-www.zikao365.com-

## **自考网校** 免费试听.自考名师.课件更新.报名演示.学习卡.













郭建华 韩旺辰 郝玉柱 张旭娟 孙茂竹 白薇

最权威的师资阵容

最及时的在线答疑

全程视频授课, 反复观看 不限次数

自考 365 网校数百门课程全面招生! 基础班+串讲班 祝您成功每一天!

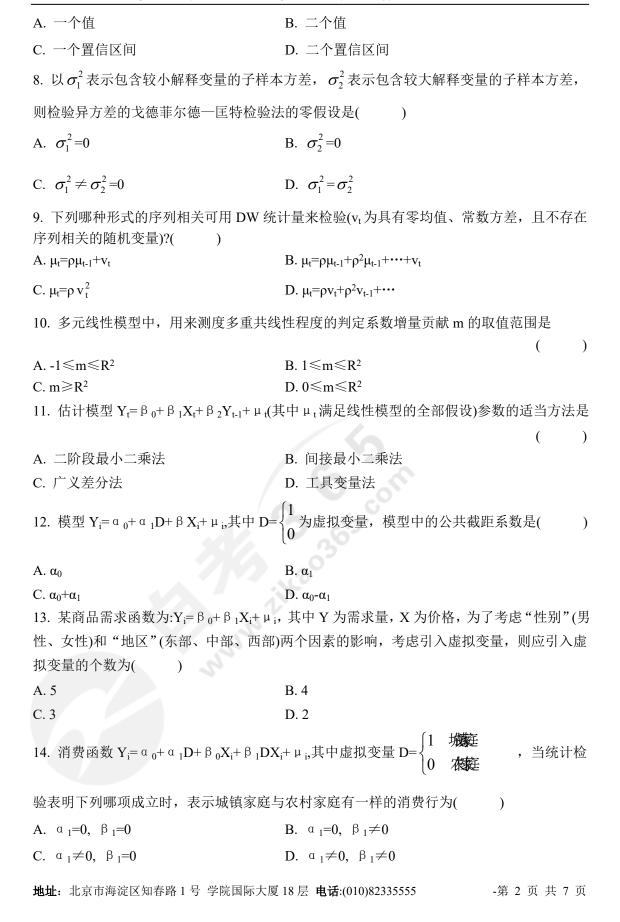
# 全国 2006 年 1 月高等教育自学考试

# 计量经济学试题

课程代码: 00142

一、单项选择题(本大题共30小题,每小题1分,共30分)

在每小题列出的四个备选项中只有一个是	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. 以 X 为解释变量, Y 为被解释变量,	将X、Y的观测值分别取对数,如果这些对数值描
成的散点图近似形成为一条直线,则适宜	了配合下面哪一模型形式?(   )
A. $Y_i = \beta_0 + \beta_1 X_i + \mu_i$	$B.\ lnY_i\!\!=\!\!\beta_0\!\!+\!\!\beta_1X_i\!\!+\!\!\mu_i$
C. $Y_i = \beta_0 + \beta_1 ln X_i + \mu_i$	$D.\ lnY_i \!\!=\!\! \beta_0 \!\!+\!\! \beta_1 lnX_i \!\!+\!\! \mu_i$
2. 下列各回归方程中,哪一个必定是错误	吴的?()
A. $Y_i = 50 + 0.6X_i$ $r_{XY} = 0.8$	$B.Y_i = -14 + 0.8X_i$ $r_{XY} = 0.87$
C. $Y_i=15-1.2X_i$ $r_{XY}=0.89$	D. $Y_i$ =-18-5.3 $X_i$ $r_{XY}$ =-0.96
3. 已知某一直线回归方程的判定系数为	0.81,则解释变量与被解释变量间的线性相关系数
为( )	<b>3</b>
A. 0.81	B. 0.90
C. 0.66	D. 0.32
4. 对于线性回归模型 Y <sub>i</sub> =β <sub>0</sub> +β <sub>1</sub> X <sub>i</sub> +μ <sub>i</sub> ,	要使普通最小二乘估计量具备无偏性,则模型必须
满足( )	
A. Ε( μ <sub>i</sub> )=0	B. Var( $\mu_i$ )= $\sigma^2$
C. Cov( $\mu_i$ , $\mu_j$ )=0	D. μ <sub>i</sub> 服从正态分布
5. 指出下列哪一变量关系是函数关系?(	)
A. 商品销售额与销售价格	B. 学习成绩总分与各门课程成绩分数
C. 物价水平与商品需求量	D. 小麦亩产量与施肥量
6. 对模型 $Y_i$ = $\beta_0$ + $\beta_1 X_{1i}$ + $\beta_2 X_{2i}$ + $\mu_i$ 进行.	总体显著性 F 检验,检验的零假设是( )
A. $\beta_1 = \beta_2 = 0$	B. $\beta_1=0$
C. β <sub>2</sub> =0	D. $\beta_0=0$ 或 $\beta_1=0$
7. 区间预测是根据给定的解释变量的值,	预测被解释变量的( )
地址: 北京市海淀区知春路1号 学院国际大厦	18 层 电话:(010)82335555 -第 1 页 共 7 页



15. 在部份调整模型: $Y_t$ = $\delta$ $\beta_0$ + $\delta$ $\beta_1 X_t$ +	$(1-\delta)Y_{t-1}+\delta$ $\mu_t$ 中, $\delta$ 被称为调整因子,其数值的大
小表示调整速度的快慢, δ 的取值范围是	<u>t</u> ( )
A1< δ<1	B1< δ <0
C. 0< δ ≤1	D. δ>1 或 δ<1
16. 有限多项式滞后模型中,将参数 β <sub>i</sub> 表	表示为关于滞后期 i 的多项式并代入原模型,变换后
的模型可以明显地减弱模型中存在的(	)
A. 异方差问题	B. 多重共线性问题
C. 序列相关问题	D. 随机解释变量问题
17. 当分布滞后模型的随机项满足线性模	型假定时,下列哪一个模型可以用最小二乘法来估
计?( )	
A. $Y_t = \alpha + \beta_0 X_t + \beta_1 X_{t-1} + \beta_2 X_{t-2} + \dots + \mu_t$	
B. $Y_t = \alpha(1-\lambda) + \beta_0 X_t + \lambda Y_{t-1} + (\mu_t - \lambda \mu_{t-1})$	
C. $Y_t = \gamma \beta_0 + \gamma \beta_1 X_t + (1 - \gamma) Y_{t-1} + (\mu_t - (1 - \gamma) \mu_{t-1})$	
D. $Y_t$ =δ $\beta_0$ +δ $\beta_1 X_t$ +(1-δ) $Y_{t-1}$ +δ $\mu_t$ 18. 某农产品的供求模型如: $\begin{cases} Q_D = \alpha_t \\ Q_S = \beta_0 \end{cases}$	$a_0 + \alpha_1 P + \alpha_2 Y + \mu_1 $ $+ \beta_1 P + \beta_2 R + \mu_2 $ s
	26
的外生变量是:( )	格,Y为消费者收入水平,R为天气条件。模型中
A. Q <sub>S</sub> 和 Q <sub>D</sub>	B. Q <sub>S</sub> 、Q <sub>D</sub> 和 P
C. P、Y 和 R	D. Y 和 R
19. 可以用来估计过渡识别方程的单方程	
A. 间接最小二乘法	B. 二阶段最小二乘法
C. 工具变量法	D. 普通最小二乘法
20. 生产函数 Y=f(L,K)具有如下性质: (	)
A. 替代弹性小于 0	B. 边际生产力小于 0
C. 边际生产力递减	D. 规模报酬递减
21. 在线性支出系统 $P_j X_j = P_j X_j^0 + \beta_j (V - \sum_{i=1}^n X_j^0 + \beta_j (V - \sum_$	$\sum_{i} P_{i} X_{i}^{0} ) \Psi($



A.	X <sup>0</sup> 是对 j	商品的基础需求量
----	---------------------	----------

B. β<sub>i</sub>是对 j 商品的边际消费倾向

C. V- 
$$\sum_{i=1}^{n} P_{i} X_{i}^{0}$$
 为剩余收入中可用于  $j$  商品上的支出

D. 
$$0 < \sum_{j=1}^{n} \beta_{j} < 1$$

22. CES 模型 Y=A[δ K<sup>-</sup>ρ+(1-δ)L<sup>-</sup>ρ] 中,0<δ<1,δ 越接近于 1,表示( )

A. 资本密集度越低

B. 资本密集度越高

C. 技术发展程度越高

D. 技术发展程度越低

23. 国民经济系统中的四大部门是(

行政部门事业部门企业部门私人部门選問選問機関

 (本)
 (本)

24. 要使总供求平衡, 国民经济中哪个平衡关系必须成立?( )

A. 漏出量总和=注入量总和

B. 出口总量=进口总量

C. 储蓄总量=投资总量

D. 税收总量=政府支出总量

25. 构造宏观经济模型的两个内容是(

A. 模型设计和模型检验

B. 总体设计和个体设计

C. 模型估计和模型应用

D. 供给导向和需求导向

26. 为了评价模型的预测误差,最好进行( )

A. 返回预测检验

B. 事后模拟检验

C. 事后预测检验

D. 事前预测检验

27. 如果一个非平稳时间序列经过 K 次差分后为平稳时间序列,则称这个时间序列是(

A. K 阶单整的

B. K 阶协整的

C. (K-1)阶单整的

D. (K-1)阶协整的

28. 总共5年、每年12个月、300户居民,这样观察形成的容量为n=300×12×5的某一指

**地址:** 北京市海淀区知春路 1 号 学院国际大厦 18 层 **电话**:(010)82335555

-第4页共7页



标的观测数据是( )	
A. 时序数据	B. 横截面数据
C. TS/CS 数据	D. 以上都不是
29. 检验两变量间是否协整的方法是(	)
A. 戈里瑟检验	B. 安斯卡姆伯——雷姆塞检验
C. 德宾——瓦特森检验	D. 格兰杰——恩格尔检验
30. 在非均衡经济计量模型的四种类型	型中,与现实经济运行系统最接近、最相符的是( )
A. 基本模型	B. 方向模型
C. 数量模型	D. 随机模型
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。
31. 经济计量模型的构成要素有(	)
A. 变量	B. 数据
C. 参数	D. 随机误差项
E. 估计量	
32. 经济计量研究中,有时引入滞后口	内生变量作为解释变量,作为解释变量的滞后内生变量
是( )	
A. 非随机变量	B. 随机变量
C. 前定变量	D. 内生变量
E. 外生变量	
33. 估计回归参数的方法主要有(	)
A. 分段回归法	B. 变参数法
<ul><li>A. 分段回归法</li><li>C. 最小二乘法</li><li>E. 矩估计法</li></ul>	D. 极大似然法
E. 矩估计法	
34. 工具变量法适合估计下列哪些模型	型(或方程)的参数?( )
A. 存在异方差的模型	B. 包含有随机解释变量的模型
C. 自回归模型	D. 存在序列相关的模型
E. 联立方程模型中恰好识别的结构方	程
35. 反映人们需求行为的弹性指标有(	)
A. 收入弹性	B. 要素替代弹性
C. 预算弹性	D. 自价格弹性



#### E. 交叉价格弹性

### 三、名词解释(本大题共7小题,每小题2分,共14分)

- 36. 内生变量
- 37. 设定误差
- 38. 分布滞后模型
- 39. 扩展线性支出系统
- 40. 混合导向
- 41. 希尔(Theil)不等系数
- 42. 非均衡

#### 四、简答题(本大题共5小题,每小题4分,共20分)

- 43. 简述用来说明回归方程拟合优度的判定系数  $R^2$  与用来检验回归方程总体显著性的 F 统计量之间的联系。
- 44. 影响预测精度的主要因素有哪些?
- 45. 以二元线性模型  $Y_i$ = $\beta_0$ + $\beta_1 X_{1i}$ + $\beta_2 X_{2i}$ + $\mu_i$ 为例,说明当  $X_1$ 与  $X_2$ 完全线性相关时,模型 参数将无法估计。
- 46. 比较 koyck 变换模型与部分调整模型的异同。
- 47. 假如某商品的需求弹性为-0.88,则降价促销的策略是否可取?

#### 五、计算题(本大题共2小题,每小题8分,共16分)

48. 根据某商品供应量(Y)与价格(X)的 10 组观测值, 计算得:

$$\Sigma$$
 X=35  $\Sigma$  Y=710  $\Sigma$  X<sup>2</sup>=132  $\Sigma$  Y<sup>2</sup>=50446  $\Sigma$  XY=2501

要求: (1)计算商品供应量与价格之间的相关系数。

- (2)建立供应量(Y)关于价格(X)的线性回归方程。
- (3)说明该线性回归方程的拟合优度。
- 49. 考察下述小型宏观经济计量模型:

$$\begin{cases} C_{t} = \alpha_{0} + \alpha_{1}Y_{t} + \mu_{1t} \\ I_{t} = \beta_{0} + \beta_{1}Y_{t} + \beta_{2}Y_{t-1} + \mu_{2t} \\ Y_{t} = C_{t} + I_{t} + G_{t} \end{cases}$$

要求: (1)试用阶条件和秩条件确定各个方程的识别状态;

(2)整个模型的识别状态如何。

#### 六、分析题(本大题共10分)

50. 已知原模型  $Y_i = \beta_0 + \beta_1 X_i + \mu_i$ , 如果  $\beta_0$  在不同"地区"(农村、城镇)是不同的,X 在达到 X\*水平以前和以后对 Y 产生的影响也是不同的。则应如何修正以上模型?

**地址:** 北京市海淀区知春路 1 号 学院国际大厦 18 层 **电话**:(010)82335555

-第 6 页 共 7 页

