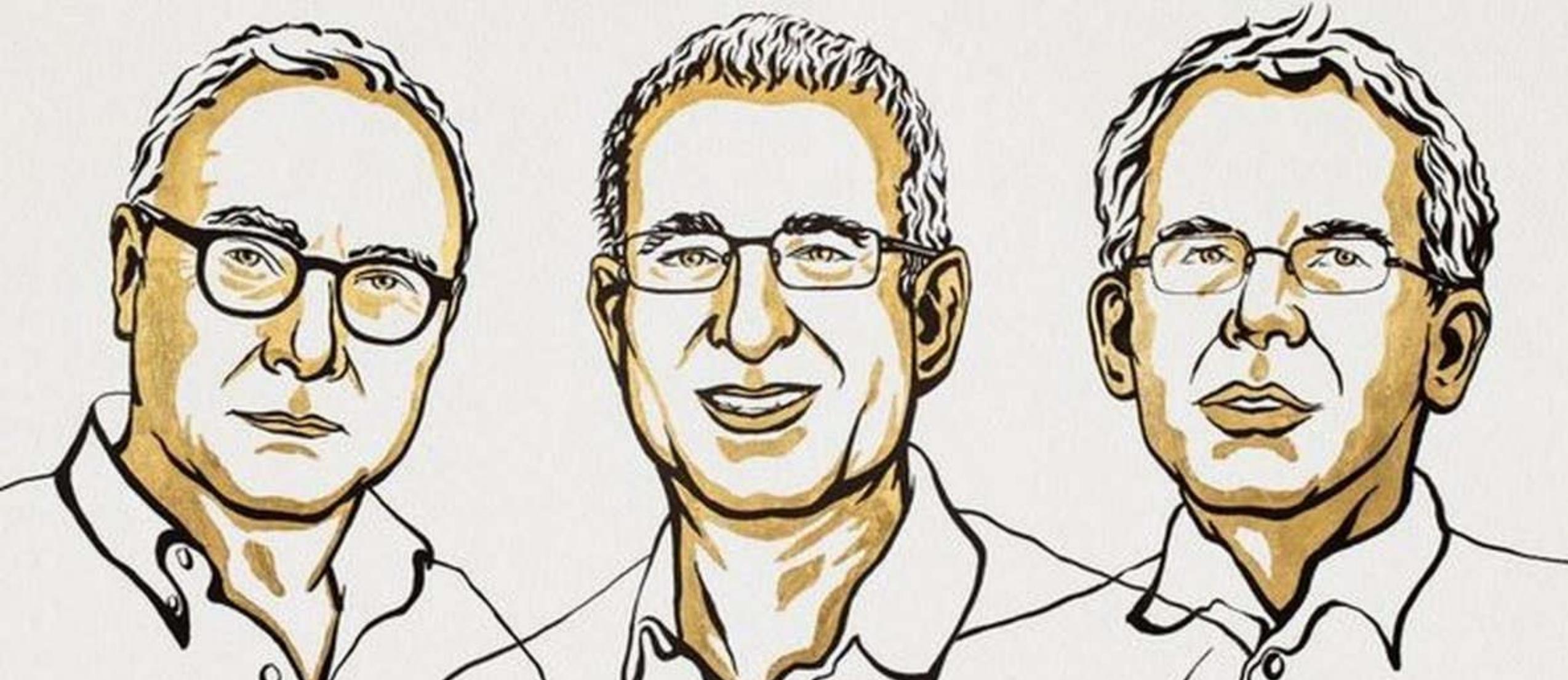


# Революция достоверности



Избавимся от минусов в эконометрике!

# Сегодня

- Краткая история эконометрики: от биологов до медиков
- Какие минусы есть в эконометрике
- Революция достоверности

# Регрессия к среднему (regression to the mean)

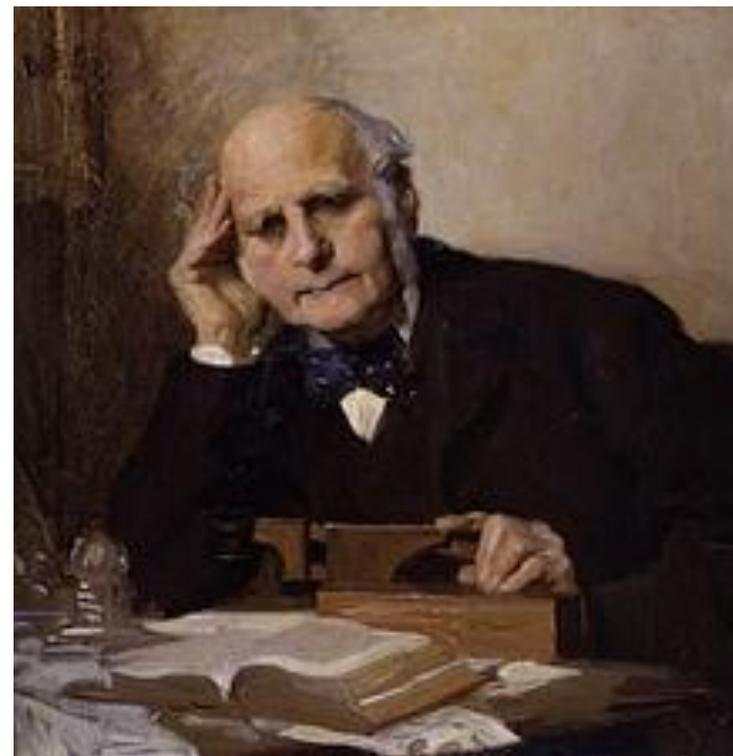
Почему у высоких родителей рождаются низкие дети?



Первая оцененная регрессия

$$\text{Рост ребенка} = 180 + 0.9 * (\text{рост родителя} - 180)$$

Рост ребенка зависит от роста родителя линейно?



Франсис Галтон

А еще рост людей нормально распределен



# Роль ирландского пива в эконометрике



Как понять, какой из двух рецептов вкуснее?

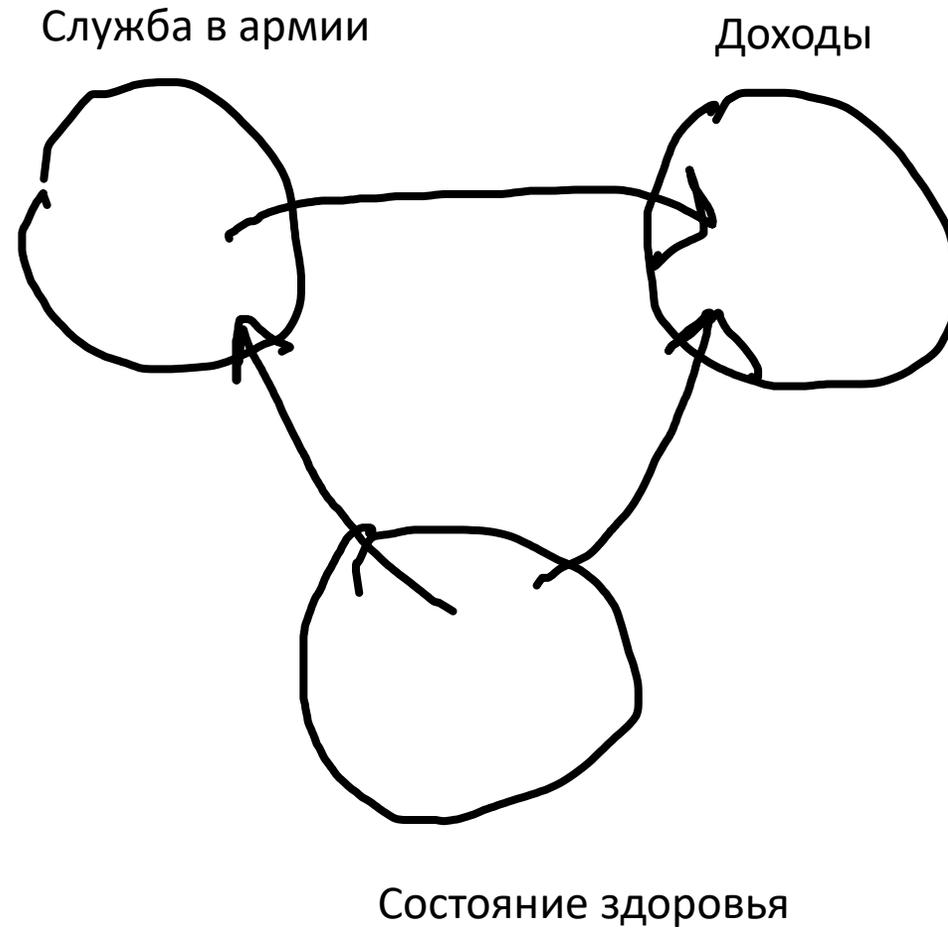


- Поставить 2 банки и спросить, какая вкуснее?
- А вдруг все время выбирают банку 1?
- Менять банки местами.
- А вдруг любителям пива чаще попадались банки определенного вида
- Контролирование и стратификация.

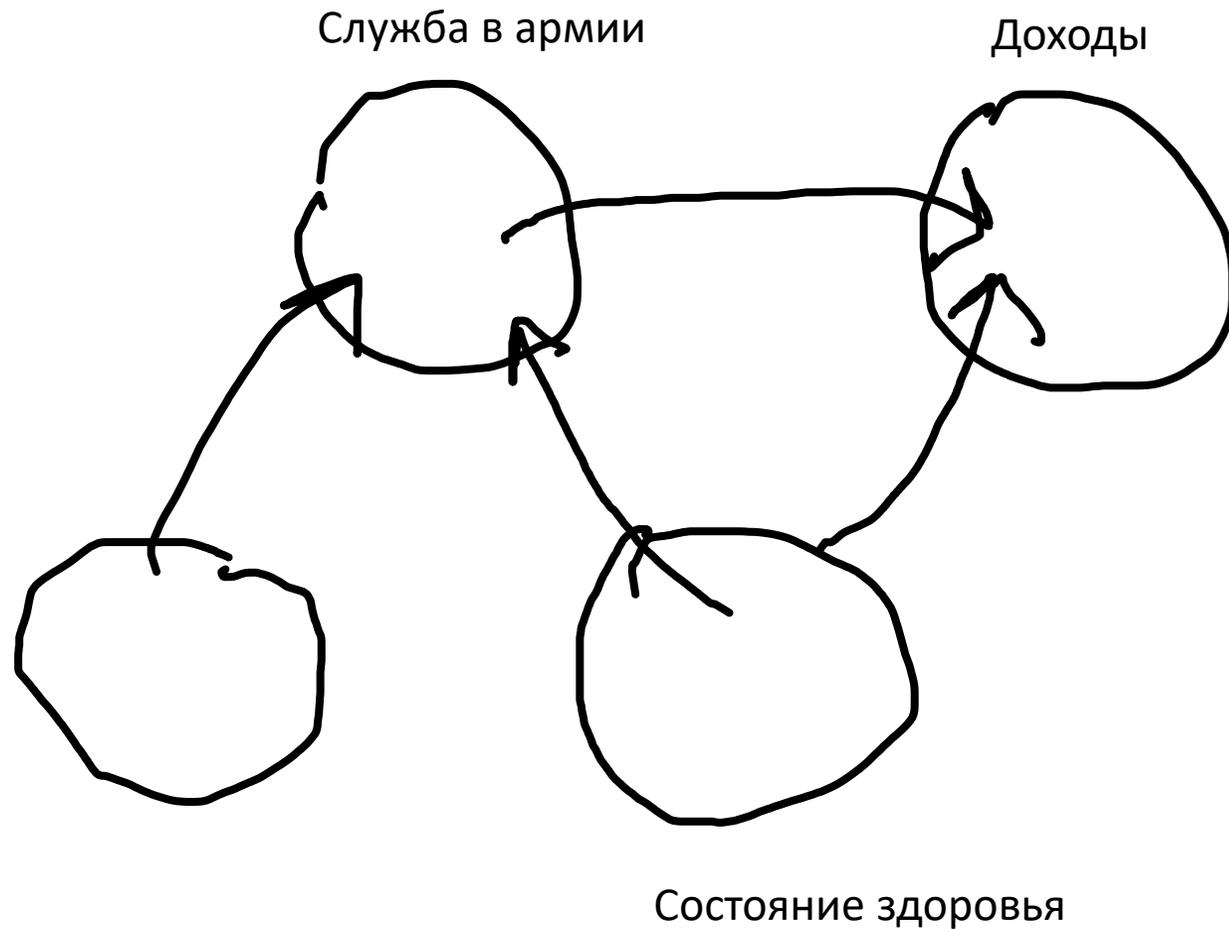


Уильям Госсет (Стьюдент)

# Контролирование



# Инструментальные переменные

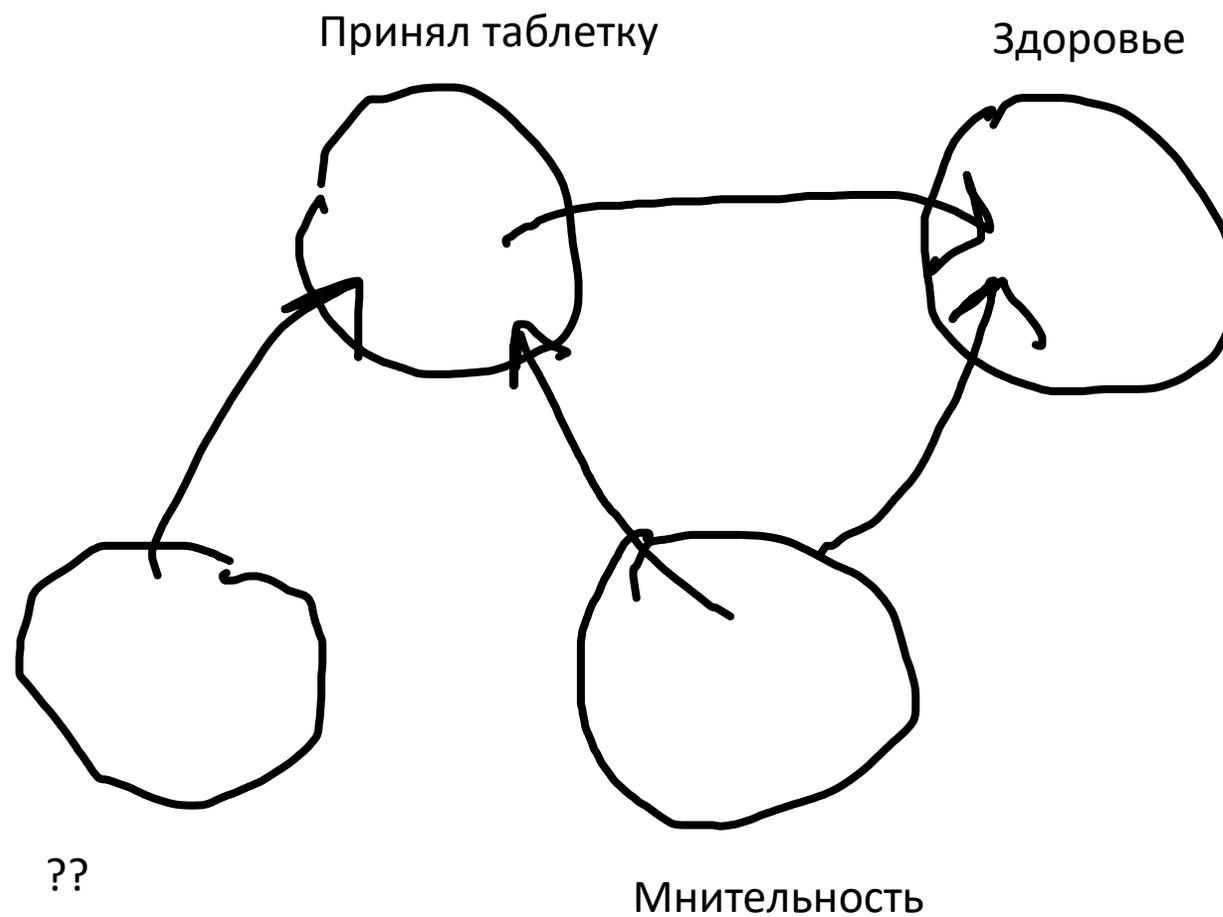


Филипп Райт

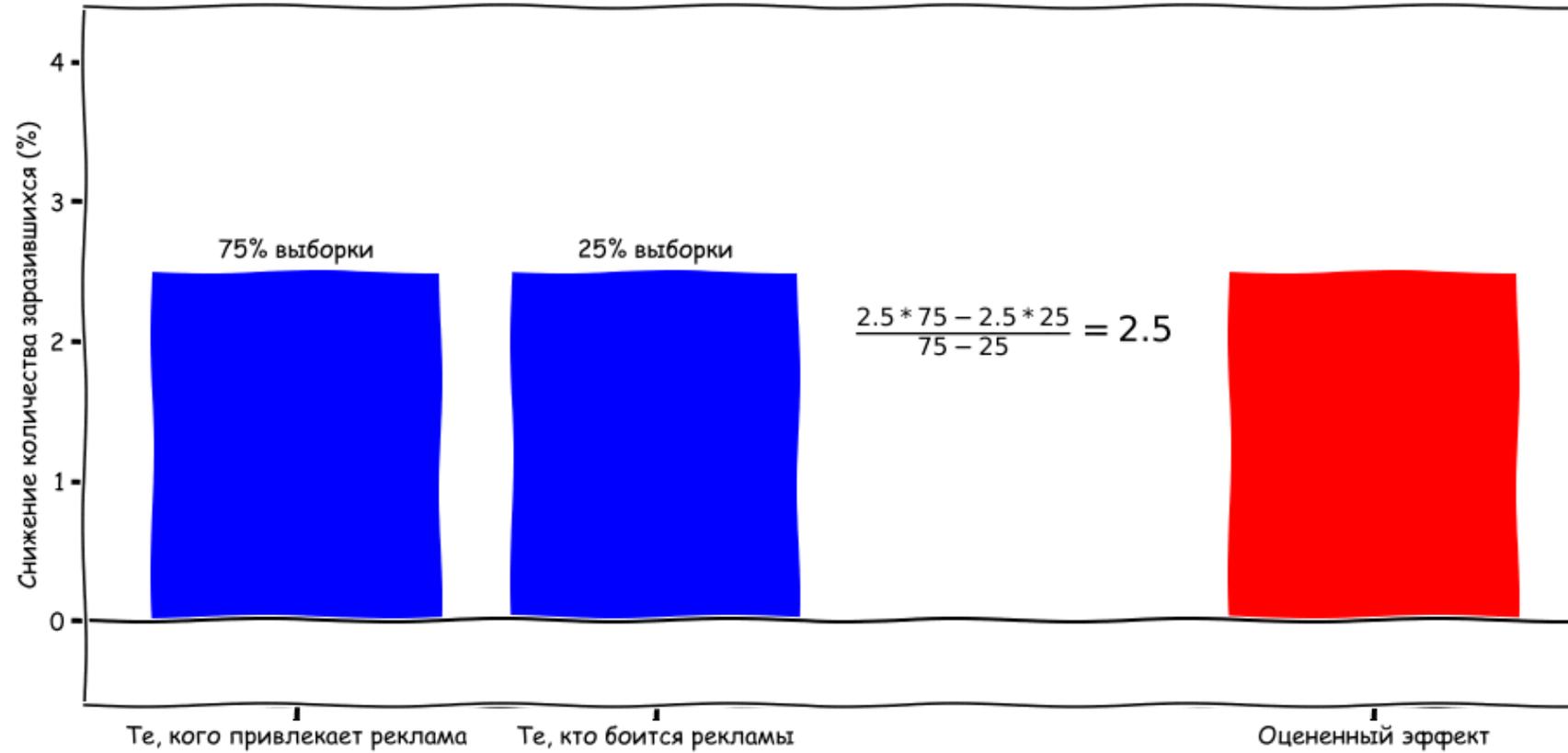
# Призывная лотерея во время войны во Вьетнаме



# Инструментальные переменные: расчет



# Инструментальные переменные



# Let's Take the Con out of Econometrics

*By* EDWARD E. LEAMER\*

## Pros:

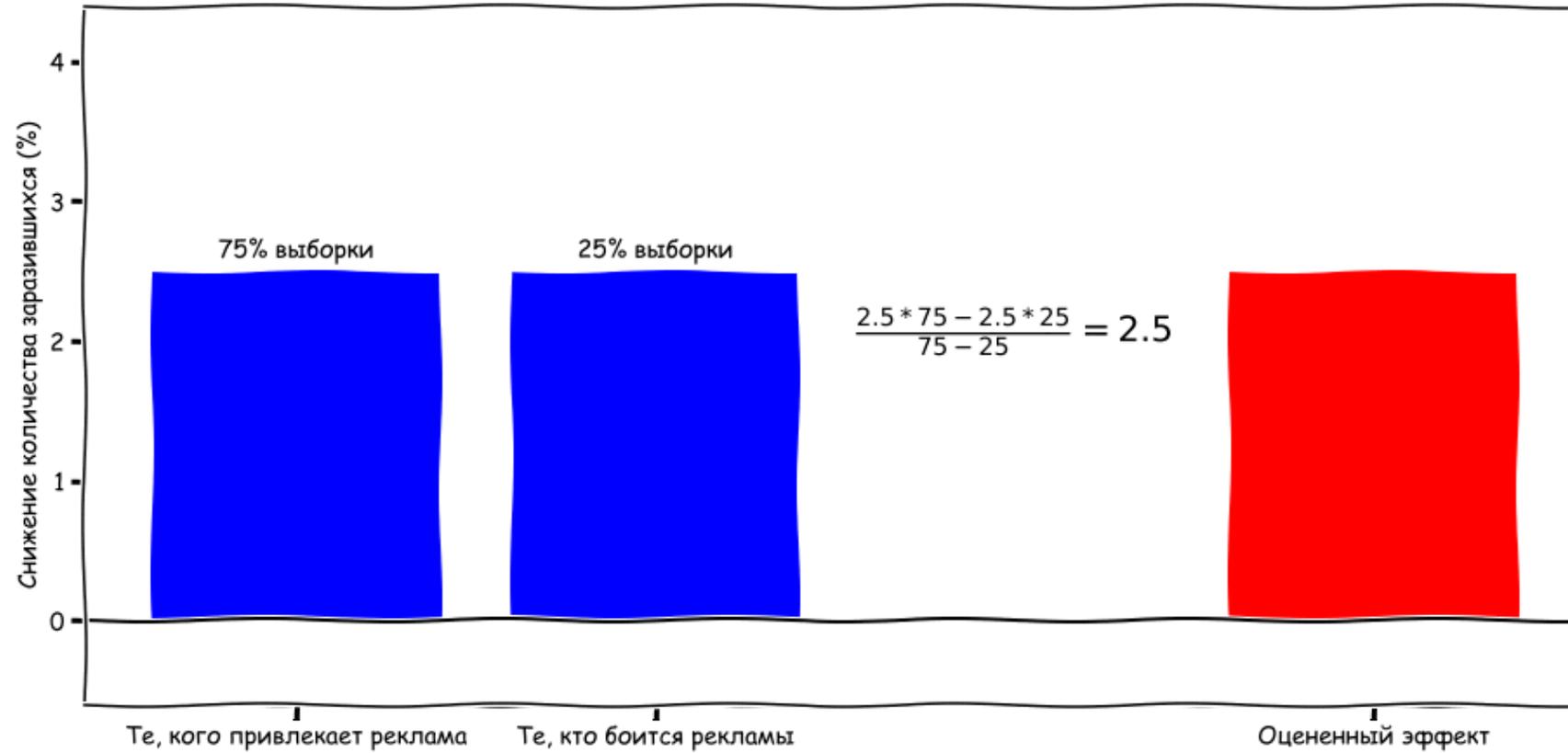
- Можно что-то говорить с умным видом

## Cons:

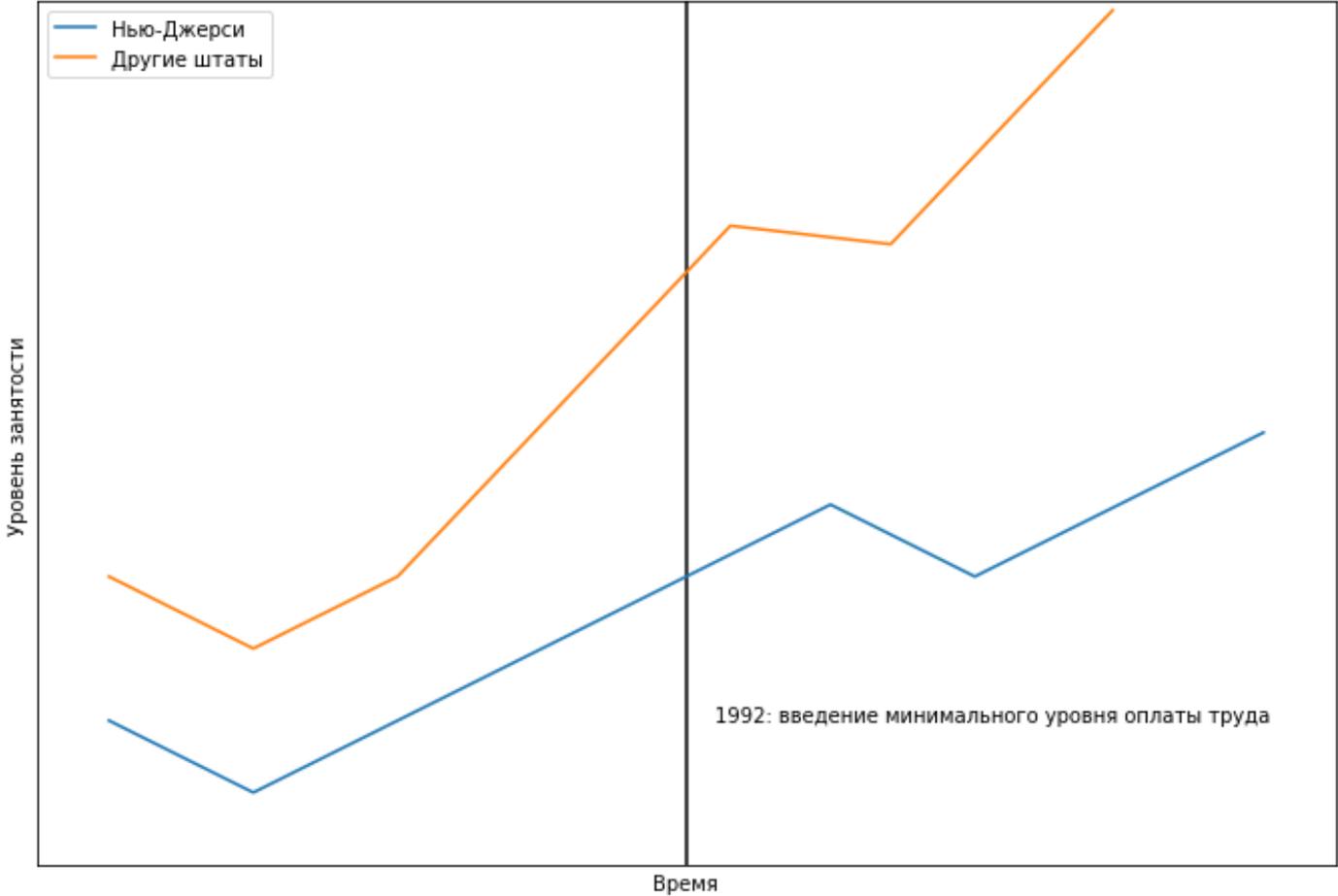
- Выбор способа оценки сильно влияет на результат
- У исследователя очень много возможностей получить ту цифру, которую он хочет получить
- Во все эти предпосылки сложно поверить
- What does regression-to-the-mean mean?

Решение: сконцентрироваться на более  
простых проверяемых предпосылках

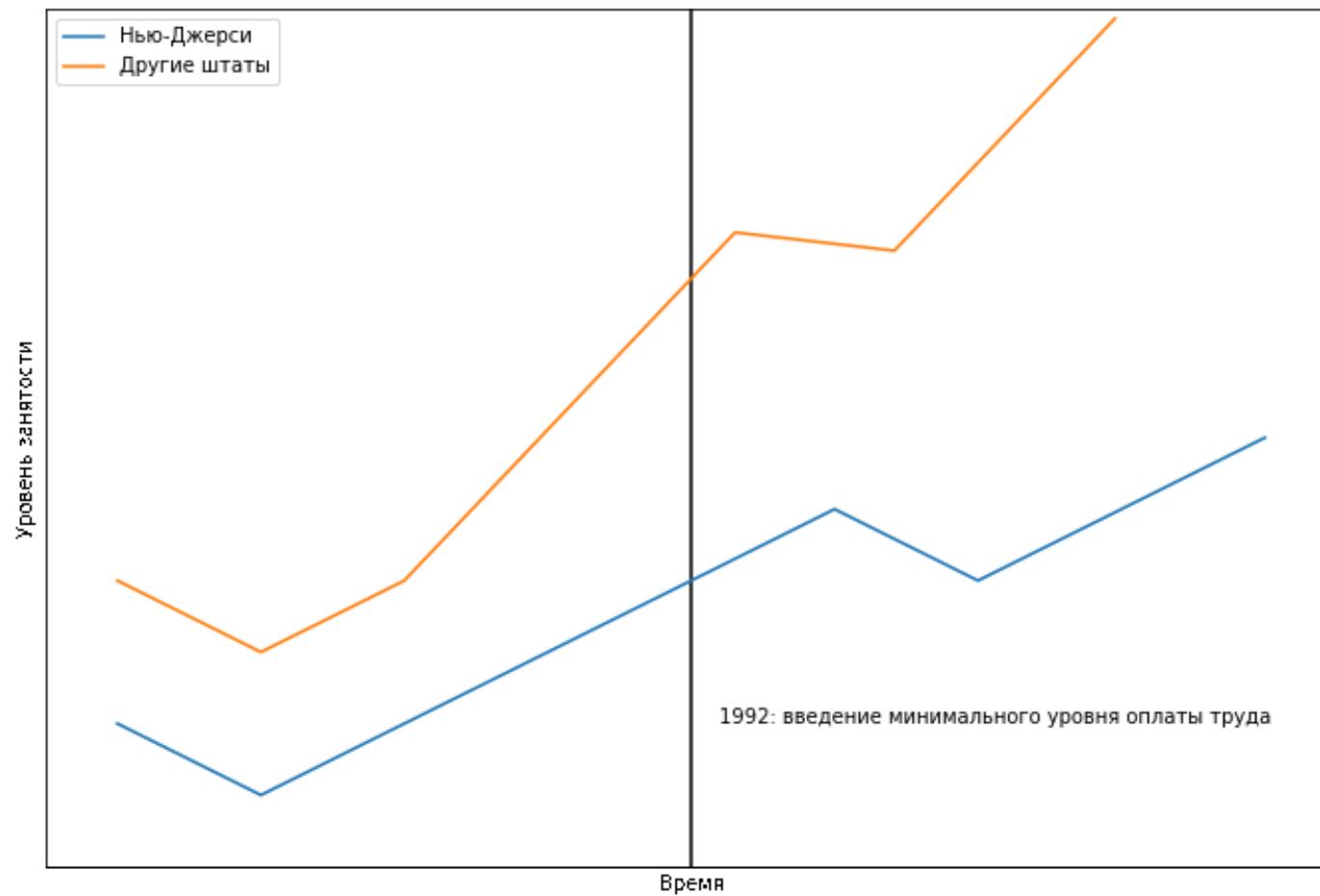
# Монотонность инструмента



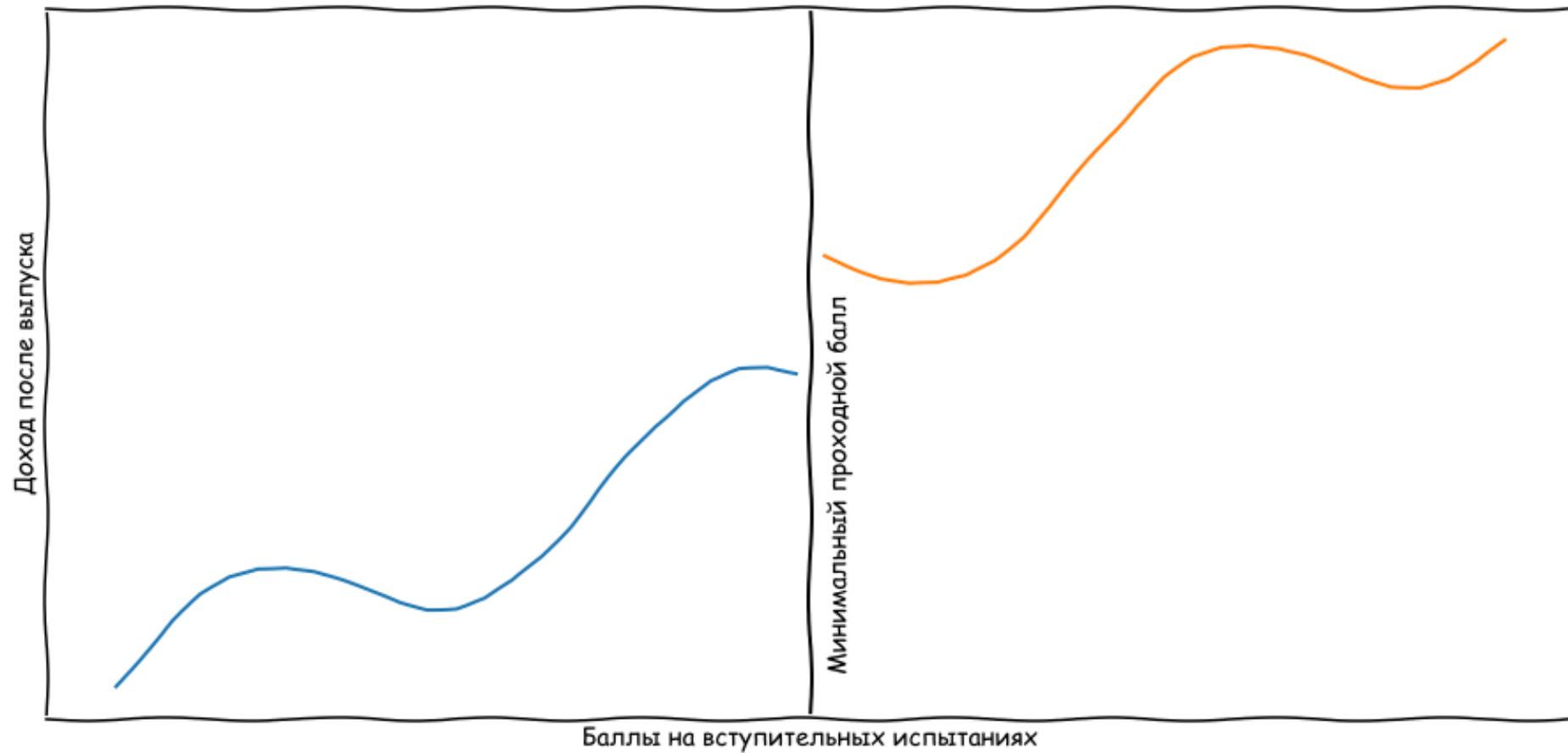
# Влияние минимального уровня оплаты труда на безработицу



# Разница разниц



# Разрывная регрессия



# Регрессия с изломом

