**Глава 6. Мультиколлинеарность**

1. Под мультиколлинеарностью понимают:

Выберите один ответ:

наличие в уравнении стохастических объясняющих переменных

наличие в уравнении регрессии большого числа незначимых параметров

наличие в уравнении регрессии неоправданно большого числа объясняющих переменных

наличие сильной линейной корреляционной зависимости между объясняющими переменными

2. В случае множественной линейной регрессии, интерпретация коэффициентов при объясняющих переменных невозможна при сильной линейной взаимосвязи между:

Выберите один ответ:

объясняющими переменными

зависимой переменной и случайным возмущением

зависимой переменной и остатками

зависимой и объясняющей переменной

3. При совершенной мультиколлинеарности верно утверждение:

Выберите один ответ:

коэффициенты уравнения регрессии определяются однозначно

влияние объясняющих переменных на зависимую переменную определяется однозначно

определитель матрицы http://iside-storage.distance.ru/img/ckeditor2/2e96fb67-1d38-44f4-acc1-d5ac8ada486f.png

имеется функциональная линейная связь объясняющих переменных

4. При мультиколлинеарности верно утверждение::

Выберите один ответ:

занижаются стандартные ошибки оценок

коэффициенты уравнения регрессии определяются однозначно

увеличиваются t- статистики коэффициентов

возможны неверные знаки у коэффициентов регрессии

5. При мультиколлинеарности верно утверждение:

Выберите один ответ:

завышаются стандартные ошибки оценок

коэффициенты регрессии не чувствительны к изменениям данных

увеличиваются t-статистики коэффициентов

знаки у коэффициентов регрессии определяются правильно

6. Для снижения стандартных ошибок параметров при мультиколлинеарности применяется:

Выберите один ответ:

метод Кохрана-Оркатта

двухшаговый метод наименьших квадратов

метод Хилдрета-Лу

гребневой метод (ридж-регрессия)

7. Гребневой метод наименьших квадратов приводит к:

Выберите один ответ:

повышению стандартных ошибок параметров

смещенным оценкам параметров

снижению t-статистики параметров

несмещенным оценкам параметров

8. Гребневой метод наименьших квадратов приводит к:

Выберите один ответ:

повышению стандартных ошибок параметров

снижению t-статистики параметров

несмещенным оценкам параметров

повышению t-статистики параметров

9. В гребневом методе наименьших квадратов прибавляют небольшое число:

Выберите один ответ:

к диагональным элементам матрицы XTX

к первому элементу матрицы XTX

к элементам первой строки и первого столбца матрицы XTX

ко всем элементам матрицы XTX

10. Если удалить из модели множественной линейной регрессии одну из двух сильно коррелирующих между собой объясняющих переменных, то модуль t-статистики коэффициента при другой значимой для модели переменной

Выберите один ответ:

будет равен критическому значению

повысится

снизится

не изменится