

203

ESTIMAÇÃO EM PROCESSOS FRACIONARIAMENTE INTEGRADOS MULTIVARIADOS.*Clarissa de Azevedo Nadalon, Silvia Regina Costa Lopes (orient.) (UFRGS).*

O objetivo desse trabalho consiste em analisar a estimação do parâmetro de diferenciação em processos fracionalmente integrados multivariados. Considerando o processo estocástico vetorial ARFIMA(p, d, q), denotado por VARFIMA(p, d, q), queremos analisar o comportamento de diversos estimadores para o parâmetro $d=(d_1, \dots, d_k)$ quando o processo é k -dimensional. Será apresentada a metodologia baseada em processos ARFIMA(p, d, q) univariado. Desejamos estender o método de estimação paramétrica W (devido a Whittle, 1951, e proposto por Fox e Taqqu, 1986) de máxima verossimilhança para processos VARFIMA(p, d, q). O estudo apresenta a estimação do parâmetro fracionário vetorial d através do estimador W para duas séries multivariados conhecidas da literatura. A análise consiste de simulações com o uso do software Matlab. (BIC).