

Spis treści

Wstęp	9
1 Wprowadzenie do mikroekonometrii	13
1.1 Mikrodane	13
1.2 Obszar mikroekonometrii, tradycje i piśmiennictwo	15
1.3 Modele mikroekonometrii	17
1.4 Główne zagadnienia mikroekonometrii	19
1.4.1 Ekonomia a strategia modelowania w mikroekonometrii	19
1.4.2 Założenia modelu regresji dla danych przekrojowych	21
1.4.3 Korelacja a przyczynowość. Relacje przyczynowe a analiza <i>ceteris paribus</i>	22
1.4.4 Efekty oddziaływania	24
1.4.5 Endogeniczność	25
1.4.6 Heterogeniczność	26
1.4.7 Skokowość, nieliniowość, zawartość informacyjna zbiorów mi- krodanych	27
1.4.8 Zbieranie danych	28
1.4.9 Nowe wyzwania dla mikroekonometrii	30
1.5 Ekonometria przestrzenna a mikroekonometria	31
1.6 Mikroekonometria na salonach: Heckman i McFadden	33
1.7 Słowa kluczowe	35
1.8 Problemy i zadania	35
2 Metody i modele	37
2.1 Metoda największej wiarygodności	37
2.1.1 Wstęp	37

2.1.2	Przykład	37
2.1.3	Definicja estymatora metody największej wiarygodności	39
2.1.4	Teoretyczne własności metody największej wiarygodności . . .	39
2.1.5	Testy statystyczne zbudowane w oparciu o metodę największej wiarygodności	40
2.1.6	Optymalizacja	41
2.1.7	Nieliniowa metoda najmniejszych kwadratów	43
2.1.8	Podsumowanie	44
2.2	Modele ze zmienną ukrytą	46
2.2.1	Wstęp	46
2.2.2	Model tobitowy	47
2.2.3	Model dwumianowy	47
2.2.4	Model uporządkowanej zmiennej wielomianowej	48
2.2.5	Modele czasów trwania	49
2.3	Słowa kluczowe	50
2.4	Problemy i zadania	50
3	Modele zmiennych jakościowych dwumianowych	53
3.1	Zmienne dwumianowe jako przedmiot modelowania	53
3.1.1	Cele modelowania zmiennej dwumianowej	54
3.1.2	Model dwumianowy	55
3.1.3	Związek Y ze zmiennymi objaśniającymi X	56
3.1.4	Intuicyjne objaśnienie modeli zmiennych dwumianowych . . .	56
3.1.5	Główne typy modeli zmiennych dwumianowych	57
3.2	Liniowy model prawdopodobieństwa	58
3.2.1	Uwagi o R -kwadrat w mikroekonometrii	62
3.3	Model logitowy	62
3.3.1	MNW dla modelu logitowego	63
3.3.2	Weryfikacja statystyczna	64
3.3.3	Interpretacja wyników: efekty krańcowe (MEM, MER, AME)	65
3.3.4	Interpretacja wyników: ilorazy szans	67
3.4	Model probitowy	69
3.4.1	Logit, probit, LMP: relacja między parametrami oraz między efektami krańcowymi	70
3.5	Endogeniczność	71
3.6	Miary dopasowania	71
3.6.1	Pseudo- R^2	71
3.6.2	Tablica trafności oraz krzywa ROC	73
3.7	Dobór zmiennych objaśniających do modeli	79
3.8	Modelowanie interakcji	80
3.9	Regresja binarna	84

3.10	Próba dobierana w modelu logitowym	85
3.11	Model logitowy dla makrodanych	87
3.12	Słowa kluczowe	90
3.13	Problemy i zadania	91
4	Modele zmiennych wielomianowych uporządkowanych	103
4.1	Wstęp	103
4.2	Zmienne uporządkowane	105
4.3	Specyfikacja modelu uporządkowanego	108
4.4	Szacowanie modelu uporządkowanego	112
4.5	Uporządkowany model probitowy i logitowy	114
4.6	Założenie proporcjonalnych szans/regresji równoległych	119
4.7	Weryfikacja założenia proporcjonalnych szans	123
4.8	Uogólniony model uporządkowany	126
4.9	Ocena jakości modelu	128
4.9.1	Ocena dopasowania modelu	128
4.9.2	Ocena zdolności predykcyjnych modelu	132
4.10	Interpretacja parametrów	135
4.10.1	Efekt kompensujący	135
4.10.2	Efekty krańcowe	136
4.10.3	Iloraz szans	138
4.11	Dane sekwencyjne	141
4.11.1	Specyfikacja modelu	142
4.11.2	Estymacja	144
4.12	Słowa kluczowe	146
4.13	Problemy i zadania	146
5	Modele zmiennych wielomianowych nieuporządkowanych	153
5.1	Wstęp	153
5.2	Wprowadzenie do modeli wielomianowych	155
5.3	Zmienne egzogeniczne	158
5.4	Model stochastycznej addytywnej użyteczności	159
5.5	Wielomianowy model logitowy	160
5.5.1	Konstrukcja	160
5.5.2	Estymacja i ocena jakości modelu	162
5.5.3	Interpretacja wyników estymacji	165
5.6	Warunkowy model logitowy	172
5.6.1	Konstrukcja	172
5.6.2	Estymacja	175
5.6.3	Interpretacja wyników estymacji	177
5.7	Logitowy model zagnieżdżony	181
5.7.1	Niezależność od nieistotnych możliwości	181

5.7.2	Konstrukcja zagnieżdżonego modelu logitowego	183
5.7.3	Inne modele wyborów dyskretnych	187
5.8	Słowa kluczowe	190
5.9	Problemy i zadania	190
6	Modele zmiennych ograniczonych	193
6.1	Wstęp	193
6.2	Model tobitowy	194
6.3	Podstawowe własności modelu	196
6.4	Estymacja za pomocą metody największej wiarygodności	199
6.5	Testy istotności i miary dopasowania dla modeli zmiennych ograniczonych	199
6.6	Regresja ucięta	201
6.7	Semiparametryczne estymatory modeli regresji tobitowej i uciętej	204
6.8	Modele selekcji próby	205
6.9	Estymacja modelu selekcji próby Heckmana	207
6.10	Modele zmiennych ograniczonych w praktyce: datki charytatywne	209
6.10.1	Regresja tobitowa i ucięta	209
6.10.2	Model selekcji próby	212
6.11	Słowa kluczowe	214
6.12	Problemy i zadania	214
7	Modele zmiennych licznikowych	217
7.1	Zmienna licznikowa	217
7.2	Model regresji Poissona	218
7.3	Model regresji ujemnej dwumianowej	221
7.4	Modele z podwyższoną liczbą zer	223
7.5	Modele zmiennych licznikowych w praktyce: liczba dzieci w rodzinie	225
7.6	Słowa kluczowe	229
7.7	Problemy i zadania	230
Bibliografia		232