

Universidad Panamericana

Análisis estadístico de los precios de acciones de Apple Inc. (AAPL)

Presentado por:

Javier Horacio Pérez Ricárdez

Análisis estadístico de los precios de acciones de Apple Inc. (AAPL)

Javier Horacio Pérez Ricárdez

Curso: Estadística para la investigación
Dra.: Gabriela Macías Esquivel

2 de octubre de 2024

Introducción

El análisis estadístico de los mercados financieros es una herramienta esencial para la toma de decisiones informadas en el ámbito de las inversiones. Este estudio se enfoca en el comportamiento de los precios de las acciones de Apple Inc. (AAPL) mediante el uso de diversas técnicas estadísticas.

Definición del Tema

El tema a estudiar es el análisis estadístico de los precios de acciones de AAPL, enfocado en la distribución de los precios, la normalidad de los datos y su relación con otras variables financieras como el volumen.

Objetivo del Proyecto

Proporcionar un análisis detallado de las características estadísticas de los precios de las acciones de AAPL, utilizando herramientas como:

- ▶ Intervalos de confianza
- ▶ Pruebas t
- ▶ Análisis de varianza (ANOVA)
- ▶ Modelos de regresión

Metodología

- ▶ Descarga de datos de Yahoo Finance.
- ▶ Cálculo de estadísticos descriptivos y pruebas de normalidad.
- ▶ Análisis de intervalos de confianza y pruebas t para comparar medias.
- ▶ Modelos de regresión lineal para analizar la relación entre precio de cierre y volumen.
- ▶ Análisis categórico utilizando percentiles.
- ▶ Análisis de varianza (ANOVA) para comparar los precios de cierre en diferentes periodos.

Importancia del Proyecto

Este análisis es crucial para:

- ▶ Comprender mejor la volatilidad del mercado.
- ▶ Tomar decisiones informadas.
- ▶ Aportar valor práctico a inversores y analistas financieros.

Impacto Social del Proyecto








Este proyecto permite a pequeños y medianos inversores acceder a herramientas estadísticas avanzadas, promoviendo la inclusión financiera. Al democratizar el análisis financiero, se facilita la toma de decisiones informadas y se desarrolla habilidades analíticas en una base más amplia de inversores.

Fomenta la educación financiera, creando un entorno de aprendizaje práctico que mejora la alfabetización financiera. Esto empodera a individuos de diversos contextos económicos, promoviendo una mayor estabilidad económica y una distribución más equitativa de la riqueza.

Conclusiones

El análisis estadístico de los precios de acciones no solo es relevante en el ámbito académico, sino que también ayuda a los inversores a tomar decisiones basadas en datos concretos y análisis rigurosos.

Referencias

-  <https://finance.yahoo.com/>
-  <https://proyecto-final-8bpaaofmufw3ggufsp8ble.streamlit.app/>
-  Fama, E. F., & French, K. R. (1992). The Cross-Section of Expected Stock Returns. *Journal of Finance*, 47(2), 427-465.
-  International Monetary Fund. (2018). Global Financial Stability Report: A Fair and Effective Financial System.
-  Nippani, S., & Washer, K. (2004). The relationship between trading volume and stock returns: Evidence from the US markets. *International Journal of Business and Economics*, 3(1), 73-82.
-  Neely, C. J., & Weller, P. A. (2010). The relationship between stock market returns and trading volume: A cross-country analysis. *Financial Review*, 45(4), 955-979.
-  Schwert, G. W. (1989). Why Does Stock Market Volatility Change Over Time? *Journal of Finance*, 44(5), 1115-1153.

Agradecimientos

Gracias por su atención. Espero que esta presentación les haya proporcionado una visión clara sobre el análisis estadístico de los precios de acciones de Apple Inc. (AAPL).