

Fe de Erratas

Revista Contaduría y Administración, enero - marzo 2014, 59(1)

Rodríguez Aguilar, R. (2004), “El coeficiente de Hurst y el parámetro α -estable para el análisis de series financieras. Aplicación al mercado cambiario mexicano”.

En el último párrafo de la página 156 y el primero de la página 157, dice:
“Una variable aleatoria X tiene distribución α -estable si tiene la siguiente función característica:

$$\varphi(w) = \begin{cases} \exp\left\{-|\gamma w|^\alpha \left[1 - i\text{sign}(w)\beta \tan\left(\frac{\pi\alpha}{2}\right)\right] + i\delta w\right\}, & (\alpha \neq 1) \\ \exp\left\{-|\gamma w| \left[1 + i\text{sign}(w)\beta \frac{2}{\pi} \log(|w|)\right] + i\delta w\right\}, & (\alpha = 1) \end{cases} \quad (5)$$

Donde los parámetros de $\text{sing}(w) = \frac{w}{|w|}$ y $\alpha \in (0, 2]$ se definen de la siguiente forma: α representa el exponente característico, el cual controla el grado de impulsividad de la variable aleatoria W . Por otra parte, el parámetro $\beta \in [-1, +1]$ controla la simetría de la distribución ($\beta=0$, para la distribución α -estable simétrica, $\beta=1$ y $\beta=-1$ para la familia de distribuciones α -estable positiva y negativa, respectivamente). Mientras que $\gamma > 0$ es un parámetro de escala, también denominado dispersión, y δ es el parámetro de posición.”

Debe decir:

“Una variable aleatoria W tiene distribución α -estable si tiene la siguiente función característica:

$$\varphi(w) = \begin{cases} \exp\left\{-|\gamma w|^\alpha \left[1 - i\text{sign}(w)\beta \tan\left(\frac{\pi\alpha}{2}\right)\right] + i\delta w\right\}, & (\alpha \neq 1) \\ \exp\left\{-|\gamma w| \left[1 + i\text{sign}(w)\beta \frac{2}{\pi} \log(|w|)\right] + i\delta w\right\}, & (\alpha = 1) \end{cases} \quad (5)$$

Donde $\text{sign}(w) = \frac{w}{|w|}$ y $\alpha \in (0, 2]$.

Los parámetros de la función se definen de la siguiente forma: $\alpha \in (0, 2]$, representa el exponente característico, el cual controla el grado de impulsividad de la variable aleatoria W ; el parámetro $\beta \in [-1, +1]$ controla la simetría de la distribución ($\beta=0$, para la distribución α -estable simétrica, $\beta=1$ y $\beta=-1$ para la familia de distribuciones α -estable positiva y negativa respectivamente); mientras que $\gamma > 0$ es un parámetro de escala, también denominado dispersión; y δ es el parámetro de posición.”