

Clustering subsecuencial de series de tiempo: Evidencia de patrones temporales en el tipo de cambio USD/MXN

Msc. Juan Francisco Muñoz Elguezábal ¹ Dr. Riemann Ruíz Cruz ²

¹Msc. Ciencia de Datos - ITESO ²Departamento de Matemáticas y Física - ITESO

Descripción General

Metodología *BoxJenkins* para series de tiempo financieras. Modelo lineal univariado que utiliza información endógena de la serie de tiempo para construir un modelo matemático con el cual realizar predicciones de valores futuros.

Diagrama General

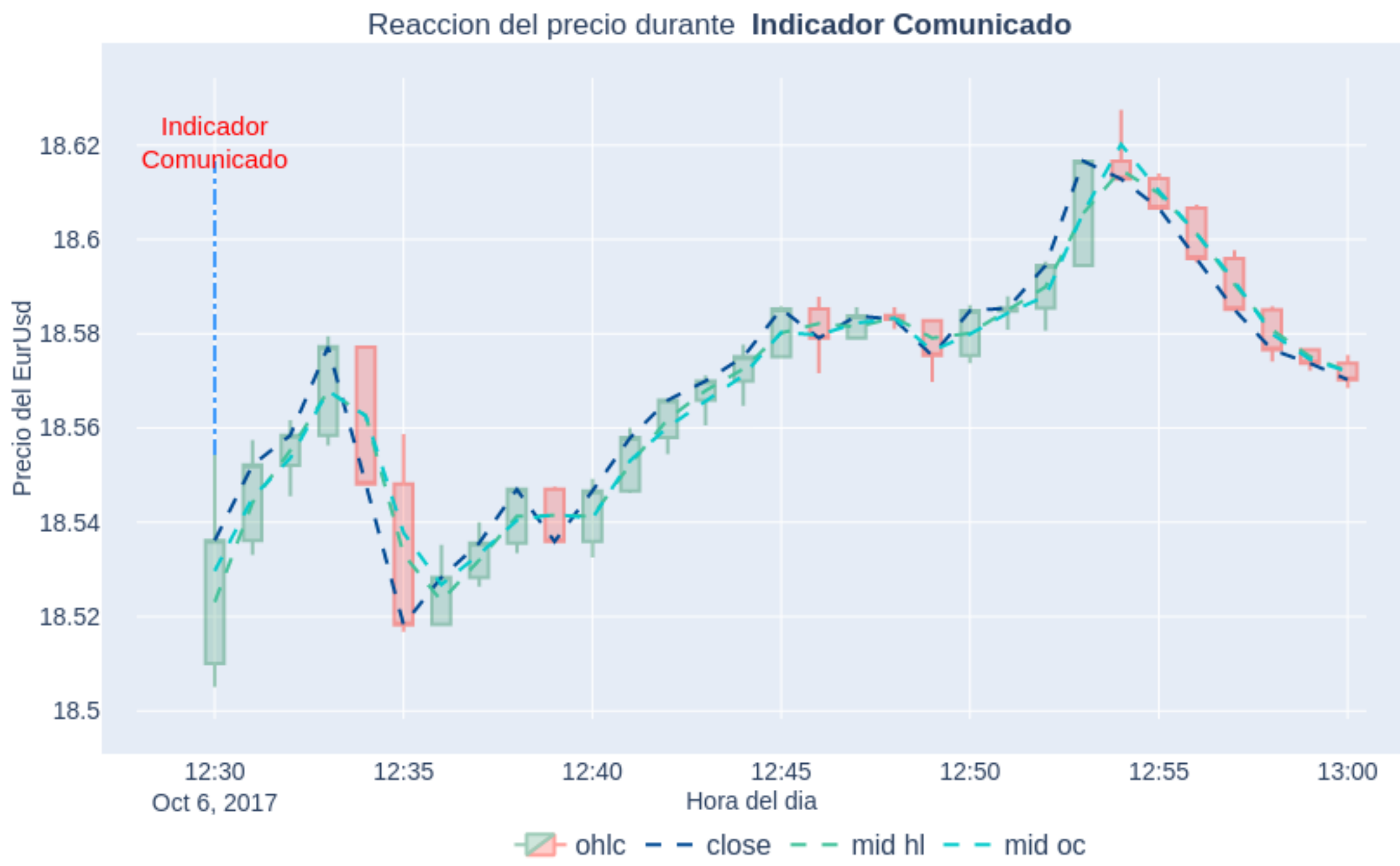


Tabla General

| categoria | usa | mex | total |
|----------------------|-----|-----|-------|
| actividad economica | 26 | 7 | 33 |
| consumo | 29 | 5 | 34 |
| energia | 4 | 0 | 4 |
| flujos de capital | 5 | 0 | 5 |
| inflacion | 0 | 4 | 4 |
| mercado inmobiliario | 11 | 1 | 12 |
| mercado laboral | 13 | 2 | 15 |
| subasta de bonos | 5 | 0 | 5 |
| tasas de interes | 1 | 1 | 2 |
| total | 94 | 20 | 114 |

