

Índice de Sharpe

$$I.S = \frac{E(R_p) - R_f}{\sigma_i}$$

Índice de Treynor

$$I.T = \frac{E(R_p) - R_f}{\beta_i}$$

$$\beta_p = \frac{COV(R_p, R_M)}{VAR(R_M)}$$

Índice de Modigliani

$$I.M = \frac{\sigma_M}{\sigma_p} \cdot [E(R_p) - R_f] - [E(R_M) - R_f]$$

Índice de Jensen

$$I.J = \alpha = [E(R_p) - R_f] - \beta \cdot [E(R_M) - R_f]$$