

Series Temporales y Predicción

Práctica 5

Procesos ARMA(p,q)

1. Identificación de un proceso ARMA(p,q)

Práctica 1.1

El fichero “prac5TS.txt” del Campus Virtual contiene datos relativos a la media diaria de clientes que compran en una tienda online cada hora. Proponed un modelo que parezca razonable para ajustar estos datos, basándose en las herramientas que tenemos disponibles y el sentido común.

2. Simulación de un proceso ARMA(p,q)

Práctica 2.1

Simulad un proceso con las mismas características que los datos analizados en el apartado anterior. Comprobad que las características numéricas (esperanza y varianza) del proceso simulado coinciden con las originales y que mediante la función `auto.arima()` se recuperen los parámetros utilizados en la simulación.

Práctica 2.2

Simulad procesos con diferentes valores para los parámetros y observad como son las correspondientes funciones de autocorrelación y autocorrelación parcial.