

FERRAMENTAS BÁSICAS, Screening

(CLICAR AQUI SE NÃO APARECER A JANELA DAS FERRAMENTAS)

The screenshot displays the Economática software interface. At the top, there is a navigation bar with icons for home, search, and help, along with the text 'Gerdau • PN • GGBR4' and 'Bovespa'. Below this is a table with columns for 'Nome', 'Classe', 'Código', 'Negociabilidade', and various return and risk metrics. A red arrow points to a plus icon in the top navigation bar. A dark overlay menu is open, showing four main categories: 'FERRAMENTAS BÁSICAS', 'FERRAMENTAS AVANÇADAS', 'INDICADORES', and 'BASE DE DADOS'. Under 'FERRAMENTAS BÁSICAS', the 'Screening' option is highlighted with a red arrow. The 'Economática' logo is visible at the bottom of the overlay.

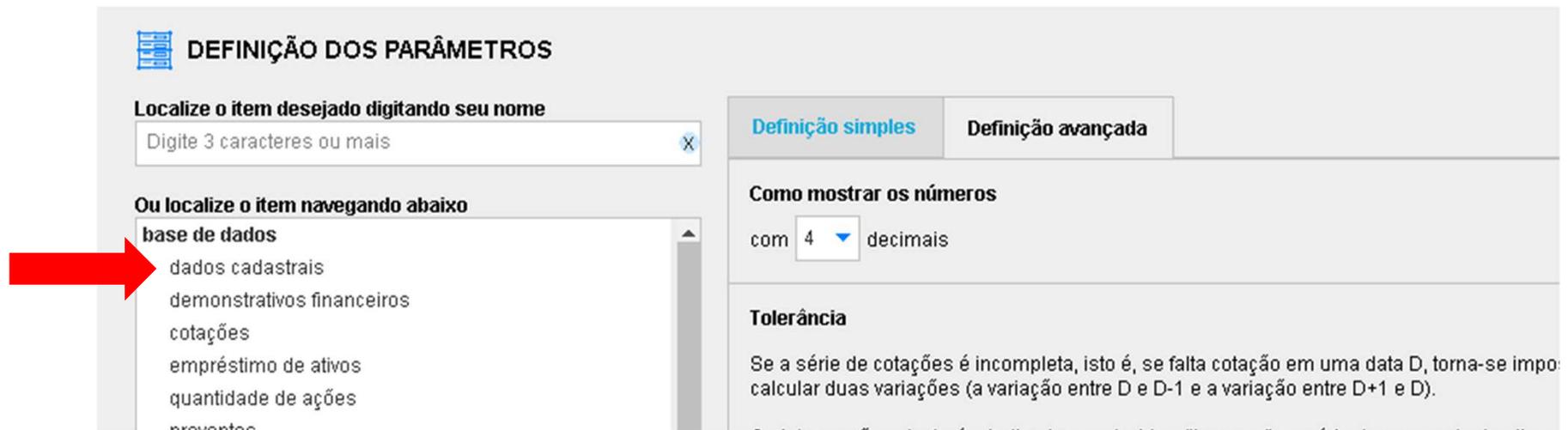
| Nome | Classe | Código | Negociabilidade | Retorno do fechamento | Retorno do fechamento | Retorno do fechamento | Risco base anual | Risco base anual | Risco base anual | Beta Mai19 | Beta 31Mai19 | Beta 31Mai19 | Cor |
|------|--------|--------|-----------------|-----------------------|-----------------------|-----------------------|------------------|------------------|------------------|------------|--------------|--------------|-----|
| | | | 31Mai19 | média mensal | média diária | média diária | Mai19 | 31Mai19 | 31Mai19 | 3 anos | 3 anos | 1 anos | |

- FERRAMENTAS BÁSICAS**
 - Screening
 - Matrix
 - Gráficos
 - Lâmina
- FERRAMENTAS AVANÇADAS**
 - Valuation DCF
 - Otimização de carteiras
 - Pair trading (long-short)
- INDICADORES**
 - Financeiros
 - Técnicos
 - De mercado
- BASE DE DADOS**
 - Dados cadastrais
 - Demonstrativos financeiros
 - Cotações
 - Empréstimo de ativos
 - Proventos
 - Quantidade de ações
 - Acionistas
 - Composição da carteira
 - Fundos que têm este ativo
 - Notícias

Economática

Escolher as opções do Screening

- Abrirá uma janela com as “TELAS PRÉ FORMATADAS”
- Clicar em “Todos os ativos”
 - Abrirá uma tela com todos os ativos da Económica
- Clicar em adicionar nova coluna, abrirá a tela:



- Clicar em dados cadastrais, selecionar códigos, clicar em OK

- Pela coluna de códigos, procurar e marcar os 10 ativos nas caixas de seleção:

| | | Classe | Código | |
|--------------------------|---|--------------|--------|-------|
| <input type="checkbox"/> | 1 | Petrobras | PN | PETR4 |
| <input type="checkbox"/> | 2 | ItauUnibanco | PN | ITUB4 |
| <input type="checkbox"/> | 3 | Vale | ON | VALE3 |
| <input type="checkbox"/> | 4 | Bradesco | PN | BBDC4 |

- Clicar no filtro

| Beta Mai19 3 anos n moeda orig | Beta 31Mai19 3 anos Em moeda orig | Beta 31Mai19 1 anos Em moeda orig | Correlacao Mai19 3 anos Em moeda orig Petrobras PN | Correlacao Mai19 3 anos Em moeda orig ItauUnibanco... | Correla Ma 3 a |
|---|--|--|--|---|----------------------|
| 1,7502 | 1,6494 | 1,5046 | 1,0000 | 0,7288 | 0,21 |
| 1,3417 | 1,1259 | 1,1083 | 0,7288 | 1,0000 | 0,11 |
| 0,9710 | 0,9704 | 0,9999 | 0,9999 | 0,4047 | 4,01 |

ou

| Bovespa | |
|---|--------|
| Tela de filtros | |
| Tela de ordenação | |
| Tela de agrupamento | |
| Pasta dos dados-do-usuário: S:\user-data\ | |
| Alterar data de todas as colunas | |
| Mostrar/Ocultar colunas | |
| Localizar | Ctrl+F |

- Nas opções de filtragem, escolher a opção “mostrar somente os marcados”

PESQUISAR O RETORNO

- Clicar em adicionar nova coluna, abrirá a tela a seguir
- Clicar em indicadores técnicos, escolher retorno. Depois, definição avançada

The screenshot displays the 'DEFINIÇÃO DOS PARÂMETROS' (Parameter Definition) interface. On the left, a search bar is present with the text 'Localize o item desejado digitando seu nome' and a placeholder 'Digite 3 caracteres ou mais'. Below it, a list of categories is shown: 'base de dados' and 'indicadores'. Under 'indicadores', 'indicadores técnicos' is selected, and 'Retorno' is highlighted. A red arrow points to this selection. On the right, the 'Definição avançada' (Advanced Definition) tab is active, indicated by a red arrow. This tab contains settings for 'Data final do período' (Final Date of Period) and 'Data inicial do período' (Initial Date of Period). The 'Data final do período' section has three options: 'data do último pregão (08/06/2019)', '1 dia antes do último pregão (06/06/2019)', and '31/05/2019', with the last one selected. The 'Data inicial do período' section has three options: 'no ano (desde 31/12/2018)', 'dd/MM/yyyy', and '3 anos atrás (desde 31/05/2016)', with the last one selected. Below these, the 'Mostrar retorno' (Show Return) section has radio buttons for 'no período', 'média semanal', 'média trimestral', 'média diária', 'média mensal', and 'média anual', with 'média diária' selected. At the bottom, there is a 'Moeda' (Currency) section.

Nas definições avançadas

- Data final do período: 31/05/2019
- Data inicial do período: 3 anos atrás
- Mostrar retorno: média diária

The image shows a screenshot of a web interface for defining advanced parameters. It is divided into three sections: 'Data final do período', 'Data inicial do período', and 'Mostrar retorno'. Red arrows point to the selected options in each section.

Data final do período

- data do último pregão (08/06/2019)
- 1 dia antes do último pregão (06/06/2019) ?
- data da última cotação
- 31/05/2019

Data inicial do período

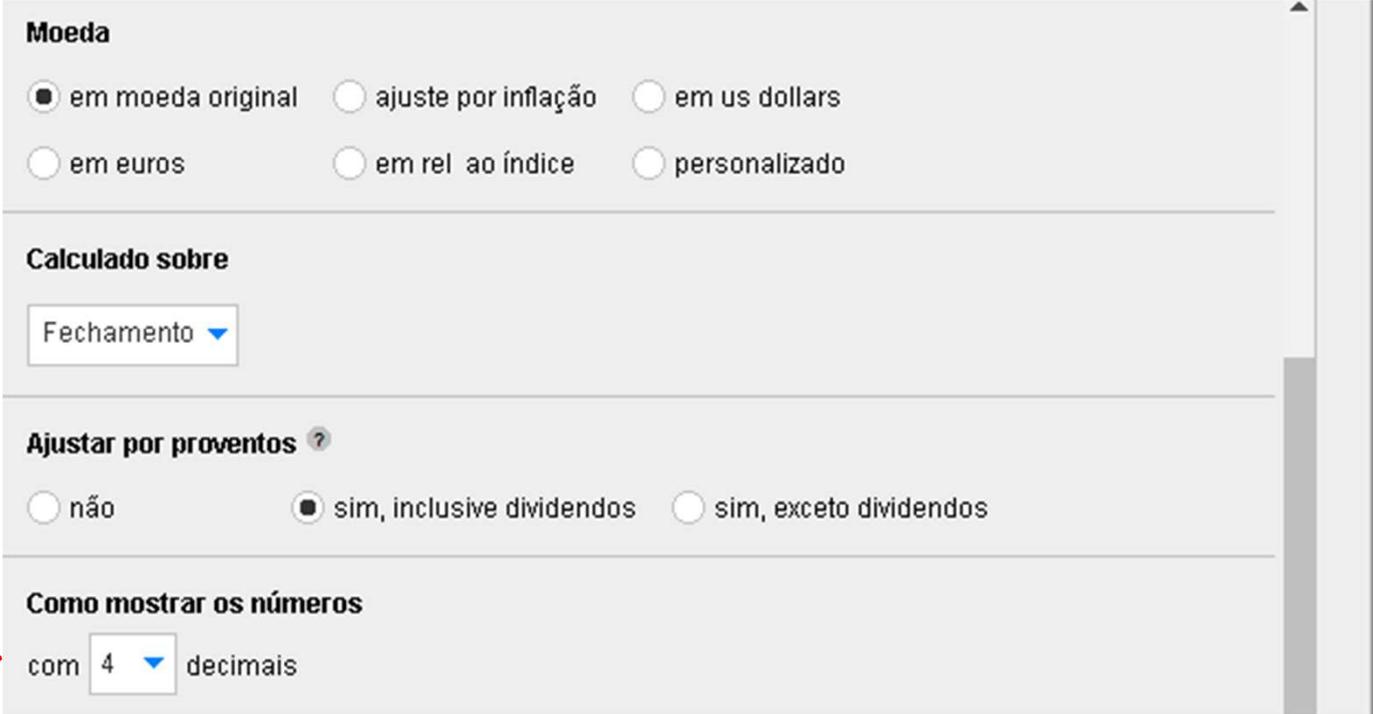
- no ano (desde 31/12/2018)
- dd/MM/yyyy
- 3 anos atrás (desde 31/05/2016) ?

Mostrar retorno

- no período
- média semanal
- média trimestral
- média diária
- média mensal
- média anual

Nas definições avançadas

- Alterar para 4 casas decimais
- Deixar as demais variáveis no padrão (compare e confirme com as imagens)



Moeda

em moeda original ajuste por inflação em us dollars

em euros em rel ao índice personalizado

Calculado sobre

Fechamento ▾

Ajustar por proventos ?

não sim, inclusive dividendos sim, exceto dividendos

Como mostrar os números

com 4 ▾ decimais



PESQUISAR O RISCO (DESVIO)

- Clicar em adicionar nova coluna, abrirá a tela a seguir
- Clicar em indicadores técnicos, escolher risco (ret discr). Depois, definição avançada

DEFINIÇÃO DOS PARÂMETROS

Localize o item desejado digitando seu nome

Digite 3 caracteres ou mais

Ou localize o item navegando abaixo

- dados cadastrais
- demonstrativos financeiros
- cotações
- empréstimo de ativos
- quantidade de ações
- proventos
- acionistas
- composição da carteira
- notícias
- dados-do-usuário
- indicadores**
 - indicadores financeiros
 - indicadores de mercado
 - indicadores técnicos
 - Risco (ret discr)**
 - definido pelo usuário
- ferramentas de análise

Definição simples | **Definição avançada**

Data

- data do último pregão (08/06/2019)
- 1 dia antes do último pregão (06/06/2019) ?
- data da última cotação
- 31/05/2019
- selecionar várias datas: 31/05/2019

Data inicial do período

- no ano (desde 31/12/2018)
- dd/MM/yyyy
- 3 anos atrás (desde 31/05/2016) ?
- EWMA lambda 97 %, tolerância 0,1 % (227 dias úteis)
- selecionar vários períodos: 3 anos

Nas definições avançadas

- Data: 31/05/2019
- Data inicial do período: 3 anos atrás

Data

data do último pregão (08/06/2019)

1 dia antes do último pregão (06/06/2019) ?

data da última cotação

31/05/2019

selecionar várias datas: 31/05/2019

Data inicial do período

no ano (desde 31/12/2018)

dd/MM/yyyy

3 anos atrás (desde 31/05/2016) ?

EWMA lambda 97 %, tolerância 0,1 % (227 dias úteis)

selecionar vários períodos: 3 anos

Nas definições avançadas

- Calcular indicador usando série de cotações: diárias
- Mostrar risco (ret discr) em base: anual
- Alterar para 4 casas decimais
- Deixar as demais variáveis no padrão (compare e confirme com as imagens)

Calcular indicador usando série de cotações

diárias mensais anuais
 semanais trimestrais

Mostrar risco (ret discr) em base

diária mensal anual
 semanal trimestral

Moeda

em moeda original ajuste por inflação em us dollars
 em euros em rel ao índice personalizado

Como mostrar os números

com decimais

PESQUISAR AS CORRELAÇÕES

- Clicar em adicionar nova coluna, abrirá a tela a seguir
- Clicar em indicadores técnicos, correlações (r). Depois, definição avançada

DEFINIÇÃO DOS PARÂMETROS

Localize o item desejado digitando seu nome

Digite 3 caracteres ou mais

Ou localize o item navegando abaixo

base de dados

- dados cadastrais
- demonstrativos financeiros
- cotações
- empréstimo de ativos
- quantidade de ações
- proventos
- acionistas
- composição da carteira
- notícias
- dados-do-usuário

indicadores

- indicadores financeiros
- indicadores de mercado
- indicadores técnicos
- Correlacao (r)**
- definido pelo usuário

Definição simples | **Definição avançada**

Data

- data do último pregão (08/06/2019)
- 1 dia antes do último pregão (06/06/2019) ?
- data da última cotação
- 31/05/2019
- selecionar várias datas: 31/05/2019

Data inicial do período

- no ano (desde 31/12/2018)
- dd/MM/yyyy
- 3 anos atrás (desde 31/05/2016) ?
- EWMA lambda 97 %, tolerância 0,1 % (227 meses)
- selecionar vários períodos: 3 anos

Nas definições avançadas

- Data: 31/05/2019
- Data inicial do período: 3 anos atrás

Data

data do último pregão (08/06/2019)

1 dia antes do último pregão (06/06/2019) ?

data da última cotação

31/05/2019

selecionar várias datas: 31/05/2019

Data inicial do período

no ano (desde 31/12/2018)

dd/MM/yyyy

3 anos atrás (desde 31/05/2016) ?

EWMA lambda 97 %, tolerância 0,1 % (227 dias úteis)

selecionar vários períodos: 3 anos

Nas definições avançadas

- Calcular indicador usando série de cotações: diárias
- Benchmark: Matriz de correlações

Calcular indicador usando série de cotações

diárias mensais anuais
 semanais trimestrais

Benchmark

Benchmark

| Séries de negócios realizados no país abaixo | Usarão o benchmark definido abaixo |
|--|------------------------------------|
| Argentina | S&P Merval |
| Brasil | Ibovespa |
| Chile | Ipsa |
| Colombia | Colcap |

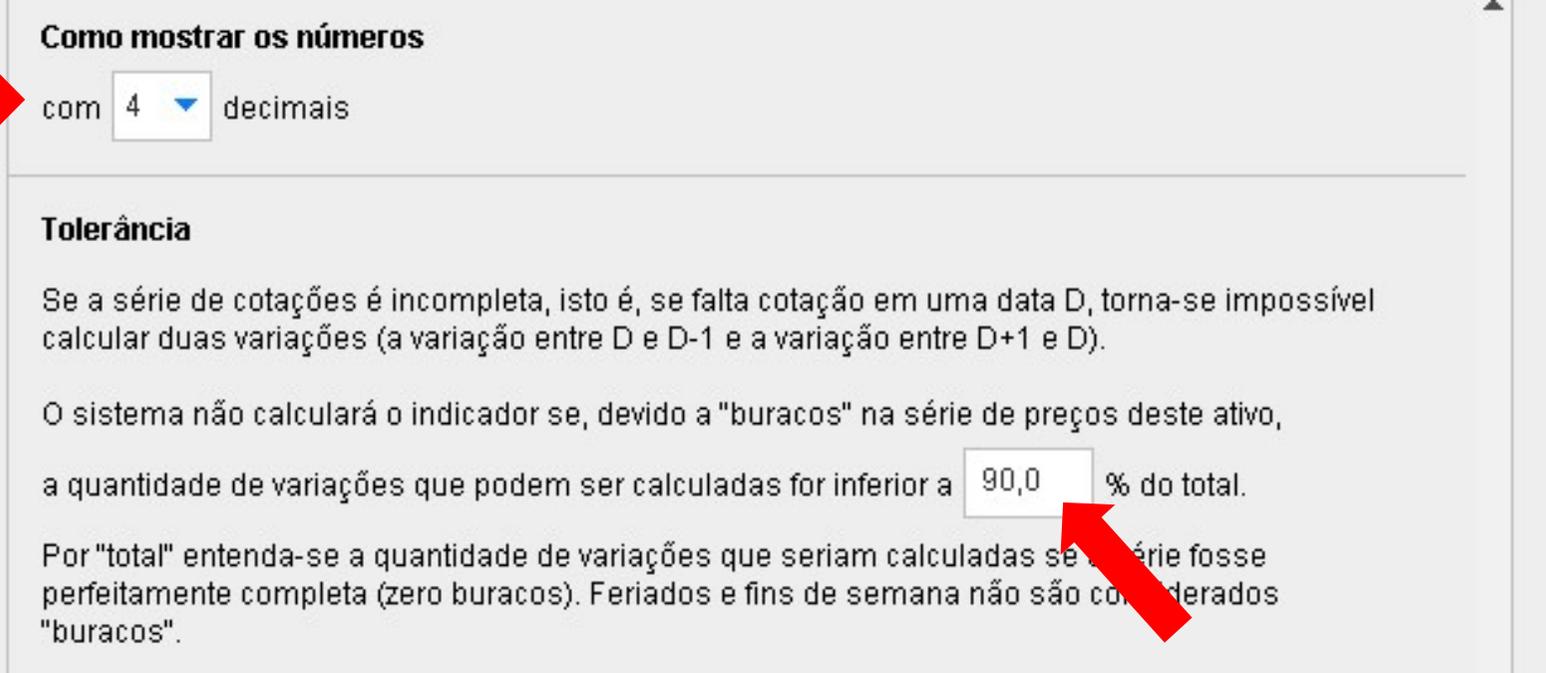
Matriz de correlações
serão criadas várias colunas apresentando a correlação de cada item da janela Screening contra todos os outros itens que estiverem presentes (neste momento) na janela Screening.

Moeda

em moeda original ajuste por inflação em us dollars
 em euros em rel ao índice personalizado

Nas definições avançadas

- Alterar para 4 casas decimais
- Deixar as demais variáveis no padrão (compare e confirme com as imagens)



Como mostrar os números

com decimais

Tolerância

Se a série de cotações é incompleta, isto é, se falta cotação em uma data D, torna-se impossível calcular duas variações (a variação entre D e D-1 e a variação entre D+1 e D).

O sistema não calculará o indicador se, devido a "buracos" na série de preços deste ativo, a quantidade de variações que podem ser calculadas for inferior a % do total.

Por "total" entenda-se a quantidade de variações que seriam calculadas se a série fosse perfeitamente completa (zero buracos). Feriados e fins de semana não são considerados "buracos".

Two red arrows point to the input fields: one to the '4' in the decimal settings and one to the '90,0' in the tolerance percentage.

- **OBSERVAÇÃO:** avaliar os resultados das correlações; se tiverem dados em branco, mudar a "Tolerância" (baixar pra 85%). Avaliar de novo. Se persistirem em branco, baixar pra 80%, e assim por diante.

EXPORTAR PARA O EXCEL

- Deve haver uma coluna com os retornos, uma com o risco e de colunas com correlações.
- Clicar com o botão direito sobre qualquer ponto, escolher “Selecionar tudo”
- Copiar (Ctrl + c). Esperar, vai aparecer um aviso. Apertar (Ctrl + c) de novo.
- Clicar numa planilha em branco do EXCEL (célula A1).
- Colar (Ctrl + v).
- Confirmar se deu tudo certo.