

1. 经济问题复杂.

2. CLR.

1) Linearity. 不会改

2) Strict Exogeneity ☆

$$E[\varepsilon_i | x] = 0, \forall i=1, \dots, n$$

3) Full rank. 不改

X 满列秩

4) Spherical error

$$\text{Var}(\varepsilon | x) = \sigma^2 I_n \text{ 轻松.}$$

5) $\varepsilon | x \sim N(0, \sigma^2 I_n)$ 轻松

3. 抽样分布

4. 判断标准.

无偏, 有效, 一致



R^2



MSE, Accuracy.
Mean Squared Error.

