

عنوان مقاله:

مطالعه رفتار برآوردگر انقباضی تحت یک قید خطی در مدل رگرسیون توانیده

محل انتشار:

مجله علوم آماری، دوره 13، شماره 1 (سال: 1398)

تعداد صفحات اصل مقاله: 14

نویسندگان:

محمد آرست - *Department Statistics, University Shahrood, Shahrood, Iran*

محمد آرشی - *Department Statistics, University Shahrood, Shahrood, Iran*

محمد رضا ربیعی - *Department Statistics, University Shahrood, Shahrood, Iran*

خلاصه مقاله:

معمولا در مسائل با بعد بالا، وقتی تعداد متغیرها بیشتر از تعداد مشاهدات است، برآوردگرهای جریمه شده بر پایه روش های انقباضی از دیدگاه خطای پیشگویی پاسخ، از کارایی بهتری نسبت به برآوردگر کمترین توان های دوم در برآورد ضرایب رگرسیونی برخوردار هستند. در این برآوردگرها پارامتر تنظیم کننده یا انقباضی نقش اساسی در انتخاب متغیر و برآورد پارامترها بازی می کند. برآوردگر انقباضی بریج، برآوردگری است که با تغییر پارامتر تنظیم کننده آن می توان به برآوردگرهای معروف ریج و لاسو دست یافت. در این مقاله برآوردگر انقباضی بریج را، با اعمال یک قید خطی روی بردار ضرایب رگرسیونی، به دست آورده سازگاری آن اثبات می شود. به علاوه در قالب یک مطالعه شبیه سازی و مثال واقعی کارایی آن از دیدگاه میانگین توان دوم خطا مورد ارزیابی قرار می گیرد.

کلمات کلیدی:

Bridge, Shrinkage Methods, برآوردگر انقباضی، برآوردگر مقید، سازگاری، میانگین توان دوم خطا، بریج.

لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/1516926>

