

## 2014 年东北财经大学数量经济学考研复试试题（回忆版）

本试题由 kaoyan.com 网友 wang7558035 提供

- 一、2 维标准正态随机变量的证明，2 维标准正态函数就不写了，问题是  $\text{copp}(X_1^2, X_2^2) = P^2$ , ( $P$  是  $\rho$ , 没法打这个字母)
- 二、1.  $X$  的平均和  $S$  的平方是相互独立的证明。2.  $(n-1) S^2 / (\text{西格玛的平方})$  服从自由度为  $n-1$  的卡方分布的证明
- 三、关于切比雪夫不等式的套用
- 四、关于双重期望的一个证明，证明  $E(E(X|Y)) = EX$
- 五、计量经济学上的自相关的问题，题干挺长的，好好看教材，这个题肯定有话说
- 六、线性回归中的  $\text{var}(b_2)$  等于什么的证明
- 七、1. 多元回归的  $B_2$  可以用最小二乘的法的的前提 2. 多元回归  $\text{var}(b_2)$  等于什么证明

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)。