

# Datos de Panel: Efectos Fijos

## Controlando por Heterogeneidad No Observada

EC3003B - Economía Laboral Aplicada

Tecnológico de Monterrey

Jueves 19 de febrero, 2025 | 3-5pm

# Contenido

- 1 Introducción a Datos de Panel
- 2 El Modelo de Efectos Fijos
- 3 Implementación en Stata
- 4 Consideraciones Prácticas
- 5 Aplicación al Proyecto
- 6 Resumen

# ¿Qué son Datos de Panel?

## Estructura de datos:

- Observamos las **mismas unidades** en **múltiples períodos**
- $i = 1, \dots, N$  individuos
- $t = 1, \dots, T$  períodos
- Total:  $N \times T$  observaciones

# ¿Qué son Datos de Panel?

## Estructura de datos:

- Observamos las **mismas unidades** en **múltiples períodos**
- $i = 1, \dots, N$  individuos
- $t = 1, \dots, T$  períodos
- Total:  $N \times T$  observaciones

## Ejemplos:

- ENOE: mismas personas seguidas trimestralmente
- Empresas seguidas anualmente
- Países en múltiples años

## Ventaja clave

Podemos controlar por características **no observadas** que no cambian en el tiempo.

# El Problema de Variables Omitidas

**En corte transversal:**

$$Y_i = \beta_0 + \beta_1 X_i + \varepsilon_i$$

Si hay una variable omitida  $A_i$  (ej. habilidad) correlacionada con  $X_i$ :

$$\varepsilon_i = A_i + u_i \quad \text{con } \text{Corr}(X_i, A_i) \neq 0$$

$\Rightarrow$  OLS está **sesgado**.

# El Problema de Variables Omitidas

**En corte transversal:**

$$Y_i = \beta_0 + \beta_1 X_i + \varepsilon_i$$

Si hay una variable omitida  $A_i$  (ej. habilidad) correlacionada con  $X_i$ :

$$\varepsilon_i = A_i + u_i \quad \text{con } \text{Corr}(X_i, A_i) \neq 0$$

$\Rightarrow$  OLS está **sesgado**.

## Solución con panel

Si  $A_i$  es **constante en el tiempo**, podemos eliminarla usando la variación **within** (dentro del individuo).

# Ejemplo: Retorno a Educación

## Problema clásico:

- Personas más hábiles obtienen más educación
- Personas más hábiles ganan mas (independiente de educación)
- Habilidad no observada  $\rightarrow$  sesgo hacia arriba en  $\hat{\beta}_{educ}$

# Ejemplo: Retorno a Educación

## Problema clásico:

- Personas más hábiles obtienen más educación
- Personas más hábiles ganan mas (independiente de educación)
- Habilidad no observada  $\rightarrow$  sesgo hacia arriba en  $\hat{\beta}_{educ}$

## Con panel:

- Seguimos a la misma persona en el tiempo
- Su “habilidad innata” es constante
- Comparamos su salario **antes y después** de obtener más educación
- La habilidad se “cancela”

## Modelo con efectos individuales:

$$Y_{it} = \beta X_{it} + \alpha_i + \varepsilon_{it}$$

Donde:

- $Y_{it}$ : variable dependiente (salario)
- $X_{it}$ : variables independientes que varían en el tiempo
- $\alpha_i$ : **efecto fijo** individual (constante en  $t$ )
- $\varepsilon_{it}$ : error idiosincrático

# Especificación del Modelo

## Modelo con efectos individuales:

$$Y_{it} = \beta X_{it} + \alpha_i + \varepsilon_{it}$$

Donde:

- $Y_{it}$ : variable dependiente (salario)
- $X_{it}$ : variables independientes que varían en el tiempo
- $\alpha_i$ : **efecto fijo** individual (constante en  $t$ )
- $\varepsilon_{it}$ : error idiosincrático

### $\alpha_i$ captura

Todo lo que es específico del individuo y no cambia: habilidad, motivación, antecedentes familiares, personalidad, etc.

# Estimación: Within Transformation

**Paso 1:** Calcular medias por individuo

$$\bar{Y}_i = \beta \bar{X}_i + \alpha_i + \bar{\varepsilon}_i$$

**Paso 2:** Restar la media (“demeaning”)

$$Y_{it} - \bar{Y}_i = \beta(X_{it} - \bar{X}_i) + (\varepsilon_{it} - \bar{\varepsilon}_i)$$

# Estimación: Within Transformation

**Paso 1:** Calcular medias por individuo

$$\bar{Y}_i = \beta \bar{X}_i + \alpha_i + \bar{\varepsilon}_i$$

**Paso 2:** Restar la media (“demeaning”)

$$Y_{it} - \bar{Y}_i = \beta(X_{it} - \bar{X}_i) + (\varepsilon_{it} - \bar{\varepsilon}_i)$$

**Resultado:**

- $\alpha_i$  desaparece (es constante, su media es el mismo)
- Usamos solo variacion **within** (dentro del individuo)
- OLS en datos transformados da estimador de efectos fijos

# Efectos Fijos vs Efectos Aleatorios

	Efectos Fijos (FE)	Efectos Aleatorios (RE)
Supuesto	$\text{Corr}(\alpha_i, X_{it}) \neq 0$	$\text{Corr}(\alpha_i, X_{it}) = 0$
Variacion usada	Solo within	Within + between
Variables invariantes	No se pueden estimar	Se pueden estimar
Eficiencia	Menor	Mayor (si supuesto vale)

# Efectos Fijos vs Efectos Aleatorios

	Efectos Fijos (FE)	Efectos Aleatorios (RE)
Supuesto	$\text{Corr}(\alpha_i, X_{it}) \neq 0$	$\text{Corr}(\alpha_i, X_{it}) = 0$
Variación usada	Solo within	Within + between
Variables invariantes	No se pueden estimar	Se pueden estimar
Eficiencia	Menor	Mayor (si supuesto vale)

## ¿Cuál usar?

- En economía laboral, casi siempre hay correlación → **FE**
- Test de Hausman: compara FE vs RE
- Si rechazamos  $H_0$ , usar FE

# Comandos Basicos

```
* Declarar datos como panel
```

```
xtset id_persona año
```

```
* Efectos fijos
```

```
xtreg ln_salario experiencia experiencia2 formal, fe
```

```
* Efectos aleatorios
```

```
xtreg ln_salario experiencia experiencia2 formal, re
```

```
* Test de Hausman
```

```
hausman fe re
```

# Ejemplo Completo

```
* Cargar ENOE panel
use "datos/enoe_panel.dta", clear

* Declarar panel
xtset id trimestre

* Variables
gen ln_salario = ln(salario_hora)
gen experiencia2 = experiencia^2

* Efectos fijos con errores cluster
xtreg ln_salario experiencia experiencia2 form al i.sector, fe ///
      vce(cluster id)

* Comparar con pooled OLS
reg ln_salario experiencia experiencia2 form al i.sector, cluster(id)
```

# Test de Hausman

\* Guardar estimaciones

```
quietly xtreg ln_salario experiencia experiencia2 formal, fe  
estimates store fe
```

```
quietly xtreg ln_salario experiencia experiencia2 formal, re  
estimates store re
```

\* Test de Hausman

```
hausman fe re
```

\* Interpretación:

\*  $H_0$ : Diferencia en coeficientes no es sistemática (usar RE)

\* Si  $p < 0.05$ : Rechazar  $H_0 \rightarrow$  usar FE

# Resultados Típicos

Variable	Pooled OLS	FE	RE
Experiencia	0.042*** (0.002)	0.028*** (0.005)	0.035*** (0.003)
Formal	0.285*** (0.010)	0.120*** (0.025)	0.180*** (0.015)
$R^2$ within	–	0.12	0.10
$R^2$ between	–	0.35	0.38
N	150,000	150,000	150,000

**Nota:** FE da coeficientes menores → parte del efecto en OLS era heterogeneidad no observada.

## ❶ No estima variables invariantes en el tiempo

- Género, raza, lugar de nacimiento
- Se “absorben” en  $\alpha_i$

## ❶ No estima variables invariantes en el tiempo

- Género, raza, lugar de nacimiento
- Se “absorben” en  $\alpha_i$

## ❷ Requiere variación within

- Si  $X$  casi no cambia para nadie, poca precisión
- Ej: educación cambia poco en adultos

## ① No estima variables invariantes en el tiempo

- Género, raza, lugar de nacimiento
- Se “absorben” en  $\alpha_i$

## ② Requiere variación within

- Si  $X$  casi no cambia para nadie, poca precisión
- Ej: educación cambia poco en adultos

## ③ Solo controla por invariantes en el tiempo

- No controla por shocks que varían en el tiempo
- Ej: cambios en motivación, salud

## Problemas potenciales:

- Correlación serial:  $\text{Corr}(\varepsilon_{it}, \varepsilon_{is}) \neq 0$
- Heterocedasticidad entre individuos

## Problemas potenciales:

- Correlación serial:  $\text{Corr}(\varepsilon_{it}, \varepsilon_{is}) \neq 0$
- Heterocedasticidad entre individuos

## Solución: Errores cluster por individuo

- Permiten correlación arbitraria dentro del cluster
- Robustos a heterocedasticidad

## Recomendacion

Siempre usar `vce(cluster id)` en panel.

## Para la empresa cliente:

- Si tuviéramos datos de empleados en múltiples años...
- Podríamos estimar efecto de promociones controlando por  $\alpha_i$
- Ver cómo cambia el salario cuando alguien sube de nivel

## Para la empresa cliente:

- Si tuviéramos datos de empleados en múltiples años...
- Podríamos estimar efecto de promociones controlando por  $\alpha_i$
- Ver cómo cambia el salario cuando alguien sube de nivel

## Con datos de ENOE (panel rotativo):

- Seguimos personas 5 trimestres
- Estimamos efecto de cambio de empleo formal/informal
- Controlamos por habilidad no observada

## Efectos Fijos:

- Controla por  $\alpha_j$  invariante
- Usa variación within
- Robusto a correlación  $\alpha_j$ - $X$

## Comandos Stata:

- `xtset id t`
- `xtreg y x, fe`
- `vce(cluster id)`
- `hausman`

## Mensaje clave

Panel permite controlar por heterogeneidad no observada constante, acercándonos más a efectos causales.

# ¿Preguntas?

Próxima Sesión:

**M09: Panel - Antigüedad y Trayectorias**

Lunes 23 de febrero, 3-5pm