

Автокорреляция бывает положительной и отрицательной

Автокорреляционная функция – это функция от ... значений уровней ряда времени и лага между двумя уровнями ряда времени

Белый шум – это ... свойство коэффициентов регрессионной модели модель авторегрессии первого порядка + модель временного ряда с независимыми одинаково распределенными наблюдениями

Боксом и Дженкинсом был предложен Систематический подход к построению ARMA-моделей

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

В результате компонентного анализа временного ряда не может быть получена ... модель приведенная множественная регрессионная мультипликативная

В результате компонентного анализа временного ряда не может быть получена ... модель структурная парная регрессионная аддитивная

В условиях гетероскедастичности остатков для оценки параметров эконометрической модели следует использовать ... обобщенный метод наименьших квадратов + метод максимального правдоподобия метод моментов

Гомоскедастичность означает ... постоянство дисперсии случайного члена регрессионного уравнения отсутствие корреляционной связи между случайным членом и объясняющими переменными регрессионной модели отсутствие автокорреляции случайного члена регрессионного уравнения

Двухшаговый МНК не применяется, если уравнение ...

точно идентифицируемо
неидентифицируемо
сверхидентифицируемо

Для описания тенденции равномерно изменяющихся уровней ряда
используют ... модель
экспоненциальную
S-образную
линейную

Для отражения влияния на структуру модели качественных переменных,
если они наблюдаемы, применяют ... переменные
поддельные
фальшивые
фиктивные +

Для отсутствия автокорреляции остатков характерно ...
отсутствие зависимости между остатками текущих и предыдущих
наблюдений
непостоянство дисперсии остатков
постоянство математического ожидания остатков

Для проверки значимости отдельных коэффициентов множественной
регрессии используют ...
нормальный закон распределения
распределение Фишера
распределение Стьюдента

Для проверки ряда на стационарность используется тест ...
Дики-Фулера
Стьюдента
Фишера

Для проверки эконометрической модели на гомоскедастичность не
применяется тест ...
Голдфелда-Квандта
Глейзера
Дарбина-Уотсона +

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

Для анализа временных рядов, в частности, используется модель скользящей средней порядка в которой моделируемая величина задается функцией от прошлых ошибок

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

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

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

Если коэффициент корреляции принимает значение больше нуля, то связь между переменными называется прямой

Значимость множественного линейного уравнения регрессии проверяется по ...
F-критерию +
-критерию
t-критерию

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

Классические примеры систем одновременных уравнений, такие как кейнсианская модель формирования доходов и модель формирования спроса относятся к трехшаговому методу наименьших квадратов

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

Неверно, что к моделям временных рядов относятся регрессионные модели

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

Структурный параметр называется идентифицируемым, если он может быть однозначно оценен с помощью косвенного метода наименьших квадратов

Структурный параметр называется сверхидентифицируемым, если косвенный метод наименьших квадратов дает несколько оценок

Тест Дарбина-Уотсона применяется для проверки наличия автокорреляции между регрессионными остатками в последовательных наблюдениях

Экономическая модель имеет вид $y = f(x) + e$

Экзогенная переменная может быть... случайной и неслучайной

Эффективная оценка параметров классической линейной регрессионной модели – оценка, имеющая наименьшую дисперсию из всех возможных несмещенных оценок