

高维线性模型中的经验似然

石坚

中国科学院数学与系统科学研究院, 北京 100080

收稿日期 2006-10-20 修回日期 网络版发布日期 2007-3-5 接受日期

摘要 研究高维线性模型中的经验似然推断. 当协变量的维数随样本量增加时, 常规的经验似然推断失效. 在适当的正则条件下, 对修正的经验似然比统计量给出了渐近分布理论.

关键词 [线性模型](#) [经验似然](#) [高维协变量](#)

分类号 [62E20](#), [62F05](#)

EMPIRICAL LIKELIHOOD FOR HIGHER DIMENSIONAL LINEAR MODELS

Shi Jian

Academy of Mathematics and Systems Science, Chinese Academy of Sciences, Beijing 100080

Abstract Empirical likelihood for higher dimensional linear model is studied in this paper. When the dimension number of covariates increases with the sample size, conventional empirical likelihood inference becomes invalid. To this end, some mild regularity conditions are imposed and an asymptotic distribution theory is established for modified statistic.

Key words [Linear models](#) [empirical likelihood](#) [higher dimensional covariates](#)

DOI:

通讯作者

扩展功能

本文信息

- ▶ [Supporting info](#)
- ▶ [PDF\(350KB\)](#)
- ▶ [\[HTML全文\]\(0KB\)](#)
- ▶ [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“线性模型”的相关文章](#)
- ▶ [本文作者相关文章](#)
- [石坚](#)