

Importante Gestión Financiera Estratégica Fórmulas PDF



Fórmulas
Ejemplos
con unidades

Lista de 18
Importante Gestión Financiera Estratégica
Fórmulas

1) Agregar tarifa Fórmula

Fórmula

$$\text{AOR} = \left(\left(\frac{\text{YR}}{d} \right) \cdot \frac{(\text{APMI}) - \text{PV}}{\text{APMI}} \right)$$

Ejemplo

$$0.3889 = \left(\left(\frac{7}{15} \right) \cdot \frac{(210) - 35}{210} \right)$$

Evaluar fórmula

2) Beta apalancada Fórmula

Fórmula

$$\beta_L = \beta_{UL} \cdot \left(1 + \left((1 - t) \cdot \left(\frac{D}{E} \right) \right) \right)$$

Ejemplo

$$0.729 = 0.3 \cdot \left(1 + \left((1 - 0.35) \cdot \left(\frac{22000}{10000} \right) \right) \right)$$

Evaluar fórmula

3) Beta sin apalancamiento Fórmula

Fórmula

$$\beta_{UL} = \frac{\beta_L}{1 + \left((1 - t) \cdot \left(\frac{D}{E} \right) \right)}$$

Ejemplo

$$0.3004 = \frac{0.73}{1 + \left((1 - 0.35) \cdot \left(\frac{22000}{10000} \right) \right)}$$

Evaluar fórmula

4) Cambio en el precio del bono completo Fórmula

Fórmula

$$\% \Delta \text{PV}^{\text{Full}} = \left(- \text{MD}_{\text{Annual}} \cdot \Delta \text{Yield} \right) + \left(\frac{1}{2} \cdot \text{AC} \cdot (\Delta \text{Yield})^2 \right)$$

Ejemplo

$$4609.4125 = \left(- 15 \cdot 55 \right) + \left(\frac{1}{2} \cdot 3.593 \cdot (55)^2 \right)$$

Evaluar fórmula

5) Convexidad efectiva Fórmula

Fórmula

$$\text{EC} = \frac{\text{PV}_+ + \text{PV}_- - (2 \cdot \text{P}_o)}{(\Delta C)^2 \cdot \text{P}_o}$$

Ejemplo

$$1.4522 = \frac{19405 + 470 - (2 \cdot 135)}{(10)^2 \cdot 135}$$

Evaluar fórmula



6) Costo del capital Fórmula

Fórmula

$$K = \left(\left(\frac{D_1}{CP} \right) + (g \cdot 0.01) \right) \cdot 100$$

Ejemplo

$$10.0556 = \left(\left(\frac{1.5}{2700} \right) + (10 \cdot 0.01) \right) \cdot 100$$

Evaluar fórmula 

7) Duración aproximada de Macaulay Fórmula

Fórmula

$$AMYD = AMD \cdot (1 + R)$$

Ejemplo

$$4.445 = 1.27 \cdot (1 + 2.50)$$

Evaluar fórmula 

8) Mortalidad en un solo mes Fórmula

Fórmula

$$SMM = \frac{PFM}{BMBM - SPR}$$

Ejemplo

$$1.294 = \frac{6580}{6030 - 945}$$

Evaluar fórmula 

9) Precio de paridad de conversión Fórmula

Fórmula

$$CPP = \frac{V_{CS}}{CR}$$

Ejemplo

$$48.7805 = \frac{1000}{20.5}$$

Evaluar fórmula 

10) Precio del bono Fórmula

Fórmula

$$PB = FV \cdot (1 + IDR)^{HP}$$

Ejemplo

$$127.1314 = 95 \cdot (1 + 0.06)^5$$

Evaluar fórmula 

11) Precio Valor del punto base Fórmula

Fórmula

$$PVBP = \frac{PV_- - PV_+}{2}$$

Ejemplo

$$9467.5 = \frac{19405 - 470}{2}$$

Evaluar fórmula 

12) Relación de cambio de acciones Fórmula

Fórmula

$$ER = \frac{OPTS}{ASP}$$

Ejemplo

$$1.834 = \frac{21.55}{11.75}$$

Evaluar fórmula 

13) Rendimiento de ganancias Fórmula

Fórmula

$$EY = \left(\frac{EPS}{MPS} \right) \cdot 100$$

Ejemplo

$$4 = \left(\frac{120}{3000} \right) \cdot 100$$

Evaluar fórmula 



14) Rendimiento de ganancias utilizando el ratio PE Fórmula

Fórmula

$$EY = \left(\frac{1}{PE} \right) \cdot 100$$

Ejemplo

$$4 = \left(\frac{1}{25} \right) \cdot 100$$

Evaluar fórmula 

15) Tasa de descuento del mercado monetario Fórmula

Fórmula

$$MMDR = \left(\frac{YR}{DM} \right) \cdot \frac{FV_{MM} - PV}{FV_{MM}}$$

Ejemplo

$$0.4755 = \left(\frac{7}{5} \right) \cdot \frac{53 - 35}{53}$$

Evaluar fórmula 

16) Tasa de dividendos Fórmula

Fórmula

$$DR = \left(\frac{DPS}{CP} \right) \cdot 100$$

Ejemplo

$$2.963 = \left(\frac{80}{2700} \right) \cdot 100$$

Evaluar fórmula 

17) Valor del derecho Fórmula

Fórmula

$$VOR = \frac{SP - RSP}{n}$$

Ejemplo

$$0.4167 = \frac{38 - 35.5}{6}$$

Evaluar fórmula 

18) Valor del derecho de uso de acciones nuevas Fórmula

Fórmula

$$V = n_{ns} \cdot \frac{MP - IP}{n_{total}}$$

Ejemplo

$$1.6 = 30 \cdot \frac{90 - 82}{150}$$

Evaluar fórmula 



Variables utilizadas en la lista de Gestión Financiera Estratégica Fórmulas anterior











- $\% \Delta PV^{\text{Full}}$ Cambio porcentual en el precio del bono
- **AC** Convexidad anual
- **AMD** Duración modificada aproximada
- **AMYD** Duración aproximada de Macaulay
- **AOR** Agregar tarifa
- **APMI** Monto pagado al vencimiento, incluidos los intereses
- **ASP** Precio de la acción del adquirente
- **BMBM** Saldo inicial de la hipoteca del mes
- **CP** Precio actual de la acción
- **CPP** Precio de paridad de conversión
- **CR** Tasa de conversión
- **d** Días
- **D** Deuda
- D_1 Dividendo en el próximo período
- **DM** Días de madurez
- **DPS** Dividendo por acción
- **DR** Tasa de dividendos
- **E** Equidad
- **EC** Convexidad efectiva
- **EPS** Ganancias por acción
- **ER** Relación de cambio
- **EY** Rendimiento de ganancias
- **FV** Valor nominal
- FV_{MM} Valor nominal del instrumento del mercado monetario
- **g** Tasa de crecimiento de dividendos
- **HP** Período de tenencia
- **IDR** Tasa de descuento implícita
- **IP** Precio de emisión de la nueva acción
- **K** Costo del capital
- MD_{Annual} Duración Anual Modificada
- **MMDR** Tasa de descuento del mercado monetario
- **MP** Precio de mercado
- **MPS** Precio de mercado por acción
- **n** Número de derechos para comprar una acción
- n_{ns} Número de acciones nuevas




- **n_{total}** Número total de todas las acciones
- **OPTS** Precio de oferta para la acción de Target
- **P_o** Precio inicial del bono
- **PB** Precio del bono
- **PE** Relación precio-beneficio (PE)
- **PFM** Prepago por un mes
- **PV** Valor actual del instrumento del mercado monetario
- **PV_-** Precio del bono cuando el rendimiento disminuye
- **PV_+** Precio del bono cuando aumenta el rendimiento
- **PVBP** Precio Valor del punto base
- **R** Tipo de interés
- **RSP** Precio de suscripción correcto
- **SMM** Moralidad de un solo mes
- **SP** Precio de mercado
- **SPR** Pago de capital programado para el mes
- **t** Tasa de impuesto
- **V** Valor del derecho
- **V_{cs}** Valor de la seguridad convertible
- **VOR** Valor del derecho por acción
- **YR** Año
- **β_L** Beta apalancada
- **β_{UL}** Beta sin apalancamiento
- **ΔC** Cambio de curva
- **$\Delta Yield$** Cambio en el rendimiento



Descargue otros archivos PDF de Importante Financiero

- [Importante Bancario Fórmulas](#) 
- [Importante Equidad Fórmulas](#) 
- [Importante Gestión de Instituciones Financieras Fórmulas](#) 
- [Importante Modelización y valoración financiera Fórmulas](#) 
- [Importante Valores de renta fija Fórmulas](#) 
- [Importante Banca de inversión Fórmulas](#) 
- [Importante Fusiones y adquisiciones Fórmulas](#) 
- [Importante Finanzas pública Fórmulas](#) 
- [Importante Gestión Financiera Estratégica Fórmulas](#) 
- [Importante Impuesto Fórmulas](#) 

Pruebe nuestras calculadoras visuales únicas

-  [Porcentaje reves](#) 
-  [Calculadora MCD](#) 
-  [Fracción simple](#) 

¡COMPARTE este PDF con alguien que lo necesite!

Este PDF se puede descargar en estos idiomas.

[English](#) [Spanish](#) [French](#) [German](#) [Russian](#) [Italian](#) [Portuguese](#) [Polish](#) [Dutch](#)

7/10/2024 | 3:55:51 AM UTC

