



calculatoratoz.com



unitsconverters.com

Fórmulas importantes de investimento Fórmulas

Calculadoras!

Exemplos!

Conversões!

marca páginas calculatoratoz.com, unitsconverters.com

Maior cobertura de calculadoras e crescente - **30.000+ calculadoras!**
Calcular com uma unidade diferente para cada variável - **Conversão de unidade embutida!**

Coleção mais ampla de medidas e unidades - **250+ medições!**

Sinta-se à vontade para COMPARTILHAR este documento com seus amigos!

[Por favor, deixe seu feedback aqui...](#)



Lista de 17 Fórmulas importantes de investimento

Fórmulas

Fórmulas importantes de investimento

1) Alfa de Jensen

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

Abrir Calculadora 

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

2) Certificado de Depósito

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

Abrir Calculadora 

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

3) Depreciação da linha reta

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

Abrir Calculadora 

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



4) Desvio Padrão do Portfólio 

fx

Abrir Calculadora 

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

ex

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

5) Estoque Total Retorno 

fx

Abrir Calculadora 

$$\text{TSR} = \frac{(P1 - P0) + D}{P0}$$

ex

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

6) Índice de rentabilidade 

fx

Abrir Calculadora 

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

ex

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

7) Juros compostos 

fx

Abrir Calculadora 

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

ex

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



8) Método atuarial Empréstimo de juros inativos 

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

Abrir Calculadora 

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

9) Pagamento por Anuidade 

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

Abrir Calculadora 

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

10) Prêmio de risco 

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

Abrir Calculadora 

$$ex \quad 49988 = 50000 - 12$$

11) Proporção de informação 

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

Abrir Calculadora 

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



12) Razão Sharpe 

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

Abrir Calculadora 

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

13) Razão Treynor 

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

Abrir Calculadora 


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

14) Rendimento de Ganhos de Capital 

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

Abrir Calculadora 

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

15) Taxa de retorno 

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

Abrir Calculadora 

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




16) Taxa de retorno real 

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

Abrir Calculadora 

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

17) Variação do portfólio 

fx

Abrir Calculadora 

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

ex

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



Variáveis Usadas

- **A** Valor principal do investimento
- **APR** Taxa de porcentagem 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
- **p₁₂** Coeficiente de Correlação de Portfólio
- **P_c** Preço atual das ações
- **P₀** Preço de estoque inicial
- **P_{0Deposit}** Valor do depósito inicial
- **P₁** 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
- **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
- **w₁** Peso do ativo 1
- **w₂** 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



Constantes, Funções, Medidas usadas

- **Função:** `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.



Verifique outras listas de fórmulas

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

Sinta-se à vontade para COMPARTILHAR este documento com seus amigos!

PDF Disponível em

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

6/12/2024 | 6:43:28 AM UTC

[Por favor, deixe seu feedback aqui...](#)

