

# CH7 習題演練

陳家威 <sup>1</sup>

NOVEMBER 22, 2022

---

<sup>1</sup>R10323045@ntu.edu.tw

7-9

1. 母親吸菸對出生嬰兒會不會有影響？
2. 直覺會有影響，但是實證上能不能證明？
3. 資料集為 `bweight_small`

- 母親吸菸者，出生嬰兒體重的平均值
- 母親不吸菸者，出生嬰兒體重的平均值
- 使用  $t$  檢定，檢定兩族群平均體重是否相同。

# 分兩群做平均，能代表什麼嗎？

考慮以下問題：

1. 醫生平均年薪 300 萬
2. 高級社畜平均年薪 200 萬
3. 所以高級社畜去當醫生，年薪可以增加？

請問哪裡怪怪的？

# 我們到底想量測什麼東西？

經濟學家有許多會想量測的「如果」問題，這些我們統稱為「處理效果」

ATE 如果隨機分配一個人去當醫生，他會比隨機分配他去當高級社畜多賺多少？

ATT 如果醫生沒當醫生，那他少賺多少？

ATU 如果把一個當了高級社畜的人抓去當醫生，他會多賺多少？

LATE 對一個只差一點點就上醫學系的高級社畜，讓他真的當醫生，可以多賺多少？

會需要考慮這麼多「處理效果」的原因，在於「結果通常不是隨機的」，而是「自我選擇的」

# 各種處理效果

ATE	$E[Y_1] - E[Y_0]$
ATT	$E[Y_1   D = 1] - E[Y_0   D = 1]$
ATU	$E[Y_1   D = 0] - E[Y_0   D = 0]$

「新聞媒體」的「處理效果」： $E[Y_1 | D = 1] - E[Y_0 | D = 0]$

當醫生的平均薪資 - 當社畜的平均薪資

事實是，會當高級社畜的人，當初可能就因為技能點不在三類，所以沒選擇當醫生。所以這種新聞媒體的「處理效果」並不能回答「當醫生可以多賺多少（ATT）」

我們需要想辦法找出「選擇當醫生的人，如果不當醫生，他的薪資會是多少」，也就是  $E[Y_0 | D = 1]$ （實際上觀測不到！）

## 回到題目 B—平均處理效果

回歸  $BWEIGHT = \beta_1 + \beta_2 MBSMOKE$ ，並解釋  $\beta_2$  的係數

我們可以將  $\beta_2$  解釋為平均處理效果嗎？

$\beta_2$  是否可以代表  $E[BWEIGHT_1] - E[BWEIGHT_0]$



# 解讀平均處理效果的條件

## 平均處理效果

只有當「抽菸」與「不抽菸」的兩組，是隨機分配時，這樣的回歸結果才能解讀為「平均處理效果」

原因：抽菸與不抽菸是一種自我選擇的結果。

假說 1：抽菸的女性普遍較不在意健康，所以懷孕時也因為不在意飲食健康等，使嬰兒體重減少。因此抽菸與懷孕只有相關，沒有因果。

# 所以一定要做實驗？

隨機分配孕婦抽菸與不抽菸，檢查兩平均（做 a 小題的回歸），即可檢查平均處理效果。

- 實驗不人道
- 我們看到的資料卻只有選擇過後的結果

所以到底如何檢視 ATE/ ATT？

1. 靠一些自我選擇的模型，例如 Roy Model
2. 靠工具變數 (IV)– 得出 LATE
3. 靠逆傾向分數加權 (inverse propensity weighting) – 在 CIA 下得出 ATE
4. ...

2000（自我選擇），2019（隨機實驗），2021（局部平均處理效果）  
年諾貝爾經濟學獎。

## C - 加入其他變數

- MMARRIED

- MAGE

- PRENTAL1

- FBABY

1. 這些變數是否為重要預設指標？
2. 是否與預期相同？
3. MBSMOKE 的係數估計發生很大的變化嗎？

## 控制了變數就有 ATE 了嗎？

如果假設我們的選擇（抽不抽菸），在控制了一些變數之後（是否已婚、有無做產檢、是否第一胎...），選擇就變成隨機的決定的話，那我們對選擇的係數，就可以詮釋為（條件）平均處理效果。

這種假設我們稱之為條件獨立假設 (CIA)。

在此題的情況下，有滿強的理由認為就算控制這些變數，抽菸還是自我選擇的結果。

在 CIA 之下，就可以用 inverse propensity weighting 的方式，計算 ATE

$$\begin{aligned} ATE = & \sum_{MBSMOKE_i=1} \left( \frac{BWEIGHT_i}{p(MBSMOKE)} \right) \\ & - \sum_{MBSMOKE_i=0} \left( \frac{BWEIGHT_i}{1 - p(MBSMOKE)} \right) \end{aligned}$$

# CHOW TEST

抽菸到底會不會有差的另外一種檢定方式 – 分組，看迴歸係數是否一樣

1. 不把抽菸加入回歸，算  $SSE_R$
2. 只對抽菸的回歸，算  $SSE_{U1}$
3. 只對不抽菸的回歸，算  $SSE_{U0}$
4. 計算  $SSE_U = SSE_{U0} + SSE_{U1}$
5. 變數的數量 = 5
6. 全部的樣本數 = 1200
7. 計算  $F = \left( \frac{SSE_R - SSE_U}{5} \right) / \left( \frac{SSE_U}{1200 - 5 \times 2} \right)$
8. 檢定  $F$  值

## D 的另一種做法

如果 MBSMOKE 沒有影響，那麼加入他們的交乘項，應該係數都會是 0

# 控制變數之後的平均處理效果

假設有 CIA，則我們可以算出平均處理效果，也就是在控制這些變數之下，我們分組的平均就有如隨機實驗般。

土法煉鋼做法

$$\begin{aligned}\tau_{ATE} &= (3143.2108 - 3154.0161) + (206.9242 - 96.3475) \times 0.715 \\ &\quad + (-5.5208 - 4.9272) \times 26.57583 + (8.2981 - 119.8472) \times 0.815 \\ &\quad + (94.0675 + 83.167) \times 0.440833 \\ &= -222.19\end{aligned}$$

用回歸技巧： $y_i = \alpha + \tau_{ATE}d_i + \beta x_i + \gamma(d_i(x_i - \bar{x})) + e_i$

7-15