

Прикладная эконометрика, 2026, т. 81, с. 68–92.

Applied Econometrics, 2026, v. 81, pp. 68–92.

DOI: 10.22394/1993-7601-2026-81-68-92

EDN: BERLZK

А. О. Гергенретер¹

Оценивание эффектов воздействия на порядковые показатели в многомерных моделях упорядоченного выбора

В работе рассматривается задача оценивания эффектов воздействия на порядковые показатели при нарушении предположения об условной независимости между переменной воздействия и зависимой переменной. Предлагается расширение существующих подходов с помощью параметрического метода на основе иерархических систем уравнений упорядоченного выбора. Получены аналитические формулы для расчета средних эффектов воздействия и средних предельных эффектов объясняющих переменных в контексте многомерных порядковых пробит-моделей в условиях эндогенности переменной воздействия и неслучайного отбора наблюдений для порядковой переменной исхода. Эмпирическая часть работы посвящена изучению влияния стресса на потребление аддитивных благ на основе данных опроса NSDUH (США) за 2020–2023 гг. Установлено значимое влияние стресса на склонность к аддитивному поведению, оценены эффекты воздействия различных уровней стресса на вероятность и частоту потребления аддитивных благ. Сравнение полученных оценок с оценками модели без учета эндогенности воздействия демонстрируют необходимость оценивания иерархических систем для корректного определения количественного влияния стресса. Показано, что вероятность потребления психоактивных веществ устойчиво возрастает при увеличении уровня стресса, причем женщины оказываются более уязвимыми к воздействию стресса. Продемонстрировано, что влияние стресса на аддитивное поведение варьируется в зависимости от социально-экономических характеристик респондентов.

Ключевые слова: иерархическая система уравнений; многомерная порядковая пробит модель; эндогенность; неслучайный отбор; эффекты воздействия; аддитивные блага; стресс.

JEL classification: C18; C31; C35; I12.

1. Введение

При изучении причинно-следственных связей в социально-экономических науках нередко возникает необходимость в оценивании эффекта воздействия одной переменной на другую. В бинарном случае средний эффект воздействия (Average Treatment Effect, ATE) обычно определяется как ожидаемое изменение значения зависимой переменной

¹ Гергенретер Анастасия Олеговна — Национальный исследовательский университет «Высшая школа экономики», Москва; agergenreter@hse.ru.