

# Fondistatistika arvutamise põhimõtted

## ***Tootlused***

Alla aastaseid tootlusi aasta baasile ei teisendata.

Üle aastased tootlused teisendatakse aasta baasile (30E/360) kasutades liitintressi.

### **NAVi muutus**

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

### **1 kuu tootlus**

$$(NAV/NAV_{1\text{ kuu tagasi}} - 1)*100\%$$

### **3 kuu tootlus**

$$(NAV/NAV_{3\text{ kuu tagasi}} - 1)*100\%$$

### **6 kuu tootlus**

$$(NAV/NAV_{6\text{ kuu tagasi}} - 1)*100\%$$

### **1 aasta tootlus**

$$(NAV/NAV_{12\text{ kuud tagasi}} - 1)*100\%$$

### **2 aasta tootlus**

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

### **3 aasta tootlus**

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

### **4 aasta tootlus**

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

### **5 aasta tootlus**

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

10 aasta tootlus

$$\left( \left( \frac{NAV}{NAV_{120\text{ kuud tagasi}}} \right)^{\frac{1}{10}} - 1 \right) * 100\%$$

15 aasta tootlus

$$\left( \left( \frac{NAV}{NAV_{180\text{ kuud tagasi}}} \right)^{\frac{1}{15}} - 1 \right) * 100\%$$

Tootlus fondi algusest

$$\left( \left( \frac{NAV}{NAV_{\text{fondi\_alguses}}} \right)^{\frac{360}{\text{Päevade\_arv\_fondi\_algusest}}} - 1 \right) * 100\%$$

Päevade arv fondi algusest arvutatakse vastavalt 30E/360 konventsioonile.

Alla aastaseid perioode aasta baasile ei teisendata, kasutatakse vastavalt muutuse valemit:  
(NAV/NAV\_fondi\_alguses - 1)\*100%

Tootlus aasta algusest

$$YTT = (NAV/NAV_{\text{aastavahetusel}} - 1) * 100\%$$

NAV\_aastavahetusel on eelmise aasta viimane NAV.