



| **UNR** Universidad
Nacional de Rosario

LICENCIATURA EN ESTADÍSTICA

Trabajo Práctico

*“Estudio de los retornos mensuales del **SPY 500**”*

Autor: Franco Santini

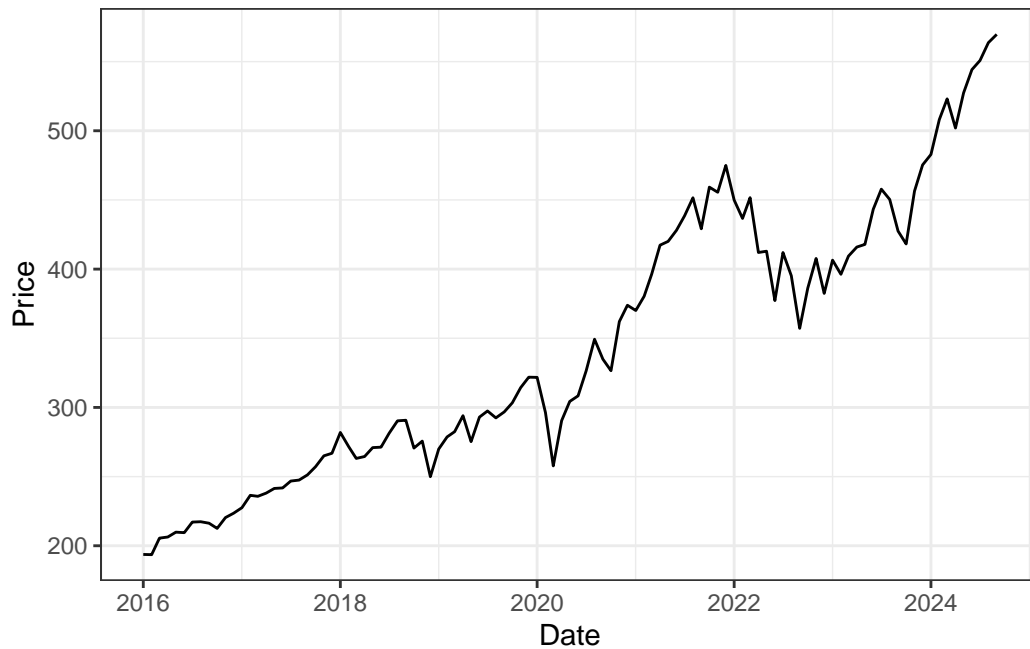
Docentes: Fernanda Mendez - Facundo Sigal

2024

Tabla de contenidos

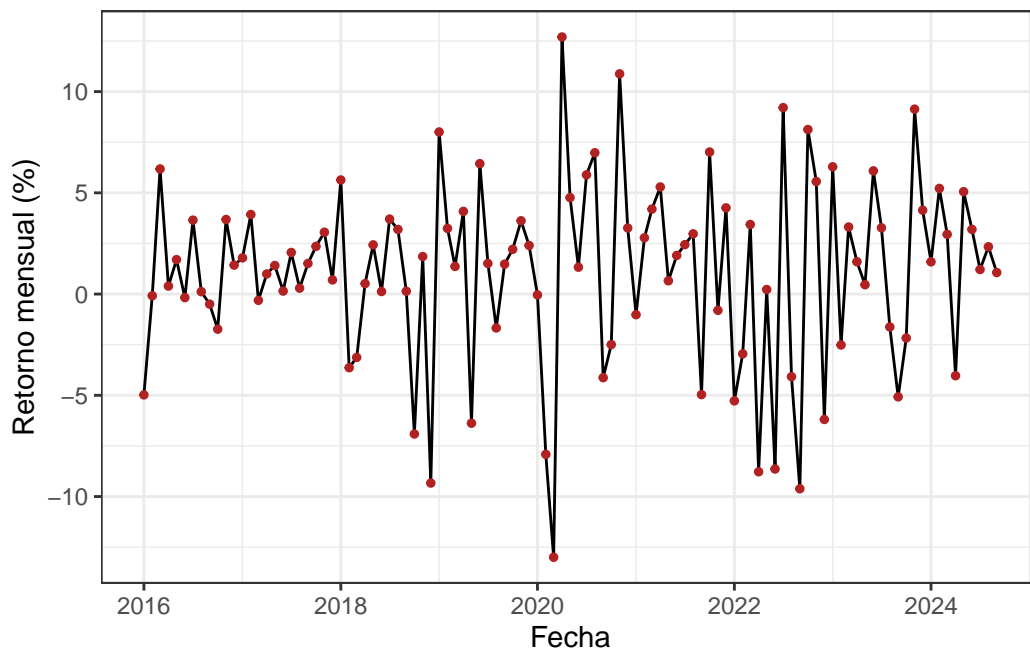
Base datos 1 (Retornos mensuales - SPY 500)	1
Análisis exploratorio	1
Análisis de dispersión	4
Base datos 2 (Unidades vendidas en HL - Empresa de logística)	5
Análisis descriptivo	5
Análisis de dispersión	7

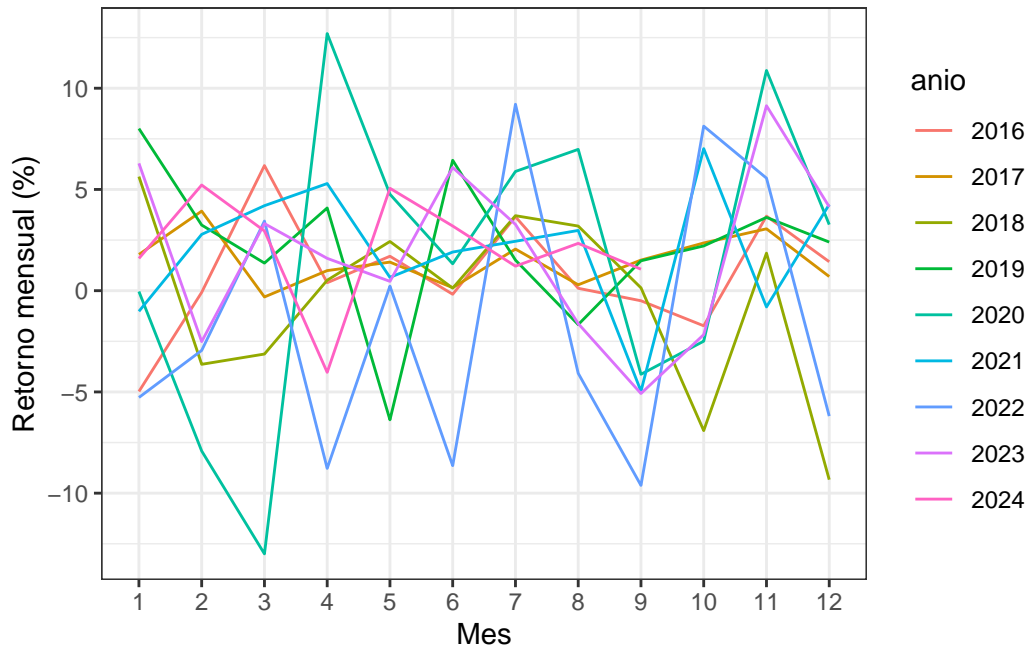
Base datos 1 (Retornos mensuales - SPY 500)



Formula del calculo del retorno mensual = $\frac{Precio_{mes\ actual} - Precio_{mes\ pasado}}{Precio_{mes\ pasado}} \cdot 100$. Si el retorno es positivo indica una ganancia, si el retorno es negativo indica una pérdida

Analisis exploratorio





En este gráfico no se observa un comportamiento estacional de la serie

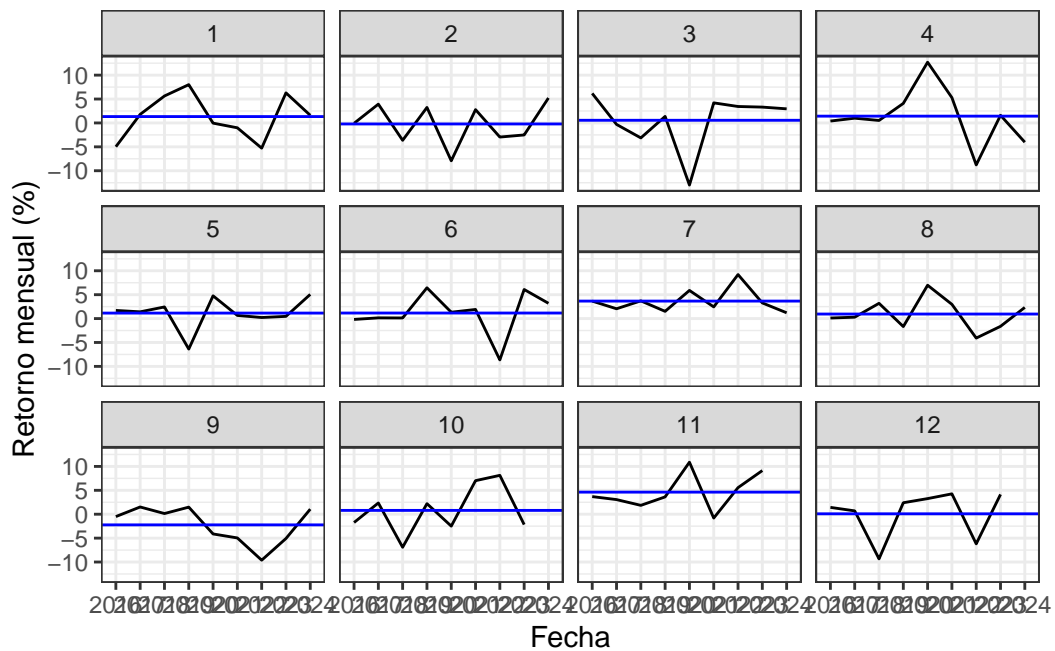
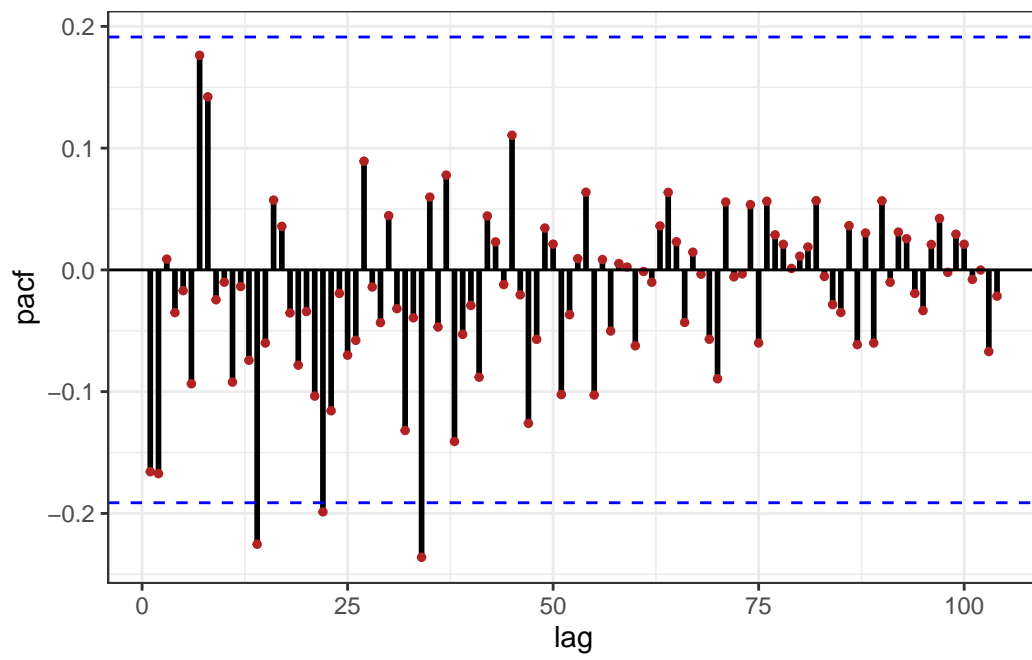
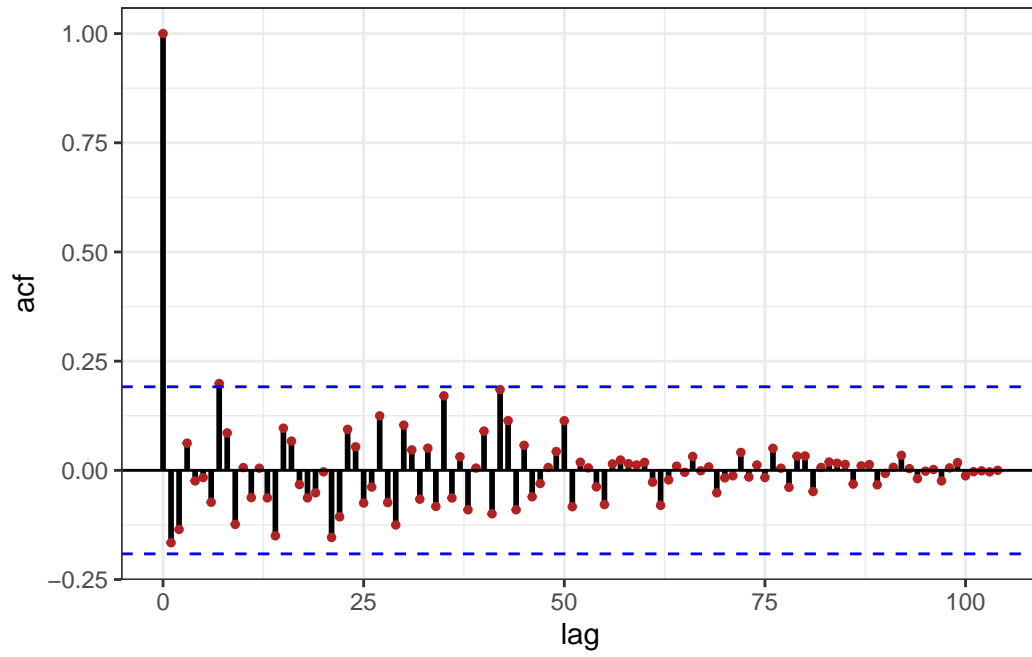
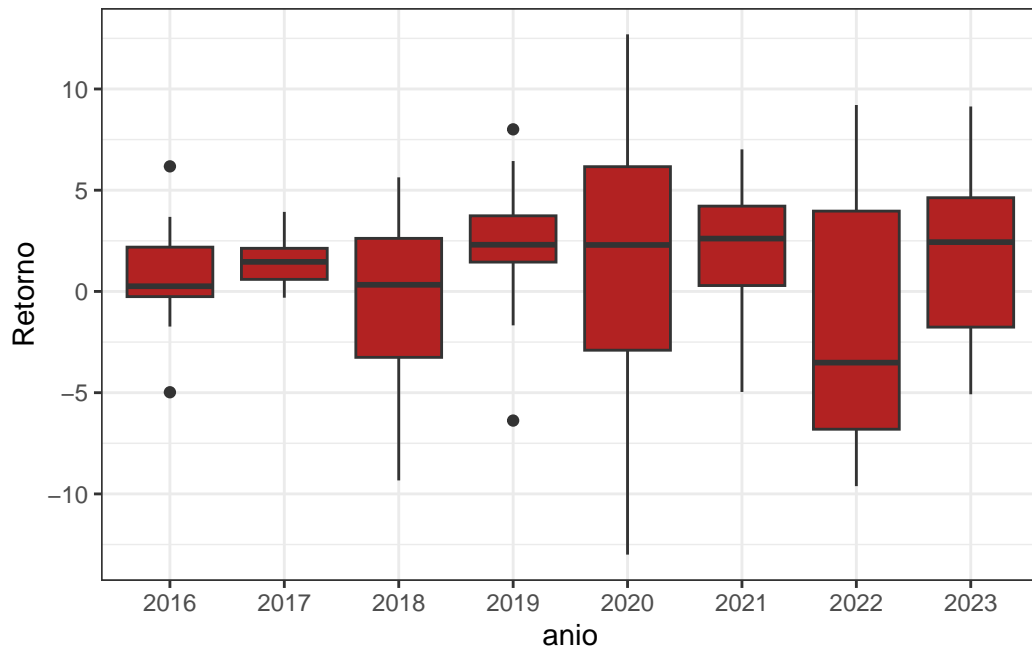


Gráfico de autocorrelación



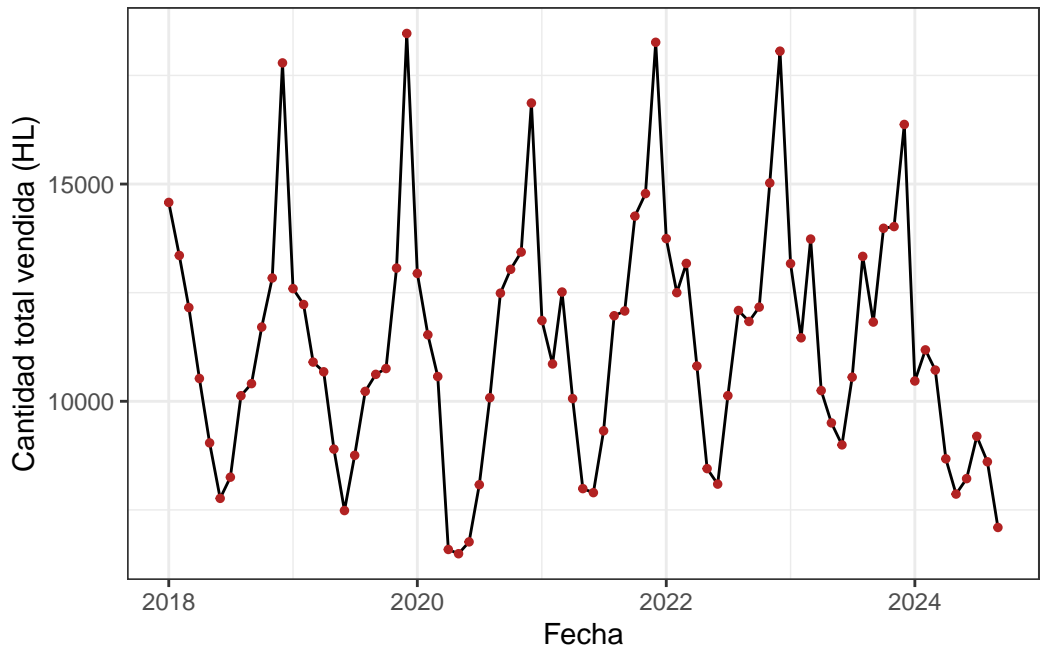
Analisis de dispersion



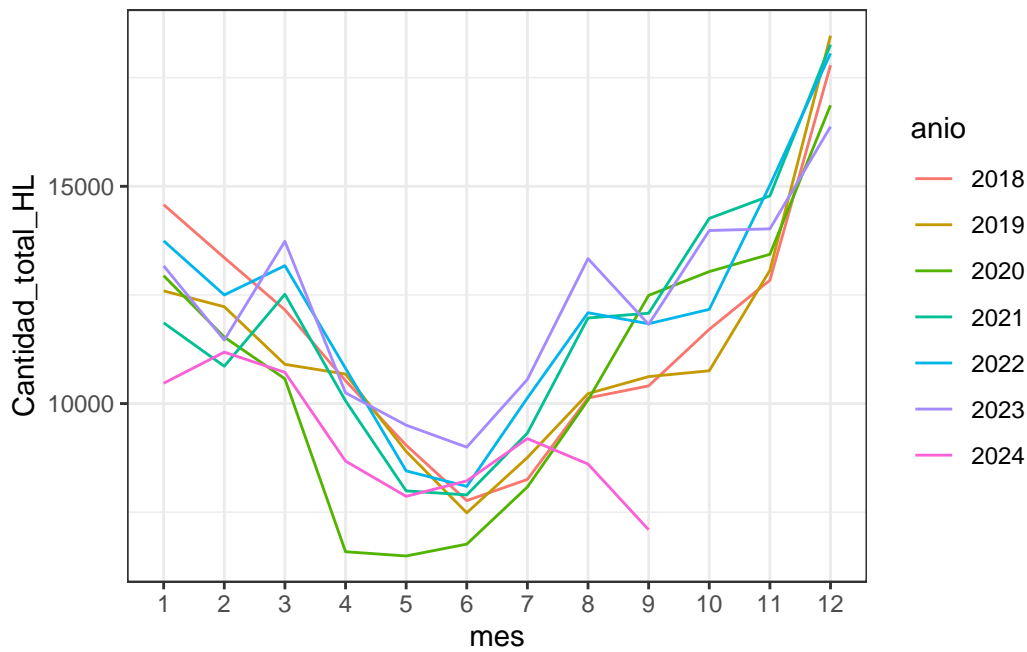
Parece haber variabilidad distintas en los años. Por lo que se podría aplicar las transformaciones de Box-Cox

Base datos 2 (Unidades vendidas en HL - Empresa de logística)

Analisis descriptivo



Parece haber un comportamiento estacional



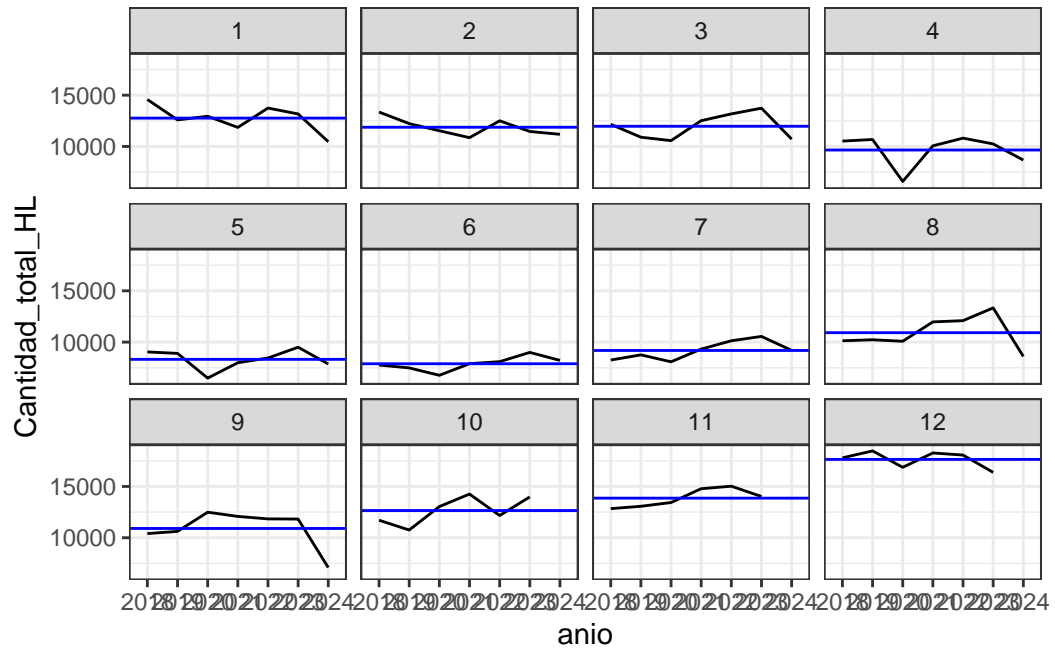
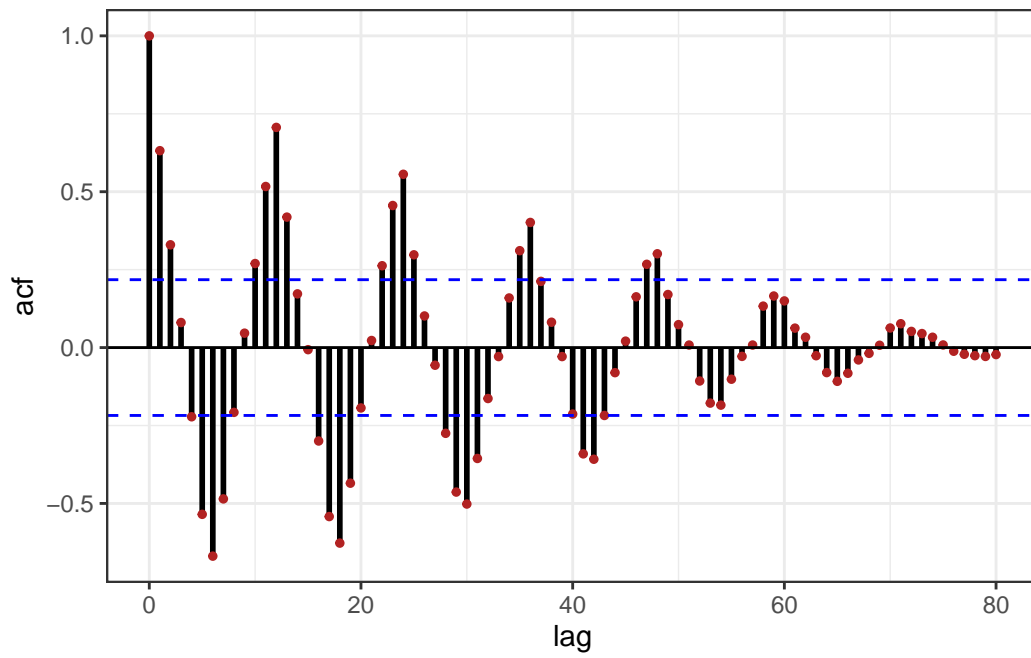
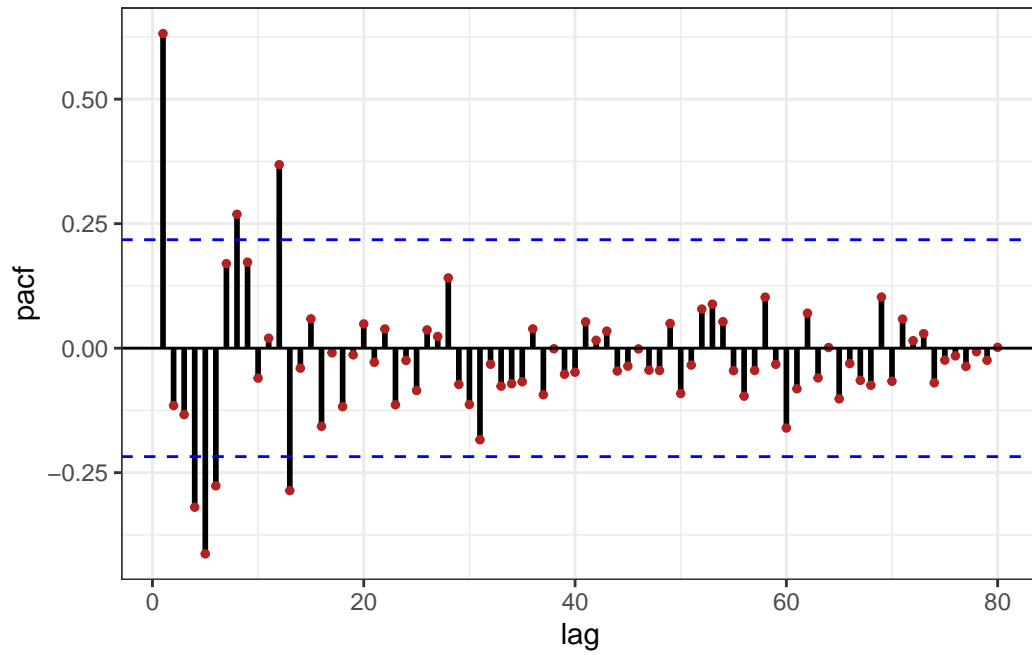
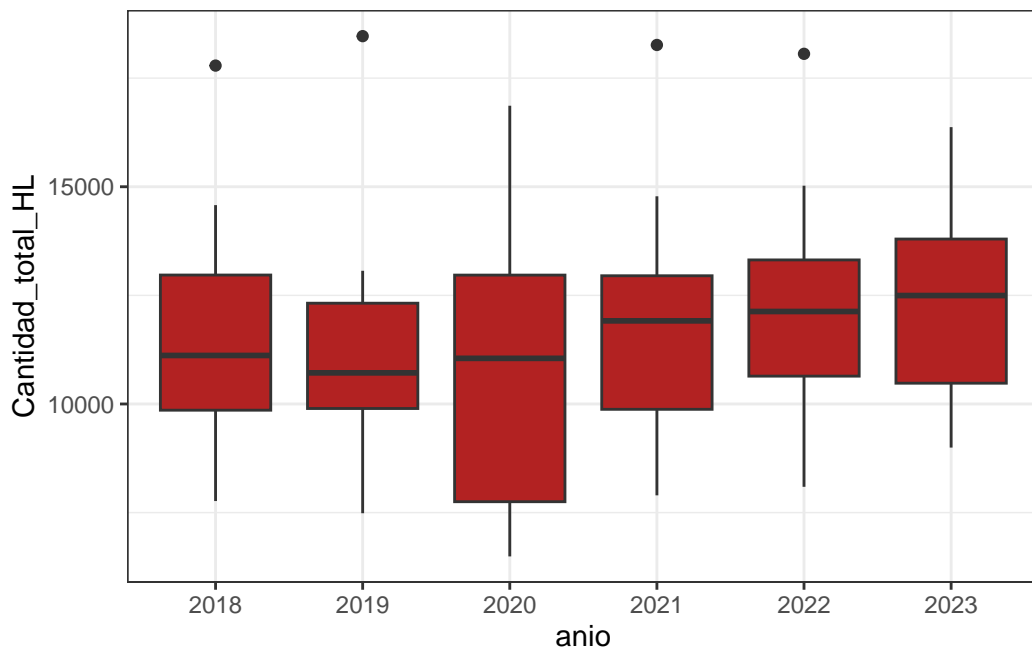


Gráfico de autocorrelación





Analisis de dispersion



Parece haber variabilidad constante, un poco más alta en el año 2020.