

**ОБ АСИМПТОТИКЕ РАСПРЕДЕЛЕНИЙ ОДНОГО
КЛАССА ДВУХШАГОВЫХ СТАТИСТИЧЕСКИХ
ОЦЕНОК МНОГОМЕРНОГО ПАРАМЕТРА**

Ю. Ю. Линке, А. И. Саханенко

В работе изучается точность оценивания неизвестных параметров в случае использования двухшаговых статистических оценок, допускающих специальные представления. Предложенный ранее авторами подход к изучению такого рода задач распространен на случай, когда оценивается многомерный параметр. В результате при широких ограничениях получены необходимые и достаточные условия слабой сходимости нормированной погрешности оценивания к многомерному нормальному распределению.

Ключевые слова и фразы: асимптотически нормальные оценки, улучшение статистических оценок, двухшаговые оценки, многомерный параметр, предельное распределение, регрессия.

Линке Юлиана Юрьевна
Саханенко Александр Иванович

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

Статья поступила
25 апреля 2012 г.