


中国十大品牌教育集团 中国十佳网络教育机构



- 自考名师全程视频授课，图像、声音、文字同步传输，享受身临其境的教学效果；
- 权威专家在线答疑，提交到答疑板的问题在 24 小时内即可得到满意答复；
- 课件自报名之日起可反复观看，不限时间、地点、次数，直到当期考试结束后一周关闭；
- 付费学员赠送 1G 超大容量电子信箱；及时、全面、权威的自考资讯全天 24 小时滚动更新；
- 一次性付费满 300 元，即可享受九折优惠；累计实际交费金额 500 元或支付 80 元会员费，可成为银卡会员，购课享受八折优惠；累计实际交费金额 1000 元或支付 200 元会员费，可成为金卡会员，购课享受七折优惠（以上须在同一学员代码下）；

英语/高等数学预备班：英语从英文字母发音、国际音标、基本语法、常用词汇、阅读、写作等角度开展教学；数学针对有高中入学水平的数学基础的同学开设。通过知识点精讲、经典例题详解、在线模拟测验，有针对性而快速的提高考生数学水平。[立即报名！](#)

基础学习班：依据全新考试教材和大纲，由辅导老师对教材及考试中所涉及的知识进行全面、系统讲解，使考生从整体上把握该学科的体系，准确把握考试的重点、难点、考点所在，为顺利通过考试做好知识上、技巧上的准备。[立即报名！](#)

真题串讲班：教育部考试中心已经启动了自考的国家题库建设，熟练掌握自考历年真题成为顺利通过考试的保障之一。自考 365 网校与权威自考辅导专家合作，推出真题串讲班网上辅导课程。通过对课程的整体情况分析及近 3 次考试的真题讲解，全面梳理考试中经常出现的知识点，并对重点难点问题配合典型例题扩展讲解。串讲班课程在考前一个月左右开通。[立即报名！](#)

习题班：自考 365 网校与北大燕园合作推出，每门课程均涵盖该课程全部考点、难点，在线测试系统按照考试难度要求自动组卷、全程在线测试、提交后自动判定成绩。我们相信经过反复练习定能使您迅速提升应试能力，使您考试梦想成真！[立即报名！](#)

自考实验班：针对高难科目开设，签协议，不及格退还学费。全国限量招生，报名咨询 010-82335555 [立即报名！](#)

全国 2008 年 10 月高等教育自学考试 计量经济学试题 课程代码：00142

一、单项选择题（本大题共 25 小题，每小题 1 分，共 25 分）

在每小题列出的四个备选项中只有一个是符合题目要求的，请将其代码填写在题后的括号内。错选、多选或未选均无分。

1. 在同一时间，不同统计单位的相同统计指标组成的数据列是（ ）
 - A. 时期数据
 - B. 时点数据
 - C. 时序数据
 - D. 截面数据

2. 根据经济学理论和政策、法规的规定而构造的反映某些经济变量关系的恒等式是（ ）
 - A. 随机方程
 - B. 非随机方程
 - C. 行为方程
 - D. 联立方程

3. 在回归模型 $Y_i = \beta_0 + \beta_1 X_i + u_i$ 中，检验 $H_0: \beta_1 = 0$ 时所用的统计量 $\frac{\hat{\beta}_1}{\sqrt{\text{Var}(\hat{\beta}_1)}}$ 服从的分布为（ ）
 - A. $\chi^2 (n-2)$
 - B. $t (n-1)$
 - C. $\chi^2 (n-1)$
 - D. $t (n-2)$

- C.技术方程
D.定义性方程
- 14.如果某个结构方程是恰好识别的，估计其参数可用（ ）
A.最小二乘法
B.极大似然法
C.广义差分法
D.间接最小二乘法
- 15.若联立方程模型中的某个方程是不可识别的，则该模型是（ ）
A.可识别的
B.不可识别的
C.过度识别
D.恰好识别
- 16.当 $\rho \rightarrow 0$ ， $\sigma \rightarrow 1$ 时，CES 生产函数趋于（ ）
A.线性生产函数
B.C—D 生产函数
C.投入产出生产函数
D.对数生产函数
- 17.若一正常商品的市场需求曲线向下倾斜，则可断定（ ）
A.它具有不变的价格弹性
B.随需求量增加，价格下降
C.随需求量增加，价格上升
D.需求无弹性
- 18.关于生产函数的边际替代率的含义，下列表述中正确的是（ ）
A.增加一个单位的某一要素投入，若要维持产出不变，则要增加另一个要素的投入数量
B.减小一个单位的某一要素投入，若要维持产出不变，则要增加另一个要素的投入数量
C.边际替代率即各个生产要素的产出弹性
D.边际替代率即替代弹性
- 19.C—D 生产函数的替代弹性为（ ）
A.-1
B.0
C.1
D. ∞
- 20.以凯恩斯的有效需求理论为基础建立的宏观经济计量模型一般是（ ）
A.需求导向
B.供给导向
C.混合导向
D.产出导向
- 21.根据模型研究对象的范围不同，可将宏观经济计量模型分为国家模型、地区模型和（ ）
A.结构分析模型
B.经济预测模型
C.政策分析模型
D.国家间模型
- 22.预测点离样本分布中心越近，预测误差（ ）
A.越小
B.不变
C.越大
D.与预测点离样本分布中心的距离无关
- 23.希尔不等系数 U 的取值范围是（ ）
A. $-\infty < U \leq -1$
B. $-1 \leq U \leq 1$
C. $0 \leq U < +\infty$
D. $1 \leq U < +\infty$

24.如果一个非平稳时间序列经过 K 次差分后变为平稳时间序列,则该序列为 ()

- A.k 阶单整的
B.k-1 阶单整的
C.k 阶协整的
D.k-1 阶协整的

25.检验协整关系的方法是 ()

- A.戈德菲尔德-匡特方法
B.德宾-瓦森方法
C.格兰杰-恩格尔方法
D.安斯卡姆伯-雷姆塞方法

二、多项选择题(本大题共 5 小题,每小题 2 分,共 10 分)

在每小题列出的五个备选项中至少有两个是符合题目要求的,请将其代码填写在题后的括号内。错选、多选、少选或未选均无分。

26.经济计量模型可应用于 ()

- A.设定模型
B.检验模型
C.经济预测
D.结构分析
E.政策评价

27.关于联立方程模型,下列说法中不正确的有 ()

- A.联立方程偏倚实质是内生变量与前定变量的高度相关
B.只有当模型中所有方程均可识别时,模型才可识别
C.结构式模型中解释变量必须是外生变量或滞后内生变量
D.简化式联立模型中简化式参数反映了解释变量对被解释变量的间接影响
E.满足经典假定时,简化式模型的最小二乘估计具有无偏、一致性

28.对模型 $Y_i = \beta_0 + \beta_1 X_{1i} + \beta_2 X_{2i} + u_i$ 进行总体显著性检验,如果检验结果表明总体线性关系显著,则以下选项中有可能正确的有 ()

- A. $\beta_1 = \beta_2 = 0$
B. $\beta_1 \neq 0, \beta_2 = 0$
C. $\beta_1 = 0, \beta_2 \neq 0$
D. $\beta_1 \neq 0, \beta_2 \neq 0$
E. $\beta_1 = \beta_2$

29.对于经典线性回归模型,各回归系数的普通最小二乘法估计量具有的优良特性有 ()

- A.无偏性
B.有效性
C.一致性
D.确定性
E.线性特性

30.检验多重共线性的方法有 ()

- A.简单相关系数检测法
B.样本分段比较法
C.方差膨胀因子检测法
D.判定系数增量贡献法
E.工具变量法

三、名词解释题（本大题共 5 小题，每小题 3 分，共 15 分）

31. 总体回归模型
32. 内生参数
33. 政策分析模型
34. 模型的超样本特性
35. 伪回归

四、简答题（本大题共 4 小题，每小题 5 分，共 20 分）

36. 假设消费对收入的回归方程为 $\hat{Y}_i = \hat{\beta}_0 + \hat{\beta}_1 X_i$
 - (1) 说明 $\hat{\beta}_0$ 和 $\hat{\beta}_1$ 的经济意义；
 - (2) 若通过样本数据得到 $r^2=0.96$, $r=0.98$, 简述这两个数字说明了什么问题。
37. 简述使用普通最小二乘法估计分布滞后模型时会遇到的问题。
38. 简述联立方程模型估计方法的类型及各类分别包含的估计方法。
39. 简述需求函数的基本特性。

五、计算题（本大题共 2 小题，每小题 10 分，共 20 分）

40. 现有 X 和 Y 的样本观测值如下：

X	2	5	10	4	10
Y	4	7	4	5	9

假设 Y 对 X 的回归方程为 $Y_i = \alpha + \beta X_i + u_i$, 且 $\text{Var}(u_i) = \sigma^2 X_i^2$, 试用适当的方法估计此回归方程。

41. 某行业利润 Y 不仅与销售额 X 有线性关系, 而且与季度因素有关。
 - (1) 如果认为季度因素使利润平均值发生变异, 应如何引入虚拟变量?
 - (2) 如果认为季度因素使利润对销售额的变化额发生变异, 应如何引入虚拟变量?
 - (3) 如果认为上述两种情况都存在, 又应如何引入虚拟变量?请针对上述三种情况分别设定利润模型。

六、分析题（本大题共 10 分）

42. 考虑如下的联立方程模型：

$$\begin{cases} Y_1 = a_{11}Y_2 + a_{12}P + \mu_1 & \text{①} \\ Y_2 = a_{21}Y_1 + a_{22}Q + \mu_2 & \text{②} \end{cases}$$

- 问：（1）指出该联立方程模型中的内、外生变量。
- （2）是否可以用工具变量法估计联立方程中的方程①？为什么？
- （3）如果可以，应该用哪个变量作为 Y_2 的工具变量？
- （4）请给出用工具变量法估计联立方程中方程①的正规方程组。

自考 365
www.zikao365.com

