

Modelos trawl en tiempo discretos

Paul Doukhan,

Laboratory of Mathematics UCP, Université Cergy-Pontoise, France.

5 april 2017

Abstract

Esta charla está dedicada a la presentación de resultados asintóticos para red barrederas a tiempo discreto, que corresponden a un caso especial de procesos a tiempo continuo introducidos por Barndorff-Nielsen *et al.* 2014. Estos modelos incluyen modelos de dependencia larga que pueden tener valores enteros. Para dos tipos de procesos considerados, demostramos que los límites son un movimiento Browniano fraccionario o un proceso de Lévy estable con una normalización particular.

Así que conseguimos un fenómeno interesante porque se observa que sumas de varias aleatorias con momentos exponenciales (posiblemente acotadas) tienden a sumas parciales asintóticamente estables.

Por otra parte, como lo han observado Barndorff-Nielsen *et al.*, la estructura de orden 2 es asintóticamente la del movimiento Browniano fraccionario.

Finalmente, se consideran estimadores del coeficiente de Hurst obtenido con log-regresión de la covarianza y por estos estimadores se demuestran resultados asintóticos. Este estimador es comparado al estimador de Whittle local, mediante simulaciones. Más desarrollos serán también propuestos.