

请勿以任何方式泄露或传播本试卷。

2020 年春季研究生计量经济学 期末试卷

考试时间：2020 年 7 月 11 日 14:00-18:00

本试卷共 2 道大题，每题 50 分，满分 100 分。

另设 1 道附加题，满分 10 分，全卷总分不超过 100 分。

重点提示：回答问题时不要翻译照搬原文。

第 1 大题 阅读 Holmes (1998, *JPE*), 回答以下问题。

(1) 本文的识别假设是什么？

(2) 如何理解文章第 672 页第 3 段段末这句话：

“... the results do not say what would happen if a state currently without a right-to-work law passed such a law but left all other policies fixed.”

(3) 如何用线性回归的方法实现表 2（第 686 页）的检验？请以第 1 行的结果为例说明，写出回归方程、被解释变量和解释变量的含义、使用的样本以及观测单位。

(4) 第 691 页估计方程 (2) 中，变量 x_i 是如何定义的？

(5) 表 5（第 693 页）第 (4) 列的结果是如何估计的？请写出相应的 STATA 命令，可以定义必要的变量并说明其含义。

(6) 文章给出表 6（第 694 页）的意图是什么？该图如何实现？请以第 1 行的结果为例说明，写出回归方程、被解释变量和解释变量的含义、使用的样本以及观测单位。

第 2 大题 阅读 Mayzlin *et al* (2014, *AER*), 回答以下问题。

(1) 文章在前言 (第 2423 页第 3 段) 中写道,

"Our main empirical analysis is akin to a differences in differences approach ..."

应该如何理解这一断言?

(2) 如果 (1) 中的断言是正确的, 那么本文的识别假设是什么?

(3) 鉴于我们通常使用交互项模型来实现双重差分这一识别策略, 如果要把本文的估计方程还原成交互项模型, 可以怎么做?

(4) 如何理解表 3 (第 2437 页) 中第 2 列和第 3 列估计结果的差异? 具体而言, 为什么 **OwnAf_{ij}** 变量在第 2 列不显著而在第 3 列显著, 而 **Nei_{ij}** 和 **NeiOwnAf_{ij}** 变量在第 2 列显著而在第 3 列不显著?

(5) 文章第 2439 页第 2 段讨论了估计结果的经济含义, 请问以下这两个数字是如何计算出来的?

"... Our estimates suggest that we would expect about seven more positive TripAdvisor reviews in case (ii) versus case (i). ... Our estimates suggest that there would be a total of six more fake negative reviews on TripAdvisor in case (iv) versus case (iii)."

(6) 文章脚注 14 (第 2444 页) 提及了我们在课堂上讲解过的文献 Altonji *et al* (2005), 如何理解文章第 2444-2445 页 (及表 6) 稳健性检验的做法及其与 Altonji *et al* (2005) 的关系?

附加题 根据这两篇文章提供的识别思路，请你提出一个基于中国情境的研究问题和研究设计。