

Proyecto algoritmos

Sebastian Castañeda Romero

February 2020

1 introduccion

FactSet Estimates - Broker Recommendations es un conjunto de datos global que proporciona información basada en recomendaciones de corredores de consenso. Al aprovechar los datos de las recomendaciones de los corredores, puede analizar las recomendaciones de consenso de calles de un activo basado en una escala de calificación unificada.

Los datos de las recomendaciones de los corredores están disponibles a través de Pipeline API, lo que significa que se puede acceder en Research y en IDE.

La base de datos de FactSet Estimates crea un diccionario de recomendaciones para cada agente que indica exactamente cómo cada una de sus recomendaciones corresponde a las propias categorías de FactSet. FactSet Estimates implementa este sistema para mantener las recomendaciones consistentes en la base de datos FactSet. No todos los corredores usan las mismas recomendaciones que FactSet tiene en su lugar; por lo tanto, FactSet trabaja con todos sus colaboradores para asignar correctamente sus recomendaciones. Al hacerlo, FactSet garantiza que las recomendaciones de sus colaboradores se capturen correctamente en la Base de datos de estimaciones.

2 Variables

Las recomendaciones de los corredores de consenso de FactSet se dividen en cinco grandes categorías: buy, overweight, hold, underweight y sell. Luego, se le otorga un rating de entre 1 y 3 se atribuye a cada categoría.

2.1 buy

Rating 1 tipo de dato float64

El número de recomendaciones en el consenso que entran en la categoría de buy.

2.2 Overweight

Rating 1.5 tipo de dato float64

El número de recomendaciones en el consenso que se incluyen en la categoría overweight.

2.3 Hold

Rating 2 tipo de dato float64

El número de recomendaciones en el consenso que entran en la categoría hold.

2.4 Underweight

Rating 2.5 tipo de dato float64

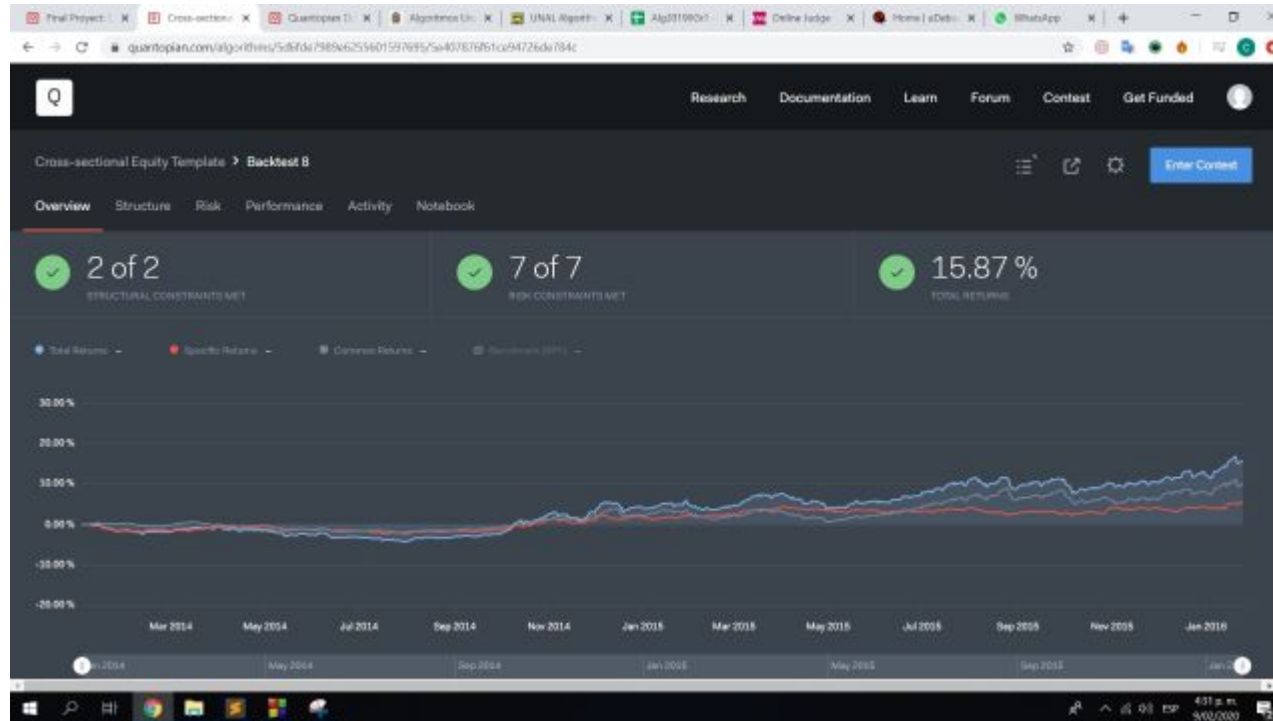
El número de recomendaciones en el consenso que entran en la categoría underweight.

2.5 Sell

Rating 3 tipo de dato float64

The number of recommendations in the consensus that fall into the sell category sell.

3 Resultados



Podemos ver en los resultados despues de correr el codigo del 2014 al 2016 que al principio durante los primeros meses no es muy efectivo pero entre septiembre y noviembre se estabiliza y comienza a tener rentabilidad hasta llegar a un 15.87 porciento.