

1. **Автокорреляционная функция – это функция от ...**
 - значений уровней ряда
 - **времени и лага между двумя уровнями ряда**
 - времени
2. **Аддитивной моделью временного ряда назыв.**
 - модель, где ряд представлен как сумма $t+s+e$
3. **Белый шум – это ...**
 - **модель авторегрессии первого порядка**
 - свойство коэффициентов регрессионной модели
 - модель временного ряда с независимыми одинаково распределенными наблюдениями
4. **В журнале эконометрика основанный в 1933г.эконометрика определяется как**
 - единство экономической теории, математики и статистики
5. **в модели с распределённым логом рассчитывается значение медианного лага. Медианный лаг**
 - это период времени в течении которого. Ответ: с момента времени t реализуется половина воздействия. В моделях с распределенным рангом рассчитывается медианный лаг
6. **В неэкономические переменные рассматривают в качестве**
 - экзогенных переменных
7. **В общем виде первым этапом эконометрическом исследовании**
 - постановка проблемы
8. **В парной линейной регрессии абсолютным показателем силы связи между переменными является**
 - коэффициент регрессии
9. **В производственной ф-ции Кобба-Дугласа коэфф. эластичности должен быть**
 - единица
10. **В результате компонентного анализа временного ряда не может быть получена ... модель**
 - мультипликативная
 - **множественная регрессионная**
 - приведенная
11. **В результате компонентного анализа временного ряда не может быть получена ... модель**
 - **парная регрессионная**
 - структурная
 - аддитивная
12. **В уравнении множественной линейной регрессии параметры при факторных переменных**
 - несравнимы между собой
13. **В уравнении множественной линейной регрессии $y=a+B_1X_1+B_2X_2+....$**
 - $B_p X_p$ параметр "x" называется коэффициент чистой регрессии



14. В условиях гетероскедастичности остатков для оценки параметров эконометрической модели следует использовать ...
- метод моментов
 - **обобщенный метод наименьших квадратов**
 - метод максимального правдоподобия
15. В эконометрике для учета неоднородности по качественным признакам в регрессивную модель вводят
- фиктивные переменные
16. В эконометрических моделях зависимые переменные принято называть
- эндогенными
17. Высший уровень измерения предполагает сравнение с
- эталоном
18. Гомоскедастичность означает ...
- отсутствие автокорреляции случайного члена регрессионного уравнения
 - отсутствие корреляционной связи между случайным членом и объясняющими переменными регрессионной модели
 - **постоянство дисперсии случайного члена регрессионного уравнения**
19. График зависимости автокорреляционные ф-ции от величины ряда назыв.
- коррелограммой
20. Двухшаговый метод наименьших квадратов
- инструментальный переменный
21. Двухшаговый МНК не применяется, если уравнение ...
- **неидентифицируемо**
 - сверхидентифицируемо
 - точно идентифицируемо
22. Для выявления сезонных колебаний на основе моделей регрессии с включением фактора времени фиктивных переменных
- число переменных должно быть меньше, кол-во фиктивных больше на единицу
23. Для двухфакторной линейной регрессии коэфф. детерминант 0,7 скорректированное значение 0,614 число наблюдений
- "10"
24. Для описания тенденции равномерно изменяющихся уровней ряда используют ... модель
- экспоненциальную
 - S-образную
 - **линейную**
25. Для отражения влияния на структуру модели качественных переменных, если они наблюдаемы, применяют ... переменные
- поддельные
 - фальшивые
 - **фиктивные**
26. Для отсутствия автокорреляции остатков характерно ...
- непостоянство дисперсии остатков
 - **отсутствие зависимости между остатками текущих и предыдущих наблюдений**



- постоянство математического ожидания остатков
27. Для оценки значимости коэффициент регрессии и его расчета доверительных интервалов используется
- статистика подчиняющаяся статистике Стьюдента при степенях свободы "n-2"
28. Для проверки значимости отдельных коэффициентов множественной регрессии используют ...
- нормальный закон распределения
 - распределение Фишера
 - распределение Стьюдента
29. Для проверки ряда на стационарность используется тест ...
- Стьюдента
 - Дики-Фулера
 - Фишера
30. Для проверки эконометрической модели на гомоскедастичность не применяется тест ...
- Глейзера
 - Дарбина-Уотсона
 - Голдфелда-Квандта
31. Для системы одновременного уравнения матрица
- иное
32. Для стационарного процесса в узком смысле не может быть того, что ...
- процесс не является стационарным в широком смысле
 - корреляционная функция зависит только от лага между уровнями ряда
 - математическое ожидание случайной величины постоянно
33. Доказано, что если выполняется предпосылка метода наименьших квадратов (условия Гакусса-Маркова) то наилучшие оценки параметров линейной регрессии
- обладают свойствами, является - несмещенными, эффективными, состоятельными
34. Долгосрочный мультипликатор в модели регрессии рассчитывается как сумма
- краткосрочного и промежуточного мультипликатора
35. Допустим, что имеем временной ряд, за 20 лет наиболее высокие значения коэфф. 3; 6; и 9-ого порядка, значит период колебания равен
- 3 года
36. Допустим, что по одним и тем же выборочным данным построены два парных линейных уравнения регрессии $y=a+vx+e$; $x=c+dy+e$ какое из соотношений линейных коэффициент корреляции является истинным?
- $z(yx)=z(yx)$
37. Допустим, что спрос на иномарки на авторынке России в зависимости от цены
- характеризуется параболой второго порядка $y=a+vx+cx$ в квадрате
38. Если абсолютное значение линейного коэффициента корреляции близко к нулю, то ...
- в линейно форме связь между переменными слабая
 - связь между переменными слабая
 - связь между переменными сильная

39. Если в динамической модели фактором выступает разовое значение
- это модуль авторегрессии
40. Если в уравнении парно-линейная регрессия $y=a+vx+e$ переменные "x" и "y" выразить в отклонениях от средних, то
- уравнение примет вид $y=vx+e$. Оценка коэффициента регрессии при этом не меняется
41. Если взаимосвязанные временные ряды содержат линейные тренды, то исходные данные заменяют
- первыми разностями
42. Если зависимая переменная "y" одного уравнения выступая "x"-ом другим, то модель в виде системы
- рекурсивных уравнений
43. Если наиболее высоким среди коэфф. корреляции оказался коэфф. первого порядка, то ряд содержит
- линейную тенденцию
44. Если система сверхидентифицирована применяют
- двухшаговый метод наименьших квадратов
45. Если структурная и приведённая форма модели имеют одинаковое число коэффициента
- модели идентифицированы
46. Если тенденции временного ряда соответствуют экспонциальной или степенной тренд метод последовательных разностей применяют не к исходным уравнениям, а к их
- логарифмам
47. Если уравнение множественной линейной регрессии построено правильно, то индекс корреляции должен быть
- больше или равен максимальному значению парному коэфф. Корреляции
48. Если функции потребления $s=kx+L$ коэффициенту регрессии больше единицы
- значит на потребление расходуется не только доход, но и сбережения
49. Зависимость между переменной типа $y=f(x)$ называется функцией регрессии (y) на (x)
- Допустим Зависимость "y" от потребления дохода "x" выражается уравнением регрессии $y=a+b$
50. Зачем вводится тождество?
- чтобы ограничить значение "k" - предельная склонность потребления
51. Значимость множественного линейного уравнения регрессии проверяется по ...
- X^2 -критерию
 - F-критерию
 - t-критерию
52. Значительной вехой явилось введение экономических барометров, упоминается
- гарвардский барометр

53. Идентификацию обеспечивают

- счетное

54. Качество экзогенных переменных выбирают которые могут быть объектом

- регулирования

55. 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

56. Кол-во системных уравнений определяется

- целями задач исследования

57. количество структурных переменных включ. уравнение регрессии, должно быть

- равно числу градации минус единица

58. Количество Эндогенных переменных моделях структурных уравнений равно числу

- уравнений в системе

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

- сезонная составляющая
- случайная составляющая
- тренд

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

- циклическая составляющая
- сезонная составляющая
- тренд

61. Корреляция между факторами переменной считается явной если эти факторы имеют

- значения парного линейного коэффициент корреляции равного 0,7 и более

62. 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

63. Косвенный МНК применяется, если уравнение ...

- неидентифицируемо
- точно идентифицируемо
- сверхидентифицируемо

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

- Фостера-Стюарта
- Спирмена
- Дарбина-Уотсона



65. 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

66. Коэффициент корреляции – это ...

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

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

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

68. Коэффициенты модели со структурными коэффициентами

- нелинейными соотношениями

69. Критерий Дарбина-Уотсона используется для

- автокорреляции в остатках

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

- независимости квадратов соседних значений фактической ошибки e_t и e_{t-2}
- статистической значимости модели в целом
- статистической значимости каждого из коэффициентов модели

71. Критерий Стьюдента применяется для ...

- проверки независимости факторов уравнения
- определения статистической значимости каждого коэффициента уравнения
- проверки модели на автокорреляцию остатков

72. Критерий Фишера используется при проверке ...

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

73. Линейная модель простой и парной регрессии имеет вид $y=a+Vx+e$ построение модели сводится к оценке "а" и "в"

- Ошибки спецификации недоучет в уравнении, ошибки выбора - отражаются в увеличении "е"

74. Линейная модель спроса и предложения характеризуется двумя уравнениями, экзогенной и переменной в нем

- нет

75. Любое экономическое исследование начинается с модели под спецификацией

- понимается формулировка вида модели по теории и связи



76. Множественная регрессия предполагает включение в уравнение регрессии двух и более факторов переменных, при этом факторы должны
- некоррелироваться между собой и количественно измеряться
77. Модели на основе временных рядов учитывающие момент времени "t" относящийся к предыдущим моментам времени "t-1" "t-2" наз.
- динамическими
78. Мультиколлинеарность проявляется между ...
- признаком и фактором
 - факторами
 - остатками
79. Мультиколлинеарность факторов – это ...
- наличие линейной зависимости между несколькими объясняющими переменными
 - отсутствие зависимости между несколькими изучаемыми переменными
 - наличие линейной связи между двумя объясняемой и объясняющей переменной
80. На главной диагонали ковариационной матрицы находятся ...
- коэффициенты корреляции
 - дисперсии коэффициентов регрессии
 - средние значения коэффициентов регрессии
81. Наличие автокорреляции остатков можно обнаружить с помощью статистики ...
- Дарбина-Уотсона
 - Фишера
 - Стьюдента
82. Наличие тенденции в временных рядах у кот-ой изучается причинноследственная связь приводит к
- ложной корреляции
83. 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
84. Неверно, что к моделям временных рядов относятся...
- Авторегрессионные модели
 - Модели скользящего среднего
 - Регрессионные модели
85. Неверный с точки зрения экономической теории, знак коэффициента линейного регрессионного уравнения может свидетельствовать ...
- об автокорреляции остатков
 - о мультиколлинеарности факторов
 - о гетероскедастичности остатков
86. Негативным последствием применения классического МНК в случае гетероскедастичности является то, что оценки коэффициентов модели не являются ...
- статистически значимыми
 - эффективными
 - состоятельными

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

- числа эндогенных переменных над числом предопределенных переменных
- числа структурных коэффициентов над числом приведенных
- числа приведенных коэффициентов над числом структурных

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

- значение коэффициента равно нулю
- оценка коэффициента положительна
- оценка коэффициента равна нулю

89. 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

90. Обобщенный метод наименьших квадратов для оценки параметров множественной

- регрессии при нарушении предпосылок относительно остатков

91. Обычный метод наименьших квадратов не рекомендуется применять к системе

- одновременных уравнений

92. Одно из правил проверки уравнения в СОУ

- счетное или ранговое

93. Описание и исследование структуры связей между переменными системами взаимосвяз. признаков осуществ. на основе

- одновременных уравнений

94. Определитель матрицы коэффициент корреляции между факторами равен нулю это значит

- что между факторами полная линейная зависимость

95. Основная задача исследования временного ряда

- выявление тенденций сезонности и случайности основных компонентов уровня ряда

96. Основное внимание в эконометрике уделяет

- ошибка спецификации модели

97. 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

98. 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
99. Оценка значимости моделей парной регрессии в целом проводится с помощью "F"
- критерия Фишера, расчет у которого предшествует
100. Оценка параметров приведенной формы осуществляется ... наименьших квадратов
- двухшаговым методом
 - косвенным методом
 - методом
101. Оценки косвенного МНК совпадают с оценками двухшагового МНК, если для уравнения выполнено ...
- ранговое условие и порядковое условие со знаком равенства
 - порядковое условие
 - ранговое условие
102. Оценки коэффициентов классической модели, полученные с помощью метода наименьших квадратов, обладают ...
- свойствами несмещенности, состоятельности и эффективности
 - только свойством эффективности
 - только свойством состоятельности
103. Оценки параметров методом наименьших параметров является
- точечными оценками теоретических коэффициентов регрессии т.к. получается на основе выборочных данных
104. Оценки параметров у уравнений парной линейной регрессии
- наиболее часто подходит методом наименьших квадратов
105. Ошибка в i-м наблюдении – это разница между значением ...
- переменной Y в i-м наблюдении и прогнозным значением этой переменной, полученным по истинной линии регрессии
 - 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
106. По десяти парам наблюдений получено уравнение линейной регрессии $y=a+57,28x$
- также известно, что сумма $x=100$, а сумма $y=200$, параметр "a"=-552,8
107. По характеру связи между переменными регрессии в целом подразделяют на две группы – ...
- равномерно возрастающие и равномерно убывающие
 - равноускоренные и равнозамедленные
 - положительные и отрицательные
108. По числу объясняющих факторов регрессии подразделяют на ...
- простые и сложные
 - двойные, тройные и т.д.
 - парные и множественные

- 109. Под регрессией понимается**
- функциональная зависимость между объясняющей или переменной и средней величиной зависимой переменной
- 110. Под спецификацией модели понимается ...**
- постановка проблемы и получение данных для ее решения
 - отбор факторов, влияющих на результат и выбор вида уравнения
 - нахождение параметров уравнения
- 111. Подставляя линейное уравнение регрессии например $y=1,9+0,85x$ значение "x", получаем "y", такой прогноз называется**
- точный
- 112. Показатель множественной корреляции оценивает тесноту связи совместного влияния факторов на результат, определяется как**
- индекс множества корреляции независимо от формы связи
- 113. Порядковое условие идентифицируемости структурного уравнения является ...**
- необходимым и достаточным
 - необходимым
 - достаточным
- 114. 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
- 115. Постоянный коэффициент эластичности имеет ... функция**
- показательная
 - степенная
 - линейная
- 116. построение функции, характеризующей зависимость уровней ряда от времени называется.**
- аналитическим сглаживанием (выравниванием ряда).
- 117. Предельная склонность к потреблению в моделях Кейнса не может принимать значения**
- больше единицы
- 118. Предположим, что модели потребления Кейнса, функция потребления имеет вид $c=1,8+0,75y$ коэффициент регрессии показывает**
- на каждые одну тыс. руб. на потребление расходуется в среднем 750
- 119. При выборе адекватной модели уравнение множественной регрессии**
- отдаем предпочтение той математической функции для кот-ой коэффициент детерминации максимален, а ошибка праксимации минимальна
- 120. При какой цене объем продаж "У" будет максимальной?**
- надо первую производную приравнять к нулю

121. При обработке исходной информации на комп-ре выбор вида уравнения парной регрессии проводится
- графическими и экспериментальными методами
122. При отборе факторов для множественной регрессии рекомендуется пользоваться правилами согласно которому число факторов обычно меньше объема совокупности в
- 6; 7; раз
123. При оценке параметров системы одновременных уравнений нецелесообразно применять ... метод наименьших квадратов
- двухшаговый
 - косвенный
 - классический
124. При построении регрессионных моделей рекомендуется, чтобы объем выборки превышал число факторов не менее чем ...
- в десять раз
 - в два раза
 - в три раза
125. При предопределенные переменные влияющие на эндогенные переменные не зависящие от СОУ называются
- экзогенными переменными
126. При применении рангового правила . Ранг=3 с тождеством 4
- система идентифицирована или сверх идентифицирована
127. При сравнении моделей множественной линейной регрессии с разным числом факторов не используют ...
- алгоритм сравнения короткой и длинной регрессии
 - коэффициент детерминации
 - скорректированный коэффициент детерминации
128. При сравнении фактического значения t
- статистики с табличным коэффициент Регрессии отклоняется если - фактическое значение " t " больше табличного
129. Приведенная форма модели для СОУ, зависимость в виде
- линейной регрессии
130. Применение метода наименьших квадратов к нелинейным функциям в парной регрессии требует выполнения одной из предпосылок метода наименьших квадратов
- линейность относительно параметров
131. Проверка качества моделей регрессии назыв.
- верификацией
132. Проверку выполнения предпосылок метода наименьших квадратов относительно остаточных величин проводят разными методами наиболее простой
- графический анализ остатков

133. Прогнозное значение экзогенных переменных на основе на основе
- приведенных уравнений
134. Прогнозное качество экономических моделей в виде уравнения регрессии оценивается с помощью
- средней ошибки праксимации
135. Простейшие модели Кейнса равно $c=a+vx$; $y=e+i$ явл.
- идентифицированный
136. Различие между "x"- индексом детерминации и его значениям уменьшается
- по мере увеличения числа наблюдения
137. Ранговое условие идентифицируемости структурного уравнения – ранг произведения расширенной матрицы структурных параметров на транспонированную матрицу ограничений уравнения равен числу эндогенных переменных ...
- системы
 - системы минус единица
 - уравнения
138. Ранговое условие идентифицируемости структурного уравнения является ...
- достаточным
 - необходимым и достаточным
 - необходимым
139. Результатом экономических исследований является
- регрессионные модели
140. С помощью коэффициента детерминации можно оценить ...
- уровень автокорреляции ошибок
 - значимость коэффициентов регрессии
 - качество уравнения регрессии в целом
141. Система экономических уравнений строится на
- любом уровне метода наименьших квадратов
142. Скорректированный коэффициент детерминации – это коэффициент детерминации, скорректированный с учетом ...
- числа факторов
 - формы связи
 - объема выборки
143. Случайный член классической линейной модели множественной регрессии должен быть распределен ...
- по экспоненциальному закону
 - по нормальному закону
 - по закону Пуассона
144. Смещенная оценка искомого параметра обладает следующим свойством: ...
- ее дисперсия минимальна
 - ее дисперсия равна нулю
 - ее математическое ожидание не равно ей

145. Согласно литературным источникам термин эконометрика впервые использовал
- Циемба. Австровенгрия 1910г.
146. Состоятельная оценка это оценка, обладающая следующим свойством:
- ее дисперсия равна нулю
 - при увеличении объема выборки оценка становится точнее
 - ее математическое ожидание равно нулю
147. Средний коэффициент эластичности показывает ...
- процентное изменение зависимой переменной при однопроцентном изменении независимой переменной
 - изменение результата с изменением на одну единицу независимой переменной
 - среднее изменение результата с изменением фактора на одну единицу
148. Стандартизованный коэффициент уравнения применяется для ...
- проверки статистической значимости фактора
 - проверки экономической значимости фактора
 - ранжирования факторов в уравнении
149. Статистическая модель потребления Кейнса включ. уравнении: $c = ky + L$
- и тождества $y = c + I$ где "c" - величина потребления, "y" - доход, "I" - инвестиции
150. Стационарность – это ...
- характеристика временного ряда, связанная с его стабильностью
 - синоним автокорреляции
 - правило отбора предикторов в регрессионную модель
151. Стационарность ...
- бывает высокая и низкая
 - бывает постоянная и переменная
 - можно рассматривать в узком и в широком смысле
152. Стохастическая (статистическая) зависимость – это ...
- нелинейная зависимость между переменными
 - связь между переменными, осложненная влиянием случайных факторов
 - связь между одним случайным и одним детерминированным фактором
153. Табличная, критическое значение Дарбина-Уотсона
- верхние и нижние границы
154. табличные критические значения t- статистики и f- критериях заданы с определенным уровнем значимости альфа. Например альфа=0,5 это значит,
- что этот уровень вероятность совершить ошибку первого рода
155. Термин эконометрика ввел в обиход
- Фриш
156. Фактическое значение критерия Дарбина-Уотсона
- от 0 до 4
157. Функция регрессии является математическим выражением ... между переменными
- функциональной зависимости
 - исключительно линейной связи



- корреляционной связи
158. Целесообразно использовать обобщенный метод наименьших квадратов, если ошибки модели ...
- обладают свойством гомоскедастичности
 - связаны с одним или несколькими факторами сильной корреляционной зависимостью
 - обладают свойством гетероскедастичности
159. Частный "f"- критерий Фишера используется в оценке значимости
- коэфф. чистой регрессии
160. Частный коэфф. корреляции нулевого порядка
- это коэфф. первой регрессии
161. Чистые коэфф. корреляции характеризуют тесноту связи между результатом соответств. факторам при
- устранении влияния других факторов уравнения регрессии
162. Чтобы уравнение считалось идентифицированным кол-во экзогенных и эндогенных переменных
- минус единица
163. Эконометрика включает понятие
- эконометрические измерения
164. Эконометрические модели на основе временных рядов могут быть построены, если ряды явл.
- стационарными с постоянной дисперсией
165. Эконометрические модели построенные по данным наблюдений за одним объектом во времени называются
- моделями временных рядов
166. Эконометрическое научное общество было создано в 1930
- США
167. Экспериментальные методы подбора от функции для уравнения парной регрессии основан
- на сравнении величины остаточным дисперсии по разным методам
168. Эффективная оценка – это оценка, ...
- дисперсия которой равна нулю
 - дисперсия которой минимальна в некотором классе несмещенных оценок
 - математическое ожидание которой равно нулю

