

2022 재무위험관리사문제집 정오표 [2022.09.19기준]

페이지	문 항 번 호	수정 전	수정 후
45	26	보기 4개 모두 기호 수정.	$h_t \rightarrow \sigma_t^2, h_{t-1} \rightarrow \sigma_{t-1}^2$ ☞ h_t를 σ_t^2로, h_{t-1}을 σ_{t-1}^2로 수정
49	12	정답 2	정답 4
53	24	보기 3번 ③ 계수 α_1 은 현재의 ~	보기 3번 ③ 계수 $\alpha_1 + \beta_1$ 은 현재의 ~ ☞ 문구 추가
53	24	문제 중앙 수식 전체 수정	파란칸에 있는 전체 수식을 45 페이지 핵심탐구에 나온 GARCH(1,1) 모형의 특성에 나온 수식으로 교체함. $ \begin{aligned} \sigma_t^2 &= \alpha_0 + \beta_1 \sigma_{t-1}^2 + \alpha_1 \epsilon_{t-1}^2 \\ &= \alpha_0 + (\alpha_1 + \beta_1) \sigma_{t-1}^2 + \alpha_1 (\epsilon_{t-1}^2 - \sigma_{t-1}^2) \\ &= \alpha_0 + (\alpha_1 + \beta_1) \sigma_{t-1}^2 + \alpha_1 \sigma_{t-1}^2 (\xi_{t-1}^2 - 1) \end{aligned} $
232	21	정답 3	정답 1
533	9	정답이 1번(레버리지 효과)으로 되어 있는데, 2 번(높은 프리미엄)도 정답입니다.	
536	25	부도 시 손실율의 표준편자가	부도 시 손실율의 표준편차 가

609	4	잘못된걸 찾는 문제로, 보기 4는 정확한 해설입니다. 정답이 2번으로 수정 되어야 합니다. [자세한 해설은 아래와 같습니다.] 보기 ① 2.24의 제곱근은 약 1.5입니다 보기 ② $V(X+3) = V(X) = 2.24$ 보기 ③ X값과 그 확률을 곱해서 모두 더하면 기대값은 2.6입니다. 보기 ④ 해설이 정확합니다.	
640	5	$V(2X)=22 \times V(X)$	$V(2X)= 2^2 \times V(X)$

다음 페이지가 이어집니다.

4과목 시장 리스크관리 51번부터 61번까지의 정답이 오류입니다.

올해 문제집을 개발하며 4과목의 문제를 대폭 수정하였습니다. 이에 답안 편집 중 오류가 발생하여 불편을 드리게 되었습니다. (499페이지와 501페이지에 있는 해설이 앞뒤가 바뀌었습니다.)

학습에 불편을 드려 정말 죄송합니다.

페이지	문항 번호	수정 전	수정 후
498	51	기존 정답 및 해설 오류	501 페이지 58 번의 해설과 답이 51 번과 매칭됩니다.
	52		501 페이지 59 번의 해설과 답이 52 번과 매칭됩니다.
	53		501 페이지 60 번의 해설과 답이 53 번과 매칭됩니다.
499	54		501 페이지 61 번의 해설과 답이 54 번과 매칭됩니다
	55		499 페이지 51 번의 해설과 답이 55 번과 매칭됩니다
500	56		499 페이지 52 번의 해설과 답이 56 번과 매칭됩니다
	57		499 페이지 53 번의 해설과 답이 57 번과 매칭됩니다
	58		499 페이지 54 번의 해설과 답이 58 번과 매칭됩니다
	59		499 페이지 55 번의 해설과 답이 59 번과 매칭됩니다
501	60		501 페이지 56 번의 해설과 답이 60 번과 매칭됩니다
	61		501 페이지 57 번의 해설과 답이 61 번과 매칭됩니다