



Эконометрика (продвинутый уровень).м

- 1) Аддитивная модель временного ряда выглядит следующим образом: ...
- 2) Если амплитуда колебаний уровней временного ряда относительно тренда приблизительно постоянна, то строят ... модель временного ряда
- 3) Наличие тенденции ... во временном ряду свидетельствует о мультипликативной модели временного ряда
- 4) Средний уровень временного ряда при наличии тенденции дисперсии ...
- 5) Мультипликативная модель временного ряда выглядит следующим образом: ...
- 6) С помощью критерия ... можно проверить наличие автокорреляции во временном ряду
- 7) Расчетное значение критерия Дарбина-Уотсона, равное 2, говорит о том, что ...
- 8) Расчетное значение критерия Дарбина-Уотсона, близкое к 4, говорит о том, что ...
- 9) Расчетное значение критерия Дарбина-Уотсона, близкое к 0, говорит о том, что ...
- 10) Связь между критерием Дарбина-Уотсона и коэффициентом автокорреляции остатков первого порядка определяется соотношением ...
- 11) Если автокорреляционная функция (АКФ) показывает выброс на первом лаге, а частная автокорреляционная функция (ЧАКФ) экспоненциально затухает, то можно предположить, что временной ряд наиболее адекватно опишет модель ...
- 12) Если автокорреляционная функция (АКФ) показывает выбросы на первых двух лагах, а частная автокорреляционная функция (ЧАКФ) экспоненциально затухает, то можно предположить, что временной ряд наиболее адекватно опишет модель ...
- 13) Если автокорреляционная функция (АКФ) экспоненциально затухает, а частная автокорреляционная функция (ЧАКФ) показывает выброс на первом лаге, то можно предположить, что временной ряд наиболее адекватно опишет модель ...





- 14) Если автокорреляционная функция (АКФ) экспоненциально затухает, а частная автокорреляционная функция (ЧАКФ) показывает выбросы на первых двух лагах, то можно предположить, что временной ряд наиболее адекватно опишет модель ...
- 15) Если автокорреляционная функция (АКФ) показывает выброс на первом лаге и частная автокорреляционная функция (ЧАКФ) показывает выброс на первом лаге, то можно предположить, что временной ряд наиболее адекватно опишет модель ...
- 16) Приведенная модель $y_t = \alpha y_{t-1} + \varepsilon_t$ является моделью ...
- 17) Марковским процессом называют модель вида ...
- 18) Процессом Юла называют модель вида ...
- 19) Приведенная модель $y_t = \alpha_1 y_{t-1} + \alpha_2 y_{t-2} + \varepsilon_t$ является моделью ...
- 20) Приведенная модель $y_t = \theta \varepsilon_{t-1} + \varepsilon_t$ является моделью ...
- 21) К свойствам стационарного временного ряда относится то, что ...
- 22) Характерным свойством стационарного временного ряда является то, что ...
- 23) Преобразование, которое необходимо применить к исходному временному ряду с наличием экспоненциального тренда для приведения его к стационарному ряду: ...
- 24) Говоря о временном ряде, элементы которого представляют «белый шум», можно утверждать, что ...
- 25) Разности ... порядка необходимо взять для сведения временного ряда к стационарному, если тенденция временного ряда описывается параболической функцией
- 26) Чтобы совершить преобразование исходного временного ряда при мультипликативной модели, которое необходимо для получения аддитивной модели, нужно ...
- 27) Для нестационарного временного ряда может быть построена модель ...
- 28) Чтобы совершить преобразование для сведения временного ряда к стационарному, если тенденция временного ряда описывается полиномом третьей степени, нужно ...

