UNIVERSIDAD DE COSTA RICA

SISTEMA DE ESTUDIOS DE POSGRADO

LA SOBREPARAMETRIZACIÓN EN EL ARIMA: UNA APLICACIÓN A

DATOS COSTARRICENCES

Tesis sometida a la consideración de la Comisión del Programa de Estudios de

Posgrado en Estadística para optar por el grado y título de Maestría Académica en

Estadística

CÉSAR ANDRÉS GAMBOA SANABRIA B12672

Ciudad Universitaria Rodrigo Facio, Costa Rica

2020

**DEDICATORIA**

Pendiente

# AGRADECIMIENTOS

También pendiente

“Esta tesis fue aceptada por la Comisión del Programa de Estudios de Posgrado en Estadística de la Universidad de Costa Rica, como requisito parcial para optar al grado y título de Maestría Académica en Estadística”

Ph.D. Álvaro Morales Ramírez

**Decano Sistema de Estudios de Posgrado**

MSc. Óscar Centeno Mora

**Director de Tesis**

Ph.D. Gilbert Brenes Camacho

**Lector**

Ph.D. ShuWei Chou.

**Lector**

MSc. Johnny Madrigal Pana

**Director Programa de Posgrado en Estadística**

César Andrés Gamboa Sanabria

**Candidato**

# Índice

**DEDICATORIA** . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . **I**

**AGRADECIMIENTOS** . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . **II**

**RESUMEN** . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . **1**

**ABSTRACT** . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . **2**

1. **INTRODUCCIÓN** . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . **3**
   1. Antecedentes . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . 3
   2. El problema . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . 4
   3. Objetivos del estudio . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . 5
   4. Metodología de la investigación . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . 5
   5. Justificación del estudio . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . 6
   6. Organización del estudio . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . 7
2. **MARCO TEÓRICO** . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . **9**
   1. Introducción . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . 9
   2. Investigaciones relacionadas . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . 9
   3. Observaciones finales sobre la revisión bibliográfica . . . . . . . . . . . . . . . . . . 9
3. **METODOLOGÍA** . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . **11**
   1. Introducción . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . 11
   2. Conceptos y definiciones en el análisis de series cronológicas . . . . . . . . . . . . . 11
      1. Definición de una serie cronológica . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . 11
      2. Procedimiento al analizar series cronológicas . . . . . . . . . . . . . . . . . 11
      3. Estacionaridad . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . 11
      4. La parsimonia . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . 11
   3. Componentes de una serie cronológica . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . 11
      1. La tendencia . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . 11
      2. Componentes estacionales . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . 11
      3. Componente cíclico . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . 11
      4. Componente irregular . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . 11
   4. Supuestos en el análisis de series cronológicas . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . 11
   5. Modelos de series cronológicas . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . 11
   6. Modelos Autorregresivos Integrados de Medias Móviles . . . . . . . . . . . . . . . . 11
      1. Modelos Autorregresivos . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . 11
      2. Modelos de Medias Móviles . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . 11

iv

v

* + 1. Metodología Box-Jenkins . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . 11
    2. Etapa 1 - Identificación . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . 11
    3. Etapa 2 - Estimación y diagnóstico . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . 11
    4. Etapa 3 - Pronóstico . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . 11
    5. Notación de los modelos ARIMA . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . 11
    6. Diferenciación . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . 11
  1. Análisis de intervención . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . 11
  2. Validación cruzada . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . 11
  3. Medidas de rendimiento . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . 11
     1. MFE . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . 11
     2. MAE . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . 11
     3. MAPE . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . 11
     4. MPE . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . 11
     5. MSE . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . 11
     6. SSE . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . 11
     7. SMSE . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . 11
     8. RMSE . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . 11
     9. NMSE . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . 11
     10. AIC . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . 11
     11. AICc . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . 11
     12. BIC . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . 11
  4. La sobreparametrización . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . 11
  5. Simulación de series cronológicas . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . 11
  6. El método propuesto . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . 11

1. **RESULTADOS** . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . **12**
   1. Introducción . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . 12
   2. Datos simulados . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . 12
      1. Comparación en datos simulados - Sobreparametrización vs auto.arima . . 12
   3. Estimaciones en datos costarricenses . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . 12
      1. Tasa de mortalidad infantil interanual . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . 12
      2. Tasa global de fecundidad . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . 12
      3. Mortalidad por causa externa . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . 12
      4. Incentivos salariales del sector público . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . 12
      5. Intereses y comisiones del sector público . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . 12
      6. Demanda eléctrica . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . 12
      7. Comparación en datos reales - Sobreparametrización vs auto.arima . . . . . 12
   4. Discusión de los resultados . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . 12
2. **CONCLUSIONES Y RECOMENDACIONES** . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . **13**
   1. Introducción . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . 13
   2. Conclusiones . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . 13
   3. Recomendaciones . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . 13
3. **ANEXOS** . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . **14**
   1. La función funcion\_1 . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . 14
4. **REFERENCIAS** . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . . **15**

# Índice de cuadros Índice de figuras

vi

1

# RESUMEN

2

**ABSTRACT**

# 1 INTRODUCCIÓN

## 1.1 Antecedentes

Conocer el estado pasado, actual y futuro tanto de un mundo como de una economía a su vez tan volátil ha producido un aumento en el análisis de los datos referidos en el tiempo. El manejo de información obtenida de manera secuencial hace referencia al uso de series cronológicas. Este tipo de datos se encuentra en diferentes áreas, tanto en investigación académica como en el análisis de datos para la toma de decisiones. En el campo financiero 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]. 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.

La información temporal tiene un peso muy relevante en la actual sociedad: El [Banco Mundial](https://databank.worldbank.org/home.aspx)[^1] 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. De manera similar al Banco Mundial, uno de los sitios más populares relacionados con el análisis de información es [Kaggle](https://www.kaggle.com/)[^2]. 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 competencias. Actualmente, para el análisis de series cronológicas, Kaggle cuenta con más de 30 competiciones[^3]. Estos son solo unos de los muchos casos donde se aplica de forma exhaustiva los análisis de series de tiempo y que evidencia su relevancia en el entorno actual.

Asimismo, los pronósticos (estimación futura de una partícula en una serie temporal) son también 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.

Los métodos existentes para llevar a cabo un análisis de series cronológicas son diversos y responden al propio contexto y tipo de datos: en la actualidad obtener buenos pronósticos o bien explicar el comportamiento de un fenómeno en el tiempo sigue siendo un tema recurrente de investigación generar una adecuada estimación es fundamental para obtener un pronóstico de confianza; además resulta importante mencionar que los modelos ARIMA tienen como objetivo explicar las relaciones pasadas de la serie cronológica para de esta manera conocer el posible comportamiento futuro de la misma [@hyndman2018forecasting].

El método ARIMA se fundamenta en las autocorrelaciones pasadas, y contempla un proceso iterativo para identificar un posible proceso óptimo a partir de una clase general de modelos. El teorema de Wold 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 autoregresivos y de medias móviles que gobiernan la serie. Para indagar los términos en el proceso de investigación se ha utilizado la identificación de parámetros mediante autocorrelogramas parciales y totales, sin embargo, los autocorrelogramas formados no analizan de forma expedita, exhaustiva y óptima los posibles coeficientes que podrían contemplarse la mencionada ecuación de Wold, pues como se comentó, esta 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]: Se trata de una susidiaria de la compañía Google que sirve de centro de reunión para todos aquellos interesados en la ciencia de datos.

[^3]: Muchas de ellas incluyen recompensas económicas que van desde los \$500 hasta los \$100,000 para aquellos que logren obtener los mejor pronósticos.

## 1.2 El problema

La dificultad visual a la hora de identificar un modelo ARIMA es que actualmente es común disponer de una gran cantidad de series cronológicas para analizar, y los autocorrelogramas solo aportan una aproximación al proceso que gobierna la serie, representando en muchos casos una pobre alternativa dado que subestiman el número de parámetros que se debería de contemplar. Aunado a esto 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], siendo estos métodos una valiosa alternativa ante los muchas veces pobres resultados en la identificación correcta del modelo.

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[^4] y que permite hacer uso de la función `auto.arima()` para estimar un modelo ARIMA basado en pruebas de raíz unitaria y minimización del AICc [@burnham2007model]. Así 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 cual se corre el riesgo de no seleccionar un modelo que ofrezca mejores pronósticos.

[^4]: Descarga gratuita en [https://cran.r-project.org/](https://cran.r-project.org/)

## 1.3 Objetivos del estudio

El del presente trabajo es diseñar un algoritmo para la selección de modelos ARIMA según la temporalidad de la serie vía sobreparametrización.

Para lograr esto, se se pretende:

\*\*0\*\* Poner objetivo de crear el algo.de sobre parametrización en el ARIMA.

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

\*\*2.\*\* Contrastar la precisión de la estimación así como la generación de pronósticos con otros métodos similares, aplicados en datos costarricenses.}

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

## 1.4 Metodología en la aplicación de series cronológicas

La aplicación de las series cronológicas persigue tres objetivos: 1) el análisis exploratorio de la serie en cuestión, 2) estimar modelos de proyección, y, 3) generar pronósticos para los posibles valores futuros que tomará el problema en cuestión. Asimismo, existen múltiples formas de proceder mediante la etapa de estimación, como lo son los métodos de suavizamiento exponencial [@brown], modelos de regresión para series temporales [@kedem], redes neuronales sequenciales aplicadas a datos longitudinales [@redes], estimaciones bayesianas [@bayes], y finalmente, 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.

Un proceso ARIMA es caracterizado por dos funciones: la autocorrelación y la autocorrelación parcial; es mediante la comparación de dichas funciones que la metodologóa Box-Jenkins busca la identifiación el proceso que describa de manera adecuada el comportamiento de una serie cronológica.

En la búsqueda de un modelo adecuado entre varios candidatos, se llevan a cabo comparaciones de medidas de bondad de ajuste y de precisión. Se consideran temporalidades mensuales, bimensuales, trimestrales o cuatrimestrales, mediante un proceso de selección fundamentada en las permutaciones de todos los parámetros de un modelo ARIMA hasta en un rango determinado, considerando 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 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 autorregresivos y de medias móviles especificados para así seleccionar la especificación que ofrezca mejores resultados al momento de pronosticar valores futuros de la serie cronológica.

## 1.5 Justificación del estudio

El accionar de políticas gubernamentales así como de otro tipo de sectores se apoya cada vez más en un acertado análisis de la información temporal de los hechos observados hasta una fecha determinada, y por ende sus posibles evoluciones en el futuro. En el campo de la demografía, uno de los principales temas de investigación son las proyecciones de población; 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. También, el campo actuarial 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, brindar evidencia sobre cómo la sobreparametrización puede contribuir a definir la especificación de un modelo ARIMA que genere pronósticos de mayor calidad, contrastando la calidad de estos con respecto a otros métodos similares, como lo son las funciones `auto.arima()` o `seas()`.

Tras desarrollar y probar el método mediante datos simulados, la aplicación real del algoritmo mostrará el potencial de la sobreparametrización en la estimación de modelos ARIMA. 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 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].

## 1.6 Organización del estudio

El presenta trabajo de investigación consta de cinco capítulos. El presente capítulo ofrece una contextualización del uso de las series de tiempo, así como la importancia de poder contar con pronósticos de calidad. Se presentó el objetivo del estudio, así como una breve descripción de la metodología empleada en la aplicación de series temporales, y cómo se planea modificar el método de estimación en los modelos ARIMA. Se concluye esta sección con hechos que justifican la importancia de esta investigación.

El siguiente capítulo consiste en el marco teórico, abarcando aspectos fundamentales de la ecuación de Wold, la metodología Box-Jenkins, la selección de los procesos que gobiernan la serie, la descripción del proceso iterativo, entre otros.

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 capítulo cuatro consiste en la presentación de los resultados, tanto en los datos simulados como en la aplicación a datos costarricenses y se contrastarán contra los obtenidos por otros métodos como el de la función `auto.arima()`, entre otros.

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

# 2 MARCO TEÓRICO

## 2.1 Introducción

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.

De esta manera, el método de Box-Jenkins inicia con el análisis exploratorio de la serie cronológica de interés, teniendo un interés particular en identificar si hay presencia de factores no estacionarios en la misma. Si en efecto se cuenta con una serie no estacionaria, ésta debe volverse estacionaria mediante algún tipo de transformación, típicamente el logaritmo natural. Con la serie ya transformada, se busca identificar el proceso que gobierna la serie, la forma clásica de hacer esto es mediante los gráficos de autocorrelación y autocorrelación parcial. Cuando se logra identificar un proceso que se adecúe más a la serie cronológica, se deben realizar los diagnósticos para evaluar la calidad del ajuste del modelo, así como las medidas de rendimiento referentes a los pronósticos que genera el modelo estimado hasta un horizonte determinado.

**2.2 Investigaciones relacionadas**

**2.3 Observaciones finales sobre la revisión bibliográfica**

10

# 3 METODOLOGÍA

**3.1 Introducción**

## 3.2 Conceptos y definiciones en el análisis de series cronológicas

**3.2.1 Definición de una serie cronológica**

**3.2.2 Procedimiento al analizar series cronológicas**

**3.2.3 Estacionaridad**

**3.2.4 La parsimonia**

## 3.3 Componentes de una serie cronológica

**3.3.1 La tendencia**

**3.3.2 Componentes estacionales**

**3.3.3 Componente cíclico**

**3.3.4 Componente irregular**

**3.4 Supuestos en el análisis de series cronológicas**

**3.5 Modelos de series cronológicas**

## 3.6 Modelos Autorregresivos Integrados de Medias Móviles

**3.6.1 Modelos Autorregresivos**

**3.6.2 Modelos de Medias Móviles**

**3.6.3 Metodología Box-Jenkins**

**3.6.4 Etapa 1 - Identificación**

**3.6.5 Etapa 2 - Estimación y diagnóstico**

**3.6.6 Etapa 3 - Pronóstico**

**3.6.7 Notación de los modelos ARIMA**

**3.6.8 Diferenciación**

**3.7 Análisis de intervención**

**3.8 Validación cruzada**

## 3.9 Medidas de rendimiento

**3.9.1 MFE**

# 4 RESULTADOS

## 4.1 Introducción

El método propuesto se probará comparándose con los resultados de seis series con distintas temporalidades: mortalidad infantil, mortalidad por causa externa, nacimientos, demanda eléctrica, intereses y comisiones del sector público e incentivos salariales del sector público.

## 4.2 Datos simulados

**4.2.1 Comparación en datos simulados - Sobreparametrización vs auto.arima**

## 4.3 Estimaciones en datos costarricenses

**4.3.1 Tasa de mortalidad infantil interanual**

**4.3.2 Tasa global de fecundidad**

**4.3.3 Mortalidad por causa externa**

**4.3.4 Incentivos salariales del sector público**

**4.3.5 Intereses y comisiones del sector público**

**4.3.6 Demanda eléctrica**

**4.3.7 Comparación en datos reales - Sobreparametrización vs auto.arima**

**4.4 Discusión de los resultados**

# 5 CONCLUSIONES Y RECOMENDACIONES

**5.1 Introducción**

**5.2 Conclusiones**

**5.3 Recomendaciones**

# 6 ANEXOS

## 6.1 La función funcion\_1

Código 1: Una función

funcion\_1 <- **function**(x,y){ x**+**y

}

# 7 REFERENCIAS

Box, G. E., Jenkins, G. M., & Reinsel, G. C. (1994). *Time Series Analysis: Forecasting and Control*. Recuperado de <https://books.google.co.cr/books?id=sRzvAAAAMAAJ>

Brown, R. (1956). *Exponential Smoothing for Predicting Demand*. Recuperado de [https://www. industrydocuments.ucsf.edu/docs/jzlc0130](https://www.industrydocuments.ucsf.edu/docs/jzlc0130)

Burnham, K. P., & Anderson, D. R. (2007). *Model Selection and Multimodel Inference: A Practical Information-Theoretic Approach*. Recuperado de [https://books.google.co.cr/books?id=](https://books.google.co.cr/books?id=IWUKBwAAQBAJ)

[IWUKBwAAQBAJ](https://books.google.co.cr/books?id=IWUKBwAAQBAJ)

Canova, F., & Hansen, B. E. (1995). Are Seasonal Patterns Constant over Time? A Test for

Seasonal Stability. *Journal of Business & Economic Statistics*, *13*(3), 237-252. Recuperado de <http://www.jstor.org/stable/1392184>

Fuller, W. A. (1995). *Introduction to Statistical Time Series*. Recuperado de [https://books.google. co.cr/books?id=wyRhjmAPQIYC](https://books.google.co.cr/books?id=wyRhjmAPQIYC)

Hernández, O. (2011). *Introducción a las Series Cronológicas* (1.ª ed., p. 1). Recuperado de [http://www.editorial.ucr.ac.cr/ciencias-naturales-y-exactas/item/1985-introduccion-a-lasseries-cronologicas.html](http://www.editorial.ucr.ac.cr/ciencias-naturales-y-exactas/item/1985-introduccion-a-las-series-cronologicas.html)

Hyndman, R. J., & Athanasopoulos, G. (2018a). *Forecasting: principles and practice*. Recuperado de <https://books.google.co.cr/books?id=/_bBhDwAAQBAJ>

Hyndman, R. J., & Athanasopoulos, G. (2018b). *Forecasting: principles and practice*. Recuperado de <https://books.google.co.cr/books?id=/_bBhDwAAQBAJ>

Hyndman, R., & Khandakar, Y. (2008). Automatic Time Series Forecasting: The forecast Package for R. *Journal of Statistical Software, Articles*, *27*(3), 1-22. <https://doi.org/10.18637/jss.v027.i03>

INEC. (2017). *Población, nacimientos, defunciones y matrimonios*. Recuperado de [http://inec.cr/ sites/default/files/documetos-biblioteca-virtual/repoblacev2017\_0.pdf](http://inec.cr/sites/default/files/documetos-biblioteca-virtual/repoblacev2017_0.pdf)

Jammalamadaka, S. R., Qiu, J., & Ning, N. (2018). *Multivariate Bayesian Structural Time Series Model*. Recuperado de <https://arxiv.org/pdf/1801.03222.pdf>

Kedem, B., & Fokianos, K. (2005). *Regression Models for Time Series Analysis*. Recuperado de <https://books.google.co.cr/books?id=8r0qE35wt44C>

Osborn, D. R., Chui, A. P. L., Smith, J., & Birchenhall, C. (2009). *Seasonality and the order of integration for consumption*. Recuperado de [http://www.est.uc3m.es/esp/nueva\_docencia/comp\_ col\_get/lade/tecnicas\_prediccion/OCSB\_OxBull1988.pdf](http://www.est.uc3m.es/esp/nueva_docencia/comp_col_get/lade/tecnicas_prediccion/OCSB_OxBull1988.pdf)

Rosero-Bixby, L. (2018). *Producto C para SUPEN. Proyección de la mortalidad de Costa Rica 2015-2150*. Recuperado de CCP-UCR website: [http://srv-website.cloudapp.net/documents/ 10179/999061/Nota+t%C3%A9cnica+tablas+de+vida+segunda+parte](http://srv-website.cloudapp.net/documents/10179/999061/Nota+t%C3%A9cnica+tablas+de+vida+segunda+parte)

Tadayon, M., & Iwashita, Y. (2020). *Comprehensive Analysis of Time Series Forecasting Using Neural Networks*. Recuperado de <https://arxiv.org/pdf/2001.09547.pdf>

Xiao, Z. (2001). Testing the Null Hypothesis of Stationarity Against an Autoregressive Unit Root

Alternative. *Journal of Time Series Analysis*, *22*(1), 87-105. [https://doi.org/10.1111/1467-9892. 00213](https://doi.org/10.1111/1467-9892.00213)