

공시일	2019-02-13
기준일	2019-02-12

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	2019-02-13
기준일	2019-02-12

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

1,076

* 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	2019-02-13
기준일	2019-02-12

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

275

SWCSI50000 신한CSI500미래S190129

82

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

536

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-02-13
기준일	2019-02-12

유로인덱스모(주식-파생형)

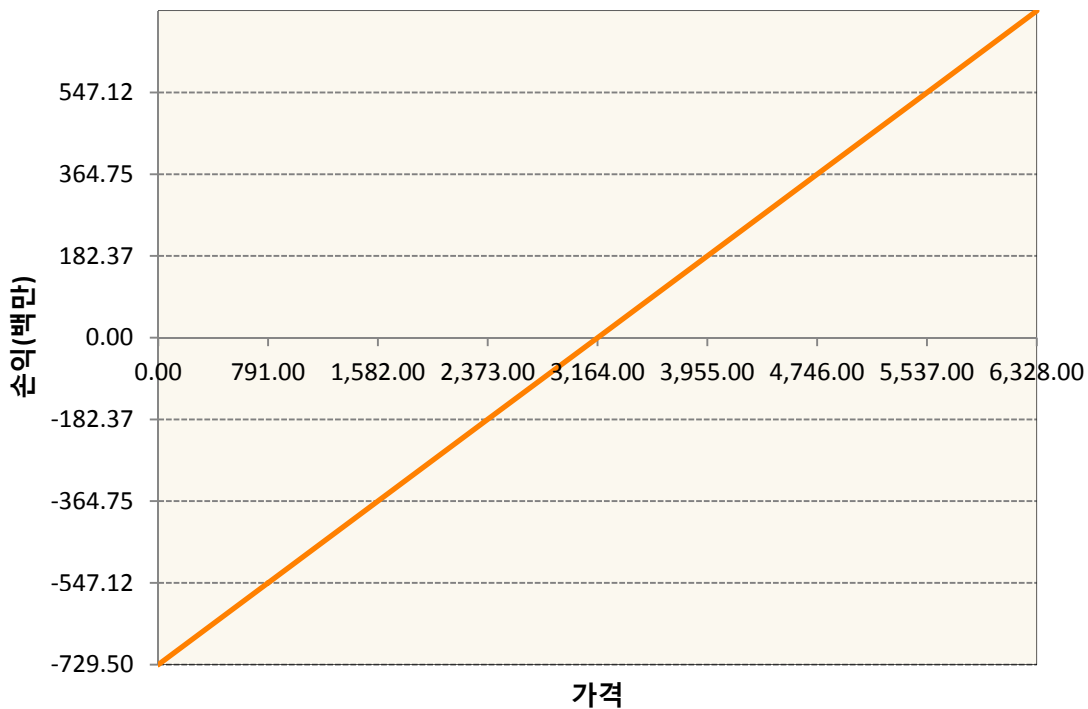
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	729	0	729	

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	2019-02-13
기준일	2019-02-12

차이나인덱스모(주식-파생형)

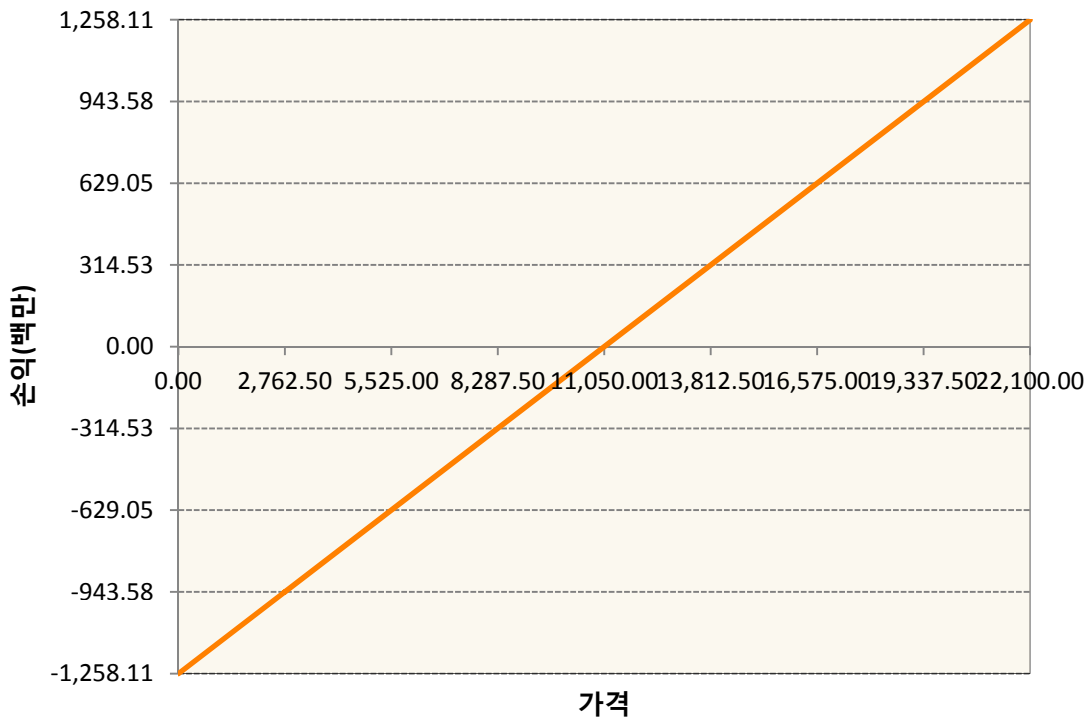
1. 계약금액

(단위:백만원)

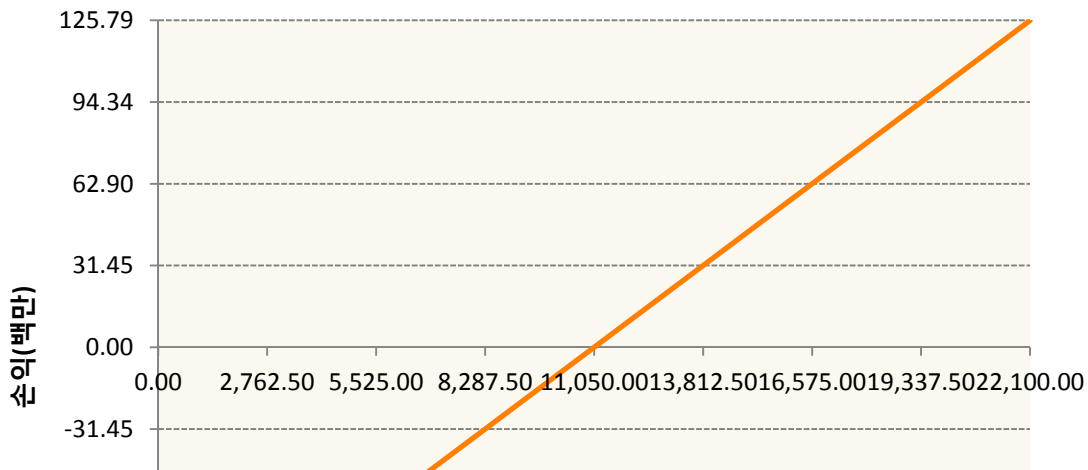
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,384	0	1,384	장내

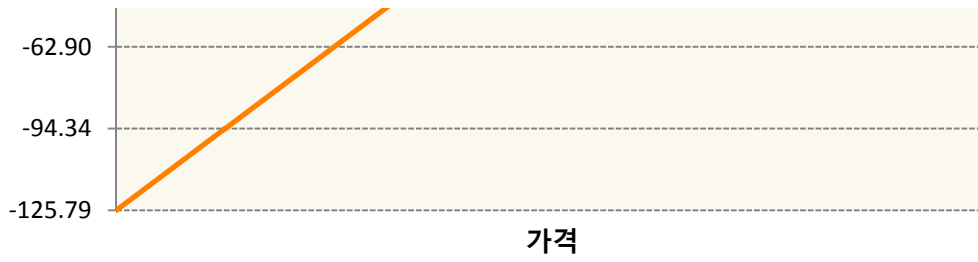
2. 만기시점의 손익구조

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	2019-02-13
기준일	2019-02-12

커버드콜모(주식혼합-파생형)

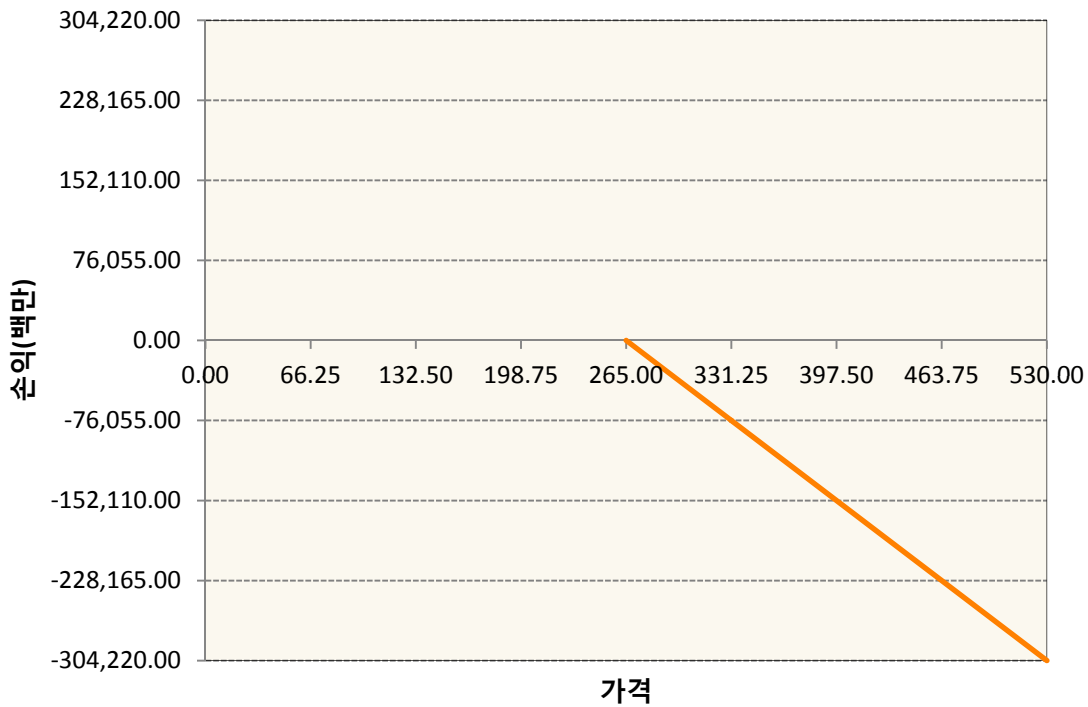
1. 계약금액

(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

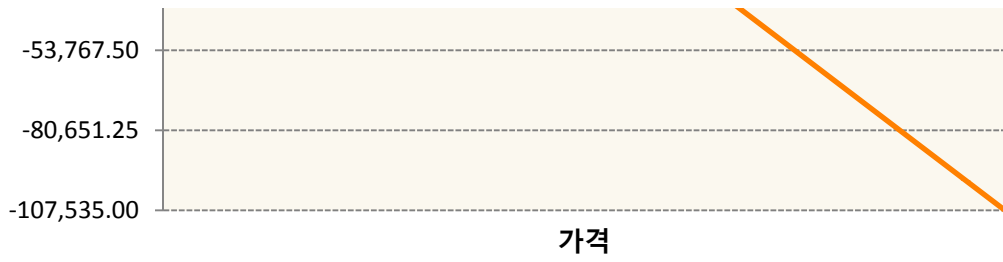
2. 만기시점의 손익구조

KR4201P22655-2019-02 콜265

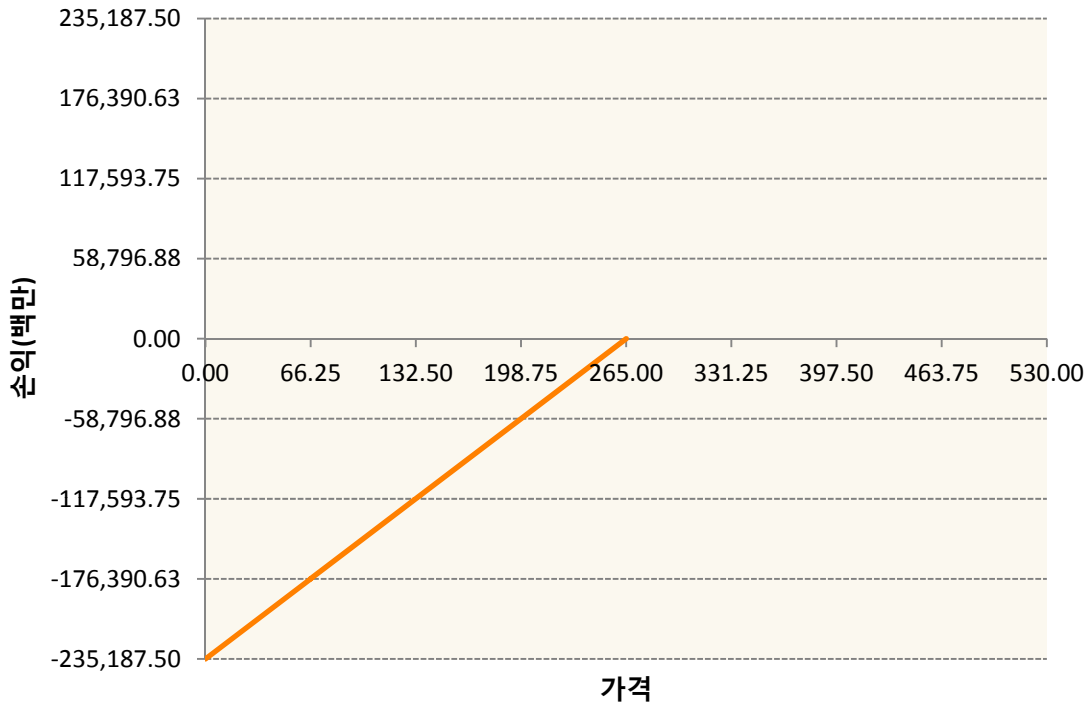


KR4201P22671-2019-02 콜267.5





KR4301P22653-2019-02 풋265



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201P22655		2019-02 콜265					26,051
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	21,130	21,014	20,886	20,749	20,605	20,455	20,300
-5.33%	16,947	16,814	16,672	16,521	16,365	16,204	16,038
-2.67%	8,681	8,676	8,666	8,650	8,626	8,594	8,553
0%	0	0	0	0	-1	-2	-5
2.67%	-8,684	-8,684	-8,684	-8,684	-8,684	-8,684	-8,684
5.33%	-17,367	-17,367	-17,367	-17,367	-17,367	-17,367	-17,367
8.00%	-26,051	-26,051	-26,051	-26,051	-26,051	-26,051	-26,051
KR4201P22671		2019-02 콜267.5					9,122
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	6,481	6,463	6,440	6,412	6,380	6,345	6,306

-5.33%	5,653	5,587	5,520	5,453	5,386	5,318	5,250
-2.67%	3,034	3,026	3,014	2,999	2,979	2,955	2,928
0%	1	1	0	0	-1	-3	-6
2.67%	-3,040	-3,040	-3,040	-3,040	-3,040	-3,040	-3,040
5.33%	-6,081	-6,081	-6,081	-6,081	-6,081	-6,081	-6,081
8.00%	-9,122	-9,122	-9,122	-9,122	-9,122	-9,122	-9,122
KR4301P22653 2019-02 풋265							3,745
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-3,574	-3,590	-3,611	-3,637	-3,669	-3,705	-3,745
-5.33%	-36	-59	-88	-123	-163	-207	-256
-2.67%	0	0	0	0	0	0	-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)

35,436

공시일	2019-02-13
기준일	2019-02-12

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

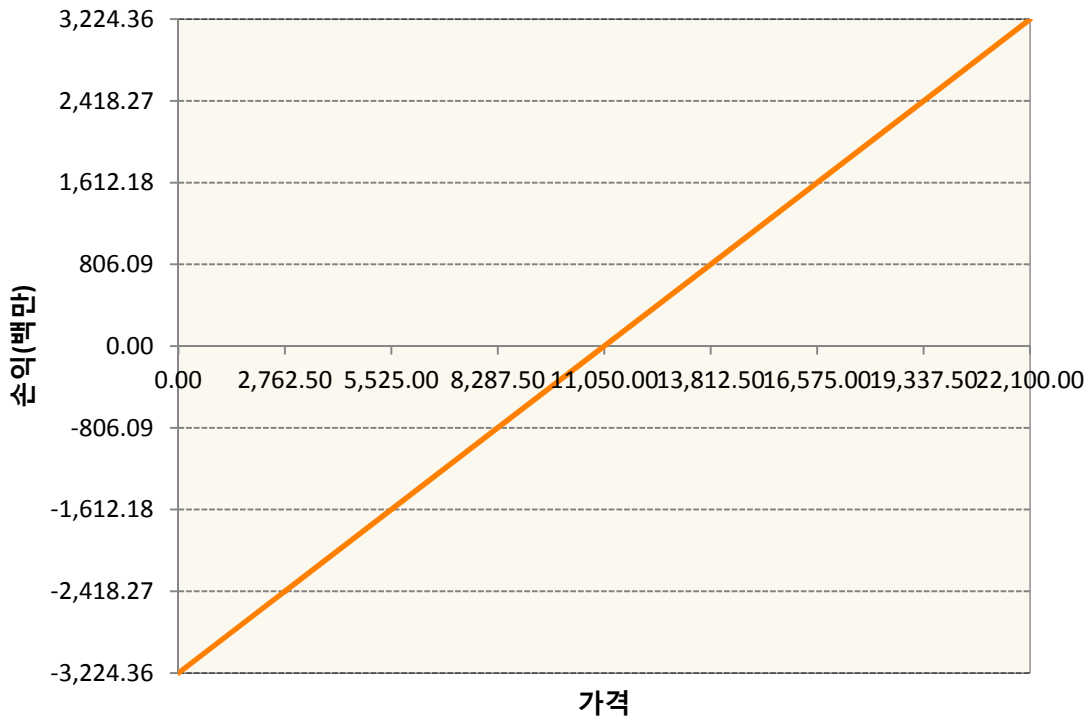
1. 계약금액

(단위:백만원)

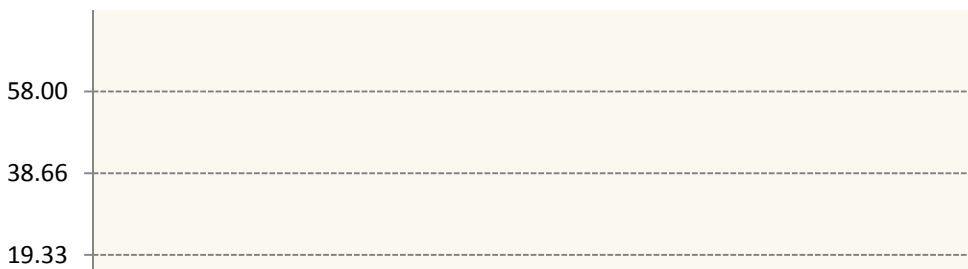
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	3,224	0	3,224	장내
누계	유가증권	옵션	0	7,647	-7,647	장내
누계	통화	선도	0	2,721	-2,721	장외

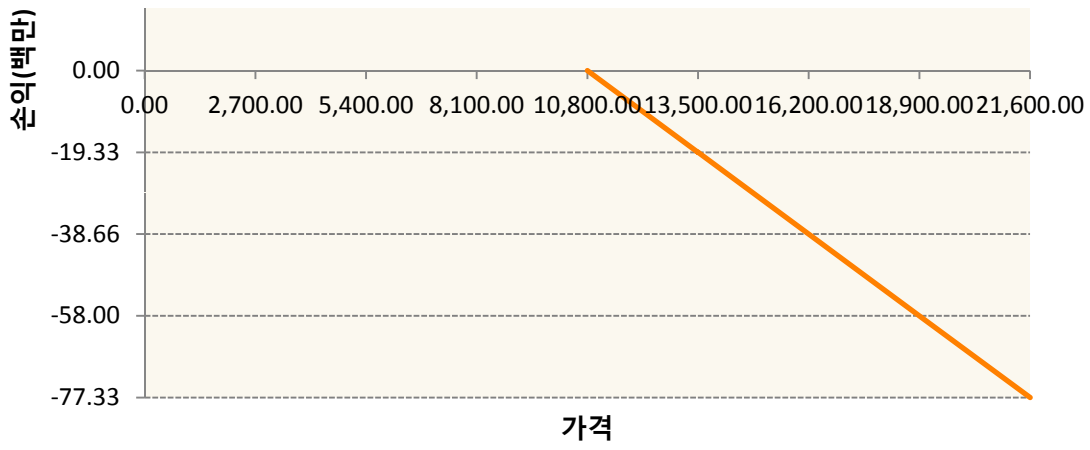
2. 만기시점의 손익구조

HCG9-HSCEI Futures Feb19

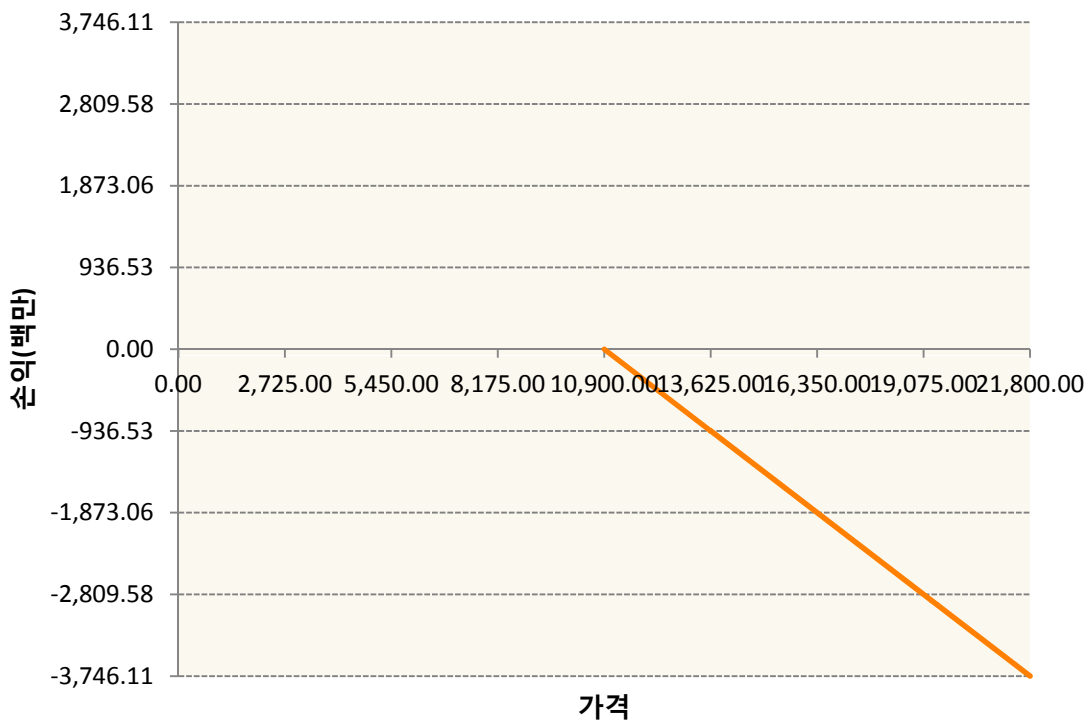


OHHIG9-C108-HSCEI

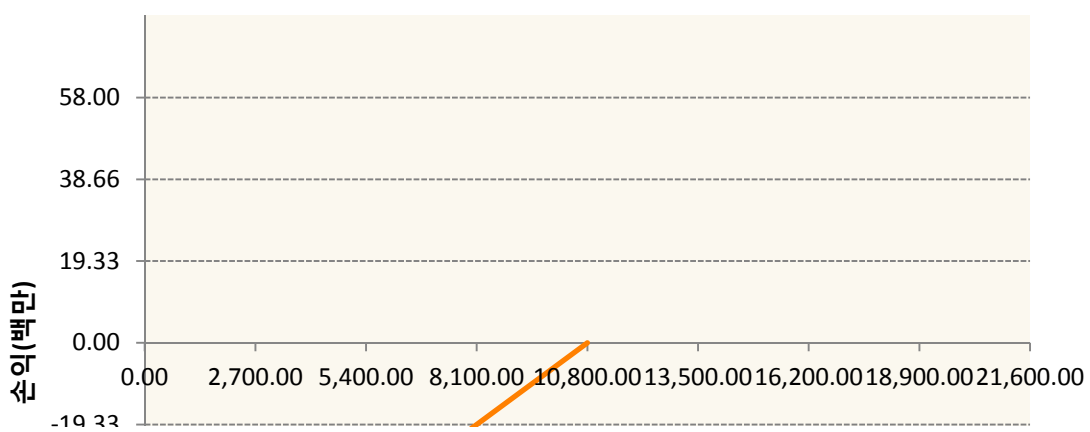


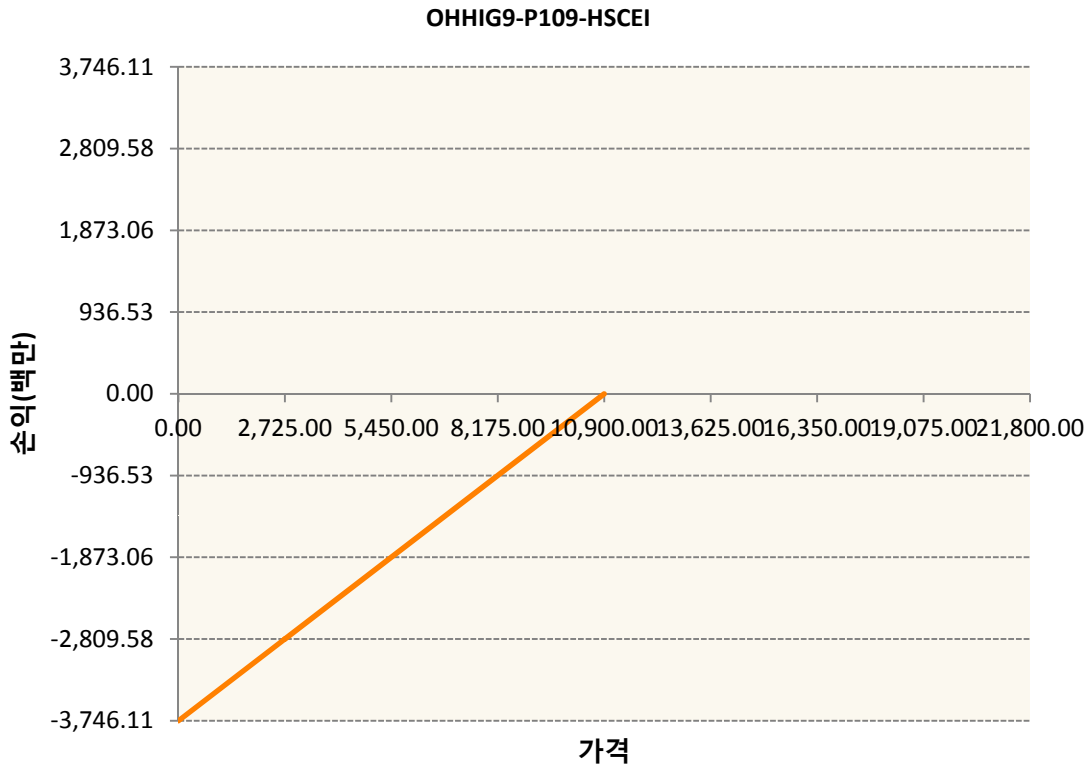
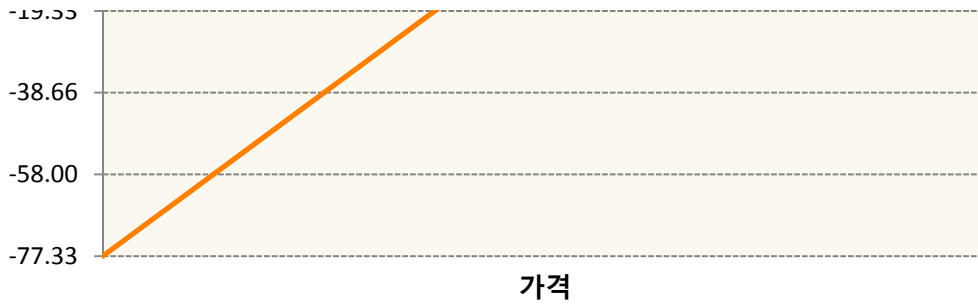


OHHIG9-C109-HSCEI



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	2019-02-13
기준일	2019-02-12

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

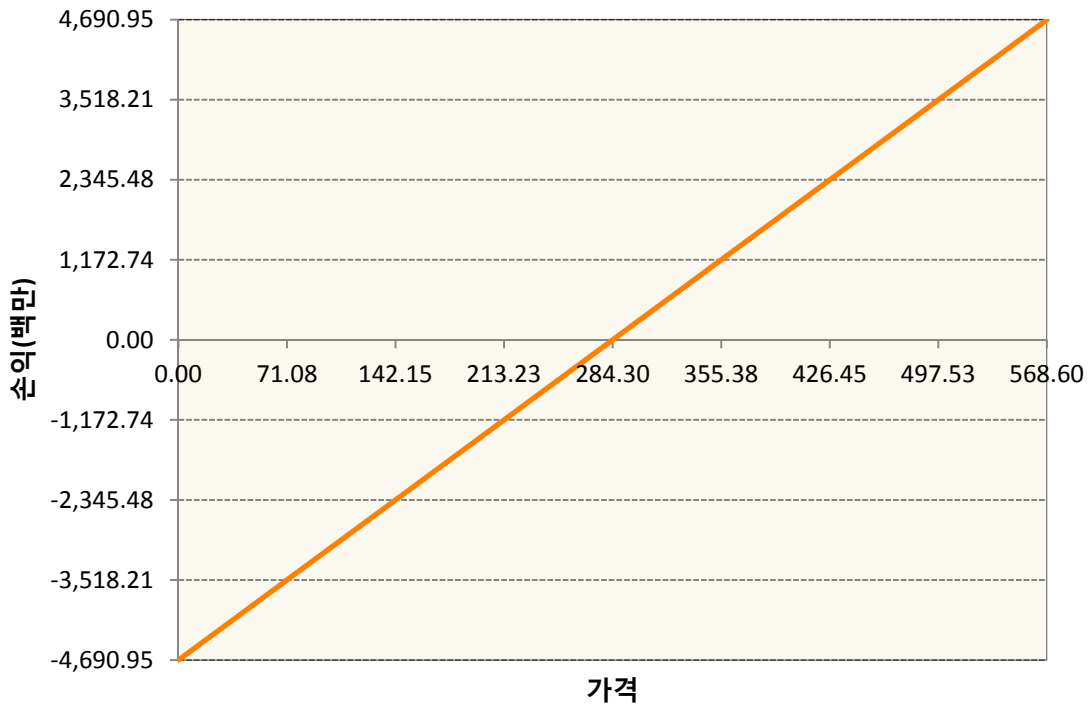
1. 계약금액

(단위:백만원)

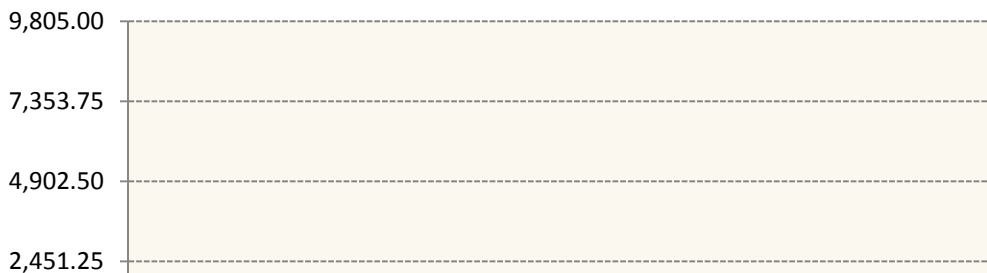
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	4,691	0	4,691	장내
누계	유가증권	스왑	31,836	0	31,836	장외
누계	유가증권	옵션	0	29,674	-29,674	장내

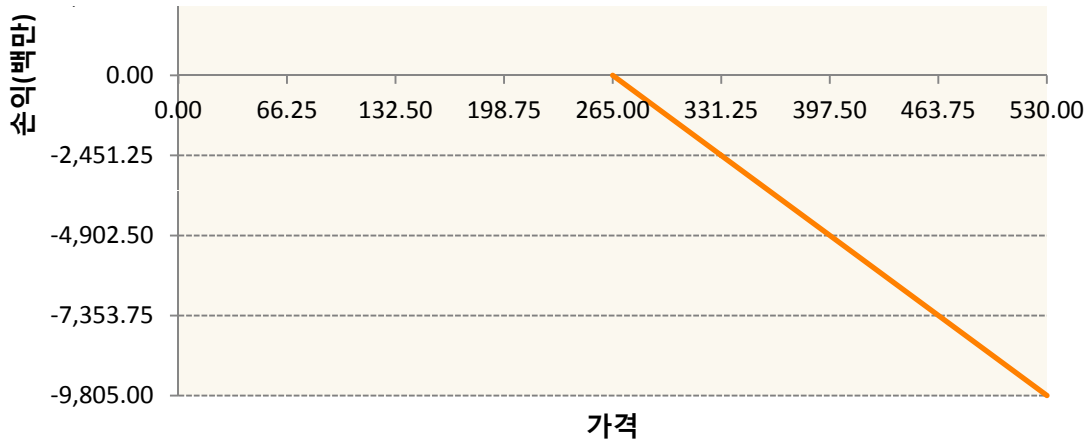
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P30007-2019-03 코스피200지수선물

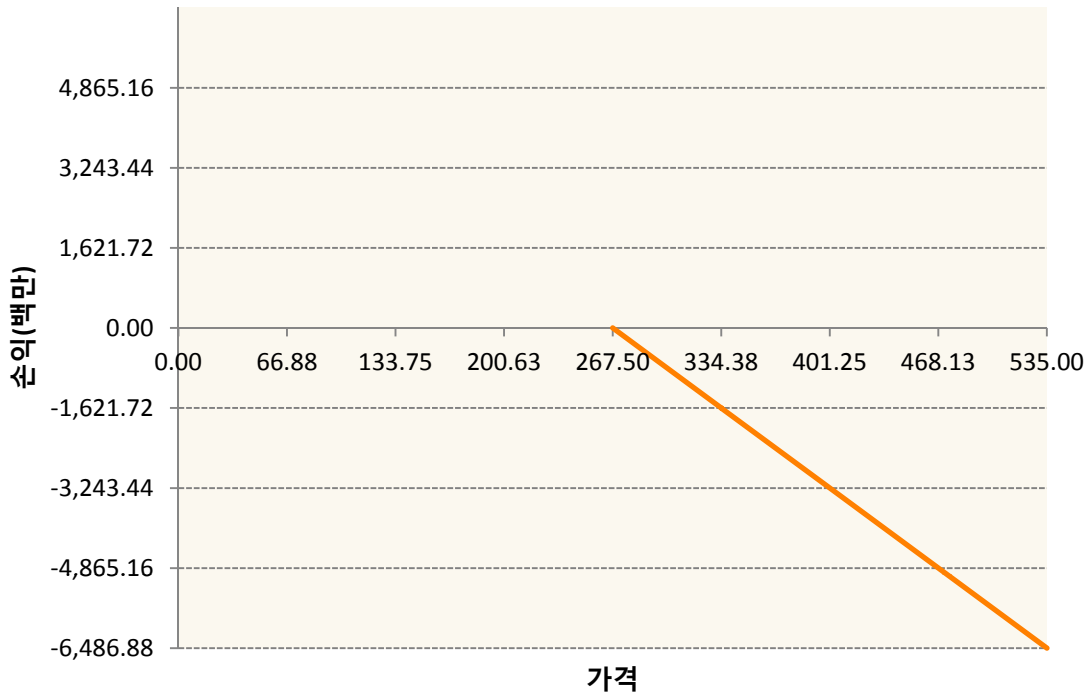


KR4201P22655-2019-02 콜265

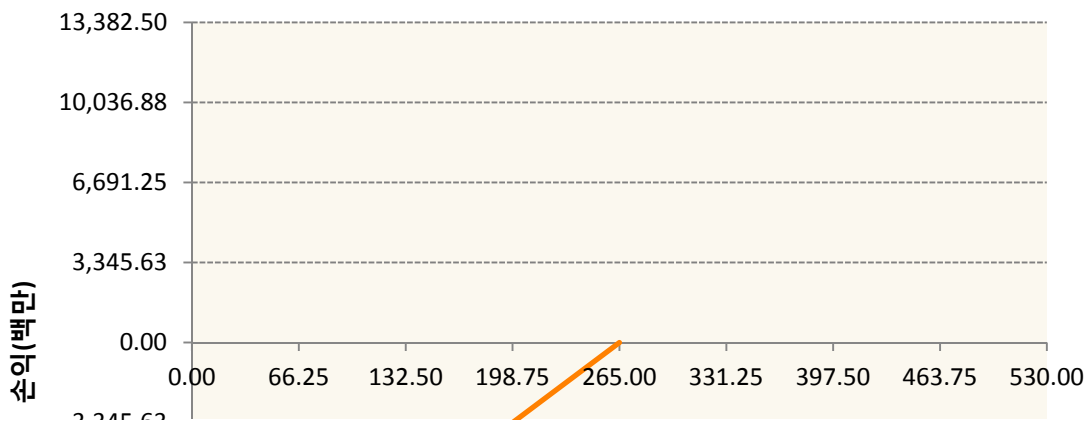


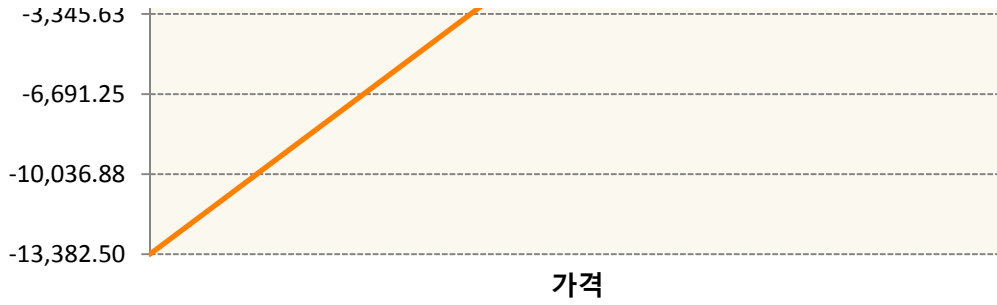


KR4201P22671-2019-02 콜267.5



KR4301P22653-2019-02 풋265





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11		UBCSFXC1 INDEX_14						2,669
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-2,669	-2,669	-2,669	-2,669	-2,669	-2,669	-2,669	
-5.33%	-1,779	-1,779	-1,779	-1,779	-1,779	-1,779	-1,779	
-2.67%	-890	-890	-890	-890	-890	-890	-890	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	890	890	890	890	890	890	890	
5.33%	1,779	1,779	1,779	1,779	1,779	1,779	1,779	
8.00%	2,669	2,669	2,669	2,669	2,669	2,669	2,669	
KR4101P30007		2019-03 코스피200지수선물						374
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-374	-374	-374	-374	-374	-374	-374	
-5.33%	-250	-250	-250	-250	-250	-250	-250	
-2.67%	-125	-125	-125	-125	-125	-125	-125	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	125	125	125	125	125	125	125	
5.33%	250	250	250	250	250	250	250	
8.00%	374	374	374	374	374	374	374	
KR4201P22655		2019-02 콜265						840
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	681	677	673	669	664	659	654	
-5.33%	546	542	537	532	527	522	517	
-2.67%	280	280	279	279	278	277	276	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	-280	-280	-280	-280	-280	-280	-280	
5.33%	-560	-560	-560	-560	-560	-560	-560	
8.00%	-840	-840	-840	-840	-840	-840	-840	
KR4201P22671		2019-02 콜267.5						550
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	

-8.00%	391	390	388	387	385	383	380
-5.33%	341	337	333	329	325	321	317
-2.67%	183	183	182	181	180	178	177
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-183	-183	-183	-183	-183	-183	-183
5.33%	-367	-367	-367	-367	-367	-367	-367
8.00%	-550	-550	-550	-550	-550	-550	-550
KR4301P22653 2019-02 풋265							213
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-203	-204	-205	-207	-209	-211	-213
-5.33%	-2	-3	-5	-7	-9	-12	-15
-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)

4,402

공시일	2019-02-13
기준일	2019-02-12

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

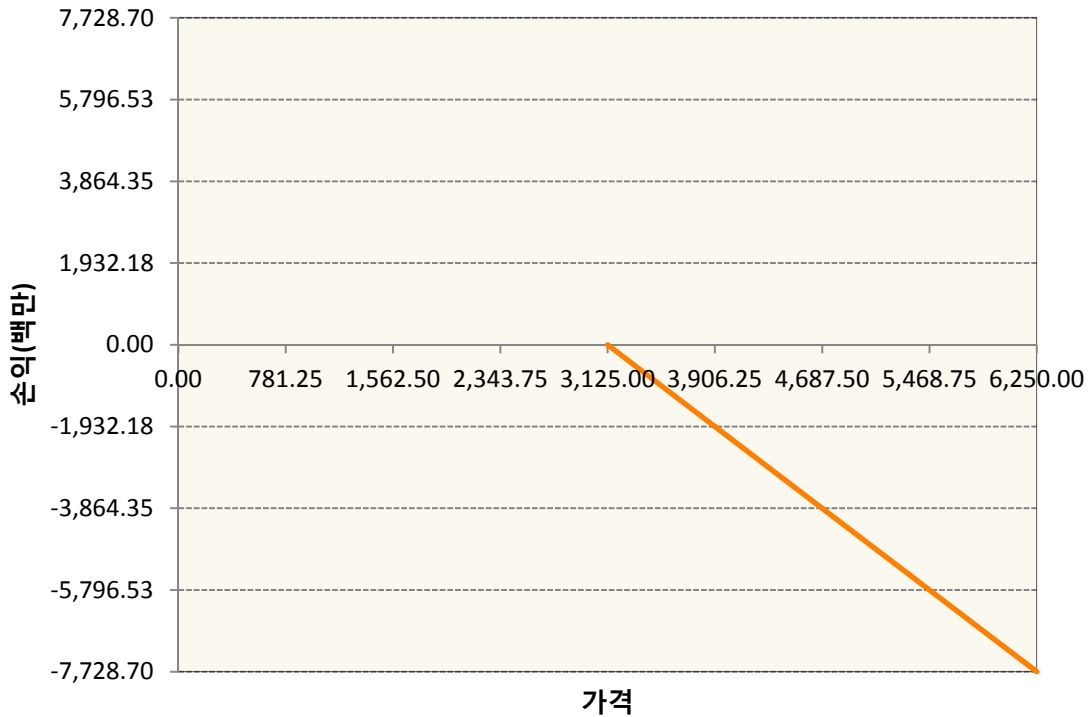
1. 계약금액

(단위:백만원)

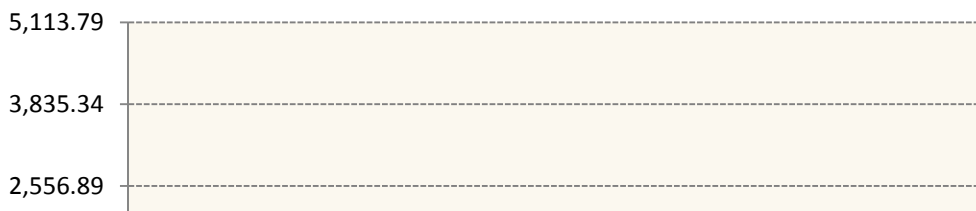
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	6,845	0	6,845	
누계	유가증권	스왑	59,879	0	59,879	장외
누계	유가증권	옵션	0	25,685	-25,685	장내
누계	통화	선도	0	15,220	-15,220	장외

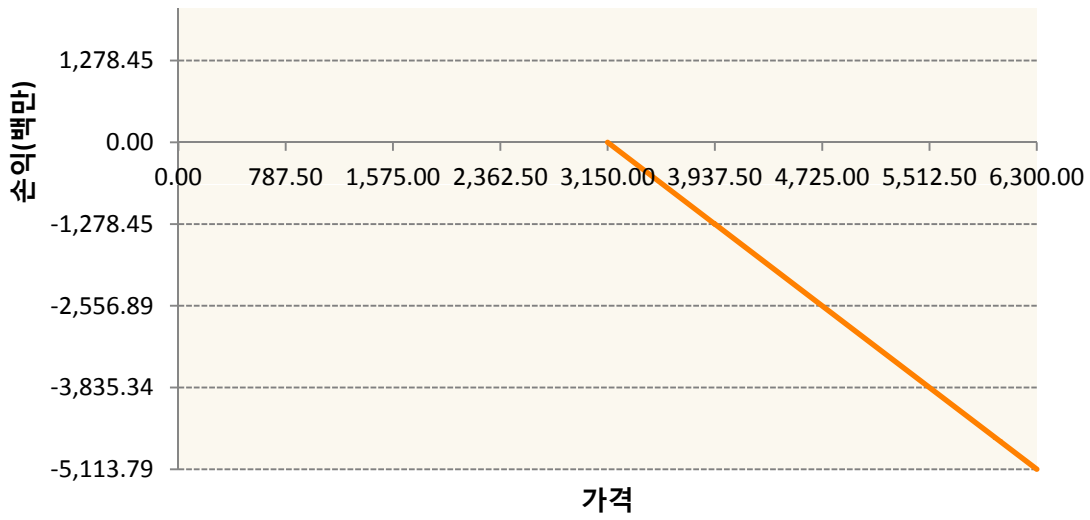
2. 만기시점의 손익구조

OESXG9-C3125-EURO STOXX 50

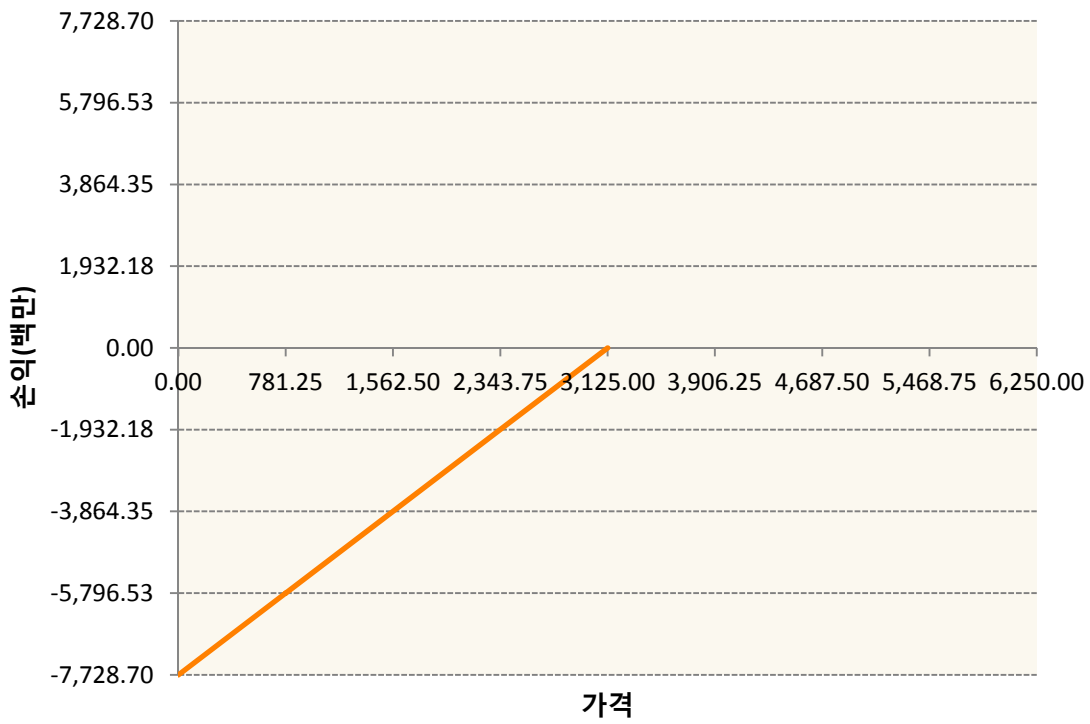


OESXG9-C3150-EURO STOXX 50

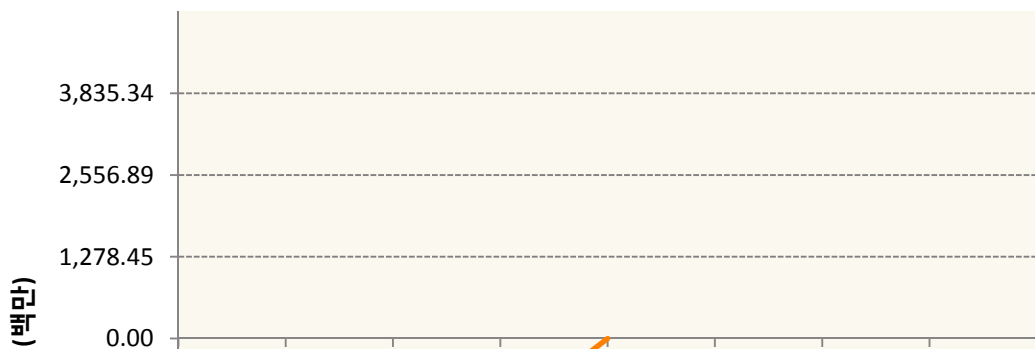


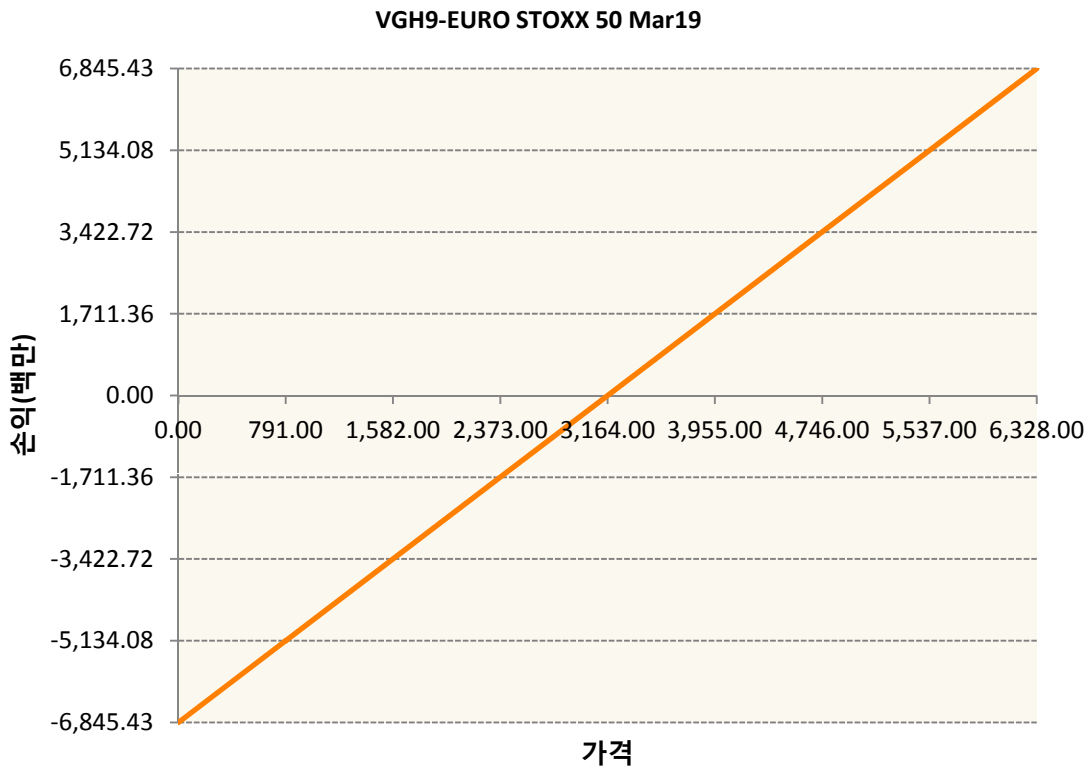
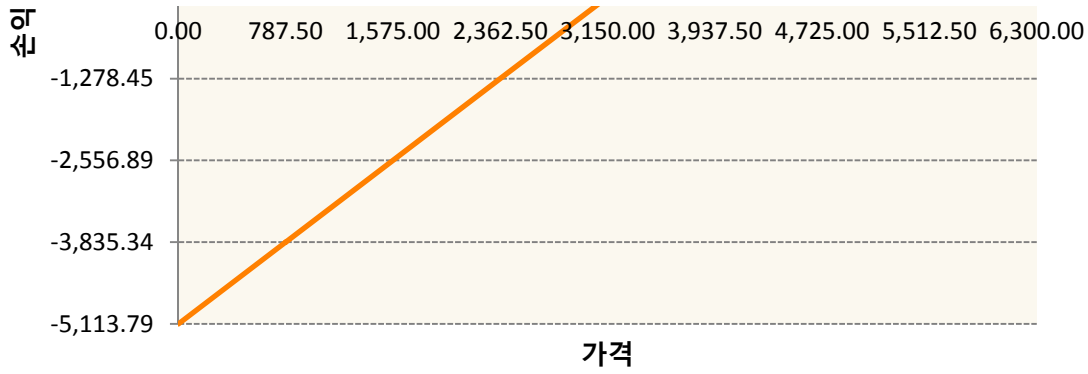


OESXG9-P3125-EURO STOXX 50



OESXG9-P3150-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY		56
FX21018X02 KRW/EUR 22-02-19E		406
FX21018Z03 KRW/EUR 22-03-19E		812
OESXG9-C31EURO STOXX 50		618
OESXG9-C31EURO STOXX 50		409
OESXG9-P31EURO STOXX 50		618
OESXG9-P31EURO STOXX 50		409
VGH9	EURO STOXX 50 Mar19	548

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

(단위:백만원)

2,537

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

(단위:백만원)

1,172

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	2019-02-13
기준일	2019-02-12

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

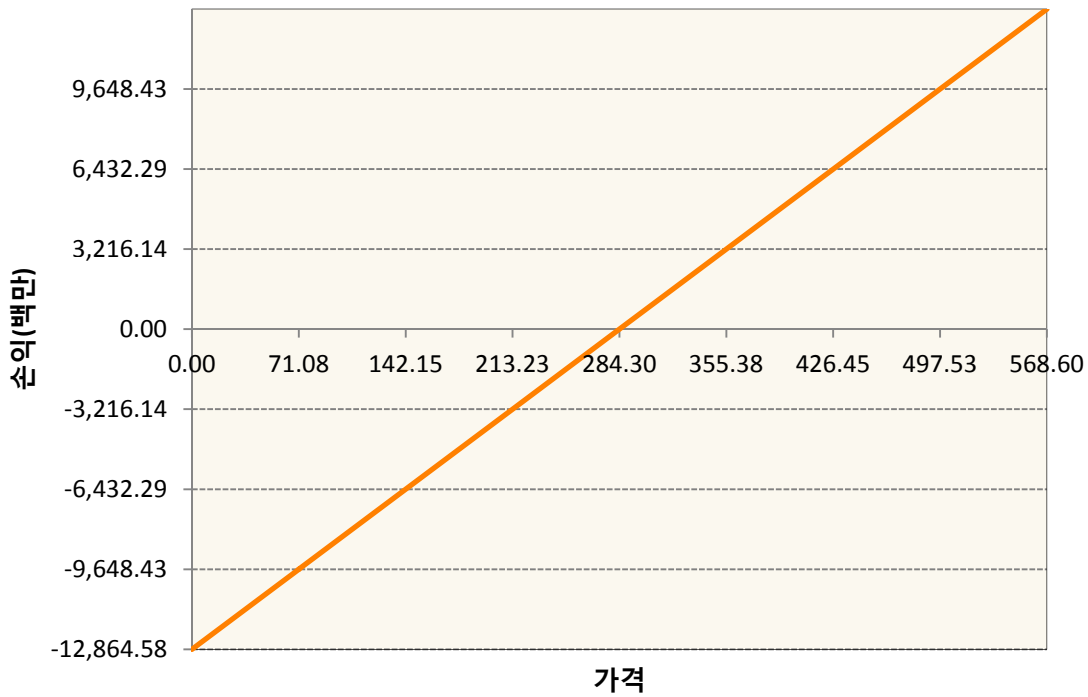
1. 계약금액

(단위:백만원)

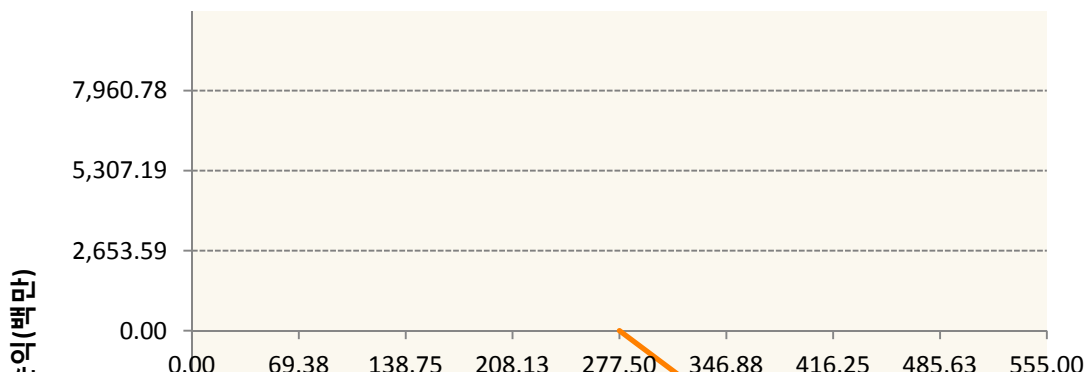
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	12,865	0	12,865	장내
누계	유가증권	옵션	2,523	22,724	-20,202	장내

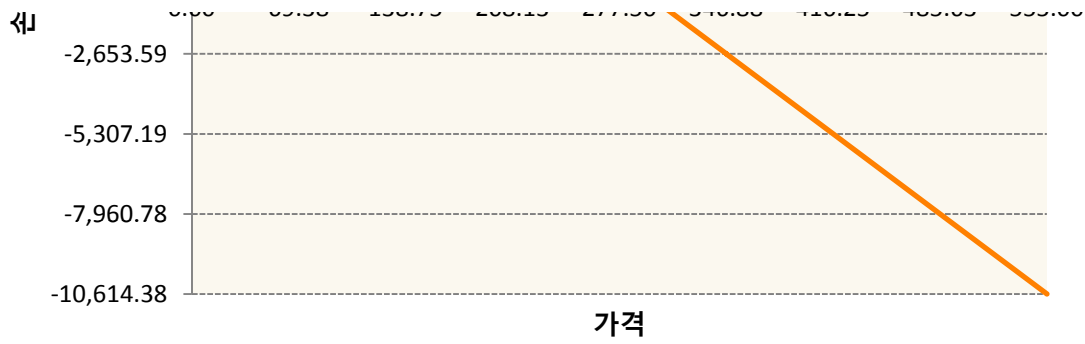
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P30007-2019-03 코스피200지수선물

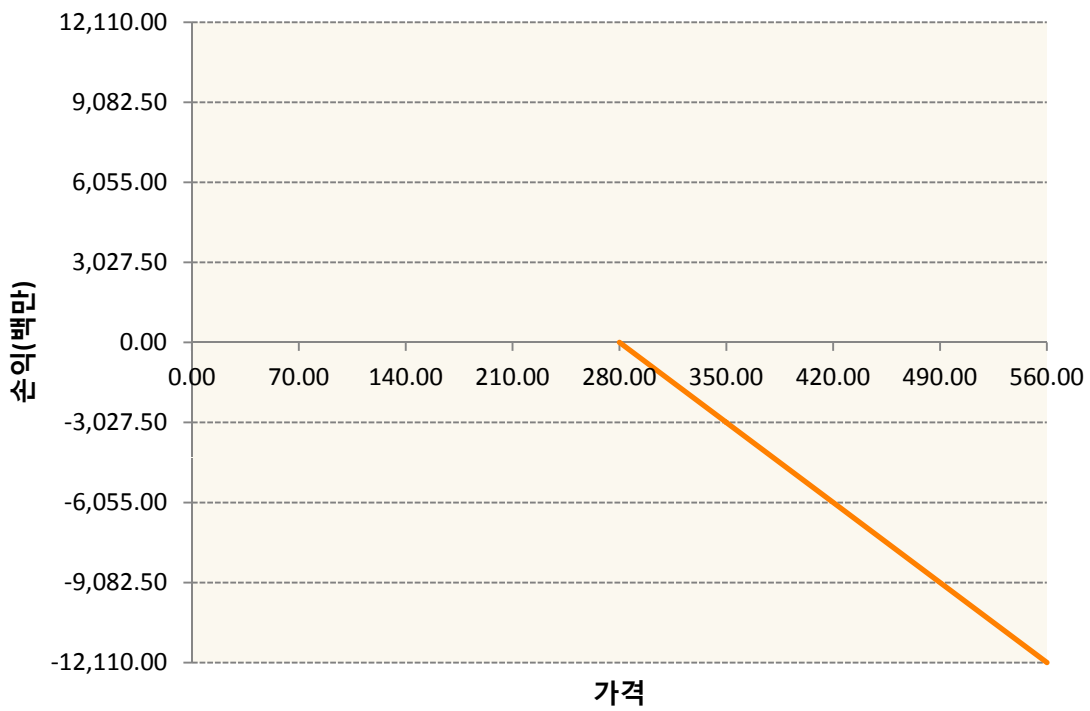


KR4201P22770-2019-02 콜277.5

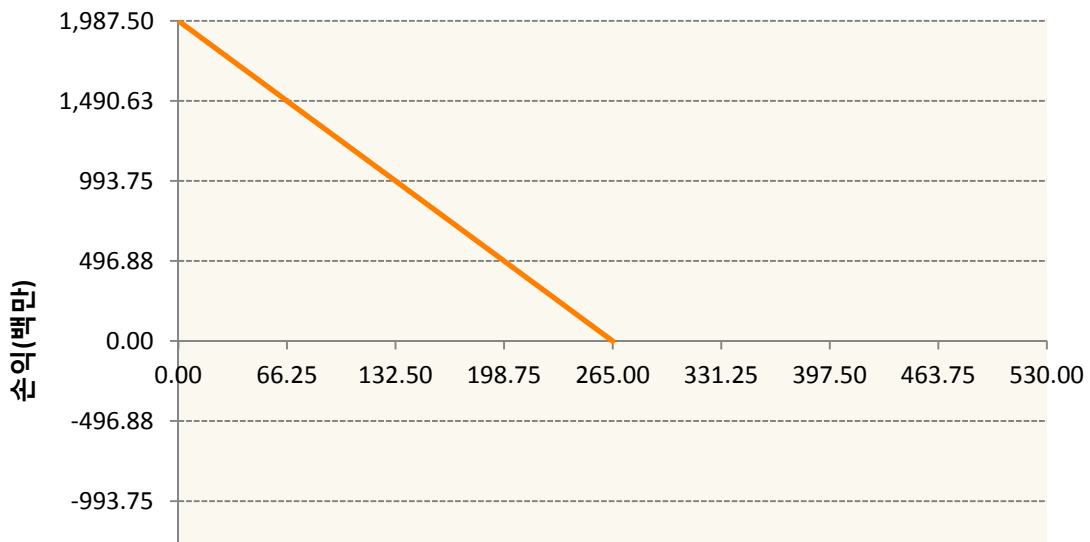


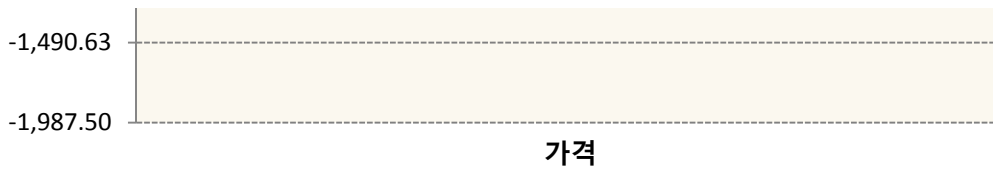


KR4201P22804-2019-02 콜280

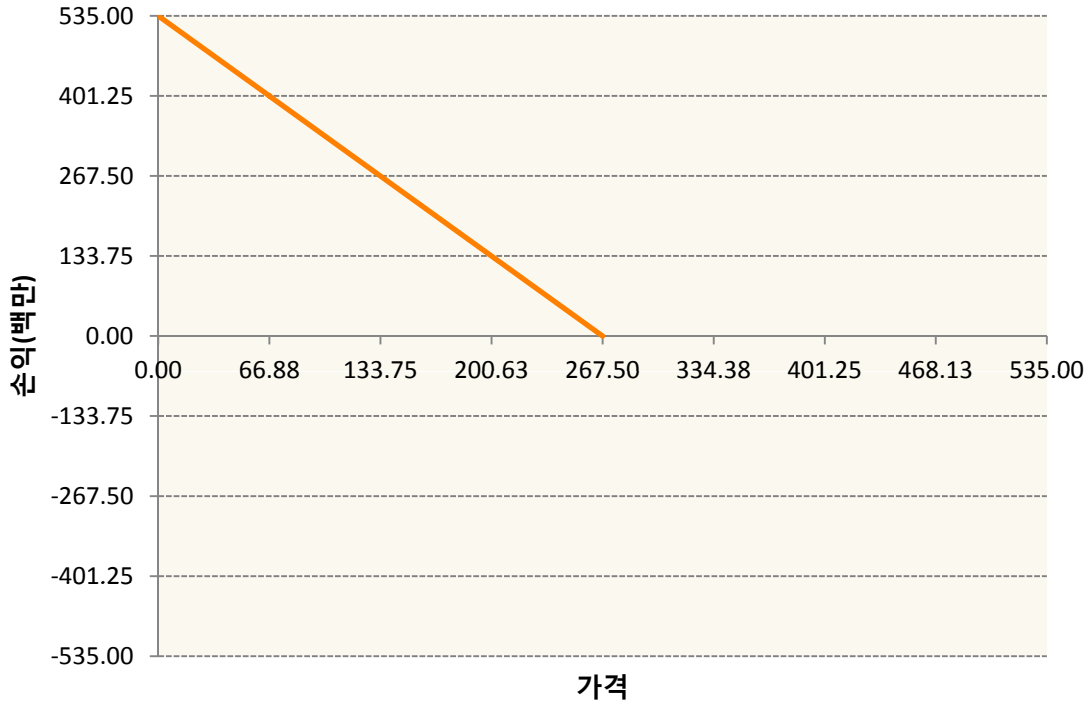


KR4301P22653-2019-02 풋265





KR4301P22679-2019-02 풋267.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101P30007		2019-03 코스피200지수선물						1,027
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-1,027	-1,027	-1,027	-1,027	-1,027	-1,027	-1,027	
-5.33%	-685	-685	-685	-685	-685	-685	-685	
-2.67%	-342	-342	-342	-342	-342	-342	-342	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	342	342	342	342	342	342	342	
5.33%	685	685	685	685	685	685	685	
8.00%	1,027	1,027	1,027	1,027	1,027	1,027	1,027	
KR4201P22770		2019-02 콜277.5						855
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	250	250	250	249	249	249	249	
-5.33%	249	248	247	246	244	242	240	
-2.67%	211	205	199	192	186	179	172	

0%	9	6	3	0	-4	-8	-12
2.67%	-277	-277	-277	-277	-277	-278	-279
5.33%	-566	-566	-566	-566	-566	-566	-566
8.00%	-855	-855	-855	-855	-855	-855	-855
KR4201P22804 2019-02 콜280							947
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	194	194	194	194	194	194	194
-5.33%	194	194	193	193	192	191	189
-2.67%	179	174	168	162	156	150	144
0%	17	12	6	0	-6	-13	-19
2.67%	-293	-293	-294	-294	-296	-297	-299
5.33%	-620	-620	-620	-620	-620	-620	-620
8.00%	-947	-947	-947	-947	-947	-947	-947
KR4301P22653 2019-02 풋265							32
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	30	30	31	31	31	31	32
-5.33%	0	0	1	1	1	2	2
-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							13
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	13	13	13	13	13	13	13
-5.33%	1	1	1	1	2	2	2
-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)

3,237

공시일	2019-02-13
기준일	2019-02-12

H2O글로벌본드(USD)(채권혼합-파

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	34	0	34	
누계	유가증권	수익증권	796	0	796	

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	2019-02-13
기준일	2019-02-12

H2O글로벌본드(UH)(채권혼합-파)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	674	0	674	
누계	유가증권	수익증권	4,167	0	4,167	

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	2019-02-13
기준일	2019-02-12

H2O글로벌본드(H)(채권혼합-파생)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	674	0	674	
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	수익증권	17,033	0	17,033	
누계	통화	선도	0	17,320	-17,320	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)

524

공시일	2019-02-13
기준일	2019-02-12

스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

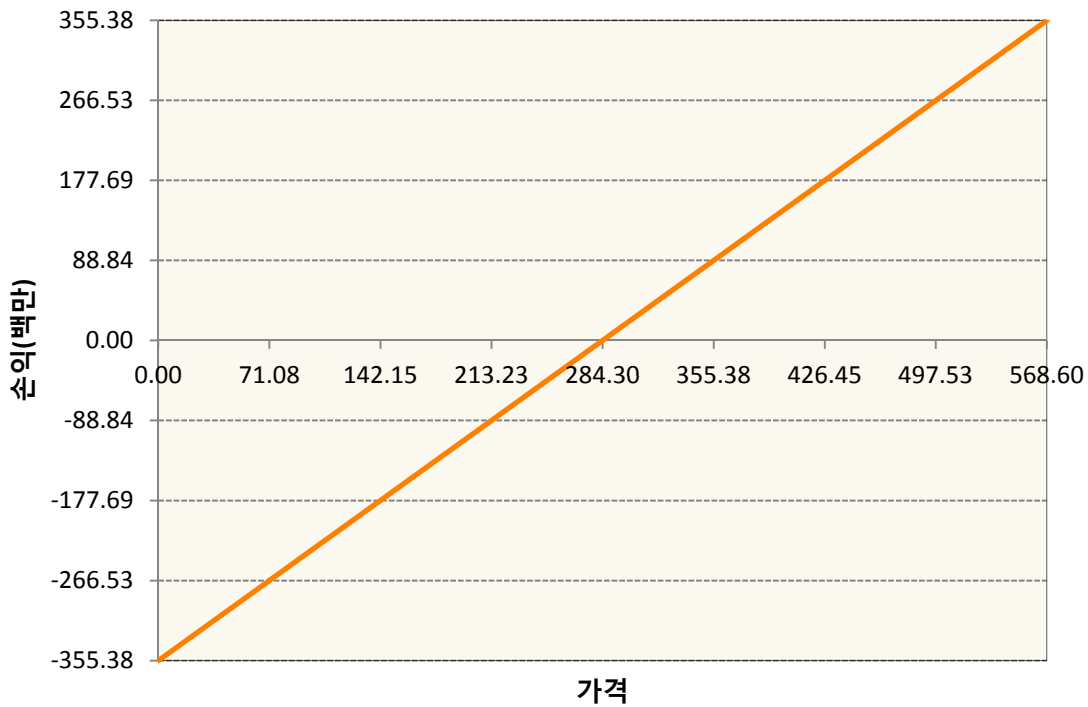
1. 계약금액

(단위:백만원)

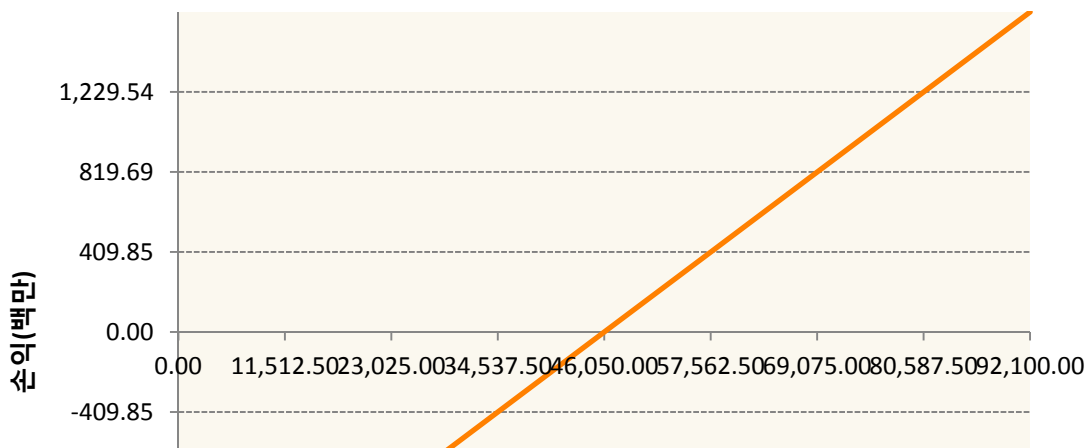
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,995	0	1,995	장내

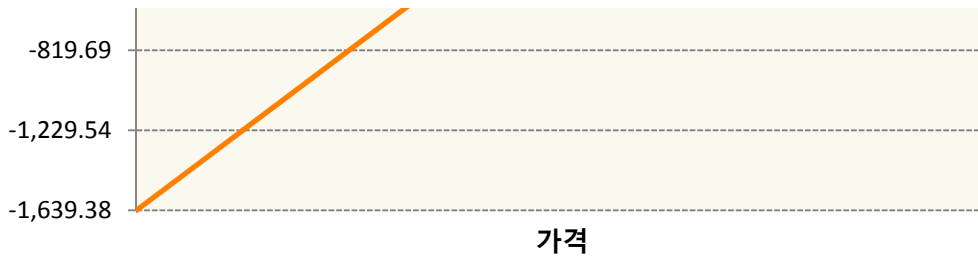
2. 만기시점의 손익구조

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						131
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-131	-131	-131	-131	-131	-131	-131	
-5.33%	-87	-87	-87	-87	-87	-87	-87	
-2.67%	-44	-44	-44	-44	-44	-44	-44	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	44	44	44	44	44	44	44	
5.33%	87	87	87	87	87	87	87	
8.00%	131	131	131	131	131	131	131	

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

180

공시일	2019-02-13
기준일	2019-02-12

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

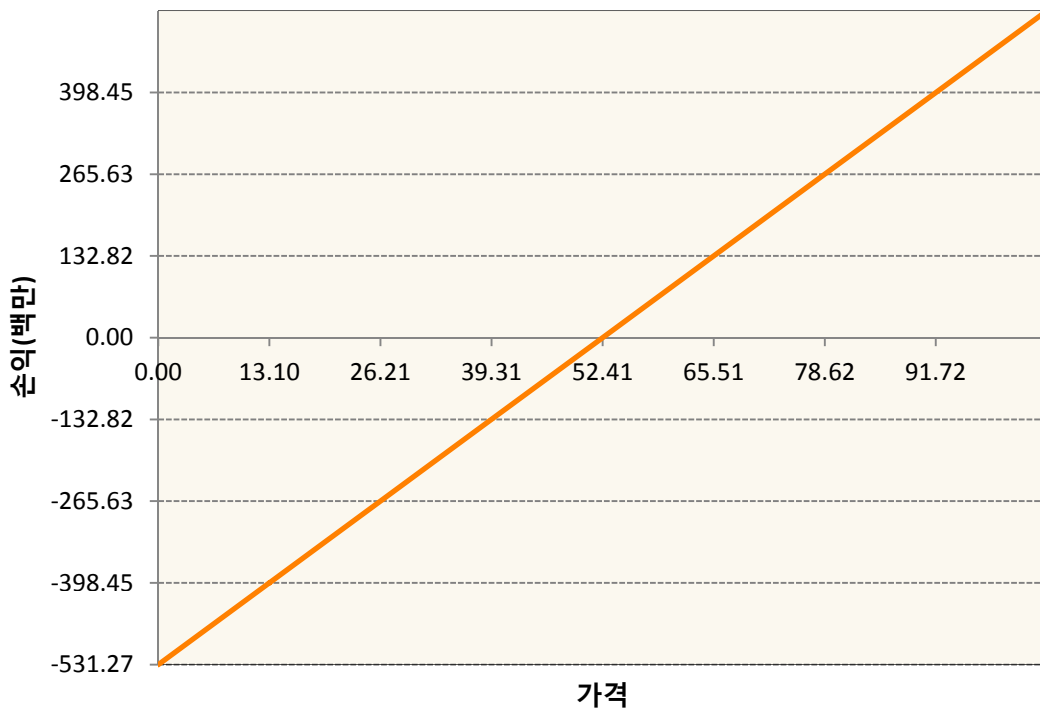
1. 계약금액

(단위:백만원)

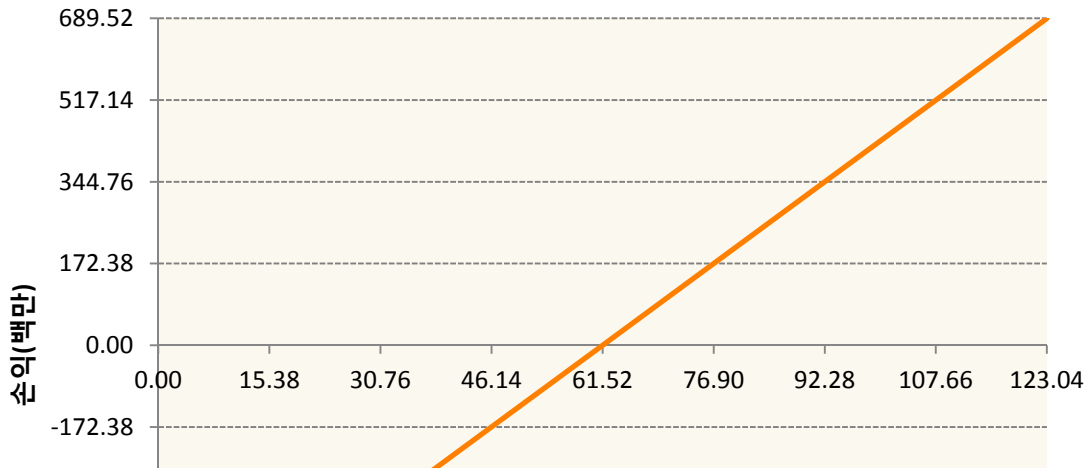
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,635	281	2,354	

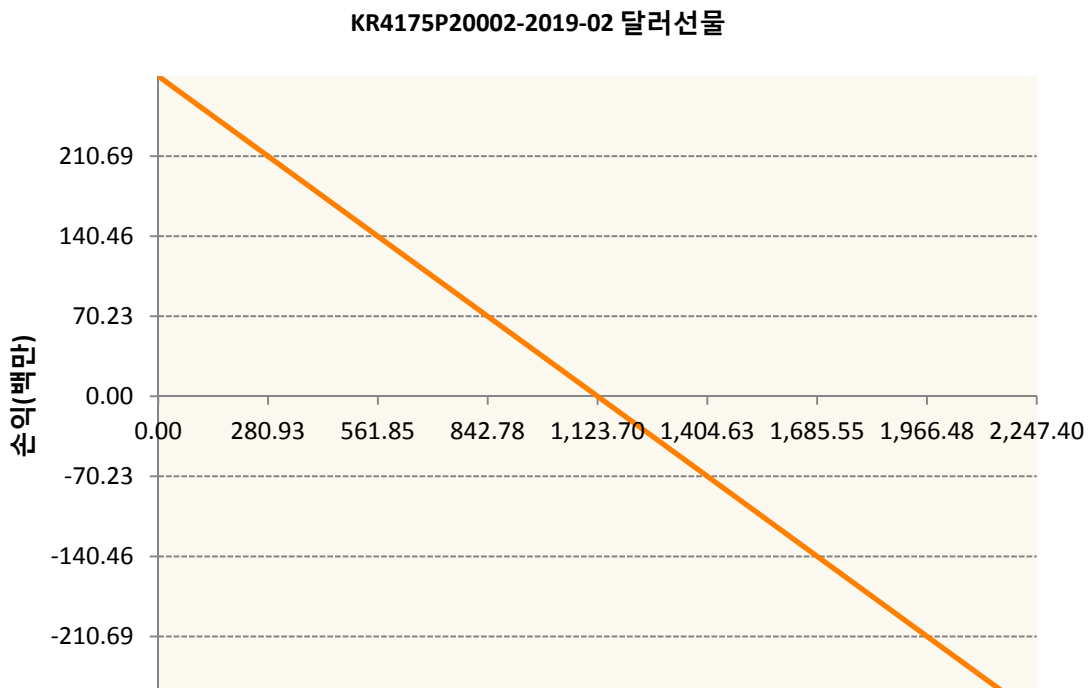
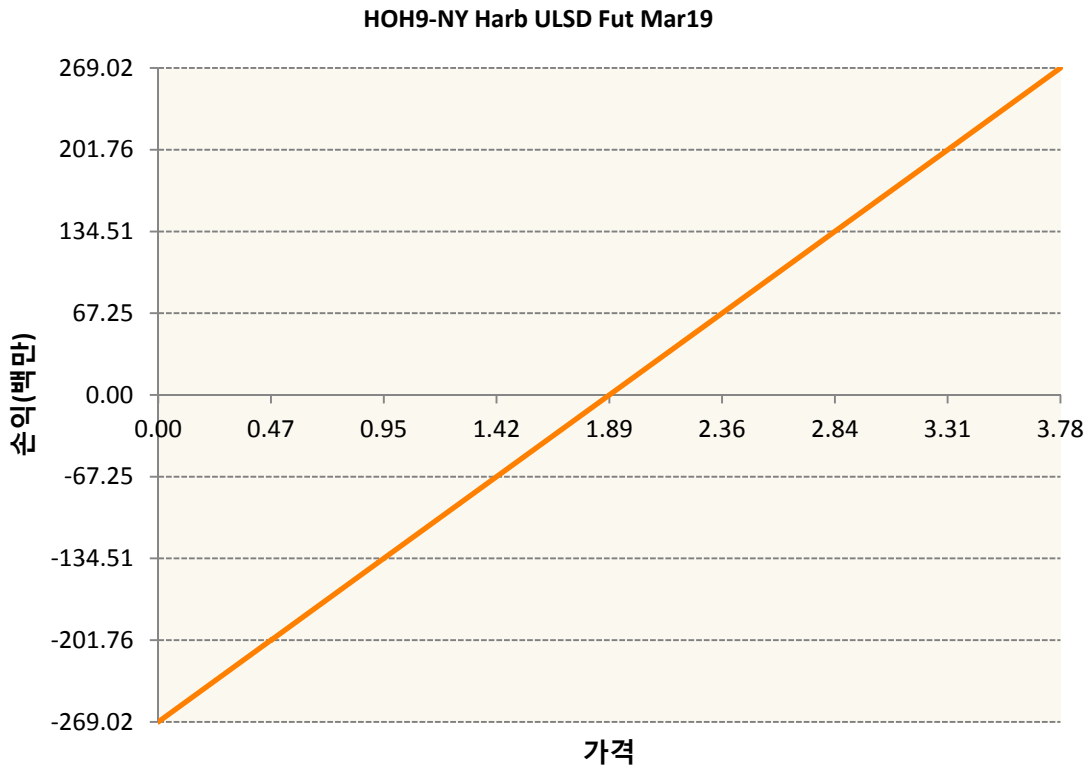
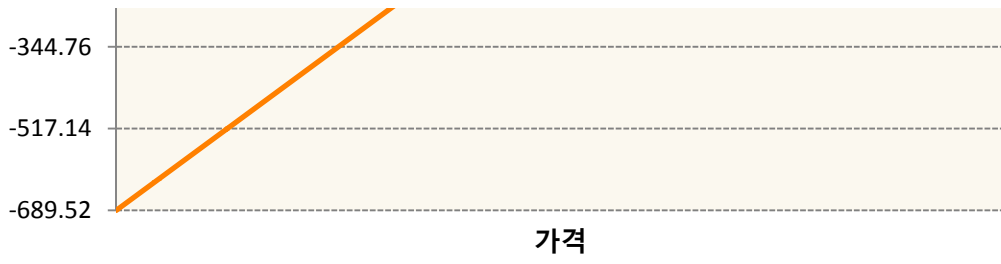
2. 만기시점의 손익구조

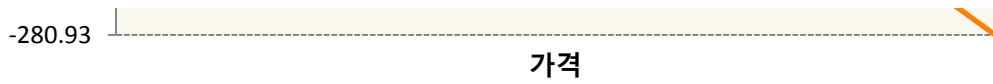
CLH9-WTI CRUDE FUTURE MAR19



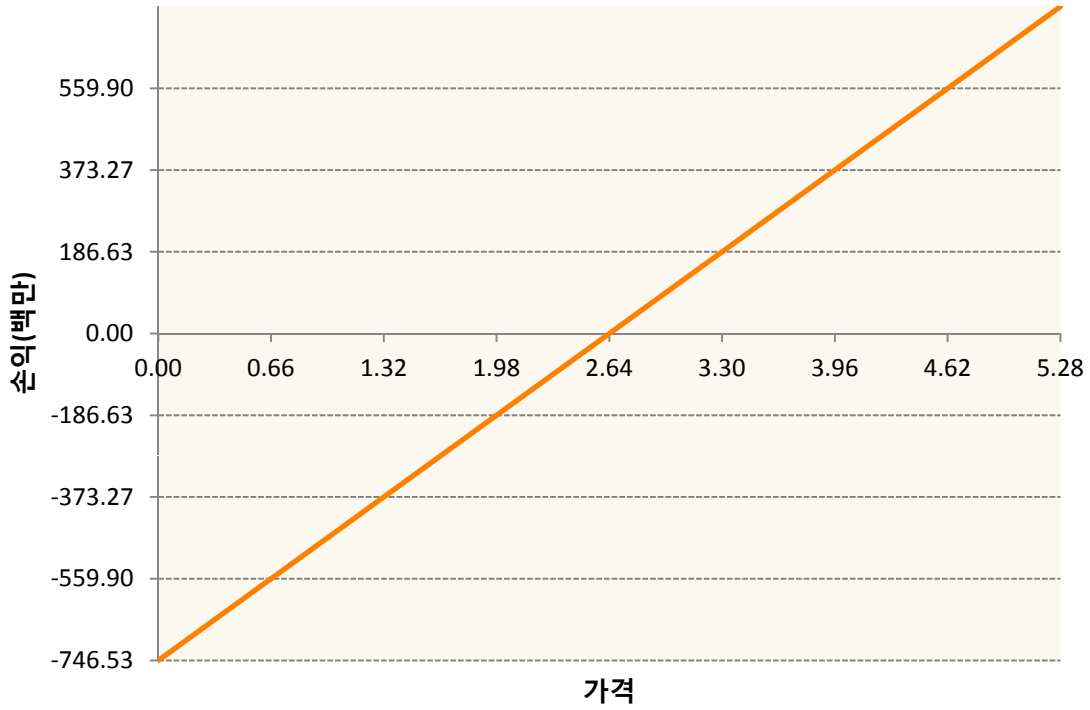
COK9-BRENT CRUDE FUTR May19



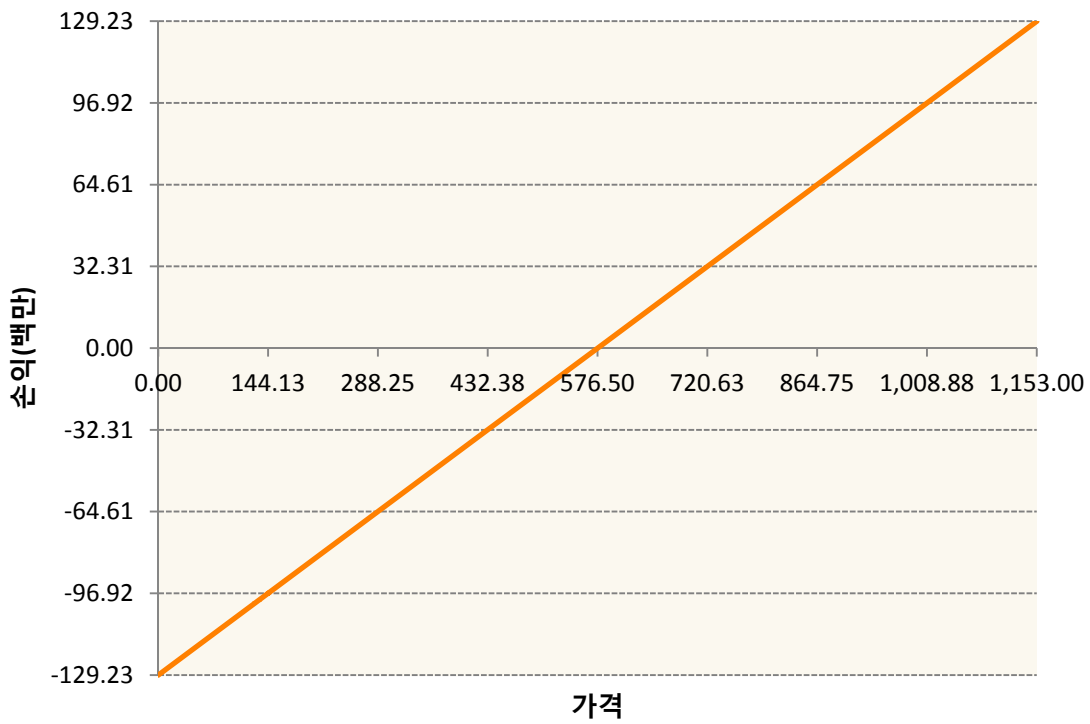




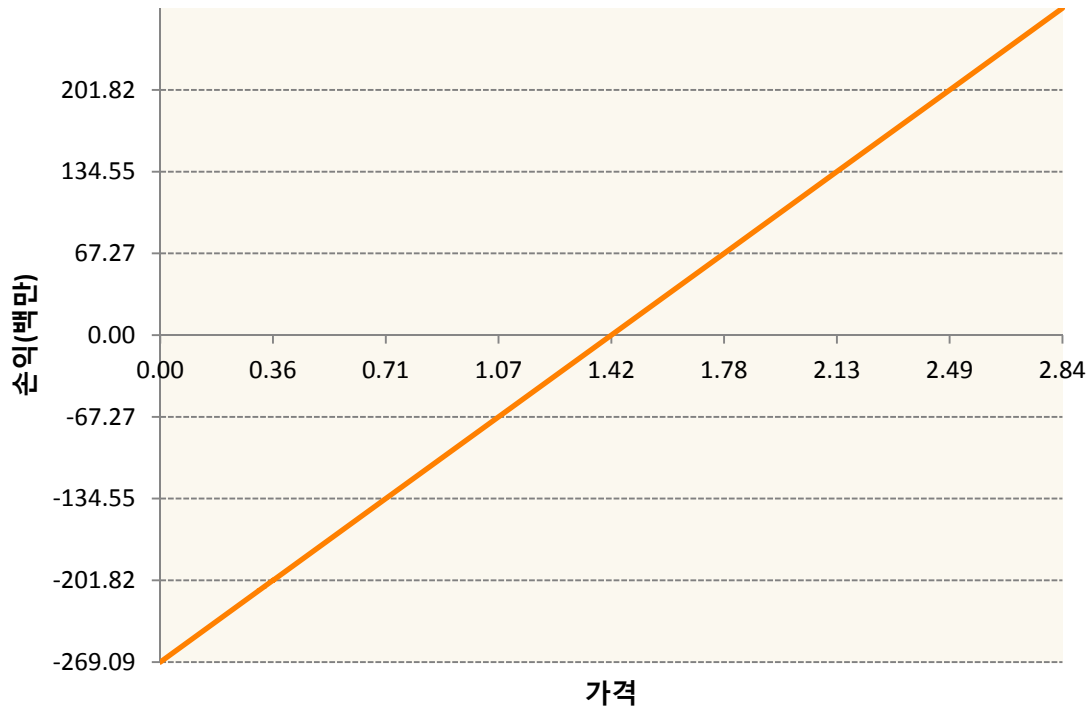
NGH19-NATURAL GAS FUTR Mar19



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	55
HOH9	NY Harb ULSD Fut Mar19	22
KR4175P200	2019-02 달러선물	22
NGH19	NATURAL GAS FUTR Mar19	60
QSH9	Low Su Gasoil G May19	10
XBH9	GASOLINE RBOB FUT Mar19	22

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

(단위:백만원)

409

공시일	2019-02-13
기준일	2019-02-12

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

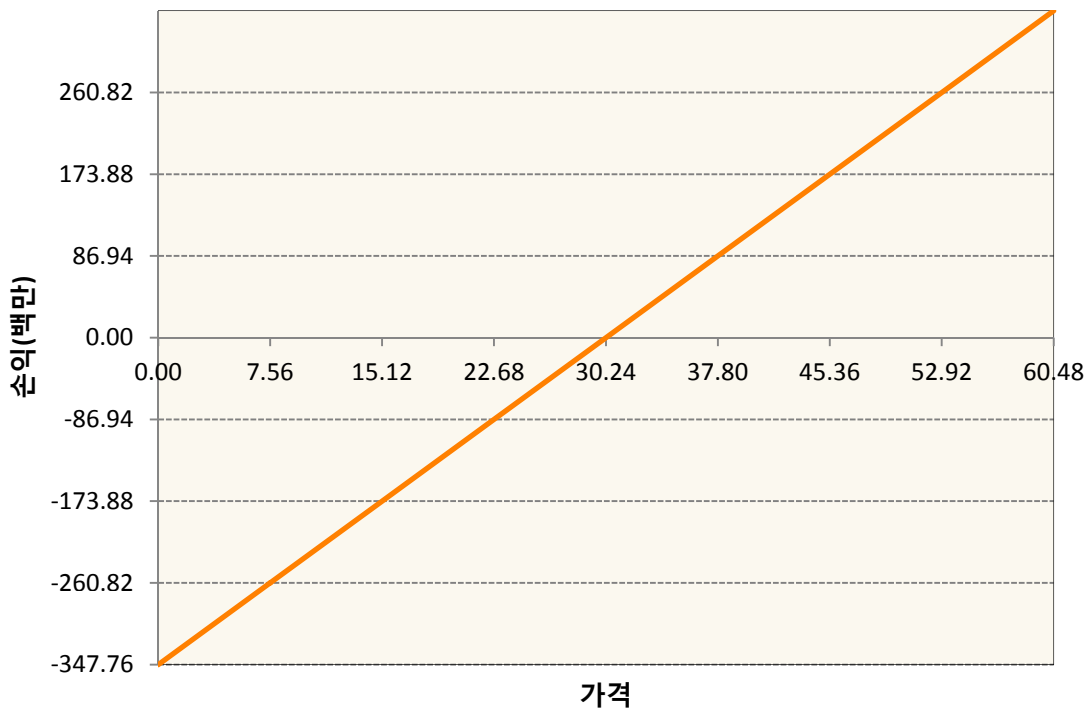
1. 계약금액

(단위:백만원)

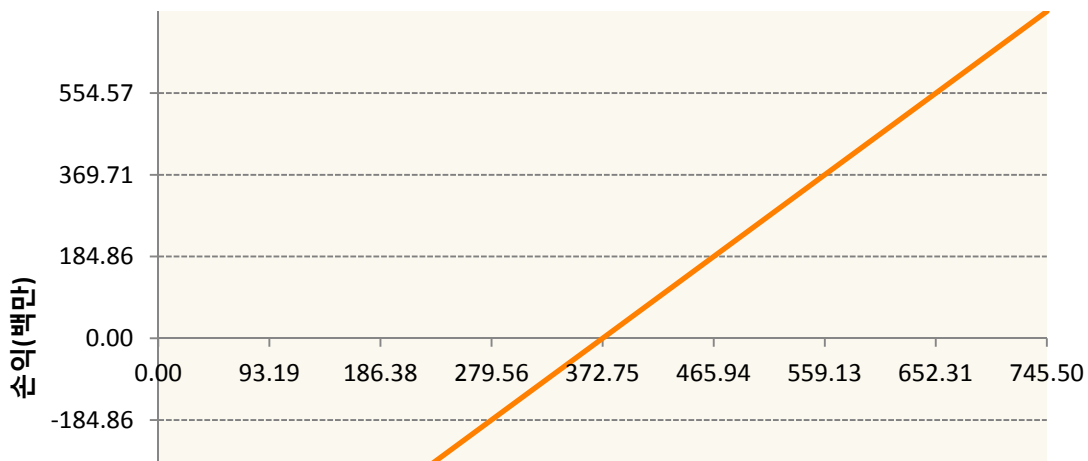
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,542	79	3,463	

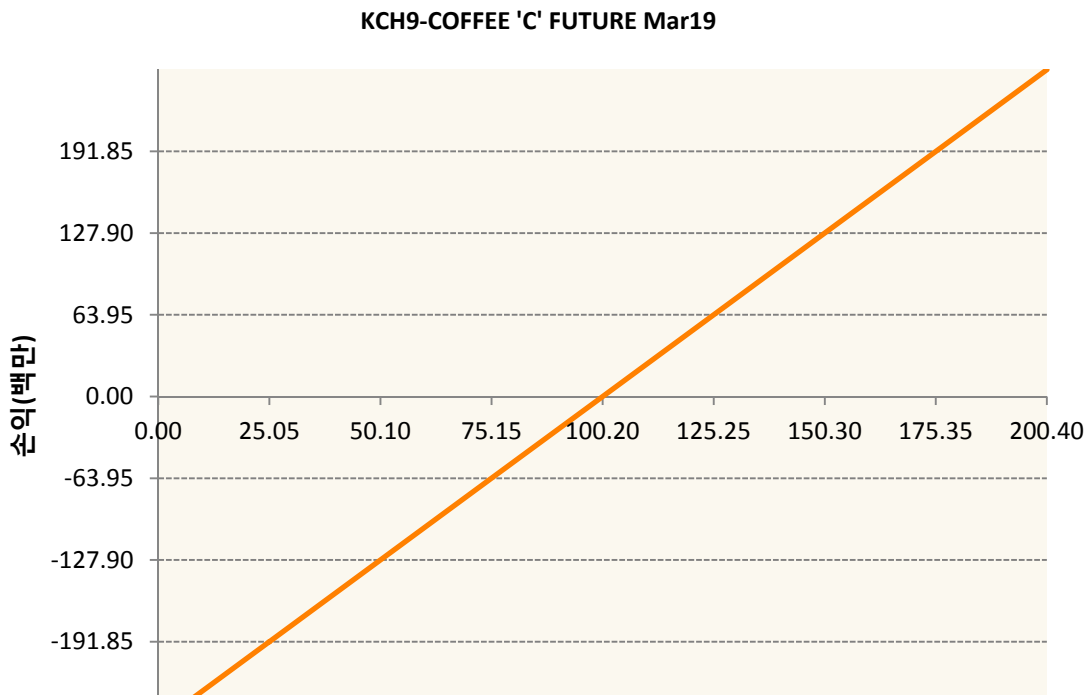
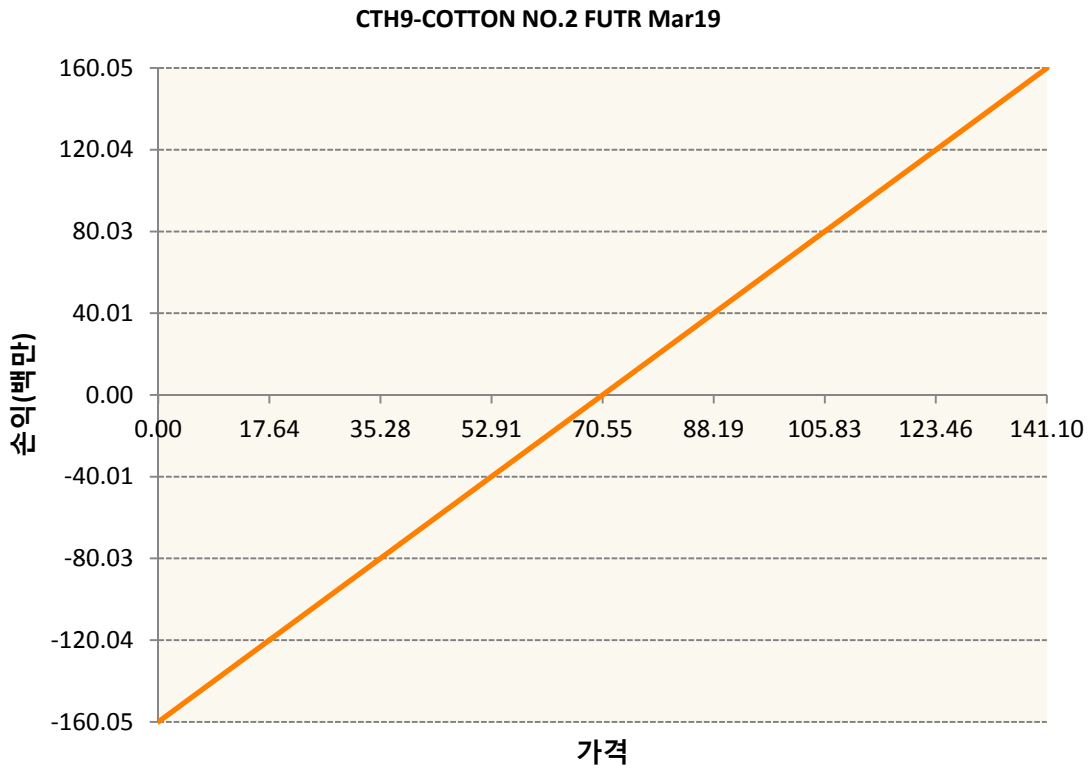
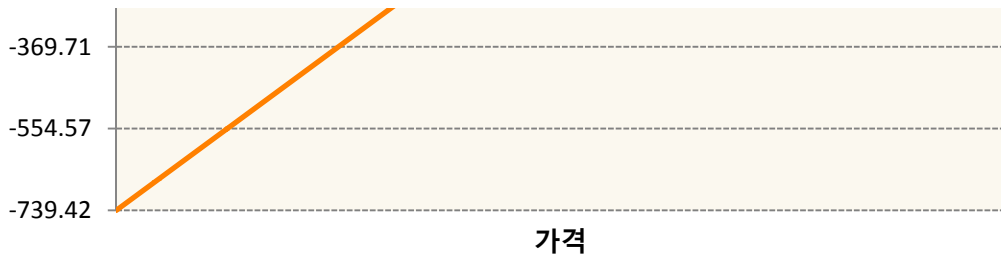
2. 만기시점의 손익구조

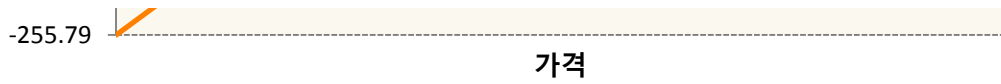
BOH9-SOYBEAN OIL FUTR Mar19



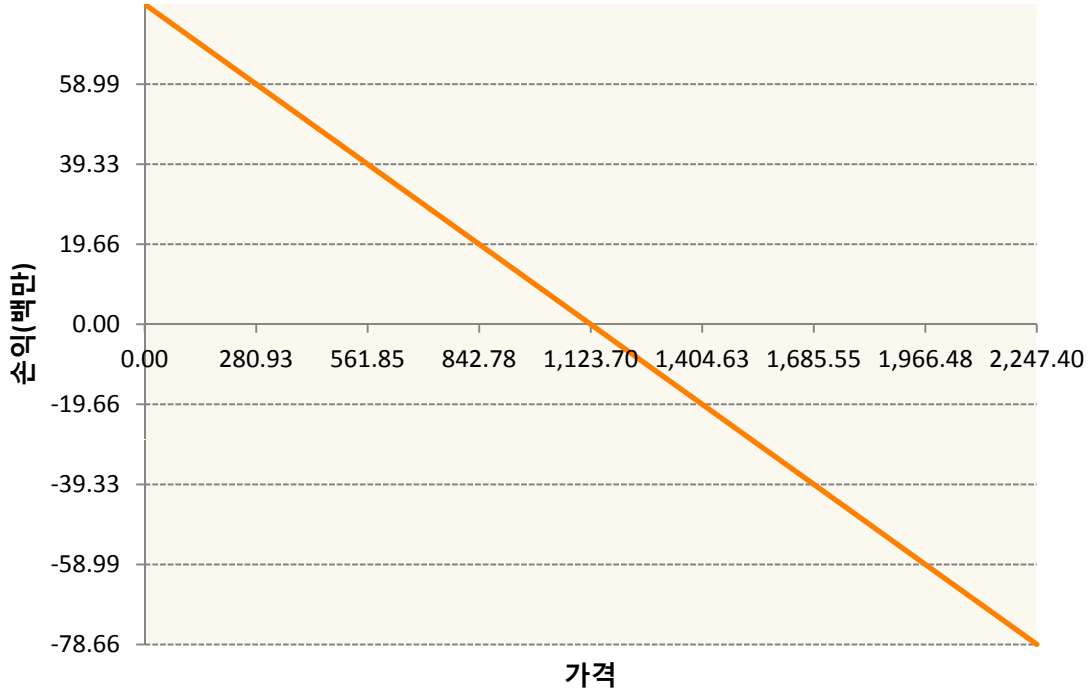
CH9-CORN FUTURE Mar19



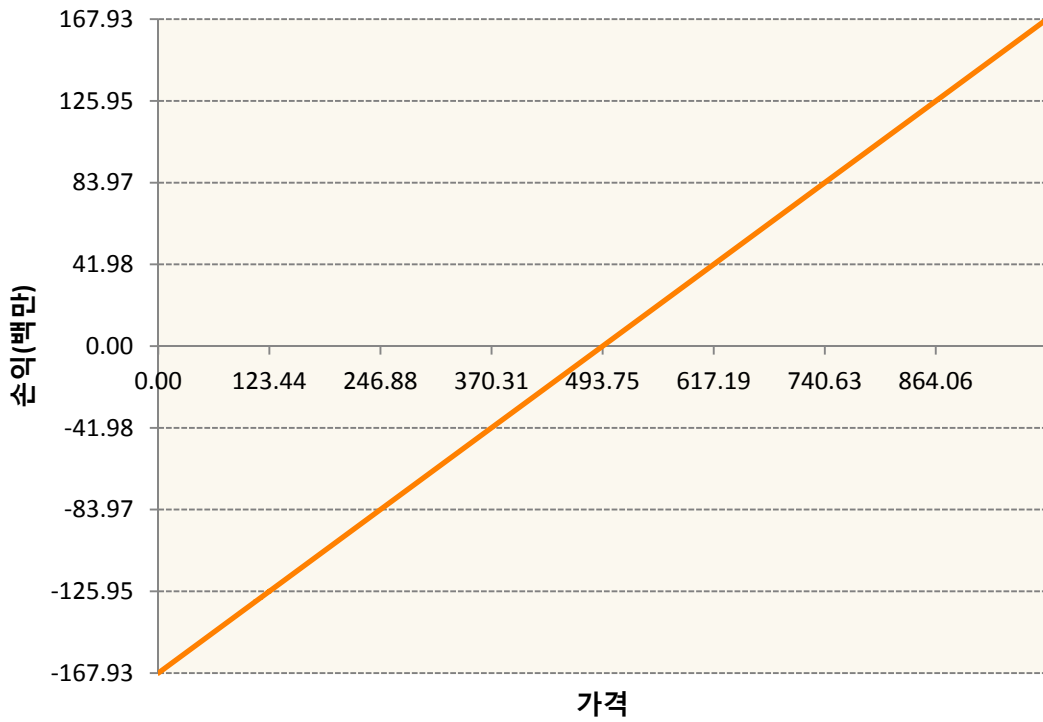




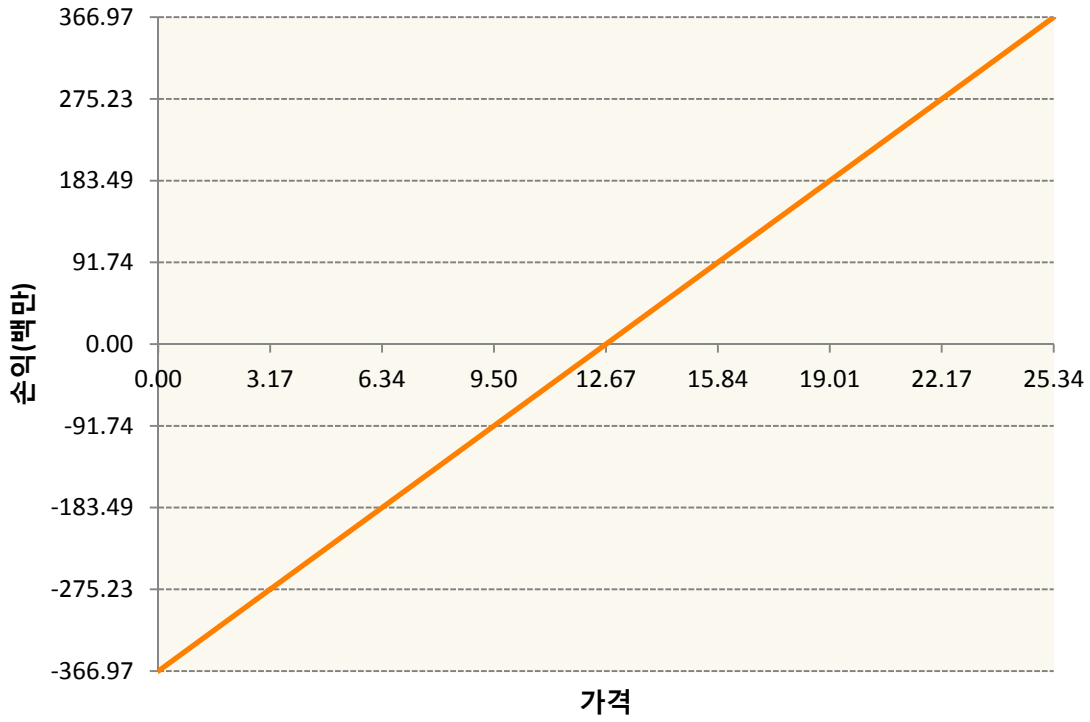
KR4175P20002-2019-02 달러선물



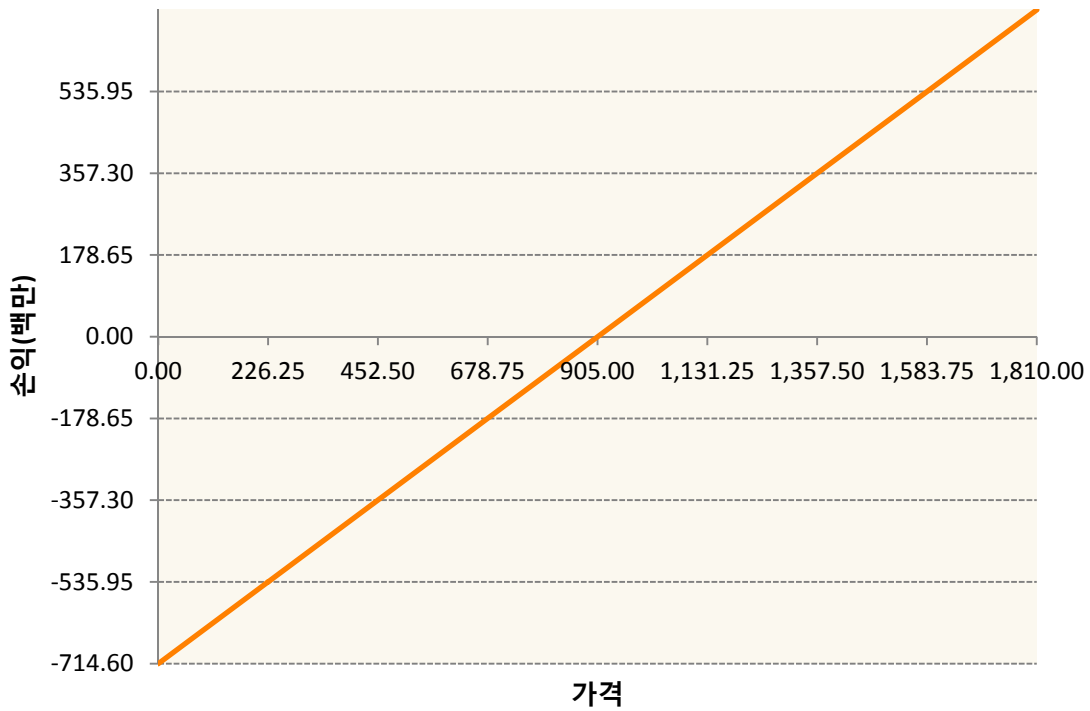
KWH9-KC HRW WHEAT FUT Mar19



SBH9-SUGAR #11 (WORLD) MAR19

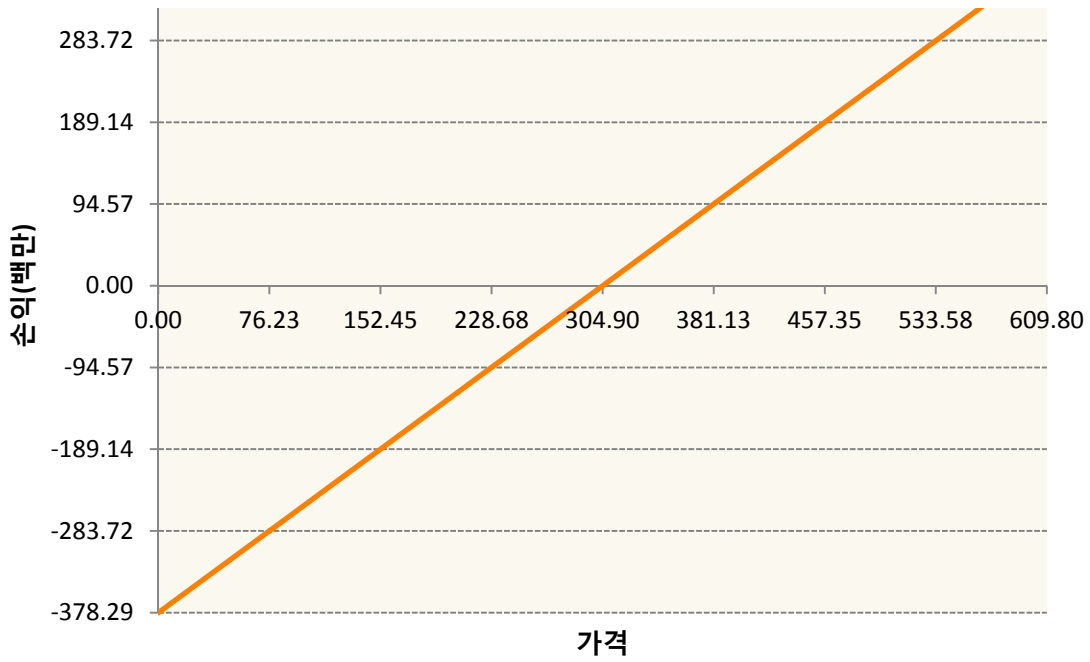


SH9-SOYBEAN FUTURE Mar19

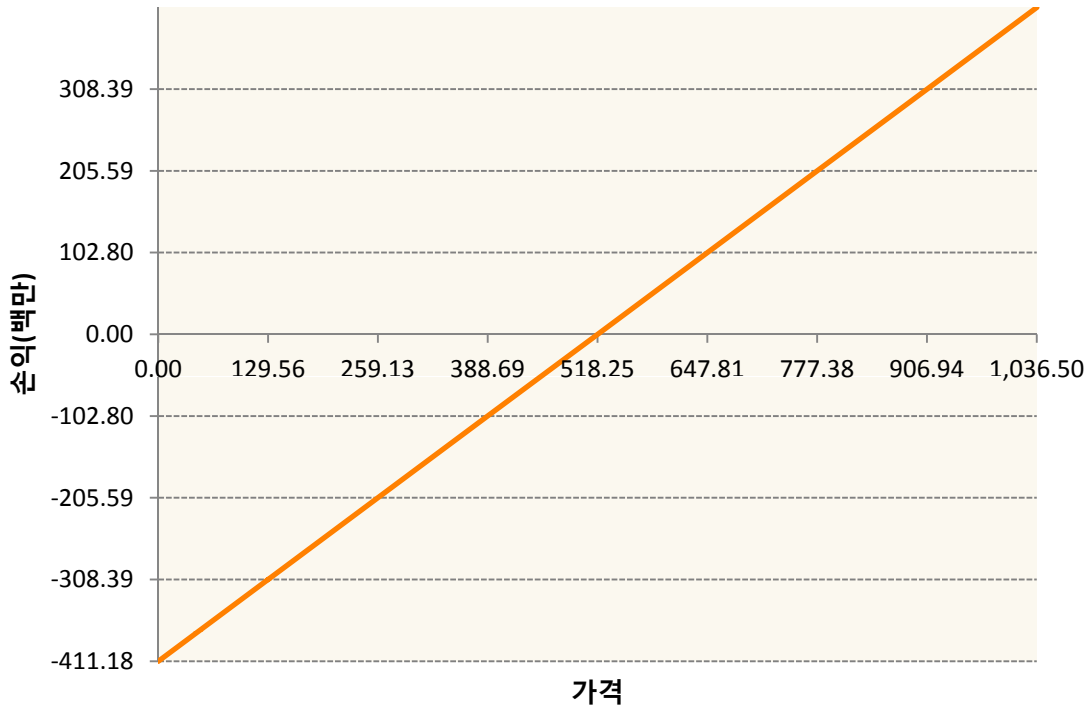


SMH9-SOYBEAN MEAL FUTR Mar19





WH9-WHEAT FUTURE(CBT) 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	20
KR4175P200	2019-02 달러선물	6

KWH9	KC HRW WHEAT FUT Mar19	13
SBH9	SUGAR #11 (WORLD) MAR19	29
SH9	SOYBEAN FUTURE Mar19	57
SMH9	SOYBEAN MEAL FUTR Mar19	30
WH9	WHEAT FUTURE(CBT) Mar19	33

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

(단위:백만원)

288