

공시일	2019-02-07
기준일	2019-02-01

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)

101

공시일	2019-02-07
기준일	2019-02-01

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

1,079

* 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	2019-02-07
기준일	2019-02-01

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)

516

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-02-07
기준일	2019-02-01

유로인덱스모(주식-파생형)

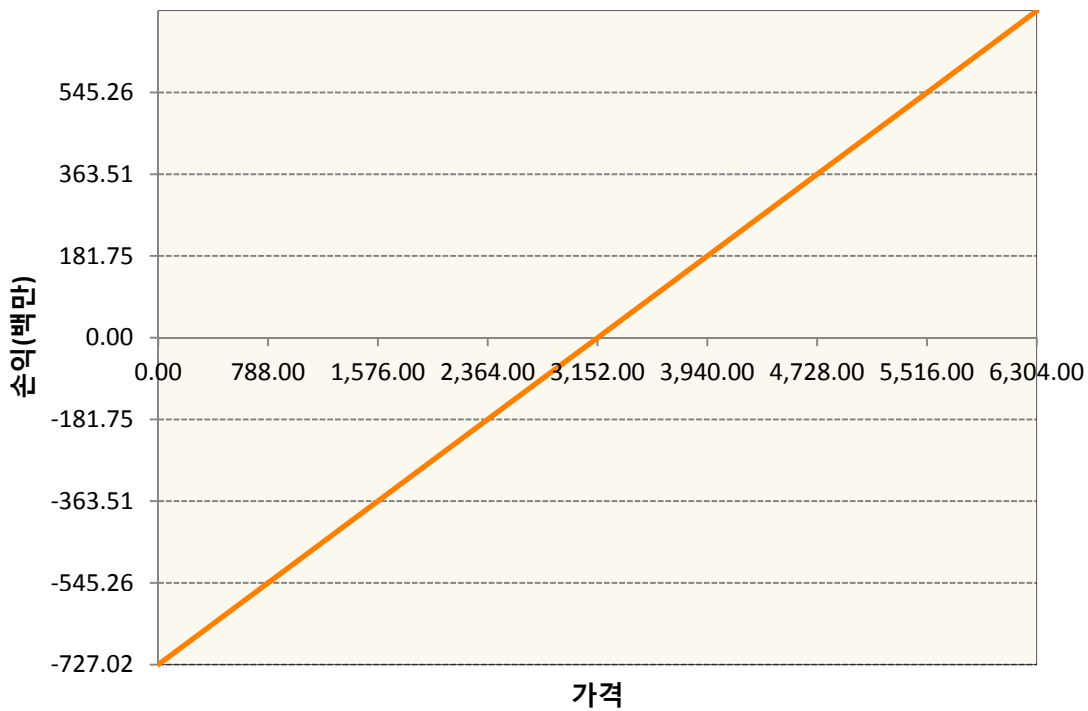
1. 계약금액

(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	2019-02-07
기준일	2019-02-01

차이나인덱스모(주식-파생형)

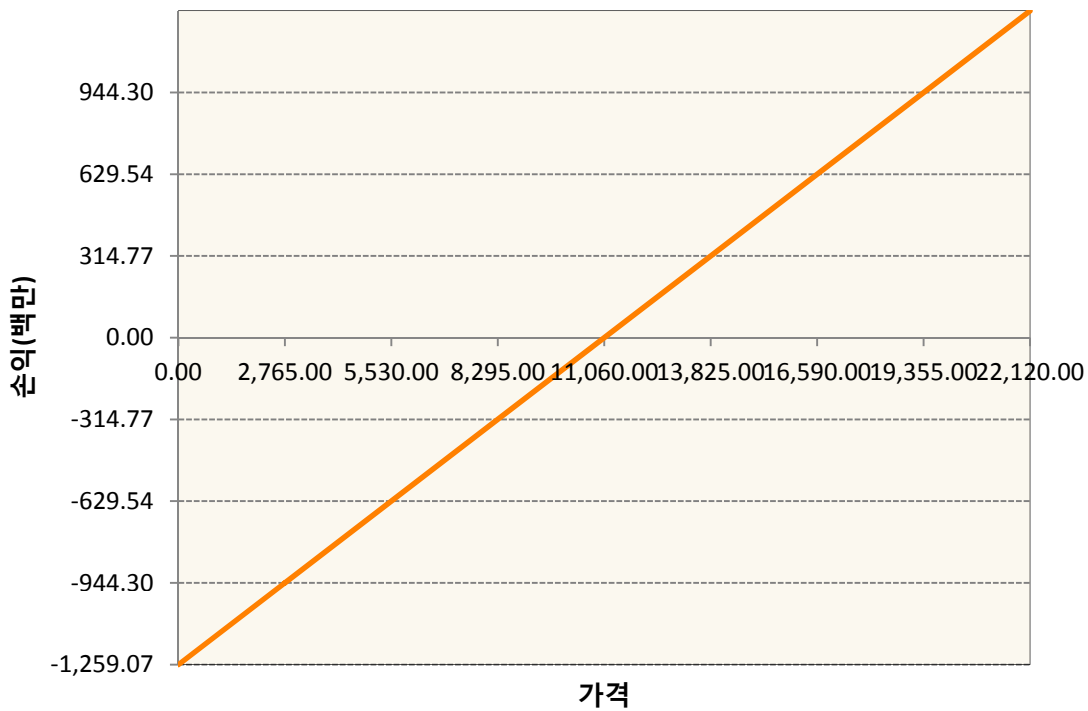
1. 계약금액

(단위:백만원)

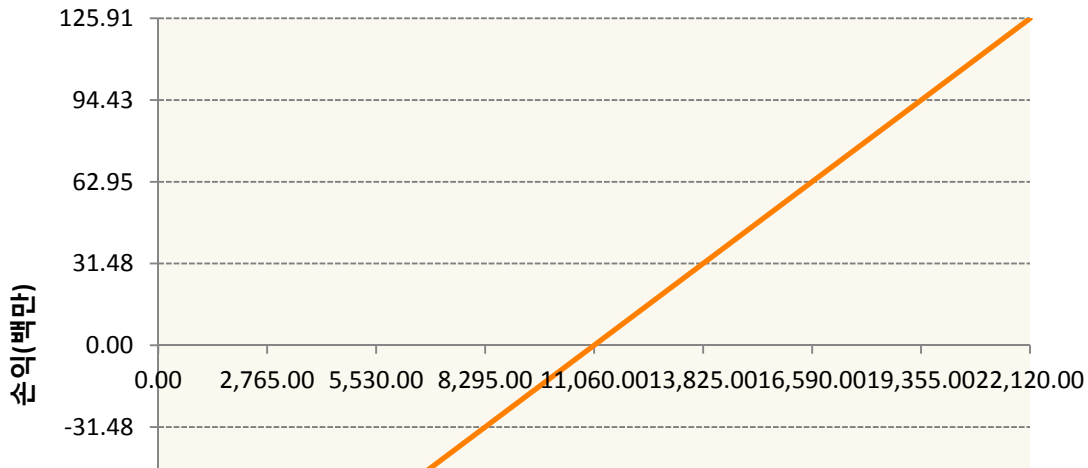
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,385	0	1,385	장내

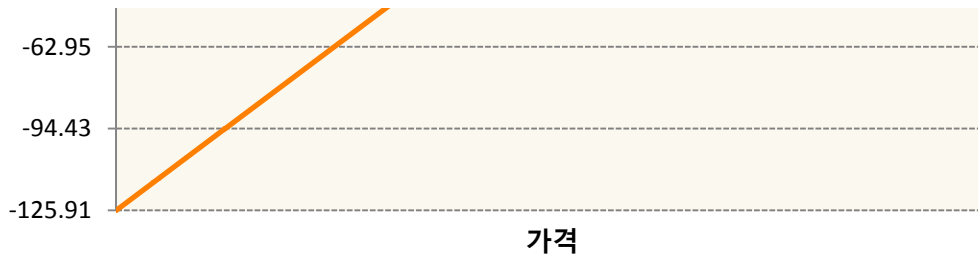
2. 만기시점의 손익구조

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)

114

공시일	2019-02-07
기준일	2019-02-01

커버드콜모(주식혼합-파생형)

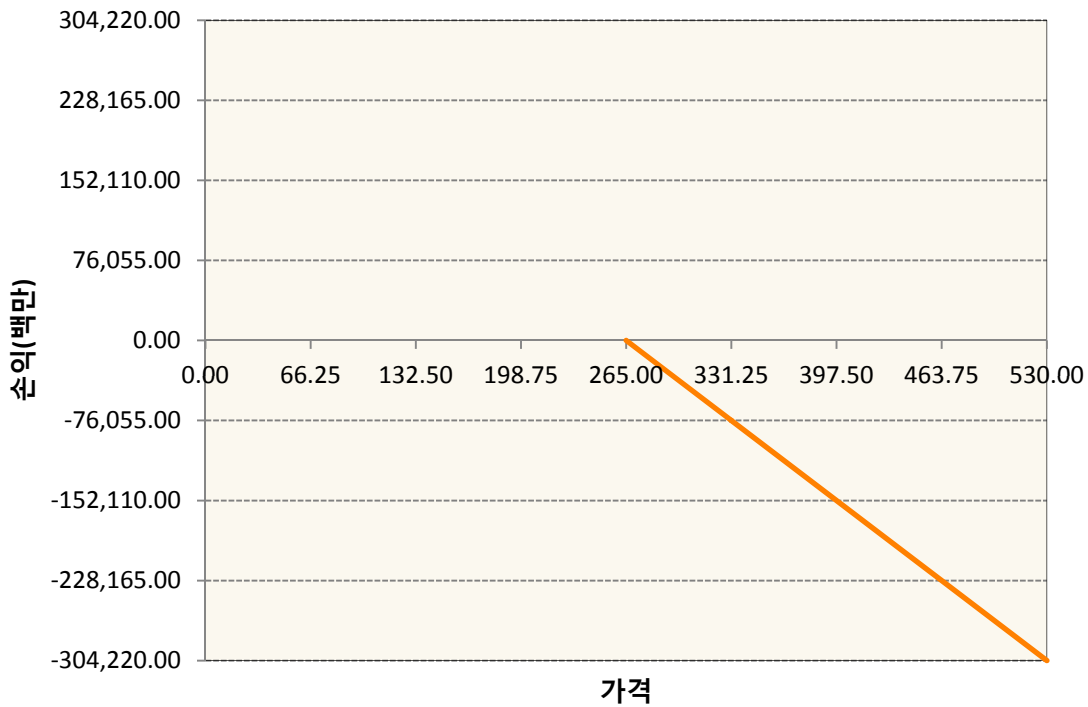
1. 계약금액

(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

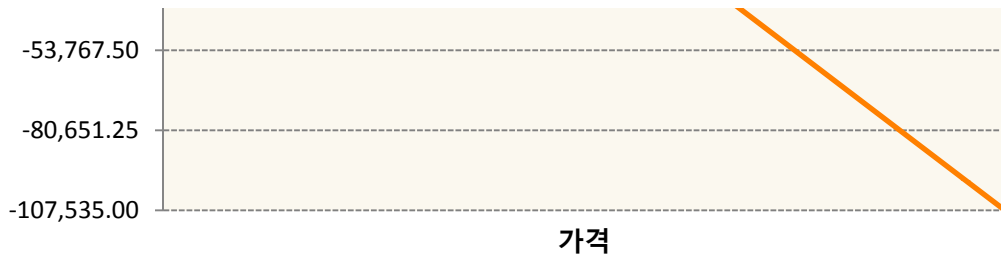
2. 만기시점의 손익구조

KR4201P22655-2019-02 콜265

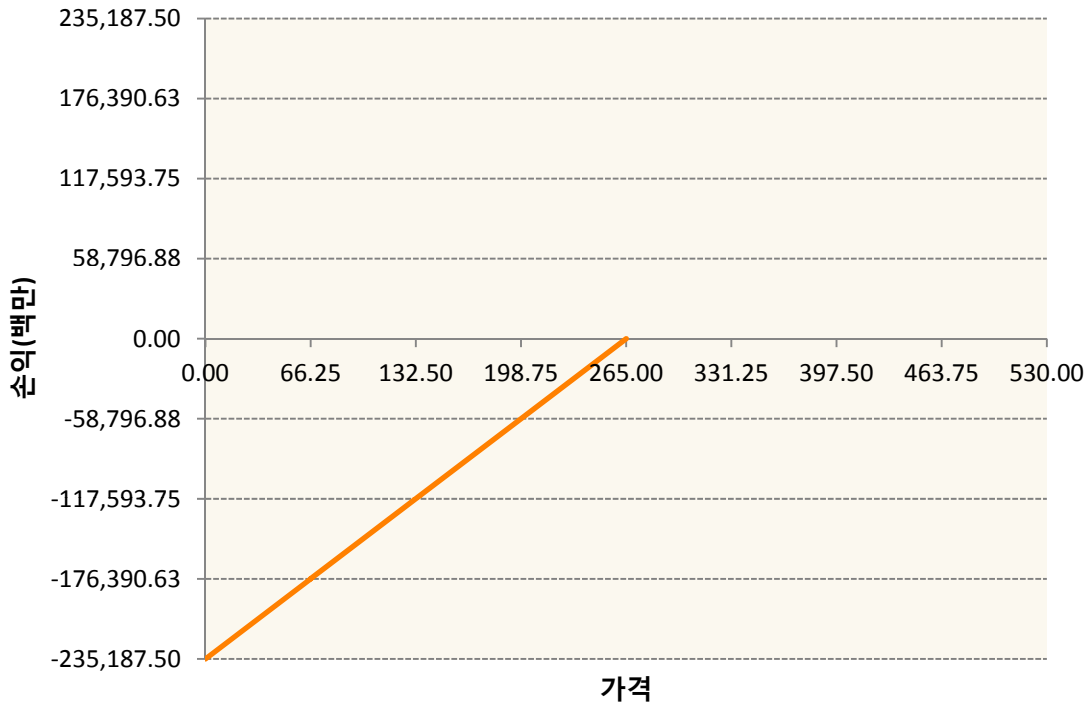


KR4201P22671-2019-02 콜267.5





KR4301P22653-2019-02 풋265



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4201P22655		2019-02 콜265					25,864
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	20,912	20,431	19,948	19,464	18,979	18,493	18,007
-5.33%	15,884	15,452	15,009	14,558	14,099	13,635	13,167
-2.67%	8,655	8,425	8,160	7,865	7,545	7,203	6,842
0%	322	246	139	0	-170	-369	-594
2.67%	-8,347	-8,363	-8,394	-8,443	-8,512	-8,605	-8,722
5.33%	-17,081	-17,084	-17,090	-17,103	-17,126	-17,161	-17,212
8.00%	-25,824	-25,824	-25,825	-25,827	-25,833	-25,845	-25,864
KR4201P22671		2019-02 콜267.5					8,988
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	6,756	6,600	6,441	6,280	6,117	5,952	5,787

-5.33%	5,300	5,132	4,962	4,792	4,621	4,450	4,278
-2.67%	2,988	2,881	2,764	2,639	2,507	2,369	2,226
0%	162	121	66	0	-77	-164	-261
2.67%	-2,850	-2,860	-2,878	-2,904	-2,939	-2,983	-3,036
5.33%	-5,904	-5,906	-5,910	-5,918	-5,930	-5,949	-5,974
8.00%	-8,965	-8,965	-8,966	-8,968	-8,971	-8,978	-8,988
KR4301P22653 2019-02 풋265							4,241
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-3,002	-3,204	-3,408	-3,615	-3,822	-4,031	-4,241
-5.33%	-410	-550	-703	-864	-1,034	-1,210	-1,390
-2.67%	-10	-30	-60	-102	-156	-223	-301
0%	6	6	4	0	-7	-20	-37
2.67%	7	7	7	6	6	5	3
5.33%	7	7	7	7	7	7	6
8.00%	7	7	7	7	7	7	7

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

(단위:백만원)

37,185

공시일	2019-02-07
기준일	2019-02-01

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

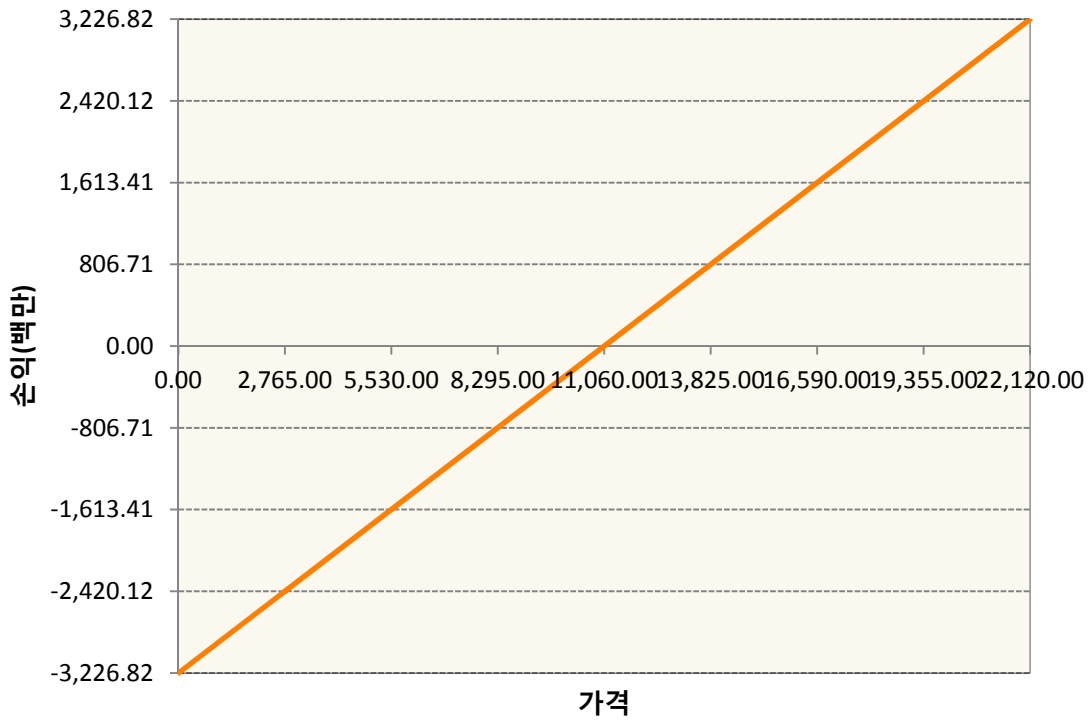
1. 계약금액

(단위:백만원)

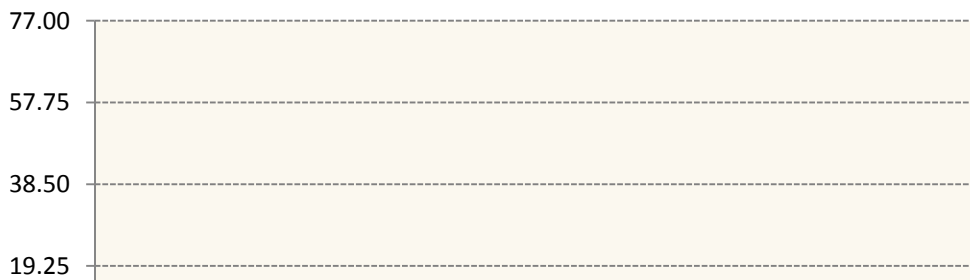
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	3,227	0	3,227	장내
누계	유가증권	옵션	0	7,615	-7,615	장내
누계	통화	선도	0	2,709	-2,709	장외

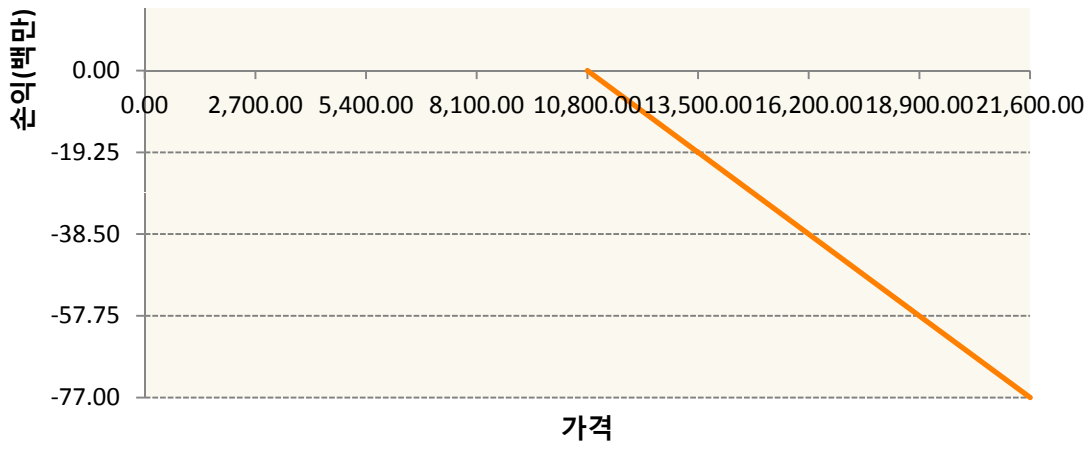
2. 만기시점의 손익구조

HCG9-HSCEI Futures Feb19

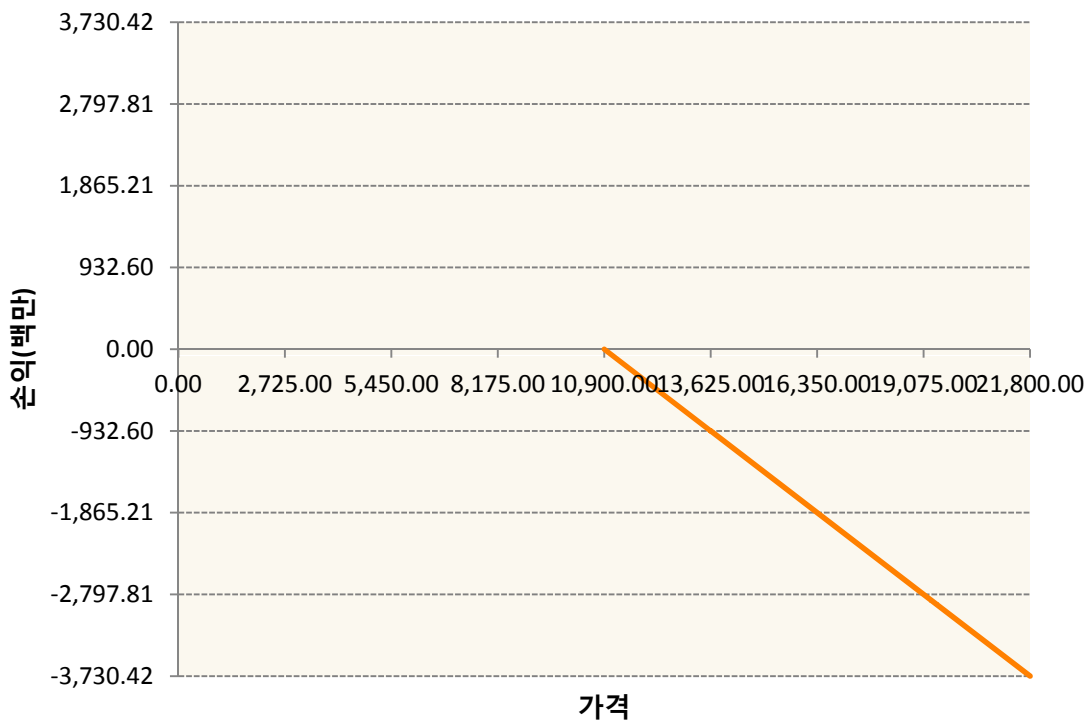


OHHIG9-C108-HSCEI

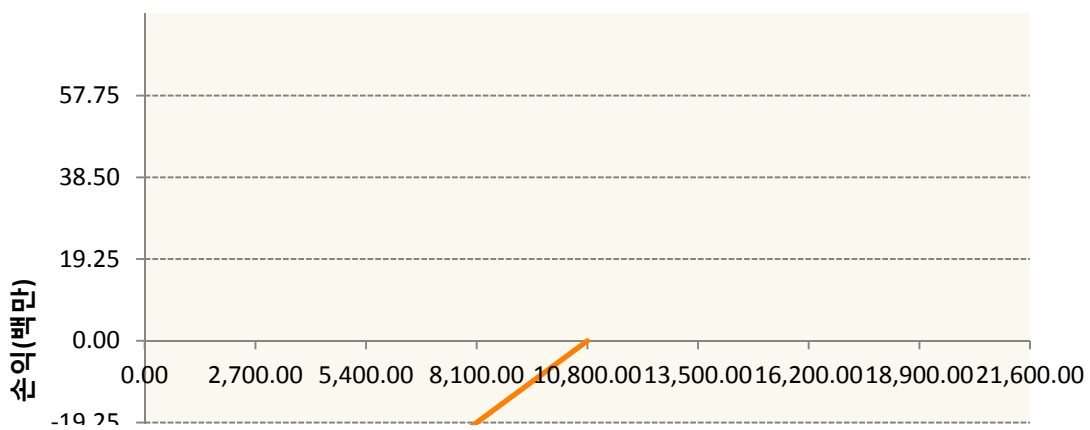


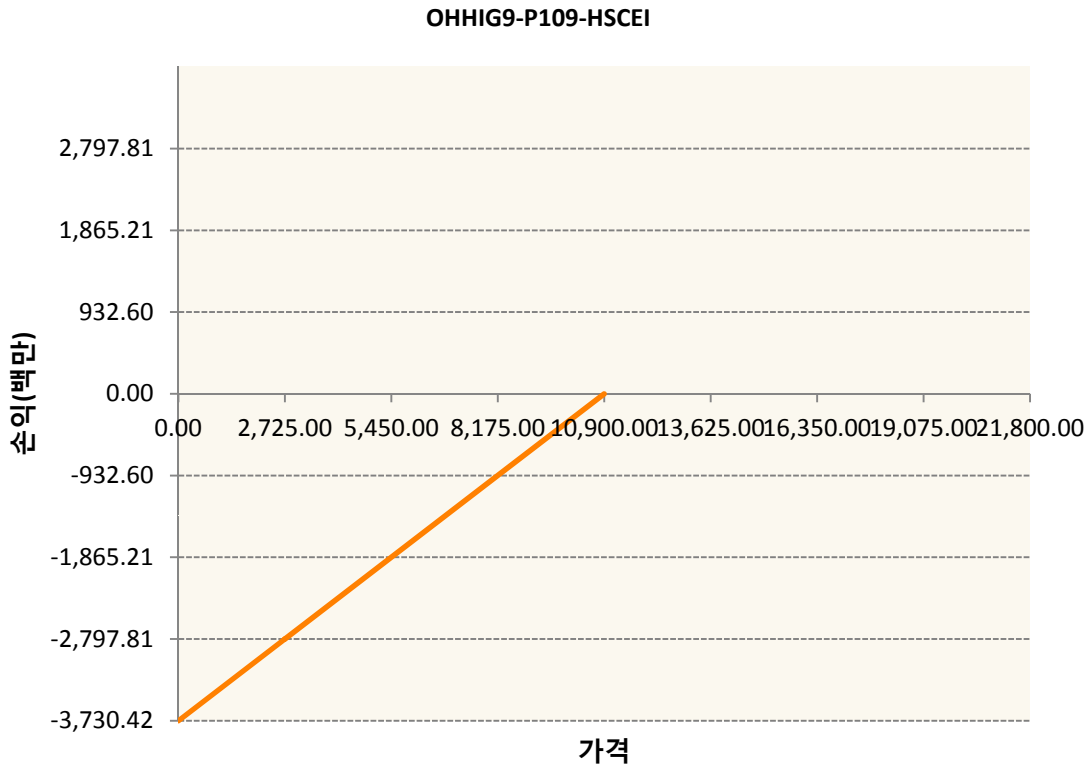
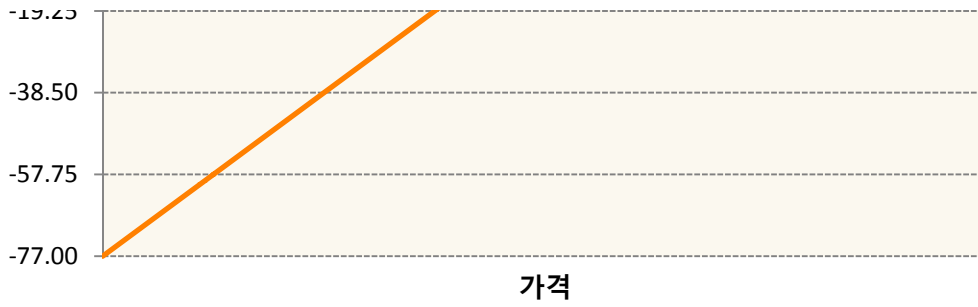


OHHIG9-C109-HSCEI



OHHIG9-P108-HSCEI





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

FX21018Z00 KRW/HKD 11-03-19E	217
HCG9 HSCEI Futures Feb19	258
OHHIG9-C1(HSCEI	6
OHHIG9-C1(HSCEI	298
OHHIG9-P1(HSCEI	6
OHHIG9-P1(HSCEI	298

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

971

공시일	2019-02-07
기준일	2019-02-01

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

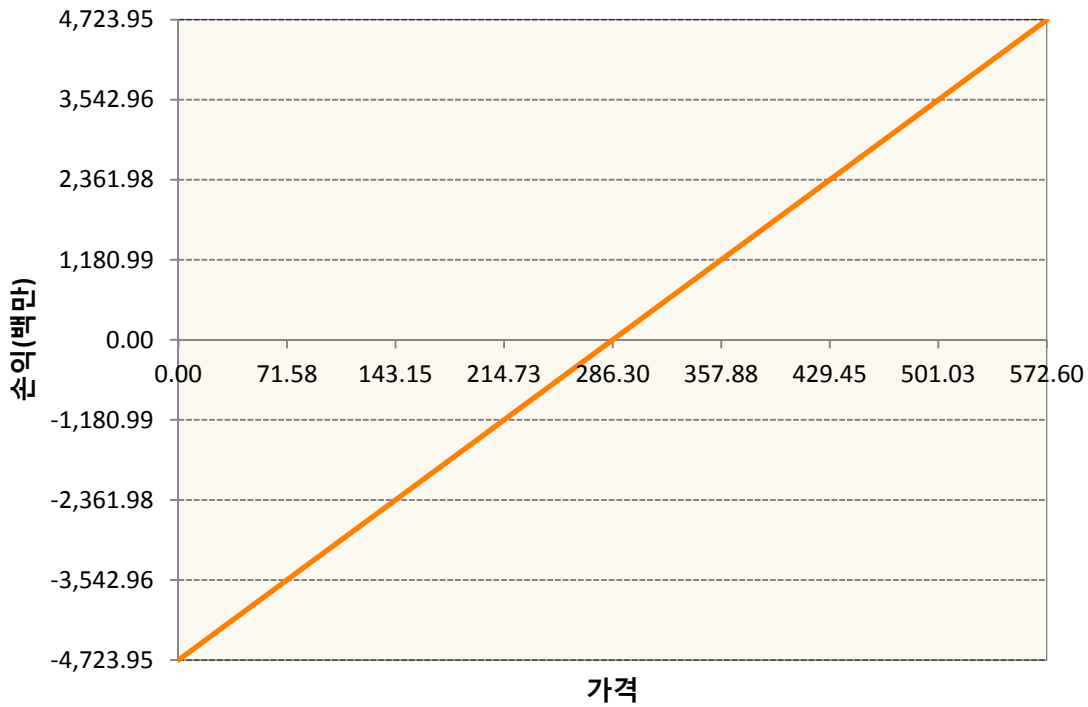
1. 계약금액

(단위:백만원)

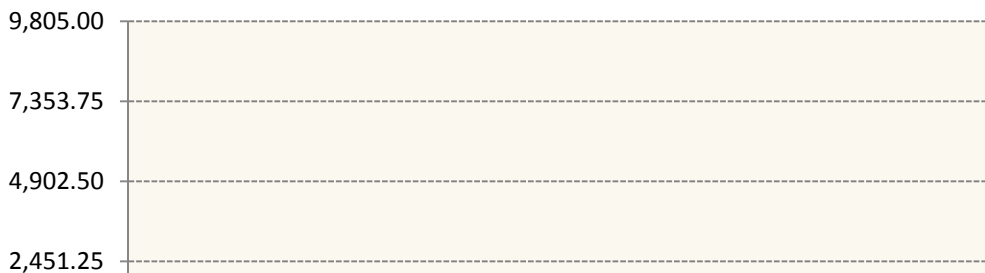
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	4,724	0	4,724	장내
누계	유가증권	스왑	31,836	0	31,836	장외
누계	유가증권	옵션	0	29,674	-29,674	장내

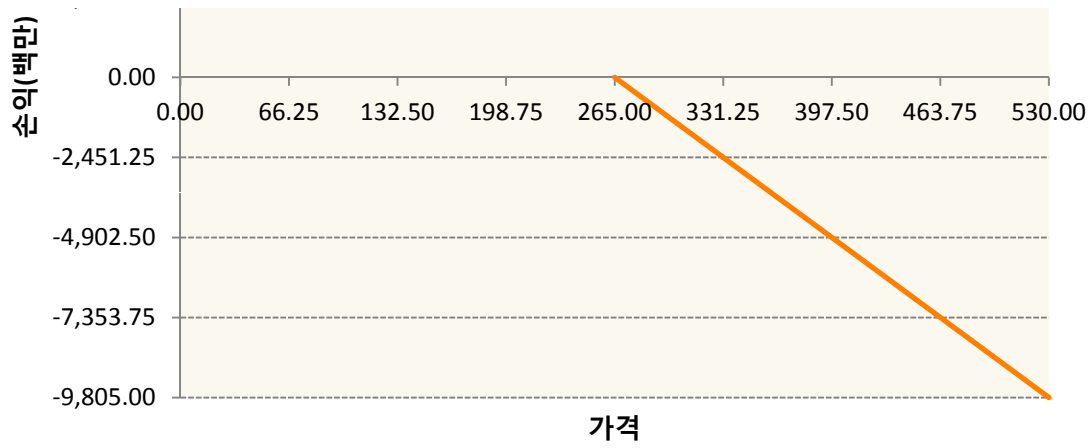
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P30007-2019-03 코스피200지수선물

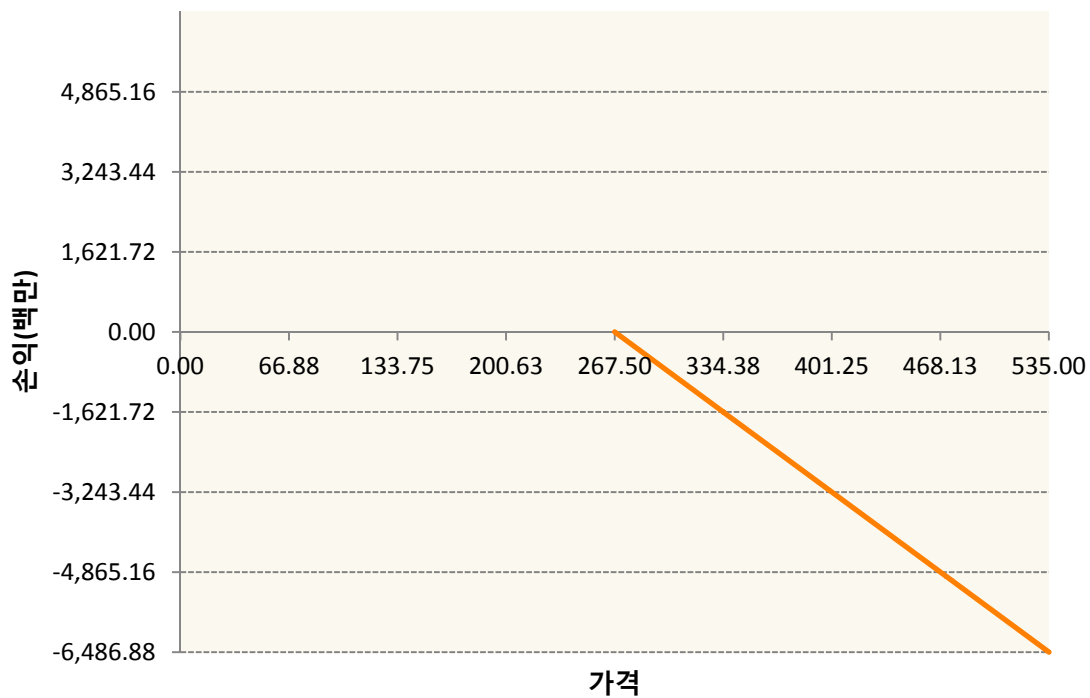


KR4201P22655-2019-02 콜265

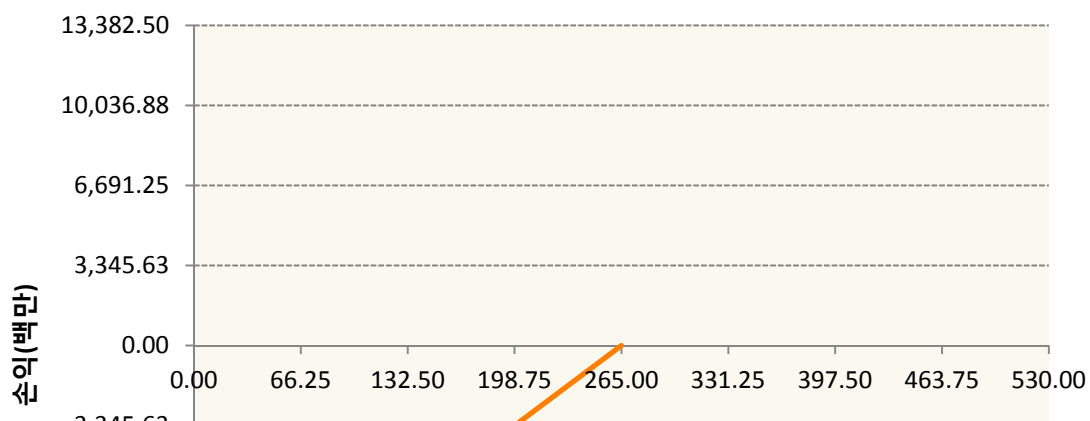


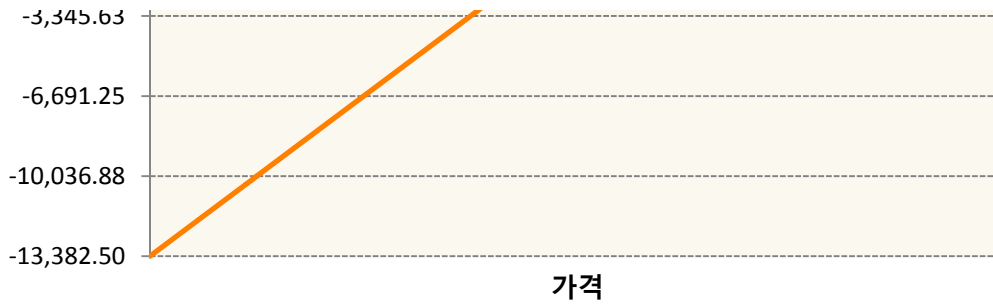


KR4201P22671-2019-02 콜267.5



KR4301P22653-2019-02 풋265





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11		UBCSFXC1 INDEX_14					2,654	
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-2,654	-2,654	-2,654	-2,654	-2,654	-2,654	-2,654	
-5.33%	-1,769	-1,769	-1,769	-1,769	-1,769	-1,769	-1,769	
-2.67%	-885	-885	-885	-885	-885	-885	-885	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	885	885	885	885	885	885	885	
5.33%	1,769	1,769	1,769	1,769	1,769	1,769	1,769	
8.00%	2,654	2,654	2,654	2,654	2,654	2,654	2,654	
KR4101P30007		2019-03 코스피200지수선물					377	
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-377	-377	-377	-377	-377	-377	-377	
-5.33%	-251	-251	-251	-251	-251	-251	-251	
-2.67%	-126	-126	-126	-126	-126	-126	-126	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	126	126	126	126	126	126	126	
5.33%	251	251	251	251	251	251	251	
8.00%	377	377	377	377	377	377	377	
KR4201P22655		2019-02 콜265					834	
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	674	658	643	627	612	596	580	
-5.33%	512	498	484	469	454	439	424	
-2.67%	279	272	263	253	243	232	221	
0%	10	8	4	0	-5	-12	-19	
2.67%	-269	-270	-271	-272	-274	-277	-281	
5.33%	-551	-551	-551	-551	-552	-553	-555	
8.00%	-832	-832	-832	-832	-833	-833	-834	
KR4201P22671		2019-02 콜267.5					542	
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	

-8.00%	408	398	389	379	369	359	349
-5.33%	320	310	299	289	279	268	258
-2.67%	180	174	167	159	151	143	134
0%	10	7	4	0	-5	-10	-16
2.67%	-172	-173	-174	-175	-177	-180	-183
5.33%	-356	-356	-357	-357	-358	-359	-360
8.00%	-541	-541	-541	-541	-541	-542	-542
KR4301P22653 2019-02 풋265							241
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-171	-182	-194	-206	-217	-229	-241
-5.33%	-23	-31	-40	-49	-59	-69	-79
-2.67%	-1	-2	-3	-6	-9	-13	-17
0%	0	0	0	0	0	-1	-2
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)

4,469

공시일	2019-02-07
기준일	2019-02-01

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

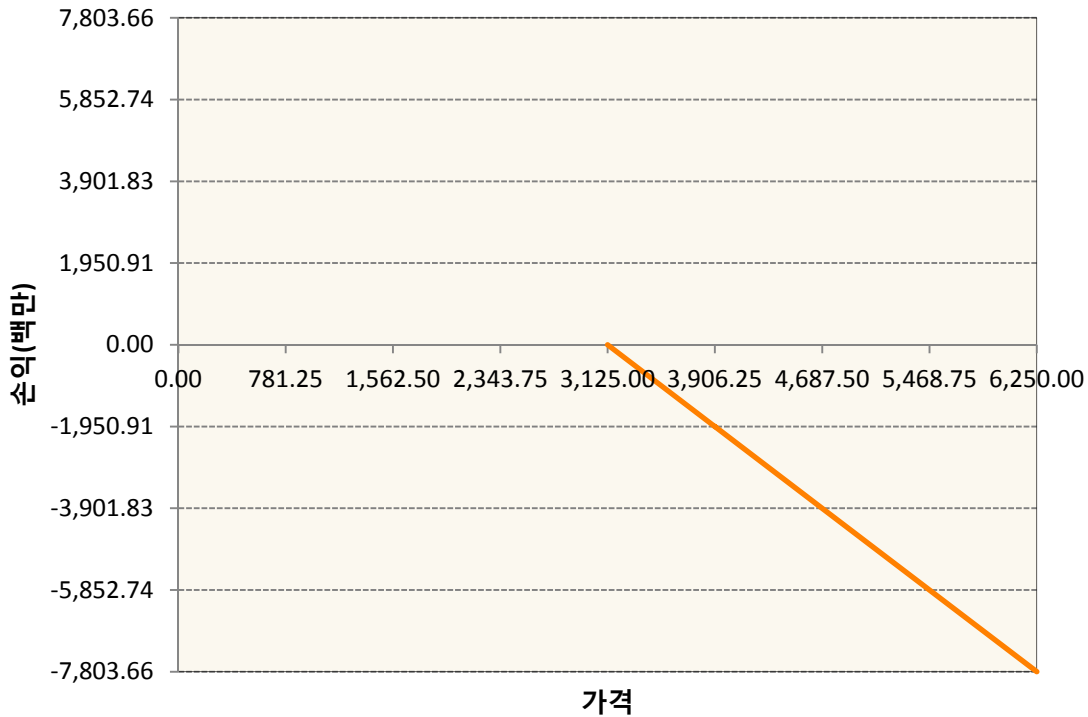
1. 계약금액

(단위:백만원)

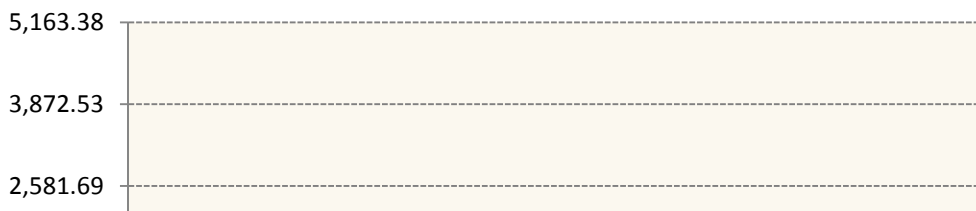
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	6,823	0	6,823	
누계	유가증권	스왑	60,457	0	60,457	장외
누계	유가증권	옵션	0	25,934	-25,934	장내
누계	통화	선도	0	15,367	-15,367	장외

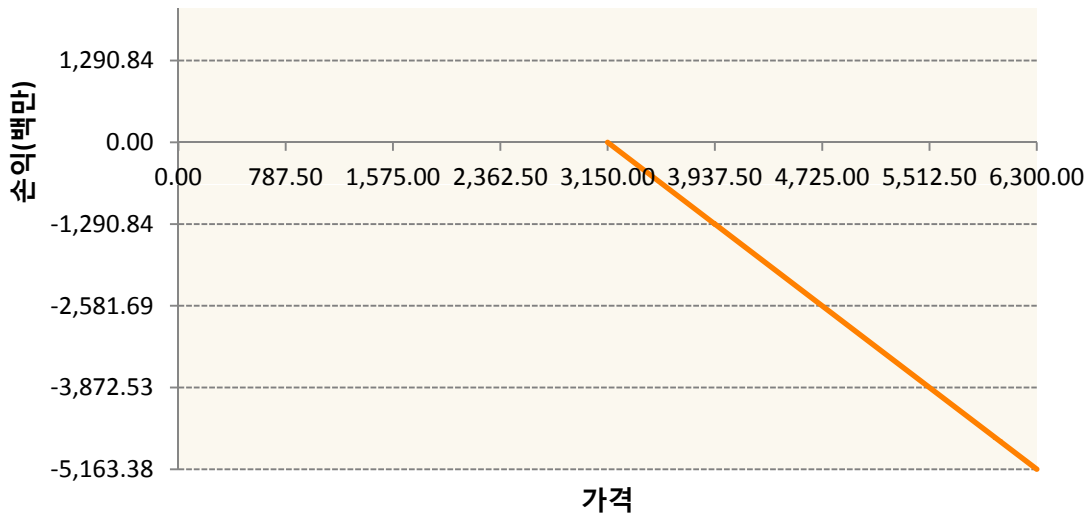
2. 만기시점의 손익구조

OESXG9-C3125-EURO STOXX 50

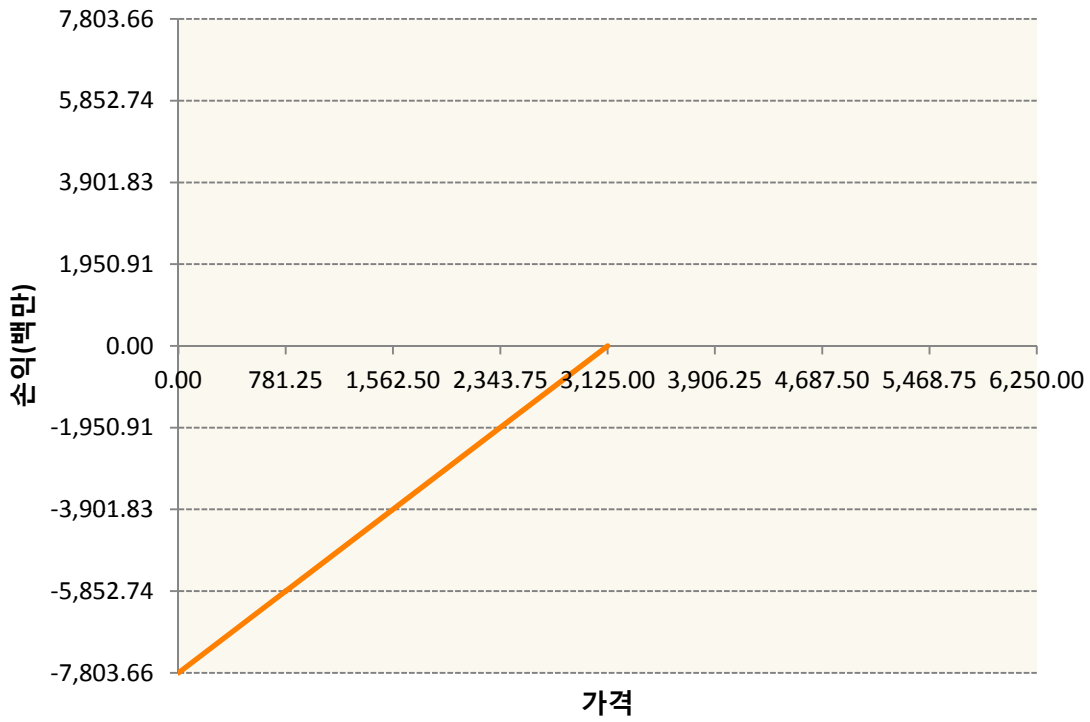


OESXG9-C3150-EURO STOXX 50

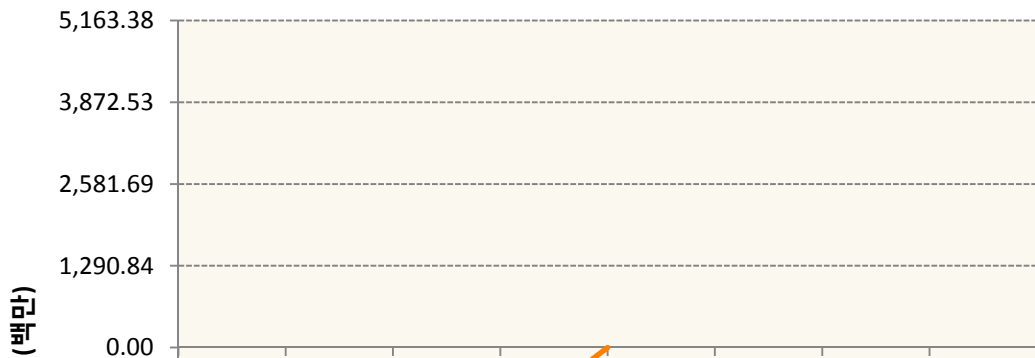


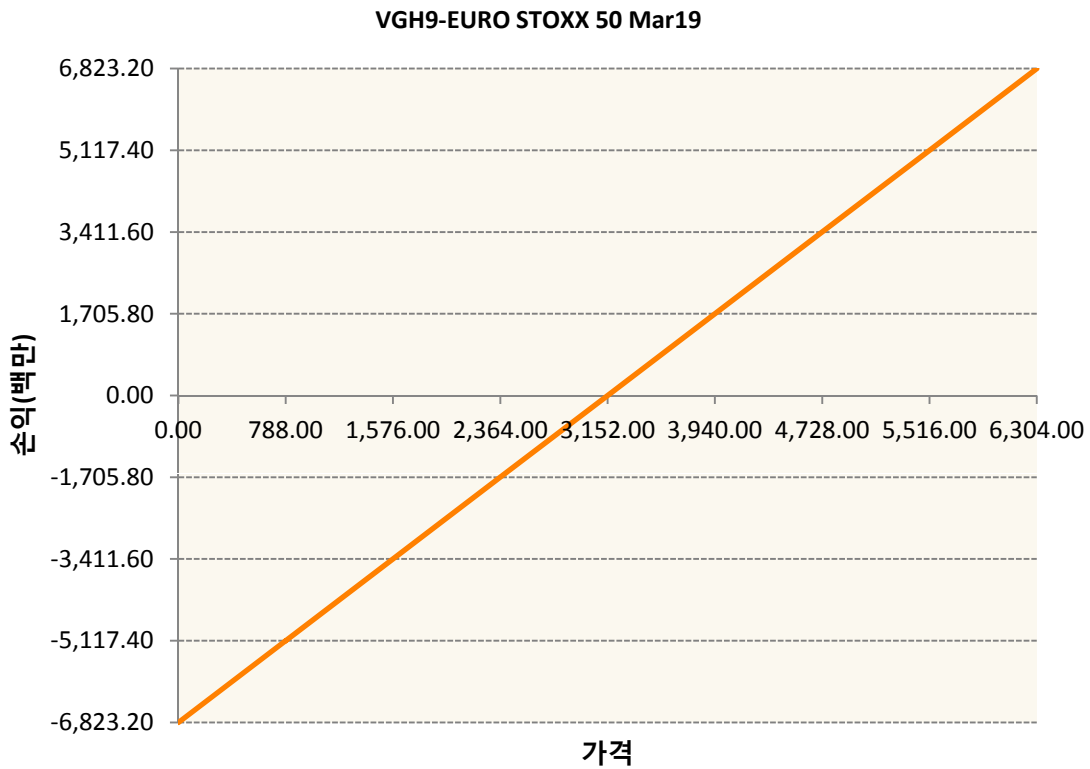
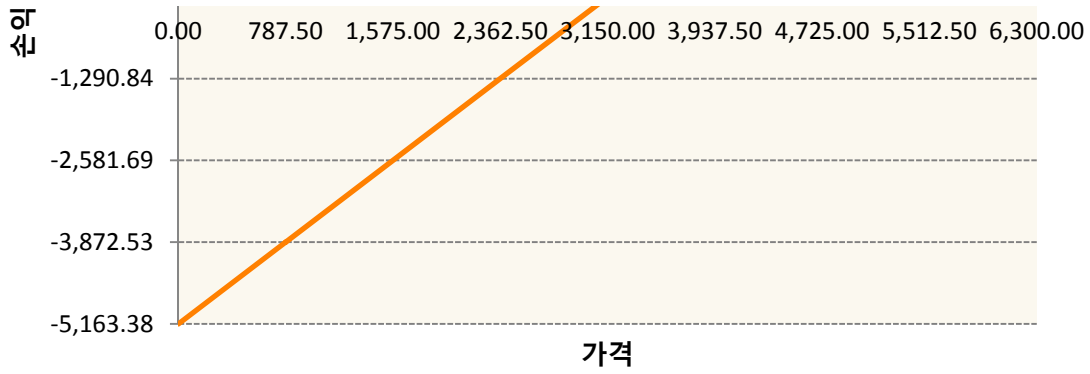


OESXG9-P3125-EURO STOXX 50



OESXG9-P3150-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY		38
FX21018X02 KRW/EUR 22-02-19E		410
FX21018Z03 KRW/EUR 22-03-19E		820
OESXG9-C31EURO STOXX 50		624
OESXG9-C31EURO STOXX 50		413
OESXG9-P31EURO STOXX 50		624
OESXG9-P31EURO STOXX 50		413
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)

1,187

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

(단위:백만원)

101

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

(단위:백만원)

152

공시일	2019-02-07
기준일	2019-02-01

스마트KRX300인덱스목표전환형1호

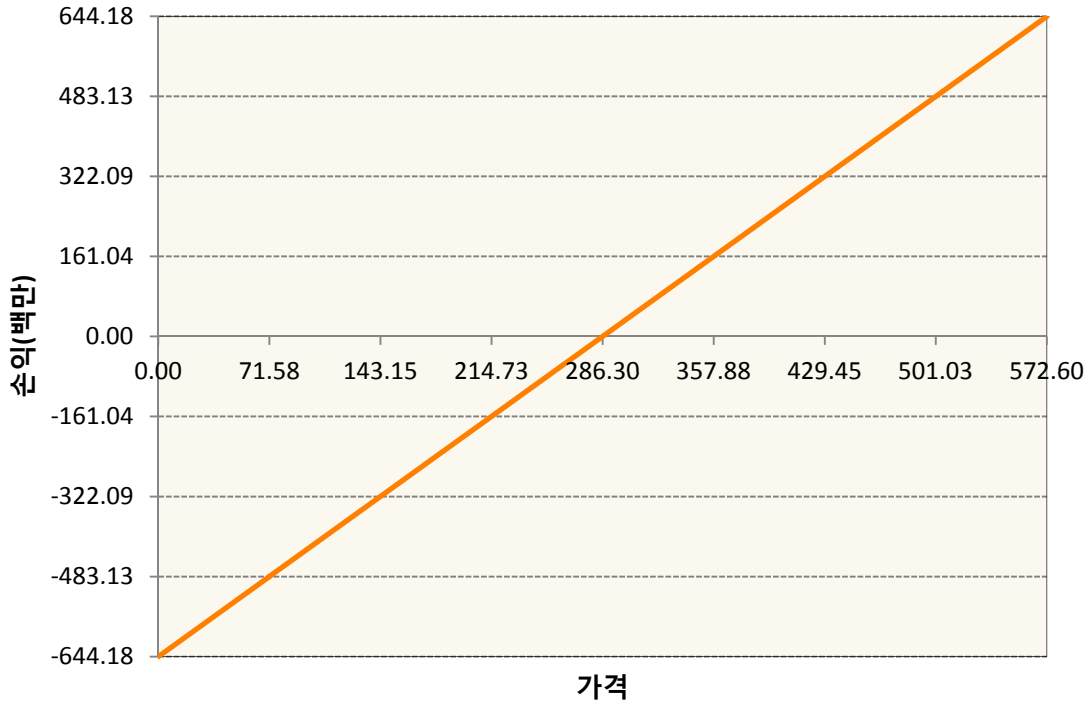
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	644	0	644	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101P30007-2019-03 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

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

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

(단위:백만원)

45

공시일	2019-02-07
기준일	2019-02-01

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

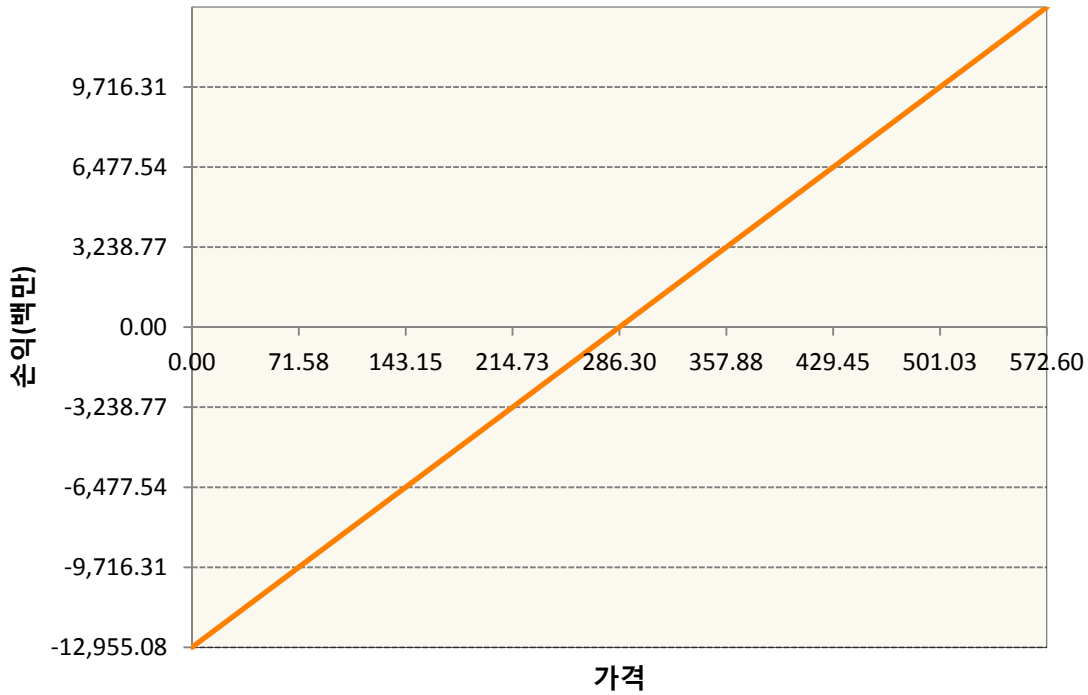
1. 계약금액

(단위:백만원)

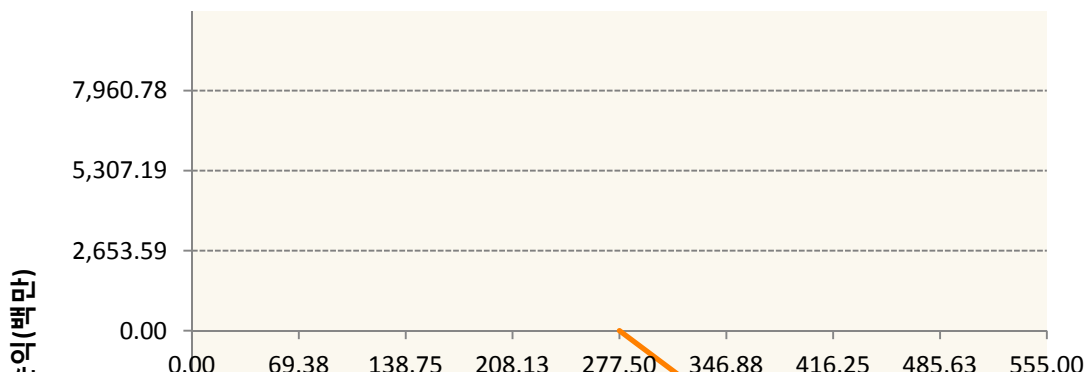
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	503	-503	장내
신규	유가증권	옵션	472	0	472	장내
누계	유가증권	선물	12,955	0	12,955	장내
누계	유가증권	옵션	2,523	22,724	-20,202	장내

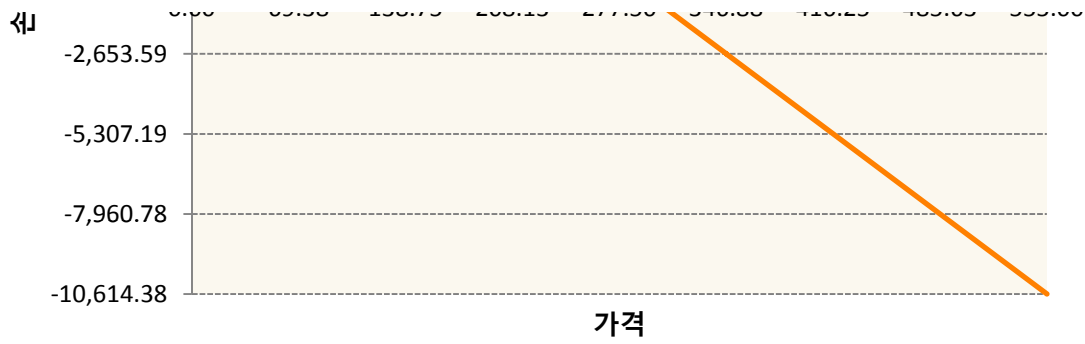
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P30007-2019-03 코스피200지수선물

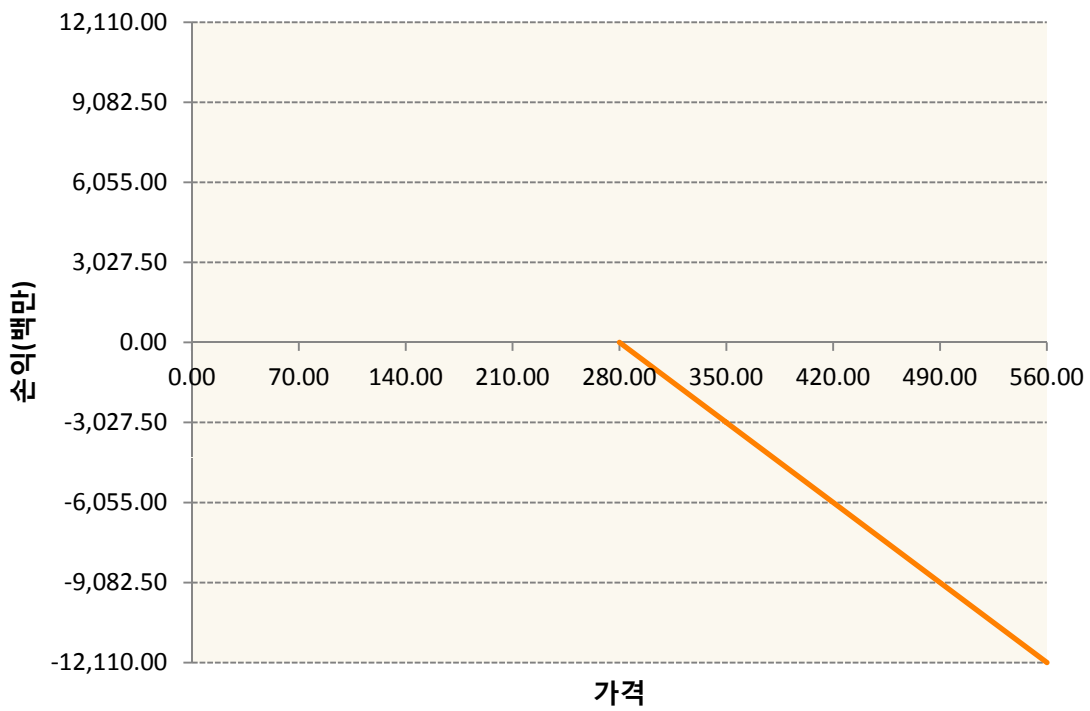


KR4201P22770-2019-02 콜277.5

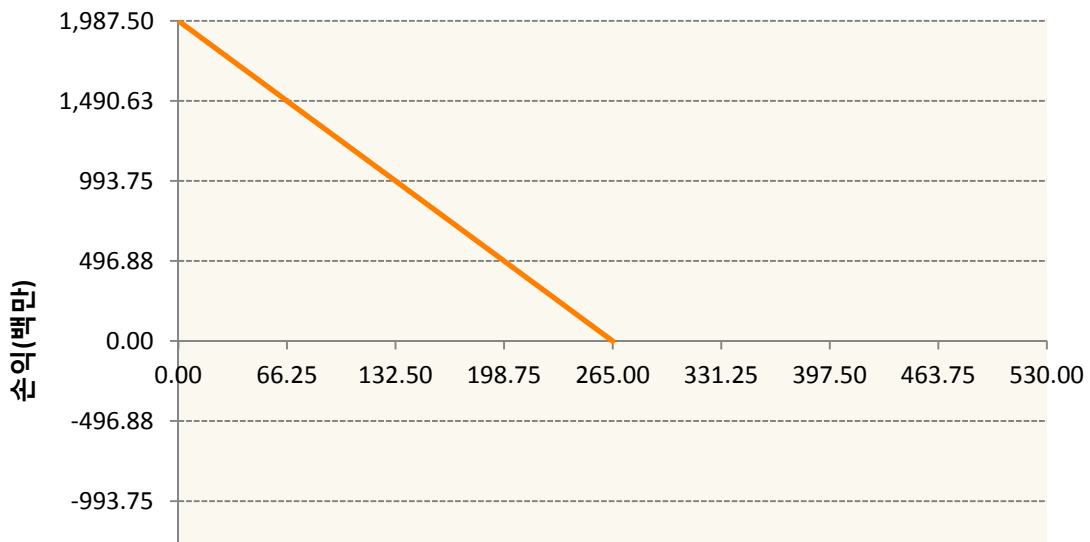


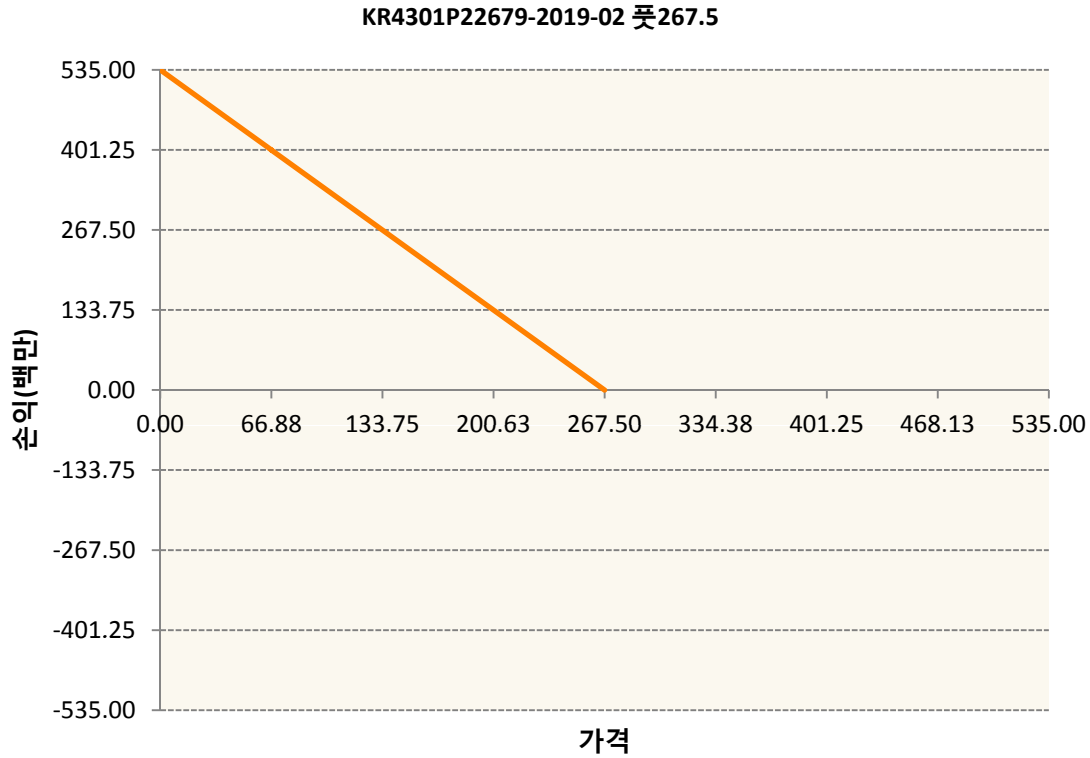
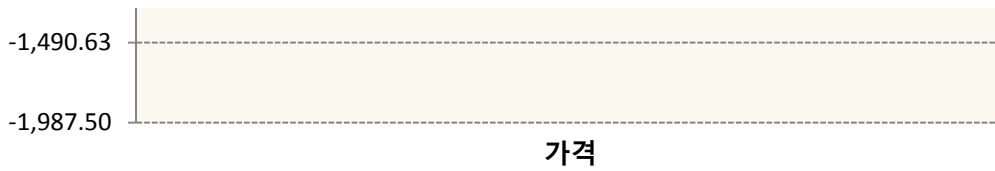


KR4201P22804-2019-02 콜280



KR4301P22653-2019-02 풋265





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101P30007		2019-03 코스피200지수선물						1,035
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-1,035	-1,035	-1,035	-1,035	-1,035	-1,035	-1,035	
-5.33%	-690	-690	-690	-690	-690	-690	-690	
-2.67%	-345	-345	-345	-345	-345	-345	-345	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	345	345	345	345	345	345	345	
5.33%	690	690	690	690	690	690	690	
8.00%	1,035	1,035	1,035	1,035	1,035	1,035	1,035	
KR4201P22770		2019-02 콜277.5						797
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	393	386	379	370	361	351	340	
-5.33%	349	336	321	307	292	277	261	
-2.67%	237	219	202	185	168	151	133	

공시일	2019-02-07
기준일	2019-02-01

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	652	0	652	

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	2019-02-07
기준일	2019-02-01

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	3,423	0	3,423	

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	2019-02-07
기준일	2019-02-01

H2O글로벌본드(H)(채권혼합-파생)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	336	0	336	
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	수익증권	14,998	0	14,998	
누계	통화	선도	0	16,290	-16,290	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	27
FX21018Z01 KRW/USD 28-02-19E	9
FX21018Z02 KRW/USD 28-02-19E	39
FX21018Z02 KRW/USD 19-02-19E	2
FX21018Z02 KRW/USD 19-02-19E	5
FX21018Z03 KRW/USD 19-02-19E	21
FX21018Z03 KRW/USD 19-02-19E	31
FX21019F00 KRW/USD 19-02-19E	15
FX21019F00 KRW/USD 19-02-19E	8
FX21019F00 KRW/USD 19-02-19E	26
FX21019F00 KRW/USD 19-02-19E	8
FX21019F00 KRW/USD 19-02-19E	13
FX21019F00 KRW/USD 19-02-19E	29
FX21019F00 KRW/USD 19-02-19E	13
FX21019F01 KRW/USD 19-02-19E	38
FX21019F01 KRW/USD 28-02-19E	14
FX21019F01 KRW/USD 28-02-19E	57
FX21019F01 KRW/USD 28-02-19E	9
FX21019F01 KRW/USD 28-02-19E	32
FX21019F02 KRW/USD 25-02-19E	135
FX21019F02 KRW/USD 28-03-19E	465
FX21019F02 KRW/USD 28-02-19E	116

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

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

(단위:백만원)

496

공시일	2019-02-07
기준일	2019-02-01

스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

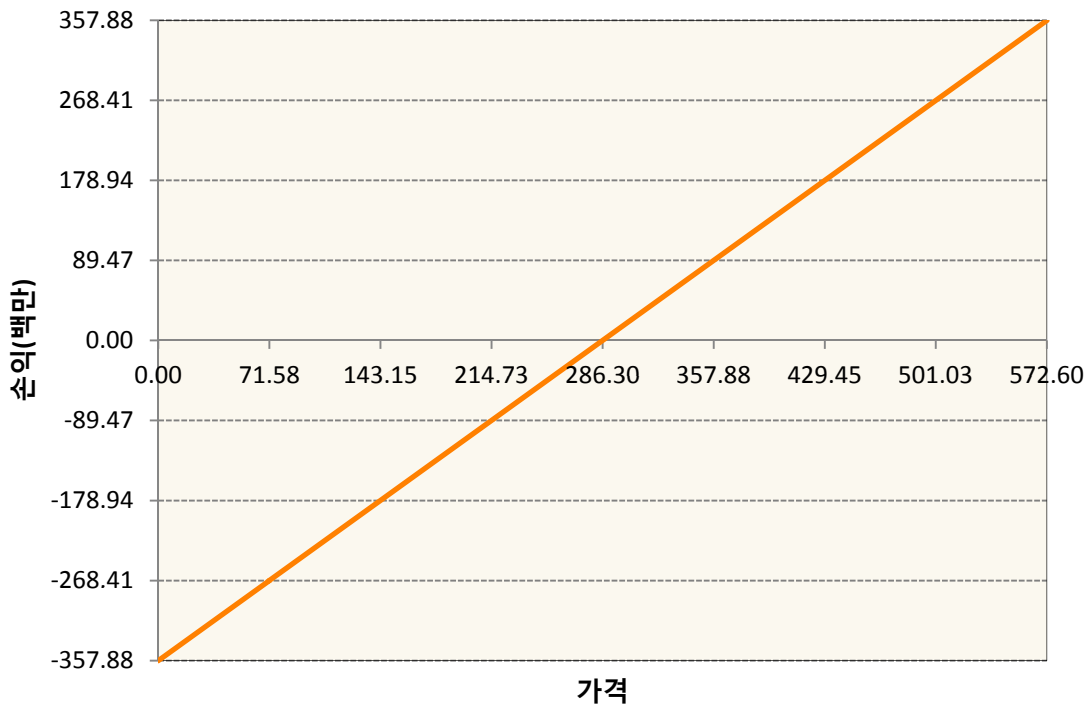
1. 계약금액

(단위:백만원)

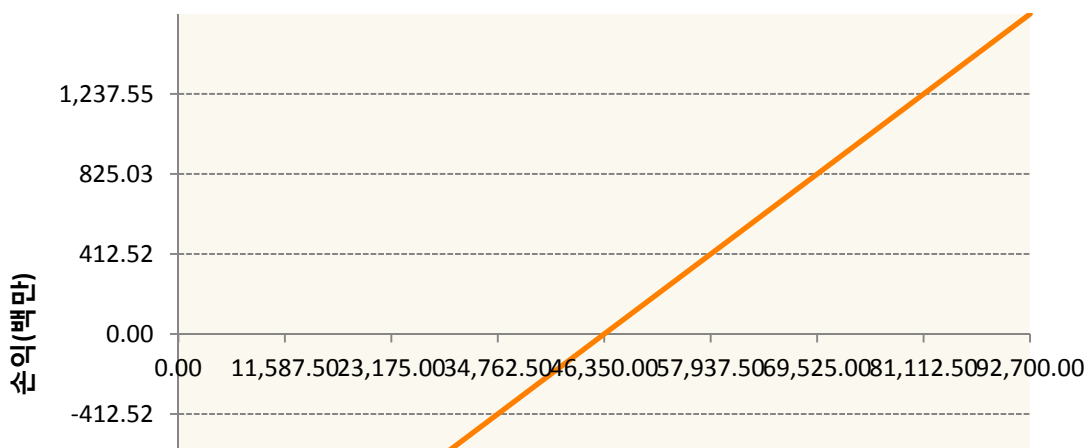
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,008	0	2,008	장내

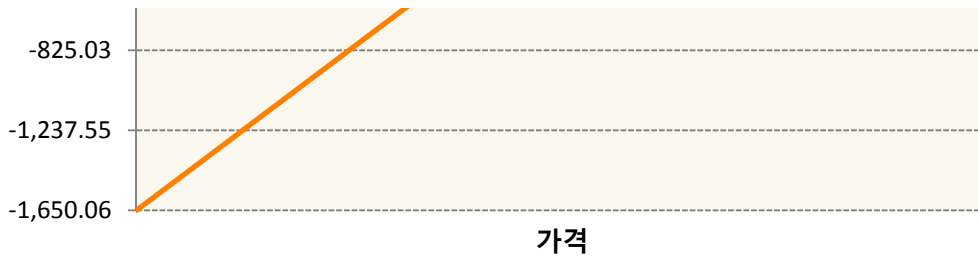
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P30007-2019-03 코스피200지수선물



KR4111P20007-2019-02 삼성전자개별선물





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101P30007		2019-03 코스피200지수선물						29
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-29	-29	-29	-29	-29	-29	-29	
-5.33%	-19	-19	-19	-19	-19	-19	-19	
-2.67%	-10	-10	-10	-10	-10	-10	-10	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	10	10	10	10	10	10	10	
5.33%	19	19	19	19	19	19	19	
8.00%	29	29	29	29	29	29	29	

KR4111P20007		2019-02 삼성전자개별선물						132
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-132	-132	-132	-132	-132	-132	-132	
-5.33%	-88	-88	-88	-88	-88	-88	-88	
-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%	88	88	88	88	88	88	88	
8.00%	132	132	132	132	132	132	132	

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

180

공시일	2019-02-07
기준일	2019-02-01

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

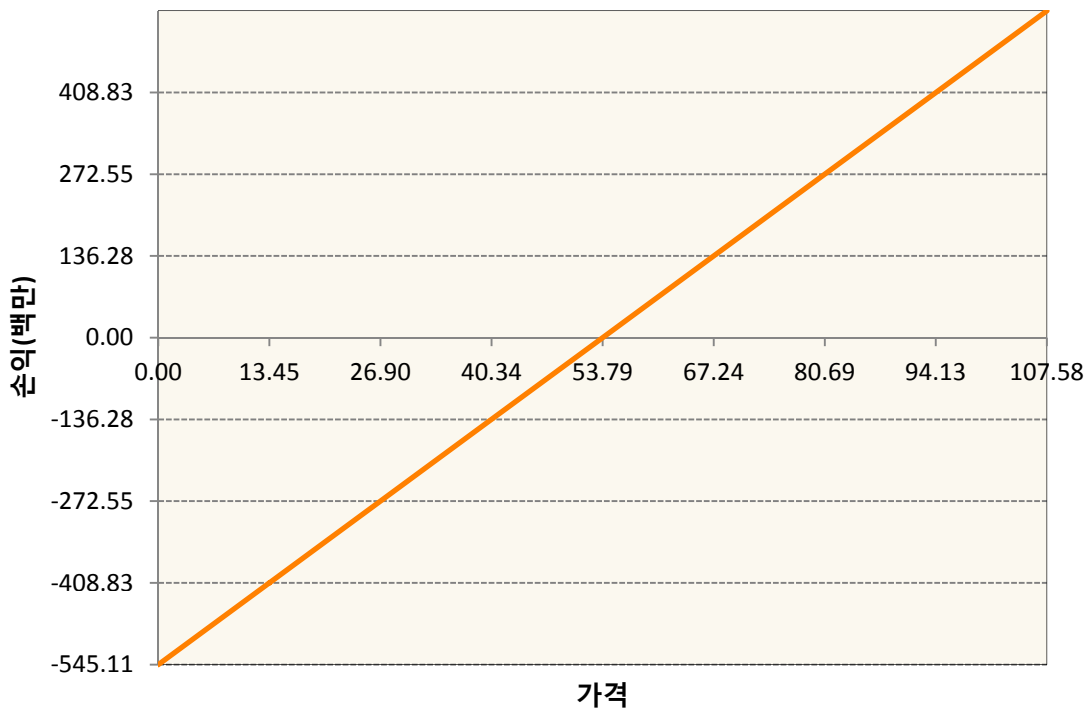
1. 계약금액

(단위:백만원)

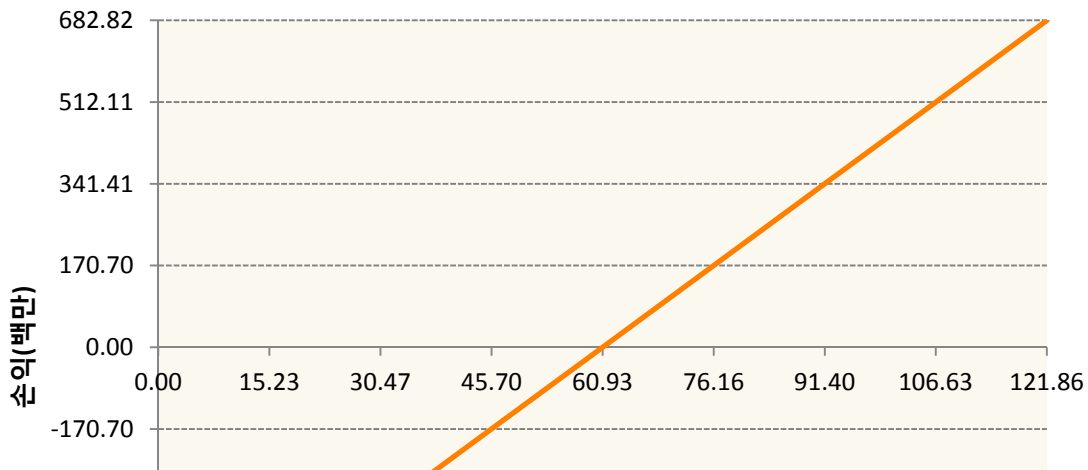
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,683	280	2,403	

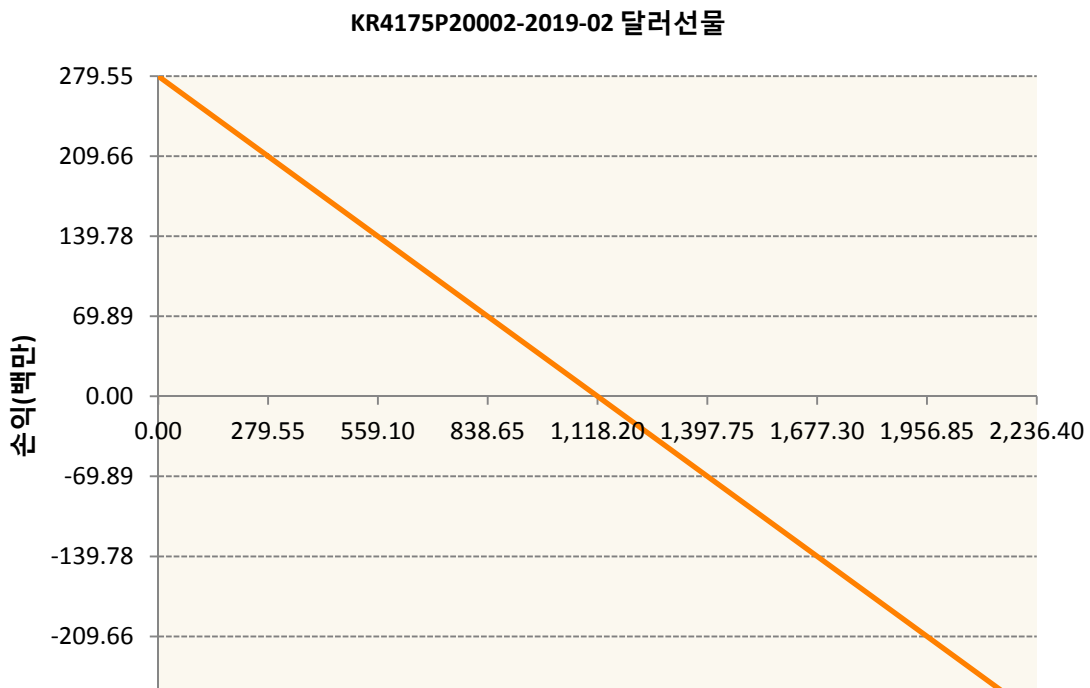
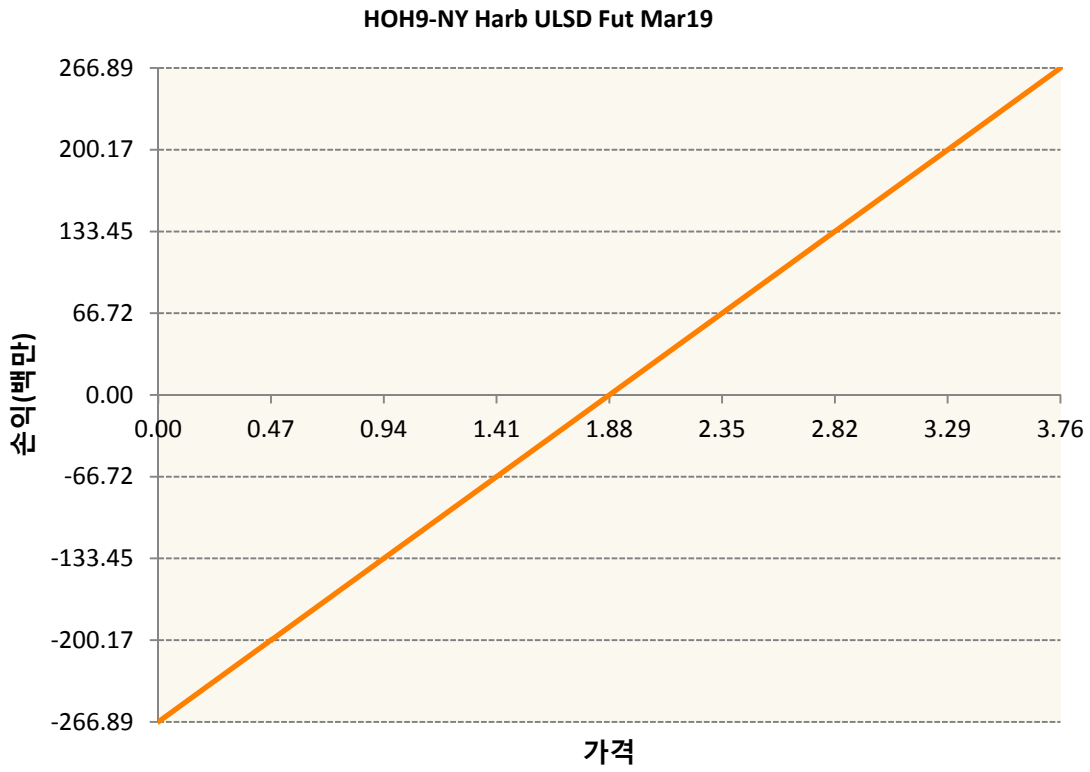
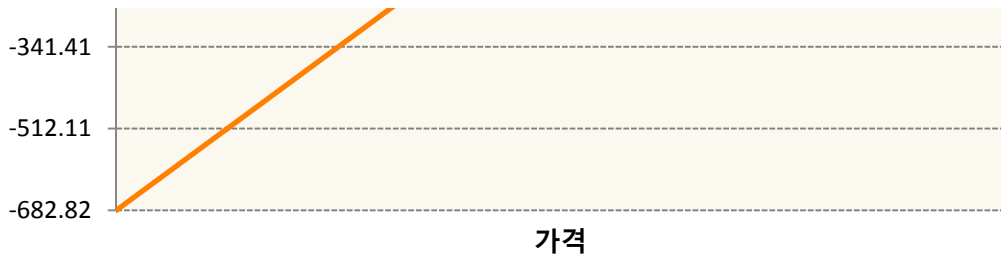
2. 만기시점의 손익구조

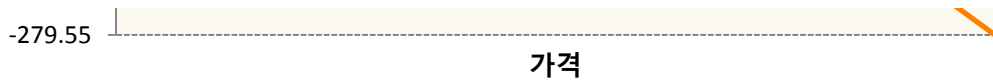
CLH9-WTI CRUDE FUTURE MAR19



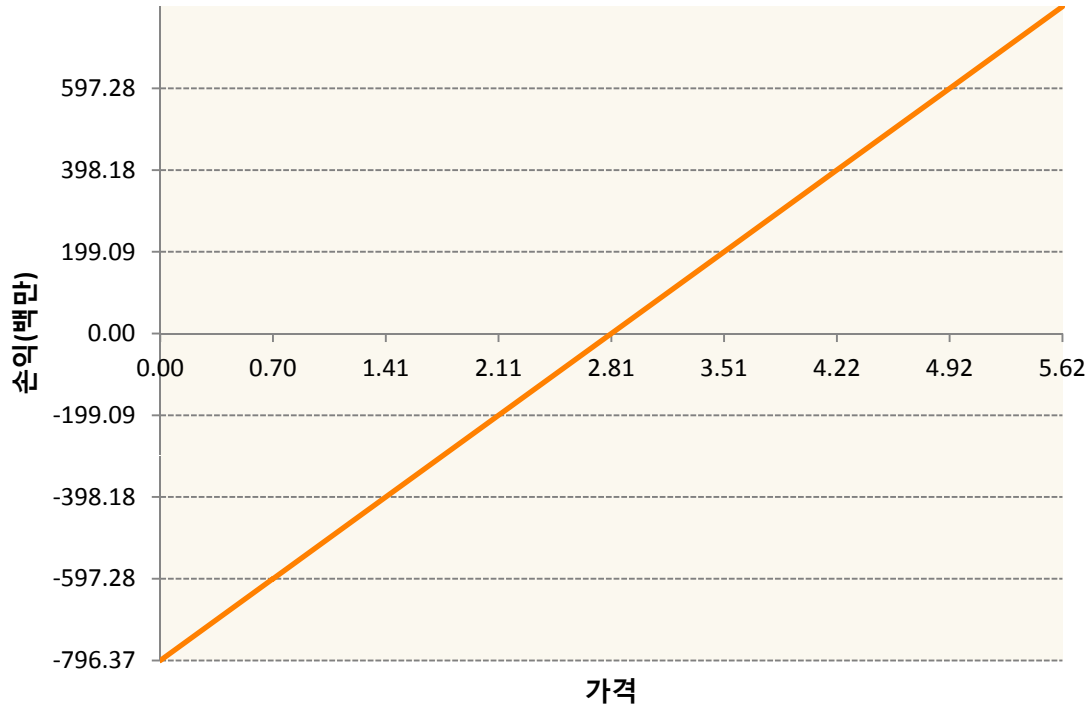
COK9-BRENT CRUDE FUTR May19



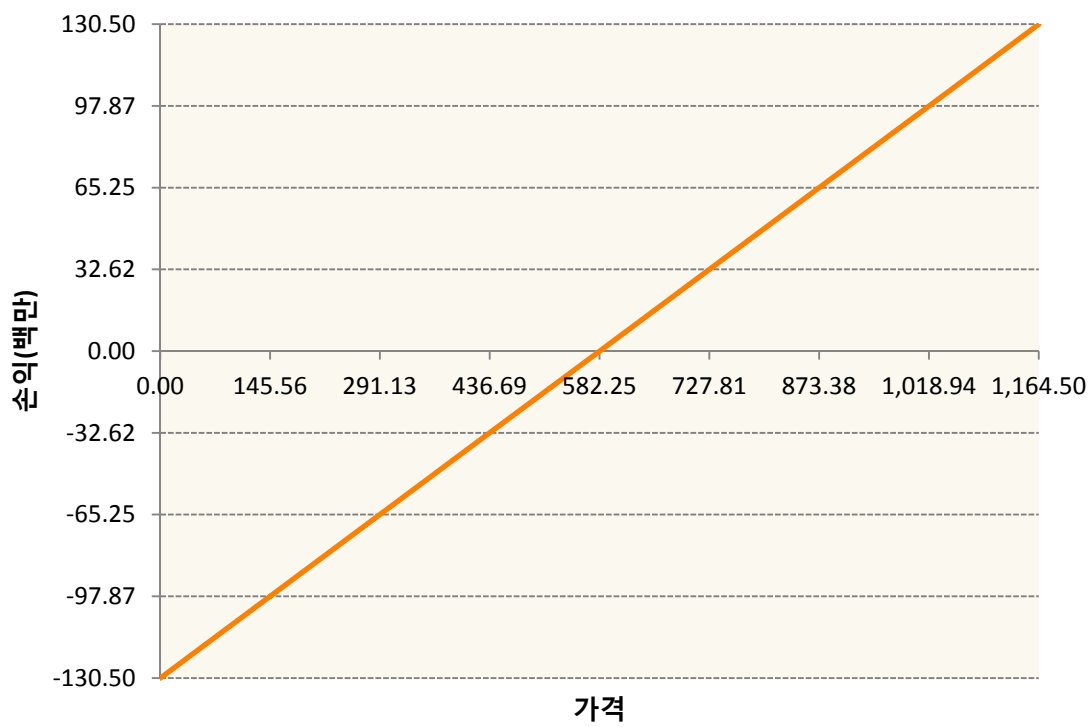




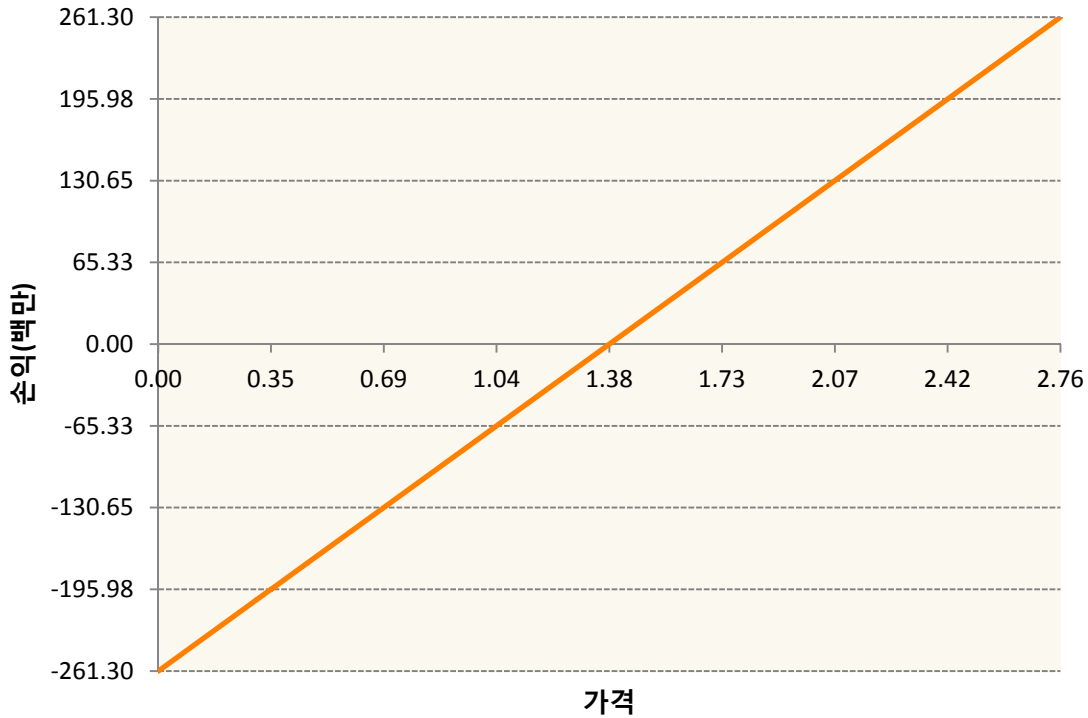
NGH19-NATURAL GAS FUTR Mar19



QSH9-Low Su Gasoil G May19



XBH9-GASOLINE RBOB FUT Mar19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLH9	WTI CRUDE FUTURE MAR19	44
COK9	BRENT CRUDE FUTR May19	55
HOH9	NY Harb ULSD Fut Mar19	21
KR4175P200	2019-02 달러선물	22
NGH19	NATURAL GAS FUTR Mar19	64
QSH9	Low Su Gasoil G May19	10
XBH9	GASOLINE RBOB FUT Mar19	21

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

424

공시일	2019-02-07
기준일	2019-02-01

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

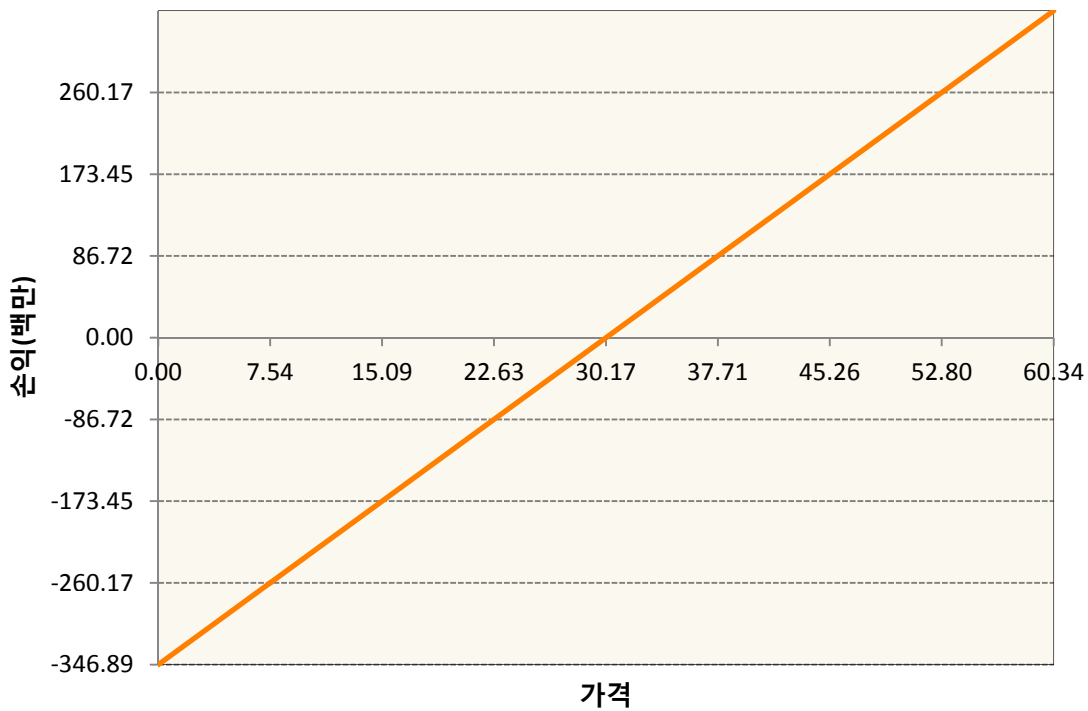
1. 계약금액

(단위:백만원)

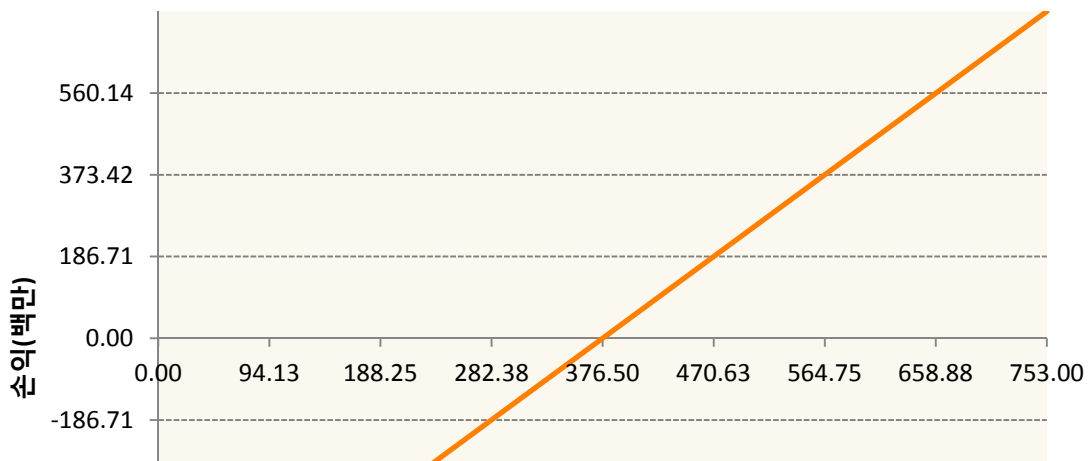
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,588	78	3,510	

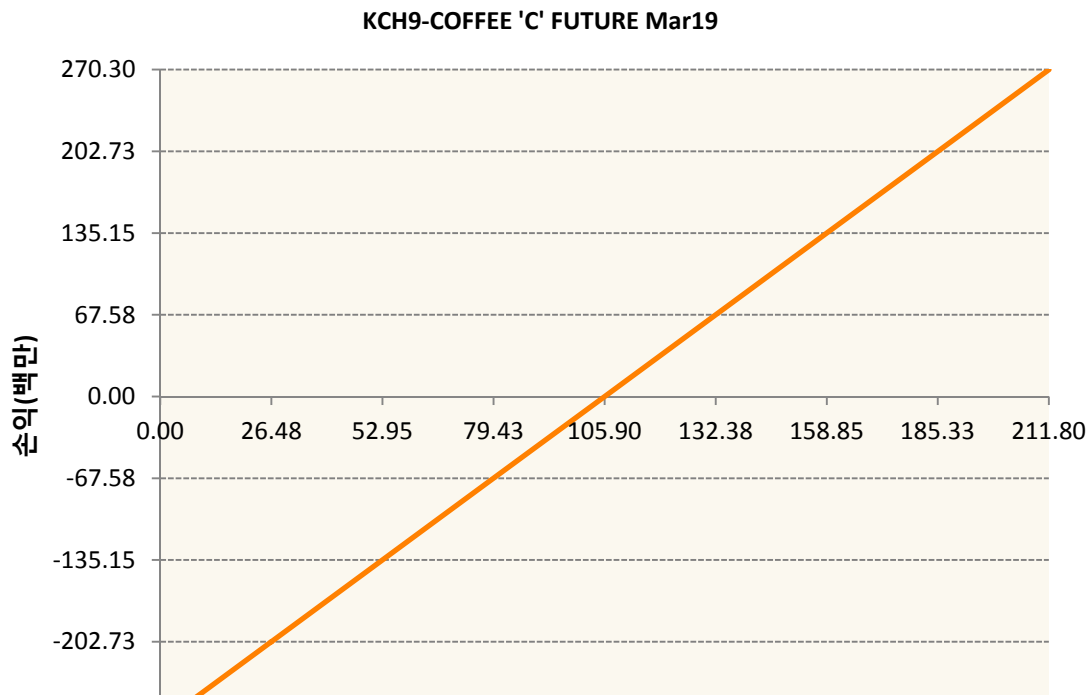
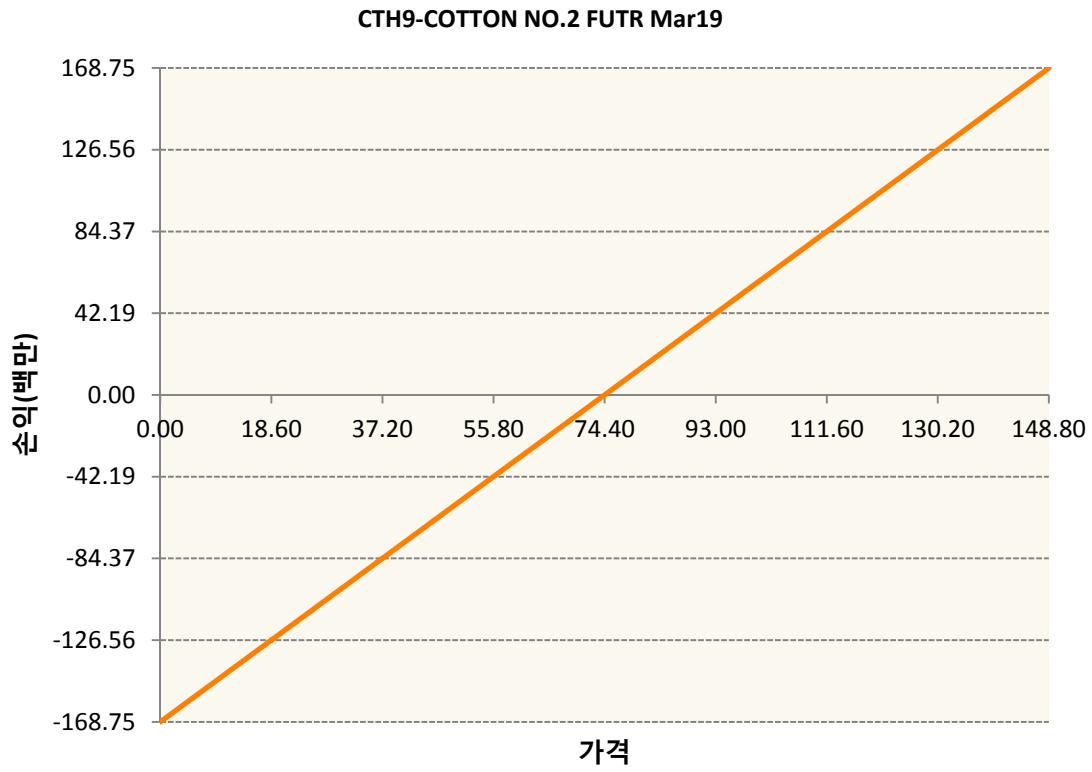
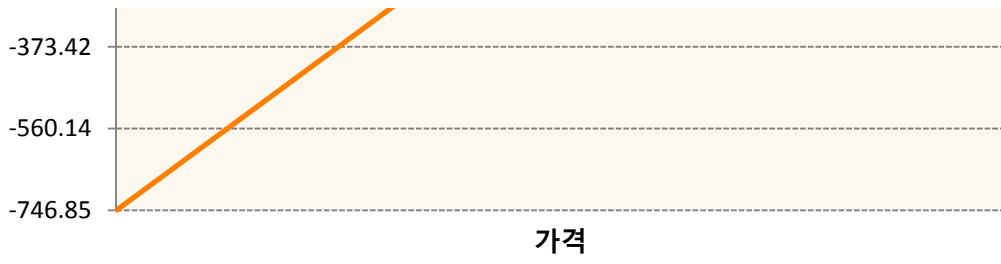
2. 만기시점의 손익구조

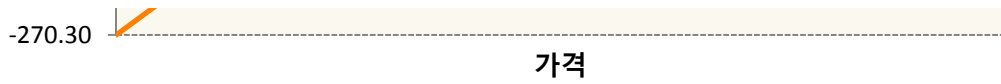
BOH9-SOYBEAN OIL FUTR Mar19



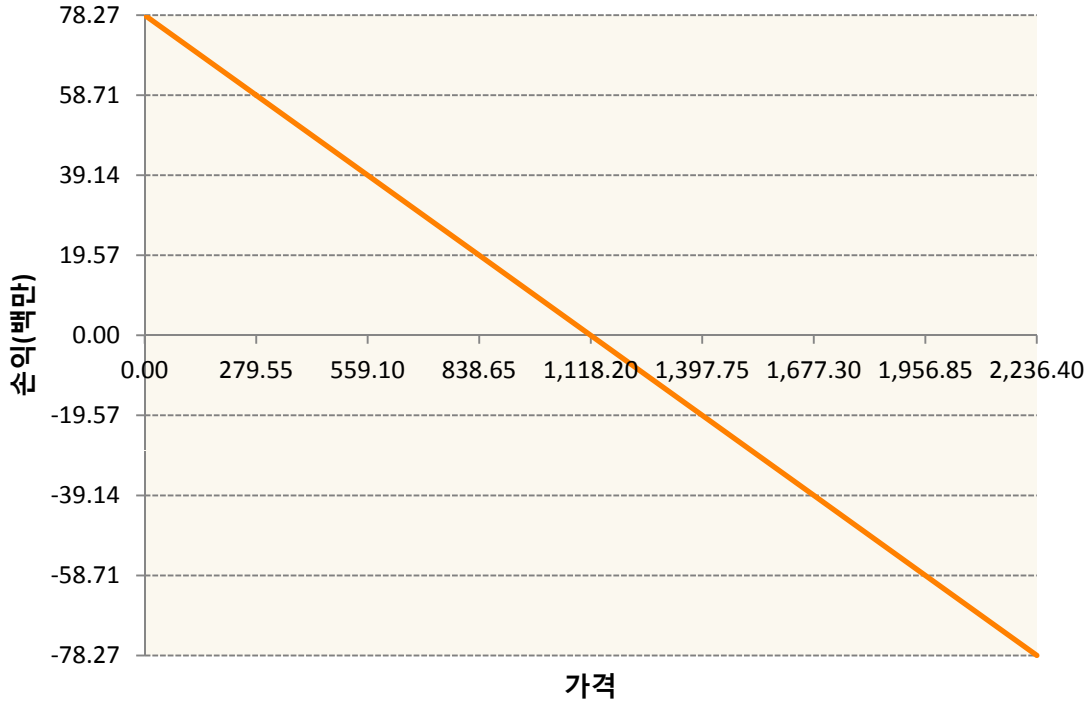
CH9-CORN FUTURE Mar19



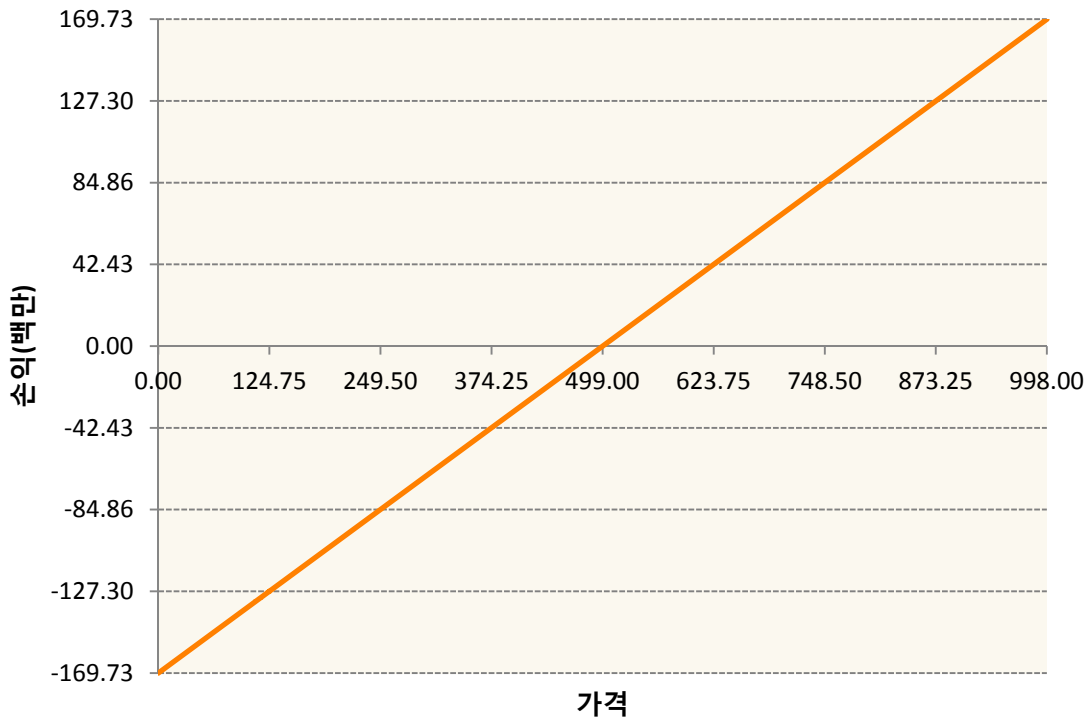




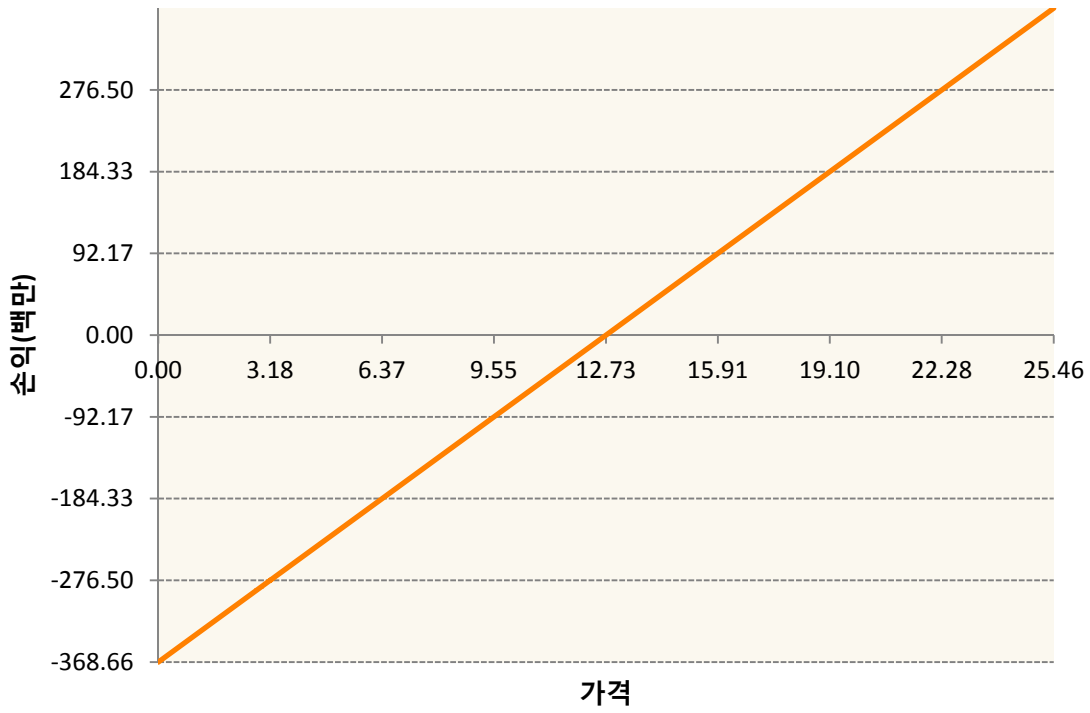
KR4175P20002-2019-02 달러선물



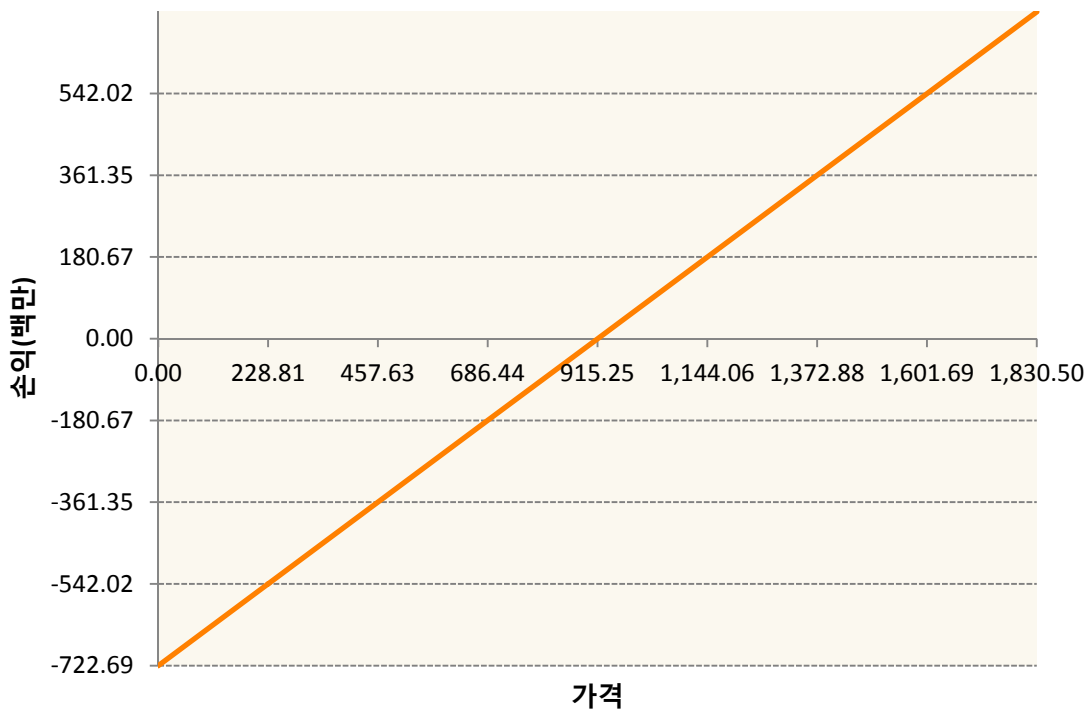
KWH9-KC HRW WHEAT FUT Mar19



SBH9-SUGAR #11 (WORLD) MAR19

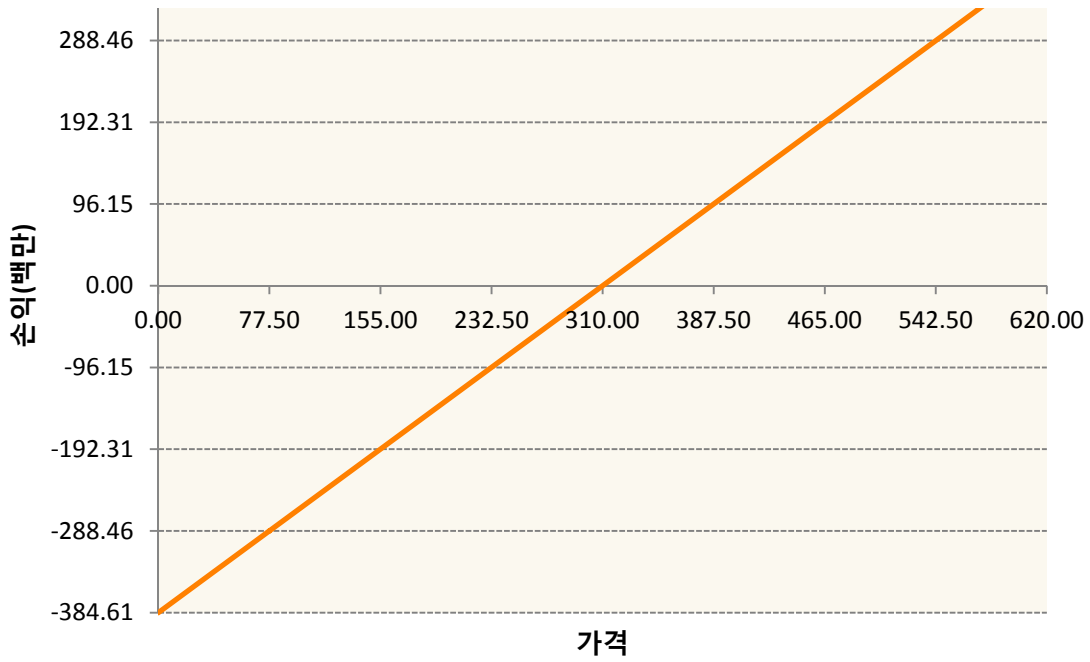


SH9-SOYBEAN FUTURE Mar19

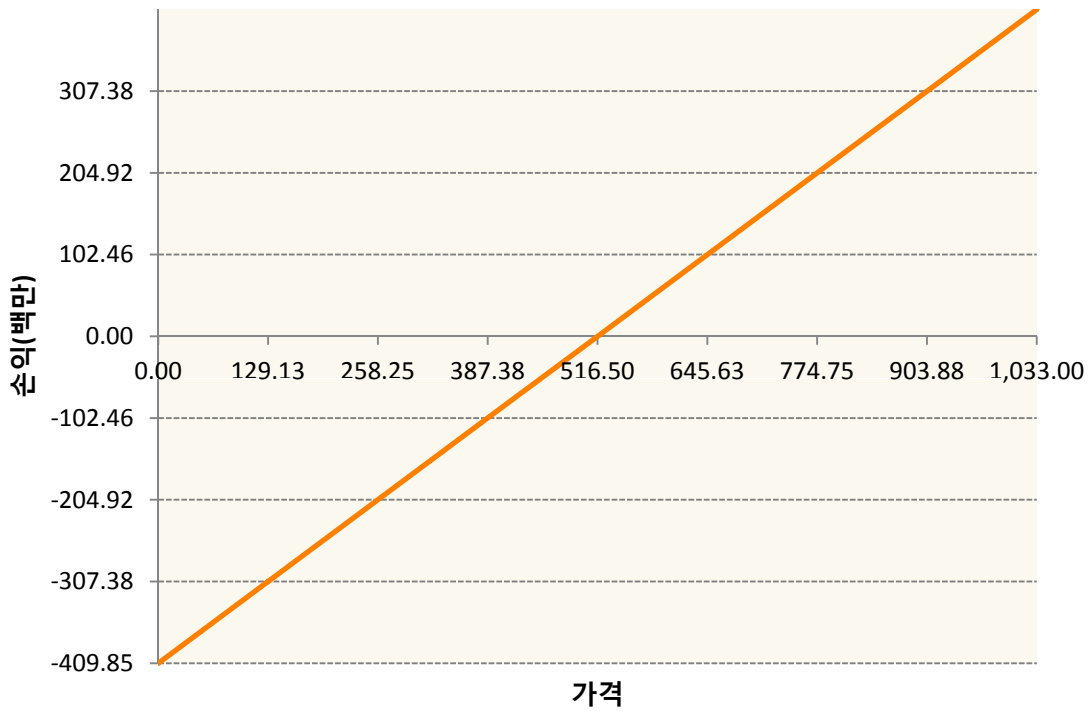


SMH9-SOYBEAN MEAL FUTR Mar19





WH9-WHEAT FUTURE(CBT) Mar19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

BOH9	SOYBEAN OIL FUTR Mar19	28
CH9	CORN FUTURE Mar19	60
CTH9	COTTON NO.2 FUTR Mar19	13
KCH9	COFFEE 'C' FUTURE Mar19	22
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	31
WH9	WHEAT FUTURE(CBT) Mar19	33

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

(단위:백만원)

294