

Trabajo 2: Análisis de Series de Tiempo

Tema: Modelos de Box y Jenkins.

Considere una de las series de tiempo utilizadas en el trabajo 1 (suavizamiento exponencial). Para la serie de tiempo seleccionada, usando R, se pide:

1. Explique de que serie se trata, el periodo en estudio y la fuente de sus datos.
2. Graficar la serie.
3. Divida las series en conjunto de entrenamiento y de test, considere la misma separación utilizada en el trabajo 1, para poder comparar los resultados luego.
4. Para los datos del conjunto de entrenamiento, ajustar un modelo de Box y Jenkins, utilizando todas las herramientas aprendidas en clases y la validación del modelo seleccionado.
5. Graficar la serie original y el ajuste realizado por el modelo elegido.
6. Hacer la predicción para las observaciones del conjunto de test, usando el modelo ajustado.
7. Calcular el MAPE de la predicción de los datos del conjunto de Test .
8. Compare la calidad de la predicción con la obtenida anteriormente usando suavizamiento exponencial.
9. Comente el trabajo en su totalidad.

Fecha de Entrega: Martes 4 de Enero de 2022