

一个简化的新Laplace AR(1)模型 参数估计及其渐近性质

朱复康, 王德辉

吉林大学数学学院, 长春 130012

收稿日期 2006-3-20 修回日期 2008-6-26 网络版发布日期 2009-2-5 接受日期

摘要 研究了一个简化的新的Laplace AR(1)模型参数的条件最小二乘估计和最大拟似然估计, 并讨论了它们的强相合性和渐近正态性. 通过数值模拟和实际例子, 说明了最大拟似然估计及模型的优越性.

关键词 [Laplace AR\(1\)模型](#), [条件最小二乘](#), [最大拟似然](#), [强相合性](#), [渐近正态性](#).

分类号 [62M10](#), [62F12](#)

Parameter Estimation and Asymptotic Properties for a Simplified New Laplace AR(1) Model

ZHU Fukang, WANG Dehui

School of Mathematics, Jilin University, Changchun 130012

Abstract In this paper, conditional least squares estimation and maximum quasi-likelihood estimation are studied for a simplified new Laplace AR(1) model, and their consistency and asymptotic normality are also considered. The simulation results show that maximum quasi-likelihood estimation dominates conditional least squares estimation via simulation.

Key words [Asymptotic normality](#) [conditional least squares](#) [Laplace AR\(1\) model](#) [maximum quasi-likelihood](#) [strong consistency](#).

DOI:

通讯作者

扩展功能

本文信息

- ▶ [Supporting info](#)
- ▶ [PDF\(334KB\)](#)
- ▶ [\[HTML全文\]\(0KB\)](#)
- ▶ [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 "[Laplace AR\(1\)模型](#), [条件最小二乘](#), [最大拟似然](#), [强相合性](#), [渐近正态性](#)." 的 [相关文章](#)
- ▶ 本文作者相关文章

- [朱复康](#)
- [王德辉](#)