

## 《高级计量经济学及 Stata 应用》

# 第二版勘误表

2025-02-18

While old errors in the first edition have been corrected, new typos have crept into the second edition. You are encouraged to email [qiang2chen2@126.com](mailto:qiang2chen2@126.com) to report typos, thanks!

- 1、第 4 页，方程(2.5)下面 1 行，“概念密度”应为“概率密度”。
- 2、第 13 页，方程(3.1)下面第 7 行，“ $\beta_k + \gamma x_m$ ”应为“ $\beta_k + \gamma x_{im}$ ”。
- 3、第 15 页，第 7 行，“superplane”应为“hyperplane”。
- 4、第 16 页，方程(3.10)下面 1 行，黑塞矩阵中的第 1 行第 1 列元素“ $\frac{\partial^2 SSR}{\partial^2 \tilde{\beta}_1}$ ”应为“ $\frac{\partial^2 SSR}{\partial \tilde{\beta}_1^2}$ ”，  
而第  $k$  行第  $k$  列元素“ $\frac{\partial^2 SSR}{\partial^2 \tilde{\beta}_k}$ ”应为“ $\frac{\partial^2 SSR}{\partial \tilde{\beta}_k^2}$ ”。
- 5、第 27 页，方程(3.35)中出现三处“ $\mathbf{y}_2$ ”，均应改为“ $\mathbf{y}$ ”（去掉下标）。
- 6、第 27 页，方程(3.35)下面 2 行，“ $\mathbf{M}_1 \mathbf{y}_2$ ”，应改为“ $\mathbf{M}_1 \mathbf{y}$ ”（去掉  $\mathbf{y}_2$  的下标）。
- 7、第 29 页附录中的“ $\lambda$ ”均应为“ $\boldsymbol{\lambda}$ ”（粗体，表示向量）。相应地，“ $\lambda^*$ ”均应为“ $\boldsymbol{\lambda}^*$ ”。
- 8、第 29 页方程(3.45)中的“ $\underbrace{(\mathbf{X}\mathbf{X})^{-1}\mathbf{X}'\mathbf{y}}_{=b}$ ”应为“ $\underbrace{(\mathbf{X}\mathbf{X})^{-1}\mathbf{X}'\mathbf{y}}_{=b}$ ”。
- 9、第 29 页方程(3.45)下面 1 行，“方程(3.38)”应为“方程(3.44)”。
- 10、第 34 页，第 3 个表格上方命令中的“> =”应为“>=”（去掉空格）。本页及下页还有几处类似的排版问题。
- 11、第 43 页，倒数第一行，“lnpl”应为“lnpf”。
- 12、第 44 页，最后一行 Stata 命令的选择项“c(1 -2)”应为“c(1-2)”（去掉空格）或“c(1 2)”（去掉短横）。
- 13、第 51 页，在 5.3 节上方，有三处“ $\chi(1)$ ”均应为“ $\chi^2(1)$ ”。
- 14、第 67 页，公式(6.6)等号左边的“ $L(\theta)$ ”应改为“ $\ln L(\theta)$ ”。
- 15、第 67 页，公式(6.11)第三项“ $\sum_{i=1}^n \frac{\partial \ln L(\boldsymbol{\theta}; \mathbf{y}_i)}{\partial \boldsymbol{\theta} \partial \boldsymbol{\theta}'}$ ”应为“ $\sum_{i=1}^n \frac{\partial \ln f(\boldsymbol{\theta}; \mathbf{y}_i)}{\partial \boldsymbol{\theta} \partial \boldsymbol{\theta}'}$ ”。
- 16、第 79 页，第三段文字的末尾，去掉一个多余的句号。
- 17、第 88 页，倒数第 4 行括号中最后两个字母，“ $x_{i2} x_{i3}$ ”应为“ $x_{i2}x_{i3}$ ”（无空格）。
- 18、第 108 页 8.5 节，第 10 行，“ $x_{t-1}x_{t-2}x_{t-3}x_{t-4}$ ”应为“ $x_{t-1} x_{t-2} x_{t-3} x_{t-4}$ ”（增加空

格)。

- 19、第 111 页，图 8.5 下面第 2 行，“一阶自相关”应为“一阶自相关系数”。
- 20、第 126 页，第 4 行，虚拟变量  $D_1$  的定义中，“非洲”应为“亚洲”。
- 21、第 145 页，倒数第 2 行，“ $\mathbf{z}'\delta$ ”应为“ $\mathbf{z}'_2\delta$ ”。
- 22、第 146 页，方程(10.34)，“ $\mathbf{z}'\delta$ ”应为“ $\mathbf{z}'_2\delta$ ”；“ $E(\mathbf{x}'_1\gamma\varepsilon)$ ”应为“ $E(\mathbf{x}'_1\gamma\varepsilon)+$ ”（补加号）
- 23、第 151 页，倒数第 8 行，“犯罪率（包括七种类型的犯罪）”改为“警察人数”。
- 24、第 155 页，文字第 1 行，“显著性不为 0”应为“显著不为 0”。
- 25、第 171 页，方程(11.12)下面 1 行，应为“其中，“ $p/(1-p)$ ”被称为“几率” (odds)”；  
本页其他地方同步更改。方程(11.13)才是“几率比” (odds ratio)的定义。
- 26、第 174 页，第三个表格上方 1 行，“Probit 模型”应为“Logit 模型”。
- 27、第 178 页，第 2 段第 3 行，原文“且均服从从非对称的”，多了一个“从”字。
- 28、第 187 页，方程(11.39)的第 2 行应为“ $= P(\varepsilon_1 > -\mathbf{x}'_1\beta_1, \varepsilon_2 > -\mathbf{x}'_2\beta_2)$ ”。
- 29、第 225 页，方程(14.5)的左边应为“ $f(y_i | \mathbf{x}_i)$ ”。
- 30、第 235 页，倒数第 2 行的工资方程中，“ $\beta_0$  location”应为“ $\beta_4$  location”。
- 31、第 247 页，第 4 行，“male\_inc（丈夫收入）”应为“male\_edu（丈夫教育年限）”。
- 32、第 255 页，方程(15.17)下面 1 行，“ $\{\bar{\mathbf{x}}_i, \bar{\mathbf{z}}_i\}$ ”应为“ $\{\bar{\mathbf{x}}_i, \mathbf{z}_i\}$ ”。
- 33、第 261 页中间，代码的第二行“reg y x1 x2 x3 i.id,r”应为“reg y x1 x2 x3 i.id,vce(cluster id)”。另外，将此行代码下面的一句话“其中，选择项“r”表示使用聚类稳健标准误，……”提前两行，放在“LSDV 法的 Stata 命令为”之前。
- 34、第 267 页，第一个表格下方 1 行，“ $\sigma_\varepsilon=0.41675665$ ”应为“ $\sigma_\varepsilon=0.15678965$ ”。
- 35、第 280 页，去掉第六行 Stata 命令中“i.state”，否则会导致严格多重共线性（尽管 Stata 会自动去掉多余的个体虚拟变量）。
- 36、第 304 页，方程(17.6)中有两处“ $y_i$ ”应为“ $y_{it}$ ”。
- 37、第 304 页，方程(17.8)最后 1 行，有两处“ $y_i$ ”应为“ $y_{it}$ ”。
- 38、第 340 页，方程(18.9) - (18.11)均漏了个体效应，即应将“ $\varepsilon_{it}$ ”变为“ $u_i + \varepsilon_{it}$ ”。
- 39、第 353 页，方程(19.16)以及下 1 行，“ $s_{\hat{\theta}_i^*}$ ”应为“ $s_{\hat{\theta}^*}$ ”。
- 40、第 354 页，方程(19.17)之后，“ $t \in [\hat{\theta} + t_{1-\alpha/2}^* \times s_{\hat{\theta}}, \hat{\theta} + t_{\alpha/2}^* \times s_{\hat{\theta}}]$ ”应为  
“ $t \in [t_{1-\alpha/2}^*, t_{\alpha/2}^*]$ ”。
- 41、第 376 页，最后一行，“在设定 VAR 模型是”应为“在设定 VAR 模型时”。

42、第 379 页, 方程(20.81)下面 2 行, “ $\varepsilon_{2t} = \varepsilon_{3t} = \dots$ ”应为“ $\varepsilon_{2t}, \varepsilon_{3t}, \dots$ ”; 而“ $y_{2t} = y_{3t} = \dots$ ”应为“ $y_{2t}, y_{3t}, \dots$ ”。

43、第 389 页倒数第 6 行处, “inflation 与 unrate” 改为 “fedfunds 与 unrate”。

44、第 400 页, 倒数第 3 行 “有时明显” 应为 “有明显”。

45、第 403 页, 倒数第 2 行 Stata 命令最后的 if 条件应为 “if q`i'==1” (去掉两个等号之间的空格)。

46、第 404 页, 第 9 行 Stata 命令最后的 if 条件应为 “if q`i'==1” (去掉两个等号之间的空格)。

47、第 411 页, 方程(21.8)应为 
$$\tilde{\Gamma} = \begin{pmatrix} \Gamma_1 & \Gamma_2 & \dots & \Gamma_{p-1} & \Gamma_p \\ \mathbf{I}_n & \mathbf{0} & \dots & \mathbf{0} & \mathbf{0} \\ \mathbf{0} & \mathbf{I}_n & \dots & \mathbf{0} & \mathbf{0} \\ \vdots & \vdots & \ddots & \vdots & \vdots \\ \mathbf{0} & \mathbf{0} & \dots & \mathbf{I}_n & \mathbf{0} \end{pmatrix}_{np \times np}$$

48、第 414 页, 方程(21.13)下面 1 行, “(21.13)” 应为 “(21.12)”。

49、第 423 页, 方程(21.24)下面第 4 行末尾, “费雪式检验与 Hadri LM 检验” 改为 “费雪式检验”。

50、第 424 页, 第 1 行, “在表 21.1 中” 应为 “在表 21.2 中”。

51、第 426 页, 方程(21.30)下面第 3 行, “ $z \equiv \frac{\hat{\rho} - \mu}{\sqrt{\sigma/n}}$ ” 应为 “ $z \equiv \frac{\hat{\rho} - \mu}{\sqrt{\sigma^2/n}}$ ”。

52、第 434-436 页, 方程(21.46)-方程(21.59), 如有出现 “t”, 都应为 “t”。

53、第 435 页, 方程(21.54), “ $\delta$ ” 应为 “ $\delta$ ”。

54、第 436 页, 方程(21.57)中 “ $\Psi$ ” 的字体应与方程(21.58)中的 “ $\Psi$ ” 一样。

55、第 449 页, 方程(22.9), “ $\varepsilon_{t-i}^2$ ” 应为 “ $\varepsilon_{t-i-1}^2$ ”。

56、第 451 页, 第 22.5 节, 第 3 段, “ $y_t = \mathbf{x}_t' \boldsymbol{\beta} + \varepsilon_t$ ” 应为 “ $y_t = \mathbf{x}_t' \boldsymbol{\beta} + \varepsilon_t$ ”。

57、第 460 页, 第 3 行, “predicth” 应为 “predict h” (漏了一个空格)。

58、第 523 页, 方程(27.15)右边, “ $\frac{1}{nh}$ ” 应为 “ $\frac{1}{nh^k}$ ”。

59、第 567 页第 1 行, “宽重复上述估计” 应为 “重复上述估计”。

60、第 492 页, 倒数第 2 行, “mtitles” 应为 “mtitle”; 而 “star(\*0.1 \*\*0.05 \*\*\*0.01)” 应为 “star(\* 0.1 \*\* 0.05 \*\*\* 0.01)” (星号之后加空格)。

61、第 531 页, 方程(27.35), “ $\hat{\boldsymbol{\beta}}$ ” 应为 “ $\hat{\boldsymbol{\beta}}_{PL}$ ”。

62、第 562 页, 方程(28.28)下面第 6-7 行, 有两处 “条件密度” 应改为 “条件期望”。

63、第 563 页, 假定 28.4 往上第 4 行开头, “量  $x$ ” 应为 “量  $D$ ”。

64、第 567 页, 第 1 行, “加入协变量宽” 改为 “加入协变量”。

65、第 576 页, 方程(29.2)往上第 4 行, “车相邻” 应为 “象相邻”。

66、第 585 页, 第 1 行, “矩阵  $A$ ” 改为 “矩阵  $W$ ”。

- 67、第 585 页，方程(29.33)的右边第一项加上求和符号“ $\sum_{r=1}^K$ ”。
- 68、第 594 页，倒数第 11 行，“1970-1974 年”应为“1970-1986 年”。
- 69、第 594 页，倒数第 8 行，“. net install xsmle, all from(<http://www.econometrics.it/stata>)”改为“. net install xsmle, all from(<http://fmwww.bc.edu/RePEc/bocode/x>)”，因为此空间面板命令的下载地址已迁移。
- 70、第 647 页，倒数第 7 行的网址应为“[www.nber.org/data\\_index.html](http://www.nber.org/data_index.html)”。
- 71、第 652 页，漏了一篇参考文献：“Blackburn, M. and D. Neumark, 1992. “Unobserved Ability, Efficiency Wages, and Interindustry Wage Differentials,” *Quarterly Journal of Economics*, 107, 1421-1436.”
- 72、第 656 页，漏了一篇参考文献：“Griliches, Z., 1976. “Wages of Very Young Men,” *Journal of Political Economy*, 84, S69-S85.”
- 73、第 657 页，参考文献[223]的第 2 行，“Stata”应为“State”。
- 74、第 663 页，参考文献[345]，“Eonometrics”应为“Econometrics”。