

## 2014 年上海财经大学计量经济学考研复试试题（回忆版）

本试题由 kaoyan.com 网友 li919271 提供

### 一、判断说理（20 分）

- 1、如果  $E u$  不等于 0，仍是无偏
- 2、若正态假定不成立，对估计及检验无影响

### 二、一个多元回归，每问 8 分。

- 1、若异方差，求最大似然估计，ols 估计正规方程，非矩阵形式。
- 2、求  $ess$   $rss$  ,  $tss$  关系，证明。
- 3、求矩估计。

### 三、

- 1、对于截面数据，请写出基本假定，并解释意义，原因。10 分。
- 2、关于时间序列的。
  - (1) 平稳条件
  - (2) 如果平稳，对于  $Y_t = a + Y_{t-1} + u$ ，求自相关系数。
  - (3) 单位根过程与随机游走一样吗？
  - (4) 求随机游走的自相关系数。

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](mailto:suggest@kaoyan.com)。