



2014 추계 심포지엄

# 자본시장에서의

# 변동성 파생상품

일시 : 2014년 11월 6일(목) 오후 4시~6시

장소 : 금융투자협회 3층 볼스홀



## 초대의 말씀

가을의 편안한 정취가 우리에게 다가와 있습니다. 한국파생상품학회 회원 여러분, 그리고 한국 자본시장의 발전을 염원하는 여러분 모두에게 기쁨과 행운의 시간들이 가득하기 바랍니다.

한국 자본시장이 V-KOSPI200선물 상장을 앞두고 있습니다. V-KOSPI 200선물은 지수선물시장을 한걸음 더 발전시킬 것으로 기대합니다. 변동성 지수선물은 옵션투자자에게 변동성위험을 헤지하는 수단을 제공할 뿐 아니라, ELS 등 장외파생상품의 헤지수요를 흡수하는 길을 제공할 것입니다. 또한 변동성지수 ETN과 연계한 차익거래와 변동성 방향성거래 등 기관투자자에게 다양한 거래 기회를 제공할 것으로 기대하고 있습니다.

이에 한국파생상품학회는 변동성 파생상품에 대한 연구와 토론의 장을 제공하고자 합니다. 변동성 파생상품이 자본시장에서 어떤 역할을 할 수 있고, 또 기관투자자 등 시장참여자들이 변동성 파생상품을 어떻게 활용할 수 있는지를 검토하고 시사점을 찾으려 합니다. 이 정책심포지엄은 변동성 파생상품에 대한 정책방향과 실천방안을 제시할 것입니다. 한국파생상품학회 회원 여러분들이 많은 관심을 가지고 정책심포지엄에 참석해 주시면 감사하겠습니다.

2014년 11월

한국파생상품학회 회장 전 상 경



사회 **엄찬영** (한국파생상품학회 총무이사, 한양대학교)

시 간	내 용
15:30~16:00	등록
16:00~16:15	<p><b>인사말씀</b></p> <p>개회사 : <b>전상경</b> (한국파생상품학회 회장, 한양대학교)                      축 사 : <b>최경수</b> (KRX 이사장)</p>
16:15~16:35	<p><b>발표 1</b></p> <p><b>발표자</b> : 김도연 (KRX 파생상품시장본부 상무)  <b>주 제</b> : 변동성지수선물(VKOSPI200) 주요 제도안</p>
16:35~17:10	<p><b>발표 2</b></p> <p><b>발표자</b> : 엄영호 (연세대학교 교수)  <b>주 제</b> : 자본시장에서의 변동성 파생상품의 역할과 활용전략</p>
17:10~17:20	Coffee Break
17:20~18:10	<p><b>토론 및 질의응답</b></p> <p>사회자: <b>최영수</b> (한국외국어대학교 교수)</p> <p><b>지정 토론자</b></p> <p><b>남길남</b> (자본시장연구원 파생상품실 연구위원)  <b>박태준</b> (KRX 파생연구센터 선임연구위원)  <b>전 균</b> (삼성증권 리서치센터 연구위원)  <b>전인태</b> (가톨릭대학교 교수)</p>



## 찾아오시는 길



### | 교통편 안내 |

- 지하철 : 5, 9호선 여의도역 5번 출구
- 버 스 : 한국거래소 정류장에서 하차
  - 간선(파랑) : 261번, 600번, 661번, 753번
  - 지선(초록) : 5711번, 5615번, 5713번, 6628번, 7613번
  - 마을 버스 : 영등포 11번