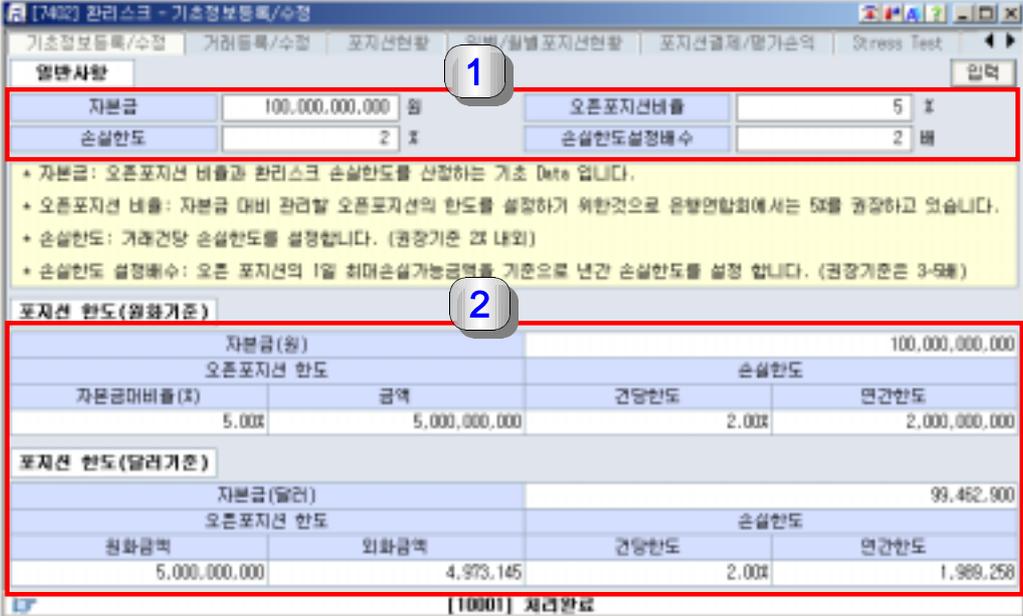




- 1. /
- 2. /
- 3. /
- 4.
- 5. /
- 6. / 가
- 7. Stress Test
- 8. Hedge Simulation
- 9. FX Risk VaR



The screenshot shows the '일반사항' (General Information) tab of the risk management system. It includes input fields for capital, loss limits, and open position limits, along with explanatory text and summary tables for position limits.

**1** (Red box highlights input fields):

- 자본금: 100,000,000,000 원
- 손실한도: 2 배
- 오픈포지션비율: 5 배
- 손실한도설정배수: 2 배

**2** (Red box highlights summary tables):

**포지션 한도 (원화기준)**

자본금 (원)		100,000,000,000	
오픈포지션 한도		손실한도	
자본금대비비율 (배)	금액	건당한도	연간한도
5.00배	5,000,000,000	2.00배	2,000,000,000

**포지션 한도 (달러기준)**

자본금 (달러)		99,462,900	
오픈포지션 한도		손실한도	
원화금액	외화금액	건당한도	연간한도
5,000,000,000	4,973,145	2.00배	1,989,258

1

:  
:  
%

:  
:  
1 가

입력

1

2



- 1. /
- 2. /
- 3. /
- 4.
- 5. /
- 6. / 가
- 7. Stress Test
- 8. Hedge Simulation
- 9. FX Risk VaR



- 1 " / (7403)"  
 , 가 ,  
 NetPosition . 가  
 - 2 가  
 - 가 / 가 가 ,  
 가 가 .



- 1. /
- 2. /
- 3. /
- 4.
- 5. /
- 6. / 가
- 7. Stress Test
- 8. Hedge Simulation
- 9. FX Risk VaR



- :  
 - 가 :  
  
 가 가  
 가 . 가 1 , 3 , 12  
 가  
 3가  
 . ( 가 )

(T.02-780-2020,080-339-2020)

- 1. /
- 2. /
- 3. /
- 4.
- 5. /
- 6. / 가
- 7. Stress Test
- 8. Hedge Simulation
- 9. FX Risk VaR

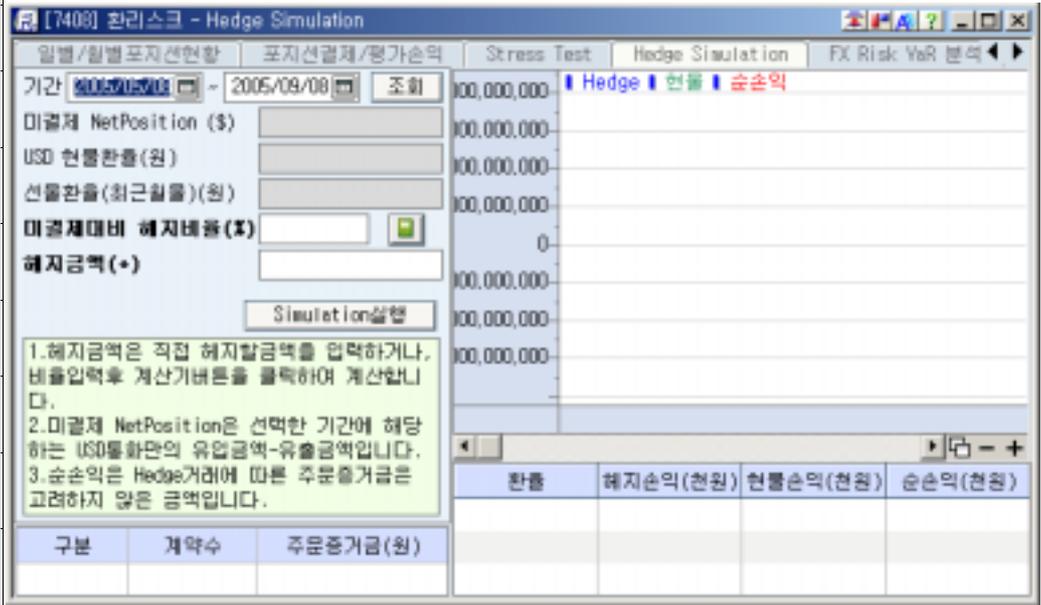
- 조회

가 .

- 가

- 가

1.	/
2.	/
3.	/
4.	
5.	/
6.	/ 가
7.	Stress Test
8.	Hedge Simulation
9.	FX Risk VaR



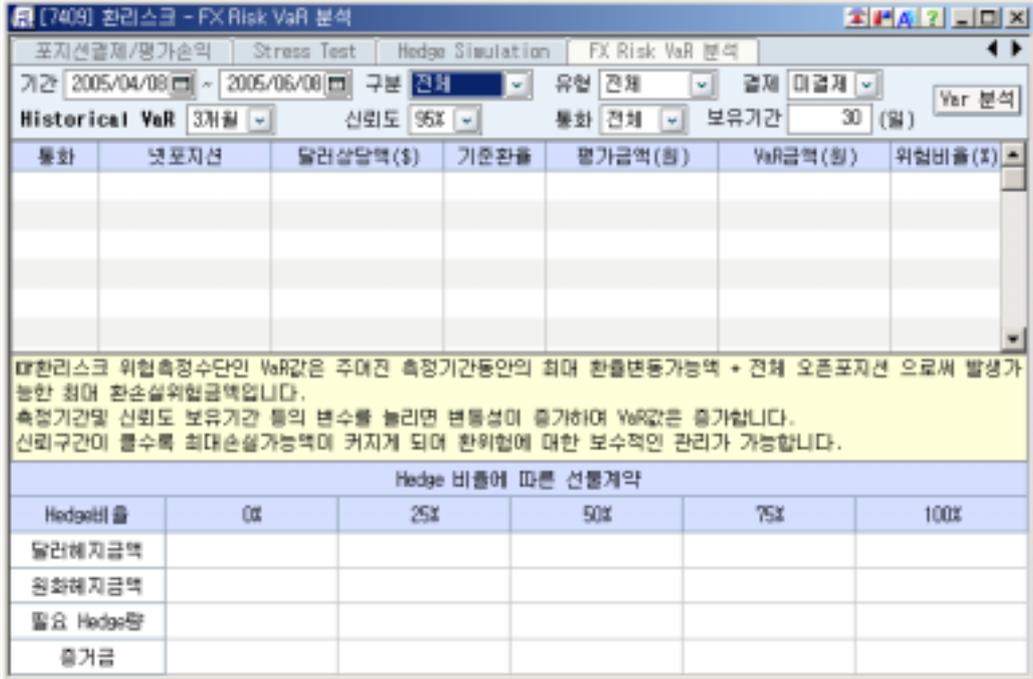
조회

Net Position

Simulation

가

1. /
2. /
3. /
- 4.
5. /
6. / 가
7. Stress Test
8. Hedge Simulation
9. FX Risk VaR



FX환리스크 위험측정수단인 VaR값은 주어진 측정기간동안의 최대 환율변동가능액 + 전체 오픈포지션 으로서 발생가능한 최대 환손실위험금액입니다.  
 측정기간 및 신뢰도 보유기간 등의 변수를 늘리면 변동성이 증가하여 VaR값은 증가합니다.  
 신뢰구간이 클수록 최대손실가능액에 커지게 되어 한위험에 대한 보수적인 관리가 가능합니다.

Hedge비율	0%	25%	50%	75%	100%
달러헤지금액					
원화헤지금액					
필요 Hedge량					
종가금					

- 가

VaR(Value at Risk) .

- 95%,99%  
 가 가

- Historical VaR .

= FX Exposure \* 가 \* , 가

VaR 가 .