

1 Heckman modelis

2007/2008 m.m. rudens semestras

Šiai užduočiai bus naudojami duomenys apie ištekėjusių moterų dalyvavimą darbo rinkoje. Duomenys yra R pakete „micEcon“, juos gausite suinstaliavę tą paketą bei parašę `library(micEcon)` ir `data(Mroz87)` R komandinėje eilutėje. Duomenis taip pat bus galima atsisiųsti iš puslapio, kuriame patalpinta šita užduotis.

1. Atlikite pradinę duomenų analizę.
2. Raskite geriausią probit modelį nusakantį moters dalyvavimą darbo rinkoje. Motyvuokite savo pasirinkimą (galima pateikti kelis geriausius modelius).
3. Kokias išvadas galite daryti remdamiesi šiuo(iais) modeliu(iais)?
4. Heckmano modelis atlyginimui w_i ir dalyvavimui darbo rinkoje h_i aprašomas šiomis lygtimis:

$$w_i^* = \mathbf{x}'_i \boldsymbol{\beta} + \varepsilon_{1i} \quad (1)$$

$$h_i^* = \mathbf{z}'_i \boldsymbol{\gamma} + \varepsilon_{2i} \quad (2)$$

$$w_i = w_i^*, h_i = 1, \text{ jei } h_i^* > 0 \quad (3)$$

$$w_i \text{ nestebimas, } h_i = 0, \text{ jei } h_i^* \leq 0, \quad (4)$$

čia

$$\begin{pmatrix} \varepsilon_{1i} \\ \varepsilon_{2i} \end{pmatrix} \sim N \left(\begin{pmatrix} 0 \\ 0 \end{pmatrix}, \begin{pmatrix} \sigma_1^2 & \sigma_{12} \\ \sigma_{12} & 1 \end{pmatrix} \right)$$

Taigi turime modelį su dviem endogeniniais kintamaisiais w_i ir h_i . Koeficientus $\boldsymbol{\beta}$ ir $\boldsymbol{\gamma}$ galima įvertinti dviem būdais: didžiausio tikėtinumo ir „heckit“. „Heckit“ metodas susideda iš dviejų etapų. Pirmame etape yra įvertinama lygtis (2), naudojant probit regresiją, antrame mažiausių kvadratų metodu įvertinama regresija:

$$w_i = \mathbf{x}'_i \boldsymbol{\beta} + \sigma_{12} \lambda_i + \eta_i,$$

čia

$$\lambda_i = \frac{\varphi(\mathbf{z}'_i \boldsymbol{\gamma})}{\Phi(\mathbf{z}'_i \boldsymbol{\gamma})}.$$

Šio modelio paklaidos yra lygios $\eta_i = \varepsilon_{1i} - \mathbf{E}(\varepsilon_{1i} | x_i, h_i = 1)$.

Parašykite funkciją, kuri atliktų heckit procedūrą.

5. Įvertinkite porą modelių su savo pasirašyta funkcija. Ko trūksta šitai funkcijai, kad ją būtų galima naudoti ieškant geriausio Heckman modelio aprašančio duotus duomenis?
6. Didžiausio tikėtinumo funkcija Heckman modeliui atrodo taip:

$$\log L(\boldsymbol{\beta}, \boldsymbol{\gamma}, \sigma_1^2, \sigma_{12}) = \sum_{h_i=0} \log P(h_i = 0) + \sum_{h_i=1} [\log f(w_i) + \log P(h_i = 1 | w_i)],$$

čia

$$\begin{aligned} P(h_i = 0) &= 1 - \Phi(\mathbf{z}'_i \boldsymbol{\gamma}) \\ P(h_i = 1 | w_i) &= \Phi \left(\frac{\mathbf{z}'_i \boldsymbol{\gamma} + (\sigma_{12} / \sigma_1^2)(w_i - \mathbf{x}'_i \boldsymbol{\beta})}{\sqrt{1 - \sigma_{12}^2 / \sigma_1^2}} \right) \\ f(w_i) &= \frac{1}{\sqrt{2\pi\sigma_1^2}} \exp \left\{ -\frac{1}{2} (w_i - \mathbf{x}'_i \boldsymbol{\beta})^2 / \sigma_1^2 \right\} \end{aligned}$$

Parašykite funkciją gražinančią šios didžiausio tikėtinumo funkcijos reikšmes duotiems parametrams.

7. Naudodamiesi parašyta funkcija įvertinkite didžiausio tikėtinumo metodu modelius vertintus heckit metodu.
8. Įvertinkite parametrų standartines paklaidas ir patikrinkite, kurie parametrai yra reikšmingi. (Naudokitės didžiausio tikėtinumo įverčių savybėmis).
9. Įvertinkite naudotų modelių gerumą, bei adekvatumą.