

공시일	2019-02-21
기준일	2019-02-20

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	2019-02-21
기준일	2019-02-20

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

1,105

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

636

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-02-21
기준일	2019-02-20

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	290
SWCSI50000 신한CSI500미래S190129	87

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

559

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-02-21
기준일	2019-02-20

유로인덱스모(주식-파생형)

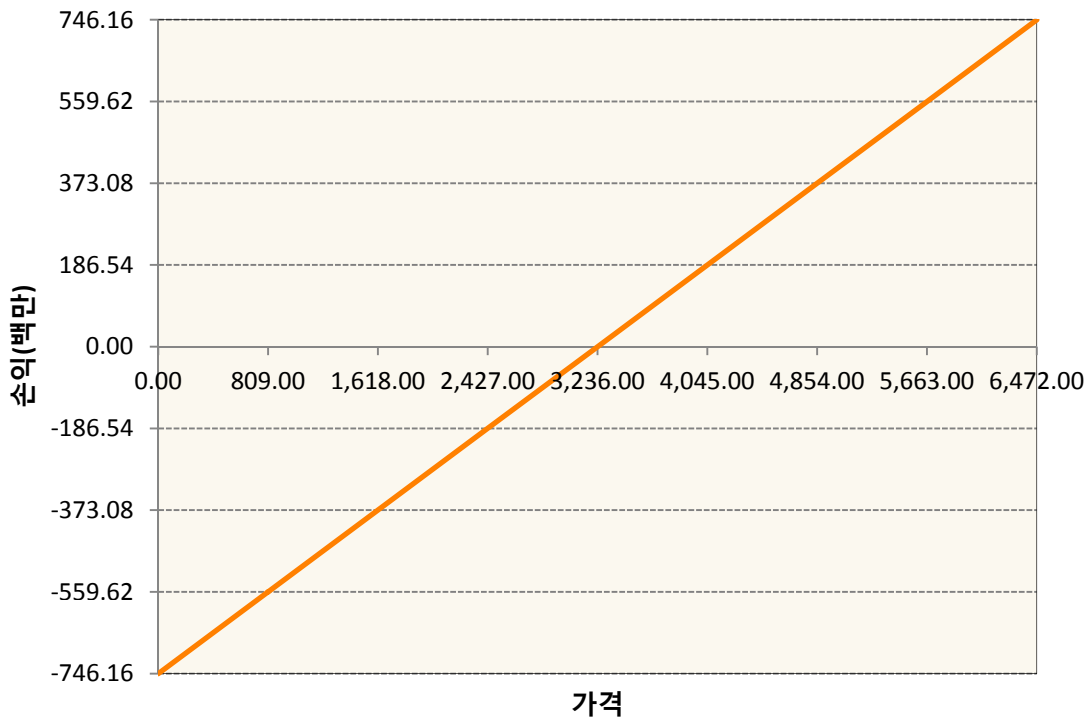
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	746	0	746	

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	2019-02-21
기준일	2019-02-20

차이나인덱스모(주식-파생형)

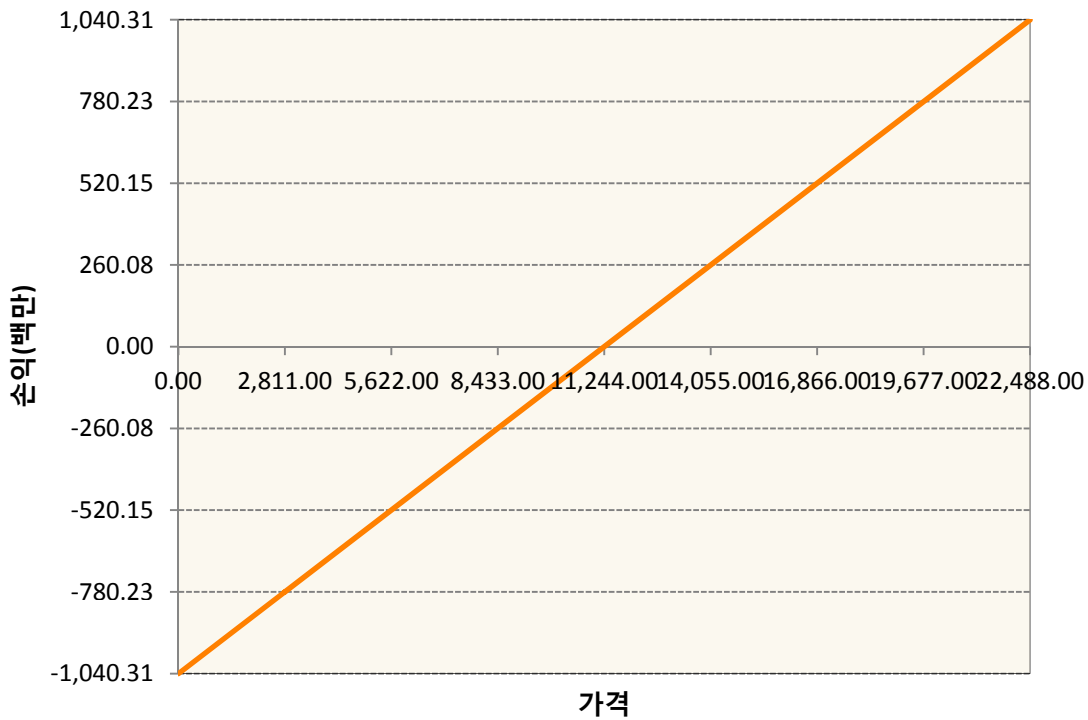
1. 계약금액

(단위:백만원)

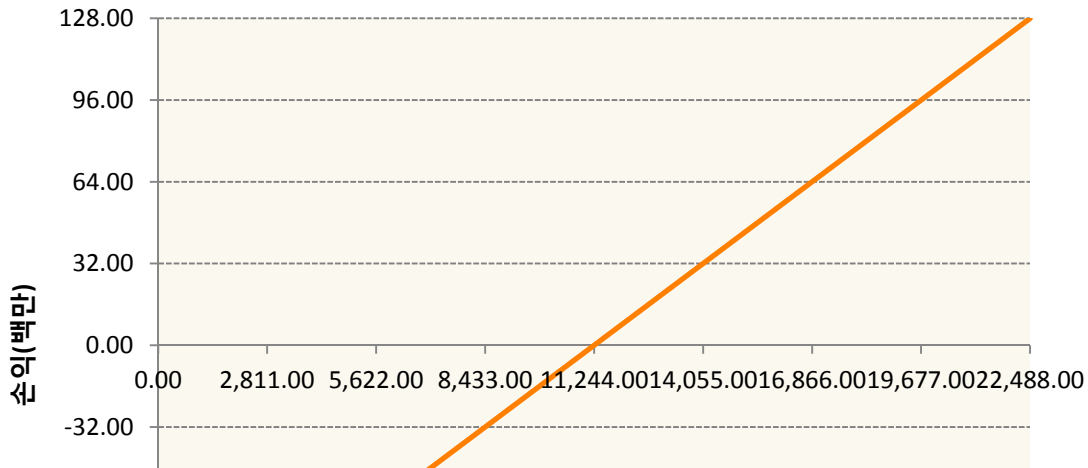
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,168	0	1,168	장내

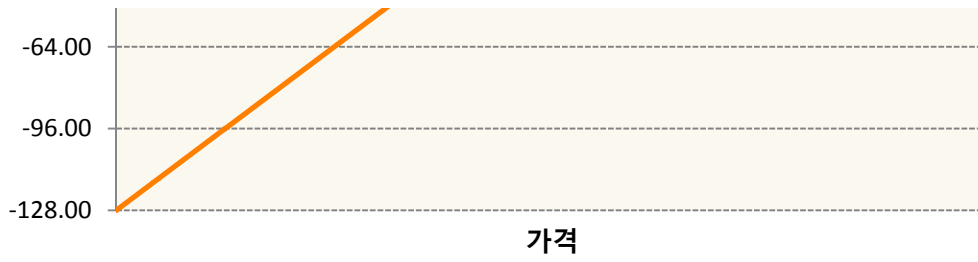
2. 만기시점의 손익구조

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)

96

공시일	2019-02-21
기준일	2019-02-20

커버드콜모(주식혼합-파생형)

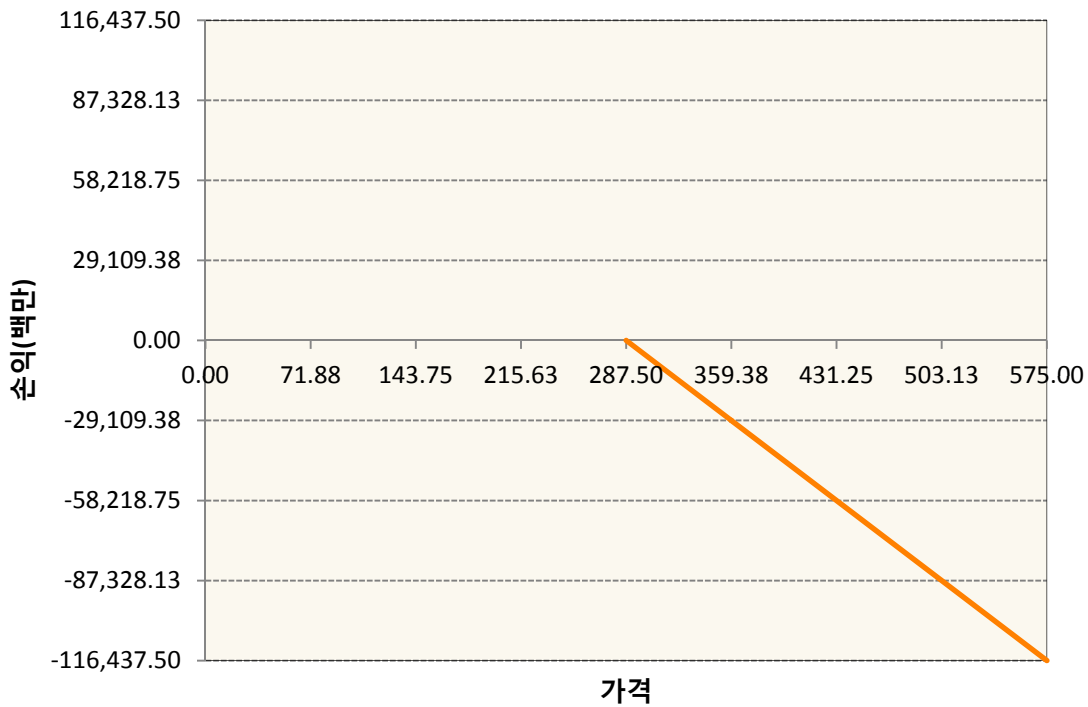
1. 계약금액

(단위:백만원)

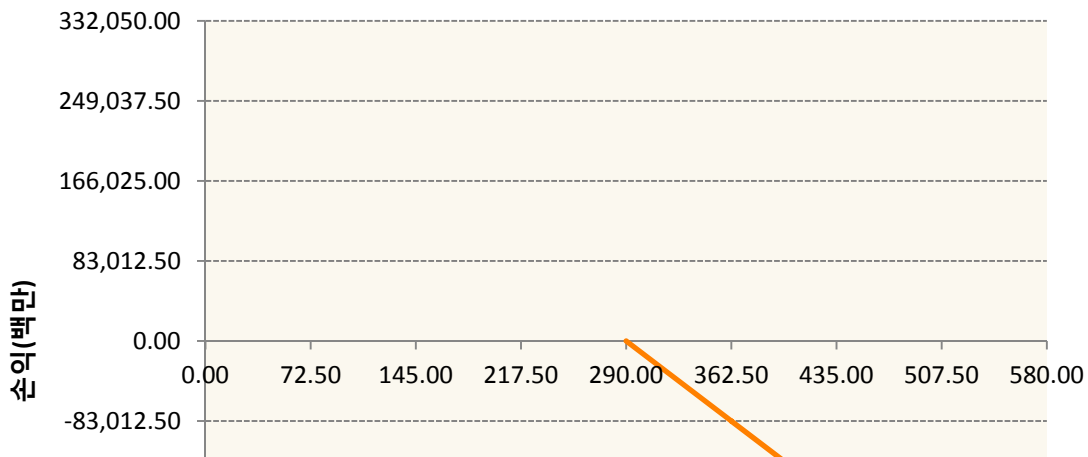
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	7,101	0	7,101	장내
누계	유가증권	옵션	0	692,863	-692,863	장내

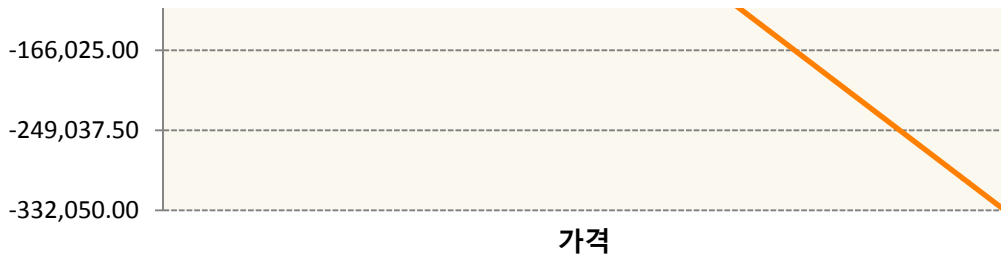
2. 만기시점의 손익구조

KR4201P32878-2019-03 콜287.5

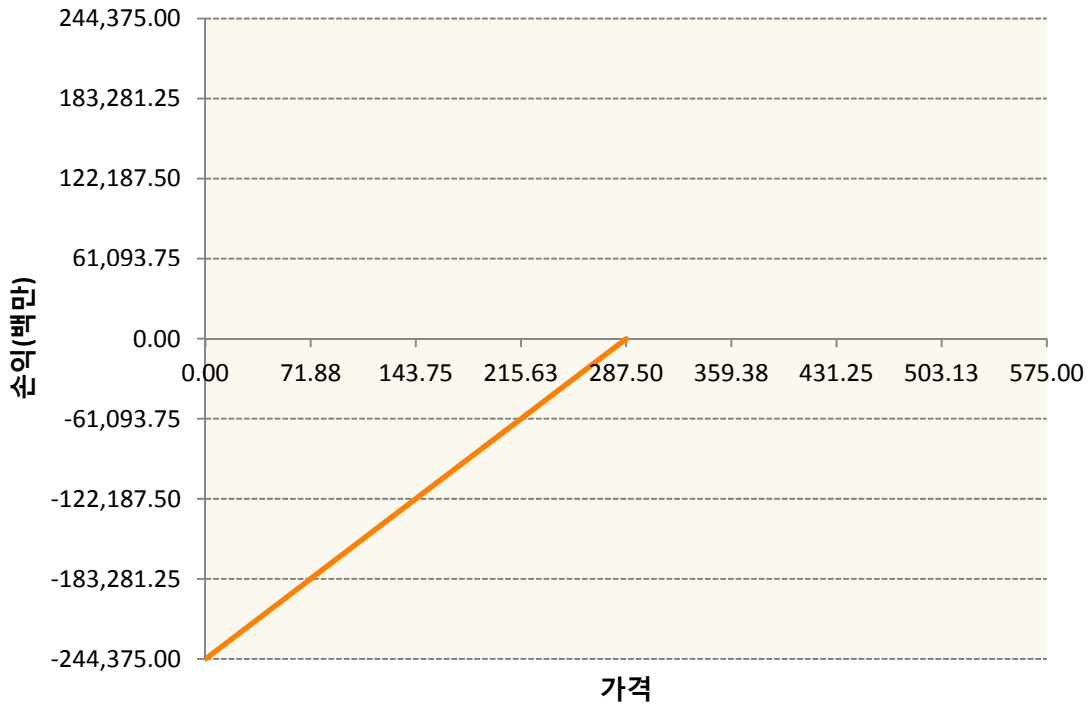


KR4201P32902-2019-03 콜290





KR4301P32876-2019-03 풋287.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201P32878		2019-03 콜287.5					7,340
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	3,039	2,973	2,889	2,789	2,675	2,549	2,411
-5.33%	2,757	2,615	2,459	2,292	2,114	1,929	1,738
-2.67%	2,058	1,841	1,619	1,393	1,165	935	703
0%	740	493	247	0	-247	-493	-740
2.67%	-1,251	-1,463	-1,680	-1,903	-2,130	-2,360	-2,593
5.33%	-3,786	-3,926	-4,082	-4,251	-4,431	-4,619	-4,816
8.00%	-6,654	-6,727	-6,819	-6,928	-7,052	-7,190	-7,340
KR4201P32902		2019-03 콜290					19,782
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	7,328	7,185	6,997	6,764	6,491	6,179	5,835

-5.33%	6,757	6,424	6,045	5,627	5,176	4,698	4,197
-2.67%	5,219	4,658	4,075	3,476	2,863	2,240	1,608
0%	2,092	1,396	698	0	-698	-1,397	-2,096
2.67%	-2,932	-3,585	-4,249	-4,920	-5,596	-6,278	-6,963
5.33%	-9,644	-10,116	-10,626	-11,166	-11,730	-12,314	-12,915
8.00%	-17,494	-17,762	-18,084	-18,453	-18,863	-19,307	-19,782
KR4301P32876 2019-03 풋287.5							15,903
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-15,764	-15,769	-15,778	-15,795	-15,820	-15,856	-15,903
-5.33%	-9,293	-9,344	-9,412	-9,499	-9,603	-9,722	-9,856
-2.67%	-3,338	-3,534	-3,743	-3,963	-4,192	-4,428	-4,670
0%	857	572	286	0	-286	-573	-859
2.67%	2,647	2,479	2,294	2,094	1,882	1,660	1,431
5.33%	3,046	3,003	2,942	2,863	2,767	2,654	2,525
8.00%	3,090	3,085	3,074	3,056	3,027	2,988	2,936

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

(단위:백만원)

43,753

공시일	2019-02-21
기준일	2019-02-20

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

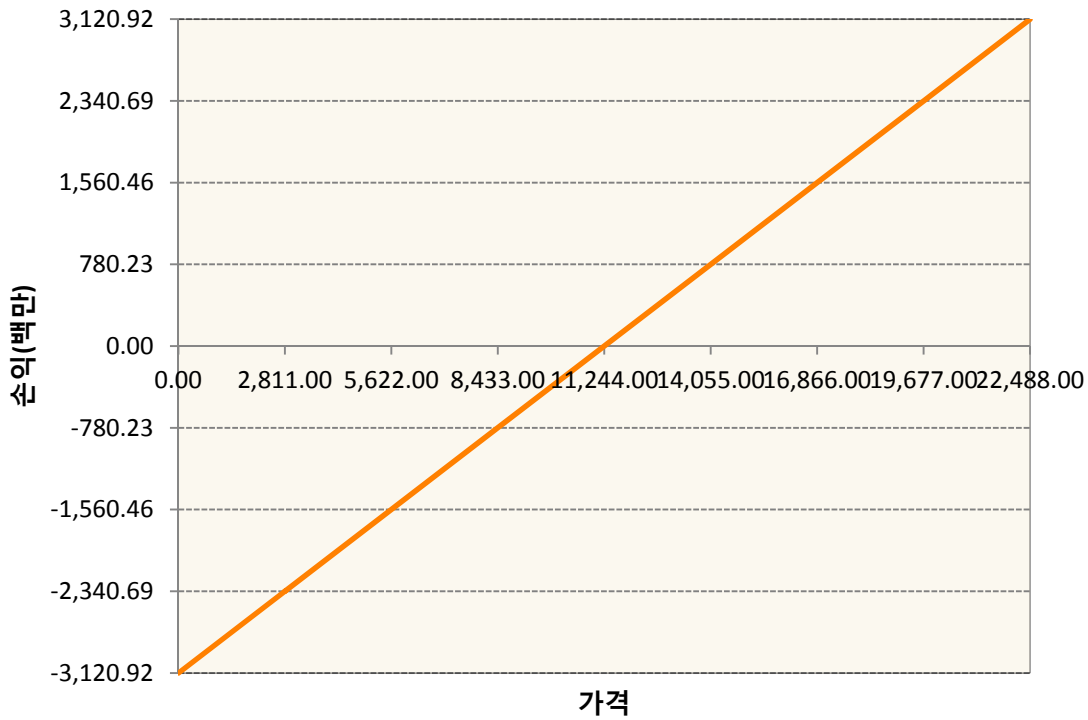
1. 계약금액

(단위:백만원)

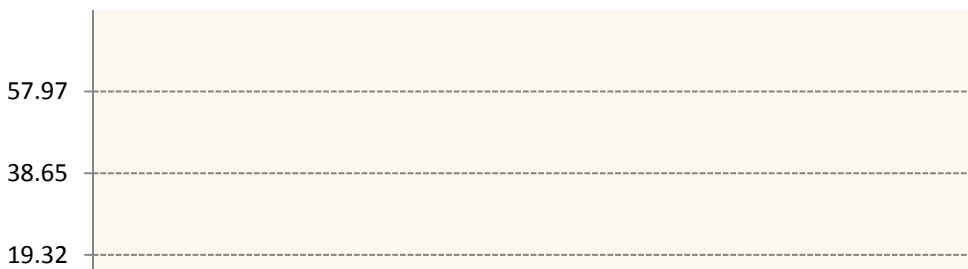
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	3,121	0	3,121	장내
누계	유가증권	옵션	0	7,332	-7,332	장내
누계	통화	선도	0	2,720	-2,720	장외

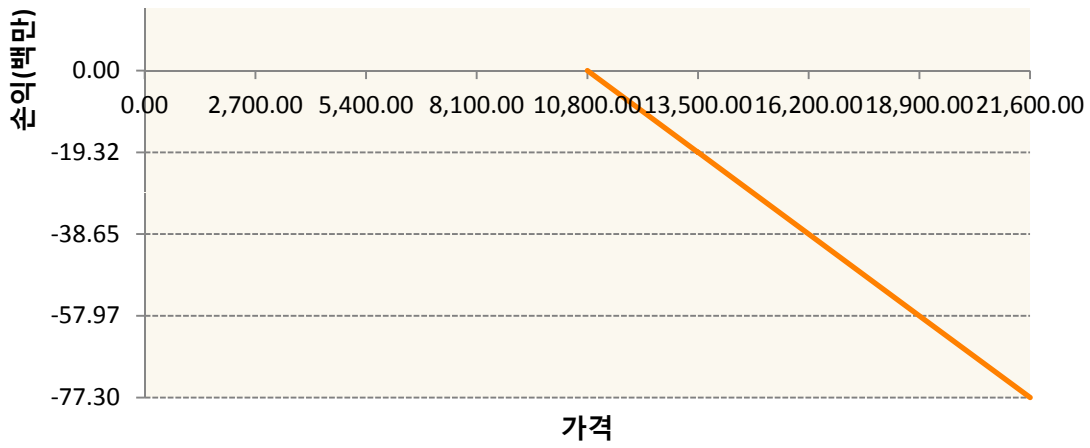
2. 만기시점의 손익구조

HCG9-HSCEI Futures Feb19

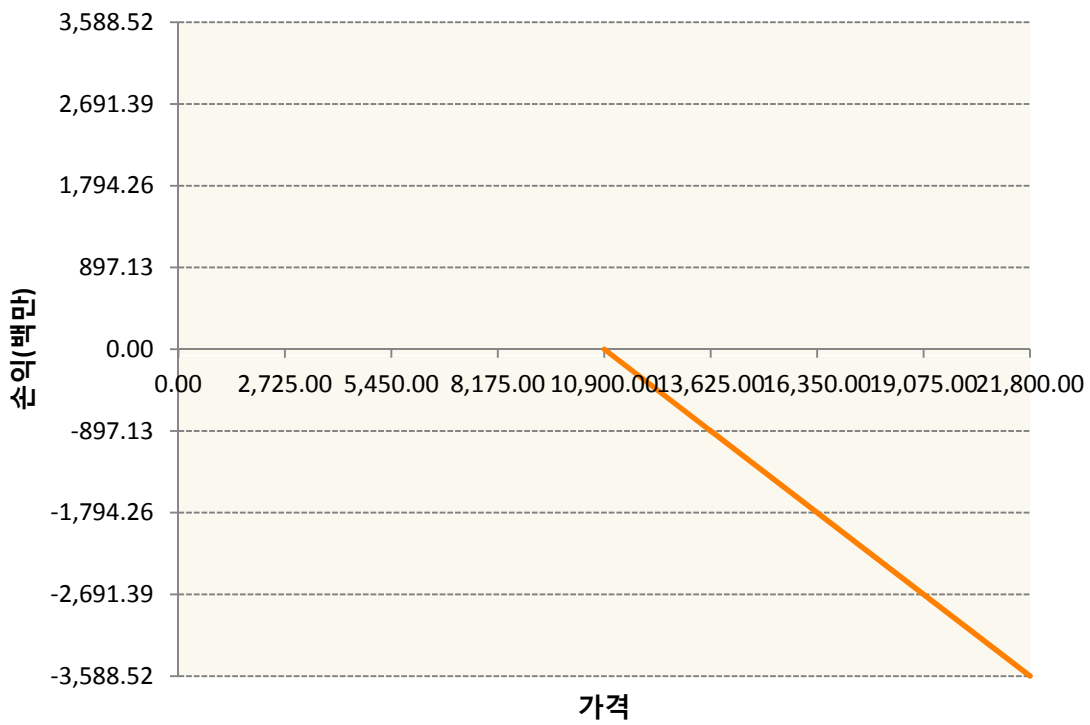


OHHIG9-C108-HSCEI

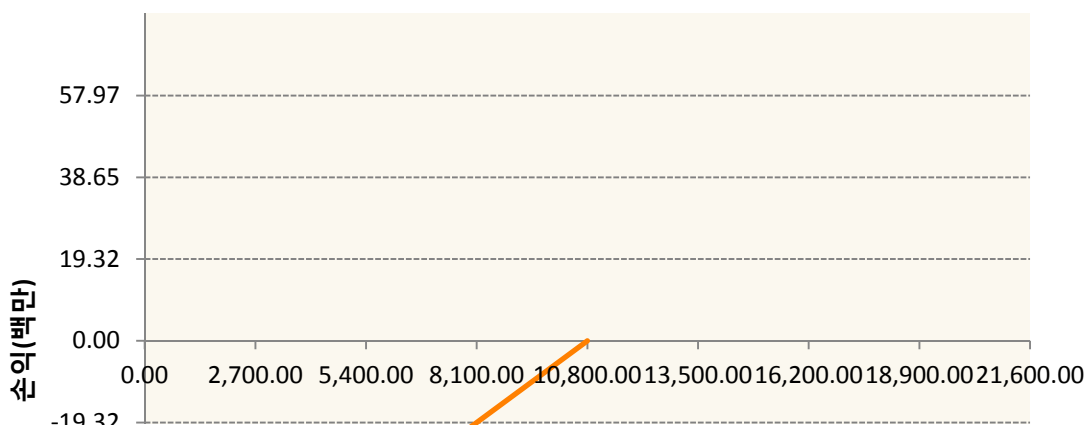


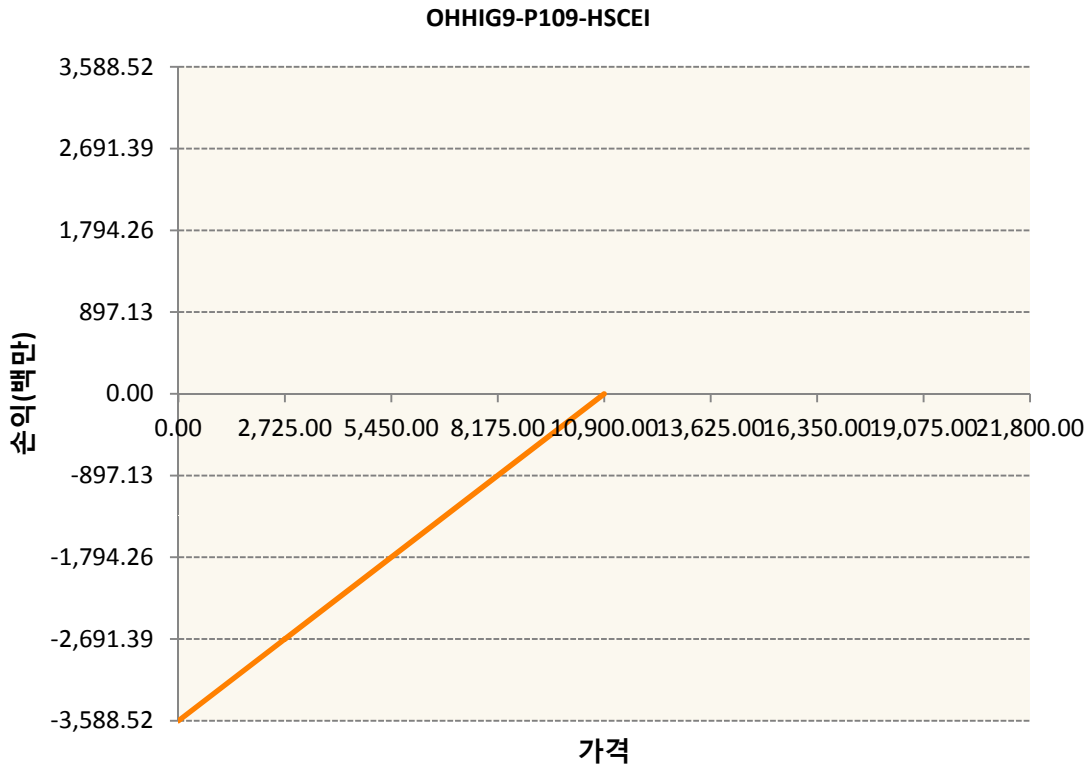
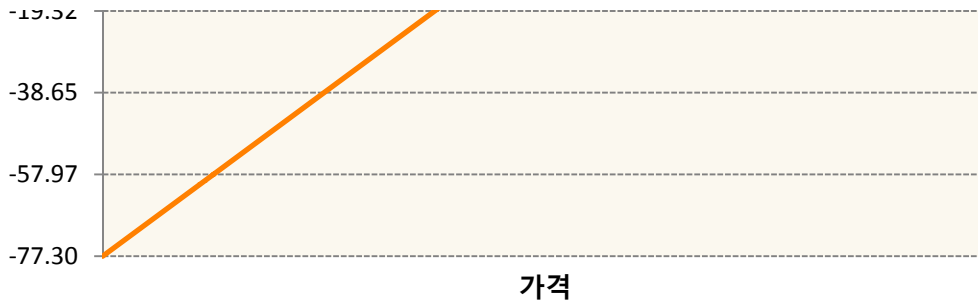


OHHIG9-C109-HSCEI



OHHIG9-P108-HSCEI





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

FX21018Z00 KRW/HKD 11-03-19E	218
HCG9 HSCEI Futures Feb19	250
OHHIG9-C1(HSCEI	6
OHHIG9-C1(HSCEI	287
OHHIG9-P1(HSCEI	6
OHHIG9-P1(HSCEI	287

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

934

공시일	2019-02-21
기준일	2019-02-20

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

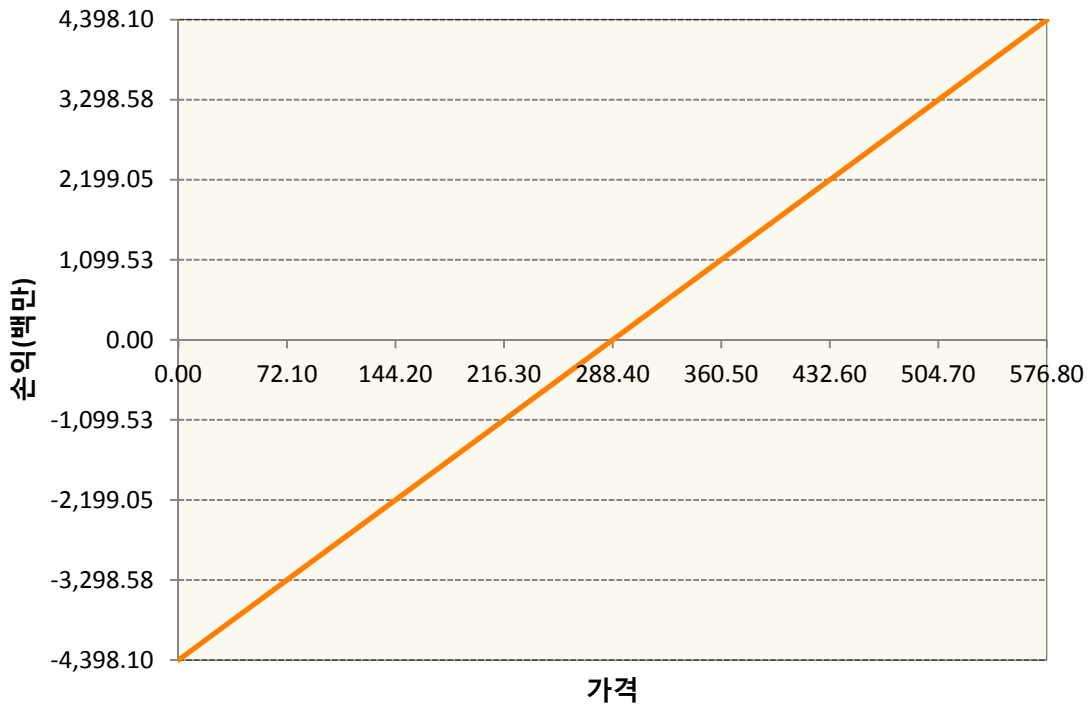
1. 계약금액

(단위:백만원)

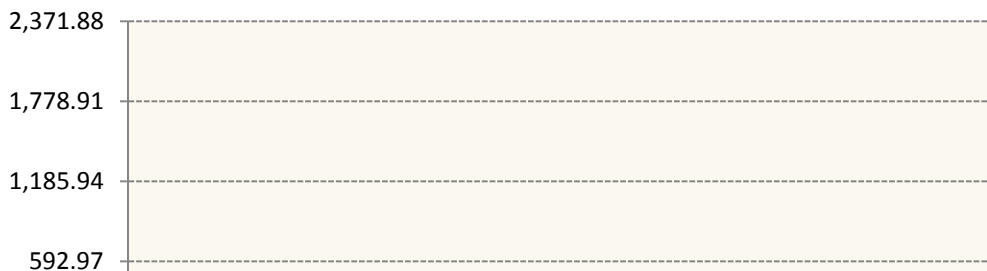
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	358	0	358	장내
누계	유가증권	선물	4,398	0	4,398	장내
누계	유가증권	스왑	31,836	0	31,836	장외
누계	유가증권	옵션	0	29,948	-29,948	장내

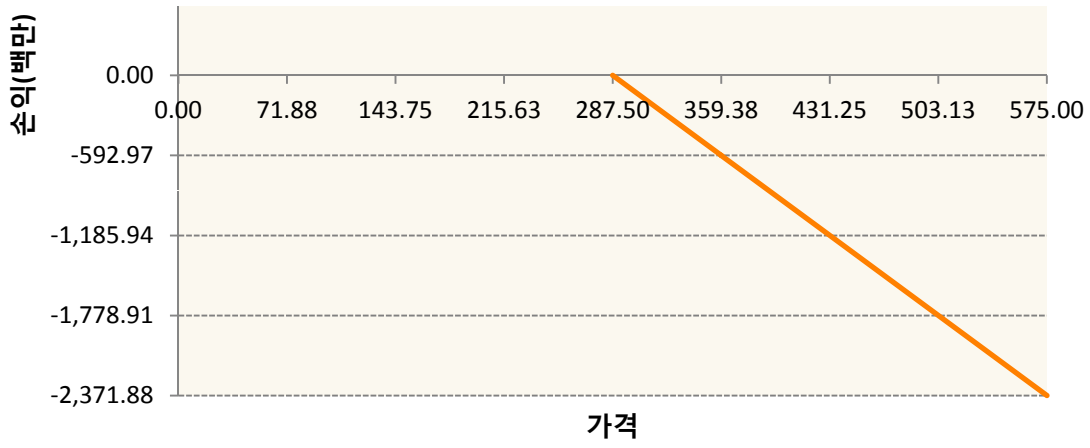
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P30007-2019-03 코스피200지수선물

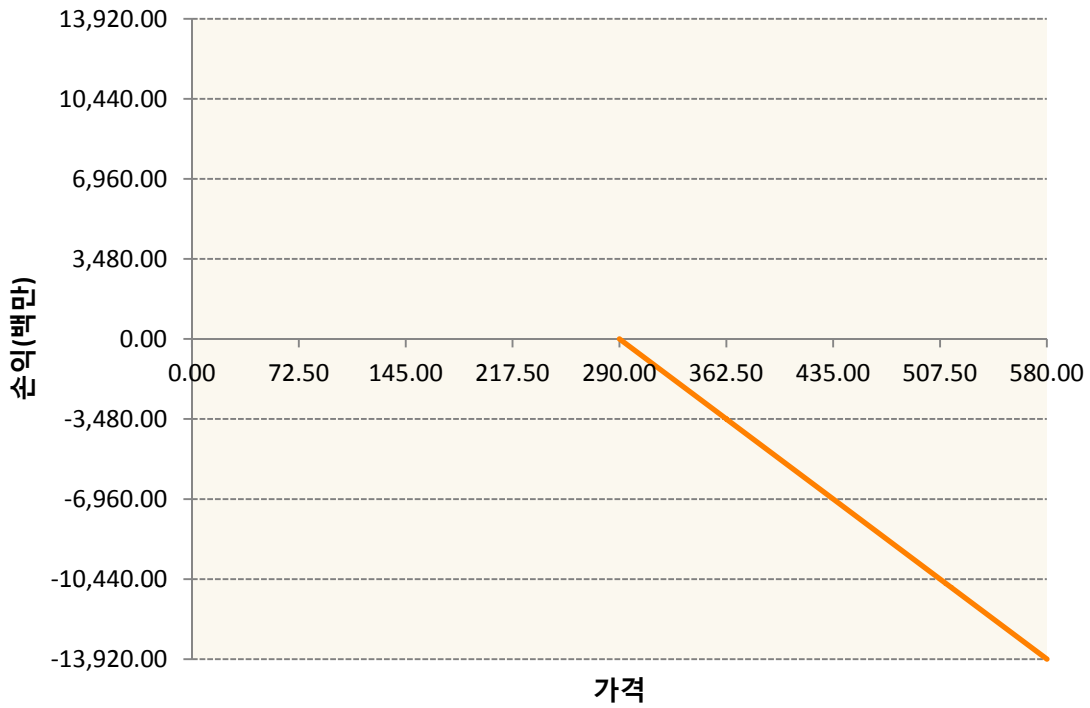


KR4201P32878-2019-03 콜287.5

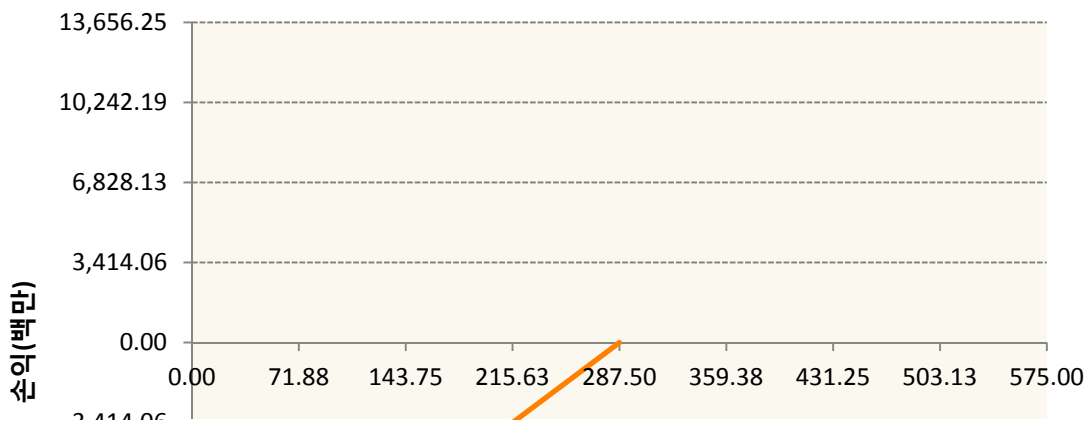


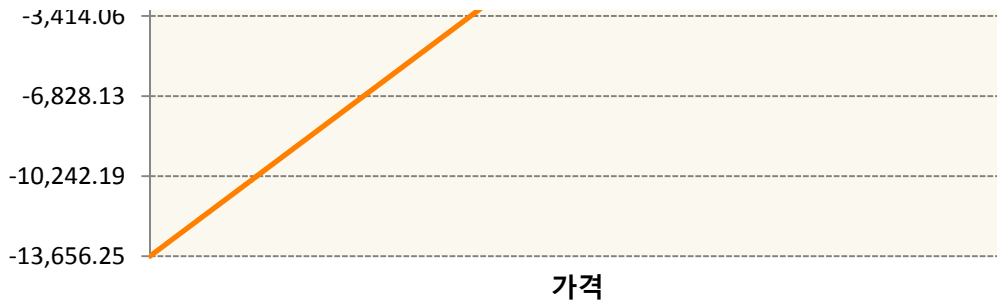


KR4201P32902-2019-03 콜290



KR4301P32876-2019-03 풋287.5





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11		UBCSFXC1 INDEX_14						2,665
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-2,665	-2,665	-2,665	-2,665	-2,665	-2,665	-2,665	
-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%	2,665	2,665	2,665	2,665	2,665	2,665	2,665	
KR4101P30007		2019-03 코스피200지수선물						352
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-352	-352	-352	-352	-352	-352	-352	
-5.33%	-235	-235	-235	-235	-235	-235	-235	
-2.67%	-117	-117	-117	-117	-117	-117	-117	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	117	117	117	117	117	117	117	
5.33%	235	235	235	235	235	235	235	
8.00%	352	352	352	352	352	352	352	
KR4201P32878		2019-03 콜287.5						150
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	62	61	59	57	54	52	49	
-5.33%	56	53	50	47	43	39	35	
-2.67%	42	37	33	28	24	19	14	
0%	15	10	5	0	-5	-10	-15	
2.67%	-25	-30	-34	-39	-43	-48	-53	
5.33%	-77	-80	-83	-87	-90	-94	-98	
8.00%	-136	-137	-139	-141	-144	-146	-150	
KR4201P32902		2019-03 콜290						829
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	

-8.00%	307	301	293	284	272	259	245
-5.33%	283	269	253	236	217	197	176
-2.67%	219	195	171	146	120	94	67
0%	88	59	29	0	-29	-59	-88
2.67%	-123	-150	-178	-206	-235	-263	-292
5.33%	-404	-424	-445	-468	-492	-516	-541
8.00%	-733	-745	-758	-774	-791	-809	-829
KR4301P32876 2019-03 풋287.5							889
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-881	-881	-882	-883	-884	-886	-889
-5.33%	-519	-522	-526	-531	-537	-543	-551
-2.67%	-187	-197	-209	-221	-234	-247	-261
0%	48	32	16	0	-16	-32	-48
2.67%	148	139	128	117	105	93	80
5.33%	170	168	164	160	155	148	141
8.00%	173	172	172	171	169	167	164

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

(단위:백만원)

4,893

공시일	2019-02-21
기준일	2019-02-20

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

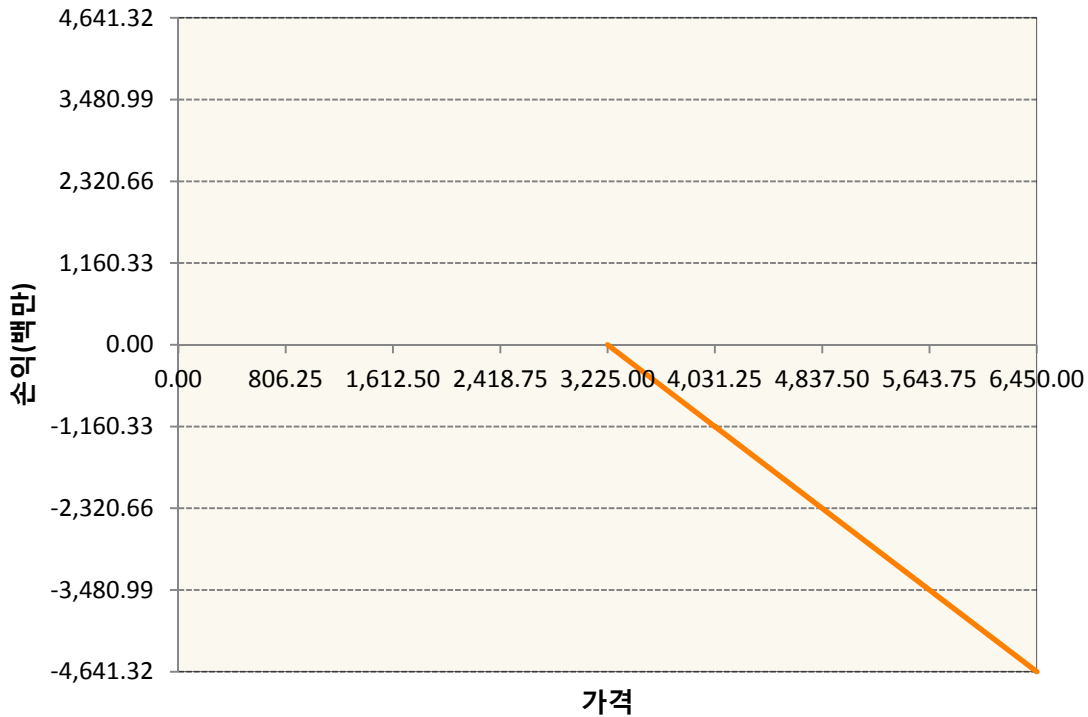
1. 계약금액

(단위:백만원)

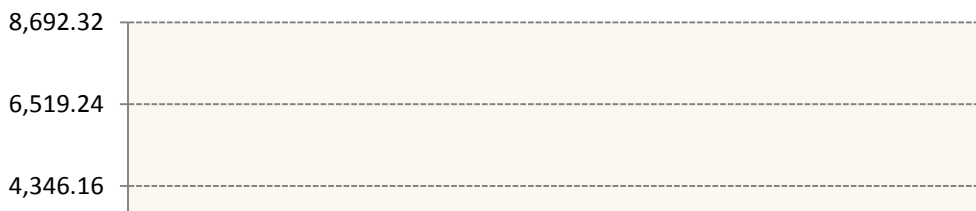
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	7,002	0	7,002	
누계	유가증권	스왑	60,128	0	60,128	장외
누계	유가증권	옵션	0	26,667	-26,667	장내
누계	통화	선도	0	20,378	-20,378	장외

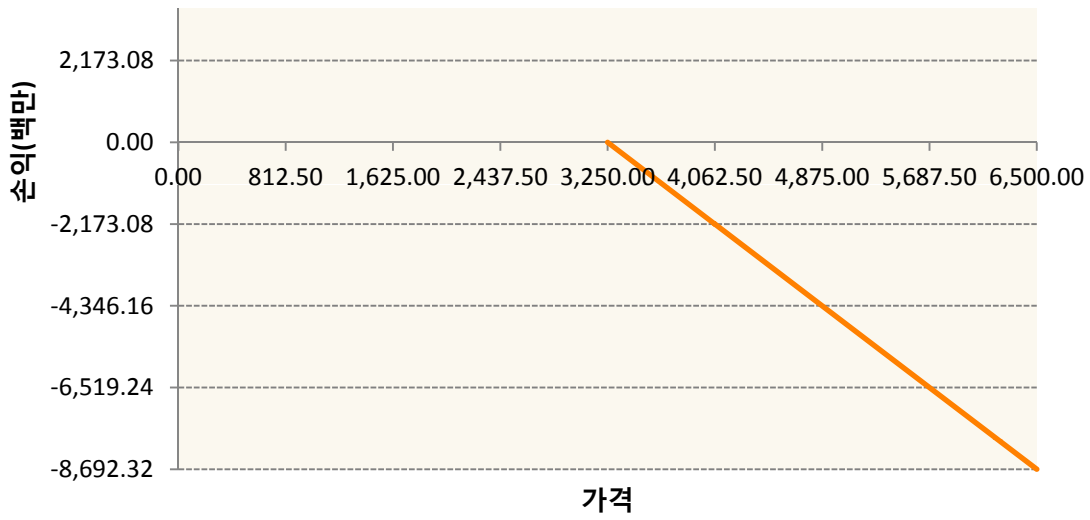
2. 만기시점의 손익구조

OESXH9-C3225-EURO STOXX 50

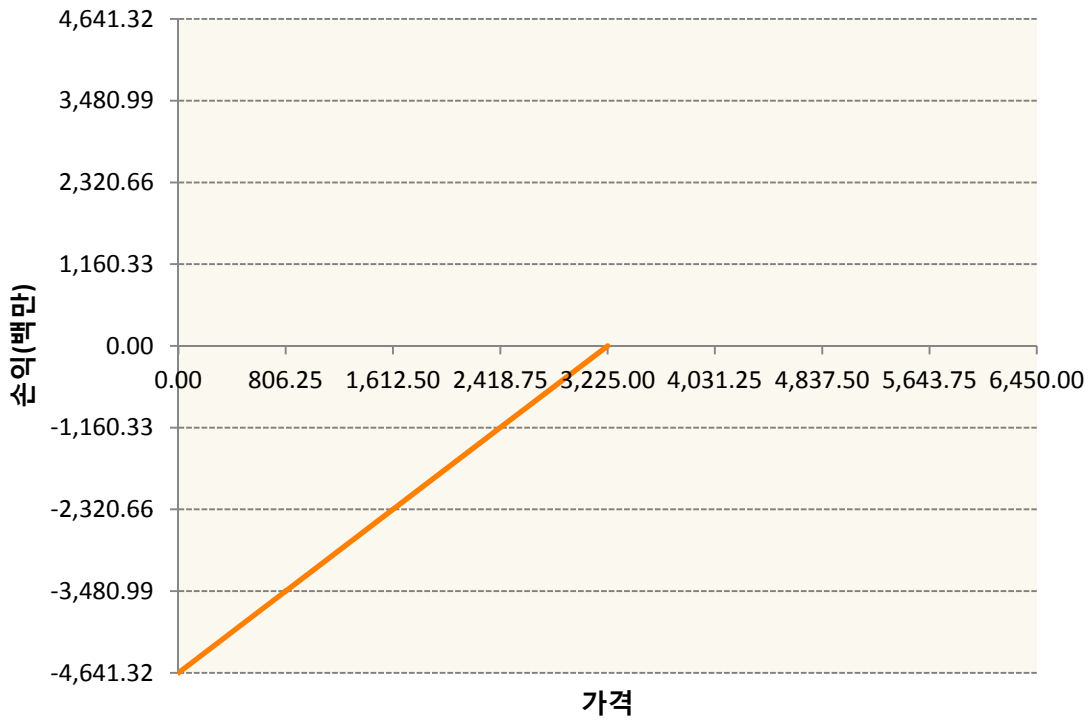


OESXH9-C3250-EURO STOXX 50

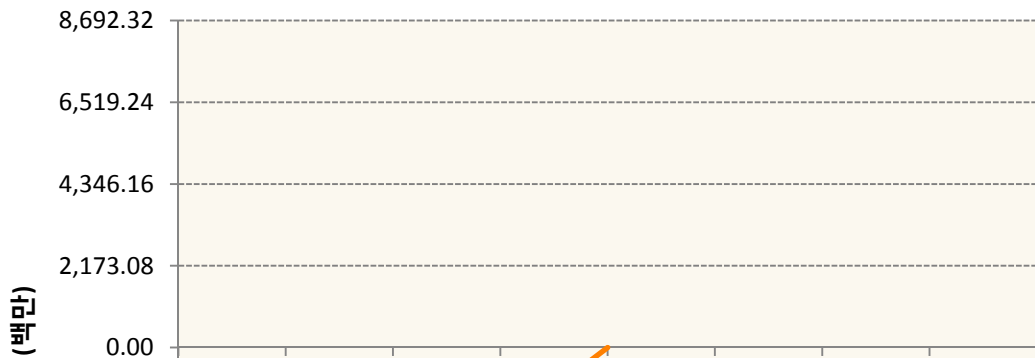


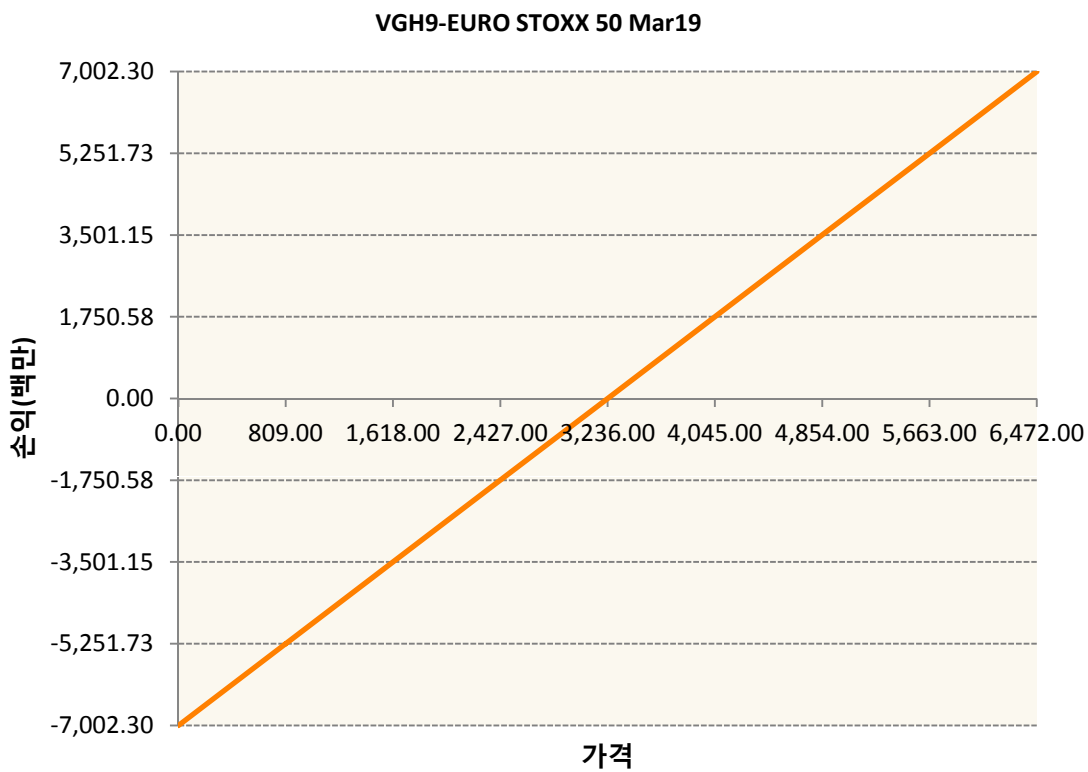
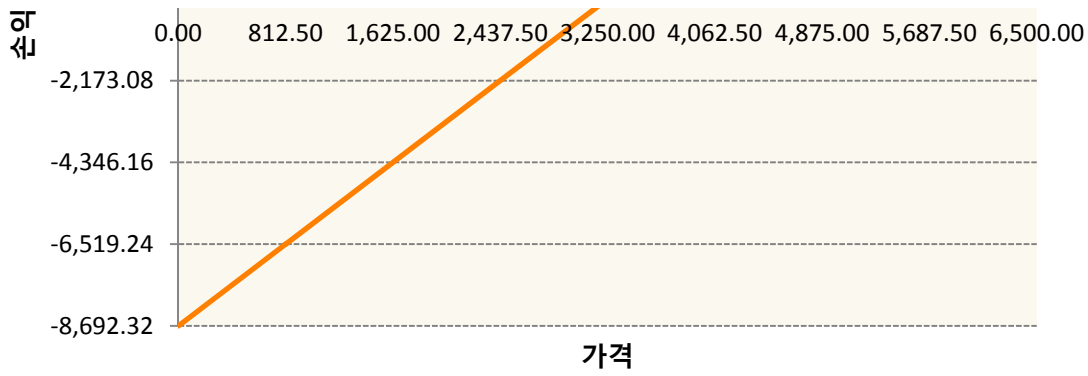


OESXH9-P3225-EURO STOXX 50



OESXH9-P3250-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY	73
FX21018X02 KRW/EUR 22-02-19E	408
FX21018Z03 KRW/EUR 22-03-19E	815
FX21019G02 KRW/EUR 24-05-19E	408
OESXH9-C32 EURO STOXX 50	371
OESXH9-C32 EURO STOXX 50	695
OESXH9-P32 EURO STOXX 50	371
OESXH9-P32 EURO STOXX 50	695
VGH9 EURO STOXX 50 Mar19	560

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

(단위:백만원)

2,840

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

(단위:백만원)

1,176

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

(단위:백만원)

100

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

(단위:백만원)

146

공시일	2019-02-21
기준일	2019-02-20

스마트KRX300인덱스목표전환형1호

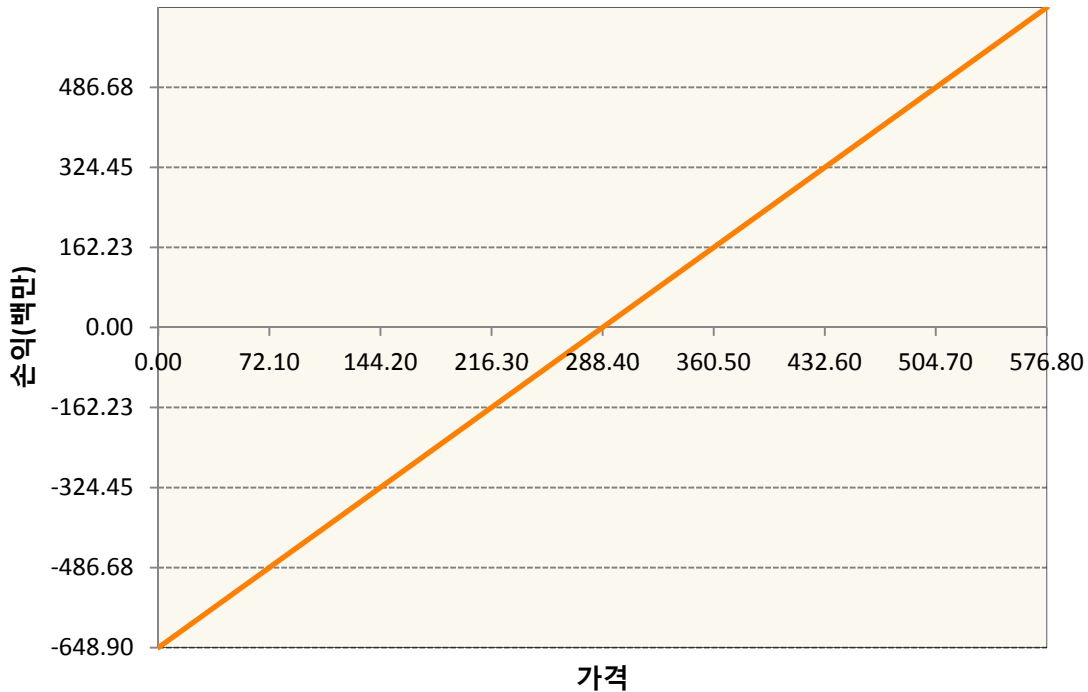
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	649	0	649	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101P30007-2019-03 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101P30007		2019-03 코스피200지수선물						52
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-52	-52	-52	-52	-52	-52	-52	
-5.33%	-35	-35	-35	-35	-35	-35	-35	
-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%	35	35	35	35	35	35	35	
8.00%	52	52	52	52	52	52	52	

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

(단위:백만원)

45

공시일	2019-02-21
기준일	2019-02-20

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

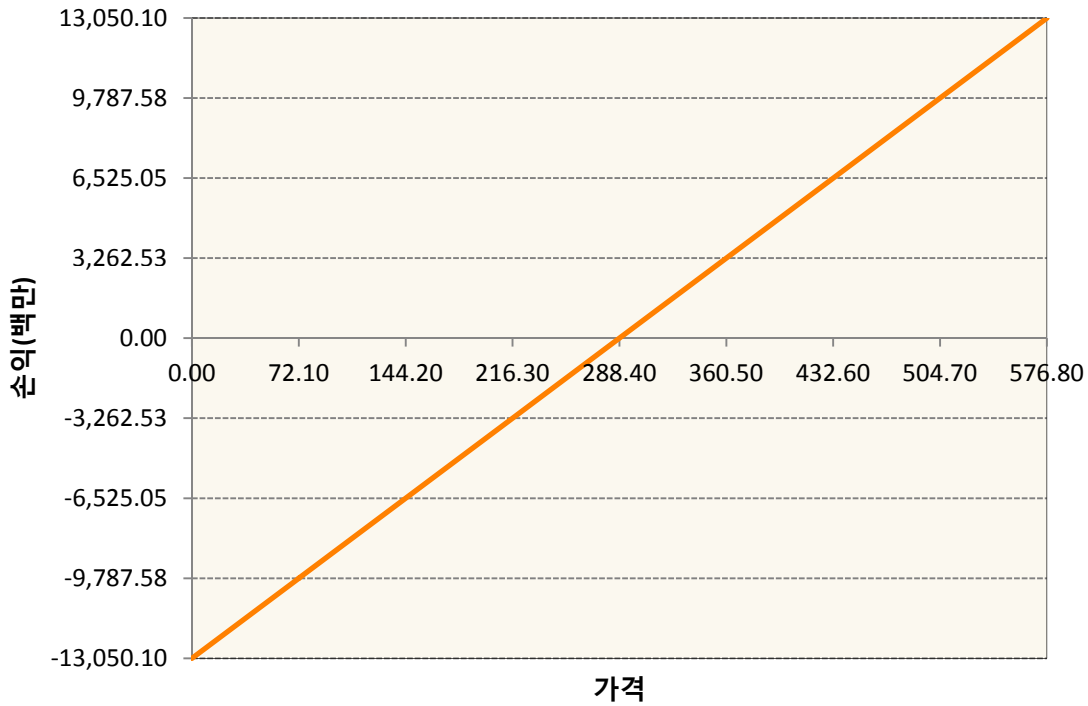
1. 계약금액

(단위:백만원)

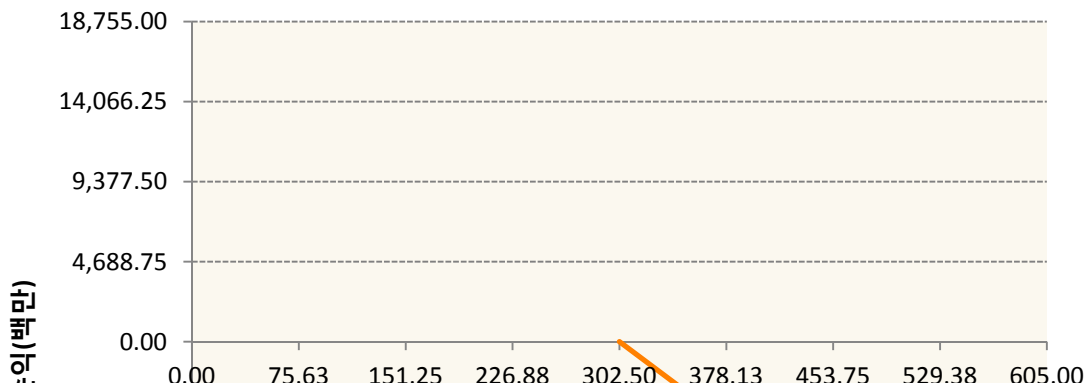
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	13,050	0	13,050	장내
누계	유가증권	옵션	2,165	24,931	-22,766	장내

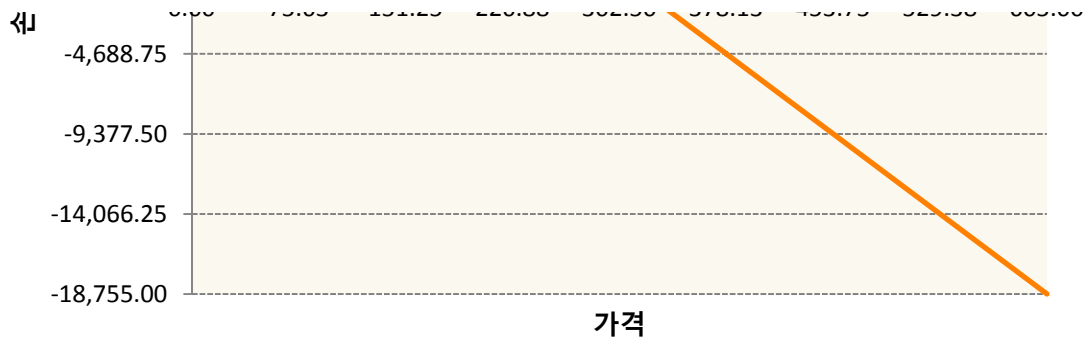
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P30007-2019-03 코스피200지수선물

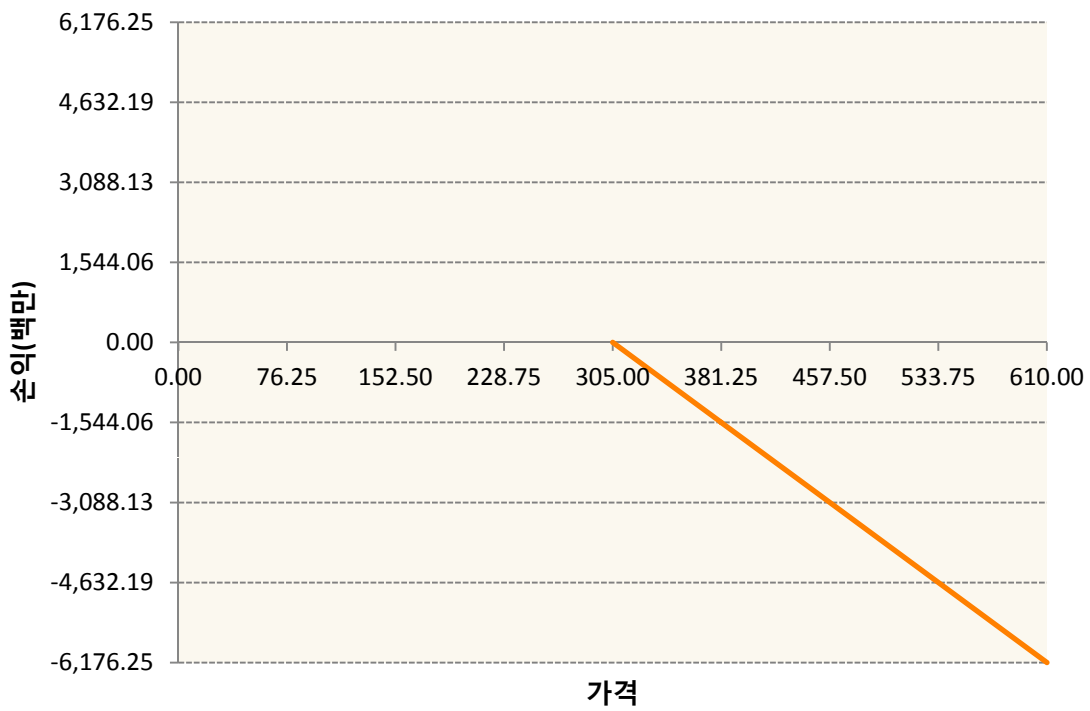


KR4201P33025-2019-03 콜302.5

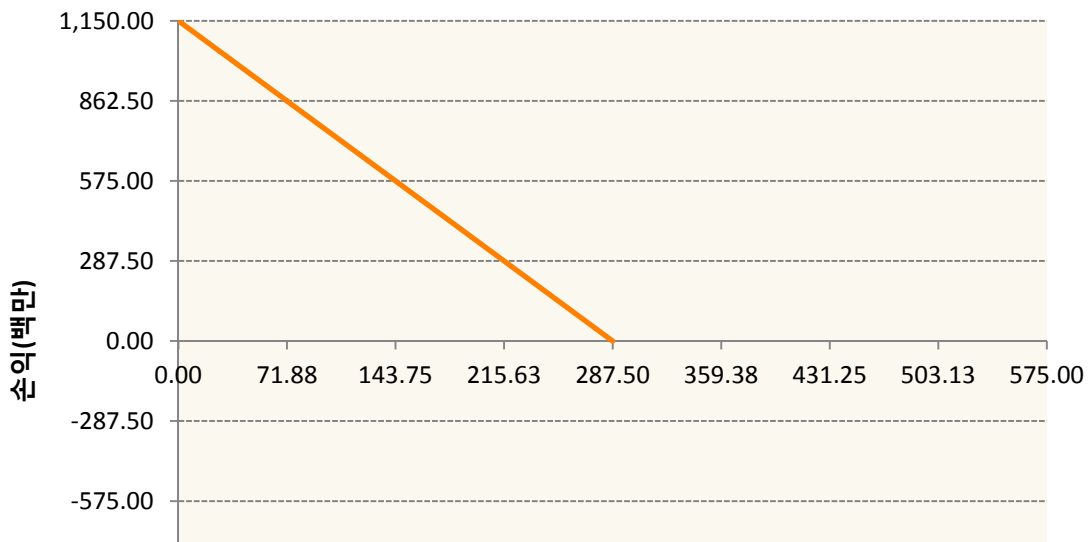


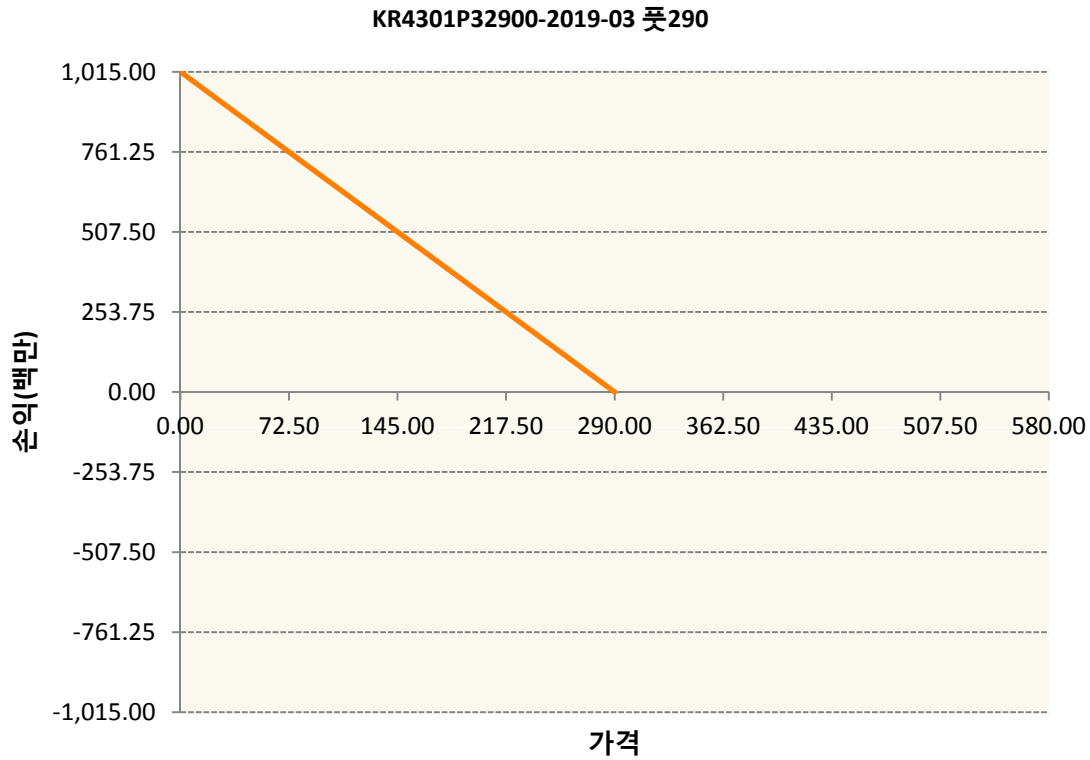
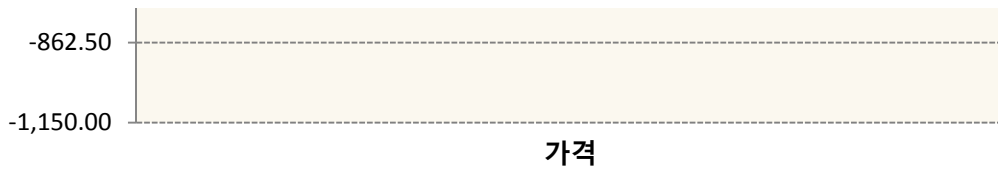


KR4201P33058-2019-03 콜305



KR4301P32876-2019-03 풋287.5





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101P30007		2019-03 코스피200지수선물						1,044
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-1,044	-1,044	-1,044	-1,044	-1,044	-1,044	-1,044	
-5.33%	-696	-696	-696	-696	-696	-696	-696	
-2.67%	-348	-348	-348	-348	-348	-348	-348	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	348	348	348	348	348	348	348	
5.33%	696	696	696	696	696	696	696	
8.00%	1,044	1,044	1,044	1,044	1,044	1,044	1,044	
KR4201P33025		2019-03 콜302.5						768
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	152	151	149	145	140	133	124	
-5.33%	148	143	136	127	116	102	87	
-2.67%	131	118	103	85	65	42	19	

0%	80	55	29	0	-30	-61	-93
2.67%	-36	-72	-109	-146	-183	-220	-258
5.33%	-245	-285	-325	-364	-404	-444	-483
8.00%	-552	-586	-621	-657	-693	-731	-768
KR4201P33058 2019-03 콜305							230
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	40	39	39	38	37	35	32
-5.33%	39	38	36	34	31	27	22
-2.67%	35	32	28	23	17	11	4
0%	23	16	8	0	-9	-18	-28
2.67%	-7	-18	-29	-41	-52	-64	-76
5.33%	-65	-78	-91	-104	-117	-130	-143
8.00%	-155	-167	-180	-192	-205	-217	-230
KR4301P32876 2019-03 풋287.5							75
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	74	74	74	74	74	75	75
-5.33%	44	44	44	45	45	46	46
-2.67%	16	17	18	19	20	21	22
0%	-4	-3	-1	0	1	3	4
2.67%	-12	-12	-11	-10	-9	-8	-7
5.33%	-14	-14	-14	-13	-13	-12	-12
8.00%	-15	-15	-14	-14	-14	-14	-14
KR4301P32900 2019-03 풋290							69
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	69	69	69	69	69	69	69
-5.33%	42	42	43	43	43	43	44
-2.67%	17	17	18	19	19	20	21
0%	-4	-2	-1	0	1	2	4
2.67%	-14	-13	-12	-11	-10	-9	-8
5.33%	-17	-17	-16	-16	-15	-14	-14
8.00%	-17	-17	-17	-17	-17	-17	-16

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

(단위:백만원)

1,796

공시일	2019-02-21
기준일	2019-02-20

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	936	0	936	

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	2019-02-21
기준일	2019-02-20

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	5,505	0	5,505	

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	2019-02-21
기준일	2019-02-20

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	18,806	0	18,806	
누계	통화	선도	0	27,178	-27,178	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		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
FX21019G01 KRW/USD 19-03-19E		105
FX21019G01 KRW/USD 19-03-19E		106
FX21019G01 KRW/USD 19-03-19E		43
FX21019G01 KRW/USD 21-03-19E		422

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

(단위:백만원)

797

공시일	2019-02-21
기준일	2019-02-20

스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

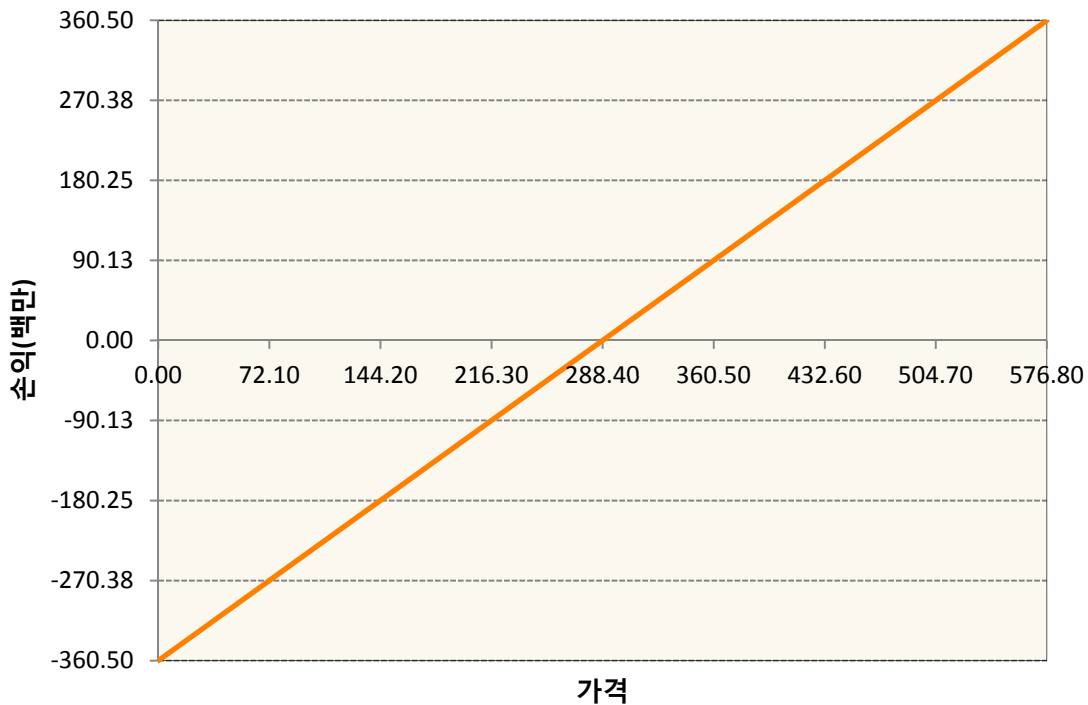
1. 계약금액

(단위:백만원)

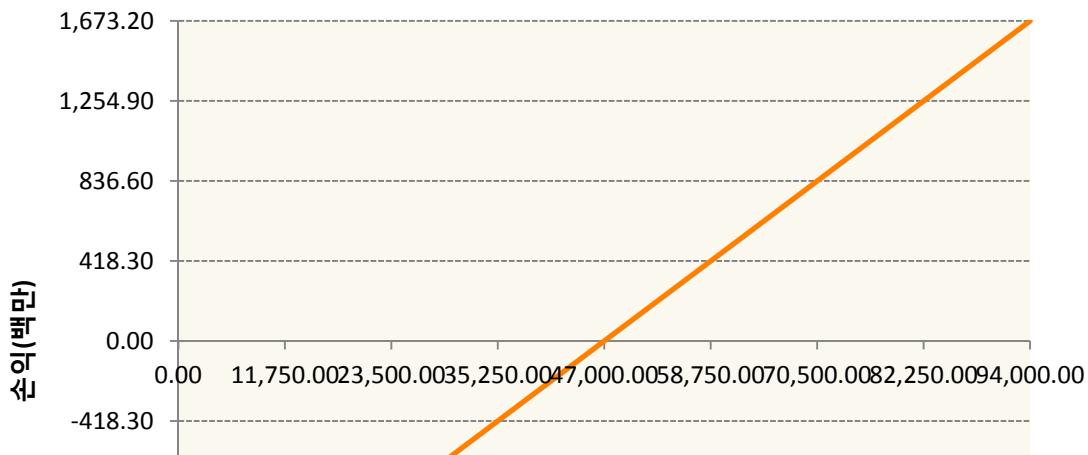
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,034	0	2,034	장내

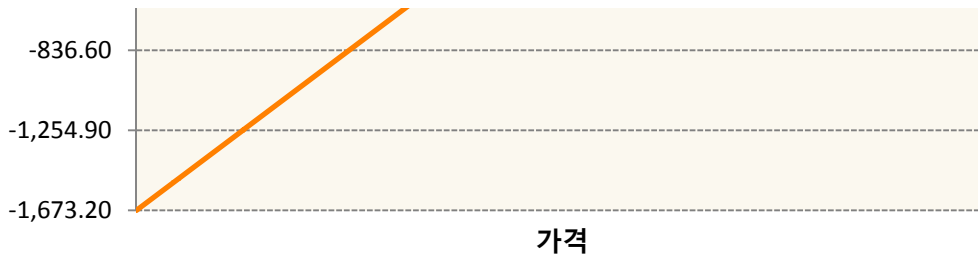
2. 만기시점의 손익구조

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						134
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-134	-134	-134	-134	-134	-134	-134	
-5.33%	-89	-89	-89	-89	-89	-89	-89	
-2.67%	-45	-45	-45	-45	-45	-45	-45	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	45	45	45	45	45	45	45	
5.33%	89	89	89	89	89	89	89	
8.00%	134	134	134	134	134	134	134	

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

181

공시일	2019-02-21
기준일	2019-02-20

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

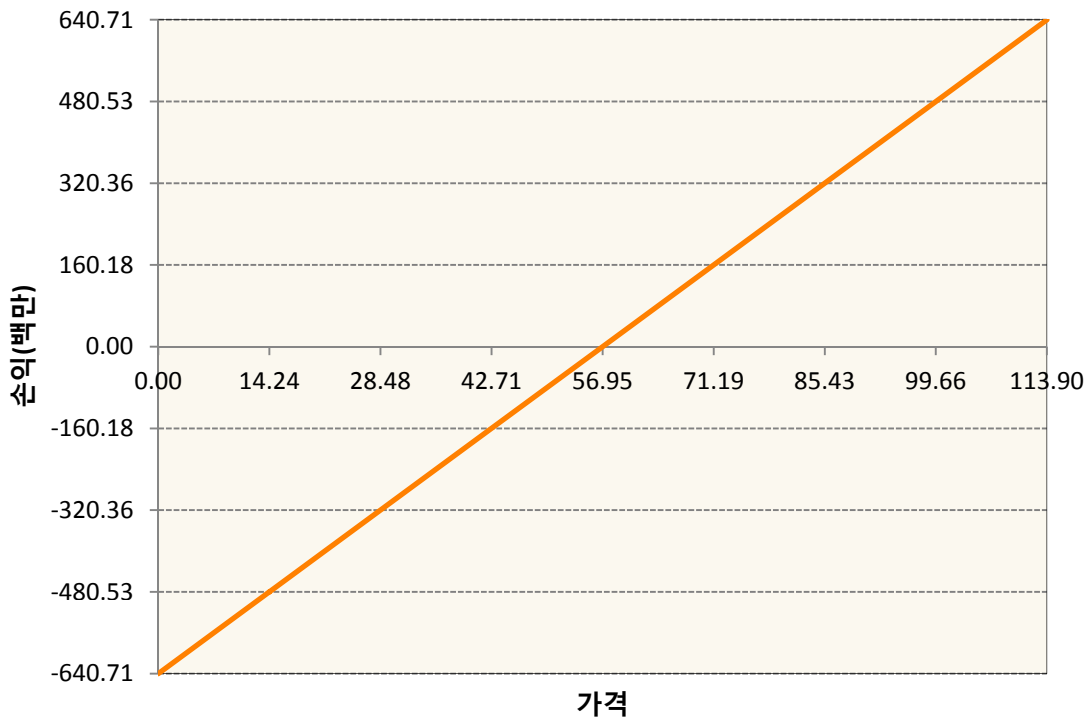
1. 계약금액

(단위:백만원)

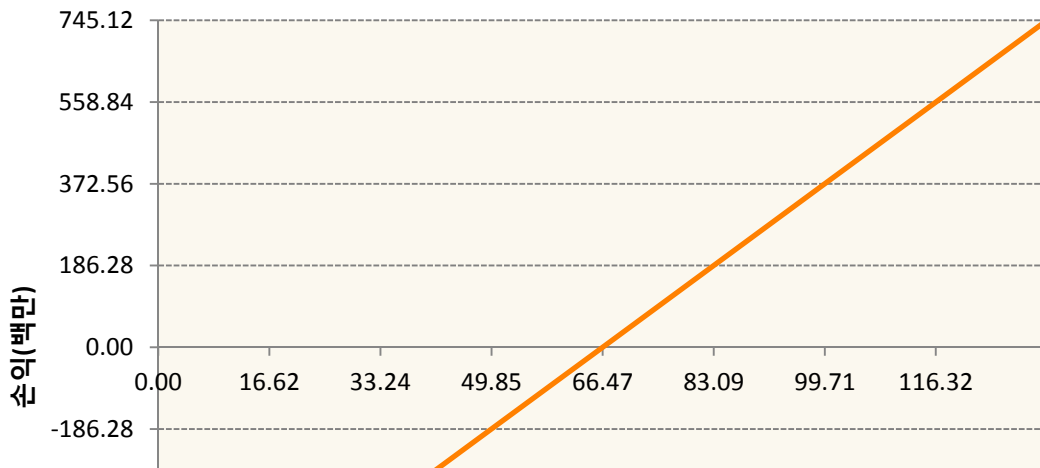
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,801	281	2,520	

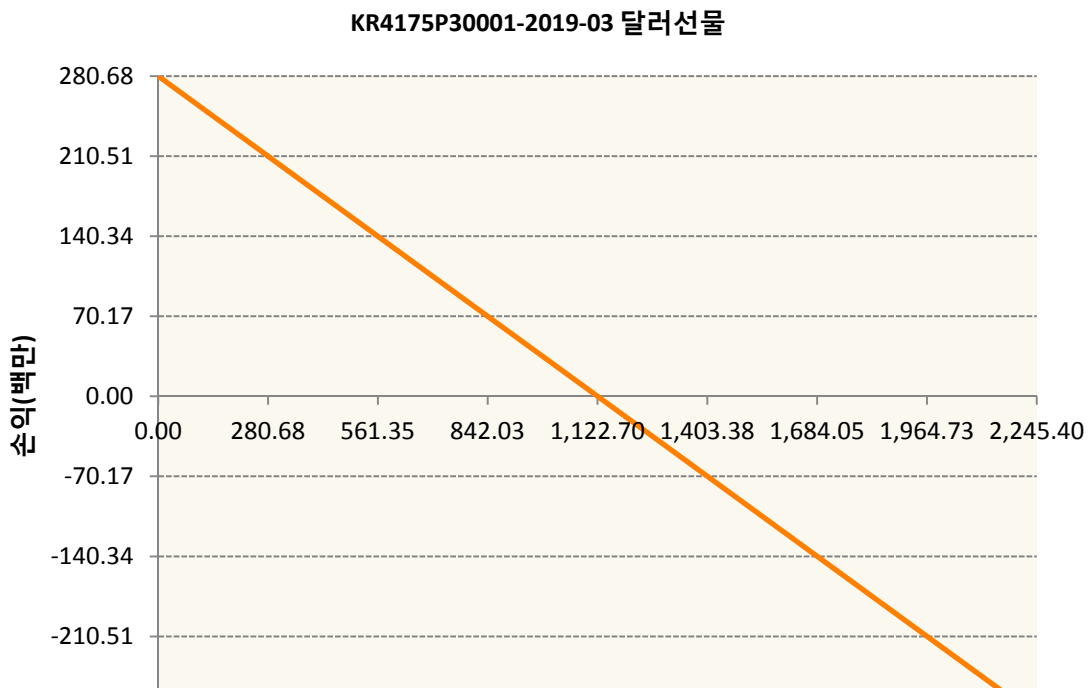
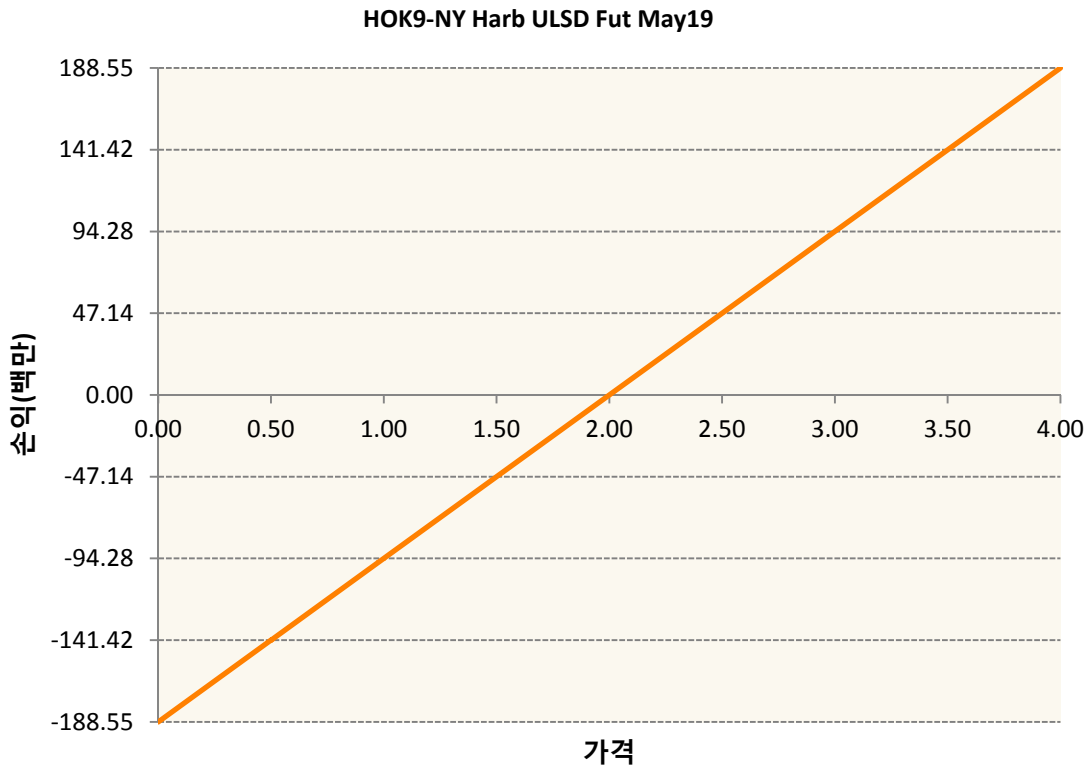
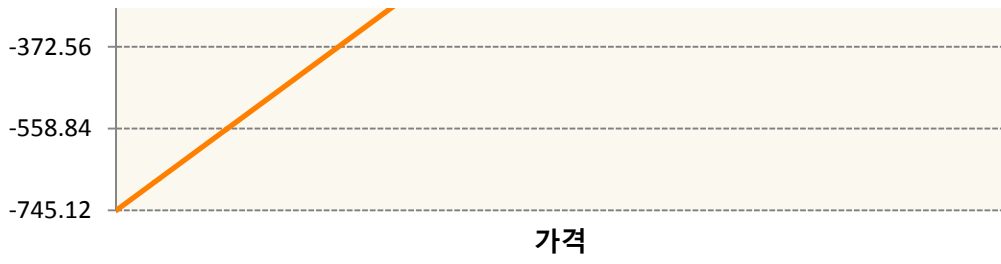
2. 만기시점의 손익구조

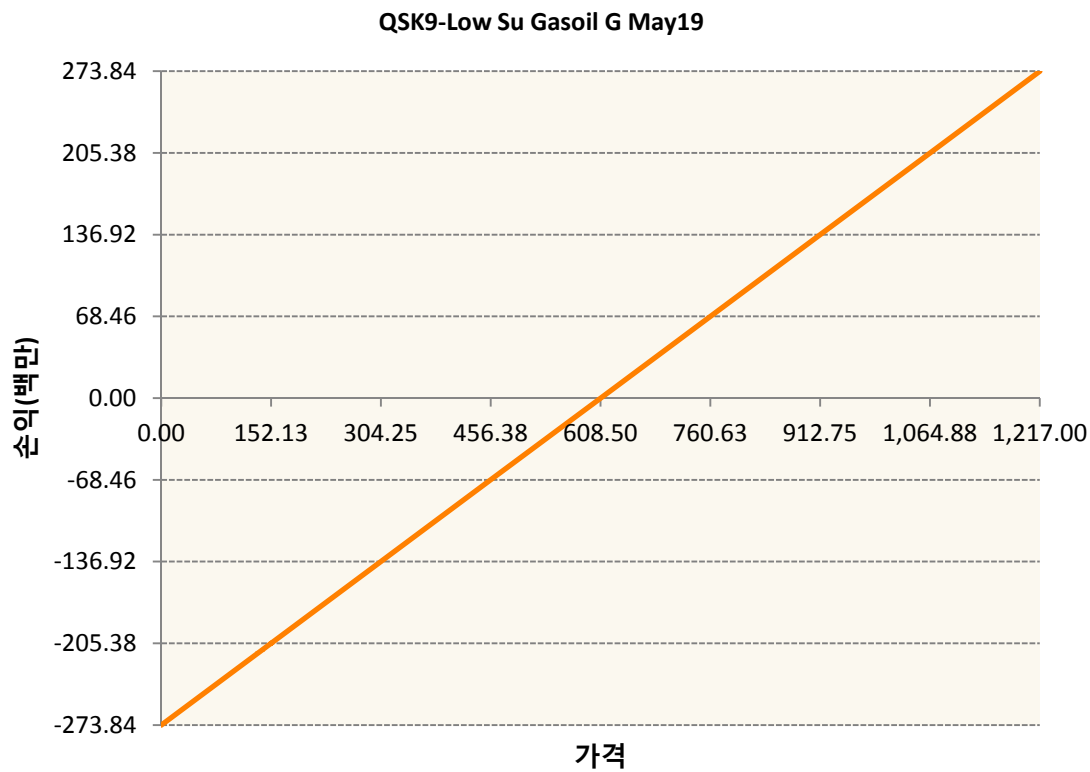
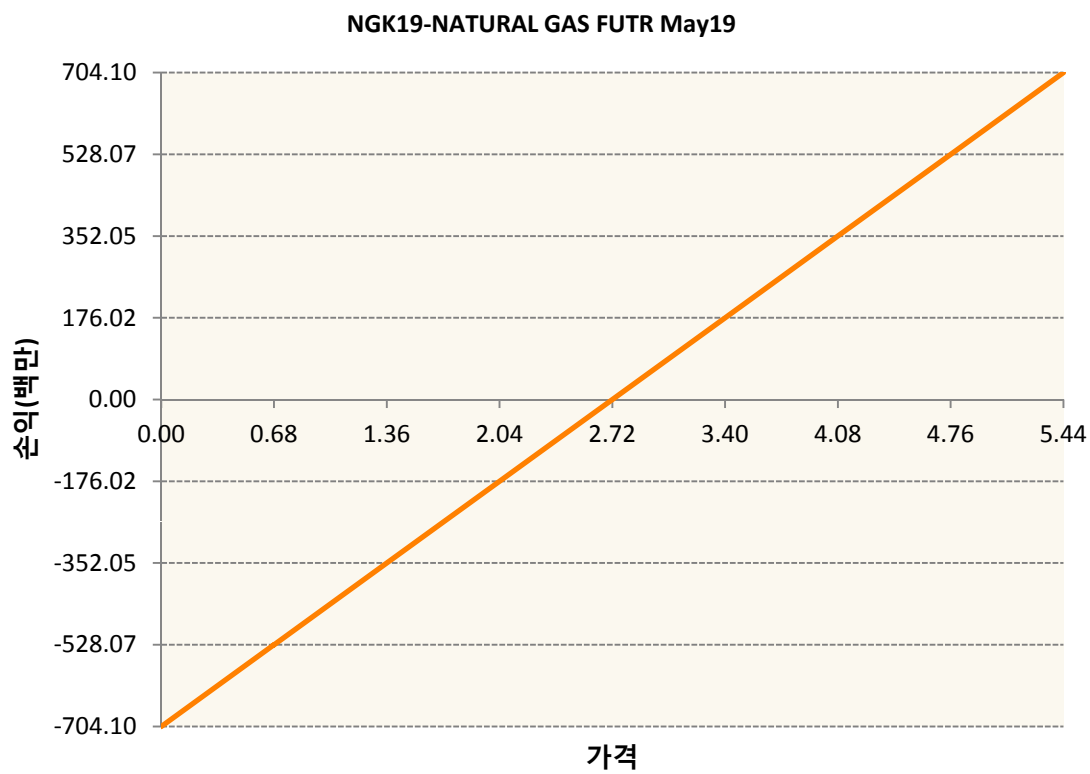
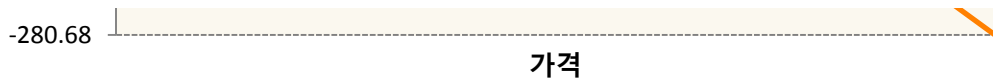
CLK9-WTI CRUDE FUTURE May19



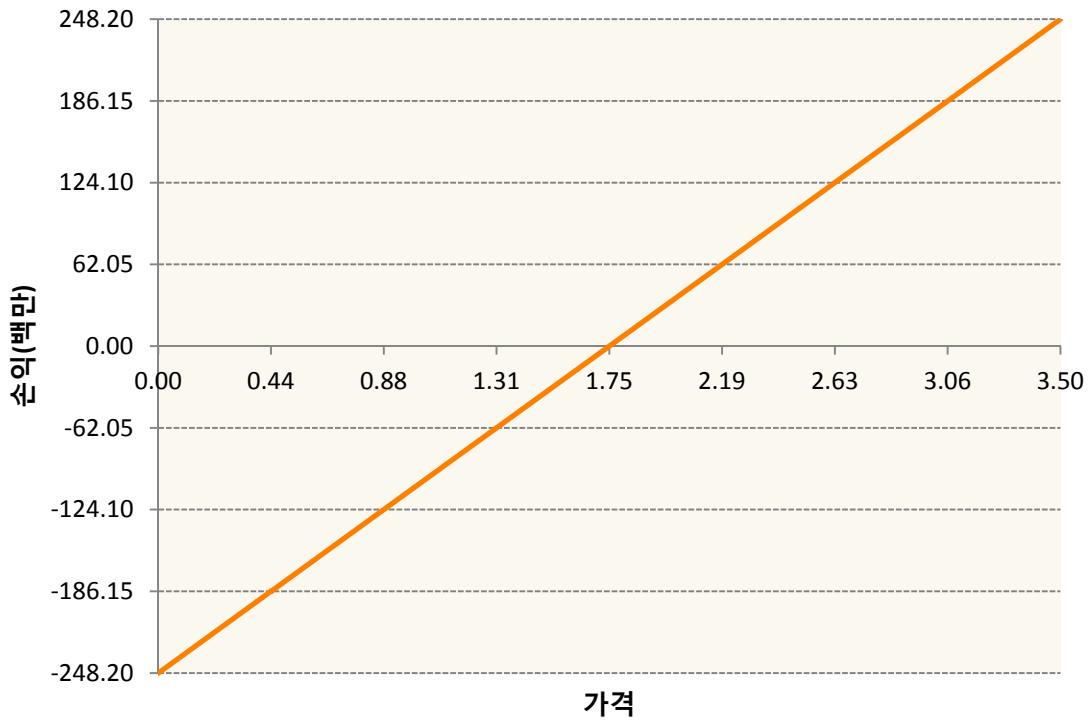
COK9-BRENT CRUDE FUTR May19







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	22
NGK19	NATURAL GAS FUTR May19	56
QSK9	Low Su Gasoil G May19	22
XBK9	GASOLINE RBOB FUT May19	20

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

(단위:백만원)

429

공시일	2019-02-21
기준일	2019-02-20

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

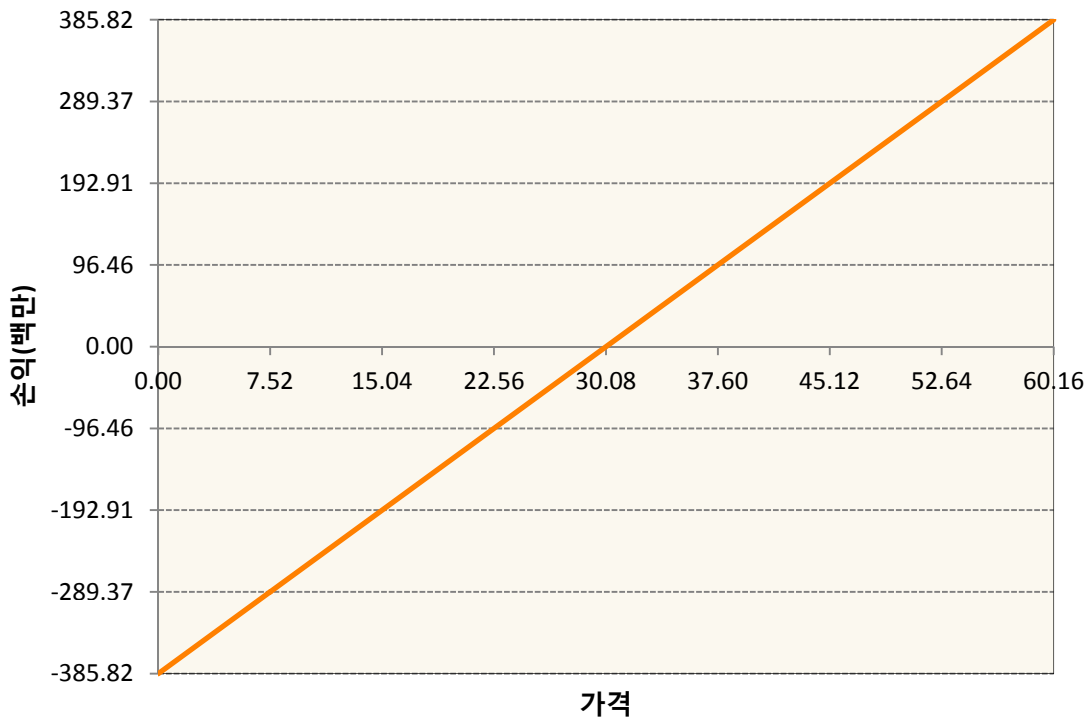
1. 계약금액

(단위:백만원)

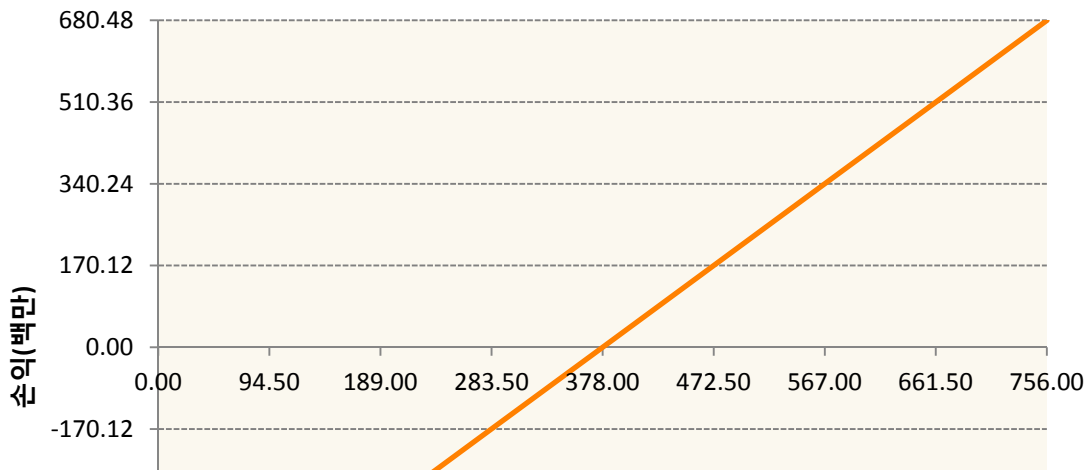
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,463	79	3,384	

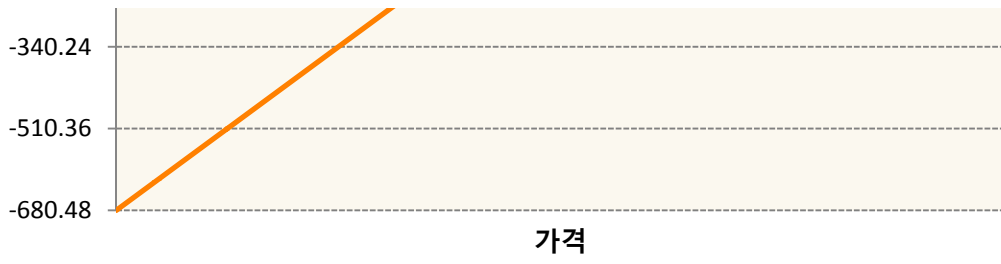
2. 만기시점의 손익구조

BOK9-SOYBEAN OIL FUTR May19

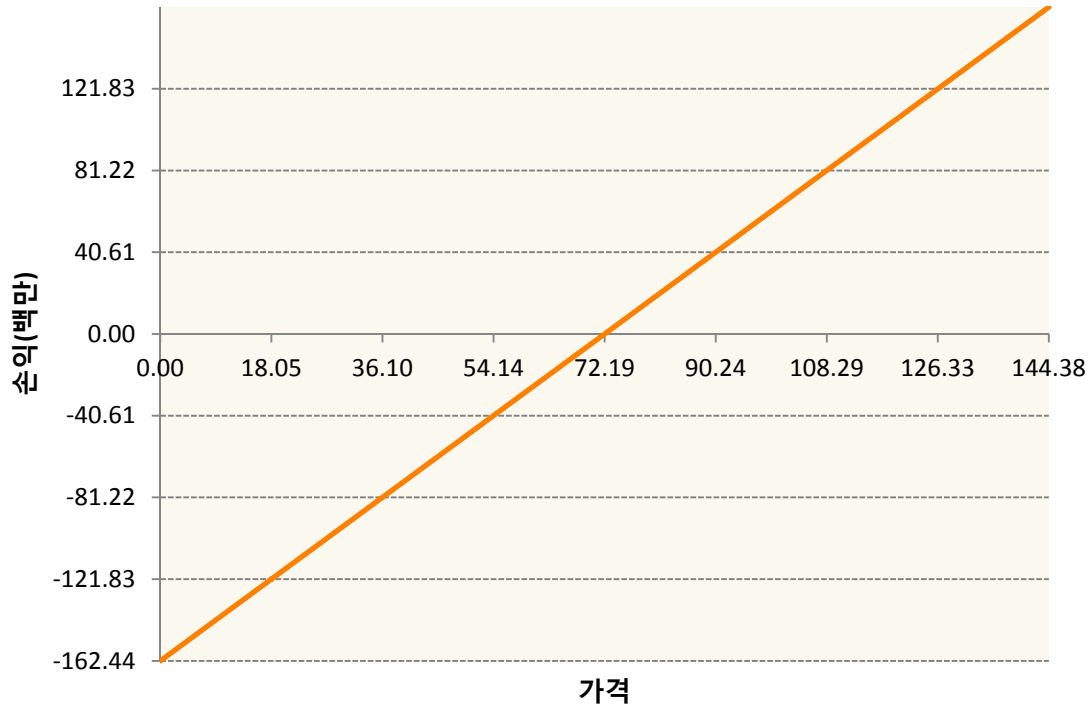


CK9-CORN FUTURE May19

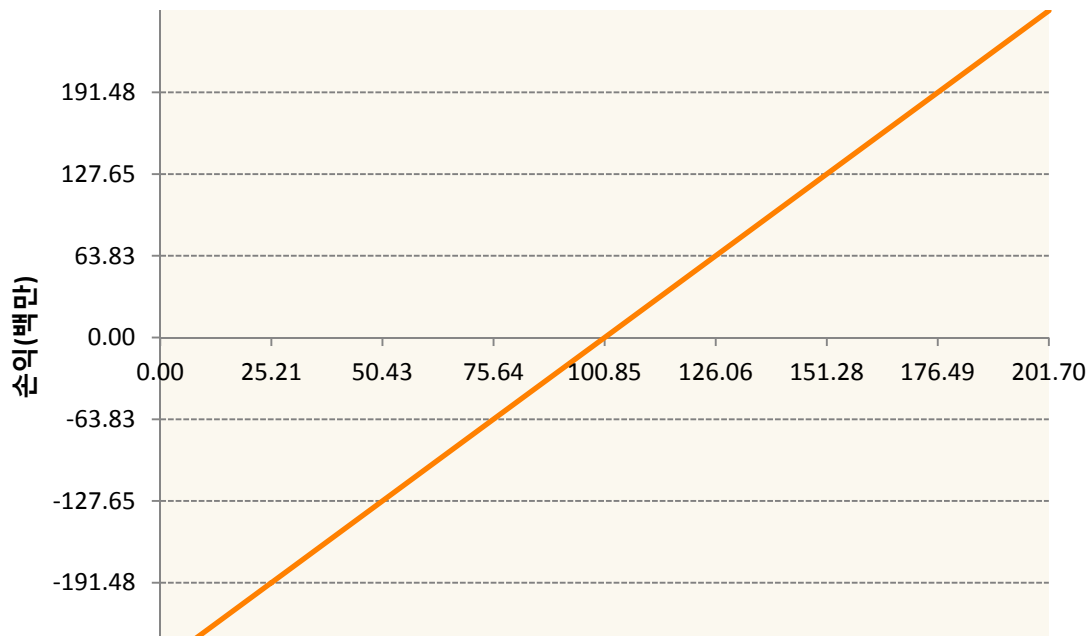


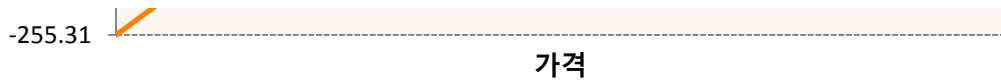


CTK9-COTTON NO.2 FUTR May19

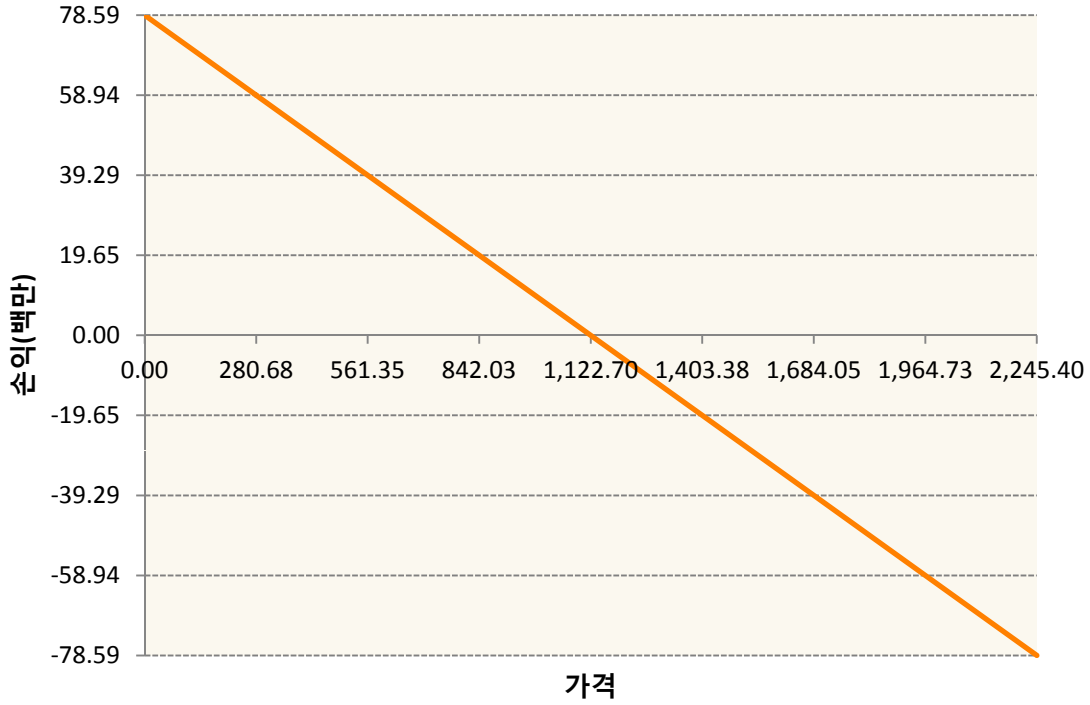


KCK9-COFFEE 'C' FUTURE May19

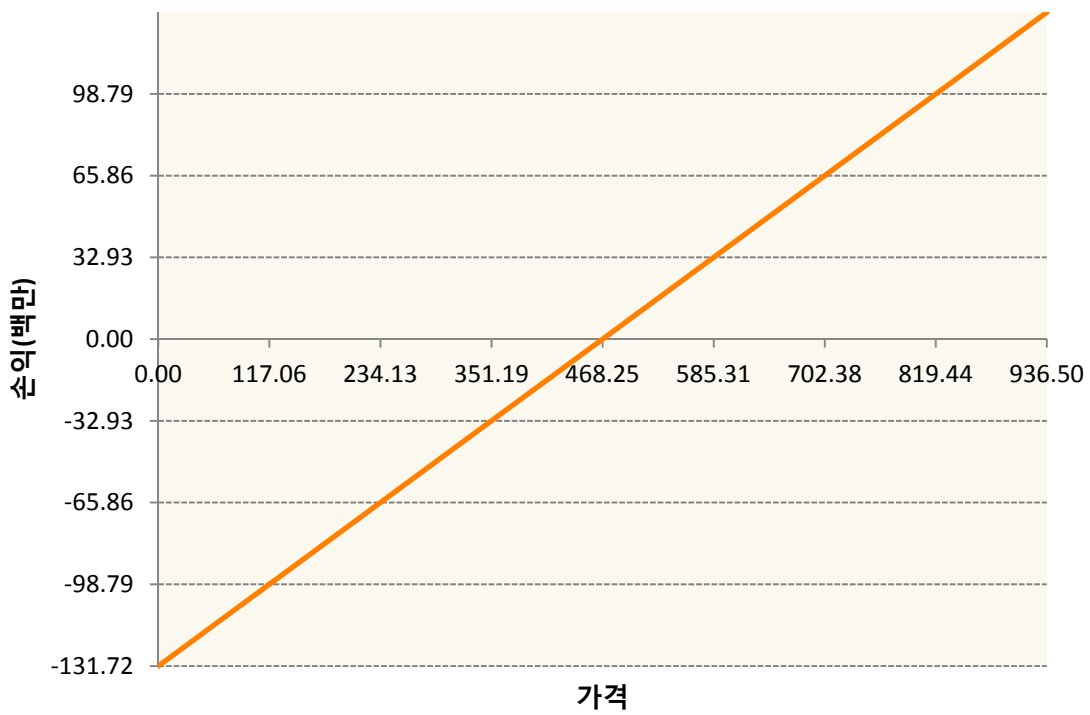




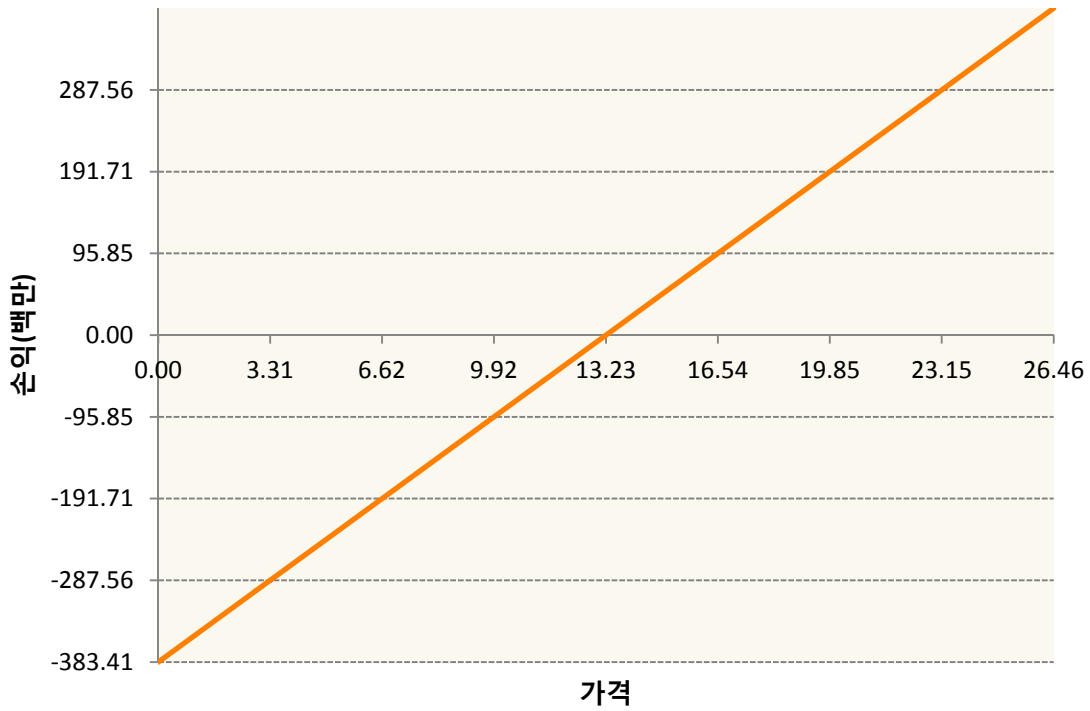
KR4175P30001-2019-03 달러선물



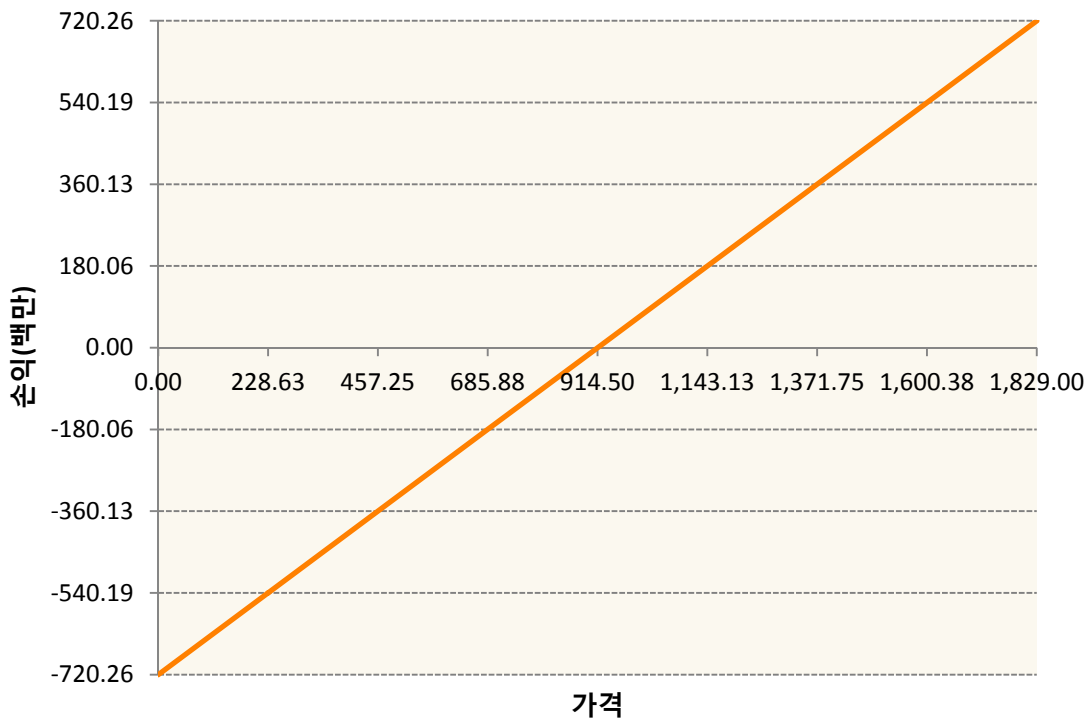
KWK9-KC HRW WHEAT FUT May19



SBK9-SUGAR #11 (WORLD) May19

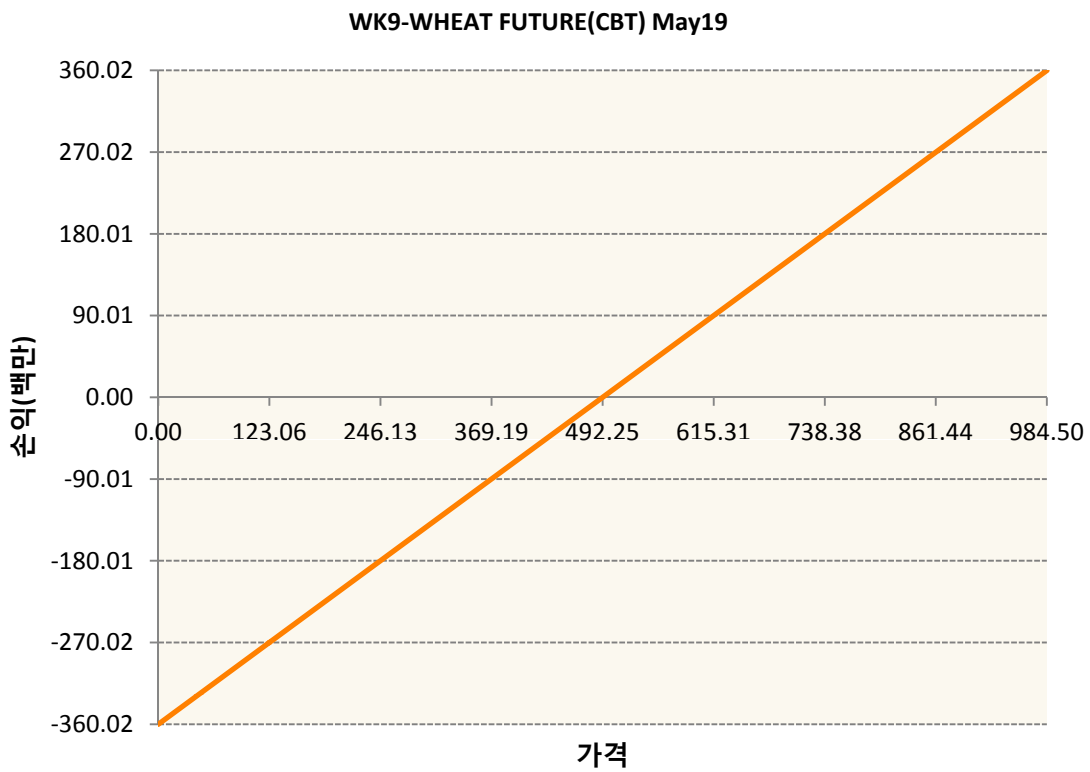
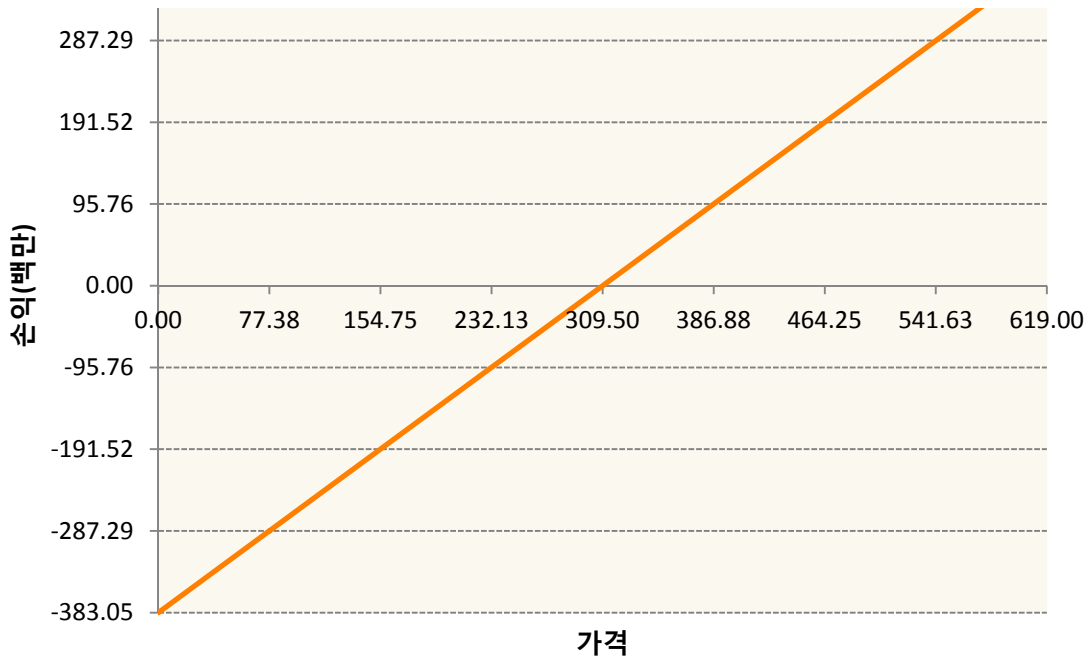


SK9-SOYBEAN FUTURE May19



SMK9-SOYBEAN MEAL FUTR May19





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

BOK9	SOYBEAN OIL FUTR May19	31
CK9	CORN FUTURE May19	54
CTK9	COTTON NO.2 FUTR May19	13
KCK9	COFFEE 'C' FUTURE May19	20
KR4175P300	2019-03 달러선물	6

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

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

(단위:백만원)

279