



Práctica 4:

Análisis de una serie temporal

Objetivo de la práctica:

El objetivo de la práctica consiste en realizar un análisis de una serie temporal, comenzando por identificar un modelo para la serie. El análisis debe continuar con la estimación de los parámetros de dicho modelo y la aplicación de los métodos necesarios para evaluar la bondad del modelo. El modelo encontrado se utilizará para realizar predicciones.

Descripción de la práctica:

El fichero de datos INGRESOS.SAV contiene los ingresos mensuales de una empresa desde enero de 1990 hasta abril de 1998. Nuestro objetivo consiste en predecir los ingresos de la empresa durante un periodo de un año, es decir hasta abril de 1999. Para ello se pide identificar, estimar y validar un modelo para esta serie temporal y evaluar su capacidad predictiva.

Tabla 1: Datos sobre los ingresos anuales de la empresa

Ingresos	1990	1991	1992	1993	1994	1995	1996	1997	1998
Enero	98,00	95,00	94,26	99,45	104,95	92,19	72,44	64,52	40,96
Febrero	100,00	98,00	96,56	102,80	107,81	94,79	77,52	68,05	45,29
Marzo	105,00	103,93	101,65	109,33	114,32	100,48	83,54	71,97	49,95
Abril	110,00	110,30	107,01	116,41	120,04	106,18	90,12	76,12	52,88
Mayo	107,00	109,39	105,69	116,90	120,21	105,23	89,70	74,23	
Junio	120,00	123,04	120,33	132,55	135,17	118,41	103,84	87,64	
Julio	125,00	127,60	126,44	138,17	139,63	121,07	108,09	89,87	
Agosto	112,00	115,21	115,74	127,24	126,97	107,86	97,06	77,80	
Septiembre	103,00	106,45	108,26	119,81	115,76	96,05	86,28	65,04	
Octubre	104,00	106,41	109,04	119,47	111,71	91,91	83,04	60,32	
Noviembre	100,00	100,90	104,31	113,21	101,09	80,62	73,26	49,03	
Diciembre	93,00	92,92	97,51	104,75	91,50	72,03	65,24	40,82	