

### ■ NCS 분류체계

대분류	중분류	소분류	세분류
03. 금융·보험	01. 금융	04. 자산운용	01. 펀드(주식, 채권, 대체투자)운용*

\* 공단의 업무특성을 반영하여 “세분류\_01.펀드운용 → 01.펀드(주식, 채권, 대체투자)운용”으로 명칭 변경

### ■ 주요사업

1. 방사성폐기물의 운반·저장·처리 및 처분
2. 방사성폐기물 관리시설의 건설, 운영 및 폐쇄 후 관리
3. 방사성폐기물 관리를 위한 자료의 수집·조사·분석 및 관리 등
4. 방사성폐기물 관리사업을 위하여 필요한 연구개발, 인력양성, 국제협력 등

### ■ 직무수행 내용

- 펀드(주식, 채권, 대체투자)운용 고객자산의 수익 극대화를 위해 거시경제, 산업 및 기업분석을 기반으로 포트폴리오를 구성하여 투자자산을 운용하고, 이와 관련한 컴플라이언스, 펀드 리스크관리, 성과평가, 펀드회계 및 수탁업무를 수행

### ■ 능력단위

- 펀드(주식, 채권, 대체투자)운용 02. 펀드 자산배분 04. 포트폴리오 운용 05. 위탁운용사 자문사 관리 08. 펀드 리스크관리 09. 펀드 성과분석

### ■ 직무 필요 지식 / 기술 / 태도

지식	○ 고용·물가·환율결정이론, 경기변동론, 금융계량분석 기법, 포트폴리오 이론 (자산배분 이론, 최적화 이론 등) 및 특성, 리스크관리 이론(리스크 유형, 리스크 측정 기법), 액티브·패시브 운용전략, 추적오차 및 변동성 추정 기법 (변동성 확대 요인, 수익률 변화 요인, 추정 모형), 위험조정수익률 측정 방법, 편입되는 개별 펀드의 특성(적정 규모, 추적오차, 변동성, 펀드비용), 위탁운용사 및 자문사 펀드 상품의 유형별 특징 (스타일별-순수·중소형주·퀀트·사회적 책임 투자, 지역별 등), 사전적, 사후적 리스크 요인, 펀드 유형별 성과분석 및 성과분해 방법론, 적정 요구 수익 및 리스크 수준, 초과성과 및 부진성과의 관리를 위한 통제 수준
기술	○ 자산군 선정에 필요한 데이터 수집 및 가공능력, VBA 활용 능력, 계량분석 프로그램 활용 능력, 산업분석 기법의 적용 및 판단 능력, 기대수익률 추정 기법의 적용 능력, 포트폴리오 구성 이론의 적용 능력, 모형 개발 및 최적화 모형 활용 능력, 자산배분시스템 활용 능력, 투자대상 자산별 적정가치 산출 기술, 운용성과 보고서를 해석하는 능력, 재간접펀드 구성 최적화 기술, 펀드 위탁운용사·자문사 성과분석시스템 활용 능력, 자산군과 사용된 전략에 따른 핵심 리스크 요인 식별 능력, 성과분석 결과를 사용자의 필요에 맞게 구성하는 능력, 벤치마크 또는 동종펀드(Peer Group)와 비교 가능한 성과 도출 기술, 펀드 운용과정의 개선 필요 여부 판단 능력
태도	○ 투자자산 및 세부 자산군에 대해 지속적으로 관심을 기울이는 태도, 다양한 정보를 최대한 분석하고자 하는 근면성, 투자자의 위험대비 기대수익 달성을 위한 자산군 발굴 노력, 모델포트폴리오를 면밀하게 분석하려는 태도, 합리성을 기반으로 포트폴리오를 구성하고자 하려는 태도, 펀드 적정운용 여부를 지속적으로 관찰하고 관리하려는 태도, 합리적 태도 (재간접펀드, 위탁운용사 및 자문사 선정 시), 업무에 필요한 이론을 꾸준히 학습하려는 태도, 리스크 단계별 수준 분류 및 이를 통한 효율적인 리스크 통제 노력, 데이터 및 계산 산식의



정확성을 유지하려는 태도, 이해관계자 입장에서 정보를 구성할 수 있는 배려심, 운용사 전체 포트폴리오 성과 측정 및 피드백을 통한 효율성 제고 노력

## ■ 직업기초능력

- 의사소통능력, 수리능력, 자원관리능력, 정보능력, 조직이해능력

## ■ 참고사이트

- [www.ncs.go.kr](http://www.ncs.go.kr) 홈페이지 → NCS 학습모듈 검색

<https://www.korad.or.kr> 한국원자력환경공단 홈페이지 → 직무내용 확인

위 직무기술서의 일부 내용은 별도분석을 통해 도출되거나 업무특성에 맞게 수정한 내용을 포함하고 있습니다.  
향후 NCS 개발 동향과 주요사업 변경 등 내·외부 상황에 따라 변경될 수 있음을 양지하여 주시기 바랍니다.

