

APLICACION DE LOS PROCESOS DE DIFUSION A

LA PLANIFICACION DEL DESARROLLO ECONOMICO.

por

Guillermo L.Gómez M. y Gerhard Tintner

Resúmen.

Bajo la hipótesis de que el desarrollo económico es un proceso de difusión, hemos investigado empíricamente la capacidad de predicción del presente modelo. Para resolver la ecuación diferencial estocástica, a través de la cual se controla el sistema, empleamos un método indirecto con la ayuda del principio de máxima verosimilitud. Primero hemos supuesto que el vector velocidad del proceso de difusión sólo depende del tiempo. Luego, hacemos la hipótesis más realista de que el vec-

tor velocidad depende también de los cambios relativos en los gastos del gobierno y en la inversión privada. Así este modelo podrá ser usado en la economía política, con ayuda de la teoría matemática del control óptimo.

§ 0. Los problemas de la planificación económica han adquirido gran importancia en las tres últimas décadas. La reconstrucción económica después de la última guerra mundial, el enfrentamiento y la creciente dependencia económico-política, financiera y comercial entre el mundo industrializado y el llamado tercer mundo, la política mundial de las materias primas y la complejidad creciente del sistema socio-económico-político y administrativo de los países industrializados han sido los más dominantes estímulos de este interés. El surgimiento y resurgimiento de algunas teorías matemáticas durante la última guerra mundial ha ofrecido un terreno fructífero a algunos problemas metodológicos de la planificación.

El presente trabajo, el cual pertenece a una serie de estudios sobre la planificación del desarrollo económico, constituye una contribución preliminar a esta problemática y quiere motivar a matemáticos, estadísticos, economistas, ingenieros, etc., de los países en vía de desarrollo a poner sus conocimientos académicos y técnicos al servicio de la lu

cha contra el subdesarrollo, el hambre, el desempleo, las deficiencias en la salud pública, la ignorancia, miseria y demás males que plagan hoy en día a dos terceras partes del mundo.

§ 1.1 La variable  $x(t)$  de dimensión  $k \times 1$  representa el estado del sistema:

$$x(t) = \begin{bmatrix} x_1(t) \\ x_2(t) \\ \vdots \\ x_k(t) \end{bmatrix} \quad (1.1.1)$$

La siguiente ecuación diferencial representa el movimiento del sistema:

$$\dot{x}(t) = f(x(t), t) + \dot{u}(t), \quad (1.1.2)$$

donde  $\dot{u}(t)$  representa todas las perturbaciones externas del sistema de carácter determinístico o estocástico.

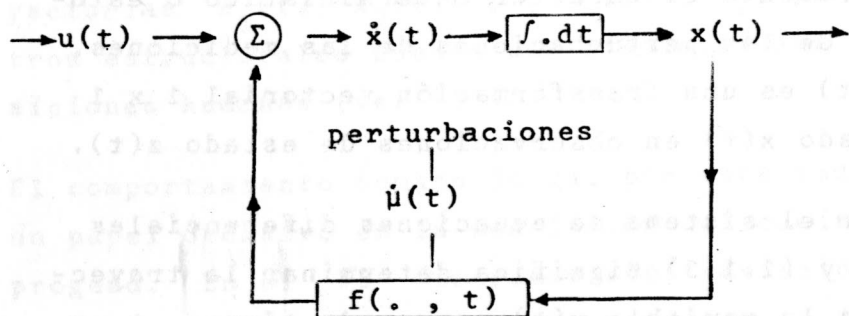


Fig. 1.1.1

Suponemos que nuestro sistema es observable. Esto significa que disponemos de un sistema de mediciones (Fig. 1.1.2) que nos permite reconstruir el estado del sistema a partir de mediciones que no están libre de error:

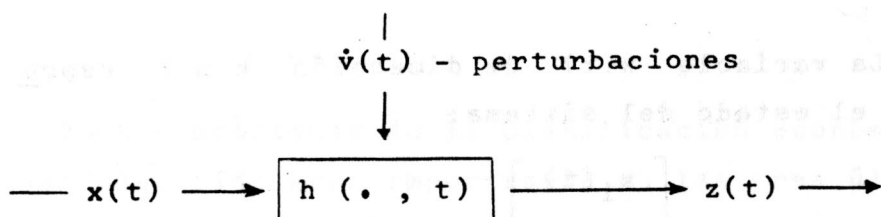


Fig. 1.1.2

donde  $\dot{v}(t)$  representa las perturbaciones del sistema de mediciones, que pueden ser de carácter de terminístico o estocástico.

La siguiente ecuación representa el sistema de ob servaciones

$$z(t) = h(x(t), t) + \dot{v}(t), \quad (1.1.3)$$

donde  $\dot{v}(t)$  es un murmullo blanco (white noise), que representa el carácter determinístico o estocástico de las perturbaciones de las mediciones.  $h(x(t), t)$  es una transformación vectorial  $1 \times 1$  del estado  $x(t)$  en observaciones de estado  $z(t)$ .

Resolver el sistema de ecuaciones diferenciales (1.1.2) y (1.1.3) significa determinar la trayectoria de la variable  $x(t)$  para cada tiempo  $t$  y para cada sistema de condiciones iniciales. En el caso determinístico, el conocimiento de  $x(t)$  para

algún  $t$  fija unívocamente la trayectoria para cada sistema de condiciones iniciales. Para el caso estocástico es además necesario determinar la distribución de la probabilidad de la trayectoria. La teoría estocástica de la estimación aunque ha alcanzado un gran nivel de desarrollo en el caso lineal, sólo ofrece soluciones satisfactorias para algunos casos no lineales [3,6,11,17]. Se dedica atención especialmente a aquellos problemas en donde la distribución de probabilidad se puede determinar conociendo un número finito de estadísticas suficientes, por ejemplo, la media y la varianza [1,5,6, 17]. Una alternativa de interés creciente es la solución de casos no lineales aproximándolos por casos lineales [16, 18].

§ 1.2. La solución  $x(t) = (x_1(t), x_2(t), \dots, x_k(t))'$  de la ecuación del movimiento de un sistema económico genera, bajo ciertas condiciones, un proceso estocástico cuya trayectoria representa el crecimiento o desarrollo económico. Las trayectorias  $x_1(t), x_2(t), \dots, x_k(t)$  y los parámetros estructurales pueden ser afectados por decisiones humanas (ver §5 ).

El comportamiento humano juega, por esta razón, un papel decisivo en la modelación del camino del progreso. En el §5 mostramos cómo variaciones en los parámetros estructurales inducen en la trayectoria del progreso aceleración, retraso o es-

tancamiento, o conducen a un nivel mayor, menor o igual en el valor de las variables en un tiempo dado.

La consideración de incertidumbre en variables como  $\dot{u}(t)$ ,  $\dot{v}(t)$  en (1.1.2) y (1.1.3) se justifica teniendo en cuenta el caracter estructural y de aproximación a la realidad del modelo, las prácticas usuales en el levantamiento de los datos estadísticos y su significado económico.

Las siguientes son tres razones muy típicas:

(1) La imperfección del modelo, puesto que algunas variables han sido excluidas por razón de simplicidad. Un modelo fiel a la realidad sería muy complicado de describir; más aún los cálculos estadísticos serían demasiado complicados dado que existieran datos disponibles para cada variable.

(2) Errores de medición debido a la cuantificación de características cualitativas y a errores en las observaciones.

(3) Simplificación en las relaciones entre las variables para propósitos empíricos.

Puesto que estamos interesados especialmente en modelos de crecimiento y desarrollo económico es conveniente hacer las siguientes hipótesis:

- (i)  $x(t)$  es un proceso estocástico evolutivo;
- (ii) las condiciones iniciales de las ecuaciones

(1.1.2) y (1.1.3) son estocásticas.

En esta forma queda establecido el carácter estocástico de las ecuaciones (1.1.2) y (1.1.3).

Por otra parte, la introducción de elementos probabilísticos en modelos de desarrollo económico, es indispensable para justificar el desarrollo desigual de sistemas con similar estructura económica y similares condiciones iniciales. [4,8,17].

§ 1.3. Con la intención de hacer el presente artículo accesible al mayor número posible de lectores, reproducimos a continuación algunos conceptos sobre procesos estocásticos. También hemos reproducido en los apéndices I, II algunos conceptos intuitivos de la teoría de sistemas y de la estimación estadística, que esperamos sean útiles al lector no experto.

Para el tratamiento de ecuaciones del tipo (1.1.2) y (1.1.3) ha sido desarrollado un nuevo método de cálculo [2,7,9,16].

Un proceso de Wiener  $w(t)$  es un proceso estocástico de Gauss con trayectorias continuas y en ninguna parte diferenciables con valor medio  $Ew(t) = 0$  y covarianza  $Ew(t)w(s) = \min(s, t)$ .

Un proceso de Gauss estacionario  $\xi(t)$  con valor medio cero y función de densidad espectral cons-

tante es llamado un murmullo blanco.

Si  $\xi(t)$  y  $w(t)$  son procesos generalizados, resulta

$$w(t) = \int_0^t \xi(s) ds. \quad (1.3.1)$$

De este modo (1.1.2) adquiere la siguiente forma diferencial:

$$dx(t) = f(x(t), t)dt + G(x(t), t)dw(t), \quad (1.3.2)$$

donde  $\dot{w}(t) = G(x(t), t) \dot{w}(t); x(t_0) = c$ .

Así obtenemos la ecuación integral de Ito:

$$x(t) = c + \int_{t_0}^t f(x(s), s)ds + \int_{t_0}^t G(x(s), s)dw(s). \quad (1.3.3)$$

La solución (1.3.3) de la ecuación diferencial estocástica (1.3.2) es un proceso de Markov con trayectorias continuas y más aún un proceso de difusión.

Todo proceso de difusión (suave) es a su vez solución de una ecuación diferencial estocástica de la forma (1.3.2), donde  $f$  es el vector de velocidad y  $G^2$  es el coeficiente de difusión del proceso.

Existen dos métodos probabilísticos básicos para abordar la clase de los procesos de difusión:

a) método teórico indirecto. Este se realiza a través de condiciones sobre la probabilidad de transición  $P(s, x, t, B)$ .

b) método directo. Este analiza la variable aleatoria  $x(t)$  y sus variaciones.

Ambos procedimientos conducen esencialmente a la misma clase de procesos (Arnold [2]). Dentro de estas dos clases de métodos existe una variedad de alternativas. El lector interesado puede dirigirse a Bharucha-Reid [3] para una vista general y más literatura.

Un proceso de Markov  $x(t)$ ,  $t_0 < t < T$ , con valores en  $\mathbb{R}^k$  y con trayectorias continuas casi con seguridad (almost sure), se llama un proceso de difusión, si su probabilidad de transición  $P(s, x, t, B)$ , para todo  $s \in [t_0, T]$ ,  $x \in \mathbb{R}^k$  y  $\epsilon > 0$ , cumple las siguientes propiedades:

$$a) \quad \lim_{t \downarrow s} \frac{1}{t-s} \int_{|y-x| > \epsilon} P(s, x, t, dy) = 0 ;$$

b) existe una función  $f(x, s)$  tal que

$$\lim_{t \downarrow s} \frac{1}{t-s} \int_{|y-x| \leq \epsilon} (y-x) P(s, x, t, dy) = f(x, s) ;$$

c) existe una función matricial  $B(x, s)$  de dimensión  $k \times k$  tal que:

$$\lim_{t \downarrow s} \frac{1}{t-s} \int_{|y-x| \leq \epsilon} (y-x) (y-x)' P(s, x, t, dy) = B(x, s).$$

Las funciones  $f$  y  $B$  se llaman coeficientes del proceso de difusión.  $B(x, s)$  es simétrica y no-ne-

gativa definida. La condición a) hace improbable cambios grandes en  $x(t)$  en intervalos de tiempo pequeños:

$$P(|x(t) - x(s)| \leq \epsilon \mid x(s) = x) = 1 - O(t-s)$$

$f(x(s), s)$  es el vector de velocidad promedio del movimiento probabilístico descrito por  $x(t)$  bajo la condición  $x(s) = x$ .  $B(x(s), s)$  es una medida para la intensidad local de las fluctuaciones de  $x(t) - x(s)$  alrededor del promedio. Es decisivo, en los procesos de difusión, que la probabilidad de transición  $P(s, x, t, B)$  se determine unívocamente, bajo ciertas condiciones de regularidad, dados el vector de impulso  $f$  y la matriz de difusión  $B$ . Esto es sorprendente ya que  $f$  y  $B$  se derivan, según definición, de los dos primeros momentos de  $P(s, x, t, B)$ , los que no determinan en general una distribución.

§ 1.4 Se intenta investigar la tendencia del desarrollo económico (a largo plazo) la cual se describe por medio de ecuaciones diferenciales estocásticas cuya solución es un proceso multivariable log-normal de difusión.

Sobre los coeficientes de difusión de este proceso multivariable log-normal de difusión hacemos las siguientes hipótesis para efectos de simplicidad (ver Bartlett [4], Pawula [12]):

$$\begin{cases} f_i(x(t), s) = f_i x_i, \\ B(i, j)(x(t), s) = b(i, j)x_i x_j, \\ b(i, j) > 0; b(i, j), f_i \in \mathbb{R}; i, j = 1(1)k. \end{cases} \quad (1.4.1)$$

Esto significa que las variaciones esperadas en  $x(t)$  y en la matriz de varianzas-covarianzas son supuestas proporcionales a los valores reales de  $x(t)$ . Si  $B(x(t), s)$  es positiva semidefinida, entonces la variable  $x(t)$  asume variaciones en el intervalo de tiempo  $\Delta t$ , aunque estas variaciones son pequeñas para pequeños  $\Delta t$ .

Estas especificaciones del proceso estocástico  $\{x(t), t > 0\}$  resultan muy razonables, si se tiene en cuenta la naturaleza mudable de la economía, el carácter continuo del desarrollo económico (cuyo estado varía estocásticamente), el complejo mundo interdependiente de las actividades económicas y su difusión.

La densidad de la probabilidad de transición  $p(s, x, t, y)$  de nuestro proceso de difusión satisface, bajo ciertas condiciones la ecuación de Fokker-Planck (forward) y de Kolmogorov (backward) siguientes (ver Gihman, Skorohod [7]) :

$$-\frac{\partial p}{\partial t} - \sum_{i=1}^k \frac{\partial}{\partial y_i} (f_i y_i p) + \frac{1}{2} \sum_{i,j=1}^k b(i, j) \frac{\partial^2}{\partial y_i \partial y_j} (y_i y_j p) = 0$$

$$\frac{\partial p}{\partial s} + \sum_{i=1}^k f_i x_i \frac{\partial p}{\partial x_i} + \frac{1}{2} \sum_{i,j=1}^k b(i,j) \cdot x_i x_j \frac{\partial^2 p}{\partial x_i \partial x_j} = 0 \quad (1.4.2)$$

Transformando las ecuaciones diferenciales parciales parabólicas (1.4.2) en ecuaciones diferenciales parciales lineales de primer orden por medio de una transformación de Fourier, se puede resolver entonces la ecuación de primer orden considerando su sistema de Lagrange asociado (ver Pawula [12]). Así resulta la función característica condicional asociada a  $p(s, x, t, y)$ . La solución para  $p(s, x, t, y)$  tiene la forma:

$$p(s, x, t, y) = (2\pi(t-s))^{-k/2} |B|^{-1/2} \left( \prod_{i=1}^k y_i \right)^{-1} \cdot \exp\left(-\frac{1}{2} (t-s)^{-1} Q\right) \quad (1.4.3)$$

donde

$$Q = (\log y_i(t) - \log x_i(s) - \beta_i(t-s)) \cdot B^{-1} (\log y_i(t) - \log x_i(t) - \beta_i(t-s))$$

$$B = (b(i,j)), \beta = f - \frac{1}{2}(b(i,i)), t > s, i, j = 1(1)k \quad (1.4.4)$$

con las funciones medias y varianzas y covarianzas de  $x(t)$  siguientes:

$$E(x_i(t)) = x_i(s) \exp(f_i(t-s)) ;$$

varianzas - covarianzas:

$$VK(x_i(t)) = x_i(s) \exp((f_i + f_j)(t-s))$$

$$(\exp(b(i,j)(t-s)) - 1) ;$$

correlaciones:

$$R(x_i(t), x_j(t)) =$$

$$= \frac{\exp(b(i,j)(t-s)) - 1}{[\exp(b(i,i)(t-s)) - 1]^{1/2} [\exp(b(j,j)(t-s)) - 1]^{1/2}},$$

para  $i, j = 1(1)k$

En el apéndice II presentamos un método de estimación para los coeficientes de difusión  $f$  y  $B$ , quienes determinan según las ecuaciones anteriores la trayectoria esperada de  $x(t)$ .

Para cada variable  $x_i(t)$  resulta una tendencia funcional exponencial. Si las condiciones iniciales y los coeficientes de difusión son conocidos, entonces es posible estimar la trayectoria del desarrollo económico por medio de las ecuaciones siguientes:

$$E(x_i(t)) = x_i(1) \exp(f_i(t-1)),$$

$$VK(x_i(t), x_j(t)) = x_i(1) x_j(1) \exp((f_i + f_j)(t-1))$$

$$(\exp((b(i,j)(t-1)) - 1),$$

para  $i, j = 1(1)k ; t = 1(1)n$ .

Con la ayuda de estas ecuaciones y con datos estadísticos anuales de Colombia para el período 1950-

1972, estimamos las siguientes tendencias funcionales. Nótese que la tendencia, según nuestra hipótesis (1.4.1), depende sólo del tiempo (ver Tabla 1.4.2):

$$\begin{cases} E(x_1(t)) = 13790.4 \exp(0.0555(t-1)); t=1,2,\dots \\ E(x_2(t)) = 10604.7 \exp(0.0530(t-1)); t=1,2,\dots \\ E(x_3(t)) = 1952.1 \exp(0.0697(t-1)); t=1,2,\dots \\ E(x_4(t)) = 760.0 \exp(0.0738(t-1)); t=1,2,\dots \end{cases} \quad (1.4.5)$$

Con estas funciones, estimadas de las tendencias nos resulta posible establecer los pronósticos que aparecen la Tabla 1.4.1, para el período de tiempo 1973-1982.

§ 1.5 Si se quiere investigar los efectos de medidas económico-políticas sobre la tendencia (a largo plazo) del desarrollo económico es necesario introducir en las ecuaciones diferenciales (1.1.2), o su equivalente (1.4.2), variables instrumentos (controles) tales como los gastos del gobierno, inversiones privadas, impuestos, tasas de descuento, etc.,... Las variables instrumento, también llamadas controles, son elementos, que por su naturaleza se dejan manipular con objetivos económico-políticos. Con este propósito queremos extender nuestras hipótesis sobre los coeficientes de difusión en la forma siguiente:

$$\begin{cases} f_i(x(t), t) = f_i^*(t) x_i(t) ; \\ B(i, j)(x(t), t) = b(i, j) x_i(t) x_j(t) ; i, j = 1(1)k , \end{cases} \quad (1.5.1)$$

donde:

$$\begin{cases} f_i^*(t) = f_{i0} + f_{i1} [\Delta G(t)] + f_{i2} [\Delta I(t)] , \\ b(i, j) > 0, f_{i0}, f_{i1}, f_{i2} \in \mathbb{R}. \end{cases}$$

Esto significa que la tendencia del desarrollo depende ahora no sólo del tiempo sino también de los cambios relativos en los gastos del gobierno  $\Delta G(t)$  y en las inversiones privadas  $\Delta I(t)$ . Esta dependencia actúa directamente a través del vector de impulso  $f$  como (1.5.1) indica.

Así se obtiene para cada variable  $x_i(t)$  la siguiente funcional exponencial de la tendencia:

$$E(x_i(t)) = x_i(1) \exp(f_i^*(t-1)), \quad (1.5.2)$$

donde:

$$f_i^*(t-1) = f_{i0}(t-1) + f_{i1} \sum_{\alpha=1}^n \Delta x_3(\alpha) + f_{i2} \sum_{\alpha=1}^n \Delta x_4(\alpha)$$

$$\Delta x_h(\alpha) = \frac{x_h(\alpha+1) - x_h(\alpha)}{2}, \quad h = 3, 4,$$

y correspondientemente la siguiente matriz funcional de la varianza - covarianza:

$$\begin{aligned} VK(x_i(t), x_j(t)) &= \\ &= x_i(t) x_j(t) \exp((f_i + f_j)(t-1)) (\exp(b(i, j)(t-1)) - 1) \end{aligned}$$

para  $i, j = 1(1)k$  ;  $t = 1, 2, \dots$

Con ayuda del principio de máxima verosimilitud, de (1.5.1), (1.4.3), (1.4.4) es posible estimar las componentes del vector de impulso  $f$  del proceso de difusión (ver Tabla 1.5.1).

De este modo es posible estimar el vector funcional de impulso (1.5.3) del proceso de difusión. Es claro que el vector impulso (1.5.3) depende del tiempo y de los cambios relativos en los gastos del gobierno y en las inversiones privadas ( ver también la tabla 1.5.2 y compárese con la tabla 1.4.2).

$$E(x_1(t)) = 13790.4 \exp[0.043(t-1) + 0.076 \sum_{\alpha=1}^t \Delta x_3(\alpha) + 0.063 \sum_{\alpha=1}^t \Delta x_4(\alpha) ],$$

$$E(x_2(t)) = 10604.7 \exp[0.037(t-1) + 0.139 \sum_{\alpha=1}^t \Delta x_3(\alpha) + 0.037 \sum_{\alpha=1}^t \Delta x_4(\alpha) ],$$

$$E(x_3(t)) = 1952.1 \exp[-0.00065(t-1) + 0.008 \sum_{\alpha=1}^t \Delta x_3(\alpha) + 0.926 \sum_{\alpha=1}^t \Delta x_4(\alpha) ],$$

$$E(x_4(t)) = 760.0 \exp[-0.00055(t-1) + 0.9366 \sum_{\alpha=1}^t \Delta x_3(\alpha) + 0.005 \sum_{\alpha=1}^t \Delta x_4(\alpha) ].$$

(1.5.3)

Bajo la hipótesis de que las inversiones privadas

$x_3(t)$  y los gastos del gobierno  $x_4(t)$  crecen con una tasa que es la tasa promedio de su crecimiento en el período 1950-1972, nos es posible establecer los siguientes pronósticos (Tabla 1.5.3) para los años 1973-1982.

Igualmente establecemos los siguientes pronósticos (Tabla 1.5.4) para el período 1973-1982, asumiendo que las tasas de crecimiento de los gastos del gobierno y de las inversiones privadas permanecen constantes durante el período 1973-1982 y tienen valores como en el año 1972.

También hemos calculado las respectivas máximas tasas decrecimiento en el período 1950-1972 suponiendo que los gastos del gobierno y las inversiones privadas crecen con estas tasas durante el período 1973-1982. Los respectivos pronósticos se indican en la Tabla 1.5.5.

La función de la tendencia (1.5.3) nos permite estimar la trayectoria del desarrollo económico bajo diferentes hipótesis sobre los cambios en las variables instrumentos. Nuestro próximo objetivo es determinar una combinación óptima de cambios en las variables instrumentos. Una combinación óptima significa que las variaciones induzcan mayores tasas de crecimiento en las variables dependientes y permanezcan en un dominio realizable. Es decir, que el sistema económico sea capaz de realizar.

§ 1.6 \* (En investigación). Para determinar una combinación óptima de variaciones, debemos escoger una función objetivo o un criterio apropiado que nos indique cuando el sistema alcanza un punto óptimo o cuando una política económica es más favorable para el desarrollo económico.

Para esta tarea, así como para el desarrollo de los algoritmos apropiados y para la caracterización de un sistema dinámico complejo por medio de un modelo matemático, ofrece la teoría matemática del control los más apropiados instrumentos.

Cuando un sistema en actividad está sometido a perturbaciones no predecibles, se hace imprescindible el uso de la teoría matemática del control, cuyo objetivo fundamental consiste entonces en mantener algunas variables del sistema dentro de un rango limitado. Así surge el tratamiento de estabilidad de sistemas bajo el efecto de perturbaciones estocásticas. Esto conduce a otro problema: la búsqueda de la mejor posible y más aceptable estrategia de control.

Nosotros consideramos un sistema descrito por la siguiente ecuación diferencial estocástica:

$$\begin{cases} dx(t) = f(x(t), t, u(x(t), t))dt + G(x(t), t, u(x(t), t))dw(t), \\ x(t_0) = c, \quad t > t_0. \end{cases} \quad (1.6.1)$$

La nueva variable adicional  $u(x(t), t)$  es una

función de control, que puede ser seleccionada de un conjunto de funciones de control admisibles.

Con la elección de la función de control  $u(x(t), t)$  hasta el tiempo  $T > \infty$  partiendo del estado  $x(s) = x$  en el tiempo  $s$ , está asociada la siguiente función de costos:

$$V_u(x(t), s) = E_{s, x} \left( \int_s^t k(x(r), r, u(x(r), r)) dr + M(x(T), T) \right) \quad (1.6.2)$$

Nosotros buscamos la función de control óptima. Esto significa una función de control admisible que minimice (1.6.2)

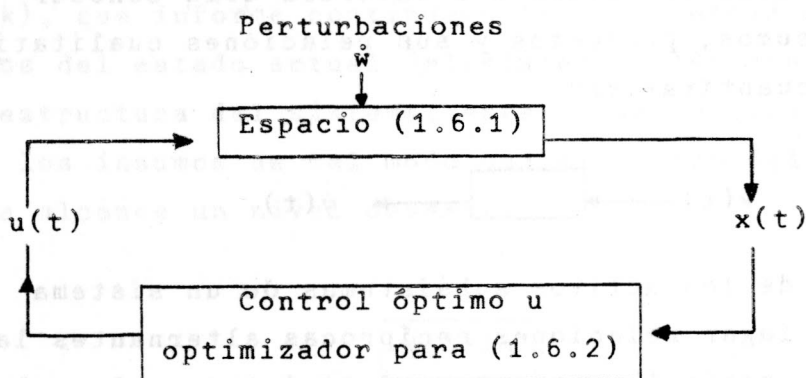


Diagrama para un ajustamiento óptimo.

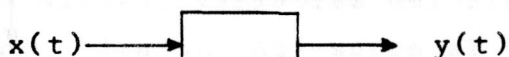
## APENDICE I

Un proceso es un cambio cualitativo o cuantitativo dependiente del tiempo, que ocurre en un objeto

que llamamos un sistema.

El concepto de cambio debe ser entendido en una forma bien amplia. Por ejemplo: Cambios en las coordenadas de una pequeña partícula, o en la temperatura de un cuerpo, o en el crecimiento de una planta, o en el crecimiento económico de un país, o en el comportamiento de una persona. Desde un punto de vista dialéctico, se describen tales cambios como un movimiento y nosotros nos interesamos especialmente en su ecuación. Un sistema esta compuesto de elementos activos. Un elemento activo es un objeto, cuya ecuación de movimiento contribuye al análisis del sistema en cuestión.

De un elemento activo nos interesa sólo conocer los insumos, productos y sus relaciones cualitatitivas y cuantitativas.



Dentro de los activos subsistemas de un sistema tienen lugar relaciones recíprocas alternantes las cuales, según la naturaleza del sistema y la selección de objetivo, varían en importancia. Llamareremos al conjunto de las relaciones características invariables (!) entre los elementos del sistema y entre los sistemas mismos, estructura del sistema.

Entre dos sistemas que son similares en una cierta forma, llamamos el más simple el modelo del más complicado. Un modelo puede ser conceptual, in-

tuitivo, artificial y natural (ver diagrama I).

Es necesario extender intuitivamente la idea de sistema para cubrir tareas de planeación. Así llamaremos un sistema en una forma aún general, una entidad dinámica organizada que puede ser influenciada desde su exterior y cuyo comportamiento puede ser manipulado de una cierta manera. Cuando en la salida del sistema disponemos de un mecanismo que nos informe en cada unidad de tiempo sobre la calidad y cantidad del producto, decimos que podemos observar el estado del sistema.

Otra extensión muy natural de nuestra concepción intuitiva, es la elaboración de un mecanismo (feed back), que informe continuamente a la unidad de insumos del estado actual del sistema. Así conocida la estructura del sistema, este mecanismo graduaría los insumos de tal modo que el estado del sistema alcance un nivel deseado.

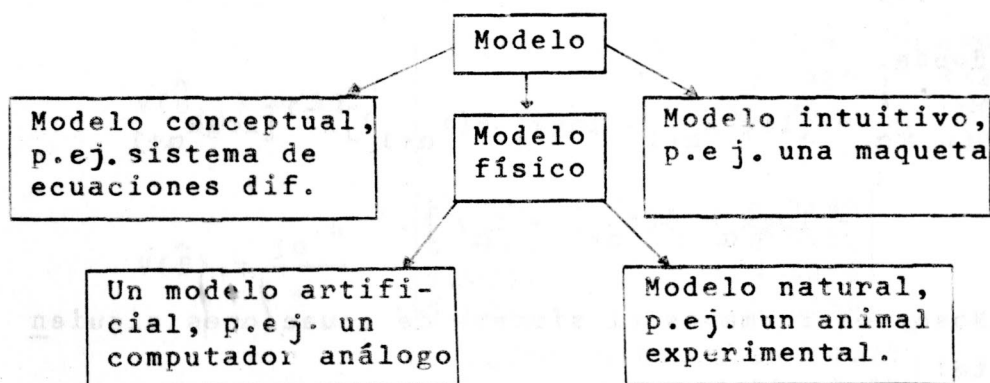


Diagrama I

## APENDICE II

### Estimaciones de máxima verosimilitud.

Nosotros derivamos las estimaciones de los coeficientes de difusión  $f$  y  $B$  empleando el principio de máxima verosimilitud.

Sean  $x_0, x_1, \dots, x_n$  los vectores de observaciones de  $x(t)$  en las unidades de tiempo  $t_0, t_1, \dots, t_n$  respectivamente. Sea además  $P[x(t_1) = x_1] = 1$ , la probabilidad conjunta de las observaciones; es to es, la función de máxima verosimilitud es:

$$L(x_0, \dots, x_n) = p(x_1)p(t_1, x_1; t_2, x_2) \dots$$

$$\dots p(t_{n-1}, x_{n-1}; t_n, x_n) =$$

$$= (2\pi)^{-nk/2} |B^{-1}|^{-n/2} \prod_{\alpha=1}^n (t_{\alpha+1} - t_{\alpha})^{-k/2} \cdot$$

$$\prod_{i=1}^k (x_{i\alpha})^{-1} \exp\left[-\frac{1}{2} (t_{\alpha} - t_{\alpha})^{-1} Q_{\alpha}\right],$$

donde:

$$Q_{\alpha} = [\log x_{\alpha+1} - \log x_{\alpha} - \beta(t_{\alpha+1})] B^{-1} [\log x_{\alpha+1} - \log x_{\alpha} - \beta(t_{\alpha+1} - t_{\alpha})].$$

Nosotros formamos el sistema de ecuaciones siguien te:

$$\frac{\partial \log L}{\partial \beta_i} = 0 \quad ; \quad \frac{\partial \log L}{\partial b(i,j)} = 0 \quad ; \quad i, j = 1(1)k$$

Solucionado este sistema de ecuación resultan estimaciones para  $f$  y  $B$ .

### APENDICE III

Aquí resumimos las más importantes estimaciones de máxima verosimilitud y sus varianzas.

Respecto al §1.4:

$$\hat{B} = 10^{-3} \begin{bmatrix} 0.7108 & 0.6939 & 0.4997 & 0.4183 \\ & 0.8872 & 0.5804 & 0.6712 \\ & & 5.7010 & 3.0980 \\ & & & 4.6040 \end{bmatrix}$$

$$\hat{\beta} = \begin{bmatrix} 0.0551 \\ 0.0525 \\ 0.0668 \\ 0.0715 \end{bmatrix}$$

$$\hat{f} = \begin{bmatrix} 0.0555 \\ 0.0530 \\ 0.0697 \\ 0.0738 \end{bmatrix}$$

$$v(\hat{\beta}_i) = \frac{10^{-4}}{t} \begin{bmatrix} 0.309 \\ 0.386 \\ 2.479 \\ 2.002 \end{bmatrix} \quad t = 1, 2, \dots$$

$$v(\hat{b}_{ij}) = 10^{-7} \begin{bmatrix} 0.4393 & 0.4835 & 1.1870 & 1.4990 \\ & 0.6845 & 2.3460 & 1.9720 \\ & & 28.260 & 15.560 \\ & & & 18.430 \end{bmatrix}$$

$$v(\hat{f}) = \frac{10^{-4}}{t} \begin{bmatrix} 0.309 \\ 0.386 \\ 2.479 \\ 2.002 \end{bmatrix} + 10^{-7} \begin{bmatrix} 0.2196 \\ 0.3422 \\ 14.1310 \\ 9.2160 \end{bmatrix}$$

$$R(x_i(t), x_j(t)) = \begin{bmatrix} 1.00 & 0.87 & 0.24 & 0.28 \\ & 1.00 & 0.25 & 0.33 \\ & & 1.00 & 0.60 \\ & & & 1.00 \end{bmatrix}$$

$$\hat{B} = 10^{-3} \begin{bmatrix} 0.637 & 0.6028 & -0.0017 & -0.0187 \\ & 0.7553 & 0.0140 & -0.0088 \\ & & 0.0136 & 0.0033 \\ & & & 0.0069 \end{bmatrix}$$

$$\hat{\beta}_0 = \begin{bmatrix} 0.04282 \\ 0.03746 \\ -0.00066 \\ -0.06056 \end{bmatrix} \quad \hat{\beta}_1 = \begin{bmatrix} 0.07588 \\ 0.13947 \\ 0.00890 \\ 0.9366 \end{bmatrix} \quad \hat{\beta}_2 = \begin{bmatrix} 0.06315 \\ 0.03703 \\ 0.92630 \\ 0.0050855 \end{bmatrix}$$

$$\hat{f}_0 = \begin{bmatrix} 0.04314 \\ 0.03784 \\ -0.00065 \\ -0.00055 \end{bmatrix} \quad \hat{f}_1 = \begin{bmatrix} 0.07620 \\ 0.13985 \\ 0.00890 \\ 0.93666 \end{bmatrix} \quad \hat{f}_2 = \begin{bmatrix} 0.06347 \\ 0.03741 \\ 0.92631 \\ 0.00508 \end{bmatrix}$$

$$V(\hat{\beta}_0) = \frac{10^{-4}}{t} \begin{bmatrix} 0.2768 \\ 0.3284 \\ 0.0059 \\ 0.0030 \end{bmatrix} \quad V(\hat{\beta}_1) = \frac{10^{-4}}{t} \begin{bmatrix} 0.1643 \\ 0.1950 \\ 0.0035 \\ 0.0017 \end{bmatrix}$$

$$V(\hat{\beta}_2) = \frac{10^{-4}}{t} \begin{bmatrix} 0.1744 \\ 0.2069 \\ 0.0037 \\ 0.0018 \end{bmatrix} \quad t = 1, 2, 3, \dots$$

$$V(\hat{f}_0) = \frac{10^{-4}}{t} \begin{bmatrix} 0.2768 \\ 0.3284 \\ 0.0059 \\ 0.0030 \end{bmatrix} + 10^{-7} \begin{bmatrix} 0.176262 \\ 0.248069 \\ 0.000812 \\ 0.000023 \end{bmatrix}$$

$$V(\hat{f}_1) = \frac{10^{-4}}{t} \begin{bmatrix} 0.1643 \\ -0.1950 \\ 0.0035 \\ 0.0017 \end{bmatrix} + 10^{-7} \begin{bmatrix} 0.0176262 \\ 0.248069 \\ 0.000812 \\ 0.000023 \end{bmatrix}$$

$$R(x_i(t), x_j(t)) = \begin{bmatrix} 1.0000 & 0.8691 & -0.0018 & -0.2822 \\ & 1.0000 & 0.0113 & -0.1230 \\ & & 1.0000 & 0.0712 \\ & & & 1.0000 \end{bmatrix}$$

$$v(\hat{f}_2) = \frac{10^{-4}}{t} \begin{bmatrix} 0.1744 \\ 0.2069 \\ 0.0037 \\ 0.0018 \end{bmatrix} + 10^{-7} \begin{bmatrix} 0.176262 \\ 0.248069 \\ 0.000812 \\ 0.000023 \end{bmatrix}$$

\*\*\*

Tabla 1.4.1

| Año  | $E(x_1(t))$ | $E(x_2(t))$ | $E(x_3(t))$ | $E(x_4(t))$ |
|------|-------------|-------------|-------------|-------------|
| 1973 | 49415.3     | 35855.3     | 9691.8      | 4147.5      |
| 1974 | 52234.9     | 37805.6     | 10391.0     | 4465.1      |
| 1975 | 55215.4     | 39861.9     | 11140.8     | 4807.0      |
| 1976 | 58366.0     | 42030.1     | 11944.6     | 5175.1      |
| 1977 | 61696.3     | 44316.2     | 12806.4     | 5571.3      |
| 1978 | 65216.7     | 46726.7     | 13730.5     | 5997.9      |
| 1979 | 68937.9     | 49268.3     | 14721.1     | 6457.2      |
| 1980 | 72871.5     | 51948.1     | 15783.3     | 6951.6      |
| 1981 | 77029.5     | 54773.7     | 16922.1     | 7483.9      |
| 1982 | 81424.7     | 57753.0     | 18143.1     | 8058.9      |

Donde:

$x_1(t)$  := producto nacional real;  $x_2(t)$  := consumo privado real,  $x_3(t)$  := inversiones privadas reales;  $x_4(t)$  := gastos reales del gobierno.

$Ex_i(t)$  := correspondiente  $x_i(t)$  esperado, El índice de precios con respecto a 1958.

Tabla 1.4.2

(en millones de pesos: 1958 = 100)

| Año  | $x_1(t)$ | $E(x_1(t))$ | $x_2(t)$ | $E(x_2(t))$ | $x_3(t)$ | $E(x_3(t))$ | $x_4(t)$ | $E(x_4(t))$ |
|------|----------|-------------|----------|-------------|----------|-------------|----------|-------------|
| 1950 | 13790.4  | 13790.4     | 10604.7  | 10604.7     | 1952.1   | 1952.1      | 760.0    | 760.0       |
| 1951 | 14657.2  | 14577.2     | 11403.9  | 11181.6     | 1949.7   | 2093.0      | 853.8    | 818.2       |
| 1952 | 15318.9  | 15409.0     | 11876.2  | 11789.7     | 2116.2   | 2244.0      | 923.5    | 880.8       |
| 1953 | 16021.9  | 16288.2     | 12326.9  | 12431.0     | 2665.1   | 2405.9      | 1080.7   | 948.3       |
| 1954 | 18226.9  | 17217.6     | 13874.0  | 13107.2     | 3088.3   | 2579.5      | 1222.9   | 1020.9      |
| 1955 | 18150.4  | 18200.0     | 13952.2  | 13820.1     | 3264.4   | 2765.6      | 1284.8   | 1099.1      |
| 1956 | 19302.3  | 19238.5     | 14587.4  | 14571.8     | 3281.4   | 2965.1      | 1246.0   | 1183.2      |
| 1957 | 20239.3  | 20336.3     | 14759.0  | 15364.4     | 3003.8   | 3179.1      | 1160.9   | 1273.8      |
| 1958 | 20682.5  | 21496.6     | 15004.9  | 16200.1     | 3338.8   | 3408.4      | 1196.1   | 1371.4      |
| 1959 | 21897.0  | 22723.2     | 15924.3  | 17081.3     | 3618.4   | 3654.4      | 1268.1   | 1476.4      |
| 1960 | 23258.0  | 24019.8     | 17034.2  | 18010.4     | 4213.0   | 3918.0      | 1442.9   | 1589.4      |
| 1961 | 24533.1  | 25390.4     | 18213.3  | 18990.0     | 4500.2   | 4200.7      | 1625.8   | 1711.1      |
| 1962 | 26106.3  | 26839.1     | 19618.1  | 20022.9     | 4684.7   | 4503.8      | 1798.5   | 1842.1      |
| 1963 | 26702.8  | 28370.5     | 20260.6  | 21112.0     | 4397.2   | 4828.8      | 1931.9   | 1983.2      |
| 1964 | 28444.6  | 29989.3     | 21940.5  | 22260.4     | 4578.7   | 5177.2      | 1843.2   | 2135.0      |
| 1965 | 29657.4  | 31700.5     | 22186.4  | 23471.2     | 4636.2   | 5550.7      | 1928.9   | 2298.5      |
| 1966 | 31458.2  | 33509.3     | 23864.4  | 24747.8     | 5257.9   | 5951.2      | 2098.5   | 2474.5      |
| 1967 | 32002.0  | 35421.4     | 23769.5  | 26093.9     | 5643.3   | 6380.6      | 2190.3   | 2664.0      |
| 1968 | 34559.7  | 37442.5     | 25338.9  | 27513.2     | 6743.8   | 6841.0      | 2358.4   | 2868.0      |
| 1969 | 37108.1  | 39578.9     | 27316.9  | 29009.8     | 7100.4   | 7334.6      | 2619.7   | 3087.6      |
| 1970 | 40556.1  | 41837.3     | 29385.9  | 30587.7     | 8028.0   | 7863.8      | 3093.7   | 3324.0      |
| 1971 | 42951.3  | 44224.5     | 31127.0  | 32251.4     | 8746.6   | 8431.2      | 3751.0   | 3578.5      |
| 1972 | 46383.8  | 46747.9     | 33675.4  | 34005.7     | 8490.0   | 9039.5      | 3662.3   | 3852.5      |

Tabla 1.5.2

| Año  | $x_1(t)$ | $E(x_1(t))$ | $x_2(t)$ | $E(x_2(t))$ | $x_3(t)$ | $E(x_3(t))$ | $x_4(t)$ | $E(x_4(t))$ |
|------|----------|-------------|----------|-------------|----------|-------------|----------|-------------|
| 1950 | 13790.4  | 13790.4     | 10604.7  | 10604.7     | 1952.1   | 1952.1      | 760.0    | 760.0       |
| 1951 | 14657.2  | 14533.2     | 11403.9  | 11205.0     | 1949.7   | 1950.7      | 853.8    | 852.6       |
| 1952 | 15318.9  | 15351.6     | 11876.2  | 11808.5     | 2116.2   | 2111.5      | 923.5    | 920.3       |
| 1953 | 16021.9  | 16507.3     | 12326.9  | 12682.0     | 2665.1   | 2687.2      | 1080.7   | 1080.2      |
| 1954 | 18226.9  | 17584.9     | 13874.0  | 13495.6     | 3088.3   | 3114.6      | 1222.9   | 1222.1      |
| 1955 | 18150.4  | 18498.0     | 13952.2  | 14145.9     | 3264.4   | 3282.9      | 1284.8   | 1281.2      |
| 1956 | 19302.3  | 19275.5     | 14587.4  | 14632.5     | 3281.4   | 3295.7      | 1246.0   | 1244.8      |
| 1957 | 20239.3  | 19913.6     | 14759.0  | 15004.9     | 3003.8   | 3043.4      | 1160.9   | 1166.5      |
| 1958 | 20682.5  | 20987.7     | 15004.9  | 15715.3     | 3338.8   | 3373.3      | 1196.1   | 1200.1      |
| 1959 | 21897.0  | 22130.9     | 15924.3  | 16511.1     | 3618.4   | 3645.0      | 1268.1   | 1269.5      |
| 1960 | 23258.0  | 23595.4     | 17034.2  | 17589.6     | 4213.0   | 4246.6      | 1442.9   | 1444.9      |
| 1961 | 24533.1  | 24982.7     | 18213.3  | 18642.3     | 4500.2   | 4525.6      | 1625.8   | 1626.7      |
| 1962 | 26106.3  | 26364.6     | 19618.1  | 19681.3     | 4684.7   | 4702.1      | 1798.5   | 1796.3      |
| 1963 | 26702.8  | 27575.4     | 20260.6  | 20606.3     | 4397.2   | 4442.3      | 1931.9   | 1923.8      |
| 1964 | 28444.6  | 28765.7     | 21940.5  | 21297.0     | 4578.7   | 4610.5      | 1843.2   | 1842.2      |
| 1965 | 29657.4  | 30164.6     | 22186.4  | 22273.3     | 4636.2   | 4663.3      | 1928.9   | 1923.3      |
| 1966 | 31458.2  | 31977.1     | 23864.4  | 23536.3     | 5257.9   | 5280.8      | 2098.5   | 2088.6      |
| 1967 | 32002.0  | 33654.6     | 23769.5  | 24661.8     | 5643.3   | 5650.2      | 2190.3   | 2175.6      |
| 1968 | 34559.7  | 35784.5     | 25338.9  | 26078.9     | 6743.8   | 6768.9      | 2358.4   | 2338.7      |
| 1969 | 37108.1  | 37805.6     | 27316.9  | 27562.3     | 7100.4   | 7111.1      | 2619.7   | 2593.7      |
| 1970 | 40556.1  | 40353.6     | 29385.9  | 29502.9     | 8028.0   | 8033.6      | 3093.7   | 3073.1      |
| 1971 | 42951.3  | 43064.3     | 31127.0  | 31670.9     | 8746.6   | 8738.8      | 3751.0   | 3749.4      |
| 1972 | 46383.8  | 44798.4     | 33675.4  | 32748.0     | 8490.0   | 8497.2      | 3662.3   | 3664.7      |

(Tabla 1.5.2. )

$R^2 = 0.894$        $R^2 = 0.998$        $R^2 = 0.999$   
 F-valor 169.56    F-valor 4465.15    F-valor 407945.6

$R^2 = 30.999$   
 F-valor 265672.1

Nota: La estimación de la correlación  $R^2$  y del respectivo F-valor muestra el porcentaje de la varianza  $x(2)$ ,  $x(3)$ ,  $x(4)$ .

Tabla 1.5.1

| $i$ | $f_{i0}$ | $f_{i1}$ | $f_{i2}$ |
|-----|----------|----------|----------|
| 1   | 0.04314  | 0.07620  | 0.06347  |
| 2   | 0.03784  | 0.13985  | 0.03741  |
| 3   | -0.00065 | 0.00890  | 0.92631  |
| 4   | -0.00055 | 0.93666  | 0.00508  |

Tabla 1.5.3

| Año  | $E(x_1(t))$ | $E(x_2(t))$ | $E(x_3(t))$ | $E(x_4(t))$ |
|------|-------------|-------------|-------------|-------------|
| 1973 | 47263.0     | 34470.2     | 9084.7      | 3936.3      |
| 1974 | 49863.1     | 36282.9     | 9712.8      | 4228.1      |
| 1975 | 52606.3     | 38190.9     | 10384.4     | 4541.5      |
| 1976 | 55500.5     | 40199.3     | 11102.4     | 4878.2      |
| 1977 | 58553.8     | 42313.3     | 11870.0     | 5239.8      |
| 1978 | 61775.1     | 44538.5     | 12690.7     | 5628.2      |
| 1979 | 65173.7     | 46880.7     | 13568.1     | 6045.4      |
| 1980 | 68759.2     | 49346.0     | 14506.3     | 6493.5      |
| 1981 | 72541.9     | 51941.1     | 15509.2     | 6974.9      |
| 1982 | 76532.8     | 54672.5     | 16581.6     | 7491.9      |

Tabla 1.5.4

| Año  | $E(x_1(t))$ | $E(x_2(t))$ | $E(x_3(t))$ | $E(x_4(t))$ |
|------|-------------|-------------|-------------|-------------|
| 1973 | 48656.8     | 35167.9     | 8256.8      | 3579.9      |
| 1974 | 50616.2     | 36363.8     | 8028.5      | 3499.0      |
| 1975 | 52654.4     | 37600.5     | 7806.5      | 3419.9      |
| 1976 | 54774.6     | 38879.2     | 7530.6      | 3342.6      |
| 1977 | 56980.3     | 40201.4     | 7330.8      | 3267.1      |
| 1978 | 59274.7     | 41568.6     | 7176.7      | 3193.2      |
| 1979 | 61661.6     | 42982.3     | 6978.2      | 3121.1      |
| 1980 | 64144.6     | 44444.0     | 6735.3      | 3050.5      |
| 1981 | 66727.5     | 45955.5     | 6537.7      | 2981.6      |
| 1982 | 69414.5     | 47518.3     | 6415.3      | 2914.2      |

Tabla 1.5.5.

| Año  | $E(x_1(t))$ | $E(x_2(t))$ | $E(x_3(t))$ | $E(x_4(t))$ |
|------|-------------|-------------|-------------|-------------|
| 1973 | 50456.5     | 36743.3     | 10811.0     | 4472.6      |
| 1974 | 54429.6     | 39694.9     | 13764.1     | 5461.6      |
| 1975 | 58715.6     | 42883.6     | 17523.7     | 6669.4      |
| 1976 | 63339.0     | 46328.5     | 22310.4     | 8144.3      |
| 1977 | 68326.6     | 50050.1     | 28404.4     | 9945.3      |
| 1978 | 73706.8     | 54070.6     | 36163.1     | 12144.6     |
| 1979 | 79510.7     | 58414.1     | 46041.0     | 14830.2     |
| 1980 | 85771.7     | 63106.5     | 58617.1     | 18109.8     |
| 1981 | 92525.6     | 68175.9     | 74628.4     | 22114.5     |
| 1982 | 99811.4     | 73652.5     | 95013.1     | 27004.9     |

## Datos estadísticos.

(En millones de pesos a precios corrientes)

| Año  | $x_1(t)$ | $x_2(t)$ | $x_3(t)$ | $x_4(t)$ | P     | $\Delta G$ | $\Delta I$ |
|------|----------|----------|----------|----------|-------|------------|------------|
| 1950 | 7860.5   | 6044.7   | 1112.7   | 433.2    | 57.0  | 0.00000    | 0.00000    |
| 1951 | 8940.9   | 6956.4   | 1189.3   | 520.8    | 61.0  | .12338     | -.00125    |
| 1952 | 9650.9   | 7482.0   | 1333.2   | 581.8    | 63.0  | .08166     | .08541     |
| 1953 | 10734.7  | 8259.0   | 1785.6   | 724.1    | 67.0  | .17028     | .25937     |
| 1954 | 12758.8  | 9711.8   | 2161.8   | 856.0    | 70.0  | .13149     | .15880     |
| 1955 | 13249.8  | 10185.1  | 2383.0   | 937.9    | 73.0  | .05065     | .05702     |
| 1956 | 14862.8  | 11232.3  | 2526.7   | 959.4    | 77.0  | -.03022    | .00522     |
| 1957 | 17810.6  | 12987.9  | 2643.3   | 1021.6   | 88.0  | -.06827    | -.08462    |
| 1958 | 20682.5  | 15004.9  | 3338.8   | 1196.1   | 100.0 | .03031     | .11154     |
| 1959 | 23648.8  | 17198.2  | 3907.9   | 1369.5   | 108.0 | .06016     | .08375     |
| 1960 | 26746.7  | 19589.3  | 4844.9   | 1659.3   | 115.0 | .13786     | .16431     |
| 1961 | 30421.0  | 22584.5  | 5580.3   | 2016.0   | 124.0 | .12679     | .06819     |
| 1962 | 34199.2  | 25699.7  | 6136.9   | 2356.0   | 131.0 | .10620     | .04098     |
| 1963 | 43525.5  | 33024.8  | 7167.5   | 3149.0   | 163.0 | .07419     | -.06135    |
| 1964 | 53760.3  | 41467.6  | 8653.8   | 3483.6   | 189.0 | -.04593    | .04127     |
| 1965 | 60797.6  | 45482.1  | 9504.2   | 3954.3   | 205.0 | .04652     | .01255     |
| 1966 | 73612.3  | 55842.6  | 12303.6  | 4910.4   | 234.0 | .08789     | .13411     |
| 1967 | 83525.2  | 62038.5  | 14729.1  | 5716.8   | 261.0 | .04379     | .07330     |
| 1968 | 96421.7  | 70695.6  | 18815.1  | 6579.8   | 279.0 | .07670     | .19500     |
| 1969 | 110953.3 | 81677.4  | 21230.1  | 7832.8   | 299.0 | .11080     | .05288     |
| 1970 | 130590.8 | 94622.7  | 25850.3  | 9961.6   | 322.0 | .18094     | .13065     |
| 1971 | 153765.5 | 111434.8 | 31312.8  | 13428.6  | 358.0 | .21248     | .08950     |
| 1972 | 185535.3 | 134701.6 | 33960.2  | 14649.2  | 400.0 | -.02365    | -.02933    |

# Notas:

- a) P: Índice nacional de precios del consumidor ;  
 $\Delta G$ : cambios relativos en los gastos del gobierno  
 $\Delta I$ : cambios relativos en la inversión privada.
- b) Hemos usado variables reales más que nominales, las cuales hemos calculado con ayuda del único índice de precios a nuestra disposición. Las variables nominales empleadas aparecen en esta tabla (ver pág.238).
- c) Fuente de los datos: Cuentas nacionales del Banco de la República, 1974.

\*\*\*

## REFERENCIAS

- (1) Astrom,K.J., Introduction to Stochastic Control Theory. Academic Press, 1970.
- (2) Arnold, L., Stochastic Differential Equations: Theory and Applications. Wiley, 1974.
- (3) Bharucha-Reid,A.T., Random Integral Equations. Academic Press, 1972.
- (4) Bartlet, M.S., An Introduction to Stochastic Process. Cambridge University Press, 1955.
- (5) Chow, G., Analysis and Control of Dynamic Economic Systems, 1975.
- (6) Fleming,W.-Rishel,R.W., Deterministic and Sto-

chastic Control Theory. Springer Verlag, 1975.

- (7) Gihman, I.I. - Shorohod, A.V., Stochastic Differential Equations. Springer Verlag, 1972.
- (8) Haavelmo, T., A Study in the Theory of Economic Evolution. North Holland, 1954.
- (9) Ito, K., "On Stochastic Differential Equations". Mem. Amer. Math. Soc. N<sup>o</sup> 4, 1951.
- (10) Liebsher, H., Klaus, G., Systeme, Informationen, Strategien. VEB Verlag. Leipzig, 1971.
- (11) McGarty, T., Stochastic System and State Estimation. Wiley, 1974.
- (12) Pawula, R.F., "Generalization and Extensions of the Fokker-Plank-Kolmogorov Equations". IEEE Trans. Inf. Theory IT-13, 33-41, 1967.
- (13) Pindyck, R., Optimal Planing for Economic Stabilization. North Holland, 1975.
- (14) Renton, A., (Ed). Modelling the Economy. Heinemann Educational Books, 1974.
- (15) Reinisch, K., Kybernetische Grundlagen und Beschreibung kontinuierlicher Systeme, 1974.
- (16) Stratonovich, R.L., Conditional Markov Processes and their Application to the Theory of optimal Control. North Holland, 1968.
- (17) Tintner, G., Sengupta, J., Stochastic Economis. Academic Press, 1972.

(18) Wasan, M.T., Stochastic Approximation. Cambridge University Press, 1962.

Universidad Técnica de Viena.

( 1976 ).

### 1. Introducción.

Existen diversas maneras de definir la distancia entre dos cuentas de la historia. En este trabajo se consideran la distancia de Levenshtein y la distancia de Hamming. La distancia de Levenshtein es la mínima cantidad de operaciones (inserción, eliminación y sustitución) necesarias para transformar una cadena en otra. La distancia de Hamming es la mínima cantidad de sustituciones necesarias para transformar una cadena en otra. Ambas distancias son medidas de la similitud entre dos cadenas de caracteres.

La Conferencia presentada en este trabajo fue patrocinada por el Departamento de Matemáticas de la Universidad Colombiana de Bogotá.