



calculatoratoz.com



unitsconverters.com

Gerenciamento de riscos

Fórmulas

Calculadoras!

Exemplos!

Conversões!

marca páginas calculatoratoz.com, unitsconverters.com

Maior cobertura de calculadoras e crescente - **30.000+ calculadoras!**
Calcular com uma unidade diferente para cada variável - **Conversão de unidade embutida!**

Coleção mais ampla de medidas e unidades - **250+ medições!**

Sinta-se à vontade para **COMPARTILHAR** este documento com seus amigos!

[Por favor, deixe seu feedback aqui...](#)



Lista de 20 Gerenciamento de riscos Fórmulas

Gerenciamento de riscos

1) Capital Econômico

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

[Abrir Calculadora !\[\]\(a870788d6ed9b8fd294b7654a8c8526b_img.jpg\)](#)

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

2) Determinação de Risco

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

[Abrir Calculadora !\[\]\(c50c8b7b2cc2cf9ff925edec0ee94c0d_img.jpg\)](#)

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

3) Exposição ao risco

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

[Abrir Calculadora !\[\]\(f60b7a900783ac3fd531bfd9c111be6d_img.jpg\)](#)

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

4) Medida Modigliani-Modigliani

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

[Abrir Calculadora !\[\]\(83bbbd261710c59db0214aa27b2edc0d_img.jpg\)](#)

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



5) Modelo de probabilidade de regressão padrão

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

[Abrir Calculadora !\[\]\(cbe80b694ebd74fcfe136a095b608235_img.jpg\)](#)

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

6) Perda dada a inadimplência

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

[Abrir Calculadora !\[\]\(3e2231b1ad3ca8da8658228c00dd08e0_img.jpg\)](#)

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

7) Prémio de risco de mercado

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

[Abrir Calculadora !\[\]\(0d5ec72f61334709c3fc9450209b754f_img.jpg\)](#)

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

8) Prêmio de risco padrão

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

[Abrir Calculadora !\[\]\(b64b40baaee5acddc1eab8538ba84754_img.jpg\)](#)

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

9) Proporção de vantagem/desvantagem

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

[Abrir Calculadora !\[\]\(aff7c69c44a5e015f18c35867ef3f5c3_img.jpg\)](#)

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



10) Razão Calmar 

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

Abrir Calculadora 

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

11) Razão de Sortino 

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

Abrir Calculadora 

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

12) Rebaixamento Máximo 

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

Abrir Calculadora 

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

13) Retorno sobre capital ajustado ao risco 

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

Abrir Calculadora 

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



14) Risco Básico 

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

Abrir Calculadora 


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

15) Risco da taxa de juros 

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

Abrir Calculadora 

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

16) Spread de crédito 

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

Abrir Calculadora 

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

17) Taxa de dor 

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

Abrir Calculadora 

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




18) Taxa de Libra Esterlina 

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

Abrir Calculadora 

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

19) Tolerância de risco 

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

Abrir Calculadora 

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

20) Valor de crédito em risco 

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

Abrir Calculadora 

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



Variáveis Usadas

- **AI** Avançando em questões
- **AMDD** Rebaixamento Máximo Médio
- **ARR** Taxa Média de Retorno
- **BR** Risco Básico
- **CAGR** Taxa composta de crescimento anual
- **CBY** Rendimento de títulos corporativos
- **CR** Razão Calmar
- **CR_v** Valor de crédito em risco
- **CS_p** Spread de crédito
- **DI** Problemas em declínio
- **DRP** Prêmio de risco padrão
- **e** Despesas
- **EaR** Ganhos em risco
- **EC** Capital Econômico
- **ECL** Perda de crédito esperada
- **EEMR** Taxa esperada do mercado de ações
- **eI** Perda Esperada
- **ER** Retorno Efetivo
- **FPC** Preço Futuro do Contrato
- **ifc** Renda de capital
- **IR_{risk}** Risco da taxa de juros
- **L** Probabilidade
- **LGD** Perda dada a inadimplência



- **M₂** Medida Modigliani-Modigliani
- **MDD** Rebaixamento Máximo
- **MGI** Renda Bruta Mensal
- **MRP** Prémio de risco de mercado
- **NP** Novo preço
- **OP** Preço original
- **p** Probabilidade
- **P_{Capital}** Custo capital
- **PD** Probabilidade de inadimplência
- **PEE** Exposição a ações públicas
- **PI** Índice de dor
- **PR** Taxa de dor
- **R** Receita
- **R_{ap}** Retorno do portfólio ajustado
- **R_f** Taxa livre de risco
- **R_i** Taxa de juro
- **R_{mkt}** Retorno sobre o portfólio de mercado
- **R_p** Retorno esperado do portfólio
- **R_{up/down}** Proporção de vantagem/desvantagem
- **RAROC** Retorno sobre capital ajustado ao risco
- **RE** Exposição ao risco
- **RI** Impacto do Risco
- **Rr** Taxa de recuperação
- **RR** Taxa requerida de retorno
- **RT** Tolerância de risco



- **S** Razão de Sortino
- **SPHA** Preço à vista do ativo coberto
- **SR** Taxa de Libira Esterlina
- **TBY** Rendimento dos títulos do Tesouro
- **V_{peak}** Valor de pico
- **V_{trough}** Valor mínimo
- **WCL** Pior perda de crédito
- **Z** Combinação linear
- **σ_d** Desvio padrão do lado negativo
- **σ_R** Risco



Constantes, Funções, Medidas usadas

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

Em uma função exponencial, o valor da função muda por um fator constante para cada mudança unitária na variável independente.



Verifique outras listas de fórmulas

- **Gerenciamento de riscos**

Fórmulas 

Sinta-se à vontade para COMPARTILHAR este documento com seus amigos!

PDF Disponível em

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

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

[Por favor, deixe seu feedback aqui...](#)

