

CRAN Task View: Empirical Finance

Nelson Seixas dos Santos

Departamento de Economia e Relações Internacionais
Faculdades de Ciências Econômicas
Universidade Federal do Rio Grande do Sul

April 12, 2017

Sumário

- 1 Introdução
- 2 CRAN Task Views
- 3 Coletando dados financeiros com Rmetrics

Introdução

Objetivos de Aprendizagem

- O que são CRAN Task Views ?
- Como instalar um CRAN Task View?
- O que é o CRAN Task Views Empirical Finance?
- Quais são os principais pacotes do CRAN Task Views Empirical Finance?
- Como coletar dados financeiros com o Rmetrics?

CRAN Task Views

- CRAN Task View é um conjunto de pacotes referentes a uma determinada área de utilização do ambiente R.
- A lista completa de Task Views está disponível, clicando aqui.
- Os mais importantes em economia são: Bayesian, Econometrics, Finance, Optimization e TimeSeries.

Instalando e Atualizando CRAN Task Views

- 1 Instale o pacote `ctv`, usando a função `install.packages("ctv")`.
- 2 Carregue o pacote `ctv`, usando a função `library('ctv')`
- 3 Instale o Task View desejado, usando a função `install.views("NomeDoTaskView")`.
- 4 Atualize os seus Task Views, usando `update.views("NomeDoTaskView")`

CRAN Task View Empirical Finance

- O CRAN Task View Empirical Finance é composto por pacotes de funções para apreçamento de ativos financeiros e gestão de risco.
- A lista completa de pacotes está disponível, clicando aqui.

CRAN Task View Empirical Finance: principais pacotes

Entre os principais pacotes, encontram-se:

- 1 Quantmod - Quantitative Financial Modelling & Trading Framework for R.
- 2 Rquantlib - Pacote de interligação com a biblioteca financeira em C QuantLib.
- 3 Rmetrics - pacote com diversas funções úteis em finanças.

Coletando dados financeiros com Rmetrics

O e-book Data Feed é uma excelente fonte para para aprender a coletar dados da Internet de modo programado em R