

عنوان مقاله:

مقایسه ی برآوردگرهای بوت استرپ، درستنمایی ماکزیمم بهبودیافته و گشتاوری پارامترهای مدل خودبازگشتی با خطاهای نامنفی

محل انتشار:

مجله مدل سازی پیشرفته ریاضی، دوره 8، شماره 2 (سال: 1397)

تعداد صفحات اصل مقاله: 22

نویسندگان:

عبدالرضا سیاره - عضو هیات علمی

صدیقه زمانی مهریان - گروه آمار، دانشگاه رازی کرمانشاه

خلاصه مقاله:

فرض نرمال بودن خطاها، یکی از فرضیات معمول در مدل های سری زمانی است اما در بعضی مواقع با مواردی مواجه می شویم که خطاها از توزیع نرمال پیروی نمی کنند. در این مقاله مدل های خودبازگشتی در نظر گرفته می شوند که در آن خطاها مستقل و هم توزیع هستند و از توزیعی از خانواده های نمایی و یا وایبل پیروی می کنند. برآوردگرهای درستنمایی ماکزیمم بهبودیافته، بوت استرپ و گشتاوری پارامترهای مجهول مدل های ذکر شده در حالت کلی محاسبه شده اند. همچنین با استفاده از مطالعات شبیه سازی عملکرد برآوردگرهای درستنمایی ماکزیمم، درستنمایی ماکزیمم بهبودیافته، بوت استرپ و گشتاوری برای این نوع از مدل های سری زمانی مورد بررسی قرار گرفته است. بر اساس این مطالعه شبیه سازی، روش درستنمایی ماکزیمم دارای میانگین مربعات خطای بزرگ تری نسبت به سه روش دیگر در مدل های خودبازگشتی با خطاهای نامنفی است

کلمات کلیدی:

برآوردگر درستنمایی ماکزیمم بهبودیافته، برآوردگر گشتاوری، بوت استرپ، مدل خودبازگشتی

لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/1813757>

