

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 Ruiz 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

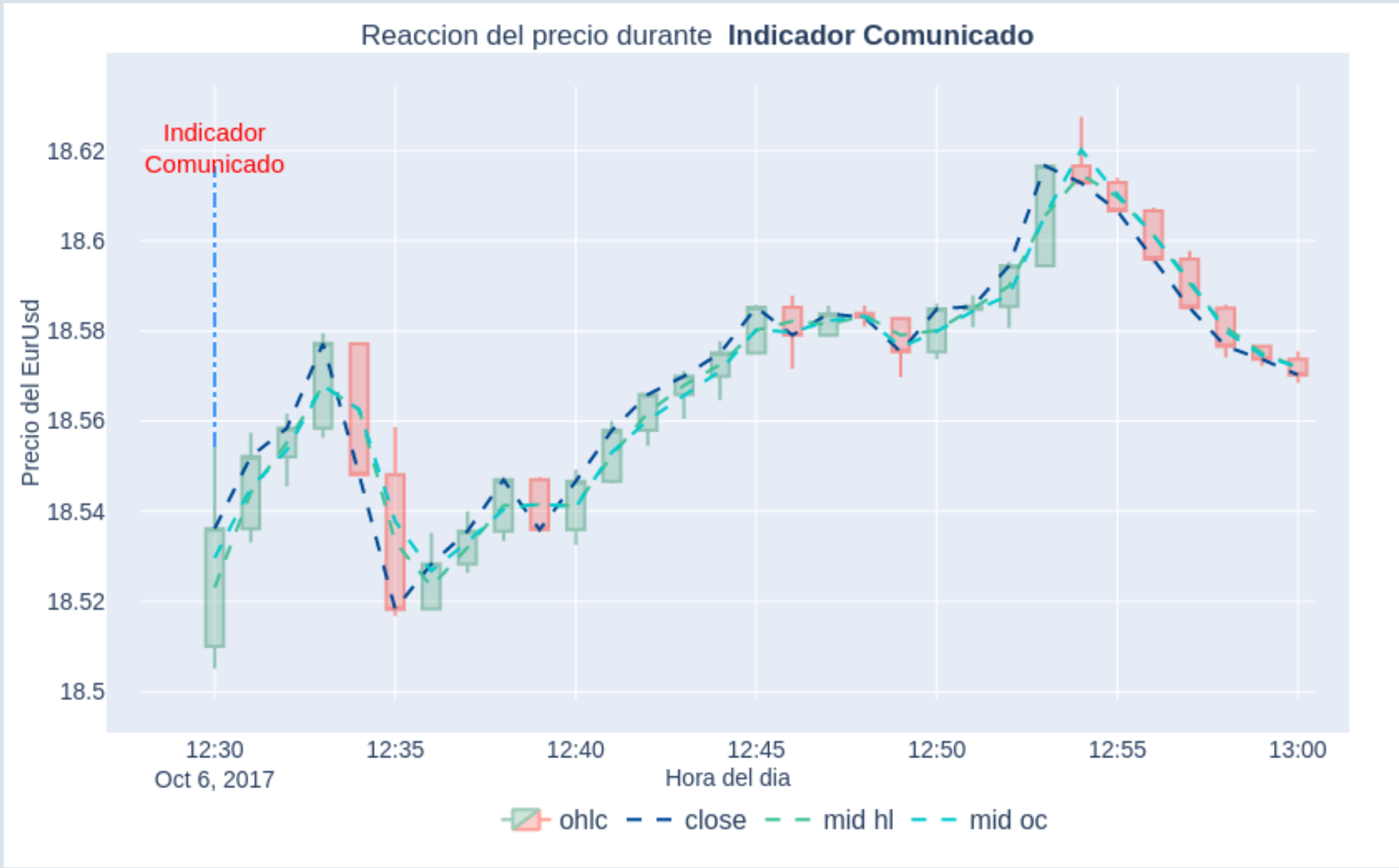


Tabla General

id	pais	ocurrencias
12-Monlation_MEX	MEX	104
1sthallation_MEX	MEX	105
3-Montuction_USA	USA	392
3-Yearuction_USA	USA	91
30-Yeauction_USA	USA	96
4-Weekuction_USA	USA	391
6-Montuction_USA	USA	395
ADPEmpChange_USA	USA	120
APIWeelStock_USA	USA	235
AccumuuntGDP_MEX	MEX	36
AveragnsMoM_USA	USA	120
AveragnsYoY_USA	USA	118
AveragyHours_USA	USA	120
BakerHgCount_USA	USA	235
BuildiChange_USA	USA	47
BuildiitsMoM_USA	USA	121
Businetories_USA	USA	120
CFTCGoitions_USA	USA	205
CFTCOiitions_USA	USA	205
CFTCUSitions_USA	USA	206
Capacization_USA	USA	120
CentrastRate_MEX	MEX	67
ChalleobCuts_USA	USA	96
ChicagyIndex_USA	USA	120
Chicag'Index_USA	USA	100
ConstringMoM_USA	USA	120
Consumidence_MEX	MEX	120
Consumnces.a_MEX	MEX	120
ConsumChange_USA	USA	120
Consumores.a_USA	USA	103
ConsumdexMoM_USA	USA	104
ConsumdexYoY_USA	USA	96
ConsumrgyMoM_USA	USA	120
ConsumrgyYoY_USA	USA	120
Consums.aMoM_USA	USA	96
ContinClaims_USA	USA	521
CoreInlation_MEX	MEX	102
CorePediture_USA	USA	239
CorePeresQoQ_USA	USA	116
Currencccount_USA	USA	40
Currennt,QoQ_MEX	MEX	36
DallassIndex_USA	USA	95
DurablOrders_USA	USA	122
Durablefense_USA	USA	15
Durabltaation_USA	USA	122
EIACruChange_USA	USA	521
EIANatChange_USA	USA	408
EmploytIndex_USA	USA	35
ExistingeMoM_USA	USA	120
ExistilesMoM_USA	USA	119
ExportdexMoM_USA	USA	105
ExportdexYoY_USA	USA	94

