

Formules d'investissement importantes Formules PDF



Formules Exemples avec unités

Liste de 17 Formules d'investissement importantes Formules

1) Amortissement linéaire Formule

Formule

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

Exemple

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

Évaluer la formule

2) Capital Gains Rendement Formule

Formule

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

Exemple

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

Évaluer la formule

3) Certificat de dépôt Formule

Formule

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

Exemple

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

Évaluer la formule

4) Écart de portefeuille Formule

Formule

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

Exemple

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

Évaluer la formule



5) Écart type du portefeuille Formule

Formule

Évaluer la formule 

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

Exemple

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

6) Indice de rentabilité Formule

Formule

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

Exemple

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

Évaluer la formule 

7) Intérêts composés Formule

Formule

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

Exemple

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

Évaluer la formule 

8) Jensen's Alpha Formule

Formule

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

Exemple

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

Évaluer la formule 

9) Méthode actuarielle Prêt d'intérêt non acquis Formule

Formule

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

Exemple

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

Évaluer la formule 

10) Paiement de Annuité Formule

Formule

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

Exemple

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

Évaluer la formule 

11) Rapport de Treynor Formule

Formule

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

Exemple

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

Évaluer la formule 



12) Rapport d'information Formule

Formule

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

Exemple

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

Évaluer la formule 

13) Ratio Sharpe Formule

Formule

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

Exemple

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

Évaluer la formule 

14) Rendement total des stocks Formule

Formule

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

Exemple

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

Évaluer la formule 

15) Risque Premium Formule

Formule

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

Exemple

$$49988 = 50000 - 12$$

Évaluer la formule 

16) Taux de rendement réel Formule

Formule

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

Exemple

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

Évaluer la formule 

17) Taux de retour Formule

Formule

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

Exemple

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

Évaluer la formule 



Variables utilisées dans la liste de Formules d'investissement importantes ci-dessus

- **A** Montant de l'investissement principal
- **APR** Taux annuel en pourcentage
- **BR** Rendement de référence
- **C** Coût de l'actif
- **CD** Certificat de dépôt
- **CGY** Rendement des gains en capital
- **CV** Valeur actuelle
- **D** Dividende
- **FV** Valeur future de l'investissement
- **i** Taux d'intérêt annuel
- **Initial Invt** Investissement initial
- **IR** Taux d'inflation
- **n** Nombre de périodes
- **n_c** Périodes composées
- **n_{Monthly}** Nombre de mensualités restantes
- **n_t** Nombre d'années
- **NPV** Valeur actuelle nette (VAN)
- **NR** Taux nominal
- **OV** Valeur d'origine
- **p** Paiement mensuel
- **p₁₂** Coefficient de corrélation du portefeuille
- **P_c** Cours actuel de l'action
- **P0** Prix de stock initial
- **P0_{Deposit}** Montant du dépôt initial
- **P1** Cours de clôture des actions
- **PI** Indice de rentabilité (IP)
- **PMT** Paiement de la rente
- **PV** Valeur actuelle
- **r** Tarif par période
- **R_p** Rendement du portefeuille
- **r_{Annual}** Taux d'intérêt nominal annuel
- **R_f** Taux sans risque
- **R_{Info}** Rapport d'information

Constantes, fonctions, mesures utilisées dans la liste des Formules d'investissement importantes ci-dessus

- **Les fonctions:** **sqrt**, **sqrt(Number)**
Une fonction racine carrée est une fonction qui prend un nombre non négatif comme entrée et renvoie la racine carrée du nombre d'entrée donné.



- **R_p** Rendement attendu du portefeuille
- **Real RR** Taux de rendement réel
- **R_f** Taux d'intérêt sans risque
- **$R_{f_{\text{return}}}$** Retour sans risque
- **R_m** Rendement annuel de l'indice de référence du marché
- **ROI** Retour sur investissement (ROI)
- **RoR** Taux de retour
- **R_p** Retour sur investissement annuel
- **RP** Prime de risque
- **S_s** Sauvetage
- **SLD** Amortissement linéaire
- **SR** Rapport de netteté
- **t** Vie
- **T** Nombre d'années d'investissement
- **T_r** Rapport de Treynor
- **TE** Erreur de suivi
- **TSR** Rendement total des actions
- **u** Prêt à intérêts non gagnés selon la méthode actuarielle
- **Var_p** Écart de portefeuille
- **w_1** Pondération de l'actif 1
- **w_2** Pondération de l'actif 2
- **α** L'alpha de Jensen
- **β_p** Bêta du portefeuille
- **σ_1** Variation des rendements des actifs 1
- **σ_2** Variation des rendements des actifs 2
- **σ_p** Écart type du portefeuille



Téléchargez d'autres PDF Important Financier

- Important Bancaire Formules 
- Important Équité Formules 
- Important Gestion des institutions financières Formules 
- Important Modélisation financière et évaluation Formules 
- Important Titres à revenu fixe Formules 
- Important Banque d'investissement Formules 
- Important Fusions et acquisitions Formules 
- Important Finance publique Formules 
- Important Gestion financière stratégique Formules 
- Important Impôt Formules 

Essayez nos calculatrices visuelles uniques

-  Part de pourcentage 
-  PGCD de deux nombres 
-  Fraction impropre 

Veuillez PARTAGER ce PDF avec quelqu'un qui en a besoin !

Ce PDF peut être téléchargé dans ces langues

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

9/23/2024 | 11:49:53 AM UTC

