

论文

## 广义线性回归拟似然估计的渐近正态性

高启兵(1), 吴耀华(2)

(1)中国科学技术大学统计与金融系, 合肥 230026; 南京师范大学金融数学系, 南京 210097;(2)中国科学技术大学统计与金融系, 合肥 230026

收稿日期 修回日期 网络版发布日期 接受日期

摘要 研究了形如 $\sum_{i=1}^n x_i(y_i - \mu(x_i^{\beta})) = 0$ 拟似然方程,

在一定的条件下证明了拟似然估计 $\widehat{\beta}_n$ 的渐近正态性; 并进一步证

明了可用于 $\beta_0$ 大样本统计推断的渐近正态性结果.

关键词 [广义线性回归](#) [拟似然估计](#) [渐近正态性](#)

分类号

## ASYMPTOTIC NORMALITY OF QUASI-MAXIMUM LIKELIHOOD ESTIMATOR IN GENERALIZED LINEAR MODELS

Gao Qibing(1), Wu Yaohua(2)

(1)Department of Statistics and Finance of USTC, Hefei 230026; Department of Financial Mathematics of Nanjing Normal University, Nanjing 210097;(2)Department of Statistics and Finance of USTC, Hefei 230026

**Abstract** This paper studies the quasi-likelihood equation  $\sum_{i=1}^n x_i(y_i - \mu(x_i^{\beta})) = 0$ . Under certain conditions, we obtain the asymptotic normality of the quasi-maximum likelihood estimate  $\widehat{\beta}_n$ . Furthermore, we obtain an asymptotic normality result of  $\beta_0$ , which can be used in the practical statistical inference.

**Key words** [Generalized linear models](#) [quasi-likelihood estimator](#) [asymptotic normality](#)

DOI:

通讯作者

### 扩展功能

本文信息

▶ [Supporting info](#)

▶ [PDF\(241KB\)](#)

▶ [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“广义线性回归”的相关文章](#)

▶ 本文作者相关文章

· [高启兵](#)

· [吴耀华](#)