

# Metoda Najmniejszych Kwadratów – przypadek wielu zmiennych cz.II

**Stanisław Cichocki**

**Natalia Nehrebecka**

Wykład 3

# Plan wykładu

- ▶ 1. MNK – przypadek wielu zmiennych

# Zapis macierzowy modelu liniowego

$$\underbrace{\begin{bmatrix} y_1 \\ \vdots \\ y_N \end{bmatrix}}_y = \underbrace{\begin{bmatrix} 1 & x_{21} & \cdots & x_{K1} \\ \vdots & \vdots & & \vdots \\ 1 & x_{2N} & \cdots & x_{KN} \end{bmatrix}}_X + \underbrace{\begin{bmatrix} \beta_1 \\ \vdots \\ \beta_K \end{bmatrix}}_\beta + \underbrace{\begin{bmatrix} \varepsilon_1 \\ \vdots \\ \varepsilon_N \end{bmatrix}}_\varepsilon$$

Stąd równanie macierzowe ma postać:

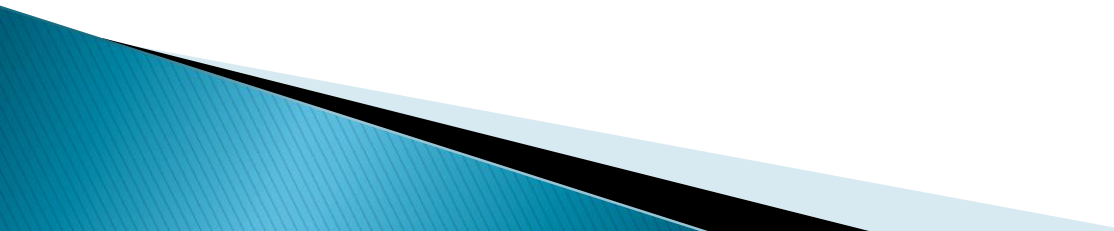
$$y = X\beta + \varepsilon$$

# Zapis macierzowy modelu liniowego

Inny wariant zapisu modelu:

$$y_i = x_i \beta + \varepsilon_i$$

dla  $i=1, \dots, N$



# MNK - przypadek wielu zmiennych

- ▶ 1. Zapisać model teoretyczny, model wyestymowany, wartości dopasowane oraz reszty dla modelu linowego zawierającego  $K$  zmiennych objaśniających wraz ze stałą.

# MNK - przypadek wielu zmiennych

- ▶ Suma kwadratów reszt - zapis macierzowy:

$$S(b) = \sum_{i=1}^N e_i^2 = [e_1 \quad \cdots \quad e_N] \begin{bmatrix} e_1 \\ \vdots \\ e_N \end{bmatrix} = e'e = (y - Xb)'(y - Xb) =$$

$$= y'y - y'Xb - b'X'y + b'X'Xb$$

- ▶ Ponieważ  $y'Xb = b'X'y$

- ▶ Zatem:  $S(b) = y'y - 2y'Xb + b'X'Xb$

# MNK - przypadek wielu zmiennych

- ▶ Warunki pierwszego rzędu:

$$\frac{\partial S(b)}{\partial b} = \frac{\partial y' y}{\partial b} - \frac{\partial 2 y' X b}{\partial b} + \frac{\partial b' X' X b}{\partial b} =$$

$$= -2 X' y + 2 X' X b = 0$$

- ▶ bo:

$$\frac{\partial \omega x}{\partial x} = \omega' \quad \frac{\partial x' A x}{\partial x} = (A + A') x$$

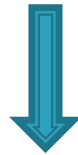
# MNK - przypadek wielu zmiennych

- ▶ Układ równań normalnych:

$$-2X' y + 2X' Xb = 0$$

$$X' Xb = X' y \quad / (X' X)^{-1}$$

$$\underbrace{(X' X)^{-1} X' X}_{I} b = (X' X)^{-1} X' y$$



$$b = (X' X)^{-1} X' y$$



# MNK - przypadek wielu zmiennych

- ▶ Rozwiązanie układu równań normalnych :

$$X' Xb = X' y$$

- ▶ istnieje o ile macierz  $X$  ma pełny rząd kolumnowy,  
tzn. jej kolumny są liniowo niezależne  $\longrightarrow$   
wtedy macierz  $X'X$  jest nieosobliwa i istnieje  $(X'X)^{-1}$ .

# MNK - przypadek wielu zmiennych

- ▶ MNK nie da się oszacować modelu w którym:
  - Kolumny macierzy  $X$  są liniowo zależne

i/lub

- ( $K > N$ ) liczba zmiennych (parametrów) przekracza liczbę obserwacji

# MNK - przypadek wielu zmiennych

- ▶ Warunki drugiego rzędu:

$$\frac{\partial^2 S(b)}{\partial b \partial b'} = -2 \frac{\partial X' y}{\partial b'} + 2 \frac{\partial X' X b}{\partial b'} = 2 X' X$$

# Pytania teoretyczne

1. Co to jest układ równań normalnych?
2. Wyprowadzić estymator MNK dla modelu z wieloma zmiennymi objaśniającymi.
3. Dlaczego nie da się uzyskać oszacowań MNK, jeśli liczba zmiennych objaśniających w modelu jest większa od liczby obserwacji?

**Dziękuję za uwagę**