



- A. 一个值  
B. 二个值  
C. 一个置信区间  
D. 二个置信区间
8. 以  $\sigma_1^2$  表示包含较小解释变量的子样本方差,  $\sigma_2^2$  表示包含较大解释变量的子样本方差, 则检验异方差的戈德菲尔德-匡特检验法的零假设是( )
- A.  $\sigma_1^2=0$   
B.  $\sigma_2^2=0$   
C.  $\sigma_1^2 \neq \sigma_2^2=0$   
D.  $\sigma_1^2=\sigma_2^2$
9. 下列哪种形式的序列相关可用 DW 统计量来检验( $v_t$  为具有零均值、常数方差, 且不存在序列相关的随机变量)?( )
- A.  $\mu_t=\rho\mu_{t-1}+v_t$   
B.  $\mu_t=\rho\mu_{t-1}+\rho^2\mu_{t-1}+\dots+v_t$   
C.  $\mu_t=\rho v_t^2$   
D.  $\mu_t=\rho v_t+\rho^2 v_{t-1}+\dots$
10. 多元线性模型中, 用来测度多重共线性程度的判定系数增量贡献  $m$  的取值范围是( )
- A.  $-1 \leq m \leq R^2$   
B.  $1 \leq m \leq R^2$   
C.  $m \geq R^2$   
D.  $0 \leq m \leq R^2$
11. 估计模型  $Y_t = \beta_0 + \beta_1 X_t + \beta_2 Y_{t-1} + \mu_t$  (其中  $\mu_t$  满足线性模型的全部假设) 参数的适当方法是( )
- A. 二阶段最小二乘法  
B. 间接最小二乘法  
C. 广义差分法  
D. 工具变量法
12. 模型  $Y_i = \alpha_0 + \alpha_1 D + \beta X_i + \mu_i$ , 其中  $D = \begin{cases} 1 \\ 0 \end{cases}$  为虚拟变量, 模型中的公共截距系数是( )
- A.  $\alpha_0$   
B.  $\alpha_1$   
C.  $\alpha_0 + \alpha_1$   
D.  $\alpha_0 - \alpha_1$
13. 某商品需求函数为:  $Y_i = \beta_0 + \beta_1 X_i + \mu_i$ , 其中  $Y$  为需求量,  $X$  为价格, 为了考虑“性别”(男性、女性)和“地区”(东部、中部、西部)两个因素的影响, 考虑引入虚拟变量, 则应引入虚拟变量的个数为( )
- A. 5  
B. 4  
C. 3  
D. 2
14. 消费函数  $Y_i = \alpha_0 + \alpha_1 D + \beta_0 X_i + \beta_1 DX_i + \mu_i$ , 其中虚拟变量  $D = \begin{cases} 1 & \text{城镇} \\ 0 & \text{农村} \end{cases}$ , 当统计检验表明下列哪项成立时, 表示城镇家庭与农村家庭有一样的消费行为( )
- A.  $\alpha_1=0, \beta_1=0$   
B.  $\alpha_1=0, \beta_1 \neq 0$   
C.  $\alpha_1 \neq 0, \beta_1=0$   
D.  $\alpha_1 \neq 0, \beta_1 \neq 0$



- A.  $X_j^0$  是对 j 商品的基础需求量
- B.  $\beta_j$  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  $Y = A[\delta K^{-\rho} + (1-\delta)L^{-\rho}]^{-\frac{1}{\rho}}$  中,  $0 < \delta < 1$ ,  $\delta$  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( )

- A.  $\left\{ \begin{array}{l} \text{行政部门} \\ \text{事业部门} \\ \text{企业部门} \\ \text{私人部门} \end{array} \right.$
- B.  $\left\{ \begin{array}{l} \text{生产部门} \\ \text{流通部门} \\ \text{分配部门} \\ \text{消费部门} \end{array} \right.$
- C.  $\left\{ \begin{array}{l} \text{农业部门} \\ \text{工业部门} \\ \text{建筑部门} \\ \text{第三产业部门} \end{array} \right.$
- D.  $\left\{ \begin{array}{l} \text{政府部门} \\ \text{家庭部门} \\ \text{企业部门} \\ \text{国外部门} \end{array} \right.$

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  $n=300 \times 12 \times 5$  的某一指

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  
C. 最小二乘法  
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(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:

$$\sum X=35 \quad \sum Y=710 \quad \sum X^2=132 \quad \sum Y^2=50446 \quad \sum XY=2501$$

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?

