



Cómo funciona el bot

Estrategia de inversión cuantitativa



Reglas cuantitativas

Revisión mensual

Transparencia total



SECCIÓN 1

¿Qué es este bot?

Es un sistema de inversión automatizado que gestiona una cartera de acciones de empresas grandes y consolidadas (large-cap), cotizadas principalmente en EE. UU. El sistema decide qué acciones comprar o vender siguiendo reglas cuantitativas fijadas de antemano, sin intervención manual en el día a día ni discreción humana sobre operaciones puntuales.

Es un proyecto personal: opera capital propio de su desarrollador, no de terceros. No es un fondo, no capta inversores, no ofrece asesoramiento y no vende ningún producto financiero. El panel público existe únicamente para mostrar de forma transparente cómo evoluciona la estrategia en la práctica.



SECCIÓN 2

Filosofía de inversión

La estrategia se apoya en principios de inversión cuantitativa respaldados por evidencia académica, más que en intuición o en el ajuste de parámetros para que "funcionen bien" sobre datos pasados. Las ideas centrales son:

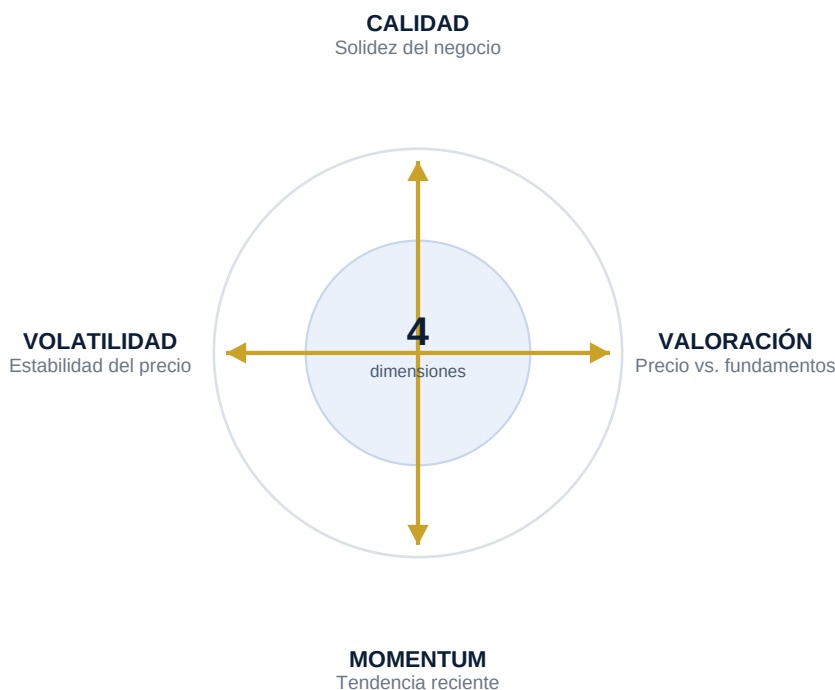
- **Reglas fijadas de antemano:** los criterios de selección no se modifican para encajar con resultados históricos conocidos, evitando el sobreajuste.
- **Análisis multidimensional:** la decisión combina distintas dimensiones de análisis, en lugar de depender de un único indicador o señal.
- **Disciplina, no predicción:** el bot no intenta anticipar noticias ni movimientos de corto plazo; sigue un proceso sistemático y repetible.
- **Revisión periódica, no reacción constante:** la cartera se revisa una vez por ciclo, no ante cada movimiento diario del mercado.



SECCIÓN 3

¿En qué se fija a la hora de elegir acciones?

Cada empresa del universo analizado recibe una puntuación en cuatro dimensiones de análisis independientes. Esas puntuaciones se combinan mediante una metodología propia para obtener un ranking final; los criterios exactos de esa combinación no se publican, ya que forman parte del método interno de la estrategia.

**Calidad**

Solidez del negocio: rentabilidad, eficiencia y salud financiera de la empresa.

Valoración

Si la acción cotiza a un precio razonable en relación con sus fundamentos.

Momentum

Tendencia reciente de precio de la acción a lo largo de los últimos meses.

Volatilidad

Estabilidad histórica del precio, penalizando acciones muy erráticas.

Con el resultado combinado se arma un ranking de todas las empresas del universo analizado, y la cartera se compone con las mejor posicionadas.



SECCIÓN 4

¿Qué hace durante el mes?

El ciclo de vida de la estrategia es mensual: una vez por mes el sistema revisa el ranking completo y decide si conviene ajustar la cartera. En líneas generales, el proceso recorre estas etapas:

1

Actualización de datos

Se actualiza la lista de empresas elegibles y se recopila información financiera y de precio de cada una.

2

Cálculo de puntuaciones

Cada empresa recibe su puntuación en las cuatro dimensiones y un ranking combinado.

3

Selección de cartera

Se eligen las empresas mejor posicionadas del ranking para formar la cartera objetivo del mes.

4

Control de calidad de datos

Si la información no está suficientemente completa, el sistema prefiere no actuar antes que operar con datos parciales.

5

Ajuste de la cartera

Se generan las compras o ventas necesarias para acercarse a la cartera objetivo, evitando movimientos innecesarios.

6

Verificación y registro

Cada operación pasa controles de seguridad antes de enviarse, y todo el proceso queda registrado.

Fuera de este ciclo de revisión, el sistema no opera por impulso ni por noticias del día: mantiene la cartera vigente y sigue monitoreando su estado general.



SECCIÓN 5

Gestión de riesgo

- **Límite por posición:** ninguna acción individual puede representar una proporción excesiva de la cartera total, para evitar concentración de riesgo.
- **Freno de emergencia a nivel de cartera:** si el valor total de la cartera cae más allá de un umbral predefinido, el sistema deja de comprar automáticamente hasta que se revise la situación manualmente. Este freno actúa sobre la cartera en su conjunto, no acción por acción.
- **Verificación antes de operar:** cada orden pasa por controles automáticos que pueden bloquearla si algo no cumple las condiciones esperadas.
- **Conciliación de posiciones:** el sistema compara periódicamente lo que cree tener en cartera con lo que realmente refleja el bróker, para detectar y resolver cualquier discrepancia.
- **Progresión gradual:** antes de operar con dinero real, la estrategia se valida primero en simulación y luego con capital reducido, aumentando la exposición solo si el desempeño lo justifica.



SECCIÓN 6

El panel público

El panel al que se accede públicamente es de solo lectura: no requiere registro, no permite operar, no ofrece ningún producto ni suscripción, y no invita a depositar dinero. Su único propósito es mostrar de forma transparente la evolución real de la estrategia.



Vista ilustrativa del panel público — no representa datos reales.

Aviso importante

Este documento es solo informativo y describe el funcionamiento general del sistema en un nivel conceptual. No constituye asesoramiento financiero, recomendación de inversión ni una oferta de ningún producto o servicio. El bot opera exclusivamente con capital propio de su desarrollador y no está disponible para gestionar capital de terceros. El rendimiento pasado no garantiza resultados futuros, y toda inversión conlleva riesgo, incluido el riesgo de pérdida del capital. Ciertos parámetros y umbrales operativos no se publican, ya que forman parte del método interno de la estrategia.

Seguí la estrategia en vivo**www.atbquant.com**