

공시일	2019-02-11
기준일	2019-02-08

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	2019-02-11
기준일	2019-02-08

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

1,078

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

617

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-02-11
기준일	2019-02-08

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	4,357	0	4,357	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI50000 신한CSI500미래S180910	267
SWCSI50000 신한CSI500미래S190129	80

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

519

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-02-11
기준일	2019-02-08

유로인덱스모(주식-파생형)

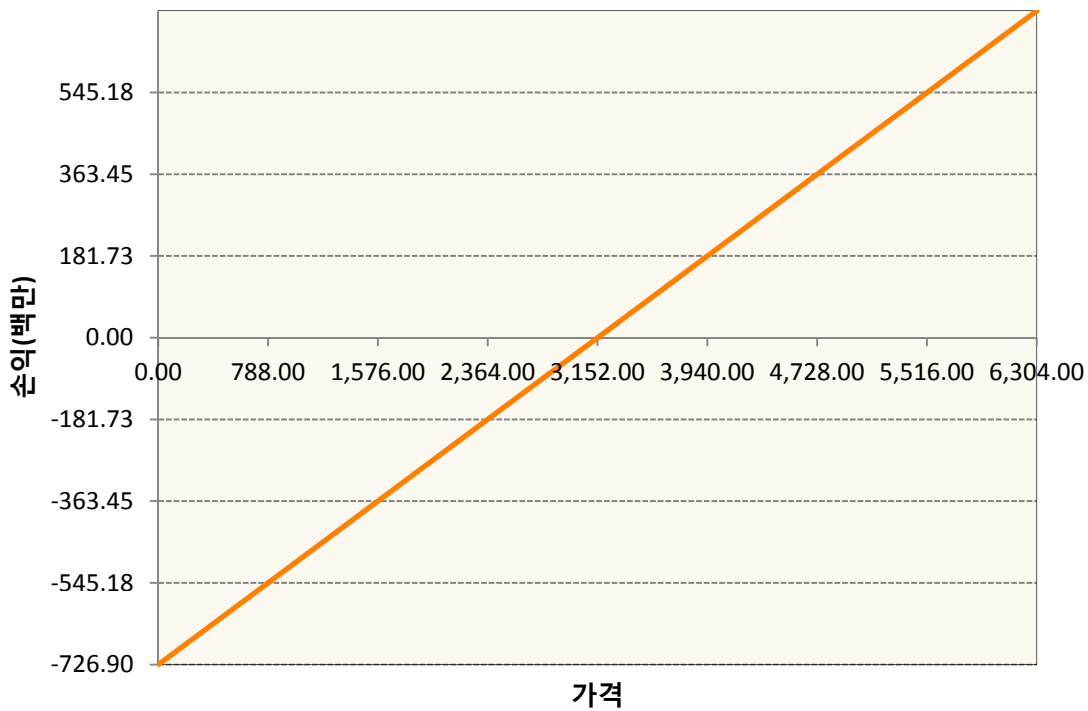
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	727	0	727	

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)

40

공시일	2019-02-11
기준일	2019-02-08

차이나인덱스모(주식-파생형)

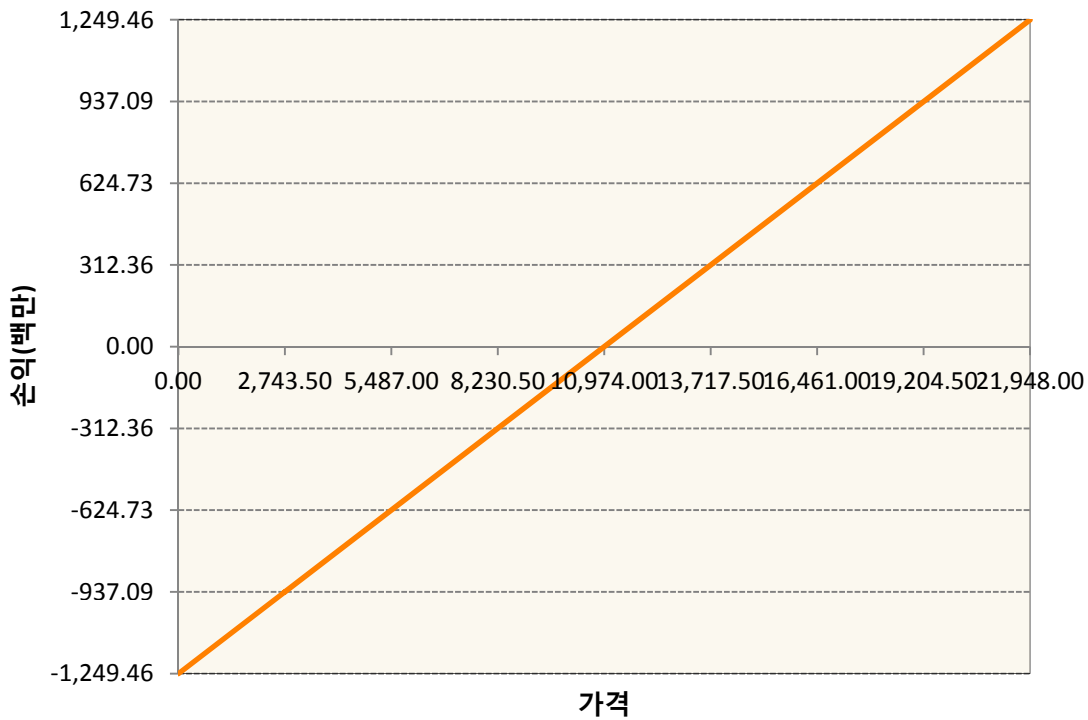
1. 계약금액

(단위:백만원)

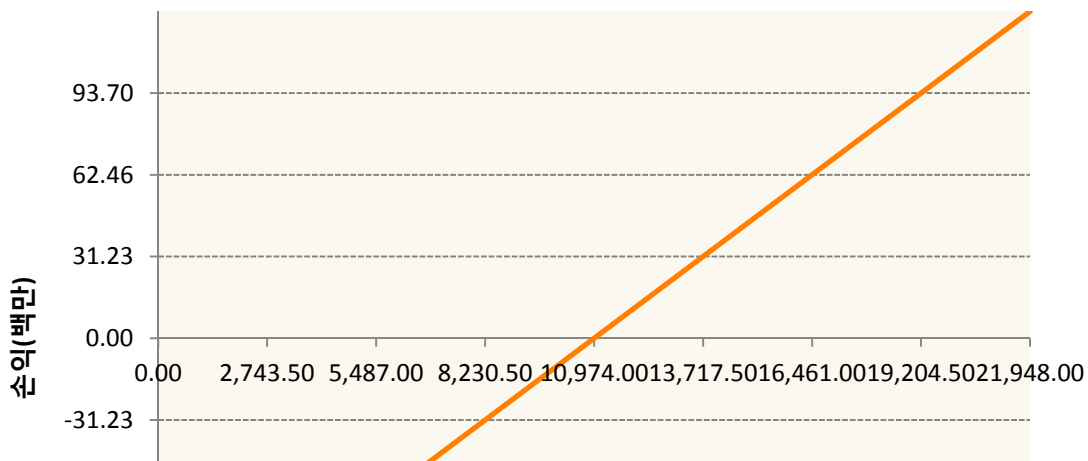
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,374	0	1,374	장내

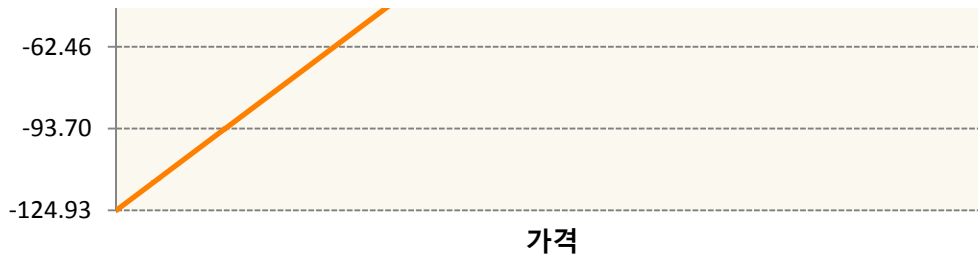
2. 만기시점의 손익구조

HCG9-HSCEI Futures Feb19



MHCG9-MINI H-SHR IDX FU Feb19





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

HCG9	HSCEI Futures Feb19	100
MHCG9	MINI H-SHR IDX FU Feb19	10

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

113

공시일	2019-02-11
기준일	2019-02-08

커버드콜모(주식혼합-파생형)

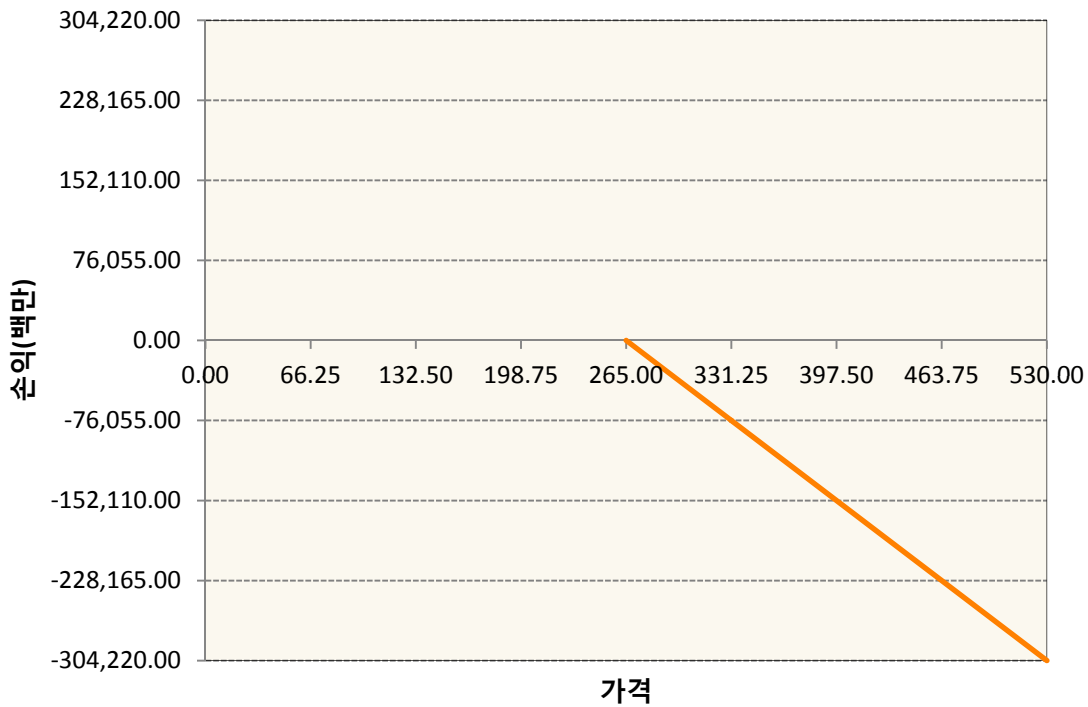
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	646,943	-646,943	장내

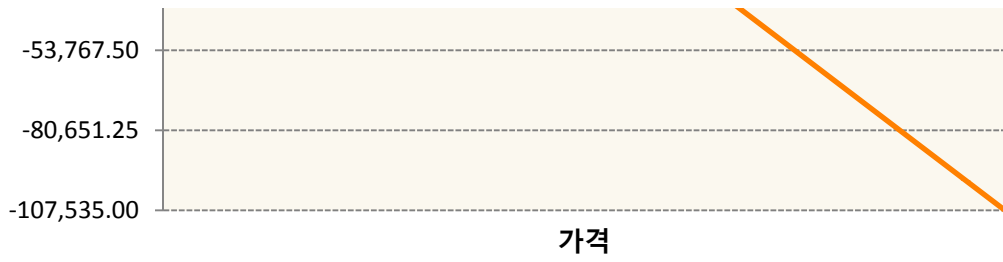
2. 만기시점의 손익구조

KR4201P22655-2019-02 콜265

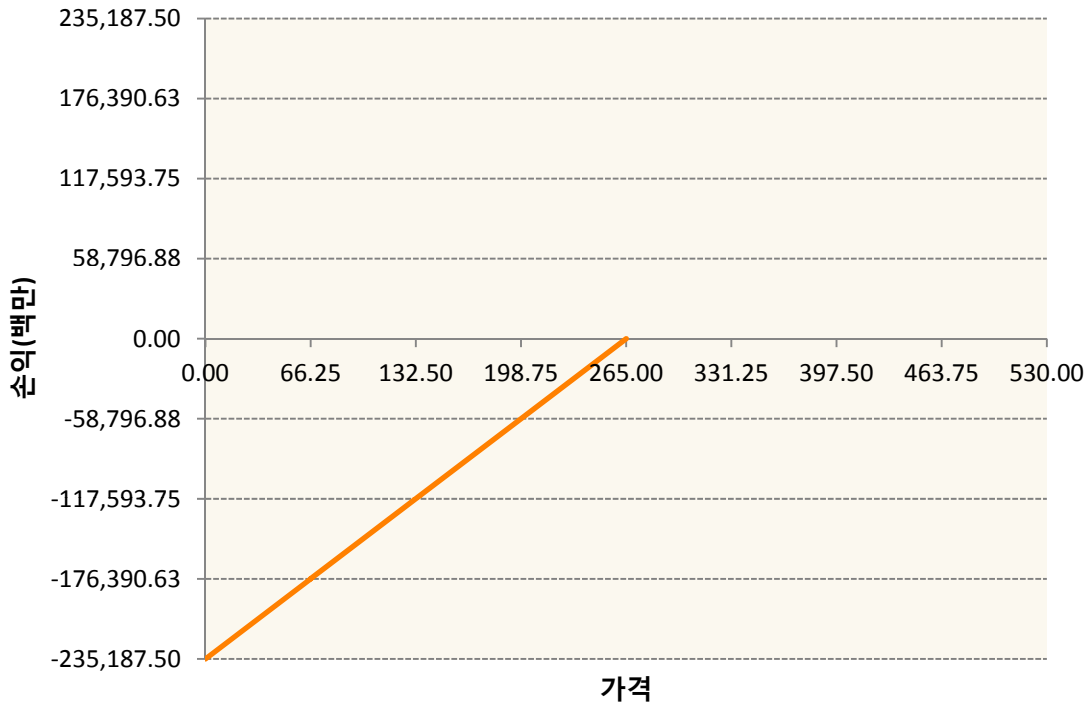


KR4201P22671-2019-02 콜267.5





KR4301P22653-2019-02 풋265



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201P22655		2019-02 콜265					25,703
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	18,350	18,123	17,880	17,624	17,357	17,082	16,800
-5.33%	15,112	14,783	14,452	14,119	13,787	13,453	13,119
-2.67%	8,434	8,280	8,103	7,906	7,691	7,461	7,219
0%	123	98	58	0	-76	-170	-282
2.67%	-8,472	-8,474	-8,478	-8,487	-8,502	-8,526	-8,561
5.33%	-17,087	-17,087	-17,087	-17,088	-17,090	-17,094	-17,101
8.00%	-25,702	-25,702	-25,702	-25,702	-25,702	-25,702	-25,703
KR4201P22671		2019-02 콜267.5					8,952
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	5,603	5,548	5,485	5,416	5,340	5,260	5,175

-5.33%	4,848	4,731	4,613	4,495	4,377	4,259	4,141
-2.67%	2,873	2,793	2,708	2,617	2,522	2,424	2,324
0%	79	60	34	0	-41	-89	-144
2.67%	-2,918	-2,920	-2,923	-2,930	-2,940	-2,955	-2,974
5.33%	-5,934	-5,934	-5,934	-5,935	-5,936	-5,939	-5,944
8.00%	-8,951	-8,951	-8,951	-8,951	-8,951	-8,951	-8,952
KR4301P22653 2019-02 풋265							5,798
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-5,411	-5,452	-5,504	-5,566	-5,636	-5,714	-5,798
-5.33%	-752	-887	-1,024	-1,162	-1,301	-1,441	-1,581
-2.67%	-8	-19	-37	-62	-95	-136	-184
0%	1	1	0	0	-1	-3	-7
2.67%	1	1	1	1	1	1	1
5.33%	1	1	1	1	1	1	1
8.00%	1	1	1	1	1	1	1

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

(단위:백만원)

37,360

공시일	2019-02-11
기준일	2019-02-08

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

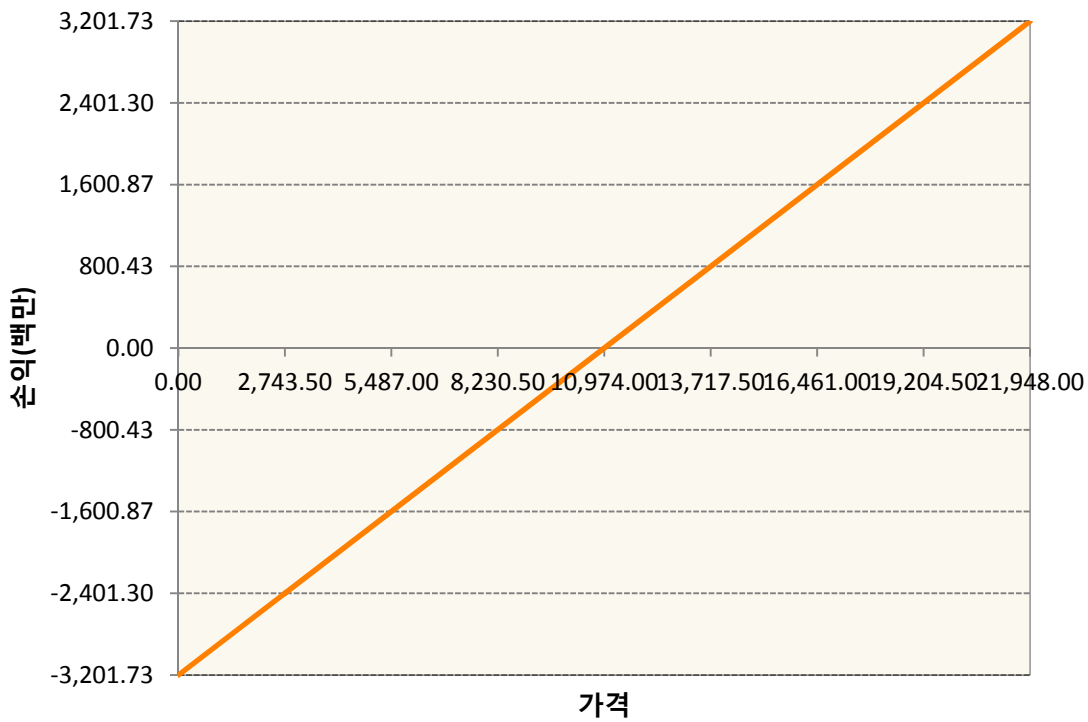
1. 계약금액

(단위:백만원)

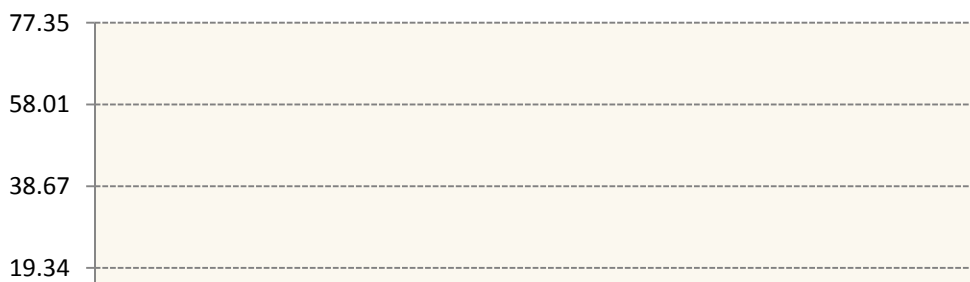
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	3,202	0	3,202	장내
누계	유가증권	옵션	0	7,649	-7,649	장내
누계	통화	선도	0	2,722	-2,722	장외

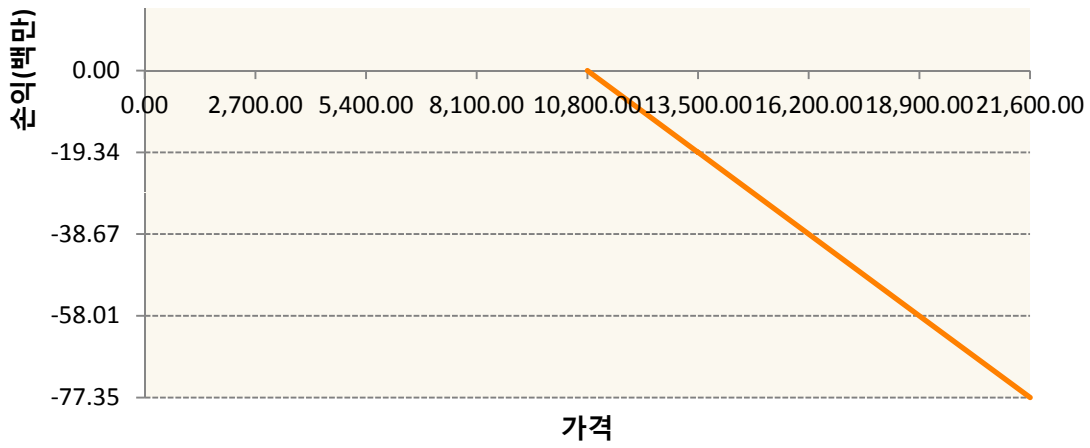
2. 만기시점의 손익구조

HCG9-HSCEI Futures Feb19

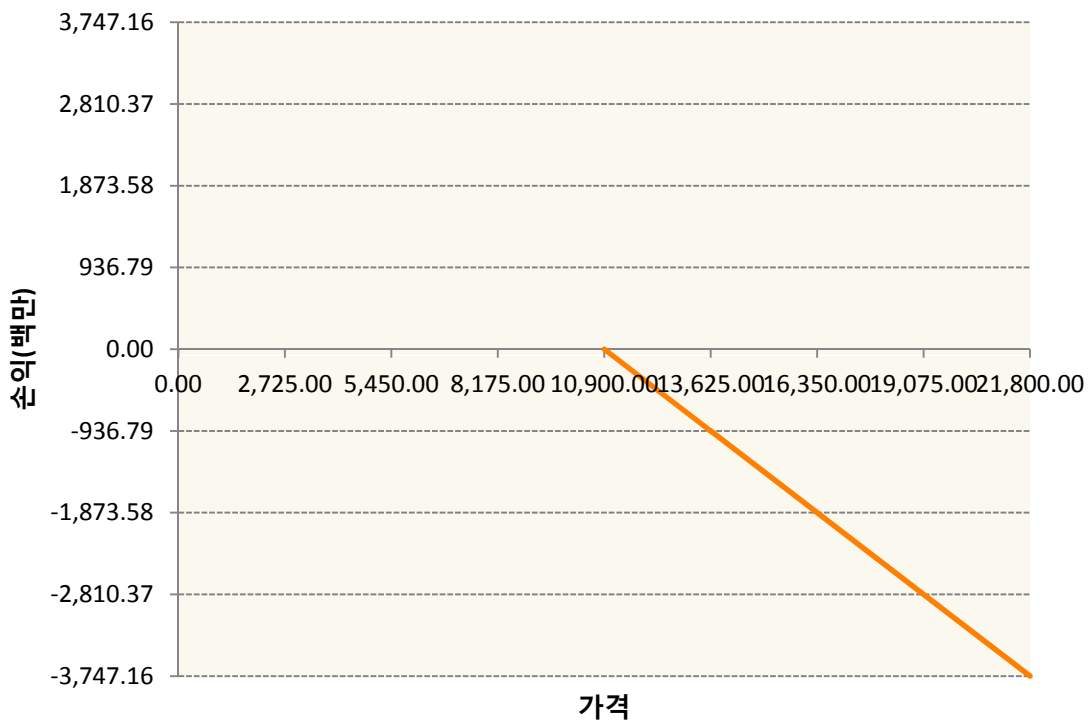


OHHIG9-C108-HSCEI

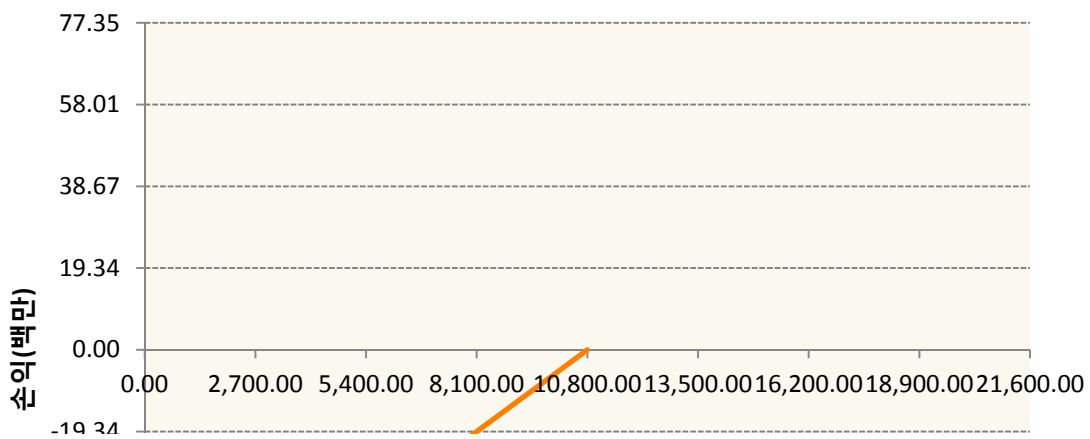


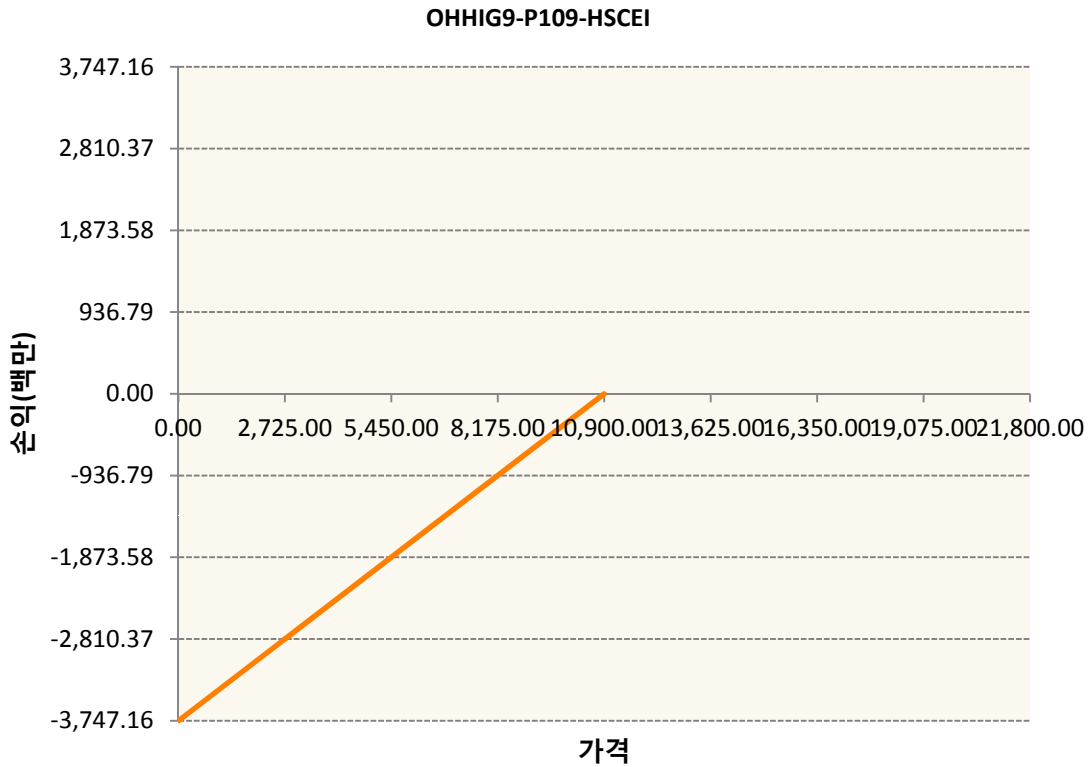
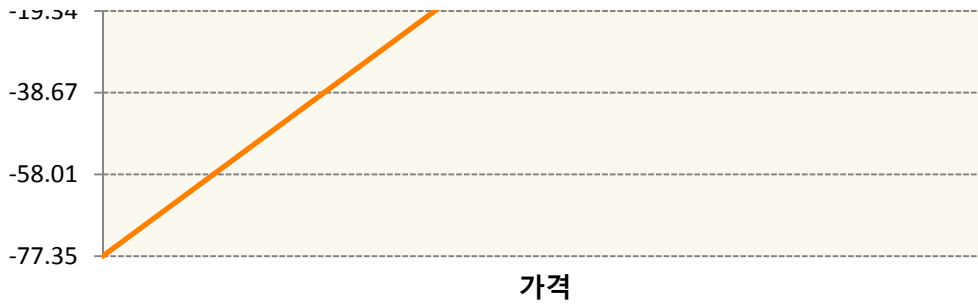


OHHIG9-C109-HSCEI



OHHIG9-P108-HSCEI





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

FX21018Z00 KRW/HKD 11-03-19E	218
HCG9 HSCEI Futures Feb19	256
OHHIG9-C1(HSCEI	6
OHHIG9-C1(HSCEI	300
OHHIG9-P1(HSCEI	6
OHHIG9-P1(HSCEI	300

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

972

공시일	2019-02-11
기준일	2019-02-08

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

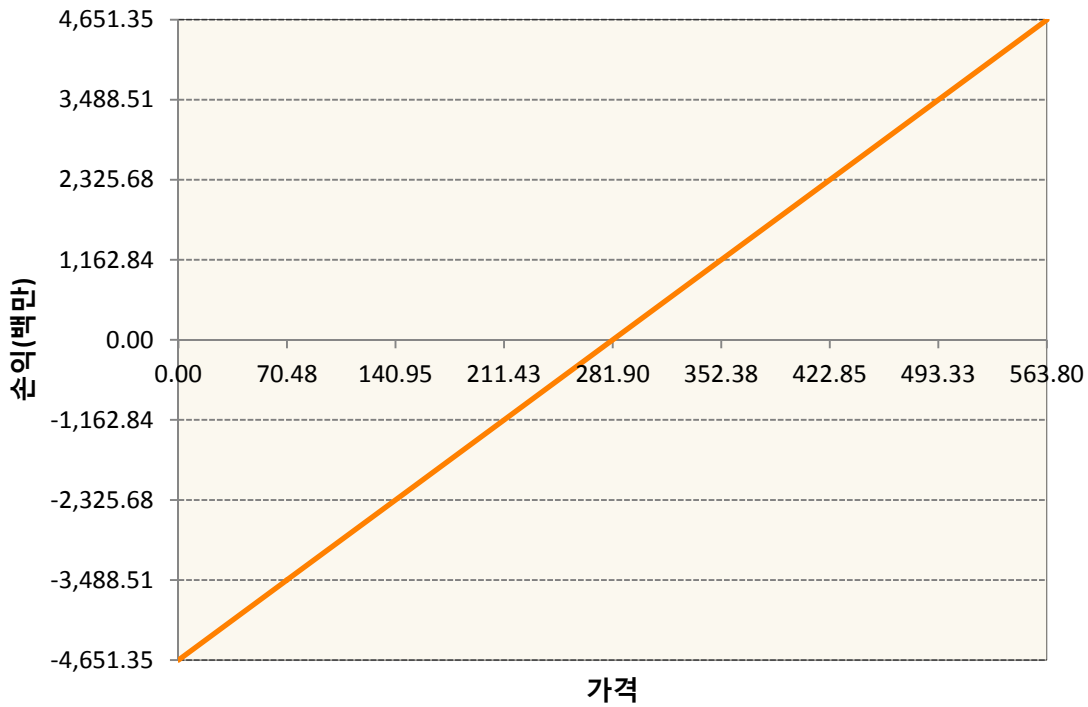
1. 계약금액

(단위:백만원)

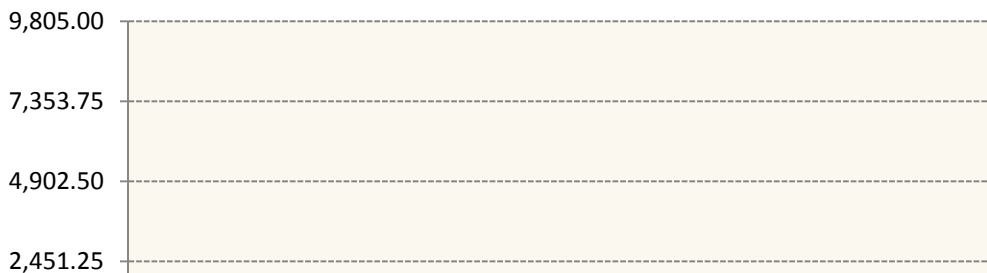
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	4,651	0	4,651	장내
누계	유가증권	스왑	31,836	0	31,836	장외
누계	유가증권	옵션	0	29,674	-29,674	장내

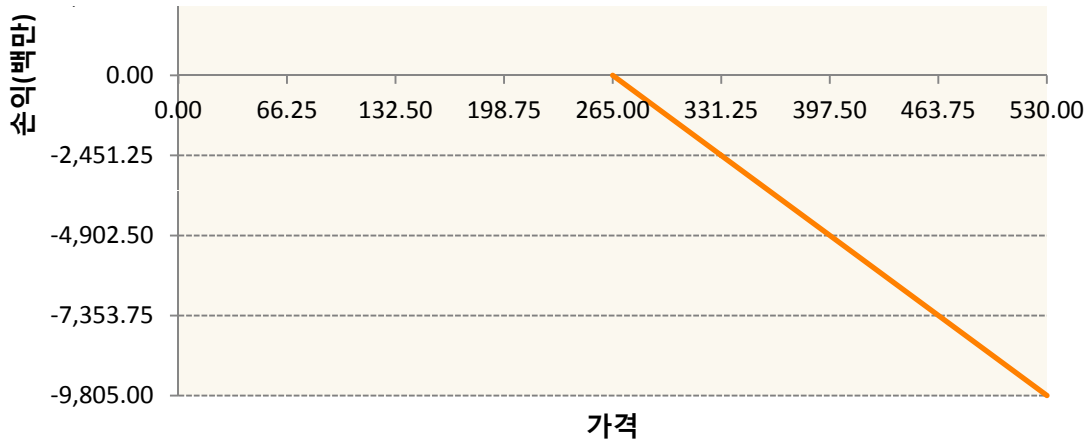
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P30007-2019-03 코스피200지수선물

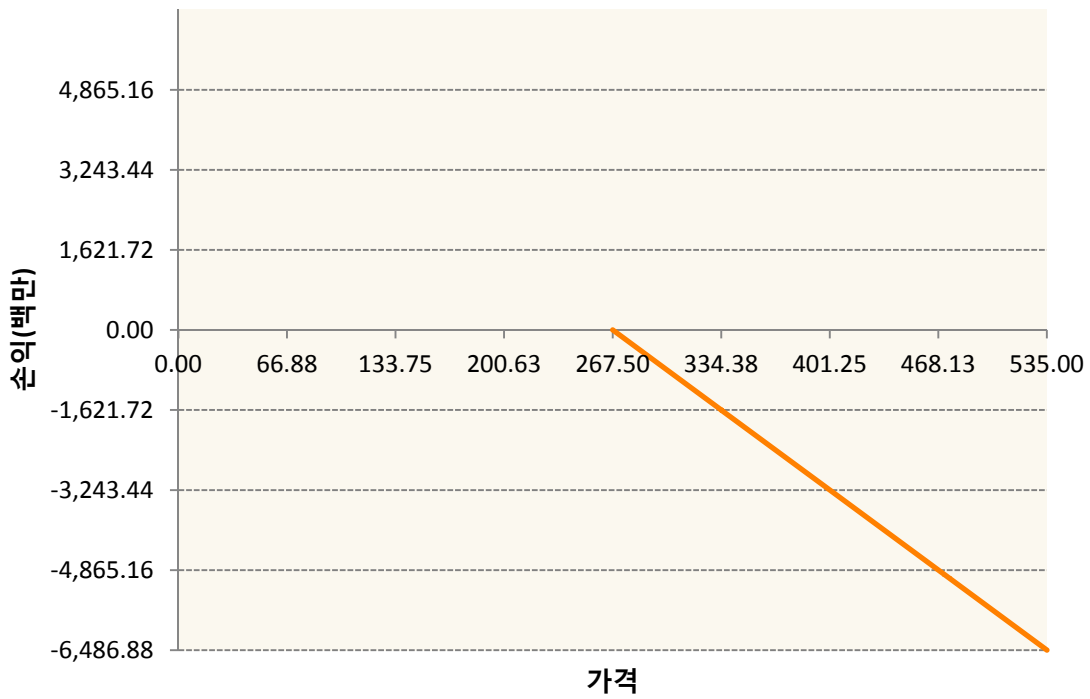


KR4201P22655-2019-02 콜265

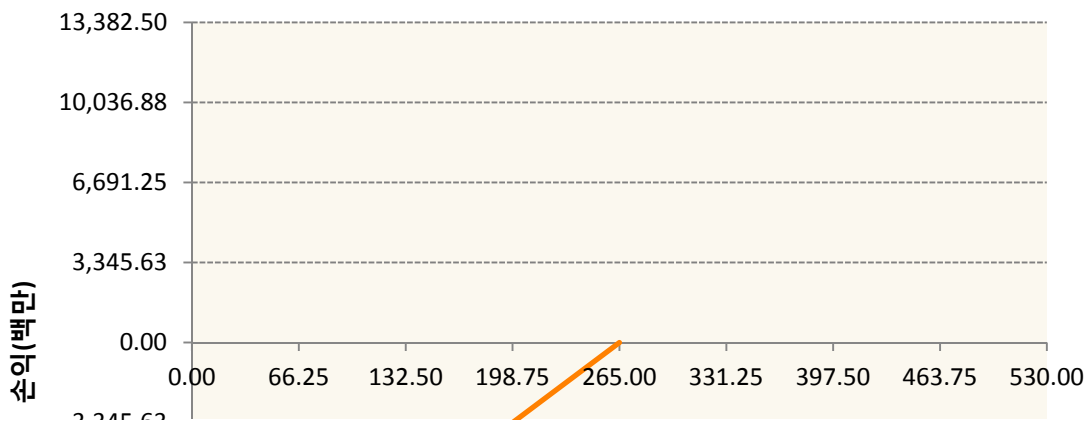


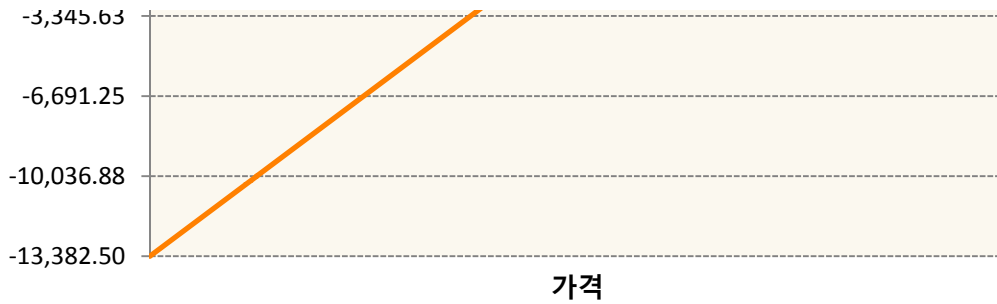


KR4201P22671-2019-02 콜267.5



KR4301P22653-2019-02 풋265





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11		UBCSFXC1 INDEX_14						2,667
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-2,667	-2,667	-2,667	-2,667	-2,667	-2,667	-2,667	
-5.33%	-1,778	-1,778	-1,778	-1,778	-1,778	-1,778	-1,778	
-2.67%	-889	-889	-889	-889	-889	-889	-889	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	889	889	889	889	889	889	889	
5.33%	1,778	1,778	1,778	1,778	1,778	1,778	1,778	
8.00%	2,667	2,667	2,667	2,667	2,667	2,667	2,667	
KR4101P30007		2019-03 코스피200지수선물						372
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-372	-372	-372	-372	-372	-372	-372	
-5.33%	-248	-248	-248	-248	-248	-248	-248	
-2.67%	-124	-124	-124	-124	-124	-124	-124	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	124	124	124	124	124	124	124	
5.33%	248	248	248	248	248	248	248	
8.00%	372	372	372	372	372	372	372	
KR4201P22655		2019-02 콜265						828
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	591	584	576	568	559	551	541	
-5.33%	487	476	466	455	444	434	423	
-2.67%	272	267	261	255	248	240	233	
0%	4	3	2	0	-2	-5	-9	
2.67%	-273	-273	-273	-274	-274	-275	-276	
5.33%	-551	-551	-551	-551	-551	-551	-551	
8.00%	-828	-828	-828	-828	-828	-828	-828	
KR4201P22671		2019-02 콜267.5						540
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	

-8.00%	338	335	331	327	322	317	312
-5.33%	292	285	278	271	264	257	250
-2.67%	173	169	163	158	152	146	140
0%	5	4	2	0	-2	-5	-9
2.67%	-176	-176	-176	-177	-177	-178	-179
5.33%	-358	-358	-358	-358	-358	-358	-359
8.00%	-540	-540	-540	-540	-540	-540	-540
KR4301P22653 2019-02 풋265							330
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-308	-310	-313	-317	-321	-325	-330
-5.33%	-43	-50	-58	-66	-74	-82	-90
-2.67%	0	-1	-2	-4	-5	-8	-10
0%	0	0	0	0	0	0	0
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)

4,484

공시일	2019-02-11
기준일	2019-02-08

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

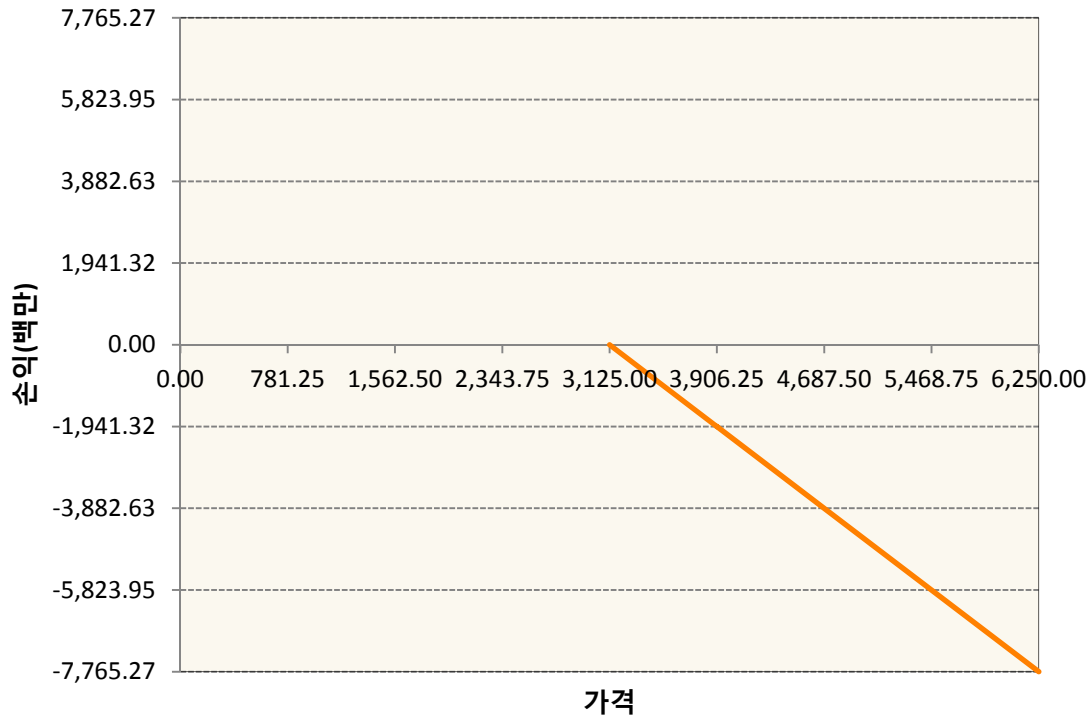
1. 계약금액

(단위:백만원)

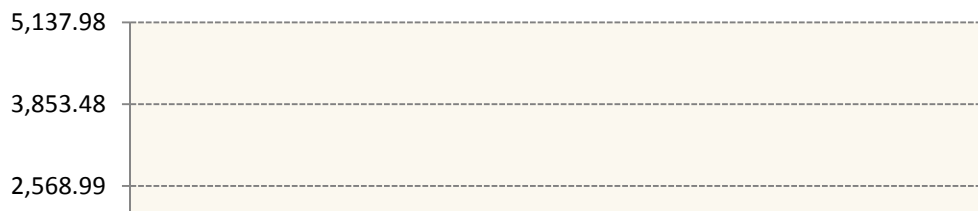
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	6,822	0	6,822	
누계	유가증권	스왑	60,162	0	60,162	장외
누계	유가증권	옵션	0	25,806	-25,806	장내
누계	통화	선도	0	15,292	-15,292	장외

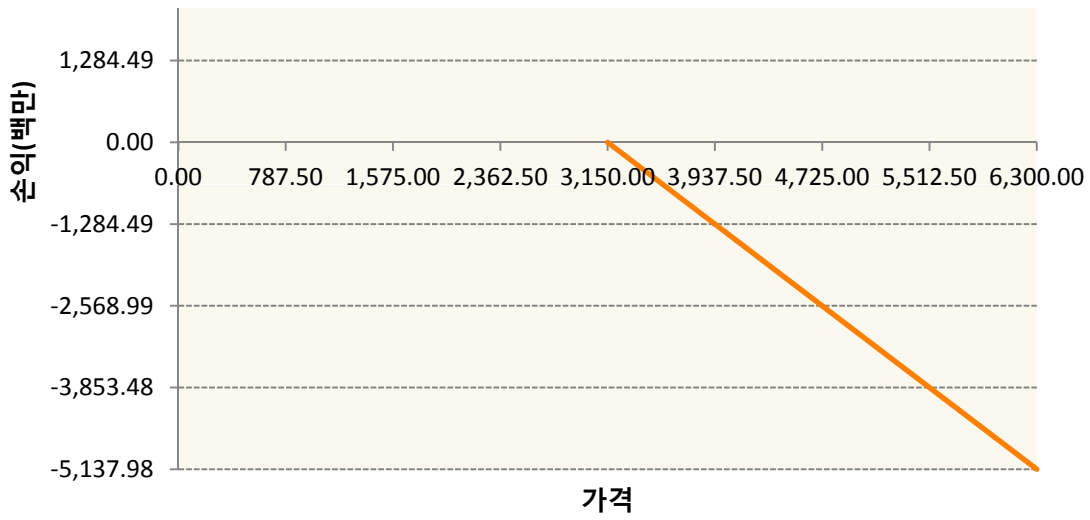
2. 만기시점의 손익구조

OESXG9-C3125-EURO STOXX 50

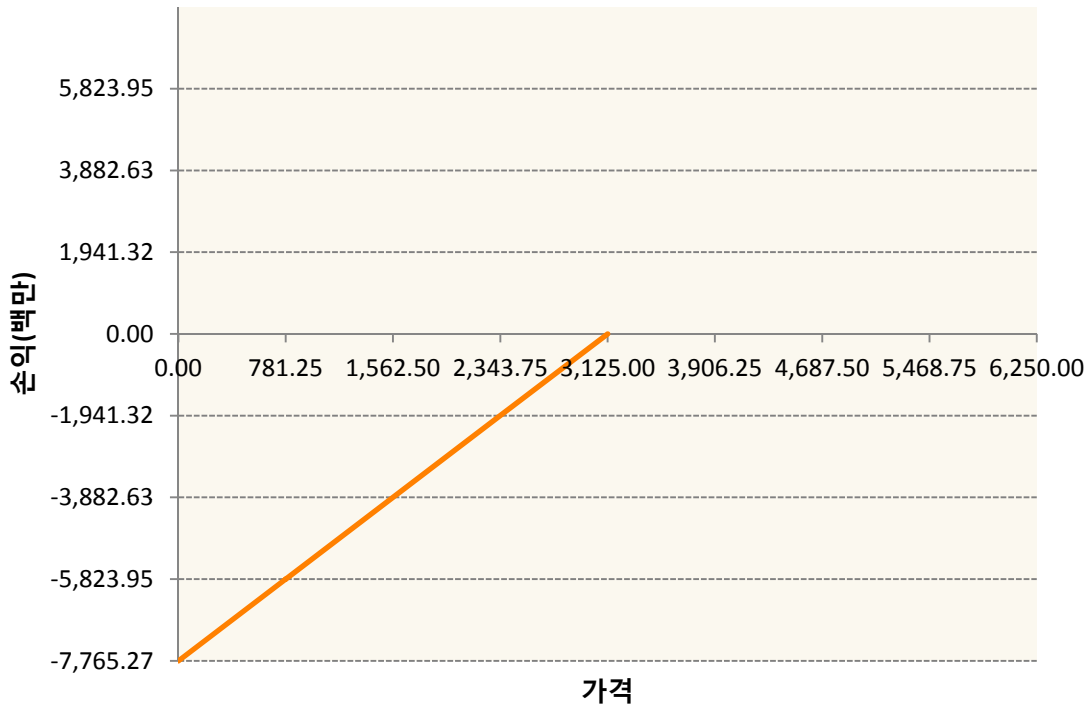


OESXG9-C3150-EURO STOXX 50

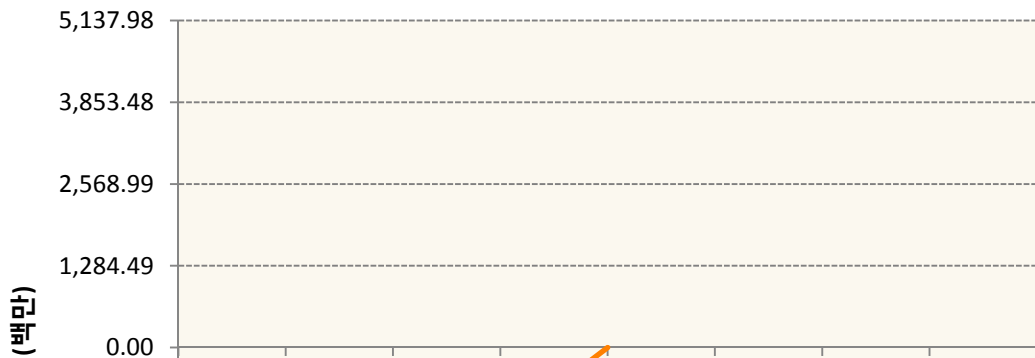


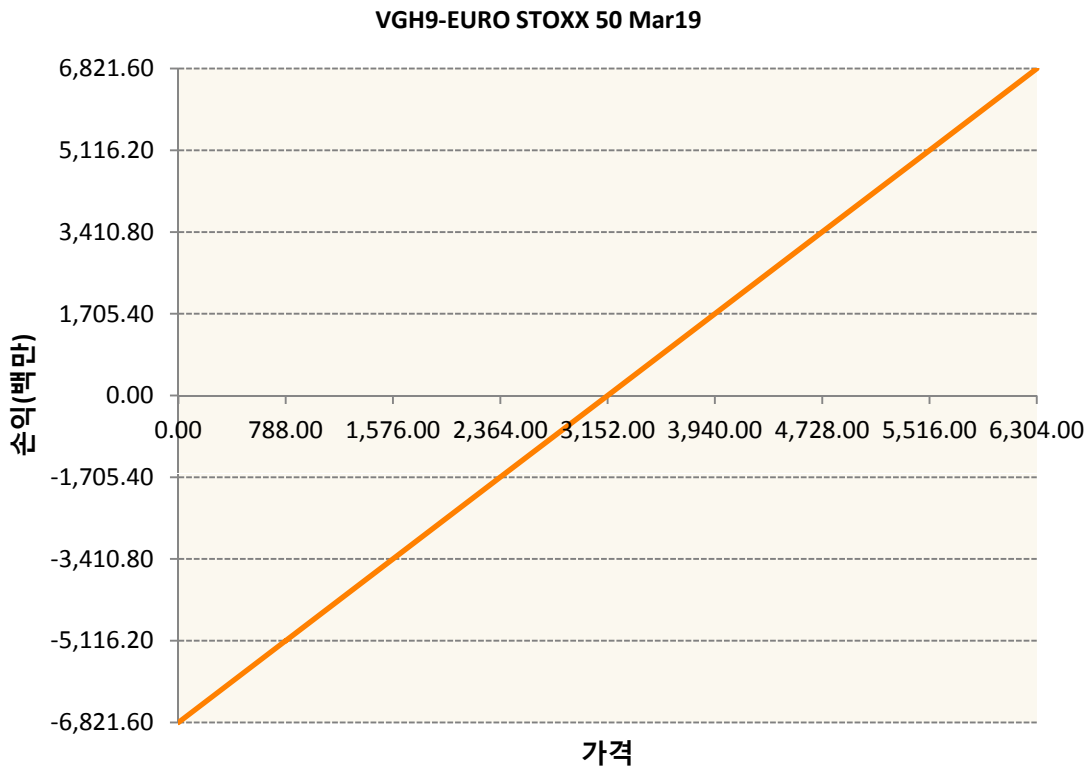
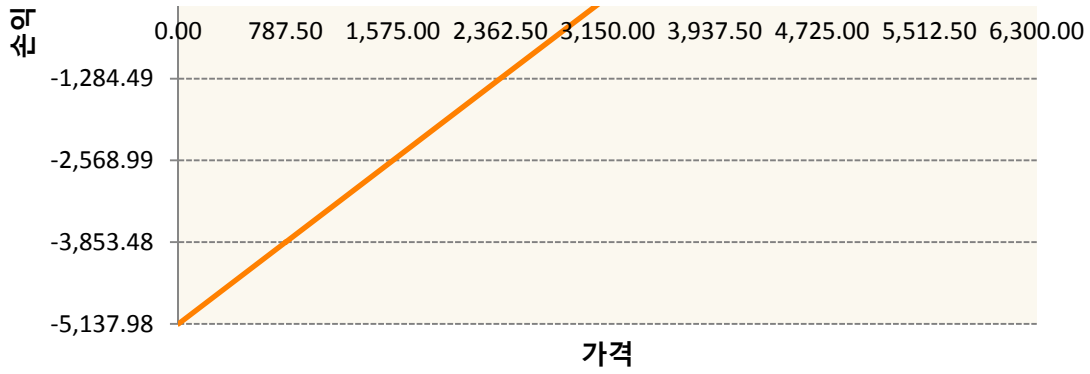


OESXG9-P3125-EURO STOXX 50



OESXG9-P3150-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY		38
FX21018X02 KRW/EUR 22-02-19E		408
FX21018Z03 KRW/EUR 22-03-19E		816
OESXG9-C31EURO STOXX 50		621
OESXG9-C31EURO STOXX 50		411
OESXG9-P31EURO STOXX 50		621
OESXG9-P31EURO STOXX 50		411
VGH9	EURO STOXX 50 Mar19	546

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

(단위:백만원)

2,524

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

(단위:백만원)

1,171

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

(단위:백만원)

100

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

(단위:백만원)

150

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

(단위:백만원)

45

공시일	2019-02-11
기준일	2019-02-08

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

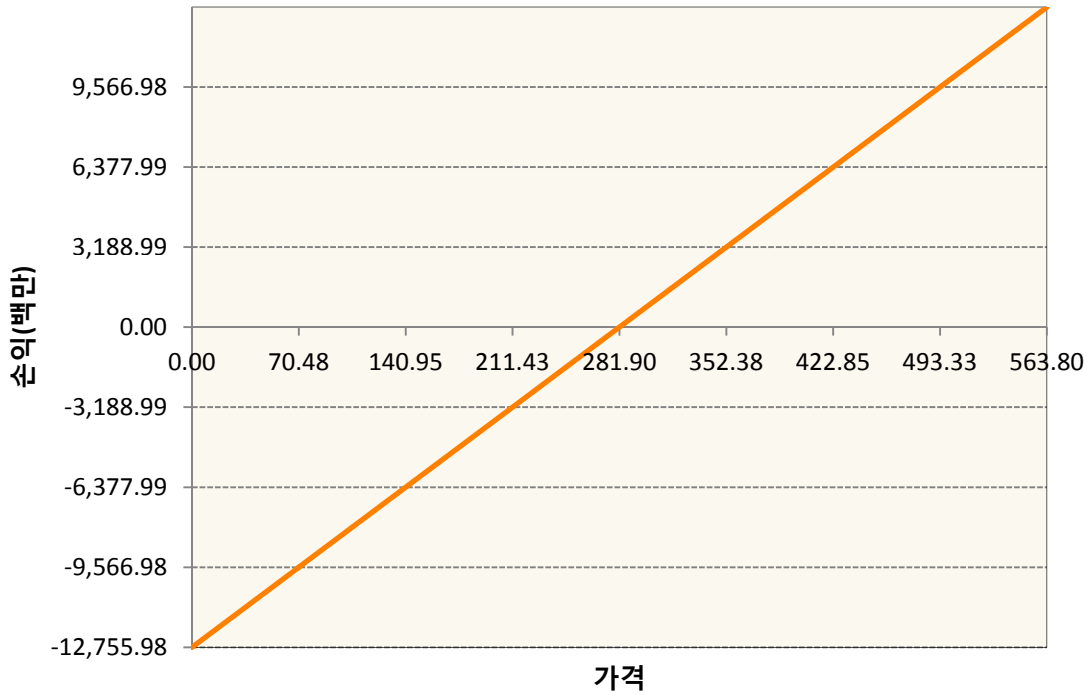
1. 계약금액

(단위:백만원)

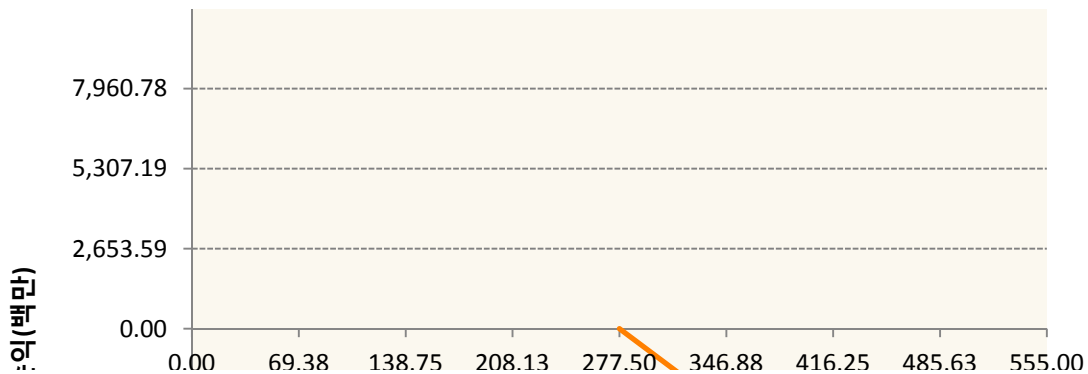
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	12,756	0	12,756	장내
누계	유가증권	옵션	2,523	22,724	-20,202	장내

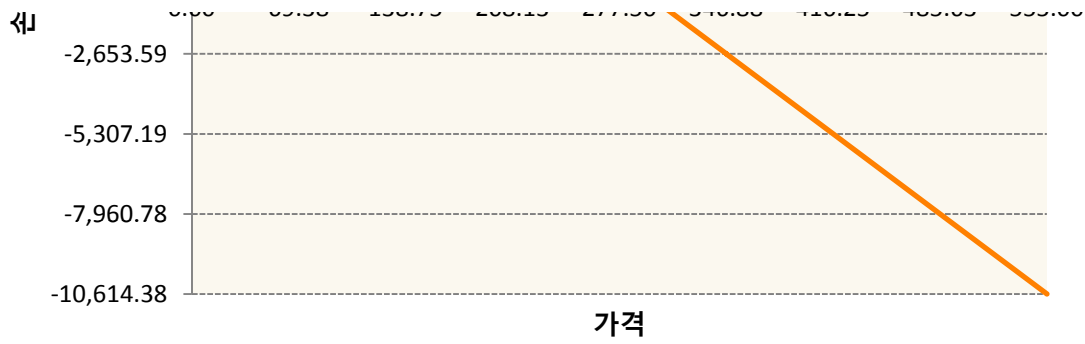
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P30007-2019-03 코스피200지수선물

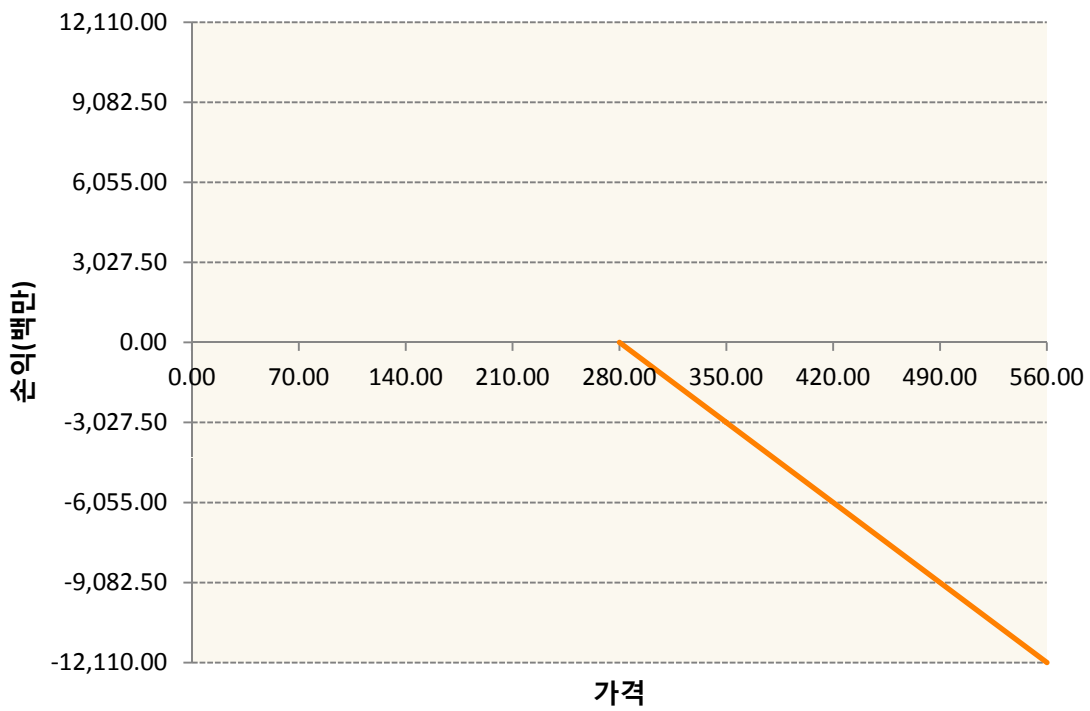


KR4201P22770-2019-02 콜277.5

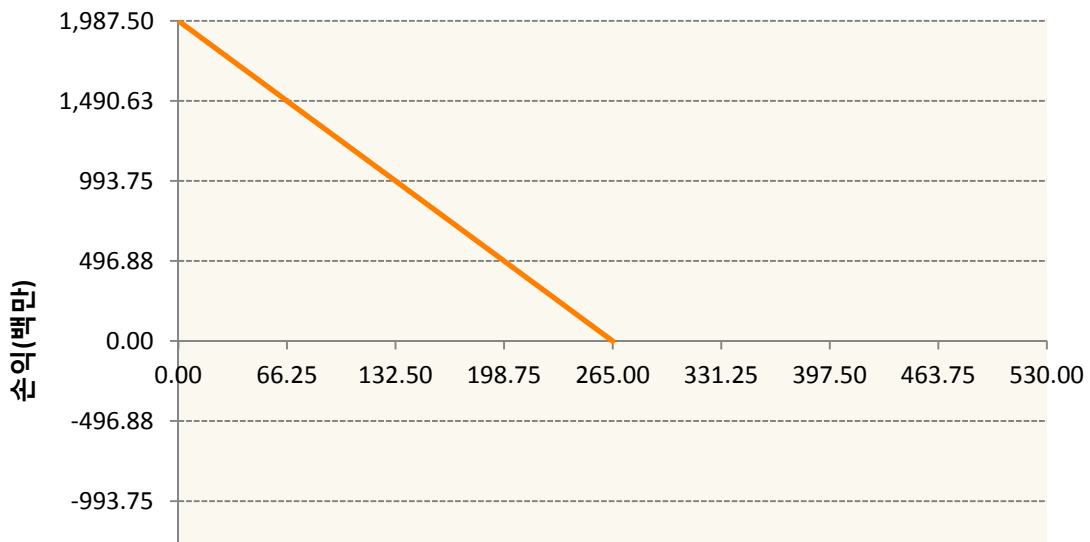


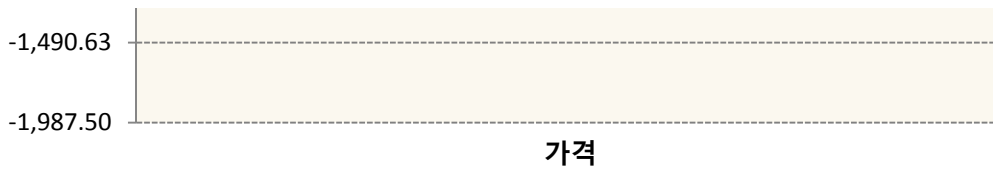


KR4201P22804-2019-02 콜280

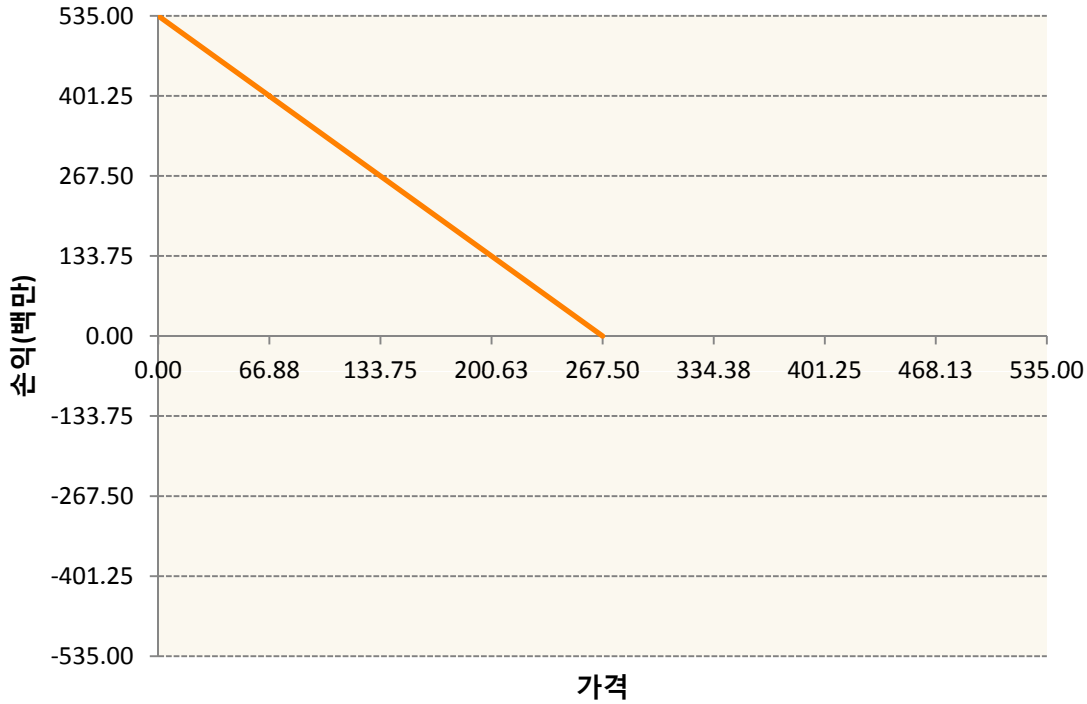


KR4301P22653-2019-02 풋265





KR4301P22679-2019-02 풋267.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101P30007		2019-03 코스피200지수선물						1,019
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-1,019	-1,019	-1,019	-1,019	-1,019	-1,019	-1,019	
-5.33%	-679	-679	-679	-679	-679	-679	-679	
-2.67%	-340	-340	-340	-340	-340	-340	-340	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	340	340	340	340	340	340	340	
5.33%	679	679	679	679	679	679	679	
8.00%	1,019	1,019	1,019	1,019	1,019	1,019	1,019	
KR4201P22770		2019-02 콜277.5						785
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	231	231	230	229	227	225	223	
-5.33%	225	222	218	212	207	200	193	
-2.67%	180	170	159	148	137	126	115	

0%	31	21	11	0	-11	-22	-33
2.67%	-215	-218	-223	-228	-234	-241	-248
5.33%	-496	-497	-498	-499	-501	-503	-507
8.00%	-783	-783	-783	-783	-784	-784	-785
KR4201P22804 2019-02 콜280							848
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	195	195	195	194	193	192	190
-5.33%	193	191	188	184	179	173	167
-2.67%	164	154	144	134	123	112	100
0%	40	26	13	0	-13	-27	-40
2.67%	-209	-215	-223	-231	-240	-250	-260
5.33%	-519	-521	-523	-525	-529	-533	-538
8.00%	-843	-843	-843	-844	-845	-846	-848
KR4301P22653 2019-02 풋265							49
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	46	46	47	47	48	48	49
-5.33%	6	7	9	10	11	12	13
-2.67%	0	0	0	1	1	1	2
0%	0	0	0	0	0	0	0
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
KR4301P22679 2019-02 풋267.5							17
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	17	17	17	17	17	17	17
-5.33%	4	4	5	5	5	6	6
-2.67%	0	0	0	0	1	1	1
0%	0	0	0	0	0	0	0
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)

2,800

공시일	2019-02-11
기준일	2019-02-08

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	765	0	765	

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	2019-02-11
기준일	2019-02-08

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	3,506	0	3,506	

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	2019-02-11
기준일	2019-02-08

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	16,416	0	16,416	
누계	통화	선도	0	16,982	-16,982	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
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		58
FX21019F01 KRW/USD 28-02-19E		9
FX21019F01 KRW/USD 28-02-19E		32
FX21019F02 KRW/USD 25-02-19E		136
FX21019F02 KRW/USD 28-03-19E		468
FX21019F02 KRW/USD 28-02-19E		117

FX21019F02(KRW/USD 29-03-19E	24
FX21019F02(KRW/USD 29-03-19E	72
FX21019F03(KRW/USD 28-02-19E	27
FX21019G00 KRW/USD 29-03-19E	27
FX21019G00 KRW/USD 29-03-19E	13
FX21019G00 KRW/USD 19-03-19E	49

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

(단위:백만원)

516

공시일	2019-02-11
기준일	2019-02-08

스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

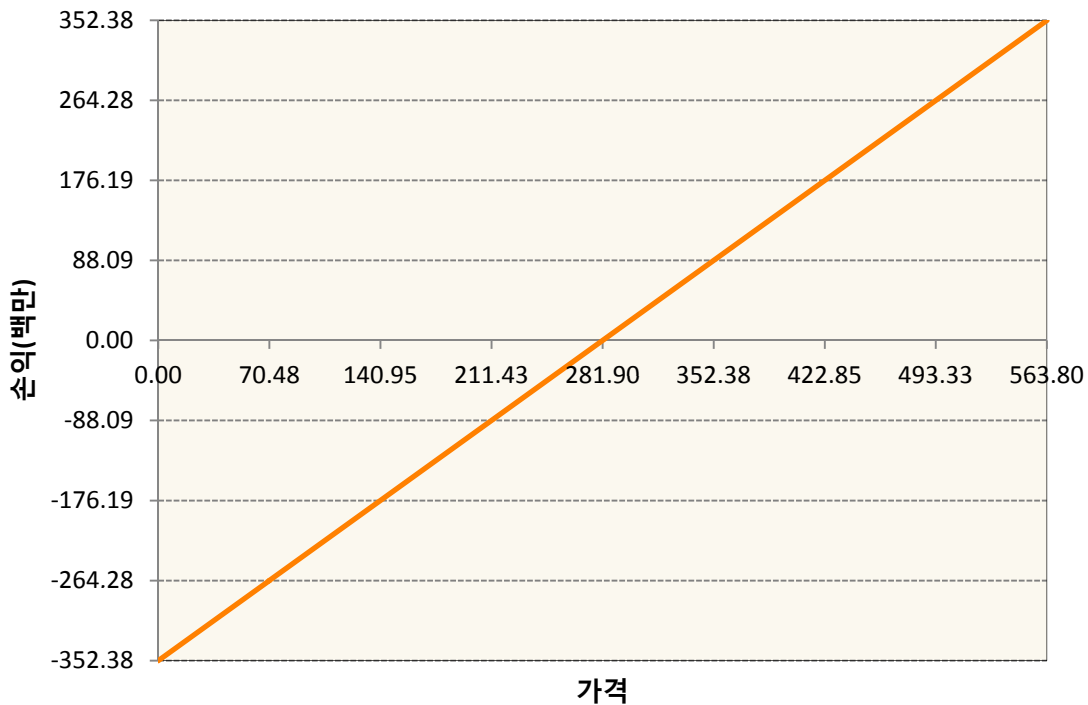
1. 계약금액

(단위:백만원)

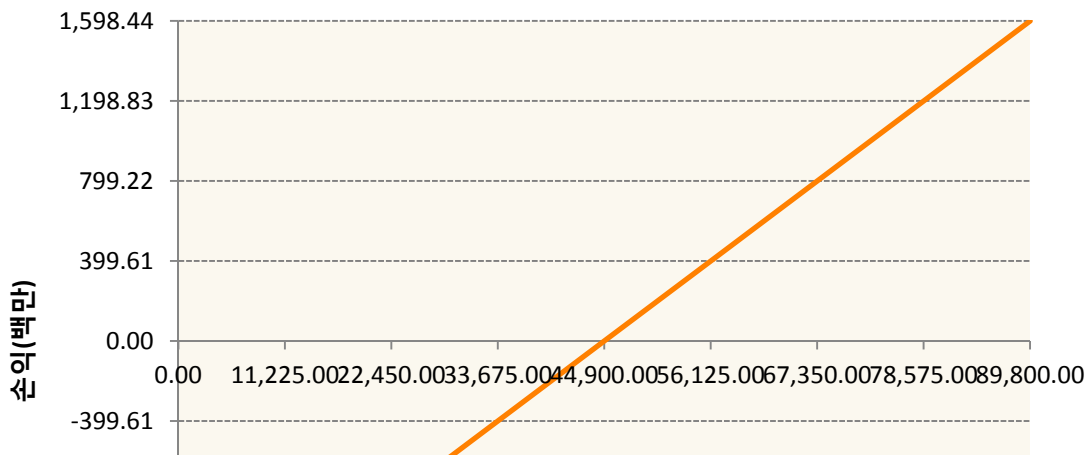
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,951	0	1,951	장내

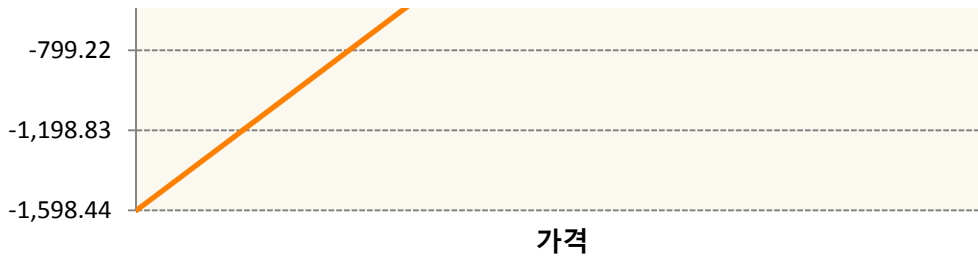
2. 만기시점의 손익구조

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						128
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-128	-128	-128	-128	-128	-128	-128	
-5.33%	-85	-85	-85	-85	-85	-85	-85	
-2.67%	-43	-43	-43	-43	-43	-43	-43	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	43	43	43	43	43	43	43	
5.33%	85	85	85	85	85	85	85	
8.00%	128	128	128	128	128	128	128	

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

176

공시일	2019-02-11
기준일	2019-02-08

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

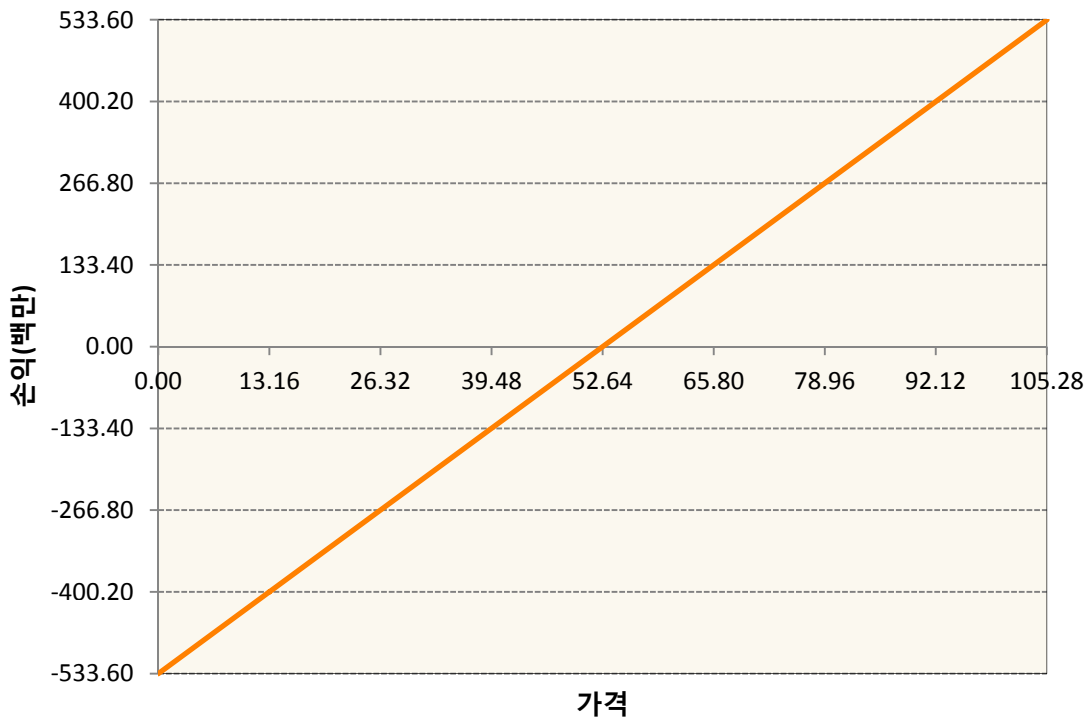
1. 계약금액

(단위:백만원)

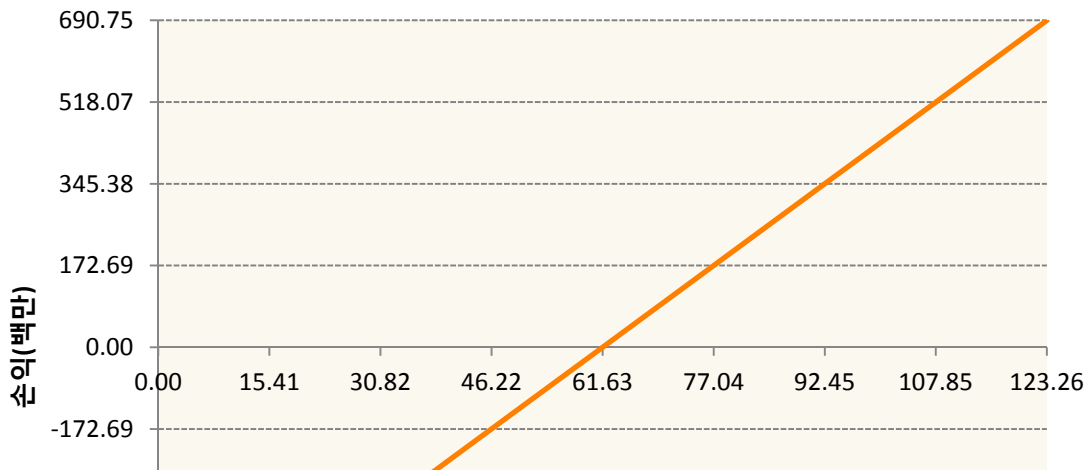
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,614	281	2,333	

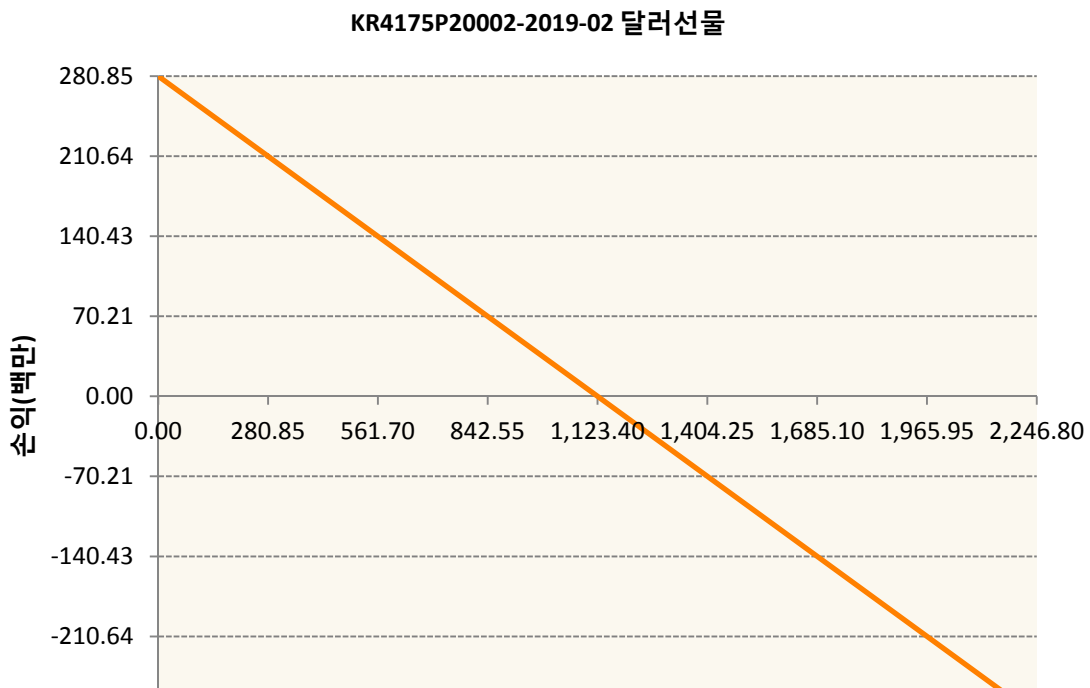
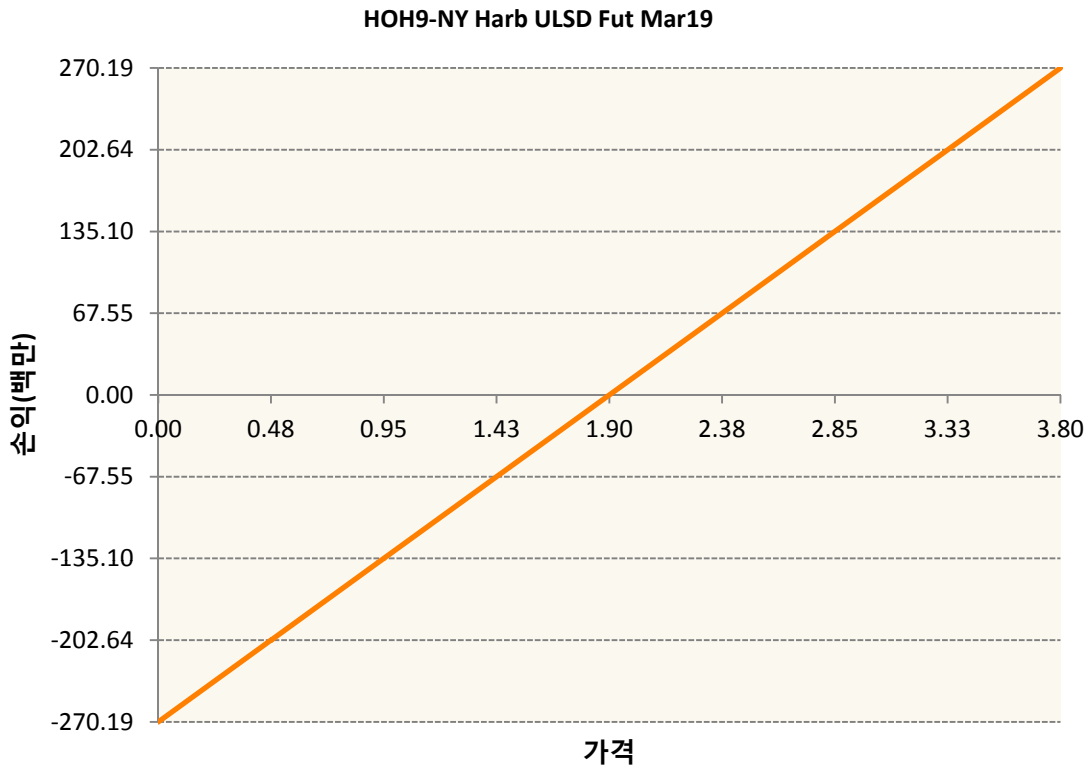
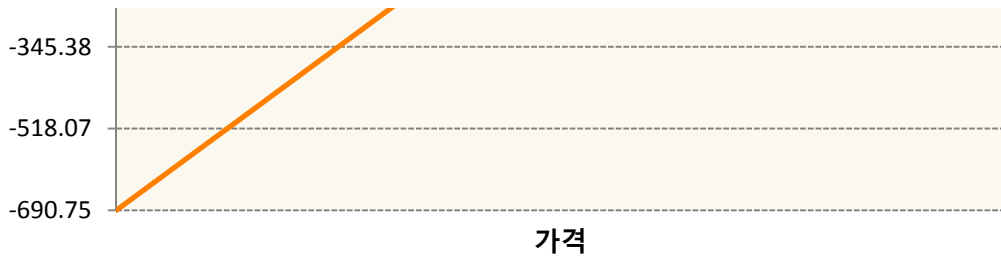
2. 만기시점의 손익구조

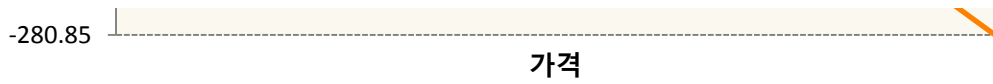
CLH9-WTI CRUDE FUTURE MAR19



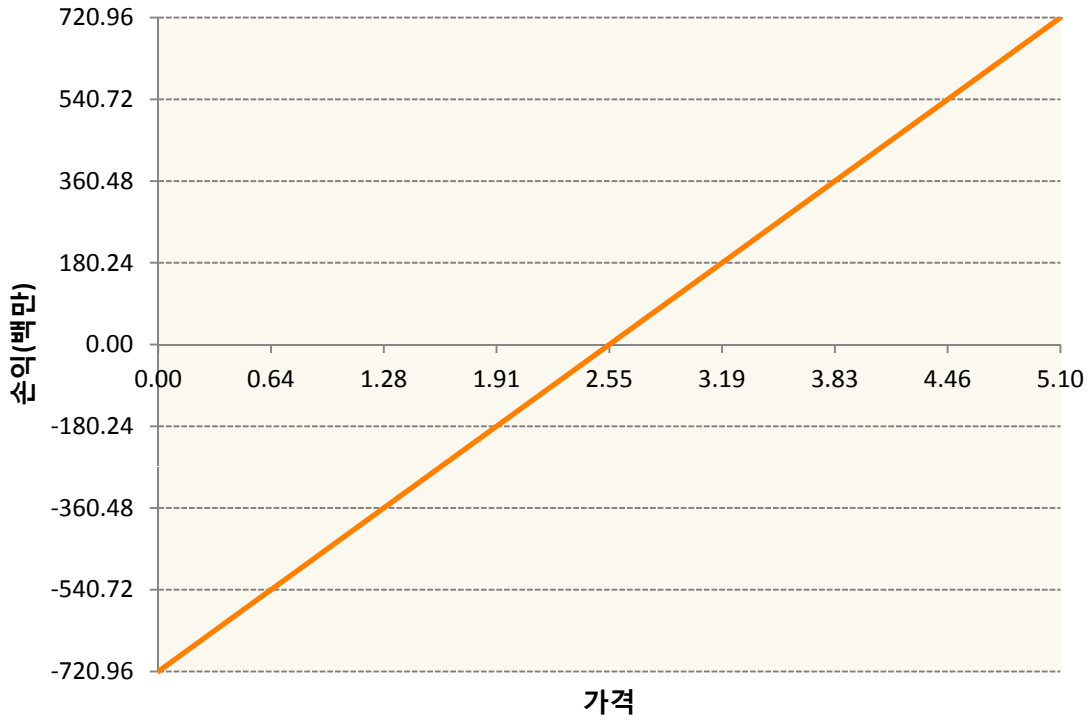
COK9-BRENT CRUDE FUTR May19



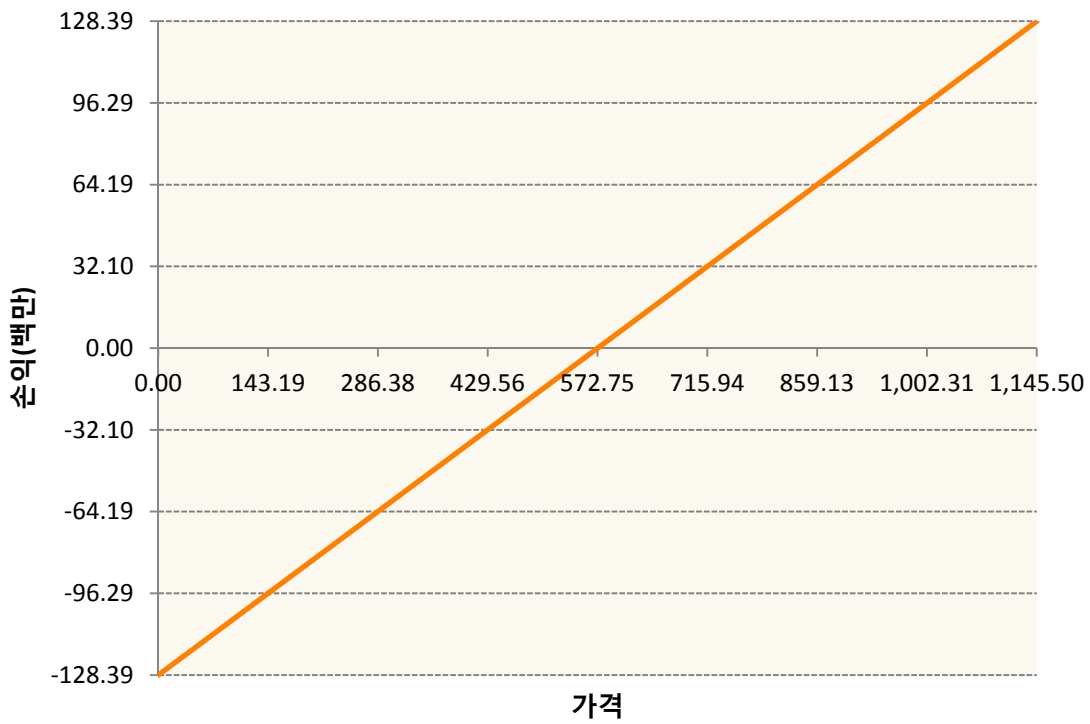




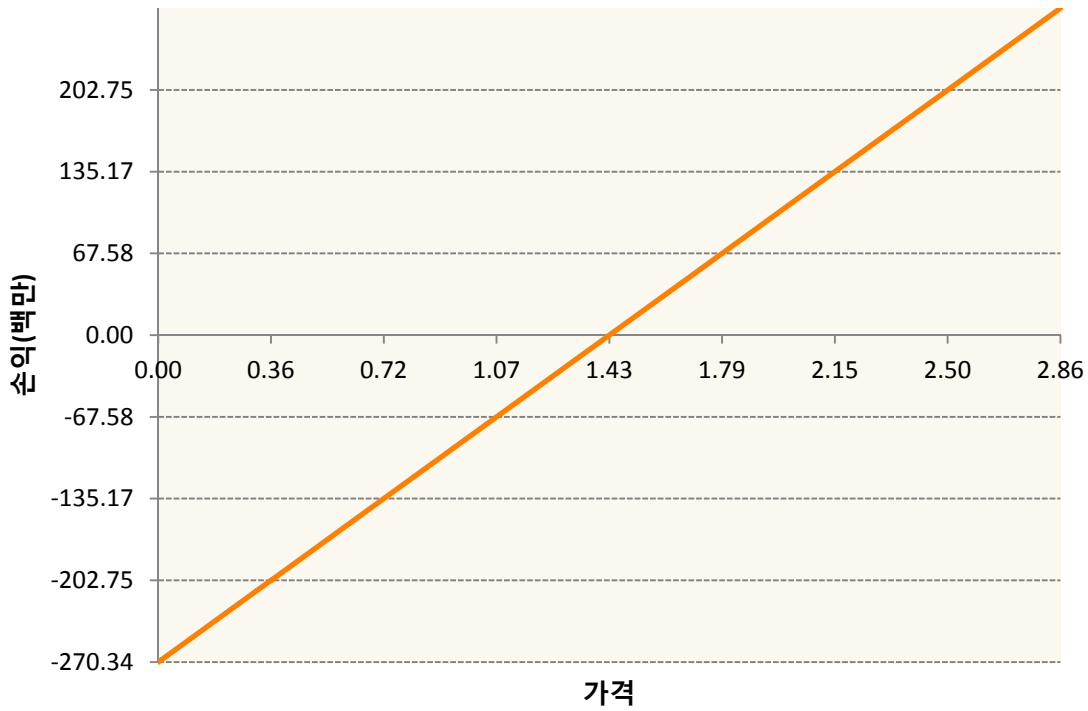
NGH19-NATURAL GAS FUTR Mar19



QSH9-Low Su Gasoil G May19



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	22
KR4175P200	2019-02 달러선물	22
NGH19	NATURAL GAS FUTR Mar19	58
QSH9	Low Su Gasoil G May19	10
XBH9	GASOLINE RBOB FUT Mar19	22

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

404

공시일	2019-02-11
기준일	2019-02-08

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

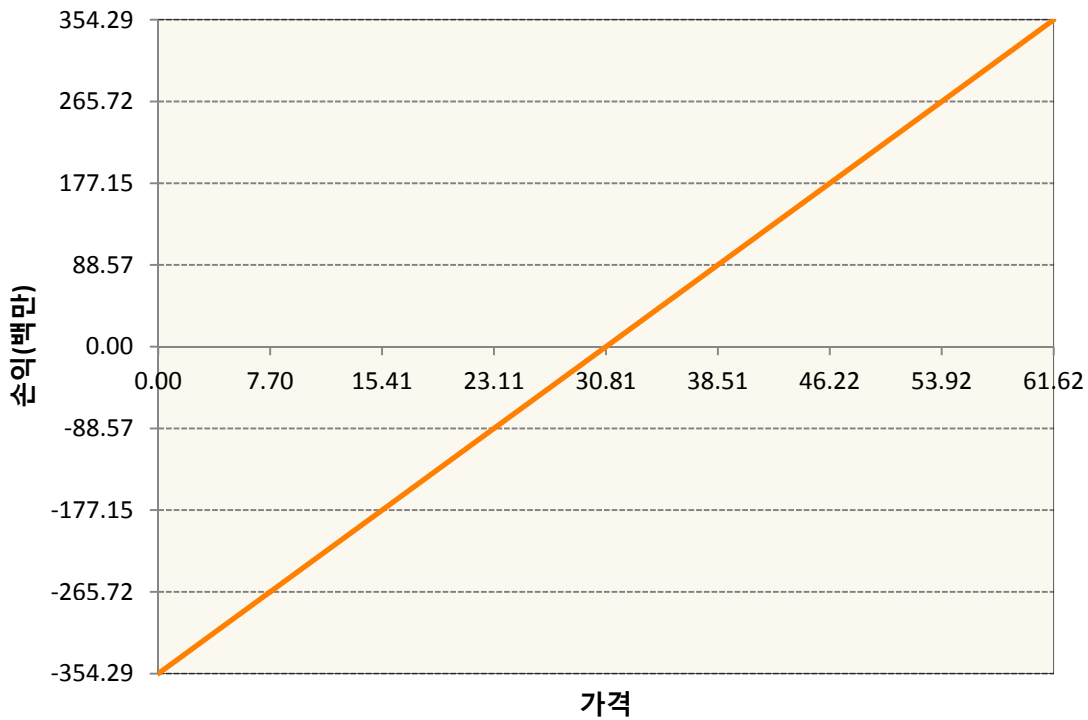
1. 계약금액

(단위:백만원)

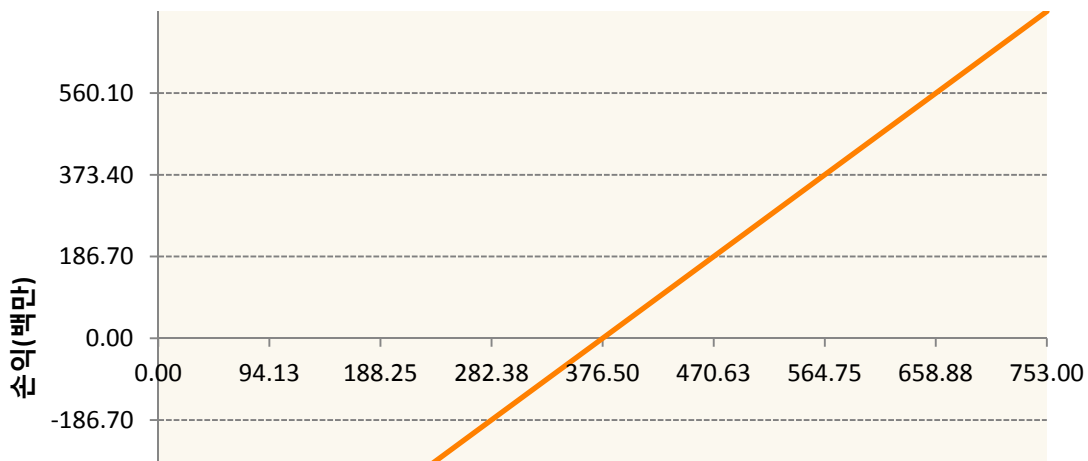
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,577	79	3,499	

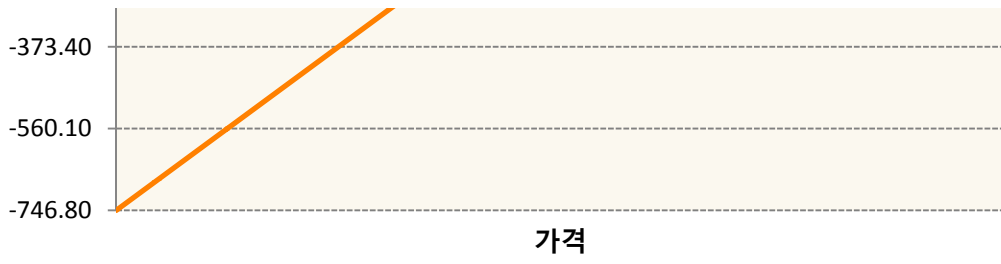
2. 만기시점의 손익구조

BOH9-SOYBEAN OIL FUTR Mar19

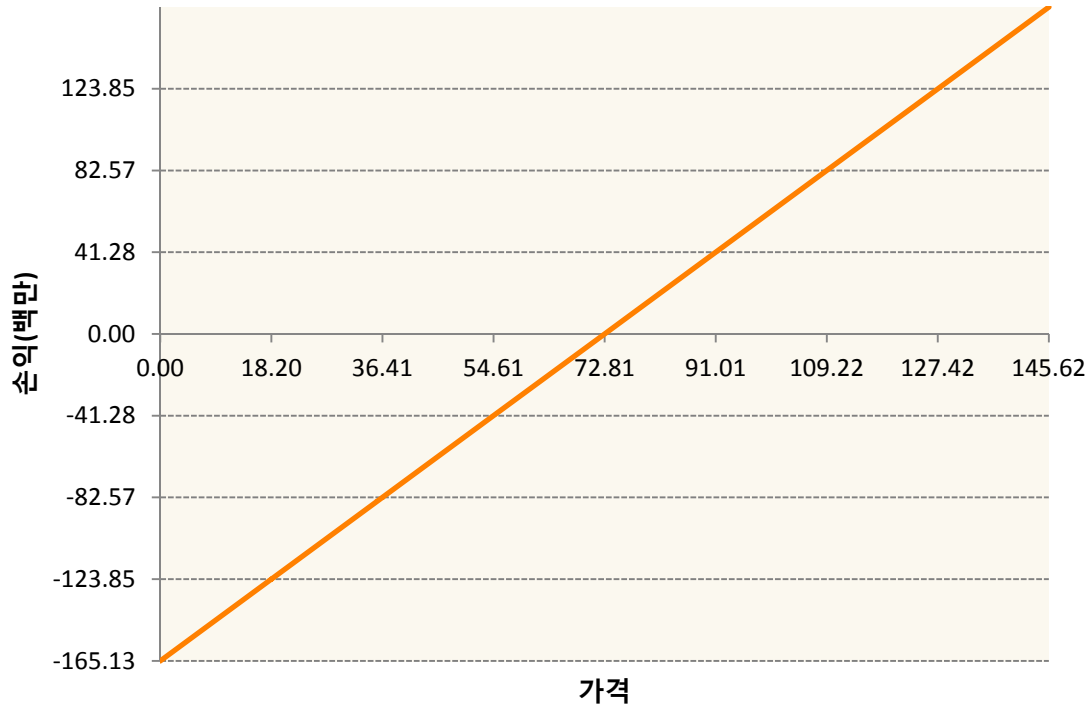


CH9-CORN FUTURE Mar19

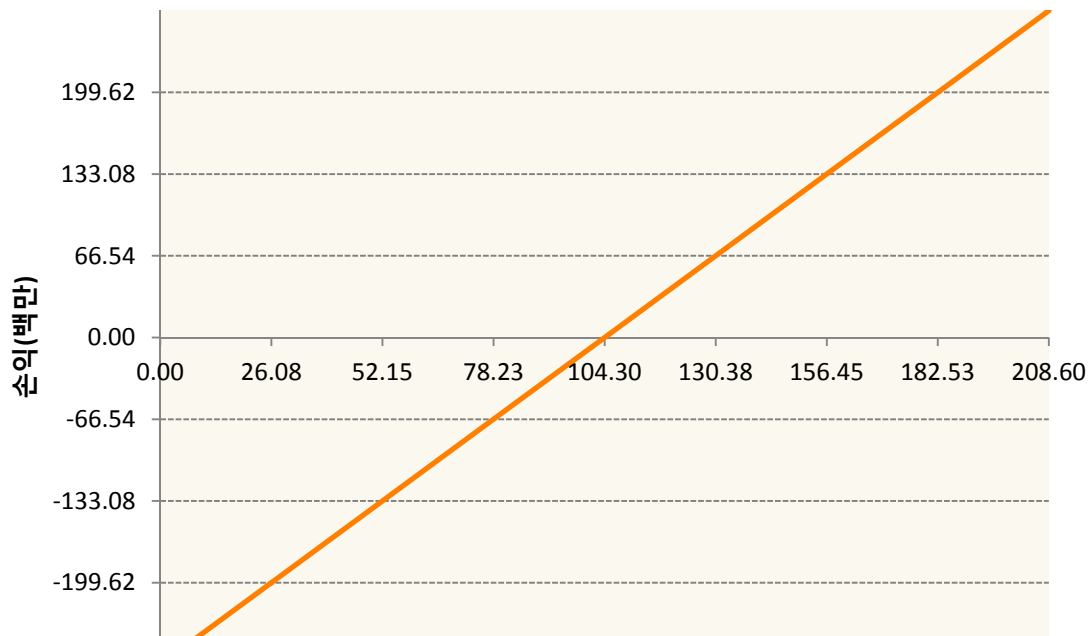


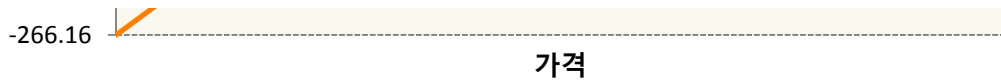


CTH9-COTTON NO.2 FUTR Mar19

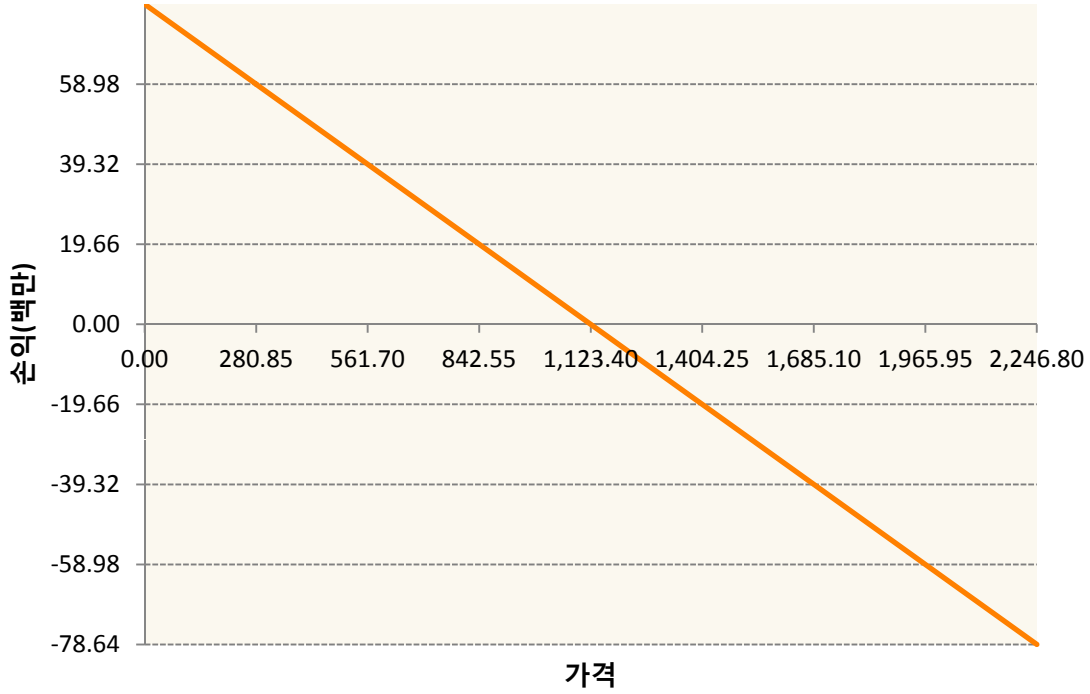


KCH9-COFFEE 'C' FUTURE Mar19

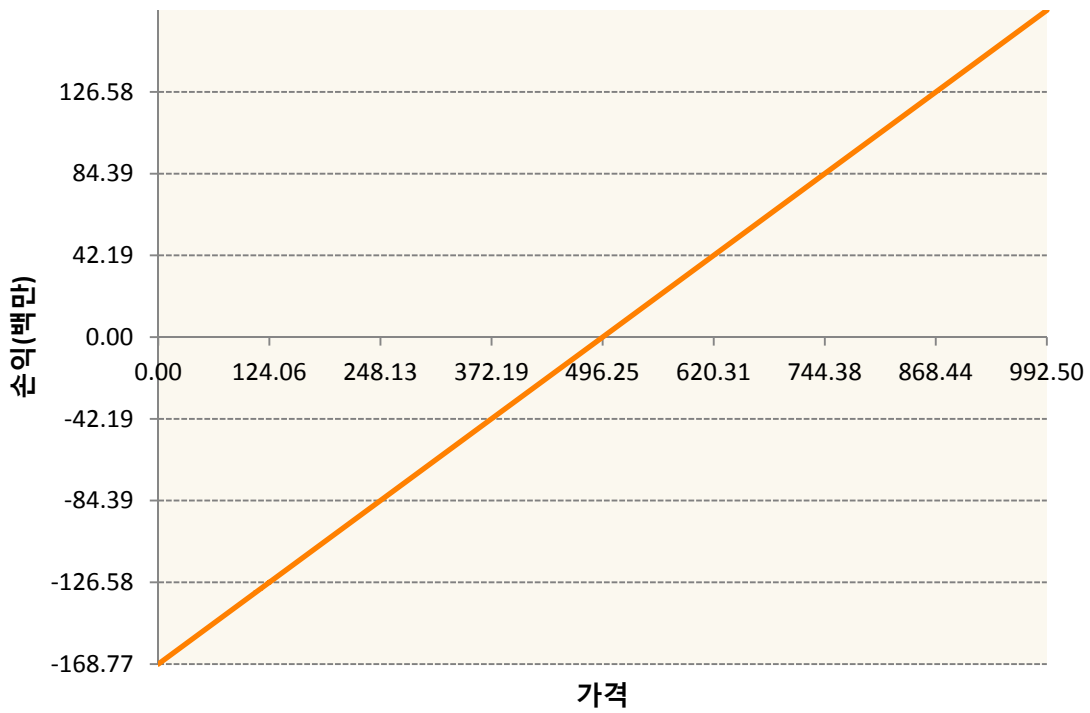




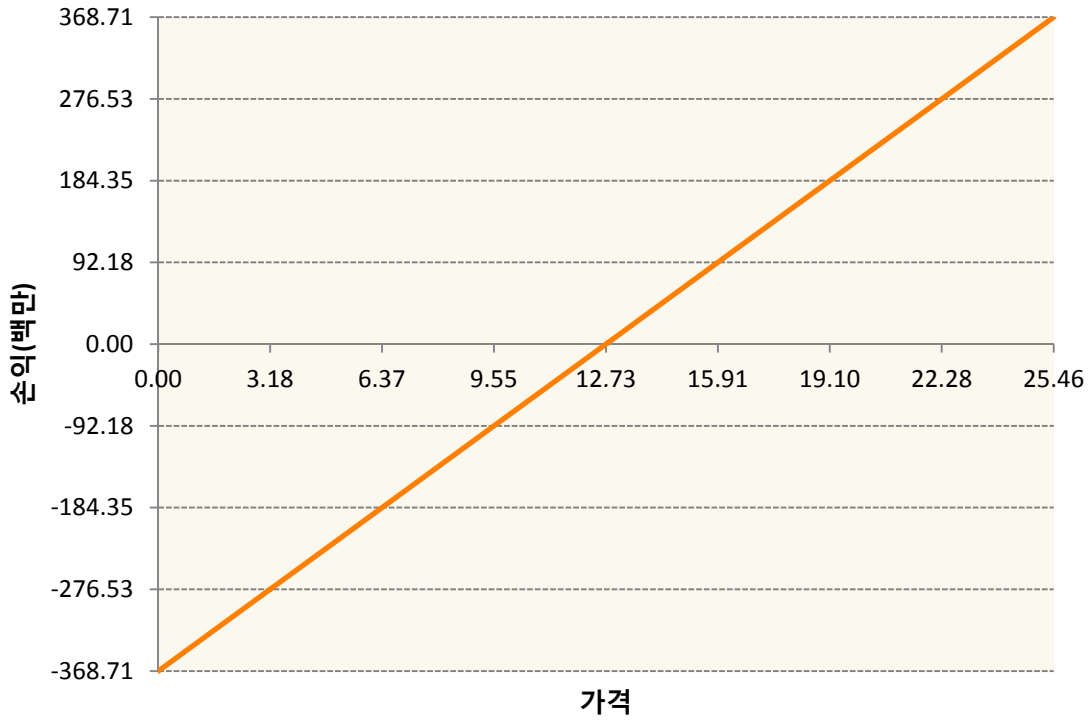
KR4175P20002-2019-02 달러선물



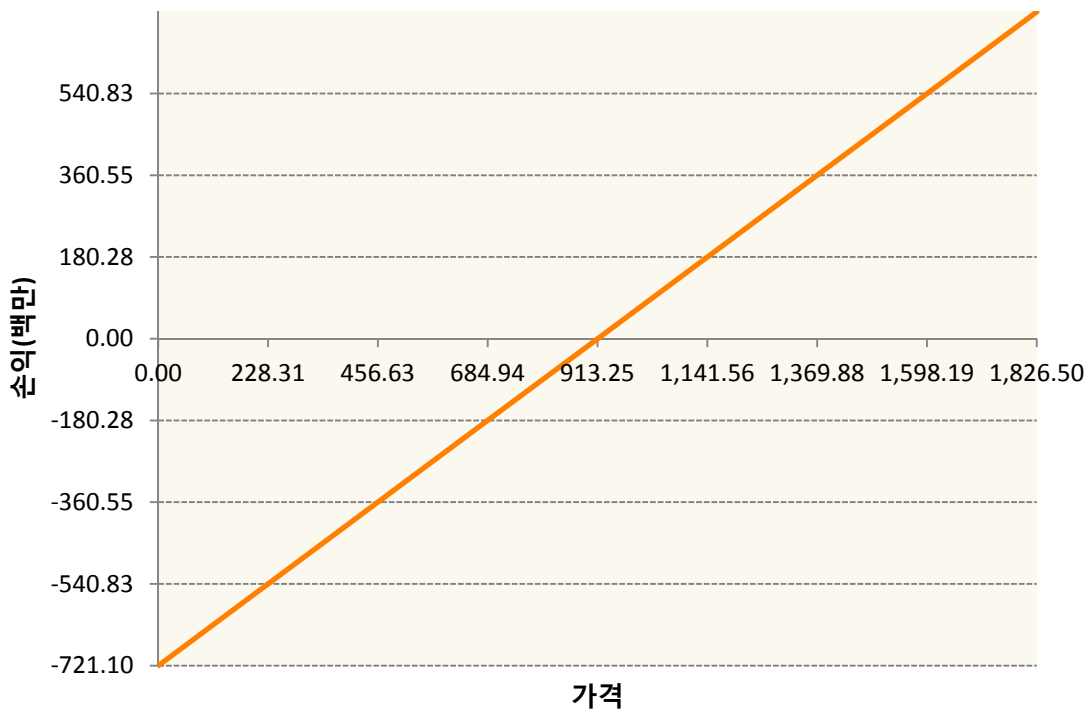
KWH9-KC HRW WHEAT FUT Mar19



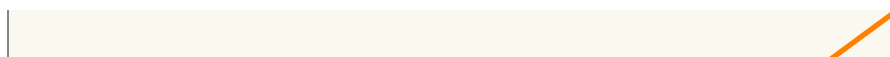
SBH9-SUGAR #11 (WORLD) MAR19

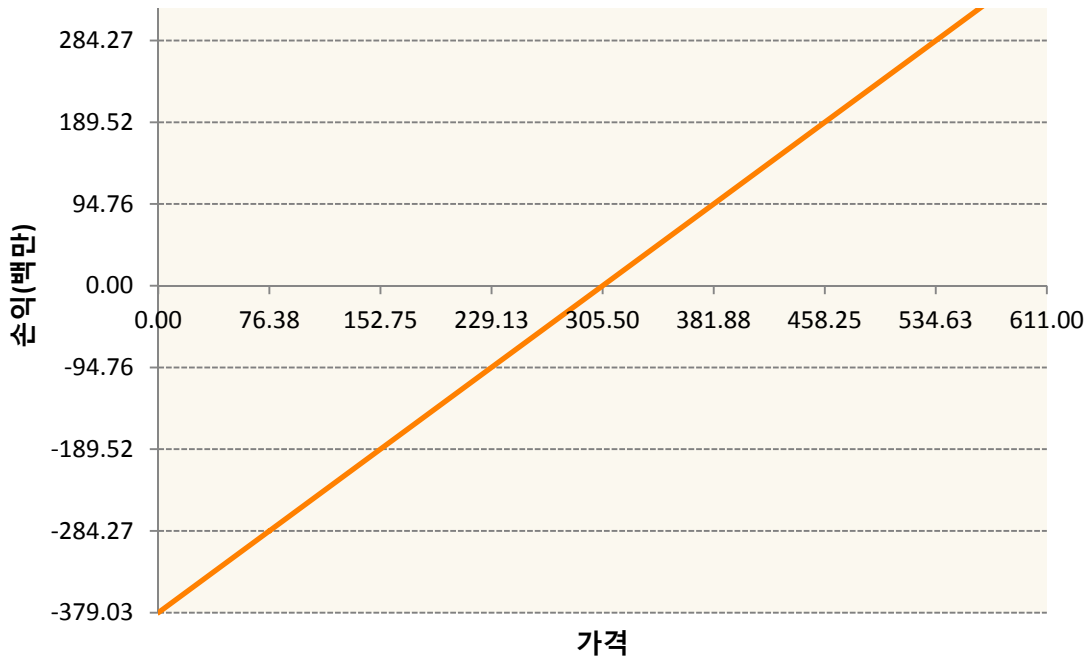


SH9-SOYBEAN FUTURE Mar19

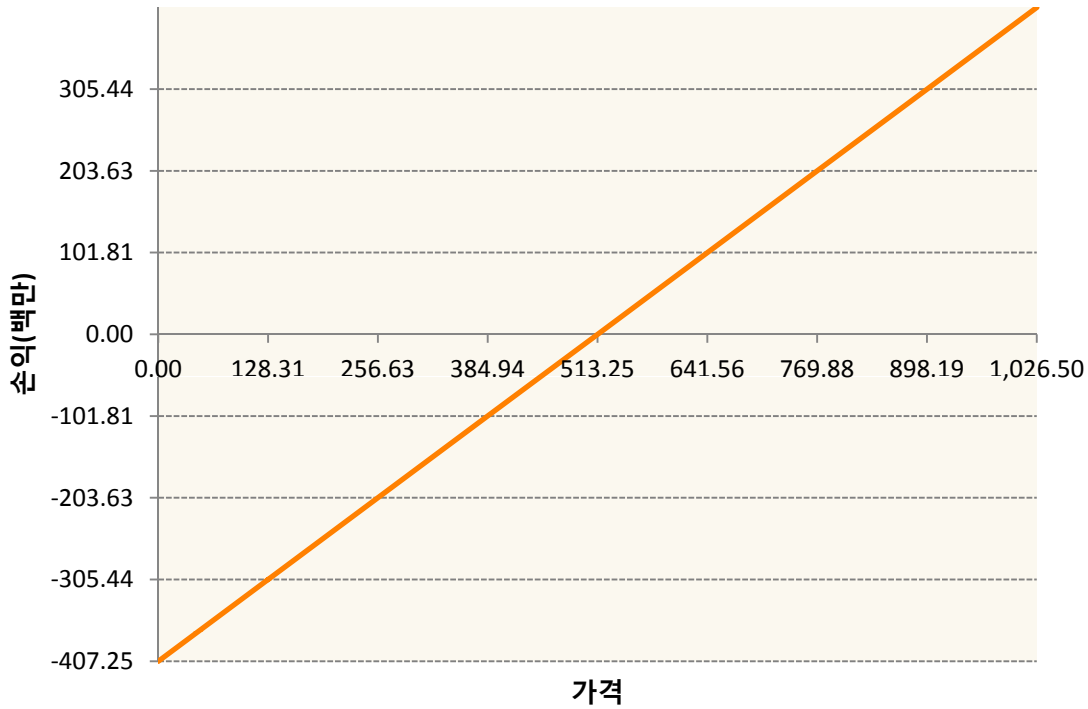


SMH9-SOYBEAN MEAL FUTR Mar19





WH9-WHEAT FUTURE(CBT) Mar19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

BOH9	SOYBEAN OIL FUTR Mar19	28
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	29
SH9	SOYBEAN FUTURE Mar19	58
SMH9	SOYBEAN MEAL FUTR Mar19	30
WH9	WHEAT FUTURE(CBT) Mar19	33

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

(단위:백만원)

290