


Название метода	Оценка	Год создания	Автор	Фотография автора	Описание
Метод наименьших квадратов (OLS)	$(X^T X)^{-1} X^T y$	1795	Carl Friedrich Gauss Лежандр		Метод оценивания параметров эконометрической модели, состоящий в минимизации суммы квадратов расхождений между наблюдаемыми значениями зависимой переменной и значениями этой переменной, вычисленными для наблюдаемых значений независимых переменных по оценённой модели связи.
Обобщённый метод наименьших квадратов (GLS)	$(X^T \Omega^{-1} X)^{-1} X^T \Omega^{-1} y$	1934	Alexander Aitken	не нашёл	Теоретическая процедура оценивания коэффициентов линейной модели регрессии в ситуации, когда случайные ошибки имеют разные дисперсии и коррелированы между собой, при этом предполагается, что ковариационная матрица вектора ошибок невырождена и все ее элементы известны.
Взвешенный метод наименьших квадратов (WLS)	$(X^T \Omega^{-1} X)^{-1} X^T \Omega^{-1} y$  при этом  $\Omega = \text{diag}(\sigma_1, \sigma_2, \dots, \sigma_n)$	он же	он же	не нашел	Процедура, состоящая в минимизации определённым образом взвешенной суммы квадратов отклонений наблюдаемых значений зависимой переменной от значений, вычисляемых по подбираемой модели связи.
Доступный обобщённый метод наименьших квадратов (FGLS)	$(X^T \hat{\Omega}^{-1} X)^{-1} X^T \hat{\Omega}^{-1} y$	тот же	он же	не нашел	Практически реализуемая процедура оценивания коэффициентов линейной модели регрессии в ситуации, когда случайные ошибки имеют разные дисперсии и коррелированы между собой, повторяющая процедуру обобщенного метода наименьших квадратов, но использующая оцененную