

PRÁCTICA 12: IDENTIFICACIÓN A PARTIR DE LA FACE Y LA FAPE

- Función de autocorrelación, función de autocorrelación parcial y modelos ARIMA

- o Establezca el proceso estocástico que mejor se adapta a las siguientes series sin estacionalidad, utilizando como criterio el comportamiento de la FACE y de la FAPE

Serie Y1

Sample: 1900:3 2003:1

Included observations: 411

Autocorrelation	Partial Correlation	AC	PAC	Q-Stat	Prob	
. *****	. *****	1	0.771	0.771	246.41	0.000
. *****	. .	2	0.606	0.026	398.62	0.000
. ****	. .	3	0.486	0.027	496.80	0.000
. ***	. .	4	0.373	-0.038	554.94	0.000
. **	. .	5	0.292	0.012	590.68	0.000
. **	. .	6	0.236	0.016	614.01	0.000
. *	* .	7	0.162	-0.066	625.06	0.000
. *	. .	8	0.097	-0.035	629.04	0.000
. .	. .	9	0.039	-0.040	629.68	0.000
. .	. .	10	0.000	0.000	629.68	0.000
. .	. .	11	-0.037	-0.035	630.27	0.000
* .	* .	12	-0.090	-0.081	633.70	0.000
* .	. .	13	-0.099	0.043	637.88	0.000
* .	. .	14	-0.113	-0.028	643.34	0.000
* .	. .	15	-0.130	-0.026	650.54	0.000
* .	* .	16	-0.153	-0.062	660.67	0.000

Serie Y2

Sample: 1900:3 2003:1

Included observations: 411

Autocorrelation	Partial Correlation	AC	PAC	Q-Stat	Prob	
**** .	**** .	1	-0.495	-0.495	101.29	0.000
. .	*** .	2	-0.028	-0.361	101.61	0.000
. .	** .	3	0.062	-0.206	103.19	0.000
. .	* .	4	-0.029	-0.157	103.54	0.000
. .	* .	5	-0.037	-0.180	104.10	0.000
. .	* .	6	0.065	-0.090	105.89	0.000
. .	* .	7	-0.026	-0.068	106.18	0.000
. .	. .	8	0.011	-0.025	106.24	0.000
. .	. .	9	-0.027	-0.053	106.54	0.000
. .	* .	10	0.000	-0.066	106.54	0.000
. *	. .	11	0.068	0.044	108.48	0.000
* .	. .	12	-0.101	-0.054	112.84	0.000
. .	. .	13	0.048	-0.037	113.84	0.000
. .	. .	14	-0.001	-0.043	113.84	0.000
. .	. .	15	0.029	0.032	114.19	0.000
* .	* .	16	-0.079	-0.063	116.88	0.000

Serie Y3

Sample: 1900:3 2003:1
Included observations: 411

Autocorrelation	Partial Correlation	AC	PAC	Q-Stat	Prob	
. *****	. *****	1	0.710	0.710	208.54	0.000
. *	***** .	2	0.108	-0.798	213.34	0.000
*** .	. .	3	-0.438	-0.046	293.04	0.000
***** .	. .	4	-0.657	-0.013	473.12	0.000
**** .	. .	5	-0.489	0.053	573.18	0.000
* .	. .	6	-0.089	0.010	576.47	0.000
. **	. .	7	0.290	-0.009	611.85	0.000
. ***	. .	8	0.454	0.029	698.75	0.000
. ***	. .	9	0.351	-0.020	750.66	0.000
. *	. .	10	0.072	-0.029	752.87	0.000
** .	* .	11	-0.219	-0.079	773.23	0.000
*** .	. .	12	-0.370	-0.017	831.45	0.000
** .	. .	13	-0.304	0.055	870.95	0.000
* .	. .	14	-0.084	-0.039	873.98	0.000
. *	. .	15	0.160	0.037	884.96	0.000
. **	. .	16	0.298	0.010	923.25	0.000

Serie Y4

Sample: 1900:3 2003:1
Included observations: 411

Autocorrelation	Partial Correlation	AC	PAC	Q-Stat	Prob	
***** .	***** .	1	-0.683	-0.683	193.19	0.000
. *	**** .	2	0.165	-0.566	204.46	0.000
. .	*** .	3	0.058	-0.419	205.87	0.000
. .	** .	4	-0.026	-0.231	206.15	0.000
. .	* .	5	-0.037	-0.139	206.72	0.000
. .	. .	6	0.063	0.010	208.40	0.000
. .	. *	7	-0.045	0.088	209.25	0.000
. .	. *	8	0.027	0.165	209.57	0.000
. .	. *	9	-0.020	0.163	209.74	0.000
. .	. .	10	-0.017	0.011	209.87	0.000
. *	. .	11	0.079	0.046	212.54	0.000
* .	. .	12	-0.106	-0.037	217.34	0.000
. *	* .	13	0.070	-0.070	219.44	0.000
. .	* .	14	-0.031	-0.136	219.85	0.000
. .	. .	15	0.048	-0.007	220.86	0.000
* .	. .	16	-0.092	-0.028	224.49	0.000

Serie Y5

Sample: 1900:3 2003:1
 Included observations: 411

Autocorrelation	Partial Correlation	AC	PAC	Q-Stat	Prob	
. *****	. *****	1	0.724	0.724	217.01	0.000
. ***	*** .	2	0.341	-0.384	265.37	0.000
. *	. **	3	0.171	0.263	277.50	0.000
. *	** .	4	0.081	-0.205	280.21	0.000
. .	. **	5	0.050	0.198	281.26	0.000
. .	* .	6	0.050	-0.128	282.30	0.000
. .	. .	7	0.026	0.056	282.58	0.000
. .	* .	8	-0.015	-0.093	282.67	0.000
. .	. .	9	-0.040	0.044	283.36	0.000
. .	. .	10	-0.045	-0.043	284.22	0.000
* .	. .	11	-0.066	-0.057	286.07	0.000
* .	. .	12	-0.096	-0.019	289.96	0.000
* .	. .	13	-0.084	0.031	293.00	0.000
* .	. .	14	-0.066	-0.054	294.86	0.000
* .	. .	15	-0.078	-0.028	297.46	0.000
* .	. .	16	-0.089	-0.022	300.87	0.000

Serie Y6

Sample: 1900:3 2003:1
 Included observations: 411

Autocorrelation	Partial Correlation	AC	PAC	Q-Stat	Prob	
. *****	. *****	1	0.994	0.994	408.90	0.000
. *****	. .	2	0.987	-0.057	813.19	0.000
. *****	. .	3	0.980	-0.041	1212.4	0.000
. *****	. .	4	0.972	-0.033	1606.4	0.000
. *****	. .	5	0.964	-0.031	1994.7	0.000
. *****	. .	6	0.955	-0.022	2377.2	0.000
. *****	. .	7	0.947	-0.029	2753.6	0.000
. *****	. .	8	0.937	-0.029	3123.7	0.000
. *****	. .	9	0.928	-0.010	3487.4	0.000
. *****	. .	10	0.919	-0.002	3844.7	0.000
. *****	. .	11	0.909	0.004	4195.7	0.000
. *****	. .	12	0.900	-0.006	4540.5	0.000
. *****	. .	13	0.891	-0.010	4878.9	0.000
. *****	. .	14	0.882	0.008	5211.1	0.000
. *****	. .	15	0.873	0.017	5537.5	0.000
. *****	. .	16	0.864	0.014	5858.1	0.000

Serie DY6=Y6-Y6(-1)

Sample: 1900:3 2003:1
 Included observations: 411

Autocorrelation	Partial Correlation	AC	PAC	Q-Stat	Prob	
. *****	. *****	1	0.771	0.771	246.23	0.000
. *****	. .	2	0.605	0.026	398.25	0.000
. ****	. .	3	0.485	0.027	496.26	0.000
. ***	. .	4	0.373	-0.039	554.21	0.000
. **	. .	5	0.292	0.012	589.86	0.000
. **	. .	6	0.236	0.017	613.18	0.000
. *	* .	7	0.163	-0.064	624.35	0.000
. *	. .	8	0.099	-0.033	628.51	0.000
. .	. .	9	0.042	-0.040	629.24	0.000
. .	. .	10	0.003	0.000	629.25	0.000
. .	. .	11	-0.034	-0.036	629.74	0.000
* .	* .	12	-0.087	-0.080	632.94	0.000
* .	. .	13	-0.095	0.045	636.81	0.000
* .	. .	14	-0.109	-0.029	641.92	0.000
* .	. .	15	-0.126	-0.027	648.77	0.000
* .	* .	16	-0.151	-0.062	658.55	0.000