**운용 – 리스크팀**

임무

1. CvaR(ES), 유동성 리스크(롤 Spread와 같이 Price 데이터 & Volume 데이터를 이용해 접근 가능한 모델 등) 등 학회가 보유중인 포트폴리오의 리스크 지표 산출
2. 바젤 규제에 대한 이해 및 해당 규제를 바탕으로 포트폴리오 리스크 제언

* 충당금 쪽에 초점이 많이 맞춰져 있어 학회 포트폴리오에 맞게 소화해야 함

1. 위기 시나리오에 대해 포트폴리오 리벨런싱 방안 제언

* 계엄 시나리오, 혹은 기업 위기 시나리오 등을 예측하거나 혹은 상황이 주어졌을때 어떻게 대응할지를 리서치팀과 협업하여 분석

해야할 일

1. 포트폴리오에 대한 CvaR(ES), 유동성 리스크 측정 모델을 바젤 규제에 맞게 제작 및 리스크 관리&경고 시스템 구축 (단발성, 이후는 보완 과정일듯)
2. 혹은 기업 위기 시나리오 등을 예측하거나 거시 상황을 분석하는 모델 제작, 리서치팀과 협업하여 거시 동향 분석 + 리벨런싱 방법 제안 (모델제작은 단발성, 모델 유지 및 거시&산업&기업 분석은 상시)

계획

1. 1월달에는 1번 업무에 집중
2. 2월달에 거시 분석 모델 제작 혹은 거시 동향 분석 과업 수행(정훈님이 만드신 기존 모델을 응용하거나 새로운 feature을 사용해서 탐색 등)
3. 포트폴리오가 결정되고 운용팀에서 운용을 시작하면 2번 업무 진행(변동 가능)