1.判断题五道

a.自变量存在相关性会扩大估计系数的方差

b.残差存在自相关会影响一致性

c.使用代理变量与变量数值存在误差时的处理方法一样

d.平稳性的必要条件是无偏性

e.AR(p)中高于p的自相关系数为零

2.简答，第四章讲义后的练习题

收入等因素对储蓄回归

a.遗漏高收入样本的影响，是否内生性为什么

b.储蓄数据有误差，影响？何时不影响无偏性

c.该模型中CEV是否成立？为什么？

3.计算，第五章讲义后的练习题

表格给出十五阶自相关系数，偏相关系数

a.估算beta1,beta2标准差，在betak(k＞2)情况下假设检验beta1,2≠0，其他beta＝0

b.给出AR1,AR2,MA1,MA2,ARMA1,1五个模型的参数，以及AIC和残差自相关系数。问选择哪个模型最好为什么

4.简答，模型选择

五十家不同风格基金公司，每个公司8-10支基金。想要用基金规模，发行时间，一个月前的过去一年回报率，对下一个月回报率做回归

a.当做联合横截面回归行不行？判断方法，给出具体何时可以用何时不可以用

b.假设上一问中结果为不能用，能否用面板数据模型做？为什么？这样做要引入哪些特征变量？

5.简答

a.差分模型，固定效应模型，随机效应模型的各自特点以及比较，如何取舍？

b.OLS中异常值的影响，如何处理？

c.多重共线性问题的特征，两个处理方法各自怎么做，有何特点？

判断题：

在自变量都相关的情况下，一员回归和多元回归得到的估计结果相同。

残差存在自相关会影响一致性。

在样本量适当大的情况下，异常值的存在不会影响最小二乘估计。

遍历性意味着自相关系数随着间隔的增大而减小。

ARMA(p，q)中高于p的偏相关系数和高于q阶的自相关系数为零。

第二题的前两问和上一年基本相同，在第一问中加了一个关于因变量的内生样本选择的考点，而不只是考了基于自变量的选择。第三问换了题，考异方差的检验和处理方法。

第三题基本不变，计算自相关系数和偏相关系数的估计方差，以及t检验；第二问还是考判断模型，跟2016年的题一样。

第四题第一问与2016年相同，第二问参见第六章作业题的第三题。

第五题多重共线性以及那几个面板模型的与2016年相同，第二问改成了考函数形式设定不当的情况有哪几种以及如何检验。