

SEMINÁRIOS
SÉRIES TEMPORAIS, ONDALETAS E DADOS
FUNCIONAIS

LOCAL: IME-USP, Bloco B - Sala B04

DATA: 18 de setembro de 2014

HORÁRIO: 15h00

MEDIDAS DE DEPENDÊNCIA LOCAL
Sumaia A. Latif, EACH-USP

O objetivo deste seminário é apresentar o estudo de algumas medidas de dependência local bivariadas e também a proposta de uma nova medida de dependência local multivariada. São considerados tanto o contexto de observações independentes quanto o de séries temporais estacionárias. Em todos os casos, estimadores não paramétricos (empíricos e/ou suavizados) são propostos e algumas de suas propriedades são obtidas. O comportamento das medidas e de seus estimadores são avaliados através de simulações. Aplicações utilizando dados reais são descritas.

(Trabalho conjunto com Pedro A. Morettin, IME-USP)