

Objetivo de la práctica de sesión 5 y 6

1. Extraer datos relacionados con activos.
 - a. Precios.
 - b. Indicadores macro, fundamentales de los activos
2. Con estos datos, establecer modelos de predicción de rendimientos
 - a. Tendencias con precios
 - b. Modelos de reversión con precios
 - c. Modelos de carry con datos de rendimientos implícitos y precios
 - d. Modelos de relación entre comportamiento activos e indicadores macro.
3. Establecer pesos de cada señal.
 - a. De forma discrecional
 - b. A través de métodos mas cuantitativos: patrones de reconocimientos o estudios de correlaciones entre señales, mejores comportamientos en el pasado, etc.
4. A partir de estas señales, construir la cartera de activos.
 - a. Calcular para cada activo su rentabilidad / riesgo a partir de combinación optima de estrategias.
 - b. Presupuesto de riesgo (fronteras eficientes) entre activos.
 - c. Saber no solo peso sino como queda la contribución a riesgos.
 - d. Efecto de diversificación por activos.
 - e. Distribución de rendimientos.