

Baixando dados diários

Lucca Simeoni Pavan

João Carlos de Carvalho

17 de novembro de 2016

Sumário

1 Ranking de negociações

1

```
knitr::opts_chunk$set(echo = TRUE, cache = TRUE, warning = FALSE, message = FALSE,
  error = FALSE, tidy = TRUE, tidy.opts = list(width.cutoff = 70))
```

1 Ranking de negociações

```
library(GetHFDData)
tickers_equity <- ghfd_get_available_tickers_from_ftp(my.date = "2016-10-30",
  type.market = "equity", max.dl.tries = 10)
```

```
##
## Reading ftp contents for equity (attempt = 1|10) Attempt 1 - File exists, skipping dl
```

```
head(tickers_equity, n = 10)
```

```
##      tickers n.trades      f.name
## 1    ITSA4    56578 ftp files/NEG_20160930.zip
## 2    PETR4    29123 ftp files/NEG_20160930.zip
## 3    ITUB4    24040 ftp files/NEG_20160930.zip
## 4    BBDC4    21710 ftp files/NEG_20160930.zip
## 5    ABEV3    20719 ftp files/NEG_20160930.zip
## 6    BBSE3    20450 ftp files/NEG_20160930.zip
## 7    BVMF3    19170 ftp files/NEG_20160930.zip
## 8    GOAU4    16868 ftp files/NEG_20160930.zip
## 9    LREN3    16716 ftp files/NEG_20160930.zip
## 10   VALE5    16141 ftp files/NEG_20160930.zip
```

Criando um vetor com as 6 ações mais negociadas em 30/10/2016.

```
top_6 <- c(as.character(head(tickers_equity$tickers)))
print(top_6)
```

```
## [1] "ITSA4" "PETR4" "ITUB4" "BBDC4" "ABEV3" "BBSE3"
```

Baixando os dados

```

dados_top6 <- ghfd_get_HF_data(top_6, type.market = "equity", first.date = as.Date("2014-11-03"),
  last.date = as.Date("2016-10-30"), first.time = "9:00:00", last.time = "18:00:00",
  type.output = "agg", agg.diff = "1 hour", dl.dir = "ftp files", max.dl.tries = 10,
  clean.files = FALSE)
save(dados_top6, file = "dados_top6.Rda")
head(dados_top6, n = 6)

```

```

load("dados_top6.Rda")
dim(dados_top6)

```

```
## [1] 22667    13
```

Agora irei criar um banco de dados para cada ação e depois tornar os preços diários.

```

library(dplyr)
dados_ITSA4 <- filter(dados_top6, InstrumentSymbol == "ITSA4") %>% select(SessionDate,
  weighted.price)
dados_PETR4 <- filter(dados_top6, InstrumentSymbol == "PETR4") %>% select(SessionDate,
  weighted.price)
dados_ITUB4 <- filter(dados_top6, InstrumentSymbol == "ITUB4") %>% select(SessionDate,
  weighted.price)
dados_BBDC4 <- filter(dados_top6, InstrumentSymbol == "BBDC4") %>% select(SessionDate,
  weighted.price)
dados_ABEV3 <- filter(dados_top6, InstrumentSymbol == "ABEV3") %>% select(SessionDate,
  weighted.price)
dados_BBSE3 <- filter(dados_top6, InstrumentSymbol == "BBSE3") %>% select(SessionDate,
  weighted.price)

```