

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 toolbar with various icons, including a red arrow pointing to a plus sign icon. Below the toolbar, a table lists various financial instruments, with a red arrow pointing to the 'Screening' option in the 'FERRAMENTAS BÁSICAS' menu. The menu is divided into four main sections: FERRAMENTAS BÁSICAS, FERRAMENTAS AVANÇADAS, INDICADORES, and BASE DE DADOS. The 'FERRAMENTAS BÁSICAS' section includes options like Screening, Matrix, Gráficos, and Lâmina. The 'FERRAMENTAS AVANÇADAS' section includes Valuation DCF, Otimização de carteiras, and Pair trading (long-short). The 'INDICADORES' section includes Financeiros, Técnicos, and De mercado. The 'BASE DE DADOS' section includes Dados cadastrais, Demonstrativos financeiros, Cotações, Empréstimo de ativos, Proventos, Quantidade de ações, Acionistas, Composição da carteira, Fundos que têm este ativo, and Notícias. The Economática logo is visible at the bottom left of the menu.

Nome	Classe	Código	Negociabilidade 31Mai19 3 anos	Retorno do fechamento média mensal	Retorno do fechamento média diária	Retorno do fechamento média diária	Risco base anual Mai19	Risco base anual 31Mai19	Risco base anual 31Mai19	Beta Mai19 3 anos	Beta 31Mai19 3 anos	Beta 31Mai19 1 anos	Cor
1 Petrobras													
2 ItauUnibanco													
3 Vale													
4 Bradesco													
5 Brasil													
6 An													
7 BS													
8 Itausa													
9 Gerdau													
10 Cielo													
11 Kroton													
12 BRF SA													
13 JBS													
14 Usiminas													
15 Suzano S.A.													
16 CCR SA													
17 BBSeguridade													
18 Lojas Renner													
19 Cemig													

- 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 Economática
- Clicar em adicionar nova coluna, abrirá a tela:

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

Definição simples | Definição avançada

Como mostrar os números

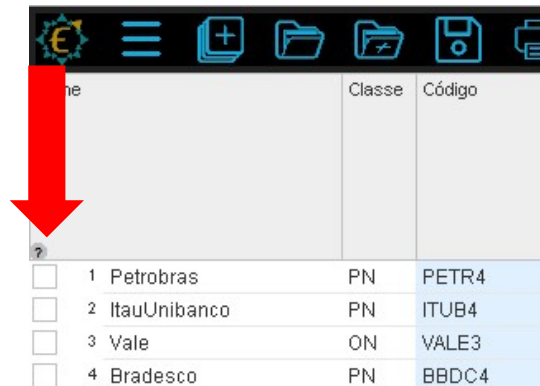
com 4 decimais

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).

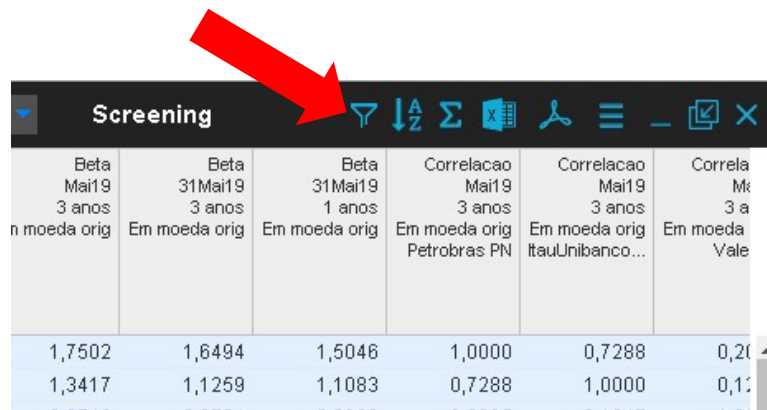
- Clicar em dados cadastrais, selecionar códigos, clicar em OK

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



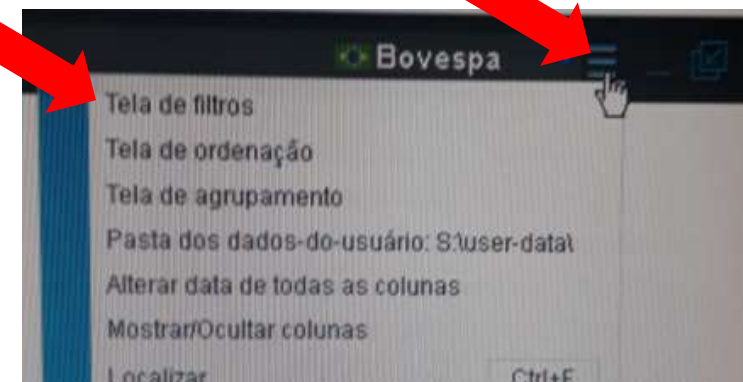
	Classe	Código
<input type="checkbox"/> 1 Petrobras	PN	PETR4
<input type="checkbox"/> 2 ItauUnibanco	PN	ITUB4
<input type="checkbox"/> 3 Vale	ON	VALE3
<input type="checkbox"/> 4 Bradesco	PN	BBDC4

- 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 Em moeda
1,7502	1,6494	1,5046	1,0000	0,7288	0,21
1,3417	1,1259	1,1083	0,7288	1,0000	0,11
0,2710	0,2704	0,2200	0,2200	0,4047	1,00

ou



- 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

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**
- Retorno**
- definido pelo usuário

Definição simples **Definição avançada**

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

Moeda

Nas definições avançadas

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

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) ?

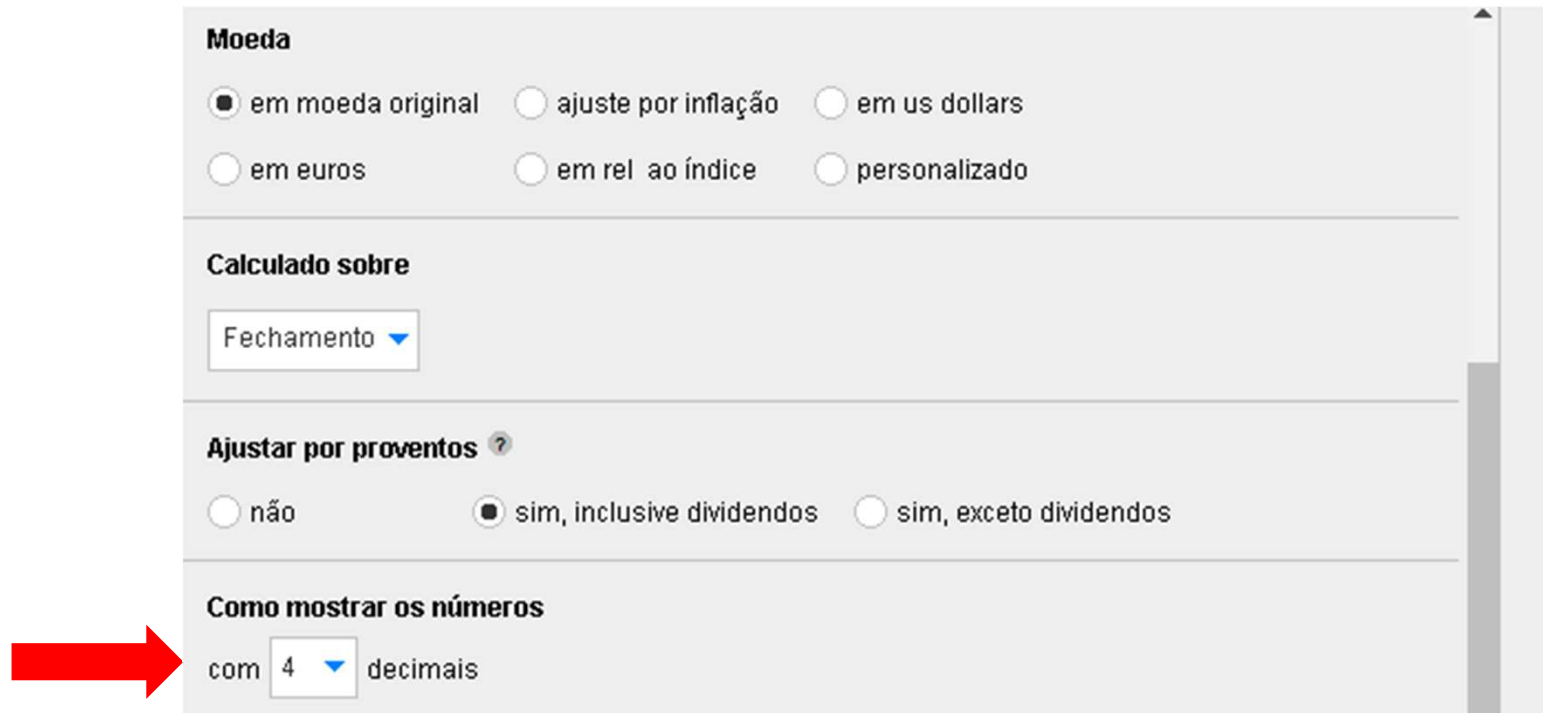
Mostrar retorno

☐ 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)

The image shows a settings panel titled 'Calcular indicador usando série de cotações'. It contains four sections with radio button options and a dropdown menu. Four red arrows point to specific settings: the first arrow points to the 'diárias' option in the first section; the second arrow points to the 'anual' option in the second section; the third arrow points to the '4' in the dropdown menu of the fourth section; and the fourth arrow points to the 'com' text in the fourth section.

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 4 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 4 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 90,0 % 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".

- **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.