



## Formule Esempi con unità

### Lista di 20 Importante Gestione del rischio Formule

#### 1) Capitale economico Formula

Formula

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

Esempio

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

Valutare la formula

#### 2) Determinazione del rischio Formula

Formula

$$\sigma_R = RI \cdot L$$

Esempio

$$84 = 21 \cdot 4$$

Valutare la formula

#### 3) Diffusione del credito Formula

Formula

$$CS_P = CBY - TBY$$

Esempio

$$0.54 = 2.5 - 1.96$$

Valutare la formula

#### 4) Esposizione al rischio Formula

Formula

$$RE = RI \cdot p$$

Esempio

$$10.5 = 21 \cdot 0.5$$

Valutare la formula

#### 5) Misura Modigliani-Modigliani Formula

Formula

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

Esempio

$$20.1 = 25 - 4.9$$

Valutare la formula

#### 6) Modello di regressione della probabilità di default Formula

Formula

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

Esempio

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

Valutare la formula

#### 7) Perdita data predefinita Formula

Formula

$$LGD = 1 - Rr$$

Esempio

$$0.6 = 1 - 0.4$$

Valutare la formula



## 8) Prelievo massimo Formula

Formula

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

Esempio

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

Valutare la formula 

## 9) Premio per il rischio di default Formula

Formula

$$DRP = R_i - R_f$$

Esempio

$$5.7 = 6 - 0.3$$

Valutare la formula 

## 10) Premio per il rischio di mercato Formula

Formula

$$MRP = EEMR - R_f$$

Esempio

$$18.7 = 19 - 0.3$$

Valutare la formula 

## 11) Rapporto del dolore Formula

Formula

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

Esempio

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

Valutare la formula 

## 12) Rapporto di calma Formula

Formula

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

Esempio

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

Valutare la formula 

## 13) Rapporto rialzo/ribasso Formula

Formula

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

Esempio

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

Valutare la formula 

## 14) Rapporto Sortino Formula

Formula

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

Esempio

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

Valutare la formula 

## 15) Rapporto sterlina Formula

Formula

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

Esempio

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

Valutare la formula 



## 16) Rendimento del capitale corretto per il rischio Formula

Formula

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

Esempio

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

Valutare la formula 

## 17) Rischio del tasso di interesse Formula

Formula

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

Esempio

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

Valutare la formula 

## 18) Rischio di base Formula

Formula

$$BR = FPC - SPHA$$

Esempio

$$14755 = 22255 - 7500$$

Valutare la formula 

## 19) Tolleranza al rischio Formula

Formula

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

Esempio

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

Valutare la formula 

## 20) Valore del credito a rischio Formula

Formula

$$CR_v = WCL - ECL$$

Esempio

$$12500 = 33000 - 20500$$

Valutare la formula 



## Variabili utilizzate nell'elenco di Gestione del rischio Formule sopra

- **AI** Problemi avanzati
- **AMDD** Prelievo massimo medio
- **ARR** Tasso medio di rendimento
- **BR** Rischio di base
- **CAGR** Tasso di crescita composto annuo
- **CBY** Rendimento delle obbligazioni societarie
- **CR** Rapporto di calma
- **CR<sub>v</sub>** Valore del credito a rischio
- **CS<sub>p</sub>** Diffusione del credito
- **DI** Problemi in declino
- **DRP** Premio per il rischio di default
- **e** Spese
- **EaR** Guadagni a rischio
- **EC** Capitale economico
- **ECL** Perdita attesa sul credito
- **EEMR** Tasso atteso del mercato azionario
- **el** Perdita attesa
- **ER** Rendimento effettivo
- **FPC** Prezzo futuro del contratto
- **ifc** Reddito da capitale
- **IR<sub>risk</sub>** Rischio del tasso di interesse
- **L** Probabilità
- **LGD** Perdita data predefinita
- **M<sub>2</sub>** Misura Modigliani-Modigliani
- **MDD** Prelievo massimo
- **MGI** Reddito lordo mensile
- **MRP** Premio per il rischio di mercato
- **NP** Nuovo prezzo
- **OP** Prezzo originale
- **p** Probabilità
- **P<sub>Capital</sub>** Costo del capitale
- **PD** Probabilità di default
- **PEE** Esposizione azionaria pubblica
- **PI** Indice del dolore
- **PR** Rapporto del dolore

## Costanti, funzioni, misure utilizzate nell'elenco di Gestione del rischio Formule sopra

- **Funzioni:** **exp**, **exp(Number)**  
*In una funzione esponenziale, il valore della funzione cambia di un fattore costante per ogni variazione unitaria della variabile indipendente.*



- **R** Reddito
- **R<sub>ap</sub>** Rendimento del portafoglio rettificato
- **R<sub>f</sub>** Tasso esente da rischio
- **R<sub>i</sub>** Tasso d'interesse
- **R<sub>mkt</sub>** Rendimento del portafoglio di mercato
- **R<sub>p</sub>** Rendimento atteso del portafoglio
- **R<sub>up/down</sub>** Rapporto rialzo/ribasso
- **RAROC** Rendimento del capitale corretto per il rischio
- **RE** Esposizione al rischio
- **RI** Impatto del rischio
- **Rr** Tasso di recupero
- **RR** Tasso di rendimento richiesto
- **RT** Tolleranza al rischio
- **S** Rapporto Sortino
- **SPHA** Prezzo spot dell'asset coperto
- **SR** Rapporto sterlina
- **TBY** Rendimento dei titoli del Tesoro
- **V<sub>peak</sub>** Valore di picco
- **V<sub>trough</sub>** Valore minimo
- **WCL** Peggior perdita di credito
- **z** Combinazione lineare
- **σ<sub>d</sub>** Deviazione standard del ribasso
- **σ<sub>R</sub>** Rischio



- **Importante Gestione del rischio**  
**Formule** 

### Prova i nostri calcolatori visivi unici

-  **Variazione percentuale** 
-  **MCM di due numeri** 
-  **Frazione propria** 

Per favore **CONDIVIDI** questo PDF con qualcuno che ne ha bisogno!

**Questo PDF può essere scaricato in queste lingue**

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

7/9/2024 | 6:37:07 AM UTC

