



calculatoratoz.com



unitsconverters.com

Risikomanagement Formeln

Rechner!

Beispiele!

Konvertierungen!

Lesezeichen calculatoratoz.com, unitsconverters.com

Größte Abdeckung von Rechnern und wächst - **30.000+ Rechner!**
Rechnen Sie mit einer anderen Einheit für jede Variable - **Eingebaute
Einheitenumrechnung!**

Größte Sammlung von Maßen und Einheiten - **250+ Messungen!**

Fühlen Sie sich frei, dieses Dokument mit Ihren Freunden
zu TEILEN!

[Bitte hinterlassen Sie hier Ihr Rückkoppelung...](#)



Liste von 20 Risikomanagement Formeln

Risikomanagement

1) Ausfallrisikoprämie

$$\text{fx } \text{DRP} = R_i - R_f$$

[Rechner öffnen !\[\]\(a870788d6ed9b8fd294b7654a8c8526b_img.jpg\)](#)

$$\text{ex } 5.7 = 6 - 0.3$$

2) Basisrisiko

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

[Rechner öffnen !\[\]\(c50c8b7b2cc2cf9ff925edec0ee94c0d_img.jpg\)](#)

$$\text{ex } 14755 = 22255 - 7500$$

3) Calmar-Verhältnis

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

[Rechner öffnen !\[\]\(f60b7a900783ac3fd531bfd9c111be6d_img.jpg\)](#)

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

4) Kreditspanne

$$\text{fx } \text{CS}_P = \text{CBY} - \text{TBV}$$

[Rechner öffnen !\[\]\(83bbbd261710c59db0214aa27b2edc0d_img.jpg\)](#)

$$\text{ex } 0.54 = 2.5 - 1.96$$



5) Kreditwert im Risiko

$$fx \quad CR_v = WCL - ECL$$

[Rechner öffnen !\[\]\(cbe80b694ebd74fcfe136a095b608235_img.jpg\)](#)

$$ex \quad 12500 = 33000 - 20500$$

6) Marktrisikoprämie

$$fx \quad MRP = EEMR - R_f$$

[Rechner öffnen !\[\]\(3e2231b1ad3ca8da8658228c00dd08e0_img.jpg\)](#)

$$ex \quad 18.7 = 19 - 0.3$$

7) Maximaler Drawdown

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

[Rechner öffnen !\[\]\(0d5ec72f61334709c3fc9450209b754f_img.jpg\)](#)

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

8) Modigliani-Modigliani-Maß

$$fx \quad M_2 = R_{ap} - R_{mkt}$$

[Rechner öffnen !\[\]\(b64b40baaee5acddc1eab8538ba84754_img.jpg\)](#)

$$ex \quad 20.1 = 25 - 4.9$$



9) Risikoadjustierte Kapitalrendite

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

Rechner öffnen 

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

10) Risikobestimmung

$$fx \ \sigma_R = RI \cdot L$$

Rechner öffnen 

$$ex \ 84 = 21 \cdot 4$$

11) Risikoexposition

$$fx \ RE = RI \cdot p$$

Rechner öffnen 

$$ex \ 10.5 = 21 \cdot 0.5$$

12) Risikotoleranz

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

Rechner öffnen 

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



13) Schmerzverhältnis 

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

Rechner öffnen 

$$ex \quad 7.333333 = \frac{110}{15}$$

14) Sortino-Verhältnis 

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

Rechner öffnen 


$$ex \quad 3.566667 = \frac{11 - 0.3}{3}$$

15) Sterling-Verhältnis 

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

Rechner öffnen 

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


16) Upside/Downside-Verhältnis 

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

Rechner öffnen 

$$ex \quad 3.090909 = \frac{17}{5.5}$$



17) Verlust bei Ausfall 

$$fx \quad LGD = 1 - Rr$$

Rechner öffnen 

$$ex \quad 0.6 = 1 - 0.4$$

18) Wahrscheinlichkeit des Standard-Regressionsmodells 

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

Rechner öffnen 

$$ex \quad 0.507499 = \frac{1}{1 + \exp(-0.03)}$$

19) Wirtschaftskapital 

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

Rechner öffnen 

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

20) Zinsrisiko 

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

Rechner öffnen 

$$ex \quad 2.982301 = \frac{450 - 113}{113}$$



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_v** Kreditwert im Risiko
- **CS_p** 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_{risk}** Zinsrisiko
- **L** Wahrscheinlichkeit
- **LGD** Verlust bei Zahlungsverzug



- **M₂** Modigliani-Modigliani-Maß
- **MDD** Maximaler Drawdown
- **MGI** Monatliches Bruttoeinkommen
- **MRP** Marktrisikoprämie
- **NP** Neuer Preis
- **OP** Original Preis
- **p** Wahrscheinlichkeit
- **P_{Capital}** Kapitalkosten
- **PD** Ausfallwahrscheinlichkeit
- **PEE** Öffentliches Beteiligungsengagement
- **PI** Schmerzindex
- **PR** Schmerzverhältnis
- **R** Einnahmen
- **R_{ap}** Rendite des angepassten Portfolios
- **R_f** Risikofreier Zinssatz
- **R_i** Zinsrate
- **R_{mkt}** Return-on-Market-Portfolio
- **R_p** Erwartete Portfoliorendite
- **R_{up/down}** 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_{peak}** Höchstwert
- **V_{trough}** Tiefstwert
- **WCL** Schlimmster Kreditverlust
- **Z** Lineare Kombination
- **σ_d** Standardabweichung der Abwärtsbewegung
- **σ_R** Risiko



Konstanten, Funktionen, verwendete Messungen

- **Funktion:** **exp**, $\exp(\text{Number})$

Bei einer Exponentialfunktion ändert sich der Wert der Funktion bei jeder Änderung der unabhängigen Variablen um einen konstanten Faktor.



Überprüfen Sie andere Formellisten

- **Risikomanagement Formeln** 

Fühlen Sie sich frei, dieses Dokument mit Ihren Freunden zu TEILEN!

PDF Verfügbar in

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

4/15/2024 | 10:35:36 AM UTC

[Bitte hinterlassen Sie hier Ihr Rückkoppelung...](#)

