**Глава 4. Автокорреляция случайных возмущений**

1. В случае автокорреляции случайных возмущений применяется:

Выберите один ответ:

гребневая регрессия (ридж-регрессия)

обычный метод наименьших квадратов

обобщенный метод наименьших квадратов

косвенный метод наименьших квадратов

2. Согласно одной из предпосылок метода наименьших квадратов случайные возмущения:

Выберите один ответ:

в соседних наблюдениях чаще имеют одинаковые знаки

в различных наблюдениях связаны линейной зависимостью

в различных наблюдениях независимы

в соседних наблюдениях чаще имеют противоположные знаки

3. Поправка Прайса-Винстена применяется для данных:

Выберите один ответ:

всех наблюдений

последнего наблюдения

первого наблюдения

первого и последнего наблюдений

4. При использовании обобщенного метода наименьших квадратов применяется формула:

Выберите один ответ:

Прайса-Винстена

Хилдрета-Лу

Эйткена

Кохрана-Оркатта

5. Отрицательной автокорреляции остатков имеет место, когда:

Выберите один ответ:

остатки в соседних наблюдениях чаще имеют противоположные знаки

сумма остатков значительно меньше нуля

остатки в соседних наблюдениях чаще имеют одинаковые знаки

остатки в различных наблюдениях независимы

6. Статистика Дарбина-Уотсона DW =2, тогда:

Выберите один ответ:

имеется отрицательная автокорреляция остатков

имеется положительная автокорреляция остатков

определенного вывода о корреляции остатков сделать нельзя

автокорреляция остатков отсутствует

7. 

Выберите один ответ:









8. 

Выберите один ответ:









9. 

Выберите один ответ:

определенного вывода об автокорреляции остатков сделать нельзя

имеется отрицательная автокорреляция остатков

автокорреляция остатков отсутствует

имеется положительная автокорреляция остатков

10. На практике для анализа коррелированности случайных отклонений используют статистику:

Выберите один ответ:

Стьюдента

Дарбина-Уотсона

Хи-квадрат

Фишера