



Formuły Przykłady z Jednostkami

Lista 17

Ważne formuły inwestowania Formuły

1) Alpha Jensena Formuła ↗

Formuła

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

Przykład

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

Oceń formułę ↗

2) Amortyzacja linii prostej Formuła ↗

Formuła

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

Przykład

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

Oceń formułę ↗

3) Całkowity zwrot z akcji Formuła ↗

Formuła

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

Przykład

$$3.6392 = \frac{(200 - 48.5) + 25}{48.5}$$

Oceń formułę ↗

4) Certyfikat Depozytowy Formuła ↗

Formuła

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

Przykład

$$5389.1179 = 5000 \cdot \left(1 + \left(\frac{0.015}{10} \right) \right)^{10 \cdot 5}$$

Oceń formułę ↗

5) Metoda aktuarialna niespłacony kredyt odsetkowy Formuła ↗

Formuła

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

Przykład

$$99354.8387 = \frac{10 \cdot 28000 \cdot 55}{100 + 55}$$

Oceń formułę ↗



6) Odchylenie standardowe portfela Formuła ↻

Formuła

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

Oceń formułę ↻

Przykład

$$0.3815 = \sqrt{(0.4)^2 \cdot 0.37^2 + (0.6)^2 \cdot 0.56^2 + 2 \cdot (0.4 \cdot 0.6 \cdot 0.37 \cdot 0.56 \cdot 0.108)}$$

7) Odsetki złożone Formuła ↻

Formuła

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

Przykład

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

Oceń formułę ↻

8) Płatność renty Formuła ↻

Formuła

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

Przykład

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

Oceń formułę ↻

9) Premia ryzyka Formuła ↻

Formuła

$$RP = ROI - R_{f_{return}}$$

Przykład

$$49988 = 50000 - 12$$

Oceń formułę ↻

10) Realna stopa zwrotu Formuła ↻

Formuła

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

Przykład

$$0.8182 = \left(\frac{1 + 19}{1 + 10}\right) - 1$$

Oceń formułę ↻

11) Sharpe Ratio Formuła ↻

Formuła

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

Przykład

$$0.3571 = \frac{8 - 3}{14}$$

Oceń formułę ↻

12) Stopa zwrotu Formuła ↻

Formuła

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

Przykład

$$30.4348 = \left(\frac{3000 - 2300}{2300}\right) \cdot 100$$

Oceń formułę ↻



13) Stosunek informacji Formuła

Formuła

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

Przykład

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

Oceń formułę 

14) Stosunek Treynora Formuła

Formuła

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

Przykład

$$5.8824 = \frac{8 - 3}{0.85}$$

Oceń formułę 

15) Wariancja portfela Formuła

Formuła

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

Przykład

$$0.1455 = (0.4)^2 \cdot 0.37^2 + (0.6)^2 \cdot 0.56^2 + 2 \cdot (0.4 \cdot 0.6 \cdot 0.37 \cdot 0.56 \cdot 0.108)$$

Oceń formułę 

16) Wskaźnik rentowności Formuła

Formuła

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

Przykład

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

Oceń formułę 

17) Zyski kapitałowe Wydajność Formuła

Formuła

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

Przykład

$$0.0309 = \frac{50 - 48.5}{48.5}$$

Oceń formułę 



Zmienne użyte na liście Ważne formuły inwestowania powyżej

- **A** Główna kwota inwestycji
- **APR** Roczna stopa procentowa
- **BR** Zwrot z benchmarku
- **C** Koszt aktywów
- **CD** Świadczenie depozytu
- **CGY** Zyski kapitałowe
- **CV** Aktualna wartość
- **D** Dywidenda
- **FV** Przyszła wartość inwestycji
- **i** Roczna stopa procentowa
- **Initial Inv** Inwestycja początkowa
- **IR** Inflacja
- **n** Liczba okresów
- **n_c** Okresy złożone
- **n_{Monthly}** Liczba pozostałych płatności miesięcznych
- **n_t** Liczba lat
- **NPV** Wartość bieżąca netto (NPV)
- **NR** Nominalna stawka
- **OV** Oryginalna wartość
- **p** Miesięczna płatność
- **ρ_{12}** Współczynnik korelacji portfela
- **P_c** Aktualna cena akcji
- **P_0** Początkowa cena akcji
- **P_0^{Deposit}** Początkowa kwota depozytu
- **P_1** Końcowa cena akcji
- **PI** Indeks Rentowności (PI)
- **PMT** Płatność renty
- **PV** Obecna wartość
- **r** Stawka za okres
- **R_p** Zwrot portfela
- **r_{Annual}** Roczna nominalna stopa procentowa
- **R_f** Stopa wolna od ryzyka
- **R_{Info}** Stosunek informacji

Stałe, funkcje, miary użyte na liście Ważne formuły inwestowania powyżej

- **Funkcje:** **sqrt**, **sqrt(Number)**
Funkcja pierwiastka kwadratowego to funkcja, która jako dane wejściowe przyjmuje liczbę nieujemną i zwraca pierwiastek kwadratowy z podanej liczby wejściowej.



- **R_p** Oczekiwany zwrot z portfela
- **Real RR** Rzeczywista stopa zwrotu
- **R_f** Stopa procentowa wolna od ryzyka
- **$R_{f_{return}}$** Zwrot bez ryzyka
- **R_m** Roczny zwrot benchmarku rynkowego
- **ROI** Zwrot z inwestycji (ROI)
- **RoR** Stopa zwrotu
- **R_p** Roczny zwrot z inwestycji
- **RP** Premia za ryzyko
- **S_s** Odzysk
- **SLD** Amortyzacja liniowa
- **SR** współczynnik Sharpe'a
- **t** Życie
- **T** Liczba lat inwestowania pieniędzy
- **T_r** Stosunek Treynora
- **TE** Błąd traktacji
- **TSR** Całkowity zwrot z zapasów
- **u** Metoda aktuarialna Pożyczka z niezarobionymi odsetkami
- **Var_p** Wariancja portfela
- **w_1** Waga aktywów 1
- **w_2** Waga aktywów 2
- **α** Alfa Jensena
- **β_p** Beta portfela
- **σ_1** Wariancja zwrotów z aktywów 1
- **σ_2** Wariancja zwrotów z aktywów 2
- **σ_p** Odchylenie standardowe portfela



Pobierz inne pliki PDF z kategorii Ważny Budżetowy

- **Ważny Bankowość Formuły** 
- **Ważny Słuszność Formuły** 
- **Ważny Zarządzanie instytucjami finansowymi Formuły** 
- **Ważny Modelowanie finansowe i wycena Formuły** 
- **Ważny Papiery wartościowe o stałym dochodzie Formuły** 
- **Ważny Bankowość inwestycyjna Formuły** 
- **Ważny Fuzje i przejęcia Formuły** 
- **Ważny Finanse publiczne Formuły** 
- **Ważny Strategiczne zarządzanie finansami Formuły** 
- **Ważny Podatek Formuły** 

Wypróbuj nasze unikalne kalkulatory wizualne

-  **Procentowy Udział** 
-  **NWD dwóch liczb** 
-  **Ułamek niewłaściwy** 

UDOSTĘPNIJ ten plik PDF komuś, kto go potrzebuje!

Ten plik PDF można pobrać w tych językach

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

9/23/2024 | 11:50:12 AM UTC

