

Selección de Heckman

Corrigiendo el Sesgo de Selección Muestral

EC3003B - Economía Laboral Aplicada

Tecnológico de Monterrey

Miércoles 18 de febrero, 2025 | 3-5pm

Contenido

- 1 El Problema de Seleccion
- 2 El Metodo de Heckman
- 3 Implementacion en Stata
- 4 Aplicacion y Limitaciones
- 5 Resumen

Motivacion: ¿Quienes Observamos?

En la ecuacion de Mincer:

$$\ln(w_i) = \beta_0 + \beta_1 S_i + \beta_2 X_i + \varepsilon_i$$

Problema: Solo observamos salarios de quienes **trabajan**.

Motivacion: ¿Quienes Observamos?

En la ecuacion de Mincer:

$$\ln(w_i) = \beta_0 + \beta_1 S_i + \beta_2 X_i + \varepsilon_i$$

Problema: Solo observamos salarios de quienes **trabajan**.

- No observamos el salario potencial de quienes no trabajan
- La decision de trabajar no es aleatoria
- Personas con bajo salario potencial pueden elegir no trabajar

Motivacion: ¿Quienes Observamos?

En la ecuacion de Mincer:

$$\ln(w_i) = \beta_0 + \beta_1 S_i + \beta_2 X_i + \varepsilon_i$$

Problema: Solo observamos salarios de quienes **trabajan**.

- No observamos el salario potencial de quienes no trabajan
- La decision de trabajar no es aleatoria
- Personas con bajo salario potencial pueden elegir no trabajar

Consecuencia

Si estimamos Mincer solo con quienes trabajan, los coeficientes pueden estar **sesgados**.

Ejemplo: Participacion Laboral Femenina

Situacion:

- Mujeres con salario potencial bajo pueden no trabajar
- Solo observamos mujeres con salario “suficiente”
- La muestra de mujeres trabajadoras no es representativa

Ejemplo: Participacion Laboral Femenina

Situacion:

- Mujeres con salario potencial bajo pueden no trabajar
- Solo observamos mujeres con salario “suficiente”
- La muestra de mujeres trabajadoras no es representativa

Sesgo de seleccion

Si mujeres con bajo salario no trabajan, el salario promedio observado de mujeres **sobreestima** el salario promedio verdadero.

⇒ Subestimamos la brecha de genero.

Formalización del Problema

Dos ecuaciones:

1. Ecuación de selección (trabajar o no):

$$D_i^* = Z_i' \gamma + u_i$$
$$D_i = 1(D_i^* > 0)$$

2. Ecuación de resultado (salario):

$$Y_i = X_i' \beta + \varepsilon_i \quad \text{observado solo si } D_i = 1$$

Dos ecuaciones:

1. Ecuación de selección (trabajar o no):

$$D_i^* = Z_i' \gamma + u_i$$
$$D_i = 1(D_i^* > 0)$$

2. Ecuación de resultado (salario):

$$Y_i = X_i' \beta + \varepsilon_i \quad \text{observado solo si } D_i = 1$$

Si $\text{Corr}(u_i, \varepsilon_i) \neq 0$:

- Los errores están correlacionados
- OLS en la muestra seleccionada es sesgado
- Necesitamos corregir por selección

Idea clave: El sesgo de seleccion es una forma de variable omitida.

$$E[Y_i|X_i, D_i = 1] = X_i'\beta + E[\varepsilon_i|D_i = 1]$$

El termino $E[\varepsilon_i|D_i = 1]$ no es cero si hay seleccion.

Idea clave: El sesgo de seleccion es una forma de variable omitida.

$$E[Y_i|X_i, D_i = 1] = X_i'\beta + E[\varepsilon_i|D_i = 1]$$

El termino $E[\varepsilon_i|D_i = 1]$ no es cero si hay seleccion.

Solucion de Heckman:

- 1 Modelar la probabilidad de seleccion
- 2 Calcular el “Inverse Mills Ratio” (IMR)
- 3 Incluir IMR como control en la ecuacion de resultado

El Inverse Mills Ratio

Bajo normalidad bivariada:

$$E[\varepsilon_i | D_i = 1] = \rho\sigma_\varepsilon \cdot \lambda(Z_i'\gamma)$$

Donde $\lambda(\cdot)$ es el **Inverse Mills Ratio**:

$$\lambda(z) = \frac{\phi(z)}{\Phi(z)}$$

- $\phi(\cdot)$: funcion de densidad normal estandar
- $\Phi(\cdot)$: funcion de distribucion acumulada

El Inverse Mills Ratio

Bajo normalidad bivariada:

$$E[\varepsilon_i | D_i = 1] = \rho\sigma_\varepsilon \cdot \lambda(Z_i'\gamma)$$

Donde $\lambda(\cdot)$ es el **Inverse Mills Ratio**:

$$\lambda(z) = \frac{\phi(z)}{\Phi(z)}$$

- $\phi(\cdot)$: funcion de densidad normal estandar
- $\Phi(\cdot)$: funcion de distribucion acumulada

Interpretacion

λ captura la “selectividad” de la muestra. Mayor λ = muestra mas seleccionada.

Etapas 1: Probit de seleccion

$$P(D_i = 1|Z_i) = \Phi(Z_i'\gamma)$$

Estimar $\hat{\gamma}$ y calcular $\hat{\lambda}_i = \lambda(Z_i'\hat{\gamma})$

Etapas 1: Probit de seleccion

$$P(D_i = 1|Z_i) = \Phi(Z_i'\gamma)$$

Estimar $\hat{\gamma}$ y calcular $\hat{\lambda}_i = \lambda(Z_i'\hat{\gamma})$

Etapas 2: OLS con correccion

$$Y_i = X_i'\beta + \delta\hat{\lambda}_i + \eta_i$$

Estimar en la muestra con $D_i = 1$.

Etapas 1: Probit de seleccion

$$P(D_i = 1|Z_i) = \Phi(Z_i'\gamma)$$

Estimar $\hat{\gamma}$ y calcular $\hat{\lambda}_i = \lambda(Z_i'\hat{\gamma})$

Etapas 2: OLS con correccion

$$Y_i = X_i'\beta + \delta\hat{\lambda}_i + \eta_i$$

Estimar en la muestra con $D_i = 1$.

Importante

$\delta = \rho\sigma_\varepsilon$. Si $\delta \neq 0$, hay evidencia de sesgo de seleccion.

Identificación: La Exclusion Restriction

Problema: Si $X = Z$, el modelo está debilmente identificado.

Solucion: Necesitamos al menos una variable que:

- ① Afecte la **seleccion** (trabajar o no)
- ② NO afecte el **resultado** (salario)

Identificación: La Exclusion Restriction

Problema: Si $X = Z$, el modelo está debilmente identificado.

Solucion: Necesitamos al menos una variable que:

- 1 Afecte la **seleccion** (trabajar o no)
- 2 NO afecte el **resultado** (salario)

Ejemplos clasicos:

- Numero de hijos pequenos (afecta si trabaja, no cuanto gana)
- Ingreso del conyuge
- Tasa de desempleo local

Sin exclusion restriction

El modelo se identifica solo por la no linealidad de λ , lo cual es fragil.

Comando heckman

```
* Metodo de maxima verosimilitud (preferido)
heckman ln_salario escolaridad experiencia experiencia2, ///
       select(trabaja = escolaridad experiencia hijos_peq ingreso_conyuge)

* Metodo de dos etapas
heckman ln_salario escolaridad experiencia experiencia2, ///
       select(trabaja = escolaridad experiencia hijos_peq ingreso_conyuge) ///
       twostep
```

Notas:

- select() especifica la ecuacion de seleccion
- Variables de exclusion: hijos_peq, ingreso_conyuge
- MLE es mas eficiente pero requiere normalidad

Interpretacion de Resultados

```
. heckman ln_salario escolaridad experiencia, ///  
      select(trabaja = escolaridad experiencia hijos_peq)
```

	Coef.	Std. Err.
ln_salario		
escolaridad	0.095	0.003
experiencia	0.042	0.002
select		
escolaridad	0.085	0.005
experiencia	0.025	0.003
hijos_peq	-0.350	0.020
/athrho	0.280	0.050
/lnsigma	-0.450	0.025
rho	0.272	
sigma	0.638	

Parametro	Interpretacion
ρ (rho)	Correlacion entre errores de seleccion y resultado
σ (sigma)	Desviacion estandar del error en ec. de salario
λ (lambda)	$= \rho \times \sigma$, coef. del IMR

Test de seleccion:

- $H_0 : \rho = 0$ (no hay sesgo de seleccion)
- Si rechazamos H_0 , la correccion de Heckman es necesaria
- Stata reporta test de Wald automaticamente

Sin correccion:

- Brecha de genero = 15 %
- Pero solo observamos mujeres que decidieron trabajar

Sin correccion:

- Brecha de genero = 15 %
- Pero solo observamos mujeres que decidieron trabajar

Con correccion de Heckman:

- Estimamos salario potencial de todas las mujeres
- Brecha corregida puede ser mayor (20-25 %)
- Mas realista del mercado laboral completo

① Supuesto de normalidad

- Errores deben ser normales bivariados
- Violacion puede sesgar resultados

① Supuesto de normalidad

- Errores deben ser normales bivariados
- Violacion puede sesgar resultados

② Exclusion restriction

- Dificil encontrar variables validas
- Sin ella, identificacion es fragil

① Supuesto de normalidad

- Errores deben ser normales bivariados
- Violacion puede sesgar resultados

② Exclusion restriction

- Dificil encontrar variables validas
- Sin ella, identificacion es fragil

③ Forma funcional

- Linealidad en ambas ecuaciones
- Parametrico vs semi/no parametrico

En la practica

Comparar resultados con y sin correccion. Si son similares, el sesgo puede no ser grave.

El problema:

- Solo observamos a quienes trabajan
- Seleccin no aleatoria
- OLS puede estar sesgado

La solucion:

- Modelo de dos ecuaciones
- Inverse Mills Ratio
- Correccion de Heckman

Comando Stata

```
heckman y x1 x2, select(d = z1 z2 z3)
```

¿Preguntas?

Proxima Sesión:

M08: Panel - Efectos Fijos

Jueves 19 de febrero, 3-5pm

Entrega E2 (Fichas): HOY 11:59pm