Enter&Forward&Backward&Stepwise

Enter：所有X一次性全部进入  
Forward：X一个一个进，每次进入P-value最小的X，直到未进入的X都不significant  
Backward：所有的X先一次性进入，然后一个一个剔除，每次剔除P-value最大的X，直到保留的X全都significant  
Stepwise：X一个一个进，但是进入新的X以后，会重新审查所有已进入X的P-value，如果进入新的X导致原来的X的P-value从significant变成不significant，则把原来的X剔除。  
  
总地来说，forward只进不出，backward只出不进，stepwise又进又出。  
有文献提到一般来讲backward的效果往往是这三种方法之中最好的，出处我就不帮你找了。  
  
另外三种方法的选择还要取决于你的目的，是要做预测，还是要解释相关关系。如果是做预测的话，在预测效果差不多的情况下，一般会选择变量数据最少的方法。  
  
这是一些资料：

[http://statmaster.sdu.dk/courses/st111/module08/index.html](http://bbs.pinggu.org/linkto.php?url=http%3A%2F%2Fstatmaster.sdu.dk%2Fcourses%2Fst111%2Fmodule08%2Findex.html)  
[http://publib.boulder.ibm.com/in ... gression\_method.htm](http://bbs.pinggu.org/linkto.php?url=http%3A%2F%2Fpublib.boulder.ibm.com%2Finfocenter%2Fspssstat%2Fv20r0m0%2Findex.jsp%3Ftopic%3D%252Fcom.ibm.spss.statistics.help%252Fsyn_regression_method.htm)