



calculatoratoz.com



unitsconverters.com

Formules d'investissement importantes Formules

calculatrices !

Exemples!

conversions !

Signet calculatoratoz.com, unitsconverters.com

Couverture la plus large des calculatrices et croissantes - **30 000+ calculatrices !**
Calculer avec une unité différente pour chaque variable - **Dans la conversion d'unité intégrée !**

La plus large collection de mesures et d'unités - **250+ Mesures !**

N'hésitez pas à PARTAGER ce document avec vos amis !

[Veuillez laisser vos commentaires ici...](#)



Liste de 17 Formules d'investissement importantes

Formules

Formules d'investissement importantes

1) Amortissement linéaire

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

Ouvrir la calculatrice 

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

2) Capital Gains Rendement

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

Ouvrir la calculatrice 

$$ex \quad 0.030928 = \frac{50 - 48.5}{48.5}$$

3) Certificat de dépôt

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

Ouvrir la calculatrice 

$$ex \quad 5389.118 = 5000 \cdot \left(1 + \left(\frac{0.015}{10} \right) \right)^{10 \cdot 5}$$



4) Écart de portefeuille 

fx

Ouvrir la calculatrice 

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

ex

$$0.145541 = (0.4)^2 \cdot (0.37)^2 + (0.6)^2 \cdot (0.56)^2 + 2 \cdot (0.4 \cdot 0.6 \cdot 0.37 \cdot 0.56 \cdot 0.108)$$

5) Écart type du portefeuille 


fx

Ouvrir la calculatrice 

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

ex

$$0.381499 = \sqrt{(0.4)^2 \cdot (0.37)^2 + (0.6)^2 \cdot (0.56)^2 + 2 \cdot (0.4 \cdot 0.6 \cdot 0.37 \cdot 0.56 \cdot 0.108)}$$

6) Indice de rentabilité 

fx

Ouvrir la calculatrice 

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

ex

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

7) Intérêts composés 

fx

Ouvrir la calculatrice 

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

ex

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



8) Jensen's Alpha 

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

Ouvrir la calculatrice 

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

9) Méthode actuarielle Prêt d'intérêt non acquis 

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

Ouvrir la calculatrice 

$$ex \quad 99354.84 = \frac{10 \cdot 28000 \cdot 55}{100 + 55}$$

10) Paiement de Annuité 

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

Ouvrir la calculatrice 

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


11) Rapport de Treynor 

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

Ouvrir la calculatrice 

$$ex \quad 5.882353 = \frac{8 - 3}{0.85}$$




12) Rapport d'information 

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

Ouvrir la calculatrice 

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

13) Ratio Sharpe 

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

Ouvrir la calculatrice 

$$\text{ex } 0.357143 = \frac{8 - 3}{14}$$

14) Rendement total des stocks 

$$\text{fx } TSR = \frac{(P1 - P0) + D}{P0}$$

Ouvrir la calculatrice 

$$\text{ex } 3.639175 = \frac{(200 - 48.5) + 25}{48.5}$$

15) Risque Premium 

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

Ouvrir la calculatrice 

$$\text{ex } 49988 = 50000 - 12$$


16) Taux de rendement réel 

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

Ouvrir la calculatrice 

$$\text{ex } 0.818182 = \left(\frac{1 + 19}{1 + 10} \right) - 1$$



17) Taux de retour Ouvrir la calculatrice 

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

$$\text{ex } 30.43478 = \left(\frac{3000 - 2300}{2300} \right) \cdot 100$$



Variables utilisées

- **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
- **P_{0Deposit}** 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
- **R_p** Rendement attendu du portefeuille
- **Real RR** Taux de rendement réel
- **R_f** Taux d'intérêt sans risque
- **R_freturn** 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
- **w₁** Pondération de l'actif 1
- **w₂** 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



Constantes, Fonctions, Mesures utilisées

- **Fonction:** `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.



Vérifier d'autres listes de formules

- [Bancaire Formules](#) 
- [Équité Formules](#) 
- [Gestion des institutions financières Formules](#) 
- [Titres à revenu fixe Formules](#) 
- [Banque d'investissement Formules](#) 
- [Loan Formules](#) 
- [Fusions et acquisitions Formules](#) 
- [Finance publique Formules](#) 
- [Impôt Formules](#) 

N'hésitez pas à PARTAGER ce document avec vos amis !

PDF Disponible en

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

6/12/2024 | 6:43:28 AM UTC

[Veillez laisser vos commentaires ici...](#)

