

Эконометрика (продвинутый уровень): курс лекций /
сост. Т. В. Сумская; Новосиб. гос. ун-т экономики и
управления. — Новосибирск : НГУЭУ, 2015. — 60 с.

СОДЕРЖАНИЕ

Предисловие.....	3
1. ВВЕДЕНИЕ В ТЕОРИЮ ПАНЕЛЬНЫХ ДАННЫХ.	
АНАЛИЗ ДВУХПЕРИОДНЫХ ПАНЕЛЬНЫХ ДАННЫХ	4
1.1. Введение в теорию панельных данных.....	4
1.2. Анализ двухпериодных панельных данных.....	5
1.2.1. Панельные данные по сравнению с независимыми наблюдениями за однотипными объектами.....	5
1.2.2. Взятие разностей.....	9
1.2.3. Обобщение на более чем два периода наблюдений.....	12
<i>Контрольные вопросы</i>	13
2. ХАРАКТЕРИСТИКИ ПАНЕЛЬНЫХ ДАННЫХ.	
ОСНОВНЫЕ ОБОЗНАЧЕНИЯ И ТЕРМИНОЛОГИЯ	14
2.1. Реальные данные.....	14
2.2. Микровыборки и общие макроопросы.....	16
2.3. Описательный анализ.....	19
2.4. Основные обозначения и терминология.....	20
<i>Контрольные вопросы</i>	21
3. ОБЗОР ЛИНЕЙНЫХ МОДЕЛЕЙ	22
3.1. Обычная регрессия.....	24
3.2. Несвязанные регрессии.....	24
3.3. SUR-модели.....	25
3.4. Фиктивные переменные.....	25
3.5. Компоненты ошибки.....	26
3.6. Случайные коэффициенты.....	27
<i>Контрольные вопросы</i>	27
4. ФИКСИРОВАННЫЕ ЭФФЕКТЫ	28
4.1. Оценивание.....	28
4.2. Проверка на наличие фиксированных эффектов.....	30
4.3. Оценки с учетом вариации между объектами наблюдения и взаимосвязь регрессий.....	31
4.4. Недостатки оценок регрессии с фиксированными эффектами.....	34
<i>Контрольные вопросы</i>	35

5. СЛУЧАЙНЫЕ ЭФФЕКТЫ.....	36
5.1. Оценивание.....	36
5.2. Взаимосвязь с другими оценками.....	40
5.3. Проверка на наличие случайных эффектов.....	41
<i>Контрольные вопросы</i>	42
6. ВЫЯВЛЕНИЕ ХАРАКТЕРА ЭФФЕКТОВ (ФИКСИРОВАННЫЕ ИЛИ СЛУЧАЙНЫЕ). ТЕСТЫ НА СПЕЦИФИКАЦИЮ МОДЕЛИ.....	43
<i>Контрольные вопросы</i>	45
7. ИНСТРУМЕНТАЛЬНЫЕ ПЕРЕМЕННЫЕ.....	46
<i>Контрольные вопросы</i>	48
8. ОБОБЩЕНИЯ ОСНОВНЫХ МОДЕЛЕЙ.....	49
8.1. Несбалансированные модели.....	49
8.2. Временные эффекты.....	50
<i>Контрольные вопросы</i>	51
БИБЛИОГРАФИЧЕСКИЙ СПИСОК.....	52
ПРИЛОЖЕНИЯ.....	55