

Programa GeneraReg.prg

Etiqueta para los resultados (series y^* , e^* y grupos Gy^*) e indicador para actualizar estimaciones

```
1 %tag = "n"
```

```
2 !update = 0
```

Especificación del modelo predicción

```
3 %modelo = "D(y) C y(-1)"
```

Muestras y horizontes (fin1, fin2 y Hmax son escalares en el Workfile)

```
4 !T1 = fin1
```

```
5 !T2 = fin2
```

```
6 !maxH = Hmax
```

Estimación del modelo de predicción

```
7 SMPL 1 !T1
```

```
8 EQUATION eq.LS%modelo
```

Una única proyección

```
9 SMPL !T1+1 !T1+10
```

```
10 eq.FORECAST(F=NA) y_ s_
```

```
11 SMPL 1 !T1+10
```

```
12 GROUP Gy{%tag} y y_ y_+2*s_ y_-2*s_
```

```
13 FREEZE(Gy{%tag}_) Gy{%tag}.LINE
```

```
14 SHOW Gy{%tag}_
```

Proyecciones recursivas: se generan las series $y\{tag\}_1, y\{tag\}_2, \dots, y\{tag\}_{!maxH}$

```
15 FOR !t = !T1+1 TO !T2-!maxH
```

```
16     IF !update = 1 THEN
```

```
17         SMPL 1 !t
```

```
18         EQUATION eq.LS {%modelo}
```

```
19     ENDIF
```

```
20     SMPL !t+1 !t+!maxH
```

```
21     eq.FORECAST temp
```

```
22     FOR !h = 1 TO !maxH
```

```
23         SMPL !t+!h !t+!h
```

```
24         SERIES y{%tag}{!h} = temp
```

```
25     NEXT !h
```

```
26     D temp
```

```
27 NEXT !t
```

Programa GeneraReg.prg

Errores de predicción: se generan las series $e_{\text{tag}1}$, $e_{\text{tag}2}$, ..., $e_{\text{tag}\{!maxH\}}$

```
28 SMPL @ALL
29 FOR !h = 1 TO !maxH
30     SERIES  $e_{\text{tag}\{!h\}} = y - y_{\text{tag}\{!h\}}$ 
31 NEXT !h
32 SMPL @ALL
```

Creamos grupos para visualizar los resultados... y sus diferencias

Grupo 1a: Proyecciones para todos los horizontes, y la serie original

```
33 GROUP  $G_{\text{tag}1a} y_{\text{tag}} * y$ 
34  $G_{\text{tag}1a}.$ LINE
35 CLOSE  $G_{\text{tag}1a}$ 
```

Grupo 1b: Errores de predicción para todos los horizontes

```
36 GROUP  $G_{\text{tag}1b} e_{\text{tag}} * 0$ 
37  $G_{\text{tag}1b}.$ LINE
38 CLOSE  $G_{\text{tag}1b}$ 
```

Grupo 2a: Proyecciones para horizontes seleccionados, y la serie original

```
39 GROUP  $G_{\text{tag}2a} y_{\text{tag}1} y_{\text{tag}\{!maxH\}} y$ 
40  $G_{\text{tag}2a}.$ LINE
41 CLOSE  $G_{\text{tag}2a}$ 
```

Grupo 2b: Errores de predicción para horizontes seleccionados

```
42 GROUP  $G_{\text{tag}2b} e_{\text{tag}1} e_{\text{tag}\{!maxH\}} 0$ 
43  $G_{\text{tag}2b}.$ LINE
44 CLOSE  $G_{\text{tag}2b}$ 
```

Evaluación de las proyecciones

```
45 RUN EvaluacionOptima
```