

Importante Gestión de riesgos Fórmulas PDF



Fórmulas Ejemplos con unidades

Lista de 20 Importante Gestión de riesgos Fórmulas

1) Capital económico Fórmula

Fórmula

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

Ejemplo

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

Evaluar fórmula

2) Determinación de riesgos Fórmula

Fórmula

$$\sigma_R = RI \cdot L$$

Ejemplo

$$84 = 21 \cdot 4$$

Evaluar fórmula

3) Diferencial de crédito Fórmula

Fórmula

$$CS_p = CBY - TBY$$

Ejemplo

$$0.54 = 2.5 - 1.96$$

Evaluar fórmula

4) Exposición a riesgos Fórmula

Fórmula

$$RE = RI \cdot p$$

Ejemplo

$$10.5 = 21 \cdot 0.5$$

Evaluar fórmula

5) Medida Modigliani-Modigliani Fórmula

Fórmula

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

Ejemplo

$$20.1 = 25 - 4.9$$

Evaluar fórmula

6) Modelo de regresión de probabilidad de incumplimiento Fórmula

Fórmula

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

Ejemplo

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

Evaluar fórmula

7) Pérdida dado el incumplimiento Fórmula

Fórmula

$$LGD = 1 - Rr$$

Ejemplo

$$0.6 = 1 - 0.4$$

Evaluar fórmula



8) Prima de riesgo de incumplimiento Fórmula

Fórmula

$$DRP = R_i - R_f$$

Ejemplo

$$5.7 = 6 - 0.3$$

Evaluar fórmula 

9) Prima de riesgo del mercado Fórmula

Fórmula

$$MRP = EEMR - R_f$$

Ejemplo

$$18.7 = 19 - 0.3$$

Evaluar fórmula 

10) Proporción de dolor Fórmula

Fórmula

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

Ejemplo

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

Evaluar fórmula 

11) Proporción esterlina Fórmula

Fórmula

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

Ejemplo

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

Evaluar fórmula 

12) Reducción máxima Fórmula

Fórmula

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

Ejemplo

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

Evaluar fórmula 

13) Relación alza/baja Fórmula

Fórmula

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

Ejemplo

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

Evaluar fórmula 

14) Relación de calma Fórmula

Fórmula

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

Ejemplo

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

Evaluar fórmula 

15) Relación de Sortino Fórmula

Fórmula

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

Ejemplo

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

Evaluar fórmula 



16) Retorno del capital ajustado al riesgo Fórmula

Fórmula

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

Ejemplo

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

Evaluar fórmula 

17) Riesgo base Fórmula

Fórmula

$$\text{BR} = \text{FPC} - \text{SPHA}$$

Ejemplo

$$14755 = 22255 - 7500$$

Evaluar fórmula 

18) Riesgo de tipo de interés Fórmula

Fórmula

$$\text{IR}_{\text{risk}} = \frac{\text{OP} - \text{NP}}{\text{NP}}$$

Ejemplo

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

Evaluar fórmula 

19) Tolerancia al riesgo Fórmula

Fórmula

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

Ejemplo

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

Evaluar fórmula 

20) Valor crediticio en riesgo Fórmula

Fórmula

$$\text{CR}_v = \text{WCL} - \text{ECL}$$

Ejemplo

$$12500 = 33000 - 20500$$

Evaluar fórmula 



Variables utilizadas en la lista de Gestión de riesgos Fórmulas anterior

- **AI** Problemas que avanzan
- **AMDD** Reducción máxima promedio
- **ARR** Tasa de retorno promedio
- **BR** Riesgo base
- **CAGR** Tasa compuesta de crecimiento anual
- **CBY** Rendimiento de los bonos corporativos
- **CR** Relación de calma
- **CR_v** Valor crediticio en riesgo
- **CS_p** Diferencial de crédito
- **DI** Problemas en declive
- **DRP** Prima de riesgo de incumplimiento
- **e** Gastos
- **EaR** Ganancias en riesgo
- **EC** Capital económico
- **ECL** Pérdida crediticia esperada
- **EEMR** Tasa esperada del mercado de valores
- **eI** Pérdida esperada
- **ER** Rentabilidad efectiva
- **FPC** Precio futuro del contrato
- **ifc** Ingresos de capital
- **IR_{risk}** Riesgo de tipo de interés
- **L** Probabilidad
- **LGD** Pérdida dado el incumplimiento
- **M₂** Medida Modigliani-Modigliani
- **MDD** Reducción máxima
- **MGI** Ingreso Bruto Mensual
- **MRP** Prima de riesgo del mercado
- **NP** Nuevo precio
- **OP** Precio original
- **p** Probabilidad
- **P_{Capital}** Costo capital
- **PD** Probabilidad de incumplimiento
- **PEE** Exposición al capital público
- **PI** Índice de dolor

Constantes, funciones y medidas utilizadas en la lista de Gestión de riesgos Fórmulas anterior

- **Funciones:** **exp**, **exp(Number)**
En una función exponencial, el valor de la función cambia en un factor constante por cada cambio de unidad en la variable independiente.




- **PR** Proporción de dolor
- **R** Ganancia
- **R_{ap}** Rendimiento de la cartera ajustada
- **R_f** Tasa libre de riesgo
- **R_i** Tasa de interés
- **R_{mkt}** Rentabilidad de la cartera de mercado
- **R_p** Rendimiento esperado de la cartera
- **R_{up/down}** Relación alza/baja
- **RAROC** Retorno del capital ajustado al riesgo
- **RE** Exposición a riesgos
- **RI** Impacto del riesgo
- **Rr** Índice de recuperación
- **RR** Tarifa de regreso requerida
- **RT** Tolerancia al riesgo
- **S** Relación de Sortino
- **SPHA** Precio al contado del activo cubierto
- **SR** Proporción esterlina
- **TBY** Rendimiento de los bonos del Tesoro
- **V_{peak}** Valor pico
- **V_{trough}** Valor mínimo
- **WCL** Peor pérdida crediticia
- **z** Combinación lineal
- **σ_d** Desviación estándar de desventaja
- **σ_R** Riesgo



Descargue otros archivos PDF de Importante Distribución de probabilidad común

- **Importante Gestión de riesgos**
Fórmulas 

Pruebe nuestras calculadoras visuales únicas

-  Cambio porcentual 
-  MCM de dos números 
-  Fracción propia 

¡COMPARTE este PDF con alguien que lo necesite!

Este PDF se puede descargar en estos idiomas.

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

7/9/2024 | 6:36:49 AM UTC

