

Statistics

[회귀분석 증명] 편향성Biasedness과 Omitted variable



Jay · 2018. 8. 17. 23:41

URL 복사

+ 이웃추가



이번 글은 간단하다.

다중회귀분석Multiple regression에서 설명변수를 정할 때, 그냥 막 이것도 말 될 것 같아서 넣는 게 아니고, 변수들에 편향bias이 없는 걸 기준으로 한다.

이번에는 간단히 1변수 회귀분석(단순선형회귀분석)에서 "Zero conditional mean 조건이 충족되지 않아 변수가 편향되게 되면, 빼먹은 변수omitted variable이 있음을 시사한다"는 점을 살펴보도록 하겠다.

말이 복잡한데, 오히려 식으로 보면 쉽다.

1. 실제 선형관계가 다음과 같다고 가정하자.

$$y = \beta_0 + \beta_1 x_1 + \beta_2 x_2 + u$$