

341

PROCESSOS DE LONGA DEPENDÊNCIA COM PARÂMETRO FRACIONÁRIO VARIANDO NO TEMPO. *Marcus Alexandre Nunes, Silvia Regina Costa Lopes (orient.) (UFRGS).*

Processos com longa dependência são aqueles utilizados para modelar dados que exibem decaimento lento das correlações entre as observações. Quebra estrutural é a observação em uma série temporal na qual ocorre algum tipo de mudança no mecanismo gerador da série. Em processos estacionários fracionariamente integrados esta mudança pode ocorrer, por exemplo, na média ou no parâmetro de longa dependência do processo. Em algumas áreas específicas, como por exemplo economia, meteorologia e finanças, conjuntos de dados com este tipo de comportamento são facilmente encontrados. Alguns artigos têm se ocupado deste problema, como os publicados por Dufrenot, Guegan e Peguin-Fassole (2003) e Ray e Tsay (2001). Neste trabalho descrevemos um novo método para detecção e estimação de pontos de quebra estrutural em processos estacionários fracionariamente integrados. O método de estimação aqui apresentado utiliza uma grade de procura para realizar a estimação destes pontos de quebra. Resultados assintóticos são ilustrados por simulações de Monte Carlo. Uma série de dados observados exemplifica a metodologia utilizada. (Fapergs).