

您的位置: 首页 >> 首发论文 >> 数学 >> 一阶随机系数INAR模型的经验似然

## 一阶随机系数INAR模型的经验似然

### Empirical likelihood for first-order random coefficient integer-valued autoregressive processes

发布时间: 2010-10-20 浏览量: 129 收藏数: 0 评论数: 0

**总览** 评价

张海祥<sup>1,\*</sup>, 王德辉<sup>1,\*</sup>, 朱复康<sup>2</sup>

( <sup>1</sup>、吉林大学数学学院; <sup>2</sup>、吉林大学数学研究所; )

**摘要:** 本文研究了一阶随机系数INAR模型的经验似然方法, 得到了对数经验似然比统计量的极限分布。我们研究了模型参数的置信域和假设检验问题。我们考虑了模型参数的极大经验似然估计及其极限分布, 最后通过数值模拟和条件最小二乘估计进行了比较。

**关键词:** 概率论与数理统计; INAR 模型; 条件最小二乘; 假设检验; 极大经验似然

Zhang Haixiang, Wang Dehui, Zhu Fukang

( Institute of Mathematics, Jilin University; )

**Abstract:** This paper studies the empirical likelihood method for a first-order random coefficient integer-valued autoregressive model. The limiting distribution of the log empirical likelihood ratio statistic is established. Confidence regions for the interested parameter and their coverage probabilities are given, and hypothesis testing is considered. The maximum empirical likelihood estimator for the parameter is derived and its asymptotic properties are established. The performances of the estimator are compared with the conditional least square estimator via simulation.

**Keywords:** INAR model; Conditional least square; Asymptotic distribution; Hypothesis Testing; Maximum empirical likelihood

PDF全文下载: 初稿 ( 75 ) [下载PDF阅读器](#)

作者简介:  
通信联系人: 王德辉

#### 【收录情况】

论文在线: 张海祥, 王德辉, 朱复康. 一阶随机系数INAR模型的经验似然[OL].  
中国科技论文在线 <http://www.paper.edu.cn/index.php/default/releasepaper/content/201010-359>  
发表期刊: 暂无

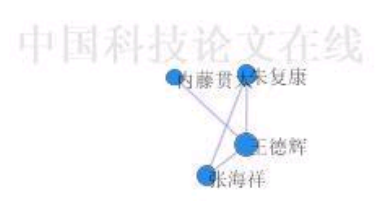
#### 首发论文搜索

题目  作者 > 请选择

定制本学科

### 陕西师范大学招聘教授

#### 本文作者合作关系 [more](#)



#### 本文相关论文 [more](#)

