

# Проверка предположений о модели

Линейная регрессия

# Предположения о модели

$$M[\varepsilon_i] = 0, i = 1, 2, \dots, N$$

$$M[\varepsilon_i \varepsilon_j] = 0, i \neq j$$

$$D[\varepsilon_i] = \sigma^2, i = 1, 2, \dots, N$$

$$\varepsilon_i \sim N(0, \sigma^2), i = 1, 2, \dots, N$$

# Критерий Дарбина — Уотсона

$$DW = \frac{\sum_{i=2}^n (\varepsilon_i - \varepsilon_{i-1})^2}{\sum_{i=1}^n \varepsilon_i^2} \approx 2(1 - \rho_1)$$