

49(6)

半参数回归模型小波估计的强相合性

胡宏昌, 胡迪鹤

武汉大学数学与统计学院

收稿日期 2005-3-7 修回日期 2005-8-22 网络版发布日期 2006-10-26 接受日期 2006-01-10

摘要 考虑半参数回归模型(), 其中 为未知参数, 为 上的未知Borel函数, 为 上的随机设计, 随机误差序列为鞅差序列, 为[0,1]上的常数序列。本文用小波的方法得到 、 的估计量分别为 、 , 并得到了它们的强相合性。

关键词 [半参数回归模型](#) [小波估计](#) [强相合性](#) [鞅差序列](#)

分类号 [62G05](#)

Strong Consistency of Wavelet Estimation in Semiparametric Regression Models

Hong Chang HU, Di He HU

School of Mathematics and Statistics, Wuhan University, Wuhan 430072

Abstract Consider the semiparametric regression model () where β is a unknown parametric vector, η is an unknown Borel function on $[0, 1]$, X is a random design vector, random error sequences is martingale difference sequences, c is constant sequence on $[0, 1]$. In the paper, the estimators of parameter and nonparameter are established by wavelet method, and the strong consistency of wavelet estimators are studied.

Key words [semiparametric regression model](#) [wavelet estimation](#) [strong consistency](#) [martingale sequences](#)

DOI:

通讯作者 胡宏昌 retutome@163.com

扩展功能

本文信息

- ▶ [Supporting info](#)
- ▶ [PDF\(419KB\)](#)
- ▶ [\[HTML全文\]\(0KB\)](#)
- ▶ [参考文献](#)

服务与反馈

- ▶ [把本文推荐给朋友](#)
- ▶ [加入我的书架](#)
- ▶ [加入引用管理器](#)
- ▶ [复制索引](#)
- ▶ [Email Alert](#)
- ▶ [文章反馈](#)
- ▶ [浏览反馈信息](#)

相关信息

- ▶ 本刊中 包含“半参数回归模型”的 [相关文章](#)
- ▶ 本文作者相关文章

- [胡宏昌](#)
- [胡迪鹤](#)