

재무위험관리사 (FRM)

실제시험 문제 복원 part 3.

1. 조건부확률문제(정시,정종) $P(B | A) = P(A \cap B) / P(A)$ ($P(A) > 0$ 일 때)
2. 최빈수, 중위수, 변동계수 정의문제 출제
3. 결합확률분포 X 의 기댓값? 묻는 문제 출제
4. 객관식 틀린거를 고르는 문제 중 틀린 보기 – 추정량 $E(\theta) = 0$ (x)
5. 귀무가설,제1종오류 유의수준 묻는 문제 출제
6. 오차항관련문제 보기)오차항 분산 1, 오차항평균0, 정규분포,독립점
7. 결정계수R 구하는 문제 출제
8. 기대수익률과 표준편차 구하는문제 출제
9. 이항분포 문제 출제
10. 신주인수권부사채에서 부채감소(x)문제 출제
11. Callable bond문제 출제
12. 표면이자율 > 시장이자율 -> 할증거래
13. 직접수익률(경상수익률)구하는 문제 출제
14. 듀레이션 개념 문제 출제
15. 수정듀레이션으로 채권가격 구하는 문제 출제
16. 채권투자전략 종류 문제 출제
17. ABS와 MBS 특성 섞어 놓고 한가지 특성 다른 거 찾는문 제 출제
MBS를으면서, ABS 특성인 자산보유자의 신용도와 분리되어 자산자체의 신용도로 발행
(긴장한 상태에서 급하게 풀면 헷갈리는 문제입니다)

18. Pass-through, pay-through 바꿔서 내용 문제 출제
19. 할인채, 이표채, 복리채 구해서 젤 이자 큰 금액을 묻는 문제 출제
20. 채권수익으로 가정 거리가 먼 것? 배당수익(x)
21. 선도이자율 구하는 계산 문제 출제
22. 영업용 순자본 산정시 차감해야 할 항목에 해당되지 않는 문제 출제
23. 객관식 맞는거를 고르는 문제 중 맞는 보기 - 내부통제(광의) > 컴플라이언스
24. 파생상품 정의 묻는 문제 출제
25. 공정가치 위험회피회계 활동 묻는 문제 출제
26. 컨버전 전략 묻는 문제 보기에 "풋매수,콜매도" 전략은? 묻는 문제 출제
27. 콜옵션 매수,풋옵션 매수 세타의 부호 묻는 문제 출제
28. 래더 콜, 래더 풋 구하는 문제 출제
29. 잠재노출,실제노출,보기에 잠재노출(0), 실제노출(+) -> 아님
30. Bid rate = 국채 offer 수익률 + bid spread 구하는 문제 출제
31. 객관식 맞는거를 고르는 문제 중 맞는 보기 - 만기 원금 교환이 적용환율을만기환율과 관계없이 거래시점의 환율이 동일하게 적용
32. 고정금리와 변동금리 교환 currency coupon swap 찾는 문제 출제
33. 외화투자 가지고 있을 때 자국통화 금리상승시 바람직한 통화스왑?
34. 금리스왑의 방향에서 유리한 스왑은행제시가격? 묻는 문제 출제
35. Step-up 문제 출제
36. 한계 VaR구하는 문제 출제
37. 지수가중 이동평균법 EWMA를 계산문제가 아닌 무슨 가중치와 %를 묻는 문제 출제
(이해하기 어려웠음)책에 있던 내용과 다른 꼬인 문제

38. 스트레스 검증 묻는 문제 중 틀린 것 찾는 보기로 정규분포(x)

39. KMV모형 묻는 문제 출제

40. 스왑 프리미엄 결정요인과 관계문제 출제

41. 외화유동성 구하는 문제 = 외화유동성자산 / 외화유동성 부채 X 100

42. 자기자본 듀레이션 구하는 문제 $(D_A \times A - D_L \times L) / K$

43. 객관식 맞는거를 고르는 문제 중 맞는 보기 - 금융투자 회사는 준법감시인 임면시 이사 회의 결의를 거쳐야 하고 그 결과를 금융위에 통보(o)

44. 현금뽑아내기 전략 묻는 문제 출제

45. 평균(아시안옵션) 문제 출제