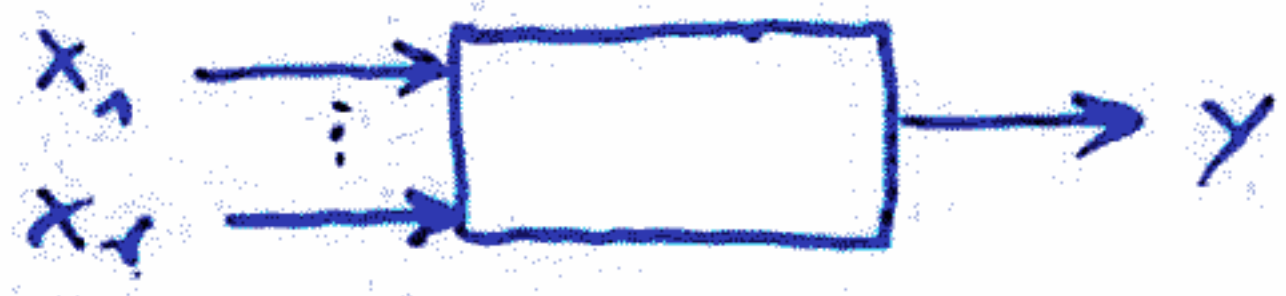


H. Späth: Algorithmen für multivariable Ausgleichsmodelle, R. Oldenbourg, München, 1974



$$y = a_1 x_1 + a_2 x_2 + \dots + a_r x_r + a_0$$

n Datensätze $\{y_k, x_{1k}, x_{2k}, \dots, x_{rk}\} \quad n > r$

Ausgleichsprinzip: $\|Xa - y\|_2 \rightarrow \min$
 euklid. Norm

d.h.: überbestimmtes lineares Gleichungssystem

multiple (linear) Regression:



simultane Schätzung mehrerer Gleichungen

falls Modelle nichtlinear:

allgemeines Approximationsproblem

- L_2
 - L_1
 - L_∞
 - L_p
- } Norm

Ökonometrie
 Biometrie