

Determinacion diferencial del modelo arima empleado en la investigación (estacionariedad)

2023-10-09

Determinacion del n diferecial

- Utiliza una prueba de raíz unitaria para determinar el número de diferencias necesarias para que las series de tiempo se vuelvan estacionarias.
- El test utilizado es el denominado Kwiatkowski-Phillips-Schmidt-Shin (KPSS)

Dando como resultado los siguientes diferenciales para cada cuenta entrenadas con el modelo arima.

Table 1: tabla

CUENTA	DIFERENCIAL
ACTIVO	1
DISPONIBILIDADES	1
INVERSIONES TEMPORARIAS	1
CARTERA	1
CARTERA VENCIDA TOTAL	1
CARTERA VENCIDA	1
CARTERA REPROGRAMADA VENCIDA	1
CARTERA REESTRUCTURADA VENCIDA	2
CARTERA REPROGRAMADA O REESTRUCTURADA VENCIDA	1
CARTERA EJECUCION TOTAL	1
CARTERA EN EJECUCION	2
CARTERA REPROGRAMADA EJECUCION	1
CARTERA REESTRUCTURADA EN EJECUCION	1
CARTERA REPROGRAMADA O REESTRUCTURADA EN EJECUCION	0
CARTERA VIGENTE TOTAL	1
CARTERA VIGENTE	2
CARTERA REPROGRAMADA VIGENTE	2
CARTERA REESTRUCTURADA VIGENTE	2
CARTERA REPROGRAMADA O REESTRUCTURADA VIGENTE	1
PREVISION PARA INCOBRABILIDAD DE CARTERA	1
OTRAS CUENTAS POR COBRAR	1
BIENES REALIZABLES	1
INVERSIONES PERMANENTES	1
BIENES DE USO	1
OTROS ACTIVOS	1
FIDEICOMISOS CONSTITUIDOS	1
PASIVO	1
OBLIGACIONES CON EL PUBLICO	1
OBLIGACIONES CON INSTITUCIONES FISCALES	0
OBLIGACIONES CON EMPRESAS PUBLICAS	1
OBLIGACIONES CON BANCOS Y ENTIDADES DE FINANCIAMIENTO	1
OTRAS CUENTAS POR PAGAR	1
PREVISIONES	1
VALORES EN CIRCULACION	1

Table 1: tabla (Continuación)

CUENTA	DIFERENCIAL
OBLIGACIONES SUBORDINADAS	2
PATRIMONIO	1
CAPITAL SOCIAL	1
APORTES NO CAPITALIZADOS	1
AJUSTES AL PATRIMONIO	0
RESERVAS	1
RESULTADOS ACUMULADOS	1
CONTINGENTES DEUDORAS	2
CUENTAS DE ORDEN DEUDORAS	1
INGRESOS FINANCIEROS	1
GASTOS FINANCIEROS	0
RESULTADO FINANCIERO BRUTO	1
OTROS INGRESOS OPERATIVOS	1
OTROS GASTOS OPERATIVOS	1
RESULTADO DE OPERACION BRUTO	1
RESULTADO DE OPERACION DESPUES DE INCOBRABLES	1
GASTOS DE ADMINISTRACION	1
GASTOS DE PERSONAL	1
SERVICIOS CONTRATADOS	1
SEGUROS	1
COMUNICACIONES Y TRASLADOS	1
IMPUESTOS	0
MANTENIMIENTO Y REPARACIONES	0
DEPRECIACION Y DESVALORIZACION DE BIENES DE USO	1
AMORTIZACION DE CARGOS DIFERIDOS Y ACTIVOS INTANGIBLES	1
OTROS GASTOS DE ADMINISTRACION	1
RESULTADO DE OPERACION NETO	1
RESULTADO DESPUES DE AJUSTE POR DIFE. DE CAMB. Y MANT. DE VALOR	1
RESPECTO INGRESOS GASTOS EXTRAORDINARIOS	0
RESULTADO NETO DEL EJERCICIO ANTES DE AJUSTES DE GESTIONES ANTERIORES	1
RESPECTO INGRESOS GASTOS DE GESTIONES ANTERIORES	0
RESULTADO ANTES DE IMPUESTOS Y AJUSTE CONTABLE POR EFECTO DE INFLACION	1
RESPECTO AJUSTE CONTABLE POR EFECTO DE LA INFLACION	0
RESULTADO ANTES DE IMPUESTOS	1
IMPUESTO SOBRE LAS UTILIDADES DE LAS EMPRESAS	0
RESULTADO NETO DE LA GESTION	1
COEFICIENTE DE ADECUACION PATRIMONIAL	1

Links

- Link del algoritmo de funcion arima utilizado (<https://github.com/robjhyndman/forecast/blob/8805b88313f9610e9c388fe1ab24e2c4adca1d42/R/newarima2.R#L95>)
- Link del algoritmo de determinación del numero de diferenciales (<https://github.com/robjhyndman/forecast/blob/master/man/ndiffs.Rd>)