

《高级计量经济学及 Stata 应用》

第二版勘误表

2023-01-21

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 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“ λ ”均应为“ $\boldsymbol{\lambda}$ ”（粗体，表示向量）。相应地，“ λ^* ”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 51 页，在 5.3 节上方，有三处“ $\chi(1)$ ”均应为“ $\chi^2(1)$ ”。
- 13、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“ $\sum_{i=1}^n \frac{\partial \ln f(\boldsymbol{\theta}; \mathbf{y}_i)}{\partial \boldsymbol{\theta} \partial \boldsymbol{\theta}'}$ ”。
- 14、第 79 页，第三段文字的末尾，去掉一个多余的句号。
- 15、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）。
- 16、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）。
- 17、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”。
- 18、第 126 页，第 4 行，虚拟变量 D_1 的定义中，“非洲”应为“亚洲”。

- 19、第 145 页，倒数第 2 行，“ $\mathbf{z}'\delta$ ”应为“ $\mathbf{z}'_2\delta$ ”。
- 20、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）
- 21、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](#)”。
- 22、第 155 页，文字第 1 行，“[显著性不为 0](#)”应为“[显著不为 0](#)”。
- 23、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。
- 24、第 174 页，第三个表格上方 1 行，“[Probit 模型](#)”应为“[Logit 模型](#)”。
- 25、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。
- 26、第 187 页，方程(11.39)的第 2 行应为“ $= P(\varepsilon_1 > -\mathbf{x}'_1\beta_1, \varepsilon_2 > -\mathbf{x}'_2\beta_2)$ ”。
- 27、第 225 页，方程(14.5)的左边应为“ $f(y_i | \mathbf{x}_i)$ ”。
- 28、第 235 页，倒数第 2 行的工资方程中，“ β_0 location”应为“ β_4 location”。
- 29、第 247 页，第 4 行，“[male_inc（丈夫收入）](#)”应为“[male_edu（丈夫教育年限）](#)”。
- 30、第 255 页，方程(15.17)下面 1 行，“ $\{\bar{\mathbf{x}}_i, \bar{z}_i\}$ ”应为“ $\{\bar{\mathbf{x}}_i, \bar{z}_i\}$ ”。
- 31、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。
- 32、第 267 页，第一个表格下方 1 行，“ $\sigma_\varepsilon=0.41675665$ ”应为“ $\sigma_\varepsilon=0.15678965$ ”。
- 33、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）。
- 34、第 304 页，方程(17.6)中有两处“ y_i ”应为“ y_{it} ”。
- 35、第 304 页，方程(17.8)最后 1 行，有两处“ y_i ”应为“ y_{it} ”。
- 36、第 340 页，方程(18.9) - (18.11)均漏了个体效应，即应将“ ε_{it} ”变为“ $u_i + \varepsilon_{it}$ ”。
- 37、第 353 页，方程(19.16)以及下 1 行，“ $s_{\hat{\theta}_i}$ ”应为“ $s_{\hat{\theta}^*}$ ”。
- 38、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
“ $t \in [t_{1-\alpha/2}^*, t_{\alpha/2}^*]$ ”。
- 39、第 376 页，最后一行，“在设定 VAR 模型是”应为“在设定 VAR 模型时”。
- 40、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 ”。

- 41、第 389 页倒数第 6 行处，“inflation 与 unrata”改为“fedfunds 与 unrata”。
- 42、第 400 页，倒数第 3 行“有时明显”应为“有明显”。
- 43、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）。
- 44、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）。

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

- 46、第 414 页，方程(21.13)下面 1 行，“(21.13)”应为“(21.12)”。
- 47、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”。
- 48、第 424 页，第 1 行，“在表 21.1 中”应为“在表 21.2 中”。
- 49、第 426 页，方程(21.30)下面第 3 行，“ $z \equiv \frac{\hat{\rho} - \mu}{\sqrt{\sigma/n}}$ ”应为“ $z \equiv \frac{\hat{\rho} - \mu}{\sqrt{\sigma^2/n}}$ ”。
- 50、第 434-436 页，方程(21.46)-方程(21.59)，如有出现“t”，都应为“t”。
- 51、第 435 页，方程(21.54)，“ δ ”应为“ δ ”。
- 52、第 436 页，方程(21.57)中“ Ψ ”的字体应与方程(21.58)中的“ Ψ ”一样。
- 53、第 449 页，方程(22.9)，“ ε_{t-i}^2 ”应为“ ε_{t-i-1}^2 ”。
- 54、第 451 页，第 22.5 节，第 3 段，“ $y_t = \mathbf{x}_t^1 \boldsymbol{\beta} + \varepsilon_t$ ”应为“ $y_t = \mathbf{x}_t' \boldsymbol{\beta} + \varepsilon_t$ ”。
- 55、第 460 页，第 3 行，“predicth”应为“predict h”（漏了一个空格）。
- 56、第 523 页，方程(27.15)右边，“ $\frac{1}{nh}$ ”应为“ $\frac{1}{nh^k}$ ”。
- 57、第 567 页第 1 行，“宽重复上述估计”应为“重复上述估计”。
- 58、第 492 页，倒数第 2 行，“mtitles”应为“mtitle”；而“star(*0.1 **0.5 ***0.01)”应为“star(* 0.1 ** 0.5 *** 0.01)”（星号之后加空格）。
- 59、第 531 页，方程(27.35)，“ $\hat{\boldsymbol{\beta}}$ ”应为“ $\hat{\boldsymbol{\beta}}_{PL}$ ”。
- 60、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”。
- 61、第 563 页，假定 28.4 往上第 4 行开头，“量 x”应为“量 D”。
- 62、第 567 页，第 1 行，“加入协变量宽”改为“加入协变量”。
- 63、第 576 页，方程(29.2)往上第 4 行，“车相邻”应为“象相邻”。
- 64、第 585 页，第 1 行，“矩阵 A”改为“矩阵 W”。

65、第 585 页，方程(29.33)的右边第一项加上求和符号“ $\sum_{r=1}^K$ ”。

- 66、第 594 页，倒数第 11 行，“1970-1974 年”应为“1970-1986 年”。
- 67、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。

- 68、第 647 页，倒数第 7 行的网址应为 “www.nber.org/data_index.html”。
- 69、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.”
- 70、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.”
- 71、第 657 页，参考文献[223]的第 2 行，“Stata” 应为 “State”。
- 72、第 663 页，参考文献[345]，“Eonometrics” 应为 “Econometrics”。