1

Marks: 1

Premija rizika, odnosno veća vrijednost očekivanog prinosa vezana je uz:

Odaberite jedan odgovor.

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
|  | a. tečajni rizik |  |
|  | b. veličinu portfelja |  |
|  | c. nesistematsku komponentu rizika |  |
|  | d. kreditni rizik |  |
|  | e. sistematsku komponentu rizika |  |

2

Marks: 1

Može li se rizik potpuno eleminirati diverzifikacijom portfelja?

Odgovor:

Točno Netočno

3

Marks: 1

Ako je očekivani povrat portfelja 10,5%, a udio vrijednosnica V1 i V2 po 50% koliki će biti očekivani prinos vrijednosnice V2, ako je očekivani prinos vrijednosnice V1 15%.

Odaberite jedan odgovor.

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
|  | a. 3% |  |
|  | b. 12,5% |  |
|  | c. 6% |  |
|  | d. 7,5% |  |
|  | e. 1,5% |  |

4

Marks: 1

Mjere izloženosti riziku su metode pomoću kojih se mogu kvantificirati/procijeniti rizici kojima je tvrtka izložena na tržištu. Koje su od nabrojanih izraza upravo te mjere:

Odaberite bar jedan odgovor.

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
|  | a. cash-and-carry |  |
|  | b. profit-at-risk |  |
|  | c. risk-at-work |  |
|  | d. cost-and-benefit |  |
|  | e. value-at-risk |  |

5

Marks: 1

Kako bi se ograničio utjecaj nesigurnosti u poslovanju koristi se kombinacija različitih financijskih instrumenata koja se naziva:

Odaberite jedan odgovor.

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
|  | a. portfelj |  |
|  | b. diverzifikacija rizika |  |
|  | c. skup metoda za uklanjanje rizika |  |

6

Marks: 1

Povrat na uložena sredstva u portfelju je:

Odaberite jedan odgovor.

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
|  | a. određen stopom inflacije |  |
|  | b. određen statističkim očekivanjem prinosa svakog dijela imovine |  |
|  | c. određen kamatnom stopom |  |
|  | d. određen ugovorenim prinosom svakog dijela imovine |  |
|  | e. određen djelomično ugovorenim prinosom, a djelomično statistički očekivanim prinosom što ovisi o vrsti dijela imovine |  |

7

Marks: 1

Promjena poreznog sustava ima utjecaja na cijenu energije. Rizik zbog te promjene je:

Odaberite bar jedan odgovor.

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
|  | a. socijalni rizik |  |
|  | b. operativni rizik |  |
|  | c. politički rizik |  |
|  | d. rizik likvidnosti tržišta |  |
|  | e. tečajni rizik |  |

8

Marks: 1

Metodologije izračuna vrijednosti value-at-risk su:

Odaberite bar jedan odgovor.

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
|  | a. analitički VaR |  |
|  | b. pseudo Monte Carlo simulacija |  |
|  | c. simulacija na osnovu povijesnih podataka |  |
|  | d. statistički VaR |  |
|  | e. Monte Carlo simulacija |  |

9

Marks: 1

Rizik likvidnosti tržišta karakterističan je za situaciju na tržištu kad:

Odaberite bar jedan odgovor.

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
|  | a. kupac ne može dobiti kredit za kupovinu proizvoda |  |
|  | b. potrošači nisu raspoloženi za kupovinu određenog proizvoda |  |
|  | c. je velika razlika između ponude za kupovinu i prodaju |  |
|  | d. kupac nema novca za kupovinu proizvoda |  |
|  | e. je nemogućnost nalaženja suugovaratelja za određeni proizvod |  |

10

Marks: 1

Tečajni rizik je karakterističan samo za tržište električne energije.

Odgovor:

Točno Netočno

9.5/10