

Dữ liệu bảng (Panel Data)

Đinh Công Khải
Tháng 5/2012

GV. Đinh Công Khải - FETP- Kinh tế lượng ứng dụng

Nội dung

1. Giới thiệu chung về dữ liệu bảng
2. Những lợi thế khi sử dụng dữ liệu bảng
3. Ước lượng mô hình hồi qui dữ liệu bảng
 - Mô hình những ảnh hưởng cố định (FEM)
 - Mô hình những ảnh hưởng ngẫu nhiên (REM)
4. Các kiểm định phương sai thay đổi và tương quan chuỗi trong dữ liệu bảng.

GV. Đinh Công Khải - FETP- Kinh tế lượng ứng dụng

Giới thiệu chung về số liệu bảng

- ❑ Thế nào là dữ liệu bảng?
 - Dữ liệu bảng là dữ liệu có 2 chiều: chiều không gian và chiều thời gian.
 - Là sự mở rộng dữ liệu chéo (cross section) theo thời gian (time series).
 - Là dữ liệu chéo theo chuỗi thời gian (cross sectional time-series data).

GV. Đinh Công Khải - FETP- Kinh tế lượng ứng dụng

Bảng cân đối (Balanced panel)

Tỉnh	Năm	GDP	Dân số
1	2005		
1	2006		
1	2007		
2	2005		
2	2006		
2	2007		
.....		
.....		
63	2005		
63	2006		
63	2007		

GV. Đinh Công Khải - FETP- Kinh tế lượng ứng dụng

Bảng không cân đối (Unbalanced panel)

Tỉnh	Năm	GDP	Dân số
1	2005		
1	2006		
1	2007		
2	2005		
2	2006		
.....		
10	2007		
.....		
63	2005		
63	2006		
63	2007		

GV. Đinh Công Khải - FETP- Kinh tế lượng ứng dụng

Những lợi thế của việc sử dụng dữ liệu bảng

- ❑ Dữ liệu bảng cung cấp nhiều thông tin hơn, biến thiên hơn, ít có sự đa cộng tuyến giữa các biến số, bậc tự do cao hơn, và hiệu quả hơn.
- ❑ Bằng cách nghiên cứu các dữ liệu chéo một cách lặp đi lặp lại, dữ liệu bảng thực hiện tốt hơn các nghiên cứu về những thay đổi xảy ra liên tục như tỷ lệ thất nghiệp, di chuyển lao động.

GV. Đinh Công Khải - FETP- Kinh tế lượng ứng dụng

Những lợi thế của việc sử dụng số liệu bảng

- ❑ Cho phép kiểm soát sự khác biệt không quan sát được giữa các thực thể (entities), ví dụ như khác biệt văn hoá giữa các quốc gia hay sự khác biệt về triết lý kinh doanh giữa các công ty.
- ❑ Cho phép kiểm soát các biến không quan sát được nhưng thay đổi theo thời gian (chính sách quốc gia, thỏa thuận quốc tế).
- ❑ Cho phép nghiên cứu các mô hình phức tạp, ví dụ như tính kinh tế do quy mô hay thay đổi công nghệ.

GV. Đinh Công Khải - FETP- Kinh tế lượng ứng dụng

Dữ liệu bảng

TABLE 16.1 INVESTMENT DATA FOR FOUR COMPANIES, 1935-1954

Observation	I	F_{-1}	C_{-1}	Observation	I	F_{-1}	C_{-1}
GE				US			
1935	33.1	1170.6	07.8	1935	209.9	1362.4	53.8
1936	45.0	2015.8	104.4	1936	355.3	1807.1	50.5
1937	77.2	2893.3	183.0	1937	469.9	2679.3	118.1
1938	44.6	2039.7	156.2	1938	282.3	1801.9	269.0
1939	48.1	2256.2	172.6	1939	230.4	1657.3	312.7
1940	74.4	2182.2	186.6	1940	361.6	2202.9	284.2
1941	113.0	1934.1	229.9	1941	412.8	2339.5	261.4
1942	97.9	1000.0	207.0	1942	445.6	2166.6	298.7
1943	67.3	1749.4	319.9	1943	361.6	1895.1	301.8
1944	56.8	1587.2	371.5	1944	289.2	1613.9	279.1
1945	93.6	2007.7	319.6	1945	258.7	1659.2	213.8
1946	150.9	2208.3	346.0	1946	420.3	2007.7	232.0
1947	147.2	1856.7	456.4	1947	420.5	1796.7	264.8
1948	146.3	1904.4	439.4	1948	494.5	1625.8	306.0
1949	98.3	1431.8	618.3	1949	405.1	1667.0	351.1
1950	93.5	1510.5	647.4	1950	418.8	1677.4	367.8
1951	135.2	1519.4	671.3	1951	588.2	2289.5	341.1
1952	157.3	2019.7	781.1	1952	645.2	2189.4	444.2
1953	179.5	2371.6	800.3	1953	541.0	2031.3	623.6
1954	189.6	2759.9	889.9	1954	459.8	2115.5	669.7
GM				WEST			
1935	317.6	3078.5	2.8	1935	12.93	191.5	1.8
1936	397.9	4361.7	32.6	1936	25.90	516.0	9.8
1937	410.6	5367.1	156.9	1937	35.05	729.0	7.4
1938	257.7	2792.2	209.2	1938	22.89	560.4	16.1
1939	330.8	4313.2	203.4	1939	18.84	519.9	23.5
1940	467.2	4543.9	207.2	1940	28.57	626.5	28.5
1941	512.0	4551.2	255.2	1941	48.51	537.1	36.2
1942	448.0	3244.1	305.7	1942	-3.34	591.2	60.8
1943	499.6	4053.7	264.1	1943	37.02	617.2	64.4
1944	547.5	4379.3	201.6	1944	37.81	626.7	91.2
1945	567.2	4840.9	265.0	1945	39.27	737.2	92.4
1946	688.1	4900.0	402.2	1946	53.46	760.5	96.0
1947	508.9	3590.5	701.5	1947	55.56	631.4	111.1
1948	529.2	3243.7	822.4	1948	-9.90	602.3	130.0
1949	555.1	3700.2	1020.1	1949	32.04	583.8	141.8
1950	642.9	3755.8	1089.0	1950	32.24	635.2	136.7
1951	755.9	4893.0	1207.7	1951	51.38	732.8	123.7
1952	607.2	4084.9	1400.5	1952	71.70	604.1	145.2
1953	1304.4	6241.7	1777.3	1953	90.08	1193.5	174.8
1954	1486.7	5569.6	2226.3	1954	68.60	1198.9	213.5

Ước lượng các mô hình hồi qui dữ liệu bảng:
Phương pháp những ảnh hưởng cố định

□ Mô hình ước lượng

$$Y_{it} = \beta_1 + \beta_2 X_{2it} + \beta_3 X_{3it} + u_{it} \quad (1)$$

$i = 1, 2, 3, 4$ và $t = 1, 2, \dots, 20$

trong đó

Y_{it} = tổng đầu tư thực của công ty i tại thời điểm t

X_{2it} = giá trị thực của công ty i tại thời điểm t

X_{3it} = trữ lượng vốn của công ty i tại thời điểm t

u_{it} = nhiễu trắng

GV. Đinh Công Khải - FETP- Kinh tế lượng ứng dụng

Ước lượng các mô hình hồi qui dữ liệu bảng (tt)

□ Xem xét việc ước lượng (1) trong 5 trường hợp sau đây:

1. Tung độ góc và hệ số góc giống nhau giữa các công ty và qua thời gian (phần dư thể hiện sự khác biệt giữa các công ty và qua thời gian).
2. Tung độ góc khác nhau giữa các cty, hệ số góc là hằng số
3. Tung độ góc khác nhau giữa các công ty và qua thời gian, hệ số góc là hằng số.

GV. Đinh Công Khải - FETP- Kinh tế lượng ứng dụng

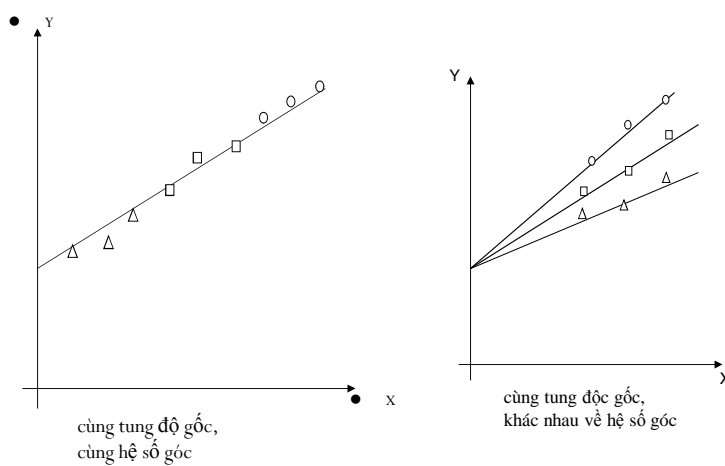
Ước lượng các mô hình hồi qui dữ liệu bảng (tt)

4. Tung độ góc và hệ số góc thay đổi giữa các công ty.
5. Tung độ góc và hệ số góc thay đổi giữa các công ty và qua thời gian.

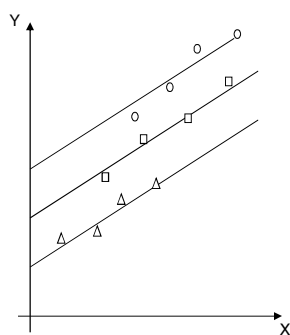
GV. Đinh Công Khải - FETP- Kinh tế lượng ứng dụng

Ước lượng các mô hình hồi qui dữ liệu bảng (tt)

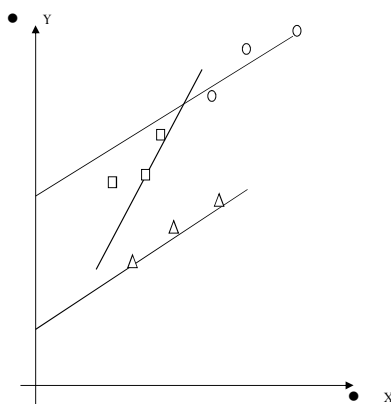
Nguồn: Cao Hào Thi



Ước lượng các mô hình hồi qui dữ liệu bảng (tt)
 Nguồn: Cao Hào Thi



Khác tung độ gốc
 Cùng hệ số góc



Khác tung độ gốc
 Khác hệ số góc

13

Ước lượng các mô hình hồi qui dữ liệu bảng (tt)

- TH 1: Tung độ gốc không đổi và hệ số góc không đổi

$$Y_{it} = \beta_1 + \beta_2 X_{2it} + \beta_3 X_{3it} + u_{it}$$

- TH 2: Tung độ gốc thay đổi theo i và hệ số góc không đổi

Mô hình những các ảnh hưởng cố định (fixed effects) hay mô hình bình phương tối thiểu các biến giả (LSDV)

$$Y_{it} = \beta_{1i} + \beta_2 X_{2it} + \beta_3 X_{3it} + u_{it}$$

Mô hình những ảnh hưởng cố định (fixed effects) hay mô hình bình phương tối thiểu các biến giả (LSDV)

- Mỗi thực thể đều có những đặc điểm riêng biệt, có thể ảnh hưởng đến các biến giải thích.

Ví dụ: Cách thức kinh doanh của một công ty có thể ảnh hưởng đến giá trị của công ty hay trữ lượng vốn của nó.

- Giả thiết rằng có sự tương quan giữa phần dư của mỗi thực thể (có chứa các đặc điểm riêng) với các biến giải thích.

GV. Đinh Công Khải - FETP- Kinh tế lượng ứng dụng

Mô hình những ảnh hưởng cố định (fixed effects) hay mô hình bình phương tối thiểu các biến giả (LSDV)

- FE có thể kiểm soát và tách ảnh hưởng của các đặc điểm riêng biệt (không đổi theo thời gian) này ra khỏi các biến giải thích để chúng ta có thể ước lượng những ảnh hưởng thực (net effects) của biến giải thích lên biến phụ thuộc.
- Các đặc điểm riêng biệt (không đổi theo thời gian) này là đơn nhất đối với 1 thực thể và không tương quan với đặc điểm của các thực thể khác.

GV. Đinh Công Khải - FETP- Kinh tế lượng ứng dụng

Ước lượng các mô hình hồi qui dữ liệu bảng (tt)

$$Y_{it} = \beta_{1i} + \beta_2 X_{2it} + \beta_3 X_{3it} + u_{it}$$

$$Y_{it} = \alpha_1 + \alpha_2 D_{2i} + \alpha_3 D_{3i} + \alpha_4 D_{4i} + \beta_2 X_{2it} + \beta_3 X_{3it} + u_{it}$$

$D_{2i} = 1$ nếu quan sát thuộc GM; bằng 0 nếu không thuộc GM

$D_{3i} = 1$ nếu quan sát thuộc US; bằng 0 nếu không thuộc US

$D_{4i} = 1$ nếu quan sát thuộc WEST, bằng 0 nếu không thuộc WEST

GV. Đinh Công Khải - FETP- Kinh tế lượng ứng dụng

Phân tích số liệu bảng (tt)

□ TH 3: Tung độ góc thay đổi theo t và hệ số góc không đổi

(sự thay đổi về công nghệ, chính sách của chính phủ, thuế)

$$Y_{it} = \beta_{1t} + \beta_2 X_{2it} + \beta_3 X_{3it} + u_{it}$$

$$Y_{it} = \alpha_1 + \alpha_2 t_{35} + \alpha_3 t_{36} + \dots + \alpha_4 t_{54} + \beta_2 X_{2it} + \beta_3 X_{3it} + u_{it}$$

$t_{35} = 1$ nếu quan sát ở năm 1935; bằng 0 nếu không phải

$t_{36} = 1$ nếu quan sát ở năm 1936; bằng 0 nếu không phải

..

$t_{54} = 1$ nếu quan sát ở năm 1954; bằng 0 nếu không phải .

GV. Đinh Công Khải - FETP- Kinh tế lượng ứng dụng

Phân tích số liệu bảng (tt)

- TH 4: Tung độ góc thay đổi theo i và t và hệ số góc không đổi

$$Y_{it} = \alpha_1 + \alpha_2 D_{2i} + \alpha_3 D_{3i} + \alpha_4 D_{4i} + \lambda_1 t_{35} + \dots + \lambda_{19} t_{53} + \beta_2 X_{2it} + \beta_3 X_{3it} + u_{it}$$

- TH 5: Tung độ thay đổi và hệ số góc thay đổi

$$Y_{it} = \alpha_1 + \alpha_2 D_{2i} + \alpha_3 D_{3i} + \alpha_4 D_{4i} + \beta_2 X_{2it} + \beta_3 X_{3it} + \gamma_1 (D_{2i} X_{2it}) + \gamma_2 (D_{2i} X_{3it}) + \gamma_3 (D_{3i} X_{2it}) + \gamma_4 (D_{3i} X_{3it}) + \gamma_5 (D_{4i} X_{2it}) + \gamma_6 (D_{4i} X_{3it}) + u_{it}$$

GV. Đinh Công Khải - FETP- Kinh tế lượng ứng dụng

Những hạn chế của FEM hay LSDV

- Có quá nhiều biến được tạo ra trong mô hình, do đó có khả năng làm giảm bậc tự do và làm tăng khả năng sự đa cộng tuyến của mô hình.
- FEM không đo lường được tác nhân không thay đổi theo thời gian như giới tính, màu da, hay chủng tộc.

GV. Đinh Công Khải - FETP- Kinh tế lượng ứng dụng

Mô hình những tác động ngẫu nhiên (random effects model)

- Đặc điểm riêng giữa các thực thể được giả sử là ngẫu nhiên và không tương quan đến các biến giải thích thì chúng ta dùng REM.
- REM xem các phần dư của mỗi thực thể (không tương quan với biến giải thích) là một biến giải thích mới.

GV. Đinh Công Khải - FETP- Kinh tế lượng ứng dụng

Mô hình những tác động ngẫu nhiên (random effects model)

$$\begin{aligned}
 Y_{it} &= \beta_{1i} + \beta_2 X_{2it} + \beta_3 X_{3it} + u_{it} \\
 \beta_{1i} &= \beta_1 + \varepsilon_i \\
 Y_{it} &= \beta_1 + \beta_2 X_{2it} + \beta_3 X_{3it} + \varepsilon_i + u_{it} \\
 w_{it} &= \varepsilon_i + u_{it} \\
 E(w_{it}) &= 0 \\
 \text{var}(w_{it}) &= \sigma_\varepsilon^2 + \sigma_u^2; \quad \text{cov}(w_{it}, w_{is}) = \frac{\sigma_\varepsilon^2}{\sigma_\varepsilon^2 + \sigma_u^2} \\
 \varepsilon_i &\sim N(0, \sigma_\varepsilon^2) \\
 u_{it} &\sim N(0, \sigma_u^2) \\
 E(\varepsilon_i u_{it}) &= 0 \\
 E(\varepsilon_i \varepsilon_j) &= 0
 \end{aligned}$$

GV. Đinh Công Khải - FETP- Kinh tế lượng ứng dụng

Mô hình FEM (LSDV) hay REM

- ❑ Nếu ε_i và X_s không có tương quan, sử dụng REM
- ❑ Nếu ε_i và X_s có tương quan, sử dụng FEM
- ❑ Nếu T lớn, N nhỏ, 2 phương pháp giống nhau
- ❑ Nếu N lớn, T nhỏ, kết quả ước lượng của 2 phương pháp khá khác nhau.
- ❑ Nếu N lớn, T nhỏ, các điều kiện trong REM được thỏa, ước lượng của REM có hiệu quả hơn FEM

GV. Đinh Công Khải - FETP- Kinh tế lượng ứng dụng

Mô hình FEM (LSDV) hay REM

- ❑ Hausman test
 - H_0 : Ước lượng của FEM và REM không khác nhau
 - $p\text{-value} < 0.05$, bác bỏ H_0
 - Nếu bác bỏ H_0 , REM không hợp lý, nên sử dụng FEM
- ❑ Breusch-Pagan Lagrange Multiplier cho REM (xttest0)
 - H_0 : Phương sai qua các thực thể là không đổi
 - $p\text{-value} < 0.05$, bác bỏ H_0

GV. Đinh Công Khải - FETP- Kinh tế lượng ứng dụng

Các test khác

- ❑ Phương sai thay đổi trong FEM (xttest 3)
Ho: Phương sai không thay đổi
p-value < 0.05, bác bỏ Ho
- ❑ Tương quan chuỗi (kiểm định nhân tử Lagrange , xtserial y x)
Ho: Không có tương quan chuỗi
p-value < 0.05, bác bỏ Ho (có tương quan chuỗi)

GV. Đinh Công Khải - FETP- Kinh tế lượng ứng dụng