

## 半参数回归模型中随机加权M估计的强逼近

薛留根

北京工业大学应用数理学院,北京100022

收稿日期 修回日期 网络版发布日期 接受日期

**摘要** 用随机加权法给出了半参数回归模型中参数的随机加权M估计,在一般的条件下证明了用随机加权统计量的分布逼近原估计量误差的分布的强有效性,并给出了M估计的最优强收敛速度.

**关键词** [半参数回归模型,随机加权法,M估计,强逼近](#)

分类号

## STRONG APPROXIMATION OF RANDOM WEIGHTING M-ESTIMATES IN SEMIPARAMETRIC REGRESSION MODEL

Liu Gen XUE

College of Applied Mathematics Sciences, Beijing Polytechnic University, Beijing 100022,P.R.China

**Abstract** In this paper, the random weighted  $M$ -estimates for a semiparametric regression model is given by random weighting method. Under some regular condition, the strong approximation of random weighted  $M$ -estimates is established, and the optimal global rates of strong convergence for  $M$ -estimates is obtained.

**Key words** [Semiparametric regression model](#) [random weighting method](#) [M-estimates](#)

DOI:

通讯作者

### 扩展功能

#### 本文信息

- ▶ [Supporting info](#)
- ▶ [PDF\(0KB\)](#)
- ▶ [\[HTML全文\]\(0KB\)](#)
- ▶ [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](#)
- ▶ [文章反馈](#)
- ▶ [浏览反馈信息](#)

#### 相关信息

- ▶ [本刊中 包含“半参数回归模型,随机加权法,M估计,强逼近”的相关文章](#)
- ▶ [本文作者相关文章](#)
- [薛留根](#)