

공시일	2019-02-14
기준일	2019-02-13

## 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	2019-02-14
기준일	2019-02-13

## 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

1,088

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

625

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-02-14
기준일	2019-02-13

## 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	279
SWCSI50000 신한CSI500미래S190129	83

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

540

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-02-14
기준일	2019-02-13

## 유로인덱스모(주식-파생형)

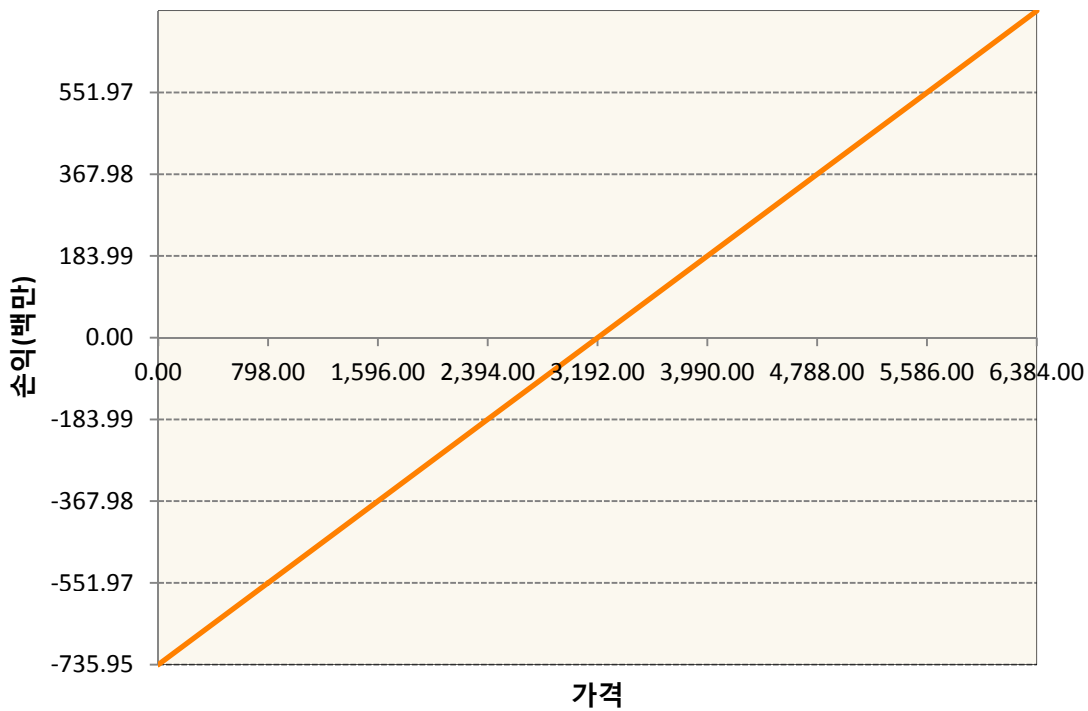
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	736	0	736	

### 2. 만기시점의 손익구조

VGH9-EURO STOXX 50 Mar19



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGH9	EURO STOXX 50 Mar19	59
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

41
----

공시일	2019-02-14
기준일	2019-02-13

## 차이나인덱스모(주식-파생형)

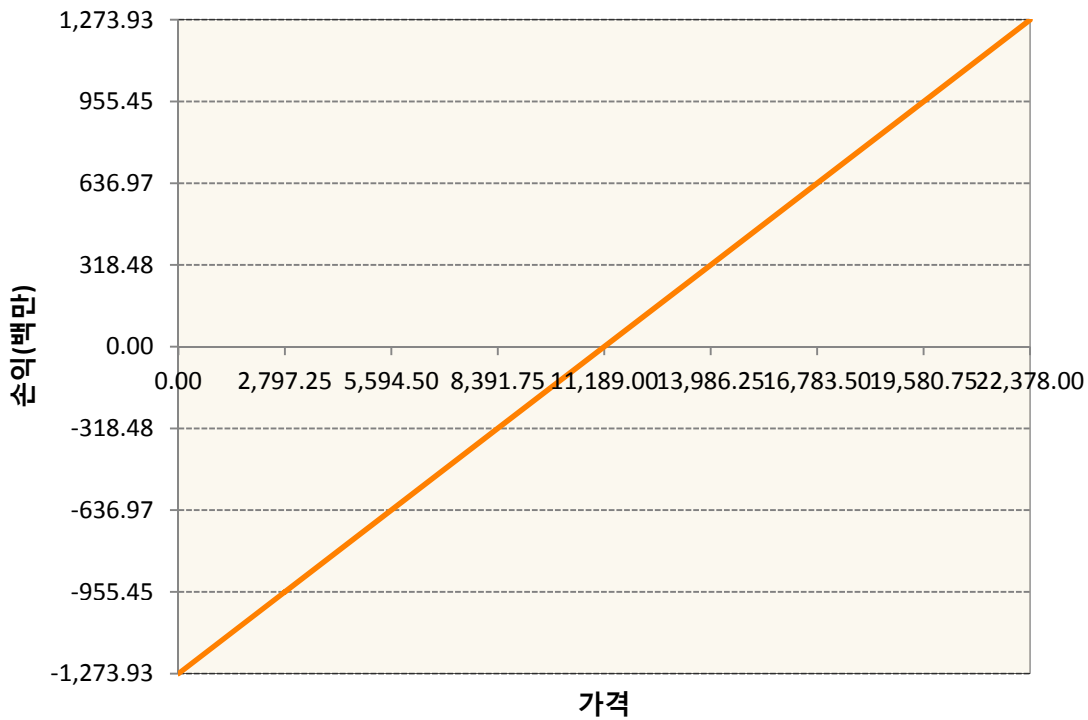
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

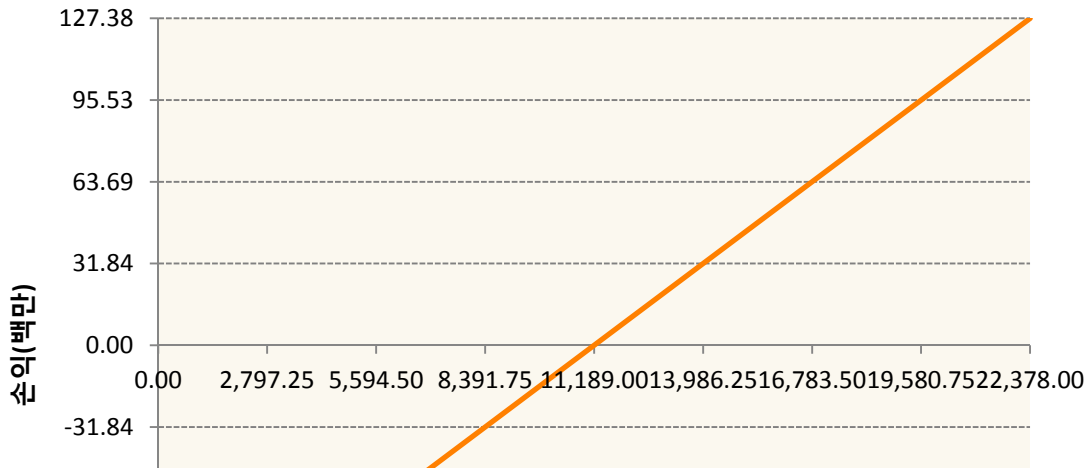
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,401	0	1,401	장내

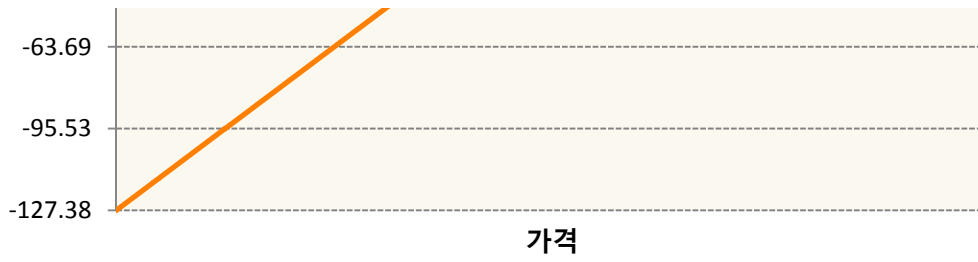
### 2. 만기시점의 손익구조

HCG9-HSCEI Futures Feb19



MHCG9-MINI H-SHR IDX FU Feb19





**3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)** (단위:백만원)

HCG9	HSCEI Futures Feb19	102
MHCG9	MINI H-SHR IDX FU Feb19	10

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

<b>114</b>
------------

공시일	2019-02-14
기준일	2019-02-13

## 커버드콜모(주식혼합-파생형)

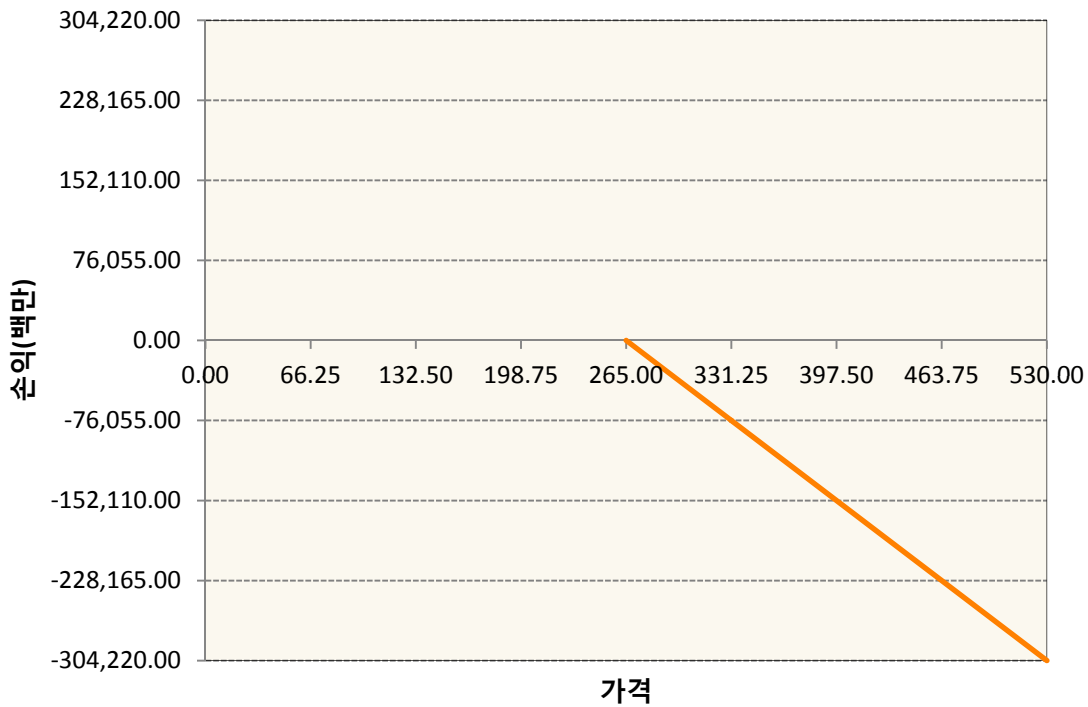
### 1. 계약금액

(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

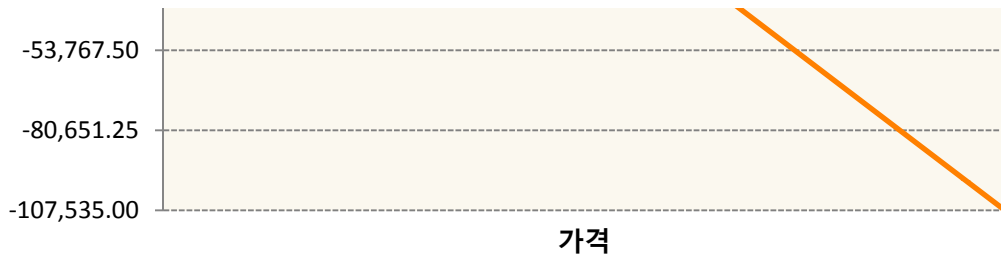
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4201P22655-2019-02 콜265

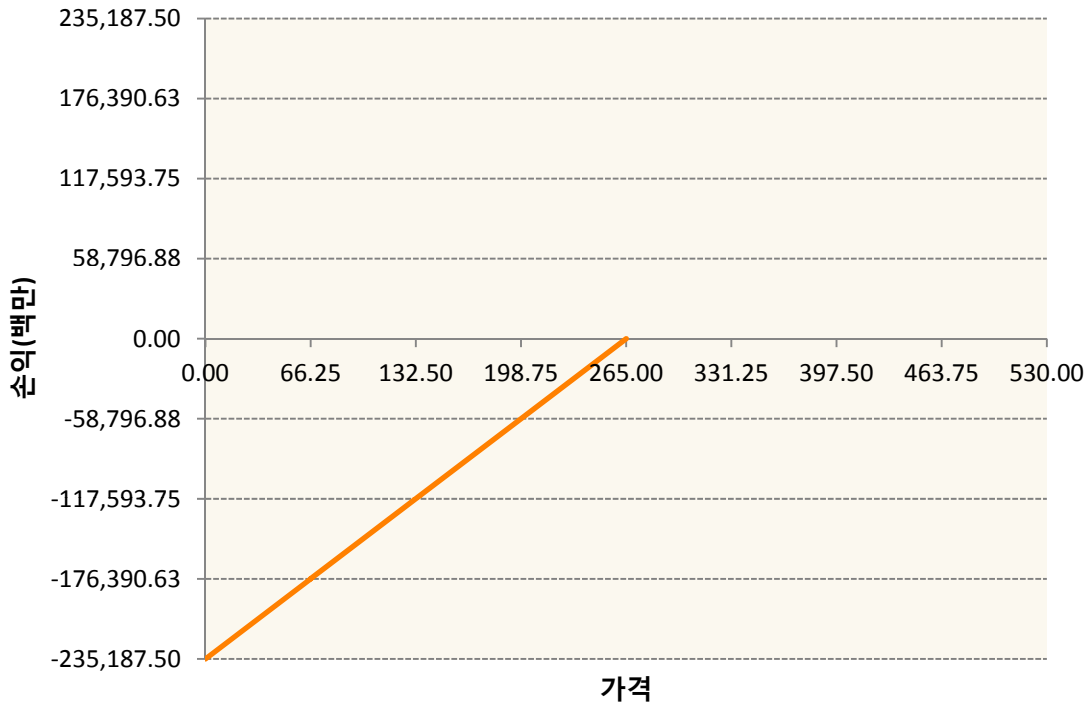


KR4201P22671-2019-02 콜267.5





KR4301P22653-2019-02 풋265



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201P22655		2019-02 콜265					26,170
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	22,693	22,610	22,519	22,422	22,320	22,214	22,103
-5.33%	17,397	17,362	17,317	17,263	17,201	17,131	17,055
-2.67%	8,723	8,723	8,723	8,723	8,722	8,721	8,718
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-8,723	-8,723	-8,723	-8,723	-8,723	-8,723	-8,723
5.33%	-17,447	-17,447	-17,447	-17,447	-17,447	-17,447	-17,447
8.00%	-26,170	-26,170	-26,170	-26,170	-26,170	-26,170	-26,170
KR4201P22671		2019-02 콜267.5					9,164
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	7,013	7,004	6,993	6,978	6,961	6,941	6,918

-5.33%	5,984	5,949	5,911	5,872	5,831	5,789	5,746
-2.67%	3,055	3,055	3,054	3,053	3,051	3,048	3,044
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-3,055	-3,055	-3,055	-3,055	-3,055	-3,055	-3,055
5.33%	-6,109	-6,109	-6,109	-6,109	-6,109	-6,109	-6,109
8.00%	-9,164	-9,164	-9,164	-9,164	-9,164	-9,164	-9,164
KR4301P22653                      2019-02 풋265							2,645
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-2,524	-2,535	-2,550	-2,569	-2,591	-2,617	-2,645
-5.33%	0	-1	-2	-5	-9	-15	-24
-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)

**35,345**

공시일	2019-02-14
기준일	2019-02-13

## 홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

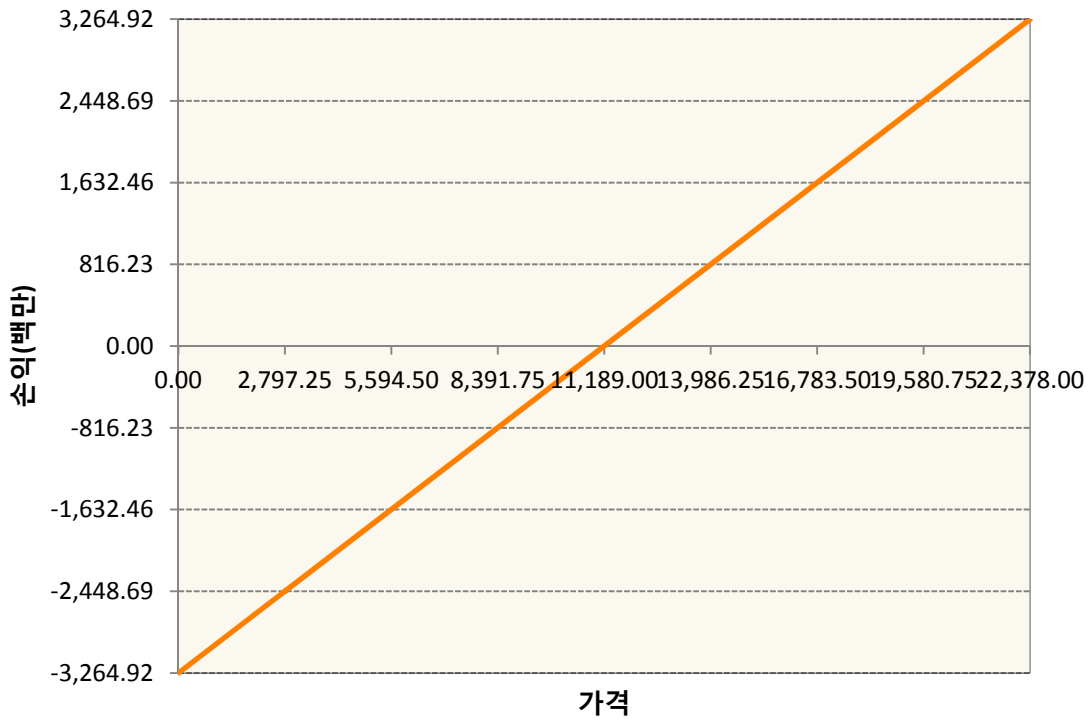
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

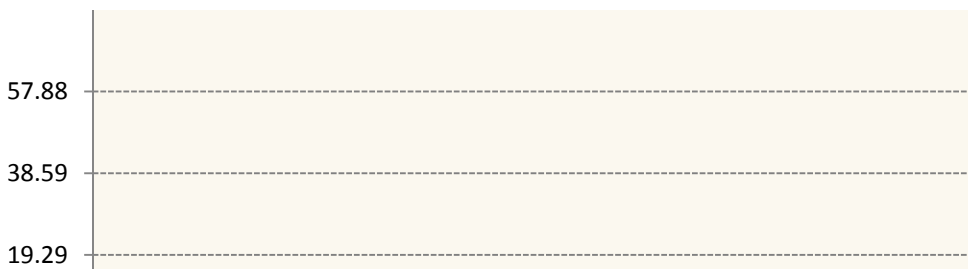
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	3,265	0	3,265	장내
누계	유가증권	옵션	0	7,632	-7,632	장내
누계	통화	선도	0	2,715	-2,715	장외

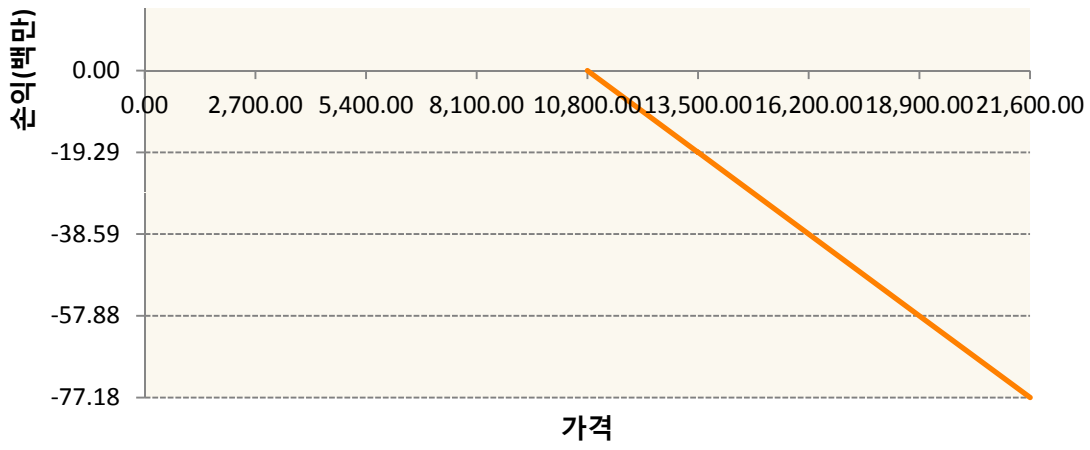
### 2. 만기시점의 손익구조

HCG9-HSCEI Futures Feb19

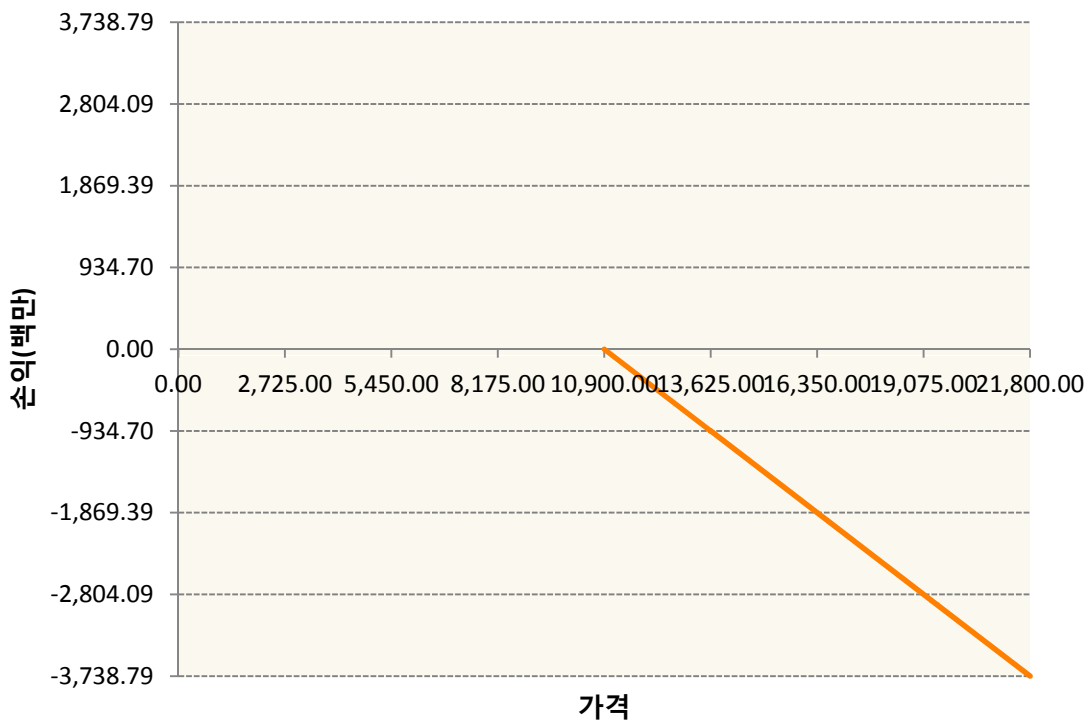


OHHIG9-C108-HSCEI

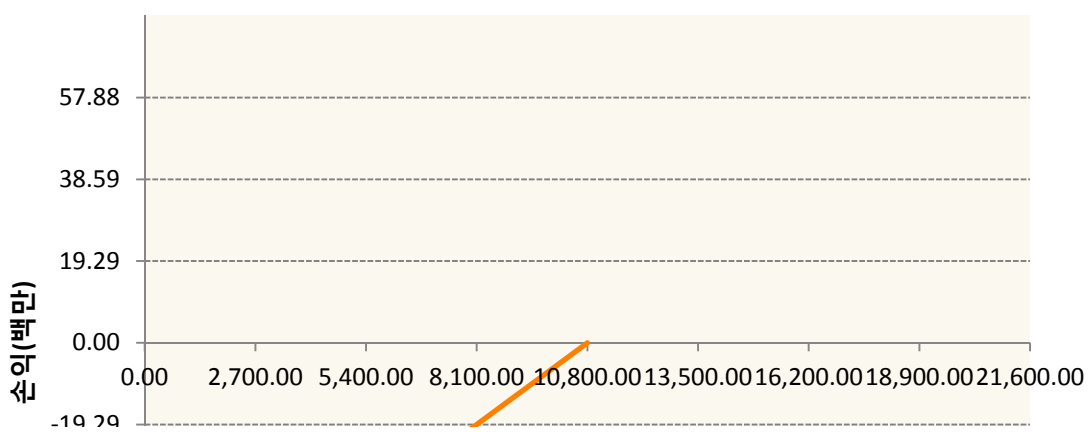


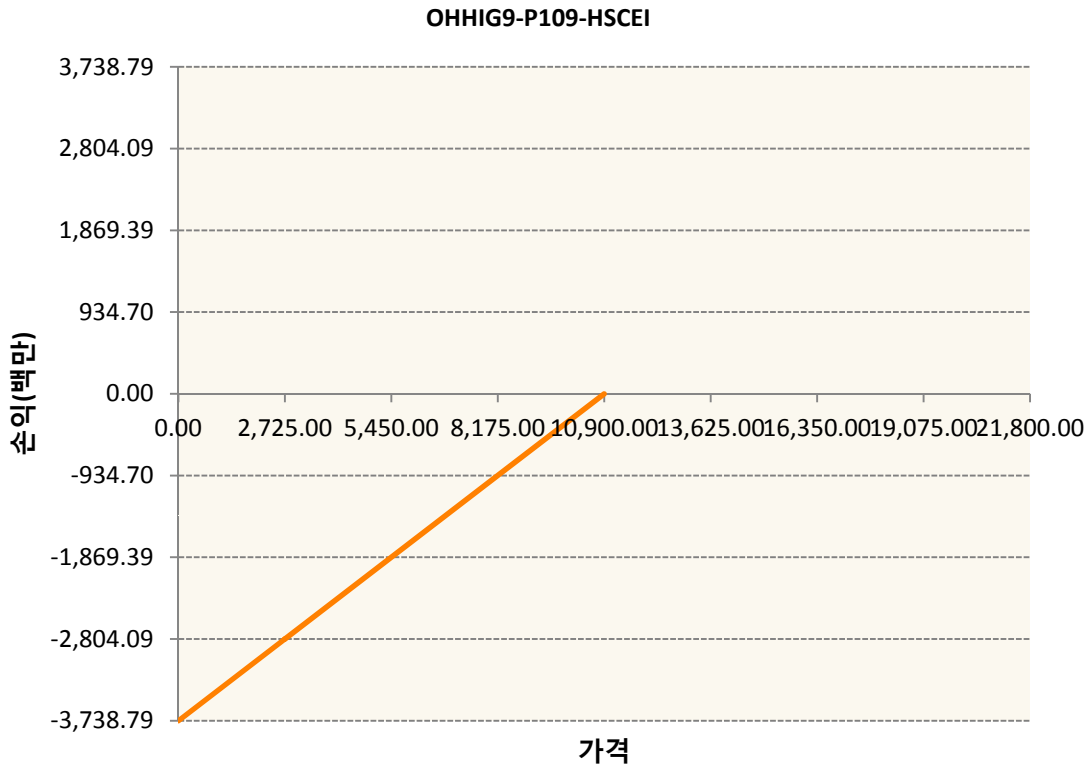
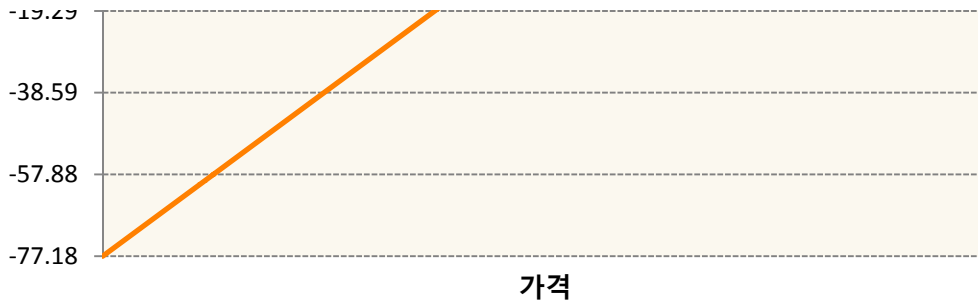


**OHHIG9-C109-HSCEI**



**OHHIG9-P108-HSCEI**





**3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)** (단위:백만원)

FX21018Z00 KRW/HKD 11-03-19E	217
HCG9 HSCEI Futures Feb19	261
OHHIG9-C1( HSCEI	6
OHHIG9-C1( HSCEI	299
OHHIG9-P1( HSCEI	6
OHHIG9-P1( HSCEI	299

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

**968**

공시일	2019-02-14
기준일	2019-02-13

## 코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

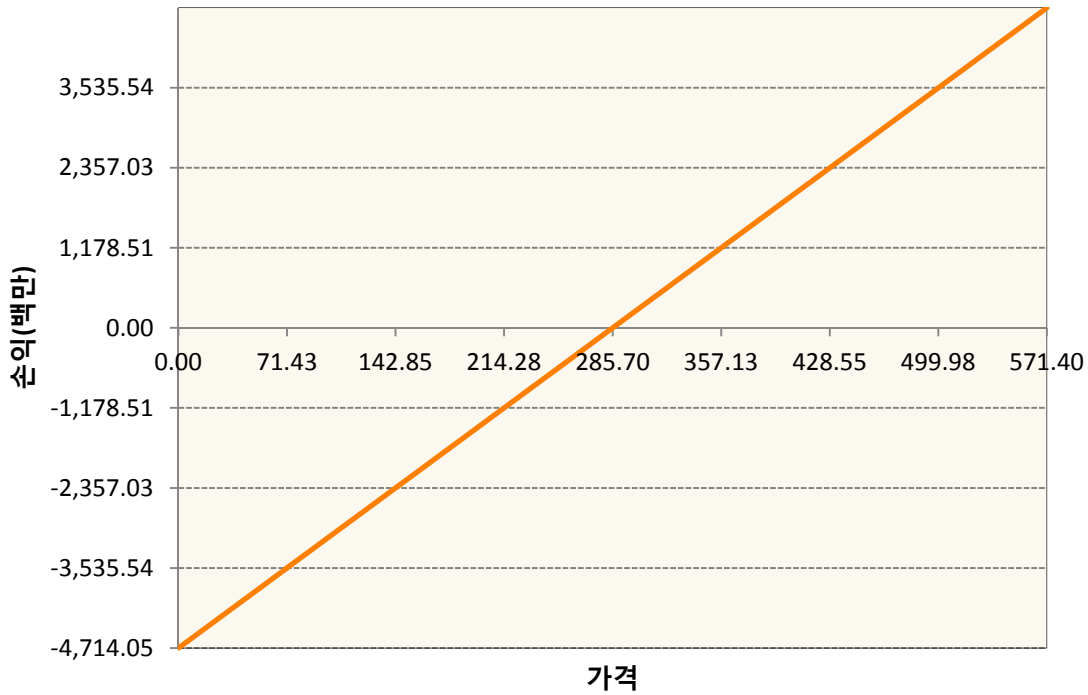
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

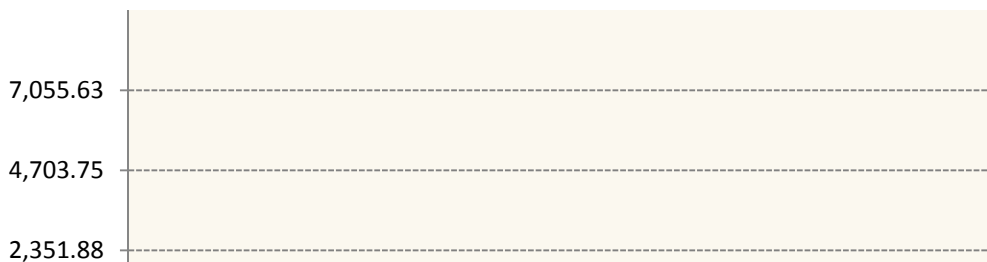
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	493	0	493	장내
누계	유가증권	선물	4,714	0	4,714	장내
누계	유가증권	스왑	31,836	0	31,836	장외
누계	유가증권	옵션	0	29,143	-29,143	장내

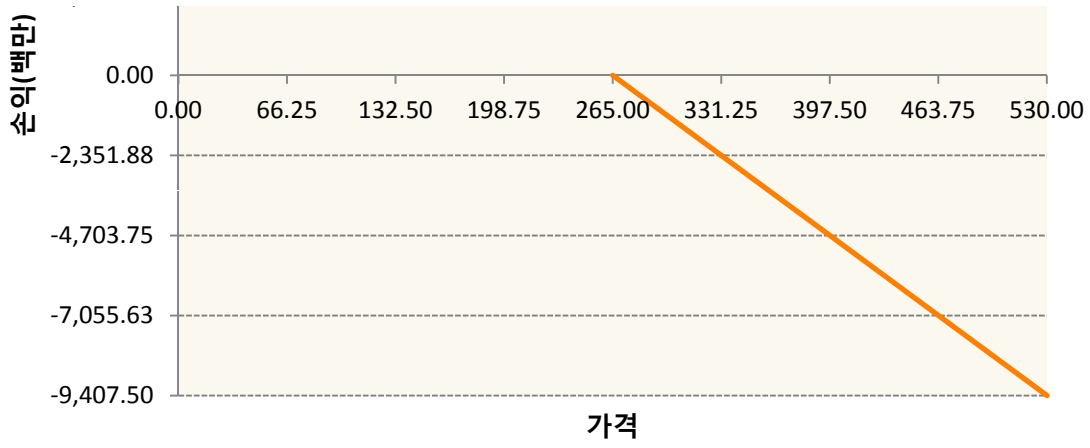
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101P30007-2019-03 코스피200지수선물

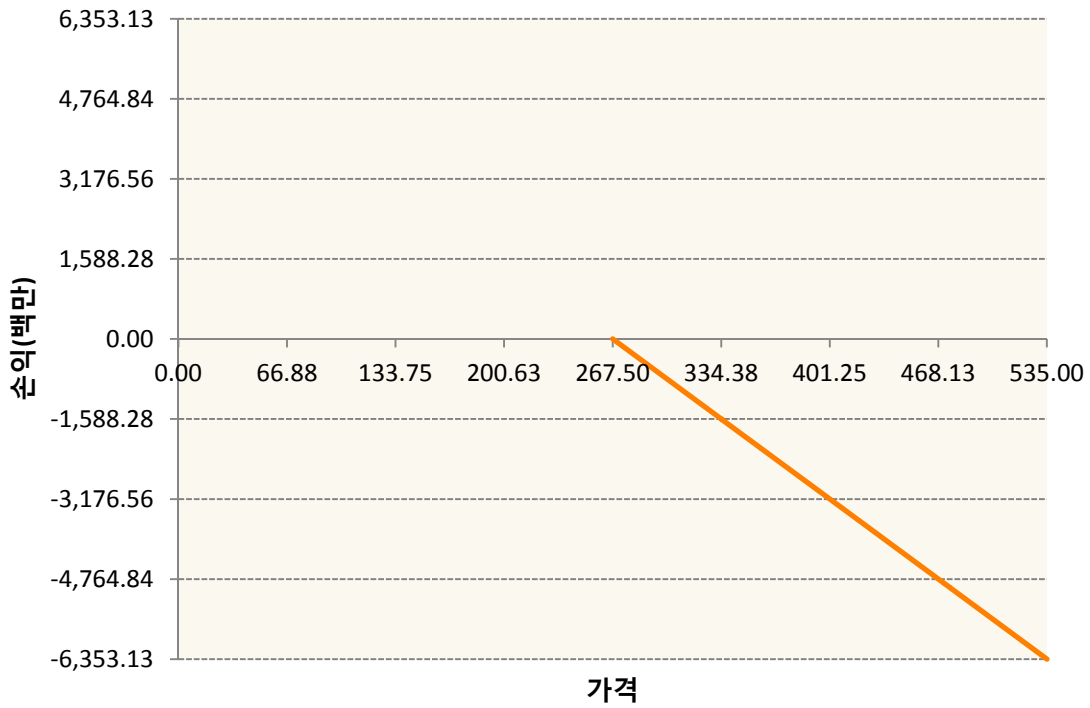


KR4201P22655-2019-02 콜265

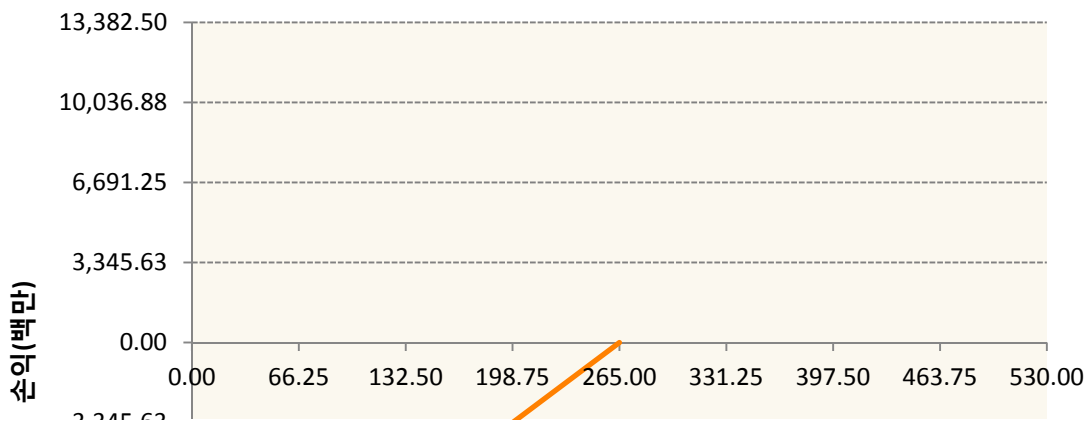


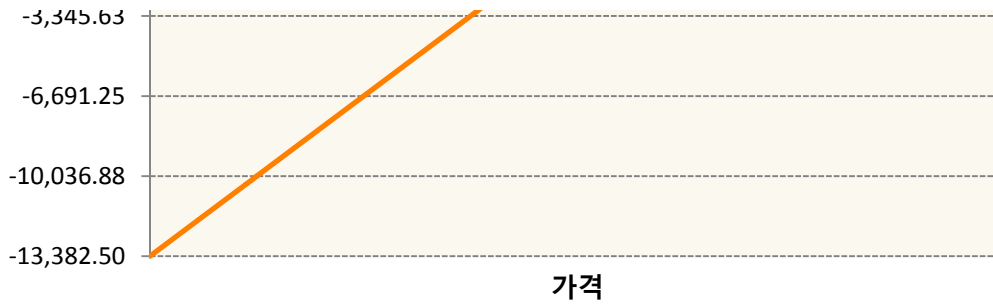


**KR4201P22671-2019-02 콜267.5**



**KR4301P22653-2019-02 풋265**





**3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)** (단위:백만원)

2.529E+11		UBCSFXC1 INDEX_14						2,668
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-2,668	-2,668	-2,668	-2,668	-2,668	-2,668	-2,668	
-5.33%	-1,779	-1,779	-1,779	-1,779	-1,779	-1,779	-1,779	
-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%	1,779	1,779	1,779	1,779	1,779	1,779	1,779	
8.00%	2,668	2,668	2,668	2,668	2,668	2,668	2,668	
KR4101P30007		2019-03 코스피200지수선물						376
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-376	-376	-376	-376	-376	-376	-376	
-5.33%	-251	-251	-251	-251	-251	-251	-251	
-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%	251	251	251	251	251	251	251	
8.00%	376	376	376	376	376	376	376	
KR4201P22655		2019-02 콜265						809
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	702	699	696	693	690	687	684	
-5.33%	538	537	536	534	532	530	527	
-2.67%	270	270	270	270	270	270	270	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	-270	-270	-270	-270	-270	-270	-270	
5.33%	-540	-540	-540	-540	-540	-540	-540	
8.00%	-809	-809	-809	-809	-809	-809	-809	
KR4201P22671		2019-02 콜267.5						541
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	

-8.00%	414	414	413	412	411	410	409
-5.33%	354	351	349	347	344	342	339
-2.67%	180	180	180	180	180	180	180
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-180	-180	-180	-180	-180	-180	-180
5.33%	-361	-361	-361	-361	-361	-361	-361
8.00%	-541	-541	-541	-541	-541	-541	-541
KR4301P22653                      2019-02 풋265							151
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-144	-144	-145	-146	-147	-149	-151
-5.33%	0	0	0	0	-1	-1	-1
-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)

**4,352**

공시일	2019-02-14
기준일	2019-02-13

## 유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

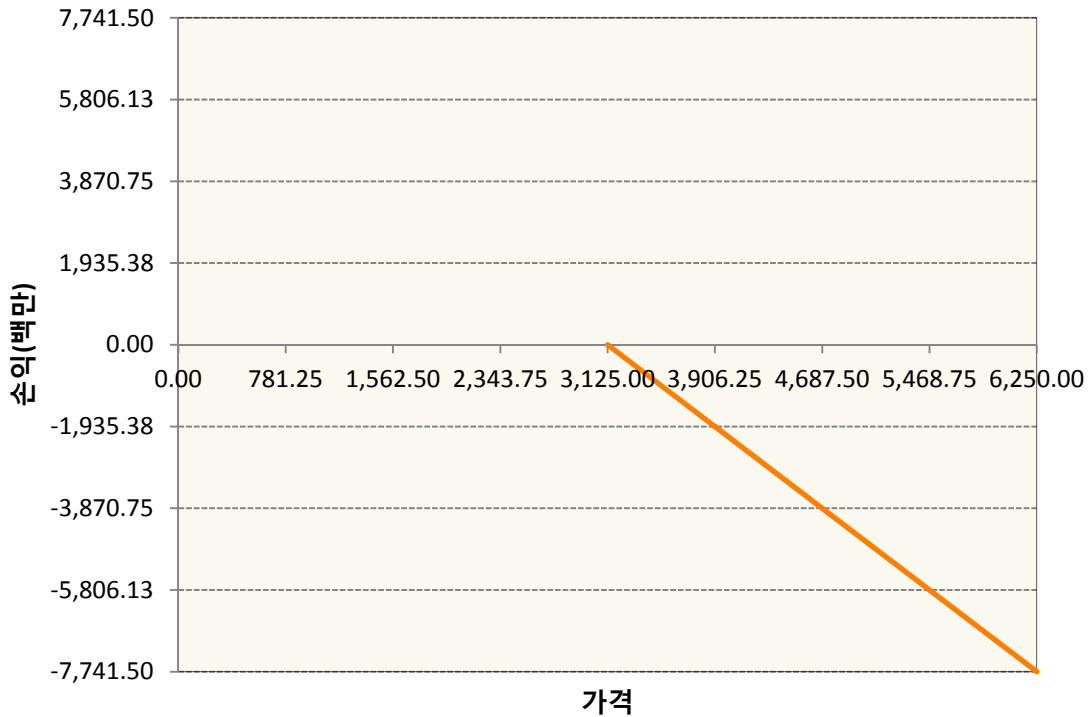
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

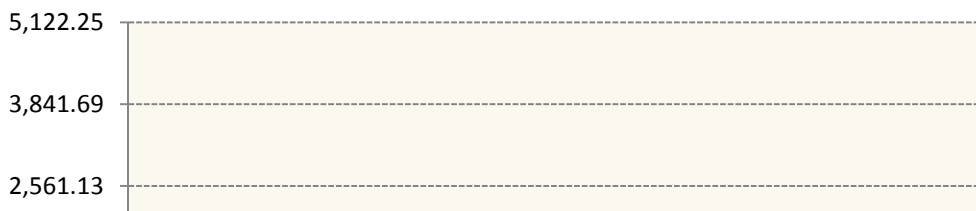
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	6,906	0	6,906	
누계	유가증권	스왑	59,978	0	59,978	장외
누계	유가증권	옵션	0	25,728	-25,728	장내
누계	통화	선도	0	15,245	-15,245	장외

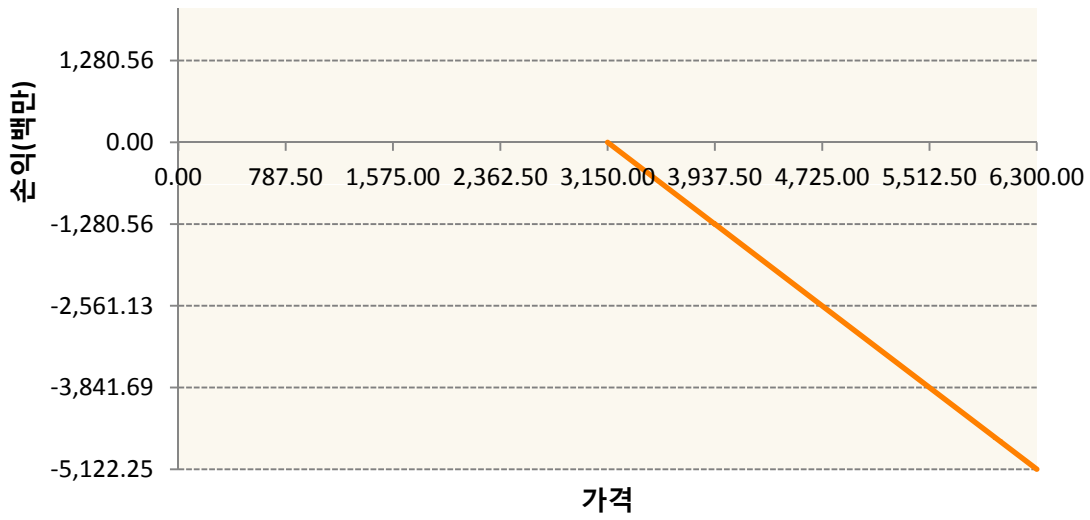
### 2. 만기시점의 손익구조

OESXG9-C3125-EURO STOXX 50

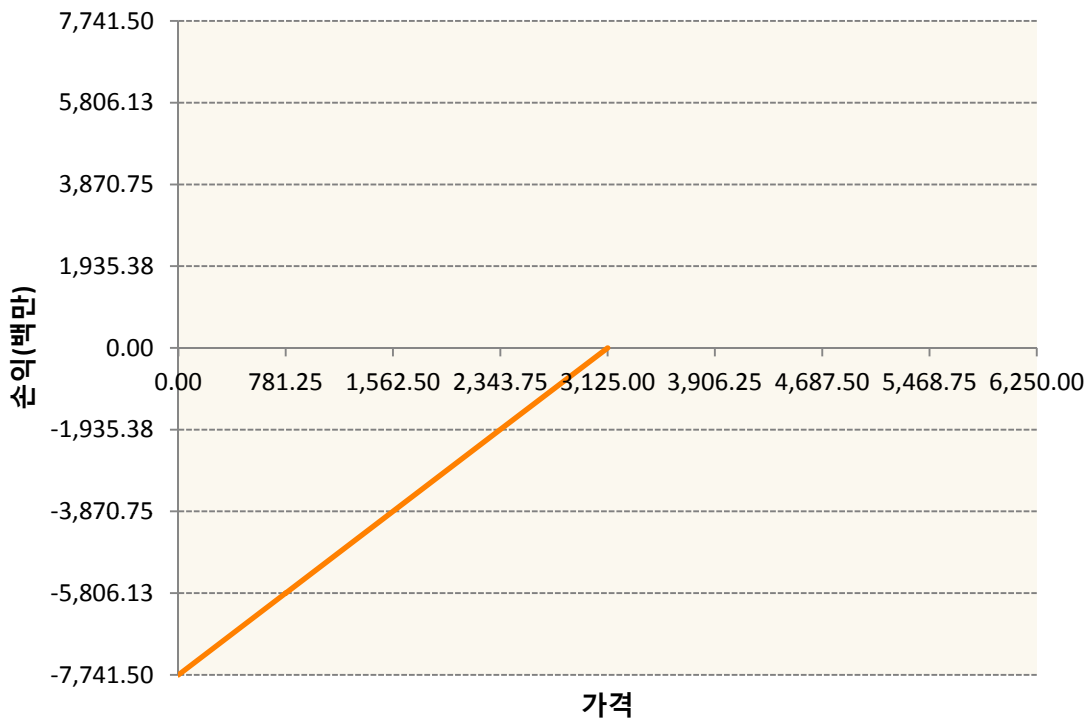


OESXG9-C3150-EURO STOXX 50

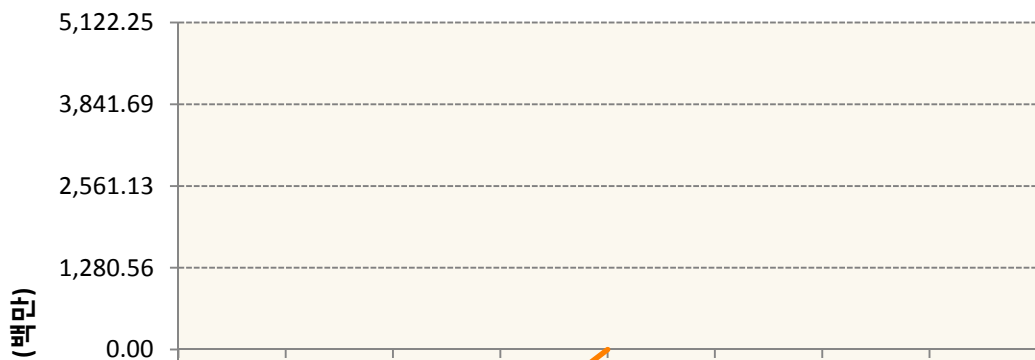


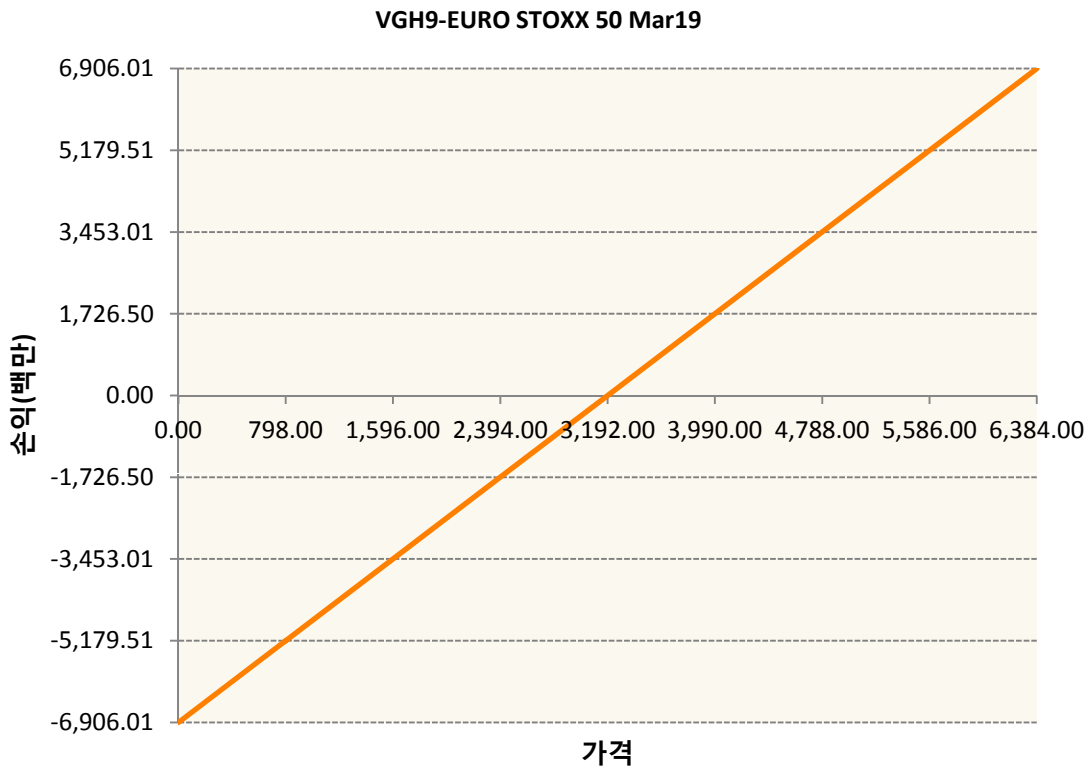
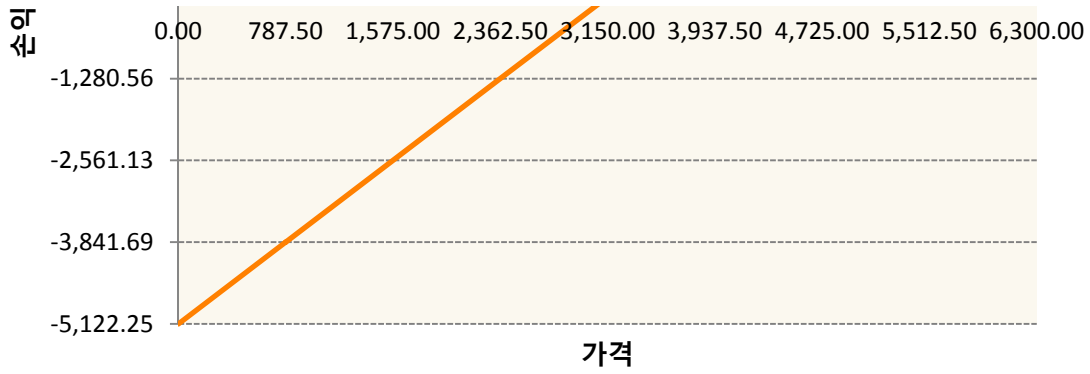


**OESXG9-P3125-EURO STOXX 50**



**OESXG9-P3150-EURO STOXX 50**





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY		66
FX21018X02 KRW/EUR 22-02-19E		407
FX21018Z03 KRW/EUR 22-03-19E		813
OESXG9-C31EURO STOXX 50		619
OESXG9-C31EURO STOXX 50		410
OESXG9-P31EURO STOXX 50		619
OESXG9-P31EURO STOXX 50		410
VGH9	EURO STOXX 50 Mar19	552

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

(단위:백만원)

2,560



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

(단위:백만원)

1,178



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

(단위:백만원)

101



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

(단위:백만원)

151

공시일	2019-02-14
기준일	2019-02-13

## 스마트KRX300인덱스목표전환형1호

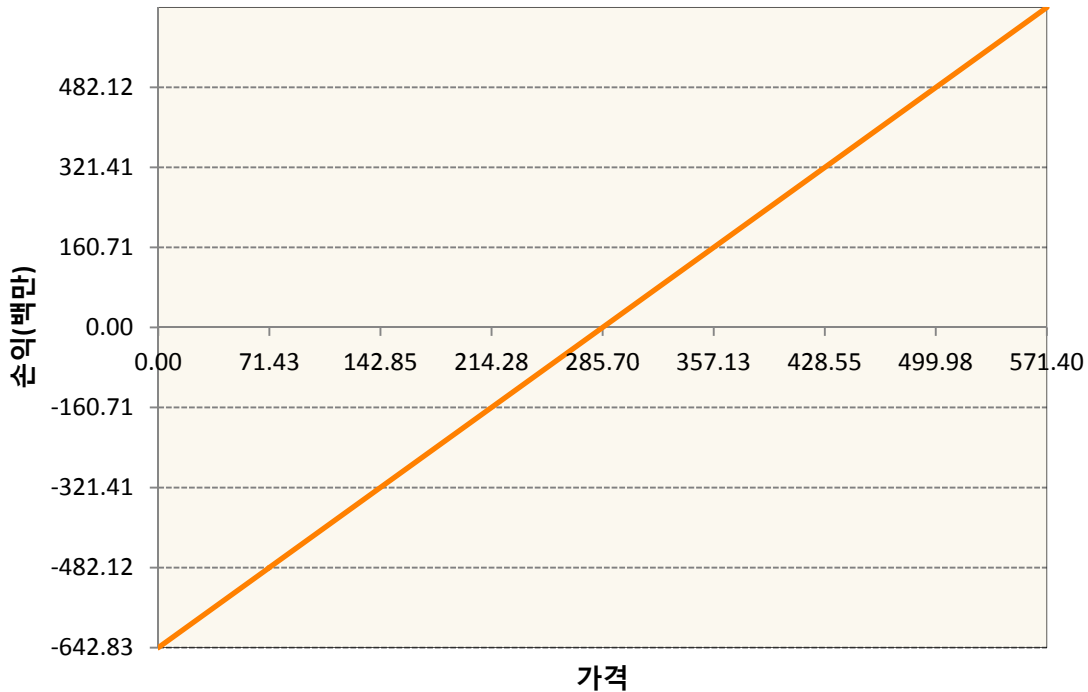
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	643	0	643	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	2019-02-14
기준일	2019-02-13

## 리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

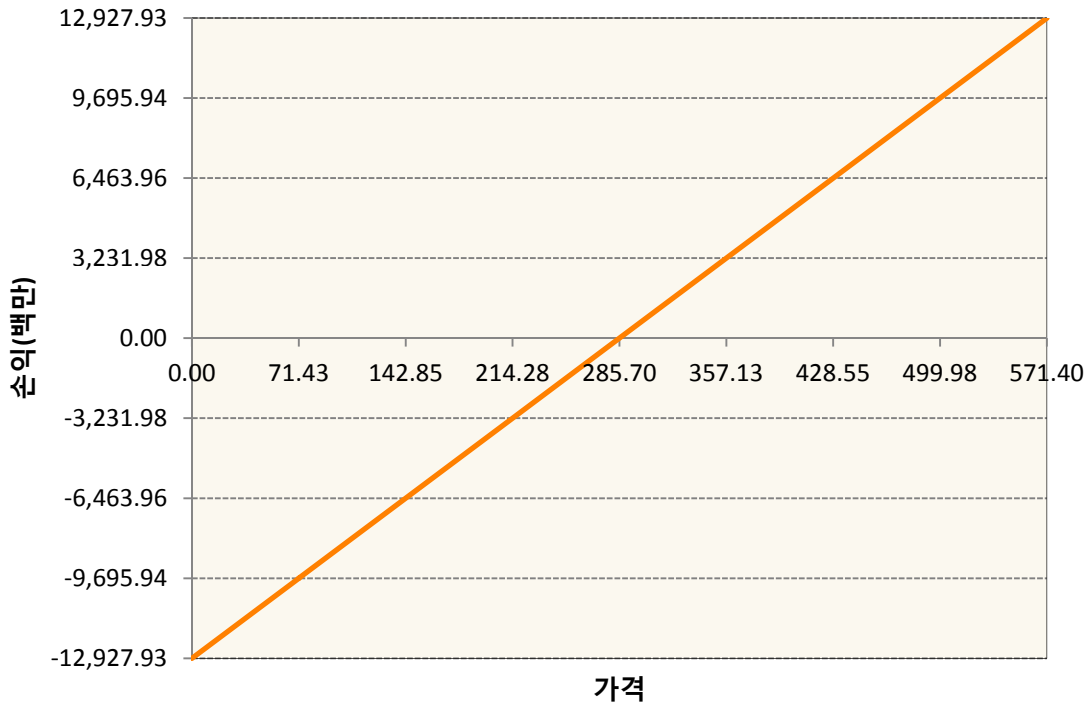
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

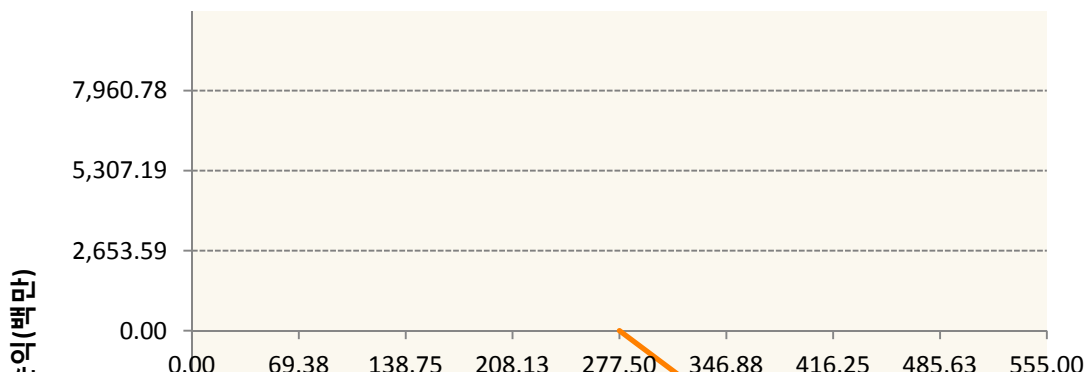
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	12,928	0	12,928	장내
누계	유가증권	옵션	2,523	22,724	-20,202	장내

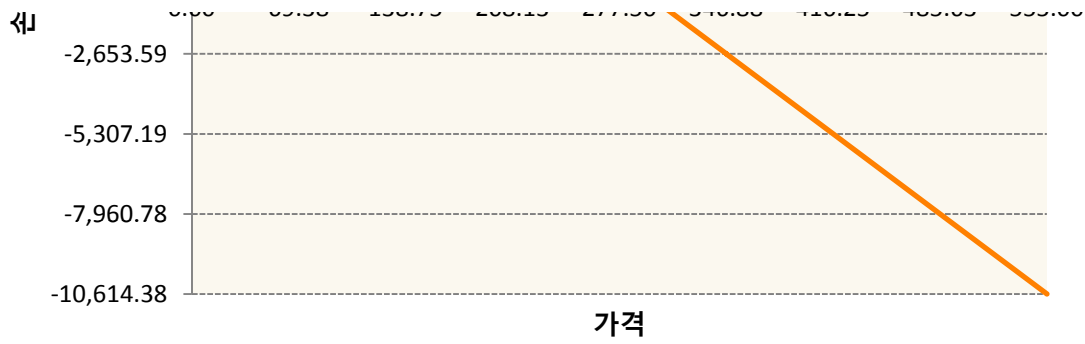
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101P30007-2019-03 코스피200지수선물

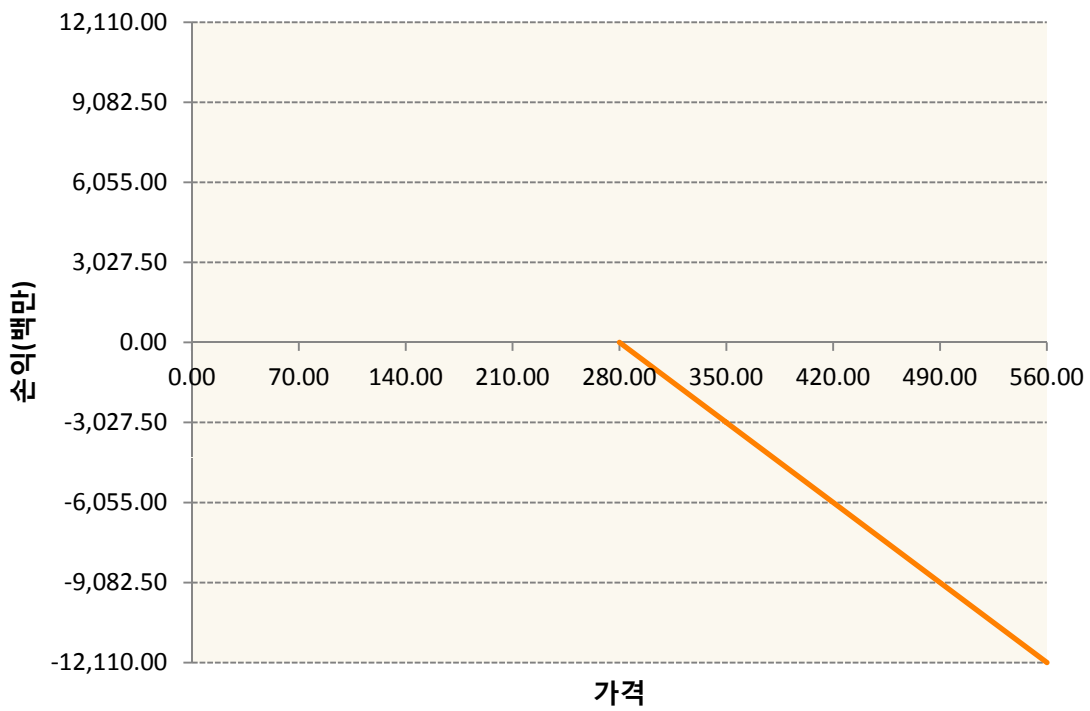


KR4201P22770-2019-02 콜277.5

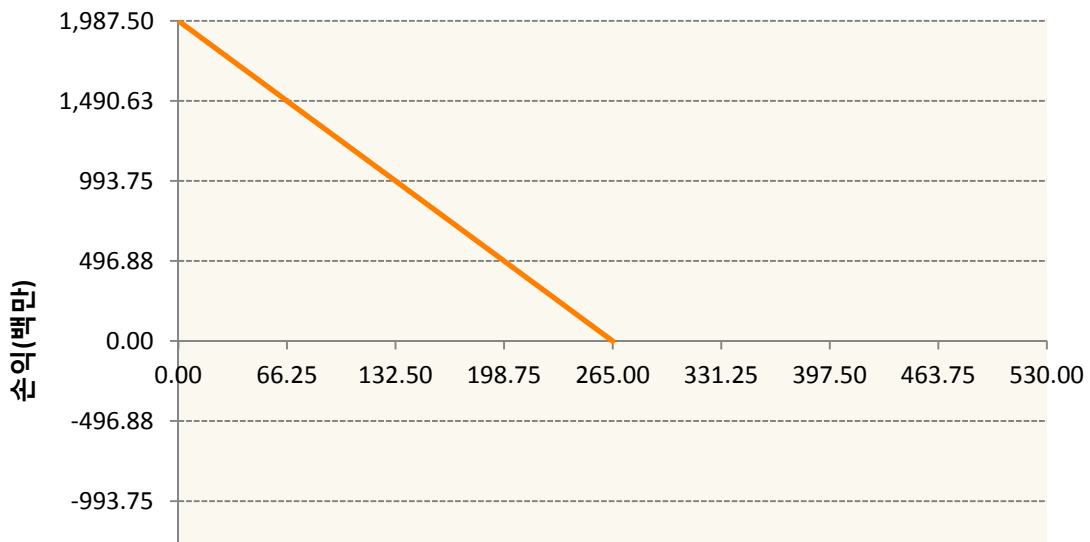


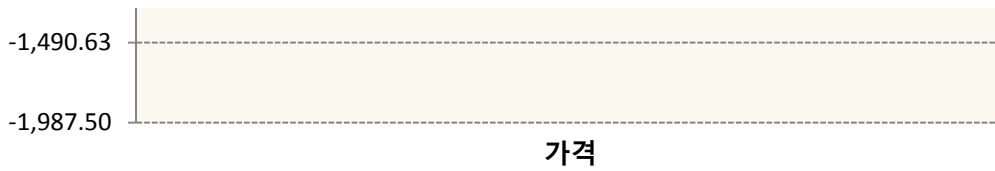


KR4201P22804-2019-02 콜280

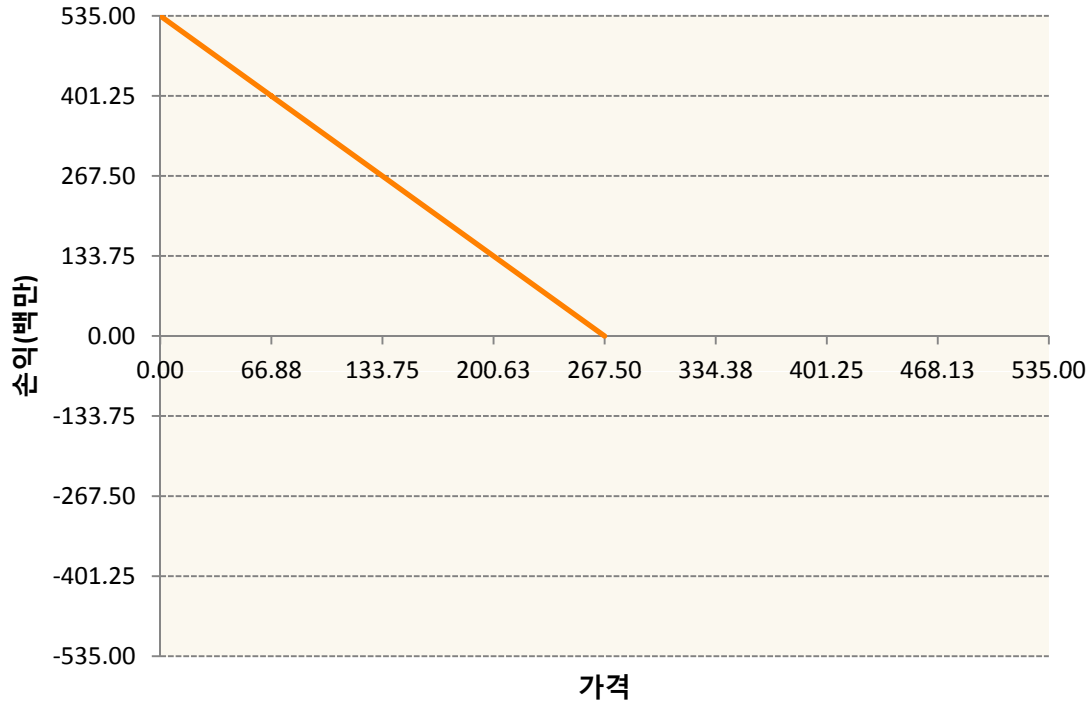


KR4301P22653-2019-02 풋265





KR4301P22679-2019-02 풋267.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101P30007		2019-03 코스피200지수선물						1,032
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-1,032	-1,032	-1,032	-1,032	-1,032	-1,032	-1,032	
-5.33%	-688	-688	-688	-688	-688	-688	-688	
-2.67%	-344	-344	-344	-344	-344	-344	-344	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	344	344	344	344	344	344	344	
5.33%	688	688	688	688	688	688	688	
8.00%	1,032	1,032	1,032	1,032	1,032	1,032	1,032	
KR4201P22770		2019-02 콜277.5						871
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	287	287	287	287	287	287	287	
-5.33%	287	287	287	286	285	285	284	
-2.67%	246	242	237	232	227	223	218	

0%	1	1	1	0	-1	-2	-3
2.67%	-289	-289	-289	-289	-289	-289	-289
5.33%	-580	-580	-580	-580	-580	-580	-580
8.00%	-871	-871	-871	-871	-871	-871	-871
KR4201P22804                      2019-02 콜280							978
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	223	223	223	223	223	223	223
-5.33%	223	223	222	222	222	222	222
-2.67%	211	207	203	199	195	190	186
0%	5	4	2	0	-3	-5	-8
2.67%	-321	-321	-321	-321	-321	-321	-321
5.33%	-650	-650	-650	-650	-650	-650	-650
8.00%	-978	-978	-978	-978	-978	-978	-978
KR4301P22653                      2019-02 풋265							22
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	21	21	22	22	22	22	22
-5.33%	0	0	0	0	0	0	0
-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							11
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	11	11	11	11	11	11	11
-5.33%	0	0	0	0	0	0	0
-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)

**3,261**

공시일	2019-02-14
기준일	2019-02-13

## 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	797	0	797	

### 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	2019-02-14
기준일	2019-02-13

## 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	4,171	0	4,171	

### 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	2019-02-14
기준일	2019-02-13

## 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	17,049	0	17,049	
누계	통화	선도	0	17,959	-17,959	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	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	136
FX21019F02 KRW/USD 28-03-19E	467
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
FX21019G01 KRW/USD 19-03-19E	54

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

(단위:백만원)

**543**

공시일	2019-02-14
기준일	2019-02-13

## 스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

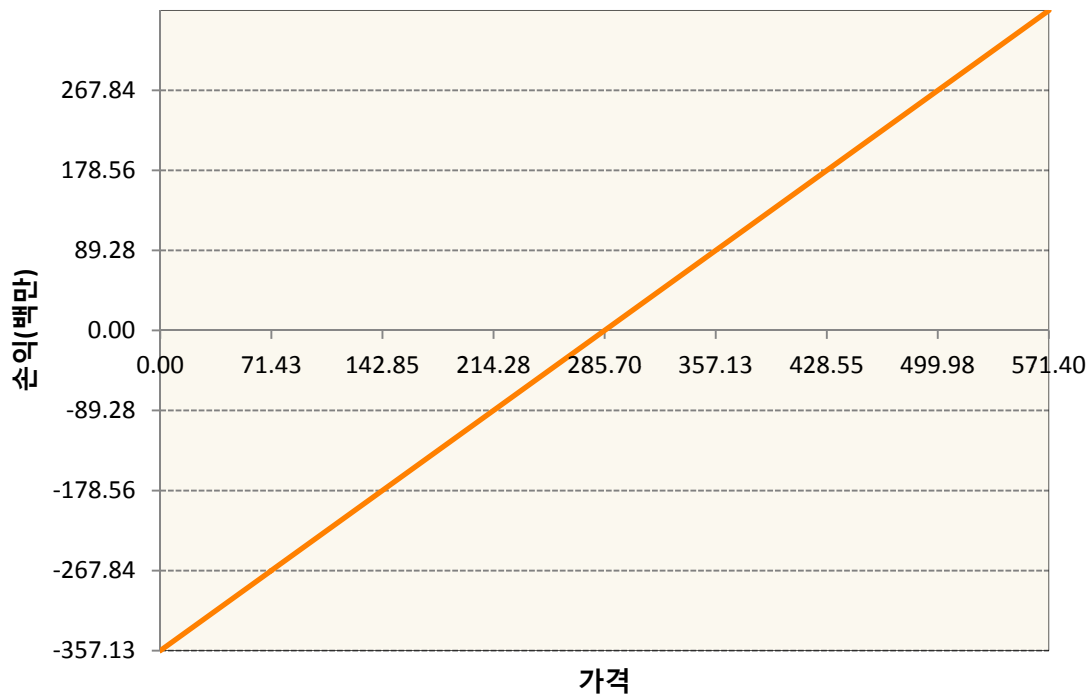
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

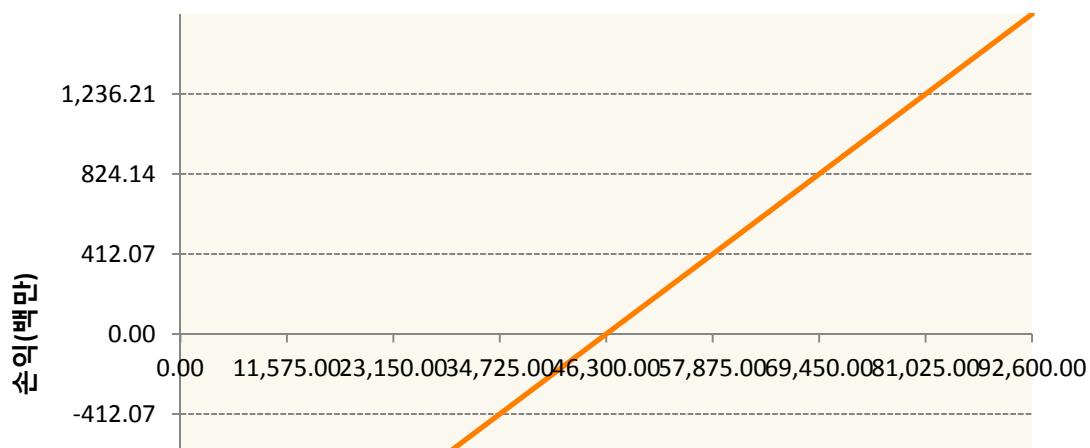
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	1,648	0	1,648	장내
누계	유가증권	선물	2,005	0	2,005	장내

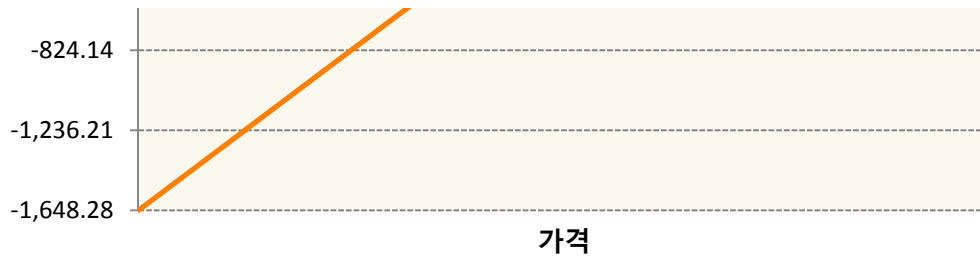
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101P30007-2019-03 코스피200지수선물



KR4111P30006-2019-03 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	

KR4111P30006		2019-03 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)

**181**

공시일	2019-02-14
기준일	2019-02-13

## 에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

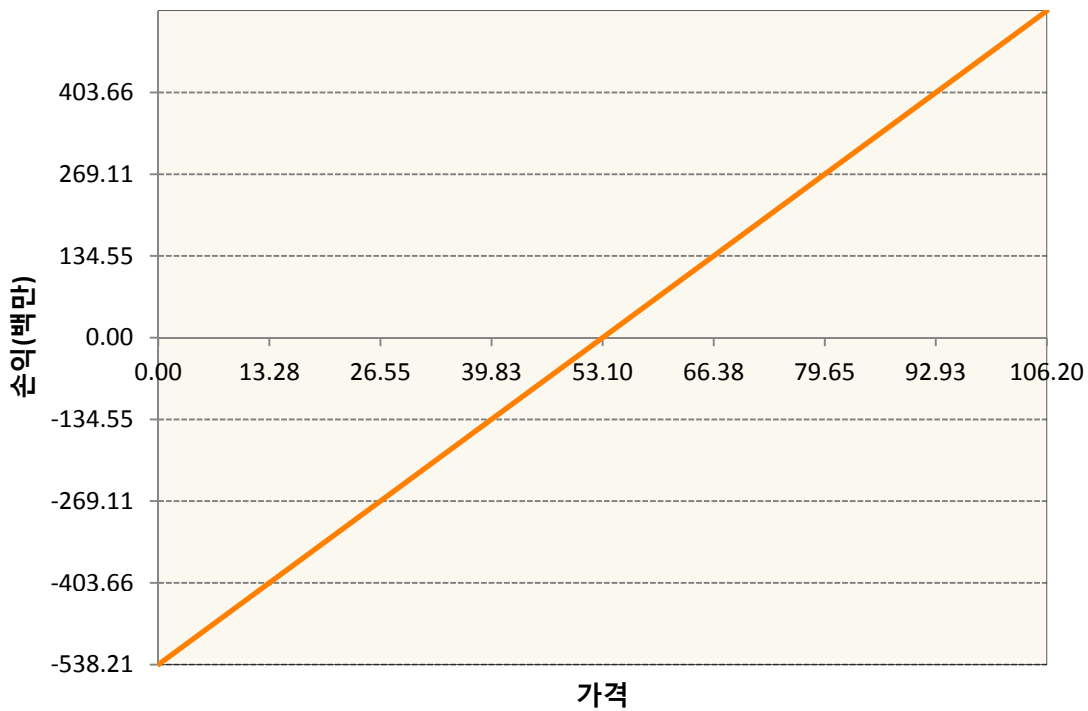
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

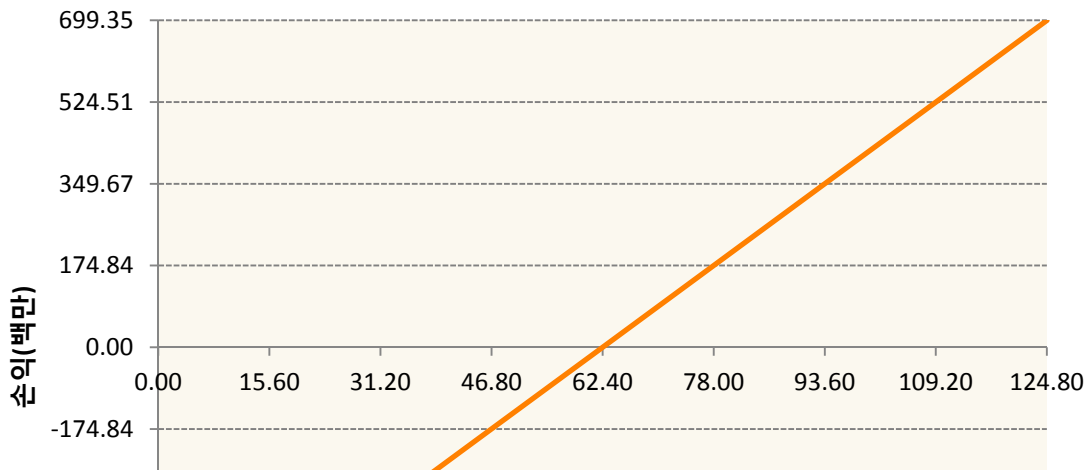
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,670	280	2,390	

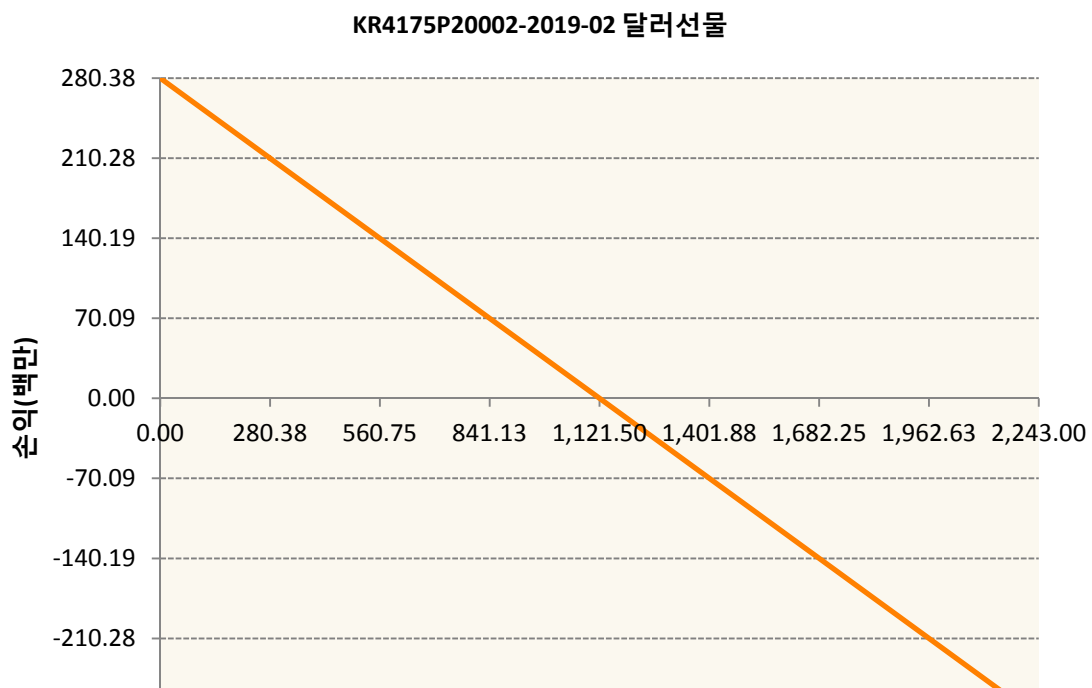
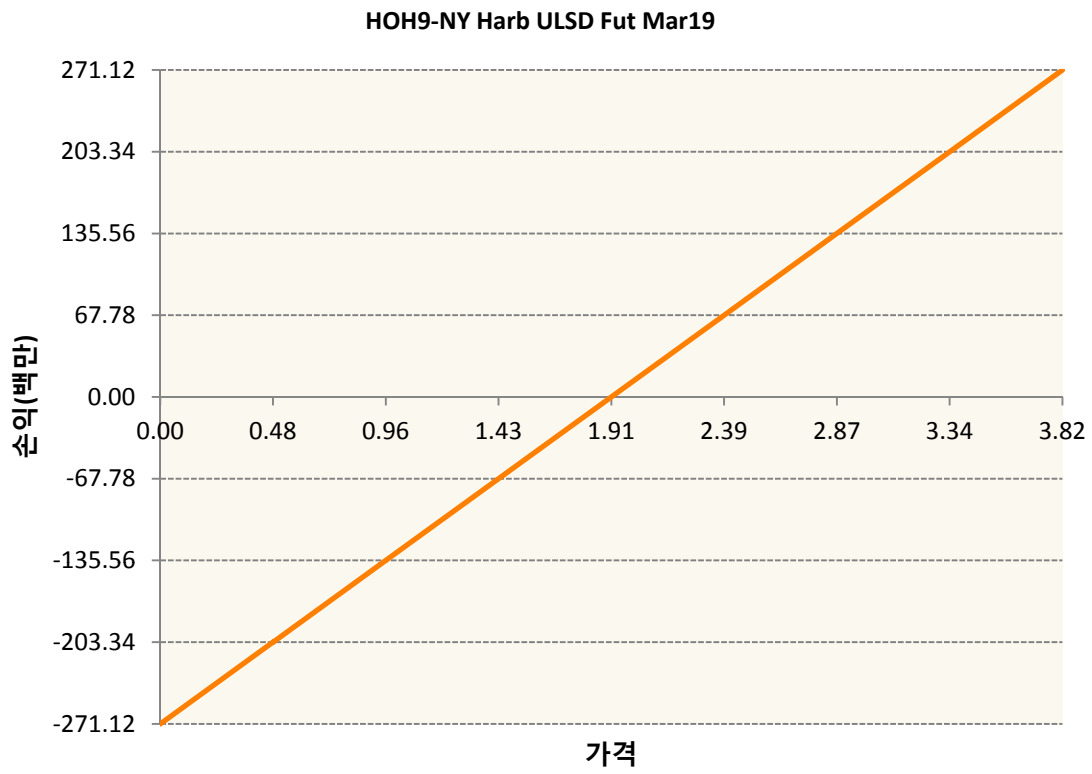
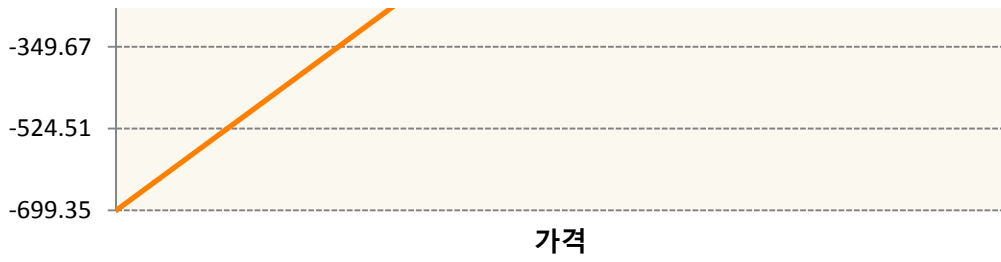
### 2. 만기시점의 손익구조

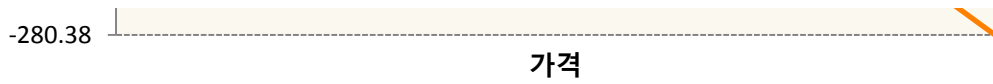
CLH9-WTI CRUDE FUTURE MAR19



COK9-BRENT CRUDE FUTR May19

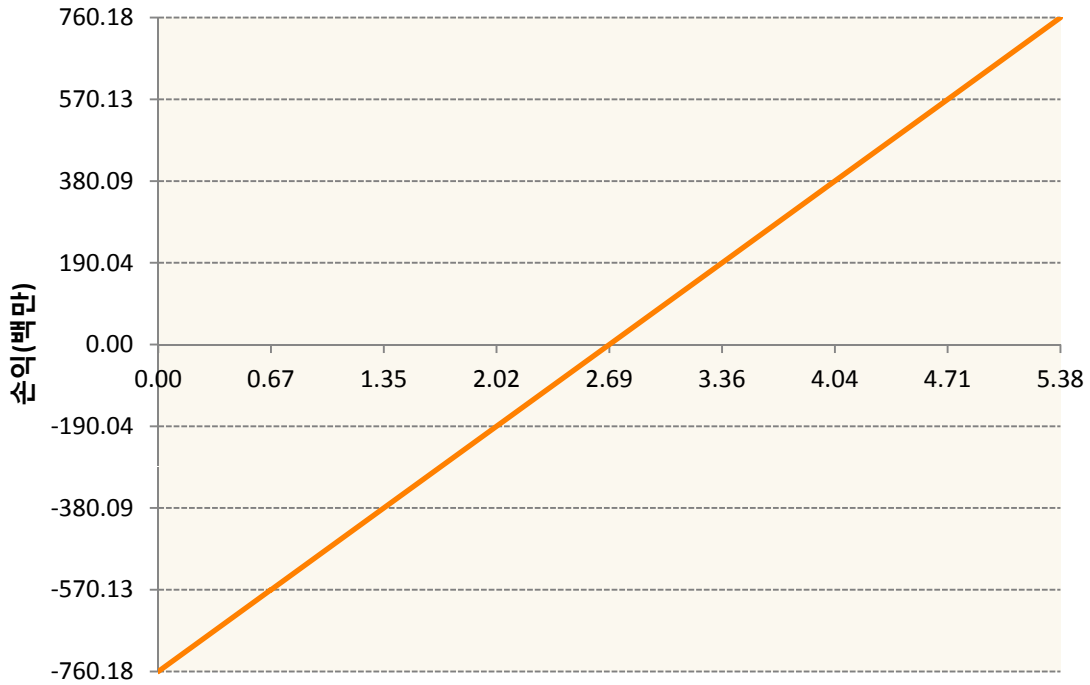






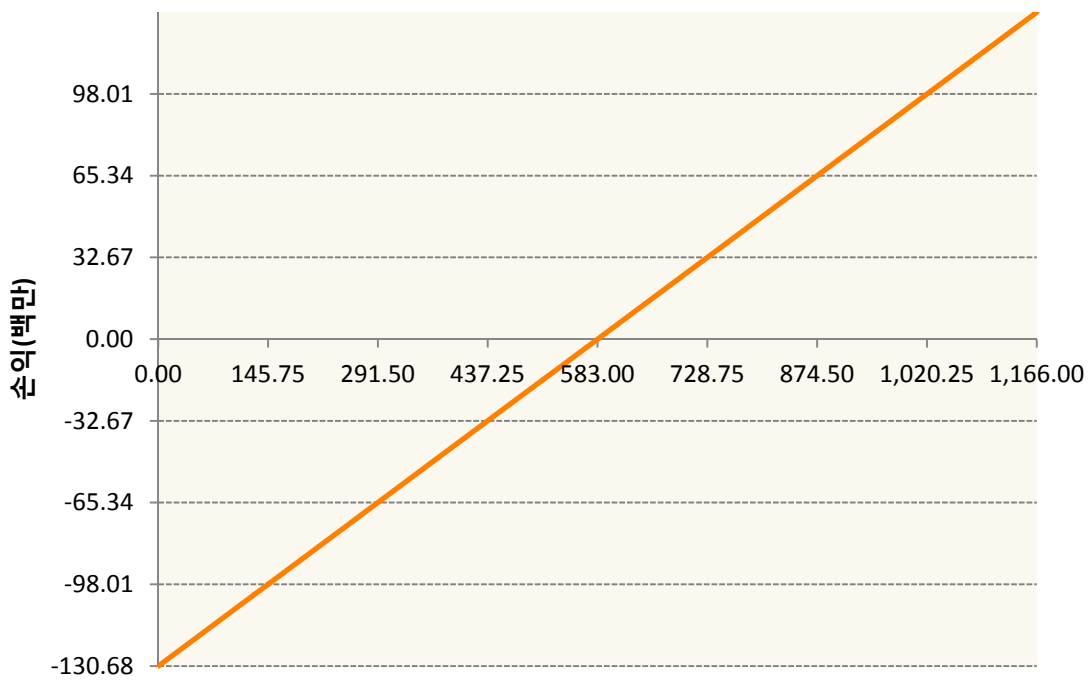
가격

NGH19-NATURAL GAS FUTR Mar19



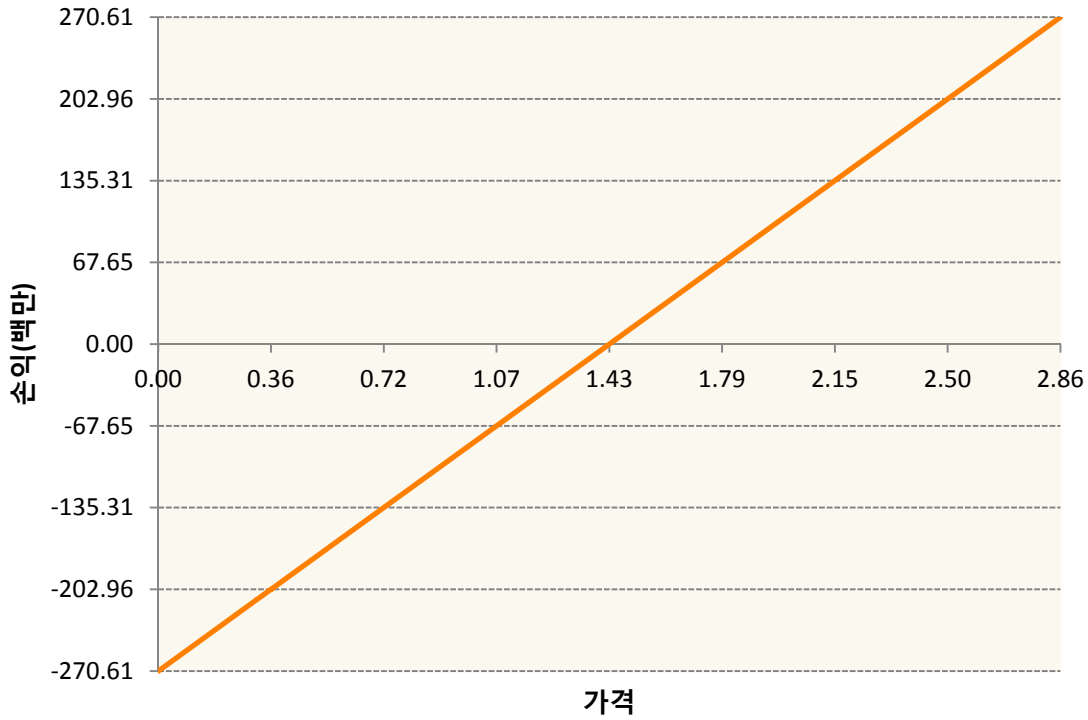
가격

QSH9-Low Su Gasoil G May19



가격

**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	61
QSH9	Low Su Gasoil G May19	10
XBH9	GASOLINE RBOB FUT Mar19	22

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

**414**

공시일	2019-02-14
기준일	2019-02-13

## 애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

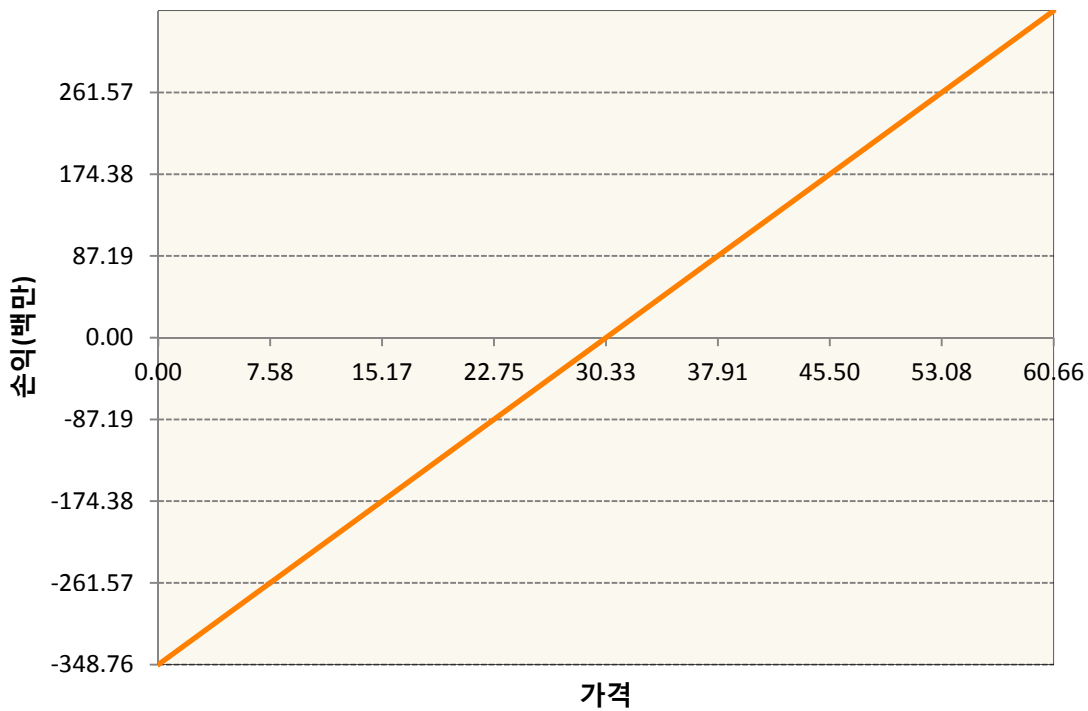
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

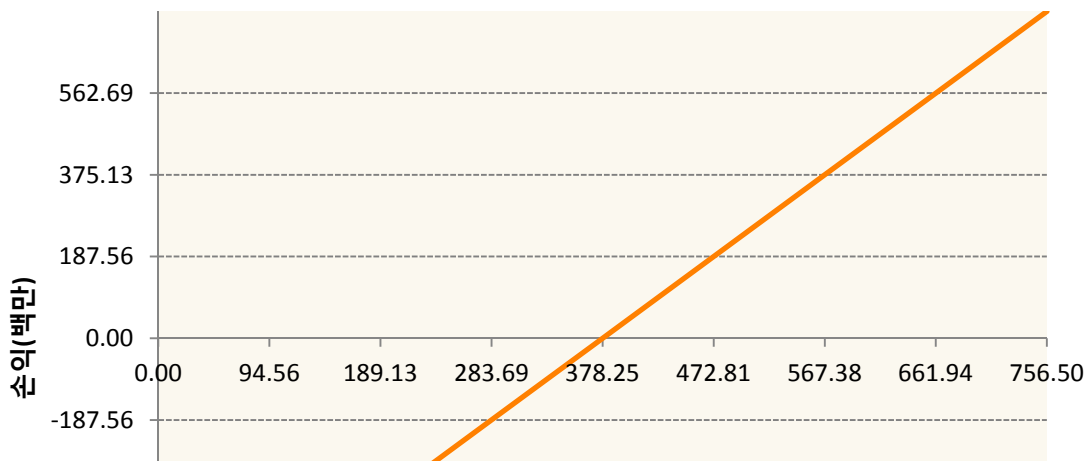
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,574	79	3,496	

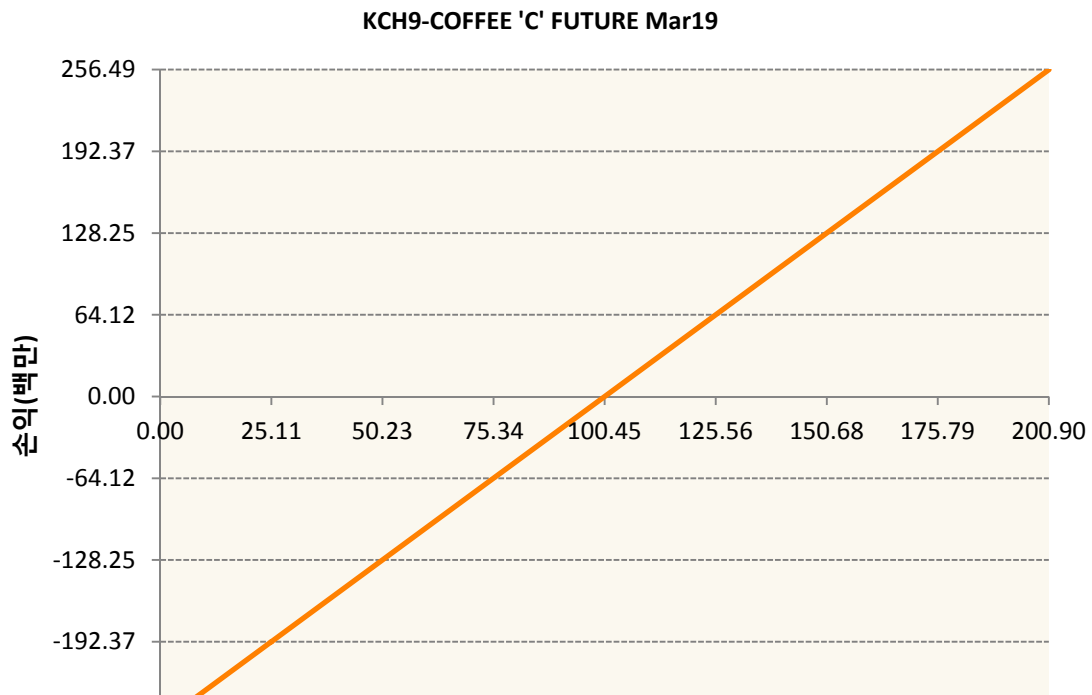
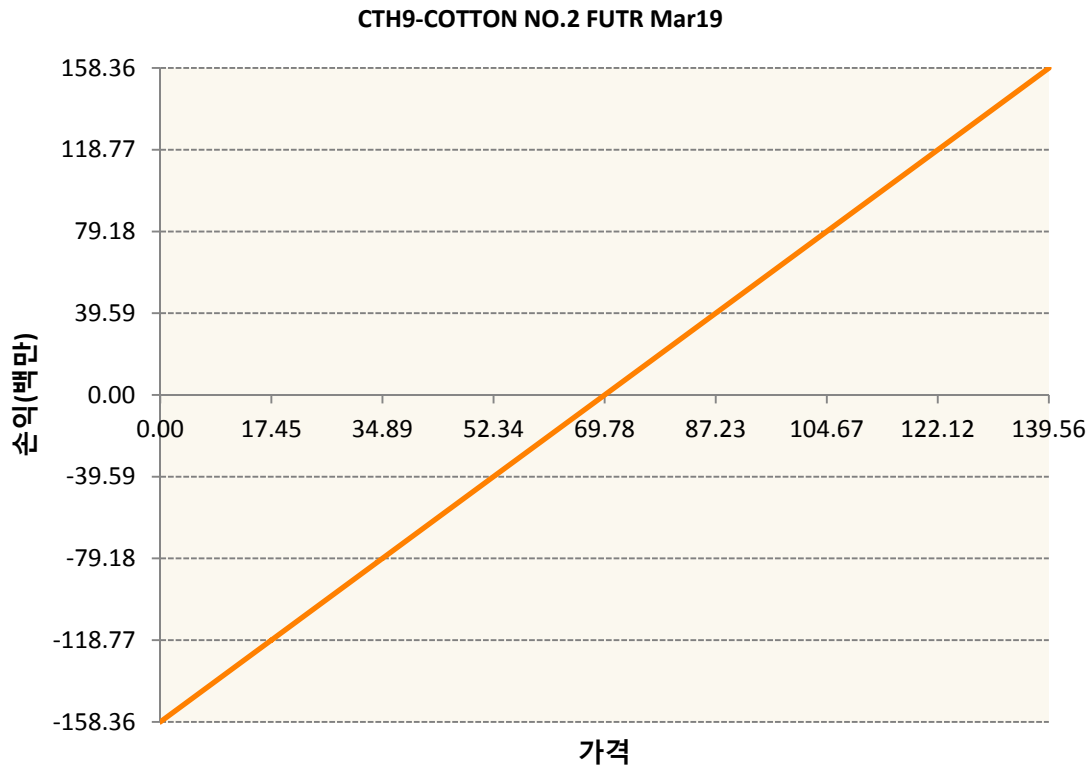
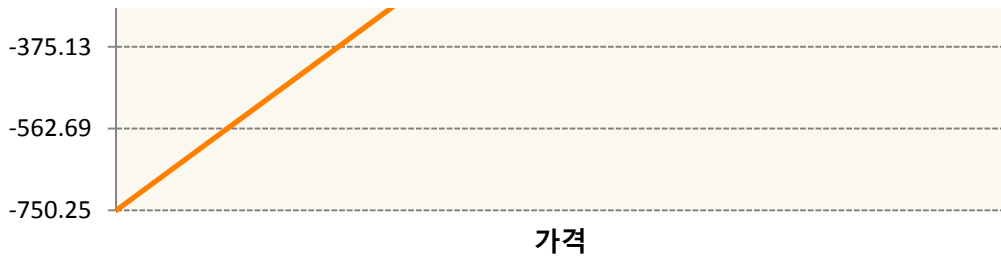
### 2. 만기시점의 손익구조

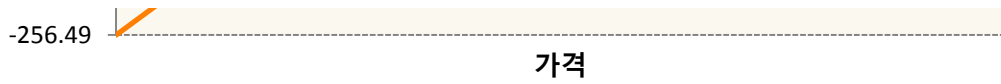
**BOH9-SOYBEAN OIL FUTR Mar19**



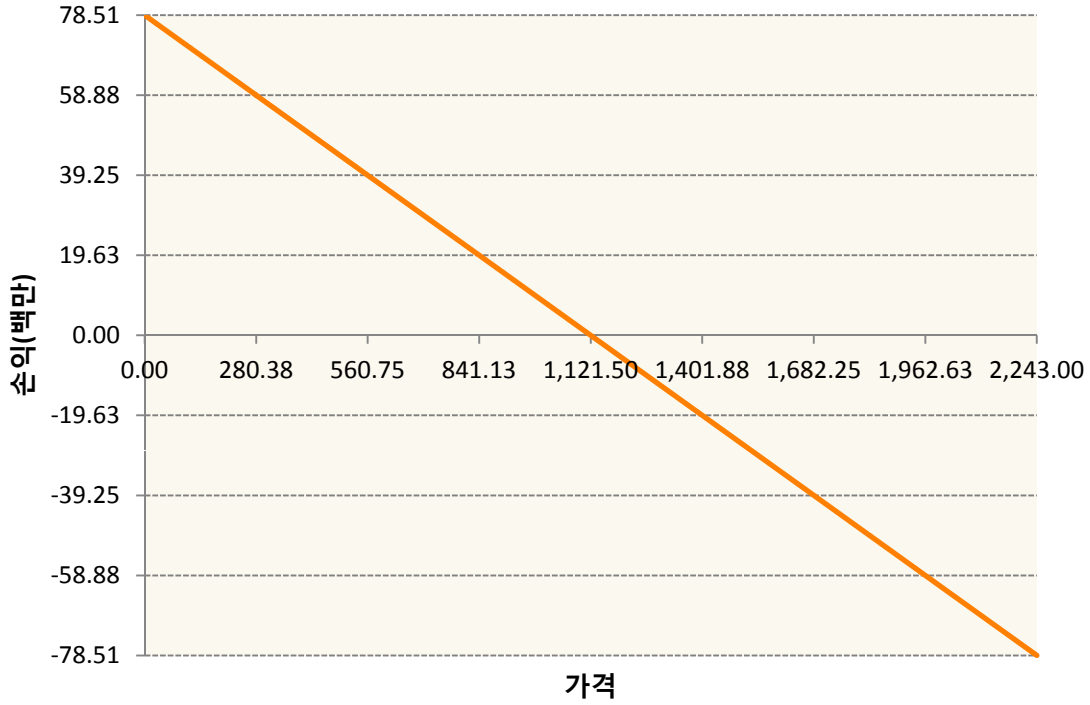
**CH9-CORN FUTURE Mar19**



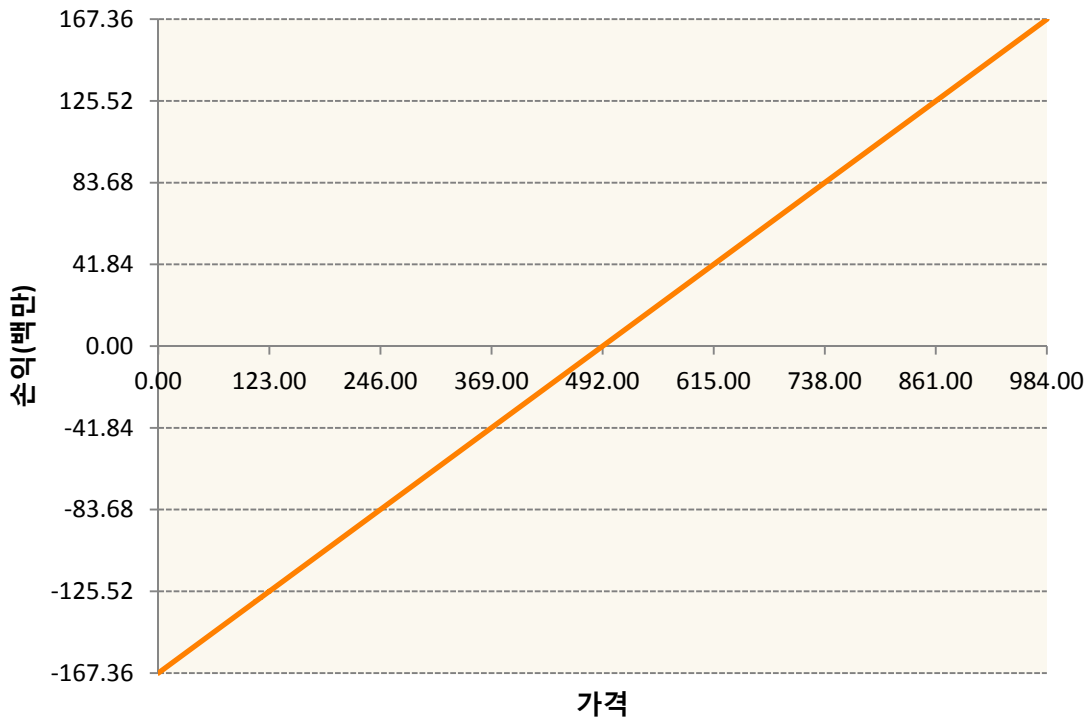




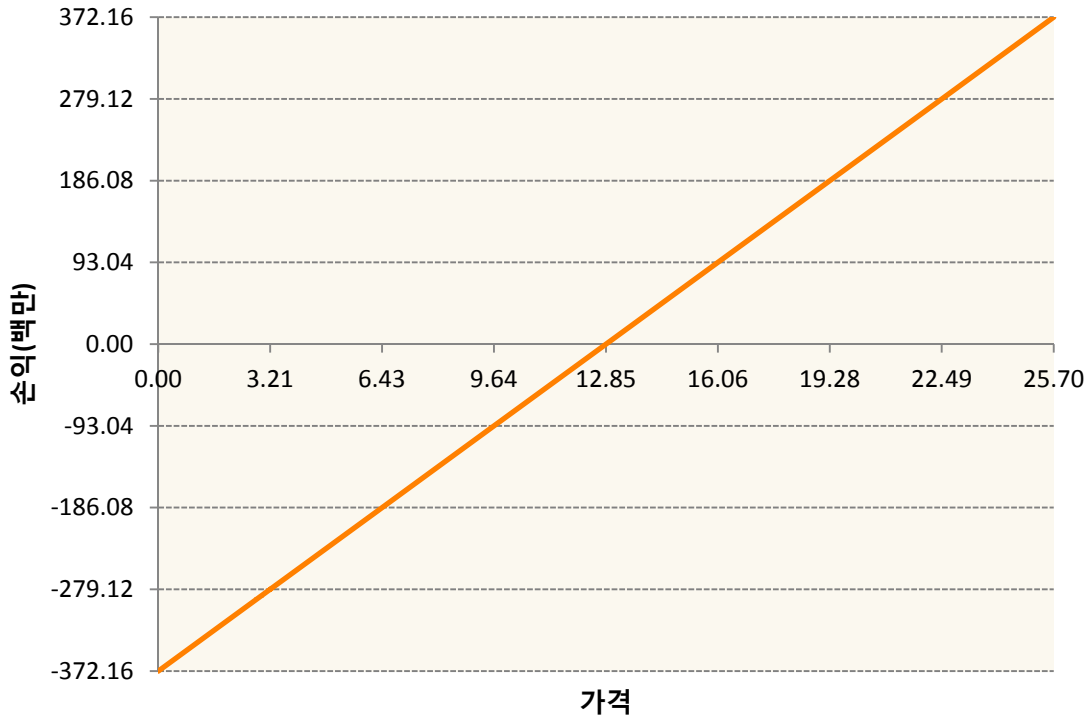
KR4175P20002-2019-02 달러선물



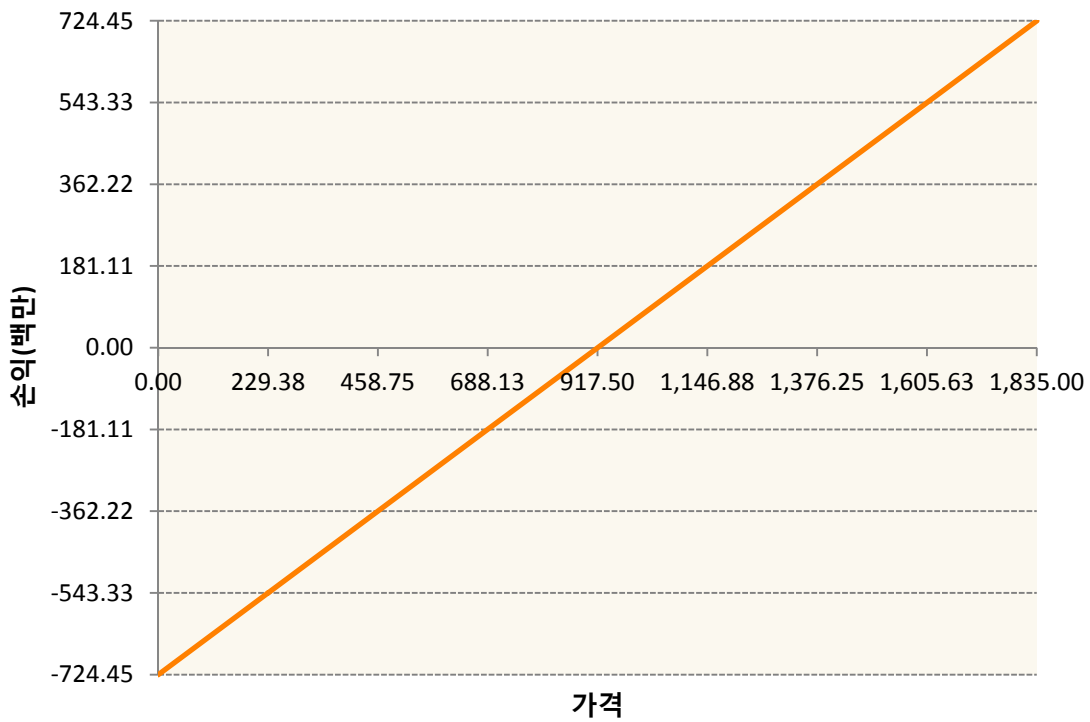
KWH9-KC HRW WHEAT FUT Mar19



SBH9-SUGAR #11 (WORLD) MAR19

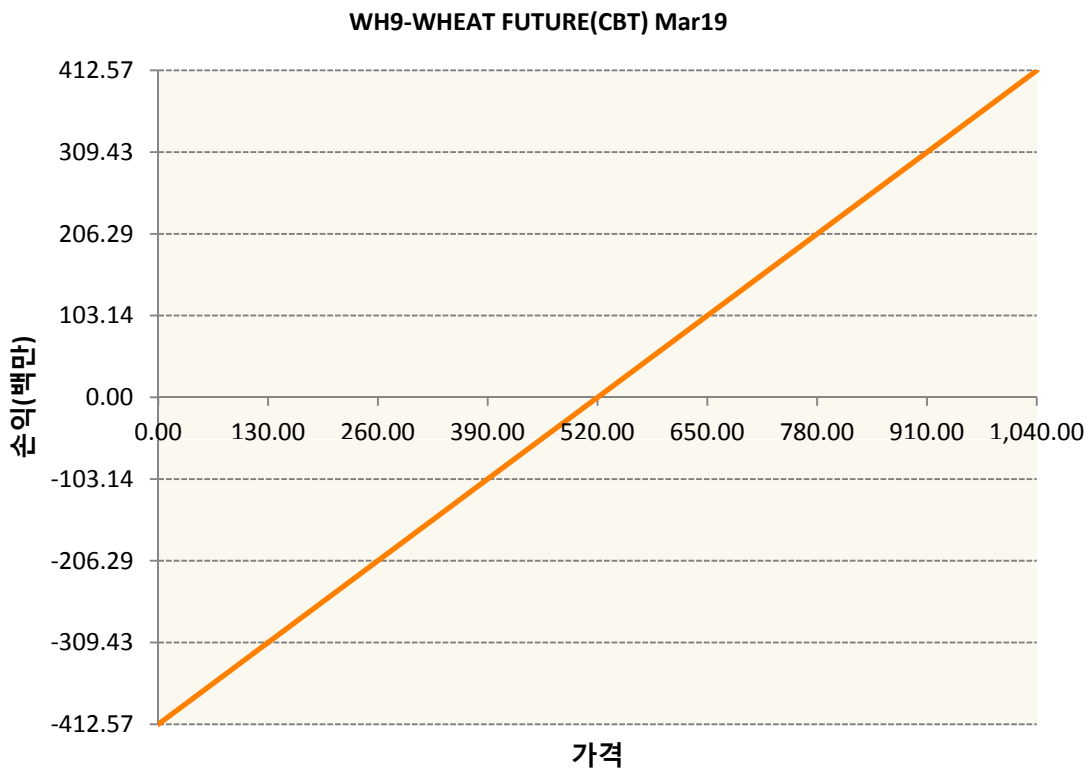
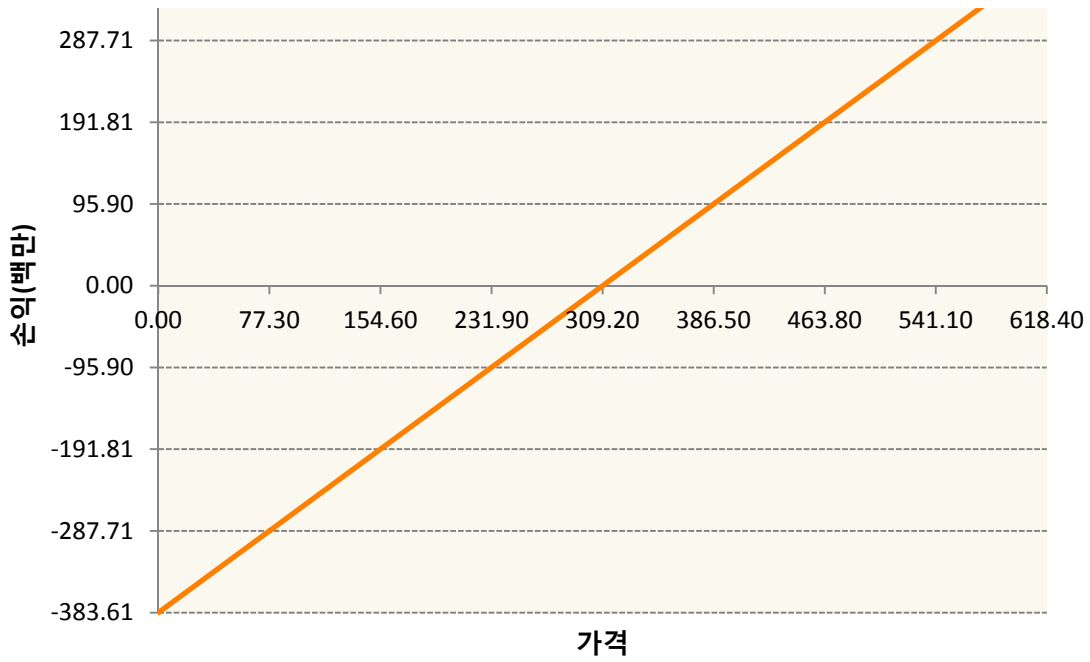


SH9-SOYBEAN FUTURE Mar19



SMH9-SOYBEAN MEAL FUTR Mar19





**3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)**

(단위:백만원)

BOH9	SOYBEAN OIL FUTR Mar19	28
CH9	CORN FUTURE Mar19	60
CTH9	COTTON NO.2 FUTR Mar19	13
KCH9	COFFEE 'C' FUTURE Mar19	21
KR4175P200	2019-02 달러선물	6

KWH9	KC HRW WHEAT FUT Mar19	13
SBH9	SUGAR #11 (WORLD) MAR19	30
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)

**290**