Εξισώσεις

$IY = \frac{CF_1}{P_0}$	Απόδοση εισοδήματος
$CY = \frac{P_1 - P_0}{P_0}$	Απόδοση κεφαλαίου
$R_{t+1} = \frac{CF_{t+1} + P_{t+1} - P_t}{P_t}$	Ποσοστιαία απόδοση
$\bar{r} = \frac{\sum_{i=1}^{n} r_i}{n}$	Αριθμητική μέση απόδοση ή αναμενόμενη απόδοση (δειγματοληψία)
$g = \sqrt[n]{(1+r_1)\times(1+r_2)\times(1+r_3)\times\ldots\times(1+r_n)} - 1$	Γεωμετρική μέση απόδοση
$E(r) = \sum_{i=1}^{n} (r_i \times p_i)$	Αναμενόμενη απόδοση (κατανομή πιθανοτήτων)
$\sigma^2 = \frac{\sum_{i=1}^{n} (r_i - \bar{r})^2}{\mathrm{N} - 1}$	Διακύμανση ενός χρεογράφου (δειγματοληψία)
$\sigma = \sqrt{\frac{\sum_{i=1}^{n} (r_i - \bar{r})^2}{\mathrm{N} - 1}}$	Τυπική απόκλιση ενός χρεογράφου (δειγματοληψία)
$\sigma^2 = \sum_{i=1}^{n} p_i (r_i - E(r))^2$	Διακύμανση ενός χρεογράφου (κατανομή πιθανοτήτων)
$\sigma = \sqrt{\sum_{i=1}^{n} p_i (r_i - E(r))^2}$	Τυπική απόκλιση ενός χρεογράφου (κατανομή πιθανοτήτων)
$CV = \frac{\sigma}{\mathrm{E}(r)}$	Συντελεστής Μεταβλητότητας
$E(r_p) = \sum_{i=1}^{n} (w_i \times E(r_i))$	Αναμενόμενη απόδοση χαρτοφυλακίου

$$\sigma_p^2 = w_A^2\sigma_{\text{A}}^2 + w_{\text{B}}^2\sigma_{\text{B}}^2 + 2w_{\text{A}}w_{\text{B}}\sigma_{\text{AB}} \text{ ή}$$

$$\sigma_p^2 = w_A^2\sigma_{\text{A}}^2 + w_{\text{B}}^2\sigma_{\text{B}}^2 + 2w_{\text{A}}w_{\text{B}}\rho_{\text{AB}}\sigma_{\text{A}}\sigma_{\text{B}}$$

Διακύμανση χαρτοφυλακίου με δύο χρεόγραφα

$$\sigma_p = \sqrt{w_A^2\sigma_{\text{A}}^2 + w_{\text{B}}^2\sigma_{\text{B}}^2 + 2w_{\text{A}}w_{\text{B}}\sigma_{\text{AB}}} \text{ ή}$$

$$\sigma_p = \sqrt{w_A^2\sigma_{\text{A}}^2 + w_{\text{B}}^2\sigma_{\text{B}}^2 + 2w_{\text{A}}w_{\text{B}}\rho_{\text{AB}}\sigma_{\text{A}}\sigma_{\text{B}}}$$

Τυπική απόκλιση χαρτοφυλακίου με δύο χρεόγραφα

$$\sigma_p^2 = \sum_{i=1}^{n} w_i^2\sigma_i^2 + \sum_{i=1}^{n}\sum_{j=1}^{n} w_i w_j \sigma_{ij} \text{ ή}$$

$$\sigma_p^2 = \sum_{i=1}^{n} w_i^2\sigma_i^2 + \sum_{i=1}^{n}\sum_{j=1}^{n} w_i w_j \rho_{ij}\sigma_i\sigma_j$$

Διακύμανση χαρτοφυλακίου με *n* χρεόγραφα

$$COV_{AB} = \sigma_{\text{AB}} = \frac{\sum_{i=1}^{n}\left(r_{Ai} - E(r_A)\right)\left(r_{Bi} - E(r_B)\right)}{\text{N} - 1}$$

Συνδιακύμανση δύο χρεογράφων (δειγματοληψία)

$$COV_{AB} = \sigma_{\text{AB}} = \sum_{i=1}^{n} p_i\left(r_{Ai} - E(r_A)\right)\left(r_{Bi} - E(r_B)\right)$$

Συνδιακύμανση δύο χρεογράφων (κατανομή πιθανοτήτων)

$$\rho_{\text{AB}} = \frac{\sigma_{AB}}{\sigma_{\text{A}}\sigma_{\text{B}}}$$

Συντελεστής συσχέτισης δύο χρεογράφων

$$w_A = \frac{\sigma_{\text{B}}^2 - \sigma_{\text{AB}}}{\sigma_{\text{A}}^2 + \sigma_{\text{B}}^2 - 2\sigma_{\text{AB}}} \text{ ή}$$

$$w_A = \frac{\sigma_{\text{B}}^2 - \rho_{\text{AB}}\sigma_{\text{A}}\sigma_{\text{B}}}{\sigma_{\text{A}}^2 + \sigma_{\text{B}}^2 - 2\rho_{\text{AB}}\sigma_{\text{A}}\sigma_{\text{B}}}$$

Χαρτοφυλάκιο ελάχιστης διακύμανσης