

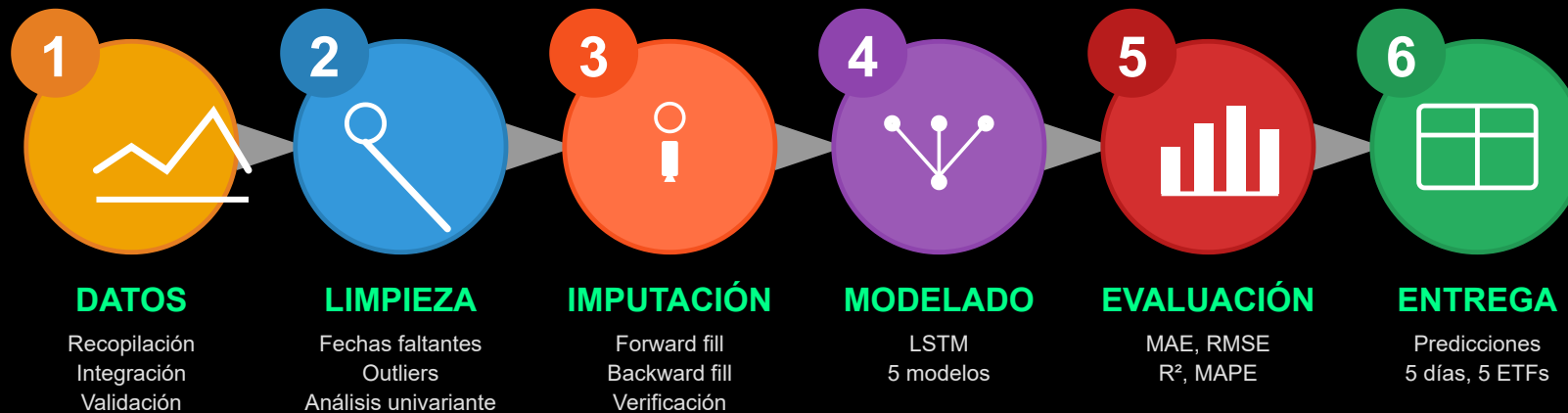
Predicción de ETFs

- Objetivo: Estimar precios a 5 días
- Público: No técnico



Autores:
Catherine Cazorla
Jesús Jiménez
Carlos Mairena¹

Flujo de Trabajo



Fuentes de Datos y Variables



Integración del Dataset

- Unir ETFs + Variables Exógenas
- Calendario y Trazabilidad de Fechas

Flujo Moderno de Sincronización de Datos Financieros



Causas de Datos Faltantes

Análisis de patrones de datos ausentes en mercados financieros

FINES DE SEMANA



Frecuencia:
52 fines de semana/año
~104 días sin datos

Mercados cerrados
Patrón predecible
40% datos faltantes

40%
de días del año

FERIADOS EE.UU.

	Año Nuevo	1 de enero
	Martin Luther King Jr.	3er lunes de enero
	Día del Presidente	3er lunes de febrero
	Viernes Santo	Variable (marzo-abril)
	Memorial Day	Último lun. de mayo
	Día de la Independencia	4 de julio
	Día del Trabajo	1er lun. de septiembre
	Acción de Gracias	4to jue. de noviembre
	Navidad	25 de diciembre

CIERRES EXTRAORDINARIOS



11 de Septiembre 2001
Ataque terrorista en NYC
Cierre: 4 días consecutivos
11-14 septiembre



Huracán Sandy 2012
Desastre natural
Cierre: 2 días
29-30 octubre

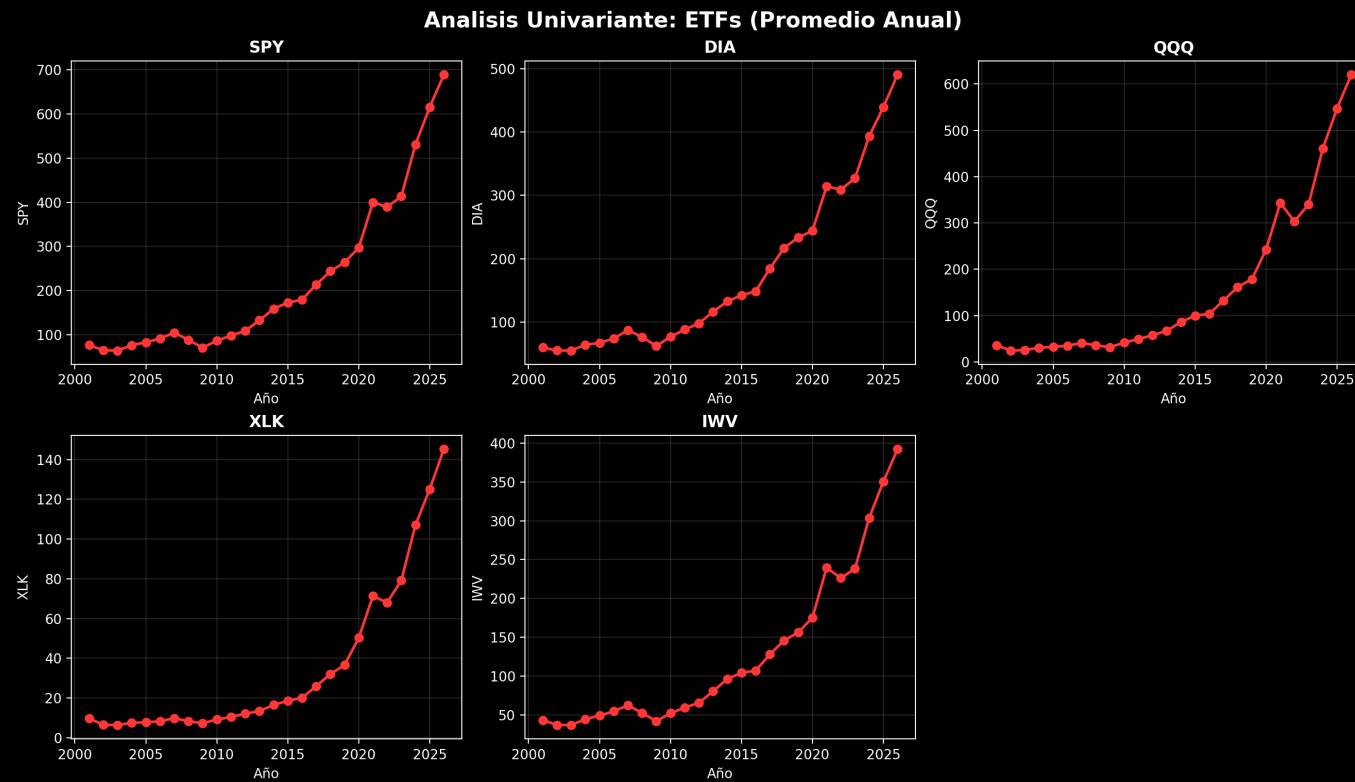


Pandemia COVID-19 2020
Crisis sanitaria global
Alta volatilidad - Sin cierre total
Circuit breakers activados

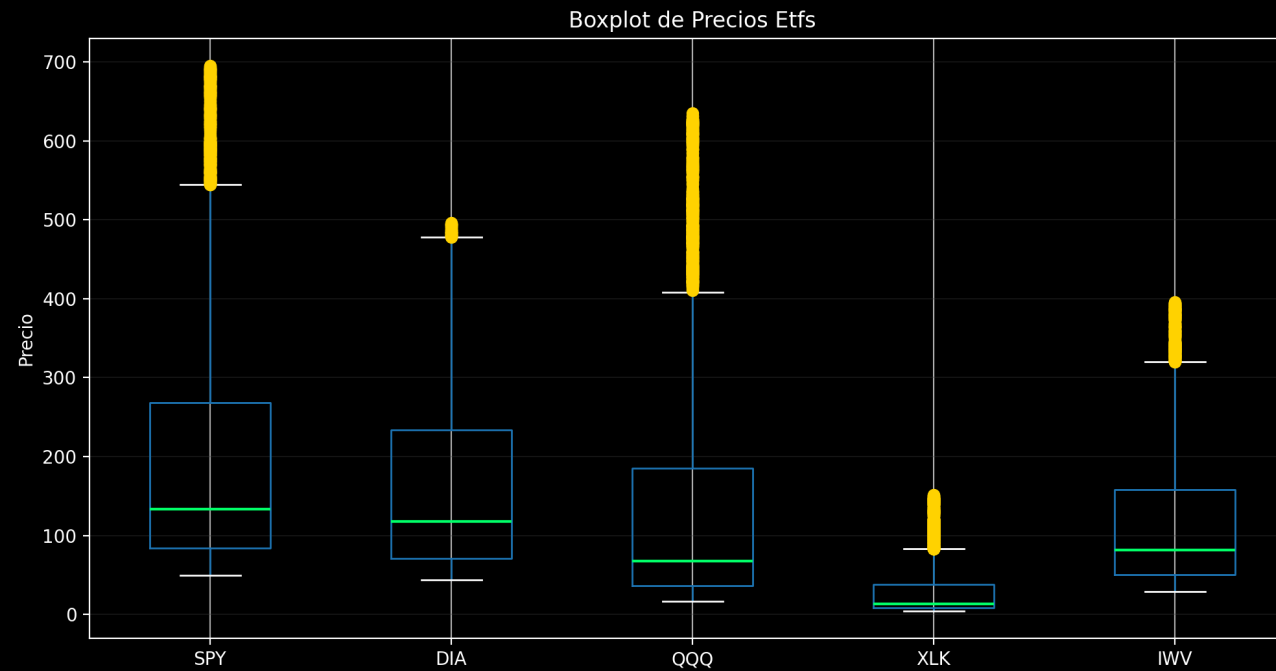


Funerales de Estado
Presidentes Ford (2007), Bush (2018)
Cierre: 1 día por duelo nacional
Cierres excepcionales

Análisis Univariante



Análisis de Outliers



Métodos de Imputación

- Forward Fill - Backward Fill

1. DATOS ORIGINALES (con valores faltantes)



2. FORWARD FILL (Propaga últimos valores válidos hacia adelante)

Rellena huecos con el último valor disponible antes del NaN



3. BACKWARD FILL (Propaga próximos valores válidos hacia atrás)

Rellena huecos con el próximo valor disponible después del NaN



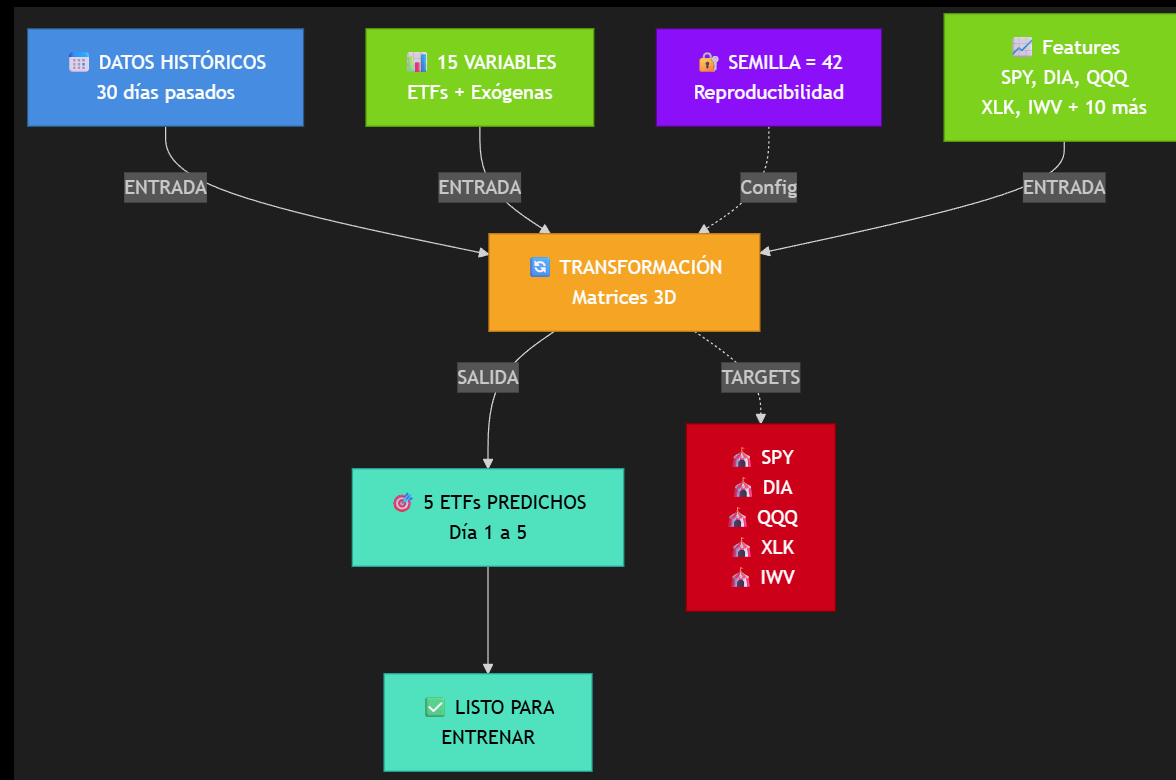
Forward Fill RECOMENDADO

- ✓ Altamente confiable
- ✓ Precio anterior es buen predictor
- ✓ Estándar en finanzas

Backward Fill COMPLEMENTARIO

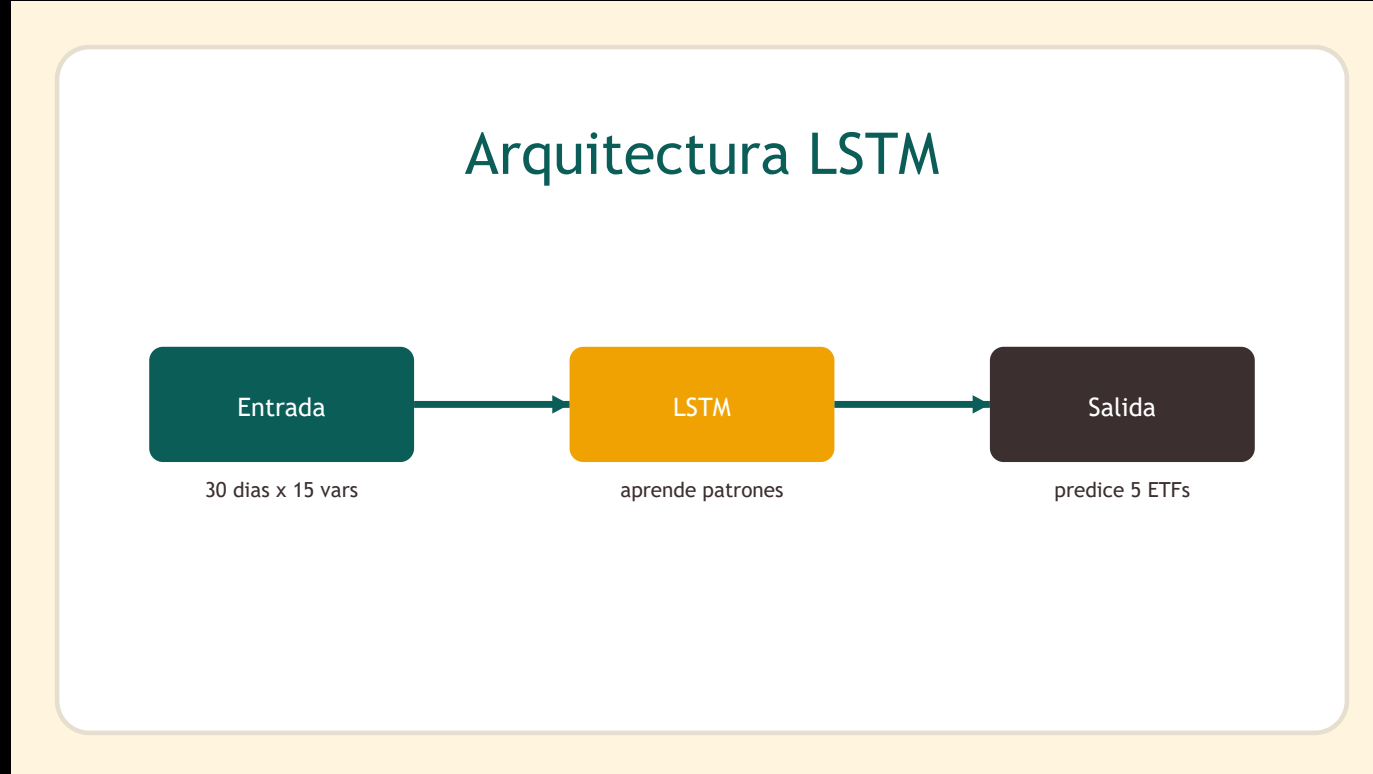
- ✓ Confiable y seguro
- ✓ Datos iniciales faltantes
- ✓ Propaga hacia atrás
- ✓ Complementa Forward Fill

Preparación de Datos Para Modelos



Modelado (LSTM)

- Modelos directos por día
- Datos recientes (5 años)



Evaluacion y validacion

- MAE, RMSE, R^2 , MAPE
- Walk-forward y validacion cruzada

Metricas reales (metodo directo)

Dia	MAE	RMSE	R2	MAPE (%)
1	21.33	26.22	0.25	4.96
2	17.84	22.46	0.42	4.04
3	20.78	26.93	0.19	4.81
4	21.03	25.89	0.21	4.91
5	20.24	25.72	0.31	4.67

Valores calculados en el notebook (datos recientes)

Entrega de predicciones

- 5 dias laborales
- Resumen por ETF

Tablero de resultados

ETF	Dia 1	Dia 5
SPY	\$647.76	\$654.02
QQQ	\$560.82	\$571.21
DIA	\$461.96	\$461.69
XLK	\$132.04	\$132.14
IWV	\$365.69	\$371.07

Ejemplo de tabla final para el usuario