

Estimación robusta para series de tiempo de conteo

Luis de la Fuente

Instituto de Estadística, Universidad de Valparaíso

Héctor Araya

Instituto de Estadística, Universidad de Valparaíso

Resumen

En el presente trabajo se pretende estimar, por medio de un método de estimación robusta, los parámetros asociados a un modelo autoregresivo de orden uno a valores enteros con una clase de ruido general que recibe el nombre de ruido de serie de potencias. Se considera la estimación de los parámetros en presencia de datos atípicos, para lo cual se lleva a cabo una estimación de momentos que está asociada a las ecuaciones de covarianza, llamadas ecuaciones de Yule-Walker.

Para estudiar los resultados de la propuesta, se estudian las propiedades del modelo, calculan los estimadores con robustez y se realiza un estudio de simulación para estudiar el comportamiento de los estimadores bajo muestras pequeñas.