

한 국 보 험 계 리 사 회

서울시 종로구 새문안로 92 광화문오피시아빌딩 1507

☎ 782-7440 FAX 782-7441

한보계 제14 - 061호

2014. 11. 4

수 신 회원제위

참 조 선임계리사, 계리.상품담당 임원, 기타관련 부서 임원

제 목 금융공학 기초교육 실시 안내

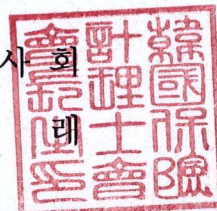
1. 귀 사의 무궁한 발전을 기원합니다.

2. 본 회는 다음과 같이 금융공학 기초교육을 실시하오니 많은 관심과 참여 부탁드리는 바입니다.

- 다 음 -

1. 대 상 : 본 회 회원(정.준)으로 회비납입자
2. 일 시 : 2014. 11. 19(수) ~ 20(목) / 2일간 / 13:00 ~ 18:00 / 일별5시간 /
3. 장 소 : 미래보험교육원 강의실(서울시 용산구 갈월동 85-3 남영빌딩 5층)
4. 교육인원 : 선착순 40명(회원대상)
5. 교육일정 및 내용 등 자세한 사항 : 별첨 참조
끝.

사단법인 한국보험계리사회
회 장 박 상



<별첨>

금융공학 기초교육

I. 교육목적

- 선물, 옵션, 스왑 등의 파생상품의 개념을 이해하고, 파생상품 및 구조화상품의 가격 결정 및 거래 전략(위험관리, 차익거래, 시세차익)을 실습을 통하여 투자 및 자산운영 분야 기초 지식을 습득하기 위함.

II. 교육개요

과 정 명	금융공학 기초교육
교육일정	2014. 11. 19(수) ~ 20(목) 【총 10시간 / 2일】 * 오후(13:00~18:00)교육 / 일별 5시간
교육대상	본회 회원(정.준)
교육정원	선착순 40명
교육장소	미래보험교육원 A강의실(4호선 숙대입구역 9번출구) <서울시 용산구 갈월동 85-3 남영빌딩 5층>
교육비	회원대상으로 회비 납입자는 무료, 미납입자: 100,000원 <우리은행 1005-502-527602 (사)한국보험계리사회>
기 타	※ 개인별 노트북 지참 필수!! (엑셀 2007버전 이상 설치 요망)

III. 교육 일람표

과목명	과 목 개 요	시간	강 사
파생상품개념	<ul style="list-style-type: none"> ○ 선물/선도, 옵션, 스왑의 개념 ○ 해당 상품의 만기 수익구조(실습) 	1H	이효섭 연구위원 (자본시장연구원)
선물/선도의 이해	<ul style="list-style-type: none"> ○ 선물과 선도의 차이 ○ 선물/선도의 이론 가격(실습) ○ 증거금 및 베이스스 위험 ○ 최적 헤지 계약(실습) 	2H	
옵션의 이해	<ul style="list-style-type: none"> ○ 옵션의 가격결정 요인 ○ 이항 모형(실습) ○ 블랙숄즈 모형(실습) ○ 옵션의 민감도(실습) ○ 이색 옵션 및 몬테카를로 시뮬레이션(실습) 	3H	
변동성 추정	<ul style="list-style-type: none"> ○ 역사적 변동성(실습) ○ EWMA GARCH(실습) ○ 내재변동성 추정(실습) 	1H	
스왑의 이해	<ul style="list-style-type: none"> ○ 이자율 스왑(실습) ○ 통화 스왑(실습) 	1H	
조화 상품의 이해	<ul style="list-style-type: none"> ○ 추가/금리/신용 연계 구조화상품 개요 ○ Monte Carlo를 이용한 ELS 평가(실습) ○ 헤지 포트폴리오의 손익 	2H	
계		10H	

→ 11. 19(수), 20(목) 교육시간은 오후 13:00 ~ 18:00 임.

※ 개인별 노트북 지참 필수 사항임!! (엑셀 2007버전이상 설치
요망)

IV. 교육신청 방법

- 신청방법 : 본 회로 성명, 소속, 연락처, 이메일 주소를 기재하여 이메일접수(actuary@actuary.or.kr) 또는 FAX 접수(02-782-7441)

ex) 신청 양식

금융공학 기초교육신청

성명	소속	H.P 연락처	이메일
홍길동	xx생명/화재 대리	010-1234-5678	abc@abc.com

V. 기타사항

- 본 회 홈페이지 공지사항 란에 안내 및 공문파일 등을 첨부하였으니 참조 바람.
- 추후 변동 및 기타사항 안내 등을 위해 정확한 핸드폰 연락처 및 이메일주소 기입 필수
- 개인별 노트북 지참 필수(엑셀 2007버전 이상 설치요망)