

## 2014 年上海财经大学金融计量经济学考研复试试题(回忆版)

本试题由 kaoyan.com 网友 luosongu880 提供

### 一、判断并证明

- (1) 简单回归误差项期望不等于零情况下参数估计期望无偏,
- (2) 误差项非正态分布对估计量与统计量没有影响

### 二、

- (1) 在异方差情况下, 用 ols 与 ml (极大似然估计) 估计 mlr 模型, 详细写出推导过程
- (2) 用 mm (距估计) 推导估计量, 以及 TSS ESS RSS 三者之间的关系,
- (3) 误差项 ar (1) 情况下, 推导 DW 与  $\beta$  之间的关系
- (4) 误差项  $u_t = \beta_1 u_{t-1} + \beta_2 u_{t-3}$  用 co 迭代法进行差分估计, 求估计量
- (5) 一个案例, 然后分析经济意义以及是否符合现实情况

### 三、时间序列

- (1) 因变量 ar (k) 时什么时候满足平稳以及如何检验平稳性
- (2) 因变量 ar (k) 满足平稳性假定情况下推导  $\text{corr}[y(t), y(t+k)]$
- (3) 因变量 ar (k) 不满足平稳性假定下
  - ①不满足平稳性假定下是不是一定导致单位根?
  - ②单位根是不是就是随机游走?
  - ③随机游走情况下, 推导  $\text{corr}[y(t), y(t+k)]$

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。