

Algoritmo Tipo de cambio USD/MXN

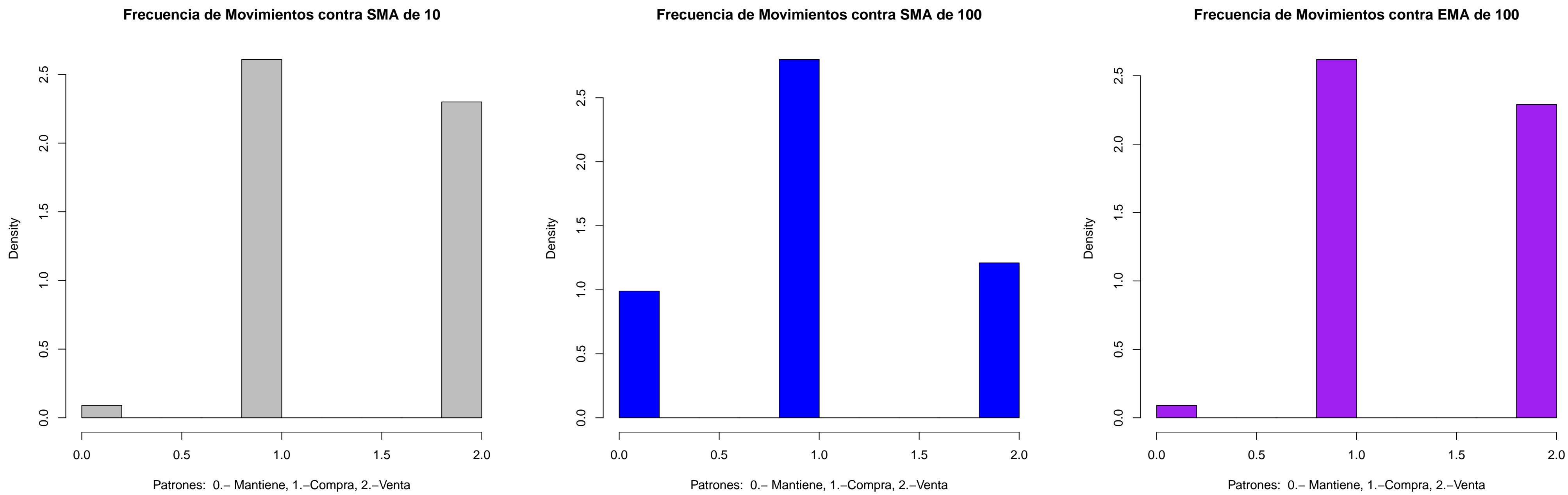
ITESO

Precios:

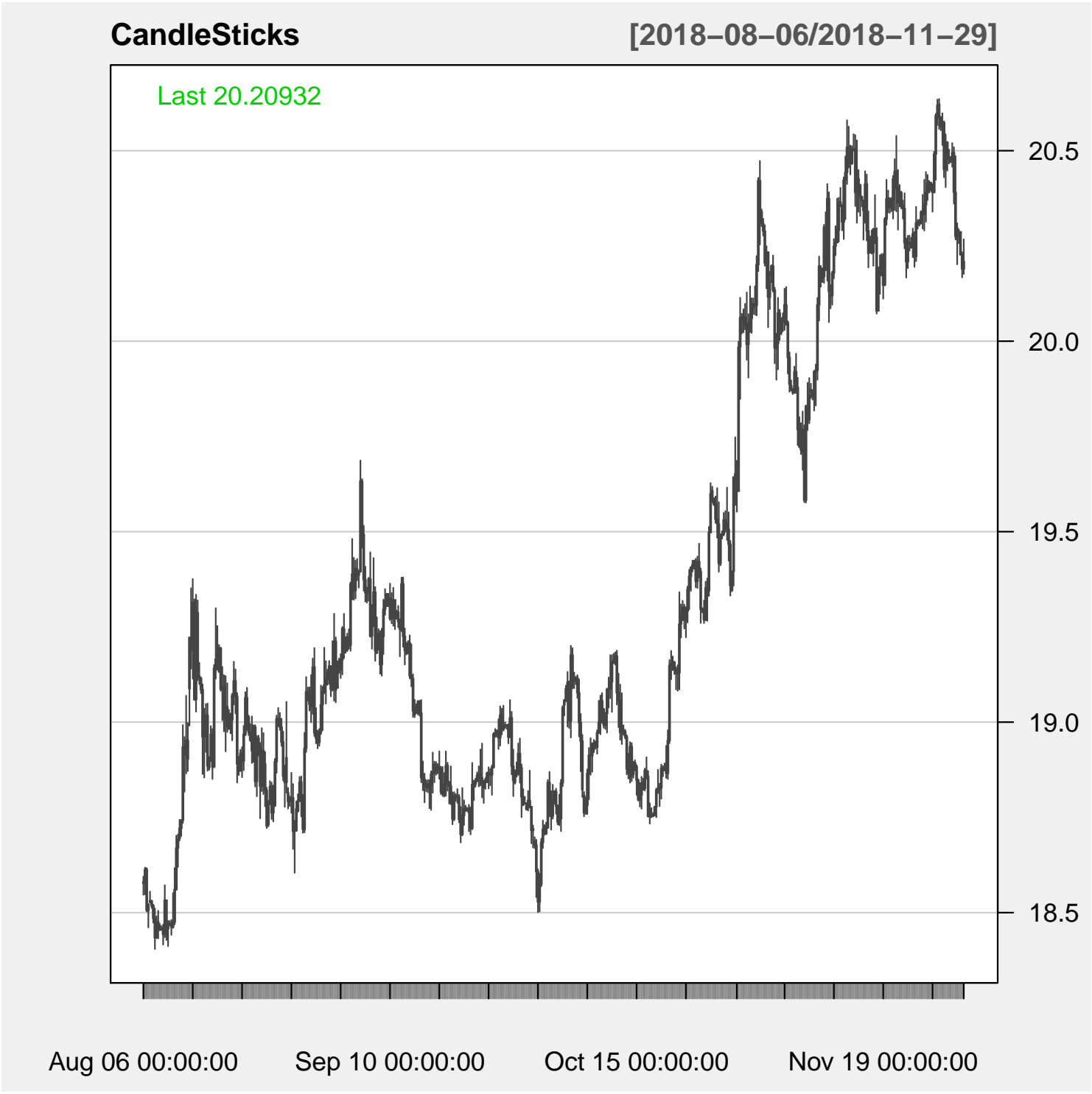


Interpretación

En la gráfica se incluye la SMA de 10 y de 100 días, así como tambien la EMA de 10 días.



CandleSticks



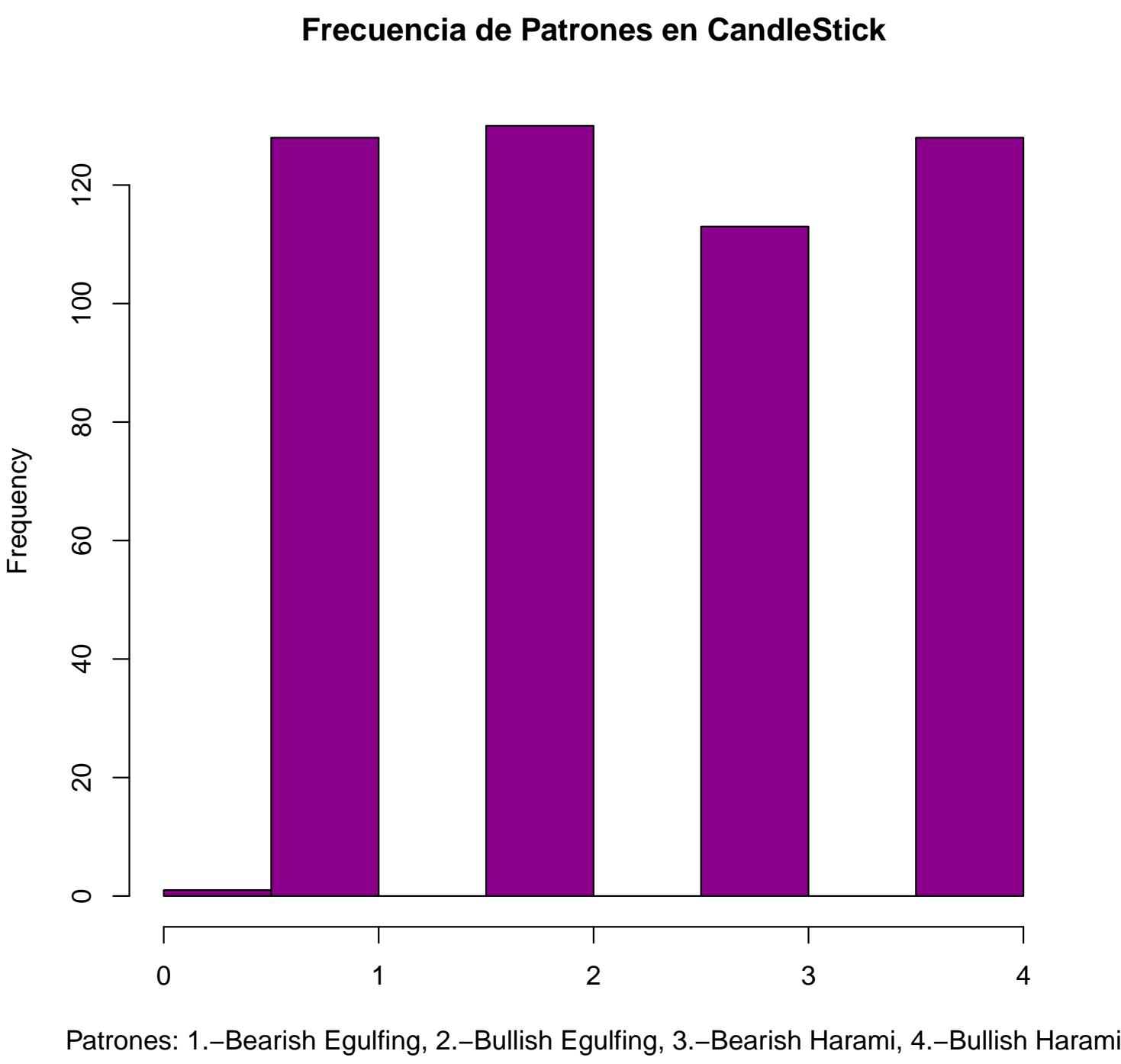
Interpretación

Se hizo un análisis del gráfico de velas, buscando que se formaran los siguientes patrones.

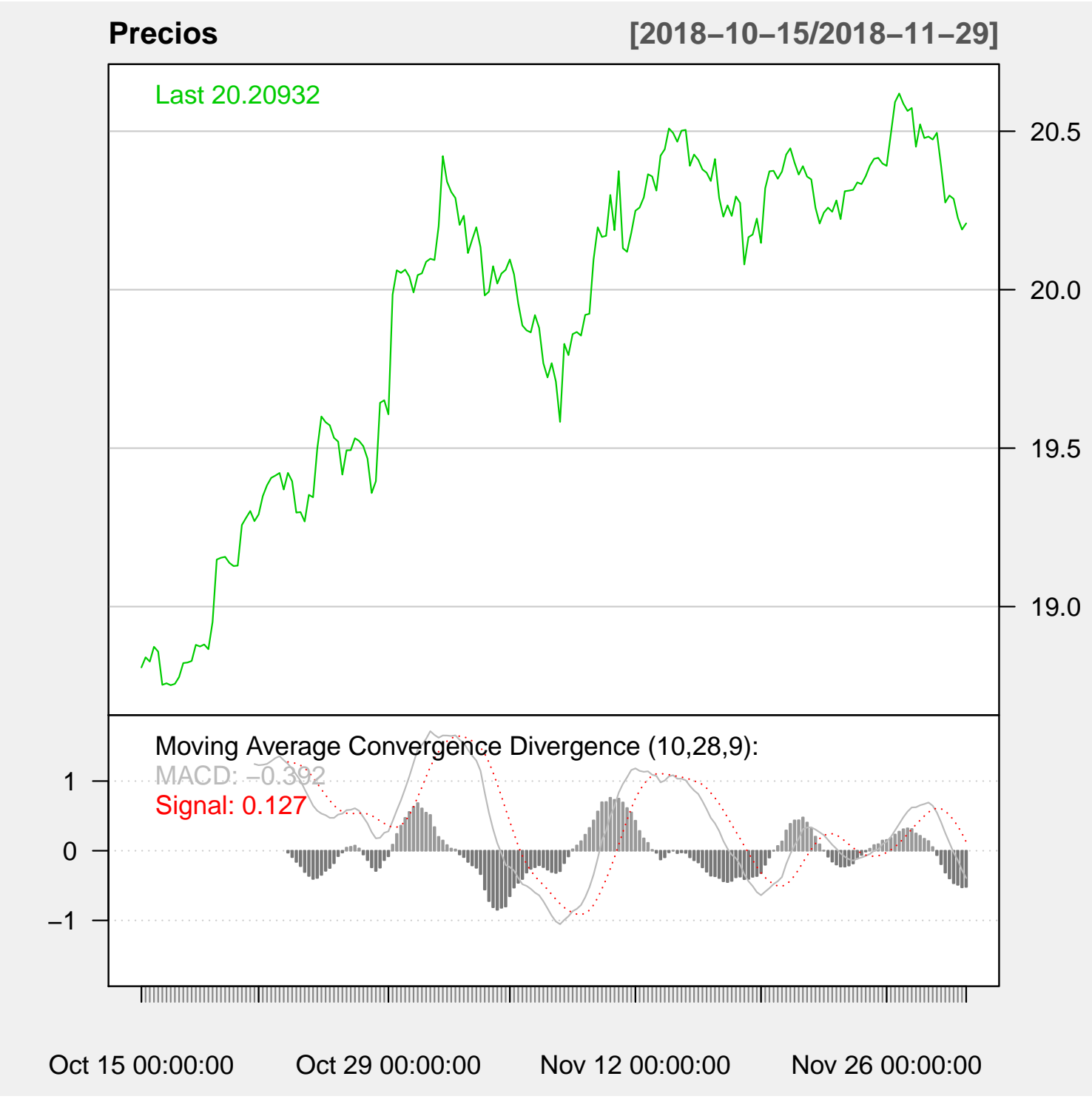
- Bearish Engulfing.
- Bullish Engulfing.
- Bearish Harami.
- Bullish Harami.

Histograma Patrones

Frecuencias presentadas en los precios.



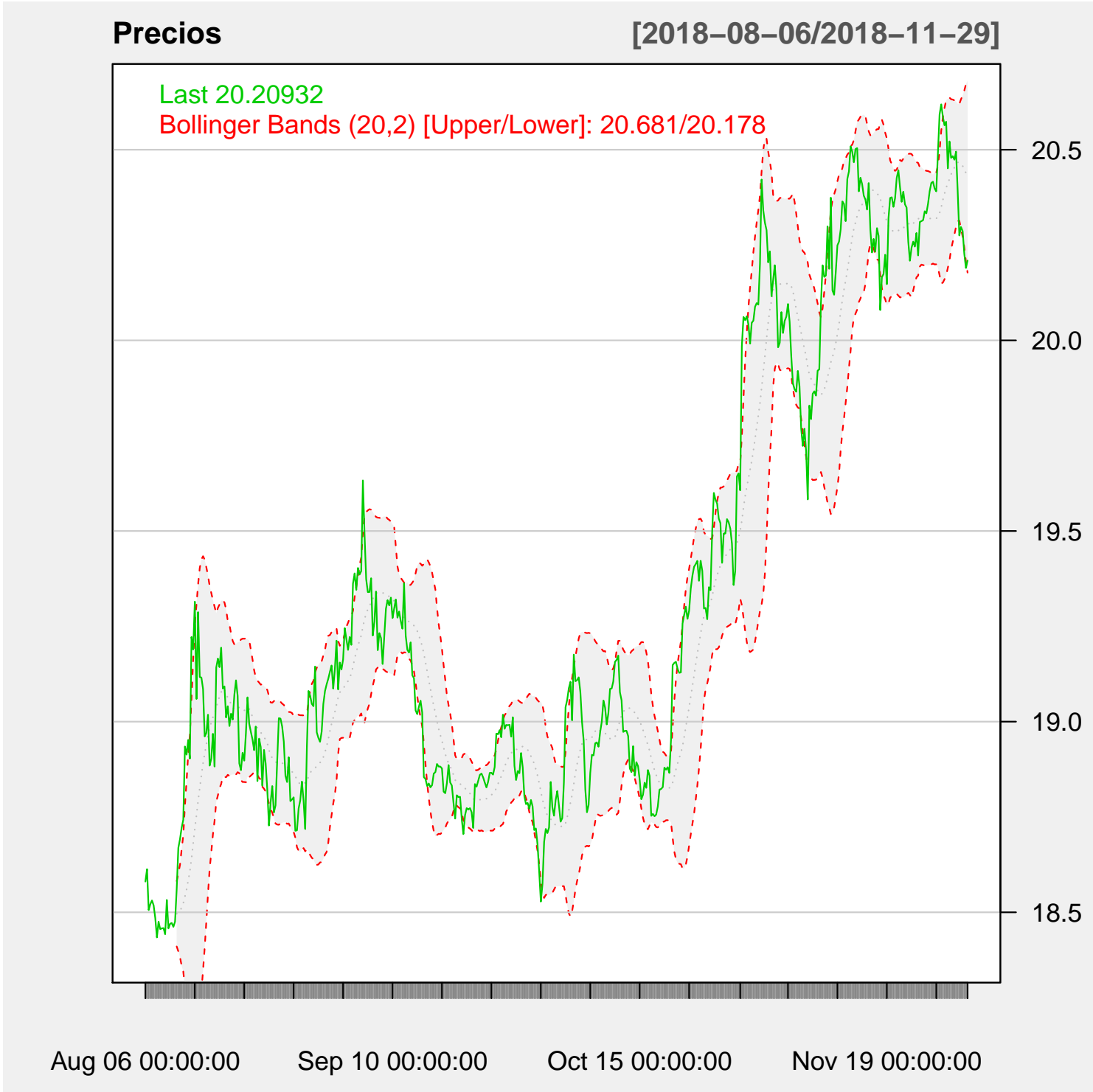
MACD



Interpretación

Tomando un periodo de tiempo de un mes existe una tendencia alcista entre el inicio de la gráfica y el final del periodo, sin embargo, El MACD muestra una divergencia negativa, donde eventualmente la acción tendrá un movimiento a la baja.

Bollinger Bands



Las señales presentadas fueron las siguientes:
Compra: 40/500
Venta: 45/500
Mantiene: 406//500

Ljung-Box test

| Ventana | P-Value |
|--------------|---------|
| 0-150 días | 0 |
| 150-300 días | 0 |
| 301-500 días | 0 |
| 500 días | 0 |

Interpretación

La prueba indica autocorreación en la Serie de tiempo . Se busca tener un p-value $\leq .05$ para aceptar que no existe autocorrelación en el primer rezago de la serie.

Kolmogorov-Smirnov test

| Ventana | P-Value |
|--------------|---------|
| 0-150 días | 0 |
| 150-300 días | 0 |
| 301-500 días | 0 |
| 500 días | 0 |

Interpretación

La prueba busca el ajuste una distribución de probabilidad en este caso a la distribución normal. Se busca que se acepte la Hipótesis nula es decir que se ajusta la distribución de probabilidad.