

## 『EViews によるデータ分析入門』の正誤表 Ver.4

\*) 読者の方々にはご迷惑をお掛けしますが、以下の様な誤植が見つかりました。修正をお願いします。

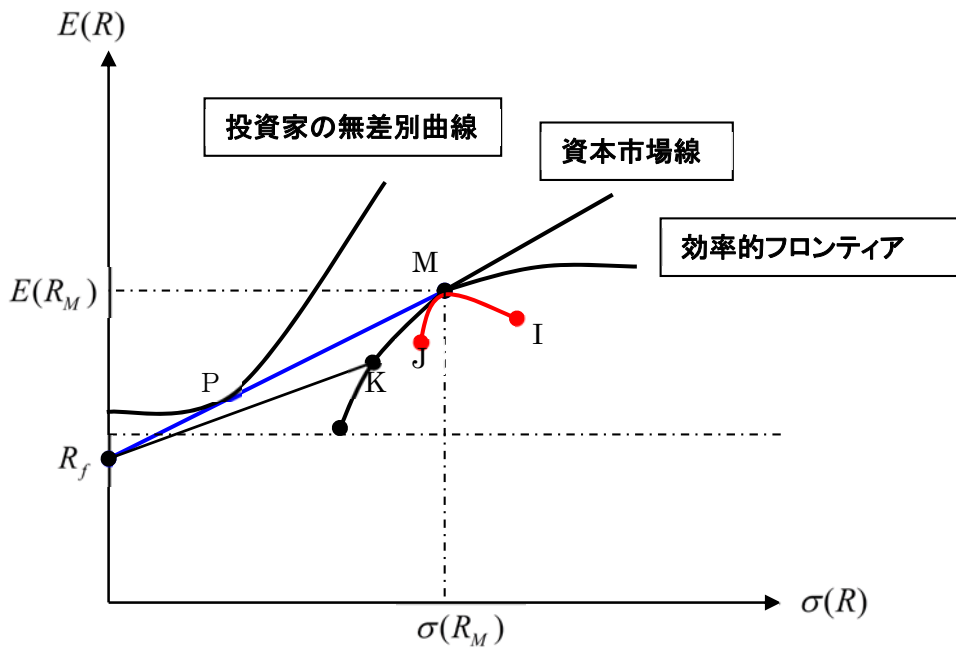
- 26 ページの図 1.34 と図 1.35 の軸の名称  
縦軸 :  $u(t-1)+0.1u(t-3) \Rightarrow u(1)+0.1u(3)$   
横軸 :  $u(t-2) \Rightarrow u(2)$
- 37 ページ、仮定 5)  
標準正規分布  $\Rightarrow$  分散  $\sigma^2$  の正規分布
- 49 ページ、上から 2 行目  
t 分布はを中心に  $\Rightarrow$  t 分布はゼロを中心に
- 63 ページ、下から 13 行目と 12 行目  
仮定 1)  $\Rightarrow$  仮定 2)  
仮定 2)  $\Rightarrow$  仮定 1)
- 72 ページ、下から 3 行目  
 $\ln y = \log(gdp / hl), \ln k = \log(k / hl)$
- 73 ページの正しい表 3.1

Sample: 1980 2002  
Included observations: 23

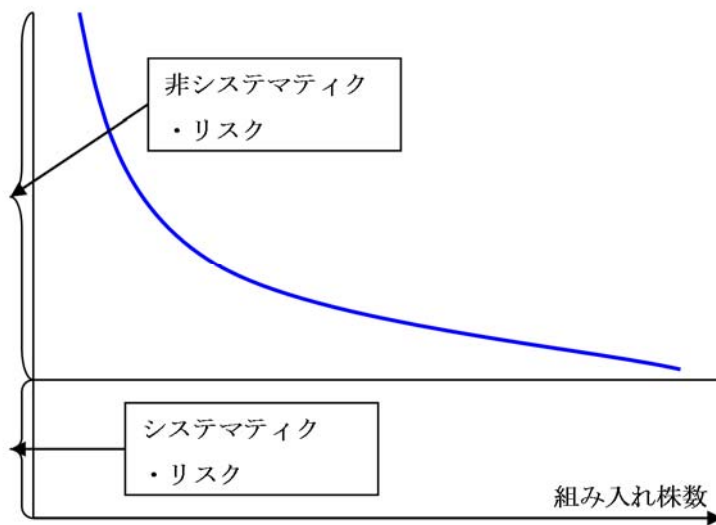
	推定値	標準誤差	検定の t 値	Prob.
変数名	Coefficient	Std. Error	t-Statistic	
切片 $\rightarrow$ C	1.048928	0.070102	14.96282	0.0000
説明変数 $\rightarrow$ LNK	0.712827	0.010013	71.18686	0.0000
R-squared	0.995873	Mean dependent var		6.033996
Adjusted R-squared	0.995677	S.D. dependent var		0.235494
S.E. of regression	0.015484	Akaike info criterion		-5.415030
Sum squared resid	0.005035	Schwarz criterion		-5.316291
Log likelihood	64.27284	Hannan-Quinn criter.		-5.390197
F-statistic	5067.569	Durbin-Watson stat		1.226323
Prob(F-statistic)	0.000000			

係数 = 0 の t 検定の P 値 (確率)

- 80 ページ、図 3.9 資本市場線



- 81 ページ、図 3.10 非システムティック・リスク



- 82 ページ、下から 5 行目

切片 =  $\Rightarrow$  切片 = 0

- 119 ページ、上から 8 行目

被説明変数  $\Rightarrow$  説明変数

- 131 ページの正しい表

**Dependent Variable: LYL85**

**Method: Least Squares**

**Sample: 1 75**

**Included observations: 75**

Variable	Coefficient	Std. Error	t-Statistic	Prob.
<b>C</b>	<b>4.451018</b>	<b>1.153417</b>	<b>3.858986</b>	<b>0.0002</b>
<b>LNS</b>	<b>0.709627</b>	<b>0.150343</b>	<b>4.720039</b>	<b>0.0000</b>
<b>LNNGD</b>	<b>-1.497194</b>	<b>0.402575</b>	<b>-3.719044</b>	<b>0.0004</b>
<b>LNSCH</b>	<b>0.728821</b>	<b>0.095078</b>	<b>7.665517</b>	<b>0.0000</b>
<b>R-squared</b>	<b>0.782067</b>	<b>Mean dependent var</b>	<b>8.400780</b>	
<b>Adjusted R-squared</b>	<b>0.772858</b>	<b>S.D. dependent var</b>	<b>0.952553</b>	
<b>S.E. of regression</b>	<b>0.453981</b>	<b>Akaike info criterion</b>	<b>1.310337</b>	
<b>Sum squared resid</b>	<b>14.63303</b>	<b>Schwarz criterion</b>	<b>1.433936</b>	
<b>Log likelihood</b>	<b>-45.13763</b>	<b>Hannan-Quinn criter.</b>	<b>1.359689</b>	
<b>F-statistic</b>	<b>84.92919</b>	<b>Durbin-Watson stat</b>	<b>2.346049</b>	
<b>Prob(F-statistic)</b>	<b>0.000000</b>			

- 160 ページ、上から 9 行目

表 7.1 次の 9 種類 ⇒ 表 7.1 の 9 種類

- 165 ページ

1. 固定効果の表示 ⇒ 3. 固定効果の表示

- 171 ページ上から 4 行目

「...計測から得られた。差分布と...」⇒「...計測から得られた残差分布と...」

- 172 ページ、下から 2 行目

明らかに通常の漸近分布を ⇒ 明らかに漸近分布を

- 214 ページ、歪度と尖度の定義

$$s_x \Rightarrow S_x$$

- 224 ページの Holland (1986) の出典

“Statistics and Causal Inference,” *Journal of the American Statistical Association* 81, 945-70.

- 211 ページ

Chapter. A ⇒ 付論 A

- 214 ページ、A.1.2 の最後の段落から 2 行前

92 % ⇒ 34%

- 225 ページ

Chapter. B ⇒ 付論 B

- 閉じページ

いーびゅーす ⇒ いーびゅーず