

Surveymetodik

Föreläsning 4

Måns Magnusson

Avd. Statistik, LiU

1 Stratifierat urval

- Notation
- Estimation
- Design effect
- Allokering av urval till strata
- Urvalsvikter vid stratifiering

Section 1

Stratifierat urval

- Ofta har vi tillgång till (kategoriska) hjälpvariabler innan vi drar vårt urval
 - Exempel: Kön, Ålder, Region o.s.v.
- Istället för att dra ett OSU kan vi stratifiera vår population i H **ömsesidigt uteslutande** “delpopulationer”
 - Exempel: Kön (2 klasser), Ålder (5 klasser) och Region (21 klasser)

$$= 2 \cdot 5 \cdot 21 = 210 \text{ strata}$$

- Från **varje strata** dras sedan (ofta) ett OSU
- Vi betraktar de olika strata som **olika populationer**.
- **Obs!** strata \neq redovisningsgrupp

- Varför vill vi stratifiera? Fler anledningar finns, nämligen...
 - Försäkra oss om att **inte få ett dåligt urval** (av en slump)
 - Vi vill ha en given precision för en eller flera **redovisningsgrupper**
 - Ibland har olika strata **olika kostnad**
 - Med stratifierade urval kan vi **öka den totala precisionen**
 - Olika grupper kan ha olika **bortfall**
- Det är inte ovanligt att flera av dessa faktorer spelar in på en och samma gång.
- Vanliga begrepp vid stratifierade urval
 - Take-all strata
 - Cut-off sampling

Subsection 1

Notation

N = populationsstorlek

N_h = populationsstorlek i strata h

\mathcal{U}_h = populationsmängden i strata h

$$N = N_1 + N_2 + \dots + N_h = \sum_{i=1}^H N_i$$

n = urvalsstorlek

n_h = populationsstorlek i strata h

\mathcal{S}_h = urvalsmängden i strata h

$$n = n_1 + n_2 + \dots + n_h = \sum_{i=1}^H n_i$$

y_{hj} = variabelvärde på enhet j i stratum h

y_{hj} = variabelvärde på enhet j i stratum h

$$t_{hy} = \sum_{j=1}^{N_h} y_{hj} = \text{total i stratum } h$$

$$t_y = t_{1y} + t_{2y} + \dots + t_{Hy} = \sum_{h=1}^H t_{hy}$$

$$\bar{y}_{h\mathcal{U}} = \frac{1}{N_h} \sum_{j=1}^{N_h} y_{hj} = \text{medelvärde i strata } h$$

$$\bar{y}_{\mathcal{U}} = \frac{1}{N} \sum_{h=1}^H \sum_{j=1}^{N_h} y_{hj} = \frac{1}{N} \sum_{h=1}^H N_h \bar{y}_{h\mathcal{U}} = \sum_{h=1}^H \frac{N_h}{N} \bar{y}_{h\mathcal{U}}$$

Vi ser också att

$$t = N \bar{y}_{\mathcal{U}} = \sum_{h=1}^H N_h \bar{y}_{h\mathcal{U}}$$

Subsection 2

Estimation

- I varje enskilt strata - som vid vanligt OSU
- Sedan kombineras dessa till en “helhets”-skattning
- Vi kan exempelvis använda oss av den “vanliga” estimatoren \bar{y}_S i varje strata h

$$\bar{y}_h = \frac{1}{n_h} \sum_{j \in S_h} y_{hj}$$

- Sedan lägger vi ihop (summerar) de enskilda skattningarna för respektive strata till en skattning för hela populationen

$$\bar{y}_{str} = \sum_{h=1}^H \frac{N_h}{N} \bar{y}_h \text{ och } \hat{t}_{str} = N \bar{y}_{str}$$

- Om \bar{y}_h är väntevärdesriktig är också \bar{y}_{str} och \hat{t}_{str} väntevärdesriktiga (*) (för härledning se Lohr, 2009, s. 79).

- $\hat{Var}(\bar{y}_{str})$ är i summan av variansen över de olika strata (*)

$$\hat{Var}(\bar{y}_{str}) = \frac{1}{N^2} \sum_{h=1}^H N_h^2 \left(1 - \frac{n_h}{N_h}\right) \frac{s_h^2}{n_h}$$

- Detta innebär:
 - Minst två observationer i varje strata
 - Vi ökar precisionen vid stratifiering om det är **stor variation mellan strata och liten variation inom strata**.
 - Det går att använda andra estimatorer (kvot- regressionsestimation)

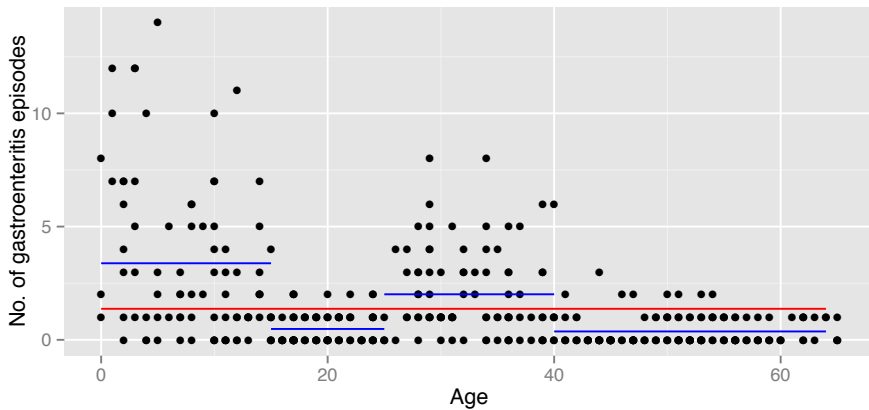
- För att beräkna ett konfidensintervall används (som vanligt) följande formel

$$\bar{y}_{str} \pm z_{\alpha/2} \sqrt{\hat{Var}(\bar{y}_{str})} \text{ och } \hat{t}_{str} \pm z_{\alpha/2} \sqrt{\hat{Var}(\hat{t}_{str})}$$

- I ex. SAS eller R används ibland $t_{\alpha/2, n-H}$ istället för $z_{\alpha/2}$
- För proportioner p_{str} se Lohr (2009, s. 80 f.)

- Vi är intresserade av att undersöka antalet fall av gastroenterit (magsjuka) i Sverige under 2011 i befolkningen 0-64 år.
- Vi är intresserade av det totala fallen av magsjuka, men också antalet fall bland yngre barn.
- Vi vet också sedan tidigare att småbarnsföräldrar är mer magsjuka än övriga åldersgrupper.
 - Vi skapar därför fyra strata (0-15 år, 16-25 år, 26-40 år och 41-65 år)
 - Vårt urval är på $n = 400$
- Urvalet fördelas proportionellt

Exempel: Gastroenterit II



Strata	N_h	n_h	\bar{y}_h	s_h
0-15 år	1687283	81	3.38	3.5
16-25 år	1851959	89	0.48	0.64
26-40 år	1812691	88	2.01	1.91
41-64 år	2935231	142	0.37	0.61
Samtliga	8287164	400	1.37	2.22

- Vad är det totala antalet fall av gastroenterit i befolkningen med tillhörande konfidensintervall?
- Hur stort urval skulle vi behöva för att få samma precision med vanligt OSU?

- Först beräknar vi \bar{y}_{str} Först beräknar vi \bar{y}_{str}

$$\bar{y}_{str} = \sum_{h=1}^H \frac{N_h}{N} \bar{y}_h = 1.37$$

- Sedan beräknar vi medelfelet för \bar{y}_{str}

$$SE(\bar{y}_{str}) = \sqrt{\frac{1}{N^2} \sum_{h=1}^H N_h^2 \left(1 - \frac{n_h}{N_h}\right) \frac{s_h^2}{n_h}} = 0.094$$

- Vi kan jämföra detta med om vi använt vanligt OSU

$$\bar{y}_S = 1.3675$$

$$SE(\bar{y}_S) = \sqrt{\frac{s^2}{n} \left(1 - \frac{n}{N}\right)} = 0.111$$

- För att få samma precision med vanligt OSU krävs ett urval på $n \approx 557$

Subsection 3

Design effect

- Som vi såg i exemplet kan vi tjäna på att stratifiera vårt urval
- Hur mycket vi tjänar brukar uttryckas som **design effect**

$$deff_{\theta} = \frac{Var(\hat{\theta} \mid \text{vår urvalsplan})}{Var(\hat{\theta} \mid \text{OSU})}$$

där $\hat{\theta}$ är vår estimator.

- Tumregel:
 - Om $deff_{\theta} < 1$ är studien **mer** precis än OSU (ex. stratifierat urval)
 - Om $deff_{\theta} > 1$ är studien **mindre** precis än OSU (ex. stratifierat urval)
- $deff_{\theta}$ går ofta att få från tidigare studier (vid design av studier)
- Exempel: Vad var designeffekten i Gastroenteritstudien i exemplet ovan?

- Vår estimator är skattningen av medelvärdet:

$$\theta = \hat{y}_{\mathcal{U}}$$

vilket ger följande design effect

$$\begin{aligned} deff_{\theta} &= \frac{Var(\hat{y}_{\mathcal{U}} \mid \text{vår urvalsplan})}{Var(\hat{y}_{\mathcal{U}} \mid \text{OSU})} = \frac{Var(\bar{y}_{str})}{Var(\bar{y}_S)} \\ &= \frac{0.008836}{0.012321} \\ &= 0.717 \end{aligned}$$

Subsection 4

Allokering av urval till strata

- Det finns många sätt att allokera sitt urval till de olika strata
De vanligaste allokeringsmetoderna är:
 - Lika allokering
 - Proportionell allokering
 - Optimal- och Neymanallokering
 - (Powerallokering)

- Vi använder Gastroenteritexemplet ovan.

Strata	N_h	\bar{y}_h	s_h
0-15 år	1687283	3.38	3.5
16-25 år	1851959	0.48	0.64
26-40 år	1812691	2.01	1.91
41-64 år	2935231	0.37	0.61
Samtliga	8287164	1.37	2.22

- Vi antar (initialt) att kostnaden för datainsamlingen (c_h) skulle vara lika stor i alla strata.
- Hur skulle detta urval allokeras med de olika sätten att allokeras urval?

- Urvalet allokeras till jämt fördelat över alla strata

$$n_1 = n_2 = \dots = n_H = \frac{n}{H}$$

- För- och nackdelar:
 - + Enkel design
 - Ineffektiv
- Vad blir detta i exemplet ovan?

- Urvalet allokeras enligt proportionellt mot de olika stratastorlekarna

$$\frac{n_h}{n} = \frac{N_h}{N} \text{ för } h = 1, 2, \dots, H$$

- För- och nackdelar:
 - + Enkel design
 - + "Självvägande" urval (minimal variation i w_i)
- Vad blir detta i exemplet ovan?

- Urvalet fördelas så att $Var(\bar{y}_{str})$ minimeras (givet olika kostnader och varians i olika strata)

$$n_h = n \cdot \frac{\frac{N_h S_h}{\sqrt{c_h}}}{\sum_{h=1}^H \frac{N_h S_h}{\sqrt{c_h}}}$$

där

c_h = kostnaden per observation i strata h

- Om kostnaden är lika i respektive strata kallas allokeringen för **Neymanallokering**

$$n_h = n \cdot \frac{N_h S_h}{\sum_{h=1}^H N_h S_h}$$

- Om även variansen är lika i respektive strata reduceras Neymanallokering till **proportionell** allokering

- För- och nackdelar:
 - + Optimal design (mindre n)
 - + Kan ta kostnader i beaktande
 - Optimerar efter endast en variabel
 - Tar inte hänsyn till intresse av redovisningsgrupper
- Exempel på användning av kostnader i olika strata:
 - Ta hänsyn till olika bortfall
 - Ta hänsyn till resekostnader vid klusterurval
- Vad blir detta i exemplet ovan (om vi antar lika kostnader)?

- Ofta intresse av **både** hela populationen **och** delpopulationer (redovisningsgrupper)
- Om vi vill göra en avvägning mellan en optimal sammanlagd skattning och skattningar i redovisningsgrupperna → **powerallokering**
- Ibland enklare att bestämma precisionen för respektive redovisningsgrupp → den totala precisionen blir då mindre mindre

- För att göra en powerallokering används följande formel (se Bankier (1988)):

$$n_h = n \cdot \frac{S_h X_h^q / \bar{y}_{h\mathcal{U}}}{\sum_{h=1}^H S_h X_h^q / \bar{y}_{h\mathcal{U}}}$$

där X_h är vilken "betydelse" vi tillskriver strata h och q är en konstant på intervallet $0 \leq q \leq 1$.

- Sätter vi $X_h = t_{hy}$ så resulterar $q = 1$ i Neymanallokering och $q = 0$ resulterar i approximativt samma precision i alla strata.
- Ett vanligt värde som kan användas är $q = \frac{1}{2}$ eller $q = \frac{1}{3}$ (se Lehtonen et al. (2004, s. 65))

Allokering	n_1	n_2	n_3	n_4	$Var(\hat{y}_U)$	$deff(\hat{y}_U)$
OSU	-	-	-	-	0.111	1
Lika	100	100	100	100	0.087	0.614
Proportionell	81	89	88	142	0.094	0.717
Neyman	191	39	112	58	0.075	0.457

- För N_h , s_h^2 och \bar{y}_h i respektive strata se sida 22.

Subsection 5

Urvalsvikter vid stratifiering

- Designvikten vid OSU är

$$w_i = \frac{1}{\pi_i} = \frac{N}{n}$$

- Vikter vid estimation (*)

$$\hat{t}_{\mathcal{U}} = \sum_{i \in \mathcal{S}} w_i y_i = \sum_{i \in \mathcal{S}} \frac{y_i}{\pi_i}$$

$$\hat{\bar{y}}_{\mathcal{U}} = \frac{\hat{t}_{\mathcal{U}}}{N} = \frac{\sum_{i \in \mathcal{S}} w_i y_i}{\sum_{i \in \mathcal{S}} w_i}$$

då

$$\sum_{i=1}^N \pi_i = n \text{ och } \sum_{i=1}^n w_i = N$$

- Denna estimator kallas **Horwitz-Thompson** estimatorn.
- Detta går enkelt att vidareutveckla för stratifierade urval

- För ett stratifierat urval får vi samma formel för totalskattningen (*):

$$\hat{t}_{\mathcal{U},str} = \sum_{j \in \mathcal{S}} w_j y_j$$

- För att beräkna $\hat{y}_{\mathcal{U},str}$ används de "stratifierade" vikterna.

$$\hat{y}_{\mathcal{U}} = \frac{\hat{t}_{\mathcal{U}}}{N} = \frac{\sum_{j \in \mathcal{S}} w_j y_{hj}}{\sum_{j \in \mathcal{S}} w_j}$$

Det går att visa att denna estimator är samma som estimatoren på sida 10 (*).

- Vid proportionell allokering har vi ett specialfall

$$w_{hj} = \frac{N_h}{n_h} = \frac{N}{n}$$

vilket innebär att vi får samma vikter i alla strata.

- Då w_j inte beror på strata kallas urvalet "självvägt"

- Utgå från Gatsroenteritexemplet på sida 22 och 29.
- Beräkna med Horwitz-Thompson estimatorn en totalskattning vid proportionellt urval och vid Neymanurval.

Bankier, M., 1988. Power allocations: determining sample sizes for subnational areas. *The American Statistician* 42 (3), 174–177.

Lehtonen, R., Pahkinen, E., Wiley, J., 2004. Practical methods for design and analysis of complex surveys. J. Wiley.

Lohr, S., 2009. Sampling: design and analysis, 2nd Edition. Thomson.