



Эконометрика финансовых рынков.э

- 1 Бета-значение ценной бумаги показывает ...
- 2 Предельная прибыль актива i – это ...
- 3 Предельная дисперсия актива i – это изменение дисперсии портфеля при ...
- 4 Если две ценные бумаги в портфеле имеют одинаковую предельную дисперсию, и разные ожидаемые прибыли то ...
- 5 Включение безрискового актива в портфель ...
- 6 Эффективный портфель – это портфель ...
- 7 Агрессивная позиция – это покупка ценных бумаг с ...
- 8 Защитная позиция – это покупка ценных бумаг с ...
- 9 У сверхзащитных ценных бумаг ...
- 10 Белый шум – это ...
- 11 Модель авторегрессии $AR(p)$ в качестве факторных переменных включает лаговые значения ...
- 12 Условие стационарности модели авторегрессии $AR(p)$:
- 13 Условие стационарности модели скользящего среднего $MA(q)$:
- 14 В модели $ARMA$ компонент $MA(q)$ означает ...
- 15 Авторегрессионный процесс называется стационарным, если регрессионный коэффициент ...
- 16 Авторегрессионный процесс называется нестационарным, если регрессионный коэффициент ...
- 17 Процесс единичного корня – это ...
- 18 Оценка порядка интегрируемости высоких порядков проводится ...





- 19) Для проведения ADF-теста необходимо вычислить ...
- 20) Условная гетероскедастичность означает ...
- 21) Безусловное среднее означает среднее значение, ...
- 22) Условное среднее означает среднее значение, ...
- 23) Безусловная дисперсия означает дисперсию, ...
- 24) Условная дисперсия означает дисперсию, ...
- 25) Идентифицировать процесс $MA(q)$ можно ...
- 26) Идентифицировать процесс $AR(p)$ можно ...
- 27) Автокорреляционная функция процесса $MA(q)$ порядка, большего чем q равна ...
- 28) Частная автокорреляционная функция процесса $AR(p)$ порядка, большего чем p равна ...
- 29) Автокорреляционная функция процесса $AR(p)$ порядка, большего чем p ...
- 30) Частная автокорреляционная функция процесса $MA(q)$ порядка, большего чем q ...
- 31) Выявить условную гетероскедастичность можно ...
- 32) $ARCH(p)$ модель используется для моделирования ...
- 33) $ARCH(p)$ модель предполагает наличие p лаговых значений ...
- 34) Факторами $ARCH(p)$ модели выступают ...
- 35) Обобщением $ARCH$ модели является добавление лаговых значений ...
- 36) Для оценки ковариации рисков факторов модель $GARCH(1, 1)$ применяться ...
- 37) Для оценки корреляции рисков факторов модель $GARCH(1, 1)$ применяться ...

