

# 半参数回归模型中误差方差估计之分布的非一致性收敛速度

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 引言:

Engle等人 $\beta_j$ 将气候条件对电力需求关系归结成半参数回归模型

\$\$

$$Y_j = X_j^{\tau} \beta_j + g(T_j) + e_j, \quad j = 1, \dots, n, \quad (1)$$

\$\$

其中  $\{e_j, 1 \leq j \leq n\}$  是iid.的随机误差, 均值为0, 方差  $\sigma^2 > 0$ ,

$\{(X_j, T_j), 1 \leq j \leq n\}$ 是 $\mathbb{R}^p \times [0, 1]$ 上的随机设计点列

且与 $\{e_j, 1 \leq j \leq n\}$  相互独立,  $\{T_j, 1 \leq j \leq n\}$  iid.,

$\beta_j$  是  $\beta$  维未知回归参数,  $g(t)$ 是定义在 $[0, 1]$ 上的未知回归函数.

关键词

分类号

# 半参数回归模型中误差方差估计之分布的非一致性收敛速度

薛留根

**Abstract**

**Key words**

DOI:

通讯作者

## 扩展功能

### 本文信息

▶ [Supporting info](#)

▶ [PDF\(301KB\)](#)

▶ [\[HTML全文\]\(0KB\)](#)

▶ [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 无 相关文章](#)

▶ 本文作者相关文章

· [薛留根](#)