

# Tarea 2

## EYP3907 - Series de Tiempo

Sebastián Celaya

Camila Echeverría

Francisca Vilca

### Introducción

Utilizando una base de datos que contiene información sobre el ancho de los anillos de árboles pertenecientes a la especie *Pino Silvestre*, que puede encontrarse en el siguiente [link](#), ajustaremos un modelo ARMA y realizaremos diversos procedimientos para comprobar su ajuste.

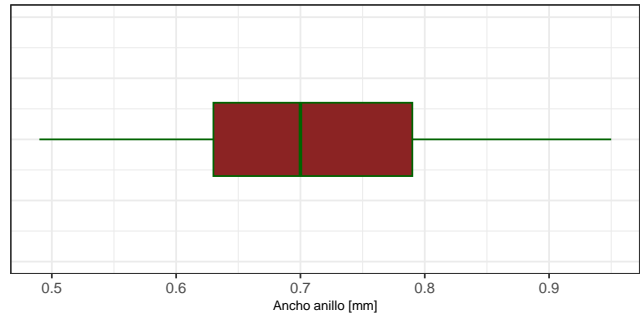


Figura 2: Boxplot de ancho de anillo

### Análisis exploratorio

La figura 1 muestra los valores del ancho del anillo registrados entre los años 1721 y 1889.

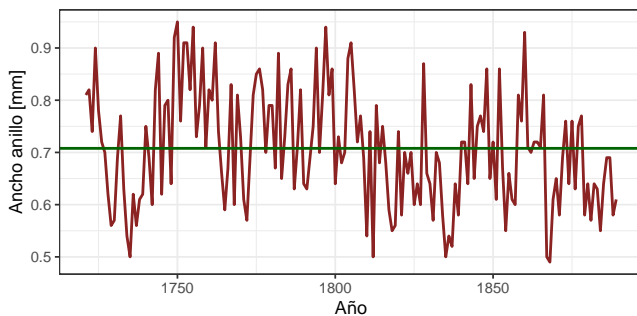


Figura 1: Variación del ancho del anillo

Gracias a la figura 2, es posible ver que la mediana de estos datos se encuentra cercana a 0.7 y que no tenemos datos atípicos, aunque la segunda mitad de las observaciones parecieran estar ligeramente más dispersa que la primera.

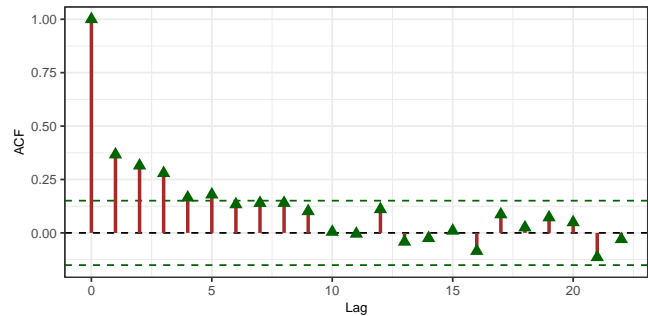


Figura 3: Gráfico de Autocorrelación

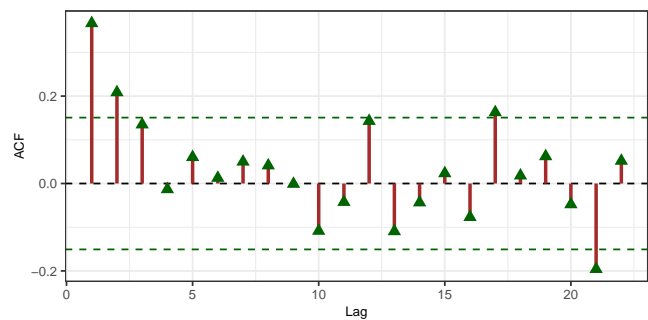
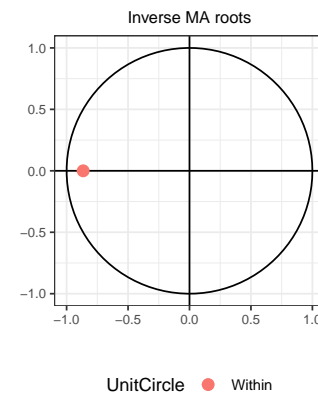


Figura 4: Gráfico de Autocorrelación Parcial

Luego, en los gráficos de la figura 3 y la figura 4 podemos ver la estructura de correlación de los datos. Si bien no se puede detectar estacionalidad a simple vista, las observaciones sí presentan altos niveles de correlación.

## Ajuste de un modelo ARMA

A simple vista, de los gráficos de ACF y PACF, vemos que nuestro modelo tiene estructura de un ARMA. Sin embargo, al usar la función `auto.arima()` como guía se recomienda usar un modelo MA(1), pero al hacerle las pruebas a los residuos, este rechaza el test de blancura. Por lo que, nuestra propuesta es un modelo `arma(1,1)`, para que este sea capaz de capturar toda la estructura de la serie temporal.



## Test de blancura - homocedasticidad y normalidad de los residuos

### ¿Es necesario realizar una transformación de Box-Cox?

## Significancia estadística de los coeficientes del modelo

Sabemos que los coeficientes del modelo deben cumplir con ser estadísticamente significantes, por lo que al revisar el valor-p asociado a cada coeficiente del modelo, es claro notar que todos son significativos, tal como se muestra en la tabla 1:

## Estacionaridad e invertibilidad del modelo ARMA

Una forma sencilla de comprobar la estacionaridad en los datos es con el test de Dickey-Fuller, el cual nos da un valor-p de 0.01 que al ser menor al 5% de significancia se rechaza la hipótesis nula de que los datos son estacionales. Por otro lado, una forma sencilla de verificar invertibilidad del modelo ARMA(1,1), es de forma gráfica, comprobando que los coeficientes se encuentren al interior de la circunferencia unitaria, lo que puede ser apreciado en la ?@fig-exp5: