

《计量经济学及 Stata 应用》

勘误表

2020-11-11

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 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”。

3、第 56 页，习题 3.6，“ $P(Y = 0) = p$ ”应为“ $P(Y = 0) = 1 - p$ ”。

4、第 60 页，4.2 节第 3 行，方程“ $y_i = \hat{\alpha} + \hat{\beta}x_i$ ”应为“ $\hat{y}_i = \hat{\alpha} + \hat{\beta}x_i$ ”。

5、第 64 页，方程(4.27)中间的“ $\sum_{i=1}^n e_i$ ”改为“ $\bar{y} \sum_{i=1}^n e_i$ ”。

6、第 70 页，中间命令部分，“gen x = rnormal(3, 4)”应为“gen x = rnormal(3, 2)”; 而“gene = rnormal(0, 9)”应为“gen x = rnormal(0, 3)”。后续的回归结果与解释也需相应调整。

7、第 73 页，方程(4.45)下面一行，相关系数的定义式应为

$$\text{“Corr}(y_i, \hat{y}_i) \equiv \frac{\sum_{i=1}^n (y_i - \bar{y})(\hat{y}_i - \bar{\hat{y}})}{\sqrt{\sum_{i=1}^n (y_i - \bar{y})^2} \sqrt{\sum_{i=1}^n (\hat{y}_i - \bar{\hat{y}})^2}} \text{”}。$$

8、第 112 页，第 3-4 行有三处“ $\chi(1)$ ”，都应改为“ $\chi^2(1)$ ”。

9、第 120 页，方程(6.22)中的“ $y_i - y$ ”改为“ $y_i - \bar{y}$ ”。

10、第 123 页，方程(6.28)下面第 1 行“大样本”应为“小样本”。

11、第 124 页，方程(6.35)中的“ $SE^*(b_k)$ ”改为“ $SE^*(\hat{\beta}_k)$ ”。

12、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”。

13、第 174 页，在第 2 行的回归命令中去掉变量“iq”。

14、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“ $\hat{\beta} - \hat{\beta}^{(i)}$ ”。

15、第 183 页倒数第 2 行，Stata 命令应为“reg y x1 x2 prov2-prov30”。

16、第 201 页，方程(10.31)中有一处“ $\hat{\beta}_{IV} - \beta_{OLS}$ ”应为“ $\hat{\beta}_{IV} - \hat{\beta}_{OLS}$ ”。

- 17、 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”。
- 18、 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。
- 19、 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”。
- 20、 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：

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

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

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

- 21、 第 239 页，方程(12.21)下面 1 行，“ $\{\bar{\mathbf{x}}_i, \bar{\mathbf{z}}_i\}$ ”应为“ $\{\bar{\mathbf{x}}_i, \mathbf{z}_i\}$ ”。
- 22、 第 241 页，倒数第 2 行，“种植业劳动力”应为“种植业劳动力对数”。
- 23、 第 275 页，第 2 个 Stata 命令中的“`dln y`”应为“`dlny`”（去掉空格）。
- 24、 第 287 页，第 3 行“10 个季度”应为“13 个季度”。
- 25、 第 290 页，最后 1 行 Stata 命令中的两处“`ln y`”均应为“`lny`”（去掉空格）。
- 26、 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”。