Глава 5. Гетероскедастичность случайных возмущений

1. Гомоскедастичность остатков подразумевает:

Выберите один ответ:

рост дисперсии случайных возмущений с увеличением значения фактора

одинаковую дисперсию случайных возмущений

понижение дисперсии случайных возмущений с уменьшением значения фактора

максимальную дисперсию случайных возмущений при средних значениях фактора

2. Обобщенный метод наименьших квадратов применяется в случае:

Выберите один ответ:

фиктивных переменных

гетероскедастичности остатков

мультиколлинеарности факторов

автокорреляции переменных

3. Гетероскедастичность остатков имеет место, когда:

Выберите один ответ:

дисперсия остатков равна нулю

дисперсия остатков является величиной постоянной

дисперсия остатков равна 1

дисперсия остатков пропорциональна квадрату объясняющей переменной

4. Для исследования гетероскедастичности случайных возмущений используется критерий:

Выберите один ответ:

Стьюдента

Фишера

Голдфелда-Квандта

Дарбина-Уотсона

5. В тесте Голдфелда-Квандта за нулевую принимается гипотеза:

Выберите один ответ:

об автокорреляции случайного члена

о гомоскедастичности случайного члена

о нормальном законе распределения случайного члена

о значимости коэффициентов регрессии

6. Оценка гетероскедастичной модели обычным методом наименьших квадратов является:

Выберите один ответ:

несостоятельной

эффективной

смещенной

неэффективной

7. Для оценки модели с гетероскедастичностью применяют:

обобщенный метод наименьших квадратов

метод Кохрана-Оркатта

обычный метод наименьших квадратов

метод Хилдрета-Лу

8. Для оценки модели с гомоскедастичностью применяют:

Выберите один ответ:

метод Хилдрета-Лу

обычный метод наименьших квадратов

обобщенный метод наименьших квадратов

метод Кохрана-Оркатта

9. 

Выберите один ответ:

есть гомоскедастичность остатков

есть автокорреляция остатков

есть гетероскедастичность остатков

нет автокорреляции остатков

10. Если в парной линейной регрессии дисперсия случайных отклонений пропорциональна объясняющей переменной , то для получения эффективных оценок необходимо:

Выберите один ответ:

все уравнение поделить на X2



все уравнение поделить на X

