

공시일	2019-03-13
기준일	2019-03-12

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)

95

공시일	2019-03-13
기준일	2019-03-12

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

1,108

* 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	2019-03-13
기준일	2019-03-12

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	7,434	0	7,434	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI50000 신한CSI500미래S190308(S180910 신규)	347
SWCSI50000 신한CSI500미래S190308(S190129 신규)	96
SWCSI50000 신한CSI500미래S190308(신규)	162

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

940

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2019-03-13
기준일	2019-03-12

유로인덱스모(주식-파생형)

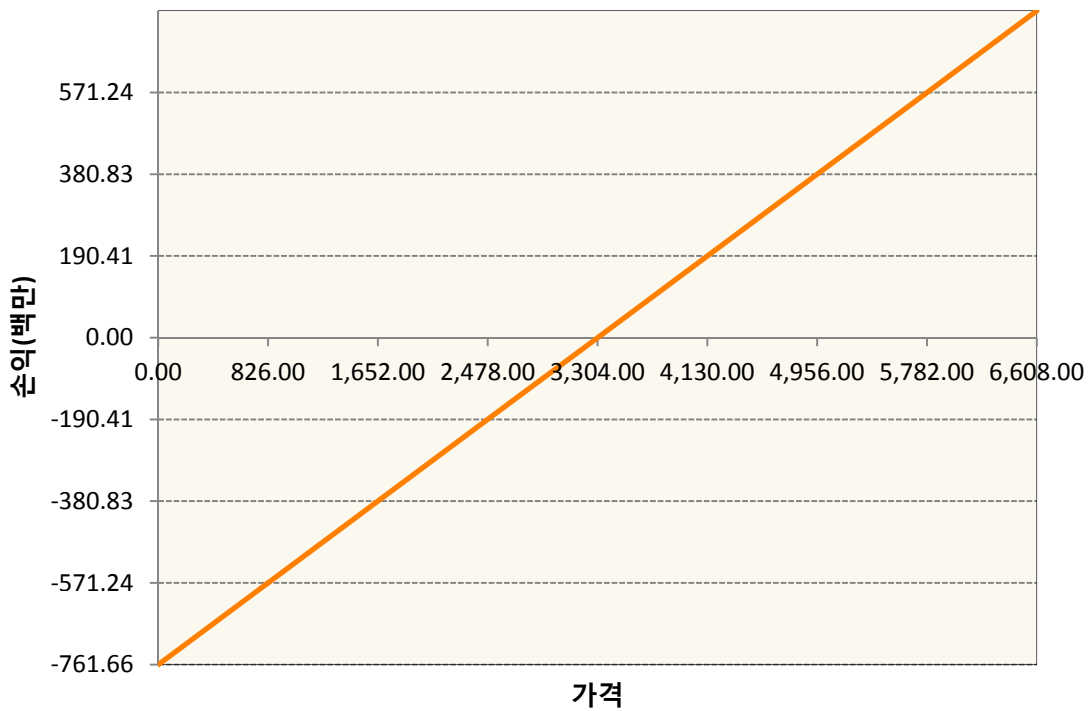
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	762	0	762	

2. 만기시점의 손익구조

VGH9-EURO STOXX 50 Mar19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGH9	EURO STOXX 50 Mar19	61
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

42

공시일	2019-03-13
기준일	2019-03-12

차이나인덱스모(주식-파생형)

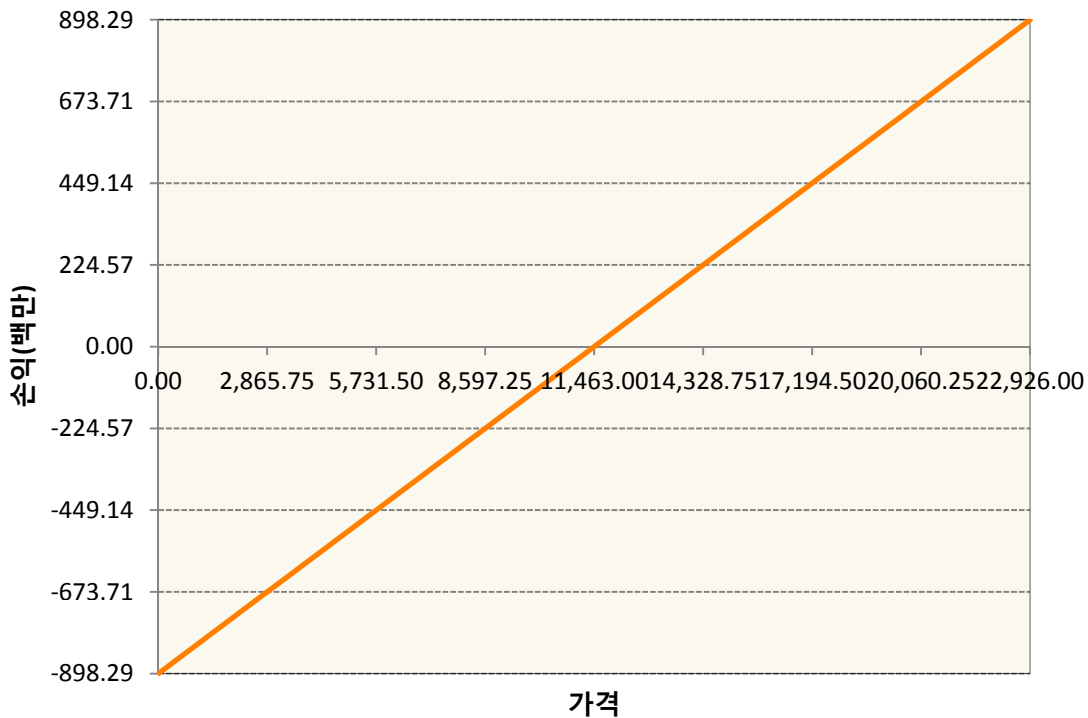
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	898	0	898	장내

2. 만기시점의 손익구조

HCH9-HSCEI Futures Mar19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCH9	HSCEI Futures Mar19	72
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

74

공시일	2019-03-13
기준일	2019-03-12

커버드콜모(주식혼합-파생형)

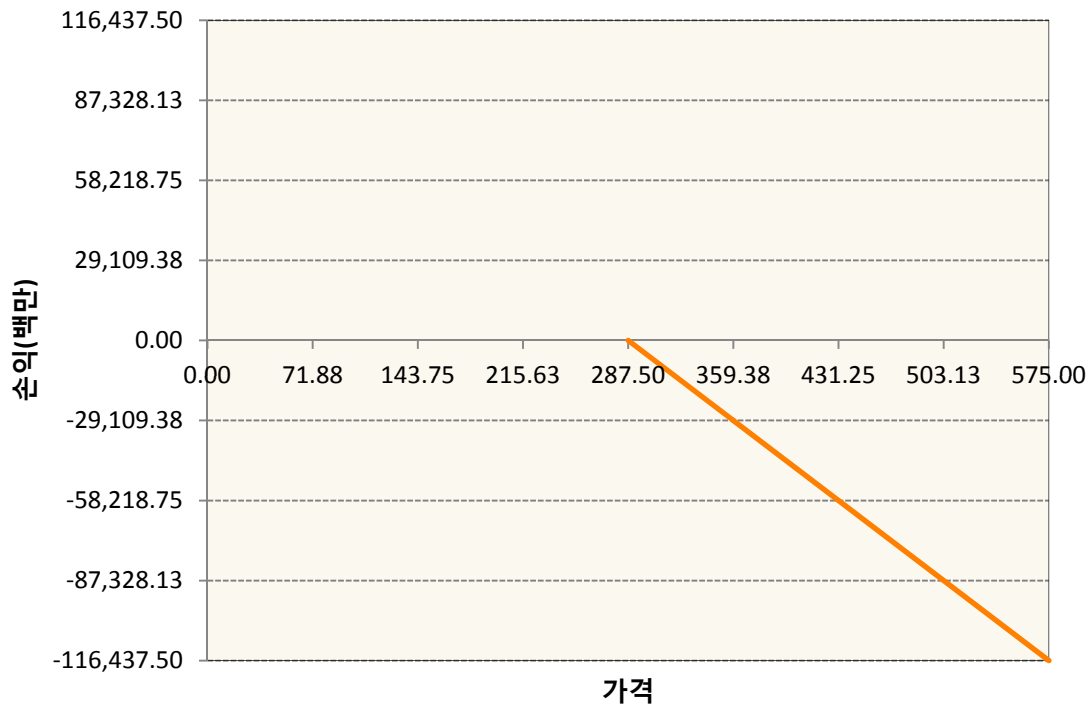
1. 계약금액

(단위:백만원)

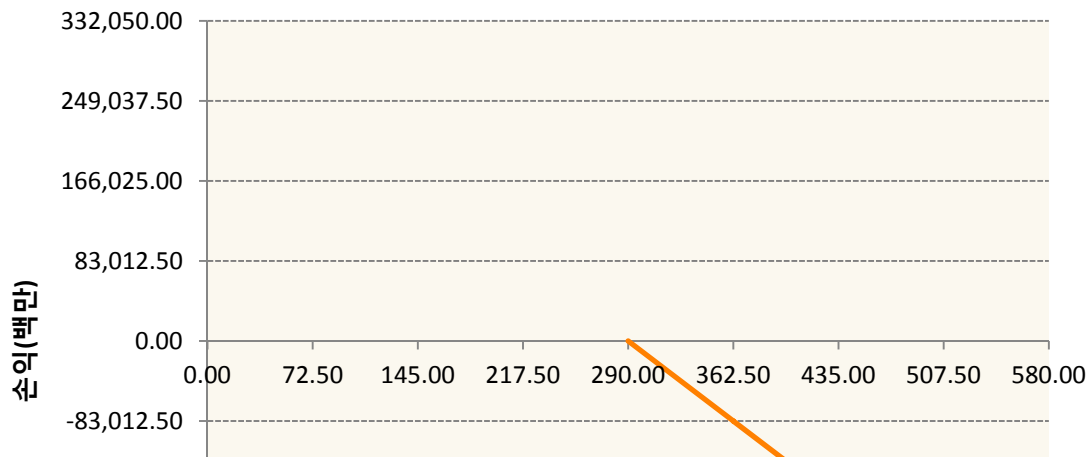
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	701,488	-701,488	장내

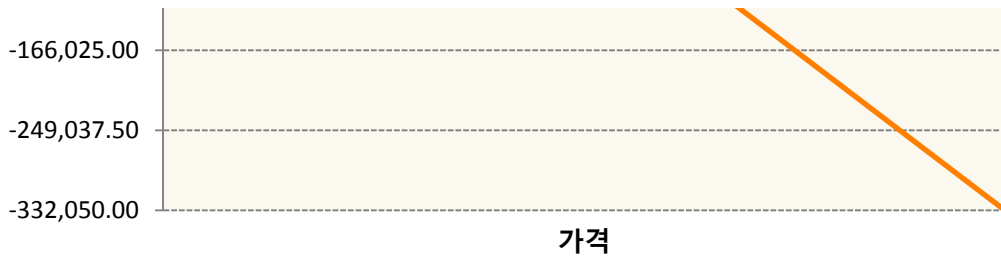
2. 만기시점의 손익구조

KR4201P32878-2019-03 콜287.5

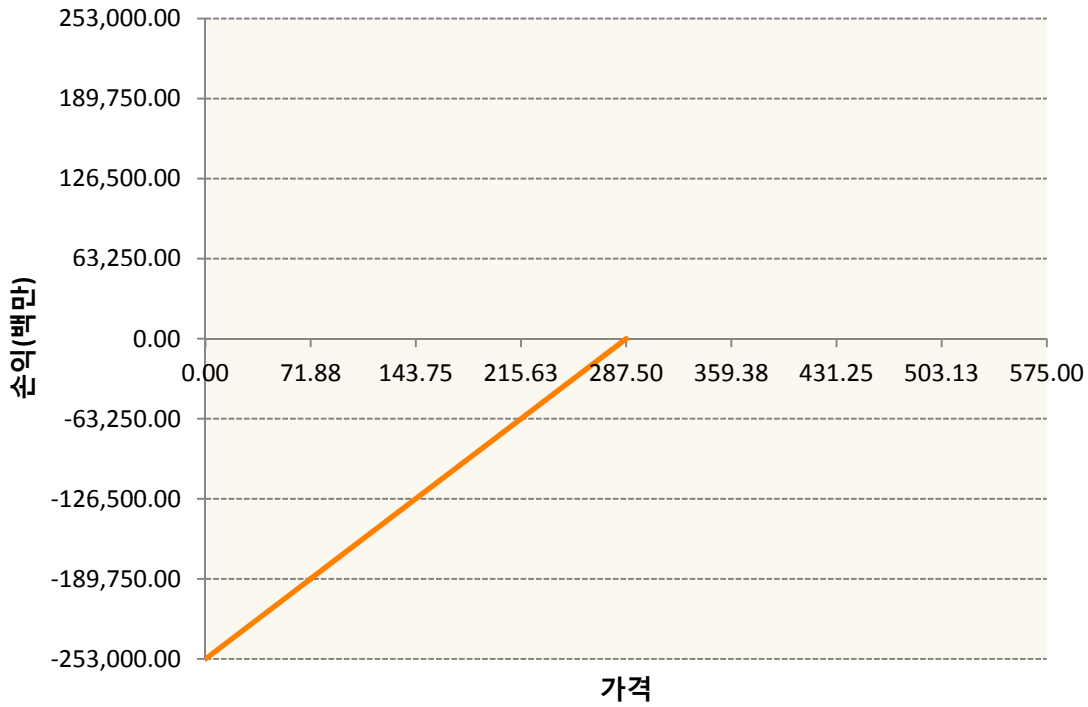


KR4201P32902-2019-03 콜290





KR4301P32876-2019-03 풋287.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201P32878		2019-03 콜287.5					5,051
		기초자산의 변동성					
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	33	33	33	33	33	33	33
-5.33%	33	33	33	33	33	33	33
-2.67%	33	33	33	32	32	30	28
0%	28	22	13	0	-17	-38	-63
2.67%	-266	-330	-396	-464	-533	-602	-672
5.33%	-2,103	-2,142	-2,187	-2,236	-2,288	-2,343	-2,401
8.00%	-5,006	-5,007	-5,011	-5,016	-5,025	-5,037	-5,051
KR4201P32902		2019-03 콜290					11,658
		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%	28	28	28	28	28	28	28
-2.67%	28	28	28	28	27	26	24
0%	26	22	14	0	-21	-50	-88
2.67%	-260	-375	-504	-644	-793	-950	-1,113
5.33%	-3,692	-3,875	-4,064	-4,256	-4,452	-4,650	-4,851
8.00%	-11,369	-11,388	-11,418	-11,460	-11,514	-11,580	-11,658
KR4301P32876 2019-03 풋287.5							19,549
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-19,549	-19,549	-19,549	-19,549	-19,549	-19,549	-19,549
-5.33%	-13,033	-13,033	-13,033	-13,033	-13,033	-13,033	-13,033
-2.67%	-6,516	-6,516	-6,516	-6,516	-6,516	-6,516	-6,516
0%	0	0	0	0	-1	-2	-4
2.67%	6,367	6,314	6,255	6,193	6,127	6,058	5,987
5.33%	8,595	8,585	8,570	8,549	8,524	8,494	8,459
8.00%	8,604	8,604	8,604	8,604	8,604	8,604	8,604

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

(단위:백만원)

27,835

공시일	2019-03-13
기준일	2019-03-12

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

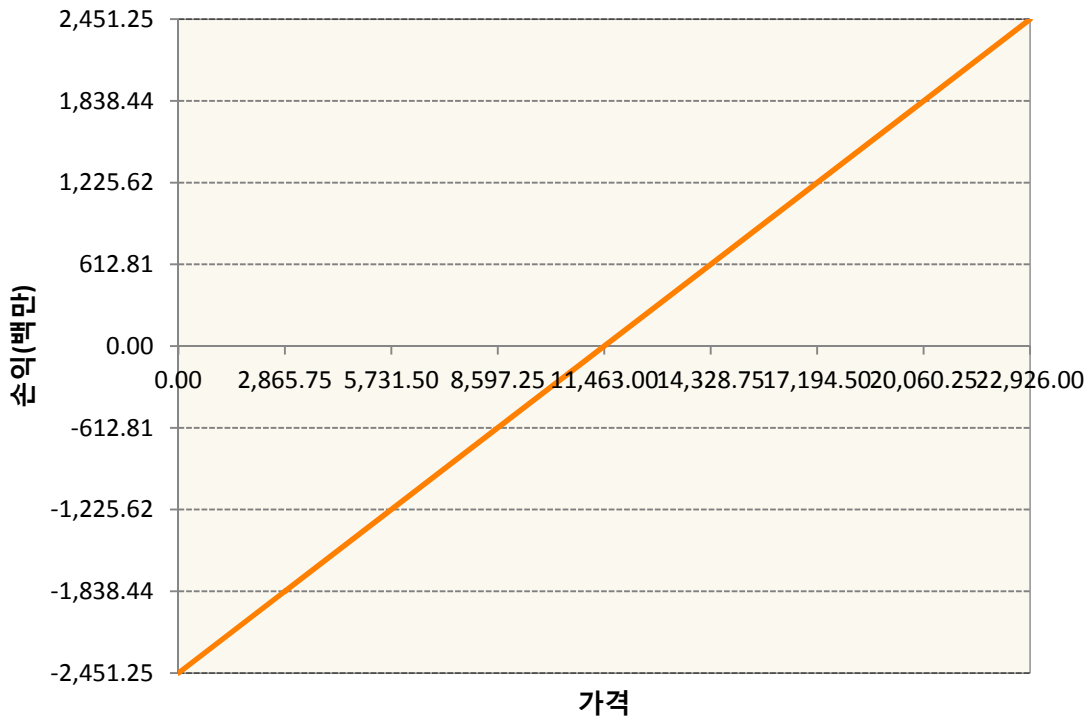
1. 계약금액

(단위:백만원)

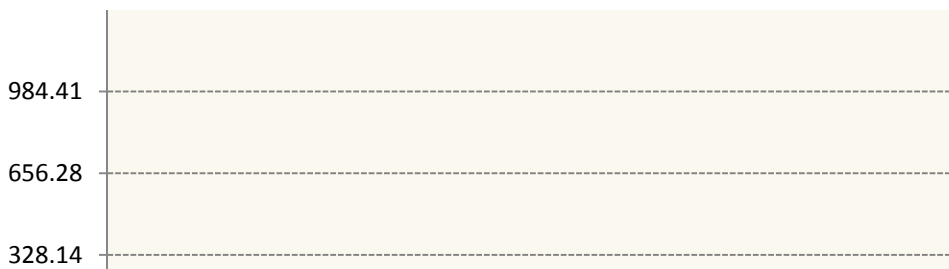
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	2,451	0	2,451	장내
누계	유가증권	옵션	0	6,266	-6,266	장내
누계	통화	선도	0	3,023	-3,023	장외

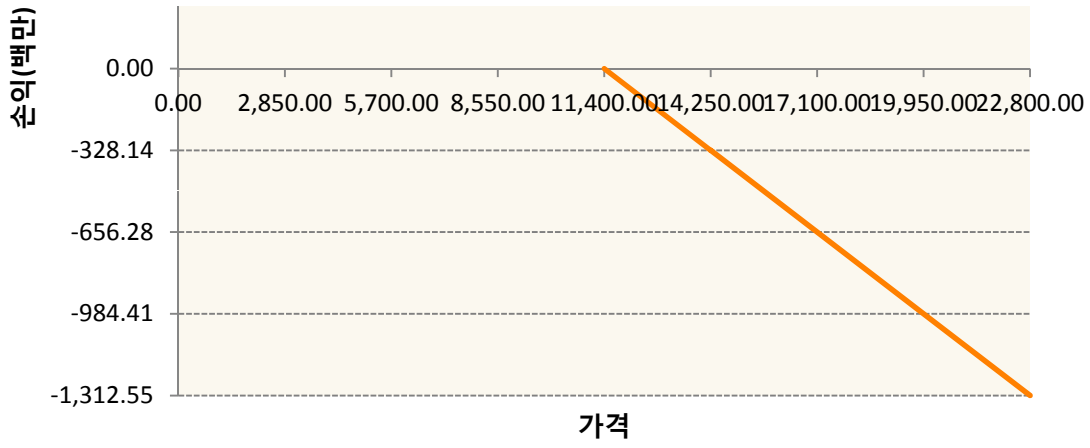
2. 만기시점의 손익구조

HCH9-HSCEI Futures Mar19

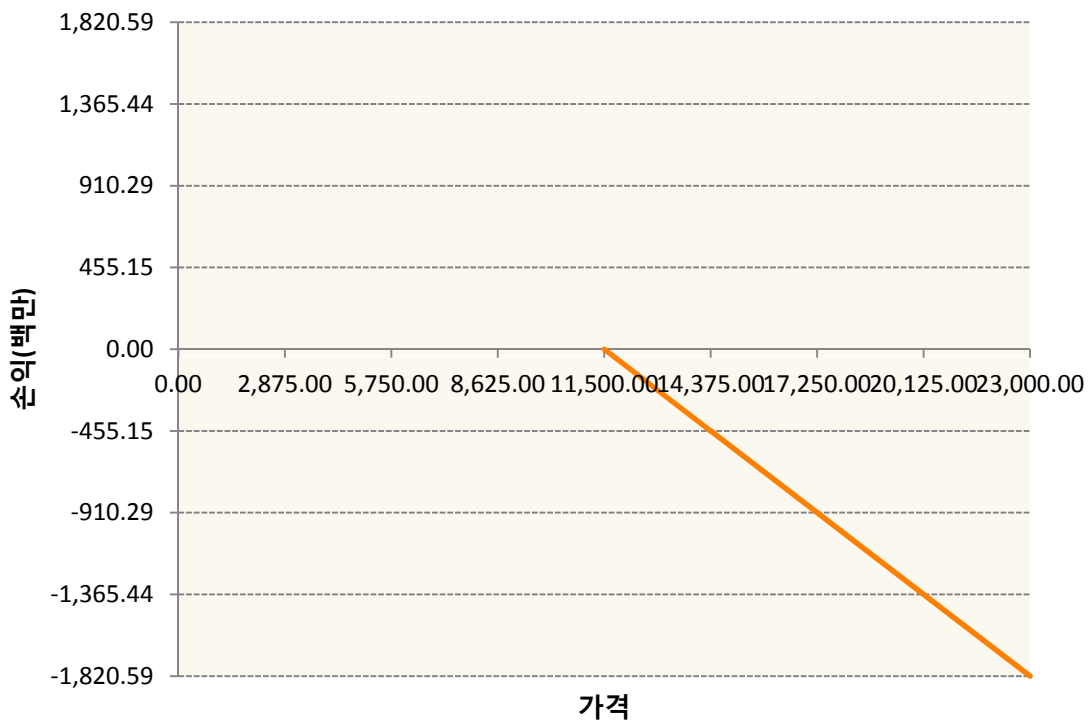


OHHIH9-C114-HSCEI

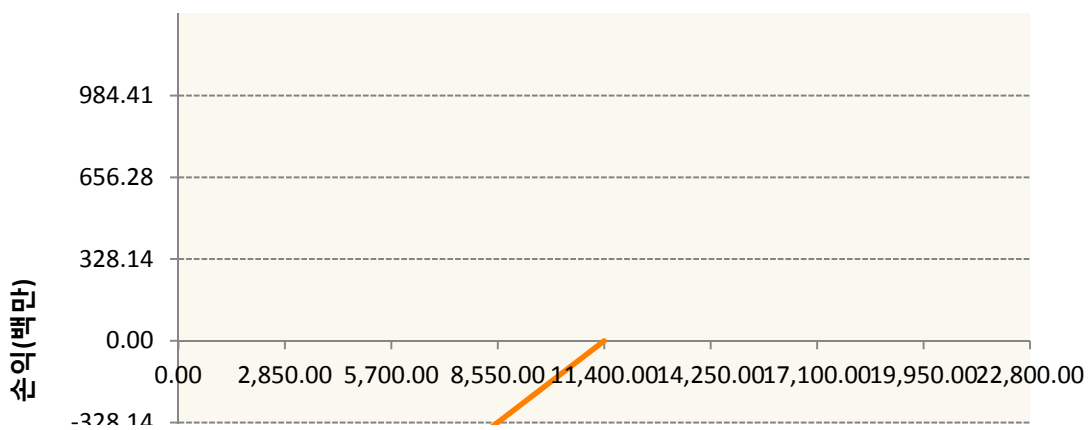


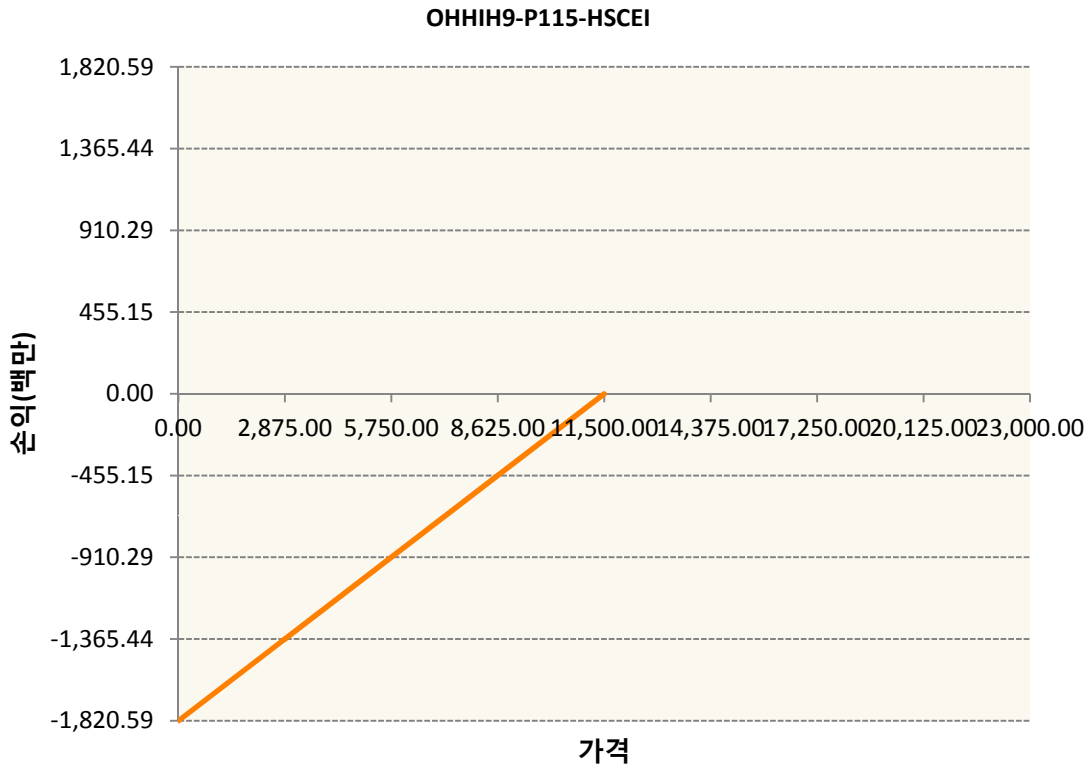


OHHIH9-C115-HSCEI



OHHIH9-P114-HSCEI





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)	(단위:백만원)
FX21019H01 KRW/HKD 24-05-19E	219
FX21019H01 KRW/HKD 24-05-19E	23
HCH9 HSCEI Futures Mar19	196
OHHIH9-C11 HSCEI	105
OHHIH9-C11 HSCEI	146
OHHIH9-P11 HSCEI	105
OHHIH9-P11 HSCEI	146

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	803

공시일	2019-03-13
기준일	2019-03-12

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

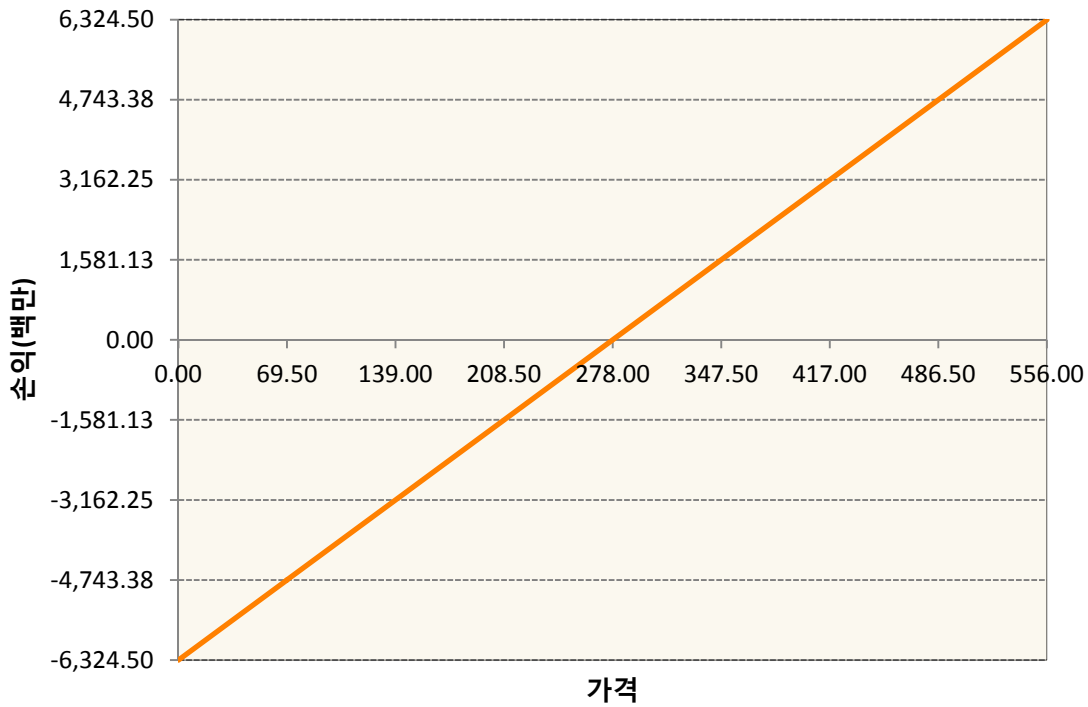
1. 계약금액

(단위:백만원)

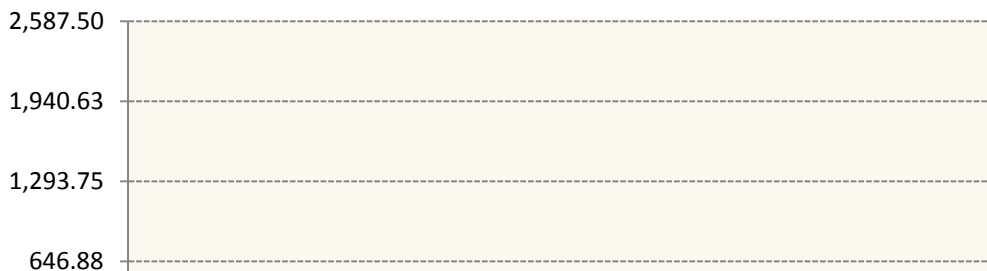
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	6,325	0	6,325	장내
누계	유가증권	스왑	35,836	0	35,836	장외
누계	유가증권	옵션	0	36,139	-36,139	장내

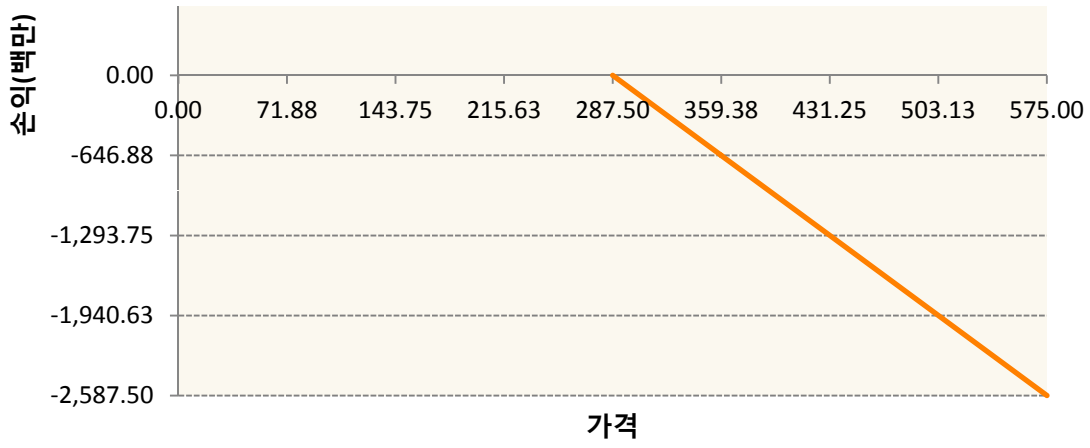
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P30007-2019-03 코스피200지수선물

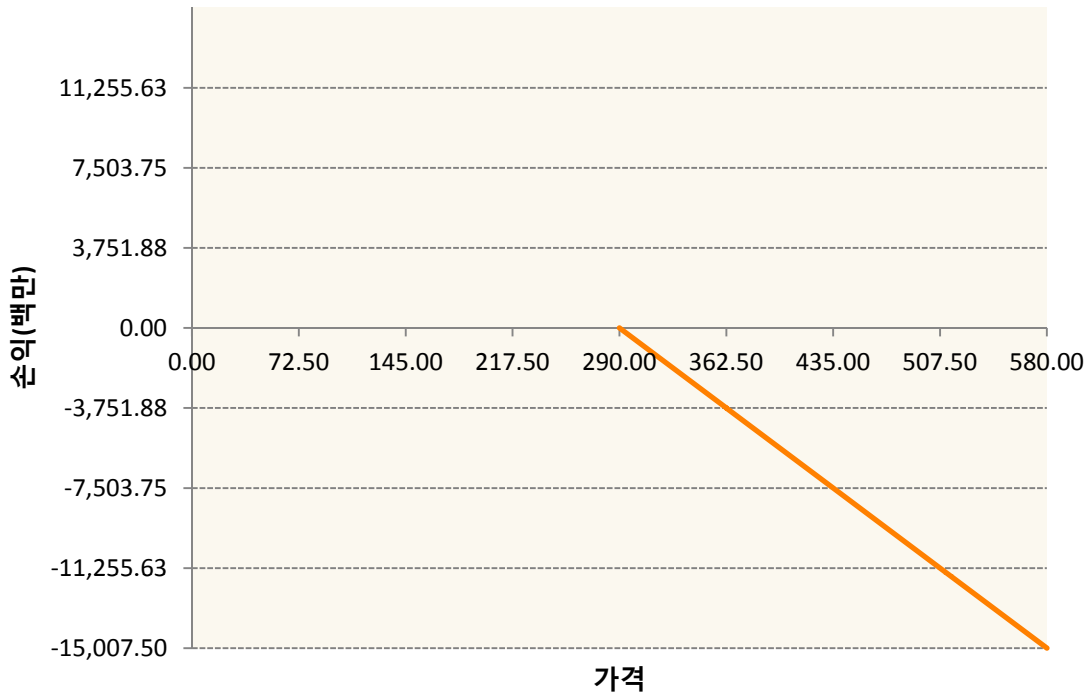


KR4201P32878-2019-03 콜287.5

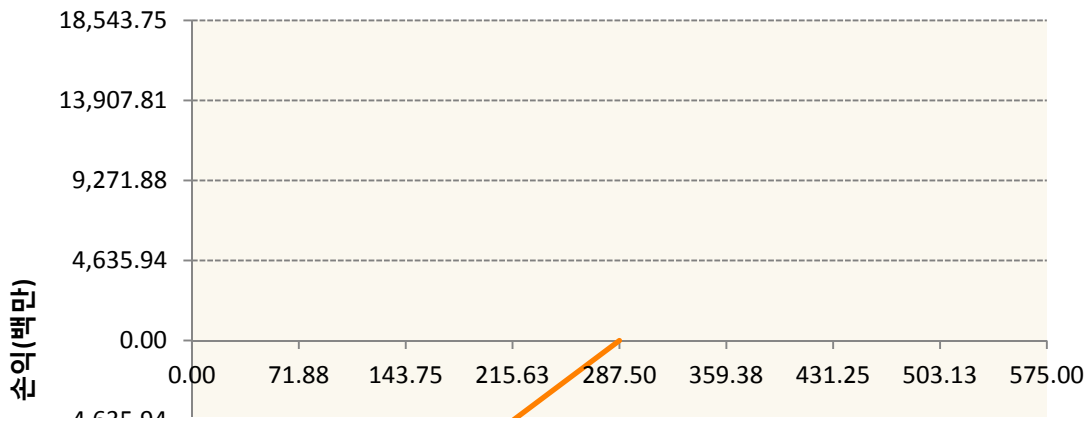


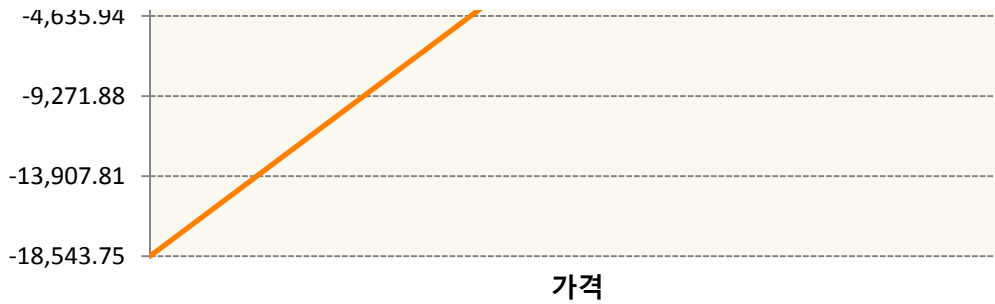


KR4201P32902-2019-03 콜290



KR4301P32876-2019-03 풋287.5





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11		UBCSFXC1 INDEX_14						2,432
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-2,432	-2,432	-2,432	-2,432	-2,432	-2,432	-2,432	
-5.33%	-1,621	-1,621	-1,621	-1,621	-1,621	-1,621	-1,621	
-2.67%	-811	-811	-811	-811	-811	-811	-811	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	811	811	811	811	811	811	811	
5.33%	1,621	1,621	1,621	1,621	1,621	1,621	1,621	
8.00%	2,432	2,432	2,432	2,432	2,432	2,432	2,432	
2.529E+11		UBCSFXC1 INDEX_15						590
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-590	-590	-590	-590	-590	-590	-590	
-5.33%	-394	-394	-394	-394	-394	-394	-394	
-2.67%	-197	-197	-197	-197	-197	-197	-197	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	197	197	197	197	197	197	197	
5.33%	394	394	394	394	394	394	394	
8.00%	590	590	590	590	590	590	590	
KR4101P30007		2019-03 코스피200지수선물						505
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-505	-505	-505	-505	-505	-505	-505	
-5.33%	-337	-337	-337	-337	-337	-337	-337	
-2.67%	-168	-168	-168	-168	-168	-168	-168	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	168	168	168	168	168	168	168	
5.33%	337	337	337	337	337	337	337	
8.00%	505	505	505	505	505	505	505	
KR4201P32878		2019-03 콜287.5						112
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	

-8.00%	1	1	1	1	1	1	1
-5.33%	1	1	1	1	1	1	1
-2.67%	1	1	1	1	1	1	1
0%	1	0	0	0	0	-1	-1
2.67%	-6	-7	-9	-10	-12	-13	-15
5.33%	-47	-48	-49	-50	-51	-52	-53
8.00%	-111	-111	-111	-111	-112	-112	-112
KR4201P3290 2019-03 콜290							527
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1	1	1	1	1	1	1
-5.33%	1	1	1	1	1	1	1
-2.67%	1	1	1	1	1	1	1
0%	1	1	1	0	-1	-2	-4
2.67%	-12	-17	-23	-29	-36	-43	-50
5.33%	-167	-175	-184	-192	-201	-210	-219
8.00%	-514	-515	-516	-518	-520	-523	-527
KR4301P32876 2019-03 풋287.5							1,433
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,433	-1,433	-1,433	-1,433	-1,433	-1,433	-1,433
-5.33%	-955	-955	-955	-955	-955	-955	-955
-2.67%	-478	-478	-478	-478	-478	-478	-478
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	467	463	458	454	449	444	439
5.33%	630	629	628	627	625	623	620
8.00%	631	631	631	631	631	631	631

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

(단위:백만원)

5,228

공시일	2019-03-13
기준일	2019-03-12

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

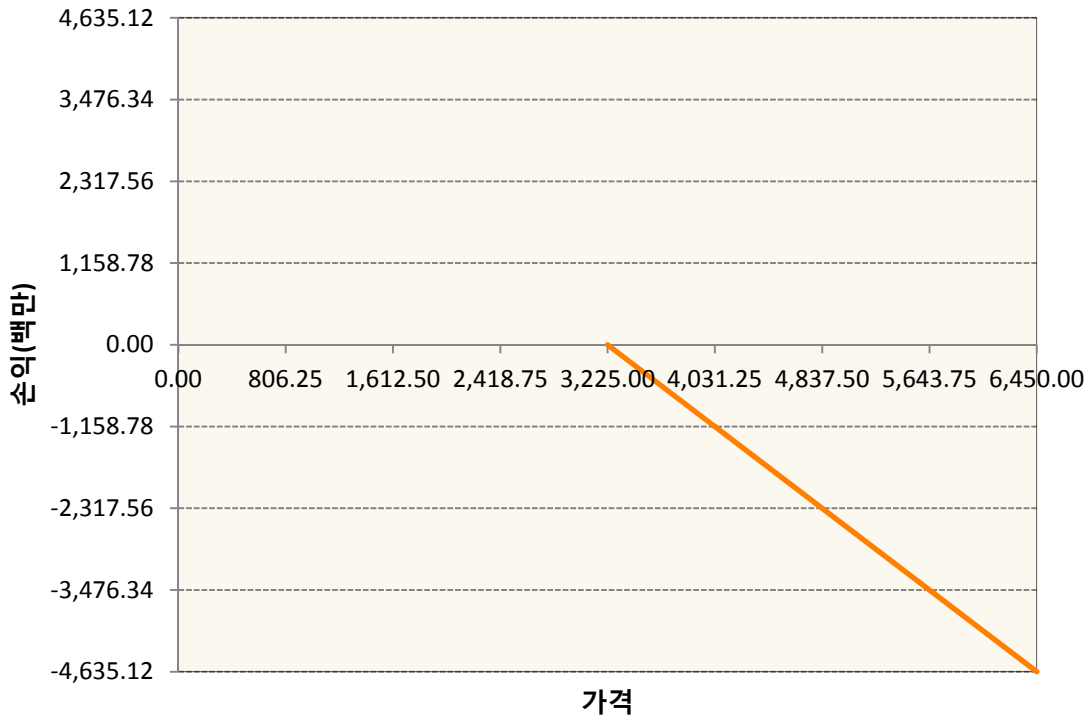
1. 계약금액

(단위:백만원)

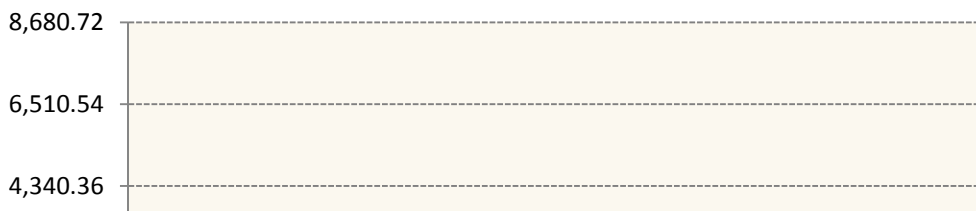
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	7,148	0	7,148	
누계	유가증권	스왑	60,049	0	60,049	장외
누계	유가증권	옵션	0	26,632	-26,632	장내
누계	통화	선도	0	15,263	-15,263	장외

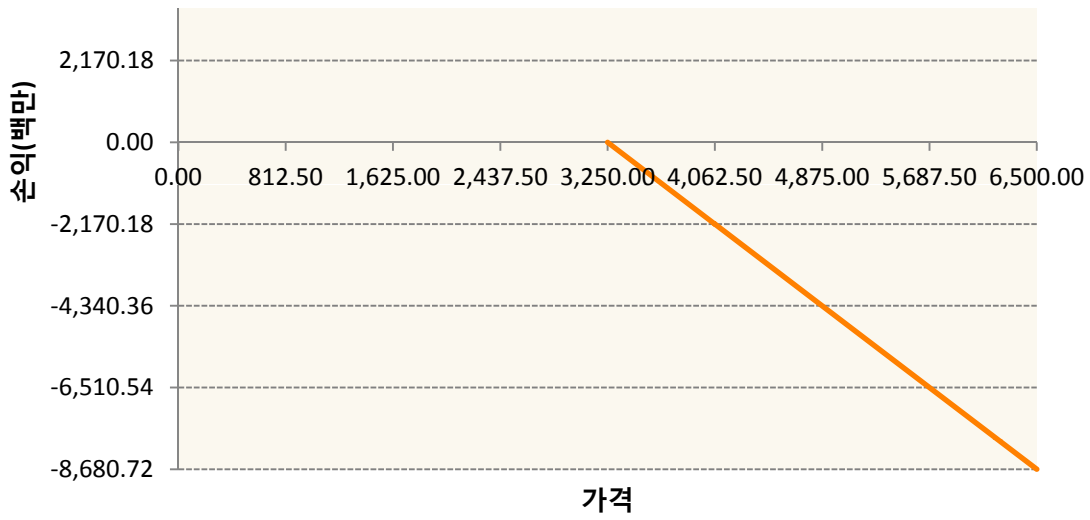
2. 만기시점의 손익구조

OESXH9-C3225-EURO STOXX 50

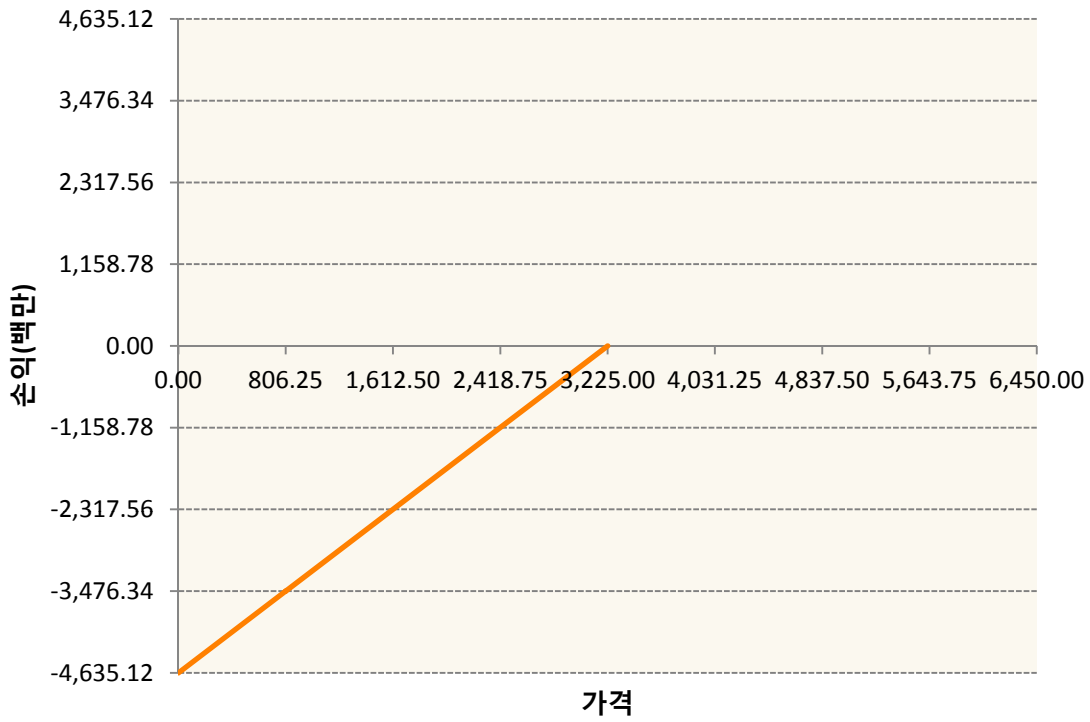


OESXH9-C3250-EURO STOXX 50

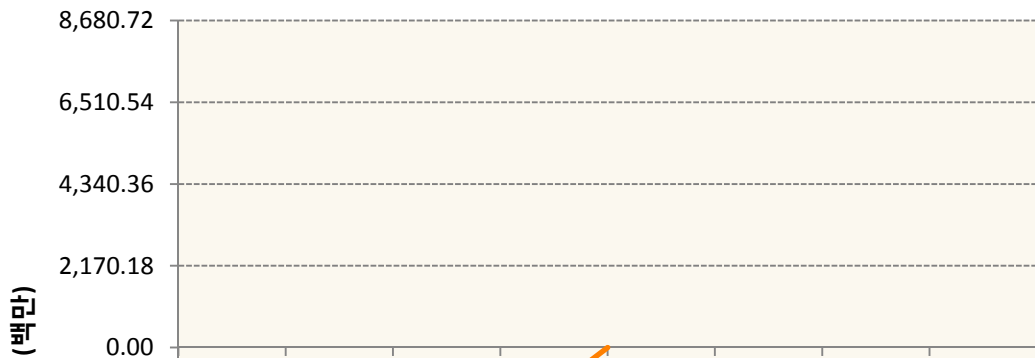


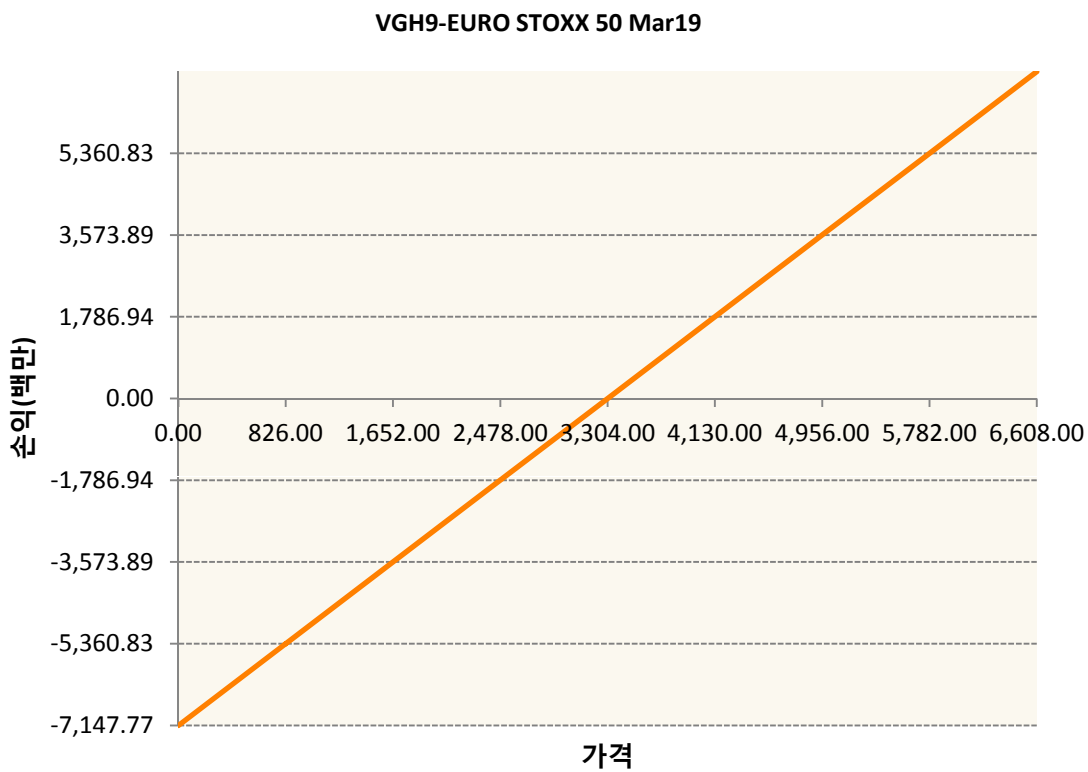
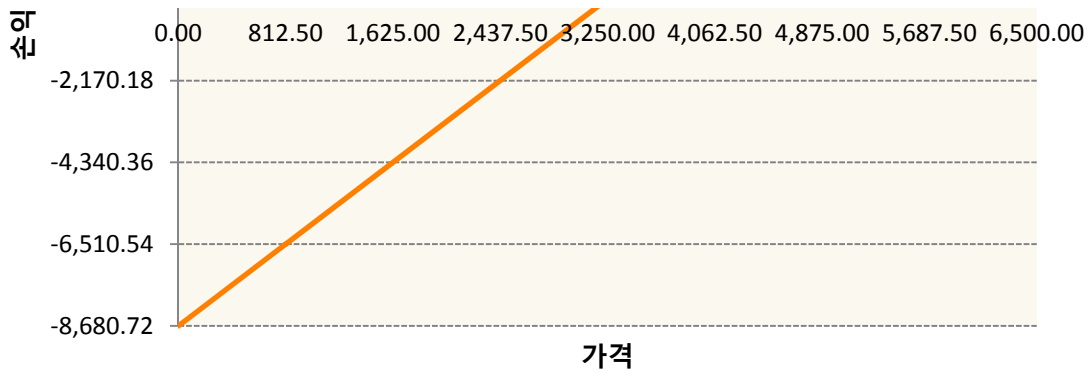


OESXH9-P3225-EURO STOXX 50



OESXH9-P3250-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY		132
FX21018Z03 KRW/EUR 22-03-19E		814
FX21019G02 KRW/EUR 24-05-19E		407
OESXH9-C32 EURO STOXX 50		371
OESXH9-C32 EURO STOXX 50		694
OESXH9-P32 EURO STOXX 50		371
OESXH9-P32 EURO STOXX 50		694
VGH9 EURO STOXX 50 Mar19		572

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

(단위:백만원)

2,668

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

(단위:백만원)

1,107

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

(단위:백만원)

95

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

(단위:백만원)

137

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

(단위:백만원)

43

공시일	2019-03-13
기준일	2019-03-12

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

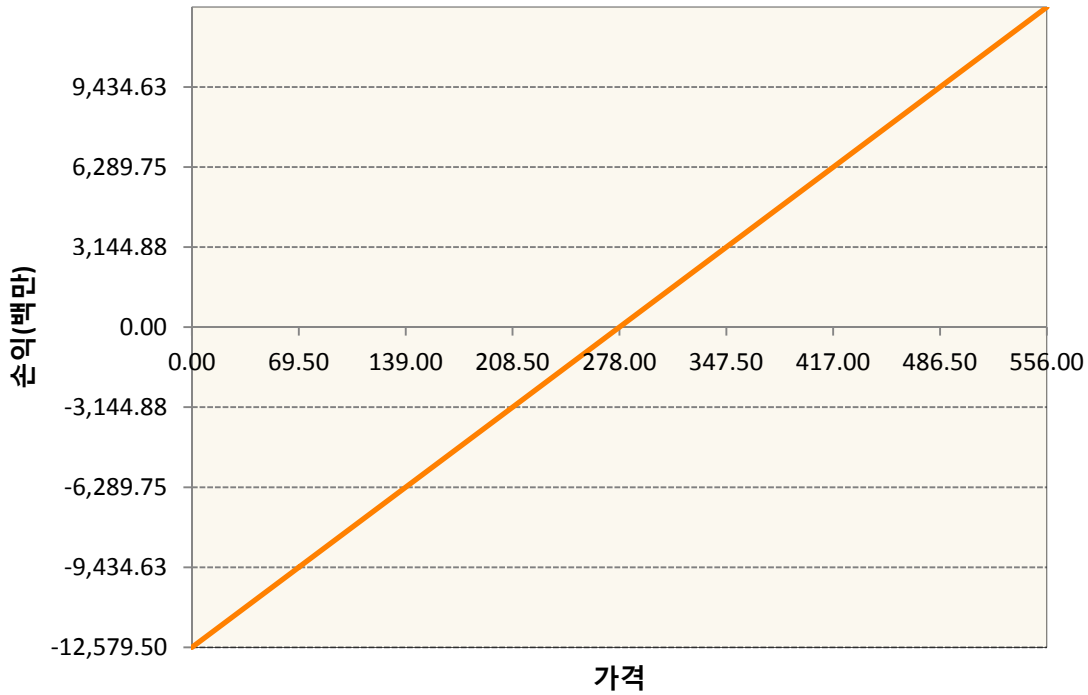
1. 계약금액

(단위:백만원)

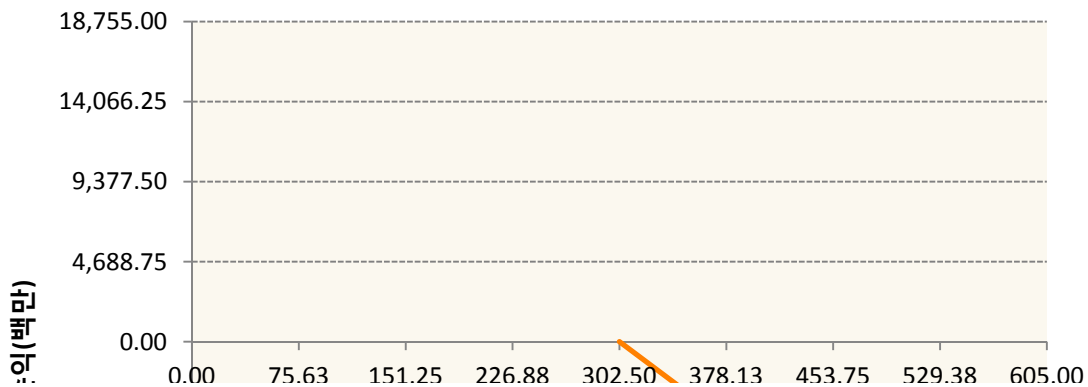
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	12,580	0	12,580	장내
누계	유가증권	옵션	2,165	24,931	-22,766	장내

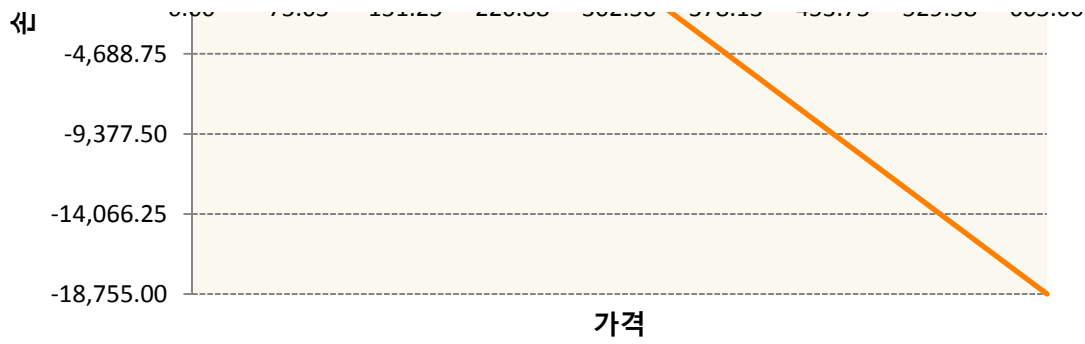
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P30007-2019-03 코스피200지수선물

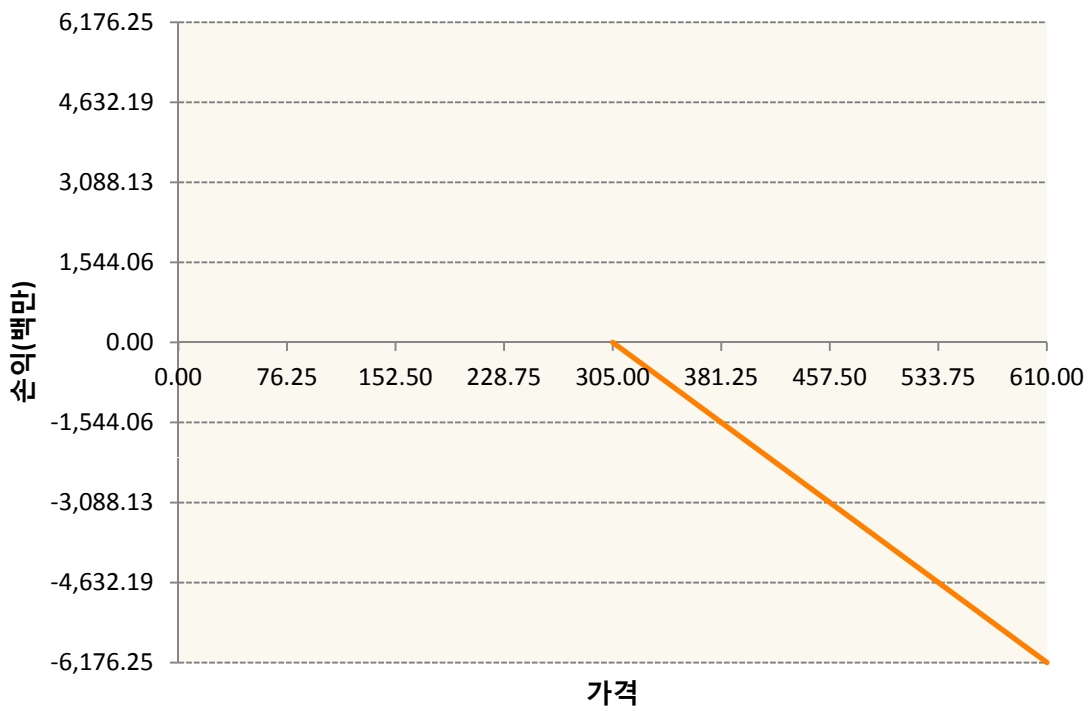


KR4201P33025-2019-03 콜302.5

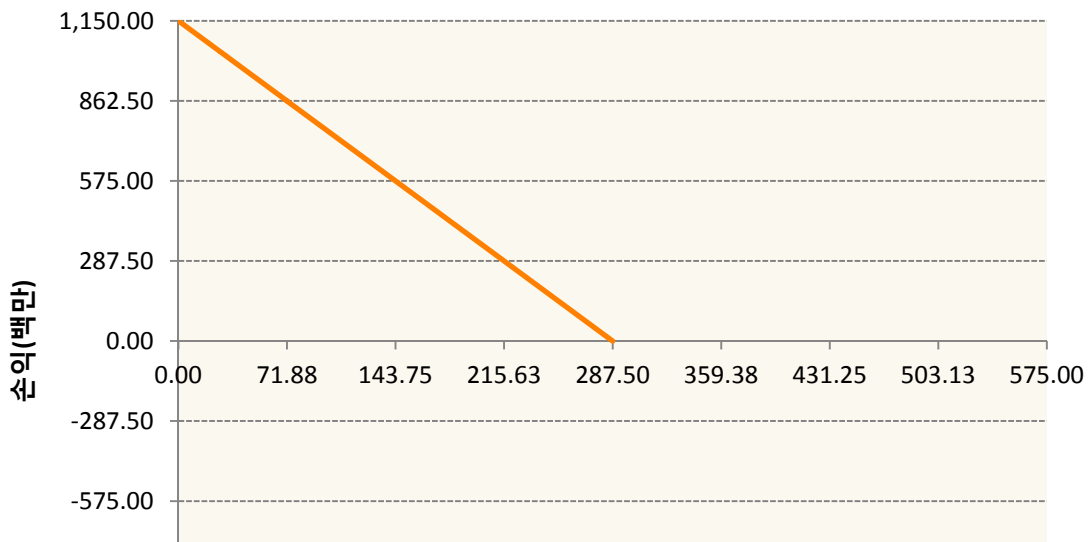


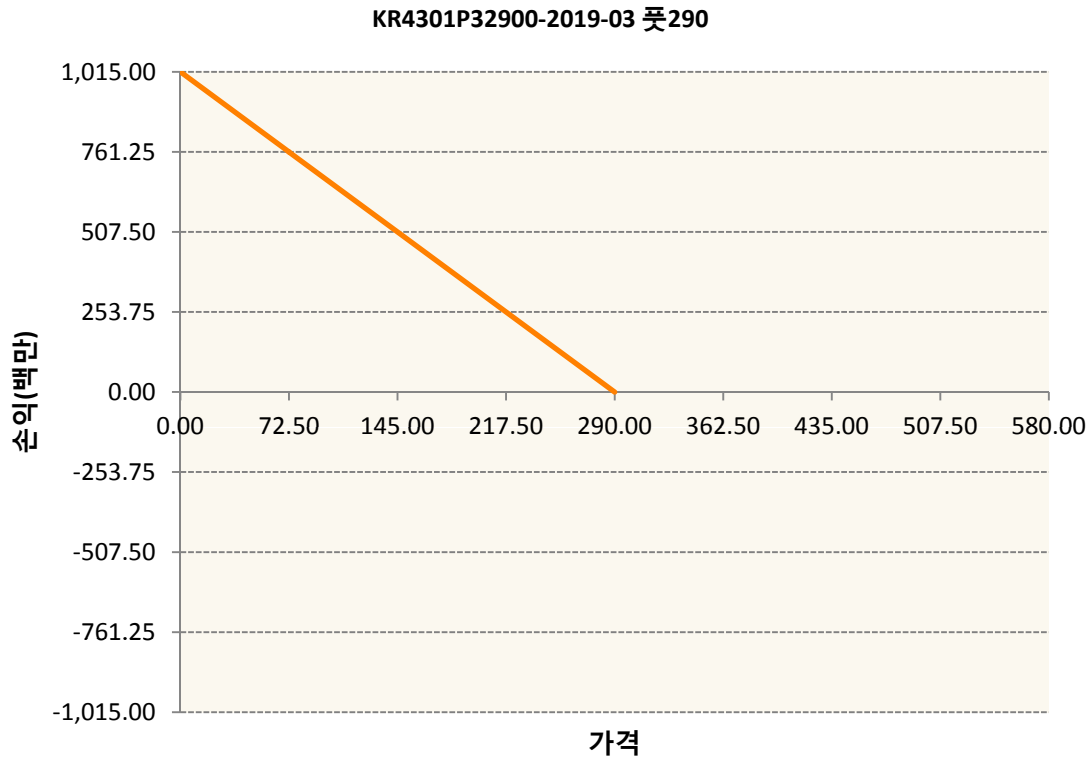
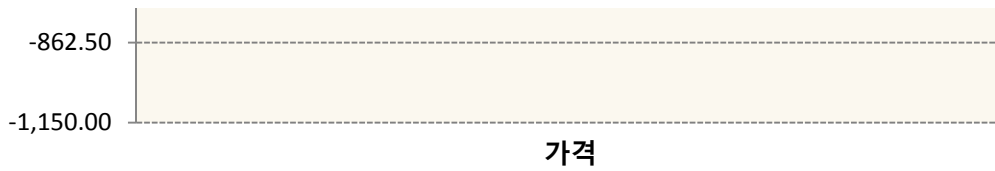


KR4201P33058-2019-03 콜305



KR4301P32876-2019-03 풋287.5





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101P30007		2019-03 코스피200지수선물						1,005
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-1,005	-1,005	-1,005	-1,005	-1,005	-1,005	-1,005	
-5.33%	-670	-670	-670	-670	-670	-670	-670	
-2.67%	-335	-335	-335	-335	-335	-335	-335	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	335	335	335	335	335	335	335	
5.33%	670	670	670	670	670	670	670	
8.00%	1,005	1,005	1,005	1,005	1,005	1,005	1,005	
KR4201P33025		2019-03 콜302.5						112
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	0	0	0	0	0	0	0	
-5.33%	0	0	0	0	0	0	0	
-2.67%	0	0	0	0	0	0	0	

0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	0	0	0	0	0	0	-1
5.33%	-1	-2	-4	-6	-9	-13	-17
8.00%	-47	-57	-68	-79	-90	-101	-112
KR4201P33058 2019-03 콜305							22
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	0	0	0	0	0	0	0
-5.33%	0	0	0	0	0	0	0
-2.67%	0	0	0	0	0	0	0
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	0	0	0	0	0	0	0
5.33%	0	0	0	-1	-1	-2	-3
8.00%	-6	-8	-10	-13	-16	-18	-22
KR4301P32876 2019-03 풋287.5							89
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	89	89	89	89	89	89	89
-5.33%	59	59	59	59	59	59	59
-2.67%	30	30	30	30	30	30	30
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-29	-29	-28	-28	-28	-28	-27
5.33%	-39	-39	-39	-39	-39	-39	-38
8.00%	-39	-39	-39	-39	-39	-39	-39
KR4301P32900 2019-03 풋290							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%	52	52	52	52	52	52	52
-2.67%	26	26	26	26	26	26	26
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-26	-26	-26	-26	-26	-25	-25
5.33%	-42	-42	-42	-42	-41	-41	-41
8.00%	-43	-43	-43	-43	-43	-43	-43

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

(단위:백만원)

1,020

공시일	2019-03-13
기준일	2019-03-12

H2O글로벌본드(USD)(채권혼합-파

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	791	0	791	
누계	유가증권	수익증권	1,695	0	1,695	

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	2019-03-13
기준일	2019-03-12

H2O글로벌본드(UH)(채권혼합-파)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	226	0	226	
누계	유가증권	수익증권	7,469	0	7,469	

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	2019-03-13
기준일	2019-03-12

H2O글로벌본드(H)(채권혼합-파생)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	904	0	904	
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	수익증권	41,160	0	41,160	
누계	통화	선도	0	43,164	-43,164	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음
FX21019F02: KRW/USD 28-03-19E	470
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	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	106
FX21019G01 KRW/USD 19-03-19E	106
FX21019G01 KRW/USD 19-03-19E	43
FX21019G01 KRW/USD 21-03-19E	425
FX21019G01 KRW/USD 21-03-19E	271
FX21019G02 KRW/USD 25-03-19E	136
FX21019G02 KRW/USD 25-03-19E	479
FX21019G03 KRW/USD 28-03-19E	253
FX21019G03 KRW/USD 28-03-19E	117
FX21019G03 KRW/USD 29-03-19E	334
FX21019G04 KRW/USD 10-04-19E	72
FX21019H00 KRW/USD 08-04-19E	36
FX21019H00 KRW/USD 10-04-19E	36
FX21019H01 KRW/USD 10-04-19E	99
FX21019H01 KRW/USD 10-04-19E	90
FX21019H01 KRW/USD 10-04-19E	108

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

(단위:백만원)

1,206

공시일	2019-03-13
기준일	2019-03-12

스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

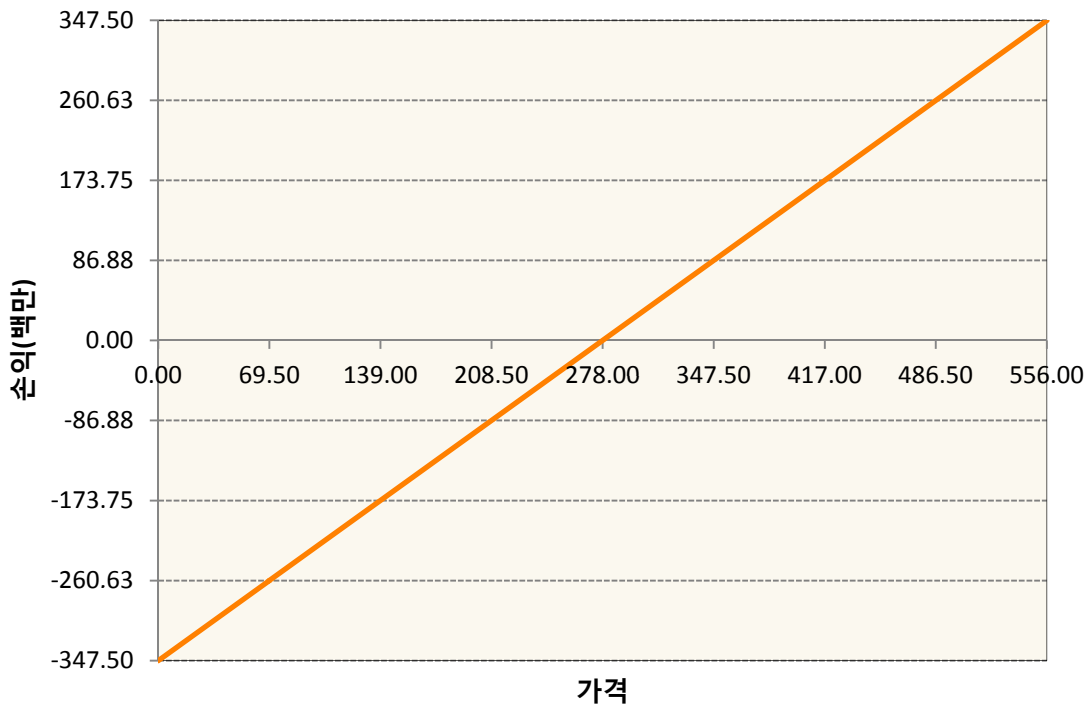
1. 계약금액

(단위:백만원)

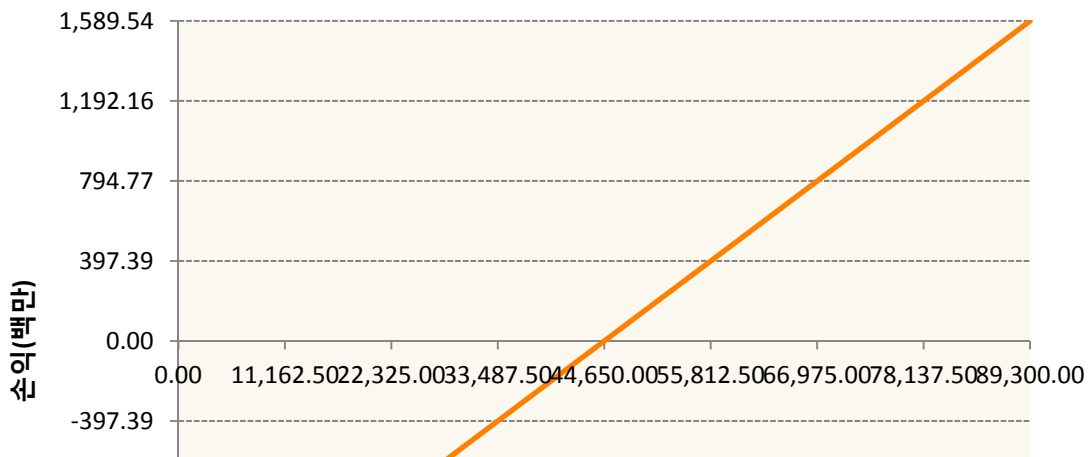
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,937	0	1,937	장내

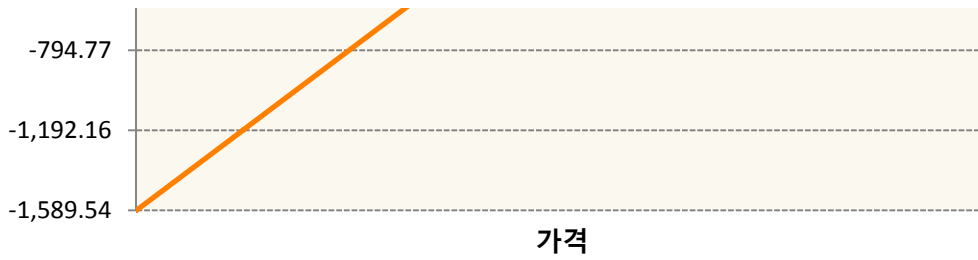
2. 만기시점의 손익구조

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						127
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-127	-127	-127	-127	-127	-127	-127	
-5.33%	-85	-85	-85	-85	-85	-85	-85	
-2.67%	-42	-42	-42	-42	-42	-42	-42	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	42	42	42	42	42	42	42	
5.33%	85	85	85	85	85	85	85	
8.00%	127	127	127	127	127	127	127	

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

170

공시일	2019-03-13
기준일	2019-03-12

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

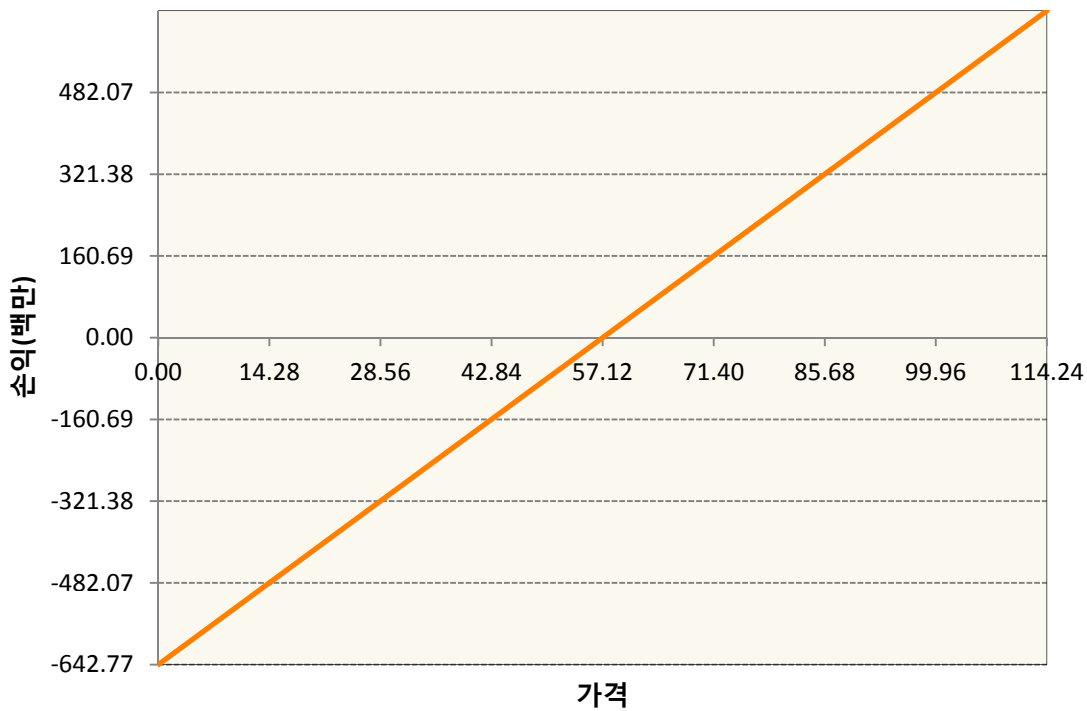
1. 계약금액

(단위:백만원)

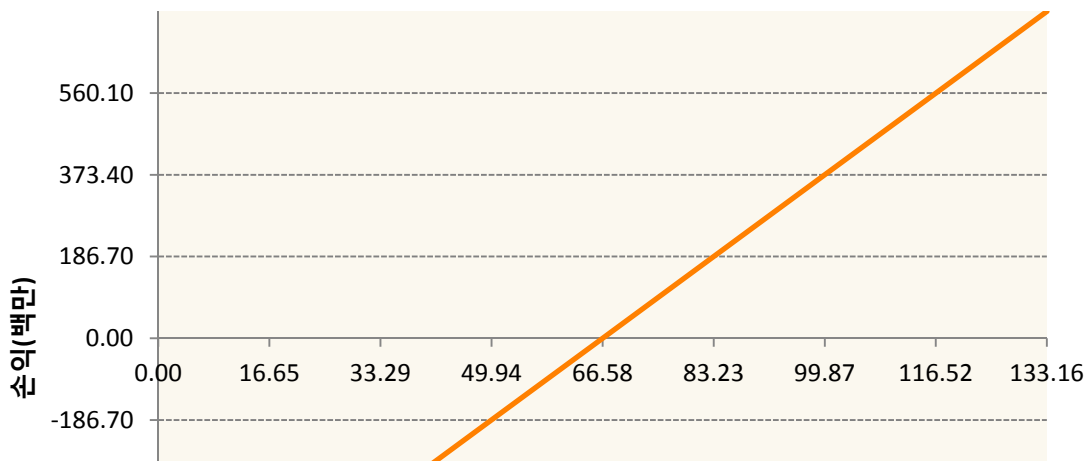
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,831	282	2,549	

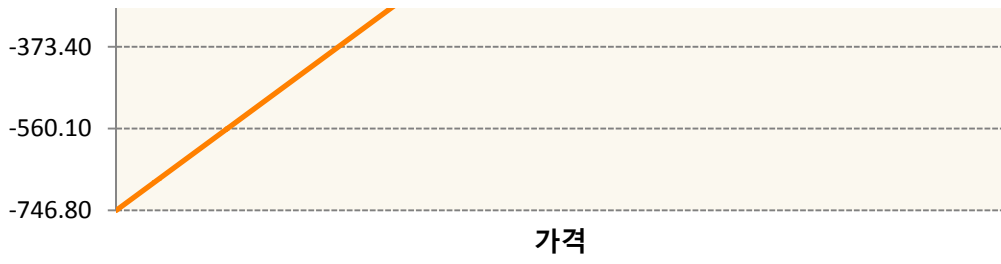
2. 만기시점의 손익구조

CLK9-WTI CRUDE FUTURE May19

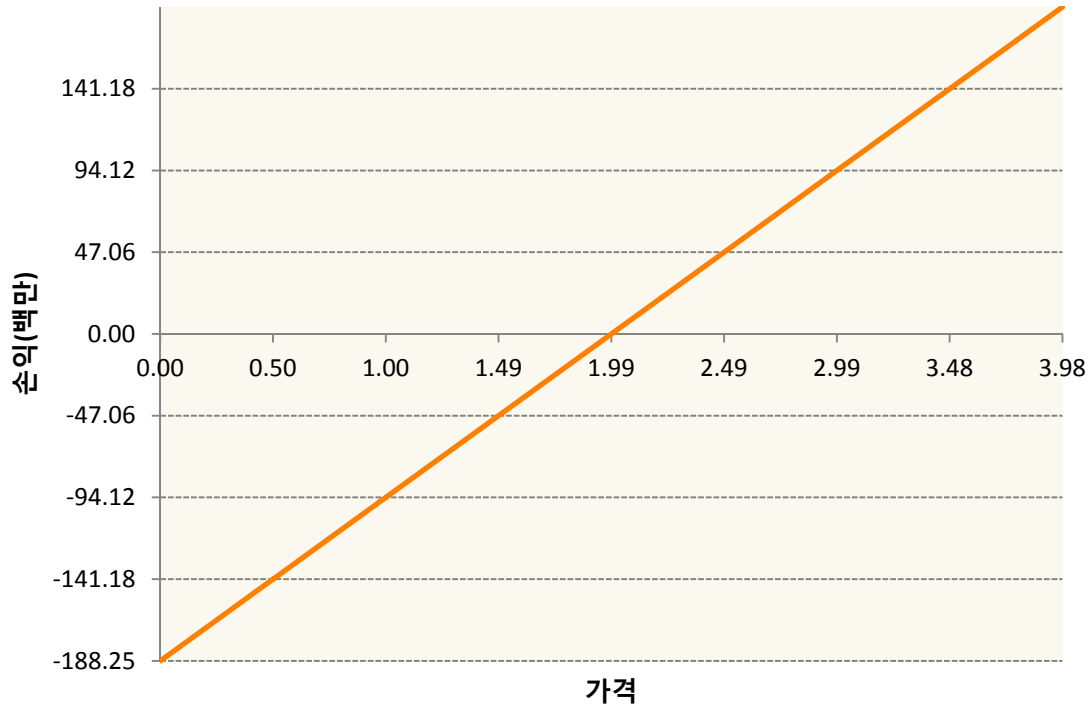


COK9-BRENT CRUDE FUTR May19



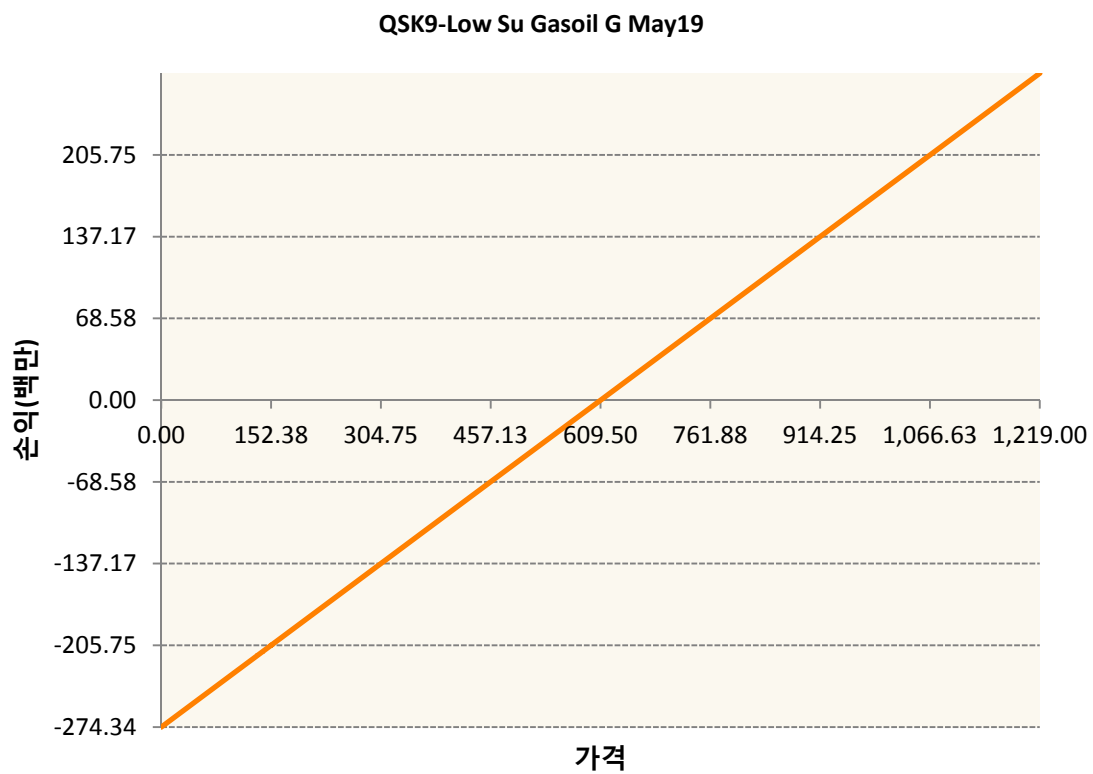
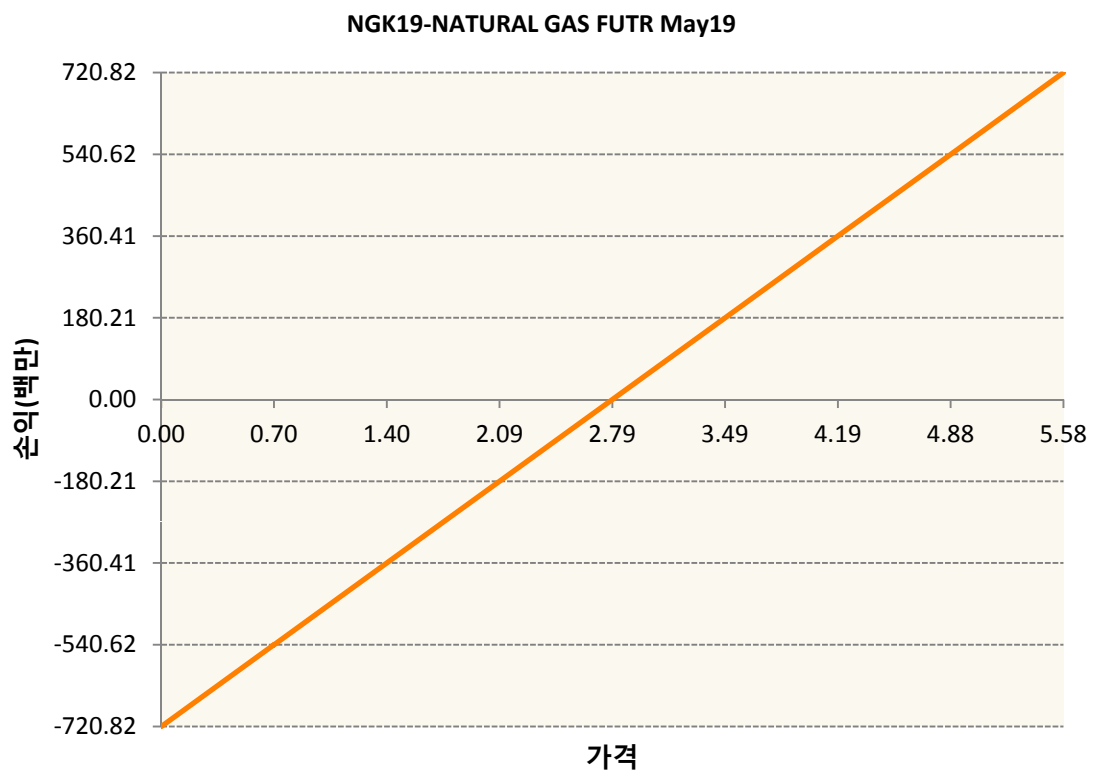
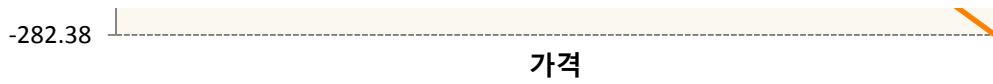


HOK9-NY Harb ULSD Fut May19

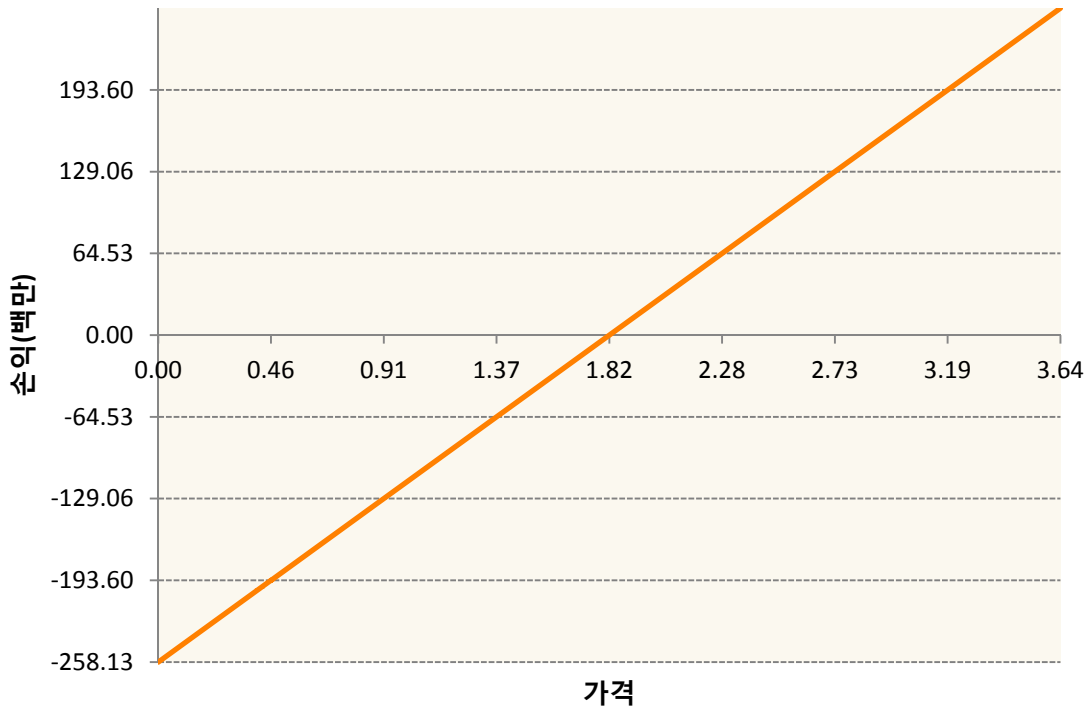


KR4175P30001-2019-03 달러선물





XBK9-GASOLINE RBOB FUT May19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

CLK9	WTI CRUDE FUTURE May19	51
COK9	BRENT CRUDE FUTR May19	60
HOK9	NY Harb ULSD Fut May19	15
KR4175P300	2019-03 달러선물	23
NGK19	NATURAL GAS FUTR May19	58
QSK9	Low Su Gasoil G May19	22
XBK9	GASOLINE RBOB FUT May19	21

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

(단위:백만원)

432

공시일	2019-03-13
기준일	2019-03-12

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

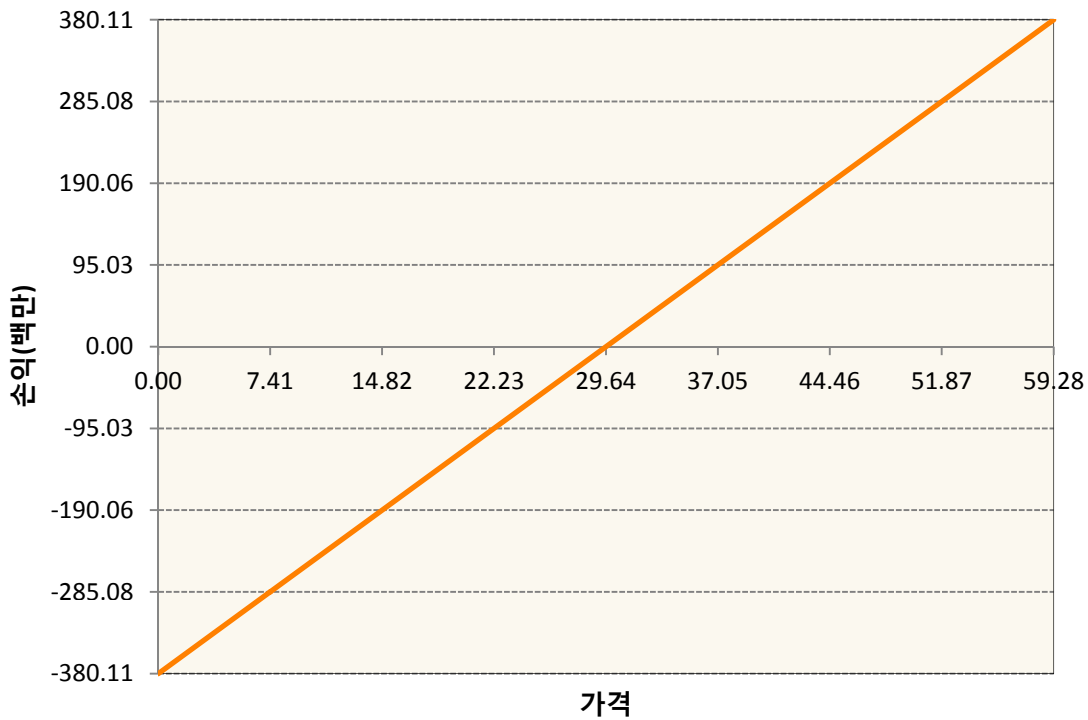
1. 계약금액

(단위:백만원)

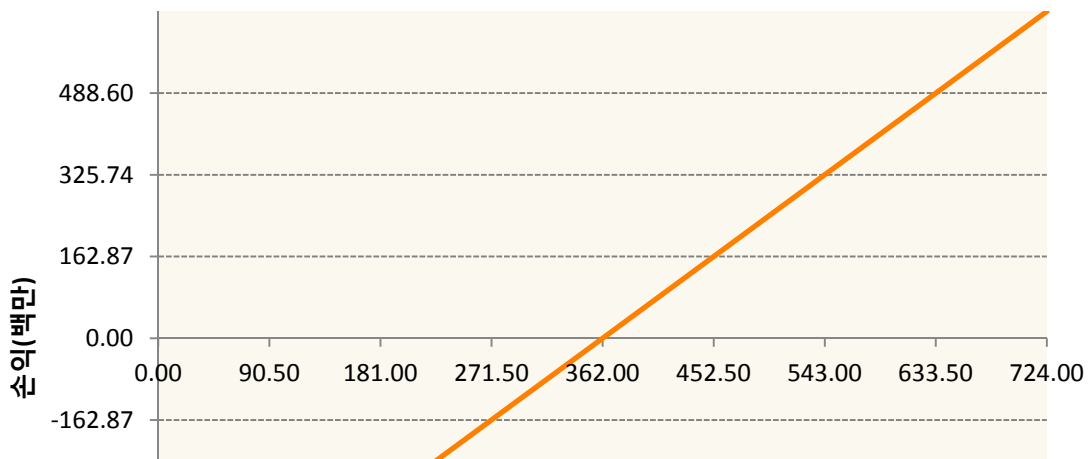
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,303	79	3,224	

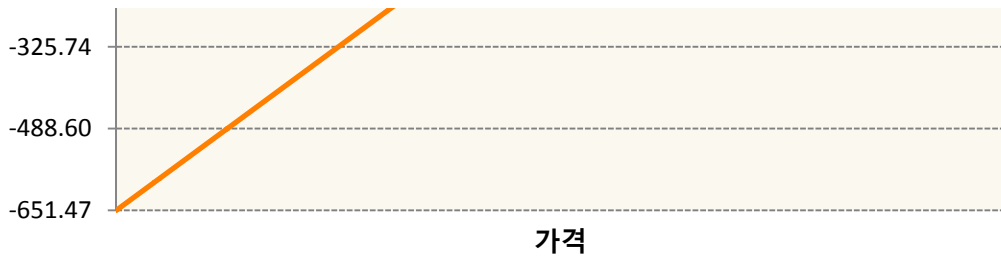
2. 만기시점의 손익구조

BOK9-SOYBEAN OIL FUTR May19

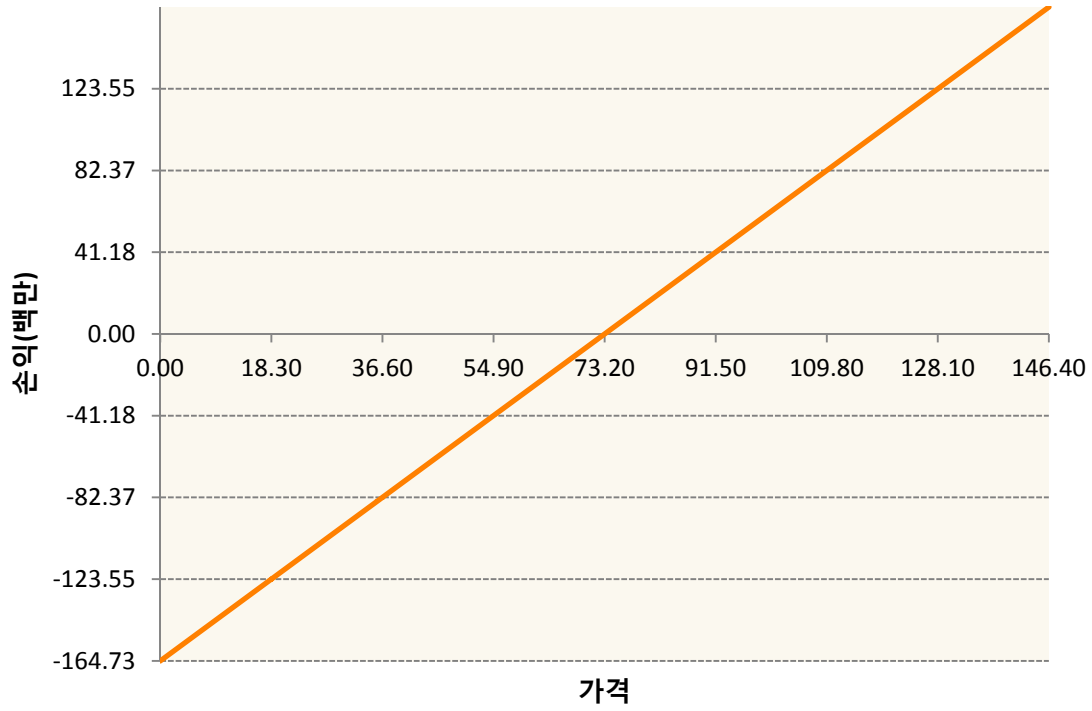


CK9-CORN FUTURE May19

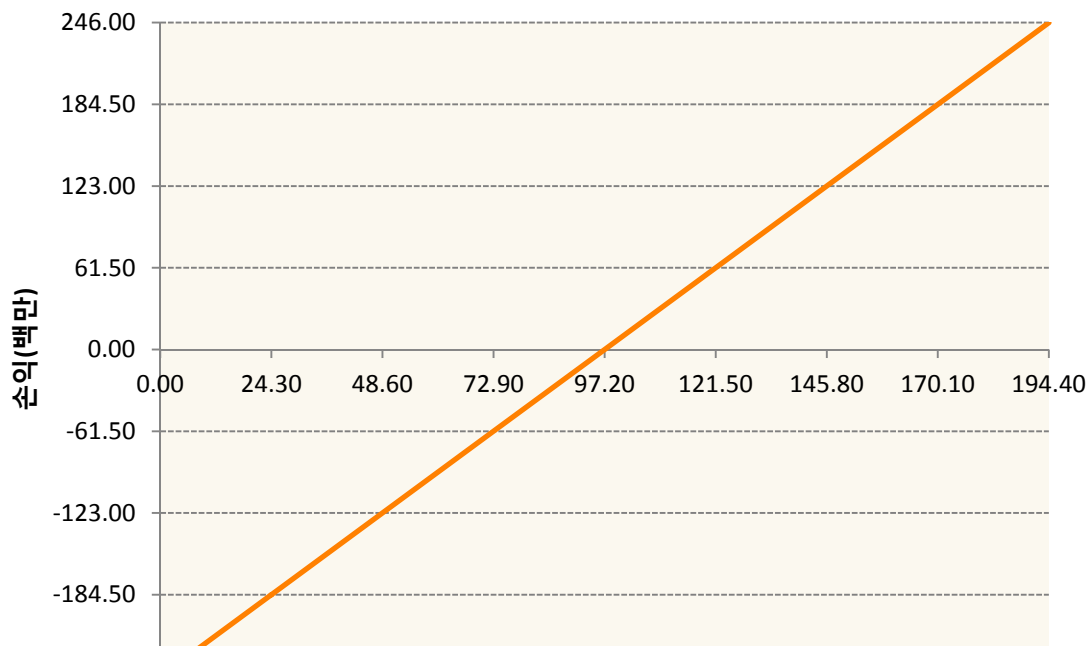


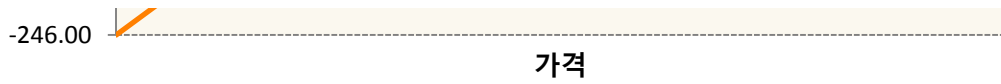


CTK9-COTTON NO.2 FUTR May19

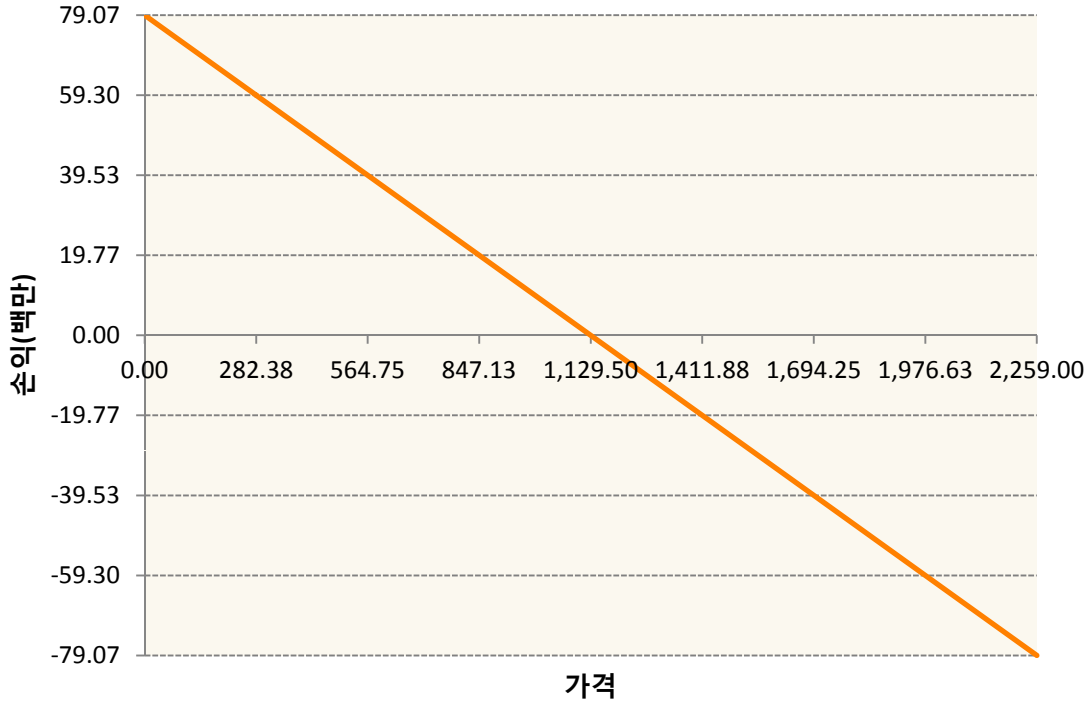


KCK9-COFFEE 'C' FUTURE May19

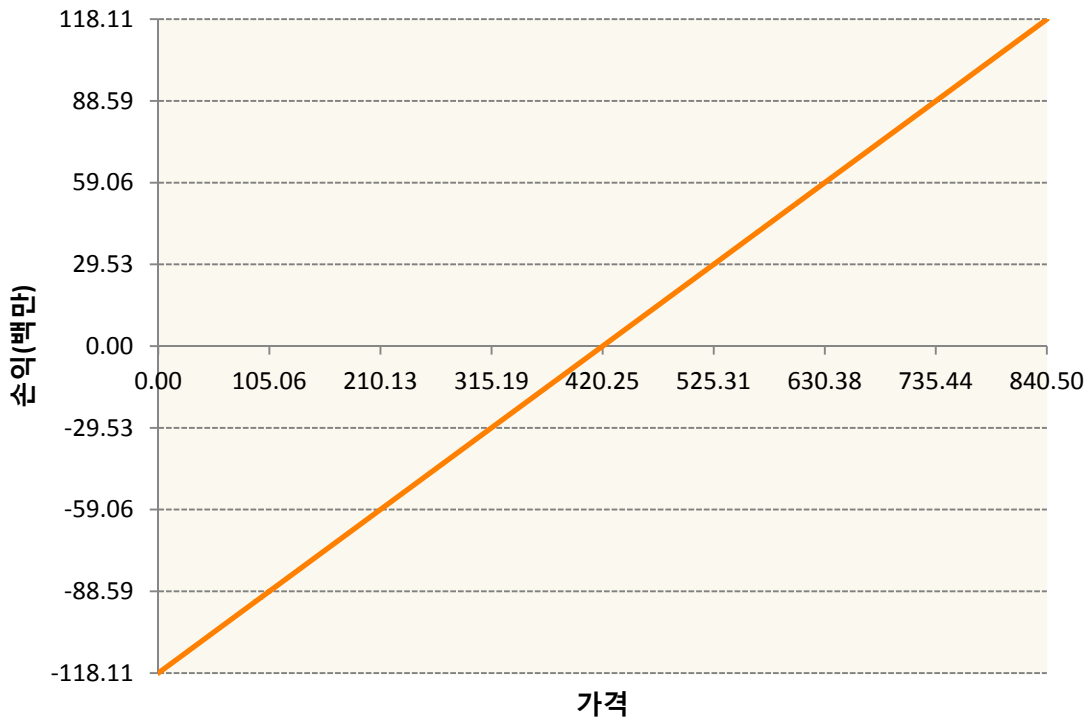




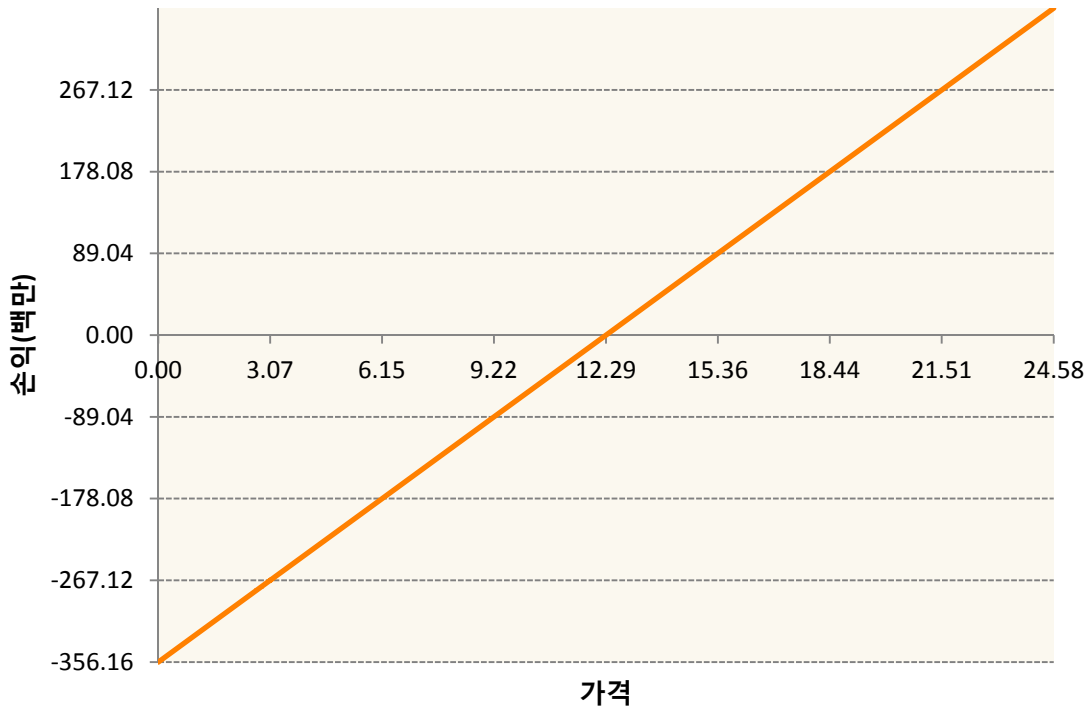
KR4175P30001-2019-03 달러선물



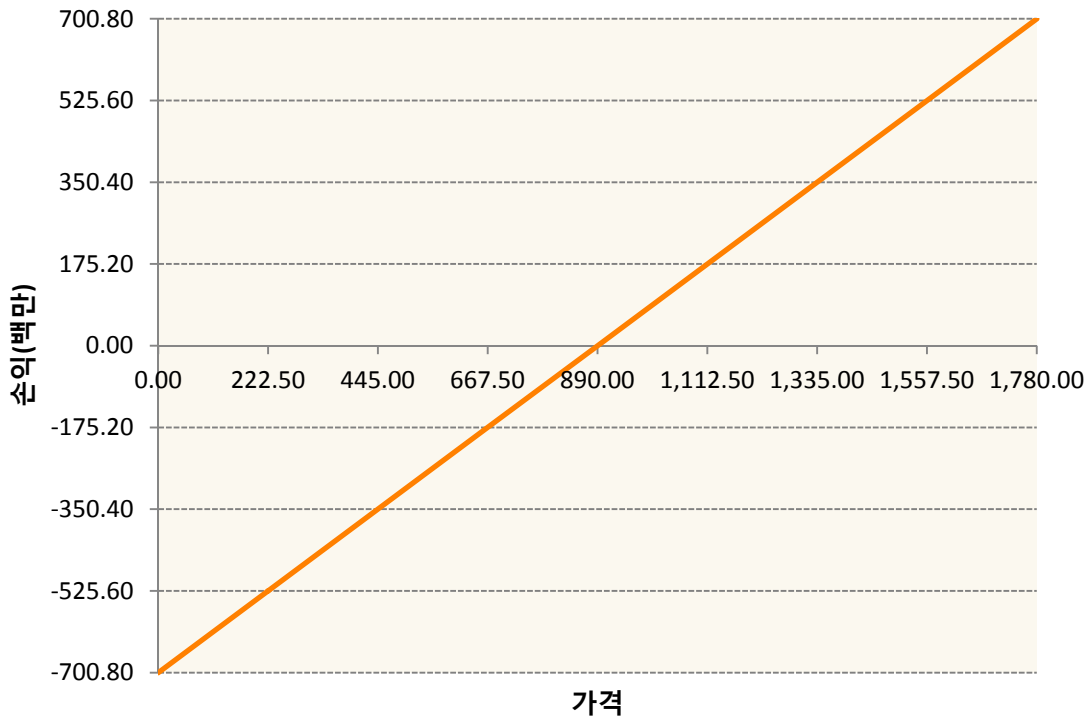
KWK9-KC HRW WHEAT FUT May19



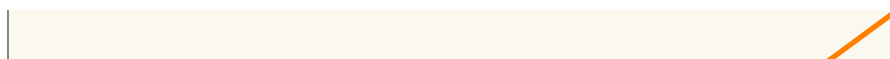
SBK9-SUGAR #11 (WORLD) May19

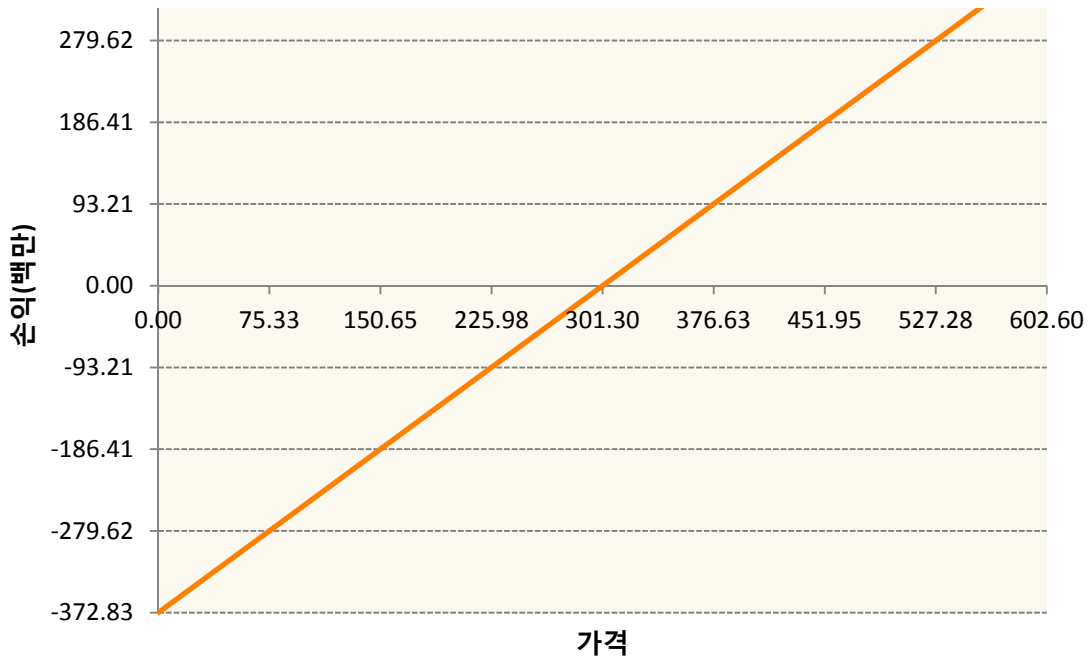


SK9-SOYBEAN FUTURE May19

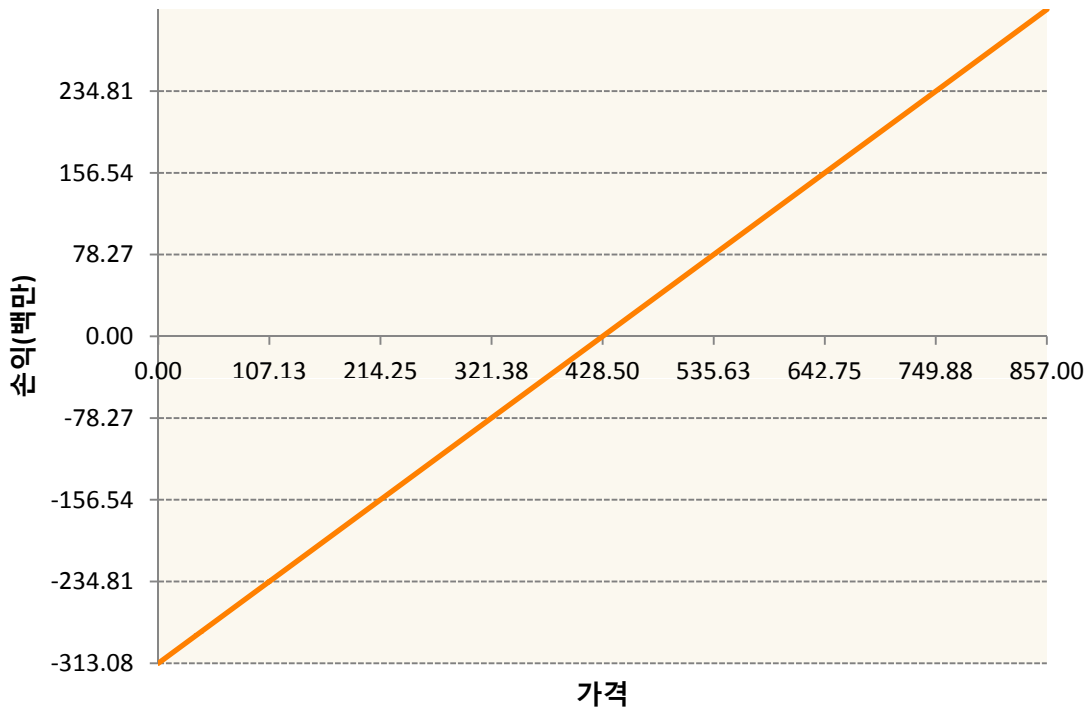


SMK9-SOYBEAN MEAL FUTR May19





WK9-WHEAT FUTURE(CBT) May19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

BOK9	SOYBEAN OIL FUTR May19	30
CK9	CORN FUTURE May19	52
CTK9	COTTON NO.2 FUTR May19	13
KCK9	COFFEE 'C' FUTURE May19	20
KR4175P300	2019-03 달러선물	6

KWK9	KC HRW WHEAT FUT May19	9
SBK9	SUGAR #11 (WORLD) May19	28
SK9	SOYBEAN FUTURE May19	56
SMK9	SOYBEAN MEAL FUTR May19	30
WK9	WHEAT FUTURE(CBT) May19	25

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

(단위:백만원)

263