

全国 2014 年 10 月高等教育自学考试

计量经济学试题

课程代码:00142

请考生按规定用笔将所有试题的答案涂、写在答题纸上。

选择题部分

注意事项:

1. 答题前,考生务必将自己的考试课程名称、姓名、准考证号用黑色字迹的签字笔或钢笔填写在答题纸规定的位置上。

2. 每小题选出答案后,用 2B 铅笔把答题纸上对应题目的答案标号涂黑。如需改动,用橡皮擦干净后,再选涂其他答案标号。不能答在试题卷上。

一、单项选择题 (本大题共 20 小题,每小题 1 分,共 20 分)

在每小题列出的四个备选项中只有一个是符合题目要求的,请将其选出并将“答题纸”的相应代码涂黑。错涂、多涂或未涂均无分。

1. 计量经济学(Econometrics)名称的提出者是

- A. 凯恩斯 B. 萨缪尔森 C. 丁伯根 D. 费里希

2. 下列说法不属于经济计量模型应用目的是

- A. 经济规律研究 B. 经济预测 C. 经济结构分析 D. 经济政策模拟

3. 系统误差是由系统因素形成的误差。系统因素是指

- A. 那些对被解释变量的作用显著,作用方向稳定,重复试验也不可能相互抵消的因素
B. 那些对被解释变量的作用显著,作用方向不稳定,重复试验也不可能相互抵消的因素
C. 那些对被解释变量的作用显著,作用方向不稳定,重复试验相互抵消的因素
D. 那些对被解释变量的作用显著,作用方向稳定,重复试验可能相互抵消的因素

4. 在同一时点或时期上,不同统计单位的相同统计指标组成的数据是

- A. 时期数据 B. 时点数据 C. 时序数据 D. 截面数据

5. 在 X 与 Y 的相关分析中

- A. X 是随机变量, Y 是非随机变量 B. Y 是随机变量, X 是非随机变量
C. X 和 Y 都是随机变量 D. X 和 Y 均为非随机变量

6. 有偏估计量是指

- A. 估计值不等于真实值
- B. 估计量的最大值不等于真实值
- C. 估计量的最小值不等于真实值
- D. 估计量的期望值不等于真实值

7. 在回归模型 $Y_t = \beta_1 + \beta_2 X_{2t} + \beta_3 X_{3t} + u_t$ 中, 序列相关是指

- A. Y 与 X 相关
- B. u_t, u_{t-1} 彼此相关
- C. X_2, X_3 与 u 相关
- D. X_2, X_3 彼此相关

8. 在对数线性模型 $\ln Y_i = \alpha + \beta \ln X_i + u$ 中, β 度量了

- A. X 变动 1% 时, Y 变动 $\beta\%$
- B. X 变动 1% 时, Y 变动 β
- C. X 变动一个单位时, Y 变动的数量
- D. Y 变动一个单位时, X 变动的数量

9. 在一元回归模型 $Y = \beta_1 + \beta_2 X + u$ 中, 回归系数 β_2 未通过显著性 t 检验, 表示

- A. $\beta_2 = 0$
- B. $\hat{\beta}_2 = 0$
- C. $\beta_2 \neq 0, \hat{\beta}_2 = 0$
- D. $\beta_2 = 0, \hat{\beta}_2 \neq 0$

10. 根据判定系数 R^2 与 F 统计量的关系可知, 当 $R^2=0$ 时, 有

- A. $F=-1$
- B. $F=0$
- C. $F=1$
- D. $F=\infty$

11. 当存在异方差时, 使用普通最小二乘法得到的估计量是

- A. 有偏估计量
- B. 有效估计量
- C. 无效估计量
- D. 渐近有效估计量

12. 怀特检验适用于检验

- A. 序列相关
- B. 异方差
- C. 多重共线性
- D. 参数显著性

13. 异方差是指回归模型中

- A. 解释变量 X 的不同观测点方差不同
- B. 解释变量 X 与被解释变量 Y 的不同观测点协方差不同
- C. 解释变量 X 与随机误差项 u 之间不同观测点协方差不同
- D. 随机误差项 u 的不同观测点方差不同

14. DW 检验适用于检验

- A. 异方差
- B. 序列相关
- C. 多重共线性
- D. 设定误差

15. 设 $Y_i = \beta_0 + \beta_1 X_i + u_i$, Y_i 为居民消费支出, X_i 为居民收入, $D=1$ 代表城镇居民,

$D=0$ 代表农村居民, 则斜率变动模型为

- A. $Y_i = \beta_0 + \beta_1 X_i + \beta_2 D + u_i$
- B. $Y_i = (\beta_0 + \beta_2) + \beta_1 X_i + u_i$
- C. $Y_i = (\beta_0 + \beta_1) + \beta_1 X_i + u_i$
- D. $Y_i = \beta_0 + \beta_1 X_i + \beta_2 DX_i + u_i$

16. 如果联立方程模型中的结构方程具有唯一统计形式，则下列结论必然成立的是
- A. 该模型可以识别 B. 该模型设定正确
C. 该模型不可识别 D. 该模型设定不正确
17. 结构式方程恰好识别是指
- A. 结构式参数有唯一数值 B. 简化式参数具有唯一数值
C. 结构式参数具有多个数值 D. 简化式参数具有多个数值
18. C-D 生产函数中的资本产出弹性是指
- A. 当劳动投入 = 1 % 时，资本增加 1 % 时所引起的产出量的变化率
B. 当劳动投入不变时，资本增加 1 % 时所引起的产出量的变化率
C. 当劳动投入 = 1 % 时，资本增加 1 % 时所引起的产出量的增量
D. 当劳动投入不变时，资本增加 1 % 时所引起的产出量的增量
19. 在 CES 生产函数 $Y = A[\delta K^{-\rho} + (1-\delta)L^{-\rho}]^{-\frac{v}{\rho}}$ 中，A 的含义为
- A. 效率参数，反映技术发达程度 B. 制度技术进步水平
C. 相对技术进步水平 D. 科技进步率
20. 如果消费模型设定为 $C_t = \beta_0 + \beta_1 Y_t + \beta_2 C_{t-1} + u_t$ ，则所依据的理论假设为
- A. 相对收入假设 B. 生命周期假设 C. 持久收入假设 D. 绝对收入假设

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，请将其选出并将“答题卡”的相应代码涂黑。错涂、多涂、少涂或未涂均无分。

21. 经济理论检验的主要内容有
- A. 回归方程的拟合优度
 - B. 误差项的性质
 - C. 回归系数的符号
 - D. 回归系数的值域
 - E. 回归系数的显著性

22. 多元回归模型 $Y_i = \beta_1 + \beta_2 X_{2i} + \beta_3 X_{3i} + u_i$ 通过了整体显著性 F 检验, 则可能的情况为
- A. $\beta_2 = 0, \beta_3 = 0$
 - B. $\beta_2 \neq 0, \beta_3 \neq 0$
 - C. $\beta_2 = 0, \beta_3 \neq 0$
 - D. $\beta_2 \neq 0, \beta_3 = 0$
 - E. $\beta_2 = \beta_3 \neq 0$
23. 计量经济模型中存在多重共线性的主要原因为
- A. 模型中存在异方差
 - B. 模型中存在虚拟变量
 - C. 经济变量相关的共同趋势
 - D. 滞后变量的引入
 - E. 样本资料的限制
24. 对于自适应预期模型, 存在的主要问题有
- A. 误差项自相关
 - B. 多重共线性
 - C. 异方差
 - D. 解释变量与误差项相关
 - E. 误差项非正态分布
25. 经济计量分析工作的步骤有
- A. 误差分析
 - B. 设定模型
 - C. 估计参数
 - D. 检验模型
 - E. 应用模型

非选择题部分

注意事项：

用黑色字迹的签字笔或钢笔将答案写在答题纸上，不能答在试题卷上。

三、名词解释题（本大题共 5 小题，每小题 3 分，共 15 分）

- 26. 结合数据
- 27. 短期影响乘数
- 28. 同方差
- 29. 阶条件
- 30. 协整

四、简答题（本大题共 5 小题，每小题 5 分，共 25 分）

- 31. 简述一元回归模型经典假定。
- 32. 简述最小二乘原理。
- 33. 简述存在随机解释变量时普通最小二乘估计存在的问题。
- 34. 简述虚拟变量陷阱及原因。
- 35. 简述自适应预期模型的原理。

五、简单应用题（本大题共 3 小题，每小题 7 分，共 21 分）

36. 以 1989~2008 年中国某企业的利润总额 Y （万元）为被解释变量，以该企业营业收入 X （万元）为解释变量进行回归，得到回归结果如下：

$$\hat{Y}_t = -261.09 + 0.2453X_t$$

$$Se=(31.327) \quad (\quad)$$

$$t=(\quad) \quad (16.616)$$

$$R^2=0.9388 \quad n=20$$

要求：（1）将括号内缺失的数据填入；（计算结果保留三位小数）

（2）检验斜率系数的显著性；（ $\alpha = 5\%$ ， $t_{0.025}(18) = 2.101$ ）

（3）如何解释系数 0.2453。

37. 设收入模型为 $Y_i = \beta_0 + \beta_1 X_{1i} + \beta_2 X_{2i} + u_i$ ，其中， Y_i 为薪金收入， X_{1i} 为受教育年限， X_{2i} 为工龄。样本来自三个行业，金融业、通讯业、制造业。为研究行业间收入差异，应如何设计模型？（以制造业为比较基础）

38. 考虑下述模型

$$C_t = \alpha_1 + \alpha_2 D_t + u_t \quad (\text{消费方程})$$

$$I_t = \beta_1 + \beta_2 D_{t-1} + v_t \quad (\text{投资方程})$$

$$D_t = C_t + I_t + Z_t$$

其中， C =消费支出， D =收入， I =投资， Z =自发支出； C 、 I 和 D 为内生变量。

要求：（1）写出消费方程的简化式方程；

（2）用阶条件研究各方程的识别问题。

六、综合应用题 （本大题共 1 小题，9 分）

39. 劳动经济学家认为：（1）教育是影响收入的主要因素，对收入有正向影响；（2）预计存在收入的性别歧视。据 500 份调查数据，得到如下回归模型：

$$\ln Y = 1.5492 + 0.0835 X_1 + 0.1081 X_2 - 0.1525 D$$

$$(16.35) \quad (21.69) \quad (6.42) \quad (-15.86)$$

$$R^2 = 0.68$$

其中， Y =收入， X_1 =受教育年限， X_2 =工龄， D =虚拟变量，女性取 1，男性取 0。括号内的数字为 t 统计量。

问：（1）回归分析的结果是否支持经济学家的想法；

（2）如果两个人的其他条件相同，受教育年限差一年，收入差多少？

（3）如何解释虚拟变量前的系数-0.1525？