**Avances y relación para presentación**

<https://github.com/lagrom/TOG>

* Extracción de datos (data.py y TOG\_1.py)
  + Función de extracción de datos
  + Corrección de función para extracción completa.
  + Almacenamiento en formato “parquet”
* Análisis exploratorio (TOG\_2\_EDA.py)
  + Describe, Boxplots y revisión de datos nulos.
* Resampling
  + Resampleo de datos a segundos
  + Revision de datos nulos
  + Imputacion “forward fill”
  + Creacion de OHLC para ask y bid.
  + Mismo proceso para volúmenes de ask y bid.
* Creacion de variable objetivo ask close – ask open
* Creacion de features o variables de función de costo
  + Mid\_price
  + Spread
  + Vol Imbalance
  + Weighted mid Price
  + VWAP
* Graficas de series y primera validación
* Modelo OLS para ver comportamiento de los datos en un modelo sencillo
  + Mid Price vs ask high
  + Vwap vs ask close
* Grafica de correlación
* Analisis de serie de tiempo para la variable target
  + Acf, pacf, df
  + En primero y segundo orden
  + Modelo ARIMA de prueba.
* Siguiente paso modelo Primeros modelos en sklearn. (pendiente)