

# EYP290i / EYP3907 - Series de Tiempo

## Segundo Semestre 2023

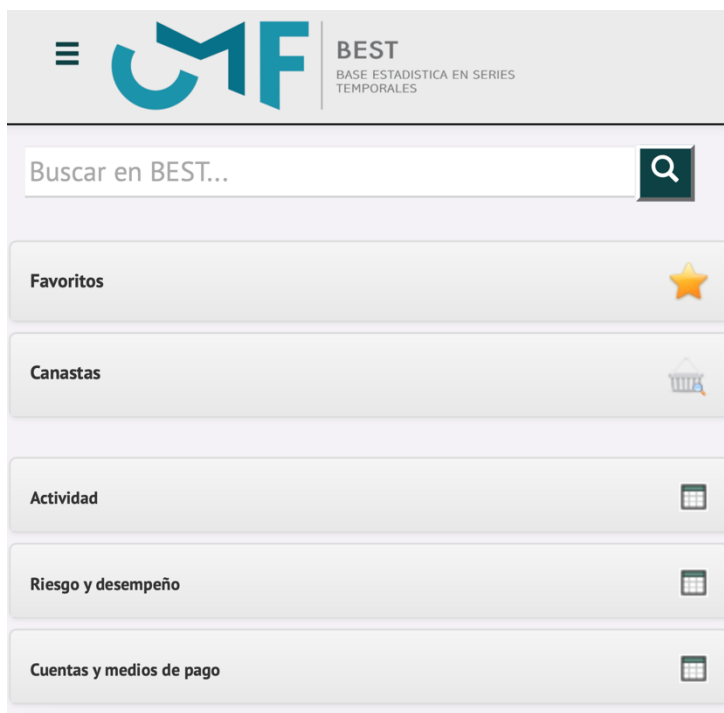
### Proyecto Final

Integrantes: 1 a 5 alumnos.

Formato: Póster (impreso en tamaño A0)

Presentación: lunes 18 de diciembre, 10.00 – 13.00 horas.

La Base Estadísticas de Series Temporales (BEST) de la Comisión para el Mercado Financiero (CMF) de Chile es una plataforma que proporciona información y estadísticas sobre distintos aspectos del mercado financiero en Chile. Esta base de datos incluye datos de series temporales relacionados con variables económicas y financieras y se puede acceder en el siguiente enlace: [www.best-cmf.cl](http://www.best-cmf.cl).



La BEST es una herramienta valiosa para analizar y comprender las tendencias y dinámicas del mercado financiero chileno. Puedes acceder a esta plataforma a través del sitio web oficial de la CMF de Chile o comunicarte con la institución para obtener información más detallada y actualizada sobre las series temporales disponibles y cómo utilizar la plataforma.

En particular en este proyecto cada grupo deberá ajustar un modelo SARIMA y SARIMAX a una serie de tiempo correspondiente a una institución financiera escogida entre los siguientes temas:

- Stock de cartera consumo en incumplimiento.
- Stock de cartera consumo normal.
- Stock total de cartera consumo.
- Stock de provisiones de crédito para cartera comercial en incumplimiento.
- Stock de provisiones de crédito para cartera comercial normal.
- Índice de provisiones por riesgo de crédito para cartera comercial en incumplimiento.

La serie escogida, deberá enviarse a [raolea@uc.cl](mailto:raolea@uc.cl) para ser aprobada.

Antes de modelar, descarte las últimas doce observaciones para poder posteriormente cuantificar la calidad predictiva de sus propuestas. Diseño del póster, colores utilizados, calidad de gráficos y tablas serán considerado en la calificación de este trabajo. Se espera que el póster sea lo más auto explicativo posible, destacando aspectos técnicos que validan las propuestas presentadas.

La versión impresa del póster deberá ser presentada el lunes 18 de diciembre, a las 10.00 horas y la versión en PDF deberá subirse a CANVAS ese mismo día a más tardar a las 09.00 horas. Se informará con anticipación el lugar donde se realizarán las presentaciones.