

П. К. Катышев, Я. Р. Магнус, А. А. Пересецкий, С. В. Головань
«Сборник задач к начальному курсу эконометрики»

Список замеченных опечаток

В этом списке содержатся опечатки, замеченные в 4-м издании (2007 г.).

стр. 31, 14-я строка сверху: $= \sigma^2 \left(\frac{\theta^2}{\sum_I X_t^2 - \frac{1}{n_I} \sum_I X_t} + \frac{(1-\theta)^2}{\sum_{II} X_t^2 - \frac{1}{n_{II}} \sum_I X_t} \right)$ следует

читать как $= \sigma^2 \left(\frac{\theta^2}{\sum_I X_t^2 - \frac{1}{n_I} (\sum_I X_t)^2} + \frac{(1-\theta)^2}{\sum_{II} X_t^2 - \frac{1}{n_{II}} (\sum_{II} X_t)^2} \right)$.

стр. 32, 2-я строка снизу: $\sum X_t^2 \leq \sum X_t^2 - n\bar{X}^2$ следует читать как $\sum X_t^2 \geq \sum X_t^2 - n\bar{X}^2$.

стр. 77, 11-я строка снизу: $n < 6$ следует читать как $n \leq 6$.

стр. 77, 9-я строка снизу: $n < 6$ следует читать как $n \leq 6$.

стр. 150, 2-я строка снизу: $s_{c_1}^2 = s_{b_1}^2 + \alpha^2 s_{b_2}^2 + 2\alpha$, $\widehat{\text{Cov}}(b_1, b_2) = 0.25$ следует читать как $s_{c_1}^2 = s_{b_1}^2 + \alpha^2 s_{b_2}^2 + 2\alpha \widehat{\text{Cov}}(b_1, b_2) = 0.25$.

стр. 158, 10-я строка снизу: $g(\beta_{\text{ML}}) = \min g(\beta)$ следует читать как $g(\widehat{\beta}_{\text{ML}}) = \min g(\beta)$.

стр. 227, 10-я строка сверху: $\widehat{\beta} = \frac{\sum_{t=1}^n x_t y_t - n\bar{x}\bar{y}}{\sum_{t=1}^n x_t^2 - n\bar{x}^2}$ следует читать как

$$\widehat{\beta} = \frac{\sum_{t=1}^n x_t y_t - n\bar{x}\bar{y}}{\sum_{t=1}^n x_t^2 - n\bar{x}^2}.$$

стр. 227, 2-я строка снизу: $\delta = \sigma^2 \left(1 + \frac{1}{n} + \frac{(x_s - \bar{x})^2}{\sum (x_t - \bar{x})^2} \right)$ следует читать как

$$\delta^2 = \widehat{\sigma}^2 \left(1 + \frac{1}{n} + \frac{(x_s - \bar{x})^2}{\sum (x_t - \bar{x})^2} \right).$$

стр. 235, 4-я строка снизу: $\frac{\text{Cov}(z^* + v, y^* + u)}{V(z + v)} = \frac{\text{Cov}(z^* + v, \beta_1 + \beta_2 z_t^* + u)}{V(z + v)}$ следует

читать как $\frac{\text{Cov}(z^* + v, y^* + u)}{V(z^* + v)} = \frac{\text{Cov}(z^* + v, \beta_1 + \beta_2 z^* + u)}{V(z^* + v)}$.

стр. 258, 8-я строка снизу: из гл. 16 учебника следует читать как из гл. 10 учебника.

стр. 262, 12-я строка снизу: $\sigma_1^2 = \sigma_2^2 = \sigma$ следует читать как $\sigma_1^2 = \sigma_2^2 = \sigma^2$.

стр. 263, 9-я строка снизу:

$$= -2\frac{n}{2} \ln 2\pi - 2\frac{n}{2} \ln \widetilde{\sigma}^2 - 2\frac{n}{2} + 2\frac{n}{2} \ln 2\pi + 2\frac{n_1}{2} \ln \widehat{\sigma}_1^2 + 2\frac{n_2}{2} \ln \widehat{\sigma}_2^2 + 2\frac{n}{2}$$

$$= 2\frac{n}{2} \ln 2\pi + 2\frac{n}{2} \ln \widetilde{\sigma}^2 + 2\frac{n}{2} - 2\frac{n}{2} \ln 2\pi - 2\frac{n_1}{2} \ln \widehat{\sigma}_1^2 - 2\frac{n_2}{2} \ln \widehat{\sigma}_2^2 - 2\frac{n}{2}.$$

стр. 263, 8-я строка снизу: $= -n \ln \widetilde{\sigma}^2 + n_1 \ln \widehat{\sigma}_1^2 + n_2 \ln \widehat{\sigma}_2^2$ следует читать как $= n \ln \widetilde{\sigma}^2 - n_1 \ln \widehat{\sigma}_1^2 - n_2 \ln \widehat{\sigma}_2^2$.

стр. 264, 4-я строка сверху: $\text{LR} = -n \ln \widetilde{\sigma}^2 + n_1 \ln \widehat{\sigma}_1^2 + \dots + n_2 \ln \widehat{\sigma}_2^2$ следует читать как $\text{LR} = n \ln \widetilde{\sigma}^2 - n_1 \ln \widehat{\sigma}_1^2 - \dots - n_r \ln \widehat{\sigma}_r^2$.

стр. 265, 10-я строка сверху: $n^2 \frac{(\hat{p} - p_0)^2}{p_0(1 - p_0)} \frac{p_0(1 - p_0)}{n}$ следует читать как $n^2 \frac{(\hat{p} - p_0)^2}{(p_0(1 - p_0))^2} \frac{p_0(1 - p_0)}{n}$.

стр. 265, 12-я строка сверху: статистики W следует читать как статистики LM.

стр. 265, 12-я строка снизу: $(1 - 0.42) \ln 1 - 0.421 - 0.5$ следует читать как $(1 - 0.42) \ln \frac{1 - 0.42}{1 - 0.5}$.

стр. 265, 11-я строка снизу: статистики W следует читать как статистики LR.

стр. 266, 13-я строка сверху: $\frac{\partial l}{\partial p}$ следует читать как $\frac{\partial l}{\partial \lambda}$.

стр. 266, 10-я строка снизу: $I_n(p) = -E \left(\frac{\partial^2 l}{\partial p^2} \right)$ следует читать как $I_n(\lambda) = -E \left(\frac{\partial^2 l}{\partial \lambda^2} \right)$.

стр. 267, 2-я строка сверху: $I_n^{-1}(p_0)$ следует читать как $I_n^{-1}(\lambda_0)$.

стр. 267, 4-я строка сверху: статистики W следует читать как статистики LM.

стр. 267, 8-я строка сверху: $= -2((n\bar{x} \ln \lambda_0 - n\lambda_0) - (n\bar{x} \ln \lambda_0 - n\lambda_0))$ следует читать как $= -2((n\bar{x} \ln \lambda_0 - n\lambda_0) - (n\bar{x} \ln \hat{\lambda} - n\hat{\lambda}))$.

стр. 267, 11-я строка сверху: статистики W следует читать как статистики LR.

стр. 323, 5-я строка сверху:

$$l = \sum_{y_t = \alpha_1} \ln F(\alpha_1 - \mathbf{x}'_t \boldsymbol{\beta}) \sum_{\alpha_1 < y_t < \alpha_2} \ln f(y_t - \mathbf{x}'_t \boldsymbol{\beta}) \sum_{y_t = \alpha_2} \ln(1 - F(\alpha_2 - \mathbf{x}'_t \boldsymbol{\beta})) \text{ следует читать как}$$

$$l = \sum_{y_t = \alpha_1} \ln F(\alpha_1 - \mathbf{x}'_t \boldsymbol{\beta}) + \sum_{\alpha_1 < y_t < \alpha_2} \ln f(y_t - \mathbf{x}'_t \boldsymbol{\beta}) + \sum_{y_t = \alpha_2} \ln(1 - F(\alpha_2 - \mathbf{x}'_t \boldsymbol{\beta})).$$

стр. 361, 12-я строка снизу: при условии $(1 - \mathbf{w}'\boldsymbol{\nu})R^f + \mathbf{w}'\mathbf{m} = \mu$ следует читать как при условии $(1 - \mathbf{w}'\boldsymbol{\nu})R^f + \mathbf{w}'\mathbf{m} = \mu$.

стр. 361, 6-я строка снизу: $\mu = (1 - \mathbf{w}'\boldsymbol{\nu})R^f + \mathbf{w}'\mathbf{m}$ следует читать как $\mu = (1 - \mathbf{w}'\boldsymbol{\nu})R^f + \mathbf{w}'\mathbf{m}$.