

عنوان مقاله:

مقایسه مخاطره انواع برآوردگرها در مدل رگرسیون چندگانه با خطای t چندگانه

محل انتشار:

مجله علوم آماری، دوره 1، شماره 2 (سال: 1386)

تعداد صفحات اصل مقاله: 14

نویسندگان:

محمد آرشی - *Department of Statistics, Ferdowsi University of Mashhad, Mashhad, Iran*

سیدمحمد مهدی طباطبایی - *Department of Statistics, Ferdowsi University of Mashhad, Mashhad, Iran*

خلاصه مقاله:

در این مقاله، با فرض اینکه در مدل رگرسیونی خطی چندگانه، بردار خطای تصادفی دارای توزیع t چند متغیره است، برآوردگرهای کمترین توانهای دوم تعمیم یافته، کمترین توانهای دوم تعمیم یافته مقید و تورنجش را برای بردار پارامتر مجهول مدل رگرسیونی بدست می آوریم. سپس با استفاده از تابع زیانهای مربعی و مربعی موزون، مخاطره برآوردگرهای بدست آمده را با یکدیگر مقایسه می کنیم و نشان می دهیم در شرایطی خاص کدامیک از برآوردگرها بر دیگری برتری دارند.

کلمات کلیدی:

Generalized Least Square Estimator, Restricted Generalized Least Square Estimator, Shrinkage Estimator, Inverse Wishart Distribution, کمترین توانهای دوم تعمیم یافته، کمترین توانهای دوم تعمیم یافته مقید، تورنجش، توزیع و بشارت معکوس

لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/1517118>

