

NCS기반 채용 직무설명서 (기금운용-증권리스크관리)

채용분야	증권리스크관리		
분류체계			
대분류	중분류	소분류	세분류
03. 금융·보험	01. 금융	04. 자산운용	01. 펀드운용 02. 주식·채권운용 03. 파생상품운용 04. 대체투자
기관 주요업무	○ 국민연금기금의 관리·운용 - 국민연금기금 투자전략의 수립 - 국내외 주식·채권·대체 부문 투자 - 국민연금기금운용 자금·자산관리 등		
능력단위	○ (펀드운용) 08. 펀드 리스크관리, 09. 펀드 성과분석 ○ (주식·채권운용) 11. 주식·채권 리스크관리, 12. 주식·채권 운용성과 분석 ○ (파생상품운용) 08. 파생상품 리스크관리, 10. 파생상품 성과평가		
직무수행내용	○ (증권리스크관리) - 리스크 한도 설정 및 배분 - 시장/신용/액티브 위험 관리 및 요인 분석 - 매크로/국가/산업/기업 분석 및 익스포저 관리 - 금융시장 모니터링 및 조기경보체계 관리 - 위기상황분석(Stress test) 및 위기대응계획 관리 - 리스크팩터 기반 위험분석 - 리스크관리시스템 운영 및 고도화 - 계량/통계적 위험분석/모델링 - 그 외 증권리스크관리와 관련된 사항 등 ○ (성과분석) - 기금운용 성과분석 및 요인분해 - 벤치마크 관리 관련 업무 - 성과평가 시스템 관리 - 그 외 성과평가와 관련된 사항 등 ○ (금융공학) - 금융공학 및 퀀트 기반 투자모형 - 통계 및 시계열모형을 통한 데이터 분석 - 멀티팩터모형을 활용한 업무 - 주식 및 채권 Valuation모형 - 글로벌 퀀트 데이터베이스(Datastream, QAD 등) 활용 업무		

전형절차	○ 서류전형 → 면접전형(평판조회 후 실시) → 전력조회·신원조사·약물검사 등 검증→ 임용
일반요건	○ 무관
교육요건	○ 무관
경력요건	○ 투자실무경력(전임 : 3년 이상)
필요지식	○ 국민연금기금 관련 규정 및 자본시장에 대한 법률지식 ○ 자본시장 및 포트폴리오 운용에 대한 지식 ○ 통계 및 계량분석, 금융수학, 재무분석 기술 ○ 데이터관리 및 시스템 운영에 관한 지식 ○ 리스크 측정 및 관리기법 등 리스크관리 이론 ○ 성과평가, 요인분해, 벤치마크에 대한 지식 등
필요기술	○ 리스크관리 및 성과평가 시스템 활용 능력 ○ 데이터 분석 능력 ○ 오피스 프로그램 활용 능력 ○ 관련 법령 해석 및 적용 능력 ○ 통계소프트웨어 활용 능력 등
직무수행태도	○ 리스크 관리 지표 설정, 측정을 정확하게 하려는 태도 ○ 리스크 및 법령·제규정 위반사항을 검토하고 분석하려는 태도 ○ 투자 리스크에 대한 객관적·분석적 태도와 리스크관리 개선을 위한 적극적인 자세 ○ 객관적으로 성과를 분석하고, 투자성과 발생 요인을 분석하려는 태도 등
직무관련 자격증	○ CFA (Level1/Level2/Level3), 공인회계사 (한국/미국/기타 국가), 변호사 (한국/미국/기타 국가), 보험계리사, 국제공인투자분석사(CIIA), FRM (국제/국내), CAIA, 세무사, 투자자산운용사, 금융투자분석사, 자산관리사 등
직업기초능력	○ 수리능력, 정보능력, 직업윤리, 의사소통능력, 문제해결능력, 대인관계능력 등
참고사이트	<ul style="list-style-type: none"> • www.ncs.go.kr • 위 직무기술서는 현재 개발된 NCS 중 국민연금공단 기금운용본부의 채용직무와 관련된 NCS를 연계하여 작성되었으며, 향후 NCS 개발 동향과 주요사업 변경 등 내·외부 상황에 따라 변경될 수 있습니다.