

部分线性模型中估计的渐近正态性

高集体, 陈希孺, 赵林城

中国科学技术大学数学系

收稿日期 1992-1-20 修回日期 1993-4-14 网络版发布日期 接受日期

摘要 考虑回归模型 $y_i = x_i \beta + g(t_i) + \sigma_{ie_i}, 1 \leq i \leq n$ 其中 $\sigma_i^2 = f(u_i), f(\cdot), g(\cdot)$ 是未知函数, (x_i, t_i, u_i) 是固定非随机设计点列, β 是待估参数, e_i 是随机误差。基于 $g(\cdot)$ 及 $f(\cdot)$ 的一类非参数估计 (包括常见的核估计和近邻估计), 我们构造了 β 的加权最小二乘估计, 并证得了最小二乘估计和加权最小二乘估计的渐近正态性。

关键词 [部分线性模型](#) [非参数估计](#) [最小二乘估计](#) [加权最小二乘估计](#) [渐近正态性](#)

分类号

Abstract

Key words

DOI:

通讯作者

扩展功能

本文信息

- ▶ [Supporting info](#)
- ▶ [PDF\(0KB\)](#)
- ▶ [\[HTML全文\]\(0KB\)](#)
- ▶ [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“部分线性模型”的相关文章](#)
- ▶ [本文作者相关文章](#)

- [高集体](#)
- [陈希孺](#)
- [赵林城](#)