

【한국투자공사 NCS기반 채용 직무기술서】

한국투자공사				
채용분야	전략적 자산배분(SAA)			
NCS 분류 체계	대분류	중분류	소분류	세분류
	03. 금융·보험	01. 금융	04. 자산운용	01. 펀드운용
중점사업 분야	<ul style="list-style-type: none"> ○ 정부, 한국은행, 공공기금 등에서 위탁받은 자금의 효율적 운용 <ul style="list-style-type: none"> - 인플레이션을 상회하는 지속적인 수익 창출로 국가자산의 대외 구매력을 보존하고 증대 ○ 공공부문 해외투자의 중심축 역할 수행 <ul style="list-style-type: none"> - 외환보유액, 연기금 및 공공부문 여유자금의 해외투자를 선도하여 해외투자 활성화 지원 ○ 금융 산업 발전 지원 <ul style="list-style-type: none"> - 국내외 금융기관과의 교류 및 협력, 금융 전문인력 육성 등을 통한 국내 금융 산업의 국제 경쟁력 제고 			
직업 기초능력	○ 문제해결능력, 의사소통능력, 정보능력, 자원관리능력, 수리능력, 직업윤리			
전략적 자산배분 (SAA)	능력단위	○ (펀드운용) 01.펀드 자산배분 (전략적자산배분)		
	직무수행 내용	<ul style="list-style-type: none"> ○ 중장기 Capital Market Assumption(자본시장가정)을 위해 자산군의 기대수익률, 변동성, 상관관계를 설정하고 연구 ○ 금융시장의 다양한 자산군 및 벤치마크를 연구 ○ KIC 설립 목적, 장기자금 소요 대응을 위한 목표 수익률 및 Risk Appetite에 기반한 리스크 수준을 설정하고, 이에 따라 중장기에 걸쳐 KIC가 지향해야 할 자산 배분 목표를 수립 ○ 거시경제 및 투자환경을 분석하고 이를 토대로 투자대상 자산군과 세부자산군, 자산군별 벤치마크를 선정, 각 자산군의 배분비율을 정함 ○ 각 자산 배분 단계별 명확한 자산 배분 목적, 책임, 조정 범위에 따른 투자 의사 결정을 진행 ○ 중장기 대체투자 자산군별 약정계획, 직간접 비중을 수립하고, 매년 연간투자 운용계획을 수립 ○ 성공적인 투자운용을 위한 지속적인 모니터링 및 리밸런싱 업무를 수행 ○ 전체적인 통합포트폴리오 모니터링·분석과 함께 대체투자 유동성을 관리 ○ 주요 해외연기금 및 국부펀드 자산배분 동향파악 및 수익률 등을 분석 		
	필요지식	<ul style="list-style-type: none"> ○ 포트폴리오 이론 및 거시경제와 투자환경에 대한 이해 ○ 수익률 및 변동성, 상관관계의 개념 ○ 수익률과 변동성에 영향을 주는 요인 ○ 기대수익률 및 기대변동성 추정 기법 ○ 금융계량분석 기법 		

	<p>필요기술</p>	<ul style="list-style-type: none"> ○ 거시경제 및 금융시장 관련 데이터 수집 및 가공능력 ○ 자산군 및 벤치마크 선정에 필요한 데이터 수집 및 가공능력 ○ 계량분석 프로그램 활용 능력 ○ 포트폴리오 구성 이론의 적용 능력 ○ 자산배분 모형 개발 및 최적화 모형 활용 능력 ○ 영어 독해, 작문, 회화 능력
	<p>직무수행태도</p>	<ul style="list-style-type: none"> ○ 자산배분 방법론을 개선하고 바람직한 투자정책 확립을 위해 노력하는 태도 ○ 최근 경제이슈와 금융환경에 관심을 기울이는 태도 ○ 객관적 분석 기준을 준수하고 분석된 정보를 왜곡하지 않는 태도 ○ 다양한 정보에 대해 비판적으로 수용하고 새로운 기법을 탐구하는 자세 ○ 투자자산 및 세부자산군, 벤치마크에 대해 지속적으로 관심을 기울이는 태도 ○ 자산배분에 있어 고객의 투자목적을 최대한 반영하려는 태도
<p>직무관련 자격증</p>	<ul style="list-style-type: none"> ○ CFA (Level1/Level2/Level3), 보험계리사, CIAA (Level3), FRM (Part2/Part1), CAIA (Level2/Level1), 투자자산운용사, 금융투자분석사, 증권분석사, 국내 FRM 	
<p>참고 사이트</p>	<ul style="list-style-type: none"> • www.ncs.go.kr • 위 직무기술서는 현재 개발된 NCS 중 한국투자공사의 채용직무와 관련된 NCS를 연계하여 작성되었으며 일부 용어는 기관의 사정에 맞게 변경되었습니다. • 직무기술서 일부 능력단위는 별도의 분석을 통해 도출된 내용을 포함하고 있습니다. 향후 NCS 개발 동향과 주요사업 변경 등 내·외부 상황에 따라 변경될 수 있음을 양지하여 주시기 바랍니다. 	