多元回归分析(1):估计

公众号: PyStaData

2021年2月20日

目录

OLS 推导

拟合优度

OLS 的无偏性

包含无关变量

遗漏变量偏误

同方差性假定

OLS 方差的成分:多重共线性

估计 σ^2 : OLS 估计量的标准误

OLS 估计的有效性:高斯-马尔科夫定理

结束语

姓名: 李刚

单位: 中南财经政法大学工商管理学院

地址: 湖北省武汉市洪山区南湖大道 182 号

邮箱: gang.li@stu.zuel.edu.cn