

A GEOMETRIC APPROACH THE RIDGE ESTIMATOR OF C. R. RAO.

Luzia Aparecida da COSTA¹
Lucas Monteiro CHAVES²
Devanil Jaques de SOUZA²

- *ABSTRACT: The geometry of the ridge estimator proposed by Rao, as well as its connections with ordinary least squares estimator, are presented. For linear combinations of the parameters, it is shown the ellipsoid where Rao's ridge estimator has lower errors than the OLS estimator. It is also shown an example studied in the literature.*
- *KEYWORDS: Ridge estimator; minimum square estimator; linear combination of parameters; square error.*

¹ Universidade Federal de Lavras - UFLA, Programa de Pós-graduação em Estatística e Experimentação Agronômica, CEP: 37200-000, Lavras, MG, Brasil. E-mail: luziamatematica@hotmail.com

² Universidade Federal de Lavras - UFLA, Departamento de Ciências Exatas, Caixa Postal 3037, CEP: 37200-000, Lavras, MG, Brasil. E-mail: jssbueno@dex.ufla.br / devaniljaques@dex.ufla.br