職務経歴書

2023 年 11 月 15 日現在氏名:ワーク太郎

■職務経歴概要

株式会社 AAAAAA に入社し、約●年間アシスタントクオンツアナリストとして業務に従事しておりました。 20XX 年からはクオンツアナリストとしてポートフォリオの最適化やリスク管理戦略の策定を経験しております。

■得意とする経験・分野・スキル

- ・数学的モデリングと統計分析
- ・データ解析とデータマイニング (Python、R)
- ・ポートフォリオ最適化とアセットロケーション
- ・金融市場のトレンド分析と予測

■会社履歴

期間	会社名	
20XX 年 XX 月~現在	株式会社 AAAAAAA	

■職務経歴詳細

株式会社 AAAAAAA 20XX 年 XX 月~現在

事業内容: ●● 従業員数: ●名 資本金: ●万円

期間	業務内容	職位
20XX年XX月	●●部 配属	アシスタントクオンツアナリ
~	【担当業務】	スト
20XX年XX月	・リスク管理モデルのサポートとデータ整備	
	・データクレンジング及びバリデーションの実行	
	・金融市場データの収集と分析	
	・市場トレンドとボラティリティの追跡	
	・プログラムトレーディングの戦略実行とモデルバックテストの支援	
	【実績】	
	・市場動向やボラティリティの追跡、データの視覚化、意思決定支援の	
	ための分析を実施	
	・アルゴリズムトレーディング戦略のバックテストを実施し、パフォー	
	マンス評価を経験	
20XX年XX月	●●部 配属	クオンツアナリスト
~	【担当業務】	
現在	・ポートフォリオ最適化モデルの開発と維持	
	・リスク管理戦略の策定及び VAR モデルの構築	
	・市場リスクの定量化とヘッジ戦略の実行	
	・デリバティブ商品の価格モデル改善と新規商品の評価	
	・オプション戦略の開発とテスト	
	・大規模データセットの処理と分析	
	・金融市場データからの予測モデルの構築と評価	
	【実績】	
	・ポートフォリオ最適化により、クライアントのリターンを年間平均で	
	●%向上	
	・アルゴリズムトレーディングプラットフォームのパフォーマンス向上	
	により、取引速度を2倍に改善	

■PC スキル/テクニカルスキル

- ・Word / 社内外文書作成、社内プレゼン資料作成が可能なレベル
- ・Excel / IF 関数、VLOOKUP、ピボットテーブル、マクロが使用できるレベル
- · PowerPoint / 会議資料、提案資料が作成できるレベル
- ·TOEIC ●点 (20XX 年 XX 月取得)
- ・日本証券アナリスト協会認定アナリスト (20XX 年 XX 月取得)

■自己 PR

ポートフォリオ最適化

私はクオンツアナリストとして、ポートフォリオ最適化の分野において幅広い経験を積んできました。 投資家とクライアントに価値あるアドバイスを提供する中でリスクを最小化し、リターンを最大化することに尽力しておりました。

効率的な資産アロケーションとリスク管理においてはダウンサイド保護戦略を導入し、市場のアルファを 追求してアクティブマネジメントの実績を築きました。

また、クライアントとの密なコミュニケーションを通じてカスタマイズされたポートフォリオ戦略を提供 し、クライアント教育にも貢献しております。常に最新の市場トレンドと知識を追求し、ポートフォリオ 最適化を心がけておりました。

今後もこれまでの経験を活かしさらなるキャリアアップを図っていきたいと考えております。 ぜひ、面接の機会をいただければと思います。何卒よろしくお願い申し上げます。

以上