

## MODELOS NO TRADICIONALES DE SERIES DE TIEMPO

### CÓDIGOS

UNR 1ECO173  
Programa de Incentivos 19/E349

### FECHAS

Inicio 2015  
Finalización 2016

### RADICACIÓN

Instituto Instituto de Investigaciones Teóricas y Aplicadas  
Escuela Estadística

### CAMPO

Disciplina Científica Matemática  
Especialidad Estadística  
Campo de Aplicación

### RESUMEN

Los modelos tradicionales de series de tiempo (ARIMA, modelos de espacio de estado, modelos de espacio de estados de innovaciones, etc.), suponen que los errores se distribuyen según una gausseana de media cero y variancia constante. Además la mayoría de ellos son considerados modelos lineales.

Sin embargo, en el análisis empírico de series de tiempo, existen muchas series que no cumplen estos supuestos. Por ejemplo, en series con datos de conteo, en donde la distribución de la variable se puede considerar como Poisson. Para el análisis de estas series de tiempo, en la bibliografía, han surgido distintas alternativas, como son, entre otros: los modelos de series de tiempo para datos de conteo, modelos con datos funcionales, modelos no lineales como, por ejemplo, son los modelos ARCH y GARCH.

En este proyecto se va a investigar sobre las consecuencias de trabajar con modelos tradicionales cuando no se cumplen los supuestos y estudiar las propuestas específicas de los modelos que contemplan esta falta de supuestos. También se comparan los resultados obtenidos con distintas metodologías

### PALABRAS CLAVE

Series de tiempo    Modelos probabilísticos    Falta de supuestos    Datos de conteo    Análisis funcional

### GRUPO DE INVESTIGACIÓN

<i>Apellido y Nombre</i>	<i>Dedicación</i>	<i>Función</i>	<i>Categoría Incentivos</i>	<i>Participación</i>
Blaconá, María Teresa	Exclusiva	Directora	I	2015-2016
Magnano, Luciana Inés	Simple	Participante	-	2015-2016
Sigal, Facundo	Simple	Integrante	V	2015-2016
Andreozzi, Lucía	Simple	Becaria	V	2015-2016

### RESOLUCIONES DEL CONSEJO SUPERIOR

<i>Acreditación</i>		<i>Continuidad 2016</i>		<i>Continuidad</i>		<i>Continuidad</i>		<i>Aprobación Informe Final</i>	
<i>C.S.Nº</i>	<i>149/2015</i>	<i>C.S.Nº</i>	<i>.-</i>	<i>C.S.Nº</i>		<i>C.S.Nº</i>		<i>C.S.Nº</i>	<i>786/2018</i>
<i>Fecha</i>	<i>22/10/2015</i>	<i>Fecha</i>	<i>.-</i>	<i>Fecha</i>		<i>Fecha</i>		<i>Fecha</i>	<i>25/10/18</i>

### FINANCIAMIENTO

<i>Año</i>	<i>2015</i>	<i>Año</i>	<i>2016</i>	<i>Año</i>		<i>Año</i>	
<i>Monto</i>	<i>.-</i>	<i>Monto</i>	<i>.-</i>	<i>Monto</i>		<i>Monto</i>	
<i>Rector N°</i>		<i>Rector N°</i>		<i>Rector N°</i>		<i>Rector N°</i>	
<i>Fecha</i>		<i>Fecha</i>		<i>Fecha</i>		<i>Fecha</i>	