

개방형 직위 직무수행요건 명세서

소속 부문	글로벌사업부문	소속실	금융공학실	직위	팀장
관련 분야	퀀트 및 딜링인프라 관리업무 수행				

I. 주요 업무내용

단위업무	과업	업무수행 내용	발생시기	비중
퀀트	가격결정 모형, 헤징전략 및 신금융상품 개발	<ul style="list-style-type: none"> - 파생상품의 이론적 가격결정모형 개발 - 파생상품 거래에 따른 헤징전략 개발 - 시장성 있는 신상품의 개발 - 가격결정/헤징 모형에 사용될 Data 분석 - 복합 파생상품의 개발 및 분해 등 	수시	30
	개발모형의 시스템 구현	<ul style="list-style-type: none"> - 파생상품 관련 모형 및 헤징 전략의 Murex내 이식/구현 - 기개발 파생상품 관련 모형 및 아키텍처 관리 등 	수시	20
시스템 유지, 관리	트레이딩 시스템 관리 지원	<ul style="list-style-type: none"> - Front Office 사용을 위한 Murex 설정 수행 - Murex 신규 모듈 도입 - Murex 패키지/모듈 도입, 구축, 유지보수 - Murex지원 개발자 API를 활용한 기능추가 - 모형 개발용 Linux 서버 관리 - Murex 및 기타 마켓데이터 벤더社와 계약 체결·갱신·해지 관리 - 마켓데이터 사용료 및 단말기 비용 산정, 부서별 비용 배분 및 절감 방안 추진 - 라이선스 및 사용 규정 준수여부 점검, 벤더 감사(Audit 대응) 	수시	30
기타 부서 지원업무	부서 지원업무	<ul style="list-style-type: none"> - 공정가치 평가회의 및 리스크관리부와 사전협의 진행 - 부서손익 분석 - 내부회계관리 운영평가 - 행내외 파생상품관련 교육지원 등 	수시	20