

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

7 Sessão Pôster

Processos k -Factor GARMA Contaminados com *Outliers* Aditivos

CLEBER BISOGNIN¹; LUCAS SERAFIM²

Resumo: O objetivo principal neste trabalho é estudar os processos estocásticos k -Factor GARMA, métodos de estimação clássicos (semiparamétricos e paramétricos) e robustos para os seus parâmetros quando o processo estocástico está ou não contaminado por *outliers* aditivos, utilizando o modelo de contaminação por mistura. Este estudo será realizado em duas etapas. Na primeira etapa, faremos um estudo analítico destes processos, da estimação. Na segunda etapa, faremos um estudo de simulações de Monte Carlo para verificarmos o comportamento dos estimadores.

¹DEST-PPGMAT, UFRGS.

²DEST, UFRGS.