Guia Add-in Economatica.





Conheça um pouco mais da **Economatica**, a melhor plataforma de inteligência e dados de mercado com infinitas possibilidades

Base de Dados

Histórico: A partir de 1986.

Países contemplados: Argentina, Brasil, Colômbia, Chile, México, Peru e EUA

Ativos: Ações, FIIs, ADRs, BDRs, ETFs, Debêntures, Títulos públicos, CRIs, CRAs (em breve), índices de renda fixa e renda variável, moedas, índices de inflação, commodities, Fundos 555, Fundos estruturados, Fundos RPPS etc.





Possibilidades

Construção de lâminas para criação de relatório personalizados nos dados e no layout.		Ferramenta para cálculo de Valuation, otimização de carteira e simulações de operações de Long & Short.		Construção de planilhas automatizadas no Excel através do nosso add-in para Excel.
Análise gráfica de todos os dados.		Extração de dados históricos em diversos formatos.		Análise setorial
Construção de carteiras hipotéticas ilimitadas.		Análise comparativa dos dados das empresas e ativos.		Programação de exportação automatizada dos dados.
Avaliação da carteira	a dc	os fundos de forma individual ou o	con	solidada por gestor.

• E mais

Diferenciais

Base de dados: Uma das maiores bases de dados no mundo em histórico e volume com a confiança e credibilidade de quem trabalha há mais de 30 anos nesse mercado. Qualidade dos dados: Dados duplamente revisados a partir das fontes oficiais.

Suporte personalizado sem custo adicional.



ÍNDICE

1.	INSTALAÇÃO	03
	1.1. Começando a Usar	03
2.	FÓRMULA ECO-SECURITIES	04
	2.1. Utilidade	04
	2.2. Preenchendo os argumentos da fórmula	04
3.	FÓRMULA ECONOMATICA	05
	3.1. Utilidade	05
	3.2. Preenchendo os argumentos da fórmula	05
	3.3. Exemplo de uso	07
4.	FÓRMULA ECO-BENCHMARK	08
	4.1. Utilidade	08
	4.2. Preenchendo os argumentos da fórmula	08
5.	FÓRMULA ECO-PORTFOLIO	09
	5.1. Utilidade	09
	5.2. Características da Carteira Percentual	09
	5.3. Características da Carteira Financeira.	10
	5.4. Preenchendo os argumentos da fórmula	11
	5.5. Tamanho máximo da Carteira	11
6.	FÓRMULA ECO- DATASET	12
	6.1. Utilidade	12
	6.2. (CA) - A relação dos proventos	12
	6.3. Preenchendo os argumentos da fórmula	12
	6.4. (PH) - A composição da carteira de investimentos de um Fundo ou de uma Carteira Hipotética	13
	6.5. Preenchendo os argumentos da fórmula	13
7.	OPCIONAIS ECO-SECURITIES	14
8.	OPCIONAIS ECONOMATICA	15
9.	OPCIONAIS ECODATASET	16

2



INSTALAÇÃO

Começando a usar

As instruções a seguir são resumidas e oferecem noções básicas sobre o tema.

O "Add-In para Excel da Economatica" é um aplicativo que permite que você acesse a base de dados dos servidores da Economatica diretamente através do Excel (sem usar a interface proprietária do sistema Economatica).

Inicialmente clique no LINK abaixo para baixar o programa "Add-In para Excel da Economatica".

https://economatica.com/add-in-excel

Em seguida, execute este programa.

Após executá-lo seu Excel deve passar a exibir uma aba chamada "Economatica".

ļ	Automatizar	Desenv	volvedor	Ajuca	Eco	onomatic	\mathbf{b}	
Ē	ee Quebra	ar Texto Auto ar e Centraliz	omaticamer ar ~	nte	Geral	% 000	ر بور بور	
,	Alinhamento			Б		Número	,00 <u>,</u> 10	(
	J	К	L	M		N	0	

Para que seu Excel possa acessar os servidores da Economatica será necessário que você faça login. O login será feito através de seu Excel. Clique no botão de "Login" que se encontra na aba "Economatica" de seu Excel.

Faça o login usando o mesmo e-mail e senha que você utiliza para acessar a interface proprietária do sistema Economatica.



Você deverá editar funções nas células do Excel para que elas apresentem dados extraídos dos servidores da Economatica.

Se você preencher uma célula com a função Eco. a célula passará a apresentar para cada finalidade específica existe uma função diferente conforme citado no manual.



FÓRMULA ECO-SECURITIES

Utilidade:

Através da função ECOSECURITIES o usuário definirá filtros para obter uma lista de determinados ativos.

Repare que ocasionalmente novos ativos entram na base de dados (emissão de novas ações etc.) por isso a cada vez que a função ECOSECURITIES for atualizada/processada ocorrerá também uma atualização dos itens da lista.

Preenchendo os argumentos da fórmula:

=ECOSECURITIES("\$T	OCK";"ACTIVE	;"TRUE";"BRA	";"XBSP";;"TI	CKER")													
D E	F G	н	I J	К	L	М	N O	P	Q	R	S						
ECOSECURITIES(Type of	Asset; Active/Canc	eled; Single Entry; C	Country; Exchange;	Show Header; Custo	mized Hea	der; Optic	onals)										
EcoSecurities Function		destand second tests	The section of a 103														
 "STOCKINDEX", "INFLATI 	type of asset of the ION", "FIXEDINCOM	"aesirea securities . IEINDEX" and others	s options are : 51	OCK, FUND, EIF	, CORPOR	ATEBUIN	D, GOVERNMENTBOINE	, ADI	r, commol	JITY, CURR	ENCY,						
								~							-		
Argumentos da função	0				?	×	Argumentos da fi	unção							ſ		×
ECOSECURITIES							ECOSECURITIES										
Type of Asset	STOCK	1				^	Cou	ntry	'BRA'		:	<u>t</u> =	"BRA"				^
Active/Canceled	"ACTIVE"	1	▲ = "ACTIVE"				Excha	nge	XBSP"		:	<u>†</u> =	"XBSP"				
Single Entry	"TRUE"	3	± = "TRUE"				Show Hea	der			:	<u>t</u> =					
Country	"BRA"	3					Customized Hea	der	TICKER"		:	<u>t</u> =	"TICKER"				
Exchange	"XBSP"	1	★ = "XBSP"			~	Optio	nals				<u>†</u> =					~
			= "Waiting f	or click on wizard	ok bu							=	"Waiting fo	r click on wiza	ard ok l	butte	
EcoSecurities Function.							EcoSecurities Fund	tion.									
	Type of Asset	Select the type of a	asset of the desire	d securities . The o	options are	e:			Count	t ry Select t	he origin c	ountry	/ of the comp	anies issuing	the des	sired	
		ADR", "COMMOD	ITY", "CURRENCY",	"STOCKINDEX", "IN	IFLATION",	, U,				securiti "PER" a	es. The opt nd others.	ions a	ire : "USA", "Al	RG", "BRA", "CI	HL", "C(OL", "N	EX",
Resultado da fórmula =	Waiting for clic	k on wizard ok bu	itton to calculate.														
						_	Resultado da form	iula =	Waiting to	r click on w	izard ok bu	itton t	o calculate.		_		
Ajuda sobre esta função	COSECURITIES (Type of Asset Active/Canceled, Single Entry, Country, Exchange, Show Header, Customized Header, Optionals) codecurities Function yreg of Asset Set of the desired securities. The options are : STOCK', 'FUND', 'ETF', 'CORPORATEBOND', 'GOVERNMENTBOND', 'ADR', 'COMMODITY', 'CURRENCY' STOCKINDEX', 'INFLATION', 'FIREDINCOMEINDEX' and others																
Não é necessário que	todos os campo	s (filtros) sejam	preenchidos. V	ocê deve preenc	cher apen	as os ca	impos que sejam ne	cessái	rios e sufici	ientes para	a definir a	lista o	de ativos qu	e você desej	a.		

TYPE OF ASSET

Neste campo você indicará a qual(is) tipo(s) de ativo pertencem os itens que você deseja listar.

As opções são: "STOCK"; "FUND"; "ETF"; "CORPORATEBOND"; "GOVERNMENTBOND"; "ADR"; "COMMODITY"; "CURRENCY"; "STOCKINDEX"; "INFLATION"; "FIXEDINCOMEINDEX"; "RPPSFUND"; "CLOSEDENDFUND" e outras.

ACTIVE / CANCELED

Indique se você deseja itens que atualmente estejam ativos ou itens cuja negociação já foi cancelada.

As opções são: "ACTIVE" e "CANCELED".

SINGLE ENTRY

Empresas que sejam emissoras de vários títulos (várias classes de ações etc.) comparecerão na lista repetidas vezes (uma vez para cada um de seus títulos). Se, entretanto, este campo for preenchido com "TRUE" a empresa comparecerá na lista uma única vez, e estará representada por seu título mais líquido.

<u>COUNTRY</u>

Indique o país de origem das empresas emissoras dos itens que você deseja.

As opções são: "USA", "ARG", "BRA", "CHL", "COL", "MEX", "PER" e outros.

EXCHANGE

Indique a bolsa onde são negociados os itens que você deseja.

As opções são os nomes das bolsas segundo o padrão ISO: "XNYS" (New York Stock Exchange); "XNAS" (NASDAQ); "XBUE" (Bolsa de Comercio de Buenos Ayres); "XBSP" (B3); "XSGO" (Bolsa de Santiago); "XBOG" (Bolsa de Bogotá); "XMEX" (Bolsa Mexicana de Valores); "XLIM" (Bolsa de Valores de Lima) e outras.

SHOW HEADER:

A célula no topo da lista de ativos estará preenchida com o cabeçalho "Código"

Em algumas situações você pode preferir omitir o cabeçalho. Por exemplo quando você está encaixando dados da Economatica em um relatório que já tem um título definido para a coluna/célula.

Para omitir o cabeçalho preencha este campo com "FALSE".

CUSTOMISED HEADER:

Através deste campo você pode escolher um cabeçalho diferente do cabeçalho padrão oferecido pelo sistema.

Digite neste campo o cabeçalho desejado.

OPTIONALS:

Através deste campo o usuário poderá fazer filtros usando outras variáveis além daquelas listadas acima. Ao final deste documento você encontrará um guia dedicado aos opcionais, entre em contato com o suporte da Economatica se precisar de orientações mais detalhadas.



FÓRMULA ECONOMATICA

Utilidade:

Através da função ECONOMATICA o usuário poderá obter dois tipos de conteúdo:

- 1. Um dado (a cotação em uma certa data, o lucro em uma certa data, o setor da empresa, o nome da gestora do fundo etc.)
- 2. A série histórica de um dado (série histórica da cotação em um determinado período, série histórica do lucro em um determinado período etc.)

1. Preenchendo os argumentos da fórmula:

fx =ECONOMAT	ICA(\$B\$6:\$B\$22;"H	Revenues";"12M	N";"LATEST";;;	;"MI	[LLIONS";;;"Rece	ita líquida")			
ECONOMA Economatic Ticker: Type	IICA(Ticker ; Attribute; Ai a Function e one (and only one) ticke	ttribute's period; Dat	e; Range start date; ") or refer to a cell wi	nterva	al; Currency; Multiplier; he ticker symbol is (Ex : A	Show Dates; Show Header; 17) or refer to a cell range w	Customized Header; Optior	nals) are (Ex : Ai	- 7:A27)
Argumentos da função			?	×	Argumentos da função			?	×
ECONOMATICA					ECONOMATICA				
Ticker	\$B\$6:\$B\$22		P>";"TTEN3 <xbsp>";"Q</xbsp>	^	Multiplier	"MILLIONS"			^
Attribute	"Revenues"				Show Dates		<u>1</u> =		
Attribute's period	"12M"	± = "12M"		- 1	Show Header		<u>+</u> =		
Date	"LATEST"	★ = "LATEST"			Customized Header	"Receita líquida"	🛨 😑 "Receita líquida"		
Range start date		<u>+</u> =		~	Optionals		<u>+</u> =		~
Economatica Function.		= "Waiting for	click on wizard ok butt		Economatica Function.		= "Waiting for click on wiz	zard ok butto	וס
	Ticker Type one (and o where the ticker ticker symbols a	nly one) ticker symbol (Ex symbol is (Ex : A7) or refe re (Ex : A7:A27).	: "MSFT") or refer to a cell r to a cell range where a l	ist of	 	Optionals Through this field different inflation Please contact Eco	l you can set various other paramet index, etc.). The syntax however ca pnomatica for instructions.	ters (like cho an be comple	osing a ax.
Resultado da fórmula =	Waiting for click on wizard ok I	button to calculate.			Resultado da fórmula =	Waiting for click on wizard ok bu	utton to calculate.		
Ajuda sobre esta função			OK Cance	lar	Ajuda sobre esta função		ОК	Can	icelar

Não é necessário que todos os campos (filtros) sejam preenchidos. Você deve preencher apenas os campos que sejam necessários e suficientes para definir a lista de ativos que você deseja

TICKER

No campo "Ticker" você deve colocar o código do ativo cuja informação você deseja.

O campo "Ticker" pode ser preenchido de 3 maneiras diferentes:

- Digitar um Ticker. Exemplo: "MSFT" (entre aspas duplas);
- Preencher com as coordenadas de uma célula onde você previamente digitou o Ticker do ativo desejado. Exemplo: A3 (sem aspas);
- Colocar uma faixa de células onde você previamente digitou os Tickers de vários ativos para os quais você deseja a informação. Exemplo: A3:A53 (sem aspas)

ATTRIBUTE

No campo "Attribute" você deverá indicar a informação que você deseja. Exemplos: cotação de fechamento, volume negociado, volatilidade, retorno, P/L e todas as outras centenas de possibilidades que são oferecidas na interface proprietária do sistema Economatica.

Há duas maneiras de preencher o campo "Attribute"

- Escolhendo o atributo em uma lista (recomendado, mais fácil)
- Digitando o nome do atributo

Escolhendo o atributo em uma lista:

Posicione o cursor no campo "Attribute" e clique no ícone destacado na imagem abaixo para acessar a lista de todos os atributos disponíveis.

Você então acessará uma tela igual à tela de escolha de atributo da interface proprietária do sistema Economatica.



<u>Digitando o nome do atributo:</u>

O nome exato que deve ser usado é aquele que aparece nas colunas da janela Screening da versão INGLÊS do sistema Economatica (interface proprietária).

		Close U1 Jul24 adj by CA's orig currency	Volume\$ Latest in this days orig currency in thousands	Volatility yearly basis 01 Jul24 1 years orig currency	Return of close in 1 years (from 01Jul23 to 01Jul24) orig currency adj by CA's
3r Petroleum	RRRP3	27,48			
Allos	ALOS3			24,74	-9,47
Alpargatas	ALPA4				

ATTRIBUTE'S PERIOD

Dependendo do atributo escolhido no campo anterior, será necessário informar o período desejado.

Exemplo: o atributo "Retorno" pode ser "no ano", "em 1 mês", "desde 05/05/2015", "desde o início da série", etc.

Vários atributos, entretanto, não estão associados a um período e para eles este campo deve ser deixado em branco. Exemplos: fechamento, patrimônio líquido, setor etc.

- Para itens como retorno, volatilidade etc. as opções são:
 - "1d", "21d", "52w", "5y", etc;
 - "YTD" (year to date), "QTD", "MTD", "WTD".
 - "From start" (desde o início da série de preços);

Guia Add-in Economatica

Guia Add-in Economatica

- "yyyy-mm-dd" (desde uma data específica);
- Para itens como lucro, margem EBITDA etc. as opções são: o "3m", "12m", "In fiscal Year" (desde o início do exercício fiscal desta empresa);
- A5 (Indicar as coordenadas da célula onde você previamente digitou o período desejado).

DATA

Neste campo você indicará a data para a qual deseja a informação escolhida no campo "Attribute".

Exemplo: a cotação de fechamento no dia 5/5/2015 ou no dia 31/12/2017 ou no dia de hoje ou há um mês etc.

Vários atributos, entretanto, não estão associados a uma data e para eles este campo deve ser deixado em branco. Exemplos: setor, nome da administradora do fundo etc.

A data deve ser escrita entre aspas duplas, em inglês e obedecendo o padrão dos exemplos abaixo.

- Para itens diários como fechamento, volatilidade, P/L etc. as opções são:
 - "yyyy-mm-dd" (em uma data específica);
 - "D-0" (no último dia já encerrado), "D-1" (um dia antes do último dia já encerrado), "D-2", etc;
 - "D-1M" (um mês antes do último dia já encerrado),
 "D-2Y" (dois anos antes do último dia já encerrado), "D-52W", etc.;
 - "latest" (no dia da última vez em que aquele ativo foi negociado/precificado. Esta data será diferente de D-0 apenas para os ativos pouco líquidos que não foram negociados/precificados em D-0);
- Para itens trimestrais como lucro, margem EBITDA, patrimônio líquido etc. as opções são:
 - "yyyy-mm-dd" (em uma data específica);
 - "latest" (do último demonstrativo financeiro disponível para aquela empresa);
 - "Jan/yyyy", "Feb/yyyy", etc (do demonstrativo financeiro com data no mês especificado);
 - "<Mar/yyyy" (do demonstrativo financeiro com data entre 8/Jan e 7/Abr) (*)
 - "<Jun/yyyy" (do demonstrativo financeiro com data entre 8/Abr e 7/Jul) (*);
 - "<Sep/yyyy" (do demonstrativo financeiro com data entre 8/Jul e 7/Out) (*);
 - "<Dec/yyyy" (do demonstrativo financeiro com data entre 8/Out e 7/Jan) (*);

(*) Estas 4 opções (onde há o sinal "<" antes no nome do mês) são úteis quando se está trabalhando com empresas com exercício fiscal irregular, ou seja, que publicam demonstrativos em datas diferentes de 31/Mar, 30/jun., 30/Set e 31/dez.

A5 (Indicar as coordenadas da célula onde você previamente digitou a data desejada).

RANGE START DATE (Série histórica)

Este campo deve ser preenchido somente quando você deseja obter uma informação para uma faixa de datas e não apenas para uma única data.

Neste campo você deverá digitar a data inicial da faixa desejada. O final da faixa será a data que você especificou previamente no campo "Date".

As opções são:

- "yyyy-mm-dd" (desde uma data específica);
- "20d" (20 dias antes da data final especificada no campo "Date"), "52w", "2y" etc.;
- A5 (Indicar as coordenadas da célula onde você previamente digitou a data desejada).

INTERVAL (Série histórica)

Este campo deve ser preenchido somente quando você deseja obter uma informação para uma faixa de datas e não apenas para uma única data.

As opções são:

- "d (mostrar os valores em todos os dias dentro da faixa de datas escolhida);
- "w" (mostrar somente os valores das sextas-feiras dentro da faixa de datas escolhida e no caso de valores acumulativos (*) mostrar os valores acumulados na semana);
- "m" (mostrar somente os valores do último dia dos meses dentro da faixa de datas escolhida e no caso de valores acumulativos (*) mostrar os valores acumulados no mês);
- "q" (mostrar somente os valores do último dia dos trimestres dentro da faixa de datas escolhida e no caso de valores acumulativos (*) mostrar os valores acumulados no trimestre);
- "y" (mostrar somente os valores do último dia dos anos dentro da faixa de datas escolhida e no caso de valores acumulativos (*) mostrar os valores acumulados no ano);
- A5 (Indicar as coordenadas da célula onde você previamente digitou a letra (d, w, m, q ou y) que representa o intervalo desejado).

(*) valores acumulativos são aqueles que estão associados a um período e não a um único momento. Exemplos: volume negociado no período, captação do fundo no período, cotação máxima do período etc.

CURRENCY

A base de dados da Economatica cobre vários países então existem dados em várias moedas diferentes (cotações, demonstrativos financeiros etc.). Através deste campo você poderá converter os dados para outras moedas.

As opções são:

- "USD" (converte para US dólares);
- "EUR" (converte para Euros, não está disponível para algumas moedas);
- "Inflation adjusted" (mostra os valores na moeda original, mas atualizados pela inflação, não está disponível para algumas moedas);

Nos casos em que a função deve retornar uma série histórica de cotações (não se aplica a atributos como Lucro etc.), através deste campo será possível também fazer com que a série inicie em uma base igual a 100.

As opções são:

- "Rebased to 100" (ajusta para que o início da série seja igual a 100)
- "USD rebased to 100" (converte para US dólares e depois ajusta para que o início da série seja igual a 100)
- "EUR rebased to 100" (converte para Euros e depois ajusta para que o início da série seja igual a 100)
- "Inflation adjusted rebased to 100" (atualiza pela inflação e depois ajusta para que o início da série seja igual a 100)

MULTIPLIER

Através deste campo você pode definir se os valores devem ser apresentados em milhares, milhões etc.

Este campo deve ser preenchido somente para itens (atributos) onde o multiplicador faz sentido. Exemplos: Ativo Total, Receita, Volume negociado etc.





Este campo não deve ser preenchido para itens (atributos) como Cotação, Margem líquida, Lucro por ação etc.

As opções são:

- "UNITS" (não aplicar nenhum multiplicador)
- "THOUSANDS"
- "MILLION"
- "BILLIONS"
- "DECIMAL" (alguns atributos como Retorno, Volatilidade etc. vem dos servidores da Economatica expressos em porcentagem (Ex.: 12,7). Caso você prefira apresentá-los em decimais use a opção "DECIMAL". Desta maneira os valores originais serão divididos por 100 e consequentemente serão apresentados em decimais (Ex.: 0,127))

SHOW DATES

Nos casos em que você definiu uma função que traz valores para uma faixa de datas aparecerá uma coluna com as respectivas datas a esquerda dos valores.

Para omitir a coluna de datas preencha este campo com "FALSE".

SHOW HEADER

O Header é a descrição que aparece na célula do topo. Exemplo: "Retorno em 1 ano", "Lucro de 3 meses", etc.

Nas funções de um único ticker e uma única data o header não aparece (por default). O header, entretanto, aparece (por default) nas duas situações abaixo:

- Quando você definiu uma função para vários tickers;
- Quando você definiu uma função que traz uma faixa de datas.

Em algumas situações você pode preferir omitir o header. Por exemplo quando você está encaixando dados da Economatica em um relatório que já tem um design definido.

Para omitir o header preencha este campo com "FALSE".

CUSTOMIZED HEADER

Através deste campo você pode escolher um cabeçalho diferente do cabeçalho padrão oferecido pelo sistema.

Digite neste campo o cabeçalho desejado.

OPTIONALS

Através deste campo você poderá fazer outras definições.

Ao final deste documento você encontrará um guia dedicado aos opcionais.

A sintaxe deste campo pode ser complexa em alguns casos, entre em contato com o suporte da Economatica se precisar de orientações mais detalhada.



EXEMPLO DE USO:

F	3	▼ : × ✓ f	x =ECONOMA	TICA(\$B\$4:\$E	3\$20;"Re	evenue	es";"12M"	;"LATEST	[";;;;"M]	LLIONS";	;;"Recei	ta líqui	da")
	А	В	С	D	E		F	G	н	I	J	к	L
1													
2													
3		Ticker	Nome	Fechamento	P/L	Rece	ita líquida						
4		PETR4 <xbsp></xbsp>	Petrobras	38,05	4,5	R\$	490.647						
5		PETR3 <xbsp></xbsp>	Petrobras	40,38	4,8	R\$	490.647						
6		VALE3 <xbsp></xbsp>	Vale	62,22	7,0	R\$	206.116						
7		ABEV3 <xbsp></xbsp>	Ambev S/A	11,41	12,4	R\$	79.481						
8		ARZZ3 <xbsp></xbsp>	Arezzo Co	51,35	13,9	R\$	4.894						
9		AERI3 <xbsp></xbsp>	Aeris	5,1	-1,8	R\$	2.516						
10		AESB3 <xbsp></xbsp>	AES Brasil	11,39	496,8	R\$	3.474						
11		ANIM3 <xbsp></xbsp>	Anima	3,15	-6,3	R\$	3.769						
12		AFIT3/YBSD>	Afluonto T	7 10	17.7	D¢	60						

7



FÓRMULA ECO-BENCHMARK

Utilidade:

Através da função ECOBENCHMARK você poderá criar um benchmark baseado em qualquer ativo disponível na base de dados da Economatica (de acordo com a base de dados contratada).

Será criada uma série de preços para este benchmark de maneira que seus retornos sejam iguais aos retornos do ativo usado como base, mas amplificados por um fator escolhido pelo usuário

Esta amplificação dos retornos do ativo base pode ser feita através da **adição de um fator** (S&P500 + 6%) ou através da **multiplicação por um fator** (110% do T-bond).

Ex: S&P 500 + 6%, CPI-U + 4%, 110% do T-Bond, etc

NOTA: A série de preços da do benchmark é construída de maneira que as variações DIÁRIAS do benchmark sejam, neste exemplo, 110% das variações DIÁRIAS do ativo usado como base. Uma consequência matemática disto é que as variações ANUAIS do benchmark serão apenas aproximadamente iguais (e não exatamente iguais) a 110% das variações ANUAIS do ativo usado como base.

A data de início da série do benchmark coincidirá com a data de início da série do ativo usado como base.

Na data final o valor da série do benchmark será 100.

EXEMPLOS DE USO:

=ECOBENCH	MARK("IBOV";"	<mark>;9;</mark>	"IBOV +	9% a.a	.")						
ECOBENCH EcoBenchMa Security: Pr	MARK(Security ; Type ark Function ovide the code for th	e of op	eration; Facto	or; Name y	e)						
IBOV + 9% a.a.					115% CDI						
Argumentos da função				? ×	Argumentos da função					?	×
ECOBENCHMARK					ECOBENCHMARK						'
Security	"IBOV"	1 = "IBO	r		Security	"CDI ACUMULADO"	Î	=	"CDI ACUMULADO"		
Type of operation	"A"	1 = "A"			Type of operation	"M"	t	=	"М"		
Factor	9	1 = 9			Factor	115	Î	=	115		
Name	IBOV + 9% a.a.	± =			Name	"115% CDI"	Ť	=	"115% CDI"		
EcoBenchMark Function.	Name Provide the desired name.	-			EcoBenchMark Function.	Name Provide the desired name.		-	*115% CDI		-
Resultado da fórmula =					Resultado da fórmula = 115% CDI				<ecobenchmark>{""ticker</ecobenchmark>	CDI /	ACUMUL
Ajuda sobre esta função			ОК	Cancelar	Ajuda sobre esta função				ОК	Can	celar

Preenchendo os argumentos da fórmula:

SECURITY

Digite neste campo o código (conforme usado no sistema Economatica), do ativo que será a base do benchmark.

Ex : "CPI-U", "S&P 500", etc., para criação do seu BENCHMARCK.

TYPE OF OPERATION

Preencha este campo com, "**A**" para adicionar um fator (Ex: S & P500 + 5%) e "**M**" para multiplicar por um fator (Ex: 110% do T-bond).

FACTOR

Digite o fator.

Ex: 5, 110, etc. Não use o símbolo "%".

NAME

Forneça o nome desejado.



FÓRMULA ECO-PORTFOLIO

Utilidade:

Através da função ECOPORTFOLIO você poderá definir a composição de uma carteira de investimentos contendo qualquer ativo que esteja disponível na base de dados da Economatica: ações, ETFs, fundos, etc ((de acordo com a base de dados contratada).

Existem dois tipos de carteiras diferentes:

- Carteira Percentual: informar os pesos percentuais de cada ativo em uma (ou mais) data.
- Carteira Financeira: informar cada transação de compra e venda.

Características da Carteira Percentual

Para definir uma carteira Porcentual o usuário deverá informar os pesos percentuais de cada ativo em uma determinada data obedecendo a formato do exemplo abaixo

Nota: Não usar o símbolo "%"

SOMA	!)	$< \sqrt{f_x} = \text{ECOPORTFO}$	LIO("P";\$C\$7:\$E\$12;"	5D";"NO";"Carteir	ra Percer	ntual")		
A	В	С	D	E	F	G	н	1
		=ECOPORTFOLIO("P";						
ECOP	ORTFOLIO(Typ	pe of portfolio; Composition/Tra	ansactions; Tolerance; Rebalan	ce; Name)				
Type	of portfolio:	on "P" for perceptage values of the r	ortfolio (it is fod with the perce	ntage weights of each asse	t) "F" to all	ocato financi	al values (S) of the
portfo	olio (it is fed wi	ith the financial values of each pu	irchase and sale)	nage weights of each asse	<i>y. r</i> to un	cate priarier	ut vutues (p	, of the
			01/01/2024	01/02/2024				
		PETR4	25	25				
		VALE3	25	25				
		IBOV	25	25				
		CDI ACUMULADO	25					
		ITUB4		25				

Será criada a série histórica do valor da cota desta carteira.

Na data de início o valor da cota será 100.

Seu início coincidirá com o início da série histórica da componente da carteira que for mais jovem, ou seja, cuja série histórica tenha iniciado mais recentemente.

Exemplo: Se um dos componentes da carteira for uma ação cujas negociações iniciaram-se há apenas 20 dias atrás, então a série do valor da cota da carteira também iniciará 20 dias atrás apenas.

Quando o usuário informar os pesos para apenas uma data, a composição daquela data será referência para as datas anteriores (desde o início) e será referência para as datas posteriores (até hoje)

Quando o usuário informar os pesos para mais de uma data, cada composição definida será referência para as datas posteriores até a data em que o usuário tenha definido uma nova composição (ou até hoje no caso de ser a última composição definida pelo usuário). A primeira composição definida pelo usuário será referência também para datas anteriores (desde o início).

Para as Carteiras Percentuais (não se aplica a carteiras Financeiras) o usuário poderá escolher entre rebalancear ou não rebalancear a composição. Veja esclarecimentos no capítulo "Preenchendo o campo REBALANCE"

Características da Carteira Financeira

Para definir uma carteira Financeira o usuário deverá informar as transações de compra e venda obedecendo o formato do exemplo abaixo.

A	В	C	D		E	F	G	H	
	=	ECOPORTFOLIO("F";							
ECOPO EcoPo	ORTFOLIO(Type of ortfolio Function of portfolio: "P" 1	f portfolio ; Compositio	on/Transactions; Tolerance; R f the portfolio (it is fed with th	ebalance; Nar e percentage w	ne) veiahts of each asset).	"F" to allo	ocate financi	al values (\$)	of the
portfo	lio (it is fed with th	e financial values of ea	ch purchase and sale)	- percentage n					
	1	03/01/2024	PETR4	R\$	50.000,00				
		03/01/2024	VALE3	R\$	30.000,00				
		03/01/2024	IBOV	R\$	10.000,00				
	_	03/01/2024	CDI ACUMULADO	R\$	5.000,00				
		03/01/2024 12/03/2024	CDI ACUMULADO ITUB4	R\$ R\$	5.000,00 15.000,00				
		03/01/2024 12/03/2024 20/03/2024	CDI ACUMULADO ITUB4 PETR4	R\$ R\$ -R\$	5.000,00 15.000,00 25.000,00				
		03/01/2024 12/03/2024 20/03/2024 16/04/2024	CDI ACUMULADO ITUB4 PETR4 ITUB4	R\$ R\$ -R\$	5.000,00 15.000,00 25.000,00 SELL ALL				

Será criada a série histórica do valor da cota desta carteira.

Seu início coincidirá com a data da primeira transação.

Na data de início o valor da cota será 100.

Na carteira Financeira (não se aplica à carteira Porcentual) além do valor da cota, será criada também a série dos valores do patrimônio da carteira.

Vender tudo de um determinado ativo

O recurso explicado a seguir é útil no caso em que se deseje vender tudo de um determinado ativo, ou seja, "**zerar**" a posição daquele ativo na carteira.

A solução mais pratica para este problema é criar uma transação e preencher o campo "**valor**" com "**SELL ALL**" (ao invés preenchê-lo com um valor financeiro).

O exemplo acima mostra uma carteira onde a posição em ITUB4 foi "zerada" em 16/04/2024.

Calculando indicadores das carteiras construídas

Depois de definir a composição da carteira usando a função ECOPORTFOLIO, você usará a função ECONOMATICA para obter dados tais como:

- série histórica do valor da cota desta carteira.
- retorno no ano da carteira.
- volatilidade da carteira.
- fazer um gráfico com a evolução do valor da carteira.
- comparar o desempenho da carteira com o desempenho de um benchmark.
- etc.

Para obter estes dados da Carteira você deverá referenciar na fórmula Economatica a posição da célula que contém a função Ecoportfolio, e por consequência o nome atribuído à carteira, como sendo o "Ticker" da função Economatica

Preenchendo os argumentos da fórmula:

TYPE OF PORTFOLIO

Este campo deve ser preenchido com **P** ou **F** caso deseje uma carteira Porcentual ou uma carteira Financeira respectivamente. Veja explicações sobre este assunto mais acima neste capítulo.

COMPOSITION / TRANSACTIONS

Neste campo você deve indicar o range de células onde você previamente digitou os pesos ou as transações da carteira.

Para definir uma **carteira Porcentual**, conforme explicado anteriormente, você deve informar os pesos percentuais de cada componente em uma (ou mais) data. Não usar o símbolo "%"

Para definir uma **carteira Financeira**, conforme explicado anteriormente, você deve informar as transações de compra e venda.

TOLERANCE

No caso de algum componente da carteira não ter cotação em uma ou mais datas, informe o período máximo que a cotação anterior daquele componente deve ser repetida. Ex : 5D (no mínimo), de 1M, 35D, etc. Caso, mesmo considerando a tolerância escolhida pelo usuário, algum componente ainda apresente datas sem cotação, então a carteira também não terá contação naquelas datas.

NAME

Preencha este campo com o nome que você deseja atribuir à carteira.

REBALANCE

Este campo deve ser preenchido somente para carteiras Percentuais (não se aplica a carteiras Financeiras).

As opções são N (no) e Y (yes). Caso este campo seja deixado em branco valerá a opção N.

- N: Não-Rebalancear. Nas datas posteriores (*) à composição informada pelo usuário a composição da carteira apresentará alterações em relação aos pesos iniciais. Essas alterações são ocasionadas pelo fato de os componentes da carteira apresentarem valorizações diferentes ao longo do tempo.
- Y: Rebalancear. Nas datas posteriores (*) à composição informada pelo usuário, a composição da carteira se manterá inalterada em relação aos pesos iniciais. A composição se manterá inalterada (apesar das componentes da carteira apresentarem valorizações diferentes ao longo do tempo) porque o sistema criará uma situação equivalente a executar vendas e compras diárias necessárias para manter os pesos iniciais inalterados.

(*) Valerá também para as datas anteriores no caso daquela composição ser a única (ou a primeira de várias) informada pelo usuário.

NOTA: Tamanho máximo da Carteira

Há um limite para o tamanho da Carteira.

No caso da **Carteira Porcentual** há um limite para a quantidade de células da matriz, isto é, há um limite para a combinação da quantidade de ativos (linhas) e a quantidade de datas nas quais a composição foi informada (colunas).

No caso da Carteira Financeira há um limite para a quantidade de transações informada.

Não é possível estabelecer um tamanho limite fixo porque este limite depende do conteúdo de cada célula.

Exemplo: Se cada célula estiver preenchida com duas casas decimais (ex 32,96) a quantidade limite de células da matriz será maior do que no caso de as células estarem preenchidas com quatro casas decimais (Ex 32,9655).

Ou seja, o tamanho máximo vai depender de como você vai preencher cada célula.

Apenas como referência, o tamanho máximo para uma Carteira Porcentual com células preenchidas com 2 casas decimais (Ex 32,96) é de aproximadamente 4500 células, isso significa, por exemplo, uma carteira com 45 ativos (linhas) e composição informada em 100 datas (colunas).



FÓRMULA ECO- DATASET

Utilidade:

A função ECODATASET retorna um dos dois tipos de dados:

- (CA) A relação dos proventos (dividendos, bonificações, juros etc.) pagos por um título.
- (PH) A composição da carteira de investimentos de um Fundo ou de uma Carteira Hipotética em várias datas (sobre carteiras hipotéticas veja capítulo Ecoportfolio).

(CA) - A relação dos proventos:

S	OMA	↓ :]	× ✓	$f_x \sim$	=ECO	DATASET(<mark>\$B\$4;"CA";\$B\$6;</mark> \$B\$7)		
	А	В	C	D	•	E	F	
1			ECODA	ATASET(Tic	:ker; D	Data Type; Range end date; Range start date; Currency; Multiplier; Optionals)		
2			EcoDat	aSet Func	tion			
3			Ticker.	: Type one	(and	only one) ticker symbol (Ex : "MSFT") or refer to a cell where the ticker symbol is (E	x: A7)	
4		PET	R4	SET(\$E	3\$4;	Descrição	Fator	
5				25/04/	2024	Dividendo de \$0.55016 por ação	0,986969259	
6	Dta. Base:	11/09/	2024	25/04/	2024	Dividendo de \$0.55016 por ação	0,986797217	
7	Dta. Inc.:	01/01/	2024	25/04/	2024	Dividendo de \$0.022371 por ação	0,999455964	
8				25/04/	2024	Dividendo de \$0.027337 por ação	0,999334816	
9				02/05/	2024	Dividendo de \$0.84963 por ação	0,97985708	
10				02/05/	2024	Dividendo de \$0.84963 por ação	0,979443002	
11				02/05/	2024	Dividendo de \$0.034548 por ação	0,999146565	
12				02/05/	2024	Dividendo de \$0.042218 por ação	0,998956196	
13				11/06/	2024	Dividendo de \$0.44807 por ação	0,988102319	
14				11/06/	2024	Juros sobre o capital próprio de \$0.52162 por ação	0,985982423	
15				11/06/	2024	Juros sobre o capital próprio de \$0.073554 por ação	0,997995262	
16				21/08/	2024	Dividendo de \$0.11385 por ação	0,997008713	
17				21/08/	2024	Dividendo de \$0.5266 por ação	0,986122438	
18				21/08/	2024	Juros sobre o capital próprio de \$0.41275 por ação	0,988969624	
10								

Preenchendo os argumentos da fórmula

ECODATASET Ticker SB54 Currency	Argumentos da função	D				?	×					
Ticker \$8534 PETR4* Data Type "CA" Tota Type "CA" Tota Type "CA" Tota Type "CA" Tota Type Tota Type Tota Type "CA" Tota Type Tota Type one (and only one) ticker symbol (Ex: "MSFT") or refer to a cell where the ticker symbol is (Ex: A7). Resultado da fórmula = Waiting for click on wizard ok button to calculate. Ajuda sobre esta funcão	ECODATASET											
Data Type 'CA' * 'CA' Range end date \$8566 45546 Range start date \$8577 45292 Currency = "Waiting for click on wizard ok butt EcoDataSet Function. = "Waiting for click on wizard ok butt Ticker Type one (and only one) ticker symbol (Ex: "MSFT") or refer to a cell where the ticker symbol is (Ex: A7). Resultado da fórmula = Waiting for click on wizard ok button to calculate. Ajuda sobre esta funcão OK Cancelar	Ticker	SBS4	Ţ	=	"PETR4"		^					
Range end date SBS6	Data Type	"CA"	Ť	=	"CA"							
Range start date SBS7 45292 Currency 	Range end date	\$B\$6	Î	=	45546							
Currency = "Waiting for click on wizard ok butt = "Waiting for click on wizard ok butt EcoDataSet Function. Ticker Type one (and only one) ticker symbol (Ex: "MSFT") or refer to a cell where the ticker symbol is (Ex: A7). Resultado da fórmula = Waiting for click on wizard ok button to calculate. Ajuda sobre esta funcão OK Cancelar	Range start date	\$B\$7	Ť	=	45292							
= "Waiting for click on wizard ok butt EcoDataSet Function. Ticker Type one (and only one) ticker symbol (Ex: "MSFT") or refer to a cell where the ticker symbol is (Ex: A7). Resultado da fórmula = Waiting for click on wizard ok button to calculate. Ajuda sobre esta funcão OK Cancelar	Currency		1	=			~					
Resultado da fórmula = Waiting for click on wizard ok button to calculate. Ajuda sobre esta funcão OK Cancelar	= "Waiting for click on wizard ok butt EcoDataSet Function. Ticker Type one (and only one) ticker symbol (Ex : "MSFT") or refer to a cell where the ticker symbol is (Ex : A7).											
	Resultado da fórmula = Ajuda sobre esta funçã	• Waiting for click on wizard ok o	butt	on t	o calculate.	Cance	lar					

TICKER

No campo "Ticker" você deve colocar o código do ativo cuja informação você deseja.

Para ativos não listados em bolsa (fundos mútuos etc.) coloque o mesmo código usado na interface proprietária do sistema Economatica.

DATA TYPE

Preencha este campo com "CA" (corporate actions) para obter a relação dos proventos (dividendos, bonificações, juros, etc) pagos por um título.

RANGE END DATE

Através deste campo você define a data final da faixa de datas desejada. As opções são:

• yyyy-mm-dd

RANGE START DATE

Através deste campo você define a data inicial da faixa de datas desejada. As opções são:

• yyyy-mm-dd

CURRENCY

Através deste campo você poderá converter os dados para outras moedas. O valor de dividendos e outros proventos pagos será convertido para a moeda escolhida. As opções são:

- USD
- EUR
- Inflation adjusted

MULTIPLIER

Para Proventos (Data Type=CA) este campo não deve ser preenchido. Não faz sentido alterar a unidade em que os proventos são apresentados.

(PH) - A composição da carteira de investimentos de um Fundo ou de uma Carteira Hipotética:

В		C D	E	F	G	Н	1	J	K	L	M	N	0	P	Q	R	S
		ECODATASET(T	icker; Data Type; Range end	date; Range	start date; C	urrency; Mu	Itiplier; Opti	onals)									
		EcoDataSet Fur	iction														
		Ticker: Type or	e (and only one) ticker symi	bol (Ex: "MSFT	") or refer to	a cell where	the ticker sy	mbol is (Ex :	A7)								
IRON	_	épéc-tout-	Descriptio	Classe	20/00/2022	21/10/2022	20/11/2022	21/12/2022	21/01/2024	20/02/2024	21/02/2024	20/04/2024	21/05/2024	20/06/2024	21/07/2024	21/08/2024	20/00/20
IBOV	_	SDSS; PH ;	Descrição	Classe	30/09/2023	31/10/2023	30/11/2023	31/12/2023	12.050	12,022	31/03/2024	12 002	12.042	12 526	12 007	31/08/2024	30/09/20
		VALE3SADSP2	vale	UN	14,676	15,440	14,040	14,10	13,050	12,032	11,010	12,002	13,042	13,520	12,907	11,334	11,00
		TTUB4 <xbsp></xbsp>	Itauunibanco	PN	0,400	6,509	0,004	7,120	7,224	7,434	7,697	7,14	7,273	7,54	7,593	7,20	7,49,
		PETR4 <xbsp></xbsp>	Petrobras	PN	7,76	8,023	7,446	7,432	8,482	8,366	7,897	9,103	8,763	8,532	8,081	1,11	7,434
		PETR3 <xbsp></xbsp>	Petrobras	ON	4,806	4,947	4,426	4,054	4,607	4,4//	4,21/	4,997	4,33	4,264	4,13	4,683	4,51
		BBAS3 <xbsp></xbsp>	Brasil	ON	3,289	3,4/4	3,502	3,44	3,683	3,752	3,725	3,697	3,813	3,728	3,569	3,56	3,65
		BBDC4 <xbsp></xbsp>	Bradesco	PN	3,611	3,641	3,802	3,844	3,628	3,23	3,397	3,418	3,219	3,122	3,02	3,574	3,60
		ELET3 <xbsp></xbsp>	Eletrobras	ON	3,584	3,49	3,675	3,673	3,711	3,932	3,823	3,557	3,348	3,424	3,641	3,31	3,347
		WEGE3 <xbsp></xbsp>	Weg	ON	2,636	2,473	2,3	2,39	2,2	2,481	2,62	2,78	2,753	3,067	3,552	3,061	3,054
		B3SA3 <xbsp></xbsp>	B3	ON	3,433	3,197	3,439	3,54	3,368	3,281	3,109	2,868	2,966	2,817	2,876	3,113	3,008
		SBSP3 <xbsp></xbsp>	Sabesp	ON	1,018	1,003	1,043	1,12	1,231	1,228	1,333	1,304	1,242	1,252	2,219	2,884	2,91
		ITSA4 <xbsp></xbsp>	Itausa	PN	2,308	2,271	2,411	2,435	2,467	2,521	2,611	2,437	2,671	2,681	2,675	2,682	2,78
		ABEV3 <xbsp></xbsp>	Ambev S/A	ON	2,826	2,858	2,731	2,637	2,639	2,523	2,541	2,533	2,513	2,462	2,407	2,517	2,578
		BPAC11 <xbsp></xbsp>	Btgp Banco	UNT	1,754	1,722	1,856	1,892	1,903	1,911	1,94	1,823	1,798	1,746	1,775	2,039	2,004
		EQTL3 <xbsp></xbsp>	Equatorial	ON	1,723	1,751	1,694	1,71	1,782	1,709	1,651	1,59	1,671	1,741	1,784	1,896	1,92
		RENT3 <xbsp></xbsp>	Localiza	ON	2,449	2,193	2,324	2,372	2,12	2,064	2,16	1,985	1,806	1,78	1,79	1,802	1,86
		RDOR3 <xbsp></xbsp>	Rede D Or	ON	1,456	1,277	1,411	1,468	1,456	1,35	1,369	1,441	1,555	1,522	1,494	1,629	1,732
		JBSS3 <xbsp></xbsp>	JBS	ON	1,005	1,15	1,196	1,235	1,221	1,195	1,13	1,262	1,619	1,798	1,811	1,781	1,72
		EMBR3 <xbsp></xbsp>	Embraer	ON	0.621	0.653	0.717	0.719	0,768	0.819	1.133	1.163	1.317	1.304	1.522	1.532	1.646
		SUZB3 <xbsp></xbsp>	Suzano S.A.	ON	1.82	1,782	1,669	1.662	1.62	1,758	2,024	1,896	1.6	1.859	1,692	1.545	1,564
		RADL3 <xbsp></xbsp>	RajaDrogasil	ON	1.712	1.649	1.611	1.639	1.482	1.551	1.616	1.548	1.588	1.614	1.671	1.571	1.55
		PRIO3 <xbsp></xbsp>	Petrorio	ON	1.842	1.926	1.665	1.61	1.614	1.596	1.805	1.822	1.655	1.728	1.827	1.667	1.52
			101	011	4 004	4 445	4 400	4 400	1.045	4.045	1.00	1.01	1 400	4 4 0 0	4 004	4 4 70	4.40

Preenchendo os argumentos da fórmula:

Ticker	SBS5	± = 'IBOV'	
Data Type	"PH"	± = 'PH'	
Range end date	"LATEST"	▲ = "LATEST"	
Range start date		<u>+</u> =	
Currency		<u>↑</u> =	
oDataSet Function.		 "Waiting for click o 	n wizard ok butt
	Ticker Type one	(and only one) ticker (ymbol (Ex : "h	ISET") or refer to a ce
	where the	ticker symbol is (Ex : A7).	isi'i yorrerereo a ce

TICKER

No campo "Ticker" você deve colocar o código do ativo cuja informação você deseja.

Para ativos não listados em bolsa (fundos mútuos etc.) coloque o mesmo código usado na interface proprietária do sistema Economatica.

DATA TYPE

Preencha este campo com "PH" (portfolio holdings) para obter a composição da carteira de investimentos de um Fundo ou de uma Carteira Hipotética em várias datas.

RANGE END DATE

Através deste campo você define a data final da faixa de datas desejada. As opções são:

- yyyy/mm/dd
- Latest: O final da faixa de datas será a data para a qual está disponível a informação mais recente.
- Last Fully Disclosed: O final da faixa de datas será a data para a qual está disponível a carteira mais recente "aberta", ou seja, da carteira mais recente que não tenha investimentos em "Títulos não revelados".

RANGE START DATE

Através deste campo você define a data inicial da faixa de datas desejada. As opções são:

- yyyy/mm/dd
- 6m (significando 6 meses antes da data definida no campo Range End Date), 3m, 2y, 5y etc.

CURRENCY

Através deste campo você poderá converter os dados para outras moedas.

ÊCONOMATICA

Para carteiras de investimentos (**Data Type=PH** na situação em que está sendo apresentado o **peso percentual** de cada ativo e não seu valor financeiro): Este campo não deve ser preenchido. A definição da moeda não terá nenhum efeito sobre os pesos percentuais.

Para carteiras de investimentos (**Data Type=PH** na situação em que está sendo apresentado o **valor financeiro** de cada ativo e não seu peso percentual): O valor financeiro de cada ativo será convertido para a moeda escolhida. As opções são:

- USD
- EUR
- Inflation adjusted

MULTIPLIER

Através deste campo você poderá escolher a unidade em que os dados devem ser apresentados (milhares etc.).

Para carteira de investimentos (**Data Type=PH** na situação em que está sendo apresentado o **peso percentual** de cada ativo e não seu valor financeiro): O valor porcentual de cada ativo será convertido conforme as opções abaixo:

- Deixar o campo vazio: serão apresentados os pesos percentuais de cada ativo (Ex. 12,7)
- Decimal: serão apresentados estes mesmos valores, mas divididos por 100 (Ex. 0,127). Este recurso é útil para permitir que o usuário possa formatar as células no Excel conforme sua preferência (adicionar símbolo "%", etc.)

Para carteira de investimentos (**Data Type=PH** na situação em que está sendo apresentado o valor financeiro de cada ativo e não seu peso percentual): O valor financeiro de cada ativo será convertido para a unidade escolhida. As opções são:

- Units (sem multiplicador)
- Thousands
- Million
- Billion



OPCIONAIS

OPCIONAIS | ECO-SECURITIES

Filtrando por atributos de texto

 As classificações dos ativos no sistema, como classificação setorial, classificação Anbima dos fundos, Gestor dos fundos e outros podem ser utilizados para filtrar a lista de ativos gerada pela fórmula Eco-securities, seguem exemplos:

Ex.1: "Sector Economatica=Construction" Ex.2: "Sector Economatica=Construction,Telecommunication" Ex.3: "Anbima classification=Multimercados balanceados" Ex.4: "Fund manager=JP Morgan"

 Os filtros do campo OPTIONALS podem usar outros operadores além da igualdade (=) e desigualdade (<>)

Ex.1: Nome da empresa CONTÉM a palavra "Health" "name~health"

Ex. 2: Nome da empresa NÃO CONTÉM a palavra "Health" "name!~health"

Ex. 3: O código ISIN da ação está disponível, ou seja, o valor deste campo NÃO É NULO "ISIN<>null"

 Filtrar as ações que participem de um determinado índice

Neste caso o filtro será através do atributo "Composição da carteira > Índices > Composição da carteira do índice", cujo código é "Index comp". Este atributo, entretanto, obrigatoriamente exige que, através de seu campo OPTIONALS, seja informado o código do índice desejado

EX.: Index comp[OPTIONALS="AmountInvestedBy=IBOV<XBSP>"]>0

Filtrando por atributos numéricos

 Filtrar ações de empresas cujo Ativo Total seja superior a 10.000.000.000

"Total assets>1000000000"

Ao fazer o filtro acima o sistema tomará os valores default atribuídos ao Ativo Total, ou seja, será considerado o valor do demonstrativo mais recente de cada empresa [DATE=LATEST] e seu valor estará expresso na moeda em que o demonstrativo foi originalmente publicado [CURRENCY=ORIGINAL CURRENCY].

Você pode, entretanto, alterar estes parâmetros conforme explicação abaixo:

Ex. 1: Referenciar o valor do Ativo Total do demonstrativo de 31/12/2018: "Total Assets[DATE=2018-12-31]>10000000000.

Ex. 2: Tomar o valor do Ativo Total em Euros: "Total Assets[CURRENCY=EUR]>1000000000.

Ex. 3: Tomar o valor do Ativo Total do demonstrativo de 31/12/2018 em Euros: "Total Assets[DATE=2018-12-31,CURRENCY=EUR]>10000000000

Modelo de Filtro Para Volume médio

Você pode construir filtros com parâmetros de data e período específicos como segue no exemplo e na figura abaixo:

Filtro do volume médio > 10.000.000 com base no volume acumulado no período de 1 mês, considerando a data final do período dia 12-09-2024:

Hist Average[DATE=2024-09-12,Attribute`s period=1M,Optionals={"std.tec.cals=7"}]>10000000

EXEMPLO DE USO:

SC	MA	✓ : >	< <tr	list Average[DA]	FE="&E2&",Attribut	e`s period="&D4&",	Optionals="&D5&"]>	"&D3
	А	В	С	D	E	F	G	н
1								
2			Dta. Últ. Cot.:	12/09/2024	2024-09-12			
3			Volume >:	10.000.000,00				
4			Périodo:	I 1M				
5			Opcional:	{"std.tec.cals=7"}				
6								
7			Filtros:					
8			="Hist Average[DATE="& <mark>E2</mark> &",Attri	bute`s period="&D4&"	,Optionals="&D5&"]>"&	D3	
Q								



Alguns atributos irão demandar o preenchimento do campo Optionals obrigatoriamente

• Composição da carteira do índice (opcional obrigatório)

Busca a informação do peso dos ativos no índice que será determinado no campo Optionals.

O opcional indica o índice para o qual será observado o peso das ações:

Index comp[OPTIONALS="AmountInvestedBy=IBOV<XBSP>"]>0

 Valor investido por fundo em determinado ativo (opcional obrigatório)

Busca o peso de alocação dos fundos no ativo/classe de ativo determinado no campo Optionals.

Ex.1: Valor investido em ações (Asset Class = STOCKS) da Microsoft (MSFT) Amountinvestedin=MSFT

Assetclass=STOCKS

Ex.2: Valor Investido por um fundo em cotas de outros fundos da mesma Empresa Gestora

CONOMATICA

AmountInvestedInFundsOfTheSame = Fund manager

Outros opcionais

 Ajuste de cotação: permite a alteração dos ajustes de proventos na cotação dos ativos.

Ajustada por proventos: AdjustByCorporateActions=Yes (default)

Sem ajuste por proventos: AdjustByCorporateActions=No

Ajustada, porém sem ajuste dos dividendos: AdjustByCorporateActions=YesExceptForCashDividend

Alguns opcionais serão apresentados em formato não intuitivo, será necessário obter a fórmula deles extraindo a fórmula diretamente do sistema web da Economatica como no exemplo a seguir:

Opcional do volume médio

Opcional: std.tec.cals=7

Fórmula:

=ECONOMATICA("PETR4";"HIST AVERAGE";"1M";"LATEST";;;;"THOUSANDS";;;"VOLUME MÉDIO 1M (em milhares)";{"std.tec.cals=7"})

	C	D	E	F	G	Н	1	J	К	L	M	N	0	р	(2	R	S	T	U	V
3	Volume médio 1M Em milhares										2ºCole a fórmu	la no Excel e ide	ntifique d	o opcional:							
i 4 (R\$ 1.399.920											Nome	Classe	"D-0";;;;"ORIGINAL CURRENCY";"THOUSA "false";"true";;{"std.te 7"})	NDS"; c.cals=						
											TTEN3 <xbsp></xbsp>	3tentos	ON	1375	7,36539						
1º C	Construa a informaç	ão no s	istema web	e solicite a	exporta	ão da fórm	ula conform	ne imagem	1:		QVQP3 <xbsp></xbsp>	524 Particip	ON								
											ABCB4 <xbsp></xbsp>	Abc Brasil	PN	1932	4,30844						
		Classe	Código	M	edia						EALT3 <xbsp></xbsp>	Aco Altona	ON	Argumentos da função							?
				do volui	:=0 me\$						EALT4 <xbsp></xbsp>	Aco Altona	PN								
				em 1 me	ses C						AERI3 <xbsp></xbsp>	Aeris	ON	ECONOMATICA							
				(de 14Ag até 13Se	1024 CC t24)						AESB3 <xbsp></xbsp>	AES Brasil	ON	Multiplier	'THOUSANDS'		1	= 'THO	USANDS"		
				Em moeda	orig						AESO3 <xbsp></xbsp>	Aesoperacoes	ON	Show Dates	'false'		Ť	= 'false			
			-	en nuna	11 GS	Alterar narâm	etech ente	coluna		1	AFLT3 <xbsp></xbsp>	Afluente T	ON	Show Header	'true'		Î	= "true"			
316	entos A Dartinia		TTEN3	13.	/5/	Ronotir octa i	roluna com	outroe narâr	metros		GRAO3 <xbsp></xbsp>	Agribrasil	ON	Customized Header			Ť	-			
2 32	se manucip	DN	GVQP3	40.1	224		2		[]]		AGXY3 <xbsp></xbsp>	Agrogalaxy	ON	Optionals	{"std.tec.cals=7"		1	= {"std.t	ec.cals=7"}		
* AU	JC Brasil		ABCBA	19.	324	insenr coluna	i a esquero	a desta			RPAD3 <xbsp></xbsp>	Alfa Holding	ON					-			
Ac	o Altona	DN	CALIS	_	233	Ocultar colun	a				RPAD5 <xbsp></xbsp>	Alfa Holding	PNA	Economatica Eunction				= vvalt	ing for click	on wizard	SK DULLO
8 . 6.4	vio		ACDI2		193	Apagar colun			Del		RPAD6 <xbsp></xbsp>	Alfa Holding	PNB		Multiplier Th	a antiana a	IN THE OFFICE	THOUSA		ONC: TRULE	ONC: (co
7 40	no P Bracil		AEGDO	20.1	794	Crescente					APTI3 <xbsp></xbsp>	Aliperti	ON		at	tributes like	"RETURN"	VOLATIL	ITY', etc con	ne from Eco	nomatic
	coneraçãos		AEGOS			Decrescente					APTI4 <xbsp></xbsp>	Aliperti	PN	_	pe	ercentage, to	divide the	em by 100	use option	"DECIMAL")	p.
9 61	luente T		AFLT3		10	Decrebeenne					FRRN3B <xbsp></xbsp>	All Norte	ON								
	ribrasil		GRA03			Inserir filtro b	aseado nes	ta coluna			FRRN5B <xbsp></xbsp>	All Norte	PNA	Kesuitado da formula = V	vaiting for click	on wizard o	K putton t	o carculato	e		
1 Ac	Ingralaw	ON	AGXY3		378	Agrupar por e	issa coluna				FRRN6B <xbsp></xbsp>	All Norte	PNB	Ajuda sobre esta função						OK	Cano
2 2 2	jioganas)		RPAD3			Marcar os ite	ns selecion	ados			AALR3 <xbsp></xbsp>	Alliar	ON	L,		_	_				
3 Alt	fa Holding	PNA	RPAD5		27	Selecionar tu	do				ALLD3 <xbsp></xbsp>	Allied	ON		726,221						
4	iu i loidilige	PNB	RPAD6					n			ALOS3 <xbsp></xbsp>	Allos	ON	1133	67,5602						
		ON	APTI3							·	ALPA3 <xbsp></xbsp>	Alpargatas	ON	69,4	8095652						
Ali	iperti	DNI	ADTIA		0						ALPA4 <xbsp></xbsp>	Alpargatas	PN	3416	2,10491						

Existem opcionais nos quais a fórmula de requisição será muito específica, entre em contato com o nosso suporte para maiores esclarecimentos.

OPCIONAIS | ECODATASET

Carteiras de investimento (Data Type=PH)

- presentation=\$: Serão apresentados os valores financeiros de cada ativo (e não seu peso percentual, que é a alternativa default).
- consolidate=yes: Caso o fundo tenha investimentos em cotas de outros fundos, todos os fundos investidos serão "abertos" e todos os ativos serão consolidados.
- interval=D (ou W, M, Q, Y): Por default, a função Ecodataset apresenta a composição da carteira nos finais de cada mês. Preenchendo o campo Optionals desta maneira a composição da carteira será apresentada dia a dia (ou no período escolhido pelo usuário).

Carteira hipotética

É possível apresentar a contribuição de cada ativo para o retorno total de uma Carteira Hipotética (carteiras criadas pelo usuário através da função Ecoportfolio) dentro em um período escolhido pelo usuário.

- presentation=contribution: Identifica quanto cada ativo integrante da carteira contribuiu para o retorno total da carteira em um determinado período.
- contributionperiod=1m: Define o período no qual será calculada a contribuição.

No exemplo acima o período escolhido foi de um mês, mas todas as opções abaixo podem ser usadas:

- 1m, 1d, 21d, 52w, 5y etc.
- YTD (year to date), QTD, MTD, WTD
- from start (desde o início da série de preços da carteira hipotética)
- yyyy-mm-dd (desde uma data específica)
- Formatação: O campo Optionals deve ser preenchido com os dois comandos abaixo (separados por ponto-e-vírgula): presentation=contribution;contributionperiod=1m

\vee : $\times \checkmark f_x \lor$ =ECODATASET(C3;"ph	;"last fully disclosed";"24M";;;F2:F3)																
С	D	E	F		G		н	1		J	К	L	м		N	0	
FUNDO 010431	-	Opcionais>	INTERVAL=Q presentation=\$														
F3) Descrição		Classe	Tipo de investimento	1	31/03/202		30/06/2022	30/09/2022	31/	12/2022	31/03/2023	30/06/202	3 30/09/2	023	31/12/2023	31/03/202/	4
Títulos não revelados			Cotas de fundos													R\$ 6.287.693	1
Títulos não revelados			Operações compromissa	das												R\$ 17.113	
Valores a pagar			Valores a pagar	-	R\$ 237.68	5 -R	\$ 12.347	-R\$ 11.202	-R\$	11.071	-R\$ 10.376	-R\$ 9.719	-R\$ 9.3	307 -	R\$ 9.780	R\$ 11.223	1
Disponibilidades			Disponibilidades		R\$ 1	0 R	\$ 10	R\$ 10	R\$	10	R\$ 10	R\$ 10	R\$	10	R\$ 10	R\$ 10	, T.
Valores a receber	America de Constru	-	2 .		R\$ 21.00	8 R	\$ 172	R\$ 14	R\$	38.001	R\$ 397	R\$ 29	R\$	14	R\$ 1	R\$ 0	6
Cosan S/A / Cod: Czz / Tipo: Out	ro		1 /	^	R\$ 79.05	2											
597570 <bran -="" cougar="" dynamo="" fia<="" master="" td=""><td>ECODATASET</td><td></td><td></td><td>-10</td><td>R\$ 7.194.84</td><td>2 R</td><td>\$ 5.365.993</td><td>R\$ 6.052.192</td><td>R\$ 5.</td><td>701.026</td><td>R\$ 5.082.643</td><td>R\$ 6.011.104</td><td>R\$ 5.789.4</td><td>468</td><td>R\$ 6.333.123</td><td></td><td></td></bran>	ECODATASET			-10	R\$ 7.194.84	2 R	\$ 5.365.993	R\$ 6.052.192	R\$ 5.	701.026	R\$ 5.082.643	R\$ 6.011.104	R\$ 5.789.4	468	R\$ 6.333.123		
BRSTNCLF1R¢LFT 210100	Range end date 'last fully disclosed'	🛨 = 'last full	y disclosed"	~		R	\$ 20.319										
Loma Negra Cia Ind Spon / Cod	Le Range start date "24M"	± = '24M'			R\$ 9.92	0											
BRSTNCLTN7 LTN 100000	Currency	† =			R\$ 6.48	2			R\$	8.201							
BRSTNCLTN7 LTN 100000	Multipliar	* -						R\$ 13.259	9								
BRSTNCLTN8 LTN 100000	Multiplier	<u>.</u>										R\$ 21.414					
Mercadolibre Inc / Cod: Meli Us	/1 Optionals F2:F3	T = {INTERV	AL=Q; presentation=5 }	×	R\$ 134.42	8											
BRSTNCNTB0 NTN-B 760199		- 'Waiting	for click on wizard ok buttor								R\$ 11.535						
BRSTNCNTB3 NTN-B 760199	EcoDataSet Function.												R\$ 24.	053			
BRSTNCNTB0 NTN-B 760199	Range end date Choose the end	date of the range	to be shown. The options are												R\$ 18.791		_
Total	you can also use	"LAST FULLY DISC	LOSED" (=last open portfolio).	ata	R\$ 7.208.05	7 R	\$ 5.374.147	R\$ 6.054.273	8 R\$ 5.	736.166	R\$ 5.084.208	R\$ 6.022.839	R\$ 5.804.	238	R\$ 6.342.144	R\$ 6.316.039	1
				_													_
Total Investido + Caixa (em mill	al Resultado da fórmula = Waiting for click on wizard ok t	outton to calculat	e.		R\$ 7.208.03	7 R	\$ 5.374.147	R\$ 6.054.273	8 R\$ 5.	736.166	R\$ 5.084.208	R\$ 6.022.839	R\$ 5.804.1	238	R\$ 6.342.144	R\$ 6.293.593	1
PL (em milhares)	Ajuda sobre esta função		OK Cancela		R\$ 7.208.05	7 R	\$ 5.374.147	R\$ 6.054.273	8 R\$ 5.	736.166	R\$ 5.084.208	R\$ 6.022.839	R\$ 5.804.	238	R\$ 6.342.144	R\$ 6.293.593	_
Data de divulgação					08/04/20	22	09/07/2022	17/10/202	2 09/	01/2023	11/04/2023	31/10/202	3 31/10/2	2023	05/01/2024	04/04/2024	4
Data da última retificação					05/08/20	22	05/08/2022	19/10/202	2 11/	01/2023	14/04/2023	20/01/202	4 27/04/2	2024	02/07/2024	06/04/2024	4

Existem opcionais nos quais a fórmula de requisição será muito específica, entre em contato com o nosso suporte para maiores esclarecimentos.

EXEMPLO DE USO:

