

공시일	2019-01-28
기준일	2019-01-25

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

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

(단위:백만원)

100

공시일	2019-01-28
기준일	2019-01-25

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

1,055

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

599

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-01-28
기준일	2019-01-25

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

267

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

399

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-01-28
기준일	2019-01-25

유로인덱스모(주식-파생형)

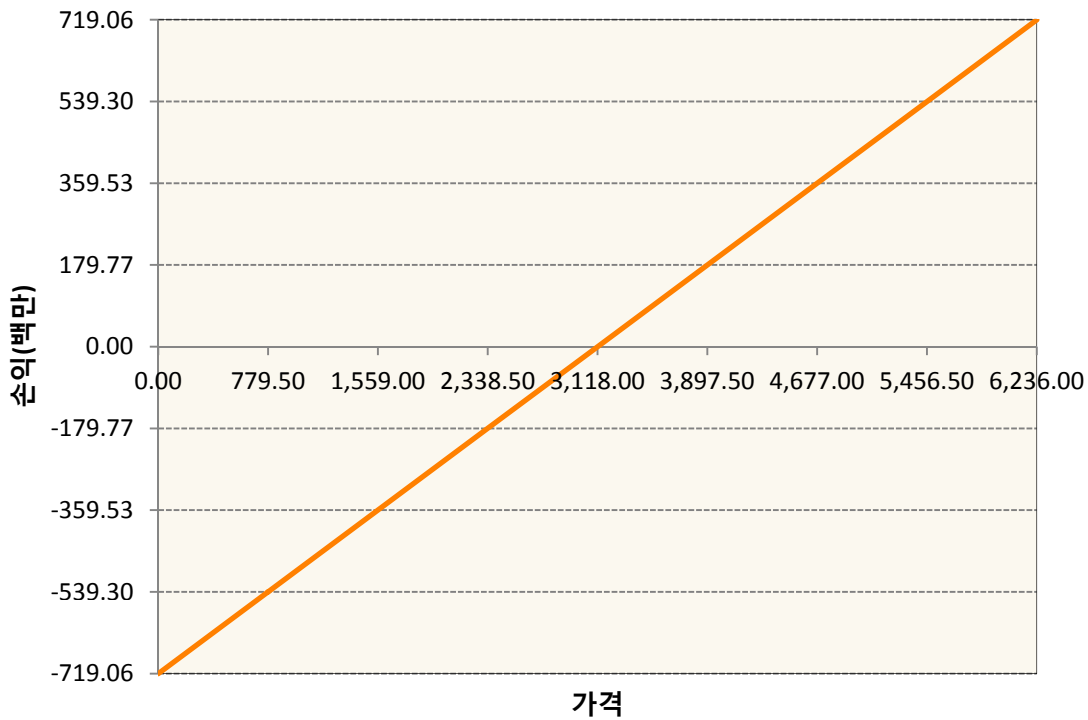
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	719	0	719	

2. 만기시점의 손익구조

VGH9-EURO STOXX 50 Mar19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGH9	EURO STOXX 50 Mar19	58
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

39

공시일	2019-01-28
기준일	2019-01-25

차이나인덱스모(주식-파생형)

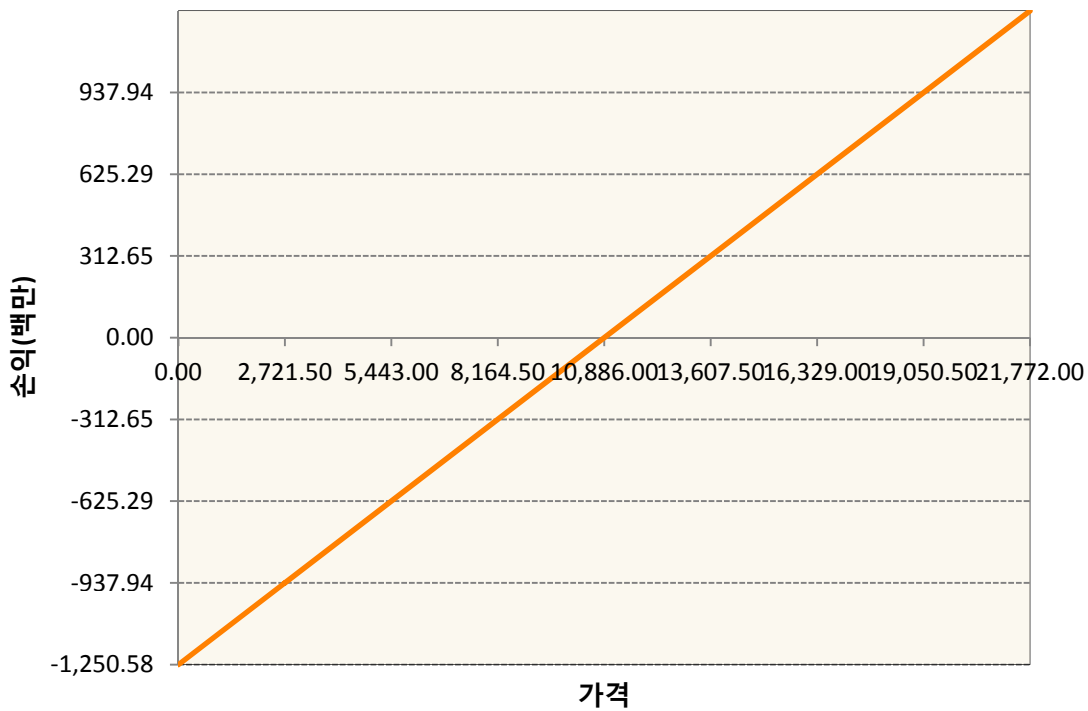
1. 계약금액

(단위:백만원)

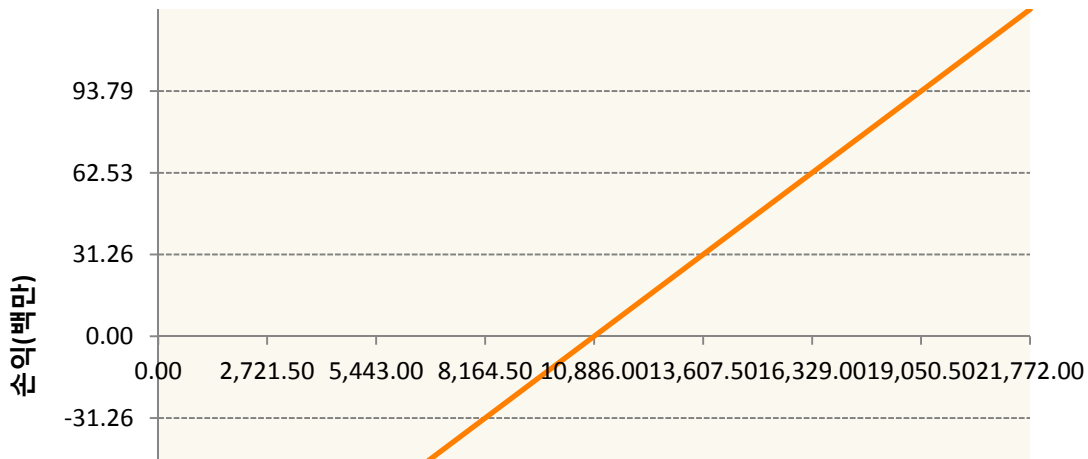
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,376	0	1,376	장내

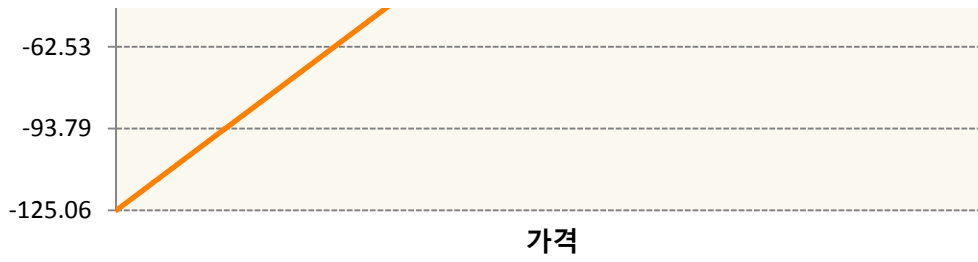
2. 만기시점의 손익구조

HCF9-HSCEI FUTURES JAN19



MHCF9-MINI H-SHR IDX FU JAN19





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

HCF9	HSCEI FUTURES JAN19	100
MHCF9	MINI H-SHR IDX FU JAN19	10

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

112

공시일	2019-01-28
기준일	2019-01-25

커버드콜모(주식혼합-파생형)

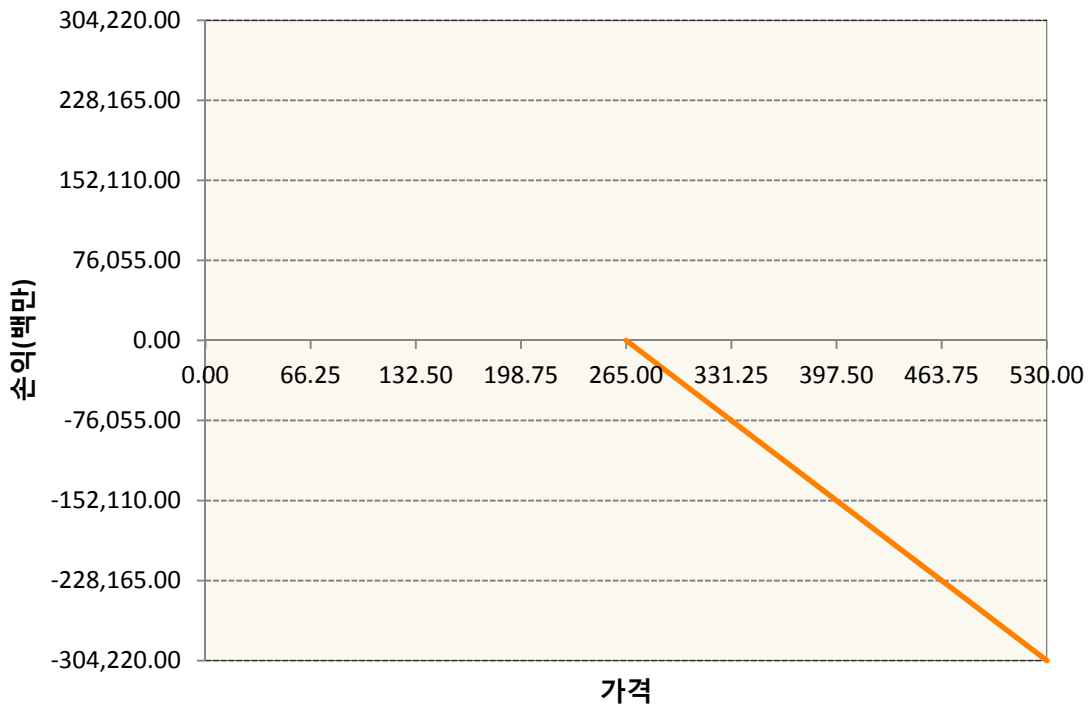
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	3,308	0	3,308	장내
누계	유가증권	옵션	0	673,443	-673,443	장내

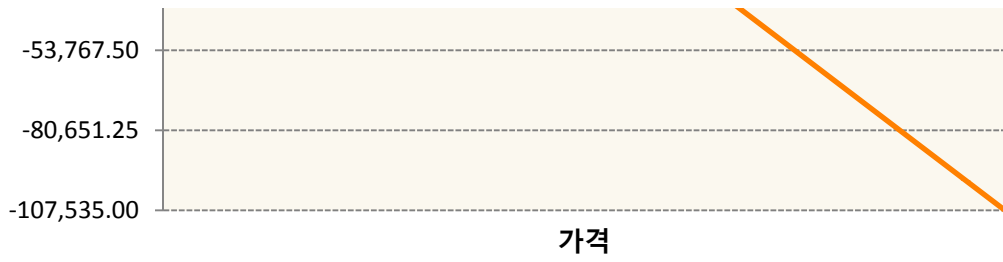
2. 만기시점의 손익구조

KR4201P22655-2019-02 콜265

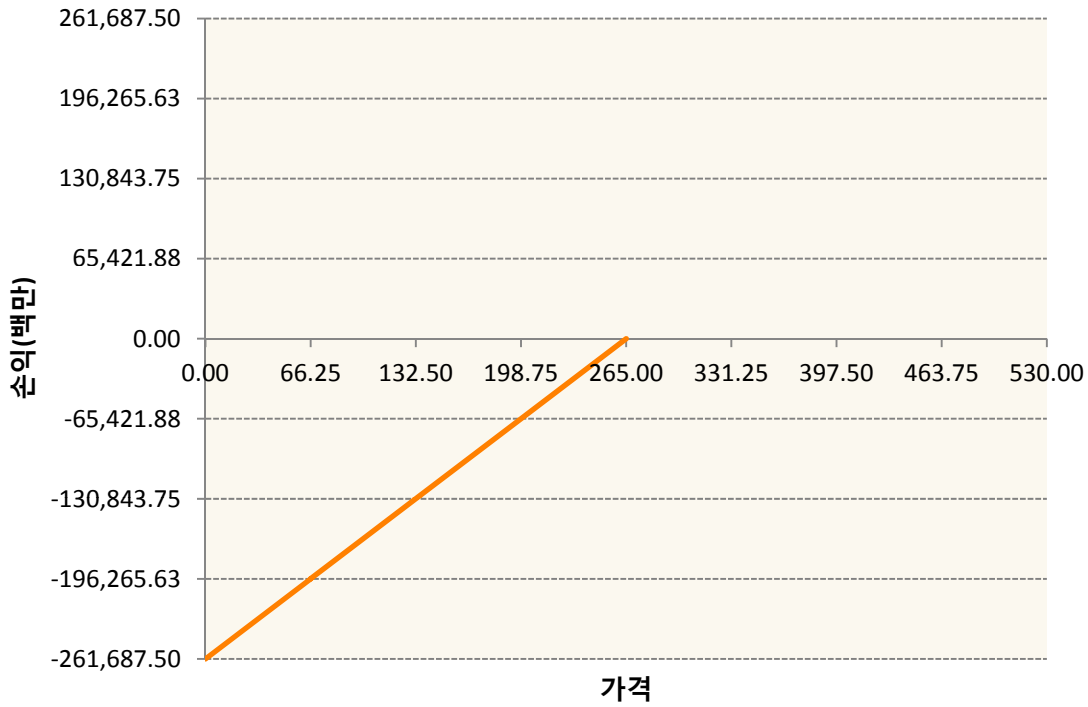


KR4201P22671-2019-02 콜267.5





KR4301P22653-2019-02 풋265



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201P22655		2019-02 콜265					24,640
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	17,960	17,422	16,873	16,316	15,752	15,184	14,611
-5.33%	14,171	13,567	12,961	12,356	11,750	11,143	10,536
-2.67%	8,325	7,847	7,346	6,827	6,294	5,750	5,197
0%	951	676	357	0	-389	-806	-1,245
2.67%	-7,235	-7,353	-7,512	-7,713	-7,953	-8,228	-8,536
5.33%	-15,735	-15,774	-15,838	-15,932	-16,058	-16,217	-16,409
8.00%	-24,326	-24,336	-24,357	-24,394	-24,452	-24,533	-24,640
KR4201P22671		2019-02 콜267.5					8,487
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	5,737	5,568	5,392	5,210	5,024	4,835	4,643

-5.33%	4,648	4,434	4,220	4,006	3,792	3,578	3,364
-2.67%	2,832	2,642	2,447	2,249	2,048	1,844	1,639
0%	405	283	147	0	-157	-321	-492
2.67%	-2,386	-2,444	-2,519	-2,608	-2,711	-2,825	-2,951
5.33%	-5,336	-5,357	-5,389	-5,434	-5,492	-5,562	-5,644
8.00%	-8,337	-8,343	-8,355	-8,374	-8,402	-8,439	-8,487
KR4301P22653 2019-02 풋265							7,665
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-6,308	-6,508	-6,722	-6,946	-7,179	-7,419	-7,665
-5.33%	-1,758	-2,040	-2,324	-2,609	-2,895	-3,182	-3,469
-2.67%	-147	-275	-424	-591	-773	-968	-1,174
0%	102	82	48	0	-64	-143	-237
2.67%	118	117	113	106	93	73	44
5.33%	118	118	118	117	116	113	107
8.00%	118	118	118	118	118	118	117

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

(단위:백만원)

38,025

공시일	2019-01-28
기준일	2019-01-25

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

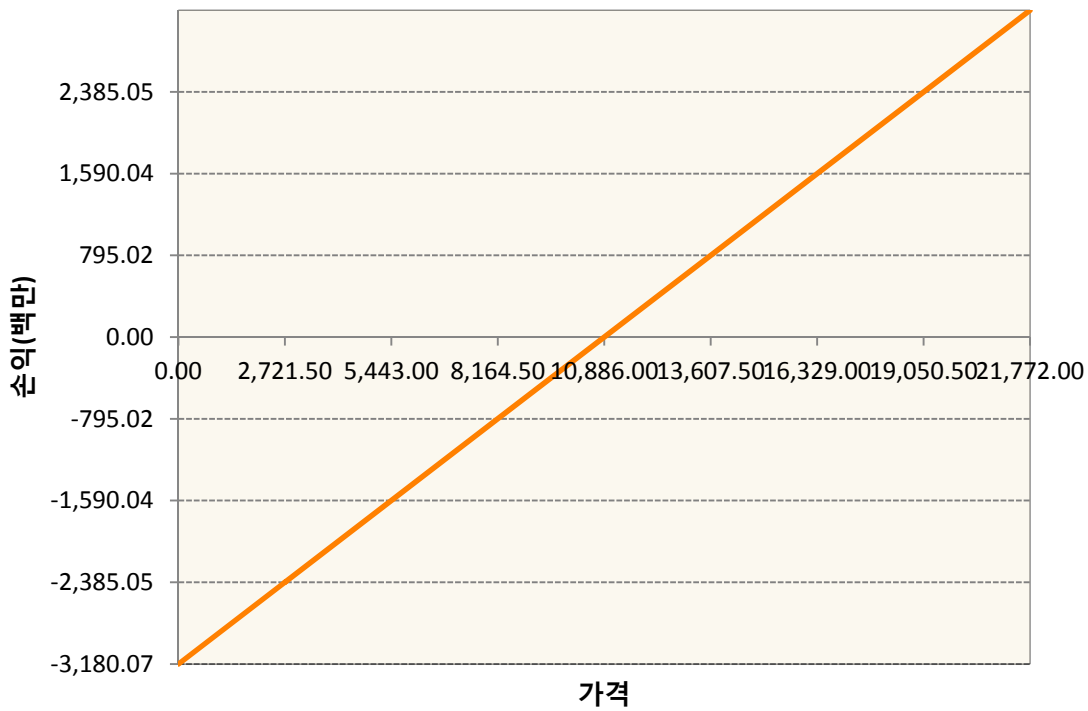
1. 계약금액

(단위:백만원)

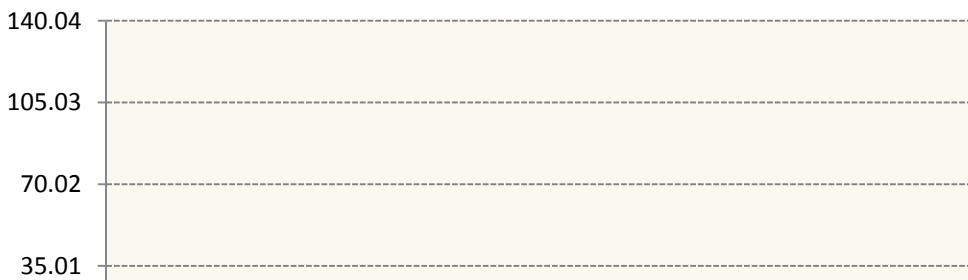
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	3,180	0	3,180	장내
누계	유가증권	옵션	0	6,996	-6,996	장내
누계	통화	선도	0	2,715	-2,715	장외

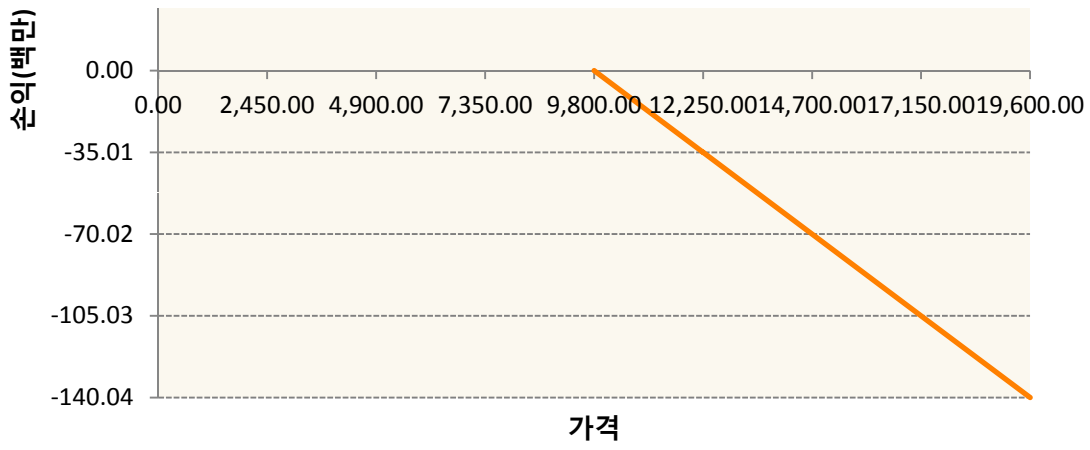
2. 만기시점의 손익구조

HCF9-HSCEI FUTURES JAN19

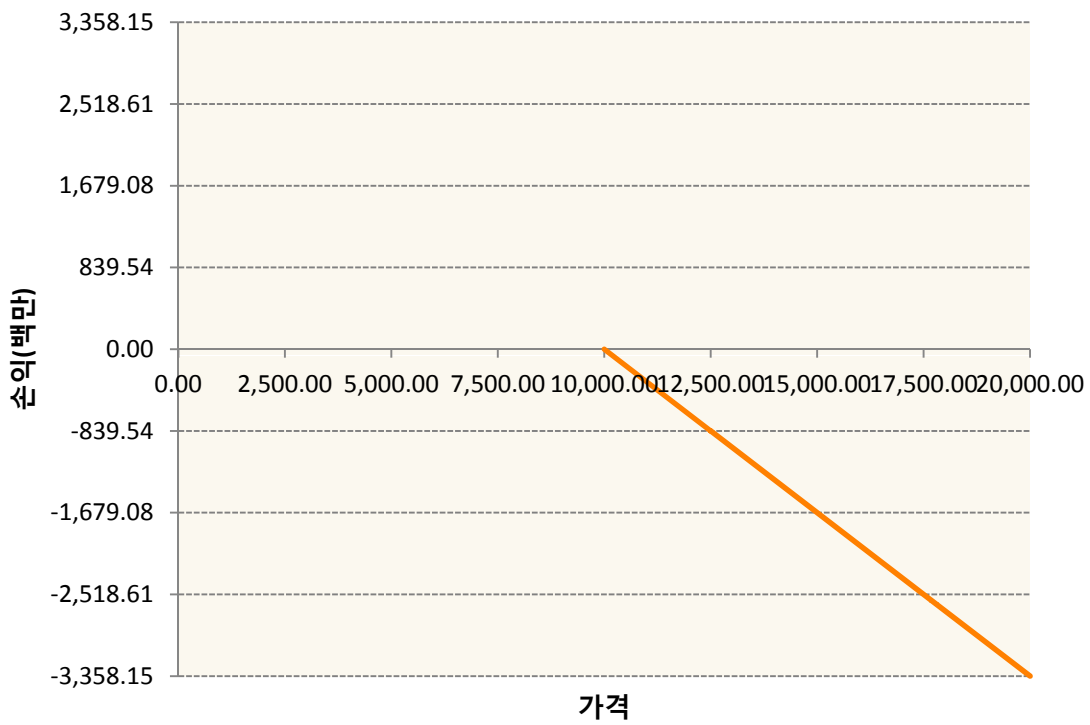


OHHIF9-C098-HSCEI

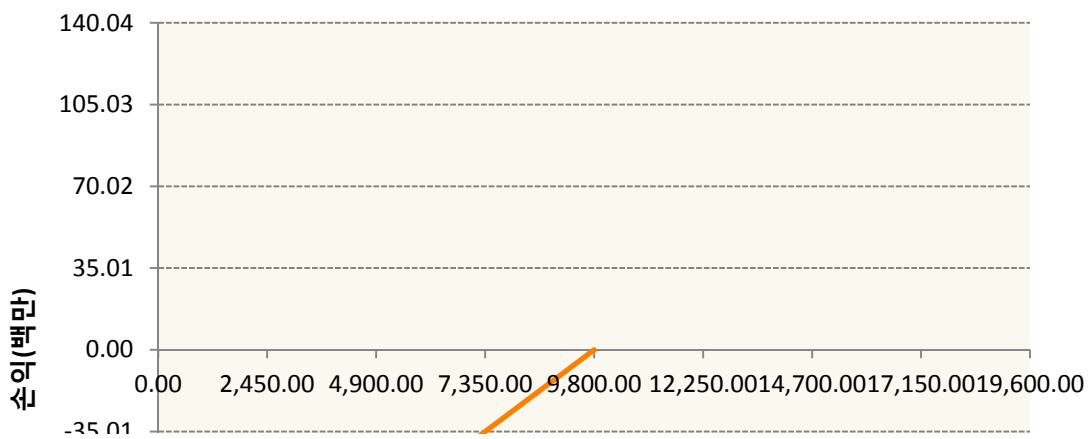


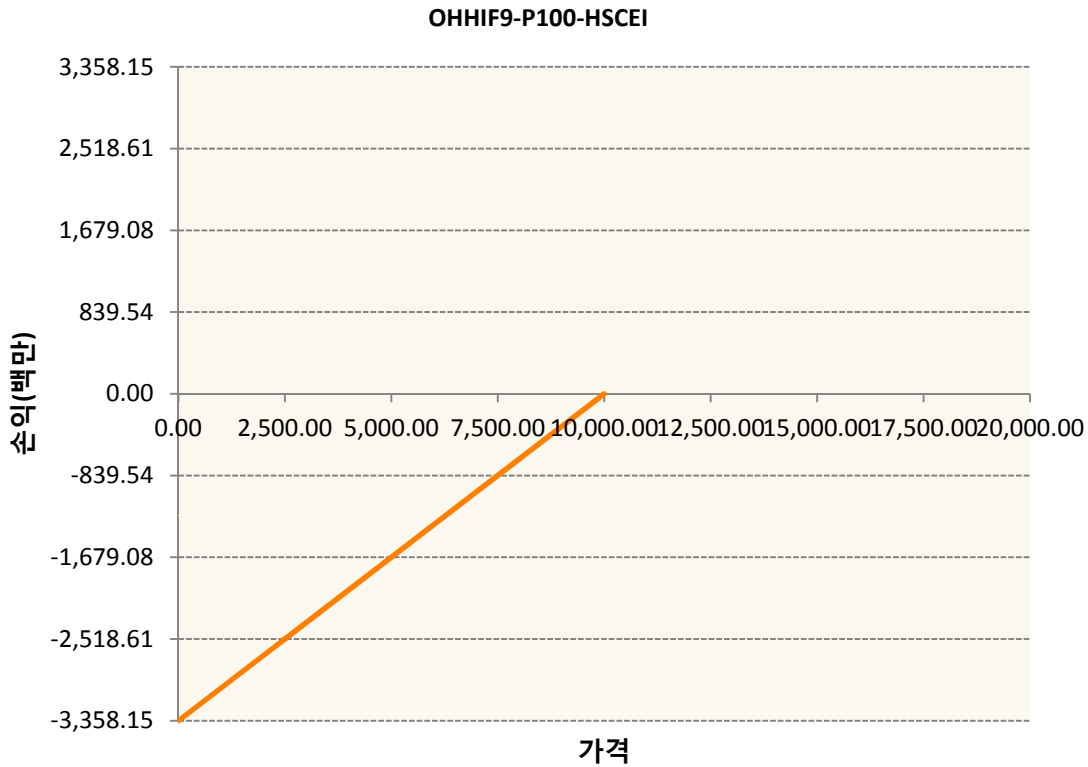


OHHIF9-C100-HSCEI



OHHIF9-P098-HSCEI





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)	(단위:백만원)
FX21018Z00 KRW/HKD 11-03-19E	217
HCF9 HSCEI FUTURES JAN19	254
OHHIF9-C09 HSCEI	11
OHHIF9-C10 HSCEI	269
OHHIF9-P09 HSCEI	11
OHHIF9-P10 HSCEI	269

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	912

공시일	2019-01-28
기준일	2019-01-25

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

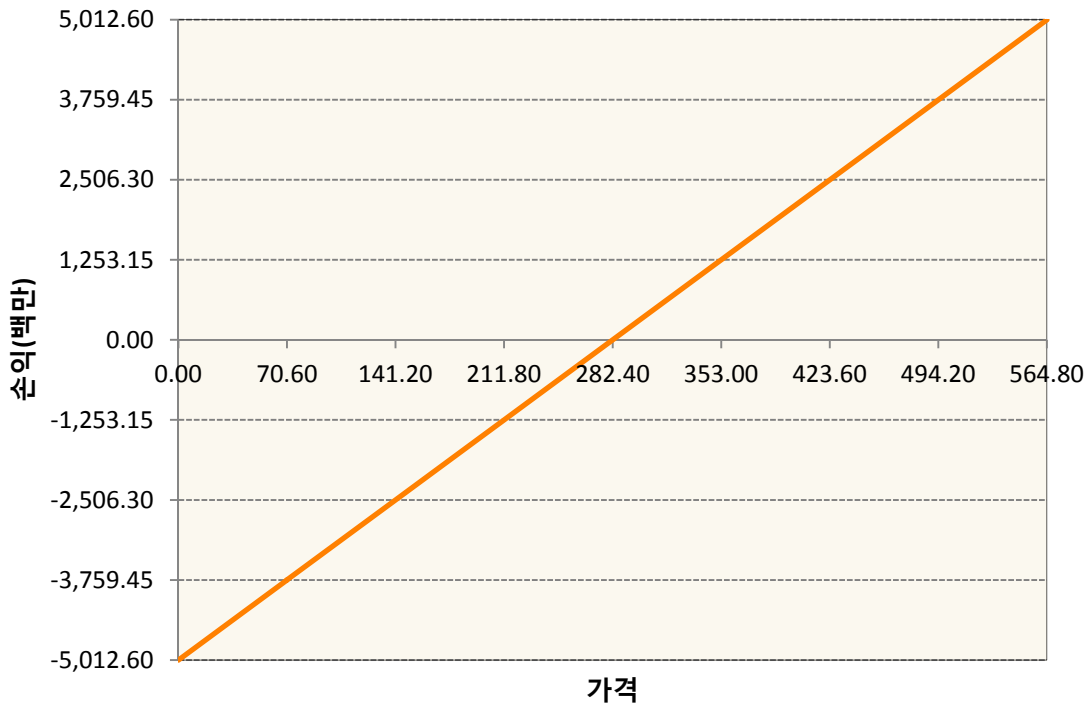
1. 계약금액

(단위:백만원)

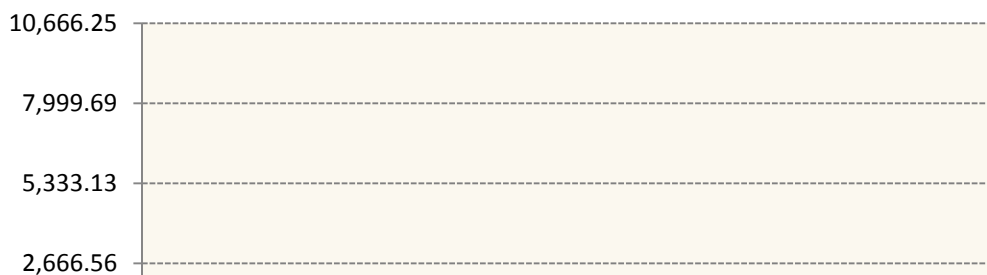
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	907	0	907	장내
누계	유가증권	선물	5,013	0	5,013	장내
누계	유가증권	스왑	31,836	0	31,836	장외
누계	유가증권	옵션	0	32,396	-32,396	장내

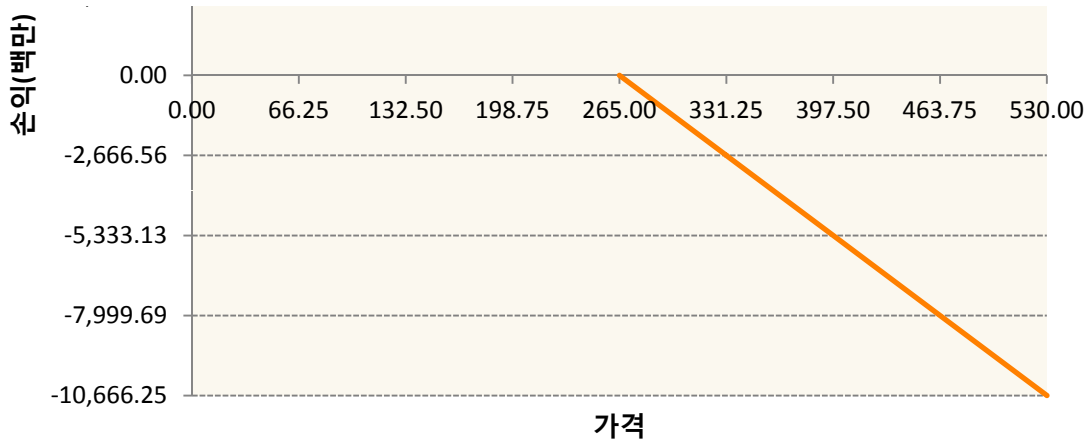
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P30007-2019-03 코스피200지수선물

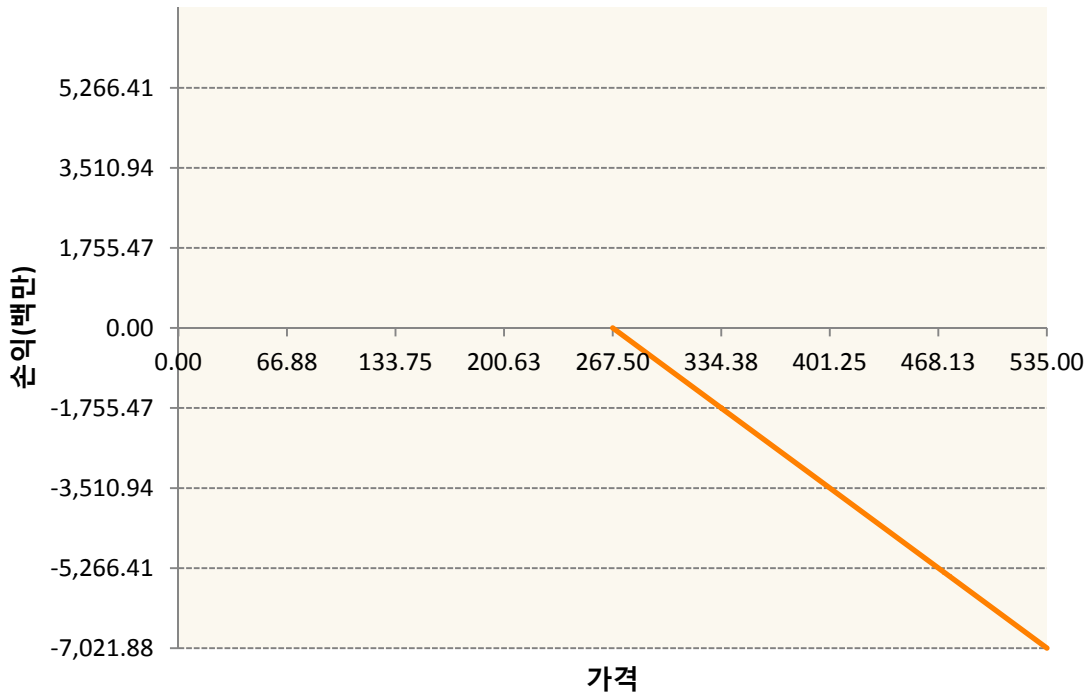


KR4201P22655-2019-02 콜265

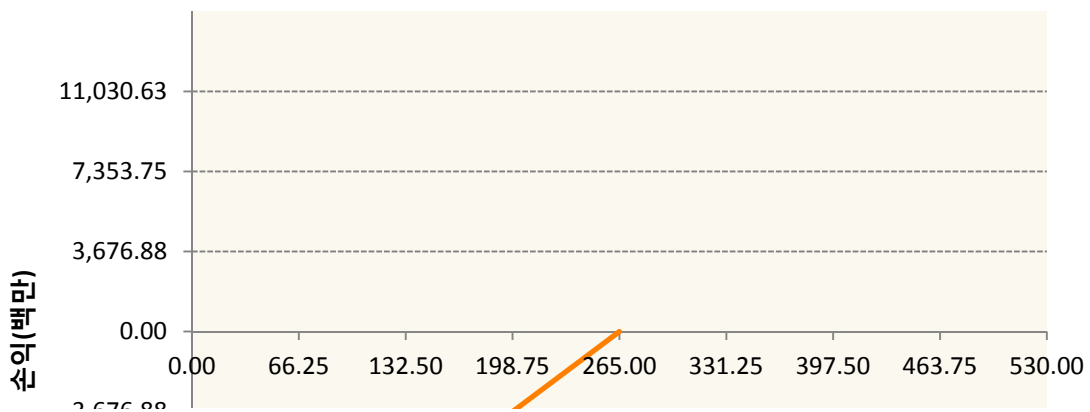




KR4201P22671-2019-02 콜267.5



KR4301P22653-2019-02 풋265





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11		UBCSFXC1 INDEX_14						2,659
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-2,659	-2,659	-2,659	-2,659	-2,659	-2,659	-2,659	
-5.33%	-1,773	-1,773	-1,773	-1,773	-1,773	-1,773	-1,773	
-2.67%	-886	-886	-886	-886	-886	-886	-886	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	886	886	886	886	886	886	886	
5.33%	1,773	1,773	1,773	1,773	1,773	1,773	1,773	
8.00%	2,659	2,659	2,659	2,659	2,659	2,659	2,659	
KR4101P30007		2019-03 코스피200지수선물						400
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-400	-400	-400	-400	-400	-400	-400	
-5.33%	-267	-267	-267	-267	-267	-267	-267	
-2.67%	-133	-133	-133	-133	-133	-133	-133	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	133	133	133	133	133	133	133	
5.33%	267	267	267	267	267	267	267	
8.00%	400	400	400	400	400	400	400	
KR4201P22655		2019-02 콜265						864
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	630	611	592	572	552	532	512	
-5.33%	497	476	454	433	412	391	369	
-2.67%	292	275	258	239	221	202	182	
0%	33	24	13	0	-14	-28	-44	
2.67%	-254	-258	-263	-270	-279	-288	-299	
5.33%	-552	-553	-555	-559	-563	-569	-575	
8.00%	-853	-853	-854	-855	-857	-860	-864	
KR4201P22671		2019-02 콜267.5						554
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	

-8.00%	375	364	352	340	328	316	303
-5.33%	304	290	276	262	248	234	220
-2.67%	185	173	160	147	134	120	107
0%	26	18	10	0	-10	-21	-32
2.67%	-156	-160	-164	-170	-177	-184	-193
5.33%	-348	-350	-352	-355	-359	-363	-369
8.00%	-544	-545	-546	-547	-549	-551	-554
KR4301P22653 2019-02 풋265							431
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-354	-366	-378	-390	-403	-417	-431
-5.33%	-99	-115	-131	-147	-163	-179	-195
-2.67%	-8	-15	-24	-33	-43	-54	-66
0%	6	5	3	0	-4	-8	-13
2.67%	7	7	6	6	5	4	2
5.33%	7	7	7	7	7	6	6
8.00%	7	7	7	7	7	7	7

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

(단위:백만원)

4,688

공시일	2019-01-28
기준일	2019-01-25

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

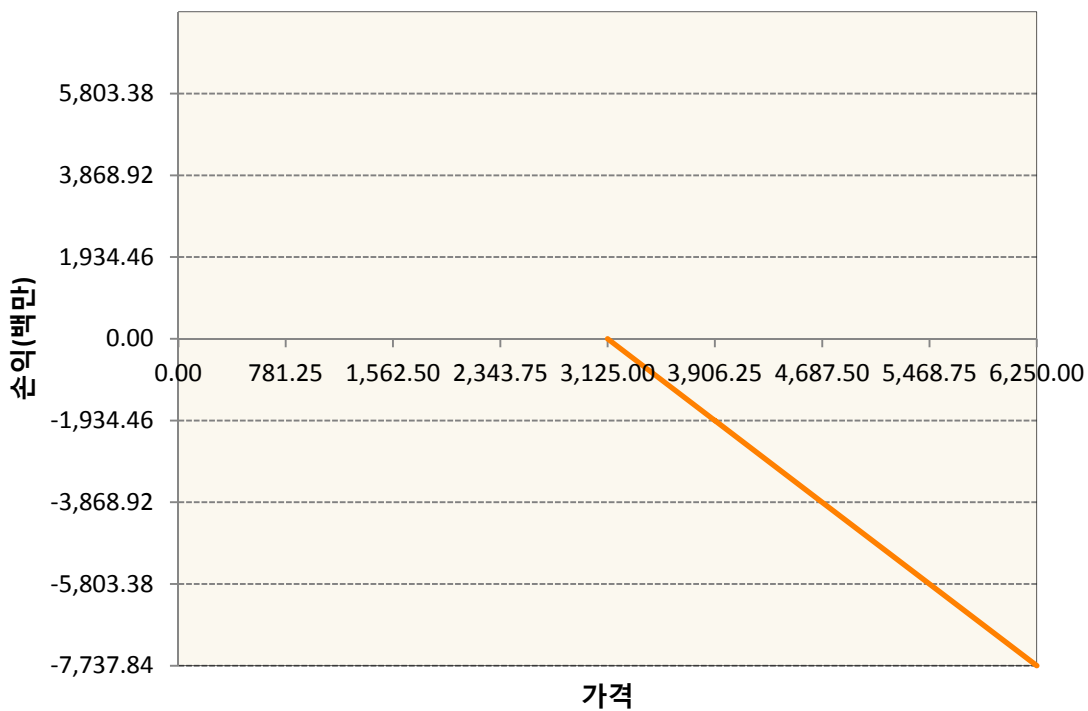
1. 계약금액

(단위:백만원)

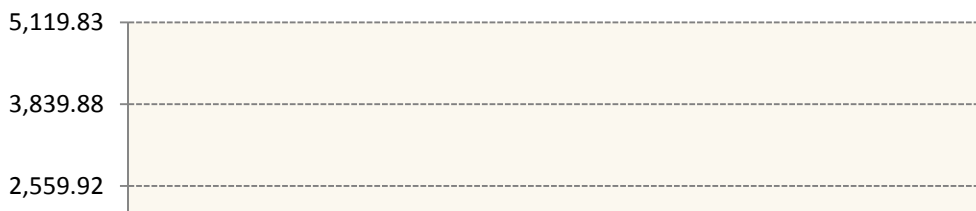
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	6,747	0	6,747	
누계	유가증권	스왑	59,949	0	59,949	장외
누계	유가증권	옵션	0	25,715	-25,715	장내
누계	통화	선도	0	15,238	-15,238	장외

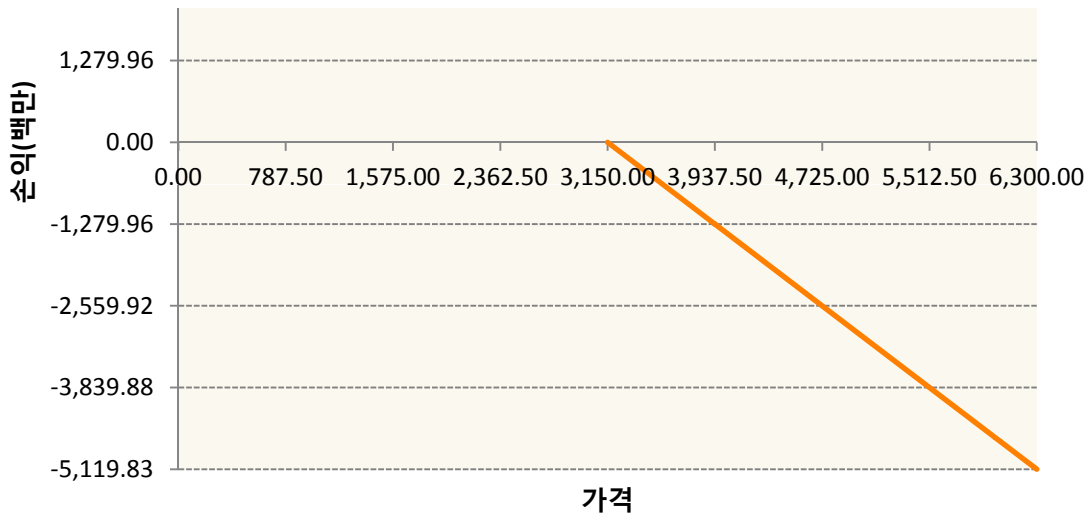
2. 만기시점의 손익구조

OESXG9-C3125-EURO STOXX 50

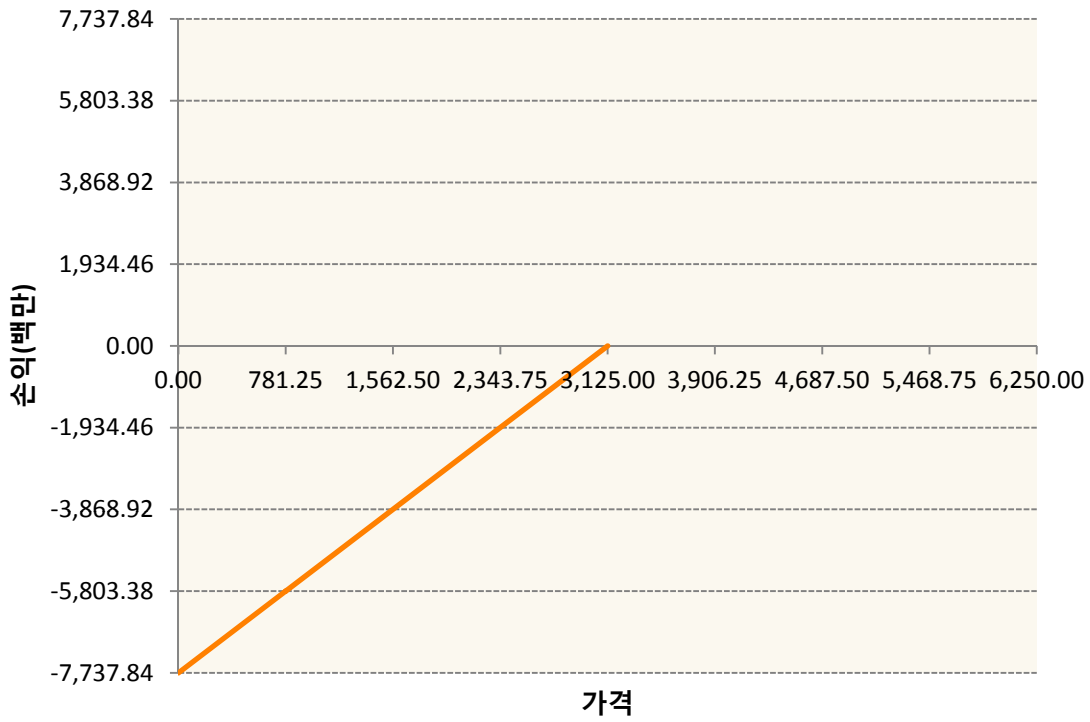


OESXG9-C3150-EURO STOXX 50

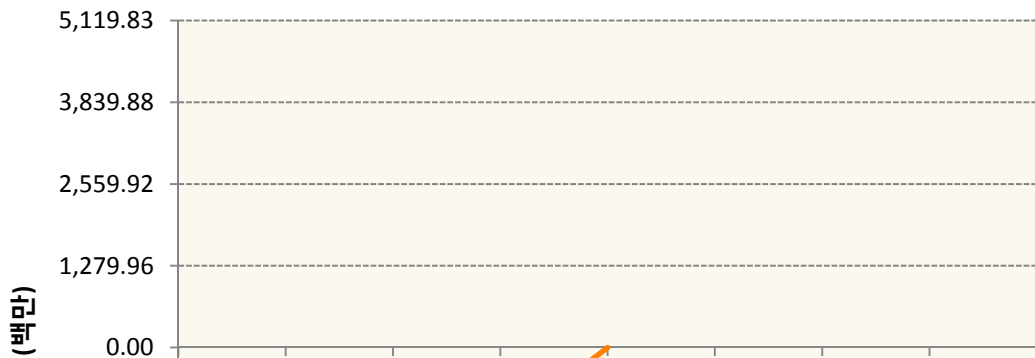


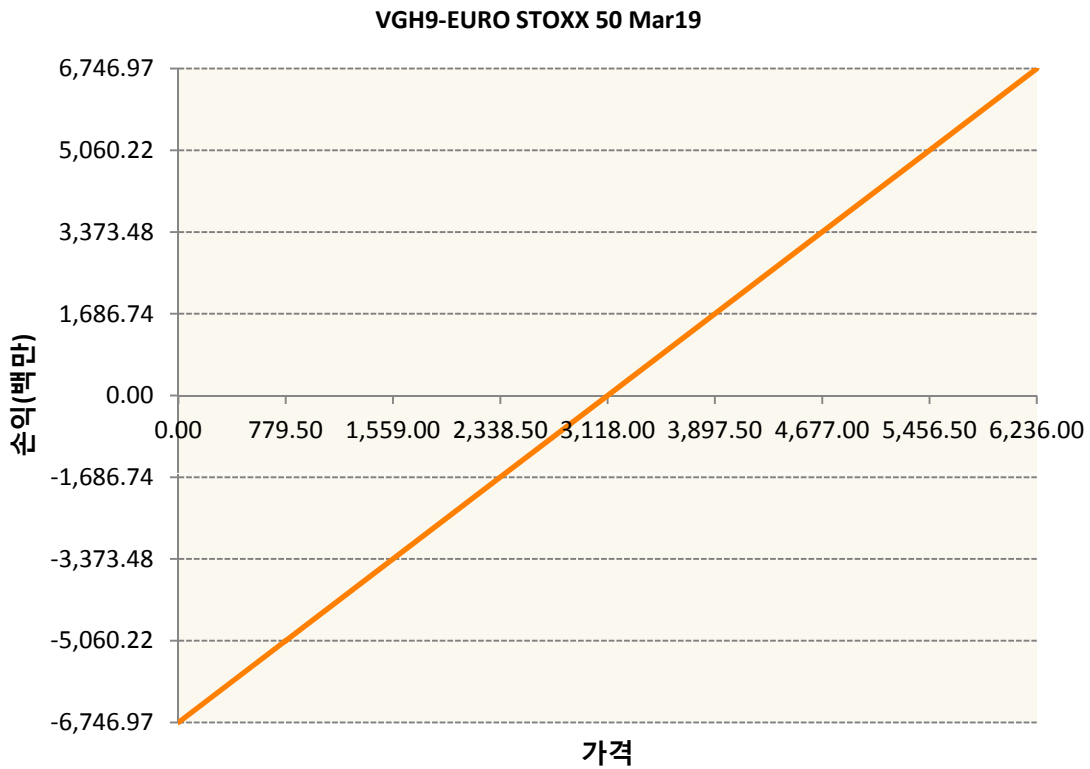
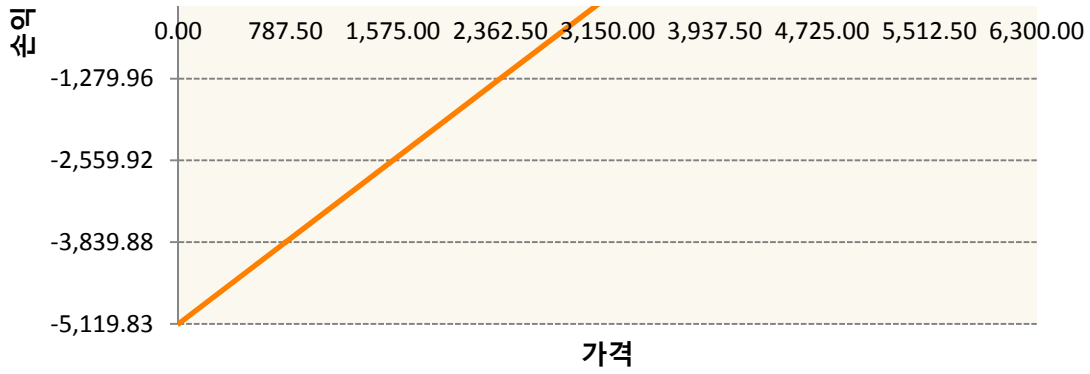


OESXG9-P3125-EURO STOXX 50



OESXG9-P3150-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY		3
FX21018X02 KRW/EUR 22-02-19E		406
FX21018Z03 KRW/EUR 22-03-19E		813
OESXG9-C31EURO STOXX 50		619
OESXG9-C31EURO STOXX 50		410
OESXG9-P31EURO STOXX 50		619
OESXG9-P31EURO STOXX 50		410
VGH9	EURO STOXX 50 Mar19	540

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

(단위:백만원)

2,460

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

(단위:백만원)

1,175

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

(단위:백만원)

100

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

(단위:백만원)

150

공시일	2019-01-28
기준일	2019-01-25

스마트KRX300인덱스목표전환형1호

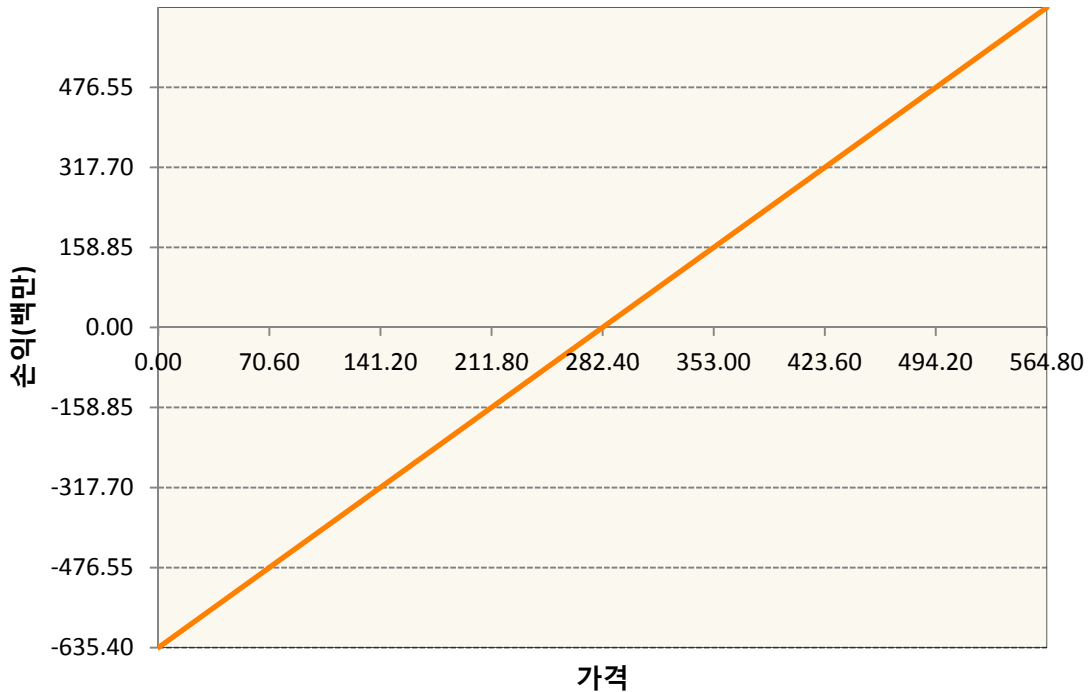
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	635	0	635	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101P30007-2019-03 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101P30007		2019-03 코스피200지수선물						51
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-51	-51	-51	-51	-51	-51	-51	
-5.33%	-34	-34	-34	-34	-34	-34	-34	
-2.67%	-17	-17	-17	-17	-17	-17	-17	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	17	17	17	17	17	17	17	
5.33%	34	34	34	34	34	34	34	
8.00%	51	51	51	51	51	51	51	

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

(단위:백만원)

45

공시일	2019-01-28
기준일	2019-01-25

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

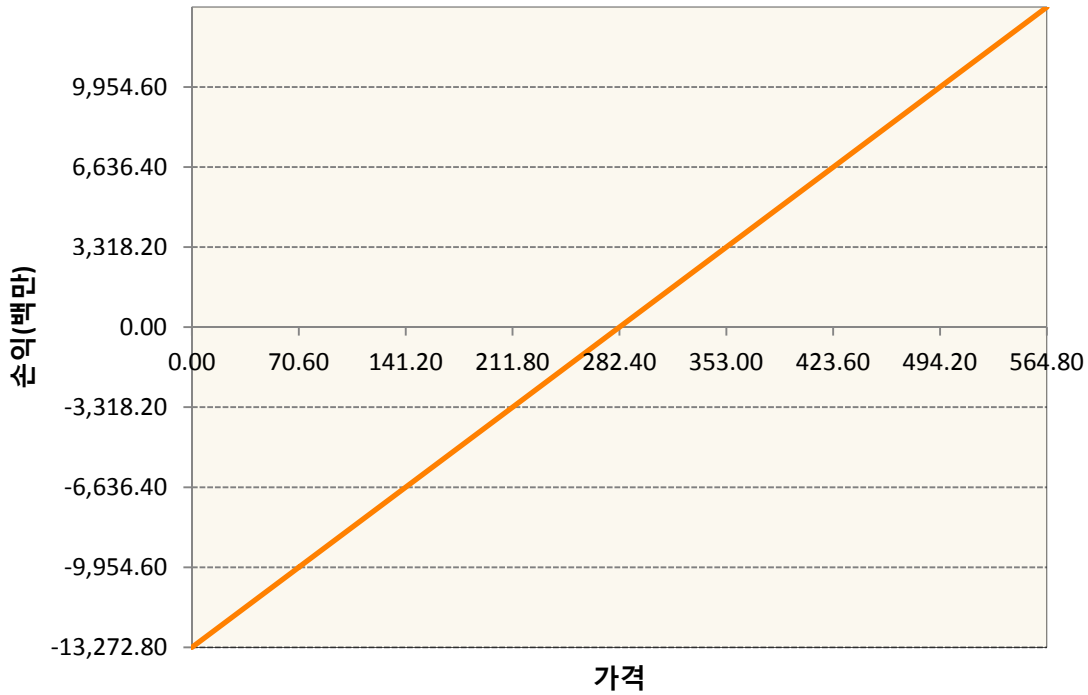
1. 계약금액

(단위:백만원)

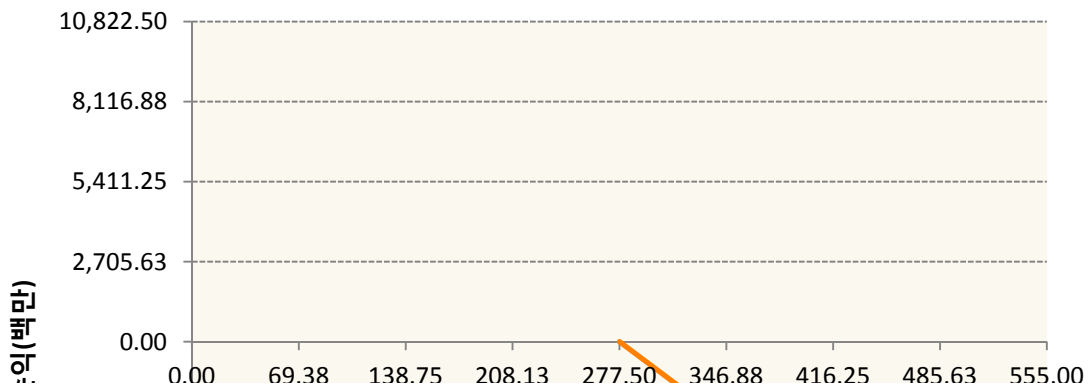
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	13,273	0	13,273	장내
누계	유가증권	옵션	2,523	23,213	-20,690	장내

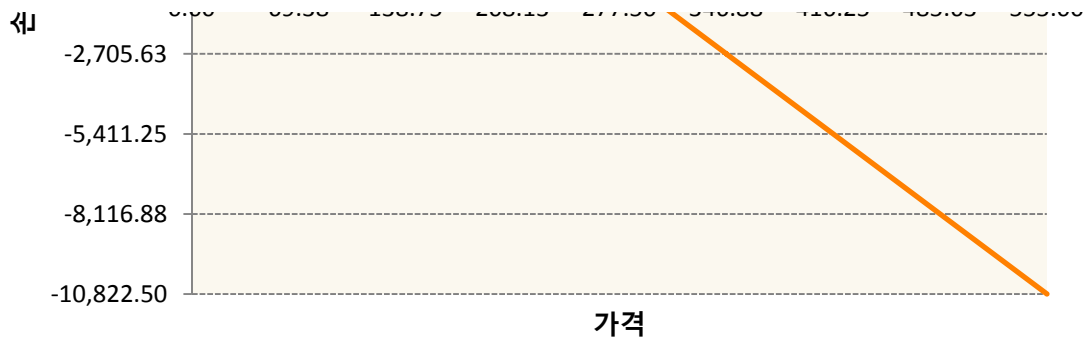
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P30007-2019-03 코스피200지수선물

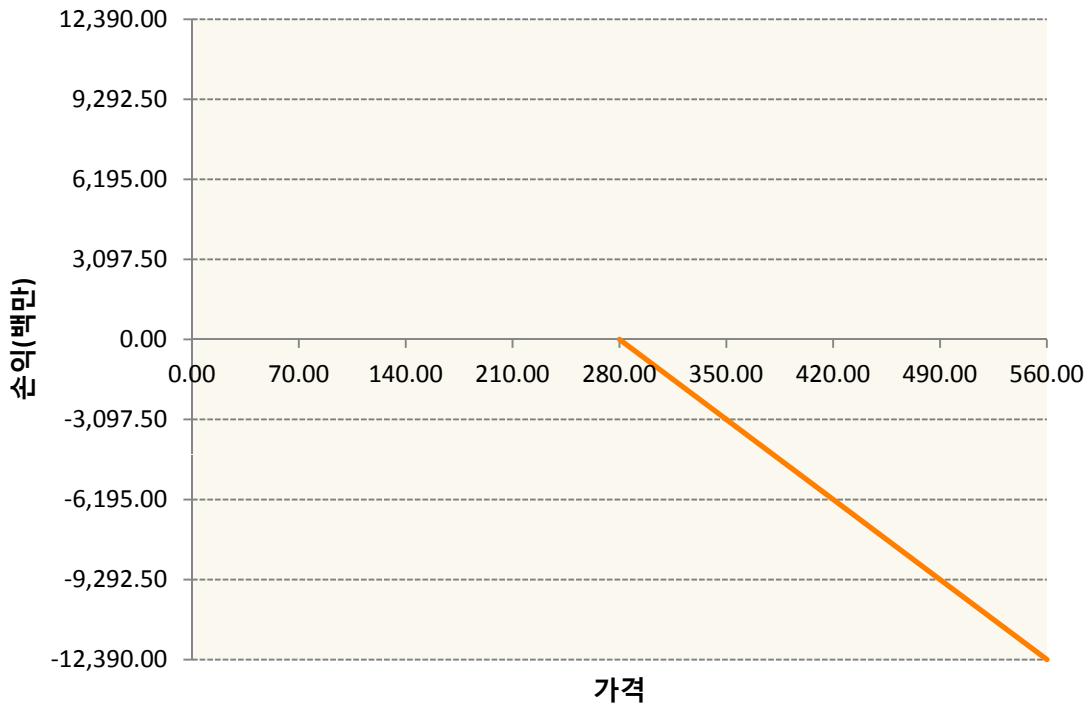


KR4201P22770-2019-02 콜277.5

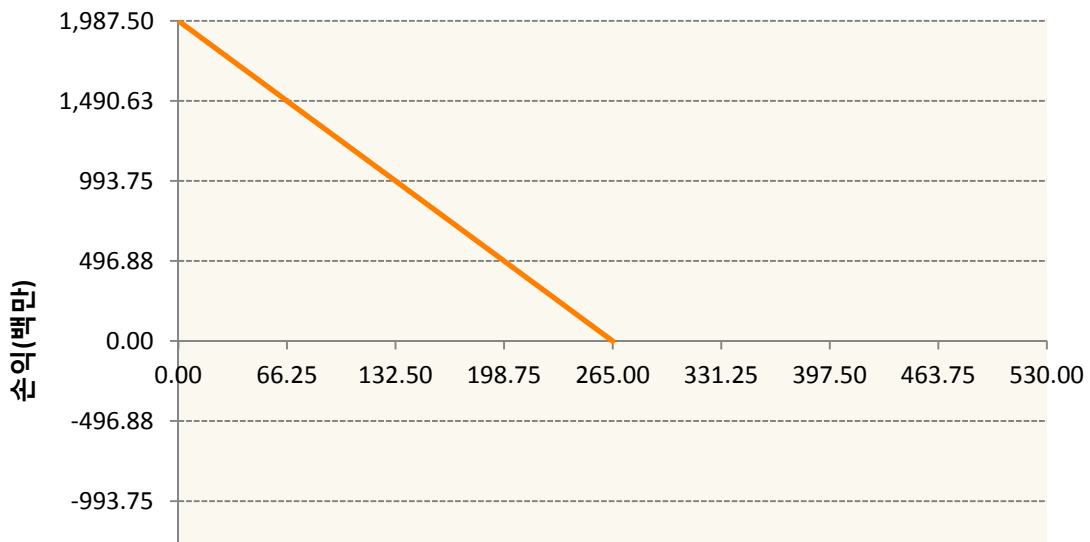


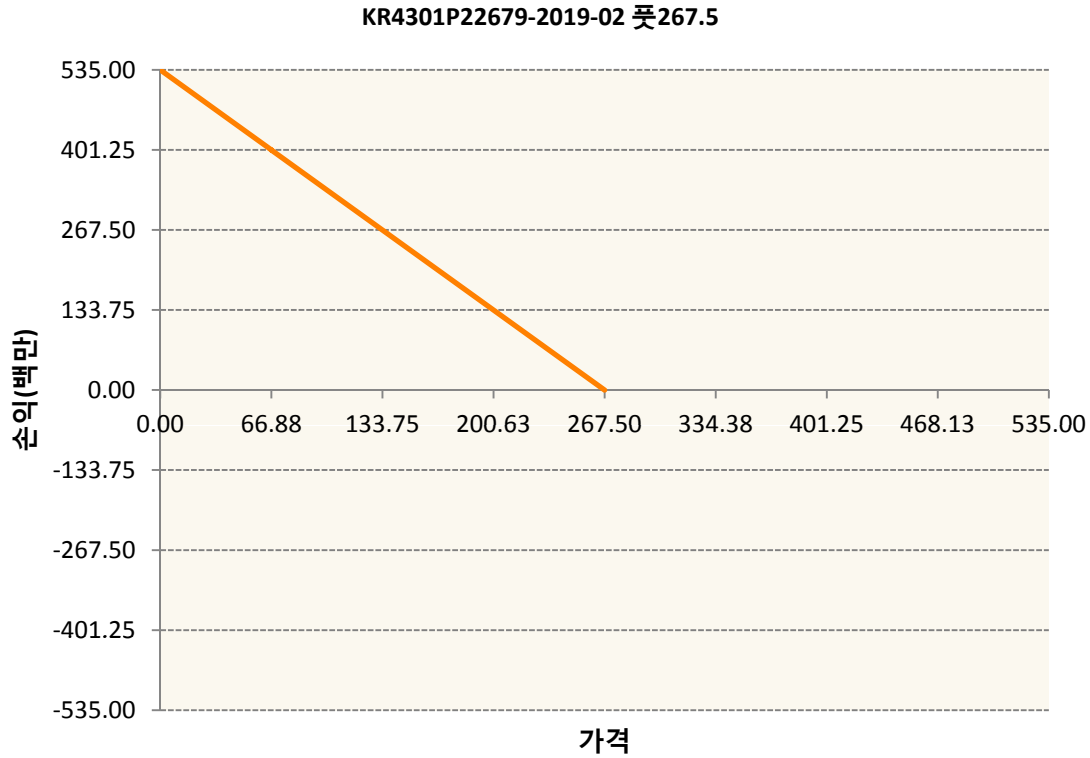
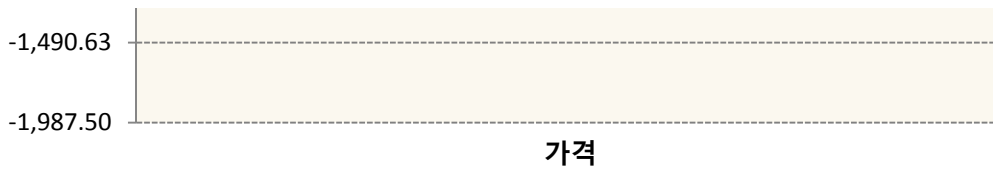


KR4201P22804-2019-02 콜280



KR4301P22653-2019-02 풋265





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101P30007		2019-03 코스피200지수선물						1,059
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-1,059	-1,059	-1,059	-1,059	-1,059	-1,059	-1,059	
-5.33%	-706	-706	-706	-706	-706	-706	-706	
-2.67%	-353	-353	-353	-353	-353	-353	-353	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	353	353	353	353	353	353	353	
5.33%	706	706	706	706	706	706	706	
8.00%	1,059	1,059	1,059	1,059	1,059	1,059	1,059	
KR4201P22770		2019-02 콜277.5						736
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	338	330	321	311	299	287	274	
-5.33%	301	287	271	254	237	219	201	
-2.67%	216	195	174	153	132	111	89	

0%	63	42	21	0	-21	-42	-64
2.67%	-153	-169	-185	-202	-220	-238	-257
5.33%	-413	-421	-431	-443	-455	-469	-483
8.00%	-694	-698	-703	-709	-717	-726	-736
KR4201P22804 2019-02 콜280							800
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	327	321	313	303	292	280	266
-5.33%	298	284	268	251	233	215	195
-2.67%	221	199	177	154	131	107	84
0%	74	49	25	0	-25	-49	-74
2.67%	-149	-169	-190	-211	-233	-256	-278
5.33%	-429	-441	-455	-470	-487	-505	-523
8.00%	-742	-747	-755	-764	-775	-787	-800
KR4301P22653 2019-02 풋265							58
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	48	49	51	53	55	56	58
-5.33%	13	15	18	20	22	24	26
-2.67%	1	2	3	4	6	7	9
0%	-1	-1	0	0	0	1	2
2.67%	-1	-1	-1	-1	-1	-1	0
5.33%	-1	-1	-1	-1	-1	-1	-1
8.00%	-1	-1	-1	-1	-1	-1	-1
KR4301P22679 2019-02 풋267.5							19
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	17	17	17	18	18	19	19
-5.33%	6	6	7	7	8	9	9
-2.67%	1	1	1	2	2	3	3
0%	0	0	0	0	0	0	1
2.67%	0	0	0	0	0	0	0
5.33%	0	0	0	0	0	0	0
8.00%	0	0	0	0	0	0	0

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

(단위:백만원)

2,508

공시일	2019-01-28
기준일	2019-01-25

H2O글로벌본드(USD)(채권혼합-파

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	28	0	28	
누계	유가증권	수익증권	651	0	651	

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	2019-01-28
기준일	2019-01-25

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	2,862	0	2,862	

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	2019-01-28
기준일	2019-01-25

H2O글로벌본드(H)(채권혼합-파생)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	404	0	404	
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	수익증권	5,412	0	5,412	
누계	통화	선도	0	14,286	-14,286	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	39
FX21018Z02 KRW/USD 19-02-19E	2
FX21018Z02 KRW/USD 19-02-19E	5
FX21018Z03 KRW/USD 19-02-19E	21
FX21018Z03 KRW/USD 19-02-19E	31
FX21019F00 KRW/USD 19-02-19E	15
FX21019F00 KRW/USD 19-02-19E	8
FX21019F00 KRW/USD 19-02-19E	26
FX21019F00 KRW/USD 19-02-19E	8
FX21019F00 KRW/USD 19-02-19E	13
FX21019F00 KRW/USD 19-02-19E	29
FX21019F00 KRW/USD 19-02-19E	13
FX21019F01 KRW/USD 19-02-19E	38
FX21019F01 KRW/USD 28-02-19E	14
FX21019F01 KRW/USD 28-02-19E	57
FX21019F01 KRW/USD 28-02-19E	9
FX21019F01 KRW/USD 28-02-19E	32
FX21019F02 KRW/USD 25-02-19E	135
FX21019F02 KRW/USD 28-03-19E	466
FX21019F02 KRW/USD 28-02-19E	117

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

(단위:백만원)

431

공시일	2019-01-28
기준일	2019-01-25

스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

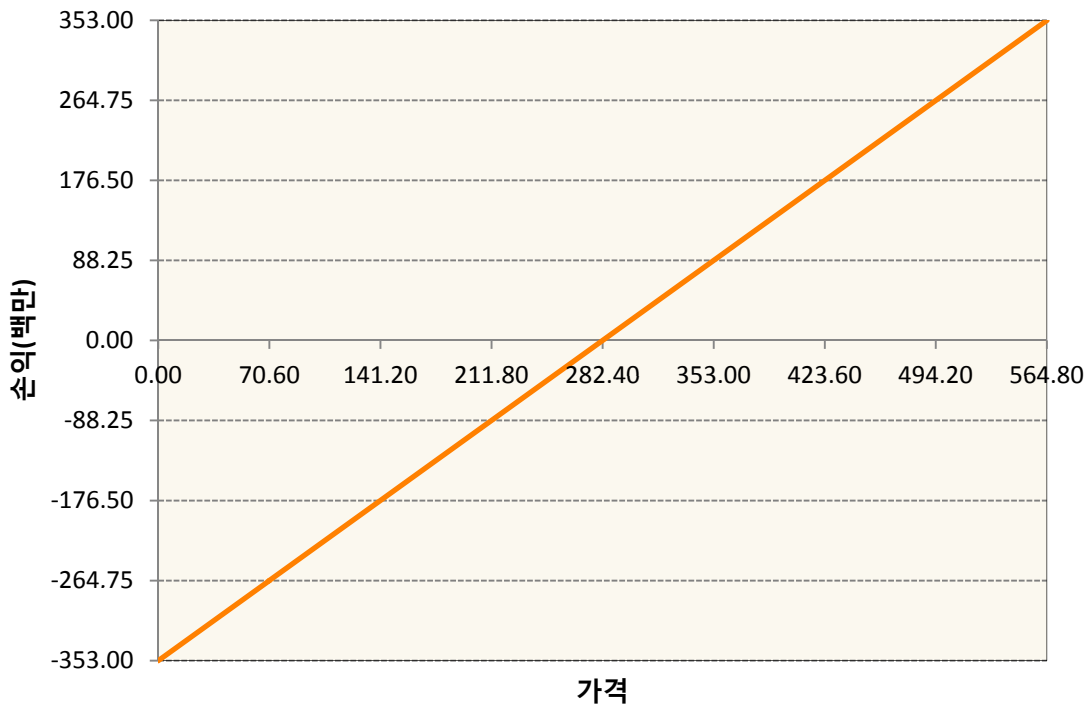
1. 계약금액

(단위:백만원)

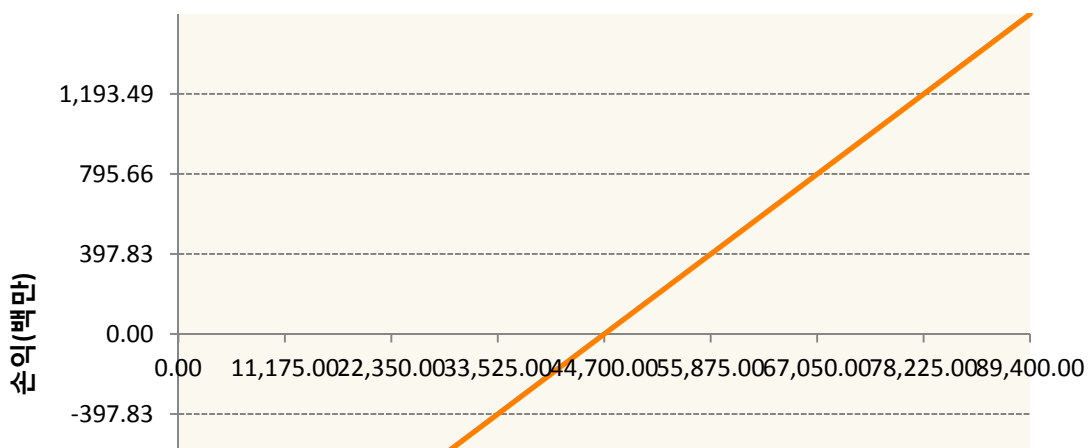
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,944	0	1,944	장내

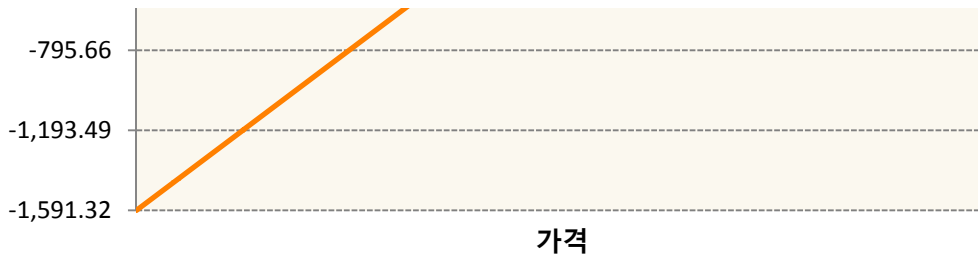
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P30007-2019-03 코스피200지수선물



KR4111P20007-2019-02 삼성전자개별선물





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101P30007		2019-03 코스피200지수선물						28
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-28	-28	-28	-28	-28	-28	-28	
-5.33%	-19	-19	-19	-19	-19	-19	-19	
-2.67%	-9	-9	-9	-9	-9	-9	-9	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	9	9	9	9	9	9	9	
5.33%	19	19	19	19	19	19	19	
8.00%	28	28	28	28	28	28	28	
KR4111P20007		2019-02 삼성전자개별선물						127
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-127	-127	-127	-127	-127	-127	-127	
-5.33%	-85	-85	-85	-85	-85	-85	-85	
-2.67%	-42	-42	-42	-42	-42	-42	-42	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	42	42	42	42	42	42	42	
5.33%	85	85	85	85	85	85	85	
8.00%	127	127	127	127	127	127	127	

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

175

공시일	2019-01-28
기준일	2019-01-25

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

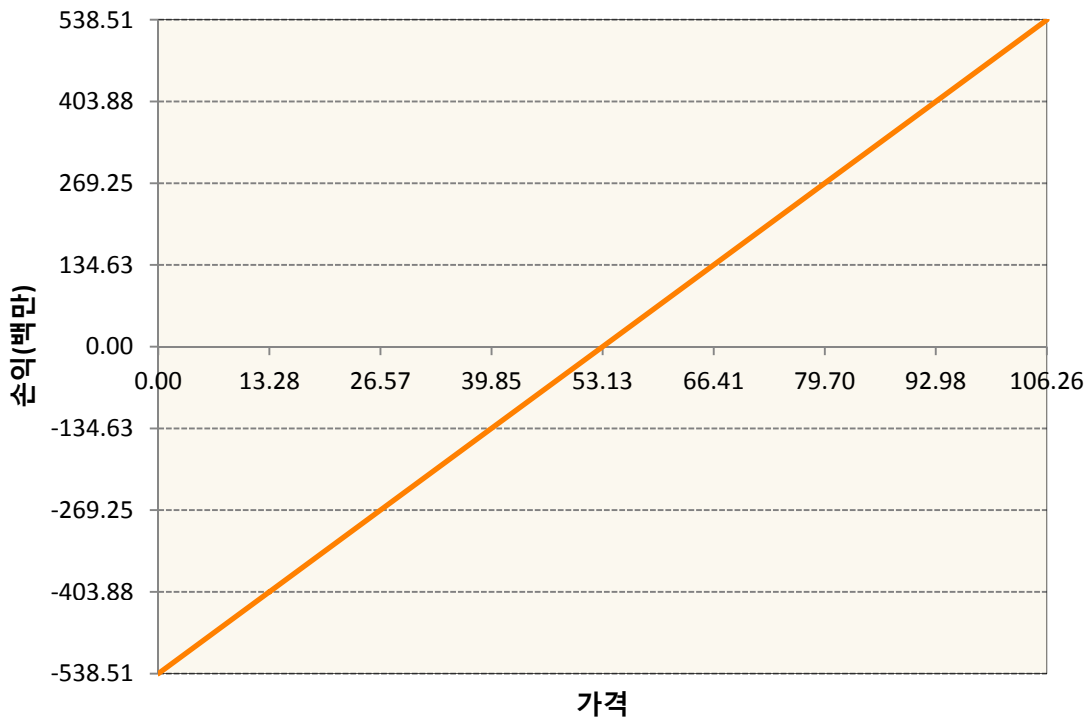
1. 계약금액

(단위:백만원)

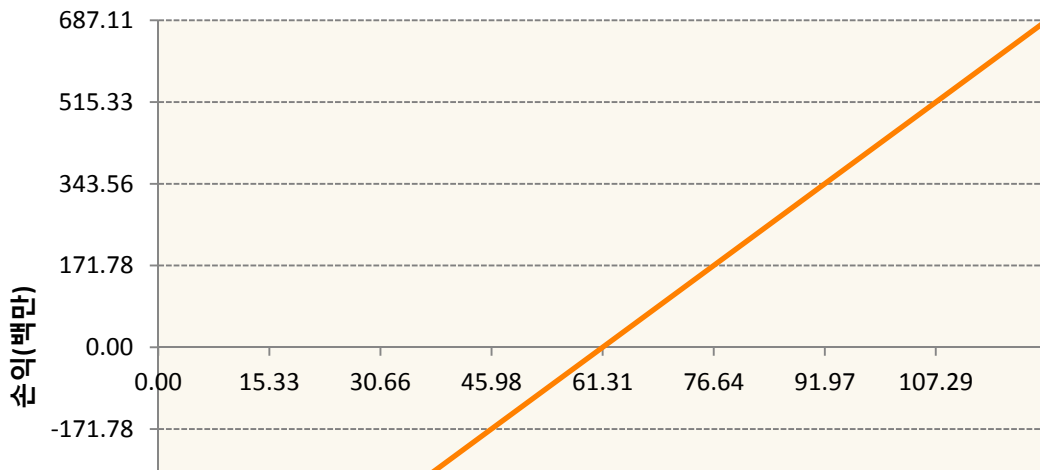
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,733	280	2,453	

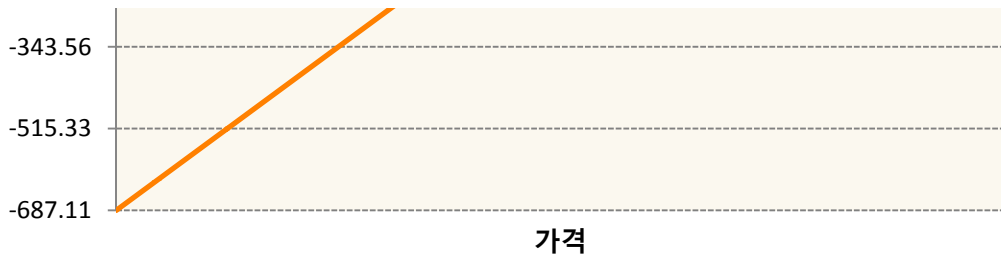
2. 만기시점의 손익구조

CLH9-WTI CRUDE FUTURE MAR19

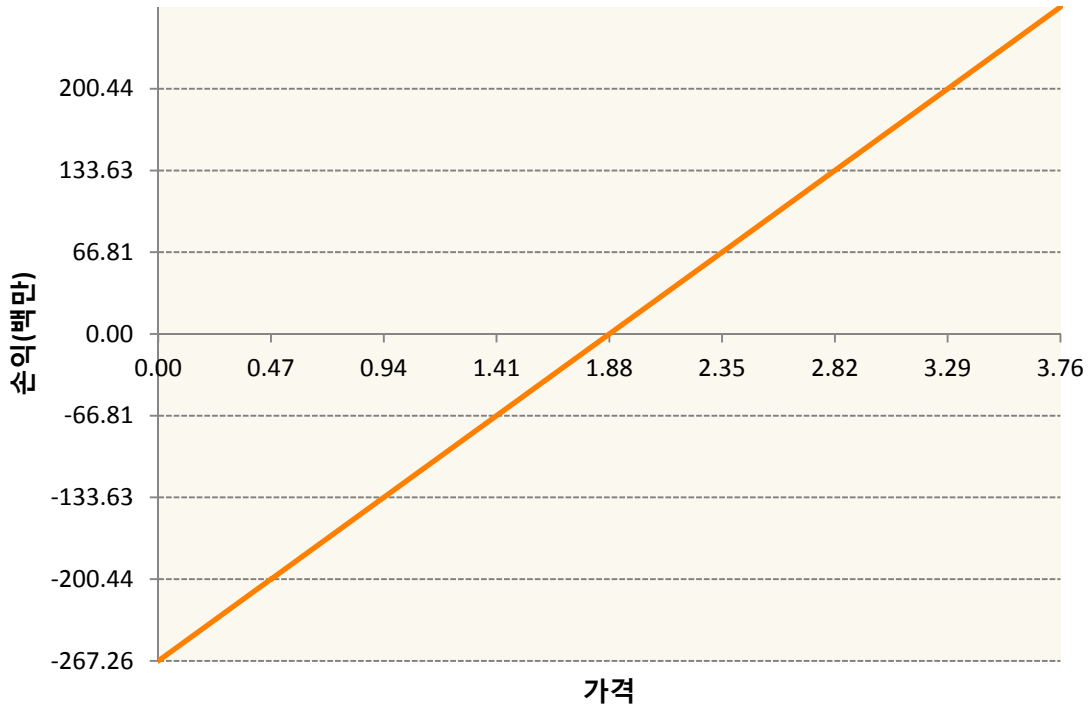


COK9-BRENT CRUDE FUTR May19

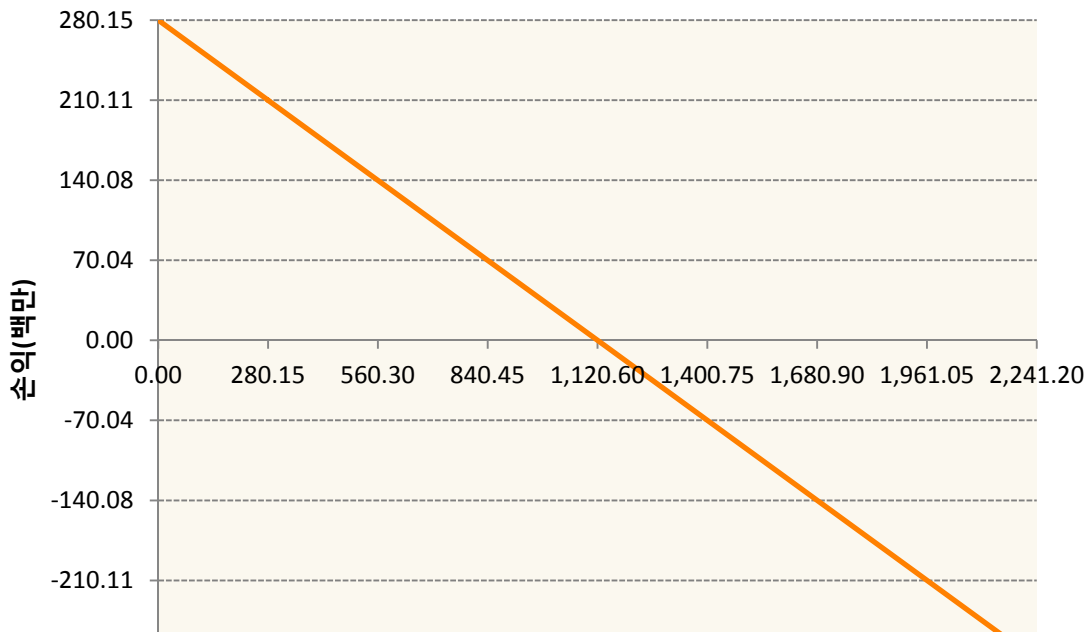


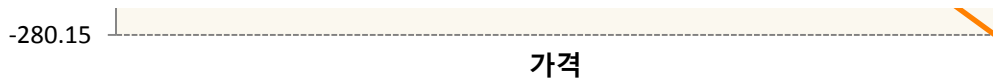


HOH9-NY Harb ULSD Fut Mar19



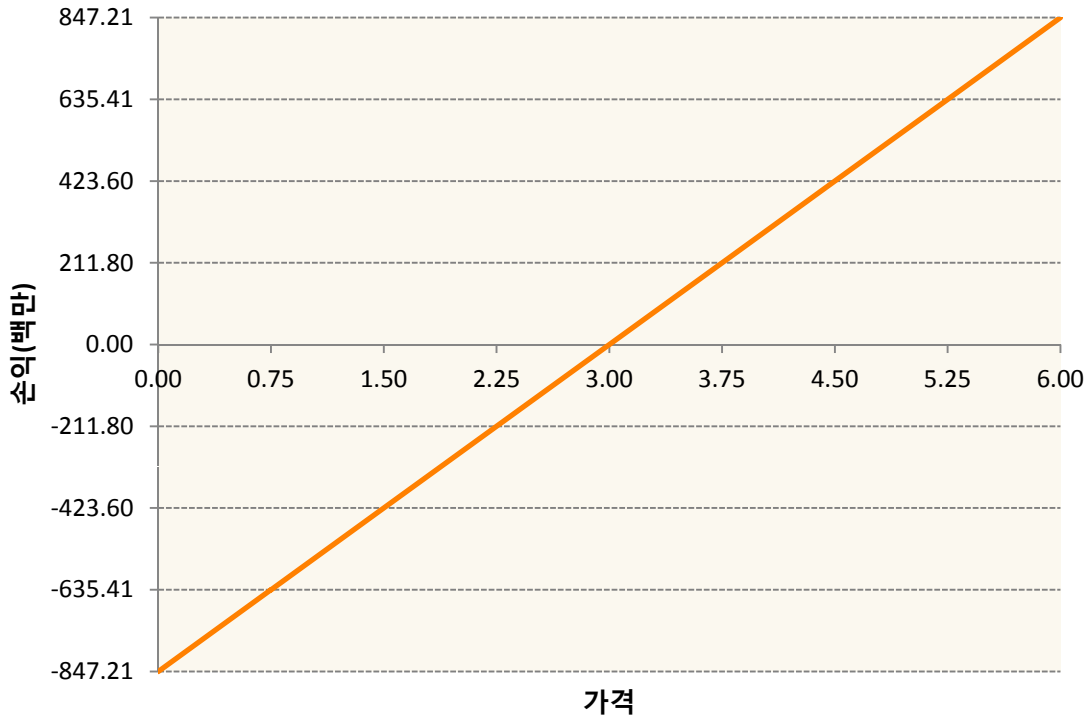
KR4175P20002-2019-02 달러선물





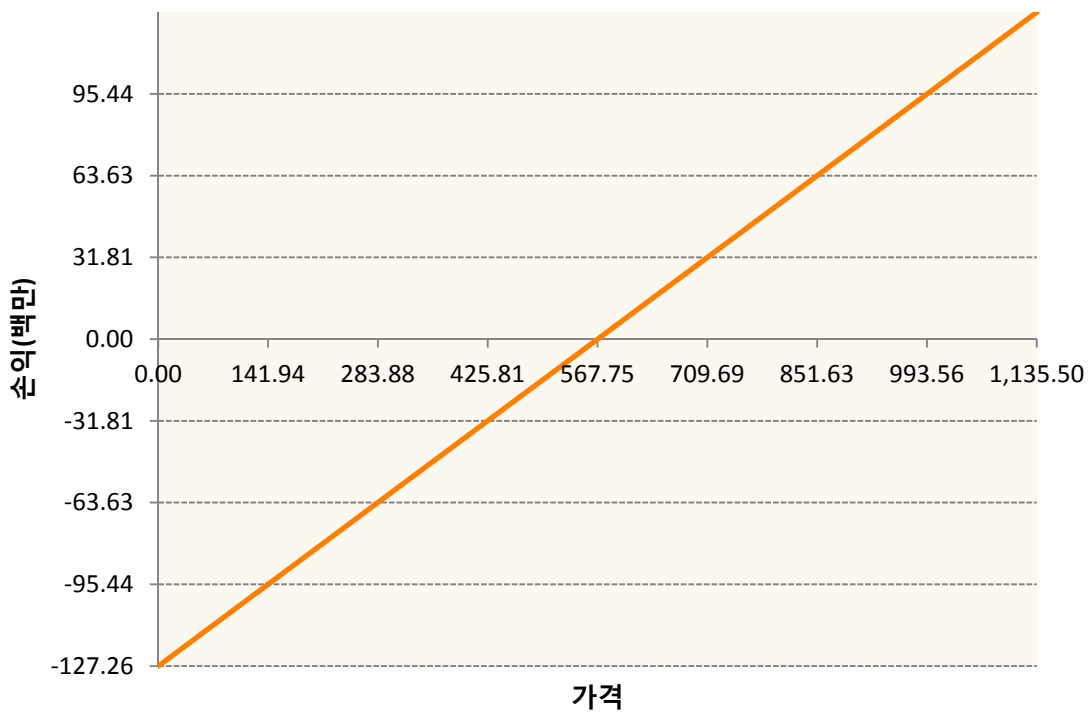
가격

NGH19-NATURAL GAS FUTR Mar19



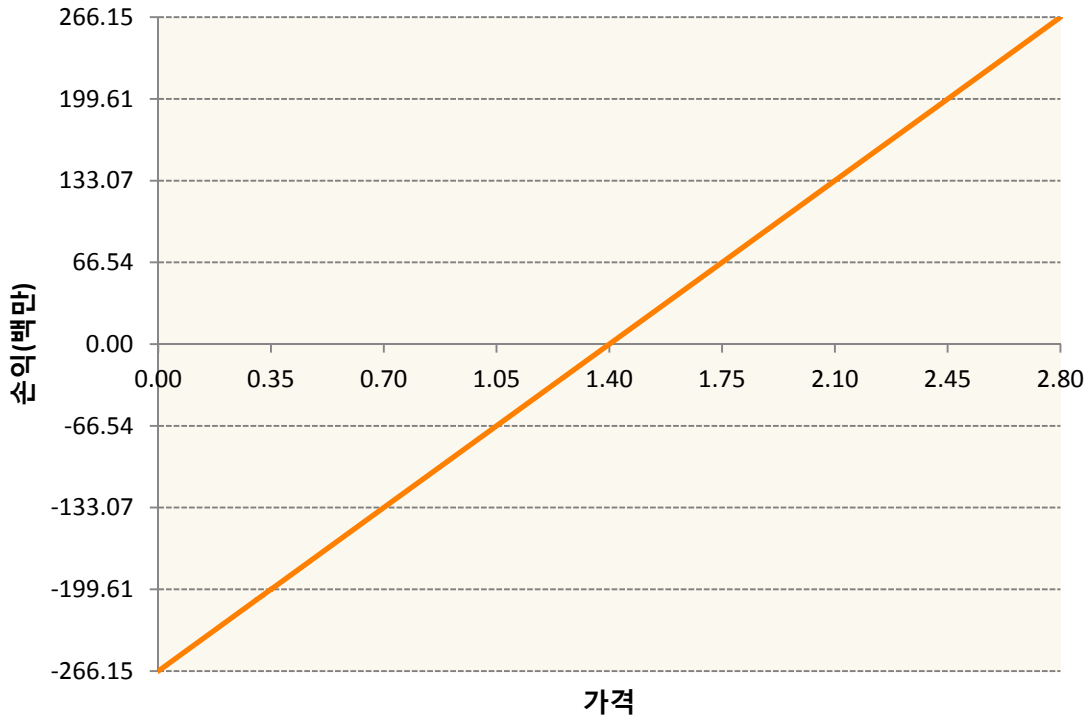
가격

QSH9-Low Su Gasoil G May19



가격

XBH9-GASOLINE RBOB FUT Mar19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLH9	WTI CRUDE FUTURE MAR19	43
COK9	BRENT CRUDE FUTR May19	55
HOH9	NY Harb ULSD Fut Mar19	21
KR4175P200	2019-02 달러선물	22
NGH19	NATURAL GAS FUTR Mar19	68
QSH9	Low Su Gasoil G May19	10
XBH9	GASOLINE RBOB FUT Mar19	21

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

431

공시일	2019-01-28
기준일	2019-01-25

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

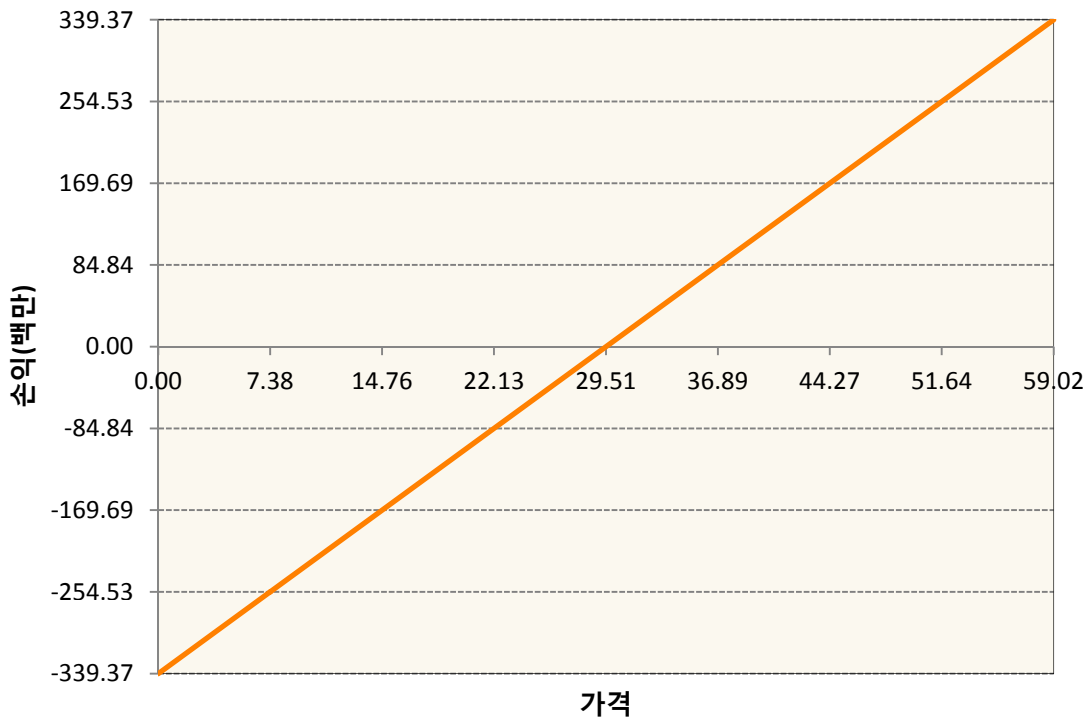
1. 계약금액

(단위:백만원)

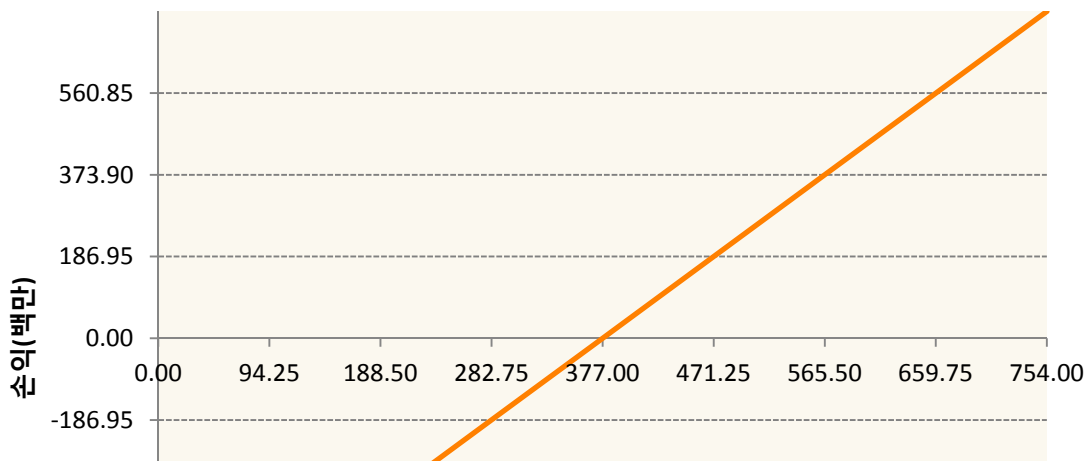
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,596	78	3,518	

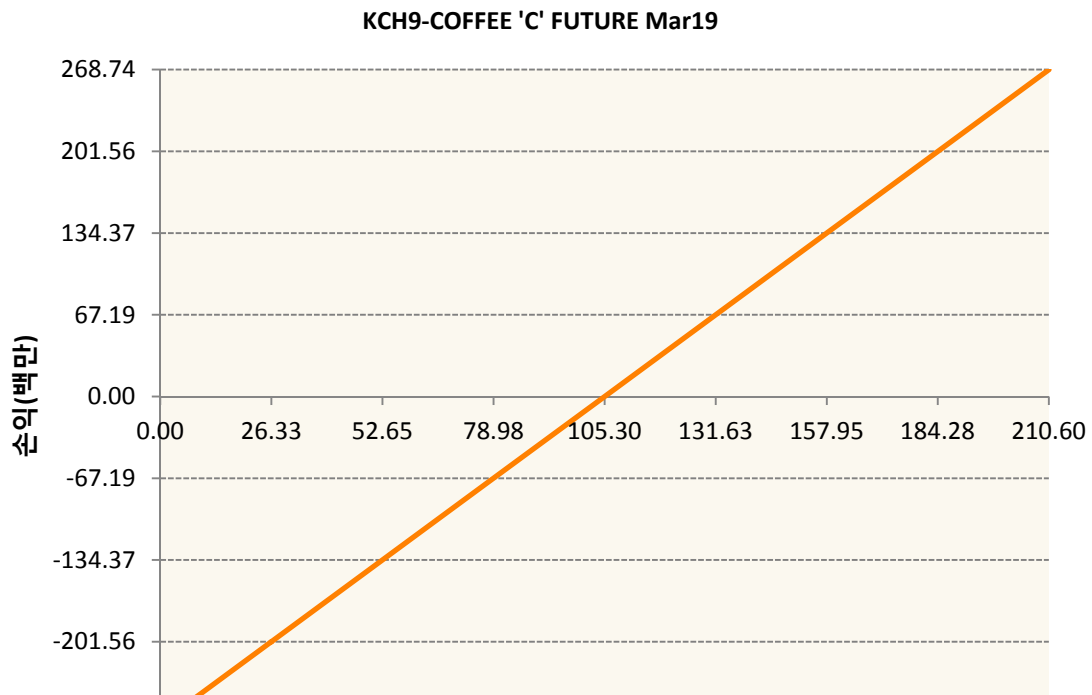
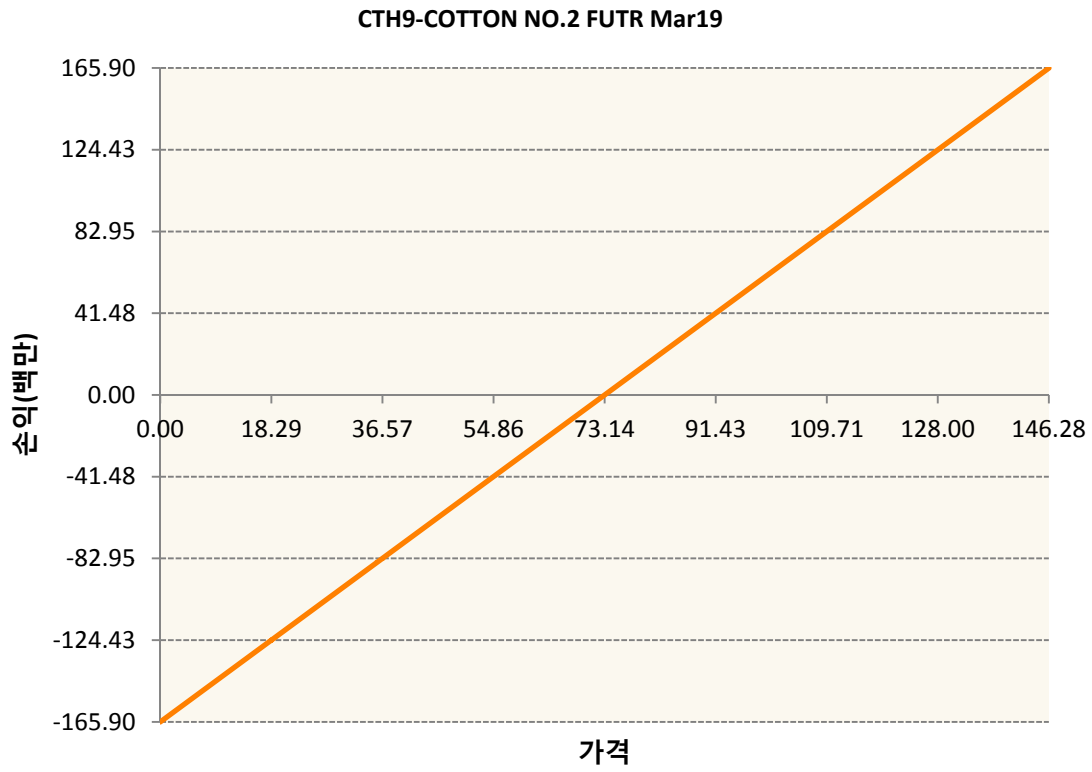
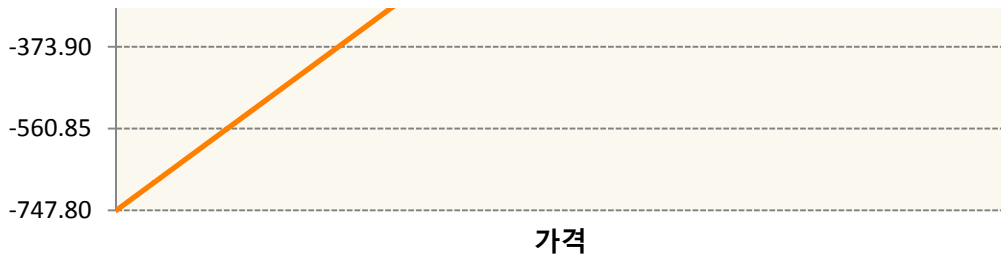
2. 만기시점의 손익구조

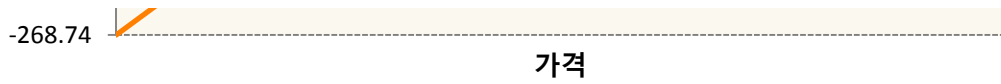
BOH9-SOYBEAN OIL FUTR Mar19



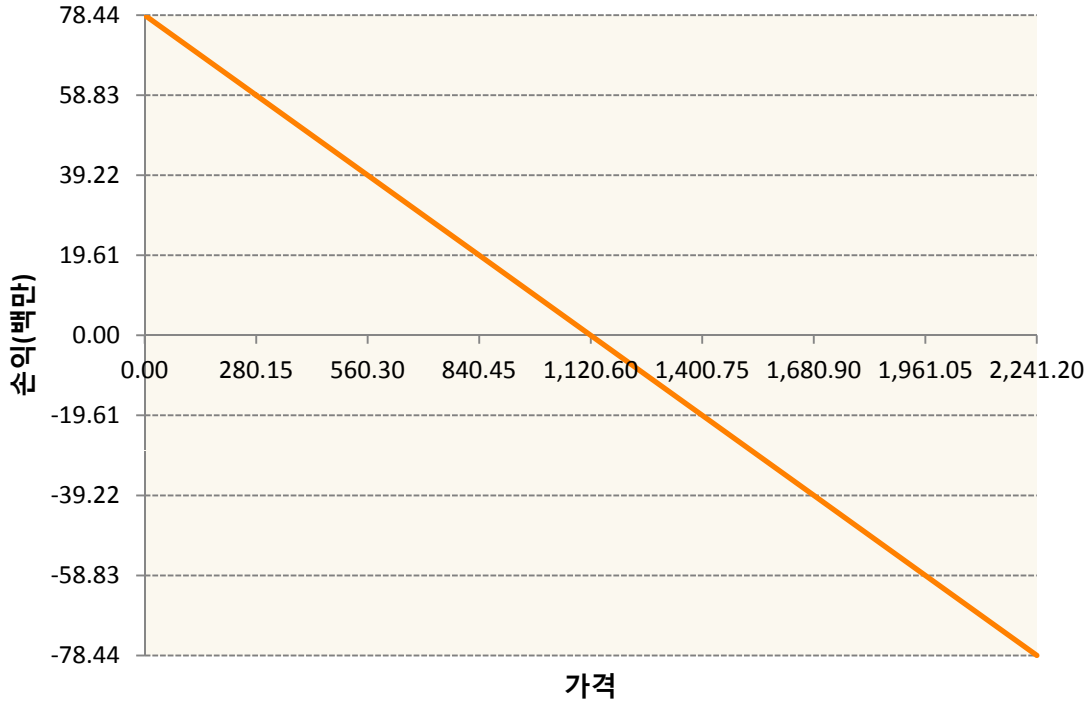
CH9-CORN FUTURE Mar19



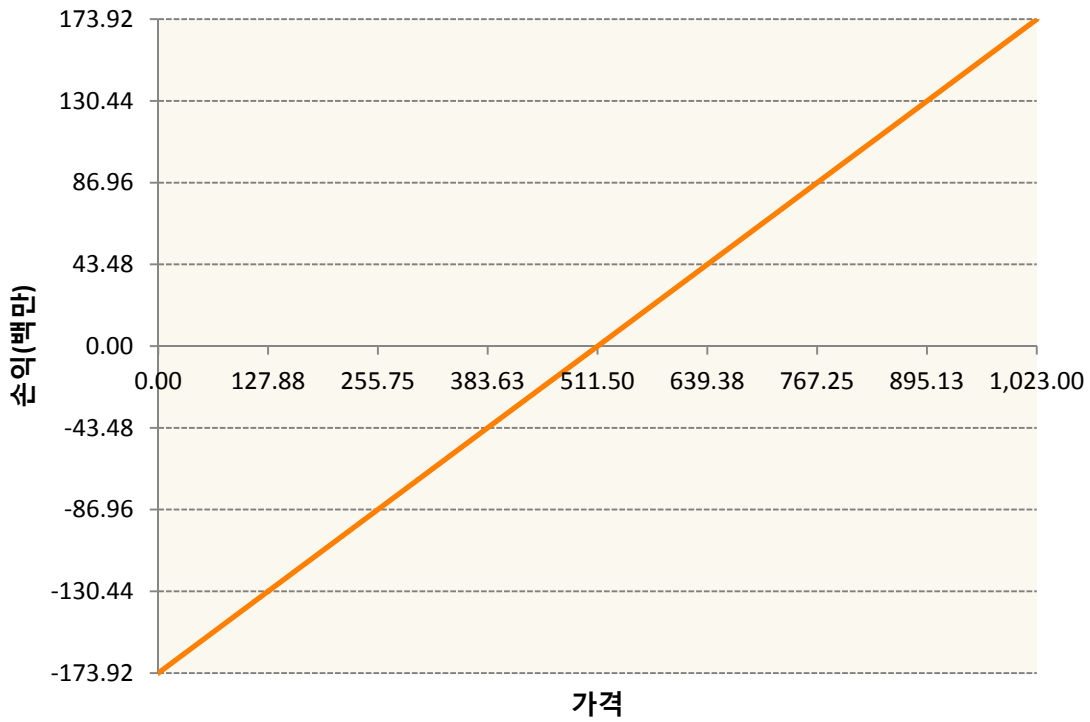




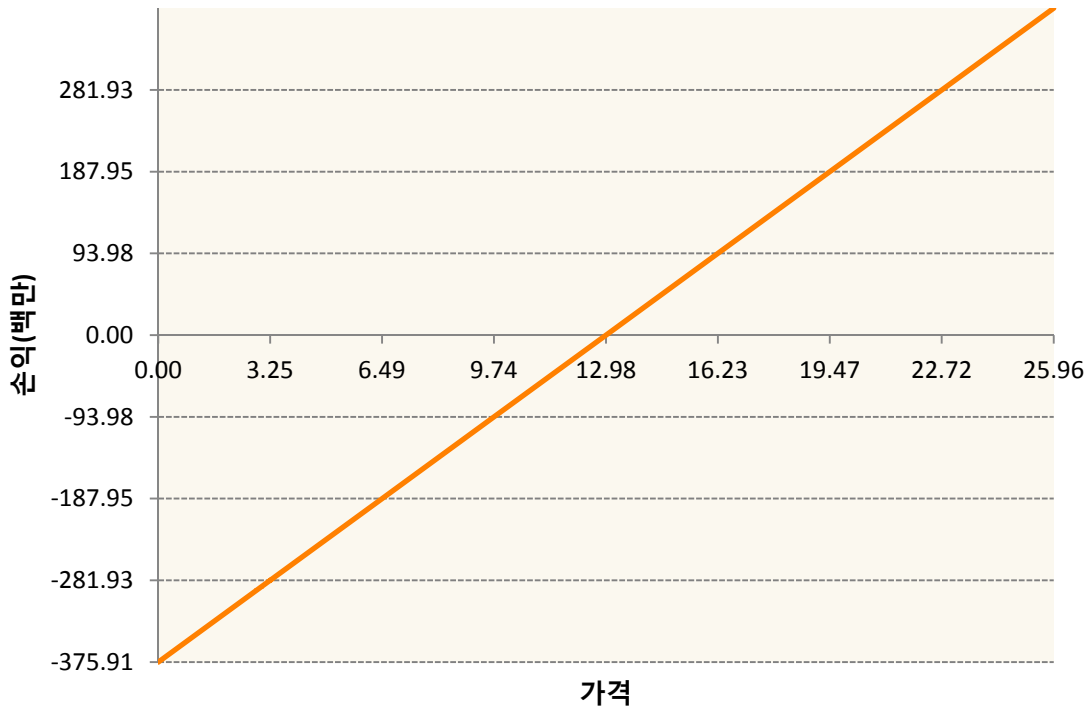
KR4175P20002-2019-02 달러선물



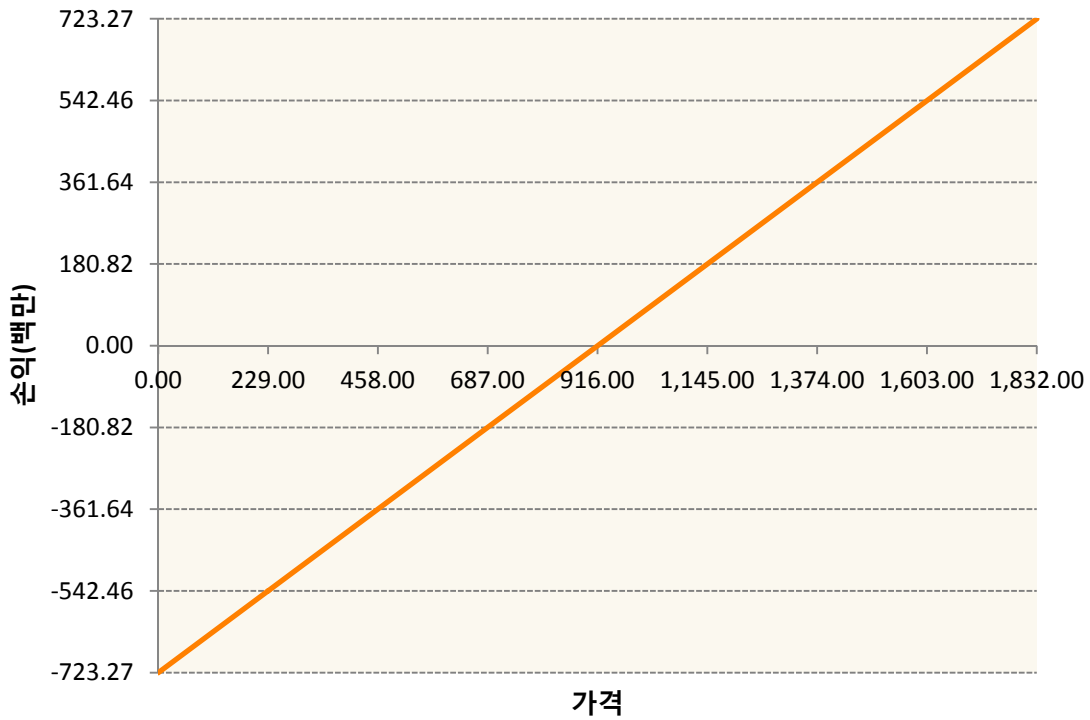
KWH9-KC HRW WHEAT FUT Mar19



SBH9-SUGAR #11 (WORLD) MAR19

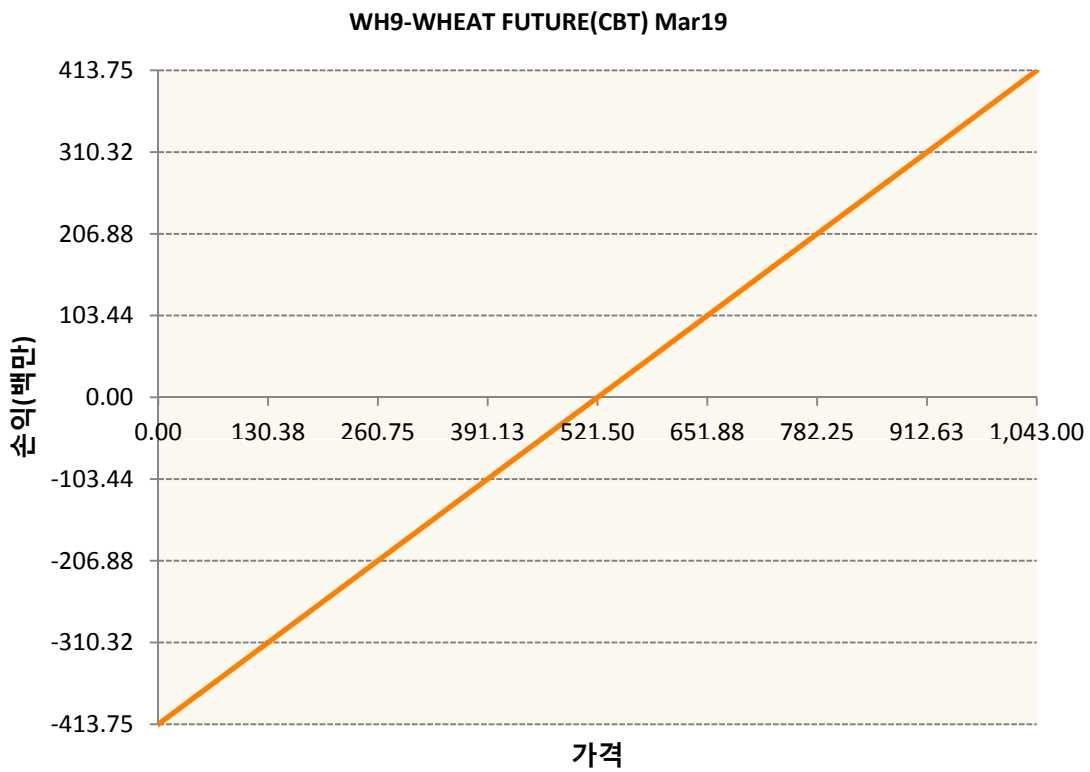
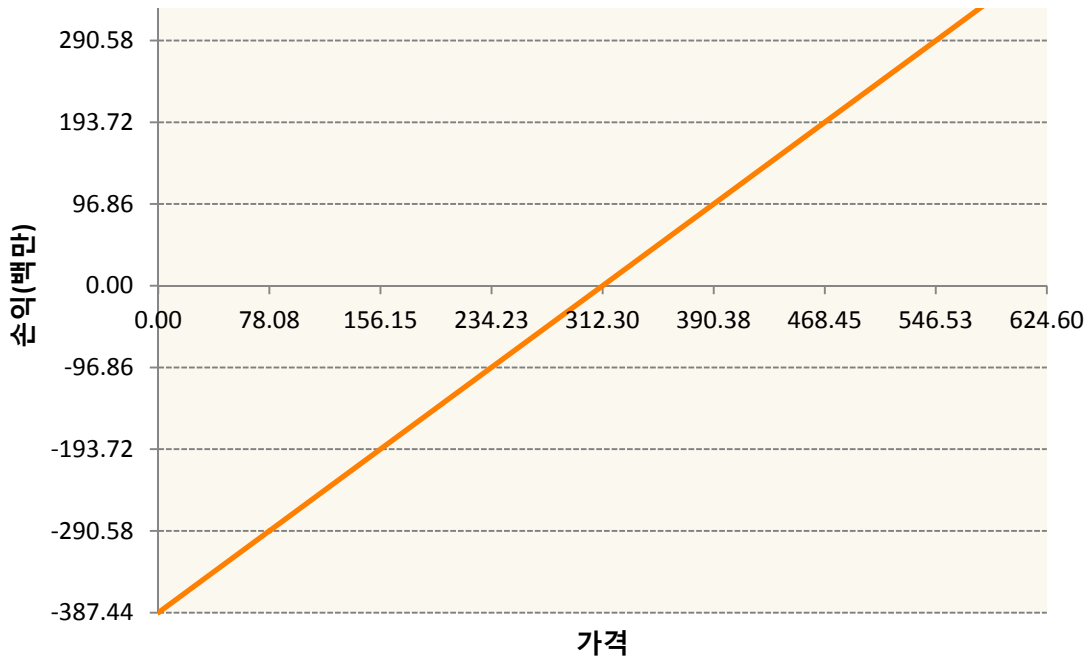


SH9-SOYBEAN FUTURE Mar19



SMH9-SOYBEAN MEAL FUTR Mar19





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

BOH9	SOYBEAN OIL FUTR Mar19	27
CH9	CORN FUTURE Mar19	60
CTH9	COTTON NO.2 FUTR Mar19	13
KCH9	COFFEE 'C' FUTURE Mar19	21
KR4175P200	2019-02 달러선물	6

KWH9	KC HRW WHEAT FUT Mar19	14
SBH9	SUGAR #11 (WORLD) MAR19	30
SH9	SOYBEAN FUTURE Mar19	58
SMH9	SOYBEAN MEAL FUTR Mar19	31
WH9	WHEAT FUTURE(CBT) Mar19	33

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

(단위:백만원)

295