

공시일	2019-11-15
기준일	2019-11-14

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	5	0	5	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)

85

공시일	2019-11-15
기준일	2019-11-14

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	14,341	0	14,341	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWMXWO0(신한MXWO 미래S190822

1,218

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

702

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-11-15
기준일	2019-11-14

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	6,772	0	6,772	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI50000 신한CSI500미래S190910(1)	380
SWCSI50000 신한CSI500미래S190910(2)	138

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

758

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-11-15
기준일	2019-11-14

유로인덱스모(주식-파생형)

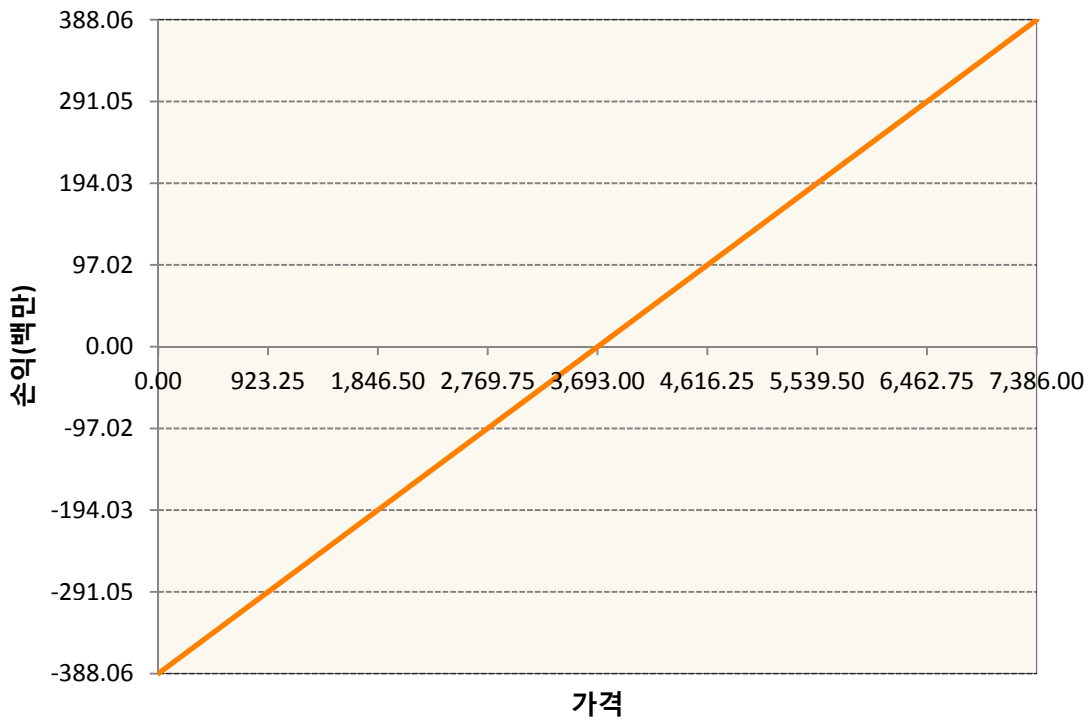
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	388	0	388	

2. 만기시점의 손익구조

VGZ9-EURO STOXX 50 Dec19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGZ9	EURO STOXX 50 Dec19	31
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

22

공시일	2019-11-15
기준일	2019-11-14

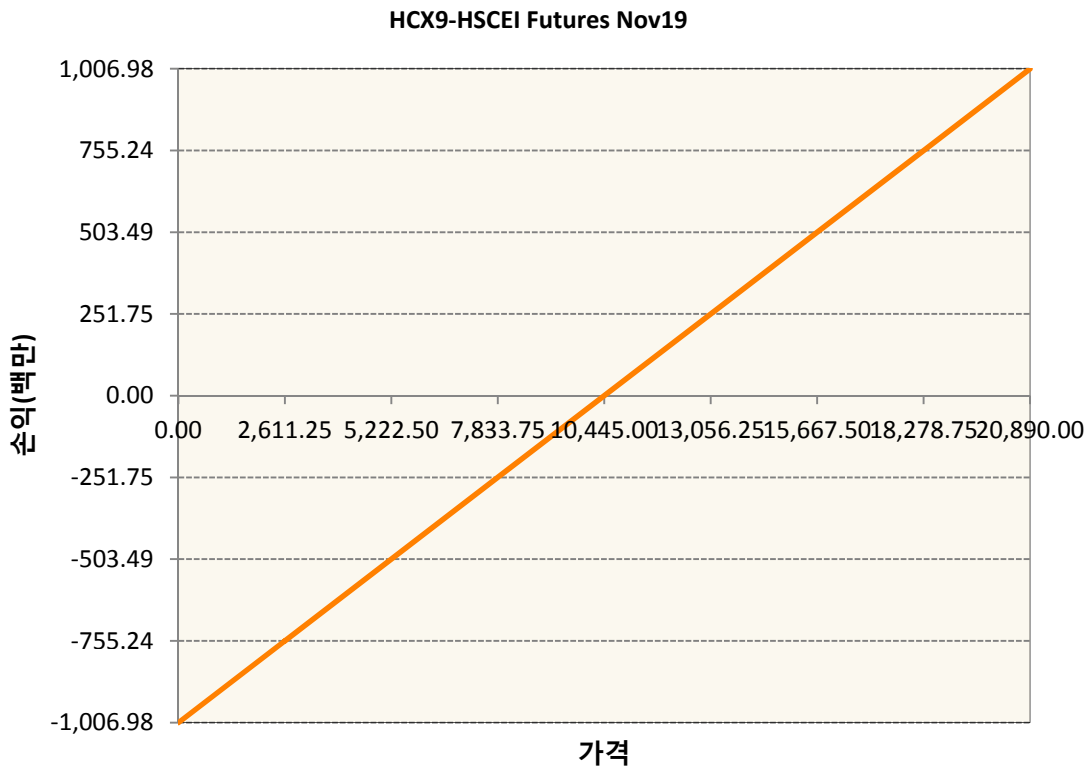
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	1,007	0	1,007	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HGX9	HSCEI Futures Nov19	81
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

72

공시일	2019-11-15
기준일	2019-11-14

커버드콜모(주식혼합-파생형)

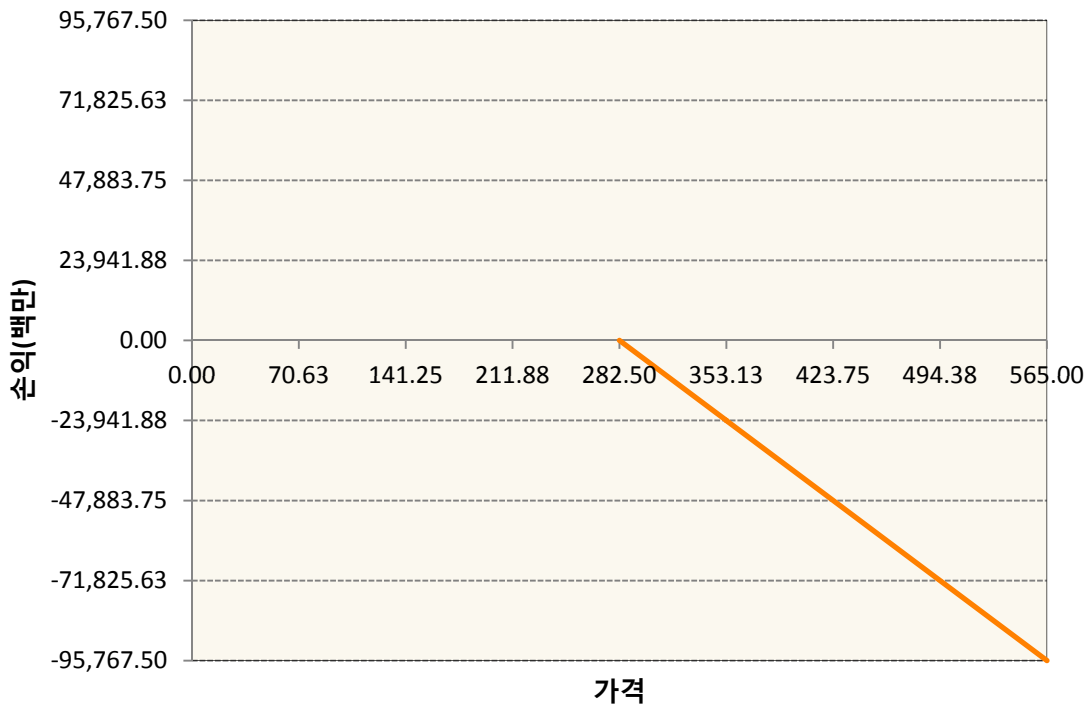
1. 계약금액

(단위:백만원)

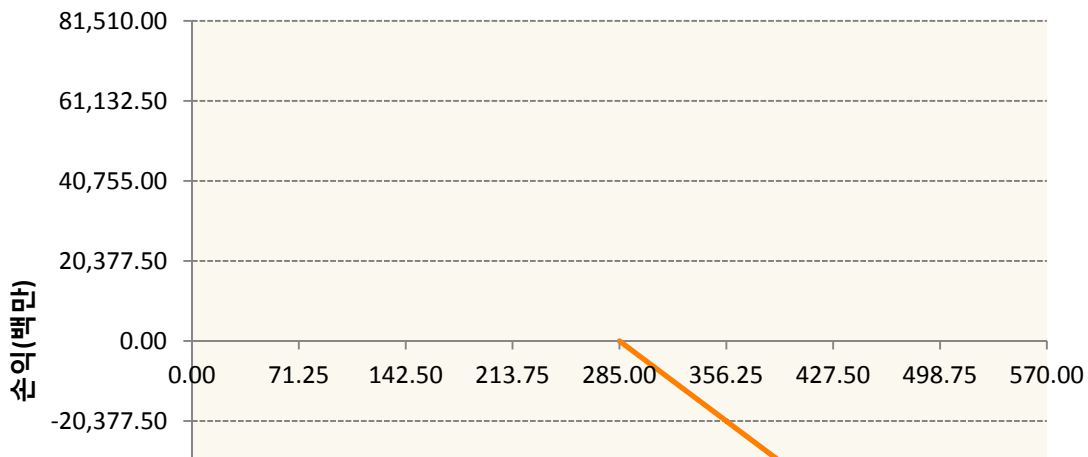
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	179,758	-179,758	장내
누계	유가증권	옵션	0	177,278	-177,278	장내

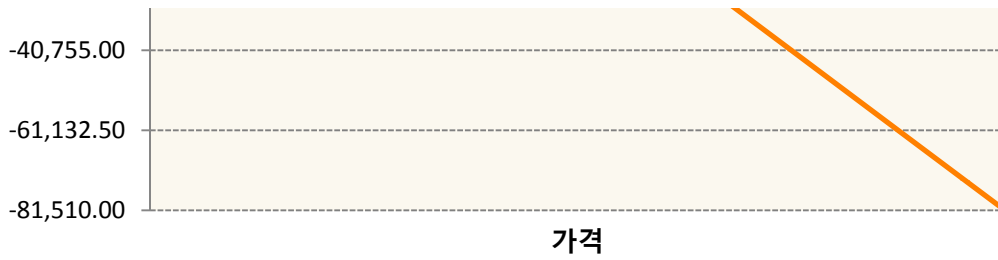
2. 만기시점의 손익구조

KR4201PC2825-2019-12 콜282.5



KR4201PC2858-2019-12 콜285





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201PC2825		2019-12 콜282.5						6,014
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	2,920	2,823	2,708	2,580	2,439	2,288	2,128	
-5.33%	2,570	2,405	2,228	2,043	1,851	1,654	1,451	
-2.67%	1,873	1,650	1,425	1,198	969	739	507	
0%	724	483	241	0	-242	-483	-725	
2.67%	-892	-1,107	-1,327	-1,552	-1,779	-2,009	-2,241	
5.33%	-2,901	-3,061	-3,234	-3,418	-3,611	-3,811	-4,016	
8.00%	-5,182	-5,282	-5,401	-5,536	-5,684	-5,844	-6,014	
KR4201PC2858		2019-12 콜285						4,864
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	2,166	2,099	2,016	1,922	1,816	1,700	1,575	
-5.33%	1,937	1,815	1,681	1,537	1,387	1,230	1,068	
-2.67%	1,453	1,277	1,096	912	725	536	346	
0%	614	409	205	0	-205	-409	-614	
2.67%	-622	-816	-1,013	-1,212	-1,412	-1,613	-1,815	
5.33%	-2,214	-2,368	-2,531	-2,701	-2,877	-3,057	-3,241	
8.00%	-4,070	-4,173	-4,291	-4,420	-4,560	-4,709	-4,864	

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

10,253

공시일	2019-11-15
기준일	2019-11-14

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

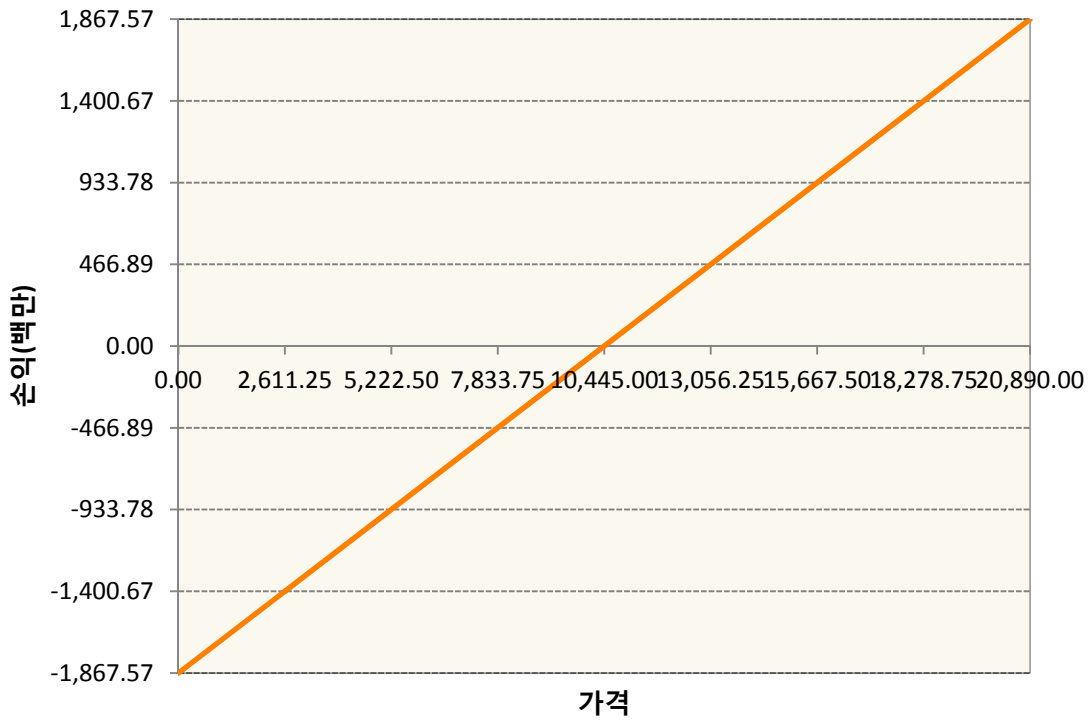
1. 계약금액

(단위:백만원)

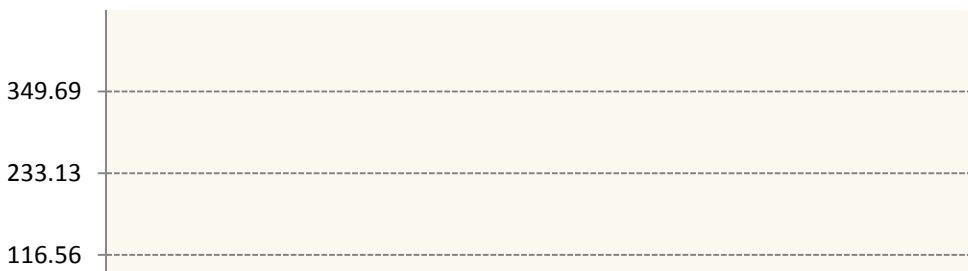
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,868	0	1,868	장내
누계	유가증권	옵션	0	5,012	-5,012	장내
누계	통화	선도	673	2,777	-2,104	장외

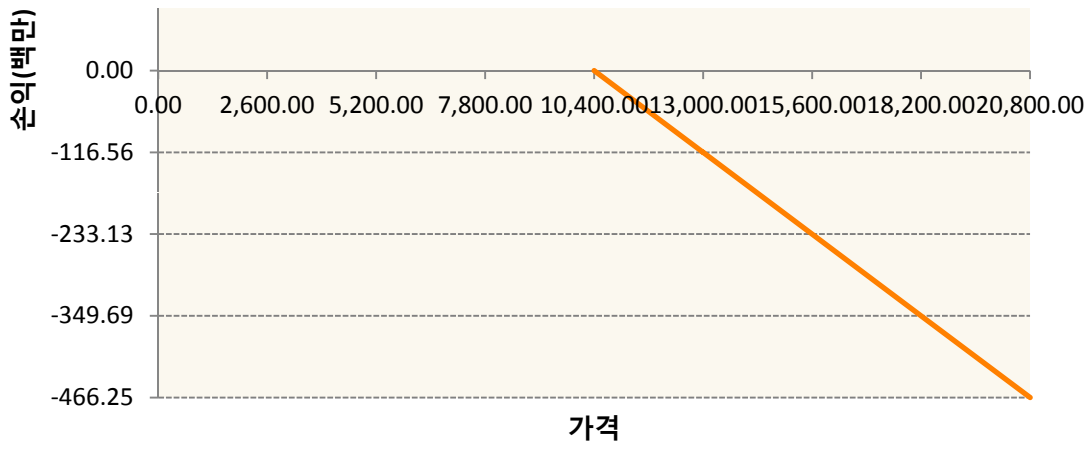
2. 만기시점의 손익구조

HCX9-HSCEI Futures Nov19

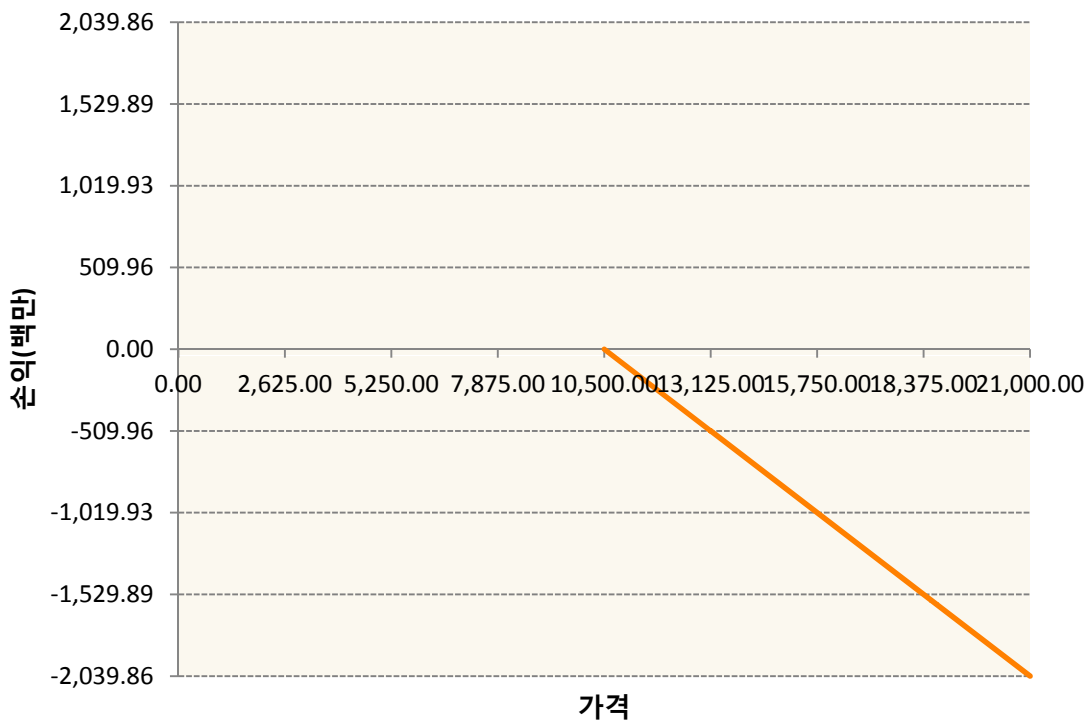


OHHIX9-C104-HSCEI

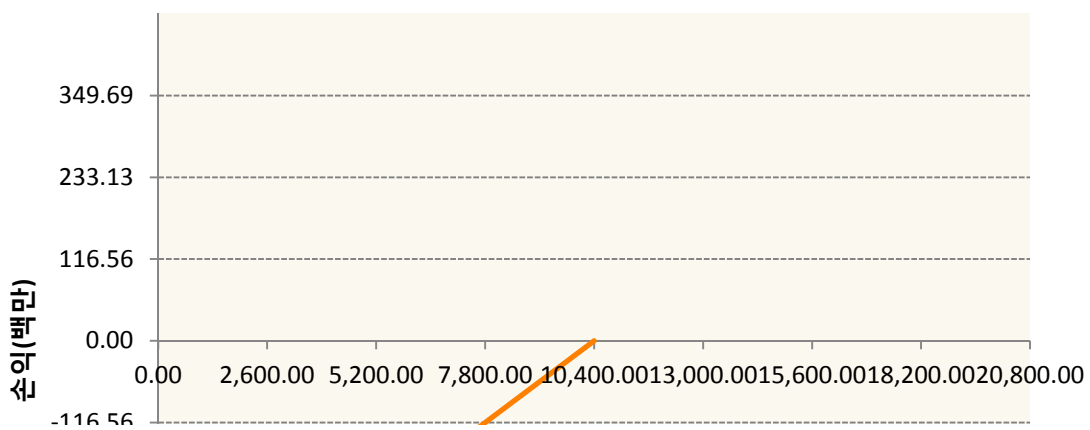


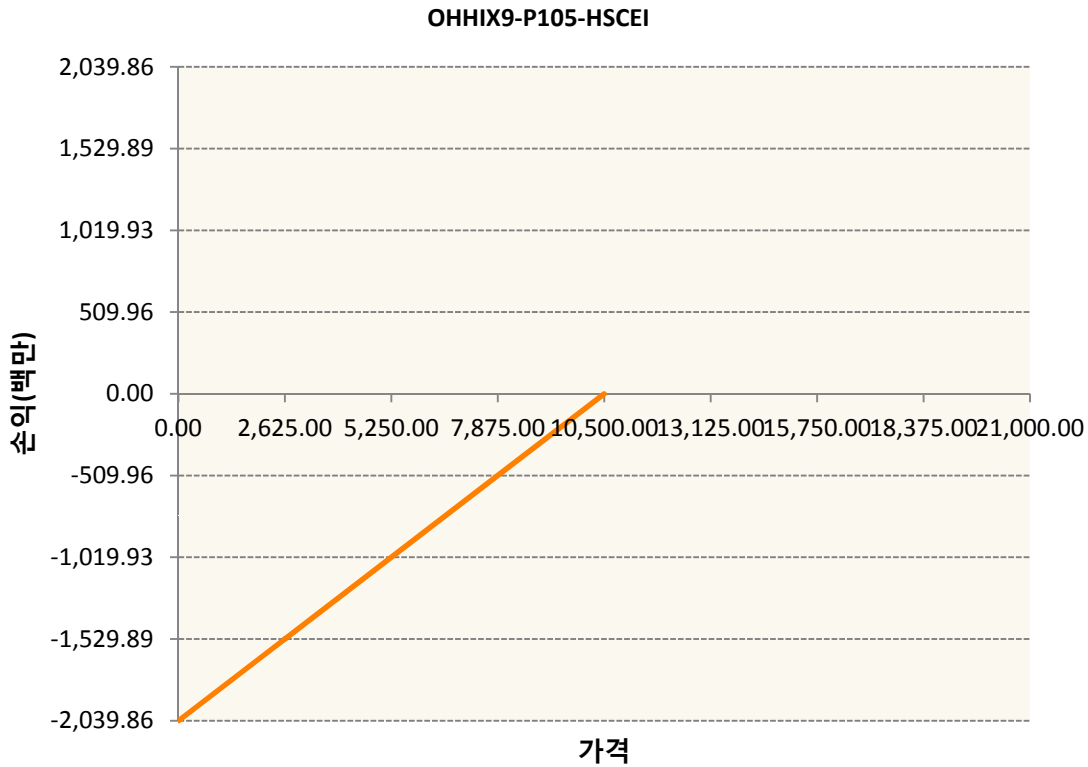


OHHIX9-C105-HSCEI



OHHIX9-P104-HSCEI





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)	(단위:백만원)
FX21019Q03 KRW/HKD 22-11-19E	222
FX21019U00 HKD/KRW 22-11-19E	6
FX21019U02 HKD/KRW 22-11-19E	48
HCX9 HSCEI Futures Nov19	149
OHHIX9-C1C HSCEI	37
OHHIX9-C1C HSCEI	163
OHHIX9-P10 HSCEI	37
OHHIX9-P10 HSCEI	163

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	577

5.33%	552	552	552	552	552	552	552
8.00%	828	828	828	828	828	828	828
KR4101PC0002 2019-12 코스피200지수선물							250
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-250	-250	-250	-250	-250	-250	-250
-5.33%	-167	-167	-167	-167	-167	-167	-167
-2.67%	-83	-83	-83	-83	-83	-83	-83
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	83	83	83	83	83	83	83
5.33%	167	167	167	167	167	167	167
8.00%	250	250	250	250	250	250	250

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

(단위:백만원)

1,023

공시일	2019-11-15
기준일	2019-11-14

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

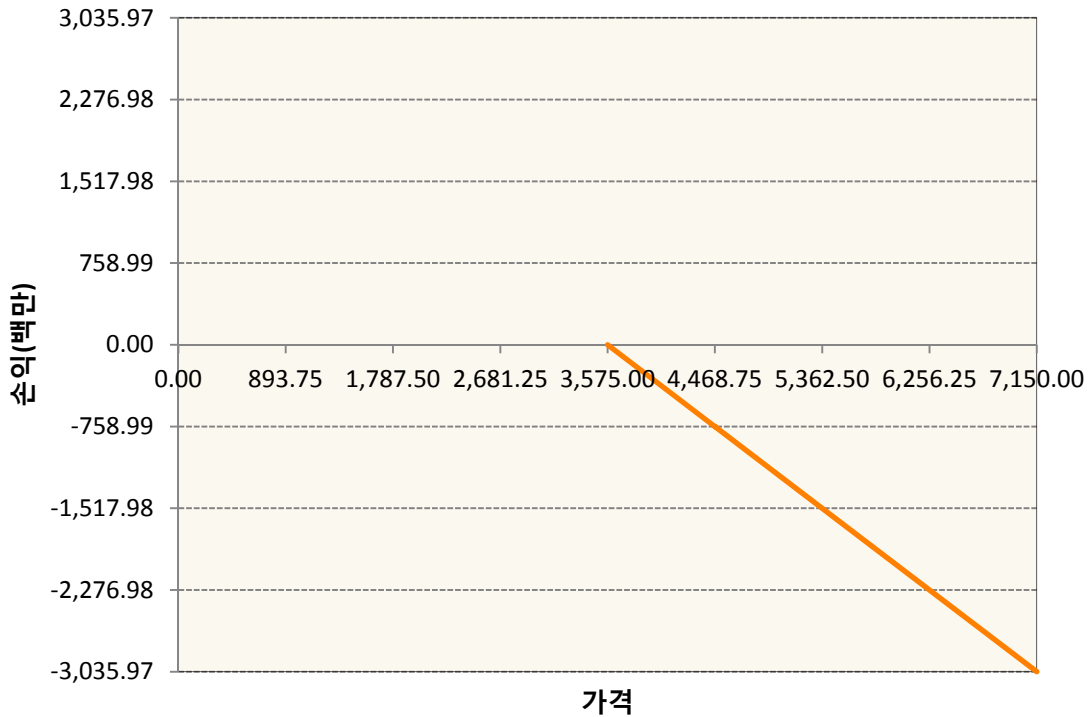
1. 계약금액

(단위:백만원)

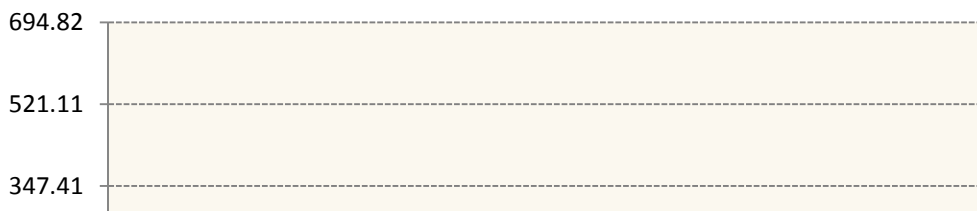
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	863	0	863	
누계	유가증권	스왑	20,216	0	20,216	장외
누계	유가증권	옵션	0	7,462	-7,462	장내
누계	통화	선도	2,028	6,048	-4,020	장외

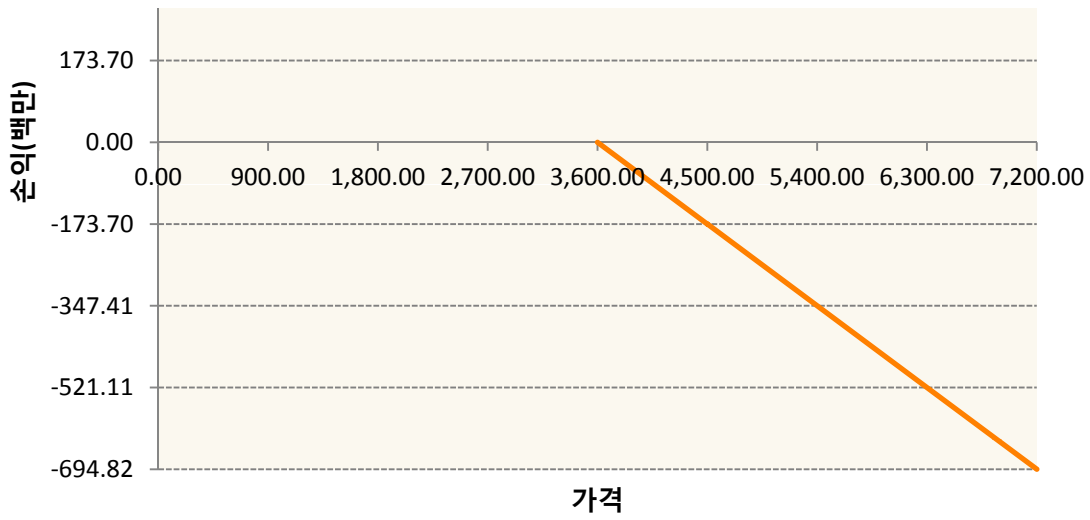
2. 만기시점의 손익구조

OESXX9-C3575-EURO STOXX 50

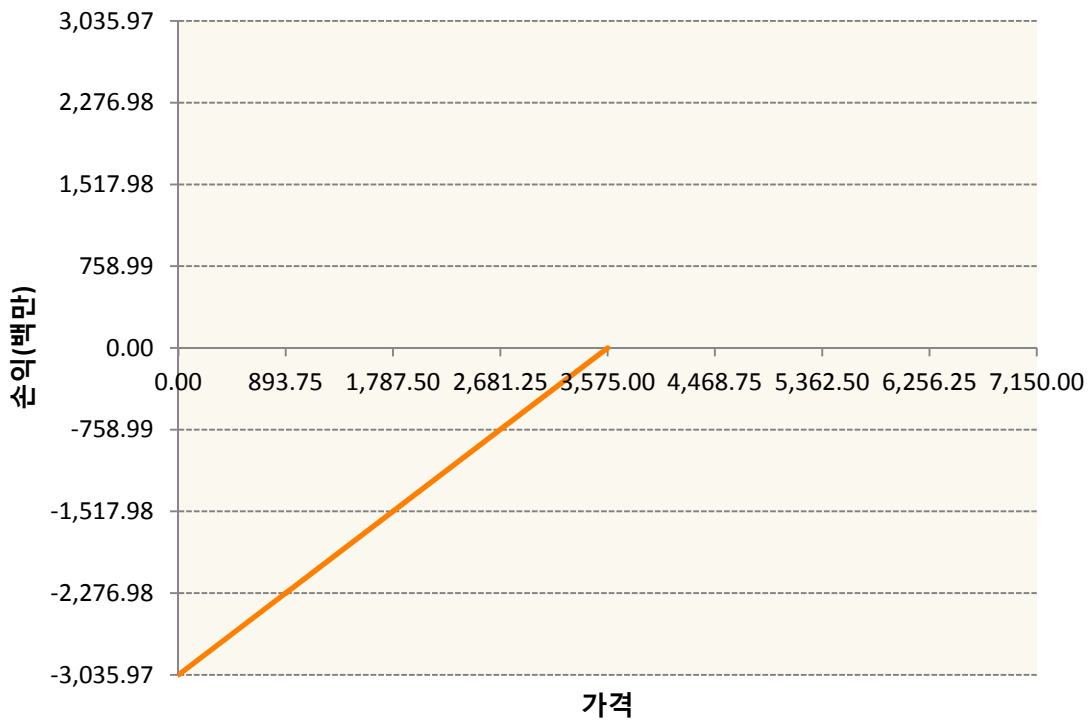


OESXX9-C3600-EURO STOXX 50

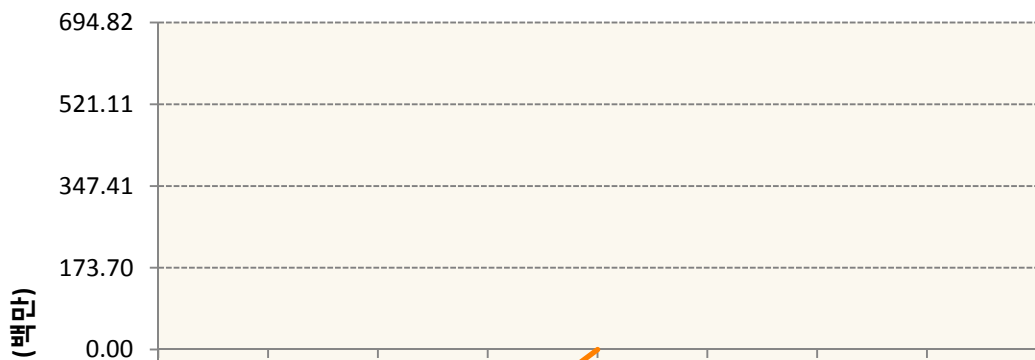


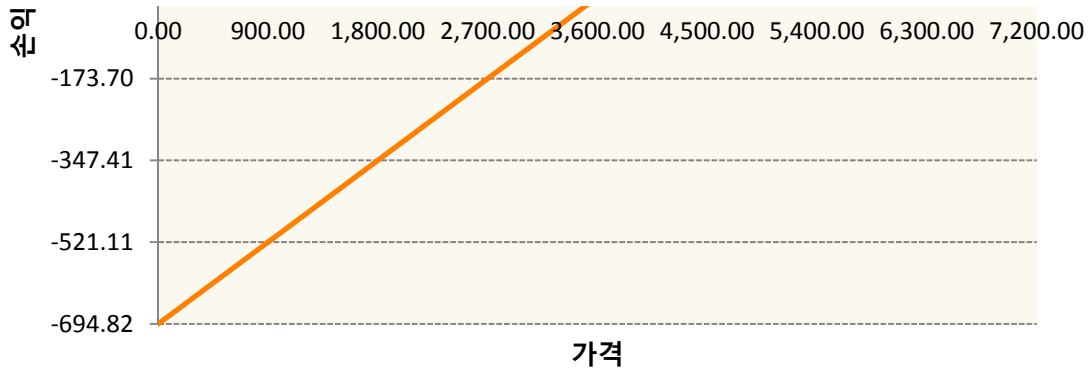


OESXX9-P3575-EURO STOXX 50

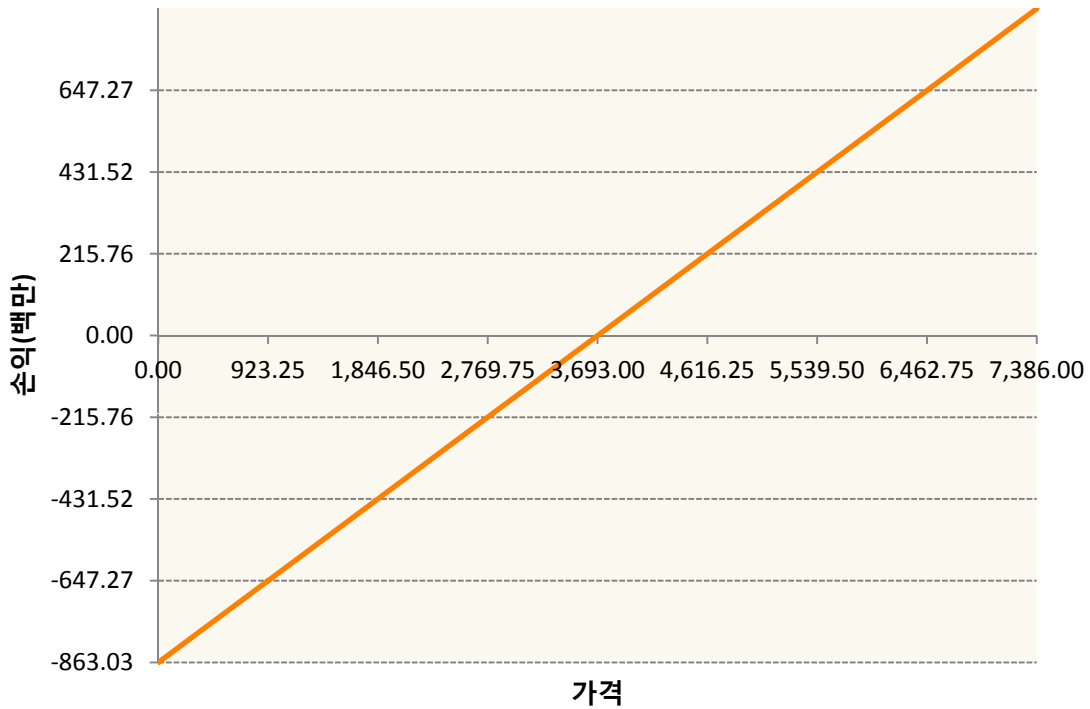


OESXX9-P3600-EURO STOXX 50





VGZ9-EURO STOXX 50 Dec19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY	24
FX21019U04 KRW/EUR 27-12-19E	484
FX21019V04 EUR/KRW 27-12-19E	162
OESXX9-C35 EURO STOXX 50	243
OESXX9-C36 EURO STOXX 50	56
OESXX9-P35 EURO STOXX 50	243
OESXX9-P36 EURO STOXX 50	56
VGZ9 EURO STOXX 50 Dec19	69

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

(단위:백만원)

779

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

(단위:백만원)

916

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

(단위:백만원)

80

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

(단위:백만원)

125

공시일	2019-11-15
기준일	2019-11-14

스마트KRX300인덱스목표전환형1호

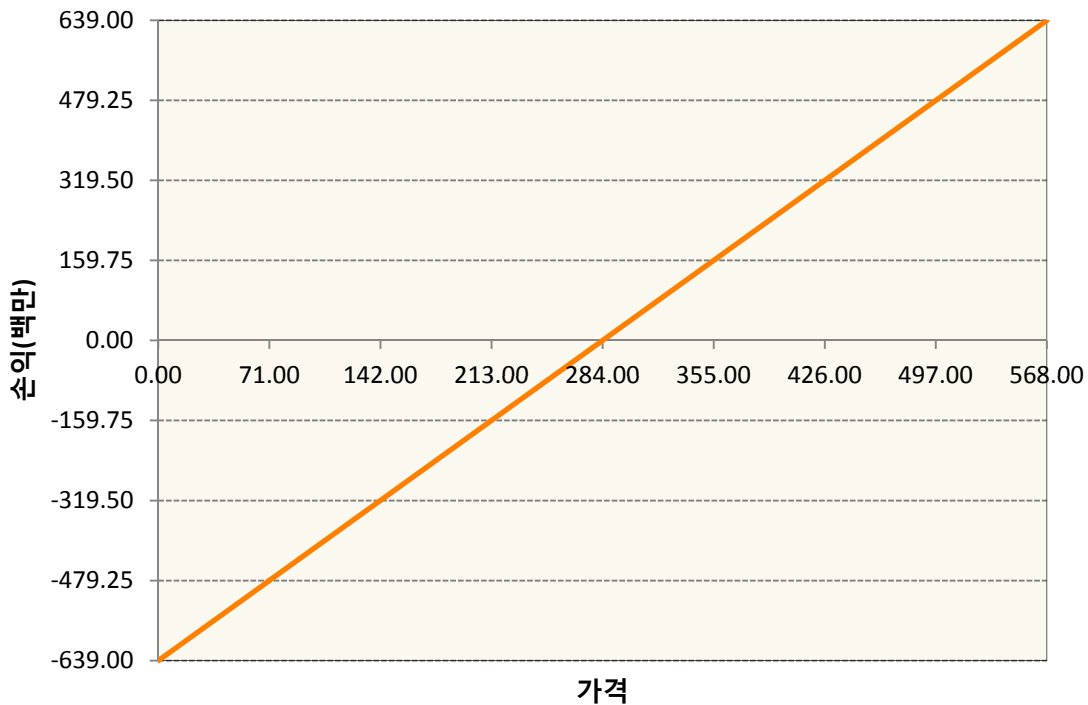
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	639	0	639	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101PC0002-2019-12 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101PC0002		2019-12 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)

40

공시일	2019-11-15
기준일	2019-11-14

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

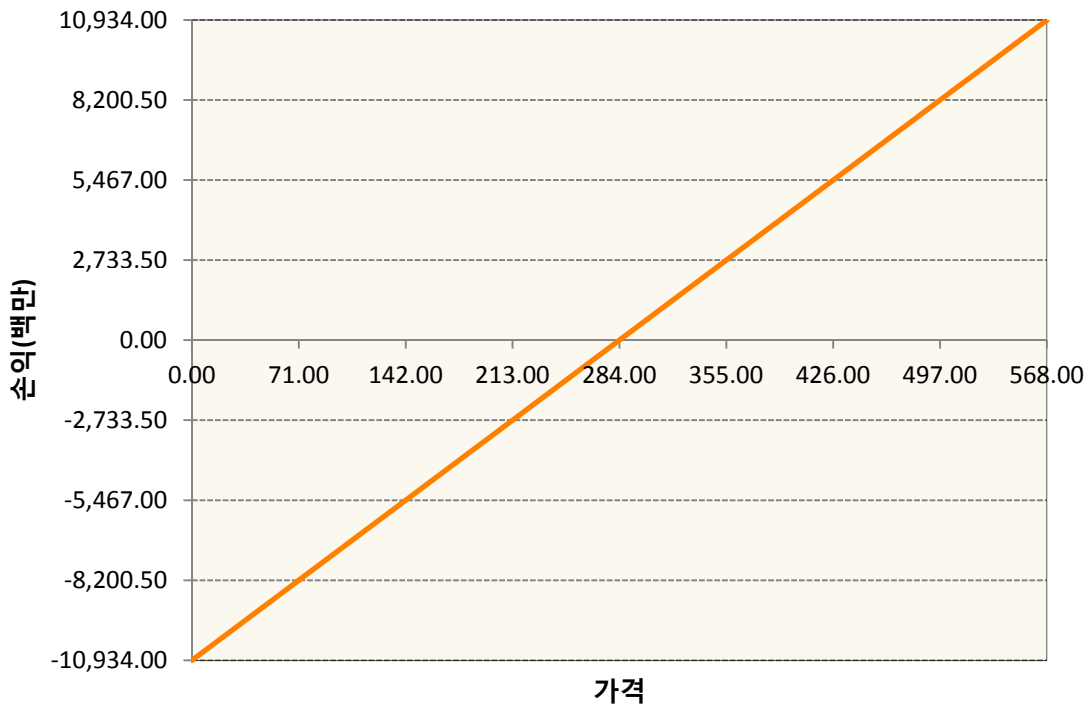
1. 계약금액

(단위:백만원)

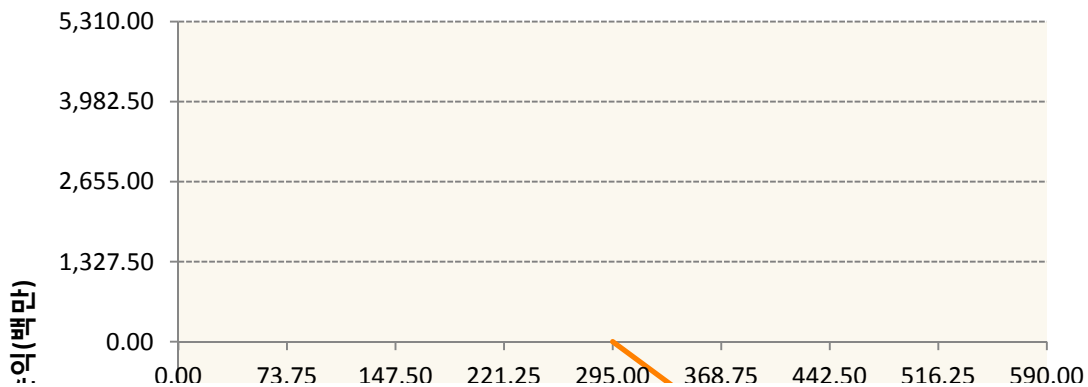
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	1,395	21,321	-19,926	장내
누계	유가증권	선물	10,934	0	10,934	장내
누계	유가증권	옵션	1,413	21,301	-19,888	장내

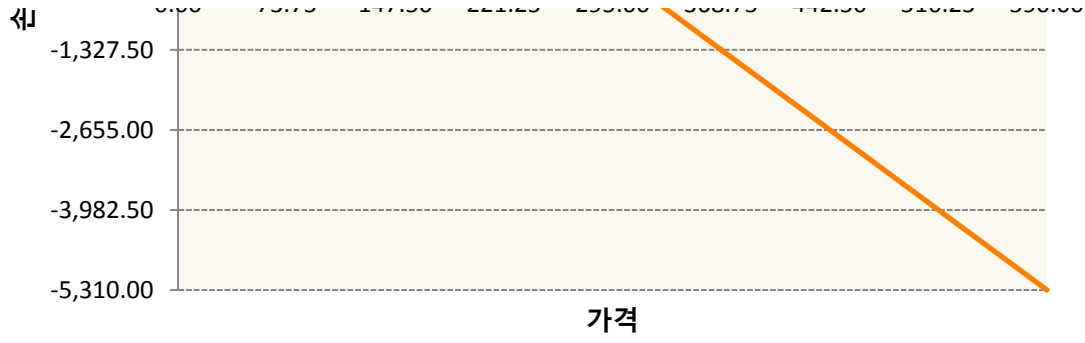
2. 만기시점의 손익구조

KR4101PC0002-2019-12 코스피200지수선물

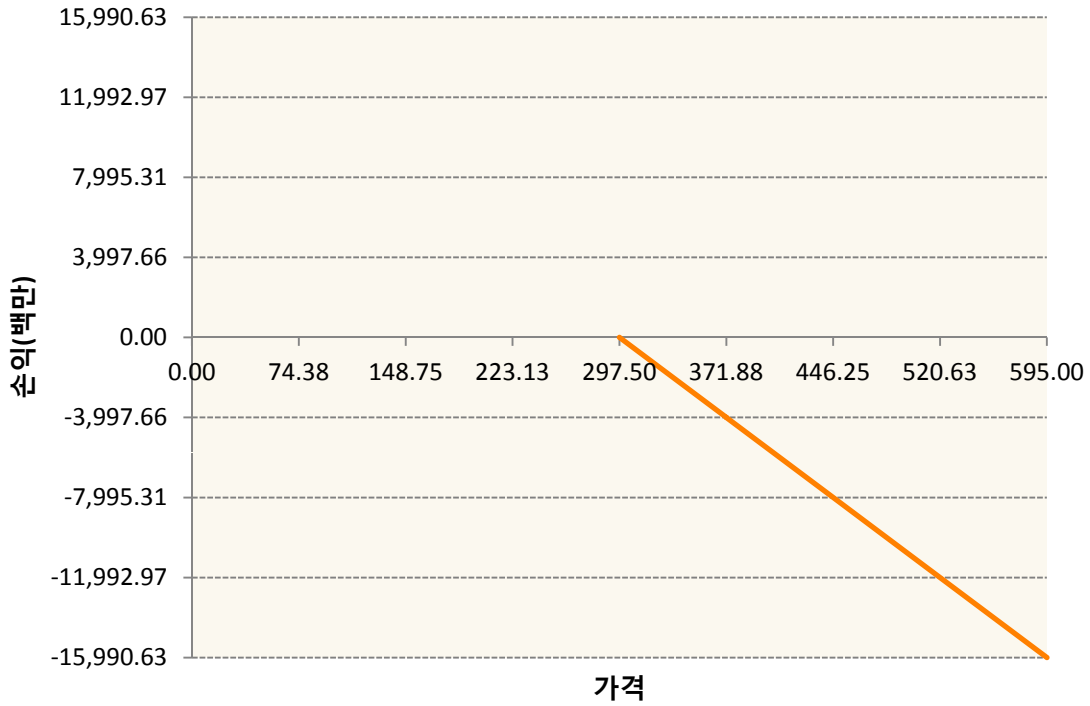


KR4201PC2957-2019-12 콜295

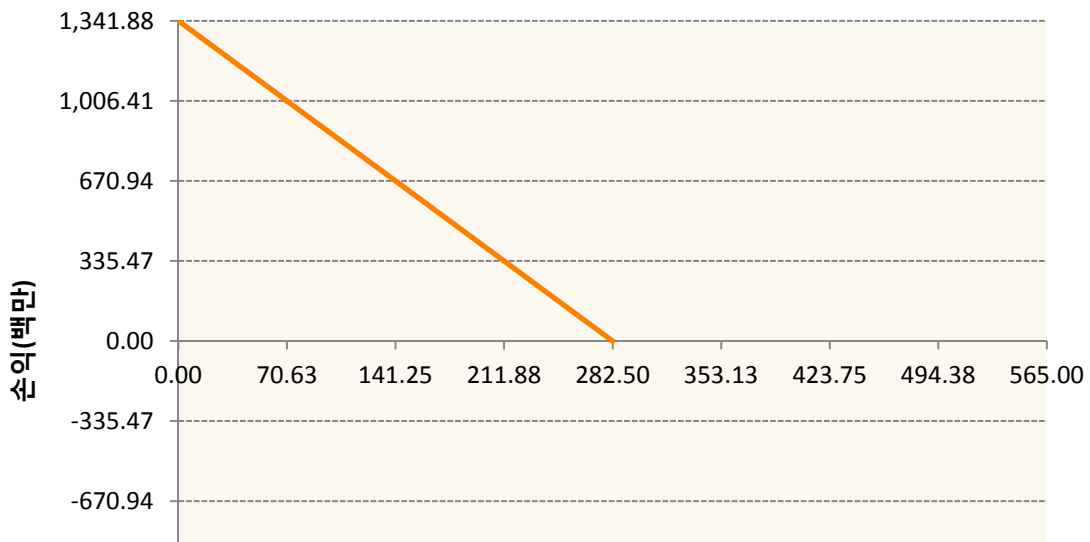


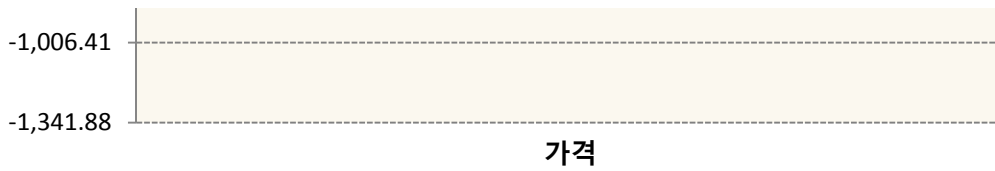


KR4201PC2973-2019-12 콜297.5

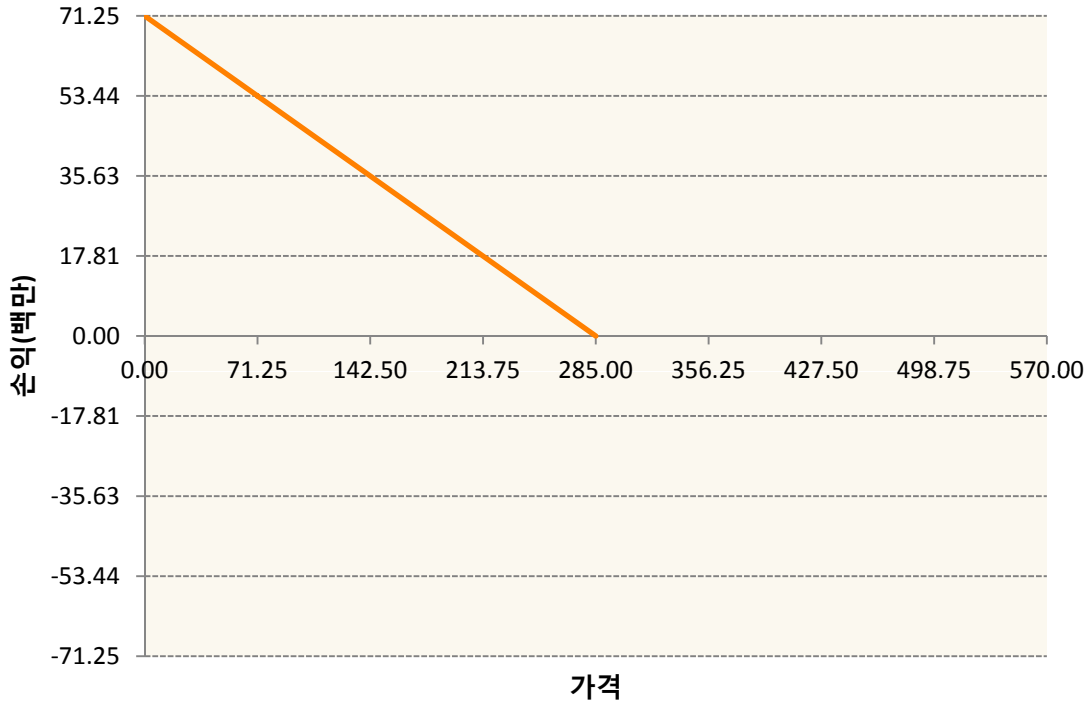


KR4301PC2824-2019-12 풋282.5





KR4301PC2857-2019-12 풋285



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101PC0002		2019-12 코스피200지수선물						875
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-875	-875	-875	-875	-875	-875	-875	
-5.33%	-583	-583	-583	-583	-583	-583	-583	
-2.67%	-292	-292	-292	-292	-292	-292	-292	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	292	292	292	292	292	292	292	
5.33%	583	583	583	583	583	583	583	
8.00%	875	875	875	875	875	875	875	
KR4201PC2957		2019-12 콜295						247
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	75	73	71	68	64	60	54	
-5.33%	71	67	62	56	50	43	36	
-2.67%	59	52	44	35	26	16	6	

0%	33	22	11	0	-12	-23	-35
2.67%	-13	-26	-39	-52	-65	-78	-91
5.33%	-83	-96	-109	-122	-136	-149	-162
8.00%	-175	-187	-198	-210	-222	-235	-247
KR4201PC2973 2019-12 콜297.5							691
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	189	185	180	172	163	151	137
-5.33%	180	171	159	145	128	109	89
-2.67%	153	135	114	91	66	39	12
0%	91	62	32	0	-33	-67	-101
2.67%	-25	-62	-100	-139	-177	-216	-255
5.33%	-209	-250	-290	-330	-371	-411	-451
8.00%	-465	-501	-538	-576	-614	-652	-691
KR4301PC2824 2019-12 풋282.5							86
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	85	85	85	86	86	86	86
-5.33%	50	50	51	51	52	53	53
-2.67%	18	19	20	21	23	24	25
0%	-5	-3	-2	0	2	3	5
2.67%	-14	-13	-12	-11	-10	-9	-7
5.33%	-16	-16	-16	-15	-15	-14	-13
8.00%	-17	-16	-16	-16	-16	-16	-16
KR4301PC2857 2019-12 풋285							5
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	5	5	5	5	5	5	5
-5.33%	3	3	3	3	3	3	3
-2.67%	1	1	1	1	1	1	1
0%	0	0	0	0	0	0	0
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)

1,504

공시일	2019-11-15
기준일	2019-11-14

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	201,257	0	201,257	

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	2019-11-15
기준일	2019-11-14

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	213,730	0	213,730	

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	2019-11-15
기준일	2019-11-14

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	543,046	0	543,046	
누계	통화	선도	0	569,059	-569,059	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음	
IE00BHNZKL13	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음	
FX21019U04 KRW/USD 25-11-19E		1,872
FX21019U04 KRW/USD 25-11-19E		1,965
FX21019V00 KRW/USD 10-12-19E		655
FX21019V00 KRW/USD 10-12-19E		692
FX21019V01 KRW/USD 16-12-19E		1,684
FX21019V01 KRW/USD 18-11-19E		2,470
FX21019V01 KRW/USD 18-11-19E		468
FX21019V02 KRW/USD 21-11-19E		5,091
FX21019V02 KRW/USD 23-12-19E		4,772
FX21019V02 KRW/USD 23-01-20E		1,404
FX21019V02 KRW/USD 25-11-19E		2,807
FX21019V02 KRW/USD 23-01-20E		1,507
FX21019V02 KRW/USD 25-11-19E		2,845
FX21019V03 KRW/USD 29-11-19E		936
FX21019V03 KRW/USD 29-11-19E		936
FX21019V04 KRW/USD 29-11-19E		1,872
FX21019V04 KRW/USD 29-11-19E		1,872
FX21019V04 KRW/USD 06-12-19E		936
FX21019V04 KRW/USD 06-12-19E		936
FX21019V04 KRW/USD 06-12-19E		936
FX21019V04 KRW/USD 06-12-19E		936
FX21019V04 KRW/USD 06-12-19E		468
FX21019X00 KRW/USD 06-12-19E		655
FX21019X00 KRW/USD 10-12-19E		468
FX21019X00 KRW/USD 10-12-19E		468
FX21019X00 KRW/USD 10-12-19E		468

FX21019X00 KRW/USD 12-12-19E	1,535
FX21019X00 KRW/USD 12-12-19E	936
FX21019X02 KRW/USD 18-12-19E	468
FX21019X02 KRW/USD 18-12-19E	936
FX21019X02 KRW/USD 18-12-19E	1,535

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

(단위:백만원)

14,408

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

(단위:백만원)

187

공시일	2019-11-15
기준일	2019-11-14

커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

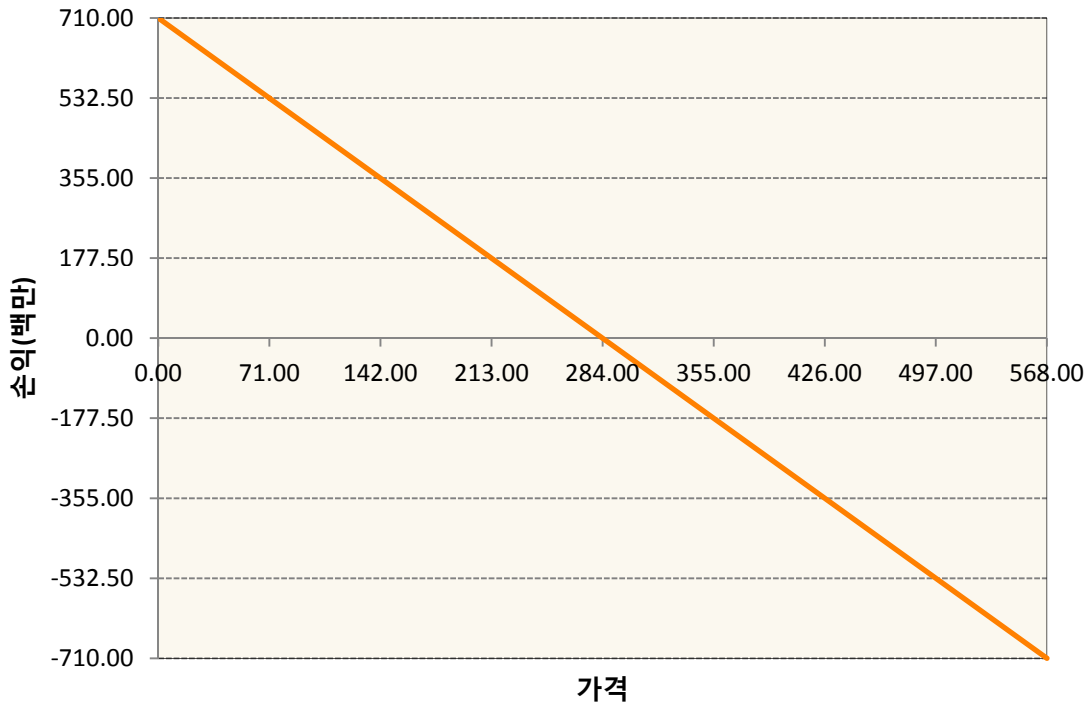
1. 계약금액

(단위:백만원)

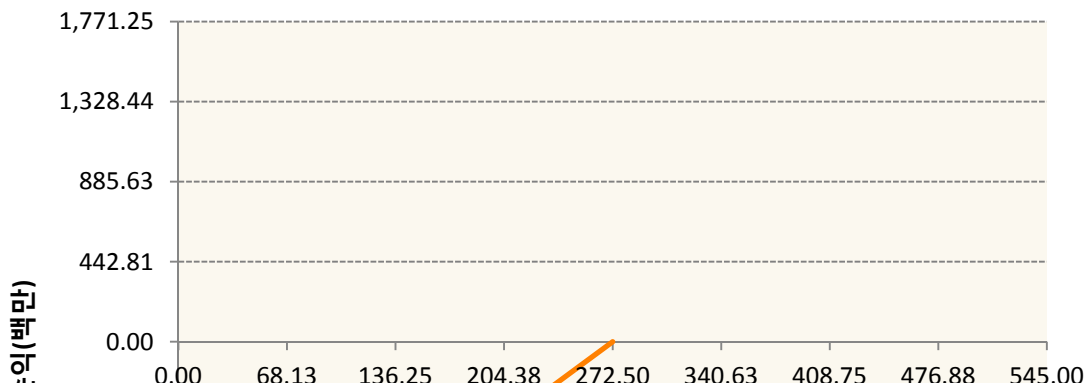
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	3,920	-3,920	장내
누계	유가증권	선물	0	710	-710	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,903	-3,903	장내

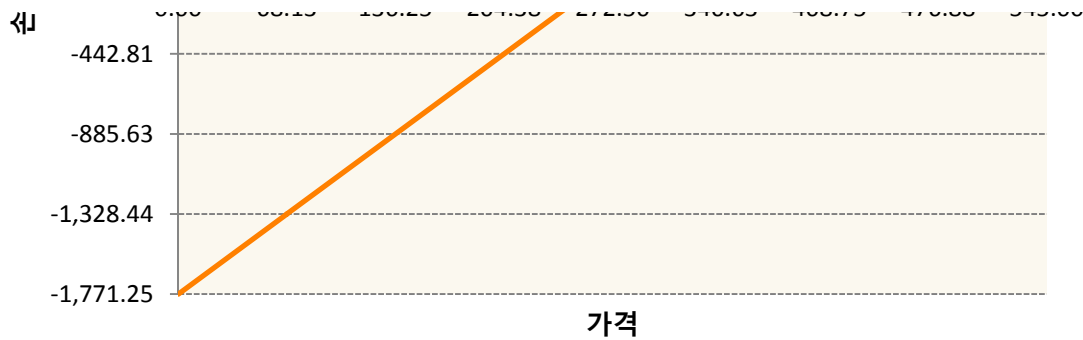
2. 만기시점의 손익구조

KR4101PC0002-2019-12 코스피200지수선물

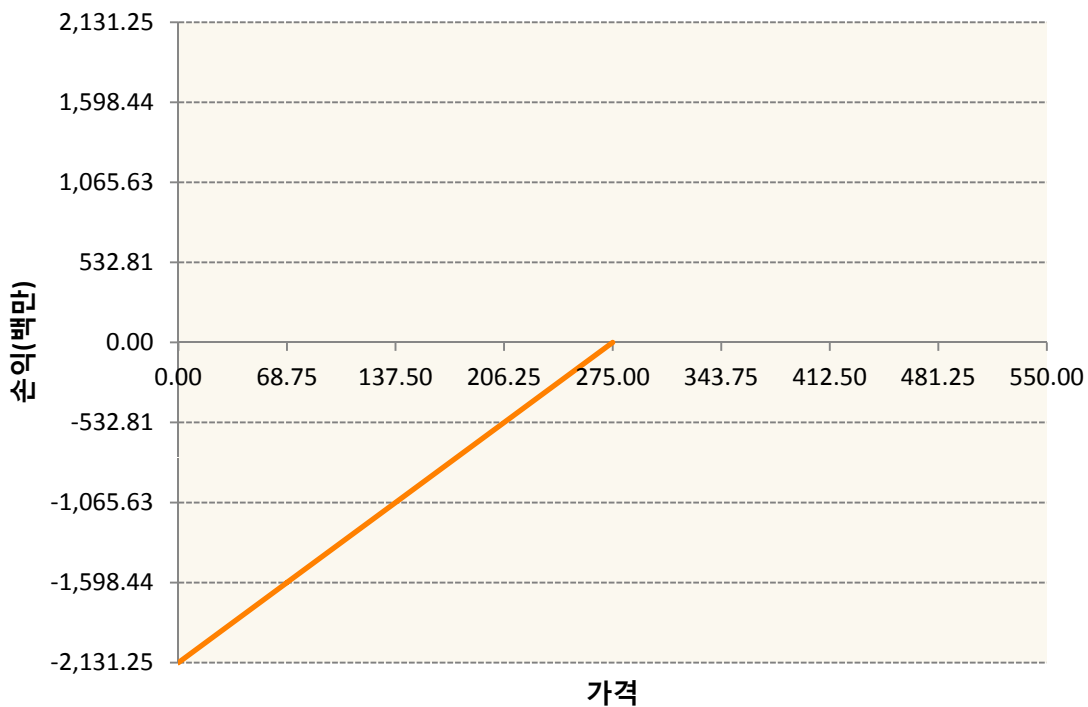


KR4301PC2725-2019-12 풋272.5





KR4301PC2758-2019-12 풋275



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101PC0002		2019-12 코스피200지수선물						57
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	57	57	57	57	57	57	57	
-5.33%	38	38	38	38	38	38	38	
-2.67%	19	19	19	19	19	19	19	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	-19	-19	-19	-19	-19	-19	-19	
5.33%	-38	-38	-38	-38	-38	-38	-38	
8.00%	-57	-57	-57	-57	-57	-57	-57	
KR4301PC2725		2019-12 풋272.5						77
기초자산의 변동성								

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-71	-72	-73	-74	-75	-76	-77
-5.33%	-30	-32	-34	-36	-38	-40	-42
-2.67%	-5	-7	-9	-11	-13	-15	-17
0%	3	2	1	0	-1	-3	-4
2.67%	4	4	4	3	3	2	2
5.33%	4	4	4	4	4	4	4
8.00%	4	4	4	4	4	4	4

KR4301PC2758

2019-12 풋275

106

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-100	-101	-101	-102	-103	-104	-106
-5.33%	-47	-49	-51	-53	-55	-57	-59
-2.67%	-10	-13	-16	-18	-21	-23	-26
0%	5	3	2	0	-2	-4	-6
2.67%	8	8	7	6	6	5	4
5.33%	8	8	8	8	8	7	7
8.00%	8	8	8	8	8	8	8

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

(단위:백만원)

192

공시일	2019-11-15
기준일	2019-11-14

H2O트리오(H)(채권혼합-파생재간접형)

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	15,382	0	15,382	
누계	통화	선도	351	15,452	-15,101	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음	
FX21019V01 KRW/USD 10-12-19E		371
FX21019V02 KRW/USD 25-11-19E		318
FX21019V03 KRW/USD 29-11-19E		318
FX21019X01 KRW/USD 13-01-20E		229
FX21019X02 USD/KRW 25-11-19E		28

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

(단위:백만원)

400

공시일	2019-11-15
기준일	2019-11-14

스마트베트남VN30인덱스(주식혼합)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	스왑	683	0	683	장외
누계	통화	선도	200	405	-206	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

2.55E+11 E1VFN30 VN ETF(EUR)	36
2.55E+11 E1VFN30 VN ETF(EUR)	18
FX21019U00 KRW/EUR 22-11-19E	2
FX21019U02 KRW/EUR 22-11-19E	2
FX21019U04 EUR/KRW 22-11-19E	2
FX21019V00 KRW/EUR 22-11-19E	2
FX21019V00 KRW/EUR 22-11-19E	2
FX21019V01 KRW/EUR 22-11-19E	2
FX21019V01 KRW/EUR 22-11-19E	2
FX21019V02 KRW/EUR 22-11-19E	4
FX21019V03 EUR/KRW 22-11-19E	14
FX21019V04 KRW/EUR 31-01-20E	3
FX21019X00 KRW/EUR 31-01-20E	3
FX21019X00 KRW/EUR 31-01-20E	6
FX21019X01 KRW/EUR 31-01-20E	5

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

(단위:백만원)

62

공시일	2019-11-15
기준일	2019-11-14

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

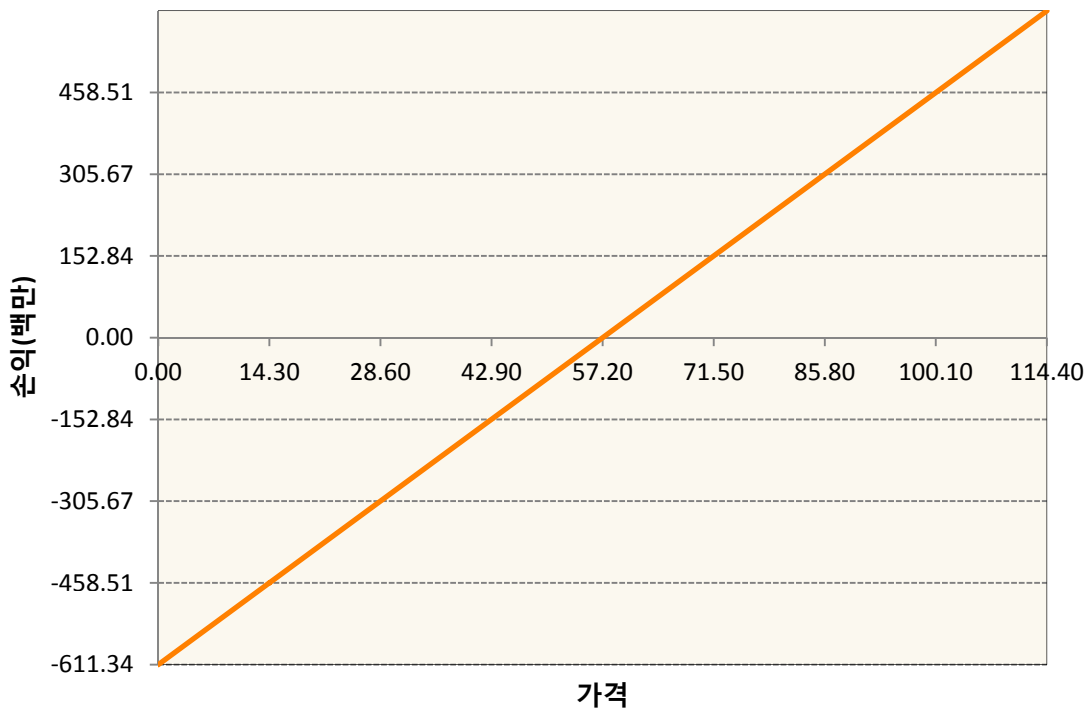
1. 계약금액

(단위:백만원)

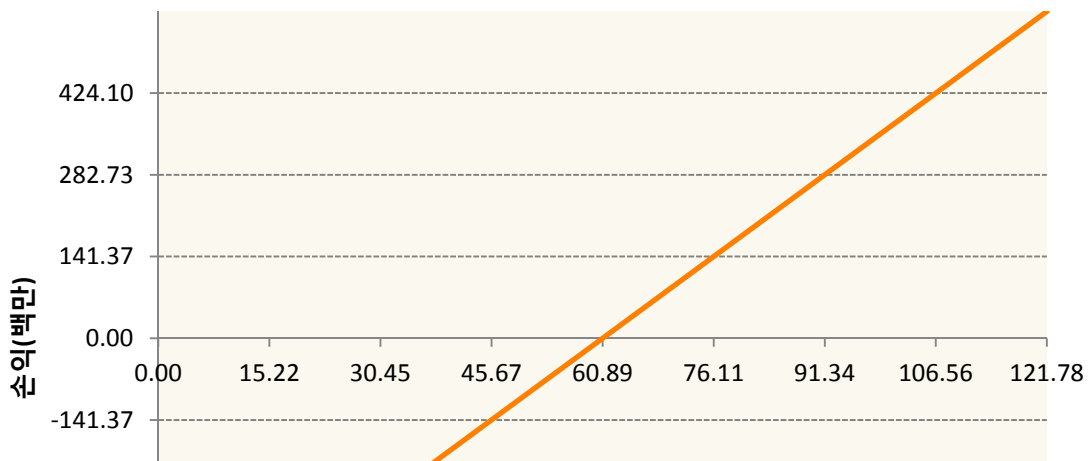
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,488	293	2,195	

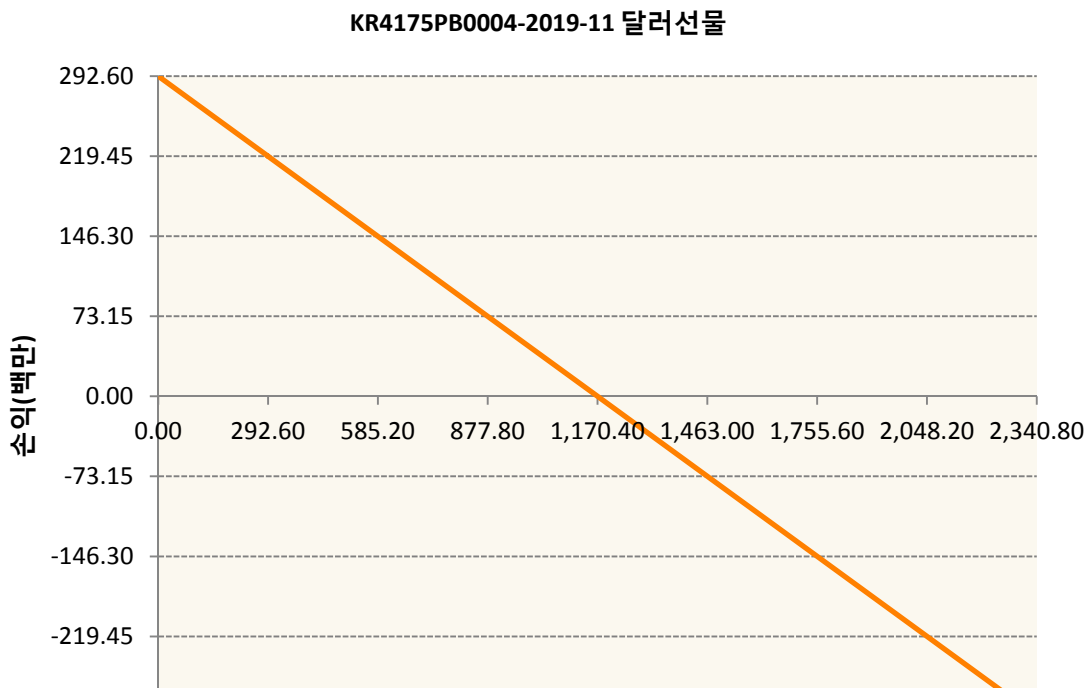
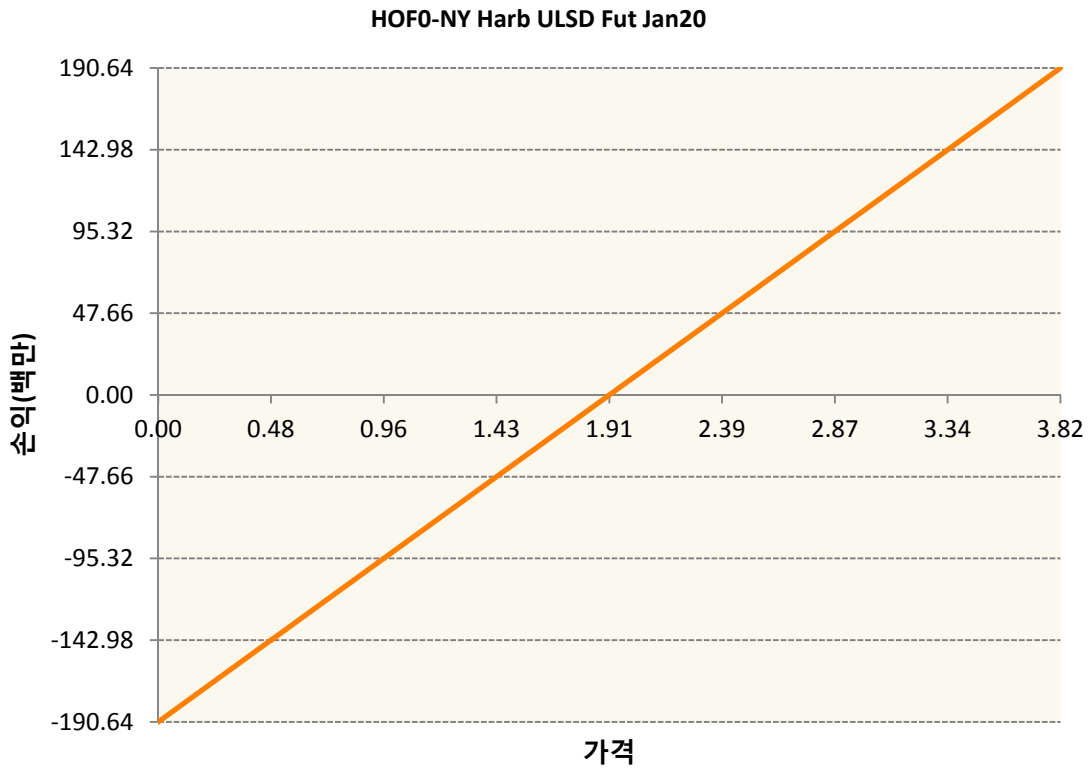
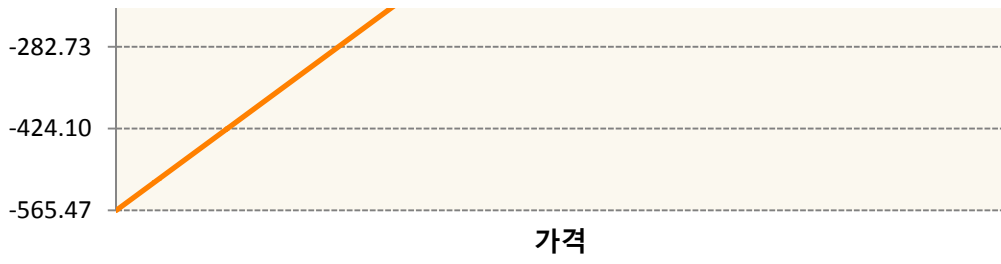
2. 만기시점의 손익구조

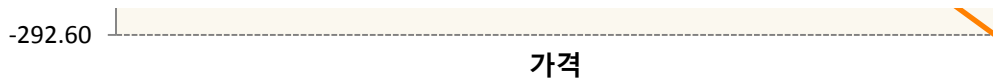
CLF0-WTI CRUDE FUTURE Jan20



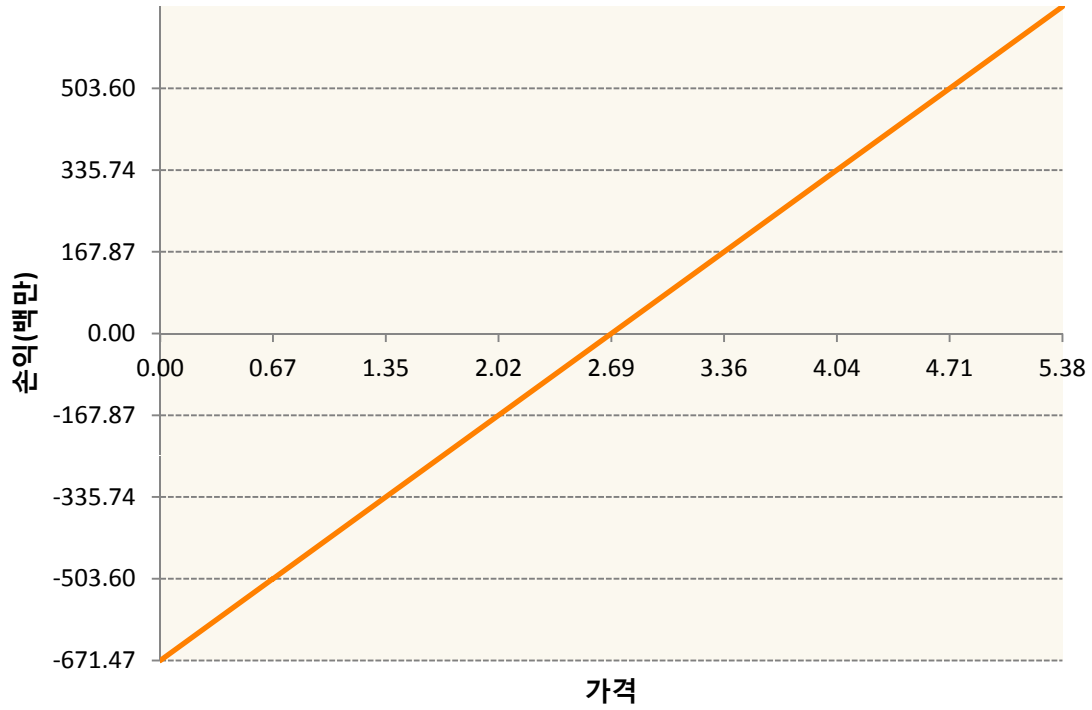
COH0-BRENT CRUDE FUTR Mar20



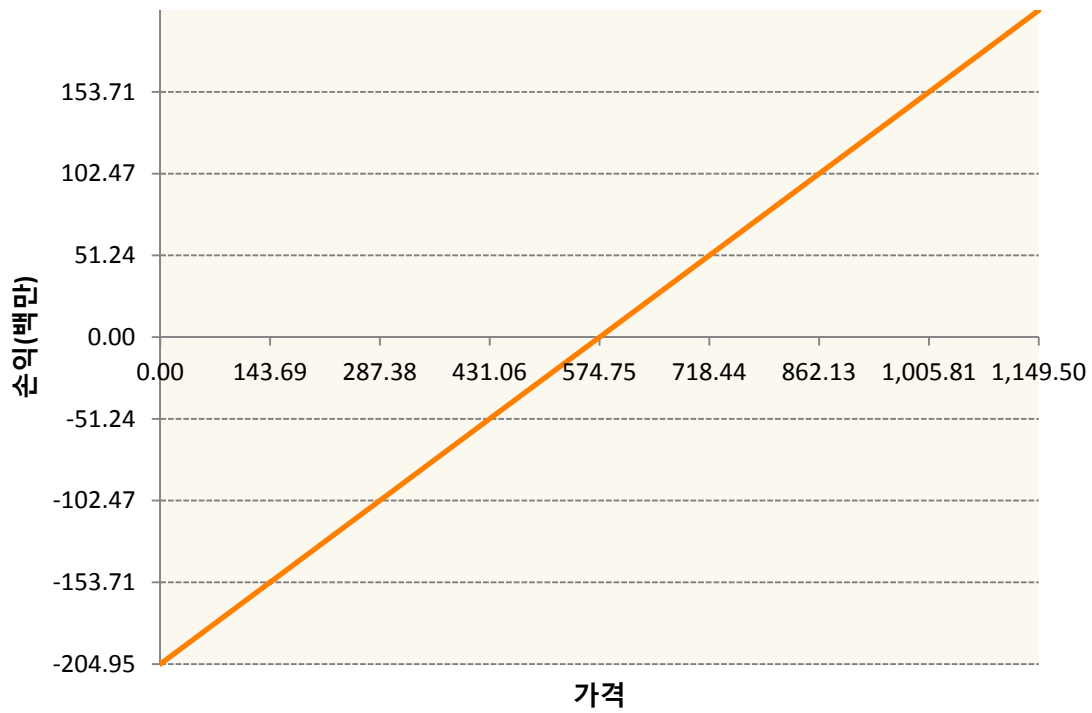




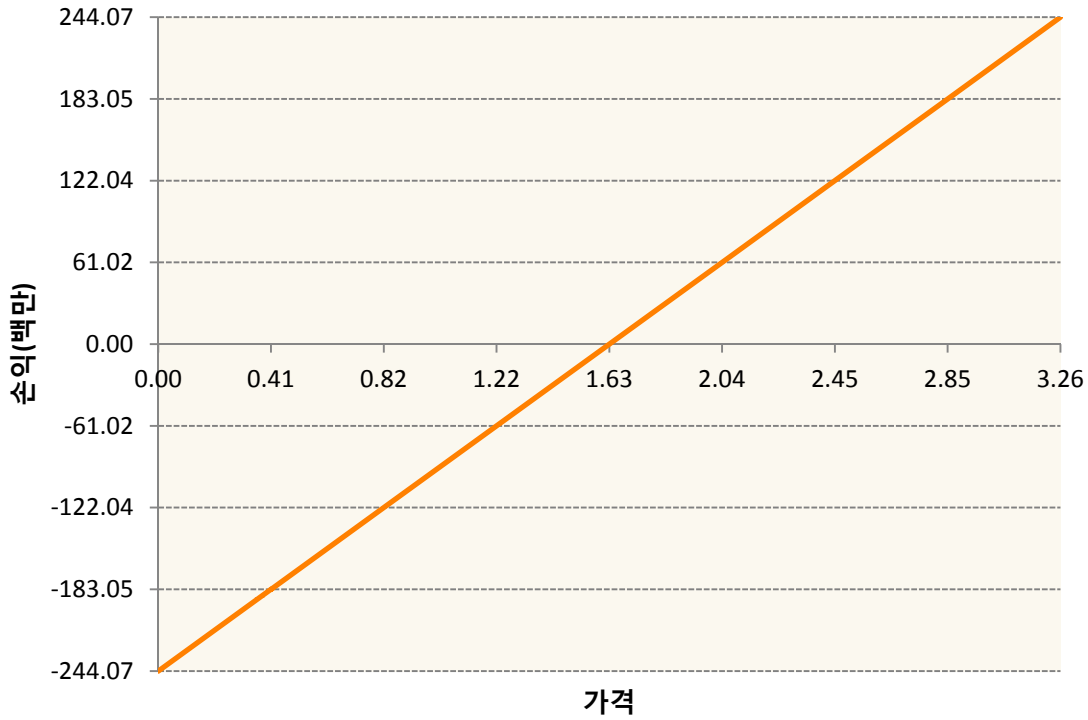
NGF20-NATURAL GAS FUTR Jan20



QSF0-Low Su Gasoil G Jan20



XBF0-GASOLINE RBOB FUT Jan20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

CLF0	WTI CRUDE FUTURE Jan20	49
COH0	BRENT CRUDE FUTR Mar20	45
HOF0	NY Harb ULSD Fut Jan20	15
KR4175PB00	2019-11 달러선물	23
NGF20	NATURAL GAS FUTR Jan20	54
QSF0	Low Su Gasoil G Jan20	16
XBF0	GASOLINE RBOB FUT Jan20	20

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

(단위:백만원)

417

공시일	2019-11-15
기준일	2019-11-14

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

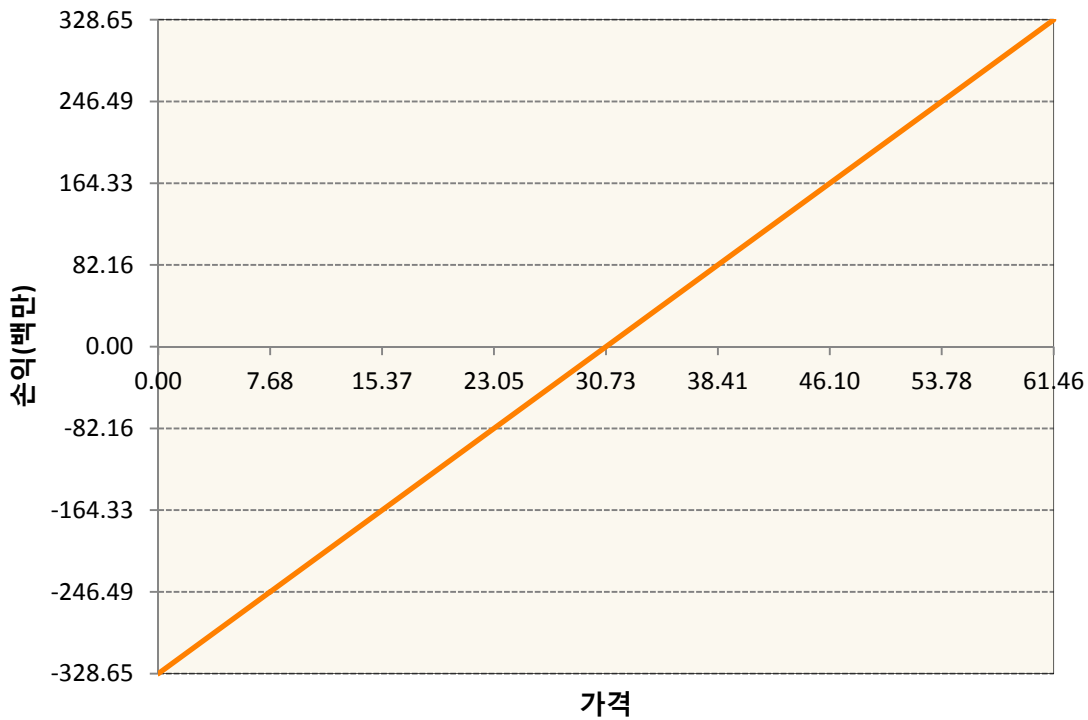
1. 계약금액

(단위:백만원)

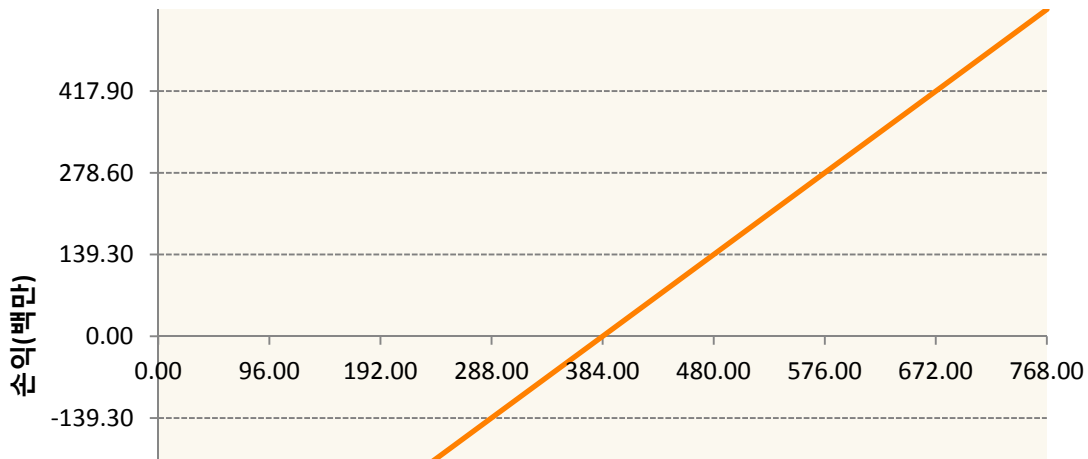
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,822	94	2,728	

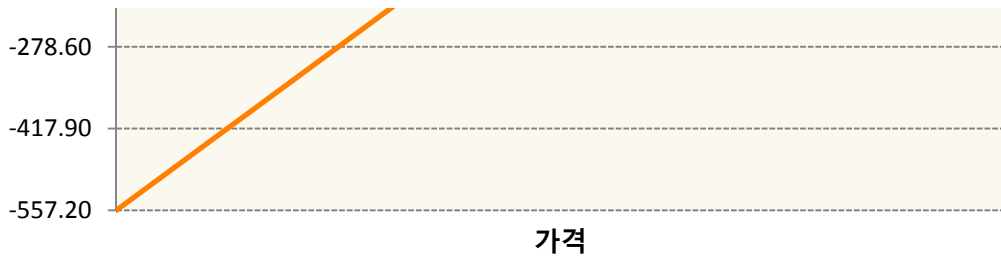
2. 만기시점의 손익구조

BOF0-SOYBEAN OIL FUTR Jan20

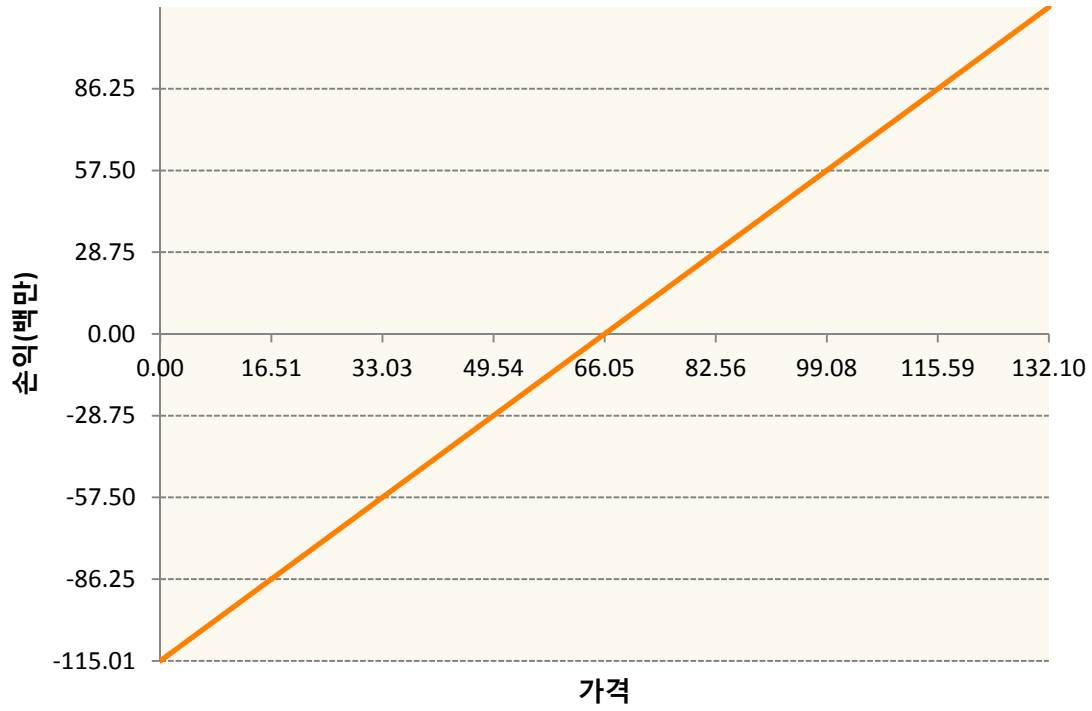


CH0-CORN FUTURE Mar20

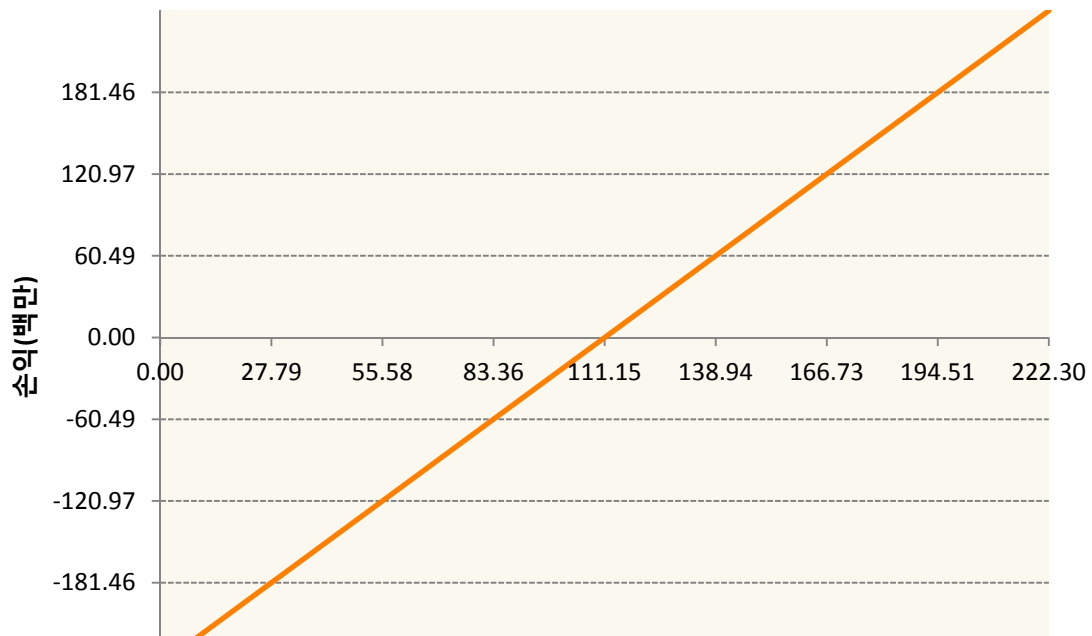


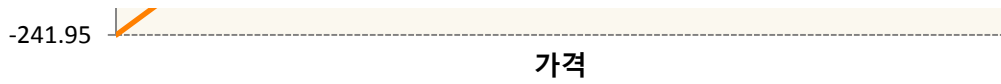


CTH0-COTTON NO.2 FUTR Mar20

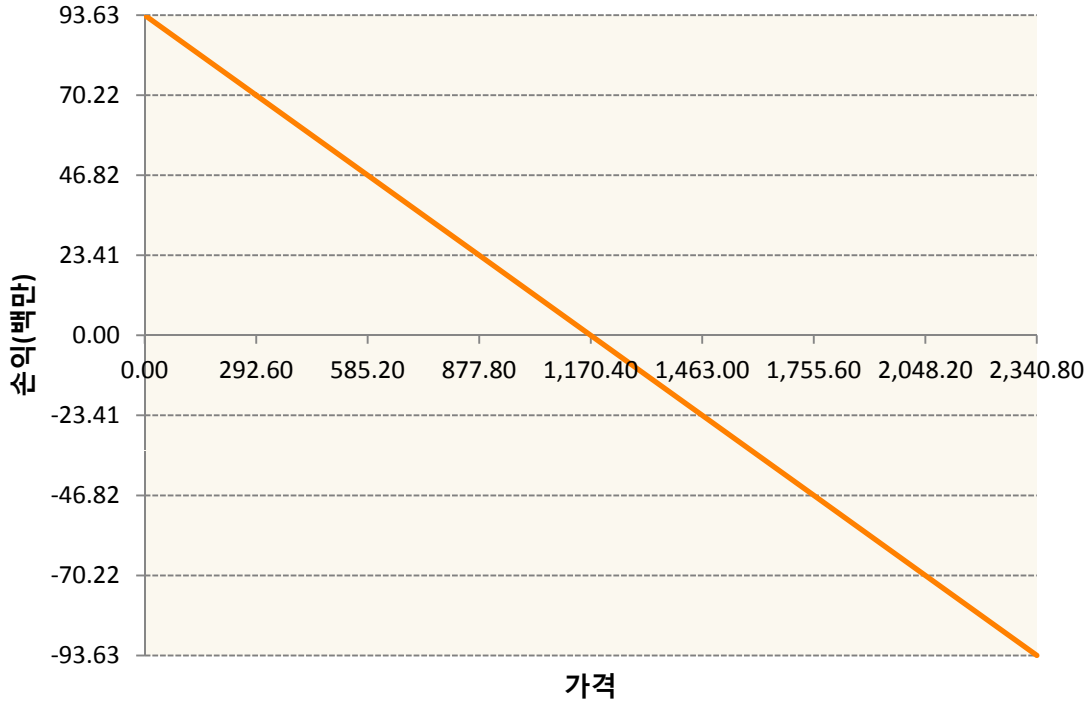


KCH0-COFFEE 'C' FUTURE Mar20

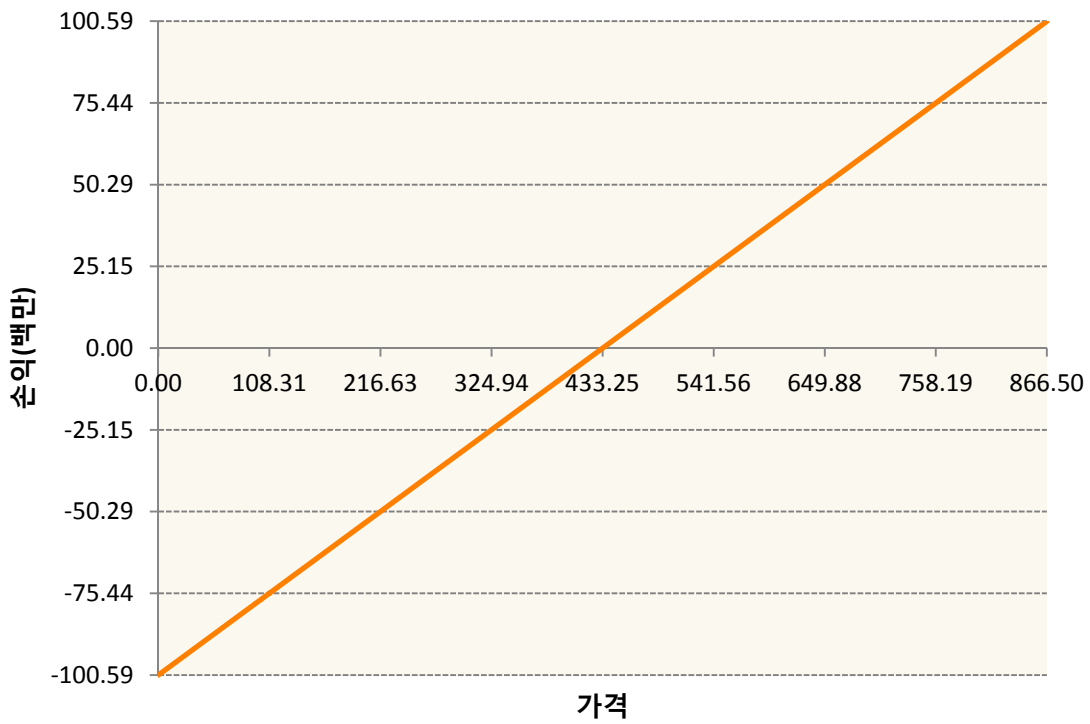




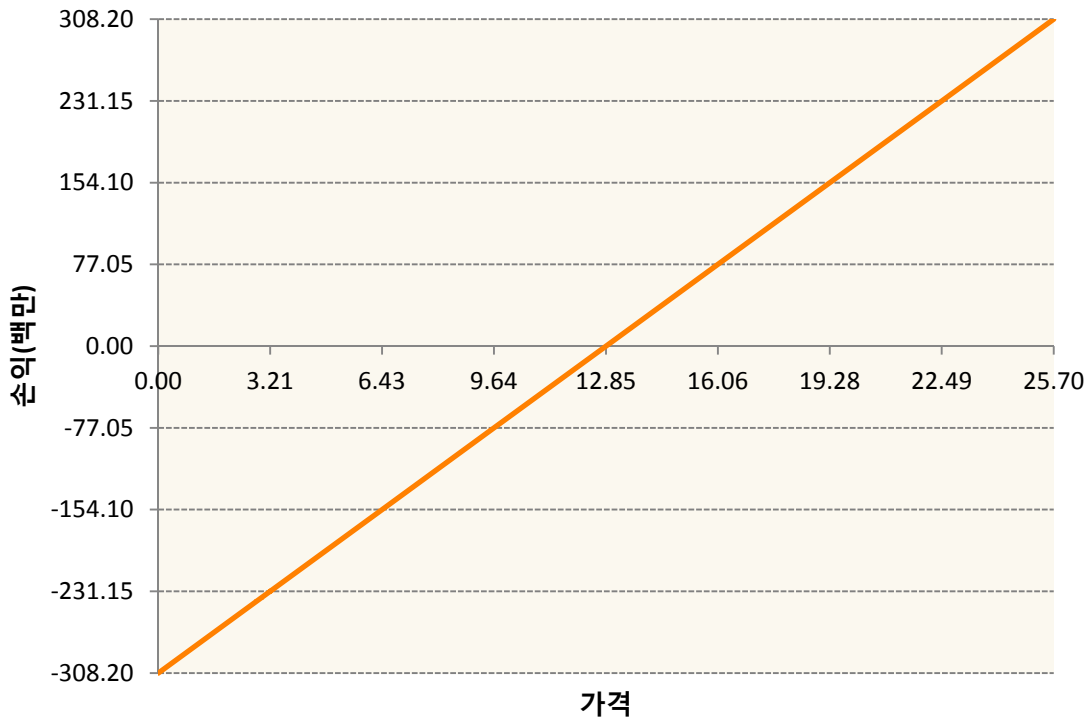
KR4175PB0004-2019-11 달러선물



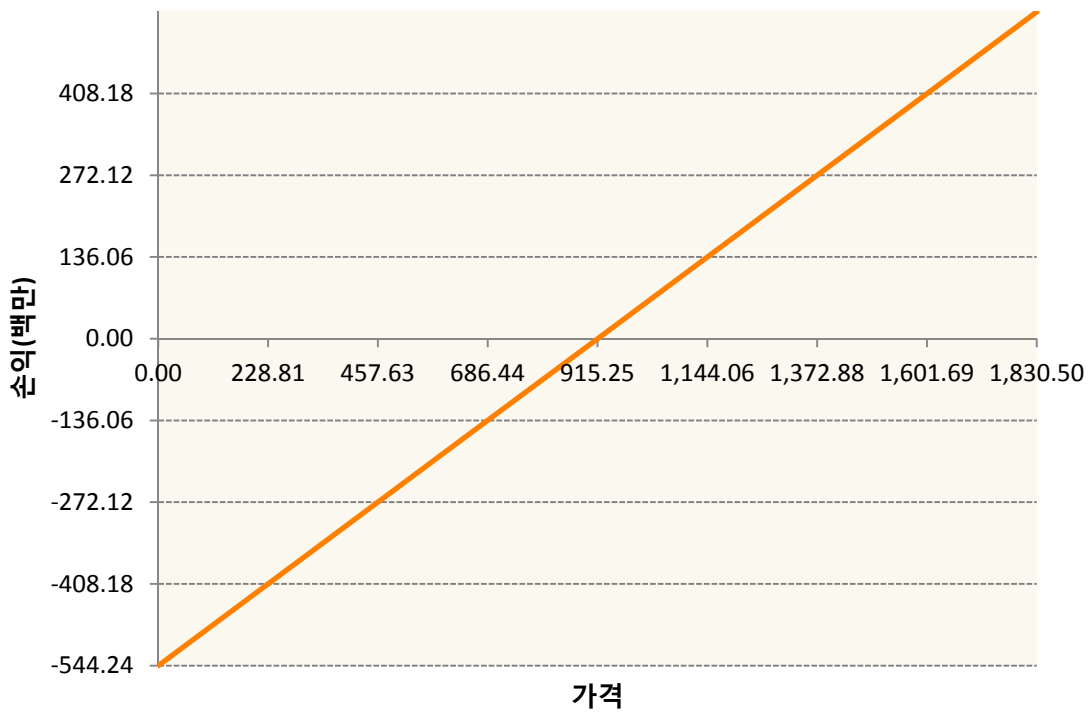
KWH0-KC HRW WHEAT FUT Mar20



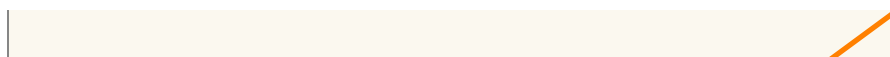
SBH0-Sugar Mar20

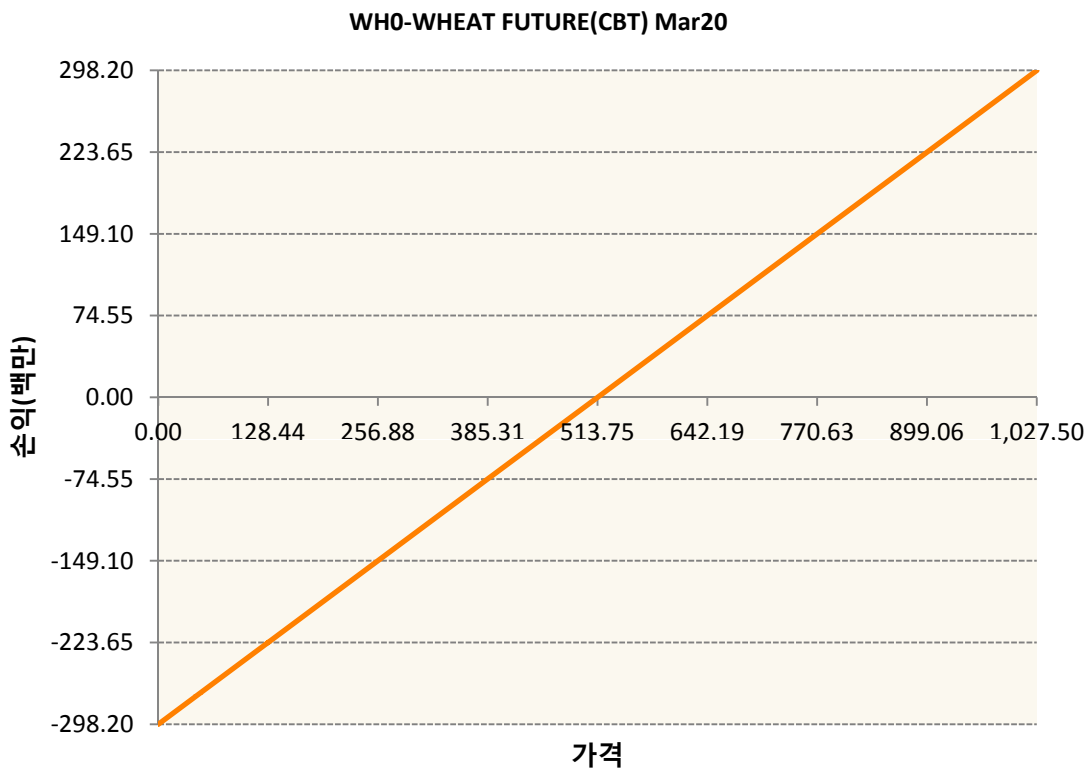
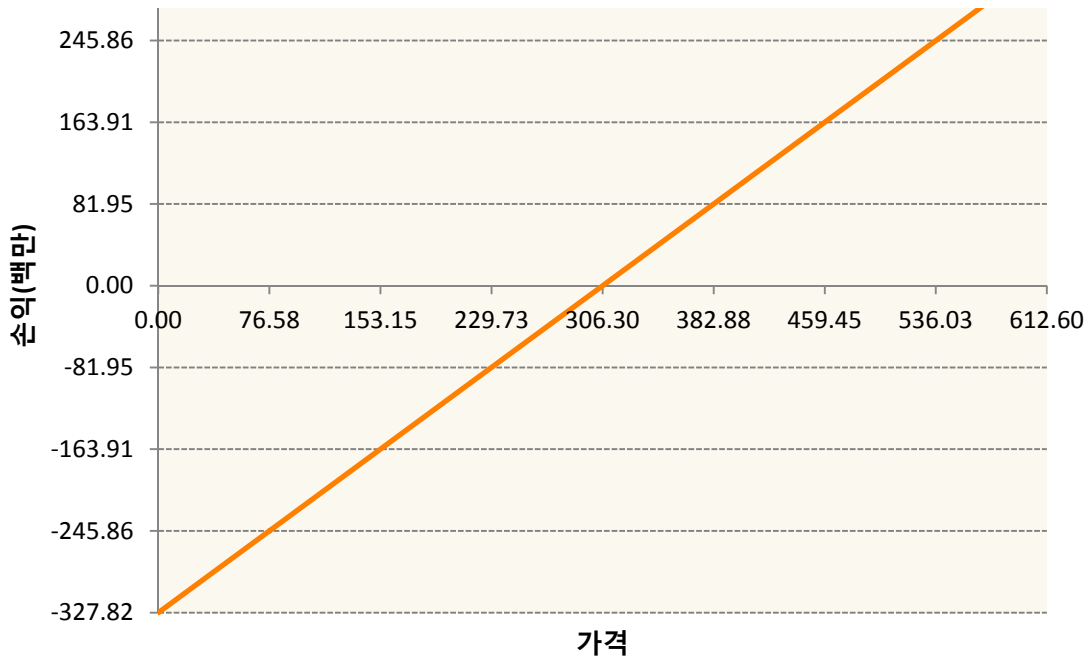


SF0-SOYBEAN FUTURE Jan20



SMF0-SOYBEAN MEAL FUTR Jan20





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
BOF0	SOYBEAN OIL FUTR Jan20	26
CH0	CORN FUTURE Mar20	45
CTH0	COTTON NO.2 FUTR Mar20	9
KCH0	COFFEE 'C' FUTURE Mar20	19
KR4175PB00	2019-11 달러선물	7

KWH0	KC HRW WHEAT FUT Mar20	8
SBH0	Sugar Mar20	25
SF0	SOYBEAN FUTURE Jan20	44
SMF0	SOYBEAN MEAL FUTR Jan20	26
WH0	WHEAT FUTURE(CBT) Mar20	24

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

(단위:백만원)

249