

Эконометрика, 2018-2019, 4 модуль
Семинары 9-10
3.06.19, 10.06.19
Для Группы Э_Б2016_Э_3
Семинарист О.А.Демидова

Решение экзаменационных вариантов прошлых лет

Дополнительные материалы

Динамические модели панельных данных

Используйте данные файла males и команды из заключительных слайдов лекции Dynamic linear models

Тобит - модель

Воспользовавшись набором данных файла CES, оцените тобит – регрессию определенного вида расходов (список переменных можно найти в файле ces.pdf) на общие расходы домохозяйств. Сравните коэффициент наклона с МНК-оценками при включении и невключении в выборку наблюдений с нулевыми расходами по товару.

Методические рекомендации по выполнению упражнения в пакете STATA

Последовательно наберите в командном окне, например,

tobit TOYS EXP, ll(0)

reg TOYS EXP

reg TOYS EXP if TOYS > 0

Модель Хекмана

Воспользовавшись набором данных файла LFP, используйте процедуру Хекмана для оценивания регрессионной зависимости LGEARN от S ASVABC ETHBLACK ETHHISP для женщин, используя в качестве переменных отбора S AGE CHILDL06 CHILDL16 MARRIED ETHBLACK ETHHISP.

Оцените ту же самую регрессию с помощью МНК.

Методические рекомендации по выполнению упражнения 4 в пакете STATA

Наберите в командном окне

gen LGEARN = ln(EARNINGS)

heckman LGEARN S ASVABC ETHBLACK ETHHISP if MALE ==0, select (S AGE CHILDL06 CHILDL16 MARRIED ETHBLACK ETHHISP)

Много полезных материалов можно найти здесь

<https://sites.google.com/site/econometricsacademy/econometrics-models>

Видео о моделях упорядоченного множественного выбора

<https://www.youtube.com/watch?v=c9kvqeLFF8U>