

Resumo

Desenvolveu-se um método para estimar a variância da média amostral, de processos estocásticos estacionários, usando combinações lineares de estimadores, mais concretamente, usando regressão linear de estimadores OBM. Combinou-se também a abordagem da regressão linear com a abordagem do tamanho ótimo dos segmentos e obteve-se um método híbrido com melhores propriedades do que os métodos combinados.

Abstract

We've developed methodology to estimate the variance of the sample mean of stationary stochastic processes using linear combinations of estimators, specifically, using regression of Overlapping Batch Means estimators. We've also combined the approach of linear regression with the approach of the optimal batch size to obtain a hybrid method which shows better properties than both methodologies combined.