

공시일	2019-02-20
기준일	2019-02-19

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)

99

공시일	2019-02-20
기준일	2019-02-19

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

1,103

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

635

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-02-20
기준일	2019-02-19

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	289
SWCSI50000 신한CSI500미래S190129	86

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

557

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-02-20
기준일	2019-02-19

유로인덱스모(주식-파생형)

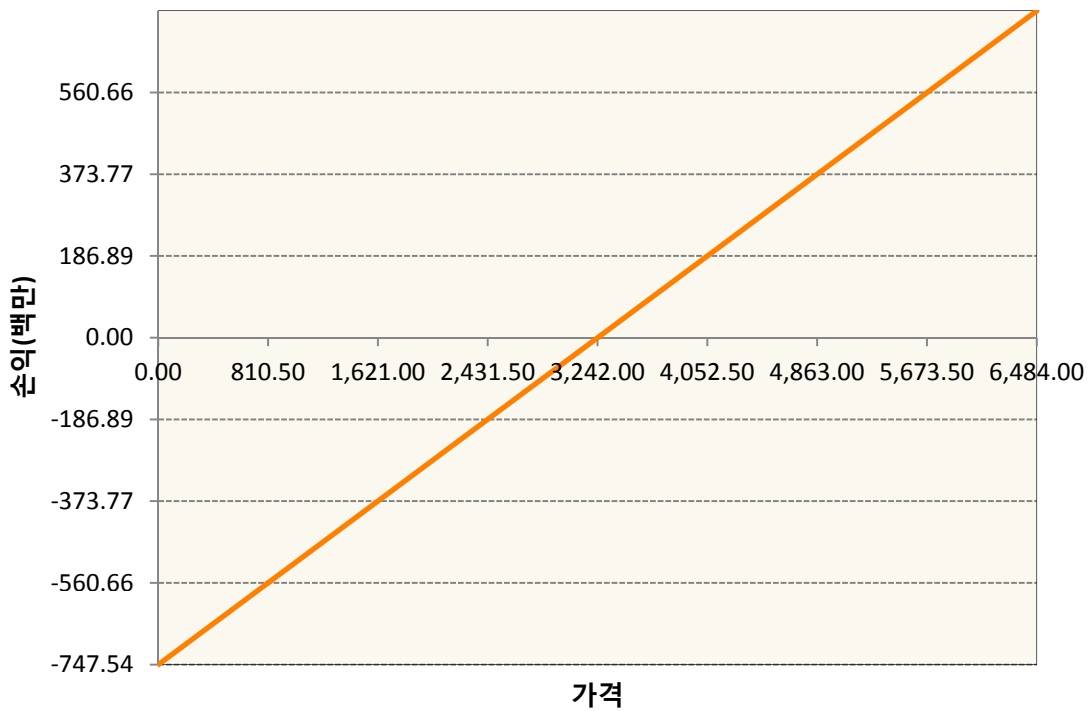
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	748	0	748	

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	2019-02-20
기준일	2019-02-19

차이나인덱스모(주식-파생형)

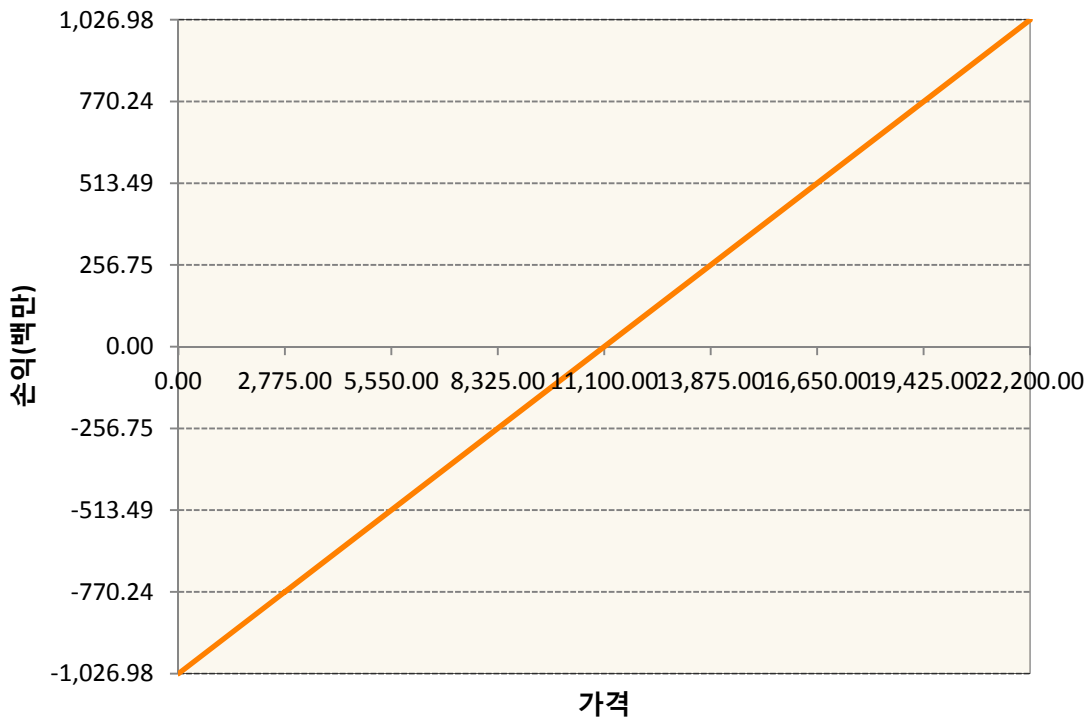
1. 계약금액

(단위:백만원)

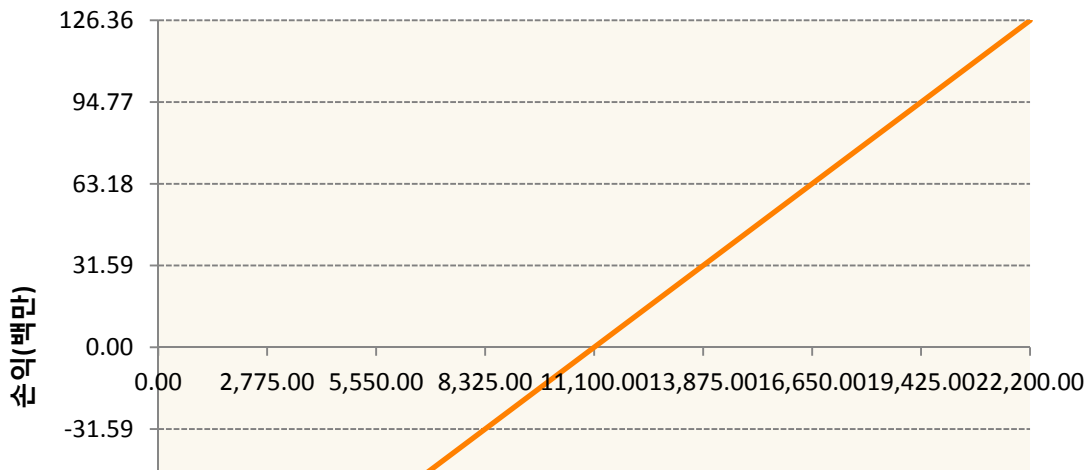
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,153	0	1,153	장내

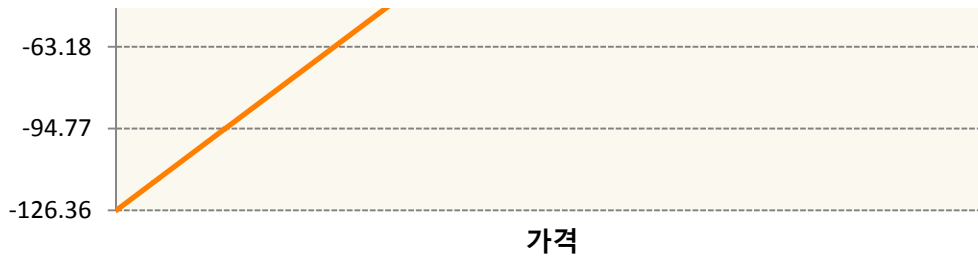
2. 만기시점의 손익구조

HCG9-HSCEI Futures Feb19



MHCG9-MINI H-SHR IDX FU Feb19





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

HCG9	HSCEI Futures Feb19	82
MHCG9	MINI H-SHR IDX FU Feb19	10

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

94

공시일	2019-02-20
기준일	2019-02-19

커버드콜모(주식혼합-파생형)

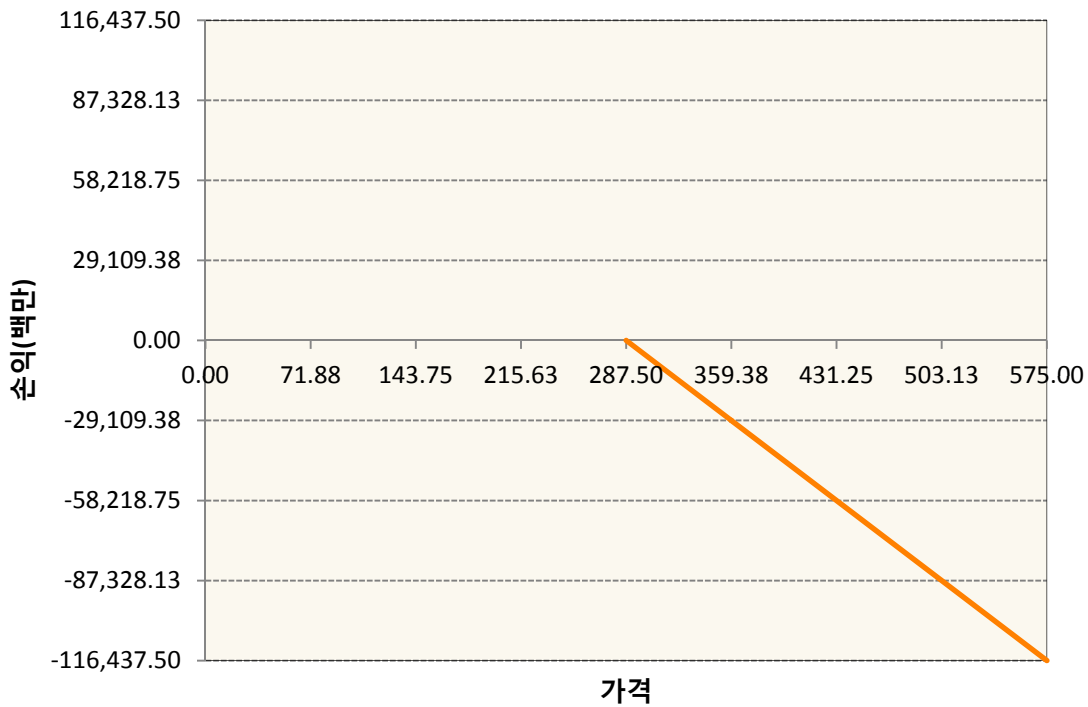
1. 계약금액

(단위:백만원)

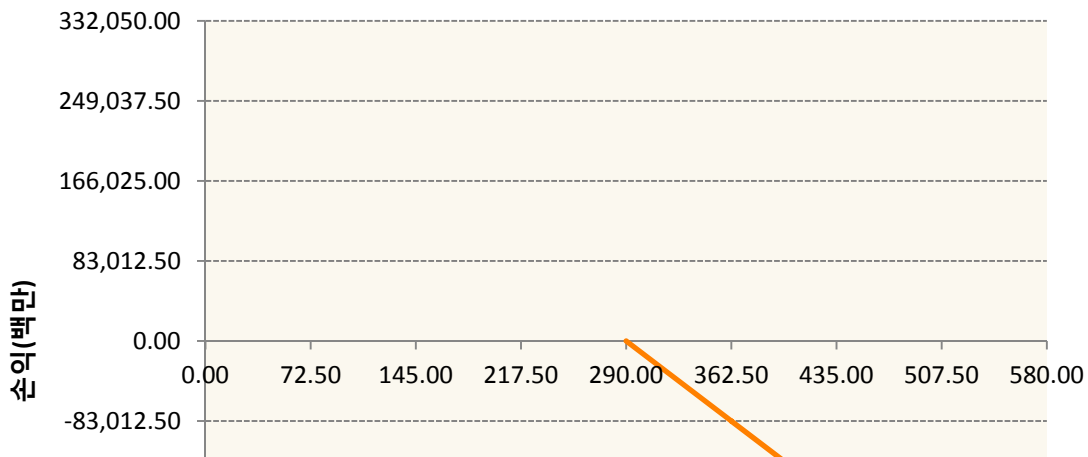
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	700,050	-700,050	장내

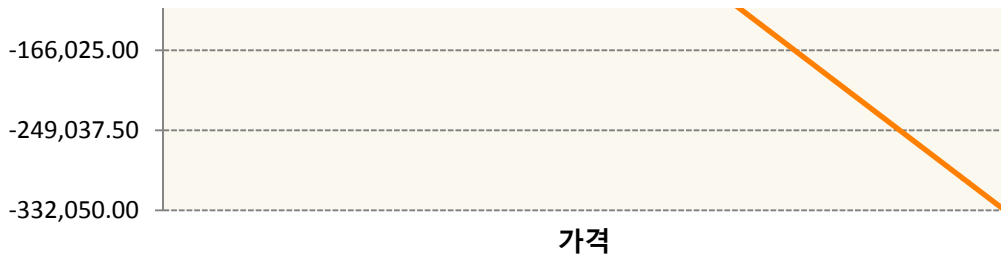
2. 만기시점의 손익구조

KR4201P32878-2019-03 콜287.5

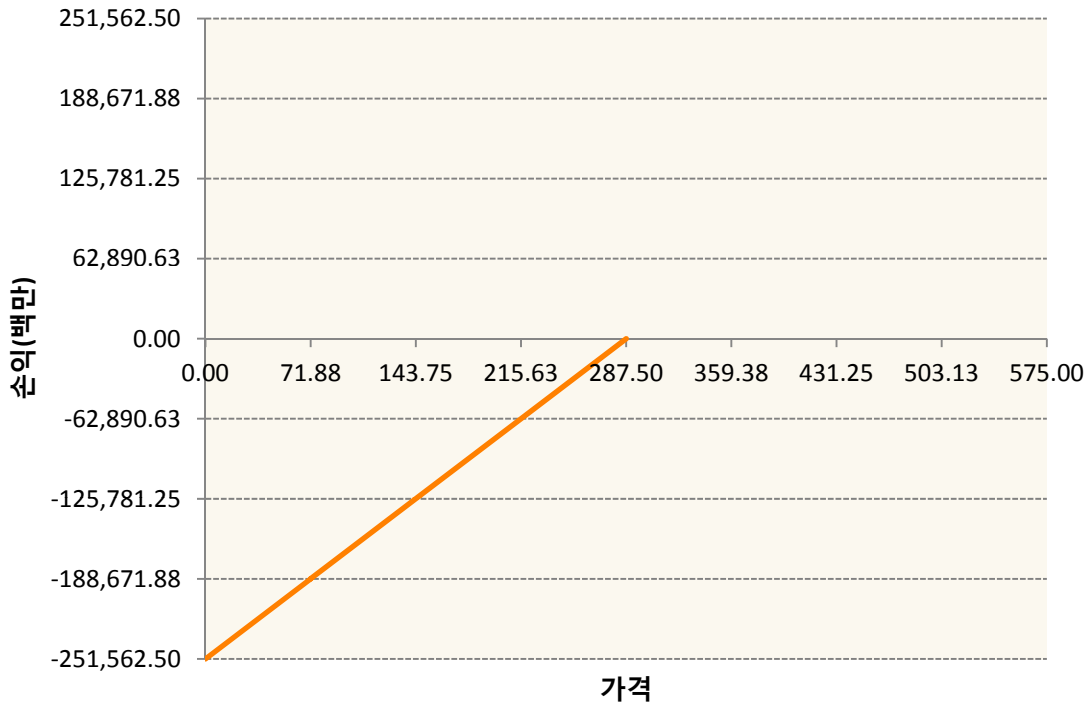


KR4201P32902-2019-03 콜290





KR4301P32876-2019-03 풋287.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201P32878		2019-03 콜287.5					6,760
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	2,453	2,404	2,339	2,258	2,163	2,054	1,933
-5.33%	2,267	2,153	2,022	1,878	1,720	1,553	1,377
-2.67%	1,767	1,573	1,370	1,160	945	726	503
0%	744	497	249	0	-249	-498	-748
2.67%	-921	-1,162	-1,406	-1,651	-1,898	-2,146	-2,394
5.33%	-3,181	-3,365	-3,560	-3,764	-3,975	-4,193	-4,416
8.00%	-5,865	-5,975	-6,104	-6,250	-6,409	-6,579	-6,760
KR4201P32902		2019-03 콜290					18,072
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	5,841	5,740	5,597	5,412	5,185	4,920	4,620

-5.33%	5,473	5,214	4,905	4,551	4,159	3,733	3,278
-2.67%	4,401	3,918	3,401	2,856	2,290	1,706	1,107
0%	2,037	1,365	685	0	-689	-1,382	-2,078
2.67%	-2,067	-2,780	-3,496	-4,212	-4,930	-5,648	-6,367
5.33%	-7,935	-8,524	-9,137	-9,768	-10,414	-11,071	-11,738
8.00%	-15,172	-15,558	-15,992	-16,467	-16,975	-17,512	-18,072
KR4301P32876 2019-03 풋287.5							17,331
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-17,233	-17,235	-17,240	-17,251	-17,268	-17,295	-17,331
-5.33%	-10,618	-10,647	-10,691	-10,752	-10,830	-10,925	-11,035
-2.67%	-4,271	-4,416	-4,581	-4,764	-4,962	-5,173	-5,395
0%	894	598	300	0	-302	-605	-909
2.67%	3,813	3,547	3,273	2,993	2,707	2,418	2,125
5.33%	4,789	4,678	4,543	4,387	4,213	4,023	3,820
8.00%	4,968	4,945	4,908	4,854	4,783	4,696	4,591

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

(단위:백만원)

42,648

공시일	2019-02-20
기준일	2019-02-19

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

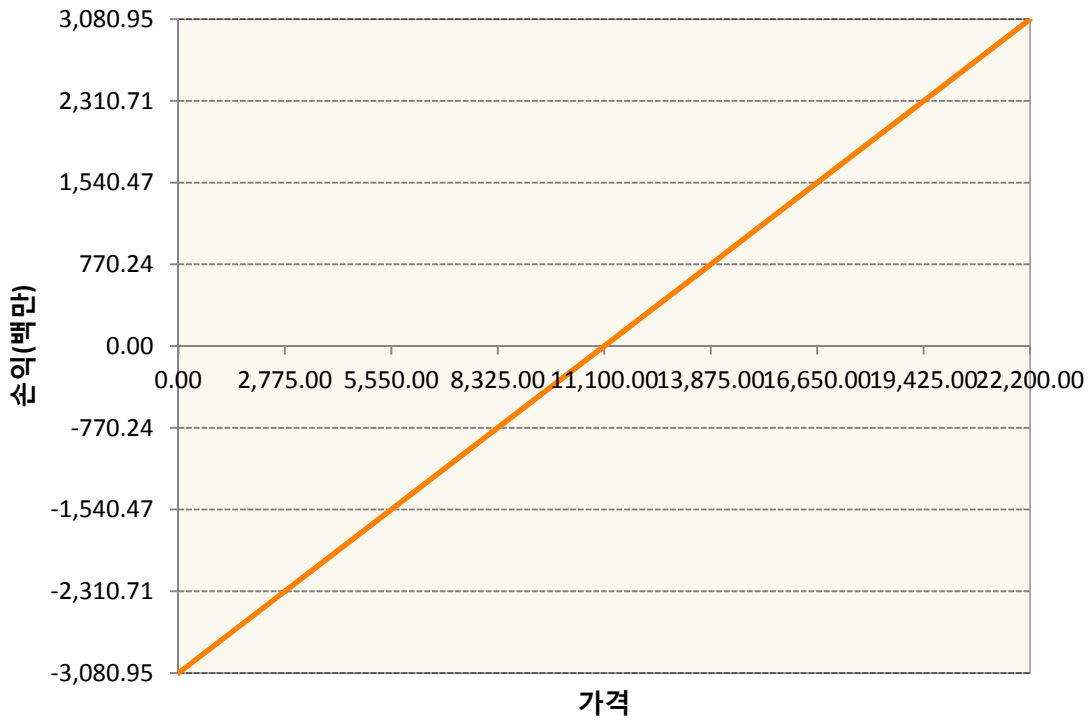
1. 계약금액

(단위:백만원)

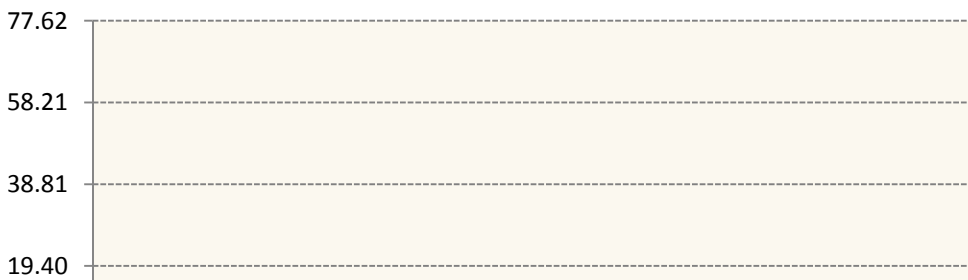
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	3,081	0	3,081	장내
누계	유가증권	옵션	0	7,362	-7,362	장내
누계	통화	선도	0	2,731	-2,731	장외

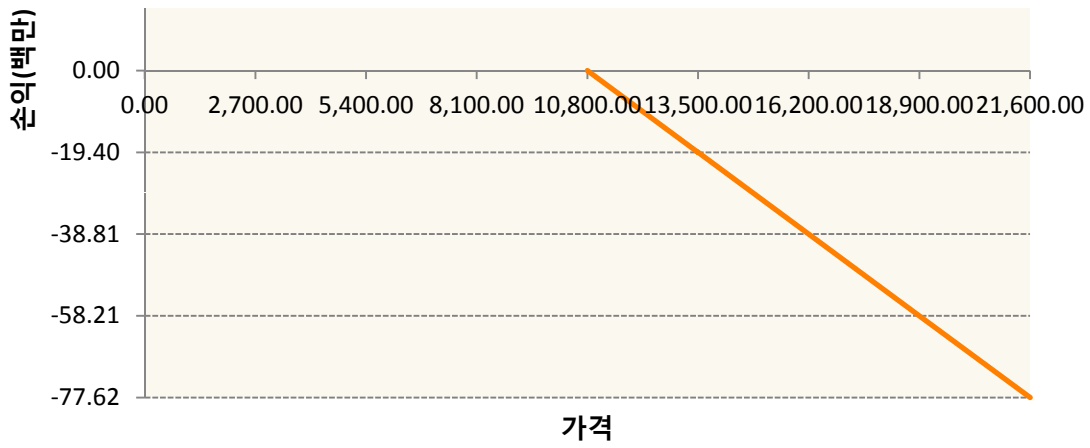
2. 만기시점의 손익구조

HCG9-HSCEI Futures Feb19

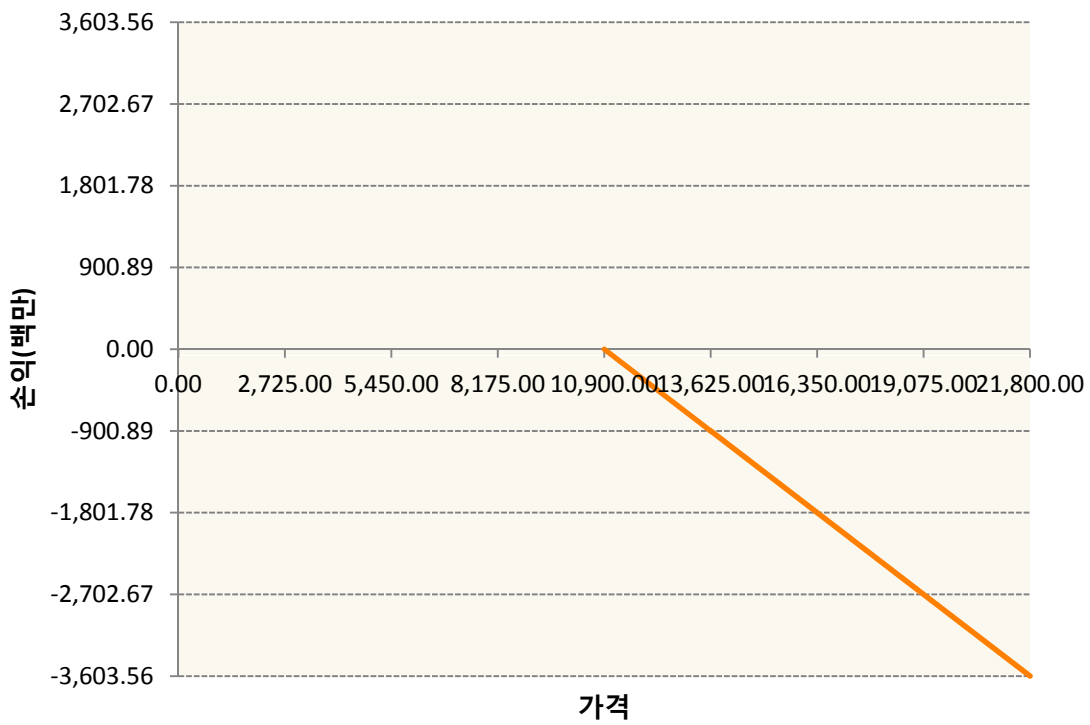


OHHIG9-C108-HSCEI

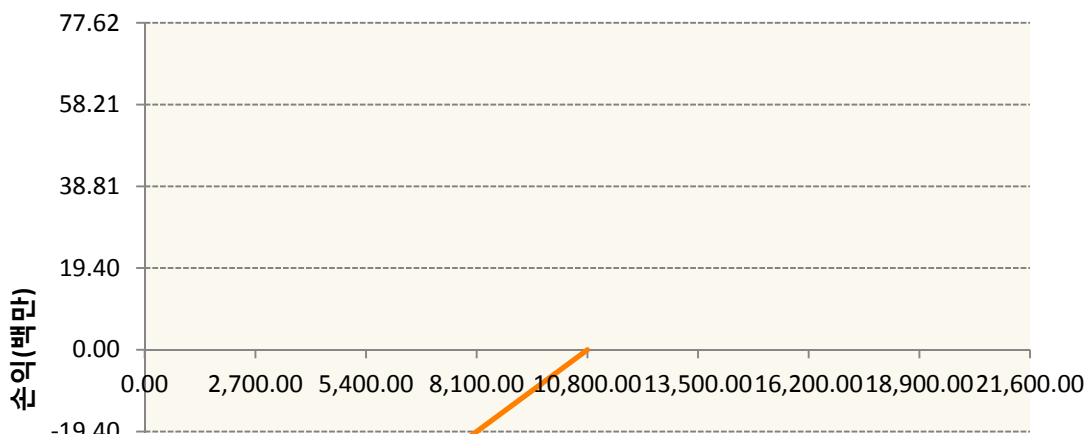


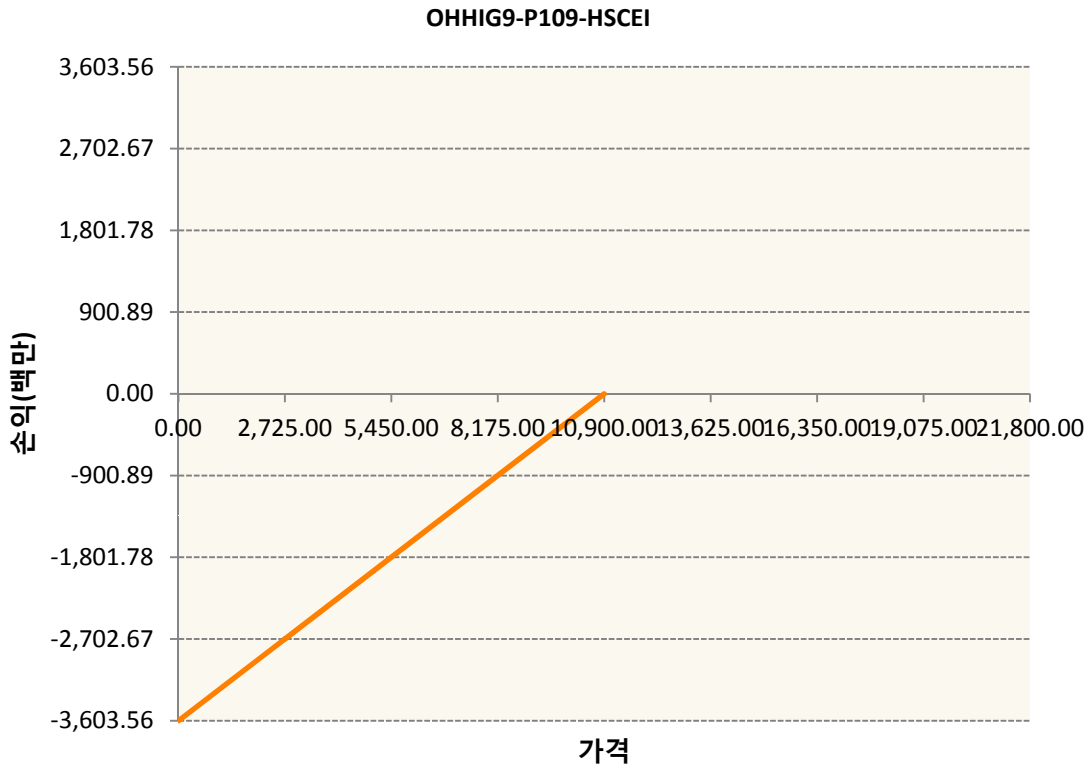
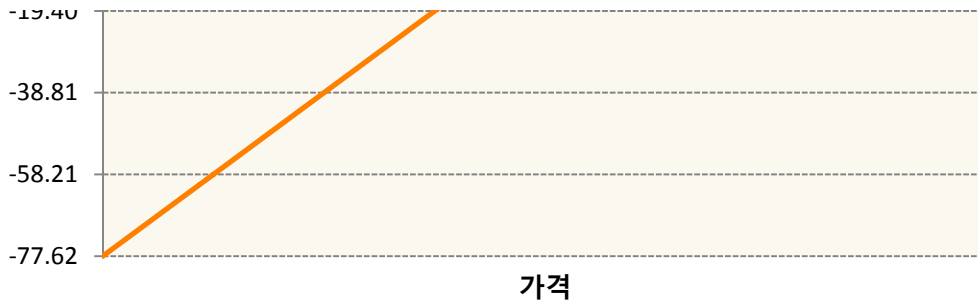


OHHIG9-C109-HSCEI



OHHIG9-P108-HSCEI





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

FX21018Z00 KRW/HKD 11-03-19E	218
HCG9 HSCEI Futures Feb19	246
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)

935

공시일	2019-02-20
기준일	2019-02-19

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

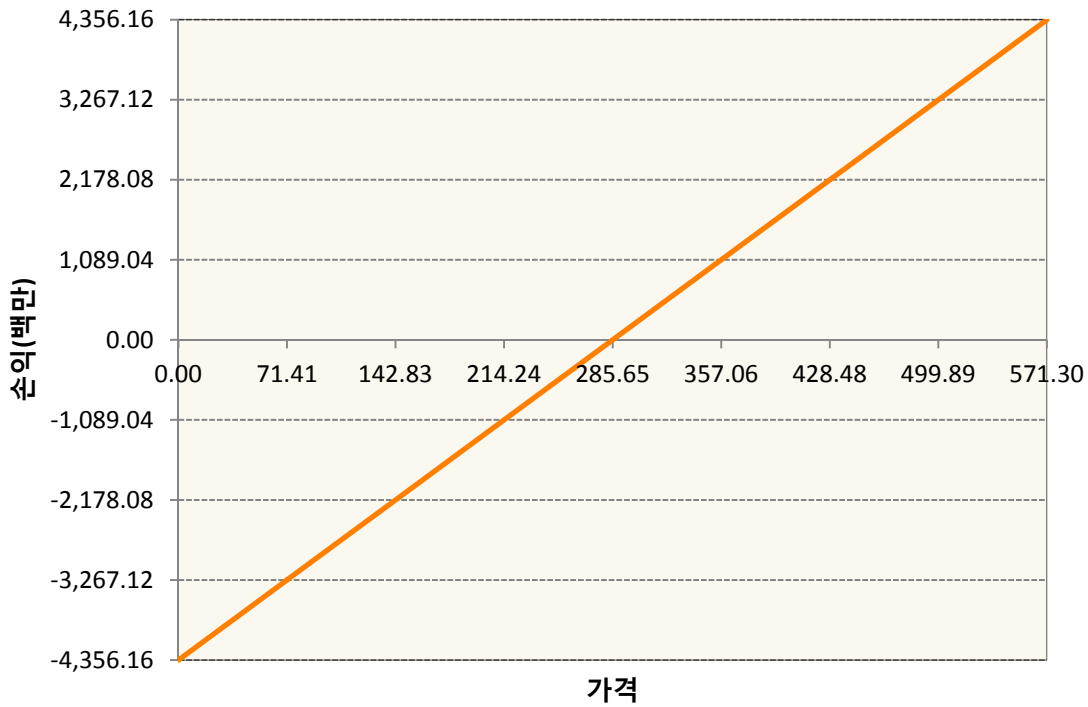
1. 계약금액

(단위:백만원)

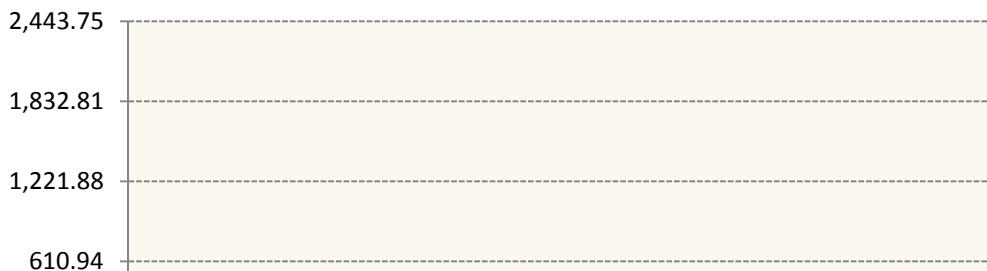
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	4,356	0	4,356	장내
누계	유가증권	스왑	31,836	0	31,836	장외
누계	유가증권	옵션	0	30,310	-30,310	장내

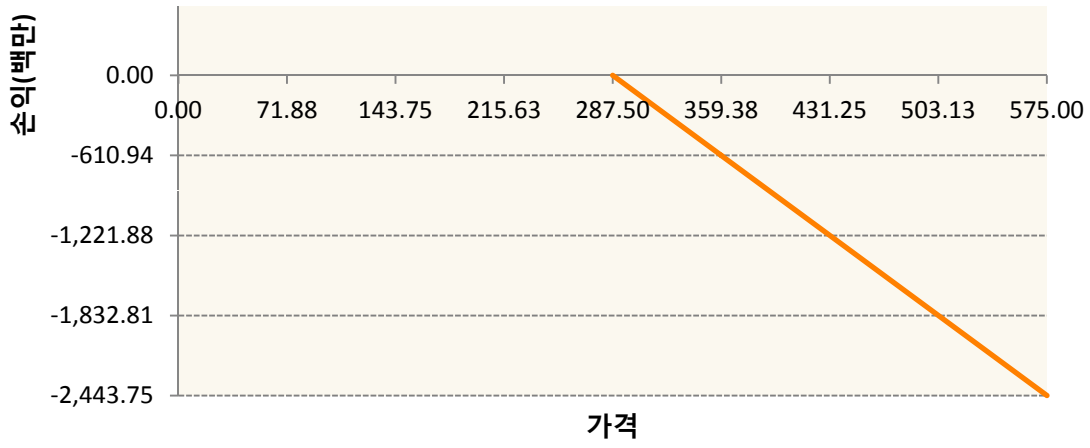
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P30007-2019-03 코스피200지수선물

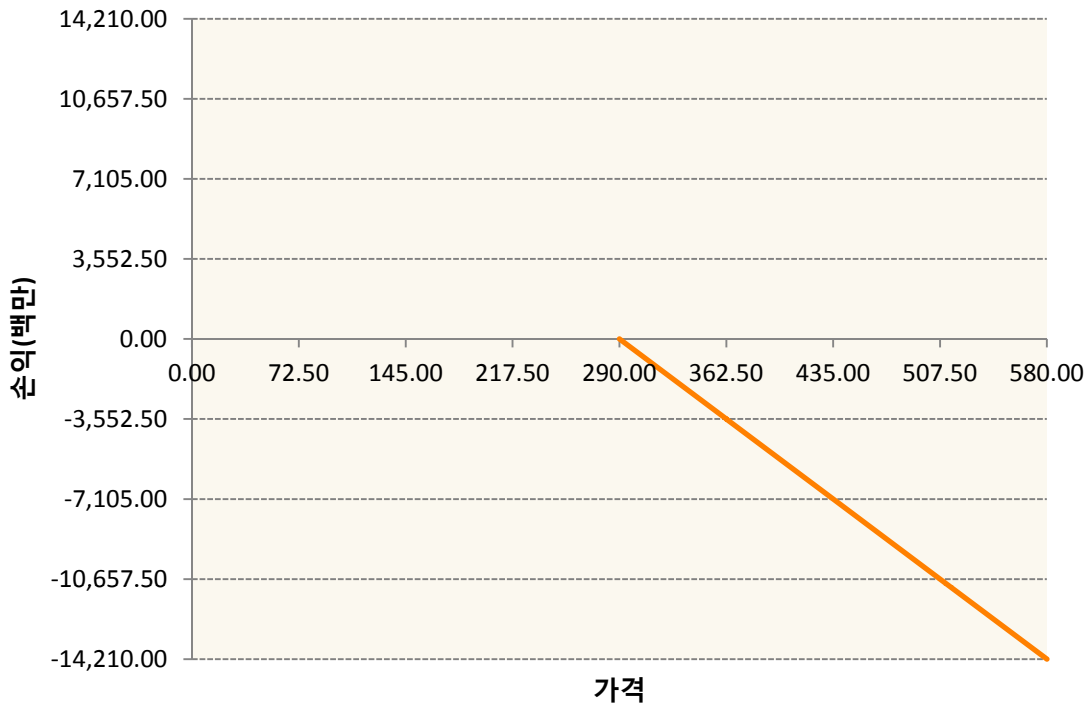


KR4201P32878-2019-03 콜287.5

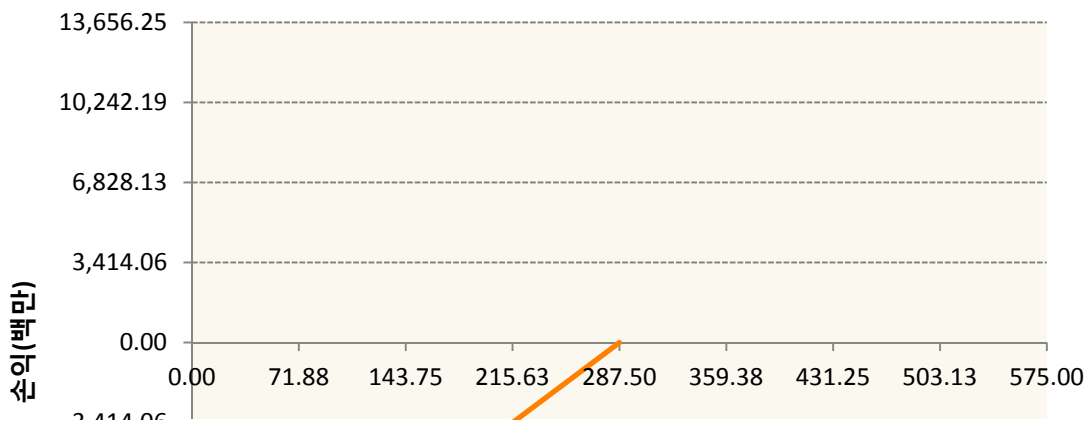


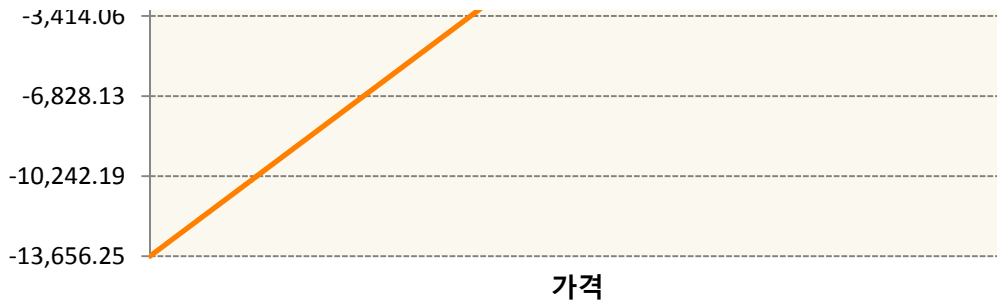


KR4201P32902-2019-03 콜290



KR4301P32876-2019-03 풋287.5





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11		UBCSFXC1 INDEX_14						2,670
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-2,670	-2,670	-2,670	-2,670	-2,670	-2,670	-2,670	
-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%	2,670	2,670	2,670	2,670	2,670	2,670	2,670	
KR4101P30007		2019-03 코스피200지수선물						348
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-348	-348	-348	-348	-348	-348	-348	
-5.33%	-232	-232	-232	-232	-232	-232	-232	
-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%	232	232	232	232	232	232	232	
8.00%	348	348	348	348	348	348	348	
KR4201P32878		2019-03 콜287.5						142
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	51	50	49	47	45	43	41	
-5.33%	48	45	42	39	36	33	29	
-2.67%	37	33	29	24	20	15	11	
0%	16	10	5	0	-5	-10	-16	
2.67%	-19	-24	-30	-35	-40	-45	-50	
5.33%	-67	-71	-75	-79	-83	-88	-93	
8.00%	-123	-125	-128	-131	-135	-138	-142	
KR4201P32902		2019-03 콜290						773
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	

-8.00%	250	246	240	232	222	211	198
-5.33%	234	223	210	195	178	160	140
-2.67%	188	168	146	122	98	73	47
0%	87	58	29	0	-30	-59	-89
2.67%	-88	-119	-150	-180	-211	-242	-272
5.33%	-340	-365	-391	-418	-446	-474	-502
8.00%	-649	-666	-684	-705	-726	-749	-773
KR4301P32876 2019-03 풋287.5							941
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-935	-936	-936	-936	-937	-939	-941
-5.33%	-576	-578	-580	-584	-588	-593	-599
-2.67%	-232	-240	-249	-259	-269	-281	-293
0%	49	32	16	0	-16	-33	-49
2.67%	207	193	178	162	147	131	115
5.33%	260	254	247	238	229	218	207
8.00%	270	268	266	263	260	255	249

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

(단위:백만원)

4,881

공시일	2019-02-20
기준일	2019-02-19

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

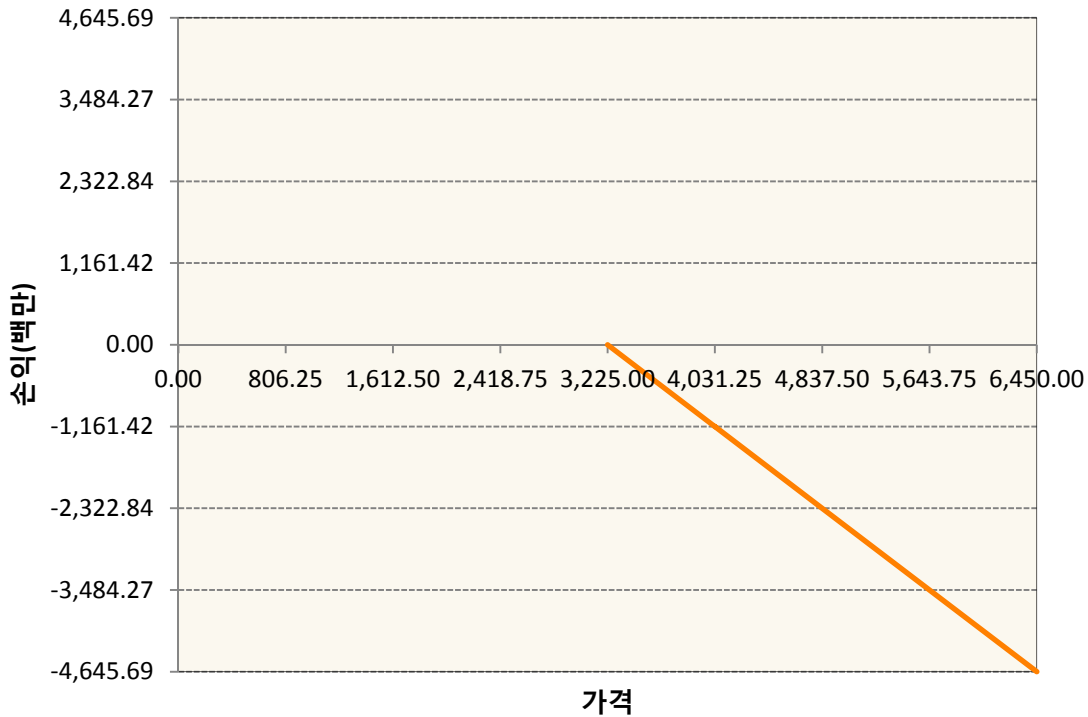
1. 계약금액

(단위:백만원)

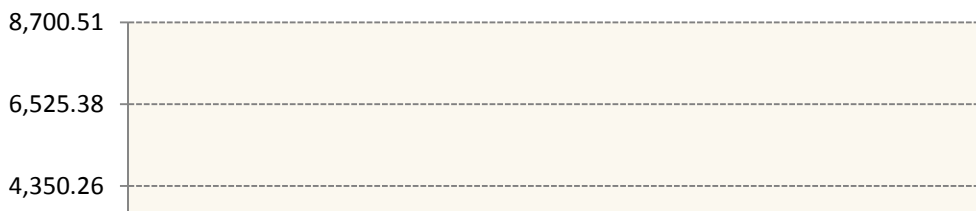
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	7,015	0	7,015	
누계	유가증권	스왑	60,185	0	60,185	장외
누계	유가증권	옵션	0	26,692	-26,692	장내
누계	통화	선도	0	15,298	-15,298	장외

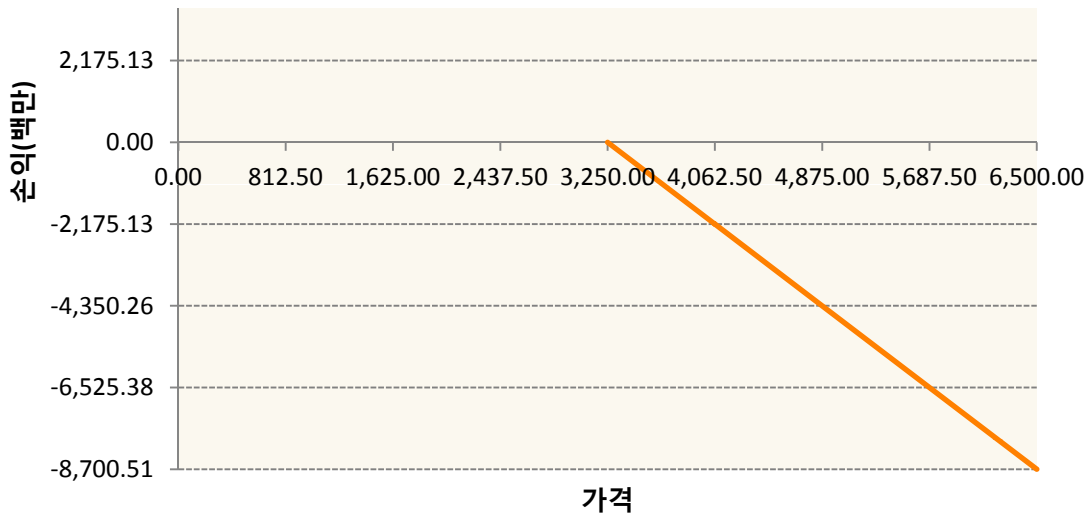
2. 만기시점의 손익구조

OESXH9-C3225-EURO STOXX 50

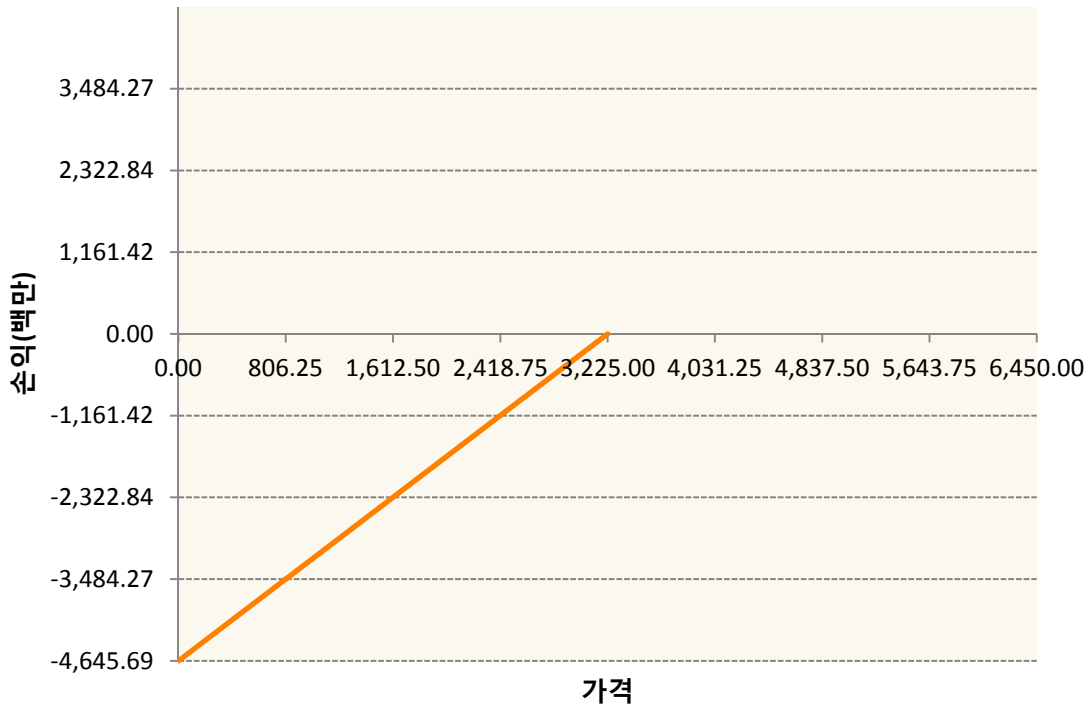


OESXH9-C3250-EURO STOXX 50

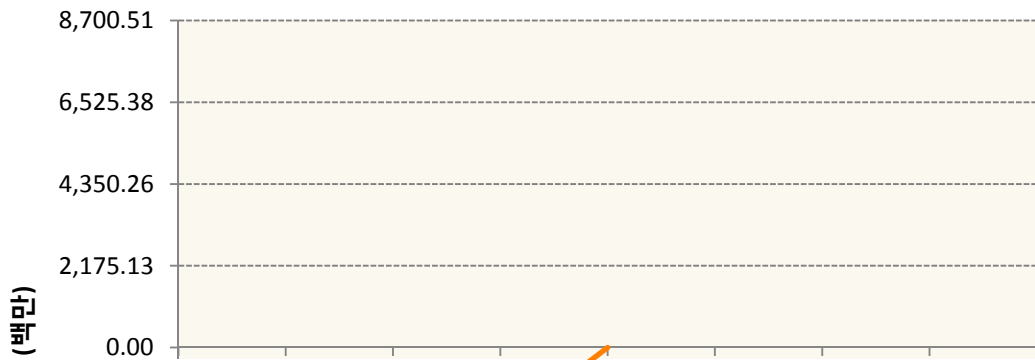


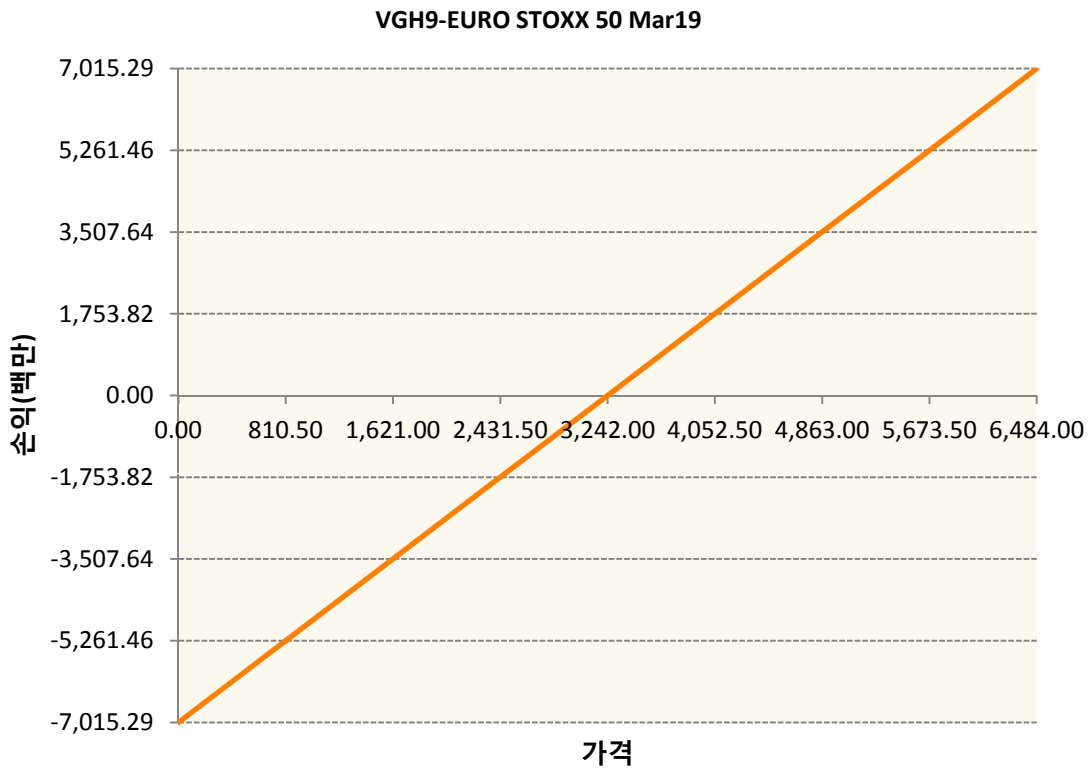
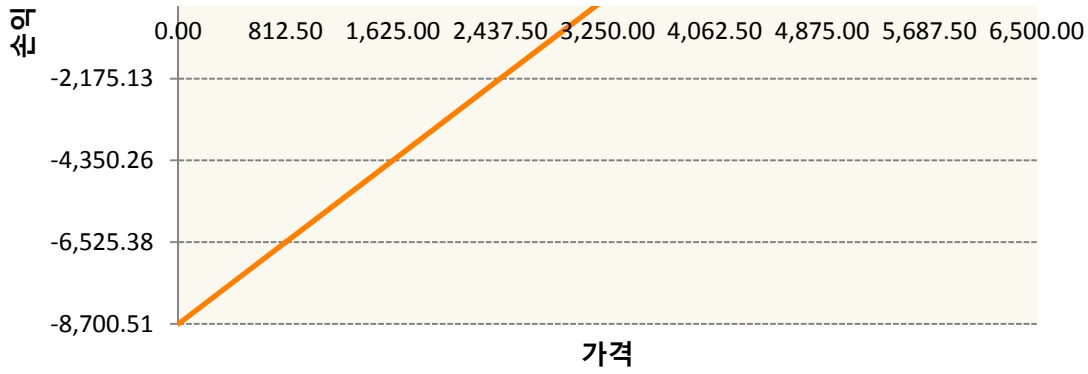


OESXH9-P3225-EURO STOXX 50



OESXH9-P3250-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY		76
FX21018X02 KRW/EUR 22-02-19E		408
FX21018Z03 KRW/EUR 22-03-19E		816
OESXH9-C32 EURO STOXX 50		372
OESXH9-C32 EURO STOXX 50		696
OESXH9-P32 EURO STOXX 50		372
OESXH9-P32 EURO STOXX 50		696
VGH9 EURO STOXX 50 Mar19		561

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

(단위:백만원)

2,640

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

(단위:백만원)

1,158

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

(단위:백만원)

99

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

(단위:백만원)

143

공시일	2019-02-20
기준일	2019-02-19

스마트KRX300인덱스목표전환형1호

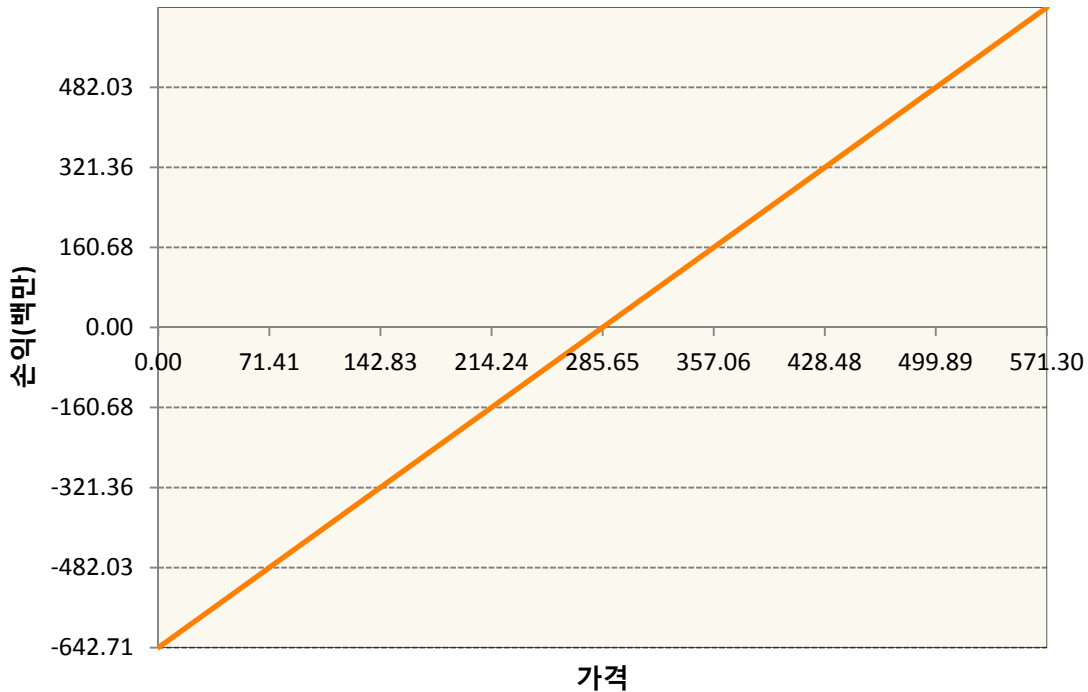
1. 계약금액

(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

가격	기초자산의 변동성						
	-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	2019-02-20
기준일	2019-02-19

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

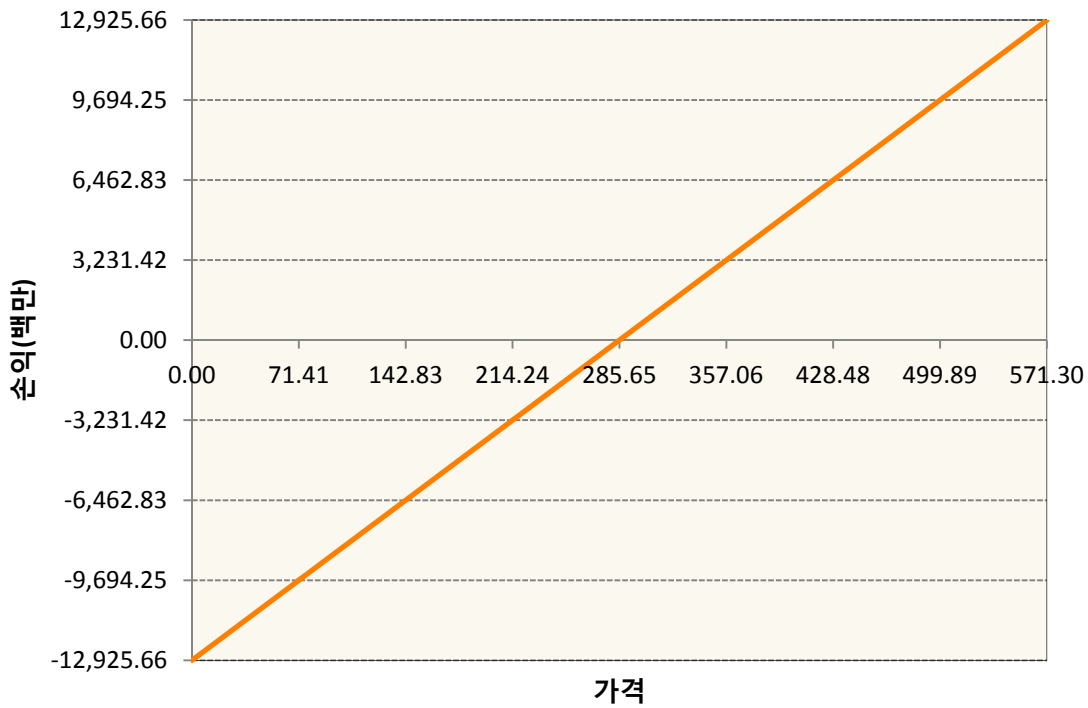
1. 계약금액

(단위:백만원)

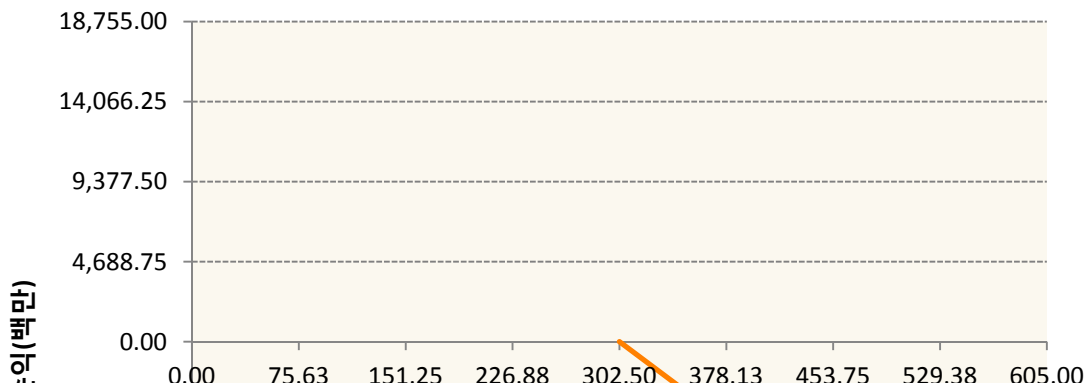
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	12,926	0	12,926	장내
누계	유가증권	옵션	2,165	24,931	-22,766	장내

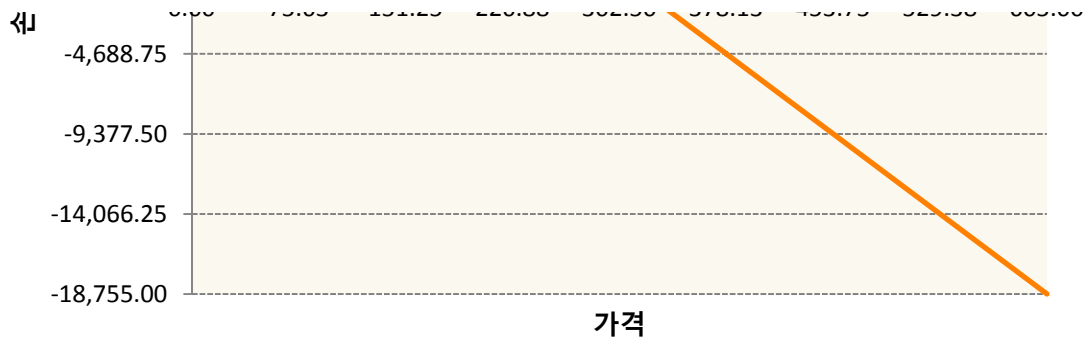
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P30007-2019-03 코스피200지수선물

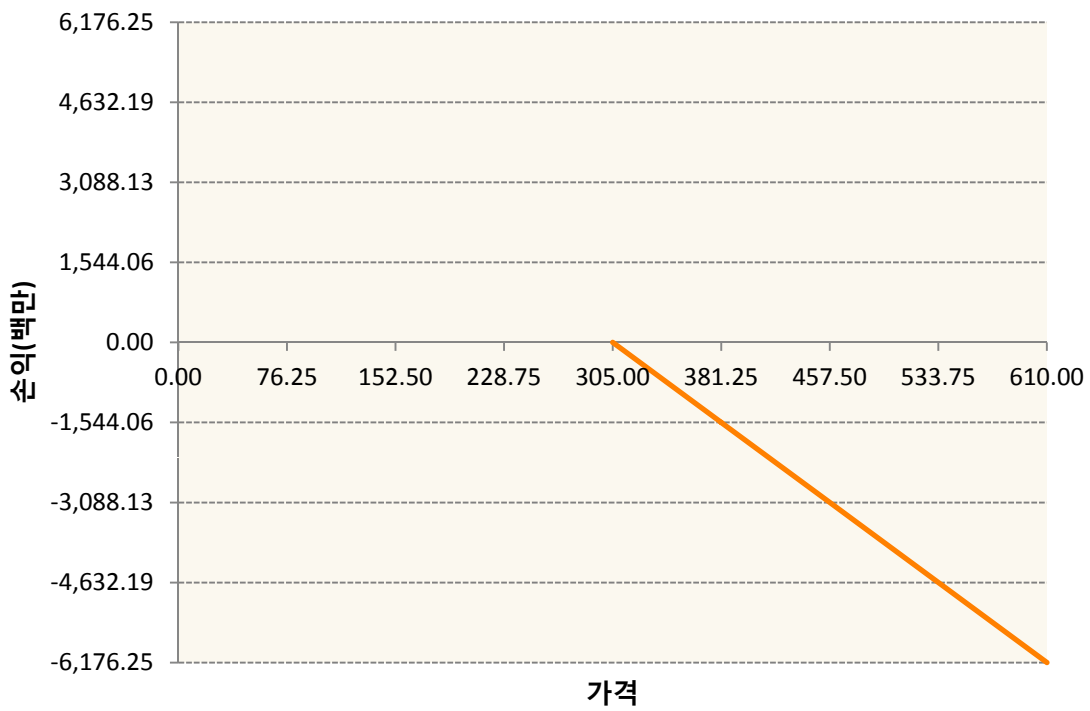


KR4201P33025-2019-03 콜302.5

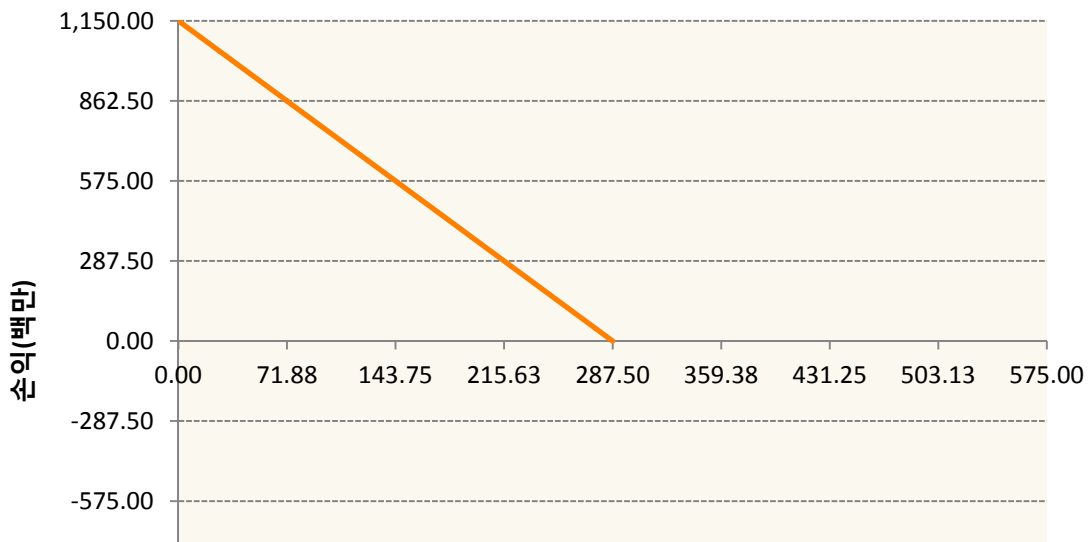


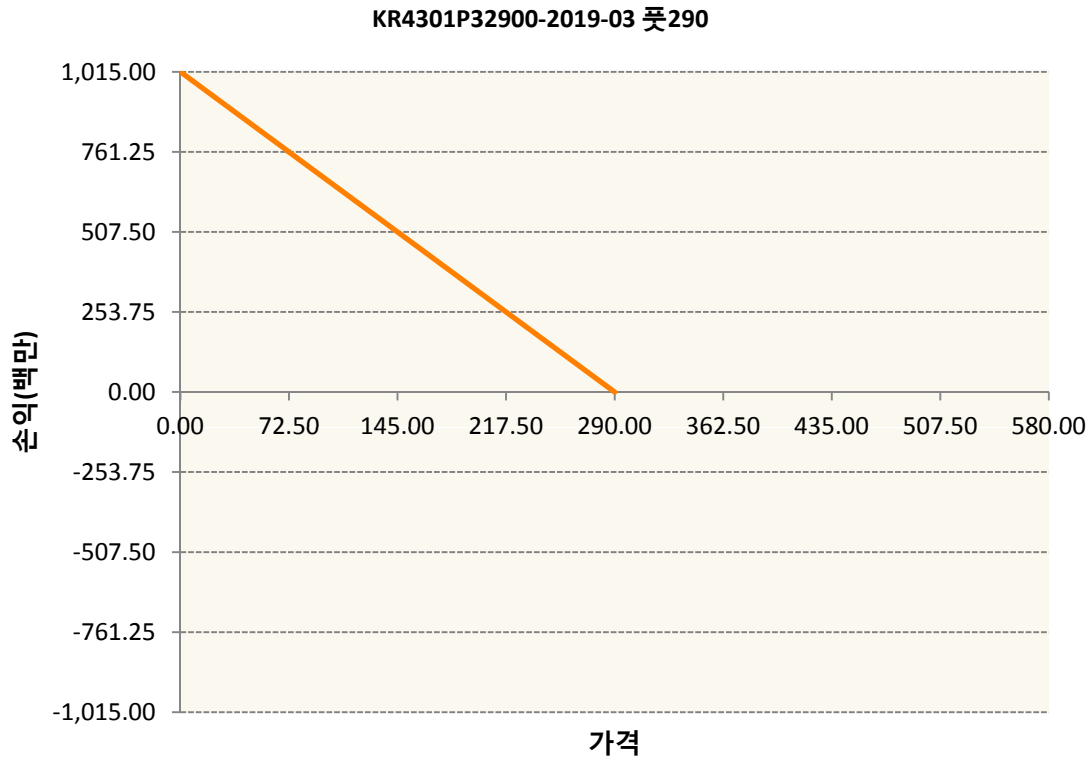
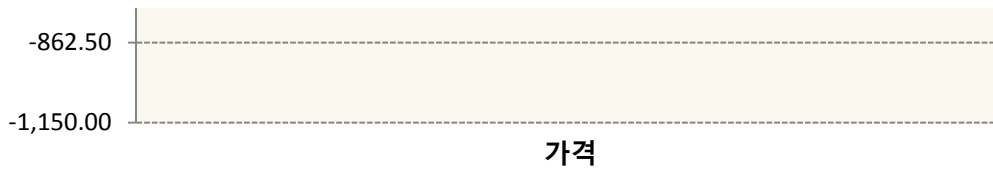


KR4201P33058-2019-03 콜305



KR4301P32876-2019-03 풋287.5





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101P30007		2019-03 코스피200지수선물						1,031
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-1,031	-1,031	-1,031	-1,031	-1,031	-1,031	-1,031	
-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%	1,031	1,031	1,031	1,031	1,031	1,031	1,031	
KR4201P33025		2019-03 콜302.5						673
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	115	114	112	109	105	100	92	
-5.33%	112	109	104	97	88	76	63	
-2.67%	102	92	80	65	48	29	8	

0%	68	48	25	0	-27	-55	-85
2.67%	-16	-49	-82	-117	-152	-188	-225
5.33%	-179	-219	-259	-299	-340	-380	-420
8.00%	-436	-475	-514	-553	-593	-633	-673
KR4201P33058 2019-03 콜305							200
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	30	30	29	28	27	26	24
-5.33%	29	28	27	25	23	20	16
-2.67%	27	25	21	17	13	7	1
0%	19	13	7	0	-8	-16	-25
2.67%	-2	-12	-22	-32	-43	-54	-66
5.33%	-46	-59	-72	-85	-98	-111	-124
8.00%	-120	-133	-147	-160	-173	-187	-200
KR4301P32876 2019-03 풋287.5							79
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	79	79	79	79	79	79	79
-5.33%	49	49	49	49	50	50	50
-2.67%	20	20	21	22	23	24	25
0%	-4	-3	-1	0	1	3	4
2.67%	-17	-16	-15	-14	-12	-11	-10
5.33%	-22	-21	-21	-20	-19	-18	-17
8.00%	-23	-23	-22	-22	-22	-21	-21
KR4301P32900 2019-03 풋290							72
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	72	72	72	72	72	72	72
-5.33%	45	46	46	46	46	46	47
-2.67%	20	20	20	21	22	22	23
0%	-3	-2	-1	0	1	2	3
2.67%	-18	-17	-16	-14	-13	-12	-11
5.33%	-24	-23	-23	-22	-21	-20	-19
8.00%	-25	-25	-25	-25	-24	-24	-23

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

(단위:백만원)

1,652

공시일	2019-02-20
기준일	2019-02-19

H2O글로벌본드(USD)(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	938	0	938	

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	2019-02-20
기준일	2019-02-19

H2O글로벌본드(UH)(채권혼합-파

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	338	0	338	
누계	유가증권	수익증권	5,516	0	5,516	

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	2019-02-20
기준일	2019-02-19

H2O글로벌본드(H)(채권혼합-파생)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	542	0	542	
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	수익증권	18,843	0	18,843	
누계	통화	선도	0	27,291	-27,291	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
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		469
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
FX21019G01 KRW/USD 21-03-19E		424

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

(단위:백만원)

810

공시일	2019-02-20
기준일	2019-02-19

스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

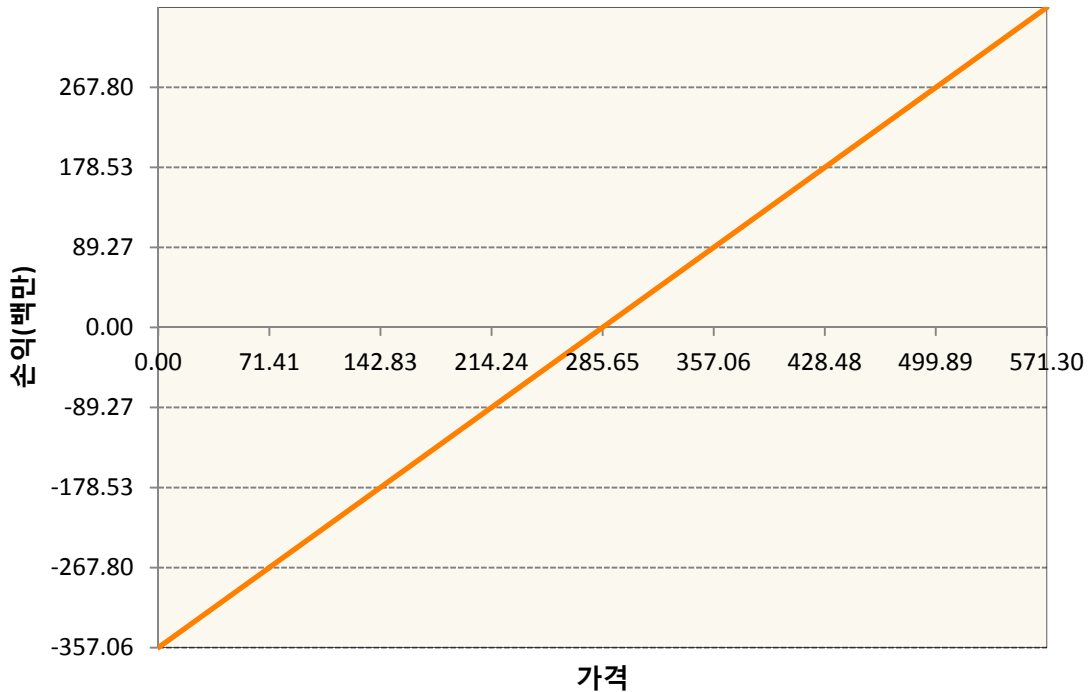
1. 계약금액

(단위:백만원)

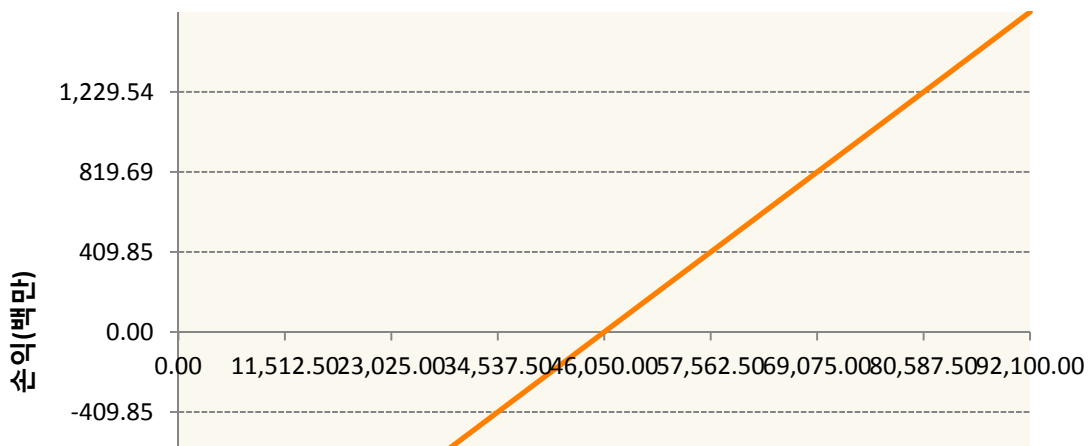
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,996	0	1,996	장내

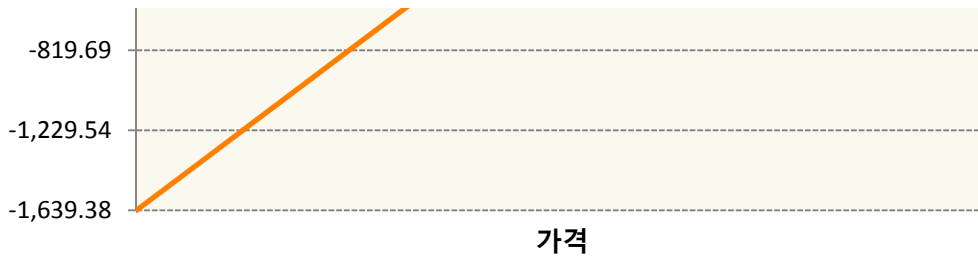
2. 만기시점의 손익구조

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)

177

공시일	2019-02-20
기준일	2019-02-19

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

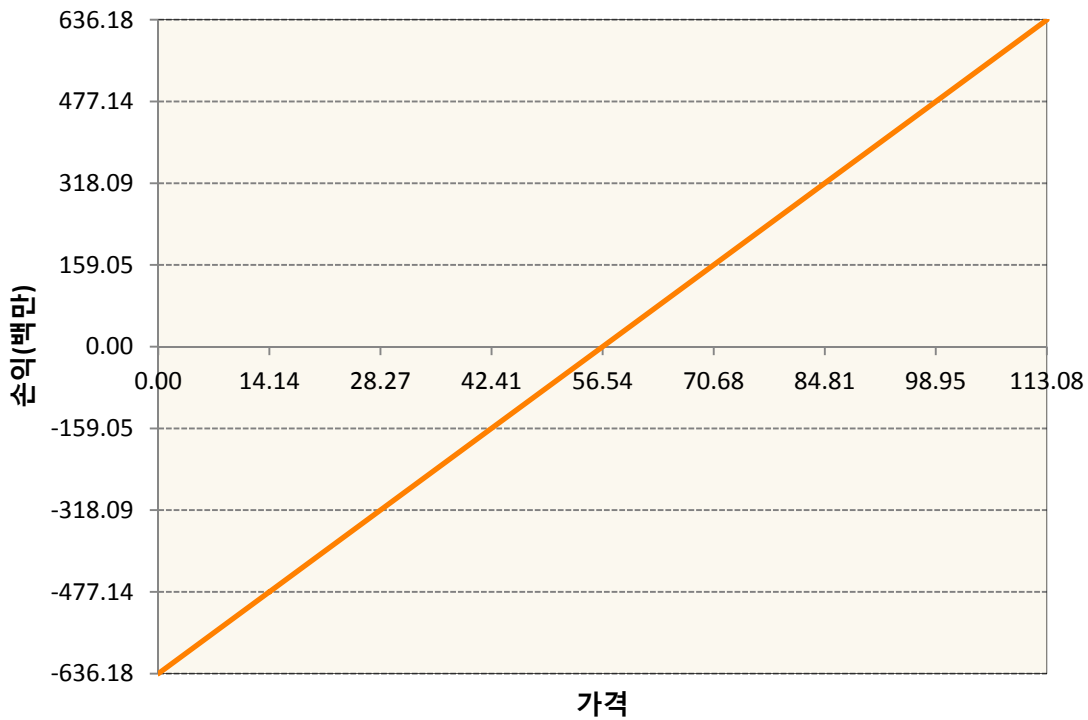
1. 계약금액

(단위:백만원)

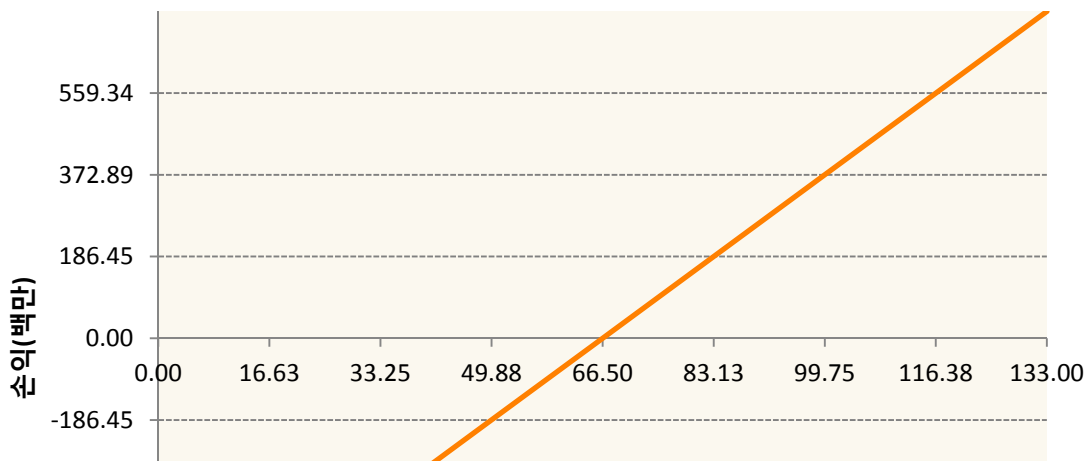
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,874	282	2,592	

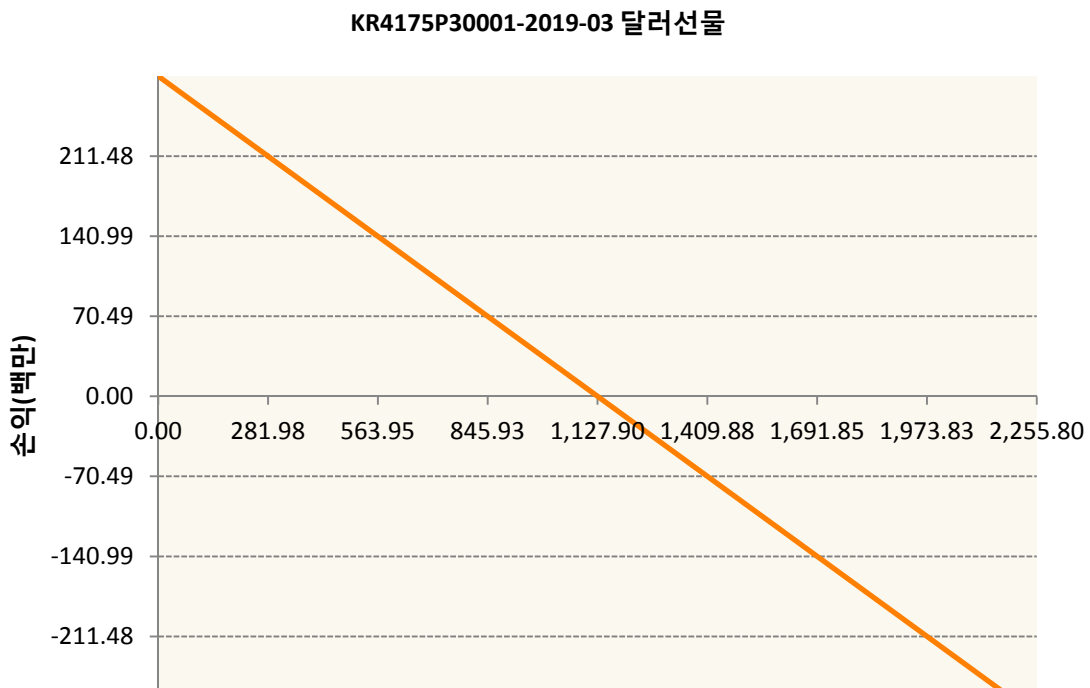
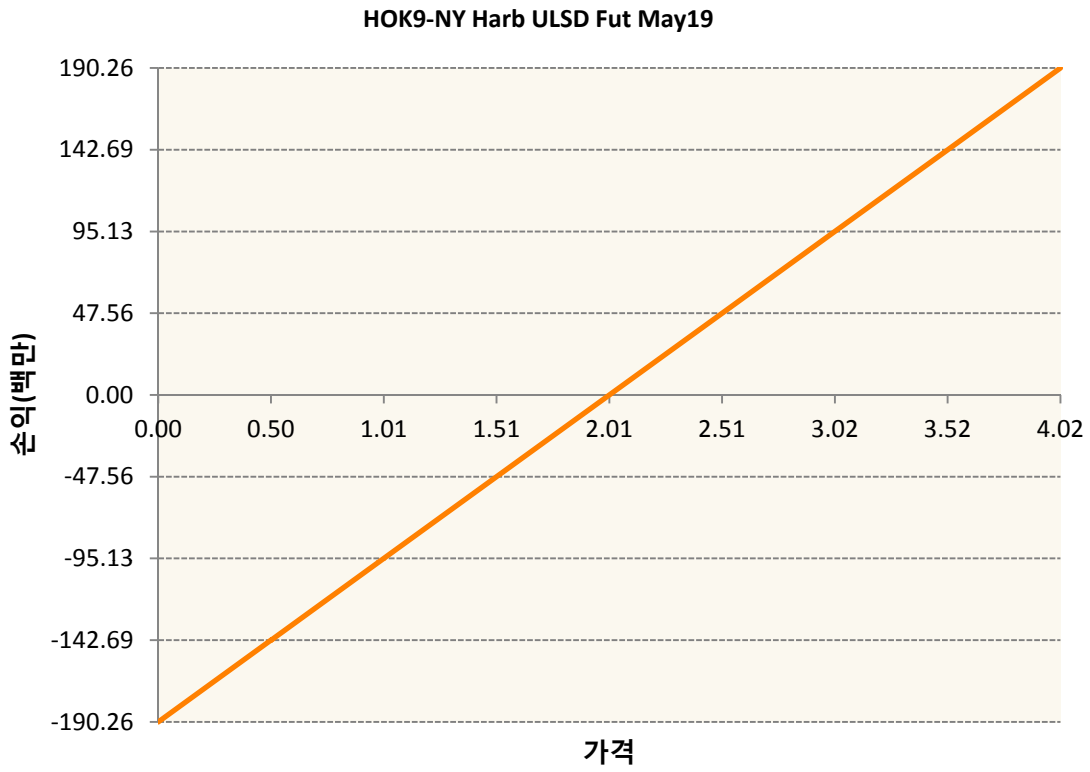
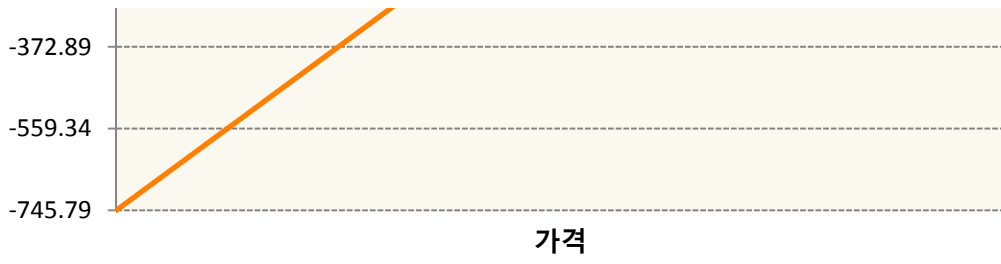
2. 만기시점의 손익구조

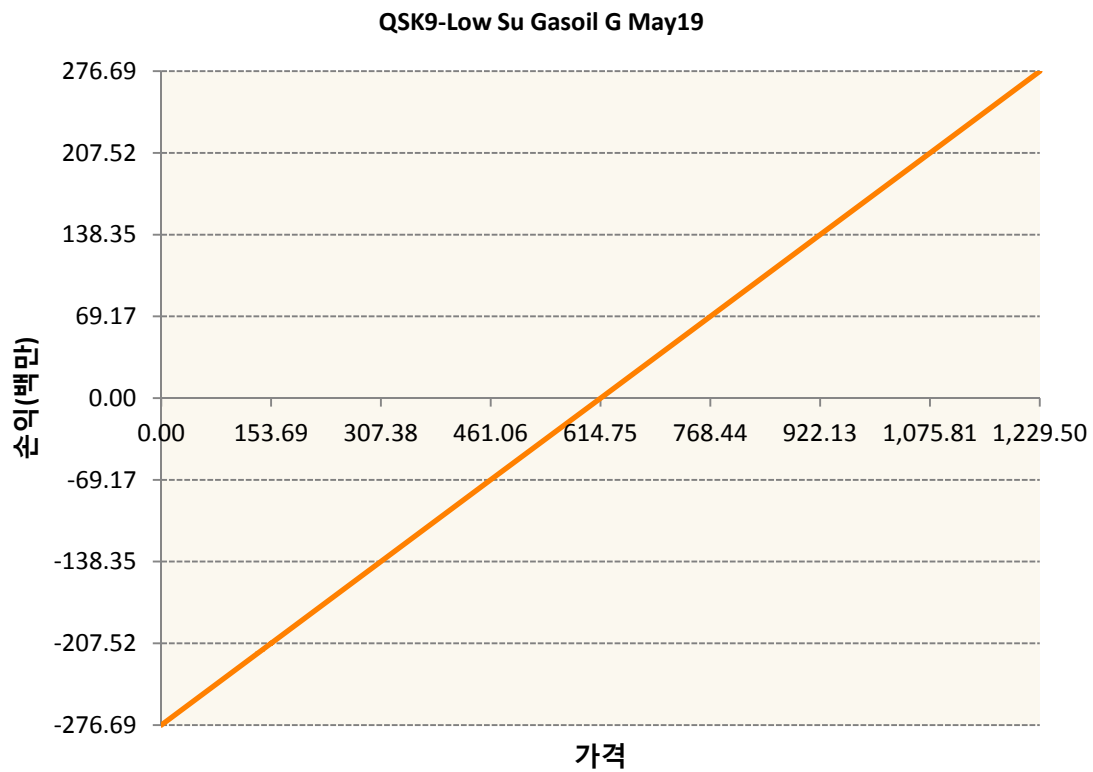
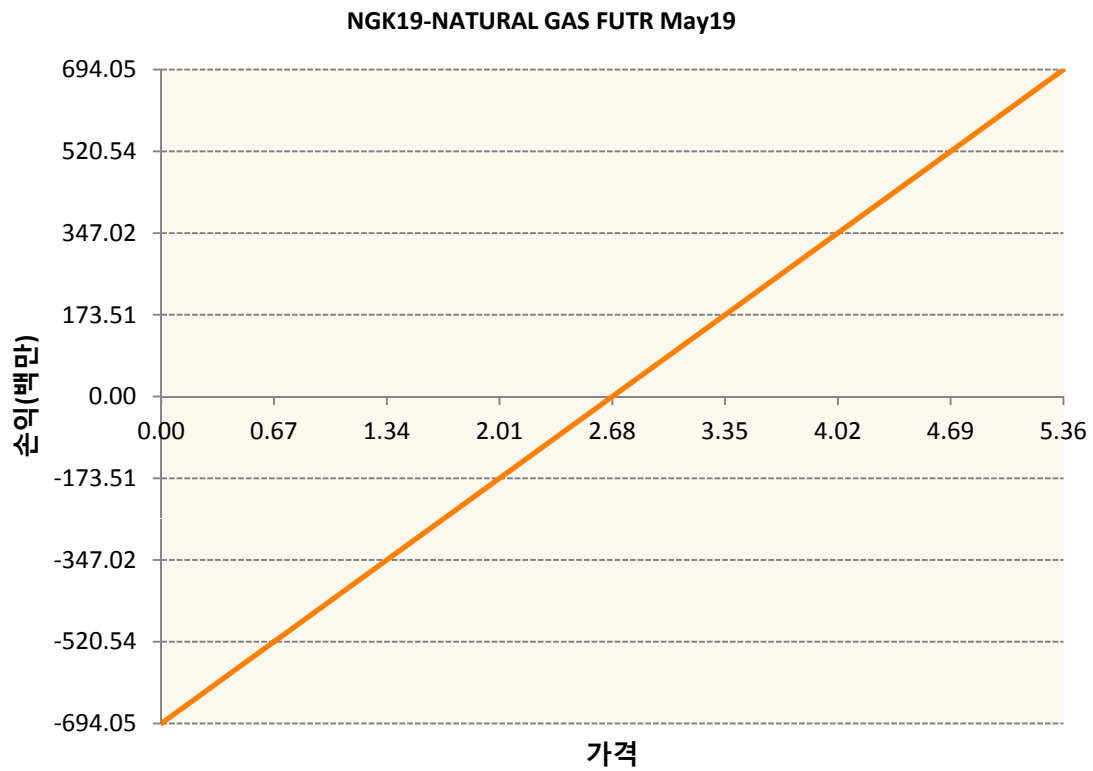
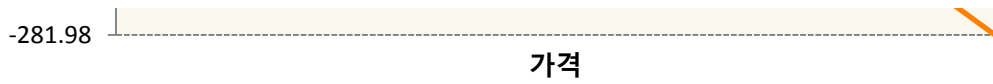
CLK9-WTI CRUDE FUTURE May19



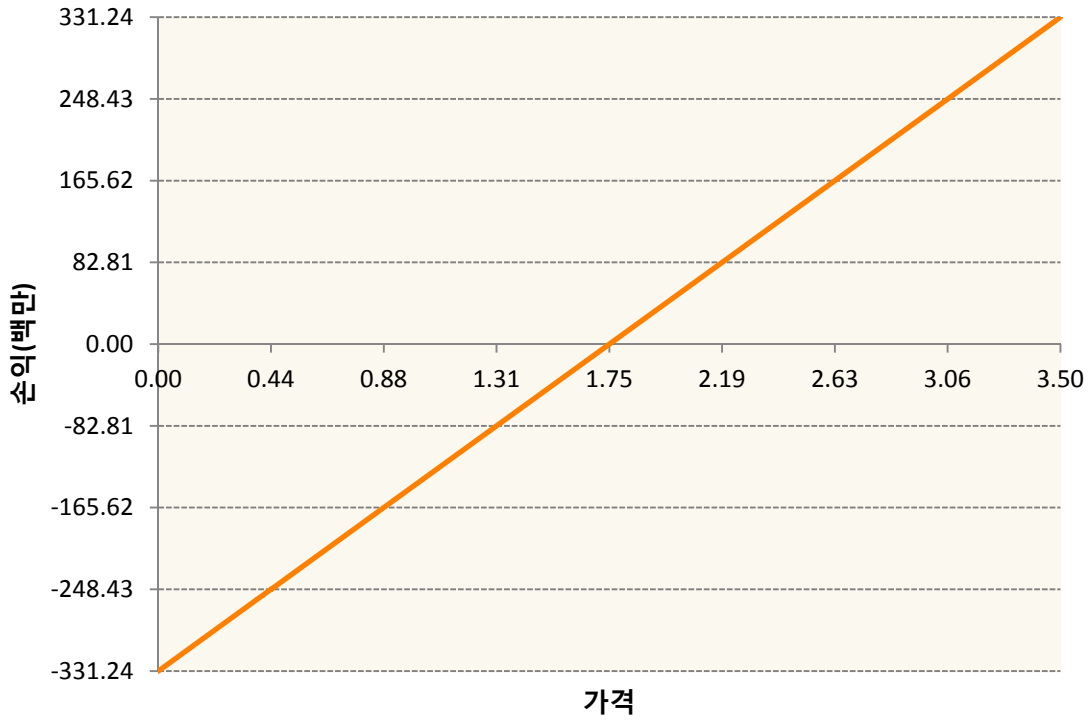
COK9-BRENT CRUDE FUTR May19







XBK9-GASOLINE RBOB FUT May19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

CLK9	WTI CRUDE FUTURE May19	51
COK9	BRENT CRUDE FUTR May19	60
HOK9	NY Harb ULSD Fut May19	15
KR4175P300	2019-03 달러선물	23
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)

437

공시일	2019-02-20
기준일	2019-02-19

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

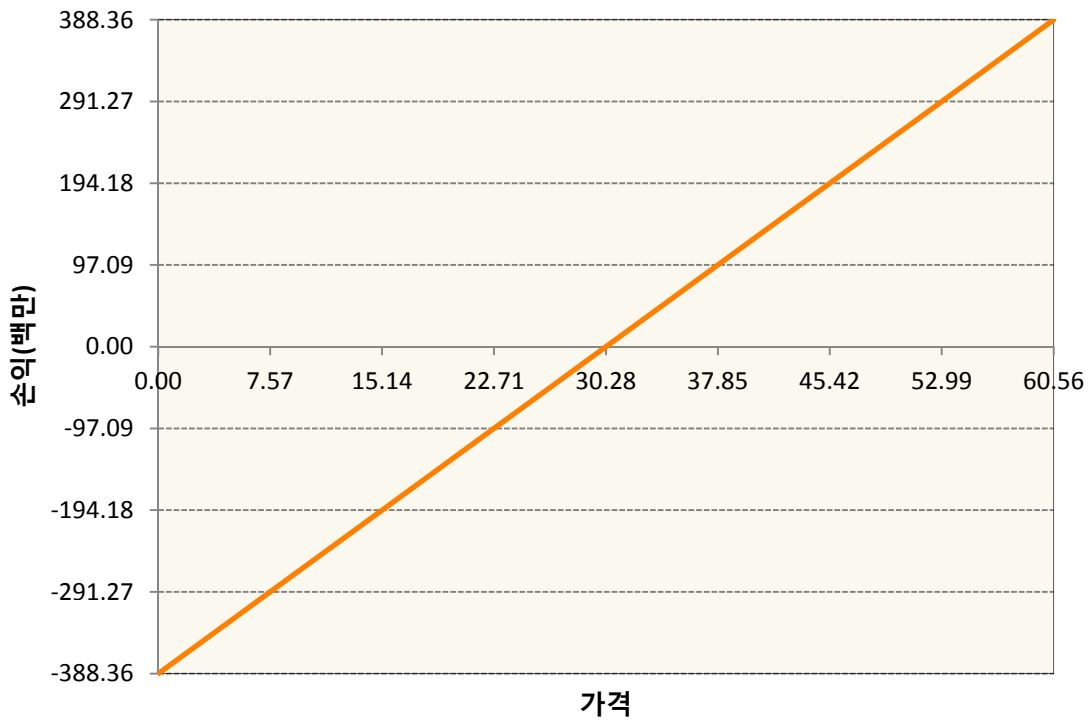
1. 계약금액

(단위:백만원)

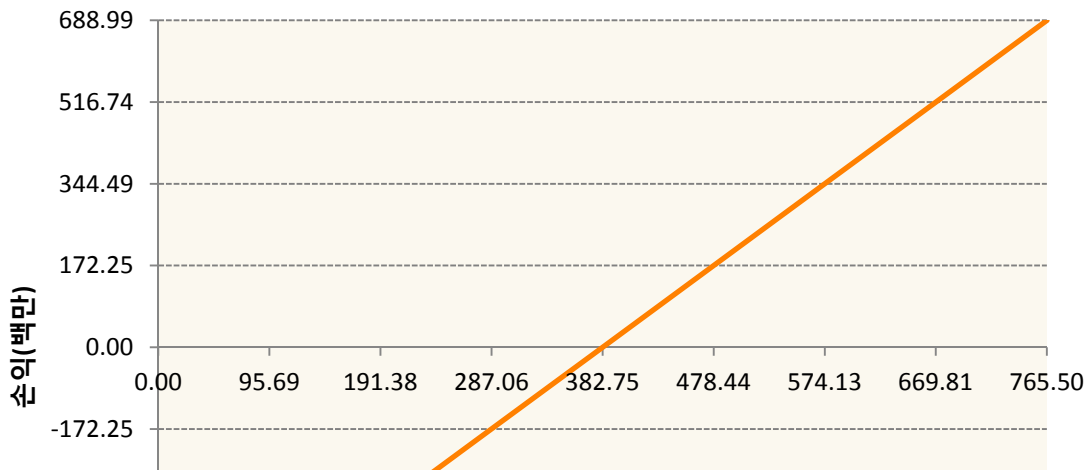
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,560	79	3,481	

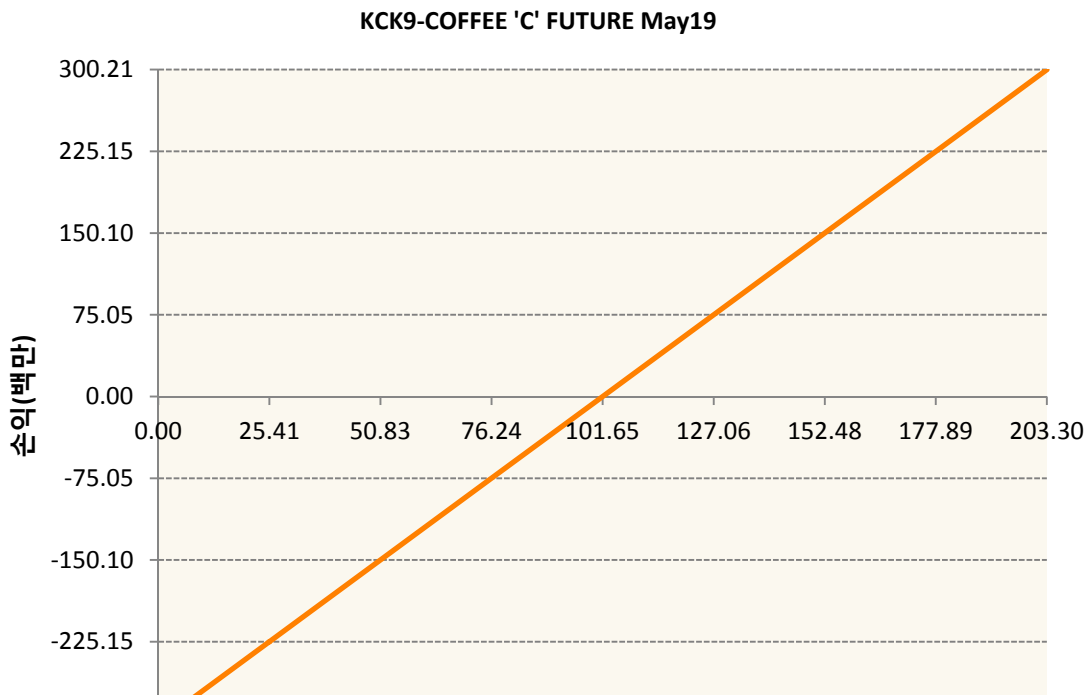
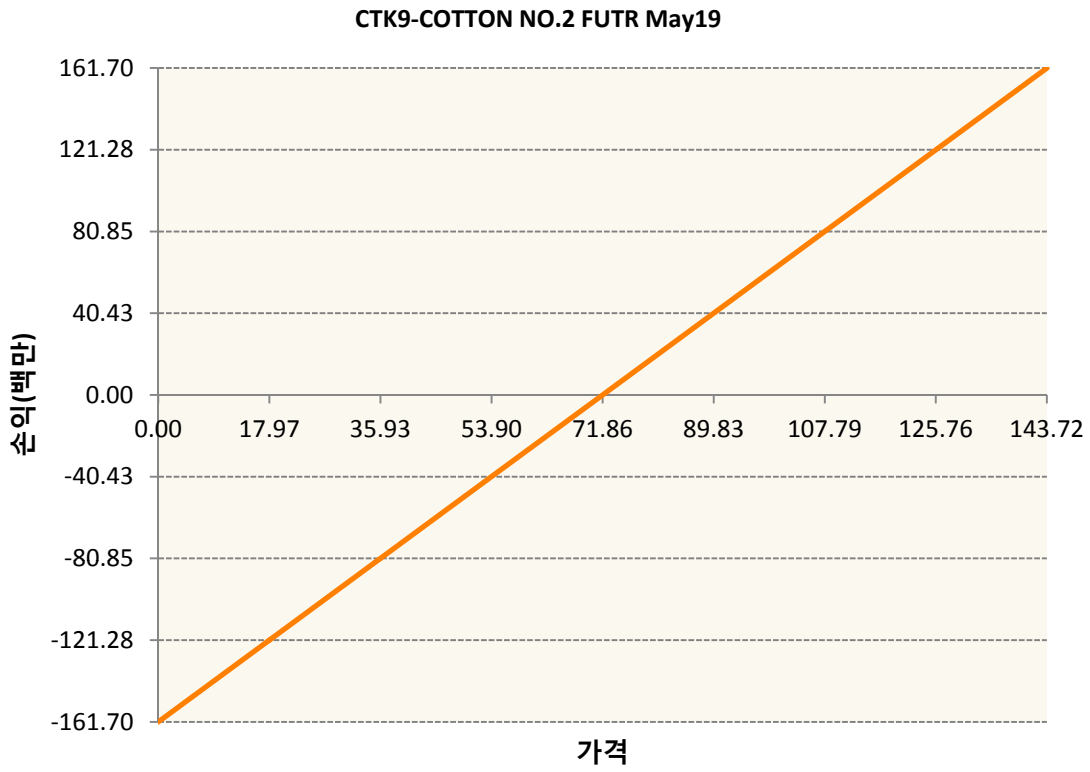
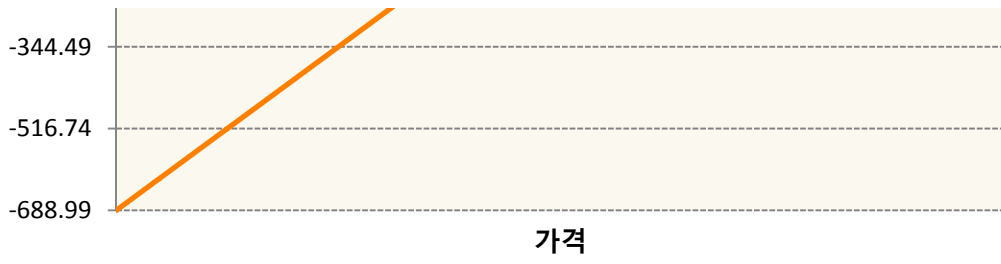
2. 만기시점의 손익구조

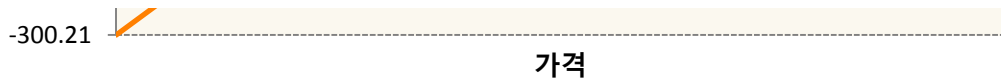
BOK9-SOYBEAN OIL FUTR May19



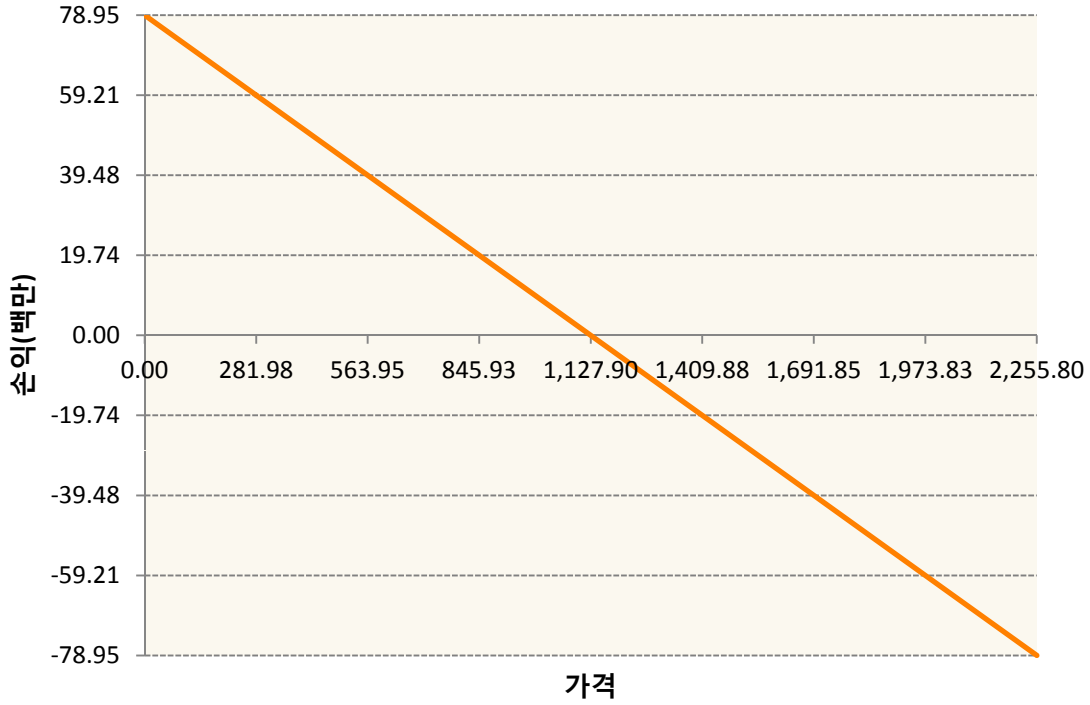
CK9-CORN FUTURE May19



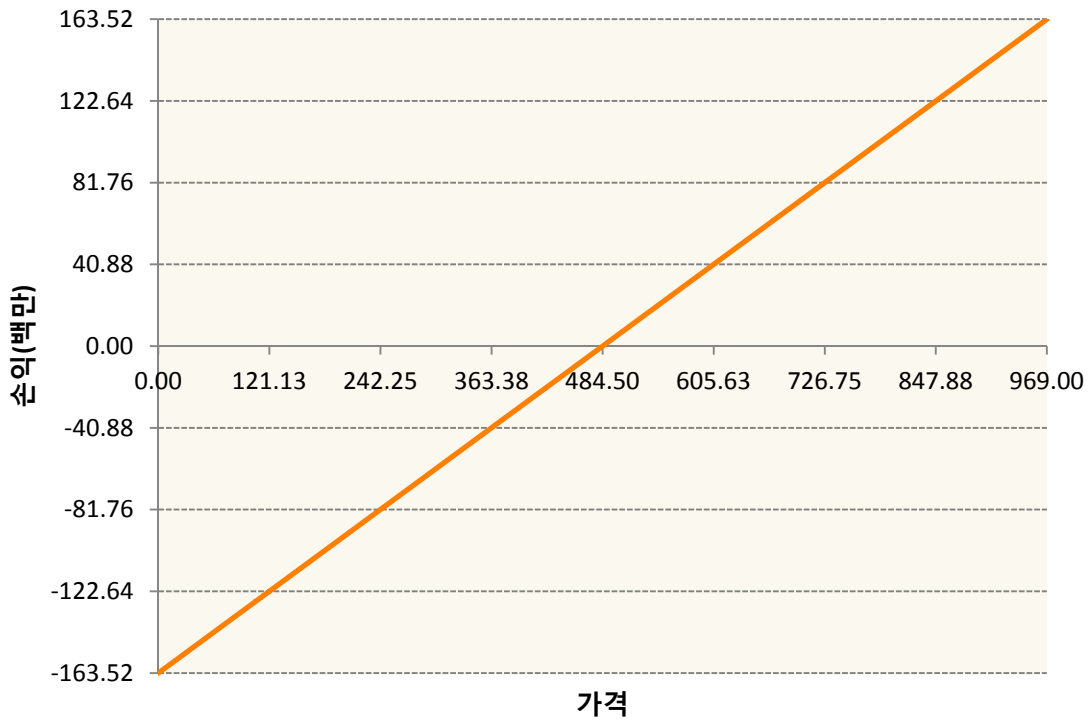




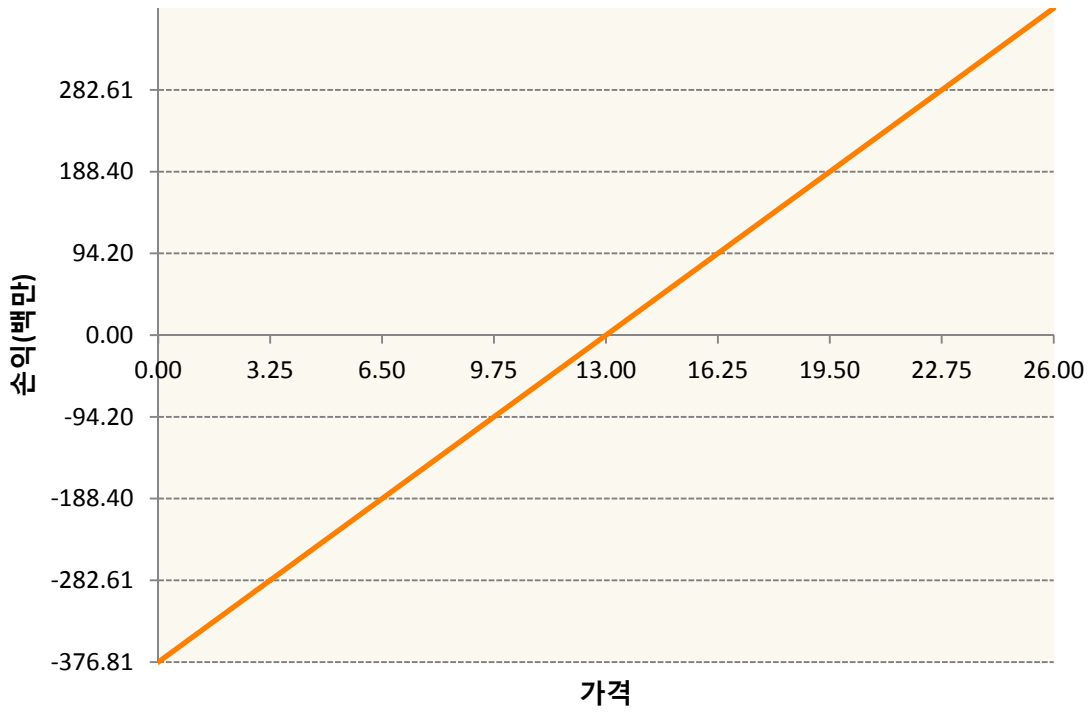
KR4175P30001-2019-03 달러선물



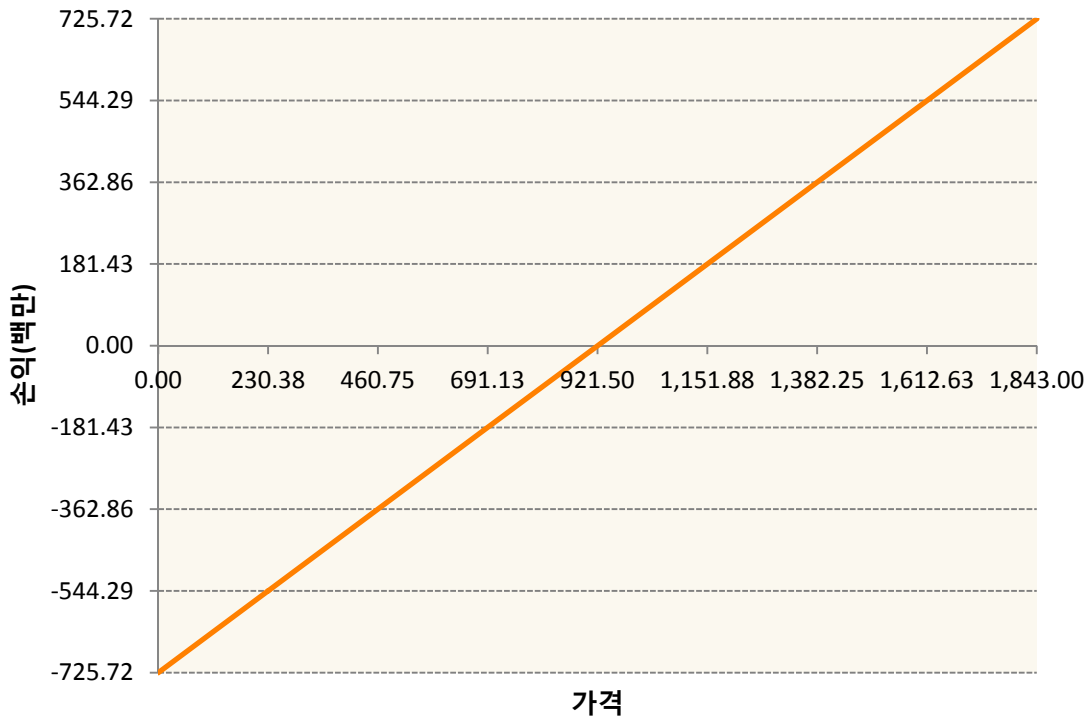
KWK9-KC HRW WHEAT FUT May19



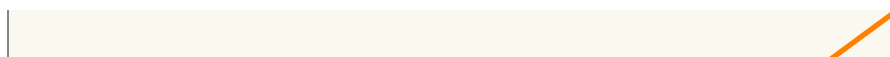
SBK9-SUGAR #11 (WORLD) May19

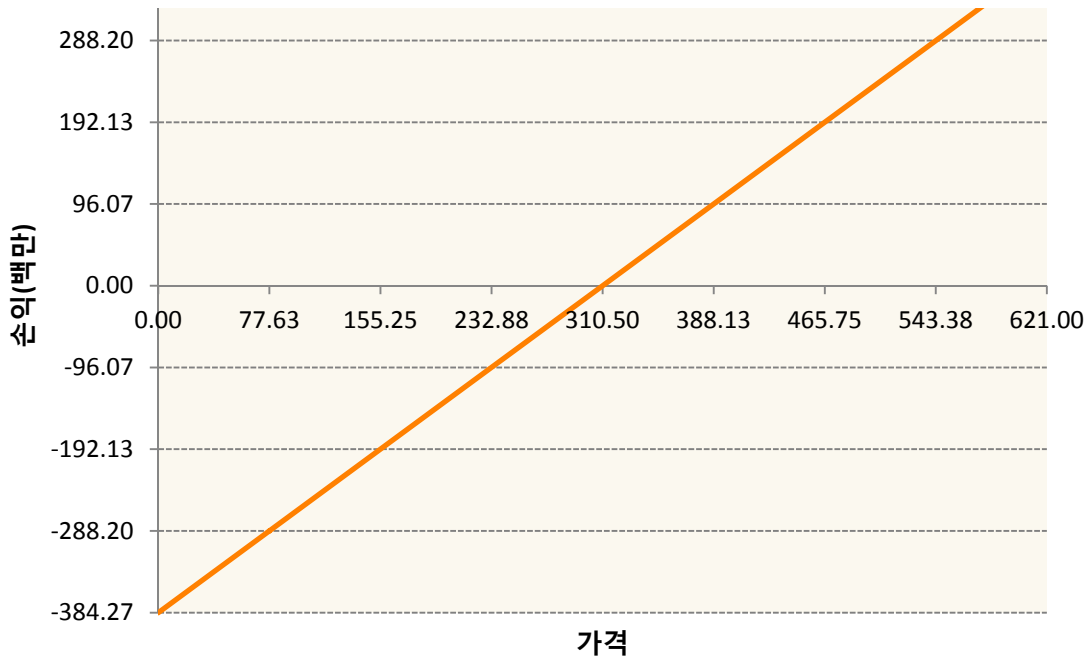


SK9-SOYBEAN FUTURE May19

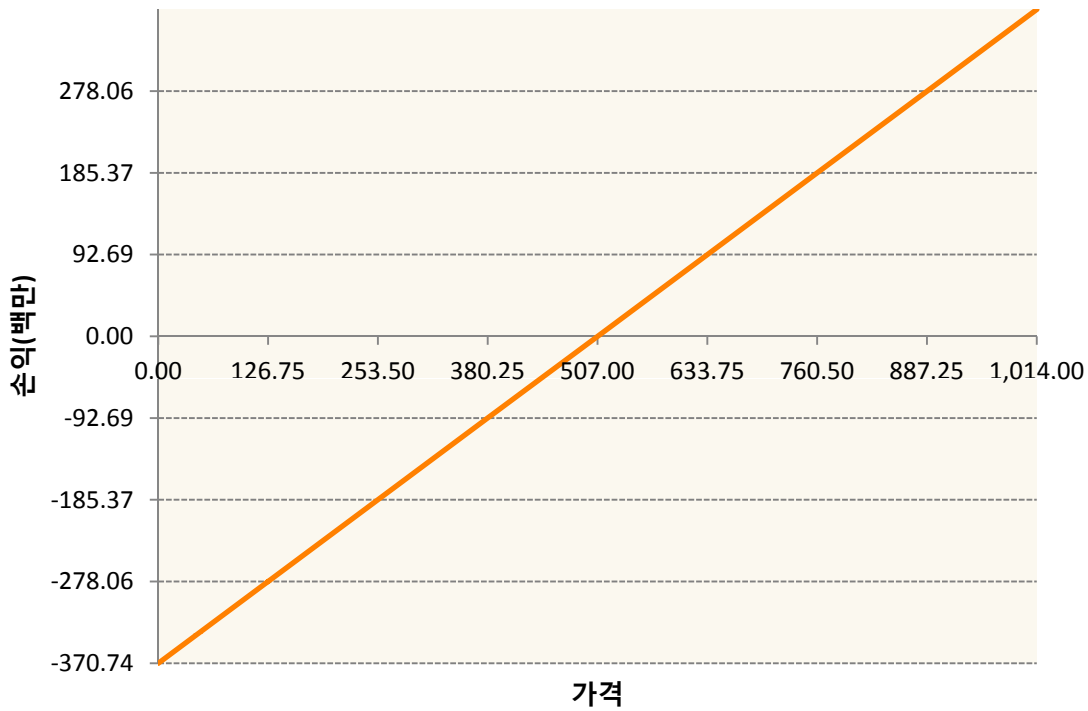


SMK9-SOYBEAN MEAL FUTR May19





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	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