

$V = 10$ (tamaño de ventana)

Ventanas

0-9
1-10
2-11
3-12
4-13
5-14
↑ ↑
inicios finales

$n - V + 1$ ventanas en total

A cada ventana le podemos sacar medidas estadísticas (media, desv. estándar, ...) y aproximar por mínimos cuadrados, rectas.

$V = 8$

| #ventana | H | $V=10$ | $V=20$ |
|----------|-------|--------|--------|
| 0 | h_0 | .3 | .4 |
| 1 | h_1 | .5 | .7 |
| 2 | h_2 | .2 | .2 |
| 3 | h_3 | .6 | .3 |
| ⋮ | ⋮ | .7 | .9 |
| ⋮ | ⋮ | | |
| ⋮ | ⋮ | | |
| ⋮ | ⋮ | | |

$\overline{H_{10}} = .53$

$\overline{H_{20}} = .63$

Para un tamaño de ventana V

$i = \text{inicio } 0, 1, 2, \dots, n-V$

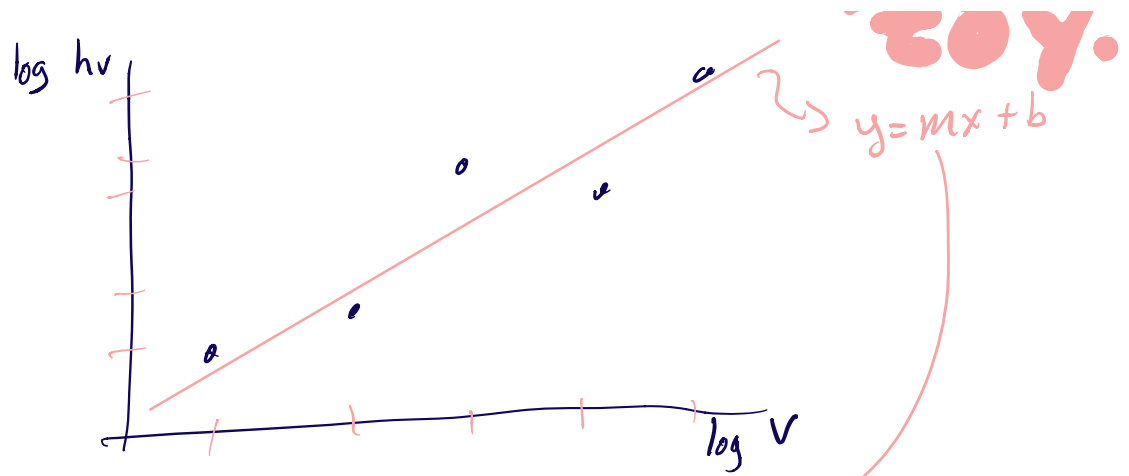
$i + V - 1 = \text{final}$

En Python

$d[i:i+V]$

= "promedio"

Si tienen dudas, aquí



$m = \text{exponente de Hurst.}$