

288

**O USO DE WAVELETS EM PROCESSOS DE LONGA DEPENDÊNCIA.** *Lisany Gonzalez de Souza, Silvia Regina Costa Lopes (orient.) (UFRGS).*

Em processos ARFIMA(0, d, 0) que modelam séries temporais com longa dependência, é preciso estimar adequadamente o valor do parâmetro fracionário d. O estimador sugerido por Jensen (1999), utiliza mínimos quadrados ordinários e funções expandidas em bases de wavelets. Após simulações verificou-se que este estimador é viciado. Com o objetivo de corrigir o vício desenvolveu-se um algoritmo iterativo que foi implementado em Fortran usando a wavelet Haar. O algoritmo acima está convergindo para um ponto fixo e não para o valor do parâmetro d. Usando uma matriz de pesos mais precisa do que a atual, espera-se obter um estimador de mínimos quadrados para o parâmetro d, que não seja viciado. (PIBIC).