

Importante Gestão Financeira Estratégica Fórmulas PDF



Fórmulas Exemplos com unidades

Lista de 18 Importante Gestão Financeira Estratégica Fórmulas

1) Beta alavancado Fórmula ↻

Fórmula

$$\beta_{UL} = \beta_{UL} \cdot \left(1 + \left((1 - t) \cdot \left(\frac{D}{E} \right) \right) \right)$$

Exemplo

$$0.729 = 0.3 \cdot \left(1 + \left((1 - 0.35) \cdot \left(\frac{22000}{10000} \right) \right) \right)$$

Avaliar Fórmula ↻

2) Beta desalavancado Fórmula ↻

Fórmula

$$\beta_{UL} = \frac{\beta_L}{1 + \left((1 - t) \cdot \left(\frac{D}{E} \right) \right)}$$

Exemplo

$$0.3004 = \frac{0.73}{1 + \left((1 - 0.35) \cdot \left(\frac{22000}{10000} \right) \right)}$$

Avaliar Fórmula ↻

3) Convexidade Efetiva Fórmula ↻

Fórmula

$$EC = \frac{PV_- + PV_+ - (2 \cdot P_o)}{(\Delta C)^2 \cdot P_o}$$

Exemplo

$$1.4522 = \frac{19405 + 470 - (2 \cdot 135)}{(10)^2 \cdot 135}$$

Avaliar Fórmula ↻

4) Custo de equidade Fórmula ↻

Fórmula

$$K = \left(\left(\frac{D_1}{CP} \right) + (g \cdot 0.01) \right) \cdot 100$$

Exemplo

$$10.0556 = \left(\left(\frac{1.5}{2700} \right) + (10 \cdot 0.01) \right) \cdot 100$$

Avaliar Fórmula ↻

5) Duração aproximada de Macaulay Fórmula ↻

Fórmula

$$AMYD = AMD \cdot (1 + R)$$

Exemplo

$$4.445 = 1.27 \cdot (1 + 2.50)$$

Avaliar Fórmula ↻

6) Mortalidade de um único mês Fórmula ↻

Fórmula

$$SMM = \frac{PFM}{BMBM - SPR}$$

Exemplo

$$1.294 = \frac{6580}{6030 - 945}$$

Avaliar Fórmula ↻



7) Mudança no preço do título integral Fórmula

Fórmula

Avaliar Fórmula 

$$\% \Delta PV^{\text{Full}} = \left(- MD_{\text{Annual}} \cdot \Delta \text{Yield} \right) + \left(\frac{1}{2} \cdot AC \cdot (\Delta \text{Yield})^2 \right)$$

Exemplo

$$4609.4125 = \left(- 15 \cdot 55 \right) + \left(\frac{1}{2} \cdot 3.593 \cdot (55)^2 \right)$$

8) Preço de paridade de conversão Fórmula

Fórmula

Exemplo

Avaliar Fórmula 

$$CPP = \frac{V_{CS}}{CR}$$

$$48.7805 = \frac{1000}{20.5}$$

9) Preço do título Fórmula

Fórmula

Exemplo

Avaliar Fórmula 

$$PB = FV \cdot (1 + IDR)^{HP}$$

$$127.1314 = 95 \cdot (1 + 0.06)^5$$

10) Relação de troca de ações Fórmula

Fórmula

Exemplo

Avaliar Fórmula 

$$ER = \frac{OPTS}{ASP}$$

$$1.834 = \frac{21.55}{11.75}$$

11) Rendimento de ganhos Fórmula

Fórmula

Exemplo

Avaliar Fórmula 

$$EY = \left(\frac{EPS}{MPS} \right) \cdot 100$$

$$4 = \left(\frac{120}{3000} \right) \cdot 100$$

12) Rendimento de ganhos usando índice PE Fórmula

Fórmula

Exemplo

Avaliar Fórmula 

$$EY = \left(\frac{1}{PE} \right) \cdot 100$$

$$4 = \left(\frac{1}{25} \right) \cdot 100$$

13) Taxa adicional Fórmula

Fórmula

Exemplo

Avaliar Fórmula 

$$AOR = \left(\left(\frac{YR}{d} \right) \cdot \frac{(APMI) - PV}{APMI} \right)$$

$$0.3889 = \left(\left(\frac{7}{15} \right) \cdot \frac{(210) - 35}{210} \right)$$



14) Taxa de desconto do mercado monetário Fórmula

Fórmula

$$\text{MMDR} = \left(\frac{\text{YR}}{\text{DM}} \right) \cdot \frac{\text{FV}_{\text{MM}} - \text{PV}}{\text{FV}_{\text{MM}}}$$

Exemplo

$$0.4755 = \left(\frac{7}{5} \right) \cdot \frac{53 - 35}{53}$$

Avaliar Fórmula 

15) Taxa de dividendos Fórmula

Fórmula

$$\text{DR} = \left(\frac{\text{DPS}}{\text{CP}} \right) \cdot 100$$

Exemplo

$$2.963 = \left(\frac{80}{2700} \right) \cdot 100$$

Avaliar Fórmula 

16) Valor do Direito Fórmula

Fórmula

$$\text{VOR} = \frac{\text{SP} - \text{RSP}}{n}$$

Exemplo

$$0.4167 = \frac{38 - 35.5}{6}$$

Avaliar Fórmula 

17) Valor do Direito usando Novas Ações Fórmula

Fórmula

$$V = n_{\text{ns}} \cdot \frac{\text{MP} - \text{IP}}{n_{\text{total}}}$$

Exemplo

$$1.6 = 30 \cdot \frac{90 - 82}{150}$$

Avaliar Fórmula 

18) Valor do preço do ponto base Fórmula

Fórmula

$$\text{PVBP} = \frac{\text{PV}_- - \text{PV}_+}{2}$$

Exemplo

$$9467.5 = \frac{19405 - 470}{2}$$

Avaliar Fórmula 



Variáveis usadas na lista de Gestão Financeira Estratégica Fórmulas acima

- **% Δ PV^{Full}** Alteração percentual no preço do título
- **AC** Convexidade Anual
- **AMD** Duração Modificada Aproximada
- **AMYD** Duração aproximada de Macaulay
- **AOR** Taxa adicional
- **APMI** Valor pago no vencimento, incluindo juros
- **ASP** Preço das ações do adquirente
- **BMBM** Saldo inicial da hipoteca do mês
- **CP** Preço atual das ações
- **CPP** Preço de paridade de conversão
- **CR** Taxa de conversão
- **d** Dias
- **D** Dívida
- **D₁** Dividendo no próximo período
- **DM** Dias de maturidade
- **DPS** Dividendo por ação
- **DR** Taxa de dividendos
- **E** Equidade
- **EC** Convexidade Efetiva
- **EPS** Lucro por ação
- **ER** Relação de troca
- **EY** Rendimento de ganhos
- **FV** Valor nominal
- **FV_{MM}** Valor nominal do instrumento do mercado monetário
- **g** Taxa de crescimento de dividendos
- **HP** Período de espera
- **IDR** Taxa de desconto implícita
- **IP** Preço de Emissão da Nova Ação
- **K** Custo de equidade
- **MD_{Annual}** Duração Modificada Anual
- **MMDR** Taxa de desconto do mercado monetário
- **MP** Preço de mercado
- **MPS** Preço de mercado por ação
- **n** Número de direitos para comprar uma ação
- **n_{ns}** Número de novas ações
- **n_{total}** Número total de todas as ações



- **OPTS** Preço de Oferta pela Ação Alvo
- **P₀** Preço inicial do título
- **PB** Preço do título
- **PE** Relação Preço-Lucro (PE)
- **PFM** Pré-pagamento por um mês
- **PV** Valor presente do instrumento do mercado monetário
- **PV₋** Preço do título quando o rendimento diminui
- **PV₊** Preço do título quando o rendimento aumenta
- **PVBP** Valor do preço do ponto base
- **R** Taxa de interesse
- **RSP** Preço de assinatura correto
- **SMM** Moralidade de um único mês
- **SP** Preço das ações
- **SPR** Reembolso Principal Programado para o Mês
- **t** Taxa de imposto
- **V** Valor do Direito
- **V_{cs}** Valor do título conversível
- **VOR** Valor do Direito por Ação
- **YR** Ano
- **β_L** Beta alavancado
- **β_{UL}** Beta desalavancado
- **ΔC** Mudança na curva
- **ΔYield** Mudança no rendimento



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 simples](#) 
-  [Calculadora MDC](#) 

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](#)

7/10/2024 | 3:56:17 AM UTC

