

공시일	2018-12-21
기준일	2018-12-20

포커스농산물모(채권-파생형)

1. 계약금액

(단위:USD 백만)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	6	0	6	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)

* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

공시일	2018-12-21
기준일	2018-12-20

좋은아침펀더멘탈인덱스모(주식)

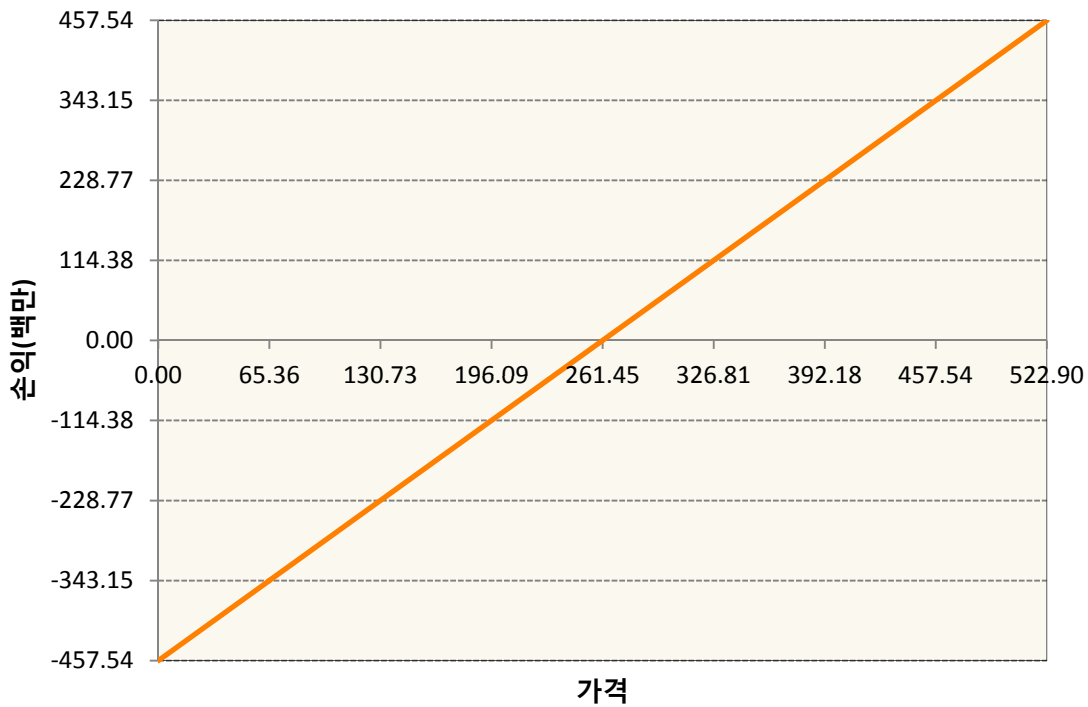
1. 계약금액

(단위:백만원)

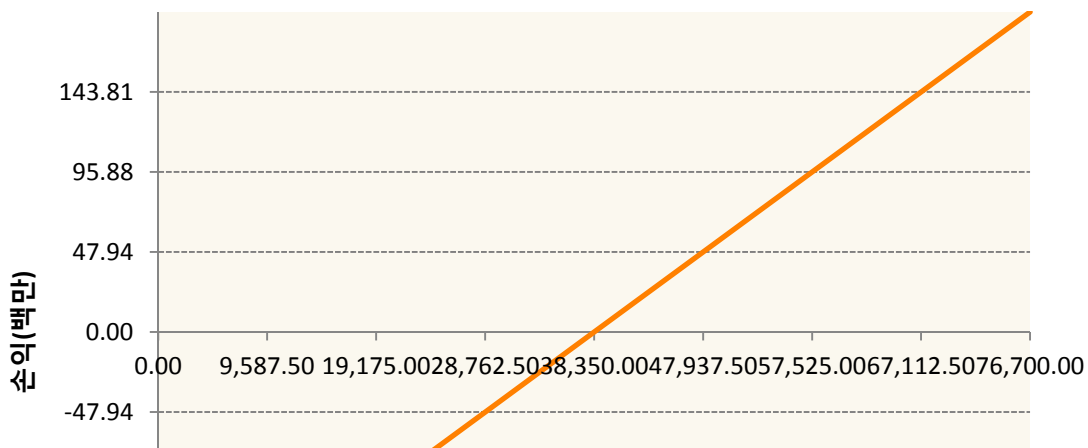
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	649	0	649	장내

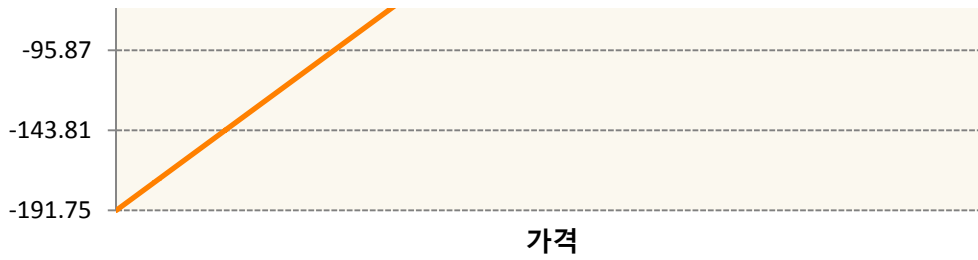
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P30007-2019-03 코스피200지수선물



KR4111P10008-2019-01 삼성전자개별선물





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101P30007		2019-03 코스피200지수선물						37
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-37	-37	-37	-37	-37	-37	-37	
-5.33%	-25	-25	-25	-25	-25	-25	-25	
-2.67%	-12	-12	-12	-12	-12	-12	-12	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	12	12	12	12	12	12	12	
5.33%	25	25	25	25	25	25	25	
8.00%	37	37	37	37	37	37	37	
KR4111P10008		2019-01 삼성전자개별선물						15
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-15	-15	-15	-15	-15	-15	-15	
-5.33%	-10	-10	-10	-10	-10	-10	-10	
-2.67%	-5	-5	-5	-5	-5	-5	-5	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	5	5	5	5	5	5	5	
5.33%	10	10	10	10	10	10	10	
8.00%	15	15	15	15	15	15	15	

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) (단위:백만원)

50

공시일	2018-12-21
기준일	2018-12-20

스마트인덱스모

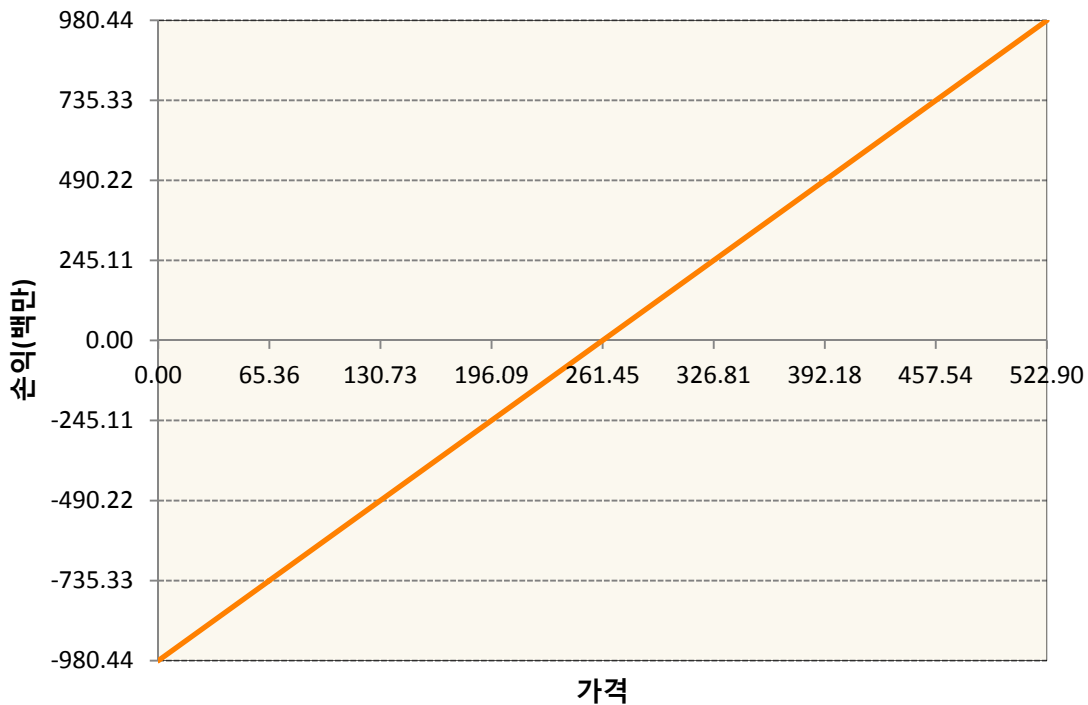
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	980	0	980	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101P30007-2019-03 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101P30007		2019-03 코스피200지수선물						79
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-79	-79	-79	-79	-79	-79	-79	
-5.33%	-53	-53	-53	-53	-53	-53	-53	
-2.67%	-26	-26	-26	-26	-26	-26	-26	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	26	26	26	26	26	26	26	
5.33%	53	53	53	53	53	53	53	
8.00%	79	79	79	79	79	79	79	

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)

(단위:백만원)

69

공시일	2018-12-21
기준일	2018-12-20

SMART합성-MSCI선진국증권상장

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	13,197	0	13,197	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWMXWO0(신한MXWO 미래S181122

1,007

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)

(단위:백만원)

524

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2018-12-21
기준일	2018-12-20

SMART중국본토중소형CSI500상장

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	3,355	0	3,355	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI50000 신한CSI500미래S180910

258

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)

(단위:백만원)

381

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2018-12-21
기준일	2018-12-20

유로인덱스모(주식-파생형)

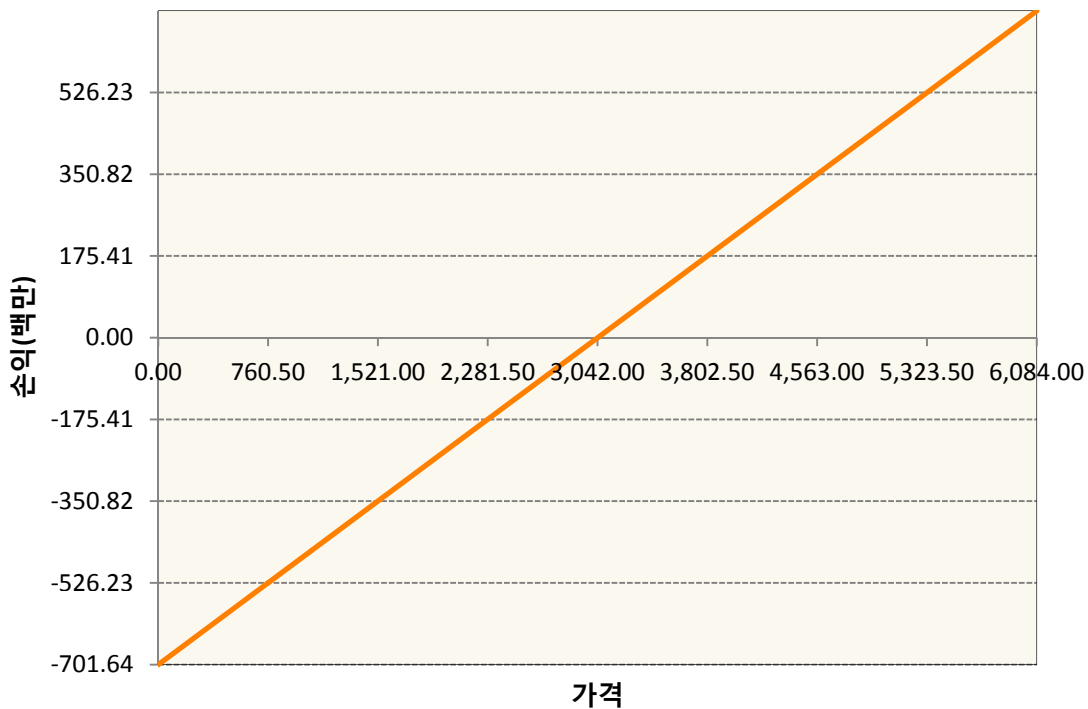
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	702	0	702	

2. 만기시점의 손익구조

VGH9-EURO STOXX 50 Mar19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGH9	EURO STOXX 50 Mar19	56
------	---------------------	----

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)

(단위:백만원)

37

공시일	2018-12-21
기준일	2018-12-20

차이나인덱스모(주식-파생형)

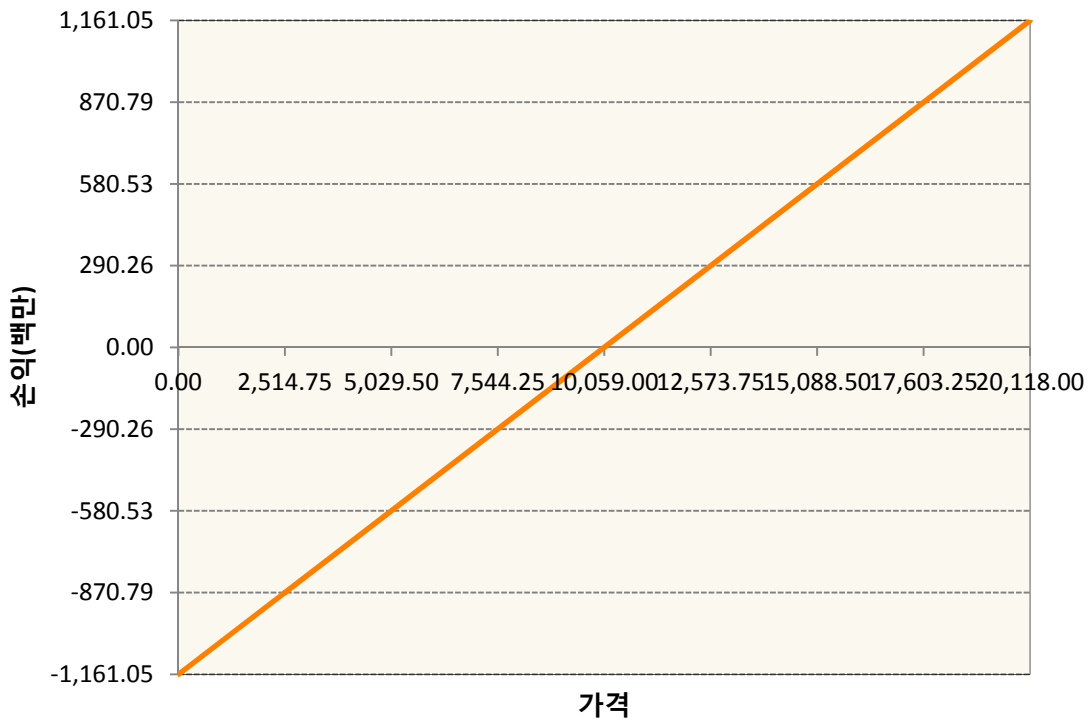
1. 계약금액

(단위:백만원)

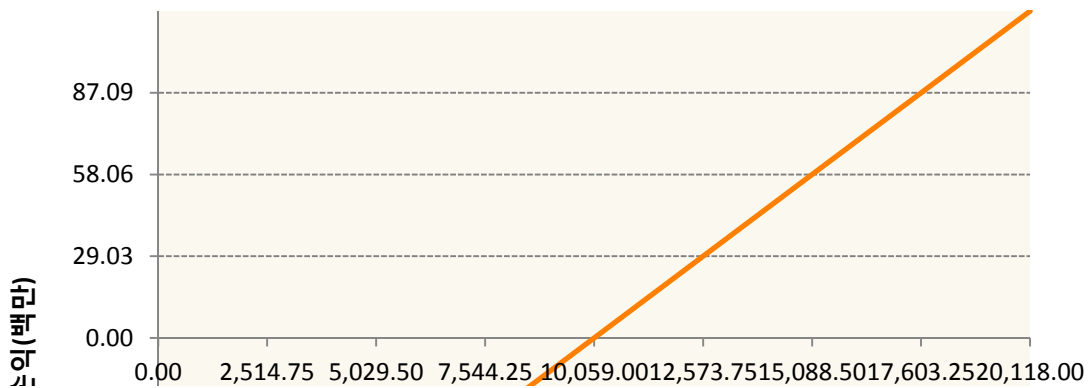
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,161	0	1,161	
누계	유가증권	선물	116	0	116	장내

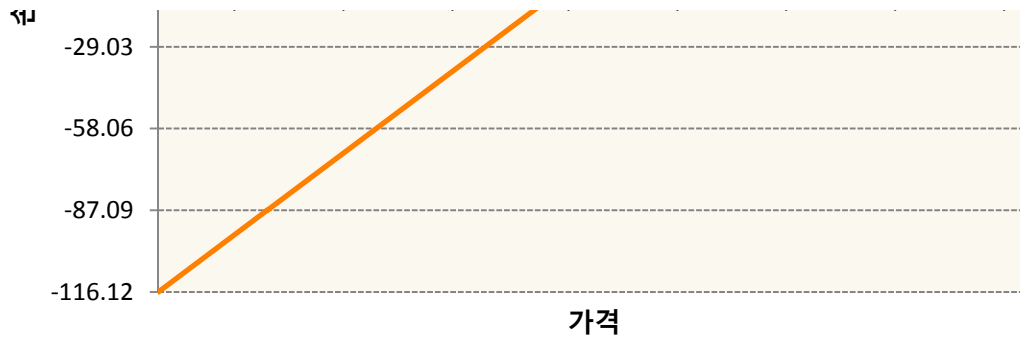
2. 만기시점의 손익구조

HCZ8-HSCEI FUTURES DEC 18



MHCZ8-MINI H-SHR IDX FU DEC18





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

HCZ8	HSCEI FUTURES DEC 18	93
MHCZ8	MINI H-SHR IDX FU DEC18	9

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) (단위:백만원)

93

공시일	2018-12-21
기준일	2018-12-20

커버드콜모(주식혼합-파생형)

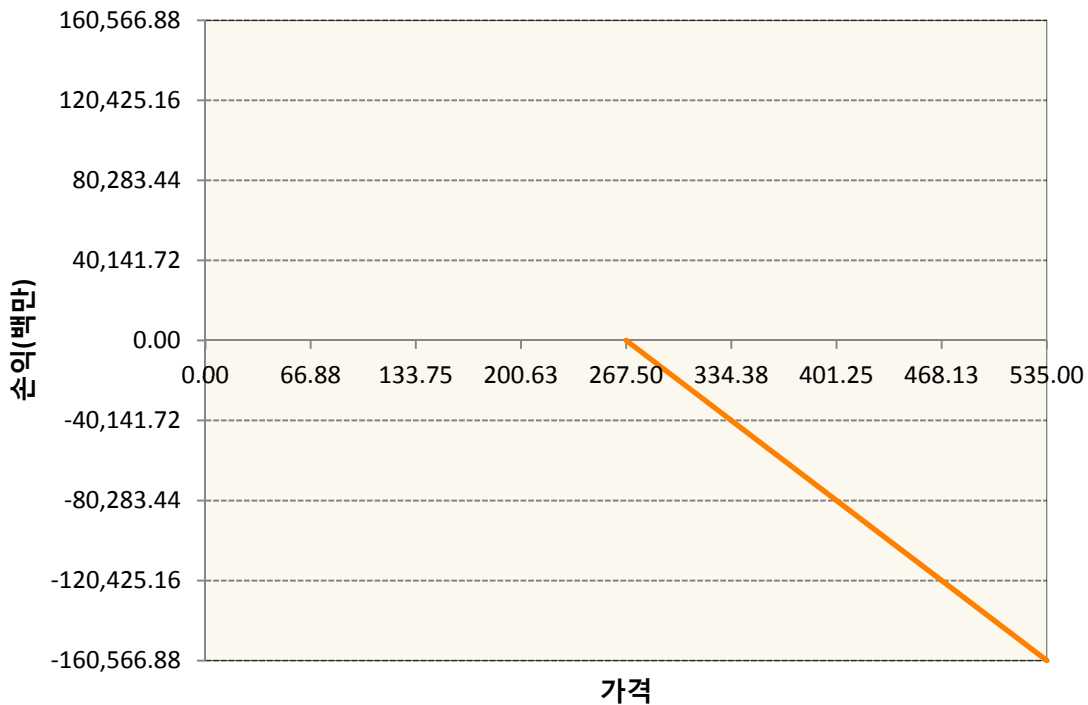
1. 계약금액

(단위:백만원)

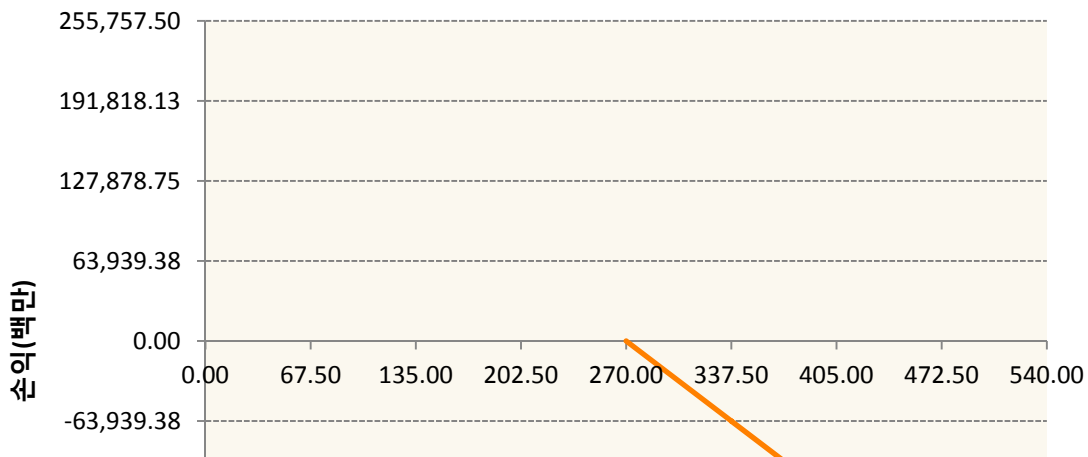
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	699,824	-699,824	장내

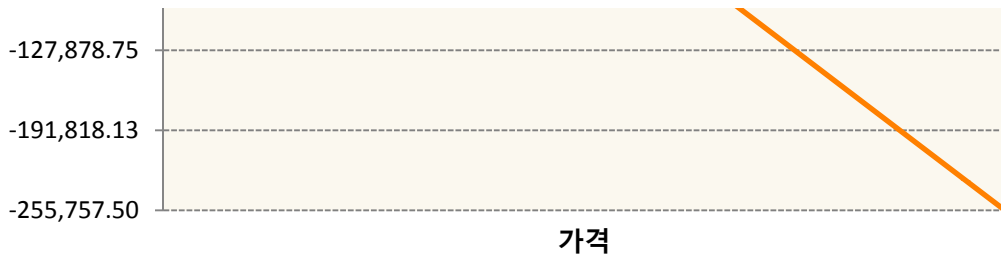
2. 만기시점의 손익구조

KR4201P12672-2019-01 콜267.5

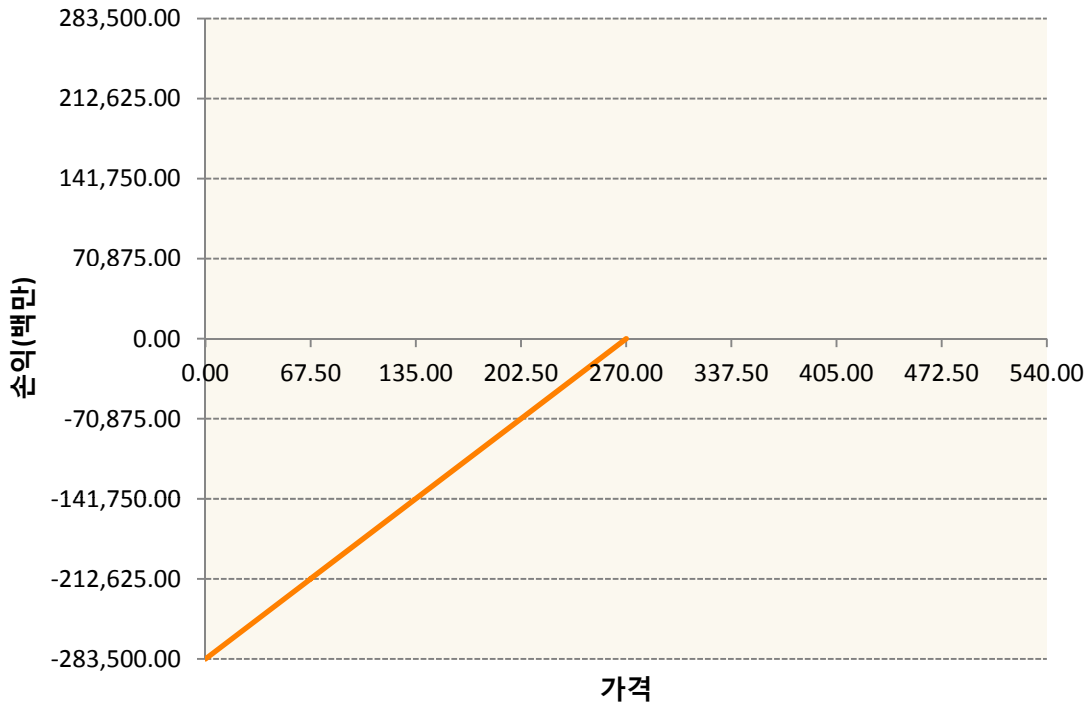


KR4201P12706-2019-01 콜270





KR4301P12704-2019-01 풋270



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4201P12672		2019-01 콜267.5					9,237
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	3,256	3,195	3,112	3,007	2,883	2,740	2,581
-5.33%	3,021	2,873	2,702	2,511	2,302	2,079	1,844
-2.67%	2,371	2,112	1,841	1,559	1,270	974	673
0%	1,011	675	338	0	-339	-678	-1,018
2.67%	-1,238	-1,570	-1,904	-2,240	-2,578	-2,917	-3,258
5.33%	-4,322	-4,575	-4,844	-5,126	-5,417	-5,716	-6,022
8.00%	-8,003	-8,156	-8,335	-8,535	-8,754	-8,989	-9,237
KR4201P12706		2019-01 콜270					13,701
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	4,252	4,183	4,084	3,954	3,793	3,602	3,384

-5.33%	4,002	3,820	3,598	3,342	3,056	2,744	2,409
-2.67%	3,247	2,894	2,514	2,111	1,690	1,254	806
0%	1,532	1,028	517	0	-521	-1,044	-1,571
2.67%	-1,513	-2,060	-2,607	-3,155	-3,703	-4,252	-4,801
5.33%	-5,936	-6,395	-6,869	-7,357	-7,855	-8,361	-8,874
8.00%	-11,448	-11,751	-12,090	-12,459	-12,854	-13,268	-13,701
KR4301P12704 2019-01 풋270							19,660
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-19,460	-19,467	-19,480	-19,504	-19,541	-19,592	-19,660
-5.33%	-12,098	-12,145	-12,214	-12,307	-12,423	-12,563	-12,724
-2.67%	-5,006	-5,183	-5,389	-5,620	-5,873	-6,145	-6,433
0%	1,112	751	379	0	-386	-776	-1,170
2.67%	5,325	4,905	4,484	4,062	3,639	3,215	2,791
5.33%	7,420	7,131	6,820	6,492	6,149	5,795	5,431
8.00%	8,130	8,007	7,853	7,670	7,460	7,227	6,974

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)

(단위:백만원)

42,830

공시일	2018-12-21
기준일	2018-12-20

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

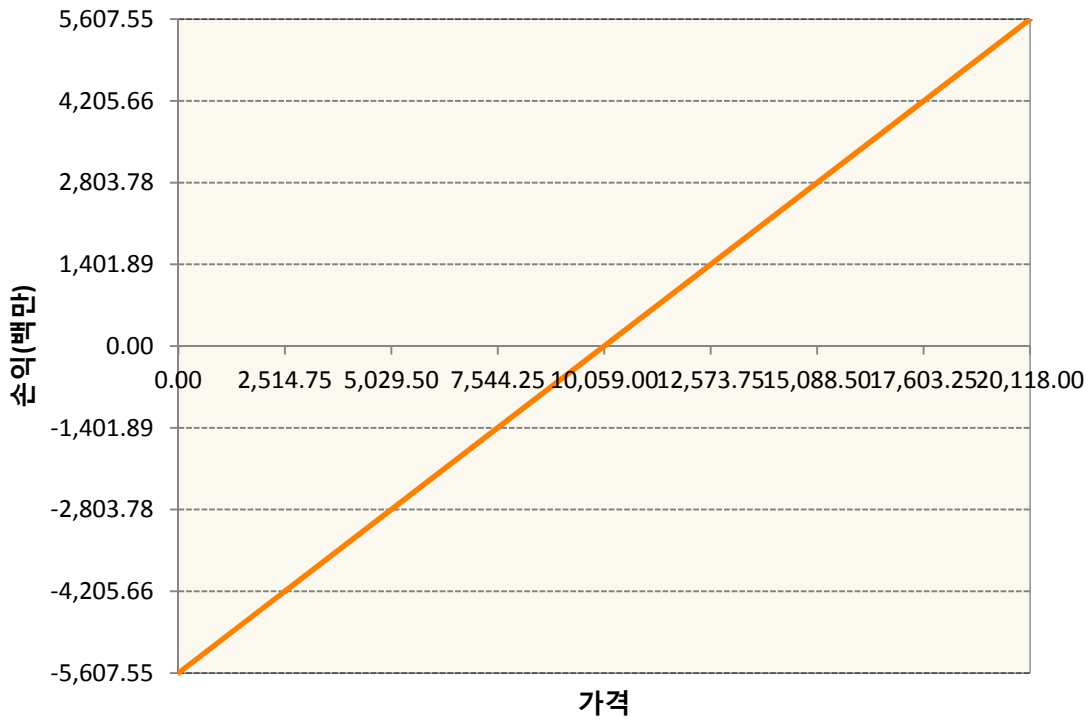
1. 계약금액

(단위:백만원)

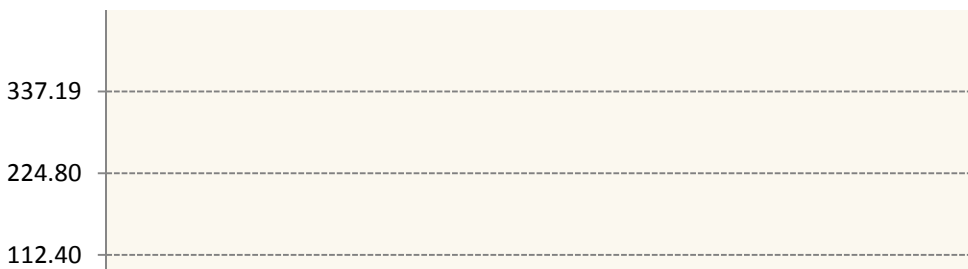
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	5,608	0	5,608	
누계	유가증권	옵션	0	13,119	-13,119	장내
누계	통화	선도	0	2,738	-2,738	장외

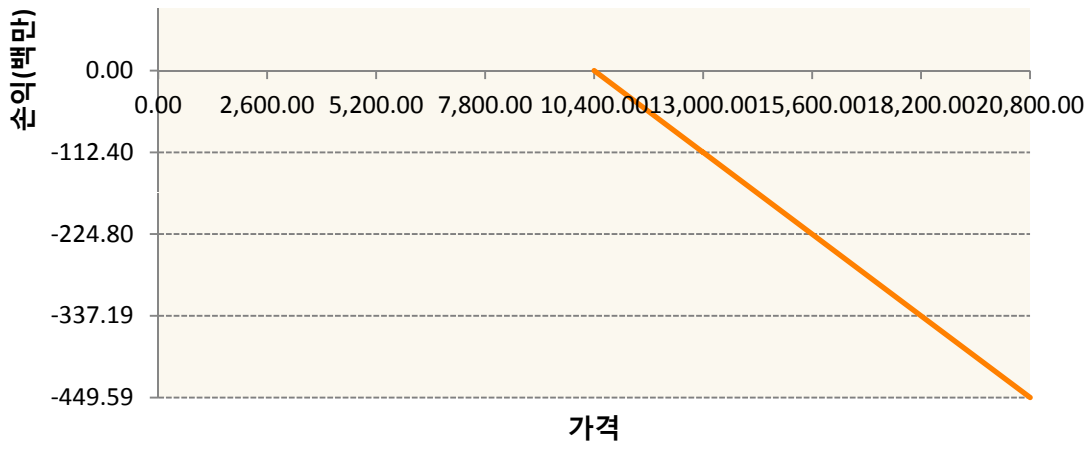
2. 만기시점의 손익구조

HCZ8-HSCEI FUTURES DEC 18

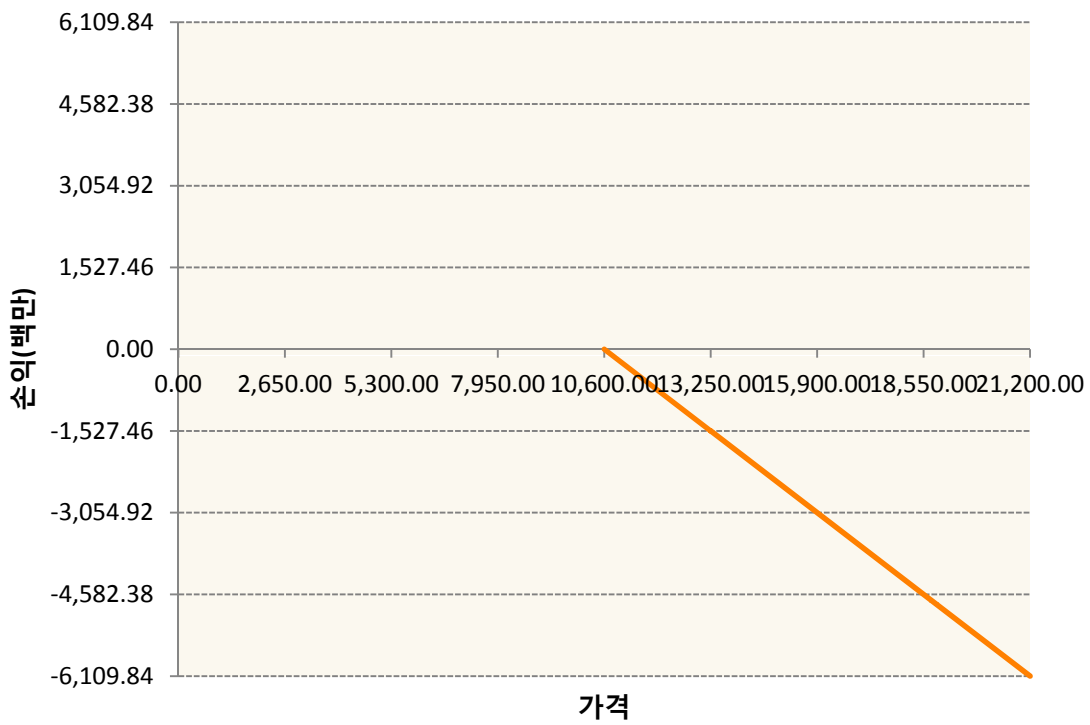


OHHI28-C104-HSCEI

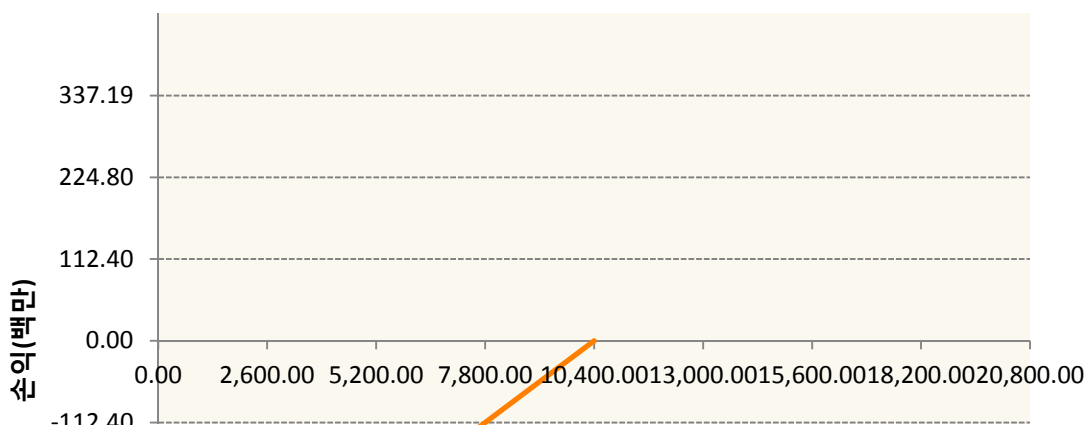


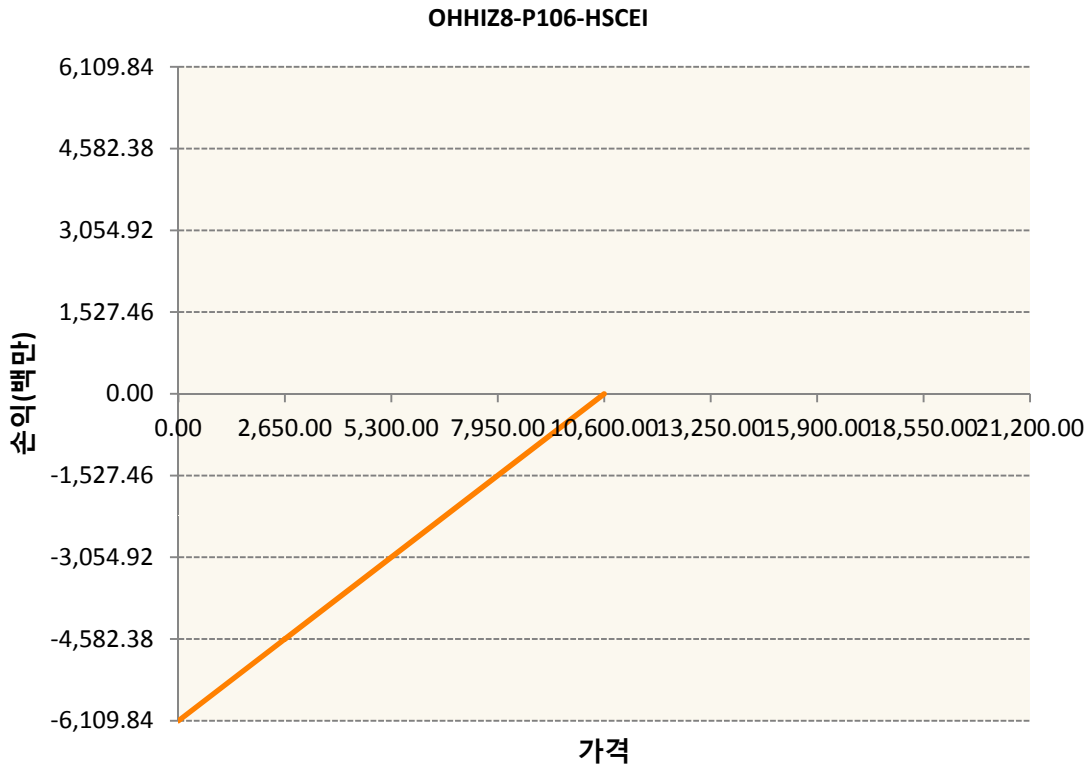
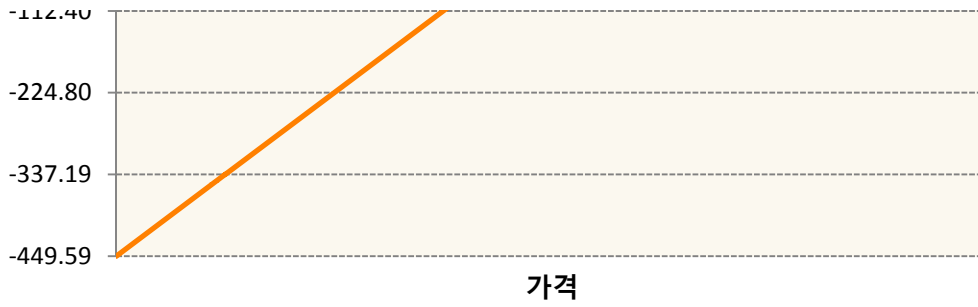


OHHIZ8-C106-HSCEI



OHHIZ8-P104-HSCEI





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)	(단위:백만원)
FX21018Z00 KRW/HKD 11-03-19E	219
HCZ8 HSCEI FUTURES DEC 18	449
OHHIZ8-C1C HSCEI	36
OHHIZ8-C1C HSCEI	489
OHHIZ8-P10 HSCEI	36
OHHIZ8-P10 HSCEI	489

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,544

공시일	2018-12-21
기준일	2018-12-20

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

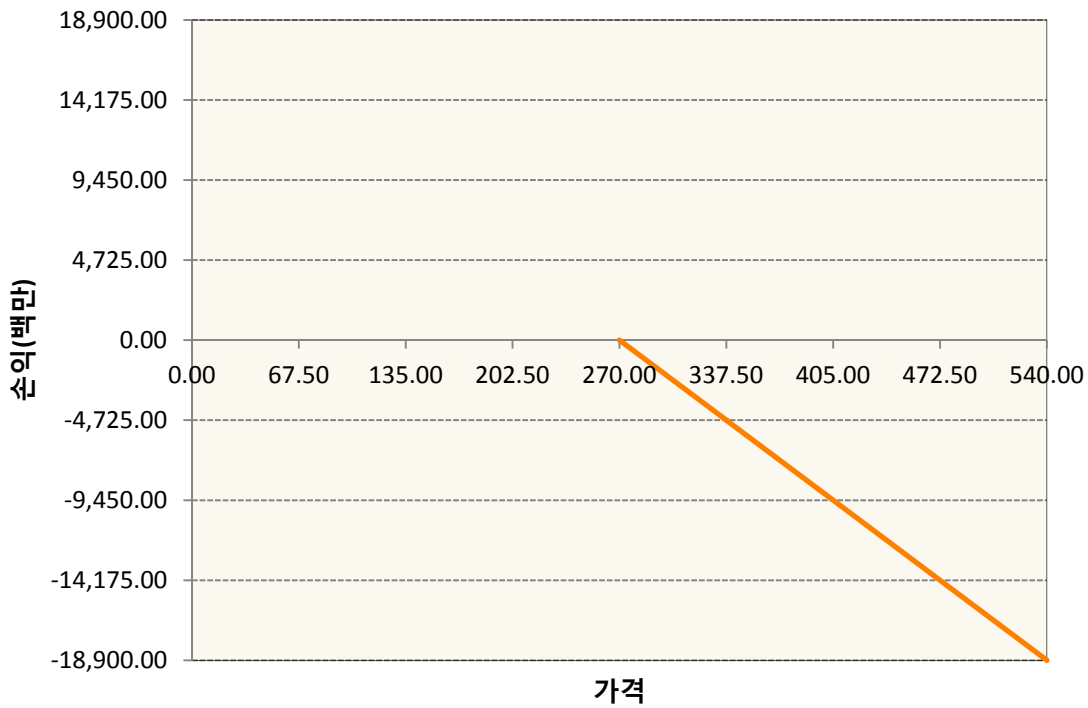
1. 계약금액

(단위:백만원)

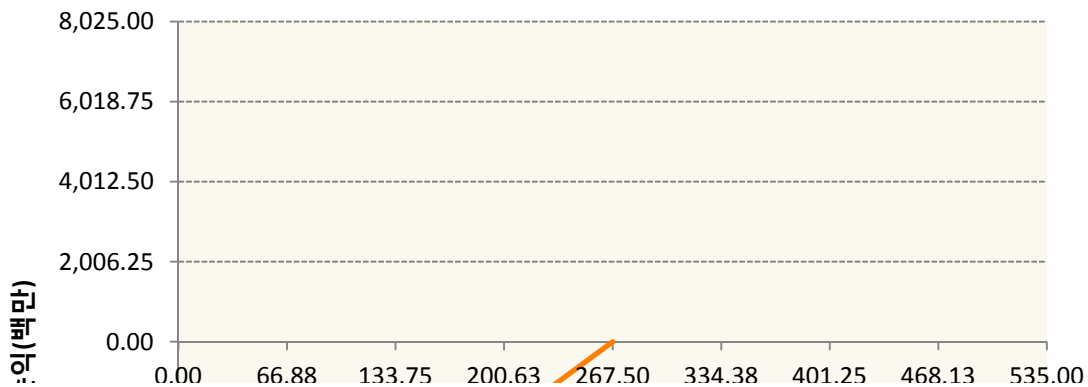
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	스왑	31,836	0	31,836	장외
누계	유가증권	옵션	0	34,350	-34,350	장내

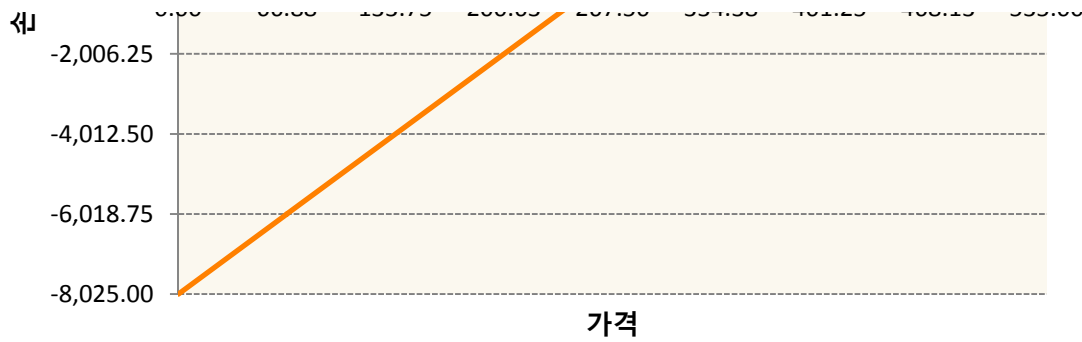
2. 만기시점의 손익구조

KR4201P12706-2019-01 콜270

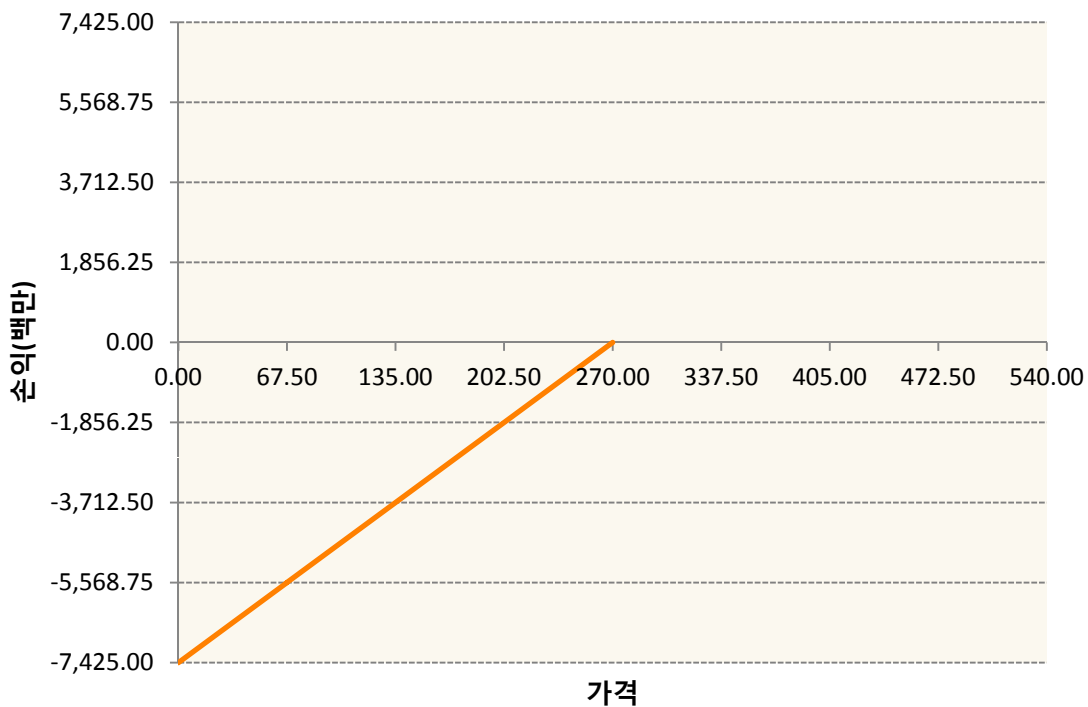


KR4301P12670-2019-01 풋267.5





KR4301P12704-2019-01 풋270



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

	2.529E+11		UBCSFXC1 INDEX_14				2,635	
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-2,635	-2,635	-2,635	-2,635	-2,635	-2,635	-2,635	
-5.33%	-1,757	-1,757	-1,757	-1,757	-1,757	-1,757	-1,757	
-2.67%	-878	-878	-878	-878	-878	-878	-878	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	878	878	878	878	878	878	878	
5.33%	1,757	1,757	1,757	1,757	1,757	1,757	1,757	
8.00%	2,635	2,635	2,635	2,635	2,635	2,635	2,635	
	KR4201P12706		2019-01 콜270				1,012	
	기초자산의 변동성							

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	314	309	302	292	280	266	250
-5.33%	296	282	266	247	226	203	178
-2.67%	240	214	186	156	125	93	60
0%	113	76	38	0	-38	-77	-116
2.67%	-112	-152	-193	-233	-274	-314	-355
5.33%	-439	-473	-508	-544	-580	-618	-656
8.00%	-846	-868	-893	-921	-950	-981	-1,012

KR4301P12670 2019-01 풋267.5 538

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-529	-530	-530	-531	-533	-535	-538
-5.33%	-320	-322	-325	-329	-333	-339	-344
-2.67%	-124	-131	-138	-146	-155	-164	-173
0%	35	23	12	0	-12	-23	-35
2.67%	133	122	110	99	87	76	64
5.33%	175	169	161	154	145	136	127
8.00%	187	185	182	178	173	168	162

KR4301P12704 2019-01 풋270 515

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-510	-510	-510	-511	-512	-513	-515
-5.33%	-317	-318	-320	-322	-325	-329	-333
-2.67%	-131	-136	-141	-147	-154	-161	-168
0%	29	20	10	0	-10	-20	-31
2.67%	139	128	117	106	95	84	73
5.33%	194	187	179	170	161	152	142
8.00%	213	210	206	201	195	189	183

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)

(단위:백만원)

4,709

공시일	2018-12-21
기준일	2018-12-20

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

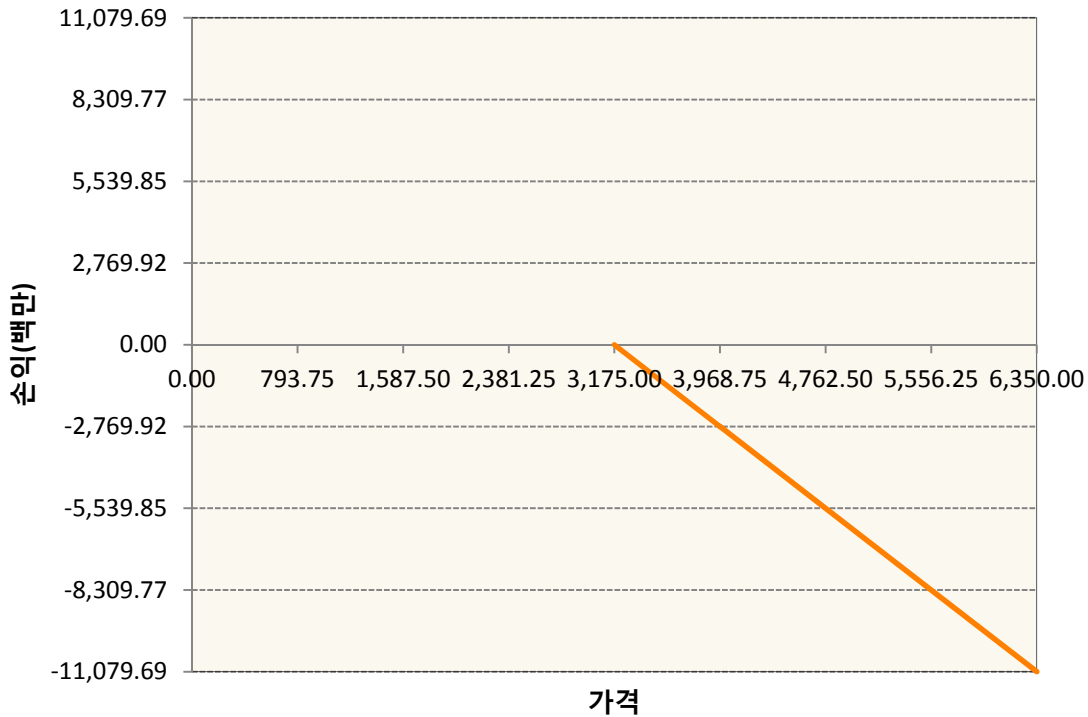
1. 계약금액

(단위:백만원)

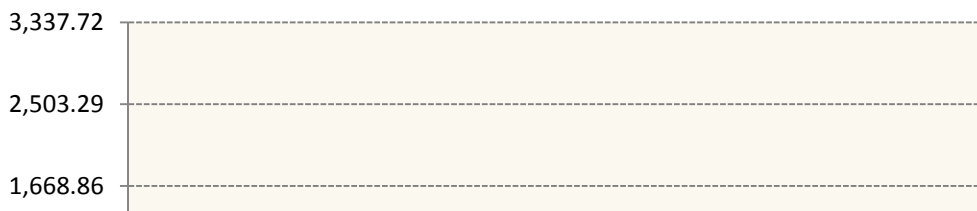
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	7,812	0	7,812	
누계	유가증권	스왑	71,920	0	71,920	장외
누계	유가증권	옵션	0	28,835	-28,835	장내
누계	통화	선도	0	25,753	-25,753	장외

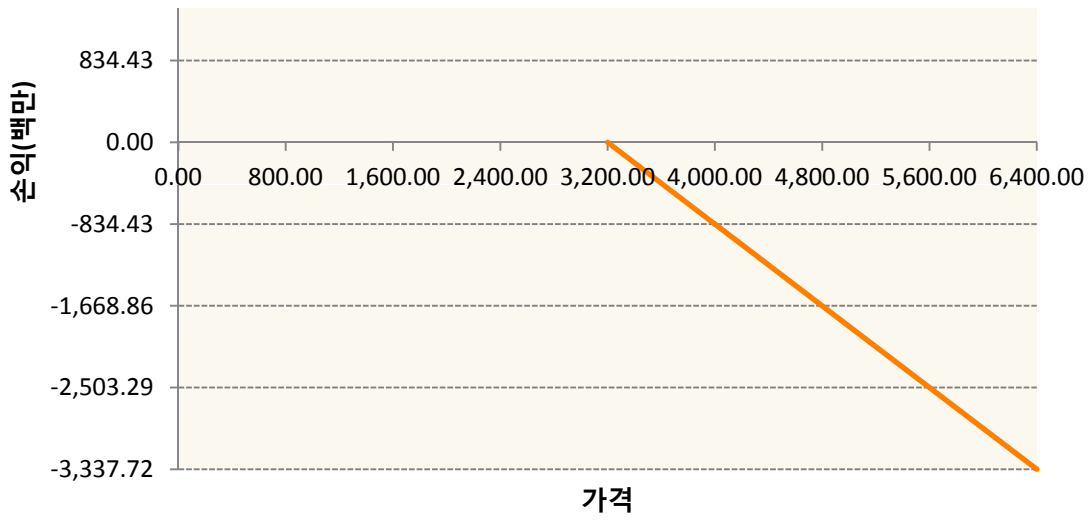
2. 만기시점의 손익구조

OESXZ8-C3175-EURO STOXX 50

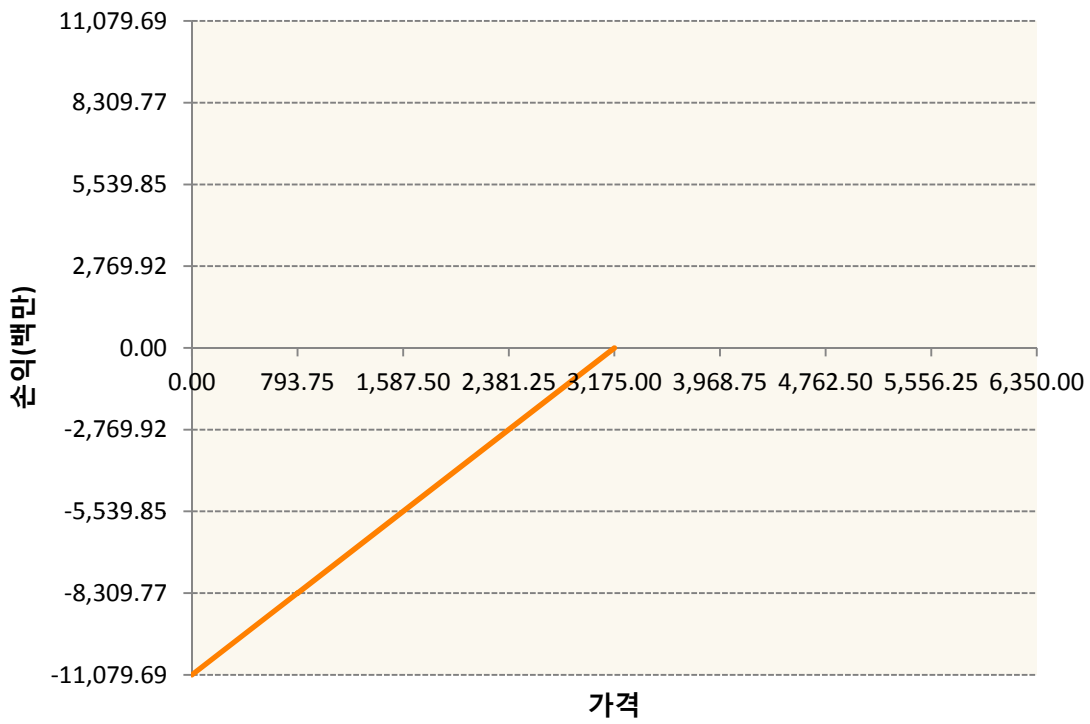


OESXZ8-C3200-EURO STOXX 50

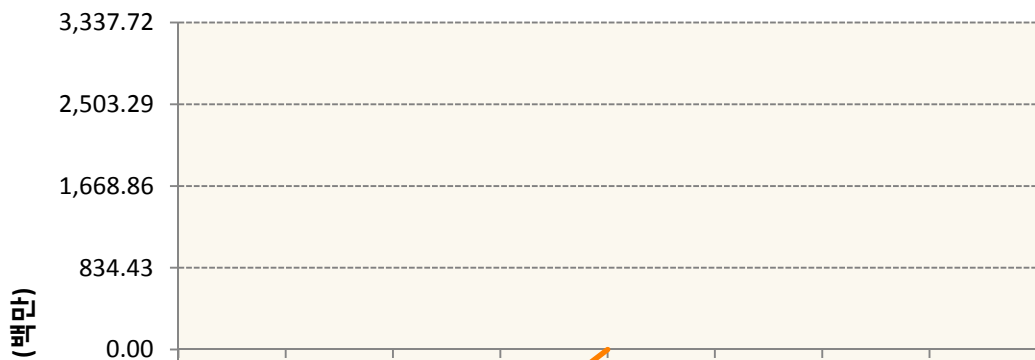


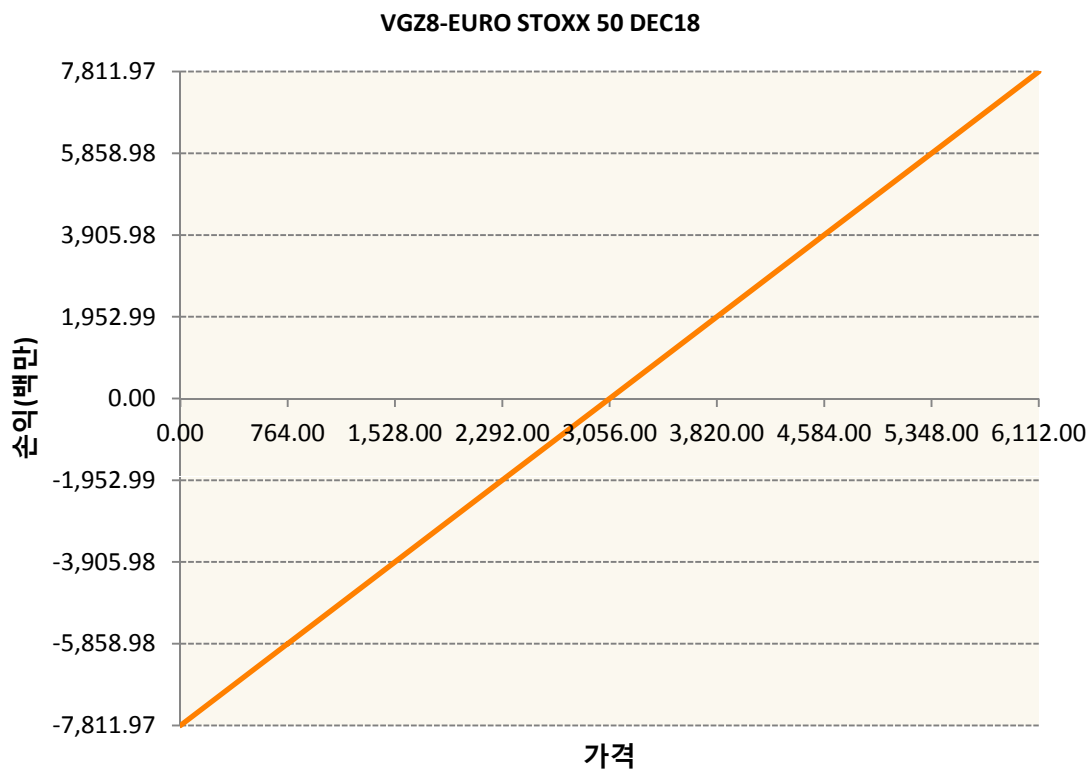
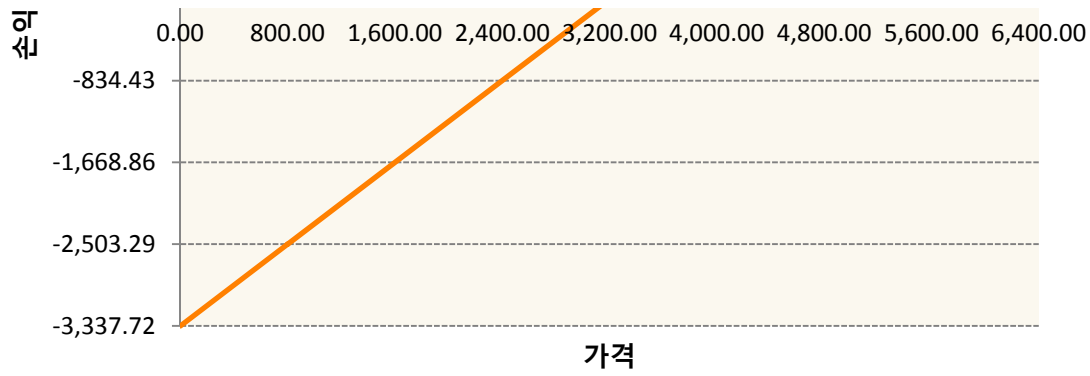


OESXZ8-P3175-EURO STOXX 50



OESXZ8-P3200-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY	76
FX21018U03 KRW/EUR 21-12-18E	824
FX21018X02 KRW/EUR 22-02-19E	412
FX21018Z03 KRW/EUR 22-03-19E	824
OESXZ8-C31 EURO STOXX 50	886
OESXZ8-C32 EURO STOXX 50	267
OESXZ8-P31 EURO STOXX 50	886
OESXZ8-P32 EURO STOXX 50	267
VGZ8 EURO STOXX 50 DEC18	625

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)

(단위:백만원)

3,171

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)

(단위:백만원)

1,075

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)

(단위:백만원)

92

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)

(단위:백만원)

137

공시일	2018-12-21
기준일	2018-12-20

스마트KRX300인덱스목표전환형1호

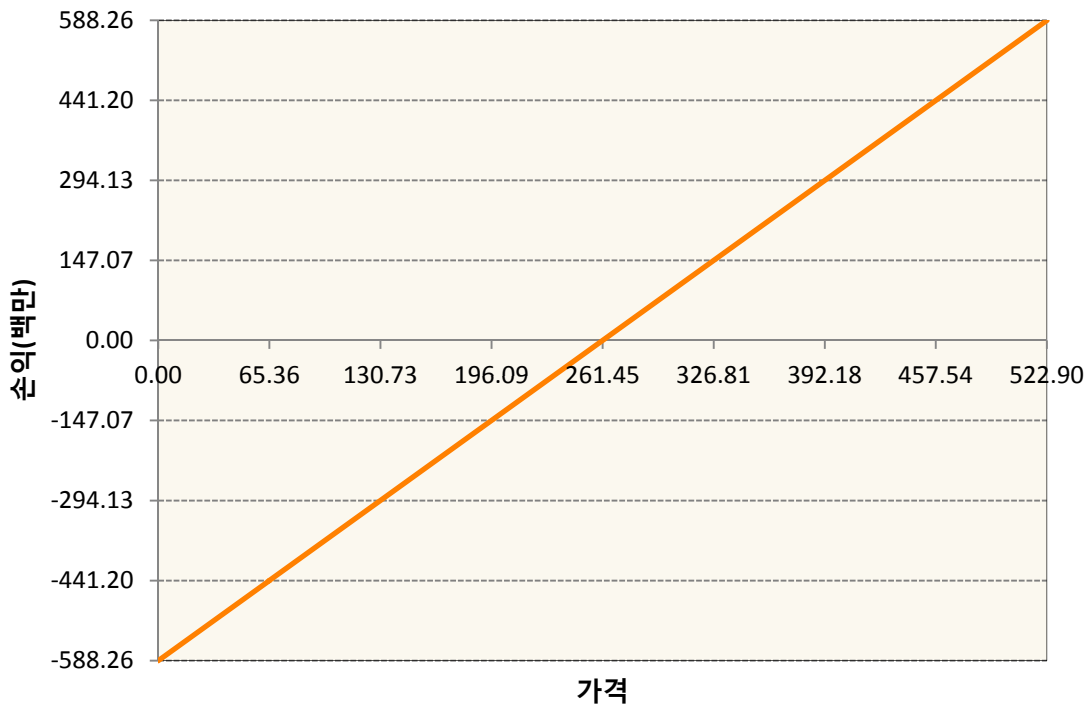
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	588	0	588	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101P30007-2019-03 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101P30007		2019-03 코스피200지수선물						48
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-48	-48	-48	-48	-48	-48	-48	
-5.33%	-32	-32	-32	-32	-32	-32	-32	
-2.67%	-16	-16	-16	-16	-16	-16	-16	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	16	16	16	16	16	16	16	
5.33%	32	32	32	32	32	32	32	
8.00%	48	48	48	48	48	48	48	

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)

(단위:백만원)

41

공시일	2018-12-21
기준일	2018-12-20

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

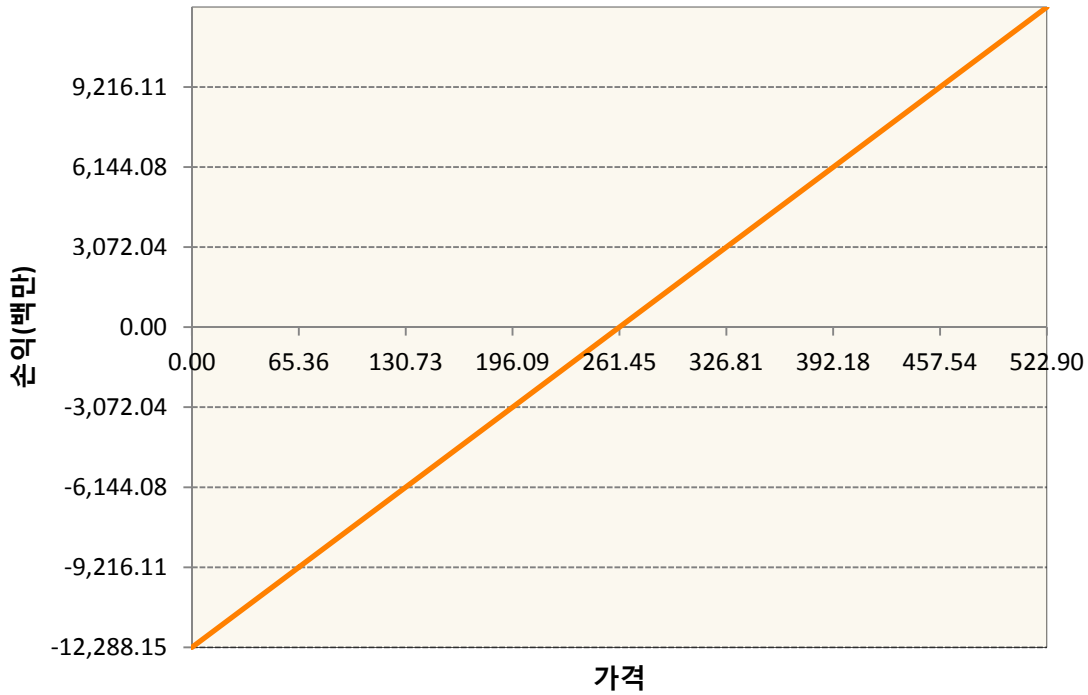
1. 계약금액

(단위:백만원)

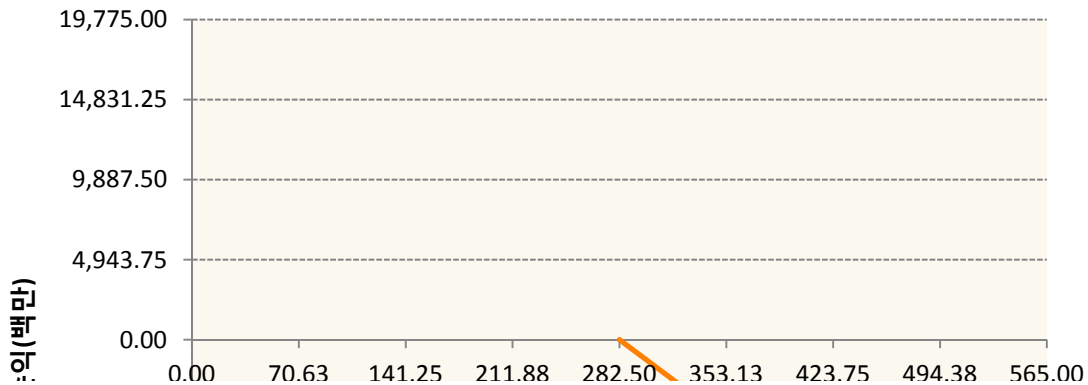
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	12,288	0	12,288	장내
누계	유가증권	옵션	1,145	23,338	-22,193	장내

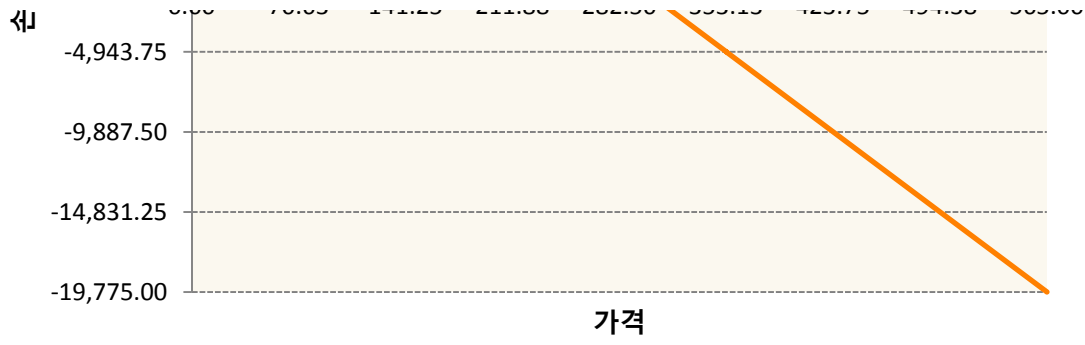
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P30007-2019-03 코스피200지수선물

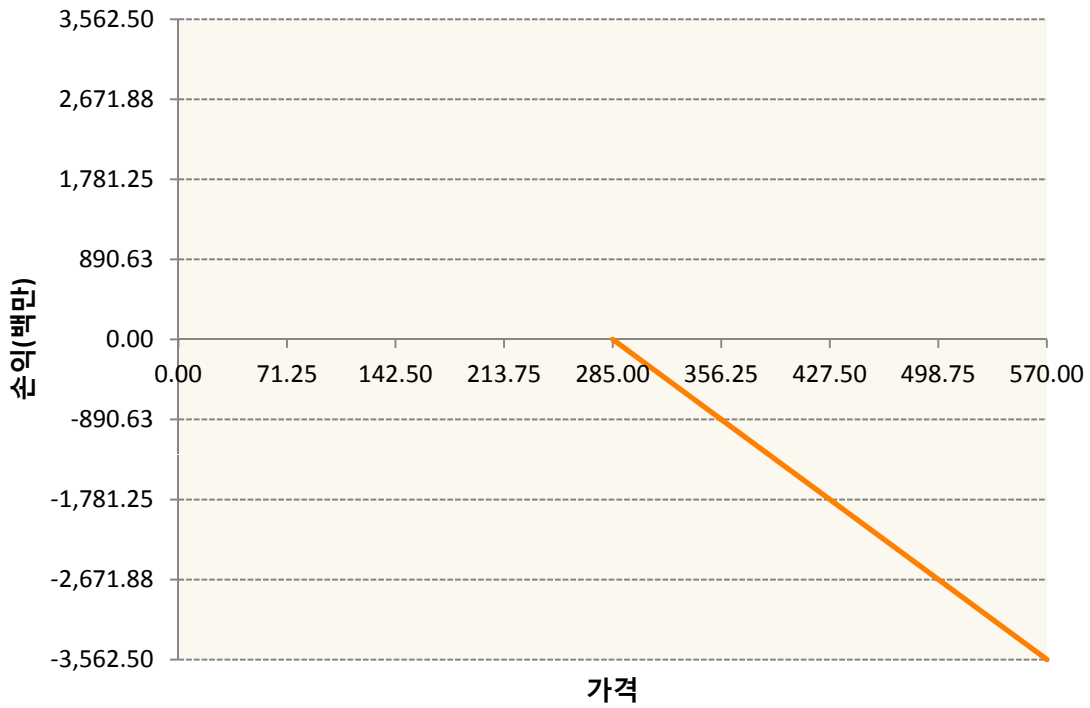


KR4201P12821-2019-01 콜282.5

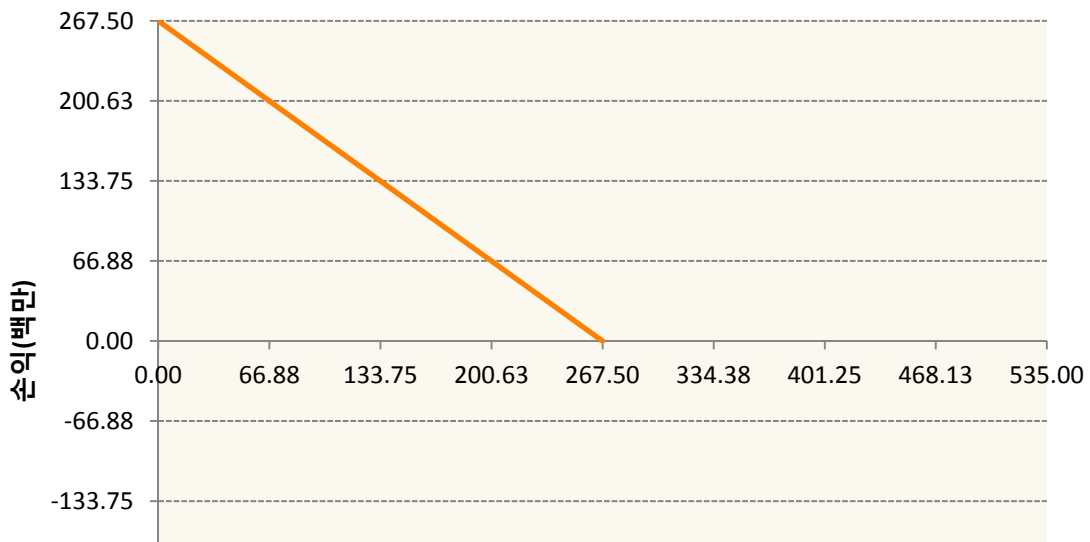


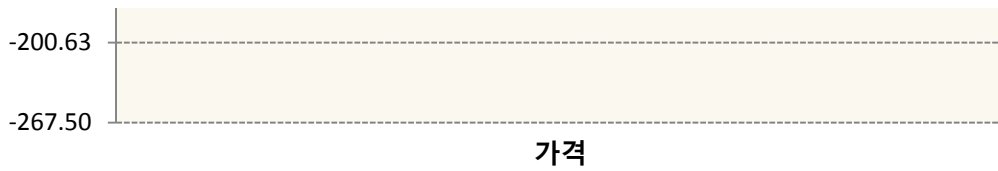


KR4201P12854-2019-01 콜285

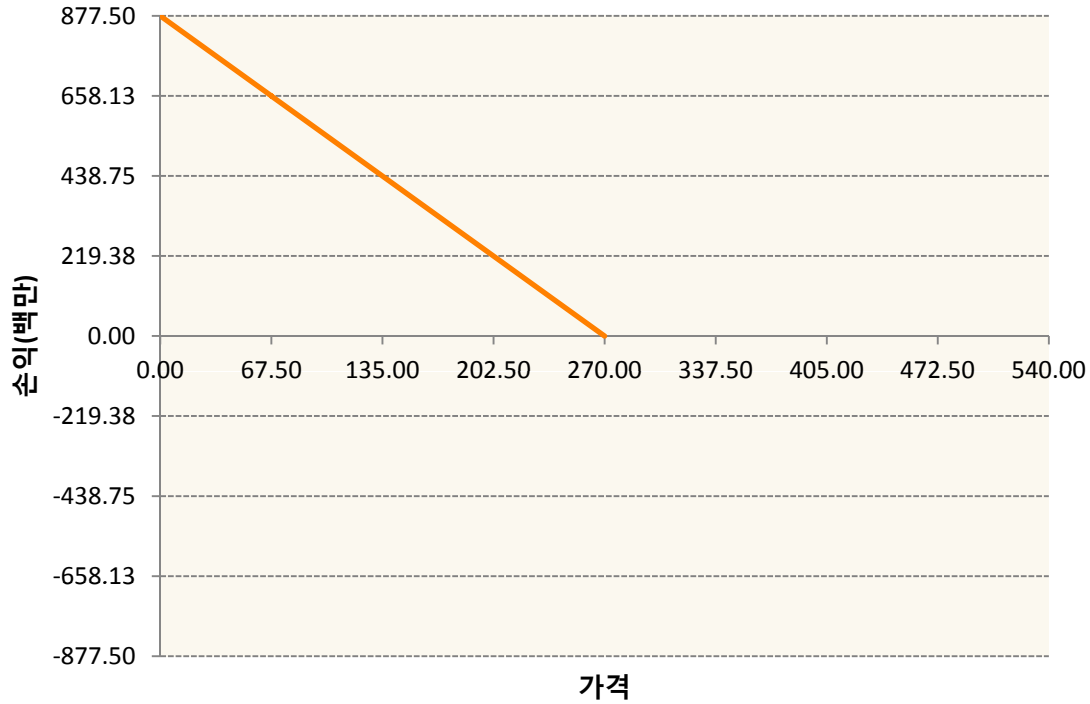


KR4301P12670-2019-01 풋267.5





KR4301P12704-2019-01 풋270



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101P30007		2019-03 코스피200지수선물						996
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-996	-996	-996	-996	-996	-996	-996	
-5.33%	-664	-664	-664	-664	-664	-664	-664	
-2.67%	-332	-332	-332	-332	-332	-332	-332	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	332	332	332	332	332	332	332	
5.33%	664	664	664	664	664	664	664	
8.00%	996	996	996	996	996	996	996	
KR4201P12821		2019-01 콜282.5						664
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	101	101	100	97	94	89	82	
-5.33%	100	97	93	87	79	68	56	
-2.67%	92	84	73	59	43	25	5	

0%	63	45	24	0	-26	-53	-82
2.67%	-11	-43	-76	-110	-145	-181	-218
5.33%	-163	-204	-245	-286	-327	-369	-411
8.00%	-412	-454	-496	-537	-580	-622	-664
KR4201P12854 2019-01 콜285							106
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	14	14	14	13	13	12	11
-5.33%	14	13	13	12	11	9	8
-2.67%	13	12	10	8	6	3	0
0%	9	7	4	0	-4	-8	-13
2.67%	-1	-5	-11	-16	-22	-28	-34
5.33%	-22	-29	-36	-43	-51	-58	-65
8.00%	-61	-68	-76	-84	-91	-99	-106
KR4301P12670 2019-01 풋267.5							18
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	18	18	18	18	18	18	18
-5.33%	11	11	11	11	11	11	11
-2.67%	4	4	5	5	5	5	6
0%	-1	-1	0	0	0	1	1
2.67%	-4	-4	-4	-3	-3	-3	-2
5.33%	-6	-6	-5	-5	-5	-5	-4
8.00%	-6	-6	-6	-6	-6	-6	-5
KR4301P12704 2019-01 풋270							61
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	60	60	60	60	60	61	61
-5.33%	37	38	38	38	38	39	39
-2.67%	15	16	17	17	18	19	20
0%	-3	-2	-1	0	1	2	4
2.67%	-16	-15	-14	-13	-11	-10	-9
5.33%	-23	-22	-21	-20	-19	-18	-17
8.00%	-25	-25	-24	-24	-23	-22	-22

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)

(단위:백만원)

1,473

공시일	2018-12-21
기준일	2018-12-20

H2O글로벌본드(USD)(채권혼합-파

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	0	0	0	
누계	유가증권	수익증권	195	0	195	

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)

* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

공시일	2018-12-21
기준일	2018-12-20

H2O글로벌본드(UH)(채권혼합-파)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	0	0	0	
누계	유가증권	수익증권	1,808	0	1,808	

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)

* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

공시일	2018-12-21
기준일	2018-12-20

H2O글로벌본드(H)(채권혼합-파생)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	0	0	0	
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	수익증권	1,311	0	1,311	
누계	통화	선도	0	1,624	-1,624	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음
FX21018X04 KRW/USD 28-02-19E	2
FX21018X04 KRW/USD 28-02-19E	3
FX21018X04 KRW/USD 28-02-19E	1
FX21018Z00 KRW/USD 28-02-19E	17
FX21018Z01 KRW/USD 28-02-19E	2
FX21018Z01 KRW/USD 28-02-19E	28
FX21018Z01 KRW/USD 28-02-19E	9
FX21018Z02 KRW/USD 28-02-19E	40
FX21018Z02 KRW/USD 19-02-19E	2
FX21018Z02 KRW/USD 19-02-19E	5
FX21018Z03 KRW/USD 19-02-19E	21

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)

(단위:백만원)

49

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)

(단위:백만원)

129

공시일	2018-12-21
기준일	2018-12-20

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

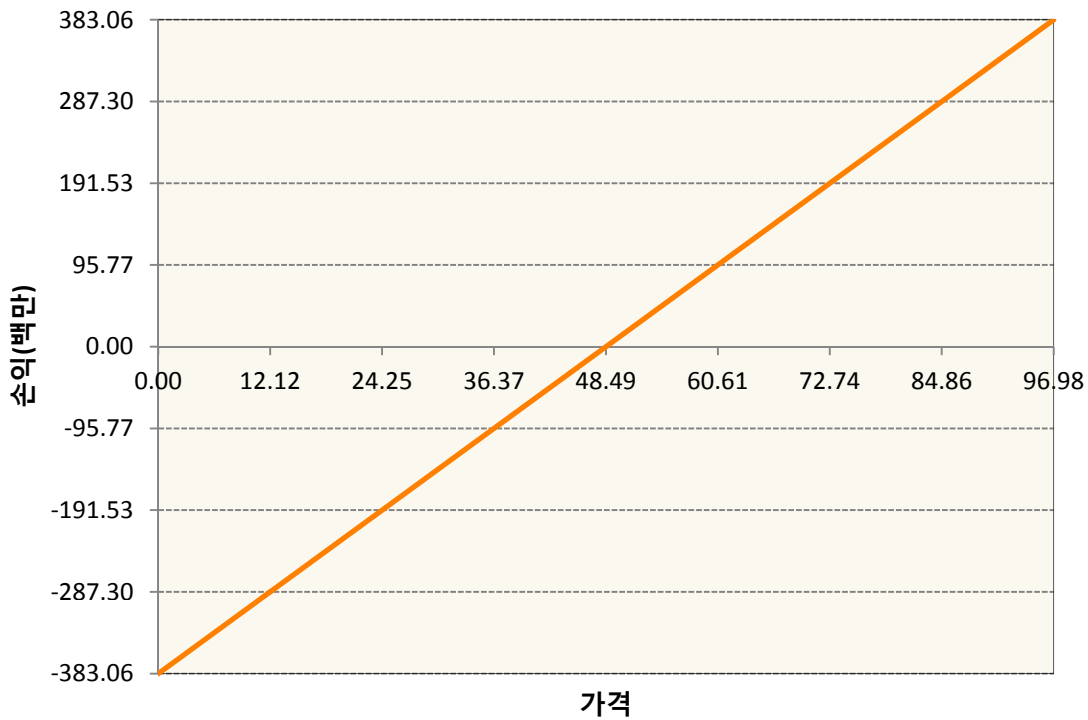
1. 계약금액

(단위:백만원)

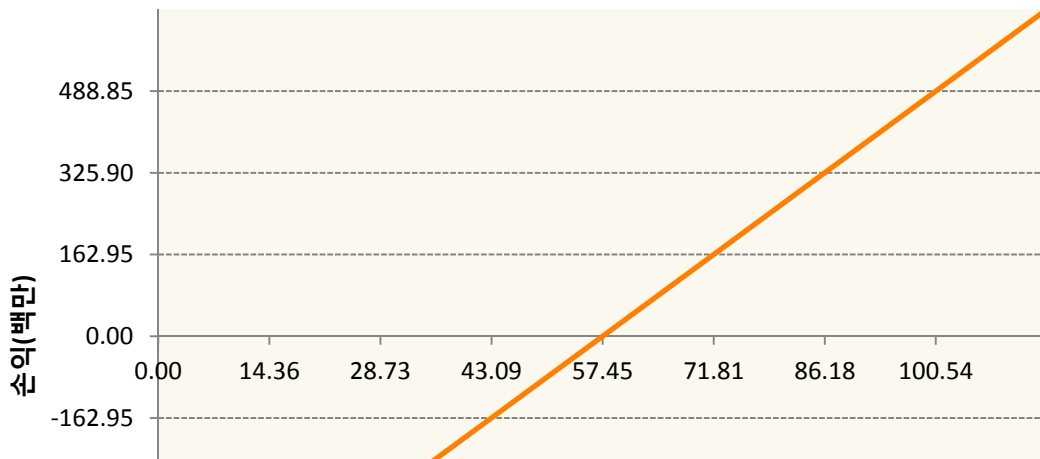
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,625	203	2,422	

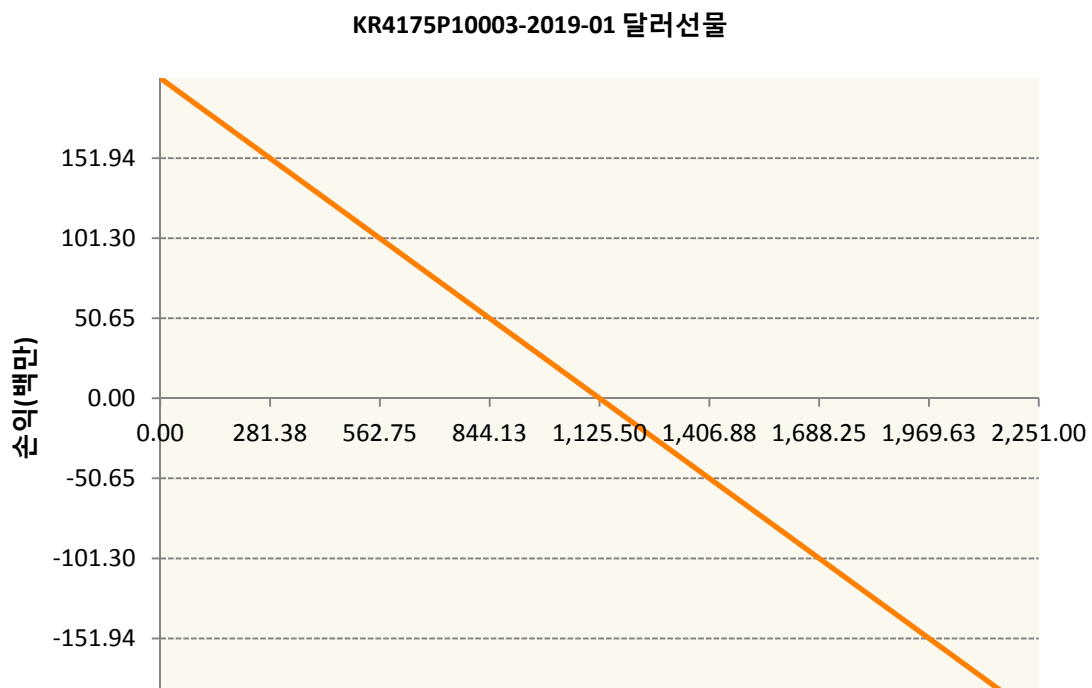
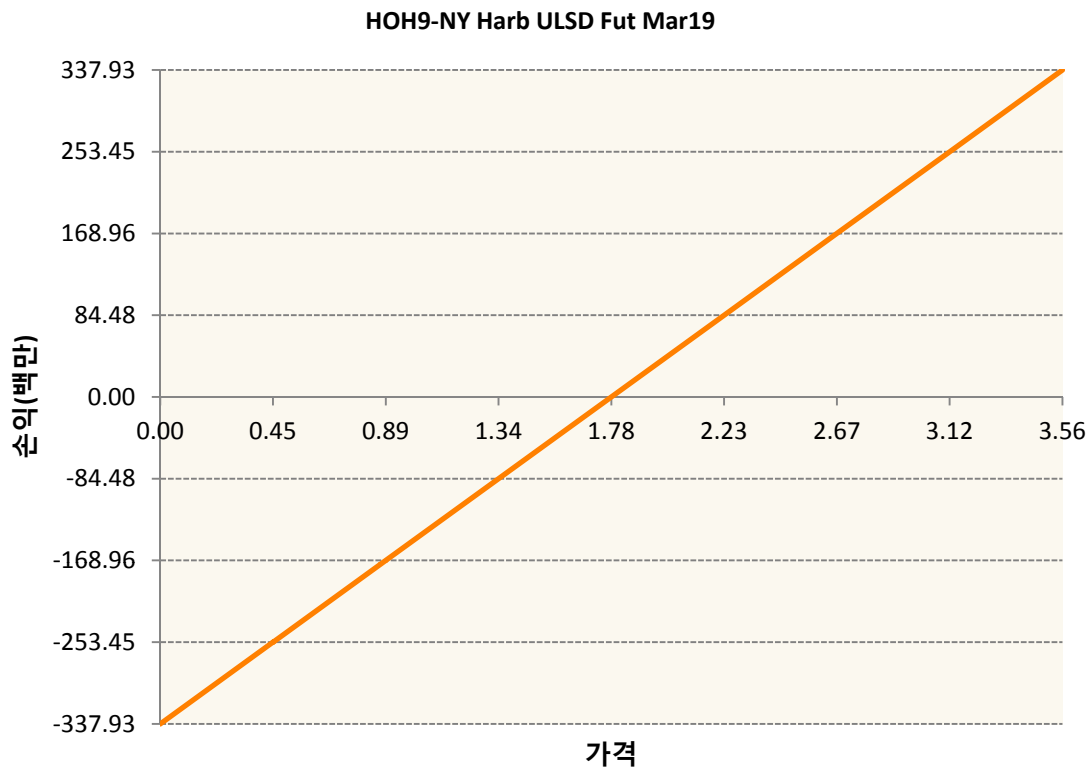
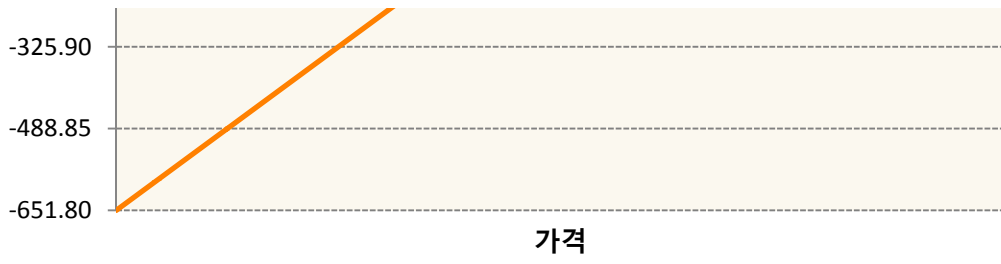
2. 만기시점의 손익구조

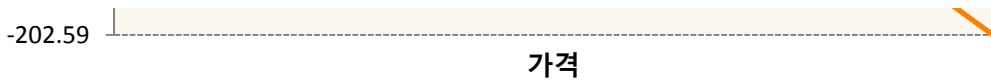
CLH9-WTI CRUDE FUTURE MAR19



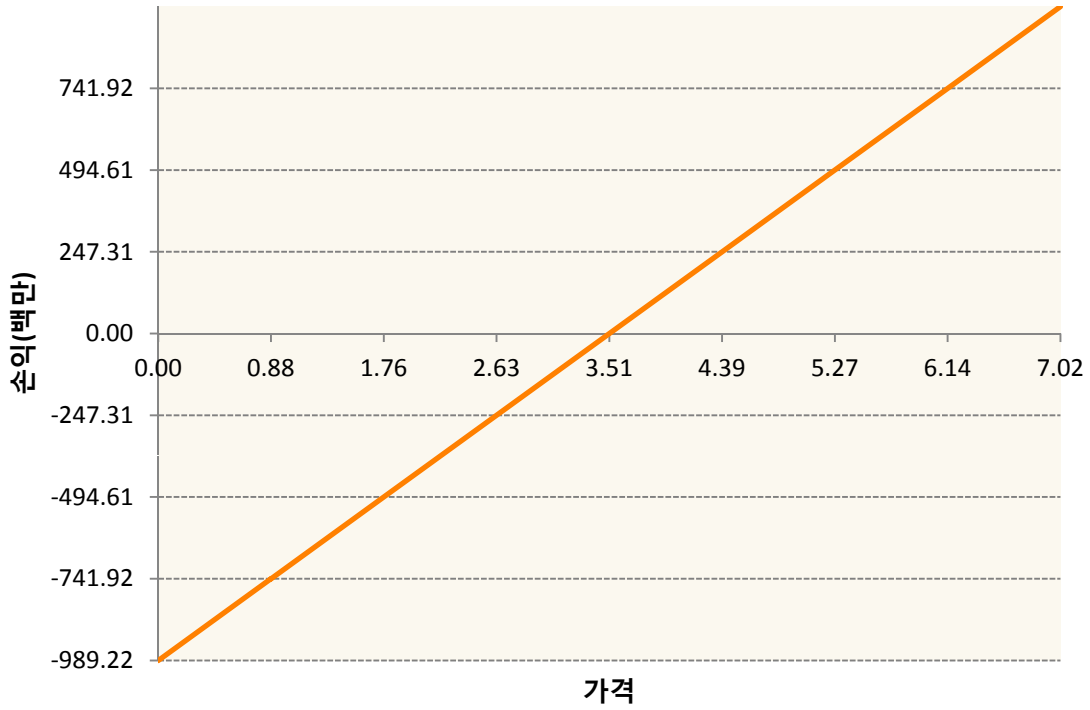
COH9-BRENT CRUDE FUTR Mar19



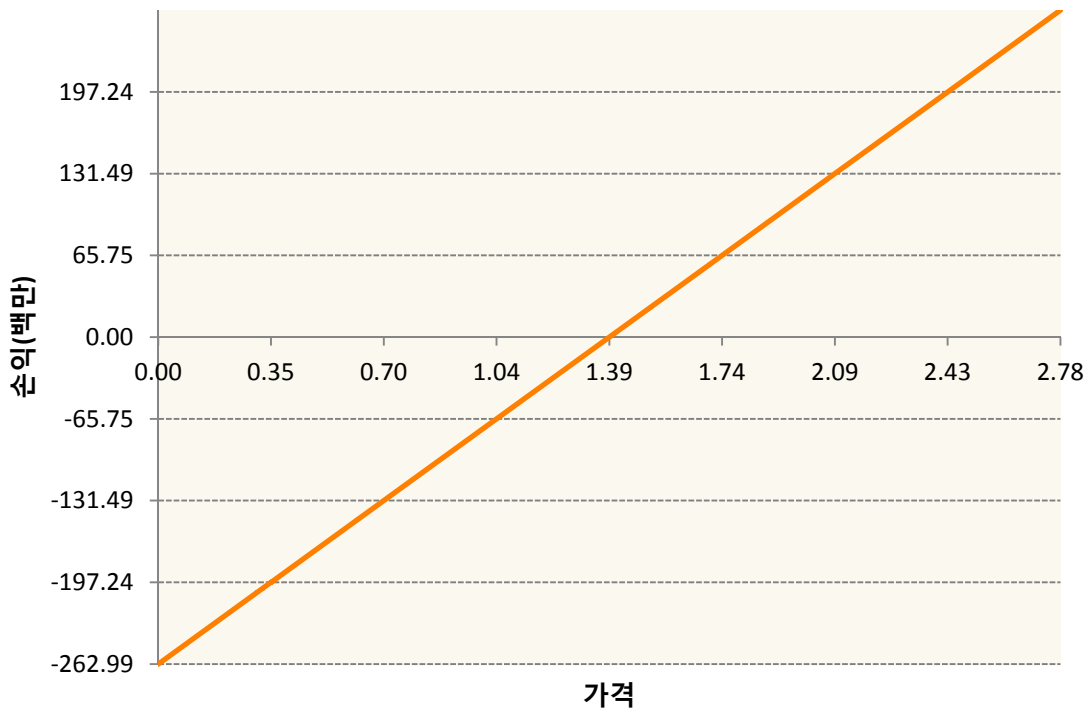




NGH19-NATURAL GAS FUTR Mar19



XBH9-GASOLINE RBOB FUT Mar19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLH9	WTI CRUDE FUTURE MAR19	31
COH9	BRENT CRUDE FUTR Mar19	52
HOH9	NY Harb ULSD Fut Mar19	27
KR4175P100	2019-01 달러선물	16
NGH19	NATURAL GAS FUTR Mar19	79
XBH9	GASOLINE RBOB FUT Mar19	21

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) (단위:백만원)

382

공시일	2018-12-21
기준일	2018-12-20

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

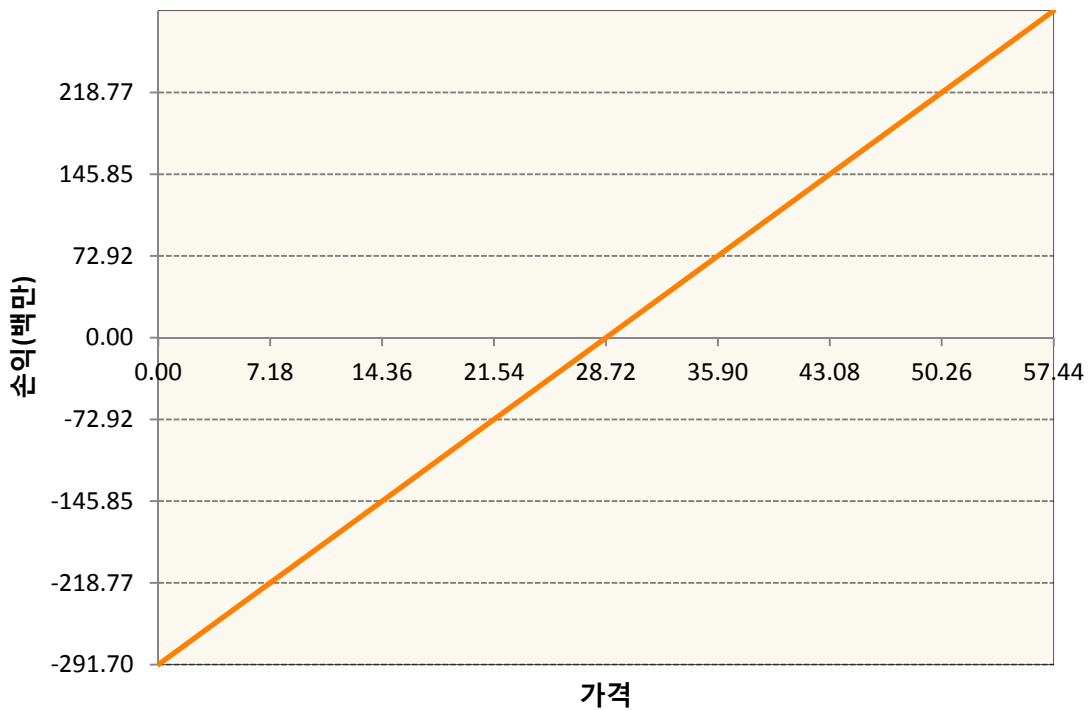
1. 계약금액

(단위:백만원)

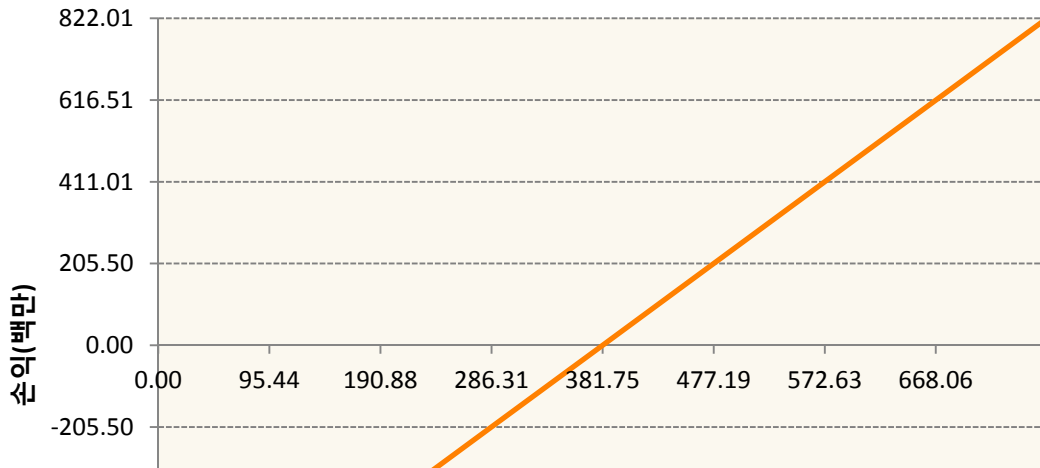
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,655	79	3,576	

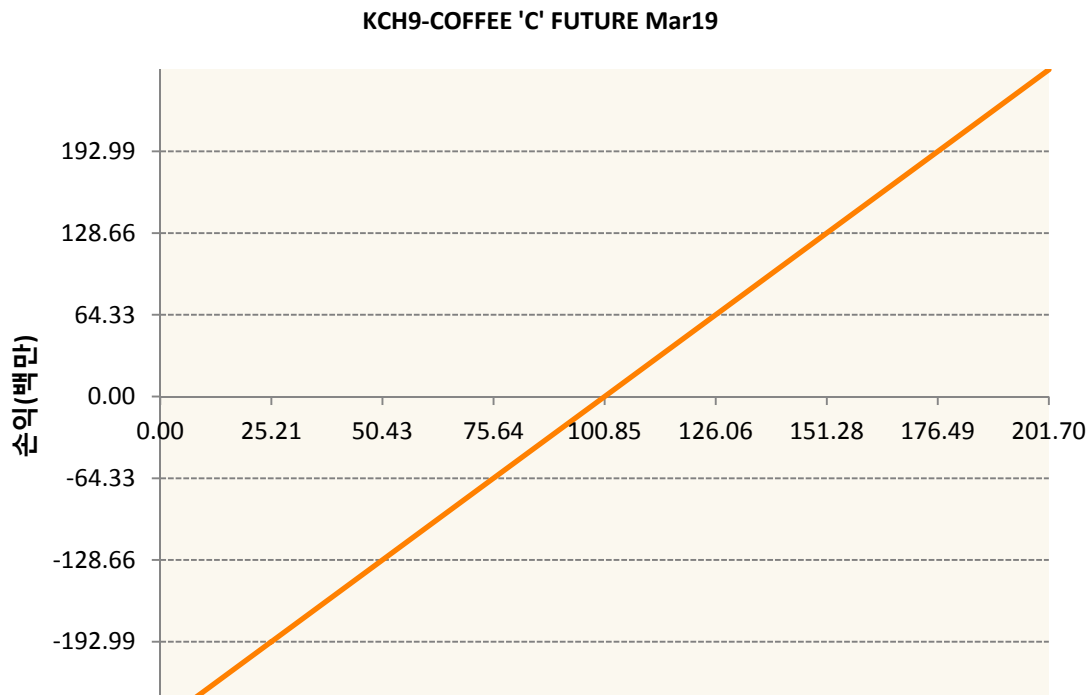
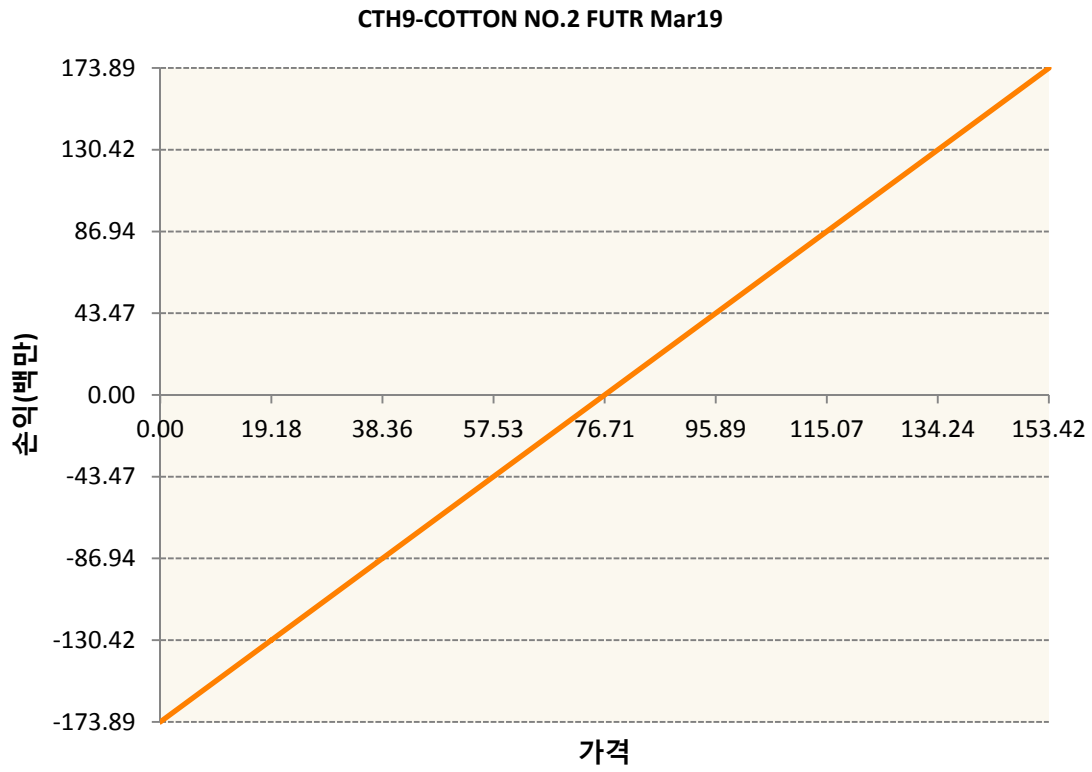
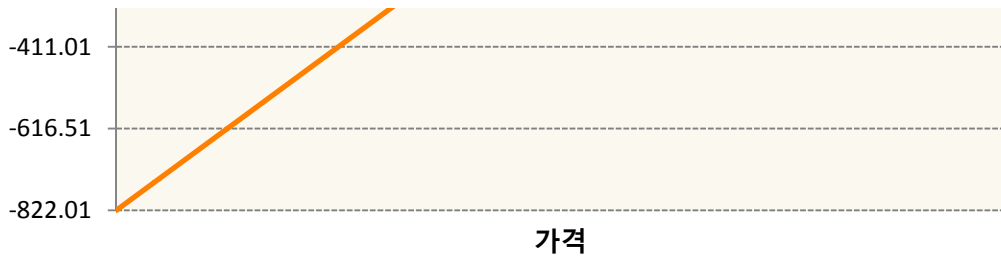
2. 만기시점의 손익구조

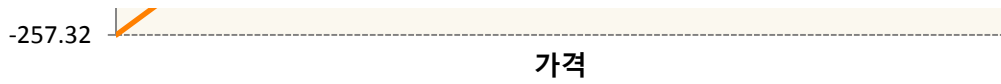
BOH9-SOYBEAN OIL FUTR Mar19



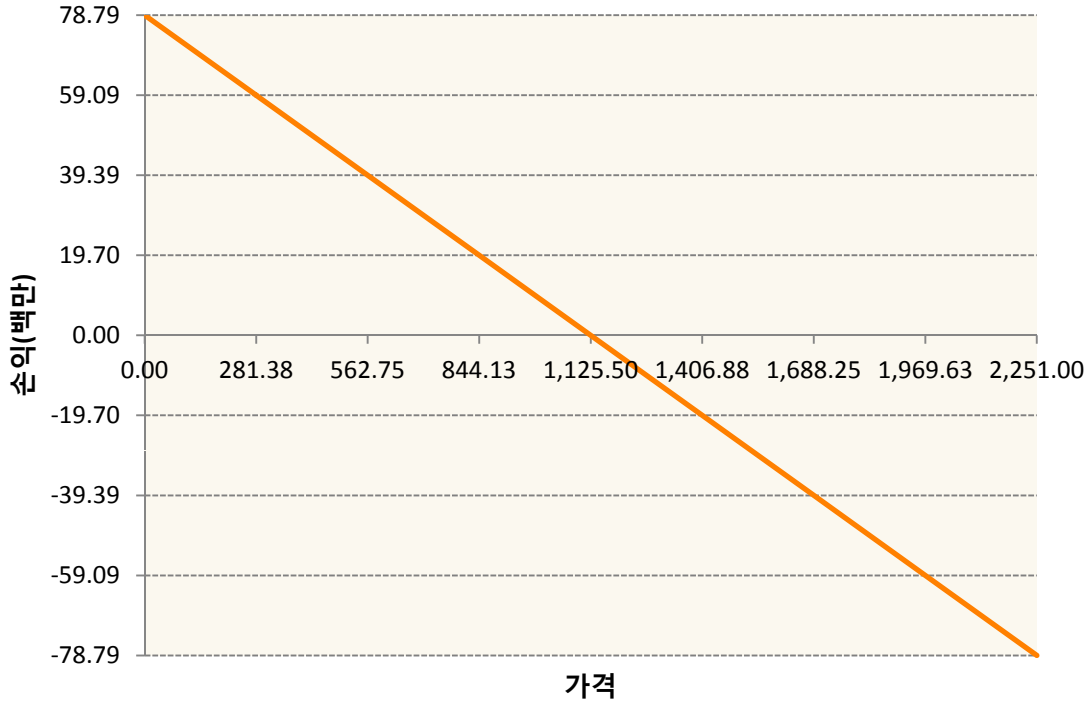
CH9-CORN FUTURE Mar19



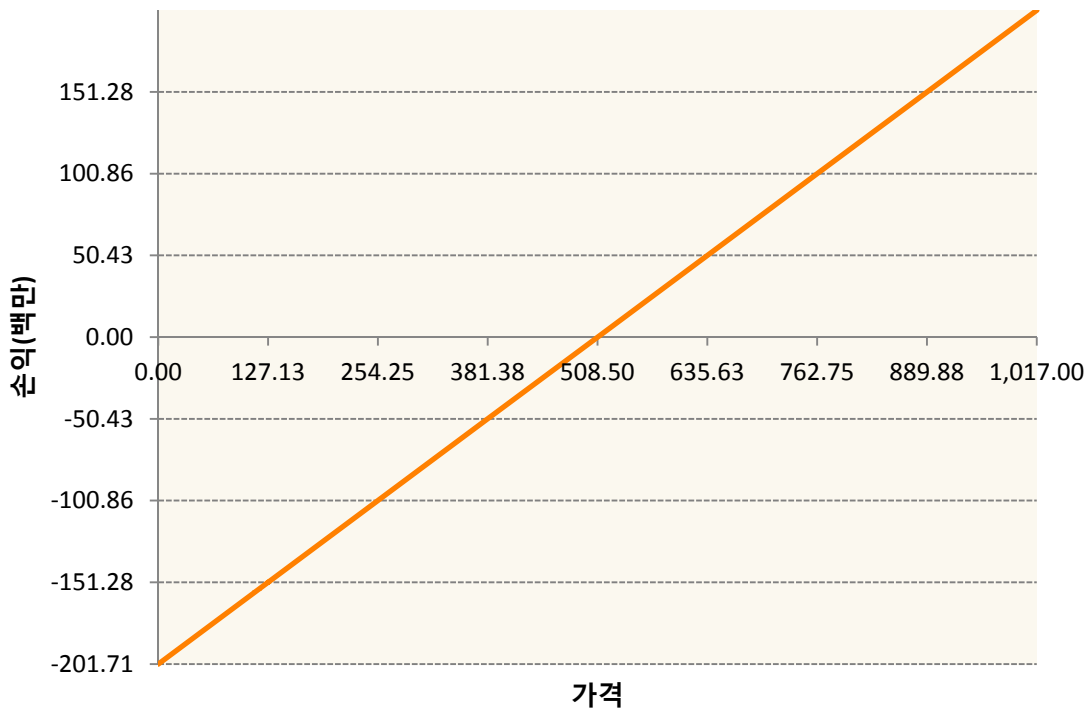




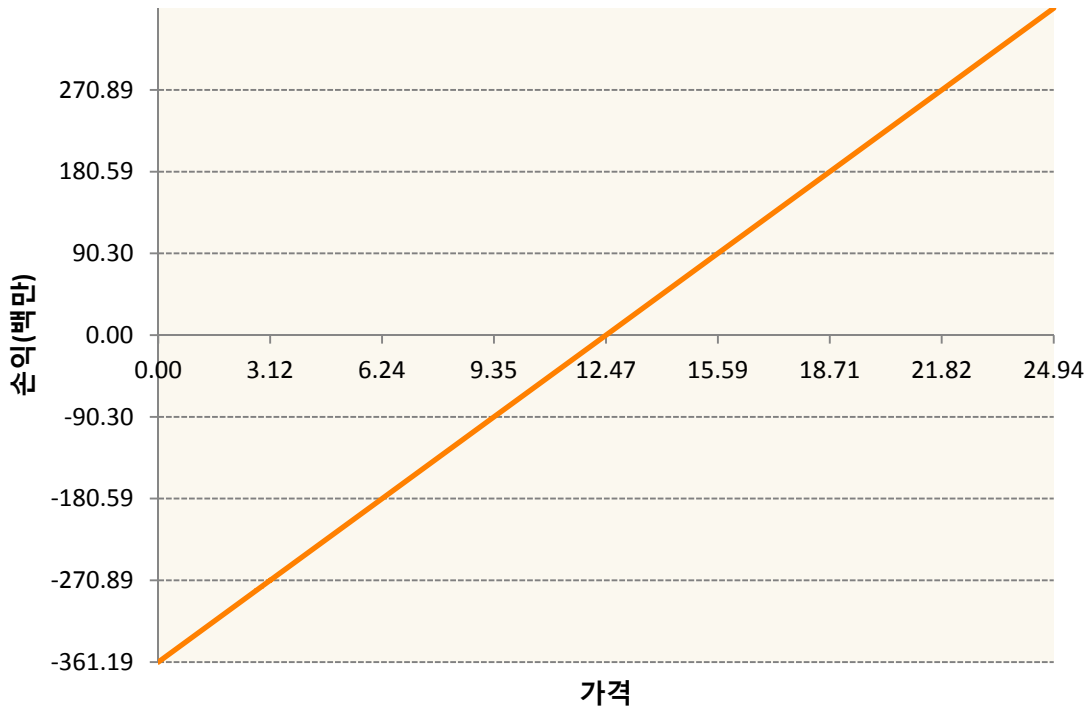
KR4175P10003-2019-01 달러선물



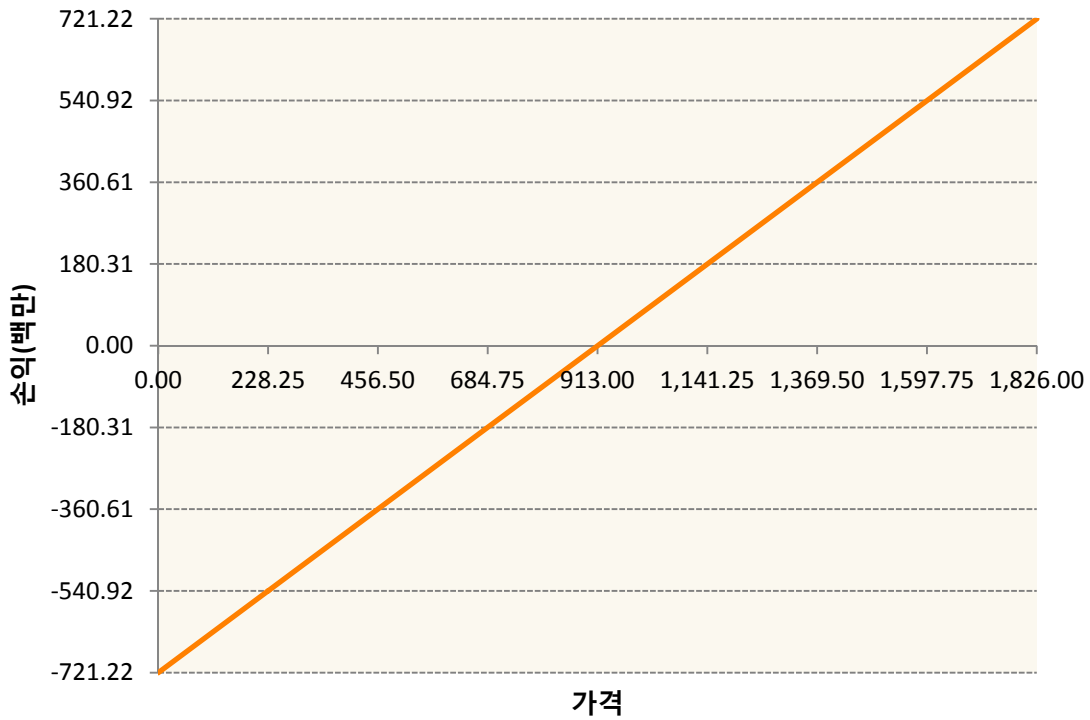
KWH9-KC HRW WHEAT FUT Mar19



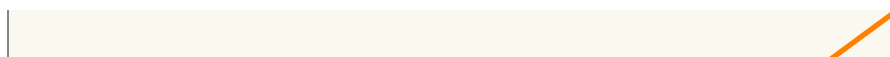
SBH9-SUGAR #11 (WORLD) MAR19

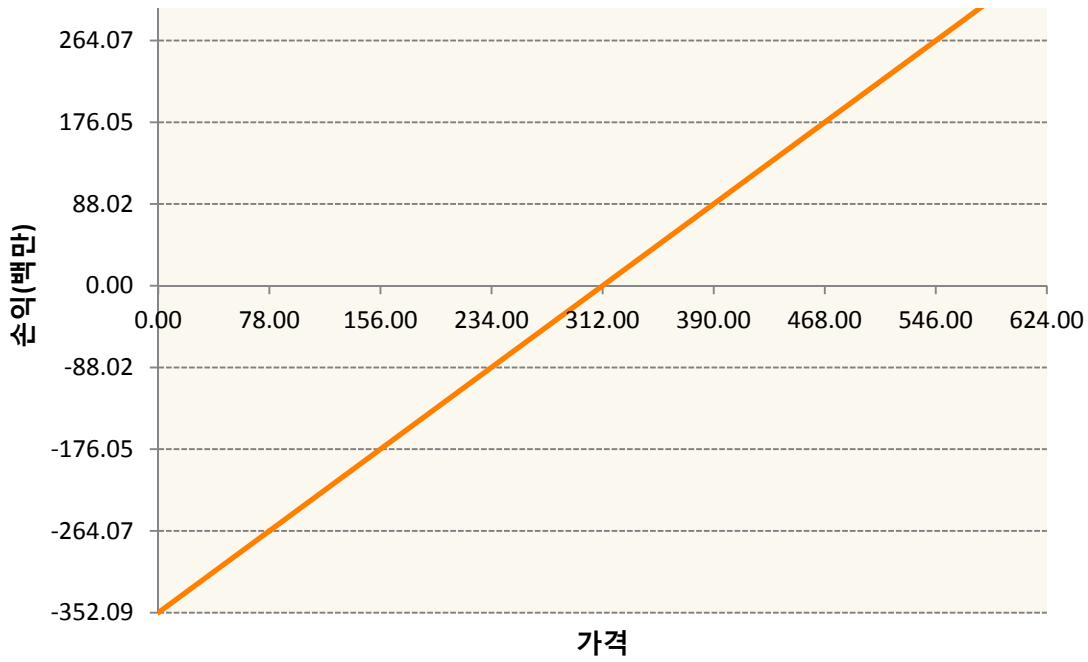


SH9-SOYBEAN FUTURE Mar19

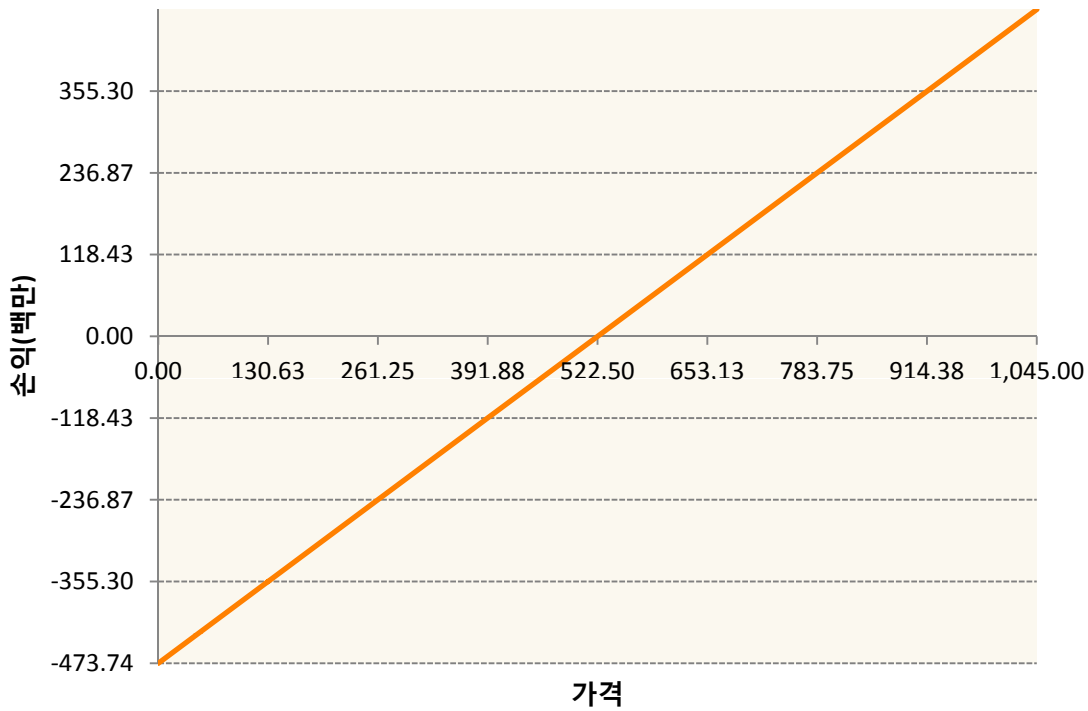


SMH9-SOYBEAN MEAL FUTR Mar19





WH9-WHEAT FUTURE(CBT) Mar19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

BOH9	SOYBEAN OIL FUTR Mar19	23
CH9	CORN FUTURE Mar19	66
CTH9	COTTON NO.2 FUTR Mar19	14
KCH9	COFFEE 'C' FUTURE Mar19	21
KR4175P100	2019-01 달러선물	6

KWH9	KC HRW WHEAT FUT Mar19	16
SBH9	SUGAR #11 (WORLD) MAR19	29
SH9	SOYBEAN FUTURE Mar19	58
SMH9	SOYBEAN MEAL FUTR Mar19	28
WH9	WHEAT FUTURE(CBT) Mar19	38

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)

(단위:백만원)

307