#### 应用回归分析

马学俊

弗一部分 1.1部分

R code

一元加权最小二 乘估计

# 第四章: 违背基本假设的情况

马学俊

苏州大学 数学科学学院

https://xuejunma.github.io/

R code

一元加权最小二 乘估计

> 1.1部分 1.2部分

2 R code

3 一元加权最小二乘估计

1.1部分

定义

什么是

定义

什么是

定义

什么是

### 应用回归分析 马学俊 第一部分 1.1部分 1.2部分

一元加权最小二

## 1.2部分

1.2部分

## 异方差性带来的问题

当存在异方差时,普通最小二乘估计存在以下问题:

● 参数估计值虽是无偏的,但不是最小方差线性无偏估计;

### R code

一元加权最小二 乘估计

```
模拟 R代码

1 > rm(list=ls())

2 > library(MASS)

3 > p <- 3; n <- 50

4 > mu <- rep(0, p)

5 > sigmu <- diag(rep(1, p))
```

• 残差图分析法