

재무위험관리사 (FRM)

실제시험 문제 복원 part 1.

1. 단순회귀모형중 오차항에 대해 틀린것은?으로 출제
보기는 오차항의 평균은 0이며 분산은 항상 일정하다. 독립변수와 오차항은 서로 독립이다.
오차항은 정규분포를 따르지 않는다.
2. 귀무가설중 검정력에 대한 정의문제 출제
3. $P(A)$, $P(B)$, A와B상관계수 값을 주고 A와B의 결합확률을 구하는 문제 출제 (교재 49페이지 11번 문제로 정리)
4. 위험중립가치평가에 의한 채권의 현재가치 계산하는 문제 출제
5. 영구채의 현재가치 계산하는 문제. 채권의 VAR값 계산할때 맥클레이듀레이션을 통해 먼저 수정듀레이션을 구한뒤 VAR값 계산하는 문제로 출제
6. 콜옵션 매수에 대한 위험등가노출금액(REE) 계산하는 문제
7. 베이즈 정리에 의한 사후확률 계산하는 문제
8. 이분산 검정 모형중 아닌 것 찾는 문제 출제
보기 Hausman, Gold, Breusch, white
9. 변동성을 구할수 있는 모형에 관한 문제 출제
보기 Garch(1.1), 다중변동성...등
10. 공분산과 상관계수 비교 중 구분하는 문제출제 (범위에 관련된문제)
11. 추정량의 정의에 대한 문제 출제 (교재 36페이지 핵심개념과 문제로 다시 개념정리)
12. 정규분포에 대한 문제 중 왜도, 초과첨도, 첨도에 관련된 문제 출제
13. 채권의 종류 중 국채 물어보는 문제 출제 (교재 76페이지 발행주체별 채권 무조건 암기!)
보기 14.국고채,국민주택채권,외국환평형기금채권,통화안정증권
15. 수익률곡선 (불편기대가설, 유동성선호가설, 시장분할가설) 설명 문제 출제

16. 바벨형 만기운용전략에 대한 정의 문제 출제
17. 외국환업무의 등록조건에 관련 문제 출제
18. 외국환업무취급기관을 찾는 문제 출제
보기. 은행, 종합금융회사, 여신전문금융업자등.
19. 옵션위험액을 구할 때 필요없는 위험액에 찾는 문제 출제
보기. 감마, 베가, 깊은외가격, 세타 (이번 오프강좌때 자세하게 설명 할 예정)
20. 신용위험액 산정원칙에 관한 문제 출제
보기. 신용환산액이 음수인 경우에도 환산한다.
21. 장외파생상품회계에서 파생상품의 정의에 대한 문제 출제 (교재 223페이지 핵심개념이 해하기로 정리)
22. 위험회피회계 중단사유 관한 문제 출제