



**Вопросы по дисциплине – Финансовый менеджмент  
( продвинутый курс) профильный курс.**

1. Цели создания и состав Совета по результативности инвестирования (Investment Performance Council – IPC).
2. Глобальные стандарты результативности инвестирования - Global Investment Performance Standards (GIPS®).
3. Подходы используемые CFA Institute при подготовке Chartered Financial Analyst – CFA (дипломированный финансовый аналитик).
4. Популярность и признание сертификата CFA.
5. Определение фирмы – требования. Основные принципы следования стандартам – Требования.
6. Рыночная оценка общих активов фирмы.
7. Документирование правил и процедур, используемые при установлении и поддержании соответствия требованиям стандартов GIPS.
8. Основные обязательства фирмы- требования.
9. Предоставление списка Композита и описание Композитов любому потенциальному клиенту по запросу.
- 10.Верификация. Аттестация третьей стороной - независимым верификатором - процессов и процедур фирмы по оценке результативности инвестирования.
- 11.Фиксация и сохранность информации, необходимых для обеспечения представления результатов инвестирования фирмы и выполнения требуемых расчетов.
- 12.Оценка ценных бумаг с фиксированным доходом.
- 13.Учет дивидендов, вознаграждение инвестиционного управляющего.
- 14.Понятие полной доходности, взвешенные по времени ставки доходности, внешние потоки средств, геометрическая связь доходностей за отдельные периоды.
- 15.Периоды оценки портфелей, понятие Большого Внешнего Потока Средств: оценка ценных бумаг с фиксированным доходом, учет дивидендов, вознаграждение инвестиционного управляющего.
- 16.Основные требования о включении дискреционных, недискреционных и находящихся под управлением без вознаграждения портфелей в Композиты фирмы.
- 17.Порядок включения в Композит новых портфелей и портфелей, прекративших существование
- 18.Использование сегмента Выделенных Активов для представления дискреционного портфеля и доходности Композита.
- 19.Искусственные и модельные портфели.
- 20.Определение общих активов фирмы, информация о доступности полного списка Композитов фирмы и их описание.

21. Использование индексов, очищенных от налогов, налоговый базис эталона, налоговый базис Композита.
22. Раскрытие информации о конфликте национального законодательства и нормативного регулирования со стандартами GIPS.
23. Стандарт 1. Профессионализм. Рекомендуемые процедуры для соответствия. Применение стандарта.
24. Стандарт 2. Целостность рынков капитала А. Рекомендуемые процедуры для соответствия. Применение стандарта.
25. Стандарт 3. Обязанности клиентов. Рекомендуемые процедуры для соответствия. Применение стандарта.
26. Стандарт 4. Обязанности работодателей. Рекомендуемые процедуры для соответствия. Применение стандарта.
27. Стандарт 5. Инвестиционный анализ, рекомендации и действия. Рекомендуемые процедуры для соответствия. Применение стандарта.
28. Стандарт 6. Конфликт интересов.
29. Процедуры инвестиционных решений. Подходы к оценке эффективности управления портфелем.
30. Рыночный и общий риск портфеля. Влияние портфеля на полный уровень риска клиента. Апостериорные альфа и бетта
31. Коэффициент Шарпа (коэффициент «доходность-разброс»).
32. Коэффициент Трейнора (коэффициент «доходность-изменчивость»). Альфы Дженсена.
33. Коэффициент Дж. Швагера. Коэффициент Сортино.
34. Понятие и классификация фондовых рынков. Алгоритм инвестиционных процедур на казахстанской фондовой бирже.
35. Выбор брокера, выбор ценных бумаг, выбор инвестиционных стратегий и технологий.
36. Ликвидность ценных бумаг. Участие в торгах и выбор позиции на торгах.
37. Различия между казахстанскими и мировыми фондовыми площадками
38. Понятие портфеля активов. Описание и классификация портфелей.
39. Информационное обеспечение финансового менеджмента. Информационное обеспечение фондового рынка.
40. Матричный метод в финансовом менеджменте.
41. Применение метода Монте-Карло для оценки инвестиционных проектов
42. Введение в Visual Basic for Applications
43. Как проводится максимизация коэффициента Шарпа. Введение запрета на продажу без покрытия
44. Определение стохастической природы входных переменных, имитация движения входных переменных, моделирование, многократное повторение процесса.
45. Методы установки надстройки SimTools в Excel для реализации

имитационного моделирования.

46. Примеры применения имитационного моделирования в корпоративных финансах.
47. Формулирование требований слушателей по эксплуатации имитационного моделирования, обсуждение, выводы.
48. Назовите функции, определяемые пользователем. Типы, циклы, массивы и объекты. Макросы и взаимодействие с пользователем.
49. Раскрыть конвертация депозитарных расписок.
50. Проблемы информационного обеспечения на казахстанской фондовой бирже. Платные ресурсы, аналитика
51. Выбор брокера, выбор ценных бумаг, выбор инвестиционных стратегий и технологий. Ликвидность ценных бумаг.
52. Какие бывают различия между казахстанской и мировыми фондовыми площадками.
53. Раскрыть конвертация депозитарных расписок.
53. Проблемы информационного обеспечения на казахстанской фондовой бирже. Платные ресурсы, аналитика.
54. Матричные операции: умножение на скаляр, сложение, транспонирование, умножение и обращение матриц. Функции для работы с массивами.
55. Построение матрицы избыточных доходностей. Построение дисперсионно-ковариационной матрицы.
56. Методы вычисления доходности и дисперсии портфеля.
57. Построение эффективного портфеля не содержащего/содержащего безрисковый актив.
58. Как проводится максимизация коэффициента Шарпа. Введение запрета на продажу без покрытия
59. Примеры применения имитационного моделирования в корпоративных финансах.
60. Формулирование требований слушателей по эксплуатации имитационного моделирования, обсуждение, выводы.

## ВОПРОСЫ

для экзамена по дисциплине

«Управление финансовыми рисками»

для магистратуры профильное направление

1. Финансовые риски, их классификация и особенности
2. Понятие финансового риска, его основные элементы
3. Причины возникновения финансового риска
4. Классификация рисков.
5. Количественное определение степени риска, «стоимости риска»
6. Понятие «риск», его виды и типы по основным классификационным признакам.
7. Финансовый риск: сущность и классификация
8. Сущность и функции финансового риск-менеджмента
9. Система финансового риск-менеджмента: основная характеристика и элементы
10. Цели и задачи системы финансового риск-менеджмента
11. Основные этапы управления финансовыми рисками
12. Современные тенденции и перспективы управления финансовыми рисками
13. Развитие теории риска в процессе эволюции экономической мысли
14. Характеристика риска как объекта финансового управления предприятием
15. Сущность, цель и задачи управления финансовыми рисками предприятия
16. Функции и механизм управления финансовыми рисками предприятия
17. Содержание процесса управления финансовыми рисками предприятия
18. Система информационного обеспечения управления финансовыми рисками предприятия
19. Система риск-анализа финансовой деятельности предприятия
20. Система риск-планирования финансовой деятельности предприятия
21. Система риск-контроллинга финансовой деятельности предприятия
22. Методический инструментарий оценки уровня риска
23. Исследование несистематических и несистематических финансовых рисков предприятия
24. Методы обоснования управленческих решений в условиях риска и неопределенности
25. Подходы к управлению (снижению и уменьшению) финансовыми рисками: лимитирование, диверсификация, страхование
26. Подходы к управлению (снижению и уменьшению) финансовыми рисками: управление активами и пассивами, хеджирование
27. Внутренние механизмы нейтрализации финансовых рисков предприятия (избежание, лимитирование, хеджирование, диверсификация, трансферт)

28. Методический инструментарий оценки «стоимости под риском» (value-at-risk)
29. Особенности управления финансовыми рисками в операционной деятельности предприятия
30. Особенности управления финансовыми рисками в инвестиционной деятельности предприятия
31. Особенности нейтрализации риска банкротства в процессе кризисного финансового развития предприятия
32. Сущность и задачи антикризисного финансового управления предприятием
33. Управление риском снижения финансовой устойчивости предприятия
34. Риск банкротства: определение, экономическая сущность
35. Специфические показатели количественной оценки степени риска (бета-коэффициент)
36. Анализ финансового состояния как метод количественной оценки риска
37. Основные коэффициенты финансового состояния, используемые для оценки рисков банкротства
38. Методы оценки риска в инвестиционных проектах
39. Принятие рискованных решений в условиях неопределенности
40. Сущность и содержание риск-менеджмента
41. Структура риск-менеджмента объекты и субъекты управления рисками
42. Функции риск-менеджмента, функции объекта и субъекта управления рисками
43. Цели риска, стоимость риска. Схема организации риск-менеджмента
44. Виды финансовых рисков организации
45. Факторы, влияющие на уровень финансовых рисков
46. Подходы к оценке финансовых рисков
47. Методы управления финансовыми рисками
48. Основные способы снижения финансовых рисков
49. Особенности применения способа лимитирования финансовых рисков
50. Сущность риск-анализа, его основные этапы.
51. Методы и инструменты качественной и количественной оценки финансовых рисков.
52. Основные способы ограничения и управления финансовыми рисками. Способы хеджирования финансовых рисков.
53. Сущность и виды страхования финансовых рисков. Методы страхования финансовых рисков
54. Сущность диверсификации финансовых рисков, типы диверсификации.
55. Сущность и механизм лимитирования финансовых рисков. Понятие индивидуального, совокупного, текущего лимита.
56. Рыночный риск: сущность, классификация и формы
57. Процентный риск: сущность и классификация
58. Валютный риск: сущность и классификация
59. Риск ликвидности: сущность и классификация

60. Операционный риск: сущность и классификация. Методы управления.

для экзамена по дисциплине  
«Управление финансовыми рисками»  
для магистратуры профильное направление

1. Финансовые риски, их классификация и особенности
2. Понятие финансового риска, его основные элементы
3. Причины возникновения финансового риска
4. Классификация рисков
5. Количественное определение степени риска, «стоимости риска»
6. Понятие «риска», его виды и типы по основным классификационным признакам
7. Финансовый риск: сущность и классификация
8. Сущность и функции финансового риск-менеджмента
9. Система финансового риск-менеджмента: основная характеристика и элементы
10. Цели и задачи системы финансового риск-менеджмента
11. Основные этапы управления финансовыми рисками
12. Современные тенденции и перспективы управления финансовыми рисками
13. Развитие теории риска в процессе эволюции экономической мысли
14. Характеристика риска как объекта финансового управления предприятием
15. Сущность, цель и задачи управления финансовыми рисками предприятия
16. Функции и механизм управления финансовыми рисками предприятия
17. Содержание процесса управления финансовыми рисками предприятия
18. Система информационного обеспечения управления финансовыми рисками предприятия
19. Система риск-анализа финансовой деятельности предприятия
20. Система риск-планирования финансовой деятельности предприятия
21. Система риск-контроллинга финансовой деятельности предприятия
22. Методический инструментарий оценки уровня риска
23. Исследование несистематических и систематических финансовых рисков предприятия
24. Методы обоснования управленческих решений в условиях риска и неопределенности
25. Подходы к управлению (снижению и уменьшению) финансовыми рисками: лимитирование, диверсификация, страхование
26. Подходы к управлению (снижению и уменьшению) финансовыми рисками: управление активами и пассивами, хеджирование
27. Внутренние механизмы нейтрализации финансовых рисков предприятия (азбужание, лимитирование, хеджирование, диверсификация, трансферт)

**Вопросы по дисциплине «Стратегический банковский менеджмент»**

«Утверждаю»

Ректор Карагандинского университета

д.э.н., профессор

Аймагамбетов Е.Б.

« \_\_\_\_\_ » \_\_\_\_\_ 2017 г.

**Перечень**

**экзаменационных вопросов для подготовки к ГАК кафедры**

**«Банковское дело»**

**по специальности магистратуры**

**6М050900 «Финансы»**

1. Эволюция взглядов различных школ финансового менеджмента и его влияние на формирование банковского менеджмента.
2. Необходимость финансового менеджмента, его цель и задачи в деятельности Банков второго уровня.
3. Финансовый менеджмент как система управления, орган управления, форма предпринимательской деятельности.
4. Сущность международного финансового менеджмента. Влияние мирового финансового кризиса на функционирование международных рынков денег и капитала.
5. Стратегия и тактика банковского менеджмента: объект и субъект управления в банках второго уровня.
6. Принципы организации стратегического банковского менеджмента.
7. Стратегический банковский менеджмент в условиях финансового кризиса.
8. Сущность финансовых рисков в банках второго уровня. Политика управления банковскими рисками.
9. Особенности стратегического банковского менеджмента: цели и направления. Функции стратегического банковского менеджмента.
10. Организационная структура современного банка. Структурирование должностей и функциональные обязанности в банке.
11. Формирование кадрового потенциала банка. Мотивация труда и её инструменты.
12. Стратегии управления коммерческим банком.
13. Кредитная политика коммерческого банка
14. Депозитная политика коммерческого банка
15. Управление прибылью банка
16. Механизм формирования собственного капитала банка. Управление собственным капиталом
17. Управление ликвидностью банка. Показатели ликвидности
18. Стратегии управления банковскими рисками



19. Стратегии управления пассивами на микро- и макроуровне
20. Банковский надзор: цели, задачи, виды. Рейтинговая система оценки деятельности банка.
21. Маркетинговые исследования и методы их проведения на рынке банковских услуг.
22. Конкуренция и конкурентоспособность банковской услуги
23. Маркетинговые коммуникации и создание новых банковских услуг в системе планирования маркетинга инноваций
24. Ценовая политика коммерческого банка и механизм формирования цен на банковские услуги
25. Сбытовая политика банка и методы стимулирования сбыта банковских услуг
26. Имидж банка и банковские услуги.
27. Реклама – направление реализации коммуникационной политики банка в сфере банковских услуг.
28. Теоретические аспекты клиентской базы банка. Система привлечения клиентов банками
29. Рефинансирование кредитных организаций, его инструменты
30. Направления и назначение процентной политики центрального банка
31. Цели и задачи валютного регулирования в РК
32. Общая характеристика системы стратегического банковского менеджмента
33. Организация банковской деятельности
34. Стратегическое и оперативное планирование деятельности банка
35. Банковский маркетинг в системе управления банковской деятельностью
36. Содержание и роль аналитической работы в деятельности банка
37. Внутренний контроль как инструмент банковского менеджмента
38. Стратегическое управление персоналом банка
39. Оценка деятельности коммерческого банка
40. Характеристика финансового менеджмента. Управление ликвидностью банка
41. Управление прибылью банка
42. Управление пассивами банка
43. Управление активами и пассивами
44. Управление кредитом и кредитными рисками
45. Управление расчетными технологиями риском
47. Управление валютным риском
48. Анализ финансовых результатов и рентабельности банка
49. Управление рыночными рисками
50. Управление банковскими инновациями
51. Управление банками в процессе санации
52. Управление безопасностью коммерческого банка
53. Управление портфельным риском и продажа банковских продуктов и услуг

54. Управление ценностью активов и потребность банка в стратегическом планировании
55. Рыночные показатели банковского риска
56. Управление процентным риском
57. Приведение организационной структуры в соответствии со стратегией.
58. Стратегические преимущества и недостатки различных банковских структур управления.
59. Перспектива деятельности по адаптации структур.
60. Организационная перестройка банка, выступающих на международных и глобальных рынках.

д.э.н., профессор

Аймагамбетов Е.Б.

2017 г.

ЭКЗАМЕНАЦИОННЫЕ ВОПРОСЫ  
К ГОСУДАРСТВЕННОМУ ЭКЗАМЕНУ  
ПО СПЕЦИАЛЬНОСТИ 6М050900 «ФИНАНСЫ»  
МАГИСТРАТУРА

Обсуждены и одобрены  
на заседании кафедры  
«Банковское дело»  
Протокол №8 от 25 марта 2017 г.  
Зав.кафедрой БД  
д.э.н., профессор  
Талимова Л.А.

Караганда 2017