Montecarlo simulation of long-term dependent processes: a primer

Borradores de Economia
Número:
648
Publicado:
Viernes, 1 Abril 2011
Clasificación JEL:
C15, C53, C63, G17, G14
Palabras clave:
Montecarlo simulation, Fractional Brownian Motion, Hurst exponent, long-term dependence
Descargar documento

Lo más reciente

El desarrollo económico de Colombia desde finales de la Guerra de los Mil Días hasta la Gran Depresión
Juliana Jaramillo-Echeverri, María Teresa Ramírez-Giraldo
Experimentando con los LLM para el pronóstico de la inflación en Colombia
Aarón Levi Garavito-Acosta, Wilmer Martinez-Rivera, Juan J. Ospina-Tejeiro, Edgar Caicedo-García
Evaluando el seguro de desempleo en una economía en desarrollo: evidencia para Colombia
Leonardo Fabio Morales, Diego Astorga-Rojas, Nicolas Guida-Johnson
Otras Publicaciones

As a natural extension to León and Vivas (2010) and León and Reveiz (2010) this paper briefly describes the Cholesky method for simulating Geometric Brownian Motion processes with long-term dependence, also referred as Fractional Geometric Brownian Motion