

# Formule importanti di investimento Formule PDF



**Formule  
Esempi  
con unità**

## Lista di 17 Formule importanti di investimento Formule

### 1) Alpha di Jensen Formula

Formula

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

Esempio

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

Valutare la formula 

### 2) Attuariale metodo non guadagnato interesse prestito Formula

Formula

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

Esempio

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

Valutare la formula 

### 3) Certificato di deposito Formula

Formula

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

Esempio

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

Valutare la formula 

### 4) Deviazione standard del portafoglio Formula

Formula

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

Esempio

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

Valutare la formula 

### 5) Indice di redditività Formula

Formula

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

Esempio

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

Valutare la formula 



## 6) Interesse composto Formula

Formula

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

Esempio

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

Valutare la formula 

## 7) Pagamento della rendita Formula

Formula

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

Esempio

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

Valutare la formula 

## 8) Primo rischio Formula

Formula

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

Esempio

$$49988 = 50000 - 12$$

Valutare la formula 

## 9) Rapporto di Treynor Formula

Formula

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

Esempio

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

Valutare la formula 

## 10) Rapporto informativo Formula

Formula

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

Esempio

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

Valutare la formula 

## 11) Rapporto Sharpe Formula

Formula

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

Esempio

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

Valutare la formula 

## 12) Rendimento dei guadagni di capitale Formula

Formula

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

Esempio

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

Valutare la formula 

## 13) Rendimento totale di azioni Formula

Formula

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

Esempio

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

Valutare la formula 



#### 14) Retta linea deprezzamento Formula

Formula

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

Esempio

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

Valutare la formula 

#### 15) Tasso di rendimento Formula

Formula

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

Esempio

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

Valutare la formula 

#### 16) Tasso reale di rendimento Formula

Formula

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

Esempio

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

Valutare la formula 

#### 17) Varianza del portafoglio Formula

Formula

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

Esempio

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

Valutare la formula 



## Variabili utilizzate nell'elenco di Formule importanti di investimento sopra

- **A** Importo principale dell'investimento
- **APR** Tasso percentuale annuo
- **BR** Rendimento del benchmark
- **C** Costo del bene
- **CD** Certificato di deposito
- **CGY** Rendimento delle plusvalenze
- **CV** Valore corrente
- **D** Dividendo
- **FV** Valore futuro degli investimenti
- **i** Tasso d'interesse annuale
- **Initial Invt** Investimento iniziale
- **IR** Tasso d'inflazione
- **n** Numero di periodi
- **$n_c$**  Periodi composti
- **$n_{\text{Monthly}}$**  Numero di pagamenti mensili rimanenti
- **$n_t$**  Numero di anni
- **NPV** Valore attuale netto (NPV)
- **NR** Tasso nominale
- **OV** Valore originale
- **p** Pagamento mensile
- **$p_{12}$**  Coefficiente di correlazione del portafoglio
- **$P_c$**  Prezzo attuale delle azioni
- **$P_0$**  Prezzo de stock iniziale
- **$P_{0\text{Deposit}}$**  Importo del deposito iniziale
- **$P_1$**  Prezzo finale delle azioni
- **PI** Indice di redditività (PI)
- **PMT** Pagamento della rendita
- **PV** Valore attuale
- **r** Tariffa per periodo
- **$R_p$**  Rendimento del portafoglio
- **$r_{\text{Annual}}$**  Tasso di interesse nominale annuo
- **$R_f$**  Tasso esente da rischio
- **$R_{\text{Info}}$**  Rapporto informativo

## Costanti, funzioni, misure utilizzate nell'elenco di Formule importanti di investimento sopra

- **Funzioni:** **sqrt**, **sqrt(Number)**  
*Una funzione radice quadrata è una funzione che accetta un numero non negativo come input e restituisce la radice quadrata del numero di input specificato.*



- **$R_p$**  Rendimento atteso del portafoglio
- **Real RR** Tasso di rendimento reale
- **$R_f$**  Tasso di interesse privo di rischio
- **$R_{f_{return}}$**  Rendimento senza rischi
- **$R_m$**  Rendimento annuo del benchmark di mercato
- **ROI** Ritorno sull'investimento (ROI)
- **RoR** Tasso di rendimento
- **$R_p$**  Ritorno annuale sull'investimento
- **RP** Premio per il rischio
- **$S_s$**  Salvare
- **SLD** Ammortamento lineare
- **SR** Rapporto di Sharpe
- **t** Vita
- **T** Numero di anni in cui viene investito il denaro
- **$T_r$**  Rapporto di Treynor
- **TE** Errore di tracciamento
- **TSR** Rendimento totale delle azioni
- **u** Metodo attuariale Prestito con interessi maturati
- **$Var_p$**  Varianza del portafoglio
- **$w_1$**  Peso dell'asset 1
- **$w_2$**  Peso patrimoniale 2
- **$\alpha$**  L'Alfa di Jensen
- **$\beta_p$**  Beta del Portafoglio
- **$\sigma_1$**  Varianza dei rendimenti delle attività 1
- **$\sigma_2$**  Varianza dei rendimenti delle attività 2
- **$\sigma_p$**  Deviazione standard del portafoglio



## Scarica altri PDF Importante Finanziario

- [Importante Bancario Formule](#) 
- [Importante Equità Formule](#) 
- [Importante Gestione delle istituzioni finanziarie Formule](#) 
- [Importante Modellazione e valutazione finanziaria Formule](#) 
- [Importante Titoli a reddito fisso Formule](#) 
- [Importante Investimento bancario Formule](#) 
- [Importante Fusioni e acquisizioni Formule](#) 
- [Importante Finanza pubblica Formule](#) 
- [Importante Gestione finanziaria strategica Formule](#) 
- [Importante Imposta Formule](#) 

## Prova i nostri calcolatori visivi unici

-  [Quota percentuale](#) 
-  [MCD di due numeri](#) 
-  [Frazione impropria](#) 

Per favore CONDIVIDI questo PDF con qualcuno che ne ha bisogno!

## Questo PDF può essere scaricato in queste lingue

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

9/23/2024 | 11:50:04 AM UTC

