Universidade Federal do Rio Grande do Sul
Instituto de Matemática
Departamento de Estatística

Anais

I SEMANÍSTICA

Semana Acadêmica do Departamento de Estatística da

Universidade Federal do Rio Grande do Sul

Porto Alegre - 23 a 25 de maio de 2012

Estimação em Processos SARFIMA com Inovações α-Estáveis

Cleber Bisognin[1]; Josiane Stein [2]

Resumo: Neste trabalho analisamos processos com a propriedade de longa dependência e sazonalidade, com inovações α-estáveis. Os processos com inovações α-estáveis apresentam a característica de ter variância infinita, além da propriedade de longa dependência. Apresentamos um estudo sobre estimação paramétrica e semiparamétrica para estes processos. Além disso, realizamos um estudo baseado em simulações de Monte Carlo, comparando os diversos estimadores definidos. Para a estimação semiparamétrica, utilizamos a metodologia de Geweke e Porter-Hudak (1983), com suas versões robustas. Para a estimação paramétrica, empregamos as propostas de Fox e Taqqu (1986) e um novo estimador sugerido.

[1]DEST-PPGMAT, UFRGS.
[2]PPGMAT, UFRGS.