Spisak teorijskih pitanja za kolokvijum iz Upravljanja finansijskim rizicima:

1. Objasnite finansijski i nefinansijski rizik
2. Objasnite dinamički i statički rizik
3. Objasnite fundamentalni i posebni rizik
4. Objasnite špekulatini i čist rizik
5. Objasnite vrste čistog rizika
6. Navedite na šta se odnose Bazelski sporazumi I, II i III
7. Objasnite vrste bankarskog rizika
8. Navedite osnovne faktore koji utiču na rizik poslovanja banaka u savremenim uslovima - TRICK
9. Navedite osnovne rizike kojima su izložene banke u svom poslovanju prema Zakonu o bankama i Odluci o upravljanju rizicima banke 2012
10. Objasnite šta je rizik likvidnosti i tri vrste likvidnosti
11. Objasnite šta je kreditni rizik i koje su komponente od kojih zavisi očekivani gubitak
12. Objasnite šta je kamatni rizik i koje su komponente kamatnog rizika
13. Objasnite šta je tržišni rizik i kako se on deli
14. Objasnite šta je devizni rizik i tri vrste deviznog rizika
15. Objasnite šta je rizik usklađenosti
16. Objasnite šta je rizik izloženosti banke i koje su zakonske granice izloženosti prema jednom licu ili grupi povezanih lica
17. Objasnite rizik ulaganja
18. Objasnite šta je rizik zemlje i tri ugla posmatranja rizika zemlje
19. Objasnite tri oblika rizika zemlje
20. Objasnite šta je operativni rizik
21. Objasnite šta je rizik reputacije
22. Objasnite šta je zakonski rizik i tri oblasti zakonskog rizika prema Bazelskom komitetu
23. Objasnite šta je strateški rizik
24. Objasnite šta je rizik insajderskih aktivnosti
25. Objasnite šta je rizik rasta i koji su razlozi za zabrinutost u vezi sa rizikom rasta banke
26. Objasnite šta je informacioni rizik
27. Objasnite šta je rizik upravljanja investicionim portfeljom
28. Objasnite šta je VaR metod i koje su tri osnovne varijante VaR metodologije
29. Objasnite šta je analitički metod računanja VaR-a
30. Objasnite način izračunavanja VaR-a analitičkim metodom
31. Objasnite šta je volatilnost
32. Objasnite istorijsku i primenjenu volatilnost
33. Objasnite šta je nivo poverenja i koja su dva osnovna nivoa poverenja koja se koriste za računanje VaR-a
34. Objasnite izračunavanje VaR-a za portfolio HOV
35. Objasnite šta je koeficijent korelacije i kako on utiče na efekat diversifikacije i rizik, tj. vrednost VaR
36. Objasnite prednosti i nedostatke analitičkog metoda za izračunavanje VaR-a
37. Objasnite kako se računa stopa prinosa portfolija
38. Objasnite kako se računa očekivana tj. srednja stopa prinosa portfolija
39. Objasnite nesistemski i sistemski rizik
40. Objasnite najmanje rizičan portfolio tj. način računanja udela akcija u portfoliju u kojem je najmanja standardna devijacija
41. Objasnite šta je metod istorijske simulacije
42. Navedite osnovne korake za implementaciju metoda istorijske simulacije
43. Objasnite prednosti metoda istorijske simulacije
44. Objasnite nedostatke metoda istorijske simulacije
45. Objasnite šta je Monte Karlo simulacija
46. Navedite 6 koraka postupka procene VaR-a pomoću Monte Karlo simulacije
47. Objasnite prednosti i nedostatke Monte Karlo simulacije
48. Objasnite šta je Backtesting
49. Navedite i ukratko objasnite korake implementacije procesa Backtesting-a.