

عنوان مقاله:

رگرسیون مفصل

محل انتشار:

سومین کنفرانس ریاضیات مالی و کاربردها (سال: 1391)

تعداد صفحات اصل مقاله: 7

نویسنده:

اصغر اکبری - گروه ریاضی، دانشگاه آزاد اسلامی واحد مبارکه

خلاصه مقاله:

تحلیل رگرسیونی یکی از روش های متداول آماری در مدل سازی رابطه بین متغیرها است، اما این روش در شکل پایه ای خود یعنی کمترین مربعات معمولی روش مناسبی در مدل سازی مسایل مالی نیست زیرا در اغلب اینگونه مسایل رابطه ها غیرخطی بوده و توزیع احتمالاتی متغیر وابسته نیز غیر نرمال است. یک روش موفق برای فایق آمدن بر این مشکلات روش مدلخطی تعمیم یافته است که در آن نیز لازم است توزیع متغیر وابسته از خانواده توزیع های نمایی باشد. یک روش جایگزین برابرد روش پیش گفته روش رگرسیون مفصل است. مزیت اصلی روش رگرسیون مفصل این است که هیچ محدودیتی در نوعتوزیع متغیر وابسته وجود ندارد. در این نوشتار ابتدا روش استفاده از رگرسیون مفصل را ارایه نموده و سپس چند مثال را ارایه کرده و در آن ها سه روش را با هم مقایسه می کنیم. در مثال ها از توزیع های با دم سنگین که در مدل سازی مسایل مالی کاربرد دارند استفاده می کنیم.

کلمات کلیدی:

کمترین مربعات معمولی، مدل خطی تعمیم یافته، تابع مفصل، رگرسیون مفصل

لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/352589>

