



## Формулы Примеры с единицами

### Список 20 Важный Управление рисками Формулы

#### 1) Базовый риск Формула ↗

Формула

$$BR = FPC - SPNA$$

Пример

$$14755 = 22255 - 7500$$

Оценить формулу ↗

#### 2) Вероятность модели регрессии по умолчанию Формула ↗

Формула

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

Пример

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

Оценить формулу ↗

#### 3) Кальмарское соотношение Формула ↗

Формула

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

Пример

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

Оценить формулу ↗

#### 4) Кредитная стоимость под риском Формула ↗

Формула

$$CR_v = WCL - ECL$$

Пример

$$12500 = 33000 - 20500$$

Оценить формулу ↗

#### 5) Кредитный риск Формула ↗

Формула

$$RE = RI \cdot p$$

Пример

$$10.5 = 21 \cdot 0.5$$

Оценить формулу ↗

#### 6) Кредитный спред Формула ↗

Формула

$$CS_p = CBV - TBV$$

Пример

$$0.54 = 2.5 - 1.96$$

Оценить формулу ↗

#### 7) Максимальная просадка Формула ↗

Формула

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

Пример

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

Оценить формулу ↗



## 8) Мера Модильяни-Модильяни Формула

Формула

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

Пример

$$20.1 = 25 - 4.9$$

Оценить формулу 

## 9) Определение риска Формула

Формула

$$\sigma_R = RI \cdot L$$

Пример

$$84 = 21 \cdot 4$$

Оценить формулу 

## 10) Премия за риск дефолта Формула

Формула

$$DRP = R_i - R_f$$

Пример

$$5.7 = 6 - 0.3$$

Оценить формулу 

## 11) Премия за рыночный риск Формула

Формула

$$MRP = EEMR - R_f$$

Пример

$$18.7 = 19 - 0.3$$

Оценить формулу 

## 12) Рентабельность капитала с поправкой на риск Формула

Формула

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

Пример

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

Оценить формулу 

## 13) Риск процентной ставки Формула

Формула

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

Пример

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

Оценить формулу 

## 14) Соотношение боли Формула

Формула

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

Пример

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

Оценить формулу 

## 15) Соотношение плюс/минус Формула

Формула

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

Пример

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

Оценить формулу 



## 16) Соотношение Сортино Формула

Формула

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

Пример

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

Оценить формулу 

## 17) Стерлинговый коэффициент Формула

Формула

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

Пример

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

Оценить формулу 

## 18) Толерантность к риску Формула

Формула

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

Пример

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

Оценить формулу 

## 19) Убыток при дефолте Формула

Формула

$$LGD = 1 - Rr$$

Пример

$$0.6 = 1 - 0.4$$

Оценить формулу 

## 20) Экономический капитал Формула

Формула

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

Пример

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

Оценить формулу 



## Переменные, используемые в списке Управление рисками Формулы выше

- **AI** Продвигающиеся проблемы
- **AMDD** Средняя максимальная просадка
- **ARR** Средняя норма прибыли
- **BR** Базовый риск
- **CAGR** Совокупный среднегодовой темп роста
- **CBY** Доходность корпоративных облигаций
- **CR** Кальмарское соотношение
- **CR<sub>v</sub>** Кредитная стоимость под риском
- **CS<sub>p</sub>** Кредитный спред
- **DI** Уменьшение количества проблем
- **DRP** Премия за риск дефолта
- **e** Затраты
- **EaR** Доходы под угрозой
- **EC** Экономический капитал
- **ECL** Ожидаемые кредитные убытки
- **EEMR** Ожидаемая ставка на рынке акций
- **eI** Ожидаемая потеря
- **ER** Эффективный доход
- **FPC** Будущая цена контракта
- **ifc** Доход от капитала
- **IR<sub>risk</sub>** Риск процентной ставки
- **L** Вероятность
- **LGD** Убыток при дефолте
- **M<sub>2</sub>** Мера Модильяни-Модильяни
- **MDD** Максимальная просадка
- **MGI** Ежемесячный валовой доход
- **MRP** Премия за рыночный риск
- **NP** Новая цена
- **OP** Изначальная цена
- **p** Вероятность
- **P<sub>Capital</sub>** Капитальные затраты
- **PD** Вероятность дефолта
- **PEE** Публичный акционерный капитал
- **PI** Индекс боли

## Константы, функции и измерения, используемые в списке Управление рисками Формулы выше

- **Функции:** **exp**, **exp(Number)**  
*В показательной функции значение функции изменяется на постоянный коэффициент при каждом изменении единицы независимой переменной.*



- **PR** Соотношение боли
- **R** Доход
- **R<sub>ap</sub>** Рентабельность скорректированного портфеля
- **R<sub>f</sub>** Безрисковая ставка
- **R<sub>i</sub>** Процентная ставка
- **R<sub>mkt</sub>** Рыночный портфель
- **R<sub>p</sub>** Ожидаемая доходность портфеля
- **R<sub>up/down</sub>** Соотношение плюс/минус
- **RAROC** Рентабельность капитала с поправкой на риск
- **RE** Кредитный риск
- **RI** Влияние риска
- **Rr** Скорость восстановления
- **RR** Требуемая норма доходности
- **RT** Толерантность к риску
- **S** Соотношение Сортино
- **SPHA** Спотовая цена хеджируемого актива
- **SR** Стерлинговый коэффициент
- **TBY** Доходность казначейских облигаций
- **V<sub>peak</sub>** Пиковое значение
- **V<sub>trough</sub>** Минимальная стоимость
- **WCL** Худшая кредитная потеря
- **Z** Линейная комбинация
- **σ<sub>d</sub>** Стандартное отклонение отрицательной стороны
- **σ<sub>R</sub>** Риск



## Загрузите другие PDF-файлы Важный Общее распределение вероятностей

- **Важный Управление рисками**  
Формулы 

### Попробуйте наши уникальные визуальные калькуляторы

-  Процентное изменение 
-  НОК двух чисел 
-  Правильная дробь 

Пожалуйста, ПОДЕЛИТЕСЬ этим PDF-файлом с теми, кому он нужен!

Этот PDF-файл можно скачать на этих языках

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

7/9/2024 | 6:37:03 AM UTC

