

Estimation and Hypothesis Testing 2 |

Les estimateurs et les tests d'hypothèses 2

Christelle Zozoungbo

27 June/juin 2024

Covariate Adjustment | *Ajustement des covariables*

Cluster Randomization | *Randomisation par grappe*

Experiments with Multiple Arms | *Les expériences avec plusieurs bras*

Factorial Design | *La conception factorielle*

A Quick Reminder | *Un petit rappel*

- ▶ Remember: Analyze as you randomize
- ▶ We prefer estimators that are unbiased and have greater precision
- ▶ N'oubliez pas : Analysez comme vous randomisez
- ▶ Nous préférons les estimateurs non biaisés et plus précis.

Covariate Adjustment | *Ajustement des covariables*

Estimator: Linear regression with covariates |

Estimateur : La régression linéaire avec des covariables

$$Y_i = \beta_0 + \beta_1 Z_i + \gamma X_i + e_i$$

- ▶ Including a **pre-treatment covariate** X that is *predictive of* the outcome variable in our regression model is called *covariate adjustment*.
- ▶ For example: pre-treatment measure of the outcome.
- ▶ Careful: This can bias our estimates, but improve their precision.
- ▶ L'inclusion d'une **covariable pré-traitement** X qui est *prédictive* de la variable de résultat dans notre modèle de régression est appelée *ajustement des covariables*.
- ▶ Par exemple : une mesure du résultat avant le traitement.
- ▶ Attention : Cela peut biaiser nos estimations, mais améliorer leur précision.

Estimator: Linear regression with covariates | *Estimateur : La régression linéaire avec des covariables*

$$Y_i = \beta_0 + \beta_1 Z_i + \gamma X_i + e_i$$

- ▶ The coefficient on the treatment variable (β_1) is again our ATE.
- ▶ The coefficient on the covariate (γ) is *not* the causal effect of that variable.
- ▶ Le coefficient sur la variable de traitement (β_1) est encore notre ATE.
- ▶ Le coefficient de la covariable (γ) n'est *pas* l'effet causal de cette variable.

Estimator: Linear regression with covariates | *Estimateur : La régression linéaire avec des covariables*

	Reject FM	
	(1)	(2)
EFM Treat	0.093***	0.095***
Standard Error	0.027	0.020
RI <i>p</i> -value	0.001	<0.001
Hypothesis	+	+
Control Mean	0.82	0.82
Control SD	0.16	0.16
DV Range	[0-1]	[0-1]
Blocked FE	Yes	Yes
Controls	No	16
Adj- R^2	0.09	0.23
Observations	998	998

Note: * $p < .1$, ** $p < 0.05$, and *** $p < 0.01$

Estimator: Linear regression with covariates | *Estimateur : La régression linéaire avec des covariables*

```
library(estimatr)  
# lm_robust(Y ~ treatment + Language + Gender)
```


Cluster Randomization | *Randomisation par grappe*

Estimator: Regression with cluster-robust standard errors | *Estimateur : La régression avec des erreurs types robustes au niveau du cluster*

$$Y_{ic} = \beta_0 + \beta_1 Z_c + e_{ic}$$

$$Y_{ic} = \beta_0 + \beta_1 Z_c + \beta_2 X_{ic} + e_{ic}$$

- ▶ Our analysis has to take into account the fact that treatment is assigned at the cluster level with *cluster-robust standard errors*.
- ▶ β_1 is the ATE of the treatment at the individual level.
- ▶ We can also do covariate adjustment at the same time.
- ▶ Notre analyse doit prendre en compte le fait que le traitement est attribué au niveau du cluster avec des *erreurs types robustes au niveau du cluster*.
- ▶ β_1 est l'ATE du traitement au niveau individuel.
- ▶ Nous pouvons également effectuer un ajustement covariable en même temps.

Cluster Randomization | *Randomisation par grappe*

```
library(estimatr)  
  
# lm_robust(Y ~ treatment, clusters=cluster_variable)  
  
# lm_robust(Y ~ treatment + covariate, clusters=cluster_variable)
```

Experiments with Multiple Arms | *Les expériences avec plusieurs bras*

Estimator 1: Difference-in-Means | *Estimateur 1 : La différence en moyennes*

Z_A only	Z_B only	Neither (control)
------------	------------	-------------------

- ▶ We can always take the difference-in-means between any two groups.
- ▶ But hypothesis testing is simpler with regression.
- ▶ Nous pouvons toujours tenir compte de la différence de moyens entre deux groupes.
- ▶ Mais le test d'hypothèse est plus simple avec la régression.

Estimator 2: Linear regression | *Estimateur 2 : La régression linéaire*

$$Y_i = \alpha + \beta_A Z_{Ai} + \beta_B Z_{Bi} + e_i$$

- ▶ Regression with an indicator variable for each of the two treatment arms.
- ▶ We can also do covariate adjustment at the same time.
- ▶ Régression avec une variable indicatrice pour chacun des deux bras de traitement.
- ▶ Nous pouvons également effectuer un ajustement covariable en même temps.

Estimator 2: Linear regression | *Estimateur 2 : La régression linéaire*

$$Y_i = \alpha + \beta_A Z_{Ai} + \beta_B Z_{Bi} + e_i$$

- ▶ β_A is the ATE of Z_A (compared with control).
- ▶ β_B is the ATE of Z_B (compared with control).
- ▶ β_A est l'ATE de Z_A (par rapport au contrôle).
- ▶ β_B est l'ATE de Z_B (par rapport au contrôle).

Estimators for Multi-arm Designs | *Les estimateurs pour les expériences avec plusieurs bras*

```
library(estimatr)

# difference_in_means(Y ~ treatment,
#                     condition1="T2",
#                     condition2="T1")

# lm_robust(Y ~ as.factor(treatment))
```


Factorial Design | *La conception factorielle*

Estimator 1: Difference-in-Means | *Estimateur 1 : La différence en moyennes*

Neither	Z_2 only
Z_1 only	Both Z_1 and Z_2

- ▶ If we have a 2×2 factorial design, we have four groups.
- ▶ We can always take the difference-in-means between any two groups.
- ▶ Si nous avons une conception factorielle 2×2 , nous avons 4 groupes.
- ▶ Nous pouvons toujours tenir compte de la différence de moyens entre deux groupes.

→

Estimator 2: Linear Regression with an Interaction Term | *Estimateur 2 : La régression linéaire avec un terme d'interaction*

$$Y_i = \beta_0 + \beta_1 Z_{1i} + \beta_2 Z_{2i} + \beta_3 Z_{1i} * Z_{2i} + e_i$$

$$Y_i = \beta_0 + \beta_1 Z_{1i} + \beta_2 Z_{2i} + \beta_3 Z_{1i} * Z_{2i} + \beta_4 X_i + e_i$$

- ▶ Indicator variables for Z_1 and Z_2 .
- ▶ We can also do covariate adjustment at the same time.
- ▶ Variables indicatrices pour Z_1 et Z_2 .
- ▶ Nous pouvons également effectuer un ajustement covariable en même temps.

Estimator 2: Linear Regression with an Interaction Term | *Estimateur 2 : La régression linéaire avec un terme d'interaction*

Neither	Z_2 only
Z_1 only	Both Z_1 and Z_2

$$Y_i = \beta_0 + \beta_1 Z_{1i} + \beta_2 Z_{2i} + \beta_3 Z_{1i} * Z_{2i} + e_i$$

- ▶ β_1 is the ATE of Z_1 conditional on $Z_2 = 0$ | *l'ATE de Z_1 conditionnel à $Z_2 = 0$, $(E[Y(Z_1 = 1) - Y(Z_1 = 0)|Z_2 = 0])$*
- ▶ β_2 is the ATE of Z_2 conditional on $Z_1 = 0$ | *l'ATE de Z_2 conditionnel à $Z_1 = 0$, $(E[Y(Z_2 = 1) - Y(Z_2 = 0)|Z_1 = 0])$*

Estimator 2: Linear Regression with an Interaction Term | *Estimateur 2 : La régression linéaire avec un terme d'interaction*

Neither	Z_2 only
Z_1 only	Both Z_1 and Z_2

$$Y_i = \beta_0 + \beta_1 Z_{1i} + \beta_2 Z_{2i} + \beta_3 Z_{1i} * Z_{2i} + e_i$$

- ▶ $\beta_1 + \beta_3 = \text{ATE of } Z_1 \text{ conditional on } Z_2 = 1$ | *l'ATE de Z_1 conditionnel à $Z_2 = 1$, $(E[Y(Z_1 = 1) - Y(Z_1 = 0)|Z_2 = 1])$*
- ▶ $\beta_2 + \beta_3 = \text{ATE of } Z_2 \text{ conditional on } Z_1 = 1$ | *l'ATE de Z_2 conditionnel à $Z_1 = 1$, $(E[Y(Z_2 = 1) - Y(Z_2 = 0)|Z_1 = 0])$*
- ▶ β_3 is called the interaction effect. β_3 est appelé l'effet d'interaction.

Estimator 2: Linear Regression with an Interaction Term | *Estimateur 2 : La régression linéaire avec un terme d'interaction*

Table 4. Adoption for Parents Sampled for SAFI & Subsidy Programs

	Used Fertilizer Season 1
Panel A. 2004 Season 1 Treatments	(1)
SAFI Season 1	0.114 (0.035)***
Starter Kit Farmer	0.059 (0.042)
Starter Kit Farmer * Demonstration Plot School	-0.026 (0.060)
Demonstration Plot School	0.006 (0.314)

Standard errors in parentheses. * significant at 10%; ** significant at 5%; *** significant at 1%

Estimator 2: Linear Regression with an Interaction Term | *Estimateur 2 : La régression linéaire avec un terme d'interaction*

```
library(estimatr)
# lm_robust(Y ~ Z1 + Z2 + Z1*Z2)

# lm_robust(Y ~ Z1*Z2)

# lm_robust(Y ~ Z1*Z2 + covariate)
```