

Tabelas para estimações e intervalos de confiança

Arthur Zaneti

Julho 2023

Tabela 1: Resultados da simulação de Monte Carlo considerando os estimadores de máxima verossimilhança do modelo de regressão quantílico Chen e os intervalos de confiança de calculados a partir da matriz de informação observada, utilizando $\alpha = 0.05, \lambda = 0.7, \beta_0 = 2, \beta_1 = -1, \beta_2 = 0.8$.

	$\hat{\lambda}$	$\hat{\beta}_0$	$\hat{\beta}_1$	$\hat{\beta}_2$
Média	0.7298296	1.9924436	-0.9830438	0.7870272
Viés	0.0298296	-0.0075564	0.0169562	-0.0129728
Erro padrão	0.0521293	0.1940724	0.2323382	0.2489700
EQM	0.0036073	0.0377212	0.0542686	0.0621543
Limites inferiores	0.6935184	1.8429395	-1.5045264	0.3332106
Limites superiores	0.8788133	2.5556083	-0.7101479	1.0670145
Taxa de cobertura	0.8890000	0.9162000	0.9184000	0.9202000

Tabela 2: Estimações para $\alpha = 0.01, \lambda = 1.1, \beta_0 = 0.4, \beta_1 = 2, \beta_2 = 1.1, \beta_3 = 1.6, \beta_4 = -3$.

	$\hat{\lambda}$	$\hat{\beta}_0$	$\hat{\beta}_1$	$\hat{\beta}_2$	$\hat{\beta}_3$	$\hat{\beta}_4$
Média	1.1219182	0.4069151	1.9937932	1.0970450	1.5957216	-2.9914779
Viés	0.0219182	0.0069151	-0.0062068	-0.0029550	-0.0042784	0.0085221
Erro padrão	0.0338770	0.0381737	0.0331552	0.0271393	0.0341265	0.0453305
EQM	0.0016281	0.0015050	0.0011378	0.0007453	0.0011829	0.0021275
Limites inferiores	1.0316671	0.3120365	1.9196754	1.0316624	1.4972782	-3.1674905
Limites superiores	1.2065745	0.4929971	2.1039074	1.1629938	1.6665681	-2.9503518
Taxa de cobertura	0.8820000	0.9130000	0.9134000	0.9142000	0.9180000	0.9218000