



calculatoratoz.com



unitsconverters.com

Ważne formuły inwestowania

Formuły

Kalkulatory!

Przykłady!

konwersje!

Zakładka calculatoratoz.com, unitsconverters.com

Najszerzy zasięg kalkulatorów i rośnięcie - **30 000+ kalkulatorów!**

Oblicz z inną jednostką dla każdej zmiennej - **W wbudowanej konwersji jednostek!**

Najszerzy zbiór miar i jednostek - **250+ pomiarów!**

Nie krępuj się UDOSTĘPNIJ ten dokument swoim znajomym!

[Zostaw swoją opinię tutaj...](#)



Lista 17 Ważne formuły inwestowania Formuły

Ważne formuły inwestowania ↗

1) Alpha Jensena ↗

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

[Otwórz kalkulator ↗](#)

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

2) Amortyzacja linii prostej ↗

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

[Otwórz kalkulator ↗](#)

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

3) Całkowity zwrot z akcji ↗

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

[Otwórz kalkulator ↗](#)

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

4) Certyfikat Depozytowy ↗

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

[Otwórz kalkulator ↗](#)

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



5) Metoda aktuarialna niespłacony kredyt odsetkowy 

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

Otwórz kalkulator 

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

6) Odchylenie standardowe portfela 

fx

Otwórz kalkulator 

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

ex

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

7) Odsetki złożone 

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

Otwórz kalkulator 

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


8) Płatność renty 

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

Otwórz kalkulator 

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



9) Premia ryzyka 

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

Otwórz kalkulator 

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

10) Realna stopa zwrotu 

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

Otwórz kalkulator 


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

11) Sharpe Ratio 

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

Otwórz kalkulator 

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


12) Stopa zwrotu 

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

Otwórz kalkulator 

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



13) Stosunek informacji 

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

Otwórz kalkulator 

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

14) Stosunek Treynora 

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

Otwórz kalkulator 

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

15) Wariancja portfela 


fx

Otwórz kalkulator 

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

ex

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

16) Wskaźnik rentowności 

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

Otwórz kalkulator 

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



17) Zyski kapitałowe Wydajność Otwórz kalkulator 

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

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



Używane zmienne

- **A** Główna kwota inwestycji
- **APR** Roczna stopa procentowa
- **BR** Zwrot z benchmarku
- **C** Koszt aktywów
- **CD** Świadczenie depozytu
- **CGY** Zyski kapitałowe
- **CV** Aktualna wartość
- **D** Dywidenda
- **FV** Przyszła wartość inwestycji
- **i** Roczna stopa procentowa
- **Initial Invt** Inwestycja początkowa
- **IR** Inflacja
- **n** Liczba okresów
- **n_c** Okresy złożone
- **n_{Monthly}** Liczba pozostałych płatności miesięcznych
- **n_t** Liczba lat
- **NPV** Wartość bieżąca netto (NPV)
- **NR** Nominalna stawka
- **OV** Oryginalna wartość
- **p** Miesięczna płatność
- **p₁₂** Współczynnik korelacji portfela
- **P_c** Aktualna cena akcji
- **P₀** Początkowa cena akcji
- **P_{0Deposit}** Początkowa kwota depozytu
- **P₁** Końcowa cena akcji
- **PI** Indeks Rentowności (PI)



- **PMT** Płatność renty
- **PV** Obecna wartość
- **r** Stawka za okres
- **R_p** Zwrot portfela
- **r_{Annual}** Roczna nominalna stopa procentowa
- **R_f** Stopa wolna od ryzyka
- **R_{Info}** Stosunek informacji
- **R_p** Oczekiwany zwrot z portfela
- **Real RR** Rzeczywista stopa zwrotu
- **R_f** Stopa procentowa wolna od ryzyka
- **R_freturn** Zwrot bez ryzyka
- **R_m** Roczny zwrot benchmarku rynkowego
- **ROI** Zwrot z inwestycji (ROI)
- **RoR** Stopa zwrotu
- **R_p** Roczny zwrot z inwestycji
- **RP** Premia za ryzyko
- **S_s** Odzysk
- **SLD** Amortyzacja liniowa
- **SR** współczynnik Sharpe'a
- **t** Życie
- **T** Liczba lat inwestowania pieniędzy
- **T_r** Stosunek Treynora
- **TE** Błąd traktacji
- **TSR** Całkowity zwrot z zapasów
- **u** Metoda aktuarialna Pożyczka z niezarobionymi odsetkami
- **Var_p** Wariancja portfela
- **w₁** Waga aktywów 1
- **w₂** Waga aktywów 2



- α Alfa Jensena
- β_p Beta portfela
- σ_1 Wariancja zwrotów z aktywów 1
- σ_2 Wariancja zwrotów z aktywów 2
- σ_p Odchylenie standardowe portfela



Stałe, funkcje, stosowane pomiary

- **Funkcjonować:** `sqrt`, `sqrt(Number)`

Funkcja pierwiastka kwadratowego to funkcja, która jako dane wejściowe przyjmuje liczbę nieujemną i zwraca pierwiastek kwadratowy z podanej liczby wejściowej.



Sprawdź inne listy formuł

- [Bankowość Formuły](#) 
- [Ślusznosc Formuły](#) 
- [Zarządzanie instytucjami finansowymi Formuły](#) 
- [Papiery wartościowe o stałym dochodzie Formuły](#) 
- [Bankowość inwestycyjna Formuły](#) 
- [Pożyczka Formuły](#) 
- [Fuzje i przejęcia Formuły](#) 
- [Finanse publiczne Formuły](#) 
- [Podatek Formuły](#) 

Nie krępuj się UDOSTĘPNIJ ten dokument swoim znajomym!

PDF Dostępne w

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

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

[Zostaw swoją opinię tutaj...](#)

