



[calculatoratoz.com](http://calculatoratoz.com)



[unitsconverters.com](http://unitsconverters.com)

# Formule importanti di investimento

## Formule

Calcolatrici!

Esempi!

Conversioni!

Segnalibro [calculatoratoz.com](http://calculatoratoz.com), [unitsconverters.com](http://unitsconverters.com)

La più ampia copertura di calcolatrici e in crescita - **30.000+ calcolatrici!**

Calcola con un'unità diversa per ogni variabile - **Nella conversione di unità costruita!**

La più ampia raccolta di misure e unità - **250+ misurazioni!**

Sentiti libero di **CONDIVIDERE** questo documento con i tuoi amici!

*[Si prega di lasciare il tuo feedback qui...](#)*



# Lista di 17 Formule importanti di investimento

## Formule

### Formule importanti di investimento

#### 1) Alpha di Jensen

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

Apri Calcolatrice 

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

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

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

Apri Calcolatrice 

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

#### 3) Certificato di deposito

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

Apri Calcolatrice 

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



4) Deviazione standard del portafoglio 


fx

Apri Calcolatrice 

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

ex

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

5) Indice di redditività 

fx

Apri Calcolatrice 

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

ex

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

6) Interesse composto 


fx

Apri Calcolatrice 

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

ex

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

7) Pagamento della rendita 

fx


Apri Calcolatrice 

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

ex

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




8) Primo rischio 

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

Apri Calcolatrice 


$$ex \quad 49988 = 50000 - 12$$

9) Rapporto di Treynor 

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

Apri Calcolatrice 


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

10) Rapporto informativo 

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

Apri Calcolatrice 


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

11) Rapporto Sharpe 

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

Apri Calcolatrice 

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


12) Rendimento dei guadagni di capitale 

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

Apri Calcolatrice 

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



13) Rendimento totale di azioni 

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

Apri Calcolatrice 


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

14) Retta linea deprezzamento 

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

Apri Calcolatrice 

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

15) Tasso di rendimento 

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

Apri Calcolatrice 

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

16) Tasso reale di rendimento 

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

Apri Calcolatrice 

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



17) Varianza del portafoglio 

fx

Apri Calcolatrice 

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

ex

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



## Variabili utilizzate

- **A** Importo principale dell'investimento
- **APR** Tasso percentuale annuale
- **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<sub>c</sub>** Periodi composti
- **n<sub>Monthly</sub>** Numero di pagamenti mensili rimanenti
- **n<sub>t</sub>** Numero di anni
- **NPV** Valore attuale netto (NPV)
- **NR** Tasso nominale
- **OV** Valore originale
- **p** Pagamento mensile
- **p<sub>12</sub>** Coefficiente di correlazione del portafoglio
- **P<sub>c</sub>** Prezzo attuale delle azioni
- **P<sub>0</sub>** Prezzo de stock iniziale
- **P<sub>0Deposit</sub>** Importo del deposito iniziale
- **P<sub>1</sub>** Prezzo finale delle azioni
- **PI** Indice di redditività (PI)



- **PMT** Pagamento della rendita
- **PV** Valore attuale
- **r** Tariffa per periodo
- **R<sub>p</sub>** Rendimento del portafoglio
- **r<sub>Annual</sub>** Tasso di interesse nominale annuo
- **R<sub>f</sub>** Tasso esente da rischio
- **R<sub>Info</sub>** Rapporto informativo
- **R<sub>p</sub>** Rendimento atteso del portafoglio
- **Real RR** Tasso di rendimento reale
- **R<sub>f</sub>** Tasso di interesse privo di rischio
- **R<sub>f</sub>return** Rendimento senza rischi
- **R<sub>m</sub>** Rendimento annuo del benchmark di mercato
- **ROI** Ritorno sull'investimento (ROI)
- **RoR** Tasso di rendimento
- **R<sub>p</sub>** Ritorno annuale sull'investimento
- **RP** Premio per il rischio
- **S<sub>s</sub>** Salvare
- **SLD** Ammortamento lineare
- **SR** Rapporto di Sharpe
- **t** Vita
- **T** Numero di anni in cui viene investito il denaro
- **T<sub>r</sub>** Rapporto di Treynor
- **TE** Errore di tracciamento
- **TSR** Rendimento totale delle azioni
- **u** Metodo attuariale Prestito con interessi maturati
- **Var<sub>p</sub>** Varianza del portafoglio
- **w<sub>1</sub>** Peso dell'asset 1
- **w<sub>2</sub>** 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



## Costanti, Funzioni, Misure utilizzate

- **Funzione:** `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.*



## Controlla altri elenchi di formule

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

Sentiti libero di **CONDIVIDERE** questo documento con i tuoi amici!

## PDF Disponibile in

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

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

[Si prega di lasciare il tuo feedback qui...](#)

