



Формулы Примеры с единицами

Список 17 Важные формулы инвестиций Формулы

1) Актуарный метод Незаработанный процентный кредит Формула

Формула

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

Пример

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

Оценить формулу

2) Амортизация с линейной линией Формула

Формула

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

Пример

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

Оценить формулу

3) Аннуитетный платеж Формула

Формула

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

Пример

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

Оценить формулу

4) Дженсена Альфа Формула

Формула

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

Пример

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

Оценить формулу

5) Доход от прироста капитала Формула

Формула

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

Пример

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

Оценить формулу

6) Индекс прибыльности Формула

Формула

$$\text{PI} = \frac{\text{NPV} + \text{Initial Inv}t}{\text{Initial Inv}t}$$

Пример

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

Оценить формулу



7) Информационное соотношение Формула

Формула

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

Пример

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

Оценить формулу 

8) Коэффициент Трейнора Формула

Формула

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

Пример

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

Оценить формулу 

9) Коэффициент Шарпа Формула

Формула

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

Пример

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

Оценить формулу 

10) Норма прибыли Формула

Формула

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

Пример

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

Оценить формулу 

11) Общий запас возврата Формула

Формула

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

Пример

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

Оценить формулу 

12) Отклонение портфеля Формула

Формула

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

Пример

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

Оценить формулу 

13) Премия за риск Формула

Формула

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

Пример

$$49988 = 50000 - 12$$

Оценить формулу 



14) Реальная ставка доходности Формула ↻

Формула

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

Пример

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

Оценить формулу ↻

15) Сертификат депозита Формула ↻

Формула

$$\text{CD} = \text{P0}_{\text{Deposit}} \cdot \left(1 + \left(\frac{r_{\text{Annual}}}{n_c} \right) \right)^{n_c \cdot n_t}$$

Пример

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

Оценить формулу ↻

16) Составной интерес Формула ↻

Формула

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

Пример

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

Оценить формулу ↻

17) Стандартное отклонение портфеля Формула ↻

Формула

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

Пример

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

Оценить формулу ↻



Переменные, используемые в списке Важные формулы инвестиций выше

- **A** Основная сумма инвестиций
- **APR** Годовая процентная ставка
- **BR** Эталонная доходность
- **C** Стоимость актива
- **CD** Сертификат депозита
- **CGY** Доходность от прироста капитала
- **CV** Текущая стоимость
- **D** дивиденд
- **FV** Будущая стоимость инвестиций
- **i** Годовая процентная ставка
- **Initial Invt** Первоначальные инвестиции
- **IR** Уровень инфляции
- **n** Количество периодов
- **n_c** Периоды сложных процентов
- **n_{Monthly}** Количество оставшихся ежемесячных платежей
- **n_t** Количество лет
- **NPV** Чистая приведенная стоимость (NPV)
- **NR** Номинальная ставка
- **OV** Исходное значение
- **p** Ежемесячно оплата
- **ρ_{12}** Коэффициент корреляции портфеля
- **P_c** Текущая цена акций
- **P_0** Начальная цена акций
- **$P_{0\text{Deposit}}$** Первоначальная сумма депозита
- **P_1** Конечная цена акции
- **PI** Индекс рентабельности (PI)
- **PMT** Аннуитетный платеж
- **PV** Текущее значение
- **r** Ставка за период
- **R_p** Возврат портфеля
- **r_{Annual}** Годовая номинальная процентная ставка
- **R_f** Безрисковая ставка

Константы, функции и измерения, используемые в списке Важные формулы инвестиций выше

- **Функции:** `sqrt`, `sqrt(Number)`
Функция извлечения квадратного корня — это функция, которая принимает на вход неотрицательное число и возвращает квадратный корень из заданного входного числа.



- **R_{Info}** Информационное соотношение
- **R_p** Ожидаемая доходность портфеля
- **Real RR** Реальная норма доходности
- **R_f** Безрисковая процентная ставка
- **R_{return}** Возврат без риска
- **R_m** Годовая доходность рыночного эталона
- **ROI** Возврат инвестиций (ROI)
- **RoR** Норма прибыли
- **R_p** Годовой возврат инвестиций
- **RP** Премия за риск
- **S_s** Спасение
- **SLD** Прямолинейная амортизация
- **SR** Коэффициент Шарпа
- **t** Жизнь
- **T** Количество лет инвестирования денег
- **T_r** Коэффициент Трейнора
- **TE** Ошибка отслеживания
- **TSR** Общий доход от акций
- **u** Актуарный метод Ссуда под незаработанные проценты
- **Var_p** Отклонение портфеля
- **w_1** Вес актива 1
- **w_2** Вес актива 2
- **α** Альфа Дженсена
- **β_p** Бета-версия портфолио
- **σ_1** Отклонение доходности активов 1
- **σ_2** Отклонение доходности активов 2
- **σ_p** Стандартное отклонение портфеля



Загрузите другие PDF-файлы Важный финансовый

- Важный Банковское дело Формулы 
- Важный Капитал Формулы 
- Важный Управление финансовыми институтами Формулы 
- Важный Финансовое моделирование и оценка Формулы 
- Важный С фиксированным доходом ценных бумаг Формулы 
- Важный Инвестиционная деятельность банков Формулы 
- Важный Слияние и поглощение Формулы 
- Важный Общественные финансы Формулы 
- Важный Стратегический финансовый менеджмент Формулы 
- Важный налог Формулы 

Попробуйте наши уникальные визуальные калькуляторы

-  процентная доля 
-  НОД двух чисел 
-  Неправильная дробь 

Пожалуйста, ПОДЕЛИТЕСЬ этим PDF-файлом с теми, кому он нужен!

Этот PDF-файл можно скачать на этих языках

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

9/23/2024 | 11:50:00 AM UTC

