

学术论文

# 尺度参数变点的非参数检验

王黎明, 王静龙

上海财经大学统计学系, 华东师范大学统计系

收稿日期 修回日期 网络版发布日期:

**摘要** 本文讨论了尺度参数模型参数变点的假设检验问题。基于两样本  $U$ -统计量, 我们给出了两个检验, 并且研究了检验统计量分布的极限性质。我们证明了这两个检验统计量的极限分布分别是  $\sup_{0 < t < 1} |B(t)|$  和极值分布, 其中  $\{B(t), 0 \leq t \leq 1\}$  是一个 Brown 桥。

**关键词** [变点](#), [U-统计量](#), [位置-尺度参数模型](#), [Brown 桥](#), [极值分布](#)。

分类号

## Non-Parameter Test for Change-Point of Scale Parameter

WANG LIMING, WANG JINGLONG

Department of Statistics, Shanghai University of Finance & Economics; Department of Statistics, East China Normal University

### Abstract

The change-point problem about the scale parameter is discussed in this paper. Based on two-sample  $U$ -statistic two tests are proposed, and their approximate distributions, which are  $\sup_{0 < t < 1} |B(t)|$  and extreme value distribution respectively, where  $\{B(t), 0 \leq t \leq 1\}$  is a Brownian bridge, are obtained.

### Key words

DOI

扩展功能
本文信息
▶ <a href="#">Supporting info</a>
▶ <a href="#">PDF(381KB)</a>
▶ <a href="#">[HTML全文](0KB)</a>
▶ <a href="#">参考文献</a>
服务与反馈
▶ <a href="#">把本文推荐给朋友</a>
▶ <a href="#">复制索引</a>
▶ <a href="#">Email Alert</a>
▶ <a href="#">文章反馈</a>
▶ <a href="#">浏览反馈信息</a>
相关信息
▶ <a href="#">本刊中包含“变点, U-统计量, 位置-尺度参数模型, Brown 桥, 极值分布。”的相关文章</a>
▶ 本文作者相关文章
· <a href="#">王黎明</a>
· <a href="#">王静龙</a>