



[calculatoratoz.com](http://calculatoratoz.com)



[unitsconverters.com](http://unitsconverters.com)

# Gestión de riesgos Fórmulas

¡Calculadoras!

¡Ejemplos!

¡Conversiones!

Marcador [calculatoratoz.com](http://calculatoratoz.com), [unitsconverters.com](http://unitsconverters.com)

Cobertura más amplia de calculadoras y creciente - ¡**30.000+** calculadoras!

Calcular con una unidad diferente para cada variable - ¡**Conversión de unidades integrada!**

La colección más amplia de medidas y unidades - ¡**250+ Medidas!**

¡Siéntete libre de COMPARTIR este documento con tus amigos!

*[Por favor, deje sus comentarios aquí...](#)*



# Lista de 20 Gestión de riesgos Fórmulas

## Gestión de riesgos

### 1) Capital económico

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

[Calculadora abierta !\[\]\(a870788d6ed9b8fd294b7654a8c8526b\_img.jpg\)](#)

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

### 2) Determinación de riesgos

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

[Calculadora abierta !\[\]\(c50c8b7b2cc2cf9ff925edec0ee94c0d\_img.jpg\)](#)

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

### 3) Diferencial de crédito

$$fx \quad CS_P = CBY - TBY$$

[Calculadora abierta !\[\]\(f60b7a900783ac3fd531bfd9c111be6d\_img.jpg\)](#)

$$ex \quad 0.54 = 2.5 - 1.96$$

### 4) Exposición a riesgos

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

[Calculadora abierta !\[\]\(83bbbd261710c59db0214aa27b2edc0d\_img.jpg\)](#)

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



## 5) Medida Modigliani-Modigliani

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

Calculadora abierta 

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

## 6) Modelo de regresión de probabilidad de incumplimiento

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

Calculadora abierta 

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

## 7) Pérdida dado el incumplimiento

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

Calculadora abierta 

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

## 8) Prima de riesgo de incumplimiento

$$fx \quad DRP = R_i - R_f$$

Calculadora abierta 

$$ex \quad 5.7 = 6 - 0.3$$


## 9) Prima de riesgo del mercado

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

Calculadora abierta 

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



10) Proporción de dolor 

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

Calculadora abierta 

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

11) Proporción esterlina 

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

Calculadora abierta 


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

12) Reducción máxima 

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

Calculadora abierta 

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

13) Relación alza/baja 

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

Calculadora abierta 

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




14) Relación de calma 

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

Calculadora abierta 

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

15) Relación de Sortino 

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

Calculadora abierta 

$$ex \quad 3.5666667 = \frac{11 - 0.3}{3}$$

16) Retorno del capital ajustado al riesgo 

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

Calculadora abierta 

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

17) Riesgo base 

$$fx \quad BR = FPC - SPHA$$

Calculadora abierta 

$$ex \quad 14755 = 22255 - 7500$$




18) Riesgo de tipo de interés 

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

Calculadora abierta 

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

19) Tolerancia al riesgo 

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

Calculadora abierta 

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

20) Valor crediticio en riesgo 

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

Calculadora abierta 

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



## Variables utilizadas

- **AI** Problemas que avanzan
- **AMDD** Reducción máxima promedio
- **ARR** Tasa de retorno promedio
- **BR** Riesgo base
- **CAGR** Tasa compuesta de crecimiento anual
- **CBY** Rendimiento de los bonos corporativos
- **CR** Relación de calma
- **CR<sub>v</sub>** Valor crediticio en riesgo
- **CS<sub>p</sub>** Diferencial de crédito
- **DI** Problemas en declive
- **DRP** Prima de riesgo de incumplimiento
- **e** Gastos
- **EaR** Ganancias en riesgo
- **EC** Capital económico
- **ECL** Pérdida crediticia esperada
- **EEMR** Tasa esperada del mercado de valores
- **eI** Pérdida esperada
- **ER** Rentabilidad efectiva
- **FPC** Precio futuro del contrato
- **ifc** Ingresos de capital
- **IR<sub>risk</sub>** Riesgo de tipo de interés
- **L** Probabilidad
- **LGD** Pérdida dado el incumplimiento



- **M<sub>2</sub>** Medida Modigliani-Modigliani
- **MDD** Reducción máxima
- **MGI** Ingreso Bruto Mensual
- **MRP** Prima de riesgo del mercado
- **NP** Nuevo precio
- **OP** Precio original
- **p** Probabilidad
- **P<sub>Capital</sub>** Costo capital
- **PD** Probabilidad de incumplimiento
- **PEE** Exposición al capital público
- **PI** Índice de dolor
- **PR** Proporción de dolor
- **R** Ganancia
- **R<sub>ap</sub>** Rendimiento de la cartera ajustada
- **R<sub>f</sub>** Tasa libre de riesgo
- **R<sub>i</sub>** Tasa de interés
- **R<sub>mkt</sub>** Rentabilidad de la cartera de mercado
- **R<sub>p</sub>** Rendimiento esperado de la cartera
- **R<sub>up/down</sub>** Relación alza/baja
- **RAROC** Retorno del capital ajustado al riesgo
- **RE** Exposición a riesgos
- **RI** Impacto del riesgo
- **Rr** Índice de recuperación
- **RR** Tarifa de regreso requerida
- **RT** Tolerancia al riesgo





- **S** Relación de Sortino
- **SPHA** Precio al contado del activo cubierto
- **SR** Proporción esterlina
- **TBY** Rendimiento de los bonos del Tesoro
- **V<sub>peak</sub>** Valor pico
- **V<sub>trough</sub>** Valor mínimo
- **WCL** Peor pérdida crediticia
- **Z** Combinación lineal
- **$\sigma_d$**  Desviación estándar de desventaja
- **$\sigma_R$**  Riesgo



## Constantes, funciones, medidas utilizadas

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

*En una función exponencial, el valor de la función cambia en un factor constante por cada cambio de unidad en la variable independiente.*



## Consulte otras listas de fórmulas

- **Gestión de riesgos Fórmulas** 

¡Siéntete libre de COMPARTIR este documento con tus amigos!

### PDF Disponible en

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

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

[Por favor, deje sus comentarios aquí...](#)

