

SEMINÁRIOS
SÉRIES TEMPORAIS, ONDALETAS E DADOS
FUNCIONAIS

LOCAL: IMECC, Unicamp, Sala 121

DATA: 30 de abril de 2015

HORÁRIO: 15h30

ANÁLISE DE MODELOS COM ESTRUTURA DE CORRELAÇÃO TEMPORAL
UTILIZANDO A DISTRIBUIÇÃO T MULTIVARIADA

Aldo Medina Garay, Unicamp

Neste seminário serão apresentados os principais resultados do uso da Distribuição t Multivariada em modelos com estrutura de correlação temporal DEC (Damping Exponential Correlation) para os erros, tendo como casos particulares os modelos AR(1) e MA(1). Serão apresentados a metodologia de estimação e estudos de previsão para os modelos censurados, com uma aplicação a dados reais. Também será feita uma breve discussão sobre o uso da metodologia em modelos cicloestacionários, via estudos de simulação.

Trabalho conjunto com Victor H. Lachos (IMECC-UNICAMP), Jacek Leskow (Institute of Mathematics, Cracow, Poland), Luis M. Castro (Univ. de Concepcin, Chile) e Christiana Drake (University of California, Davis)