



## Formuły Przykłady z Jednostkami

### Lista 20 Ważny Zarządzanie ryzykiem Formuły

#### 1) Domyślna premia za ryzyko Formuła ↻

Formuła

$$DRP = R_i - R_f$$

Przykład

$$5.7 = 6 - 0.3$$

Oceń formułę ↻

#### 2) Ekspozycja na ryzyko Formuła ↻

Formuła

$$RE = RI \cdot p$$

Przykład

$$10.5 = 21 \cdot 0.5$$

Oceń formułę ↻

#### 3) Kapitał Ekonomiczny Formuła ↻

Formuła

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

Przykład

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

Oceń formułę ↻

#### 4) Maksymalna wypłata Formuła ↻

Formuła

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

Przykład

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

Oceń formułę ↻

#### 5) Miara Modiglianiego-Modiglianiego Formuła ↻

Formuła

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

Przykład

$$20.1 = 25 - 4.9$$

Oceń formułę ↻

#### 6) Określenie ryzyka Formuła ↻

Formuła

$$\sigma_R = RI \cdot L$$

Przykład

$$84 = 21 \cdot 4$$

Oceń formułę ↻

#### 7) Prawdopodobieństwo domyślnego modelu regresji Formuła ↻

Formuła

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

Przykład

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

Oceń formułę ↻



## 8) Premia za ryzyko rynkowe Formuła

Formuła

$$MRP = EEMR - R_f$$

Przykład

$$18.7 = 19 - 0.3$$

Oceń formułę 

## 9) Ryzyko podstawowe Formuła

Formuła

$$BR = FPC - SPHA$$

Przykład

$$14755 = 22255 - 7500$$

Oceń formułę 

## 10) Ryzyko stopyprocentowej Formuła

Formuła

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

Przykład

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

Oceń formułę 

## 11) Spread kredytowy Formuła

Formuła

$$CS_p = CBY - TBY$$

Przykład

$$0.54 = 2.5 - 1.96$$

Oceń formułę 

## 12) Stosunek funta szterlinga Formuła

Formuła

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

Przykład

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

Oceń formułę 

## 13) Stosunek plus/minus Formuła

Formuła

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

Przykład

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

Oceń formułę 

## 14) Stosunek spokoju Formuła

Formuła

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

Przykład

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

Oceń formułę 

## 15) Strata z tytułu niewykonania Formuła

Formuła

$$LGD = 1 - R_r$$

Przykład

$$0.6 = 1 - 0.4$$

Oceń formułę 



## 16) Tolerancja ryzyka Formuła

Formuła

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

Przykład

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

Oceń formułę 

## 17) Wartość kredytu zagrożona Formuła

Formuła

$$CR_v = WCL - ECL$$

Przykład

$$12500 = 33000 - 20500$$

Oceń formułę 

## 18) Współczynnik bólu Formuła

Formuła

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

Przykład

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

Oceń formułę 

## 19) Współczynnik sortowania Formuła

Formuła

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

Przykład

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

Oceń formułę 

## 20) Zwrot z kapitału skorygowany o ryzyko Formuła

Formuła

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

Przykład

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

Oceń formułę 



## Zmienne użyte na liście Zarządzanie ryzykiem Formuły powyżej

- **AI** Zagadnienia zaawansowane
- **AMDD** Średnia maksymalna wypłata
- **ARR** Średnia stopa zwrotu
- **BR** Ryzyko podstawowe
- **CAGR** Składana roczna stopa wzrostu
- **CBY** Rentowność obligacji korporacyjnych
- **CR** Stosunek spokoju
- **CR<sub>v</sub>** Wartość kredytu zagrożona
- **CS<sub>p</sub>** Spread kredytowy
- **DI** Problemy malejące
- **DRP** Domyślna premia za ryzyko
- **e** Wydatki
- **EaR** Zarobki zagrożone
- **EC** Kapitał Ekonomiczny
- **ECL** Oczekiwana strata kredytowa
- **EEMR** Oczekiwana stopa rynku akcji
- **eI** Oczekiwana strata
- **ER** Efektywny zwrot
- **FPC** Przyszła cena kontraktu
- **ifc** Dochód z kapitału
- **IR<sub>risk</sub>** Ryzyko stopyprocentowej
- **L** Prawdopodobieństwo
- **LGD** Strata z tytułu niewykonania
- **M<sub>2</sub>** Miara Modiglianiego-Modiglianiego
- **MDD** Maksymalna wypłata
- **MGI** Miesięczny dochód brutto
- **MRP** Premia za ryzyko rynkowe
- **NP** Nowa cena
- **OP** Cena oryginalna
- **p** Prawdopodobieństwo
- **P<sub>Capital</sub>** Koszt kapitału
- **PD** Prawdopodobieństwo niewypłacalności
- **PEE** Ekspozycja na kapitał publiczny
- **PI** Indeks bólu
- **PR** Współczynnik bólu

## Stałe, funkcje, miary użyte na liście Zarządzanie ryzykiem Formuły powyżej

- **Funkcje:** **exp**,  $\exp(\text{Number})$   
*w przypadku funkcji wykładniczej wartość funkcji zmienia się o stały współczynnik przy każdej zmianie jednostki zmiennej niezależnej.*





- **R** Przychód
- **R<sub>ap</sub>** Zwrot z skorygowanego portfela
- **R<sub>f</sub>** Stopa wolna od ryzyka
- **R<sub>i</sub>** Oprocentowanie
- **R<sub>mkt</sub>** Zwrot na portfelu rynkowym
- **R<sub>p</sub>** Oczekiwany zwrot z portfela
- **R<sub>up/down</sub>** Stosunek plus/minus
- **RAROC** Zwrot z kapitału skorygowany o ryzyko
- **RE** Ekspozycja na ryzyko
- **RI** Wpływ ryzyka
- **Rr** Szybkość odzyskiwania
- **RR** Wymagana stopa zwrotu
- **RT** Tolerancja ryzyka
- **S** Współczynnik sortowania
- **SPHA** Cena spot zabezpieczonego aktywa
- **SR** Stosunek funta szterlinga
- **TBY** Rentowność obligacji skarbowych
- **V<sub>peak</sub>** Wartość szczytowa
- **V<sub>trough</sub>** Wartość minimalna
- **WCL** Najgorsza strata kredytowa
- **Z** Kombinacja liniowa
- **σ<sub>d</sub>** Odchylenie standardowe wady
- **σ<sub>R</sub>** Ryzyko



## Pobierz inne pliki PDF z kategorii Ważny Wspólny rozkład prawdopodobieństwa

- **Ważny Zarządzanie ryzykiem**  
Formuły 

### Wypróbuj nasze unikalne kalkulatory wizualne

-  Procentowej zmiany 
-  NWW dwóch liczby 
-  Ułamek właściwy 

**UDOSTĘPNIJ** ten plik PDF komuś, kto go potrzebuje!

Ten plik PDF można pobrać w tych językach

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

7/9/2024 | 6:37:16 AM UTC

