2014 Quantitative Analysis for Financial Mathematics

*** Opening Remark**

· 최희준 교수(연세대학교 수학과)

*** Quant 입문자를 위한 금융공학 가이드**

· 홍창수 실장(NICE P&I 금융공학연구소) 10:00-10:30

*** 국내외 파생상품 규제 동향**

· 이효섭 박사(자본시장연구원 파생상품실) 10:30-11:00

- Break time 11:00-11:10 -

*** 시장충격모형의 소개**

· 김도형 박사(트레이드 인포매틱스) 11:10-11:40

*** 계량적 관찰을 통해 본 한국 증시**

· 문병로 교수(서울대학교 컴퓨터공학과) 11:40-12:10

- Lunch time 12:10-2:00 -

*** Dependency Structure of CDS rates in HPC**

· 마용기 교수(공주대학교 응용수학과) 2:00-2:30

*** Contract for Difference를 활용한 위험관리기법**

· 전균 이사(삼성증권 파생상품시장분석 리서치센터) 2:30-3:00

*** 신상품 취급 절차와 퀀트 업무**

· 이상호 차장(KDB 산업은행 리스크 관리부) 3:00-3:30

- Break time 3:30-3:50 –

*** 신용파생상품 동향 및 거래 실무**

· 양정용 부장(우리투자증권 FICC 파생 운용부) 3:50-4:20

*** 최근 Equity OTC 시장 동향**

· 지현준 박사(한국투자증권 투자공학부) 4:20-4:50

*** Credit Derivatives Structuring**

· 김영성 박사(미래에셋 증권 FICC 퀀트팀) 4:50-5:20

- Closing (5:30-)

일자 2014.5.17(토)
장소 금융투자교육원 6층 Leaders Hall
주최 연세대학교 수학과 수리과학연구소,
한국금융공학포럼