

# Regressão Descontinuada

Inferência Causal (MI628A)



**UNICAMP**

Marília Rocha  
Thiago Paulichen  
Tiago Amorim  
IMECC - Unicamp

25 de Junho de 2024

A Regressão Descontinuada (*Regression Discontinuity Design* - RDD) é utilizada quando a atribuição do tratamento depende deterministicamente de uma covariável. Quando essa atribuição é exata, o processo de seleção é totalmente conhecido e pode ser modelado para produzir uma inferência causal não-viesada.

---

Adaptado de: *Waiting for Life to Arrive*  
THOMAS D COOK

# Sumário

---

## Histórico

- Linha do Tempo
- Dificuldades e Ressurgimento

## Regressão Descontinuada

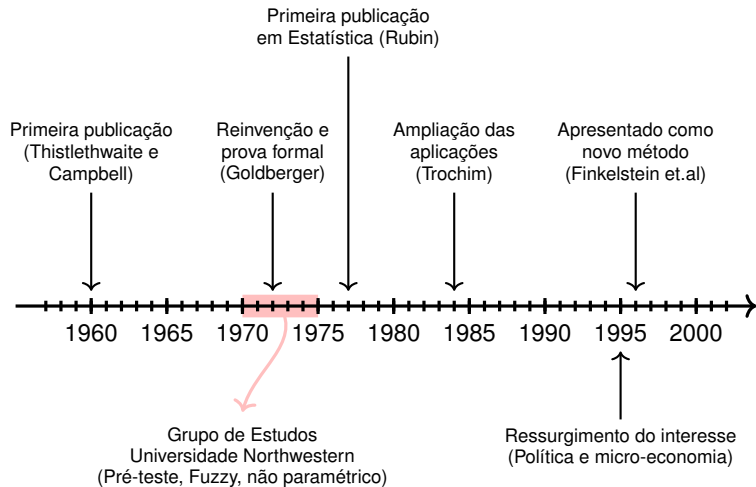
- Sharp* RD
- Fuzzy* RD
- Estimadores Locais
- Teste de Densidade de McCrary

## Exemplos

- Toy Problem*
- Medicare*
- Pacotes disponíveis

## Referências

# Linha do Tempo



Levantamento de Cook [2008]

# Dificuldades e Ressurgimento

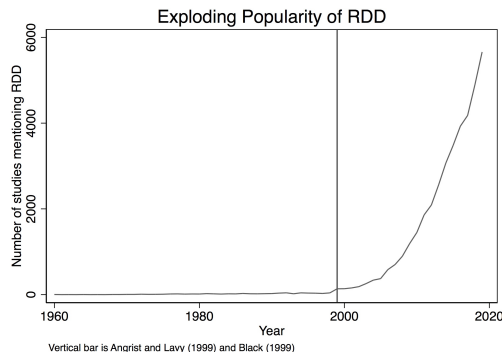
## Impasses:

- Preconceito da comunidade estatística por um tema desenvolvido pelas ciências sociais;
- Desenvolvimento inicial restrito ao grupo da Northwestern;
- Papers usavam diferentes termos para RDD.

## Razões para o ressurgimento:

- Desenvolvimento por economistas renomados em diversas instituições;
- Nova gama de aplicações.

Maiores detalhes em Cook [2008].



Fonte: Cunningham [2021]

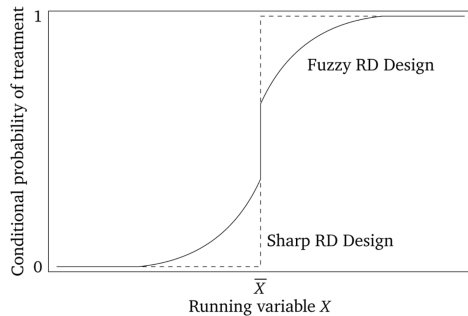
# Descontinuidade *Sharp* e *Fuzzy*

**Sharp:** a atribuição de tratamento segue uma regra determinista:

$$Z_i = \begin{cases} 1 & \text{se } x_i \geq c \\ 0 & \text{c.c.} \end{cases}$$

**Fuzzy:** a probabilidade de atribuição de tratamento é descontínua em um ponto de corte conhecido:

$$\mathbb{P}(Z_i = 1 \mid x_i) = \begin{cases} g_1(x_i) & \text{se } x_i \geq c \\ g_0(x_i) & \text{c.c.} \end{cases}$$



Fonte: Cunningham [2021]

# Descontinuidade *Sharp* e *Fuzzy*

**Sharp:** a atribuição de tratamento segue uma regra determinista:

$$Z_i = \begin{cases} 1 & \text{se } x_i \geq c \\ 0 & \text{c.c.} \end{cases}$$

**Fuzzy:** a probabilidade de atribuição de tratamento é descontínua em um ponto de corte conhecido:

$$\mathbb{P}(Z_i = 1 \mid x_i) = \begin{cases} g_1(x_i) & \text{se } x_i \geq c \\ g_0(x_i) & \text{c.c.} \end{cases}$$

## Exemplos:

- S** Droga administrada a pacientes com uma taxa acima de certo limite.
- S** Aulas de recuperação obrigatória para alunos com média abaixo de certo valor.
- F** Programa da saúde suplementar oferecido à famílias que se enquadram em determinado critério de renda.

# Descontinuidade *Sharp* e *Fuzzy*





# Sharp RD

---

Tratamento é determinado como  $Z_i = \mathbb{I}[X_i \geq c]$ , onde  $X_i$  é a variável de atribuição e  $c$  é o ponto de corte.

## Suposições:

- (A1)  $\mathbb{E}(Y_i(0) \mid X_i)$  é contínuo em  $X_i = c$ ;
- (A2)  $\mathbb{E}(Y_i(1) \mid X_i)$  é contínua em  $X_i = c$ ;
- (A3)  $\mathbb{E}(Y_i(1) - Y_i(0) \mid X_i)$  é contínua em  $X_i = c$ ;

Um design RD foca no ponto de corte na estimação do efeito causal:

$$\tau_c := \mathbb{E}(\tau_i \mid X_i = c) = \mathbb{E}(Y_i(1) - Y_i(0) \mid X_i = c),$$

e considera principalmente amostras localmente próximas ao ponto de corte.

# Sharp RD

---

Dado  $\varepsilon > 0$  e as suposições **(A1)**, **(A2)** e **(A3)**, podemos tomar os limites laterais ao longo do ponto de corte  $c$ , obtendo:

$$\begin{aligned}\mathbb{E}(Y_i(1) \mid X_i = c) &= \lim_{\varepsilon \rightarrow 0} \mathbb{E}(Y_i(1) \mid X_i = c + \varepsilon) \\ &= \lim_{\varepsilon \rightarrow 0} \mathbb{E}(Y_i(1) \mid Z_i = 1, X_i = c + \varepsilon) \\ &= \lim_{\varepsilon \rightarrow 0} \mathbb{E}(Y_i \mid X_i = c + \varepsilon).\end{aligned}$$

Similarmente:

$$\mathbb{E}(Y_i(0) \mid X_i = c) = \lim_{\varepsilon \rightarrow 0} \mathbb{E}(Y_i \mid X_i = c - \varepsilon).$$

Dessa forma temos que:

$$\tau_c = \lim_{\varepsilon \rightarrow 0} [\mathbb{E}(Y_i \mid X_i = c + \varepsilon) - \mathbb{E}(Y_i \mid X_i = c - \varepsilon)].$$

# Fuzzy RD

---

A probabilidade condicional do tratamento  $\mathbb{P}(Z_i = 1 \mid X_i)$ , não pula de 0 para 1 no ponto de corte.  $\mathbb{P}(Z_i = 1 \mid X_i)$  é descontínua em  $c$  e o tamanho dessa descontinuidade está entre 0 e 1.

## Suposição adicional:

**(A4)**  $Y_i(0), Y_i(1) \perp Z_i \mid X_i$  (ignorabilidade).

Com isso, para um  $\varepsilon > 0$  dado, temos:

$$\begin{aligned} & \mathbb{E}(Y_i \mid X_i = c + \varepsilon) - \mathbb{E}(Y_i \mid X_i = c - \varepsilon) \\ &= \mathbb{E}(Y_i(0) + Z_i \tau_i \mid X_i = c + \varepsilon) - \mathbb{E}(Y_i(0) + Z_i \tau_i \mid X_i = c - \varepsilon) \\ \textbf{(A4)} &= \mathbb{E}(Y_i(0) \mid X_i = c + \varepsilon) + \mathbb{E}(Z_i \mid X_i = c + \varepsilon) \mathbb{E}(\tau_i \mid X_i = c + \varepsilon) - \mathbb{E}(Y_i(0) \mid X_i = c - \varepsilon) \\ &\quad - \mathbb{E}(Z_i \mid X_i = c - \varepsilon) \mathbb{E}(\tau_i \mid X_i = c - \varepsilon). \end{aligned}$$

# Fuzzy RD

---

Fazendo o limite  $\varepsilon \rightarrow 0$ , segue que:

$$\lim_{\varepsilon \rightarrow 0} [\mathbb{E}(Y_i | X_i = c + \varepsilon) - \mathbb{E}(Y_i | X_i = c - \varepsilon)] = \left( \lim_{\varepsilon \rightarrow 0} [\mathbb{E}(Z_i | X_i = c + \varepsilon) - \mathbb{E}(Z_i | X_i = c - \varepsilon)] \right) \tau_c$$

isto é:

$$\tau_c = \lim_{\varepsilon \rightarrow 0} \left[ \frac{\mathbb{E}(Y_i | X_i = c + \varepsilon) - \mathbb{E}(Y_i | X_i = c - \varepsilon)}{\mathbb{E}(Z_i | X_i = c + \varepsilon) - \mathbb{E}(Z_i | X_i = c - \varepsilon)} \right].$$

Observe que o caso *Sharp* pode ser visto como um caso particular do *Fuzzy*, uma vez que neste caso:

$$\lim_{\varepsilon \rightarrow 0} [\mathbb{E}(Z_i | X_i = c + \varepsilon) - \mathbb{E}(Z_i | X_i = c - \varepsilon)] = 1.$$

# Estimadores Locais

## Estimador local não-paramétrico:

$$\hat{\tau}_c = \frac{\sum_{i:c \leq X_i < c+h} Y_i K\left(\frac{X_i - c}{h}\right)}{\sum_{i:c \leq X_i < c+h} K\left(\frac{X_i - c}{h}\right)} - \frac{\sum_{i:c-h < X_i < c} Y_i K\left(\frac{X_i - c}{h}\right)}{\sum_{i:c-h < X_i < c} K\left(\frac{X_i - c}{h}\right)},$$

onde  $K(u)$  é um kernel com  $\int_{-1}^1 K(u) du = 1$ . É viesado em  $\mathcal{O}(h)$ .

## Estimador local linear (*Sharp* RD):

$$\hat{\tau}_c = \hat{\beta}_0^+ - \hat{\beta}_0^-$$

onde  $\hat{\beta}_0^+$  e  $\hat{\beta}_0^-$  vem do ajuste de  $Y_i$  por mínimos quadrados:

$$\min_{\beta^+} \sum_{i:c \leq X_i < c+h} (Y_i - \beta_0^+ - \beta_x^+(X_i - c))^2 \quad \text{e} \quad \min_{\beta^-} \sum_{i:c-h < X_i < c} (Y_i - \beta_0^- - \beta_x^-(X_i - c))^2.$$

Viés com regressão é em geral  $\mathcal{O}(h^2)$ .

# Estimadores Locais

## Estimador local linear (*Fuzzy RD*):

$$\hat{\tau}_c = \frac{\hat{\tau}_y}{\hat{\tau}_z} = \frac{\hat{\beta}_0^+ - \hat{\beta}_0^-}{\hat{\alpha}_0^+ - \hat{\alpha}_0^-}$$

onde  $\hat{\beta}_0^+$  e  $\hat{\beta}_0^-$  seguem fórmula para descontinuidade *sharp* e  $\hat{\alpha}_0^+$  e  $\hat{\alpha}_0^-$  vem do ajuste de  $Z_i$  por mínimos quadrados:

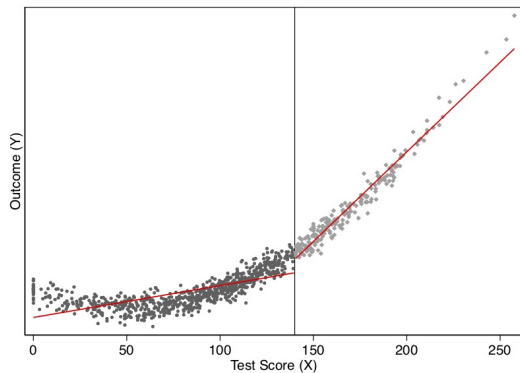
$$\min_{\alpha^+} \sum_{i: c \leq X_i < c+h} (Z_i - \alpha_0^+ - \alpha_x^+(X_i - c))^2$$

$$\min_{\alpha^-} \sum_{i: c-h < X_i < c} (Z_i - \alpha_0^- - \alpha_x^-(X_i - c))^2.$$

Imbens and Lemieux [2008] sugerem **fortemente** fazer regressão.

É sugerido usar  $h \propto N^{-\delta}$ , com  $1/5 < \delta < 2/5$ .  
 $h$  ótimo estimado com validação cruzada.

É preciso tomar cuidado para não confundir descontinuidade com não-linearidade!



Fonte: Cunningham [2021]

# Estimador da Variância

Distribuição assintótica:

$$\sqrt{Nh}(\hat{\tau} - \tau) \rightarrow \mathcal{N}\left(0, \frac{1}{\tau_z^2} V_{\tau_y} + \frac{\tau_y^2}{\tau_z^4} V_{\tau_z} - 2 \frac{\tau_y}{\tau_z^3} C_{\tau_y \tau_z}\right).$$

Um estimador *pluggin* é estimar os termos da equação acima.

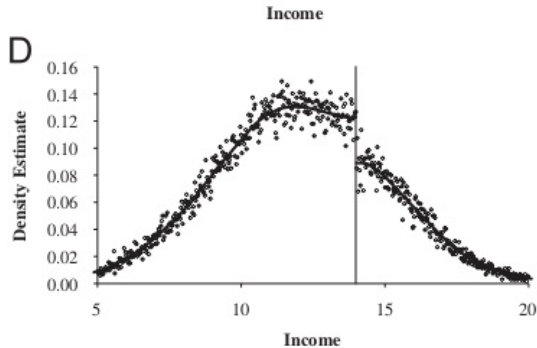
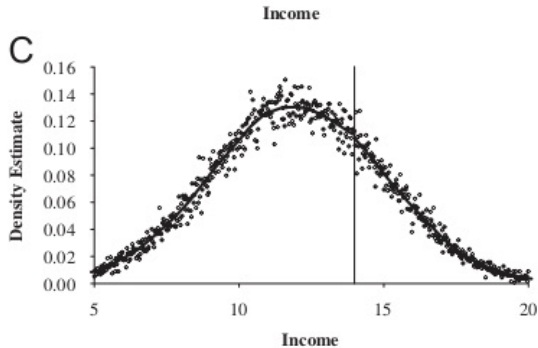
- $\hat{V}_{\tau_y} = \frac{4}{\hat{f}_x(c)} (\hat{\sigma}_{y^+}^2 + \hat{\sigma}_{y^-}^2)$
- $\hat{V}_{\tau_z} = \frac{4}{\hat{f}_x(c)} (\hat{\sigma}_{z^+}^2 + \hat{\sigma}_{z^-}^2)$
- $\hat{C}_{\tau_y \tau_z} = \frac{4}{\hat{f}_x(c)} (\hat{C}_{yz^+} + \hat{C}_{yz^-})$
- $\hat{f}_x(x) = \frac{N_{h^+} + N_{h^-}}{2Nh}$
- $\hat{\sigma}_{y^+}^2 = \frac{1}{N_{h^+}} \sum_{i:c \leq X_i < c+h} (Y_i - \hat{Y}(X_i))^2$
- $\hat{\sigma}_{z^+}^2 = \frac{1}{N_{h^+}} \sum_{i:c \leq X_i < c+h} (Z_i - \hat{Z}(X_i))^2$
- $\hat{C}_{yz^+} = \frac{1}{N_{h^+}} \sum_{i:c \leq X_i < c+h} (Y_i - \hat{Y}(X_i))(Z_i - \hat{Z}(X_i))$

Os termos *negativos* tem somatório em  $\{i : c - h < X_i < c\}$ , e usam  $N_{h^-}$ .

Pode-se substituir pelo estimador robusto de um TSLS para RD *Fuzzy* e de OLS para RD *Sharp*.

# Teste de Densidade de McCrary

O teste de densidade de McCrary [2008] ajuda a avaliar a validade dos dados. Avaliação envolve o uso de polinômios locais para estimar densidade.



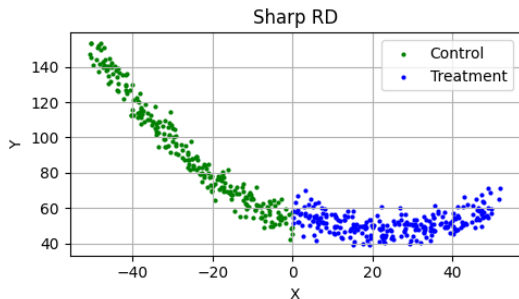
Fonte: Cunningham [2021]



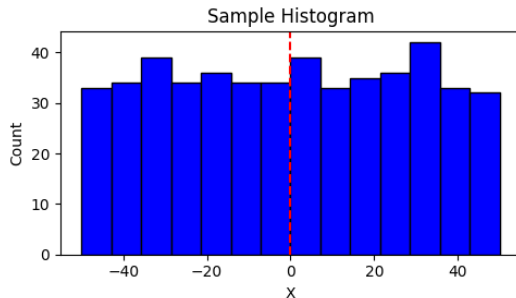
# Toy Problem

Função geradora dos dados:

$$Y_i = 50 - X_i + 0.02X_i^2 + 10\mathbb{I}(X_i > 0) + \mathcal{N}(0, 5)$$



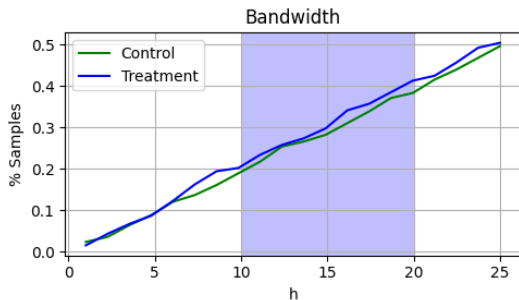
Avaliação da densidade de pontos.



Não foi encontrado código pronto em Python para cálculo da densidade local.  
Em R: **rddensity**.

# Toy Problem

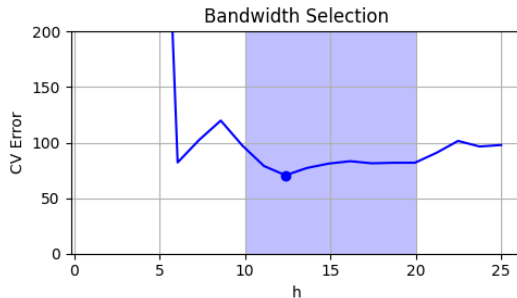
Largura da banda sugerida:  $h$  equivalente a 20 a 40% dos pontos de cada lado.



Otimização feita com validação cruzada com 50% dos de cada lado.

$$CV(h) = \frac{1}{N} \sum_i (Y_i - \hat{Y}_h(X_i))^2$$

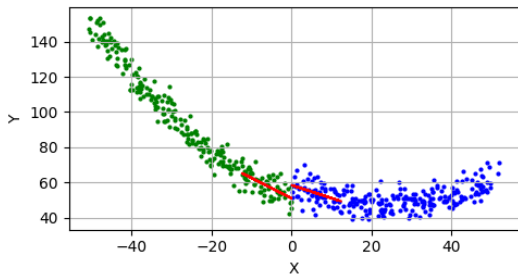
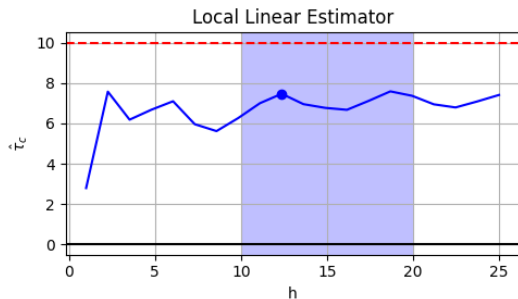
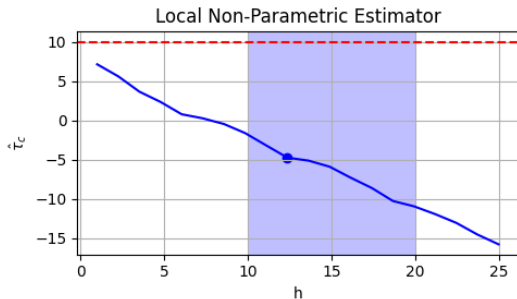
$$h^* = \underset{h}{\operatorname{argmin}} CV(h)$$



# Toy Problem

Estimador não-paramétrico local: retângulo em  $[c-h, c+h]$ .

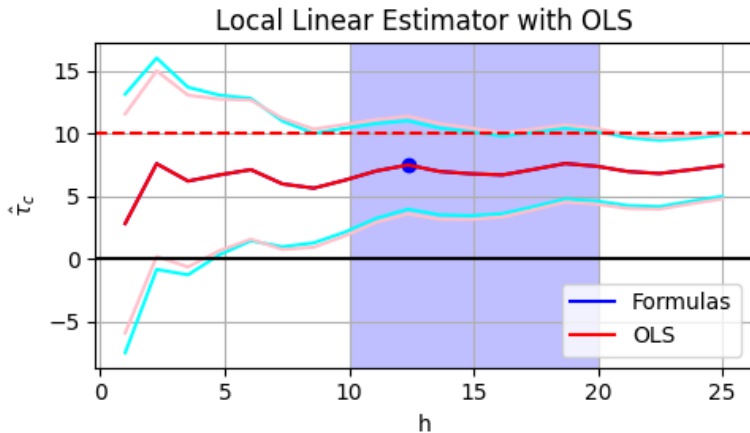
$$\hat{\tau}_c = \frac{\sum_{i=1}^N Y_i \mathbb{I}(c \leq X_i < c+h)}{\sum_{i=1}^N \mathbb{I}(c \leq X_i < c+h)} - \frac{\sum_{i=1}^N Y_i \mathbb{I}(c-h < X_i < c)}{\sum_{i=1}^N \mathbb{I}(c-h < X_i < c)}.$$



# Toy Problem

Para utilizar mínimos quadrados é construída uma aproximação conjunta dos dois *lados*:

$$\min_{\beta} \sum_{i: c-h < X_i < c+h} (Y_i - \beta_0 - \beta_x^+(X_i - c)\mathbb{I}(c \leq X_i < c+h) - \beta_x^-(X_i - c)\mathbb{I}(c-h < X_i < c) - \beta_\tau Z_i)^2$$



# Medicare

---

**Objetivo:** Avaliar o impacto do plano de saúde na utilização de cuidados médicos. (Card et al. [2008])

**Limitações:** Heterogeneidade de cobertura, viés de seleção - oferta e procura dependem da saúde inicial, confundindo comparações observacionais.

**Solução:** Abordagem de regressão descontinuada para comparar o estado de saúde entre pessoas imediatamente antes e imediatamente após os 65 anos de idade (elegibilidade para o programa *Medicare*):

- Mudanças no número de consultas médicas recentes e nas internações hospitalares;
- Efeitos em diferentes subgrupos;
- Quantificar até que ponto o início da elegibilidade ao *Medicare* reduz ou aumenta as disparidades no uso de diferentes tipos de serviços.

# Medicare: Definição do modelo

---

## Modelo:

$$y_{ija} = X_{ija}\alpha + f_j(\alpha; \beta) + \sum_k C_{ija}^k \gamma^k + u_{ija}$$

- $y_{ija}$ : uso de cuidados de saúde para o indivíduo  $i$  no grupo socioeconômico  $j$  na idade  $a$ ;
- $X_{ija}$ : conjunto de covariáveis (por exemplo, gênero e região);
- $f_j(\alpha; \beta)$ : função suavizada representando o perfil de idade do resultado  $y$  para o grupo  $j$ ;
- $C_{ija}^k$ : características da cobertura de seguro mantida pelo indivíduo;
- $u_{ija}$ : componente de erro não observado.

# Medicare: Definição do modelo

**Problema na estimação (Cobertura do seguro é endógena):** a elegibilidade ao programa está associada a uma redução das diferenças de cobertura entre os grupos demográficos, mas há um aumento nessas diferenças quando olhamos para coberturas com mais benefícios.

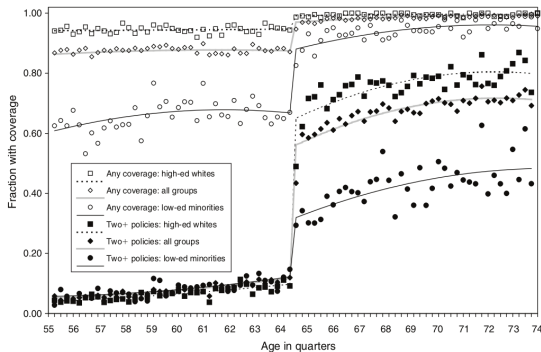


Figura: Cobertura por qualquer seguro e por duas ou mais apólices, por idade e grupo demográfico.

Fonte: Card et al. [2008]

## Medicare: Definição do modelo

---

**Solução:** Definir um modelo de probabilidade para as variáveis indicadoras  $C_{ija}^1$  (qualquer cobertura) e  $C_{ija}^2$  (plano com maior cobertura e com mais benefícios):

$$C_{ija}^1 = X_{ija}\beta_j^1 + g_j^1(a) + D_a\pi_j^1 + \nu_{ija}^1,$$

$$C_{ija}^2 = X_{ija}\beta_j^2 + g_j^2(a) + D_a\pi_j^2 + \nu_{ija}^2,$$

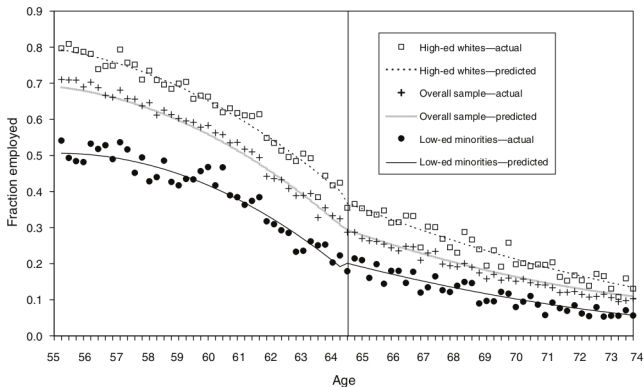
onde  $\beta_j^1$  e  $\beta_j^2$  são coeficientes dos grupos socioeconômicos,  $g_j^1(a)$  e  $g_j^2(a)$  são perfis de idade destes grupos, e  $D_a$  uma indicadora para ter 65 anos ou mais. Supondo que os perfis sejam contínuos aos 65 anos, qualquer descontinuidade em  $y$  pode ser atribuída a descontinuidades no seguro.



# Medicare: Resultados

## Outras mudanças aos 65 anos (aposentadoria):

- A continuidade exige que todos os outros fatores que possam afetar o resultado tenham mudanças suaves aos 65 anos.
- Todos os perfis possuem comportamento suave aos 65 anos em relação à empregabilidade.



Fonte: Card et al. [2008]

# Medicare: Resultados

	1997–2003 NHIS				1992–2003 NHIS			
	Delayed care last year		Did not get care last year		Saw doctor last year		Hospital stay last year	
	Age 63–64 (1)	RD at 65 (2)	Age 63–64 (3)	RD at 65 (4)	Age 63–64 (5)	RD at 65 (6)	Age 63–64 (7)	RD at 65 (8)
Overall sample	7.2	-1.8 (0.4) ↓	4.9	-1.3 (0.3) ↓	84.8	1.3 (0.7) ↑	11.8	1.2 (0.4) ↑
Classified by ethnicity and education:								
White non-Hispanic:								
High school dropout	11.6	-1.5 (1.1)	7.9	-0.2 (1.0)	81.7	3.1 (1.3)	14.4	1.6 (1.3)
High school graduate	7.1	0.3 (2.8)	5.5	-1.3 (2.8)	85.1	-0.4 (1.5)	12.0	0.3 (0.7)
At least some college	6.0	-1.5 (0.4)	3.7	-1.4 (0.3)	87.6	0.0 (1.3)	9.8	2.1 (0.7)
Minority:								
High school dropout	13.6	-5.3 (1.0)	11.7	-4.2 (0.9)	80.2	5.0 (2.2)	14.5	0.0 (1.4)
High school graduate	4.3	-3.8 (3.2)	1.2	1.5 (3.7)	84.8	1.9 (2.7)	11.4	1.8 (1.4)
At least some college	5.4	-0.6 (1.1)	4.8	-0.2 (0.8)	85.0	3.7 (3.9)	9.5	0.7 (2.0)
Classified by ethnicity only:								
White non-Hispanic								
	6.9	-1.6 (0.4)	4.4	-1.2 (0.3)	85.3	0.6 (0.8)	11.6	1.3 (0.5)
Black non-Hispanic (all)	7.3	-1.9 (1.1)	6.4	-0.3 (1.1)	84.2	3.6 (1.9)	14.4	0.5 (1.1)
Hispanic (all)	11.1	-4.9 (0.8)	9.3	-3.8 (0.7)	79.4	8.2 (0.8)	11.8	1.0 (1.6)

Tabela: Medidas de acesso aos cuidados de saúde pouco antes dos 65 anos e descontinuidade estimadas.

# Medicare: Resultados

---

## Mudanças no acesso e utilização de cuidados médicos:

- 7% das pessoas relataram atrasar os cuidados e 5% relataram não receber cuidados, com taxas mais elevadas para as minorias com menor escolaridade e hispânicos. As estimativas implicam redução aos 65 anos em ambas as medidas;
- Os grupos com menor escolaridade e minoritários têm menor probabilidade de ter uma consulta de rotina, mas são mais propensos a ter passado por um período hospitalar;
- As estimativas sugerem que o limiar dos 65 anos está associado a um aumento nas consultas médicas de rotina, com ganhos maiores para os grupos com taxas mais baixas antes dos 65;
- No geral, há um aumento grande nas taxas de hospitalização aos 65 anos (da ordem dos 10%), mas os ganhos são maiores para os brancos com melhor escolaridade do que para outros grupos.

# Pacotes - Linguagem R

---

- `rddtools`
- `rdd`
- `rdrobust`
- `rddensity`

# Referências (1)

---

- Joshua D Angrist and Jörn-Steffen Pischke. *Mostly harmless econometrics: An empiricist's companion*. Princeton university press, 2009.
- David Card, Carlos Dobkin, and Nicole Maestas. The impact of nearly universal insurance coverage on health care utilization: evidence from medicare. *American Economic Review*, 98(5):2242–2258, 2008.
- Thomas D Cook. “waiting for life to arrive”: a history of the regression-discontinuity design in psychology, statistics and economics. *Journal of Econometrics*, 142(2):636–654, 2008.
- Scott Cunningham. *Causal inference: The mixtape*. Yale university press, 2021. URL [https://mixtape.scunning.com/06-regression\\_discontinuity](https://mixtape.scunning.com/06-regression_discontinuity). Acessado: 18/06/2024.
- Michael O Finkelstein, Bruce Levin, and Herbert Robbins. Clinical and prophylactic trials with assured new treatment for those at greater risk: I. a design proposal. *American Journal of Public Health*, 86(5):691–695, 1996.
- Arthur S Goldberger. Selection bias in evaluating treatment effects: Some formal illustrations. Manuscrito não publicado, 1972a.

## Referências (2)

---

- Arthur S Goldberger. Selection bias in evaluating treatment effects: the case of interaction. Manuscrito não publicado, 1972b.
- Guido W Imbens and Thomas Lemieux. Regression discontinuity designs: A guide to practice. *Journal of econometrics*, 142(2):615–635, 2008.
- David S Lee and Thomas Lemieux. Regression discontinuity designs in economics. *Journal of economic literature*, 48(2):281–355, 2010.
- Justin McCrary. Manipulation of the running variable in the regression discontinuity design: A density test. *Journal of econometrics*, 142(2):698–714, 2008.
- Donald B Rubin. Assignment to treatment group on the basis of a covariate. *Journal of educational Statistics*, 2(1):1–26, 1977.
- Donald L Thistlethwaite and Donald T Campbell. Regression-discontinuity analysis: An alternative to the ex post facto experiment. *Journal of Educational psychology*, 51(6):309, 1960.
- William MK Trochim. *Research design for program evaluation: The regression-discontinuity approach*, volume 6. SAGE Publications, Incorporated, 1984.

# Perguntas?

