

现代稳健回归方法



[现代稳健回归方法_下载链接1](#)

著者:[加] 罗伯特·安德森 著

[现代稳健回归方法_下载链接1](#)

标签

评论

哈哈哈哈哈呵呵呵呵哈哈

好书，学习计量必备工具书。

在社会科学中，现代稳健及耐抗性回归方法还不太为人所知。这些方法之所以被称为“现代方法”，是因为它们通常属于密集型计算，这是当前很多依赖今天的高速电脑的统计方法的一个特征。《现代稳健回归方法》通过一套统一的符号系统，介绍了不同来源的多种稳健回归方法，以及它们彼此之间的联系。在主要统计软件如SAS和Stata已经采用这些最新回归方法的情况下，本书显得非常及时

习惯在京东购物。学习中，活到老学到老……

买了很多本，一个老师推荐的读本，扎实计量经济学基础，讲得很详细，慢慢研究。

此系列书很好，值得读

很有用的一套工具类书籍，看起来挺方便的，还不错哦

非常好 很值得 下次有机会再买

读万卷书行万里路开卷有益

难道可靠的就是今生今世结合本地背带裤阿拉善盟

这套绿皮书还是值得收藏的

小本书轻薄好携带，京东送货快，快递员态度好！

书写得简单有用，值得收藏！

在社会科学中，现代稳健及耐抗性回归方法还不太为人所知。这些方法之所以被称为“现代方法”，是因为它们通常属于密集型计算，这是当前很多依赖今天的高速电脑的统一方法的一个特征。

本人购买了 格致方法 定量研究系列 这一套书 很不错的啊 建议购买啊
好书值得购买收藏和学习

经典丛书，值得购买！robust

不会只有我在买这个书吧 每天神叨叨推公式

不错，速度很快！

东西还不错，物流业迅速。

书外观不错，没有破损。送货及时，只是加上运费后比书的原价还要高，也还行吧。

书很不错，对学习非常有帮助，纸张质量也好。后面争取凑齐一套！！

非常价廉物美啊。凑字数是个辛苦活。

活动买的，非常不错。。。。

不错，可以略读，知道基本概念，细节还是去念英文材料吧。

不错.....

个人觉得适合高年级本科或者研一的学生做课外读物

还不错吧，质量挺好，还没看

京东特价买的，非常不错啊

这个系列的书都很不错

还不错的这次发票没开错

非常好的系列，简单易懂

一会就看完了，也正是想要的内容。不错

在社会科学中，现代稳健及耐抗性回归方法还不太为人所知。这些方法之所以被称为“现代方法”，是因为它们通常属于密集型计算，这是当前很多依赖今天的高速电脑的统一方法的一个特征。《现代稳健回归方法》通过一套统一的符号系统，介绍了不同来源的多种稳健回归方法，以及它们彼此之间的联系。在主要统计软件如SAS和Stata已经采用这些最新回归方法的情况下，《现代稳健回归方法》显得非常及时。

还可以吧。。。。。

还可以吧。

应该是正品

不错的书

值得收藏

翻译质量一般，有些翻译不准确。书本到手是封皮较脏。印刷质量较差。

好好好

不错。

不错

很好

还行

好

稳健回归 robust regression

统计学稳健估计中的一种方法，其主要思路是对异常值十分敏感的经典最小二乘回归中的目标函数进行修改。经典最小二乘回归以使误差平方和达到最小为其目标函数。因为方差为一不稳健统计量，故最小二乘回归是一种不稳健的方法。不同的目标函数定义了不同的稳健回归方法。常见的稳健回归方法有：最小中位平方(least median square; LMS)法、M估计法等。一种在下列场合下仍具有较好性质的回归估计方法:1. 模型的先验假设不完全成立,实际情况与此略有背离;2.存在少量具有过失误差的数据(例如异常值)。一般来说,一方面,由于实际情况很难与回归模型的先验假设完全吻合,这会对建立模型及相应的调用robustfit函数作稳健回归

regress函数和regstats函数利用普通最小二乘法估计模型中的参数，参数的估计值受异常值的影响比较大。robustfit函数采用加权最小二乘法估计模型中的参数，受异常值的影响就比较小。robustfit函数用来作稳健的多重线性或广义线性回归分析，下面介绍robustfit函数的用法。1.4.1. robustfit函数的用法 robustfit函数有以下几种调用方式：b = robustfit(X,y) b = robustfit(X,y,wfun,tune) b = robustfit(X,y,wfun,tune,const) [b,stats] = robustfit(...)

(1) b = robustfit(X,y)
返回多重线性回归方程中系数向量 β 的估计值b，这里的b为一个 $1 \times p$ 的向量。输入参数X为自变量观测值矩阵（或设计矩阵），它是的矩阵。与regress函数不同的是，默认情况下，robustfit函数自动在X第1列元素的左边加入一列1，不需要用户自己添加。输入参数y为因变量的观测值向量，是的列向量。

robustfit函数把y或X中不确定数据NaN作为缺失数据而忽略它们。 $n \times 1$ 或 $n \times p$

(2) b = robustfit(X,y,wfun,tune) 用参数wfun指定加权函数，用参数tune

指定调节常数。wfun为字符串，其可能的取值如表1-3所示。表1-3

robustfit函数支持的加权函数 加权函数 (wfun) 函数表达式 默认调节常数值

'andrews' sin(||)wlr=??< 1.339 'bisquare' (默认值)

22(1)(||1)wlr=??< 4.685 'cauchy' 21(1)wr=+ 2.385 'fair'

1(1||)wr=+ 1.400 'huber' 1max(1, ||)wr= 1.345 'logistic' tanh()wr=

1.205 'ols' 普通最小二乘，无加权函数 无 'talwar' (||1)wlr=<

2.795 'welsch' 2rwe=?= 2.985

若调用时没有指定调节常数tune，则用表1-3中列出的默认调节常数值进行计算。表1-3中加权函数中的r通过下式计算residr = tunes1-h $\times$ 其

中resid为上一步迭代的残差向量，tune为调节常数，h是由最小二乘拟合得到的中心化杠杆值向量，s为误差项的标准差的估计。s的计算公式为：s =

MAD/0.6745，其中MAD为残差绝对值的中位数，在正态分布下，这个估计是无偏的。

若X中有p列，计算MAD时，将残差绝对值向量的前p个最小值舍去。

用户可以定义自己的权重函数，函数的输入必须是残差向量，输出是权重向量。在调用robustfit函数时，把自定义权重函数的句柄（形如@myfun）作为wfun参数传递给robustfit函数，此时必须指定tune参数。

简洁明了的口袋型专业书，案例丰富，重视应用，理论点到即止

稳健回归用的很多，希望这套书全部翻译

好书一本，值得一读好书一本，值得一读

收到书了，这套书真的不错，希望印刷无问题

值得购买的一套，这个系列的书价格便宜，印刷质量也不错，对方法的介绍比较系统。

书多有益。书多有益。

经典书籍经典书籍经典书籍

非常经典的绿皮书系列!不容错过!

还行，翻译的不错，买来收着

[现代稳健回归方法 下载链接1](#)

书评

[现代稳健回归方法_下载链接1](#)