

Versão: 1.0

Última Atualização: 13/6/2000

Autor: Luiz Alvares Rezende de Souza

Licença de uso: Freeware

Disponibilização:

<http://www.risktech.com.br>

CALENDARIO.XLA

▪ Finalidade

Biblioteca de Excel que implementa funções para o cálculo de calendário financeiro: dias úteis entre datas, primeiro dia útil do mês, dias úteis após dias corridos, etc.

▪ Instalação

- 1) Copie o arquivo CALENDARIO.XLA para o diretório de sua aplicação/planilha Excel.
- 2) Abra o Excel.
- 3) Clique no menu Ferramentas (Tools), na opção Suplementos (Add-ins).
- 4) Clique no botão Procurar (Browse) e aponte para o diretório onde você colocou o arquivo CALENDARIO.XLA no passo 1.
- 5) Marque o CALENDARIO.XLA e clique OK.
- 6) Clique OK novamente na caixa dos Suplementos.
- 7) A instalação está concluída e a função estará disponível todas as vezes em que você abrir o seu Excel.

▪ Desinstalação

- 1) Abra o Excel.
- 2) Clique no menu Ferramentas (Tools), na opção Suplementos (Add-ins).
- 3) Desmarque a biblioteca RiskTechCalendario.
- 4) Clique no botão OK na caixa dos Suplementos.
- 5) A desinstalação está concluída, e a função estará indisponível nas próximas vezes em que você abrir o seu Excel. Se algum arquivo utilizá-la, você terá de reinstalá-la quando for utilizá-lo. Para tanto basta seguir os passos de 1 a 4, mas marcando a biblioteca, ao invés de desmarcá-la.

▪ Funções disponíveis

1) DiasCorridosEntreDatas(DataInicial As Date, DataFinal As Date)

Retorna o número de dias corridos entre 2 datas.

2) DiasUteisEntreDatas(DataInicial As Date, DataFinal As Date)

Retorna o número de dias úteis entre 2 datas.

3) DiasCorridosAposDiasUteis(Data As Date, DiasUteis As Long)

Retorna o número de dias corridos apos DiasUteis da Data

4) DiasUteisAposDiasCorridos(Data As Date, DiasCorridos As Long)

Retorna o numero de dias úteis apos DiasCorridos da Data

5) DataAposDiasCorridos(Data As Date, dias As Long)

Retorna a data distante dias corridos de Data

6) DataAposDiasUteis(Data As Date, dias As Long)

Retorna a data distante dias úteis de Data

7) ProximoDiaUtil(Data As Date)

Retorna o dia util seguinte a Data

8) PrimeiroDiaUtilMes(Data As Date)

Retorna o primeiro dia util do mês que contem Data

9) UltimoDiaUtilMes(Data As Date) As Date

Retorna o ultimo dia util do mês que contem Data

10) EFeriado(Data As Date) As Boolean

Retorna Verdadeiro se é feriado

11) EFimSemana(Data As Date) As Boolean

Retorna Verdadeiro se é sábado ou domingo

12) EDiaUtil(Data As Date) As Boolean

Retorna Verdadeiro se é dia útil

13) DiaDaSemana(Data As Date) As String

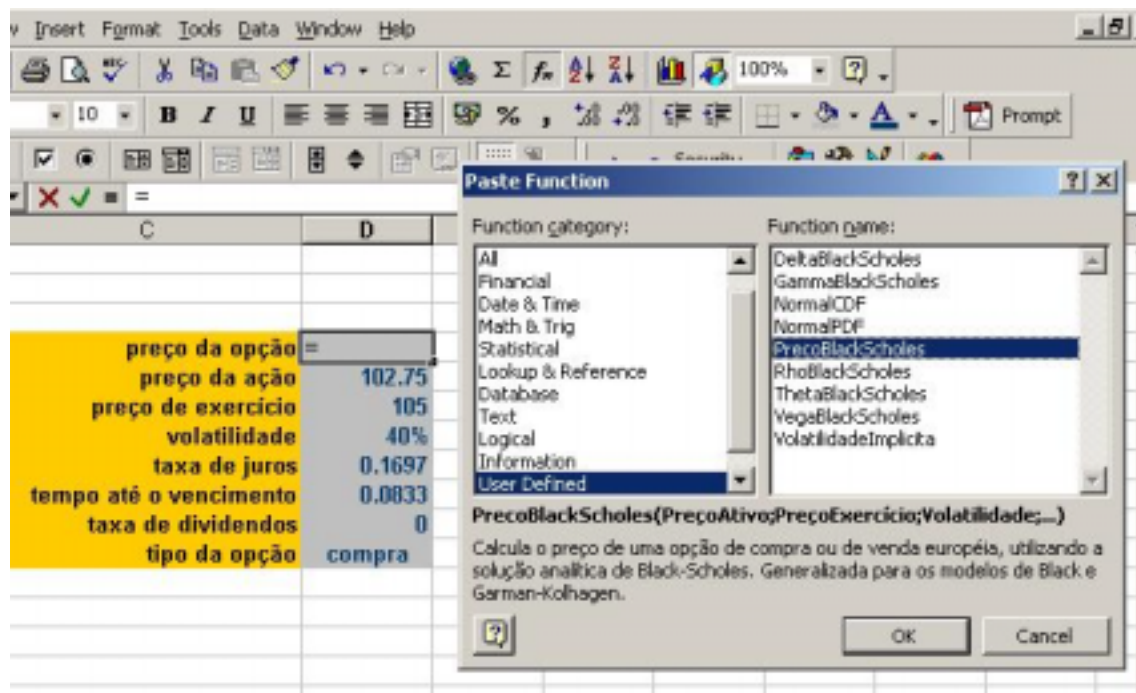
Retorna uma String com o dia da Semana

▪ Utilização

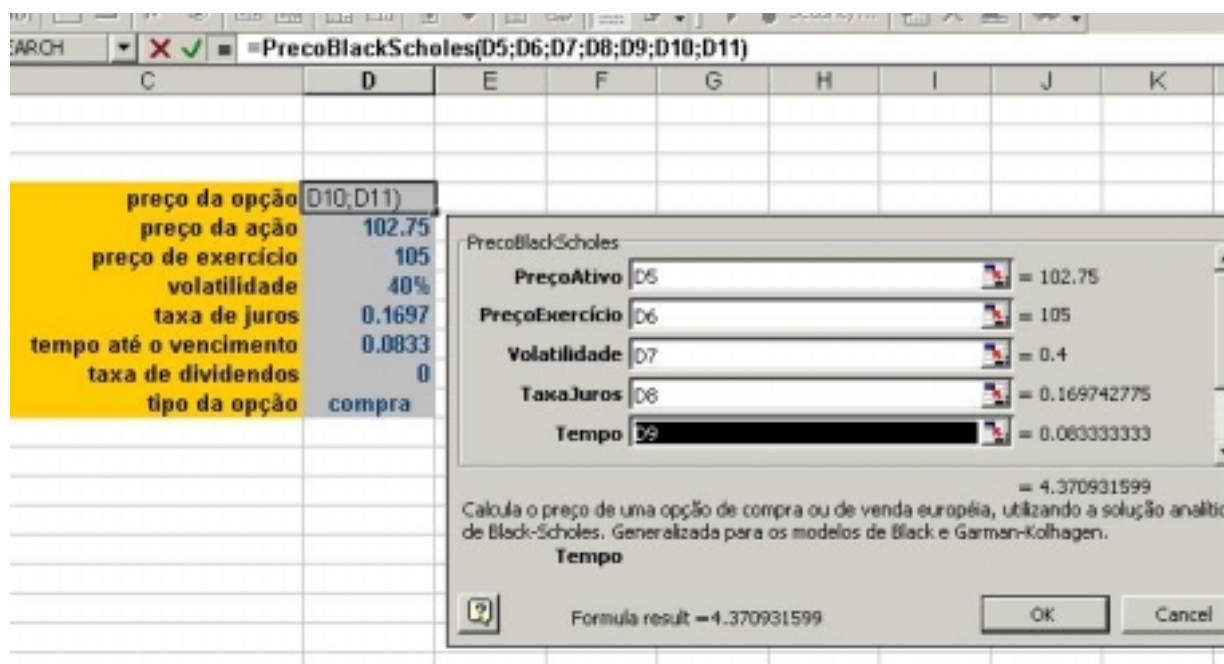
Há duas maneiras de se utilizar qualquer uma das funções disponíveis na biblioteca:

1) Utilizar o assistente de funções para montar a fórmula (recomendado)

- Marque a célula que receberá a fórmula
- Clique no assistente de funções: botão f_x
- Escolha a categoria “Definidas pelo usuário” (User Defined)



- Clique na função desejada e em OK.
- O assistente lhe ajudará a montar os argumentos, bastando apontar para as células com os argumentos na planilha, ou entrá-los diretamente.



2) Digitar diretamente o nome da função numa célula da planilha:

Se a planilha possuir uma coluna com as informações necessárias ao cálculo do preço de uma opção, por exemplo, marca-se a célula que receberá o preço da opção, e digita-se a fórmula: “=PrecoBlackScholes(D5;D6;D7;D8;D9;D10;D11)” e conclui-se com ENTER.

▪ Planilha Exemplo

Como planilha exemplo, consulte a **calendario.xls** na seção **Modelos em Excel** do RiskTech.com.

Importante

- 1) O código-fonte das funções disponíveis na biblioteca CALENDARIO.XLA encontram-se protegidos por senha. A única finalidade dessa proteção é impedir a alteração não-intencional, ou mesmo intencional, do código original das funções, produzindo resultados imprevisíveis.
- 2) Nem o RiskTech.com, nem seus patrocinadores, nem o Ibmecc Business School, responsabilizam-se pelo uso comercial dessas bibliotecas de funções. Sua divulgação é feita em caráter de ilustração, operacionalização e instrumentalização dos modelos e conceitos apresentados ao longo do RiskTech.com e não em caráter comercial.