Mezcla de distribuciones

La estimaciÛn de la media es sesgada, es decir, es diferente del par·metro a estimar.

EstimaciÛn de pronÛstico para llegar a la media de nuevo Sin considerar dos fases, la recuperaciÛn serÌa pasar de la rcesiÛn profunda (roja) a la media (lÌnea roja).

Al considerar las fases, se pueden alcanzar dos medias: primero la media de recesiÛn y desp˙es pasar a la media de expansiÛn.

De que depende la velocidad de una din·mica?

1

P IBt =   
 + P IBt1

Si el proceso es estacionario entonces j j < 1: Estacionario implica media y varianza constante en un tiempo determinado.

Media del proceso P IB?

P IB=   
 + P IB

Despejando P IBse tiene:

P IB=

1 si   
 > 0 entonces la media es positiva P IB> 0

Si no es cercana a cero (m·s velocidad o menos velocidad?) Si se acerca a cero (m·s velocidad o menos velocidad?)

Pr·ctica 3:

1) Obtener los los momentos (media y varianza) de las cuatro fases 2) Obtener los momentos (media y vairanza) de toda la muestra 3) Compararlas y explicarlas

Ej. de simulaciÛn:

4) Aplicar la ecuaciÛn P IBt =   
 + P IBt1

Valores del proceso   
 = 1; = 0:6; T = 200; P IB0 = 2

5) GraÖcar el proceso

6) Calcular la media del proceso

7) Aplicar P IBShock = 17:9 un shock negativo inicial y estimar el tiempo en el que se alcanzar· la media, graÖcar el tiempo de recuperaciÛn. 8) Valores del proceso   
 = 1; = 0:2; T = 200; P IB0 = 2

9) Repetir de 5 a 7

10) En cu·l proceso 4 u 8 se llega m·s r·pido a la media?

2