

О РЕШЕНИЯХ УРАВНЕНИЯ ДЛЯ УЛУЧШАЮЩИХ ДОБАВОК В ЗАДАЧАХ РЕГРЕССИИ

Ю. Ю. Линке, А. И. Саханенко

В работе рассматривается задача поиска решения некоторого функционального уравнения, которое специальным образом зависит от распределения некоторой случайной величины. Такие уравнения естественным образом возникают при построении состоятельных оценок в задачах регрессии в случае, когда дисперсии основных наблюдений зависят от основного неизвестного параметра, а независимые переменные измеряются со случайными ошибками. В статье приведен также один простой пример задачи регрессии, в которой возникает необходимость решения изучаемого в работе уравнения.

Ключевые слова и фразы: функциональное уравнение, регрессия, ошибки в независимых переменных, зависимость дисперсий от параметра, двухшаговое оценивание.

Линке Юлиана Юрьевна

Институт математики
им. С. Л. Соболева СО РАН,
просп. Академика Коптюга, 4;
Новосибирск, 630090 РОССИЯ.
Новосибирский государственный университет,
Новосибирск, 630090 РОССИЯ.
E-mail: linke@math.nsc.ru

Статья поступила
1 июля 2011 г.

Саханенко Александр Иванович

Институт математики
им. С. Л. Соболева СО РАН,
просп. Академика Коптюга, 4,
Новосибирск, 630090 РОССИЯ.
E-mail: aisakh@mail.ru