

ESTUDIO BOLSA AMERICANA

Proyecto de EDA del S&P500, Oro y principales sectores de Estados Unidos

Adrián Ruiz Donado

CONTENIDO

01

Resumen

02

Objetivos

03

Hipótesis

04

Índices

05

FANG y BRK-B

06

Sectores

07

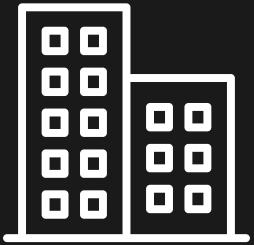
Conclusión

08

Contacto



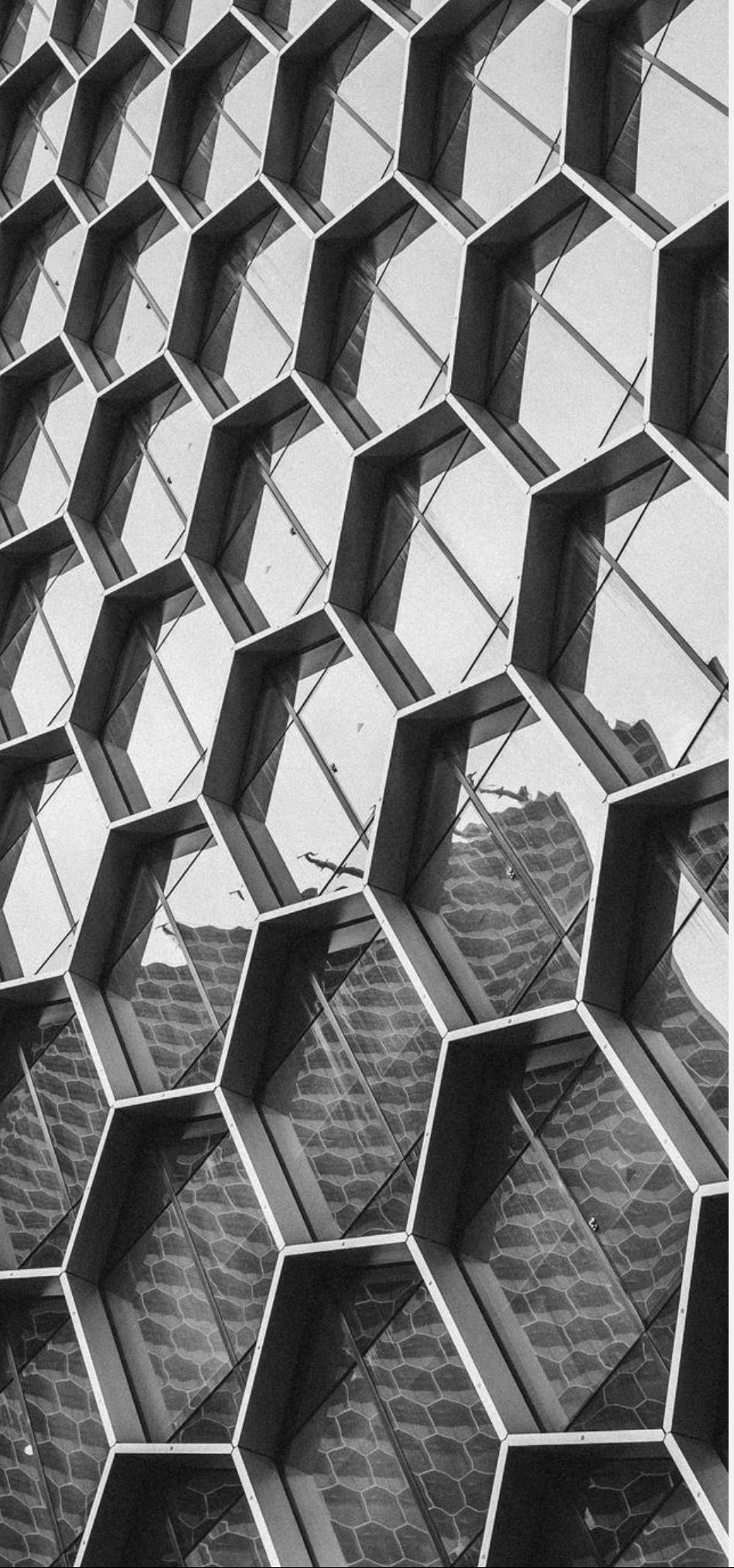
RESUMEN DEL PROYECTO



En el contexto actual de inflación se ha vuelto más necesario que nunca elegir los mejores vehículos de inversión para proteger el patrimonio personal.



El Oro, indexarse al S&P500 o invertir en las principales tecnológicas, industriales o bancos siempre han sido los métodos más atractivos; pero ha llegado la hora de compararlos y estudiarlos.



OBJETIVOS



Objetivo n° 1

Buscar la mayor rentabilidad



Objetivo n° 2

Encontrar los mejores sectores



Objetivo n° 3

Validar y definir una tesis de inversión usando valores analíticos cuantificables



HIPÓTESIS



Hipótesis n° 1

El S&P500 es el índice con mayor rentabilidad



Hipótesis n° 2

El oro es el segundo valor en el que invertir



Hipótesis n° 3

BRK-B y FANG son los valores que más aportan al índice



Hipótesis n° 4

Los sectores más atractivos de USA son las tecnológicas



Hipótesis n° 5

Tesis de inversión

HIGHLIGHTS

Datasets

- o 1 dataset de 8 Gb
- o 3 dataset creados
- o 2 índices, evoluciones
- o Librería Yahoo Finance

01



Estado datos

- o Pocos NaN
- o Fechas object
- o Columnas superfluas

02



03

Limpieza y tratamiento de datos

- o Llenado con YFinance
- o Fechas a Datetime
- o Generación índice FANG

Tendencia del oro vs. S&P 500



ÍNDICES

- o Tendencia alcista
- o Periodo de 10 años
- o Fuerte correlación



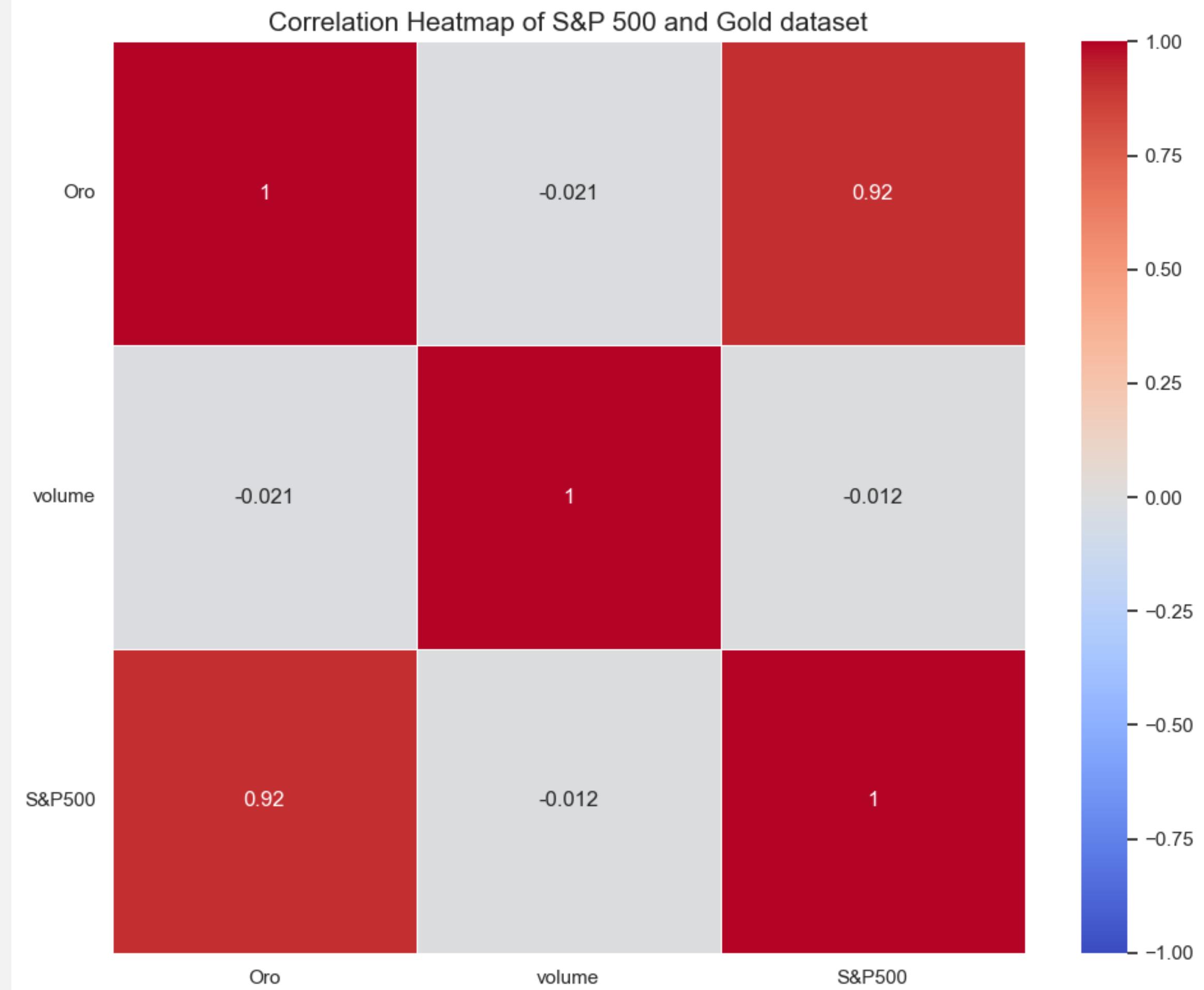
ORO



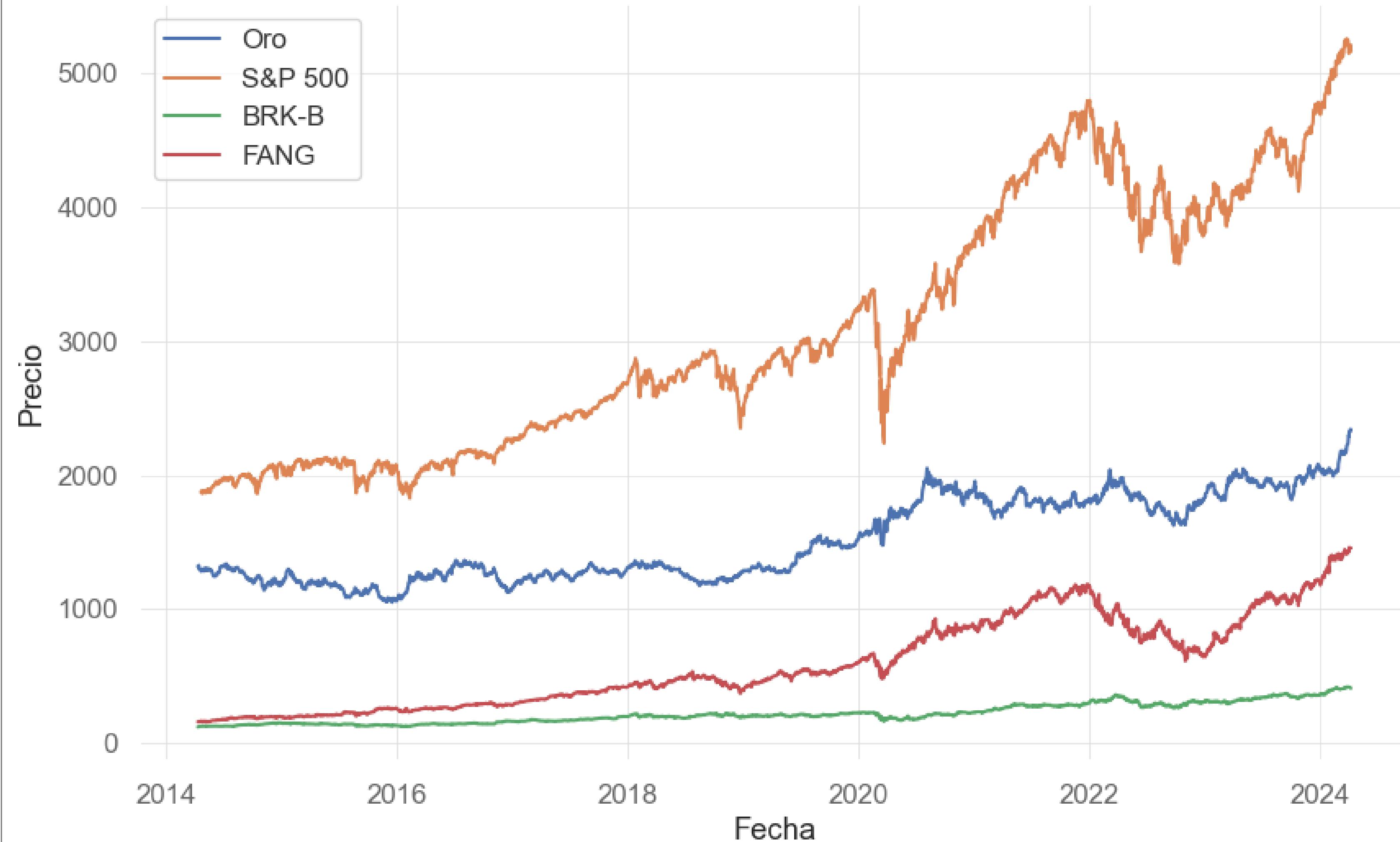
S&P500

82% Rentabilidad

175% Rentabilidad

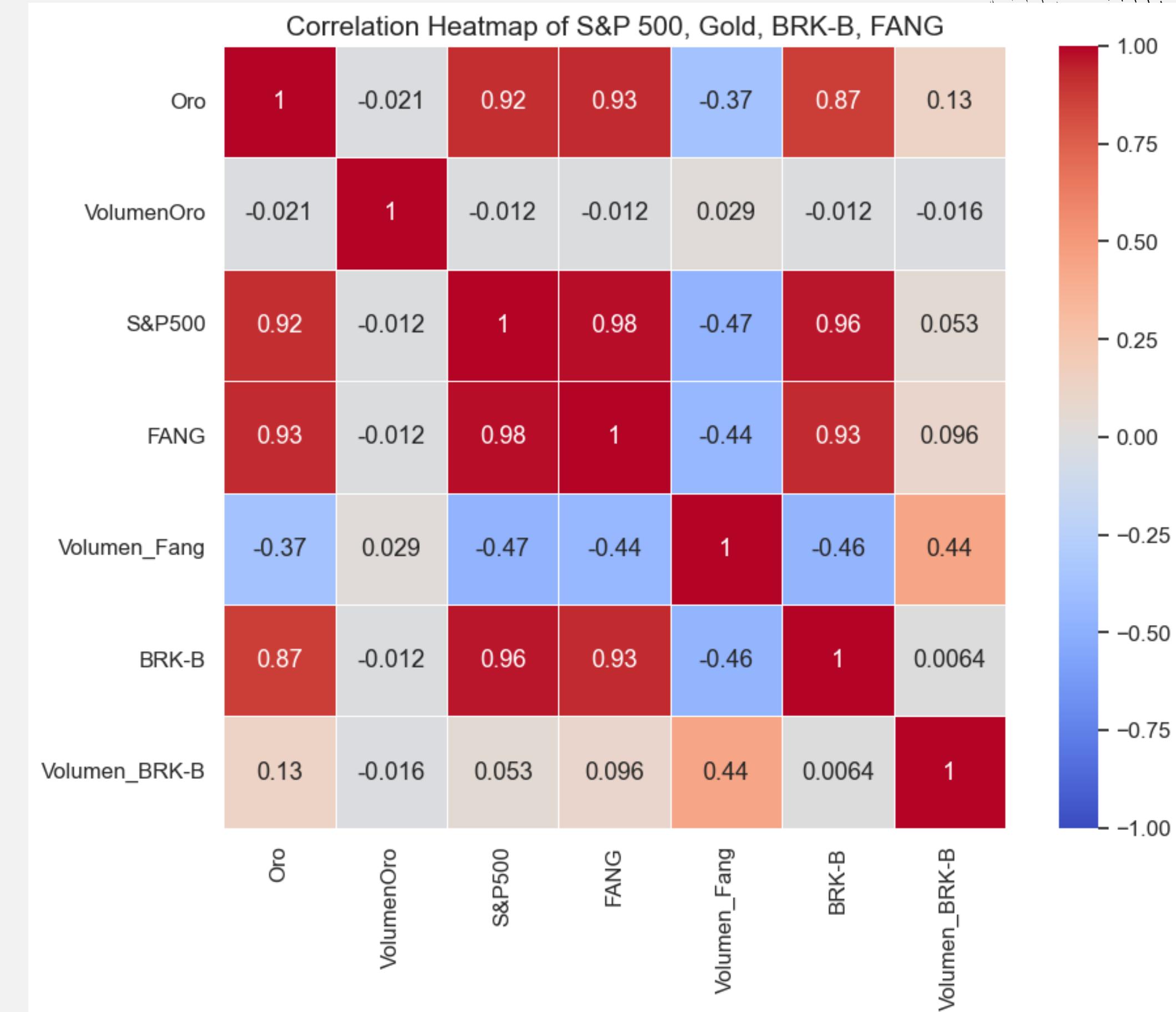


Tendencia del oro vs. S&P 500 vs FANG vs BRK-B



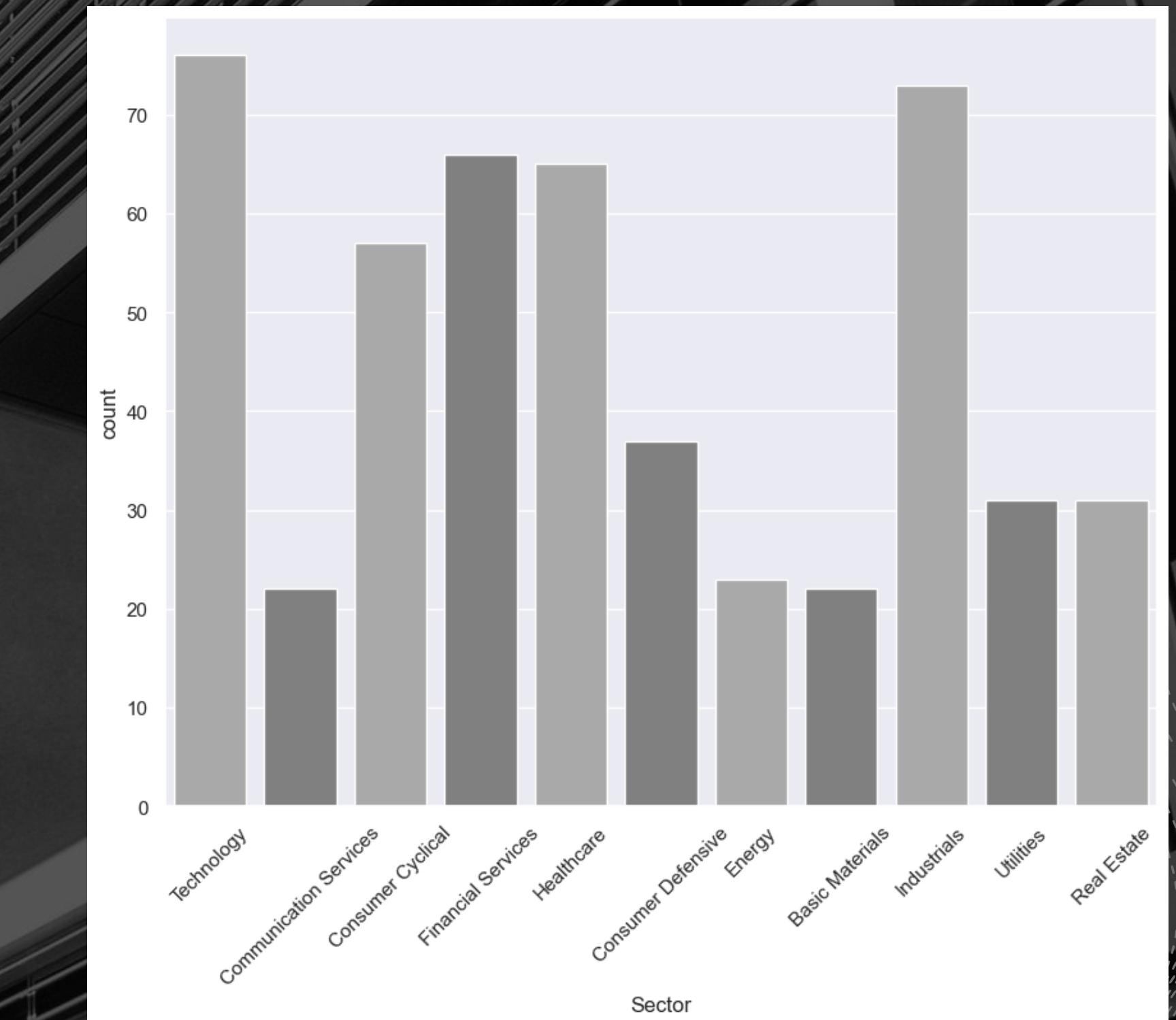
FANG Y BRK-B

- S&P500 tiene una fuerte relación con las FANG (22% de su capitalización)
- BRK-B empresa fuerte correlación con el SP500 y menor con el oro. Su peso menor al 2% del índice
- Los volúmenes de negociación tienen una correlación negativa notable con los índices.
- El volumen de BRK-B tiene una correlación notable con el volumen de las FANG, es habitual encontrarte un mix de inversión en superinversores

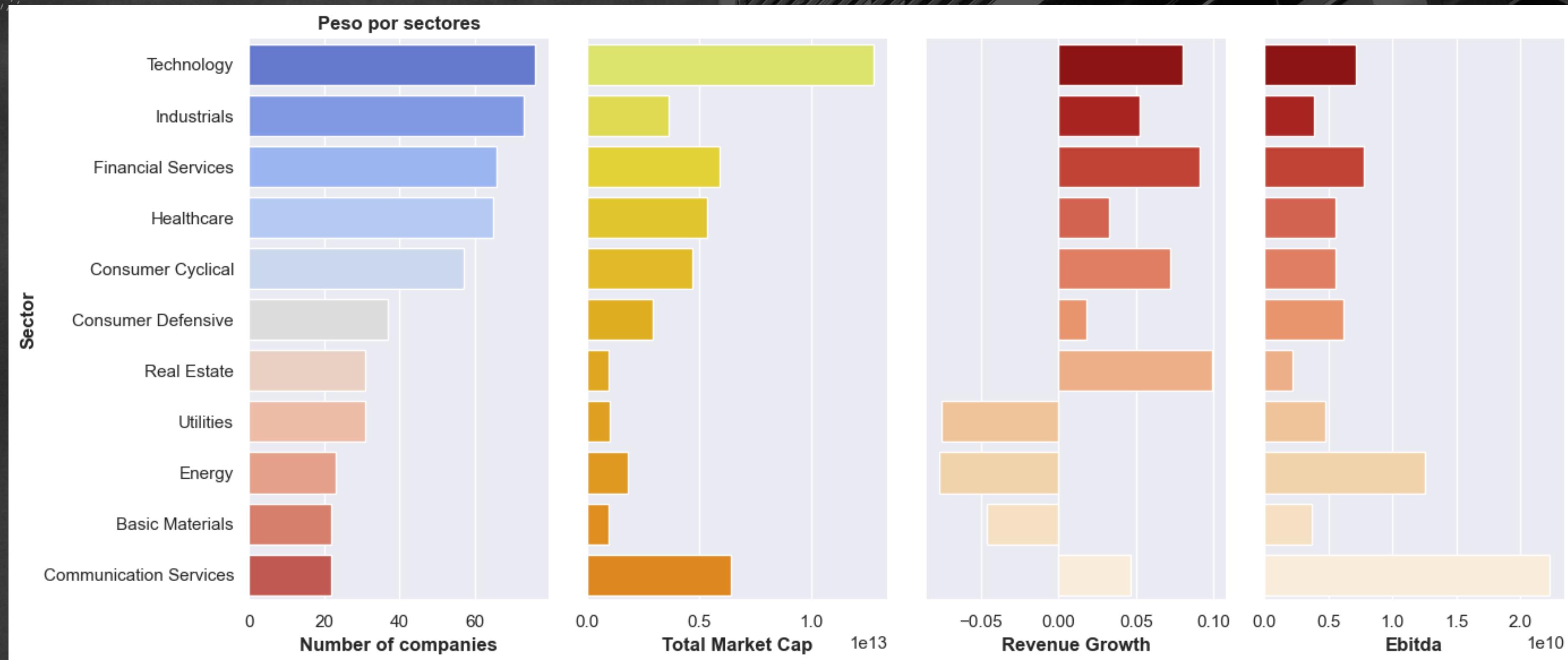


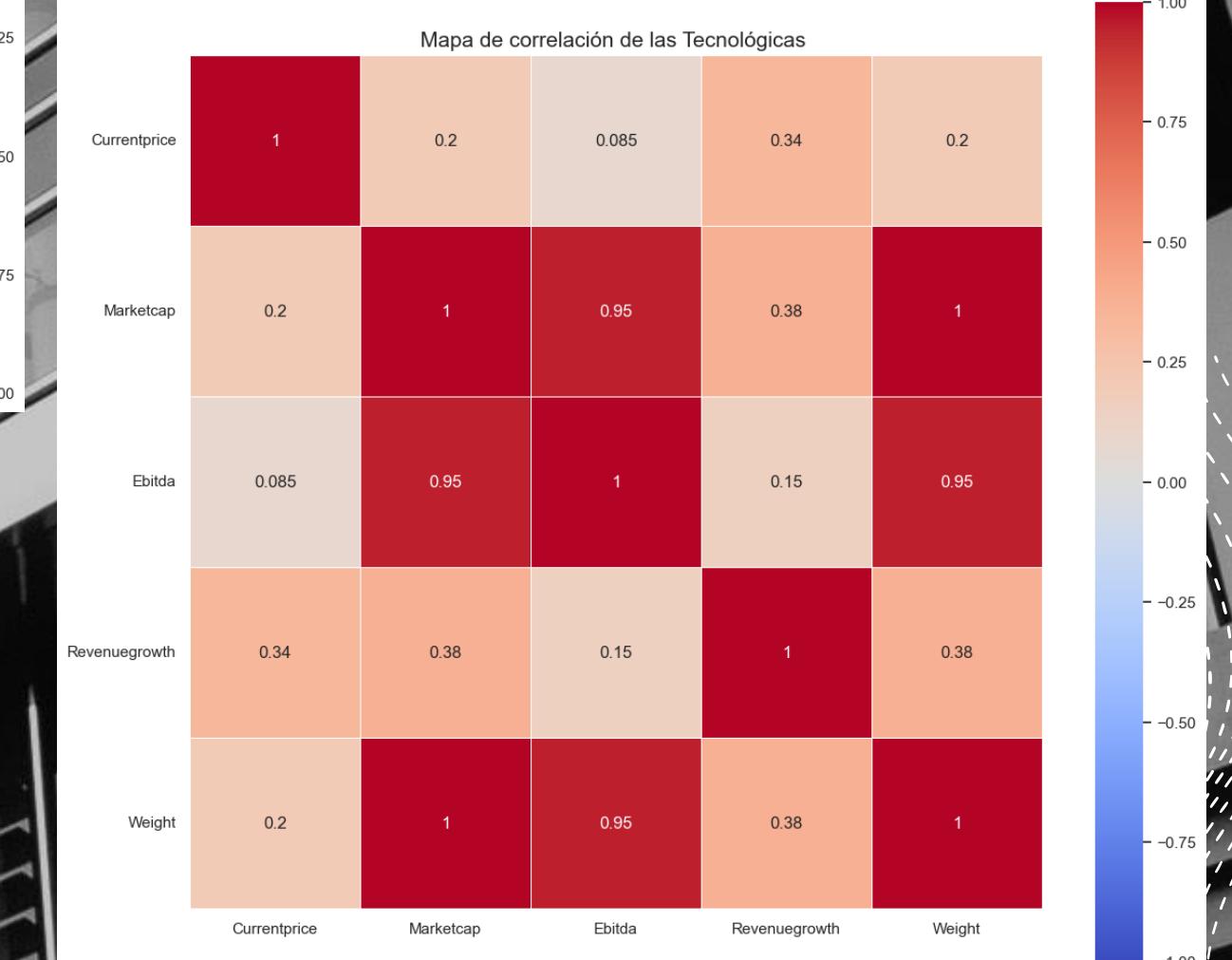
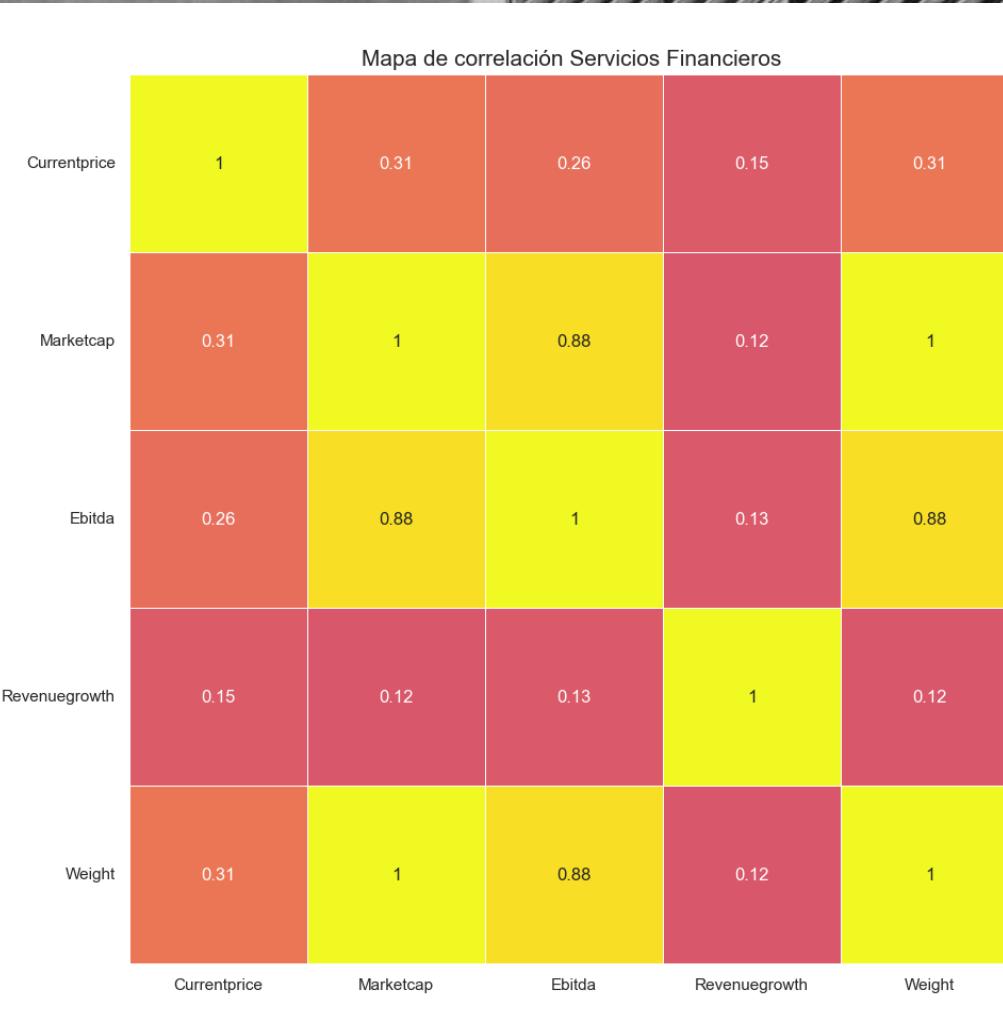
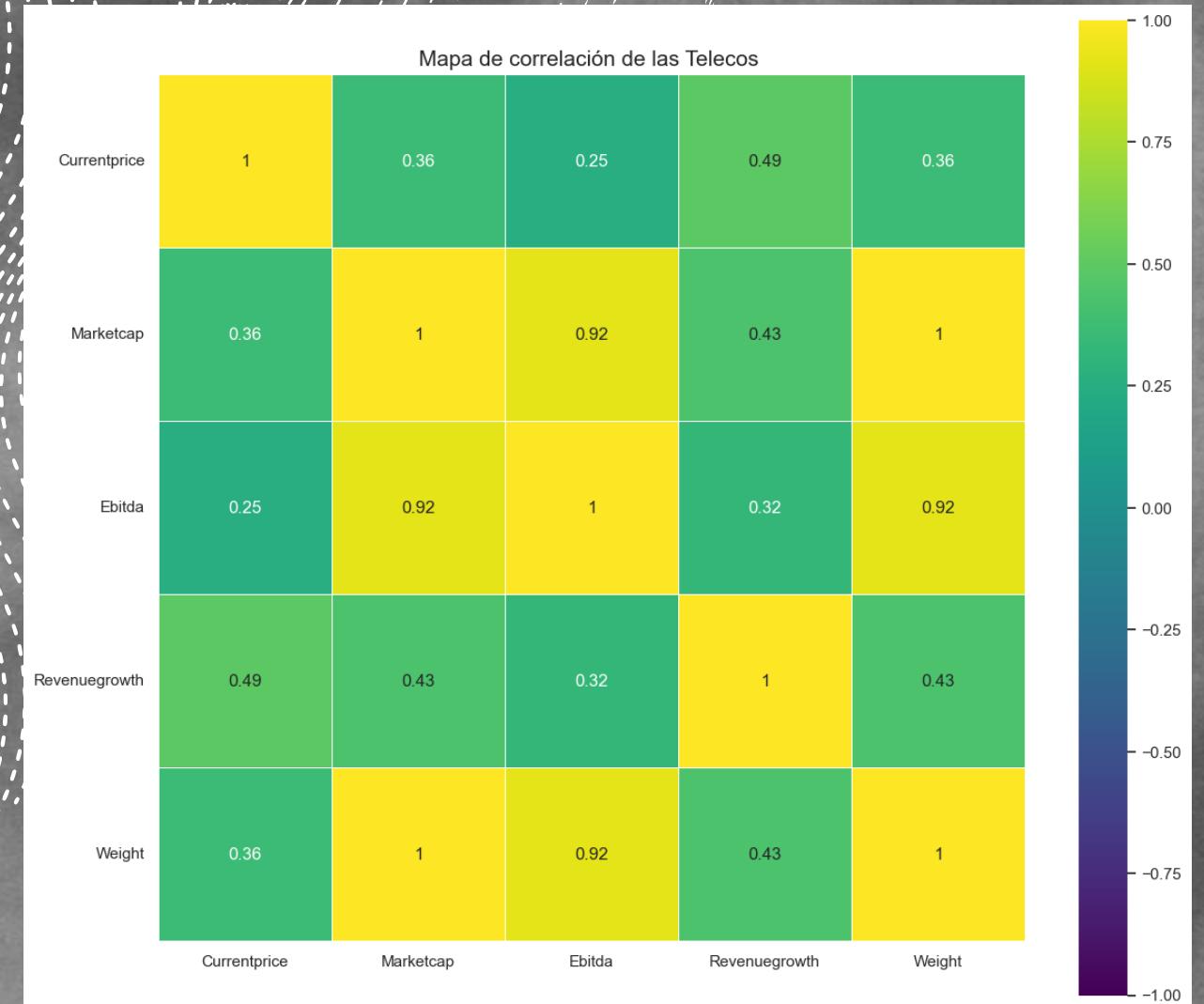
SECTORES

Consumer Cyclical
Financial Services
Communication Services
Healthcare
Basic Materials Real Estate
Industrials
Utilities Energy
Technology
Consumer Defensive



SECTORES





CONCLUSIONES

Hipótesis 1-2

- El SP500 tuvo una rentabilidad del 175% estos últimos 10 años mientras que el oro fue el 80%
- Existe una fuerte correlación entre ambos valores en el largo plazo.
- Validamos ambas hipótesis

Hipótesis 3

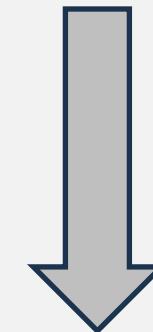
- Se confirma el elevado peso de las FANG y de BRK-B en el índice.
- Se observan correlaciones que pueden ser útiles en un modelo.
- **Válidamos la hipótesis**

Hipótesis 4

- Los mejores sectores en el 2023 son el tecnológico, telecomunicaciones y financiero.
- Se observan correlaciones parecidas por sector
- Validación parcial de la hipótesis

Hipótesis 5

- Tenemos un conjunto de variables relacionadas.
- ¿FACTORIZAR?
- ¿CREAR UN MODELO?



MACHINE LEARNING

**En caso de duda o consulta,
póngase en contacto con:**



Adrián Ruiz Donado

-  +34 647158470
-  adrian.ruiz.donado@gmail.com
-  <https://github.com/adriani94bil>
-  Bilbao

¡GRACIAS POR SU ATENCIÓN