

3.2 회귀계수의 추정

3.2.1 최소제곱법

$\hat{\beta}_{LSE}$ = 계산과정에서

$$(y^t X \beta)^t = \beta^t X^t y$$

여기서, $y^t X \beta$ 의 차원은 (1×1) 으로 스칼라 \rightarrow 전치행렬도 스칼라 \Rightarrow 전치해도 무방

$$-\beta^t X^t y - \beta^t X^t y = -2\beta^t X^t y$$