부자과학시대를 열어가는

삼성선물

| 1. / | |
|---------------------|--|
| 2. / | 응 (7401) 환리스크 · 1 1 · · · · · · · · · · · · · · · · |
| | 시세 기타용화 USOKRM JPYORIDI선 - |
| 3. / | 전물(USU) 1,005.30 면(JPY) 536.27 바람도(BDP) 1,825.37 USUJPY 건물(건활물) 1,005.40 유로(EUR) 1,222.54 프랑(DFF) 804.57 IDV/DB |
| | |
| 4. | |
| | 2005/06/03 1,007.80 107.64 0.81766 0.95090 1.25280 1,012,00 |
| 5. / | 2005/06/02 1,012.80 108.20 0.81506 0.95075 1.25170 |
| | 2005/05/01 1,010.70 108.66 0.81994 0.95252 1.25580 0.000 |
| 6. / 가 | 2005/05/30 1,002.50 107.96 0.80122 0.54837 1.23760 1.008.00 |
| | 2005/05/27 1,002.50 132.25 0.79479 0.54601 1.22900 1.006.00 |
| 7. Stress Test | 2005/05/25 1,000.60 107.68 0.79371 0.54597 1.22720 1,004,00- |
| | 2005/05/24 1,000.70 107.59 0.79567 0.54735 1.23060 |
| 8. Hedge Simulation | 2005/05/23 1,004.40 107.74 0.79542 0.54666 1.23140 1.002.00 |
| o. nougo omulation | 2005/05/20 1,004.40 106.15 0.79637 0.54678 1.22220 1,000.00 |
| Q EV Dick VoD | 2005/05/18 1,005.20 107.01 0.78858 0.54360 1.21770 2005/05 06 |
| 9. FA RISK VAR | 2005/05/17 1,004.50 107.43 0.79346 0.54526 1.22990 • • • |
| | 1): 7; 2): (JPY,EUR,GBP,CHF) 7; 3):))1. JPYKRW계산 ((/ 7;) 2. / 3. / 4): 57; 7; 7; (7;) 5): 下二 |







| 1. / | |
|---------------------|--|
| 2 | 🖳 [7403] 환리스크 - 거래등록/수정 🏾 🔊 패레 외 💷 💌 |
| 2. / | 거래등록/수정 포지선현황 일별/일별포지선현황 포지선결제/평가순익 Stress Test Hedge 5◀♪ |
| 3. / | ·거래내역동록/수정 1 동록 수정 삭제 결제내역동록/수정 2 동록/수정 ·거래구분 수물의 · ·거래유현 수출 · 화정결제일 2000/05/08 □ |
| 4. | ·계약원 2005/06/08 	 ·계약원을(원) |
| 5. / | · 동화 USU · · · · · · · · · · · · · · · · · · |
| | |
| 6. / 가 | 7년(1억오회 ····계약을가운 C 클레일가운 ···································· |
| 7. Stress Test | 결제 계약일 거래번호 유형 통화 계약판률 금액 결제일 결제판률 . |
| 8. Hedge Simulation | |
| 9. FX Risk VaR | |
| | |
| | |
| | |
| | |
| | - : , , , , , , , , , , , , , , , , , , |
| | - : |
| | : / , / ,Local / , : , |
| | / : , , , |
| | |
| | |
| | |
| | <u>3</u> 가 가 |
| | |
| | |
| | |

투자과학시대를 열어가는

SAMSUNG 삼성선물

| 1. / | | | | | | |
|---------------------|------------|------------------|-------------|-------------|-----------------------|-----------------------|
| 2 / | [7404] 환경 | 스크 - 포지션현황 | | | | IPA ? LOX |
| 2. 1 | 포지선현황 | 일별/필별포지 | 선현황 포지 | 선렬제/평가손익 | Stress Test Hedge S | inulation 🛛 FX Ri 💶 🕨 |
| 3 / | 기간 2005/ | /05/08 🔲 ~ 2005/ | 07/08 🔲 >해당 | 기간의 전제 미결제3 | 포지션현황을 조회합니다 | . <u>조회</u> |
| 0. / | | 통화 | | | 00.000.000 | 가손익 |
| 1 | | 금액 | | | 000 000 000 | |
| | 유입 | 계약환율 | | | 100,000,000 | |
| 5 / | | 환산액(KRW) | | | 100.000.000 | |
| 5. / | | 금액 | | | 00,000,000 | |
| e / 7L | # 8 | 계약환율 | | 1 | | 2 |
| 0. / /r | | 환산역(KHV) | | · | 0 | |
| 7 Otropp Toot | | ⇒ 0H | | | 100,000,000 | |
| | Net | 평균계약화율 | | | | |
| 0 Lladge Cimulation | Position | 환산액(KRW) | | | 100,000,000 | |
| 6. Heage Simulation | | 평가환율 | | | 100.000.000 | |
| | 평가 | 평가환산액(KRW) | | | 00,000,000 | |
| 9. FA RISK VAR | | 평가손익 | | | 100.000.000 | |
| | 4 | | | | 1 1 | <u>•</u> ि-+ |
| | | | | | | |
| | - 🚺 | | " | / | (7403)" | |
| | | , NetPositio | h | | 가 | - 3 |
| | | | | | ~1 | |
| | - 2 | | | 7 | ł | |
| | - 가 | | / 가 | 가 | 가 | 가 , |
| | | | | | | |



| 1. / | | | | | | | | | |
|---------------------|------------|---------|-----------|------|-----------|--------------|-------------|----------|-----------------|
| | 류 [7405] 환 | 리스크 - 8 | 3월/월월포지견헌 | 활 | | | | | * # A 2 |
| 2. / | 포지션현황 | 22 | /월별포지션현황 | 포지견결 | 제/평가손의 | Stress Test | Hedge Simul | ation FX | Risk VaR 분석 া 🖡 |
| | @ 얼까포지(| 9 08 | 별포지션 | 기간 | 005/05/08 | ~ 2005/07/08 | 1 | | 조회 |
| 3. / | 구분 견체 | . : | 형 전체 💌 | 걸제 | 전체 🖃 🕴 | 통화 전체 💽 | | | |
| | | - | 82 | 1 | 4 | 유출 | Net Posi | itian | |
| 4 | - 12 M | 통화 | 금먹 | 평균환율 | 금액 | 평균환율 | 금액 | 명균환율 | 환산역(KR#) |
| 4. | | | | | | | | | |
| | | | | | | | | | |
| 5. / | | | | | | | | | |
| | | | | | | | | | |
| · · · · | | | | | | | | | |
| 6. / 가 | | | | | | | | | |
| | | | | | | | | | |
| 7 Stress Test | | | | | | | | | |
| 7. 0(1035 103) | | | | | | | | \frown | |
| | | | | | | | | | 2 |
| 8. Hedge Simulation | | | | | | | | | |
| <u> </u> | | | | | | | | | <u> </u> |
| 0 EV Diale MaD | | | | | | | | | |
| 9. FA RISK VAR | | | | | | | | | |
| | - | | | | | , , | , | , | , |
| | | | | | | | | | |
| | | | | | | | | | |
| | | | | | | | | | |
| | _ (1 | Net | Position | | | | | 가 | |
| | | | | | | • | | - 1 | |
| | | | | | | | | | |
| | 0 | | | | | _1 | | | |
| | - 🕊 | | | | .(| 가 | 가 | | |
| | | | | | | フト | | |) |
| | | | | | | . 1 | | | •) |
| | | | | | | | | | |
| | | | | | | | | | |
| | | | | | | | | | |
| | | | | | | | | | |
| | | | | | | | | | |
| | | | | | | | | | |
| | | | | | | | | | |
| | | | | | | | | | |
| | | | | | | | | | |
| | | | | | | | | | |
| | | | | | | | | | |
| | | | | | | | | | |
| | | | | | | | | | |
| | | | | | | | | | |
| | | | | | | | | | |
| | | | | | | | | | |
| | | | | | | | | | |
| | | | | | | | | | |
| | | | | | | | | | |
| | | | | | | | | | |
| | | | | | | | | | |
| | 1 | | | | | | | | |



| [| - | | | | | | | | | |
|---------------------|------------|------------|----------|-----------------------------|----------|-------------|---------------------------------------|------------------------|-------------|-----------------------|
| 1. / | | | | | | | | | | |
| / | 응 [7406] 원 | 리스크 - 포지 | 신결제/8 | 봉가손역 | | | | | | PAR JUX |
| 2. / | 일별/원별 | 포지견현황 | 포지션 | 걸제/평가손 | 역 Stres | s Test Hedg | e Simulatio | n FX Ris | k YaR 분석 | 4 • |
| 2 | 1921 | 3 04 SHELL | 0//0/200 | <u>이미</u> 구분[36] 134816 | ⊴য়া ⊴ | 유명 건제 | ····································· | 월 전체 💽 190-202004 L | ETEPOIOLITS | |
| 3. / | *제소의 | BI7L4.91 | | 120 TRACTS | ା ଅପରେ ଆ | 지아영종과함드 | 의 3개파 | | 2011111112 | 에게 문의하세요. 로카:당권구리) |
| | 계약일 | 유송인 5 | 204 | 기레변호 | 통하 | 금역 | 개약화율 | 23029 | 現外対象 | 명가수익 ▲ |
| 4. | | | | | | | | | 0.12.8 | |
| | | | | | | | | | | |
| 5. / | | | | | | | | | | |
| | | | | | | | | | | |
| 6. / 가 | | | | | | | | | | |
| | | | | | | | | | | |
| 7. Stress Test | | | | | | | | | | |
| | | | | | | | | | | |
| 8. Hedge Simulation | | | | | | | | | | |
| | | | | | | | | | | |
| 9. FX Risk VaR | | | | | | | | | | |
| | | | | | | | | | | * |
| | | | | | | | | | | |
| | - | : | | | | | | | | |
| | - 7 | F : | | | | | | | | |
| | | | | | | | | | | |
| | | | | | | | | | | |
| | | | | | | | | | | |
| | | | | | | | | | | |
| | 가 | | | | 가 | | | | | |
| | 가 | | | | | 1 | , | 3 | | ,12 |
| | | | 가 | | | | | | | |
| | | | | | 3가 | | | | | |
| | | | | | (| | | | 71 |) |
| | | | | • | (| | | | ~1 |) |
| | | <u> </u> | | | | | | | | |
| | | (1.02-7 | /80-2 | 2020,0 | 80-339 | -2020) | | | | |
| | | | • | | | | | | | |
| | | | | | | | | | | |
| | | | | | | | | | | |
| | | | | | | | | | | |
| | | | | | | | | | | |
| | | | | | | | | | | |
| | | | | | | | | | | |
| | | | | | | | | | | |
| | | | | | | | | | | |
| | | | | | | | | | | |



| 1. / | |
|---------------------|---|
| | 류 [7407] 2년스크 - Stress Test 유민수 2 - 미 · · |
| 2. / | 일별/월별포자선현황 포지선결제/평가손의 Stress Test Hedge Simulation FX Risk VeR 분석 《) |
| | 기간 806596598 월 ~ 2005/07/08 월 구분 전체 🔍 유형 전체 🔍 올해 전체 🔍 통화 전체 🔍 조회 |
| 3. / | 현재환율 1,007.80 I 비상순학그래프 |
| | 明台登録 1.000.00 0 |
| 4. | DHU -7.00 0- |
| | DHI = -0.77 |
| E / | |
| J. / | -0 |
| | UT항후 명상환율에 따른 한 TA Evoltion의 소약을 초점 -D- |
| 6. / 가 | 할 수 있습니다. 하 |
| | <양단의 SpinHE 조망> |
| 7. Stress Test | 예상순익(원) 스 |
| | 통화 Net Position 현재환율 태상환율 현재명가금액(원) 태상명가금액(원) 금액(원) 비율(I) |
| 0 Lladra Cimulation | t 0 0 0 0 |
| 8. Heage Simulation | |
| | |
| 9. FX Risk VaR | |
| | |
| | |
| | - |
| | |
| | |
| | <u>조회</u> |
| | |
| | |
| | - 7ŀ |
| | |
| | |
| | - 가 |
| | |
| | , , |
| | · · |
| | |
| | |
| | |
| | |
| | |
| | |
| | |
| | |
| | |
| | |
| | |
| | |
| | |
| | |



| | | |
|---------------------|---|---------------------------|
| 1. / | | |
| | 🔝 [7408] 환리스크 - Hedge Simulation | |
| 2. / | 일별/월별포지선현황 포지선결제/평가손역 Stress Test Hedge Sin | aulation FX Risk YaR 분석 🖡 |
| 0 / | 기간 80015015012 = ~ 2005/09/08 = 조회 100,000,000 # Hedge # 현용 1 | 순손익 |
| 3. / | DI걸쳐 NetPosition (\$) 00.000.000 | |
| | USD 현물환율(원) 00.000.000- | |
| 4. | 신물환율(최근월물)(원) 00,000,000 | |
| | 미경제대비 해지비율(#) | |
| 5. / | 해지금액(+) 00.000.000 | |
| I | Simulation삶앱 (00,000,000- | |
| 6. / 가 | 1.헤지금액은 직접 헤지할금액을 입력하거나, 000,000,000 | |
| | 비율입력후 계산기버튼을 클릭하여 계산합니 | |
| 7. Stress Test | 2.미결제 NetPosition은 선택한 기간에 해당 | |
| | 하는 USD통화단의 유입공액-유출공액입니다. | <u> </u> |
| 8. Hedge Simulation | 고려하지 않은 금액입니다. 환율 체시관역(전용 | 8) 현물은빅(전원) '운은빅(전원) |
| | 그분 개약스 주문증거금(원) | |
| 9. FX Risk VaR | | |
| | <u>, , , , , , , , , , , , , , , , , , , </u> | |
| | | |
| | _ <u>_ 소회</u> | |
| | Net Position | |
| | | |
| | , | Simulation |
| | プ | |
| | | , |
| | | |
| | | |
| | | |
| | | |
| | | |
| | | |
| | | |
| | | |
| | | |
| | | |
| | | |
| | | |
| | | |
| | | |
| | | |
| | | |
| | | |
| | | |



| [r | | | | | | |
|--------------------|------------------------------------|------------------------------------|---------------------------------------|-------------------------------|---------------------------|--------------|
| 1. / | | | | | | |
| 2 / | 🔝 [7409] 환리스: | ∃ - FX Risk VaR I | 분석 | | | THA? IDX |
| Z. / | 포지선결제/평기 | 가손익 Stress | Test Hedge Si | isulation FX Risk | : VaR 분석 | •• |
| 3 / | 712 2005/04/08 | 2005/06/08 | ····································· | - 유럽 건계 | 걸제 [미결차 | Var 분석 |
| . , | Historical Va | R 37H 🖬 💌 | 신뢰도 95% 💌 | 실 통화 전체 | 모유기간 | 30 (8) |
| 4. | · 변화 것 | 포시선 달 | 김양양백(\$) 기 | 1순환율 생가급역 | (8) WH급역(8 | () 위험비율(X) - |
| 5. / | | | | | | |
| 6. / 가 | 17: 화리스크 위험/ | 8.정스다이 VaDZES | 2 조매지 송정기기 | 15010 회대 화용법의 | = 개능액 • 저희 오프: | · · |
| 7. Stress Test | 동안 최대 환손실 측정기간및 신뢰 신뢰구간이 물수에 | 위험금액입니다. 도 보유기간 등의 록 최대순실가능액 | 변수를 놀리면 변 이 커지게 되며 환 | 동성이 증가하여 YaRg 탄위험에 대한 보수적S | 있은 증가합니다. 인 관리가 가능합니다. | |
| 8 Hedge Simulation | | | Hedge H | 율에 따른 선물계약 | | |
| o. nedge omdation | Hedgebil 율 | 00 | 258 | 50# | 75% | 100% |
| 9. FX Risk VaR | 달러헤지금액 | | | | | |
| | 원화해지금액 | | | | | |
| | 필요 Hedge량 | | | | | |
| | 응거급 | | | | | |
| | - | | | | | 가 |
| | VaR(Val | ue at Risk) | | | | |
| | | · · · · · , | | | | |
| | _ | 05% 00 | 0/ | | | |
| | - | 3070,93 | //0 | | | 71 |
| | | 71 | | | | 71 |
| | 가 | | | | | |
| | | Historia | al VaR | | | |
| | | Thistoric | | • | | |
| | | = FX E | xposure * | 가 | * , | |
| | | | , | , | | 가 |
| | | | VaR | 가 | | |
| | | | | | | |
| | | | | | | |
| | | | | | | |
| | | | | | | |
| | | | | | | |
| | | | | | | |
| | | | | | | |