

Análisis de Series Temporales: Tarea 2 - Ejercicio 2

Alejandro Del Hierro Diez
Miguel Martín Mateos

Gabriel Rodríguez Canal
Sergio García Prado

25 de noviembre de 2018

- a) Describir estas dos series ($\{Y_t\}$) puede crearse con el PROC EXPAND de SAS, indicando claramente para cada una de ellas qué frecuencias elegiríais a priori para ajustar un modelo con tendencia polinómica más ondas.

[TODO]

```
DATA CLASS;  
    INPUT NAME $ 1-8 SEX $ 10 AGE 12-13 HEIGHT 15-16 WEIGHT 18-22;  
CARDS;  
JOHN      M      12      59      99.5  
JAMES     M      12      57      83.0  
ALFRED    M      14      69      112.5  
ALICE     F      13      56      84.0  
RUN;  
  
PROC MEANS;  
    VAR AGE HEIGHT WEIGHT;  
RUN;  
  
PROC PLOT;  
    PLOT WEIGHT*HEIGHT;  
RUN;
```

Figura 1: ejemplo sas

- b) Ajustar por suavizado exponencial, con el PROC ESM, los tres modelos que se consideren más apropiados para la serie $\{Y_t\}$ y comprobar su adecuación.

[TODO]

- c) Elegir el modelo que se considere más apropiado entre los tres del apartado b) y con ese modelo dar las predicciones para las próximas 6 observaciones. Justificar la elección del modelo.

[TODO]

- d) Utilizando en el ajuste solamente los datos hasta el final de 1990 que no incluyan ningún caso de 1991, calcular los errores de predicción para el año 1991 y su correspondiente SSE_p (suma de s errores al cuadrado correspondientes a predicciones $\{1, 2, \dots, s\}$ pasos hacia adelante) para los tres modelos del apartado b). Comentar si la elección hecha en el apartado c) está de acuerdo con los resultados obtenidos en este caso al comparar la capacidad de predicción de los distintos modelos para el año 1991. Adjuntad el programa con el lenguaje control que hayáis utilizado en este apartado.

[TODO]

- e) Obtener con el PROC FORECAST de *SAS* el SSE_p para el modelo de *Winter Multiplicativo* con las mismas constantes de suavizado y los valores iniciales de los parámetros lo más próximos posible a los obtenidos en el apartado d) con el PROC ESM para este modelo. Adjuntar el programa con el lenguaje control que hayáis utilizado para obtenerlo.

[TODO]

- f) Ajustar un modelo para la serie $\{X_t\}$ con el módulo Time Series Forecasting System de *SAS* razonando porqué se ha elegido. Utilizar el modelo elegido para predecir valores futuros de esta serie y establecer la comparación con los seis valores obtenidos en el apartado c) junto con sus bandas de predicción.

[TODO]