

KURSSIN OSA I

Luennot perustuvat kirjan lukuihin 1-5 (numerot viittaavat sivunumeroihin):

- ehdollinen odotusarvo ja sen ominaisuudet (14)
- merkinnät (27–28)
- ositettujen matriisien laskusäännöt (28-30)
- momenttimenetelmä (30–34)
- pienimmän neliösumman menetelmä (33–37)
- 54-67 (viimeisen sivun toiseen kappaleeseen asti) (mm. regressoreiden lineaariset muunnokset!)
- 68–69 (FWL-lause)
- 73–75 (mallin selityskyvyn mittaaminen)
- 86-107
- 111-115 (mm. yli- ja alispesifiointi)
- 132-133
- 135-136 (lause 4.1 ja sen todistus)
- 138-144
- 150-155
- 190-191 (Waldin tunnusluku ja asymptoottinen normaalisuus)
- 196–199 (mm. White'in t-tunnusluku; ei seuraavien sivujen lisätarkasteluja).

Lisäksi oletetaan taustatietoja:

- vektorin pituus (43)
- matriisin X sarakkeiden virittämä avaruus (49-50)
- lineaarinen riippumattomuus (52-53)
- matriisin $X'X$ käännettävyys (53)
- t- ja F-jakaumat (136-137) sekä
- suurten lukujen lait ja keskeiset raja-arvolauseet (146-150).