



Formules Exemples avec unités

Liste de 20 Important Gestion des risques Formules

1) Capitale économique Formule ↻

Formule

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

Exemple

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

Évaluer la formule ↻

2) Détermination des risques Formule ↻

Formule

$$\sigma_R = RI \cdot L$$

Exemple

$$84 = 21 \cdot 4$$

Évaluer la formule ↻

3) Exposition à risque Formule ↻

Formule

$$RE = RI \cdot p$$

Exemple

$$10.5 = 21 \cdot 0.5$$

Évaluer la formule ↻

4) Mesure Modigliani-Modigliani Formule ↻

Formule

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

Exemple

$$20.1 = 25 - 4.9$$

Évaluer la formule ↻

5) Modèle de régression de probabilité de défaut Formule ↻

Formule

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

Exemple

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

Évaluer la formule ↻

6) Perte en cas de défaut Formule ↻

Formule

$$LGD = 1 - R_r$$

Exemple

$$0.6 = 1 - 0.4$$

Évaluer la formule ↻

7) Prime de risque de défaut Formule ↻

Formule

$$DRP = R_i - R_f$$

Exemple

$$5.7 = 6 - 0.3$$

Évaluer la formule ↻



8) Prime de risque de marché Formule ↻

Formule

$$\text{MRP} = \text{EEMR} - R_f$$

Exemple

$$18.7 = 19 - 0.3$$

Évaluer la formule ↻

9) Rapport calme Formule ↻

Formule

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

Exemple

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

Évaluer la formule ↻

10) Rapport de douleur Formule ↻

Formule

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

Exemple

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

Évaluer la formule ↻

11) Ratio de la livre sterling Formule ↻

Formule

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

Exemple

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

Évaluer la formule ↻

12) Ratio de sortie Formule ↻

Formule

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

Exemple

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

Évaluer la formule ↻

13) Ratio hausse/baisse Formule ↻

Formule

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

Exemple

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

Évaluer la formule ↻

14) Rendement du capital ajusté en fonction du risque Formule ↻

Formule

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

Exemple

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

Évaluer la formule ↻

15) Risque de base Formule ↻

Formule

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

Exemple

$$14755 = 22255 - 7500$$

Évaluer la formule ↻



16) Risque de taux d'intérêt Formule ↻

Formule

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

Exemple

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

Évaluer la formule ↻

17) Spread de crédit Formule ↻

Formule

$$CS_p = CBY - TBY$$

Exemple

$$0.54 = 2.5 - 1.96$$

Évaluer la formule ↻

18) Tirage maximum Formule ↻

Formule

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

Exemple

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

Évaluer la formule ↻

19) Tolérance au risque Formule ↻

Formule

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

Exemple

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

Évaluer la formule ↻

20) Valeur du crédit à risque Formule ↻

Formule

$$CR_v = WCL - ECL$$

Exemple

$$12500 = 33000 - 20500$$

Évaluer la formule ↻



Variables utilisées dans la liste de Gestion des risques Formules ci-dessus

- **AI** Problèmes avancés
- **AMDD** Tirage maximum moyen
- **ARR** Taux de rendement moyen
- **BR** Risque de base
- **CAGR** Taux de croissance annuel composé
- **CBY** Rendement des obligations d'entreprise
- **CR** Rapport calme
- **CR_v** Valeur du crédit à risque
- **CS_p** Spread de crédit
- **DI** Problèmes en déclin
- **DRP** Prime de risque de défaut
- **e** Dépenses
- **EaR** Gains menacés
- **EC** Capitale économique
- **ECL** Perte de crédit attendue
- **EEMR** Taux attendu du marché des actions
- **eI** Perte attendue
- **ER** Retour effectif
- **FPC** Prix futur du contrat
- **ifc** Revenus du capital
- **IR_{risk}** Risque de taux d'intérêt
- **L** Probabilité
- **LGD** Perte en cas de défaut
- **M₂** Mesure Modigliani-Modigliani
- **MDD** Tirage maximum
- **MGI** Revenu brut mensuel
- **MRP** Prime de risque de marché
- **NP** Nouveau prix
- **OP** Prix d'origine
- **p** Probabilité
- **P_{Capital}** Coût en capital
- **PD** Probabilité de défaut
- **PEE** Exposition aux actions publiques
- **PI** Indice de douleur

Constantes, fonctions, mesures utilisées dans la liste des Gestion des risques Formules ci-dessus

- **Les fonctions:** **exp**, **exp(Number)**
Dans une fonction exponentielle, la valeur de la fonction change d'un facteur constant pour chaque changement d'unité dans la variable indépendante.



- **PR** Rapport de douleur
- **R** Revenu
- **R_{ap}** Rendement du portefeuille ajusté
- **R_f** Taux sans risque
- **R_i** Taux d'intérêt
- **R_{mkt}** Rendement du portefeuille de marché
- **R_p** Rendement attendu du portefeuille
- **R_{up/down}** Ratio hausse/baisse
- **RAROC** Rendement du capital ajusté en fonction du risque
- **RE** Exposition à risque
- **RI** Impact du risque
- **Rr** Taux de récupération
- **RR** Taux de rendement requis
- **RT** Tolérance au risque
- **S** Ratio de sortie
- **SPHA** Prix au comptant de l'actif couvert
- **SR** Ratio de la livre sterling
- **TBY** Rendement des bons du Trésor
- **V_{peak}** Valeur maximale
- **V_{trough}** Valeur minimale
- **WCL** Pire perte de crédit
- **Z** Combinaison linéaire
- **σ_d** Écart type de la baisse
- **σ_R** Risque



- Important Gestion des risques
Formules 

Essayez nos calculatrices visuelles uniques

-  Changement en pourcentage 
-  PPCM de deux nombres 
-  Fraction propre 

Veuillez PARTAGER ce PDF avec quelqu'un qui en a besoin !

Ce PDF peut être téléchargé dans ces langues

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

7/9/2024 | 6:36:53 AM UTC

