

## عنوان مقاله:

برآورد بیزی همبستگی پارامترهای دو متغیر تصادفی پواسون: کاربردی برای تصمیم گیری بنگاه

## محل انتشار:

فصلنامه پژوهش های اقتصادی ایران، دوره 21، شماره 66 (سال: 1395)

تعداد صفحات اصل مقاله: 17

## نویسنده:

فرزاد اسکندری - دانشیار گروه آمار دانشگاه علامه طباطبائی،

## خلاصه مقاله:

در این مطالعه براساس مدل های خطی تعمیم یافته بیز، به بررسی همبستگی پارامترهای دو توزیع پواسون پرداخته شده است. با توجه به نبود فرم بسته توزیع های پسین، آمار بیزی سلسله مراتبی با استفاده از الگوریتم متروپلیس- هستینگز برای بررسی همبستگی پارامترها در دو توزیع پواسون ارایه می شود. در این رابطه، بیشترین احتمال ناحیه پسین برای ضرایب متغیرها ی کمکی در مدل محاسبه شده است. با استفاده از معیار اطلاع انحراف بیزی نیز نشان داده شده است مدل پواسون- لگ نرمال بهتر از مدل پواسون-گاما می تواند همبستگی بین پارامترهای دو توزیع پواسون را ارزیابی کند. در پایان ، روش پیشنهادی برای داده های شبیه سازی شده بانک تجارت مورد استفاده قرار گرفته است.

## کلمات کلیدی:

توزیع دو متغیری گسسته، مدل پواسون- لگ نرمال، مدل پواسون- گاما، روش بیزی سلسله مراتبی، الگوریتم متروپلیس- هستینگز

## لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/682338>

