

Μέθοδοι Αξιολόγησης της Προβλεπτικής Ικανότητας Γραμμικών Μοντέλων

Ψαράκης Στυλιανός

Περίληψη

Η επιλογή του κατάλληλου γραμμικού μοντέλου για την μελέτη ενός συγκεκριμένου προβλήματος έχει εξετασθεί από πολλές πλευρές στη διεθνή βιβλιογραφία. Στην βιβλιογραφία μόνο σχετικά πρόσφατα έχουν αναπτυχθεί μεθοδολογίες που αξιολογούν της προβλεπτική ικανότητα γραμμικών μοντέλων. Η διατριβή κινείται προς τη κατεύθυνση αυτή. Συγκεκριμένα γίνεται προσπάθεια να αποτιμηθεί η προβλεπτική ικανότητα ενός μοντέλου με βάση τη σύγκριση των παρατηρούμενων τιμών με τις αντίστοιχες αναμενόμενες τιμές της εξαρτημένης μεταβλητής σε μία ακολουθία χρονικών στιγμών που το υπό εξέταση μοντέλο έχει εφαρμοσθεί. Η αξιολόγηση στηρίζεται στη «βαθμολογία» του υπό κρίση μοντέλου κάθε χρονική στιγμή για την οποία υπάρχουν παρατηρήσεις. Η τελική απόδοση του μοντέλου εκφράζεται ως συνάρτηση της «βαθμολογίας» αυτής. Για το σκοπό αυτό κατασκευάζονται διάφορες στατιστικές συναρτήσεις των οποίων οι κατανομές μελετώνται ώστε να καταστεί δυνατή η εξαγωγή στατιστικών συμπερασμάτων.