

Стандартная ошибка оценивания (Standard estimation error)

Раздел: [Метрики](#)

Стандартная ошибка оценивания — величина, равная квадратному корню среднеквадратической ошибки (MSE — mean square error) [регрессии](#). MSE , в свою очередь, равна сумме квадратов разностей между наблюдаемыми y и оцененными с помощью регрессии значениями \hat{y} , вычисленной по всем наблюдениям и отнесенной к их числу n :

$$\widehat{E}_{st} = \sqrt{MSE} = \sqrt{\frac{1}{n} \sum_{i=1}^n (y - \hat{y})^2}.$$

Значение стандартной ошибки позволяет увидеть степень отклонения значений, полученных с помощью регрессии, от фактически наблюдаемых, и таким образом оценить точность соответствующей модели.