**《计量经济学：非参数估计及Gauss应用》**

**勘误表**

1. P14 表1.1订正为：

表1.1 二元选择模型的probit估计结果(n=200)

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| 扰动项分布 | 设计1：N(0,1) | 设计2：对数正态 | 设计3：Weibull | 设计4：t(3) |
| 真实值 | 估计值 | t值 | 估计值 | t值 | 估计值 | t值 | 估计值 | t值 |
|  | 1.118  | 3.413  | 1.391  | 3.137  | 2.660  | 2.966  | 0.816  | 3.568  |
|   | 1.056  | 5.854  | 1.453  | 5.060  | 4.269  | 4.998  | 0.685  | 4.827  |
|   | 2.290  | 6.117  | 3.356  | 5.075  | 7.724  | 4.313  | 1.731  | 9.406  |
|   | 0.820  | 2.702  | 1.162  | 3.044  | 2.616  | 4.015  | 0.872  | 2.909  |
| 似然函数值 |

|  |
| --- |
| -50.432 |

 | -39.031 | -22.32 | -60.73 |
| LR\_Chi2 (p值) | 107.3(0.00) | 151.2(0.00) | 163.6(0.00) | 89.3(0.00) |
| Pseudo R2 | 0.738 | 0.866 | 0.974 | 0.629 |

**注：**此结果是一次随机抽样样本的Probit估计，其中LR\_Chi2是原假设“解释变量x1,x2和x3系数均等于零”的似然比检验统计量的值，括号中的p值是检验此原假设的概率值；Pseudo R2是伪拟合优度; 参数估计的t值是参数估计值除以其标准误。

另外，在表1.1之后，增加表1.1（续）（n=800时的结果）如下：

表1.1（续） 二元选择模型的probit估计结果(n=800)

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| 扰动项分布 | 设计1：N(0,1) | 设计2：对数正态 | 设计3：Weibull | 设计4：t(3) |
| 真实值 | 估计值 | t值 | 估计值 | t值 | 估计值 | t值 | 估计值 | t值 |
|  | 0.991  | 8.014  | 1.690  | 8.070  | 2.071  | 7.858  | 1.144  | 9.663  |
|   | 1.073  | 11.553  | 1.648  | 14.151  | 2.403  | 11.105  | 1.015  | 13.226  |
|   | 1.992  | 11.452  | 3.420  | 13.679  | 4.570  | 11.155  | 2.094  | 13.460  |
|   | 0.539  | 3.990  | 0.687  | 4.300  | 1.128  | 5.143  | 0.291  | 2.194  |
| 似然函数值 |

|  |
| --- |
| -232.44 |

 | -155.771 | -119.94 | -233.68 |
| LR\_Chi2 (p值) | 395.5(0.00) | 601.1(0.00) | 664.2(0.00) | 405.0(0.00) |
| Pseudo R2 | 0.717 | 0.871 | 0.925 | 0.711 |

1. P17第14行“和”改为：和
2. P21倒第7行“大数定理”改为：大数定律。
3. P29第13行的第一个双重和改为
4. P36第15行的“＝1”改为“＝0”。
5. P46第12行“”改为“”。
6. P46第16行“90%、95%和99%”改为“10%、5%和1%”。
7. P66倒第8行“”应为“”。
8. P67图3-3第中的“”应为“”。
9. P68图3-6中的“”应为“”。
10. P95图4-6中，“beat0”均为“beta0”, “beat1”均为“beta1”。
11. P101倒11行中的“”应为“”。
12. P103倒7行中的“”应为“”。
13. P109第13行中的“(4.15)”应为“(4.16)”，第14行中的“”应为“”。