



## Formeln Beispiele mit Einheiten

### Liste von 20 Wichtig Risikomanagement Formeln

#### 1) Ausfallrisikoprämie Formel

Formel

$$DRP = R_i - R_f$$

Beispiel

$$5.7 = 6 - 0.3$$

Formel auswerten

#### 2) Basisrisiko Formel

Formel

$$BR = FPC - SPHA$$

Beispiel

$$14755 = 22255 - 7500$$

Formel auswerten

#### 3) Calmar-Verhältnis Formel

Formel

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

Beispiel

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

Formel auswerten

#### 4) Kreditspanne Formel

Formel

$$CS_p = CBY - TBY$$

Beispiel

$$0.54 = 2.5 - 1.96$$

Formel auswerten

#### 5) Kreditwert im Risiko Formel

Formel

$$CR_v = WCL - ECL$$

Beispiel

$$12500 = 33000 - 20500$$

Formel auswerten

#### 6) Marktisikoprämie Formel

Formel

$$MRP = EEMR - R_f$$

Beispiel

$$18.7 = 19 - 0.3$$

Formel auswerten

#### 7) Maximaler Drawdown Formel

Formel

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

Beispiel

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

Formel auswerten



## 8) Modigliani-Modigliani-Maß Formel

Formel

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

Beispiel

$$20.1 = 25 - 4.9$$

Formel auswerten 

## 9) Risikoadjustierte Kapitalrendite Formel

Formel

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

Beispiel

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

Formel auswerten 

## 10) Risikobestimmung Formel

Formel

$$\sigma_R = RI \cdot L$$

Beispiel

$$84 = 21 \cdot 4$$

Formel auswerten 

## 11) Risikoexposition Formel

Formel

$$RE = RI \cdot p$$

Beispiel

$$10.5 = 21 \cdot 0.5$$

Formel auswerten 

## 12) Risikotoleranz Formel

Formel

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

Beispiel

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

Formel auswerten 

## 13) Schmerzverhältnis Formel

Formel

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

Beispiel

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

Formel auswerten 

## 14) Sortino-Verhältnis Formel

Formel

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

Beispiel

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

Formel auswerten 

## 15) Sterling-Verhältnis Formel

Formel

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

Beispiel

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

Formel auswerten 



## 16) Upside/Downside-Verhältnis Formel

Formel

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

Beispiel

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

Formel auswerten 

## 17) Verlust bei Ausfall Formel

Formel

$$LGD = 1 - Rr$$

Beispiel

$$0.6 = 1 - 0.4$$

Formel auswerten 

## 18) Wahrscheinlichkeit des Standard-Regressionsmodells Formel

Formel

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

Beispiel

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

Formel auswerten 

## 19) Wirtschaftskapital Formel

Formel

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

Beispiel

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

Formel auswerten 

## 20) Zinsrisiko Formel

Formel

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

Beispiel

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

Formel auswerten 



## In der Liste von Risikomanagement Formeln oben verwendete Variablen

- **AI** Fortschreitende Probleme
- **AMDD** Durchschnittlicher maximaler Drawdown
- **ARR** Durchschnittliche Rendite
- **BR** Basisrisiko
- **CAGR** Jährliche Wachstumsrate
- **CBY** Rendite von Unternehmensanleihen
- **CR** Calmar-Verhältnis
- **CR<sub>v</sub>** Kreditwert im Risiko
- **CS<sub>p</sub>** Kreditspanne
- **DI** Abnehmende Probleme
- **DRP** Ausfallrisikoprämie
- **e** Kosten
- **EaR** Gefährdete Erträge
- **EC** Wirtschaftskapital
- **ECL** Erwarteter Kreditverlust
- **EEMR** Erwarteter Aktienmarktzins
- **eI** Erwarteter Verlust
- **ER** Effektive Rendite
- **FPC** Zukünftiger Vertragspreis
- **ifc** Einkünfte aus Kapital
- **IR<sub>risk</sub>** Zinsrisiko
- **L** Wahrscheinlichkeit
- **LGD** Verlust bei Zahlungsverzug
- **M<sub>2</sub>** Modigliani-Modigliani-Maß
- **MDD** Maximaler Drawdown
- **MGI** Monatliches Bruttoeinkommen
- **MRP** Marktrisikoprämie
- **NP** Neuer Preis
- **OP** Original Preis
- **p** Wahrscheinlichkeit
- **P<sub>Capital</sub>** Kapitalkosten
- **PD** Ausfallwahrscheinlichkeit
- **PEE** Öffentliches Beteiligungsengagement
- **PI** Schmerzindex
- **PR** Schmerzverhältnis

## Konstanten, Funktionen, Messungen, die in der Liste von Risikomanagement Formeln oben verwendet werden

- **Funktionen:** **exp**,  $\exp(\text{Number})$   
*Bei einer Exponentialfunktion ändert sich der Funktionswert bei jeder Einheitsänderung der unabhängigen Variablen um einen konstanten Faktor.*









- **R** Einnahmen
- **R<sub>ap</sub>** Rendite des angepassten Portfolios
- **R<sub>f</sub>** Risikofreier Zinssatz
- **R<sub>i</sub>** Zinsrate
- **R<sub>mkt</sub>** Return-on-Market-Portfolio
- **R<sub>p</sub>** Erwartete Portfoliorendite
- **R<sub>up/down</sub>** Upside/Downside-Verhältnis
- **RAROC** Risikoadjustierte Kapitalrendite
- **RE** Risikoexposition
- **RI** Risikoauswirkungen
- **Rr** Erholungsrate
- **RR** Erforderliche Rendite
- **RT** Risikotoleranz
- **S** Sortino-Verhältnis
- **SPHA** Spotpreis des abgesicherten Vermögenswerts
- **SR** Sterling-Verhältnis
- **TBY** Rendite von Staatsanleihen
- **V<sub>peak</sub>** Höchstwert
- **V<sub>trough</sub>** Tiefstwert
- **WCL** Schlimmster Kreditverlust
- **z** Lineare Kombination
- **σ<sub>d</sub>** Standardabweichung der Abwärtsbewegung
- **σ<sub>R</sub>** Risiko



## Laden Sie andere Wichtig Gemeinsame Wahrscheinlichkeitsverteilung-PDFs herunter

- **Wichtig Risikomanagement Formeln** 

### Probieren Sie unsere einzigartigen visuellen Rechner aus

-  **Prozentualer Änderung** 
-  **KGV von zwei zahlen** 
-  **Echter bruch** 

Bitte TEILEN Sie dieses PDF mit jemandem, der es braucht!

### Dieses PDF kann in diesen Sprachen heruntergeladen werden

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

7/9/2024 | 6:36:58 AM UTC

