

## 广义线性回归参数的“学生化”极限定理

岳丽(1), 陈希孺(2)

(1)武汉大学数学与统计学院, 武汉 430072; (2)中国科学院研究生院, 北京 100049

收稿日期 2005-5-16 修回日期 2006-2-12 网络版发布日期 2008-4-16 接受日期

**摘要** 在一定条件下证明了当广义线性回归参数  $\beta_0$  的极大似然估计  $\widehat{\beta}_n$  满足形如  $F_n^{\frac{1}{2}}(\beta_0)(\widehat{\beta}_n - \beta_0) \stackrel{d}{\longrightarrow} N(0, I)$  的极限定理时, 用  $\widehat{\beta}_n$  取代  $F_n^{\frac{1}{2}}(\beta_0)$  中的  $\beta_0$  时, 结果仍成立.

**关键词** [广义线性回归](#), [渐近正态性](#), [学生化](#).

分类号 [62J05](#)

YUE Li(1), CHEN Xiru(2)

(1)School of Mathematics and Statistics, Wuhan University, Wuhan 430072; (2) Graduate School, Chinese Academy of science, Beijing 100049

**Abstract** It is proven, under suitable conditions, that whenever the MLE  $\widehat{\beta}_n$  for the parameter  $\beta_0$  of the Generalized Linear Models satisfies the limit theorem of the form  $F_n^{\frac{1}{2}}(\beta_0)(\widehat{\beta}_n - \beta_0) \stackrel{d}{\longrightarrow} N(0, I)$ , the result still holds if  $\beta_0$  in  $F_n^{\frac{1}{2}}(\beta_0)$  is replaced by  $\widehat{\beta}_n$ .

**Key words** [General linear model](#) [asymptotic normality](#) [limit theorem](#).

DOI:

通讯作者

### 扩展功能

#### 本文信息

- ▶ [Supporting info](#)
- ▶ [PDF\(353KB\)](#)
- ▶ [\[HTML全文\]\(0KB\)](#)
- ▶ [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“广义线性回归, 渐近正态性, 学生化.” 的相关文章](#)
- ▶ [本文作者相关文章](#)

- [岳丽](#)
- [陈希孺](#)