



| **UNR** Universidad  
Nacional de Rosario

## LICENCIATURA EN ESTADÍSTICA

### Trabajo Práctico

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

Autor: Franco Santini

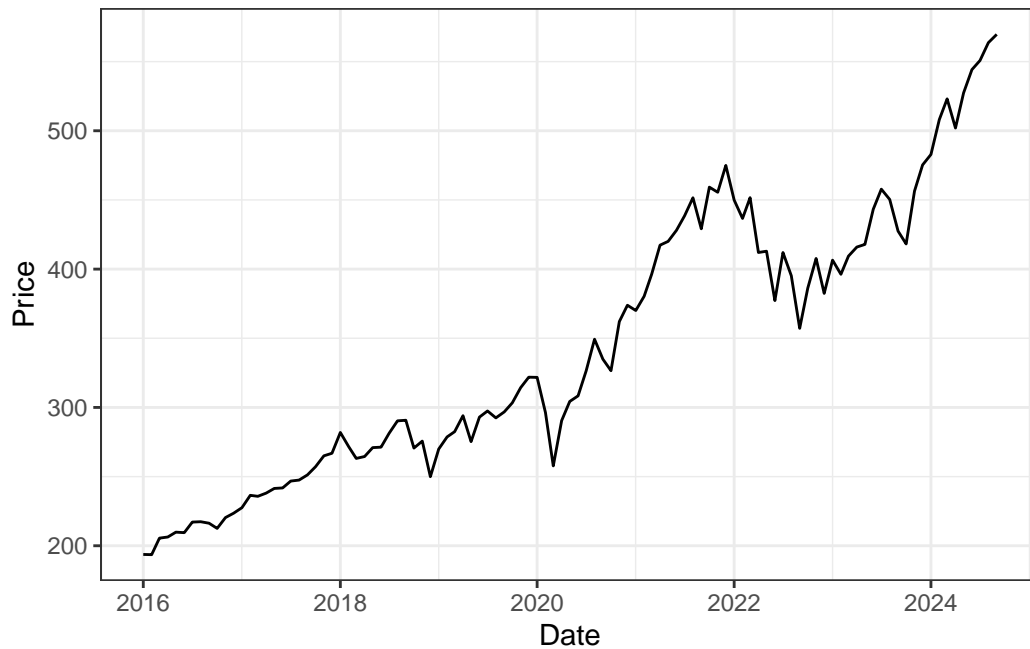
Docentes: Fernanda Mendez - Facundo Sigal

2024

**Tabla de contenidos**

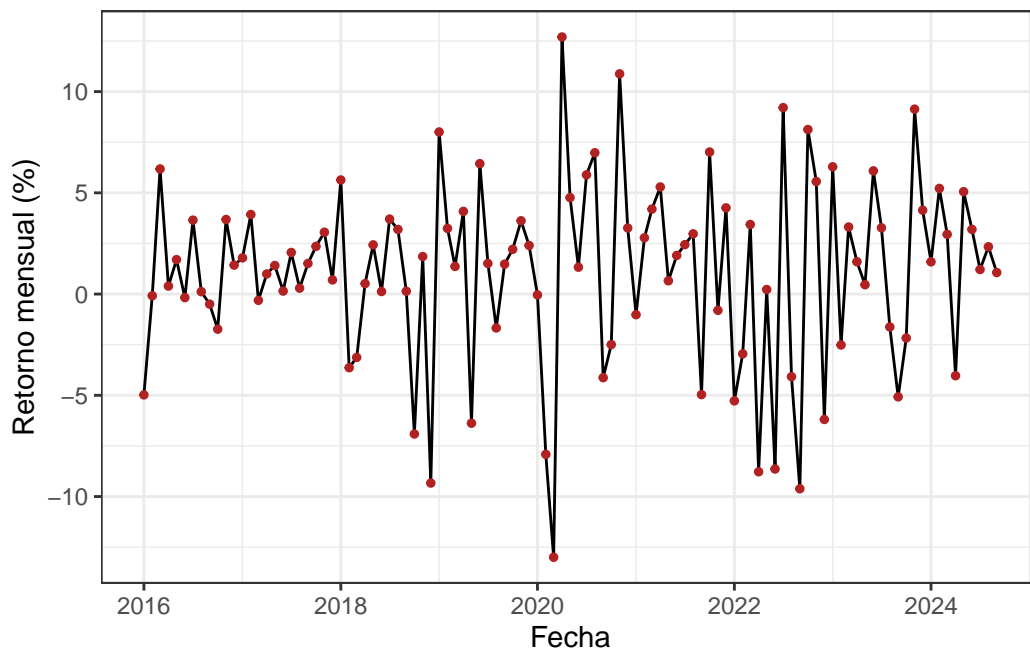
<b>Base datos 1 (Retornos mensuales - SPY 500)</b>	<b>1</b>
Análisis exploratorio . . . . .	1
Análisis de dispersión . . . . .	4
<b>Base datos 2 (Unidades vendidas en paletas - Empresa de logística)</b>	<b>5</b>
Análisis descriptivo . . . . .	5
Análisis de dispersión . . . . .	7

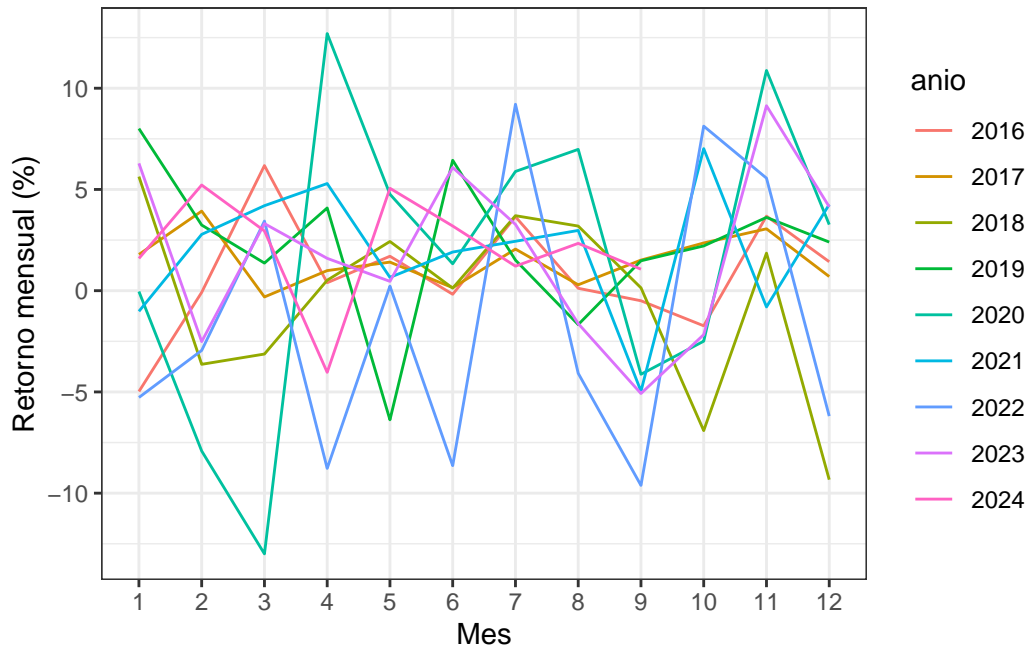
## Base datos 1 (Retornos mensuales - SPY 500)



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

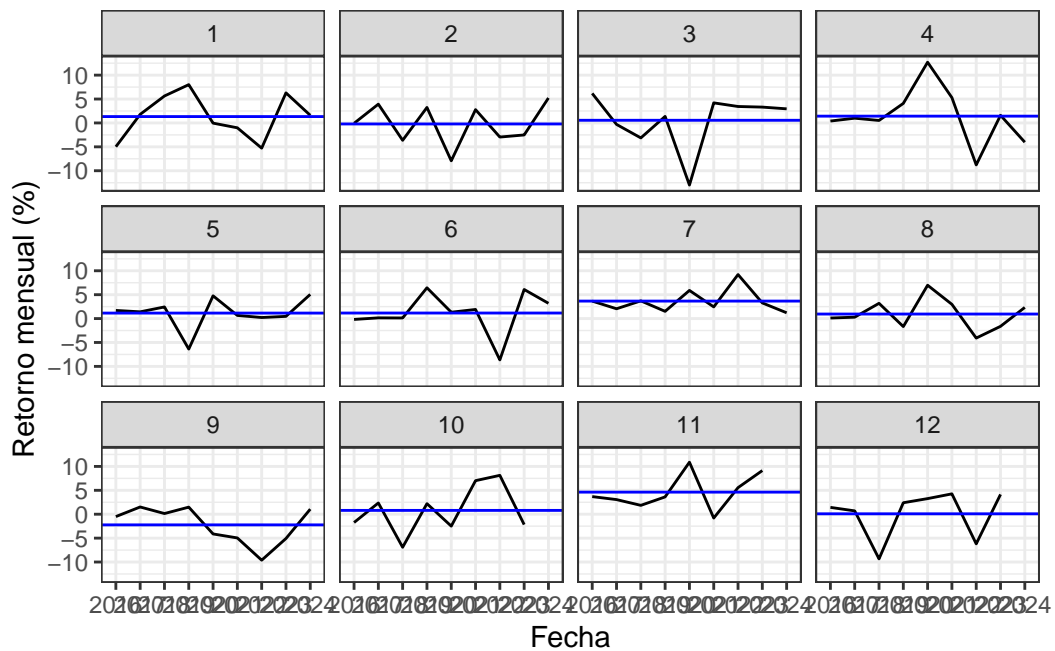
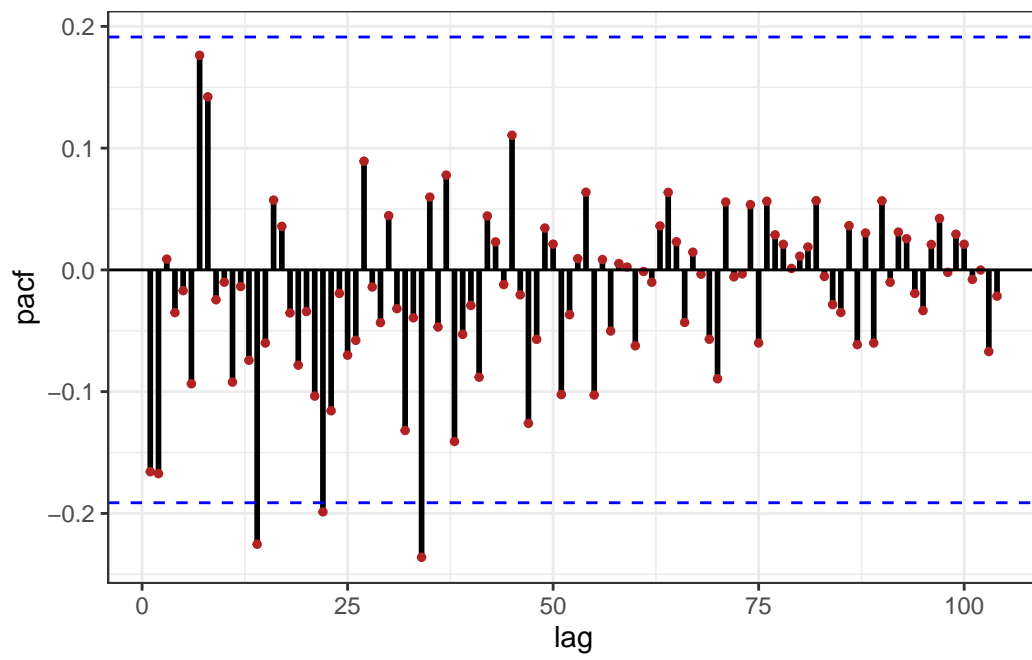
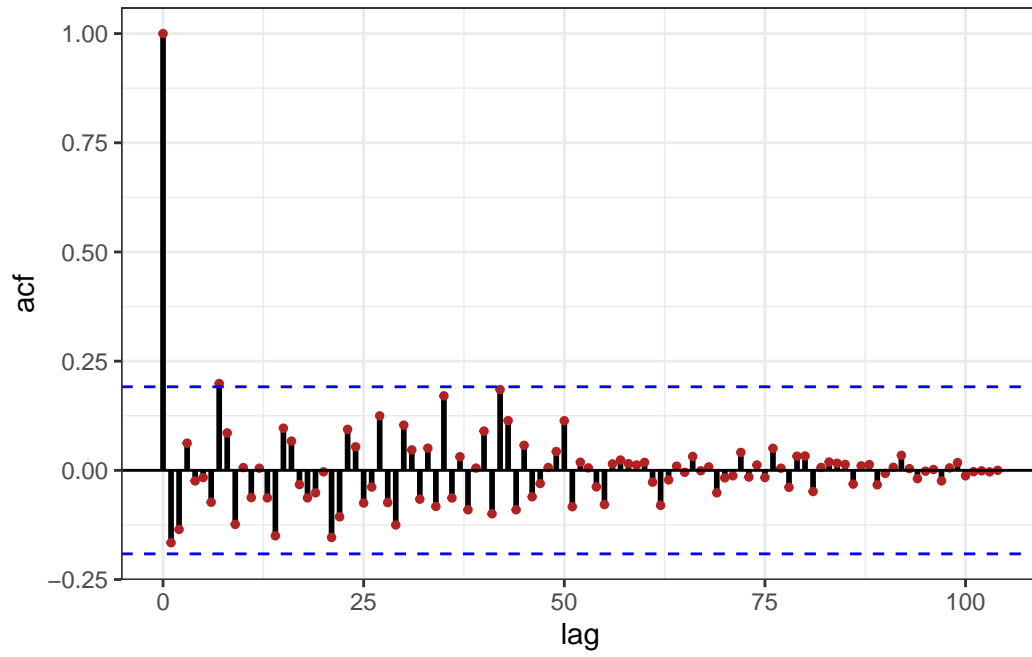
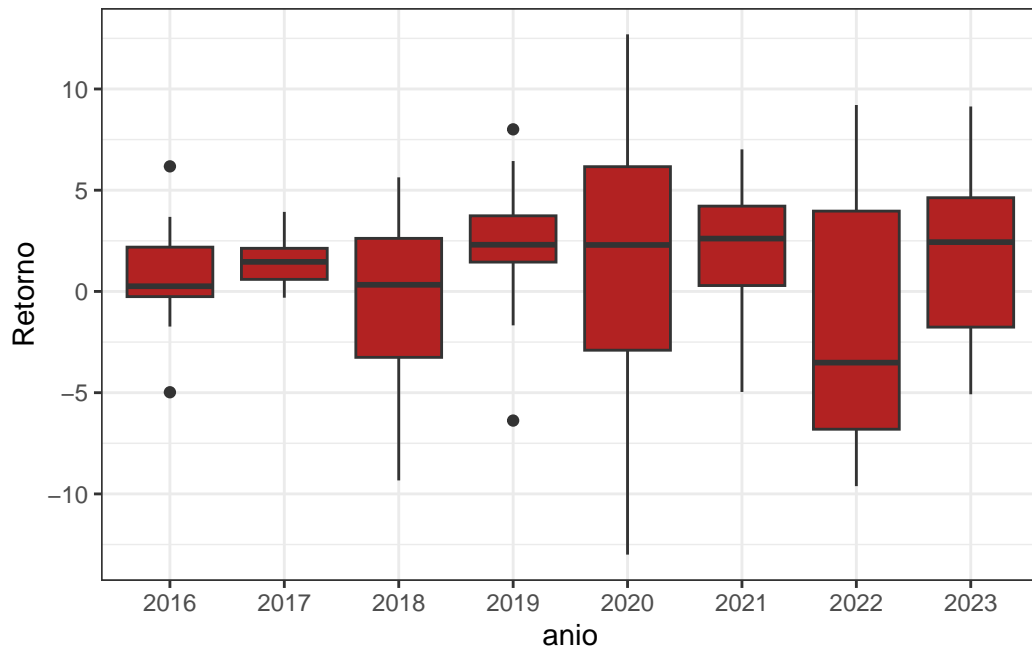


Gráfico de autocorrelación



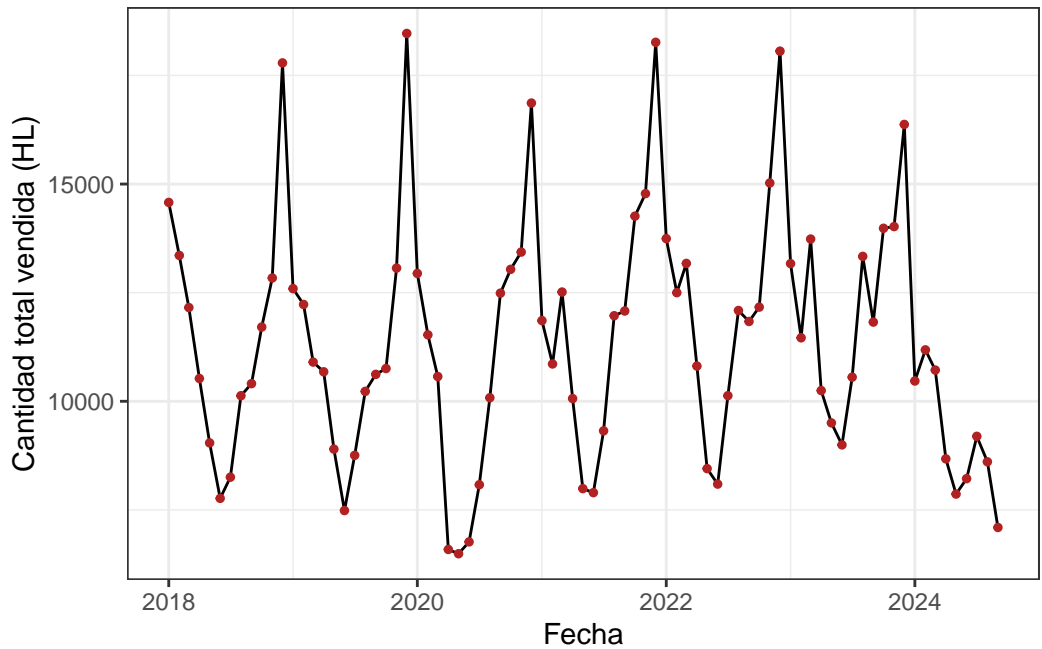
## Analisis de dispersion



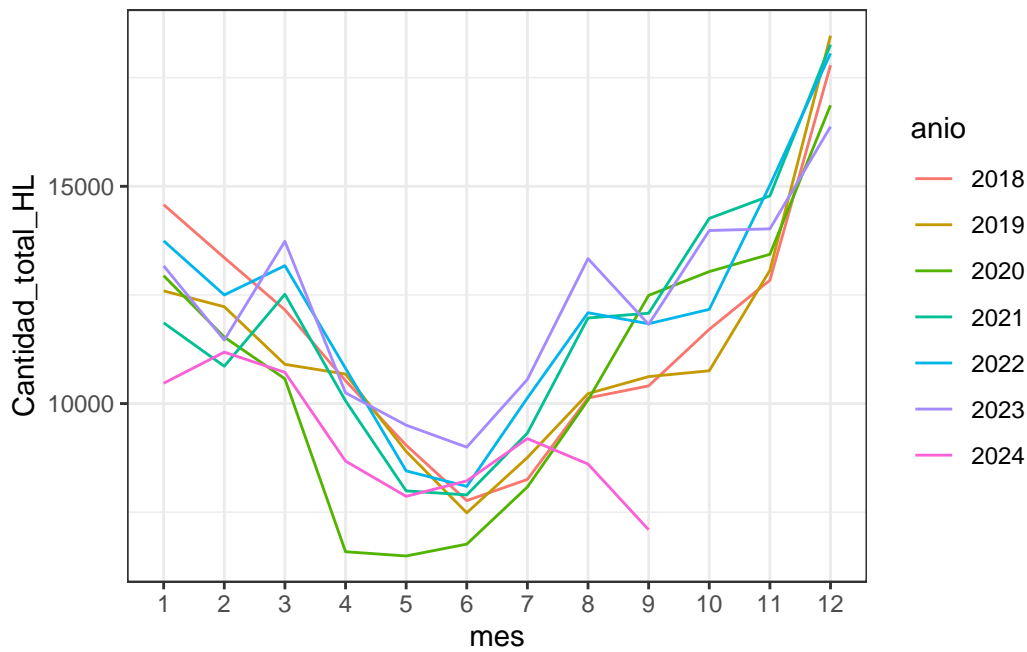
Parece haber variabilidad distintas en los años. Por lo que se podría aplicar las transformaciones de Box-Cox

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

Analisis descriptivo



Parece haber un comportamiento estacional



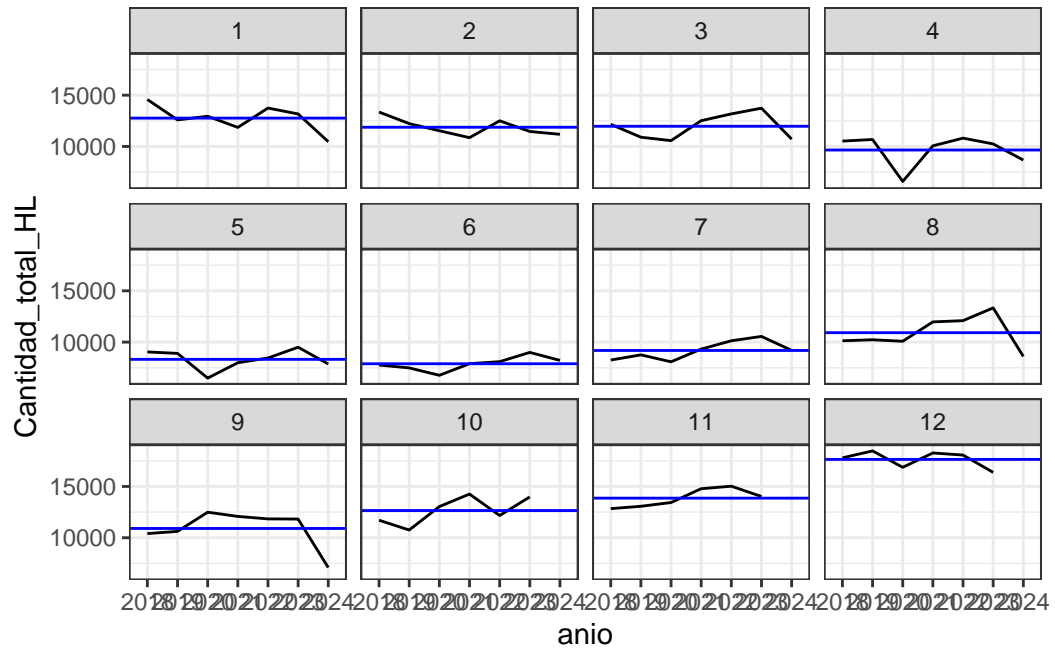
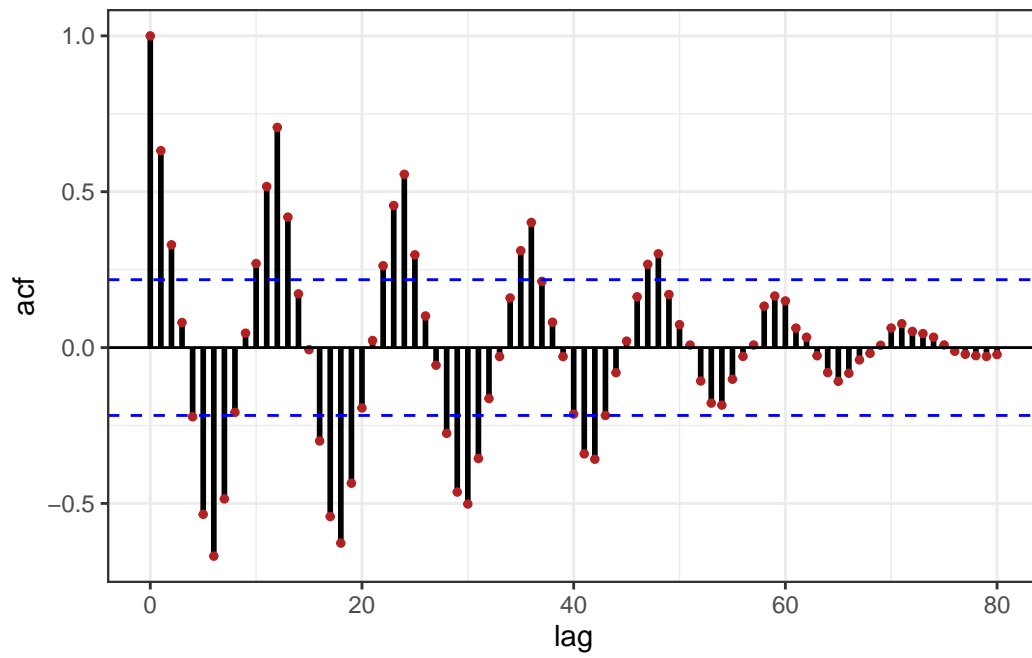
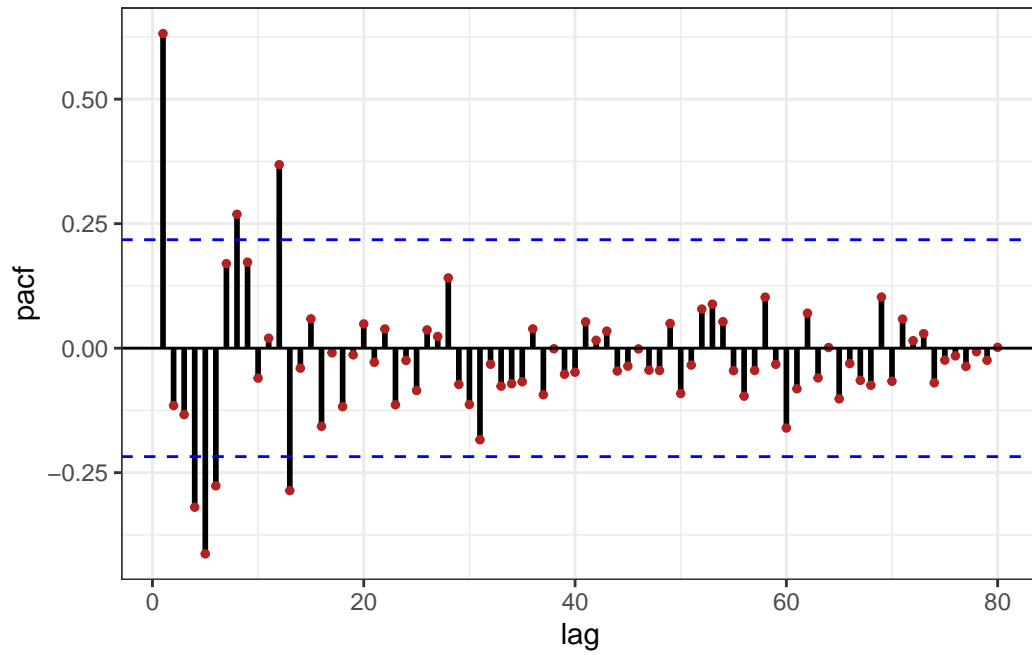


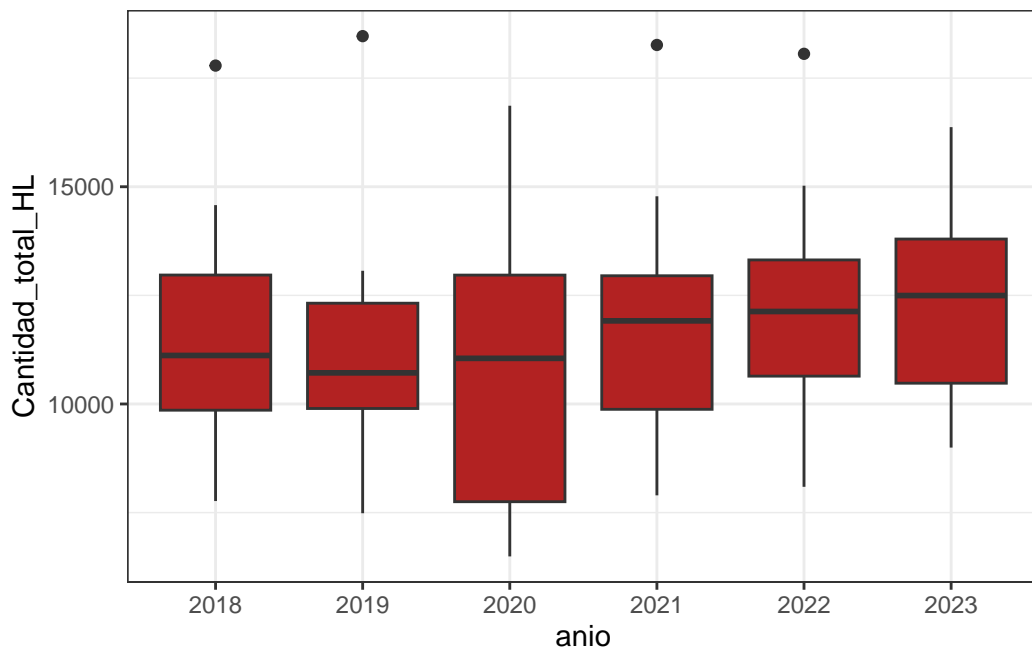
Gráfico de autocorrelación







### Analisis de dispersion



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