

공시일	2019-02-12
기준일	2019-02-11

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	2019-02-12
기준일	2019-02-11

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

1,075

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

616

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-02-12
기준일	2019-02-11

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	272
SWCSI50000 신한CSI500미래S190129	81

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

529

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-02-12
기준일	2019-02-11

유로인덱스모(주식-파생형)

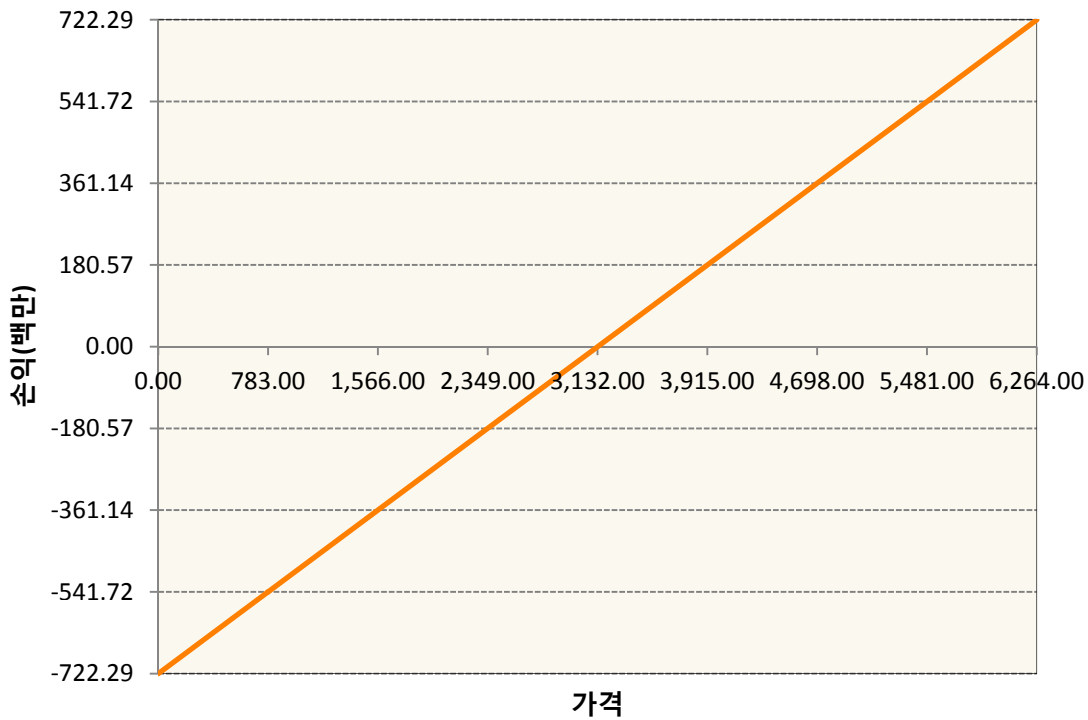
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	722	0	722	

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	2019-02-12
기준일	2019-02-11

차이나인덱스모(주식-파생형)

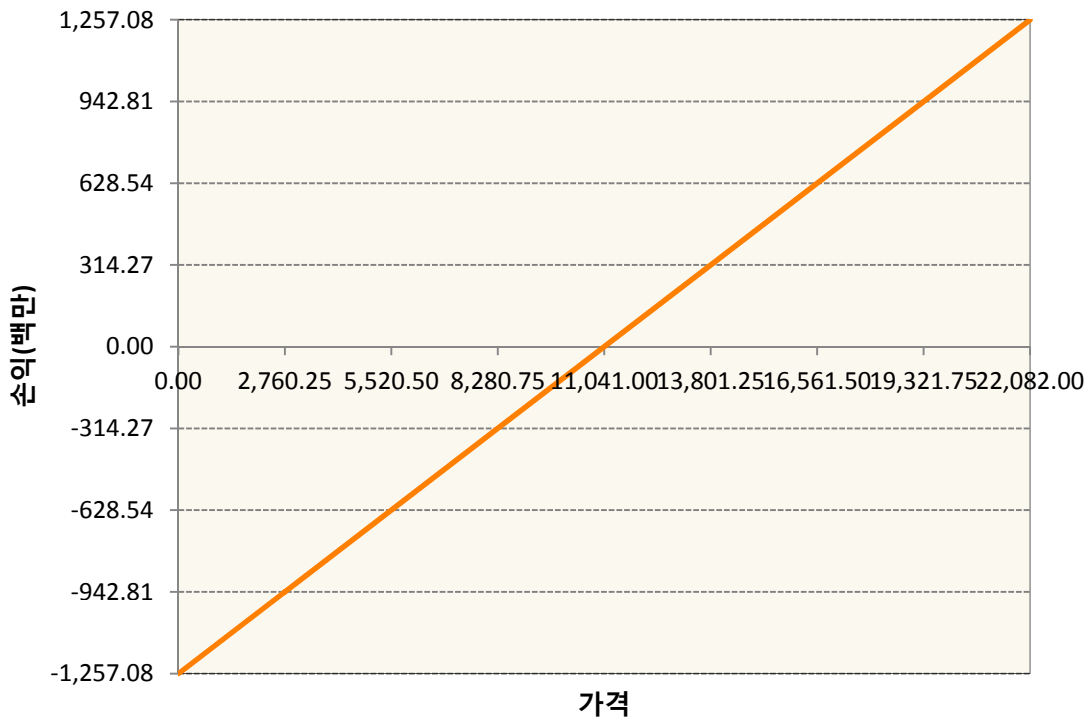
1. 계약금액

(단위:백만원)

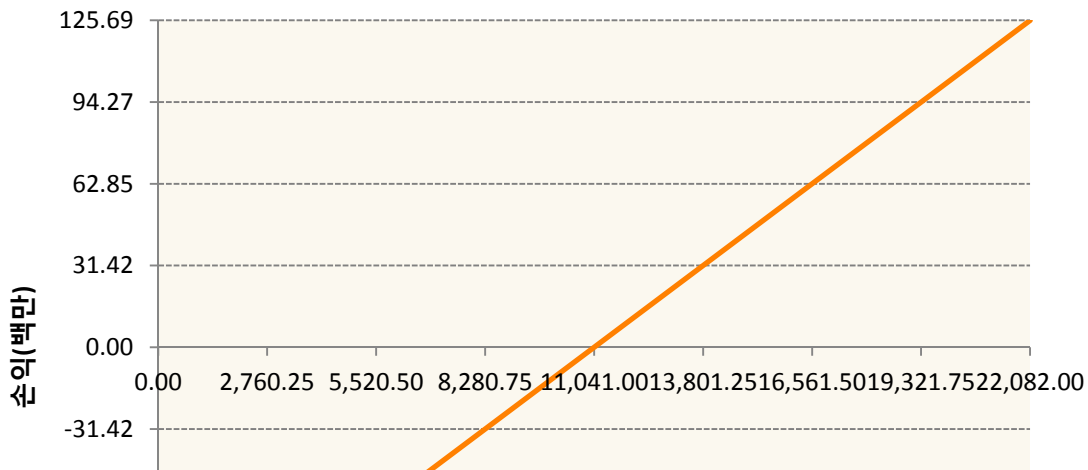
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,383	0	1,383	장내

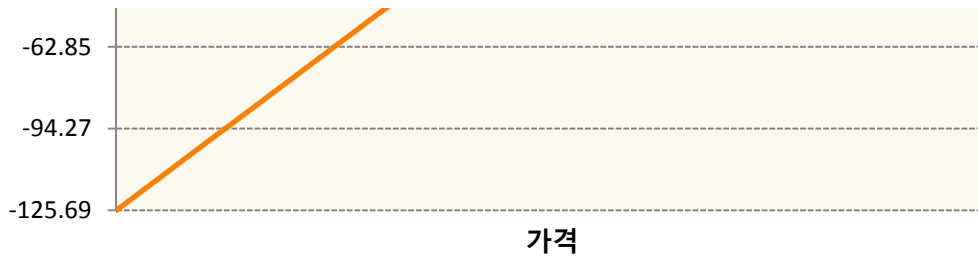
2. 만기시점의 손익구조

HCG9-HSCEI Futures Feb19



MHCG9-MINI H-SHR IDX FU Feb19





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

HCG9	HSCEI Futures Feb19	101
MHCG9	MINI H-SHR IDX FU Feb19	10

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

113

공시일	2019-02-12
기준일	2019-02-11

커버드콜모(주식혼합-파생형)

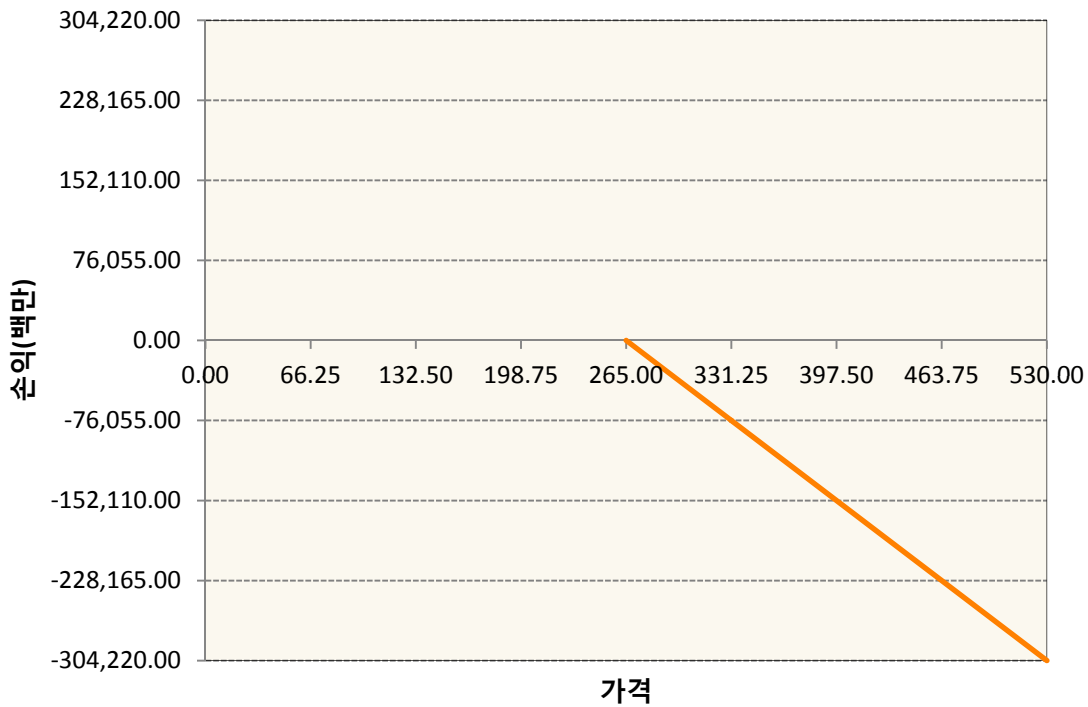
1. 계약금액

(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

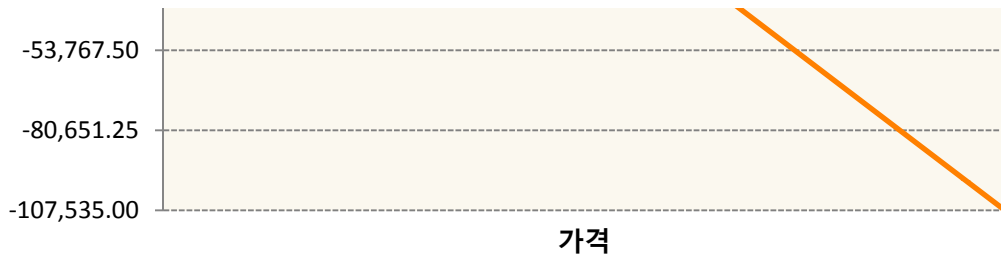
2. 만기시점의 손익구조

KR4201P22655-2019-02 콜265

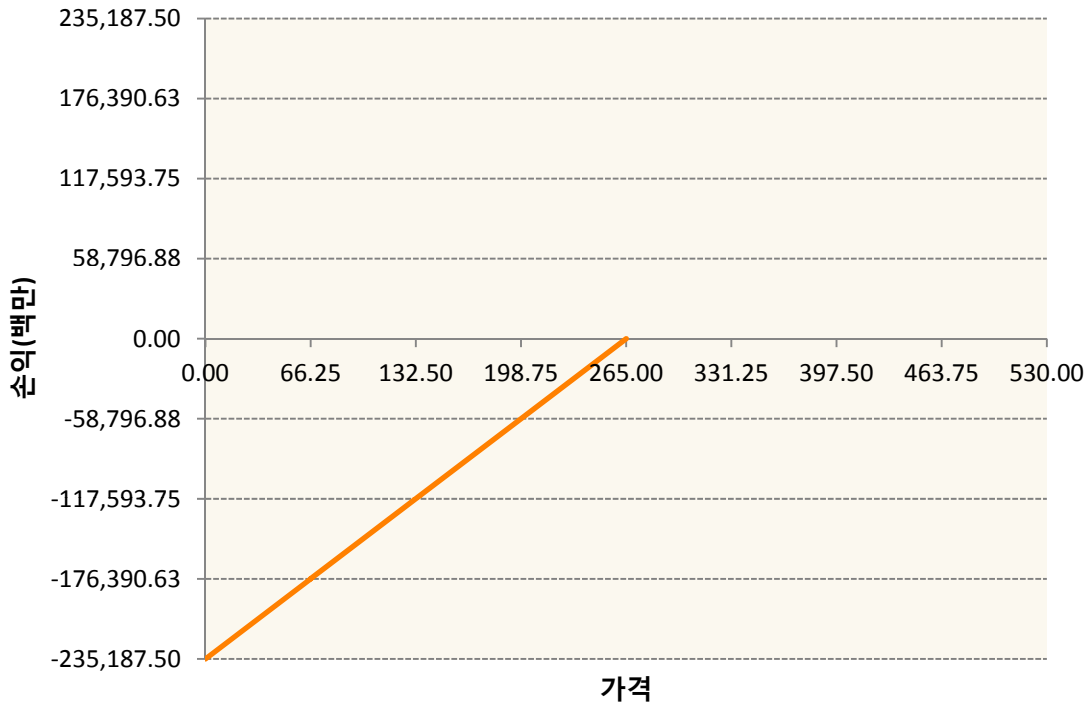


KR4201P22671-2019-02 콜267.5





KR4301P22653-2019-02 풋265



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4201P22655		2019-02 콜265					25,895
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	19,326	19,201	19,060	18,906	18,742	18,570	18,390
-5.33%	16,105	15,885	15,663	15,438	15,210	14,981	14,751
-2.67%	8,599	8,559	8,504	8,434	8,349	8,251	8,140
0%	9	8	5	0	-10	-25	-47
2.67%	-8,626	-8,626	-8,626	-8,626	-8,626	-8,627	-8,629
5.33%	-17,260	-17,260	-17,260	-17,260	-17,260	-17,261	-17,261
8.00%	-25,895	-25,895	-25,895	-25,895	-25,895	-25,895	-25,895
KR4201P22671		2019-02 콜267.5					9,060
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	5,846	5,823	5,795	5,762	5,723	5,680	5,633

-5.33%	5,209	5,125	5,041	4,957	4,873	4,790	4,706
-2.67%	2,975	2,943	2,905	2,862	2,813	2,761	2,705
0%	10	9	5	0	-8	-20	-35
2.67%	-3,013	-3,013	-3,013	-3,013	-3,014	-3,015	-3,016
5.33%	-6,037	-6,037	-6,037	-6,037	-6,037	-6,037	-6,037
8.00%	-9,060	-9,060	-9,060	-9,060	-9,060	-9,060	-9,060
KR4301P22653 2019-02 풋265							5,022
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-4,865	-4,877	-4,894	-4,918	-4,947	-4,982	-5,022
-5.33%	-271	-346	-425	-508	-593	-680	-769
-2.67%	0	0	-1	-3	-6	-10	-18
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)

36,016

공시일	2019-02-12
기준일	2019-02-11

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

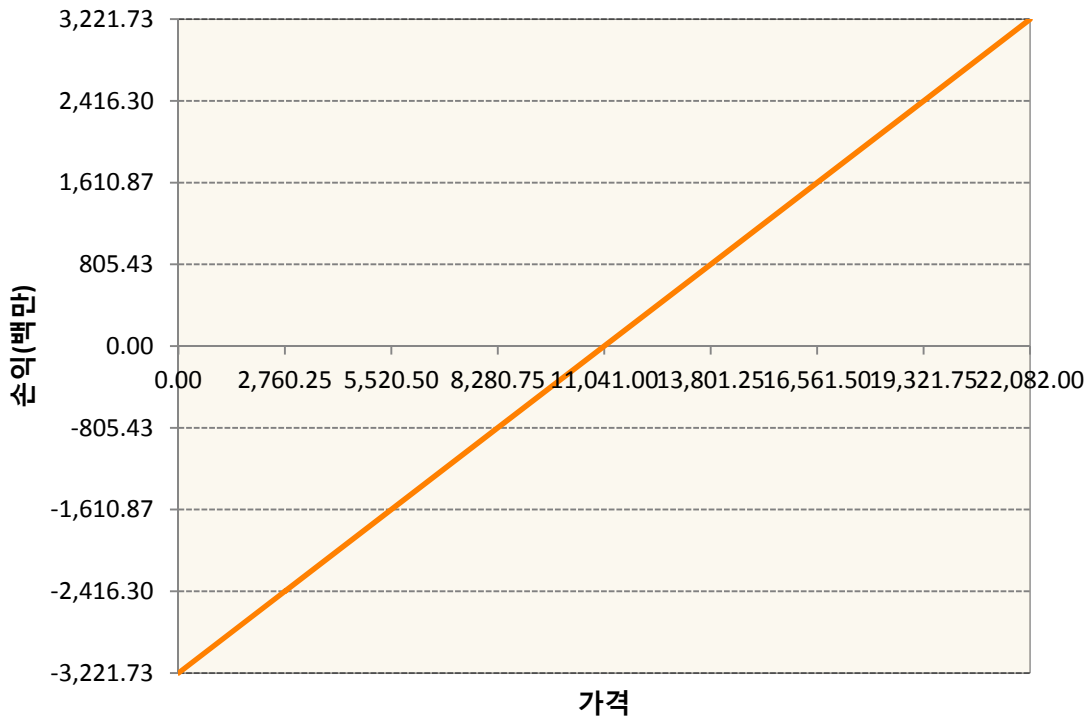
1. 계약금액

(단위:백만원)

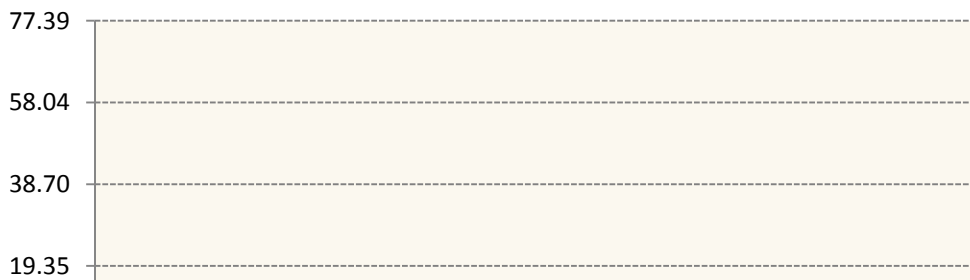
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	3,222	0	3,222	장내
누계	유가증권	옵션	0	7,653	-7,653	장내
누계	통화	선도	0	2,723	-2,723	장외

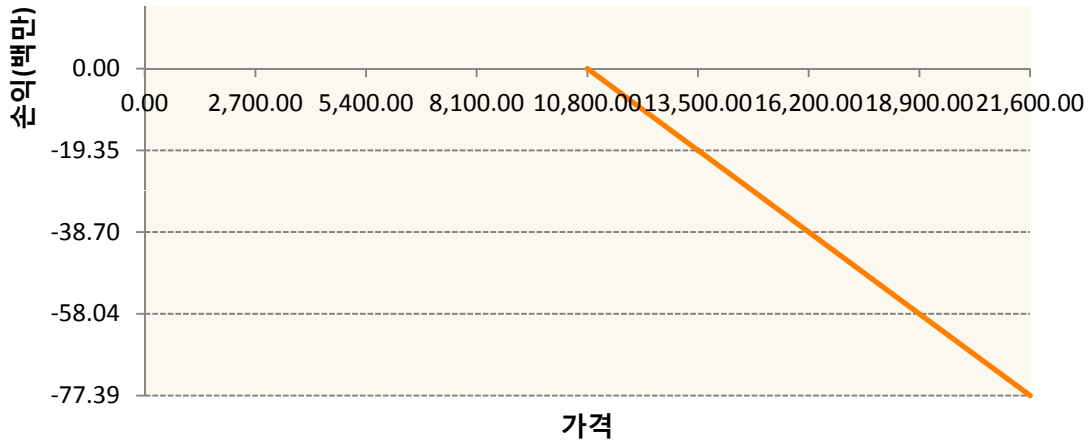
2. 만기시점의 손익구조

HCG9-HSCEI Futures Feb19

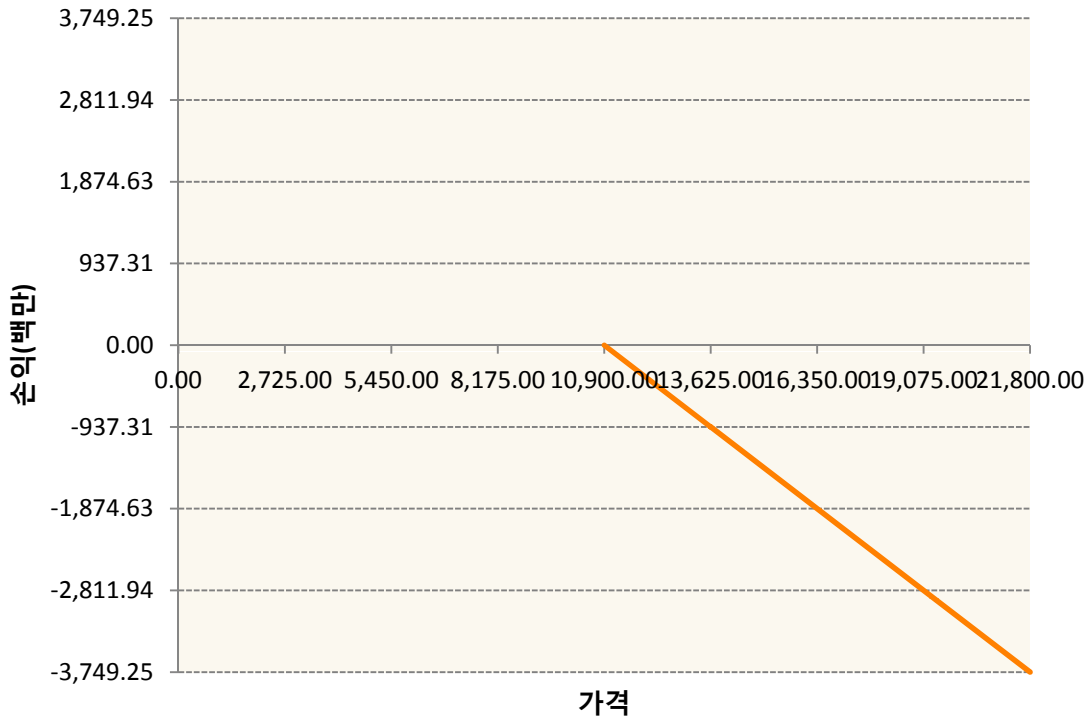


OHHIG9-C108-HSCEI

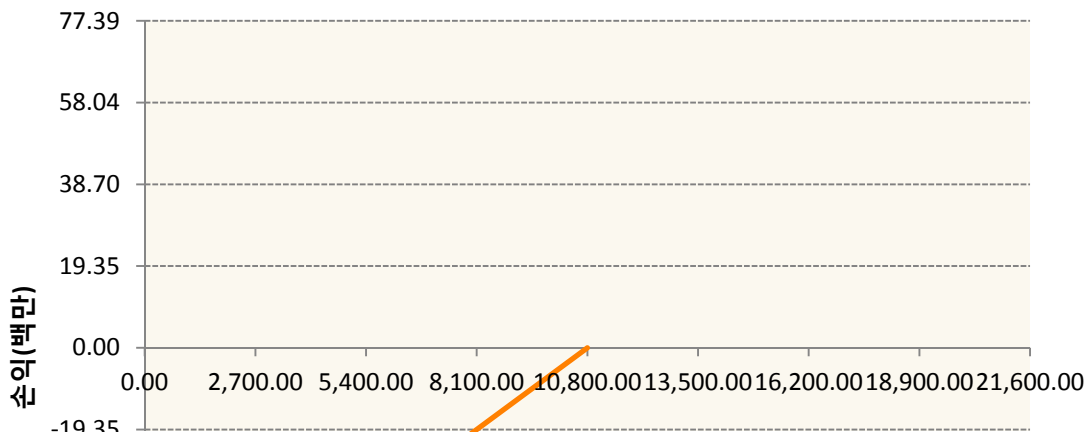


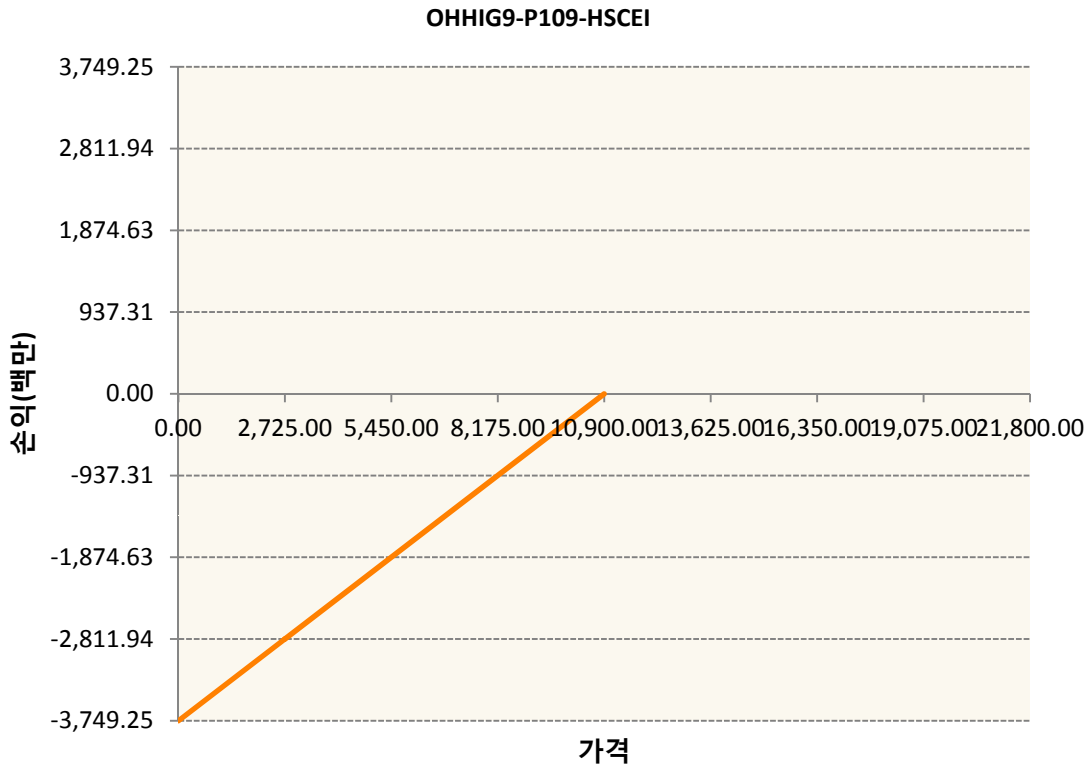
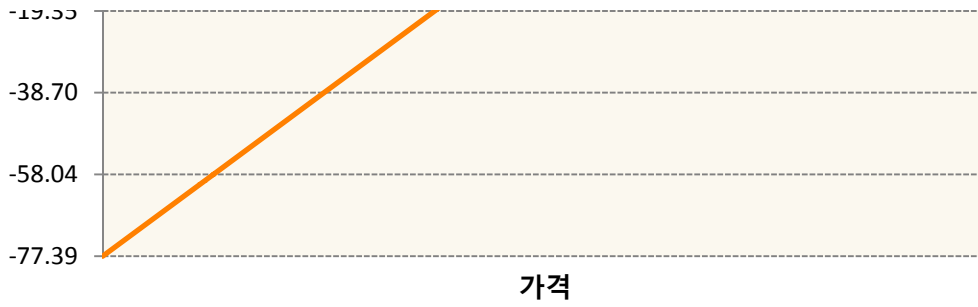


OHHIG9-C109-HSCEI



OHHIG9-P108-HSCEI





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

FX21018Z00 KRW/HKD 11-03-19E	218
HCG9 HSCEI Futures Feb19	258
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)

971

공시일	2019-02-12
기준일	2019-02-11

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

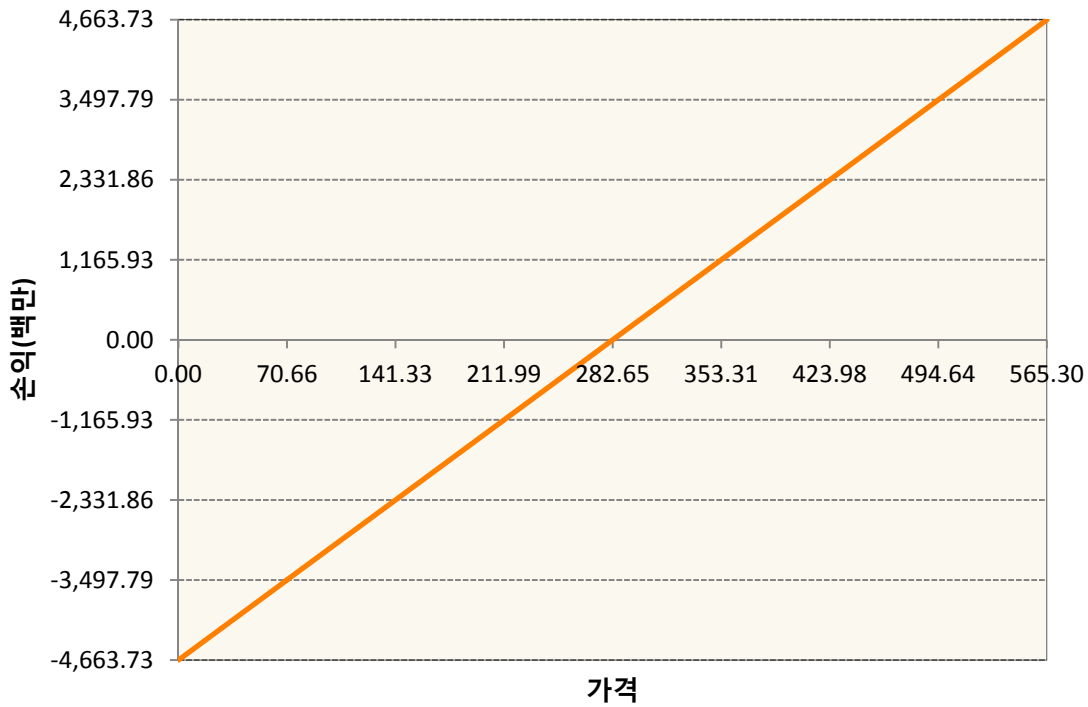
1. 계약금액

(단위:백만원)

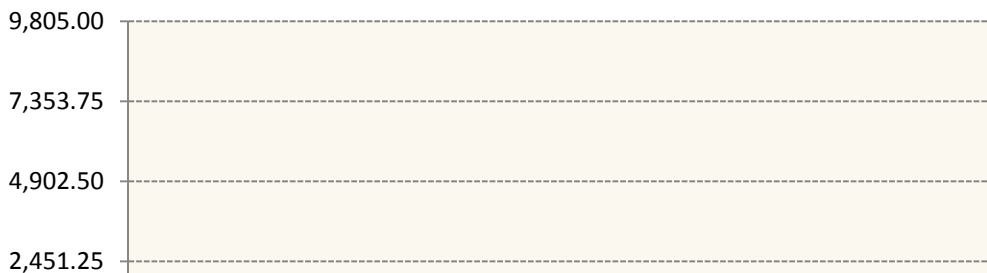
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	4,664	0	4,664	장내
누계	유가증권	스왑	31,836	0	31,836	장외
누계	유가증권	옵션	0	29,674	-29,674	장내

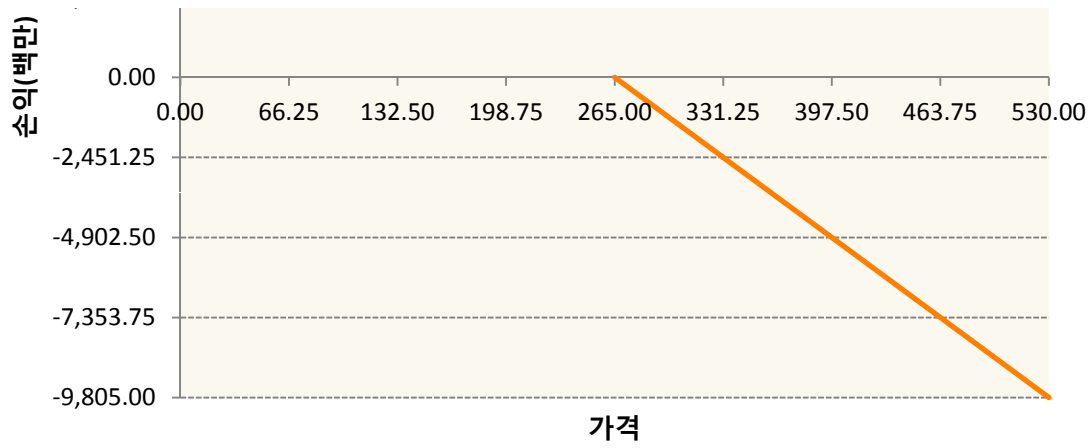
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P30007-2019-03 코스피200지수선물

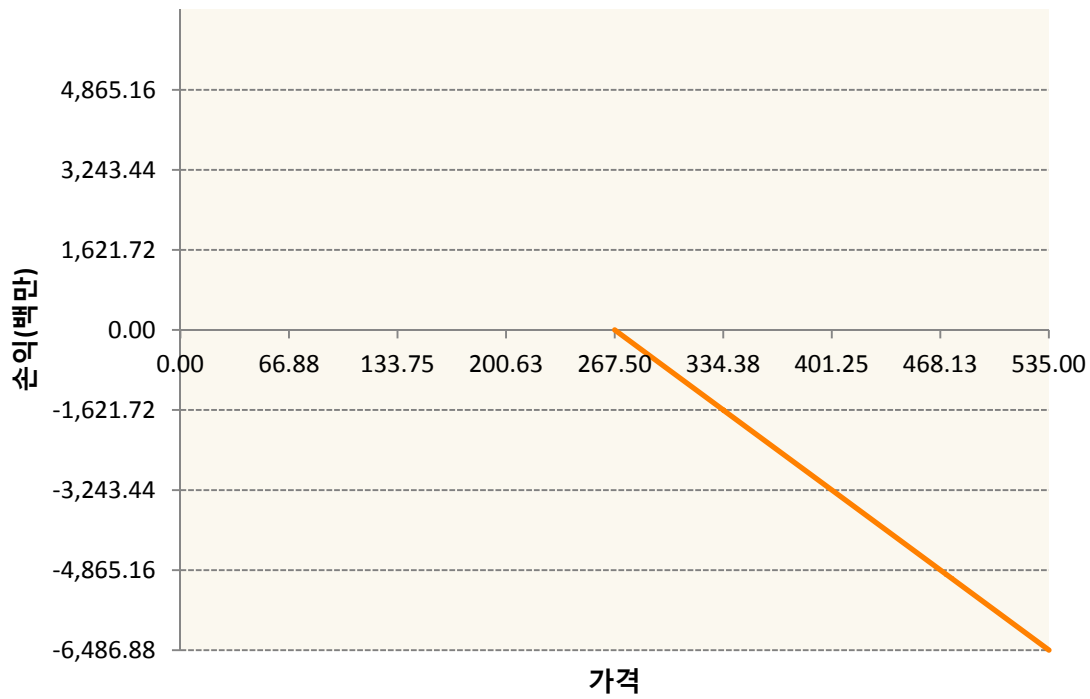


KR4201P22655-2019-02 콜265

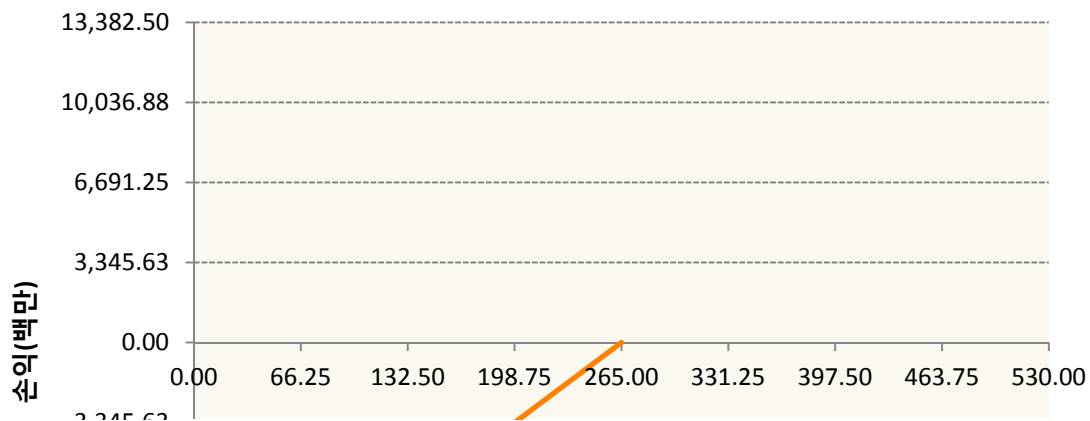


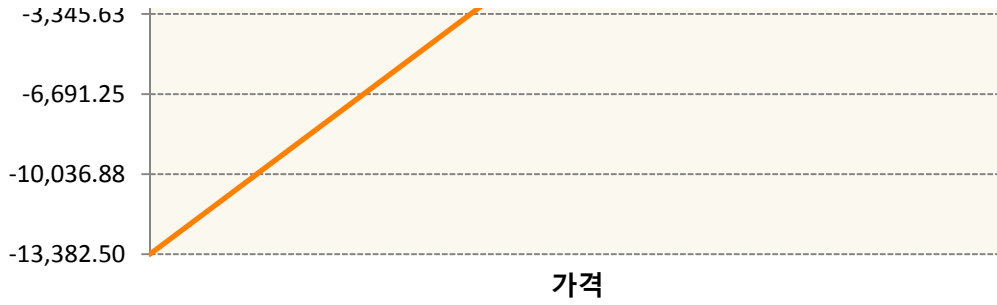


KR4201P22671-2019-02 콜267.5



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						835
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	623	619	614	609	604	598	593	
-5.33%	519	512	505	498	490	483	475	
-2.67%	277	276	274	272	269	266	262	
0%	0	0	0	0	0	-1	-2	
2.67%	-278	-278	-278	-278	-278	-278	-278	
5.33%	-556	-556	-556	-556	-556	-556	-556	
8.00%	-835	-835	-835	-835	-835	-835	-835	
KR4201P22671		2019-02 콜267.5						547
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	

-8.00%	353	351	350	348	345	343	340
-5.33%	314	309	304	299	294	289	284
-2.67%	179	178	175	173	170	167	163
0%	1	1	0	0	0	-1	-2
2.67%	-182	-182	-182	-182	-182	-182	-182
5.33%	-364	-364	-364	-364	-364	-364	-364
8.00%	-547	-547	-547	-547	-547	-547	-547
KR4301P22653 2019-02 풋265							286
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-277	-277	-278	-280	-281	-283	-286
-5.33%	-15	-20	-24	-29	-34	-39	-44
-2.67%	0	0	0	0	0	-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)

4,424

공시일	2019-02-12
기준일	2019-02-11

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

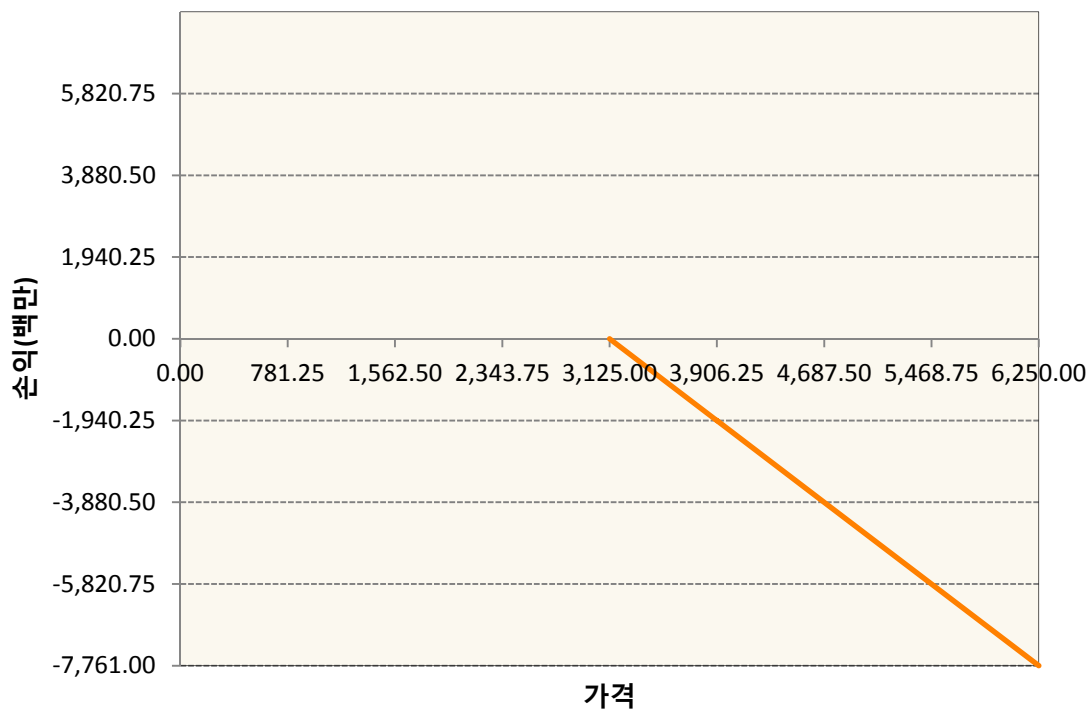
1. 계약금액

(단위:백만원)

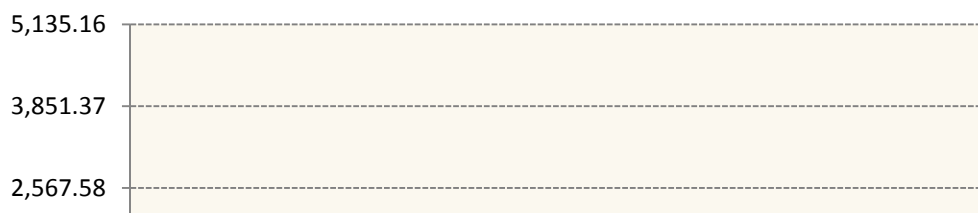
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	6,778	0	6,778	
누계	유가증권	스왑	60,128	0	60,128	장외
누계	유가증권	옵션	0	25,792	-25,792	장내
누계	통화	선도	0	15,283	-15,283	장외

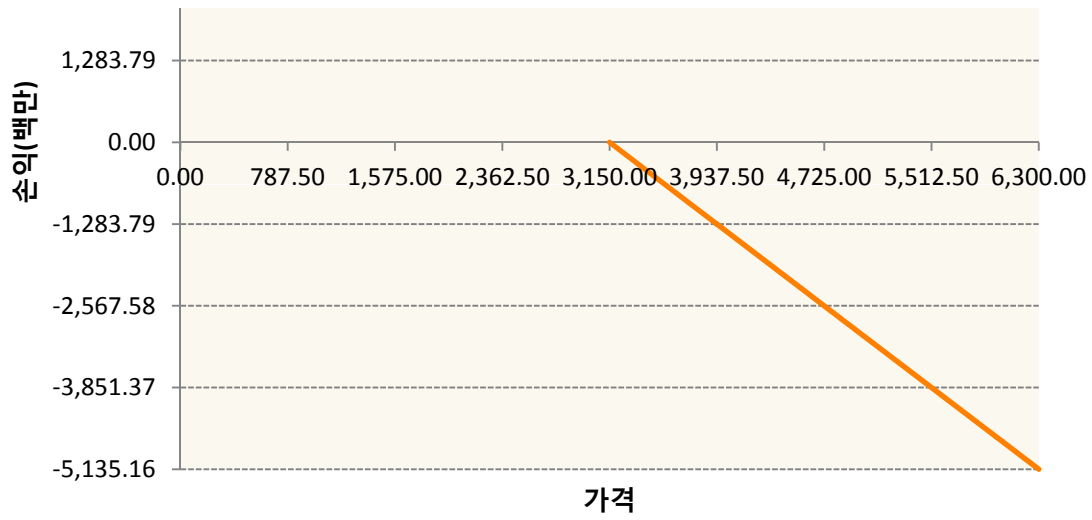
2. 만기시점의 손익구조

OESXG9-C3125-EURO STOXX 50

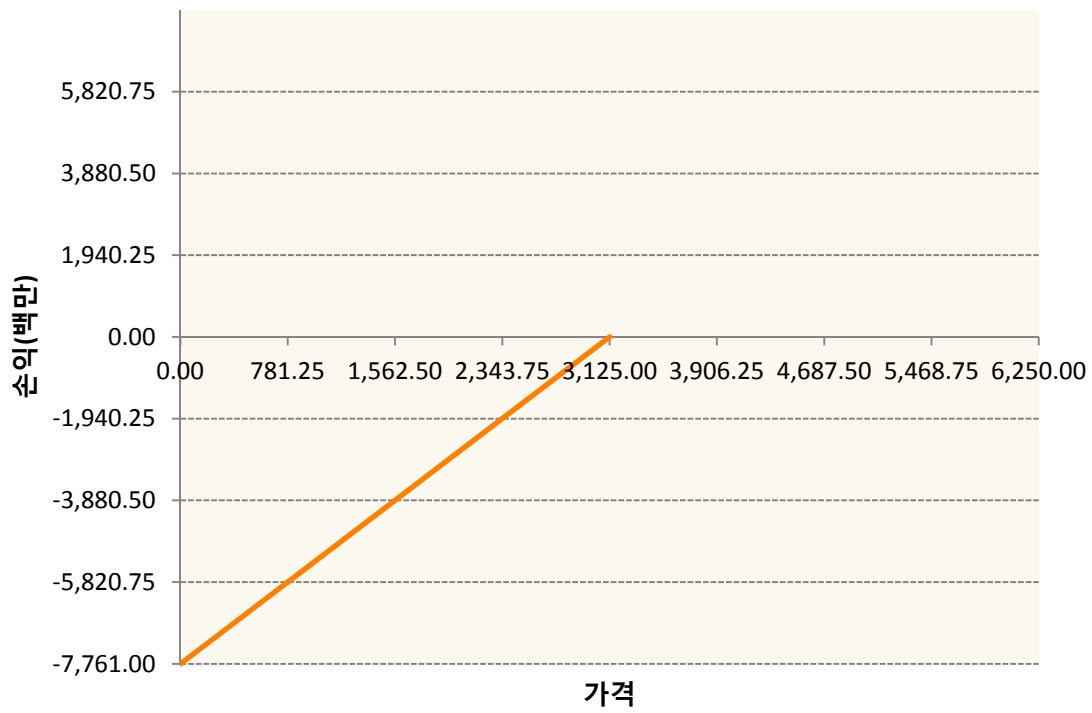


OESXG9-C3150-EURO STOXX 50



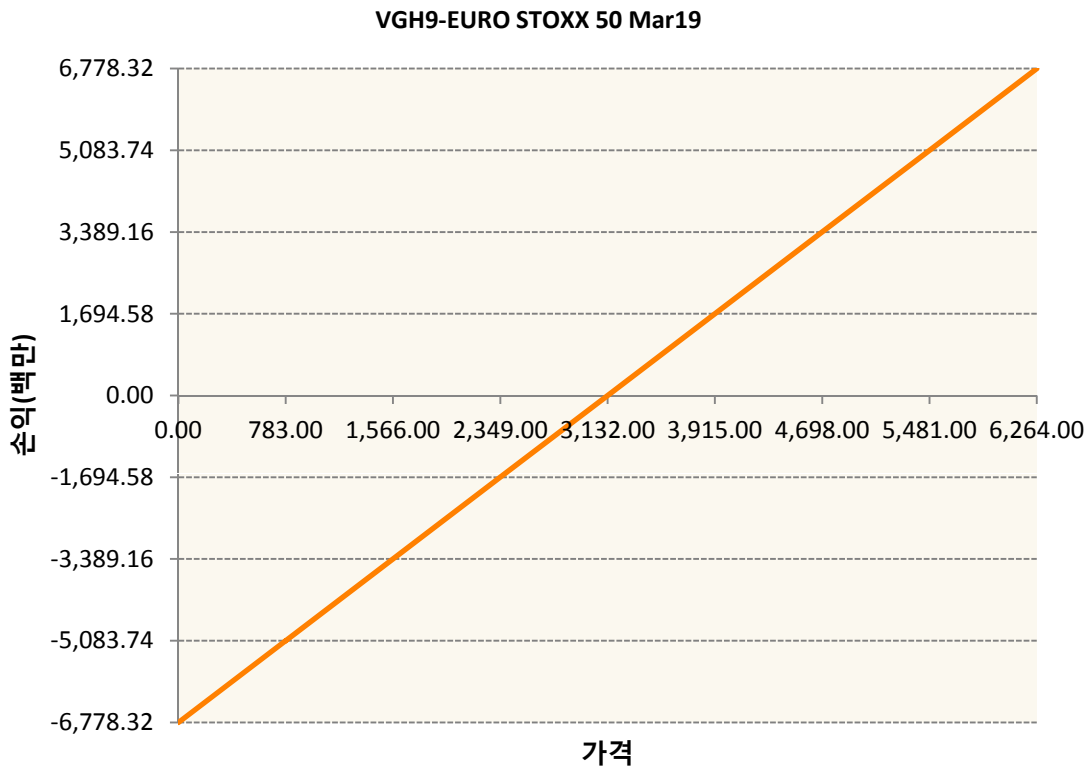
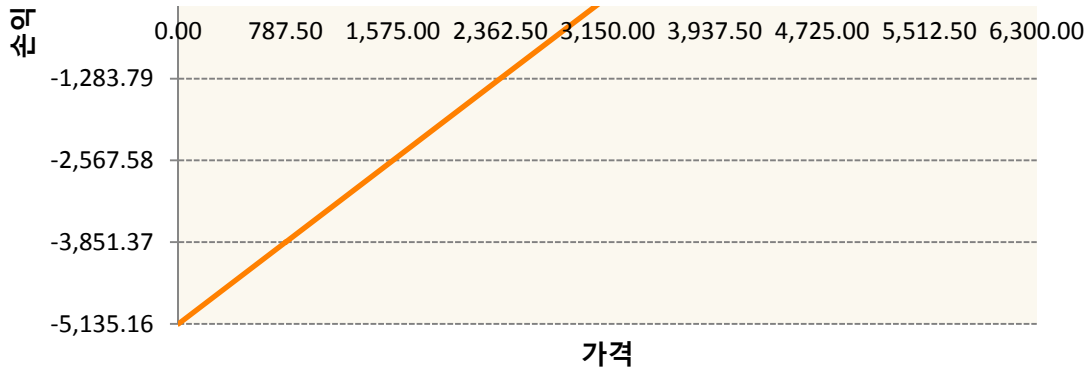


OESXG9-P3125-EURO STOXX 50



OESXG9-P3150-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY		34
FX21018X02 KRW/EUR 22-02-19E		408
FX21018Z03 KRW/EUR 22-03-19E		815
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	542

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

(단위:백만원)

2,515

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

(단위:백만원)

1,165

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

(단위:백만원)

100

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

(단위:백만원)

149

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

(단위:백만원)

45

공시일	2019-02-12
기준일	2019-02-11

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

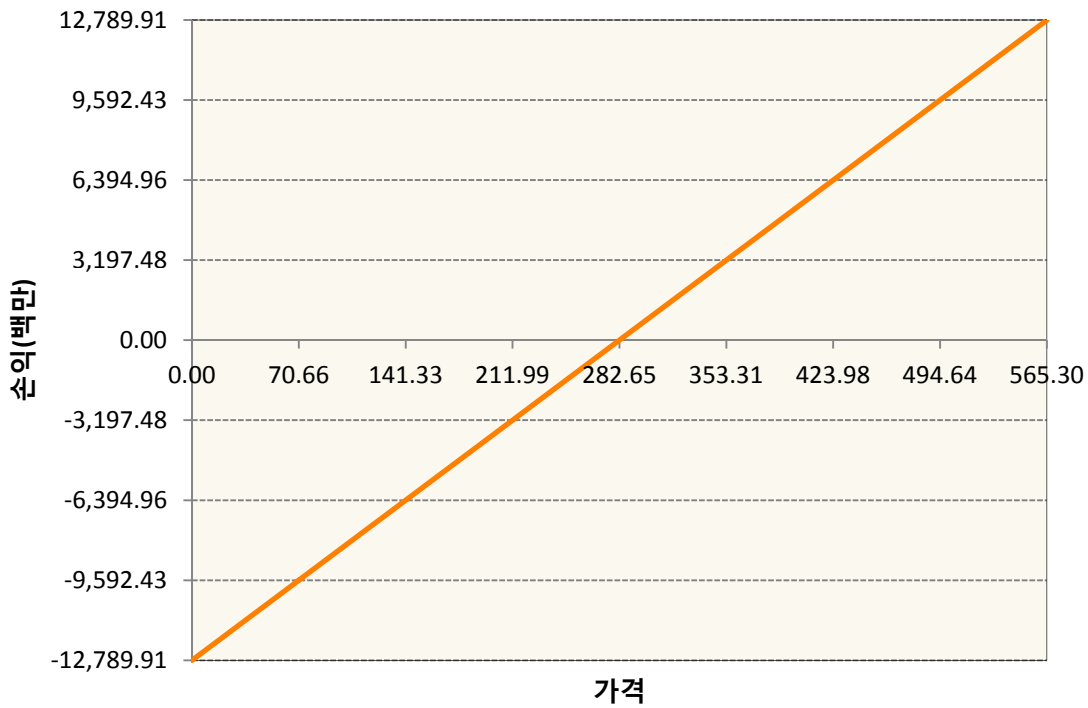
1. 계약금액

(단위:백만원)

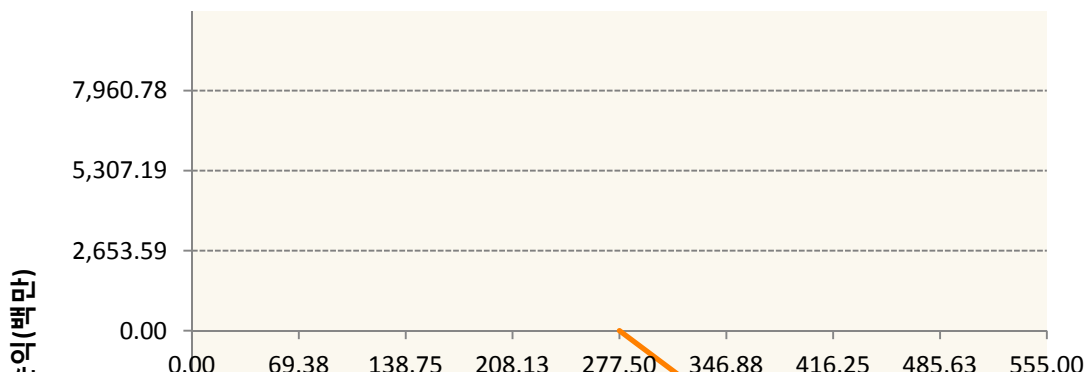
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	12,790	0	12,790	장내
누계	유가증권	옵션	2,523	22,724	-20,202	장내

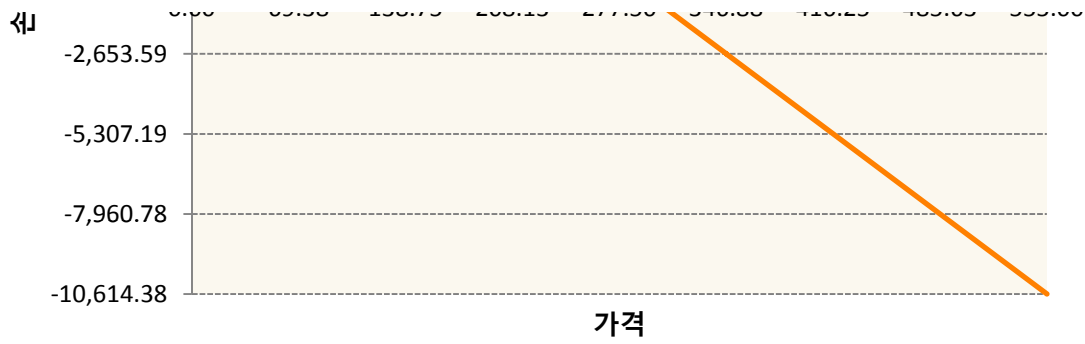
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P30007-2019-03 코스피200지수선물

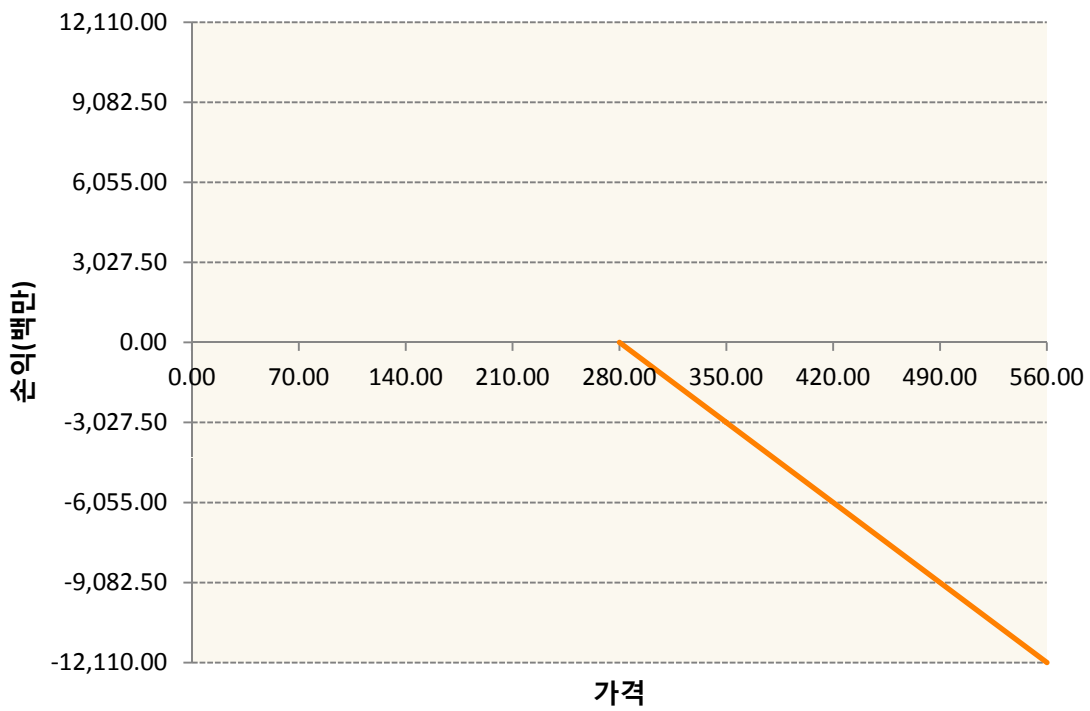


KR4201P22770-2019-02 콜277.5

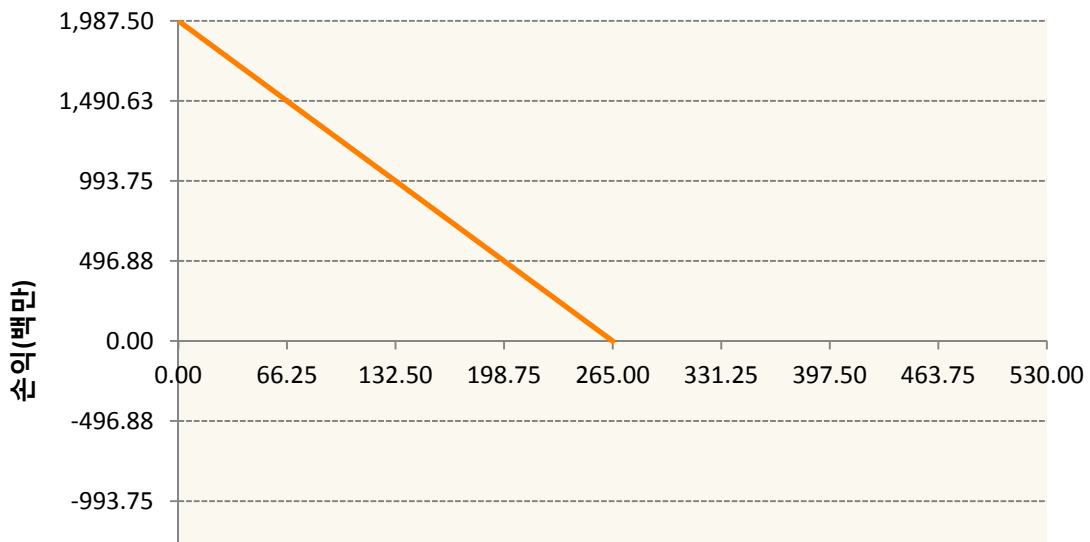


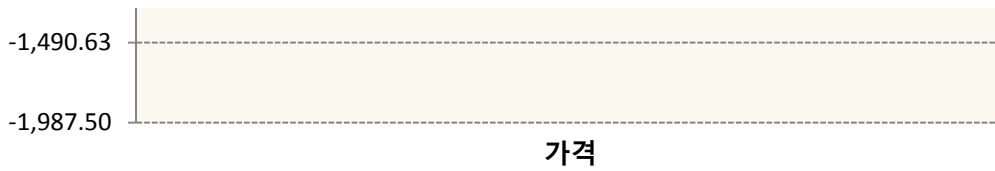


KR4201P22804-2019-02 콜280

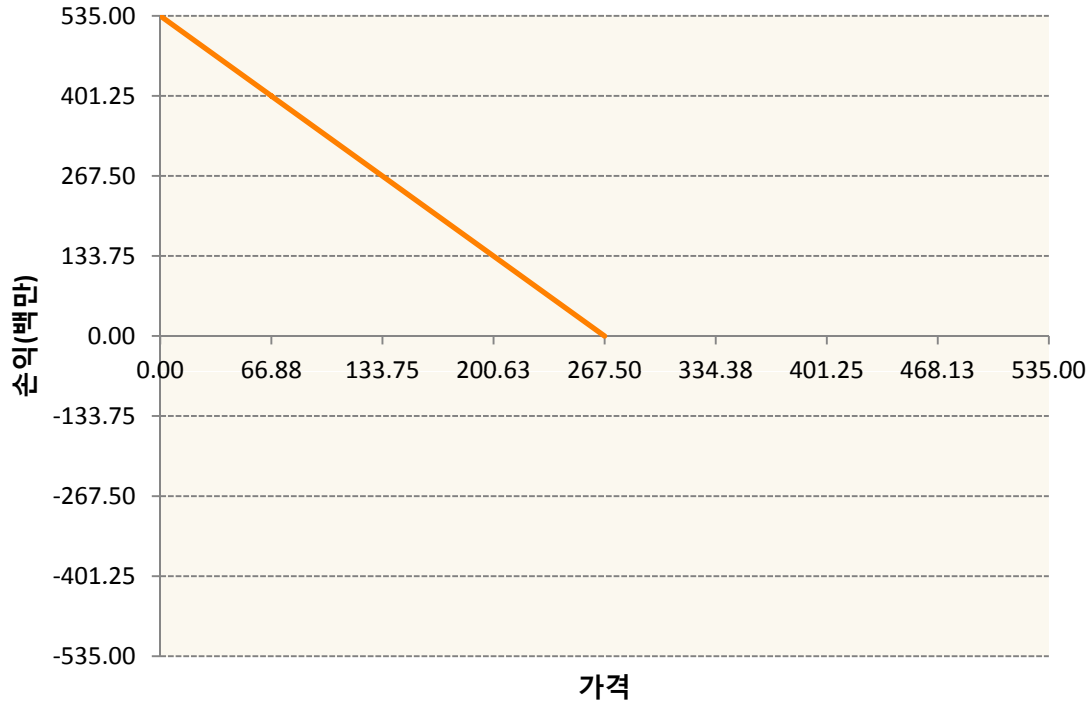


KR4301P22653-2019-02 풋265





KR4301P22679-2019-02 풋267.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101P30007		2019-03 코스피200지수선물						1,021
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-1,021	-1,021	-1,021	-1,021	-1,021	-1,021	-1,021	
-5.33%	-681	-681	-681	-681	-681	-681	-681	
-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%	681	681	681	681	681	681	681	
8.00%	1,021	1,021	1,021	1,021	1,021	1,021	1,021	
KR4201P22770		2019-02 콜277.5						827
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	212	212	212	212	212	211	211	
-5.33%	211	210	209	207	204	201	198	
-2.67%	181	174	166	159	151	144	136	

0%	18	13	6	0	-7	-14	-21
2.67%	-252	-253	-254	-255	-257	-259	-262
5.33%	-539	-539	-539	-539	-540	-540	-540
8.00%	-827	-827	-827	-827	-827	-827	-827
KR4201P22804 2019-02 콜280							902
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	165	165	165	165	165	165	165
-5.33%	165	165	164	163	161	160	157
-2.67%	151	145	140	133	126	119	112
0%	27	18	9	0	-9	-18	-27
2.67%	-253	-255	-258	-261	-264	-269	-273
5.33%	-576	-576	-576	-577	-577	-578	-579
8.00%	-902	-902	-902	-902	-902	-902	-902
KR4301P22653 2019-02 풋265							42
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	41	41	41	42	42	42	42
-5.33%	2	3	4	4	5	6	6
-2.67%	0	0	0	0	0	0	0
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							16
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	16	16	16	16	16	16	16
-5.33%	3	3	3	3	3	4	4
-2.67%	0	0	0	0	0	0	0
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)

3,090

공시일	2019-02-12
기준일	2019-02-11

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	764	0	764	

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	2019-02-12
기준일	2019-02-11

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	3,500	0	3,500	

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	2019-02-12
기준일	2019-02-11

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	16,388	0	16,388	
누계	통화	선도	0	17,332	-17,332	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
FX21019G00 KRW/USD 19-03-19E	27

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

(단위:백만원)

526

공시일	2019-02-12
기준일	2019-02-11

스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

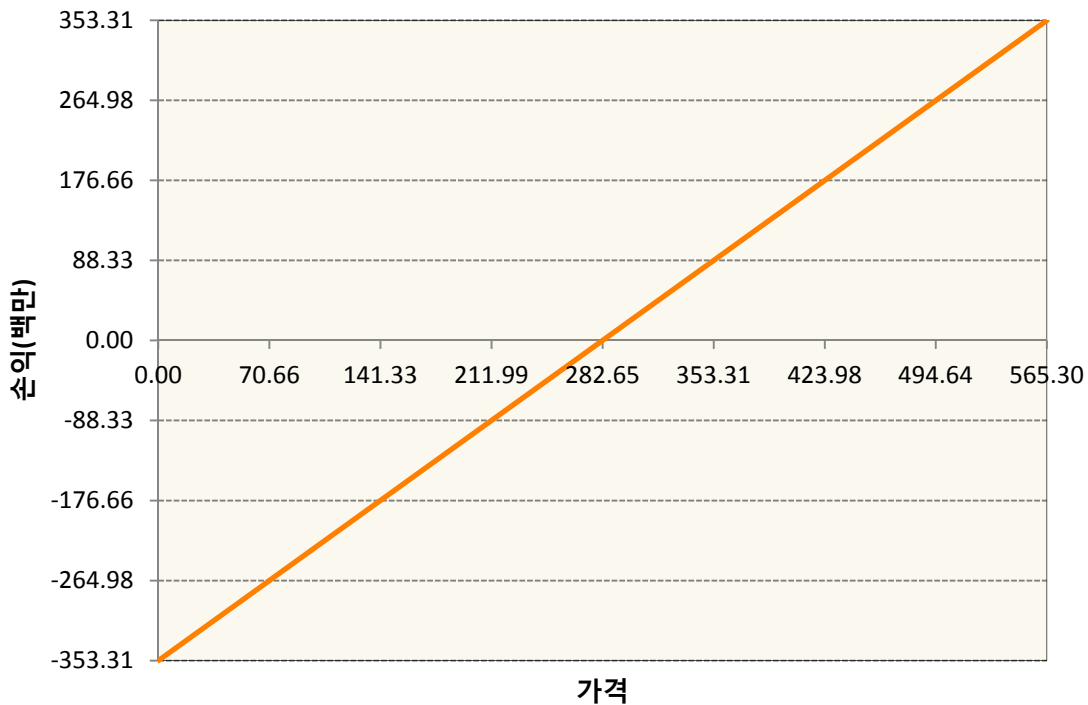
1. 계약금액

(단위:백만원)

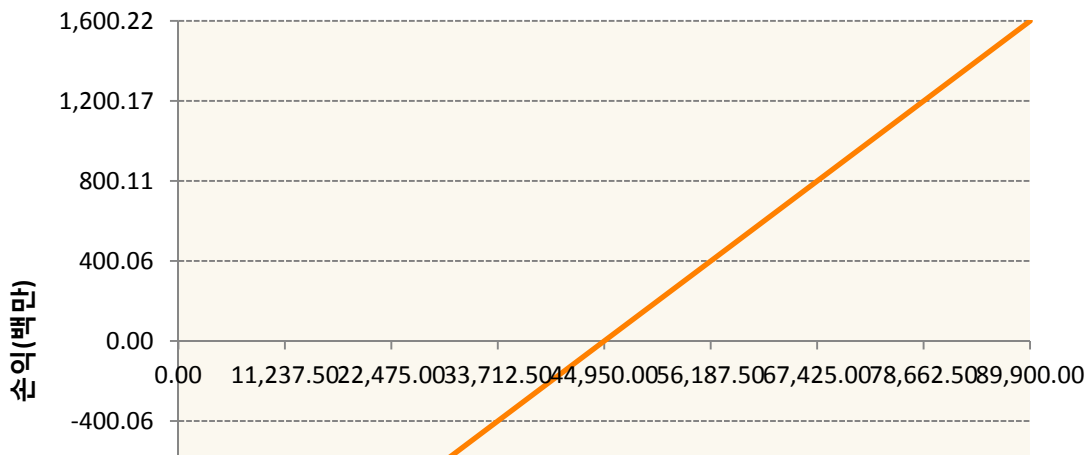
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,954	0	1,954	장내

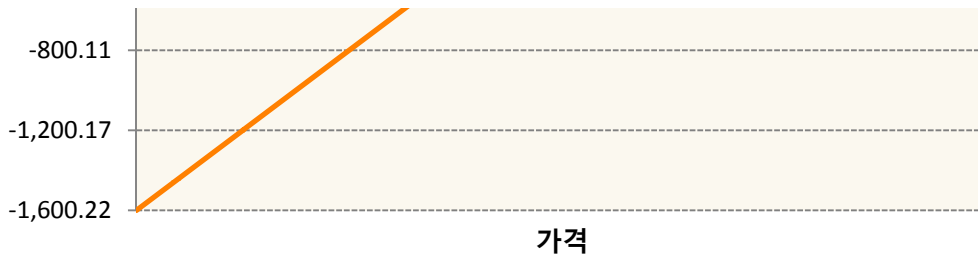
2. 만기시점의 손익구조

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	2019-02-12
기준일	2019-02-11

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

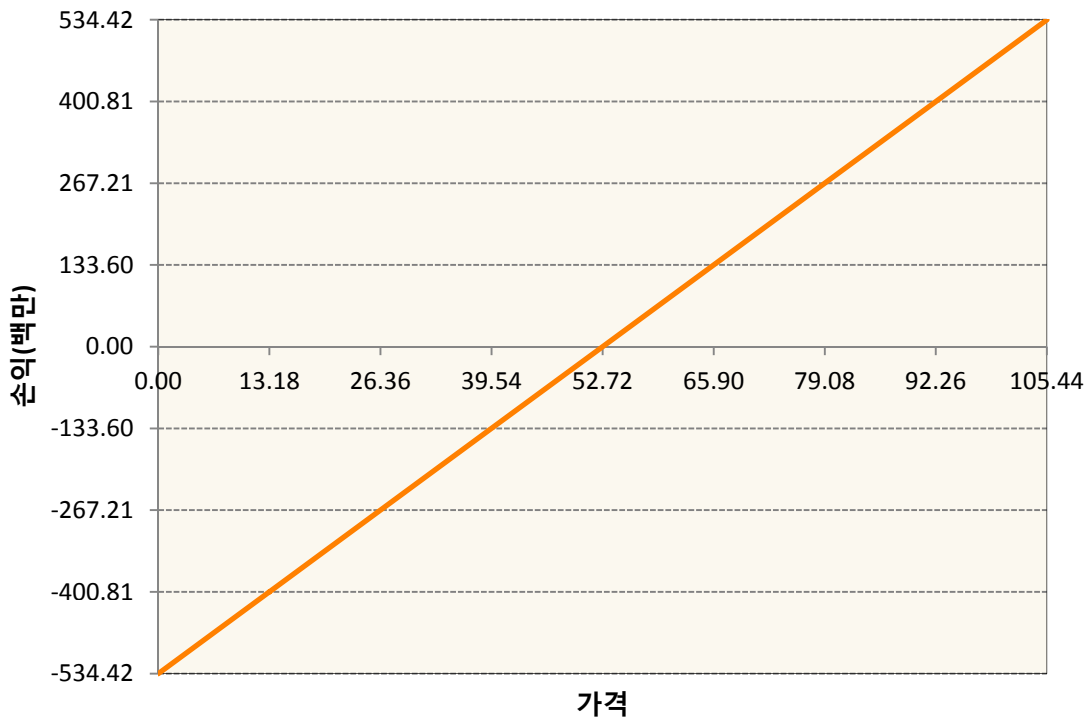
1. 계약금액

(단위:백만원)

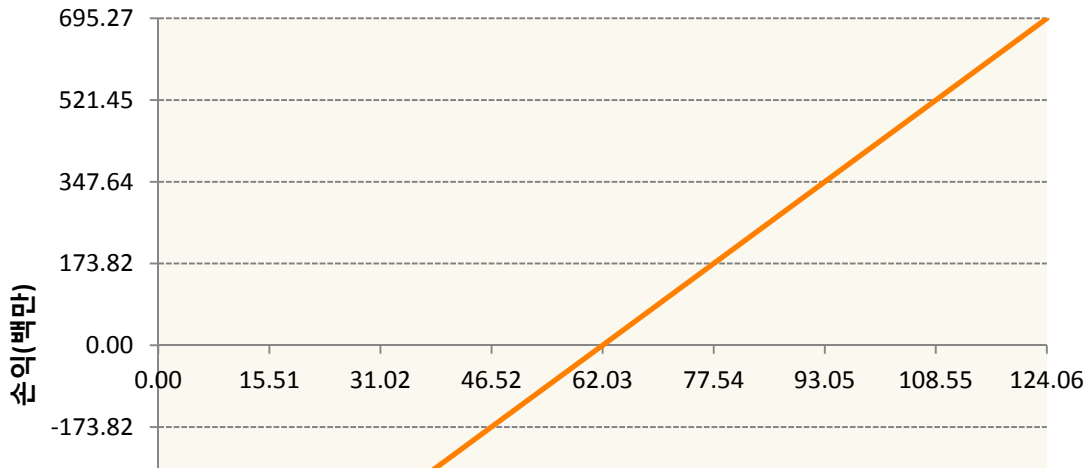
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,635	281	2,354	

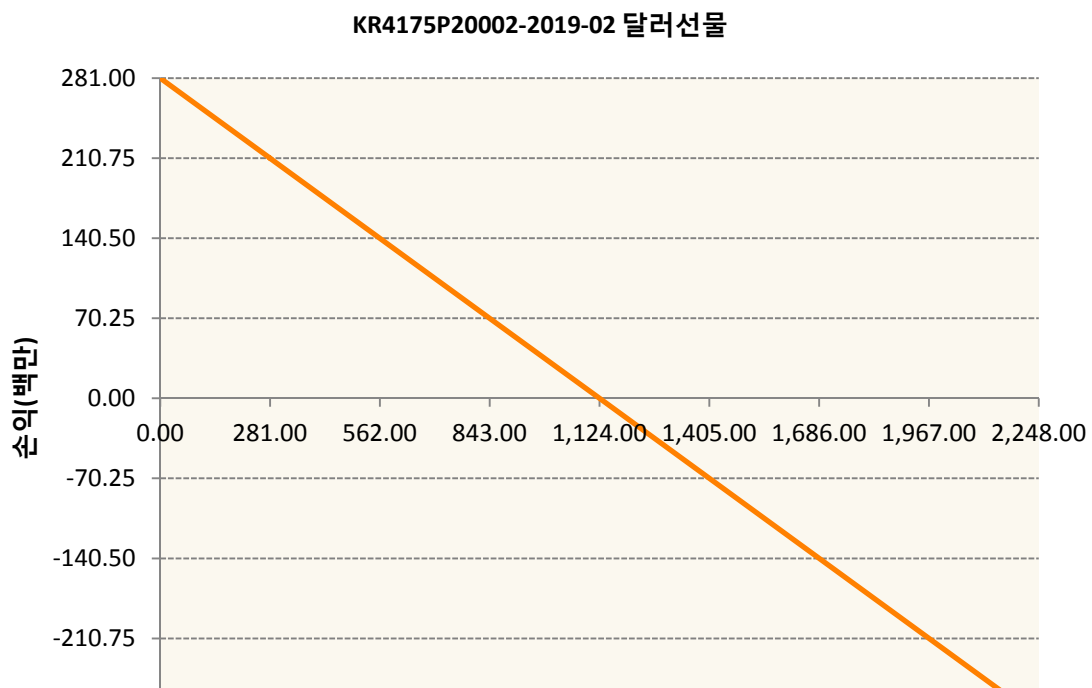
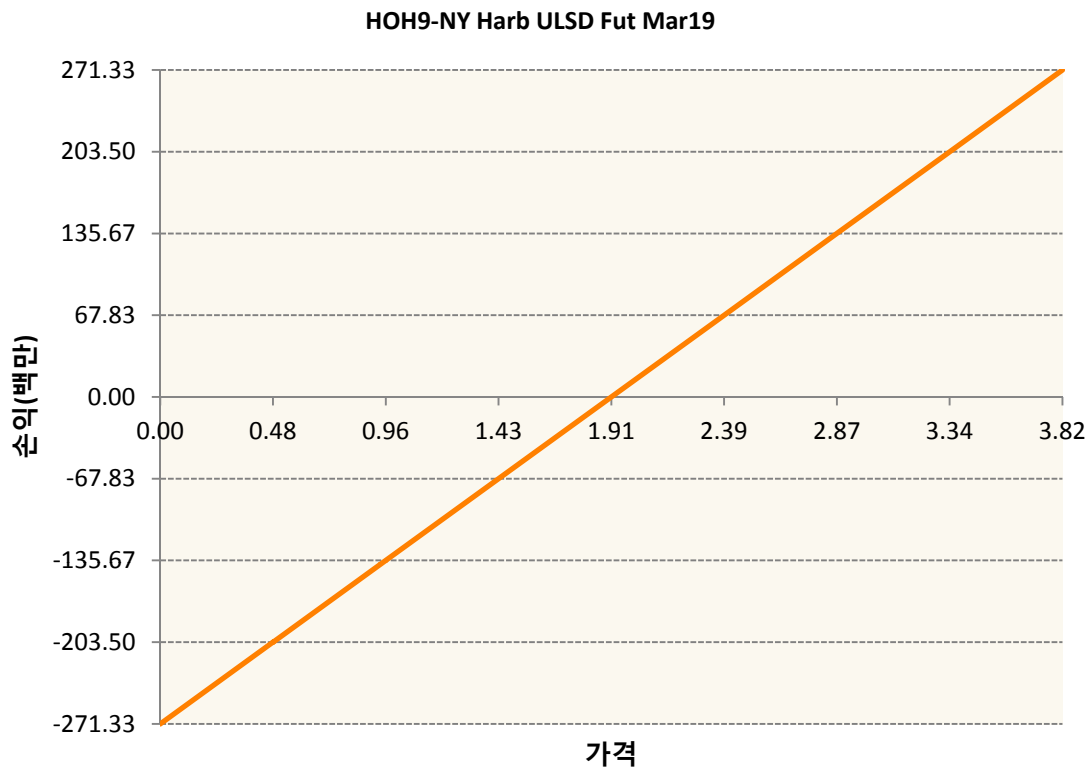
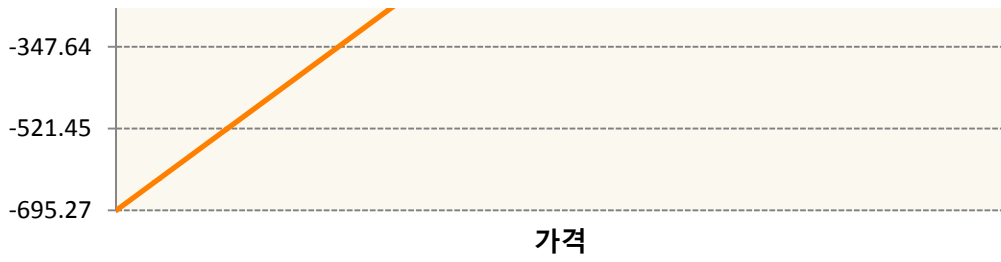
2. 만기시점의 손익구조

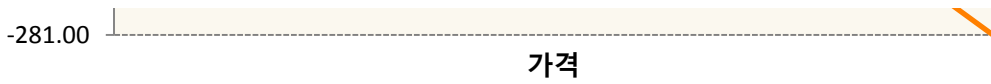
CLH9-WTI CRUDE FUTURE MAR19



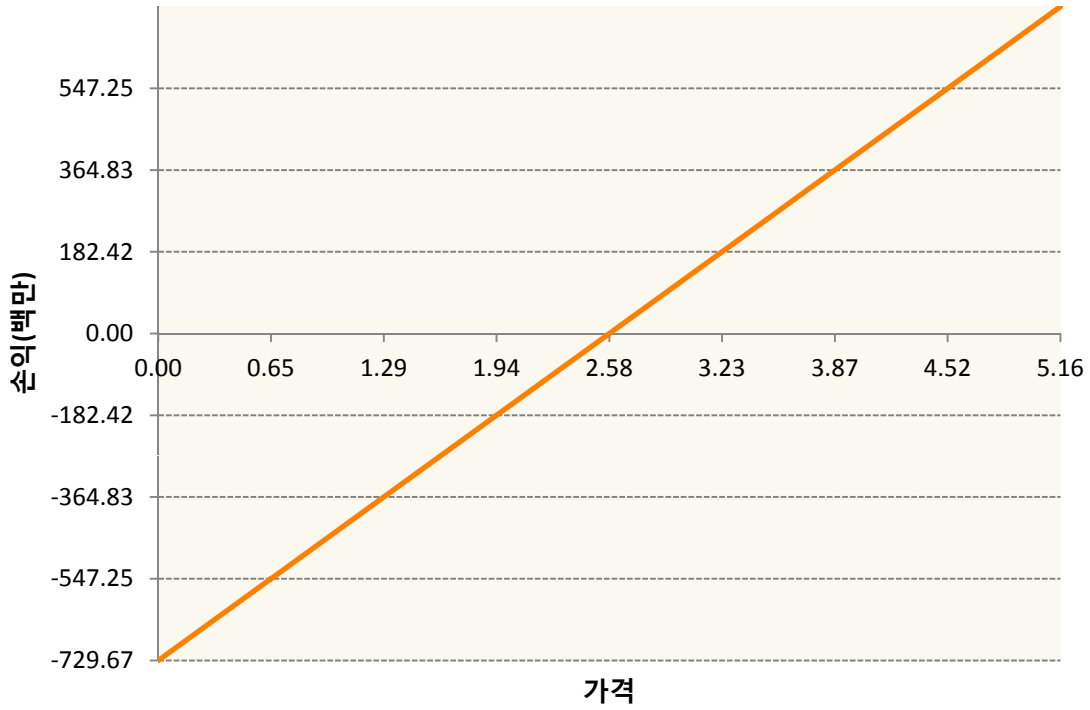
COK9-BRENT CRUDE FUTR May19



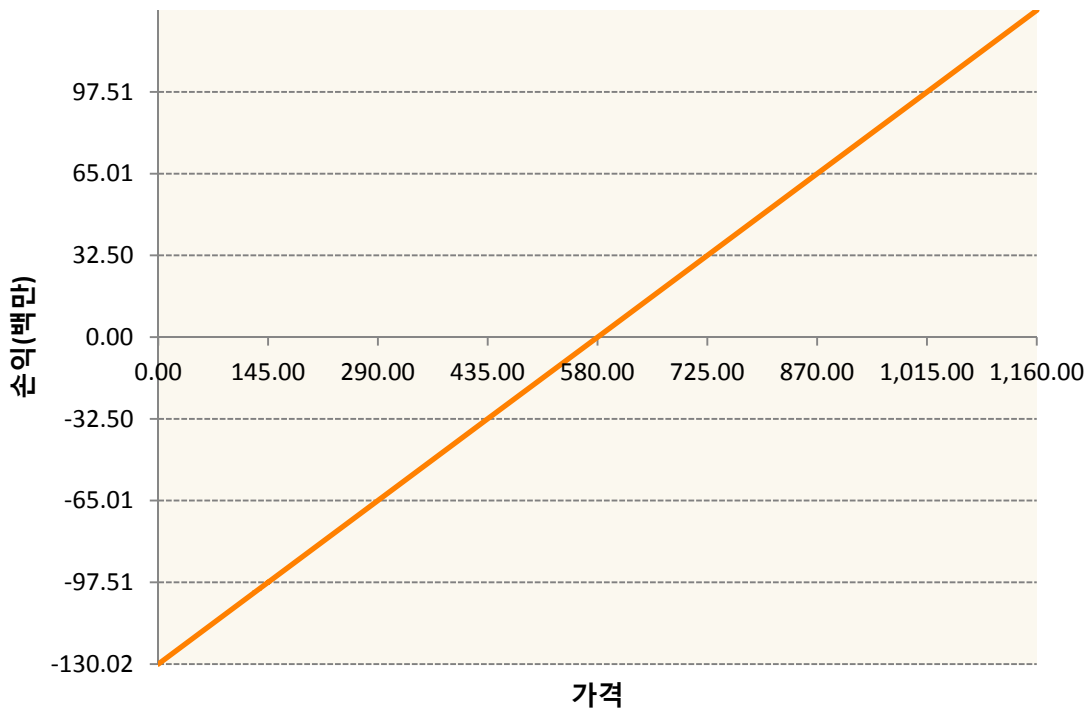




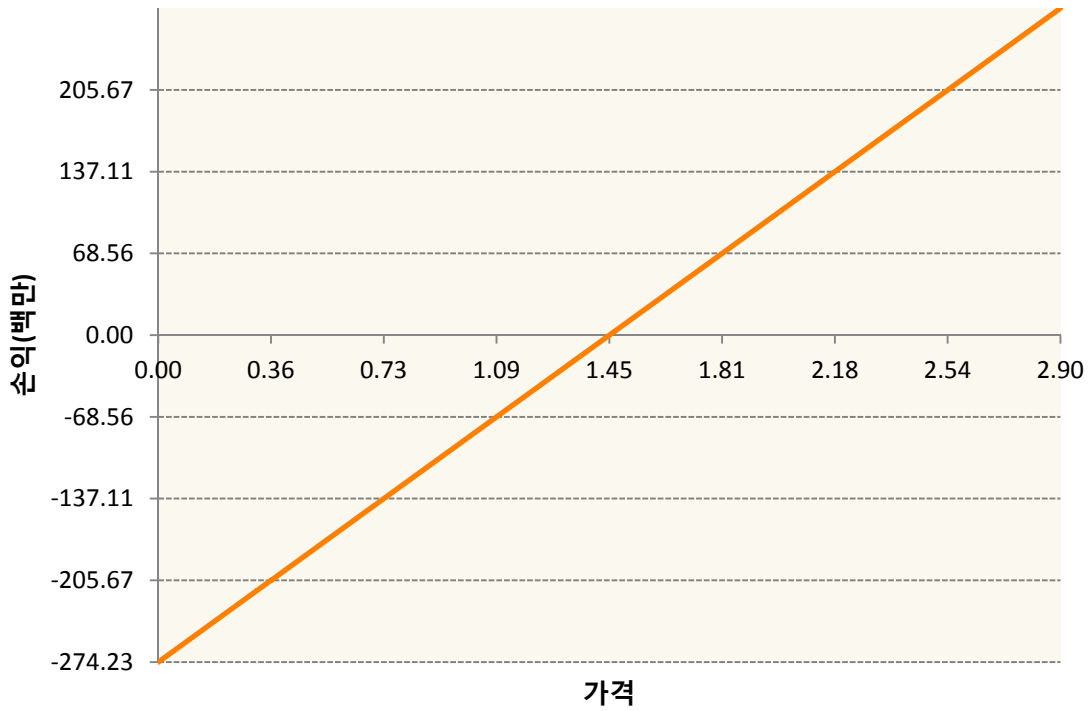
NGH19-NATURAL GAS FUTR Mar19



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	56
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)

407

공시일	2019-02-12
기준일	2019-02-11

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

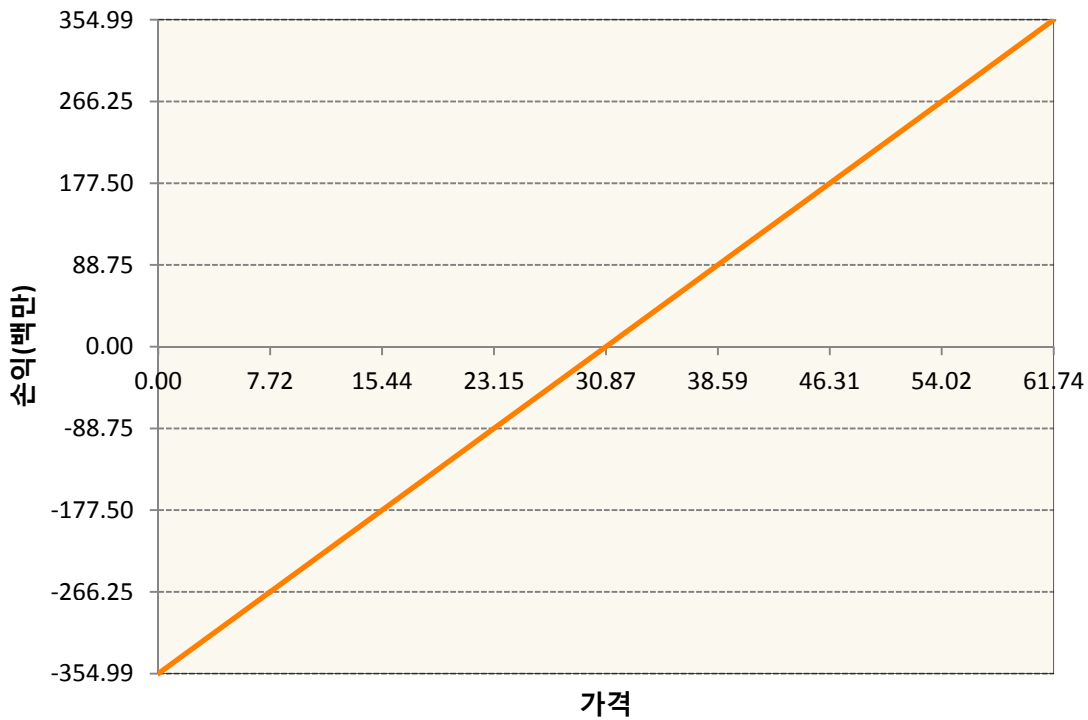
1. 계약금액

(단위:백만원)

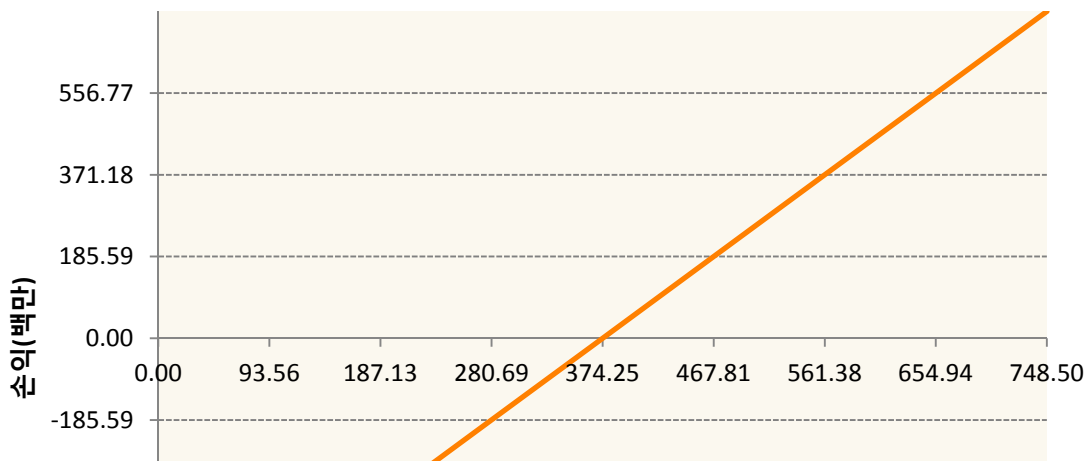
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,572	79	3,494	

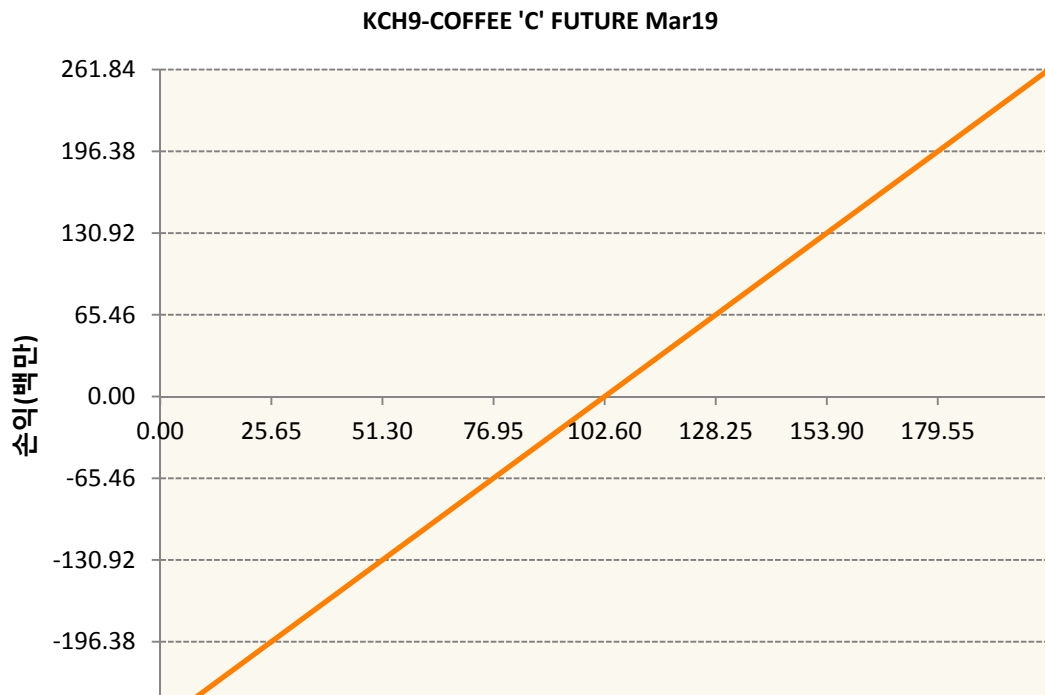
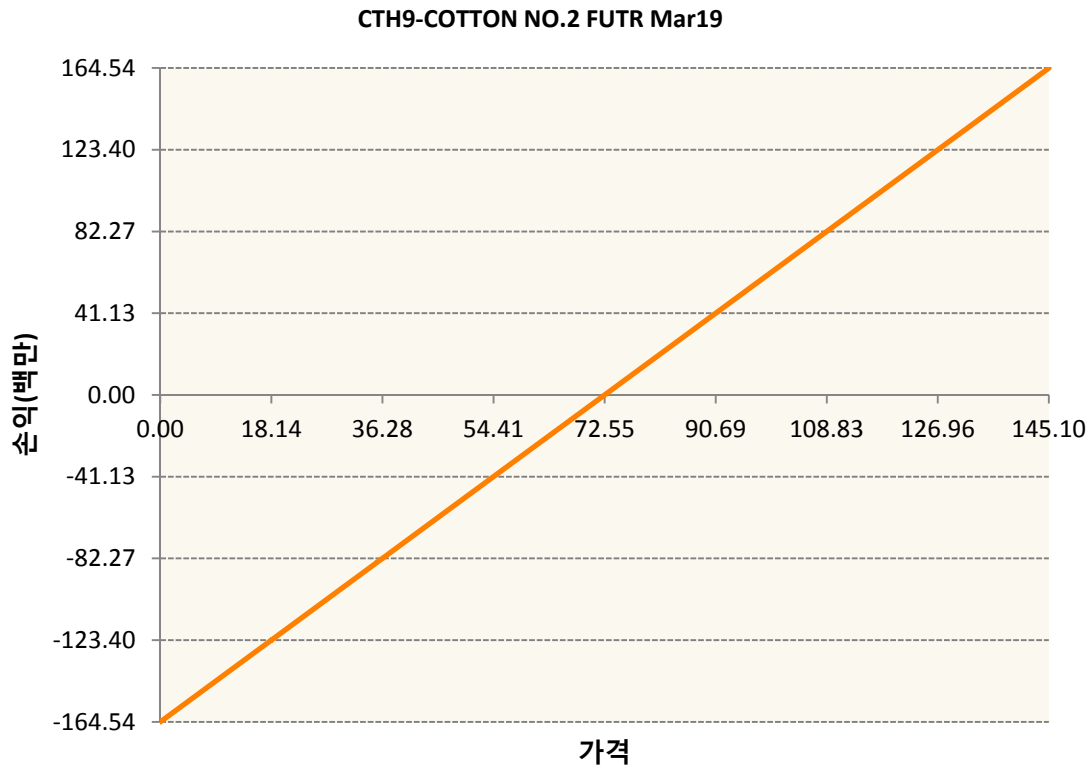
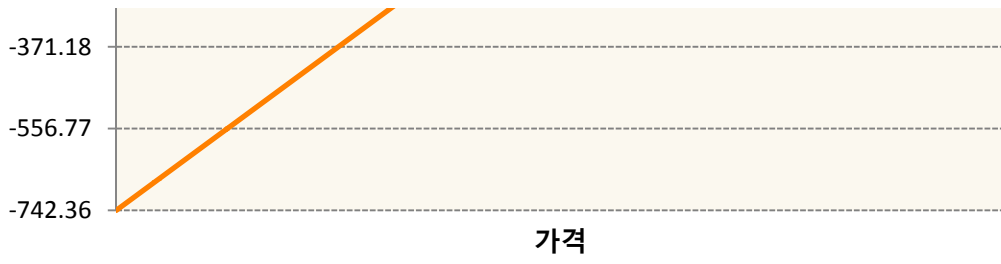
2. 만기시점의 손익구조

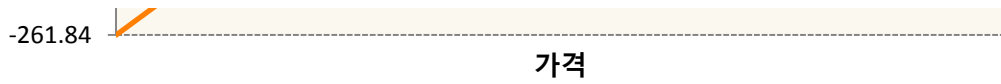
BOH9-SOYBEAN OIL FUTR Mar19



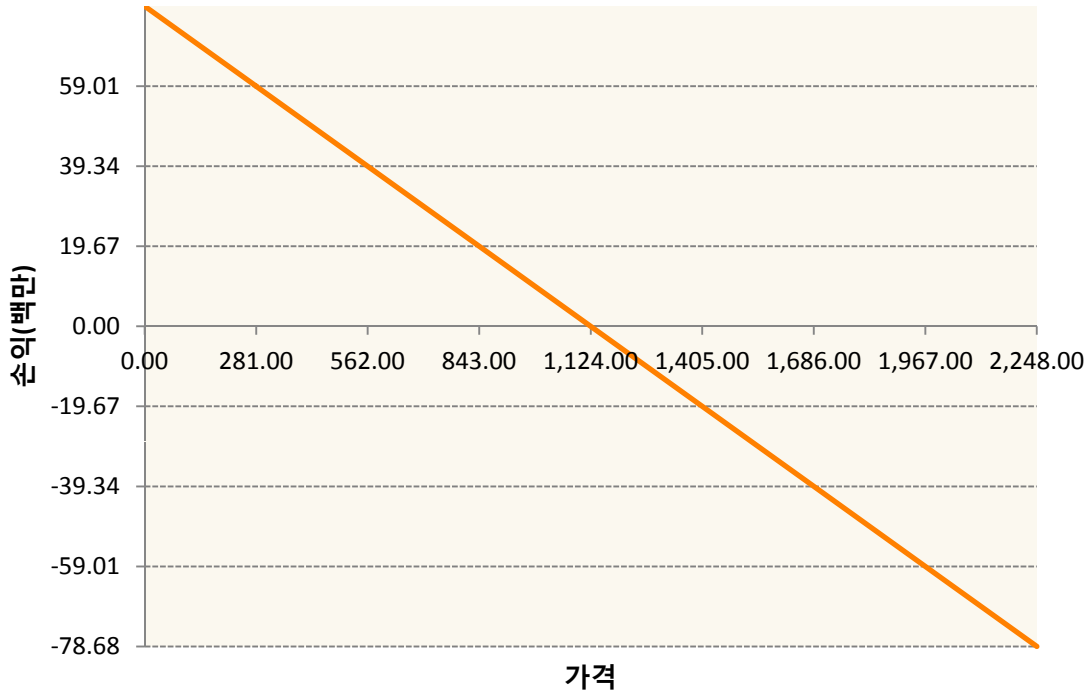
CH9-CORN FUTURE Mar19



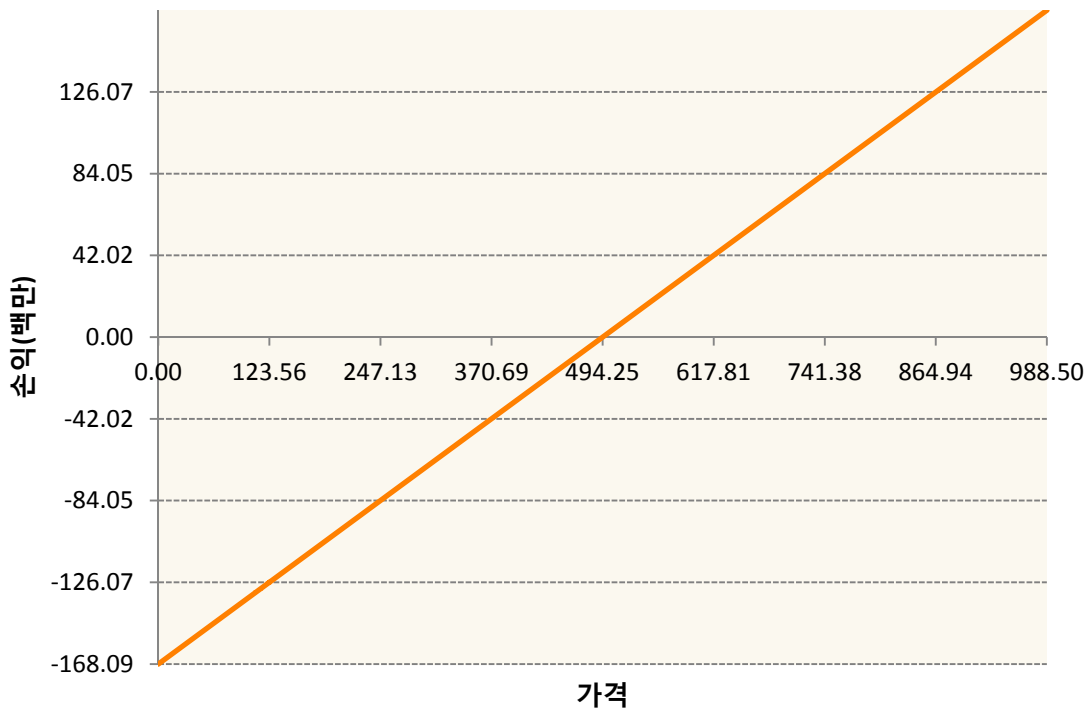




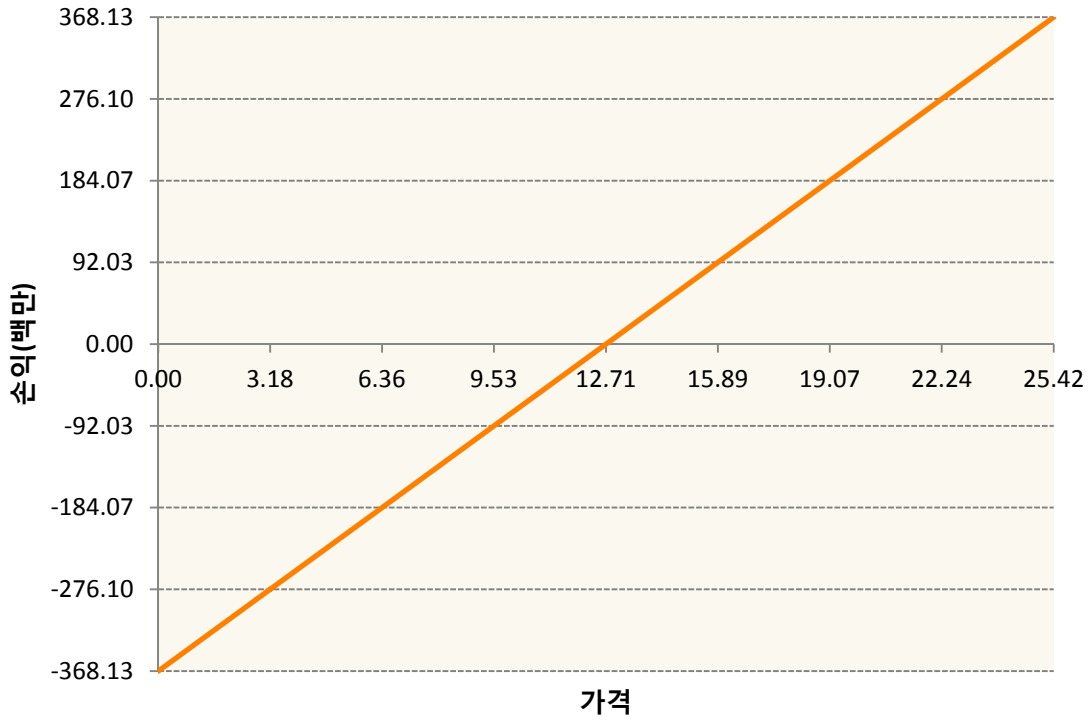
KR4175P20002-2019-02 달러선물



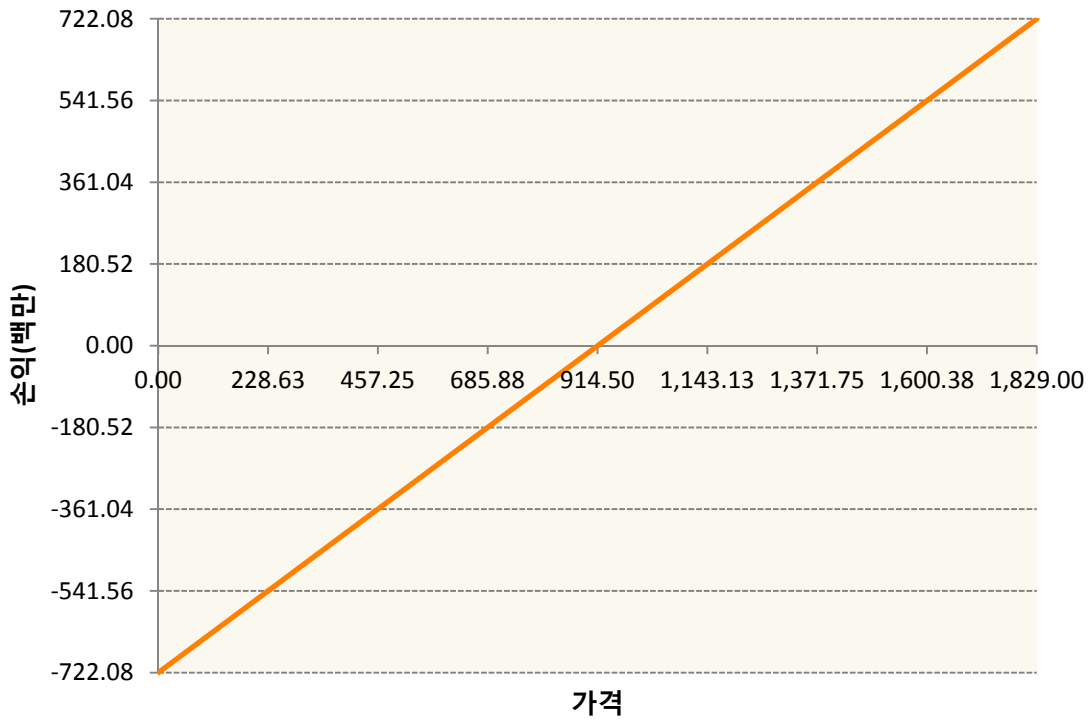
KWH9-KC HRW WHEAT FUT Mar19



SBH9-SUGAR #11 (WORLD) MAR19

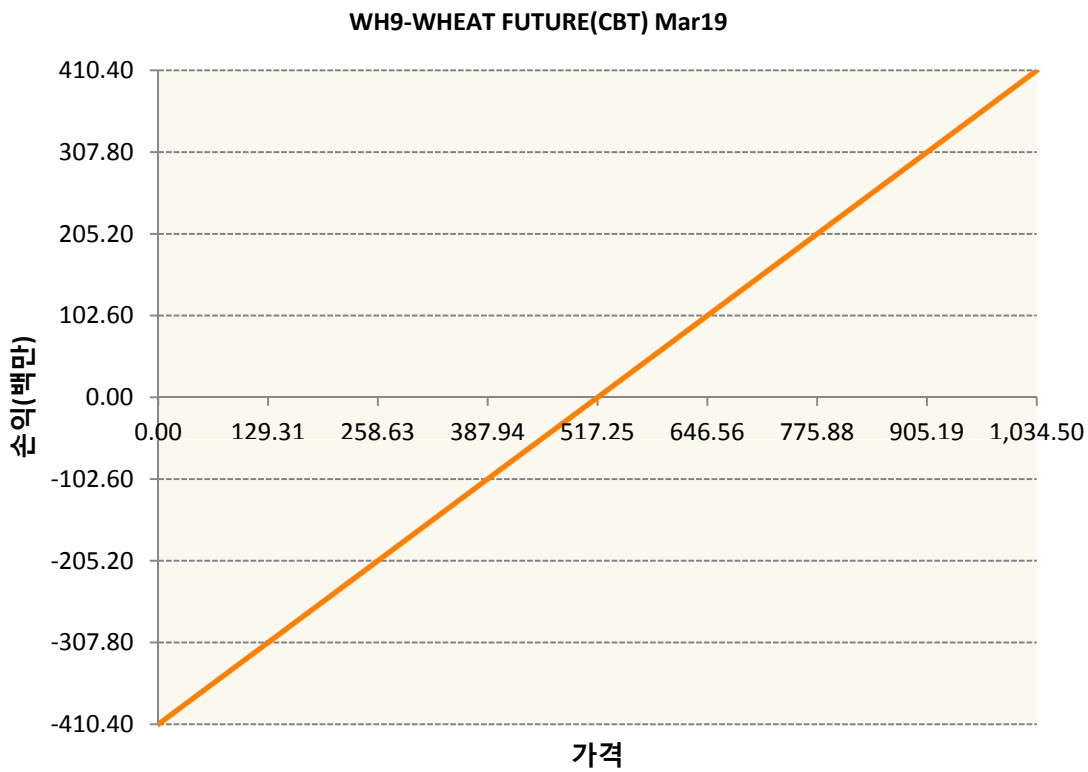
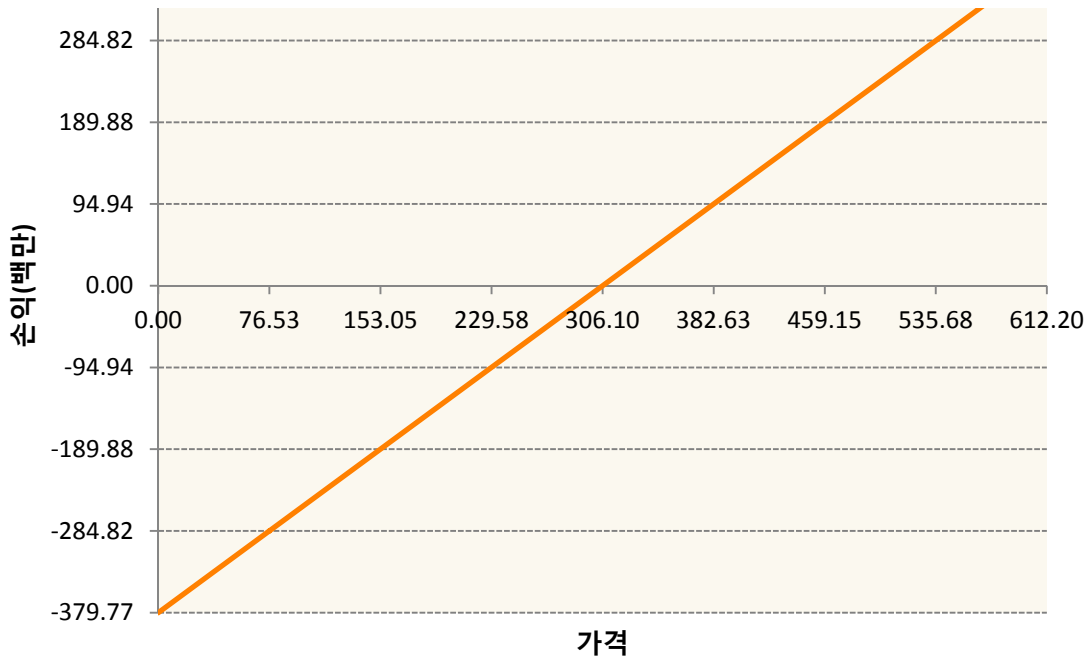


SH9-SOYBEAN FUTURE Mar19



SMH9-SOYBEAN MEAL FUTR Mar19





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

BOH9	SOYBEAN OIL FUTR Mar19	28
CH9	CORN FUTURE Mar19	59
CTH9	COTTON NO.2 FUTR Mar19	13
KCH9	COFFEE 'C' FUTURE Mar19	21
KR4175P200	2019-02 달러선물	6

KWH9	KC HRW WHEAT FUT Mar19	13
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