calculatoratoz.com

unitsconverters.com

# Risicomanagement Formules

Rekenmachines! Voorbeelden! Conversies!

Bladwijzer **calculatoratoz.com**, **unitsconverters.com**

Breedste dekking van rekenmachines en groeiend - **30.000_ rekenmachines!**
Bereken met een andere eenheid voor elke variabele - **In ingebouwde eenheidsconversie!**
Grootste verzameling maten en eenheden - **250+ metingen!**

DEEL dit document gerust met je vrienden!

*Laat hier uw feedback achter...*

© calculatoratoz.com. A softusvista inc. venture!

# Lijst van 20 Risicomanagement Formules

## Risicomanagement

### 1) Basisrisico

Rekenmachine openen

fx $$BR = FPC - SPHA$$

ex $$14755 = 22255 - 7500$$

### 2) Calmar-verhouding

Rekenmachine openen

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

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

### 3) Economisch Kapitaal

Rekenmachine openen

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

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

### 4) Kredietspreiding

Rekenmachine openen

fx $$CS_P = CBY - TBY$$

ex $$0.54 = 2.5 - 1.96$$

## 5) Kredietwaarde in gevaar

Rekenmachine openen

fx $$CR_v = WCL - ECL$$

ex $$12500 = 33000 - 20500$$

## 6) Marktrisicopremie

Rekenmachine openen

fx $$MRP = EEMR - R_f$$

ex $$18.7 = 19 - 0.3$$

## 7) Maximale opname

Rekenmachine openen

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

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

## 8) Modigliani-Modigliani-maatstaf

Rekenmachine openen

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

ex $$20.1 = 25 - 4.9$$

## 9) Opwaartse/neerwaartse verhouding

Rekenmachine openen

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

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

## 10) Pijnverhouding

Rekenmachine openen

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

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

## 11) Renterisico

Rekenmachine openen

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

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

## 12) Risicobepaling

Rekenmachine openen

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

ex $$84 = 21 \cdot 4$$

## 13) Risicoblootstelling

Rekenmachine openen

fx $$RE = RI \cdot p$$

ex $$10.5 = 21 \cdot 0.5$$

## 14) Risicotolerantie

Rekenmachine openen

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

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

## 15) Sortino-verhouding

Rekenmachine openen

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

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

## 16) Standaardrisicopremie

Rekenmachine openen

fx $$DRP = R_i - R_f$$

ex $$5.7 = 6 - 0.3$$

## 17) Sterling-ratio

Rekenmachine openen

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

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

## 18) Verlies bij wanbetaling

Rekenmachine openen

fx $$LGD = 1 - Rr$$

ex $$0.6 = 1 - 0.4$$

## 19) Voor risico gecorrigeerd rendement op kapitaal

Rekenmachine openen

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

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

## 20) Waarschijnlijkheid van standaardregressiemodel

Rekenmachine openen

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

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

© calculatoratoz.com. A softusvista inc. venture!

# Variabelen gebruikt

- **AI** Oprukkende problemen
- **AMDD** Gemiddelde maximale opname
- **ARR** Gemiddeld rendement
- **BR** Basisrisico
- **CAGR** Samengestelde jaarlijkse groeisnelheid
- **CBY** Rendement bedrijfsobligaties
- **CR** Calmar-verhouding
- $CR_V$ Kredietwaarde in gevaar
- $CS_P$ Kredietspreiding
- **DI** Dalende problemen
- **DRP** Standaardrisicopremie
- **e** Uitgaven
- **EaR** Inkomsten in gevaar
- **EC** Economisch Kapitaal
- **ECL** Verwacht kredietverlies
- **EEMR** Verwachte aandelenmarktrente
- **el** Verwacht verlies
- **ER** Effectief rendement
- **FPC** Toekomstige contractprijs
- **ifc** Inkomsten uit kapitaal
- $IR_{risk}$ Renterisico
- **L** Waarschijnlijkheid
- **LGD** Verlies bij wanbetaling

© calculatoratoz.com. A softusvista inc. venture!

- **$M_2$** Modigliani-Modigliani-maat
- **MDD** Maximale opname
- **MGI** Maandelijks bruto-inkomen
- **MRP** Marktrisicopremie
- **NP** Nieuwe prijs
- **OP** Originele prijs
- **p** Waarschijnlijkheid
- **$P_{Capital}$** Kapitaalkosten
- **PD** Waarschijnlijkheid van wanbetaling
- **PEE** Blootstelling aan publieke aandelen
- **PI** Pijnindex
- **PR** Pijnverhouding
- **R** Winst
- **$R_{ap}$** Rendement op aangepaste portefeuille
- **$R_f$** Risicovrij tarief
- **$R_i$** Rente
- **$R_{mkt}$** Rendement op marktportfolio
- **$R_p$** Verwacht portefeuillerendement
- **$R_{up/down}$** Opwaartse/neerwaartse verhouding
- **RAROC** Voor risico gecorrigeerd rendement op kapitaal
- **RE** Risicoblootstelling
- **RI** Risico-impact
- **Rr** Herstelpercentage
- **RR** Vereist rendement
- **RT** Risicotolerantie

© calculatoratoz.com. A softusvista inc. venture!

- **S** Sortino-verhouding
- **SPHA** Spotprijs van afgedekt actief
- **SR** Sterling-ratio
- **TBY** Rendement op staatsobligaties
- $V_{peak}$ Piekwaarde
- $V_{trough}$ Trogwaarde
- **WCL** Het ergste kredietverlies
- **z** Lineaire combinatie
- $\sigma_d$ Standaardafwijking van nadeel
- $\sigma_R$ Risico

© calculatoratoz.com. A softusvista inc. venture!

# Constanten, functies, gebruikte metingen

- Functie: **exp**, exp(Number)
  *Bij een exponentiële functie verandert de waarde van de functie met een constante factor voor elke eenheidsverandering in de onafhankelijke variabele.*

© calculatoratoz.com. A softusvista inc. venture!

## Controleer andere formulelijsten

- **Risicomanagement Formules**

DEEL dit document gerust met je vrienden!

## PDF Beschikbaar in

English Spanish French German Russian Italian Portuguese Polish Dutch

*4/15/2024 | 10:35:36 AM UTC* *Laat hier uw feedback achter...*