

Estudo do teste SNHT para detecção de pontos de mudança em séries temporais

Giovanna Garutti Chianezzi ¹

Maria Sílvia de Assis Mour ²

Resumo

O estudo de séries temporais é de extrema importância para uma melhor compreensão de como se desenvolvem determinados eventos ao longo do tempo. Para isso, ser capaz de indicar o momento exato em que um determinado fenômeno muda o seu padrão de comportamento é um recurso muito interessante. Este trabalho se aprofunda na temática da detecção de pontos de mudança em séries temporais por meio da utilização do SNHT (Standard Normal Homogeneity Test), que consiste em um teste estatístico proposto especificamente para este propósito. Um estudo a partir de séries de médias móveis simuladas, é realizado para avaliar o poder do teste e seu desempenho. O SNHT será aplicado em dados referentes ao número de casos novos de Covid-19 na cidade de São Paulo, na tentativa de se entender melhor o comportamento da pandemia da Covid-19 durante o seu primeiro ano.

Palavras-chave: Covid-19; Quebra estrutural; Séries Temporais; SNHT.

¹ Departamento de Estatística, UFSCar – giovanna.chianezzi@estudante.ufscar.br

² Departamento de Estatística, UFSCar – msilvia@ufscar.br