

## Título: Séries Temporais e suas Autocorrelações Amostrais Viciadas e Estimadores de Mínima Distância Corrigidos de Vício

Prof. Gustavo de Carvalho Lana

### Resumo:

Funções de autocorrelações são de grande importância no estudo de séries temporais, devido ao seu papel na identificação de modelos, mas também em estimação. No entanto, a existência de vício nas funções de autocorrelações amostrais impacta negativamente tanto a identificação quanto a estimação. O estimador de mínima distância corrigido de vício (BCMDE) considera uma correção para o estimador de mínima distância (MDE) comum, que leva em consideração o vício na função de autocorrelação amostral quando a média é desconhecida. Estudos de simulação mostram que o BCMDE apresenta um bom desempenho em comparação com outros métodos utilizados na literatura como máxima verossimilhança, estimador Whittle, e o MDE.