

A'-1 セミパラメトリックモデルでの部分尤度比の  
高次漸近展開と逐次解析への応用

長崎大学・経済 永井圭二

代表的なセミパラメトリックモデルである比例ハザードモデルの検定問題を考える。検定統計量として、対数部分尤度比を Chernoff-Savage 統計量と見なし、 $U$ -統計量の理論を用いて高次に展開する。応用として、逐次確率比検定を考え、Woodroffe-Lai-Siegmund の非線形更新定理の適用を行う。また、比例ハザードモデルでの有限次元パラメータの変化の問題を考え、逐次解析的な方法を用いて Shiriyayev-Roberts 型の停止則の動作特性の高次漸近展開を求める。