

Прикладная эконометрика, 2022, т. 67, с. 121–143.

Applied Econometrics, 2022, v. 67, pp. 121–143.

DOI: 10.22394/1993-7601-2022-67-121-143

Е. В. Коссова, Б. С. Потанин¹

Оценивание модели с гауссовским мультиномиальным эндогенным переключением и неслучайным отбором

Предлагается двухшаговая процедура оценивания модели с мультиномиальным переключением при предположении о совместном нормальном распределении случайных ошибок. На симулированных данных демонстрируется преимущество предлагаемого подхода над популярными альтернативами при нарушении допущения о независимости от посторонних альтернатив. С помощью предложенного метода оценивается премия за брак для мужчин. Получены статистические свидетельства в пользу того, что для состоящих в зарегистрированном браке данная премия является отрицательной, а для состоящих в незарегистрированном — положительной.

Ключевые слова: модели с переключением; неслучайный отбор; эндогенность.

JEL classification: C34; J12.

Введение

В микроэконометрике широко используются модели с переключением, в которых вид основного уравнения определяется в соответствии с некоторым правилом. Правило, «переключающее режимы» основного уравнения, может задаваться значением переменной, эндогенной по отношению к данному уравнению. Начиная с основополагающей работы Дж. Хекмана (Heckman, 1979), экономическая литература изобилует прикладными исследованиями, использующими предложенный им метод оценивания регрессий с эндогенным бинарным переключением. Теоретическое развитие подхода Хекмана шло в двух направлениях: отказ от предпосылки о совместном нормальном распределении за счет использования более гибкой спецификации модели (Pigini, 2015) и переход к более сложным правилам переключения. Например, в работе (Коссова, Потанин, 2018) рассматривается случай, когда переключение задается несколькими бинарными правилами. Однако проблема оценивания моделей с механизмами переключения, альтернативными бинарному, остается слабо изученной. В частности, в некоторых исследованиях возникает необходимость учета

¹ **Коссова Елена Владимировна** — Национальный исследовательский университет «Высшая школа экономики», Москва; ekossova@hse.ru.

Потанин Богдан Станиславович — Национальный исследовательский университет «Высшая школа экономики», Москва; bogdanpotanin@gmail.com.