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 špekulativni i čist rizik
5. Navedite na šta se odnose Bazelski sporazumi I, II i III
6. Navedite rizike kojima su izložene banke u svom poslovanju
7. Objasnite šta je rizik likvidnosti i tri vrste likvidnosti
8. Objasnite šta je kreditni rizik i koje su komponente od kojih zavisi očekivani gubitak
9. Objasnite šta je kamatni rizik i koje su komponente kamatnog rizika
10. Objasnite šta je tržišni rizik
11. Objasnite šta je devizni rizik
12. Objasnite šta je rizik usklađenosti
13. Objasnite šta je rizik izloženosti banke
14. Objasnite rizik ulaganja
15. Objasnite šta je rizik zemlje
16. Objasnite šta je operativni rizik
17. Objasnite šta je rizik reputacije
18. Objasnite šta je zakonski rizik i tri oblasti zakonskog rizika prema Bazelskom komitetu
19. Objasnite šta je strateški rizik
20. Objasnite šta je rizik insajderskih aktivnosti
21. Objasnite šta je informacioni rizik
22. Objasnite šta je rizik upravljanja investicionim portfeljom
23. Objasnite šta je VaR metod i koje su tri osnovne varijante VaR metodologije
24. Objasnite šta je analitički metod računanja VaR-a
25. Objasnite način izračunavanja VaR-a analitičkim metodom
26. Objasnite šta je volatilnost
27. Objasnite šta je nivo poverenja i koja su dva osnovna nivoa poverenja koja se koriste za računanje VaR-a
28. Objasnite izračunavanje VaR-a za portfolio HOV
29. Objasnite šta je koeficijent korelacije i kako on utiče na efekat diversifikacije i rizik
30. Objasnite prednosti i nedostatke analitičkog metoda za izračunavanje VaR-a
31. Objasnite kako se računa stopa prinosa portfolija
32. Objasnite nesistemski i sistemski rizik
33. Objasnite najmanje rizičan portfolio
34. Objasnite šta je metod istorijske simulacije
35. Navedite osnovne korake za implementaciju metoda istorijske simulacije
36. Objasnite prednosti i nedostatke metoda istorijske simulacije
37. Objasnite šta je Monte Karlo simulacija
38. Objasnite prednosti i nedostatke Monte Karlo simulacije
39. Objasnite šta je Backtesting
40. Objasnite VAR metodologiju za devizni rizik