

机密★启用前

2025 年 4 月高等教育自学考试全国统一考试

计量经济学

(课程代码 00142)

注意事项:

1. 本试卷分为两部分, 第一部分为选择题, 第二部分为非选择题。
2. 应考者必须按试题顺序在答题卡(纸)指定位置上作答, 答在试卷上无效。
3. 涂写部分、画图部分必须使用 2B 铅笔, 书写部分必须使用黑色字迹签字笔。

第一部分 选择题

一、单项选择题: 本大题共 20 小题, 每小题 1 分, 共 20 分。在每小题列出的备选项中只有一项是最符合题目要求的, 请将其选出。

1. 在城镇居民消费需求分析中, 某学者使用不同省份的居民收入和居民消费的连续五个年度的数据。该研究数据属于
A. 截面数据 B. 时序数据
C. 面板数据 D. 虚拟变量数据
2. 具有一定概率分布的随机变量, 其数值由模型自身决定的变量是
A. 内生变量 B. 外生变量
C. 滞后变量 D. 解释变量
3. 经济计量分析工作包括建立模型和应用模型两个基本环节。下列选项中属于应用模型环节的是
A. 设定模型 B. 估计参数
C. 检验模型 D. 评价经济政策
4. 下列选项中, 不属于回归系数估计量性质的是
A. 线性无偏性 B. 渐进性
C. 一致性 D. 有效性
5. 在回归模型 $Y = \beta_0 + \beta_1 X + u$ 中, 下列选项关于误差项和误差平方和的说法错误的是
A. 误差项可以有正有负 B. 误差项为因变量实际值和回归值的差异
C. 误差平方和越大越好 D. 误差平方和的数值大小取决于参数 β_0 和 β_1

6. 如果回归模型中随机扰动项的方差不是常数, 而是随着样本观测点的不同而取不同的数值, 则称为随机干扰项的
A. 同方差性 B. 方差齐性
C. 序列相关性 D. 异方差性
7. 下列选项中, 不属于近似多重共线性统计后果的是
A. 判定系数很高 B. 回归系数估计量的方差很大
C. 拟合的残差平方和很小 D. 回归系数估计量的准确性很高
8. 假设消费函数 $Y_t = \alpha_0 + \alpha_1 X_t + \alpha_2 X_{t-1} + \alpha_3 X_{t-2} + u_t$, 其中变量 X_{t-2} 的含义为
A. 解释变量滞后 1 期项 B. 解释变量滞后 2 期项
C. 被解释变量滞后 1 期项 D. 被解释变量滞后 2 期项
9. 下列选项中, 不属于时间滞后现象产生的原因是
A. 心理因素 B. 制度因素
C. 随机因素 D. 技术因素
10. 下列选项中, 不属于简化模型特点的是
A. 较好的预测功效 B. 与经济理论相一致
C. 解释变量是弱外生性的 D. 模型参数是稳定的
11. 斜率能够度量变量 Y 对另一个变量 X 的弹性的模型是
A. 对数线性模型 B. 半对数模型
C. 双曲线模型 D. 多项式模型
12. 下列选项中, 不属于需求函数特性的是
A. 非负性 B. 非对称性
C. 单调性 D. 零阶齐次性
13. 下列选项中, 属于联立方程式的是
A. 会计恒等式 B. 技术方程式
C. 行为方程式 D. 以上三个选项都属于
14. 克莱因建立的“1921-1941 年美国宏观经济模型”的理论基础是
A. 经济增长理论 B. 生命周期理论
C. 有效需求理论 D. 货币需求理论
15. 取值为 0 和 1 的变量不属于
A. 连续变量 B. 哑变量
C. 虚拟变量 D. 二进制变量
16. 下列选项中, 关于对数单位模型 (logit) 说法错误的是
A. 被解释变量为虚拟变量 B. 随机误差项是异方差的
C. 可用最小二乘法估计 D. 样本足够大时, 可用加权最小二乘法估计

17. 下列选项中, 无法对时间序列平稳性进行检验的是

- A. 单位根检验
- B. DF 检验
- C. ADF 检验
- D. White 检验

18. 下列选项中, 属于时间序列模型的是

- A. 自回归过程
- B. 移动平均过程
- C. 自回归移动平均过程
- D. 以上三个选项都属于

19. 下列选项中, 不属于面板数据的优点的是

- A. 可解决样本容量不足的问题
- B. 模型设定错误不会引起较大的偏差
- C. 可多层面分析经济问题
- D. 可减少难以度量变量所带来的问题

20. 下列选项中, 属于仅随时间变化, 而与个体无关的变量的是

- A. 利率
- B. 企业利润
- C. 各地区的气候条件
- D. 家庭收入

二、多项选择题: 本大题共 5 小题, 每小题 2 分, 共 10 分。在每小题列出的备选项中至少有两项是符合题目要求的, 请将其选出, 错选、多选或少选均无分。

21. 在经济计量分析工作中, 检验模型通常使用的准则包括

- A. 经济理论准则
- B. 最优性准则
- C. 经济计量准则
- D. 统计准则
- E. 简洁原则

22. 下列选项中属于自回归模型的有

- A. 自适应预期模型
- B. 对数线性模型
- C. 随机效应模型
- D. 部分调整模型
- E. 双曲线模型

23. 二阶段最小二乘法 (2SLS) 估计必须满足的条件有

- A. 结构式方程必须是可识别的
- B. 随机误差项必须满足零均值的假定
- C. 不存在严重多重共线性
- D. 样本容量足够大
- E. 随机误差项必须满足无自相关的假定

24. 下列选项中属于随机时间序列模型的建立步骤的有

- A. 利用实际经验判断模型的阶数
- B. 利用相关图和偏相关图对模型进行识别
- C. 对模型参数进行估计
- D. 对模型进行诊断和检验
- E. 对时间序列模型进行预测

25. 下列选项中关于最小二乘虚拟变量法 (LSDV) 对固定效应模式进行估计的说法正确的有

- A. 参数估计量具有一致性
- B. 存在异方差时, 也可得到无偏估计
- C. 无法适用于不齐面板数据
- D. 存在异方差时, 也可以得到一致估计
- E. 存在异方差时, 参数估计的协方差矩阵无需进行调整

第二部分 非选择题

三、名词解释题: 本大题共 5 小题, 每小题 3 分, 共 15 分。

26. 系统变参数模型

27. 几何分布滞后模型

28. 工具变量法

29. 一阶单整序列

30. 最小二乘虚拟变量法

四、简答题: 本大题共 5 小题, 每小题 5 分, 共 25 分。

31. 什么是区间预测?

32. 简述多重共线性问题的处理办法。

33. 简述虚拟变量模型的特征。

34. 简述相对收入理论消费函数的估计方法。

35. 简述面板数据模型的变量的类型。

五、计算题: 本大题共 2 小题, 每小题 8 分, 共 16 分。

36. 利用 18 年的数据估计城镇居民家庭的人均生活消费支出函数:

$$Y = 79.93 + 0.69X_t$$

$$Se(12.40)(0.01)$$

$$R^2 = 0.99, DW = 0.57$$

其中, 人均生活消费支出为 Y , 人均实际收入为 X 。

回答: (1) 检验模型是否存在序列相关 ($d_L = 1.18$)。

(2) 请问 DW 检验是否适用于检验高阶自回归形式的序列相关? 如果不能, 可以采用什么方法进行检验?

37. 假设一个收入—消费模型的回归分析结果如下所示:

$$C = -0.1186 + 0.9853Y + 232.85D - 0.1534DY$$

其中, C 为居民消费支出, Y 为居民可支配收入; D 为虚拟变量, 1978 年以前为 0, 1978 年以后为 1。

回答: (1) 1978 年以前, 居民的边际消费倾向是多少?

(2) 1978 年以后, 居民的边际消费倾向是多少?

(3) 如果变量 DY 的 t 值为 15.41, 请问 1978 年以前和 1978 年以后两个阶段的居民边际消费倾向是否有显著的变化? (t 检验临界值为 1.96)

六、分析题：本大题共 1 小题，每小题 14 分，共 14 分。

38. 为估计某省纺织行业的生产函数，使用了 18 个纺织企业 1995 年的产值 Y 、职工人数 L 和资产数额 K 进行回归分析，得到如下的样本模型：

$$\log(Y) = -2.5655 + 0.7585\log(L) + 0.6862\log(K)$$

$$\text{Se} (1.50) \quad (0.31) \quad (0.28)$$

回答：(1) 请计算资产数额 (K) 的 t 值。

(2) 资产数额投入对产出的影响显著吗？是怎么样的影响？（ t 检验临界值为 1.96）

(3) 如果模型的 RSS 为 2.3509，TSS 为 12.8396，请问回归模型的判定系数是多少？并简要解释判定系数的含义。

(4) 模型中的解释变量个数会不会影响判定系数的值？