

# “Bases de Datos Financieras”

Óscar Carchano Alcina

*Profesor Departamento de Economía Financiera y Actuarial*

*Universidad de Valencia*

[Oscar.Carchano@uv.es](mailto:Oscar.Carchano@uv.es)

Diciembre 2018

# ÍNDICE

1. Yahoo! Finance
2. Eikon
3. Datastream
4. SABI

## 2. Eikon

**Reuters** es una agencia de noticias que suministra información a medios de comunicación y mercados financieros.

La Universidad de Valencia tiene contratadas varias licencias de su base de datos Eikon. Para los estudiantes de la UV, se puede acceder con el carnet de la universidad en la Biblioteca de Ciencias Sociales “Gregori Maians” del Campus de Tarongers.



## 2. Eikon

En la planta 0 iremos al mostrador de información. Allí pediremos que nos den acceso a la sala donde está el ordenador (es el 20) con acceso a la base de datos Eikon. Debemos dejar nuestro nombre y carnet de la universidad.

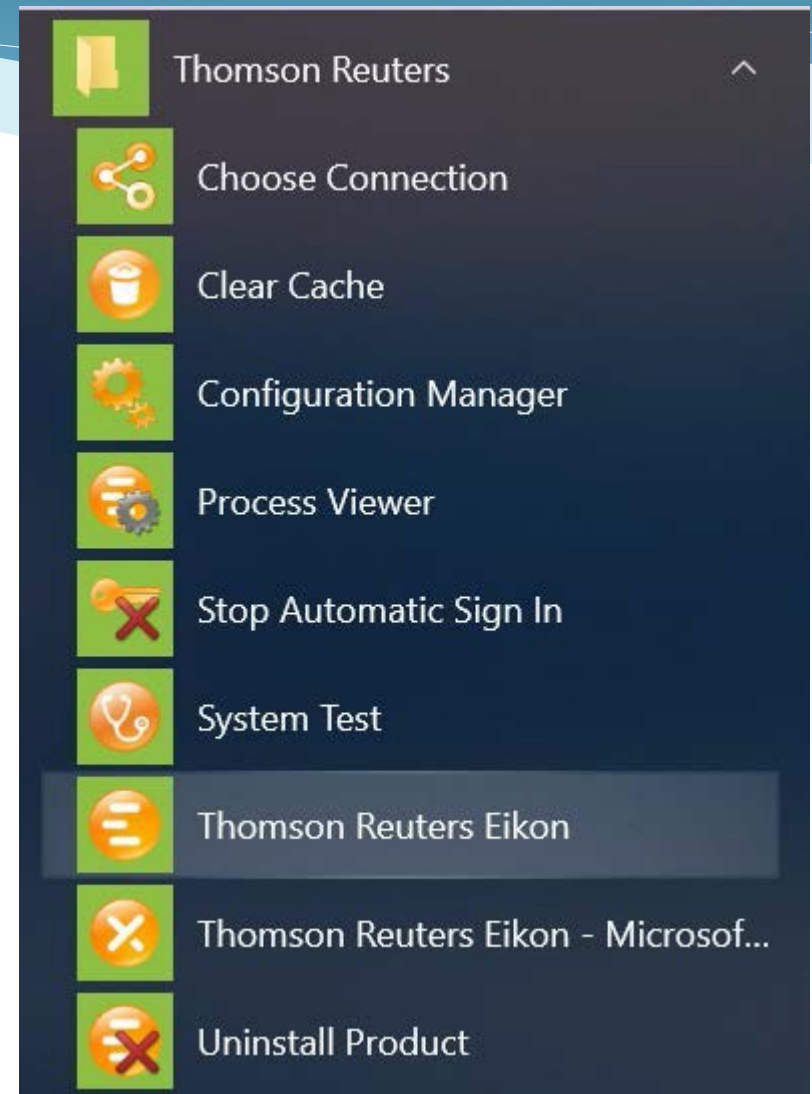
Después, nos acompañarán a la sala donde se encuentra dicho ordenador.



## 2. Eikon

En el ordenador si accedemos desde el icono de inicio de Windows buscamos la carpeta de Thomson Reuters:

En el escritorio si hay accesos directos se verán así:



## 2. Eikon

Thomson Reuters **Eikon** es una plataforma que nos provee de información financiera de todos los activos del mundo de una forma más visual.

The screenshot displays the Thomson Reuters Eikon platform interface for Telefonica SA. The top navigation bar includes the TEF.MC ticker, a search bar, and workspace tabs. The main header shows the company name, a small price chart, and key financial metrics: 6.8920 EUR, -0.0680, -0.9770%, and a volume of 812,028. The interface is divided into two main sections: CORPORATE INFORMATION and BUSINESS SUMMARY.

CORPORATE INFORMATION >		BUSINESS SUMMARY >
Headquarters	Gran Via 28 MADRID MAD 28013 Spain	Telefonica, S.A. is an integrated and diversified telecommunications group operating in Europe and Latin America. The Company's services and products include Mobile business, Fixed-line telephony business and Digital services. Its segments include Telefonica Spain, Telefonica Brazil, Telefonica Germany, Telefonica United Kingdom and Telefonica Hispanoamerica (formed by the Company's operators in Argentina, Chile, Peru, Colombia, Mexico, Venezuela and Central America, Ecuador and Uruguay). These segments are engaged in activities relating to wireline, wireless, cable, data, Internet and television (TV) businesses and other digital services in accordance with each location. It offers a range of mobile and related services and products to personal and business customers. It offers traditional fixed telecommunication services, Internet and broadband multimedia services and data and business-solutions services. It offers a range of digital services, such as Internet of Things (IoT).
Telephone	+34-915-840640	
Fax	+34-914-827987	
Website	<a href="https://www.telefonica.es/">https://www.telefonica.es/</a>	
FY End	31-Dec-2018	
Employees	122,563	KEY RATIOS
Shariah Compliant Flag	Not Certified	

Additional interface elements include a navigation menu with tabs like Overview, News & Research, Price & Charts, Estimates, Financials, ESG, Events, Ownership, Debt & Credit, Peers & Valuation, Derivatives, Filings, and a 360 Menu. The bottom right corner shows filters for Fiscal Year and Calendar Year.

## 2. Eikon

Una opción bastante interesante es descargar las cuentas de una empresa. Para eso buscaríamos la pestaña de Financials y dentro de ella la opción preferida.

The screenshot displays the Eikon interface for Telefonica SA (TEF.MC). The top navigation bar includes a search bar with 'TEF.MC' and a price summary: 6.9500, -0.0790, -1.1239%, EUR. Below this, the 'Telefonica SA | Summary' page is shown with a price chart. The 'Financials' tab is selected, and its dropdown menu is open, listing options: Income Statement, Balance Sheet, Cash Flow, Operating Metrics, Segments, Major Customers, Ratios - Key Metrics, Ratios - Overview, Ratios - Profit/Value/Risk, and Earnings Quality. The 'BUSINESS SUMMARY' section on the left provides a brief overview of the company's operations across various regions. The 'PRICE PERFORMANCE' section on the right lists key metrics like Open, Prev. Close, Bid / Ask, VWAP, Turnover, Volume, and YTD.

Overview	News & Research	Price & Charts	Estimates	Financials	ESG	Events	Ownership	Debt & Credit	Peers							
<b>BUSINESS SUMMARY &gt;</b> <p>Telefonica, S.A. is an integrated and diversified telecommunication America. The Company's services and products include Mobile bu Digital services. Its segments include Telefonica Spain, Telefonica United Kingdom and Telefonica Hispanoamerica (formed by the C Peru, Colombia, Mexico, Venezuela and Central America, Ecuador engaged in activities relating to wireline, wireless, cable, data, Inte other digital services in accordance with each location. It offers a r products to personal and business customers. It offers traditional f and broadband multimedia services and data and business-solutio services, such as Internet of Things (IoT).</p>				<ul style="list-style-type: none"> <li>Income Statement</li> <li>Balance Sheet</li> <li>Cash Flow</li> <li>Operating Metrics</li> <li>Segments</li> <li>Major Customers</li> <li>Ratios - Key Metrics</li> <li>Ratios - Overview</li> <li>Ratios - Profit/Value/Risk</li> <li>Earnings Quality</li> </ul>			<b>PRICE PERFORMANCE &gt;</b> <table border="1"> <tr><td>Open</td></tr> <tr><td>Prev. Close</td></tr> <tr><td>Bid / Ask</td></tr> <tr><td>VWAP</td></tr> <tr><td>Turnover</td></tr> <tr><td>Volume</td></tr> <tr><td>YTD</td></tr> </table>			Open	Prev. Close	Bid / Ask	VWAP	Turnover	Volume	YTD
Open																
Prev. Close																
Bid / Ask																
VWAP																
Turnover																
Volume																
YTD																



## 2. Eikon

A la derecha podemos ver una opción para descargar los datos en una hoja de Excel.

BALANCE SHEET 

Quarterly Standardised in Millions of Euros

Filed In

Spain (TEF)

Period

Quarterly

View

Standardised

[+] Show All

Download to Excel

	2018		2017				2016			
	<div>Jun-2018</div>	<div>Mar-2018</div>	<div>Dec-2017</div>	<div>Sep-2017</div>	<div>Jun-2017</div>	<div>Mar-2017</div>	<div>Dec-2016</div>	<div>Sep-2016</div>	<div>Jun-2016</div>	
Earnings Quality Score	65	58	53	41	43	39	33	40	42	
Period End Date	30-Jun-2018	31-Mar-2018	31-Dec-2017	30-Sep-2017	30-Jun-2017	31-Mar-2017	31-Dec-2016	30-Sep-2016	30-Jun-2016	
Assets (€ Millions)										
+ Cash and Short Term Investments	6,214	7,763	7,346	6,050	9,636	11,114	6,690	6,248	5,492	
+ Accounts Receivable - Trade, Net	7,859	10,800	10,093	10,323	10,740	10,601	10,675	10,749	11,172	
+ Total Receivables, Net	9,403	11,903	11,468	11,622	12,194	12,082	12,208	12,053	12,513	
Total Inventory	1,220	1,174	1,117	1,228	1,029	1,125	1,055	1,153	1,123	
Prepaid Expenses	1,588	—	—	—	—	—	—	—	—	
+ Other Current Assets, Total	959	0	0	1	17	17	21	24	25	
Total Current Assets	19,384	20,840	19,931	18,901	22,876	24,338	19,974	19,478	19,153	

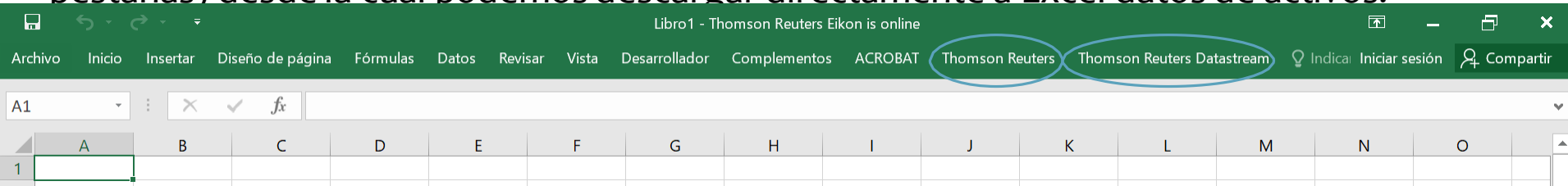


## 2. Eikon

Balances de Telefónica - Excel									
Archivo Inicio Insertar Diseño de página Fórmulas Datos Revisar Vista Desarrollador Complementos ACROBAT Thomson Reuters									
<div> <div>Pegar</div> <div>Portapapeles</div> </div> <div> <div>Tahoma 8 A A</div> <div>N K S</div> <div>Fuente</div> </div> <div> <div>Ajustar texto</div> <div>Alineación</div> </div> <div> <div>General</div> <div>Número</div> </div> <div> <div>Formato condicional</div> <div>Dar formato como tabla</div> <div>Estilos de celda</div> <div>Estilos</div> </div>									
A1	Telefonica SA   Balance Sheet   Thomson Reuters Eikon								17-Oct-2018 19:02
	A	B	C	D	E	F	G	H	
1	Telefonica SA   Balance Sheet   Thomson Reuters Eikon								17-Oct-2018 19:02
2									
3	Balance Sheet								
4	Quarterly Standardised in Millions of Euros								
5		2018			2017				
6		Jun-2018	Mar-2018	Dec-2017	Sep-2017	Jun-2017	Mar-2017	Dec-2016	
7	Earnings Quality Score	65	58	53	41	43	39	33	
8	Period End Date	30-Jun-2018	31-Mar-2018	31-Dec-2017	30-Sep-2017	30-Jun-2017	31-Mar-2017	31-Dec-2016	30-Jun-2016
9	Assets (€ millions)								
10	Cash and Short Term Investments	6.214	7.763	7.346	6.050	9.636	11.114	6.690	
11	Cash & Equivalents	3.662	4.822	5.192	3.696	6.046	7.391	3.736	
12	Short Term Investments	2.552	2.941	2.154	2.354	3.590	3.723	2.954	
13	Accounts Receivable - Trade, Net	7.859	10.800	10.093	10.323	10.740	10.601	10.675	
14	Accounts Receivable - Trade, Gross	10.569	--	--	--	--	--	--	

## 2. Eikon

Thomson Reuters **Eikon** - **Microsoft Excel** es un Add in de Excel (dos nuevas pestañas) desde la cual podemos descargar directamente a Excel datos de activos.



Al abrir este Excel tendremos dos pestañas de Reuters:

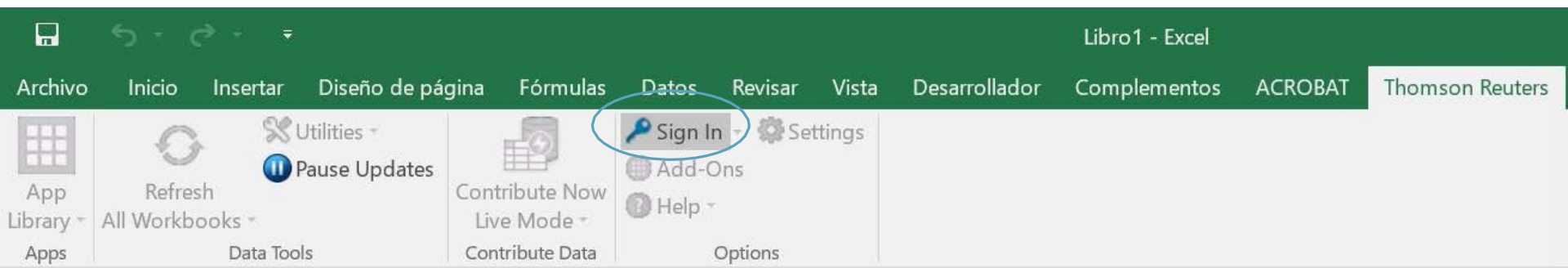
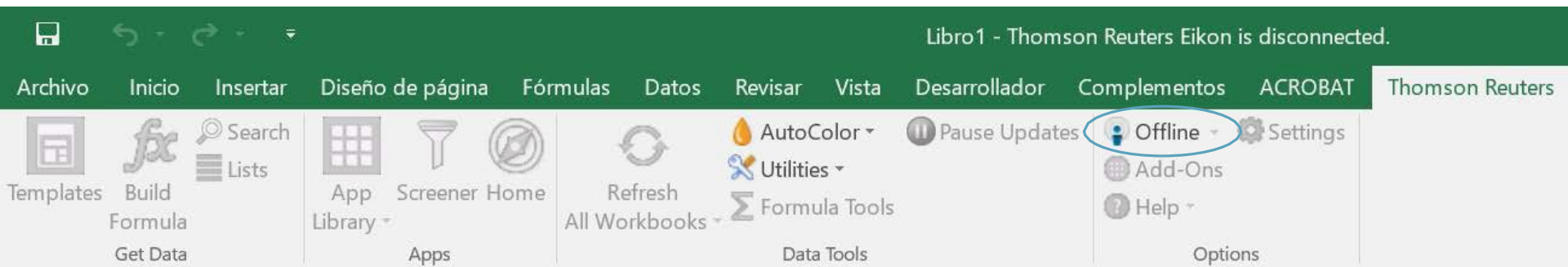
- Thomson Reuters [**Eikon**]
- Thomson Reuters **Datastream**

Eikon y Datastream son dos bases de datos distintas. En Eikon hay acceso a todas las frecuencias de datos (destacar intradiarios, por ej. precios a 1 minuto) tanto series de precios como de datos fundamentales (ratios, dividendos, etc...).

En Datastream solo tenemos datos diarios o de frecuencia inferior (por ejemplo, datos semanales), pero en algunas ocasiones son series más largas que en Eikon.

## 2. Eikon

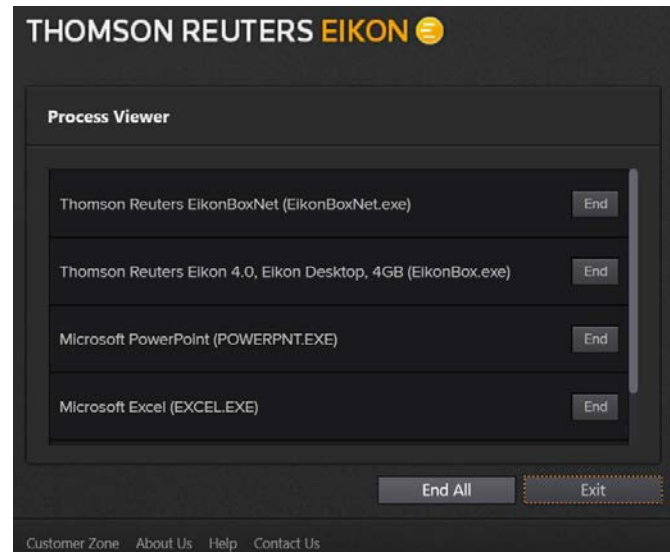
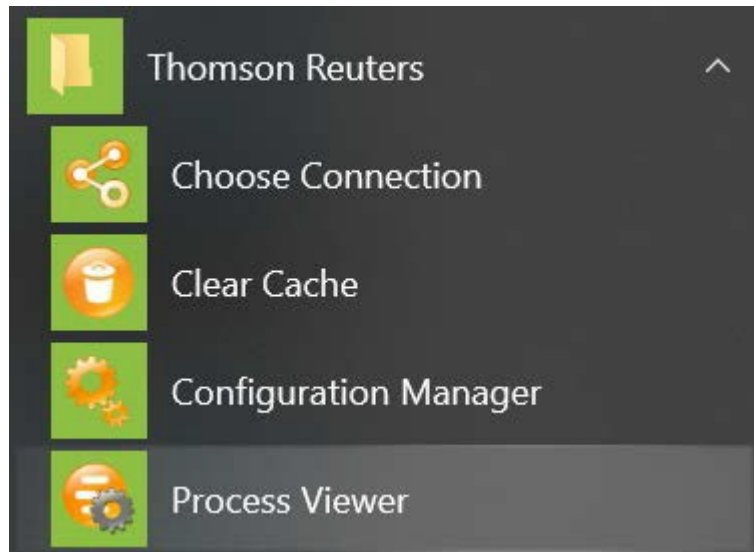
Para acceder a Thomson Reuters **Eikon - Microsoft Excel** activos.



## 2. Eikon

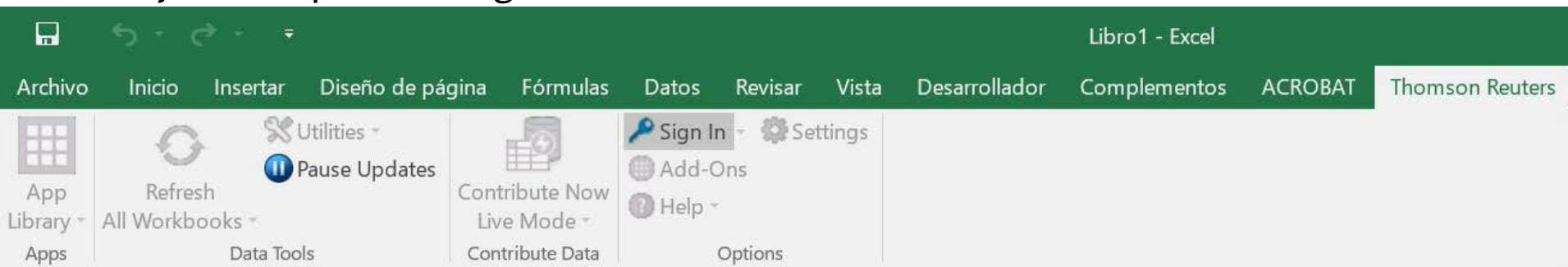
Para acceder a Thomson Reuters **Eikon - Microsoft Excel** activos.

Si no aparece directamente “Sign In” o si al ticar en Offline no pasa a “Sign In”, la solución será cerrar todos los procesos. En inicio de Windows, buscamos dentro de la carpeta Reuters, Process Viewer, lo abrimos y presionamos en “End All”.

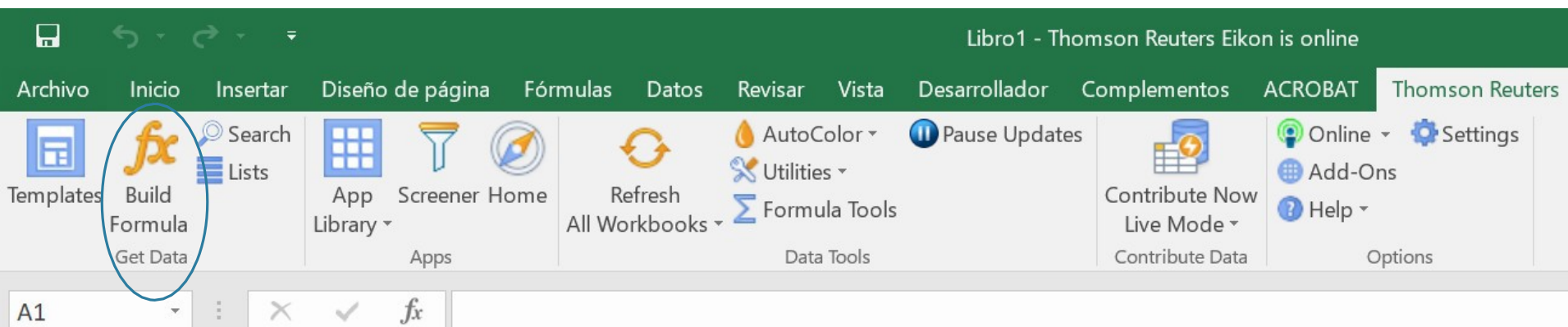


## 2. Eikon

Ahora ya debe aparecer “Sign In”



Ahora ya tenemos la plataforma activa:








Lo que vamos a utilizar es “Build Formula” para determinar que datos queremos descargar.

## 2. Eikon

Thomson Reuters Eikon - Microsoft Office | Formula Builder



Instruments:

DATA ITEMS   Interval: Daily ▼

Category:	Fields:	Description	Parameters & Quick Functions
Favorites (0)	RECENTLY USED	Definition:	
▶ Real Time (3979)	Company Market Cap	No item selected	
▶ Reference & Identifiers (3)	Settle		
▶ Reference & Identifiers (223)	Trade Date		
▶ Issuer Level Credit Rating (30)	Bid		
▶ Price & Volume (342)	Contributor		
▶ Reuters Fundamentals (1546)	Contributor Source		
▶ Period End Ratios (1412)	Trade Date		
▶ Time Series Ratios (32)	 Price to Cash Flow		
▶ I/B/E/S Estimates (15038)	 Net Profit Margin		
▶ StarMine Models & Analytics (377)	 Market Cap		
▶ Corporate Actions (155)	Bid		
	<span>Add All</span> (25)		

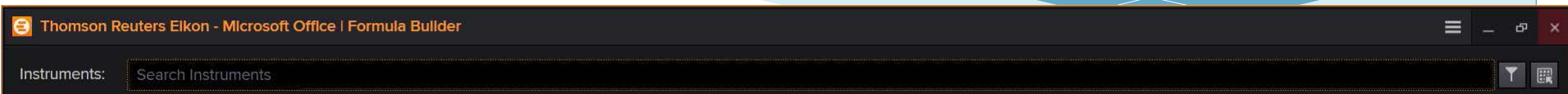
Selected Items: *Drag to Reorder* Clear All

`=TR("","","CH=Fd RH=IN",B2)`

Layout
Update Frequency
☐ Add data fields as cell references 
☒ Consolidate Formulas 
Cancel
Insert



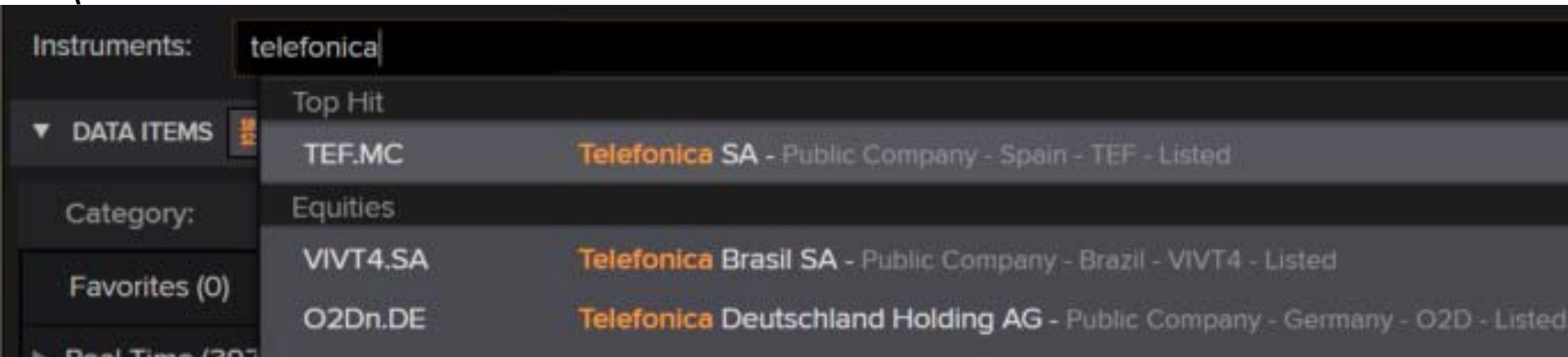
## 2. Eikon



### Instruments:

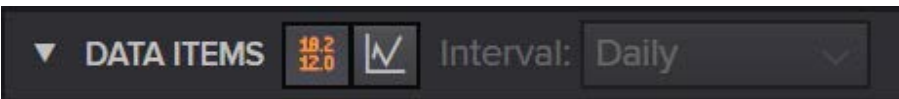
Aquí es donde buscaremos los activos financieros y datos macroeconómicos de cualquier país, cualquiera que los que se disponga información publicada o suministrada por brokers: acciones, futuros, opciones..., datos del paro, IPC, PIB...

Pondremos el nombre del dato y seleccionaremos aquel que corresponde al MERCADO QUE NOS INTERESA.





## 2. Eikon



**Data Ítems:** Tenemos que seleccionar entre dos opciones:

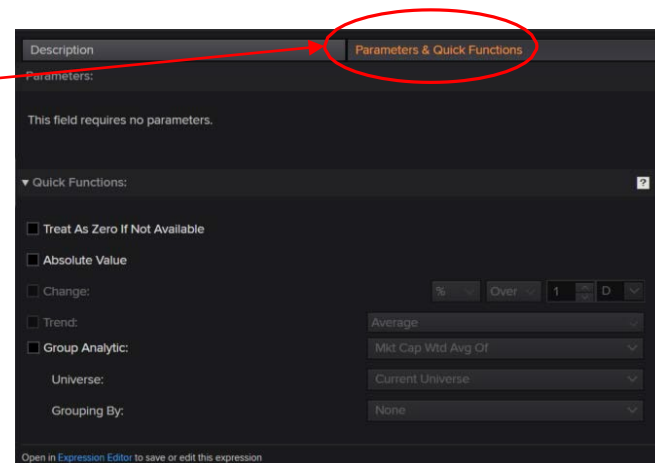
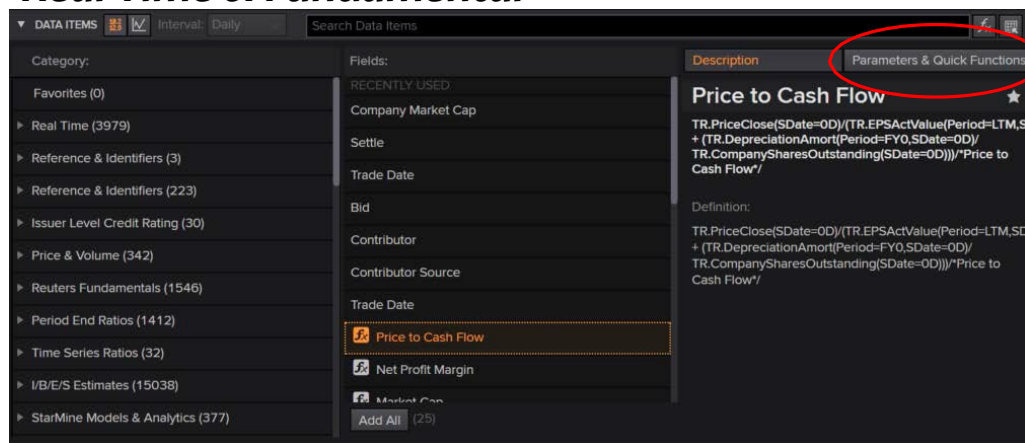
El primer botón es de ***Real Time & Fundamental***, pero la UV no tiene contratado tiempo real, por lo que nos servirá para descargar solo *datos “fundamentales”*.

El segundo botón es de ***Time Series***, o sea, series temporales. Aquí se puede obtener todo lo relacionado con la cotización en el mercado del activo, precio, bid, ask, volumen, etc...

## 2. Eikon



### Real Time & Fundamental



De izquierda a derecha en columnas tenemos primero los datos por tipología en **CATEGORY** y el número de ítems posibles para cada categoría.

En la columna central está **FIELD**, que serán los ítems dentro de una categoría en concreto o si no hemos seleccionado nada los recientemente usados.

Finalmente, a la derecha tenemos **DESCRIPTION** y **PARAMETERS & QUICK FUNCTIONS**, donde primero nos aparece la descripción del ítem y después tenemos opciones de descarga. Solo para algunos datos se pueden descargar series temporales.

## 2. Eikon

### Descargar series temporales de datos fundamentales

The screenshot shows the Eikon interface with the 'Parameters & Quick Functions' tab selected. The 'Series' checkbox is highlighted with a red circle. The interface includes a list of fields on the left, a description of the selected field, and various parameters and quick functions on the right.

Fields:

- Company Market Cap
- Changes in Working Capital
- Capital Expenditures
- Total Capital
- Long Term Debt to Total Capital, Percent
- Weighted Average Cost of Capital, (%)
- Market Capitalisation
- Market Capitalization
- Short Interest Market Cap Rank
- Total Debt / Total Capital, % (Pvt)
- Issue Market Cap
- LT Debt / Total Capital, % (Pvt)
- Capital Lease Obligations
- Current Tot Cash & Equiv/Mkt Cap, LFY
- Capital Expenditures, Discrete
- Changes in Working Capital, Discrete

Description: Company Market Cap

Parameters:

- As of: 1D
- Scale: 0
- Currency: Default
- Shares and Market Capitalization types: value
- Output: value

Quick Functions:

- Treat As Zero If Not Available
- Absolute Value
- Change: % Over 1 D
- Trend: Average
- Group Analytic: Mkt Cap Wtd Avg Of
- Universe: Current Universe
- Grouping By: None

The screenshot shows the Eikon interface with the 'Parameters & Quick Functions' tab selected. The 'Series' checkbox is highlighted with a red circle. The interface includes a list of fields on the left, a description of the selected field, and various parameters and quick functions on the right.

Parameters & Quick Functions:

- Last
- 100
- D
- Scale: 0
- Currency: De
- Shares and Market Capitalization types: value
- Output: va

Quick Functions:

- Trading Days: D
- Fiscal Year: FY
- Fiscal Semi-Annual: FS
- Fiscal Quarter: FQ
- Fiscal Interim: FI
- Calendar Year: CY

### PARAMETERS & QUICK FUNCTIONS:

Si aparece arriba a la derecha la opción de ticar en “Series” es que podremos bajar la serie histórica los últimos X datos con frecuencia que nosotros determinaremos.

## 2. Eikon



### Time Series

The screenshot shows the Eikon Time Series interface. The top bar includes 'Instruments: TEF,MC' and a search bar. The main area is divided into three columns:

- DATA ITEMS:** A list of data items on the left, with a dropdown menu open showing various intervals (Tick, Minute, 5 Minutes, 10 Minutes, 30 Minutes, 60 Minutes, Daily, Weekly, Monthly, Quarterly, Yearly, Tas, Taq, TasTaq). The 'Daily' interval is selected.
- Fields:** A list of fields in the center, including 'Close', 'Count', 'High', 'Low', 'Open', 'Timestamp', and 'Volume'. The 'Close' field is highlighted.
- Parameters & Quick Functions:** A panel on the right with various settings, including 'Start', 'End', 'RT Feed', 'Time Zone', 'Number of Rows', 'Trading Hours Only', 'TS Repeat', 'Adjusted', 'Sorting Order', 'NULL', and 'Day'.

Esta será la opción más utilizada. Ticaremos en el botón de “Time Series” y seleccionaremos en “Interval” la frecuencia de los datos (intradiaria, diaria, semanal...), en categorías seleccionaremos “Trade Price” (precios negociados), en Field o campo ticaremos dos veces en “Timestamp” (fechas) y después dos veces en Close (precios de cierre). Finalmente, iremos al campo de Parámetros.

## 2. Eikon



### *Time Series: Parámetros*

A screenshot of the 'Parameters & Quick Functions' dialog box in Eikon. The dialog has a dark background with white text. It contains several settings for time series data, each with a label and a dropdown menu. The settings are: Start (empty), End (empty), RT Feed (IDN), Time Zone (USER), Number of Rows (25), Trading Hours Only (NO), TS Repeat (YES), Adjusted (YES), Sorting Order (DESC), NULL (empty), and Day (empty).

Label	Value
Start	
End	
RT Feed	IDN
Time Zone	USER
Number of Rows	25
Trading Hours Only	NO
TS Repeat	YES
Adjusted	YES
Sorting Order	DESC
NULL	
Day	

En “Number of Rows” pondremos el número de datos que queremos descargar, por ejemplo, 10 años de datos diarios son unos 2.500 aproximadamente.

Otra opción es seleccionar en “Start” la fecha de comienzo y en “End” la fecha fin. Si no pones la de fin, entonces entiende que es hasta hoy.

La opción “Adjusted” en YES lo que quiere decir es si la serie de precios es corregida por ampliaciones de capital, dividendos, splits etc... Lo recomendable es decir que sí.

“Sorting Order” es para determinar si queremos los datos de forma ascendente (primero los más antiguos y después los actuales) o al revés.

## 2. Eikon

Una vez introducidos los parámetros deseados podremos observar abajo los ítems seleccionados, en este caso, fechas y precios de cierre:

Aquí los podemos eliminar o reordenar

Y después veremos el código Eikon con las características finales de nuestra selección.

=Rhistory() es la función en Excel para descargar datos desde Eikon (también sirve =TR()). A continuación vendría el ticker de la acción entre comillas, después los ítems seleccionados separados por punto y coma, después número de datos y la frecuencia (1D = datos diarios), CH:Fd hace referencia a los encabezados de las columnas (si queremos en las columnas (CH) aparezca los ítems seleccionados (Fd = Field), en “Layout” se puede manipular esto). Se va creando este código automáticamente en la forma que vamos avanzando.

Finalmente, en que celda irán los datos en la hoja Excel (en este caso, B2). Si está todo correcto, le podemos dar a “Insert”.



## 2. Eikon

[illegible]



## 2. Eikon

Cuando necesitamos descargar muchos ítems de muchas acciones y queramos en el futuro añadir más de ambos (ítems y acciones), lo más práctico será crear un columna con los tickers de Eikon para los datos que queremos y otra columna con el código Eikon para los ítems. Ahora, en la fórmula, para la parte de datos que queremos descargar y para la parte de ítems, lo que hacemos es seleccionar el rango de celdas donde están sus respectivos códigos.

**Thomson Reuters Eikon - Microsoft Office | Formula Builder**

Instruments: **\$C\$2:\$C\$136**

DATA ITEMS: **182 320** Interval: **Daily**

Formula: **=TR(\$C\$2:\$C\$136;\$D\$2:\$D\$13;"CH=Fd RH=IN";F1)**

	A	B	C	D	E	F	G	H	I	J	K	L	M	N	O	P	Q	R
1					=TR(\$C\$2:\$C\$136;\$D\$2:\$D\$13;"CH=Fd RH=IN";F1)				TR.TOTALRET	TR.DIVIDEND	Price To Book	P/E (Daily Tin	TR.PRICECLO	Price To Sale	Net Debt To	TR.ROEACTV	1/TR.EVTOEB	Main Index
2	azValor Iberia	Galp Energia SGPS SA	GALP.LS	TR.NAICSSECTOR	1,0 GALP.LS	Manufacturin	12732035208	8,3%	3,5%	307%	16,3	8,5	0,8	0,6	11%	17%	PSI All Share G	
3		Tubacex SA	TUBA.MC	TR.MARKETCAPLOCALCURN	0,0 TUBA.MC	Manufacturin	413564012	-5,9%	NULL	153%	NULL	11,6	0,7	5,5	-1%	6%	IBEX 35 Index	
4		Técnicas Reunidas SA	TRE.MC	TR.TOTALRETURN6MO/100	-4,0 TRE.MC	Construction	1452178080	4,2%	3,6%	382%	NULL	67,5	0,3	NULL	NULL	2%	IBEX 35 Index	
5		Spain(Kingdom OF)		TR.DIVIDENDYIELD/100														
6		Elecnor SA	ENOR.MC	TR.PriceToBVPerShare	3,0 ENOR.MC	Construction	997020000	-12,2%	2,6%	206%	13,4	14,9	0,4	4,5	NULL	11%	IBEX 35 Index	
7		Mota-Engil	MOTA.LS	TR.PE	4,0 MOTA.LS	Construction	449834737,1	-38,5%	NULL	195%	163,3	2,5	0,2	3,3	NULL	19%	PSI All Share G	
8		Nos Sgps SA	NOS.LS	TR.PriceClose(\$Date=0D)/(TR.Pr	1,0 NOS.LS	Information	2542836572	8,7%	6,1%	249%	19,3	4,5	1,6	2,1	8%	16%	PSI All Share G	
9		SonaeCom SA	SNC.LS	TR.PRICECLOSALPERSHARE	0,5 SNC.LS	Information	812597496,6	18,6%	1,4%	74%	11,1	86,4	5,5	NULL	NULL	0%	PSI All Share G	
10		Zardoya Oitiz SA	ZOT.MC	TR.NetDebtToEBITDA	-6,5 ZOT.MC	Manufacturin	3544948583	-6,3%	4,0%	916%	24,2	177,6	4,5	NULL	42%	6%	IBEX 35 Index	
11		Coca-Cola European Partner	CCE.MC	TR.ROEACTVALUE/100	-2,0 CCE.MC	Manufacturin	21296518889	16,0%	2,7%	271%	19,0	17,3	1,7	3,1	6%	7%	IBEX 35 Index	
12	azValor Interne	Buenaventura Mining Co Inc	BUEV.LM	1/TR.EVTOEBITDA	-3,5 BUEV.LM	Mining, Quar	12164722138	-13,2%	0,4%	115%	42,0	NaN	2,7	NULL	NULL	11%	S&P Lima Gen	
13		Consol Energy Inc	CEIX.K	TR.PriceMainIndex	5,0 CEIX.K	Mining, Quar	1138333535	38,5%	NULL	359%	7,9	6,6	0,8	1,4	NULL	23%	S&P 500 Index	
14		Grupo Mexico SAB de CV	GMEXICOB.MX		2,0 GMEXICOB.M	Mining, Quar	4,0264E+11	-14,2%	4,4%	172%	14,0	262,5	2,0	1,0	17%	18%	S&P/Bmv Ipc	

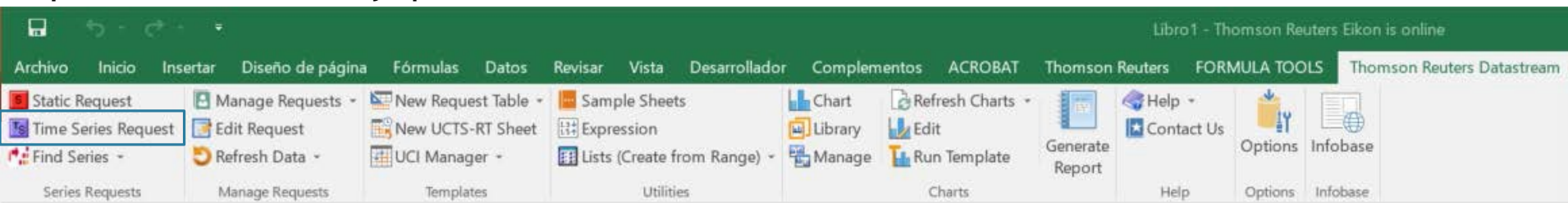
## 2. Eikon

Para más información sobre el manejo de Thomson Reuters **Eikon** visita el siguiente link:

<https://training.thomsonreuters.com/cert/eikon/#flr451>

### 3. Datastream

Otra de las pestañas que Eikon activa es la de **Datastream**. Normalmente solo utilizaremos esta base de datos cuando los datos encontrados en Eikon no nos parecen suficientes y queremos intentar encontrar más.





En “**Time Series Request**” haremos la descarga de datos con las opciones deseadas.

# 3. Datastream




Dentro de esta opción, en “**Find Series**” buscaremos el ticker Datastream (que no coincide con el de Eikon) para el dato que queremos obtener.



**Time Series Request**


Request Details

Series/List   **Find Series**  History


☐ RIC ☐ TS for each item in list

Datatypes/Expressions    **Datatypes** 

Start Date   Frequency  

End Date  

Options

☐ Display Custom Header  ☐ Hyperlink to Datatype Definition

☒ Display Row Titles

☒ Display Column Titles

☐ Display Headings

☐ Transpose Data

☐ Display Code

☐ Display Currency

☐ Display Latest Value First

☐ Hyperlink to Series Metadata

Display Expression

☐ 1st Series

☒ 1st Series & Description

Display Datatype

☒ Description

☐ Mnemonic

☒ Embed Formula

TS Format

☐ Yearly-Date

☐ Quarterly-Date

☒ Auto Refresh

Help Default Option Submit Cancel

# 3. Datastream

Una vez presionamos en **Find Series** nos aparece el DFO Navigator desde donde haremos nuestras búsquedas. En la ventana Explore meteremos el nombre del dato y haremos click en Search.

A continuación nos salen todas las posibilidades ordenadas de más probable a menos (más estrellas, más utilizado).

A la izquierda, Category nos sirve para afinar mejor la búsqueda si no encontramos lo buscado a la primera.

The screenshot displays the DFO Navigator application window. The top menu bar includes options like BACK, RECENT SEARCHES, USE SEARCH REF, SEARCHING HINTS, SYNCHRONISE USER DATA, CHARTING, and HELP. The main search bar contains the text 'telefonica'. On the left, a 'Refine Search' panel shows categories like Options (23,225), Warrants (2,790), Futures (823), Bonds & Convertibles (235), Credit Default Swaps (156), Equities (98), and Constituent Lists (33). The main area shows 'Results for telefonica' with a table of 15 results. Each row includes a star rating, a checkbox, the Name, Symbol, Category, Market, and Origin. Below the table, there are links to explore more results and a section for 'Changes on Datastream'. At the bottom, a 'Telefonica' details panel shows various identifiers (Mnemonic, Code, RIC, T1 Code, SEDOL, ISIN, Local Code), latest value (6,979 EUR), timespan (02/03/1987 - 08/10/2018, Daily), headline coverage, exchange (IBES, MSCI, WorldScope), market (Mercado Continuo Espanol), currency (Euro), and type (Equity).

Star Rating	Checkbox	Name	Symbol	Category	Market	Origin
★★★★	<input type="checkbox"/>	TELEFONICA	E:TEF	Equities	Spain	Mercado Continuo Espanol
★★★★	<input type="checkbox"/>	TELEFONICA DTL (XET) HLDG.	D:O2DX	Equities	Germany	XETRA
★★★★	<input type="checkbox"/>	TELEFONICA DTL HLDG.	D:O2D	Equities	Germany	Deutsche Boerse AG
★★★★	<input type="checkbox"/>	TELEFONICA BRASIL PN	BR:YCL	Equities	Brazil	Sao Paulo
★★★★	<input type="checkbox"/>	TELF.02 CZECH REPUBLIC	CZ:STE	Equities	Czech Republic	Prague
★★★★	<input type="checkbox"/>	TELEFONICA (BUD)	HU:TEF	Equities	Spain	Budapest
★★★★	<input type="checkbox"/>	EUREX-TELEFONICA CONTINUOUS	GEFCS00	Futures	Germany	EUREX Deutschland
★★★★	<input type="checkbox"/>	IDEM-TELEFONICA CONTINUOUS	MEFCS00	Futures	Italy	Italian Derivatives Market
★★★★	<input type="checkbox"/>	LIFFE-TELEFONICA SA CONTINUOUS	LTECS00	Futures	United Kingdom	NYSE Euronext Liffe
★★★★	<input type="checkbox"/>	MEFF-TELEFONICA CONTINUOUS	MTECS00	Futures	Spain	MEFF Renta Variable
★★★★	<input type="checkbox"/>	Telefonica (European) Continuous Call	TEFEC.SERIESC	Options	Spain	MEFF Renta Variable
★★★★	<input type="checkbox"/>	Telefonica (European) Continuous Put	TEFEC.SERIESP	Options	Spain	MEFF Renta Variable
★★★★	<input type="checkbox"/>	Telefonica Continuous Call	TNESC.SERIESC	Options	Germany	EUREX Deutschland
★★★★	<input type="checkbox"/>	Telefonica Continuous Put	TNESC.SERIESP	Options	Germany	EUREX Deutschland



# 3. Datastream

En los **Results for telefónica** nos aparecen las series más probables que sean lo que buscamos.

Abajo a la derecha, nos aparece un descriptor de la primera opción de Results o de la serie seleccionada.

En el caso de telefónica, vemos que su ticker Datastream es E:TEF (Equity Telefónica) y a su derecha vemos que es Equities, del mercado Español y que cotiza en el mercado continuo.

Si es la opción deseada, ticaremos dos veces sobre él.

The screenshot shows the DFO Navigator application window. The search bar at the top contains 'telefonica'. The 'Results for telefonica' table lists various financial instruments. The first row, 'E:TEF', is circled in blue. A blue arrow points from the text 'ticaremos dos veces sobre él.' to this row. Below the table, the 'Telefonica' details panel is also circled in blue. It shows the ticker 'E:TEF', its category 'Equities', and its market 'Spain'. The 'Latest Value' is 6,979 (EUR) as of 02/03/1987 - 08/10/2018. The 'Headline Coverage' is 'P RI (from mar. 1987) MV DY PE PI More...'. The 'Market' is 'Spain' and the 'Currency' is 'Euro'. The 'Type' is 'Equity'. The 'Explorers' section lists 'Spain » Fixed Line Telecommunications'.

Symbol	Category	Market	Origin
E:TEF	Equities	Spain	Mercado Continuo Espanol
D:O2DX	Equities	Germany	MEFF
D:O2D	Equities	Germany	Deutsche Boerse AG
BR:YCL	Equities	Brazil	Sao Paulo
CZ:STE	Equities	Czech Republic	Prague
HN:TEF	Equities	Spain	Budapest
GEFCS00	Futures	Germany	EUREX Deutschland
MEFCS00	Futures	Italy	Italian Derivatives Market
LTECS00	Futures	United Kingdom	NYSE Euronext Liffe
MTECS00	Futures	Spain	MEFF Renta Variable
TEFEC.SERIESC	Options	Spain	MEFF Renta Variable
TEFEC.SERIESP	Options	Spain	MEFF Renta Variable
TNESC.SERIESC	Options	Germany	EUREX Deutschland
ETEF.SERIESC	Options	Spain	MEFF Renta Variable
TNESC.SERIESP	Options	Germany	EUREX Deutschland

Mnemonic	Code	RIC	T1 Code	SEDOL	ISIN	Local Code
E:TEF	929534	TEF.MC	TEF-MC	5732524	E50178430E18	E5:TEF

# 3. Datastream

Ahora ya tenemos nuestra serie seleccionada. Si queremos más series, repetiríamos la operación anterior y se añadiría a la lista. Si en Datatypes/Expressions no ponemos nada, por defecto nos baja la serie de precios.

En Start Date nos aparece distintas opciones cuanto histórico queremos. Si no fijamos el End Date, por defecto nos descarga hasta el último dato disponible.

En Frequency determinamos si queremos datos diarios, semanales etc...

**Time Series Request**

Request Details

Series/List:

☐ RIC ☐ TS for each item in list

Datatypes/Expressions:

Start Date:

End Date:

Options

☐ Display Custom Header  ☐ Hyperlink to Datatype Definition

☒ Display Row Titles ☐ Display Column Titles ☐ Display Headings

☐ Transpose Data ☐ Display Code ☐ Display Currency

☐ Display Latest Value First ☐ Hyperlink to Series Metadata

Display Expression: ☐ 1st Series ☒ 1st Series & Description

Display Datatype: ☒ Description ☐ Mnemonic

☒ Embed Formula

TS Format: ☐ Yearly-Date ☐ Quarterly-Date

☒ Auto Refresh



### 3. Datastream

Si queremos más variables más allá del precio, entonces presionaremos en Datatypes/Expressions, con lo que nos aparece la pantalla de la derecha.

Aquí podremos añadir más información a descargar sobre nuestro activo o dato macro, como son datos fundamentales, volumen etc...

Como hemos dicho, si no se selecciona nada, se descargará el precio ajustado por defecto (Default)

The screenshot shows the DFO Navigator application window. The search bar at the top contains 'Equities'. On the left, the 'Refine Search' panel shows 'Datatype Hierarchy' with 'Time Series' selected (15,735 results) and 'Static' (1,114 results). The 'Source' section shows 'Multiple' selected. The main table, titled 'Equities', displays 1,000 of 16,849 results, sorted by Rankin. The table columns are Name, Symbol, Type, Source, and Currency. The results list various financial metrics like Price (Adjusted - Default), Market Value (Capital), Dividend Yield, Price/Earnings Ratio (Adjusted), Price Index, and Earnings Per Share (Forward and Trailing).

Name	Symbol	Type	Source	Currency
Price (Adjusted - Default)	P	Time Series	Datastream	Y
Market Value (Capital)	MV	Time Series	Datastream	Y
Dividend Yield	DY	Time Series	Datastream	N
Price/Earnings Ratio (Adjusted)	PE	Time Series	Datastream	N
Price Index	PI	Time Series	Datastream	Y
12 Month Forward Earnings Per Share	EPS1FD12	Time Series	IBES	Y
12 Month Trailing Earnings Per Share	EPS1TR12	Time Series	IBES	Y
Adjustment Factor (Accumulated)	AF	Time Series	Datastream	N
Adjustment Factor (Not Accumulated)	AX	Time Series	Datastream	N

# 3. Datastream

Lo más habitual será descargar el mayor número de datos, por lo que en Start Date pondremos Base Date (toda la base de datos disponible).

En Frequency no está la opción de datos intradiarios, principal diferencia con la base de datos Eikon.

En cuanto a la parte de Options, se suele ticar también Display Latest Value First, ver el último dato primero. Aunque si queremos ver más fácilmente desde donde tenemos datos, lo dejamos sin ticar.

**Time Series Request**

**Request Details**

Series/List: E:TEF  
☐ RIC ☐ TS for each item in list

Datatypes/Expressions:   
☐ ☐

Start Date: Base Date Frequency: Daily  
 End Date:

**Options**

☐ Display Custom Header  ☐ Hyperlink to Datatype Definition

☒ Display Row Titles ☐ Display Expression

☒ Display Column Titles ☐ 1st Series

☐ Display Headings ☒ 1st Series & Description

☐ Transpose Data ☐ Display Datatype

☐ Display Code ☒ Description

☐ Display Currency ☐ Mnemonic

☒ Display Latest Value First ☒ Embed Formula

☐ Hyperlink to Series Metadata

TS Format: ☐ Yearly-Date ☐ Quarterly-Date

☒ Auto Refresh

# 3. Datastream

Se puede observar como el código Excel utilizado por Datastream es totalmente diferente al de Eikon.

Como pasaba con Eikon, la fórmula la podemos modificar desde la misma celda. También la podemos copiar y modificar en otra celda.

Igualmente recomendable es hacer una lista de activos/datos con sus tickers Datastream.

Libro1 - Thomson Reuters Eikon is online

Archivo Inicio Insertar Diseño d Fórmulas Datos Revisar Vista Desarrollo Comple ACROBA Thomsor Thomsor Indicac Iniciar sesión Compartir

Calibri 11 A<sup>+</sup> A<sup>-</sup> N K S Fuente Alineación Número Estilos General Formato condicional Insertar Σ Dar formato como tabla Eliminar Formato Celdas Modificar

E1 =DSGRID("E:TEF"," ", "Base Date"," ", "D"," ", "RowHeader=true;ColHeader=true;LatestFirstValue=true;DispSeriesDescription=false;YearlyTSFormat=false;QuarterlyTSFormat=false"," ")

	A	B	C	D	E	F	G	H	I	J
1	Updated at 05:09:46				Name	TELEFONICA				
2		TEF.MC	TEF.MC		08/10/2018	6,98				
3		Timestamp	Trade Close		05/10/2018	6,92				
4		08/10/2018	6,978		04/10/2018	6,96				
5		05/10/2018	6,92		03/10/2018	6,917				
6		04/10/2018	6,96		02/10/2018	6,753				
7		03/10/2018	6,917		01/10/2018	6,828				
8		02/10/2018	6,753		28/09/2018	6,818				
9		01/10/2018	6,828		27/09/2018	6,953				
10		28/09/2018	6,818		26/09/2018	6,888				
11		27/09/2018	6,953		25/09/2018	6,78				
12		26/09/2018	6,888		24/09/2018	6,83				
13		25/09/2018	6,78		21/09/2018	6,851				
14		24/09/2018	6,83		20/09/2018	6,859				

## 3. Datastream

Para más información sobre el manejo de Datastream, visita el siguiente link:

<https://training.thomsonreuters.com/cert/datastream/#flr305>

¡MUCHAS GRACIAS POR  
VUESTRA ATENCIÓN!

Óscar Carchano Alcina  
*Profesor Departamento Economía Financiera y Actuarial*  
*Universidad de Valencia*  
[Oscar.Carchano@uv.es](mailto:Oscar.Carchano@uv.es)