

EJERCICIO PARTE PRÁCTICA SERIES TEMPORALES

En este ejercicio los alumnos deben demostrar que son capaces de utilizar el programa Python de forma adecuada para trabajar con series temporales.

Para ello se les facilitan unos datos sobre una serie temporal, a su vez se permite que usen apuntes, los códigos compartidos durante las sesiones, así como ayuda complementaria que puedan encontrar en internet. También está permitido trabajar en grupos de hasta 3 personas.

Las tareas que deben realizar son:

1. Determinar si es una serie estacionaria o no, utilizando diferentes procedimientos. En este punto es necesario realizar análisis gráficos y diferentes test.
2. Determinar si es una serie estacional y en su caso cual es la frecuencia con la que se da la estacionalidad.
3. Determinar cuál es modelo óptimo para estimar. Para ello se puede utilizar el autoarima u otro tipo de análisis.
4. Comprobar que el modelo estimado es correcto. Para este punto es necesario tanto analizar las predicciones como los residuos