

Семинар 5.

1. Пусть уравнение $y_t = \beta_0 + \beta_1 x_t + \varepsilon_t$ оценивается методом инструментальных переменных с помощью инструментальной переменной z_t , принимающей только два значения 0 и 1. Покажите, что

$$\hat{\beta}_{1,IV} = (\overline{y_1} - \overline{y_0}) / (\overline{x_1} - \overline{x_0}),$$

где $\overline{y_j}$, $\overline{x_j}$ – средние значения по подвыборке наблюдений $t : z_t = j, j = 0, 1$.

Список используемой литературы.

Магнус Я.Р., Катышев П.К., Пересецкий А.А. (2007). Эконометрика. Начальный курс : учебник для вузов.