

## 计量经济学

### 一、单项选择题（每题1分）

1. 计量经济学是下列哪门学科的分支学科（ C ）。  
A. 记录学 B. 数学 C. 经济学 D. 数理记录学
2. 计量经济学成为一门独立学科的标志是（ B ）。  
A. 1930年世界计量经济学会成立 B. 1933年《计量经济学》会刊出版  
C. 1969年诺贝尔经济学奖设置 D. 1926年计量经济学（Economics）一词构造出来
3. 外生变量和滞后变量统称为（ D ）。  
A. 控制变量 B. 解释变量 C. 被解释变量 D. 前定变量
4. 横截面数据是指（ A ）。  
A. 同一时点上不一样记录单位相似记录指标构成的数据 B. 同一时点上相似记录单位相似记录指标构成的数据  
C. 同一时点上相似记录单位不一样记录指标构成的数据 D. 同一时点上不一样记录单位不一样记录指标构成的数据
5. 同一记录指标，同一记录单位准时间次序记录形成的数据列是（ C ）。  
A. 时期数据 B. 混合数据 C. 时间序列数据 D. 横截面数据
6. 在计量经济模型中，由模型系统内部原因决定，体现为具有一定的概率分布的随机变量，其数值受模型中其他变量影响的变量是（ B ）。  
A. 内生变量 B. 外生变量 C. 滞后变量 D. 前定变量
7. 描述微观主体经济活动中的变量关系的计量经济模型是（ A ）。  
A. 微观计量经济模型 B. 宏观计量经济模型 C. 理论计量经济模型 D. 应用计量经济模型
8. 经济计量模型的被解释变量一定是（ C ）。  
A. 控制变量 B. 政策变量 C. 内生变量 D. 外生变量
9. 下面属于横截面数据的是（ D ）。  
A. 1991—各年某地区20个乡镇企业的平均工业产值  
B. 1991—各年某地区20个乡镇企业各镇的工业产值  
C. 某年某地区20个乡镇工业产值的合计数 D. 某年某地区20个乡镇各镇的工业产值
10. 经济计量分析工作的基本环节是（ A ）。  
A. 设定理论模型→搜集样本资料→估计模型参数→检查模型 B. 设定模型→估计参数→检查模型→应用模型  
C. 个体设计→总体估计→估计模型→应用模型 D. 确定模型导向→确定变量及方程式→估计模型→应用模型
11. 将内生变量的前期值作解释变量，这样的变量称为（ D ）。  
A. 虚拟变量 B. 控制变量 C. 政策变量 D. 滞后变量
12. （ B ）是具有一定概率分布的随机变量，它的数值由模型自身决定。  
A. 外生变量 B. 内生变量 C. 前定变量 D. 滞后变量
13. 同一记录指原则时间次序记录的数据列称为（ B ）。  
A. 横截面数据 B. 时间序列数据 C. 修匀数据 D. 原始数据
14. 计量经济模型的基本应用领域有（ A ）。  
A. 构造分析、经济预测、政策评价 B. 弹性分析、乘数分析、政策模拟  
C. 消费需求分析、生产技术分析、 D. 季度分析、年度分析、中长期分析
15. 变量之间的关系可以分为两大类，它们是（ A ）。  
A. 函数关系与有关关系 B. 线性有关关系和非线性有关关系  
C. 正有关关系和负有关关系 D. 简朴有关关系和复杂有关关系
16. 有关关系是指（ D ）。  
A. 变量间的非独立关系 B. 变量间的因果关系 C. 变量间的函数关系 D. 变量间不确定性的依存关系

17. 進行有關分析時的兩個變量 ( A )。

- A. 都是隨機變量 B. 都不是隨機變量  
C. 一種是隨機變量, 一種不是隨機變量 D. 隨機的或非隨機都可以

18. 表達  $x$  和  $y$  之間真實線性關係的是 ( C )。

- A.  $\hat{Y}_t = \hat{\beta}_0 + \hat{\beta}_1 X_t$  B.  $E(Y_t) = \beta_0 + \beta_1 X_t$  C.  $Y_t = \beta_0 + \beta_1 X_t + u_t$  D.  $Y_t = \beta_0 + \beta_1 X_t$

19. 參數  $\beta$  的估計量  $\hat{\beta}$  具有有效性是指 ( B )。

- A.  $\text{var}(\hat{\beta})=0$  B.  $\text{var}(\hat{\beta})$  為最小 C.  $(\hat{\beta}-\beta)=0$  D.  $(\hat{\beta}-\beta)$  為最小

20. 對於  $Y_i = \hat{\beta}_0 + \hat{\beta}_1 X_i + e_i$ , 以  $\hat{\sigma}$  表達估計原則誤差,  $\hat{Y}$  表達回歸值, 則 ( B )。

- A.  $\hat{\sigma}=0$  時,  $\sum(Y_i - \hat{Y}_i) = 0$  B.  $\hat{\sigma}=0$  時,  $\sum(Y_i - \hat{Y}_i)^2 = 0$   
C.  $\hat{\sigma}=0$  時,  $\sum(Y_i - \hat{Y}_i)$  為最小 D.  $\hat{\sigma}=0$  時,  $\sum(Y_i - \hat{Y}_i)^2$  為最小

21. 設樣本回歸模型為  $Y_i = \hat{\beta}_0 + \hat{\beta}_1 X_i + e_i$ , 則一般最小二乘法確定的  $\hat{\beta}_1$  的公式中, 錯誤的是 ( D )。

- A.  $\hat{\beta}_1 = \frac{\sum(X_i - \bar{X})(Y_i - \bar{Y})}{\sum(X_i - \bar{X})^2}$  B.  $\hat{\beta}_1 = \frac{n\sum X_i Y_i - \sum X_i \sum Y_i}{n\sum X_i^2 - (\sum X_i)^2}$   
C.  $\hat{\beta}_1 = \frac{\sum X_i Y_i - n\bar{X}\bar{Y}}{\sum X_i^2 - n\bar{X}^2}$  D.  $\hat{\beta}_1 = \frac{n\sum X_i Y_i - \sum X_i \sum Y_i}{\sigma_x^2}$

22. 對於  $Y_i = \hat{\beta}_0 + \hat{\beta}_1 X_i + e_i$ , 以  $\hat{\sigma}$  表達估計原則誤差,  $r$  表達有關係數, 則有 ( D )。

- A.  $\hat{\sigma}=0$  時,  $r=1$  B.  $\hat{\sigma}=0$  時,  $r=-1$  C.  $\hat{\sigma}=0$  時,  $r=0$  D.  $\hat{\sigma}=0$  時,  $r=1$  或  $r=-1$

23. 產量 ( $X$ , 台) 與單位產品成本 ( $Y$ , 元/台) 之間的回歸方程為  $\hat{Y} = 356 - 1.5X$ , 這闡明 ( D )。

- A. 產量每增長一台, 單位產品成本增長 356 元 B. 產量每增長一台, 單位產品成本減少 1.5 元  
C. 產量每增長一台, 單位產品成本平均增長 356 元 D. 產量每增長一台, 單位產品成本平均減少 1.5 元

24. 在總體回歸直線  $E(\hat{Y}) = \beta_0 + \beta_1 X$  中,  $\beta_1$  表達 ( B )。

- A. 當  $X$  增長一種單位時,  $Y$  增長  $\beta_1$  個單位 B. 當  $X$  增長一種單位時,  $Y$  平均增長  $\beta_1$  個單位  
C. 當  $Y$  增長一種單位時,  $X$  增長  $\beta_1$  個單位 D. 當  $Y$  增長一種單位時,  $X$  平均增長  $\beta_1$  個單位

25. 對回歸模型  $Y_i = \beta_0 + \beta_1 X_i + u_i$  進行檢查時, 一般假定  $u_i$  服從 ( C )。

- A.  $N(0, \sigma_i^2)$  B.  $t(n-2)$  C.  $N(0, \sigma^2)$  D.  $t(n)$

26. 以  $Y$  表達實際觀測值,  $\hat{Y}$  表達回歸估計值, 則一般最小二乘法估計參數的準則是使 ( D )。

- A.  $\sum(Y_i - \hat{Y}_i) = 0$  B.  $\sum(Y_i - \hat{Y}_i)^2 = 0$  C.  $\sum(Y_i - \hat{Y}_i) = \text{最小}$  D.  $\sum(Y_i - \hat{Y}_i)^2 = \text{最小}$

27. 設  $Y$  表達實際觀測值,  $\hat{Y}$  表達 OLS 估計回歸值, 則下列哪項成立 ( D )。

- A.  $\hat{Y}=Y$                       B.  $\hat{Y}=\bar{Y}$                       C.  $\bar{\hat{Y}}=Y$                       D.  $\bar{\hat{Y}}=\bar{Y}$

28. 用 OLS 估计經典线性模型  $Y_i = \beta_0 + \beta_1 X_i + u_i$ ，则样本回归直线通過點 \_\_\_\_\_ D \_\_\_\_\_。

- A.  $(X, Y)$                       B.  $(X, \hat{Y})$                       C.  $(\bar{X}, \hat{Y})$                       D.  $(\bar{X}, \bar{Y})$

29. 以  $Y$  表达实际观测值， $\hat{Y}$  表达 OLS 估计回归值，则用 OLS 得到的样本回归直线  $\hat{Y}_i = \hat{\beta}_0 + \hat{\beta}_1 X_i$  满足 ( A )。

- A.  $\sum(Y_i - \hat{Y}_i) = 0$                       B.  $\sum(Y_i - \bar{Y}_i)^2 = 0$                       C.  $\sum(Y_i - \hat{Y}_i)^2 = 0$                       D.  $\sum(\hat{Y}_i - \bar{Y}_i)^2 = 0$

30. 用一组有 30 个观测值的样本估计模型  $Y_i = \beta_0 + \beta_1 X_i + u_i$ ，在 0.05 的明显性水平下對  $\beta_1$  的明显性作 t 检查，则  $\beta_1$  明显地不等于零的条件是其记录量 t 不小于 ( D )。

- A.  $t_{0.05}(30)$                       B.  $t_{0.025}(30)$                       C.  $t_{0.05}(28)$   
D.  $t_{0.025}(28)$

31. 已知某一直线回归方程的鉴定系数為 0.64，则解释变量与被解释变量间的线性有关系数为 ( B )。

- A. 0.64                      B. 0.8                      C. 0.4                      D. 0.32

32. 有关系数  $r$  的取值范围是 ( D )。

- A.  $r \leq -1$                       B.  $r \geq 1$                       C.  $0 \leq r \leq 1$   
D.  $-1 \leq r \leq 1$

33. 鉴定系数  $R^2$  的取值范围是 ( C )。

- A.  $R^2 \leq -1$                       B.  $R^2 \geq 1$                       C.  $0 \leq R^2 \leq 1$                       D.  $-1 \leq R^2 \leq 1$

34. 某一特定的  $X$  水平上，總体  $Y$  分布的离散度越大，即  $\sigma^2$  越大，则 ( A )。

- A. 预测区间越宽，精度越低                      B. 预测区间越宽，预测误差越小  
C. 预测区间越窄，精度越高                      D. 预测区间越窄，预测误差越大

35. 假如  $X$  和  $Y$  在记录上独立，则有关系数等于 ( C )。

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

36. 根据决定系数  $R^2$  与  $F$  记录量的关系可知，當  $R^2=1$  時，有 ( D )。

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

37. 在 C—D 生产函数  $Y = AL^\alpha K^\beta$  中，( A )。

- A.  $\alpha$  和  $\beta$  是弹性                      B.  $A$  和  $\alpha$  是弹性                      C.  $A$  和  $\beta$  是弹性                      D.  $A$  是弹性

38. 回归模型  $Y_i = \beta_0 + \beta_1 X_i + u_i$  中，有关检查  $H_0: \beta_1 = 0$  所用的记录量  $\frac{\hat{\beta}_1 - \beta_1}{\sqrt{\text{Var}(\hat{\beta}_1)}}$ ，下列說法對的是 ( D )。

- A. 服從  $\chi^2(n-2)$                       B. 服從  $t(n-1)$                       C. 服從  $\chi^2(n-1)$                       D. 服從  $t(n-2)$

39. 在二元线性回归模型  $Y_i = \beta_0 + \beta_1 X_{1i} + \beta_2 X_{2i} + u_i$  中， $\beta_1$  表达 ( A )。

- A. 當  $X_2$  不变時， $X_1$  每变动一种單位  $Y$  的平均变动。                      B. 當  $X_1$  不变時， $X_2$  每变动一种單位  $Y$  的平均变动。

- C. 當  $X_1$  和  $X_2$  都保持不變時,  $Y$  的平均變動。  
D. 當  $X_1$  和  $X_2$  都變動一種單位時,  $Y$  的平均變動。
40. 在雙對數模型  $\ln Y_i = \ln \beta_0 + \beta_1 \ln X_i + u_i$  中,  $\beta_1$  的含義是 ( D )。
- A.  $Y$  有關  $X$  的增長量  
B.  $Y$  有關  $X$  的增長速度  
C.  $Y$  有關  $X$  的邊際傾向  
D.  $Y$  有關  $X$  的彈性
41. 根據樣本資料已估計得出人均消費支出  $Y$  對人均收入  $X$  的回歸模型為  $\ln Y_i = 2.00 + 0.75 \ln X_i$ , 這表明人均收入每增長 1%, 人均消費支出將增長 ( C )。
- A. 2%  
B. 0.2%  
C. 0.75%  
D. 7.5%
42. 按經典假設, 線性回歸模型中的解釋變量應是非隨機變量, 且 ( A )。
- A. 與隨機誤差項不有關  
B. 與殘差項不有關  
C. 與被解釋變量不有關  
D. 與回歸值不有關
43. 根據鑑定係數  $R^2$  與  $F$  記錄量的關係可知, 當  $R^2=1$  時有 ( C )。
- A.  $F=1$   
B.  $F=-1$   
C.  $F=\infty$   
D.  $F=0$
44. 下面說法對的是 ( D )。
- A. 內生變量是非隨機變量  
B. 前定變量是隨機變量  
C. 外生變量是隨機變量  
D. 外生變量是非隨機變量
45. 在詳細的模型中, 被認為是具有一定概率分布的隨機變量是 ( A )。
- A. 內生變量  
B. 外生變量  
C. 虛擬變量  
D. 前定變量
46. 回歸分析中定義的 ( B )。
- A. 解釋變量和被解釋變量都是隨機變量  
B. 解釋變量為非隨機變量, 被解釋變量為隨機變量  
C. 解釋變量和被解釋變量都為非隨機變量  
D. 解釋變量為隨機變量, 被解釋變量為非隨機變量
47. 計量經濟模型中的被解釋變量一定是 ( C )。
- A. 控制變量  
B. 政策變量  
C. 內生變量  
D. 外生變量
48. 在由  $n=30$  的一組樣本估計的、包括 3 個解釋變量的線性回歸模型中, 計算得多重決定係數為 0.8500, 則調整後的多重決定係數為 ( D )。
- A. 0.8603  
B. 0.8389  
C. 0.8655  
D. 0.8327
49. 下列樣本模型中, 哪一種模型一般是無效的 ( B )。
- A.  $C_i$  (消費)  $= 500 + 0.8 I_i$  (收入)  
B.  $Q_i^d$  (商品需求)  $= 10 + 0.8 I_i$  (收入)  $+ 0.9 P_i$  (價格)  
C.  $Q_i^s$  (商品供應)  $= 20 + 0.75 P_i$  (價格)  
D.  $Y_i$  (產出量)  $= 0.65 L_i^{0.6}$  (勞動)  $K_i^{0.4}$  (資本)
50. 用一組有 30 個觀測值的樣本估計模型  $y_t = b_0 + b_1 x_{1t} + b_2 x_{2t} + u_t$  後, 在 0.05 的明顯性水平上對  $b_1$  的明顯性作  $t$  檢查, 則  $b_1$  明顯地不等於零的條件是其記錄量  $t$  不小於等於 ( C )。
- A.  $t_{0.05}(30)$   
B.  $t_{0.025}(28)$   
C.  $t_{0.025}(27)$   
D.  $F_{0.025}(1,28)$
51. 模型  $\ln y_t = \ln b_0 + b_1 \ln x_t + u_t$  中,  $b_1$  的實際含義是 ( B )。
- A.  $x$  有關  $y$  的彈性  
B.  $y$  有關  $x$  的彈性  
C.  $x$  有關  $y$  的邊際傾向  
D.  $y$  有關  $x$  的邊際傾向
52. 在多元線性回歸模型中, 若某個解釋變量對其他解釋變量的鑑定係數靠近於 1, 則表明模型中存在 ( C )。

A. 异方差性 B. 序列有关 C. 多重共线性 D. 高拟合优度

53. 线性回归模型  $y_t = b_0 + b_1x_{1t} + b_2x_{2t} + \dots + b_kx_{kt} + u_t$  中, 检查  $H_0: b_i = 0 (i = 0, 1, 2, \dots, k)$  时, 所用的记录量



服从 ( C )

A.  $t(n-k+1)$  B.  $t(n-k-2)$  C.  $t(n-k-1)$  D.  $t(n-k+2)$

54. 调整的鉴定系数  $\bar{R}^2$  与多重鉴定系数  $R^2$  之间有如下关系 ( D )

A.  $\bar{R}^2 = \frac{n-1}{n-k-1} R^2$  B.  $\bar{R}^2 = 1 - \frac{n-1}{n-k-1} R^2$

C.  $\bar{R}^2 = 1 - \frac{n-1}{n-k-1} (1+R^2)$  D.  $\bar{R}^2 = 1 - \frac{n-1}{n-k-1} (1-R^2)$

55. 有关经济计量模型进行预测出现误差的原因, 对的说法是 ( C )。

A. 只有随机原因 B. 只有系统原因 C. 既有随机原因, 又有系统原因 D. A、B、C 都不对

56. 在多元线性回归模型中对样本容量的基本规定是 (k 为解释变量个数): ( C )

A.  $n \geq k+1$  B.  $n < k+1$  C.  $n \geq 30$  或  $n \geq 3(k+1)$  D.  $n \geq 30$

57. 下列说法中对的是: ( D )

A. 假如模型的  $R^2$  很高, 我们可以认为此模型的质量很好

B. 假如模型的  $R^2$  较低, 我们可以认为此模型的质量较差

C. 假如某一参数不能通过明显性检查, 我们应当剔除该解释变量

D. 假如某一参数不能通过明显性检查, 我们不应随便剔除该解释变量

58. 半对数模型  $Y = \beta_0 + \beta_1 \ln X + \mu$  中, 参数  $\beta_1$  的含义是 ( C )。

A. X 的绝对量变化, 引起 Y 的绝对量变化 B. Y 有关 X 的边际变化

C. X 的相对变化, 引起 Y 的期望值绝对量变化 D. Y 有关 X 的弹性

59. 半对数模型  $\ln Y = \beta_0 + \beta_1 X + \mu$  中, 参数  $\beta_1$  的含义是 (A)。

A. X 的绝对量发生一定变动时, 引起因变量 Y 的相对变化率

B. Y 有关 X 的弹性

C. X 的相对变化, 引起 Y 的期望值绝对量变化

D. Y 有关 X 的边际变化

60. 双对数模型  $\ln Y = \beta_0 + \beta_1 \ln X + \mu$  中, 参数  $\beta_1$  的含义是 ( D )。

A. X 的相对变化, 引起 Y 的期望值绝对量变化

B. Y 有关 X 的边际变化

C. X 的绝对量发生一定变动时, 引起因变量 Y 的相对变化率

D. Y 有关 X 的弹性

61. Goldfeld-Quandt 措施用于检查 ( A )

A. 异方差性

B. 自有关性

C. 随机解释变量

D. 多重共线性

62. 在异方差性状况下, 常用的估计措施是 ( D )

A. 一阶差分法

B. 广义差分法

C. 工具变量法

D. 加权最小二乘法

63. White 检查措施重要用于检查 ( A )

A. 异方差性

B. 自有关性

C. 随机解释变量

D. 多重共线性

64. Glejser 检查措施重要用于检查 ( A )

A. 异方差性

B. 自有关性

C. 随机解释变量

D. 多重共线性

65. 下列哪种措施不是检查异方差的措施 ( D )
- A. 戈德菲尔特——匡特检查      B. 怀特检查      C. 戈裏瑟检查      D. 方差膨胀因子检查
66. 當存在异方差現象時, 估计模型参数的合适措施是 ( A )
- A. 加权最小二乘法      B. 工具变量法      C. 广义差分法      D. 使用非样本先验信息
67. 加权最小二乘法克服异方差的重要原理是通過赋予不一样观测點以不一样的权数, 從而提高估计精度, 即 ( B )
- A. 重视大误差的作用, 轻视小误差的作用      B. 重视小误差的作用, 轻视大误差的作用
- C. 重视小误差和大误差的作用      D. 轻视小误差和大误差的作用
68. 假如戈裏瑟检查表明, 一般最小二乘估计成果的残差  $e_i$  与  $x_i$  有明显的形式  $|e_i| = 0.28715x_i + v_i$  的有关关系 (  $v_i$  满足线性模型的所有經典假设), 則用加权最小二乘法估计模型参数時, 权数应為 ( C )
- A.  $x_i$       B.  $\frac{1}{x_i^2}$       C.  $\frac{1}{x_i}$       D.  $\frac{1}{\sqrt{x_i}}$
69. 果戈德菲尔特——匡特检查明显, 則認為何問題是严重的 ( A )
- A. 异方差問題      B. 序列有关問題      C. 多重共线性問題      D. 设定误差問題
70. 设回归模型為  $y_i = bx_i + u_i$ , 其中  $Var(u_i) = \sigma^2 x_i$ , 則  $b$  的最有效估计量為 ( C )
- A.  $\hat{b} = \frac{\sum xy}{\sum x^2}$       B.  $\hat{b} = \frac{n\sum xy - \sum x \sum y}{n\sum x^2 - (\sum x)^2}$       C.  $\hat{b} = \frac{\bar{y}}{\bar{x}}$       D.  $\hat{b} = \frac{1}{n} \sum \frac{y}{x}$
71. 假如模型  $y_t = b_0 + b_1 x_t + u_t$  存在序列有关, 則 ( D )。
- A.  $cov(x_t, u_t) = 0$       B.  $cov(u_t, u_s) = 0 (t \neq s)$       C.  $cov(x_t, u_t) \neq 0$       D.  $cov(u_t, u_s) \neq 0 (t \neq s)$
72. DW 检查的零假设是 (  $\rho$  為随机误差项的一阶有关系数) ( B )。
- A.  $DW = 0$       B.  $\rho = 0$       C.  $DW = 1$       D.  $\rho = 1$
73. 下列哪個序列有关可用 DW 检查 (  $v_t$  為具有零均值, 常数方差且不存在序列有关的随机变量) ( A )。
- A.  $u_t = \rho u_{t-1} + v_t$       B.  $u_t = \rho u_{t-1} + \rho^2 u_{t-2} + \dots + v_t$       C.  $u_t = \rho v_t$       D.  $u_t = \rho v_t + \rho^2 v_{t-1} + \dots$
74. DW 的取值范围是 ( D )。
- A.  $-1 \leq DW \leq 0$       B.  $-1 \leq DW \leq 1$       C.  $-2 \leq DW \leq 2$       D.  $0 \leq DW \leq 4$
75. 當  $DW = 4$  時, 阐明 ( D )。
- A. 不存在序列有关      B. 不能判断与是否存在一阶自有关
- C. 存在完全的正的一阶自有关      D. 存在完全的负的一阶自有关
76. 根据 20 個观测值估计的成果, 一元线性回归模型的  $DW = 2.3$ 。在样本容量  $n = 20$ , 解释变量  $k = 1$ , 明显性水平為 0.05 時, 查得  $d_l = 1, d_u = 1.41$ , 則可以决断 ( A )。
- A. 不存在一阶自有关      B. 存在正的一阶自有关      C. 存在负的一阶自有关      D. 無法确定
77. 當模型存在序列有关現象時, 合适的参数估计措施是 ( C )。
- A. 加权最小二乘法      B. 间接最小二乘法      C. 广义差分法      D. 工具变量法
78. 對於原模型  $y_t = b_0 + b_1 x_t + u_t$ , 广义差分模型是指 ( D )。

A.  $\frac{y_t}{\sqrt{f(x_t)}} = b_0 \frac{1}{\sqrt{f(x_t)}} + b_1 \frac{x_t}{\sqrt{f(x_t)}} + \frac{u_t}{\sqrt{f(x_t)}}$

B.  $Vy_t = b_1 Vx_t + Vu_t$

C.  $Vy_t = b_0 + b_1 Vx_t + Vu_t$

D.  $y_t - \rho y_{t-1} = b_0(1-\rho) + b_1(x_t - \rho x_{t-1}) + (u_t - \rho u_{t-1})$

79. 采用一阶差分模型一阶线性自有关問題合用于下列哪种状况 ( B )。

- A.  $\rho \approx 0$       B.  $\rho \approx 1$       C.  $-1 < \rho < 0$       D.  $0 < \rho < 1$

80. 定某企业的生产决策是由模型  $S_t = b_0 + b_1 P_t + u_t$  描述的 (其中  $S_t$  為产量,  $P_t$  為价格), 又知: 假如该企业在  $t-1$  期生产过剩, 經營人員會削減  $t$  期的产量。由此决断上述模型存在 ( B )。

- A. 异方差問題      B. 序列有关問題      C. 多重共线性問題      D. 随机解释变量問題

81. 根据一种  $n=30$  的样本估计  $y_t = \hat{\beta}_0 + \hat{\beta}_1 x_t + e_t$  後计算得  $DW=1.4$ , 已知在 5% 的置信度下,

$dl=1.35, du=1.49$ , 则認為原模型 ( D )。

- A. 存在正的一阶自有关      B. 存在负的一阶自有关      C. 不存在一阶自有关      D. 無法判断与否存在一阶自有关。

82. 于模型  $y_t = \hat{\beta}_0 + \hat{\beta}_1 x_t + e_t$ , 以  $\rho$  表达  $e_t$  与  $e_{t-1}$  之间的线性有关关系 ( $t=1, 2, \dots, T$ ), 则下列明显錯誤的是 ( B )。

- A.  $\rho = 0.8, DW = 0.4$       B.  $\rho = -0.8, DW = -0.4$       C.  $\rho = 0, DW = 2$       D.  $\rho = 1, DW = 0$

83. 同一记录指原則時間次序记录的数据列稱為 ( B )。

- A. 横截面数据      B. 時間序列数据      C. 修匀数据      D. 原始数据

84. 當模型存在严重的多重共线性時, OLS 估计量将不具有 ( D )

- A. 线性      B. 無偏性      C. 有效性      D. 一致性

85. 經驗認為某個解释与其他解释变量间多重共线性严重的状况是這個解释变量的 VIF ( C )。

- A. 不小于      B. 不不小于      C. 不小于 5      D. 不不小于 5

86. 模型中引入实际上与解释变量有关的变量, 會导致参数的 OLS 估计量方差 ( A )。

- A. 增大      B. 减小      C. 有偏      D. 非有效

87. 對於模型  $y_t = b_0 + b_1 x_{1t} + b_2 x_{2t} + u_t$ , 与  $r_{12}=0$  相比,  $r_{12}=0.5$  時, 估计量的方差将是本来的 ( B )。

- A. 1 倍      B. 1.33 倍      C. 1.8 倍      D. 2 倍

88. 假如方差膨胀因子  $VIF=10$ , 则什么问题是严重的 ( C )。

- A. 异方差問題      B. 序列有关問題      C. 多重共线性問題      D. 解释变量与随机项的有关性

89. 在多元线性回归模型中, 若某個解释变量對其他解释变量的鉴定系数靠近于 1, 则表明模型中存在 ( C )。

- A. 异方差      B. 序列有关      C. 多重共线性      D. 高拟合优度

90. 存在严重的多重共线性時, 参数估计的原則差 ( A )。

- A. 变大      B. 变小      C. 無法估计      D. 無穷大

91. 完全多重共线性時, 下列判断不對的是 ( D )。

- A. 参数無法估计      B. 只能估计参数的线性组合      C. 模型的拟合程度不能判断      D. 可以计算模型的拟合程度

92. 设某地区消费函数  $y_i = c_0 + c_1 x_i + \mu_i$  中, 消费支出不仅与收入  $x$  有关, 并且与消费者的年龄构成有关,

若将年龄构成分為小孩、青年人、成年人和老年人 4 個层次。假设边际消费倾向不变, 则考虑上述构成原因的影响時, 该消费函数引入虚拟变量的個数为 ( C )

- A. 1 個      B. 2 個      C. 3 個      D. 4 個

93. 當质的原因引進經濟计量模型時, 需要使用 ( D )

- A. 外生变量      B. 前定变量      C. 内生变量      D. 虚拟变量

94. 由于引進虚拟变量, 回归模型的截距或斜率随样本观测值的变化而系统地变化, 這種模型稱為

( A )

- A. 系统变参数模型      B. 系统模型      C. 变参数模型      D. 分段线性回归模型

95. 假设回归模型为  $y_i = \alpha + \beta x_i + \mu_i$ ，其中  $X_i$  为随机变量， $X_i$  与  $U_i$  有关则  $\beta$  的一般最小二乘估计量

( D )

- A. 无偏且一致      B. 无偏但不一致      C. 有偏但一致      D. 有偏且不一致

96. 假定对的回归模型为  $y_i = \alpha + \beta_1 x_{1i} + \beta_2 x_{2i} + \mu_i$ ，若遗漏理解释变量  $X_2$ ，且  $X_1$ 、 $X_2$  线性有关则  $\beta_1$  的

一般最小二乘法估计量 ( D )

- A. 无偏且一致      B. 无偏但不一致      C. 有偏但一致      D. 有偏且不一致

97. 模型中引入一种无关的解释变量 ( C )

- A. 对模型参数估计量的性质不产生任何影响      B. 导致一般最小二乘估计量有偏  
C. 导致一般最小二乘估计量精度下降      D. 导致一般最小二乘估计量有偏，同步精度下降

98. 设消费函数  $y_i = a_0 + a_1 D + b_1 x_i + u_i$ ，其中虚拟变量  $D = \begin{cases} 1 & \text{东中部} \\ 0 & \text{西部} \end{cases}$ ，假如记录检查表明  $a_1 = 0$  成立，

则东中部的消费函数与西部的消费函数是 ( D )。

- A. 互相平行的      B. 互相垂直的      C. 互相交叉的      D. 互相重叠的

99. 虚拟变量 ( A )

- A. 重要来代表质的原因，但在有些状况下可以用来代表数量原因      B. 只能代表质的原因  
C. 只能代表数量原因      D. 只能代表季节影响原因

100. 分段线性回归模型的几何图形是 ( D )。

- A. 平行线      B. 垂直线      C. 光滑曲线      D. 折线

101. 假如一种回归模型中不包括截距项，对一种具有  $m$  个特性的质的原因要引入虚拟变量数目为 ( B )。

- A.  $m$       B.  $m-1$       C.  $m-2$       D.  $m+1$

102. 设某商品需求模型为  $y_t = b_0 + b_1 x_t + u_t$ ，其中  $Y$  是商品的需求量， $X$  是商品的价格，为了考虑整年 12 个月份季节变动的影响，假设模型中引入了 12 个虚拟变量，则会产生的问题为 ( D )

- A. 异方差性      B. 序列有关      C. 不完全的多重共线性      D. 完全的多重共线性

103. 对于模型  $y_t = b_0 + b_1 x_t + u_t$ ，为了考虑“地区”原因（北方、南方），引入 2 个虚拟变量形成截距变动模型，则会产生 ( C )。

- A. 序列的完全有关      B. 序列不完全有关      C. 完全多重共线性      D. 不完全多重共线性

104. 设消费函数为  $y_i = \alpha_0 + \alpha_1 D + b_0 x_i + b_1 D x_i + u_i$ ，其中虚拟变量  $D = \begin{cases} 1 & \text{城镇家庭} \\ 0 & \text{农村家庭} \end{cases}$ ，当记录检查表明下列哪项成立时，表达城镇家庭与农村家庭有同样的消费行为 ( A )。

- A.  $a_1 = 0, b_1 = 0$       B.  $a_1 \neq 0, b_1 \neq 0$       C.  $a_1 \neq 0, b_1 = 0$       D.  $a_1 = 0, b_1 \neq 0$

105. 设无限分布滞后模型为  $Y_t = \alpha + \beta_0 X_t + \beta_1 X_{t-1} + \beta_2 X_{t-2} + L + U_t$ ，且该模型满足 Koyck 变换的假定，

则长期影响系数为 ( C )

- A.  $\frac{\beta_0}{\lambda}$       B.  $\frac{\beta_0}{1+\lambda}$       C.  $\frac{\beta_0}{1-\lambda}$       D. 不确定

106. 对于分布滞后模型，时间序列资料的序列有关问题，就转化为 ( B )。

- A. 异方差问题      B. 多重共线性问题      C. 多出解释变量      D. 随机解释变量

107. 在分布滞后模型  $Y_t = \alpha + \beta_0 X_t + \beta_1 X_{t-1} + \beta_2 X_{t-2} + L + u_t$  中，短期影响乘数为 ( D )。

- A.  $\frac{\beta_1}{1-\alpha}$       B.  $\beta_1$       C.  $\frac{\beta_0}{1-\alpha}$       D.  $\beta_0$



108. 對於自適應預期模型，估計模型參數應採用( D )。
- A. 一般最小二乘法      B. 間接最小二乘法      C. 二階段最小二乘法      D. 工具變量法
109. koyck 變換模型參數的一般最小二乘估計量是( D )。
- A. 無偏且一致      B. 有偏但一致      C. 無偏但不一致      D. 有偏且不一致
110. 下列屬於有限分布滯後模型的是( D )。
- A.  $Y_t = \alpha + \beta_0 X_t + \beta_1 Y_{t-1} + \beta_2 Y_{t-2} + L + u_t$       B.  $Y_t = \alpha + \beta_0 X_t + \beta_1 Y_{t-1} + \beta_2 Y_{t-2} + L + \beta_k Y_{t-k} + u_t$
- C.  $Y_t = \alpha + \beta_0 X_t + \beta_1 X_{t-1} + \beta_2 X_{t-2} + L + u_t$       D.  $Y_t = \alpha + \beta_0 X_t + \beta_1 X_{t-1} + \beta_2 X_{t-2} + L + \beta_k X_{t-k} + u_t$
111. 消費函數模型  $\hat{C}_t = 400 + 0.5I_t + 0.3I_{t-1} + 0.1I_{t-2}$ ，其中  $I$  為收入，則當期收入  $I_t$  對未來消費  $C_{t+2}$  的影響是： $I_t$  增長一單位， $C_{t+2}$  增長( C )。
- A. 0.5 個單位      B. 0.3 個單位      C. 0.1 個單位      D. 0.9 個單位
112. 下面哪一種不是幾何分布滯後模型( D )。
- A. koyck 變換模型      B. 自適應預期模型      C. 局部調整模型      D. 有限多項式滯後模型
113. 有限多項式分布滯後模型中，通過將本來分布滯後模型中的參數表達為滯後期  $i$  的有限多項式，從而克服了原分布滯後模型估計中的( D )。
- A. 異方差問題      B. 序列有關問題      C. 多重共性問題      D. 參數過多難估計問題
114. 分布滯後模型  $Y_t = \alpha + \beta_0 X_t + \beta_1 X_{t-1} + \beta_2 X_{t-2} + \beta_3 X_{t-3} + u_t$  中，為了使模型的自由度到達 30，必須擁有多少年的觀測資料( D )。
- A. 32      B. 33      C. 34      D. 38
115. 假如聯立方程中某個構造方程包括了所有的變量，則這個方程為( C )。
- A. 恰好識別      B. 過度識別      C. 不可識別      D. 可以識別
116. 下面有關簡化式模型的概念，不對的是( C )
- A. 簡化式方程的解釋變量都是前定變量      B. 簡化式參數反應解釋變量對被解釋的變量的總影響
- C. 簡化式參數是構造式參數的線性函數      D. 簡化式模型的經濟含義不明確
117. 對聯立方程模型進行參數估計的措施可以分兩類，即：( B )。
- A. 間接最小二乘法和系統估計法      B. 單方程估計法和系統估計法
- C. 單方程估計法和二階段最小二乘法      D. 工具變量法和間接最小二乘法
118. 在構造式模型中，其解釋變量( C )。
- A. 都是前定變量      B. 都是內生變量      C. 可以內生變量也可以是前定變量
- D. 都是外生變量
119. 假如某個構造式方程是過度識別的，則估計該方程參數的措施可用( A )。
- A. 二階段最小二乘法      B. 間接最小二乘法      C. 廣義差分法      D. 加權最小二乘法
120. 當模型中第  $i$  個方程是不可識別的，則該模型是( B )。
- A. 可識別的      B. 不可識別的      C. 過度識別      D. 恰好識別
121. 構造式模型中的每一種方程都稱為構造式方程，在構造方程中，解釋變量可以是前定變量，也可以是( C )
- A. 外生變量      B. 滯後變量      C. 內生變量      D. 外生變量和內生變量
122. 在完備的構造式模型 
$$\begin{cases} C_t = a_0 + a_1 Y_t + u_{1t} \\ I_t = b_0 + b_1 Y_t + b_2 Y_{t-1} + u_{2t} \\ Y_t = C_t + I_t + G_t \end{cases}$$
 中，外生變量是指( D )。
- A.  $Y_t$       B.  $Y_{t-1}$       C.  $I_t$       D.  $G_t$
123. 在完備的構造式模型 
$$\begin{cases} C_t = a_0 + a_1 Y_t + u_{1t} \\ I_t = b_0 + b_1 Y_t + b_2 Y_{t-1} + u_{2t} \\ Y_t = C_t + I_t + G_t \end{cases}$$
 中，隨機方程是指( D )。

A. 方程 1                      B. 方程 2                      C. 方程 3                      D. 方程 1 和 2

124. 联立方程模型中不属于随机方程的是 ( D )。

A. 行为方程                      B. 技术方程                      C. 制度方程                      D. 恒等式

125. 构造式方程中的系数称为 ( C )。

A. 短期影响乘数                      B. 长期影响乘数                      C. 构造式参数                      D. 简化式参数

126. 简化式参数反应对应的解释变量对被解释变量的 ( C )。

A. 直接影响                      B. 间接影响                      C. 前两者之和                      D. 前两者之差

127. 对于恰好识别方程, 在简化式方程满足线性模型的基本假定的条件下, 间接最小二乘估计量具有 ( D )。

A. 精确性                      B. 无偏性                      C. 真实性                      D. 一致性

## 二、多选题 (每题 2 分)

1. 计量经济学是如下哪些学科相结合的综合性学科 ( ADE )。

A. 记录学                      B. 数理经济学                      C. 经济记录学                      D. 数学

E. 经济学

2. 从内容角度看, 计量经济学可分为 (AC )。

A. 理论计量经济学                      B. 狭义计量经济学                      C. 应用计量经济学                      D. 广义计量经济学                      E. 金融计量经济学

3. 从学科角度看, 计量经济学可分为 ( BD )。

A. 理论计量经济学                      B. 狭义计量经济学                      C. 应用计量经济学                      D. 广义计量经济学                      E. 金融计量经济学

4. 从变量的因果关系看, 经济变量可分为 ( AB )。

A. 解释变量                      B. 被解释变量                      C. 内生变量                      D. 外生变量                      E. 控制变量

5. 从变量的性质看, 经济变量可分为 (CD )。

A. 解释变量                      B. 被解释变量                      C. 内生变量                      D. 外生变量                      E. 控制变量

6. 使用时序数据进行经济计量分析时, 规定指标记录的 ( ABCDE )。

A. 对象及范围可比                      B. 时间可比                      C. 口径可比                      D. 计算措施可比                      E. 内容可比

7. 一种计量经济模型由如下哪些部分构成 ( ABCD )。

A. 变量                      B. 参数                      C. 随机误差项                      D. 方程式                      E. 虚拟变量

8. 与其他经济模型相比, 计量经济模型有如下特点 (BCD )。

A. 确定性                      B. 经验性                      C. 随机性                      D. 动态性                      E. 灵活性

9. 一种计量经济模型中, 可作为解释变量的有 ( ABCDE )。

A. 内生变量                      B. 外生变量                      C. 控制变量                      D. 政策变量                      E. 滞后变量

10. 计量经济模型的应用在于 ( ABCD )。

A. 构造分析                      B. 经济预测                      C. 政策评价                      D. 检查和发展经济理论                      E. 设定和检查模型

11. 下列哪些变量属于前定变量 ( CD )。

A. 内生变量                      B. 随机变量                      C. 滞后变量                      D. 外生变量                      E. 工具变量

12. 经济参数的分为两大类, 下面哪些属于外生参数 ( ABCD )。

A. 折旧率                      B. 税率                      C. 利息率                      D. 凭经验估计的参数                      E. 运用记录措施估计得到的参数

13. 在一种经济计量模型中, 可作为解释变量的有 ( BCDE )。

A. 内生变量                      B. 控制变量                      C. 政策变量                      D. 滞后变量                      E. 外生变量

14. 对于经典线性回归模型, 各回归系数的一般最小二乘法估计量具有的优良特性有 ( ABE )。

A. 无偏性                      B. 有效性                      C. 一致性                      D. 确定性                      E. 线性特性

15. 指出下列哪些现象是有关关系 (ACD )。

A. 家庭消费支出与收入                      B. 商品销售额与销售量、销售价格

C. 物价水平与商品需求量 D. 小麦高产与施肥量 E. 学习成绩总分与各门课程分数

16. 一元线性回归模型  $Y_i = \beta_0 + \beta_1 X_i + u_i$  的经典假设包括 (ABCDE )。

A.  $E(u_i) = 0$  B.  $\text{var}(u_i) = \sigma^2$  C.  $\text{cov}(u_i, u_s) = 0$  D.  $\text{Cov}(x_i, u_i) = 0$  E.  $u_i \sim N(0, \sigma^2)$

17. 以  $Y$  表达实际观测值,  $\hat{Y}$  表达 OLS 估计回归值,  $e$  表达残差, 则回归直线满足 ( ABE )。

A. 通过样本均值点  $(\bar{X}, \bar{Y})$

B.  $\sum Y_i = \sum \hat{Y}_i$

C.  $\sum (Y_i - \hat{Y}_i)^2 = 0$

D.  $\sum (\hat{Y}_i - \bar{Y})^2 = 0$

E.  $\text{cov}(X_i, e_i) = 0$

18.  $\hat{Y}$  表达 OLS 估计回归值,  $u$  表达随机误差项,  $e$  表达残差。假如  $Y$  与  $X$  为线性有关关系, 则下列哪些是对的 (AC )。

A.  $E(Y_i) = \beta_0 + \beta_1 X_i$

B.  $Y_i = \hat{\beta}_0 + \hat{\beta}_1 X_i$

C.  $Y_i = \hat{\beta}_0 + \hat{\beta}_1 X_i + e_i$

D.  $\hat{Y}_i = \hat{\beta}_0 + \hat{\beta}_1 X_i + e_i$

E.  $E(Y_i) = \hat{\beta}_0 + \hat{\beta}_1 X_i$

19.  $\hat{Y}$  表达 OLS 估计回归值,  $u$  表达随机误差项。假如  $Y$  与  $X$  为线性有关关系, 则下列哪些是对的 ( BE )。

A.  $Y_i = \beta_0 + \beta_1 X_i$

B.  $Y_i = \beta_0 + \beta_1 X_i + u_i$

C.  $Y_i = \hat{\beta}_0 + \hat{\beta}_1 X_i + u_i$

D.  $\hat{Y}_i = \hat{\beta}_0 + \hat{\beta}_1 X_i + u_i$

E.  $\hat{Y}_i = \hat{\beta}_0 + \hat{\beta}_1 X_i$

20. 回归分析中估计回归参数的措施重要有 ( CDE )。

A. 有关系数法

B. 方差分析法

C. 最小二乘估计法

D. 极大似然法

E. 矩估计法

21. 用 OLS 法估计模型  $Y_i = \beta_0 + \beta_1 X_i + u_i$  的参数, 要使参数估计量为最佳线性无偏估计量, 则规定 (ABCDE )。

A.  $E(u_i) = 0$

B.  $\text{Var}(u_i) = \sigma^2$

C.  $\text{Cov}(u_i, u_j) = 0$

D.  $u_i$  服从正态分布

E.  $X$  为非随机变量, 与随机误差项  $u_i$  不有关。

22. 假设线性回归模型满足所有基本假设, 则其参数的估计量具有 (CDE )。

A. 可靠性

B. 合理性

C. 线性

D. 无偏性

E. 有效性

23. 一般最小二乘估计的直线具有如下特性 ( ABDE )。

A. 通过样本均值点  $(\bar{X}, \bar{Y})$

B.  $\sum Y_i = \sum \hat{Y}_i$

C.  $\sum (Y_i - \hat{Y}_i)^2 = 0$

D.  $\sum e_i = 0$

E.  $\text{Cov}(X_i, e_i) = 0$

24. 由回归直线  $\hat{Y}_i = \hat{\beta}_0 + \hat{\beta}_1 X_i$  估计出来的  $\hat{Y}_i$  值 ( ADE )。

A. 是一组估计值。

B. 是一组平均值

C. 是一种几何级数

D. 也许等于实际值  $Y$

E. 与实际值  $Y$  的离差之和等于零

25. 反应回归直线拟合优度的指标有 ( ACE )。

A. 有关系数

B. 回归系数

C. 样本决定系数

D. 回归方程的原则差

E. 剩余变差 (或残差平方和)

26. 对于样本回归直线  $\hat{Y}_i = \hat{\beta}_0 + \hat{\beta}_1 X_i$ , 回归变差可以表达为 ( ABCDE )。

A.  $\sum (Y_i - \bar{Y})^2 - \sum (Y_i - \hat{Y}_i)^2$

B.  $\hat{\beta}_1^2 \sum (X_i - \bar{X})^2$

C.  $R^2 \sum (Y_i - \bar{Y}_i)^2$                       D.  $\sum (\hat{Y}_i - \bar{Y}_i)^2$                       E.  $\hat{\beta}_1 \sum (X_i - \bar{X}_i)(Y_i - \bar{Y}_i)$

27. 對於樣本回歸直線  $\hat{Y}_i = \hat{\beta}_0 + \hat{\beta}_1 X_i$ ， $\hat{\sigma}$  為估計原則差，下列決定系數的算式中，對的的有 ( ABCDE )。

A.  $\frac{\sum (\hat{Y}_i - \bar{Y}_i)^2}{\sum (Y_i - \bar{Y}_i)^2}$                       B.  $1 - \frac{\sum (Y_i - \hat{Y}_i)^2}{\sum (Y_i - \bar{Y}_i)^2}$   
 C.  $\frac{\hat{\beta}_1^2 \sum (X_i - \bar{X}_i)^2}{\sum (Y_i - \bar{Y}_i)^2}$                       D.  $\frac{\hat{\beta}_1 \sum (X_i - \bar{X}_i)(Y_i - \bar{Y}_i)}{\sum (Y_i - \bar{Y}_i)^2}$                       E.  $1 - \frac{\hat{\sigma}^2(n-2)}{\sum (Y_i - \bar{Y}_i)^2}$

28. 下列有關係數的算式中，對的的有 ( ABCDE )。

A.  $\frac{\overline{XY} - \bar{X}\bar{Y}}{\sigma_X \sigma_Y}$                       B.  $\frac{\sum (X_i - \bar{X}_i)(Y_i - \bar{Y}_i)}{n \sigma_X \sigma_Y}$   
 C.  $\frac{\text{cov}(X, Y)}{\sigma_X \sigma_Y}$                       D.  $\frac{\sum (X_i - \bar{X}_i)(Y_i - \bar{Y}_i)}{\sqrt{\sum (X_i - \bar{X}_i)^2 \sum (Y_i - \bar{Y}_i)^2}}$                       E.  $\frac{\sum X_i Y_i - n \bar{X} \bar{Y}}{\sqrt{\sum (X_i - \bar{X}_i)^2 \sum (Y_i - \bar{Y}_i)^2}}$

29. 鑑定系數  $R^2$  可表達為 ( BCE )。

A.  $R^2 = \frac{RSS}{TSS}$                       B.  $R^2 = \frac{ESS}{TSS}$                       C.  $R^2 = 1 - \frac{RSS}{TSS}$                       D.  $R^2 = 1 - \frac{ESS}{TSS}$                       E.  $R^2 = \frac{ESS}{ESS + RSS}$

30. 線性回歸模型的變通最小二乘估計的殘差  $e_i$  滿足 ( ACDE )。

A.  $\sum e_i = 0$                       B.  $\sum e_i Y_i = 0$                       C.  $\sum e_i \hat{Y}_i = 0$                       D.  $\sum e_i X_i = 0$                       E.  $\text{cov}(X_i, e_i) = 0$

31. 調整後的鑑定系數  $\bar{R}^2$  的對的體現式有 ( BCD )。

A.  $1 - \frac{\sum (Y_i - \bar{Y}_i)^2 / (n-1)}{\sum (Y_i - \hat{Y}_i)^2 / (n-k)}$                       B.  $1 - \frac{\sum (Y_i - \hat{Y}_i)^2 / (n-k-1)}{\sum (Y_i - \bar{Y}_i)^2 / (n-1)}$   
 C.  $1 - (1-R^2) \frac{(n-1)}{(n-k-1)}$                       D.  $R^2 - \frac{k(1-R^2)}{n-k-1}$                       E.  $1 - (1+R^2) \frac{(n-k)}{(n-1)}$

32. 對總體線性回歸模型進行明顯性檢查時所用的 F 記錄量可表達為 ( BC )。

A.  $\frac{ESS/(n-k)}{RSS/(k-1)}$                       B.  $\frac{ESS/(k-1)}{RSS/(n-k)}$                       C.  $\frac{R^2/(k-1)}{(1-R^2)/(n-k)}$                       D.  $\frac{(1-R^2)/(n-k)}{R^2/(k-1)}$                       E.  $\frac{R^2/(n-k)}{(1-R^2)/(k-1)}$

33. 將非線性回歸模型轉換為線性回歸模型，常用的數學處理措施有 ( AB )

- A. 直接置換法                      B. 對數變換法                      C. 級數展開法  
 D. 廣義最小二乘法                      E. 加權最小二乘法

34. 在模型  $\ln Y_i = \ln \beta_0 + \beta_1 \ln X_i + \mu_i$  中 ( ABCD )

- A.  $Y$  與  $X$  是非線性的                      B.  $Y$  與  $\beta_1$  是非線性的                      C.  $\ln Y$  與  $\beta_1$  是線性的  
 D.  $\ln Y$  與  $\ln X$  是線性的                      E.  $Y$  與  $\ln X$  是線性的

35. 對模型  $y_i = b_0 + b_1 x_{1i} + b_2 x_{2i} + u_i$  進行總體明顯性檢查，假如檢查成果總體線性關係明顯，則有 ( BCD )。

- A.  $b_1 = b_2 = 0$     B.  $b_1 \neq 0, b_2 = 0$     C.  $b_1 = 0, b_2 \neq 0$     D.  $b_1 \neq 0, b_2 \neq 0$     E.

$b_1 = b_2 \neq 0$

36. 剩余变差是指 ( ACDE )。

- A. 随机原因影响所引起的被解释变量的变差  
 B. 解释变量变动所引起的被解释变量的变差  
 C. 被解释变量的变差中，回归方程不能做出解释的部分  
 D. 被解释变量的总变差与回归平方和之差  
 E. 被解释变量的实际值与回归值的离差平方和

37. 回归变差 (或回归平方和) 是指 (BCD )。

- A. 被解释变量的实际值与平均值的离差平方和  
 B. 被解释变量的回归值与平均值的离差平方和  
 C. 被解释变量的总变差与剩余变差之差  
 D. 解释变量变动所引起的被解释变量的变差  
 E. 随机原因影响所引起的被解释变量的变差

38. 设  $k$  为回归模型中的参数个数 (包括截距项)，则总体线性回归模型进行明显性检查时所用的 F 记录量可表达为 (BC )。

- A.  $\frac{\sum(\hat{Y}_i - \bar{Y})^2 / (n-k)}{\sum e_i^2 / (k-1)}$     B.  $\frac{\sum(\hat{Y}_i - \bar{Y})^2 / (k-1)}{\sum e_i^2 / (n-k)}$     C.  $\frac{R^2 / (k-1)}{(1-R^2) / (n-k)}$     D.  $\frac{(1-R^2) / (n-k)}{R^2 / (k-1)}$     E.  $\frac{R^2 / (n-k)}{(1-R^2) / (k-1)}$

39. 在多元线性回归分析中，修正的可决系数  $\bar{R}^2$  与可决系数  $R^2$  之间 ( AD )。

- A.  $\bar{R}^2 < R^2$     B.  $\bar{R}^2 \geq R^2$     C.  $\bar{R}^2$  只能不小于零    D.  $\bar{R}^2$  也许为负值

40. 下列计量经济分析中那些很也许存在异方差问题 ( ABCDE )

- A. 用横截面数据建立家庭消费支出对家庭收入水平的回归模型  
 B. 用横截面数据建立产出对劳动和资本的回归模型  
 C. 以凯恩斯的有效需求理论为基础构造宏观计量经济模型  
 D. 以国民经济核算帐户为基础构造宏观计量经济模型  
 E. 以30年的时序数据建立某种商品的市場供需模型

41. 在异方差条件下一般最小二乘法具有如下性质 ( AB )

- A. 线性    B. 无偏性    C. 最小方差性    D. 精确性    E. 有效性

42. 异方差性将导致 ( BCDE )。

- A. 一般最小二乘法估计量有偏和非一致    B. 一般最小二乘法估计量非有效  
 C. 一般最小二乘法估计量的方差的估计量有偏    D. 建立在一般最小二乘法估计基础上的假设检查失效  
 E. 建立在一般最小二乘法估计基础上的预测区间变宽

43. 下列哪些措施可用于异方差性的检查 ( DE )。

- A. DW检查    B. 方差膨胀因子检查法    C. 鉴定系数增量奉献法    D. 样本分段比较法    E. 残差回归检查法

44. 当模型存在异方差现象时，加权最小二乘估计量具有 (ABCDE )。

- A. 线性    B. 无偏性    C. 有效性    D. 一致性    E. 精确性

45. 下列说法对的有 (BE )。

- A. 当异方差出现时，最小二乘估计是有偏的和不具有最小方差特性  
 B. 当异方差出现时，常用的t和F检查失效  
 C. 异方差状况下，一般的OLS估计一定高估了估计量的原则差  
 D. 假如OLS回归的残差体现出系统性，则阐明数据中不存在异方差性  
 E. 假如回归模型中遗漏一种重要变量，则OLS残差必然体现出明显的趋势

46. DW 检查不合用一下列状况的序列有关检查 ( ABC )。

- A. 高阶线性自回归形式的序列有关  
 B. 一阶非线性自回归的序列有关  
 C. 移动平均形式的序列有关  
 D. 正的一阶线性自回归形式的序列有关  
 E. 负的一阶线性自回归形式的序列有关

47. 以  $d_l$  表达记录量 DW 的下限分布,  $d_u$  表达记录量 DW 的上限分布, 则 DW 检查的不确定区域是 ( BC )。

A.  $d_u \leq DW \leq 4 - d_u$     B.  $4 - d_u \leq DW \leq 4 - d_l$     C.  $d_l \leq DW \leq d_u$     D.  $4 - d_l \leq DW \leq 4$     E.  $0 \leq DW \leq 4$

48. DW 检查不合用于下列状况下的一阶线性自有关检查 ( BCD )。

A. 模型包具有随机解释变量    B. 样本容量太小    C. 非一阶自回归模型  
D. 具有滞後的被解释变量    E. 包具有虚拟变量的模型

49. 针对存在序列有关现象的模型估计, 下述哪些措施也许是合用的 ( BDE )。

A. 加权最小二乘法    B. 一阶差分法    C. 残差回归法    D. 广义差分法    E. Durbin 两步法

50. 假如模型  $y_t = b_0 + b_1 x_t + u_t$  存在一阶自有关, 一般最小二乘估计仍具有 ( AB )。

A. 线性    B. 無偏性    C. 有效性    D. 真实性    E. 精确性

51. DW 检查不能用于下列哪些现象的检查 ( ABCDE )。

A. 递增型异方差的检查    B.  $u_t = \rho u_{t-1} + \rho^2 u_{t-2} + v_t$  形式的序列有关检查

C.  $x_t = b_0 + b_1 x_{t-1} + u_t$  形式的多重共线性检查    D.  $y_t = \hat{\beta}_0 + \hat{\beta}_1 x_t + \hat{\beta}_2 y_{t-1} + e_t$  的一阶线性自有关检查

E. 遗漏重要解释变量导致的设定误差检查

52. 下列哪些回归分析中很也许出现多重共线性问题 ( AC )。

A. 资本投入与劳动投入两个变量同步作为生产函数的解释变量    B. 消费作被解释变量, 收入作解释变量的消费函数

C. 本期收入和前期收入同步作为消费的解释变量的消费函数

D. 商品价格, 地区, 消费风俗同步作为解释变量的需求函数

E. 每亩施肥量, 每亩施肥量的平方同步作为小麦亩产的解释变量的模型

53. 当模型中解释变量间存在高度的多重共线性时 ( ACD )。

A. 各个解释变量对被解释变量的影响将难以精确鉴别    B. 部分解释变量与随机误差项之间将高度有关

C. 估计量的精度将大幅度下降    D. 估计对于样本容量的变动将十分敏感

E. 模型的随机误差项也将序列有关

54. 下述记录量可以用来检查多重共线性的严重性 ( ACD )。

A. 有关系数    B. DW 值    C. 方差膨胀因子    D. 特性值    E. 自有关系数

55. 多重共线性产生的原因重要有 ( ABCD )。

A. 经济变量之间往往存在同方向的变化趋势

B. 经济变量之间往往存在著亲密的关联

C. 在模型中采用滞後变量也轻易产生多重共线性

D. 在建模过程中由于解释变量选择不妥, 引起了变量之间的多重共线性

E. 以上都对的

56. 多重共线性的处理措施重要有 ( ABCDE )。

A. 保留重要的解释变量, 去掉次要的或替代的解释变量

B. 运用先验信息变化参数的约束形式

C. 变换模型的形式    D. 综合使用时序数据与截面数据

E. 逐渐回归法以及增长样本容量

57. 有关多重共线性, 判断错误的有 ( ABC )。

A. 解释变量两两不有关, 则不存在多重共线性

B. 所有的 t 检查都不明显, 则阐明模型总体是不明显的

C. 有多重共线性的计量经济模型没有应用的意义

D. 存在严重的多重共线性的模型不能用于构造分析

58. 模型存在完全多重共线性时, 下列判断对的是 ( AB )。

A. 参数无法估计

B. 只能估计参数的线性组合

C. 模型的鉴定系数为 0

D. 模型的鉴定系数为 1

59. 下列判断对的是有 ( ABC )。

A. 在严重多重共线性下, OLS 估计量仍是最佳线性無偏估计量。

B. 多重共线性问题的实质是样本现象, 因此可以通过增长样本信息得到改善。

C. 虽然多重共线性下, 很难精确辨别各个解释变量的单独影响, 但可据此模型进行预测。

D. 假如回归模型存在严重的多重共线性, 可不加分析地去掉某个解释变量从而消除多重共线性。

60. 在包具有随机解释变量的回归模型中, 可用作随机解释变量的工具变量必须具有的条件有, 此工具变量 ( AE )。

A. 与该解释变量高度有关

B. 与其他解释变量高度有关

- C. 与随机误差项高度有关                      D. 与该解释变量不有关                      E. 与随机误差项不有关
61. 有关虚拟变量，下列表述對的有 ( ABCD )
- A. 是质的原因的数量化                      B. 取值為 1 和 0
- C. 代表质的原因                      D. 在有些状况下可代表数量原因                      E. 代表数量原因
62. 虚拟变量的取值為 0 和 1，分别代表某种属性的存在与否，其中 ( BC )
- A. 0 表达存在某种属性                      B. 0 表达不存在某种属性                      C. 1 表达存在某种属性
- D. 1 表达不存在某种属性                      E. 0 和 1 代表的内容可以随意设定
63. 在截距变动模型  $y_i = \alpha_0 + \alpha_1 D + \beta x_i + \mu_i$  中，模型系数 ( AC )
- A.  $\alpha_0$  是基础类型截距项                      B.  $\alpha_1$  是基础类型截距项
- C.  $\alpha_0$  称为公共截距系数                      D.  $\alpha_1$  称为公共截距系数                      E.  $\alpha_1 - \alpha_0$  為差异截距系数
64. 虚拟变量的特殊应用有 ( ABC )
- A. 调整季节波动                      B. 检查模型构造的稳定性                      C. 分段回归
- D. 修正模型的设定误差                      E. 工具变量法
65. 对于分段线性回归模型  $y_i = \beta_0 + \beta_1 x_i + \beta_2 (x_i - x^*) D + \mu_i$ ，其中 ( BE )
- A. 虚拟变量 D 代表品质原因                      B. 虚拟变量 D 代表数量原因                      C. 认为  $x_i = x^*$  界，前後两段回归直线的斜率不一样
- D. 认为  $x_i = x^*$  界，前後两段回归直线的截距不一样                      E. 该模型是系统变参数模型的一种特殊形式
66. 下列模型中属于几何分布滞后模型的有 ( ABC )
- A. koyck 变换模型                      B. 自适应预期模型                      C. 部分调整模型                      D. 有限多项式滞后模型
- E. 广义差分模型
67. 对于有限分布滞后模型，将参数  $\beta_i$  表达為有关滞后  $i$  的多项式并代入模型，作这种变换可以 ( CD )。
- A. 使估计量從非一致变為一致                      B. 使估计量從有偏变為無偏                      C. 減弱多重共线性
- D. 防止因参数過多而自由度局限性                      E. 減輕异方差問題
68. 在模型  $Y_t = \alpha + \beta_0 X_t + \beta_1 X_{t-1} + \beta_2 X_{t-2} + \beta_3 X_{t-3} + u_t$  中，延期过渡性乘数是指 ( BCD )
- A.  $\beta_0$                       B.  $\beta_1$                       C.  $\beta_2$                       D.  $\beta_3$                       E.  $\beta_1 + \beta_2 + \beta_3$
69. 对几何分布滞后模型的三种变换模型，即 koyck 变换模型、自适应预期模型、局部调整模型，其共同特点是 ( ABCD )
- A. 具有相似的解釋变量                      B. 仅有三个参数需要估计                      C. 用  $Y_{t-1}$  替代了原模型中解釋变量的所有滞后变量
- D. 防止了原模型中的多重共线性問題                      E. 都以一定經濟理论為基础
70. 当构造方程為恰好识别時，可选择的估计措施是 ( CD )
- A. 最小二乘法                      B. 广义差分法                      C. 间接最小二乘法
- D. 二阶段最小二乘法                      E. 有限信息极大似然估计法
71. 对联立方程模型参数的單方程估计法包括 ( ABD )
- A. 工具变量法                      B. 间接最小二乘法                      C. 完全信息极大似然估计法
- D. 二阶段最小二乘法                      E. 三阶段最小二乘法

72. 小型宏观计量经济模型  $\begin{cases} C_t = a_0 + a_1 Y_t + u_{1t} \\ I_t = b_0 + b_1 Y_t + b_2 Y_{t-1} + u_{2t} \\ Y_t = C_t + I_t + G_t \end{cases}$  中, 第 1 个方程是 ( ABCD )

- A. 构造式方程                      B. 随机方程                      C. 行为方程                      D. 线性方程                      E. 定义方程

73. 构造式模型中的解释变量可以是 (ABCDE)

- A. 外生变量                      B. 滞后内生变量                      C. 虚拟变量  
D. 滞后外生变量                      E. 模型中其他构造方程的被解释变量

74. 与单方程计量经济模型相比, 联立方程计量经济模型的特点是 ( ADF )。

- A. 合用于某一经济系统的研究                      B. 合用于单一经济现象的研究                      C. 揭示经济变量之间的单项因果关系  
D. 揭示经济变量之间互相依存、互相因果的关系                      E. 用单一方程来描述被解释变量和解释变量的数量关系

F. 用一组方程来描述经济系统内内生变量和外生变量 (先决变量) 之间的数量关系

75. 随机方程包括哪四种方程 ( ABD )。

- A. 行为方程                      B. 技术方程                      C. 经验方程                      D. 制度方程                      E. 记录方程

76. 下列有关联立方程模型的识别条件, 表述对的对的有 ( BD )。

- A. 方程只要符合阶条件, 就一定符合秩条件                      B. 方程只要符合秩条件, 就一定可以识别  
C. 方程识别的阶条件和秩条件互相独立                      D. 秩条件成立时, 根据阶条件判断方程是恰好识别还是过度识别

77. 对于 C-D 生产函数模型  $Y = AL^\alpha K^\beta e^\mu$ , 下列说法中对的对的有 ( ABC )。

- A. 参数 A 反应广义的技术进步水平                      B. 资本要素的产出弹性  $E_K = \beta$   
C. 劳动要素的产出弹性  $E_L = \alpha$                       D.  $\alpha + \beta$  必然等于 1

78. 对于线性生产函数模型  $Y = \alpha_0 + \alpha_1 K + \alpha_2 L + \mu$ , 下列说法中对的对的有 ( ABCD )。

- A. 假设资本 K 与劳动 L 之间是完全可替代的                      B. 资本要素的边际产量  $MP_K = \alpha_1$   
C. 劳动要素的边际产量  $MP_L = \alpha_2$                       D. 劳动和资本要素的替代弹性  $\sigma = \infty$

79. 有关绝对收入假设消费函数模型  $C_t = \alpha + \beta_0 Y_t + \beta_1 Y_t^2 + \mu_t$  ( $t = 1, 2, \dots, T$ ), 下列说法对的对的有 ( ABCD )。

- A. 参数  $\alpha$  表达自发性消费                      B. 参数  $\alpha > 0$                       C. 参数  $\beta_0$  表达边际消费倾向                      D. 参数  $\beta_1 < 0$

80. 建立生产函数模型时, 样本数据的质量问题包括 ( BCDE )。

- A. 线性                      B. 完整性                      C. 精确性                      D. 可比性                      E. 一致性

### 三、名词解释 (每题 3 分)

1. 经济变量: 经济变量是用来描述经济原因数量水平的指标。(3 分)
2. 解释变量: 是用来解释作为研究对象的变量 (即因变量) 为何变动、怎样变动的变量。(2 分) 它对因变量的变动做出解释, 体现为方程所描述的因果关系中的“因”。(1 分)
3. 被解释变量: 是作为研究对象的变量。(1 分) 它的变动是由解释变量做出解释的, 体现为方程所描述的因果关系的果。(2 分)
4. 内生变量: 是由模型系统内部原因所决定的变量, (2 分) 体现为具有一定概率分布的随机变量, 是模型求解的成果。(1 分)
5. 外生变量: 是由模型系统之外的原因决定的变量, 体现为非随机变量。(2 分) 它影响模型中的内生变量, 其数值在模型求解之前就已经确定。(1 分)



6. 滯後变量：是滯後内生变量和滯後外生变量的合称，(1分)前期的内生变量称为滯後内生变量；(1分)前期的外生变量称为滯後外生变量。(1分)
7. 前定变量：一般将外生变量和滯後变量合称为前定变量，(1分)即是在模型求解此前已经确定或需要确定的变量。(2分)
8. 控制变量：在计量经济模型中人为设置的反应政策规定、决策者意愿、经济系统运行条件和状态等方面的变量，(2分)它一般属于外生变量。(1分)
9. 计量经济模型：为了研究分析某个系统中经济变量之间的数量关系而采用的随机代数模型，(2分)是以数学形式对客观经济现象所作的描述和概括。(1分)
10. 函数关系：假如一种变量  $y$  的取值可以通过另一种变量或另一组变量以某种形式惟一地、精确地确定，则  $y$  与这个变量或这组变量之间的关系就是函数关系。(3分)
11. 有关关系：假如一种变量  $y$  的取值受另一种变量或另一组变量的影响，但并不由它们惟一确定，则  $y$  与这个变量或这组变量之间的关系就是有关关系。(3分)
12. 最小二乘法：用使估计的剩余平方和最小的原则确定样本回归函数的措施，称为最小二乘法。(3分)
13. 高斯-马尔可夫定理：在古典假定条件下，OLS 估计量是模型参数的最佳线性无偏估计量，这一结论即是高斯-马尔可夫定理。(3分)
14. 总变差 (总离差平方和)：在回归模型中，被解释变量的观测值与其均值的离差平方和。(3分)
15. 回归变差 (回归平方和)：在回归模型中，因变量的估计值与其均值的离差平方和，(2分)也就是由解释变量解释的变差。(1分)
16. 剩余变差 (残差平方和)：在回归模型中，因变量的观测值与估计值之差的平方和，(2分)是不能由解释变量所解释的部分变差。(1分)
17. 估计原则误差：在回归模型中，随机误差项方差的估计量的平方根。(3分)
18. 样本决定系数：回归平方和在总变差中所占的比重。(3分)
19. 点预测：给定自变量的某一种值时，运用样本回归方程求出对应的样本拟合值，以此作为因变量实际值和其均值的估计值。(3分)
20. 拟合优度：样本回归直线与样本观测数据之间的拟合程度。(3分)
21. 残差：样本回归方程的拟合值与观测值的误差称为回归残差。(3分)
22. 明显性检查：运用样本成果，来证明一种虚拟假设的真伪的一种检查程序。(3分)
23. 回归变差：简称 ESS, 表达由回归直线 (即解释变量) 所解释的部分 (2分)，表达  $x$  对  $y$  的线性影响 (1分)。
24. 剩余变差：简称 RSS, 是未被回归直线解释的部分 (2分)，是由解释变量以外的原因导致的影响 (1分)。
25. 多重决定系数：在多元线性回归模型中，回归平方和与总离差平方和的比值 (1分)，也就是在被解释变量的总变差中能由解释变量所解释的那部分变差的比重，我们称之为多重决定系数，仍用  $R^2$  表达 (2分)。
26. 调整后的决定系数：又称修正后的决定系数，记为，是为了克服多重决定系数会伴随解释变量的增长而增大的缺陷提出来的，(2分)  
其公式为：(1分)。
27. 偏有关系数：在  $Y$ 、 $X_1$ 、 $X_2$  三个变量中，当  $X_1$  既定期 (即不受  $X_1$  的影响)，表达  $Y$  与  $X_2$  之间有关关系的指标，称为偏有关系数，记做。(3分)
28. 异方差性：在线性回归模型中，假如随机误差项的方差不是常数，即对不一样的解释变量观测值彼此不一样，则称随机项  $u_i$  具有异方差性。(3分)
29. 戈德菲尔特-匡特检查：该措施由戈德菲尔特 (S. M. Goldfeld) 和匡特 (R. E. Quandt) 于1965年提出，用对样本进行分段比较的措施来判断异方差性。(3分)
30. 怀特检查：该检查由怀特 (White) 在1980年提出，通过建立辅助回归模型的方式来判断异方差性。(3分)
31. 戈里瑟检查和帕克检查：该检查法由戈里瑟和帕克于1969年提出，其基本原理都是通过建立残差序列对解释变量的 (辅助) 回归模型，判断随机误差项的方差与解释变量之间是否存在较强的有关关系，进而判断与是否存在异方差性。(3分)
32. 序列有关性：对于模型

随机误差项互相独立的基本假设体现为 (1分)

假如出现

即对于不一样的样本点，随机误差项之间不再是完全互相独立，而是存在某种有关性，则认为出现了序列有关性 (Serial

Correlation)。 (2分)

33. 虚假序列有关：是指模型的序列有关性是由于省略了明显的解释变量而导致的。
34. 差分法：差分法是一类克服序列有关性的有效措施，被广泛的采用。差分法是将原模型变换为差分模型，分为一阶差分法和广义差分法。
35. 广义差分法：广义差分法可以克服所有类型的序列有关带来的问题，一阶差分法是它的一种特例。
36. 自回归模型：
37. 广义最小二乘法：是最有普遍意义的最小二乘法，一般最小二乘法和加权最小二乘法是它的特例。
38. DW 检查：德宾和瓦特森与 1951 年提出的一种适于小样本的检查措施。DW 检查法有五个前提条件。
39. 科克伦-奥克特迭代法：是通过逐次迭代去寻求更为满意的估计值，然后再采用广义差分法。详细来说，该措施是运用残差去估计未知的。(
40. Durbin 两步法：当自有关系系数未知，可采用 Durbin 提出的两步法去消除自有关。第一步对一元回归模型，使用 OLS 法估计其参数，第二步再运用广义差分。
41. 有关系数：度量变量之间有关程度的一种系数，一般用  $\rho$  表达。 ， ， 越靠近于 1，有关程度越强，越靠近于 0，有关程度越弱。
42. 多重共线性：是指解释变量之间存在完全或不完全的线性关系。
43. 方差膨胀因子：是指解释变量之间存在多重共线性时的方差与不存在多重共线性时的方差之比。
44. 把质的原因量化而构造的取值为 0 和 1 的人工变量。
45. 在设定模型时假如模型中解释变量的构成，模型函数的形式以及有关随机误差项的若干假定等内容的设定与客观实际不一致，运用计量经济学模型来描述经济现象而产生的误差。
46. 是指与模型中的随机解释变量高度有关，与随机误差项不有关的变量。
47. 用工具变量替代模型中与随机误差项有关的随机解释变量的措施。
48. 由于引进虚拟变量，回归模型的截距或斜率随样本观测值的变化而系统地变化。
49. 这是虚拟变量的一种应用，当解释变量低于某个已知的临界水平时，我们取虚拟变量设置而成的模型称之为分段线性回归模型。
50. 分布滞后模型：假如滞后变量模型中没有滞后因变量，因变量受解释变量的影响分布在解释变量不一样步期的滞后值上，则称这种模型为分布滞后模型。
51. 有限分布滞后模型：滞后期长度有限的分布滞后模型称为有限分布滞后模型。
52. 无限分布滞后模型：滞后期长度无限的分布滞后模型称为无限分布滞后模型。
53. 几何分布滞后模型：对于无限分布滞后模型，假如其滞后变量的系数  $b_i$  是按几何级数衰减的，则称这种模型为几何分布滞后模型。
54. 联立方程模型：是指由两个或更多互相联络的方程构建的模型。
55. 构造式模型：是根据经济理论建立的反应经济变量间直接关系构造的计量方程系统。
56. 简化式模型：是指联立方程中每个内生变量只是前定变量与随机误差项的函数。
57. 构造式参数：构造模型中的参数叫构造式参数
58. 简化式参数：简化式模型中的参数叫简化式参数。
59. 识别：就是指与否则能从简化式模型参数估计值中推导出构造式模型的参数估计值。
60. 不可识别：是指无法从简化式模型参数估计值中推导出构造式模型的参数估计值。
61. 识别的阶条件：假如一种方程能被识别，那么这个方程不包括的变量的总数应不小于或等于模型系统中方程个数减 1。
62. 识别的秩条件：一种方程可识别的充足必要条件是：所有不包括在这个方程中的参数矩阵的秩为  $m-1$ 。
63. 间接最小二乘法：先运用最小二乘法估计简化式方程，再通过参数关系体系，由简化式参数的估计值求解得构造式参数的估计值

## 五、计算与分析题（每题 10 分）

以上内容仅为本文档的试下载部分，为可阅读页数的一半内容。如要下载或阅读全文，请访问：<https://d.book118.com/626111234231011011>