



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



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

# Gestion des risques Formules

calculatrices !

Exemples!

conversions !

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

Couverture la plus large des calculatrices et croissantes - **30 000+ calculatrices !**

Calculer avec une unité différente pour chaque variable - **Dans la conversion d'unité intégrée !**

La plus large collection de mesures et d'unités - **250+ Mesures !**

N'hésitez pas à PARTAGER ce document avec vos amis  
!

[Veillez laisser vos commentaires ici...](#)



# Liste de 20 Gestion des risques Formules

## Gestion des risques

### 1) Capitale économique

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

[Ouvrir la calculatrice !\[\]\(a870788d6ed9b8fd294b7654a8c8526b\_img.jpg\)](#)

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

### 2) Détermination des risques

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

[Ouvrir la calculatrice !\[\]\(c50c8b7b2cc2cf9ff925edec0ee94c0d\_img.jpg\)](#)

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

### 3) Exposition à risque

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

[Ouvrir la calculatrice !\[\]\(f60b7a900783ac3fd531bfd9c111be6d\_img.jpg\)](#)

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

### 4) Mesure Modigliani-Modigliani

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

[Ouvrir la calculatrice !\[\]\(83bbbd261710c59db0214aa27b2edc0d\_img.jpg\)](#)

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



## 5) Modèle de régression de probabilité de défaut

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

[Ouvrir la calculatrice !\[\]\(cbe80b694ebd74fcfe136a095b608235\_img.jpg\)](#)

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

## 6) Perte en cas de défaut

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

[Ouvrir la calculatrice !\[\]\(3e2231b1ad3ca8da8658228c00dd08e0\_img.jpg\)](#)

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

## 7) Prime de risque de défaut

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

[Ouvrir la calculatrice !\[\]\(0d5ec72f61334709c3fc9450209b754f\_img.jpg\)](#)

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

## 8) Prime de risque de marché

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

[Ouvrir la calculatrice !\[\]\(b64b40baaee5acddc1eab8538ba84754\_img.jpg\)](#)

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



9) Rapport calme 

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

Ouvrir la calculatrice 

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

10) Rapport de douleur 

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

Ouvrir la calculatrice 


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

11) Ratio de la livre sterling 

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

Ouvrir la calculatrice 

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


12) Ratio de sortie 

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

Ouvrir la calculatrice 

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




13) Ratio hausse/baisse 

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

Ouvrir la calculatrice 


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

14) Rendement du capital ajusté en fonction du risque 

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

Ouvrir la calculatrice 


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

15) Risque de base 

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

Ouvrir la calculatrice 

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

16) Risque de taux d'intérêt 

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

Ouvrir la calculatrice 

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



17) Spread de crédit 

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

Ouvrir la calculatrice 


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

18) Tirage maximum 

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

Ouvrir la calculatrice 

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

19) Tolérance au risque 

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

Ouvrir la calculatrice 

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

20) Valeur du crédit à risque 

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

Ouvrir la calculatrice 

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



## Variables utilisées

- **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<sub>v</sub>** Valeur du crédit à risque
- **CS<sub>p</sub>** 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<sub>risk</sub>** Risque de taux d'intérêt
- **L** Probabilité
- **LGD** Perte en cas de défaut



- **M<sub>2</sub>** 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<sub>Capital</sub>** Coût en capital
- **PD** Probabilité de défaut
- **PEE** Exposition aux actions publiques
- **PI** Indice de douleur
- **PR** Rapport de douleur
- **R** Revenu
- **R<sub>ap</sub>** Rendement du portefeuille ajusté
- **R<sub>f</sub>** Taux sans risque
- **R<sub>i</sub>** Taux d'intérêt
- **R<sub>mkt</sub>** Rendement du portefeuille de marché
- **R<sub>p</sub>** Rendement attendu du portefeuille
- **R<sub>up/down</sub>** 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<sub>peak</sub>** Valeur maximale
- **V<sub>trough</sub>** Valeur minimale
- **WCL** Pire perte de crédit
- **Z** Combinaison linéaire
- **$\sigma_d$**  Écart type de la baisse
- **$\sigma_R$**  Risque



## Constantes, Fonctions, Mesures utilisées

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

*Dans une fonction exponentielle, la valeur de la fonction change d'un facteur constant pour chaque changement d'unité dans la variable indépendante.*



## Vérifier d'autres listes de formules

- **Gestion des risques Formules** 

N'hésitez pas à PARTAGER ce document avec vos amis  
!

### PDF Disponible en

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

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

[Veuillez laisser vos commentaires ici...](#)

