



Tecnológico de Monterrey

Actividad Clase Bloomberg

Diego Alfredo Silva Flores

04 de abril del 2025

Series de Tiempo

Raymundo

Grok: <https://grok.com/chat/1d1a2d92-4c6d-4306-b983-af1796b8a947>

Colab:

<https://colab.research.google.com/drive/1xVfsCGmOIE7izk2VsfnknoYEiaXs6GbhU?usp=sharing>

Github: <https://github.com/DiegoS005/Actividad-Bloomberg>

Interpretación: En base al código se puede concluir que la hipótesis de la estacionaria tiene media y varianza constantes en el tiempo estudiado, gracias a esto se pueden aplicar modelos ARMA, ya que si no es estacionaria no se puede aplicar este modelo, así mismo se justifica el uso del modelo ARMA debido a los picos significativos en los primeros rezagos lo que indica que un ARMA (1,1) puede ser adecuado

Los modelos ARMA son útiles para explicar y predecir series de tiempo estacionarias, el cual se verifica por medio de los coeficientes de pruebas t, la revisión de residuos que deben de comportarse como ruido blanco y a evaluar el AIC, BIC o los errores de predicción, al predecir el precio de acción entre más largo sea el tiempo a predecir disminuye la precisión del modelo

La cointegración evita falsos regresores y permite que el VECM si hay más de una relación de cointegración