

روش دنباله‌ای تسریع یافته کلی در برآورد فاصله اطمینان تابعی از پارامترها در مدل خودبازگشتی

سیدمحمود میرجلیلی* (باید سخنران باشد) سودابه سجادی پناه

گروه آمار، دانشکده علوم ریاضی، دانشگاه ولایت گروه ریاضی.

* عضو هیئت علمی دانشگاه ولایت، دانشجوی دکتری دانشگاه یزد. am.ma@ac.ir

چکیده

در این مقاله، روش دنباله‌ای تسریع یافته کلی در برآورد فاصله‌ای تابعی خطی در مدل خودبازگشتی مرتبه p بررسی شده است. نتایج مطالعه عملکرد برآورد فاصله‌ای بر اساس برآوردهای حداقل مربعات تحت قضیه ارائه شده است. سپس با استفاده از شبیه‌سازی مونت کارلو در مدل خودبازگشتی مرتبه دوم، نتایج تئوری بررسی شده است که بدین منظور متغیر توقف حاصل از روش نمونه‌گیری دنباله‌ای، نسبت متغیر به اندازه نمونه بهینه و احتمال پوشش فاصله اطمینان محاسبه شده است. در انتها کاربرد روش پیشنهادی در داده‌های واقعی نشان داده شده است. واژگان کلیدی روش نمونه‌گیری دنباله‌ای تسریع یافته کلی؛ فرایند خودبازگشتی؛ شبیه‌سازی مونت کارلو.