

Эконометрика, 2020-2021, 4 модуль
Семинар 1
05.04.2021
Группы Э_Б2018_Э_3
Семинарист О.А.Демидова

- 1) Разбор вопросов по кр.3
- 2) С помощью данных файла `ordered_health.dta` оцените факторы, влияющие на здоровье пациента. В качестве зависимой переменной выберите `healthstatus`, которая принимает значения 1, 2, 3, соответствующие состоянию здоровья (`fair`, `good`, `excellent`).
Необходимые команды могут быть найдены в файле `ordered_health.do`.
- 3) С помощью данных файла `multinomial_fishing.dta` оцените факторы, влияющие на выбор способа рыбалки. В качестве зависимой переменной выберите `mode`, которая принимает значения 1, 2, 3, 4, соответствующие 1 – с берега, 2 – с причала, 3 – с собственной лодки, 4 – с арендованной лодки). Необходимые команды могут быть найдены в файле `multinomial_logit.do`.
- 4) 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`

- 5) 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 LGEARNS ASVABC ETHBLACK ETHHISP if MALE ==0, select (S AGE  
CHILDL06 CHILDL16 MARRIED ETHBLACK ETHHISP)
```

б) Представление временных рядов в пакете STATA

Просьба посмотреть видеоматериалы Chuck Huber, посвященные представлению данных различной частотности (годовых, квартальных, месячных, недельных, ежедневных) в STATA:

Time series in Stata, part 1: Formatting and managing dates

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

и еще два материала этого же автора

<https://www.youtube.com/watch?v=JYrnG71zJhM>

<https://www.youtube.com/watch?v=ik8r4WvrPkc>,

выбрать интересные Вам временные ряды и построить их графики (а также графики их первых разностей).