

공시일	2019-02-18
기준일	2019-02-15

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	2019-02-18
기준일	2019-02-15

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

1,090

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

626

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-02-18
기준일	2019-02-15

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	278
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	2019-02-18
기준일	2019-02-15

유로인덱스모(주식-파생형)

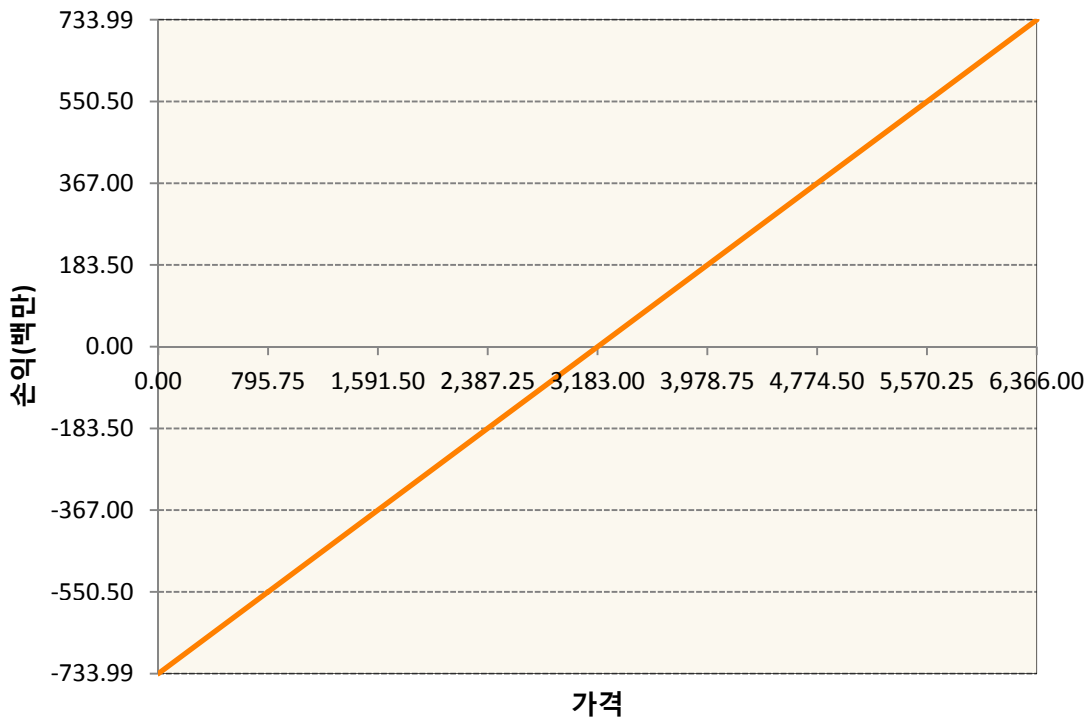
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	734	0	734	

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	2019-02-18
기준일	2019-02-15

차이나인덱스모(주식-파생형)

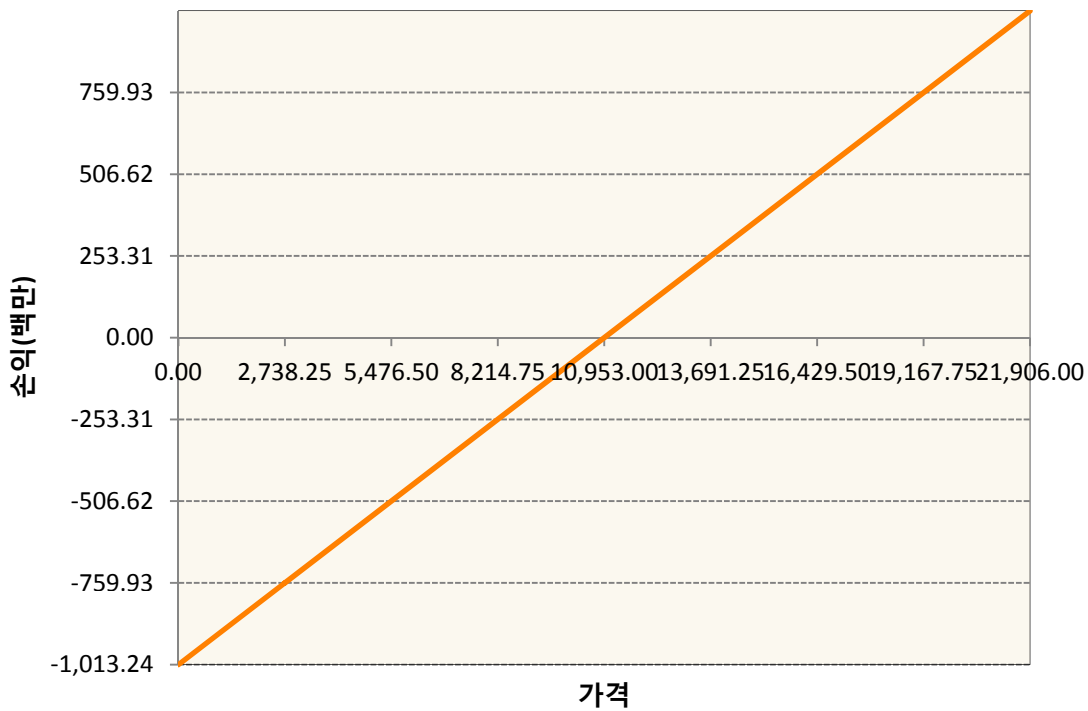
1. 계약금액

(단위:백만원)

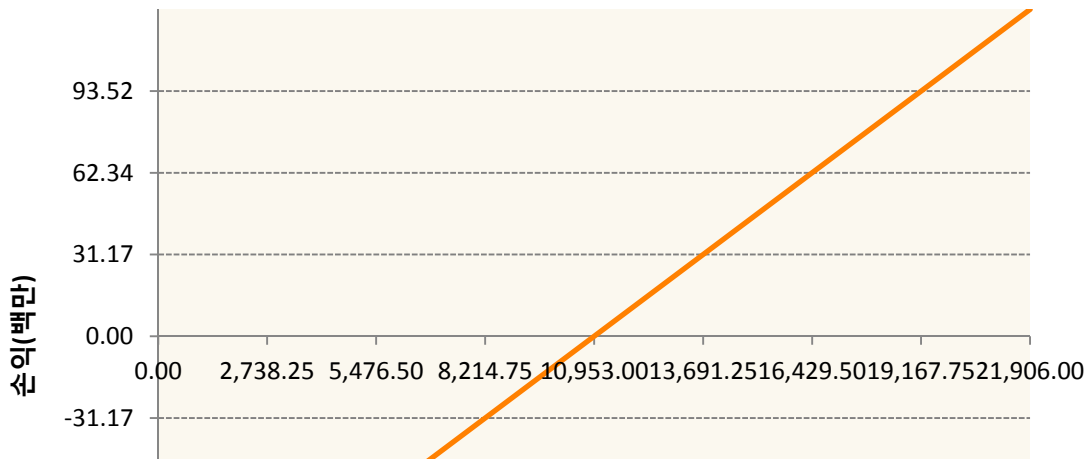
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,138	0	1,138	장내

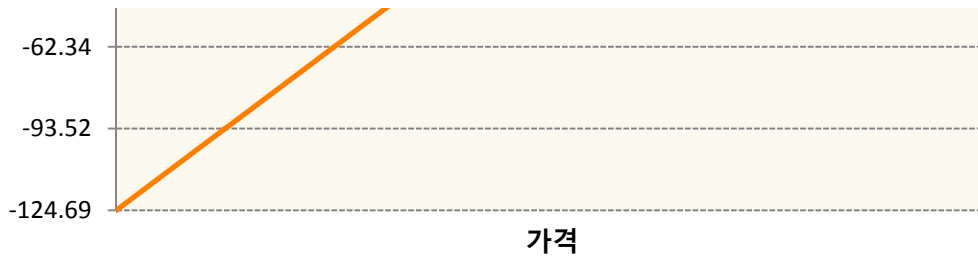
2. 만기시점의 손익구조

HCG9-HSCEI Futures Feb19



MHCG9-MINI H-SHR IDX FU Feb19





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

HCG9	HSCEI Futures Feb19	81
MHCG9	MINI H-SHR IDX FU Feb19	10

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

93

공시일	2019-02-18
기준일	2019-02-15

커버드콜모(주식혼합-파생형)

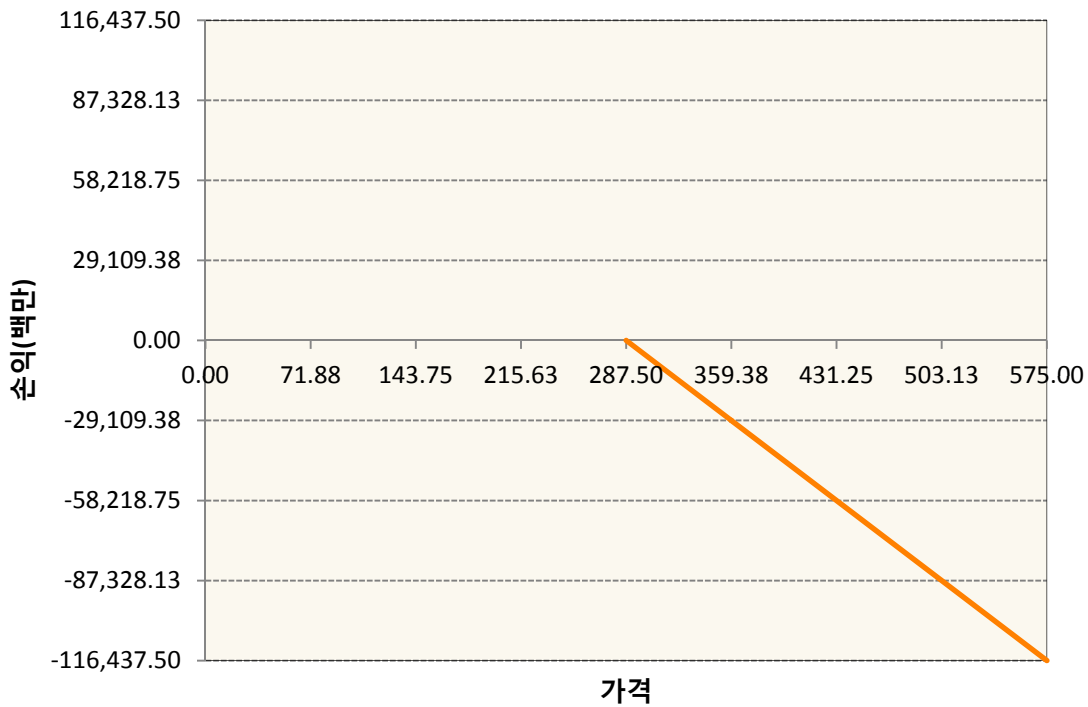
1. 계약금액

(단위:백만원)

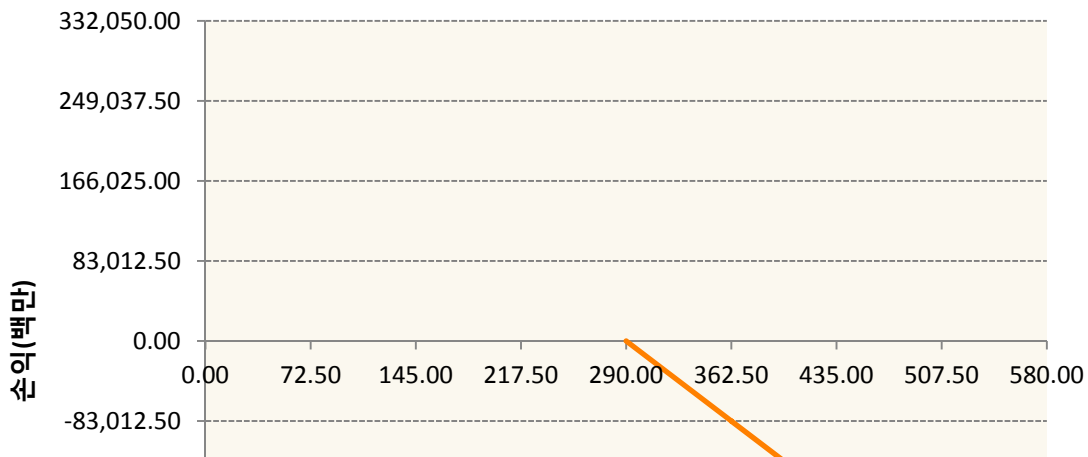
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	526,161	-526,161	장내
누계	유가증권	옵션	0	700,050	-700,050	장내

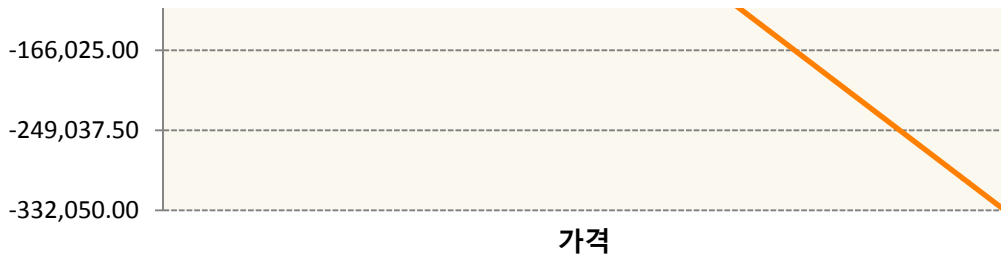
2. 만기시점의 손익구조

KR4201P32878-2019-03 콜287.5

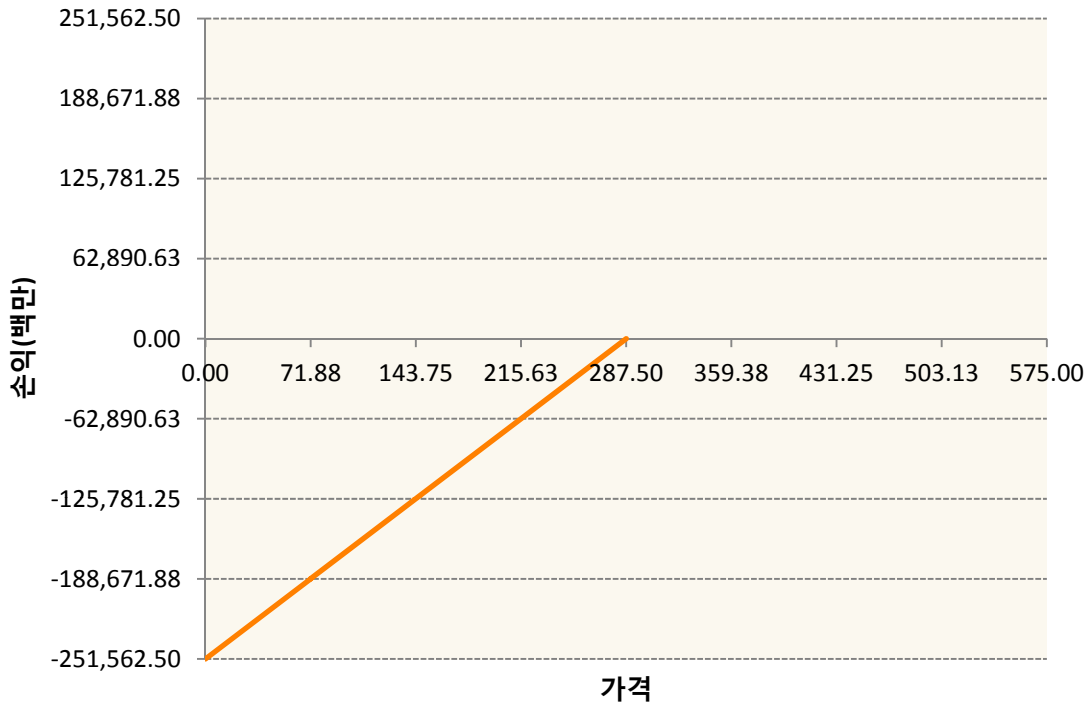


KR4201P32902-2019-03 콜290





KR4301P32876-2019-03 풋287.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201P32878		2019-03 콜287.5					6,598	
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	2,495	2,436	2,359	2,264	2,154	2,029	1,892	
-5.33%	2,290	2,163	2,018	1,858	1,686	1,502	1,310	
-2.67%	1,783	1,576	1,359	1,134	903	668	428	
0%	794	531	266	0	-266	-533	-801	
2.67%	-785	-1,051	-1,318	-1,587	-1,856	-2,125	-2,396	
5.33%	-2,932	-3,148	-3,374	-3,608	-3,848	-4,093	-4,342	
8.00%	-5,510	-5,654	-5,816	-5,994	-6,185	-6,387	-6,598	
KR4201P32902		2019-03 콜290					17,662	
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	6,011	5,884	5,709	5,488	5,221	4,913	4,567	

-5.33%	5,592	5,297	4,948	4,552	4,115	3,643	3,142
-2.67%	4,481	3,960	3,402	2,815	2,205	1,576	931
0%	2,169	1,455	731	0	-736	-1,477	-2,221
2.67%	-1,738	-2,513	-3,288	-4,064	-4,840	-5,616	-6,392
5.33%	-7,299	-7,975	-8,671	-9,380	-10,102	-10,832	-11,570
8.00%	-14,221	-14,704	-15,233	-15,799	-16,397	-17,019	-17,662
KR4301P32876 2019-03 풋287.5							17,544
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-17,458	-17,460	-17,464	-17,473	-17,488	-17,511	-17,544
-5.33%	-10,861	-10,884	-10,922	-10,975	-11,045	-11,130	-11,232
-2.67%	-4,479	-4,606	-4,756	-4,925	-5,110	-5,309	-5,520
0%	870	584	294	0	-297	-595	-896
2.67%	4,076	3,792	3,503	3,209	2,912	2,612	2,311
5.33%	5,243	5,111	4,955	4,779	4,586	4,379	4,160
8.00%	5,481	5,450	5,402	5,337	5,253	5,151	5,033

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

(단위:백만원)

41,889

공시일	2019-02-18
기준일	2019-02-15

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

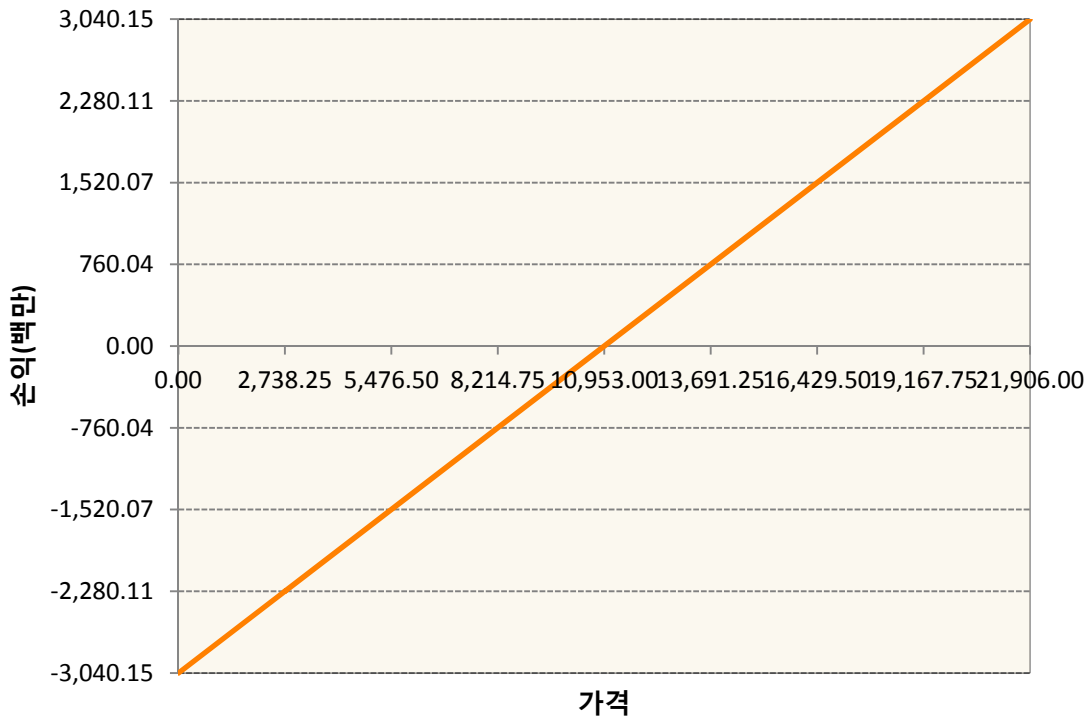
1. 계약금액

(단위:백만원)

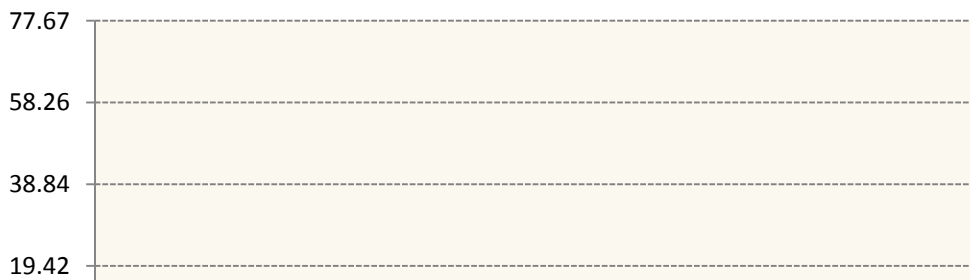
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	3,040	0	3,040	장내
누계	유가증권	옵션	0	7,367	-7,367	장내
누계	통화	선도	0	2,733	-2,733	장외

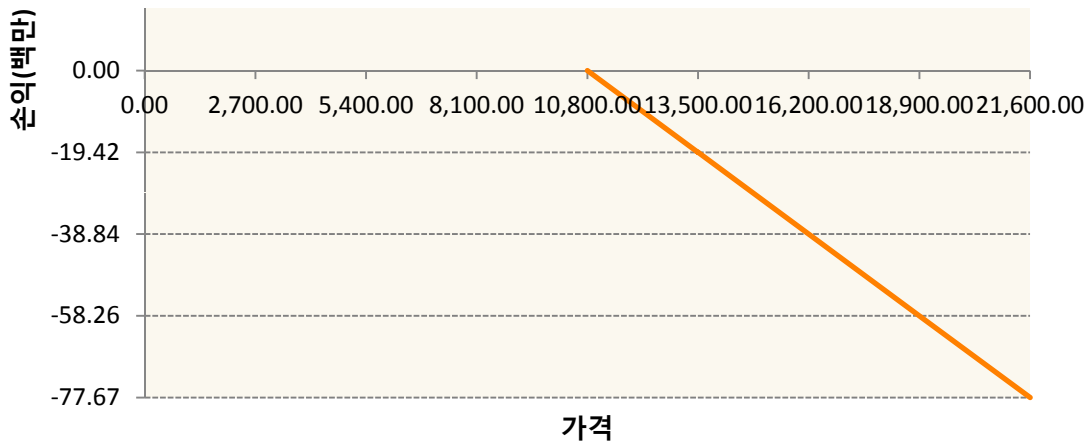
2. 만기시점의 손익구조

HCG9-HSCEI Futures Feb19

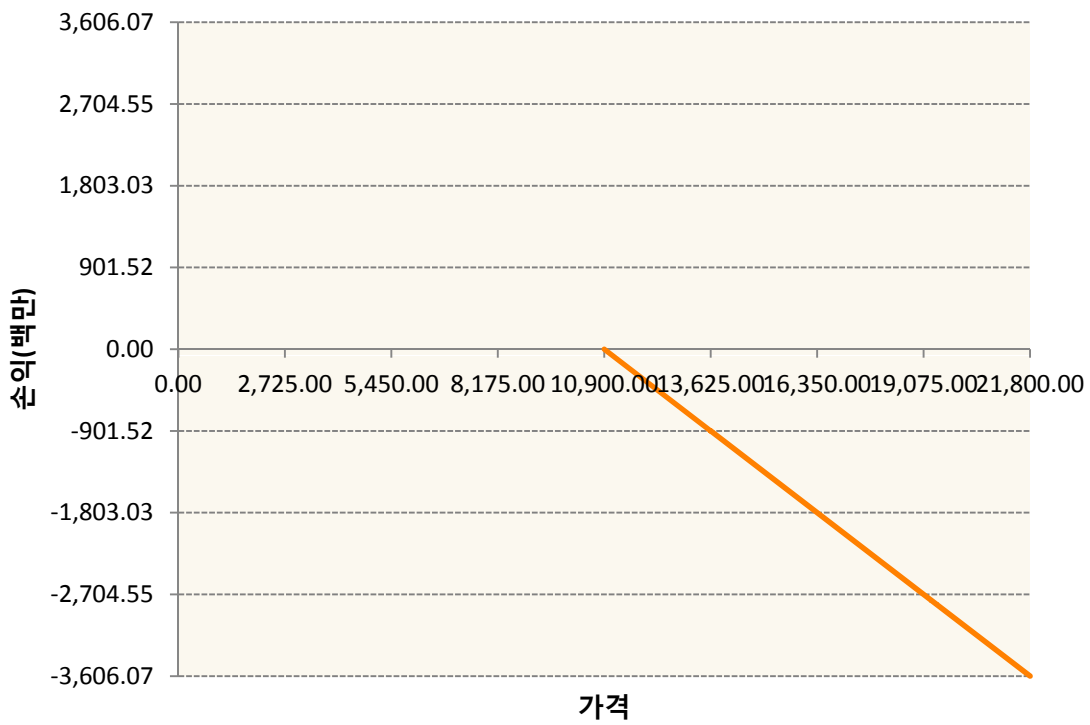


OHHIG9-C108-HSCEI

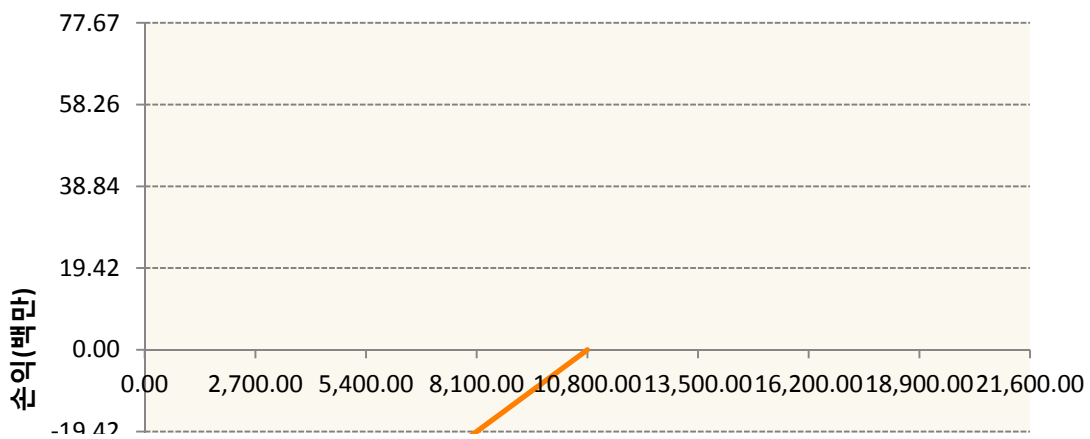


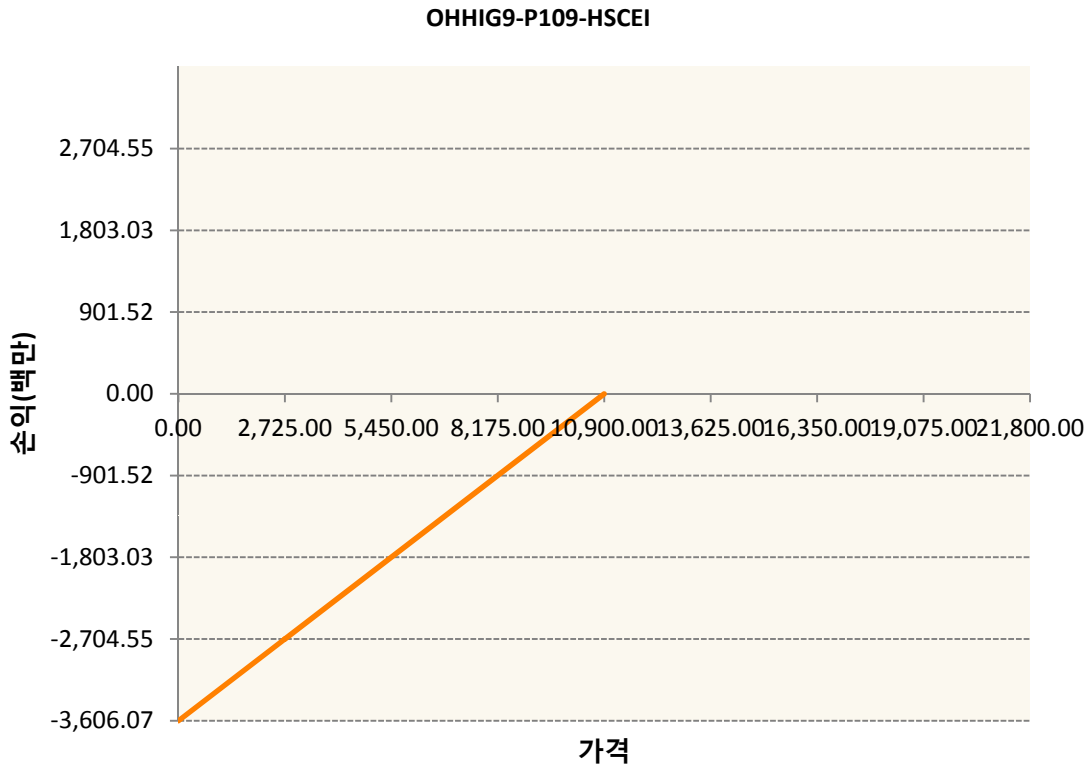
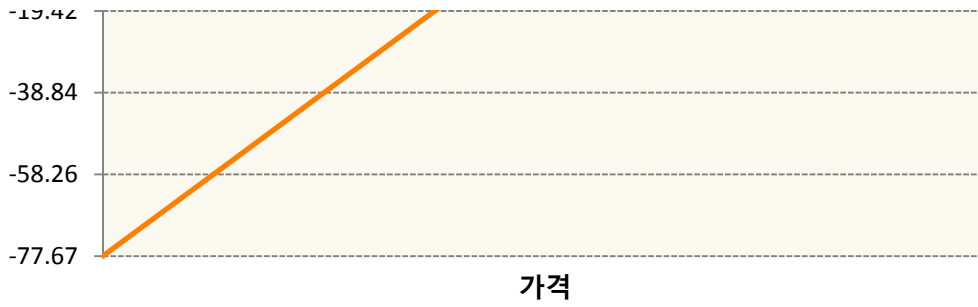


OHHIG9-C109-HSCEI



OHHIG9-P108-HSCEI





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

FX21018Z00 KRW/HKD 11-03-19E	219
HCG9 HSCEI Futures Feb19	243
OHHIG9-C1(HSCEI	6
OHHIG9-C1(HSCEI	288
OHHIG9-P1(HSCEI	6
OHHIG9-P1(HSCEI	288

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

929

공시일	2019-02-18
기준일	2019-02-15

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

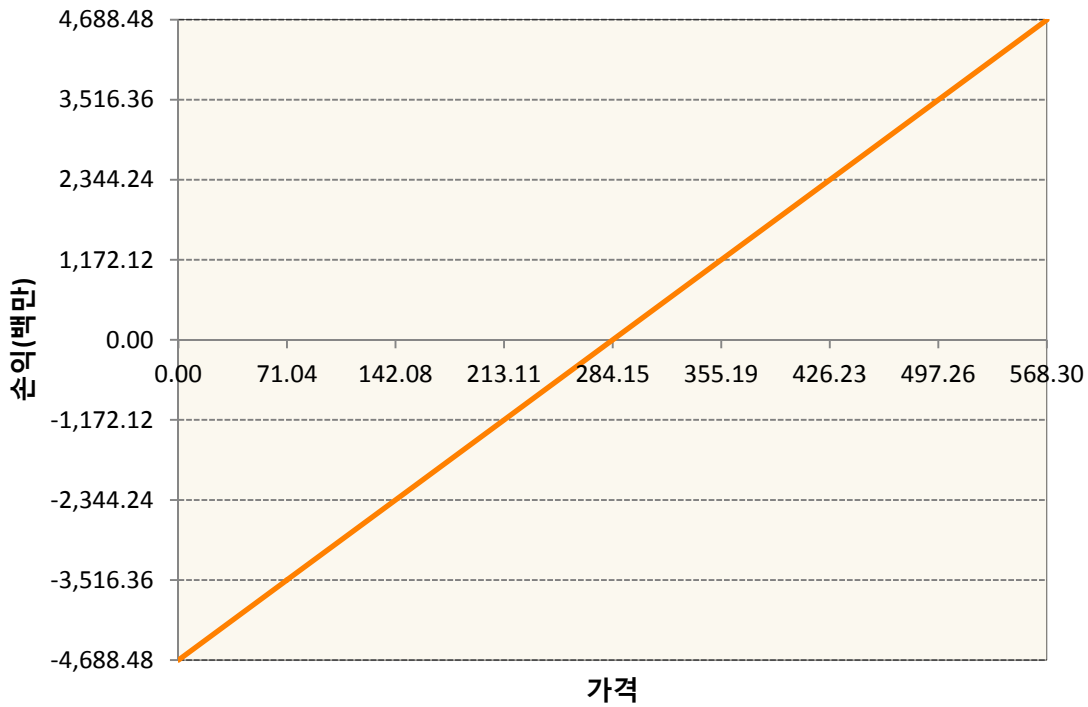
1. 계약금액

(단위:백만원)

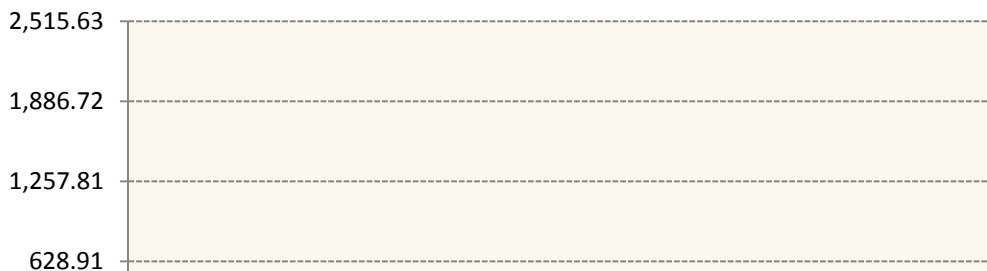
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	31,045	-31,045	장내
누계	유가증권	선물	4,688	0	4,688	장내
누계	유가증권	스왑	31,836	0	31,836	장외
누계	유가증권	옵션	0	30,672	-30,672	장내

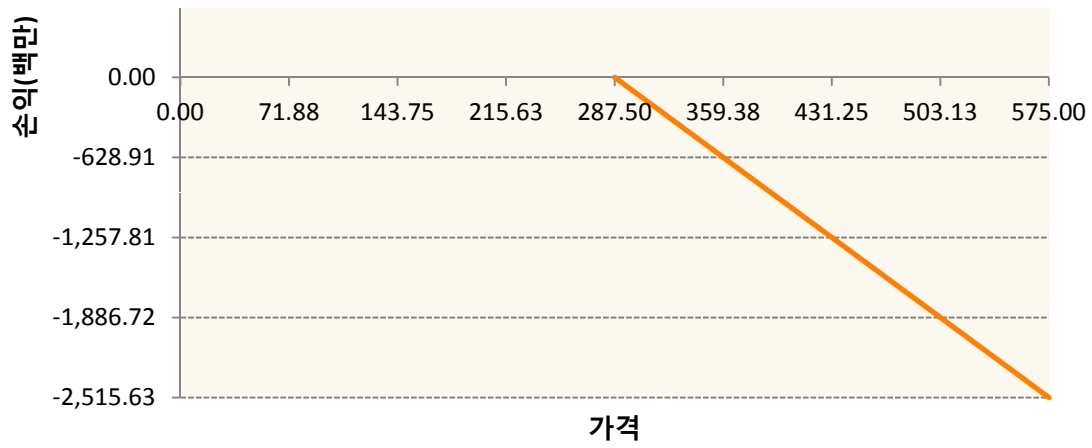
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P30007-2019-03 코스피200지수선물

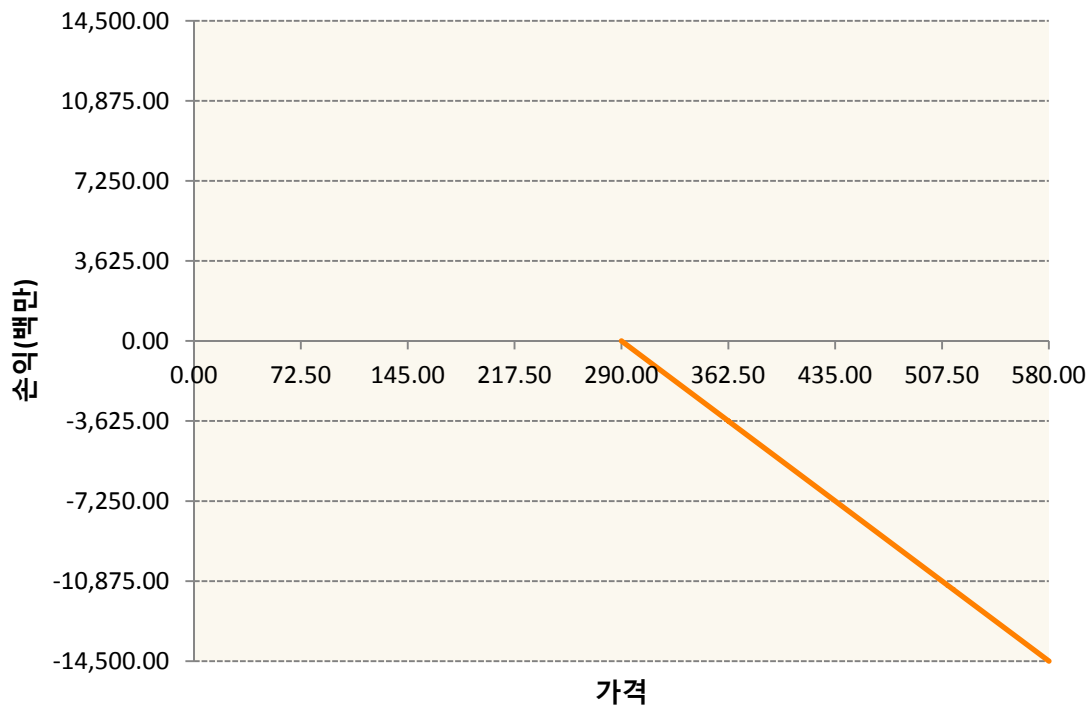


KR4201P32878-2019-03 콜287.5

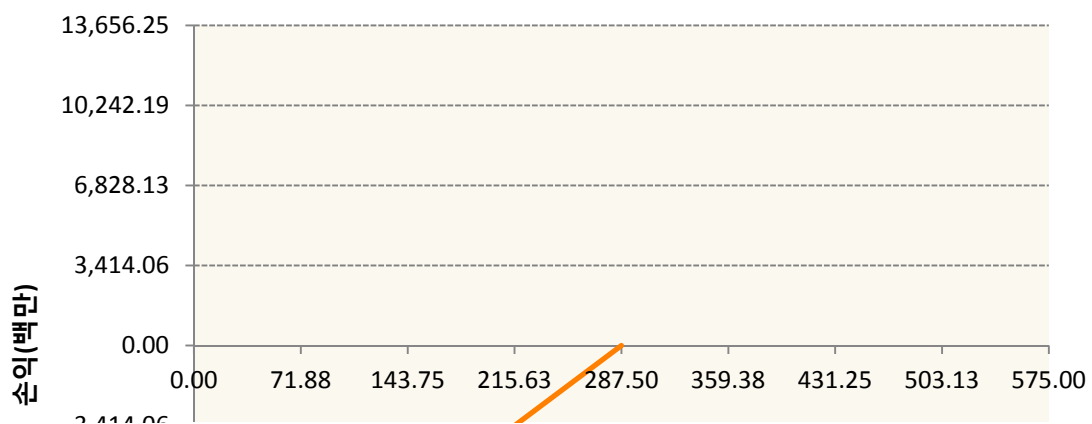


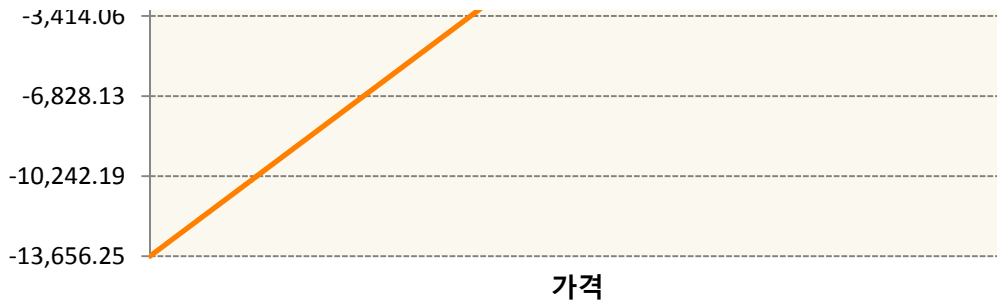


KR4201P32902-2019-03 콜290



KR4301P32876-2019-03 풋287.5





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11		UBCSFXC1 INDEX_14						2,671
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-2,671	-2,671	-2,671	-2,671	-2,671	-2,671	-2,671	
-5.33%	-1,780	-1,780	-1,780	-1,780	-1,780	-1,780	-1,780	
-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%	1,780	1,780	1,780	1,780	1,780	1,780	1,780	
8.00%	2,671	2,671	2,671	2,671	2,671	2,671	2,671	
KR4101P30007		2019-03 코스피200지수선물						375
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-375	-375	-375	-375	-375	-375	-375	
-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%	375	375	375	375	375	375	375	
KR4201P32878		2019-03 콜287.5						143
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	54	53	51	49	47	44	41	
-5.33%	49	47	44	40	36	32	28	
-2.67%	39	34	29	25	20	14	9	
0%	17	11	6	0	-6	-12	-17	
2.67%	-17	-23	-28	-34	-40	-46	-52	
5.33%	-63	-68	-73	-78	-83	-88	-94	
8.00%	-119	-122	-126	-130	-134	-138	-143	
KR4201P32902		2019-03 콜290						771
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	

-8.00%	262	257	249	240	228	215	199
-5.33%	244	231	216	199	180	159	137
-2.67%	196	173	149	123	96	69	41
0%	95	64	32	0	-32	-65	-97
2.67%	-76	-110	-144	-177	-211	-245	-279
5.33%	-319	-348	-379	-410	-441	-473	-505
8.00%	-621	-642	-665	-690	-716	-743	-771
KR4301P32876 2019-03 풋287.5							952
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-948	-948	-948	-949	-949	-951	-952
-5.33%	-590	-591	-593	-596	-600	-604	-610
-2.67%	-243	-250	-258	-267	-277	-288	-300
0%	47	32	16	0	-16	-32	-49
2.67%	221	206	190	174	158	142	125
5.33%	285	277	269	259	249	238	226
8.00%	298	296	293	290	285	280	273

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

(단위:백만원)

4,906

공시일	2019-02-18
기준일	2019-02-15

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

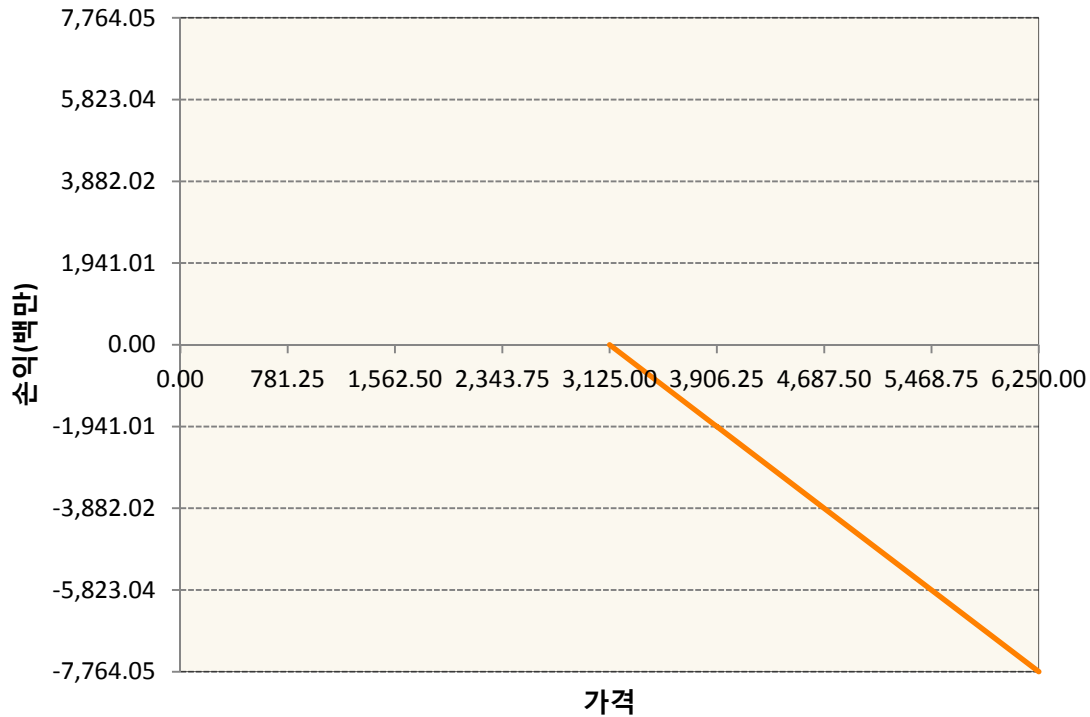
1. 계약금액

(단위:백만원)

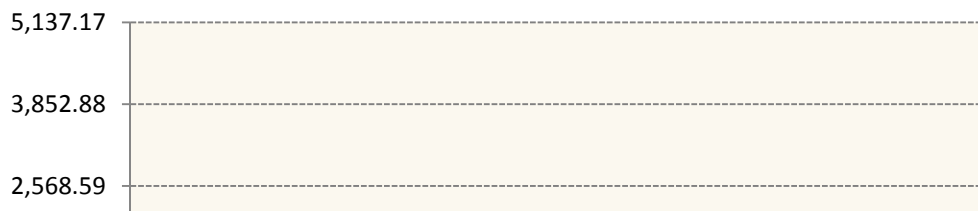
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	6,888	0	6,888	
누계	유가증권	스왑	60,153	0	60,153	장외
누계	유가증권	옵션	0	25,802	-25,802	장내
누계	통화	선도	0	15,290	-15,290	장외

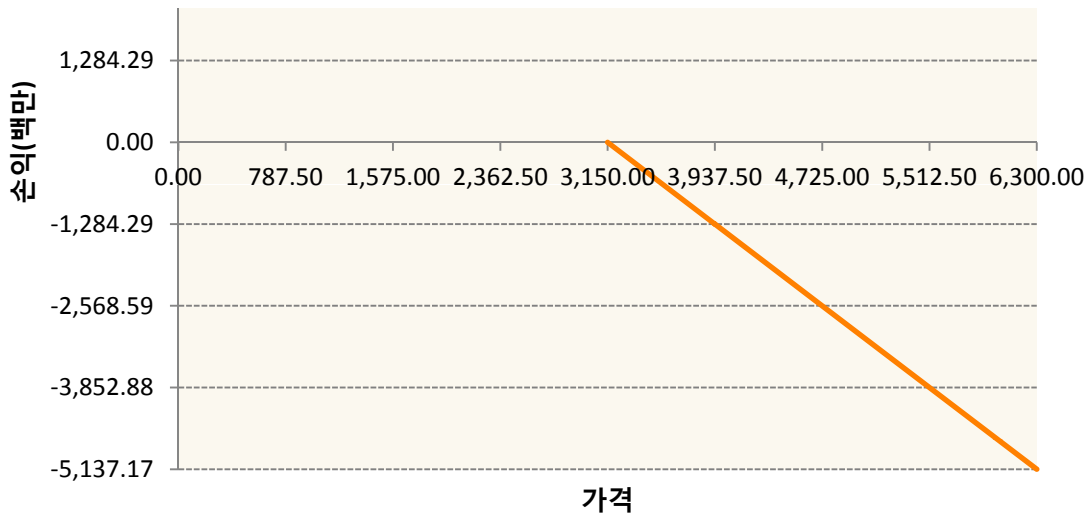
2. 만기시점의 손익구조

OESXG9-C3125-EURO STOXX 50

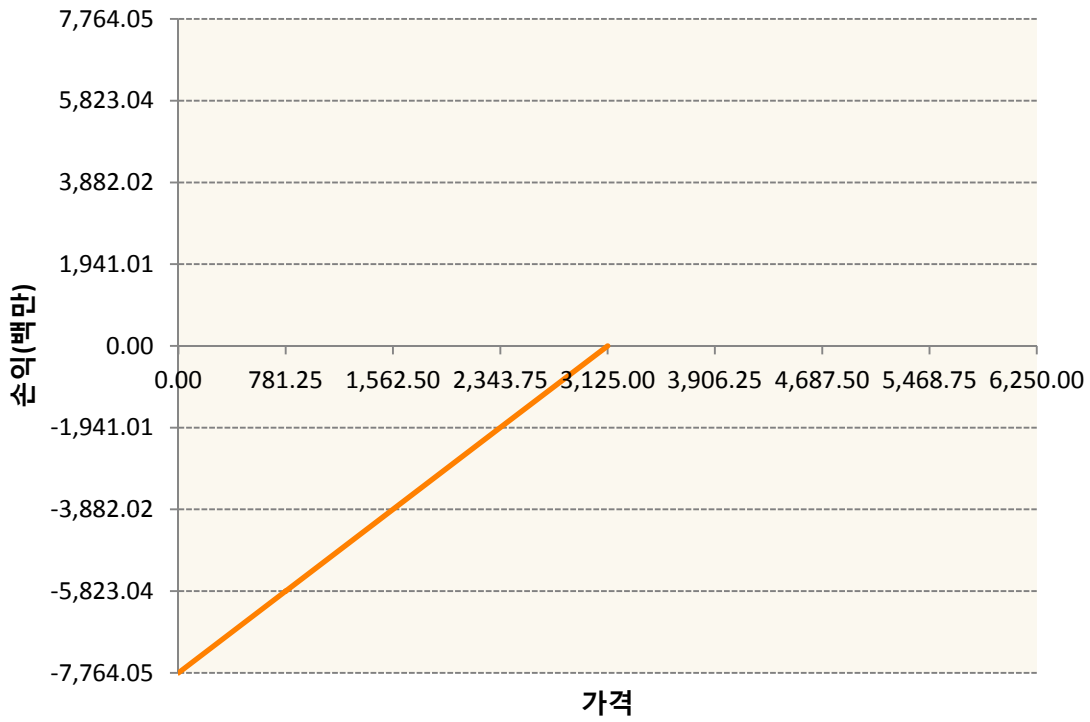


OESXG9-C3150-EURO STOXX 50

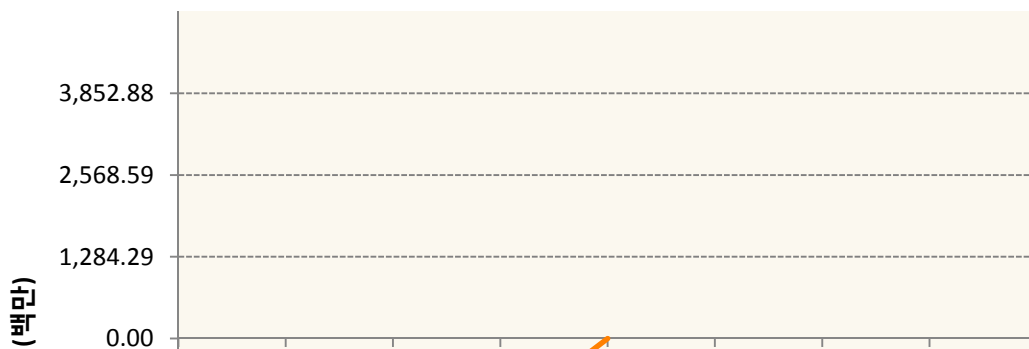


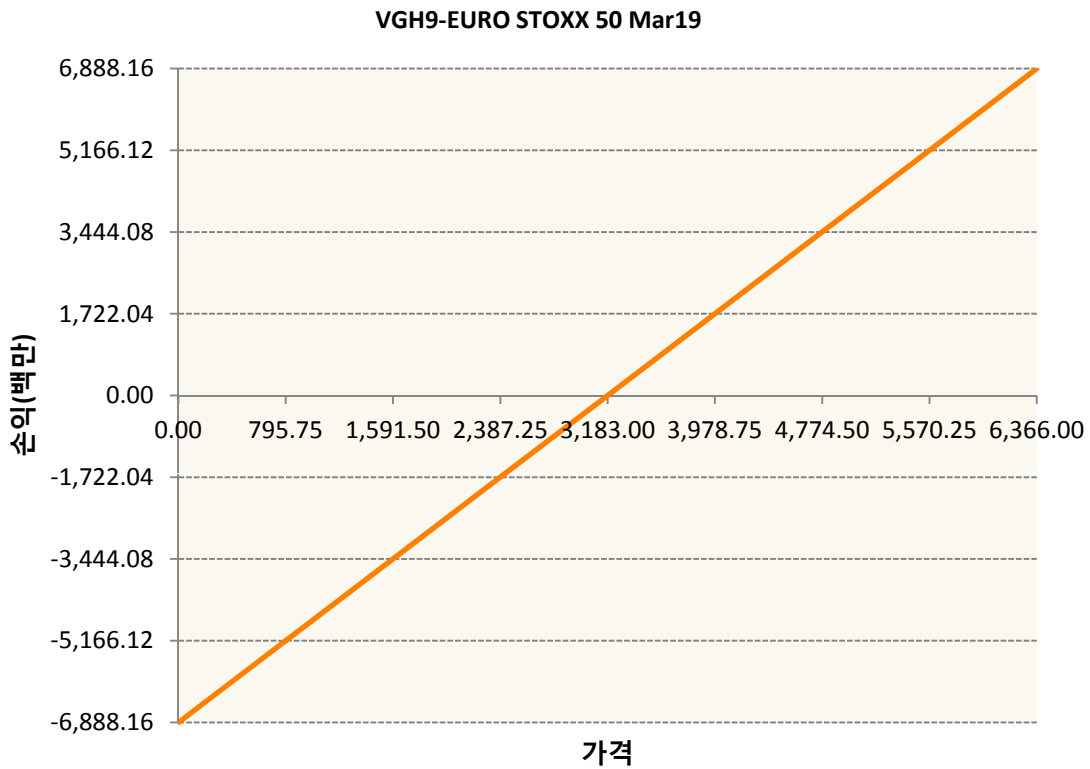
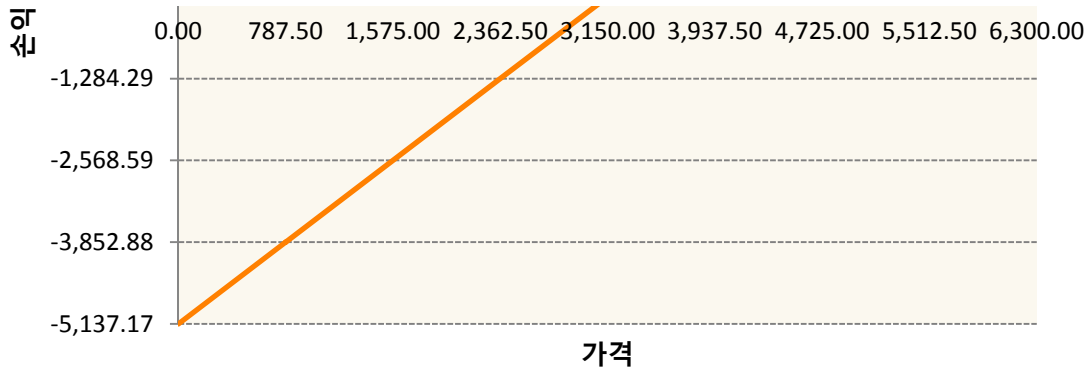


OESXG9-P3125-EURO STOXX 50



OESXG9-P3150-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY		70
FX21018X02 KRW/EUR 22-02-19E		408
FX21018Z03 KRW/EUR 22-03-19E		815
OESXG9-C31EURO STOXX 50		621
OESXG9-C31EURO STOXX 50		411
OESXG9-P31EURO STOXX 50		621
OESXG9-P31EURO STOXX 50		411
VGH9	EURO STOXX 50 Mar19	551

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

(단위:백만원)

2,571

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

(단위:백만원)

1,173

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	2019-02-18
기준일	2019-02-15

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

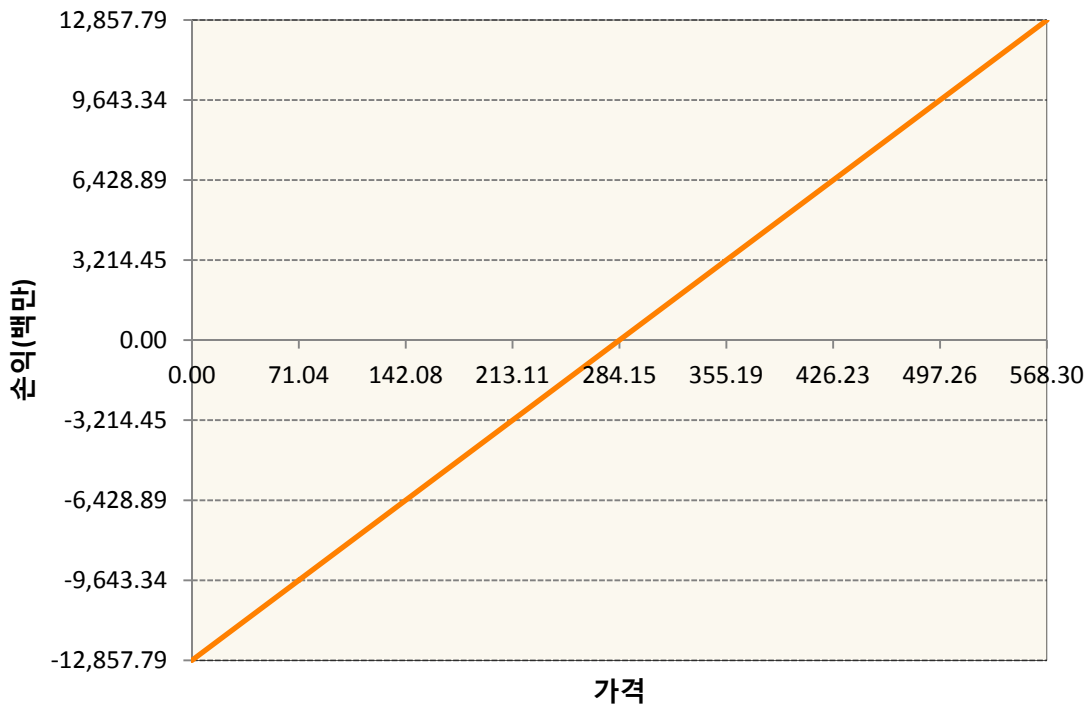
1. 계약금액

(단위:백만원)

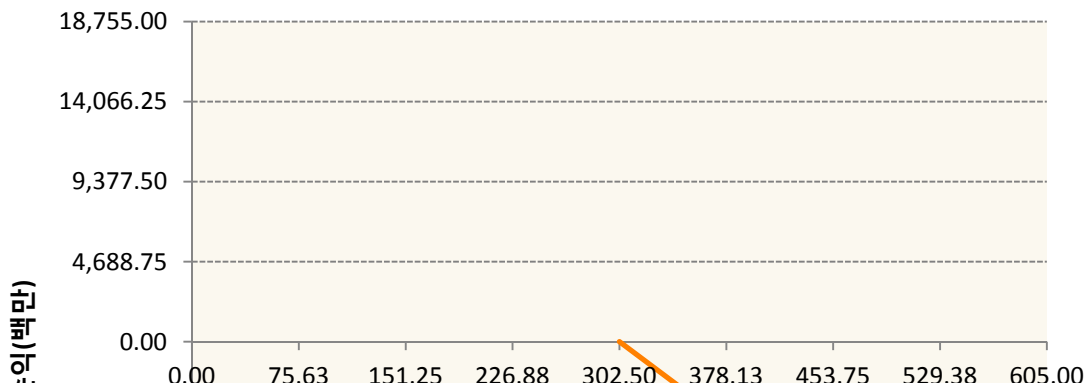
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	2,124	24,947	-22,824	장내
누계	유가증권	선물	12,858	0	12,858	장내
누계	유가증권	옵션	2,165	24,931	-22,766	장내

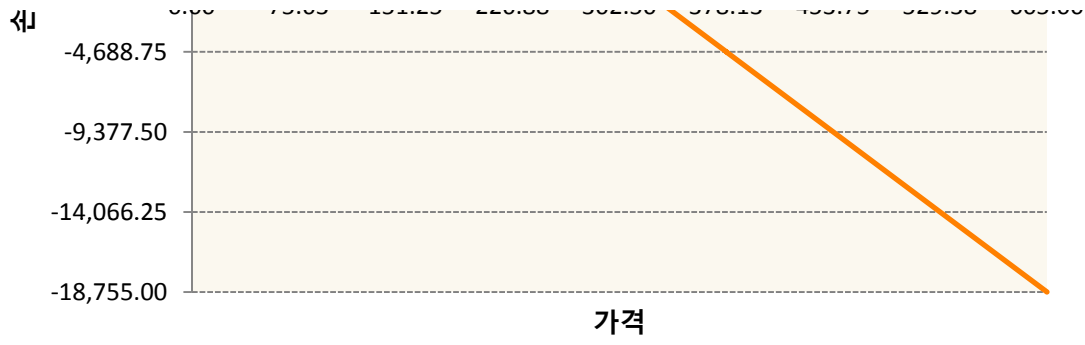
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P30007-2019-03 코스피200지수선물

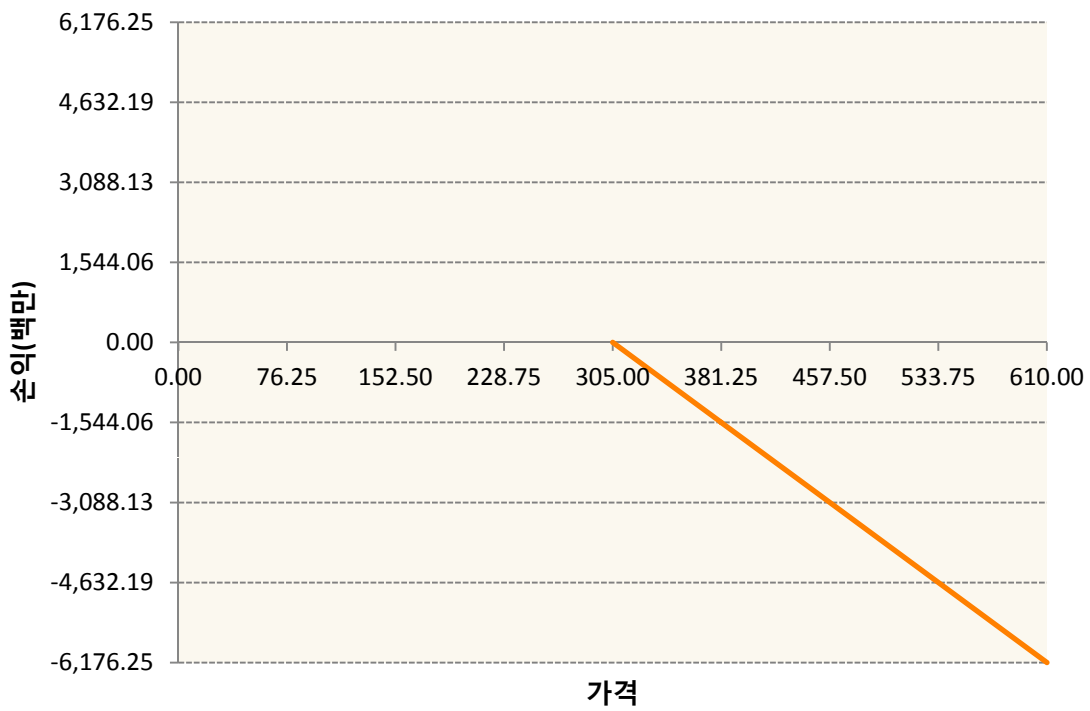


KR4201P33025-2019-03 콜302.5

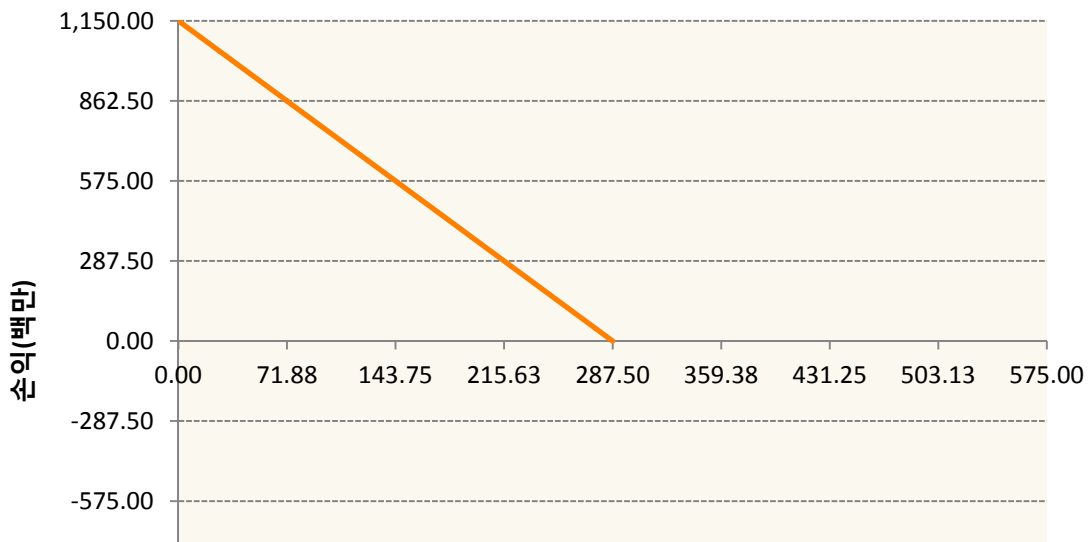


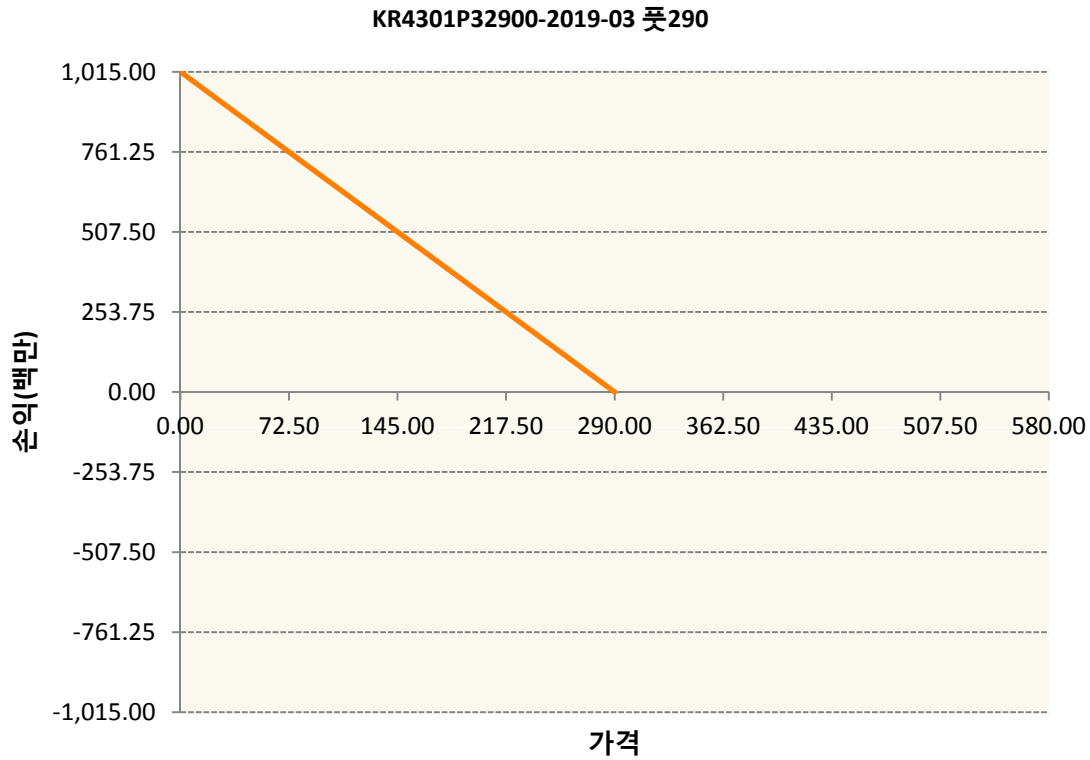
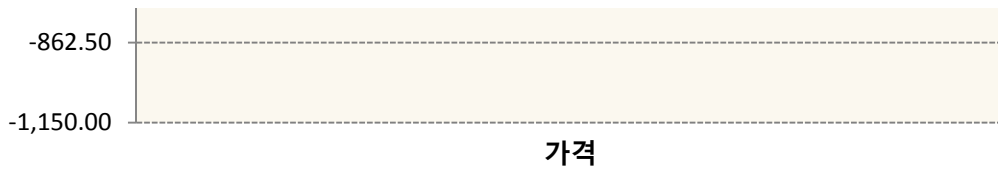


KR4201P33058-2019-03 콜305



KR4301P32876-2019-03 풋287.5





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101P30007		2019-03 코스피200지수선물						1,028
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-1,028	-1,028	-1,028	-1,028	-1,028	-1,028	-1,028	
-5.33%	-685	-685	-685	-685	-685	-685	-685	
-2.67%	-343	-343	-343	-343	-343	-343	-343	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	343	343	343	343	343	343	343	
5.33%	685	685	685	685	685	685	685	
8.00%	1,028	1,028	1,028	1,028	1,028	1,028	1,028	
KR4201P33025		2019-03 콜302.5						670
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	128	126	124	120	115	107	98	
-5.33%	124	120	113	104	93	80	64	
-2.67%	112	100	86	69	49	28	4	

0%	75	52	27	0	-29	-60	-92
2.67%	-10	-45	-80	-117	-155	-194	-233
5.33%	-167	-210	-253	-296	-339	-382	-425
8.00%	-410	-453	-496	-540	-583	-626	-670
KR4201P33058 2019-03 콜305							200
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	34	33	33	32	30	28	26
-5.33%	33	32	30	28	25	21	17
-2.67%	30	27	23	19	13	7	0
0%	21	15	8	0	-9	-18	-28
2.67%	-1	-11	-22	-33	-45	-57	-69
5.33%	-44	-57	-71	-84	-98	-112	-126
8.00%	-114	-128	-143	-157	-171	-186	-200
KR4301P32876 2019-03 풋287.5							80
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	80	80	80	80	80	80	80
-5.33%	50	50	50	50	50	51	51
-2.67%	20	21	22	23	23	24	25
0%	-4	-3	-1	0	1	3	4
2.67%	-19	-17	-16	-15	-13	-12	-11
5.33%	-24	-23	-23	-22	-21	-20	-19
8.00%	-25	-25	-25	-24	-24	-24	-23
KR4301P32900 2019-03 풋290							73
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	73	73	73	73	73	73	73
-5.33%	46	46	46	46	47	47	47
-2.67%	20	21	21	21	22	23	23
0%	-3	-2	-1	0	1	2	3
2.67%	-19	-18	-16	-15	-14	-13	-11
5.33%	-26	-25	-24	-23	-23	-22	-21
8.00%	-28	-27	-27	-27	-26	-26	-25

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

(단위:백만원)

1,661

공시일	2019-02-18
기준일	2019-02-15

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	825	0	825	

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	2019-02-18
기준일	2019-02-15

H2O글로벌본드(UH)(채권혼합-파)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	113	0	113	
누계	유가증권	수익증권	5,062	0	5,062	

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	2019-02-18
기준일	2019-02-15

H2O글로벌본드(H)(채권혼합-파생)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	677	0	677	
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	수익증권	18,291	0	18,291	
누계	통화	선도	0	21,259	-21,259	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		32
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		14
FX21019F00 KRW/USD 19-02-19E		29
FX21019F00 KRW/USD 19-02-19E		14
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		33
FX21019F02 KRW/USD 25-02-19E		136
FX21019F02 KRW/USD 28-03-19E		470
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	14
FX21019G00 KRW/USD 19-03-19E	50
FX21019G00 KRW/USD 19-03-19E	27
FX21019G01 KRW/USD 19-03-19E	54
FX21019G01 KRW/USD 19-03-19E	106
FX21019G01 KRW/USD 19-03-19E	106
FX21019G01 KRW/USD 19-03-19E	43

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

(단위:백만원)

642

공시일	2019-02-18
기준일	2019-02-15

스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

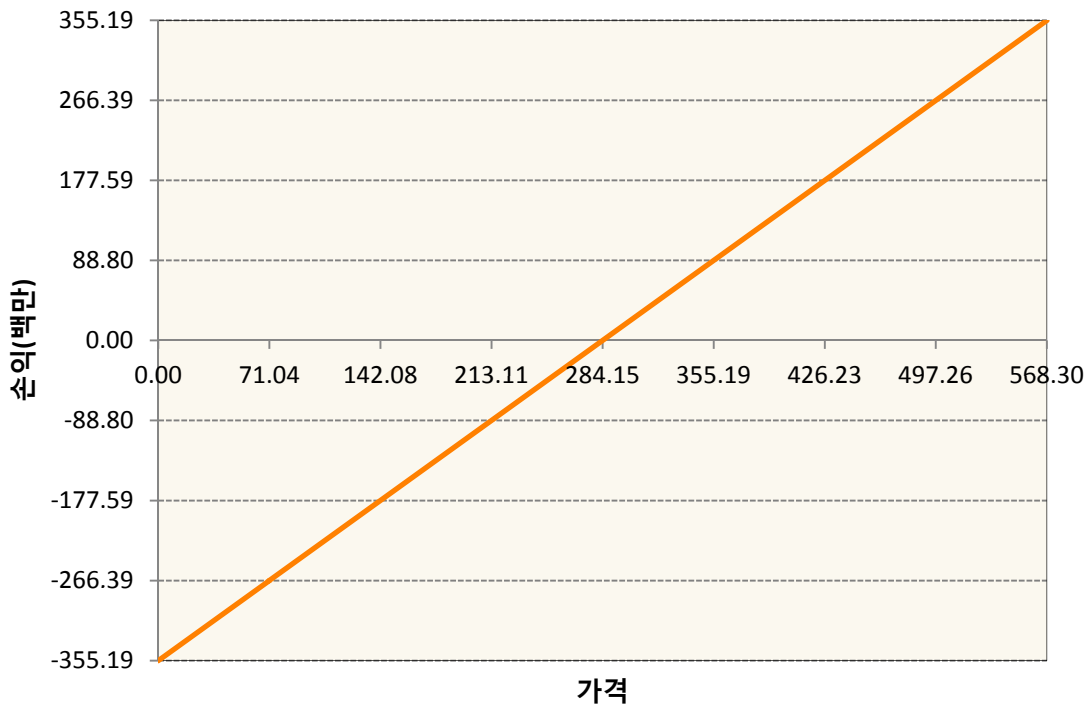
1. 계약금액

(단위:백만원)

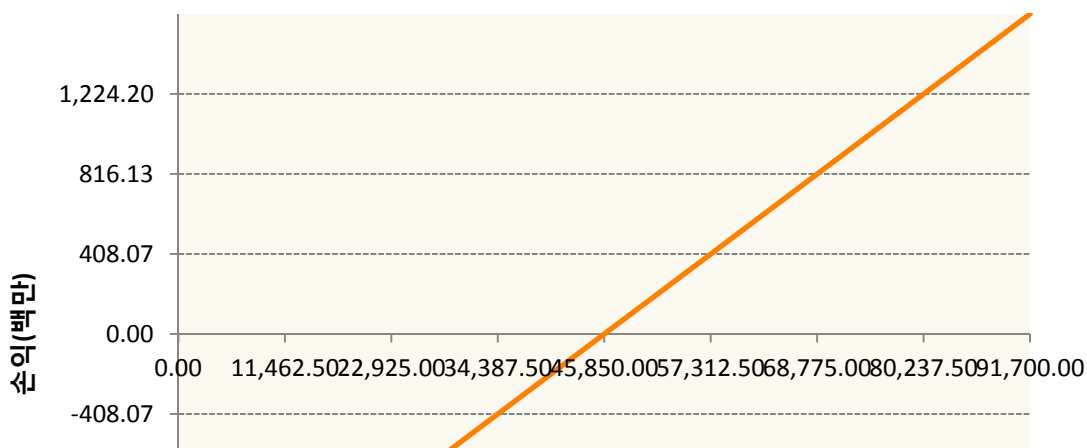
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,987	0	1,987	장내

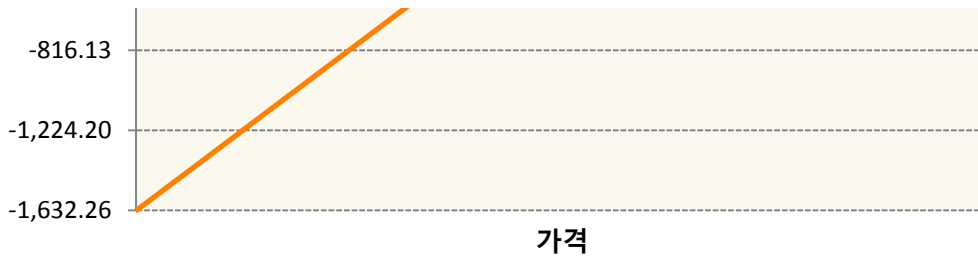
2. 만기시점의 손익구조

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						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)

182

공시일	2019-02-18
기준일	2019-02-15

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

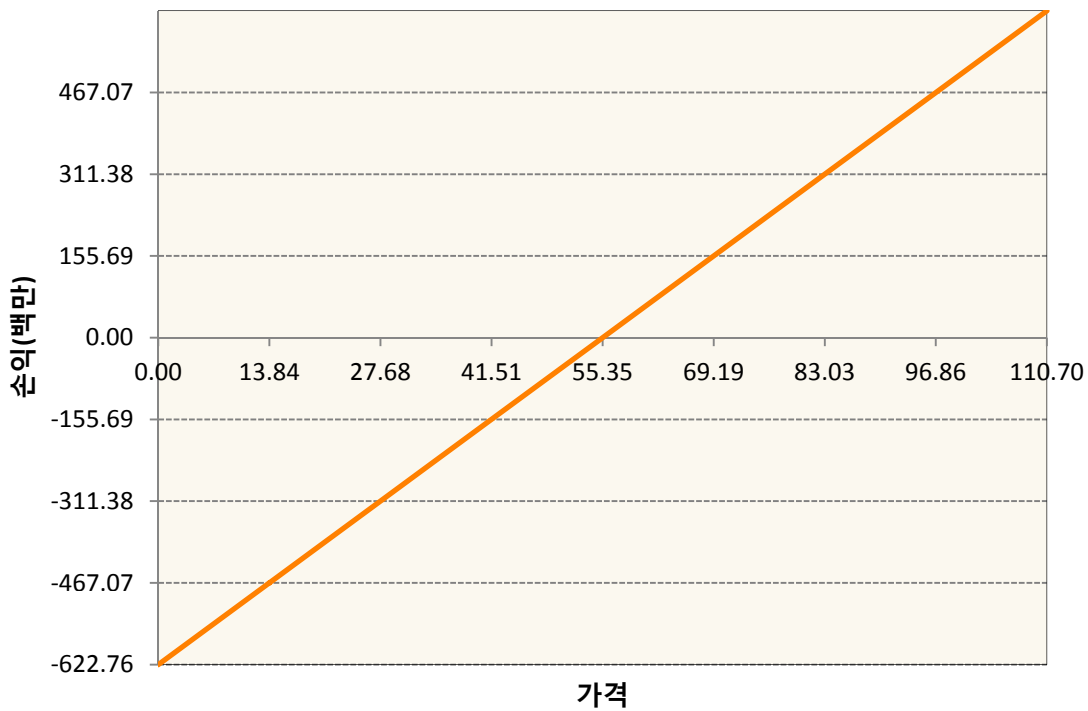
1. 계약금액

(단위:백만원)

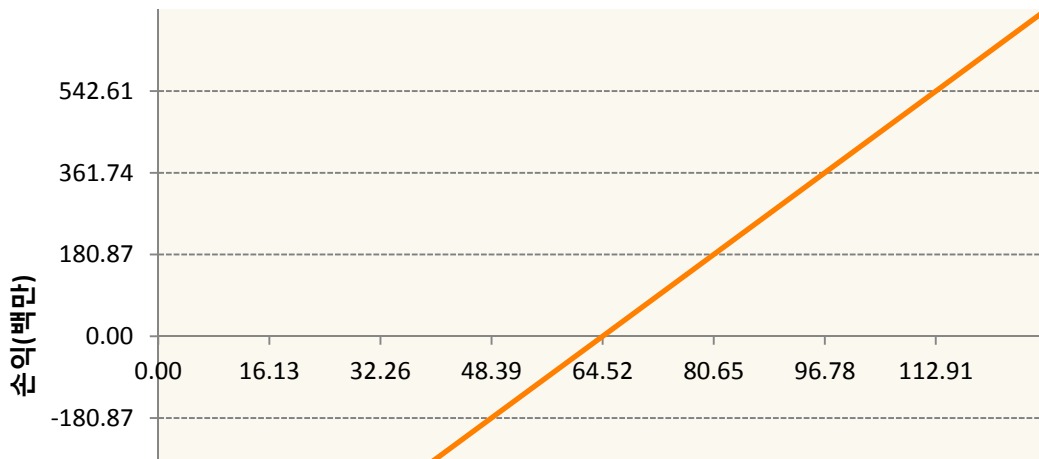
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,803	282	2,521	

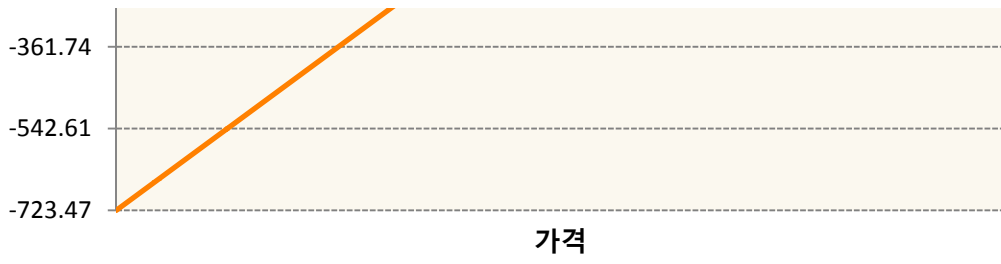
2. 만기시점의 손익구조

CLK9-WTI CRUDE FUTURE May19

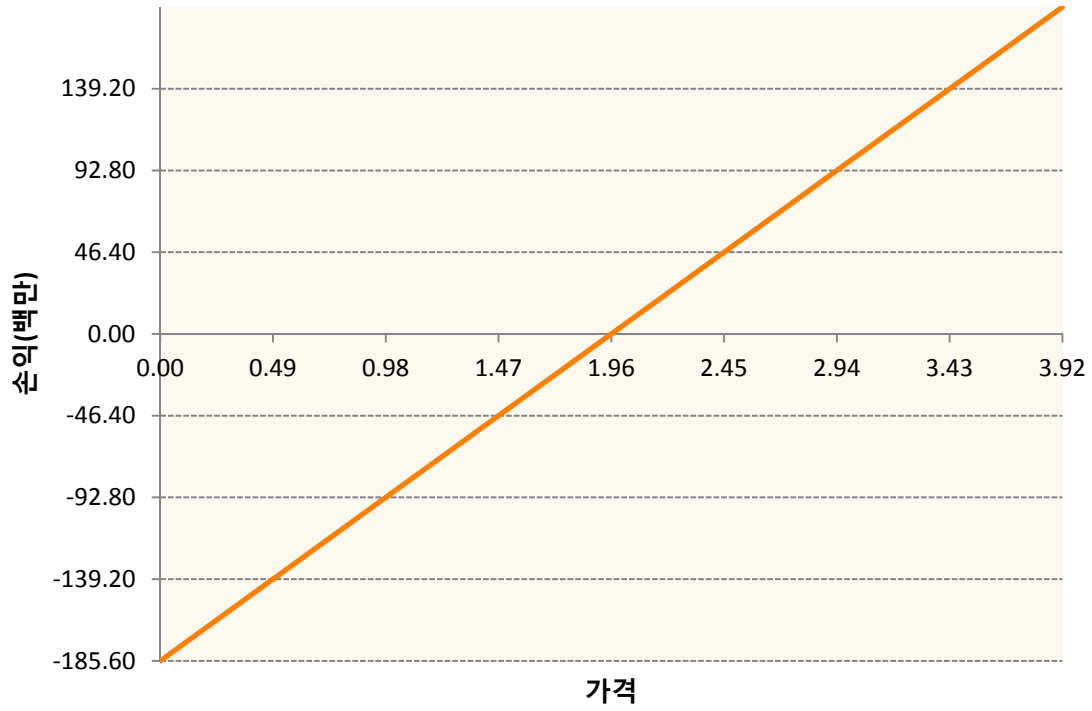


COK9-BRENT CRUDE FUTR May19

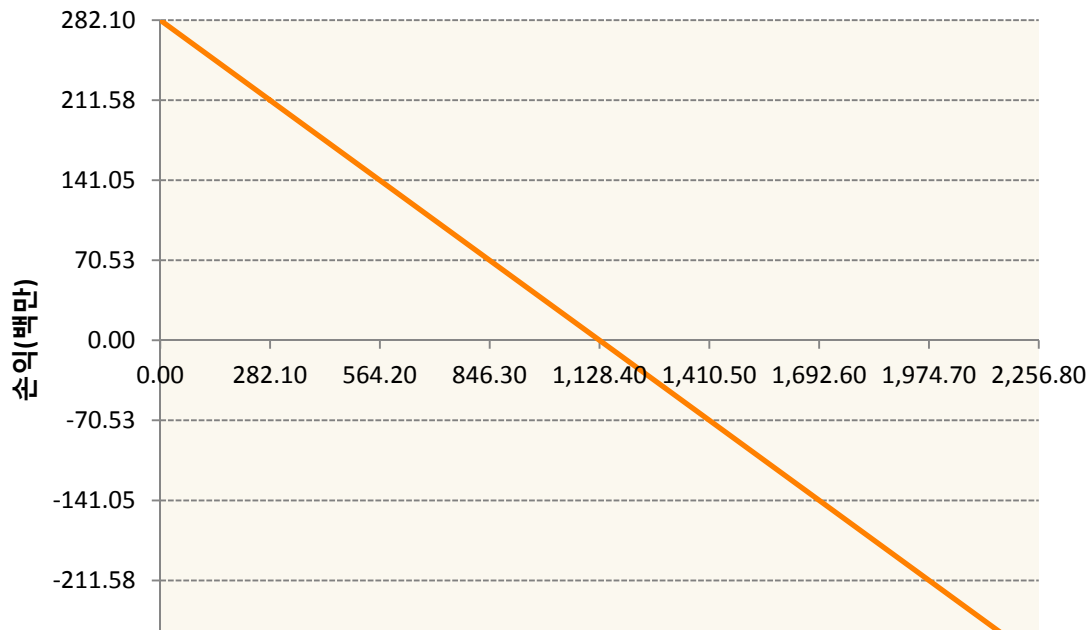


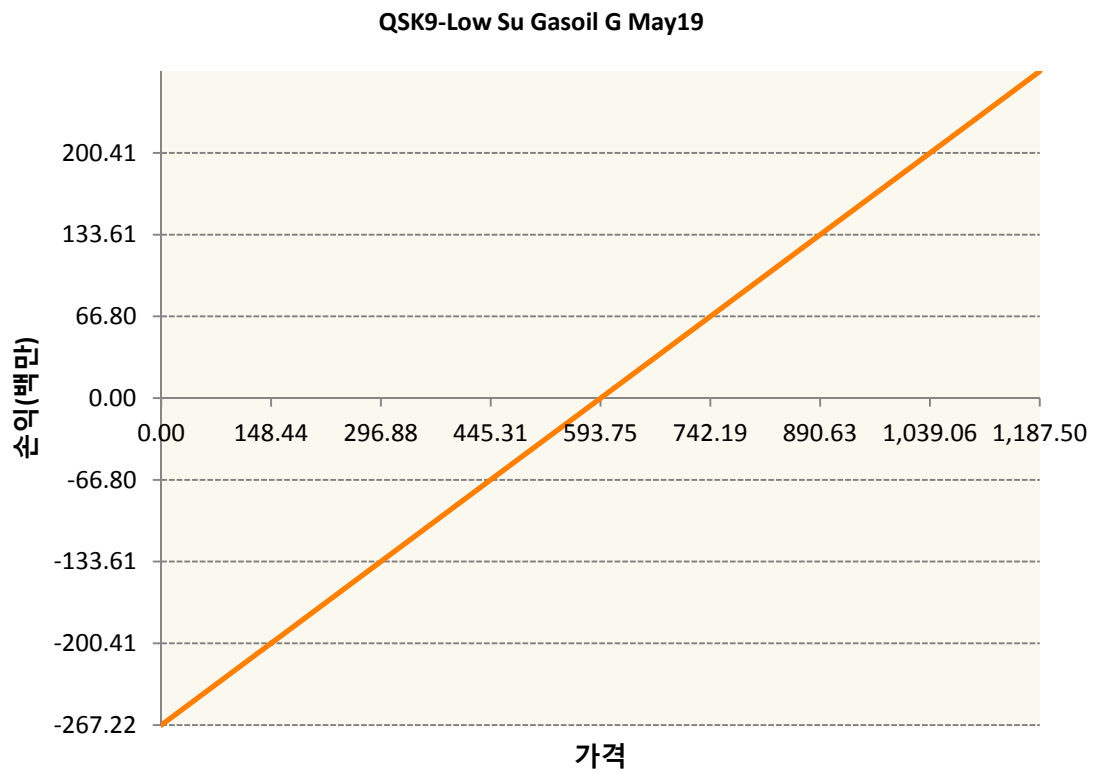
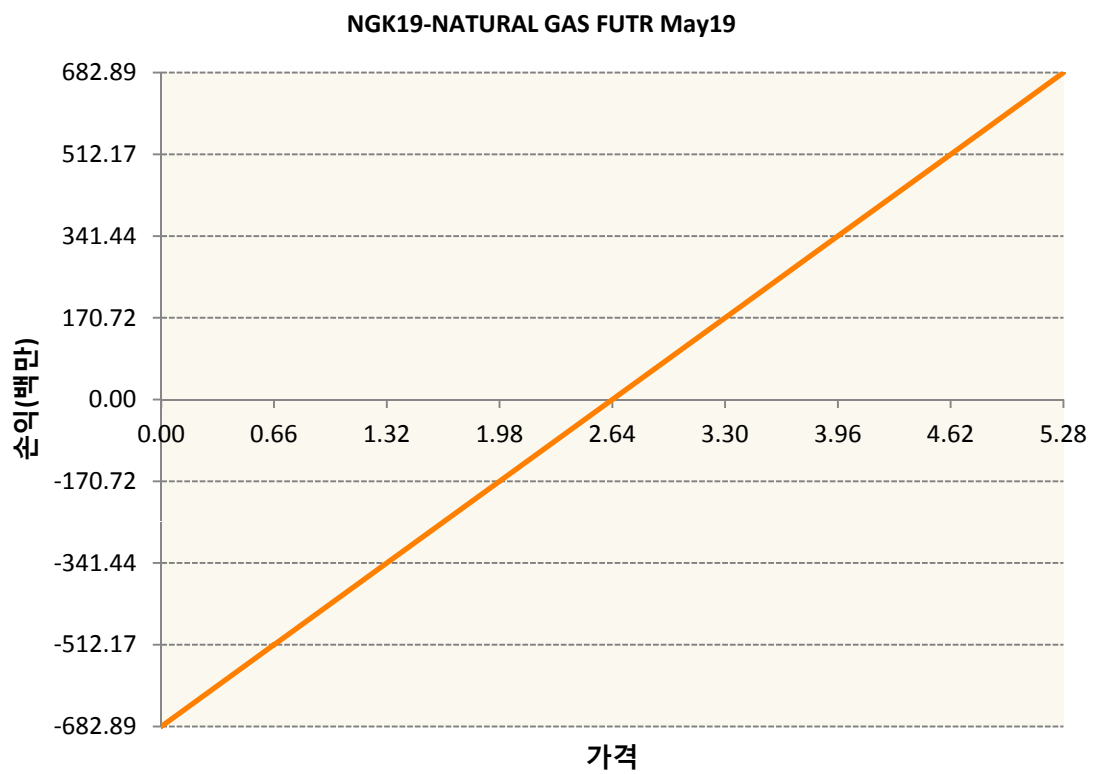
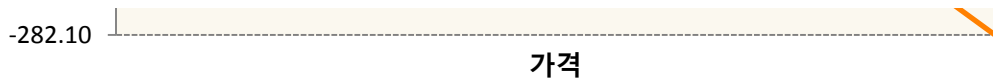


HOK9-NY Harb ULSD Fut May19

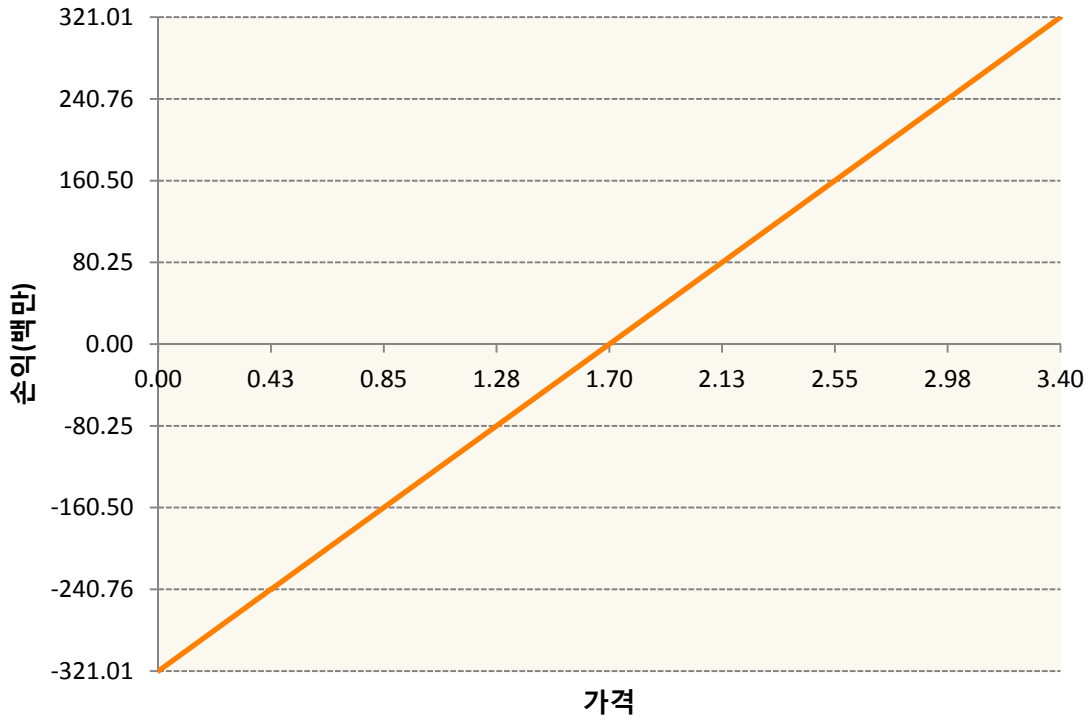


KR4175P30001-2019-03 달러선물





XBK9-GASOLINE RBOB FUT May19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

CLK9	WTI CRUDE FUTURE May19	50
COK9	BRENT CRUDE FUTR May19	58
HOK9	NY Harb ULSD Fut May19	15
KR4175P300	2019-03 달러선물	23
NGK19	NATURAL GAS FUTR May19	55
QSK9	Low Su Gasoil G May19	21
XBK9	GASOLINE RBOB FUT May19	26

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

(단위:백만원)

426

공시일	2019-02-18
기준일	2019-02-15

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

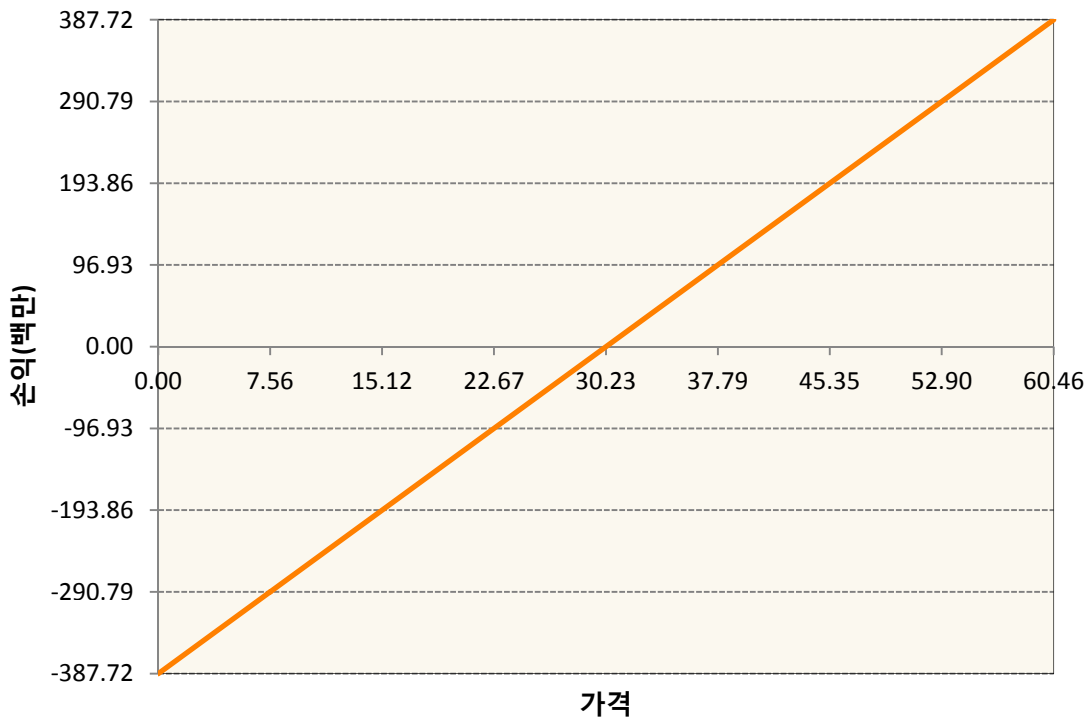
1. 계약금액

(단위:백만원)

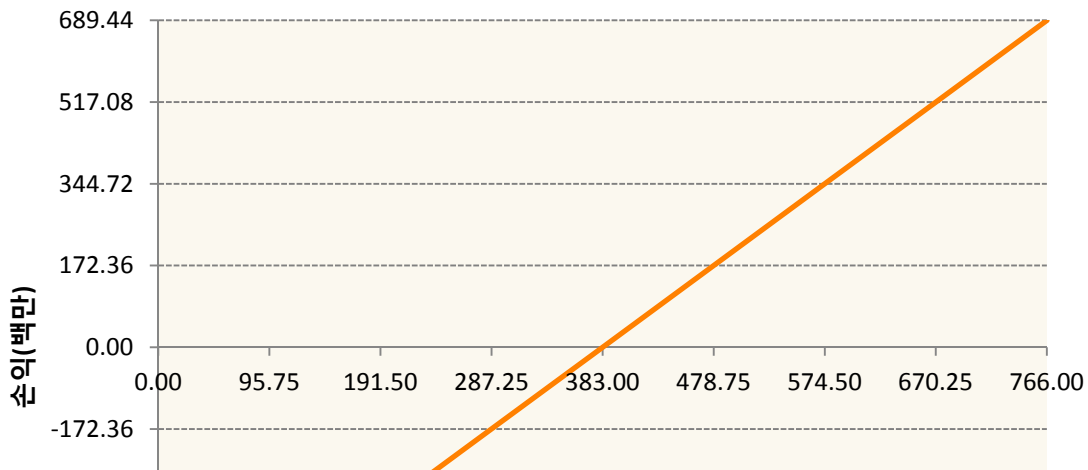
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,542	79	3,463	

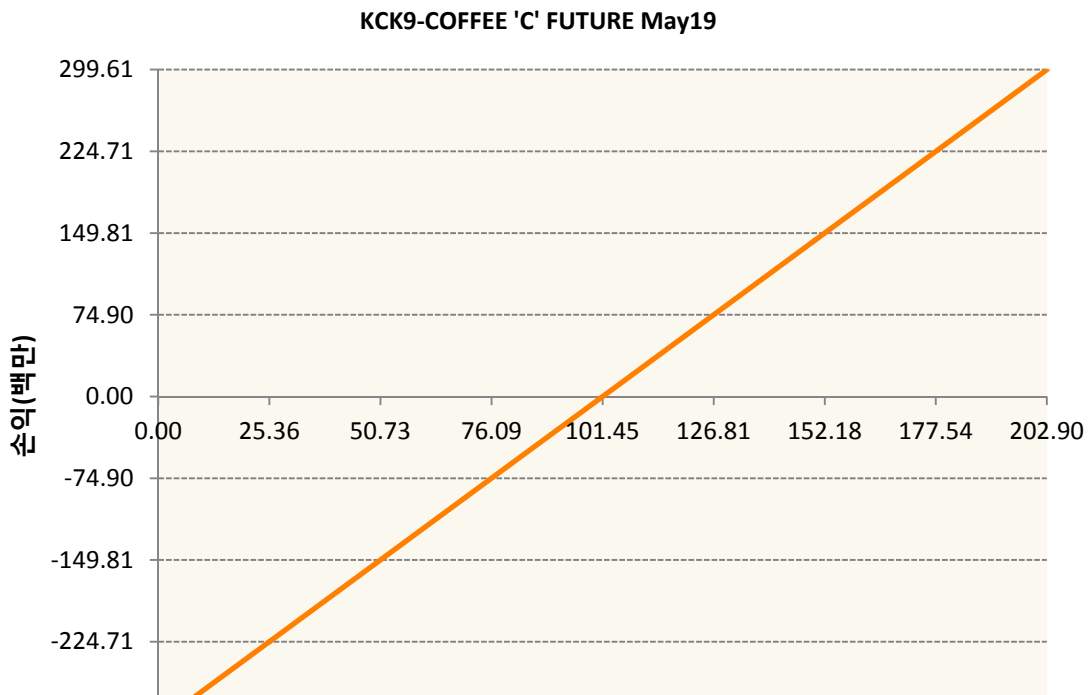
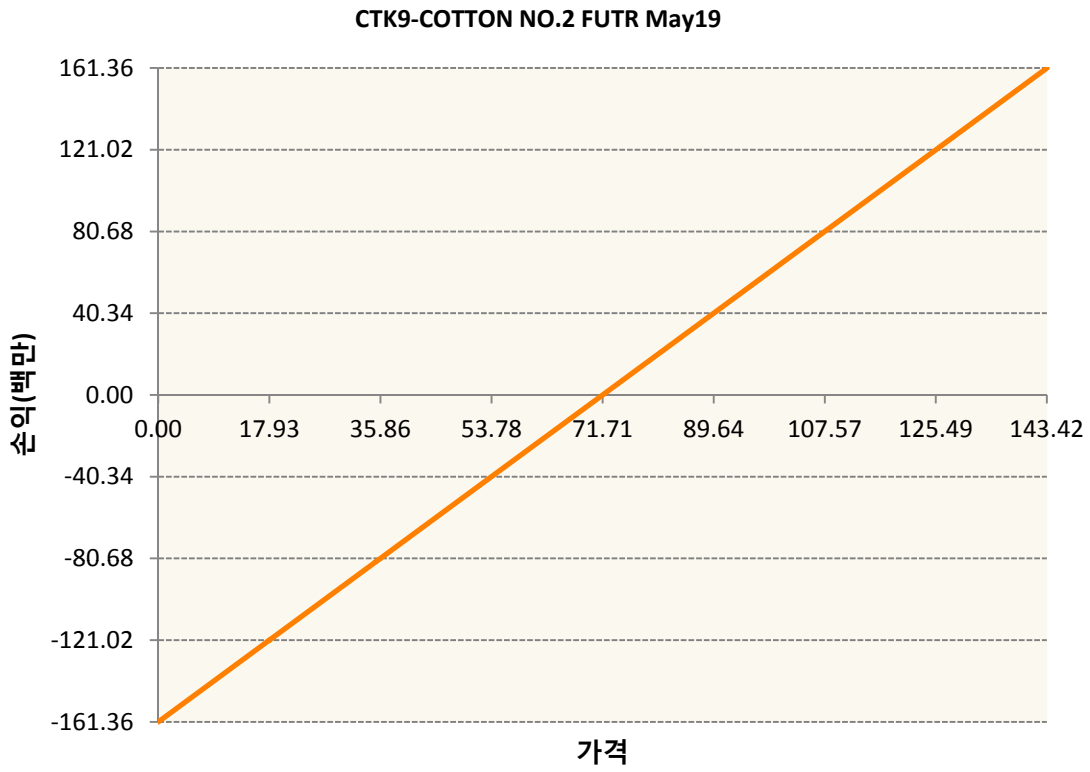
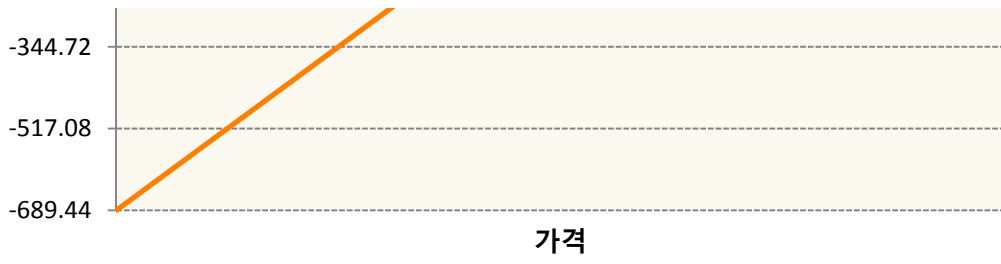
2. 만기시점의 손익구조

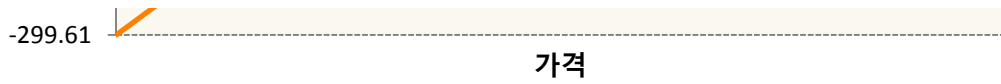
BOK9-SOYBEAN OIL FUTR May19



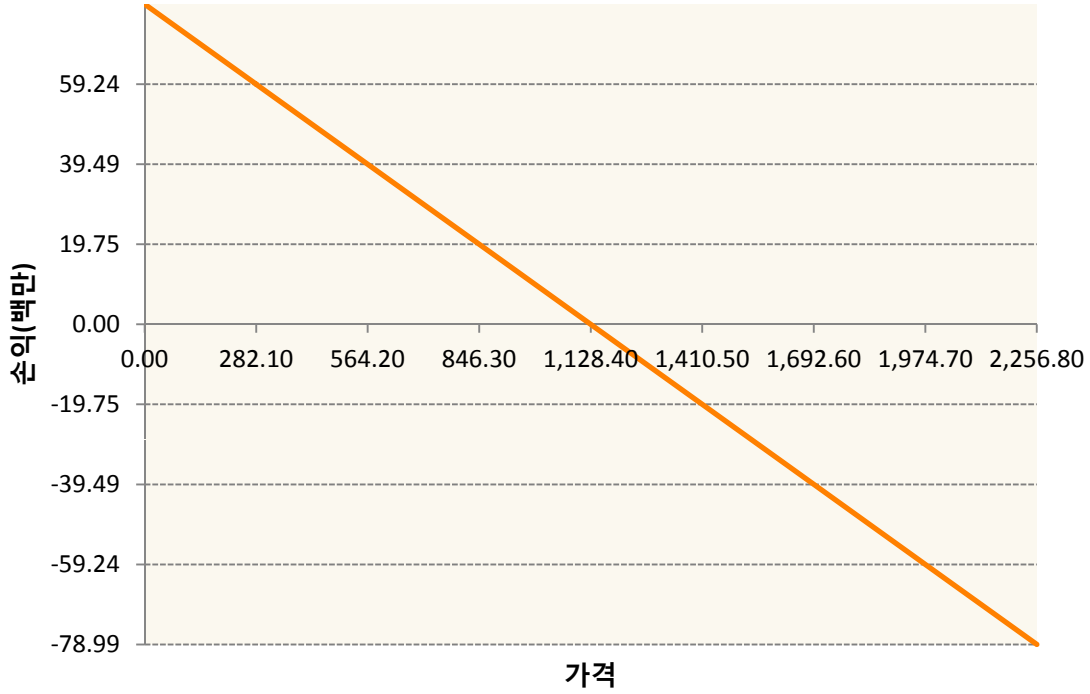
CK9-CORN FUTURE May19



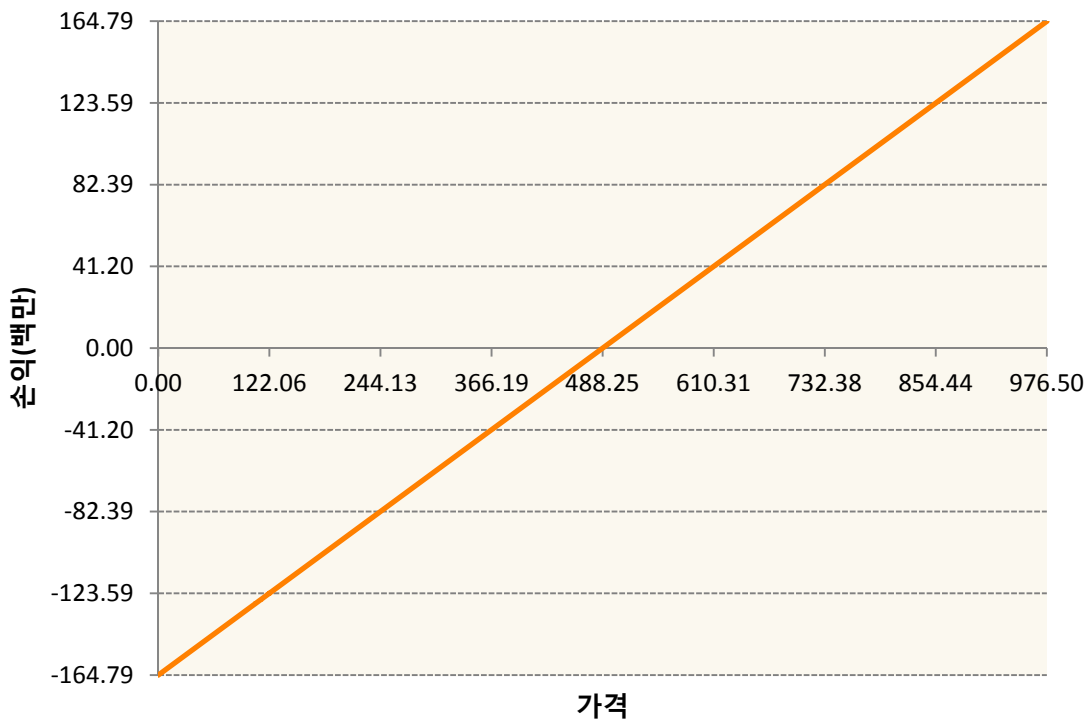




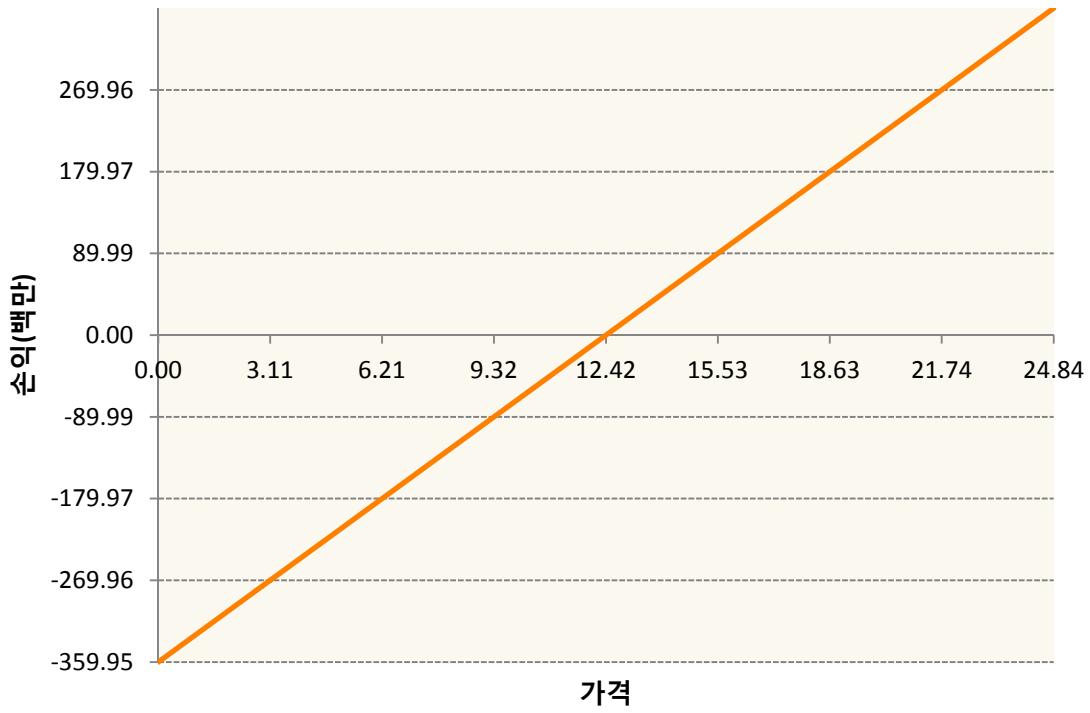
KR4175P30001-2019-03 달러선물



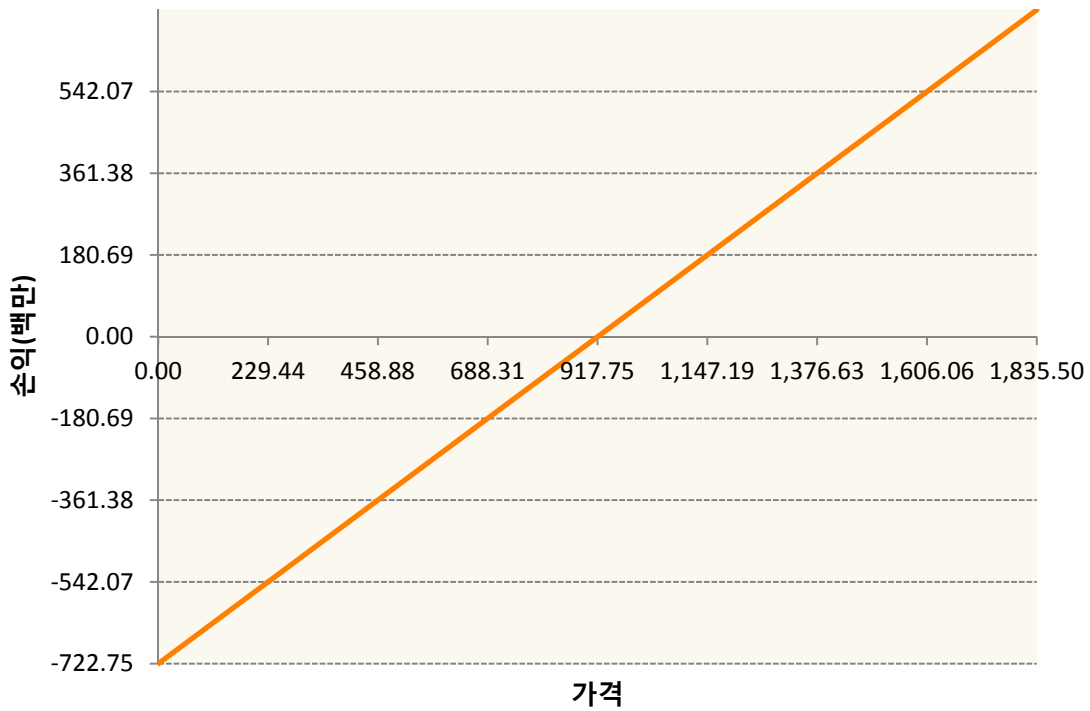
KWK9-KC HRW WHEAT FUT May19



SBK9-SUGAR #11 (WORLD) May19

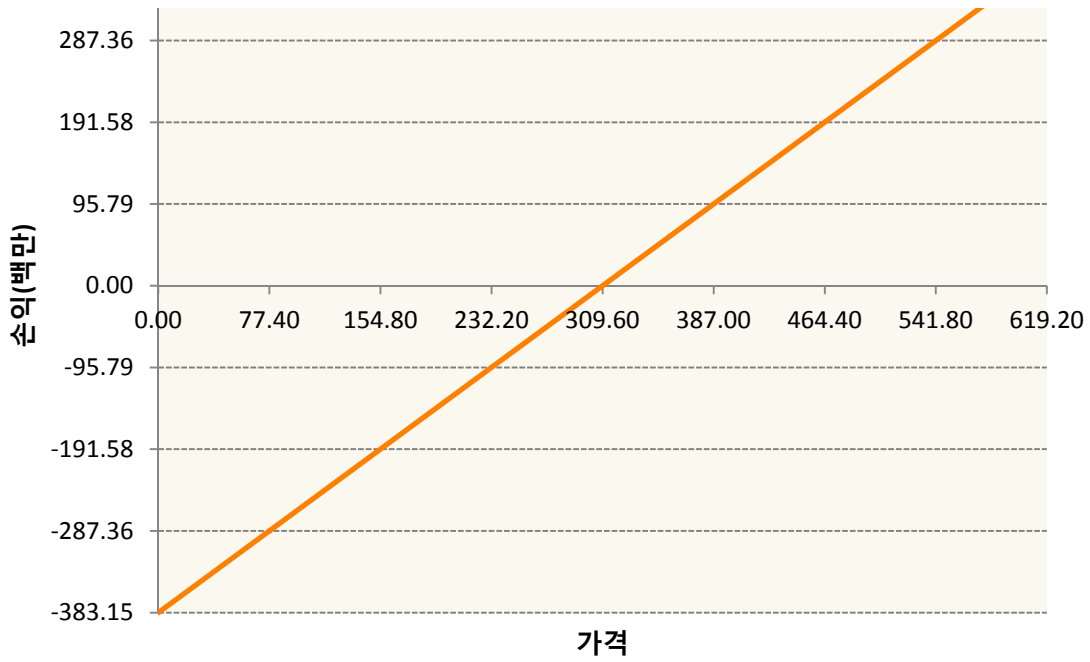


SK9-SOYBEAN FUTURE May19

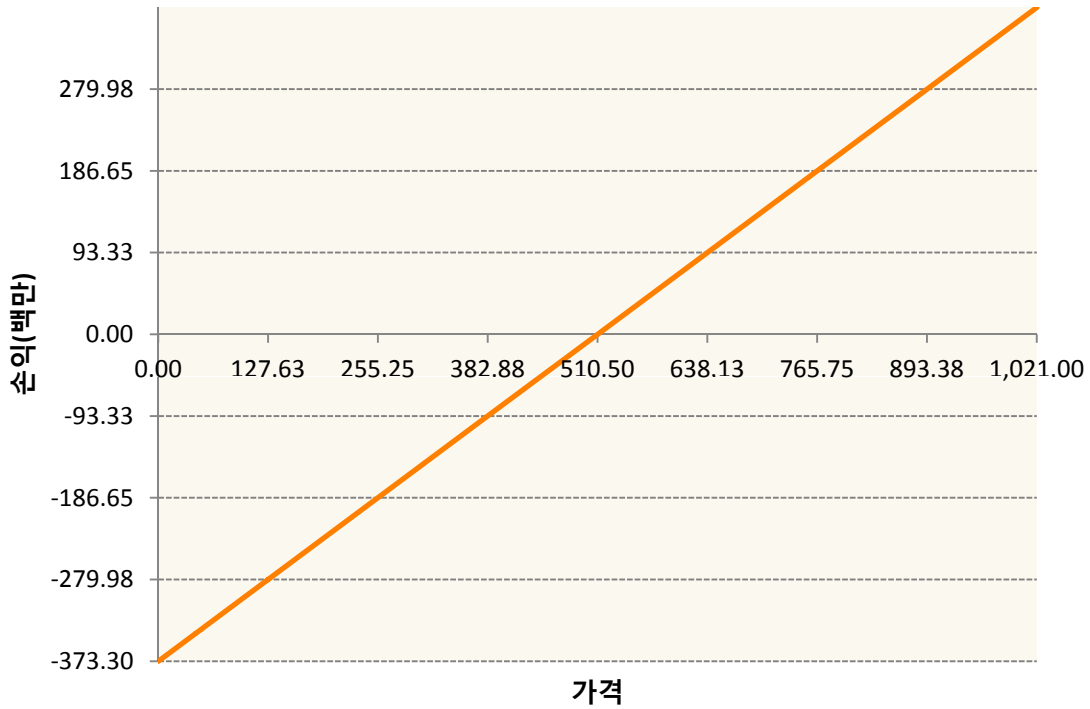


SMK9-SOYBEAN MEAL FUTR May19





WK9-WHEAT FUTURE(CBT) May19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

BOK9	SOYBEAN OIL FUTR May19	31
CK9	CORN FUTURE May19	55
CTK9	COTTON NO.2 FUTR May19	13
KCK9	COFFEE 'C' FUTURE May19	24
KR4175P300	2019-03 달러선물	6

KWK9	KC HRW WHEAT FUT May19	13
SBK9	SUGAR #11 (WORLD) May19	29
SK9	SOYBEAN FUTURE May19	58
SMK9	SOYBEAN MEAL FUTR May19	31
WK9	WHEAT FUTURE(CBT) May19	30

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

(단위:백만원)

287