Reporte del pronóstico del tipo de cambio dólar-peso

Semana del 25 al 29 de septiembre de 2023

Elaborado por:

Dr. José Luis Chávez Hurtado
Est. Karen Montserrat Rubio Torres

Documento con licencia de:

25 de septiembre de 2023

Elaborado por:

Dr. José Luis Chávez Hurtado
Profesor-Investigador adscrito al departamento de Métodos Cuantitativos. CUCEA. Universidad de Guadalajara. Profesor-Investigador de tiempo completo ITESO. SNI Nivel I
jose.churtado@academicos.udg.mx

Est. Karen Montserrat Rubio Torres

Estudiante de licenciatura en Negocios Internacionales CUCEA. Universidad de Guadalajara. Prestadora de servicio social en Módulo 9. Modelos y pronósticos de economía. Plataforma Economía de Jalisco: Acción contra la recesión global. CUCEA-Universidad de Guadalajara

karen.rubio3811@alumnos.udg.mx

Palabras clave:

Modelos de pronóstico, *Deep Learning*, tipo de cambio, *polynomial surrogate models*, *response surface methodology*, *support vector machines*, *artificial neural networks*, *Kriging*.

Contenido:

En el presente documento se muestran los resultados obtenidos para el pronóstico del tipo de cambio de la semana en curso. La metodología para obtener dichos resultados puede ser consultada en el documento titulado “Metodología para el desarrollo de modelos de tipo Deep Learning para el pronóstico del tipo de cambio peso – dólar”.

Cómo citar:

Chávez Hurtado, J. L. y Rubio Torres, K. M. (2023, 25 de septiembre). *Reporte del pronóstico del tipo de cambio dólar-peso. Semana del 25 al 29 de septiembre de 2023*. Modelos y pronósticos de economía. Plataforma Economía de Jalisco: Acción contra la recesión global. CUCEA-Universidad de Guadalajara. https://economiajalisco.cucea.udg.mx/app/modelos-pronosticos/documentos

Error de aprendizaje

Los errores de aprendizaje para los cinco modelos implementados utilizando la base de datos extraída del Banco de México se muestran en la Tabla 1.[1]

Tabla 1. Errores de aprendizaje calculados para los cinco modelos de pronóstico

Modelo	MARD	Mean ARD	R^2
PSM	2.80204%	0.54085%	0.98268
RSM	2.84196%	0.55203%	0.98290
SVM	2.80228%	0.54546%	0.97282
Kriging	2.75669%	0.54044%	0.98190
GRNN	1.81238%	0.29044%	0.97627

Fuente: Elaboración propia.

[1] Para más información respecto al modelado y pronóstico, consulte: Chávez Hurtado, J. L. (2022, junio). *Metodología para el desarrollo de modelos de tipo Deep Learning para el pronóstico del tipo de cambio peso - dólar*. Modelos y pronósticos en economía. Plataforma Economía de Jalisco: Por la resiliencia económica. CUCEA-Universidad de Guadalajara. https://economiajalisco.cucea.udg.mx/app/modelos-pronosticos/documentos

Pronóstico

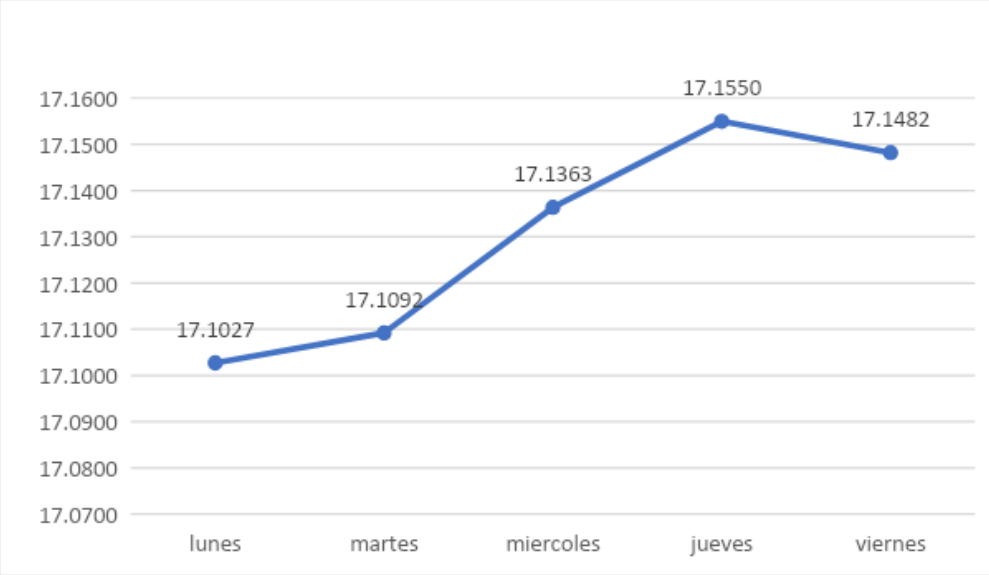
De acuerdo con el modelo con el mejor desempeño durante la fase de aprendizaje, el pronóstico del tipo de cambio para la semana del 25 al 29 de septiembre de 2023 se muestra en la Tabla 2 y en la Gráfica 1.

Tabla 2. Pronóstico del tipo de cambio dólar-peso para la semana del 25 al 29 de septiembre de 2023

lunes	martes	miércoles	jueves	viernes
17.1027	17.1092	17.1363	17.1550	17.1482

Fuente: Elaboración propia.

Gráfica 1. Pronóstico del tipo de cambio dólar-peso para la semana del 25 al 29 de septiembre de 2023



Fuente: Elaboración propia.

Conclusiones

De acuerdo con el modelo de pronóstico, se espera que durante la semana del 25 al 29 de septiembre de 2023 el dólar tenga una subida constante de precio alcanzando su pico máximo el jueves.