

на модела; X_i - факторни променливи; а u_i - остатъци. Регресионният модел позволява да се изчисли вероятността:

$$\hat{P}_i = \frac{1}{1 + e^{-(\beta_0 + \sum \beta_i X_i)}}.$$

Решаването на модела минава през оценката на една междинна (непряко включена) dummy променлива Y_i , която приема две стойности - 0 или 1, в зависимост от избраната ситуация; P_i е вероятността да се сбъдне събитието: $Y = 1$, а $(1 - P_i)$ - вероятността то да не настъпи: $Y = 0$.

Използването на подобна регресия (Иванова, Лазаров, 2001) е свързано с определени предварителни процедури, към които изследователят трябва да се отнесе достатъчно сериозно. На първо място това е изключително важната икономическа обосновка на значенията 1 и 0 на променливата Y_i . Препоръчва се съпоставянето на факторната променлива с друга такава, с която са в логическо (от гледна точка на теорията) взаимодействие, т. е. те да бъдат не само в тясна корелация⁴.

При статистическа значимост на модела се потвърждава хипотезата за рационалност в нейната слаба форма. Затова след оценка на модела по метода на максималното правдоподобие се проверява моделът чрез статистическата значимост на характеристиката $\chi^2 = -2(\log(L_0) - \log(L_1))$, където L_0 е функцията на правдоподобие на нулевия модел ($\beta_2 = 0$), а L_1 - на емпиричния регресионен модел. Практически е невъзможно изследването за рационалност в неговата силна форма, като се имат предвид описаното в предходната точка и фактът, че се прави косвена оценка.

ВКЛЮЧВАНЕ НА РАЦИОНАЛНИТЕ ОЧАКВАНИЯ В МАКРОИКОНОМИЧЕСКИТЕ МОДЕЛИ

От началото на 80-те години на XX се подема критика на стандартните макроикономически модели, представени чрез структурни системи от уравнения.

Недостатъците основно се откриват в начина на дефиниране на параметрите като структурни и тяхната реална оценка, която невинаги отговаря на дефиницията. Задава се въпросът дали тези параметри трябва да остават непроменени през изследвания период при смяна на икономическата политика. В критиката на Р. Лукас от началото на 70-те години на XX век се акцентира върху възможността да се изменят параметрите на моделите вследствие промяната на икономическите правила и характерната за традиционните модели неизменяемост на тези параметри в крайна сметка води до грешки, които трудно биха могли да се компенсират.

⁴ Статистически значима корелационна зависимост може да се прояви и при променливи, които не са в реално въздействие. Това е добре известно и се дефинира като "лъжлива регресия/корелация".