

2010 年上海交通大学 879 经济学（II）考研试题（回忆版）

本试题由 kaoyan.com 网友 zhouheng1212 提供

微观：第一题，道格拉斯函数。问你，1 函数满足什么是效用函数 2. 什么是边际效用 3. 什么是边际替代率 4. 预算约束 5. 求效用最大的 X_1, X_2 .

第二题， $U = w^{1/2}$. w 为财富，资本为 10000，买彩票 50% 中 22000，50% 中 0，彩票价格为 p . 收益为 r

1. 什么是风险厌恶，2 求期望收益，以及对应的效用. 3. p 为多少是期望效用和无风险效用相等。

第三题，两个航空公司博弈。问，1 如何理解占优策略，题中例子有占优策略吗。2 如何理解纳什均衡，题中例子是否存在纳什均衡。

第四题，一个软件公司发股票融资，问 1 什么是道德风险和逆向选择，2 举例说明题中公司会遇到哪些道德风险和逆向选择。3 如何在市场上避免道德风险和逆向选择，提建议。

统计：

第一题，已知，当 x_1 在 $(0, 1)$ ， x_2 在 $(0, 1)$ 时， $f(x_1, x_2) = x_1 + x_2$ 。

其余为 $f=0$ 。

求 $E[X_2/x_1]$ 和 $\text{var}[X_2/x_1]$

第二题，硬币扔 6 次，4 为正面，2 次反面。1. 设计一方法检验。2. 95% 的置信区间。3 置信区间值

第三题有点向计量经济，一个回归方程 $\log Q$ （关于劳动力和资金的）（对数化了的多元方程），已知 R^2 ，系数的相关系数已知，等等。证 1，5% 的显著性水平下劳动力和资金系数相等。2，证 5% 的显著性水平下规模效益不变 3. 求 Q 为何

第四题。提求概率，顾客买 A、B、C 三种商品，买 A、B、C 的三个概率已知，AB、AC 概率已知， $p(BC)=0$ ，求只卖 A 或 B 的概率。

（我地理解，这里没说明事件独立，题中条件可计算出 $p(ABC)=0$ ）

第五题，是英语写的题。一回归方程， $Y_i = bX_i + U_i$, $i=1, 2$. 已知 U 的分布，1. 证 $\text{VAR}U=0$. 2. 忘了 3. 最小二乘估计 b . 4. $Eb=b$. 5. 求 b

以上试题来自 kaoyan.com 网友的回忆，仅供参考，纠错请发邮件至 suggest@kaoyan.com。