

공시일	2019-03-04
기준일	2019-02-28

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)

97

공시일	2019-03-04
기준일	2019-02-28

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	2019-03-04
기준일	2019-02-28

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)

617

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-03-04
기준일	2019-02-28

유로인덱스모(주식-파생형)

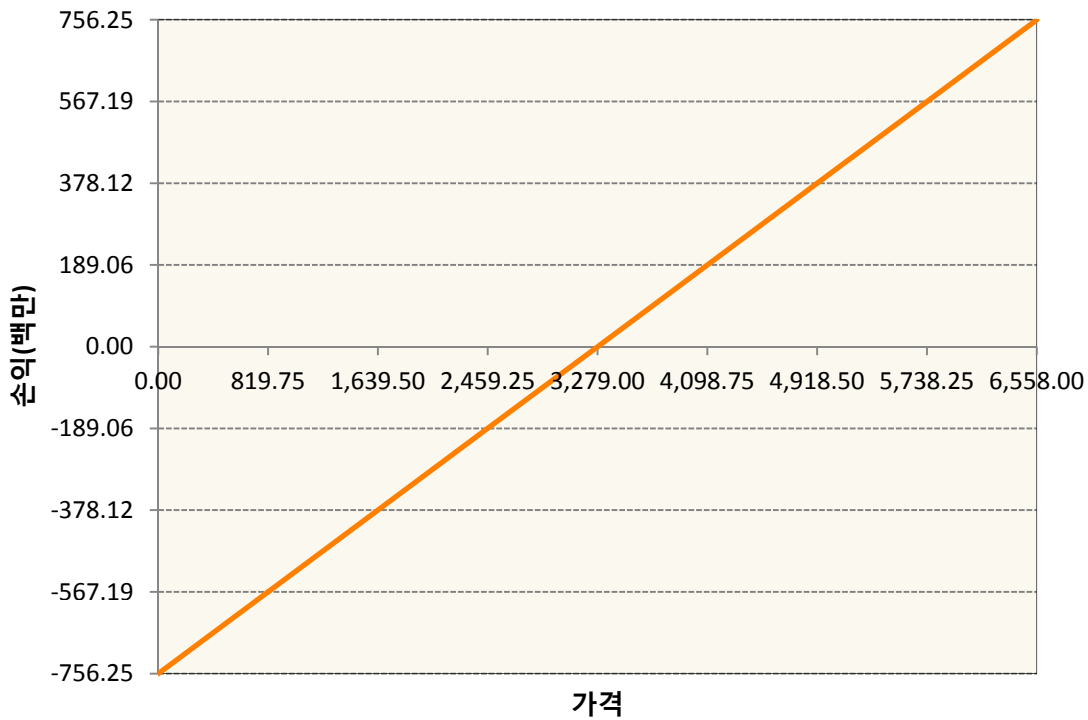
1. 계약금액

(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	2019-03-04
기준일	2019-02-28

차이나인덱스모(주식-파생형)

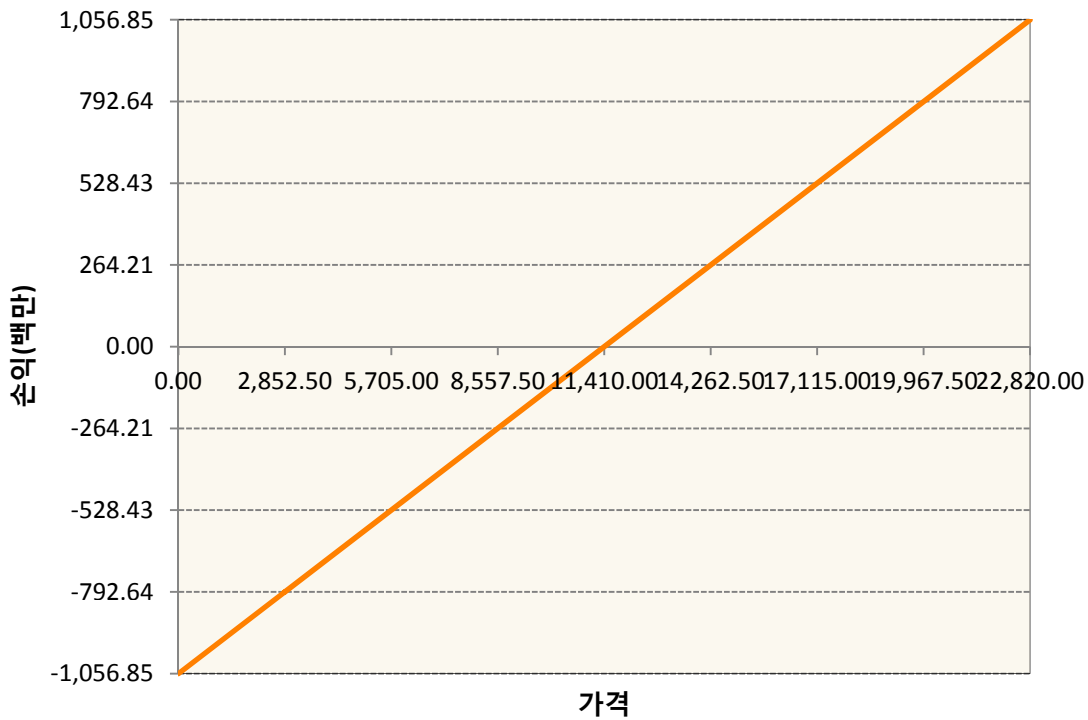
1. 계약금액

(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

HCH9-HSCEI Futures Mar19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCH9	HSCEI Futures Mar19	85
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

87

공시일	2019-03-04
기준일	2019-02-28

커버드콜모(주식혼합-파생형)

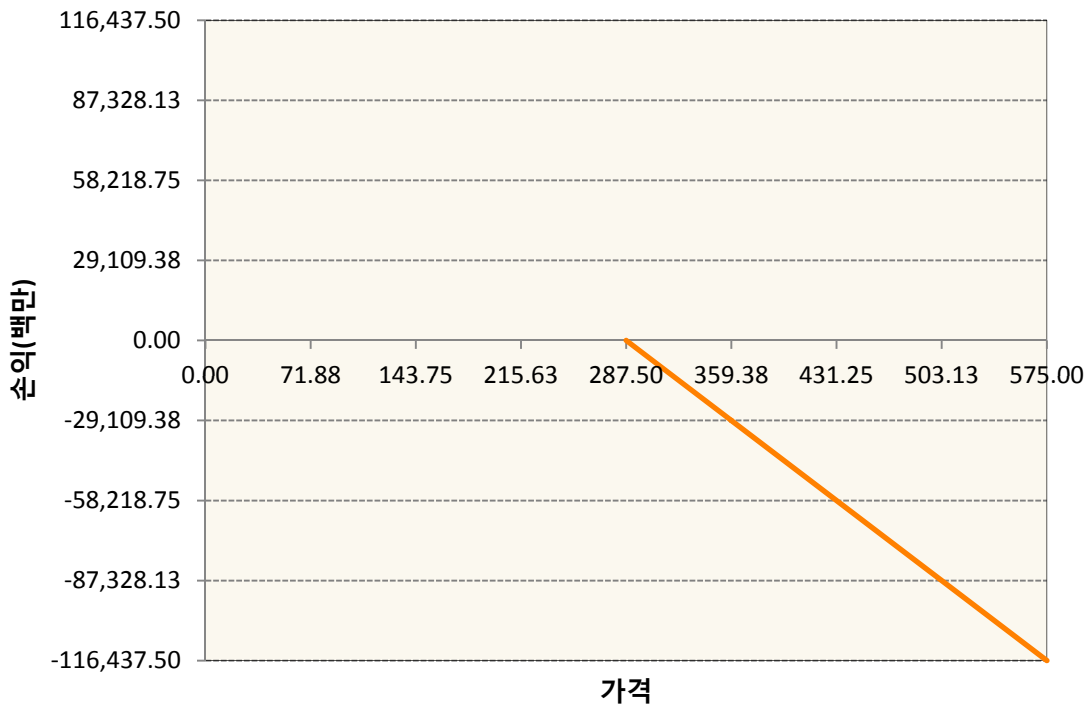
1. 계약금액

(단위:백만원)

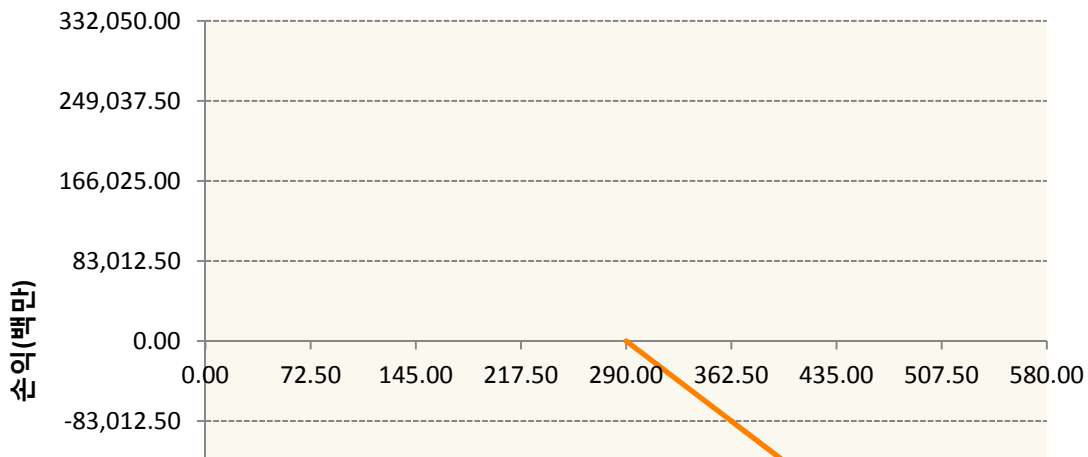
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	3,552	0	3,552	장내
누계	유가증권	옵션	0	689,269	-689,269	장내

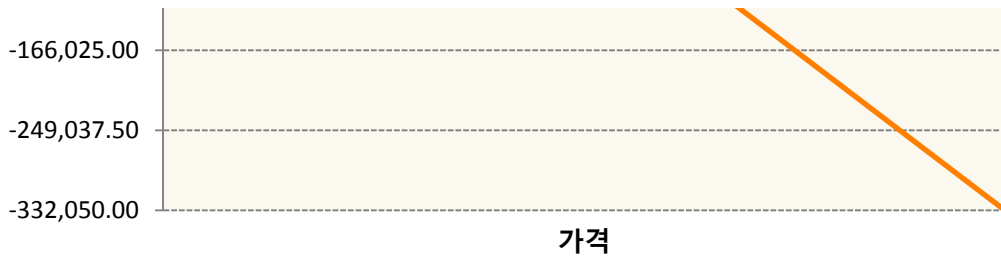
2. 만기시점의 손익구조

KR4201P32878-2019-03 콜287.5

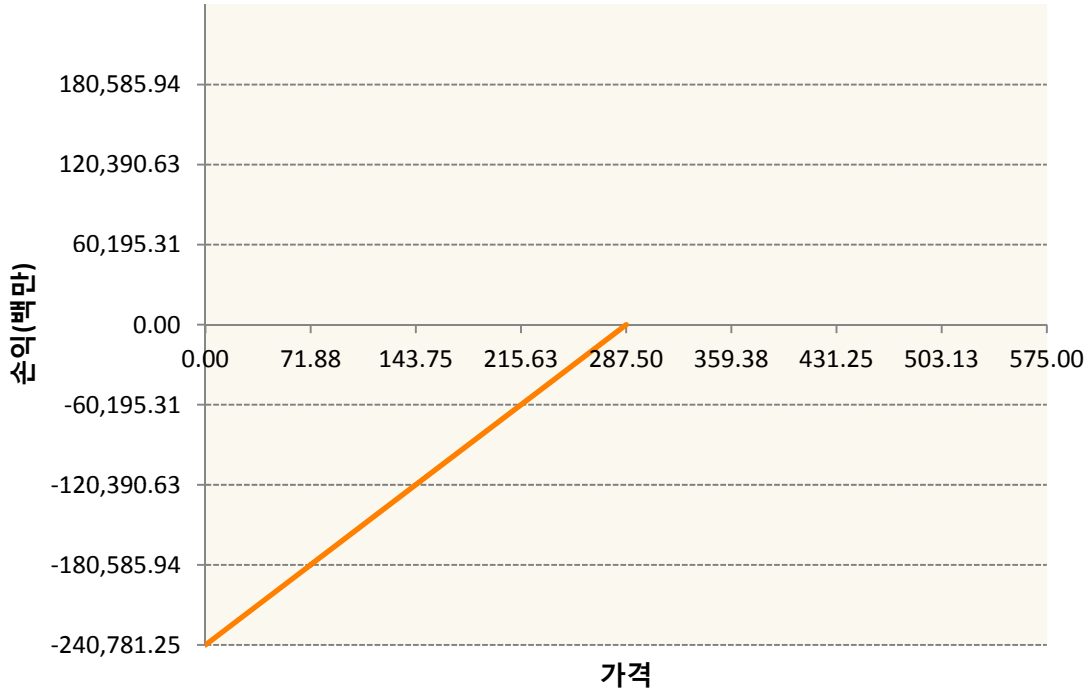


KR4201P32902-2019-03 콜290





KR4301P32876-2019-03 풋287.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201P32878		2019-03 콜287.5					6,633	
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	1,686	1,674	1,655	1,627	1,589	1,542	1,485	
-5.33%	1,626	1,578	1,516	1,441	1,355	1,258	1,152	
-2.67%	1,354	1,234	1,102	962	815	661	502	
0%	569	381	191	0	-192	-385	-579	
2.67%	-989	-1,180	-1,372	-1,565	-1,760	-1,955	-2,151	
5.33%	-3,294	-3,423	-3,563	-3,712	-3,868	-4,030	-4,197	
8.00%	-6,074	-6,134	-6,209	-6,298	-6,400	-6,512	-6,633	
KR4201P32902		2019-03 콜290					17,449	
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	3,755	3,736	3,700	3,644	3,565	3,461	3,331	

-5.33%	3,657	3,563	3,434	3,270	3,072	2,844	2,588
-2.67%	3,151	2,880	2,572	2,232	1,865	1,476	1,069
0%	1,497	1,010	510	0	-518	-1,041	-1,570
2.67%	-2,153	-2,719	-3,285	-3,852	-4,420	-4,987	-5,555
5.33%	-8,023	-8,461	-8,922	-9,400	-9,892	-10,396	-10,908
8.00%	-15,519	-15,753	-16,028	-16,341	-16,685	-17,055	-17,449
KR4301P32876 2019-03 풋287.5							17,440
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-17,426	-17,426	-17,426	-17,427	-17,429	-17,433	-17,440
-5.33%	-11,095	-11,099	-11,107	-11,122	-11,144	-11,176	-11,216
-2.67%	-4,840	-4,898	-4,972	-5,061	-5,165	-5,282	-5,411
0%	633	427	216	0	-219	-441	-665
2.67%	3,760	3,552	3,338	3,120	2,898	2,674	2,447
5.33%	4,608	4,543	4,460	4,361	4,247	4,120	3,982
8.00%	4,700	4,693	4,680	4,659	4,627	4,585	4,532

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

(단위:백만원)

43,756

공시일	2019-03-04
기준일	2019-02-28

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

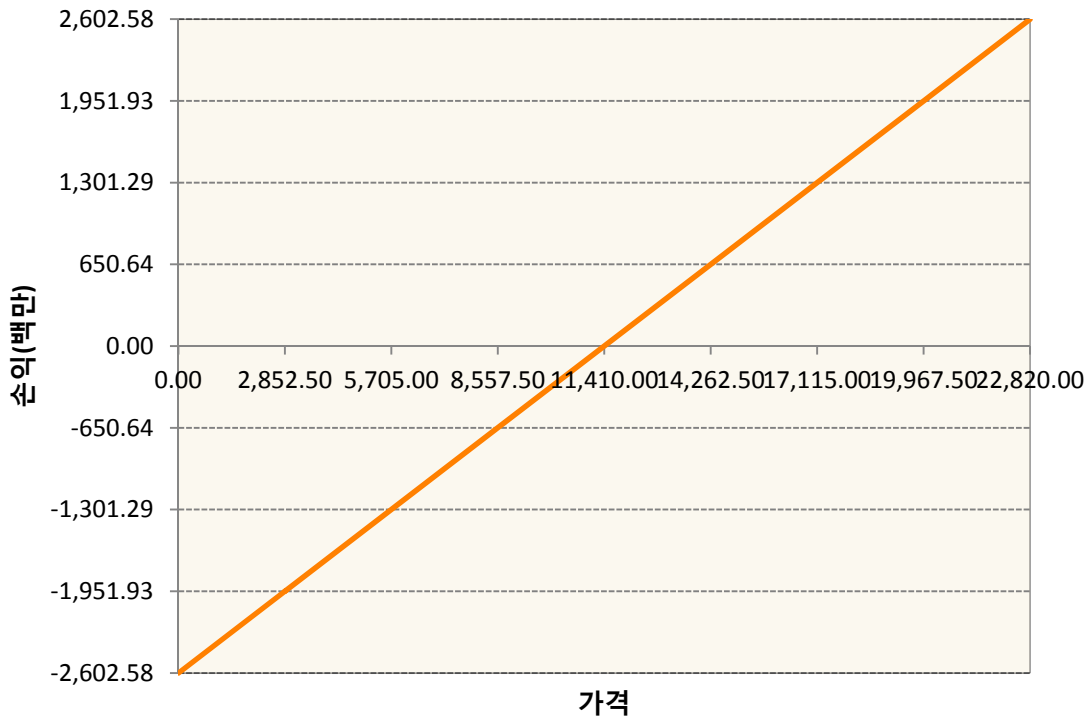
1. 계약금액

(단위:백만원)

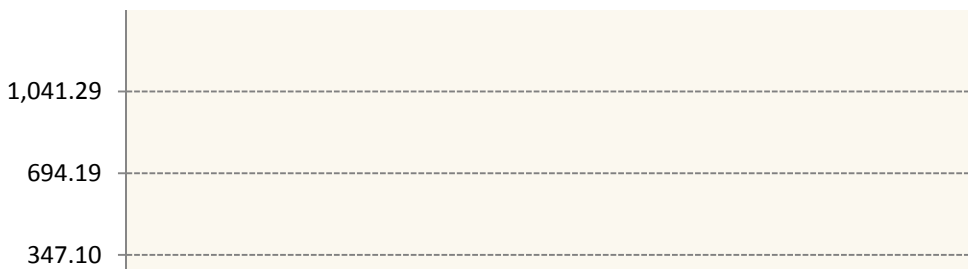
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	2,603	0	2,603	장내
누계	유가증권	옵션	0	6,567	-6,567	장내
누계	통화	선도	0	2,722	-2,722	장외

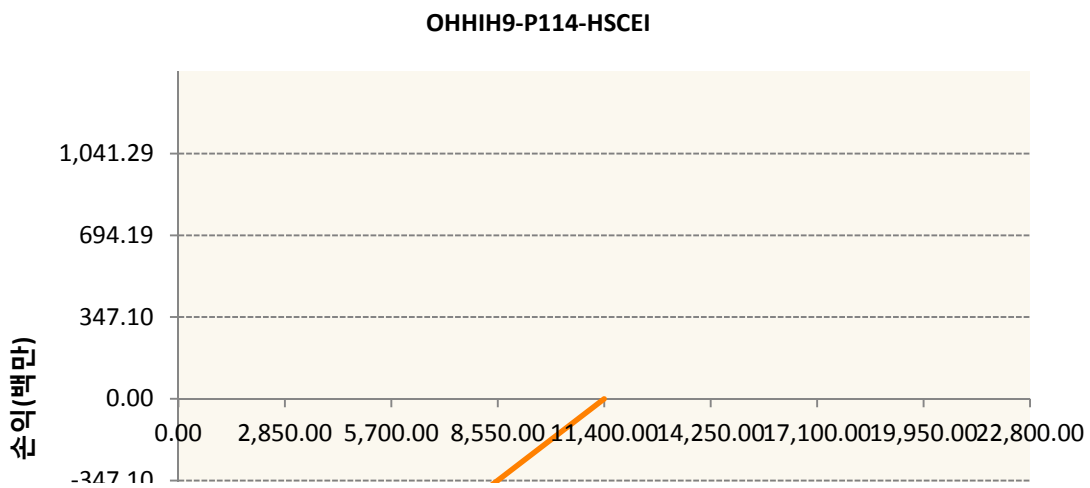
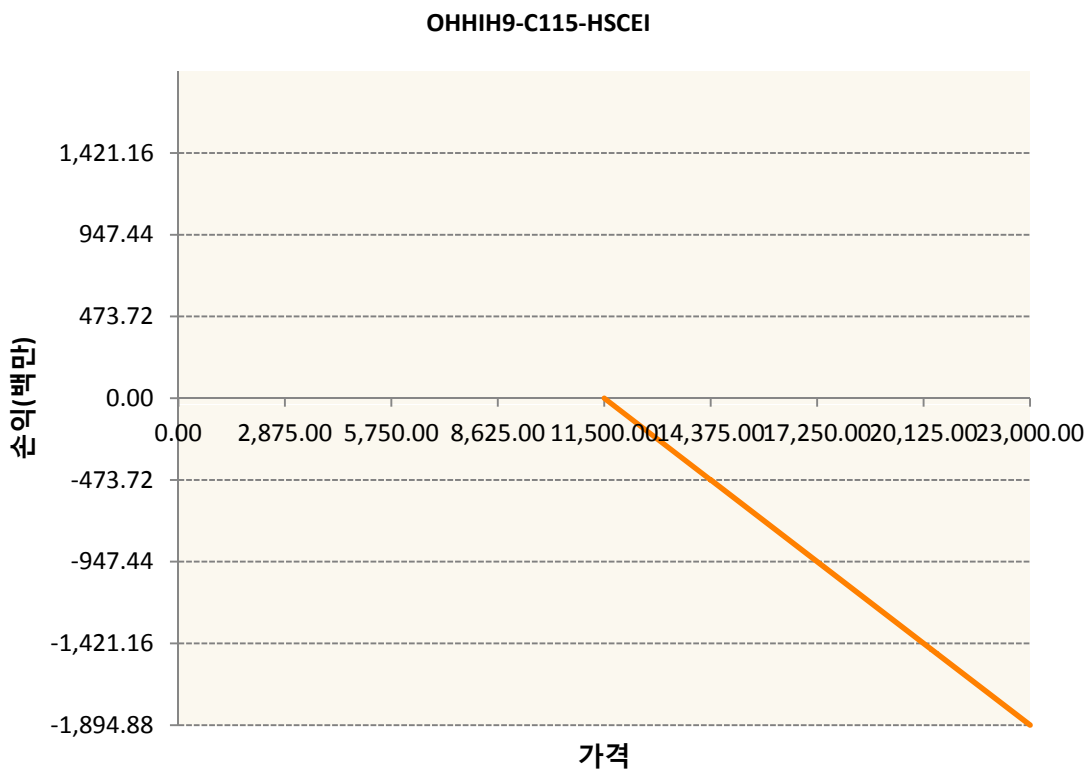
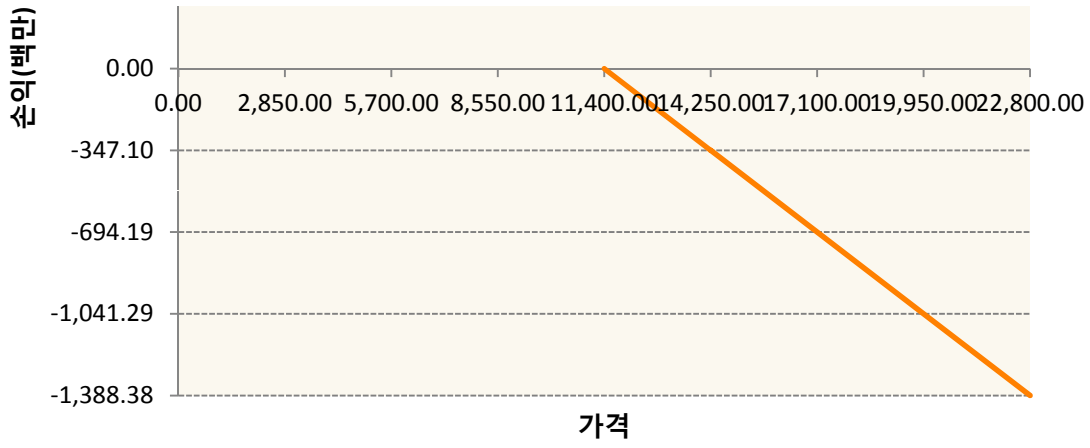
2. 만기시점의 손익구조

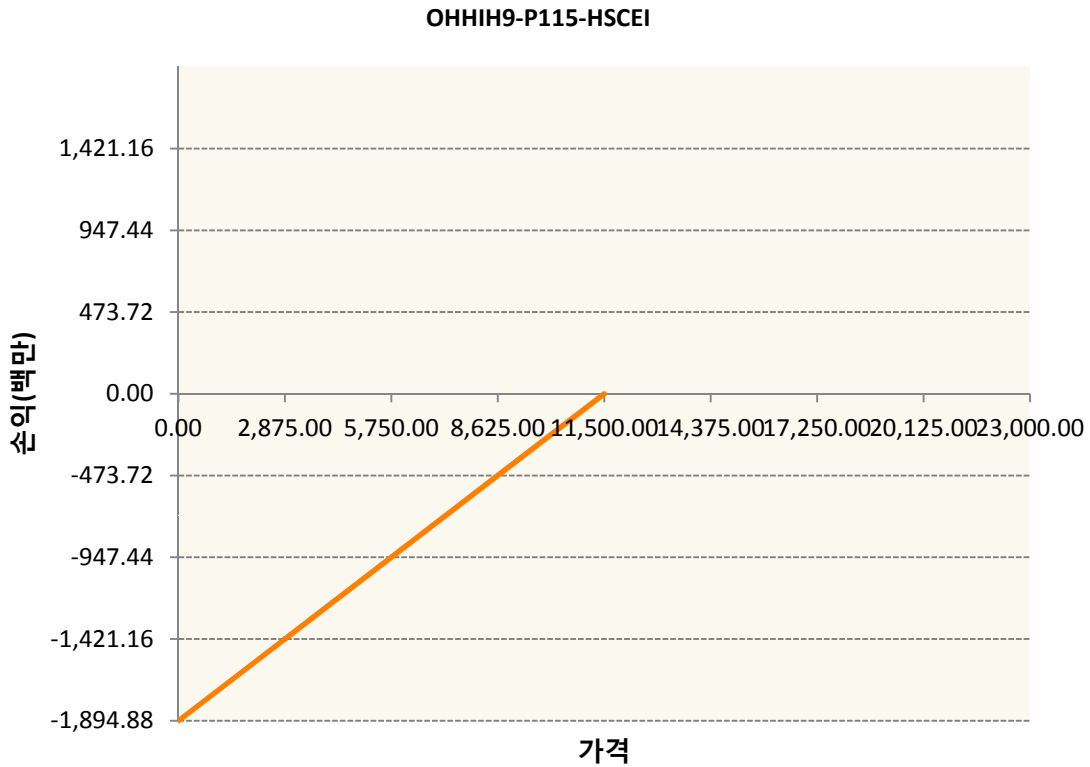
HCH9-HSCEI Futures Mar19



OHHIH9-C114-HSCEI







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

FX21018Z00 KRW/HKD 11-03-19E	218
HCH9 HSCEI Futures Mar19	208
OHHIH9-C11 HSCEI	111
OHHIH9-C11 HSCEI	152
OHHIH9-P11 HSCEI	111
OHHIH9-P11 HSCEI	152

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

830

공시일	2019-03-04
기준일	2019-02-28

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

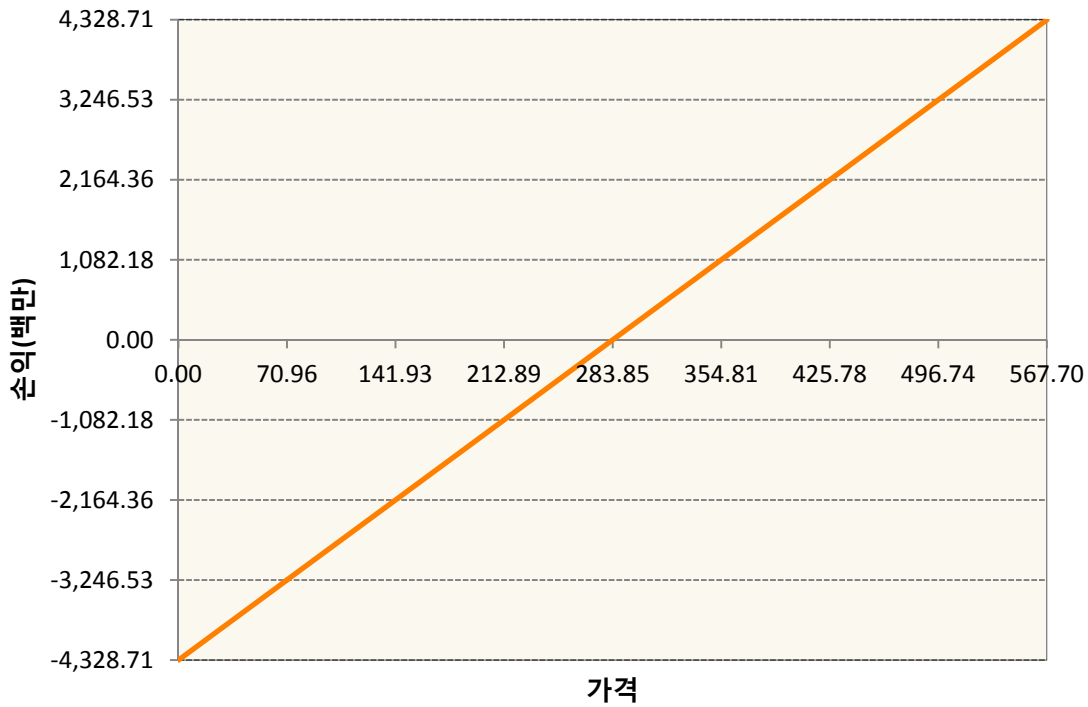
1. 계약금액

(단위:백만원)

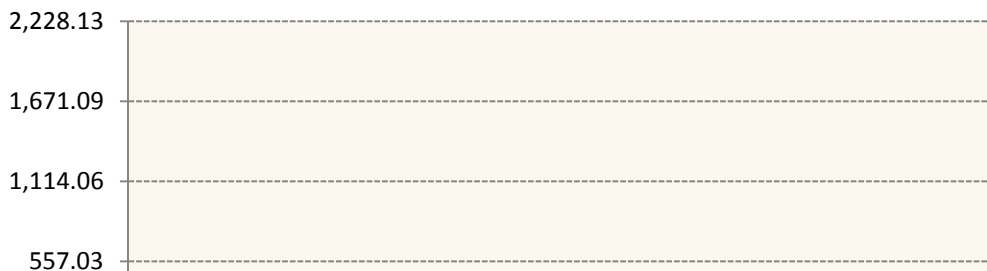
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	4,329	0	4,329	장내
누계	유가증권	스왑	28,836	0	28,836	장외
누계	유가증권	옵션	0	29,152	-29,152	장내

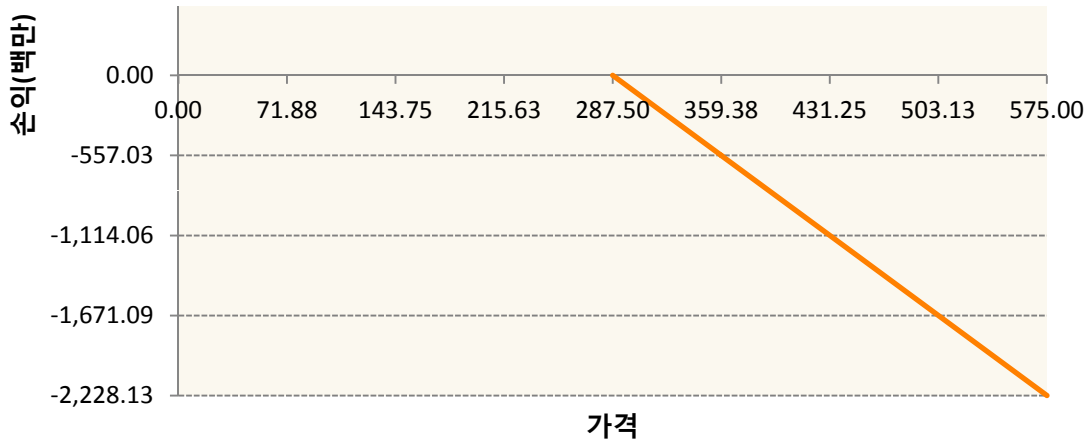
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P30007-2019-03 코스피200지수선물

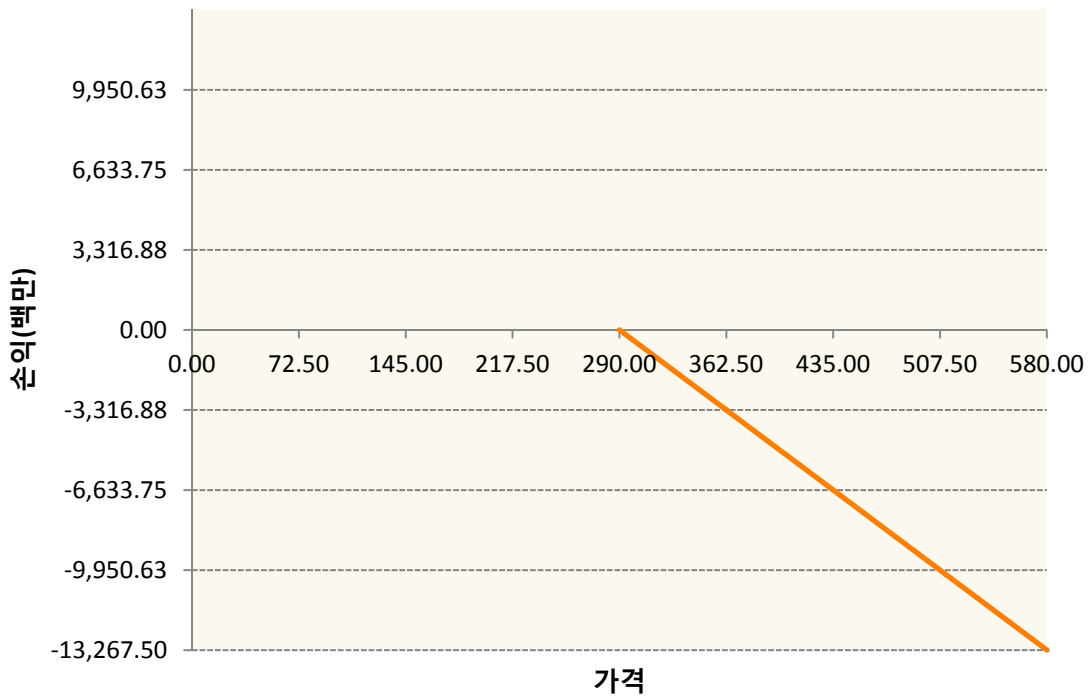


KR4201P32878-2019-03 콜287.5

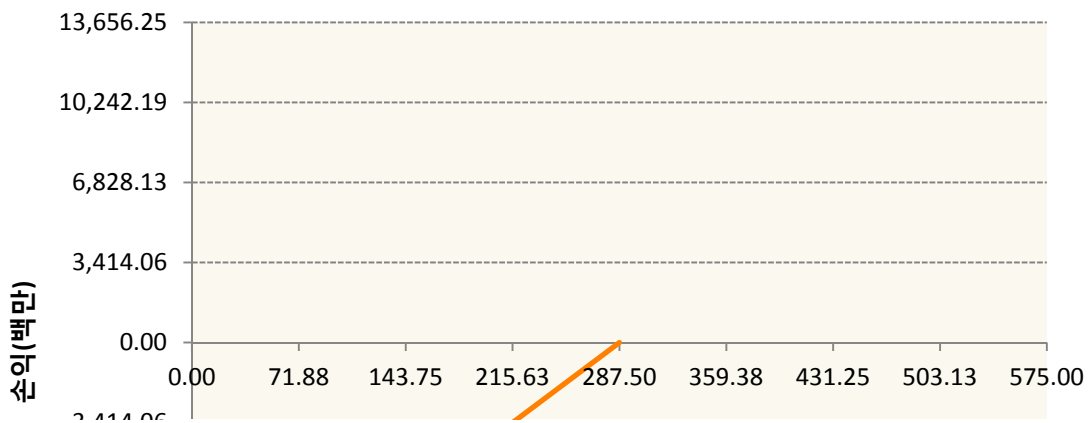


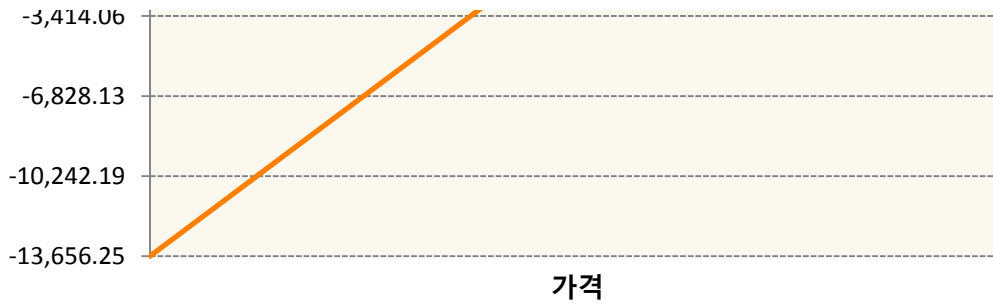


KR4201P32902-2019-03 콜290



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						346
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-346	-346	-346	-346	-346	-346	-346	
-5.33%	-231	-231	-231	-231	-231	-231	-231	
-2.67%	-115	-115	-115	-115	-115	-115	-115	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	115	115	115	115	115	115	115	
5.33%	231	231	231	231	231	231	231	
8.00%	346	346	346	346	346	346	346	
KR4201P32878		2019-03 콜287.5						127
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	32	32	32	31	30	30	28	
-5.33%	31	30	29	28	26	24	22	
-2.67%	26	24	21	18	16	13	10	
0%	11	7	4	0	-4	-7	-11	
2.67%	-19	-23	-26	-30	-34	-37	-41	
5.33%	-63	-65	-68	-71	-74	-77	-80	
8.00%	-116	-117	-119	-121	-122	-125	-127	
KR4201P32902		2019-03 콜290						697
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	

-8.00%	150	149	148	146	142	138	133
-5.33%	146	142	137	131	123	114	103
-2.67%	126	115	103	89	75	59	43
0%	60	40	20	0	-21	-42	-63
2.67%	-86	-109	-131	-154	-177	-199	-222
5.33%	-321	-338	-356	-376	-395	-415	-436
8.00%	-620	-629	-640	-653	-667	-681	-697
KR4301P32876 2019-03 풋287.5							989
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-988	-988	-988	-988	-989	-989	-989
-5.33%	-629	-629	-630	-631	-632	-634	-636
-2.67%	-275	-278	-282	-287	-293	-300	-307
0%	36	24	12	0	-12	-25	-38
2.67%	213	201	189	177	164	152	139
5.33%	261	258	253	247	241	234	226
8.00%	267	266	265	264	262	260	257

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

(단위:백만원)

4,671

공시일	2019-03-04
기준일	2019-02-28

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

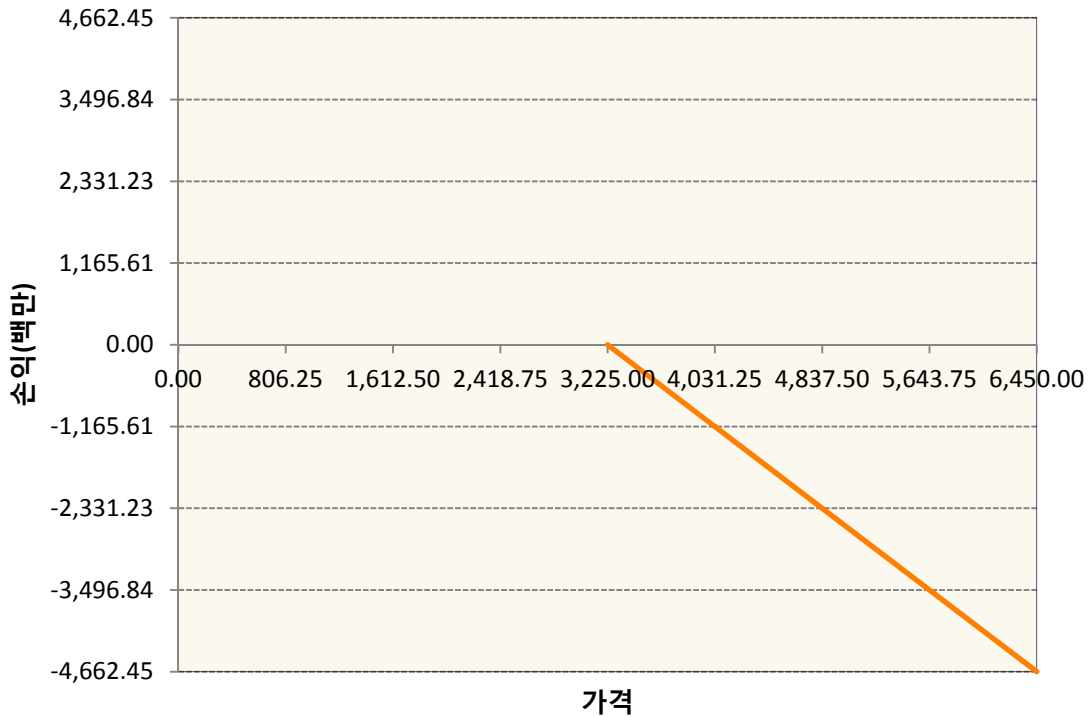
1. 계약금액

(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	7,098	0	7,098	
누계	유가증권	스왑	60,402	0	60,402	장외
누계	유가증권	옵션	0	26,789	-26,789	장내
누계	통화	선도	0	15,353	-15,353	장외

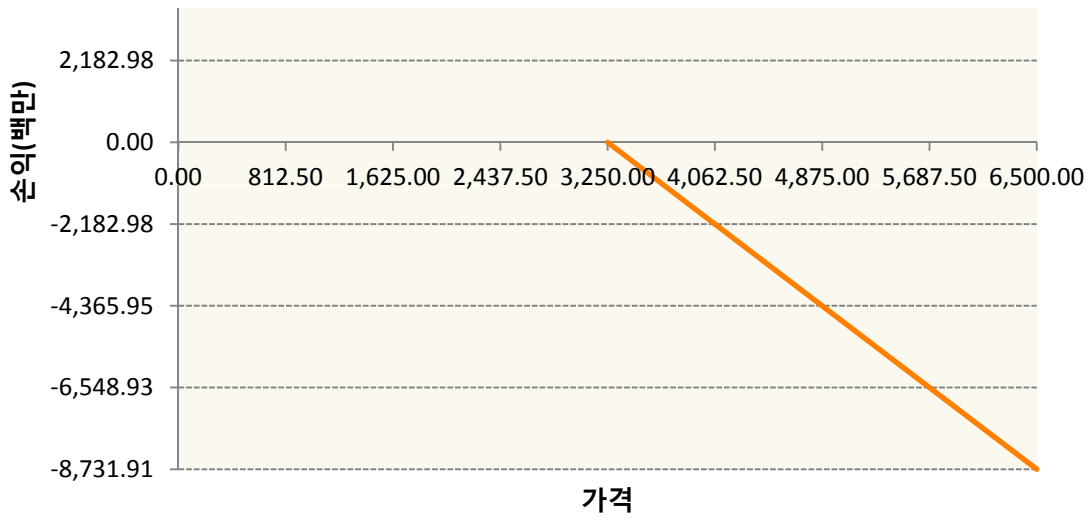
2. 만기시점의 손익구조

OESXH9-C3225-EURO STOXX 50

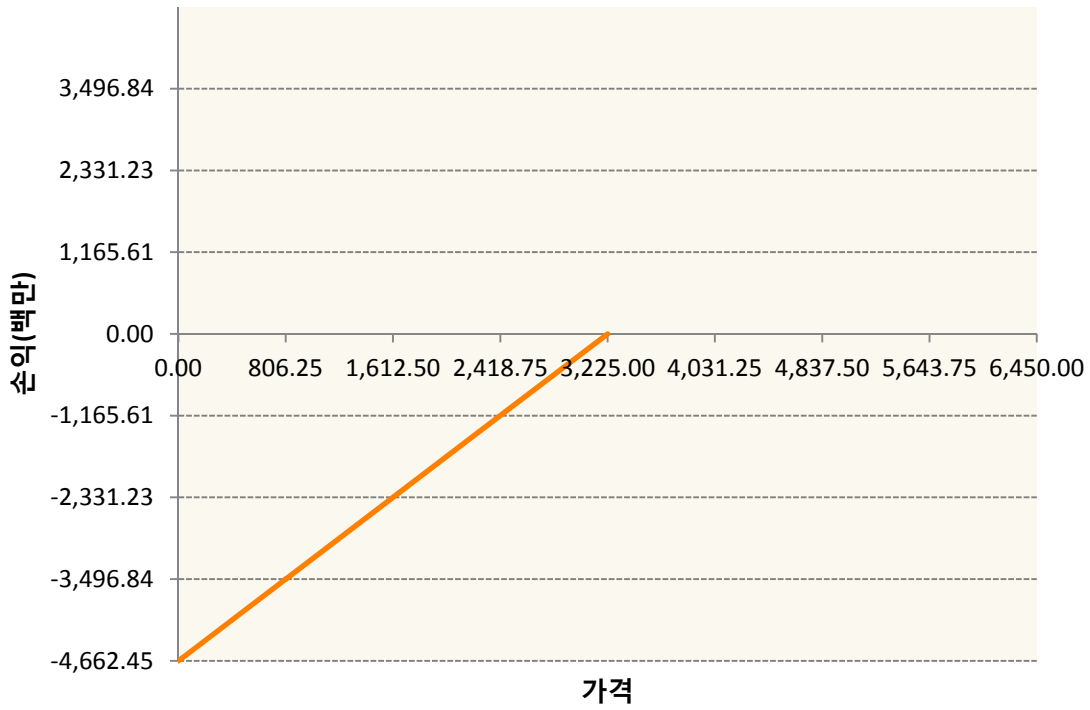


OESXH9-C3250-EURO STOXX 50

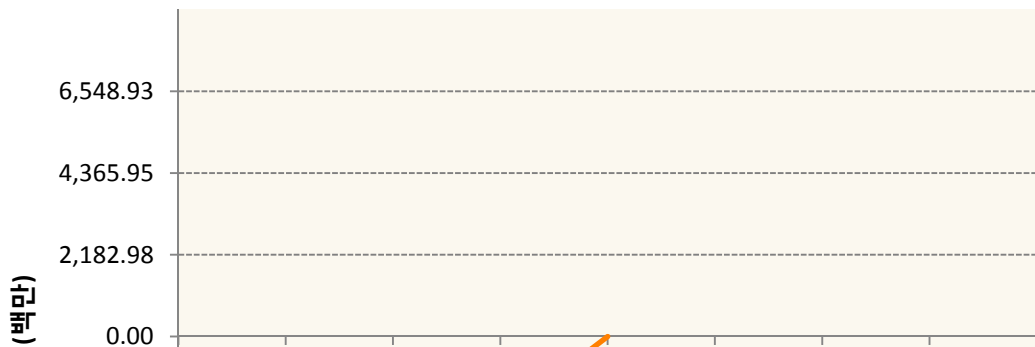


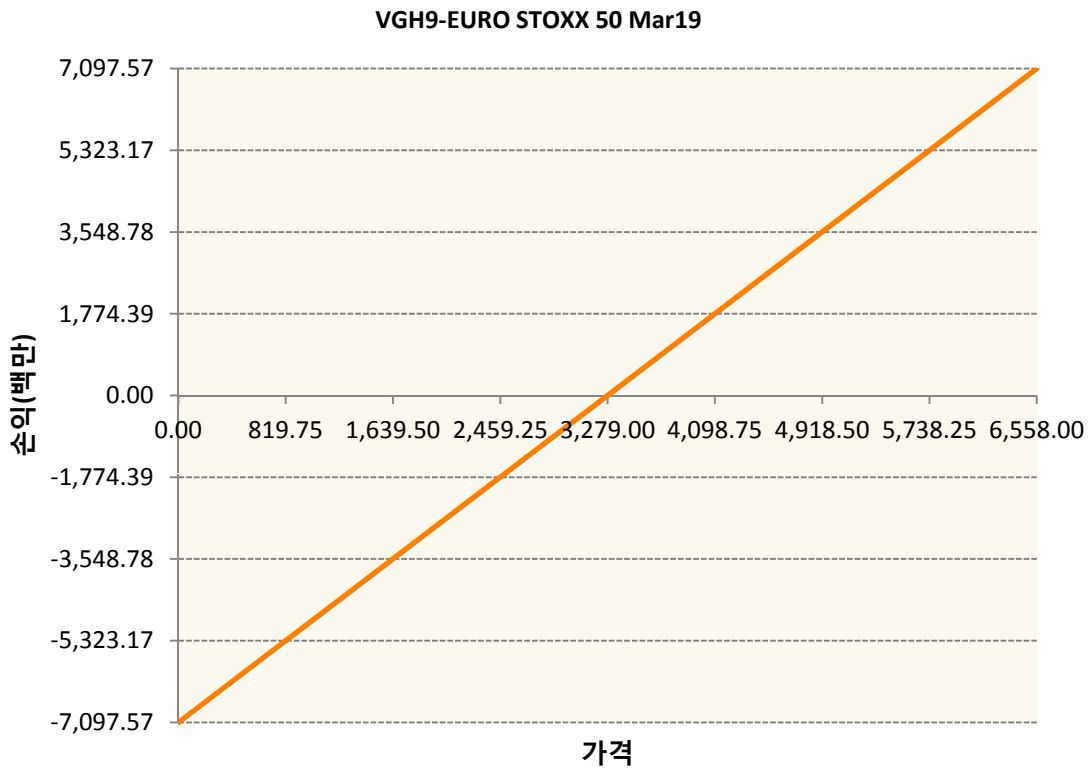
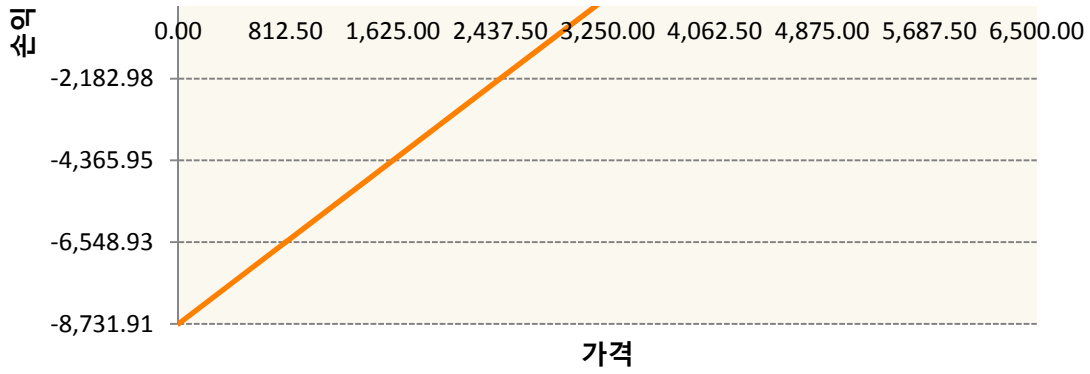


OESXH9-P3225-EURO STOXX 50



OESXH9-P3250-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY		110
FX21018Z03 KRW/EUR 22-03-19E		819
FX21019G02 KRW/EUR 24-05-19E		409
OESXH9-C32 EURO STOXX 50		373
OESXH9-C32 EURO STOXX 50		699
OESXH9-P32 EURO STOXX 50		373
OESXH9-P32 EURO STOXX 50		699
VGH9	EURO STOXX 50 Mar19	568

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

(단위:백만원)

2,663

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

(단위:백만원)

1,139

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

(단위:백만원)

97

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

(단위:백만원)

141

공시일	2019-03-04
기준일	2019-02-28

스마트KRX300인덱스목표전환형1호

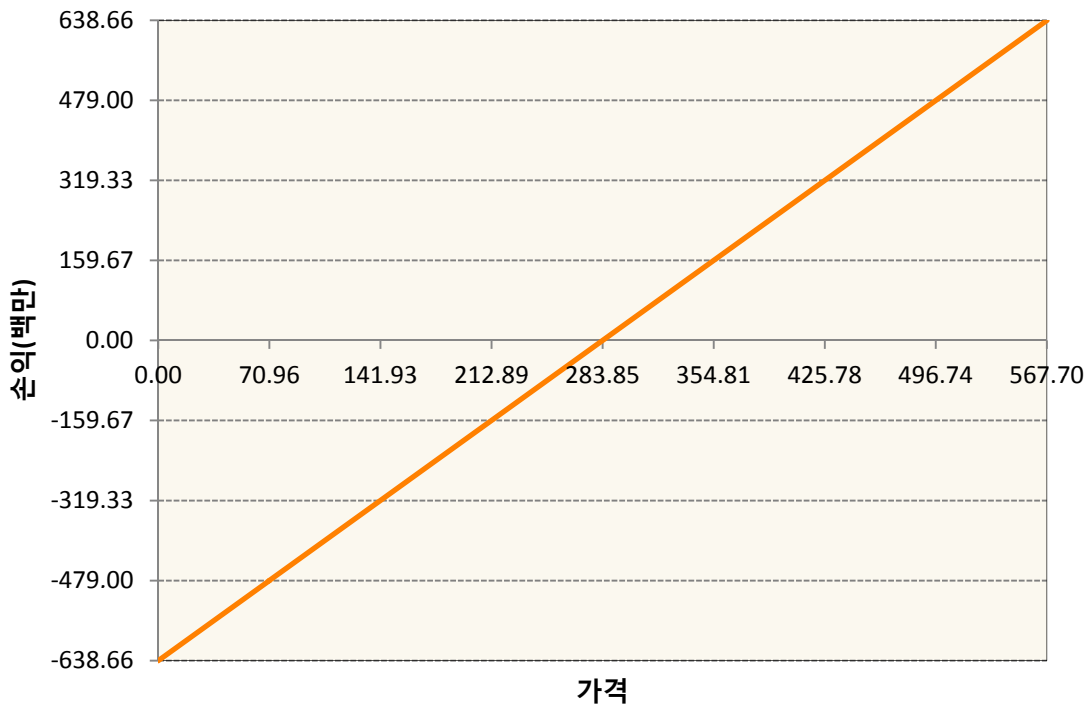
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	639	0	639	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101P30007-2019-03 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101P30007 2019-03 코스피200지수선물 51

가격	기초자산의 변동성						
	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-51	-51	-51	-51	-51	-51	-51
-5.33%	-34	-34	-34	-34	-34	-34	-34
-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%	34	34	34	34	34	34	34
8.00%	51	51	51	51	51	51	51

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

(단위:백만원)

44

공시일	2019-03-04
기준일	2019-02-28

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

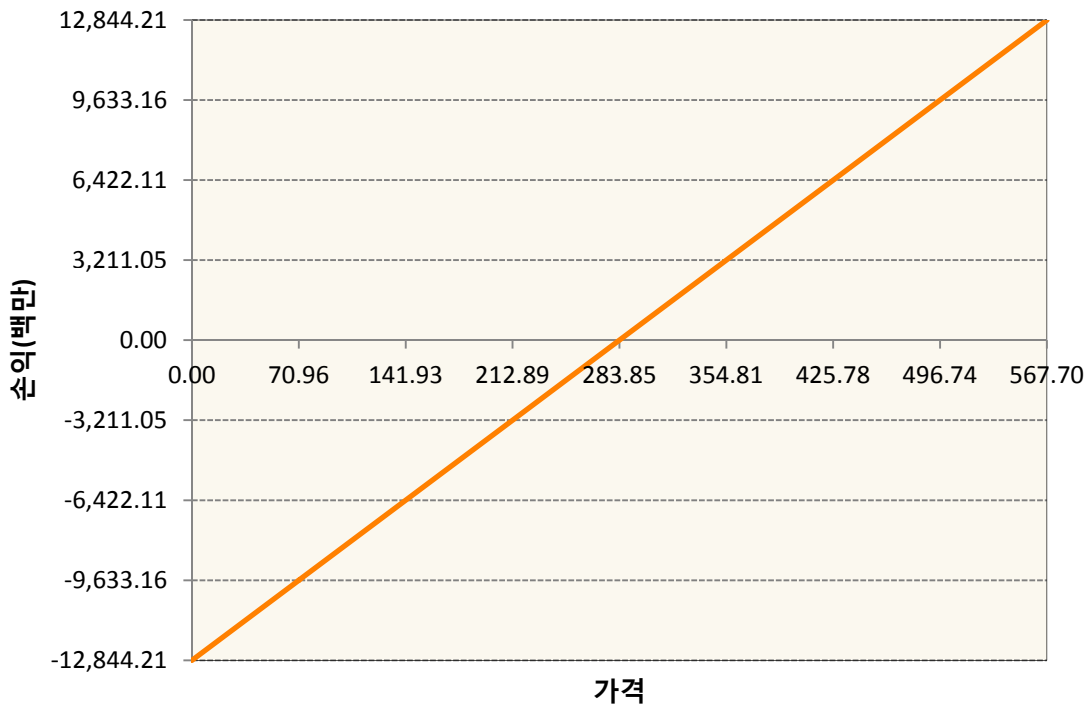
1. 계약금액

(단위:백만원)

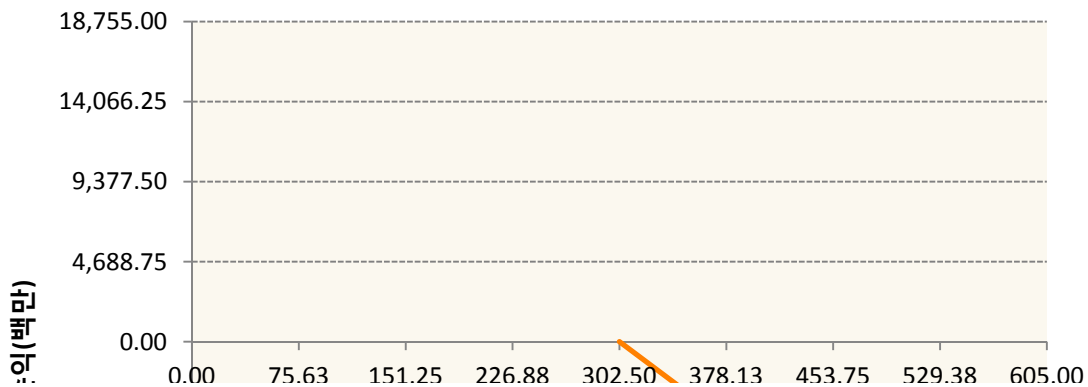
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	12,844	0	12,844	장내
누계	유가증권	옵션	2,165	24,931	-22,766	장내

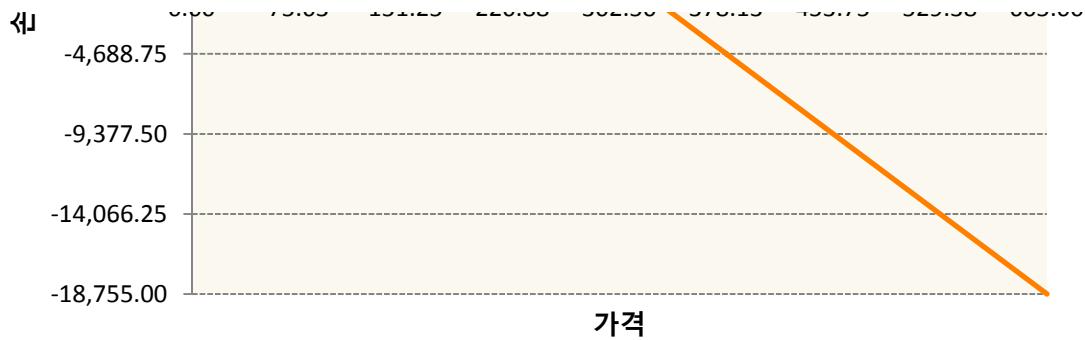
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P30007-2019-03 코스피200지수선물

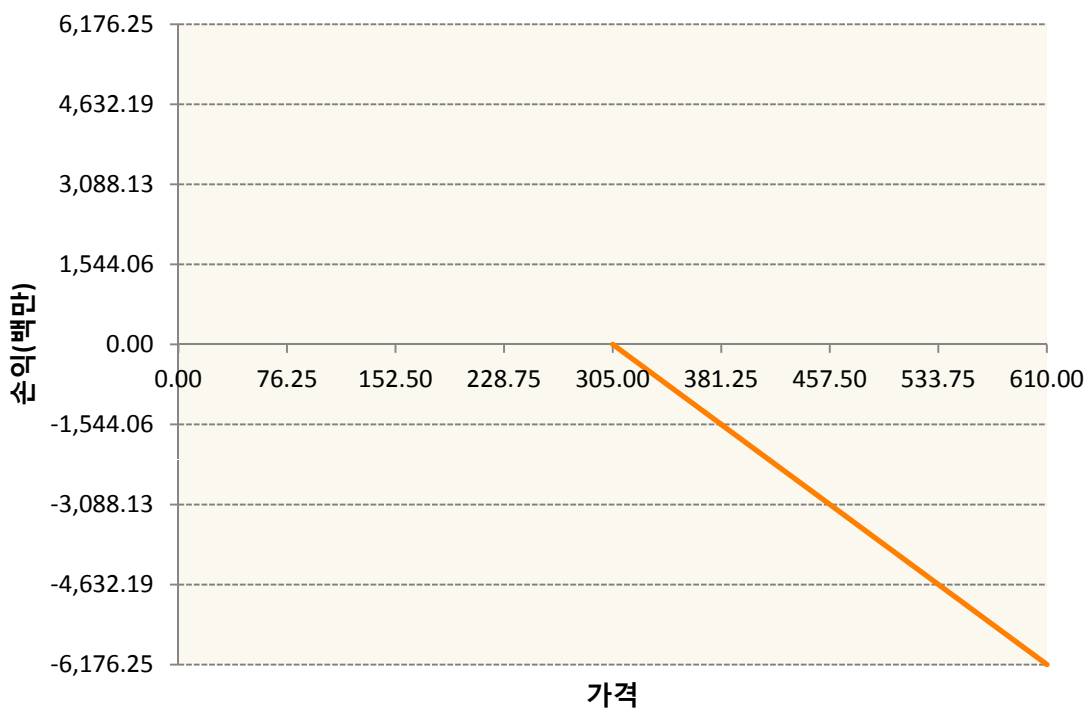


KR4201P33025-2019-03 콜302.5

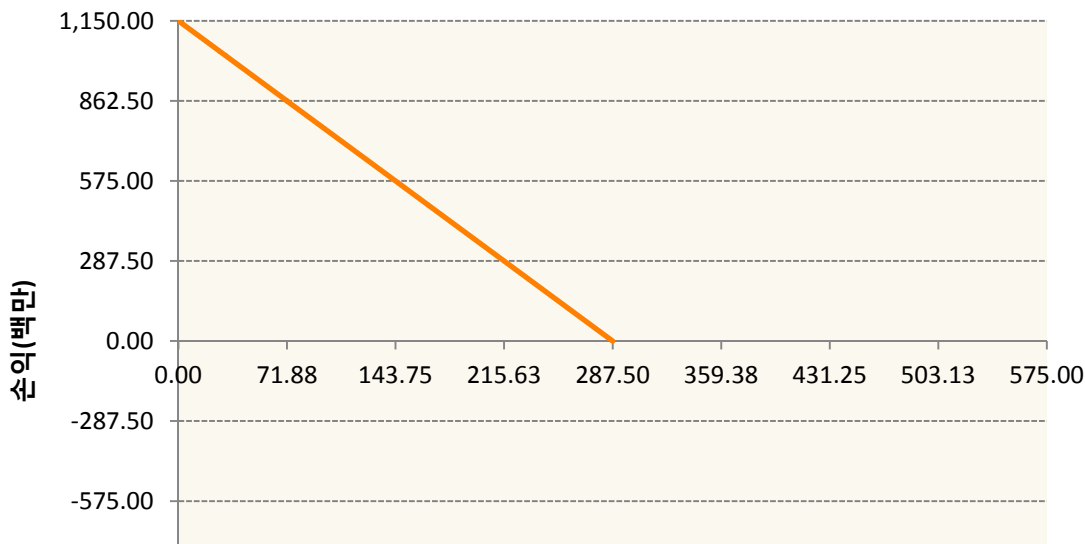


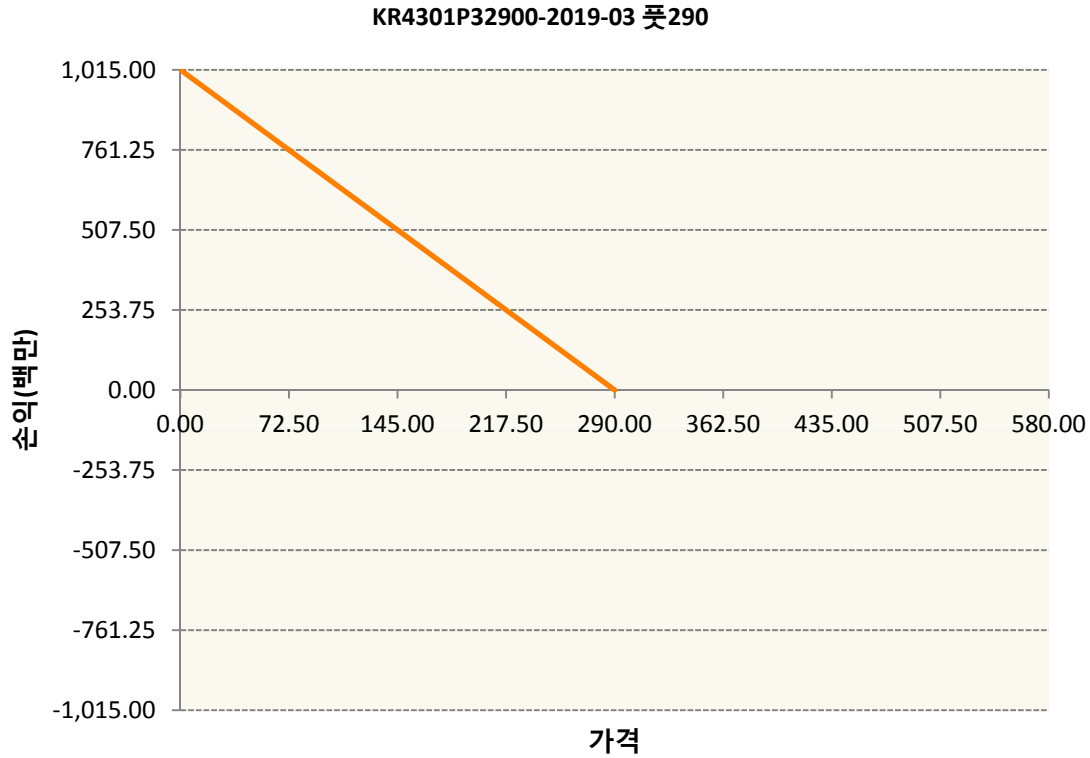
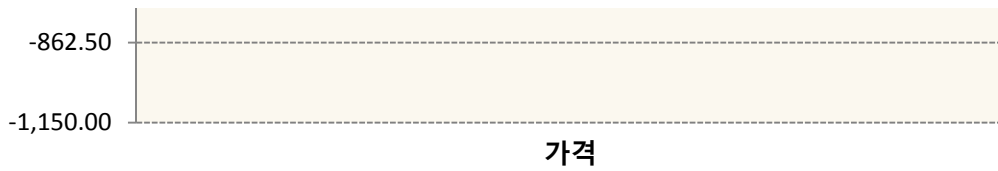


KR4201P33058-2019-03 콜305



KR4301P32876-2019-03 풋287.5





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101P30007		2019-03 코스피200지수선물						1,027
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-1,027	-1,027	-1,027	-1,027	-1,027	-1,027	-1,027	
-5.33%	-685	-685	-685	-685	-685	-685	-685	
-2.67%	-342	-342	-342	-342	-342	-342	-342	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	342	342	342	342	342	342	342	
5.33%	685	685	685	685	685	685	685	
8.00%	1,027	1,027	1,027	1,027	1,027	1,027	1,027	
KR4201P33025		2019-03 콜302.5						569
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	48	48	48	48	47	46	44	
-5.33%	48	47	47	45	42	39	34	
-2.67%	46	43	39	34	27	18	7	

0%	34	25	13	0	-15	-32	-50
2.67%	-14	-35	-57	-80	-105	-130	-157
5.33%	-141	-172	-202	-233	-264	-296	-327
8.00%	-382	-412	-443	-474	-506	-537	-569
KR4201P33058 2019-03 콜305							163
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	11	11	11	11	11	11	10
-5.33%	11	11	11	11	10	9	8
-2.67%	11	10	9	8	6	4	1
0%	8	6	3	0	-4	-9	-14
2.67%	-2	-8	-14	-21	-28	-35	-43
5.33%	-34	-43	-52	-62	-72	-82	-92
8.00%	-100	-110	-121	-131	-142	-152	-163
KR4301P32876 2019-03 풋287.5							83
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	83	83	83	83	83	83	83
-5.33%	53	53	53	53	53	53	54
-2.67%	23	23	24	24	25	25	26
0%	-3	-2	-1	0	1	2	3
2.67%	-18	-17	-16	-15	-14	-13	-12
5.33%	-22	-22	-21	-21	-20	-20	-19
8.00%	-22	-22	-22	-22	-22	-22	-22
KR4301P32900 2019-03 풋290							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%	49	49	49	49	49	49	49
-2.67%	22	23	23	23	23	24	24
0%	-2	-1	-1	0	1	2	2
2.67%	-19	-18	-17	-16	-15	-14	-13
5.33%	-25	-25	-24	-23	-23	-22	-21
8.00%	-26	-26	-26	-26	-25	-25	-25

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

(단위:백만원)

1,482

공시일	2019-03-04
기준일	2019-02-28

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	986	0	986	

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	2019-03-04
기준일	2019-02-28

H2O글로벌본드(UH)(채권혼합-파)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	259	0	259	
누계	유가증권	수익증권	6,276	0	6,276	

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	2019-03-04
기준일	2019-02-28

H2O글로벌본드(H)(채권혼합-파생)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	1,462	0	1,462	
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	수익증권	38,345	0	38,345	
누계	통화	선도	0	38,358	-38,358	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음	
FX21019F02: KRW/USD 28-03-19E		468
FX21019F02: KRW/USD 29-03-19E		24
FX21019F02: KRW/USD 29-03-19E		72
FX21019G00 KRW/USD 29-03-19E		27
FX21019G00 KRW/USD 29-03-19E		13
FX21019G00 KRW/USD 19-03-19E		49
FX21019G00 KRW/USD 19-03-19E		27
FX21019G01 KRW/USD 19-03-19E		54
FX21019G01 KRW/USD 19-03-19E		105
FX21019G01 KRW/USD 19-03-19E		106
FX21019G01 KRW/USD 19-03-19E		43
FX21019G01 KRW/USD 21-03-19E		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
FX21019G03 KRW/USD 28-03-19E		117
FX21019G03 KRW/USD 29-03-19E		333
FX21019G04 KRW/USD 10-04-19E		72

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

(단위:백만원)

1,096

공시일	2019-03-04
기준일	2019-02-28

스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

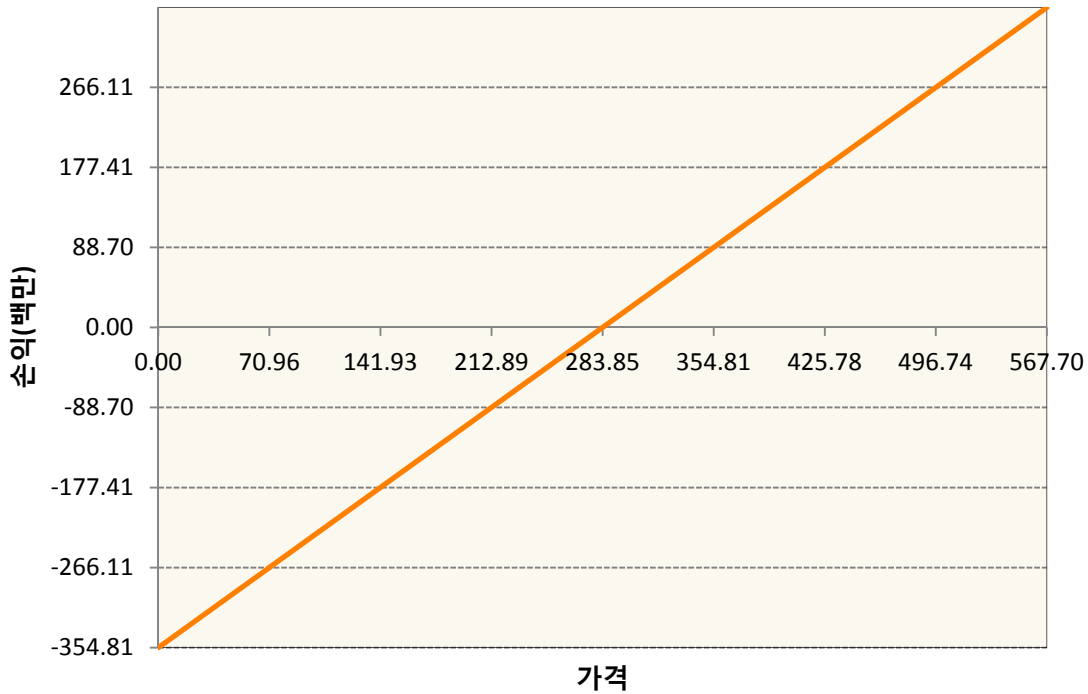
1. 계약금액

(단위:백만원)

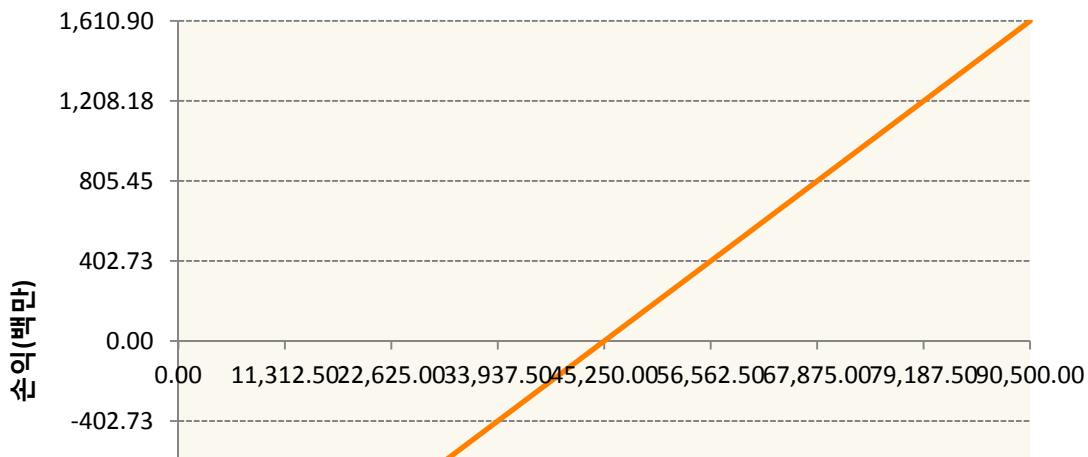
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,966	0	1,966	장내

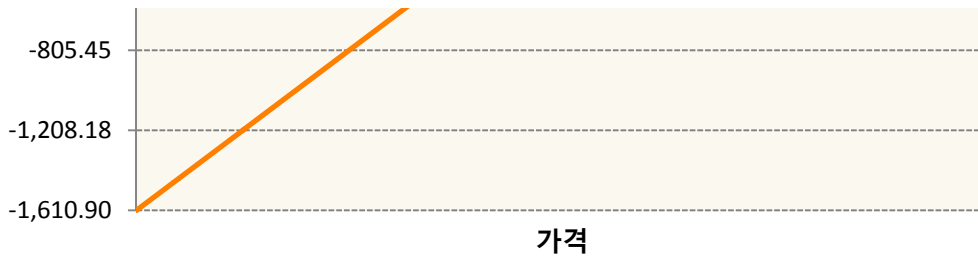
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P30007-2019-03 코스피200지수선물



KR4111P30006-2019-03 삼성전자개별선물





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101P30007		2019-03 코스피200지수선물						28
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-28	-28	-28	-28	-28	-28	-28	
-5.33%	-19	-19	-19	-19	-19	-19	-19	
-2.67%	-9	-9	-9	-9	-9	-9	-9	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	9	9	9	9	9	9	9	
5.33%	19	19	19	19	19	19	19	
8.00%	28	28	28	28	28	28	28	
KR4111P30006		2019-03 삼성전자개별선물						128
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-128	-128	-128	-128	-128	-128	-128	
-5.33%	-86	-86	-86	-86	-86	-86	-86	
-2.67%	-43	-43	-43	-43	-43	-43	-43	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	43	43	43	43	43	43	43	
5.33%	86	86	86	86	86	86	86	
8.00%	128	128	128	128	128	128	128	

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

172

공시일	2019-03-04
기준일	2019-02-28

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

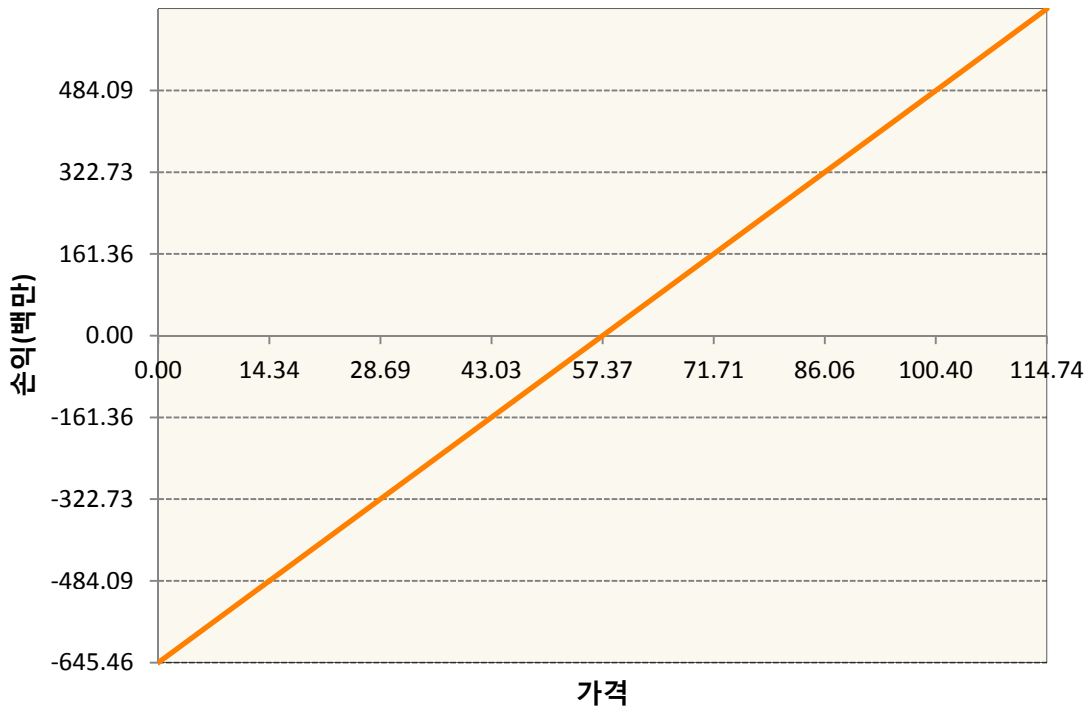
1. 계약금액

(단위:백만원)

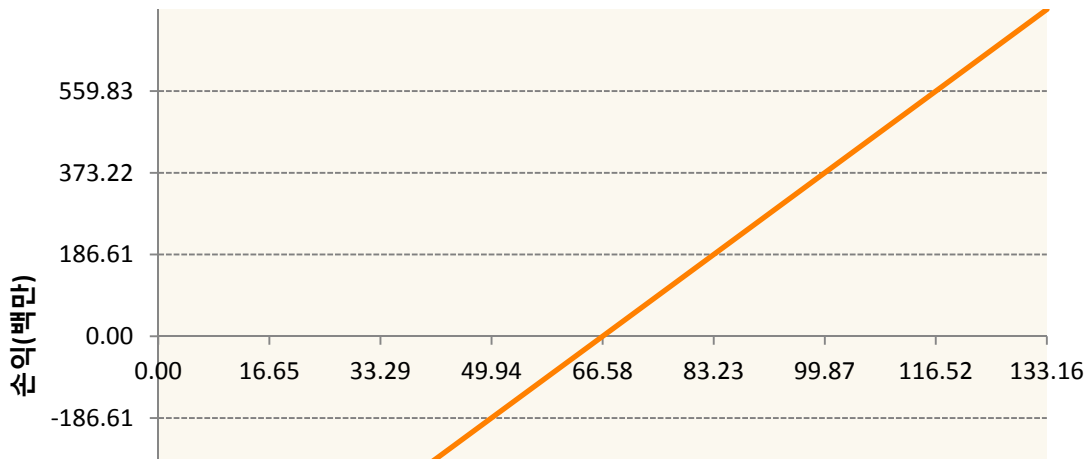
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,840	281	2,559	

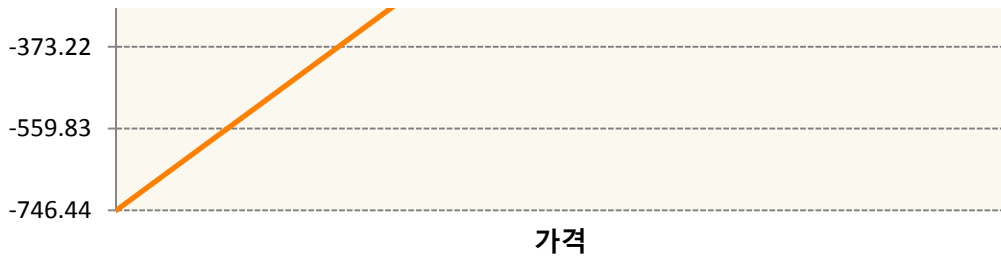
2. 만기시점의 손익구조

CLK9-WTI CRUDE FUTURE May19

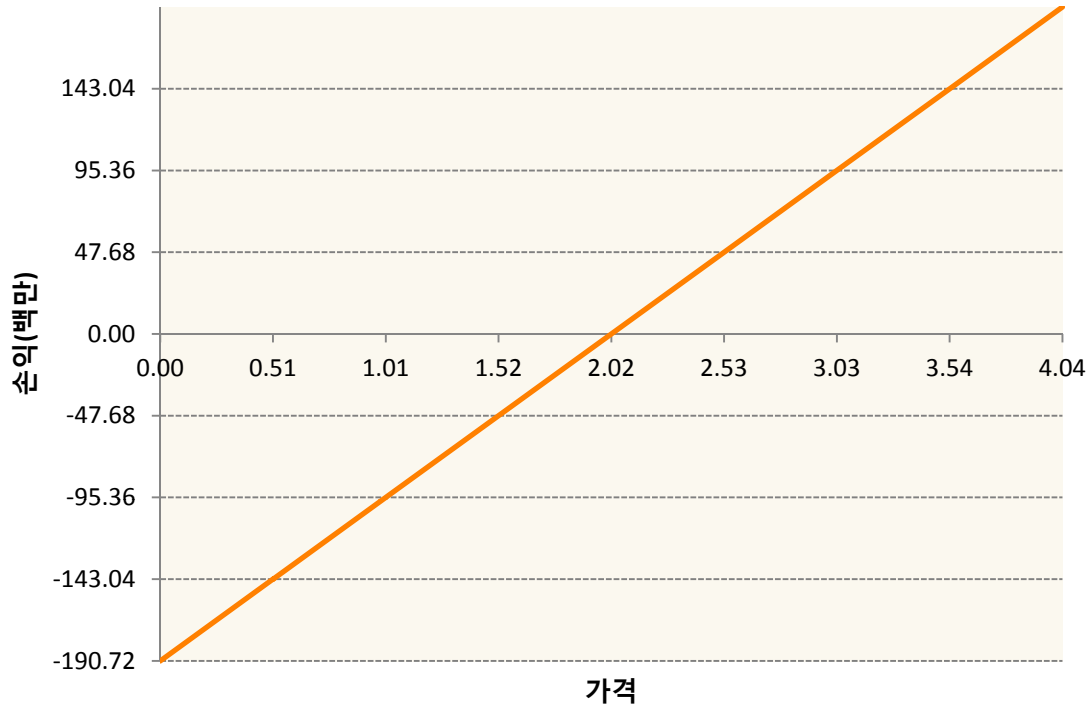


COK9-BRENT CRUDE FUTR May19

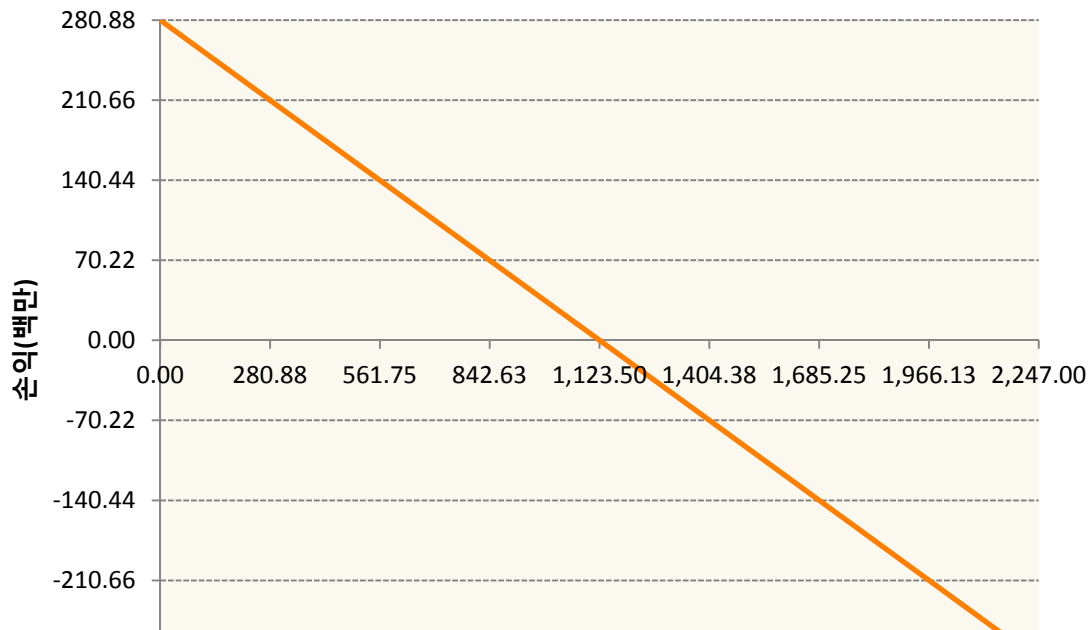


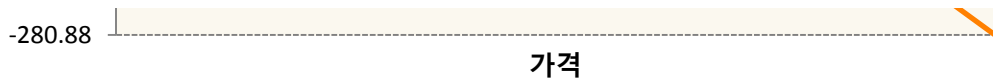


HOK9-NY Harb ULSD Fut May19

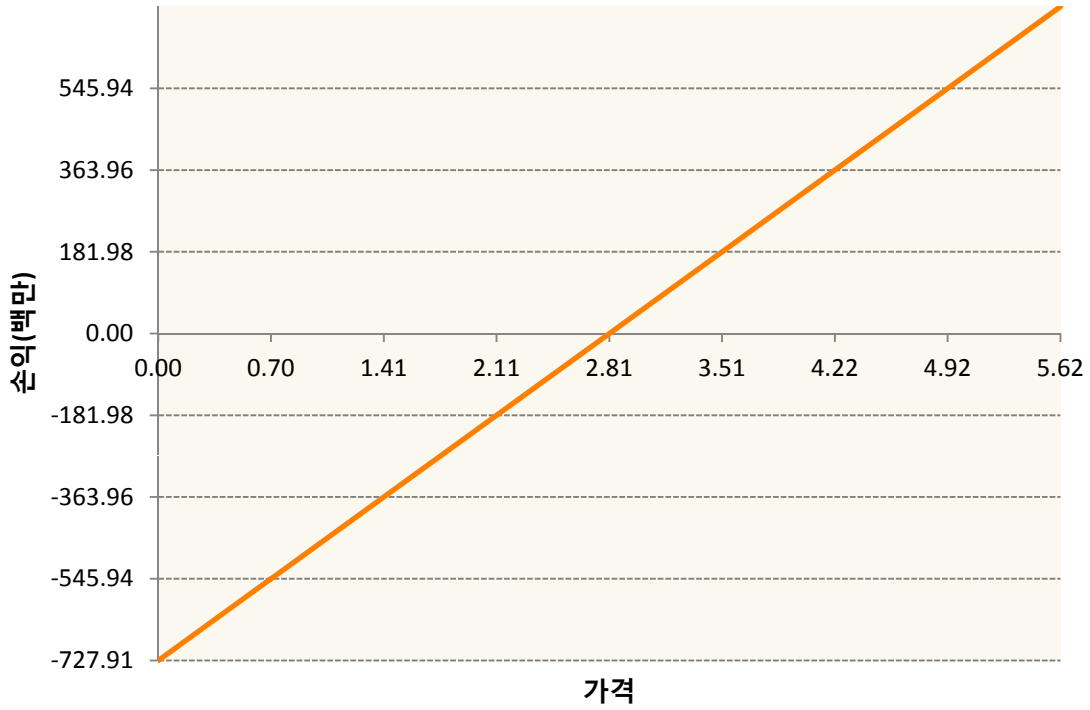


KR4175P30001-2019-03 달러선물

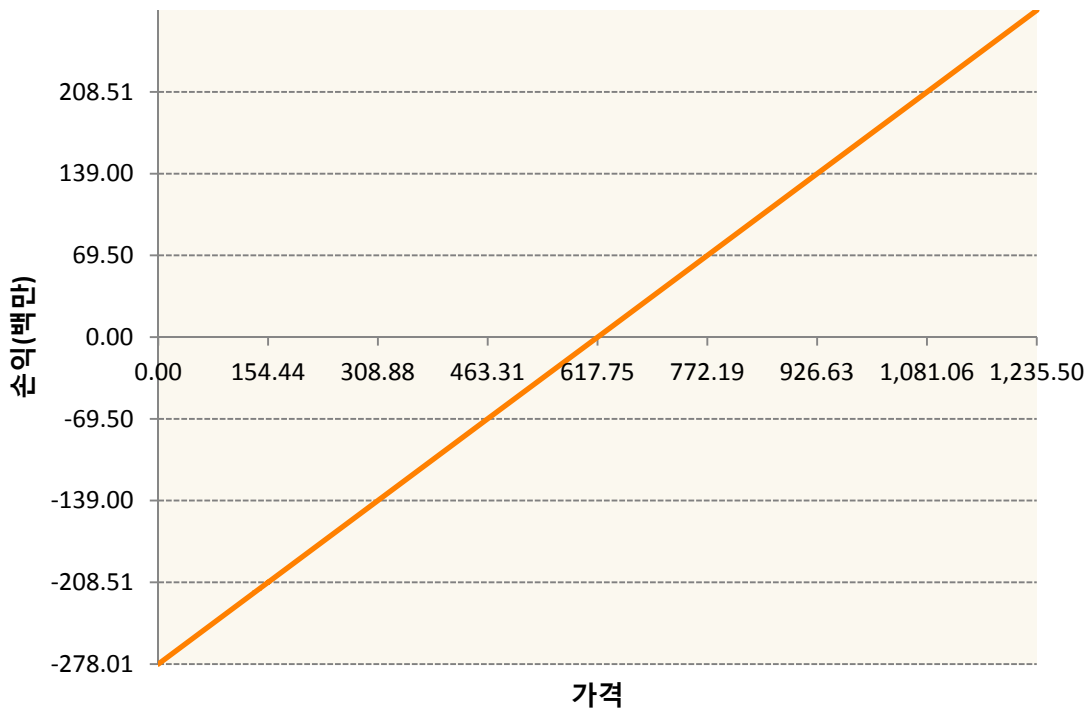




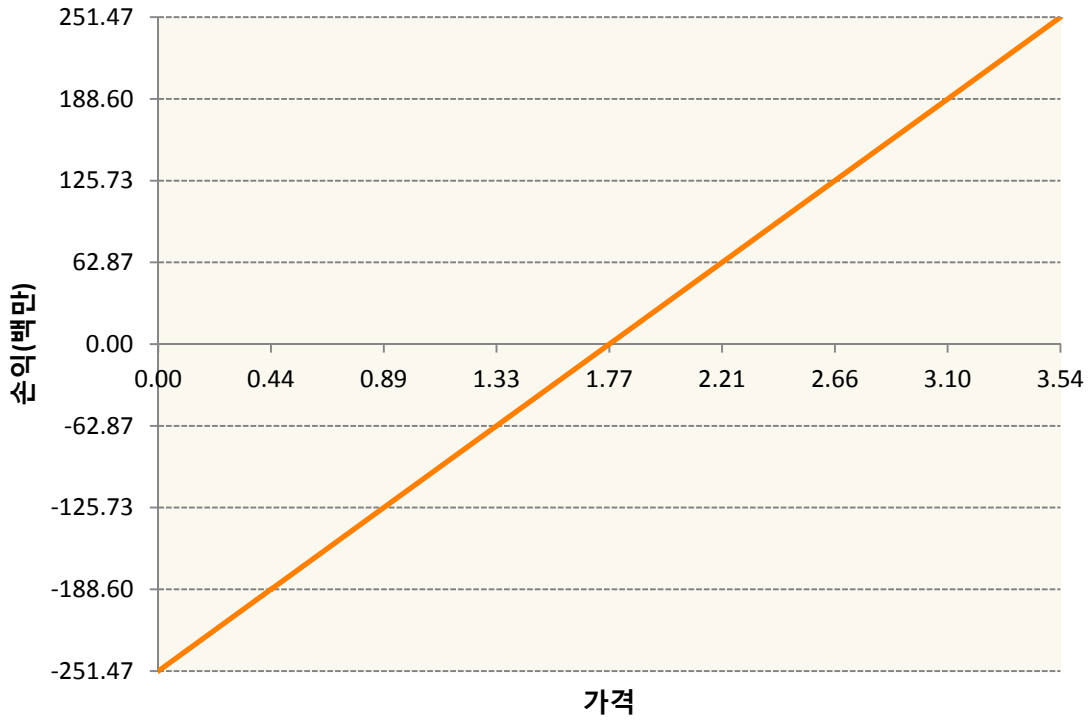
NGK19-NATURAL GAS FUTR May19



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	58
QSK9	Low Su Gasoil G May19	22
XBK9	GASOLINE RBOB FUT May19	20

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

(단위:백만원)

435

공시일	2019-03-04
기준일	2019-02-28

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

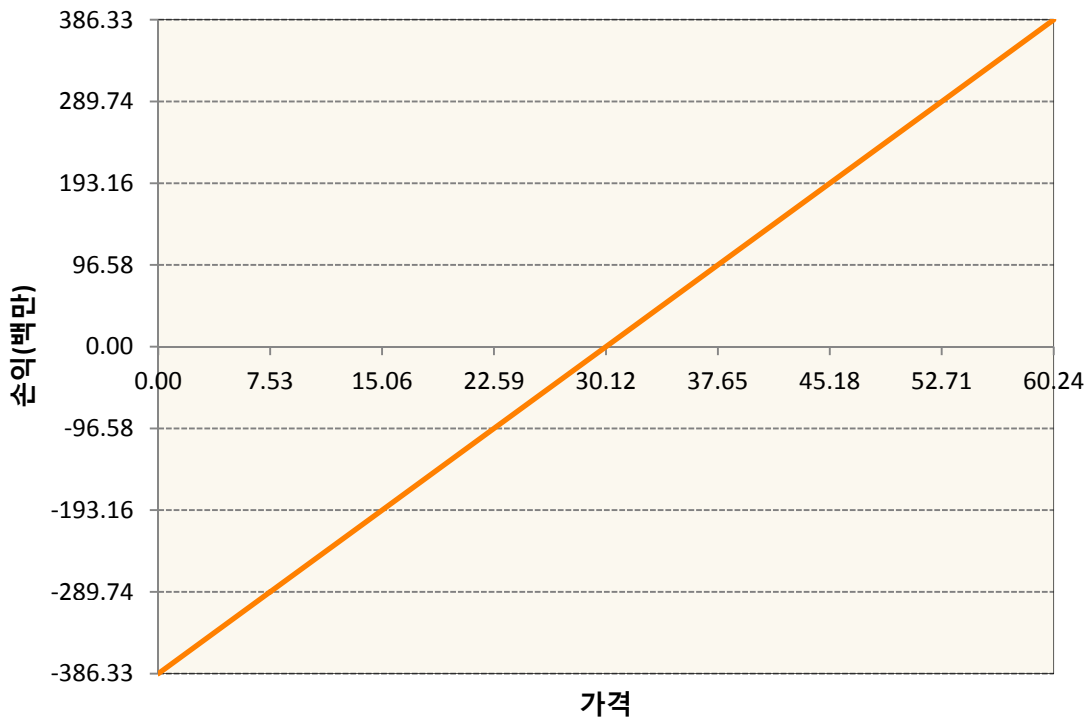
1. 계약금액

(단위:백만원)

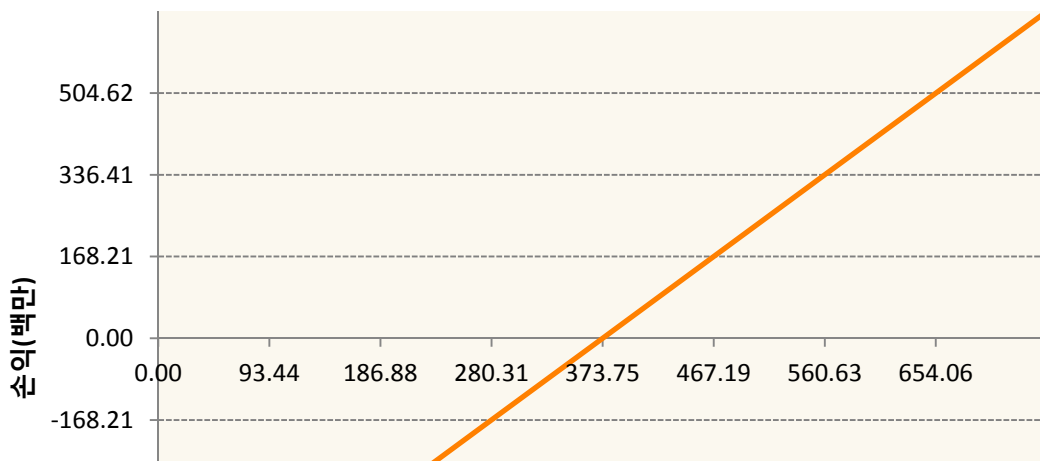
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,420	79	3,341	

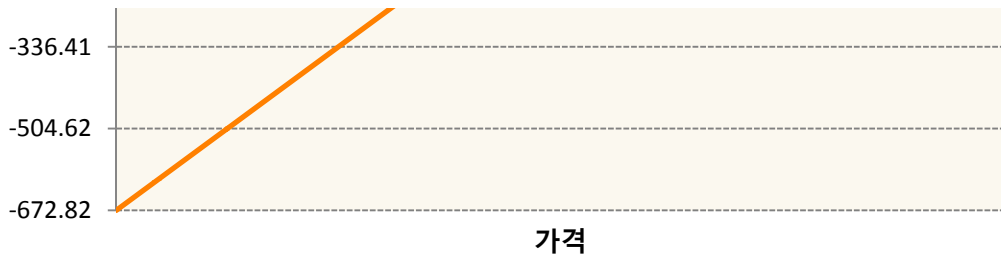
2. 만기시점의 손익구조

BOK9-SOYBEAN OIL FUTR May19

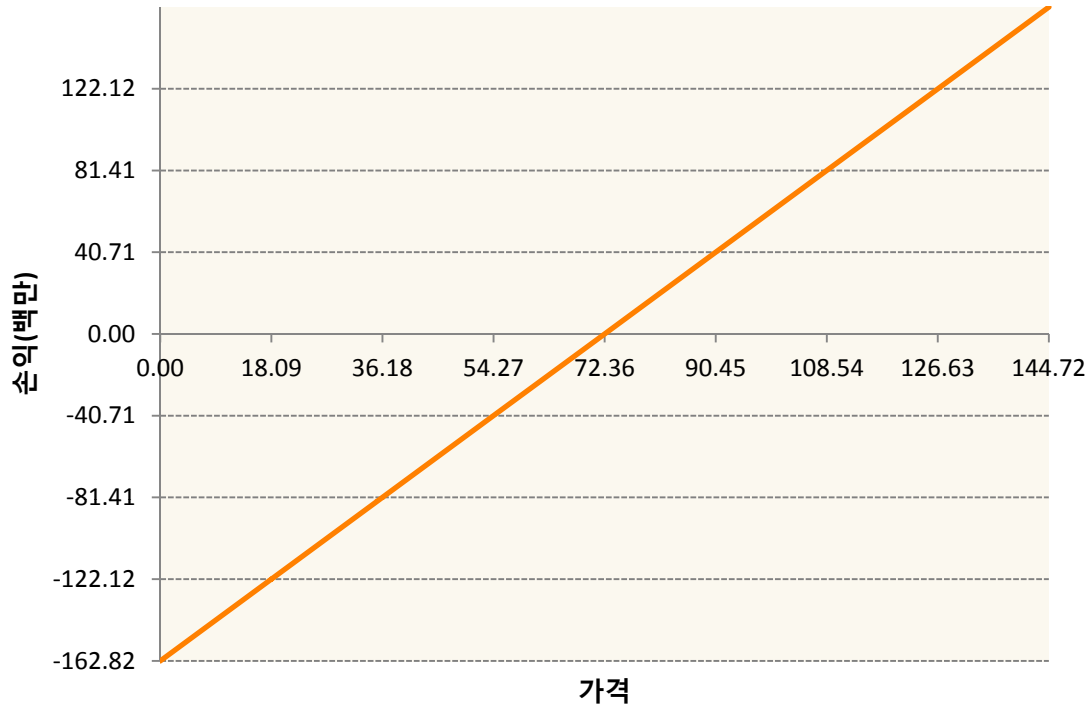


CK9-CORN FUTURE May19

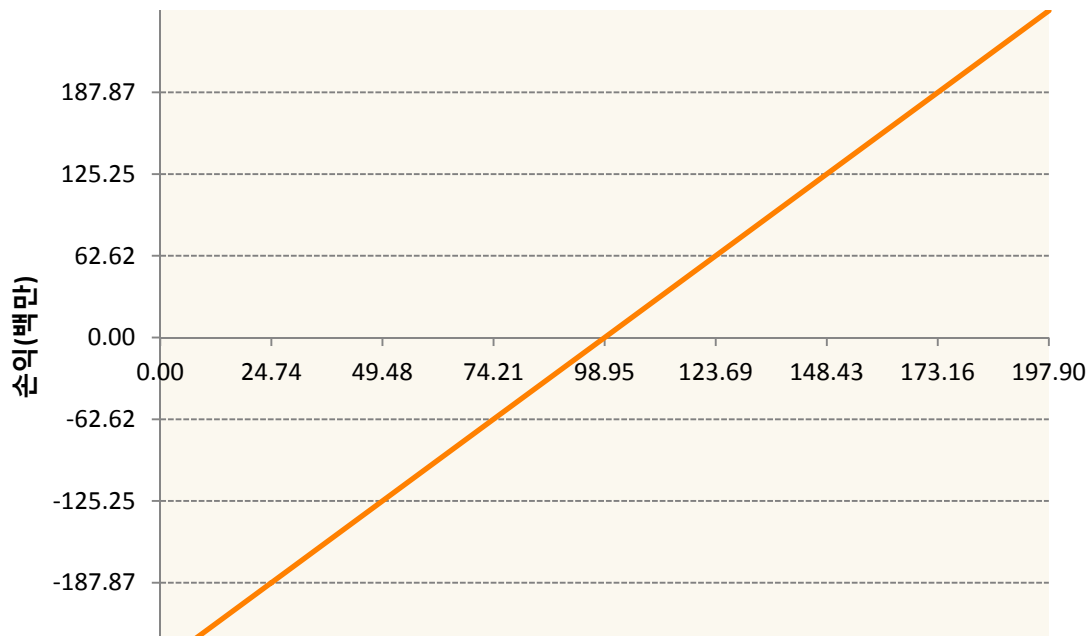


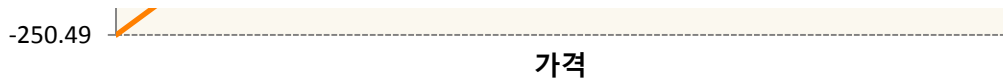


CTK9-COTTON NO.2 FUTR May19

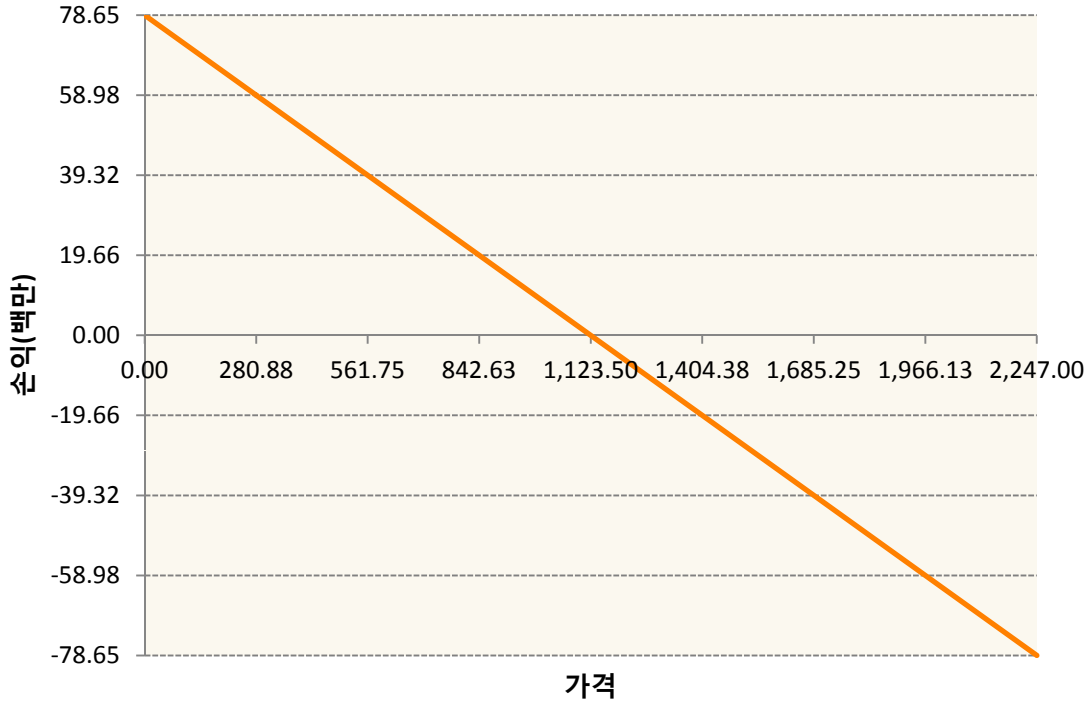


KCK9-COFFEE 'C' FUTURE May19

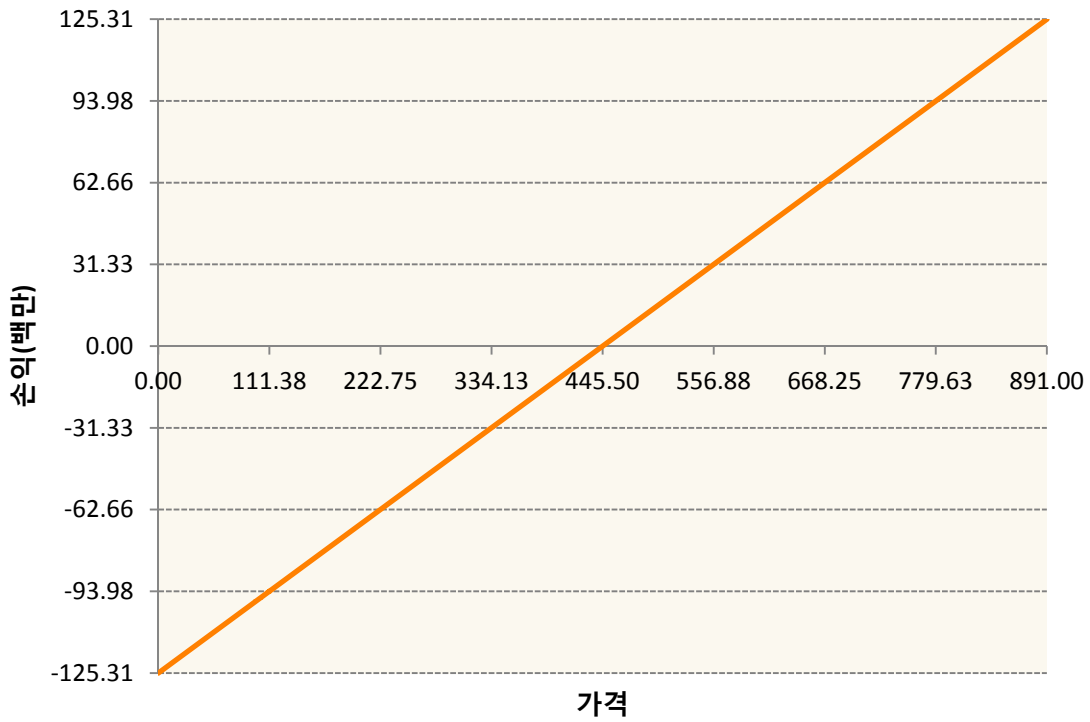




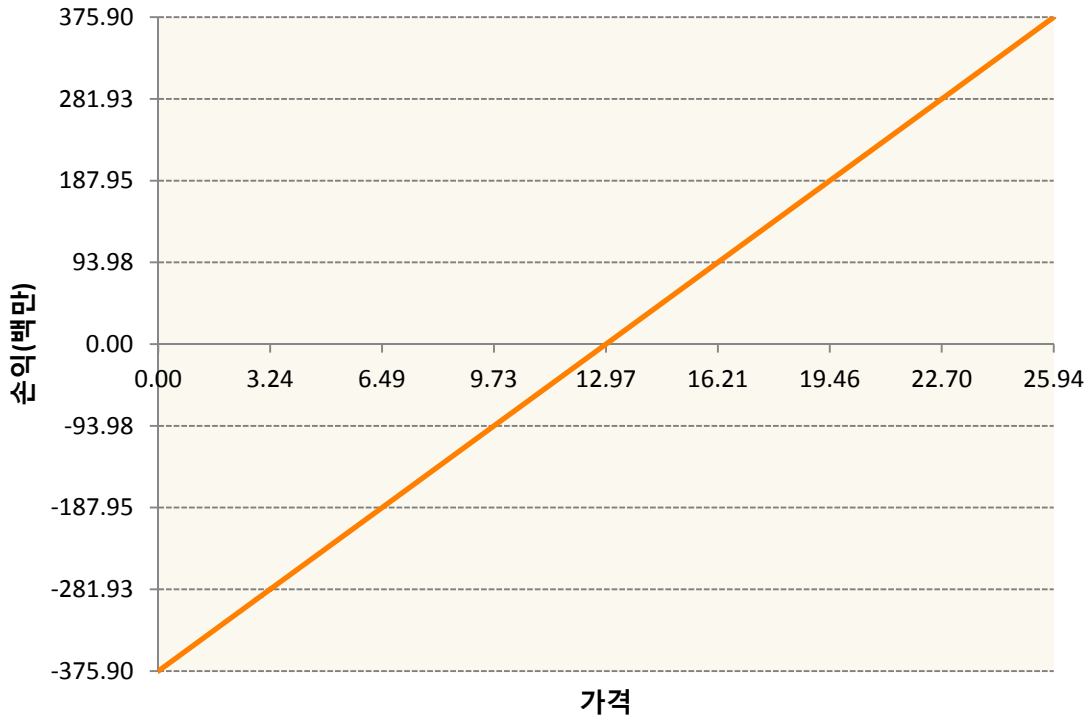
KR4175P30001-2019-03 달러선물



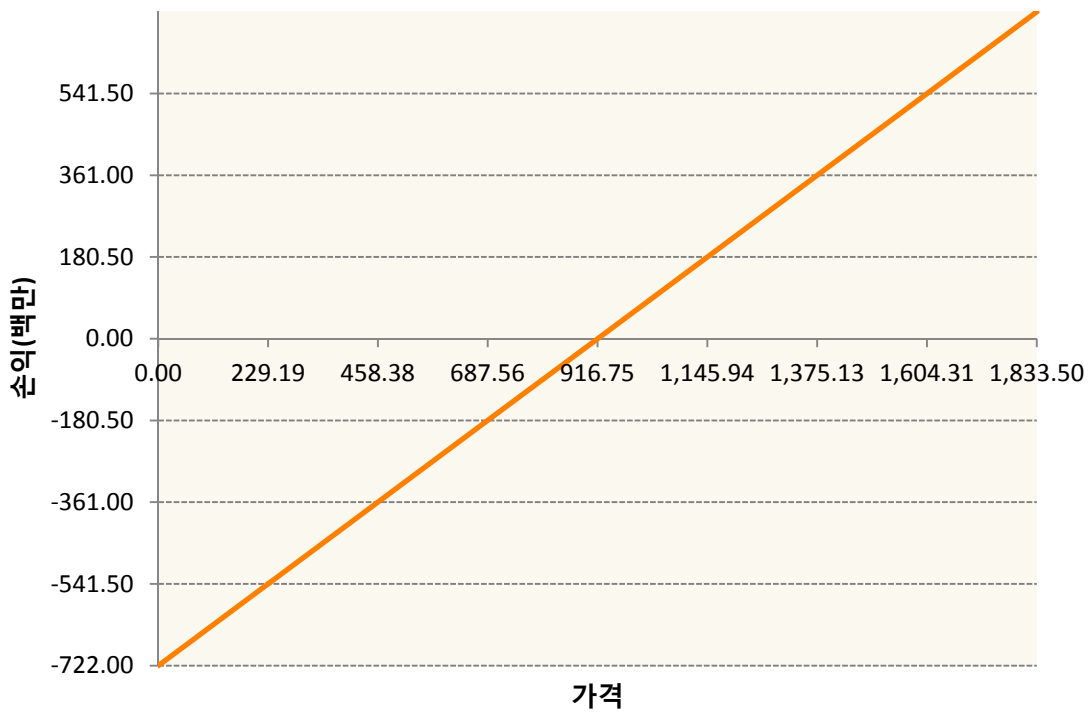
KWK9-KC HRW WHEAT FUT May19



SBK9-SUGAR #11 (WORLD) May19

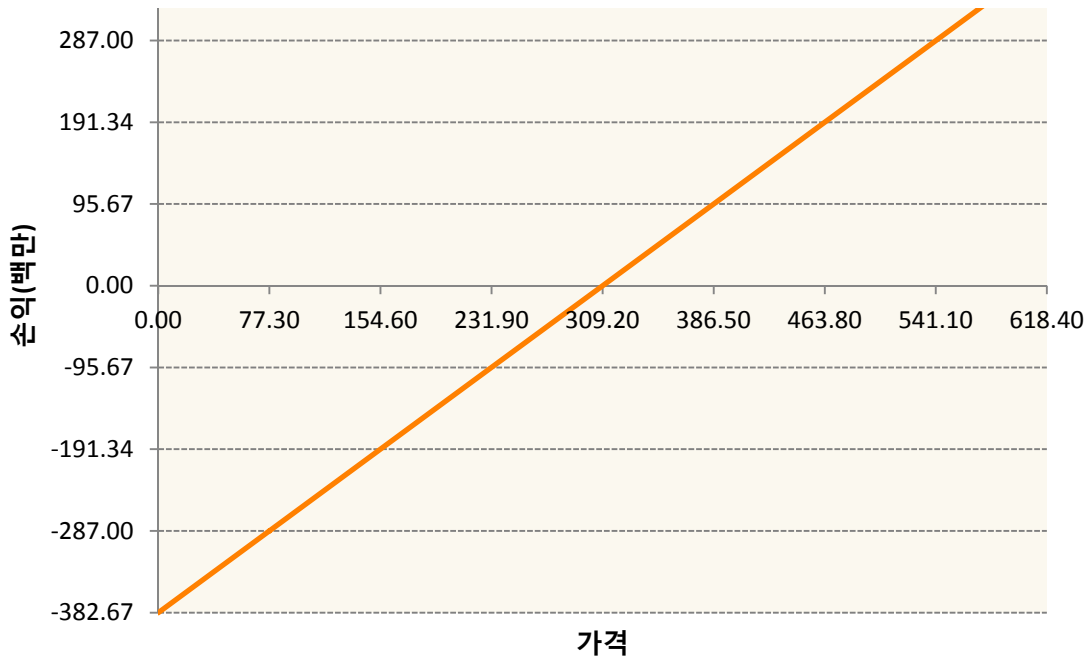


SK9-SOYBEAN FUTURE May19

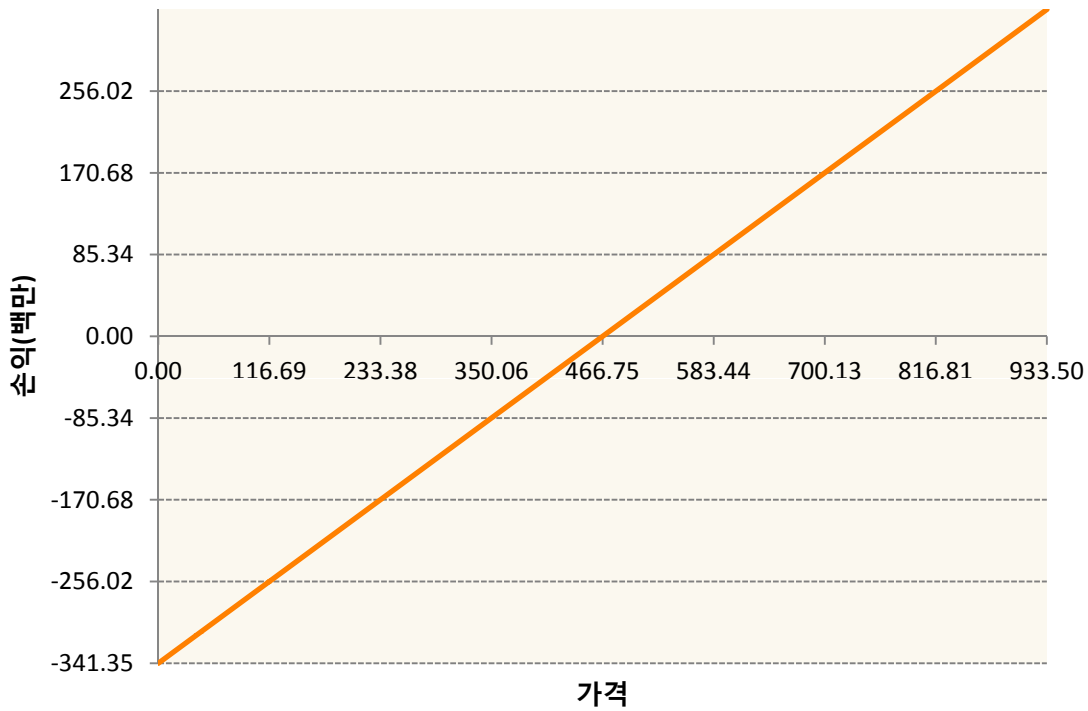


SMK9-SOYBEAN MEAL FUTR May19





WK9-WHEAT FUTURE(CBT) May19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

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

KWK9	KC HRW WHEAT FUT May19	10
SBK9	SUGAR #11 (WORLD) May19	30
SK9	SOYBEAN FUTURE May19	58
SMK9	SOYBEAN MEAL FUTR May19	31
WK9	WHEAT FUTURE(CBT) May19	27

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

(단위:백만원)

273