***Definición de Términos para Proyecto de Análisis de Datos***

1. **Partes del acuerdo:**
   1. Firma: Swell Capital, representada por Gonzalo Cavanagh, Raúl Quiroga y Octavio Gamboa.
   2. Consultores: Iván Serrano y Olga Serna.
2. ***Objetivo general:*** “Se propone proyecto para optimizar estrategias actuales”.

Resultado: Optimización de estrategias actuales con *backtests* probados en varios activos.

1. ***Objetivos específicos:***
2. “*Backtest* de estrategias actuales”
   1. Construcción de un portafolio que sigue el algoritmo de órdenes de acuerdo con la estrategia definida por Swell, para calcular estadísticas históricas de retorno/riesgo.
3. “Optimización de estrategias actuales”.
   1. Análisis de los parámetros (SL, TP, apalancamiento) utilizados en las estrategias actuales.
   2. Desarrollo de un modelo de optimización de los parámetros para mejorar el desempeño de la estrategia.
4. “Desarrollo de variantes a estrategias actuales mediante el análisis de performance en varios activos, utilizando herramientas sofisticadas de análisis estadístico”.
   1. Análisis del modelo utilizado para crear la señal de estrategias actuales.
   2. Desarrollo de modelos que buscan optimizar la efectividad de la señal.
5. ***Entregables asociados a los objetivos específicos:***
6. Códigos y resultados para *backtesting* de las estrategias definidas por el alcance.
7. Códigos y resultados de estrategias definidas por el alcance con parámetros óptimos.
8. Códigos y resultados de estrategias definidas por el alcance con señales óptimas.
9. ***Duración y cronograma:***
10. La duración prevista es de 12 semanas con un total de 144 horas de trabajo de los consultores, se realizarán reuniones de seguimiento y retroalimentación:
    * Se realizarán reuniones de seguimiento una vez por semana donde se presentarán los avances de la semana.
    * Las partes podrán solicitar reuniones adicionales si hay algún tema bloqueante que se deba solucionar para continuar con las actividades programadas en la semana.
11. Cronograma:



1. ***Fecha y condiciones de inicio:***
2. El inicio del proyecto está determinado por:
   * Entrega de algoritmo de órdenes de acuerdo con la estrategia definida por Swell, para calcular estadísticas históricas de retorno/riesgo.
   * La entrega a conformidad de las bases de datos necesarias para el análisis de las estrategias. La conformidad con las bases de datos la darán los consultores una vez revisadas.
3. ***Alcance:***
4. Estrategias bajo análisis: ETF (SPXL, FAS, ECH) y monedas (BTC, ZAR, ETH).
5. Tipo de análisis: el conocimiento aportado por los consultores se enfoca en modelos cuantitativos que serán desarrollados con base en el conocimiento de mercado suministrado por Swell para cada uno de los activos.
6. ***Costo:***

La duración es de 12 semanas con un total de 144 horas de trabajo de los consultores y el costo total del proyecto es de USD 8,640. Los pagos se realizan en tres partes iguales cuando se reciba cada entregable especificado en la sección *Entregables asociados a los objetivos específicos*.

1. ***Contingencias:***

Los términos acordados podrán ser modificados por acuerdo mutuo por medio de comunicación directa entre las partes mediante correo electrónico o reuniones solicitadas por los interesados.