

『入門 実践する計量経済学』第1刷の誤り

1. P32

$$\sum_{i=1}^n \tilde{u}_i^2 = \sum_{i=1}^n (Y_i - (\tilde{\alpha} + \tilde{\beta}X_i))^2 = \sum_{i=1}^n (Y_i - \tilde{\alpha}_i - \tilde{\beta}X_i)^2$$

→

$$\sum_{i=1}^n \tilde{u}_i^2 = \sum_{i=1}^n (Y_i - (\tilde{\alpha} + \tilde{\beta}X_i))^2 = \sum_{i=1}^n (Y_i - \tilde{\alpha} - \tilde{\beta}X_i)^2$$

*数式のタイポです。 $\tilde{\alpha}_i$ ではなく、 $\tilde{\alpha}$ となります。

2. P204(9.1節の最後)

仮定4 (誤差項の均一分散以外は全て成立しているとします。

→仮定4 (誤差項の均一分散) 以外は全て成立しているとします。

3. P210、索引 P399、P401

実行可能な最小最小2乗法 → 実行可能な最小2乗法

4. P222

OLS推定量の分散が、通常の標準誤差 $\sigma^2 / \sum_{t=1}^T (X_t - \bar{X})^2$ と異なるのは明らかでしょう。

→不均一分散と系列相関に対して頑健なOLS推定量の分散が、通常のOLS推定量の分散 $\sigma^2 / \sum_{t=1}^T (X_t - \bar{X})^2$ と異なるのは明らかでしょう。

5. P266

最尤法によってパラメータを推定し、予測値 $\hat{P}\{Y_i = 1\} = \hat{\alpha}_{ML} + \hat{\beta}_{ML}X_i$ を計算します。

→最尤法によってパラメータを推定し、予測値 $\hat{P}\{Y_i = 1\} = F(\hat{\alpha}_{ML} + \hat{\beta}_{ML}X_i)$ を計算します。

6. P292

GDP(対数)に対して、 $1.148 (= 0.522 \times (7.8 - 5.6))$ 倍の違いをもたらします。GDPの対数で1.148倍は、GDPだと3.15倍($= e^{1.148}$)の違いになります。

→GDP(対数)に対して、 $1.148 (= 0.522 \times (7.8 - 5.6))$ の差をもたらします。GDPの対数で1.148の差は、GDPだと3.15倍($= e^{1.148}$)の違いになります。

7. P328

操作変数は割合変数Wが閾値c以上なら1となるダミー変数とする。

→操作変数は割当変数Wが閾値c以上なら1となるダミー変数とする。