

1. Белый шум – это ...

- *свойство коэффициентов регрессионной модели
- *модель временного ряда с независимыми одинаково распределенными наблюдениями
- *модель авторегрессии первого порядка

2. В условиях гетероскедастичности остатков для оценки параметров эконометрической модели следует использовать ...

- *обобщенный метод наименьших квадратов
- *метод максимального правдоподобия
- *метод моментов

3. Для стационарного процесса в узком смысле не может быть того, что ...

- *математическое ожидание случайной величины постоянно
- *процесс не является стационарным в широком смысле
- *корреляционная функция зависит только от лага между уровнями ряда

4. Для проверки ряда на стационарность используется тест ...

- *Дики-Фулера
- *Стьюдента
- *Фишера

5. Целесообразно использовать обобщенный метод наименьших квадратов, если ошибки модели ...

- *обладают свойством гомоскедастичности
- *обладают свойством гетероскедастичности
- *связаны с одним или несколькими факторами сильной корреляционной зависимости

6. Значимость множественного линейного уравнения регрессии проверяется по ...

- X²-критерию
- F-критерию
- t-критерию

7. Ранговое условие идентифицируемости структурного уравнения является ...

- *необходимым
- *достаточным
- *необходимым и достаточным

8. Функция регрессии является математическим выражением ... между переменными

- *функциональной зависимости
- *корреляционной связи
- *исключительно линейной связи

9. Косвенный МНК применяется, если уравнение ...

- *неидентифицируемо
- *точно идентифицируемо
- *сверхидентифицируемо

10. Автокорреляционная функция – это функция от ...

- *значений уровней ряда
- *времени и лага между двумя уровнями ряда
- *времени

11. Стационарность – это ...

- *характеристика временного ряда, связанная с его стабильностью
- *правило отбора предикторов в регрессионную модель
- *синоним автокорреляции

12. Стационарность ...

- *бывает высокая и низкая
- *бывает постоянная и переменная
- *можно рассматривать в узком и в широком смысле

13. Ковариация – это ...

- *явление линейной стохастической связи между переменными
- *показатель, характеризующий тесноту линейной стохастической связи между переменными
- *показатель, позволяющий установить факт наличия линейной стохастической связи между переменными

14. Наличие автокорреляцию в остатках можно обнаружить с помощью

- *Дарбина-Уотсона
- *Фишера
- *Стьюдента

15. На главной диагонали ковариационной матрицы $S(b)=S2(XTX)^{-1}$ находятся ...

- *средние значения коэффициентов регрессии
- *коэффициенты корреляции
- *дисперсии коэффициентов регрессии

16. Наличие автокорреляции остатков можно обнаружить с помощью статистики ...

- *Дарбина-Уотсона
- *Фишера
- *Стьюдента

17. Коэффициент при независимой переменной в парном линейном уравнении регрессии показывает....

- *процентное изменение зависимой переменной при однопроцентном изменении независимой переменной
- *среднее изменение результата с изменением фактора на одну единицу
- *изменение результата с изменением на одну единицу независимой переменной

18. Критерий Фишера используется при проверке ...

- *статистической значимости модели в целом
- *на автокорреляцию в ряду фактической ошибки
- *независимости факторов модели

19. Наличие тренда в уровнях ряда проверяется с помощью теста ...

- *Фостера-Стюарта
- *Спирмена
- *Дарбина-Уотсона.

20. Эффективная оценка – это оценка, ...

- *дисперсия которой равна нулю
- *дисперсия которой минимальна в некотором классе несмещенных оценок
- *математическое ожидание которой равно нулю

21. Неидентифицируемость системы эконометрических уравнений связана с превышением ...

- *числа структурных коэффициентов над числом приведенных
- *числа приведенных коэффициентов над числом структурных
- *числа эндогенных переменных над числом predetermined переменных

22. Для проверки эконометрической модели на гомоскедастичность не применяется тест ...

- *Дарбина-Уотсона
- Голдфелда-Квандта

Глейзера Уайта

23. Для проверки ряда на стационарность используется тест ...

*Дики-Фулера

*Стьюдента

*Фишера

24. С помощью средней ошибки аппроксимации оценивают ...

*тесноту связи между переменными

*качество уравнения регрессии в целом

*значимость коэффициентов регрессии

25. Неверно утверждать, относительно метода наименьших квадратов (МНК) оценки линейной регрессионной модели, что МНК ...

*минимизирует сумму абсолютных значений остатков

*минимизирует сумму квадратов остатков

*максимизирует сумму квадратов остатков

26. Для описания тенденции равномерно изменяющихся уровней ряда используют ... модель

*экспоненциальную

*S-образную

*линейную

27. По характеру связи между переменными регрессии в целом подразделяют на две группы

— ...

*положительные и отрицательные

*равноускоренные и равнозамедленные

*равномерно возрастающие и равномерно убывающие

28. Для проверки значимости отдельных коэффициентов множественной регрессии используют критерий...

*Стьюдента

*Фишера

*Дарбина-Уотсона

*Фостера-Стюарта

29. Гомоскедастичность означает ...

*отсутствие автокорреляции случайного члена регрессионного уравнения

*постоянство дисперсии случайного члена регрессионного уравнения

*отсутствие корреляционной связи между случайным членом и объясняющими переменными регрессионной модели

30. В результате компонентного анализа временного ряда не может быть получена ... модель

*мультипликативная

*множественная регрессионная

*приведенная

31. Отрицательный характер взаимосвязи между переменными X и Y означает, что ...

*рост X не оказывает влияния на изменение Y

*с ростом X происходит убывание Y

*с ростом X происходит рост Y

32. При оценке параметров системы одновременных уравнений нецелесообразно применять ... метод наименьших квадратов

*двухшаговый

*косвенный

*классический

33. Компонента временного ряда, отражающая влияние периодически действующих факторов, – это...

*сезонная составляющая

*случайная составляющая

*тренд

34. Оценки косвенного МНК совпадают с оценками двухшагового МНК, если для уравнения выполнено ...

*ранговое условие

*порядковое условие

*ранговое условие и порядковое условие со знаком равенства

35. Ранговое условие идентифицируемости структурного уравнения – ранг произведения расширенной матрицы структурных параметров на транспонированную матрицу ограничений уравнения равен числу эндогенных переменных ...

*системы

*уравнения

*системы минус единица

36. Неверно, что к моделям временных рядов относятся...

*Регрессионные модели

*авторегрессионные модели

*модели скользящего среднего

37. Компонента временного ряда, отражающая влияние постоянно действующих факторов, – это ...

*тренд

*сезонная составляющая

*циклическая составляющая

38. Автокорреляционная функция – это функция от ...

*значений уровней ряда

*времени и лага между двумя уровнями ряда

*времени

39. Ошибка в i -м наблюдении – это разница между значением ...

*объясняющей переменной в i -м наблюдении и прогнозным значением этой переменной

*переменной Y в i -м наблюдении и прогнозным значением этой переменной, полученным по выборочной линии регрессии

*переменной Y в i -м наблюдении и прогнозным значением этой переменной, полученным по истинной линии регрессии

40. Для отражения влияния на структуру модели качественных переменных, если они наблюдаемы, применяют ... переменные

*фиктивные

*поддельные

*фальшивые

41. Двухшаговый МНК не применяется, если уравнение ...

*точно идентифицируемо

*неидентифицируемо

*сверхидентифицируемо

42. При сравнении моделей множественной линейной регрессии с разным числом факторов не используют ...

*коэффициент детерминации

- *скорректированный коэффициент детерминации
- *алгоритм сравнения короткой и длинной регрессии

43. Случайный член классической линейной модели множественной регрессии должен быть распределен ...

- *по экспоненциальному закону
- *по закону Пуассона
- *по нормальному закону

44. Оценка параметров приведенной формы осуществляется ... наименьших квадратов

- *методом
- *косвенным методом
- *двухшаговым методом

45. С помощью коэффициента детерминации можно оценить ...

- *уровень автокорреляции ошибок
- *значимость коэффициентов регрессии
- *качество уравнения регрессии в целом

46. Оценки коэффициентов классической модели, полученные с помощью метода наименьших квадратов, обладают ...

- *свойствами несмещенности, состоятельности и эффективности
- *Только свойством состоятельности
- *Только свойством эффективности

47. Для проверки ряда на стационарность используется тест ...

- *Дики-Фулера
- *Стьюдента
- *Фишера

48. Порядковое условие идентифицируемости структурного уравнения: число исключенных из уравнения предопределенных переменных должно быть не меньше числа включенных ...

- *эндогенных переменных плюс единица
- *эндогенных переменных
- *эндогенных переменных минус единица

49. Если абсолютное значение линейного коэффициента корреляции близко к нулю, то ... в линейно форме связь между переменными ...

- слабая
- сильная
- отсутствует

50. При построении регрессионных моделей рекомендуется, чтобы объем выборки превышал число факторов не менее чем ...

- в десять раз
- в два раза
- в три раза

51. Негативным последствием применения классического МНК в случае гетероскедастичности является то, что оценки коэффициентов модели не являются ...

- *эффективными
- *Состоятельными
- *Статистически значимыми

52. Критерий Стьюдента применяется для

- *проверки независимости факторов уравнения
- *определения статистической значимости каждого коэффициента уравнения

*проверки модели на автокорреляцию остатков

53. Состоятельная оценка это оценка, обладающая следующим свойством:

*при увеличении объема выборки оценка становится точнее

*Её математическое ожидание равно нулю

*Её дисперсия равна нулю

54. Скорректированный коэффициент детерминации - это коэффициент детерминации, скорректированный с учетом

*числа факторов

*объема выборки

*формы связи

55. Смещенная оценка искомого параметра обладает следующим свойством: ...

*ее дисперсия минимальна

*ее дисперсия равна нулю

*ее математическое ожидание не равно ей

56. Нулевая гипотеза при проверке коэффициента уравнения регрессии на статистическую значимость гласит, что ...

*значение коэффициента равно нулю

*оценка коэффициента положительна

*оценка коэффициента равна нулю

57. Коэффициент корреляции – это ...

*показатель, позволяющий установить факт наличия линейной стохастической связи между переменными

*явление линейной стохастической связи между переменными

*показатель, характеризующий тесноту линейной стохастической связи между переменными

58. Для отсутствия автокорреляции остатков характерно ...

*непостоянство дисперсии остатков

*отсутствие зависимости между остатками текущих и предыдущих наблюдений

*постоянство математического ожидания остатков

59. Порядковое условие идентифицируемости структурного уравнения является ...

*необходимым

*достаточным

*необходимым и достаточным

60. Мультиколлинеарность проявляется между ...

*признаком и фактором

*факторами

*остатками

61. Коэффициент детерминации характеризует долю ...

*дисперсии зависимой переменной, объясняемую регрессией в общей ее дисперсии

*дисперсии зависимой переменной, не объясненную регрессией в общей дисперсии зависимой переменной

*разброса зависимой переменной, не объясненную регрессией

62. Неверный с точки зрения экономической теории, знак коэффициента линейного регрессионного уравнения может свидетельствовать ...

*об автокорреляции остатков

*о мультиколлинеарности факторов

*о гетероскедастичности остатков

63. По числу объясняющих факторов регрессии подразделяют на ...

*парные и множественные

*простые и сложные

*двойные, тройные и т.д

64. Постоянный коэффициент эластичности имеет ... функция

*линейная

*степенная

*показательная

65. О наличии мультиколлинеарности не свидетельствует факт того, что ... близки к единице

*коэффициенты множественной детерминации некоторых объясняющих факторов с остальными

*коэффициенты парной корреляции результирующего признака с каждым из объясняющих по модулю

*некоторые коэффициенты парной корреляции среди объясняющих факторов по модулю

66. Стохастическая (статистическая) зависимость – это ...

*нелинейная зависимость между переменными

*связь между одним случайным и одним детерминированным фактором

*связь между переменными, осложненная влиянием случайных факторов

67. Мультиколлинеарность факторов – это ...

*наличие линейной связи между двумя объясняемой и объясняющей переменной

*отсутствие зависимости между несколькими изучаемыми переменными

*наличие линейной зависимости между несколькими объясняющими переменными

68. Под спецификацией модели понимается ...

*нахождение параметров уравнения

*отбор факторов, влияющих на результат и выбор вида уравнения

*постановка проблемы и получение данных для ее решения

69. Корреляция – это ...

*показатель, характеризующий тесноту линейной стохастической связи между переменными

*явление линейной стохастической связи между переменными

*показатель, позволяющий установить факт наличия линейной стохастической связи между переменными

70. Критерий Дарбина-Уотсона используется для проверки гипотезы о ...

*Статической значимости модели в целом

*Статической зависимости каждого из коэффициентов модели

*Независимости квадратов соседних значений фактической ошибки e_t^2 и e_{t-2}

71. Средний коэффициент эластичности показывает ...

*среднее изменение результата с изменением фактора на одну единицу

*процентное изменение зависимой переменной при однопроцентном изменении независимой переменной

*изменение результата с изменением на одну единицу независимой переменной

72. Стандартизованный коэффициент уравнения применяется для

*ранжирование факторов в уравнении

*проверки статистической значимости фактора

*проверки экономической значимости фактора

73. Если значение структурного параметра невозможно получить, даже зная значения параметров приведенной формы, то это параметр

Неидентифицируемый

74. Неверно, что для проверки эконометрической модели на гомоскедастичность применяется тест ...

Голдфелда-Квандта

Дарбина-Уотсона

Глейзера Уайта

75. В эконометрической модели зависимая переменная разбивается на две части – ...

***объяснительную и случайную**

*положительную и отрицательную

*простую и сложную

76. В регрессионном анализе при ... зависимости каждому значению одной переменной соответствует определенное распределение другой переменной

*функциональной

***статистической**

*корреляционной

77. Тест Дики-Фуллера имеет ... разновидности

две

три

четыре

78. В результате компонентного анализа временного ряда не может быть получена ... модель

*структурная

***парная регрессионная**

*аддитивная

79. Автокорреляция бывает ...

*объяснительной и случайной

*простой и сложной

***положительной и отрицательной**

*случайной и неслучайной

80. Неверно, что наиболее распространенным инструментом анализа систем одновременных уравнений является ... метод наименьших квадратов

косвенный

двухшаговый

трехшаговый

классический

81. Для проверки значимости отдельных коэффициентов множественной регрессии используют ...

нормальный закон распределения

распределение Фишера

распределение Стьюдента

82. Ковариация – это показатель, характеризующий ...

***степень рассеяния значений двух переменных относительно их математических ожиданий**

***взаимосвязь этих переменных**

*связь между линейной стохастической и переменными

*тесноту линейной стохастической связи между переменными

83. Случайные величины бывают ...

***дискретными и непрерывными**

*строго стационарными и слабостационарными

*положительными и отрицательными

*простыми и сложными

84. Неверно, что к свойствам оценок параметров классической линейной регрессионной модели относят ...

состоятельность

многомерность

несмещенность

эффективность

85. Боксом и Дженкинсом был предложен ...

***систематический подход к построению ARMA-моделей**

*стационарный временной ряд «Белый шум»

*косвенный метод построения квадратов

86. Эффективная оценка параметров классической линейной регрессионной модели – оценка, ...

*математическое ожидание которой равно нулю

*дисперсия которой равна нулю

***имеющая наименьшую дисперсию из всех возможных несмещенных оценок**

87. Структурный параметр называется идентифицируемым, если ...

*косвенный наименьших квадратов дает несколько оценок

*его значение невозможно получить, даже зная значения параметров приведенной формы

***он может быть однозначно оценен с помощью косвенного метода наименьших квадратов**

88. Структурный параметр называется сверхидентифицируемым, если ...

***косвенный метод наименьших квадратов дает несколько оценок**

*его значение невозможно получить, даже зная значения параметров приведенной формы

*он может быть однозначно оценен с помощью косвенного метода наименьших квадратов

89. Для анализа временных рядов, в частности, используется модель скользящей средней порядка (q) (модель MA(q)), в которой ...

*текущее значение моделируемой переменной задается функцией от прошлых значений самой переменной

*сочетается авторегрессионные процессы с процессами скользящей средней

***моделируемая величина задается функцией от прошлых ошибок**

90. Обобщенный метод наименьших квадратов применяется для устранения ...

автокорреляции

систематической ошибки остаточной дисперсии

гетероскедастичности

характера динамики процесса

91. Упорядоченный набор $x = (x_1, x_2, \dots, x_n)$ случайных величин - это ... случайная величина

Многомерная

92. Эконометрическое моделирование состоит из ... основных этапов

трех

четырёх

шести

семи

93. Результат функционирования анализируемой экономической системы характеризует ...

функция

Результирующая

94. В регрессионном анализе при корреляционной зависимости между переменными каждому значению одной переменной соответствует определенное ... другой переменной
математическое ожидание
значение
распределение

95. Мерой качества уравнения регрессии является коэффициент ...
детерминации
корреляции
автокорреляции
эластичности

96. Остаток в i -м наблюдении – это разница между значением ...
*объясняющей переменной в i -м наблюдении и прогнозным значением этой переменной
*переменной Y в i -м наблюдении и прогнозным значением этой переменной, полученным по истинной линии регрессии
*переменной Y в i -м наблюдении и прогнозным значением этой переменной, полученным по выборочной линии регрессии

97. С помощью теста ... можно найти наличие автокорреляции между регрессионными остатками в последовательных наблюдениях
Уайта
Льинга-Бокса
Дарбина-Уотсона
Бреуша-Годфри

98. Если коэффициент корреляции принимает значение больше нуля, то ...
*связь между переменными называется прямой
*связь между переменными называется обратной
*линейная корреляционная связь отсутствует
*корреляционная зависимость становится функциональной

99. Экономическая модель имеет вид ...
 $y = f(x)$
 $y = a + b_1x + b_2x^2$
 $y = f(x) + e$
 $y = f(a + b_1x + b_2x^2)$

100. Установить факт наличия (отсутствия) связи между переменными, проверить статистическую значимость этой связи, а также осуществить прогноз неизвестных значений эндогенной переменной по заданным значениям экзогенных переменных можно с помощью ...
уравнения регрессии
метода наименьших квадратов
коэффициента корреляции
теоремы Айткета
теста Голдфелда-Квандта

101. Экзогенная переменная может быть ...
положительной и отрицательной
дискретной и непрерывной
случайной и неслучайной

102. Классические примеры систем одновременных уравнений, такие как куйнсианская модель формирования доходов и модель формирования спроса, относятся к ...
*косвенному методу наименьших квадратов
*двухшаговому методу наименьших квадратов

*трехшаговому методу наименьших квадратов

103. Тест Дарбина-Уотсона применяется для ...

*проверки наличия автокорреляции между регрессионными остатками в последовательных наблюдениях

*оценки структурных коэффициентов

*проверки независимости остатков модели временного ряда

*определения тренда во временном ряду

104. Для отражения влияния на эндогенную переменную y (Y) сопутствующих качественных переменных в регрессионную модель вводятся ... переменные

поддельные

фальшивые

фиктивные