

공시일	2019-02-19
기준일	2019-02-18

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	2019-02-19
기준일	2019-02-18

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

1,100

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

633

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-02-19
기준일	2019-02-18

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	288
SWCSI50000 신한CSI500미래S190129	86

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

550

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-02-19
기준일	2019-02-18

유로인덱스모(주식-파생형)

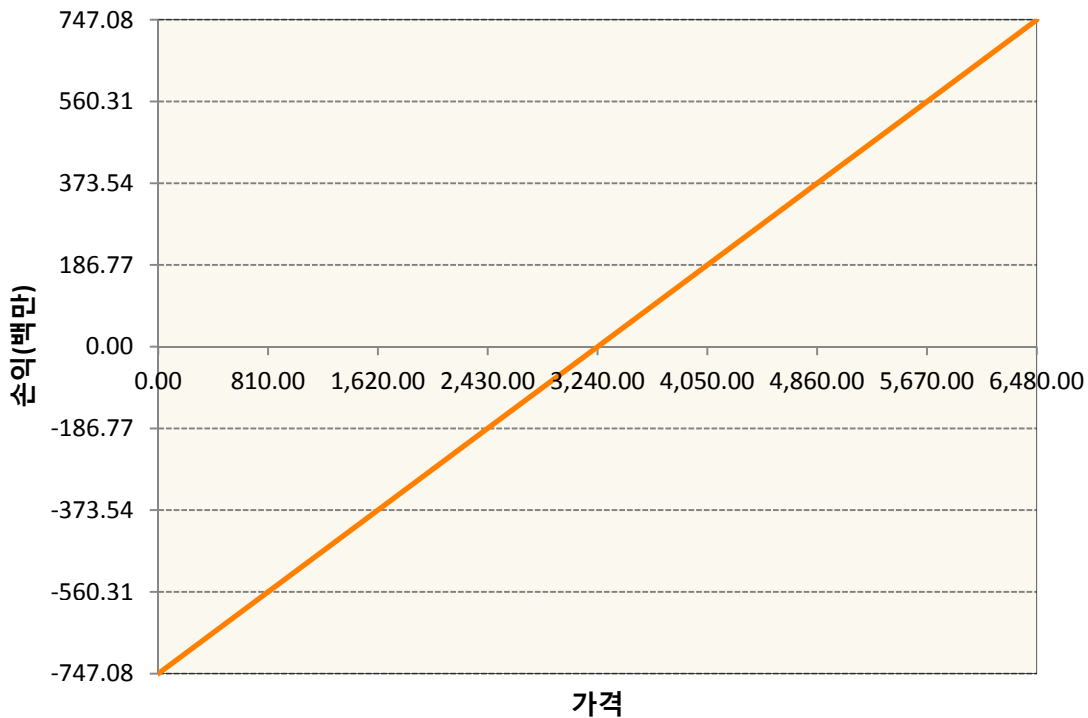
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	747	0	747	

2. 만기시점의 손익구조

VGH9-EURO STOXX 50 Mar19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGH9	EURO STOXX 50 Mar19	60
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

42

공시일	2019-02-19
기준일	2019-02-18

차이나인덱스모(주식-파생형)

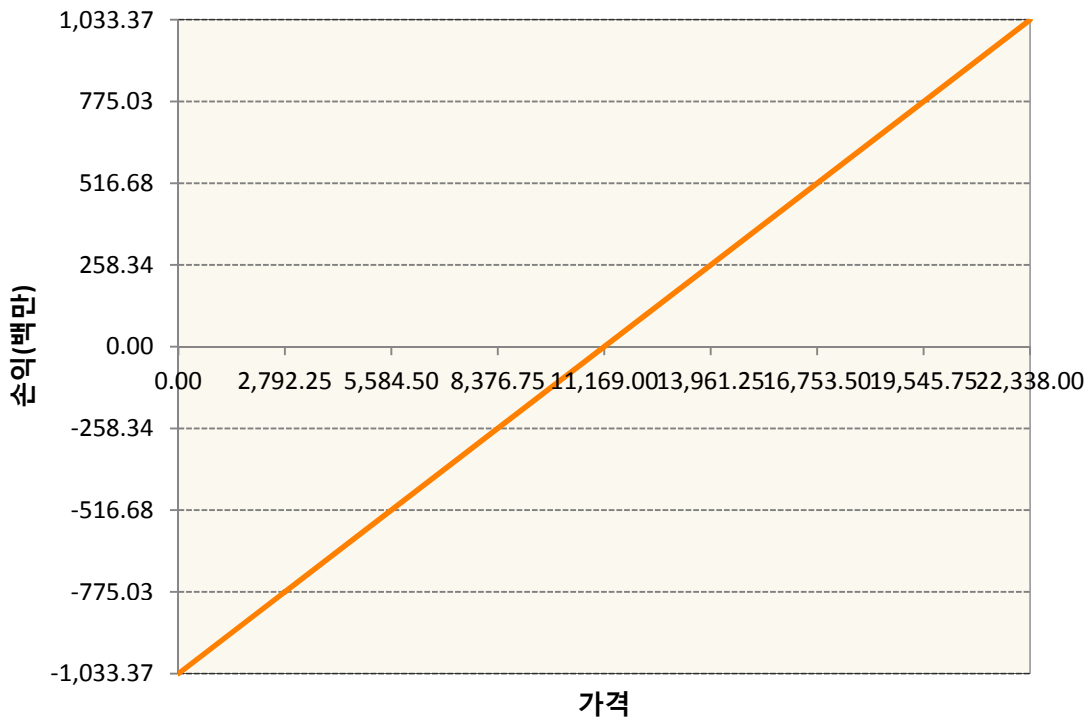
1. 계약금액

(단위:백만원)

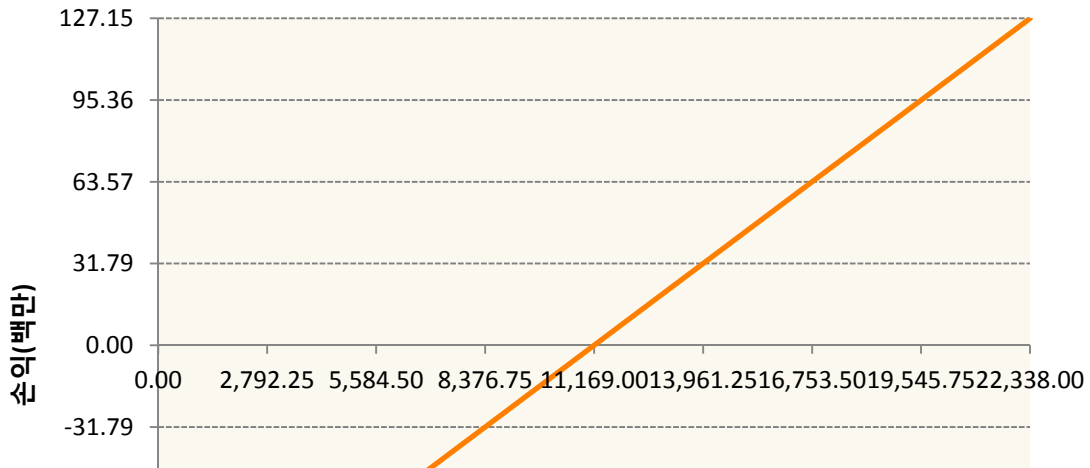
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,161	0	1,161	장내

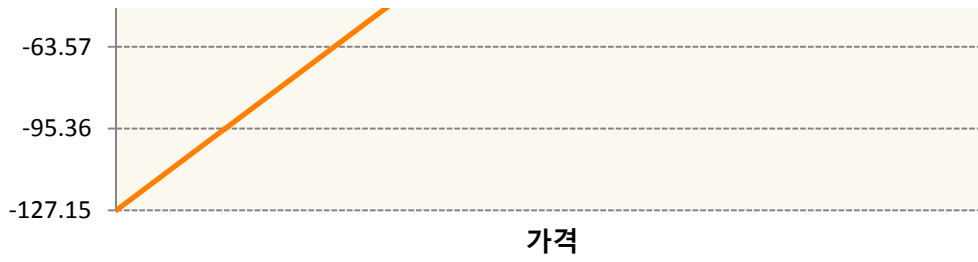
2. 만기시점의 손익구조

HCG9-HSCEI Futures Feb19



MHCG9-MINI H-SHR IDX FU Feb19





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

HCG9	HSCEI Futures Feb19	83
MHCG9	MINI H-SHR IDX FU Feb19	10

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

95

공시일	2019-02-19
기준일	2019-02-18

커버드콜모(주식혼합-파생형)

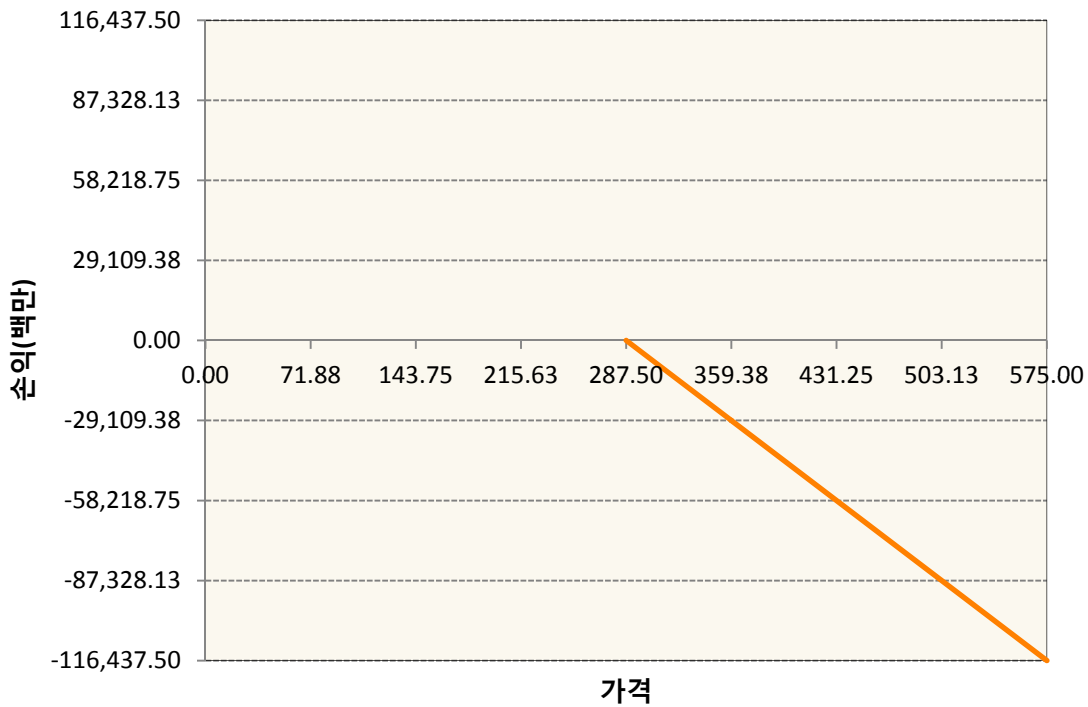
1. 계약금액

(단위:백만원)

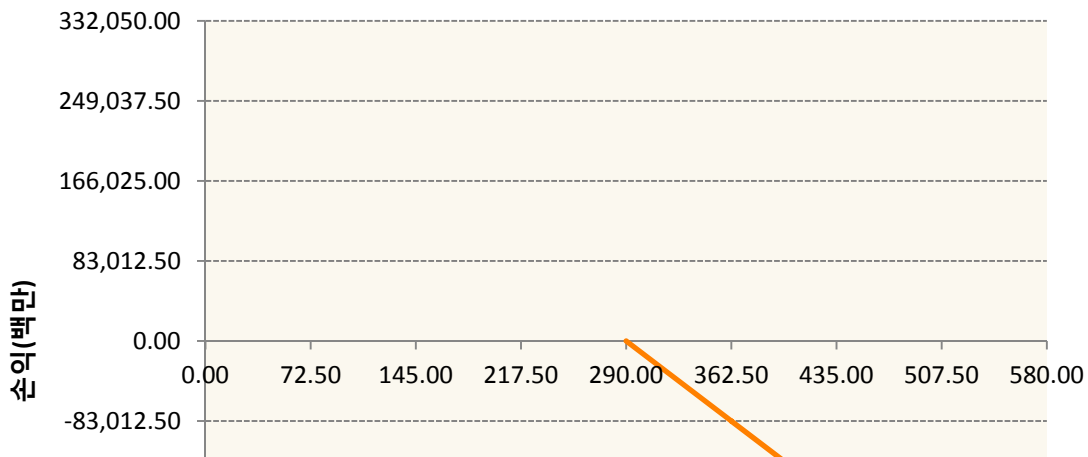
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	700,050	-700,050	장내

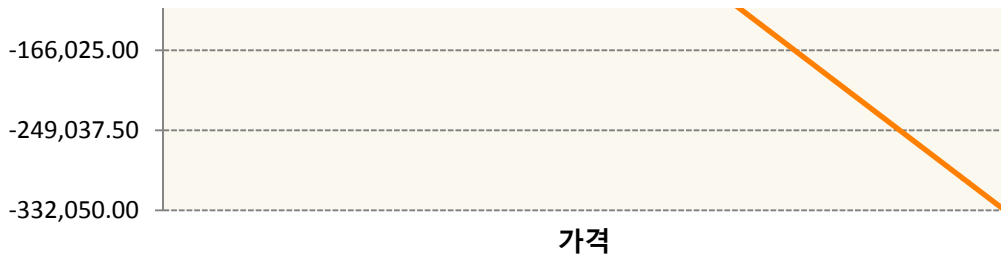
2. 만기시점의 손익구조

KR4201P32878-2019-03 콜287.5

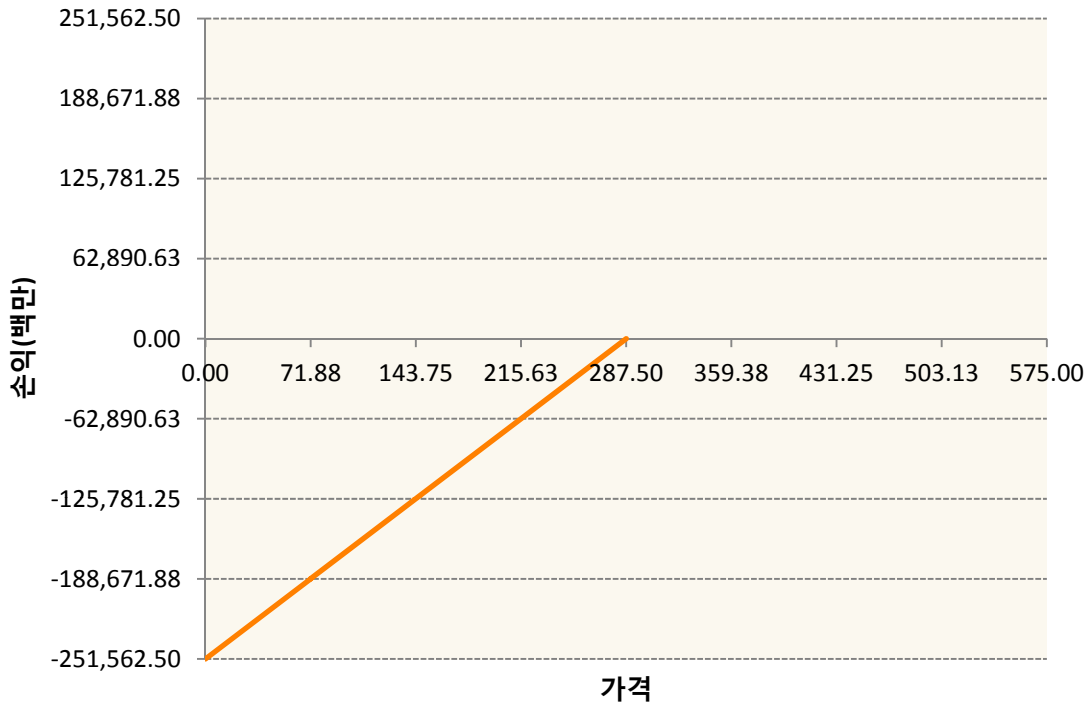


KR4201P32902-2019-03 콜290





KR4301P32876-2019-03 풋287.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201P32878		2019-03 콜287.5					6,919
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	2,673	2,614	2,538	2,446	2,338	2,218	2,085
-5.33%	2,448	2,319	2,174	2,016	1,846	1,666	1,479
-2.67%	1,878	1,670	1,455	1,233	1,007	778	545
0%	765	510	255	0	-255	-511	-766
2.67%	-989	-1,229	-1,473	-1,720	-1,968	-2,218	-2,469
5.33%	-3,315	-3,494	-3,686	-3,888	-4,098	-4,315	-4,538
8.00%	-6,039	-6,146	-6,271	-6,414	-6,570	-6,739	-6,919
KR4201P32902		2019-03 콜290					18,559
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	6,418	6,294	6,124	5,909	5,652	5,355	5,023

-5.33%	5,965	5,667	5,318	4,926	4,497	4,036	3,548
-2.67%	4,723	4,197	3,640	3,059	2,459	1,844	1,216
0%	2,115	1,414	709	0	-712	-1,426	-2,141
2.67%	-2,249	-2,967	-3,689	-4,413	-5,139	-5,867	-6,595
5.33%	-8,328	-8,907	-9,512	-10,140	-10,784	-11,442	-12,110
8.00%	-15,704	-16,077	-16,500	-16,967	-17,469	-18,001	-18,559
KR4301P32876 2019-03 풋287.5							17,136
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-17,036	-17,038	-17,044	-17,055	-17,073	-17,100	-17,136
-5.33%	-10,403	-10,435	-10,482	-10,547	-10,628	-10,726	-10,839
-2.67%	-4,084	-4,239	-4,414	-4,605	-4,809	-5,025	-5,250
0%	891	595	298	0	-299	-598	-897
2.67%	3,492	3,256	3,008	2,752	2,488	2,218	1,945
5.33%	4,259	4,174	4,067	3,939	3,793	3,630	3,452
8.00%	4,377	4,363	4,337	4,299	4,246	4,178	4,094

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

(단위:백만원)

43,202

공시일	2019-02-19
기준일	2019-02-18

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

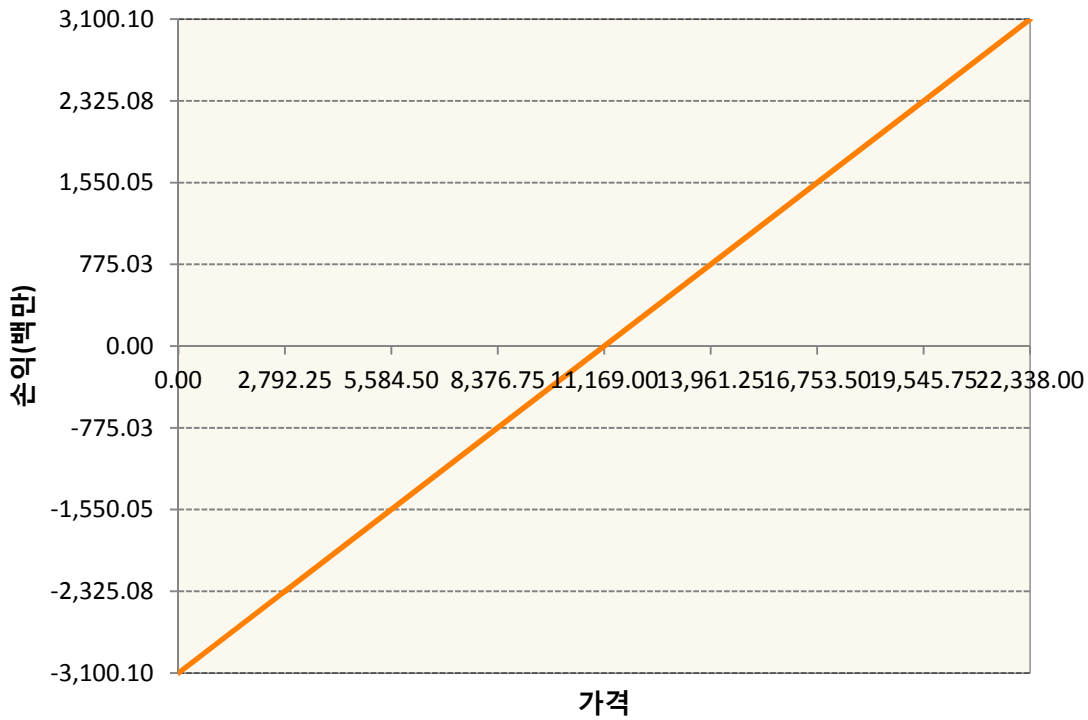
1. 계약금액

(단위:백만원)

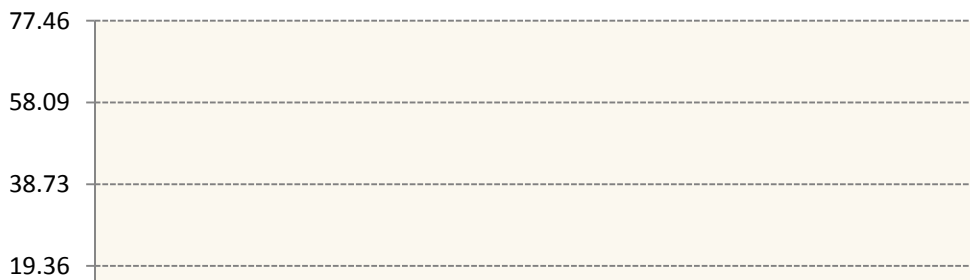
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	3,100	0	3,100	장내
누계	유가증권	옵션	0	7,347	-7,347	장내
누계	통화	선도	0	2,726	-2,726	장외

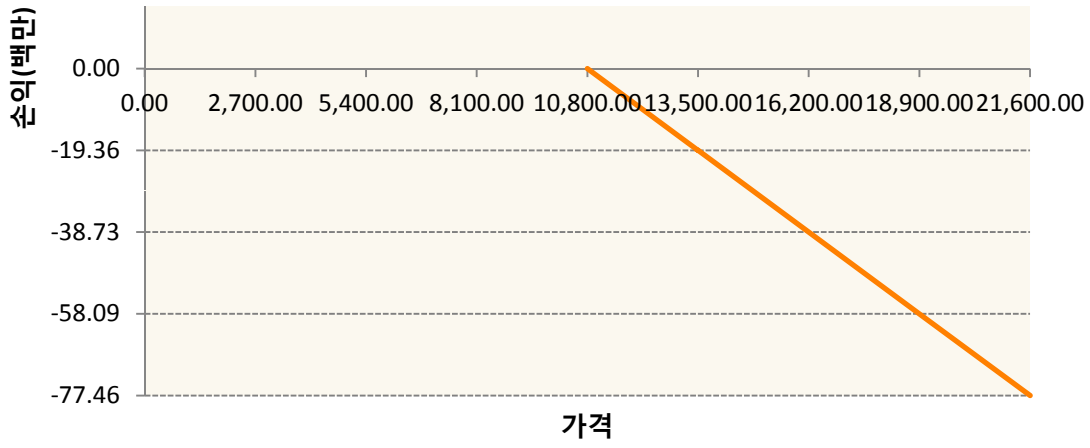
2. 만기시점의 손익구조

HCG9-HSCEI Futures Feb19

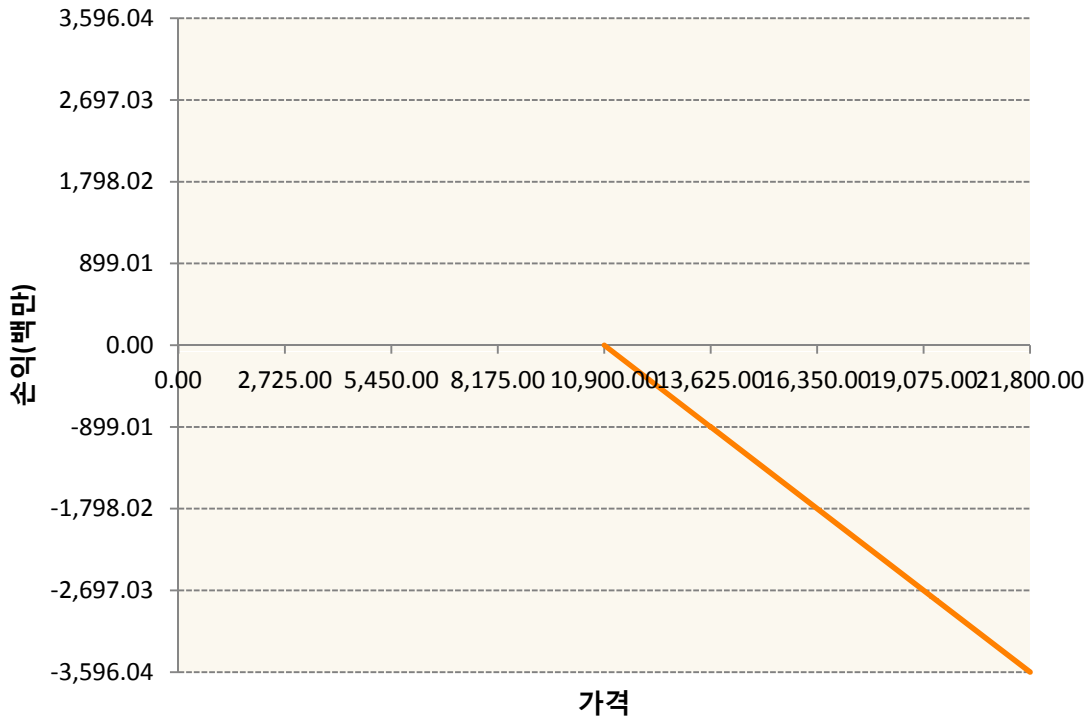


OHHIG9-C108-HSCEI

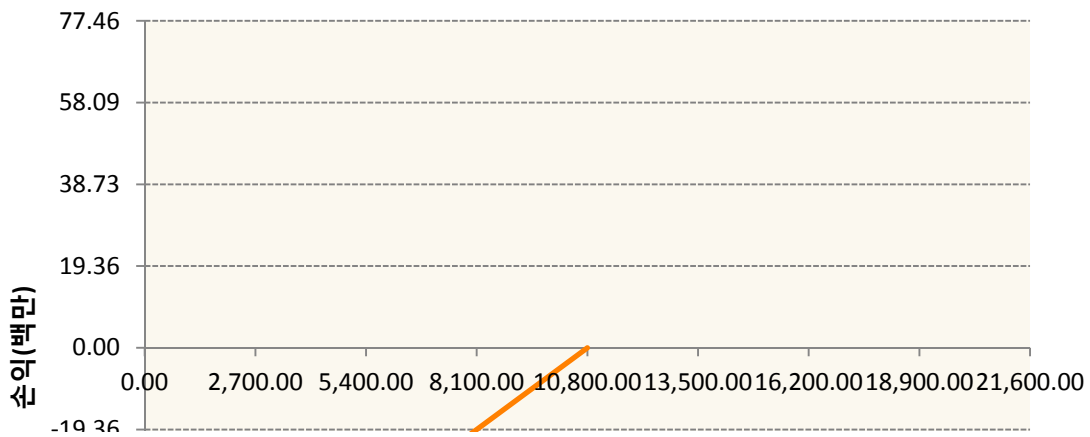


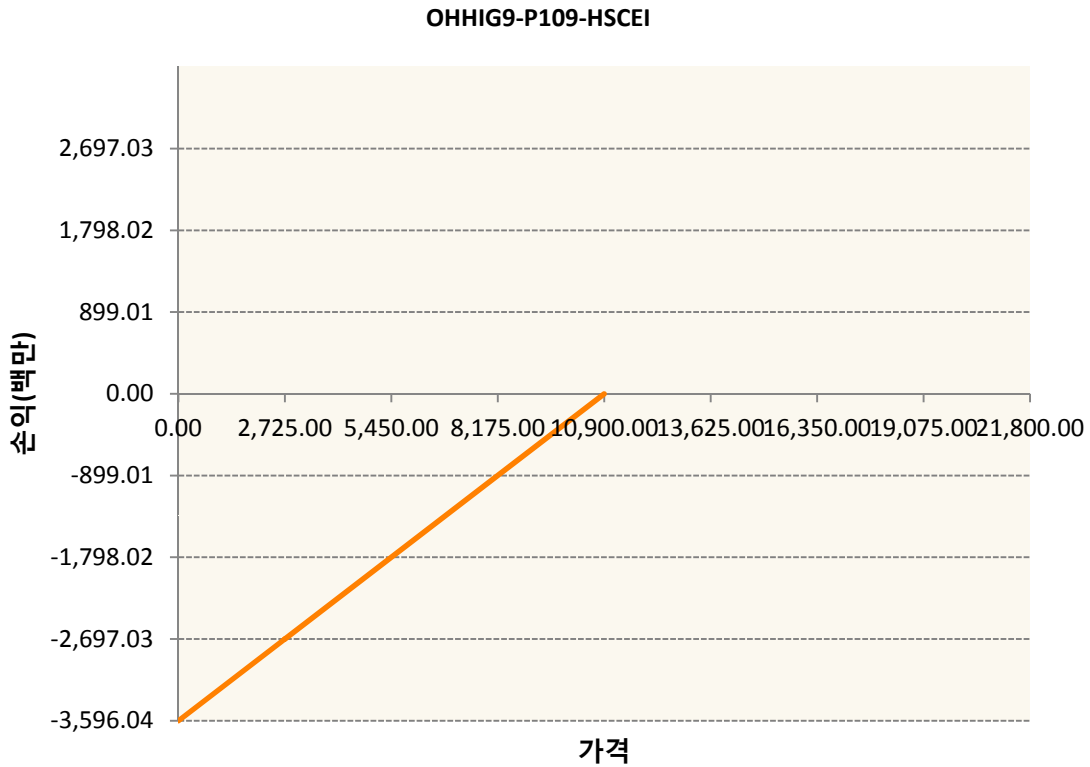
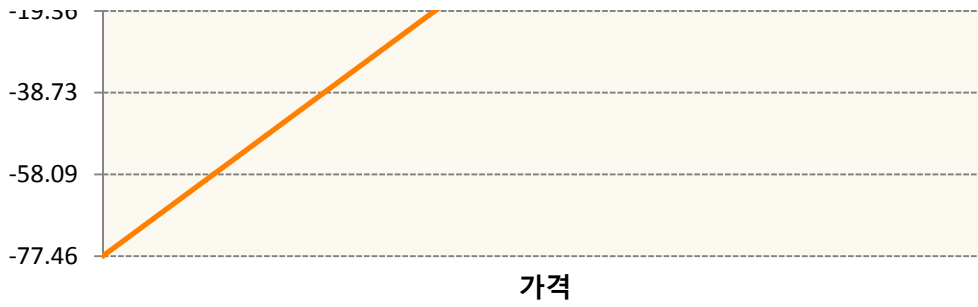


OHHIG9-C109-HSCEI



OHHIG9-P108-HSCEI





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

FX21018Z00 KRW/HKD 11-03-19E	218
HCG9 HSCEI Futures Feb19	248
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)

933

공시일	2019-02-19
기준일	2019-02-18

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

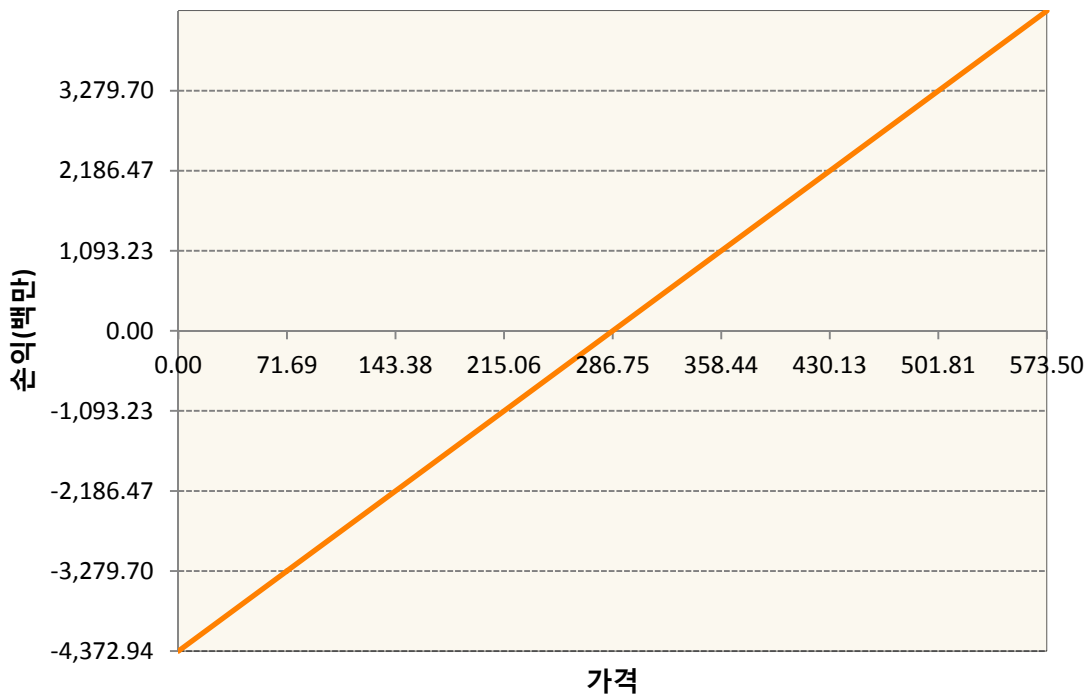
1. 계약금액

(단위:백만원)

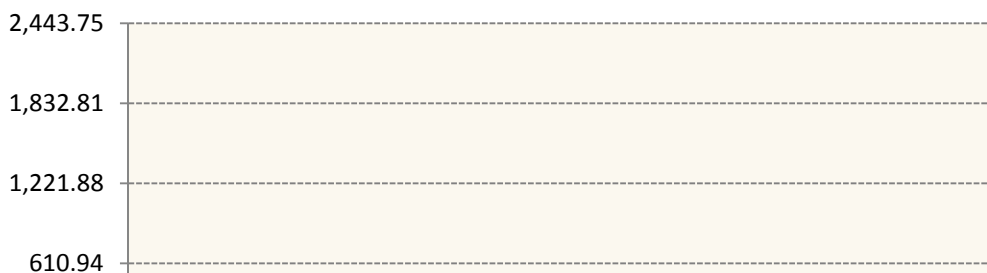
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	358	-358	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	359	0	359	장내
누계	유가증권	선물	4,373	0	4,373	장내
누계	유가증권	스왑	31,836	0	31,836	장외
누계	유가증권	옵션	0	30,310	-30,310	장내

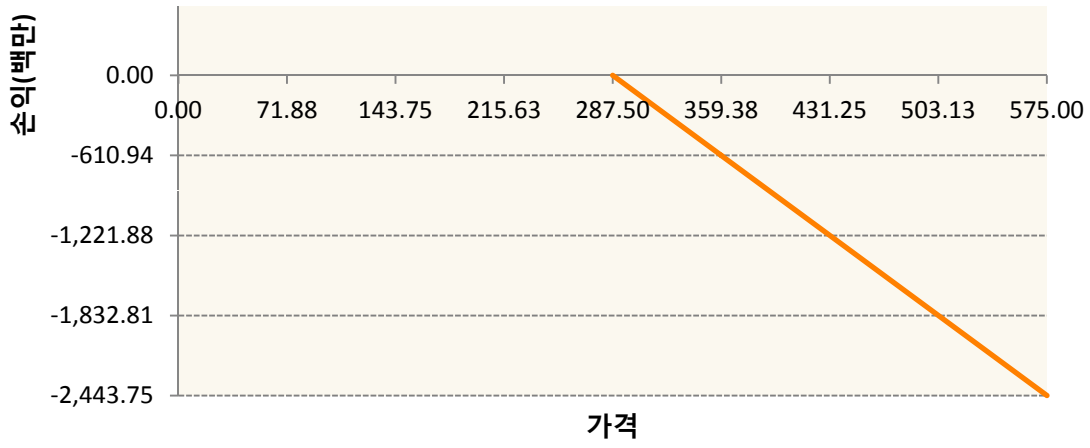
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P30007-2019-03 코스피200지수선물

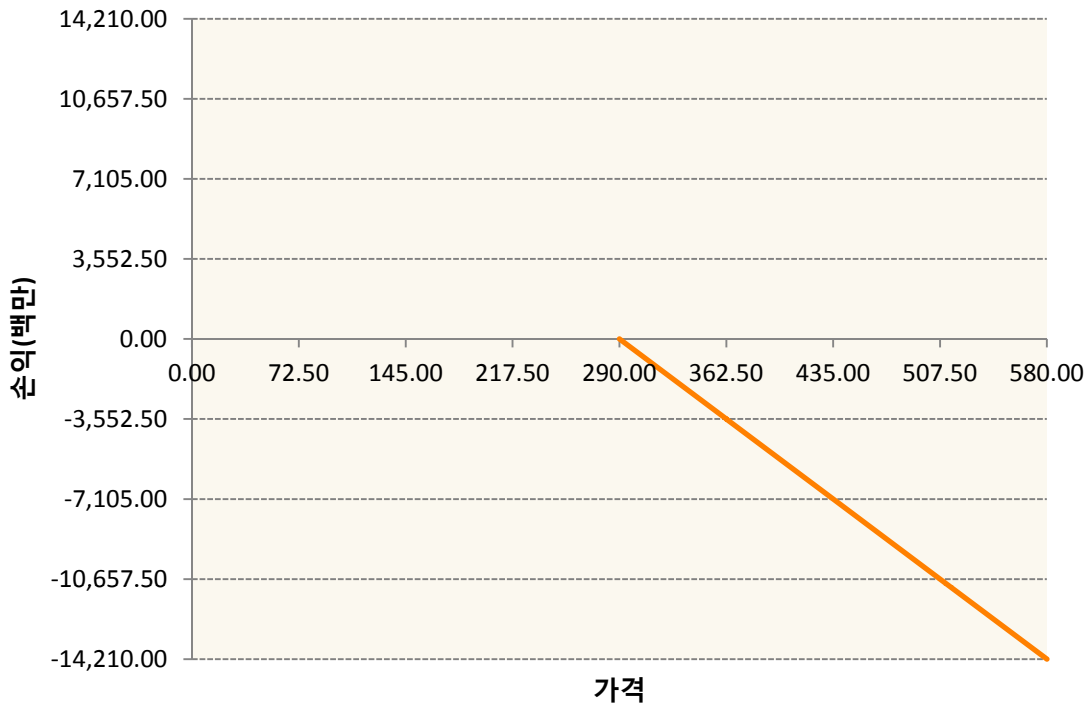


KR4201P32878-2019-03 콜287.5

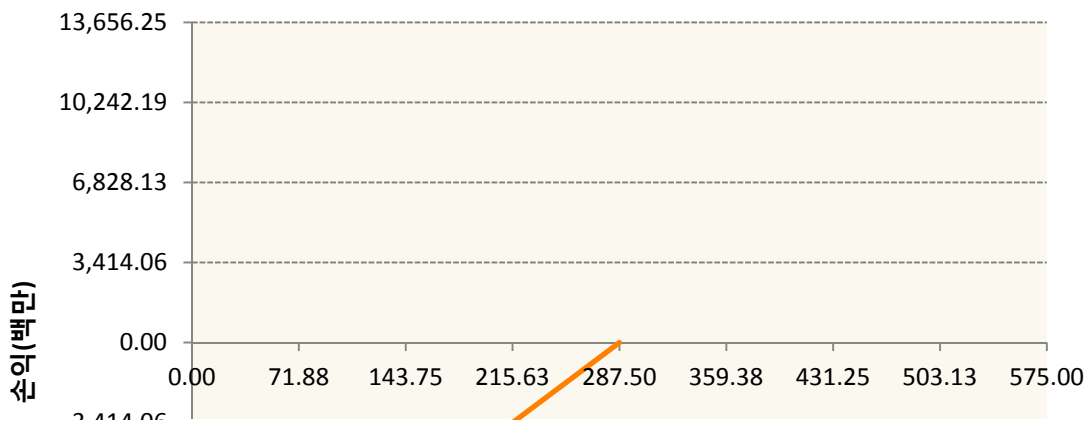


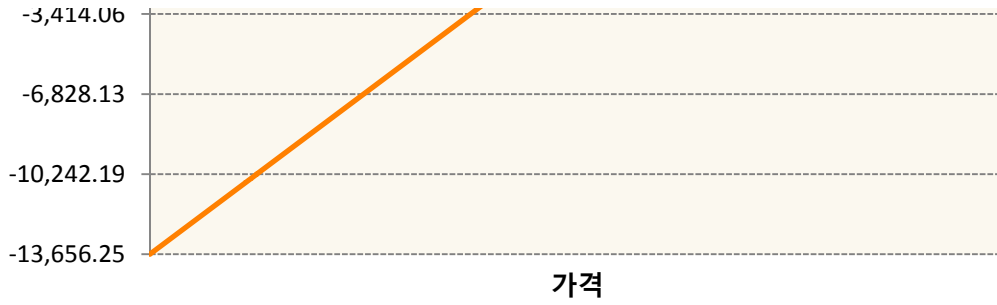


KR4201P32902-2019-03 콜290



KR4301P32876-2019-03 풋287.5





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11		UBCSFXC1 INDEX_14						2,664
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-2,664	-2,664	-2,664	-2,664	-2,664	-2,664	-2,664	
-5.33%	-1,776	-1,776	-1,776	-1,776	-1,776	-1,776	-1,776	
-2.67%	-888	-888	-888	-888	-888	-888	-888	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	888	888	888	888	888	888	888	
5.33%	1,776	1,776	1,776	1,776	1,776	1,776	1,776	
8.00%	2,664	2,664	2,664	2,664	2,664	2,664	2,664	
KR4101P30007		2019-03 코스피200지수선물						349
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-349	-349	-349	-349	-349	-349	-349	
-5.33%	-233	-233	-233	-233	-233	-233	-233	
-2.67%	-116	-116	-116	-116	-116	-116	-116	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	116	116	116	116	116	116	116	
5.33%	233	233	233	233	233	233	233	
8.00%	349	349	349	349	349	349	349	
KR4201P32878		2019-03 콜287.5						145
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	56	55	53	51	49	47	44	
-5.33%	51	49	46	42	39	35	31	
-2.67%	39	35	31	26	21	16	11	
0%	16	11	5	0	-5	-11	-16	
2.67%	-21	-26	-31	-36	-41	-47	-52	
5.33%	-70	-73	-77	-82	-86	-91	-95	
8.00%	-127	-129	-132	-135	-138	-141	-145	
KR4201P32902		2019-03 콜290						794
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	

-8.00%	275	269	262	253	242	229	215
-5.33%	255	243	228	211	192	173	152
-2.67%	202	180	156	131	105	79	52
0%	91	61	30	0	-30	-61	-92
2.67%	-96	-127	-158	-189	-220	-251	-282
5.33%	-356	-381	-407	-434	-461	-490	-518
8.00%	-672	-688	-706	-726	-748	-770	-794
KR4301P32876 2019-03 풋287.5							930
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-925	-925	-925	-926	-927	-928	-930
-5.33%	-565	-566	-569	-573	-577	-582	-588
-2.67%	-222	-230	-240	-250	-261	-273	-285
0%	48	32	16	0	-16	-32	-49
2.67%	190	177	163	149	135	120	106
5.33%	231	227	221	214	206	197	187
8.00%	238	237	235	233	230	227	222

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

(단위:백만원)

4,897

공시일	2019-02-19
기준일	2019-02-18

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

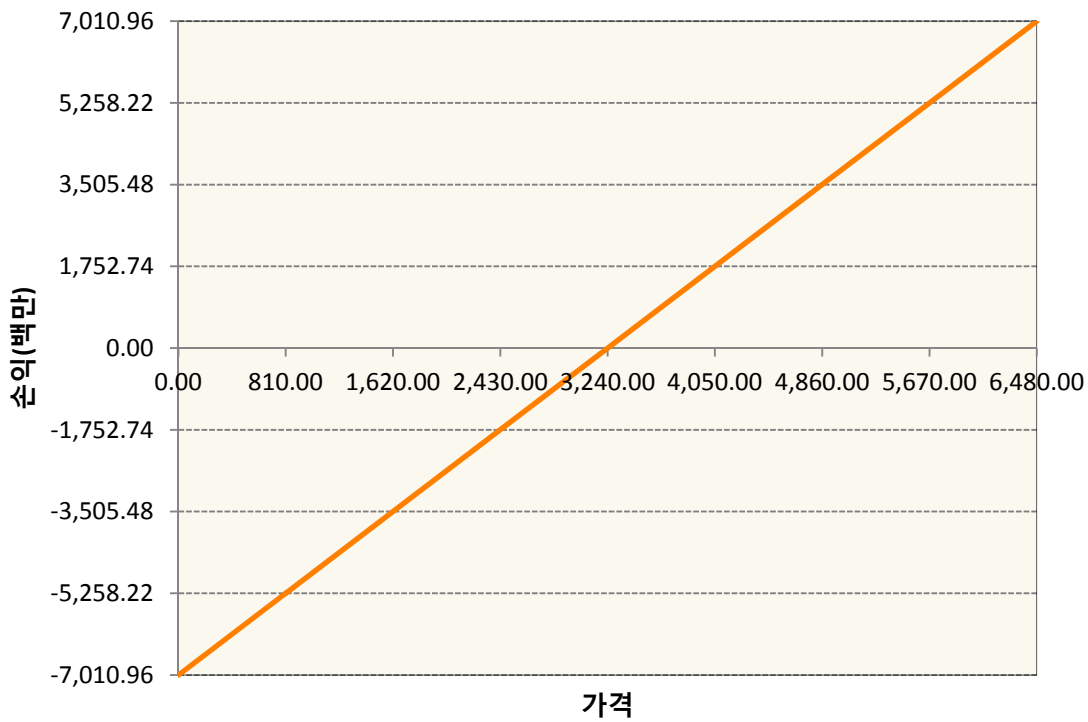
1. 계약금액

(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	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	7,011	0	7,011	
누계	유가증권	스왑	60,134	0	60,134	장외
누계	통화	선도	0	15,285	-15,285	장외

2. 만기시점의 손익구조

VGH9-EURO STOXX 50 Mar19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

260105SQP×SG EURO Covered CALL STRATEGY	71
FX21018X02 KRW/EUR 22-02-19E	408
FX21018Z03 KRW/EUR 22-03-19E	815
VGH9 EURO STOXX 50 Mar19	561

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

(단위:백만원)

1,146

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

(단위:백만원)

1,176

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

(단위:백만원)

101

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

(단위:백만원)

151

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

(단위:백만원)

45

공시일	2019-02-19
기준일	2019-02-18

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

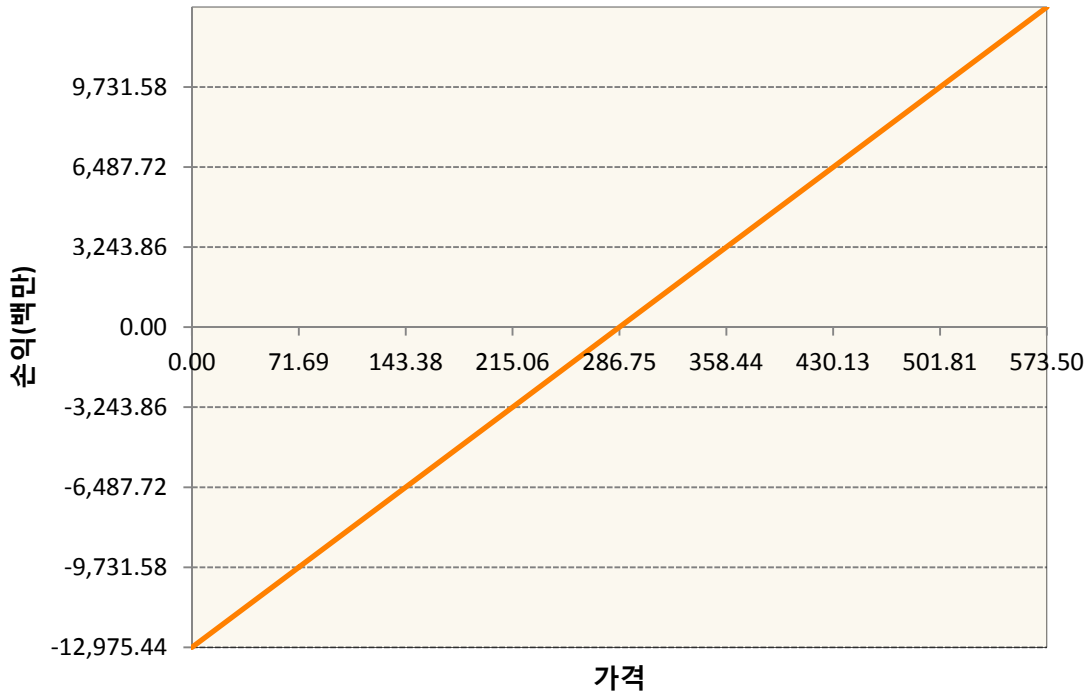
1. 계약금액

(단위:백만원)

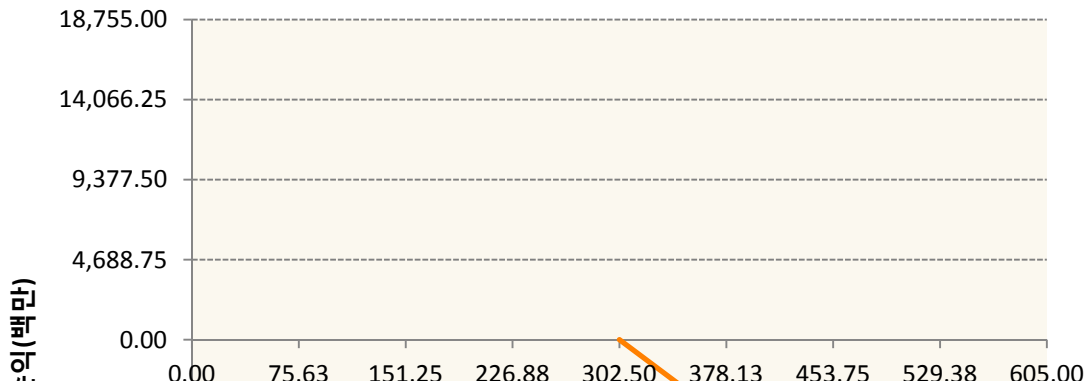
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	12,975	0	12,975	장내
누계	유가증권	옵션	2,165	24,931	-22,766	장내

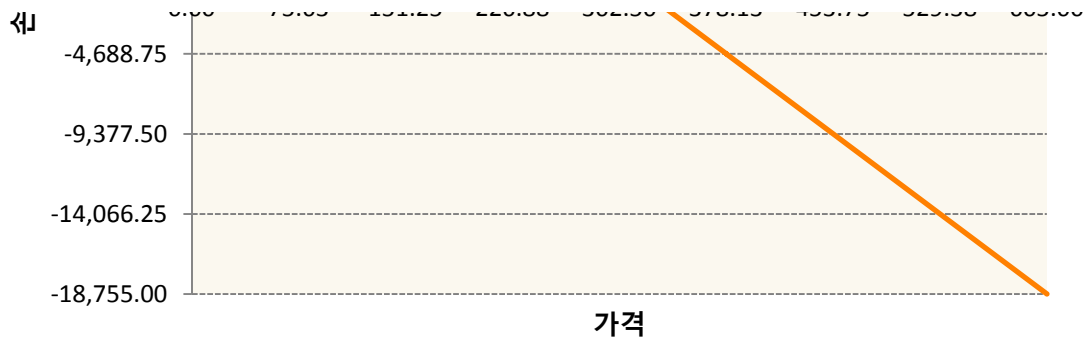
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P30007-2019-03 코스피200지수선물

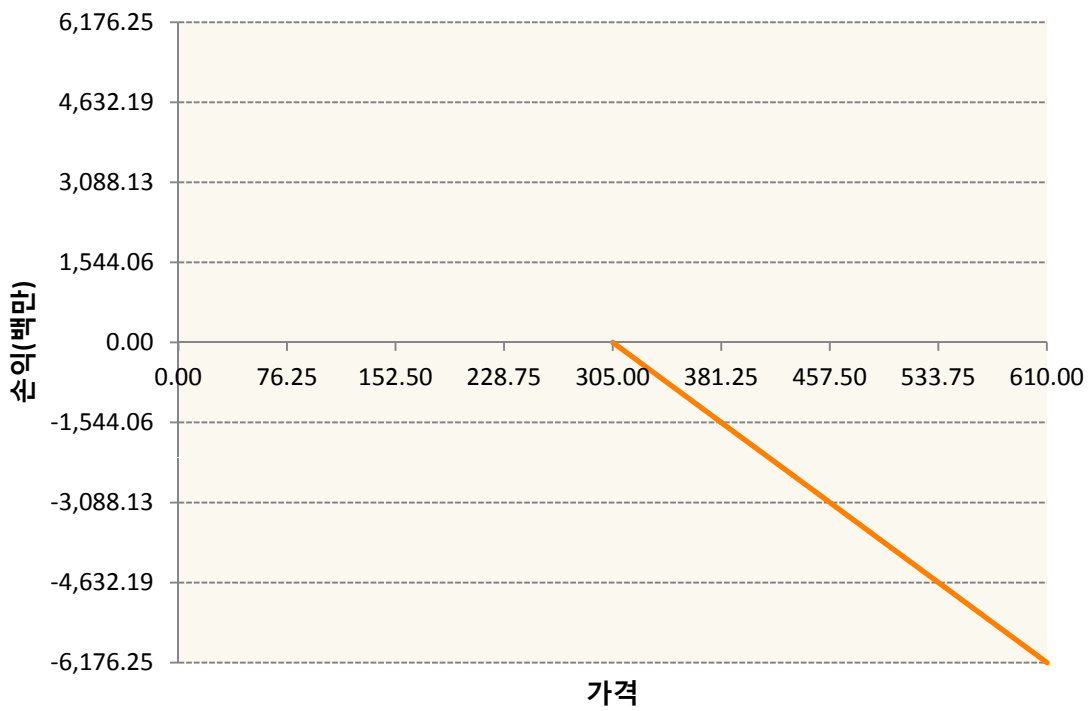


KR4201P33025-2019-03 콜302.5

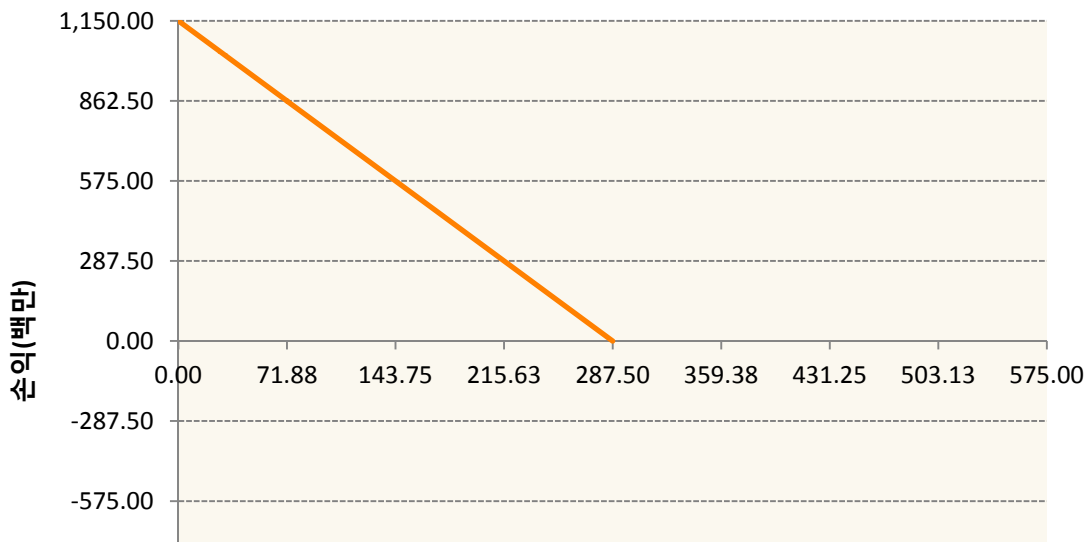


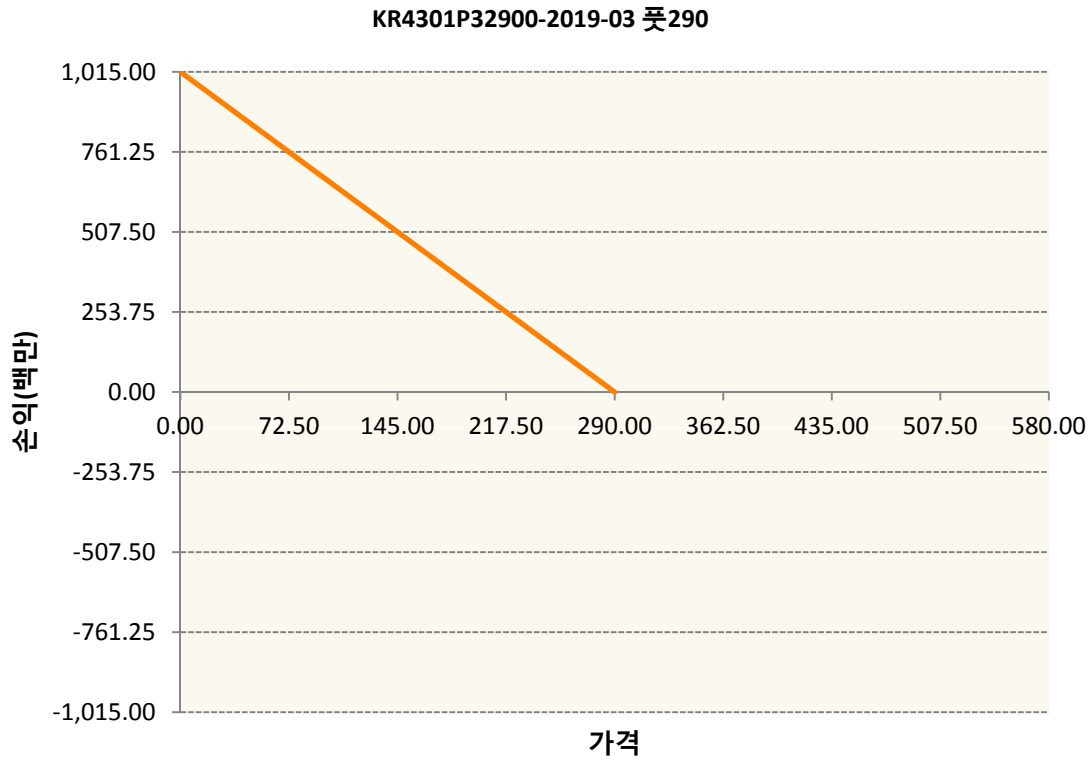
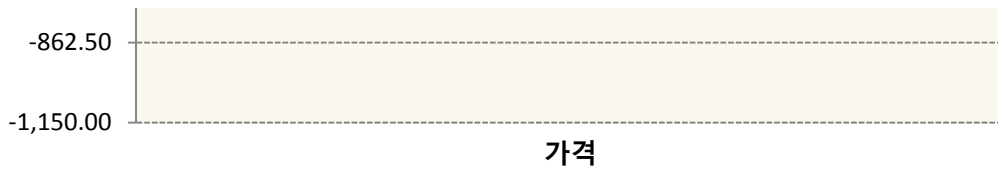


KR4201P33058-2019-03 콜305



KR4301P32876-2019-03 풋287.5





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101P30007		2019-03 코스피200지수선물						1,035
		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	
KR4201P33025		2019-03 콜302.5						706
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	132	131	129	125	120	114	105	
-5.33%	129	125	118	110	99	86	71	
-2.67%	115	104	90	73	54	33	10	

0%	75	52	27	0	-29	-59	-90
2.67%	-21	-55	-91	-127	-164	-202	-240
5.33%	-197	-238	-280	-321	-362	-403	-444
8.00%	-467	-506	-545	-585	-625	-666	-706
KR4201P33058 2019-03 콜305							211
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	35	34	34	33	32	30	28
-5.33%	34	33	31	29	26	23	18
-2.67%	31	28	24	20	14	8	1
0%	21	15	8	0	-9	-18	-27
2.67%	-3	-14	-24	-35	-47	-59	-71
5.33%	-52	-65	-78	-91	-105	-118	-131
8.00%	-130	-143	-157	-170	-184	-197	-211
KR4301P32876 2019-03 풋287.5							78
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	78	78	78	78	78	78	78
-5.33%	48	48	48	48	49	49	50
-2.67%	19	19	20	21	22	23	24
0%	-4	-3	-1	0	1	3	4
2.67%	-16	-15	-14	-13	-11	-10	-9
5.33%	-19	-19	-19	-18	-17	-17	-16
8.00%	-20	-20	-20	-20	-19	-19	-19
KR4301P32900 2019-03 풋290							72
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	71	72	72	72	72	72	72
-5.33%	45	45	45	45	45	46	46
-2.67%	19	19	20	20	21	22	23
0%	-3	-2	-1	0	1	2	3
2.67%	-17	-16	-15	-13	-12	-11	-10
5.33%	-22	-21	-21	-20	-19	-18	-18
8.00%	-23	-23	-23	-22	-22	-22	-21

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

(단위:백만원)

1,710

공시일	2019-02-19
기준일	2019-02-18

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	824	0	824	

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	2019-02-19
기준일	2019-02-18

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	5,171	0	5,171	

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	2019-02-19
기준일	2019-02-18

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	18,279	0	18,279	
누계	통화	선도	0	21,205	-21,205	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		32
FX21019F02 KRW/USD 25-02-19E		136
FX21019F02 KRW/USD 28-03-19E		468
FX21019F02 KRW/USD 28-02-19E		117

FX21019F02(KRW/USD 29-03-19E	24
FX21019F02(KRW/USD 29-03-19E	72
FX21019F03(KRW/USD 28-02-19E	27
FX21019G00 KRW/USD 29-03-19E	27
FX21019G00 KRW/USD 29-03-19E	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	105
FX21019G01 KRW/USD 19-03-19E	106
FX21019G01 KRW/USD 19-03-19E	43

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

(단위:백만원)

630

공시일	2019-02-19
기준일	2019-02-18

스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

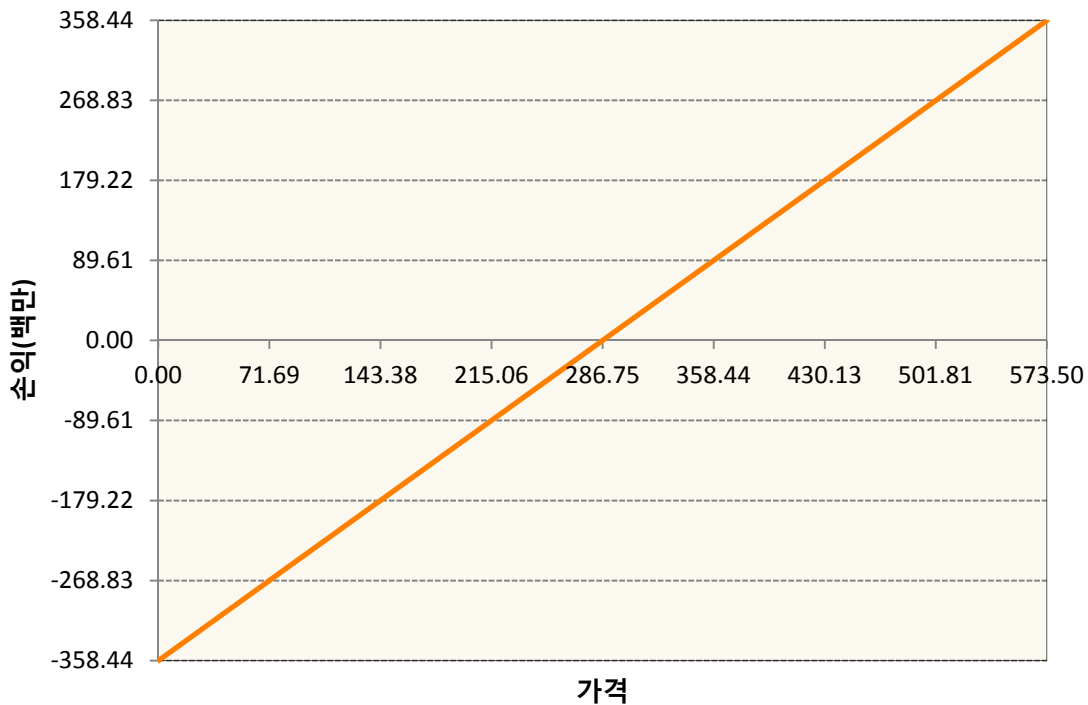
1. 계약금액

(단위:백만원)

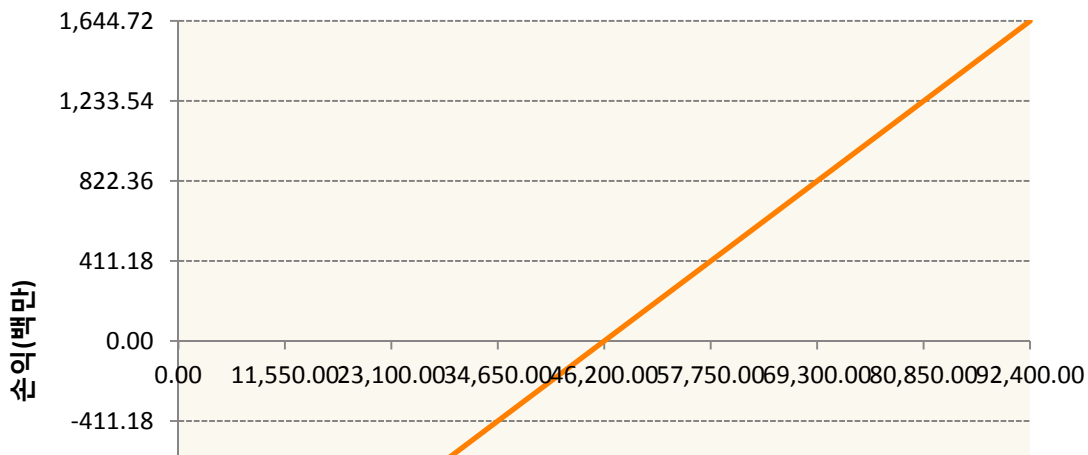
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,003	0	2,003	장내

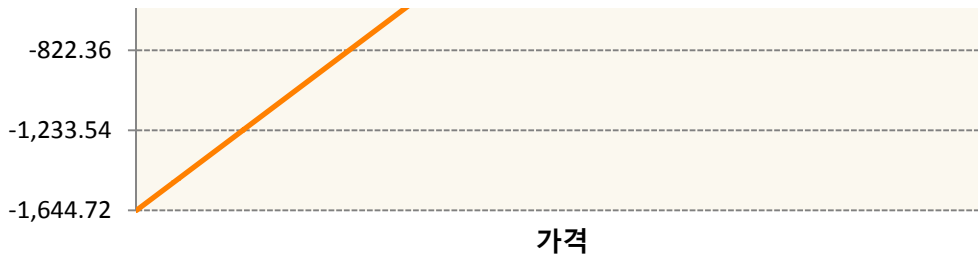
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P30007-2019-03 코스피200지수선물



KR4111P30006-2019-03 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	
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)

180

공시일	2019-02-19
기준일	2019-02-18

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

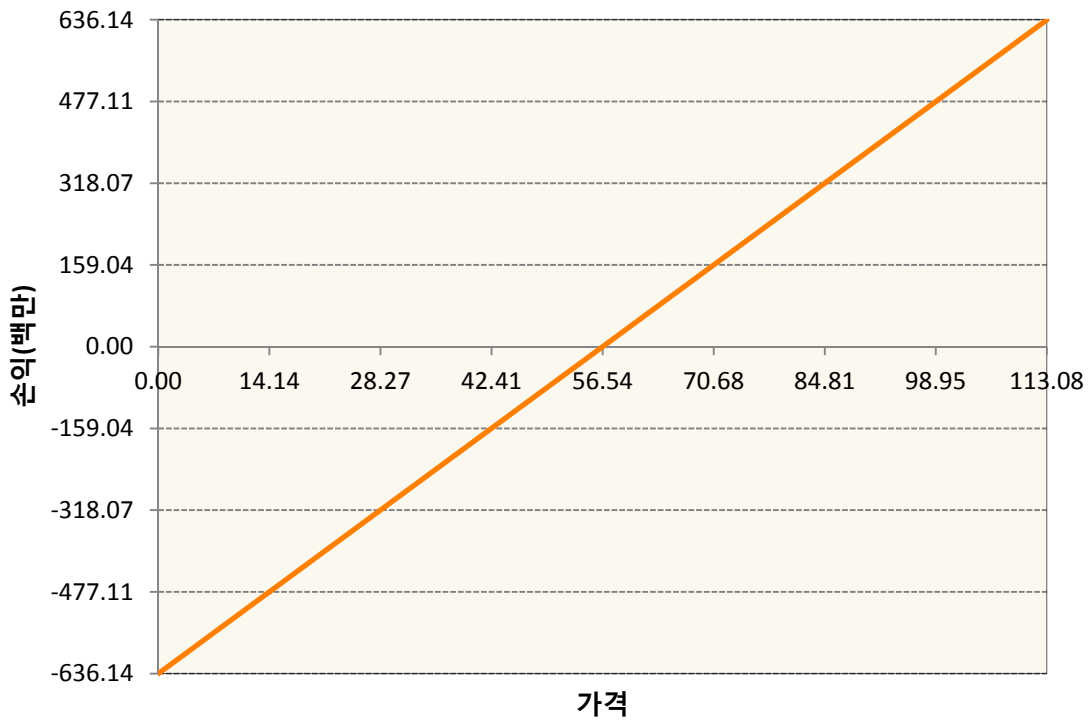
1. 계약금액

(단위:백만원)

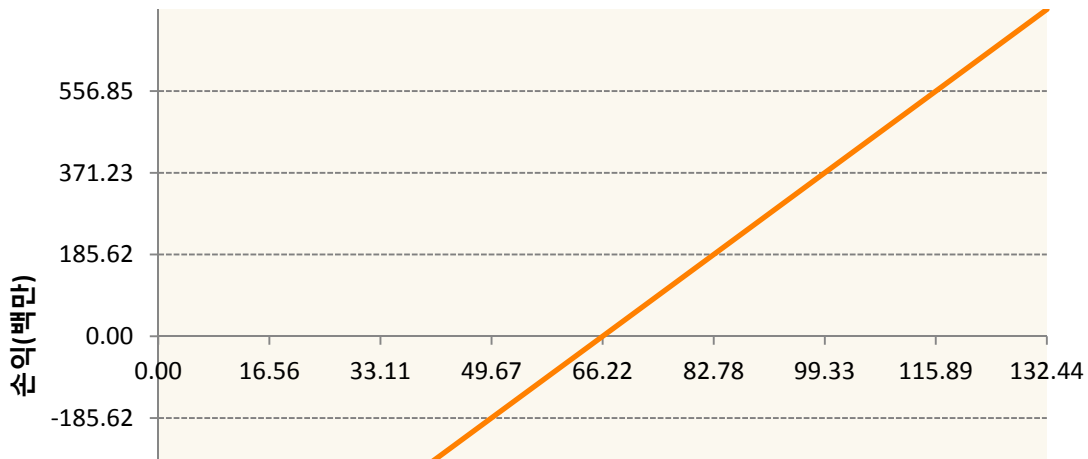
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,869	281	2,588	

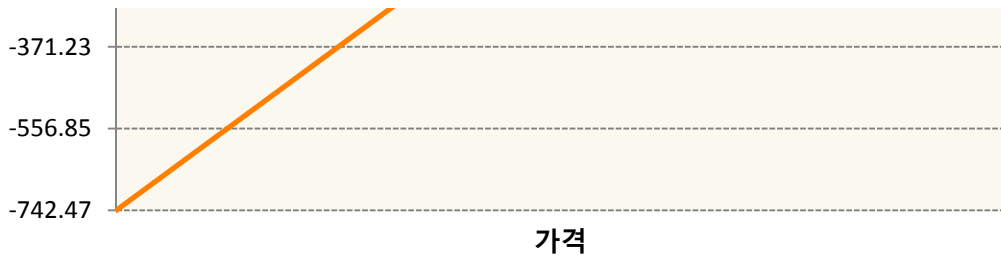
2. 만기시점의 손익구조

CLK9-WTI CRUDE FUTURE May19

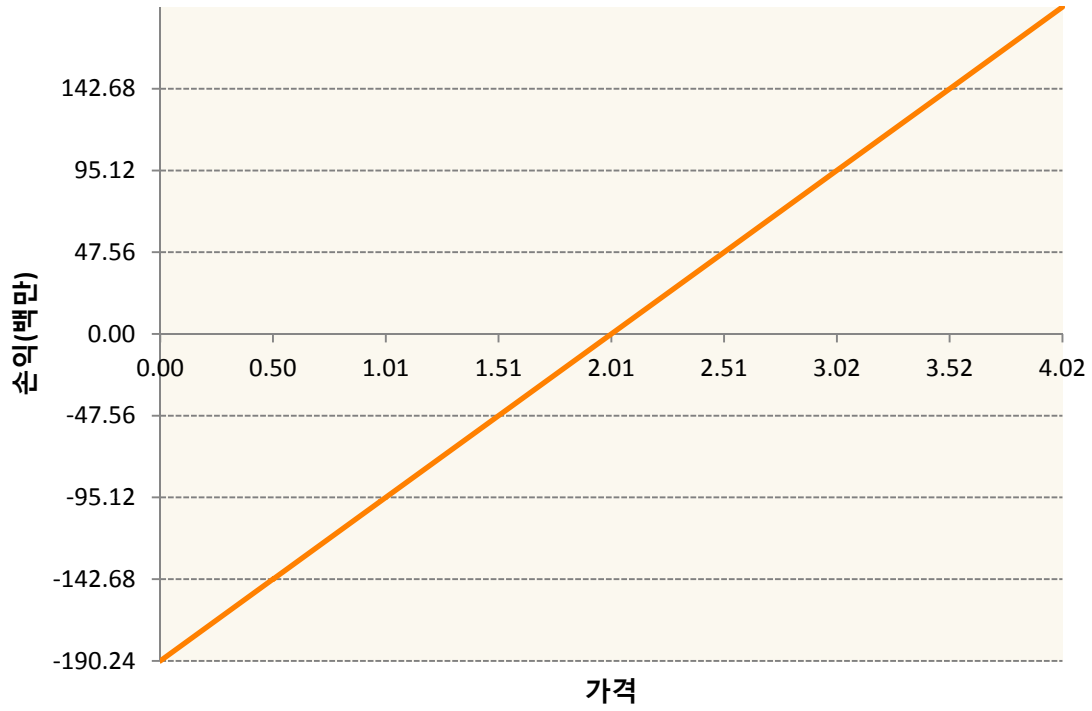


COK9-BRENT CRUDE FUTR May19

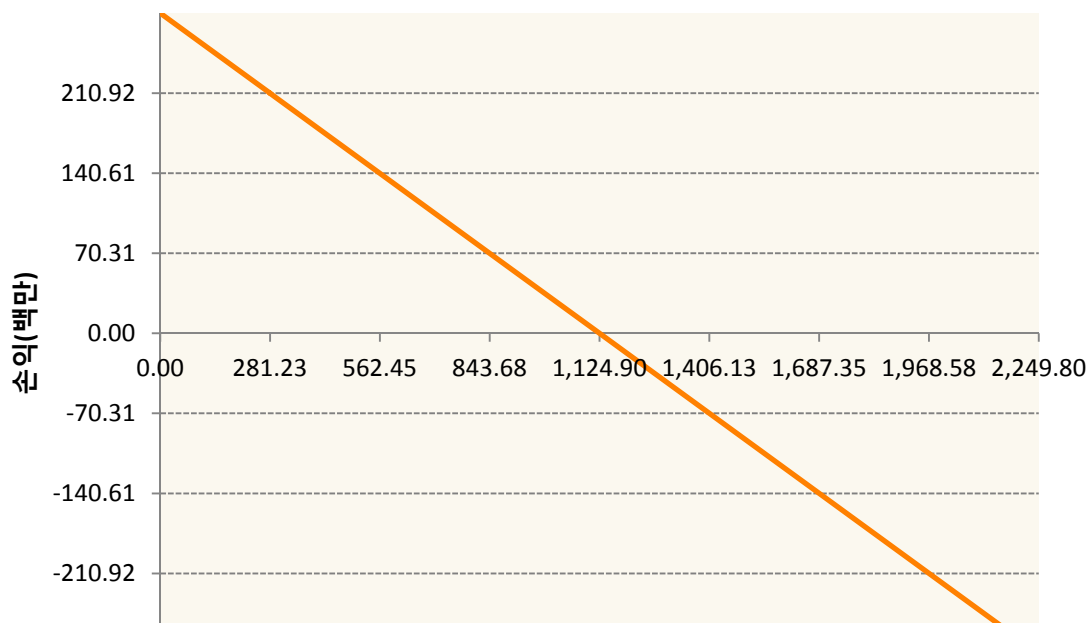


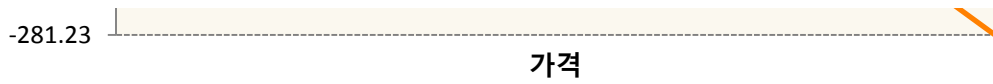


HOK9-NY Harb ULSD Fut May19

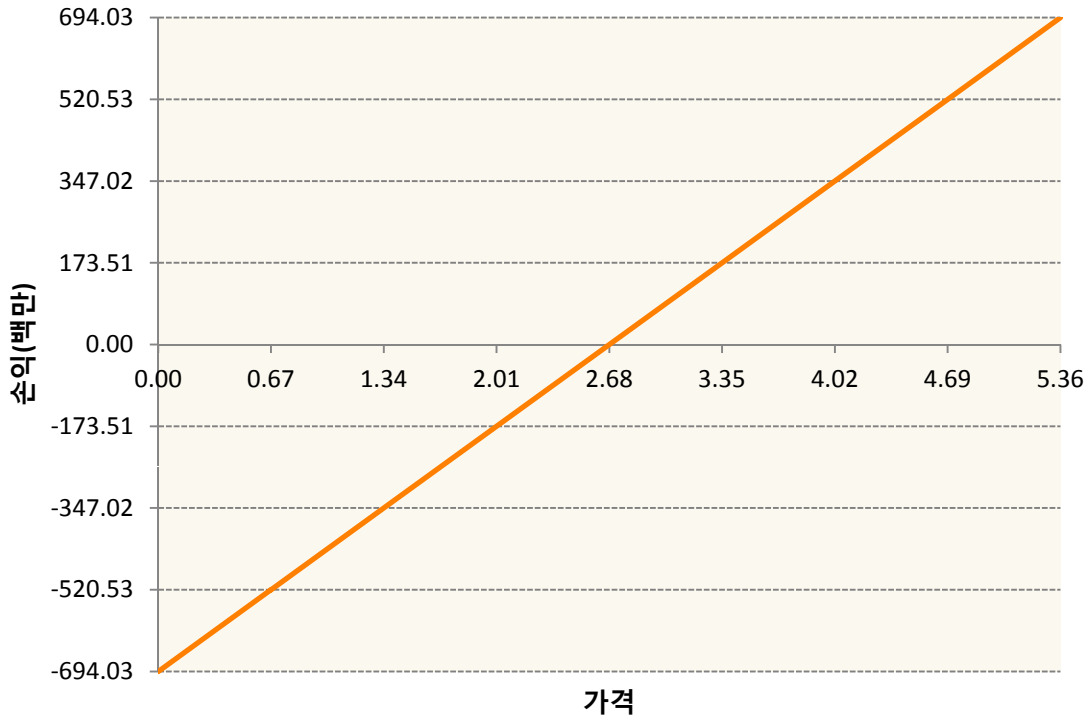


KR4175P30001-2019-03 달러선물

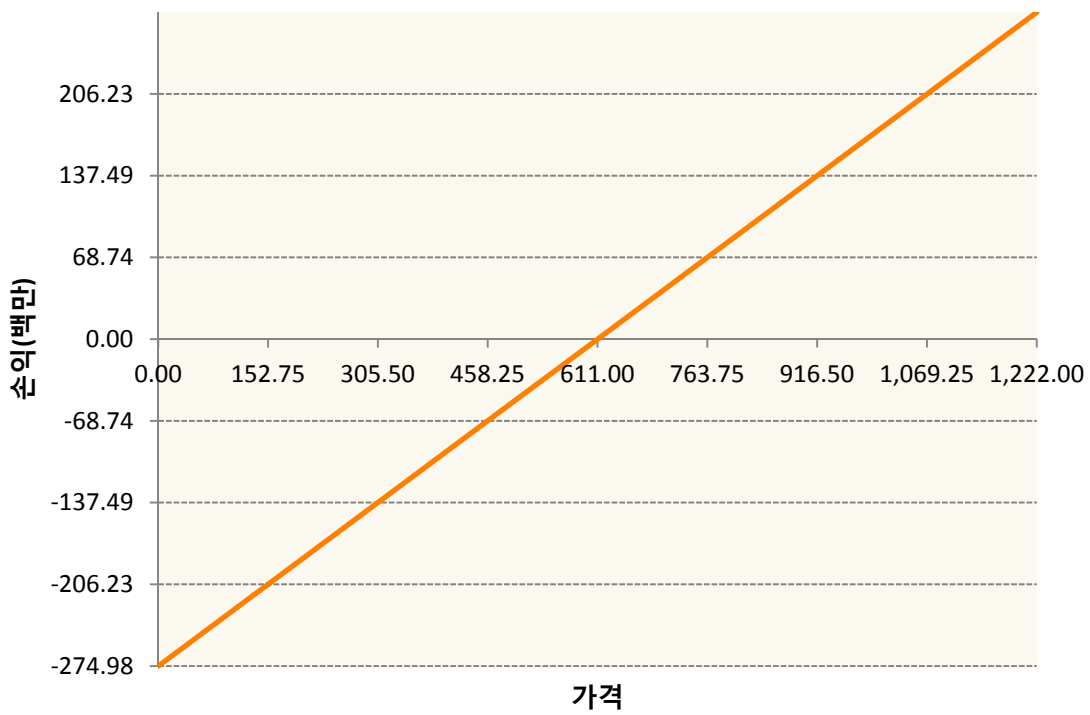




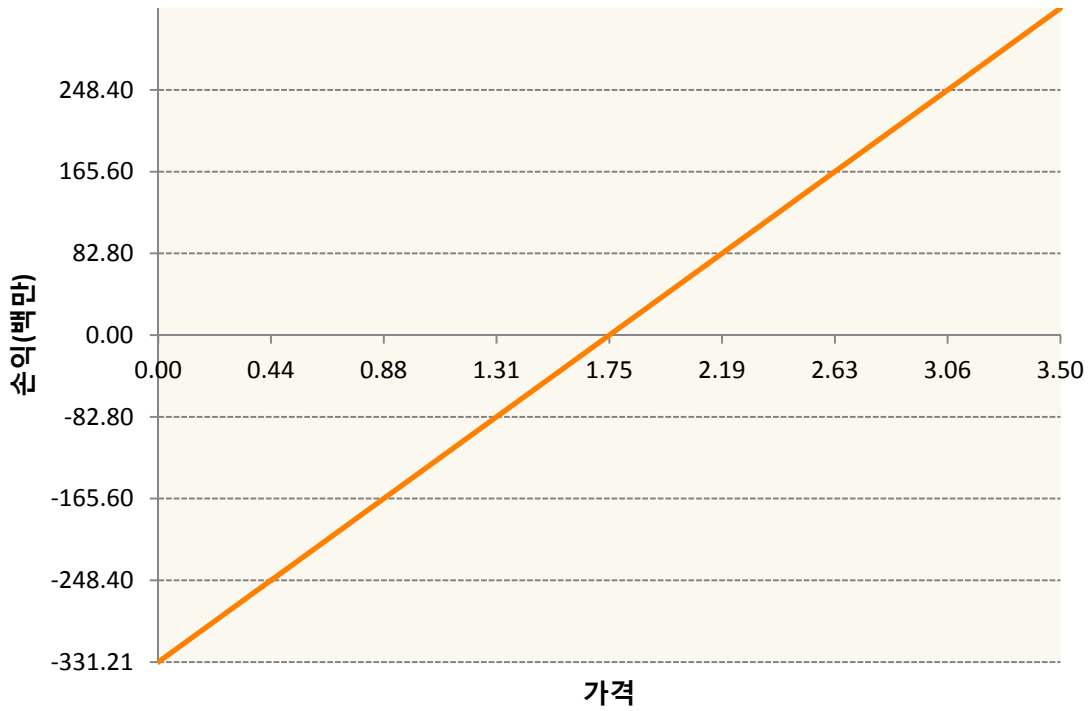
NGK19-NATURAL GAS FUTR May19



QSK9-Low Su Gasoil G May19



XBK9-GASOLINE RBOB FUT May19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

CLK9	WTI CRUDE FUTURE May19	51
COK9	BRENT CRUDE FUTR May19	59
HOK9	NY Harb ULSD Fut May19	15
KR4175P300	2019-03 달러선물	22
NGK19	NATURAL GAS FUTR May19	56
QSK9	Low Su Gasoil G May19	22
XBK9	GASOLINE RBOB FUT May19	26

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

(단위:백만원)

436

공시일	2019-02-19
기준일	2019-02-18

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

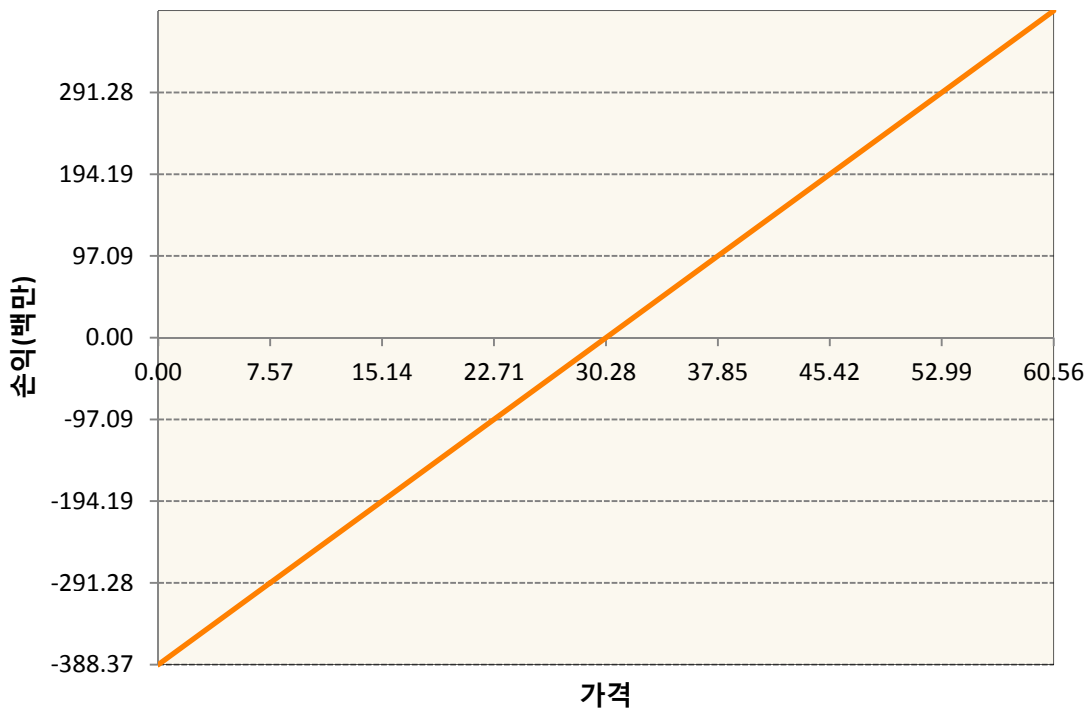
1. 계약금액

(단위:백만원)

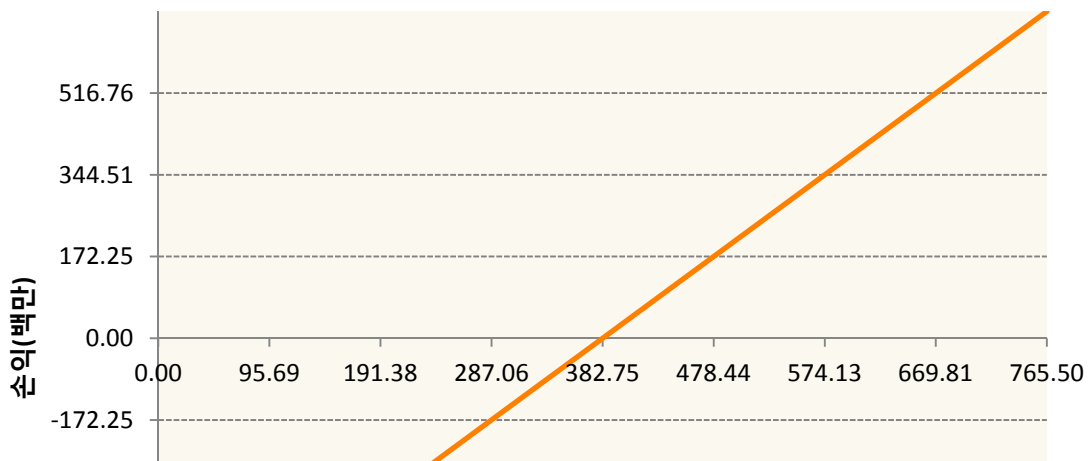
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,560	79	3,482	

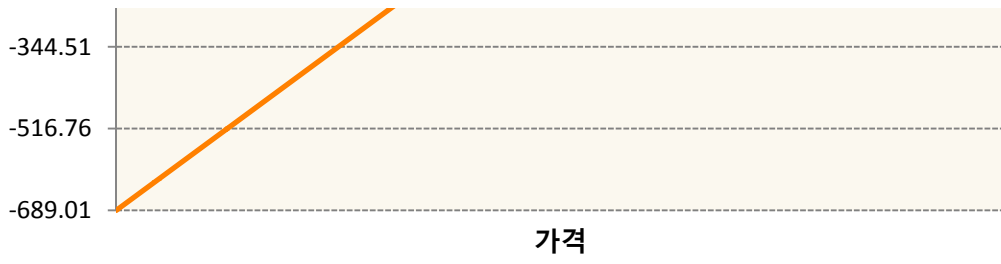
2. 만기시점의 손익구조

BOK9-SOYBEAN OIL FUTR May19

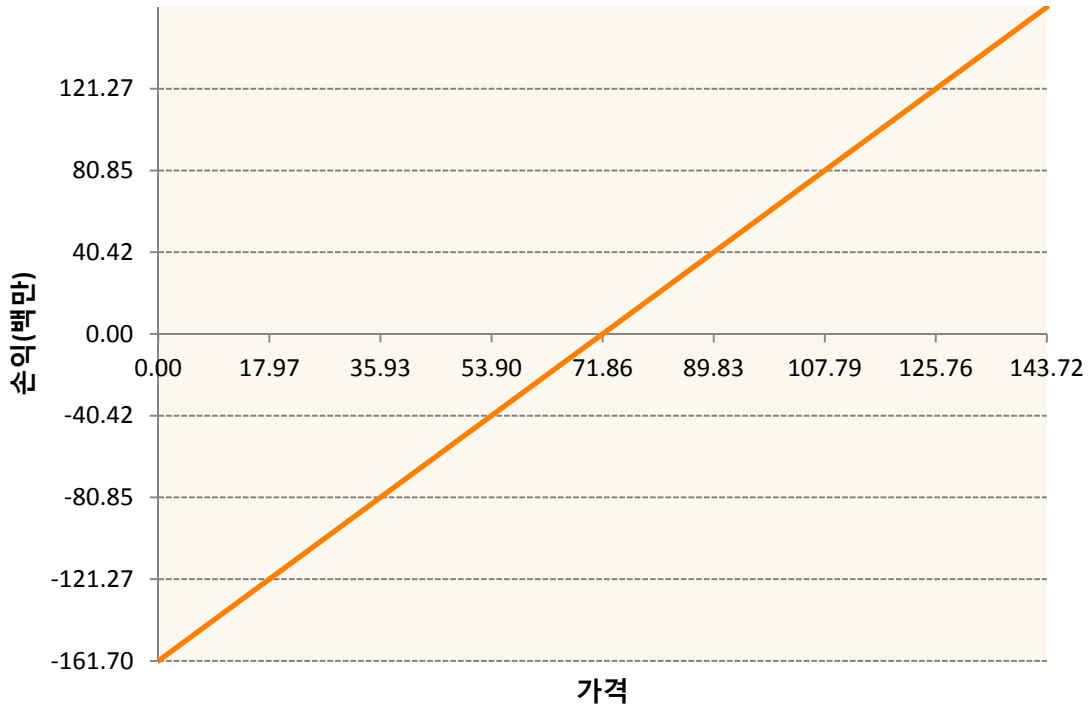


CK9-CORN FUTURE May19

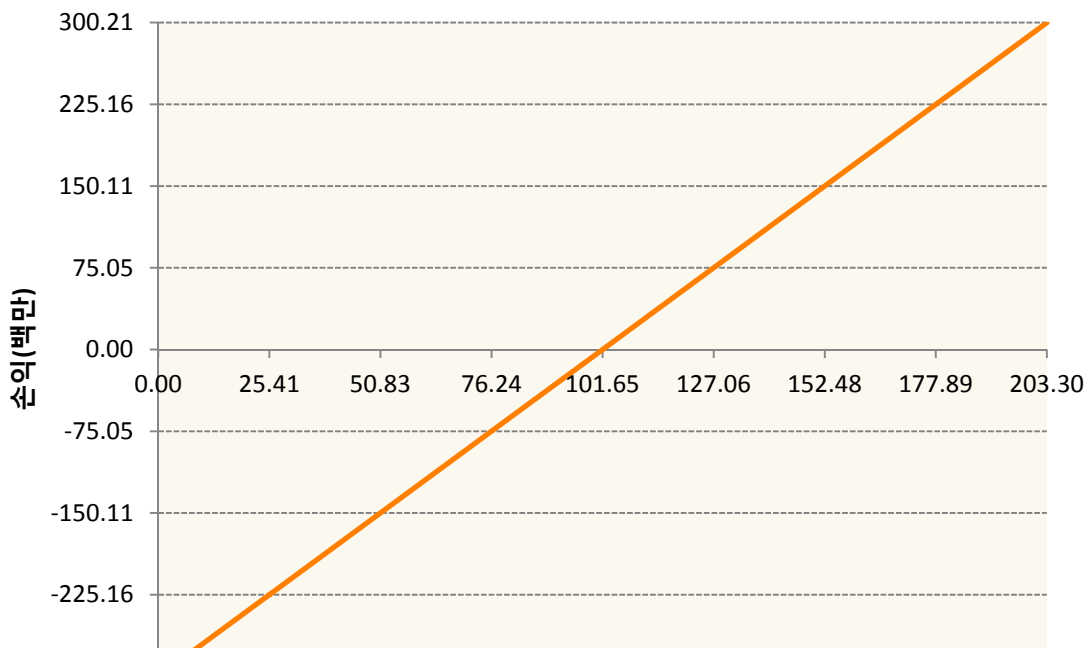


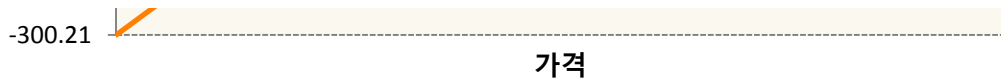


CTK9-COTTON NO.2 FUTR May19

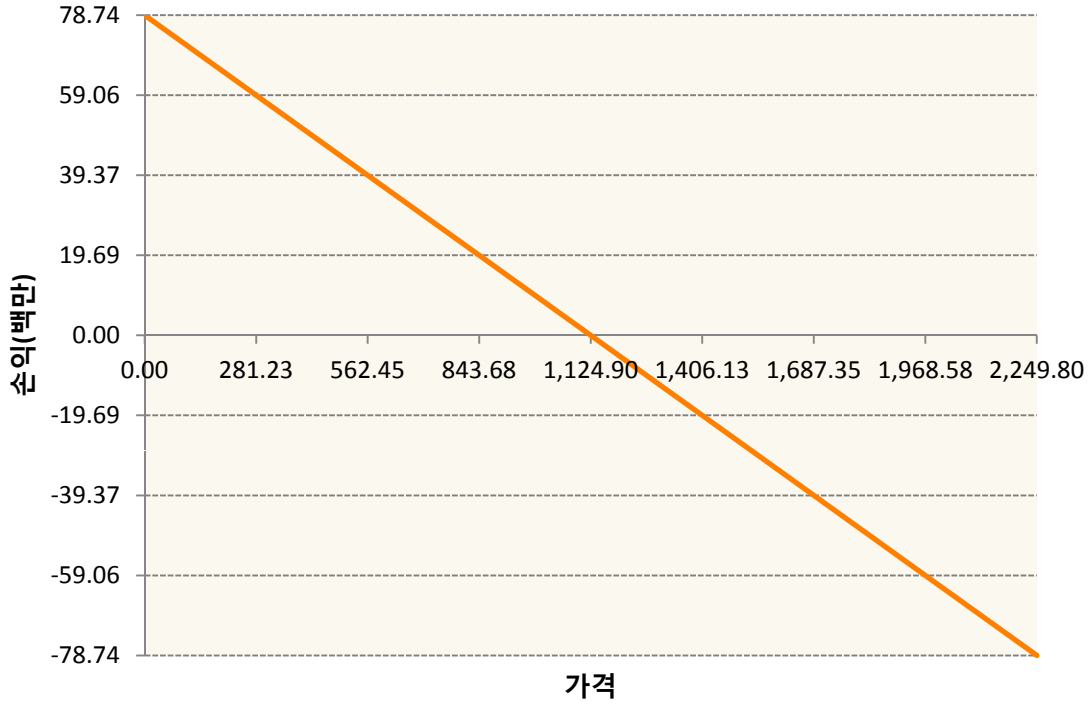


KCK9-COFFEE 'C' FUTURE May19

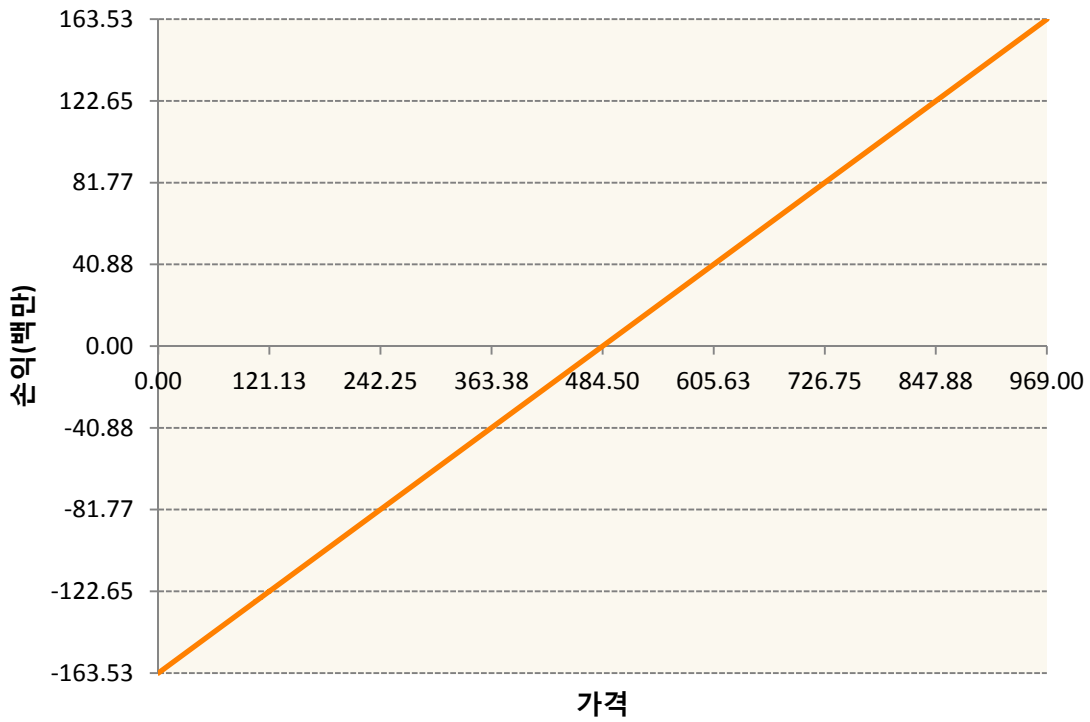




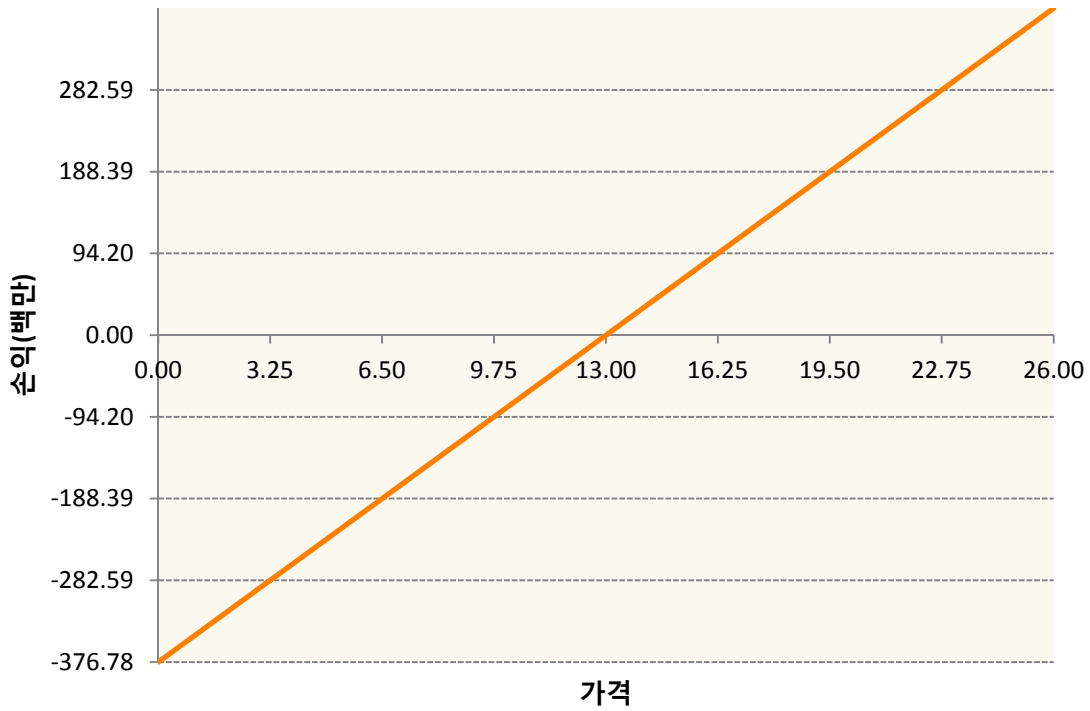
KR4175P30001-2019-03 달러선물



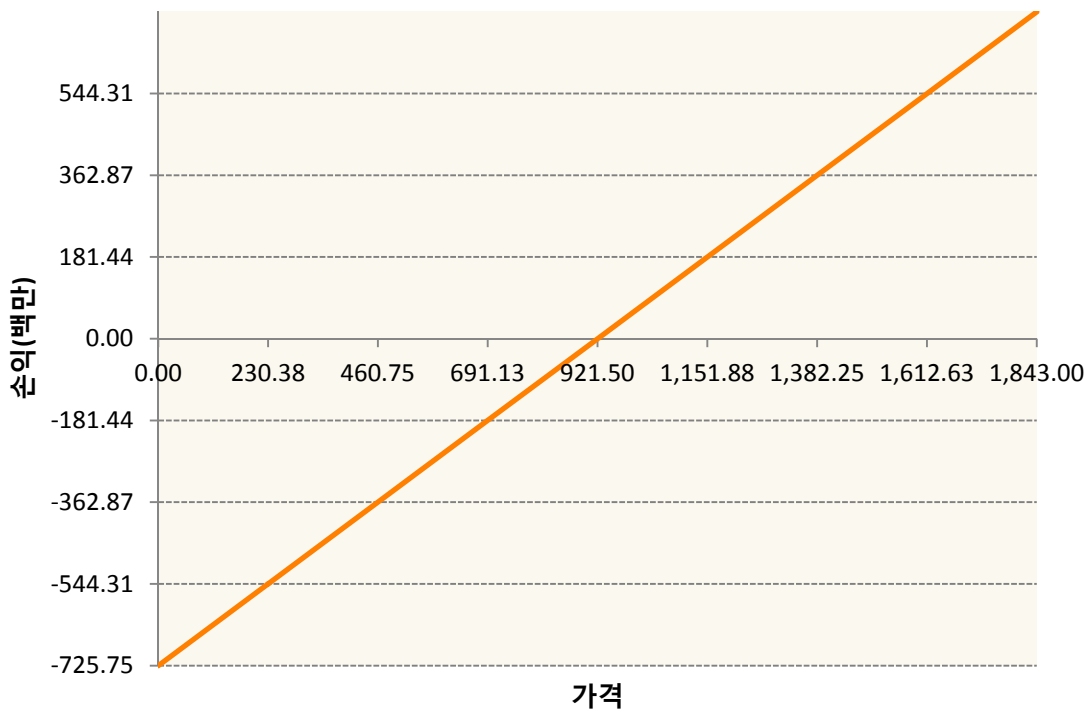
KWK9-KC HRW WHEAT FUT May19



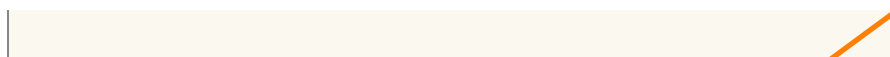
SBK9-SUGAR #11 (WORLD) May19

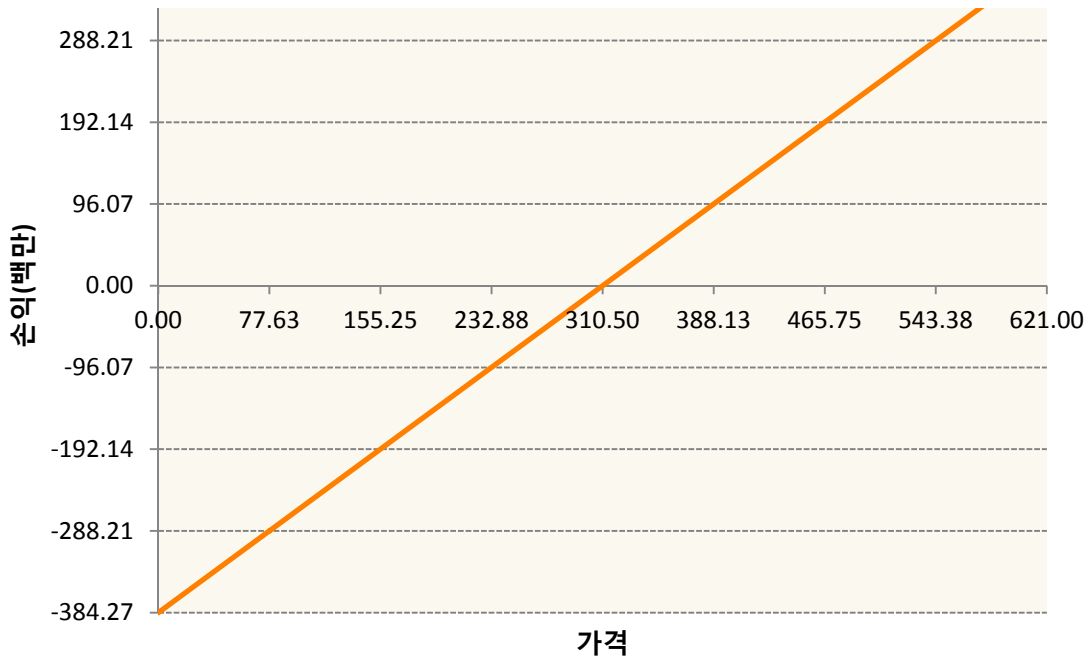


SK9-SOYBEAN FUTURE May19

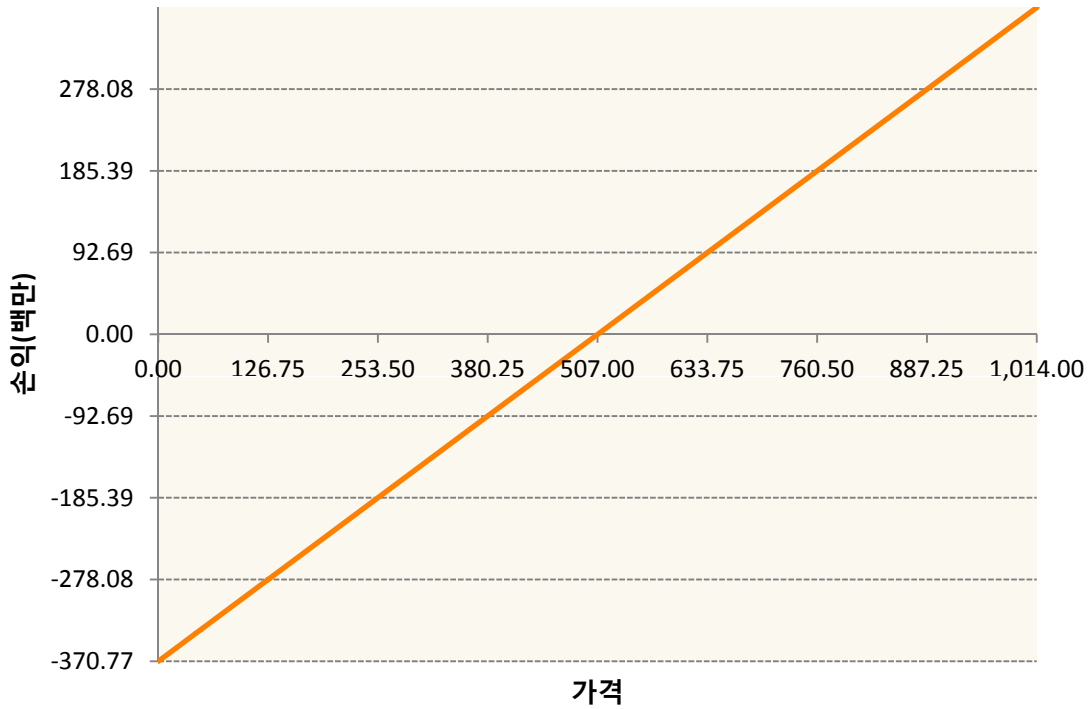


SMK9-SOYBEAN MEAL FUTR May19





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	30
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)

289