



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

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

[Abrir Calculadora !\[\]\(a870788d6ed9b8fd294b7654a8c8526b_img.jpg\)](#)

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

2) Certificado de Depósito

 $CD = P_0_{\text{Deposit}} \cdot \left(1 + \left(\frac{r_{\text{Annual}}}{n_c}\right)\right)^{n_c \cdot n_t}$

[Abrir Calculadora !\[\]\(c50c8b7b2cc2cf9ff925edec0ee94c0d_img.jpg\)](#)

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

3) Depreciação da linha reta

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

[Abrir Calculadora !\[\]\(f60b7a900783ac3fd531bfd9c111be6d_img.jpg\)](#)

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



4) Desvio Padrão do Portfólio ↗

fx

Abrir Calculadora ↗

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

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 ↗

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

Abrir Calculadora ↗

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

6) Índice de rentabilidade ↗

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

Abrir Calculadora ↗

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

7) Juros compostos ↗

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

Abrir Calculadora ↗

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



8) Método atuarial Empréstimo de juros inativos ↗

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

[Abrir Calculadora ↗](#)

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

9) Pagamento por Anuidade ↗

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

[Abrir Calculadora ↗](#)

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

10) Prêmio de risco ↗

$$fx \quad RP = ROI - Rf_{return}$$

[Abrir Calculadora ↗](#)

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

11) Proporção de informação ↗

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

[Abrir Calculadora ↗](#)

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



12) Razão Sharpe ↗

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

Abrir Calculadora ↗

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

13) Razão Treynor ↗

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

Abrir Calculadora ↗

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

14) Rendimento de Ganhos de Capital ↗

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

Abrir Calculadora ↗

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

15) Taxa de retorno ↗

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

Abrir Calculadora ↗

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



16) Taxa de retorno real ↗

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

[Abrir Calculadora ↗](#)

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

17) Variação do portfólio ↗**fx**[Abrir Calculadora ↗](#)

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

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 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
- **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](#) ↗
- [Modelagem e Avaliação Financeira Fórmulas](#) ↗
- [Títulos de Renda Fixa Fórmulas](#) ↗
- [Investimento bancário Fórmulas](#) ↗
- [Fusões e aquisições Fórmulas](#) ↗
- [Finanças públicas Fórmulas](#) ↗
- [Gestão Financeira Estratégica 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](#)

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

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

