



Universidad Autónoma de Nuevo León
Facultad de Ciencias Físico Matemáticas

Productos Financieros Derivados
Mtro. Jaime Jovanny Escobedo González

Grupo: 051

Aarón Villegas Kane

ID: 1848627

8 de mayo del 2022

Green woods fue quien desarrolló los intervalos y el error estándar

Error estándar: $SE(S(t)) = S(t) \sqrt{\sum \frac{d_i}{R_i} (R_i - d_i)}$

Intervalo de confianza: $S(t) \pm 1.96 SE(S(t))$
en el 95%.

↑
Normal
Estándar

0 → Control

Tratamiento = 0 (Control)

1 → tratamiento

t	R _i	d _i	l _i	d _i /R _i	1-d _i /R _i	S(t)	$\frac{d_i}{R_i(R_i-d_i)}$	\sum	int
0	21	0	0	0	1	1	0	0	(-)
1	21	2	0	0.0952	0.9048	0.9048	0.005	0.005	(.7793, 1)
2	19	2	0	0.1052	0.8948	0.8096	0.0061	0.0111	(.6924, .9768)
3	17	1	0	0.0588	0.9412	0.7620	0.0036	0.0147	(.5809, .931)
4	16	2	0	0.125	0.875	0.6667	0.0089	0.0236	(.4660, .8679)
5	14	2	0	0.1428	0.8572	0.5714	0.0119	0.0355	(.3603, .7825)
8	12	4	0	0.3333	0.6667	0.3809	0.0416	0.0771	(.1735, .5882)
11	8	2	0	0.25	0.75	0.2856	0.0416	0.1187	(.0927, .4785)
12	6	2	0	0.3333	0.6667	0.1904	0.0833	0.202	(.0226, .3582)
15	4	1	0	0.25	0.75	0.1428	0.0833	0.2853	(0, .2923)
17	3	1	0	0.3333	0.6667	0.0952	0.1666	0.4519	(0, .2206)
22	2	1	0	0.5	0.5	0.0476	0.5	0.9519	(0, .1385)
23	1	1	0	1	0	0	0	0.9519	(0, 0)

Si se cruzan los intervalos de confianza entre 2 funciones, significa que estadísticamente es posible que las funciones sean idénticas

Tratamiento = 1 (detallistas)

t	R _i	d _i	d _i	d _i /R _i	1 - d _i /R _i	S(t)	$\frac{d_i}{R_i(1-d_i)}$	\sum	L _i	L _s
0	21	0	0	0	1	1	0	0	-	-
1	21	0	0	0	1	1	0	0	-	-
2	21	0	0	0	1	1	0	0	-	-
3	21	3	3	0.1428	0.8572	0.8572	0.0079	0.0079	0.6919	.9830
4	17	1	1	0.0588	0.9412	0.8067	0.0036	.0115	0.6372	.9762
5	16	0	0	0	1	0.8067	0	.0115	.6372	.9762
6	15	1	1	0.0666	0.9334	0.7529	0.0048	.0163	0.5645	.9413
7	13	0	0	0	1	0.7529	0	.0163	.5645	.9413
8	12	1	1	0.0833	0.9167	0.6903	0.0076	.0239	.4812	.8994
9	11	1	1	0.0909	0.9091	0.6276	0.0090	.0329	.4045	.8506
10	10	0	0	0	1	0.6276	0	.0329	.4045	.8506
11	9	0	0	0	1	0.6276	0	.0329	.4045	.8506
12	8	0	0	0	1	0.6276	0	.0329	.4045	.8506
13	7	1	1	0.1428	0.8572	0.5380	0.0238	.0567	.2869	.7891
14	6	1	1	0.1666	0.8334	0.4483	0.0333	0.09	.1847	.7119