

Stima Semi-Nonparametrica per Modelli Univariati e Bivariati di Scelta Binaria.

Giuseppe De Luca
Università di Roma Tor Vergata - ISFOL

Versione: 11 Agosto 2006

Abstract

In questo articolo, noi utilizziamo l'approccio Semi-Nonparametrico (SNP) di Gallant e Nychka (1987) per stimare modelli univariati e bivariati di scelta binaria. Dopo aver discusso problemi di identificazione e di stima, noi proponiamo un set di nuovi comandi Stata per la stima semiparametrica di tre tipi di modelli. Il primo è un modello semiparametrico di scelta binaria che generalizza il modello probit. Il corrispondente stimatore SNP è una versione più veloce e più accurata dello stimatore SNP implementato in Stata da Stewart (2004). Gli altri due modelli sono invece generalizzazioni del modello probit bivariato, con e senza problemi di selezione. Tali stimatori sono \sqrt{n} -consistenti e asintoticamente normali sotto assunzioni piuttosto deboli sulla forma distributiva degli errori. L'utilizzo di questi comandi è illustrato attraverso alcune applicazioni empiriche.

Parole chiavi: Stimatori SNP, Modelli di Scelta Binaria, Problemi di Selezione.