

Importante Gerenciamento de riscos Fórmulas PDF



Fórmulas Exemplos com unidades

Lista de 20 Importante Gerenciamento de riscos Fórmulas

1) Capital Econômico Fórmula

Fórmula

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

Exemplo

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

Avaliar Fórmula

2) Determinação de Risco Fórmula

Fórmula

$$\sigma_R = RI \cdot L$$

Exemplo

$$84 = 21 \cdot 4$$

Avaliar Fórmula

3) Exposição ao risco Fórmula

Fórmula

$$RE = RI \cdot p$$

Exemplo

$$10.5 = 21 \cdot 0.5$$

Avaliar Fórmula

4) Medida Modigliani-Modigliani Fórmula

Fórmula

$$M_2 = R_{ap} - R_{mkt}$$

Exemplo

$$20.1 = 25 - 4.9$$

Avaliar Fórmula

5) Modelo de probabilidade de regressão padrão Fórmula

Fórmula

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

Exemplo

$$0.5075 = \frac{1}{1 + \exp(-0.03)}$$

Avaliar Fórmula

6) Perda dada a inadimplência Fórmula

Fórmula

$$LGD = 1 - R_r$$

Exemplo

$$0.6 = 1 - 0.4$$

Avaliar Fórmula

7) Prêmio de risco de mercado Fórmula

Fórmula

$$MRP = EEMR - R_f$$

Exemplo

$$18.7 = 19 - 0.3$$

Avaliar Fórmula



8) Prêmio de risco padrão Fórmula

Fórmula

$$DRP = R_i - R_f$$

Exemplo

$$5.7 = 6 - 0.3$$

Avaliar Fórmula 

9) Proporção de vantagem/desvantagem Fórmula

Fórmula

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

Exemplo

$$3.0909 = \frac{17}{5.5}$$

Avaliar Fórmula 

10) Razão Calmar Fórmula

Fórmula

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

Exemplo

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

Avaliar Fórmula 

11) Razão de Sortino Fórmula

Fórmula

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

Exemplo

$$3.5667 = \frac{11 - 0.3}{3}$$

Avaliar Fórmula 

12) Rebaixamento Máximo Fórmula

Fórmula

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

Exemplo

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

Avaliar Fórmula 

13) Retorno sobre capital ajustado ao risco Fórmula

Fórmula

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

Exemplo

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

Avaliar Fórmula 

14) Risco Básico Fórmula

Fórmula

$$BR = FPC - SPHA$$

Exemplo

$$14755 = 22255 - 7500$$

Avaliar Fórmula 

15) Risco da taxa de juros Fórmula

Fórmula

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

Exemplo

$$2.9823 = \frac{450 - 113}{113}$$

Avaliar Fórmula 



16) Spread de crédito Fórmula

Fórmula

$$CS_p = CBY - TBY$$

Exemplo

$$0.54 = 2.5 - 1.96$$

Avaliar Fórmula 

17) Taxa de dor Fórmula

Fórmula

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

Exemplo

$$7.3333 = \frac{110}{15}$$

Avaliar Fórmula 

18) Taxa de Libra Esterlina Fórmula

Fórmula

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

Exemplo

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

Avaliar Fórmula 

19) Tolerância de risco Fórmula

Fórmula

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

Exemplo

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

Avaliar Fórmula 

20) Valor de crédito em risco Fórmula

Fórmula

$$CR_v = WCL - ECL$$

Exemplo

$$12500 = 33000 - 20500$$

Avaliar Fórmula 



Variáveis usadas na lista de Gerenciamento de riscos Fórmulas acima

- **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** Prêmio 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

Constantes, funções, medidas usadas na lista de Gerenciamento de riscos Fórmulas acima

- **Funções:** **exp**, **exp(Number)**
Em uma função exponencial, o valor da função muda por um fator constante para cada mudança unitária na variável independente.



- **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 Libra 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



- **Importante Gerenciamento de riscos**
Fórmulas 

Experimente nossas calculadoras visuais exclusivas

-  **Fração própria** 
-  **MMC de dois números** 

Por favor, COMPARTILHE este PDF com alguém que precise dele!

Este PDF pode ser baixado nestes idiomas

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

7/9/2024 | 6:37:12 AM UTC

