

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

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

12 kuu tootlus

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

24 kuu tootlus

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

36 kuu tootlus

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

48 kuu tootlus

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

60 kuu tootlus

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

Tootlus fondi algusest

$$\left(\left(\frac{NAV}{NAV_{fondi_alguses}} \right)^{\frac{360}{Päevade_arv_fondi_algusest}} - 1 \right) * 100\%$$

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

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

NAV_aastavahetusel on eelmise aasta viimane NAV.

Volatiilsus

Volatiilsus kajastab fondiosaku hinnamuutusest tulevat tulususe kõikumist. Väärtus arvutatakse viimase 24 kuu tulususte standardhälbe põhjal järgmise valemi alusel:

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