

calculatoratoz.comunitsconverters.com

Gestione del rischio Formule

[Calcolatrici!](#)[Esempi!](#)[Conversioni!](#)

Segnalibro calculatoratoz.com, unitsconverters.com

La più ampia copertura di calcolatrici e in crescita - **30.000+ calcolatrici!**
Calcola con un'unità diversa per ogni variabile - **Nella conversione di unità
costruita!**

La più ampia raccolta di misure e unità - **250+ misurazioni!**

Sentiti libero di CONDIVIDERE questo documento con i
tuoi amici!

[Si prega di lasciare il tuo feedback qui...](#)



Lista di 20 Gestione del rischio Formule

Gestione del rischio ↗

1) Capitale economico ↗

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

[Apri Calcolatrice ↗](#)

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

2) Determinazione del rischio ↗

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

[Apri Calcolatrice ↗](#)

ex
$$84 = 21 \cdot 4$$

3) Diffusione del credito ↗

fx
$$CS_P = CBY - TBY$$

[Apri Calcolatrice ↗](#)

ex
$$0.54 = 2.5 - 1.96$$

4) Esposizione al rischio ↗

fx
$$RE = RI \cdot p$$

[Apri Calcolatrice ↗](#)

ex
$$10.5 = 21 \cdot 0.5$$



5) Misura Modigliani-Modigliani

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

[Apri Calcolatrice !\[\]\(cbe80b694ebd74fcfe136a095b608235_img.jpg\)](#)

ex $20.1 = 25 - 4.9$

6) Modello di regressione della probabilità di default

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

[Apri Calcolatrice !\[\]\(3e2231b1ad3ca8da8658228c00dd08e0_img.jpg\)](#)

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

7) Perdita data predefinita

fx $LGD = 1 - Rr$

[Apri Calcolatrice !\[\]\(0d5ec72f61334709c3fc9450209b754f_img.jpg\)](#)

ex $0.6 = 1 - 0.4$

8) Prelievo massimo

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

[Apri Calcolatrice !\[\]\(b64b40baaee5acddc1eab8538ba84754_img.jpg\)](#)

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



9) Premio per il rischio di default ↗

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

Apri Calcolatrice ↗

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

10) Premio per il rischio di mercato ↗

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

Apri Calcolatrice ↗

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

11) Rapporto del dolore ↗

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

Apri Calcolatrice ↗

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

12) Rapporto di calma ↗

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

Apri Calcolatrice ↗

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



13) Rapporto rialzo/ribasso ↗

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

Apri Calcolatrice ↗

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

14) Rapporto Sortino ↗

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

Apri Calcolatrice ↗

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

15) Rapporto sterlina ↗

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

Apri Calcolatrice ↗

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

16) Rendimento del capitale corretto per il rischio ↗

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

Apri Calcolatrice ↗

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



17) Rischio del tasso di interesse ↗

fx
$$\text{IR}_{\text{risk}} = \frac{\text{OP} - \text{NP}}{\text{NP}}$$

[Apri Calcolatrice ↗](#)

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

18) Rischio di base ↗

fx
$$\text{BR} = \text{FPC} - \text{SPHA}$$

[Apri Calcolatrice ↗](#)

ex
$$14755 = 22255 - 7500$$

19) Tolleranza al rischio ↗

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

[Apri Calcolatrice ↗](#)

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

20) Valore del credito a rischio ↗

fx
$$\text{CR}_v = \text{WCL} - \text{ECL}$$

[Apri Calcolatrice ↗](#)

ex
$$12500 = 33000 - 20500$$



Variabili utilizzate

- **AI** Problemi avanzati
- **AMDD** Prelievo massimo medio
- **ARR** Tasso medio di rendimento
- **BR** Rischio di base
- **CAGR** Tasso di crescita composto annuo
- **CBY** Rendimento delle obbligazioni societarie
- **CR** Rapporto di calma
- **CR_v** Valore del credito a rischio
- **CS_P** Diffusione del credito
- **DI** Problemi in declino
- **DRP** Premio per il rischio di default
- **e** Spese
- **EaR** Guadagni a rischio
- **EC** Capitale economico
- **ECL** Perdita attesa sul credito
- **EEMR** Tasso atteso del mercato azionario
- **el** Perdita attesa
- **ER** Rendimento effettivo
- **FPC** Prezzo futuro del contratto
- **ifc** Reddito da capitale
- **IR_{risk}** Rischio del tasso di interesse
- **L** Probabilità
- **LGD** Perdita data predefinita



- **M₂** Misura Modigliani-Modigliani
- **MDD** Prelievo massimo
- **MGI** Reddito lordo mensile
- **MRP** Premio per il rischio di mercato
- **NP** Nuovo prezzo
- **OP** Prezzo originale
- **p** Probabilità
- **P_{Capital}** Costo del capitale
- **PD** Probabilità di default
- **PEE** Esposizione azionaria pubblica
- **PI** Indice del dolore
- **PR** Rapporto del dolore
- **R** Reddito
- **R_{ap}** Rendimento del portafoglio rettificato
- **R_f** Tasso esente da rischio
- **R_i** Tasso d'interesse
- **R_{mkt}** Rendimento del portafoglio di mercato
- **R_p** Rendimento atteso del portafoglio
- **R_{up/down}** Rapporto rialzo/ribasso
- **RAROC** Rendimento del capitale corretto per il rischio
- **RE** Esposizione al rischio
- **RI** Impatto del rischio
- **Rr** Tasso di recupero
- **RR** Tasso di rendimento richiesto
- **RT** Tolleranza al rischio



- **S** Rapporto Sortino
- **SPHA** Prezzo spot dell'asset coperto
- **SR** Rapporto sterlina
- **TBY** Rendimento dei titoli del Tesoro
- **V_{peak}** Valore di picco
- **V_{trough}** Valore minimo
- **WCL** Peggiore perdita di credito
- **Z** Combinazione lineare
- **σ_d** Deviazione standard del ribasso
- **σ_R** Rischio



Costanti, Funzioni, Misure utilizzate

- **Funzione: exp, exp(Number)**

In una funzione esponenziale, il valore della funzione cambia di un fattore costante per ogni variazione unitaria della variabile indipendente.



Controlla altri elenchi di formule

- Gestione del rischio Formule 

Sentiti libero di CONDIVIDERE questo documento con i tuoi amici!

PDF Disponibile in

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

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

[Si prega di lasciare il tuo feedback qui...](#)

