

Домашнее задание по эконометрике для группы Э_Б2016_Э_3 №4 (часть 1), 2018-2019

Используйте волну RLMS выделенного Вам года (ту же, что в задании 3.4), данные об индивидах или домохозяйствах (предпочтительнее, там больше информации о семье).

Выберите одну непрерывную зависимую переменную, например, о доходе индивида в соответствующем году.

- 1) Выберите (при необходимости создайте) необходимые объясняющие переменные.
- 2) Среди Ваших регрессоров скорее всего те, которые могут оказаться эндогенными (например, уровень образования).
- 3) Постарайтесь найти подходящие инструменты для эндогенных регрессоров (например, какие-то переменные для членов их семьи).
- 4) Проверьте качество выбранных инструментов (релевантность и валидность).
Проведите тесты Хаусмана, Дарбина-Ву-Хаусмана, Саргана или Хансена. Если инструменты не проходят «проверку», постарайтесь подобрать другие.
- 5) Сравните оценки Вашей регрессии с помощью МНК и 2-х шагового МНК, используя на первом шаге выбранные Вами инструментальные переменные.
- 6) Оформите все в виде связного текста (не забыв вставить необходимые таблицы) и отошлите учебному ассистенту.

Сроки отсылки данных и текста учебному ассистенту Алленовой Анастасии по адресу nastallen97@mail.ru: 23-59 (время) 13 апреля.

Время для личной беседы:

15 апреля в 17-00 - 21-00. Записаться на конкретное время можно на семинаре или по почте demidova@hse.ru.