

Робастность (Robustness)

Синонимы: Устойчивость

Робастность (англ. robustness, от robust — «крепкий», «сильный», «твердый», «устойчивый») в математической статистике это устойчивость вероятностной оценки к наличию в данных аномальных значений или к нарушению предположений, ограничивающих применение соответствующего статистического метода.

Например, если при получении оценки с помощью некоторой модели (скажем, линейной регрессии) используется предположение о том, что данные распределены по нормальному закону, то возникает вопрос, насколько состоятельной окажется оценка, если распределение данных отклоняется от нормального. Если смещение оценки при отклонении распределения от нормального невелико, то ее называют **робастной**.