

공시일	2019-02-26
기준일	2019-02-25

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	2019-02-26
기준일	2019-02-25

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	13,865	0	13,865	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWMXWO0(신한MXWO 미래S190222

1,114

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

642

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-02-26
기준일	2019-02-25

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	315
SWCSI50000 신한CSI500미래S190129	94

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

600

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-02-26
기준일	2019-02-25

유로인덱스모(주식-파생형)

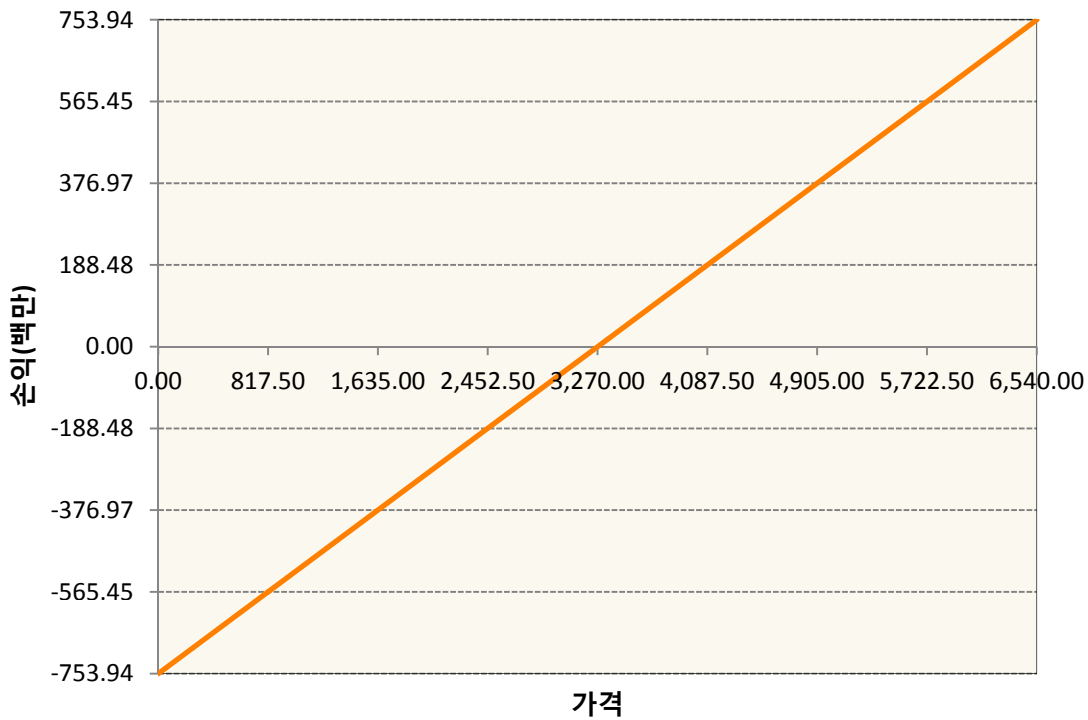
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	754	0	754	

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	2019-02-26
기준일	2019-02-25

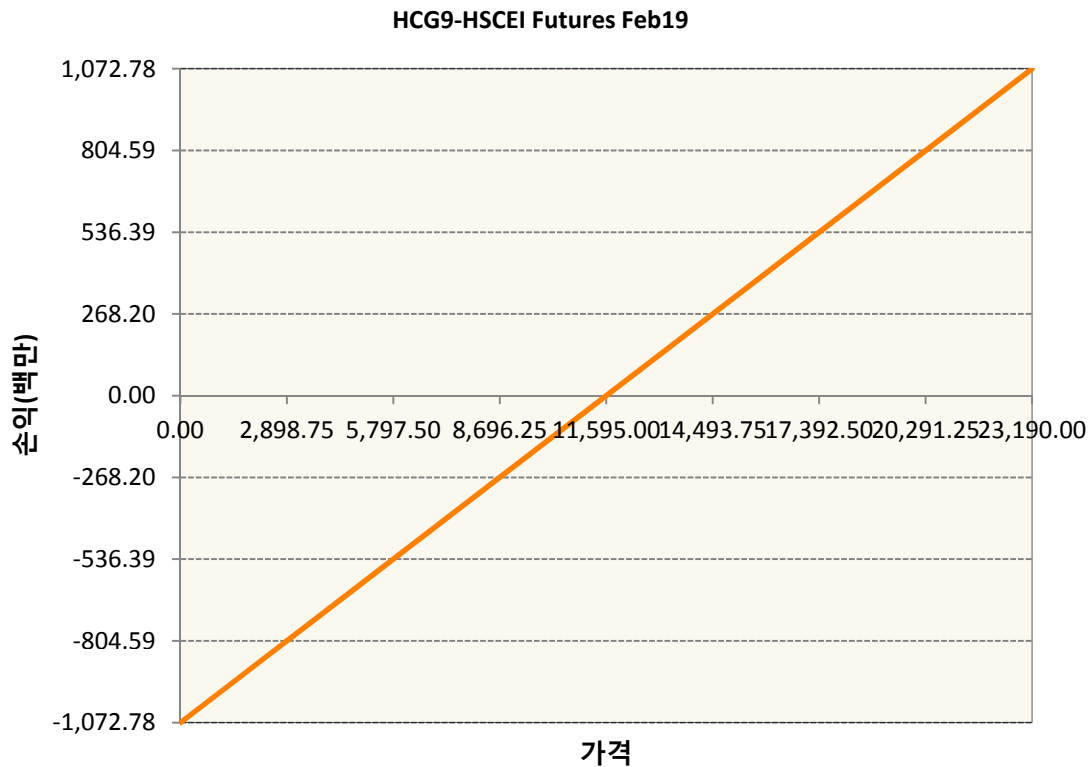
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	1,073	0	1,073	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCG9	HSCEI Futures Feb19	86
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

88

공시일	2019-02-26
기준일	2019-02-25

커버드콜모(주식혼합-파생형)

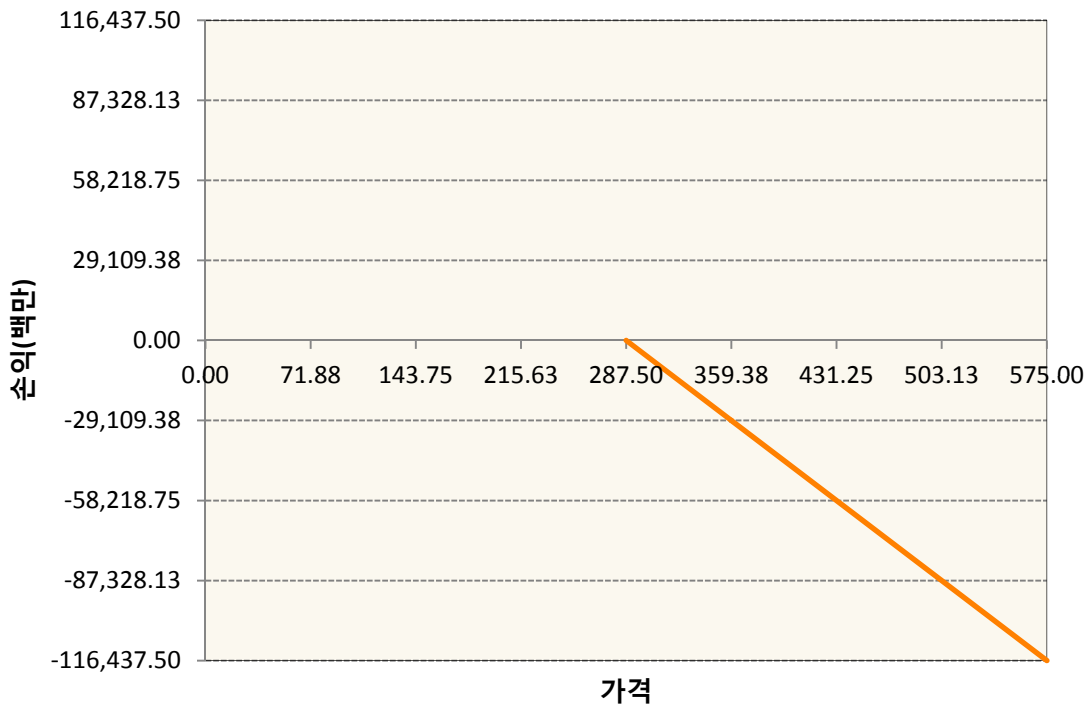
1. 계약금액

(단위:백만원)

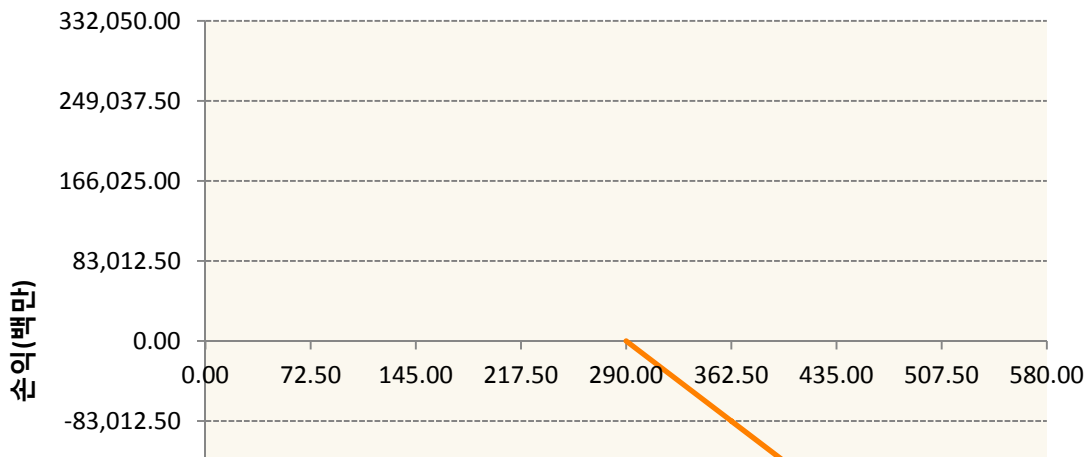
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	692,863	-692,863	장내

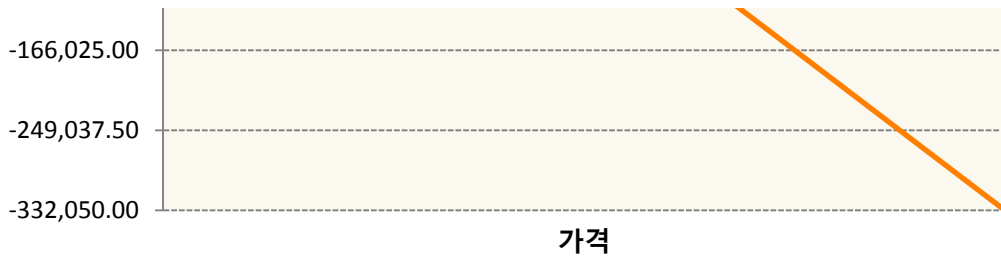
2. 만기시점의 손익구조

KR4201P32878-2019-03 콜287.5

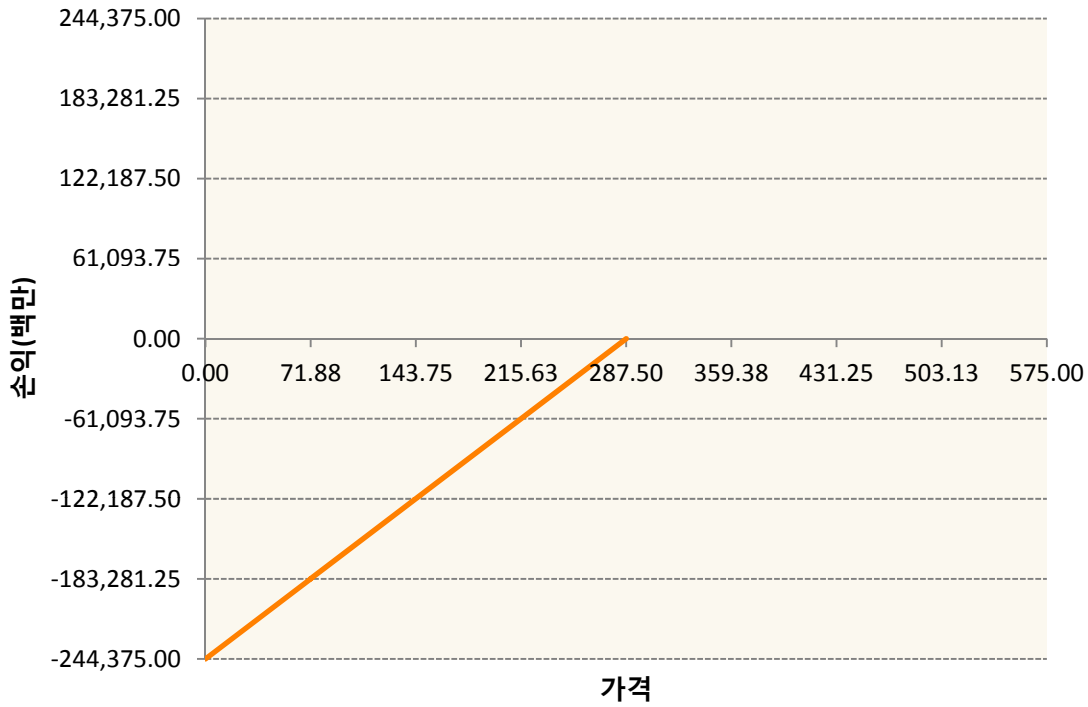


KR4201P32902-2019-03 콜290





KR4301P32876-2019-03 풋287.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201P32878		2019-03 콜287.5					7,536
		기초자산의 변동성					
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	2,861	2,817	2,758	2,686	2,601	2,504	2,397
-5.33%	2,640	2,527	2,400	2,262	2,115	1,960	1,798
-2.67%	1,992	1,802	1,608	1,410	1,210	1,008	804
0%	649	433	217	0	-217	-434	-651
2.67%	-1,449	-1,621	-1,801	-1,987	-2,177	-2,372	-2,570
5.33%	-4,114	-4,212	-4,325	-4,453	-4,591	-4,740	-4,897
8.00%	-7,077	-7,119	-7,175	-7,245	-7,330	-7,427	-7,536
KR4201P32902		2019-03 콜290					20,265
		기초자산의 변동성					
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	6,744	6,657	6,533	6,372	6,176	5,947	5,686

-5.33%	6,327	6,074	5,777	5,444	5,079	4,687	4,272
-2.67%	4,962	4,481	3,979	3,461	2,929	2,387	1,837
0%	1,849	1,233	617	0	-617	-1,234	-1,851
2.67%	-3,415	-3,964	-4,527	-5,099	-5,680	-6,266	-6,858
5.33%	-10,496	-10,847	-11,237	-11,660	-12,111	-12,584	-13,075
8.00%	-18,660	-18,824	-19,035	-19,288	-19,580	-19,907	-20,265
KR4301P32876 2019-03 풋287.5							15,999
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-15,923	-15,924	-15,928	-15,936	-15,950	-15,970	-15,999
-5.33%	-9,411	-9,444	-9,491	-9,554	-9,630	-9,721	-9,825
-2.67%	-3,364	-3,532	-3,714	-3,905	-4,105	-4,311	-4,523
0%	749	500	250	0	-251	-502	-754
2.67%	2,226	2,111	1,978	1,830	1,668	1,495	1,313
5.33%	2,454	2,436	2,406	2,364	2,308	2,238	2,155
8.00%	2,468	2,467	2,464	2,458	2,447	2,429	2,405

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

(단위:백만원)

45,732

공시일	2019-02-26
기준일	2019-02-25

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

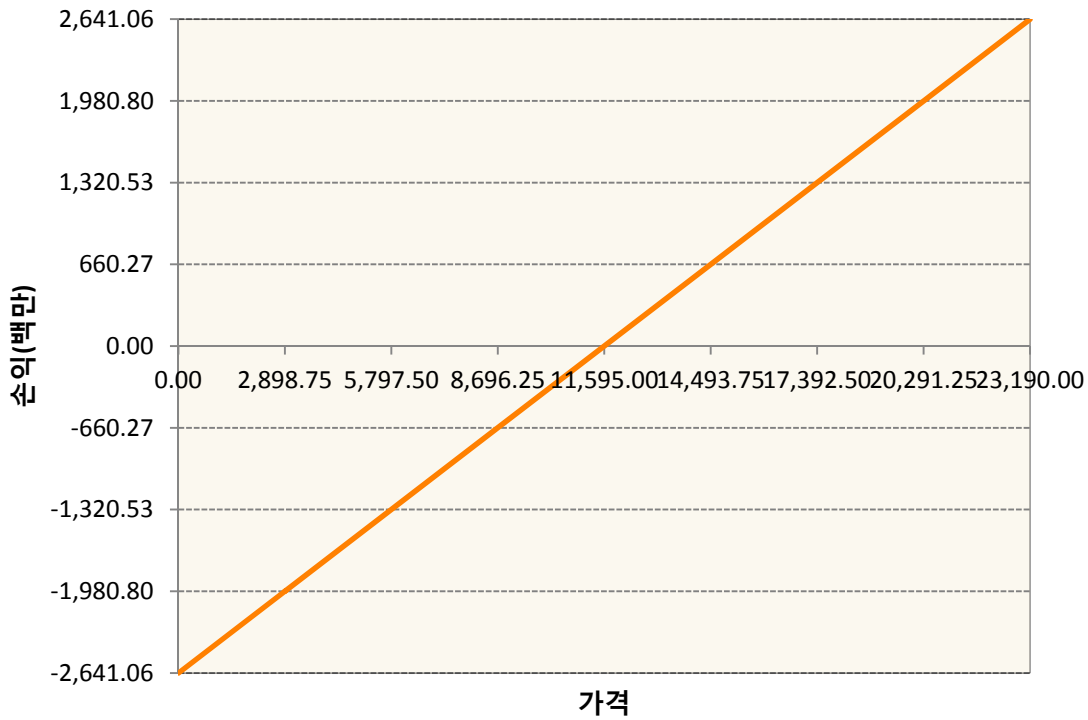
1. 계약금액

(단위:백만원)

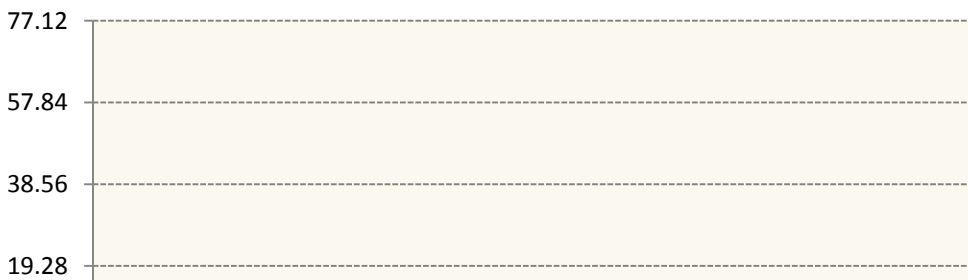
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	2,641	0	2,641	장내
누계	유가증권	옵션	0	6,226	-6,226	장내
누계	통화	선도	0	2,714	-2,714	장외

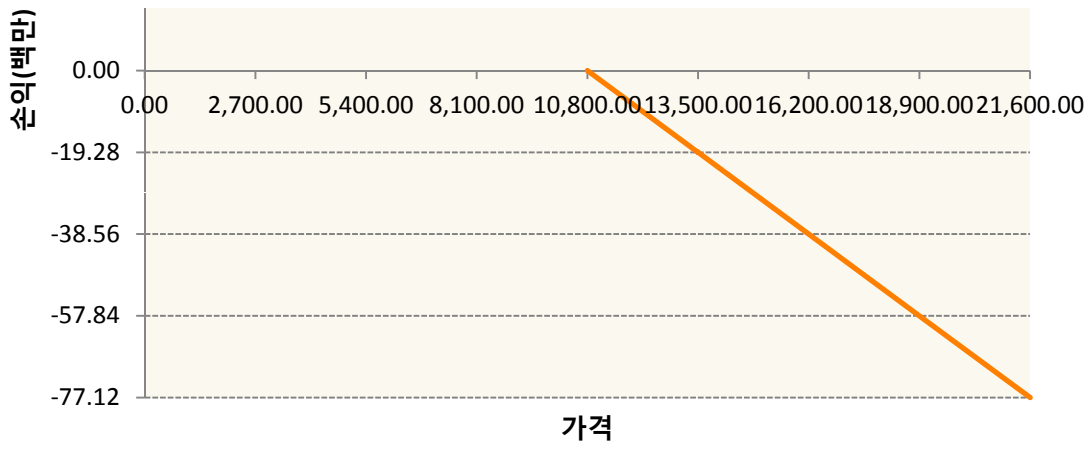
2. 만기시점의 손익구조

HCG9-HSCEI Futures Feb19

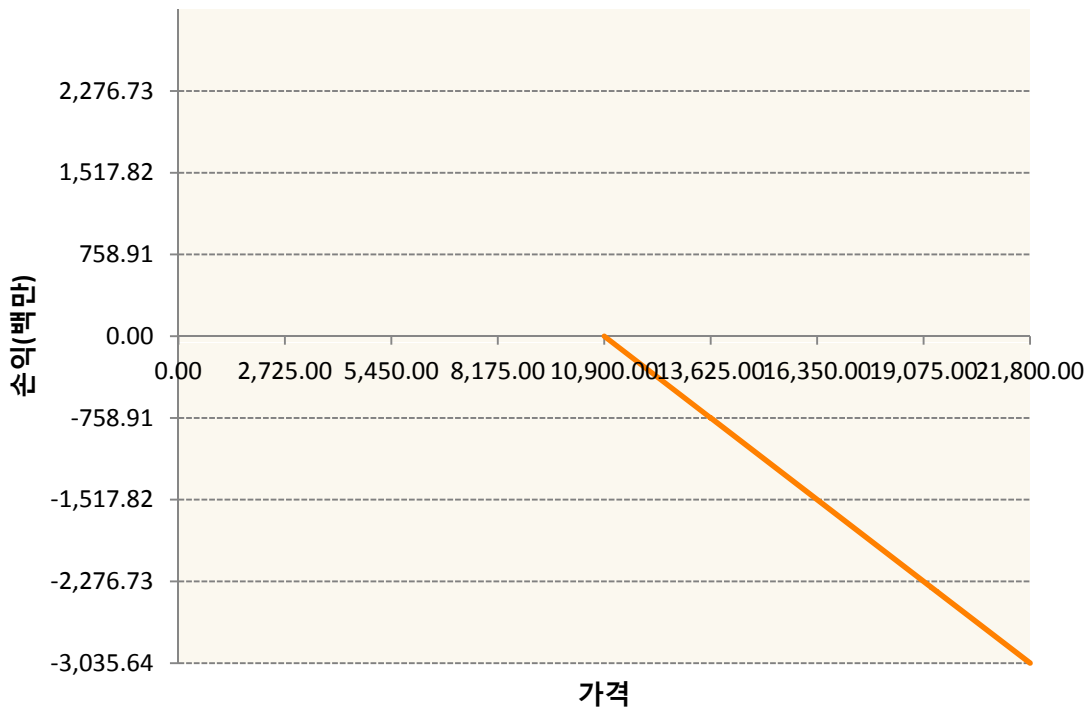


OHHIG9-C108-HSCEI

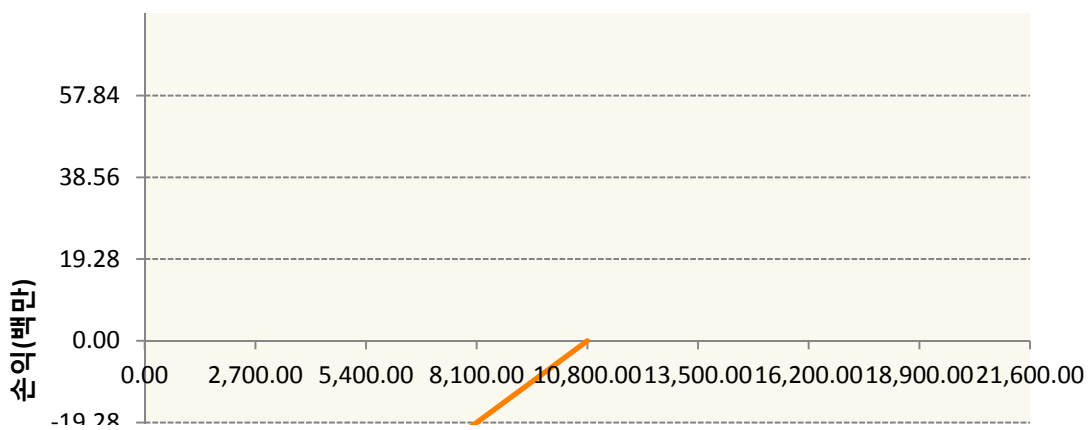


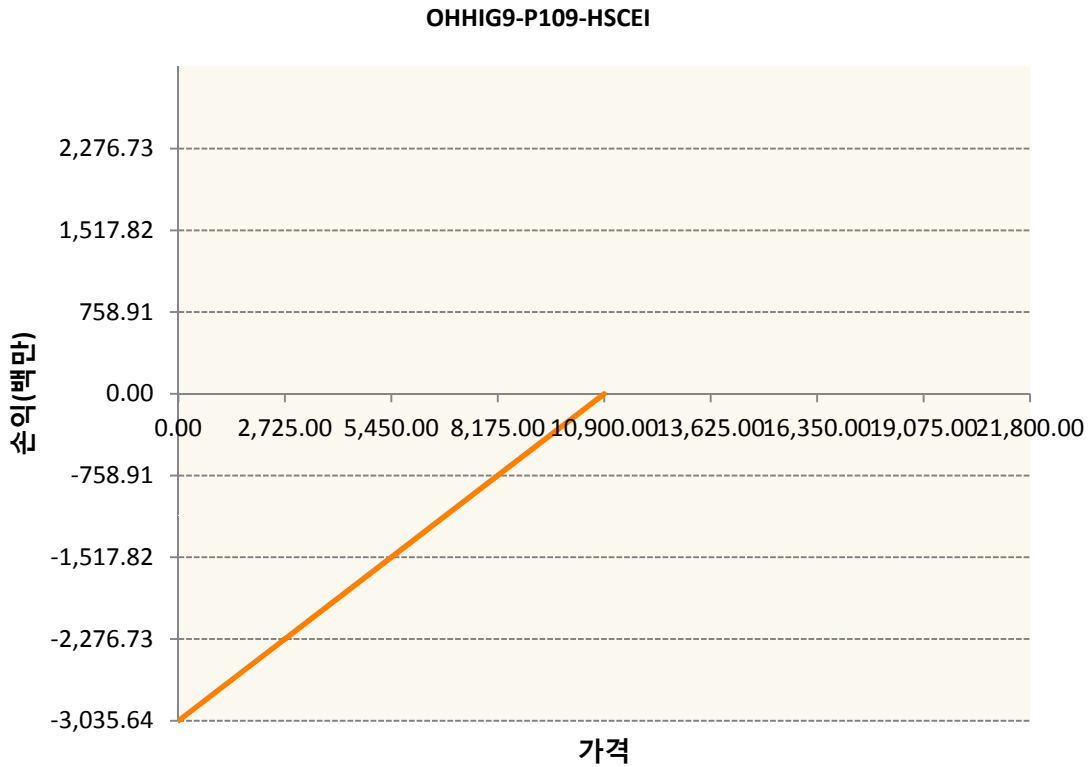
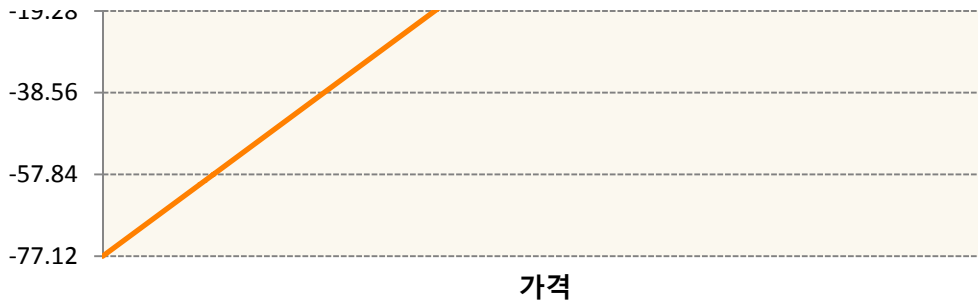


OHHIG9-C109-HSCEI



OHHIG9-P108-HSCEI





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)	(단위:백만원)
FX21018Z00 KRW/HKD 11-03-19E	217
HCG9 HSCEI Futures Feb19	211
OHHIG9-C1(HSCEI	6
OHHIG9-C1(HSCEI	243
OHHIG9-P1(HSCEI	6
OHHIG9-P1(HSCEI	243

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	805

공시일	2019-02-26
기준일	2019-02-25

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

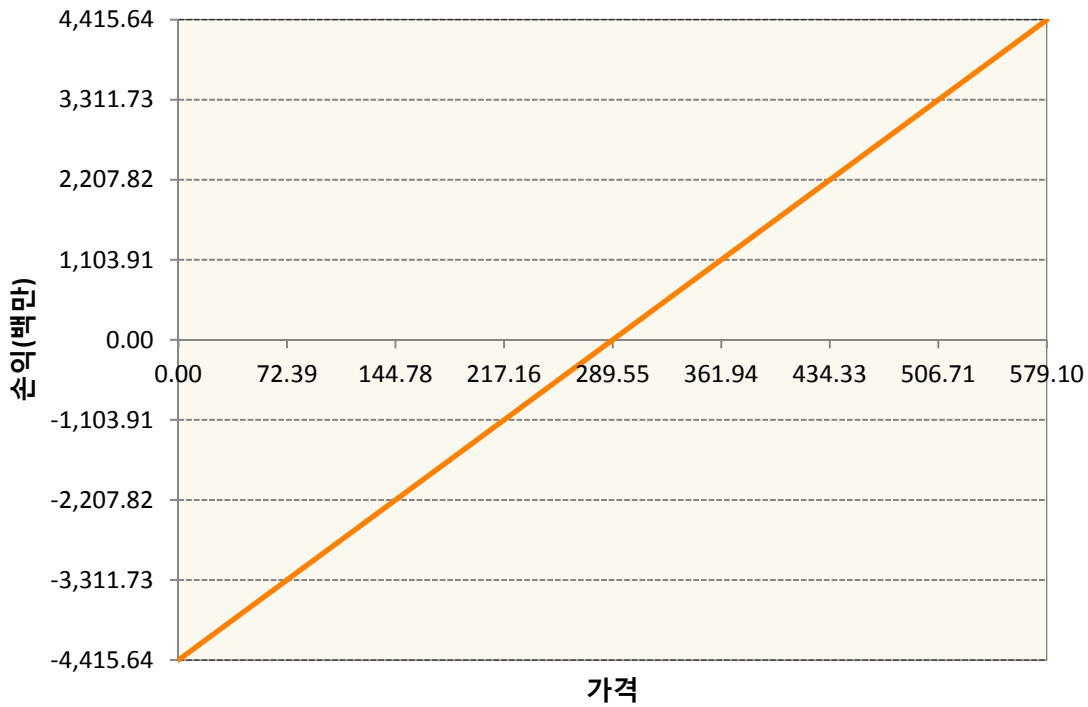
1. 계약금액

(단위:백만원)

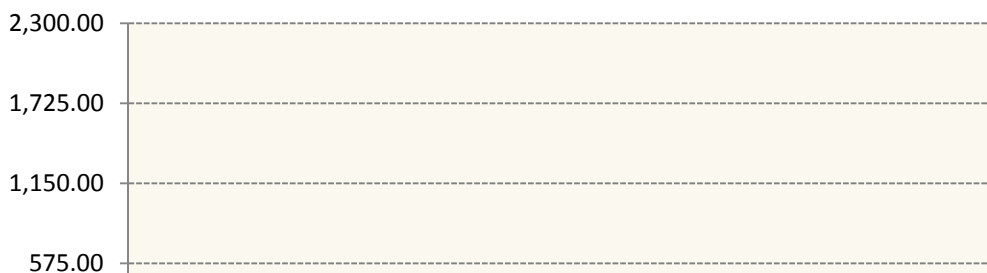
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	4,416	0	4,416	장내
누계	유가증권	스왑	28,836	0	28,836	장외
누계	유가증권	옵션	0	29,586	-29,586	장내

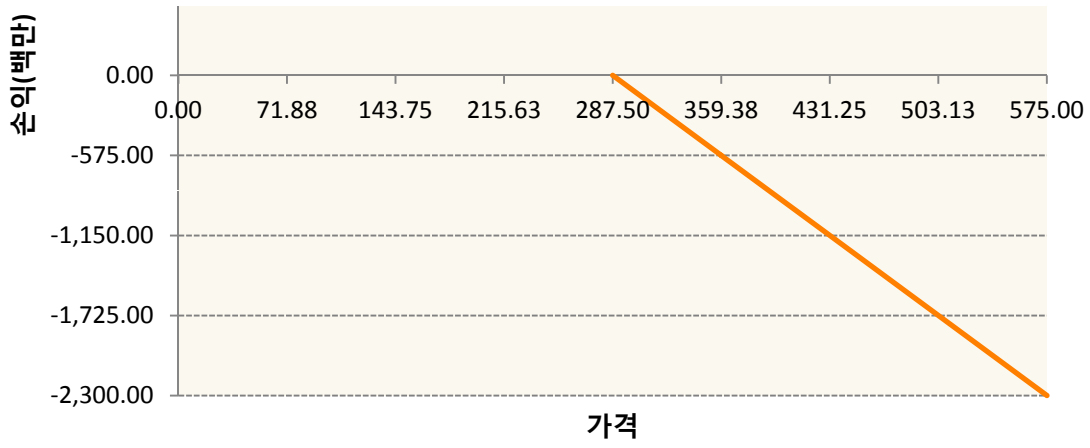
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P30007-2019-03 코스피200지수선물

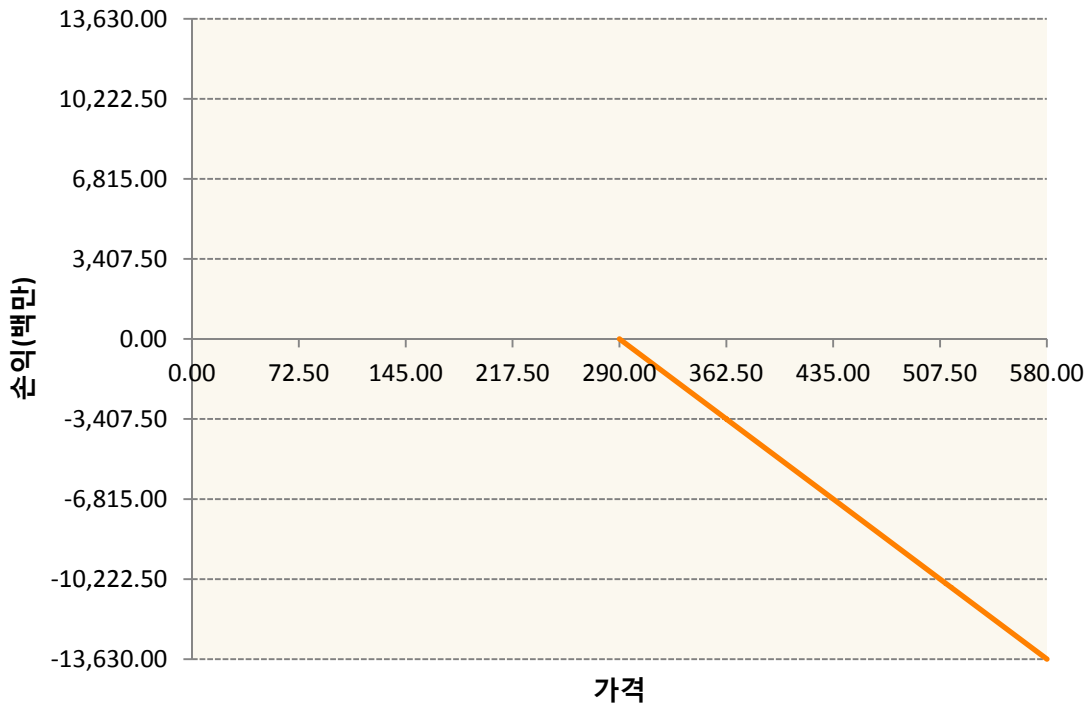


KR4201P32878-2019-03 콜287.5

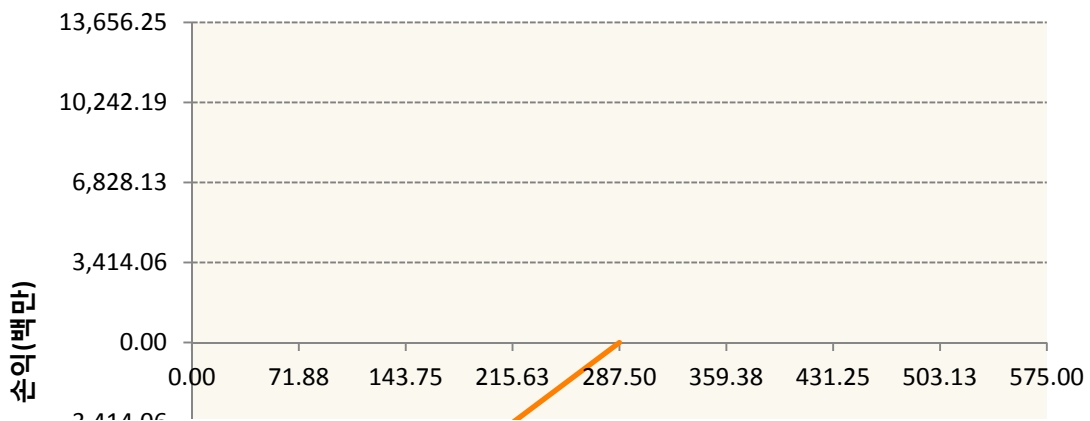


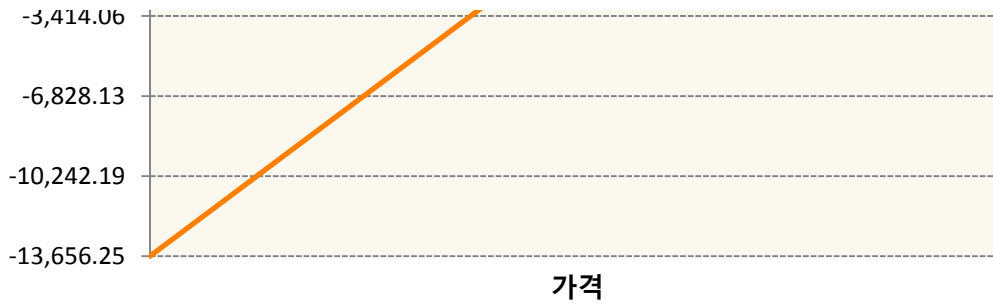


KR4201P32902-2019-03 콜290



KR4301P32876-2019-03 풋287.5





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11		UBCSFXC1 INDEX_14						2,413
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-2,413	-2,413	-2,413	-2,413	-2,413	-2,413	-2,413	
-5.33%	-1,608	-1,608	-1,608	-1,608	-1,608	-1,608	-1,608	
-2.67%	-804	-804	-804	-804	-804	-804	-804	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	804	804	804	804	804	804	804	
5.33%	1,608	1,608	1,608	1,608	1,608	1,608	1,608	
8.00%	2,413	2,413	2,413	2,413	2,413	2,413	2,413	
KR4101P30007		2019-03 코스피200지수선물						353
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-353	-353	-353	-353	-353	-353	-353	
-5.33%	-235	-235	-235	-235	-235	-235	-235	
-2.67%	-118	-118	-118	-118	-118	-118	-118	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	118	118	118	118	118	118	118	
5.33%	235	235	235	235	235	235	235	
8.00%	353	353	353	353	353	353	353	
KR4201P32878		2019-03 콜287.5						149
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	57	56	54	53	51	49	47	
-5.33%	52	50	47	45	42	39	36	
-2.67%	39	36	32	28	24	20	16	
0%	13	9	4	0	-4	-9	-13	
2.67%	-29	-32	-36	-39	-43	-47	-51	
5.33%	-81	-83	-85	-88	-91	-94	-97	
8.00%	-140	-141	-142	-143	-145	-147	-149	
KR4201P32902		2019-03 콜290						832
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	

-8.00%	277	273	268	262	254	244	233
-5.33%	260	249	237	223	208	192	175
-2.67%	204	184	163	142	120	98	75
0%	76	51	25	0	-25	-51	-76
2.67%	-140	-163	-186	-209	-233	-257	-282
5.33%	-431	-445	-461	-479	-497	-517	-537
8.00%	-766	-773	-781	-792	-804	-817	-832
KR4301P32876 2019-03 풋287.5							894
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-890	-890	-890	-891	-891	-892	-894
-5.33%	-526	-528	-530	-534	-538	-543	-549
-2.67%	-188	-197	-208	-218	-229	-241	-253
0%	42	28	14	0	-14	-28	-42
2.67%	124	118	111	102	93	84	73
5.33%	137	136	134	132	129	125	120
8.00%	138	138	138	137	137	136	134

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

(단위:백만원)

4,694

공시일	2019-02-26
기준일	2019-02-25

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

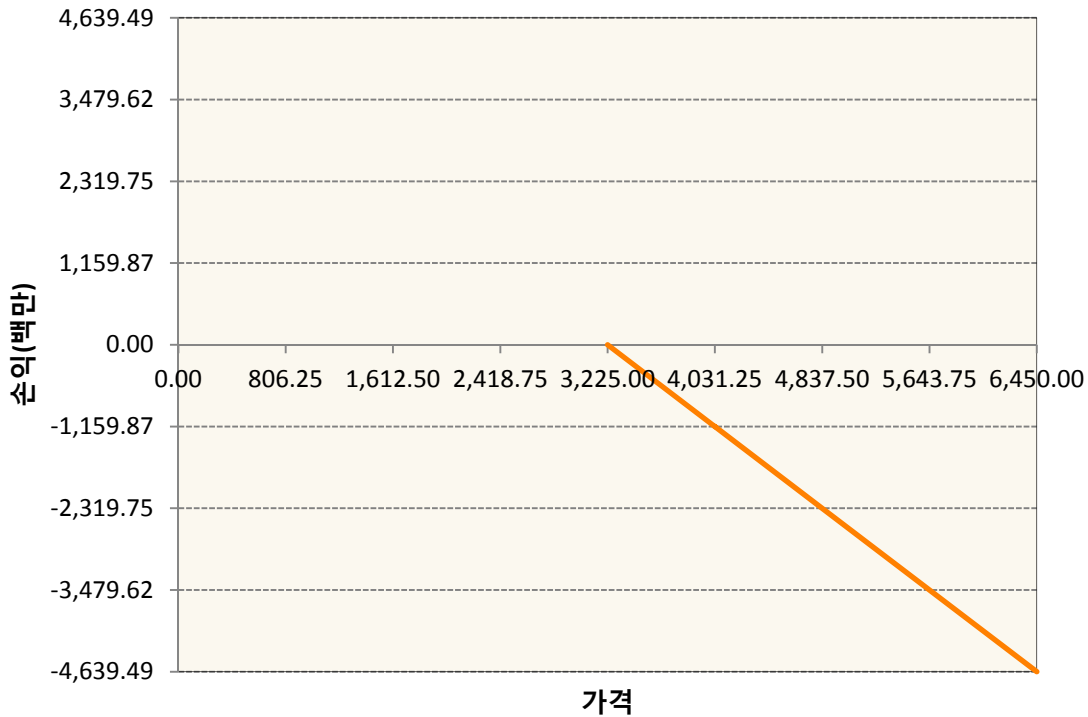
1. 계약금액

(단위:백만원)

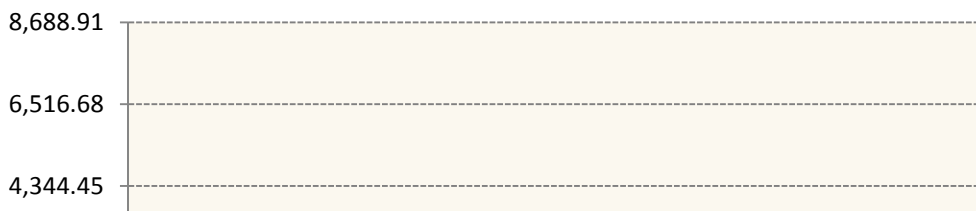
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	7,075	0	7,075	
누계	유가증권	스왑	60,102	0	60,102	장외
누계	유가증권	옵션	0	26,657	-26,657	장내
누계	통화	선도	0	15,277	-15,277	장외

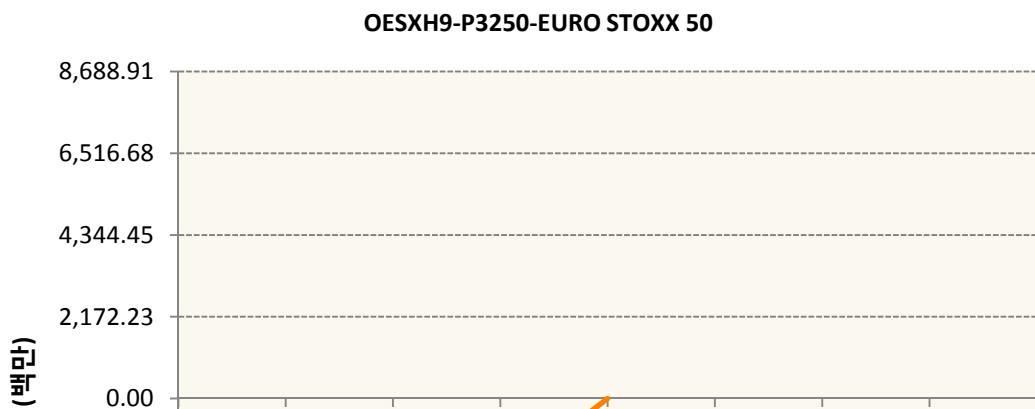
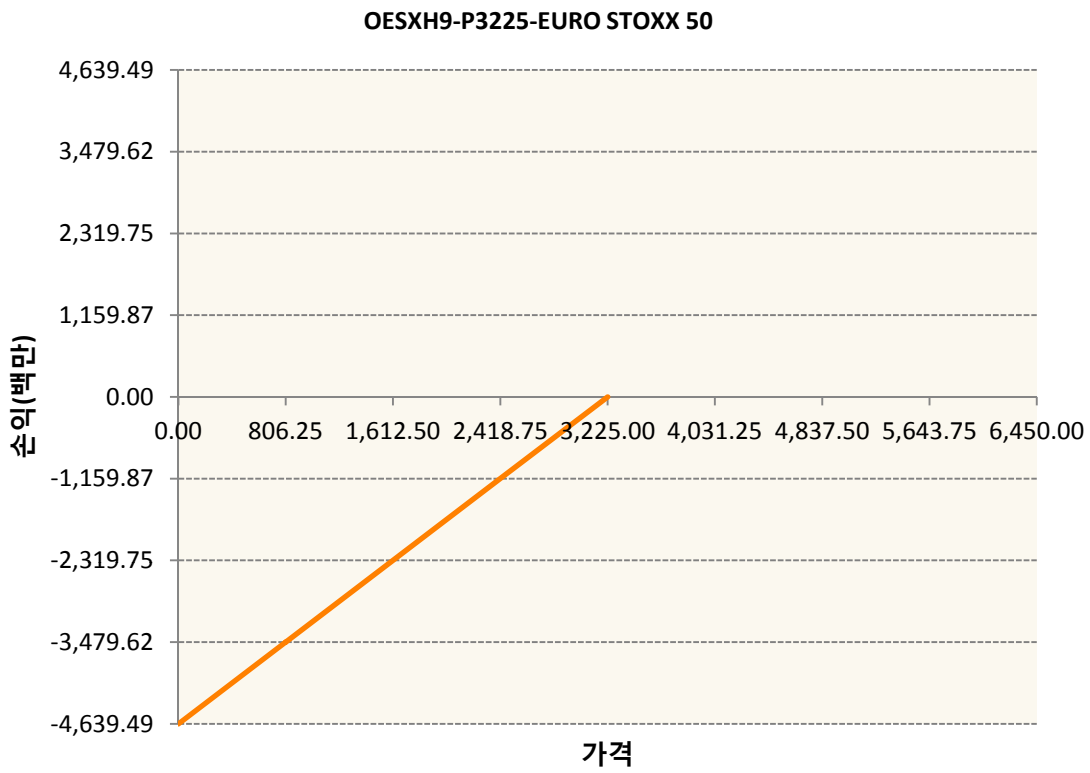
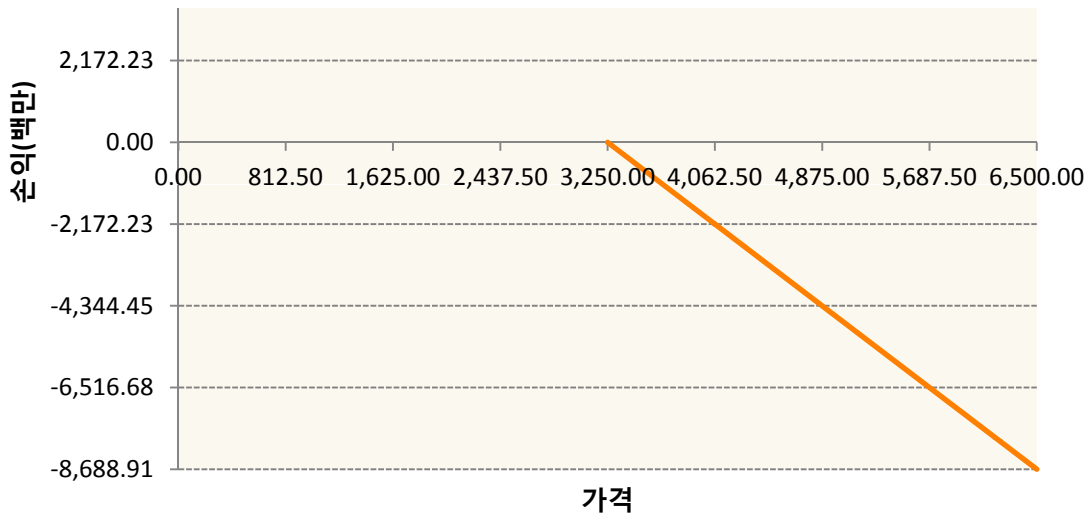
2. 만기시점의 손익구조

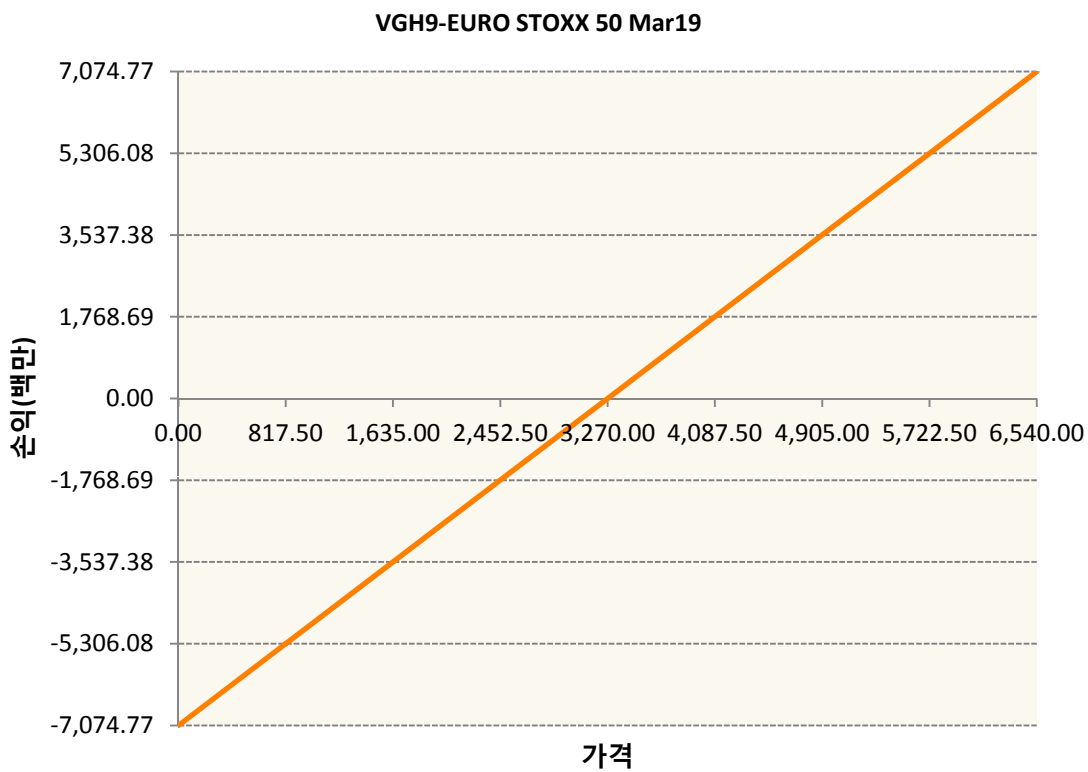
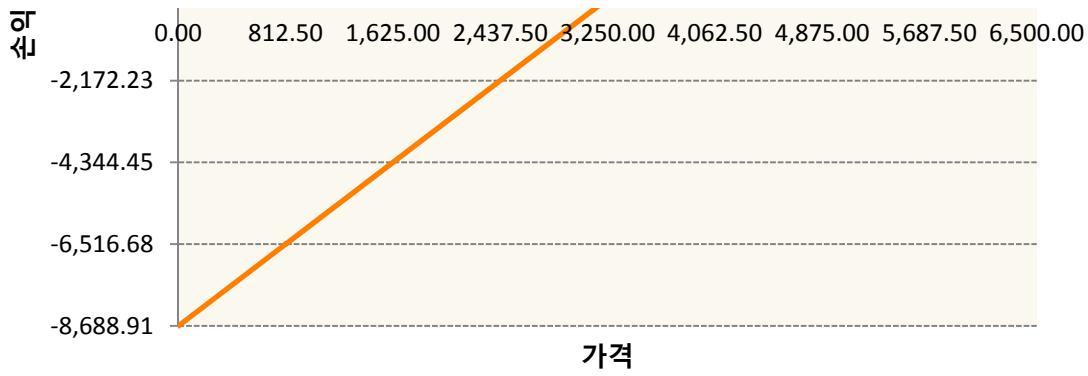
OESXH9-C3225-EURO STOXX 50



OESXH9-C3250-EURO STOXX 50







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY		99
FX21018Z03 KRW/EUR 22-03-19E		815
FX21019G02 KRW/EUR 24-05-19E		407
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		566

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

(단위:백만원)

2,650

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

(단위:백만원)

1,160

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	2019-02-26
기준일	2019-02-25

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

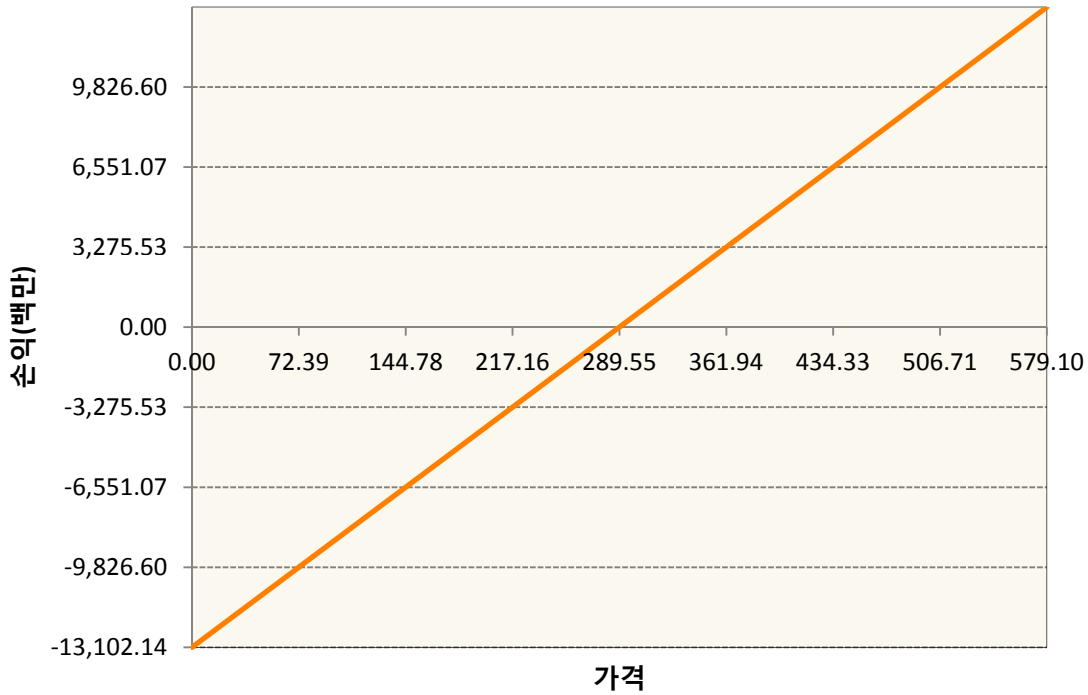
1. 계약금액

(단위:백만원)

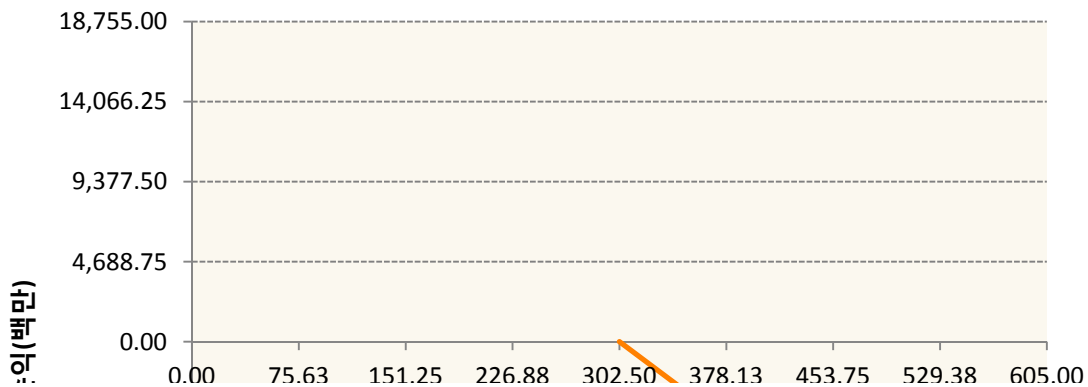
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	13,102	0	13,102	장내
누계	유가증권	옵션	2,165	24,931	-22,766	장내

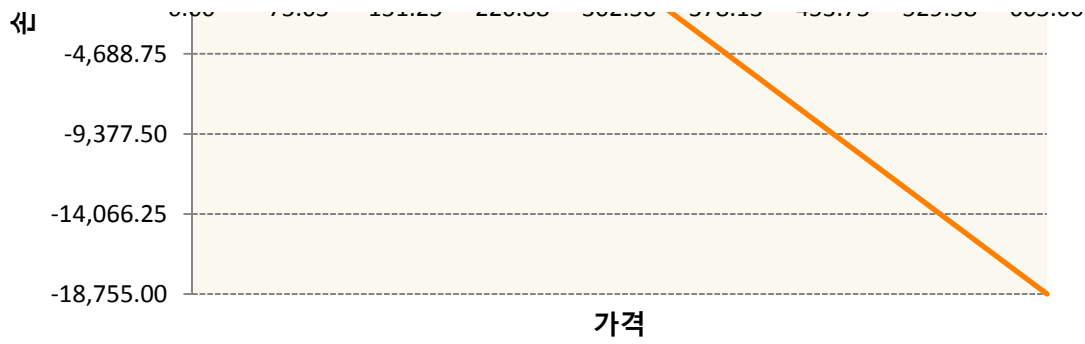
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P30007-2019-03 코스피200지수선물

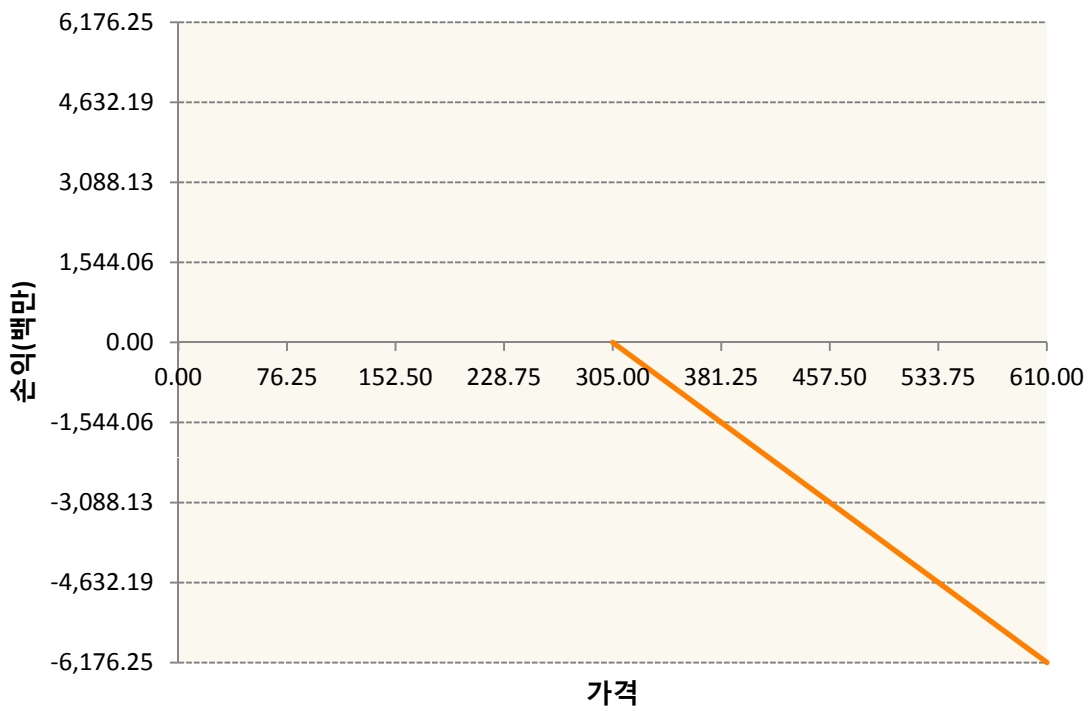


KR4201P33025-2019-03 콜302.5

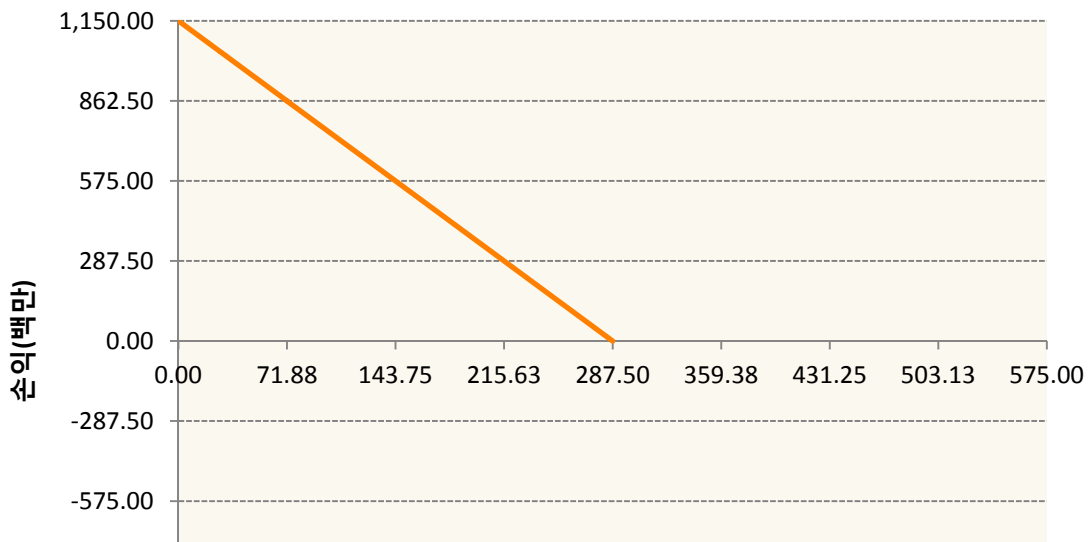


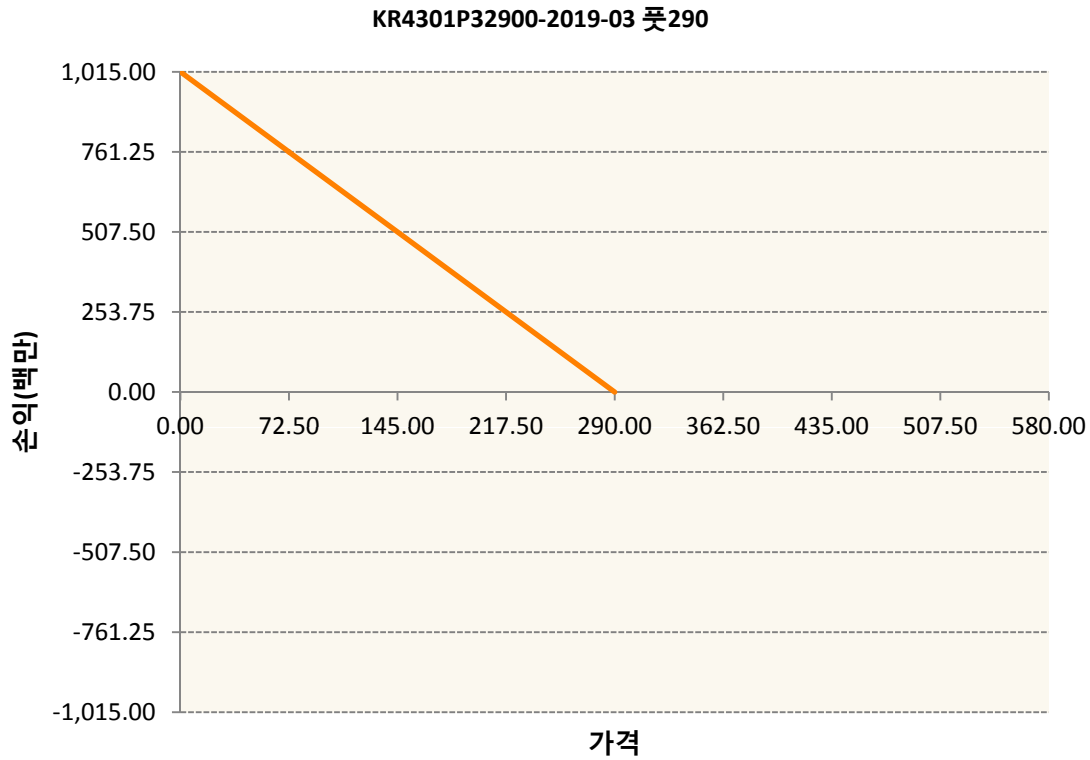
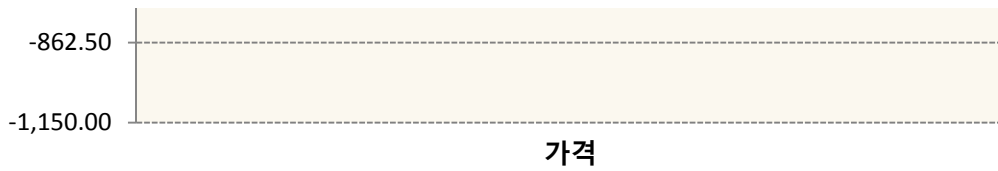


KR4201P33058-2019-03 콜305



KR4301P32876-2019-03 풋287.5





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101P30007		2019-03 코스피200지수선물						1,046
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-1,046	-1,046	-1,046	-1,046	-1,046	-1,046	-1,046	
-5.33%	-697	-697	-697	-697	-697	-697	-697	
-2.67%	-349	-349	-349	-349	-349	-349	-349	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	349	349	349	349	349	349	349	
5.33%	697	697	697	697	697	697	697	
8.00%	1,046	1,046	1,046	1,046	1,046	1,046	1,046	
KR4201P33025		2019-03 콜302.5						761
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	120	120	119	117	114	110	104	
-5.33%	118	116	111	106	98	89	78	
-2.67%	107	99	87	74	58	41	22	

0%	66	46	24	0	-25	-51	-79
2.67%	-44	-75	-107	-139	-172	-205	-238
5.33%	-257	-292	-326	-361	-396	-431	-466
8.00%	-580	-608	-637	-667	-698	-729	-761
KR4201P33058 2019-03 콜305							225
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	30	30	30	29	29	28	26
-5.33%	30	29	28	27	25	23	19
-2.67%	28	26	23	19	15	10	5
0%	18	13	7	0	-7	-15	-23
2.67%	-9	-18	-28	-38	-48	-59	-69
5.33%	-67	-79	-90	-102	-113	-125	-136
8.00%	-162	-172	-182	-193	-204	-214	-225
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	17	18	19	20	21
0%	-4	-2	-1	0	1	2	4
2.67%	-10	-10	-9	-9	-8	-7	-6
5.33%	-12	-11	-11	-11	-11	-11	-10
8.00%	-12	-12	-12	-12	-12	-11	-11
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	44	44	44
-2.67%	17	18	18	19	19	20	21
0%	-3	-2	-1	0	1	2	3
2.67%	-12	-12	-11	-10	-9	-8	-8
5.33%	-14	-14	-14	-14	-13	-13	-12
8.00%	-15	-14	-14	-14	-14	-14	-14

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

(단위:백만원)

1,772

공시일	2019-02-26
기준일	2019-02-25

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	978	0	978	

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	2019-02-26
기준일	2019-02-25

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	5,632	0	5,632	

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	2019-02-26
기준일	2019-02-25

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	33,329	0	33,329	
누계	통화	선도	0	37,655	-37,655	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		39
FX21019F01 KRW/USD 28-02-19E		14
FX21019F01 KRW/USD 28-02-19E		57
FX21019F01 KRW/USD 28-02-19E		9
FX21019F01 KRW/USD 28-02-19E		32
FX21019F02 KRW/USD 28-03-19E		466
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		105
FX21019G01 KRW/USD 19-03-19E		43
FX21019G01 KRW/USD 21-03-19E		421
FX21019G01 KRW/USD 21-03-19E		269

FX21019G02 KRW/USD 25-03-19E	135
FX21019G02 KRW/USD 25-03-19E	475
FX21019G03 KRW/USD 28-03-19E	251
FX21019G03 KRW/USD 28-03-19E	117

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

(단위:백만원)

1,092

공시일	2019-02-26
기준일	2019-02-25

스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

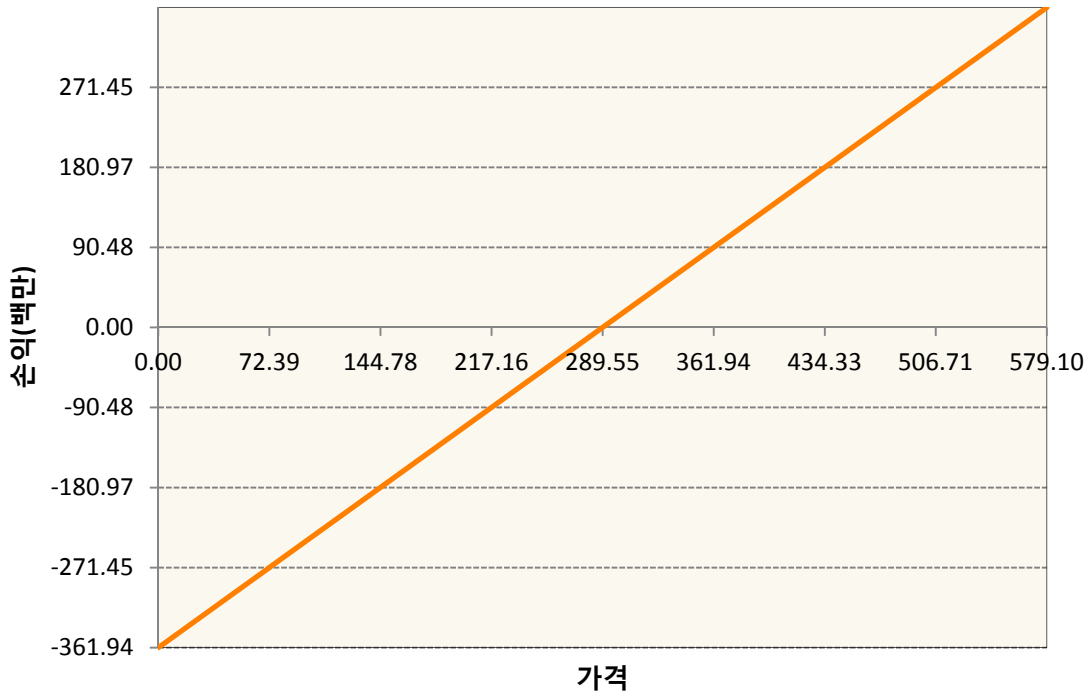
1. 계약금액

(단위:백만원)

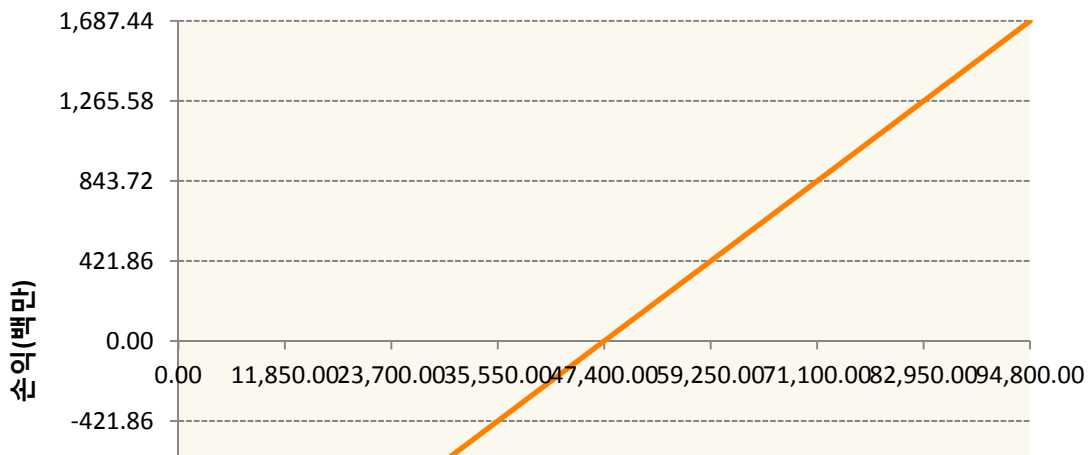
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,049	0	2,049	장내

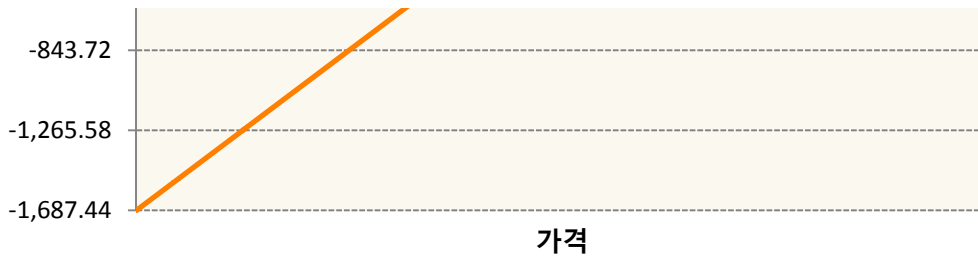
2. 만기시점의 손익구조

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						135
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-135	-135	-135	-135	-135	-135	-135	
-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%	135	135	135	135	135	135	135	

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

179

공시일	2019-02-26
기준일	2019-02-25

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

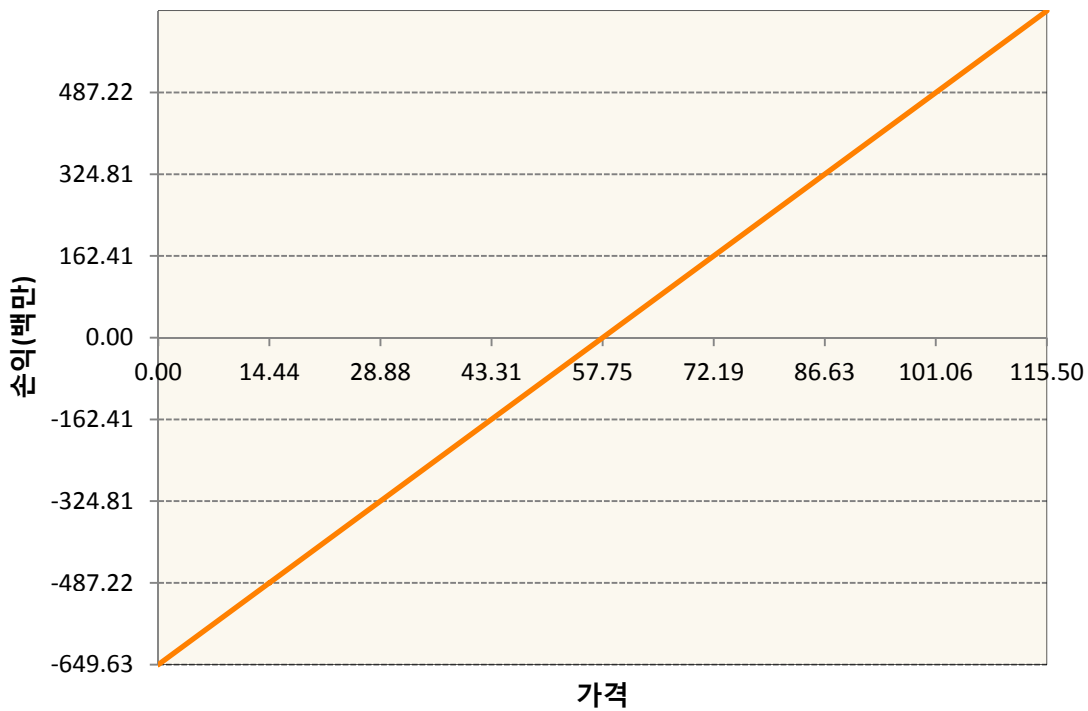
1. 계약금액

(단위:백만원)

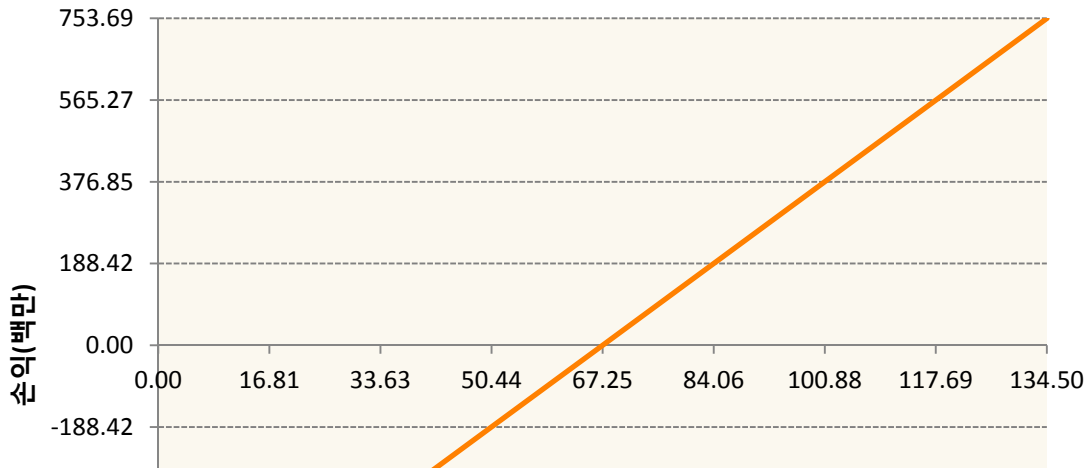
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,840	280	2,560	

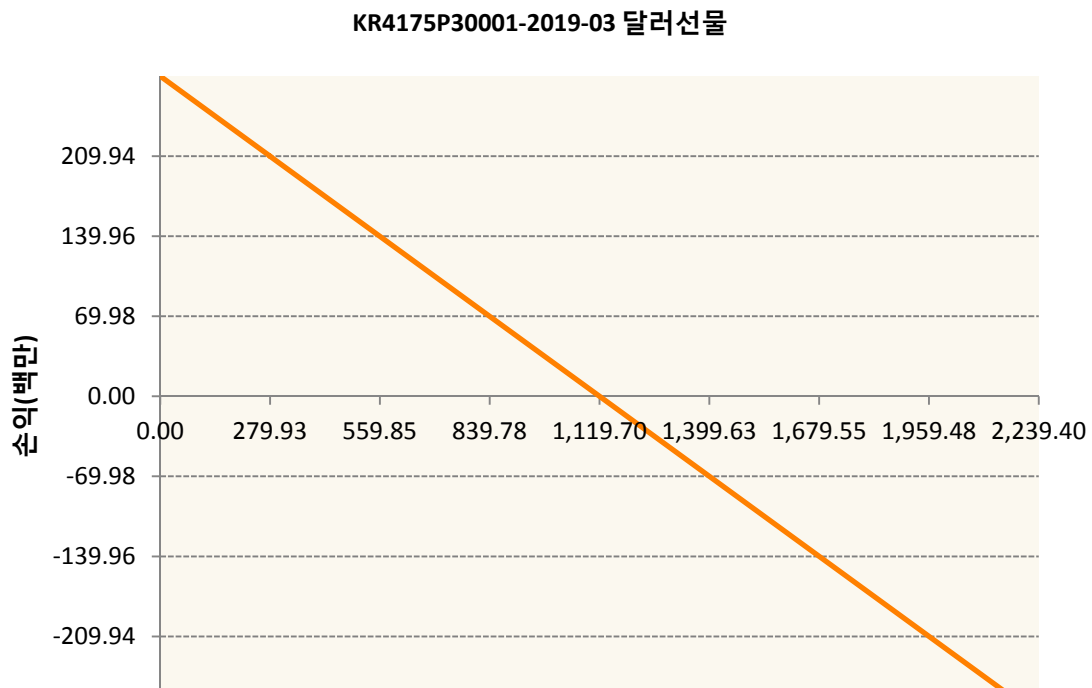
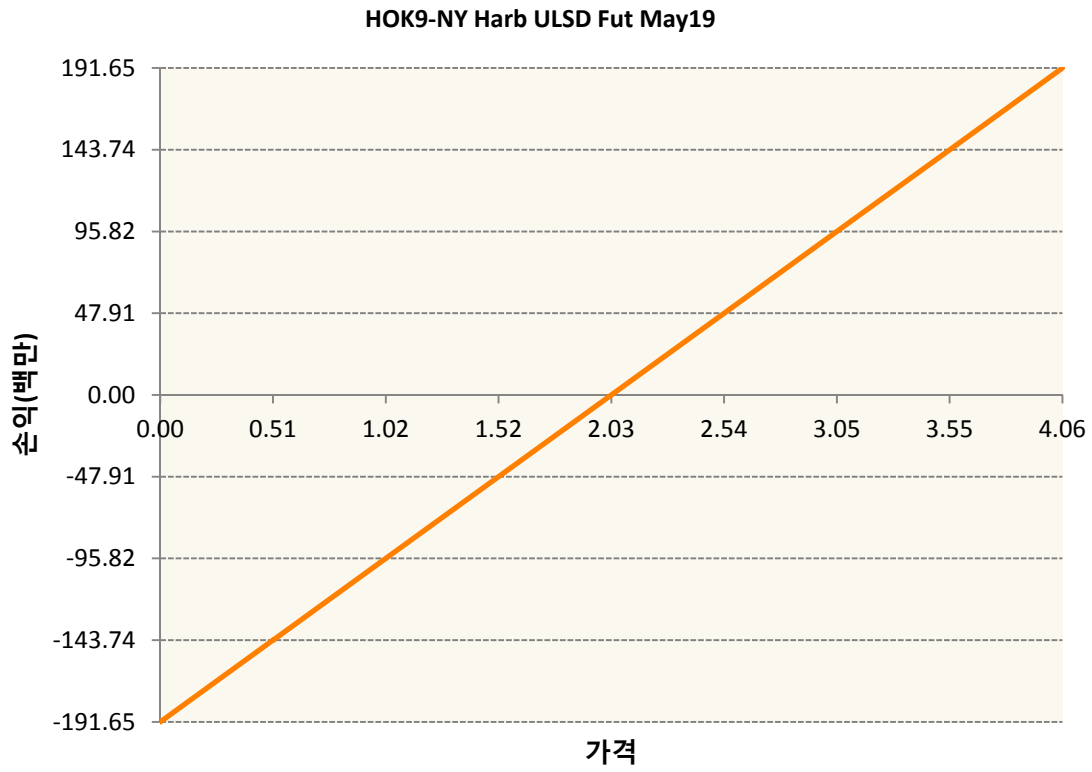
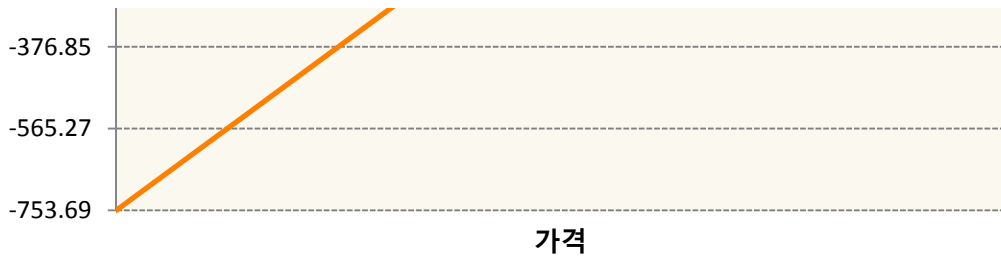
2. 만기시점의 손익구조

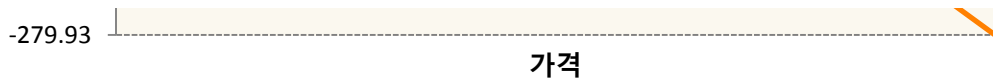
CLK9-WTI CRUDE FUTURE May19



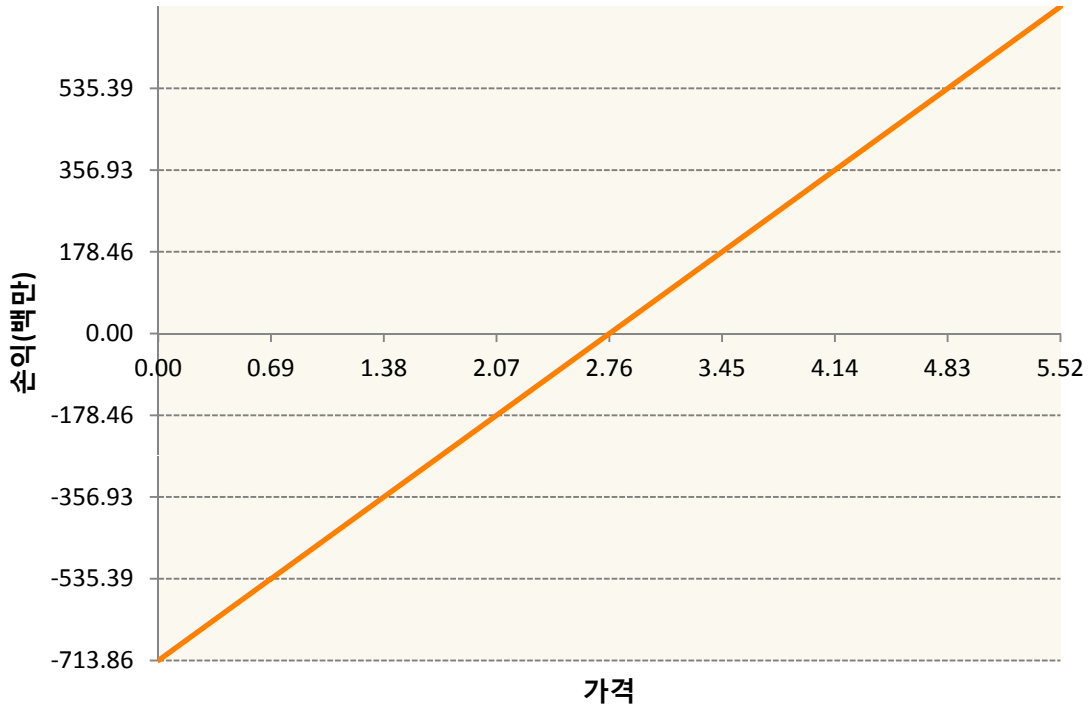
COK9-BRENT CRUDE FUTR May19



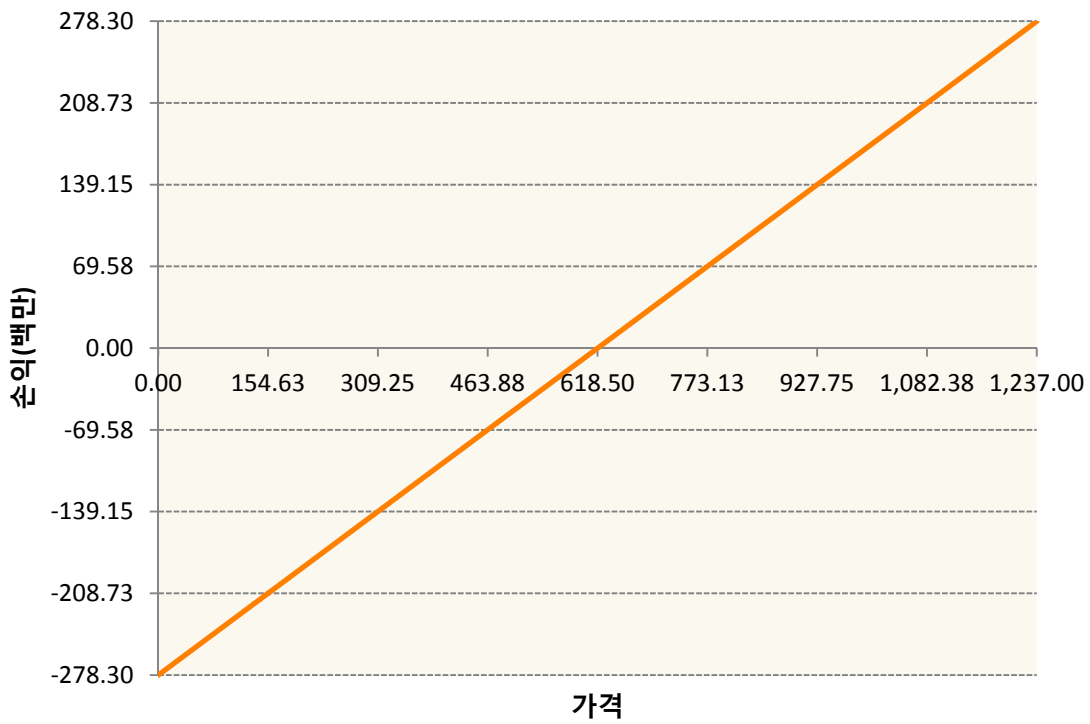




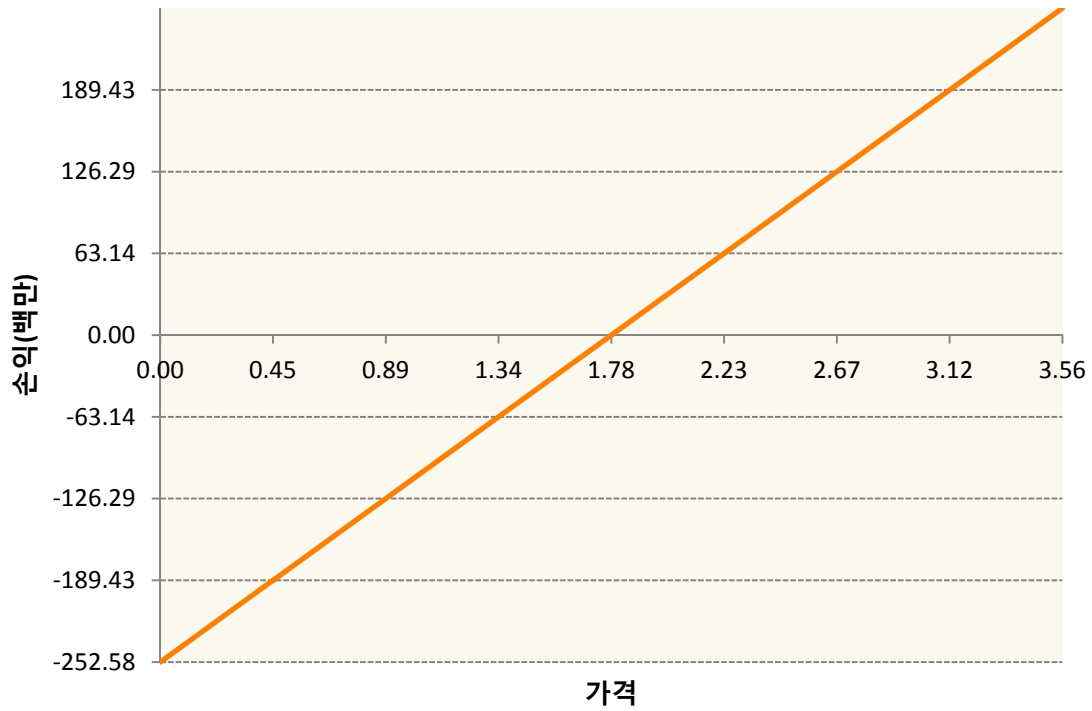
NGK19-NATURAL GAS FUTR May19



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)

433

공시일	2019-02-26
기준일	2019-02-25

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

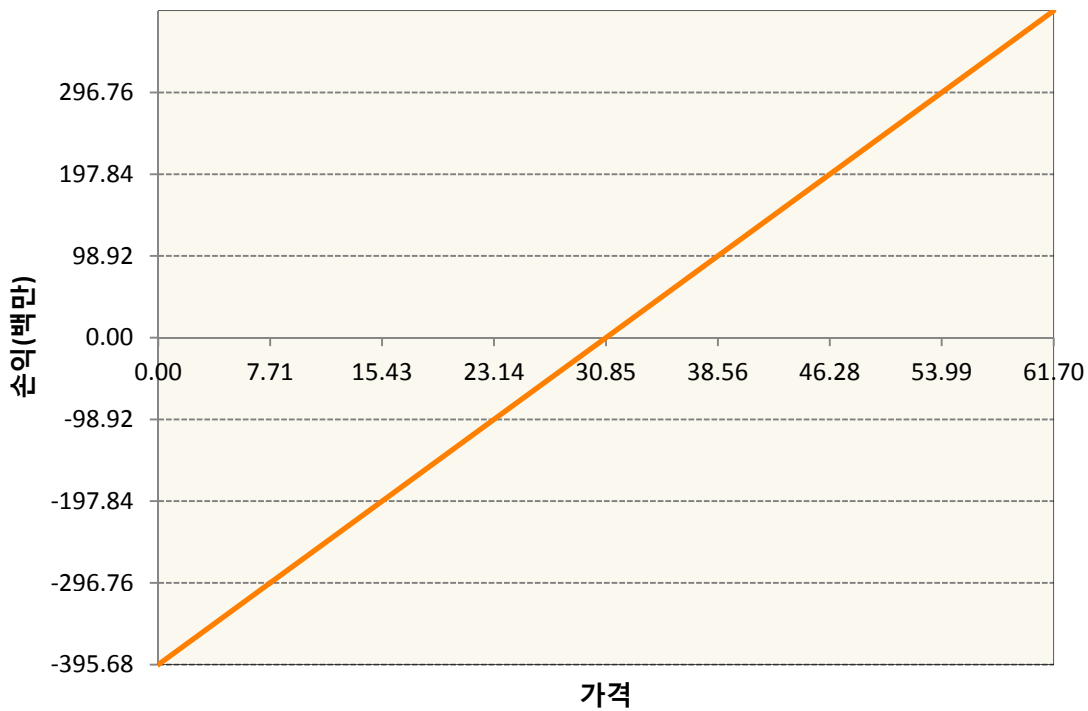
1. 계약금액

(단위:백만원)

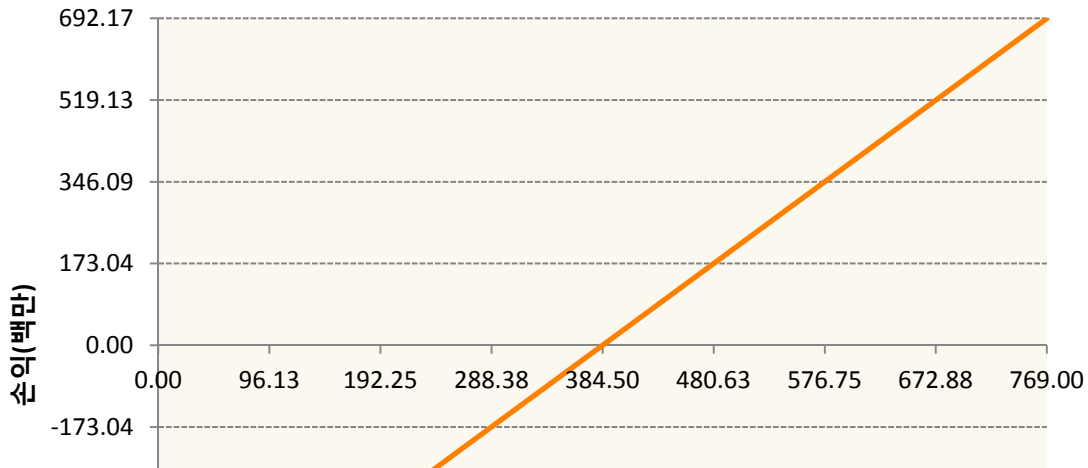
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,492	78	3,414	

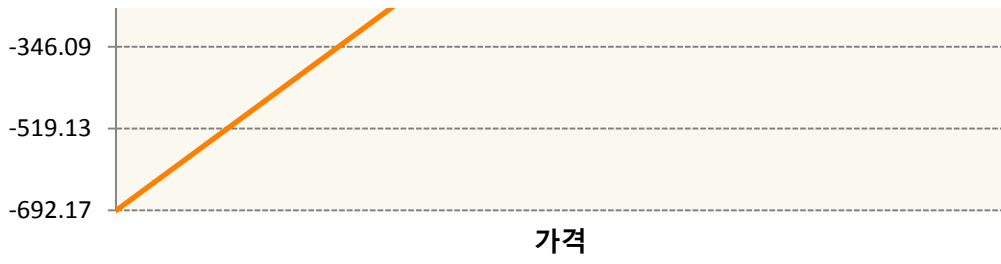
2. 만기시점의 손익구조

BOK9-SOYBEAN OIL FUTR May19

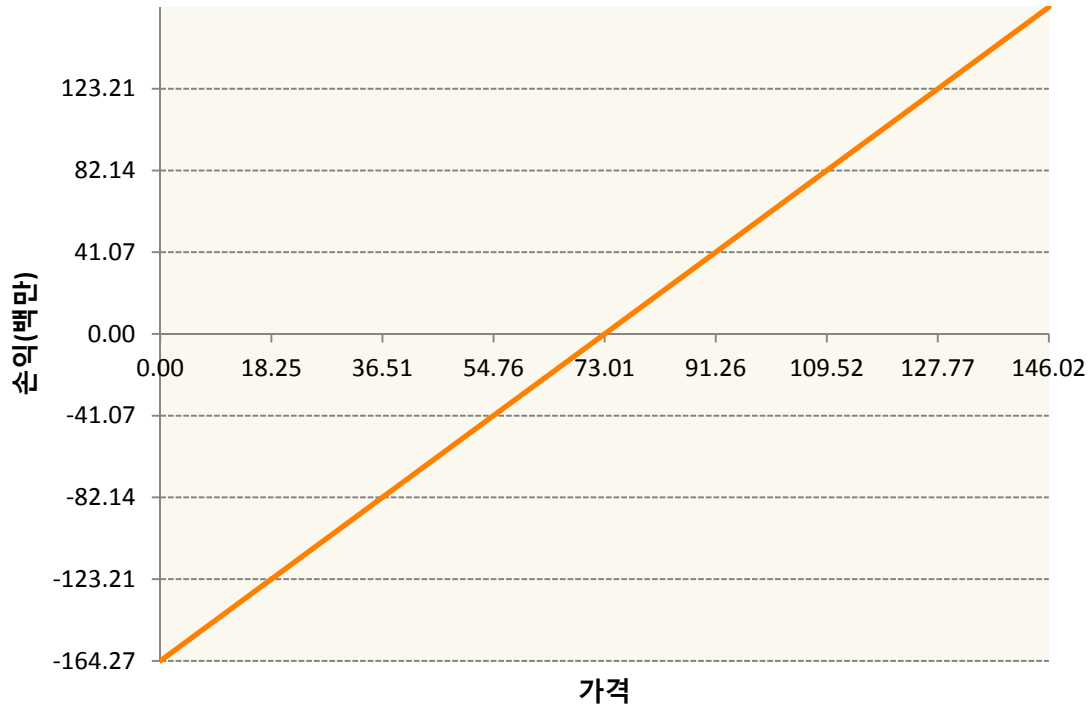


CK9-CORN FUTURE May19

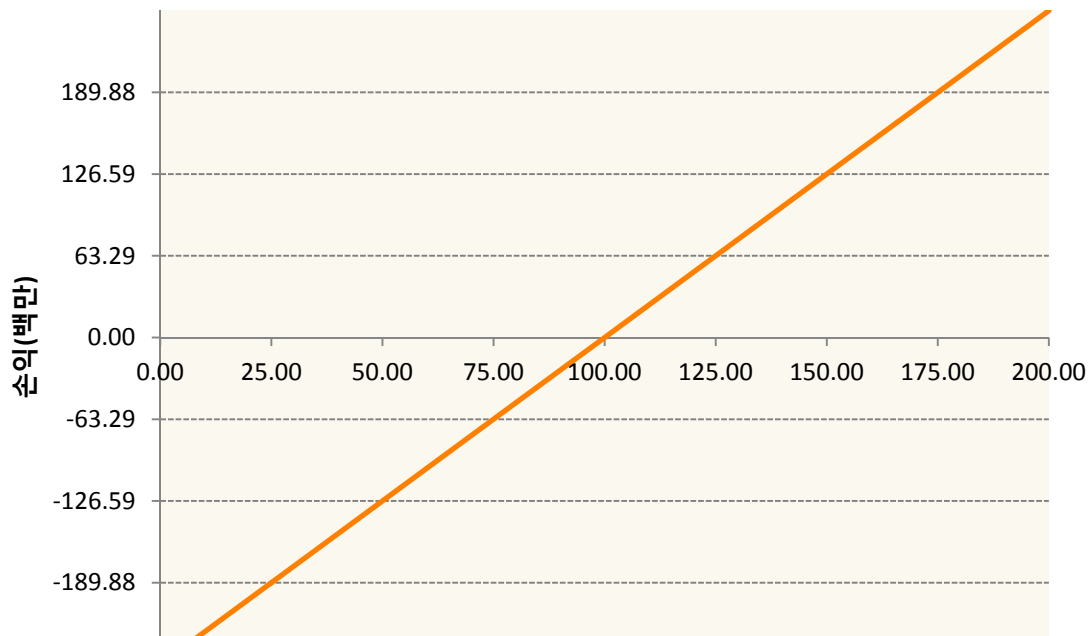


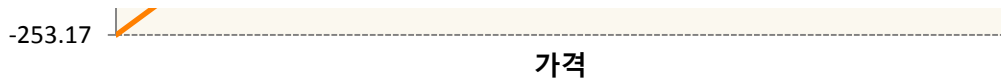


CTK9-COTTON NO.2 FUTR May19

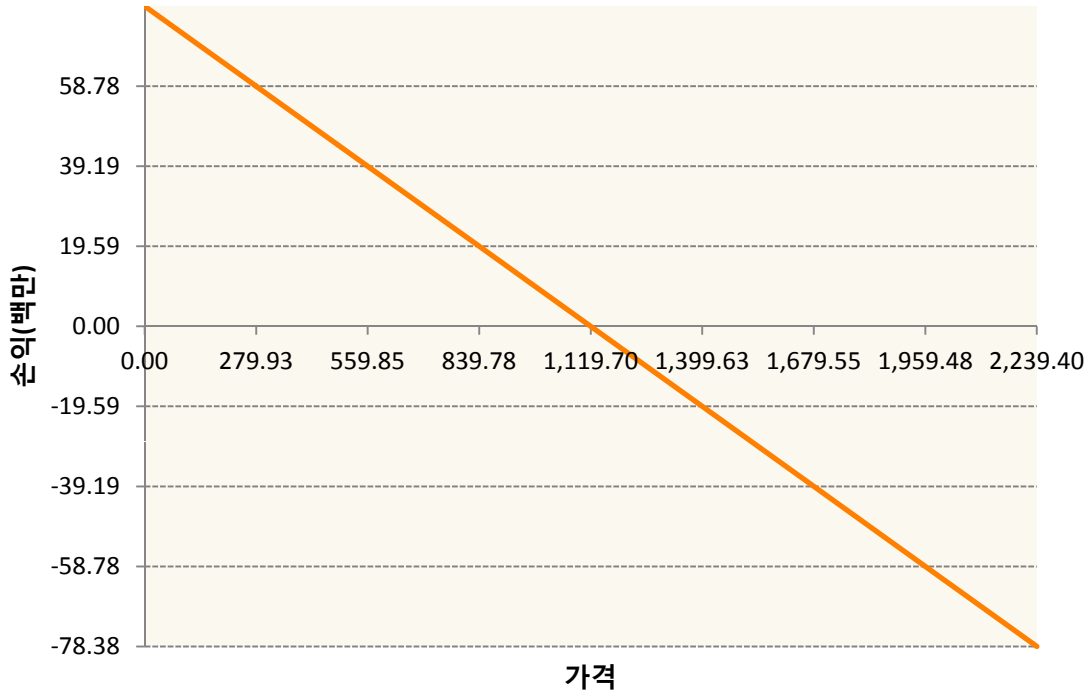


KCK9-COFFEE 'C' FUTURE May19

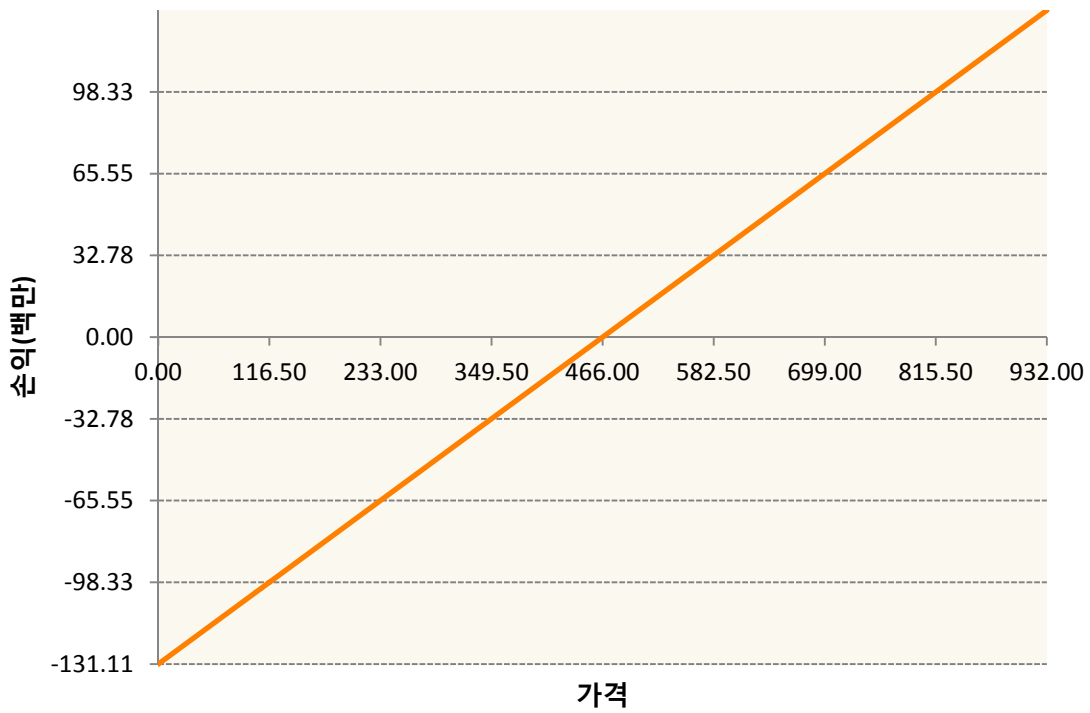




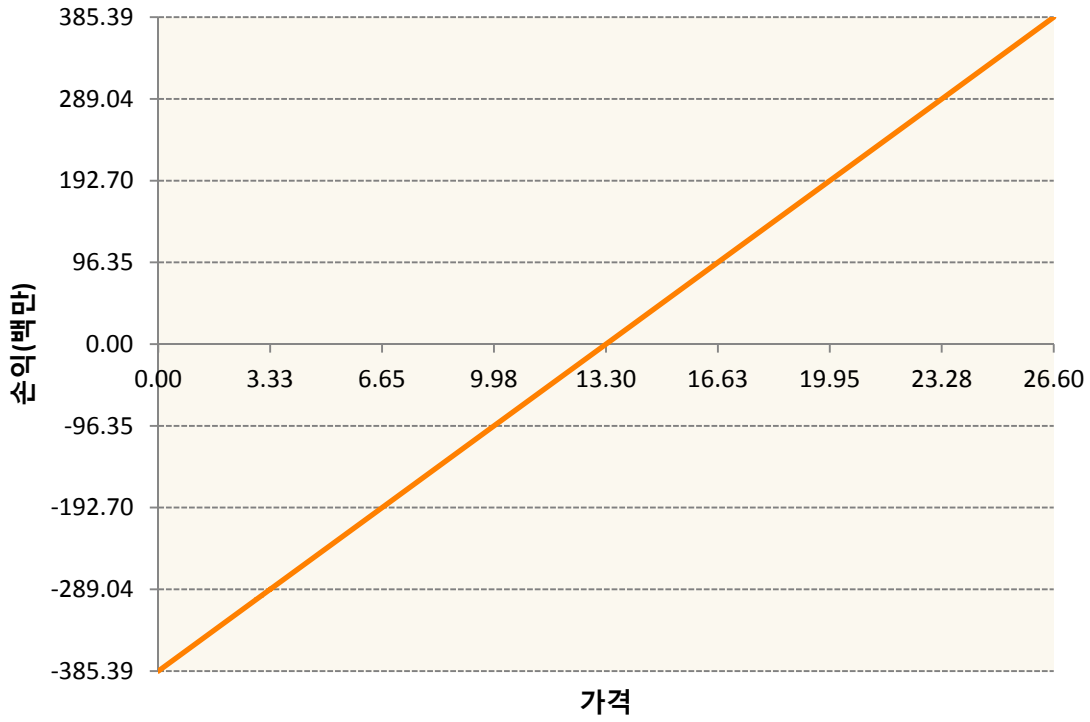
KR4175P30001-2019-03 달러선물



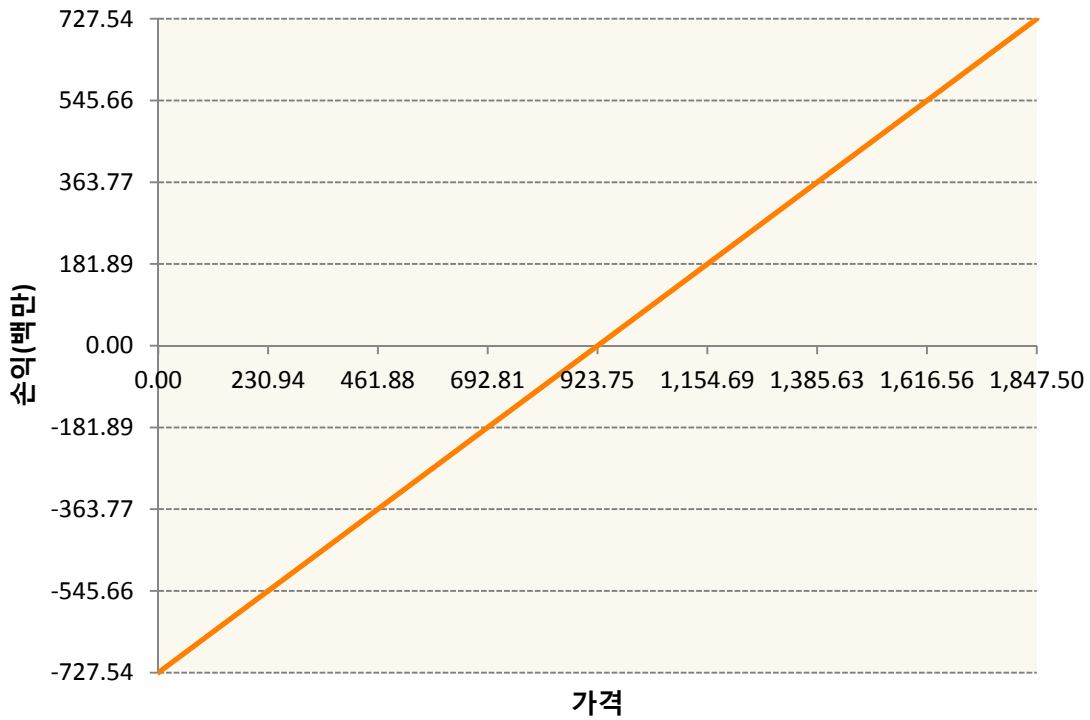
KWK9-KC HRW WHEAT FUT May19



SBK9-SUGAR #11 (WORLD) May19

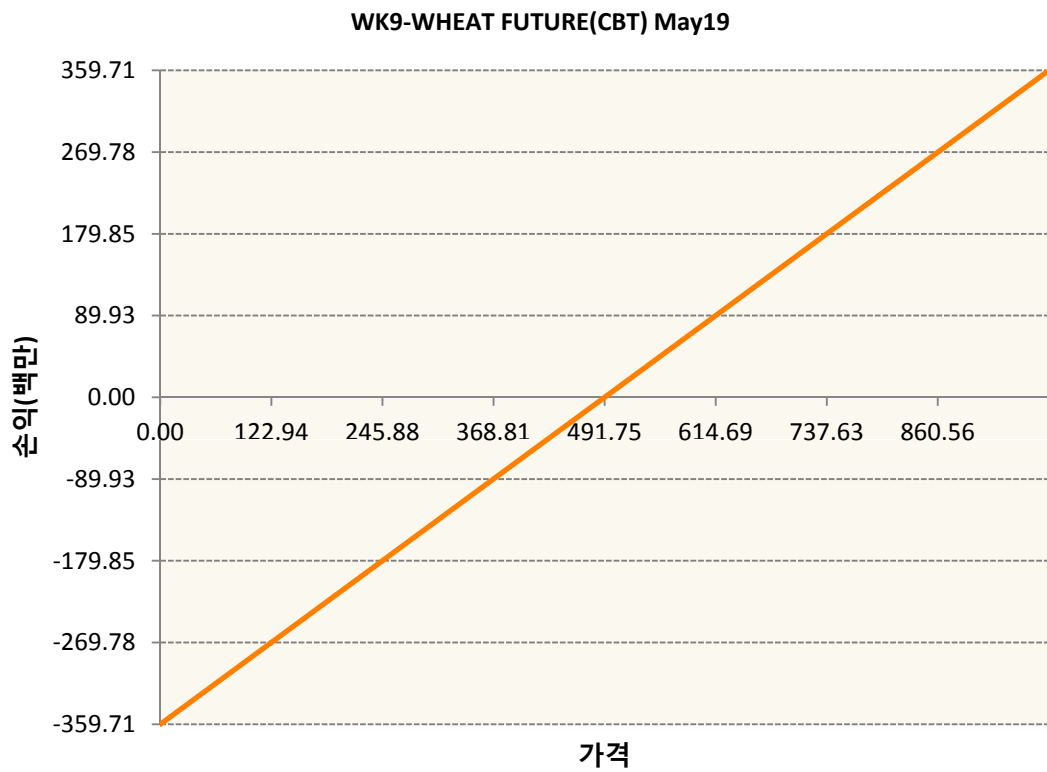
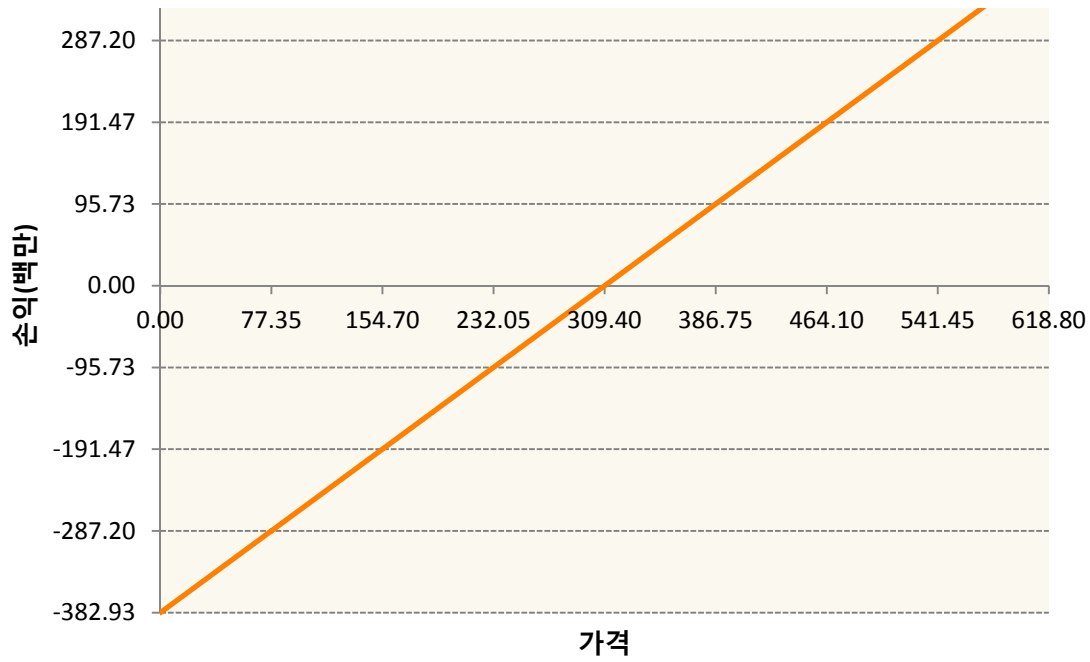


SK9-SOYBEAN FUTURE May19



SMK9-SOYBEAN MEAL FUTR May19





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

BOK9	SOYBEAN OIL FUTR May19	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