

Proyecciones Basadas en Caminatas Logarítmicas

Predicciones de Mercado usando Proyecciones Log-Normales y Modelos ARIMA

Inicio: Abril 2024 Fin: Abril 2025

Acciones recomendadas para invertir a la baja

Conociendo la estrategia

I. Proyección del S&P 500 a 1 año con diferentes rangos de confianza

Utilizamos el índice del S&P 500 para mostrarte como se ven y como es el funcionamiento de las caminatas logarítmicas y como funcionan los rangos de confianza

```

WolframAlpha["PROJECTION NYSE:SPGI",
WolframAlpha
IncludePods {"Projections", AppearanceElements {"Pods"},
incluye cápsulas
Elementos de apariencia
TimeConstraint {20, Automatic, Automatic, Automatic}]
límite de duración
automático
automático
automático
    
```

Out[]=



Iniciando el modelo ARIMA (Autorregresivo Integrado de Media Móvil)

II. Información de los títulos

Estos títulos fueron rankeados y seleccionados por nuestro algoritmo entre 2000 títulos, los cuales en este caso tienen mayor probabilidad de disminución de su valor. Por esta razón son las acciones que recomendamos invertir a la baja.

```

In[ ]:= sts={"NYSE:ES", "NYSE:HRL", "NYSE:EL", "NYSE:TSN", "NYSE:BAX", "NYSE:CCI",
           "NASDAQ:WBA", "NYSE:DG", "NYSE:D", "NYSE:PFE", "NYSE:FMC", "NYSE:VFC"};
           [deriva]

properties1={"Symbol", "Name", "Price", "Volume", "Dividend"};
           [símbolo]           [volumen]

dat = Table[FinancialData[s,p],
           [tabla] [datos financieros]
           {s,sts}, {p,properties1}];

ststable=
  Style[TableForm[dat, TableHeadings[None, Style[#, Bold]&/@{"Ticker Symbol",
  [estilo] [forma de tabla] [cabeceras de tabla] [nin...] [estilo] [negrita] [símbolo]
           "Name", "Current Price", "Volume", "Dividend"}]], FontFamily["Verdana", 14]
           [volumen]           [familia de tipo de letra]

```

Out[]=

Ticker Symbol	Name	Current Price	Volume
NYSE:ES	Eversource Energy	\$ 60.84	2 087 281 shares
NYSE:HRL	Hormel Foods	\$ 35.60	823 794 shares
NYSE:EL	Estee Lauder	\$ 147.36	1 840 565 shares
NYSE:TSN	Tyson Foods	\$ 61.32	1 797 131 shares
NYSE:BAX	Baxter	\$ 40.93	2 161 941 shares
NYSE:CCI	Crown Castle International	\$ 95.44	2 968 232 shares
NASDAQ:WBA	Walgreens Boots Alliance	\$ 17.81	2 977 918 shares
NYSE:DG	Dollar General	\$ 143.16	486 441 shares
NYSE:D	Dominion Resources	\$ 51.23	885 853 shares
NYSE:PFE	Pfizer	\$ 26.27	6 328 091 shares
NYSE:FMC	FMC	\$ 58.40	1 011 108 shares
NYSE:VFC	VF	\$ 12.99	2 000 334 shares

III. Comportamiento historico

Evaluación del comportamiento histórico de los títulos

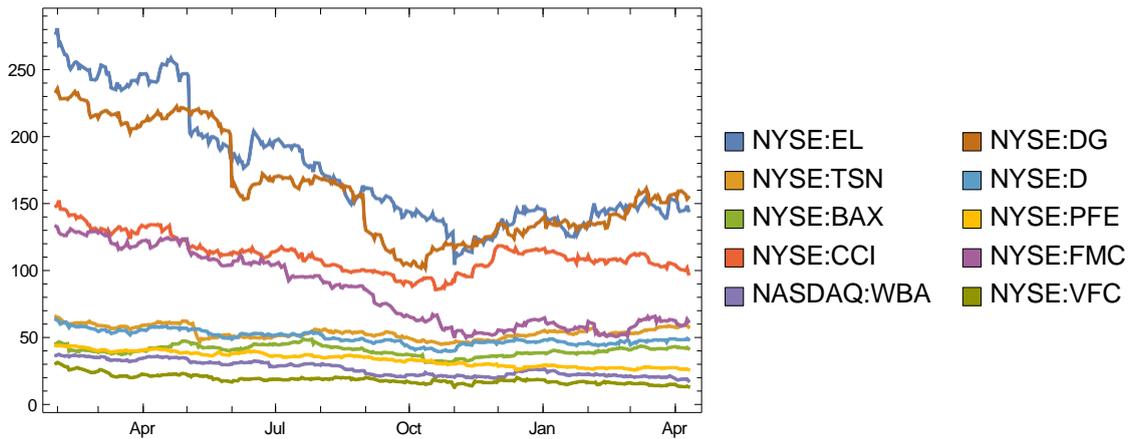
```

In[ ]:= sp500const = {"NYSE:EL", "NYSE:TSN", "NYSE:BAX", "NYSE:CCI",
                    "NASDAQ:WBA", "NYSE:DG", "NYSE:D", "NYSE:PFE", "NYSE:FMC", "NYSE:VFC"};
                    |deriva

sp500ts =
  TimeSeries[FinancialData[#, "Close", {{2023, 02, .1}, {2024, 4, 10}}]] & /@
  |serie temporal |datos financieros |cierra
  sp500const;
DateListPlot[sp500ts,
  |representación de lista respecto a fechas
  PlotLegends[SwatchLegend[sp500const, LegendLayout -> {"Column", 2}]]
  |leyendas de rep |color leyenda |disposición de leyenda |columna

```

Out[]:=



IV. Simulación de diversificación del portfolio

En este apartado haremos una simulación en la cual se dividirán los recursos de forma equiperada.

```

In[ ]:= alloc =
  {0.1000, 0.1000, 0.1000, 0.1000, 0.1000, 0.1000, 0.1000, 0.1000, 0.1000, 0.1000};

```

```

In[ ]:= portfolio=TimeSeriesThread[alloc.&#,sp500ts]

```

Out[]:=



V. Visualización de datos historicos agrupados:

Utilice este grafico como guía del comportamiento histórico acumulado de los títulos

```

In[ ] := pc = PieChart[alloc,
  |diagrama circular
  ChartLabels Placed[Style[#, Small, Italic, FontFamily Helvetica] & /@
  |etiquetas de día |colocado |estilo |tamañ |itálica |familia de tipo de letra
  sp500const, "RadialCallOut"],
  ColorFunction DarkBands,
  |función de color
  SectorOrigin {π/4, "Clockwise"}, ChartStyle Opacity[.6],
  |origen de sector |estilo de diag... |opacidad
  ImageSize 50, ImagePadding {{100, 100}, {100, 100}}];
  |tamaño de imagen |relleno de imagen
  DateListPlot[portfolio, Filling Axis, Epilog Inset[pc, {{2023, 1, 25}, 1}],
  |representación de lista respect |relleno |eje |epílogo |encarte
  ImageSize Large, PlotTheme Detailed,
  |tamaño de im... |grande |tema de representación
  PlotLabel
  |etiqueta de representación
  Style["Comportamiento historico acumulado, 2023 - 2024", 14, Orange]
  |estilo |constante |naranja

```

Out[] =



VI. Recolección de datos

En este apartado ya estamos listos para el inicio del cruzamiento de información histórica

```
In[ ] := adjPortfolio = TimeSeries[portfolio, TemporalRegularity -> True]
      [serie temporal [regularidad temporal [verdad]
eproc = TimeSeriesModelFit[adjPortfolio]
      [ajusta modelo de serie temporal
```

Out[] =



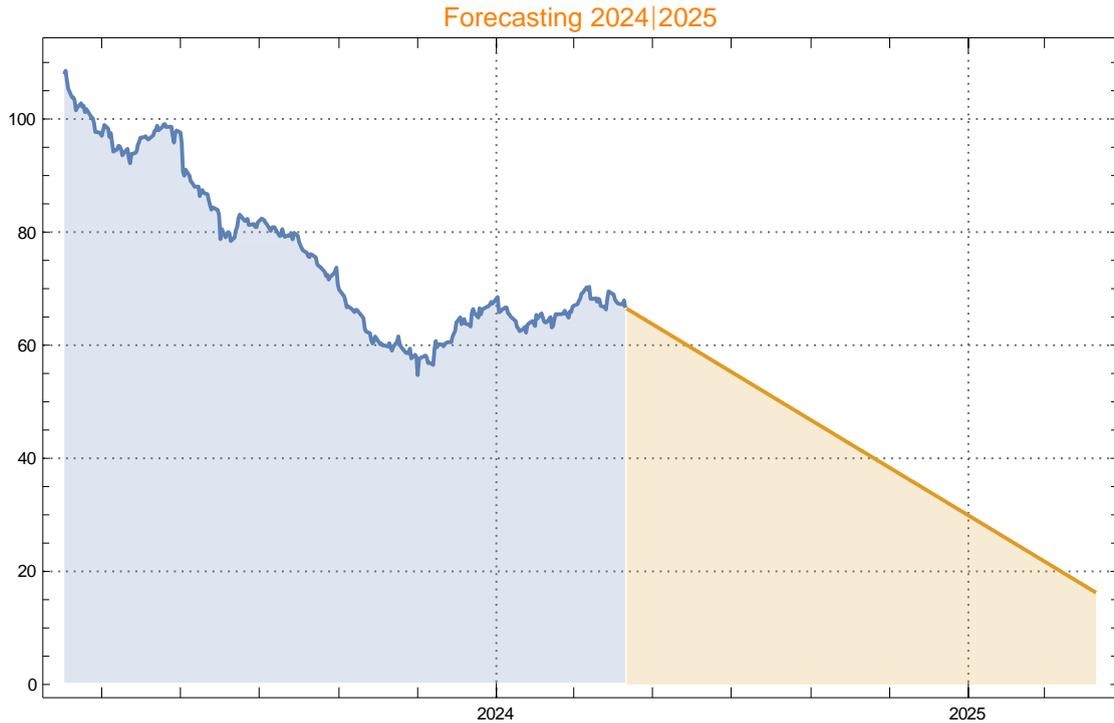
Out[] =



VII. Resultados Obtenidos Proyecciones Pieuler.com a la baja 2024 - 2025

```
In[ ] := forecast = TimeSeriesForecast[eproc, {365}];
      [pronostica serie temporal]
DateListPlot[{adjPortfolio, forecast}, Filling -> Axis, PlotTheme -> "Detailed",
      [representación de lista respecto a fechas [relleno [eje [tema de representación]
ImageSize -> "Large", PlotLabel -> Style["Forecasting 2024|2025", 14, Orange]
      [tamaño de im... [grande [etiqueta de r... [estilo [naranja
```

Out[] =



VIII. RESUMEN EJECUTIVO

Estimado Inversor,

En PIEULER.COM, ofrecemos análisis detallados y proyecciones precisas para ayudarte a tomar decisiones informadas. Nuestro proceso se basa en datos de Wolfram Finance, donde utilizamos caminatas logarítmicas para obtener rangos de confianza. Esto nos permite identificar límites mínimos y máximos para cada acción.

A partir de estos rangos, calculamos un porcentaje de proyección para identificar acciones con el mejor potencial de apreciación. También utilizamos el índice Beta, que mide la volatilidad de cada acción respecto al mercado, y el ratio Sharpe, que ajusta el rendimiento por riesgo.

El modelo ARIMA Forecast nos permite identificar tendencias alcistas y bajistas con alta precisión, dándonos una visión clara para rankear portafolios. Así, reducimos el ruido del mercado y ofrecemos información confiable.

Ahora, puedes acceder a nuestro plan “Sintiendo el Poder”, que incluye un análisis personalizado de tu portfolio, un ranking de las 10 mejores empresas para invertir al alza según nuestro algoritmo, y mucho más. También puedes optar por el plan “Inversor Inteligente” para obtener rankings ampliados y análisis de criptomonedas, o por el plan “Lobo de Wall Street” para beneficios adicionales como pronósticos personalizados y recomendaciones de diversificación.

Elige el plan adecuado para ti, y esperamos juntos ver tu patrimonio crecer.

¡Suscríbete hoy y descubre por qué en PIEULER.COM estamos “Más allá de lo evidente”!

Atentamente,

El equipo de PIEULER.COM

