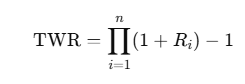
파이썬 포트폴리오 관리 시험 문제

1. 다음 중 미국 경제지표 데이터를 입수하기 위해 가장 널리 사용되는 싸이트는?
   1. 한국은행 ecos (ecos.bok.or.kr)
   2. 한국통계청 (kosis.kr)
   3. 야후 파이낸스 (finance.yahoo.com)
   4. FRED (fred.stlousfed.org)
2. 애플리케이션간의 데이터교환을 위해 널리 사용되는 데이터 표현방식에는 XML과 ( ) 형식이 있다. ( )안에 적합한 것은?
   1. Hyper text
   2. Mark down
   3. Mark up
   4. JSON
3. 다음 중 테스트 기간의 실제 변수값과 예측값 간의 오차를 나타내는 것은?
   1. Root Mean Square % Error (RMSE(%))
   2. Standard Deviation
   3. Skewness
   4. Kurtosis
4. 다음 수식은 어떤 수익률을 표현하는 산식인가
   1. 내부수익률
   2. 시간가중 수익률
   3. 만기수익률
   4. 연평균수익률
5. 대부분의 금융시계열은 정규분포에 비해 중앙값에 보다 집중되는 반면 극단치도 정규분포에 비해 많이 나타나는 경향이 있다. 이로 인해 우리가 위험의 정규분포를 가정할 경우에는 금융위기 등 극단적 상황에서의 위험을 ①과소평가 ②과대평가 할 위험이 있다
6. 다음 위험평가 지표 중 과거 최고치 대비 손실액을 평가하는 지표는?
   1. Maximum Draw Down (MDD)
   2. Value at Risk (VaR)
   3. Sharpe Ratio
   4. Jensen Ratio
7. 델타의 변화만큼 기초자산을 매매하여 옵션의 수익구조를 복제하는 헤징 기법은?
   1. CPPI
   2. TPPI
   3. 델타헷지
   4. Protective Put
8. 연기금은 안정적 운용을 통한 부채지급능력의 확보와 운용성과 향상을 통해 수익자의 연금 기여금 납부 부담을 경감하는 이중책무를 달성하여야 한다. 이를 위해 널리 채택하고 있는 자산배분 기법은?
   1. Asset Liability Management (ALM)
   2. Liability Driven Investment (LDI)
   3. Asset Driven Investment (ADI)
   4. Risk Parity
9. Black-Litterman 모델에서 시장 가격에 반영되어 있는 기대 수익률을 나타내는 것은?
   1. Manager’s Active View
   2. Market Implied Return
   3. Covariance Matrix
   4. Black-Litterman expected return
10. 각 자산의 위험기여도가 동일하도록 포트폴리오 비중을 배분하는 자산배분 기법은?
    1. Minimum Variance
    2. Portfolio Insurance
    3. Risk Parity
    4. Black-Litterman Model