

BQUANT FINANCE · CATÁLOGO COMPLETO

BQuant MCP

Asistente cuantitativo profesional
para inversores en español.

192

HERRAMIENTAS

8

DOMINIOS DE DATOS

20+

AÑOS DE HISTÓRICO

*Documento de referencia. Cada herramienta explicada con caso de uso.
Acceso a través de Claude, ChatGPT y Cursor.*

I · INTRODUCCIÓN

¿Qué es BQuant MCP?

Un puente entre tu asistente de IA y la infraestructura cuantitativa profesional.

BQuant MCP es un servidor que sigue el protocolo MCP (Model Context Protocol) y conecta cualquier asistente de IA compatible — Claude Desktop, Cursor, Continue, Cline — con el cluster de datos cuantitativos de BQuant Finance.

En lugar de pagar miles de euros al mes por terminales Bloomberg o FactSet, o reconstruir manualmente datos dispersos en Yahoo, Google Finance y hojas de cálculo, un suscriptor de BQuant MCP puede simplemente preguntar en español a su asistente y obtener respuesta de calidad institucional en segundos.

Este documento es la referencia completa: las 192 herramientas explicadas con un caso de uso real para cada una, y las bases de datos detalladas hasta el campo. El modelo IA selecciona automáticamente las herramientas relevantes para cada pregunta y combina varias cuando hace falta.

Algunas preguntas que puedes hacer

- ¿Qué acciones del S&P 500 tienen ROCE superior al 25%, F-Score 8+ y han batido EPS los últimos cuatro trimestres?
- Compara NVDA, AMD y ASML desde mi perspectiva como inversor en euros durante el último año.
- ¿Qué congresistas compraron Tesla en los 30 días previos al último beat de earnings?
- Dame los fondos UCITS con mejor Sharpe a 5 años y patrimonio superior a 500 millones en RV global.
- ¿Hay algún cluster de insiders comprando en small caps con valoración atractiva según el modelo Lynch?
- ¿Qué empresas mencionan más «inteligencia artificial» en sus earnings calls de los últimos seis meses?

II · PUESTA EN MARCHA

Configuración

Tres pasos. Sin instalación local, sin dependencias.

El MCP es un endpoint HTTPS al que tu cliente de IA se conecta directamente. Ningún software adicional que instalar en tu máquina.

01 Suscríbete y recibe tu API key

En bquantfunds.info/mcp obtienes una clave personal con formato `bq_live_...`. Identifica tu cuenta y se puede rotar bajo demanda.

02 Añade el servidor a tu cliente

Configura el endpoint en Claude Desktop, Cursor, Continue, Cline u otro cliente compatible con MCP. La configuración es una entrada en JSON con dos campos: URL del servidor y token de autenticación.

```
{
  "mcpServers": {
    "bquant": {
      "url": "https://mcp.bquantfunds.info/mcp",
      "auth": "Bearer bq_live_XXXXXXXXXXXXXXXXXXXXXXXXXXXX"
    }
  }
}
```

03 Empieza a preguntar

Abre tu asistente y pregunta lo que quieras en lenguaje natural. El modelo selecciona automáticamente las herramientas adecuadas. No hay curva de aprendizaje técnico.

Clientes compatibles

Claude Desktop · configuración nativa MCP en preferencias

Cursor · **Continue** · **Cline** · IDEs con soporte MCP integrado

Claude API · **SDK** · para integración programática avanzada

Otros clientes MCP · cualquier cliente compatible con el protocolo

III · COBERTURA

Datos al servicio del análisis

Ocho dominios de datos especializados, integrados y actualizados diariamente.

Procesos de ingesta y validación propios con redundancias y un sistema de versionado histórico (point-in-time) para análisis y backtests fiables, sin sesgo de mirar al futuro. Cobertura desde 1993 para documentos regulatorios SEC y hasta 50+ años para indicadores macro.

79 K+

acciones cotizadas globalmente — US, Europa, Asia

54 K+

fondos UCITS europeos y planes de pensiones España

70 M

filas de fundamentales históricos — 86 ratios

20+

años de histórico fiable para análisis sin sesgo de futuro

Bases de datos integradas

Acciones — universo global

Cobertura completa del universo equity mundial: 79.000+ acciones cotizadas con datos fundamentales (86 ratios financieros estandarizados), precios diarios desde la salida a bolsa de cada compañía y un catálogo precomputado con métricas técnicas, de valoración y de calidad. Veinte años de histórico fiable para análisis y backtests sin sesgo de mirar al futuro.

Datos estandarizados de calidad institucional con validaciones automáticas de valores atípicos. Cobertura simultánea de los principales mercados — Nueva York, Nasdaq, Londres, XETRA, Euronext, BME, SIX, Bolsa de Madrid.

CUENTA DE RESULTADOS

ingresos · coste de ventas · margen bruto · gastos operativos · beneficio operativo · beneficio neto · EBITDA · EBIT · beneficio por acción (BPA) · acciones en circulación

BALANCE

activo total · activo corriente · caja y equivalentes · cuentas a cobrar · inventario · inmovilizado · fondo de comercio · intangibles · pasivo total · deuda a largo plazo · patrimonio neto · reservas

CASH FLOW

flujo de caja operativo · flujo de inversión · flujo de financiación · CapEx · free cash flow · stock-based compensation · dividendos pagados · recompra de acciones

RATIOS DE CALIDAD

ROCE · ROIC · ROE · ROA · margen bruto / operativo / neto · cobertura de intereses · F-Score Piotroski (0-9) · Z-Score Altman · M-Score Beneish

RATIOS DE APALANCAMIENTO

current ratio · quick ratio · deuda / patrimonio · deuda neta · deuda neta / EBITDA · deuda / capital

EFICIENCIA

rotación de activos · rotación de inventario · días de cobro · días de pago · ciclo de conversión de efectivo · CapEx / ventas

PRECIOS Y TÉCNICOS

precios diarios diario · cierre ajustado por dividendos y splits · medias móviles 20/50/100/200 · golden cross · ATR · RSI · distancia a máximo 52 semanas · distancia a máximo histórico

VALORACIÓN Y DIVIDENDOS

PER · PER forward · PEG · EV/EBITDA · EV/sales · P/B · P/S · Lynch fair value · Graham number · yield de dividendo · payout ratio · FCF yield · buyback yield · potencial alcista vs precio objetivo

METADATA CORPORATIVA

nombre · CEO · sector GICS · industria · país · año fundación · empleados · descripción · pertenencia a índices (S&P; 500, NASDAQ 100, DOW 30, Russell 1000/2000) · tags temáticos (IA, ciberseguridad, EV, biotech, gaming, cloud, etc.)

Fondos de inversión y planes de pensiones

Cobertura completa del universo UCITS europeo: 53.900 fondos con valores liquidativos diarios, ratings institucionales, categorías, fees detallados y análisis de riesgo institucional. Más planes de pensiones España. Histórico de hasta 20 años para los fondos clásicos. Un catálogo con 135 columnas precomputadas listo para screening avanzado.

Datos institucionales actualizados diariamente. Instantáneas semanales del catálogo desde mayo de 2026 para reconstruir el estado del universo en cualquier momento del pasado.

IDENTIFICACIÓN

ISIN · identificador interno · ticker · nombre · gestora · domicilio · divisa base

CATEGORÍA Y ESTILO

categoría UCITS · clase de activo · style box (large value, mid blend, small growth, etc.) · foco geográfico · foco sectorial · enfoque ESG

RENTABILIDAD

valor liquidativo diario · YTD · 1 mes · 3 meses · 6 meses · 1 año · 3 años · 5 años · 10 años · 15 años · 20 años · desde inicio · retornos por año natural

MÉTRICAS DE RIESGO

Sharpe 3 / 5 / 10 años · Sortino · drawdown máximo · duración del drawdown · volatilidad anualizada · captura al alza · captura a la baja · beta · alpha vs benchmark · tracking error

COMISIONES Y RATINGS

TER · ongoing charge · comisión de gestión · comisión de entrada · comisión de salida · rating institucional (1-5 estrellas) · rating analista (Gold/Silver/Bronze/Neutral/Negative)

TAMAÑO Y ACCESIBILIDAD

patrimonio · tamaño del fondo · clase de participación · inversión mínima retail · acumulación o distribución

Indicadores macroeconómicos

Indicadores macroeconómicos completos de la Reserva Federal y otras fuentes alternativas. Histórico de más de 50 años con sistema de versiones — cada valor conserva todas sus revisiones sucesivas para análisis y backtests que reflejen exactamente qué se sabía en cada momento.

Sistema point-in-time: cada dato lleva la fecha en que se midió, la fecha en que se publicó por primera vez y todas las versiones posteriores. Permite reconstruir la información disponible en cualquier fecha histórica sin contaminación por revisiones futuras.

TIPOS DE INTERÉS

FEDFUNDS · Treasury 1M / 3M / 6M / 1Y / 2Y / 5Y / 10Y / 20Y / 30Y · 10Y-2Y (curva) · 10Y-3M · hipotecas 30 años

EMPLEO

tasa de paro · creación de empleo no agrícola (NFP) · solicitudes iniciales de desempleo · solicitudes continuadas · vacantes laborales · tasa de participación

INFLACIÓN

IPC general · IPC subyacente · PCE · PCE subyacente · IPP · expectativas de inflación 5 y 10 años · yields reales (TIPS)

ACTIVIDAD ECONÓMICA

PIB · PIB real · producción industrial · ISM Manufacturing · PMI servicios · ventas minoristas · viviendas iniciadas · índice de indicadores líderes (LEI)

DIVISAS Y MATERIAS PRIMAS

tipo de cambio dólar/euro · dólar/yen · dólar/yuan · WTI · Brent · oro · índice dólar amplio

VERSIONADO HISTÓRICO

fecha de medición · fecha de publicación · fecha de cada revisión · valor numérico · historial completo de revisiones

Tipos de cambio

Tipos de cambio diarios oficiales del Banco Central Europeo cubriendo 33 monedas con base euro, histórico desde 2020. Permite análisis multi-divisa, comparativas internacional y currency-retornos cubiertos para inversores en euros.

Datos oficiales del BCE actualizados diariamente. Permite calcular el rendimiento real de inversiones internacionales separando el efecto del subyacente del efecto del tipo de cambio.

PARES EUR-BASE DISPONIBLES

USD · GBP · JPY · CHF · SEK · NOK · DKK · CAD · AUD · NZD · BRL · MXN · CNY · HKD · SGD · KRW · INR · TRY · ZAR · PLN · CZK · HUF · ILS · THB · IDR · MYR · PHP · ISK · BGN · RON

CAMPOS POR PAR

fecha · tipo de cambio · fuente · histórico desde 2020

USO TÍPICO

valoración multi-divisa de carteras · currency-retornos cubiertos · comparativas de stocks en distintos mercados normalizadas a EUR · análisis de correlación FX vs macro

Smart money — insiders, congresistas y superinversores

Tres fuentes independientes de capital institucional agrupadas: trades de insiders corporativos estadounidenses (CEOs, CFOs, directivos, accionistas $\geq 10\%$), operaciones de senadores y congresistas del Congreso de Estados Unidos, y carteras 13F declaradas trimestralmente por superinversores institucionales (Buffett, Ackman, Burry, Klarman, Greenblatt, Pabrai, Greenlight, Third Point, etc.). El conjunto más diferencial del catálogo — permite cruces multi-fuente que ninguna fuente individual permite.

Datos enriquecidos automáticamente con señales derivadas: clusters de compras simultáneas, marcadores de transacciones CEO/CFO, scoring de convicción, cambios porcentuales en cartera vs trimestre anterior. Patrimonios y estados de los congresistas vinculados con los trades.

INSIDERS CORPORATIVOS

ticker · nombre del insider · cargo (CEO, CFO, Director, etc.) · tipo de transacción (compra pura, venta, opción ejercida, venta automática) · acciones · precio · valor en dólares · fecha de la operación · fecha del filing · señal de cluster en 7 días · marcador CEO/CFO

CONGRESISTAS USA

político · partido · estado · cámara (Senado / Casa de Representantes) · ticker · tipo de transacción · rango de importe en dólares · fecha de la operación · fecha del disclosure · latencia disclosure · propietario (él / cónyuge / conjunto / dependiente) · patrimonio del político

SUPERINVERSORES (13F)

declarante (nombre del inversor) · ticker · acciones · valor · porcentaje de la cartera · cambio vs trimestre anterior (nuevo / aumentado / reducido / vendido) · fecha del reporte · histórico multi-trimestre

ACTIVISTAS (13D)

declarante · ticker · porcentaje de participación · fecha del filing · número de enmienda · propósito declarado · clasificación activist vs pasivo

Documentos regulatorios SEC

Archivo completo de la SEC desde 1993. Característica única — cada documento es accesible desde el punto de vista del que declara (¿qué ha declarado BlackRock?) y desde el punto de vista del sujeto declarado (¿quién ha declarado sobre Nvidia?). Cubre formularios anuales, trimestrales, eventos materiales, holdings institucionales, trades de insiders y notificaciones de venta restringida.

Vista dual única en el mercado — los documentos están normalizados para permitir consultas por declarante o por compañía objeto del filing. Mapeo automático entre identificadores internos SEC y tickers de mercado.

REPORTES PERIÓDICOS

10-K (anual) · 10-Q (trimestral) · 20-F (anual empresas extranjeras) · 6-K (eventos extranjeras) · S-1 (registro para salida a bolsa) · DEF 14A (proxy statement)

EVENTOS MATERIALES

8-K (eventos corporativos relevantes) · tipos de item 8-K · S-3 y S-4 (registros adicionales) · S-8 (planes de acciones para empleados)

HOLDINGS INSTITUCIONALES

13F (holdings trimestrales institucionales) · 13F-NT (notificación) · Schedule 13D (activista ≥5%) · Schedule 13G (pasivo ≥5%) · enmiendas 13D/A y 13G/A

INSIDERS

Form 3 (declaración inicial) · Form 4 (cada trade) · Form 5 (anual) · Form 144 (intención de venta de acciones restringidas)

CAMPOS COMUNES

identificador del declarante · número de accession · tipo de formulario · fecha del filing · período del reporte · URL al documento original · identificador del sujeto declarado · clasificación automática activista / pasivo

Earnings — conferencias de resultados y sorpresas

Dos fuentes complementarias del ciclo de resultados: transcripts completos de las conferencias de earnings (prepared remarks + Q&A;) con búsqueda por palabra clave multi-acción, y sorpresas históricas de EPS y revenue cubriendo 3.863 tickers estadounidenses con hasta 35 años de cobertura. Permite análisis temático, backtests de alpha por palabra clave y track records de aciertos/fallos.

Transcripts con detección automática de quién habla (CEO, CFO, COO, analistas) y análisis de sentiment por sección. Resúmenes ejecutivos pre-procesados largos y cortos disponibles. Búsqueda búsqueda por palabra clave rápida con generación de snippets de contexto.

IDENTIFICACIÓN TRANSCRIPTS

ticker · fecha del evento · año fiscal · trimestre fiscal · final de período · URL del call

CONTENIDO TRANSCRIPTS

prepared remarks (texto completo) · sección Q&A; (texto completo) · participantes · introducción del operador · disclaimer

ANÁLISIS TRANSCRIPTS

detección automática del CEO · del CFO · del COO · de los analistas (con la firma) · sentiment global · sentiment por sección · keywords principales · resumen ejecutivo · temáticas detectadas (IA, aranceles, supply chain, despidos, etc.)

SORPRESAS EPS

EPS estimado · EPS reportado · sorpresa porcentual · marcador beat / fallo / inline · track record histórico

SORPRESAS REVENUE

revenue estimado · revenue reportado · sorpresa porcentual · track record histórico

COBERTURA SORPRESAS

principalmente listados estadounidenses + ADRs · 3.863 tickers únicos · hasta 35 años de histórico para grandes capitalizaciones

Noticias financieras

Noticias financieras de múltiples fuentes agregadas (sin atribución específica de fuente), enriquecidas con extracción automática de tickers mencionados, scoring de sentiment y clasificación temática. Volumen alto con actualización casi en tiempo real.

Pipeline diario que extrae automáticamente los tickers mencionados en cada noticia, asigna un score de sentiment y clasifica por temática interna. Permite análisis del estado narrativo del mercado en cualquier ventana temporal.

IDENTIFICACIÓN

identificador único · fecha de publicación · fuente · autor · titular · URL · marcador de noticia sindicada

CONTENIDO

titular · resumen corto · resumen largo · cuerpo completo (cuando disponible) · keywords del titular · etiquetas de categoría · clasificaciones temáticas

ANÁLISIS

score de sentiment (de -1 a +1) · etiqueta sentiment (bajista / neutral / alcista) · tickers mencionados (lista) · confianza de la mención por ticker

METADATA DE FUENTE

dominio de la fuente · score de autoridad · retardo de publicación vs mercado · árbol de sindicación (original vs republicaciones)

III · COBERTURA

Fuentes integradas

Nueve fuentes especializadas normalizadas y servidas tras un único endpoint.

Equity global · 9 mercados

Universo equity global con datos fundamentales de 86 ratios, precios, dividendos, splits, ratings de analistas y forecasts. Cobertura simultánea de Estados Unidos, Europa y Asia.

Fondos UCITS · Europa

53.000 fondos UCITS europeos con valores liquidativos diarios, ratings de analistas, categorías, comisiones detalladas e instantáneas semanales del catálogo desde mayo de 2026.

SEC filings · 1993+

Archivo completo de la SEC desde 1993: reportes anuales (10-K), trimestrales (10-Q), eventos materiales (8-K), holdings institucionales (13D, 13G, 13F), trades de insiders (formularios 3, 4 y 144). Vista dual por declarante y por sujeto.

Insiders · Form 4

Operaciones de insiders corporativos estadounidenses enriquecidas con señales derivadas: detección de clusters de compras simultáneas, marcadores CEO/CFO, scoring de convicción.

Congress trades · STOCK Act

Trades del Congreso y Senado de Estados Unidos según el STOCK Act, enriquecidos con patrimonio, estado, partido y comisiones de cada político.

Superinvestor 13F

Carteras 13F declaradas trimestralmente por superinversores institucionales: Buffett, Ackman, Burry, Klarman, Greenblatt, Pabrai, Greenlight, Third Point, etc.

Macro · indicadores oficiales

Indicadores macroeconómicos de Estados Unidos: tipos de interés, empleo, inflación, curva de tipos, dashboard de recesión. Versionado histórico para análisis point-in-time.

FX · multi-divisa oficial

Tipos de cambio diarios oficiales del Banco Central Europeo cubriendo 33 monedas con base euro. Histórico desde 2020 con calidad institucional.

Earnings surprises · 35 años

Sorpresas de resultados (EPS y revenue) cubriendo 3.863 tickers estadounidenses con hasta 35 años de histórico para grandes capitalizaciones.

IV · HERRAMIENTAS

El catálogo

Ciento noventa y dos herramientas organizadas en nueve categorías funcionales.

Cada herramienta es una función SQL optimizada que devuelve resultados estructurados al asistente, que los presenta al usuario en lenguaje natural. Combinables entre sí para resolver queries complejas multi-fuente. En las páginas siguientes, cada herramienta está documentada con un caso de uso real.

01 Screening de acciones	<i>32 herramientas</i>
Búsqueda y filtrado del universo equity global (79 000+ tickers). Filtros combinables por ...	
02 Análisis fundamental	<i>26 herramientas</i>
Acceso completo a 86 ratios financieros con histórico de 20+ años. Comparativas peer y sec...	
03 Smart money tracking	<i>31 herramientas</i>
Categoría diferencial del catálogo. Cruza cuatro fuentes independientes de smart money: in...	
04 SEC documentos — perspectiva dual	<i>16 herramientas</i>
Acceso completo a SEC filings desde 1993. Característica única del MCP: cada filing puede ve...	
05 Earnings y analista	<i>18 herramientas</i>
Cobertura completa del ciclo earnings. Surprises históricas (35 años, EEUU+ADRs...	
06 Macro y sectorial	<i>19 herramientas</i>
Base macro completa con indicadores oficiales y alternativos. Detección de regímenes, análisis es...	
07 Fondos y pensiones	<i>30 herramientas</i>
Diferencial absoluto del MCP español. Cobertura completa de fondos UCITS europeos institucio...	
08 Cross-fuente y convergencia	<i>16 herramientas</i>
La edge propietaria del catálogo. Diecisiete herramientas que cruzan dos o más fuentes de ...	
09 FX y multi-divisa	<i>4 herramientas</i>
Última incorporación al catálogo. Resuelve un problema sistemáticamente ignorado por los b...	

IV · 01

Screening de acciones

Búsqueda y filtrado del universo equity global (79 000+ tickers). Filtros combinables por sector, país, exchange, market cap, ratios fundamentales y técnicos, ESG, dividendos, índices.

“ PROMPT PRINCIPAL

Dame las acciones del NASDAQ 100 con ROCE mayor al 25%, F-Score 8 o 9 y rompiendo máximos históricos hoy.

Combina screener_acciones + all_time_high_breakers para encontrar acciones que cumplan las condiciones simultáneamente.

Herramientas

§ screener_acciones

Screener master sobre 313 columnas precomputadas. Filtros arbitrarios combinables: ratios, técnicos, exchange, sector, país, dividend, ESG.

EJEMPLO Acciones europeas del sector industrial con margen operativo superior al 15% y deuda neta negativa

§ screener_eu_quality

Versión preconfigurada con defaults curados para EU Quality: ROCE alto, F-Score 7+, balance sólido, exchanges principales europeos.

EJEMPLO Aplica el filtro EU Quality estándar para descubrir compounders europeos top quartile

§ acciones_quality_momentum

Convergencia de calidad fundamental + momentum técnico + compras de smart money opcional. Setup clásico de selección equity institucional.

EJEMPLO Quality + momentum confirmado por smart money en el S&P; 500 los últimos 90 días

§ trend_quality_screener

Stacked uptrend momentum institucional: MA50 sobre MA200, precio sobre MA50, ROCE sobre umbral. Compounders en tendencia limpia.

EJEMPLO Quality compounders en stacked uptrend técnico ahora mismo

§ all_time_high_breakers

Acciones rompiendo máximos históricos hoy o cerca. La señal técnica más simple y poderosa para detectar liderazgo de mercado.

EJEMPLO Qué acciones del Russell 2000 están rompiendo máximos históricos esta semana

§ near_52w_high_screener

Tickers cerca de máximos de 52 semanas ($\leq 5\%$ de distancia) o mínimos ($\leq 5\%$). Útil para momentum o reversal plays.

EJEMPLO Acciones a menos del 3% del máximo de 52 semanas con volumen creciente

§ breakouts_52w

Tickers que han cruzado el máximo (alza) o mínimo (baja) de 52 semanas en los últimos N días. Señal técnica clásica.

EJEMPLO Breakouts confirmados al alza en los últimos cinco días en empresas con market cap > 5B

§ technical_setups

Setups técnicos clásicos sobre stock_catalog: golden cross, oversold reversal, gap up sostenido, base alta apretada.

EJEMPLO Acciones con golden cross activado y RSI por debajo de 70 en sector tech

§ multi_kpi_screener_alpha

Combinación arbitraria de KPIs fundamentales con alpha histórica medida. Estudio por quintils cross-universo.

EJEMPLO Empresas en top quintil de ROIC y EV/EBITDA bajo con alpha forward histórica positiva

§ theme_tags_screener

Búsqueda por tag temático: artificial-intelligence, metaverse, cybersecurity, gaming, cloud, electric-vehicles, biotech, clean-energy.

EJEMPLO Empresas tag artificial-intelligence con ROCE superior al 20% y free cash flow positivo

§ description_keyword_screener

Busca empresas con keywords específicas en su descripción corporativa. Útil para temáticas no etiquetadas oficialmente.

EJEMPLO Empresas que mencionan «quantum computing» en su descripción corporativa

§ company_profile_screener

Screener por metadata corporativo: año fundación, número empleados, headquarters country, exchange listing, CEO tenure.

EJEMPLO Empresas fundadas antes de 1980 con más de 50 000 empleados en US o Europa

§ index_constituents

Acciones que pertenecen a un índice concreto: SP500, NASDAQ100, DOW30, RUSSELL2000, RUSSELL1000, STOXX600.

EJEMPLO Composición actual del Russell 2000 con métricas fundamentales

§ liquidity_screener

Screener por dollar_volume (ADV en USD). Para garantizar que los tickers tengan liquidez institucional suficiente.

EJEMPLO Acciones con dollar volume promedio diario superior a 100M USD en últimas 4 semanas

§ lynch_graham_picks

Picks por modelo Lynch fair value o Graham number con potencial alcista porcentual y calidad verificada.

EJEMPLO Top 20 picks Lynch con potencial alcista superior al 50% y F-Score 7+

§ graham_lynch_value_screener

Screener Graham (defensive value) o Lynch (growth-at-reasonable-price) con filtros estrictos clásicos.

EJEMPLO Defensive value picks estilo Graham en utilities y consumer staples

§ Piotroski winners

F-Score Piotroski alto (8-9) combinado con momentum positivo y ausencia de red flags. Quality at-its-best.

EJEMPLO Piotroski 9 con momentum YTD positivo y sin red flags

§ red_flags_screener

Anti-patrón: detecta acciones con varias señales financieras de alerta — útil para evitar trampa de valores.

EJEMPLO Acciones con al menos 3 red flags activos en small cap US

§ balance_sheet_strength

Empresas con balance sheet sólido: liquidez (current ratio), solvencia (debt/equity) y cobertura de intereses fuertes.

EJEMPLO Compañías con net debt negativo, current ratio > 2 y interest coverage > 10

§ net_debt_quality

Balance sheet fuerte por apalancamiento NETO (descuenta caja). Identifica empresas con cash position dominante.

EJEMPLO Empresas con net debt/EBITDA menor a -1 (más caja que deuda) y ROCE > 15%

§ efficiency_leaders

Empresas que generan mucho con poco capital: asset turnover alto + ROIC alto + working capital eficiente.

EJEMPLO Top capital-efficient companies con ROIC > 25% en sector tech y healthcare

§ fcf_machines

Acciones con alta generación de FCF (free cash flow yield alto) + crecimiento FCF + sostenibilidad.

EJEMPLO FCF machines con yield > 8% y crecimiento FCF a 5 años positivo

§ wacc_value_creators

Empresas que CREAN valor económico: ROIC superior al WACC con margen amplio sostenible.

EJEMPLO Value creators con spread ROIC-WACC superior a 10 puntos los últimos 5 años

§ margin_expansion_screener

Stocks con N+ márgenes (gross, operating, net) expandiendo monotónicamente últimos K periodos. Operating leverage en acción.

EJEMPLO Empresas con expansión simultánea de 3 márgenes los últimos 4 trimestres

§ short_squeeze_candidates

Acciones con alto short interest + momentum + ratio days-to-cover elevado. Setup de squeeze potencial.

EJEMPLO Short squeeze candidates con short interest > 20% y momentum positivo última semana

§ multibagger_screener

Acciones que han sido multibaggers a 15-20 años (estudio histórico). Pattern recognition de winners de largo plazo.

EJEMPLO Top multibaggers de los últimos 20 años con retorno > 10x

§ recent_splits

Stock splits efectivos en los últimos N días (default 180). Señal técnica clásica.

EJEMPLO Stock splits ejecutados en los últimos 6 meses con ratio mínimo 2:1

§ buscar_acciones

Búsqueda por ticker, ISIN o nombre. Búsqueda fuzzy para resolver consultas ambiguas.

EJEMPLO Busca empresas con nombre similar a «Berkshire»

§ ranking_acciones

Ranking de acciones por una métrica, con filtros opcionales sector / país / exchange.

EJEMPLO Top 50 empresas por market cap en sector tech US, ordenadas por ROCE descendente

§ sectores_mercado

Lista sectores GICS con conteo de acciones y distribución estadística de PE, ROCE, márgenes por sector.

EJEMPLO Stats agregados de cada sector GICS: PE medio, ROCE medio, número de empresas

§ industry_metric_distribution

Distribución estadística de UNA métrica fundamental en UNA industria + lista de outliers en top/bottom.

EJEMPLO Distribución de ROCE en industria semiconductors con top 10 y bottom 10

§ adv_ticker

Perfil de liquidez completo de UN ticker: ADV histórico, free float, bid-ask spread medio.

EJEMPLO Perfil de liquidez completo de NVDA en los últimos 12 meses

IV · 02

Análisis fundamental

Acceso completo a 86 ratios financieros con histórico de 20+ años. Comparativas peer y sectoriales, consensos de analistas con consenso y dispersión, modelos de valoración Lynch, Graham y WACC, análisis de crecimiento y segmentos.

“ PROMPT PRINCIPAL

Evalúa Inditex frente a su sector: ROCE, márgenes, crecimiento de ingresos a 5 años, balance y posicionamiento en cada métrica relevante.

ticker_360 con comparar_ticker_vs_sector devuelve análisis fundamental completo con percentiles sectoriales y posicionamiento.

Herramientas

§ ticker_360

Briefing completo de un ticker en una sola query: snapshot, fundamentales, smart money, análisis cualitativo, ratings.

EJEMPLO Análisis 360° de Microsoft con todas las dimensiones disponibles

§ ticker_full_history

Brief EXHAUSTIVO de un ticker en UNA llamada (más completo que ticker_360): instantánea + histórico fundamental completo + transcripts.

EJEMPLO Análisis histórico completo de Apple con series fundamentales de 20 años

§ fundamentales_snapshot

Snapshot fundamental actual con aproximadamente 70 campos consolidados — el resumen más denso disponible.

EJEMPLO Snapshot fundamental actual de Tesla con todas las métricas clave

§ fundamentales_historicos

Series históricas de los estados financieros de una acción. Income statement, balance sheet, cash flow con histórico de 20+ años.

EJEMPLO Income statement completo de Nvidia desde 2010

§ fundamentales_brief_con_contexto

Brief fundamental condensado de un ticker con contexto sectorial: dónde está vs su sector en métricas clave.

EJEMPLO Brief de Alphabet con contexto vs sector communication services

§ fundamentales_segmentos

Auto-detecta y devuelve TODAS las métricas segmentadas de un ticker (por producto, geografía, división).

EJEMPLO Desglose de Amazon por segmento: AWS, advertising, retail North America, retail international

§ metrica_timeseries

Serie temporal de UNA métrica para un ticker, ordenada cronológicamente. Outliers detectados y stats agregados.

EJEMPLO Evolución del ROCE de Visa los últimos 15 años

§ metricas_disponibles_ticker

Lista qué metric_ids tiene disponibles un ticker concreto (con al menos 3 valores históricos).

EJEMPLO Qué métricas tiene cubiertas Inditex en la base fundamental

§ catalogo_metricas

Explora el catálogo de métricas fundamentales en datos fundamentales. Discovery de qué se puede medir.

EJEMPLO Lista completa de métricas fundamentales disponibles agrupadas por familia

§ crecimiento_metrica

Crecimiento de una métrica: YoY más reciente, CAGR 3Y/5Y/10Y, valores inicio y fin con dispersión por periodo.

EJEMPLO Crecimiento de revenue de Costco: YoY, CAGR 5 y 10 años

§ comparar_acciones_metrica

Compara una métrica entre N acciones en un año o periodo concreto.

EJEMPLO Compara ROCE 2025 de Apple, Microsoft, Google, Meta y Amazon

§ comparar_acciones_snapshot

Compara 2-10 acciones lado a lado: instantánea fundamental actual con todas las métricas relevantes alineadas.

EJEMPLO Snapshot comparativo de NVDA, AMD, INTC y AVGO lado a lado

§ comparar_ticker_vs_sector

Análisis profundo de UNA métrica de un ticker vs distribución del sector. Percentiles y posicionamiento.

EJEMPLO Posicionamiento del ROCE de Nestlé vs sector consumer staples (percentiles)

§ peer_benchmarking

Compara un ticker contra sus N pares más cercanos en su industry (o sector). Auto-detección de peers.

EJEMPLO Benchmark de Visa contra sus top 5 peers en payments processing

§ percentiles_metrica

Distribución estadística (P10/P25/P50/P75/P90) de una métrica en el universo o segmento.

EJEMPLO Distribución completa de F-Score Piotroski en sector industriales

§ consenso_consensus

Consensus de analistas para los próximos N periodos del ticker: avg, low, high, n_analistas por trimestre/año.

EJEMPLO Consenso de EPS forward 4 trimestres para Salesforce

§ consenso_dispersion

Dispersión del consenso por periodo: $(high-low)/avg \times 100$. Mide incertidumbre del panel de analistas.

EJEMPLO Dispersión del consenso para Tesla en próximos 8 trimestres

§ forward_estimates_movers

Acciones con consensus de analistas previendo aceleración fuerte en EPS o revenue.

EJEMPLO Acciones con mayor aceleración consensus EPS forward vs trailing en sector tech

§ actual_vs_estimate

Compara valores reportados vs consenso previo para detectar aciertos/fallos históricos.

EJEMPLO Track record actual vs estimate de Meta últimos 12 trimestres

§ analyst_target_mispriced

Acciones donde los analistas ven mayor upside (mispricing) + calidad verificada.

EJEMPLO Acciones con upside > 30% según analistas y F-Score 7+

§ dividend_growth_quality

Dividendo creciente SOSTENIBLE por velocidad (CAGR), no solo por antigüedad. Payout ratio razonable.

EJEMPLO Dividend growers sostenibles con CAGR 10y > 8% y payout < 60%

§ dividend_yield_quality_combo

Income con quality combinado: yield decente + dividendo creciente + sostenibilidad financiera.

EJEMPLO Dividendo yield > 3% con CAGR 5y > 6% y F-Score 7+

§ dividend_champions

Acciones con histórico largo de dividendo creciente: aristocrats (25+ años) y kings (50+ años).

EJEMPLO *Lista actual de dividend aristocrats US con yield y CAGR de dividendo*

§ dividend_history_ticker

Historial completo de dividendos de un ticker: ex_date, amount, currency, payment_date, declaration_date.

EJEMPLO *Historico de dividendos de Coca-Cola los últimos 20 años*

§ dividend_calendar

Próximos ex-dates en los siguientes N días. Útil para income strategies y dividend capture.

EJEMPLO *Próximas fechas ex-dividend en las próximas 4 semanas para mi watchlist*

§ buyback_leaders

Acciones recomprando acciones agresivamente (buyback yield alto). Capital return alternativo al dividendo.

EJEMPLO *Top empresas por buyback yield los últimos 4 trimestres con FCF positivo*

IV · 03

Smart money tracking

Categoría diferencial del catálogo. Cruza cuatro fuentes independientes de smart money: insiders corporativos US, trades del Congreso, holdings de superinversores institucionales (13F · public filings) y actividad alrededor de reuniones Fed.



PROMPT PRINCIPAL

¿Dónde están comprando insiders y congresistas a la vez en small caps US, ordenado por número de fuentes convergentes?

smart_money_convergence cruza tres fuentes y devuelve acciones con triple alineación alcista: compras de insiders, compras del Congreso, y documentos activistas recientes.

Herramientas

§ search_insider_trades

Búsqueda de insider trades enriquecidos. Filtros por ticker, role, tipo de transacción, ventana, valor mínimo.

EJEMPLO *Compras de insiders > 500K USD en sector tech los últimos 60 días*

§ insider_cluster_alert

Acciones con clusters de insiders comprando (≥N insiders distintos en 7 días). Señal de consenso interno.

EJEMPLO *Alertas de cluster con ≥3 insiders comprando en últimas 2 semanas*

§ insider_sells_warning

Opuesto a la alerta de cluster: acciones con N+ insiders distintos vendiendo en ventana. Señal bajista potencial.

EJEMPLO *Acciones con cluster de ventas insider (≥3 vendedores) en small cap tech*

§ insider_sentiment_ticker

Sentiment agregado de insiders en ventana: compras vs ventas, número de compradores y vendedores únicos, señales de cluster y operaciones CEO/CFO.

EJEMPLO *Sentiment insider de Palantir los últimos 6 meses con desglose CEO/CFO*

§ insider_ownership_alignment

Skin in the game: insiders con alta participación que ADEMÁS están comprando más. Doble compromiso.

EJEMPLO *Acciones con propiedad insider > 15% y al menos 2 compras puras los últimos 90 días*

§ insider_quarterly_summary

Resumen pre-agregado de insider activity por trimestre. Tabla optimizada para consultas cross-acción rápidas.

EJEMPLO *Resumen quarterly de insider activity en S&P; 500 en Q1 2026*

§ contrarian_insider_buys

Insiders comprando acciones cerca de mínimos 52 semanas. Señal contrarian: ¿insiders compran en debilidad?

EJEMPLO Contrarian compras de insiders cerca de mínimos 52 semanas en sector consumer

§ search_congress_trades

Búsqueda de trades de congresistas USA enriquecidos con net_worth y state del político.

EJEMPLO Trades del Congreso en NVDA los últimos 12 meses

§ congress_party_divergence

Tickers donde demócratas y republicanos discrepan: unos compran, otros venden. señal de información asimétrica.

EJEMPLO Acciones con compras republicanas y ventas demócratas (o viceversa) en últimos 90 días

§ politician_360

Perfil completo de un congresista USA: trades totales, gain/loss agregado, top positions, sector tilt.

EJEMPLO Perfil completo del congresista Dan Crenshaw con trades, P&L; y sector tilt

§ politician_wealth_performance

Correlaciona net_worth del político con performance (gain_loss) de sus trades. ¿Los ricos eligen mejor?

EJEMPLO Relación net worth vs performance trade en miembros del Senate Banking Committee

§ search_superinvestor_holdings

Holdings de superinversores institucionales: Buffett, Ackman, Burry, Klarman, Greenblatt, Pabrai, etc.

EJEMPLO Holdings de Bill Ackman ordenados por % del portfolio

§ superinvestor_list

Lista de todos los superinversores con número de posiciones, AUM y top holding. Discovery del universo.

EJEMPLO Lista completa de superinversores con AUM y top holding

§ superinvestor_portfolio

Cartera completa de un superinvestor con weights actuales y cambios vs trimestre anterior.

EJEMPLO Portfolio actual de Berkshire Hathaway con cambios recientes

§ superinvestor_consensus

Acciones con consenso entre superinversores: ≥N holders distintos en dataroma_holdings.

EJEMPLO Acciones con ≥5 superinversores como inversores simultáneos

§ fed_decisions

Histórico de decisiones Fed: tipo actual vs consenso, sorpresas, eventos macro alrededor.

EJEMPLO Últimas 8 decisiones de la Fed con sorpresa vs consensus y reacción macro

§ fed_regime_classifier

Clasifica el régimen monetario actual de la Fed: hike / cut / hold con metadata.

EJEMPLO Régimen monetario Fed actual con métricas de soporte

§ fed_decision_macro_reaction

Para últimas N reuniones Fed, mide reacción típica de macros en T+1d / T+5d / T+30d.

EJEMPLO Reacción típica de yield curve y dollar T+1d y T+5d post última reunión Fed

§ fed_impact_sectors

Últimas N reuniones Fed enriquecidas: actual vs consenso, noticias ±3d, top 5 tickers por sector que reaccionan.

EJEMPLO Impacto sectorial de las últimas 4 reuniones Fed con top tickers movers

§ fed_insider_timing

Actividad insider 5 días antes y 5 días después de cada reunión Fed. Detección de posible anticipación informativa.

EJEMPLO Insider activity ±5d alrededor de reuniones Fed en últimos 2 años

§ smart_money_anticipates_macro_event

Detecta eventos macro (cruces de threshold) y mide actividad insider/congress en ventana previa.

EJEMPLO ¿Hubo compras pre-evento en últimas 5 inversiones de curva 10Y-2Y?

§ smart_money_convergence

Acciones con actividad simultánea de múltiples fuentes smart money. La convergencia es la edge propietaria.

EJEMPLO Acciones con convergencia triple: compras de insiders + compras del Congreso + activist 13D documentos

§ smart_money_fundamental

Acciones con compras de insiders puro (sólo 'Buy') Y buenos fundamentales. Quality screen con confirmación.

EJEMPLO Compras de smart money + F-Score 7+ + ROCE > 15% los últimos 60 días

§ insider_vs_congress_solapamiento

Tickers donde AMBOS — insiders corporativos Y congresistas — compran simultáneamente en ventana.

EJEMPLO Solapamiento insider + Congress buying en small cap defense últimos 90 días

§ analyst_smart_money_alignment

Acciones con CONVERGENCIA multi-fuente alcista en últimos N días: analista upgrades + insider + congress.

EJEMPLO Triple alcista convergence: analista upgrade + compras de insiders + compras del Congreso últimos 30 días

§ high_conviction_buys

Triple alineación alcista: analista Compra/Compra fuerte + compras de insiders + potencial alcista vs PT.

EJEMPLO High conviction setup: analista Compra fuerte + compras de insiders + upside > 25%

§ sector_smart_money_pulse

Estado actual de smart money por sector GICS + fundamentales agregados del sector.

EJEMPLO Sectores con mayor actividad neta de smart money en últimas 4 semanas

§ sector_rotation

Rotación de capital entre sectores: smart money del período reciente vs previo.

EJEMPLO Rotación sectorial smart money últimos 3 meses vs trimestre anterior

§ dividend_aristocrat_smart_money

Dividend champions con histórico largo + endorsement reciente de smart money (insiders).

EJEMPLO Aristocrats con compras de insiders confirmado en últimos 6 meses

§ pt_upgrade_with_insiders

Price target upgrades $\geq X\%$ en últimos N días confirmados por compras de insiders.

EJEMPLO subidas de precio objetivo > 20% con compras de insiders confirmatorios en sector tech

§ transcript_keyword_alpha

Backtest: ¿el keyword X en transcripts predice alpha forward? Estudio por quintils sobre menciones.

EJEMPLO ¿Mencionar «AI agents» en conferencias de resultados predice alpha forward a 90 días?

IV · 04

SEC documentos — perspectiva dual

Acceso completo a SEC filings desde 1993. Característica única del MCP: cada filing puede verse desde el declarante (quién declara) y desde el subject (sobre quién va). Cobertura institucional + insider.

“ PROMPT PRINCIPAL

¿Quiénes declararon participaciones superiores al 5% en Nvidia el último año, y qué porcentaje son activistas frente a holders pasivos?

who_filed_on combinado con sec_activist_tracker devuelve declarantes, naturaleza (13D vs 13G), número de documentos y enlaces directos a SEC.

Herramientas

§ sec_documentos_ticker

SEC documentos recientes para un ticker, resueltos vía ticker_cik_map. Subject perspective: documentos SOBRE el ticker.

EJEMPLO Últimos 20 documentos SEC sobre Apple

§ sec_documentos_calendar

Calendario reciente de documentos multi-acción: qué se ha filed en los últimos N días por form_type.

EJEMPLO Todos los 8-K filed en últimas 2 semanas con eventos materiales

§ sec_periodic_history

Historial de documentos periódicos (10-K, 10-Q, 20-F) de un ticker con metadata histórica.

EJEMPLO Histórico completo de 10-K y 10-Q de Microsoft con fechas de filing

§ who_filed_on

¿Quiénes han filed 13G/13D sobre un ticker recientemente? Identifica BlackRock, Vanguard, activists.

EJEMPLO Quiénes declararon ≥5% sobre Tesla los últimos 18 meses con clasificación activist/passive

§ declarante_portfolio

Portfolio declarado completo de un declarante institucional (BlackRock, Vanguard, State Street) vía 13D/13G.

EJEMPLO Portfolio documentos de participación significativa (13D y 13G) declarado de BlackRock con todos los tickers ≥5%

§ declarante_13f_recent

13F recientes de un declarante institucional con URLs directas al documento original.

EJEMPLO Últimos 13F documentos de Renaissance Technologies con enlaces SEC

§ top_active_declarantes

Top declarantes institucionales por actividad reciente. ¿Quién está más activo en activismo o accumulation?

EJEMPLO Top 20 declarantes más activos en Schedule 13D los últimos 6 meses

§ declarante_target_solapamiento

¿En qué tickers coinciden 2 declarantes institucionales? Solapamiento de convicción entre Buffett y Pabrai, por ejemplo.

EJEMPLO Solapamiento de posiciones declaradas entre Berkshire y Pershing Square

§ sec_activist_tracker

Top acciones con MÁS Schedule 13D documentos recientes. Acumulación de activistas sistémica detectable.

EJEMPLO Top acciones con mayor actividad activist 13D en últimos 12 meses

§ sec_passive_holder_changes

Schedule 13G documentos (passive ≥5% holders) sobre UN ticker recientemente. Quién ha cruzado el umbral.

EJEMPLO Cambios recientes de holders pasivos ≥5% sobre Berkshire Hathaway

§ sec_13g_burst_universe

Acciones con BURST de 13G documentos — señal de acumulación institucional pasiva concentrada.

EJEMPLO Acciones con burst anormal de 13G documentos en últimos 90 días

§ sec_8k_burst

Acciones con burst anormal de 8-K documentos — señal de eventos materiales en curso.

EJEMPLO Acciones con ≥3 8-K filed en últimas 2 semanas

§ sec_form3_new_insiders

Form 3 documentos — nuevas declaraciones de insider (llegada de CEO, CFO, 10%+ owners).

EJEMPLO Nuevos Form 3 los últimos 30 días en empresas mid cap

§ sec_144_selling_intent

Form 144 — insiders notifican intención de vender stock restringido. Señal de cooling-off (intención previa).

EJEMPLO Form 144 documentos recientes en empresas con high momentum

§ sec_filing_event_alpha

Estudio de eventos: alpha forward post-filing SEC por tipo de formulario.

EJEMPLO Alpha forward histórico post-13D documentos primary en small cap

§ transcripts_calendar

Calendario de conferencias de resultados recientes en transcripts.

EJEMPLO Conferencias de resultados publicados en las últimas 2 semanas con tickers y fechas

IV · 05

Earnings y analista

Cobertura completa del ciclo earnings. Surprises históricas (35 años, EEUU + ADRs), transcripts completos con búsqueda búsqueda por palabra clave, ratings de analistas con track record por firm y price target changes.

“ PROMPT PRINCIPAL

¿Qué empresas tech mencionan más «inteligencia artificial» en sus calls este trimestre? Dame las 5 con mayor frecuencia y un snippet.

transcript_keyword_trending busca multi-acción en últimos 90 días en sector tech y devuelve tickers ordenados por menciones con snippet.

Herramientas

§ earnings_calendar

Acciones reportando en próximos N días con consensus y guidance previo. Útil para agenda semanal.

EJEMPLO Earnings reportes próximos 7 días en empresas con market cap > 10B

§ earnings_event_full_picture

Snapshot 360° de un earnings event específico: consenso, actual, surprises, insiders previos, news, transcript.

EJEMPLO Picture completo del Q4 2025 earnings event de Nvidia

§ earnings_beat_track_record

Track record histórico de beats y fallos para un ticker: tasa de aciertos, surprise media, consistencia.

EJEMPLO Track record beats EPS de Salesforce los últimos 12 trimestres

§ revenue_surprise_track_record

Track record de revenue aciertos/fallos (top-line). Mejor signal de quality que beats EPS via cost cutting.

EJEMPLO Revenue beats track record de Costco últimos 16 trimestres

§ actual_vs_estimate

Compara valores reportados vs consenso previo para detectar aciertos/fallos históricos con magnitud.

EJEMPLO Actual vs estimate de Tesla los últimos 8 trimestres con dispersión analista

§ pre_earnings_setup

Tickers reportando próximamente enriquecidos con calidad + smart money + cambios de precio objetivo recientes.

EJEMPLO Setup pre-resultados semana próxima con insider activity y cambios de precio objetivo

§ earnings_surprise_smart_money_pre

Sorpresas alcistas en resultados donde insiders y/o congress compraron ANTES del reporte. Patrón potencial de leak.

EJEMPLO Beats > 10% con compras de insiders en ventana pre-reporte últimos 12 meses

§ transcript_latest

Último earnings transcript disponible para un ticker con metadata completa.

EJEMPLO Último transcript de Microsoft con prepared remarks y Q&A;

§ transcript_by_quarter

Recupera UN transcript específico de un ticker por quarter concreto.

EJEMPLO Transcript de Apple Q1 2025 completo

§ transcript_search

Búsqueda búsqueda por palabra clave en transcripts de un ticker con snippets de contexto.

EJEMPLO Búsqueda «AI agents» en transcripts de Salesforce los últimos 8 trimestres

§ transcript_summary_long

Resumen largo pre-procesado del earnings call más reciente. HTML estructurado.

EJEMPLO Resumen ejecutivo del último call de Meta Platforms

§ transcript_keyword_trending

Cross-ticker: ¿qué empresas mencionan AI, tariff, GLP-1, layoffs más frecuentemente este trimestre?

EJEMPLO Empresas que más mencionan «tariff» en calls de últimos 90 días

§ transcript_topic_evolution_ticker

Cómo evoluciona la narrative de un ticker: frecuencia de keywords per quarter en sus calls.

EJEMPLO Evolución de menciones «cloud» en calls de Amazon últimos 5 años

§ analyst_ratings_recent_ticker

Ratings recientes de analistas para un ticker: firm, action, price target, fecha.

EJEMPLO Ratings recientes de Tesla en últimos 90 días con price targets

§ analyst_ratings_by_firm

Ratings recientes emitidos por una firm específica (Morgan Stanley, JPM, Goldman, etc.).

EJEMPLO Últimas 20 calls de Morgan Stanley en sector tech

§ top_analysts_ticker

Top analistas cubriendo un ticker ordenados por track record: stars, success rate, avg return histórico.

EJEMPLO Top 10 analistas con mejor track record cubriendo Nvidia

§ pt_changes_recent

Cambios significativos de precio objetivo en últimos N días con magnitud y direccionalidad.

EJEMPLO Cambios PT >15% en últimos 7 días en sector financiero

§ pt_upgrade_post_return

subidas de precio objetivo: ¿el mercado premia los aumentos de precio objetivo? Backtest excess return tras revisiones.

EJEMPLO Excess return forward 30d tras subidas de precio objetivo >10% por sector

IV · 06

Macro y sectorial

Base macro completa con indicadores oficiales y alternativos. Detección de regímenes, análisis estudio de eventos sobre eventos macro, comparación de performance sectorial por régimen y proyección por análogos históricos.

“ PROMPT PRINCIPAL

¿Qué pasó históricamente con los sectores ETF en los doce meses siguientes a una inversión de la curva 10Y-2Y? Dame medias por sector y win rate.

sector_performance_in_macro_regime busca períodos con T10Y2Y negativo, calcula returns forward y agrega por sector con win rate.

Herramientas

§ macro_search

Búsqueda de indicadores macro en el catálogo oficial y fuentes alternativas. Discovery por keyword.

EJEMPLO Indicadores macro relacionados con housing market en el catálogo

§ macro_indicator_detail

Metadata completa + estadísticas de carga de un indicador macro específico.

EJEMPLO Detalle completo del indicador macro T10Y2Y con frecuencia y stats

§ macro_series_history

Serie histórica de un indicador macro, ordenada cronológicamente.

EJEMPLO Histórico completo de FEDFUNDS últimos 30 años

§ macro_recent_releases

Indicadores macro publicados o revisados en últimos N días.

EJEMPLO Macro releases publicados o revisados última semana

§ macro_revision_history

Historial de TODAS las versiones (vintages) de UN valor específico. Crítico para análisis PIT.

EJEMPLO Vintage history del valor de NFP para abril 2024 (revisiones sucesivas)

§ macro_compare_series

Compara hasta 6 indicadores macro alineados por obs_date para análisis cross-indicator.

EJEMPLO Comparar T10Y2Y, FEDFUNDS, UNRATE y CPIAUCSL alineados los últimos 5 años

§ macro_yield_curve

Snapshot de la curva de tipos del Tesoro USA (T1M..T30Y) a una fecha concreta.

EJEMPLO Yield curve completa T1M..T30Y a fecha 25 mayo 2026

§ macro_outliers_today

Detección automática: ¿qué indicadores macro están en estado extremo hoy comparado con su distribución histórica?

EJEMPLO Indicadores macro en estado outlier hoy comparados con histórico de 30 años

§ macro_regime_compound

Fechas históricas cumpliendo N condiciones macro SIMULTÁNEAMENTE.

EJEMPLO Periodos históricos con $T10Y2Y < 0 + UNRATE > 5\% + ISM < 50$ simultáneamente

§ regime_persistence_analysis

Estadística de duración de periodos cumpliendo condición en histórico. Cuánto duran los regímenes.

EJEMPLO Duración media histórica de periodos con yield curve invertida

§ macro_lead_lag_analysis

Lag óptimo entre 2 indicadores macro. Discovery de leading indicators reales.

EJEMPLO Lag óptimo entre yield curve y unemployment rate

§ recession_dashboard

Dashboard de indicadores clave de recesión USA: yield curve, employment, claims, leading economic index.

EJEMPLO Estado actual del recession dashboard con probabilidad implícita

§ recession_dashboard_history_chart

Backtest del recession_dashboard: para cada mes en un rango, computa los componentes históricamente.

EJEMPLO Histórico mensual del recession dashboard últimos 10 años

§ cross_asset_state_of_the_world

Snapshot multi-fuente del estado macro del mundo a una fecha: rates, equities, FX, commodities, vol.

EJEMPLO State of the world cross-asset hoy con todos los benchmarks

§ historical_macro_analogs

Fechas históricas más similares al estado macro actual. ¿Qué pasó las últimas veces?

EJEMPLO 5 fechas históricas más similares al actual + reacción de mercado posterior

§ market_breadth_dashboard

Termómetro de mercado: % stocks sobre MA50/MA200, golden cross activos, máximo de 52 semanas vs lows.

EJEMPLO Market breadth dashboard actual del S&P; 500

§ sector_performance_in_macro_regime

Sector ETFs cuando un indicador macro cumple una condición. Backtest histórico por régimen.

EJEMPLO Performance sectorial cuando UNRATE sube > 0.5pp en 6 meses

§ kpi_alpha_predictive_power

Estudio por quintils: ¿qué KPI predice realmente alpha forward? Pregunta retail evidence-based.

EJEMPLO ¿Funcionó F-Score como predictor de alpha forward 12m los últimos 10 años?

§ event_study_returns

Estudio de eventos: cómo se mueve el precio antes y después de eventos corporativos arbitrarios.

EJEMPLO Estudio de eventos returns post-13D documentos $\pm 30d$ agrupado por sector

IV · 07

Fondos y pensiones

Diferencial absoluto del MCP español. Cobertura completa de fondos UCITS europeos institucionales (53.900 fondos), planes de pensiones España (923) y análisis cuantitativo institucional aplicado al universo retail fiscalmente eficiente.



PROMPT PRINCIPAL

Dame los fondos UCITS RV global con mejor Sharpe a 5 años, patrimonio > 500M, ongoing charge < 1% y consistencia top quartile.

screener_fondos con filtros estrictos + fondos_consistencia_total devuelve una lista corta que cumple las cuatro condiciones simultáneamente.

Herramientas

§ screener_fondos

Screener master sobre 135 columnas del fund catalog. La herramienta más versátil para descubrimiento.

EJEMPLO Fondos RV global con Sharpe 5y > 1 y ongoing charge < 1.2%

§ buscar_fondos

Búsqueda de fondos por nombre, ISIN o gestora con fuzzy matching.

EJEMPLO Busca fondos con «Vanguard» en el nombre o gestora

§ ranking_fondos

Ranking de fondos por cualquier métrica con filtros sector / categoría / gestora / tamaño.

EJEMPLO Top 50 fondos RV Europa por Sharpe 5 años con AUM > 100M

§ taxonomia_fondos

Lista categorías de fondos con conteo por tipo. Discovery de qué categorías existen.

EJEMPLO Catálogo completo de categorías de fondos UCITS europeos con número de fondos por categoría

§ categoria_stats

Estadísticas de una categoría de fondos: medianas, P25, P75 de todas las métricas.

EJEMPLO Stats medios y percentiles de categoría RV Tecnología global

§ gestoras_ranking

Ranking de gestoras por AUM, número de fondos 5 estrellas, medalist positive %, sharpe agregado.

EJEMPLO Top 20 gestoras por % de fondos 5 estrellas con AUM > 10B

§ comparar_fondos

Comparativa lado a lado de hasta 10 fondos por ISIN con todas las métricas relevantes alineadas.

EJEMPLO Compara 4 fondos RV global por ISIN: Sharpe, fees, drawdown, capture

§ similar_fondos

Dado un ISIN, encuentra fondos similares en la misma categoría con métricas comparables.

EJEMPLO Fondos similares al Fundsmith Equity con mejor Sharpe

§ fund_percentile

Percentil de un fondo en CADA métrica vs su categoría. Posicionamiento granular.

EJEMPLO Posicionamiento completo del Fundsmith Equity vs su categoría en todas las métricas

§ fondos_consistencia_total

Fondos en top quartile de su categoría simultáneamente en múltiples horizontes – consistent winners.

EJEMPLO Fondos top quartile en 3y, 5y, 10y simultáneamente en categoría RV global

§ fondos_alpha_consistency

Fondos con alpha consistente en varios períodos vs benchmark – separan suerte de skill.

EJEMPLO Fondos RV USA con alpha positivo en 3y, 5y y 10y simultáneamente

§ fondos_capture_asymmetry

Defensivos puros: alto captura al alza combinado con bajo captura a la baja.

EJEMPLO Fondos con captura al alza > 95% y captura a la baja < 70% en RV global

§ fondos_low_risk

Fondos defensivos: drawdown contenido + volatilidad baja + sharpe positivo.

EJEMPLO Fondos defensivos con max drawdown 5y > -15% y vol < 10%

§ fondos_short_term_risk

Risk/return en ventana 1 año (no precomputado en otras tools que usan 3y/5y).

EJEMPLO Risk/return último año de fondos RV Europa con AUM > 500M

§ fondos_low_cost

Fondos de bajo coste: fee_level + management_fee + ongoing_charge bajos simultáneamente.

EJEMPLO Fondos UCITS europeos con ongoing charge < 0.3% por categoría

§ fondos_accessible_retail

Fondos con barrera de entrada baja para retail (mínimo inversión).

EJEMPLO Fondos UCITS con inversión mínima ≤ 1000€ y Sharpe 5y > 0.8

§ fondos_long_term_track

Fondos con track record largo (15-20 años) y datos completos.

EJEMPLO Fondos con 20+ años de track record y retorno anualizado > 8%

§ fondos_tracking_quality

Calidad de tracking para ETFs / fondos índice: tracking error + correlación con benchmark.

EJEMPLO Calidad de tracking de ETFs SP500 UCITS por tracking error

§ fondos_esg_performance

Fondos con ESG alto + performance real. Combina sostenibilidad con resultados.

EJEMPLO Fondos ESG con rating alto y Sharpe 5y > 1

§ fondos_medalist_rated

Fondos con rating analista positivo (Gold / Silver / Bronze).

EJEMPLO Fondos rating Gold en categoría RV global con AUM > 1B

§ fondos_por_style_box

Filtrado por Style Box estándar (large value, mid blend, small growth, etc.).

EJEMPLO Fondos large value RV USA con Sharpe 5y > 0.9

§ fondo_returns_custom

Return custom-window de un fondo por ISIN. Cualquier ventana arbitraria.

EJEMPLO Retorno del Fundsmith Equity entre 1 enero 2020 y 31 diciembre 2024

§ fondo_calendar_year_returns

Desglose de retornos por año natural + comparativa vs categoría.

EJEMPLO Retornos año a año del Fundsmith Equity vs categoría

§ fondo_rolling_metrics

Vol / Sharpe / MaxDD rolling con agregados sintetizados.

EJEMPLO Sharpe rolling 12 meses del Fundsmith Equity los últimos 10 años

§ fondo_drawdown_forensic

Análisis forense de drawdowns históricos: magnitud, duración, recovery time, contexto.

EJEMPLO Análisis de drawdowns históricos > 15% del Fundsmith Equity

§ fondo_event_study

Compara reacción de N fondos a una event_date específica. Útil para evaluar comportamiento en crisis.

EJEMPLO Reacción de 5 fondos RV global al crash de marzo 2020

§ fondo_crisis_performance

Performance del fondo en cada crisis histórica preset: COVID, GFC, Brexit, taper tantrum.

EJEMPLO Performance del Fundsmith Equity en cada crisis histórica preset

§ fondos_correlation_pair

Correlación entre 2 fondos: Pearson + rolling + spread analysis.

EJEMPLO Correlación rolling 12m entre Fundsmith Equity y Vanguard FTSE All-World

§ correlation_matrix

Matriz de correlaciones para N tickers o fondos (pares + estadísticas).

EJEMPLO Matriz de correlación 4 fondos: Fundsmith, Lindsell, Seilern, Pictet Global

§ stocks_correlation_pair

Correlación entre 2 stocks: Pearson + rolling + spread analysis.

EJEMPLO Correlación rolling 12m entre NVDA y AMD

IV · 08

Cross-fuente y convergencia

La edge propietaria del catálogo. Diecisiete herramientas que cruzan dos o más fuentes de datos en una sola query, devolviendo señales convergentes que ninguna fuente individual puede aportar.

“ PROMPT PRINCIPAL

Dame las acciones con noticias positivas en últimos 7 días, donde insiders están comprando y la calidad fundamental supera el percentil 80 del sector.

news_impact_smart_money_quality cruza tres fuentes y devuelve acciones con triple alineación validada: cobertura mediática + compras de insiders + quality top sector.

Herramientas

§ news_impact_smart_money_quality

Triple cross-fuente: news recientes + smart money comprando + calidad fundamental verificada. La señal más densa.

EJEMPLO Triple convergencia: noticias positivas + compras de insiders + F-Score 7+ en últimas 2 semanas

§ fundamental_convergence

Top percentil de una métrica fundamental combinado con insider activity reciente.

EJEMPLO Top decile ROCE con compras de insiders confirmado los últimos 90 días

§ fundamental_metric_change_alpha

Alpha post-cambio significativo en métrica fundamental. Estudio de eventos sobre rotaciones de calidad.

EJEMPLO Alpha forward 90d tras saltos de F-Score de ≤ 4 a ≥ 7

§ news_driven_insider_timing

Para cada noticia material de un ticker, ¿hubo insider trades en ventana cercana? Detección de leaks.

EJEMPLO Acciones con noticia material + ventas de insiders en ventana $\pm 5d$ último trimestre

§ ticker_news_insiders

Cruce noticias + insider trades para un ticker en ventana específica.

EJEMPLO Cruce news + insider trades de Palantir últimos 6 meses

§ ticker_news_timeline

Timeline de cobertura mediática de un ticker: nº noticias por semana o mes.

EJEMPLO Timeline de cobertura mediática semanal de Tesla últimos 12 meses

§ news_volume_burst

Detecta acciones con BURST anormal de cobertura de noticias vs su media histórica.

EJEMPLO Acciones con burst de noticias > 3 sigma vs media en última semana

§ news_top_tickers

Tickers MÁS mencionados en news en últimos N días.

EJEMPLO Top 20 tickers más mencionados en news las últimas 24 horas

§ buscar_noticias

Búsqueda de noticias de mercado por keyword o ticker.

EJEMPLO Noticias recientes sobre «AI chip shortage» últimas 4 semanas

§ ticker_smart_money

Vista consolidada de un ticker: Congress trades + insiders + holdings 13F agregados.

EJEMPLO Smart money instantánea consolidado de Palantir últimos 6 meses

§ dividend_cut_recovery_pattern

Detección de dividend cuts + análisis price recovery post-cut. ¿Trampa o oportunidad?

EJEMPLO Dividend cuts $\geq 50\%$ últimos 5 años + recovery price forward 12m por sector

§ split_event_alpha

Alpha post-stock-split por bucket de ratio. ¿Funcionan todavía los splits como señal?

EJEMPLO Alpha forward 90d post-splits por ratio bucket últimos 10 años

§ stock_drawdown_forensic

Drawdowns $\geq X\%$ históricos de un ticker con magnitud, duración, recovery.

EJEMPLO Drawdowns históricos $\geq 30\%$ de Meta con duración y recovery time

§ smart_money_anticipates_macro_event

Detecta eventos macro (cruces de threshold) y mide actividad insider Y congress en ventana previa.

EJEMPLO ¿Hubo actividad insider/congress pre-última subida Fed > 50 bps?

§ sec_filing_event_alpha

Alpha post-SEC filing por form type. Backtest sistemático del valor de cada formulario.

EJEMPLO Excess return forward 30d post-13D filing primary últimos 5 años

§ news_during_macro_event

Analiza market_news durante períodos en que un indicador macro cumple threshold.

EJEMPLO Top tickers y narrativas durante períodos T10Y2Y < 0 últimos 10 años

IV · 09

FX y multi-divisa

Última incorporación al catálogo. Resuelve un problema sistemáticamente ignorado por los brokers retail: ver el rendimiento real de inversiones internacional en la moneda del inversor (típicamente EUR para el universo español).

“ PROMPT PRINCIPAL

Compara mi return real en euros de NVDA, ASML, ITX y HSBA durante el último año, separando efecto subyacente y efecto FX.

cross_currency_performance devuelve por cada ticker: return local, return EUR, fx_impact_pct. Identifica cuánto del rendimiento es selección de acciones y cuánto FX.

Herramientas

§ fx_history_pair

Serie temporal de un par FX (EURUSD, EURGBP, EURJPY, etc.). 33 pares disponibles desde 2020.

EJEMPLO Histórico diario EURUSD últimos 5 años

§ currency_hedged_return

El return real de un stock en tu base_currency vs el return local. Cuantifica el efecto FX oculto.

EJEMPLO Currency-hedged return de NVDA en EUR vs USD último año

§ cross_currency_performance

Comparativa de N stocks en distintas monedas, normalizados a tu base_currency. Comparables directamente internacional.

EJEMPLO Performance EUR-normalizada de 5 stocks: NVDA, ASML, ITX, 7203.T, HSBA.L

§ fx_macro_correlation

Correlación entre un par FX y un indicador macro. EURUSD vs T10Y2Y, JPY vs DGS10, etc.

EJEMPLO Correlación rolling 12m entre EURUSD y T10Y2Y

V · GUÍA DE USO

Descubrir el catálogo

Cómo orientarse el primer día: qué tools, qué activos, qué campos, qué taxonomía.

Una vez configurado el MCP, basta con preguntar en lenguaje natural. Pero alguien que empieza necesita primero entender qué hay disponible. Esta guía recoge las preguntas que devuelven el catálogo real — qué herramientas existen, qué activos están cubiertos, qué métricas se pueden filtrar y cómo está categorizado el mercado.

El catálogo de herramientas

El primer paso es entender qué tools tiene el asistente para trabajar. El propio modelo conoce la lista completa y la describe a demanda.

- ¿Qué herramientas tienes disponibles?
- Agrupa las tools por categoría: screening, análisis fundamental, smart money, earnings, macro, fondos...
- ¿Qué tool me recomiendas para encontrar acciones value con momentum?
- ¿Qué herramientas cruzan más de una fuente?
- ¿Para qué sirve la tool insider_cluster_alert?

Buscar directamente — por nombre, ISIN o ticker

Antes de cualquier análisis hace falta encontrar el activo. El MCP tiene tools de búsqueda fuzzy sobre acciones, fondos y noticias: basta con dar un trozo de texto, un ISIN o un ticker y devuelve los matches.

- ¿Qué fondo es el ISIN LU0996182563?
- Encuentra fondos Vanguard de renta variable USA
- Lista los fondos de la gestora Fundsmith
- ¿Cuál es el ticker de Inditex? ¿Y de Sanofi?
- Busca acciones con «cyber» en el nombre
- ¿Qué planes de pensiones españoles cubres?
- Encuentra noticias recientes con keyword «GLP-1»

El universo de activos

Saber cuántos activos hay y cómo están distribuidos evita pedir cosas imposibles. El catálogo incluye tools específicas para listar el universo de cada dominio.

- ¿Cuántas acciones cubres y de qué países?
- ¿Qué índices puedo filtrar? (S&P 500, NASDAQ 100, Russell 2000, STOXX 600...)
- Dame los constituyentes actuales del Russell 2000
- ¿Qué categorías de fondos UCITS europeos hay?
- Lista los superinversores con holdings declarados
- ¿Qué indicadores macroeconómicos tienes?

El catálogo de métricas y campos

Antes de pedir un screening sofisticado, descubre qué métricas se pueden usar como filtros. Cada dominio tiene su propio catálogo de campos precomputados.

- ¿Qué métricas fundamentales puedo usar en screening?
- ¿Qué ratios de valoración están disponibles?
- ¿Qué métricas tiene cubiertas Inditex en la base fundamental?
- ¿Qué tags temáticos puedo filtrar? (IA, biotech, EV, ciberseguridad...)
- ¿Qué campos hay en el catálogo de fondos?

La taxonomía del mercado

Para filtrar el universo a un subconjunto relevante, descubre primero cómo está categorizado. Esto evita filtros vagos y permite navegación por agregados.

- ¿Qué sectores GICS hay y cuántas empresas en cada uno?
- Dame los stats medios de cada sector: PE, ROCE, márgenes
- ¿Qué industrias dentro del sector tecnología?
- Lista las categorías de fondos con conteo y patrimonio agregado
- ¿Qué tipos de Style Box hay?
- ¿Qué exchanges cubres?

Combinar fuentes — la edge propietaria

El verdadero diferencial del MCP es cruzar fuentes en una sola consulta. Las señales más fiables vienen de convergencias multi-fuente que ninguna fuente individual aporta.

- Dame acciones con noticias positivas + insider buying + calidad top sector
- ¿Dónde están comprando insiders y congresistas a la vez?
- Earnings beats donde insiders compraron justo antes del reporte
- ¿Qué empresas tienen analyst upgrades + insider buys los últimos 30 días?
- Sectores con más actividad de smart money esta semana

Profundizar y refinar

Después de un análisis inicial, casi siempre conviene profundizar. El modelo recuerda el contexto y puede ampliar cualquier resultado sin repetir setup.

- Profundiza en el primer ticker de los resultados anteriores
- Compara los top 3 contra el sector en todas las métricas relevantes
- ¿Qué smart money hay alrededor de este ticker?
- ¿Qué dicen los últimos earnings calls de estas empresas?
- Dame el análisis técnico de [ticker] además del fundamental

Buenas prácticas

Algunas pautas que mejoran la calidad de las respuestas y ahorran iteraciones.

- Empieza por descubrir — pregunta qué hay antes de pedir análisis específicos
- Si no encuentras un activo, búscalo por nombre parcial o ISIN — la búsqueda es fuzzy
- Pide percentiles en vez de valores absolutos («ROCE top quartile del sector» mejor que «ROCE alto»)
- Combina horizontes — fundamental + técnico + smart money da más contexto que cada uno por separado
- Cuestiona los resultados — pide al modelo que explique por qué aparece cada acción



Para más información o suscripción

bquantfunds.info

WEB

@Gsnchez

X / TWITTER