**金融计量经济学**

期中考试参考答案

**Q1**

1. 不正确。1, 2, 3’, 4满足
2. 不正确。统计学家不太关注有效性（但答了正确，并说明统计学家不太关注，扣1-2分）。统计学家关注方法的特性、估计的性质、适用的边界条件、算法的简捷、收敛的速度等量化的问题；

计量学家关注模型的适应性、稳健性、结果的可靠性、经济变量之间的存在性等量化分析工具本身的特性。

1. 不正确。看Sigma^2和R2
2. 不正确。同等重要，或者说统计显著性是基础

**Q2**

1. **证明过程较简单，但考虑到此题分值较大，如没有证明某一无偏扣2分**
2. 直接展开，可以不用对covariance做进一步展开，考虑到分值较大，var(β)需要写出形式，否则扣一分

（此题我们之前作业类似的题目批得比较宽松，可能存在一点misleading，但为了有一点区分度，故会稍严格，请大家理解）

**Q3**

1. 在某一给定pareduc水平时，当educ增加1年，wage增加100\*()%（6分）

言之有理即可（6分）一些错误理由：父母教育多，则子女教育也会越多/越少，或者没有列出具体原因等等，会扣1-2分

1. 给定其他条件，pareduc每增加1单位，educ对wage增长百分比的边际影响减小0.078%；

2.204%和2.828%

这一题只在均值水平考虑的，扣2-3分

1. 此题要注意的是pareduc有两项，都要考虑

* 在给定任意下，检验，t检验（说F检验也可以）；（由于educ大概可以取1-20+的值，实际操作可以取特定值用F检验）

其他可以部分得分的答案包括以下：

* 答到本人受教育20年以内，可能是正相关，考虑到了educ的影响
* **对原假设：**进行t检验，需要写出检验过程和结论（如果是对教育收益理解有歧义）
* 上面过程用均值替代的
* 只对检验，没有考虑全面