

공시일	2019-02-25
기준일	2019-02-22

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	2019-02-25
기준일	2019-02-22

SMART합성-MSCI선진국증권상장

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	13,865	0	13,865	장외
누계	지수	스왑	13,865	0	13,865	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWMXWO0(신한MXWO 미래S190222

1,109

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

638

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-02-25
기준일	2019-02-22

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	299
SWCSI50000 신한CSI500미래S190129	89

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

567

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-02-25
기준일	2019-02-22

유로인덱스모(주식-파생형)

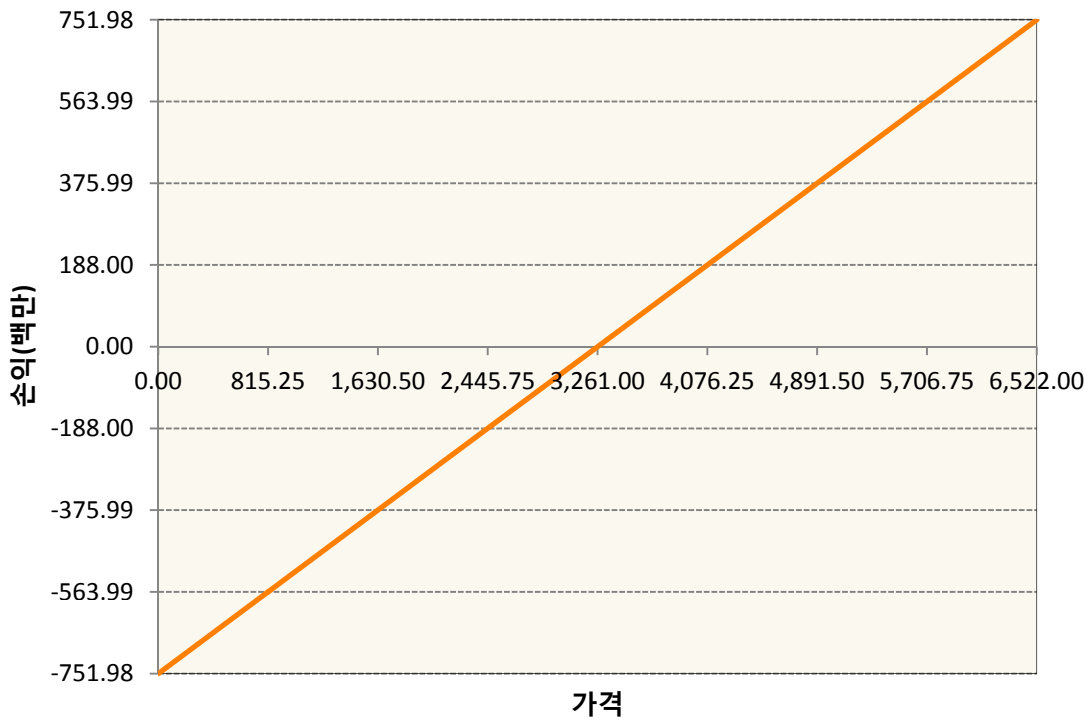
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	752	0	752	

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	2019-02-25
기준일	2019-02-22

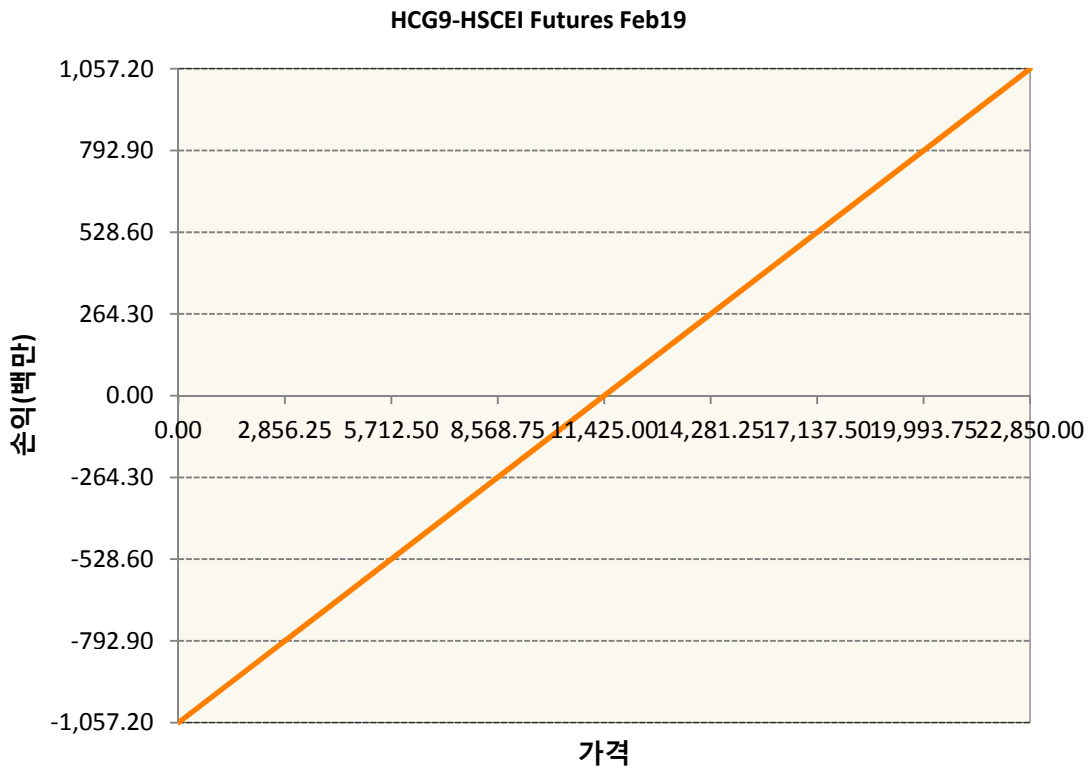
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	1,057	0	1,057	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCG9	HSCEI Futures Feb19	85
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

87

공시일	2019-02-25
기준일	2019-02-22

커버드콜모(주식혼합-파생형)

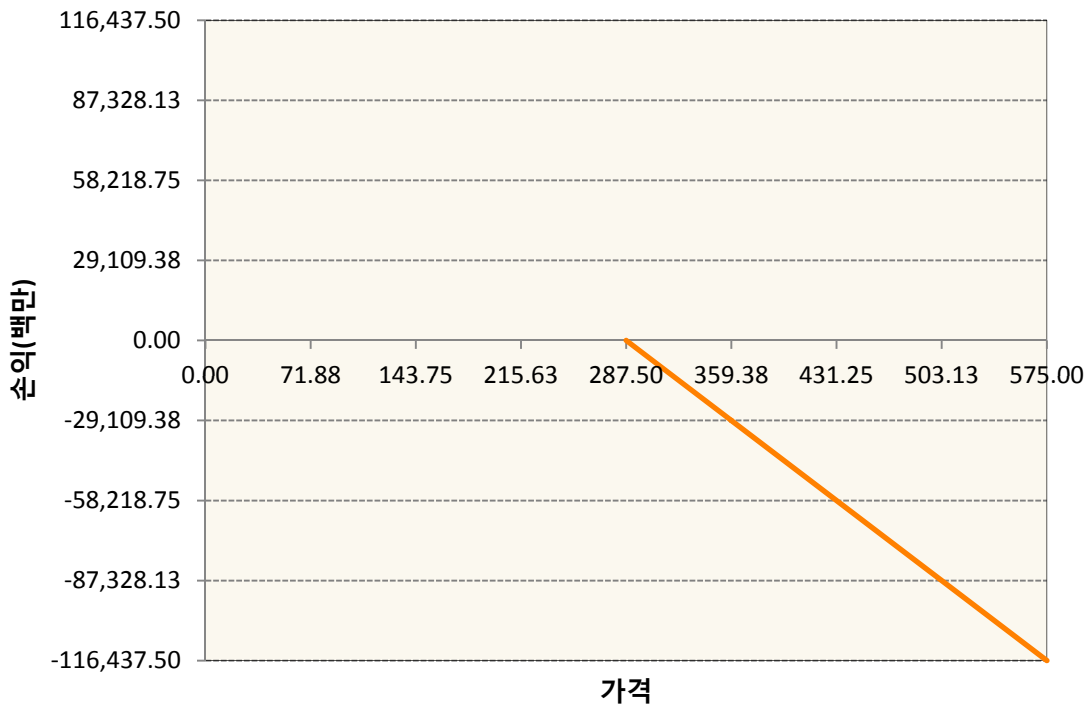
1. 계약금액

(단위:백만원)

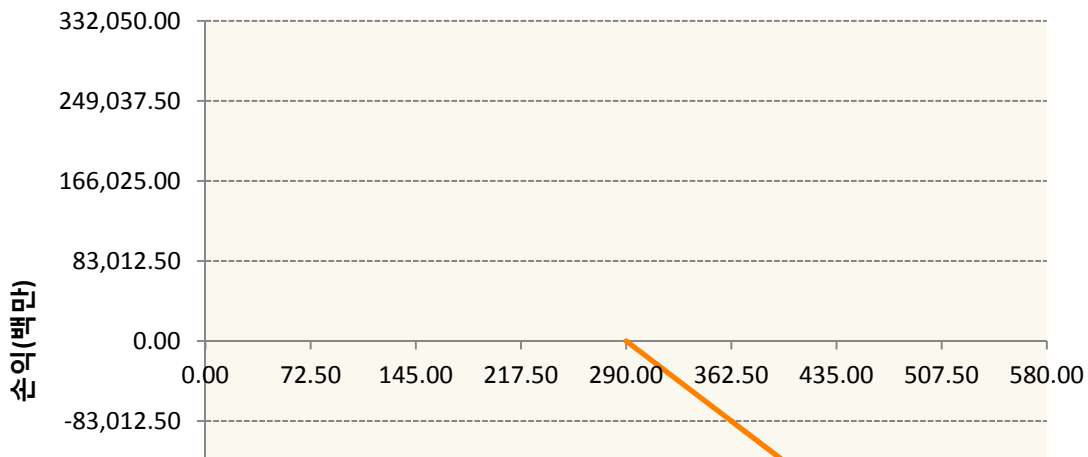
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	692,863	-692,863	장내

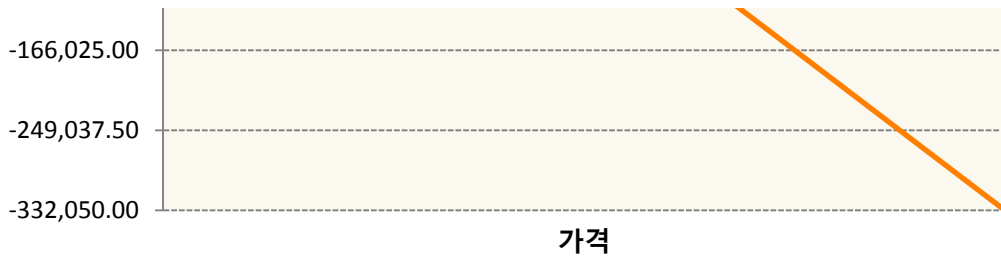
2. 만기시점의 손익구조

KR4201P32878-2019-03 콜287.5

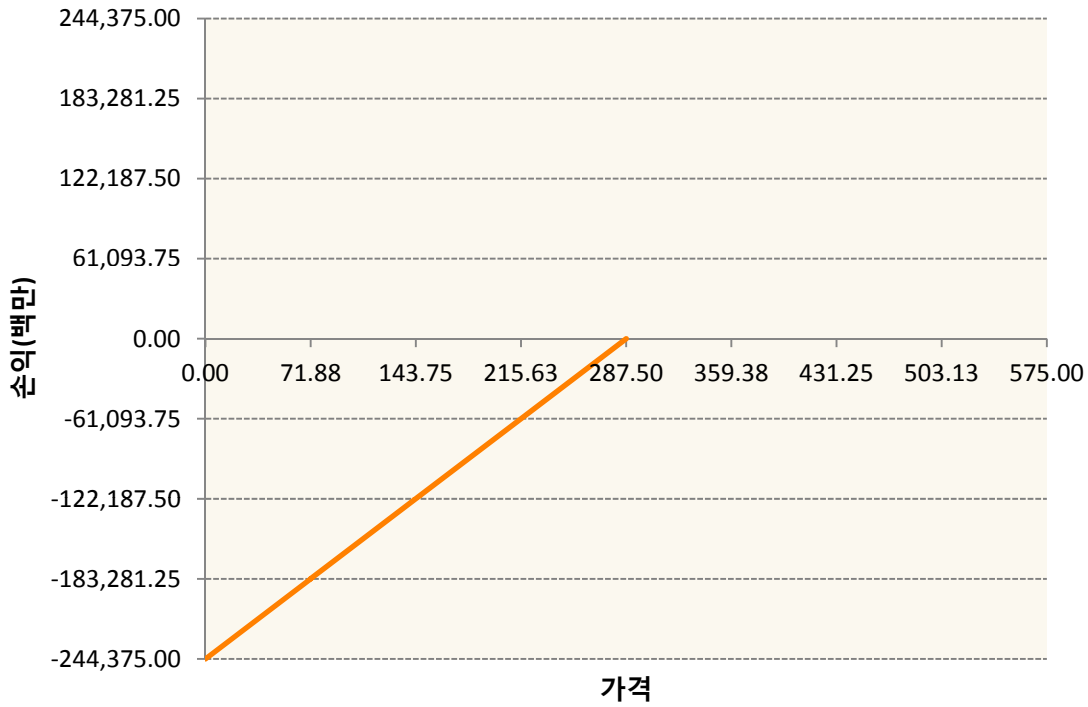


KR4201P32902-2019-03 콜290





KR4301P32876-2019-03 풋287.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201P32878		2019-03 콜287.5					7,429	
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	2,982	2,924	2,851	2,762	2,660	2,545	2,420	
-5.33%	2,722	2,591	2,447	2,291	2,126	1,953	1,773	
-2.67%	2,038	1,831	1,620	1,406	1,189	970	750	
0%	702	468	234	0	-234	-468	-703	
2.67%	-1,339	-1,533	-1,735	-1,942	-2,153	-2,369	-2,587	
5.33%	-3,932	-4,054	-4,191	-4,342	-4,504	-4,675	-4,855	
8.00%	-6,845	-6,903	-6,979	-7,071	-7,177	-7,297	-7,429	
KR4201P32902		2019-03 콜290					20,007	
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	7,128	7,009	6,847	6,644	6,402	6,124	5,813	

-5.33%	6,616	6,314	5,968	5,583	5,167	4,723	4,257
-2.67%	5,133	4,604	4,053	3,486	2,906	2,316	1,717
0%	1,992	1,328	664	0	-665	-1,329	-1,994
2.67%	-3,149	-3,758	-4,378	-5,007	-5,643	-6,284	-6,930
5.33%	-10,028	-10,446	-10,904	-11,393	-11,909	-12,445	-12,999
8.00%	-18,021	-18,242	-18,514	-18,832	-19,189	-19,583	-20,007
KR4301P32876 2019-03 풋287.5							15,979
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-15,883	-15,885	-15,891	-15,901	-15,919	-15,944	-15,979
-5.33%	-9,386	-9,425	-9,479	-9,550	-9,636	-9,736	-9,851
-2.67%	-3,369	-3,547	-3,738	-3,940	-4,149	-4,366	-4,589
0%	791	528	264	0	-264	-529	-794
2.67%	2,400	2,265	2,112	1,943	1,762	1,571	1,370
5.33%	2,691	2,665	2,625	2,569	2,498	2,413	2,313
8.00%	2,714	2,712	2,707	2,697	2,680	2,656	2,622

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

(단위:백만원)

44,729

공시일	2019-02-25
기준일	2019-02-22

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

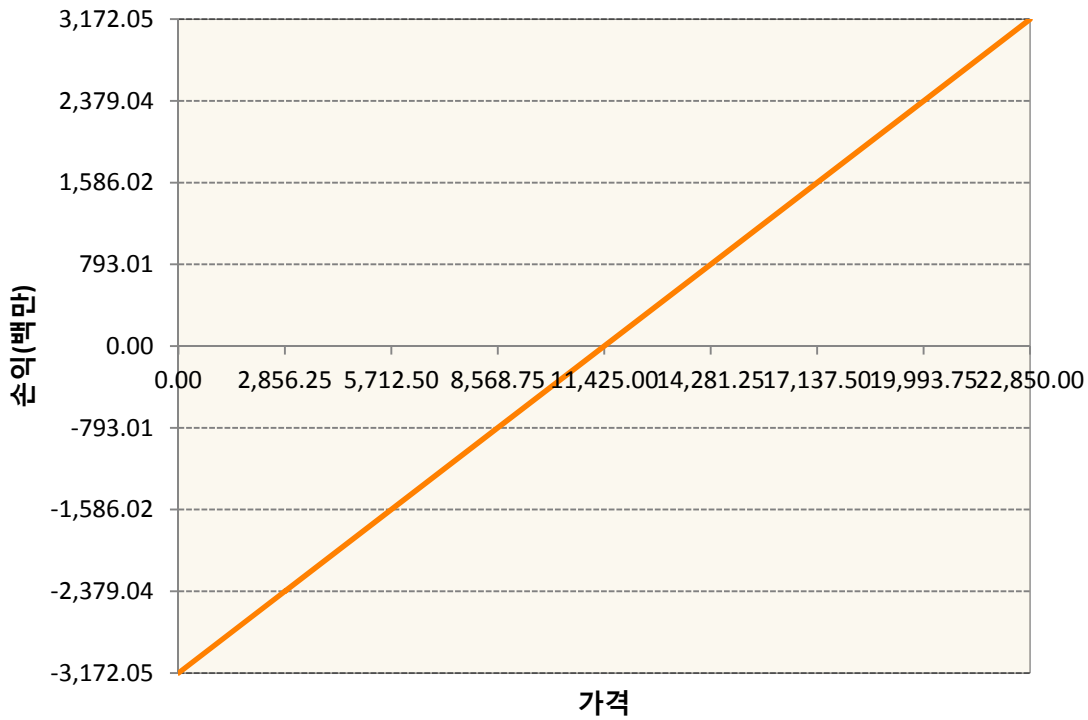
1. 계약금액

(단위:백만원)

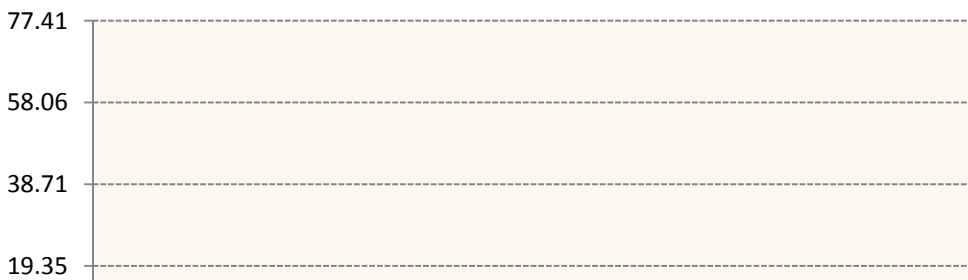
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	3,172	0	3,172	장내
누계	유가증권	옵션	0	7,343	-7,343	장내
누계	통화	선도	0	2,724	-2,724	장외

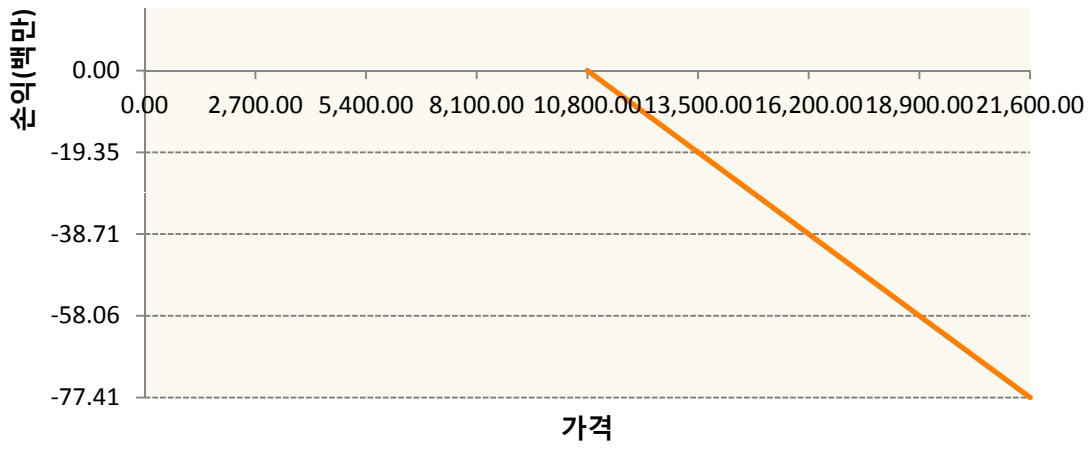
2. 만기시점의 손익구조

HCG9-HSCEI Futures Feb19

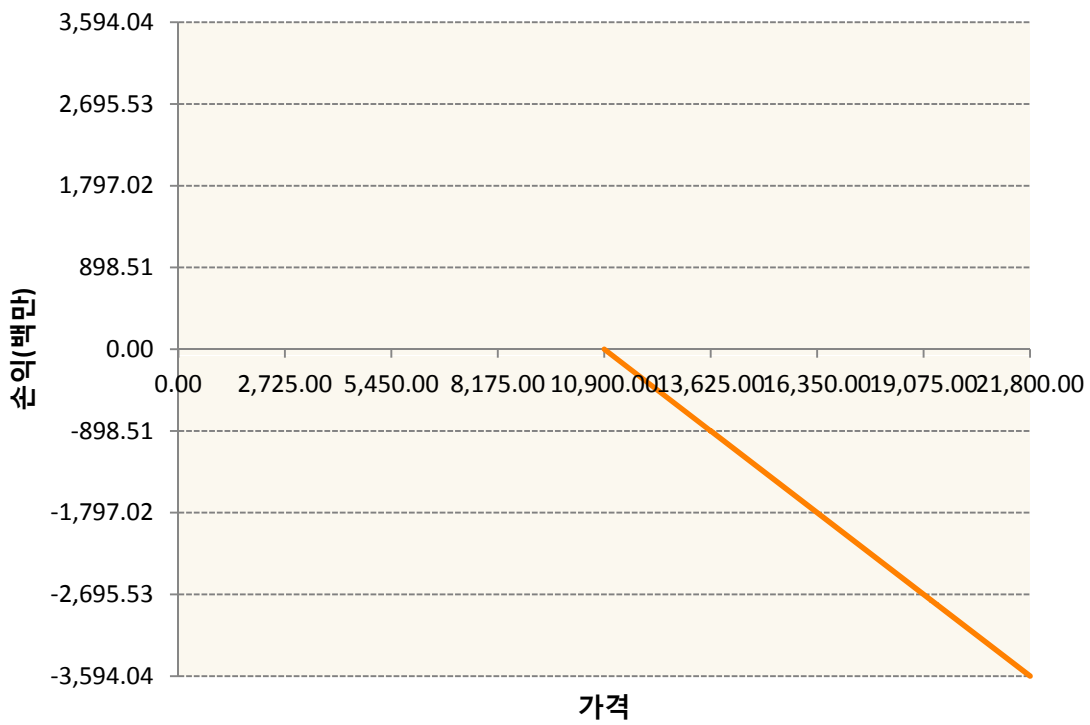


OHHIG9-C108-HSCEI

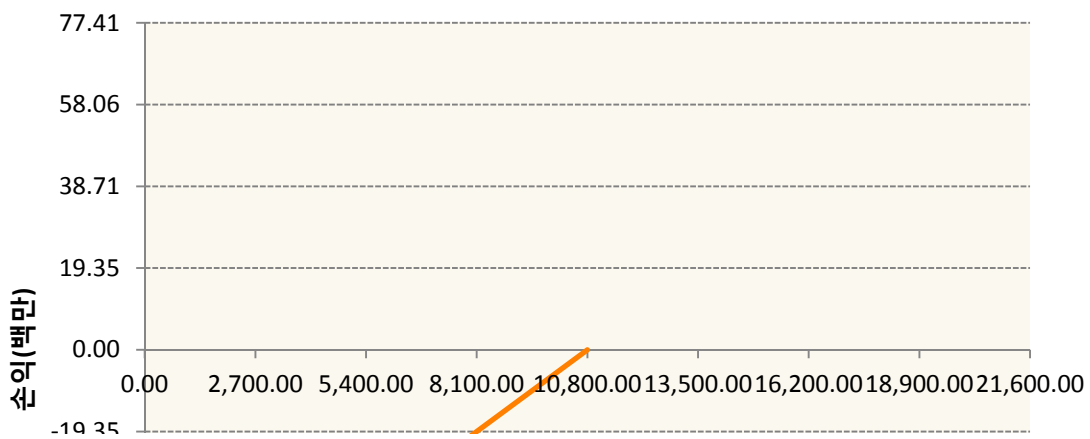


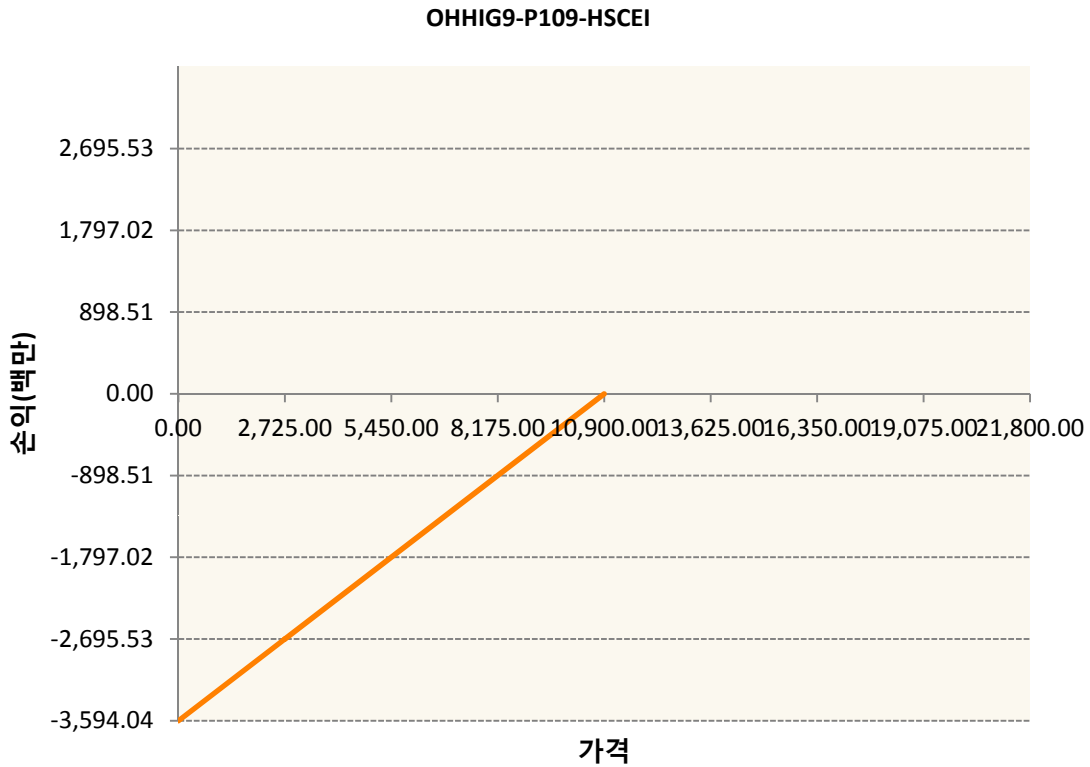
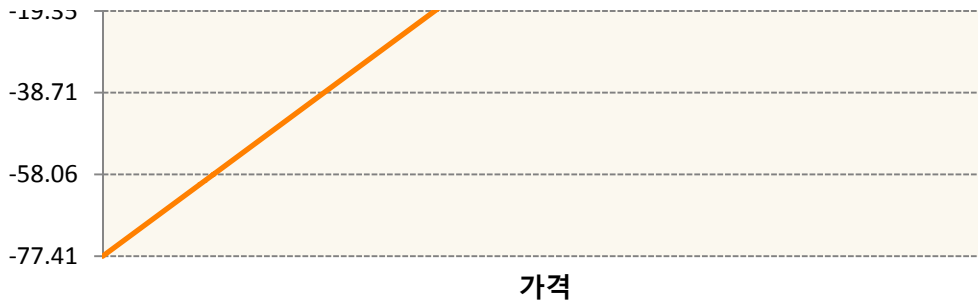


OHHIG9-C109-HSCEI



OHHIG9-P108-HSCEI





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)	(단위:백만원)
FX21018Z00 KRW/HKD 11-03-19E	218
HCG9 HSCEI Futures Feb19	254
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)
	941

공시일	2019-02-25
기준일	2019-02-22

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

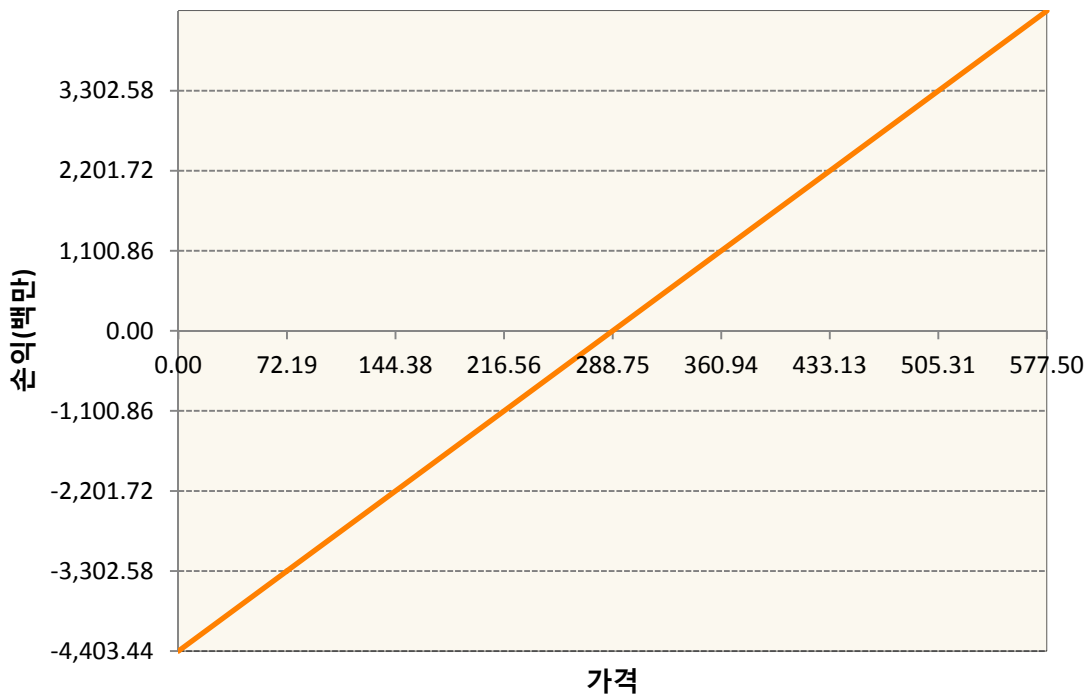
1. 계약금액

(단위:백만원)

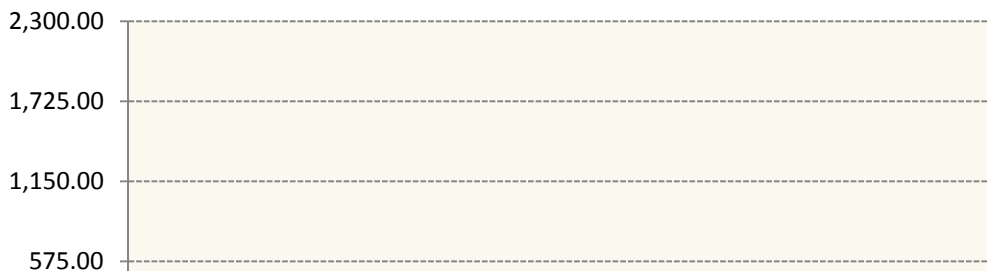
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	3,000	-3,000	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	4,403	0	4,403	장내
누계	유가증권	스왑	28,836	0	28,836	장외
누계	유가증권	옵션	0	29,586	-29,586	장내

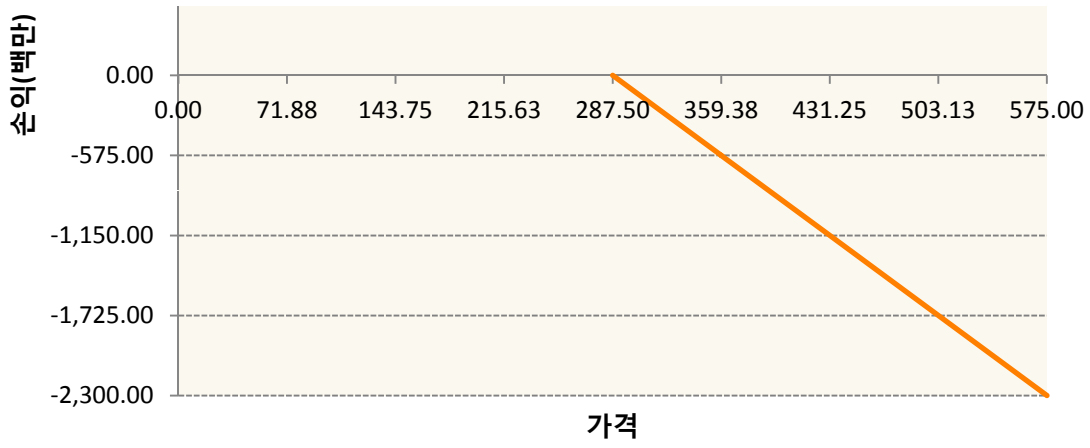
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P30007-2019-03 코스피200지수선물

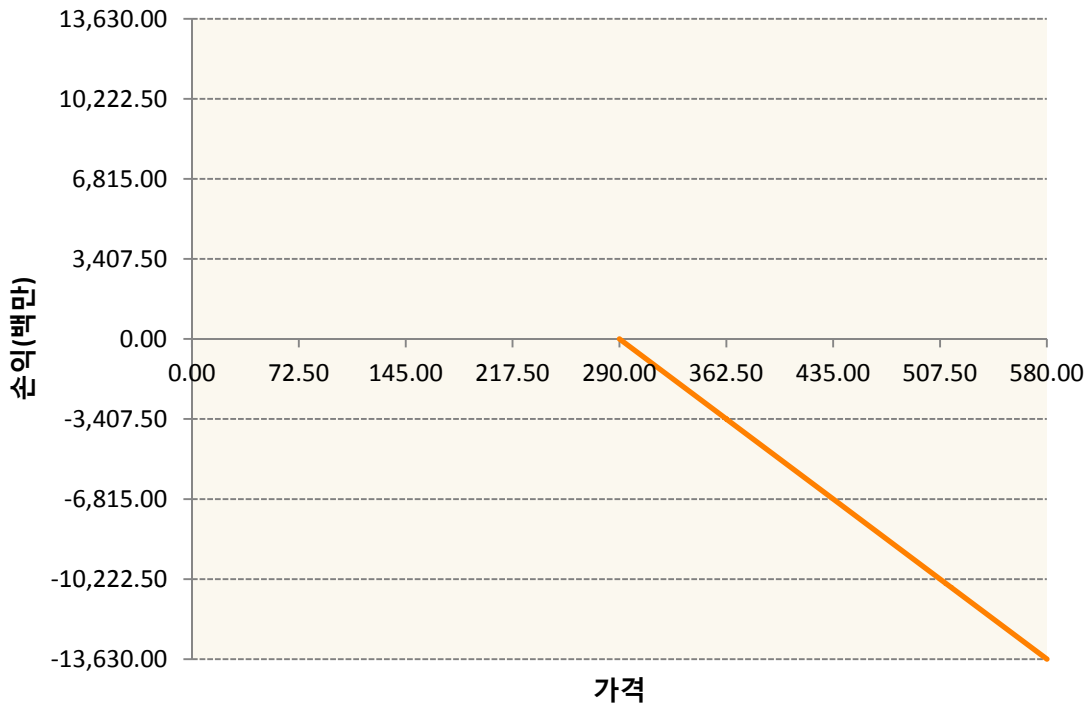


KR4201P32878-2019-03 콜287.5

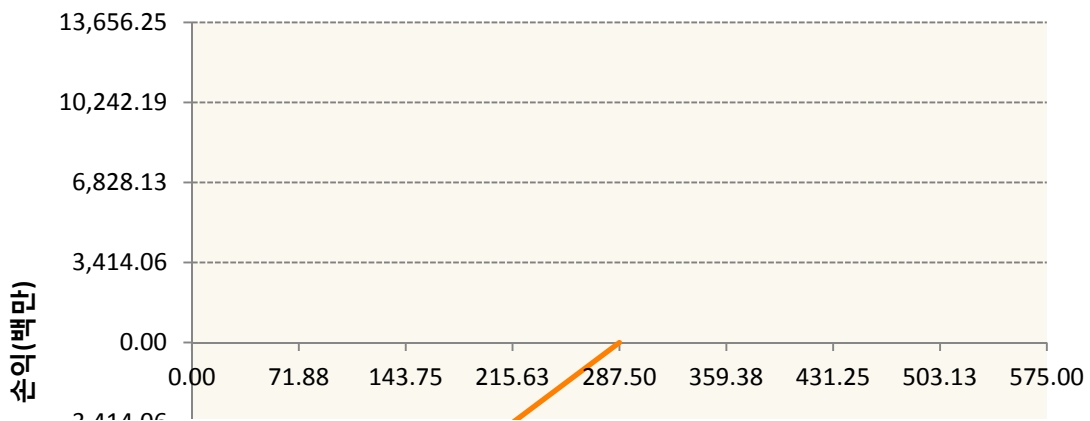


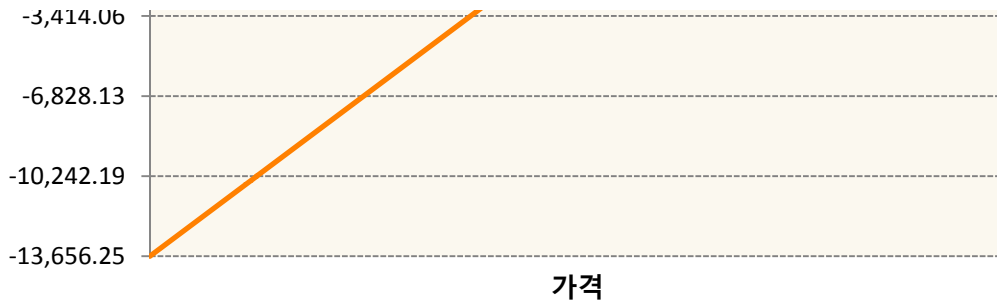


KR4201P32902-2019-03 콜290



KR4301P32876-2019-03 풋287.5





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11		UBCSFXC1 INDEX_14						2,416
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-2,416	-2,416	-2,416	-2,416	-2,416	-2,416	-2,416	
-5.33%	-1,611	-1,611	-1,611	-1,611	-1,611	-1,611	-1,611	
-2.67%	-805	-805	-805	-805	-805	-805	-805	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	805	805	805	805	805	805	805	
5.33%	1,611	1,611	1,611	1,611	1,611	1,611	1,611	
8.00%	2,416	2,416	2,416	2,416	2,416	2,416	2,416	
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						147
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	59	58	56	55	53	50	48	
-5.33%	54	51	48	45	42	39	35	
-2.67%	40	36	32	28	23	19	15	
0%	14	9	5	0	-5	-9	-14	
2.67%	-26	-30	-34	-38	-43	-47	-51	
5.33%	-78	-80	-83	-86	-89	-92	-96	
8.00%	-135	-136	-138	-140	-142	-144	-147	
KR4201P32902		2019-03 콜290						821
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	

-8.00%	293	288	281	273	263	251	239
-5.33%	272	259	245	229	212	194	175
-2.67%	211	189	166	143	119	95	70
0%	82	55	27	0	-27	-55	-82
2.67%	-129	-154	-180	-206	-232	-258	-284
5.33%	-412	-429	-448	-468	-489	-511	-534
8.00%	-740	-749	-760	-773	-788	-804	-821
KR4301P32876 2019-03 풋287.5							893
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-888	-888	-888	-889	-890	-891	-893
-5.33%	-525	-527	-530	-534	-538	-544	-550
-2.67%	-188	-198	-209	-220	-232	-244	-256
0%	44	29	15	0	-15	-30	-44
2.67%	134	127	118	109	98	88	77
5.33%	150	149	147	144	140	135	129
8.00%	152	152	151	151	150	148	147

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

(단위:백만원)

4,660

공시일	2019-02-25
기준일	2019-02-22

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

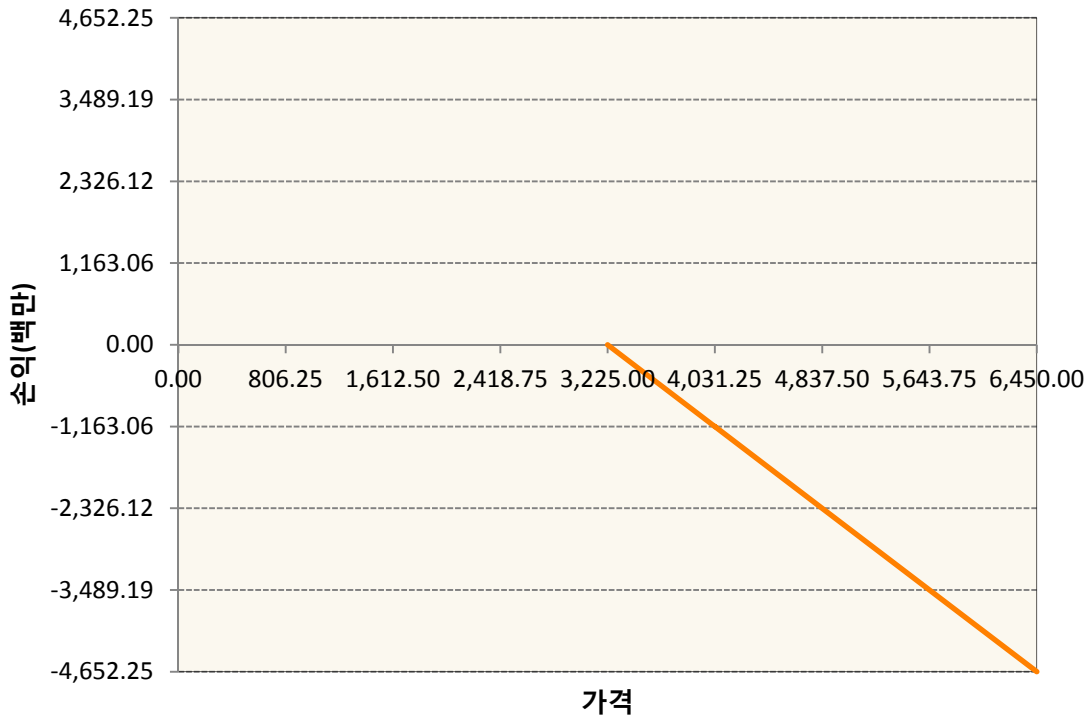
1. 계약금액

(단위:백만원)

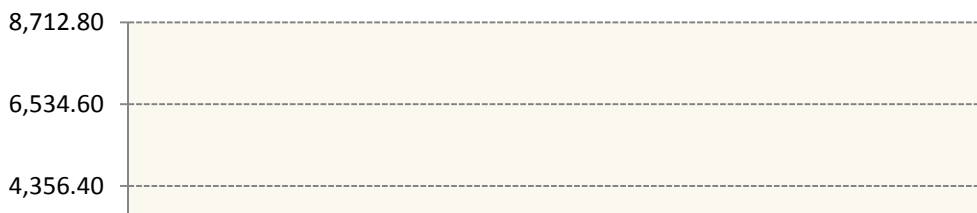
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	7,058	0	7,058	
누계	유가증권	스왑	60,269	0	60,269	장외
누계	유가증권	옵션	0	26,730	-26,730	장내
누계	통화	선도	0	15,319	-15,319	장외

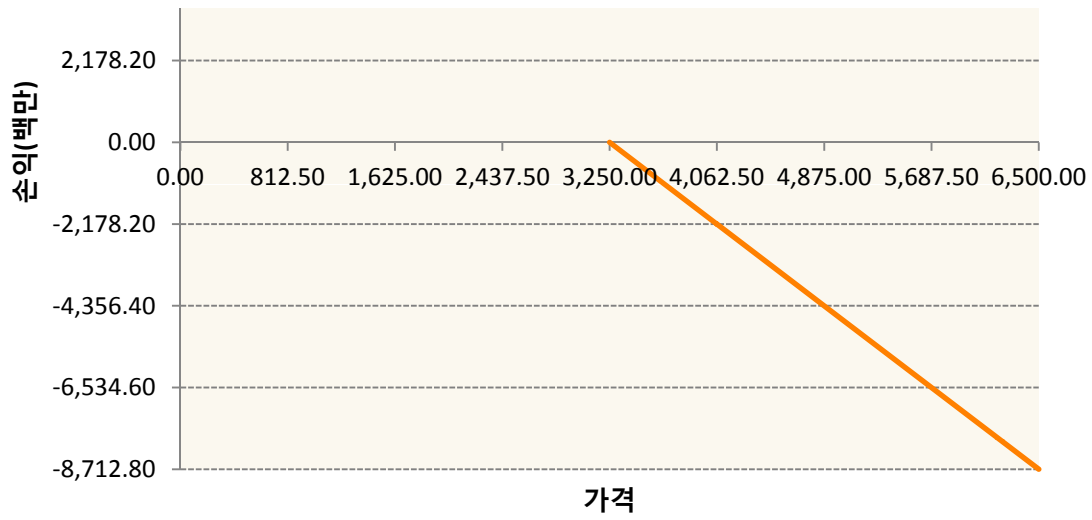
2. 만기시점의 손익구조

OESXH9-C3225-EURO STOXX 50

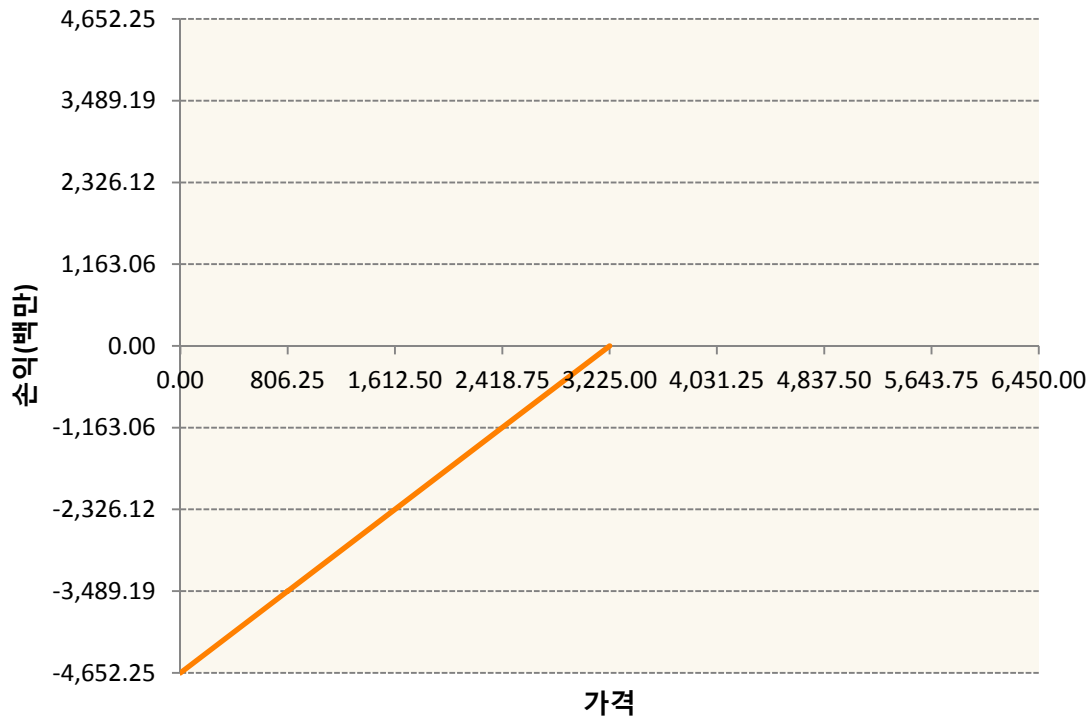


OESXH9-C3250-EURO STOXX 50

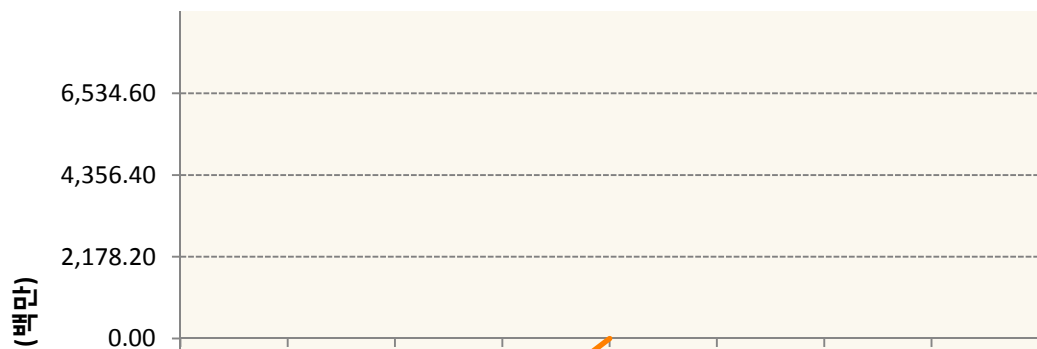


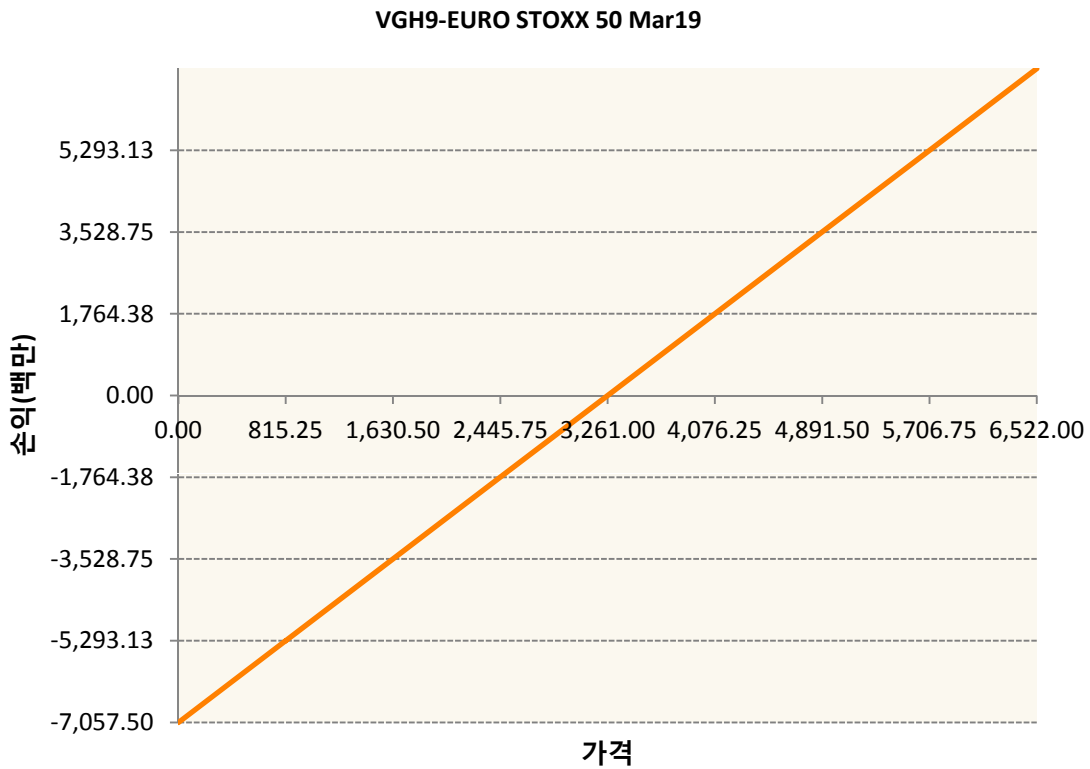
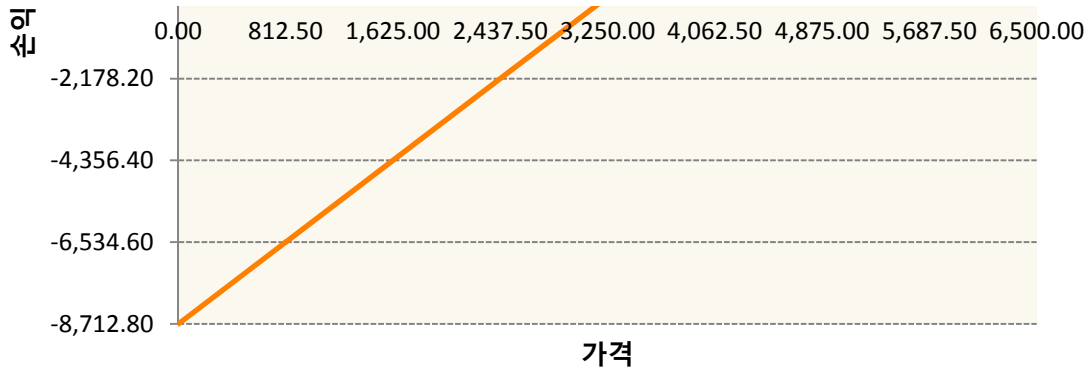


OESXH9-P3225-EURO STOXX 50



OESXH9-P3250-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY		93
FX21018Z03 KRW/EUR 22-03-19E		817
FX21019G02 KRW/EUR 24-05-19E		409
OESXH9-C32 EURO STOXX 50		372
OESXH9-C32 EURO STOXX 50		697
OESXH9-P32 EURO STOXX 50		372
OESXH9-P32 EURO STOXX 50		697
VGH9 EURO STOXX 50 Mar19		565

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

(단위:백만원)

2,649

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

(단위:백만원)

1,161

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

(단위:백만원)

99

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

(단위:백만원)

144

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

(단위:백만원)

45

공시일	2019-02-25
기준일	2019-02-22

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

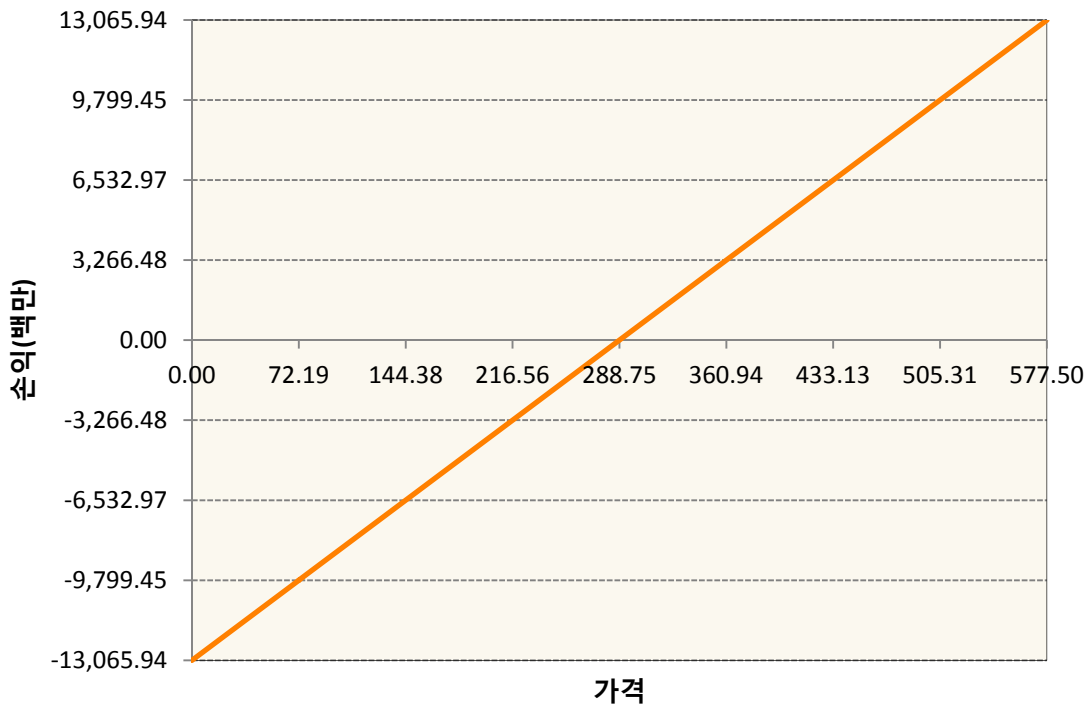
1. 계약금액

(단위:백만원)

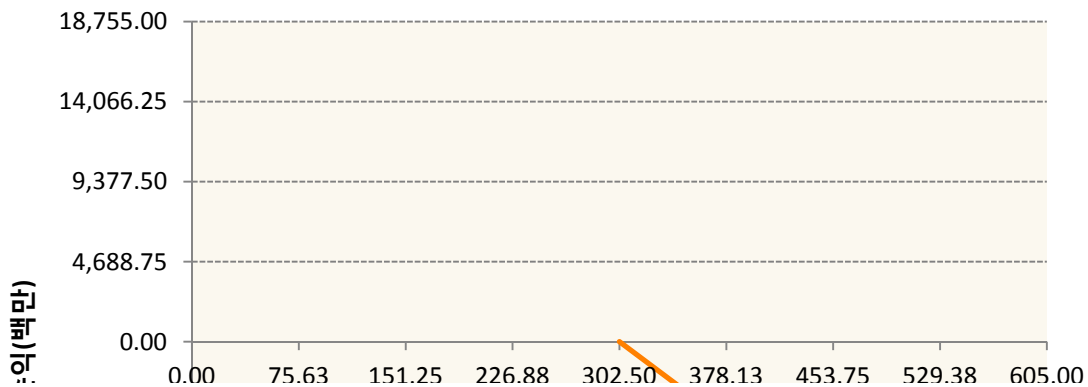
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	13,066	0	13,066	장내
누계	유가증권	옵션	2,165	24,931	-22,766	장내

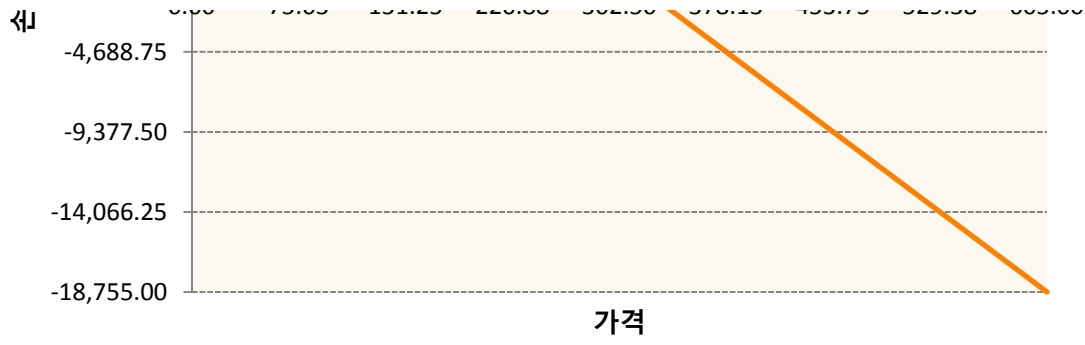
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P30007-2019-03 코스피200지수선물

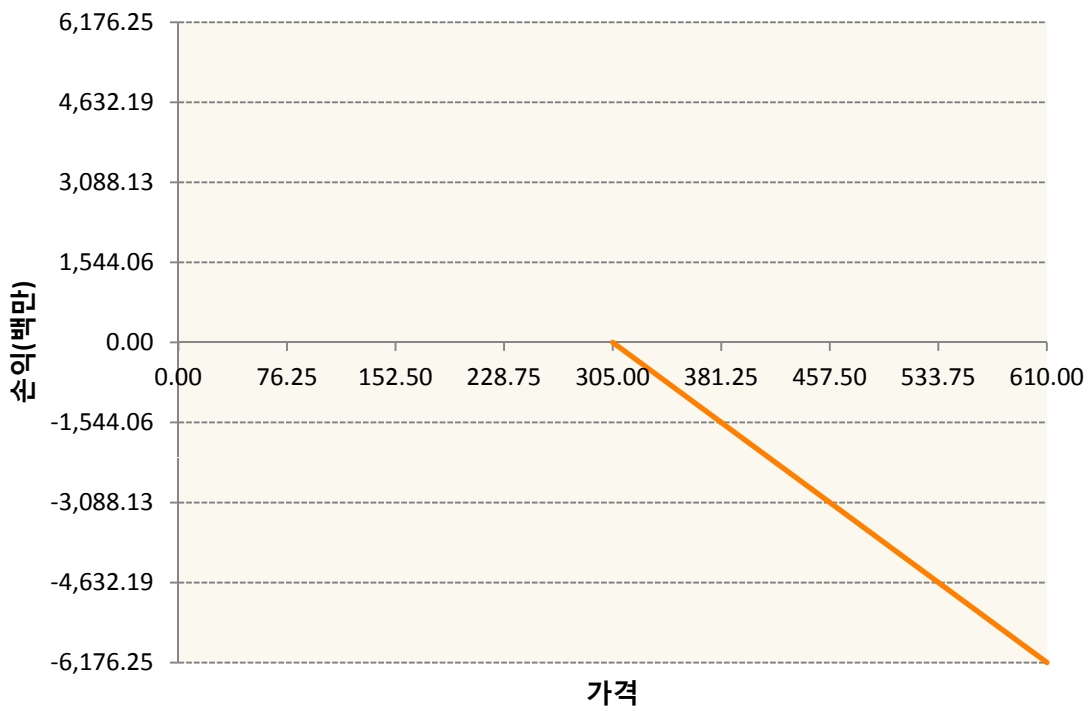


KR4201P33025-2019-03 콜302.5

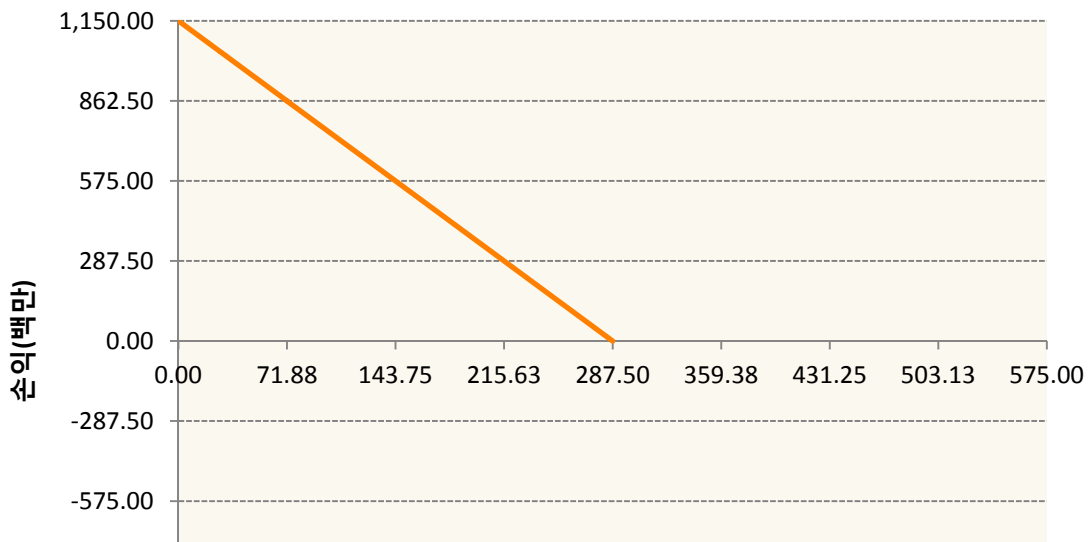


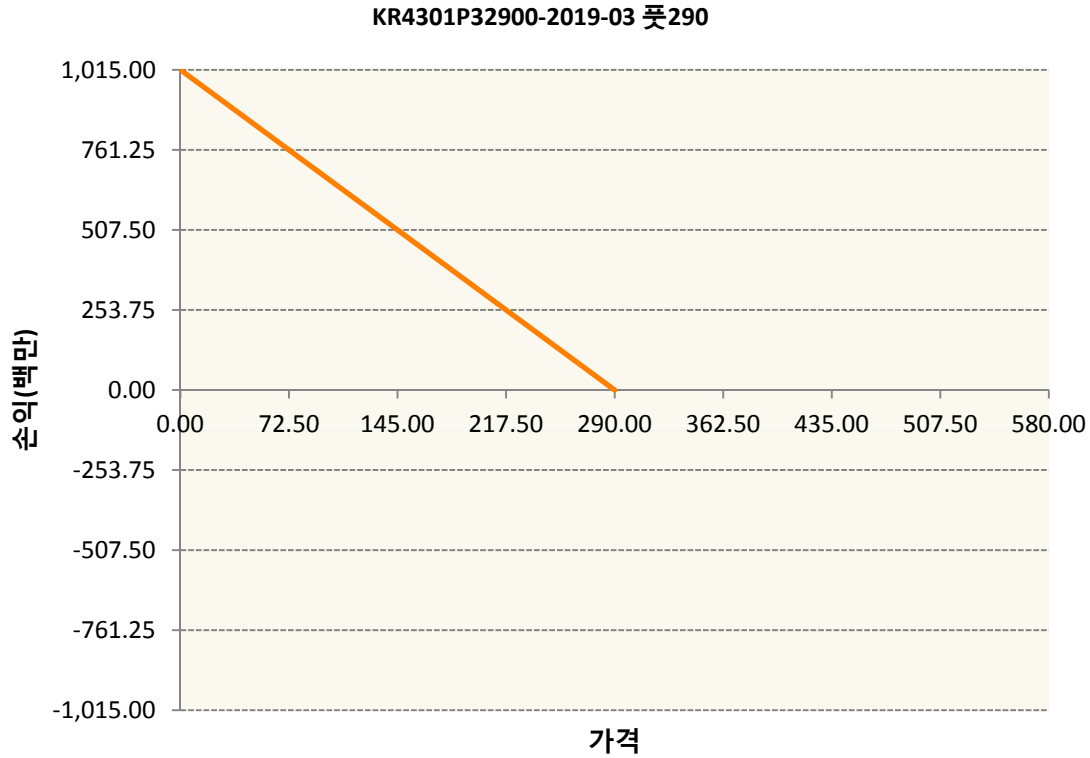
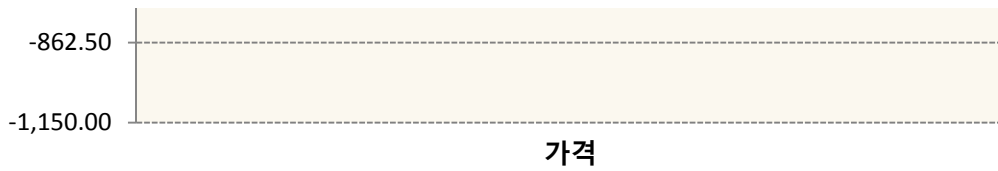


KR4201P33058-2019-03 콜305



KR4301P32876-2019-03 풋287.5





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101P30007		2019-03 코스피200지수선물						1,045
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-1,045	-1,045	-1,045	-1,045	-1,045	-1,045	-1,045	
-5.33%	-697	-697	-697	-697	-697	-697	-697	
-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%	697	697	697	697	697	697	697	
8.00%	1,045	1,045	1,045	1,045	1,045	1,045	1,045	
KR4201P33025		2019-03 콜302.5						767
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	140	139	137	134	130	124	117	
-5.33%	137	133	127	119	109	98	84	
-2.67%	122	111	97	81	63	42	21	

0%	75	52	27	0	-28	-57	-87
2.67%	-40	-74	-109	-144	-179	-215	-251
5.33%	-252	-289	-327	-365	-402	-440	-478
8.00%	-566	-597	-630	-663	-698	-732	-767
KR4201P33058 2019-03 콜305							229
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	36	36	35	35	34	32	30
-5.33%	35	34	33	31	29	25	22
-2.67%	32	29	26	21	16	11	4
0%	21	15	8	0	-8	-17	-26
2.67%	-8	-19	-29	-40	-51	-62	-74
5.33%	-67	-79	-91	-104	-116	-129	-141
8.00%	-159	-170	-182	-193	-205	-217	-229
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	45	46	46
-2.67%	16	17	18	19	20	21	22
0%	-4	-2	-1	0	1	2	4
2.67%	-11	-11	-10	-9	-8	-7	-6
5.33%	-13	-13	-12	-12	-12	-11	-11
8.00%	-13	-13	-13	-13	-13	-12	-12
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	19	20	21
0%	-3	-2	-1	0	1	2	3
2.67%	-13	-12	-11	-11	-10	-9	-8
5.33%	-15	-15	-15	-15	-14	-14	-13
8.00%	-16	-16	-16	-15	-15	-15	-15

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

(단위:백만원)

1,784

공시일	2019-02-25
기준일	2019-02-22

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	979	0	979	

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	2019-02-25
기준일	2019-02-22

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	5,635	0	5,635	

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	2019-02-25
기준일	2019-02-22

H2O글로벌본드(H)(채권혼합-파생)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	5,964	0	5,964	
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	수익증권	33,344	0	33,344	
누계	통화	선도	0	38,032	-38,032	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	270
FX21019G02 KRW/USD 25-03-19E	136
FX21019G02 KRW/USD 25-03-19E	477
FX21019G03 KRW/USD 28-03-19E	252

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

(단위:백만원)

1,113

공시일	2019-02-25
기준일	2019-02-22

스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

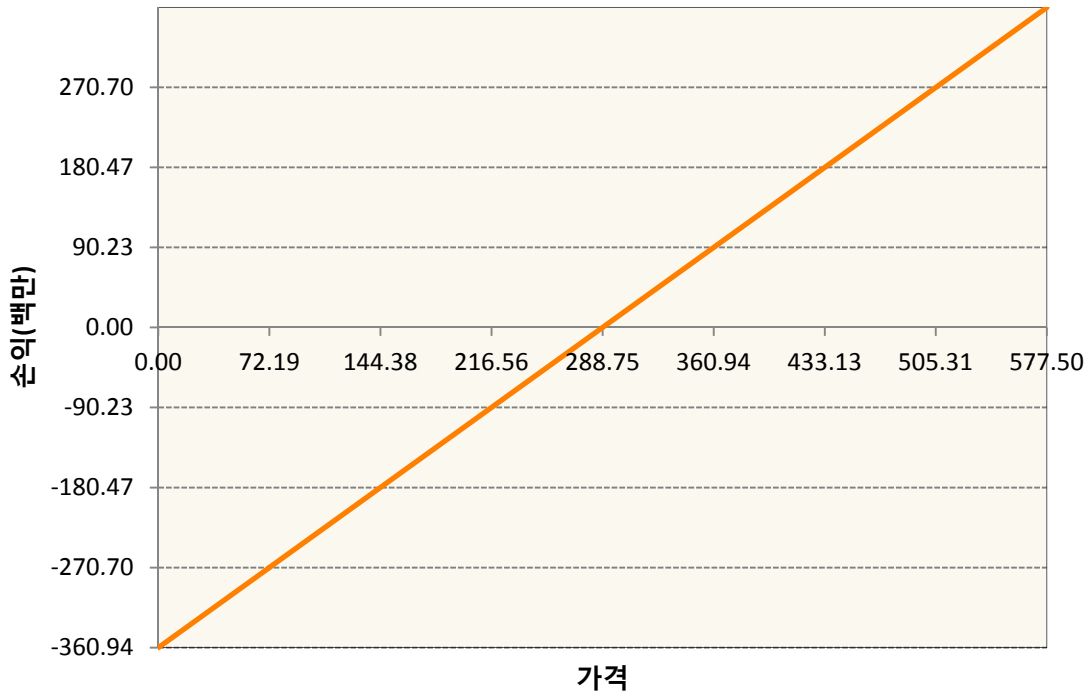
1. 계약금액

(단위:백만원)

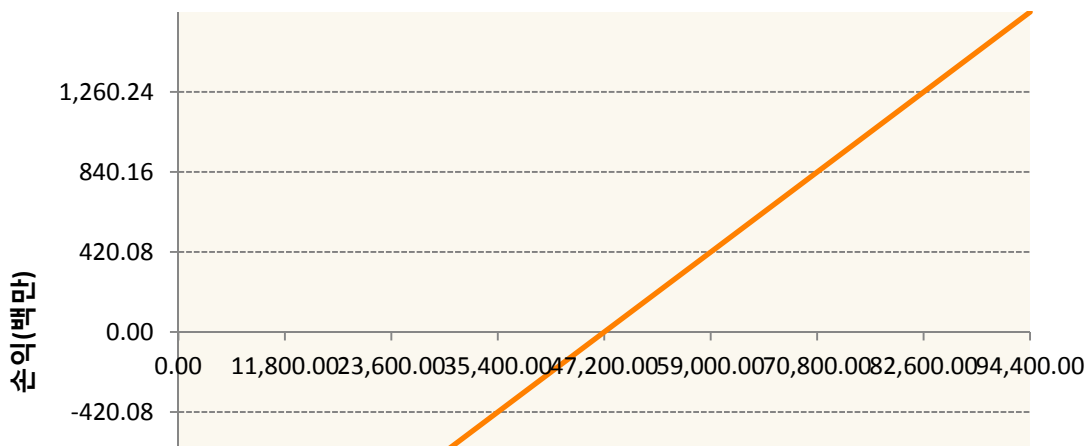
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,041	0	2,041	장내

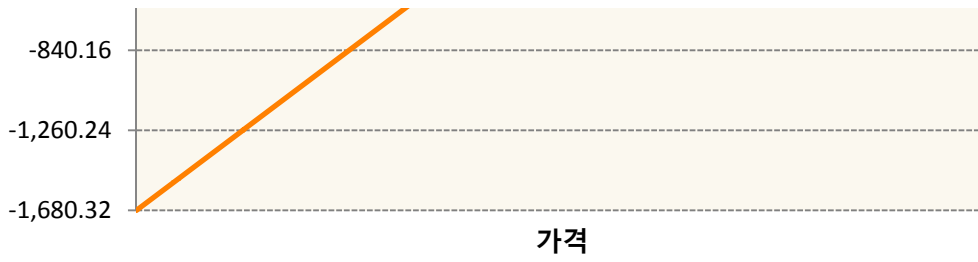
2. 만기시점의 손익구조

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%	-90	-90	-90	-90	-90	-90	-90	
-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%	90	90	90	90	90	90	90	
8.00%	134	134	134	134	134	134	134	

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

179

공시일	2019-02-25
기준일	2019-02-22

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

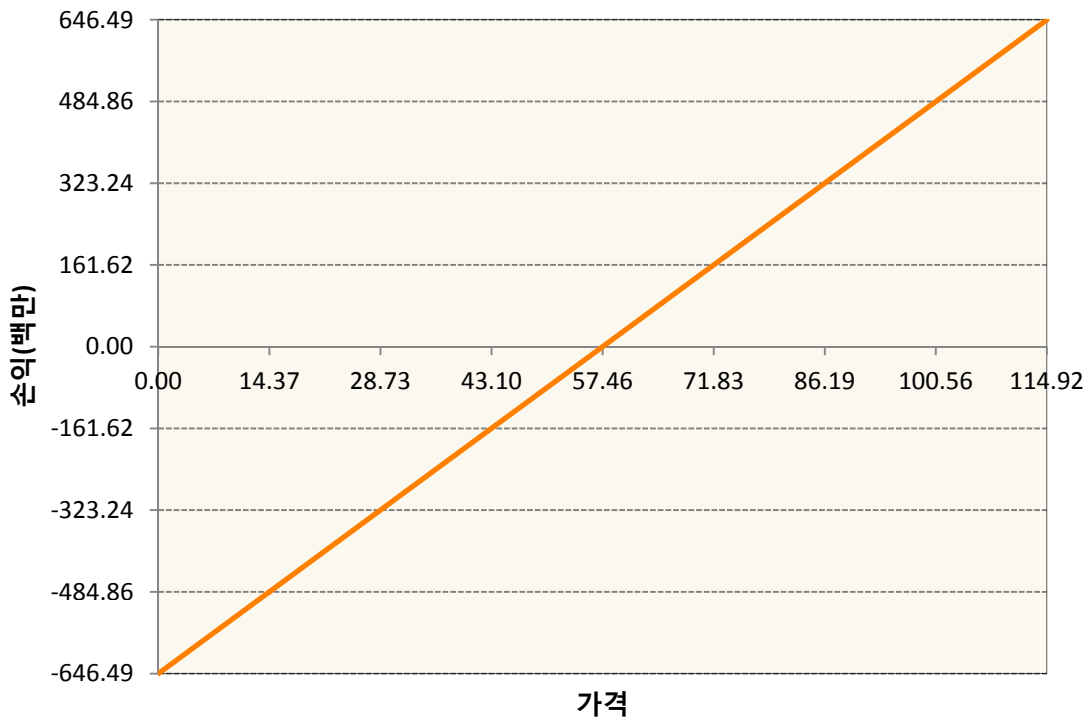
1. 계약금액

(단위:백만원)

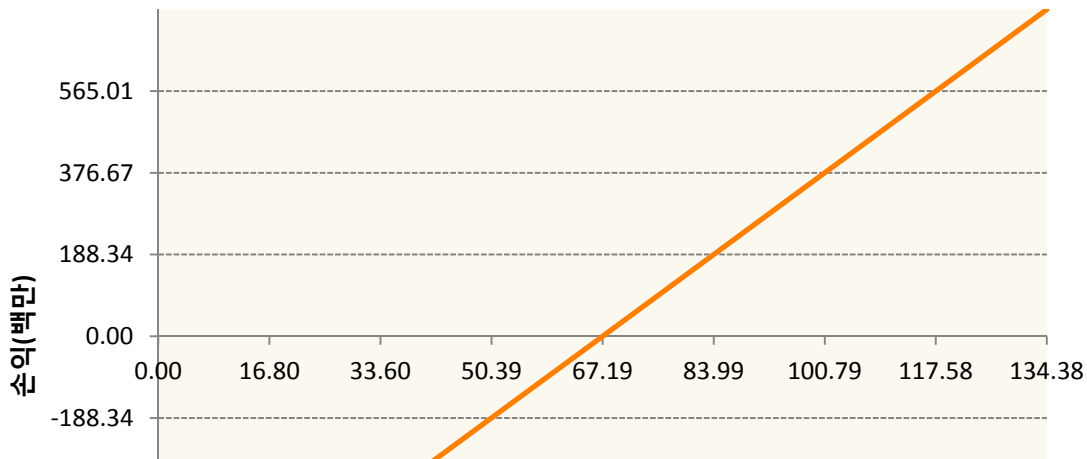
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,833	281	2,552	

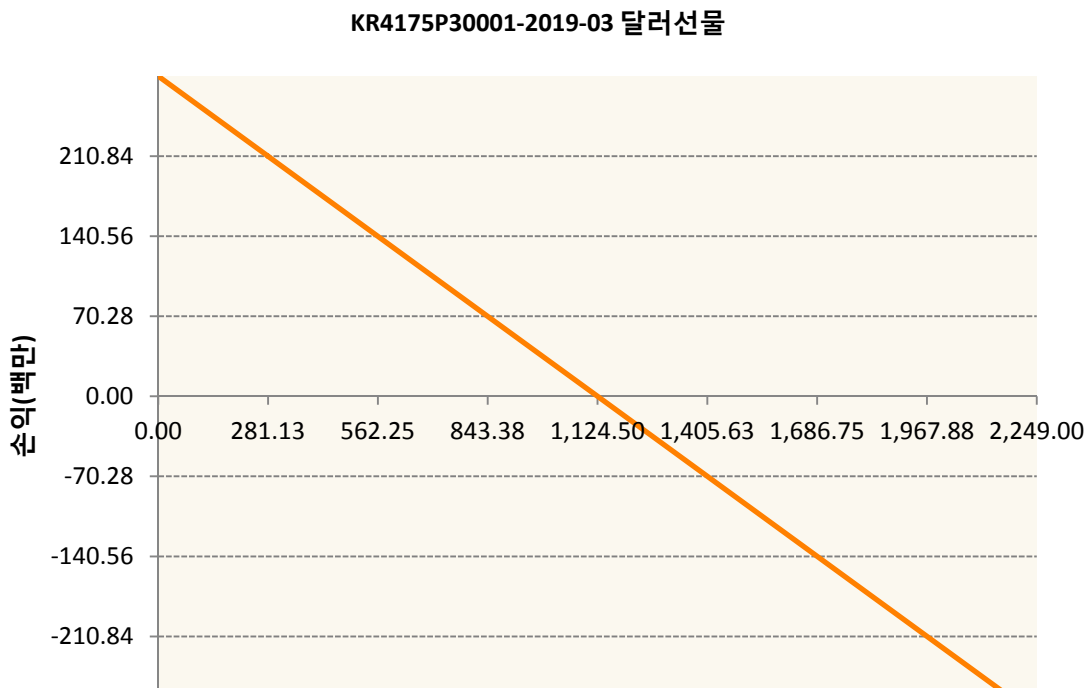
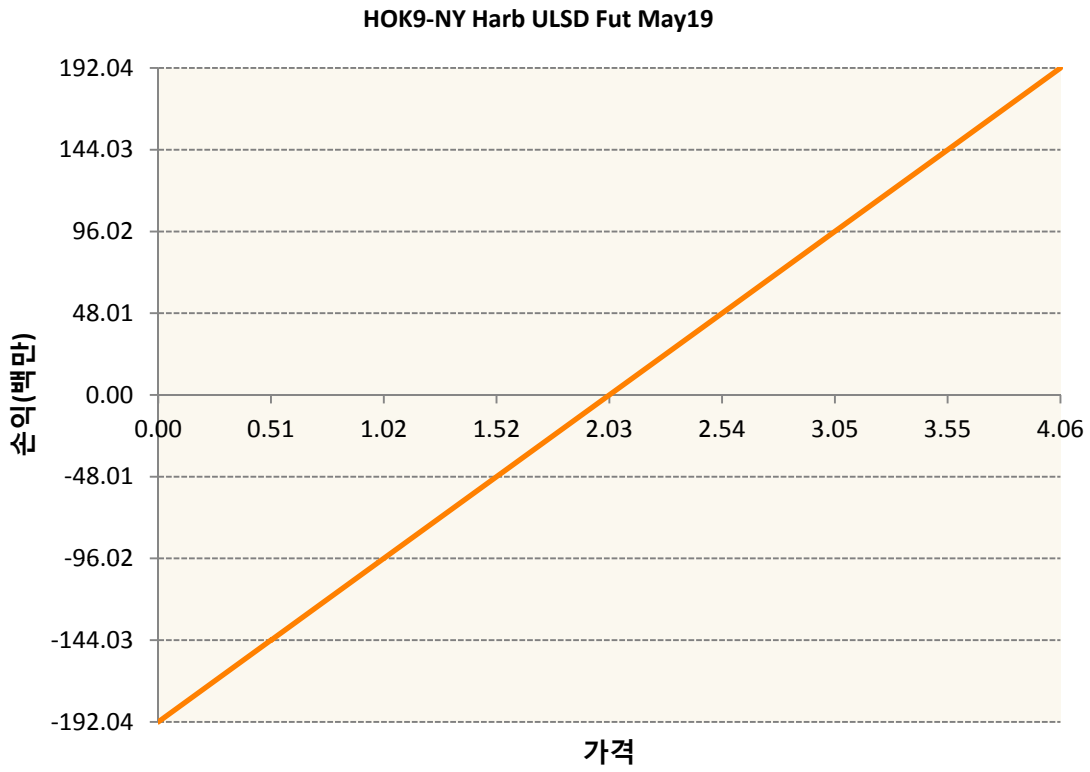
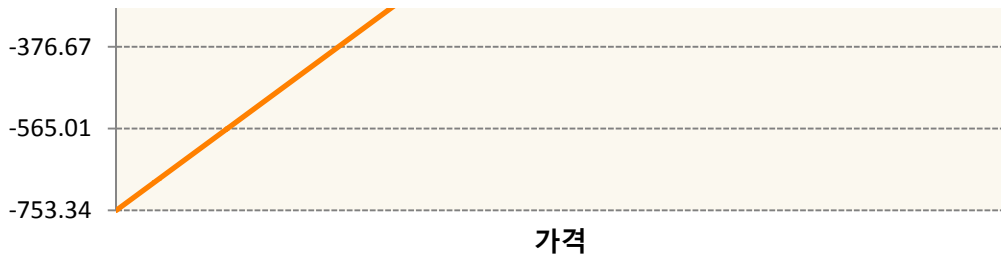
2. 만기시점의 손익구조

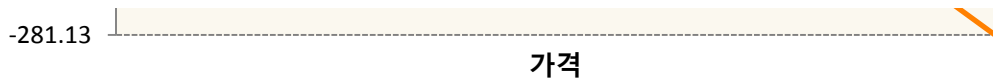
CLK9-WTI CRUDE FUTURE May19



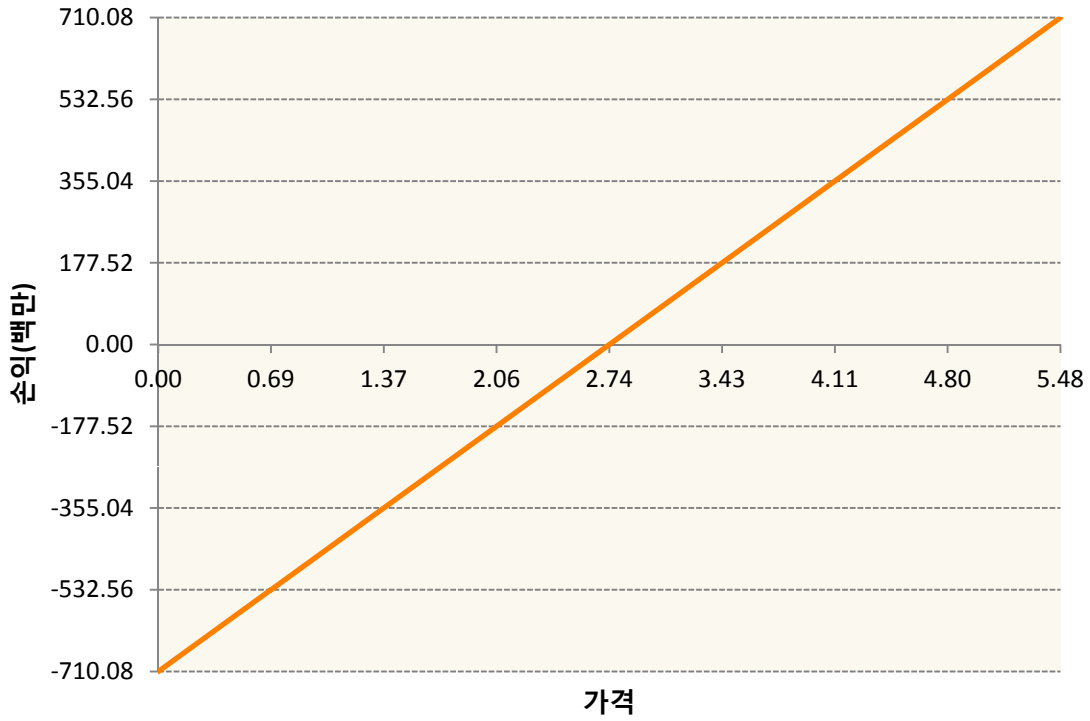
COK9-BRENT CRUDE FUTR May19



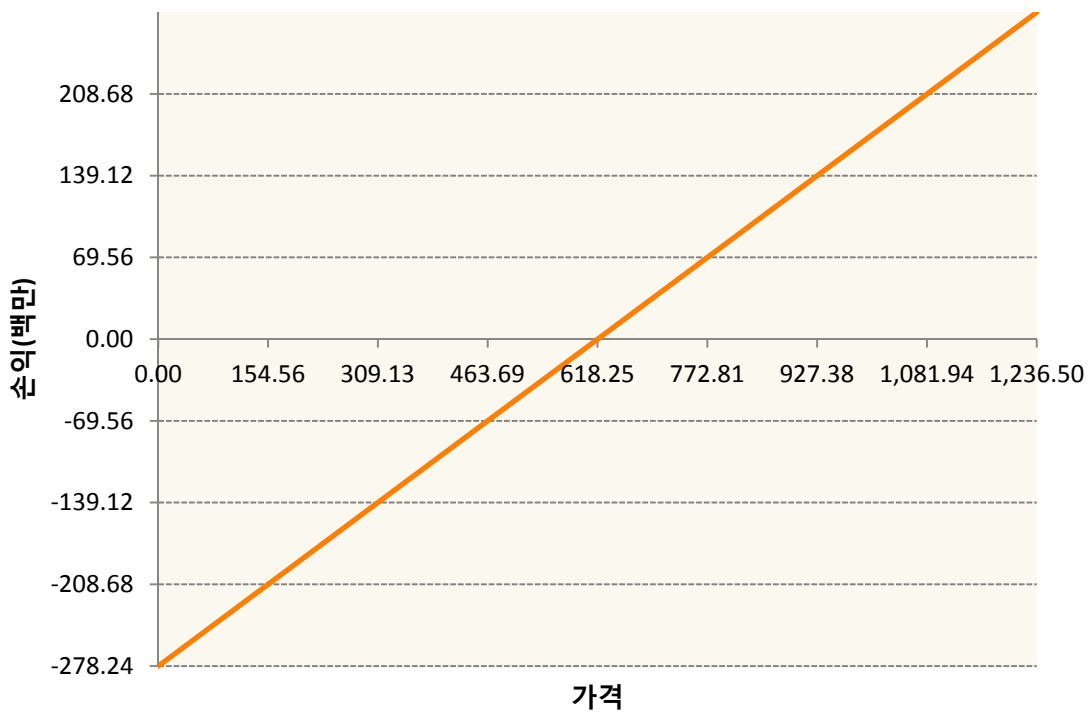




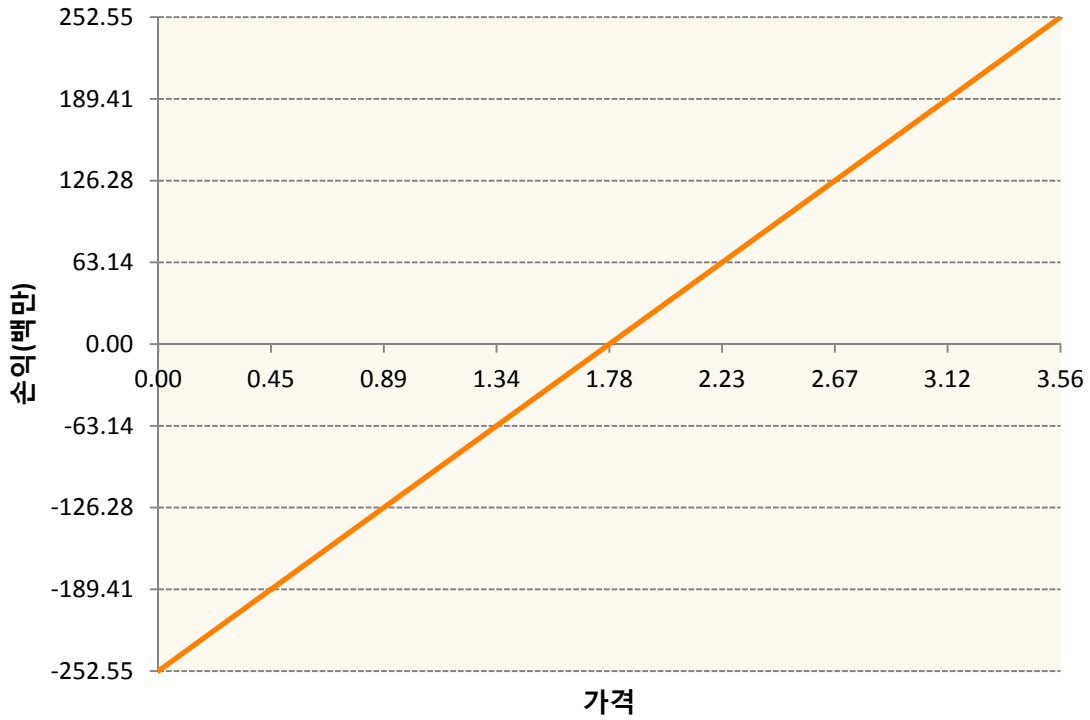
NGK19-NATURAL GAS FUTR May19



QSK9-Low Su Gasoil G May19



XBK9-GASOLINE RBOB FUT May19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

CLK9	WTI CRUDE FUTURE May19	52
COK9	BRENT CRUDE FUTR May19	60
HOK9	NY Harb ULSD Fut May19	15
KR4175P300	2019-03 달러선물	22
NGK19	NATURAL GAS FUTR May19	57
QSK9	Low Su Gasoil G May19	22
XBK9	GASOLINE RBOB FUT May19	20

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

(단위:백만원)

432

공시일	2019-02-25
기준일	2019-02-22

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

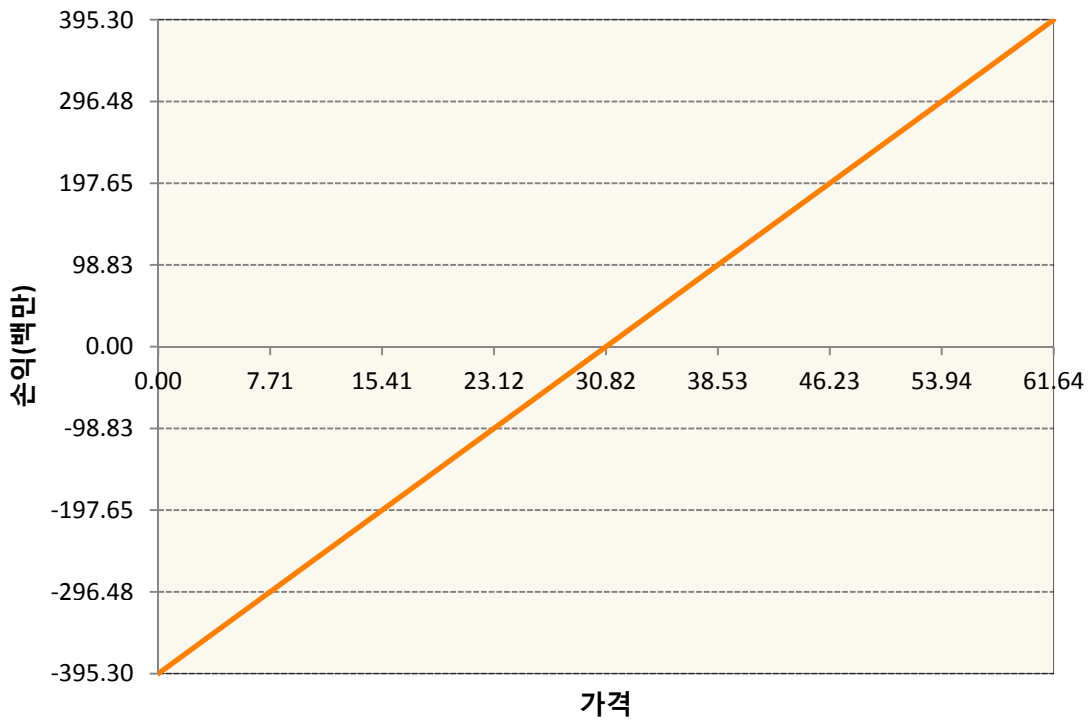
1. 계약금액

(단위:백만원)

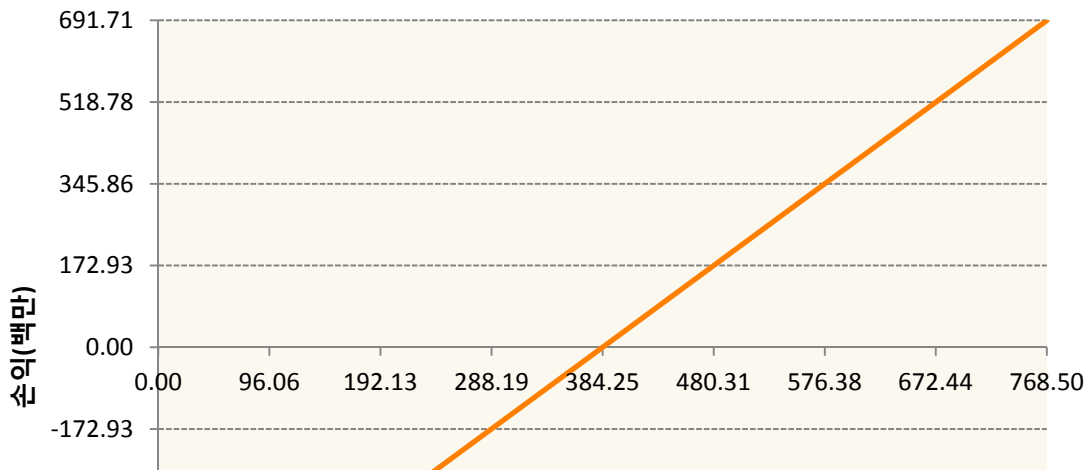
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,489	79	3,410	

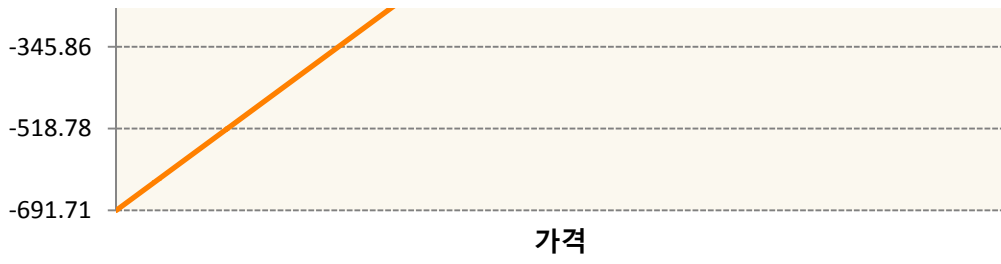
2. 만기시점의 손익구조

BOK9-SOYBEAN OIL FUTR May19

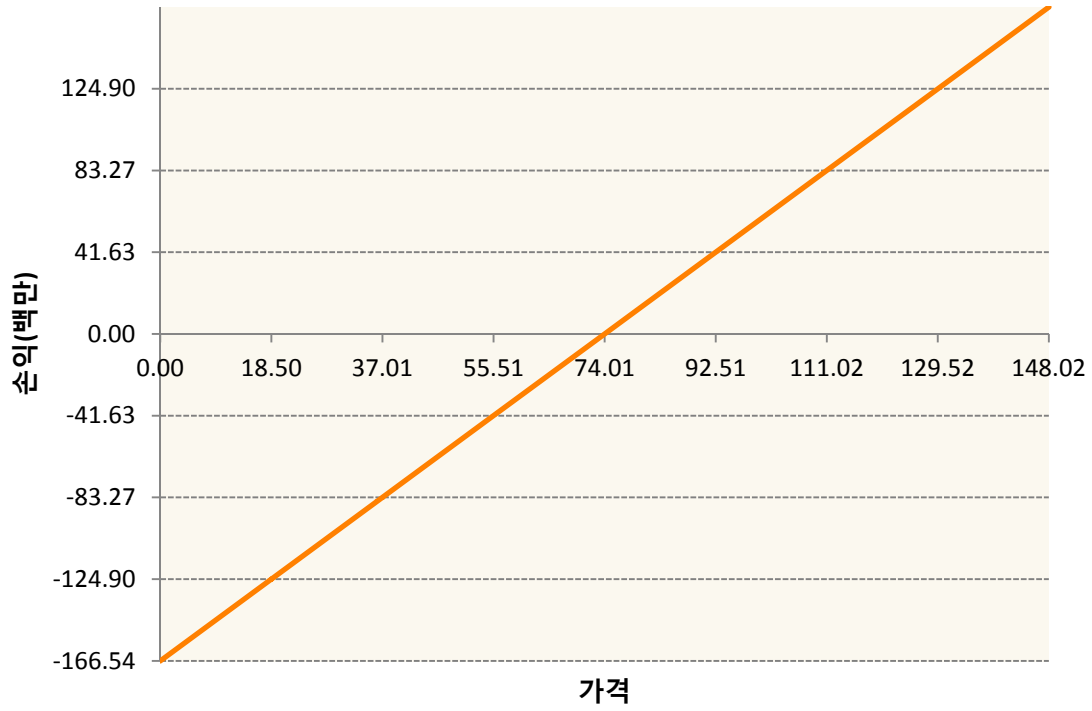


CK9-CORN FUTURE May19

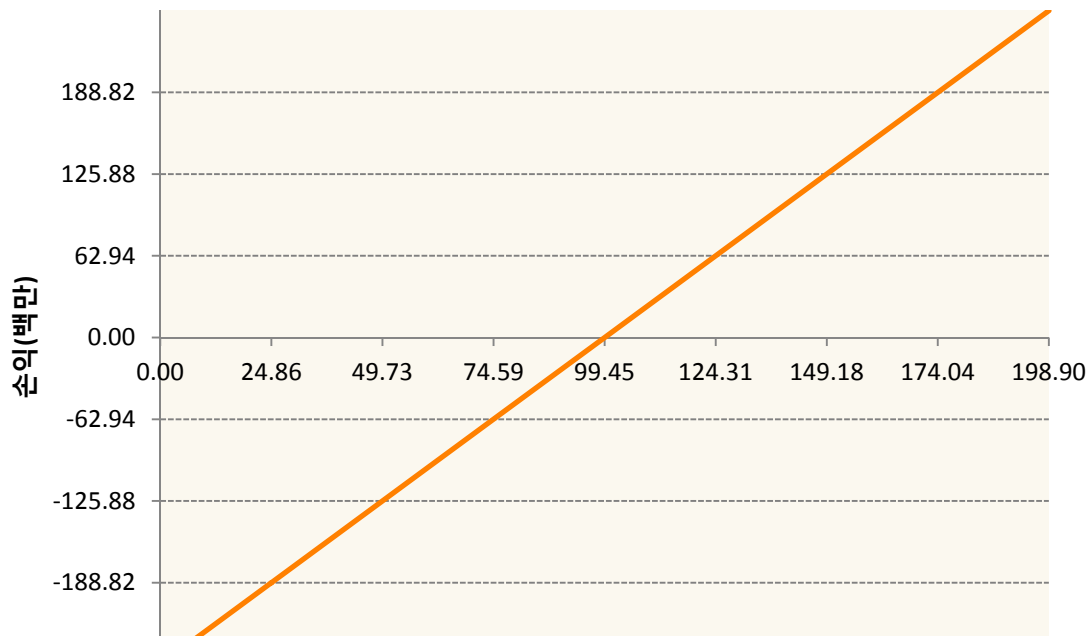


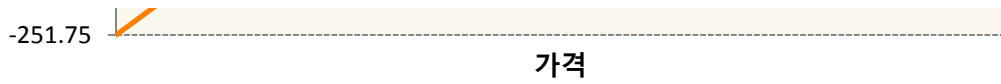


CTK9-COTTON NO.2 FUTR May19

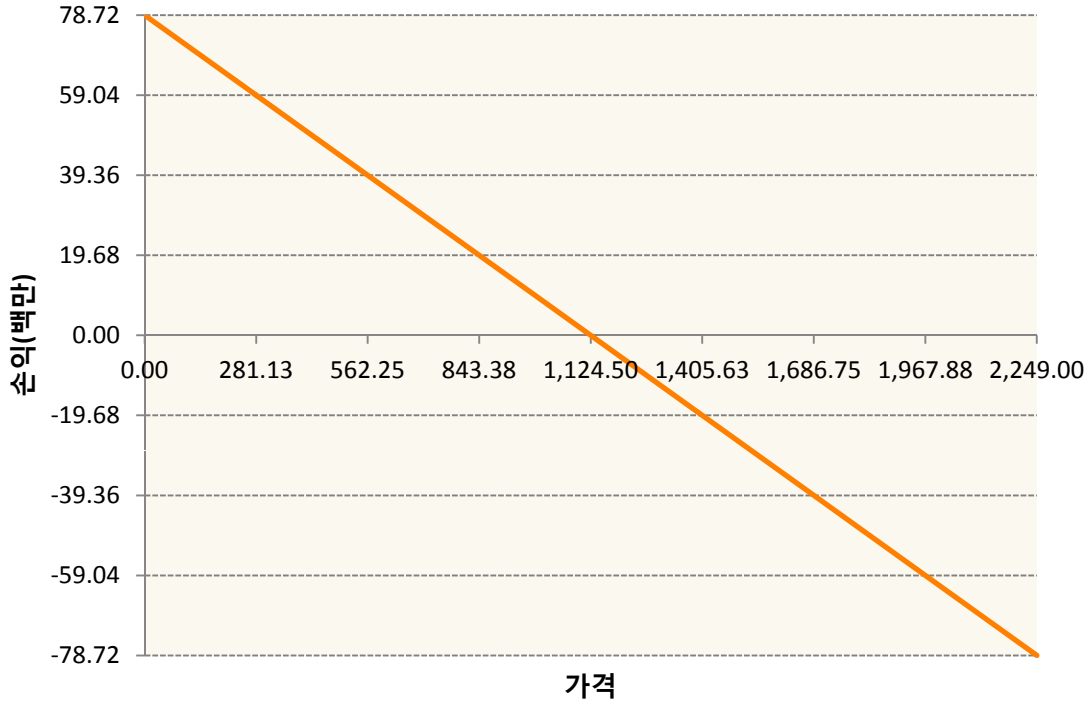


KCK9-COFFEE 'C' FUTURE May19

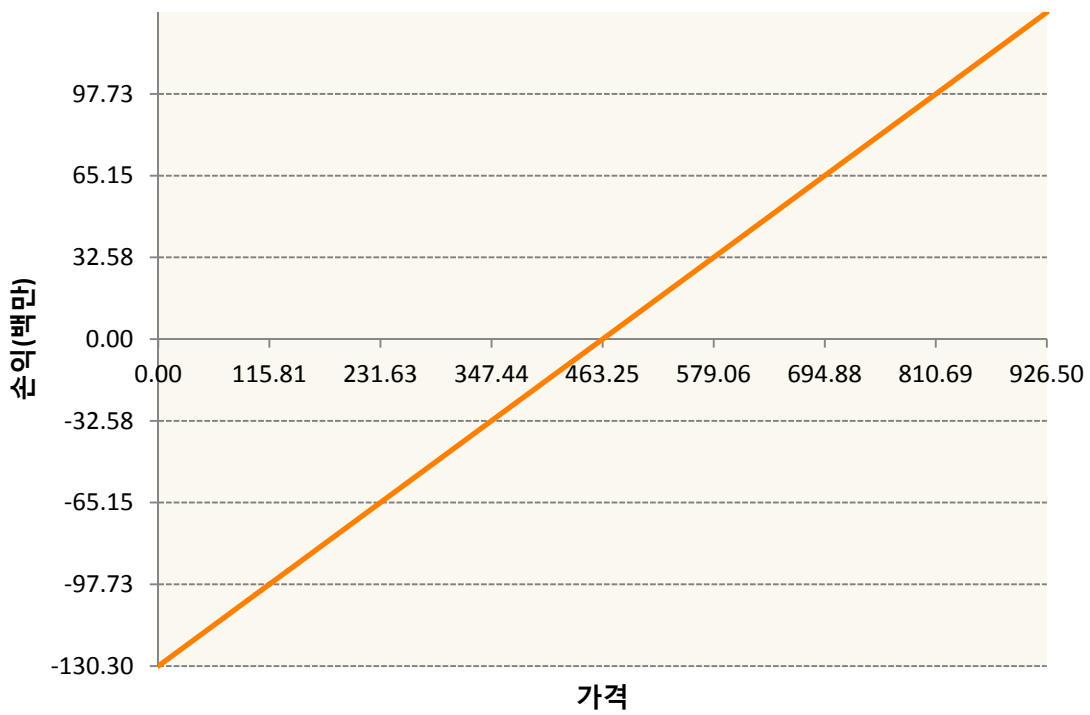




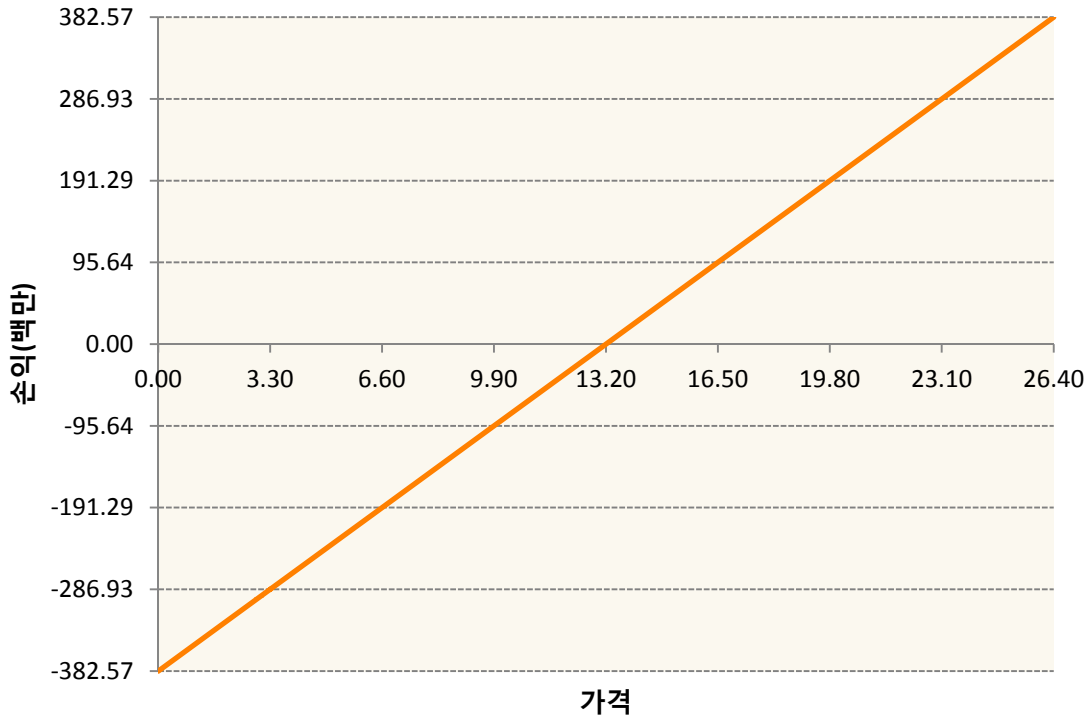
KR4175P30001-2019-03 달러선물



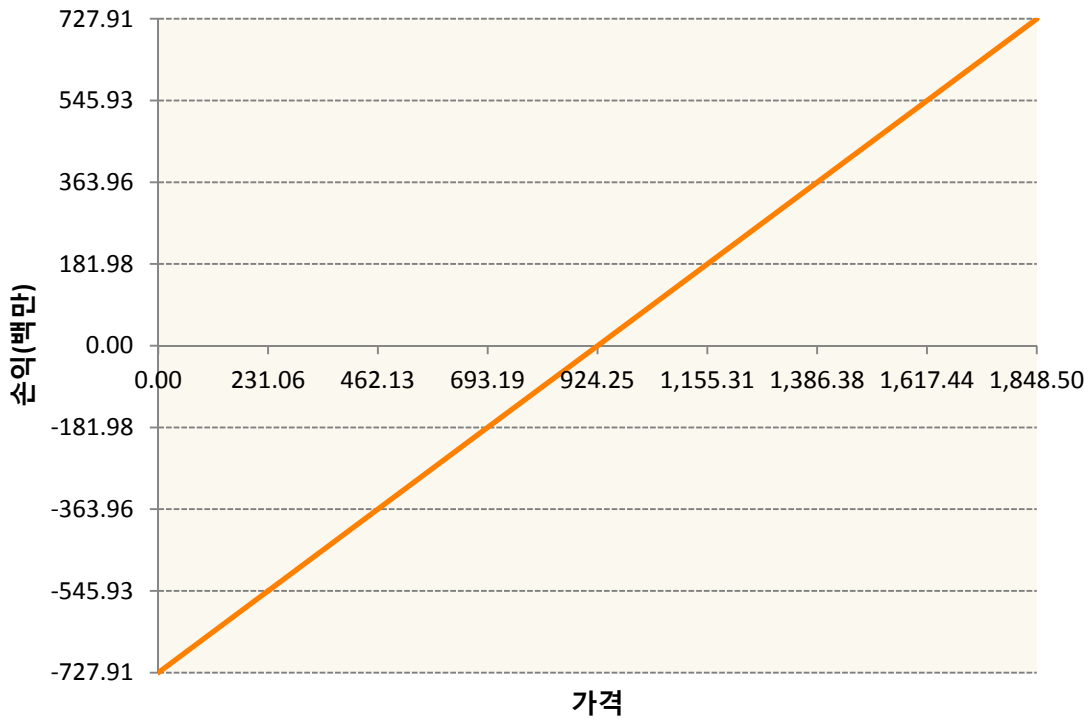
KWK9-KC HRW WHEAT FUT May19



SBK9-SUGAR #11 (WORLD) May19

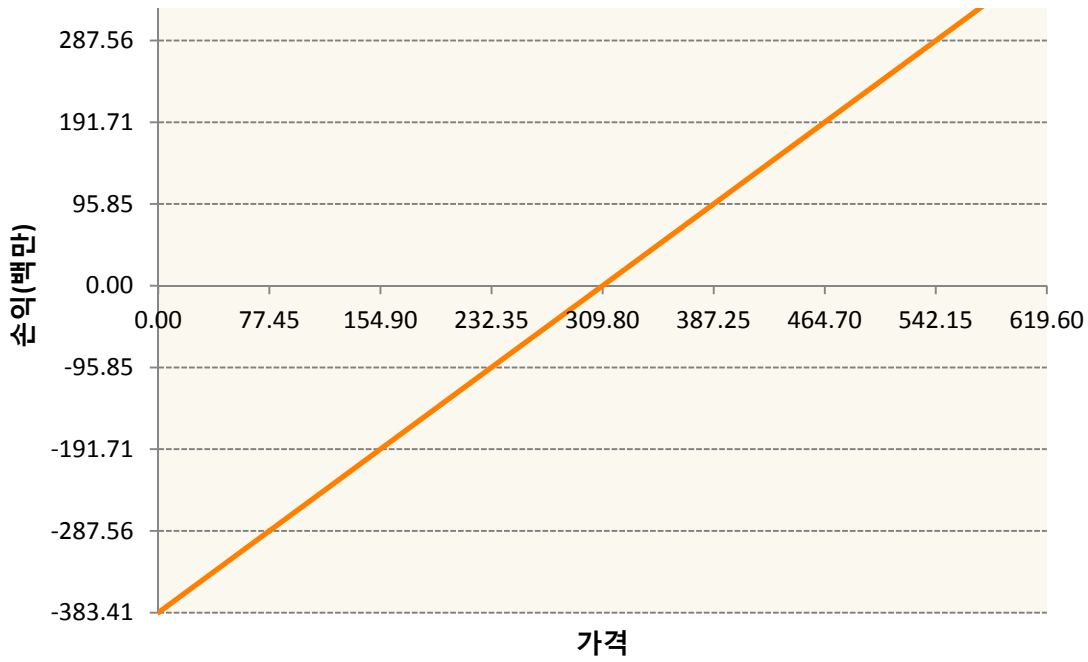


SK9-SOYBEAN FUTURE May19

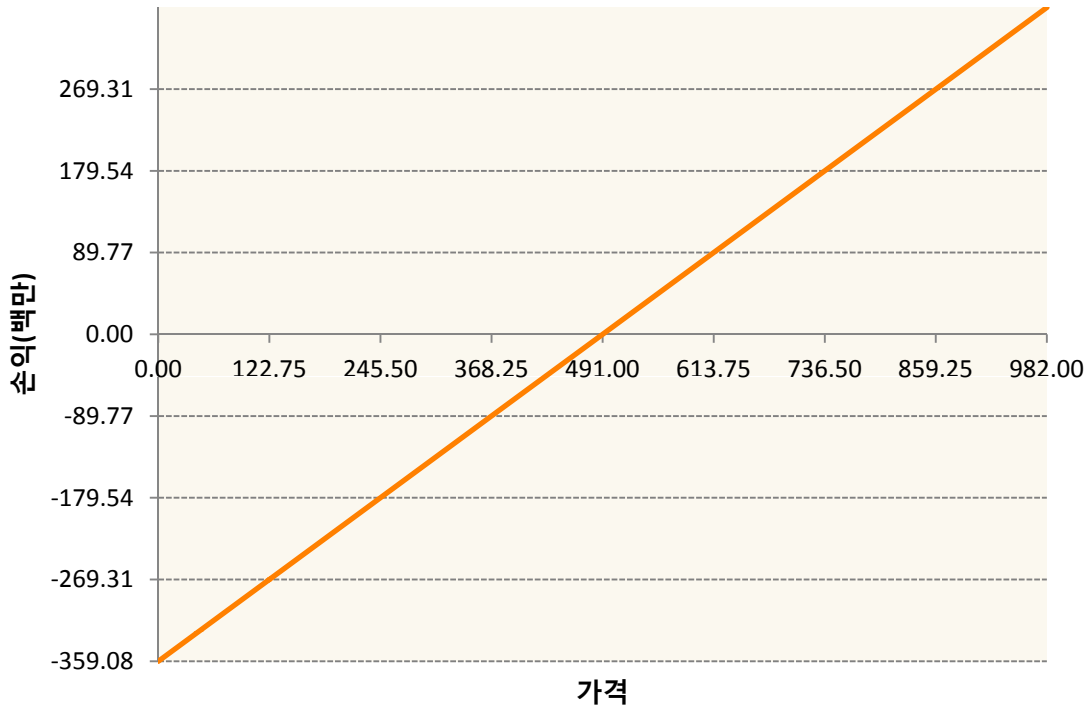


SMK9-SOYBEAN MEAL FUTR May19





WK9-WHEAT FUTURE(CBT) May19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

BOK9	SOYBEAN OIL FUTR May19	32
CK9	CORN FUTURE May19	55
CTK9	COTTON NO.2 FUTR May19	13
KCK9	COFFEE 'C' FUTURE May19	20
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	29

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

(단위:백만원)

279