

# 「Quant(Quantitative Analyst)」과정 신설(안)

(’14. 8. 28, 금융투자교육원)

## 1 개설 목적

- 다양한 금융 투자전략에 대한 리스크 측정방안을 학습함으로써 투자전략별로 투자수익과 리스크를 관리할 수 있는 퀀트 양성과정

## 2 과정 특징

- 다양한 투자전략에 따라 수용할 수 있는 적정 리스크를 분석하고 리스크 대비 수익을 극대화 할 수 있는 전문역량 강화
- 투자부서 입장에서 적정 리스크를 분석하여 리스크 관리부서와 유기적으로 협조할 수 있도록 실무사례 중심으로 교육과정 구성

## 3 과정 개요

- (교육대상)
  - 투자 업무를 실제로 수행하는 업무 종사자
  - 투자 부서 내의 퀀트 업무 종사자
  - 미들 오피스 내의 모니터링 종사자
- (교육시간) 11일 42시간
- (수 강 료) 정회원사: 336,000원 / 특별·준회원사: 525,000원  
일반인: 748,000원
- (교육일정) ’14. 11. 3 (월) ~ 11. 26 (수) / 월,수,금 17:00~21:30
- (정원) 42명
- (고용보험) 적용
- (수료기준) 출석률 80% 이상

※ 본 교육과정은 정원 미달 시 폐강, 정원 초과 시 교육원이 정하는 기준에 따라 교육생을 선정 또는 제한할 수 있음

## 4

## 커리큘럼(고용보험 환급과정)

과 목 명	주 요 내 용	시 간
지수 복제	- 단순 지수 복제, Enhanced Index 등 지수 포트폴리오를 복제하는 다양한 기법, 추적오차 발생 원인과 보완 방법	2
다양한 지수 구성 방법 비교	- Market Cap Weight, Equal Weight 등 다양한 지수 구성 방법의 수익률, 리스크 특성 비교	2
Core-Satellite	- 포트폴리오 구성 기준, 기법, 장단점, 성공/실패 사례	2
정량모형(Quantitative Model)에 기초한 전략	- 모델 구성 접근법 및 구성 과정에서의 오류와 실수, 객관적 검증, 사후 모델 업데이트 등 - Low-volatility Strategies, 최적화 포트폴리오 등	8
레버리지	- 레버리지에 따른 투자 특성, 투자 결과, 유의 사항 및 관리방안, 적정 레버리지 결정 방법, 실패/성공 사례 * 레버리지가 낮은 전략: 120/20 or 130/30 * 레버리지가 높은 전략: 1.5~3배	2
Sector Rotation	- 포트폴리오 변경 기준 및 예측 오류 가능성 리스크 통제 방안	2
리스크 특성 기준 포트폴리오 구성	- 개별 종목 기준보다는 종목들의 고유한 리스크 특성(Beta, style, Industry, Duration 등)별 포트폴리오 구성 - 구성 전략의 특성과 유의점	4
Market-Neutral Strategy	- 짝이 되는 종목/포트폴리오 선정 및 구성 기준, 기법 장단점, 성공/실패 사례, 협의의 Long-short, Pair Trading, Convergence Trade	4
Event Driven	- 전략의 특성, 수익/리스크, 리스크통제를 위한 유의 사항	2
Contrarian, Trend Following	- 전략의 특성, 수익/리스크, 리스크통제를 위한 유의 사항	2
Liability-Driven Investment	- 연금 등 향후 발생부채를 고려한 투자전략 - 위험요인 및 위험 관리 방법	4
Market Anomaly	- 시장의 비정상성을 이용하는 전략의 특성, 수익/리스크, 리스크통제 유의 사항	2
Currency	- 외환 투자 혹은 환헤지 리스크 특성, 리스크통제 유의 사항	2
Commodity	- 상품 투자의 특성, 유의 사항 및 관리방안, 실패/성공 사례	2
Quant의 경력관리	- 경력 목표설정, 경력개발, 멘토링 등을 통한 자기개발	2
총 시간		42