

Тема 7. Система эконометрических уравнений

1. Для оценивания параметров точно идентифицируемой системы уравнений применяется:

- а) ДМНК, КМНК
- б) ДМНК, МНК, КМНК
- в) КМНК

2. Эндогенные переменные:

- а) зависимые переменные
- б) независимые переменные
- в) датированные предыдущими моментами времени

3. Экзогенные переменные:

- а) зависимые переменные
- б) независимые переменные
- в) датированные предыдущими моментами времени

4. Система вида
$$\begin{cases} y_1 = a_{11}x_1 + a_{12}x_2 + \dots + a_{1m}x_m + u_1; \\ y_2 = a_{21}x_1 + a_{22}x_2 + \dots + a_{2m}x_m + u_2; \\ \dots \\ y_k = a_{k1}x_1 + a_{k2}x_2 + \dots + a_{km}x_m + u_k. \end{cases}$$
 называется:

- а) системой независимых уравнений
- б) системой рекурсивных уравнений
- в) системой взаимозависимых (совместных, одновременных) уравнений

5. Система вида
$$\begin{cases} y_1 = a_{11}x_1 + a_{12}x_2 + \dots + a_{1m}x_m + u_1; \\ y_2 = b_{21}y_1 + a_{21}x_1 + a_{22}x_2 + \dots + a_{2m}x_m + u_2; \\ y_3 = b_{31}y_1 + b_{32}y_2 + a_{31}x_1 + a_{32}x_2 + \dots + a_{3m}x_m + u_3; \\ \dots \\ y_k = b_{k1}y_1 + b_{k2}y_2 + \dots + b_{kk-1}y_{k-1} + a_{k1}x_1 + a_{k2}x_2 + \dots + a_{km}x_m + u_k. \end{cases}$$
 называется:

- а) системой независимых уравнений
- б) системой рекурсивных уравнений
- в) системой взаимозависимых (совместных, одновременных) уравнений

6. Система вида
$$\begin{cases} y_1 = b_{12}y_2 + b_{13}y_3 + \dots + b_{1k}y_k + a_{11}x_1 + a_{12}x_2 + \dots + a_{1m}x_m + u_1; \\ y_2 = b_{21}y_1 + b_{23}y_3 + \dots + b_{2k}y_k + a_{21}x_1 + a_{22}x_2 + \dots + a_{2m}x_m + u_2; \\ \dots \\ y_k = b_{k1}y_1 + b_{k2}y_2 + \dots + b_{kk-1}y_{k-1} + a_{k1}x_1 + a_{k2}x_2 + \dots + a_{km}x_m + u_k. \end{cases}$$
 называется:

- а) системой независимых уравнений
- б) системой рекурсивных уравнений
- в) системой взаимозависимых (совместных, одновременных) уравнений

7. Если $M - m \geq k - 1$ и ранг матрицы A меньше $(K-1)$ то уравнение:

- а) сверхидентифицировано
- б) неидентифицировано
- в) точно идентифицировано

8. Какой метод применяется для оценивания параметров сверхидентифицированного уравнения?

в) ДМНК, КМНК

б) КМНК

в) ДМНК

9. Какой метод применяется для оценивания параметров неидентифицированного уравнения?

а) ДМНК, КМНК

б) ДМНК, МНК

в) параметры такого уравнения нельзя оценить

10. Если $M - m > k - 1$ и ранг матрицы A больше $(K-1)$ то уравнение:

а) сверхидентифицировано

б) неидентифицировано

в) точно идентифицировано