

## NCS기반 채용 직무설명서 (기금운용)

채용분야		신입직원	
분류체계			
대분류	중분류	소분류	세분류
03. 금융·보험	01. 금융	04. 자산운용	01. 펀드운용
			02. 주식·채권운용
03. 파생상품운용			
04. 대체투자			
		06. 증권·외환	02. 외환·파생업무
현재 NCS 분류체계에 세분류 미개발			운용전략
			수탁자책임
			기금법무
			자금관리
			증권자산관리
			대체자산관리
			기금정보운영
			기금정보분석
			기금정보기획
<b>기관 주요업무</b>	<ul style="list-style-type: none"> <li>○ 국민연금기금의 관리·운용</li> <li>- 국민연금기금 투자전략의 수립</li> <li>- 국내외 주식·채권·대체 부문 투자</li> <li>- 국민연금기금운용 자금·자산관리 등</li> </ul>		
<b>직업기초능력</b>	<ul style="list-style-type: none"> <li>○ 의사소통능력, 문제해결능력, 수리능력, 조직이해능력, 정보능력, 직업윤리, 자원관리능력</li> </ul>		
<b>능력단위</b>	<ul style="list-style-type: none"> <li>○ (펀드운용) 02. 펀드 자산배분, 08. 펀드 리스크관리, 09. 펀드 성과분석</li> <li>○ (주식·채권운용) 05. 기업분석, 08. 주식투자전략 수립, 09. 채권투자전략 수립, 10. 주식·채권 포트폴리오 구성, 11. 주식·채권 리스크관리, 12. 주식·채권 운용성과 분석, 13. 주식투자목표 수립, 14. 채권투자목표 수립</li> <li>○ (파생상품운용) 08. 파생상품 리스크관리, 10. 파생상품 성과평가</li> <li>○ (대체투자) 02. 투자전략 수립, 05. 투자실행, 06. 투자자산 관리, 07. 투자회수, 09. 투자 성과평가, 10. 투자 리스크관리</li> <li>○ (외환·파생업무) 04. 외환·파생 상품설계 제안, 05. 은행간거래 관리, 07. 외환·파생 리스크관리, 08. 외환·파생 후선업무, 09. 외환·파생 조사분석, 10. 외환·파생 업무 지원, 11. 외환·파생 컴플라이언스</li> <li>○ (운용전략) 투자전략, 투자기획, 전략리서치</li> <li>○ (수탁자책임) 책임투자, 주주권행사</li> <li>○ (기금법무) 계약검토, 법률자문, 소송관리, 법무지원</li> <li>○ (운용지원) 자금관리, 증권자산관리, 대체자산관리</li> <li>○ (기금정보) 기금정보운영, 기금정보분석, 기금정보기획</li> </ul>		

직무수행내용

- (투자전략)
  - 기준 포트폴리오 수립 지원
  - 중기 및 연간 자금운용계획 수립 지원
  - 자산군 및 세부자산군별 벤치마크지수 설정
  - 연간 자금운용계획 수립 및 현황 관리
  - 위탁정책, 외환정책, 기금운용지침 수립 지원
  - 신규 상품 및 자산군별 전략수립
  - 목표초과수익률 계획 수립 등
- (TAA운용)
  - 월간 자금운용계획 수립 및 현황 관리
  - 멀티에셋 위탁운용 계획 수립 및 현황관리
  - TAA Overlay 직접운용 체계 구축
  - 매크로, 개별자산군 리서치
  - TAA 모델, 알고리즘 개발 등
- (전략리서치)
  - 국내외 경제분석 및 전망
  - 국내외 금융시장 분석 및 전망
  - 대체투자 세부자산군별 시장분석 및 전망
  - 기초 전망(하우스뷰) 관리 및 자산배분 수립 지원
  - 경제, 금융 시나리오 관리 및 위기 분석 지원
  - 자본시장가정(자산군별 수익·위험 특성) 수립
  - 해외 연기금 운용현황 정기조사 등
- (책임투자)
  - 책임투자(ESG통합, 주주권 등) 정책 및 지침 수립 지원 등 책임투자 관련 제반 사항
  - 책임투자(ESG통합) 전략 수립 및 리서치
  - 책임투자(ESG통합) 실행계획 수립 및 실행 지원
  - 책임투자 연차보고서 발간
  - 국내외 보유 상장주식 의결권 행사 지원
  - 수탁자책임전문위원회 안건 작성 지원 등
- (주주권행사)
  - 기업지배구조 관련 사항 리서치
  - 주주권 이행 관련 업무 실행계획 수립
  - 국내외 보유 상장주식 의결권 행사
  - 중점관리사안 관련 기업과의 대화 등 주주권 이행 관련 업무
  - 수탁자책임전문위원회 안건 작성 지원
  - 주주권 행사에 대한 법률 및 회계 관련 사항
  - 주주활동 관련 공시 등
- (주식전략)
  - 국내주식 투자전략 수립 및 기획
  - 국내주식 포트폴리오 현황분석 및 모니터링
  - 국내주식 보유포트폴리오 위험관리
  - 국내주식 직접 운용
  - 국내주식 데이터베이스 관리
  - 국내주식 트레이딩 관련 업무
  - 거래증권사 선정 및 약정배분 기준 수립 및 관리 등
- (리서치)
  - 국내 주식 모델포트폴리오(MP) 구성 및 관리
  - 국내 주식 액티브펀드 투자가능종목군(Investment Universe), 패시브펀드 투자가능종목군(Basket Universe) 구성 및 관리
  - 산업 및 기업조사 분석
  - 국내 주식 액티브 직접운용

- 보유종목 권리행사(유, 무상 청약 등)
- 포트폴리오 현황분석 및 모니터링 등
- (패시브투자)
  - 국내 주식 패시브 직접운용
  - 주식관련 장내파생상품 운용
  - 보유종목 권리행사(유, 무상 청약 등)
  - 포트폴리오 현황분석 및 모니터링
  - 국내 주식 트레이딩 등
- (위탁투자)
  - 국내 주식 위탁운용
  - 위탁운용 유형 개발, 자산배분 등 위탁운용계획 수립 및 집행
  - 위탁운용사 선정 및 관리기준 수립
  - 위탁운용사 선정·관리 및 운용성과 평가
  - 위탁펀드 현황 분석 및 점검 등
- (국채투자)
  - 국내 채권 직접운용(국채)
  - 국내 채권 국채입찰 및 유통시장 거래기관 선정 및 관리
  - 원화단기자금 운용 등
- (크레딧투자)
  - 국내 채권 직접운용(크레딧채권)
  - 채권관련 파생상품 및 구조화채권 운용
  - 국내 채권 발행시장 거래기관 선정 및 관리
  - 회사채 등 투자가능 발행기관군 구성 및 신용관리
  - 포트폴리오 현황 분석 및 모니터링 등
- (채권위탁)
  - 국내 채권 위탁운용
  - 국내 채권 위탁운용계획 수립 및 집행
  - 국내 채권 위탁운용사 선정 및 관리기준 수립
  - 국내 채권 위탁운용사 선정·관리 및 평가
  - 국내 채권 위탁펀드 현황 분석 및 점검 등
- (해외주식위탁)
  - 해외 주식 운용계획 수립 및 성과분석
  - 해외 주식 위탁운용(파생상품 포함)
  - 해외 주식 위탁운용사 선정 및 관리
  - 해외 주식 위탁운용사와의 전략적 제휴 등
- (해외주식직접)
  - 해외 주식 직접운용(파생상품 포함)
  - 해외 주식 직접운용 투자가능종목군 구성 및 관리
  - 해외 주식 직접운용 거래증권사 선정 및 관리 등
- (해외주식전략)
  - 해외주식 신규 장기 전략 발굴
  - 해외주식 목표 포트폴리오 수립
  - 위탁 또는 직접운용(파생상품 포함)을 통한 보완펀드 운용 등
- (해외채권크레딧)
  - 해외 채권 직접운용 및 위탁운용(파생상품 포함)
  - 해외 채권 직접운용 거래증권사 선정 및 관리
  - 해외 채권 위탁운용사 선정 및 관리
  - 해외 채권 위탁운용사와의 전략적 제휴 등

- (해외국공채)
  - 해외 채권 직접운용 (파생상품 포함)
  - 해외 채권 직접운용 거래증권사 선정 및 관리 등
- (외환운용)
  - 외환거래 및 환위험 관리
  - 환헤지를 위한 파생상품 거래
  - 외화 단기자금 운용
  - 외환익스포저 관리 등
- (사모투자)
  - 사모 투자 및 관리
  - 사모 위탁운용사·사후관리 자문기관 선정 및 관리
  - 사모 투자전략 수립 및 신규 투자대상 발굴
  - 사모 전략적 제휴 관리
  - 사모 관련 대체투자위원회 안건상정 및 행정업무
  - 글로벌 사모대출 및 세컨더리 전략 관련 업무 등
- (부동산투자)
  - 부동산 투자 및 관리
  - 위탁운용사·사후관리 자문기관 선정 및 관리
  - 신규 투자대상 발굴
  - 부동산 투자 관련 대체투자위원회 안건상정 및 행정업무 등
- (인프라투자)
  - 인프라 투자 및 관리
  - 인프라 위탁운용사·사후관리 자문기관 선정 및 관리
  - 인프라 신규 투자대상 발굴
  - 인프라 투자 관련 대체투자위원회 안건상정 및 행정업무 등
- (증권리스크관리)
  - 리스크 예산 수립 및 배분
  - 시장/신용/액티브 위험 측정 및 요인분해
  - 매크로/국가/산업/기업 분석 및 익스포저 관리
  - 금융시장 모니터링 및 조기경보체계 관리
  - 위기상황분석(Stress test) 및 위기대응계획 관리
  - 리스크팩터모델 개발 및 관리
  - 리스크관리시스템 개발 및 관리 등
- (대체리스크관리)
  - 대체투자 사전위험검토 (투자심사기능)
  - 대체투자 사후위험관리 보고 (국내외 대체투자 포트폴리오 및 지표 분석)
  - 투자관리위원회 운영
  - 대체투자 리스크 관련 시스템 관리 및 개선
  - 대체투자 리스크 자문기관 관리
  - 국내 대체투자자산 공정가치 평가 등
- (성과분석)
  - 기금운용 성과분석 및 요인분해
  - 벤치마크 관리 관련 업무
  - 성과평가 시스템 관리 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 등

- (기금법무)
  - 기금운용 관련 법령의 해석 및 제·개정안에 관한 검토
  - 국내외 기금운용에 따른 투자관련 주요 계약에 관한 법률 검토
  - 국내외 기금운용 및 의결권 행사 등 권리행사 관련 법률자문
  - 국내외 기금운용 관련 소송에 관한 사항
  - 국내외 기금운용 관련 법적 분쟁사안 점검 및 관리
  - 대체투자 법률위험 사전검토 및 사후관리
  - 외부 법률 자문 변호사 선정 및 관리
  - 기금운용 업무수행 관련 기금운용본부 임직원에 대한 법률지원 등
- (자금관리)
  - 국내외 자금배정 및 출납관리
  - 국민연금기금 회계결산(재무,예산) 및 매입가 관리
  - 기금 관련 통계관리
  - 주거래은행, 외화금고은행 선정 및 관리
  - 국내외 투자자산 세금관리
  - 국내외 세무자문사 선정·관리 등
- (증권자산관리)
  - 국내외 주식 및 채권 자산보관 및 관리
  - 수입 및 지출 결의
  - 국내외 유가증권 대여 및 관리
  - 수탁은행, 사무관리사, 해외미들서비스 기관 등 선정 및 관리
  - 투자자산 권리행사 정보등록 및 관리 등
- (대체자산관리)
  - 국내외 대체투자 자산보관 및 관리
  - 대체투자 수탁은행, 사무관리사 선정지원 및 관리
  - 대체투자 자금 집행 및 회수
  - 국내 인프라 직접운용 BTO 관리 및 지원(지분율50% 이상) 등
- (기금정보운영)
  - 주거래은행, 수탁은행, 사무관리사, 외화금고은행 선정 지원 및 사업관리
  - 백오피스 관련 시스템 개발
  - 자산운용, 사이버뱅킹, 주문관리 시스템 개발
  - 정보교류시스템(국내외 증권사, 운용사, 수탁기관 등) 개발
  - 운영관리시스템(ITSM) 개발 등
- (기금정보분석)
  - 미들오피스 관련 시스템 개발
  - 정보분석시스템 개발
  - 대체투자시스템 개발
  - 책임투자/주주권행사 관련 시스템 개발
  - 글로벌 투자솔루션 관련 개발
  - 글로벌 리서치(기업분석, 시장분석, 경제분석 등) 환경 구축 등
- (기금정보기획)
  - 기금운용 중장기 정보화 발전계획 수립 및 관리
  - 기금운용 정보화사업 계획 수립 및 사업관리
  - IT신기술 및 금융디지털 혁신 기술 도입 적용
  - 글로벌 투자솔루션 도입 적용
  - 기금운용 전산장비 및 재해복구시스템 유지관리
  - 기금운용 시스템 아키텍처 수립 및 솔루션 운영
  - 기금운용 데이터베이스 관리 및 데이터 표준화 등

<p><b>필요지식</b></p>	<ul style="list-style-type: none"> <li>○ 국민연금기금 관련 규정 및 자본시장에 대한 법률지식</li> <li>○ 자본시장 및 포트폴리오 운용에 대한 지식</li> <li>○ 금융상품 및 금융실무에 대한 이해</li> <li>○ 경제지표에 대한 지식</li> <li>○ 통계, 재무, 세무, 회계, 계량분석, 금융수학 관련 지식 등</li> <li>○ 금융시장 별 거래구조 및 관행 등</li> <li>○ 데이터관리 및 시스템 운영에 관한 지식</li> <li>○ 민법, 상법 등 기본법 지식</li> </ul>
<p><b>필요기술</b></p>	<ul style="list-style-type: none"> <li>○ 거시경제 및 금융시장 관련 데이터 수집 및 가공 능력</li> <li>○ 재무 분석 기술</li> <li>○ 데이터 분석 능력</li> <li>○ 통계소프트웨어 활용 능력 등</li> <li>○ 스프레드시트 프로그램 활용 능력</li> <li>○ 오피스 프로그램 활용 기술</li> <li>○ 관련 법령 해석 및 적용 능력</li> <li>○ 영어 회화, 독해, 작문 능력</li> <li>○ 의사전달 및 논리적 설득 능력</li> </ul>
<p><b>직무수행태도</b></p>	<ul style="list-style-type: none"> <li>○ 최근 경제이슈와 경제 환경에 관심을 기울이는 태도</li> <li>○ 문제해결을 위한 전략적, 창의적 사고방식 및 태도</li> <li>○ 논리적인 사고와 판단을 내릴 수 있는 태도</li> <li>○ 다양한 정보에 대한 분석적 사고, 객관적 태도</li> <li>○ 체계적 자료수집 및 정리태도 등</li> <li>○ 새로운 정보를 수용하고 폭넓은 시각을 유지하는 자세</li> <li>○ 정밀하고 책임감 있는 업무처리 태도</li> <li>○ 근면·성실하고 예절과 품격을 실천하는 태도</li> <li>○ 수리적으로 정확도를 기하려는 꼼꼼한 태도</li> <li>○ 다양한 이해관계자를 고려하는 종합적 사고 등</li> </ul>
<p><b>직무관련 자격증</b></p>	<ul style="list-style-type: none"> <li>○ CFA (Level1/Level2/Level3), 공인회계사 (한국/미국/기타 국가), 변호사 (한국/미국/기타 국가), 보험계리사, 국제공인투자분석사(CIIA), FRM (국제/국내), CAIA, 세무사, 투자자산운용사, 금융투자분석사, 펀드투자권유 자문인력, 증권투자권유 자문인력, 파생상품투자권유 자문인력, 재무위험관리사, 선물거래상담사, 파생상품 투자상담사, 자산관리사 등</li> </ul>
<p><b>참고사이트</b></p>	<ul style="list-style-type: none"> <li>• <a href="http://www.ncs.go.kr">www.ncs.go.kr</a></li> <li>• 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.</li> </ul>