

공시일	2019-02-22
기준일	2019-02-21

## 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	2019-02-22
기준일	2019-02-21

## 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

1,109

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

639

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-02-22
기준일	2019-02-21

## 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	291
SWCSI50000 신한CSI500미래S190129	87

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

556

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-02-22
기준일	2019-02-21

## 유로인덱스모(주식-파생형)

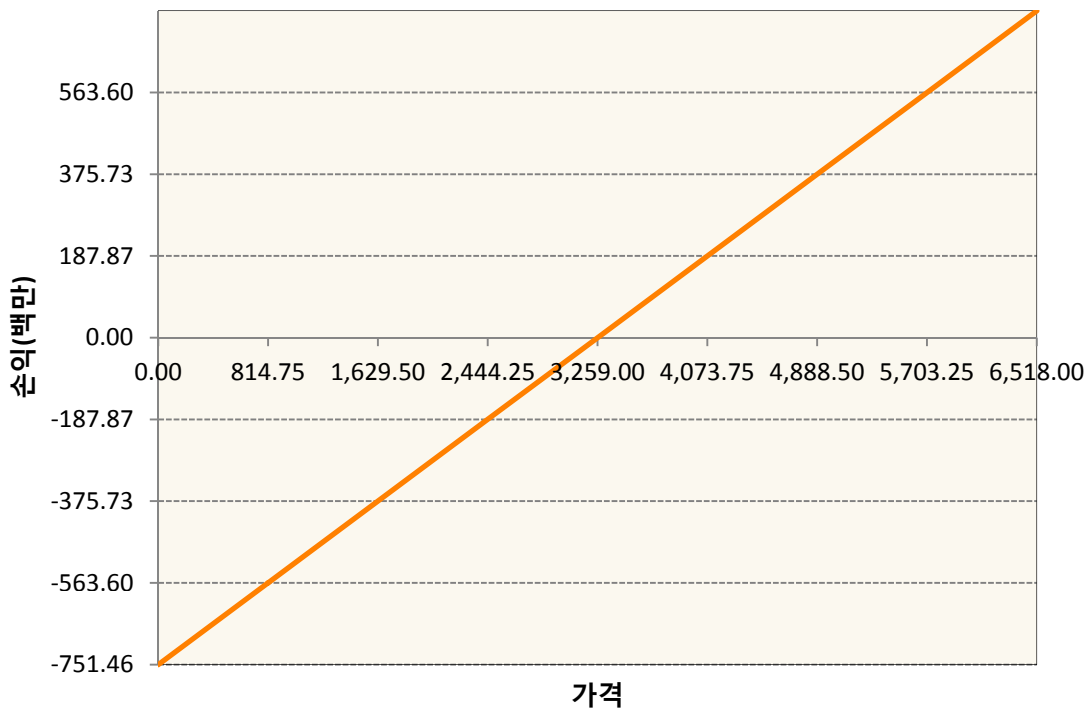
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	751	0	751	

### 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	2019-02-22
기준일	2019-02-21

## 차이나인덱스모(주식-파생형)

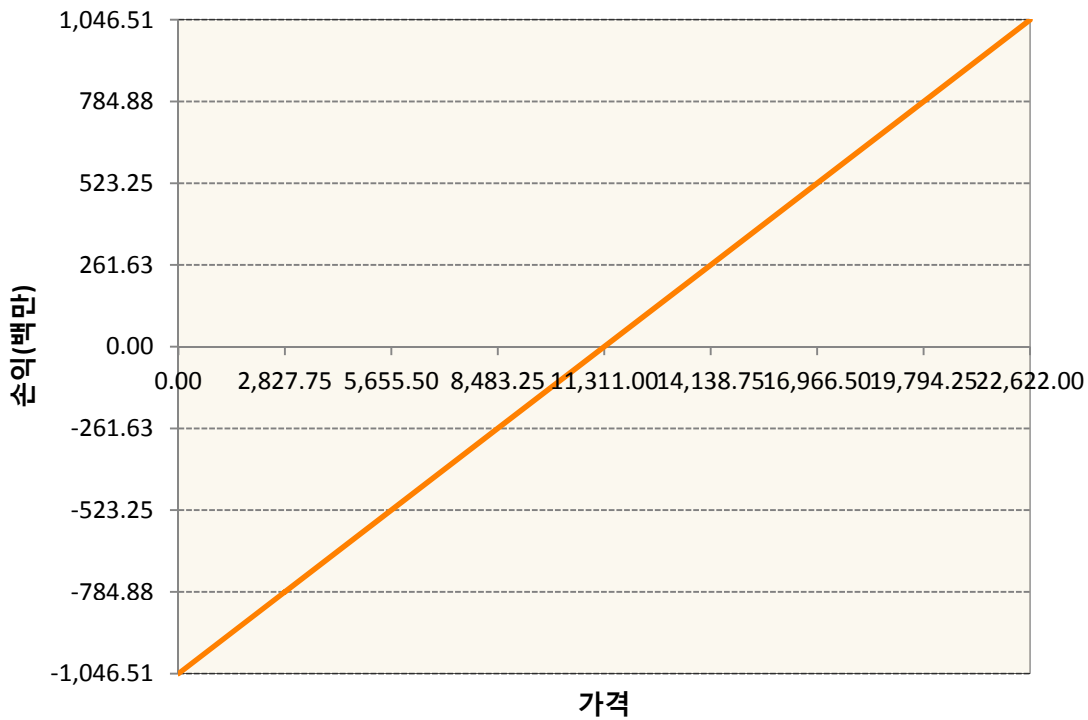
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

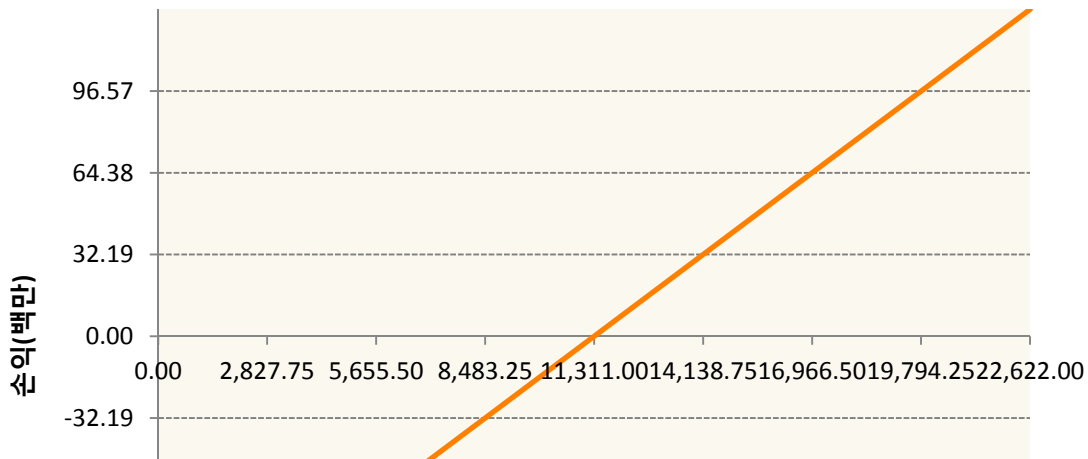
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,175	0	1,175	장내

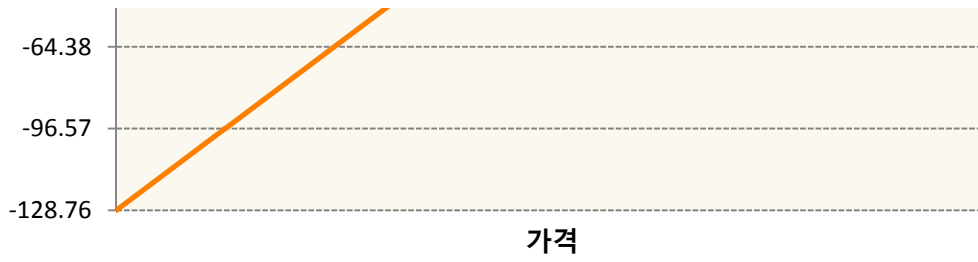
### 2. 만기시점의 손익구조

HCG9-HSCEI Futures Feb19



MHCG9-MINI H-SHR IDX FU Feb19





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

HCG9	HSCEI Futures Feb19	84
MHCG9	MINI H-SHR IDX FU Feb19	10

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

<b>96</b>
-----------

공시일	2019-02-22
기준일	2019-02-21

## 커버드콜모(주식혼합-파생형)

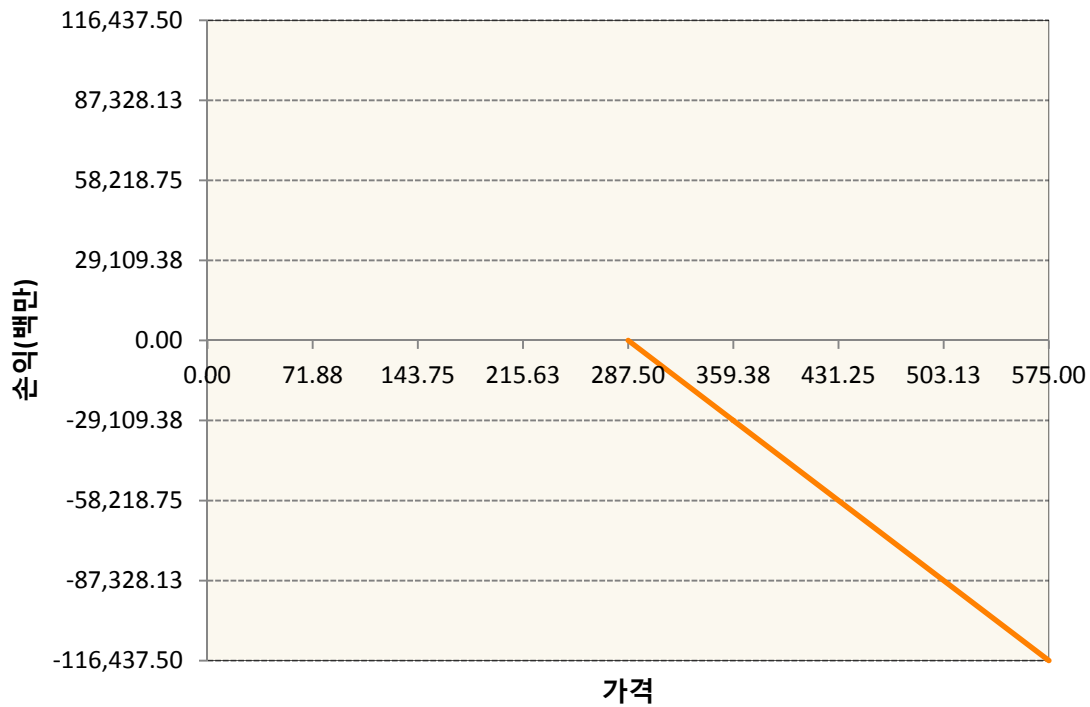
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

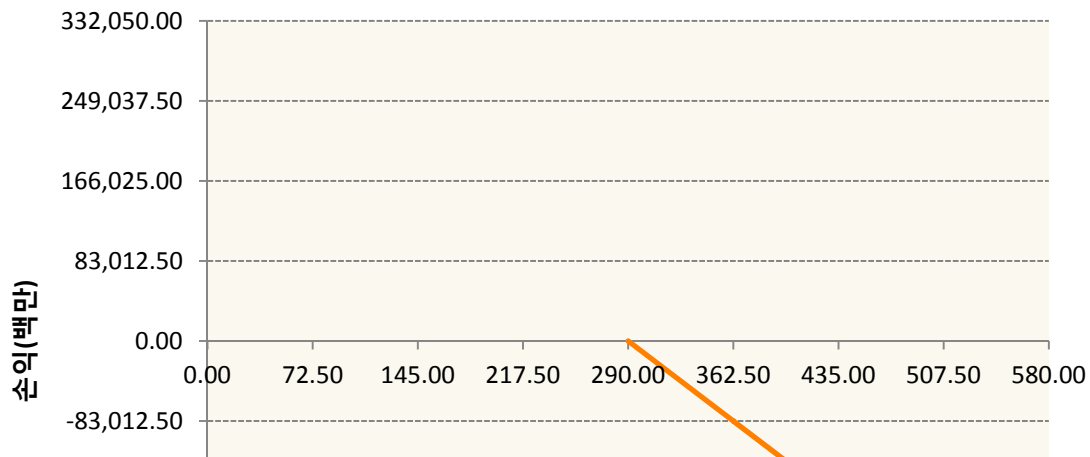
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	692,863	-692,863	장내

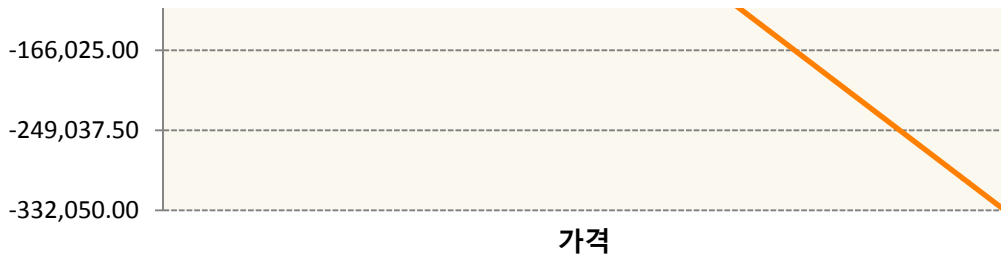
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4201P32878-2019-03 콜287.5

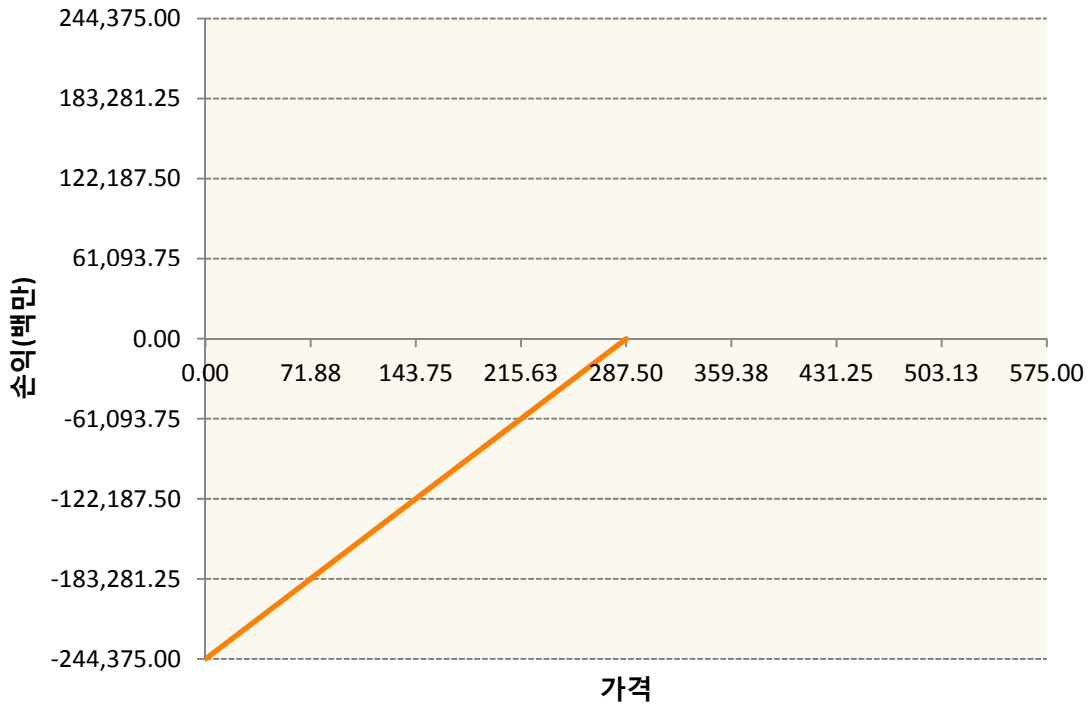


KR4201P32902-2019-03 콜290





KR4301P32876-2019-03 풋287.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201P32878		2019-03 콜287.5					7,358
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	2,981	2,920	2,843	2,749	2,642	2,523	2,392
-5.33%	2,716	2,581	2,432	2,271	2,101	1,922	1,738
-2.67%	2,034	1,823	1,607	1,388	1,166	942	716
0%	722	481	241	0	-241	-481	-722
2.67%	-1,279	-1,483	-1,694	-1,911	-2,131	-2,354	-2,581
5.33%	-3,831	-3,964	-4,112	-4,274	-4,446	-4,628	-4,817
8.00%	-6,715	-6,782	-6,867	-6,969	-7,086	-7,216	-7,358
KR4201P32902		2019-03 콜290					19,815
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	7,154	7,025	6,853	6,637	6,382	6,090	5,764

-5.33%	6,623	6,309	5,950	5,552	5,121	4,663	4,181
-2.67%	5,137	4,595	4,032	3,451	2,856	2,251	1,637
0%	2,041	1,361	681	0	-681	-1,363	-2,045
2.67%	-2,997	-3,632	-4,277	-4,929	-5,588	-6,251	-6,918
5.33%	-9,755	-10,206	-10,695	-11,214	-11,757	-12,321	-12,902
8.00%	-17,654	-17,903	-18,204	-18,551	-18,939	-19,362	-19,815
KR4301P32876                      2019-03 풋287.5							15,993
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-15,879	-15,882	-15,889	-15,902	-15,923	-15,953	-15,993
-5.33%	-9,396	-9,439	-9,499	-9,576	-9,669	-9,778	-9,901
-2.67%	-3,396	-3,580	-3,778	-3,987	-4,205	-4,430	-4,661
0%	828	552	276	0	-276	-553	-829
2.67%	2,574	2,419	2,246	2,058	1,858	1,648	1,430
5.33%	2,934	2,898	2,846	2,777	2,691	2,589	2,472
8.00%	2,969	2,965	2,957	2,943	2,920	2,887	2,843

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

(단위:백만원)

**44,186**

공시일	2019-02-22
기준일	2019-02-21

## 홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

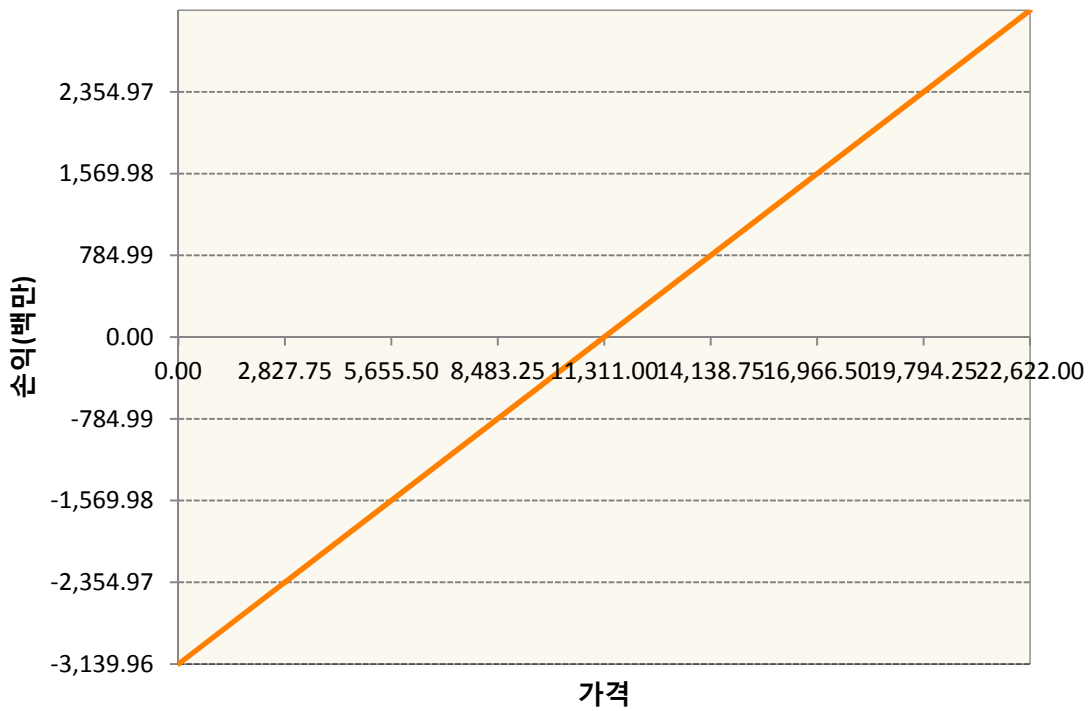
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

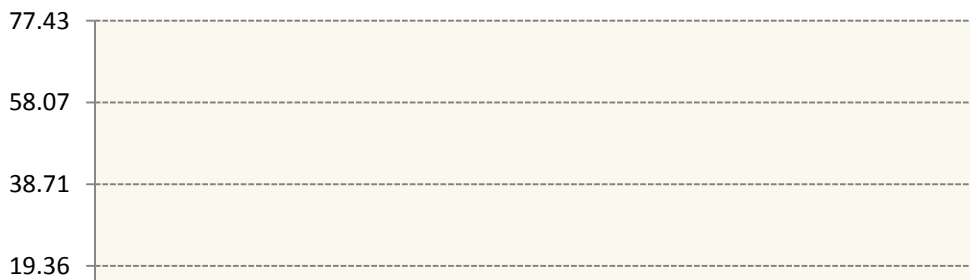
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	3,140	0	3,140	장내
누계	유가증권	옵션	0	7,344	-7,344	장내
누계	통화	선도	0	2,724	-2,724	장외

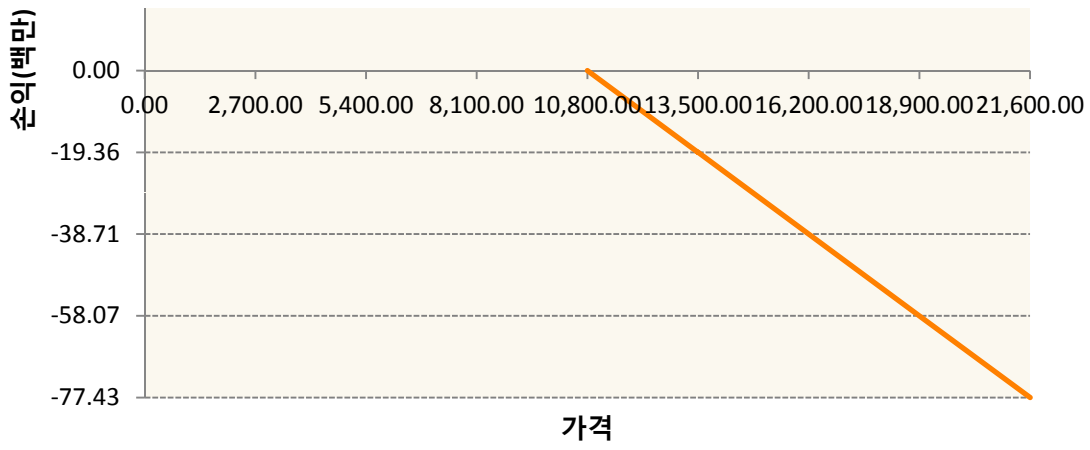
### 2. 만기시점의 손익구조

HCG9-HSCEI Futures Feb19

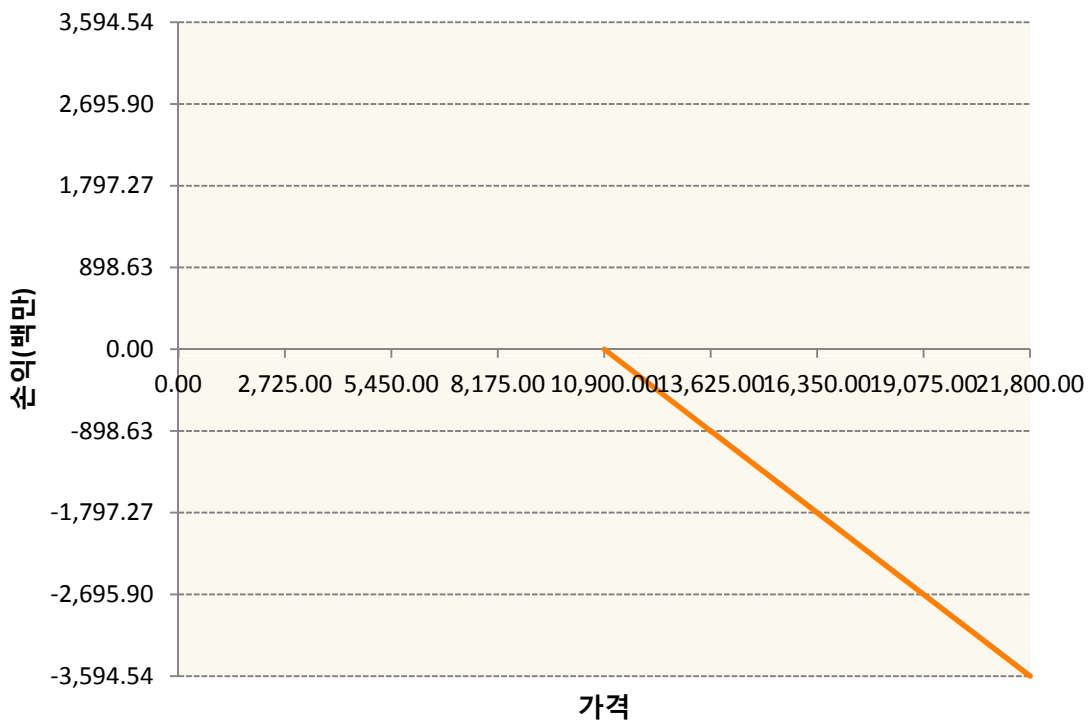


OHHIG9-C108-HSCEI

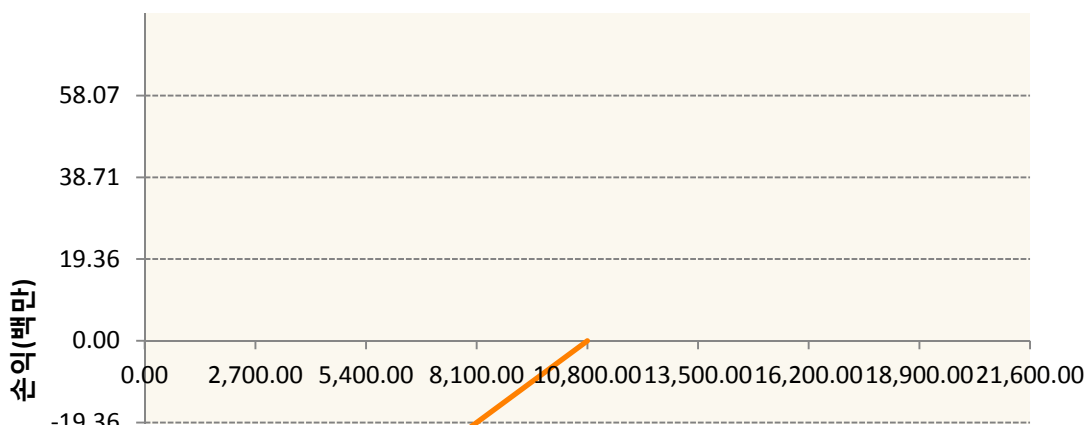


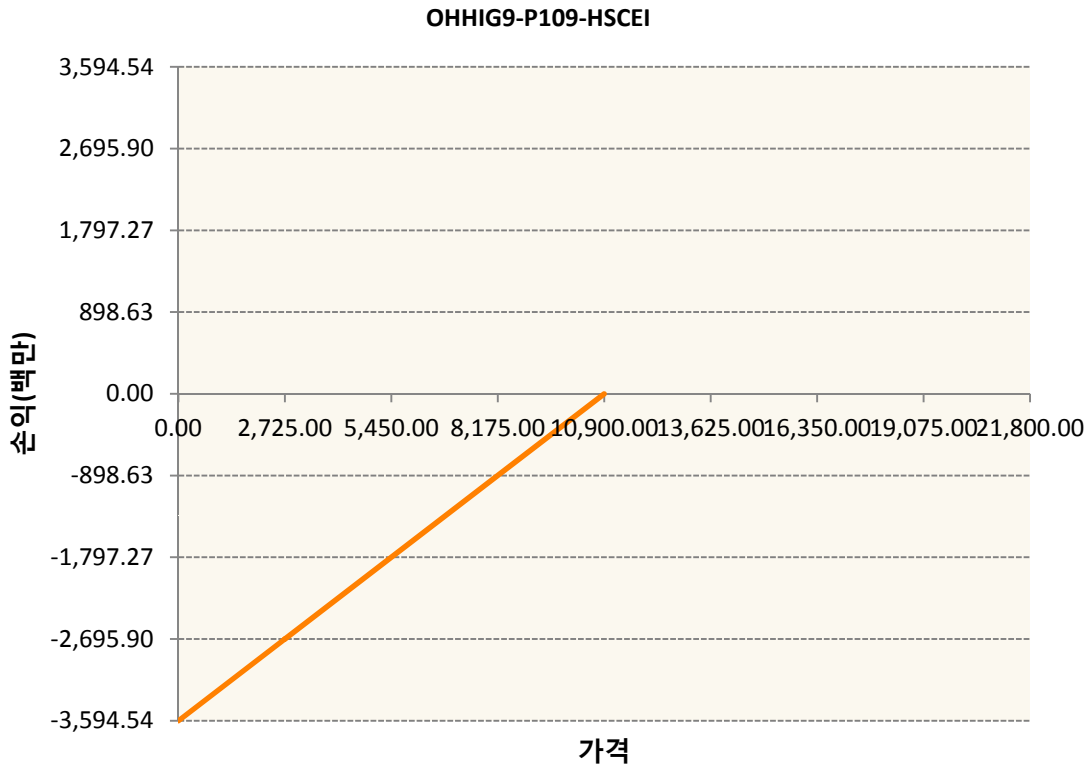
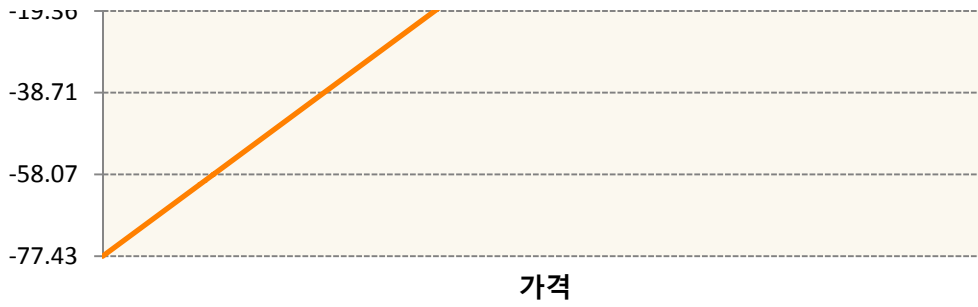


**OHHIG9-C109-HSCEI**



**OHHIG9-P108-HSCEI**





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

FX21018Z00 KRW/HKD 11-03-19E	218
HCG9 HSCEI Futures Feb19	251
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)

**938**

공시일	2019-02-22
기준일	2019-02-21

## 코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

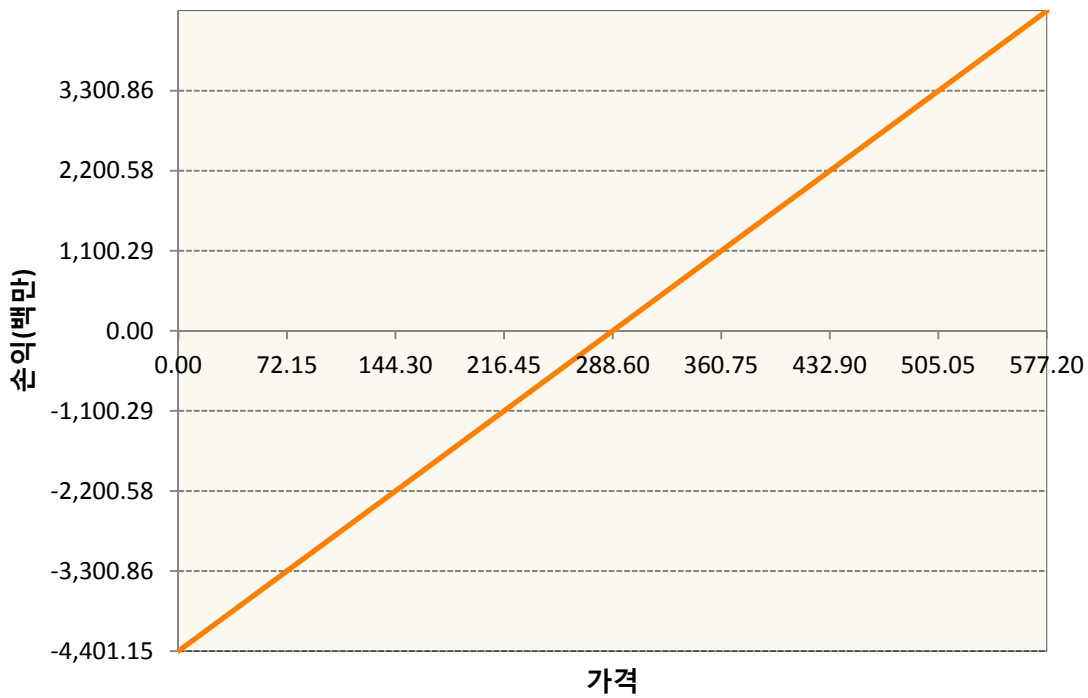
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

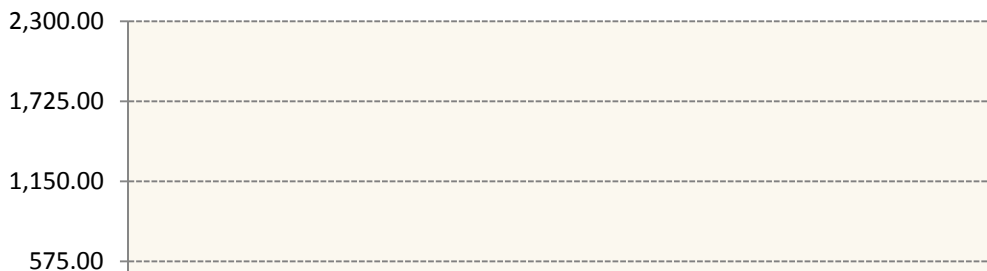
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	358	0	358	장내
누계	유가증권	선물	4,401	0	4,401	장내
누계	유가증권	스왑	31,836	0	31,836	장외
누계	유가증권	옵션	0	29,586	-29,586	장내

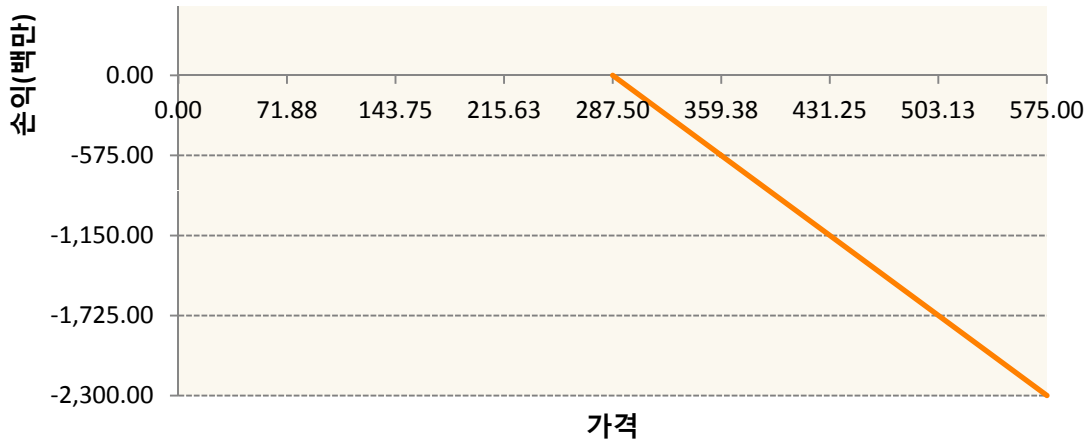
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101P30007-2019-03 코스피200지수선물

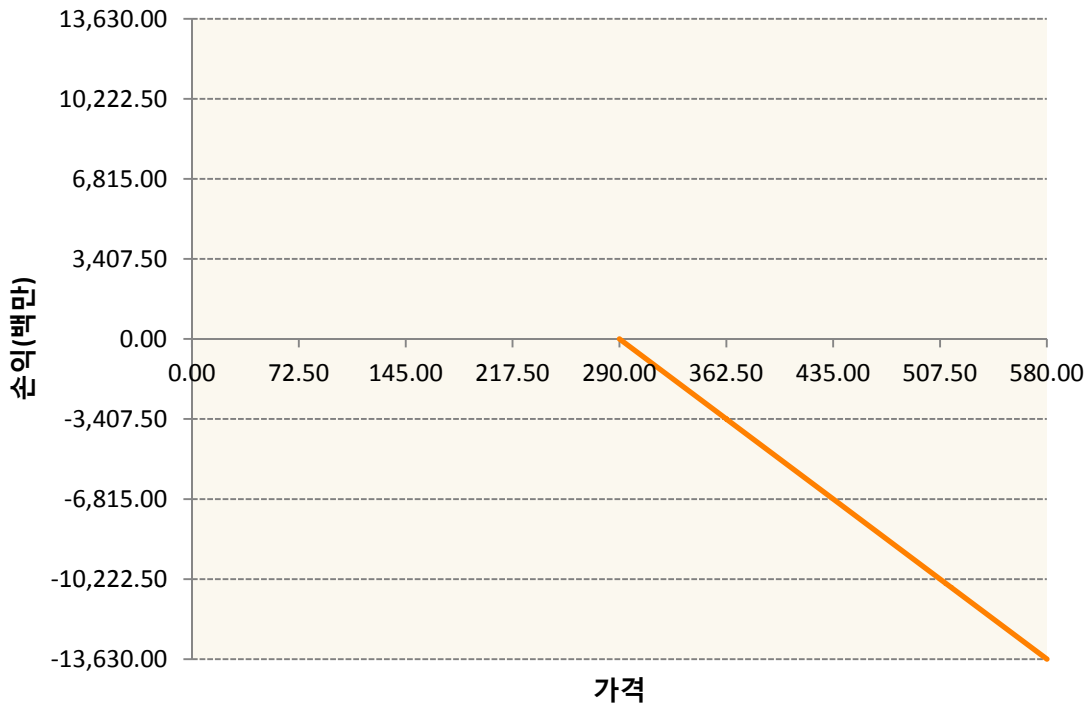


KR4201P32878-2019-03 콜287.5

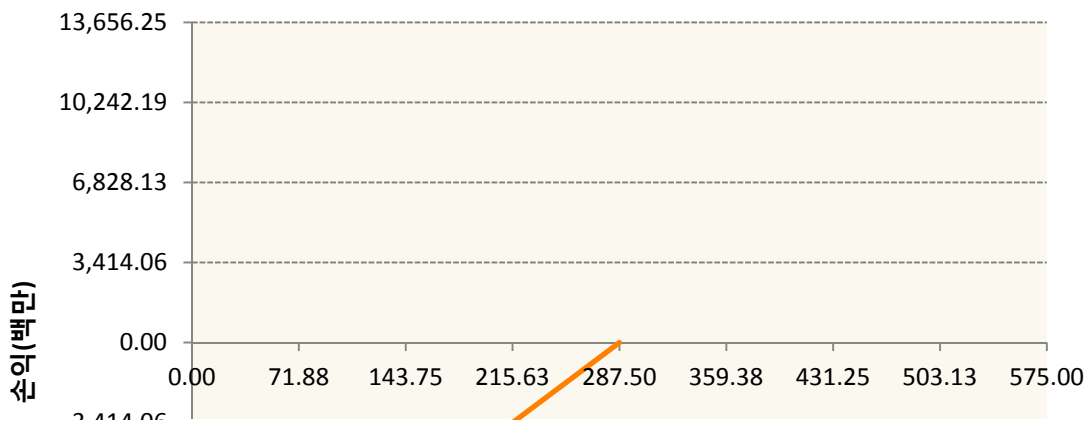


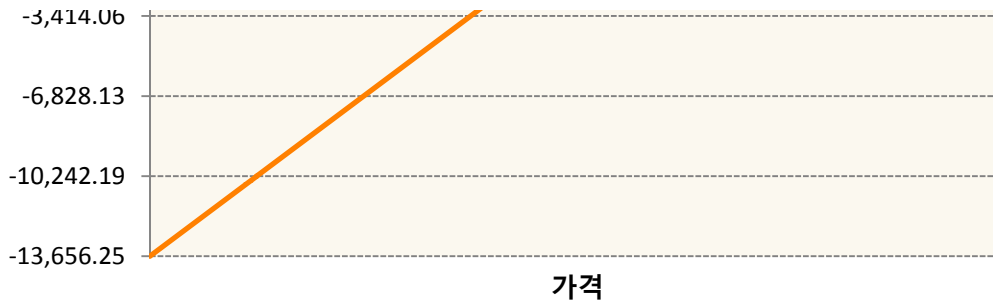


KR4201P32902-2019-03 콜290



KR4301P32876-2019-03 풋287.5





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

2.529E+11		UBCSFXC1 INDEX_14					2,668	
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-2,668	-2,668	-2,668	-2,668	-2,668	-2,668	-2,668	
-5.33%	-1,778	-1,778	-1,778	-1,778	-1,778	-1,778	-1,778	
-2.67%	-889	-889	-889	-889	-889	-889	-889	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	889	889	889	889	889	889	889	
5.33%	1,778	1,778	1,778	1,778	1,778	1,778	1,778	
8.00%	2,668	2,668	2,668	2,668	2,668	2,668	2,668	
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					145	
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	59	58	56	54	52	50	47	
-5.33%	54	51	48	45	41	38	34	
-2.67%	40	36	32	27	23	19	14	
0%	14	10	5	0	-5	-10	-14	
2.67%	-25	-29	-33	-38	-42	-47	-51	
5.33%	-76	-78	-81	-84	-88	-91	-95	
8.00%	-133	-134	-136	-138	-140	-143	-145	
KR4201P32902		2019-03 콜290					813	
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	

-8.00%	294	288	281	272	262	250	237
-5.33%	272	259	244	228	210	191	172
-2.67%	211	189	165	142	117	92	67
0%	84	56	28	0	-28	-56	-84
2.67%	-123	-149	-176	-202	-229	-257	-284
5.33%	-400	-419	-439	-460	-483	-506	-530
8.00%	-725	-735	-747	-761	-777	-795	-813
KR4301P32876                      2019-03 풋287.5							894
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-887	-888	-888	-889	-890	-891	-894
-5.33%	-525	-527	-531	-535	-540	-546	-553
-2.67%	-190	-200	-211	-223	-235	-248	-260
0%	46	31	15	0	-15	-31	-46
2.67%	144	135	125	115	104	92	80
5.33%	164	162	159	155	150	145	138
8.00%	166	166	165	164	163	161	159

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

(단위:백만원)

**4,892**

공시일	2019-02-22
기준일	2019-02-21

## 유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

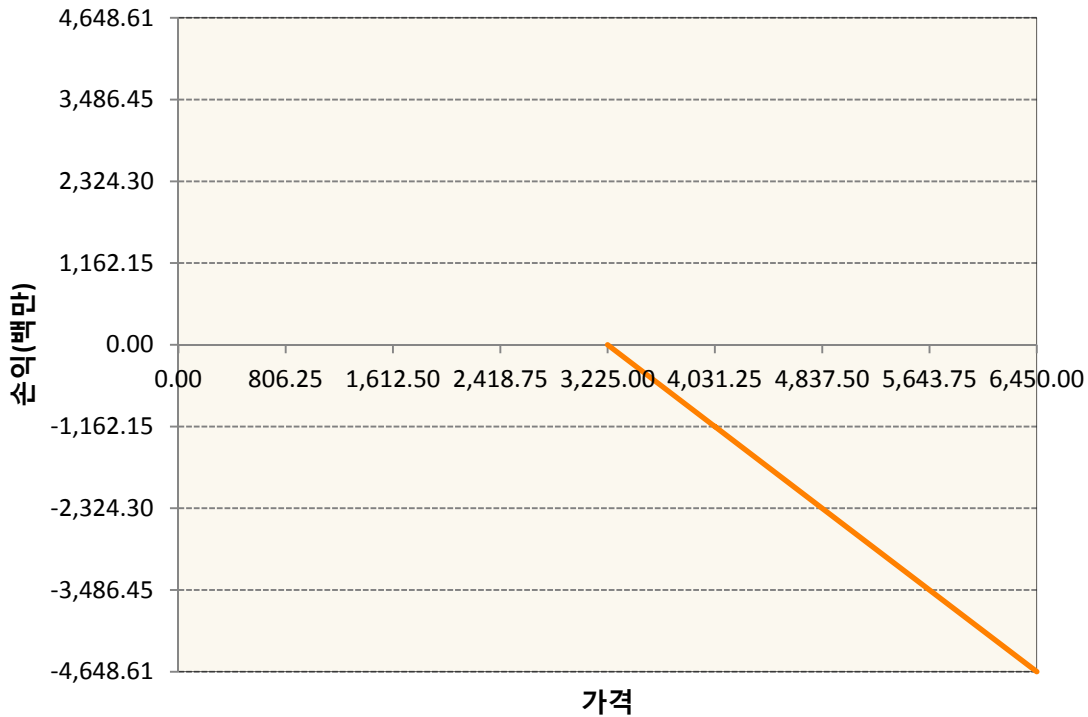
### 1. 계약금액

(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	7,053	0	7,053	
누계	유가증권	스왑	60,224	0	60,224	장외
누계	유가증권	옵션	0	26,709	-26,709	장내
누계	통화	선도	0	20,410	-20,410	장외

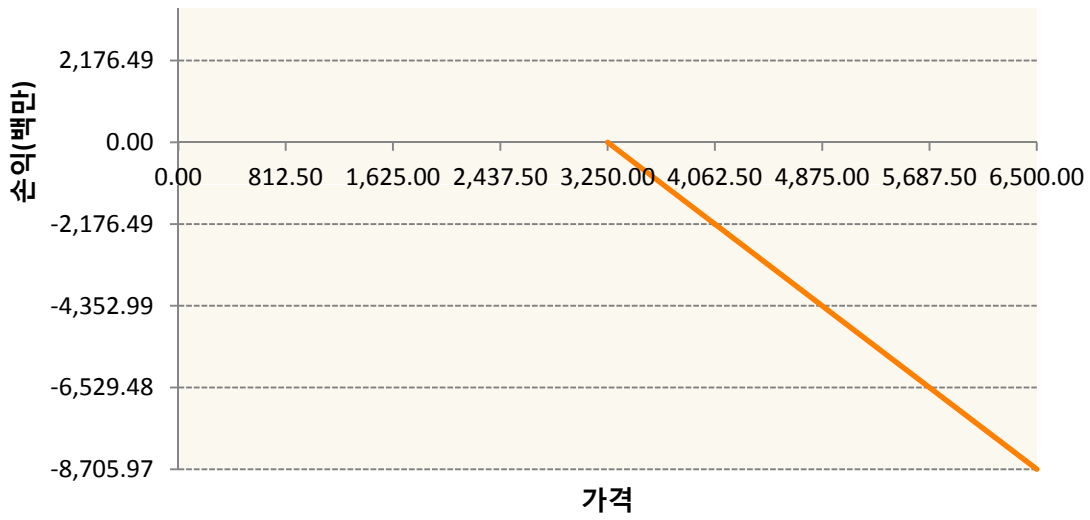
### 2. 만기시점의 손익구조

OESXH9-C3225-EURO STOXX 50

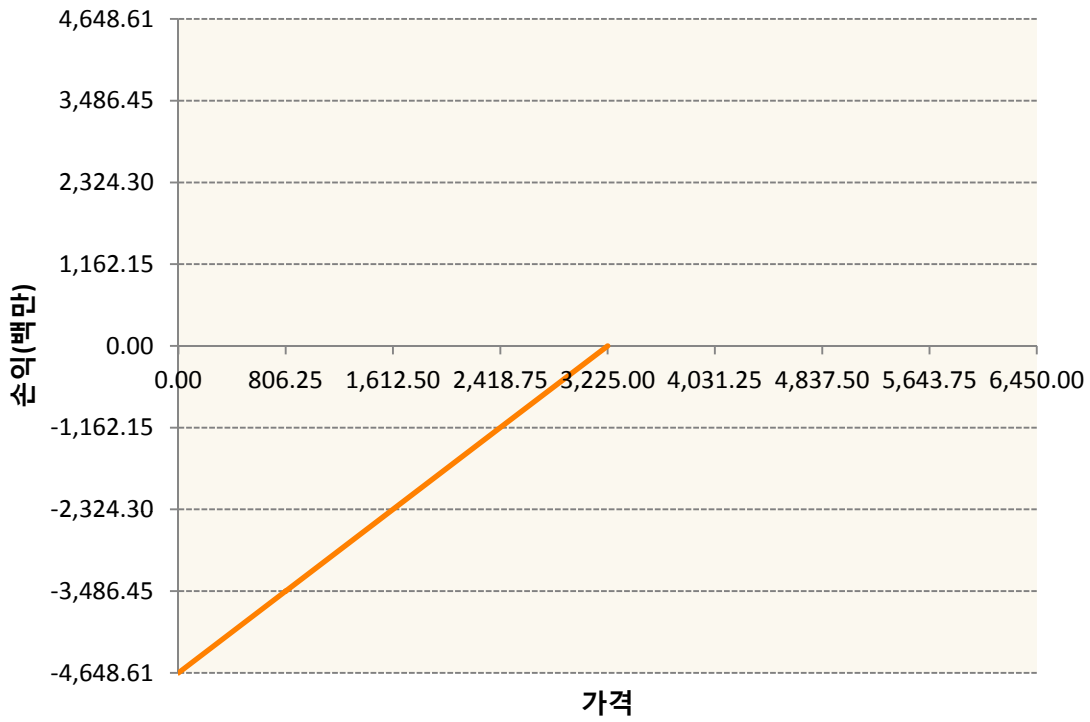


OESXH9-C3250-EURO STOXX 50

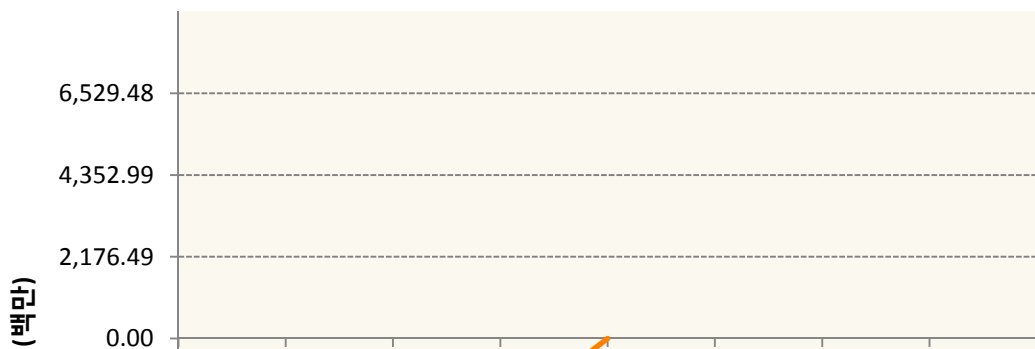


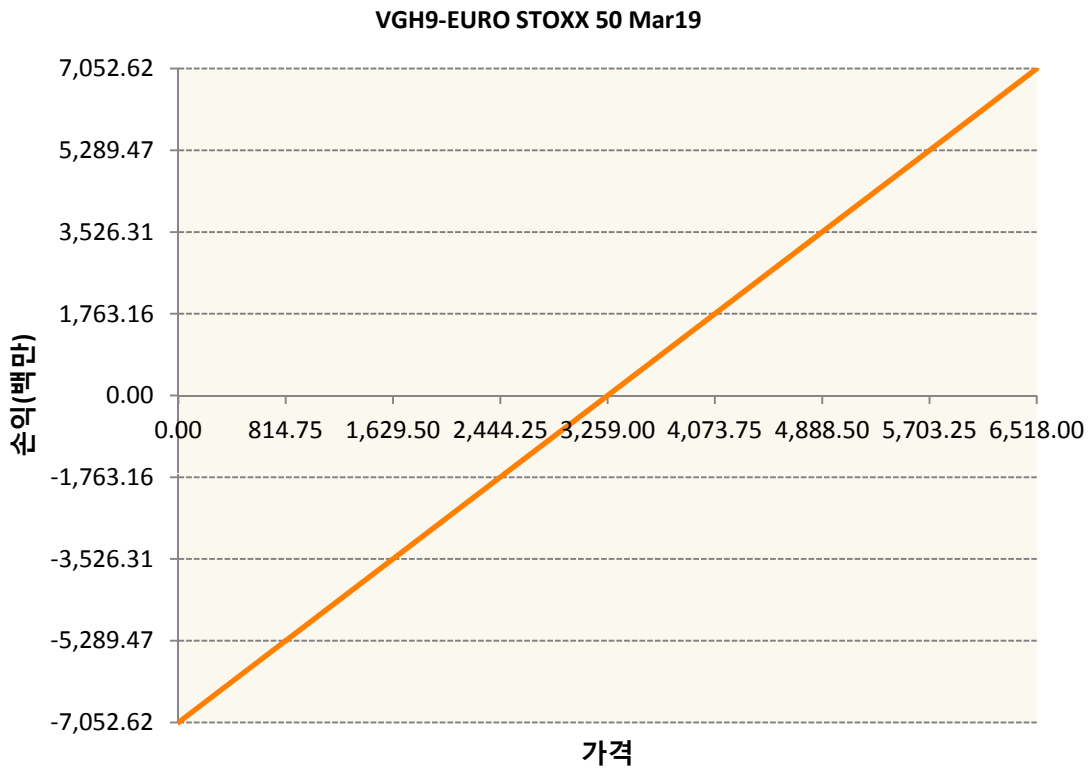
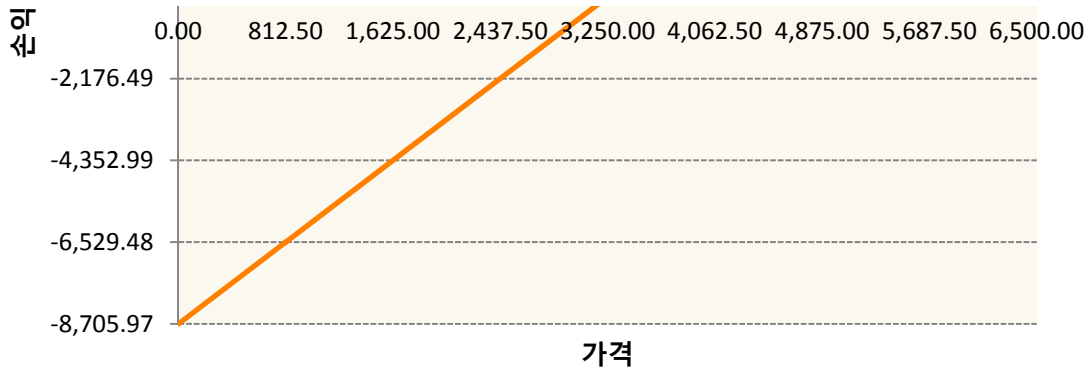


OESXH9-P3225-EURO STOXX 50



OESXH9-P3250-EURO STOXX 50





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

260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY	89
FX21018X02 KRW/EUR 22-02-19E	408
FX21018Z03 KRW/EUR 22-03-19E	816
FX21019G02 KRW/EUR 24-05-19E	408
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	564

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

(단위:백만원)

2,864



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

(단위:백만원)

1,163



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

(단위:백만원)

99



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

(단위:백만원)

144

공시일	2019-02-22
기준일	2019-02-21

## 스마트KRX300인덱스목표전환형1호

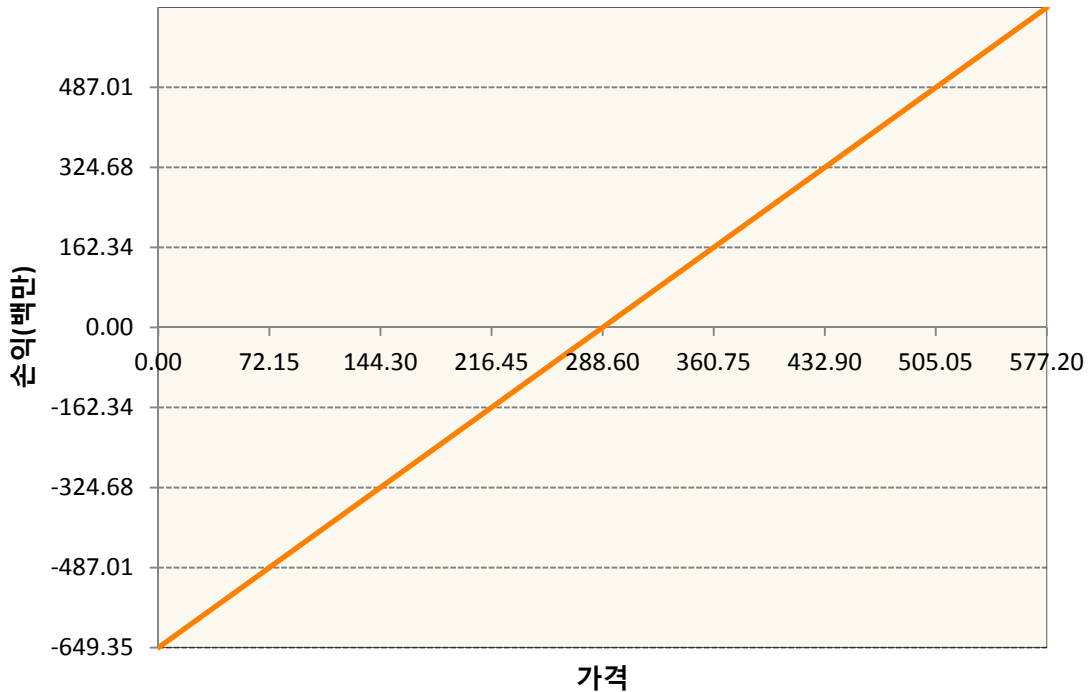
### 1. 계약금액

(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

가격	기초자산의 변동성						
	-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	2019-02-22
기준일	2019-02-21

## 리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

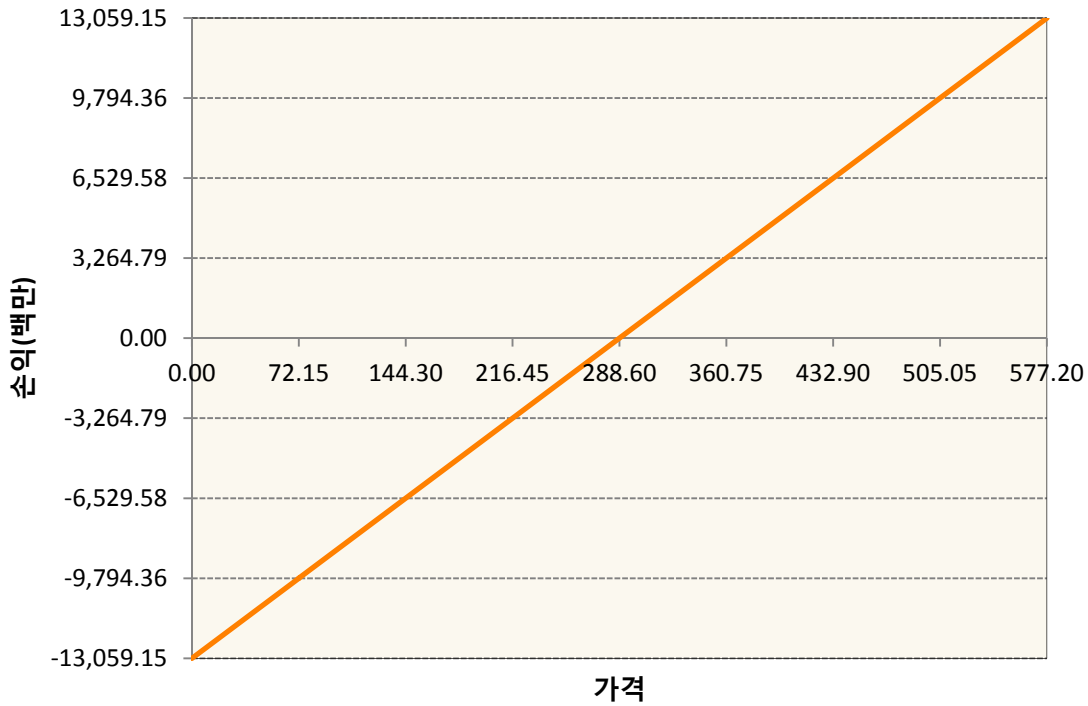
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

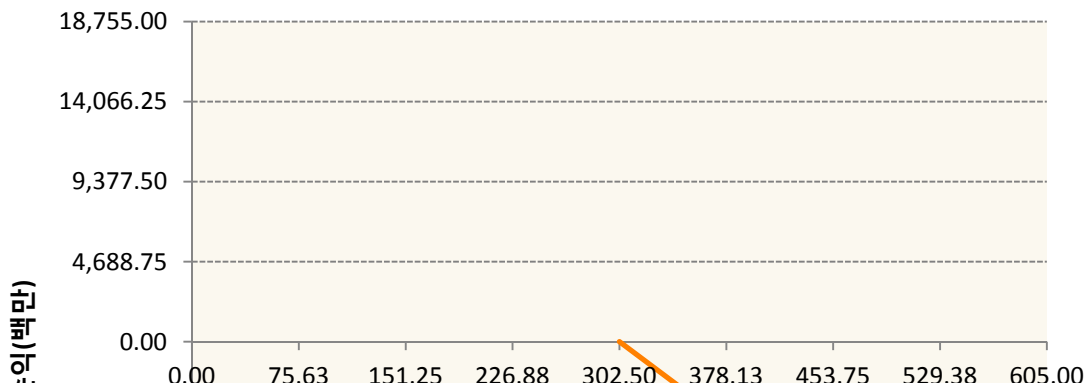
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	13,059	0	13,059	장내
누계	유가증권	옵션	2,165	24,931	-22,766	장내

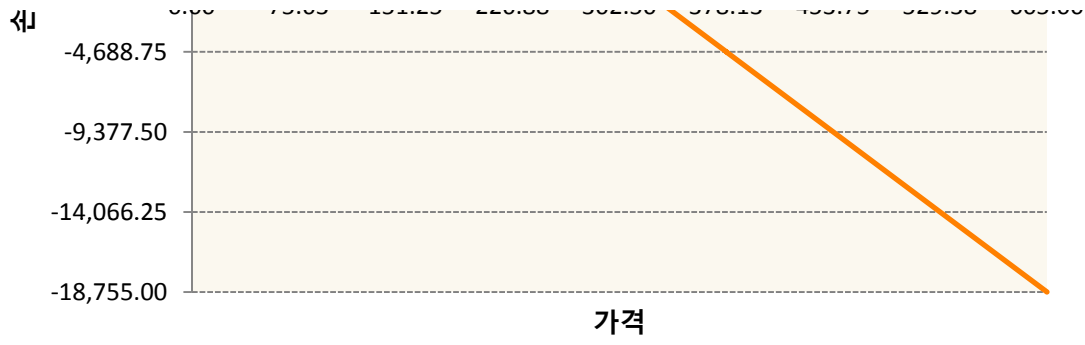
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101P30007-2019-03 코스피200지수선물

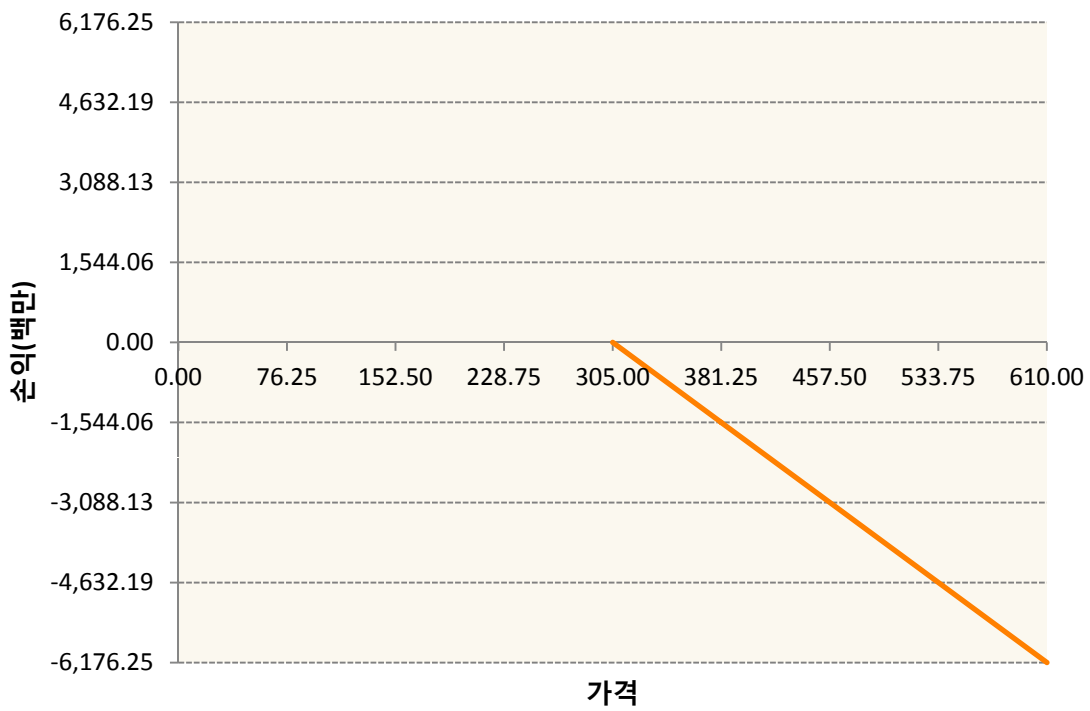


KR4201P33025-2019-03 콜302.5

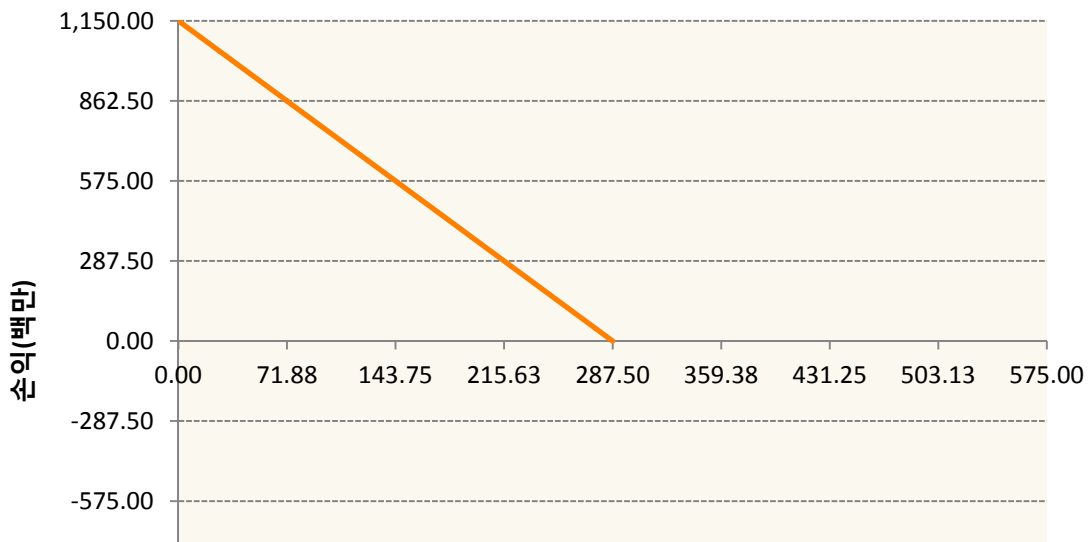


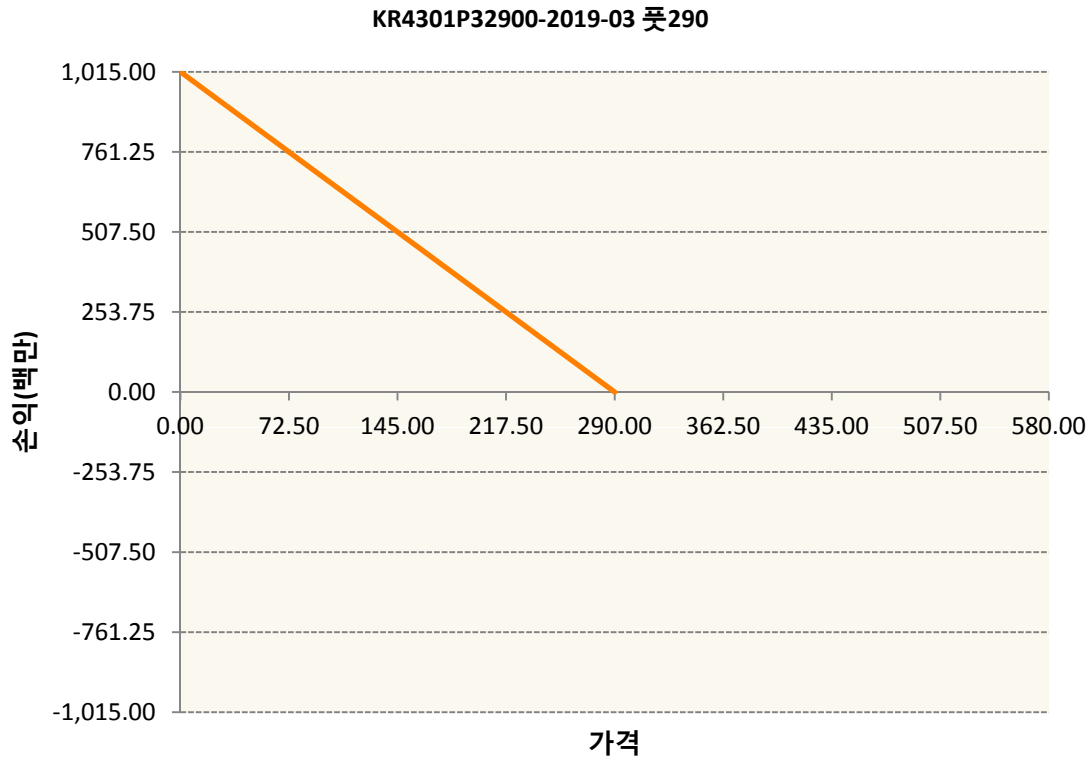
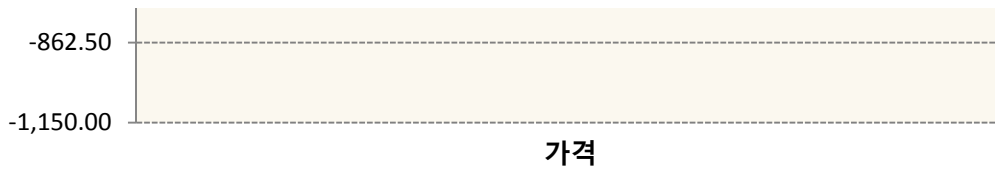


KR4201P33058-2019-03 콜305



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						763
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	144	143	141	138	133	127	119	
-5.33%	141	136	130	122	111	99	84	
-2.67%	125	113	99	82	63	42	19	

0%	77	53	27	0	-29	-59	-90
2.67%	-37	-72	-108	-143	-180	-216	-253
5.33%	-245	-284	-323	-361	-400	-439	-478
8.00%	-553	-586	-620	-655	-691	-727	-763
KR4201P33058                      2019-03 콜305							228
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	37	37	37	36	35	33	31
-5.33%	37	36	34	32	29	26	22
-2.67%	33	30	27	22	17	10	4
0%	22	15	8	0	-9	-18	-27
2.67%	-8	-18	-29	-40	-51	-63	-74
5.33%	-65	-78	-90	-103	-116	-129	-141
8.00%	-155	-167	-179	-191	-203	-216	-228
KR4301P32876                      2019-03 풋287.5							75
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	75	75	75	75	75	75	75
-5.33%	44	44	45	45	46	46	47
-2.67%	16	17	18	19	20	21	22
0%	-4	-3	-1	0	1	3	4
2.67%	-12	-11	-11	-10	-9	-8	-7
5.33%	-14	-14	-13	-13	-13	-12	-12
8.00%	-14	-14	-14	-14	-14	-14	-13
KR4301P32900                      2019-03 풋290							70
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	70	70	70	70	70	70	70
-5.33%	43	43	43	43	43	44	44
-2.67%	17	18	18	19	20	20	21
0%	-3	-2	-1	0	1	2	3
2.67%	-14	-13	-12	-11	-10	-9	-8
5.33%	-16	-16	-16	-15	-15	-14	-14
8.00%	-17	-17	-17	-17	-16	-16	-16

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

(단위:백만원)

**1,780**

공시일	2019-02-22
기준일	2019-02-21

## H2O글로벌본드(USD)(채권혼합-파

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	45	0	45	
누계	유가증권	수익증권	983	0	983	

### 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	2019-02-22
기준일	2019-02-21

## H2O글로벌본드(UH)(채권혼합-파

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	146	0	146	
누계	유가증권	수익증권	5,659	0	5,659	

### 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	2019-02-22
기준일	2019-02-21

## H2O글로벌본드(H)(채권혼합-파생)

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	8,664	0	8,664	
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	수익증권	27,496	0	27,496	
누계	통화	선도	0	34,882	-34,882	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		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
FX21019G01 KRW/USD 21-03-19E		423

FX21019G01 KRW/USD 21-03-19E  
FX21019G02 KRW/USD 25-03-19E  
FX21019G02 KRW/USD 25-03-19E

270
136
477

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

(단위:백만원)

<b>1,023</b>
--------------

공시일	2019-02-22
기준일	2019-02-21

## 스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

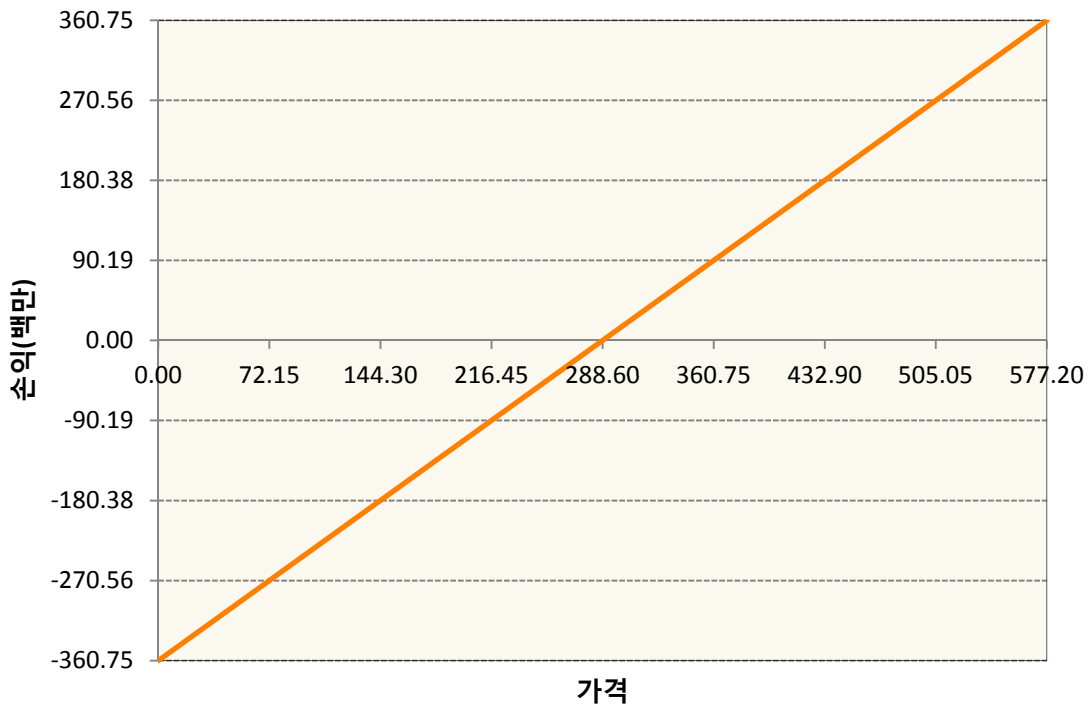
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

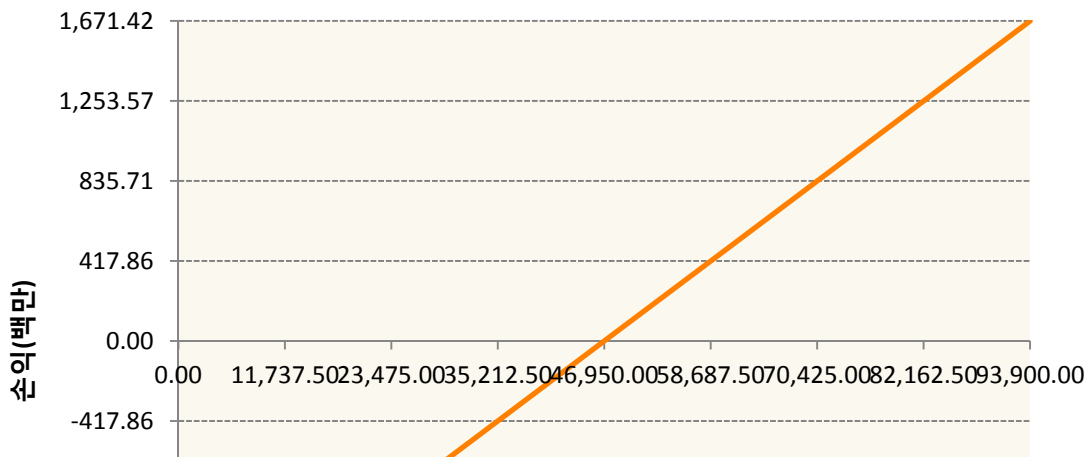
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,032	0	2,032	장내

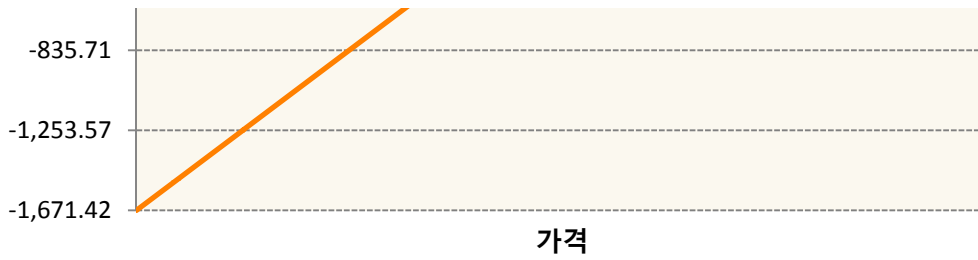
### 2. 만기시점의 손익구조

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)

**180**

공시일	2019-02-22
기준일	2019-02-21

## 에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

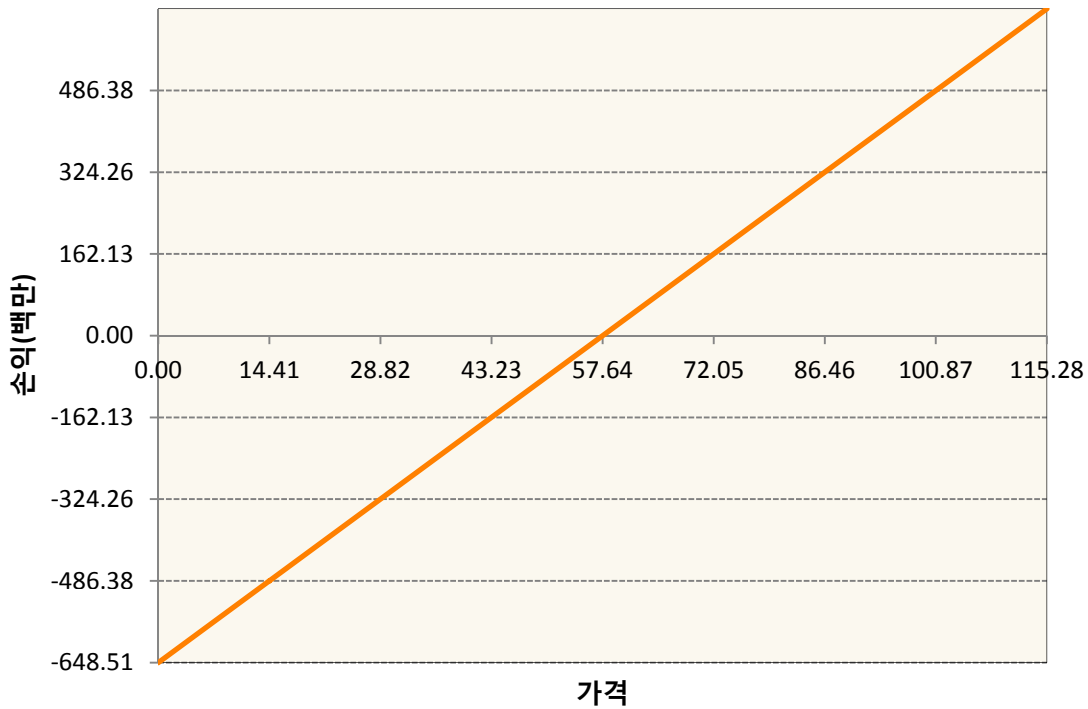
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

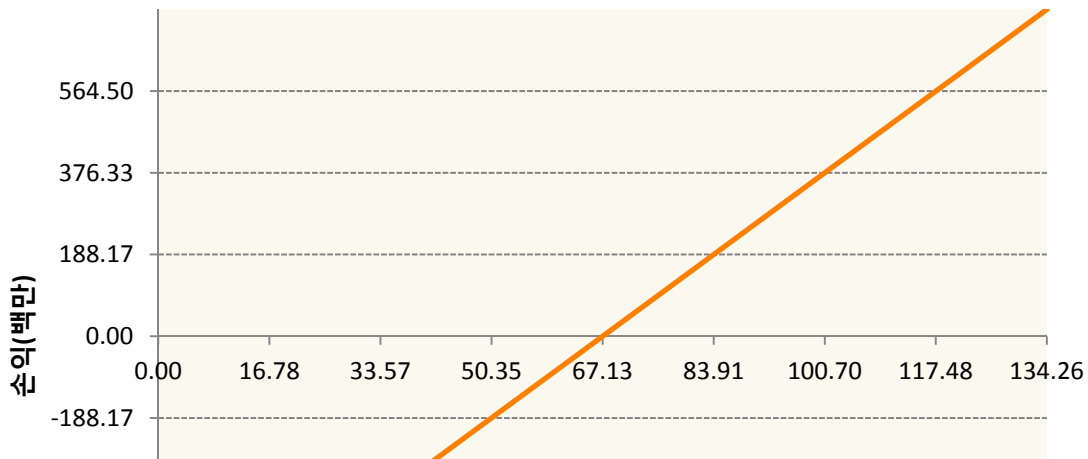
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,817	281	2,536	

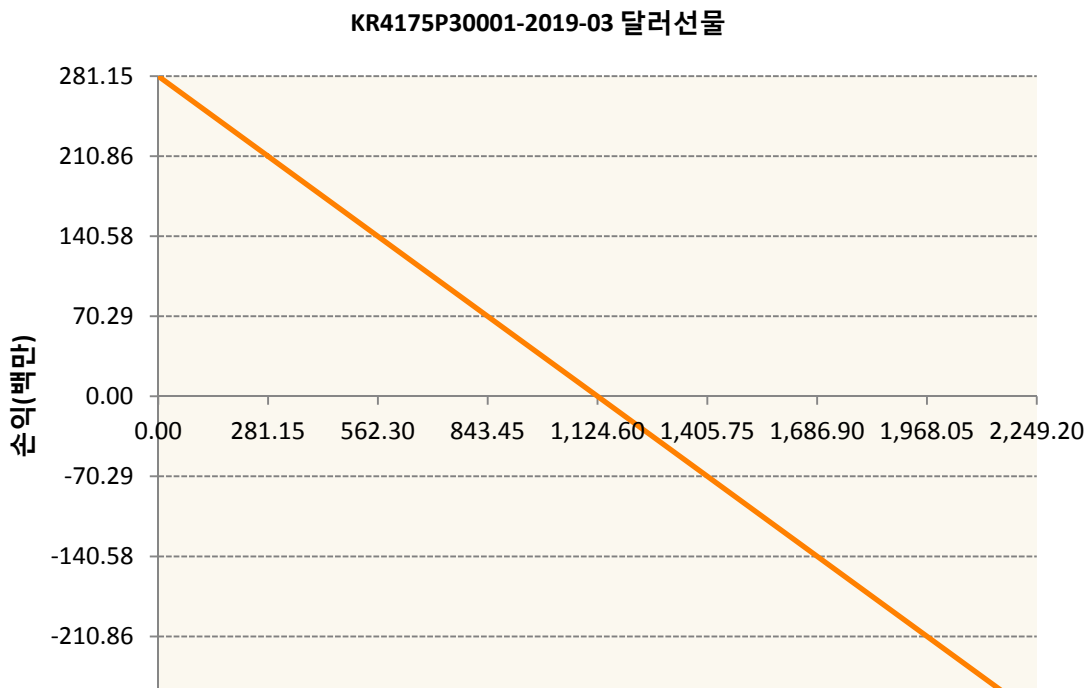
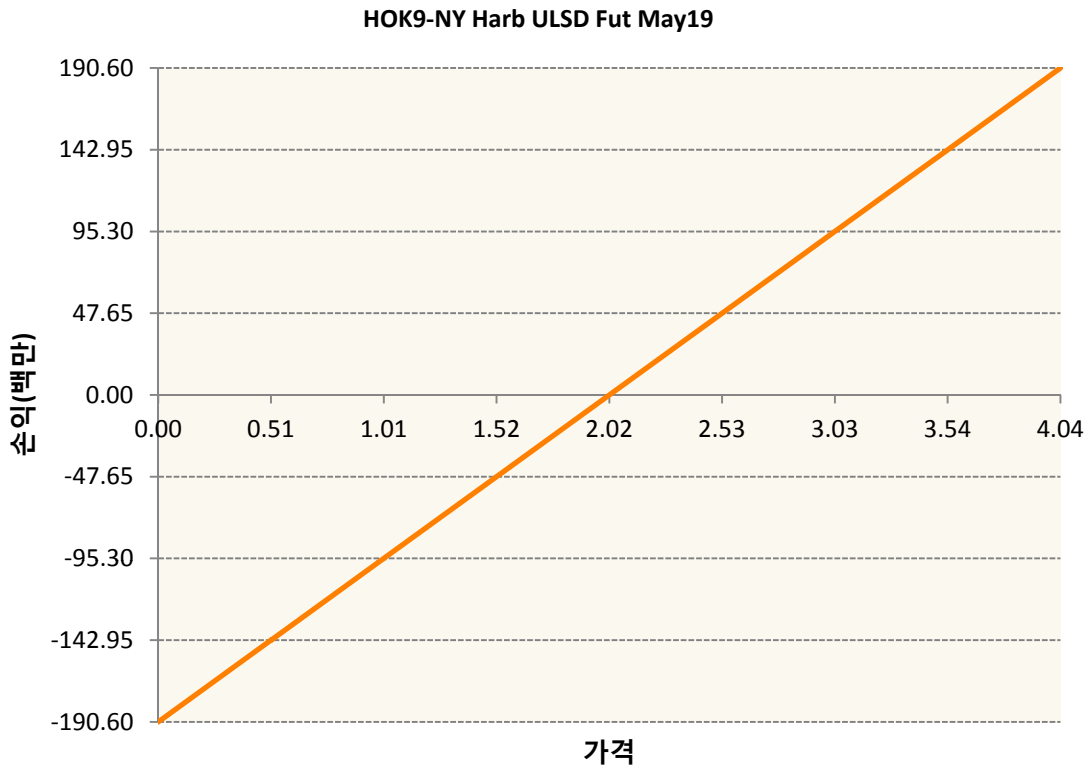
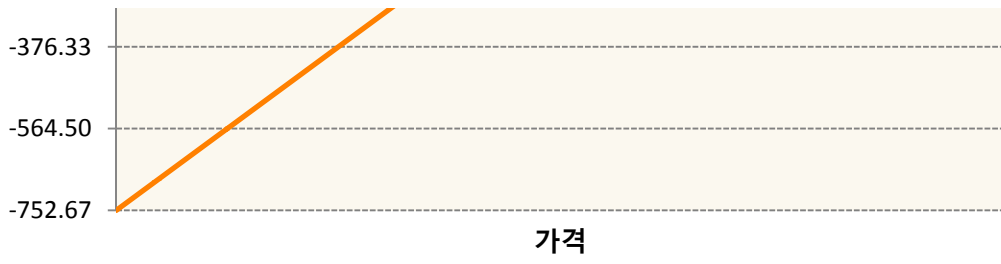
### 2. 만기시점의 손익구조

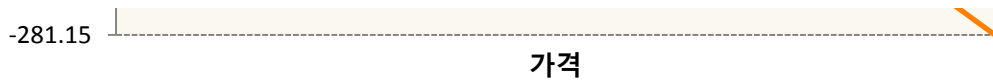
CLK9-WTI CRUDE FUTURE May19



COK9-BRENT CRUDE FUTR May19

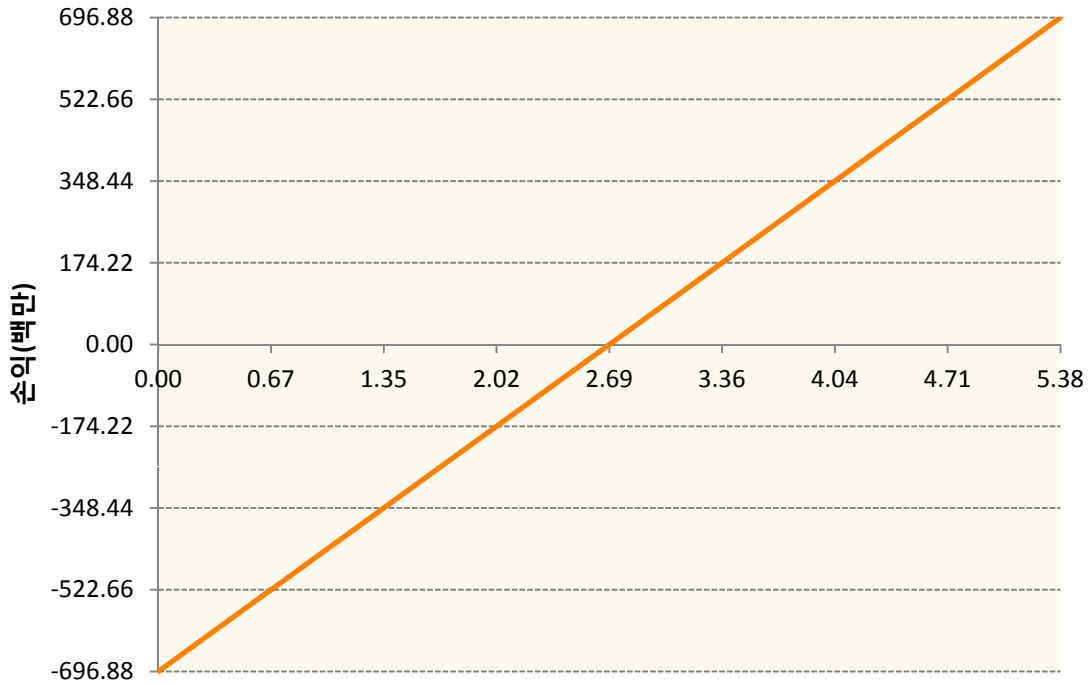






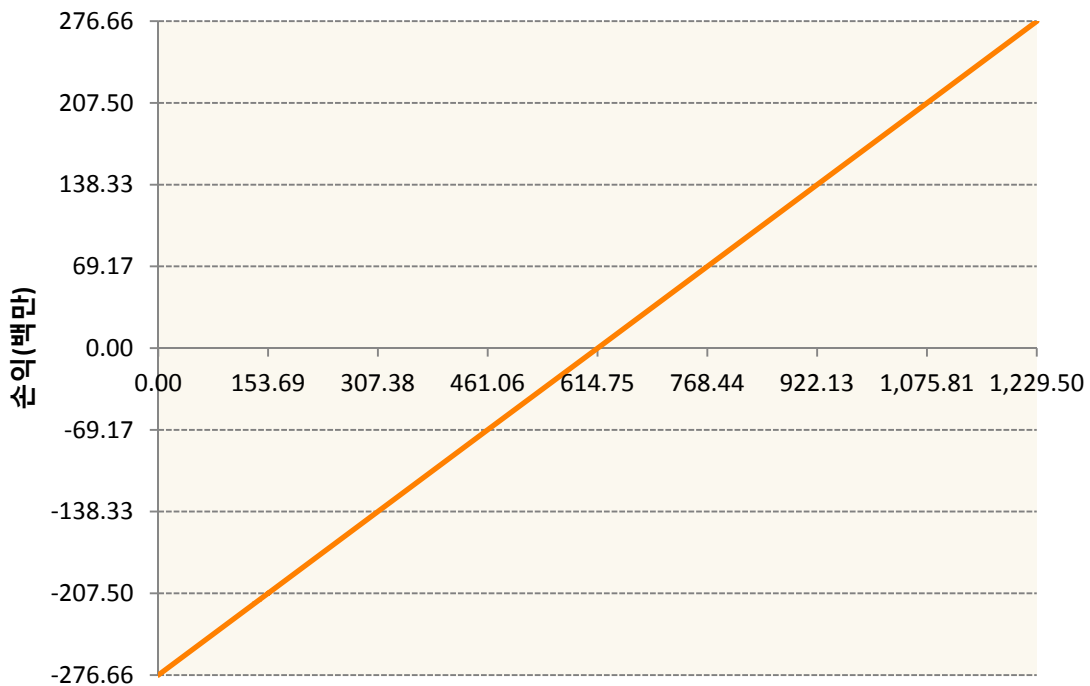
가격

NGK19-NATURAL GAS FUTR May19



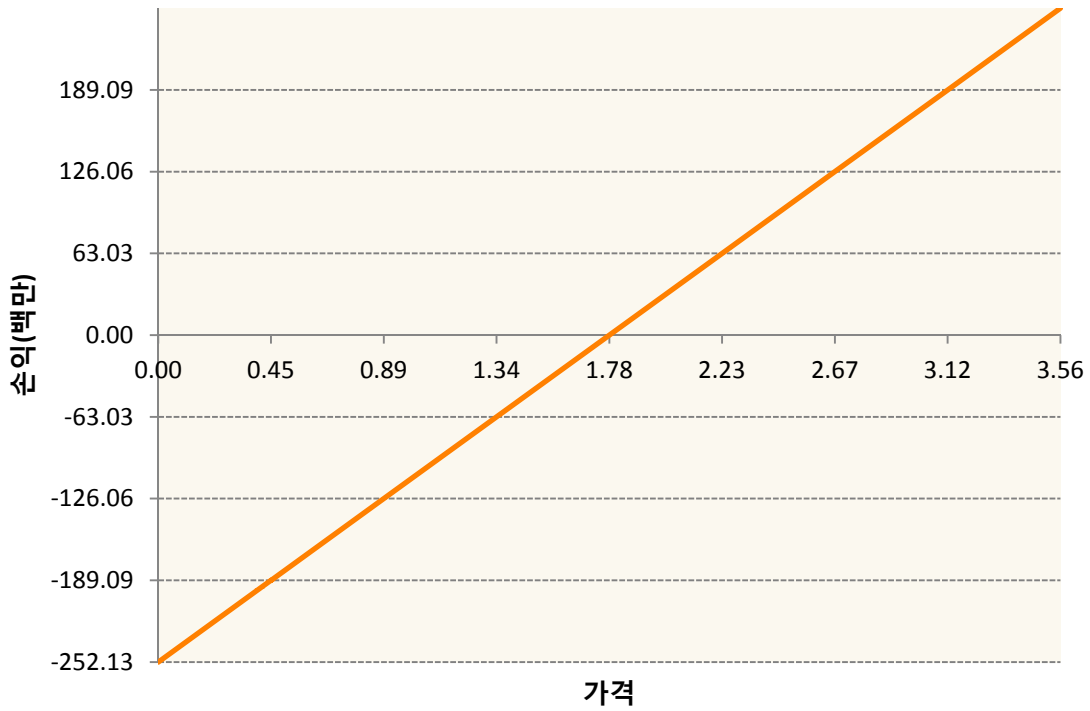
가격

QSK9-Low Su Gasoil G May19



가격

**XBK9-GASOLINE RBOB FUT May19**



**3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)**

(단위:백만원)

CLK9	WTI CRUDE FUTURE May19	52
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)

**430**

공시일	2019-02-22
기준일	2019-02-21

## 애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

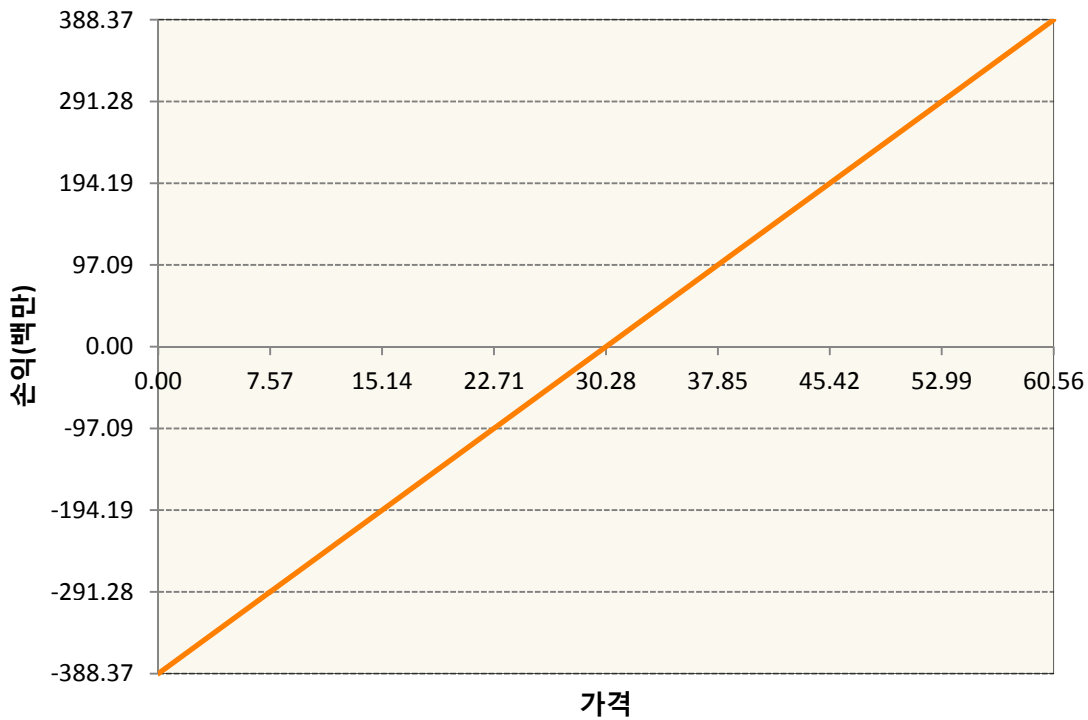
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

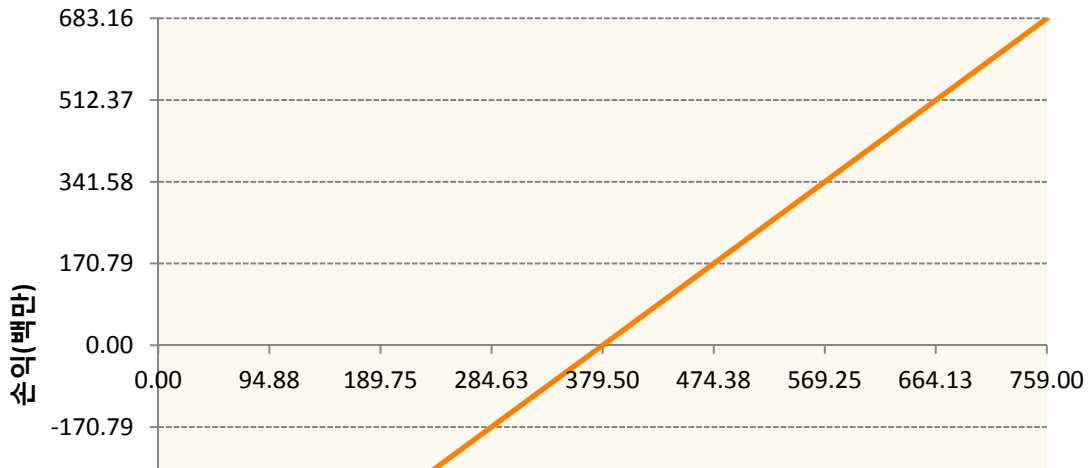
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,465	79	3,387	

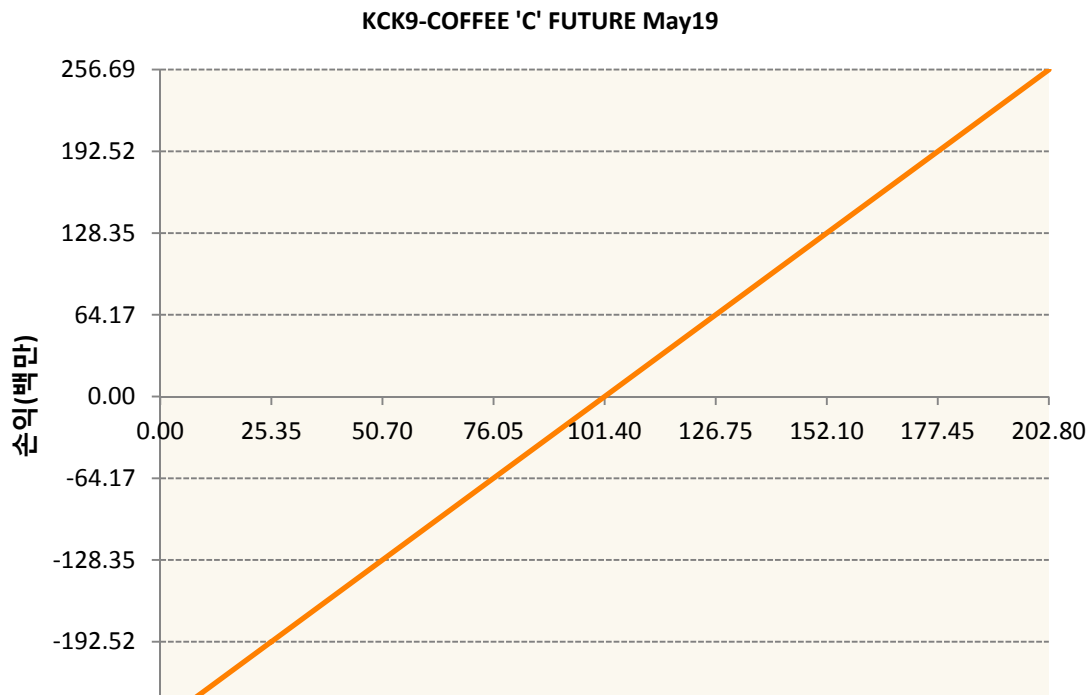
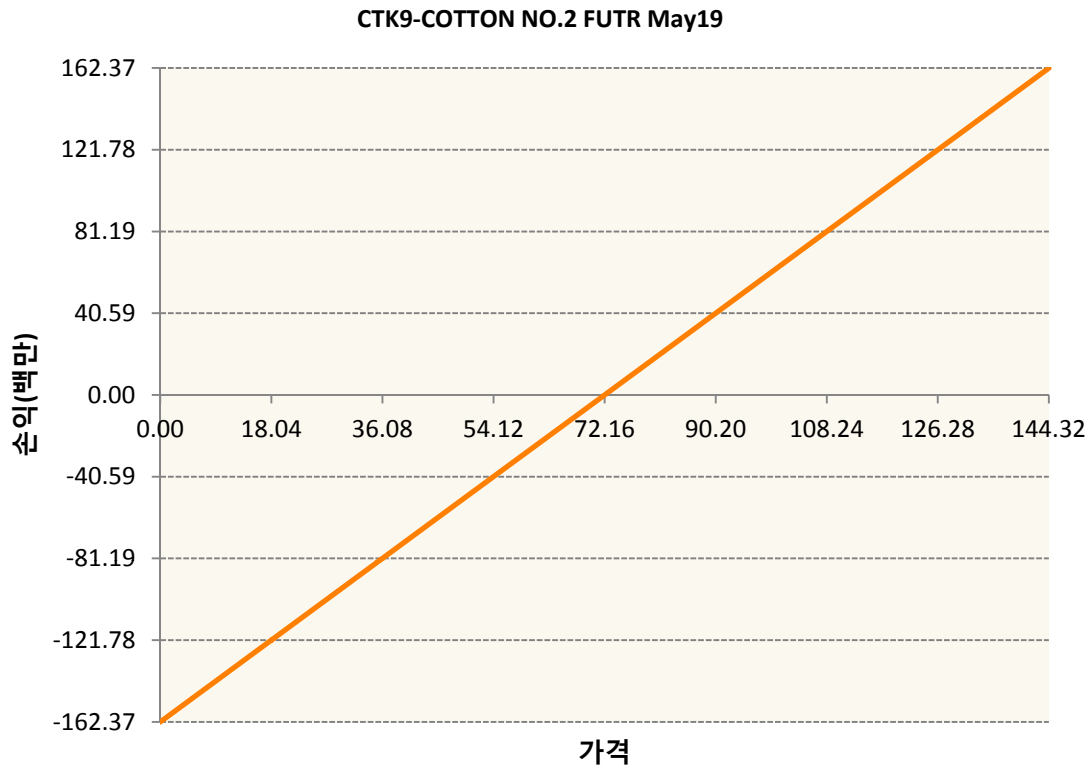
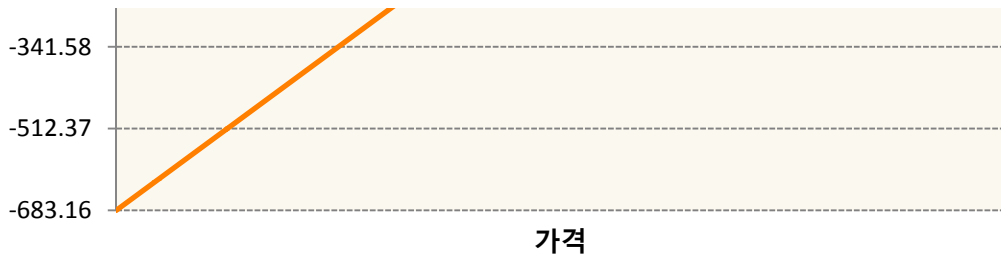
### 2. 만기시점의 손익구조

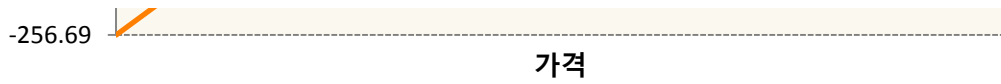
**BOK9-SOYBEAN OIL FUTR May19**



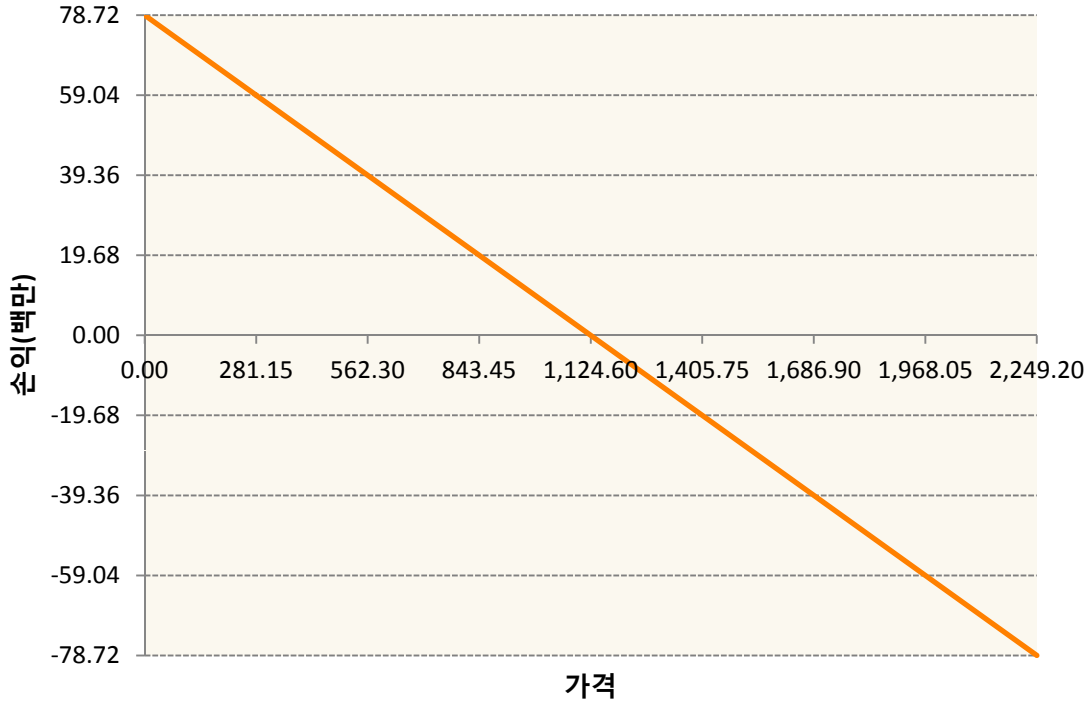
**CK9-CORN FUTURE May19**



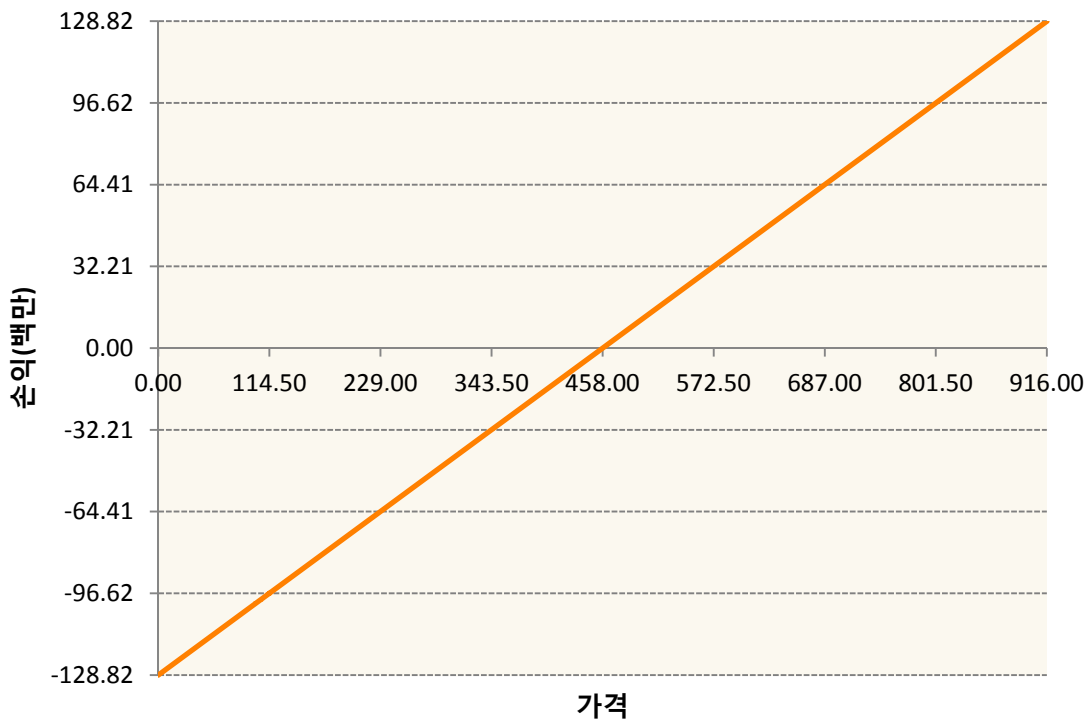




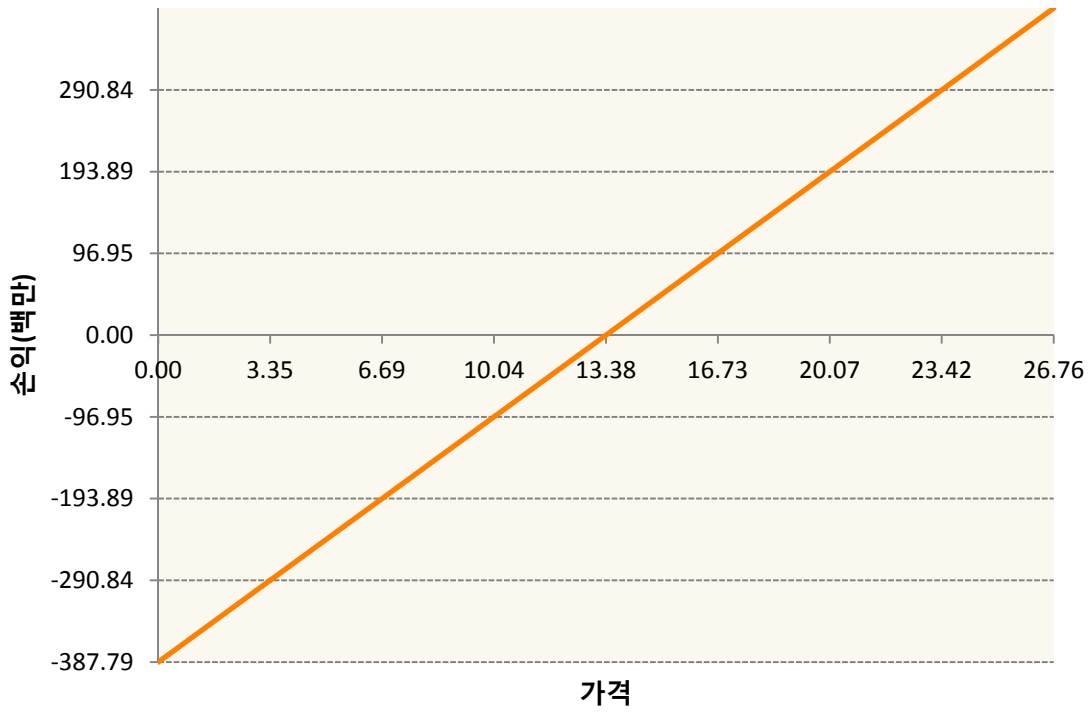
KR4175P30001-2019-03 달러선물



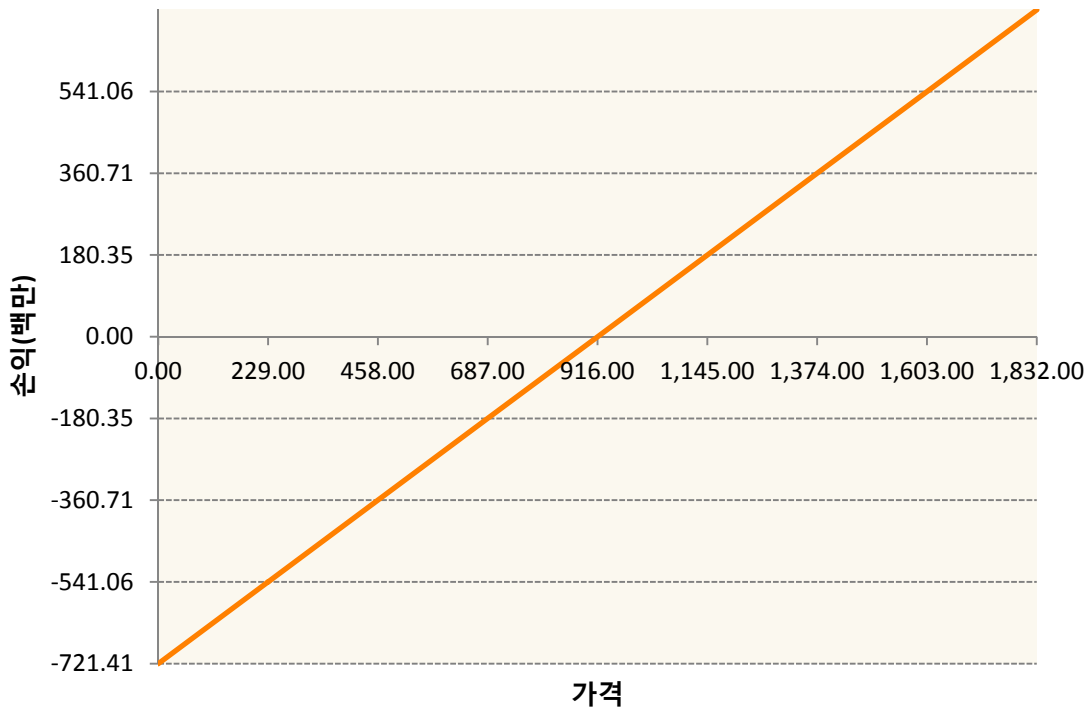
KWK9-KC HRW WHEAT FUT May19



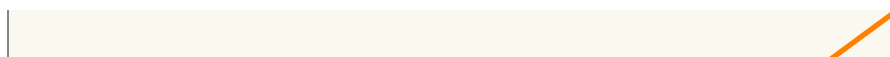
SBK9-SUGAR #11 (WORLD) May19

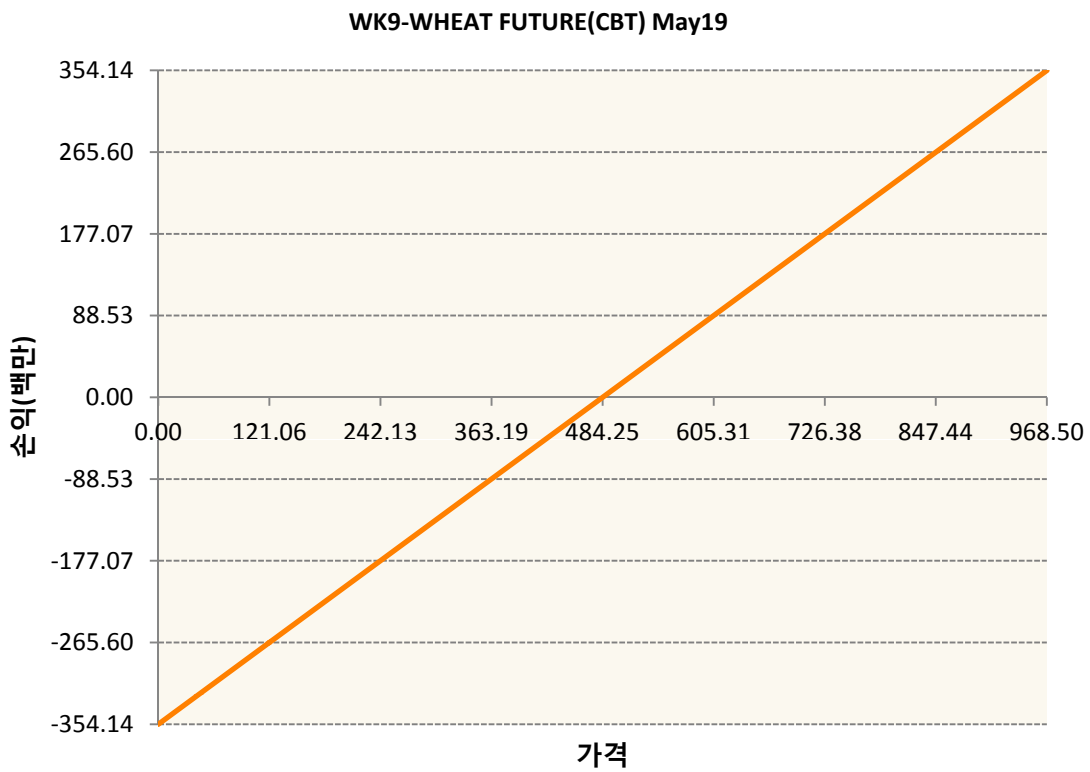
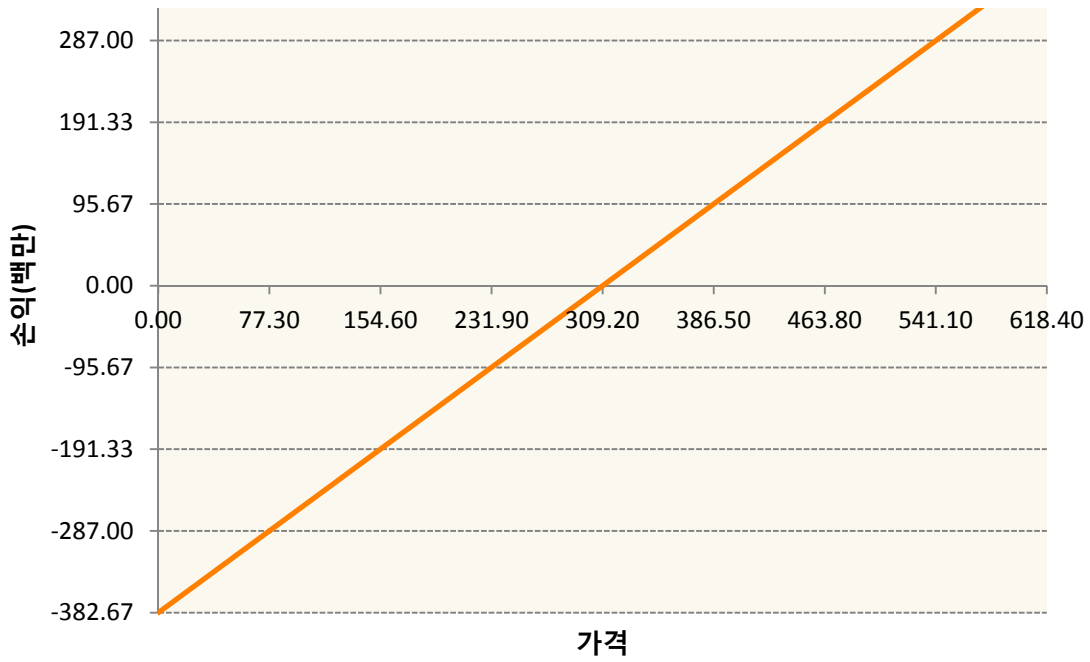


SK9-SOYBEAN FUTURE May19



SMK9-SOYBEAN MEAL FUTR May19





**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	21
KR4175P300	2019-03 달러선물	6

KWK9	KC HRW WHEAT FUT May19	10
SBK9	SUGAR #11 (WORLD) May19	31
SK9	SOYBEAN FUTURE May19	58
SMK9	SOYBEAN MEAL FUTR May19	31
WK9	WHEAT FUTURE(CBT) May19	28

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

(단위:백만원)

**278**