

Об эффективном оценивании функции регрессии с дискретным временем

Пчелинцев Евгений Анатольевич

Томский государственный университет

evgen-pch@yandex.ru

Соавторы: Никифоров Н. И., Пергаменщиков С. М.

Секция: Теория вероятностей

Рассматривается задача статистического непараметрического оценивания для модели дискретной регрессии. На основе метода оценивания, развитого в [1], строится новая процедура оценивания, для которой установлено, что скорость сходимости является почти параметрической (с точностью до логарифмического коэффициента), т. е. устанавливается свойство суперэффективности. Более того, в этом случае вычисляется константа Пинскера для соболевского класса с экспоненциальными коэффициентами.

- [1] E. A. Pchelintsev, S. M. Pergamenshchikov, M. A. Povzun, *Efficient estimation methods for non-Gaussian regression models in continuous time*, Annals of the Institute of Statistical Mathematics, 74 (2022), 113–142.