

Comportamiento asintótico de estimadores robustos bajo corta y larga dependencia

Hélène Boistard

Université Toulouse I - Capitole, FRANCE

Email: `helene@boistard.fr`

Este trabajo presenta las propiedades asintóticas de unos estimadores robustos de localización y escala bajo corta y larga dependencia. Estos estimadores, tales como el estimador de escala propuesto inicialmente por Rousseeuw y Croux (1993), se pueden expresar en términos de cuantiles empíricos de un U -proceso. El resultado principal es el comportamiento asintótico de los U -procesos bajo corta y larga dependencia. Se usa para derivar la distribución asintótica y la eficiencia de los estimadores estudiados gracias al método Delta. Unos experimentos de Monte-Carlo permiten comprobar las tasas de convergencia de los estimadores y las propiedades de robustez cuando los datos están contaminados por datos atípicos. También se observará un ejemplo basado en datos reales.