



Fórmulas Exemplos com unidades

Lista de 17 Fórmulas importantes de investimento Fórmulas

1) Alfa de Jensen Fórmula

Fórmula

Exemplo

Avaliar Fórmula 

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

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

2) Certificado de Depósito Fórmula

Fórmula

Exemplo

Avaliar Fórmula 

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

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

3) Depreciação da linha reta Fórmula

Fórmula

Exemplo

Avaliar Fórmula 

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

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

4) Desvio Padrão do Portfólio Fórmula

Fórmula

Avaliar Fórmula 

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

Exemplo

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

5) Estoque Total Retorno Fórmula

Fórmula

Exemplo

Avaliar Fórmula 

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

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



6) Índice de rentabilidade Fórmula ↻

Fórmula

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

Exemplo

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

Avaliar Fórmula ↻

7) Juros compostos Fórmula ↻

Fórmula

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

Exemplo

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

Avaliar Fórmula ↻

8) Método atuarial Empréstimo de juros inativos Fórmula ↻

Fórmula

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

Exemplo

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

Avaliar Fórmula ↻

9) Pagamento por Anuidade Fórmula ↻

Fórmula

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

Exemplo

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

Avaliar Fórmula ↻

10) Prêmio de risco Fórmula ↻

Fórmula

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

Exemplo

$$49988 = 50000 - 12$$

Avaliar Fórmula ↻

11) Proporção de informação Fórmula ↻

Fórmula

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

Exemplo

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

Avaliar Fórmula ↻

12) Razão Sharpe Fórmula ↻

Fórmula

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

Exemplo

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

Avaliar Fórmula ↻

13) Razão Treynor Fórmula ↻

Fórmula

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

Exemplo

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

Avaliar Fórmula ↻



14) Rendimento de Ganhos de Capital Fórmula

Fórmula

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

Exemplo

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

Avaliar Fórmula 

15) Taxa de retorno Fórmula

Fórmula

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

Exemplo

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

Avaliar Fórmula 

16) Taxa de retorno real Fórmula

Fórmula

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

Exemplo

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

Avaliar Fórmula 

17) Variação do portfólio Fórmula

Fórmula

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

Exemplo

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

Avaliar Fórmula 



Variáveis usadas na lista de Fórmulas importantes de investimento acima

- **A** Valor principal do investimento
- **APR** Taxa percentual anual
- **BR** Retorno de referência
- **C** Custo do ativo
- **CD** Comprovante de depósito
- **CGY** Rendimento de ganhos de capital
- **CV** Valor atual
- **D** Dividendo
- **FV** Valor futuro do investimento
- **i** Taxa de juros anual
- **Initial Invt** Investimento inicial
- **IR** Taxa de inflação
- **n** Número de Períodos
- **n_c** Períodos compostos
- **n_{Monthly}** Número de pagamentos mensais restantes
- **n_t** Número de anos
- **NPV** Valor Presente Líquido (VPL)
- **NR** Taxa nominal
- **OV** Valor original
- **p** Pagamento mensal
- **p_{12}** Coeficiente de Correlação de Portfólio
- **P_c** Preço atual das ações
- **P_0** Preço de estoque inicial
- **$P_{0\text{Deposit}}$** Valor do depósito inicial
- **P_1** Preço final das ações
- **PI** Índice de Rentabilidade (PI)
- **PMT** Pagamento de anuidade
- **PV** Valor presente
- **r** Taxa por Período
- **R_p** Retorno de portfólio
- **r_{Annual}** Taxa de juros nominal anual
- **R_f** Taxa livre de risco

Constantes, funções, medidas usadas na lista de Fórmulas importantes de investimento acima

- **Funções:** `sqrt`, `sqrt(Number)`
Uma função de raiz quadrada é uma função que recebe um número não negativo como entrada e retorna a raiz quadrada do número de entrada fornecido.



- **R_{info}** Proporção de informação
- **R_p** Retorno esperado do portfólio
- **Real RR** Taxa real de retorno
- **R_f** Taxa de juros livre de risco
- **$R_{freturn}$** Retorno sem risco
- **R_m** Retorno anual do benchmark de mercado
- **ROI** Retorno do Investimento (ROI)
- **RoR** Taxa de retorno
- **R_p** Retorno Anual do Investimento
- **RP** Prêmio de risco
- **S_s** Salvamento
- **SLD** Depreciação linear
- **SR** Razão de Sharpe
- **t** Vida
- **T** Número de anos em que o dinheiro é investido
- **T_r** Razão de Treynor
- **TE** Erro de rastreamento
- **TSR** Retorno total de estoque
- **u** Método Atuarial Empréstimo com Juros Não Ganhos
- **Var_p** Variação do portfólio
- **w_1** Peso do ativo 1
- **w_2** Peso do ativo 2
- **α** Alfa de Jensen
- **β_p** Beta do Portfólio
- **σ_1** Variação dos retornos sobre ativos 1
- **σ_2** Variância dos retornos sobre os ativos 2
- **σ_p** Desvio Padrão do Portfólio



Baixe outros PDFs de Importante Financeiro

- [Importante Bancário Fórmulas](#) 
- [Importante Equidade Fórmulas](#) 
- [Importante Gestão de Instituições Financeiras Fórmulas](#) 
- [Importante Modelagem e Avaliação Financeira Fórmulas](#) 
- [Importante Títulos de Renda Fixa Fórmulas](#) 
- [Importante Investimento bancário Fórmulas](#) 
- [Importante Fusões e aquisições Fórmulas](#) 
- [Importante Finanças públicas Fórmulas](#) 
- [Importante Gestão Financeira Estratégica Fórmulas](#) 
- [Importante Imposto Fórmulas](#) 

Experimente nossas calculadoras visuais exclusivas

-  [Fração imprópria](#) 
-  [MDC de dois números](#) 

Por favor, **COMPARTILHE** este PDF com alguém que precise dele!

Este PDF pode ser baixado nestes idiomas

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

9/23/2024 | 11:50:08 AM UTC

