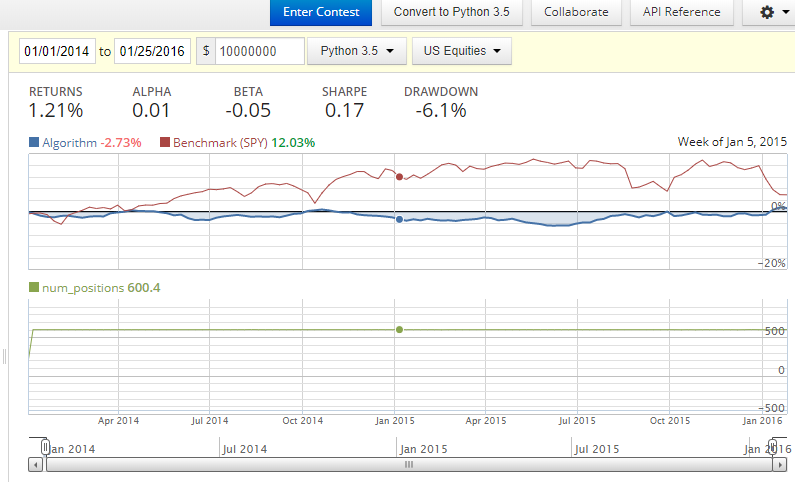
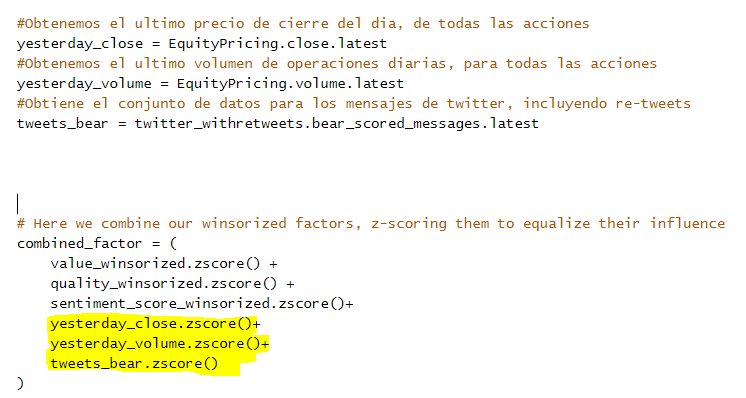
Algoritmo de Trading

Tomando el algoritmo Cross-sectional Equity Template, de <https://www.quantopian.com/algorithms/5e40bbf686d3f6003e89c67c> , se obtiene un resultado similar a este:

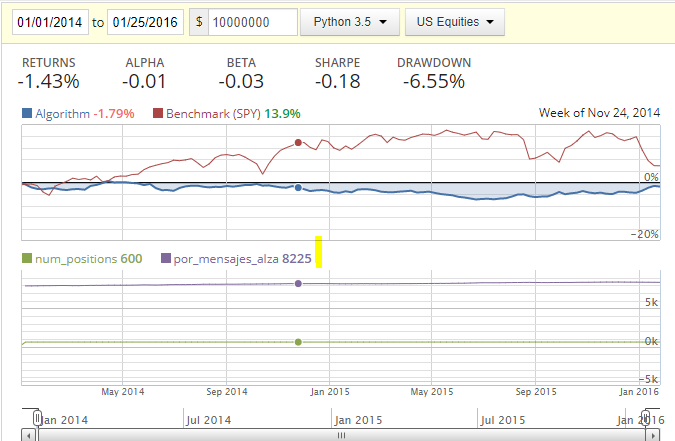


Este algoritmo tiene originalmente 3 variables, se le incluyen 3 variables más:



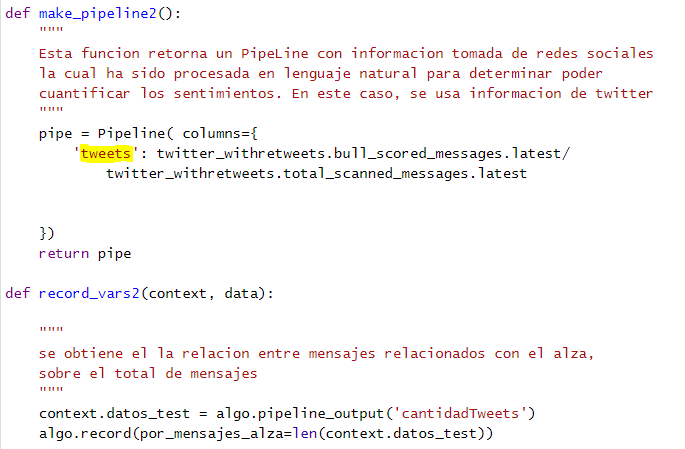
* **yesterday\_close**: Obtenemos el ultimo precio de cierre del día, de todas las acciones usando EquityPricing.close.latest.
* **yesterday\_volume**: Obtenemos el ultimo volumen de operaciones diarias, para todas las acciones. Usamos EquityPricing.volume.latest
* **tweets\_bear**: Obtiene el conjunto de datos para los mensajes de twitter, incluyendo re-tweets. Usamos los re-tweets, ya que indica que llego a más gente el mensaje. twitter\_withretweets.bear\_scored\_messages.latest

Se puede notar que el algoritmo varia, respecto al original. También, aparece otra grafica, con el label “por\_mensajes\_alza”

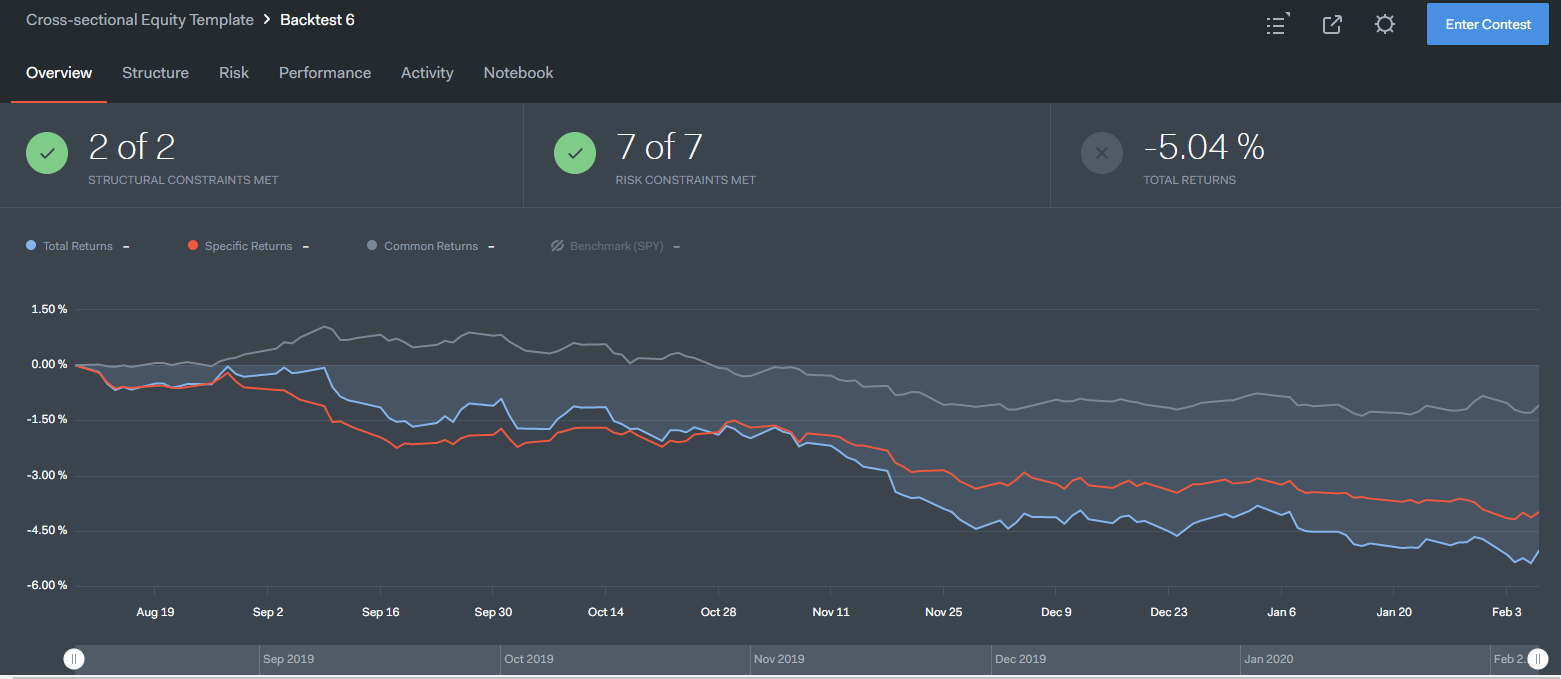


La relación se considera muy alta. Se recomienda revisar muy bien para futuros desarrollos.

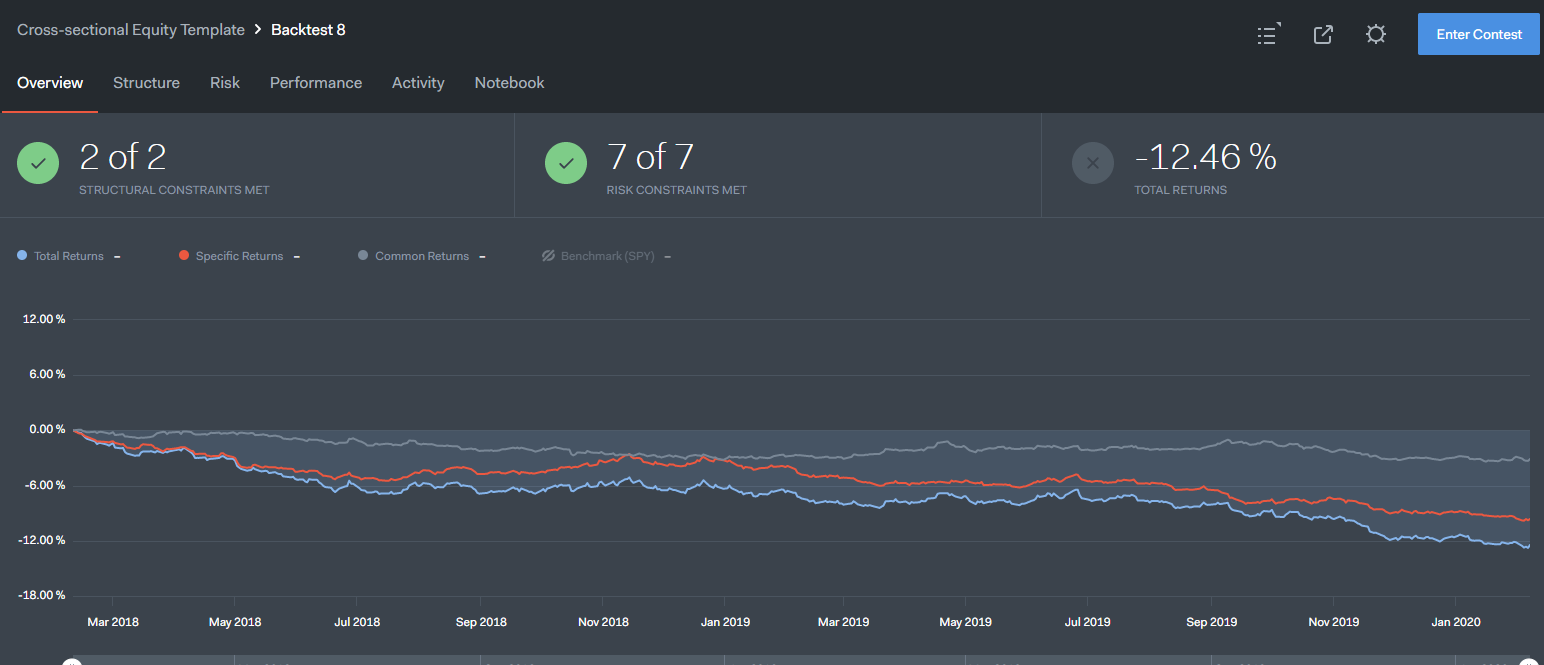
Esta corresponde al relación de mensajes relacionados sentimientos de alza, sobre el total de mensajes de twitter.



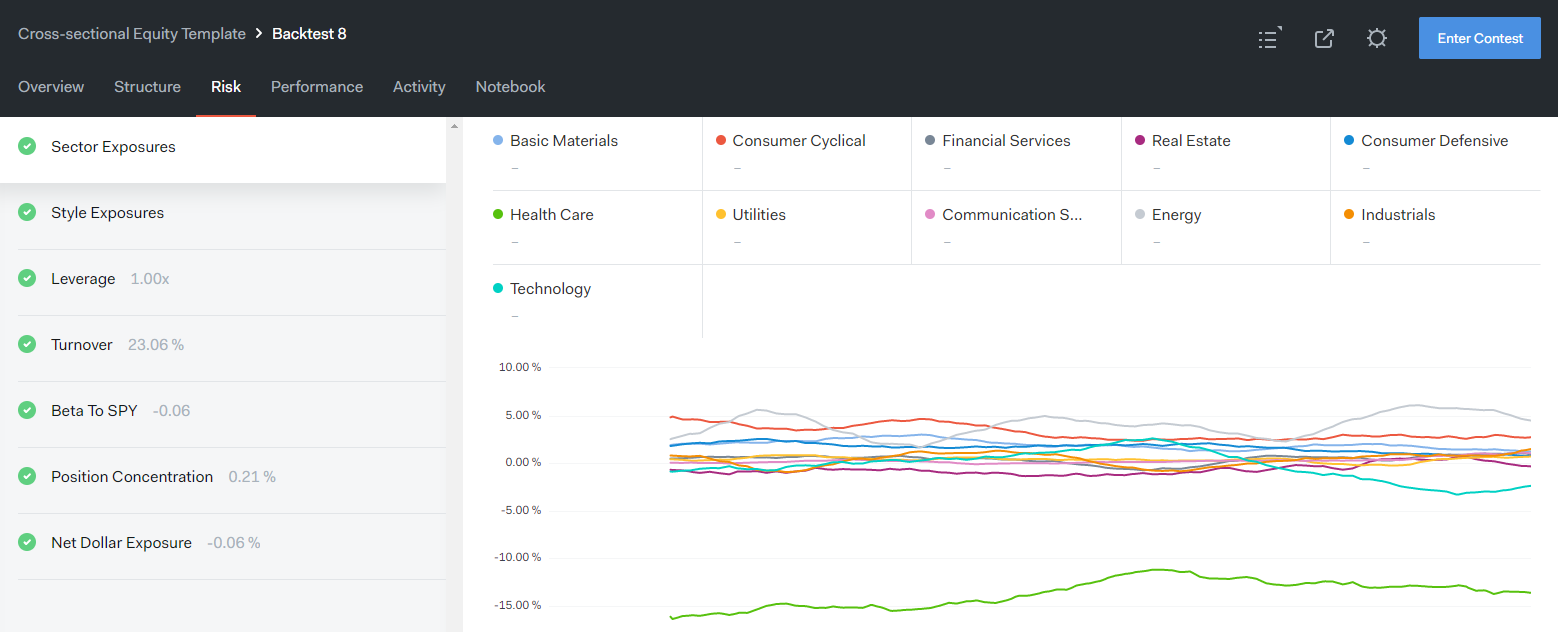
Test de los 6 meses:



Test de los 2 años:



Nótese que se han validaciones que tuvo el algoritmo; fallo en el retorno.



Referencias:

<https://www.quantopian.com/docs/data-reference/psychsignal>

<https://www.quantopian.com/docs/data-reference/daily_pricing>