Государственное бюджетное общеобразовательное учреждение

города Москвы «Школа №1532»

**Непараметрическая оценка регрессии методом Розенблатта - Парзена**

10 класс, ГБОУ Школа №1532

Фукс Даниил С

Руководитель: учитель информатики

ГБОУ Школа 1532,

Сергиенко Антон Борисович

Москва 2024

**Оглавление**

**Введение**

**Актуальность работы**

В современном мире стоимость проведения экспериментов значительно возросла, поэтому для экономии ресурсов и достижения необходимых прогнозов важно уметь предсказывать результаты экспериментов. Существуют два основных подхода к построению графиков зависимости на основе выборочных данных: параметрическая и непараметрическая оценка. Параметрическая модель имеет недостатки, такие как:

* **Предположение о функциональной форме**: Параметрическая оценка требует предположения о функциональной форме зависимости между независимыми и зависимыми переменными. Если это предположение неверно, то модель может давать неточные или неправильные результаты.
* **Ограниченность модели**: Параметрическая модель имеет ограниченное количество параметров, которые могут быть оценены. Это ограничивает способность модели улавливать сложные зависимости в данных.
* **Чувствительность к выбросам**: Параметрическая оценка регрессии может быть чувствительна к выбросам в данных. Одиночные аномальные значения могут сильно влиять на оценку параметров и приводить к неточным результатам.

Непараметрическая оценка регрессии в свою очередь имеет недостатки, например, требуемый объем данных и высокую вычислительную сложность, однако она обладает лучшей гибкостью, т.е. не требуют предварительного задания функциональной формы зависимости между переменными, также непараметрические методы обычно менее чувствительны к выбросам, поскольку они не полагаются на предположения о распределении данных или о функциональной форме модели. Главные минусы непараметрической оценки регрессии методом Розенблатта-Парезна заключаются в требуемом объеме данных, а также в сложности вычислении оптимальных параметров.

**Цель работы**

Разработка и анализ эффективности моделирования многомерной многозначной функции на основе экспериментальных данных через использования непараметрической оценки регрессии.

**Основная часть**

Главная формула, которая будет использоваться для вычисления предположительной формулы:

– элемент выборки,

– точка, для которой ищется точка ,

– элемент выборки,

– настраиваемый параметр.

Параметр «выключает» точки, который расположены слишком далеко от искомого значения. Это позволяет учитывать только нужные нам данные. Т.к. – настраиваемый параметр, то при непараметрическая оценка регрессии будет представлять из себя среднее арифметическое, т.к. будут учитываться все точки и делиться на их количество.

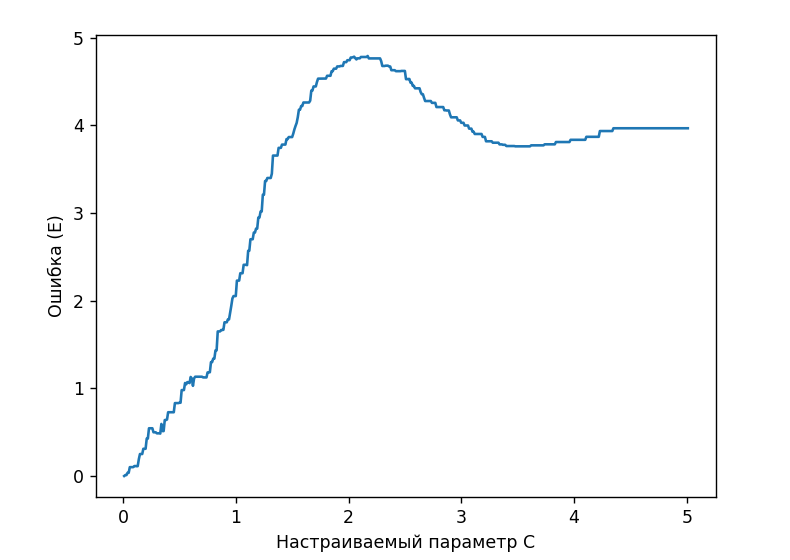
Такой вариант не подходит, т.к. данная модель может выдавать слишком неточные значения, из-за чего параметр требуется подбирать под каждую выборку. Чтобы определять, насколько параметр подходит под выборку, требуется определять «ошибку», которая определяется по формуле:

– элемент выборки

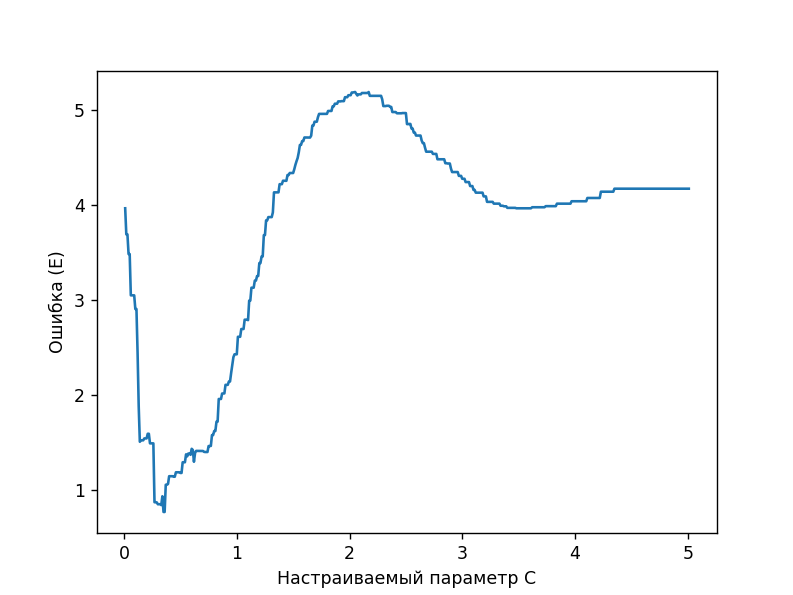
– смоделированное значение

– количество элементов выборки

Автор работы написал код, который вычисляет зависимость «ошибки» от параметра . Был получен следующий результат:



На графике видно, что при такой модели при → 0 ошибка будет минимальна.

Так происходит из-за точек, которые у нас уже имеются. При слишком малом функция моделирования точки создает только те же значения, что уже есть в выборке. Для того, чтобы такого не происходило, нам требуется не включать в выборку точку, которая уже существует. Если исключить такие точки, то получится следующий график:

На нем видно, что теперь при → 0 ошибка не минимальна.