

مقایسه‌ی روش‌های پارامتری و نیمه پارامتری در برآورد پارامتر توابع مفصل

A-۱۰-۶۳۲

سارا میرپیروزی - هادی جباری نوقابی

گروه آمار دانشگاه فردوسی مشهد

چکیده: تابع مفصل در مطالعات اخیر توجهات بسیاری را برای مدل سازی مشاهدات چند متغیره به خود جلب کرده است. یک ویژگی مهم توابع مفصل این است که آن‌ها ما را قادر می سازند توزیع‌های حاشیه‌ای یک متغیره و توزیع توام آن‌ها را به طور جداگانه مشخص کنیم. پارامتر تابع مفصل وابستگی ذاتی بین متغیرهای حاشیه‌ای را نشان می‌دهد و می‌تواند به وسیله‌ی روش‌های پارامتری یا نیمه پارامتری برآورد شود. هدف این مقاله مقایسه‌ی روش درست‌نمایی ماکسیمم با یک روش نیمه پارامتری است که با توزیع‌های حاشیه‌ای یک متغیره به عنوان توابع مجهول سروکار دارد. در این مقاله روش نیمه پارامتری معرفی شده توسط جنست و همکاران (۱۹۹۵) رادر نظر می‌گیریم. نتایج مطالعات شبیه سازی نشان می‌دهد که برآوردگرهای درست‌نمایی ماکسیمم در مقابل توزیع‌های حاشیه‌ای نامشخص، دقیق نیستند و روش نیمه پارامتری از روش درست‌نمایی ماکسیمم بهتر است.

واژه‌های کلیدی: تابع مفصل، درست‌نمایی ماکسیمم، روش نیمه پارامتری، وابستگی