



calculatoratoz.com



unitsconverters.com

Fórmulas importantes de inversión

Fórmulas

¡Calculadoras!

¡Ejemplos!

¡Conversiones!

Marcador calculatoratoz.com, unitsconverters.com

Cobertura más amplia de calculadoras y creciente - ¡**30.000+** calculadoras!
Calcular con una unidad diferente para cada variable - ¡**Conversión de unidades
integrada!**

La colección más amplia de medidas y unidades - ¡**250+** Medidas!

¡Siéntete libre de COMPARTIR este documento con tus amigos!

[Por favor, deje sus comentarios aquí...](#)



Lista de 17 Fórmulas importantes de inversión

Fórmulas

Fórmulas importantes de inversión

1) Alfa de Jensen

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

Calculadora abierta 

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

2) Certificado de deposito

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

Calculadora abierta 

$$ex \quad 5389.118 = 5000 \cdot \left(1 + \left(\frac{0.015}{10} \right) \right)^{10 \cdot 5}$$

3) Desviación estándar de la cartera

fx

Calculadora abierta 

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

ex

$$0.381499 = \sqrt{(0.4)^2 \cdot (0.37)^2 + (0.6)^2 \cdot (0.56)^2 + 2 \cdot (0.4 \cdot 0.6 \cdot 0.37 \cdot 0.56 \cdot 0.108)}$$



4) Índice de Rentabilidad 

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

Calculadora abierta 

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

5) Interés compuesto 

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

Calculadora abierta 


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

6) La depreciación de línea recta 

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

Calculadora abierta 

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

7) Método actuarial Préstamo de intereses no devengados 

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

Calculadora abierta 

$$ex \quad 99354.84 = \frac{10 \cdot 28000 \cdot 55}{100 + 55}$$



8) Pago de la anualidad 

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

Calculadora abierta 

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

9) Prima de riesgo 

$$\text{fx } \text{RP} = \text{ROI} - \text{Rf}_{\text{return}}$$

Calculadora abierta 

$$\text{ex } 49988 = 50000 - 12$$

10) Proporción de Treynor 

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

Calculadora abierta 

$$\text{ex } 5.882353 = \frac{8 - 3}{0.85}$$

11) Ratio de Sharpe 

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

Calculadora abierta 

$$\text{ex } 0.357143 = \frac{8 - 3}{14}$$




12) Relación de información 

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

Calculadora abierta 

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

13) Rendimiento de las ganancias de capital 

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

Calculadora abierta 

$$ex \quad 0.030928 = \frac{50 - 48.5}{48.5}$$

14) Retorno Total de Stock 

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

Calculadora abierta 

$$ex \quad 3.639175 = \frac{(200 - 48.5) + 25}{48.5}$$

15) Tasa de retorno 

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

Calculadora abierta 

$$ex \quad 30.43478 = \left(\frac{3000 - 2300}{2300} \right) \cdot 100$$




16) Tasa de retorno real 

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

Calculadora abierta 

$$ex \text{ } 0.818182 = \left(\frac{1 + 19}{1 + 10} \right) - 1$$

17) Variación de la cartera 

fx

Calculadora abierta 

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

ex

$$0.145541 = (0.4)^2 \cdot (0.37)^2 + (0.6)^2 \cdot (0.56)^2 + 2 \cdot (0.4 \cdot 0.6 \cdot 0.37 \cdot 0.56 \cdot 0.108)$$



Variables utilizadas

- **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_{Monthly}** Número de pagos mensuales restantes
- **n_t** Número de años
- **NPV** Valor actual neto (NPV)
- **NR** Tasa nominal
- **OV** Valor original
- **p** Mensualidad
- **p₁₂** Coeficiente de correlación de cartera
- **P_c** Precio actual de las acciones
- **P₀** Precio de Stock Inicial
- **P_{0Deposit}** 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_{Annual}** Tasa de interés nominal anual
- **R_f** Tasa libre de riesgo
- **R_{Info}** Relación de información
- **R_p** Rendimiento esperado de la cartera
- **Real RR** Tasa de rendimiento real
- **R_f** Tasa de interés libre de riesgo
- **R_freturn** 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
- **w₁** Peso del activo 1
- **w₂** Peso del activo 2



- α Alfa de Jensen
- β_p Beta de la cartera
- σ_1 Variación de rendimientos sobre activos 1
- σ_2 Variación de los rendimientos de los activos 2
- σ_p Desviación estándar de la cartera



Constantes, funciones, medidas utilizadas

- **Función:** **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.



Consulte otras listas de fórmulas

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

¡Siéntete libre de COMPARTIR este documento con tus amigos!

PDF Disponible en

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

9/20/2024 | 10:06:26 AM UTC

[Por favor, deje sus comentarios aquí...](#)

