



一类新的 Kantorovich 型不等式及其在统计中的应用

<http://www.firstlight.cn> 2007-08-07

0. 不等式(1)当 $x' = 1/\sqrt{2}(1, 0, \dots, 0, 1)$ 时等号成立.(1)式有各种各样的推广形式. 它们总称为 Kantorovich 型不等式. Kantorovich 型不等式在统计中的应用主要是讨论广义 Gauss-Markoff 模型中归系数向量的最小二乘估计相对于最佳线性无偏估计的效率的界, 见文 [1] 及其参考文献. 本文证明了一类新的 Kantorovich 型不等式, 以及它在估计一类新的最小二乘估计效率的界中的应用, 并且给出了它在估计一类广义相关系数和多元正态线性模型下一类线性假设检验统计量的界中的应用.

[存档文本](#)