***Definición inicial de términos para proyecto de análisis de datos***

Objetivo general: “Se propone proyecto para optimizar estrategias actuales”.

Objetivos específicos:

1. *“Backtest de estrategias actuales”.*
   * 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.
2. *“Optimización de estrategias actuales”.*
   * Análisis de los parámetros (SL, TP, apalancamiento) utilizado en las estrategias actuales.
   * Desarrollo de un modelo de optimización de los parámetros para mejorar el desempeño de la estrategia.
3. *“Desarrollo de variantes a estrategias actuales”.*
   * Análisis del modelo utilizado para crear la señal de estrategias actuales.
   * Desarrollo de modelos que buscan optimizar la efectividad de la señal.

Alcance:

* Estrategias bajo análisis: ETF (spxl, fas, ech) y monedas (MXN, ZAR, TRY).
* 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.

Entregables: asociados a los objetivos específicos:

* Códigos y resultados para backtesting de las estrategias definidas por el alcance.
* Códigos y resultados de estrategias definidas por el alcance con parámetros óptimos.
* Códigos y resultados de estrategias definidas por el alcance con señales óptimas.

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

Cronograma: fecha y condiciones de inicio, periodicidad de reuniones de seguimiento y retroalimentación.

Modificación a términos acordados: procedimiento para tratar contingencias se enmarca en la comunicación directa entre las partes mediante correo electrónico o reuniones solicitadas por los interesados.

Duración: 12 semanas (144 horas).

Costo total: USD 8,640