

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

Processos ARFIMA Contaminados com *Outliers* Aditivos

CLEBER BISOGNIN¹; PAULA SIENTCHKOVSKI²

Resumo: O objetivo principal neste trabalho é estudar os processos estocásticos ARFIMA, métodos de estimação clássicos paramétricos 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, isto é, estudo das propriedades do processo e estimadores dos parâmetros. Na segunda etapa, faremos um estudo de simulações de Monte Carlo para verificarmos o comportamento destes estimadores.

¹DEST-PPGMAT, UFRGS.

²DEST, UFRGS.