

The background of the slide is a blurred image of a financial market display. It features various stock indices and their values in different colors (green for up, red for down). Visible text includes "OMXC25", "OMXC25 INDEX", "1172.94", "0.81%", "10916.69", "10847.17", "Buy", "OMXRG1", "OMX RIGA GI", "984.13", "0.87%", "57.3180", "6025.9680", "5993.7030", "Buy", "OMX18", "OMX ICELAND 8", "599.40", "28287.66", "7056.04", "Buy", "6230.9", "1172.94", "0.81%", and "Sell".

ML

Fondos de Inversión

POR:

Laura Maria Martinez

Lorenz Jhoan Pulgar

Lesly Pamela Lopez



Un ETF es un conjunto de activos que cotiza en la bolsa de valores. Los ETFs son vehículos que ayudan a invertir de manera diversificada y con bajo costo.



Tipos de ETF: ETF de índices clásicos de renta variable y renta fija, selección activa, monetario, materia prima, sectoriales, regionales, globales e inversos

Características ETF

Transparencia

Flexibilidad

Liquidez

Diversidad.

Comisiones.

Replicación:

- Física: replica parte o total de la rentabilidad sus indices. Pero los activos del índice debe ser iguales.
- Sintética : Canasta de valores que pueden o no estar relacionados con el índice. Así que, se realizan contratos de permutas financieras o swap.

DIFERENCIAS	
INVERSIÓN PASIVA	INVERSIÓN ACTIVA
Su objetivo es replicar al mercado para conseguir su misma rentabilidad	Su objetivo es batir al mercado para lograr una rentabilidad mayor con el mismo o menor presupuesto de riesgo
Inversión a largo plazo	Inversión a largo plazo y para periodos cortos con el objetivo de intentar aprovechar las dislocaciones de los mercados financieros
Invierte en una cesta de acciones o bonos que conforman un mercado o segmento del mismo.	Invierte en activos individuales como bonos o acciones
Comisiones reducidas	Comisiones más elevadas que la pasiva
No requiere grandes conocimientos financieros	Requiere conocer el mercado y estar atento a sus movimientos. Esto implica tener un equipo de analistas que aumenta el coste de la gestión.
No requiere un seguimiento exhaustivo de las inversiones por el equipo gestor desde un punto de vista financiero	Requiere un seguimiento diario de las inversiones por parte del equipo gestor

¿Qué elementos para elegir un ETF?

TER (Total Expense Ratio): Debe estar < 0.5% anual

Tracking Error: Cuanto menor sea el tracking error, más eficiente será la réplica del ETF.

Exposición e Índice al que sigue

Mercado en el que cotiza

Volumen: Alto volumen frente a otros índices.

Spread: Sea lo menor

Método de Replicación

¿Qué se busca con el proyecto?

- ☐ Decidir cuándo y si invertir en un ETF que siga al nasdaq o mantenerse fuera del mercado. Financiera.
- ☐ Enmarcar la decisión financiera como un problema de Machine Learning.
- ☐ Crear una variable objetivo adecuada. (Predecir el precio de las acciones para su compra y venta. 1 día en el futuro)
- ☐ Encontrar un modelo utilizando 1 o varias técnicas de Machine Learning. (Modelo de clasificación)
- ☐ ¿Qué parámetros se tuvo en cuenta para escoger el índice de ETF?
- ☐ Elementos para elegir un ETF, principalmente el VOLUMEN, TIER Y el METODO DE REPLICA FISICA.
- ☐ Inversión PASIVA.
- ☐ Datos financieros gratuitos y reales.