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 koje su granice izloženosti banke prema povezanom licu sa bankom i kolika je granica ukupnih velikih izloženosti koju propisuje NBS
18. Objasnite rizik ulaganja
19. Objasnite šta je rizik zemlje i tri ugla posmatranja rizika zemlje
20. Objasnite tri oblika rizika zemlje
21. Objasnite šta je operativni rizik
22. Objasnite šta je rizik reputacije
23. Objasnite šta je zakonski rizik i tri oblasti zakonskog rizika prema Bazelskom komitetu
24. Objasnite šta je strateški rizik
25. Objasnite šta je rizik insajderskih aktivnosti
26. Objasnite šta je rizik rasta i koji su razlozi za zabrinutost u vezi sa rizikom rasta banke
27. Objasnite šta je informacioni rizik
28. Objasnite šta je rizik upravljanja investicionim portfeljom
29. Objasnite šta je VaR metod i koje su tri osnovne varijante VaR metodologije
30. Objasnite šta je analitički metod računanja VaR-a
31. Objasnite način izračunavanja VaR-a analitičkim metodom
32. Objasnite šta je volatilnost
33. Objasnite istorijsku I primenjenuvolatilnost
34. Objasnite šta je nivo poverenja i koja su dva osnovna nivoa poverenja koja se koriste za računanje VaR-a
35. Objasnite izračunavanje VaR-a za portfolio HOV
36. Objasnite šta je koeficijent korelacije i kako on utiče na efekat diversifikacije i rizik, tj. vrednost VaR
37. Objasnite prednosti i nedostatke analitičkog metoda za izračunavanje VaR-a
38. Objasnite kako se računa stopa prinosa portfolija
39. Objasnite kako se računa očekivana tj. srednja stopa prinosa portfolija
40. Objasnite nesistemski i sistemski rizik
41. Objasnite najmanje rizičan portfolio tj. način računanja udela akcija u portfoliju u kojem je najmanja standardna devijacija
42. Objasnite šta je metod istorijske simulacije
43. Navedite osnovne korake za implementaciju metoda istorijske simulacije
44. Objasnite prednosti metoda istorijske simulacije
45. Objasnite nedostatke metoda istorijske simulacije
46. Objasnite šta je Monte Karlo simulacija
47. Navedite 6 koraka postupka procene VaR-a pomoću Monte Karlo simulacije
48. Objasnite prednosti i nedostatke Monte Karlo simulacije
49. Objasnite šta je Backtesting
50. Navedite i ukratko objasnite korake implementacije procesa Backtesting-a.