



## Fórmulas Ejemplos con unidades

## Lista de 17 Fórmulas importantes de inversión Fórmulas

### 1) Alfa de Jensen Fórmula

Fórmula

$$\alpha = R_p - (R_f + \beta_p \cdot (R_m - R_f))$$

Ejemplo

$$11.585 = 12 - (0.5 + 0.85 \cdot (0.40 - 0.5))$$

Evaluar fórmula

### 2) Certificado de deposito Fórmula

Fórmula

$$CD = P_{0\text{Deposit}} \cdot \left( 1 + \left( \frac{r_{\text{Annual}}}{n_c} \right)^{n_c \cdot n_t} \right)$$

Ejemplo

$$5389.1179 = 5000 \cdot \left( 1 + \left( \frac{0.015}{10} \right)^{10 \cdot 5} \right)$$

Evaluar fórmula

### 3) Desviación estándar de la cartera Fórmula

Fórmula

$$\sigma_p = \sqrt{(w_1)^2 \cdot \sigma_1^2 + (w_2)^2 \cdot \sigma_2^2 + 2 \cdot (w_1 \cdot w_2 \cdot \sigma_1 \cdot \sigma_2 \cdot \rho_{12})}$$

Ejemplo

$$0.3815 = \sqrt{(0.4)^2 \cdot 0.37^2 + (0.6)^2 \cdot 0.56^2 + 2 \cdot (0.4 \cdot 0.6 \cdot 0.37 \cdot 0.56 \cdot 0.108)}$$

Evaluar fórmula

### 4) Índice de Rentabilidad Fórmula

Fórmula

$$PI = \frac{NPV + \text{Initial Invt}}{\text{Initial Invt}}$$

Ejemplo

$$1.35 = \frac{700 + 2000}{2000}$$

Evaluar fórmula

### 5) Interés compuesto Fórmula

Fórmula

$$FV = A \cdot \left( 1 + \left( \frac{i}{n} \right) \right)^{n \cdot T}$$

Ejemplo

$$1.6E+9 = 100000 \cdot \left( 1 + \left( \frac{8}{2} \right) \right)^{2 \cdot 3}$$

Evaluar fórmula



## 6) La depreciación de línea recta Fórmula

Fórmula

$$SLD = \frac{C - S_s}{t}$$

Ejemplo

$$404.5 = \frac{4500 - 455}{10}$$

Evaluar fórmula 

## 7) Método actuarial Préstamo de intereses no devengados Fórmula

Fórmula

$$u = \frac{n_{\text{Monthly}} \cdot P \cdot APR}{100 + APR}$$

Ejemplo

$$99354.8387 = \frac{10 \cdot 28000 \cdot 55}{100 + 55}$$

Evaluar fórmula 

## 8) Pago de la anualidad Fórmula

Fórmula

$$PMT = \frac{r \cdot PV}{1 - (1 + r)^{-n}}$$

Ejemplo

$$9 = \frac{0.50 \cdot 10}{1 - (1 + 0.50)^{-2}}$$

Evaluar fórmula 

## 9) Prima de riesgo Fórmula

Fórmula

$$RP = ROI - R_{f_{\text{return}}}$$

Ejemplo

$$49988 = 50000 - 12$$

Evaluar fórmula 

## 10) Proporción de Treynor Fórmula

Fórmula

$$T_r = \frac{R_p - R_f}{\beta_p}$$

Ejemplo

$$5.8824 = \frac{8 - 3}{0.85}$$

Evaluar fórmula 

## 11) Ratio de Sharpe Fórmula

Fórmula

$$SR = \frac{R_p - R_f}{\sigma_p}$$

Ejemplo

$$0.3571 = \frac{8 - 3}{14}$$

Evaluar fórmula 

## 12) Relación de información Fórmula

Fórmula

$$R_{\text{Info}} = \frac{R_p - BR}{TE}$$

Ejemplo

$$0.25 = \frac{5 - 3}{8}$$

Evaluar fórmula 

## 13) Rendimiento de las ganancias de capital Fórmula

Fórmula

$$CGY = \frac{P_c - P_0}{P_0}$$

Ejemplo

$$0.0309 = \frac{50 - 48.5}{48.5}$$

Evaluar fórmula 



#### 14) Retorno Total de Stock Fórmula

Fórmula

$$\text{TSR} = \frac{(P_1 - P_0) + D}{P_0}$$

Ejemplo

$$3.6392 = \frac{(200 - 48.5) + 25}{48.5}$$

Evaluar fórmula 

#### 15) Tasa de retorno Fórmula

Fórmula

$$\text{RoR} = \left( \frac{CV - OV}{OV} \right) \cdot 100$$

Ejemplo

$$30.4348 = \left( \frac{3000 - 2300}{2300} \right) \cdot 100$$

Evaluar fórmula 

#### 16) Tasa de retorno real Fórmula

Fórmula

$$\text{Real RR} = \left( \frac{1 + \text{NR}}{1 + \text{IR}} \right) - 1$$

Ejemplo

$$0.8182 = \left( \frac{1 + 19}{1 + 10} \right) - 1$$

Evaluar fórmula 

#### 17) Variación de la cartera Fórmula

Fórmula

$$\text{Var}_p = (w_1)^2 \cdot \sigma_1^2 + (w_2)^2 \cdot \sigma_2^2 + 2 \cdot (w_1 \cdot w_2 \cdot \sigma_1 \cdot \sigma_2 \cdot \rho_{12})$$

Ejemplo

$$0.1455 = (0.4)^2 \cdot 0.37^2 + (0.6)^2 \cdot 0.56^2 + 2 \cdot (0.4 \cdot 0.6 \cdot 0.37 \cdot 0.56 \cdot 0.108)$$

Evaluar fórmula 



## Variables utilizadas en la lista de Fórmulas importantes de inversión anterior

- **A** Monto de la inversión principal
- **APR** Tasa de porcentaje anual
- **BR** Rentabilidad de referencia
- **C** Costo del activo
- **CD** Certificado de deposito
- **CGY** Rendimiento de ganancias de capital
- **CV** Valor actual
- **D** Dividendo
- **FV** Valor futuro de la inversión
- **i** Tasa de interés anual
- **Initial Invt** Inversión inicial
- **IR** Tasa de inflación
- **n** Número de períodos
- **$n_c$**  Períodos compuestos
- **$n_{\text{Monthly}}$**  Número de pagos mensuales restantes
- **$n_t$**  Número de años
- **NPV** Valor actual neto (NPV)
- **NR** Tasa nominal
- **OV** Valor original
- **p** Mensualidad
- **$p_{12}$**  Coeficiente de correlación de cartera
- **$P_c$**  Precio actual de las acciones
- **P0** Precio de Stock Inicial
- **$P0_{\text{Deposit}}$**  Monto del depósito inicial
- **P1** Precio final de las acciones
- **PI** Índice de Rentabilidad (PI)
- **PMT** Pago de anualidad
- **PV** Valor presente
- **r** Tarifa por Periodo
- **$R_p$**  Retorno de cartera
- **$r_{\text{Annual}}$**  Tasa de interés nominal anual
- **$R_f$**  Tasa libre de riesgo
- **$R_{\text{Info}}$**  Relación de información

## Constantes, funciones y medidas utilizadas en la lista de Fórmulas importantes de inversión anterior











- **Funciones:** `sqrt`, `sqrt(Number)`  
*Una función de raíz cuadrada es una función que toma un número no negativo como entrada y devuelve la raíz cuadrada del número de entrada dado.*



- **$R_p$**  Rendimiento esperado de la cartera
- **Real RR** Tasa de rendimiento real
- **$R_f$**  Tasa de interés libre de riesgo
- **$R_{f_{return}}$**  Devolución sin riesgos
- **$R_m$**  Rentabilidad anual del índice de referencia del mercado
- **ROI** Retorno de la Inversión (ROI)
- **RoR** Tasa de retorno
- **$R_p$**  Retorno anual de la inversión
- **RP** Prima de riesgo
- **$S_s$**  Salvar
- **SLD** Depreciación fija
- **SR** Relación de Sharpe
- **t** Vida
- **T** Número de años que se invierte el dinero
- **$T_r$**  Proporción de Treynor
- **TE** Error de seguimiento
- **TSR** Rentabilidad total de las acciones
- **u** Método actuarial Préstamo con intereses no devengados
- **$Var_p$**  Variación de la cartera
- **$w_1$**  Peso del activo 1
- **$w_2$**  Peso del activo 2
- **$\alpha$**  Alfa de Jensen
- **$\beta_p$**  Beta de la cartera
- **$\sigma_1$**  Variación de rendimientos sobre activos 1
- **$\sigma_2$**  Variación de los rendimientos de los activos 2
- **$\sigma_p$**  Desviación estándar de la cartera



## 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 públicas Fórmulas](#) 
- [Importante Gestión Financiera Estratégica Fórmulas](#) 
- [Importante Impuesto Fórmulas](#) 

## Pruebe nuestras calculadoras visuales únicas

-  [Porcentaje de participación](#) 
-  [MCD de dos números](#) 
-  [Fracción impropia](#) 

¡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](#)

9/23/2024 | 11:49:49 AM UTC

