

180

ESTIMAÇÃO DE PROCESSOS ESTOCÁSTICOS FRACIONARIAMENTE INTEGRADOS - UMA APLICAÇÃO NA GENÉTICA. *Alberto Tagliari Postal, Sílvia Regina Costa Lopes* (Departamento de Estatística e PPG-Mat, Instituto de Matemática, UFRGS).

Recentemente, na literatura de séries temporais, diversos pesquisadores estão estudando aquelas que apresentam características de longa dependência. Esta característica aparece quando, mesmo para tempos bastante distantes, a autocorrelação entre as variáveis não é desprezível. Conforme artigos estudados, as seqüências de DNA apresentam longa dependência, e o objetivo aqui é determinar se essa longa dependência pode ser explicada através de um modelo ARFIMA (autoregressivos fracionariamente integrados com médias móveis) de parâmetros (p, d, q) com o parâmetro de diferenciação d estimado através de diversos métodos estatísticos. Neste projeto de pesquisa, apresentamos cinco diferentes procedimentos de estimação para d baseados nas classes de métodos semi-paramétricos e paramétricos (BIC-Fapergs).