



# Estrategias de gestión cuantitativa



# Objetivo

La gestión cuantitativa de inversiones es una alternativa que difiere de la gestión de activos tradicional. Esta tipología de gestión aprovecha las nuevas capacidades tecnológicas a través del uso de modelos estadísticos y técnicas de *machine learning* para generar señales y construir **estrategias de inversión** con algoritmos objetivos. Las señales están basadas en el aprendizaje automático de las relaciones históricas entre variables de mercado de alta frecuencia y las series de precios de los activos. Las estrategias pueden ser de alta frecuencia o de posicionamiento a medio-largo plazo.

## A quién va dirigido

El servicio va dirigido a entidades que gestionen riesgos o activos financieros. Por ejemplo:



**Mesas de tesorería**



**Gestoras de activos**



**Oficinas familiares**



**Entidades no financieras que gestionen riesgos financieros**

# Características del servicio

Los servicios de consultoría en estrategias de inversión cuantitativa son los siguientes:

01

Puesta a disposición del cliente modelos exitosos ya desarrollados en Afi (código abierto)

02

Desarrollo de nuevos modelos a medida (laboratorio de consultoría cuantitativa)

03

Generación sistemática de señales de posicionamiento en activos sobre la base de estrategias o modelos del cliente.

04

Desarrollo de soluciones digitales aplicadas a la gestión cuantitativa

05

Un equipo multidisciplinar nutrido por experiencias en:

- **Finanzas Cuantitativas:** Uno de los primeros equipos en España dedicados a las finanzas cuantitativas. Especialistas en el uso de *Machine Learning* en finanzas. Especialistas en valoración de instrumentos financieros y medición de riesgos.
- **Afi Research:** Más de 30 años de servicio de análisis económico de mercados financieros, ofreciendo información y opinión rigurosa sobre el entorno relevante para la toma de decisiones de nuestros clientes.
- **Afi inversiones Globales, SGIC:** Gestión desde el rigor analítico y total independencia. Amplia lista de clientes: entidades financieras, compañías de seguros, gestión de activos.
- **Soluciones Digitales:** Especialistas en desarrollo de soluciones de apoyo a la comercialización de productos de inversión. Implementación de soluciones tecnológicas en el ámbito financiero, *Big Data* e Inteligencia Artificial.

Prestamos estos servicios de modelos muy concretos para mesas de tesorería de entidades financieras y no financieras, así como para gestoras de activos. Algunos de los modelos desarrollados con propósito más amplio se muestran en nuestro informe mensual de indicadores y estrategias cuantitativas Afi Research.

## Informe mensual de indicadores y estrategias cuantitativas

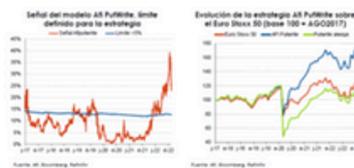


**Afi Research**

### Indicadores y estrategias cuantitativas

Febrero 2023

**Afi PuWite® continúa desaconsejando la venta de opciones put a 1 mes sobre el Euro Stoxx 50**



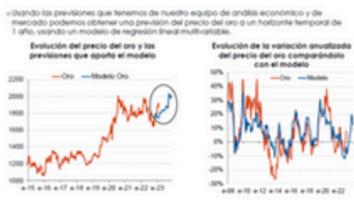
**El indicador Afi Risk On/Off apunta a estado "risk-off" por lo que es coherente mantener un posicionamiento defensivo**



**El modelo Long/Short Sectorial del Stoxx 400 recomienda las siguientes estrategias para enero:**



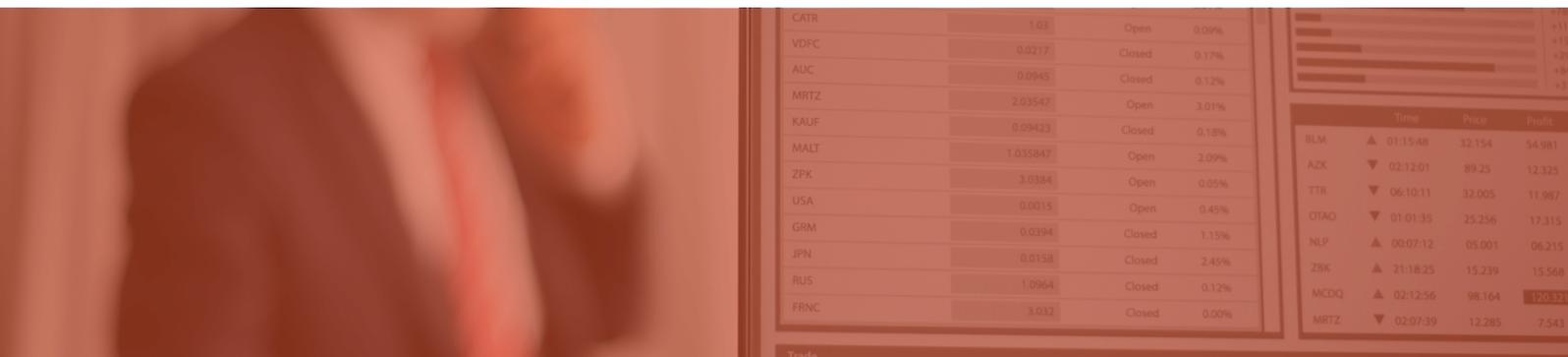
**El modelo de previsiones del precio del oro sigue teniendo una señal positiva del oro para 2023**



**El modelo HMM S&P recomienda la compra de renta variable estadounidense, aconseja comprar el S&P500 en febrero**



Afi es una compañía española líder en asesoramiento, consultoría y formación independiente en economía, finanzas y tecnología. La empresa fue fundada en 1987 por un grupo de destacados académicos y, desde entonces, se ha convertido en un referente en la prestación de servicios y productos para el ámbito financiero. Nuestro equipo está formado por más de 200 profesionales altamente cualificados, entre los que se incluyen más de una veintena de socios.



## Contacto

Para más información contacta con:



**Ángel Moreno**  
Socio director  
[amoreno@afi.es](mailto:amoreno@afi.es)



**José Manuel Amor**  
Socio director  
[jamor@afi.es](mailto:jamor@afi.es)



**Adrián González Vázquez**  
Consultor  
[agonzalez@afi.es](mailto:agonzalez@afi.es)



[www.afi.es](http://www.afi.es)

C./Marques de Villamejor, n. 5  
28006, Madrid

Telf.: 915 200 100

[info@afi.es](mailto:info@afi.es)