

167

ESTIMAÇÃO DE MÁXIMA VEROSSIMILHANÇA EM PROCESSOS MANNEVILLE-POMEAU. *Pablo Cristini Guedes, Silvia Regina Costa Lopes (orient.) (UFRGS).*

Neste trabalho consideramos o método da máxima verossimilhança, através da aproximação proposta por Whittle (1951), para estimar o parâmetro dos processos Manneville-Pomeau. Estes processos são obtidos a partir de iterações da transformação T_s de Manneville-Pomeau com parâmetro s . A transformação T_s gera um processo estocástico estacionário e ergódico quando s pertence ao intervalo $(1/2, 1)$. O objetivo é apresentar a estimação do parâmetro s , através do método que possui as melhores propriedades estatísticas. Através de simulações de Monte Carlo apresentamos a média, o vício e o erro quadrático médio das estimativas para diferentes valores do parâmetro s . Nestas simulações apresentamos os processos Manneville-Pomeau com e sem ruído branco Gaussiano aditivo. (CNPq).