

Seminario 2

Trading Estacional en Renta Variable

Fecha: domingo 17 de enero, 2021

Horario: de 10:00 a 14:15

Duración: 4 horas.

PONENTE:

ROBERTO MARCOS

Trader institucional. Experto en el diseño de algoritmos de inversión mediante reglas mecánicas robustas, machine learning, inteligencia artificial y data mining. Fundador de varias startups tecnológicas, más de 14 años de experiencia en la inversión cuantitativa tanto como investigador como inversor. Su operativa no se fundamenta en el uso de indicadores ni en el análisis gráfico, sino en la búsqueda de anomalías recurrentes que le proporcionen una ventaja estadística.

PROGRAMA:

Módulo 1. Introducción a la Estacionalidad

- ¿Qué es la estacionalidad?
- ¿Por qué se produce la estacionalidad?
- Tipos de estacionalidades

Módulo 2. Diseños de herramientas de búsqueda estacional básica

- Estrategias de búsqueda rápida
- Estrategias de búsqueda profunda
- Estrategias de búsqueda en proximidad de “festivos”
- Carteras estacionales de invierno para Renta Variable americana
- Carteras estacionales de invierno para Renta Variable europea

Módulo 3. Diseño de búsqueda Estacional Avanzado con Stock Picking

- Técnica de Búsqueda Inversa usando ETFs.
- Técnica de Búsqueda por Tramos.
- Validación de Filtros Stock Picking.

Módulo 4. Filtros de Marketing Timing con datos fundamentales

- Con datos de empleo.
- Con datos intermercados.

Módulo 5. Técnicas Avanzadas

- Selección de zonas robustas.
- Filtros de liquidez.
- Validación cruzada.
- Diseño con deslistadas
- Estrategias de incorporación
- Creación y ejecución de órdenes

Módulo 6. Construcción del Calendario de Carteras Estacionales