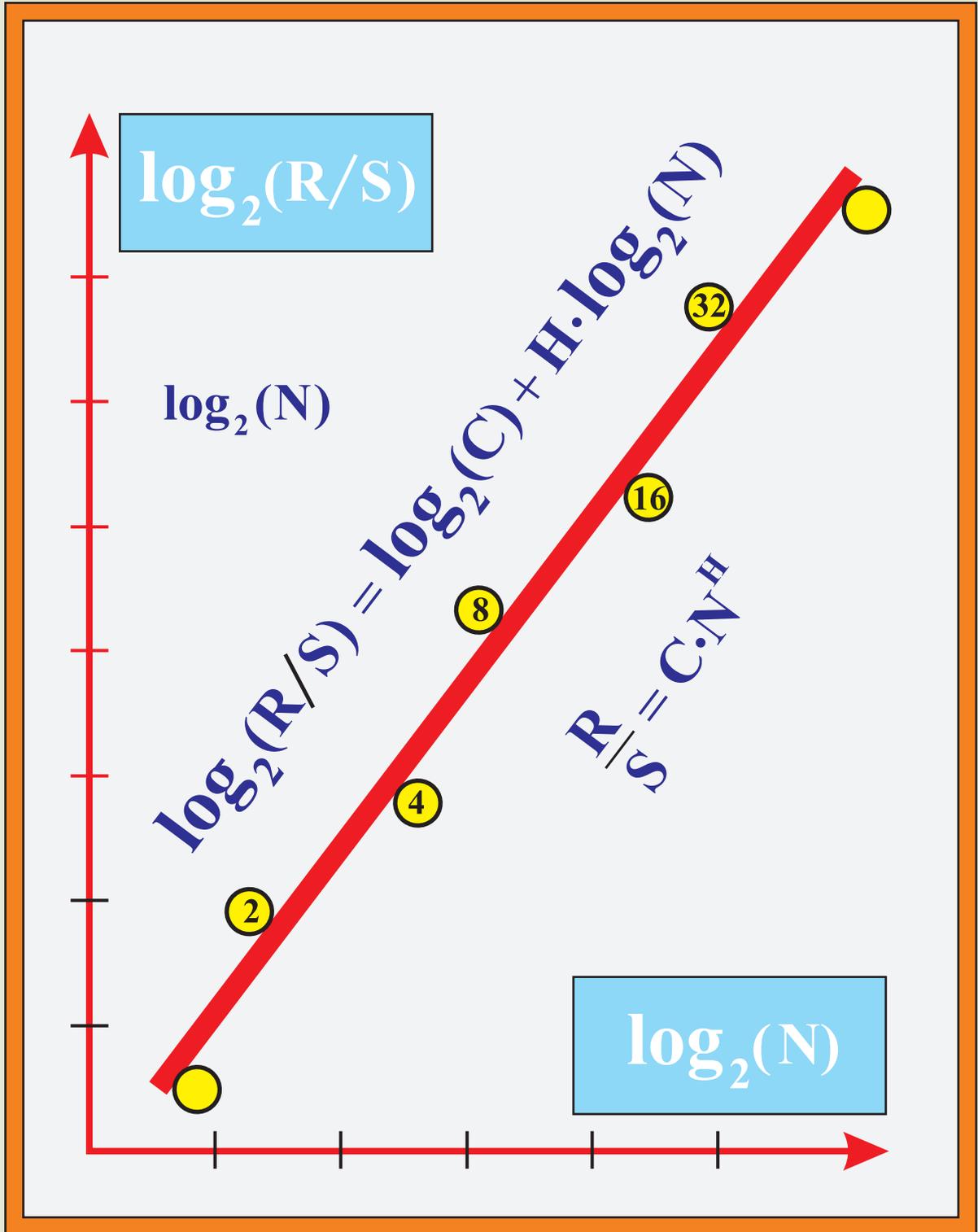




Expoente de Hurst



The Long - Term Dependence of Water Levels
 Trans. of the Amer. Society of Civil Eng. 1951

Harold Edwin Hurst

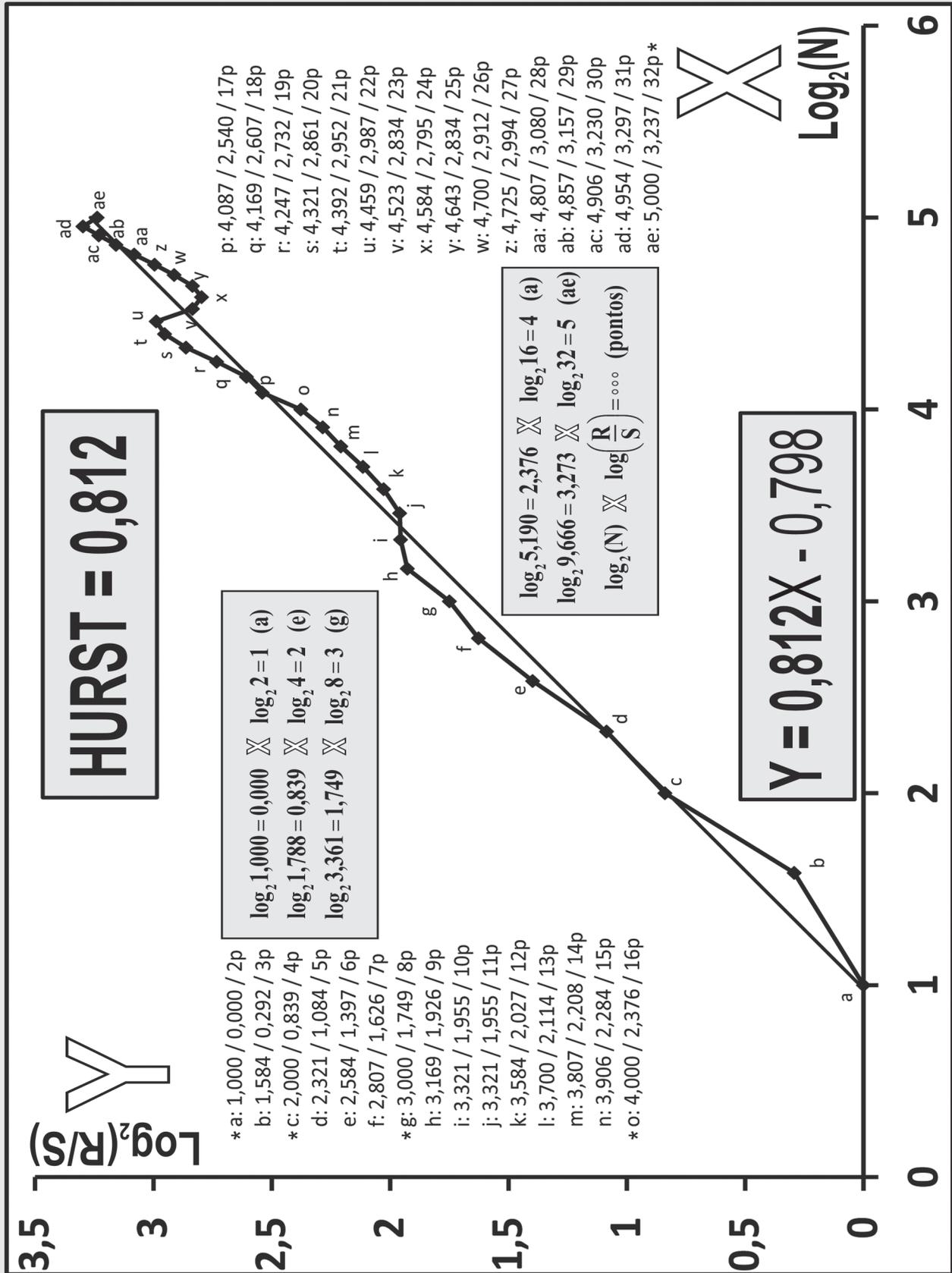
E

H



1.2 Tangente do Gráfico Reta MMQ de Hurst

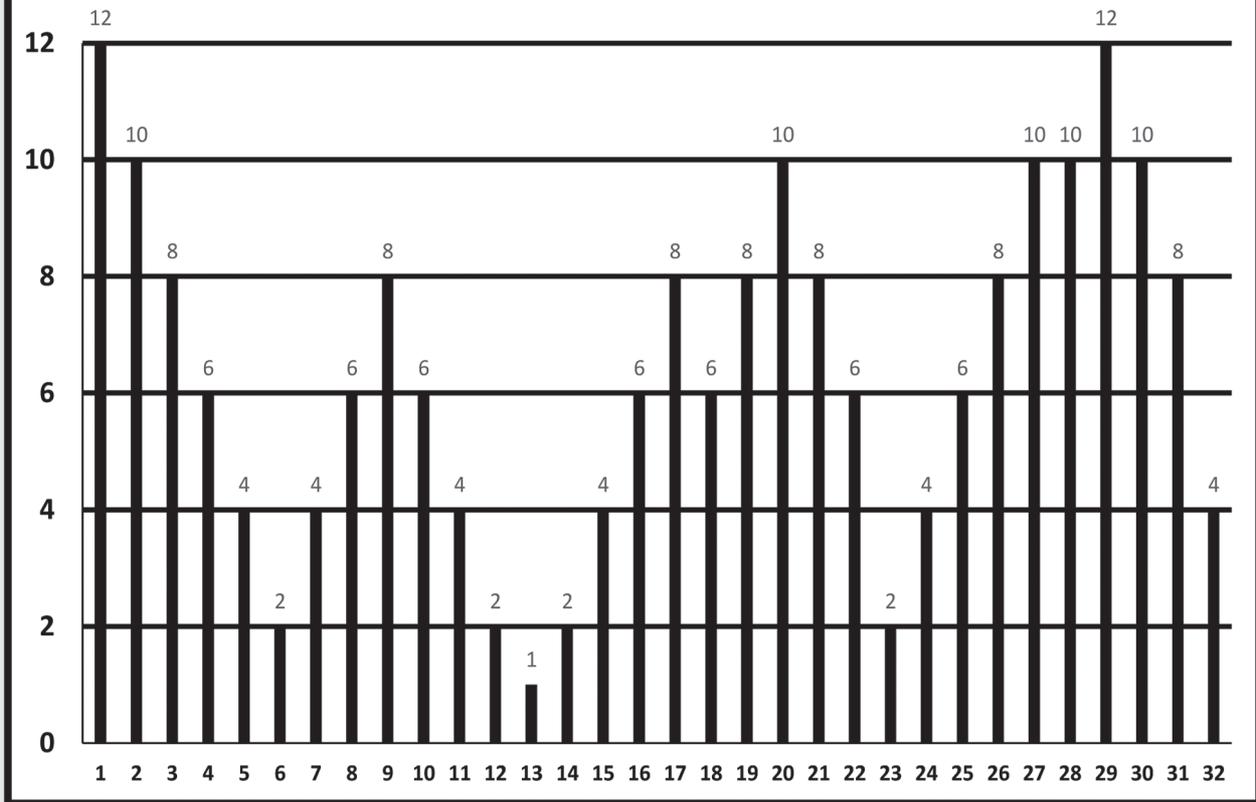
H = 0,812



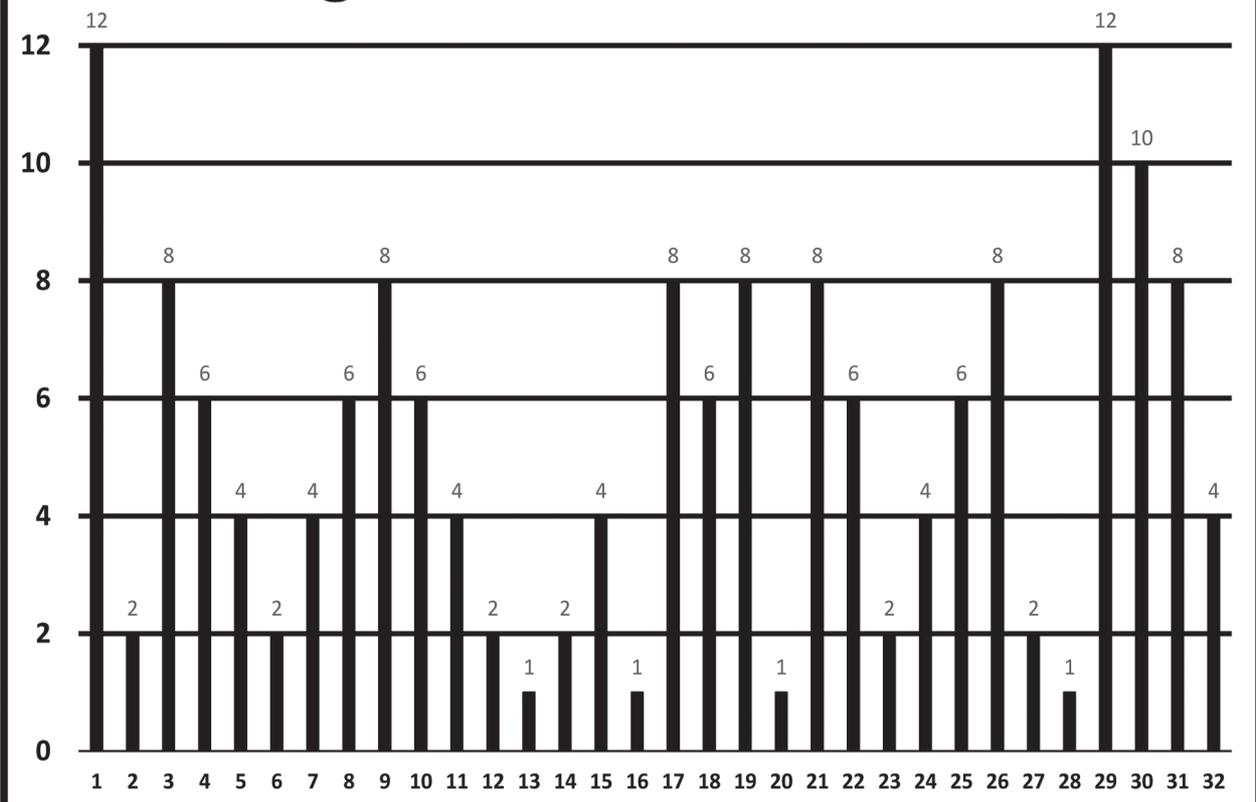


1.3 Séries Numéricas como Exemplos de Hurst

Smoother Trend $H = 0,812$

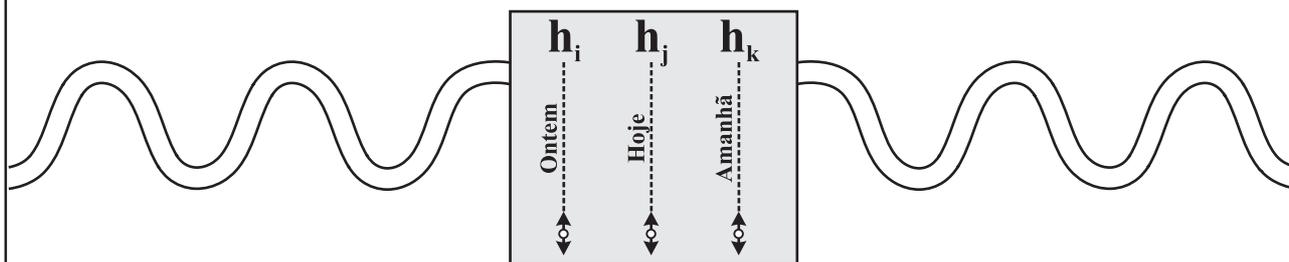


Roughness Trend $H = 0,712$





3.0 Nomações das Mulas de Mandelbrot



Memória Persistente $1/2 < H \leq 1$

Se, entre ontem (h_i) e hoje (h_j), **crece** ($h_j > h_i$) ou **diminui** ($h_j < h_i$), é provável (segundo o valor de **H**) que, entre hoje (h_j) e amanhã (h_k), **creça** ($h_k > h_j$) ou **diminua** ($h_k < h_j$).

M

Se a propensão anterior da série for de *crecer/decrescer*, sua tendência posterior será igualmente de *crecer/decrescer*;

como a *mula teimosa* que, por não temer “chicotadas”, não muda sua direção.

P

Memória Antipersistente $0 \leq H < 1/2$

Se, entre ontem (h_i) e hoje (h_j), **crece** ($h_j > h_i$) ou **diminui** ($h_j < h_i$), é provável (segundo o valor de **H**) que, entre hoje (h_j) e amanhã (h_k), **diminua** ($h_k < h_j$) ou **creça** ($h_k > h_j$).

M

Se a propensão anterior da série for de *crecer/decrescer*, sua tendência posterior será diferentemente de *decrescer/crecer*;

como a *mula volúvel* que, por temer “chicotadas”, muda sua direção.

A

Memória Browniana $H = 1/2$

Se, entre ontem (h_i) e hoje (h_j), **crece** ($h_j > h_i$) ou **diminui** ($h_j < h_i$), não é provável (segundo o valor de **H**) que, entre hoje (h_j) e amanhã (h_k), **creça** ($h_k > h_j$) ou **diminua** ($h_k < h_j$).

M

Se a propensão anterior da série for *browniana*, sua tendência posterior será igualmente *browniana*; como a *mula insensível* que, por não sentir “chicotadas”, não tem direção.

B



Cotação Diária do Dólar Comercial (2006): Hurst = 0,51

