\subsection{Antecedentes}

El manejo de información obtenida de manera secuencial, a lo largo del tiempo, hace referencia al uso de series cronológicas. Este tipo de datos se encuentra en diferentes áreas de investigación. En el campo financiero, por ejemplo, es común hablar de la devaluación del colón con respecto al dólar, cantidad de exportaciones mensuales de un determinado producto o las ventas de este [@oscarh-1]. En la actualidad, el estudio de las series cronológicas posee una particular importancia en el análisis de datos en la investigación de mercados bancarios y proyecciones demográficas que de manera conjunta apoyan la toma de decisiones para la aprobación presupuestaria en distintas áreas. El [Banco Mundial](https://databank.worldbank.org/home.aspx)[^1], por ejemplo, cuenta en su sitio web con datos para el análisis de series cronológicas de indicadores de desarrollo, capacidad estadística, indicadores educativos, estadísticas de género, nutrición y población. Además del Banco Mundial, uno de los sitios más populares relacionados con el análisis de datos es [Kaggle](https://www.kaggle.com/)[^2]; se trata de una subsidiaria de la compañía Google que sirve de centro de reunión para todos aquellos interesados en la ciencia de datos. En su sitio web, Kaggle ofrece una gran cantidad de conjuntos de datos para poner a prueba distintas formas de análisis o bien, para participar en competiciones ya sean remuneradas o no. Actualmente, para el análisis de series cronológicas, Kaggle cuenta con más de 30 competiciones, donde muchas de ellas incluyen recompensas económicas que van desde los \$500 hasta los \$100,000 para aquellos que logren obtener los mejor pronósticos. Cuando se ha establecido un modelo, los pronósticos son utilizados en instituciones públicas, gobiernos municipales, instituciones del sector privado, centros académicos, población civil, centros nacionales o regionales de investigación y organizaciones no gubernamentales dedicadas al desarrollo social. Si las entidades previamente mencionadas cuentan con proyecciones de calidad, la puesta en marcha de sus respectivos planes tendrá un impacto mayor y más efectivo.

Generar un modelo adecuado es fundamental para obtener un pronóstico de calidad y es aquí donde resulta importante mencionar una diferencia clave entre los dos modelos clásicos más utilizados: los modelos de suavizamiento exponencial y los modelos ARIMA. Ambos representan enfoques complementarios a un problema, pues los modelos de suavizamiento exponencial se fundamentan en un enfoque más descriptivo de los componentes de la serie cronológica en estudio, mientras que los modelos ARIMA tienen como objetivo explicar las relaciones pasadas de ésta [@hyndman2018forecasting]. Este tipo de métodos que estudian las autocorrelaciones pasadas no supone ningún patrón en particular en la serie histórica que se busca pronosticar, sino que contempla un proceso iterativo para identificar un posible modelo a partir de una clase general de modelos, lo cual tiene una estrecha relación con el teorema de Wold que será estudiado más adelante y que sugiere que todo proceso estacionario puede ser determinado de una forma específica y cuya ecuación posee, en realidad, infinitos coeficientes pero que debe ser reducido a una cantidad finita para luego evaluar su ajuste sometiéndolo a diferentes pruebas y medidas de rendimiento. Al trabajar con la metodología de Box-Jenkins, uno de los pasos a concretar es identificar los parámetros del proceso $ARIMA(p,d,q)(P,D,Q)\_s$ que gobiernan la serie. En la actualidad, para estudiar este tipo de modelos se ha utilizado la identificación de parámetros mediante autocorrelogramas parciales y totales, sin embargo, estos autocorrelogramas no abarcan muchos de los coeficientes que contempla la mencionada ecuación de Wold, pues como se mencionó, ésta posee infinitos coeficientes, razón por la cual el método propuesto busca aproximar de una mejor manera la identificación del modelo cubriendo un mayor número de posibilidades de dichos parámetros mediante lo que suele considerarse un problema: la sobreparametrización.

[^1]: [https://databank.worldbank.org/home.aspx](https://databank.worldbank.org/home.aspx)

[^2]: [https://www.kaggle.com/](https://www.kaggle.com/)

\subsection{El problema}

El gran obstáculo que presenta la identificación visual es que, actualmente, es común disponer de una gran cantidad de series cronológicas para analizar, lo que dificulta tener suficiente personal capacitado para realizar exitosamente este análisis visual e identificar adecuadamente los modelos. Aunado a esto, aún en el caso de que se dispusiera de los recursos para contar con el personal suficientemente capacitado para realizar esta identificación visual, siempre existirá el problema de la subjetividad, pues a pesar de que alguien proponga un patrón que gobierne la serie, otra persona podría tener otra interpretación del proceso, proponiendo así una especificación diferente. Esto sucede incluso con cantidades moderadas de series cronológicas a analizar, por lo que la generación de algoritmos que ayuden a esta identificación se vuelve cada vez más necesaria [@auto.arima].

Han sido varias las aproximaciones a un método que genere de manera automática un modelo ARIMA, siendo uno de los métodos automatizados de estimación más populares es el que ofrece el paquete `forecast` [@auto.arima] del lenguaje de programación R[^3] y permite hacer uso de la función `auto.arima()` para estimar un modelo ARIMA basado en pruebas de raíz unitaria y minimización del AICc [@burnham2007model]. De esta forma se obtiene un modelo temporal definiendo las diferenciaciones requeridas en la parte estacional $d$ mediante las pruebas KPSS [@doi:10.1111/1467-9892.00213] o ADF [@fuller1995introduction], y la no estacional $D$ utilizando las pruebas OCSB [@Osborn2009SEASONALITYAT] o la Canova-Hansen [@10.2307/1392184], seleccionado el orden óptimo para los términos $ARIMA(p, d, q)(P, D, Q)\_s$ para una serie cronológica determinada. Sin embargo, alternativas como la función `auto.arima()` no someten a prueba las posibles especificaciones de un modelo en un rango determinado, concepto conocido como sobreparametrización, dejando así un vacío en el cuál se corre el riesgo de no seleccionar un modelo que ofrezca mejores pronósticos.

[^3]: Descarga gratuita en [https://cran.r-project.org/](https://cran.r-project.org/)

\subsection{Objetivos del estudio}

Teniendo en consideración lo previamente mencionado, esta investigación tiene como objetivo general diseñar un algoritmo para la selección de modelos ARIMA según la temporalidad de la serie vía sobreparametrización. Para lograr esto, se busca de manera específica alcanzar lo siguiente:

\*\*1.\*\* Aplicar validación cruzada en distintos horizontes de pronóstico para identificar la mejor especificación de un modelo ARIMA.

\*\*2.\*\* Comparar la precisión de los pronósticos con métodos similares, como el propuesto por Rob Hyndman, de la Oficina de Censos de los Estados Unidos, entre otros.

\*\*3.\*\* Integrar el desarrollo de la metodología de análisis de series temporales en una librería del lenguaje estadístico R.

\subsection{Metodología del estudio}

Las series cronológicas por sí solas representan solo un insumo para abordar, como mínimo, tres objetivos básicos: 1) realizar análisis exploratorios usando mediante métodos de visualización y medidas de posición y variabilidad, como ver su crecimiento o decrecimiento a lo largo del tiempo, detectar valores atípicos o cambios drásticos en el nivel o valor medio de la serie, 2) generar modelos estadísticos que sirvan como una simplificación de la realidad, y 3) generar pronósticos para los posibles valores futuros que tomará el problema en cuestión. Los tres objetivos anteriores se trabajan de manera secuencial, pues es necesario realizar primero el análisis exploratorio de los datos para tener una noción global del panorama y así conocer la serie cronológica con la que se está trabajando. Una vez hecho esto, existen múltiples formas de generar modelos para estos datos, como por ejemplo los métodos de suavizamiento exponencial desarrollados en la década de 1950 [@brown], modelos de regresión para series temporales [@kedem], redes neuronales para la estimación de pronósticos [@redes], estimaciones bayesianas [@bayes] o los procesos autorregresivos integrados de medias móviles o ARIMA por sus siglas en inglés [@box-jenkins], siendo estos últimos el foco de interés en este estudio pues se trata de modelos que se basan en las relaciones pasadas de la propia serie cronológica; es decir, toman como referencia las correlaciones entre los valores actuales y pasados de la serie para entender el comportamiento de la misma en el futuro.

Los modelos ARIMA, son los de uso más extendido en el análisis de series cronológicas. El nombre ARIMA es la abreviatura inglesa para AutoRegresive Integrated Moving Average, y son aplicados mediante la metodología de Box-Jenkins. Como menciona Rob. Hyndman [@hyndman\_box-jenkins], la metodología de Box-Jenkins difiere a los demás métodos porque no supone un determinado patrón en la serie cronológica, sino que parte de un proceso iterativo para identificar el modelo de un gran grupo de estos para luego ponerlo a prueba según varias medidas de rendimiento. Un proceso ARIMA es caracterizado por dos funciones: la autocorrelación y la autocorrelación parcial; es mediante la comparación de dichas funciones que la metodología Box-Jenkins busca la identificación el proceso que describa de manera adecuada el comportamiento de una serie cronológica.

Es a partir de la necesidad de obtener pronósticos lo más precisos posible que el presente trabajo propone una metodología para la estimación un modelo ARIMA de una serie cronológica determinada abarcando más posibilidades que los enfoques tradicionales, cuya temporalidad sea mensual, bimensual, trimestral o cuatrimestral, mediante un proceso de selección fundamentada en las permutaciones de todos los parámetros de un modelo ARIMA hasta en un rango determinado, considerando además la inclusión semiautomática de intervenciones en periodos específicos y la validación cruzada para evaluar la calidad de las particiones de la base de datos en conjuntos para entrenar y probar el rendimiento del modelo. Dichas pruebas involucran, entre otras medidas de rendimiento, el MAE, RMSE, MAPE y MASE, las cuales sirven de insumo para utilizar un método de consenso entre ellas y seleccionar el modelo más adecuado mediante la sobreparametrización: se comparan todos los posibles en in intervalo específico de términos definiendo una diferenciación adecuada para la serie y permutando hasta un máximo definido para los términos de especificación de un $ARIMA(p, d, q)(P, D, Q)\_s$ para así seleccionar la especificación que ofrezca mejores resultados al momento de pronosticar valores futuros de la serie cronológica.

\subsection{Justificación del estudio}

En la demografía, uno de los principales temas de investigación se trata de las proyecciones de población, cuya importancia radica, entre otras cosas, en que durante una emergencia conocer la posible cantidad de población que habita una zona es clave para la rápida reacción de las autoridades en el envío de ayuda o en la ejecución de planes de evacuación; este tipo de situaciones se dan en Costa Rica y en muchos lugares del mundo ante condiciones climáticas adversas como huracanes o inundaciones o más recientemente ante la pandemia del covid-19. El campo actuarial, por ejemplo, también se ve beneficiado al mejorar sus métodos de pronóstico, pues una de sus principales áreas de estudio es la mortalidad, ya que representa un insumo de vital importancia para la planificación y sostenibilidad de los sistemas de pensiones, servicios de salud tanto pública como privada, seguros de vida y asuntos hipotecarios [@supenprodc].

El principal aporte de este estudio es, por medio de un proceso de simulación, aportar evidencia sobre cómo la sobreparametrización puede contribuir a definir la especificación de un modelo ARIMA que genere pronósticos adecuados, contrastando la calidad de estos con respecto a otros métodos similares, como lo son las funciones `auto.arima()` o `seas()`.

Una vez que el método ha sido desarrollado y probado mediante datos simulados, la aplicación real mostrará el verdadero alcance y potencial de la sobreparametrización en la estimación de modelos ARIMA al ser utilizado en datos reales para de este modo representar una herramienta para la toma de decisiones. En el campo demográfico, por ejemplo, las estadísticas vitales son sistematizadas y divulgadas año tras año, por tanto, revelan los cambios acontecidos durante este periodo. Esta información junto con la proveniente de los censos de población constituye la base para construir los diferentes índices, tasas y otros indicadores que revelan la situación demográfica del país, información de gran relevancia para la planificación nacional, regional y local en diversos campos. Uno de estos principales campos o áreas de acción es la salud pública, para la cual la tasa de mortalidad infantil se considera uno de los indicadores prioritarios dado que refleja no solo las condiciones de salud de la población infante, sino también los niveles de desarrollo del país, pues depende de la calidad de la atención de la salud, principalmente de la prenatal y perinatal, así como de las condiciones de saneamiento. Por tanto, su continuo monitoreo es fundamental para diseñar, implementar y evaluar políticas de salud pública orientadas a disminuir y erradicar aquellas que son prevenibles [@calidad\_vitales]. Por su parte, la Contraloría General de la República dispone de información completa, pública, proveniente de fuentes primarias, actualizada en tiempo, de libre acceso, procesable tanto por humanos como por máquinas, en formatos abiertos, con licencia libre de uso, permanente y sin costos de utilización.

\subsection{Organización del estudio}

Esta tesis consta de cinco capítulos, de los cuáles el primero ofrece una contextualización del uso de las series de tiempo, así como la importancia de poder contar con pronósticos de calidad. Se presentaron además objetivos que busca alcanzar el estudio, así como una breve descripción de la metodología que se empleará y que será discutida más detalladamente en los capítulos posteriores. Se concluye esta sección con hechos que justifican la importancia de esta investigación.

El siguiente capítulo consiste en el marco teórico y la revisión de la literatura asociada con el estudio.

En el tercer capítulo se describe en detalle toda la metodología relacionada al estudio, iniciando con una descripción global de los conceptos más fundamentales del análisis de series cronológicas, pasando por los componentes fundamentales de las mismas: tendencia, estacionalidad, ciclos e irregularidades. En este capítulo se discuten también los supuestos clásicos del análisis de series cronológicas, los distintos tipos de modelos, el análisis de intervención, la validación cruzada y las medidas de rendimiento; aspectos cruciales para obtener un modelo ARIMA vía sobreparametrización. La sección metodológica culmina con la descripción del proceso de simulación que se utilizará, así como la discusión del método propuesto.

El siguiente capítulo consiste trata la presentación de los resultados, tanto en los datos simulados como en la aplicación a datos costarricenses.

El último capítulo busca discutir los principales resultados, así como señalar las conclusiones más importantes y ofrecer algunas recomendaciones que orienten futuros estudios relacionados.

Finalmente se ofrece en la sección de anexos los códigos en lenguaje R más importantes utilizados en el estudio, así como una sección dedicada a las referencias bibliográficas obtenidas para esta investigación.