

SEMINÁRIOS
SÉRIES TEMPORAIS, ONDALETAS E DADOS
FUNCIONAIS

LOCAL: **IME-USP, Sala 09 do Bloco B**

DATA: **10 de abril de 2014**

HORÁRIO: **15h00**

TESTES, AGRUPAMENTOS E CLASSIFICAÇÃO DE SÉRIES TEMPORAIS
Alúcio Pinheiro, Unicamp

Suponha G grupos de séries temporais, isto é, $\mathbf{X}_1, \dots, \mathbf{X}_{n_g}$ são observadas para cada agrupamento $g = 1, \dots, G$. Apresentamos testes baseados em quase U -estatísticas para verificar a plausibilidade estatística desses grupos. Aplicam-se esses conceitos em grupos de séries temporais estacionárias, não-estacionárias e sujeitas à contaminação de valores aberrantes. Um procedimento de agrupamento baseado nessas estatísticas de teste, assim como um de classificação de novas séries. A metodologia é motivada por resultados teóricos, e ilustrada em estudos de simulação e em dados reais.

(trabalho conjunto com Márcio Valk, UFRGS)