金融计量期末

1.判断题五道（考完没对答案不知道正确解答，也请不要告诉我正确解答=\_=谢）

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？