

# 『計量経済学』 NLAS

西山慶彦・新谷元嗣・川口大司・奥井亮 [著]

## 正誤表

発行所 株式会社有斐閣

2019年7月30日 初版第1刷発行

ISBN 978-4-641-05385-4

©2019, Yoshihiko Nishiyama, Mototsugu Shintani, Daiji Kawaguchi, Ryo Okui, Printed in Japan

本書の内容につきまして、下記の通り誤りがございました。お詫びして訂正いたします。

第1刷の発行後、柳貴英氏・岩澤政宗氏・菊地信義氏・金谷信氏・三好向洋氏をはじめ、多くの方から誤りの指摘ならびに評価と助言をいただきました。深く感謝します。なお、第1刷の正誤表に掲載している誤りは、第2刷以降では訂正しております。第2刷の正誤表に掲載している誤りは第1刷にも適用されます。同様に第3刷の正誤表掲載のものは第1、2刷にも適用されます。

### 第1刷（2019年7月30日発行）の正誤表

---

■ 30 ページ, 例題 2.3 の上 3 行目 :

[誤] この値が正ならば分布は左に歪んでいるという。

[正] この値が正ならば分布の右裾が長く、分布は右に歪んでいるという

■ 41 ページ, 例題 2.4 の解答例(2)(5) : (等号記号抜け)

[正] (2)  $E(X) = \int_{-\infty}^{\infty} x f_X(x) dx = \int_0^2 1/2x^2 dx = [1/6x^3]_0^2 = 4/3$

(5)  $E(X^3) = \int_0^2 x^3 1/2x dx = \int_0^2 1/2x^4 dx = [1/10x^5]_0^2 = 16/5$

■ 67 ページ, 解答例 1 行目 :

[誤]  $z = (y - \mu_Y)/(\sigma_Y\sqrt{1 - \rho^2})$  と変数変換すると,  $dz = \sigma_Y\sqrt{1 - \rho^2} dy$

[正]  $v = (y - \mu_Y)/(\sigma_Y\sqrt{1 - \rho^2})$  と変数変換すると,  $dy = \sigma_Y\sqrt{1 - \rho^2} dv$

■ 73 ページ, 下から 3 行目 :

[誤] indentically

[正] identically

■ 80 ページ, 1-1 の 2 行目 :

[誤] 基本的な考え方の説明しよう。

[正] 基本的な考え方を説明しよう。

■ 91 ページ, 例題 3.1 の 1 行目 :

[誤] 「開票速報」について

[正] 「開票速報」について

■ 96 ページ, 5 箇所 (1%有意水準の臨界値) :

[誤] 2.54

[正] 2.58

■ 118 ページ, 仮定 4.1 の(A3) :

[誤]  $x_i$  と  $u_i$  の 4 次のモーメントが有限である。

[正]  $X_i$  と  $u_i$  の 4 次のモーメントが有限である。

■ 122 ページ, (4.26)式の下 1 行目 :

[誤] (2.5)式 (24 ページ)

[正] (2.5)式 (23 ページ)

■ 125 ページ, (4.31)式の下 1 行目 :

[誤] サンプルサイズが小さいときには

[正] サンプルサイズが小さいときには

■ 146 ページ, 下から 6 行目 :

[誤]  $X_{1i}$

[正]  $X_i$

■ 161 ページ, (5.10)式の下 2 行目 :

[誤] サンプルサイズが小さい場合は

[正] サンプルサイズが小さい場合は

■ 177 ページ, 下から 14 行目 :

[誤] 分布をさだめることができるようにしている

[正] 分布をさだめることができるようにしている

■ 194 ページ, 下から 12 行目 :

[誤] 係数推定値の肩に「\*\*」とあるのは, この係数が 5% の有意水準で有意であることを示している。

[正] 係数推定値の肩に「\*\*\*」とあるのは, この係数が 1% の有意水準で有意であることを示している。

■ 195 ページ, 表 5-6 :

有意水準を表す\*に, 以下のとおり誤りがありました。

- 信頼(1)のセル : 0.225 のところは\*\*でなく, \*\*\*
- 規範(5)のセル : 0.338 のところは\*でなく, \*\*
- 規範(6)のセル : 0.342 のところは\*でなく, \*\*
- 初期時点对数 GDP(5)セル : -1.991 のところは\*\*でなく, \*\*\*
- 教育水準 (5)のセル : 4.387 のところは\*でなく, \*\*
- 教育水準 (6)のセル : 4.270 のところは星なしでなく, \*

■ 198 ページ, 5-2 の最後の一文 :

[誤] 最後に $Y_t$ を $\bar{X}_t$ に回帰する。

[正] 最後に $Y_t$ を $\bar{X}_t$ に定数項を含めずに回帰する。

■ 223~225 ページ, 10 箇所 :

[誤]  $E(u_{it} | \dots)$

[正]  $E(u_{it} | \dots \alpha_i)$

■ 238 ページ, 7~8 行目「なお,」と「 $\bar{Y}$ はすべての観測値から」の間に以下を挿入 :

$\bar{Y}_t$ は  $t$  時点での  $\bar{Y}_{it}$  の平均, つまり,  $\bar{Y}_t = \sum_{j=1}^N Y_{jt} / N$  であり,

■ 250 ページ, 6 行目 :

[誤] ただし, 強外生の仮定は必要ではなく,  $E(\Delta u_{it} | \Delta X_{1it}) = 0$  という少し弱い仮定のもとで, これらの結果は成り立つ。

[正] ただし, 一貫性, 漸近正規性に関しては, 強外生の仮定は必要ではなく,  $E(\Delta u_{it} | \Delta X_{1it}, \dots, \Delta X_{kit}) = 0$  という少し弱い仮定のもとで, これらの結果は成り立つ。

■ 250 ページ, 下から 8 行目 :

[誤]  $E(\Delta u_{it}|X_{1it}) = 0$

[正]  $E(\Delta u_{it}|\Delta X_{1it}, \dots, \Delta X_{kit}) = 0$

■ 252 ページ, 8 行目 :

[誤] OLS の推定をすればよい

[正] OLS で推定すればよい

■ 275 ページ, 実証例 7.1 の 3 行目 :

[誤] プロセイン

[正] プロイセン

■ 278 ページ, 5 行目 :

[誤]  $\frac{1}{N}$

[正]  $\frac{1}{\sqrt{N}}$

■ 280 ページ, 実証例 7.2 下から 5 行目 :

[誤] 臨界値の 2.66

[正] 臨界値の 2.57

■ 285 ページ, 12 行目 :

[誤] まず

[正] まず

■ 294 ページ, 下から 6 行目の見出し :

[誤] 標準偏差に関する補足

[正] 標準誤差に関する補足

■ 320 ページ, 15 行目・16 行目 :

引用箇所 Guggenberger(2010a)と Guggenberger(2010b)が逆

■ 320 ページ, 下から 8 行目 :

[誤] 操作変数法は, 欠落変数をもたらすような

[正] 操作変数法は, 欠落変数バイアスをもたらすような

■ 324 ページ最終行から 325 ページ, 19 カ所 :

[誤]  $m + p$

[正]  $k + p$

■ 第 8 章, 13 カ所 :

[誤] 累積密度

[正] 累積分布

■ 335 ページ, (8.4)式 1 つ目の等式 :

[誤]  $E[(Y_i - Pr_i)^2]$

[正]  $E[(Y_i - Pr_i)^2 | X_{1i}, X_{2i}, X_{3i}]$

■ 343 ページ, 下から 8 行目 :

[誤]  $\hat{\beta}_1$

[正]  $\hat{\beta}_0$

■ 346 ページ, 例題 8.1 解答例の式の右辺 :

[誤]

$$\frac{\exp(\sum_{j=1}^k \hat{\beta}_j X_{ji})}{1 + \exp(\sum_{j=1}^k \hat{\beta}_j X_{ji})} \hat{\beta}_j$$

[正]

$$\frac{\exp(\hat{\beta}_0 + \sum_{j=1}^k \hat{\beta}_j X_{ji})}{[1 + \exp(\hat{\beta}_0 + \sum_{j=1}^k \hat{\beta}_j X_{ji})]^2} \hat{\beta}_j$$

■ 349 ページ, 表 8-1(4)ロジットの標準誤差 :

[誤]

(3.307), (1.806), (3.424), (1.242), (1.227)

[正]

(0.026), (0.005), (0.163), (0.058), (0.471)

■ 353 ページ,  $Y_i^*$  の  $J$  区間 :

[誤]  $(\mu_J < Y_i^*)$

[正]  $(\mu_{J-1} < Y_i^*)$

■ 354 ページ, (8.30)式の左辺 :

[誤]  $l_i$

[正]  $LL_i$

■ 355 ページ, (8.31)式の左辺 4 箇所 :

[誤]  $\Pr$

[正]  $\hat{\Pr}$

■ 359 ページ,  $Y_i^*$ の $J$ 区間 :

[誤]  $(\mu_J < Y_i^*)$

[正]  $(\mu_{J-1} < Y_i^*)$

■ 362 ページ, 12~13 行目 :

[誤] 求められるが, そのためには

[正] 求められ, 識別のため,

■ 362 ページ, 14 行目 :

[誤]  $\beta_{10}, \beta_{11}, \dots, \beta_{ik}$

[正]  $\beta_{10}, \beta_{11}, \dots, \beta_{1k}$

■ 362 ページ, 下から 5~4 行目 :

[誤] このような基準化によって

[正] ここで

■ 364 ページ, 実証例 8.3 の上 1 行 :

[誤]  $(k+1) \times J$

[正]  $(k+1) \times (J-1)$

■ 368 ページ, (8.44)式の左辺 :

[誤]  $E(Y_i > 0 | X_{1i}, \dots, X_{ki})$

[正]  $\Pr(Y_i > 0 | X_{1i}, \dots, X_{ki})$

■ 369 ページ, (8.46)式の左辺 :

[誤]  $E(Y|X_1, \dots, X_k, Y_i > 0)$

[正]  $E(Y_i|X_{1i}, \dots, X_{ki}, Y_i > 0)$

■ 370 ページ, (8.50)式の $Y_i = 0$ のときの $\Phi(\cdot)$  :

[誤]  $\Phi(\beta_0 + \beta_1 X_{1i} + \dots + \beta_k X_{ki})$

[正]  $\Phi\left(\frac{\beta_0 + \beta_1 X_{1i} + \dots + \beta_k X_{ki}}{\sigma}\right)$

■ 375 ページ, 下から 4 行目 :

[誤] 平均処置効果

[正] 平均限界効果

■ 377 ページ, 9 行目 :

[誤] (8.60)式の推定残差を(8.63 式)の

[正] (8.57)式の推定残差を(8.58 式)の

■ 378 ページ, 1 行目 :

[誤] 賃金弾力性を $\beta_1$ として計算

[正] 賃金弾力性を計算

■ 393 ページ, 10 行目 :

[誤] 本書

[正] 本章

■ 397 ページ, 6 行目 :

[誤] 全員を参加をさせた

[正] 全員を参加させた

■ 398 ページ, 下から 6 行目 :

[誤] プログラムの制度的側面を詳細を調べたり

[正] プログラムの制度的側面の詳細を調べたり

■ 400 ページ, 5 行目の式の左辺第 2 項 :

[誤]  $-(Y_i|D_i = 0)$

[正]  $-E(Y_i|D_i = 0)$

■ 407, 409 ページ,  $\text{displaystyle}$  式 4 カ所 :

[誤]  $\sum_{i=1}^N$

[正]  $\sum_x$

■ 412 ページ, 2 行目 :

[誤]  $E[e(X_i)]$

[正]  $e(X_i)$

■ 413 ページ, 2 行目 :

[誤] この推定を実際に行うためには

[正] この推定を実際に行うためには

■ 414 ページ, 第 5 節 10 行目 :

[誤] 所与とたとき

[正] 所与としたとき

■ 415 ページ, 下から 8 行目 :

[誤]  $\arg \min_a$

[正]  $\arg \min_{a,\beta}$

■ 419 ページ, (9.8)式 :

[誤]

$$\frac{\frac{1}{N_1} \sum_{i=1}^N Y_i - \frac{1}{N_0} \sum_{i=1}^N Y_i}{\frac{1}{N_1} \sum_{i=1}^N D_i - \frac{1}{N_0} \sum_{i=1}^N D_i}$$

[正]

$$\frac{\frac{1}{N_1} \sum_{i=1}^N Z_i Y_i - \frac{1}{N_0} \sum_{i=1}^N (1-Z_i) Y_i}{\frac{1}{N_1} \sum_{i=1}^N Z_i D_i - \frac{1}{N_0} \sum_{i=1}^N (1-Z_i) D_i}$$

■ 419 ページ, 下から 7 行目 :

[誤]  $D_1 = 1 \quad D_i = 0$



[正]  $Z_i = 1$   $Z_i = 0$

■ 420 ページ, 下から 4 行目 :

[誤] 操作変数推定量 (ワールド推定量)

[正] その推定対象 (estimand)

■ 447 ページ, (9.25)式左辺 :

[誤]  $Y_{it}$

[正]  $Y_i$

■ 448 ページ, 3 行目 :

[誤]  $Y_{it}$

[正]  $Y_i$

■ 452 ページ, (9.29)式左辺 :

[誤]  $Y_{it}$

[正]  $Y_i$

■ 461 ページ, 下から 8 行目 :

[誤] については, の章末補論 A

[正] については, 章末補論 A

■ 486 ページ, 第 2 段落 2 行目 :

[誤] 標準偏差

[正] 標準誤差

■ 486 ページ, 第 2 段落 3 行目, 4 行目 :

[誤] の推定量

[正] の平方根の推定量

■ 501 ページ, (3)2 行目 :

[誤] BIC には

[正] BIC は

■ 550 ページ, 第 2 段落 2 行目 :

[誤] 水準 $Y_t$ を階差 $\Delta Y_t$ を置き換える

[正] 水準 $Y_t$ を階差 $\Delta Y_t$ に置き換える

■ 562 ページ, 第 3 段落下から 4 行目 :

[誤] 常に意識ながら

[正] 常に意識しながら

■ 568 ページ, 下から 2 行目 :

[誤] 月次の介入データ

[正] 日次の介入データ

■ 570 ページ, 6 行目 :

[誤] 1995 年 6 月 21 日

[正] 1995 年 4 月 18 日

■ 574 ページ, (11.68)式, 第 1 の等号のあと :

[誤]

$$\frac{\sum_{t=2}^T Y_{t-1} \varepsilon_t}{\sum_{t=2}^T Y_{t-1}^2}$$

[正]

$$T \frac{\sum_{t=2}^T Y_{t-1} \varepsilon_t}{\sum_{t=2}^T Y_{t-1}^2}$$

■ 576 ページ, 下から 10 行目 :

[誤] Im, Pesaran, and Shin, 2002

[正] Im, Pesaran, and Shin, 2003

■ 582 ページ, 下から 7 行目 :

[誤] MSFE は $(1 + \beta_1 + \dots + \beta_1^{2(h-1)})\sigma_\varepsilon^2$

[正] MSFE は $(1 + \beta_1^2 + \dots + \beta_1^{2(h-1)})\sigma_\varepsilon^2$

■ 589 ページ, 下から 5 行目 :

[誤]  $D_i$ が独立である場合に限り

[正]  $D_i$ が潜在的な結果と独立である場合に限り

■ 603 ページ, 1 行目 :

[誤] 確認することができる

[正] 確認することができる

■ 620 ページ, 7 行目 :

[誤] 渡部・藤原 (2011)

[正] 藤原・渡部 (2011)

■ 628 ページ, 2 行目 :

[誤] この組合せを意味を理解するために

[正] この組合せの意味を理解するために

■ 634 ページ, 下から 2 行目 :

[誤] 係数をつけてを足し合わせた

[正] 係数 $x_i$ をつけて足し合わせた

■ 643 ページ, 上から 2 つ目の式  $\text{Var}(Y)$  の式の 2 つ目の等号のあと :

[誤]  $\text{Cov}(Y_2, Y_2)$

[正]  $\text{Cov}(Y_2, Y_k)$

■ 645 ページ, 1 行目 :

[誤]  $\text{Var}(Y) = E[(Y - \mu)(Y - \mu)']$

[正]  $\text{Var}(\bar{Y}) = E[(\bar{Y} - \mu)(\bar{Y} - \mu)']$

■ 647 ページ, 下から 4 行目 :

[誤] 任意の $\varepsilon > 0$ について

[正] 任意の $\varepsilon > 0$ について

■ 655 ページ, (B.1)式, 左辺 :

[誤]

$$\frac{\partial Q}{\partial b_0}$$

$$\frac{\partial Q}{\partial b_1}$$

[正]

$$\frac{\partial Q(b_0, b_1)}{\partial b_0} \Big|_{b_0=\hat{\beta}_0, b_1=\hat{\beta}_1}$$

$$\frac{\partial Q(b_0, b_1)}{\partial b_1} \Big|_{b_0=\hat{\beta}_0, b_1=\hat{\beta}_1}$$

■ 673 ページ, 2 行目 :

[誤] またが制約が

[正] または制約が

■ 674 ページ, B.1.10 の 3 行目 :

[誤]  $(Y_t, X_t'$

[正]  $(Y_t, X_t)$ ,

■ 690 ページ, 1 行目 :

[誤]  $f(x_N; \theta)$ すると

[正]  $f(x_N; \theta)$ とすると

■ 690 ページ, 2 行目 :

[誤]  $\theta = \int T(x)f_N(\mathbf{x}; \theta)dx$

[正]  $\theta = \int T(x)f_N(x; \theta)dx$

■ 696 ページ, 10 行目 :

[誤] 1 つ焦点についての議論

[正] 1 つの焦点についての議論

■ 704 ページ, 付表 1 右裾確率 :

[誤]  $P(Z \leq x)$

[正]  $P(Z \geq x)$

■ 709 ページ, 14 行目 :

[誤] Guggenberger(2010)

[正] Guggenberger(2010b)

■ 709 ページ, 下から 16 行目 :

[誤] Wang, W., and Ida, T. (2016)の位置

[正] 711 ページ下から 12 行目に

■ 726 ページ, や行 :

[誤] 要藤正任 (M. Yoda)

[正] 要藤正任 (M. Yodo)

■ 引用文献 (707–712 ページ) : 以下の文献情報が欠落しております。

【英語文献】

Diebold, F.X. (2015) *Forecasting*, Department of Economics, University of Pennsylvania,  
<http://www.ssc.upenn.edu/~fdiebold/Textbooks.html>.

竹内啓 (1963) 『数理統計学——データ解析の方法』東洋経済新報社。

第 2 刷 (2020 年 10 月 30 日発行) の正誤表

---

■ 407 ページ, 16 行目 :

[誤] 参加者がまったくいなくてもかまわない

[正] 不参加者がいなければならない

■ 422 ページ, 8 行目 :

[誤]  $+E(Y_{1i} - Y_{0i} | D_{1i} - D_{0i} = -1)$

[正]  $-E(Y_{1i} - Y_{0i} | D_{1i} - D_{0i} = -1)$

第 3 刷 (2021 年 11 月 20 日発行) の正誤表

---

■ 87 ページ, 最終行 :

[誤] 練習問題 3-3

[正] 練習問題 3-1

■ 引用文献 (707–712 ページ) : 以下の文献情報が欠落しております。

【英語文献】

White, H. (1980) “A Heteroskedasticity-Consistent Covariance Matrix Estimator and a Direct Test for Heteroskedasticity,” *Econometrica*, 48(4), 817-838