

Procesos de Larga Memoria Localmente Estacionarios

Wilfredo Palma

Departamento de Estadística, Facultad de Matemáticas, Pontificia Universidad Católica de Chile.

Resumen Este trabajo estudia procesos de larga memoria con parametros variantes en el tiempo. Se propone una clase general de estos modelos y se desarrollan tecnicas de estimacion, incluyendo una extension del metodo de Whittle y las ecuaciones de Kalman. Este ultimo metodo permite la estimacion de modelos con observaciones faltantes. El desempeño para muestras finitas de estos estimadores se estudia por medio de simulaciones Monte Carlo. A su vez, se analiza el comportamiento asintotico de los estimadores, demostrandose su consistencia, normalidad y eficiencia. Aplicaciones de estas metodologias a datos reales tambien se discuten.