



FACULTAD DE CIENCIAS EMPRESARIALES
CARRERA PROFESIONAL DE INGENIERÍA
ECONÓMICA Y DE NEGOCIOS

**“LA CONTRIBUCIÓN DE LAS NOTICIAS EN LA PREDICCIÓN
DEL TIPO DE CAMBIO EN EL PERÚ: 2017-2021”**

Tesis para optar el título profesional de:
INGENIERO ECONOMISTA

Presentado por:

Ines Gabriela Paredes Perez (0000-0001-6894-4372)

Saul Villanueva Pariona (0000-0001-5243-6365)

Asesor:

Erick Wilfredo Lahura Serrano (0000-0001-9199-4677)

Lima – Perú

2024

ACTA DE SUSTENTACIÓN DE TESIS

Lima, 22 de marzo de 2024

Los integrantes del Jurado de tesis:

| | |
|------------|-------------------------------------|
| Presidente | Alexander Grande Espino |
| Miembro 1 | Rebeca Sosa Barrantes |
| Miembro 2 | Cesar Antonio Ordoñez Zuñiga |

Se reúnen para evaluar la tesis titulada:

LA CONTRIBUCIÓN DE LAS NOTICIAS EN LA PREDICCIÓN DEL TIPO DE CAMBIO EN EL PERU: 2017-2021

Presentado por los bachilleres:

Inés Gabriela Paredes Pérez y Saúl Villanueva Pariona

Para optar al título profesional de
INGENIERO ECONOMICO

Asesorado por:

Erick Wilfredo Lahura Serrano

Luego de haber evaluado el informe final de tesis y evaluado el desempeño de los estudiantes de la Carrera de **Ingeniería Económica y de Negocios** en la sustentación, concluyen de manera unánime (X) por mayoría simple () calificar a:

| | | | |
|-------------------|-----------------------------|------------------------------|-----------------|
| Tesista: | Inés Gabriela Paredes Pérez | | |
| Nota (en letras): | Dieciocho | | |
| Aprobado () | Aprobado - Muy buena (X) | Aprobado - Sobresaliente () | Desaprobado () |

| | | | |
|-------------------|--------------------------|------------------------------|-----------------|
| Tesista: | Saúl Villanueva Pariona | | |
| Nota (en letras): | Dieciocho | | |
| Aprobado () | Aprobado - Muy buena (X) | Aprobado - Sobresaliente () | Desaprobado () |

Desaprobado (0-12)/Aprobado (13-15)/Aprobado con mención muy buena (16-18)/Aprobado con mención sobresaliente (19-20).

Los miembros del jurado firman en señal de conformidad.



ALEXANDER GRANDE ESPINO
Presidente del Jurado



ERICK WILFREDO LAHURA SERRANO
Asesor



REBECA SOSA BARRANTES
Miembro 1



CESAR ANTONIO ORDOÑEZ ZUÑIGA
Miembro 2

DECLARACIÓN DE ORIGINALIDAD DE CONTENIDO DE INFORME FINAL DE TESIS¹

Lima, 28 de Junio del 2024

Señor, Dr.

Percy Mayta Tristán

Dirección General de Investigación, Desarrollo e Innovación

Universidad Científica del Sur

Presente. –

De nuestra consideración,

Yo: Saúl Villanueva Pariona e Inés Gabriela Paredes Pérez, egresados de la carrera de Ingeniería Económica de la Universidad Científica del Sur, en conjunto con el asesor/la asesora de tesis Erick Wilfredo Lahura Serrano, declaramos que este informe final de tesis/trabajo de investigación titulado: LA CONTRIBUCION DE LAS NOTICIAS EN LA PREDICCIÓN DEL TIPO DE CAMBIO EN EL PERÚ: 2017-2021, sustentado para obtener el título de Ingeniero Económico es original.

Es decir, no contiene plagio parcial ni total, cuando se utilizó información de fuentes externas se reconoció la autoría mediante la adecuada citación y los resultados obtenidos son producto entero de nuestra investigación y no han sido falseados ni fabricados. Todo esto en cumplimiento del Código de ética en la investigación, Reglamento del Comité de Integridad Científica, Reglamento de Propiedad Intelectual, Normas y procedimientos de los trabajos de investigación para la obtención de títulos profesionales y grados académicos², que afirmamos conocer en su totalidad.

Por ello, en caso de identificarse alguna situación de plagio, falsificación o fabricación de resultados, nos allanamos al proceso de investigación que establezca la Universidad y las posibles sanciones que pudieran surgir.

Firmamos en conformidad con lo declarado,

Firma Tesista 1
DNI: 75441101

Firma Tesista 2
DNI: 70455172

¹ En conformidad con la Resolución del Consejo Directivo N° 084-2022-SUNEDU/CD

² Los documentos están en: <https://investigacion.cientifica.edu.pe/reglamentos/>



Firma del asesor de tesis
DNI

INFORME DE REVISIÓN DE ORIGINALIDAD

Título del documento evaluado. La contribución de las noticias en la predicción del tipo de cambio en el Perú: 2017-2021

Autores. Inés Gabriela Paredes Pérez; Saúl Villanueva Pariona

Mecanismo de revisión de originalidad. Evaluación con Turnitin (ID 2425967889).

Resultado de la evaluación. 9%

Revisado por. Magaly Kelly Guerrero Huaracallo.

Comentarios sobre la revisión. Filtros usados: excluir fuentes de menos de 12 palabras.

v.3.0. La contribución de las noticias

INFORME DE ORIGINALIDAD

9%

INDICE DE SIMILITUD

9%

FUENTES DE INTERNET

3%

PUBLICACIONES

3%

TRABAJOS DEL ESTUDIANTE

FUENTES PRIMARIAS

1

www.bcrp.gob.pe

Fuente de Internet

1%

2

archivo.gestion.pe

Fuente de Internet

1%

3

ojs.uc.cl

Fuente de Internet

1%

4

nep.repec.org

Fuente de Internet

1%

5

Submitted to Universidad Científica del Sur

Trabajo del estudiante

<1%

6

Submitted to Universidad de Lima

Trabajo del estudiante

<1%

LA CONTRIBUCIÓN DE LAS NOTICIAS EN LA PREDICCIÓN DEL TIPO DE CAMBIO EN EL PERÚ: 2017-2021

INÉS GABRIELA PAREDES PEREZ*

Universidad Científica del Sur
180000712@cientifica.edu.pe

SAÚL VILLANUEVA PARIONA**

Universidad Científica del Sur
180000892@cientifica.edu.pe

ERICK LAHURA***

Banco Central de Reserva del Perú
erick.lahura@bcrp.gob.pe

Resumen

El objetivo de esta investigación es determinar si los titulares de noticias publicadas en línea contribuyen en la predicción del rendimiento diario del tipo de cambio sol-dólar en el Perú durante el periodo 2017-2021. Para ello, se analizaron los titulares de noticias publicadas en el portal web del diario “El Comercio” y se identificaron aquellos relacionados a palabras clave como dólar, crisis e incertidumbre. Las noticias fueron extraídas mediante la técnica de raspado de datos de la web o web scraping. El análisis empírico se basa en la estimación por máxima verosimilitud de un modelo de regresión dinámico con errores GARCH para predecir el rendimiento del tipo de cambio nominal. Los resultados muestran que los titulares de noticias publicadas en línea contribuyen al pronóstico del rendimiento del tipo de cambio, siendo los más relevantes los titulares de noticias asociados a la palabra crisis.

Palabras clave : Tipo de cambio, noticias en línea, volatilidad, dólar, crisis, incertidumbre.

Clasificación JEL : C22, F31, F37, G17

* Bachiller en Ingeniería Económica y de Negocios, Universidad Científica del Sur.

** Bachiller en Ingeniería Económica y de Negocios, Universidad Científica del Sur.

*** Autor corresponsal. Subgerencia de Investigación Económica, Banco Central de Reserva del Perú (BCRP). Profesor del Departamento de Economía de la Pontificia Universidad Católica del Perú y del Departamento de Ingeniería Económica y Contabilidad Corporativa de la Universidad Científica del Sur.