



Juan Carlos Martínez-Ovando <jc.martinez.ovando@gmail.com>

distribución posterior para f

2 messages

stefano molina <stefanom16@gmail.com>

3 May 2017 at 17:45

To: Juan Carlos Martínez-Ovando <jc.martinez.ovando@gmail.com>

Hola Profesor, buenas tardes,

Estoy teniendo un poco de conflicto para determinar la distribución posterior de f_i respecto a las demás variables para el modelo dinámico.

Comencé por determinar la derivación de la fórmula como la presenta Hedibert Freitas Lopes(adjunto imagen) por medio de una regresión multivariada, según entiendo utiliza el estimador por mínimos cuadrados generalizados para

$$y = F'f_i + e \quad \text{con} \quad f_i \sim N(0, I)$$

Quisiera saber si me puede dar un hint para el caso dinámico donde se tiene el modelo de la misma manera pero con f_i centrado en f_{i-1} , es decir

$$y = F'f_i + e \quad \text{con} \quad f_i \sim N(f_{i-1}, I)$$

He tratado de definir una variable $f_i - f_{i-1}$ pero creo que no está funcionando hasta ahora.

Gracias y saludos,
Stefano

$$f_i \sim N((I_k + \beta' \Sigma^{-1} \beta)^{-1} \beta' \Sigma^{-1} y_i, (I_k + \beta' \Sigma^{-1} \beta)^{-1})$$

Captura de pantalla 2017-05-03 a la(s) 12.20.45.png
14K

Juan Carlos Martínez-Ovando <jc.martinez.ovando@gmail.com>

4 May 2017 at 11:25

To: stefano molina <stefanom16@gmail.com>

Hola Stefano,

Revidsare el paper de Hedibert de nuevo y te comento, sale...

Saludos!
JC

[Quoted text hidden]