



**Tecnológico
de Monterrey**

Evidencia Situación problema
Series Tiempo - Capital Analyst

REPORTE

Rafael Narro Rabago A01385439

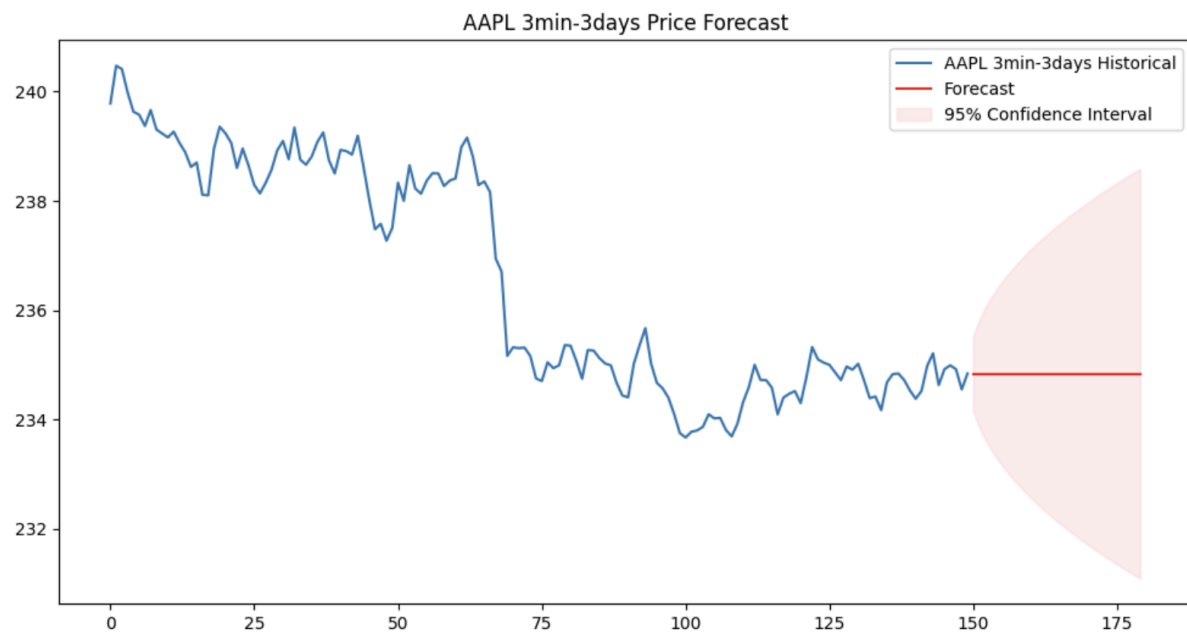
14/03/25

Profesores:
Profesor: Raymundo Diaz

Ordenes con su justificación de colab:

3/10/2025 Market - Buy AAPL 2500 MKT 225.23 EQUITIES USD eea39943-f42e-4617-81b7-cab4630ebf0f Filled

ADD/VIEW
NOTES



Forecast Interpretation for AAPL 3min-3days:
Last observed value: 234.84
Average forecast value: 234.84
Forecast change: 0.00
Trend: Upward forecast trend
95% CI range at period 30: [231.10, 238.58]


Con el código observe un Upward forecast trend el cual me dio a entender que la tendencia era alcista. Al final el modelo se equivocó ya que gracias a las noticias de los aranceles y las tarifas a Canadá sobre su aluminio y acero, la acción de AAPL cayó en cuenta abajo.



3/13/2025	Market - Sell	GRRR	-1000000	MKT	27.47	EQUITIES	USD	f7e556c1-c2a0-4a16-9db8-2711357713f3	Filled	ADD/VIEW NOTES
3/13/2025	Market - Buy	GRRR	1000000	MKT	28.52	EQUITIES	USD	6371b6e1-7341-43a5-8ad1-a135a263015c	Filled	ADD/VIEW NOTES




Forecast Interpretation for GRRR:
Last observed value: 27.94
Average forecast value: 29.50
Forecast change: 1.56
Trend: Upward forecast trend
95% CI range at period 30: [16.27, 42.31]

Decidí comprar GRRR debido a los resultados contundentes que me mandó el análisis, desafortunadamente debido a que el jueves era un día totalmente rojo para todas las acciones decidí cerrar posición para la reducción de pérdidas debido a que se esperaba que ese fuera el ultimo día de mercado para subir la evidencia, por lo cual no convenía dejar la acción moviéndose porque era el ultimo día. El siguiente día la acción subió un 29% dándole la razón a mi modelo.

 GRRR



Gorilla Technology Group Inc. 

NASDAQ

Technology Services • Packaged Software

33.59 USD

+7.68 +29.64%

Last update at 15:53 GMT-6

3/13/2025

Market -
Buy

META

40000

MKT

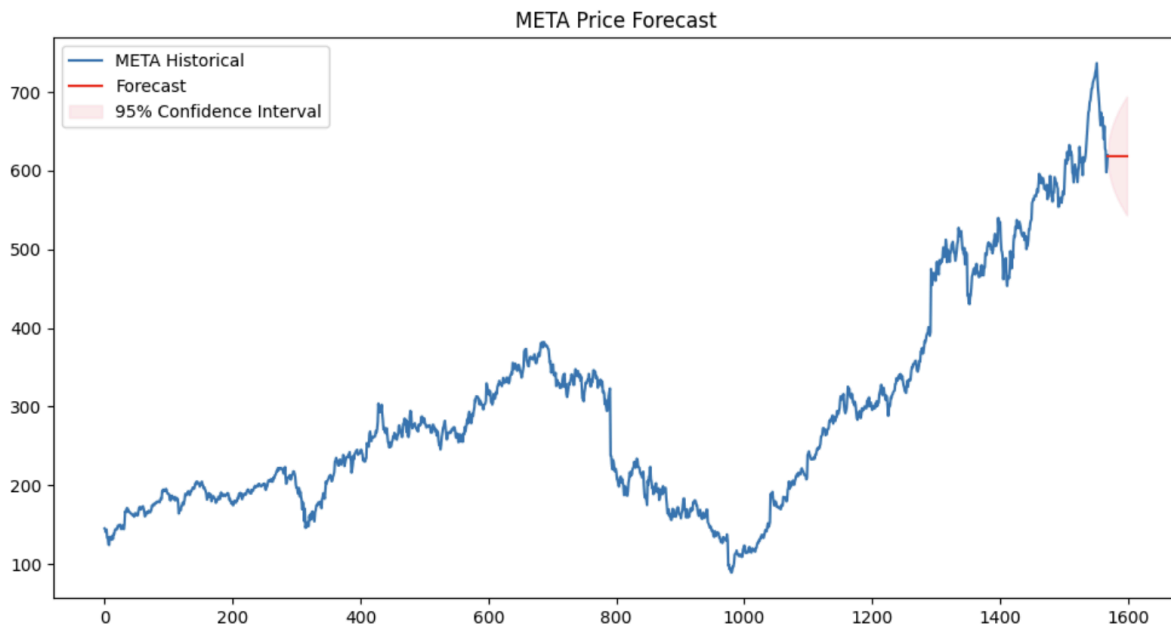
595.09

EQUITIES

USD

8ec2b616-5c87-432b-
af6f-c6ceadc261bb

Filled

ADD/VIEW
NOTES

Forecast Interpretation for META:

Last observed value: 619.56

Average forecast value: 618.93

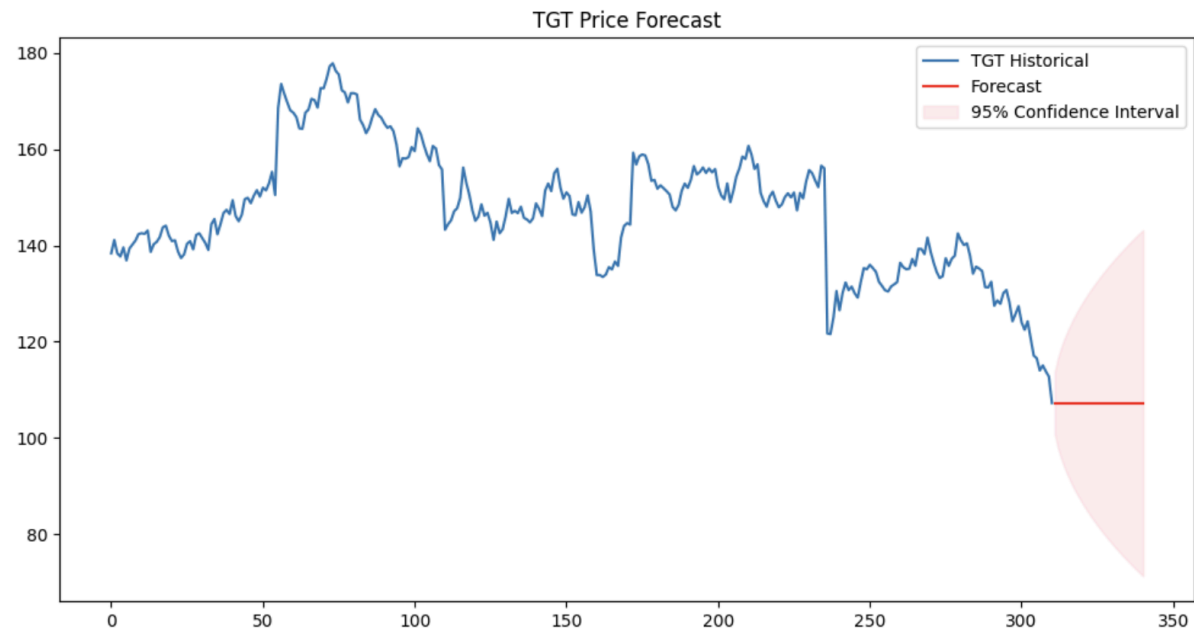
Forecast change: -0.63

Trend: Downward forecast trend

95% CI range at period 30: [543.81, 694.04]

Se realizo una compra de meta debido a que como se puede observar en la grafica su precio de ese momento estaba por debajo de la linea rojo de predicción, por lo cual hice una compra. El modelo resulto exitoso hasta el dia de hoy viernes 14 de marzo.

Comprándolo a un precio de 595.09 y a dia de hoy esta a 607.60

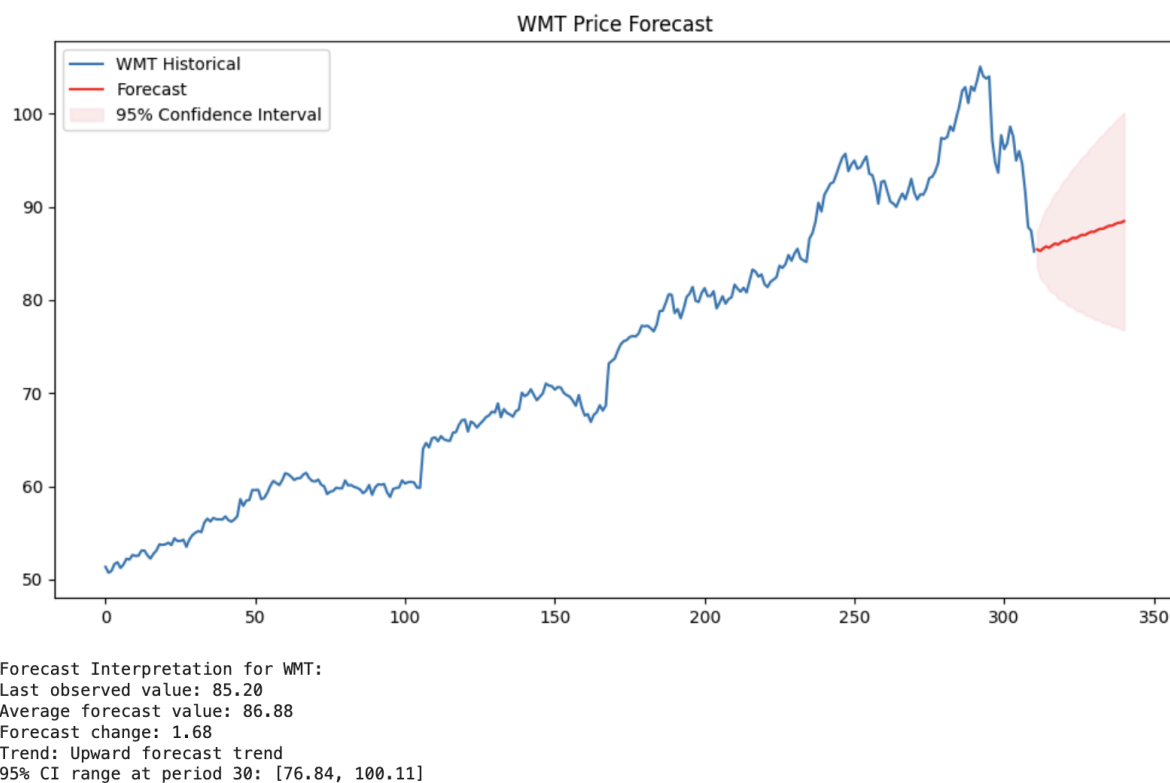


Forecast Interpretation for TGT:
Last observed value: 107.28
Average forecast value: 107.28
Forecast change: 0.00
Trend: Upward forecast trend
95% CI range at period 30: [71.40, 143.16]

Esta compra fue riesgosa debido a que como se observa en la grafica la tendencia es claramente bajista pero en esos momentos el precio ya estaba por debajo de la linea roja por lo cual la compre. El movimiento no fue exitoso TGT siguió bajando hasta el dia de hoy.

3/13/2025 Market-Buy WMT 100000 MKT 84.72 EQUITIES USD e6543459-eb6d-4b9a-b777-1cd1e927f5c9 Filled

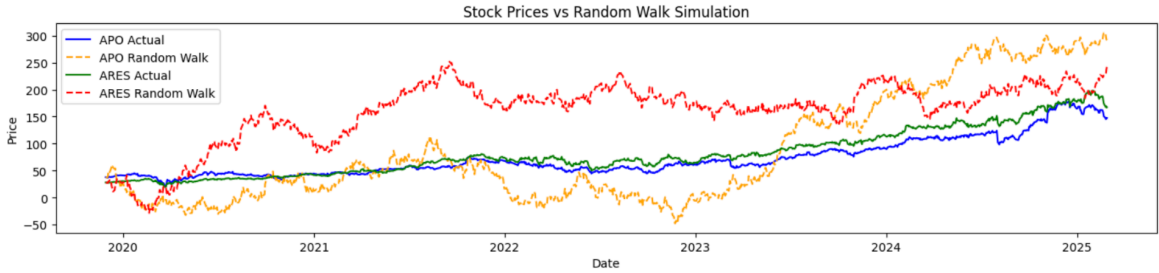
ADD/VIEW
NOTES



Se realizo la compra de walmart por lo contundente que salio el resultado del grafico, la compra fue un exito ya que ahora mismo WMT se encuentra en un precio superior que el de compra, pero no ha subido enormemente. Esto seria una acción que se debería dejar a largo plazo por el gran grafico que nos muestra.

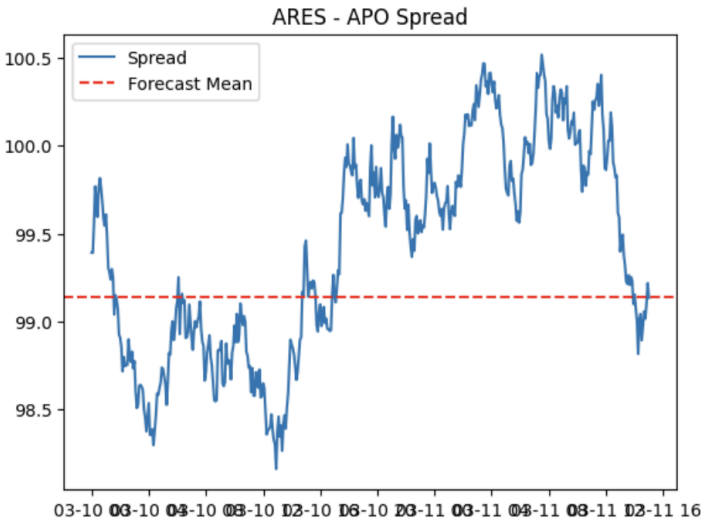
3/14/2025	Market - Short	APO	-50610	MKT	133.64	EQUITIES	USD	dea9cc3f-d705-43a5-bc76-c05b1fe64167	Filled	ADD/VIEW NOTES
3/14/2025	Market - Buy	ARES	150000	MKT	145.51	EQUITIES	USD	8ceaccc3-1bdd-423c-a84a-d3c59dd18421	Filled	ADD/VIEW NOTES

Result: Reject the null hypothesis – APO and ARES prices are cointegrated.



Estas acciones van en par debido a que las dos estan 99% COINTEGRADAS por lo cual se realizo una estrategia de SPREAD. Esta fue una estrategia la cual se realizo el ultimo dia por lo que fue muy rápida y se debian controlar las posibles perdidas.

ARES y APO están cointegrados, su diferencia (spread) es predecible. Si el spread está alto (108.6), compramos ARES (debido a que el precio estaba mas abajo) y shorteamos APO (debido a que el precio esta mas arriba), esperando que baje a la media (98.26) para ganar dinero antes del cierre del mercado.



Al momento de realizar el spread después de finalizar el código, ya era muy tarde. Antes el spread se encontraba en 108.6 y al momento de las compras estaba en 99.8. Debido a que el valor promedio del spread es de 98.26 no se pudieron tener utilidades gigantescas, pero fue una estrategia muy interesante y al final del todo exitosa.

Resultados:

En un mercado muy volátil y con tendencia bajista, logré reducir significativamente las pérdidas en mi portafolio, aunque terminé en números rojos. A pesar de las condiciones difíciles, **superé el rendimiento del profesor**, lo que muestra que mis decisiones estratégicas ayudaron a limitar el impacto de un entorno tan complicado. Este resultado no solo refleja que pude controlar pérdidas que podrían haber sido mucho mayores, sino que también demuestra mi capacidad para adaptarme a un mercado inusual y desafiante.

Más allá de los números, esta experiencia me dejó un aprendizaje invaluable ya que enfrenté situaciones impredecibles que pusieron a prueba mi análisis y mi toma de decisiones. Sin duda tuve muchos aspectos que mejorar pero este proceso enriquecerá mi desarrollo académico al aumentar mi comprensión de los mercados financieros, y también mi crecimiento profesional al prepararme para manejar escenarios complejos en el futuro con mayor confianza y habilidad.

Recomendación:

Para mis actividades futuras, he aprendido que es fundamental confiar plenamente en los datos que analizo, ya que estos ofrecen una base sólida para tomar decisiones informadas, incluso en mercados impredecibles. Además planeo ajustar mi enfoque con los stop-loss, optando por establecer límites menos estrictos y más flexibles. Esto me permitirá darle al mercado el tiempo necesario para que los números confirmen las tendencias que he identificado, en lugar de cerrar posiciones demasiado pronto por miedo a pérdidas temporales. Con esta estrategia busco equilibrar el riesgo y la paciencia, dejando que las dinámicas del mercado se desarrollen a mi favor cuando los datos lo respalden. Este cambio refleja una lección clave de mi experiencia reciente: a veces, la volatilidad inicial puede ser engañosa, y darle espacio a las proyecciones basadas en análisis sólido puede marcar la diferencia entre una pérdida evitable y una ganancia bien ganada.