

5. ΤΟ ΚΡΙΤΗΡΙΟ C_p του MALLOWS

Εκτός από τις μεθόδους που αναπτύξαμε στις προηγούμενες ενότητες για επιλογή των ανεξαρτήτων μεταβλητών που θα συμπεριληφθούν στο μοντέλο υπάρχει και ένα άλλο κριτήριο το οποίο τελευταία εφαρμόζεται πολύ συχνά. Το κριτήριο αυτό βοηθά στον καθορισμό ενός "*optimal*" υποσυνόλου ανεξαρτήτων μεταβλητών ονομάζεται κριτήριο C_p και έχει προταθεί από τον Mallows (1973). Το κριτήριο αυτό έχει ως στόχο να ισορροπήσει το πλήθος του αριθμού των μεταβλητών που περιλαμβάνονται στο μοντέλο σε σχέση με το αποτέλεσμα που έχει να παραληφθεί κάποια σημαντική μεταβλητή και συνδέεται άμεσα με τον συτελεστή προσδιορισμού. Η ανάπτυξη του κριτηρίου αυτού είναι πέρα από τους σκοπούς του μαθήματός μας.