



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



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

# Важные формулы инвестиций Формулы

Калькуляторы!

Примеры!

Преобразования!

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

Самый широкий охват калькуляторов и рост - **30 000+ калькуляторов!**  
Расчет с разными единицами измерения для каждой переменной - **Встроенное преобразование единиц измерения!**

Самая широкая коллекция измерений и единиц измерения - **250+ измерений!**

Не стесняйтесь **ПОДЕЛИТЬСЯ** этим документом с друзьями!

*[Пожалуйста, оставьте свой отзыв здесь...](#)*



# Список 17 Важные формулы инвестиций Формулы

## Важные формулы инвестиций

### 1) Актуарный метод Незаработанный процентный кредит

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

[Открыть калькулятор !\[\]\(a870788d6ed9b8fd294b7654a8c8526b\_img.jpg\)](#)

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

### 2) Амортизация с линейной линией

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

[Открыть калькулятор !\[\]\(c50c8b7b2cc2cf9ff925edec0ee94c0d\_img.jpg\)](#)

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

### 3) Аннуитетный платеж

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

[Открыть калькулятор !\[\]\(f60b7a900783ac3fd531bfd9c111be6d\_img.jpg\)](#)

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

### 4) Дженсена Альфа

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

[Открыть калькулятор !\[\]\(83bbbd261710c59db0214aa27b2edc0d\_img.jpg\)](#)

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




5) Доход от прироста капитала 

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

[Открыть калькулятор !\[\]\(cbe80b694ebd74fcfe136a095b608235\_img.jpg\)](#)

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

6) Индекс прибыльности 

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

[Открыть калькулятор !\[\]\(3e2231b1ad3ca8da8658228c00dd08e0\_img.jpg\)](#)

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

7) Информационное соотношение 

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

[Открыть калькулятор !\[\]\(0d5ec72f61334709c3fc9450209b754f\_img.jpg\)](#)

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

8) Коэффициент Трейнора 

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

[Открыть калькулятор !\[\]\(b64b40baaee5acddc1eab8538ba84754\_img.jpg\)](#)

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




9) Коэффициент Шарпа 

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

Открыть калькулятор 


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

10) Норма прибыли 

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

Открыть калькулятор 

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

11) Общий запас возврата 

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

Открыть калькулятор 

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

12) Отклонение портфеля 

fx

Открыть калькулятор 

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

ex

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




13) Премия за риск 

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

Открыть калькулятор 

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

14) Реальная ставка доходности 

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

Открыть калькулятор 

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

15) Сертификат депозита 

$$fx \quad CD = P0_{\text{Deposit}} \cdot \left( 1 + \left( \frac{r_{\text{Annual}}}{n_c} \right) \right)^{n_c \cdot n_t}$$

Открыть калькулятор 

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

16) Составной интерес 

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

Открыть калькулятор 

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



17) Стандартное отклонение портфеля 

fx

Открыть калькулятор 

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

ex

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



## Используемые переменные

- **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<sub>c</sub>** Периоды сложных процентов
- **n<sub>Monthly</sub>** Количество оставшихся ежемесячных платежей
- **n<sub>t</sub>** Количество лет
- **NPV** Чистая приведенная стоимость (NPV)
- **NR** Номинальная ставка
- **OV** Исходное значение
- **p** Ежемесячно оплата
- **p<sub>12</sub>** Коэффициент корреляции портфеля
- **P<sub>c</sub>** Текущая цена акций
- **P<sub>0</sub>** Начальная цена акций
- **P<sub>0Deposit</sub>** Первоначальная сумма депозита
- **P<sub>1</sub>** Конечная цена акции
- **PI** Индекс рентабельности (PI)



- **PMT** Аннуитетный платеж
- **PV** Текущее значение
- **r** Ставка за период
- **R<sub>p</sub>** Возврат портфеля
- **r<sub>Annual</sub>** Годовая номинальная процентная ставка
- **R<sub>f</sub>** Безрисковая ставка
- **R<sub>Info</sub>** Информационное соотношение
- **R<sub>p</sub>** Ожидаемая доходность портфеля
- **Real RR** Реальная норма доходности
- **R<sub>f</sub>** Безрисковая процентная ставка
- **R<sub>f</sub>return** Возврат без риска
- **R<sub>m</sub>** Годовая доходность рыночного эталона
- **ROI** Возврат инвестиций (ROI)
- **RoR** Норма прибыли
- **R<sub>p</sub>** Годовой возврат инвестиций
- **RP** Премия за риск
- **S<sub>s</sub>** Спасение
- **SLD** Прямолинейная амортизация
- **SR** Коэффициент Шарпа
- **t** Жизнь
- **T** Количество лет инвестирования денег
- **T<sub>r</sub>** Коэффициент Трейнора
- **TE** Ошибка отслеживания
- **TSR** Общий доход от акций
- **u** Актуарный метод Ссуда под незаработанные проценты
- **Var<sub>p</sub>** Отклонение портфеля
- **w<sub>1</sub>** Вес актива 1
- **w<sub>2</sub>** Вес актива 2





- $\alpha$  Альфа Дженсена
- $\beta_p$  Бета-версия портфолио
- $\sigma_1$  Отклонение доходности активов 1
- $\sigma_2$  Отклонение доходности активов 2
- $\sigma_p$  Стандартное отклонение портфеля













## Константы, функции, используемые измерения

- **Функция:** `sqrt`, `sqrt(Number)`

Функция извлечения квадратного корня — это функция, которая принимает на вход неотрицательное число и возвращает квадратный корень из заданного входного числа.



## Проверьте другие списки формул

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

Не стесняйтесь ПОДЕЛИТЬСЯ этим документом с друзьями!

## PDF Доступен в

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

9/20/2024 | 10:06:26 AM UTC

[Пожалуйста, оставьте свой отзыв здесь...](#)

