

Objetivo de la práctica de sesión 7 y 8

Para una serie de acciones de renta variable, construiremos una cartera de activos, en base a los siguientes datos y señales.

1. Datos
 - a. Series de Precios.
 - b. Rentabilidades a diferentes periodos.
 - c. Datos fundamentales de cada acción: PER, Price to book, dividendos, crecimiento beneficios, etc...
 - d. Recomendaciones de analistas y brokers sobre las acciones.
 - e. Datos de sentimiento (Twitter, isentimun.)
 - f. Otros datos que nos den señales sobre las acciones (informes, text mining.).
2. Con estos datos, establecer modelos de predicción de rendimientos
 - a. Cross sectional momentum a diferentes horizontes de inversion.
 - b. Contrarían.
 - c. Ranking por ratios fundamentales
 - d. Ranking por preferencias de analistas
 - e. Ranking por sentimientos
 - f. Otros
3. Establecer para cada modelo posiciones largas, cortas, número de posiciones y nivel de inversión.
4. Dar peso a cada modelo y calcular el rendimiento de la cartera agregada por modelo, junto con su volatilidad asociadas.
5. Hallara las correlaciones con activos tradicionales y modelos de regresión.
6. Conclusiones sobre la metodología y ventajas y desventajas de cada modelo aplicado.