

Fondų rodiklių skaičiavimo principai

Investicijų graža

Periodams iki vienerių metų skaičiuojamas faktinis pokytis.

Periodams virš metų investicijų graža skaičiuojama metų pagrindu. Skaičiavimo bazė (30E/360).

NAV pokytis

$$(NAV_i/NAV_{i-1} - 1) * 100\%$$

1 mėnesio graža

$$(NAV/NAV_{\text{prieš}_1_{\text{mėnesi}}} - 1) * 100\%$$

3 mėnesių graža

$$(NAV/NAV_{\text{prieš}_3_{\text{mėnesius}}} - 1) * 100\%$$

6 mėnesių graža

$$(NAV/NAV_{\text{prieš}_6_{\text{mėnesius}}} - 1) * 100\%$$

12 mėnesių graža

$$(NAV/NAV_{\text{prieš}_12_{\text{mėnesių}}} - 1) * 100\%$$

24 mėnesių graža

$$\left(\left(\frac{NAV}{NAV_{\text{prieš } 24 \text{ mėn.}}} \right)^{\frac{1}{2}} - 1 \right) * 100\%$$

36 mėnesių graža

$$\left(\left(\frac{NAV}{NAV_{\text{prieš } 36 \text{ mėn.}}} \right)^{\frac{1}{3}} - 1 \right) * 100\%$$

48 mėnesių graža

$$\left(\left(\frac{NAV}{NAV_{\text{prieš } 48 \text{ mėn.}}} \right)^{\frac{1}{4}} - 1 \right) * 100\%$$

60 mėnesių graža

$$\left(\left(\frac{NAV}{NAV_{\text{prieš } 60 \text{ mėn.}}} \right)^{\frac{1}{5}} - 1 \right) * 100\%$$

Investicijų grąža nuo fondo pradžios

$$\left(\left(\frac{NAV}{NAV_{fondo_pradžioje}} \right)^{\frac{360}{Dienų\ sk.\ nuo\ fondo\ pradžios}} - 1 \right) * 100\%$$

Skaičiavimo bazė 30E/360.

Periodams iki vienerių metų skaičiuojams faktinis pokytis.

Naudojama formulė: $(NAV/NAV_fondo_pradžioje - 1)*100\%$

Standartinis nuokrypis (volatility)

Standartinis nuokrypis – tai statistinis rizikos rodiklis, parodantis, kaip per paskutinius 24 mėnesius svyravo Fondo investicinio vieneto mėnesinis vertės pokytis, išreikštas procentais. Kuo didesnė rodiklio reikšmė, tuo didesnė investicijos pelningumo rizika.

$$\sqrt{\frac{12}{N-1} \times \sum_{i=1}^N (Y_i - \bar{Y})^2} = \sigma \times \sqrt{12}$$