

공시일	2019-02-27
기준일	2019-02-26

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	2019-02-27
기준일	2019-02-26

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

1,117

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

643

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-02-27
기준일	2019-02-26

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)

618

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-02-27
기준일	2019-02-26

유로인덱스모(주식-파생형)

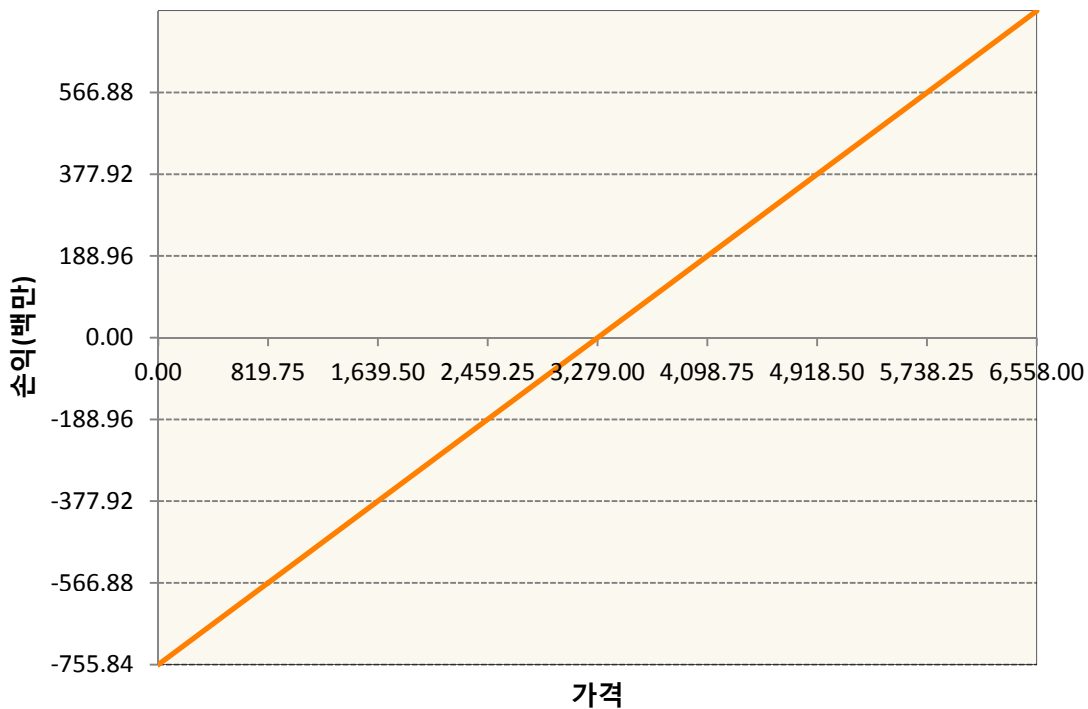
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	756	0	756	

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	2019-02-27
기준일	2019-02-26

차이나인덱스모(주식-파생형)

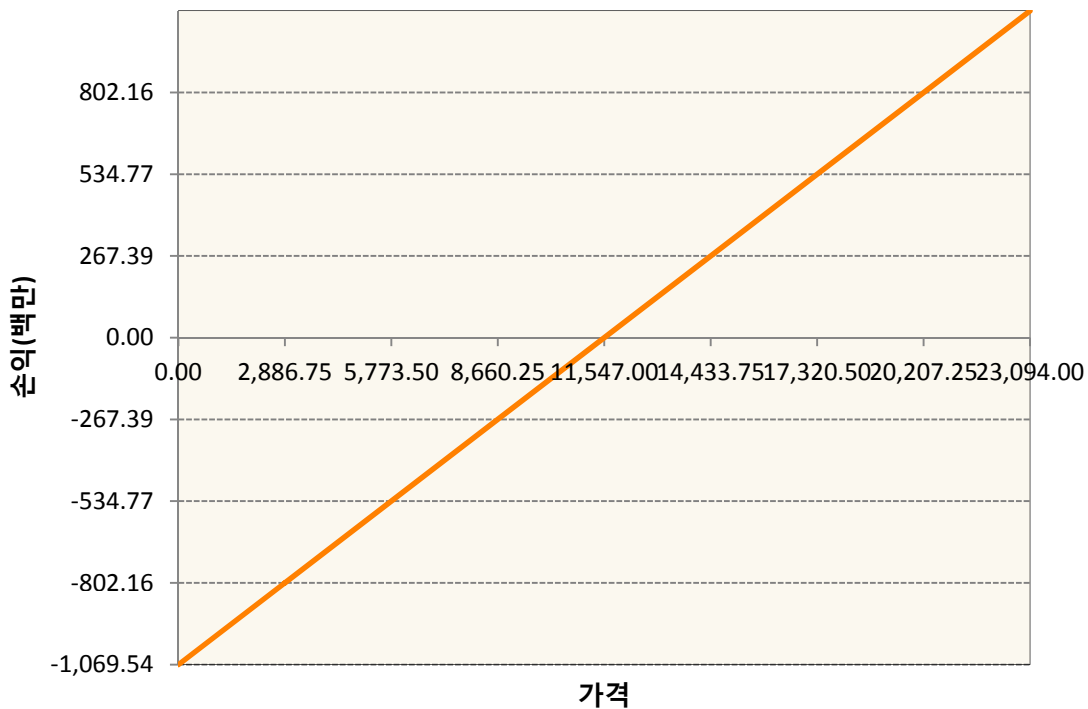
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,070	0	1,070	장내

2. 만기시점의 손익구조

HCH9-HSCEI Futures Mar19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCH9	HSCEI Futures Mar19	86
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

88

공시일	2019-02-27
기준일	2019-02-26

커버드콜모(주식혼합-파생형)

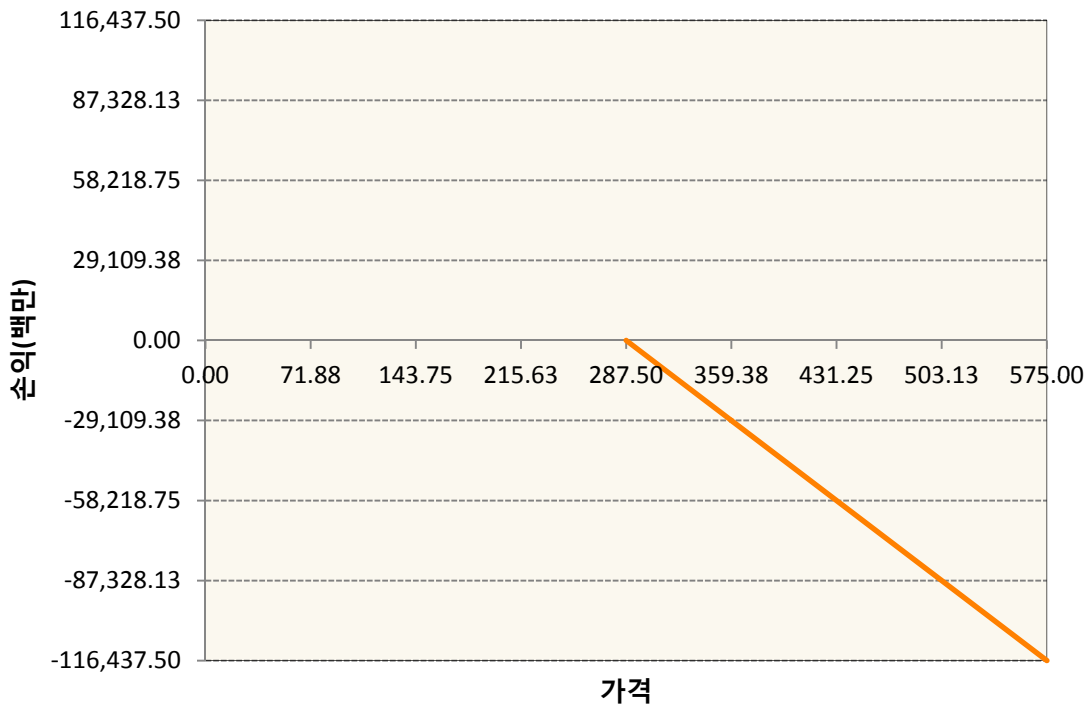
1. 계약금액

(단위:백만원)

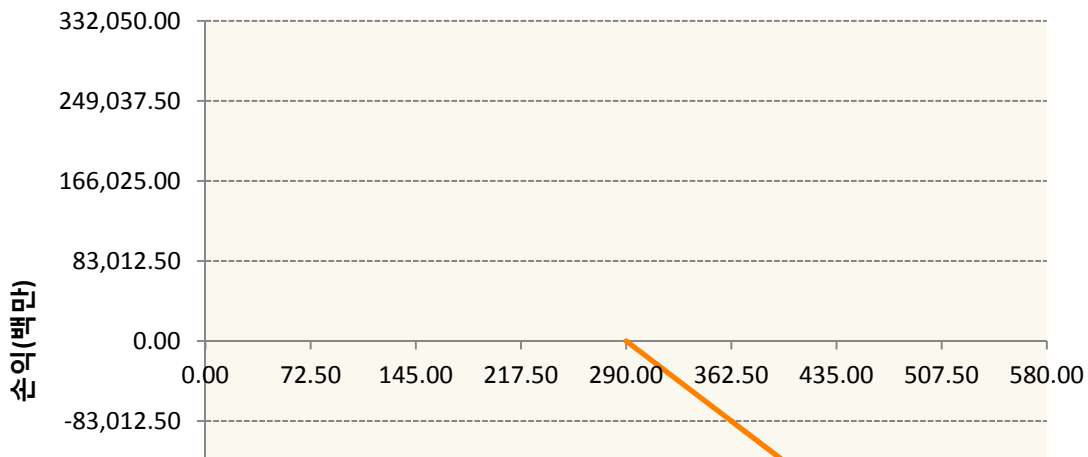
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	692,863	-692,863	장내

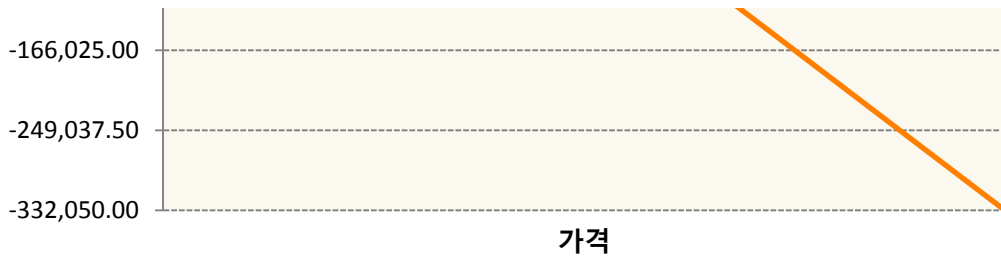
2. 만기시점의 손익구조

KR4201P32878-2019-03 콜287.5

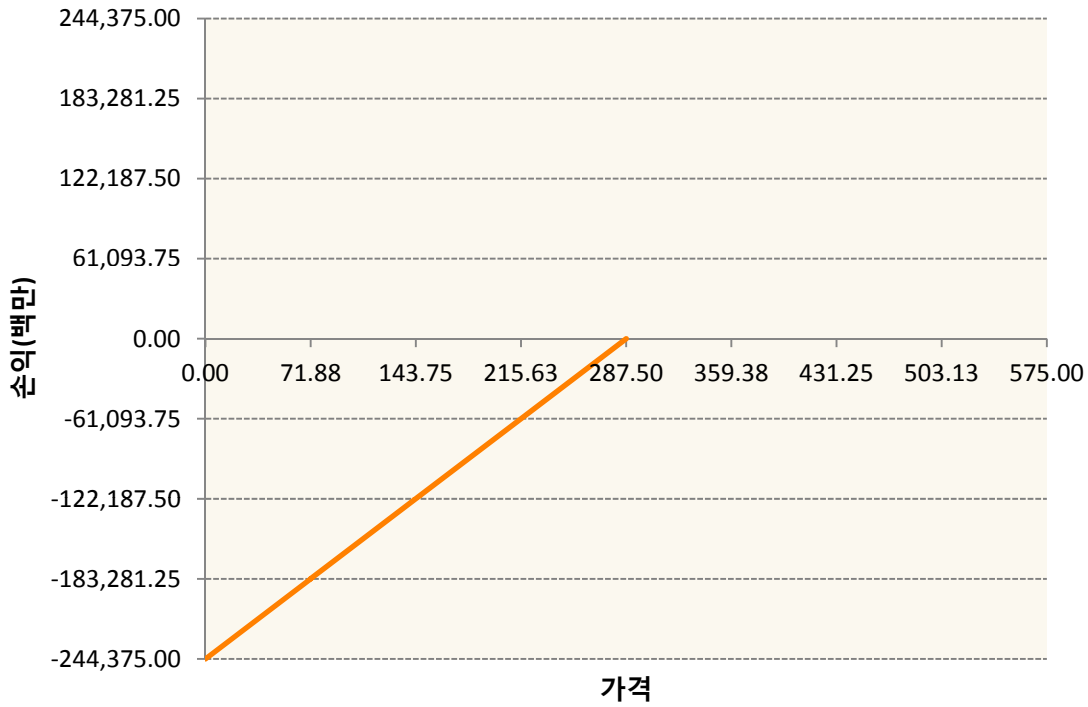


KR4201P32902-2019-03 콜290





KR4301P32876-2019-03 풋287.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201P32878		2019-03 콜287.5					7,375	
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	2,559	2,527	2,481	2,423	2,353	2,271	2,179	
-5.33%	2,393	2,298	2,190	2,070	1,939	1,800	1,653	
-2.67%	1,848	1,675	1,496	1,312	1,125	935	743	
0%	631	421	210	0	-210	-421	-631	
2.67%	-1,369	-1,542	-1,722	-1,908	-2,097	-2,290	-2,485	
5.33%	-3,979	-4,079	-4,195	-4,323	-4,462	-4,609	-4,765	
8.00%	-6,918	-6,960	-7,016	-7,087	-7,171	-7,268	-7,375	
KR4201P32902		2019-03 콜290					19,744	
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	5,948	5,886	5,794	5,668	5,510	5,320	5,100	

-5.33%	5,645	5,441	5,195	4,910	4,593	4,247	3,876
-2.67%	4,532	4,105	3,652	3,179	2,689	2,187	1,673
0%	1,769	1,181	591	0	-592	-1,185	-1,778
2.67%	-3,179	-3,728	-4,287	-4,854	-5,426	-6,003	-6,583
5.33%	-10,066	-10,424	-10,820	-11,245	-11,694	-12,164	-12,651
8.00%	-18,137	-18,306	-18,519	-18,773	-19,065	-19,390	-19,744
KR4301P32876 2019-03 풋287.5							16,563
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-16,523	-16,524	-16,525	-16,529	-16,535	-16,546	-16,563
-5.33%	-10,017	-10,034	-10,062	-10,101	-10,153	-10,216	-10,292
-2.67%	-3,807	-3,936	-4,081	-4,237	-4,404	-4,579	-4,762
0%	720	480	240	0	-240	-480	-720
2.67%	2,452	2,331	2,193	2,041	1,878	1,705	1,524
5.33%	2,720	2,701	2,671	2,629	2,573	2,504	2,423
8.00%	2,735	2,734	2,731	2,725	2,715	2,700	2,677

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

(단위:백만원)

46,235

공시일	2019-02-27
기준일	2019-02-26

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

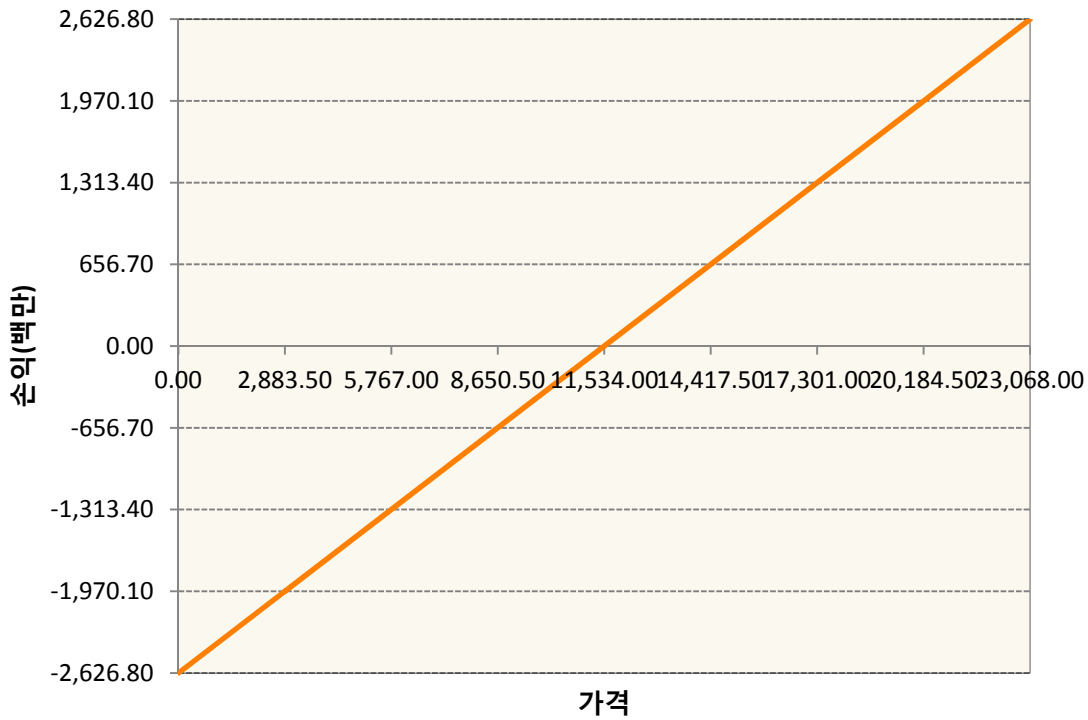
1. 계약금액

(단위:백만원)

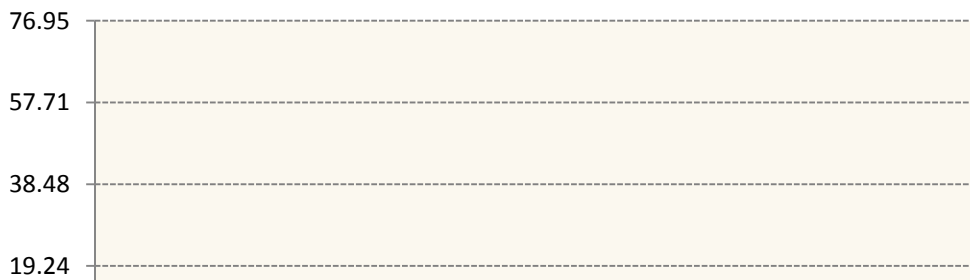
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	2,627	0	2,627	장내
누계	유가증권	옵션	0	6,212	-6,212	장내
누계	통화	선도	0	2,708	-2,708	장외

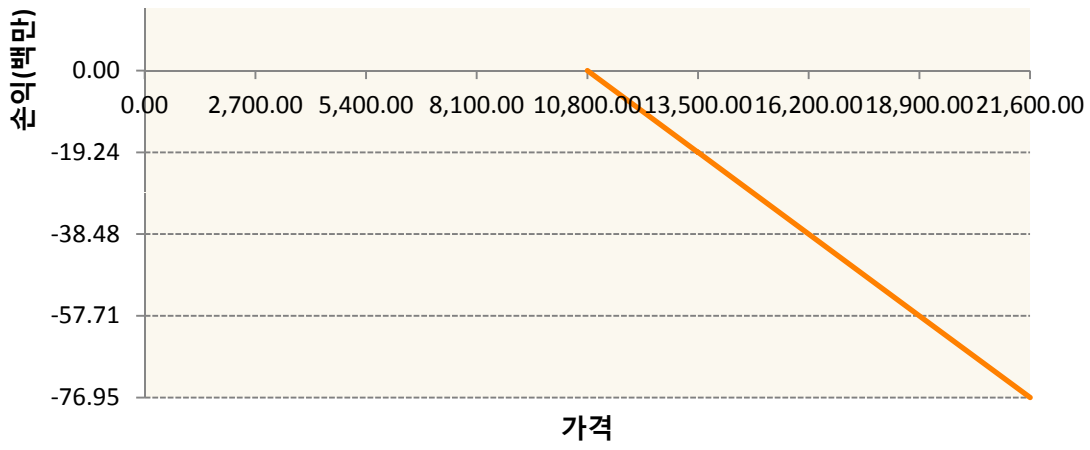
2. 만기시점의 손익구조

HCG9-HSCEI Futures Feb19

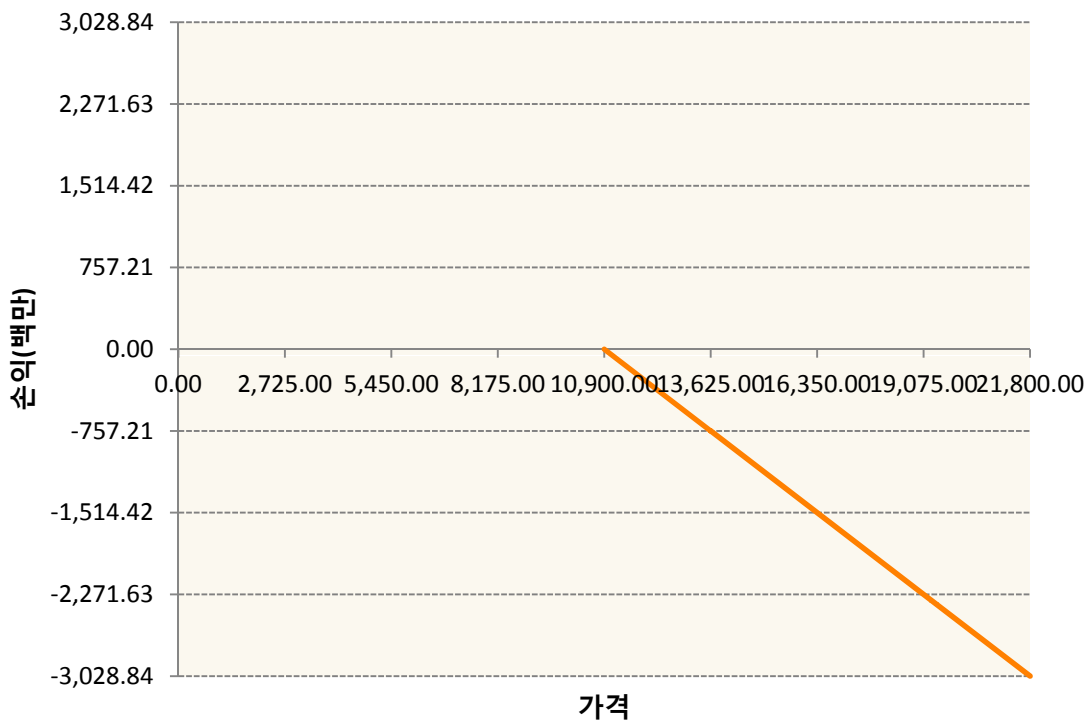


OHHIG9-C108-HSCEI

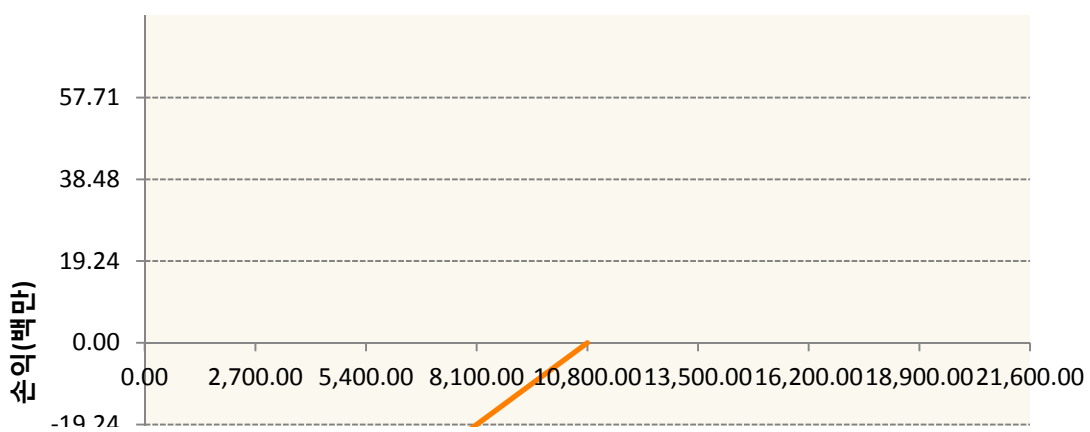


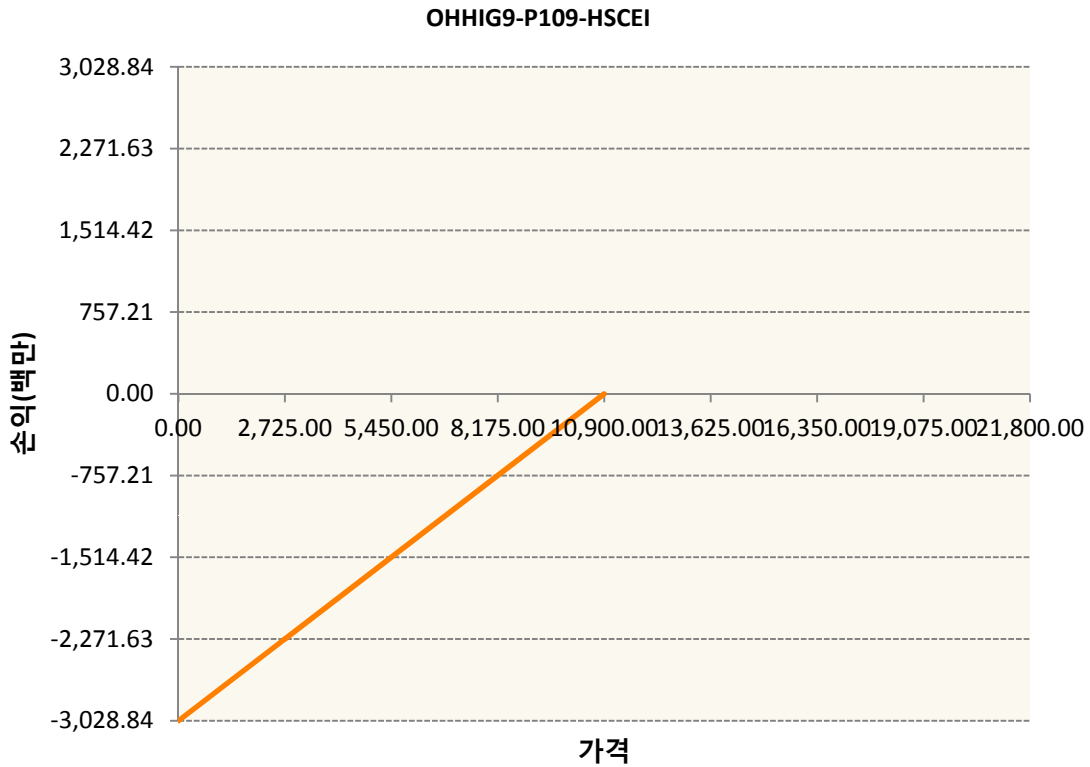


OHHIG9-C109-HSCEI



OHHIG9-P108-HSCEI





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

FX21018Z00 KRW/HKD 11-03-19E	217
HCG9 HSCEI Futures Feb19	210
OHHIG9-C1(HSCEI	6
OHHIG9-C1(HSCEI	242
OHHIG9-P1(HSCEI	6
OHHIG9-P1(HSCEI	242

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

804

공시일	2019-02-27
기준일	2019-02-26

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

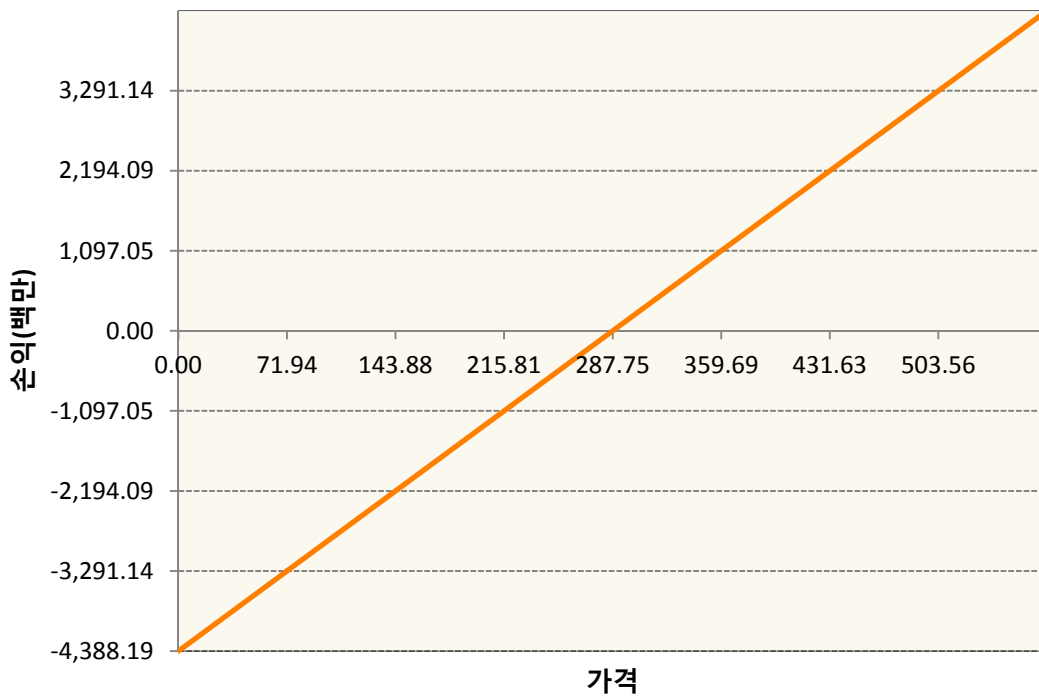
1. 계약금액

(단위:백만원)

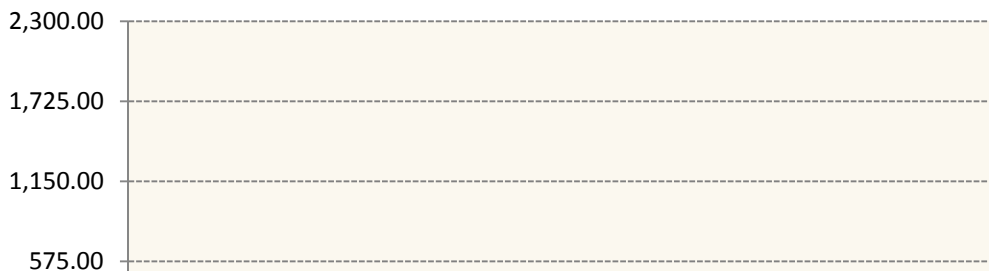
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	216	0	216	장내
누계	유가증권	선물	4,388	0	4,388	장내
누계	유가증권	스왑	28,836	0	28,836	장외
누계	유가증권	옵션	0	29,369	-29,369	장내

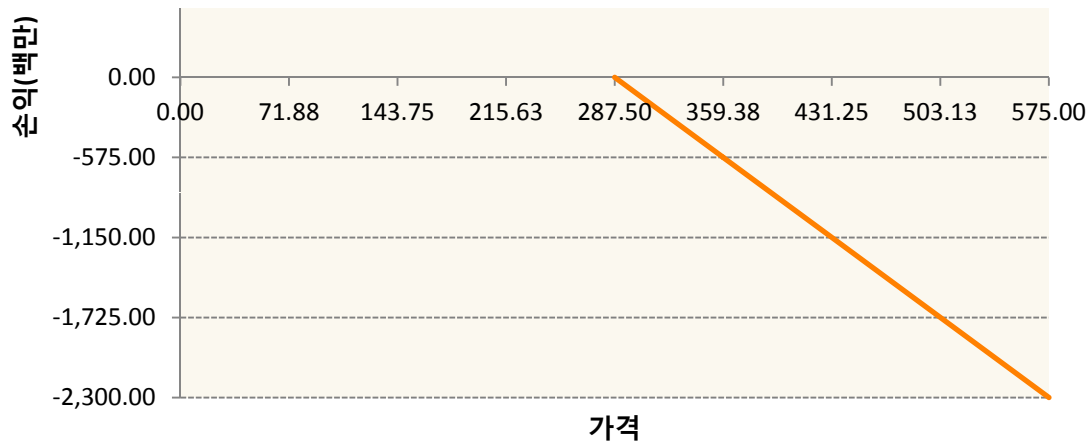
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P30007-2019-03 코스피200지수선물

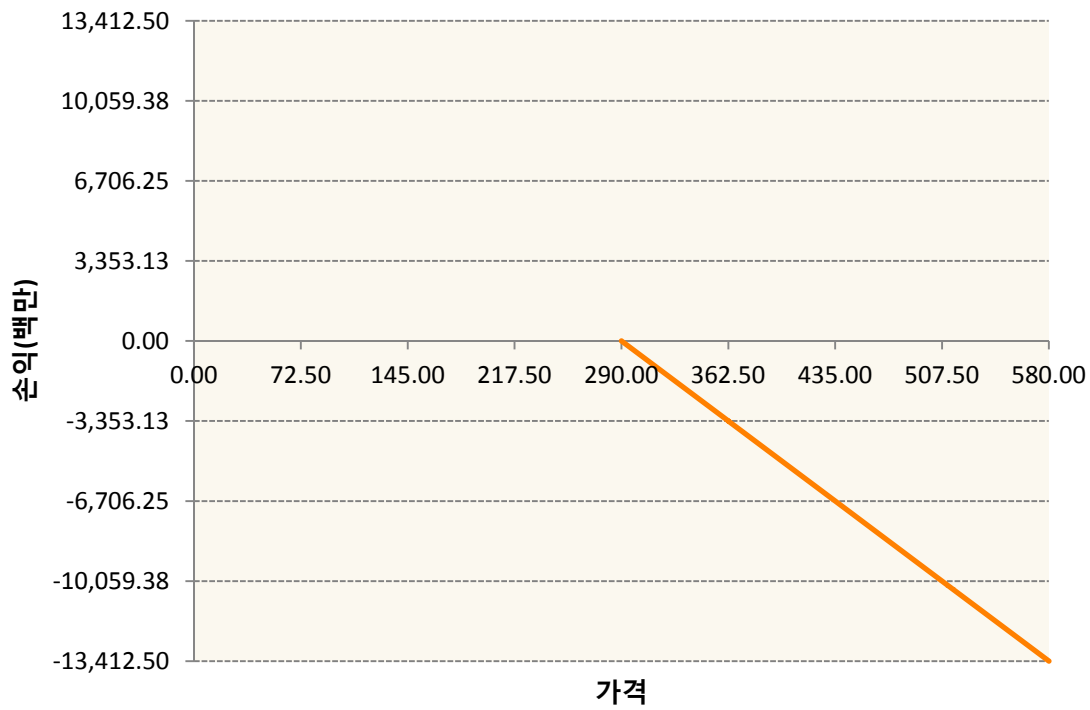


KR4201P32878-2019-03 콜287.5

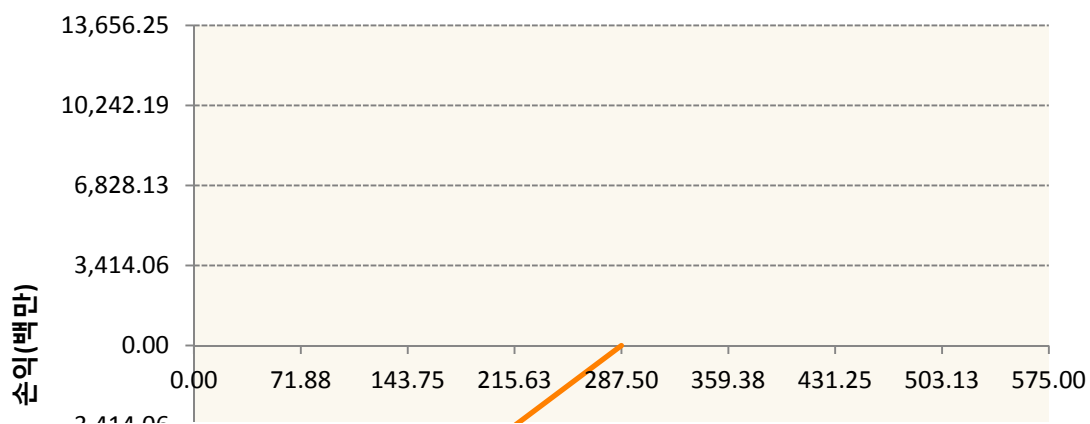


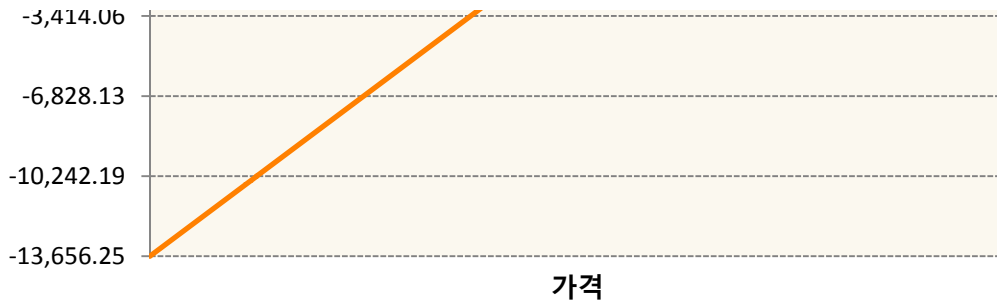


KR4201P32902-2019-03 콜290



KR4301P32876-2019-03 풋287.5





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11		UBCSFXC1 INDEX_14						2,410
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-2,410	-2,410	-2,410	-2,410	-2,410	-2,410	-2,410	
-5.33%	-1,606	-1,606	-1,606	-1,606	-1,606	-1,606	-1,606	
-2.67%	-803	-803	-803	-803	-803	-803	-803	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	803	803	803	803	803	803	803	
5.33%	1,606	1,606	1,606	1,606	1,606	1,606	1,606	
8.00%	2,410	2,410	2,410	2,410	2,410	2,410	2,410	
KR4101P30007		2019-03 코스피200지수선물						351
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-351	-351	-351	-351	-351	-351	-351	
-5.33%	-234	-234	-234	-234	-234	-234	-234	
-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%	234	234	234	234	234	234	234	
8.00%	351	351	351	351	351	351	351	
KR4201P32878		2019-03 콜287.5						146
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	51	50	49	48	46	45	43	
-5.33%	47	45	43	41	38	36	33	
-2.67%	37	33	30	26	22	18	15	
0%	12	8	4	0	-4	-8	-12	
2.67%	-27	-30	-34	-38	-41	-45	-49	
5.33%	-79	-81	-83	-85	-88	-91	-94	
8.00%	-137	-137	-139	-140	-142	-144	-146	
KR4201P32902		2019-03 콜290						798
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	

-8.00%	240	238	234	229	223	215	206
-5.33%	228	220	210	198	186	172	157
-2.67%	183	166	148	128	109	88	68
0%	71	48	24	0	-24	-48	-72
2.67%	-128	-151	-173	-196	-219	-242	-266
5.33%	-407	-421	-437	-454	-472	-491	-511
8.00%	-733	-739	-748	-758	-770	-783	-798
KR4301P32876 2019-03 풋287.5							926
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-923	-923	-923	-924	-924	-925	-926
-5.33%	-560	-561	-562	-564	-567	-571	-575
-2.67%	-213	-220	-228	-237	-246	-256	-266
0%	40	27	13	0	-13	-27	-40
2.67%	137	130	123	114	105	95	85
5.33%	152	151	149	147	144	140	135
8.00%	153	153	153	152	152	151	150

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

(단위:백만원)

4,720

공시일	2019-02-27
기준일	2019-02-26

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

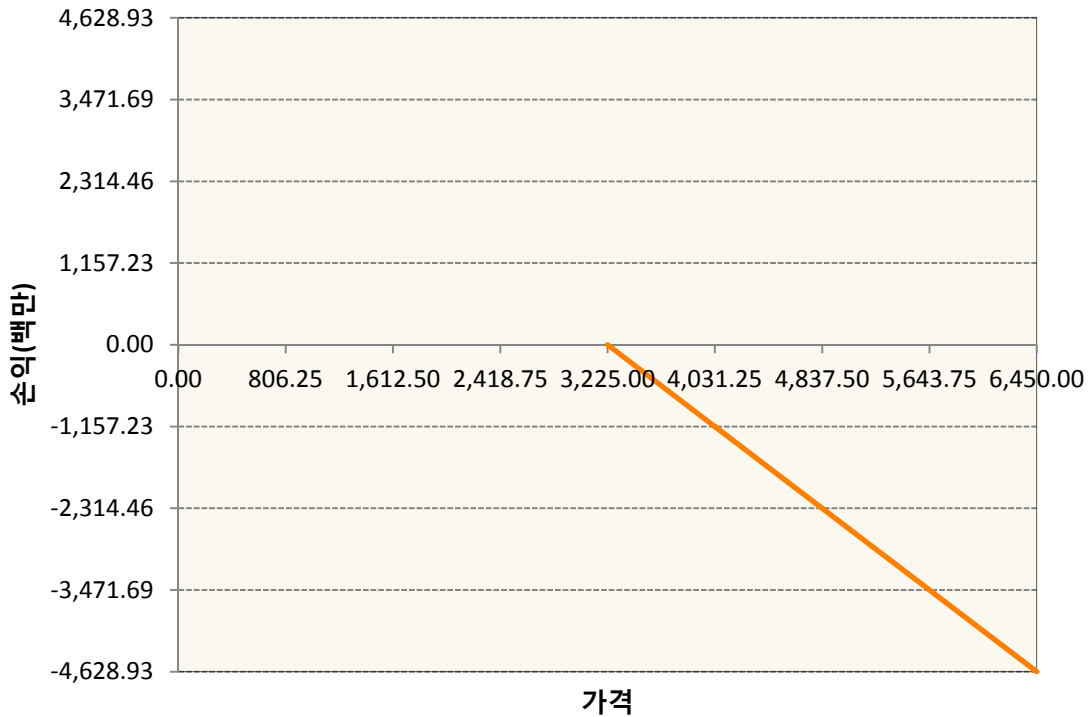
1. 계약금액

(단위:백만원)

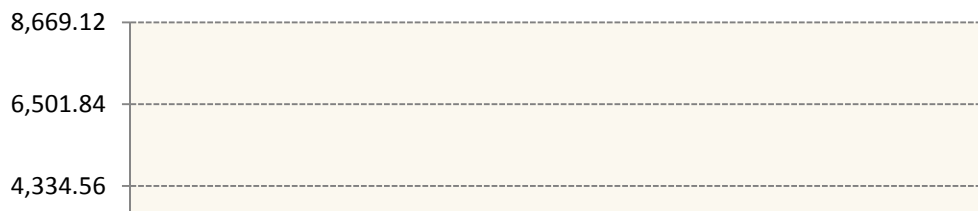
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	7,093	0	7,093	
누계	유가증권	스왑	59,966	0	59,966	장외
누계	유가증권	옵션	0	26,596	-26,596	장내
누계	통화	선도	0	15,242	-15,242	장외

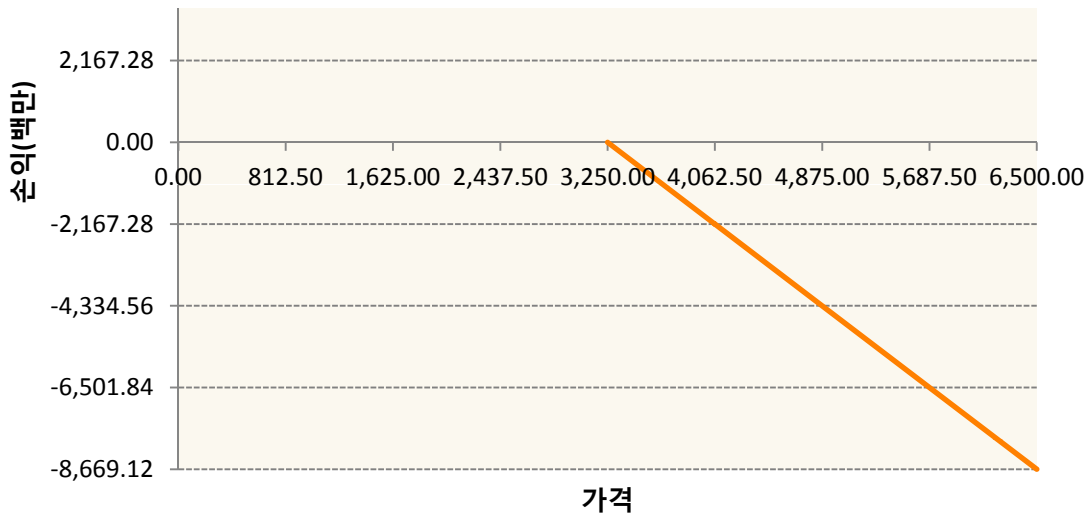
2. 만기시점의 손익구조

OESXH9-C3225-EURO STOXX 50

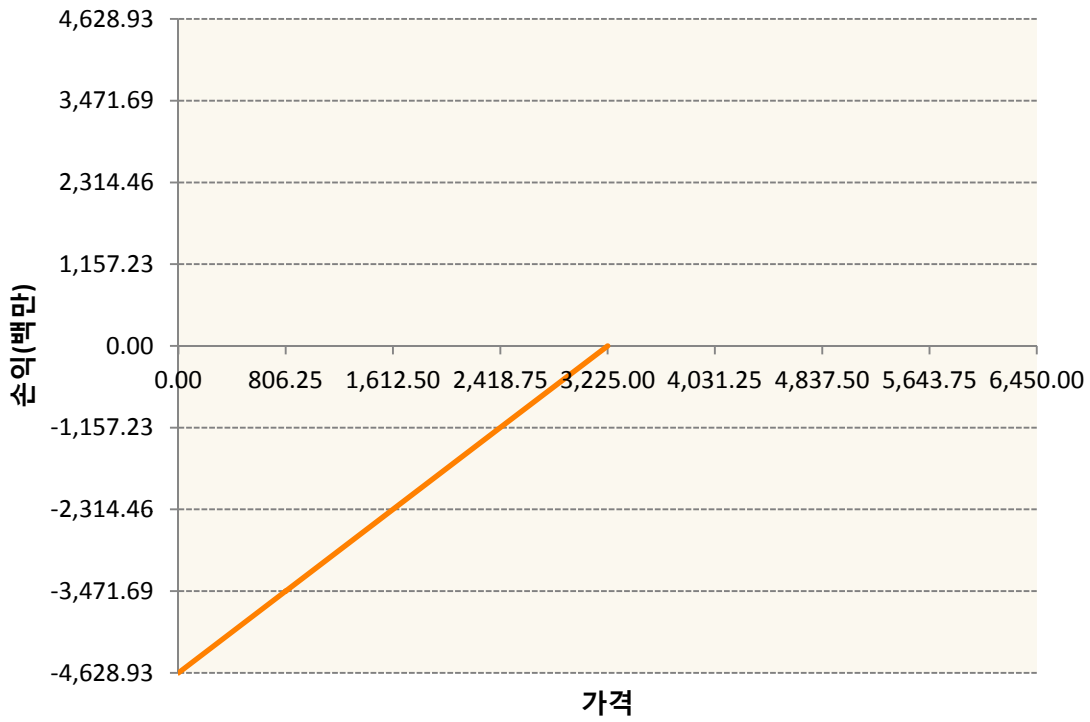


OESXH9-C3250-EURO STOXX 50

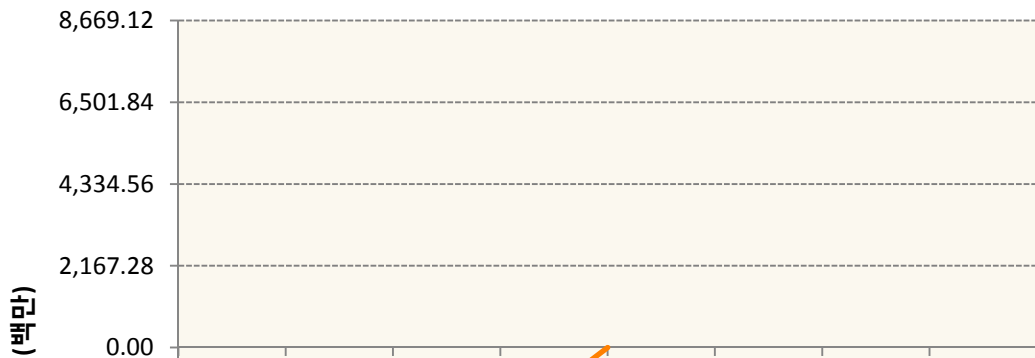


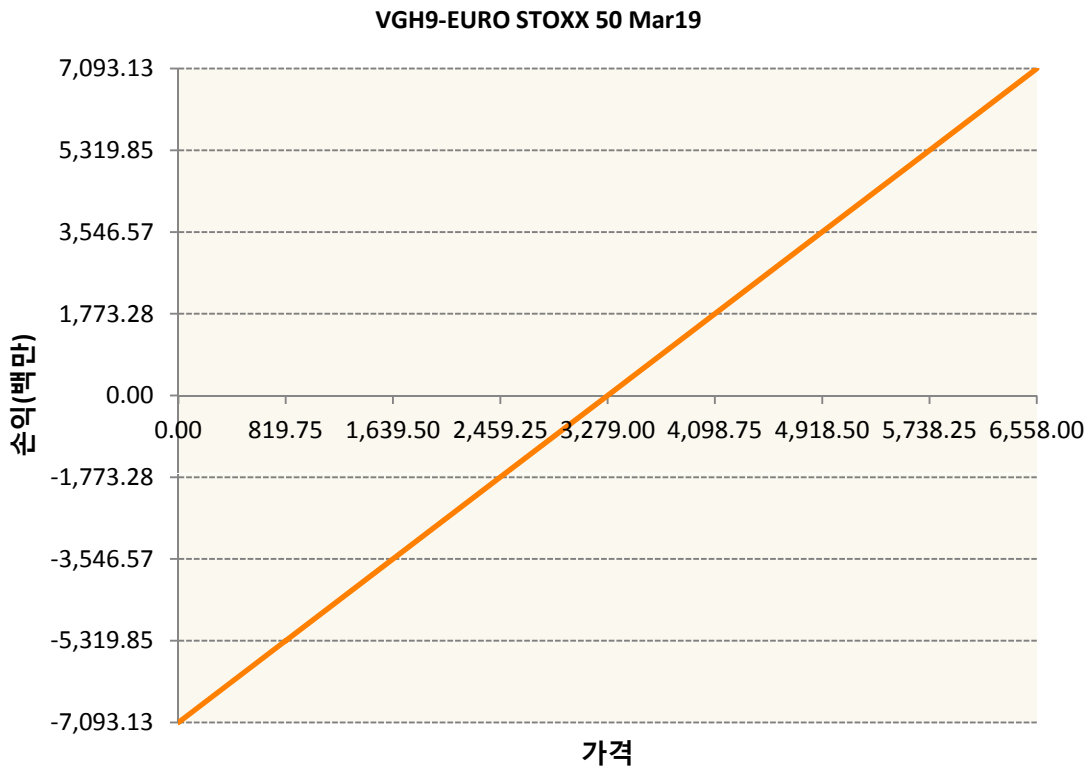
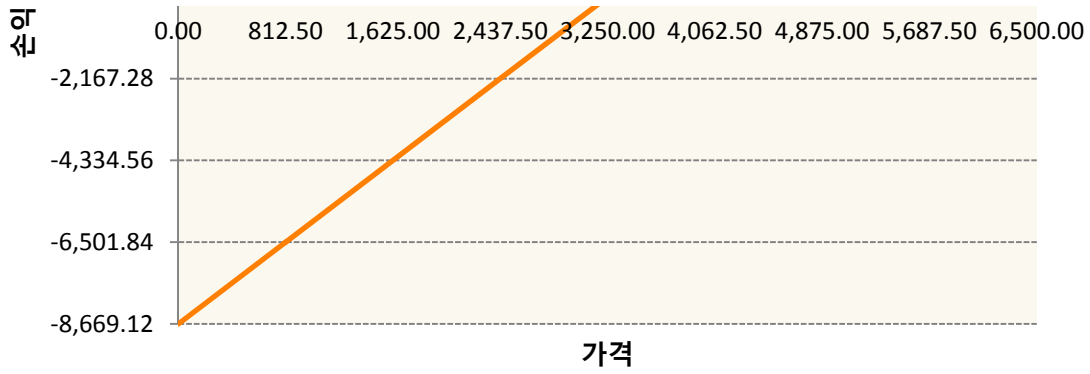


OESXH9-P3225-EURO STOXX 50



OESXH9-P3250-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY		107
FX21018Z03 KRW/EUR 22-03-19E		813
FX21019G02 KRW/EUR 24-05-19E		406
OESXH9-C32 EURO STOXX 50		370
OESXH9-C32 EURO STOXX 50		694
OESXH9-P32 EURO STOXX 50		370
OESXH9-P32 EURO STOXX 50		694
VGH9 EURO STOXX 50 Mar19		567

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

(단위:백만원)

2,652

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

(단위:백만원)

1,153

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

(단위:백만원)

99

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

(단위:백만원)

143

공시일	2019-02-27
기준일	2019-02-26

스마트KRX300인덱스목표전환형1호

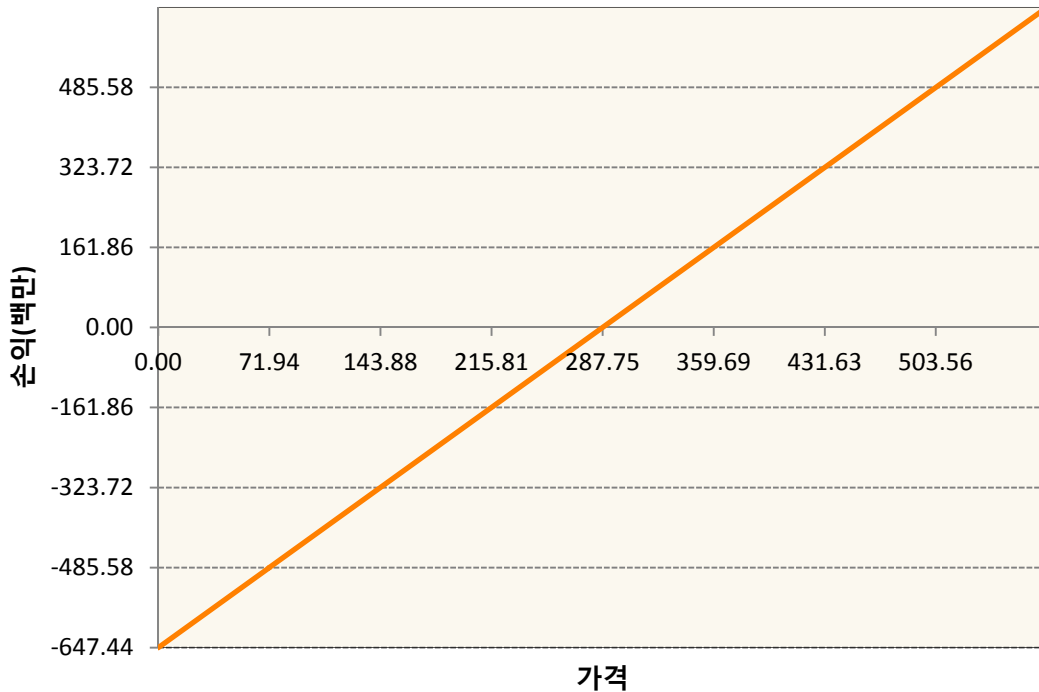
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	647	0	647	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)

44

공시일	2019-02-27
기준일	2019-02-26

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

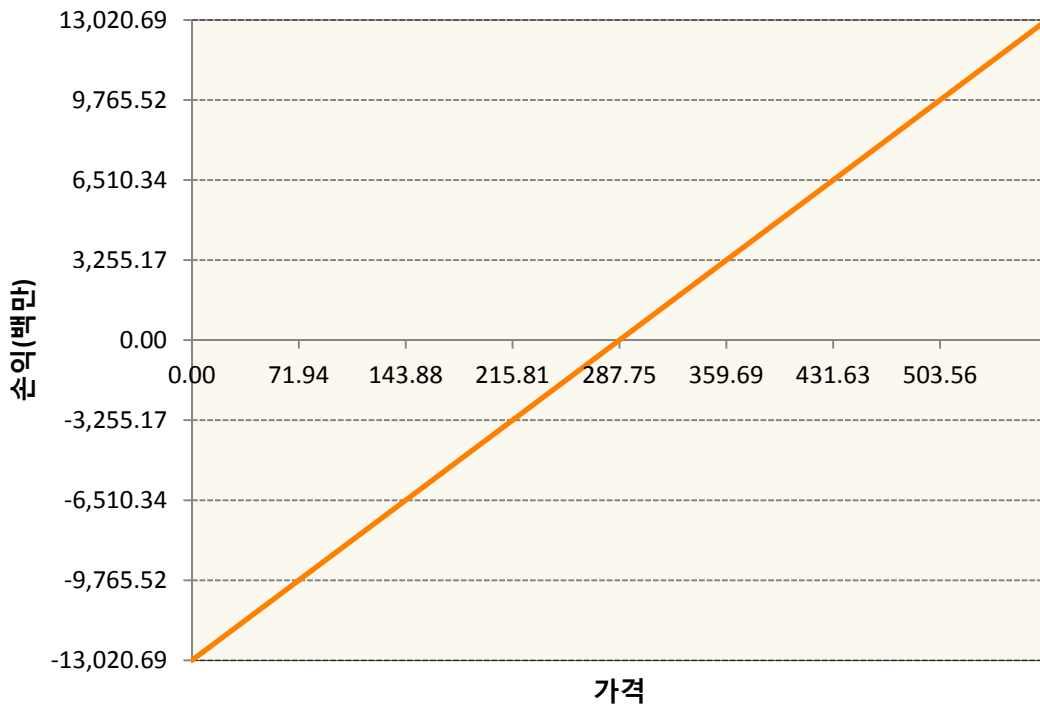
1. 계약금액

(단위:백만원)

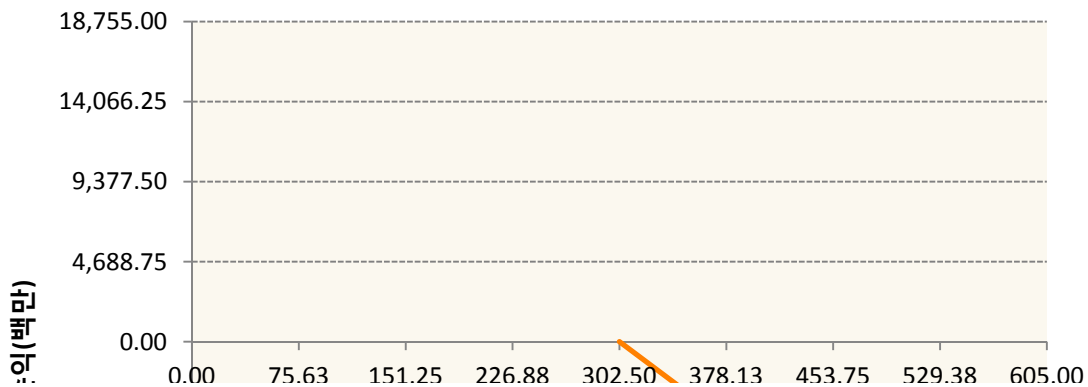
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	13,021	0	13,021	장내
누계	유가증권	옵션	2,165	24,931	-22,766	장내

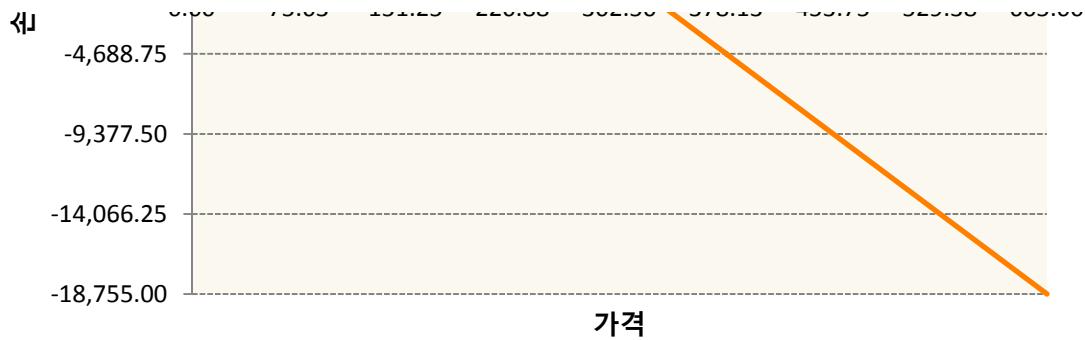
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P30007-2019-03 코스피200지수선물

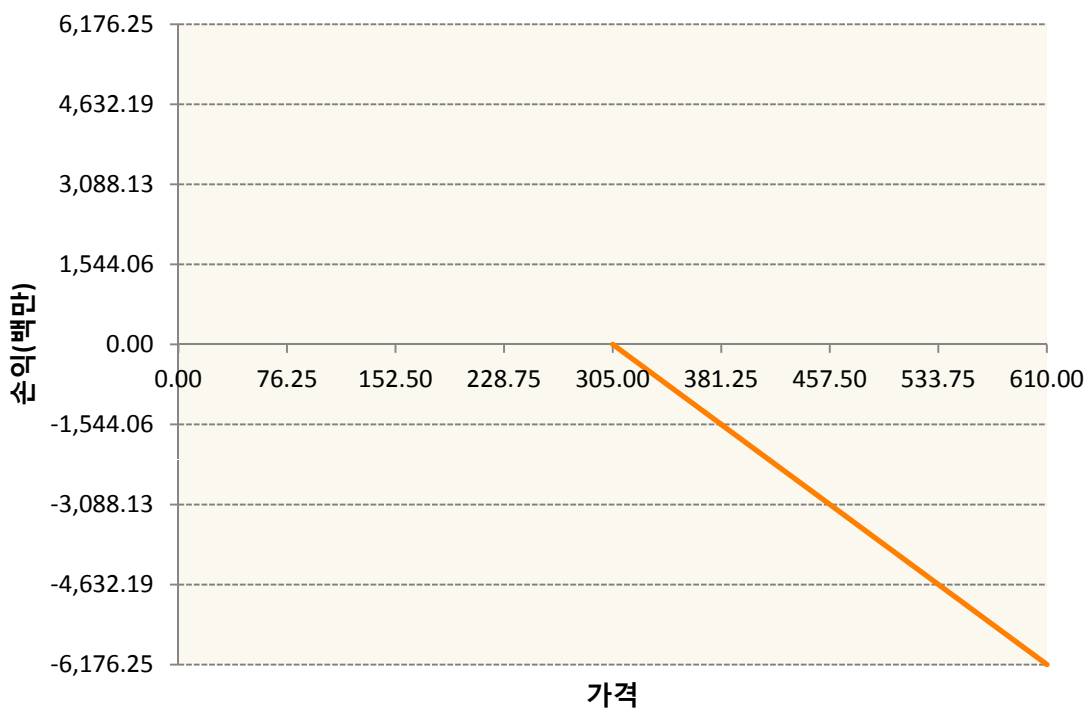


KR4201P33025-2019-03 콜302.5

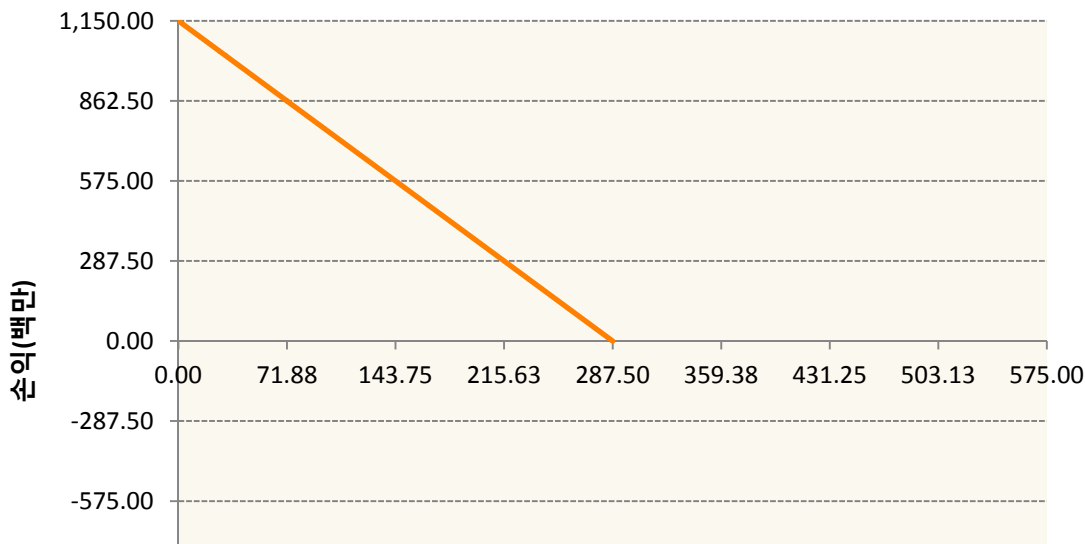


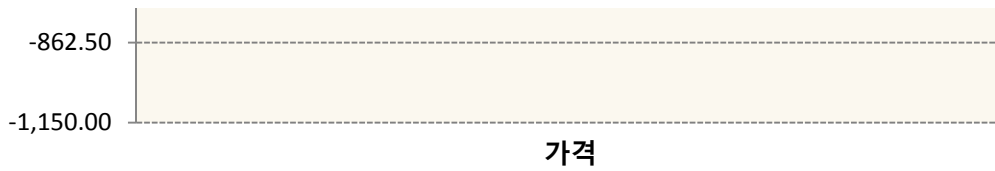


KR4201P33058-2019-03 콜305

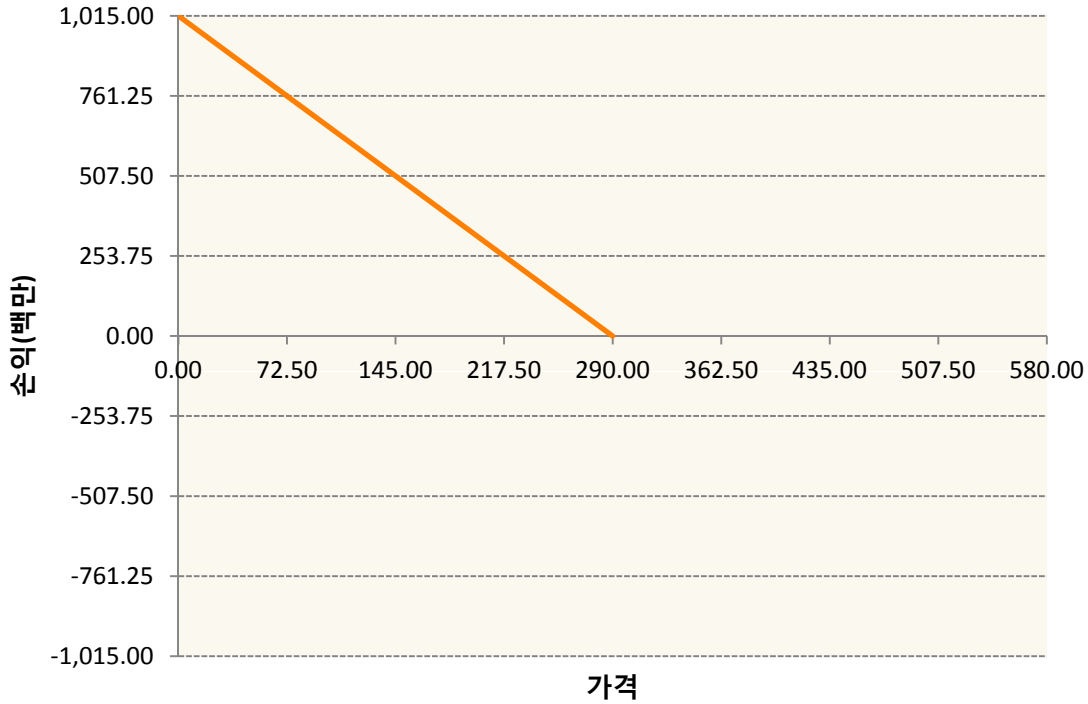


KR4301P32876-2019-03 풋287.5





KR4301P32900-2019-03 풋290



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101P30007		2019-03 코스피200지수선물						1,042
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-1,042	-1,042	-1,042	-1,042	-1,042	-1,042	-1,042	
-5.33%	-695	-695	-695	-695	-695	-695	-695	
-2.67%	-347	-347	-347	-347	-347	-347	-347	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	347	347	347	347	347	347	347	
5.33%	695	695	695	695	695	695	695	
8.00%	1,042	1,042	1,042	1,042	1,042	1,042	1,042	
KR4201P33025		2019-03 콜302.5						718
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	97	97	96	95	93	90	86	
-5.33%	96	95	92	87	81	74	65	
-2.67%	89	82	73	62	49	34	18	

0%	57	40	21	0	-22	-46	-71
2.67%	-36	-65	-94	-125	-155	-187	-218
5.33%	-230	-264	-298	-332	-366	-399	-433
8.00%	-538	-566	-595	-625	-656	-687	-718
KR4201P33058 2019-03 콜305							211
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	24	24	24	24	23	22	21
-5.33%	24	23	23	22	20	18	16
-2.67%	22	21	19	16	12	8	4
0%	15	11	6	0	-6	-13	-21
2.67%	-7	-16	-24	-34	-43	-53	-62
5.33%	-59	-70	-81	-92	-103	-114	-125
8.00%	-148	-158	-168	-179	-190	-200	-211
KR4301P32876 2019-03 풋287.5							78
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	78	78	78	78	78	78	78
-5.33%	47	47	47	48	48	48	48
-2.67%	18	19	19	20	21	22	22
0%	-3	-2	-1	0	1	2	3
2.67%	-12	-11	-10	-10	-9	-8	-7
5.33%	-13	-13	-13	-12	-12	-12	-11
8.00%	-13	-13	-13	-13	-13	-13	-13
KR4301P32900 2019-03 풋290							72
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	72	72	72	72	72	72	72
-5.33%	45	45	45	45	45	46	46
-2.67%	19	19	20	20	21	21	22
0%	-3	-2	-1	0	1	2	3
2.67%	-14	-13	-12	-11	-10	-10	-9
5.33%	-16	-16	-15	-15	-15	-14	-14
8.00%	-16	-16	-16	-16	-16	-16	-16

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

(단위:백만원)

1,702

공시일	2019-02-27
기준일	2019-02-26

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	975	0	975	

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	2019-02-27
기준일	2019-02-26

H2O글로벌본드(UH)(채권혼합-파

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	168	0	168	
누계	유가증권	수익증권	5,780	0	5,780	

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	2019-02-27
기준일	2019-02-26

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	33,212	0	33,212	
누계	통화	선도	0	41,713	-41,713	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		27
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		465
FX21019F02 KRW/USD 28-02-19E		116
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		268

FX21019G02 KRW/USD 25-03-19E	135
FX21019G02 KRW/USD 25-03-19E	474
FX21019G03 KRW/USD 28-03-19E	251
FX21019G03 KRW/USD 28-03-19E	116
FX21019G03 KRW/USD 29-03-19E	331

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

(단위:백만원)

1,212

공시일	2019-02-27
기준일	2019-02-26

스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

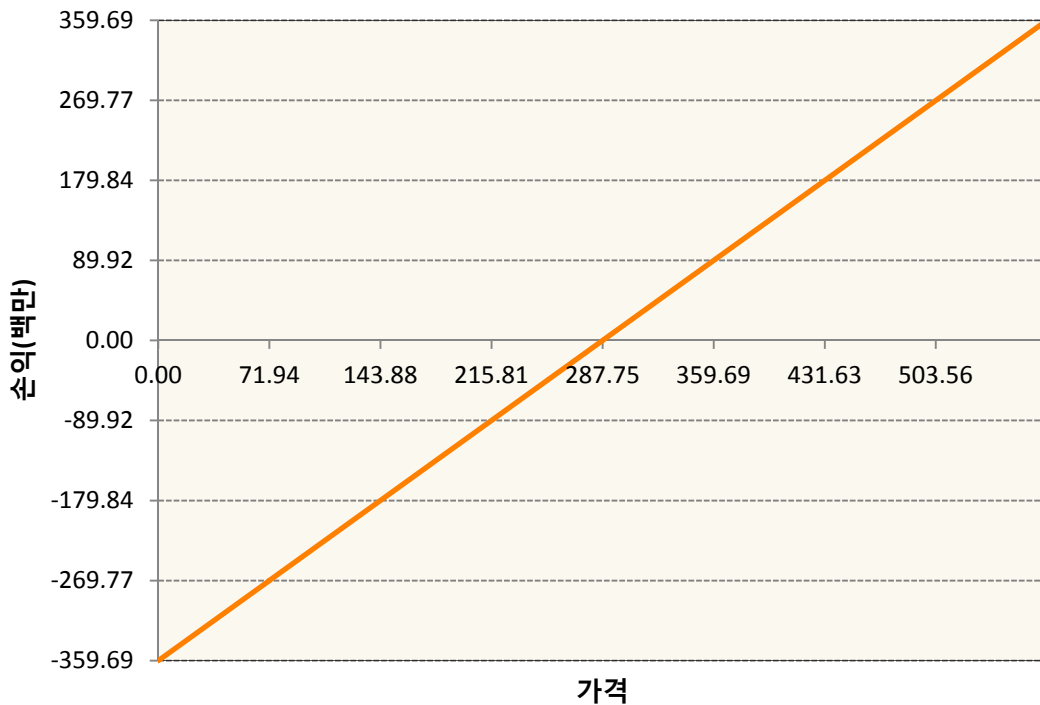
1. 계약금액

(단위:백만원)

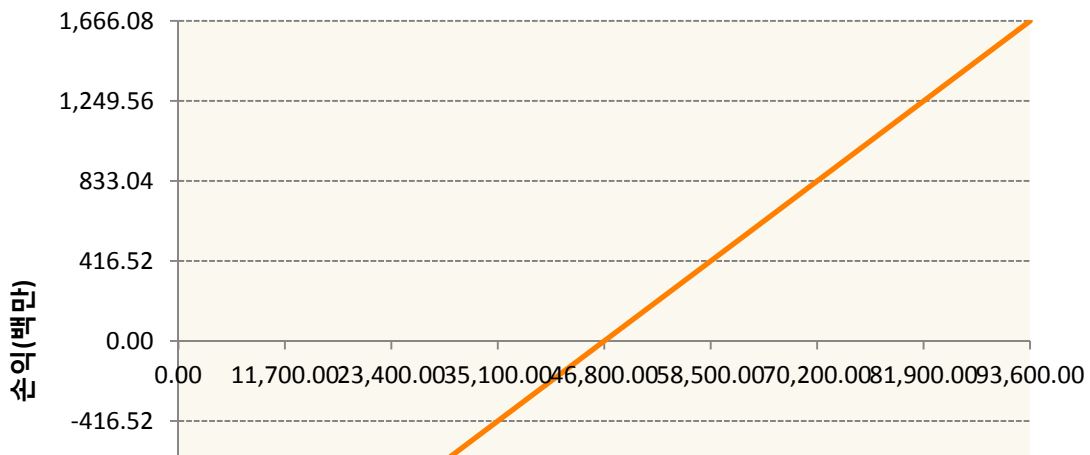
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,026	0	2,026	장내

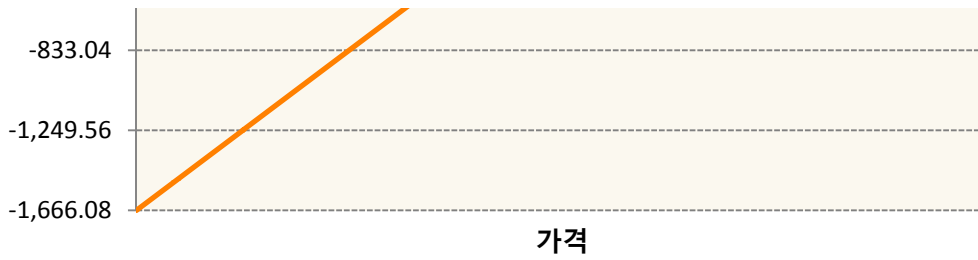
2. 만기시점의 손익구조

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						133
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-133	-133	-133	-133	-133	-133	-133	
-5.33%	-89	-89	-89	-89	-89	-89	-89	
-2.67%	-44	-44	-44	-44	-44	-44	-44	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	44	44	44	44	44	44	44	
5.33%	89	89	89	89	89	89	89	
8.00%	133	133	133	133	133	133	133	

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

176

공시일	2019-02-27
기준일	2019-02-26

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

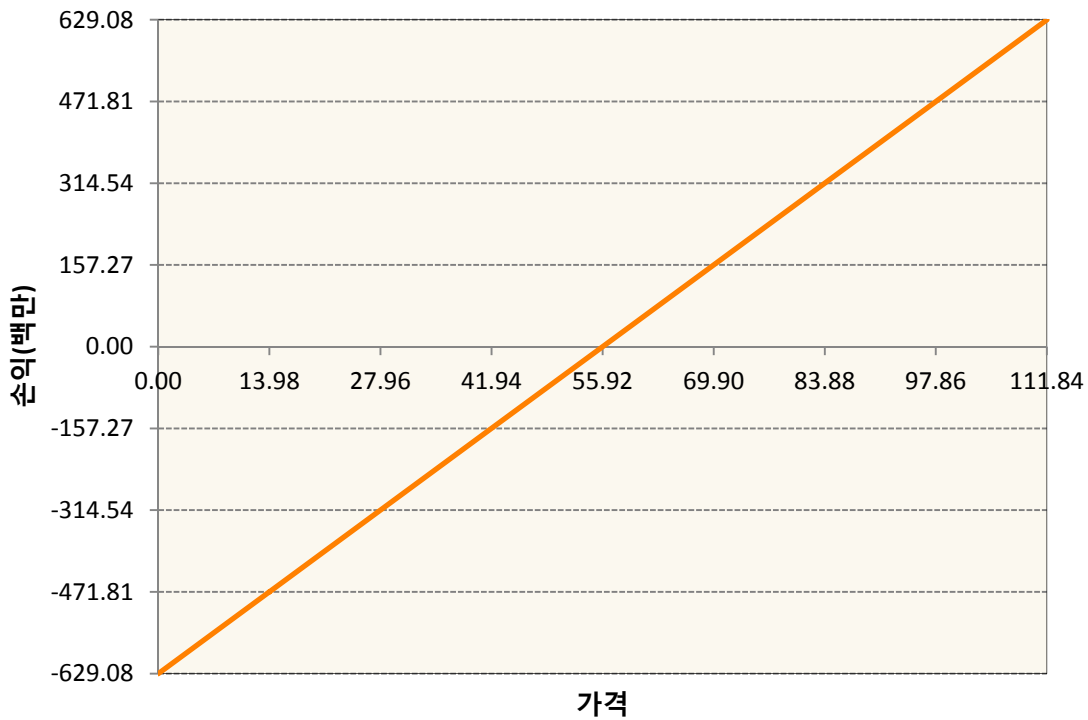
1. 계약금액

(단위:백만원)

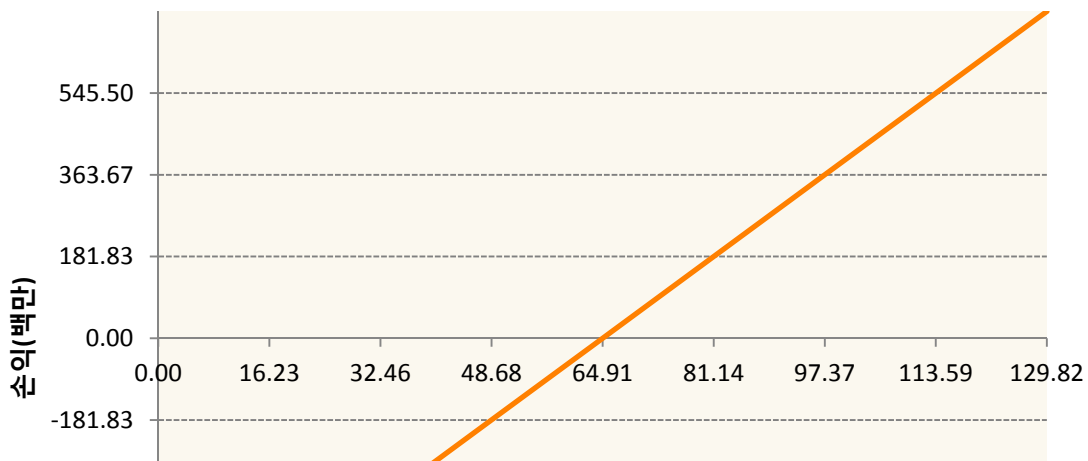
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,789	279	2,510	

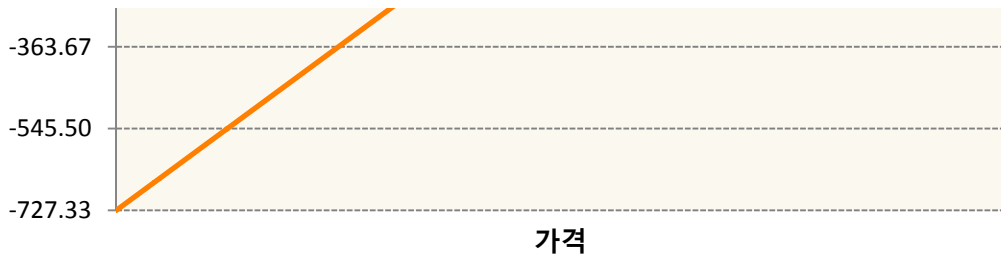
2. 만기시점의 손익구조

CLK9-WTI CRUDE FUTURE May19

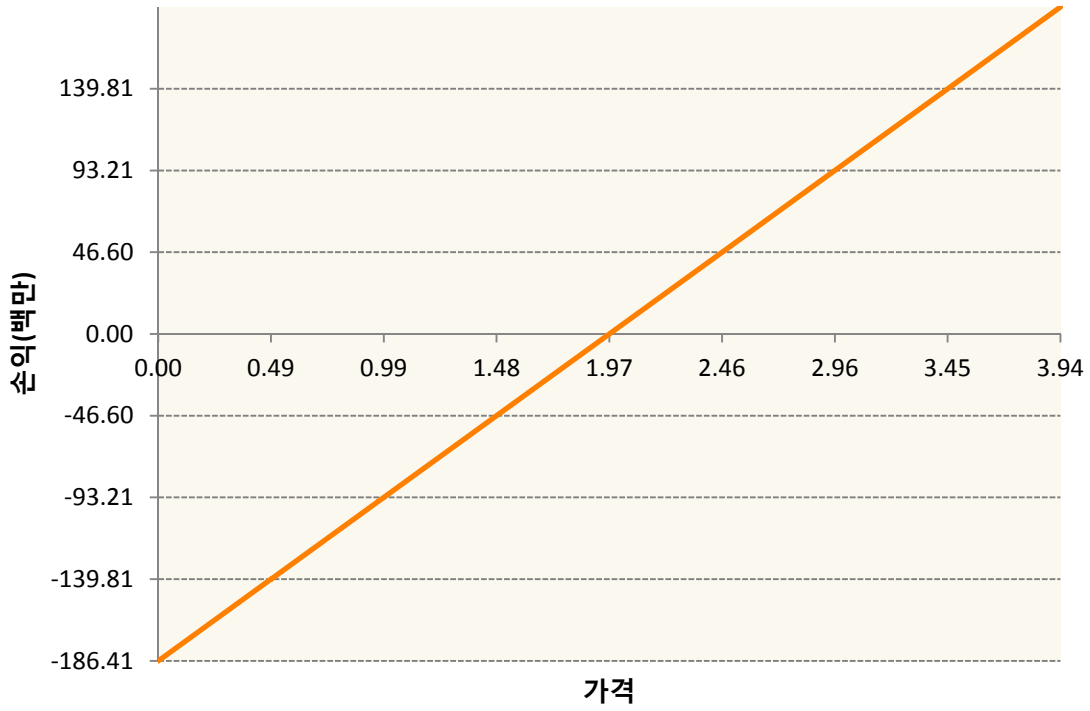


COK9-BRENT CRUDE FUTR May19

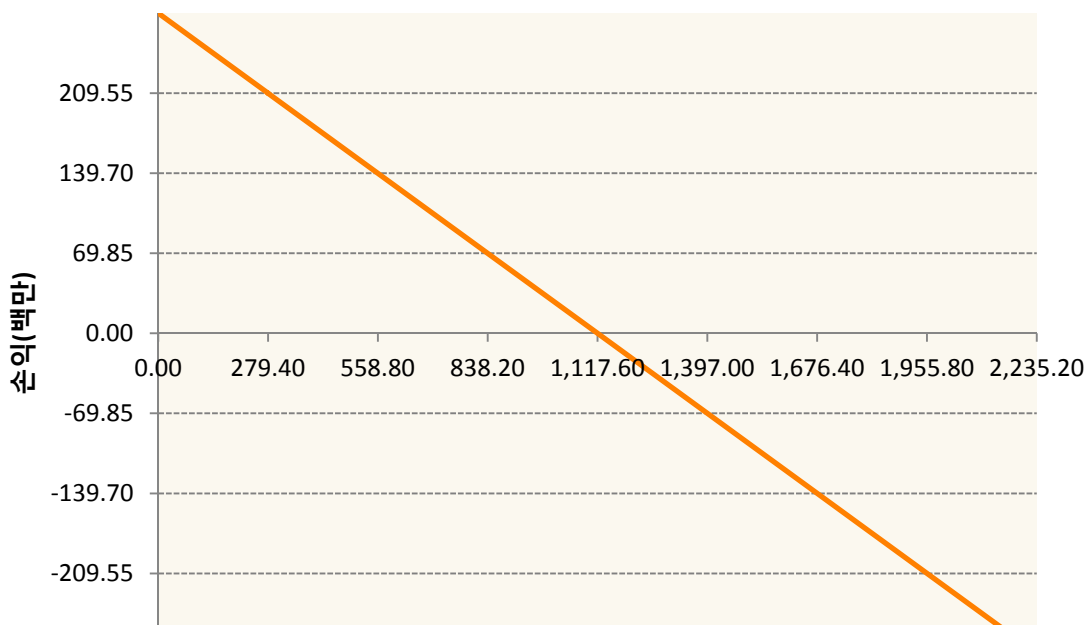


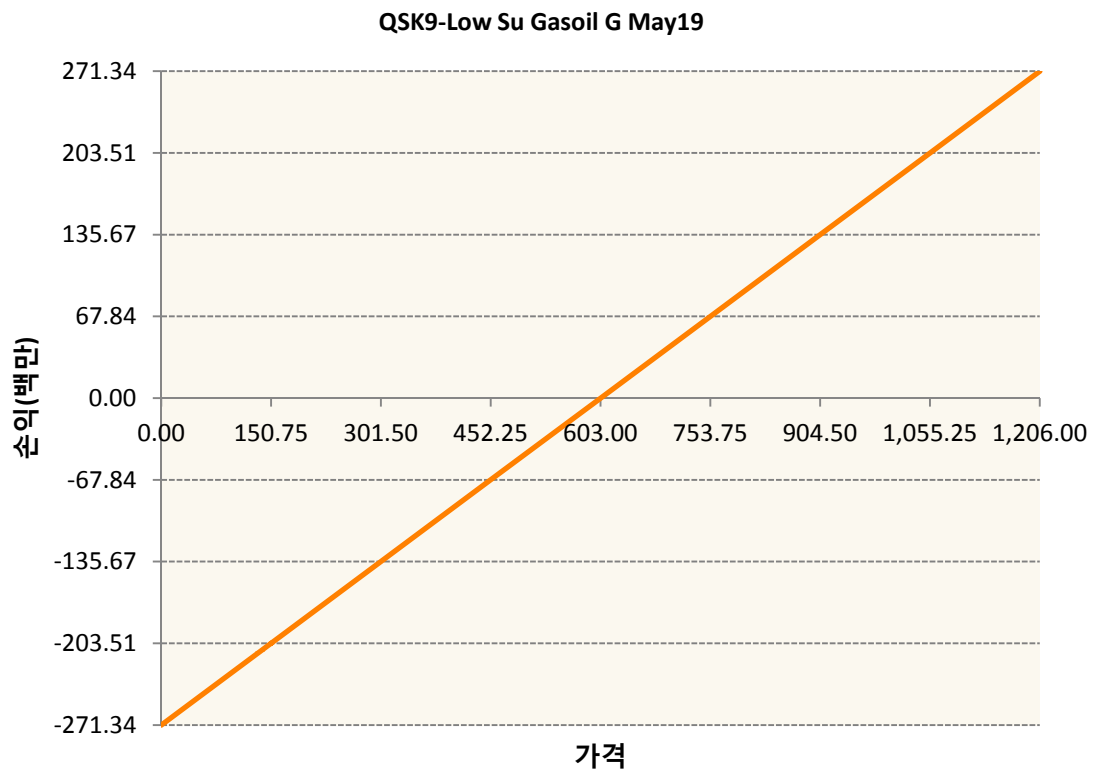
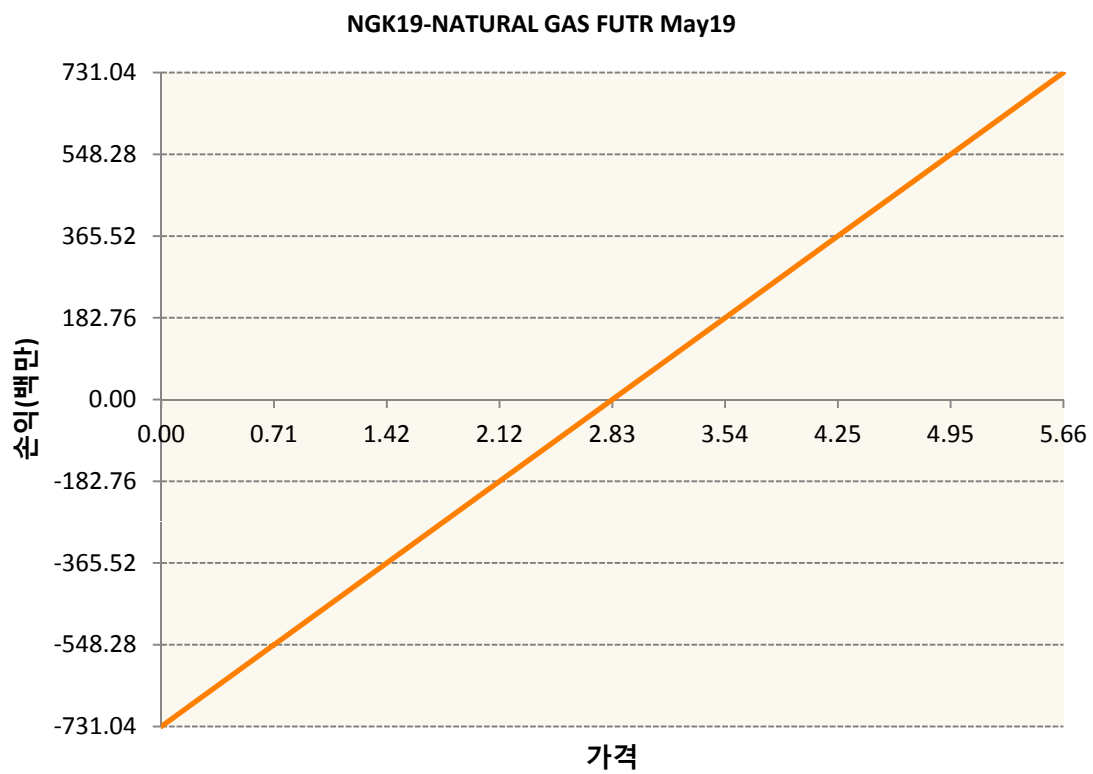
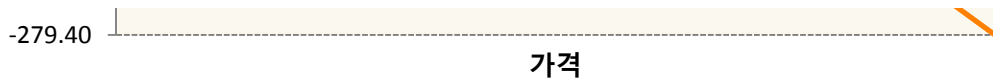


HOK9-NY Harb ULSD Fut May19

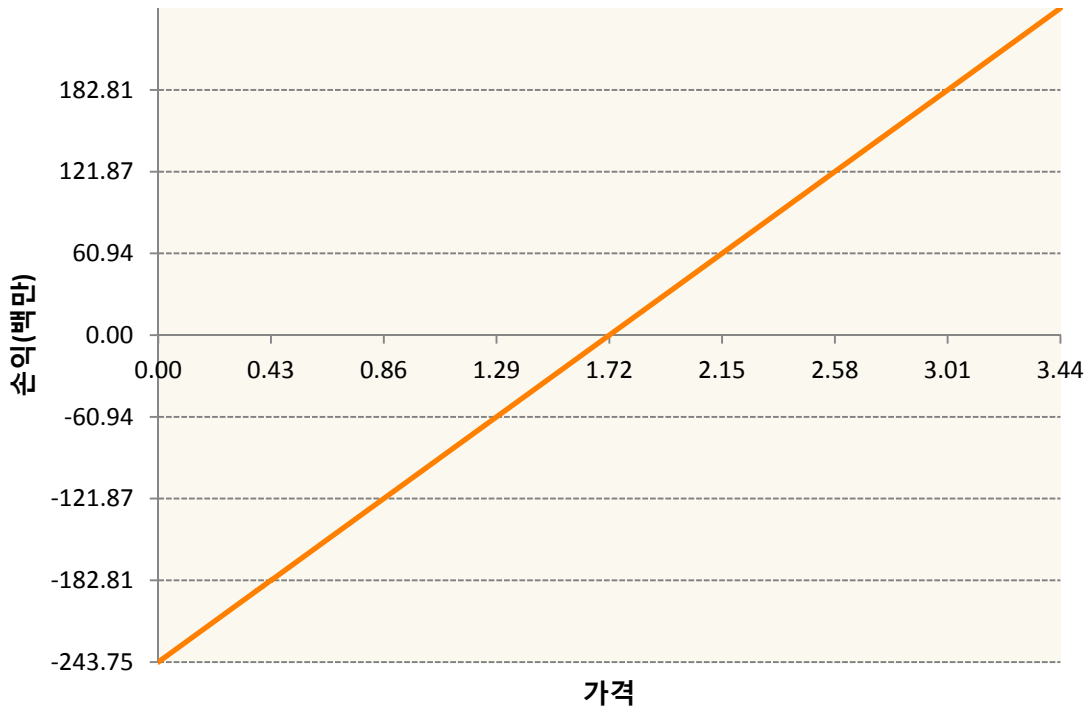


KR4175P30001-2019-03 달러선물





XBK9-GASOLINE RBOB FUT May19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

CLK9	WTI CRUDE FUTURE May19	50
COK9	BRENT CRUDE FUTR May19	58
HOK9	NY Harb ULSD Fut May19	15
KR4175P300	2019-03 달러선물	22
NGK19	NATURAL GAS FUTR May19	58
QSK9	Low Su Gasoil G May19	22
XBK9	GASOLINE RBOB FUT May19	19

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

(단위:백만원)

429

공시일	2019-02-27
기준일	2019-02-26

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

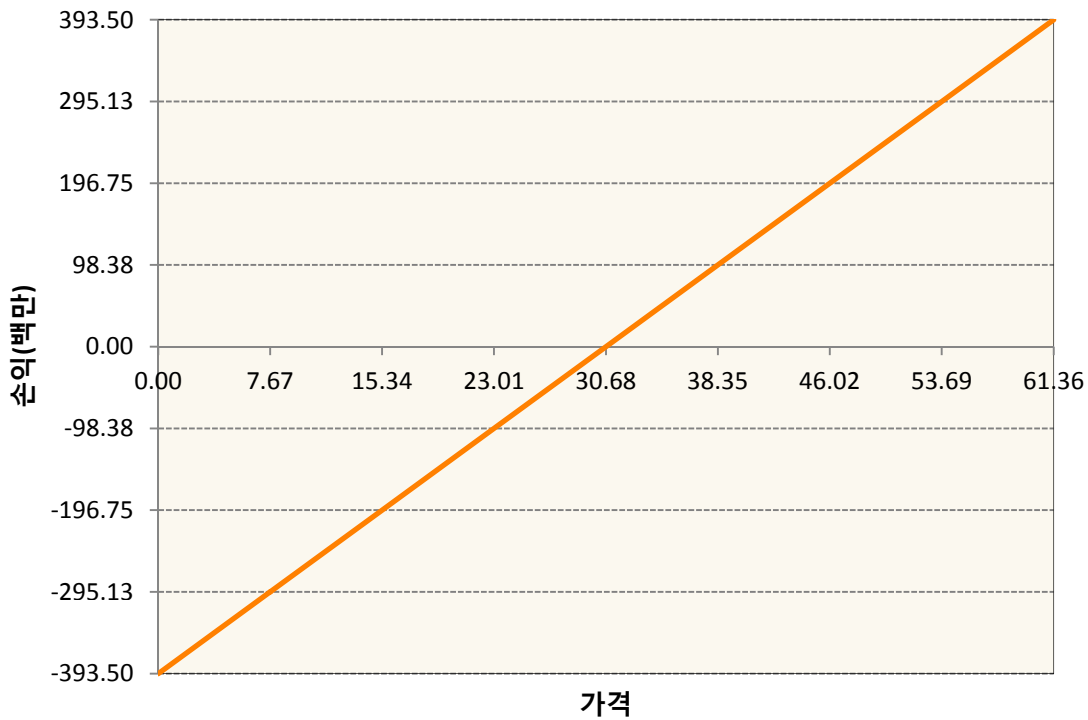
1. 계약금액

(단위:백만원)

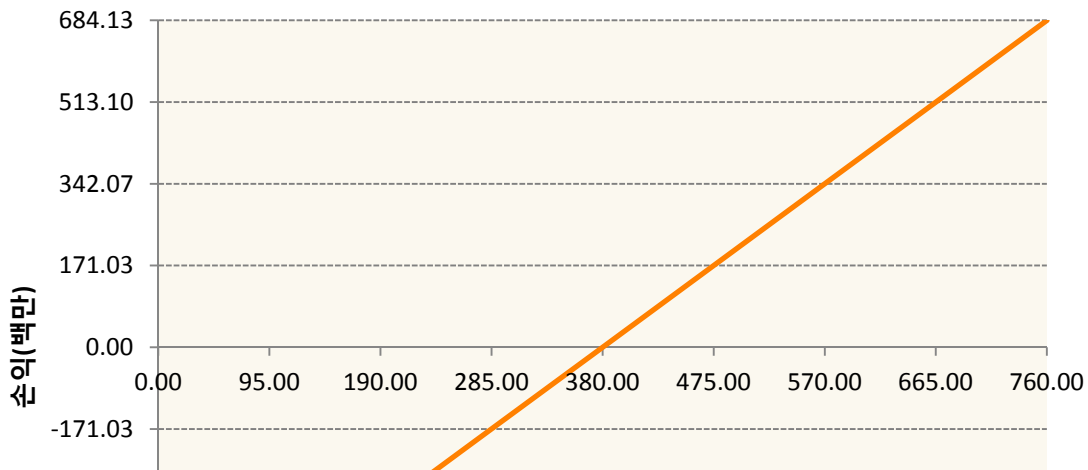
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,456	78	3,378	

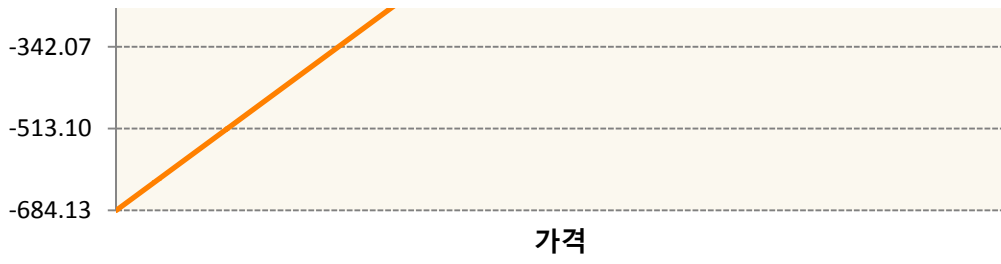
2. 만기시점의 손익구조

BOK9-SOYBEAN OIL FUTR May19

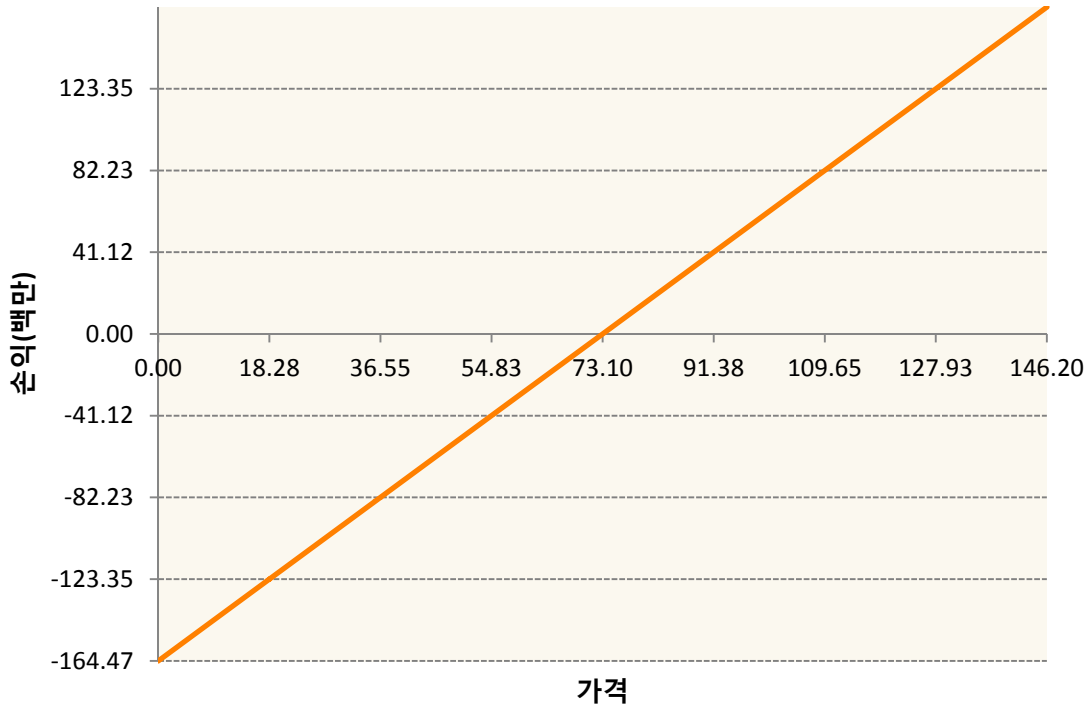


CK9-CORN FUTURE May19

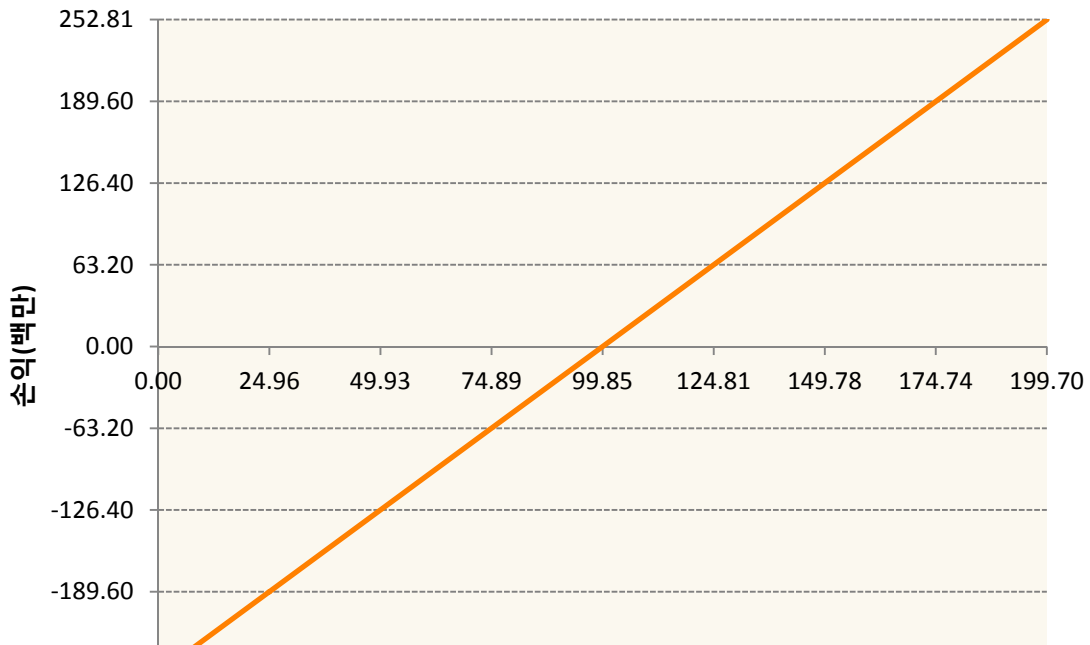


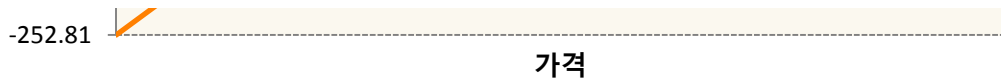


CTK9-COTTON NO.2 FUTR May19

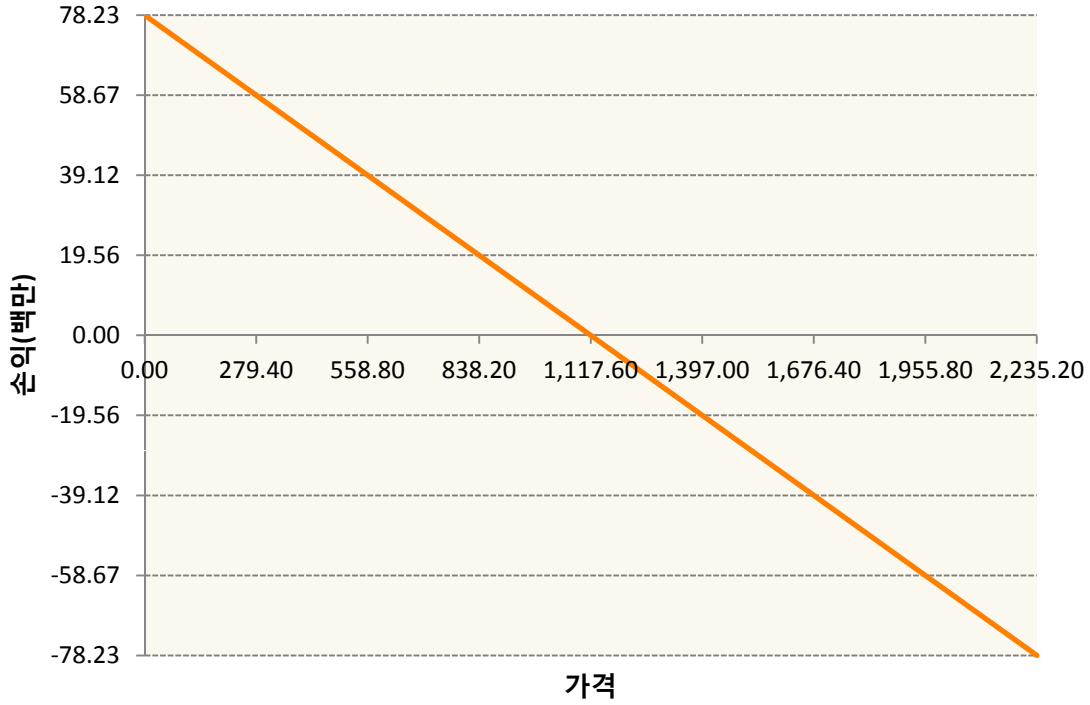


KCK9-COFFEE 'C' FUTURE May19

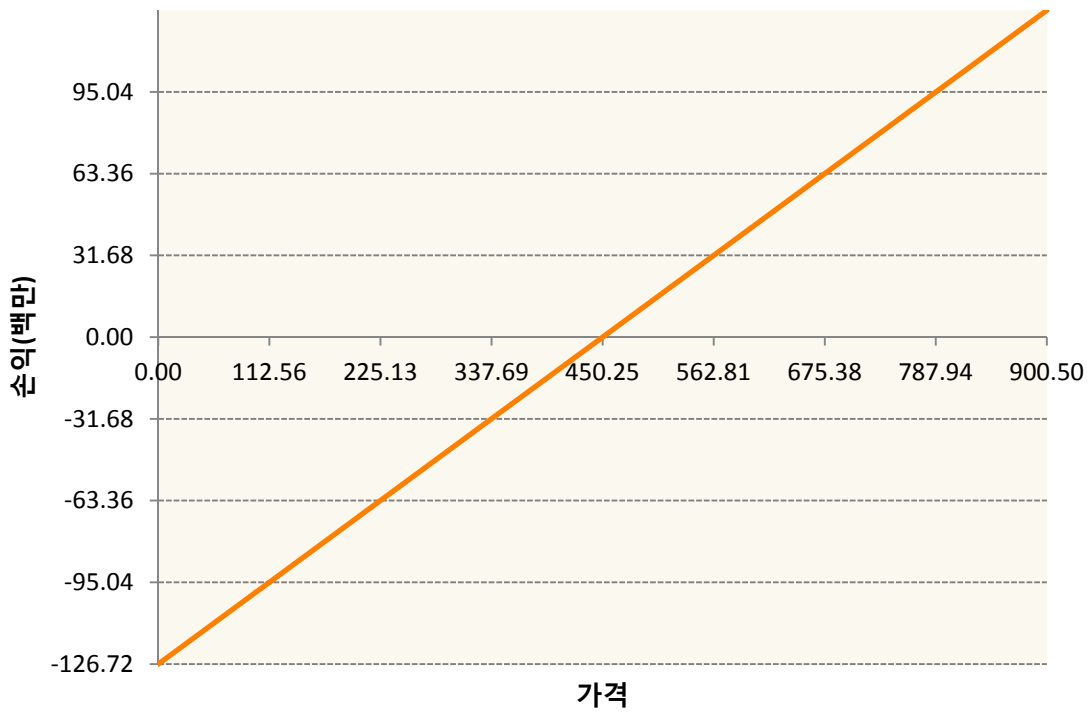




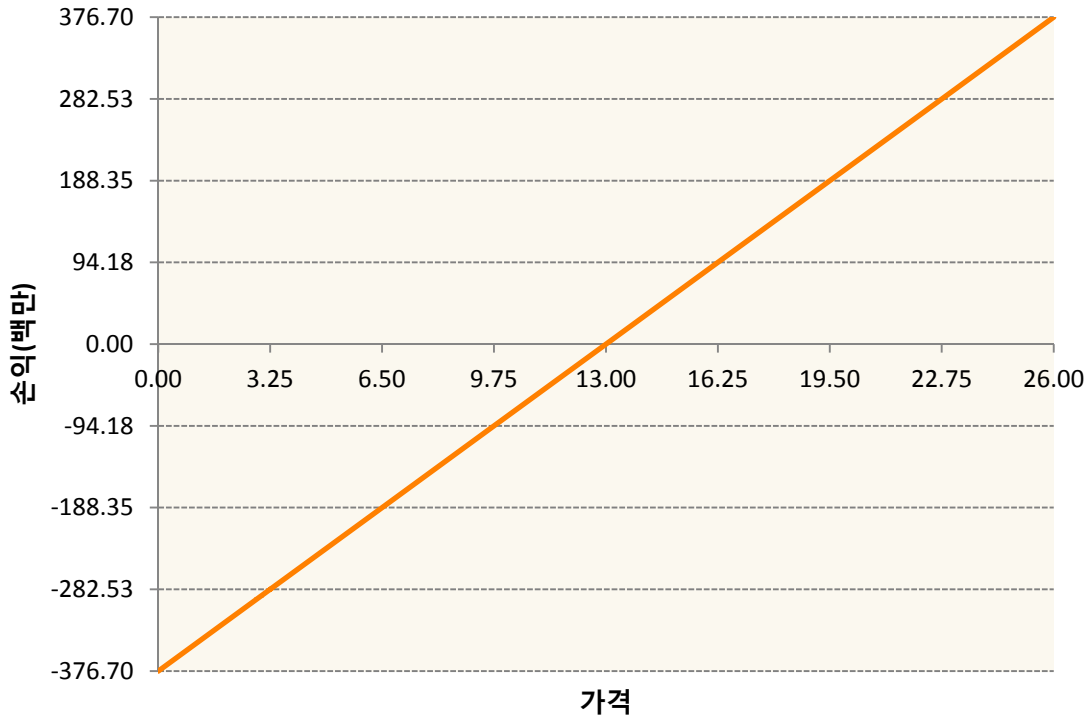
KR4175P30001-2019-03 달러선물



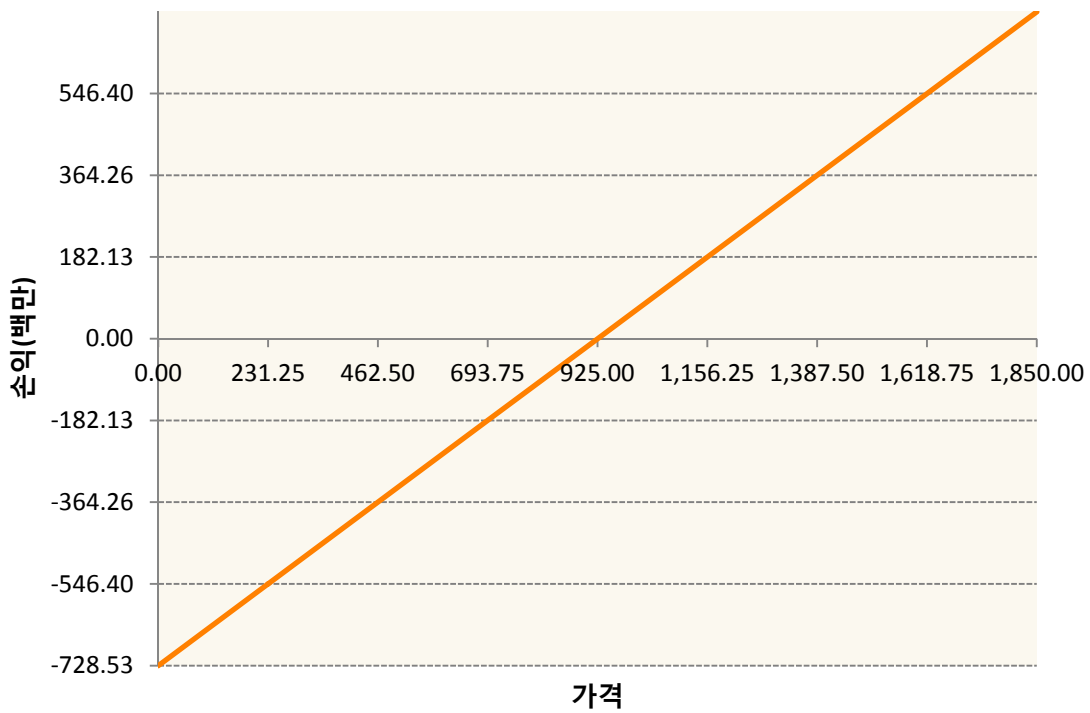
KWK9-KC HRW WHEAT FUT May19



SBK9-SUGAR #11 (WORLD) May19

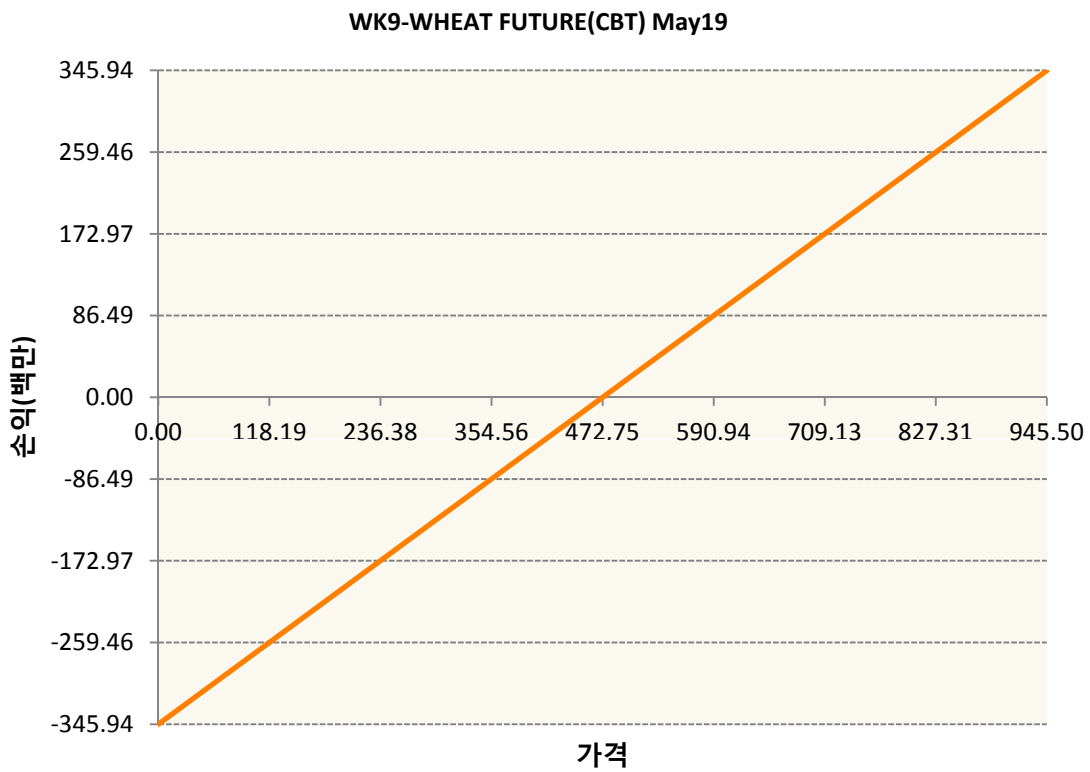
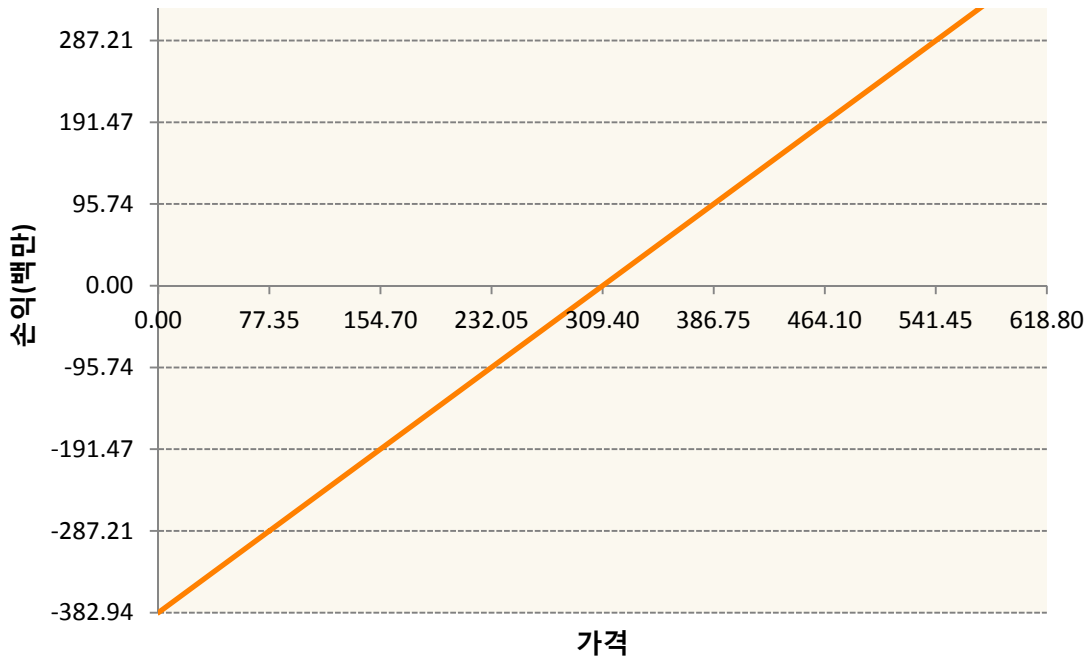


SK9-SOYBEAN FUTURE May19



SMK9-SOYBEAN MEAL FUTR May19





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
BOK9	SOYBEAN OIL FUTR May19	31
CK9	CORN FUTURE May19	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	30
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)

276