



| **UNR** Universidad
Nacional de Rosario

LICENCIATURA EN ESTADÍSTICA

Trabajo Práctico

*“Evaluación de las Tendencias de Ventas Mensuales en una Empresa de Logística
Mediante Series de Tiempo”*

Autor: Santini, Franco

Docentes: Mendez, Fernanda - Sigal, Facundo

2024

Tabla de contenidos

Introducción	1
Análisis descriptivo	1
Análisis de dispersion	3
Identificación del modelo	4
Diferenciación de la serie	4
Bibliografía	10

Introducción

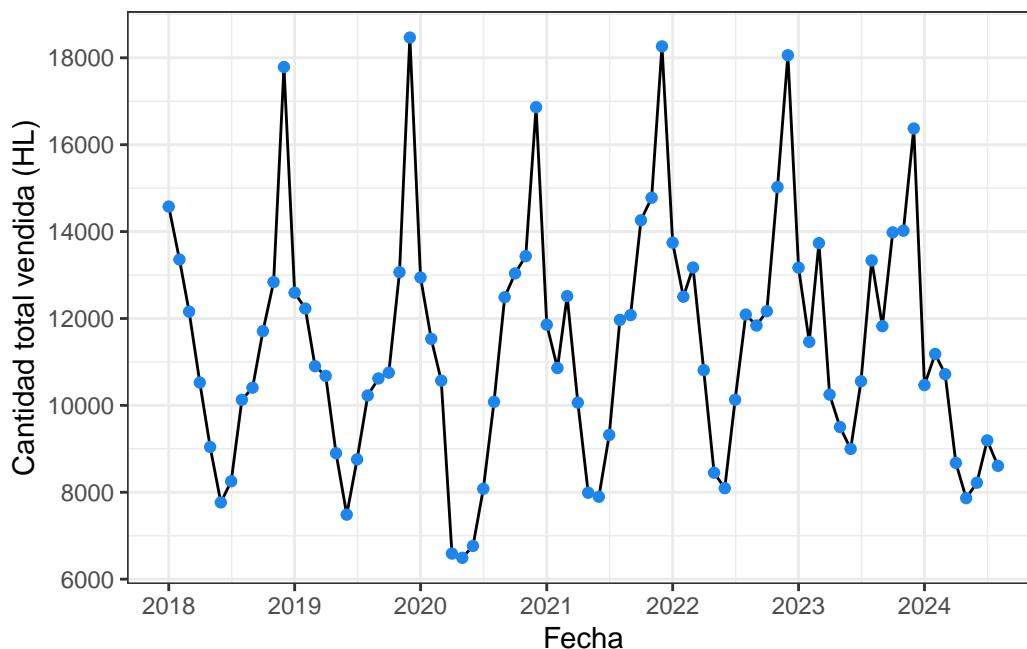
En este trabajo se busca estudiar las unidades vendidas en Hectolitro¹ (HL) de una importante empresa de logística en la ciudad de Casilda, Santa Fe. El estudio se realiza con 80 observaciones, medidas mensualmente en el período (01/01/2018 - 31/08/2024).

Cabe aclarar que en el período de estudio, atravesamos un evento muy catastrófico en todas las áreas, particularmente en el sector de logística, la pandemia del COVID-19. Al afectar principalmente a las personas, Argentina implementó el Aislamiento Social, Preventivo y Obligatorio (ASPO) como medida para combatir la pandemia de COVID-19. Debido a esta medida, a fines de marzo del 2020 - principios de abril del 2020, el sector de logística fue afectado y en general se produjo una caída en las ventas con respecto al año anterior.

Teniendo esto en cuenta, resulta de interés pronosticar a futuro las unidades vendidas en (HL) de la empresa, mediante modelos de *series de tiempo*.

Análisis descriptivo

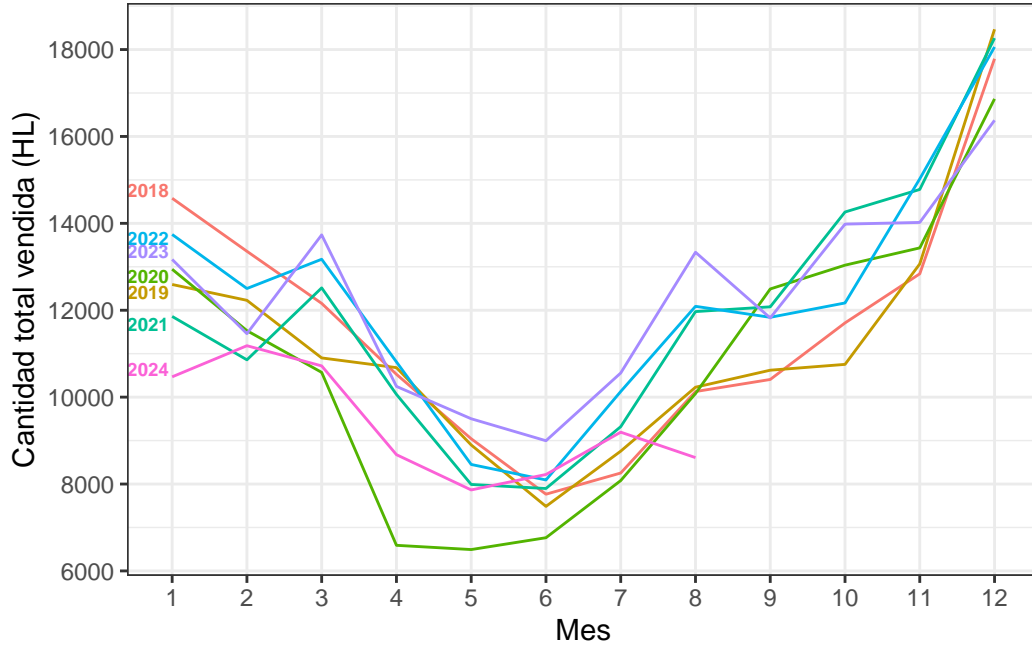
Figura 1: Unidades vendidas mensuales en (HL)



En la Figura 1 se puede observar un comportamiento estacional de las unidades vendidas, disminuye considerablemente en los meses (mayo, junio y julio) y luego aumenta considerablemente en los meses (noviembre - diciembre - enero) en casi todos los años, exceptuando el año 2020 por la pandemia.

¹Unidad de volumen equivalente a 100 litros.

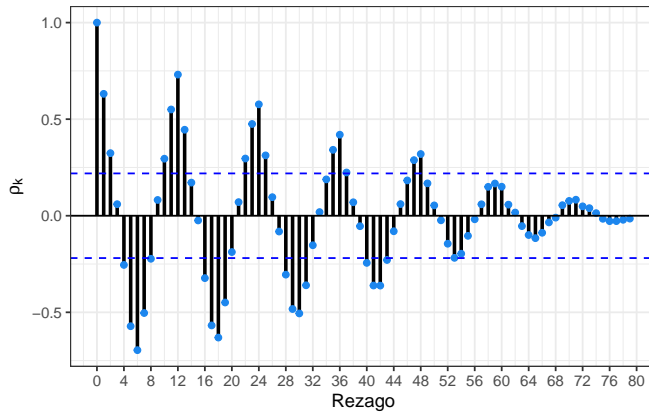
Figura 2: Comportamiento anual de las unidades vendidas en (HL)



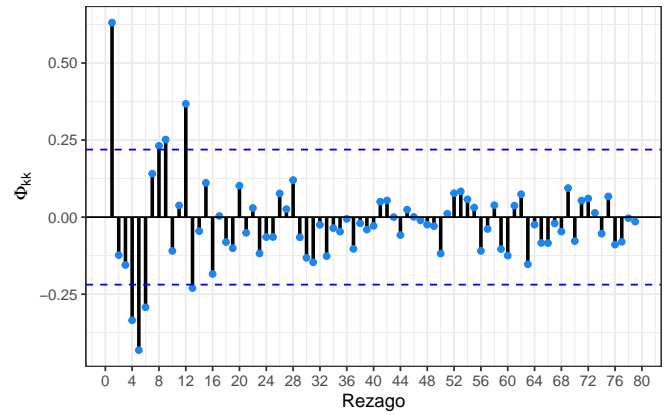
En Figura 2 podemos observar que claramente hay un comportamiento estacional de las unidades vendidas, pero se descarta cualquier tipo de tendencia creciente o decreciente de las mismas, dado que no se observa ni un crecimiento, ni un decrecimiento año a año de las unidades vendidas mensuales.

Figura 3: Funciones de autocorrelación muestral

(a) FACM



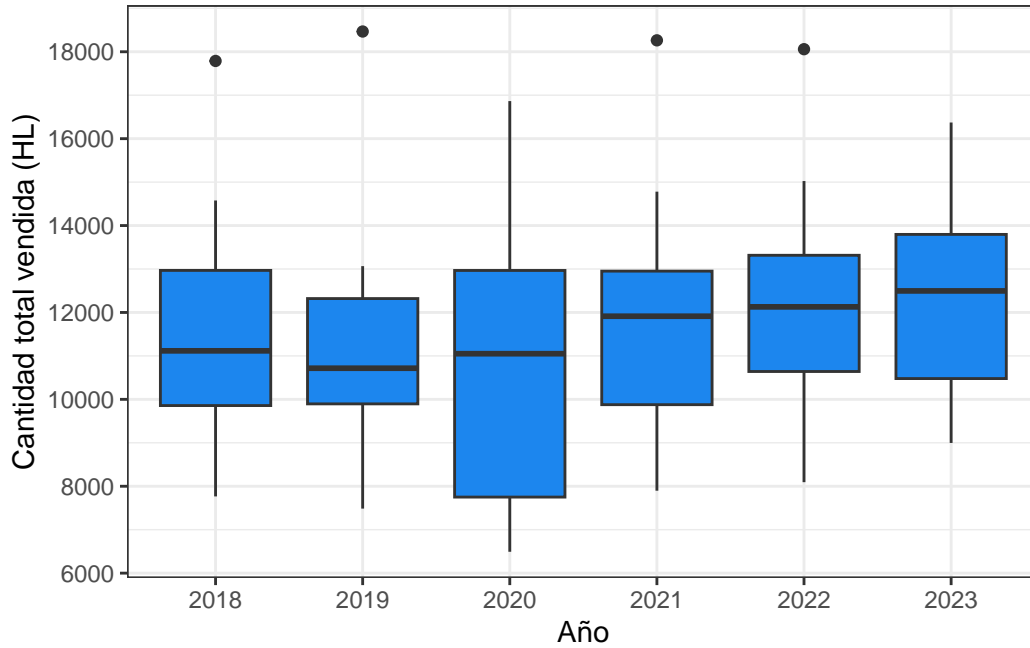
(b) FACPM



En Figura 3 se puede observar que la FACM tiene un decrecimiento lento y oscilante, notando también que en los rezagos 12, 24, 36 y 48 son significativos esto da un indicio de que la serie tiene un comportamiento estacional, mientras que la FACPM parece tener un decrecimiento aproximadamente exponencial.

Analisis de dispersion

Figura 4: Boxplots de las unidades vendidas en (HL) por año



Se puede observar en la Figura 4 que la variabilidad no parece ser constante año a año, por lo que puede estar dando una advertencia de que la serie no es estacionaria en varincia, además se puede apreciar la presencia de outliers en los años 2018, 2019, 2021 y 2022. Se excluyó el año 2024 de la Figura 4 porque no estaban los datos completos.

Una vez observados los Boxplots, procederemos a realizar la transformación de Box-Cox. Dependiendo del valor de λ obtenido, determinaremos si es necesario transformar la serie o si puede mantenerse en su forma original. Además, puede ser de utilidad ajusta el coeficiente de variación según los valores de λ arrojados por la transformación de Box-Cox, de esta manera, podremos identificar si una transformación de potencia es adecuada para estabilizar la varianza de la serie.

Tabla 1: Coeficiente de variación

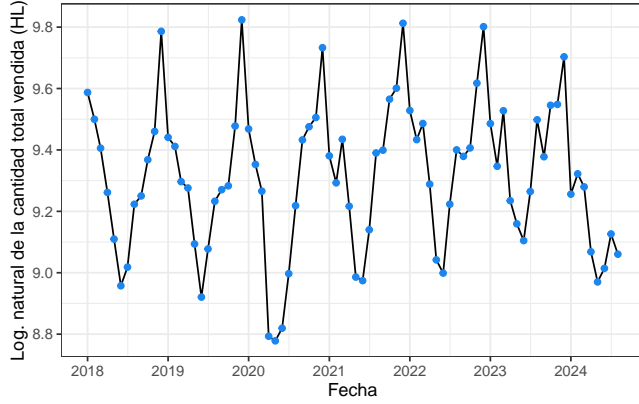
λ	Coeficiente de variación
-2.0	0.5001
-1.0	0.2433
-0.5	0.1206
0.0	0.0258
0.5	0.1198
1.0	0.2405
2.0	0.4909

Observando la Tabla 1, el coeficiente de variación mínimo esta asociado a un $\lambda = 0$, por lo que es apropiado aplicar la transformacion $y^{(\lambda)} = \ln(y)$.

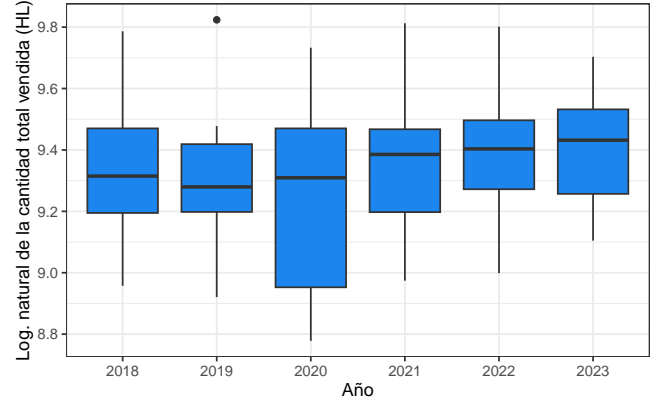
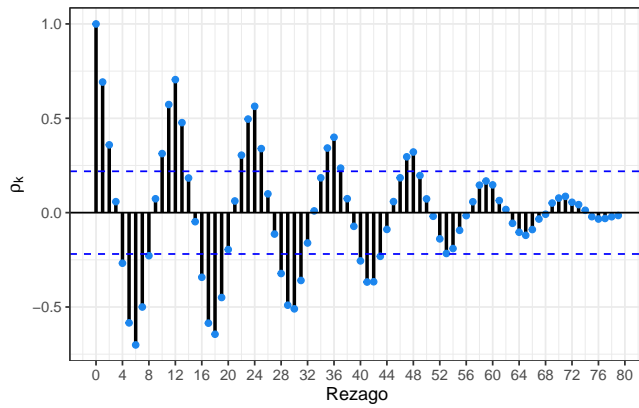
Identificación del modelo

Figura 5: Resumen de la Serie transformada

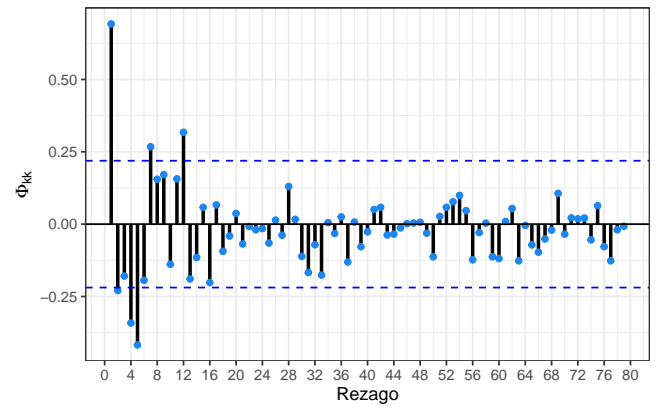
- (a) Log. natural de las unidades vendidas mensuales en (HL) (b) Boxplots del Log. natural de las unidades vendidas en (HL) por año



(c) FACM



(d) FACPM



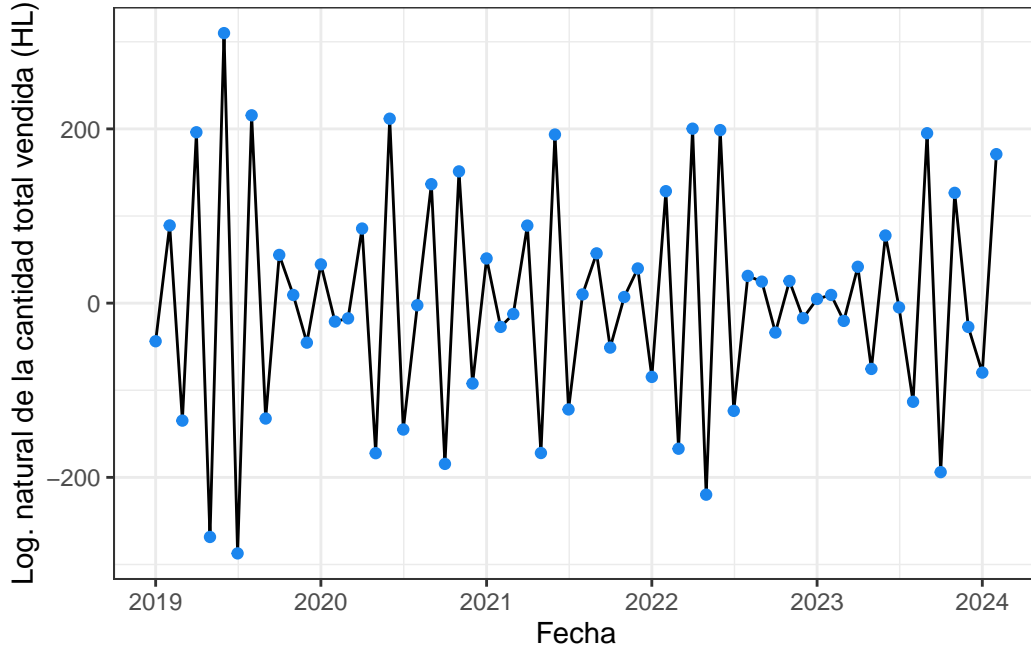
Luego de transformar a la serie, se realizó la Figura 5 que contiene un resumen acerca del comportamiento de la serie. Notando, que ahora en el gráfico (b) se puede observar que la variabilidad parece ser un poco más constante año a año.

Diferenciación de la serie

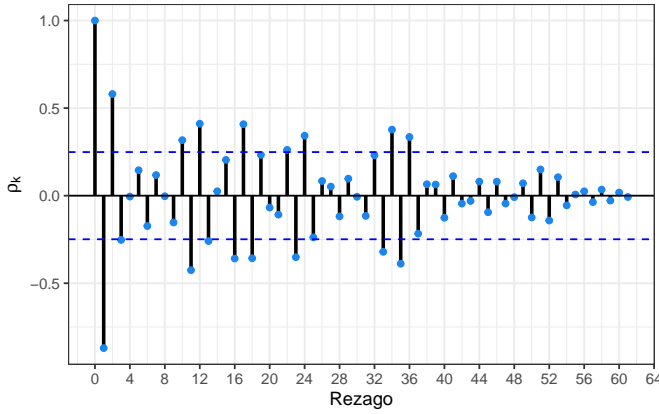
Una vez realizado el análisis descriptivo, se notó el comportamiento estacional de la serie, por lo qué, se realiza una diferenciación en la parte estacional de la misma, pasando a trabajar con 62 observaciones.

Figura 6: Resumen de la Serie diferenciada en la parte estacional

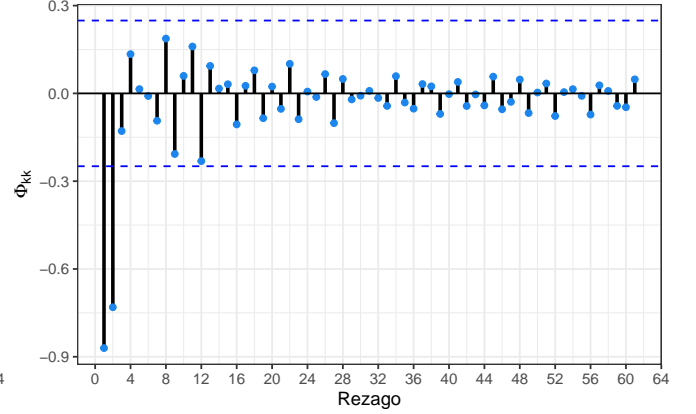
(a) Log. natural de las unidades vendidas mensuales en (HL)



(b) FACM



(c) FACPM



En la Figura 6 se observa, el gráfico de la serie diferenciada en la parte estacional y sus respectivas funciones de autocorrelación muestral y de autocorrelación parcial muestral. En el gráfico (a) se puede observar que la serie parece ser estacionaria, dado que varía de manera oscilante sobre un valor constante. Luego para realizar la identificación de los posibles modelos que se pueden ajustar a esta serie, utilizaremos los gráficos (b) y (c). En el gráfico de la FACM se puede observar que 2 rezagos son significativos, y el tercer rezago está en el límite de ser significativo, viendo la parte estacional parece que los rezagos 12, 24 y 36 son significativos, presentando un decrecimiento exponencial. En el gráfico de la FACPM se puede observar que solo los primeros 2 rezagos son significativos, y el rezago 12 correspondiente a la parte estacional, parece estar al límite de ser significativo.

Por lo que teniendo esto en cuenta, planteamos los siguientes modelos que se pueden ajustar a nuestra serie:

- Modelo 1: $SARIMA(2, 0, 2)(1, 1, 0)_{12}$
- Modelo 2: $SARIMA(2, 0, 2)(2, 1, 0)_{12}$
- Modelo 3: $SARIMA(2, 0, 3)(1, 1, 0)_{12}$
- Modelo 4: $SARIMA(2, 0, 3)(2, 1, 0)_{12}$

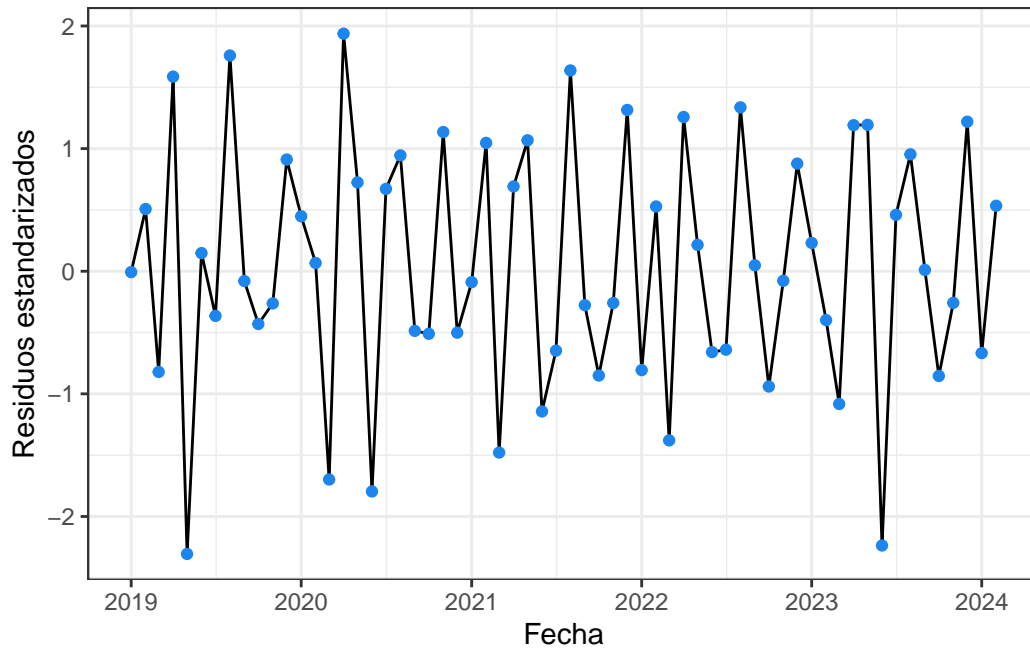
Una vez planteado los modelos que vamos a utilizar para el pronóstico de la serie, se procede a estimarlos y compararlos.

Tabla 2: Comparación de los modelos

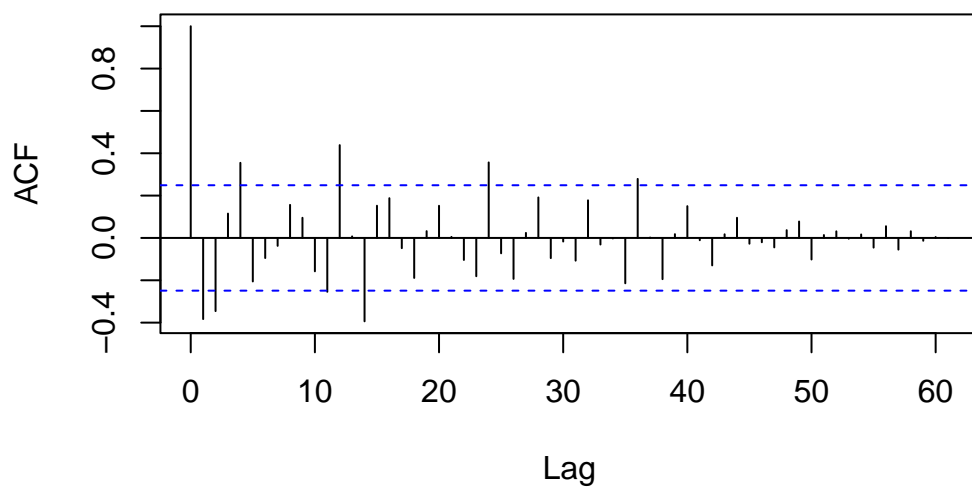
Modelos	AIC	$\hat{\sigma}^2$
Modelo 1	513.8809	149.0926
Modelo 2	480.6486	77.3964
Modelo 3	465.8509	55.0152
Modelo 4	448.5474	37.7562
Mod. automático	441.2442	38.8303

Se puede observar, que los modelos con menor AIC son:

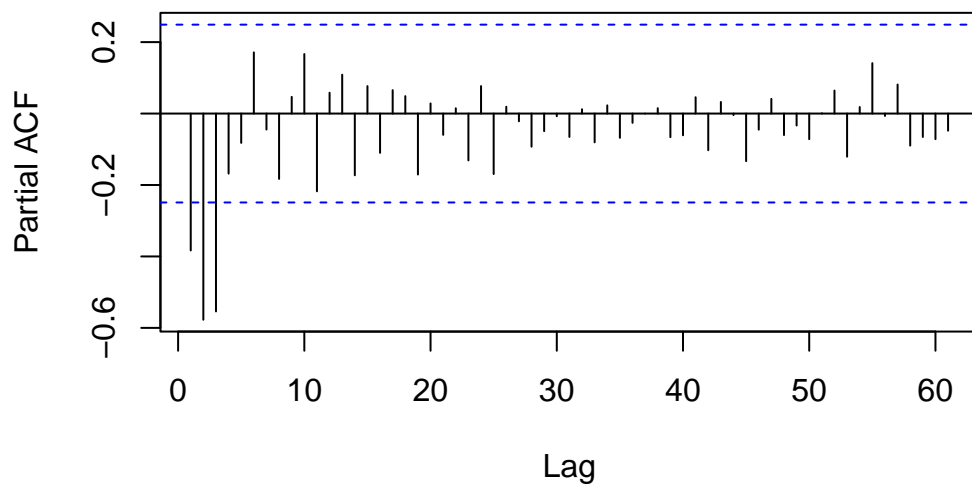
- $SARIMA(2, 0, 3)(2, 1, 0)_{12}$
- $SARIMA(0, 0, 5)(0, 1, 0)_{12}$, este modelo corresponde a la selección automática.

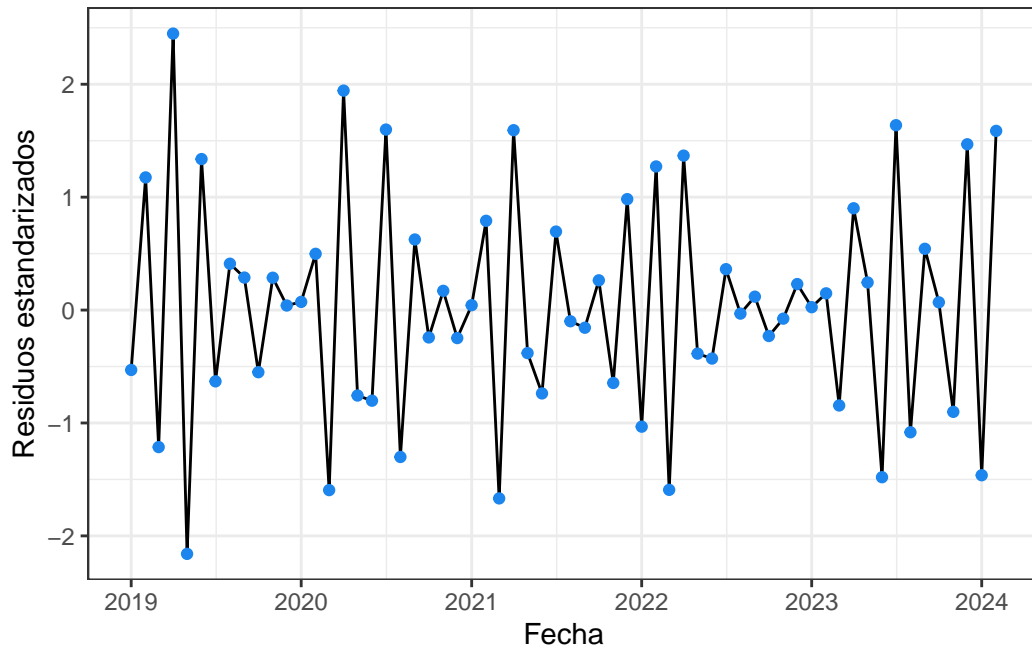


Series m4\$residuals

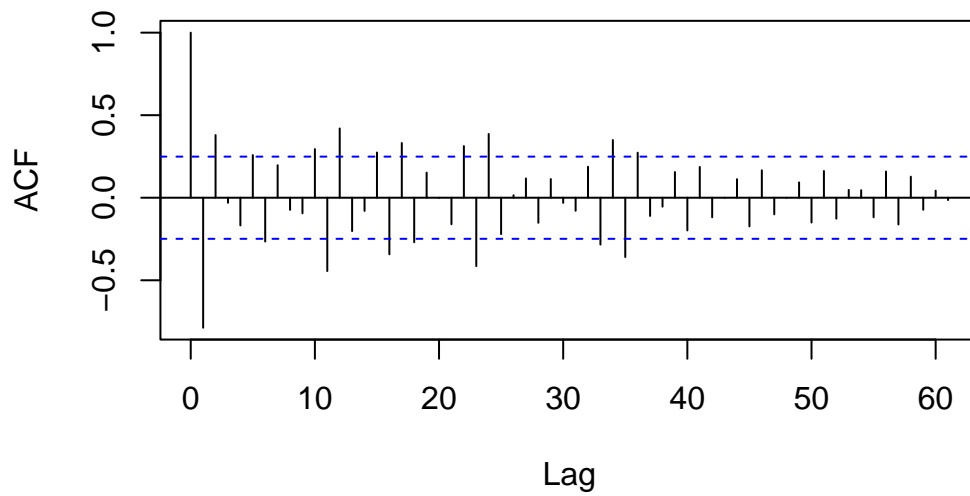


Series m4\$residuals

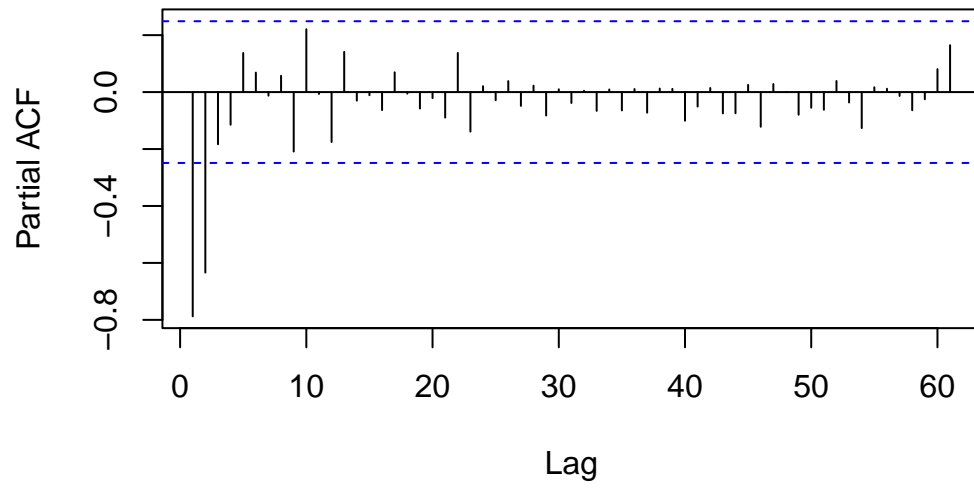




Series m_auto\$residuals



Series m_auto\$residuals



Bibliografía

- Wei, W.S. (2006) Time Series Analysis: Univariate and Multivariate Methods, 2nd edition
- Hyndman, R.J., & Athanasopoulos, G. (2021) Forecasting: principles and practice, 3rd edition