

# Especificación de Interfaz de Entrada/Salida (I/O) - Sistema de Predictores Universales

Arquitectura de Sistemas

February 18, 2026

## Contents

<b>1</b>	<b>Resumen Ejecutivo</b>	<b>2</b>
<b>2</b>	<b>Vector de Configuración (Hyper-Inputs)</b>	<b>2</b>
<b>3</b>	<b>Flujo de Entrada (Data Injection)</b>	<b>2</b>
3.1	1. Fase de Calibración (Bootstrapping) . . . . .	2
3.2	2. Fase Operativa (Online Stream) . . . . .	2
<b>4</b>	<b>Salidas del Sistema (System Outputs)</b>	<b>3</b>
4.1	1. Señal de Control (Prediction Signal) . . . . .	3
4.2	2. Indicadores de Estado (State Telemetry) . . . . .	3
<b>5</b>	<b>Diagrama de I/O Abstracto</b>	<b>5</b>
5.1	Ciclo de Proceso Interno . . . . .	5
<b>6</b>	<b>Persistencia (Snapshotting)</b>	<b>5</b>
6.1	Protocolo de Snapshotting Atómico y Verificado . . . . .	6

# 1 Resumen Ejecutivo

Este documento define la interfaz abstracta de Entrada/Salida (I/O) para el Sistema de Predictores Universales, independiente de su implementación específica (Python/JAX, C++, Rust, FPGA). Describe los vectores de configuración necesarios para instanciar el sistema, el flujo de datos en tiempo de ejecución y la estructura de las señales de salida y telemetría.

## 2 Vector de Configuración (Hyper-Inputs)

El sistema se inicializa mediante un vector de configuración  $\Lambda$  que define la topología y sensibilidad de los módulos. Estos parámetros suelen ser estáticos durante la sesión de operación o calibrados por un meta-optimizador externo.

Parámetro	Símbolo	Descripción Funcional
Regularización Entrópica	$\epsilon$	Suavizado del transporte de masa en el Orquestador JKO (Sinkhorn).
Tasa de Aprendizaje	$\tau$	Velocidad de adaptación de los pesos $\rho$ ante gradientes de energía.
Profundidad de Firma	$L$	Grado de trunqueo de la Log-Signature (Kernel D - Topológico).
Memoria WTMM	$N_{buf}$	Tamaño de la ventana deslizante para estimar singularidades.
Cono de Besov	$C_{besov}$	Radio de influencia para el seguimiento de máximos en ondelettes.
Umbral de Hölder	$H_{min}$	Valor crítico de regularidad que activa el <i>Circuit Breaker</i> .
Umbral CUSUM	$h$	Nivel de desviación acumulada que dispara el reinicio de pesos.
Slack CUSUM	$k$	Tolerancia a la deriva ("ruido blanco") permitida sin acumular error.
Memoria de Volatilidad	$\alpha$	Tasa de decaimiento (EMA) para estimar la varianza del error.

Table 1: Vector de Hiperparámetros  $\Lambda$

## 3 Flujo de Entrada (Data Injection)

### 3.1 1. Fase de Calibración (Bootstrapping)

Estado inicial requerido antes de la operación secuencial.

**Entrada:** Historia  $\mathcal{H} = \{y_{-T}, \dots, y_0\}$

- **Estructura:** Serie temporal de vectores  $\mathbf{y} \in \mathbb{R}^d$  o escalares  $y \in \mathbb{R}$ .
- **Propósito:**
  - Inicialización de núcleos dependientes de historia (ej. parámetros de Lévy).
  - Estabilización de los pesos iniciales  $\rho_0$  del orquestador.
  - Llenado del búfer de singularidad para el módulo WTMM.

### 3.2 2. Fase Operativa (Online Stream)

Ciclo de actualización paso a paso en tiempo  $t$ .

**Entrada del Paso  $t$ :** Tupla  $(y_t, y_{target}, \tau_{epoch})$

- **Marca de Tiempo ( $\tau_{epoch}$ ):** Timestamp absoluto (Unix Nanoseconds). Obligatorio para sincronización y cálculo de latencia en la política de abandono.
- **Observación Actual ( $y_t$ ):**
  - El nuevo dato disponible en  $t$ .
  - Se utiliza para alimentar los núcleos  $(K_A, K_B, K_C, K_D)$  y generar las predicciones para  $t + 1$ .
  - **Gestión de Errores de Dominio:** Si  $|y_t| > 20\sigma$  (respecto a la normalización histórica), el dato se clasifica como *Outlier Catastrófico*. El sistema debe descartar la entrada, mantener el estado inercial y emitir una alerta crítica de validación, protegiendo los núcleos de divergencia numérica.

- **Malla de Inferencia (Anti-Aliasing Input):**

- **Frecuencia de Muestreo vs Escalas ( $N_{buf}$ ):** Para garantizar la estabilidad del análisis WTMM (Singularidades del Kernel D), la frecuencia de inyección de datos debe mantener una densidad suficiente respecto a las escalas wavelet más finas.
- *Restricción:* Se impone una **Frecuencia Mínima de Inyección** (Nyquist soft-limit) dependiente de  $C_{besov}$ . Si la densidad de eventos cae por debajo de este umbral, el espectro multifractal colapsará, y el sistema debe congelar la actualización de la rama topológica.

- **Objetivo de Validación ( $y_{target}$ ):**

- El valor "real" correspondiente a la predicción generada en el paso anterior ( $t - 1$ ).
- Generalmente  $y_{target} \equiv y_t$  (en predicción one-step-ahead causal).
- Se utiliza para calcular el error  $e_t = y_{target} - \hat{y}_{t|t-1}$  y calcular el gradiente de energía  $\nabla E$  para el transporte JKO.

- **Métrica de Abandono (Staleness Policy):**

- **Tiempo de Vida (TTL):** Parámetro  $\Delta_{max}$ .
- **Comportamiento ante Violación:** Si el retraso de  $y_{target}$  excede  $\Delta_{max}$ , la actualización JKO se cancela.
- **Señal de Integridad:** El sistema debe emitir una bandera persistente de *Inferencia Degradada* ("Stale Weights"). Esto alerta al ejecutor de que, aunque la predicción  $\hat{y}$  sigue generándose, los pesos  $\rho$  tienen inercia obsoleta y el riesgo ya no está siendo optimizado geoméricamente.

## 4 Salidas del Sistema (System Outputs)

### 4.1 1. Señal de Control (Prediction Signal)

La salida primaria para la toma de decisiones.

**Salida:**  $\hat{y}_{t+1}$

- **Descripción:** Estimación del valor esperado del proceso para el siguiente instante.
- **Malla de Inferencia (Output Quantization):**
  - La salida  $\hat{y}_{t+1}$  se entrega en el espacio normalizado (Z-Score) consistente con la entrada  $y_t$ .
  - El Actor/Ejecutor es responsable de aplicar la transformación inversa (des-normalización) utilizando las estadísticas de ventana rodante si se requiere un precio absoluto.
- **Composición:** Combinación convexa de los núcleos base:  $\hat{y}_{t+1} = \sum_{i \in \{A,B,C,D\}} \rho_i^{(t)} \cdot K_i(y_t)$ .

### 4.2 2. Indicadores de Estado (State Telemetry)

Variables latentes que describen la "salud" y el régimen del mercado.

- **Estado de Riesgo ( $\mathbb{S}_{risk}$ ):**
  - **Exponente de Hölder local ( $H_t$ ):** Medida de regularidad puntual.  $H_t < 0.5$  indica antipersistencia/ruido;  $H_t < H_{min}$  indica crash/shock inminente.
  - **Curtosis Empírica ( $\kappa_t$ ):** Cuarto momento estandarizado de los residuos de predicción sobre ventana móvil:

$$\kappa_t = \frac{E[(e_t - \mu_e)^4]}{(\sigma_e)^4}$$

donde  $e_t = y_{target} - \hat{y}_{t|t-1}$  son los residuos de predicción.

- \* **Propósito:** Validar la idoneidad del umbral CUSUM adaptativo. Valores  $\kappa_t > 3$  indican distribución leptocúrtica (colas pesadas), lo cual activa el ajuste logarítmico del umbral  $h_t = k \cdot \sigma \cdot (1 + \ln(\kappa_t/3))$ .

- \* **Interpretación:**  $\kappa_t \approx 3$  (Gaussiano),  $\kappa_t \in [5, 10]$  (régimen de volatilidad financiera estándar),  $\kappa_t > 15$  (régimen de crisis con eventos extremos frecuentes).
- \* **Alerta:** Si  $\kappa_t > 20$  de forma persistente, emitir advertencia de posible falla en el modelo de residuos o presencia de outliers sistemáticos no detectados.
- **Entropía del Predictor DGM ( $H_{DGM}$ ):** Entropía diferencial de la distribución de valores de la función valor neuronal  $V_\theta(t, x)$  sobre el dominio espacial:

$$H_{DGM} = - \int p_V(v) \log p_V(v) dv$$

donde  $p_V(v)$  es la densidad empírica de valores de  $V_\theta$  evaluados en una malla de puntos del dominio.

- \* **Propósito:** Monitorizar la salud de la Rama B (solución HJB mediante Deep Galerkin Method) y detectar colapso de modo donde la red neuronal predice una solución constante o degenerada.
- \* **Umbral de Colapso:** Se debe comparar contra la entropía de la condición terminal:  $H_{DGM} \geq \gamma \cdot H[g]$  con  $\gamma \in [0.5, 1.0]$ . Si la desigualdad se viola persistentemente (más de 10 pasos consecutivos), emitir `ModeDegradationAlert`.
- \* **Acción Correctiva:** Reducir el peso de la Rama B en el orquestador ( $\rho_B \rightarrow 0$ ) y priorizar ramas alternativas hasta que se re-entrene la red DGM o se reinicialicen sus pesos.
- \* **Nota:** Este indicador solo es relevante si la Rama B está activa ( $\rho_B > 0.05$ ). Para sistemas que no utilizan DGM, este campo puede omitirse o reportarse como `NaN`.
- **Estadístico CUSUM ( $G^+$ ):** Nivel de desajuste estructural acumulado.
- **Distancia al Colapso ( $h_t - G^+$ ):** Margen de seguridad restante antes de un reinicio forzado del modelo. Nota:  $h_t$  es ahora dinámico y depende de  $\sigma_t$  y  $\kappa_t$ .
- **Energía Libre Residual ( $\mathcal{F}$ ):** Valor instantáneo del funcional de JKO. Monitoriza si el modelo está "atrapado" en un mínimo local estable o si la regularización entrópica  $\epsilon$  es demasiado alta, diluyendo excesivamente la capacidad predictiva del transporte de masa.
- **Estado del Orquestador ( $\rho$ ):**
  - **Vector de Pesos:**  $[\rho_A, \rho_B, \rho_C, \rho_D]$  tal que  $\sum \rho = 1$ .
  - Indica qué "física" domina actualmente el mercado (Saltos vs Difusión vs Memoria vs Topología).
- **Health-Check Estocástico:**
  - **Convergencia Sinkhorn (Bool):** Indica si el algoritmo de transporte de masa convergió dentro del número máximo de iteraciones.
  - *True:* Distancia Wasserstein exacta. *False:* Aproximación sub-óptima (alerta de precisión numérica).
- **Flags de Operación (Modo y Circuit Breakers):**
  - **Modo de Operación Base:**
    - \* *Standard (MSE):* Operación normal bajo supuestos Gaussianos locales.
    - \* *Robust (Huber):* Operación defensiva activada por singularidades ( $H_t < H_{min}$ ) o alta volatilidad.
  - **Modo de Inferencia Degradada (Degraded Inference Mode):** Flag booleano crítico para monitoreo de calidad temporal:
    - \* **Condición de Activación:** Se activa cuando el Time-To-Live (TTL) de la señal  $y_{target}$  excede el umbral máximo permitido:

$$TTL(y_{target}) = t_{current} - t_{signal} > \Delta_{max}$$

\* **Implicaciones Operacionales:**

1. La actualización del transporte JKO se suspende inmediatamente
2. Los pesos  $\rho$  se congelan en su último valor válido (modo inercial)

3. Las predicciones  $\hat{y}_{t+1}$  continúan generándose, pero son sub-óptimas pues no reflejan el estado real del mercado
  4. El riesgo ya NO está siendo optimizado geométricamente
- \* **Señalización al Ejecutor:** Este flag debe alertar explícitamente que:
    - Las predicciones actuales tienen *confianza degradada*
    - Los pesos son obsoletos (stale weights)
    - Se recomienda reducir exposición o operar en modo conservador
    - El sistema opera en "modo supervivencia" hasta que se restablezca el flujo de datos frescos
  - \* **Recuperación:** El flag se desactiva automáticamente cuando se recibe una señal fresca con  $\text{TTL}(y_{target}) < 0.8 \cdot \Delta_{max}$  (umbral con histéresis para evitar oscilaciones). En ese momento se reanuda el transporte JKO y se emite **NormalOperationRestoredEvent**.
  - **Emergency Mode (Singularity Fallback):** Flag que indica si se activó el modo de emergencia por singularidad crítica ( $H_t < H_{min}$ ), forzando  $w_D \rightarrow 1.0$  y cambiando a métrica de Huber.
  - **Regime Change Detected:** Flag que indica si CUSUM detectó un cambio de régimen en el último paso, con reinicio de entropía a distribución uniforme.

## 5 Diagrama de I/O Abstracto



### 5.1 Ciclo de Proceso Interno

1. **Ingesta:** Recibir  $y_t$ . Actualizar historial local.
2. **Análisis de Singularidad:** Calcular  $H_t$  usando WTMM sobre ventana reciente.
3. **Control de Calidad (CUSUM):**
  - Calcular error  $e_t$  usando  $y_{target}$  y la predicción almacenada  $\hat{y}_{t|t-1}$ .
  - Actualizar acumulador de deriva  $G^+$ .
  - Si  $G^+ > h$  o  $H_t < H_{min} \rightarrow$  Emitir señal de reinicio/alerta.
4. **Transporte (JKO):**
  - Calcular gradiente de energía  $\nabla E$  basado en  $e_t$ .
  - Transportar masa de probabilidad  $\rho_{t-1} \rightarrow \rho_t$  (Sinkhorn).
5. **Proyección:**
  - Ejecutar núcleos  $K_i(y_t)$  para obtener componentes.
  - Agregar componentes usando nuevos pesos  $\rho_t$  para obtener  $\hat{y}_{t+1}$ .

## 6 Persistencia (Snapshotting)

Para garantizar la continuidad operativa, el sistema debe ser capaz de serializar su estado interno completo  $\Sigma_t$  en cualquier instante  $t$ .

$$\Sigma_t = \{\rho_t, G_t^+, \sigma_{ema}^2, \kappa_t, H_{DGM}, \text{Flags}, \text{Búfer}_{WTMM}, \text{KernelsState}\}$$

donde:

- $\kappa_t$ : Curtosis empírica móvil de los errores de predicción (window size = 252).
- $H_{DGM}$ : Entropía diferencial del predictor DGM (para detección de mode collapse).

- **Flags:** Estructura de flags booleanos que incluye `DegradedInferenceMode`, `EmergencyMode`, y `RegimeChangeDetected`.

La estructura `KernelsState` se debe segmentar en sub-bloques independientes (K-Blocks) para permitir actualizaciones modulares o parciales:

$$\text{KernelsState} = \{S_A(\text{Lévy}), S_B(\text{PDE}), S_C(\text{Memoria}), S_D(\text{Topología})\}$$

La operación de restauración  $Load(\Sigma_t)$  debe permitir reanudar el flujo en  $t + 1$  sin necesidad de re-calibración sobre la historia  $\mathcal{H}$ . La correcta restauración de  $\kappa_t$  y  $H_{DGM}$  es crítica para preservar la capacidad de detección de anomalías y mode collapse tras un reinicio.

## 6.1 Protocolo de Snapshotting Atómico y Verificado

Se exige el uso de formatos de serialización binaria (ej. Protocol Buffers, MessagePack) en lugar de texto (JSON/XML) para el almacenamiento de  $\Sigma_t$ . Esto minimiza la latencia de I/O en operaciones de "Hot-Start" críticas.

- **Integridad Obligatoria (Mandatory Checksum):** Dado que se utilizan formatos binarios densos, un error de un solo bit en el estado de las matrices de los núcleos o el búfer WTMM podría provocar un colapso del sistema o comportamiento indefinido. Por tanto, la estructura  $\Sigma_t$  debe incluir un hash de validación robusto (ej. SHA-256 o CRC32c) al final del bloque.
- **Validación Pre-Inyección:** La rutina de restauración  $Load(\Sigma_t)$  debe recalcular y validar este hash *antes* de inyectar el estado en la memoria operativa. Si la validación falla, el snapshot debe descartarse y el sistema debe reiniciarse en modo "Cold-Start" (recarga de historia).