선형 회귀 세션 과제

과 의 개념 및 가 보완한 의 한계 정리

6기 2조 장윤태

을 수식으로 정의하면 와 같으며 사용된 ,는 다음과 같다.

(Regression Sum of Squares) :

(Error Sum of Squares) :

(Total Sum of Squares) :

즉 전체 변동량 중에서 모형이 설명할 수 있는 변동량의 비율이다.

을 수식으로 정의하면 와 같으며 사용된 , 는 다음과 같다.

: 사용된 설명변수

: 설명변수 + 절편의 개수

즉 설명변수의 설명력을 고려한 값이다.

에는 모형의 설명변수가 많아질수록 값이 계속 증가한다는 한계가 존재한다.

이를 가 보완하여 설명변수의 개수에 상관없이 값을 구할 수 있다.

설명변수가 증가한다고 무작정 값이 증가하지 않고 추가된 설명변수의 설명력이 떨어질 경우 오히려 값이 감소하는 특징을 지닌다.