



calculatoratoz.com



unitsconverters.com

Управление рисками Формулы

Калькуляторы!

Примеры!

Преобразования!

Закладка calculatoratoz.com, unitsconverters.com

Самый широкий охват калькуляторов и рост - **30 000+ калькуляторов!**

Расчет с разными единицами измерения для каждой переменной -

Встроенное преобразование единиц измерения!

Самая широкая коллекция измерений и единиц измерения - **250+ измерений!**



Не стесняйтесь **ПОДЕЛИТЬСЯ** этим документом с друзьями!

[Пожалуйста, оставьте свой отзыв здесь...](#)



Список 20 Управление рисками Формулы

Управление рисками

1) Базовый риск

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

[Открыть калькулятор !\[\]\(cbe2492b119e39e02a1dab2af4a4b296_img.jpg\)](#)

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

2) Вероятность модели регрессии по умолчанию

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

[Открыть калькулятор !\[\]\(870f5d5e9c0d57485634be3ecf52f3ca_img.jpg\)](#)

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

3) Кальмарское соотношение

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

[Открыть калькулятор !\[\]\(7d1d6890825e83a6a4a51febe2dcc7f3_img.jpg\)](#)

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



4) Кредитная стоимость под риском

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

[Открыть калькулятор !\[\]\(e78f798d4ea5c530c9db49e7d26e6b95_img.jpg\)](#)

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

5) Кредитный риск

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

[Открыть калькулятор !\[\]\(05be7c7a8995decd503647c99211f7c2_img.jpg\)](#)

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

6) Кредитный спред

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

[Открыть калькулятор !\[\]\(fe3aebe81acea8d45108cd2768939da7_img.jpg\)](#)

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

7) Максимальная просадка

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

[Открыть калькулятор !\[\]\(899d8b7697d64725bf017d3296cfcf1b_img.jpg\)](#)

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

8) Мера Модильяни-Модильяни

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

[Открыть калькулятор !\[\]\(40770d9ed6ed4f1222ebf89a1396e8b2_img.jpg\)](#)

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



9) Определение риска 

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

[Открыть калькулятор !\[\]\(e2376d476d06eb31946dc01a69a4403a_img.jpg\)](#)

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

10) Премия за риск дефолта 

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

[Открыть калькулятор !\[\]\(0b5e7e25e8775f7e7e80906ada4f0021_img.jpg\)](#)

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

11) Премия за рыночный риск 

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

[Открыть калькулятор !\[\]\(bd3b31712ad9bab5a241210fa6925cdd_img.jpg\)](#)

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

12) Рентабельность капитала с поправкой на риск 

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

[Открыть калькулятор !\[\]\(7bc43b319a082987e20f7bf78f4bab80_img.jpg\)](#)

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


13) Риск процентной ставки 

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

[Открыть калькулятор !\[\]\(4a7b4ce770af8456e11a71f9565c8c2b_img.jpg\)](#)

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




14) Соотношение боли 

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

Открыть калькулятор 

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

15) Соотношение плюс/минус 

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

Открыть калькулятор 

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

16) Соотношение Сортино 

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

Открыть калькулятор 

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


17) Стерлинговый коэффициент 

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

Открыть калькулятор 

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



18) Толерантность к риску 

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

[Открыть калькулятор !\[\]\(9dfdaff1d86ba3c1f8353b4d1b61b8c5_img.jpg\)](#)

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

19) Убыток при дефолте 

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

[Открыть калькулятор !\[\]\(2b376d1a92330ab09dad2665d2f89bf5_img.jpg\)](#)

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

20) Экономический капитал 

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

[Открыть калькулятор !\[\]\(c444627dab9fee9a1550c053ffaaaae2_img.jpg\)](#)

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



Используемые переменные

- **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_v** Кредитная стоимость под риском
- **CS_p** 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_{risk}** Риск процентной ставки
- **L** Вероятность
- **LGD** Убыток при дефолте



- **M_2** Мера Модильяни-Модильяни
- **MDD** Максимальная просадка
- **MGI** Ежемесячный валовой доход
- **MRP** Премия за рыночный риск
- **NP** Новая цена
- **OP** Изначальная цена
- **p** Вероятность
- **P_{Capital}** Капитальные затраты
- **PD** Вероятность дефолта
- **PEE** Публичный акционерный капитал
- **PI** Индекс боли
- **PR** Соотношение боли
- **R** Доход
- **R_{ap}** Рентабельность скорректированного портфеля
- **R_f** Безрисковая ставка
- **R_i** Процентная ставка
- **R_{mkt}** Рыночный портфель
- **R_p** Ожидаемая доходность портфеля
- **$R_{\text{up/down}}$** 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_{peak}** Пиковое значение
- **V_{trough}** Минимальная стоимость
- **WCL** Худшая кредитная потеря
- **Z** Линейная комбинация
- **σ_d** Стандартное отклонение отрицательной стороны
- **σ_R** Риск



Константы, функции, используемые измерения

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

В показательной функции значение функции изменяется на постоянный коэффициент при каждом изменении единицы независимой переменной.



Проверьте другие списки формул

- **Управление рисками**
Формулы 

Не стесняйтесь **ПОДЕЛИТЬСЯ** этим документом с друзьями!

PDF Доступен в

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

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

[Пожалуйста, оставьте свой отзыв здесь...](#)

