

《计量经济学及 Stata 应用》

勘误表

2022-10-12

You are encouraged to email qiang2chen2@126.com to report typos, thanks!

- 1、第 25 页，方程(3.6)最右边的式子应为：
$$\lim_{\Delta x_1 \rightarrow 0} \frac{f(x_1 + \Delta x_1, x_2, \dots, x_n) - f(x_1, x_2, \dots, x_n)}{\Delta x_1}$$
- 2、第 30 页，方程(3.21)中的“ a_{21} ”应为“ a_{2n} ”。
- 3、第 41 页中间，即使 \mathbf{A} 不是对称矩阵，“ $\mathbf{A} \text{Var}(\mathbf{X}) \mathbf{A}'$ ”也称为“夹心估计量”。
- 4、第 45 页，图 3.19 的标题改为“对比无条件密度与 $s = 16$ 的条件密度”。
- 5、第 48 页，第 2 行最后，“条件概率密度”应为“边缘概率密度”。
- 6、第 56 页，习题 3.6，“ $P(Y = 0) = p$ ”应为“ $P(Y = 0) = 1 - p$ ”。
- 7、第 60 页，4.2 节第 3 行，方程“ $y_i = \hat{\alpha} + \hat{\beta}x_i$ ”应为“ $\hat{y}_i = \hat{\alpha} + \hat{\beta}x_i$ ”。
- 8、第 63 页，第 1 行，方程(4.16)中的第 1 个“ y ”应为“ y_i ”。
- 9、第 64 页，方程(4.27)中间的“ $\sum_{i=1}^n e_i$ ”改为“ $\bar{y} \sum_{i=1}^n e_i$ ”。
- 10、第 70 页，中间命令部分，“gen x = rnormal(3,4)”应为“gen x = rnormal(3,2)”; 而“gen e = rnormal(0,9)”应为“gen e = rnormal(0,3)”。后续的回归结果与解释也需相应调整。
- 11、第 73 页，方程(4.45)下面一行，相关系数的定义式应为
$$\text{Corr}(y_i, \hat{y}_i) = \frac{\sum_{i=1}^n (y_i - \bar{y})(\hat{y}_i - \bar{\hat{y}})}{\sqrt{\sum_{i=1}^n (y_i - \bar{y})^2} \sqrt{\sum_{i=1}^n (\hat{y}_i - \bar{\hat{y}})^2}}$$
”。
- 12、第 100 页，倒数第 5 行，“身在南方”应改为“身在北方”。
- 13、第 112 页，第 3-4 行有三处“ $\chi(1)$ ”，都应改为“ $\chi^2(1)$ ”。
- 14、第 120 页，方程(6.22)中的“ $y_i - y$ ”改为“ $y_i - \bar{y}$ ”。
- 15、第 123 页，方程(6.28)下面第 1 行“大样本”应为“小样本”。
- 16、第 124 页，方程(6.35)中的“ $SE^*(b_k)$ ”改为“ $SE^*(\hat{\beta}_k)$ ”。

- 17、 第 146 页，习题 7.3 第(3)、(4)、(7)、(8)小题中的“5%的置信度”（共出现 4 次）均应改为“5%的显著性水平”。
- 18、 第 159 页，第 6 行中的“bgodfrey”应为“bgodfrey”（字母 o 加下划线）。
- 19、 第 174 页，在第 2 行的回归命令中去掉变量“iq”。
- 20、 第 179 页，方程(9.21)上面 2 行与下面 2 行的“ $\hat{\beta} - \hat{\beta}^{(i)}$ ”（共出现 2 次）应为“ $\hat{\beta} - \hat{\beta}^{(i)}$ ”。
- 21、 第 183 页倒数第 2 行，Stata 命令应为“reg y x1 x2 prov2-prov30”。
- 22、 第 201 页，方程(10.31)中有一处“ $\hat{\beta}_{IV} - \beta_{OLS}$ ”应为“ $\hat{\beta}_{IV} - \hat{\beta}_{OLS}$ ”。
- 23、 第 202 页，倒数第 5 行，“犯罪率（包括七种类型的犯罪）”改为“警察人数”。
- 24、 第 204 页，最后一行的 Stata 命令中，“smsa(iq = med kww)”应为“smsa (iq = med kww)”，即在“smsa”之后增加一个空格。
- 25、 第 213 页方程(11.5)下面 2 行，“原点对称”应为“纵轴对称”。
- 26、 第 213 页脚注中的选择项“yttitle(概率密度)”应为“yttitle(累积分布函数)”，而图 11.2 的纵坐标相应地改为“累积分布函数”。
- 27、 第 217 页，方程(11.19)下面 1 行，“几率比 (odds ratio)”应为“几率 (odds)”。在第 218 页的多处，应做类似改动。总结如下：

$$\text{几率 (odds): } \frac{p}{1-p} \quad (\text{方程 11.19})$$

$$\text{对数几率 (log-odds): } \ln\left(\frac{p}{1-p}\right) \quad (\text{方程 11.20})$$

$$\text{几率比 (odds ratio): } \frac{\frac{p^*}{1-p^*}}{\frac{p}{1-p}} \quad (\text{方程 11.21})$$

- 28、 第 239 页，方程(12.21)下面 1 行，“ $\{\bar{x}_i, \bar{z}_i\}$ ”应为“ $\{\bar{x}_i, z_i\}$ ”。
- 29、 第 241 页，倒数第 2 行，“种植业劳动力”应为“种植业劳动力对数”。
- 30、 第 241 页，倒数第 1 行，“农村消费者价格”之前，应加“，”（逗号）。
- 31、 第 260 页，表格第(4)列所汇报的结果有误，应与第 247 页的回归结果保持一致。
- 32、 第 275 页，第 2 个 Stata 命令中的“dln y”应为“dlny”（去掉空格）。
- 33、 第 278 页，倒数第 8 行，“Var(p-1)”应为“VAR(p-1)”。
- 34、 第 287 页，第 3 行“10 个季度”应为“13 个季度”。
- 35、 第 288 页，文字部分第 1 行“10 个季度”应为“13 个季度”，而第 3 行命令中的选择项“step(10)”应为“step(13)”。
- 36、 第 290 页，最后 1 行 Stata 命令中的两处“ln y”均应为“lny”（去掉空格）。
- 37、 第 307 页，倒数第 3 行改为“其中，变量 lrgnp 的取值始于 1909 年，而变量 lun 的取值始于年 1890”。