

Отбор значимых признаков

Линейная регрессия

Статистика критерия Стьюдента

$$t = \frac{\theta_i}{S_{\hat{\theta}_i}} \succ t(N - m)$$

$$S_{\hat{\theta}_i}^2 = S^2 q_{ii}, \quad S^2 = \frac{ESS}{N - m}$$

ESS — объяснённая дисперсия

q_{ii} — это i -й диагональный элемент матрицы $(X^T X)^{-1}$