

Замеченные неточности и опечатки Версия 7 января 2020 года

Ошибки в оглавлении: глава 9. Панельные данные начинается на 276 странице, а не на 262. Задания для подготовки к главе 3 — стр. 94, а не 23.

Лена Леденёва, спасибо!

Стр. 72. Четвертый абзац снизу. Вместо "Таким образом, ковариационная матрица вектора оценок коэффициентов имеет вид" должно быть написано: "Таким образом, ковариационная матрица вектора случайных ошибок имеет вид"

Никита Фокин, спасибо!

Стр. 82. п. (б) В длинной последовательности равенств для вычисления t-расч. крышки должны стоять над "бетами" везде, а не только в последней строчке
Спасибо Ксении Мурыгиной!

Стр. 89, 217, 333, 337, 471. Вместо "Kreuger" везде должно быть написано Krueger. Надеюсь, Алан Крюгер простит меня за эту неточность.

Лена Леденёва, спасибо!

Стр. 113. На рис. 4.2 на вертикальной оси вместо "бета 2" следует написать "бета 1".
Мохаммад Ахмад, спасибо!

Стр. 140. В условии задания 9 корреляция должна быть равна не 0,04, а 0,4 (иначе условие не соответствует решению в конце книги).

Артём Гришанов, спасибо!

Стр. 192. В четвертом абзаце вместо "Последняя из формул дает подсказку, как можно получить состоятельную оценку дисперсии случайной ошибки" должно быть написано: "Последняя из формул дает подсказку, как можно получить состоятельную оценку дисперсии оценки коэффициента".

Лена Леденёва, спасибо!

Стр. 226. Вместо ссылки [Stock, Watson, 2010] следует указать [Сток, Ватсон, 2015].

Стр. 228: В последнем абзаце вместо "Постройте уравнение зависимости цены колготок от их плотности, состава и производителя" должно быть написано: "Постройте уравнение зависимости цены колготок от их плотности и состава".

Стр. 229: таблицу вверху страницы нужно заменить вот на эту (так как в старой таблице, вопреки условию, используются неробастные стандартные ошибки):

Модель 1: МНК, использованы наблюдения 1–74

Зависимая переменная: Price

Робастные оценки стандартных ошибок (с поправкой на гетероскедастичность), вариант HC1

	Коэффициент	Ст. ошибка	t-статистика	P-значение	
const	-4644,35	55368,3	-0,08388	0,9334	
DEN	176,448	44,1866	3,993	0,0002	***
polyamid	103,653	559,096	0,1854	0,8535	

lykra	391,328	493,780	0,7925	0,4308
cotton	156,537	538,444	0,2907	0,7722
wool	476,064	1080,10	0,4408	0,6608
Сумма кв. остатков	2,16e+09	Ст. ошибка модели		5641,841
R-квадрат	0,490681	Испр. R-квадрат		0,453231
F(5, 68)	82,01416	P-значение (F)		2,01e-27

Стр. 229: В решении пункта (в) представлены результаты теста Чоу для модели, неробастной к гетероскедастичности. Поэтому его лучше заменить вот таким (гораздо более лаконичным) решением:

Решение.

Для осуществления теста Чоу нужно оценить новую модель, добавив в неё соответствующую переменную сдвига и все необходимые переменные наклона, как это показано в главе про фиктивные переменные. В данном случае р-значение робастного к гетероскедастичности теста Чоу меньше, чем 0,05. Следовательно, мы отвергаем гипотезу об однородности выборки и делаем вывод о наличии структурного сдвига.

Спасибо Станиславу Голеву за внимательность!

Стр. 264. в таблице 8.3 вместо «firat stage» должно быть написано «first stage»

Стр.293. В списке предпосылок модели со случайными эффектами последняя формула является отдельной (шестой) предпосылкой. Так что перед ней следует поставить цифру **6** и **точку**.

Лена Леденёва, спасибо!

Стр. 296. Во втором абзаце вместо « t на t » должно быть написано « T на T »
Неточность заметили Ксения Мурыгина и Никита Либобахин

Стр. 308. В первой строчке последнего абзаца все игреки должны быть строчными.

Стр. 323. Последний абзац. В третье строчке лучше заменить «вождение автомобилем» на «управление автомобилем»; в седьмой строчке лучше заменить «опыт вождения автомобилем» на «опыт управления автомобилем».

Стр. 333. Вместо [Card, Kreuger, 1994] должно быть [Card, Kreuger, 2000].

Стр. 361. Вместо [Айвазян, Фантаццини, 2014] должно быть [Айвазян, Фантаццини, 2015].

Стр. 368-370. Везде в формулах вместо значков фунта должен стоять знак суммы.

Стр. 409. Во второй и третьей строчке нужно добавить корни из «икс» (см. выделенные красным цветом правки. Должно быть вот так:

$$= \frac{1}{(\sum z_i^2)^2} E \left(\sum z_i^2 * u_i^2 + \sum_{i \neq j} z_i * z_j * \frac{\varepsilon_i}{\sqrt{x_i}} * \frac{\varepsilon_j}{\sqrt{x_j}} \right) =$$

$$= \frac{\sum z_i^2 * E(u_i^2)}{(\sum z_i^2)^2} + \frac{\sum_{i \neq j} \frac{z_i}{\sqrt{x_i}} * \frac{z_j}{\sqrt{x_j}} * E(\varepsilon_i \varepsilon_j)}{(\sum z_i^2)^2} = \{E(\varepsilon_i \varepsilon_j) = 0\} =$$

Лена Леденёва, спасибо!

Стр. 409. В последней дроби в знаменателе вместо "МНК" должно быть написано "ВМНК"

Стр. 409. В третьей строчке **снизу** над самой последней бетой не должно стоять крышки. Правильно вот так: $E(\hat{\beta}_{\text{ВМНК}} - \beta)^2$

Стр. 413. В пункте (в) во второй дисперсии вместо "МНК" должно быть написано "ВМНК". В том же самом пункте в большой дроби в знаменателе вместо "МНК" должно быть написано "ВМНК"

Михаил Бида, спасибо!

Стр. 419, пункт (в). Вместо «на которую завышена МНК-оценка» должно быть «на которую занижена МНК-оценка»

Михаил Бесценный, спасибо!

Стр. 423 в третьей строчке вместо ковариации икс и у должна стоять ковариация икс и эпсилон.

Оксана Кузнецова, спасибо!

Стр. 425 внизу страницы слова «авторы работы» должны быть написаны шрифтом такого же размера, как и прочий текст.

Лена Леденёва, спасибо!

Стр. 433. Примечания к таблице: "В модели (г) инструмент для ED76 — переменная NEARC4". Должно быть "В модели (в)..."

Лена Леденёва, спасибо!

Стр. 471. Следует добавить в список литературы следующие позиции:

Davidson Russell and MacKinnon James G. (2004). *Econometric Theory and Methods*. Oxford University Press

MacKinnon, James G. and Halbert White (1985). Some heteroskedasticity- consistent covariance matrix estimators with improved finite sample properties. *Journal of Econometrics*, 29, 305-325.

Stock, J., & Yogo, M. (2005). Testing for Weak Instruments in Linear IV Regression. In D. Andrews & J. Stock (Eds.), *Identification and Inference for Econometric Models: Essays in Honor of Thomas Rothenberg* (pp. 80-108). Cambridge: Cambridge University Press.

Лена Леденёва, спасибо!