

trendet

September 16, 2019

1 trendet - is a Python package for trend detection on stock time series data

por Álvaro Bartolomé del Canto @ alvarob96 en GitHub

1.1 Introducción

trendet es un paquete de Python para la identificación de tendencias alcistas y/o bajistas de las acciones en base a sus datos históricos de cierre. **trendet** es una herramienta que se basa en los datos extraídos por **investpy** de las acciones, siendo este otro paquete de Python que extrae datos de Investing.com.

De todas formas, **trendet** puede ser utilizado para identificar tendencias en cualquier `pandas.DataFrame` se una serie temporal que contenga al menos una columna con valores numéricos; aunque su uso esté orientado a la identificación de tendencias en datos históricos de acciones.

1.2 Instalación

Para instalar **trendet** se requiere una versión de Python 3.x y tener **pip** instalado, para así poder instalar paquetes de Python de [PyPI](#). De este modo, **trendet** se instalará desde la terminal de la forma:

```
$ python -m pip install trendet==0.5
```

O, en caso de disponer de una versión de **trendet** instalada, para actualizar dicha versión a la última disponible, ejecutar la siguiente orden en terminal:

```
$ python -m pip install trendet --upgrade
```

1.3 Uso

Dado que **trendet** está integrado con **investpy**, las principales funcionalidades del paquete están orientadas a los datos extraídos de **investpy**, en este caso los `pandas.DataFrame` que contienen los datos de apertura, máximo, mínimo y cierre de una acción. Es decir, **trendet** está orientado a su uso con conjuntos de datos relacionados con los datos históricos de distintos productos financieros sobre series temporales para identificar las tendencias que han tenido lugar a lo largo del tiempo.

```
[1]: import trendet
[2]: (trendet.__author__, trendet.__version__)
[2]: ('Alvaro Bartolome @ alvarob96 on GitHub', '0.5')
```

De este modo se procederá al desglose y uso de las principales funciones de **trendet**:

1.3.1 trendet.identify_trends()

En el ejemplo presentado a continuación, la función `identify_trends` se utilizará para detectar 3 tendencias alcistas y bajistas, donde cada una de dichas tendencias se considerará tal, si abarca una ventana superior a 5 días. De este modo, las tendencias identificadas, en caso de haberlo sido, se identificarán de manera única con cada una de las etiquetas introducidas.

```
[23]: df = trendet.identify_trends(equity='bbva',
                                   country='spain',
                                   from_date='01/01/2018',
                                   to_date='01/01/2019',
                                   window_size=5,
                                   trend_limit=3,
                                   labels=['A', 'B', 'C'])
[24]: df.head()
```

```
[24]:
```

	Open	High	Low	Close	Volume	Currency	Up Trend	Down Trend
Date								
2018-01-02	7.139	7.169	7.050	7.082	15960000	EUR	A	NaN
2018-01-03	7.113	7.120	7.055	7.094	13320000	EUR	A	NaN
2018-01-04	7.113	7.274	7.104	7.221	20790000	EUR	A	NaN
2018-01-05	7.259	7.282	7.203	7.253	13580000	EUR	A	NaN
2018-01-08	7.274	7.293	7.220	7.235	13420000	EUR	A	NaN

1.3.2 trendet.identify_all_trends()

trendet a través de la función `identify_all_trends` permite la identificación de todas las tendencias encontradas en los datos históricos de cierre recuperado por **investpy**. La diferencia entre esta función y `identify_trends` es que esta función permite recuperar todas las tendencias encontradas sin ninguna restricción.

```
[43]: df = trendet.identify_all_trends(equity='orange',
                                       country='france',
                                       from_date='01/01/2018',
                                       to_date='01/01/2019',
                                       window_size=5)
[44]: df.head()
```

```
[44]:
```

	Open	High	Low	Close	Volume	Currency	Up Trend	Down Trend
Date								
2018-01-02	14.52	14.53	14.39	14.52	5620000	EUR	NaN	NaN
2018-01-03	14.53	14.54	14.37	14.49	5710000	EUR	NaN	NaN

2018-01-04	14.53	14.54	14.42	14.49	7180000	EUR	NaN	NaN
2018-01-05	14.52	14.62	14.47	14.62	5740000	EUR	NaN	NaN
2018-01-08	14.62	14.72	14.59	14.70	4570000	EUR	NaN	NaN

1.3.3 trendet.identify_df_trends()

Adicionalmente, como mencionado previamente, **trendet** puede ser utilizado con cualquier `pandas.DataFrame` con la función `identify_df_trends` aunque su uso está orientado a ser combinado con **investpy**. De este modo, el único requisito del dataset de entrada es que contenga una columna con datos en formato `int64` o `float64`, es decir, de tipo numérico para poder calcular las tendencias correctamente. Por tanto, dado un `pandas.DataFrame` de entrada, se identificarán las tendencias del mismo aunque sus valores no se correspondan con valores de mercado.

```
[27]: import investpy
```

```
[28]: (investpy.__author__, investpy.__version__)
```

```
[28]: ('Alvaro Bartolome <alvarob96@usal.es>', '0.9.2')
```

```
[38]: df = investpy.get_historical_data(equity='coca-cola',
                                     country='united states',
                                     from_date='01/01/2018',
                                     to_date='01/01/2019')
```

```
[39]: df.head()
```

```
[39]:
```

	Open	High	Low	Close	Volume	Currency
Date						
2018-01-02	45.91	45.94	45.51	45.54	10870000	USD
2018-01-03	45.49	45.69	45.34	45.44	12640000	USD
2018-01-04	45.56	46.22	45.45	46.08	12710000	USD
2018-01-05	46.02	46.20	45.79	46.07	13110000	USD
2018-01-08	45.95	46.10	45.88	46.00	7070000	USD

```
[40]: df = trendet.identify_df_trends(df=df, column='Close')
```

```
[41]: df.head()
```

```
[41]:
```

	Open	High	Low	Close	Volume	Currency	Up	Trend	Down	Trend
Date										
2018-01-02	45.91	45.94	45.51	45.54	10870000	USD	NaN		NaN	
2018-01-03	45.49	45.69	45.34	45.44	12640000	USD	NaN		NaN	
2018-01-04	45.56	46.22	45.45	46.08	12710000	USD	NaN		NaN	
2018-01-05	46.02	46.20	45.79	46.07	13110000	USD	NaN		NaN	
2018-01-08	45.95	46.10	45.88	46.00	7070000	USD	NaN		NaN	

Adicionalmente, se procederá a la visualización de los resultados obtenidos por **trendet** con el fin de reflejar sobre una gráfica las tendencias identificadas en la serie temporal introducida. De este modo, se hará uso del estilo para **matplotlib** creado por [Dih5](https://github.com/Dih5) en GitHub, estilo orientado a las publicaciones científicas, **paper-themes**.

A través de este estilo, junto con el uso de funcionalidades de **matplotlib** y **seaborn** para la visualización de los datos, se procederá a la creación de las gráficas del `pandas.DataFrame` resultante de **trendet** donde las tendencias alcistas se representan en color verde y las bajistas en color rojo.

```
[7]: import trendet

[10]: import matplotlib.pyplot as plt

import seaborn as sns
sns.set(style='darkgrid')

[12]: df = trendet.identify_all_trends(equity='bbva',
                                     country='spain',
                                     from_date='01/01/2018',
                                     to_date='01/01/2019',
                                     window_size=5)

[13]: df.reset_index(inplace=True)

[15]: with plt.style.context('paper'):
    plt.figure(figsize=(20, 10))

    ax = sns.lineplot(x=df['Date'], y=df['Close'])

    labels = df['Up Trend'].dropna().unique().tolist()

    for label in labels:
        sns.lineplot(x=df[df['Up Trend'] == label]['Date'],
                     y=df[df['Up Trend'] == label]['Close'],
                     color='green')

        ax.axvspan(df[df['Up Trend'] == label]['Date'].iloc[0],
                   df[df['Up Trend'] == label]['Date'].iloc[-1],
                   alpha=0.2,
                   color='green')

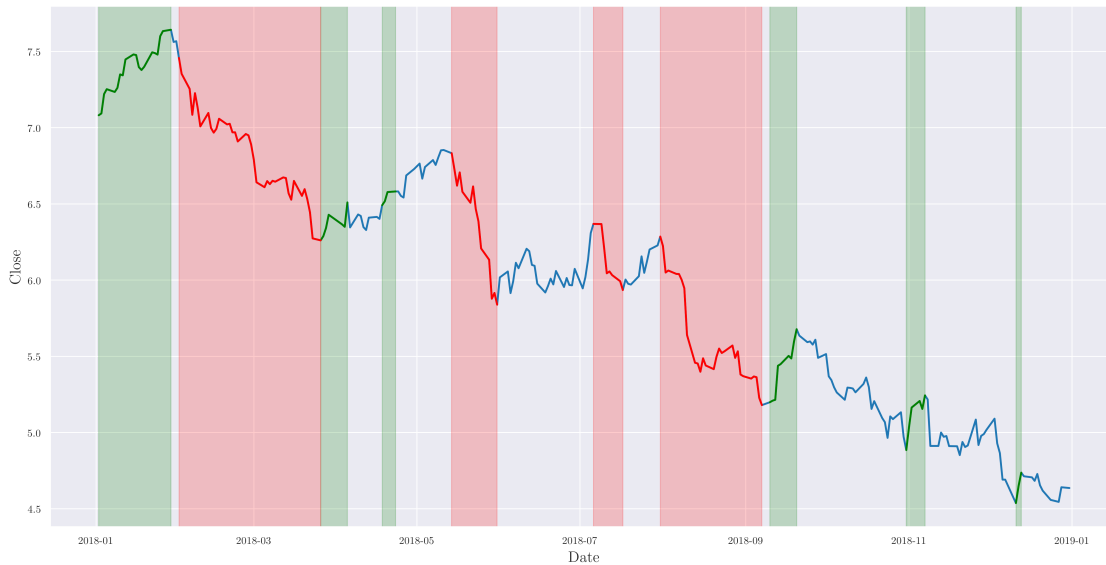
    labels = df['Down Trend'].dropna().unique().tolist()

    for label in labels:
        sns.lineplot(x=df[df['Down Trend'] == label]['Date'],
                     y=df[df['Down Trend'] == label]['Close'],
                     color='red')

        ax.axvspan(df[df['Down Trend'] == label]['Date'].iloc[0],
                   df[df['Down Trend'] == label]['Date'].iloc[-1],
                   alpha=0.2,
                   color='red')

    plt.figure(figsize=(20,10))
```

```
plt.show()
```



<Figure size 6000x3000 with 0 Axes>

1.4 Información Adicional

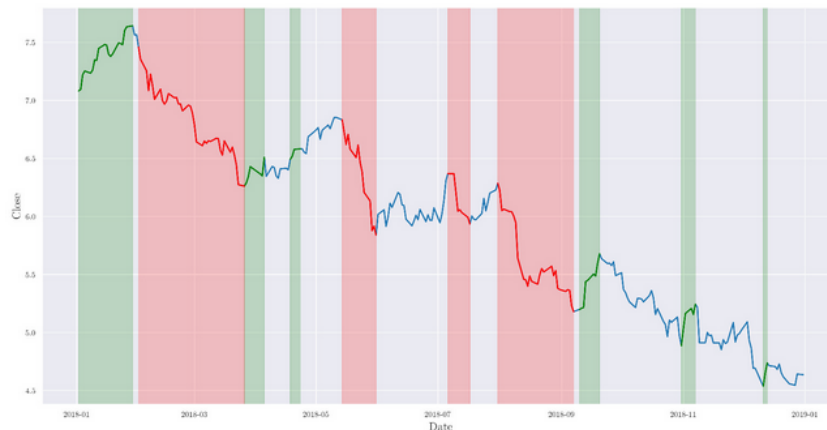
Dado que **trendet** es un paquete de Python de código abierto, se ha subido a [Python Package Index](#) para que se pueda instalar fácilmente a través de **pip**. Además, con el fin de probar tanto los casos de éxito como el control de errores, se ha integrado con herramientas de **CI** (Continuous Integration) como [Travis CI](#), [Azure Pipelines](#) y [GitHub Actions](#) (a la cual tengo acceso solicitado en fase Beta). Resultante de la CI, se calcula el **code coverage**, es decir, el porcentaje de líneas de código útil a lo largo de todas las líneas ejecutables del paquete; cuyo resultado se sube a [codecov](#) que es una herramienta que realiza dicho cálculo, resultante de [pytest](#), en este caso.

```
[1]: from IPython.display import Image
      Image(filename='trendet.png')
```

[1]:

trendet - is a Python package for trend detection on stock time series data

python 3.5 | 3.6 | 3.7 | pypi v0.5 | status alpha | Azure Pipelines succeeded | Travis CI passing | docs passing | codecov 97%
downloads 262/month



trendet is a Python package for trend detection
on stock time series data

Por último, como se ha mencionado previamente, la creación de **trendet** tiene como propósito principal su integración con [investpy](#), al igual que con cualquier `pandas.DataFrame` relacionado con valores históricos sobre series temporales de algún producto financiero.

1.5 Documentación

La documentación de [trendet](#) se ha generado con [sphinx](#) que es una herramienta para generar documentación en Python basado en *reStructuredText*. Además, la documentación se ha subido al sistema de alojamiento de documentación [Read the Docs](#).

De este modo, se podrá encontrar la documentación en: <https://trendet.readthedocs.io/>

1.6 Licencia

MIT License

Copyright (c) 2019 Álvaro Bartolomé del Canto

Permission is hereby granted, free of charge, to any person obtaining a copy of this software and associated documentation files (the "Software"), to deal in the Software without restriction, including without limitation the rights to use, copy, modify, merge, publish, distribute, sublicense,

and/or sell copies of the Software, and to permit persons to whom the Software is furnished to do so, subject to the following conditions:

The above copyright notice and this permission notice shall be included in all copies or substantial portions of the Software.

THE SOFTWARE IS PROVIDED “AS IS”, WITHOUT WARRANTY OF ANY KIND, EXPRESS OR IMPLIED, INCLUDING BUT NOT LIMITED TO THE WARRANTIES OF MERCHANTABILITY, FITNESS FOR A PARTICULAR PURPOSE AND NONINFRINGEMENT. IN NO EVENT SHALL THE AUTHORS OR COPYRIGHT HOLDERS BE LIABLE FOR ANY CLAIM, DAMAGES OR OTHER LIABILITY, WHETHER IN AN ACTION OF CONTRACT, TORT OR OTHERWISE, ARISING FROM, OUT OF OR IN CONNECTION WITH THE SOFTWARE OR THE USE OR OTHER DEALINGS IN THE SOFTWARE.

1.7 Autor

Álvaro Bartolomé del Canto, 2019