

响应变量随机缺失下的广义变系数模型的估计

李志强(1), 薛留根(2)

(1)北京化工大学理学院, 北京 100029; 北京工业大学应用数理学院, 北京 100022; (2)北京工业大学应用数理学院, 北京 100022.

收稿日期 2006-2-9 修回日期 2007-4-25 网络版发布日期 2008-11-19 接受日期

摘要 在响应变量随机缺失时,利用拟似然方法给出了广义变系数模型中非参数函数系数的估计. 研究了所得到的估计的渐近性质,求出了估计的渐近偏差与渐近方差,并进行模拟比较.

关键词 [随机缺失](#),[广义变系数模型](#),[拟似然估计](#),[渐近正态性](#).

分类号 [62G08](#)

The Estimation of Generalized Varying-Coefficient Model with Response Variables Missing at Random

LI Zhiqiang(1), XUE Liugen(2)

(1)College of Sciences, Beijing University of Chemical Technology, Beijing 100029; College of Applied Sciences, Beijing University of Technology, Beijing 100022; (2) College of Applied Sciences, Beijing University of Technology, Beijing 100022.

Abstract A quasi-likelihood estimation is considered for nonparameter coefficient function in generalized varying-coefficient model with response variables missing at random. It is shown that the proposed estimation is asymptotically normal, moreover, the asymptotical bias and the variance of the estimation are given.

Key words [Missing at random](#), [generalized varying-coefficient model](#), [quasi-likelihood estimation](#), [asymptotical normality](#).

DOI:

通讯作者

扩展功能

本文信息

- ▶ [Supporting info](#)
- ▶ [PDF\(372KB\)](#)
- ▶ [\[HTML全文\]\(0KB\)](#)
- ▶ [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“[随机缺失, 广义变系数模型, 拟似然估计, 渐近正态性.](#)”的 [相关文章](#)
- ▶ 本文作者相关文章

- [李志强](#)
- [薛留根](#)