

# Belangrijk Risicomanagement Formules Pdf



## Formules Voorbeelden met eenheden

### Lijst van 20 Belangrijk Risicomanagement Formules

#### 1) Basisrisico Formule

Formule

$$BR = FPC - SPHA$$

Voorbeeld

$$14755 = 22255 - 7500$$

Evalueer de formule 

#### 2) Calmar-verhouding Formule

Formule

$$CR = \left( \frac{ARR}{MDD} \right) \cdot -1$$

Voorbeeld

$$0.24 = \left( \frac{12}{-50} \right) \cdot -1$$

Evalueer de formule 

#### 3) Economisch Kapitaal Formule

Formule

$$EC = \frac{EaR}{RR}$$

Voorbeeld

$$7750 = \frac{620}{0.08}$$

Evalueer de formule 

#### 4) Kredietspreiding Formule

Formule

$$CS_p = CBY - TBY$$

Voorbeeld

$$0.54 = 2.5 - 1.96$$

Evalueer de formule 

#### 5) Kredietwaarde in gevaar Formule

Formule

$$CR_v = WCL - ECL$$

Voorbeeld

$$12500 = 33000 - 20500$$

Evalueer de formule 

#### 6) Marktrisicopremie Formule

Formule

$$MRP = EEMR - R_f$$

Voorbeeld

$$18.7 = 19 - 0.3$$

Evalueer de formule 

#### 7) Maximale opname Formule

Formule

$$MDD = \left( \frac{V_{\text{trough}} - V_{\text{peak}}}{V_{\text{peak}}} \right) \cdot 100$$

Voorbeeld

$$-50 = \left( \frac{25000 - 50000}{50000} \right) \cdot 100$$

Evalueer de formule 



## 8) Modigliani-Modigliani-maatstaf Formule

Formule

$$M_2 = R_{ap} - R_{mkt}$$

Voorbeeld

$$20.1 = 25 - 4.9$$

Evalueer de formule 

## 9) Opwaartse/neerwaartse verhouding Formule

Formule

$$R_{up/down} = \frac{AI}{DI}$$

Voorbeeld

$$3.0909 = \frac{17}{5.5}$$

Evalueer de formule 

## 10) Pijnverhouding Formule

Formule

$$PR = \frac{ER}{PI}$$

Voorbeeld

$$7.3333 = \frac{110}{15}$$

Evalueer de formule 

## 11) Renterisico Formule

Formule

$$IR_{risk} = \frac{OP - NP}{NP}$$

Voorbeeld

$$2.9823 = \frac{450 - 113}{113}$$

Evalueer de formule 

## 12) Risicobepaling Formule

Formule

$$\sigma_R = RI \cdot L$$

Voorbeeld

$$84 = 21 \cdot 4$$

Evalueer de formule 

## 13) Risicoblootstelling Formule

Formule

$$RE = RI \cdot p$$

Voorbeeld

$$10.5 = 21 \cdot 0.5$$

Evalueer de formule 

## 14) Risicotolerantie Formule

Formule

$$RT = \frac{PEE \cdot 0.35}{MGI}$$

Voorbeeld

$$17.5 = \frac{500000 \cdot 0.35}{10000}$$

Evalueer de formule 

## 15) Sortino-verhouding Formule

Formule

$$S = \frac{R_p - R_f}{\sigma_d}$$

Voorbeeld

$$3.5667 = \frac{11 - 0.3}{3}$$

Evalueer de formule 



## 16) Standaardrisicopremie Formule

Formule

$$\text{DRP} = R_i - R_f$$

Voorbeeld

$$5.7 = 6 - 0.3$$

Evalueer de formule 

## 17) Sterling-ratio Formule

Formule

$$\text{SR} = \left( \frac{\text{CAGR}}{\text{AMDD} - 10} \right) \cdot -1$$

Voorbeeld

$$10 = \left( \frac{150}{-5 - 10} \right) \cdot -1$$

Evalueer de formule 

## 18) Verlies bij wanbetaling Formule

Formule

$$\text{LGD} = 1 - R_r$$

Voorbeeld

$$0.6 = 1 - 0.4$$

Evalueer de formule 

## 19) Voor risico gecorrigeerd rendement op kapitaal Formule

Formule

$$\text{RAROC} = \frac{R - e - el + ifc}{P_{\text{Capital}}}$$

Voorbeeld

$$374.15 = \frac{780000 - 47000 - 6700 + 22000}{2000}$$

Evalueer de formule 

## 20) Waarschijnlijkheid van standaardregressiemodel Formule

Formule

$$\text{PD} = \frac{1}{1 + \exp(-z)}$$

Voorbeeld

$$0.5075 = \frac{1}{1 + \exp(-0.03)}$$

Evalueer de formule 



## Variabelen gebruikt in lijst van Riscicomagement Formules hierboven

- **AI** Oprukkende problemen
- **AMDD** Gemiddelde maximale opname
- **ARR** Gemiddeld rendement
- **BR** Basisrisico
- **CAGR** Samengestelde jaarlijkse groeisnelheid
- **CBY** Rendement bedrijfsobligaties
- **CR** Calmar-verhouding
- **CR<sub>v</sub>** Kredietwaarde in gevaar
- **CS<sub>p</sub>** Kredietspreiding
- **DI** Dalende problemen
- **DRP** Standaardrisicopremie
- **e** Uitgaven
- **EaR** Inkomsten in gevaar
- **EC** Economisch Kapitaal
- **ECL** Verwacht kredietverlies
- **EEMR** Verwachte aandelenmarktrente
- **eI** Verwacht verlies
- **ER** Effectief rendement
- **FPC** Toekomstige contractprijs
- **ifc** Inkomsten uit kapitaal
- **IR<sub>risk</sub>** Renterisico
- **L** Waarschijnlijkheid
- **LGD** Verlies bij wanbetaling
- **M<sub>2</sub>** Modigliani-Modigliani-maat
- **MDD** Maximale opname
- **MGI** Maandelijks bruto-inkomen
- **MRP** Marktrisicopremie
- **NP** Nieuwe prijs
- **OP** Originele prijs
- **p** Waarschijnlijkheid
- **P<sub>Capital</sub>** Kapitaalkosten
- **PD** Waarschijnlijkheid van wanbetaling
- **PEE** Blootstelling aan publieke aandelen
- **PI** Pijnindex

## Constanten, functies, metingen gebruikt in de lijst met Riscicomagement Formules hierboven

- **Functies:** **exp**, **exp(Number)**  
*Bij een exponentiële functie verandert de waarde van de functie met een constante factor voor elke eenheidsverandering in de onafhankelijke variabele.*









- **PR** Pijnverhouding
- **R** Winst
- **R<sub>ap</sub>** Rendement op aangepaste portefeuille
- **R<sub>f</sub>** Risicovrij tarief
- **R<sub>i</sub>** Rente
- **R<sub>mkt</sub>** Rendement op marktportfolio
- **R<sub>p</sub>** Verwacht portefeuillerendement
- **R<sub>up/down</sub>** Opwaartse/neerwaartse verhouding
- **RAROC** Voor risico gecorrigeerd rendement op kapitaal
- **RE** Risicoblootstelling
- **RI** Risico-impact
- **Rr** Herstelpercentage
- **RR** Vereist rendement
- **RT** Risicotolerantie
- **S** Sortino-verhouding
- **SPHA** Spotprijs van afgedekt actief
- **SR** Sterling-ratio
- **TBY** Rendement op staatsobligaties
- **V<sub>peak</sub>** Piekwaarde
- **V<sub>trough</sub>** Trogwaarde
- **WCL** Het ergste kredietverlies
- **Z** Lineaire combinatie
- **σ<sub>d</sub>** Standaardafwijking van nadeel
- **σ<sub>R</sub>** Risico



## Download andere Belangrijk Gemeenschappelijke waarschijnlijkheidsverdeling pdf's

- **Belangrijk Risicomanagement Formules** 

### Probeer onze unieke visuele rekenmachines

-  **Percentage Verandering** 
-  **KGV van twee getallen** 
-  **Juiste fractie** 

DEEL deze PDF met iemand die hem nodig heeft!

### Deze PDF kan in deze talen worden gedownload

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

7/9/2024 | 6:37:21 AM UTC

