

## 变系数EV模型基于核估计的误差方差估计

李泽华(1), 刘万荣(2), 吴小腊(2)

(1)华南农业大学理学院统计系, 广州 510642; 湖南师范大学数学与计算机科学学院, 长沙 410081; (2)湖南师范大学数学与计算机科学学院, 长沙 410081.

收稿日期 2007-4-3 修回日期 2007-10-17 网络版发布日期 2009-5-15 接受日期

**摘要** 在利用核函数法和广义最小二乘法讨论变系数EV模型系数参数估计的基础上给出了其误差方差  $\sigma^2$  的一种估计量  $\widehat{\sigma}_n^2$ , 证明了所定义的估计量  $\widehat{\sigma}_n^2$  有很好的大样本性质.

**关键词** [变系数EV模型, 核估计, 误差方差估计, 相合性.](#)

分类号 [62G05](#)

## Estimation of the Error Variance Based on Kernel Estimation in Varying-Coefficients EV Model

LI Zehua(1), LIU Wanrong(2), WU Xiaola(2)

(1)College of Science, South China Agricultural University, Guangzhou 10642; Mathematics and Computer Department, Hunan Normal University, Changsha 410081; (2)Mathematics and Computer Department, Hunan Normal University, Changsha 410081.

**Abstract** In this paper, the estimation of the error variance for the varying-coefficients EV model is given by using kernel smoothing and generalized least square method. The strong consistency of the estimator is obtained.

**Key words** [Varying-coefficient EV models](#) [kernel estimation](#) [estimation of the error variance consistency.](#)

DOI:

通讯作者

### 扩展功能

#### 本文信息

- ▶ [Supporting info](#)
- ▶ [PDF\(389KB\)](#)
- ▶ [\[HTML全文\]\(0KB\)](#)
- ▶ [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](#)

#### 相关信息

- ▶ 本刊中 包含“[变系数EV模型, 核估计, 误差方差估计, 相合性.](#)”的 [相关文章](#)
- ▶ 本文作者相关文章
  - [李泽华](#)
  - [刘万荣](#)
  - [吴小腊](#)