

Содержание

Предисловие.....	7
Глава 1. Модели с дискретными объясняемыми переменными. Метод максимального правдоподобия	10
1.1 Модели, в которых объясняемая переменная принимает только два различных значения	10
1.2. Использование метода максимального правдоподобия для оценивания моделей бинарного выбора	18
1.3. Показатели качества моделей бинарного выбора, критерии согласия с имеющимися данными, сравнение альтернативных моделей	24
1.4. Интерпретация коэффициентов	35
1.5. Проверка выполнения стандартных предположений	38
1.6. Модели, в которых объясняемая переменная принимает несколько различных значений	47
1.6.1. Порядковая пробит-модель	47
1.6.2. Мультиномиальная модель.....	55
1.7. Цензурированная модель регрессии (тобит-модель).....	67
1.8. Модель Тобит-И.....	86
Глава 2. Инструментальные переменные. Системы одновременных уравнений	99
2.1. Проблема коррелированности случайных ошибок с объясняющими переменными.....	99
2.2. Модели, в которых некоторые объясняющие переменные коррелированы с ошибкой.....	111
2.2.1. Модели с ошибками в измерении объясняющих переменных	111
2.2.2. Модели одновременных уравнений.....	113
2.3. Метод инструментальных переменных.....	116
2.4. Проблема идентифицируемости структурной формы системы одновременных уравнений.....	125
2.5. Проверка выполнения условий идентифицируемости структурных уравнений	133
2.6. Оценивание систем одновременных уравнений	158
2.6.1. Косвенный метод наименьших квадратов.....	158
2.6.2. Двухшаговый метод наименьших квадратов.....	159
2.6.3. GLS-оценивание систем одновременных уравнений. Трехшаговый метод наименьших квадратов.....	167

2.6.4. Оценивание систем одновременных уравнений с использованием метода максимального правдоподобия.....	170
2.6.5. Связь между различными оценками систем одновременных уравнений	175
2.6.6. Проверка правильности спецификации системы одновременных уравнений	177
2.6.7. Примеры оценивания систем одновременных уравнений	183
2.6.8. Прогнозирование по оцененной системе одновременных уравнений.....	207
Глава 3. Панельные данные	213
3.1. Модель кажущихся несвязанными регрессий, модель ковариационного анализа.....	213
3.2. Фиксированные эффекты.....	242
3.3. Случайные эффекты.....	248
3.4. Коэффициенты детерминации, разложение полной суммы квадратов.....	258
3.5. Выбор между моделями с фиксированными или случайными эффектами	264
3.6. Автокоррелированные ошибки.....	272
3.7. Двухфакторные (двунаправленные) модели	276
3.7.1. Фиксированные эффекты	276
3.7.2. Случайные эффекты	279
3.7.3. Критерии для индивидуальных и временных эффектов.....	281
3.8. Несбалансированные панели.....	284
3.9. Эндогенные объясняющие переменные.....	285
3.10. Модели с индивидуально-специфическими переменными.....	291
3.10.1. Оценивание в RE- и FE-моделях.....	291
3.10.2. Модель Хаусмана-Тейлора.....	294
3.11. Динамические модели	297
3.12. Модели бинарного выбора.....	313
3.12.1. Логит-модель с фиксированными эффектами	319
3.12.2.Пробит-модель со случайными эффектами	323
3.12.3. Пример.....	325
3.13. Тобит-модели	334
Глава 4. Структурные и приведенные формы векторных авторегрессий и моделей коррекции ошибок.....	347
Литература.....	372

Предметный указатель.....	374
----------------------------------	------------

В книге рассматриваются методы статистического анализа регрессионных моделей с ограниченной (цензурированной) зависимой переменной, систем одновременных уравнений, панельных данных, а также структурных форм векторных авторегрессий и моделей коррекции ошибок. Предназначена для студентов, освоивших вводный курс эконометрики. Представляет интерес для специалистов в области экономики и финансов.