

半参数回归模型的几乎无偏岭估计

胡宏昌

湖北师范学院数学与统计学院, 黄石 435002

收稿日期 2008-4-16 修回日期 2008-12-30 网络版发布日期 2010-1-26 接受日期

摘要 提出了半参数回归模型的几乎无偏岭估计, 并与岭估计进行了比较, 在均方误差意义下, 几乎无偏岭估计优于岭估计. 然后讨论了有偏参数的选取问题. 最后, 用模拟算例和实际应用说明了几乎无偏岭估计的有效性和可行性.

关键词 [半参数回归模型](#), [几乎无偏岭估计](#), [均方误差](#), [小波核](#).

分类号 [62G05](#)

Almost Unbiased Ridge Estimators in a Semiparametric Regression Model

HU Hongchang

School of Mathematics and Statistics, Hubei Normal University, Huangshi 435002

Abstract A semiparametric regression model is considered, and the almost unbiased ridge estimators (AURR) of both parameters and nonparameters is introduced without a restrained design matrix. The AURR is compared with ridge estimator (RR) under a mean square error (MSE), the result shows that the former excels the latter, and the optimal value for the biased parameter is established by minimum MSE. The validity and feasibility of AURR are demonstrated by a simulation example.

Key words [Semiparametric regression model](#), [almost unbiased ridge estimator](#), [mean square error](#), [wavelet kernel](#).

DOI:

通讯作者

扩展功能

本文信息

▶ [Supporting info](#)

▶ [PDF\(470KB\)](#)

▶ [\[HTML全文\]\(0KB\)](#)

▶ [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“[半参数回归模型, 几乎无偏岭估计, 均方误差, 小波核.](#)”的 [相关文章](#)

▶ 本文作者相关文章

· [胡宏昌](#)