

공시일	2019-04-12
기준일	2019-04-11

## 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	2019-04-12
기준일	2019-04-11

## 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

1,150

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

675

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-04-12
기준일	2019-04-11

## 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)	358
SWCSI50000 신한CSI500미래S190308(S190129 신규)	99
SWCSI50000 신한CSI500미래S190308(신규)	167

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

<b>975</b>
------------

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-04-12
기준일	2019-04-11

## 유로인덱스모(주식-파생형)

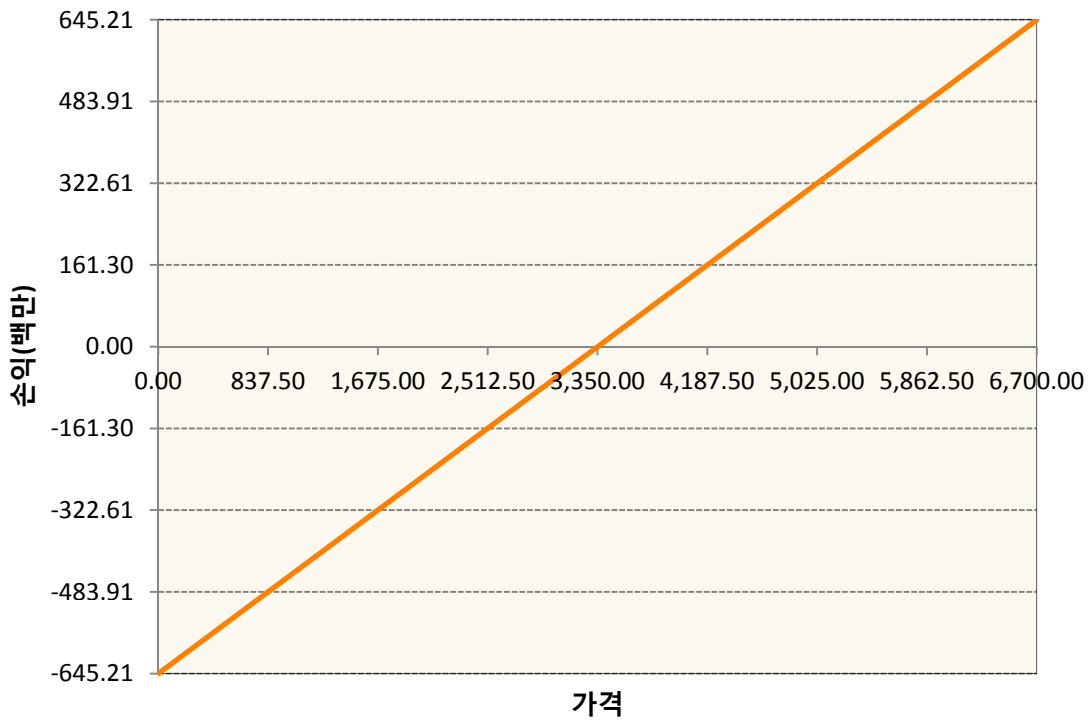
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	645	0	645	

### 2. 만기시점의 손익구조

VGM9-EURO STOXX 50 JUN19



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGM9	EURO STOXX 50 JUN19	52
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

37
----

공시일	2019-04-12
기준일	2019-04-11

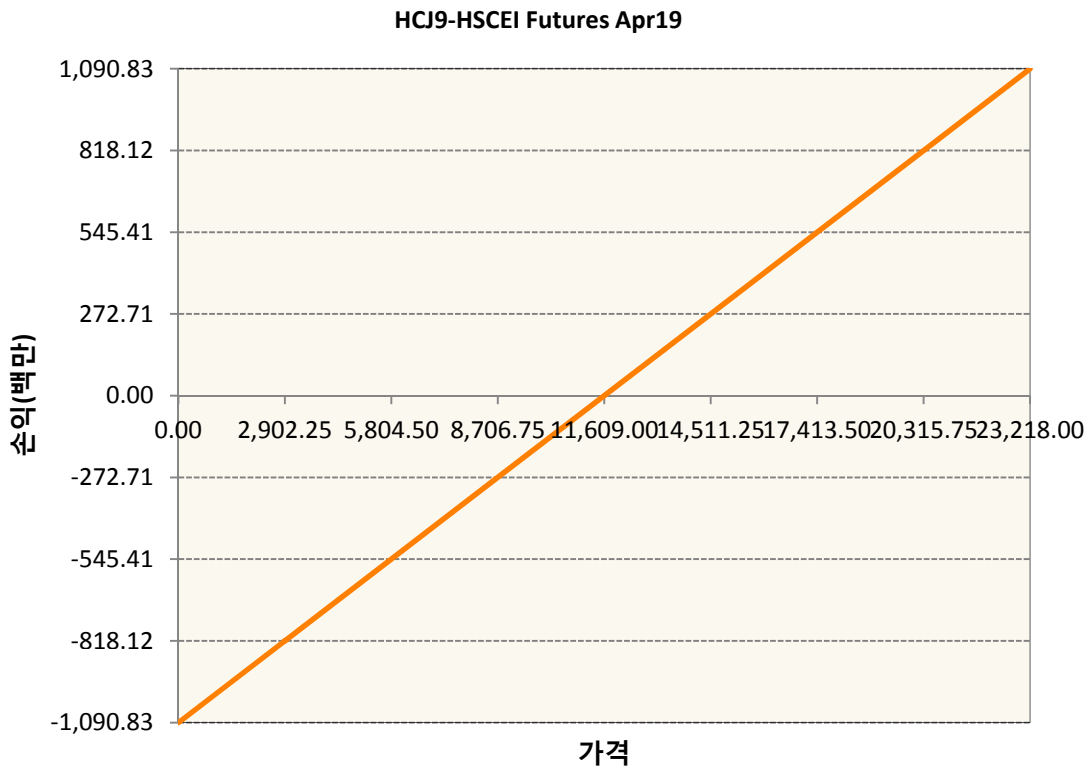
## 차이나인덱스모(주식-파생형)

### 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	1,091	0	1,091	장내

### 2. 만기시점의 손익구조



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCI9	HSCEI Futures Apr19	87
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

89
----

공시일	2019-04-12
기준일	2019-04-11

## 커버드콜모(주식혼합-파생형)

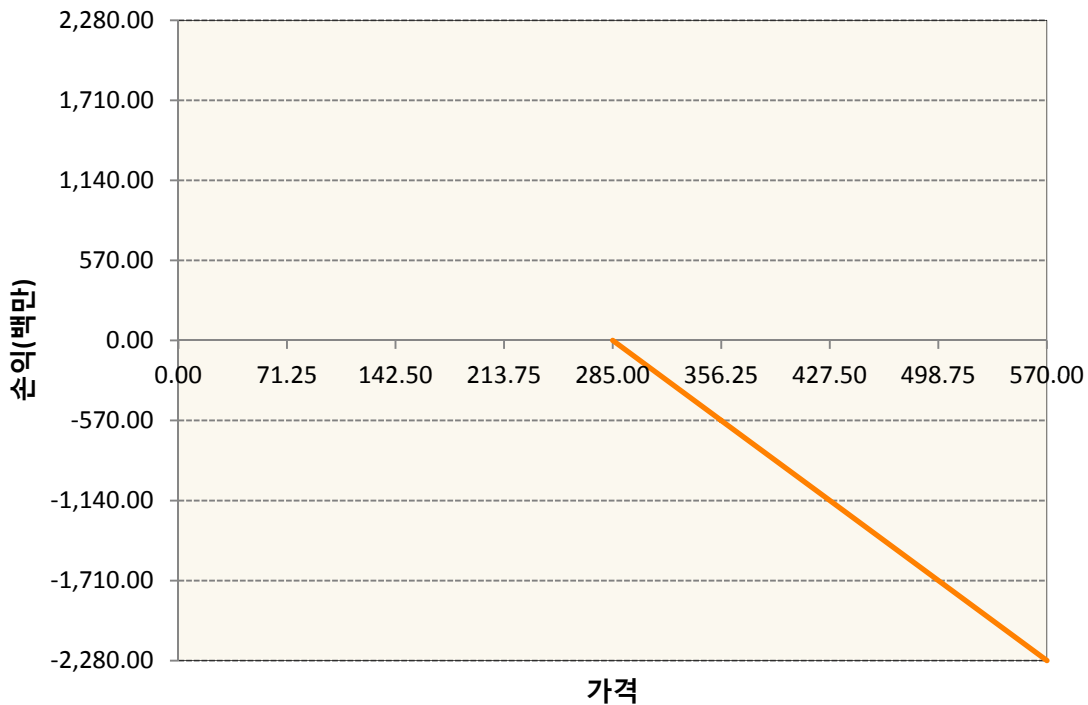
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

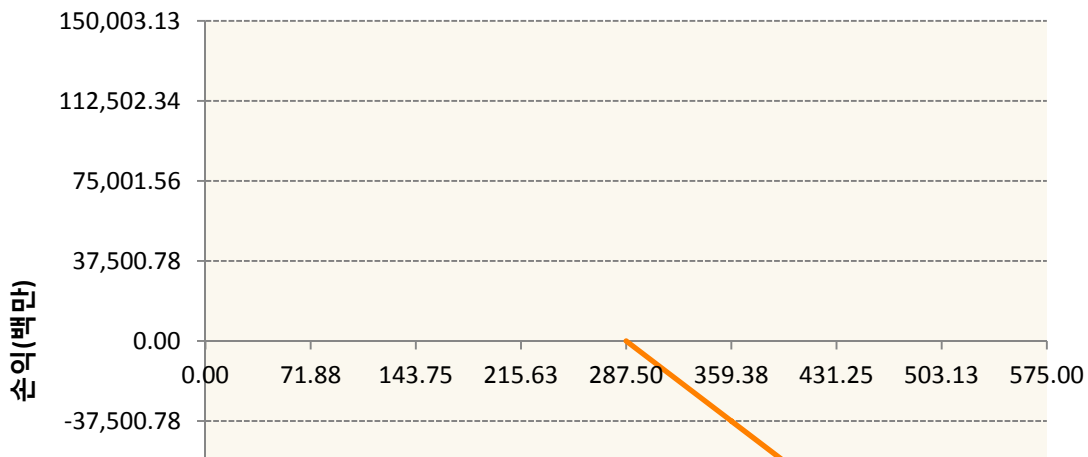
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	196,745	-196,745	장내
누계	유가증권	옵션	0	194,406	-194,406	장내

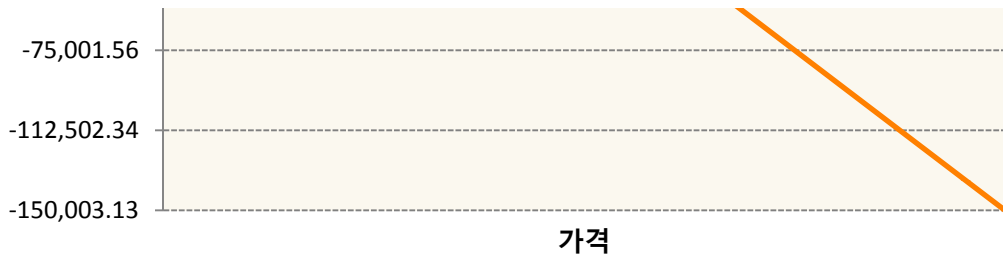
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4201P52850-2019-05 콜285

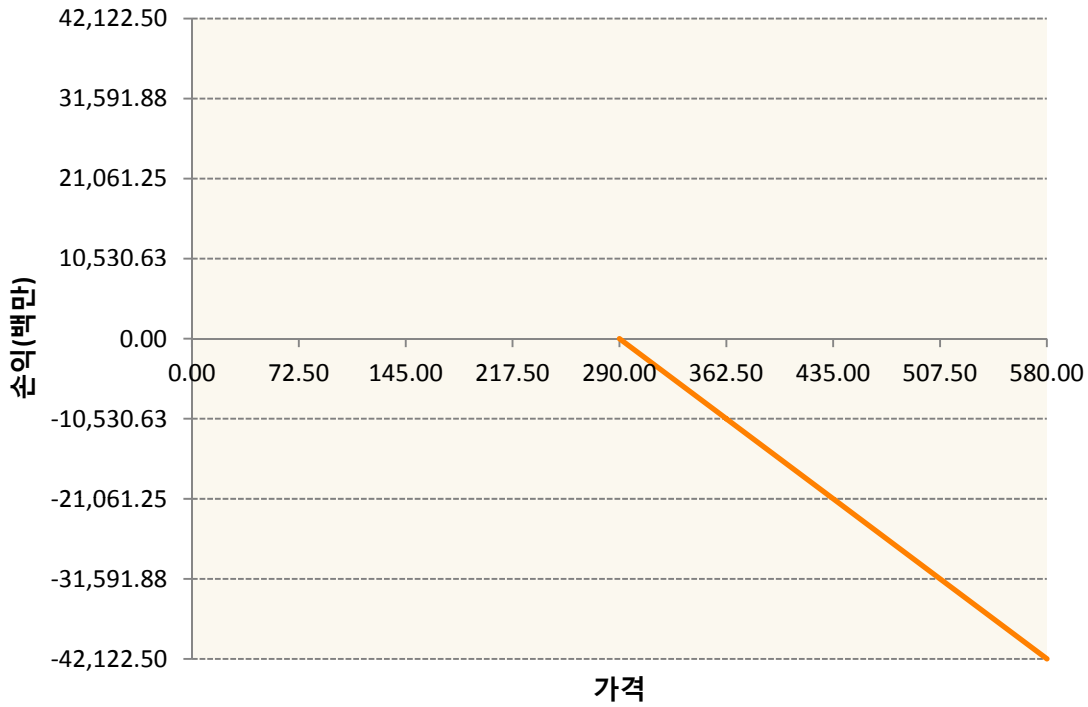


KR4201P52876-2019-05 콜287.5





KR4201P52900-2019-05 콜290



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201P52850		2019-05 콜285					148
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	66	65	63	60	58	55	52
-5.33%	59	56	53	49	45	41	37
-2.67%	43	39	34	29	25	20	15
0%	15	10	5	0	-5	-10	-15
2.67%	-27	-31	-35	-39	-44	-48	-53
5.33%	-78	-81	-83	-87	-90	-94	-97
8.00%	-135	-136	-138	-140	-142	-145	-148
KR4201P52876		2019-05 콜287.5					9,232
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	3,724	3,642	3,537	3,412	3,268	3,107	2,931

-5.33%	3,391	3,214	3,018	2,805	2,580	2,343	2,098
-2.67%	2,560	2,283	1,999	1,709	1,415	1,118	818
0%	971	647	324	0	-324	-647	-971
2.67%	-1,467	-1,756	-2,052	-2,353	-2,658	-2,966	-3,277
5.33%	-4,622	-4,824	-5,045	-5,281	-5,530	-5,789	-6,057
8.00%	-8,243	-8,354	-8,491	-8,649	-8,827	-9,022	-9,232
KR4201P52900                      2019-05 콜290							2,445
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	883	866	843	814	780	741	697
-5.33%	817	776	729	677	621	561	498
-2.67%	637	567	494	419	342	263	182
0%	268	179	90	0	-90	-179	-269
2.67%	-335	-421	-509	-597	-686	-775	-865
5.33%	-1,153	-1,219	-1,289	-1,362	-1,438	-1,516	-1,597
8.00%	-2,124	-2,164	-2,210	-2,262	-2,319	-2,381	-2,445

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

(단위:백만원)

**11,461**

공시일	2019-04-12
기준일	2019-04-11

## 홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

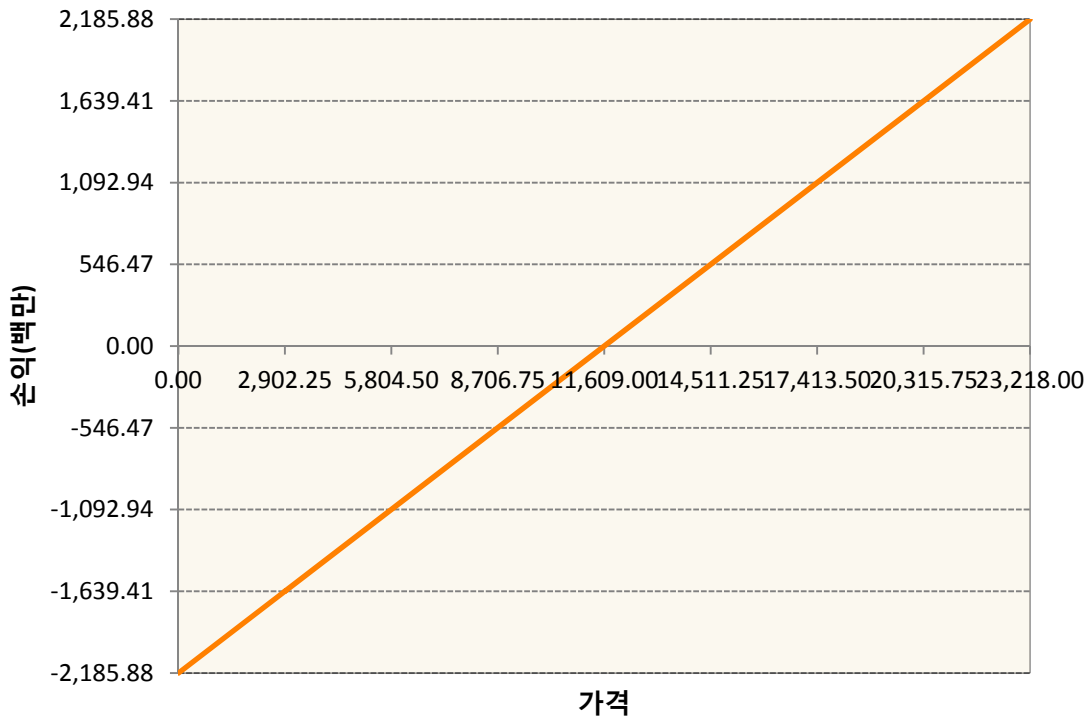
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

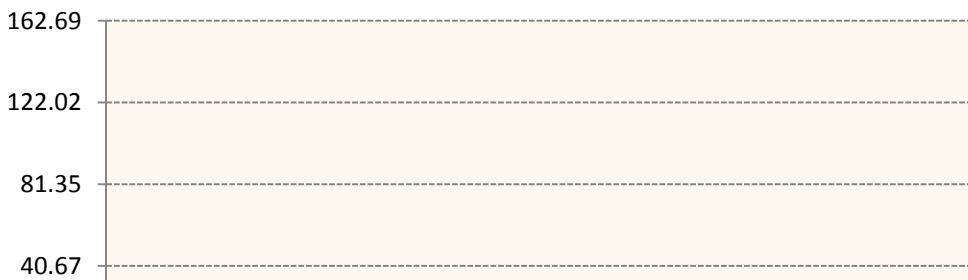
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	2,186	0	2,186	장내
누계	유가증권	옵션	0	5,578	-5,578	장내
누계	통화	선도	0	3,050	-3,050	장외

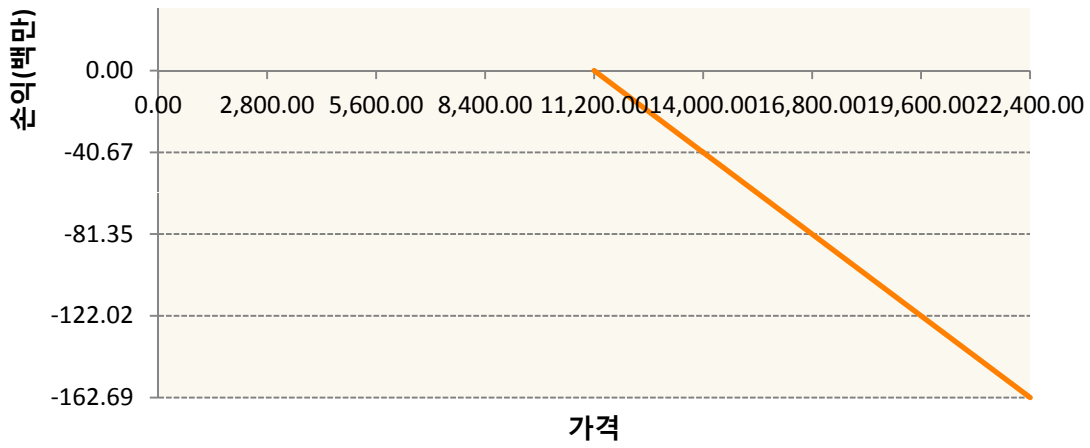
### 2. 만기시점의 손익구조

HCJ9-HSCEI Futures Apr19

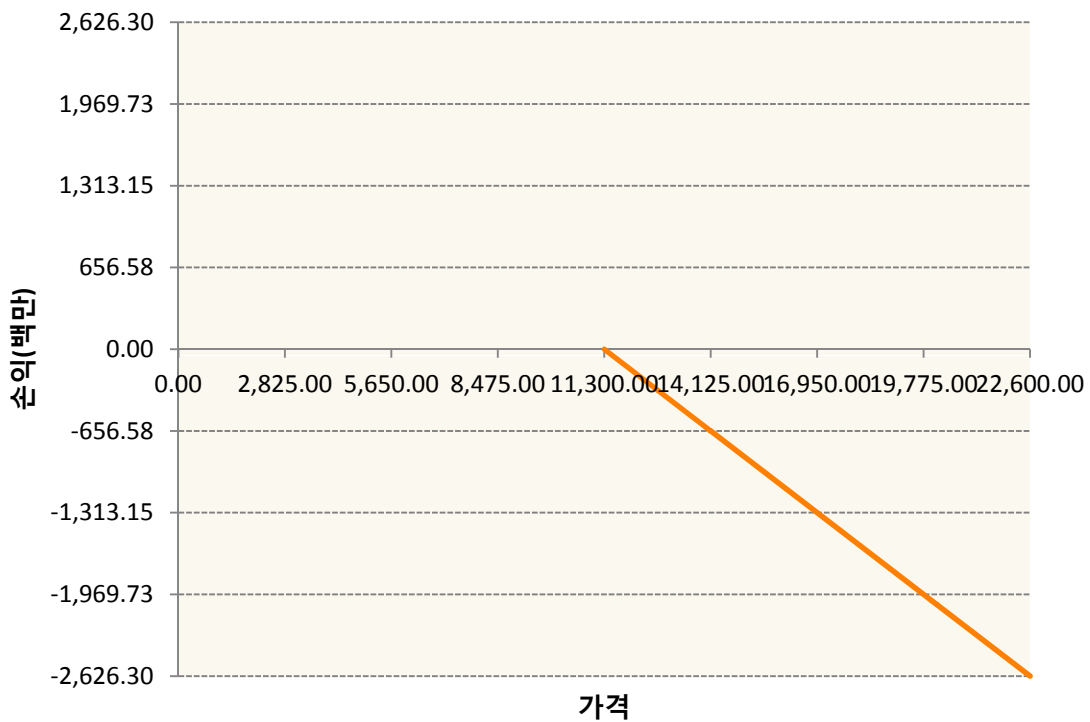


OHHIJ9-C112-HSCEI

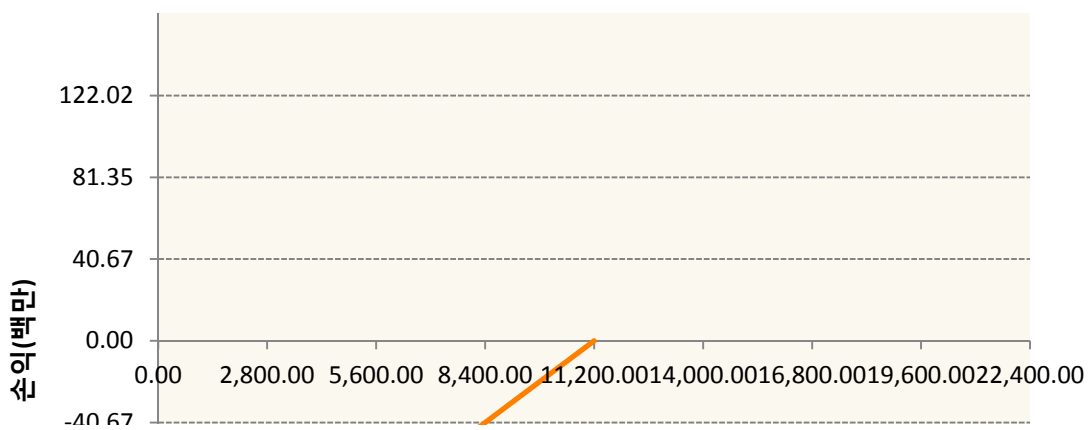


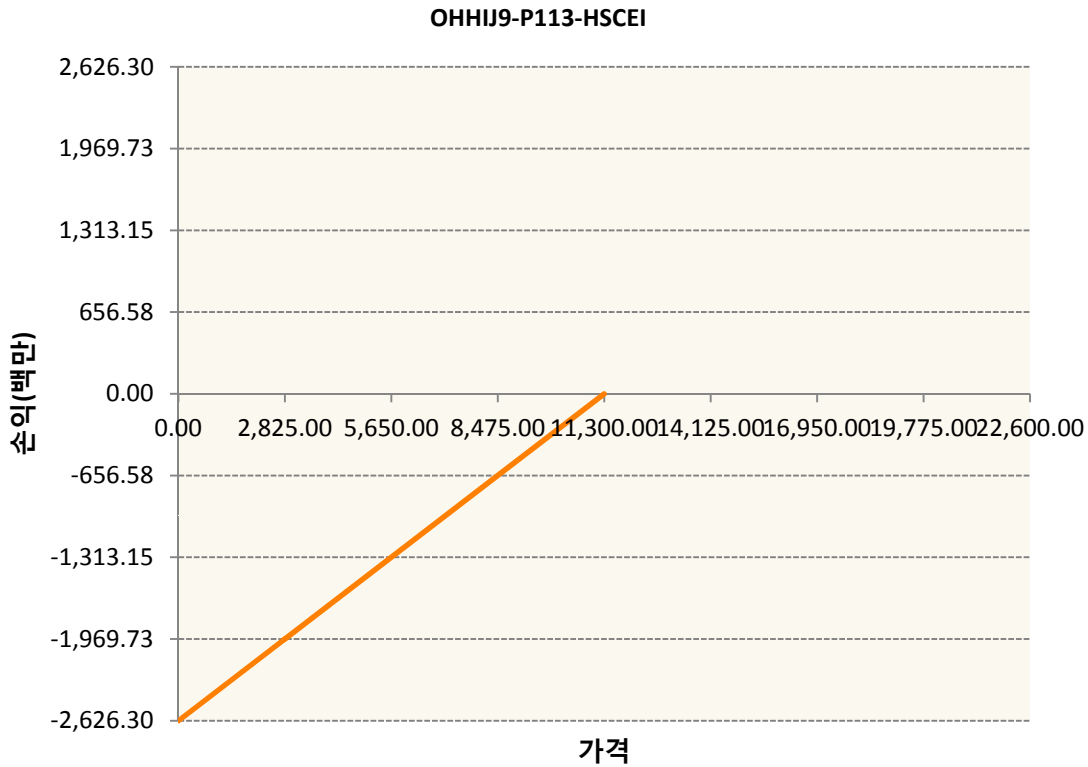
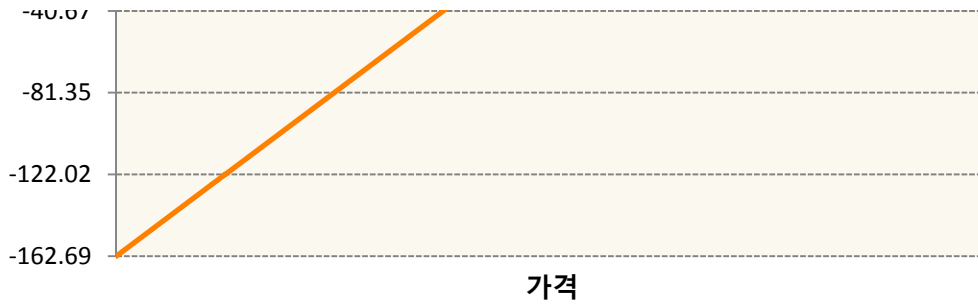


**OHHIJ9-C113-HSCEI**



**OHHIJ9-P112-HSCEI**





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)	(단위:백만원)
FX21019H01 KRW/HKD 24-05-19E	221
FX21019H01 KRW/HKD 24-05-19E	23
HCJ9 HSCEI Futures Apr19	175
OHHIJ9-C11 HSCEI	13
OHHIJ9-C11 HSCEI	210
OHHIJ9-P11: HSCEI	13
OHHIJ9-P11: HSCEI	210

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	719



5.33%	1,633	1,633	1,633	1,633	1,633	1,633	1,633	
8.00%	2,449	2,449	2,449	2,449	2,449	2,449	2,449	
2.529E+11							UBCSFXC1 INDEX_15	594
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-594	-594	-594	-594	-594	-594	-594	
-5.33%	-396	-396	-396	-396	-396	-396	-396	
-2.67%	-198	-198	-198	-198	-198	-198	-198	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	198	198	198	198	198	198	198	
5.33%	396	396	396	396	396	396	396	
8.00%	594	594	594	594	594	594	594	
KR4101P60004							2019-06 코스피200지수선물	322
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-322	-322	-322	-322	-322	-322	-322	
-5.33%	-215	-215	-215	-215	-215	-215	-215	
-2.67%	-107	-107	-107	-107	-107	-107	-107	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	107	107	107	107	107	107	107	
5.33%	215	215	215	215	215	215	215	
8.00%	322	322	322	322	322	322	322	

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

(단위:백만원)

3,309

공시일	2019-04-12
기준일	2019-04-11

## 유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

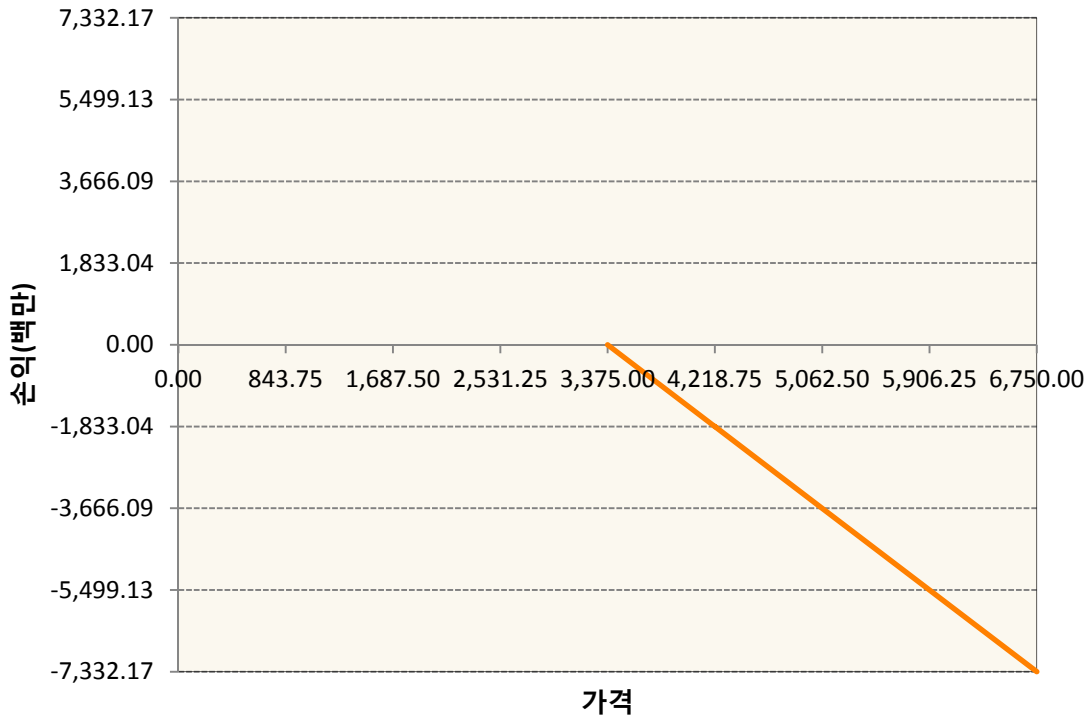
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

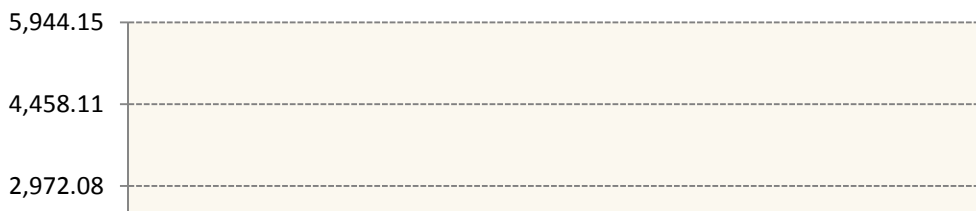
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	6,452	0	6,452	
누계	유가증권	스왑	60,688	0	60,688	장외
누계	유가증권	옵션	0	26,553	-26,553	장내
누계	통화	선도	0	17,997	-17,997	장외

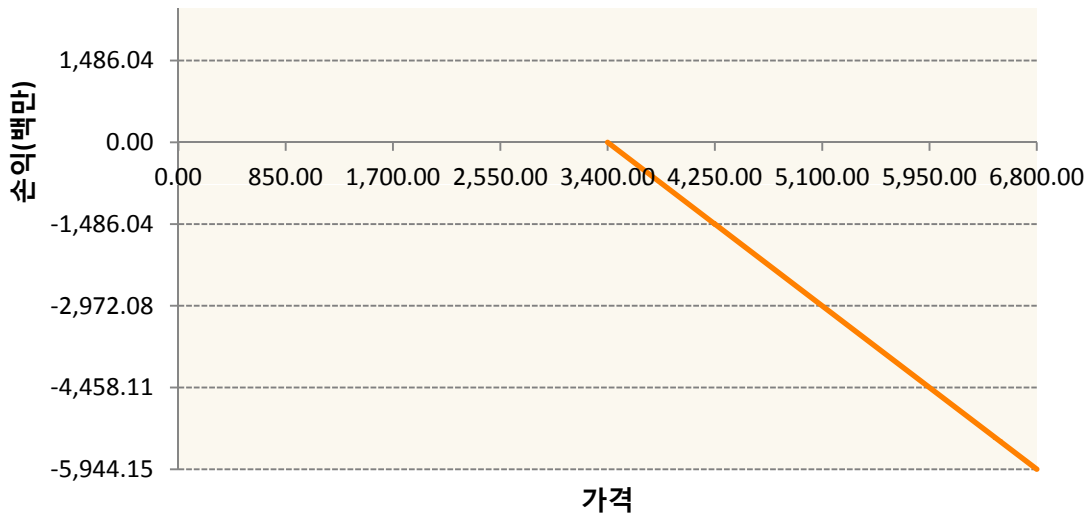
### 2. 만기시점의 손익구조

**OESXJ9-C3375-EURO STOXX 50**

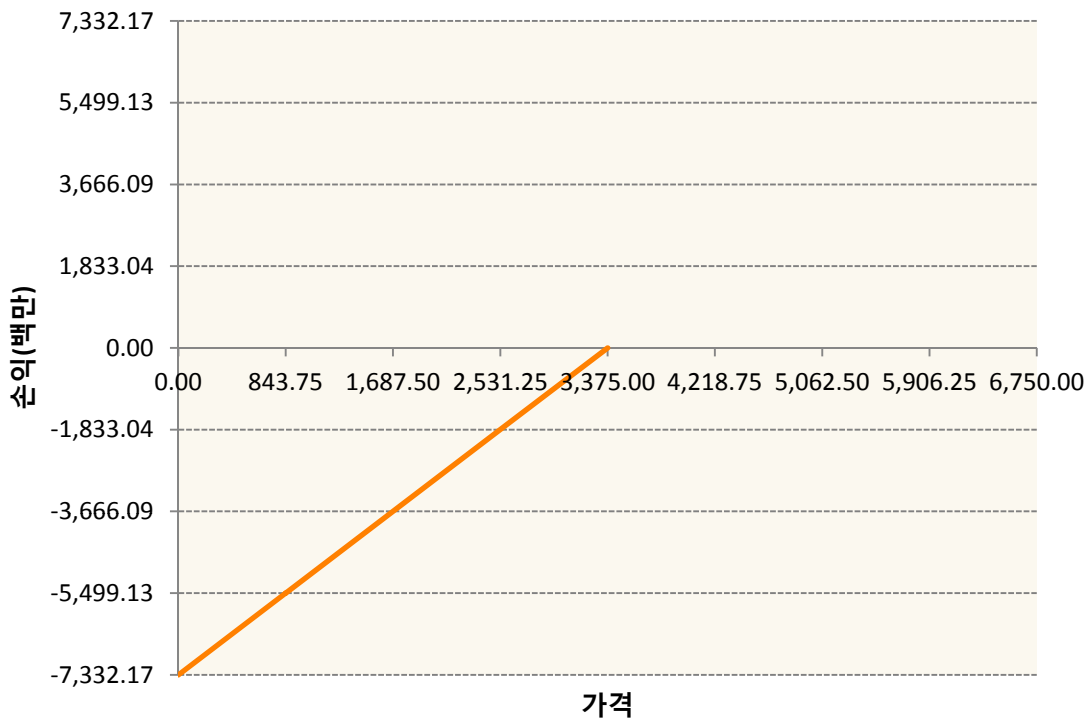


**OESXJ9-C3400-EURO STOXX 50**

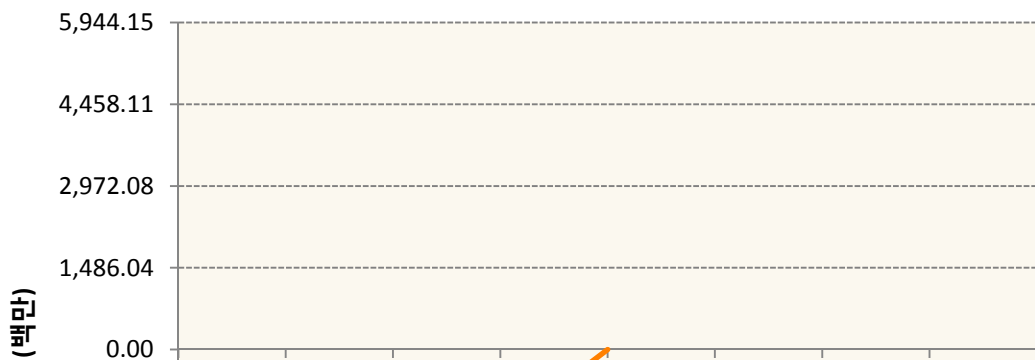


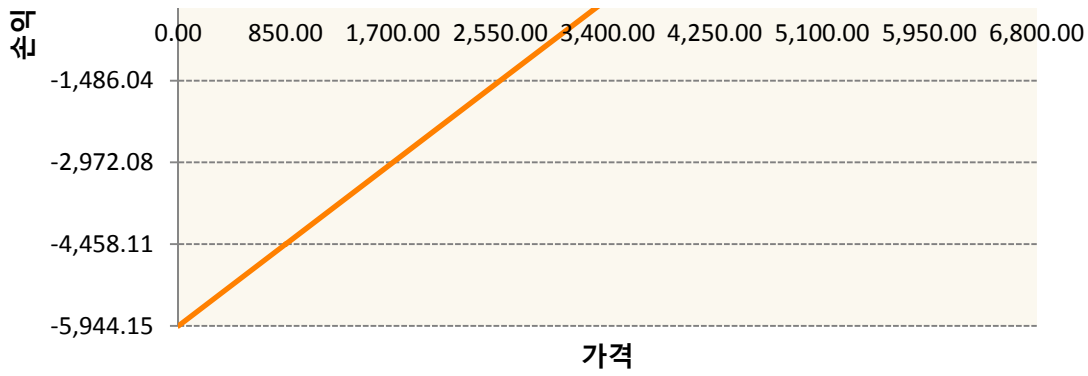


OESXJ9-P3375-EURO STOXX 50

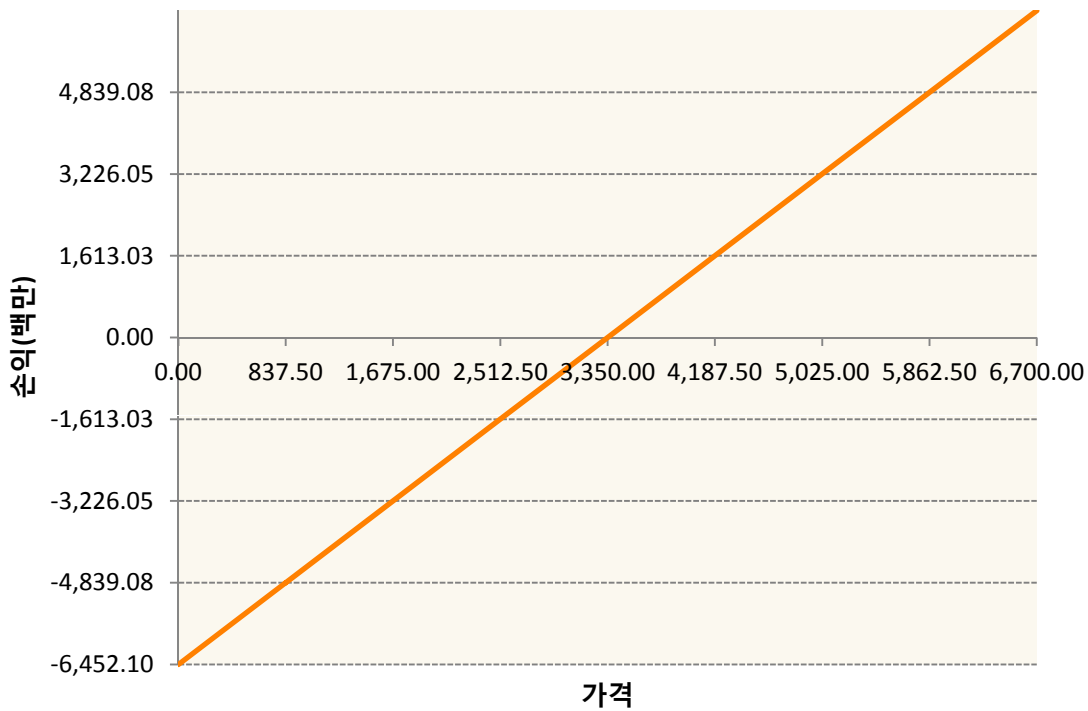


OESXJ9-P3400-EURO STOXX 50





VGM9-EURO STOXX 50 JUN19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY	196
FX21019G02 KRW/EUR 24-05-19E	411
FX21019H03 KRW/EUR 28-06-19E	823
FX21019J01E KRW/EUR 28-06-19E	206
OESXJ9-C33 EURO STOXX 50	587
OESXJ9-C34 EURO STOXX 50	476
OESXJ9-P33 EURO STOXX 50	587
OESXJ9-P34 EURO STOXX 50	476
VGM9 EURO STOXX 50 JUN19	516

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

(단위:백만원)

2,816



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

(단위:백만원)

1,110



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

(단위:백만원)

95



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

(단위:백만원)

138



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

(단위:백만원)

43

공시일	2019-04-12
기준일	2019-04-11

## 리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

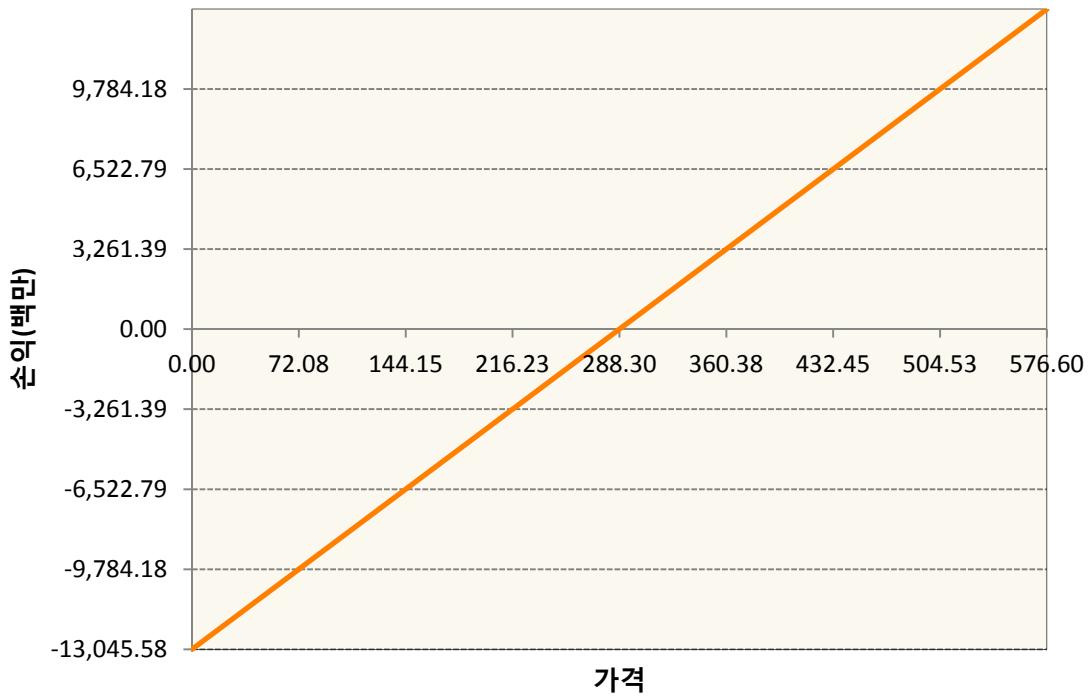
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

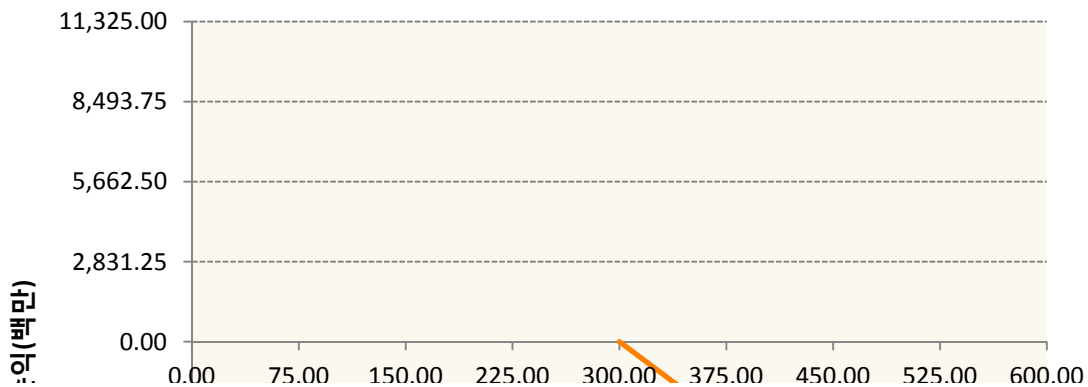
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	1,773	24,880	-23,107	장내
누계	유가증권	선물	13,046	0	13,046	장내
누계	유가증권	옵션	1,794	24,862	-23,068	장내

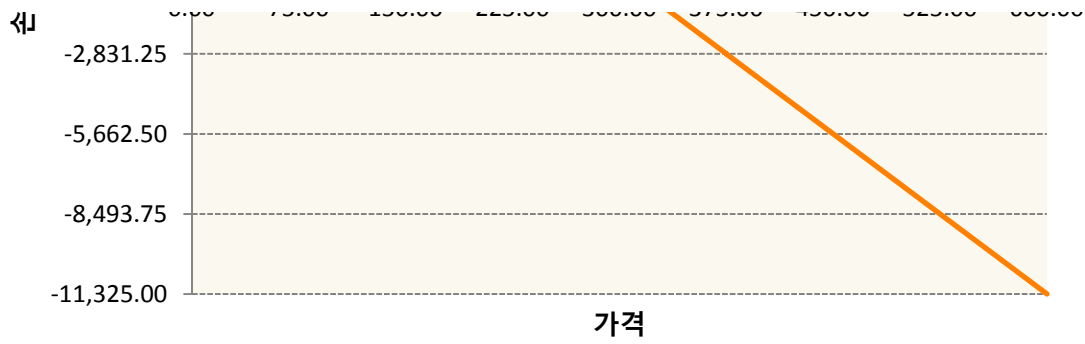
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101P60004-2019-06 코스피200지수선물

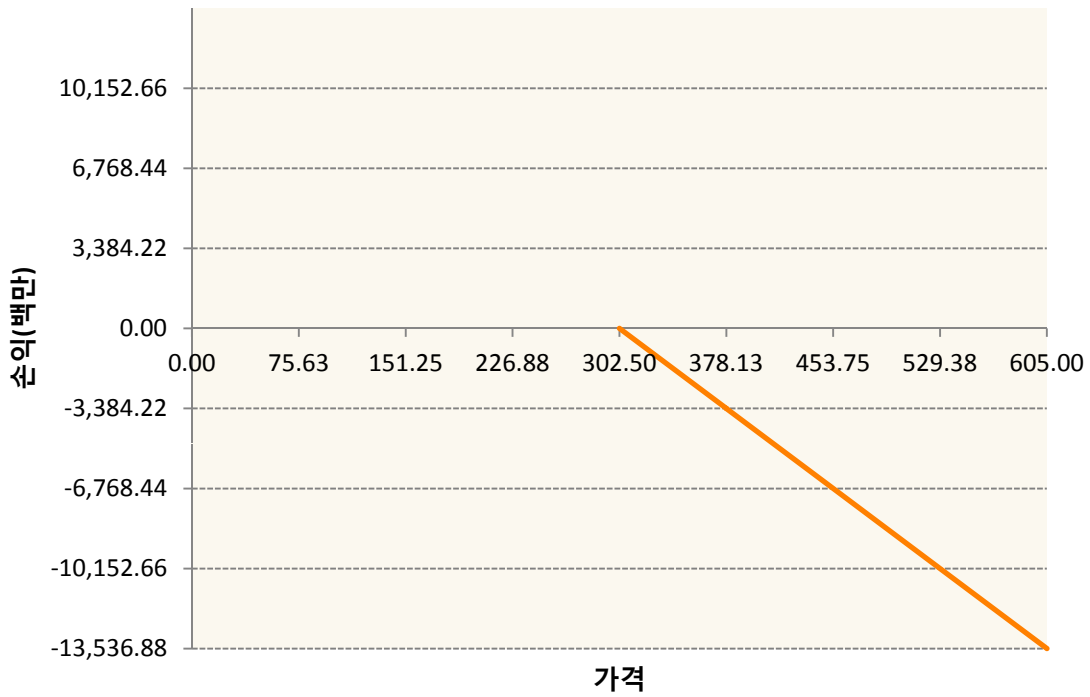


KR4201P53007-2019-05 콜300

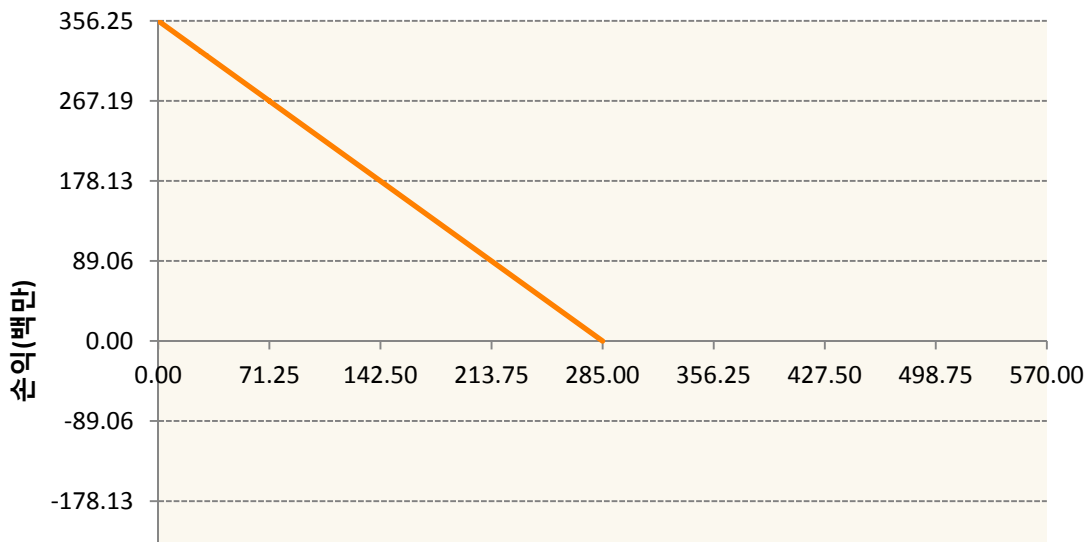


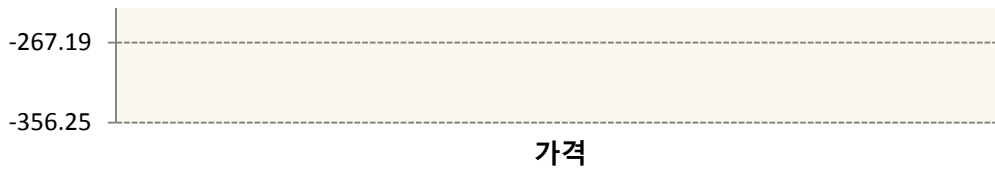


KR4201P53023-2019-05 콜302.5

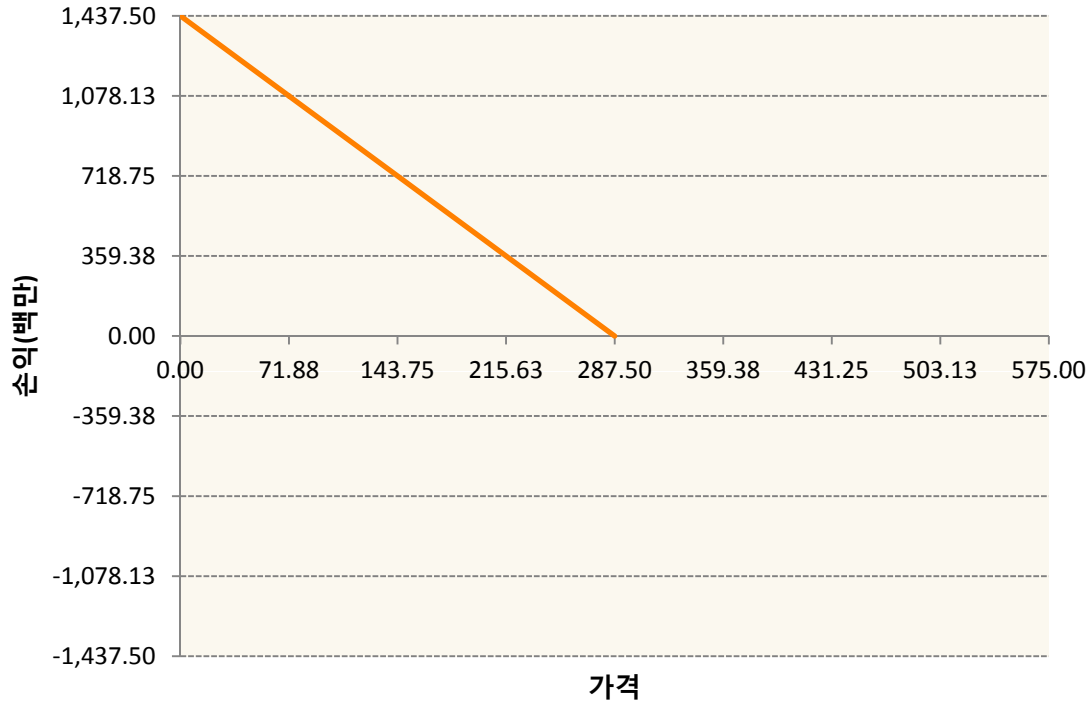


KR4301P52858-2019-05 풋285





KR4301P52874-2019-05 풋287.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101P60004		2019-06 코스피200지수선물						1,040
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-1,040	-1,040	-1,040	-1,040	-1,040	-1,040	-1,040	
-5.33%	-694	-694	-694	-694	-694	-694	-694	
-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%	694	694	694	694	694	694	694	
8.00%	1,040	1,040	1,040	1,040	1,040	1,040	1,040	
KR4201P53007		2019-05 콜300						490
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	109	108	106	103	99	94	87	
-5.33%	105	101	96	89	81	72	61	
-2.67%	92	82	71	59	45	30	14	

0%	54	37	19	0	-20	-40	-60
2.67%	-27	-50	-74	-97	-121	-144	-168
5.33%	-166	-190	-214	-238	-263	-287	-311
8.00%	-361	-381	-402	-423	-445	-468	-490
KR4201P53023                      2019-05 콜302.5							536
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	104	103	102	99	95	90	84
-5.33%	102	98	93	87	79	69	58
-2.67%	90	82	71	58	44	28	11
0%	56	39	20	0	-21	-44	-67
2.67%	-21	-47	-73	-100	-127	-154	-181
5.33%	-162	-191	-221	-250	-279	-308	-338
8.00%	-373	-399	-425	-453	-480	-508	-536
KR4301P52858                      2019-05 풋285							22
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	22	22	22	22	22	22	22
-5.33%	13	13	13	13	13	13	14
-2.67%	4	5	5	5	6	6	6
0%	-1	-1	0	0	0	1	1
2.67%	-3	-3	-3	-3	-2	-2	-2
5.33%	-4	-3	-3	-3	-3	-3	-3
8.00%	-4	-4	-4	-4	-3	-3	-3
KR4301P52874                      2019-05 풋287.5							96
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	96	96	96	96	96	96	96
-5.33%	58	58	58	58	59	59	60
-2.67%	22	23	24	25	26	27	29
0%	-5	-3	-2	0	2	3	5
2.67%	-17	-16	-15	-13	-12	-11	-10
5.33%	-20	-19	-19	-18	-18	-17	-16
8.00%	-20	-20	-20	-20	-20	-19	-19

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

(단위:백만원)

**1,761**

공시일	2019-04-12
기준일	2019-04-11

## H2O글로벌본드(USD)(채권혼합-파

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	68	0	68	
누계	유가증권	수익증권	3,613	0	3,613	

### 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	2019-04-12
기준일	2019-04-11

## H2O글로벌본드(UH)(채권혼합-파)

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	1,481	0	1,481	
누계	유가증권	수익증권	21,224	0	21,224	

### 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	2019-04-12
기준일	2019-04-11

## H2O글로벌본드(H)(채권혼합-파생)

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	2,051	0	2,051	
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	수익증권	73,312	0	73,312	
누계	통화	선도	0	75,531	-75,531	장외

### 2. 만기시점의 손익구조

### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음
FX21019H01 KRW/USD 19-04-19E	146
FX21019H02 KRW/USD 19-04-19E	118
FX21019H02 KRW/USD 19-04-19E	208
FX21019H02 KRW/USD 19-04-19E	255
FX21019H02 KRW/USD 22-04-19E	155
FX21019H02 KRW/USD 22-04-19E	365
FX21019H02 KRW/USD 22-04-19E	428
FX21019H03 KRW/USD 22-04-19E	365
FX21019H03 KRW/USD 25-04-19E	365
FX21019H03 KRW/USD 25-04-19E	419
FX21019H03 KRW/USD 25-04-19E	182
FX21019H04 KRW/USD 29-04-19E	456
FX21019H04 KRW/USD 29-04-19E	529
FX21019H04 KRW/USD 29-04-19E	321
FX21019H04 KRW/USD 29-04-19E	273
FX21019H05 KRW/USD 10-05-19E	46
FX21019H05 KRW/USD 10-05-19E	91
FX21019H05 KRW/USD 10-05-19E	91
FX21019J001 KRW/USD 10-05-19E	45
FX21019J002 KRW/USD 10-06-19E	100
FX21019J003 KRW/USD 10-05-19E	155
FX21019J004 KRW/USD 10-05-19E	73
FX21019J005 KRW/USD 10-05-19E	273
FX21019J006 KRW/USD 10-05-19E	228
FX21019J007 KRW/USD 10-05-19E	73
FX21019J011 KRW/USD 20-05-19E	128
FX21019J012 KRW/USD 20-05-19E	18

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

(단위:백만원)

**2,052**

공시일	2019-04-12
기준일	2019-04-11

## 스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

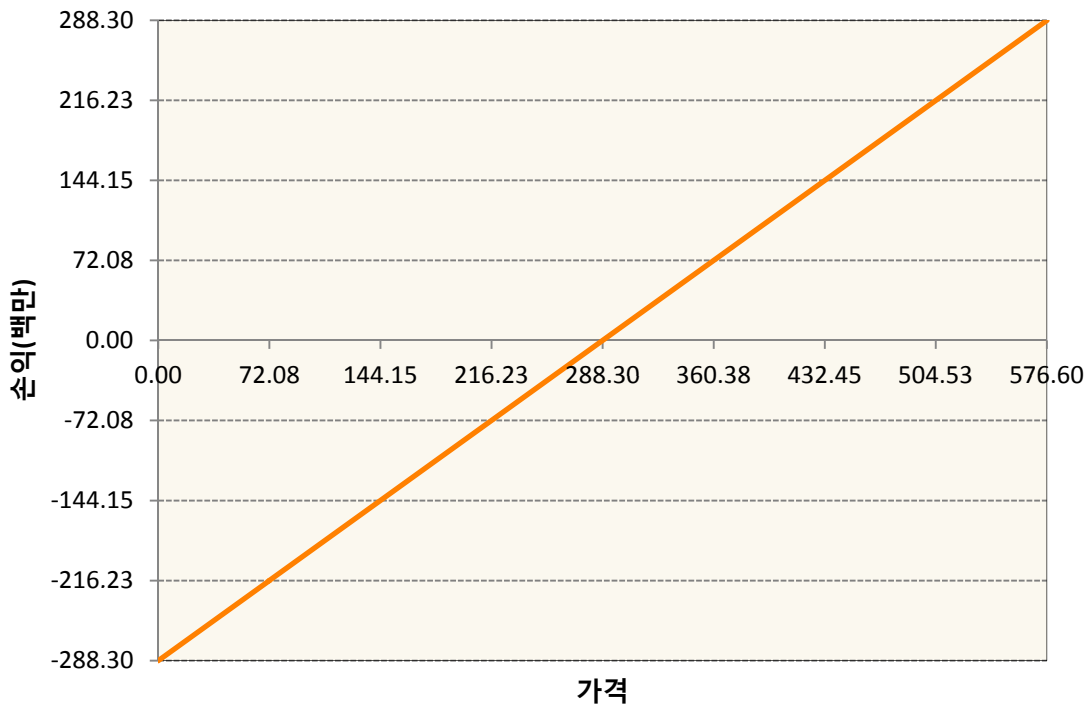
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

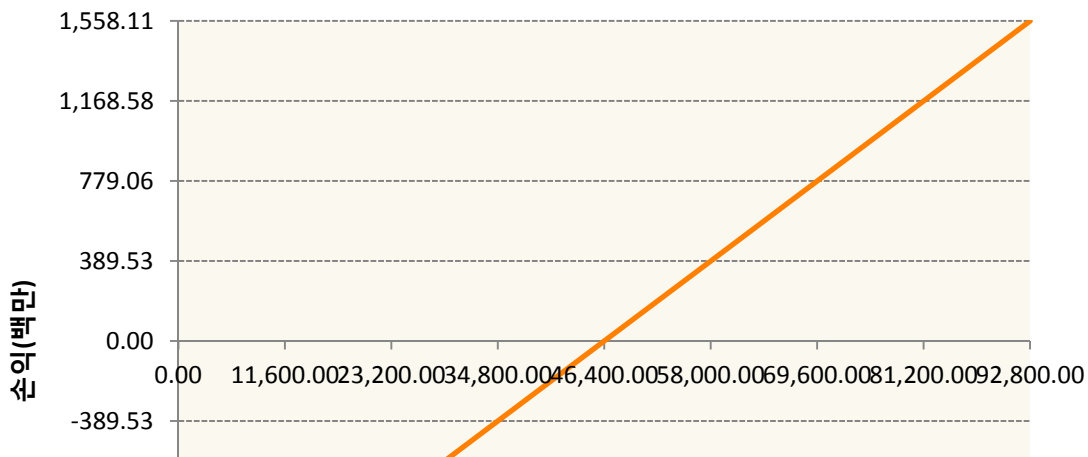
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,846	0	1,846	장내

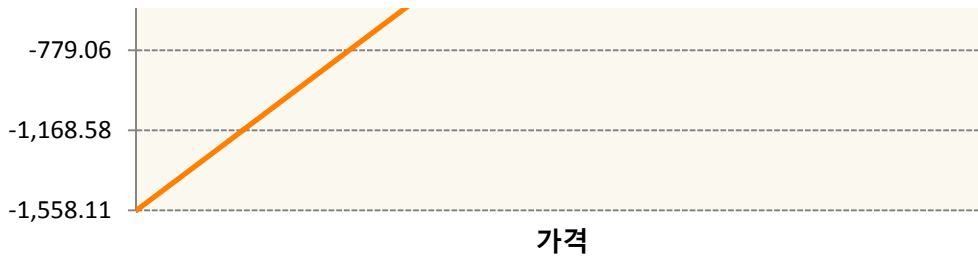
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101P60004-2019-06 코스피200지수선물



KR4111P50004-2019-05 삼성전자개별선물





**3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)** (단위:백만원)

KR4101P60004		2019-06 코스피200지수선물						23
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-23	-23	-23	-23	-23	-23	-23	
-5.33%	-15	-15	-15	-15	-15	-15	-15	
-2.67%	-8	-8	-8	-8	-8	-8	-8	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	8	8	8	8	8	8	8	
5.33%	15	15	15	15	15	15	15	
8.00%	23	23	23	23	23	23	23	
KR4111P50004		2019-05 삼성전자개별선물						124
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-124	-124	-124	-124	-124	-124	-124	
-5.33%	-83	-83	-83	-83	-83	-83	-83	
-2.67%	-41	-41	-41	-41	-41	-41	-41	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	41	41	41	41	41	41	41	
5.33%	83	83	83	83	83	83	83	
8.00%	124	124	124	124	124	124	124	

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

**162**

공시일	2019-04-12
기준일	2019-04-11

## 커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

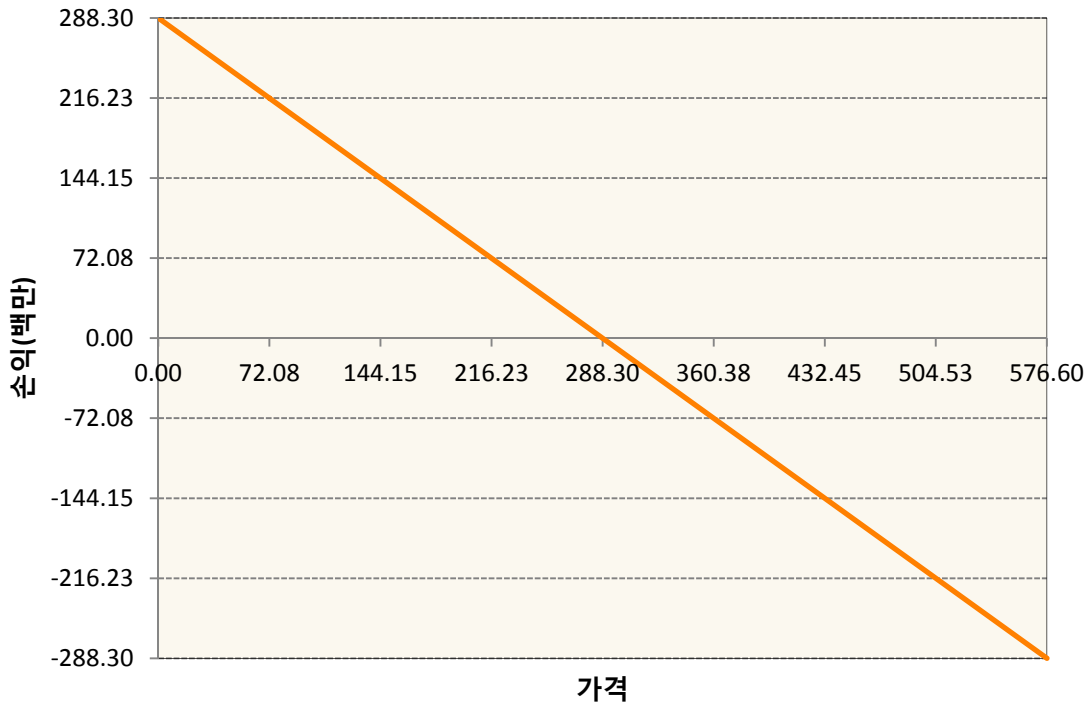
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

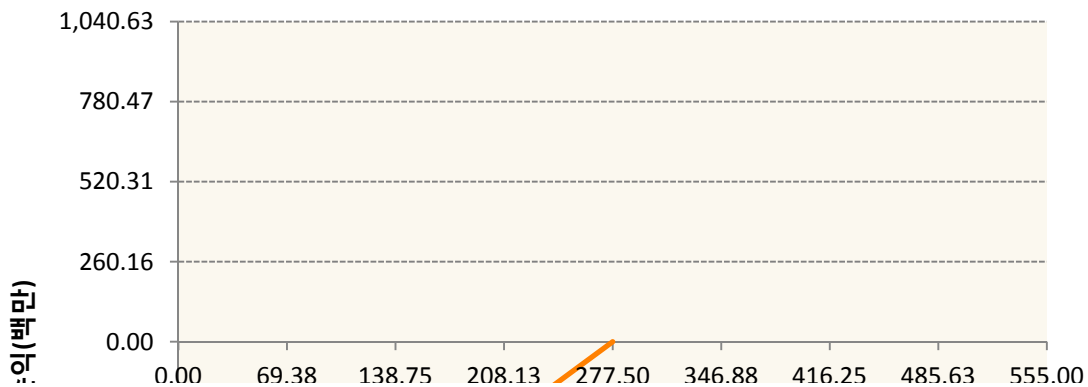
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	1,887	-1,887	장내
누계	유가증권	선물	0	288	-288	장내
누계	유가증권	옵션	0	1,881	-1,881	장내

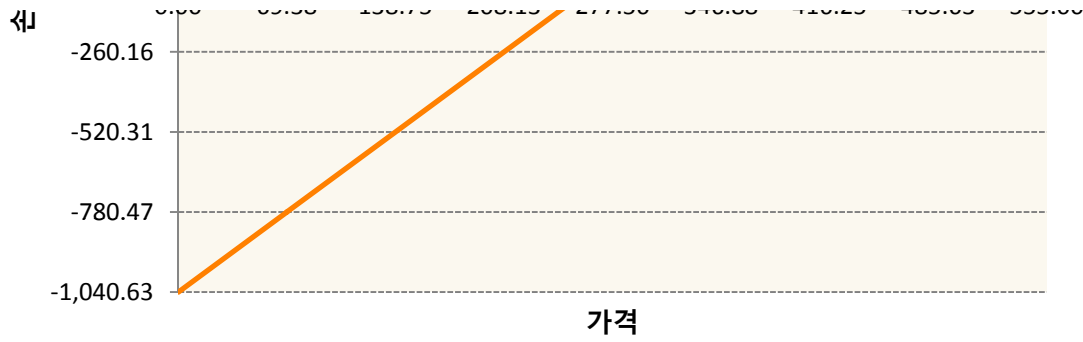
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101P60004-2019-06 코스피200지수선물

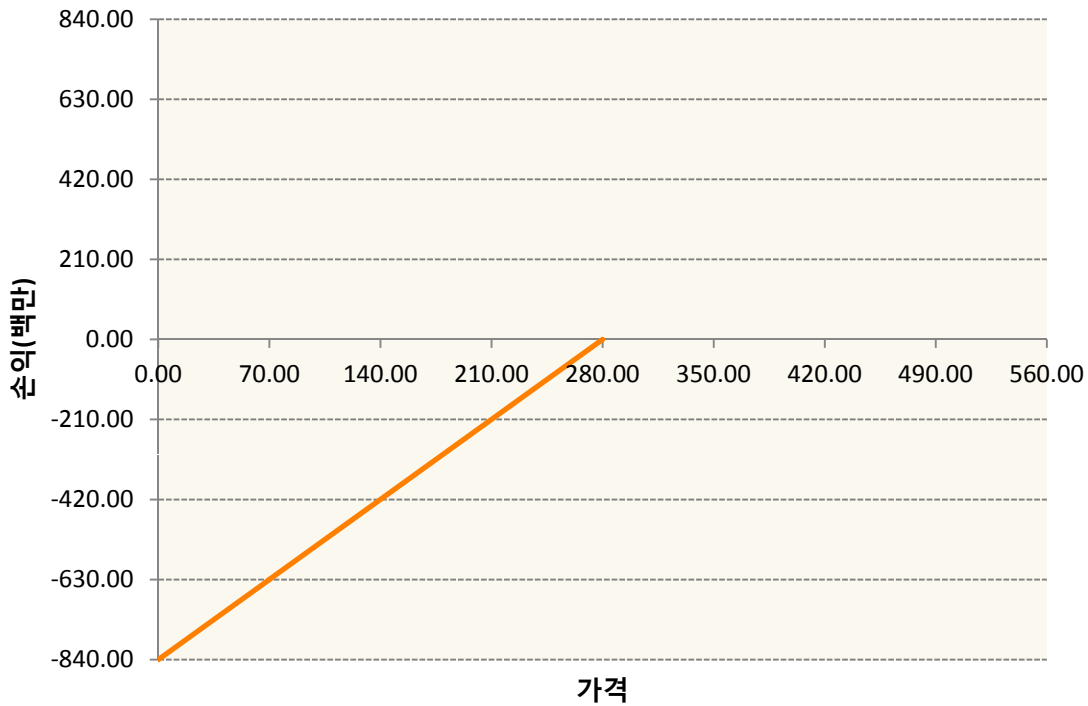


KR4301P52775-2019-05 풋277.5





KR4301P52809-2019-05 풋280



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101P60004		2019-06 코스피200지수선물						23
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	23	23	23	23	23	23	23	
-5.33%	15	15	15	15	15	15	15	
-2.67%	8	8	8	8	8	8	8	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	-8	-8	-8	-8	-8	-8	-8	
5.33%	-15	-15	-15	-15	-15	-15	-15	
8.00%	-23	-23	-23	-23	-23	-23	-23	
KR4301P52775		2019-05 풋277.5						49
기초자산의 변동성								

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-47	-47	-47	-48	-48	-49	-49
-5.33%	-21	-22	-23	-24	-25	-26	-27
-2.67%	-4	-5	-6	-8	-9	-10	-11
0%	2	1	1	0	-1	-2	-2
2.67%	3	3	3	2	2	2	1
5.33%	3	3	3	3	3	3	3
8.00%	3	3	3	3	3	3	3

KR4301P52809

2019-05 풋280

45

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-43	-43	-43	-44	-44	-44	-45
-5.33%	-22	-22	-23	-23	-24	-25	-25
-2.67%	-5	-6	-7	-8	-9	-10	-11
0%	2	1	1	0	-1	-2	-2
2.67%	4	3	3	3	3	2	2
5.33%	4	4	4	4	4	3	3
8.00%	4	4	4	4	4	4	4

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

(단위:백만원)

98

공시일	2019-04-12
기준일	2019-04-11

## 에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

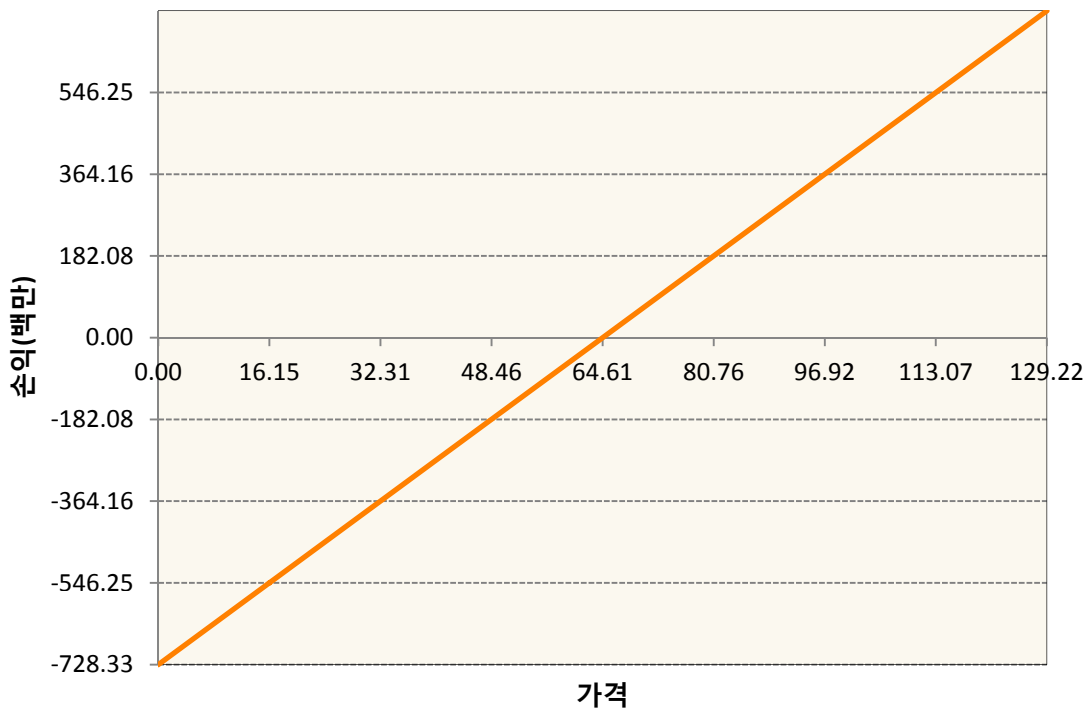
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

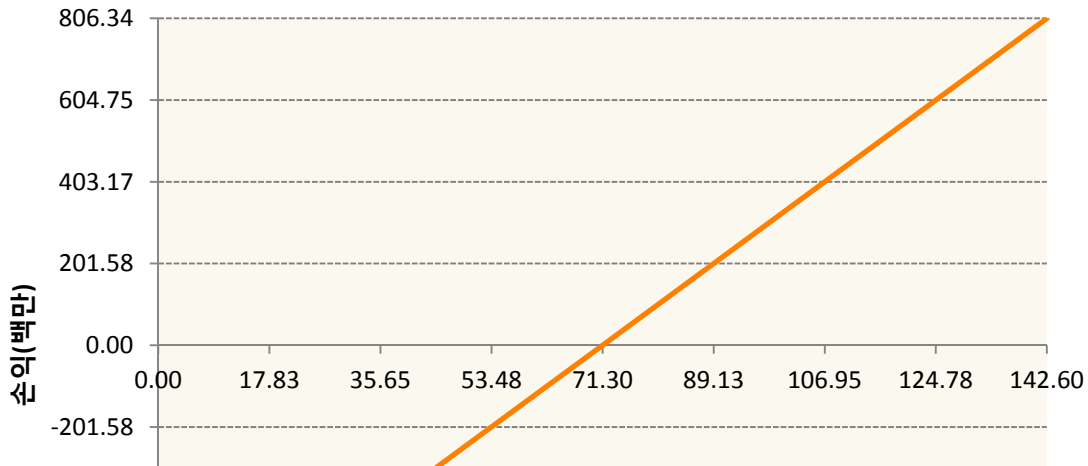
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,009	285	2,724	

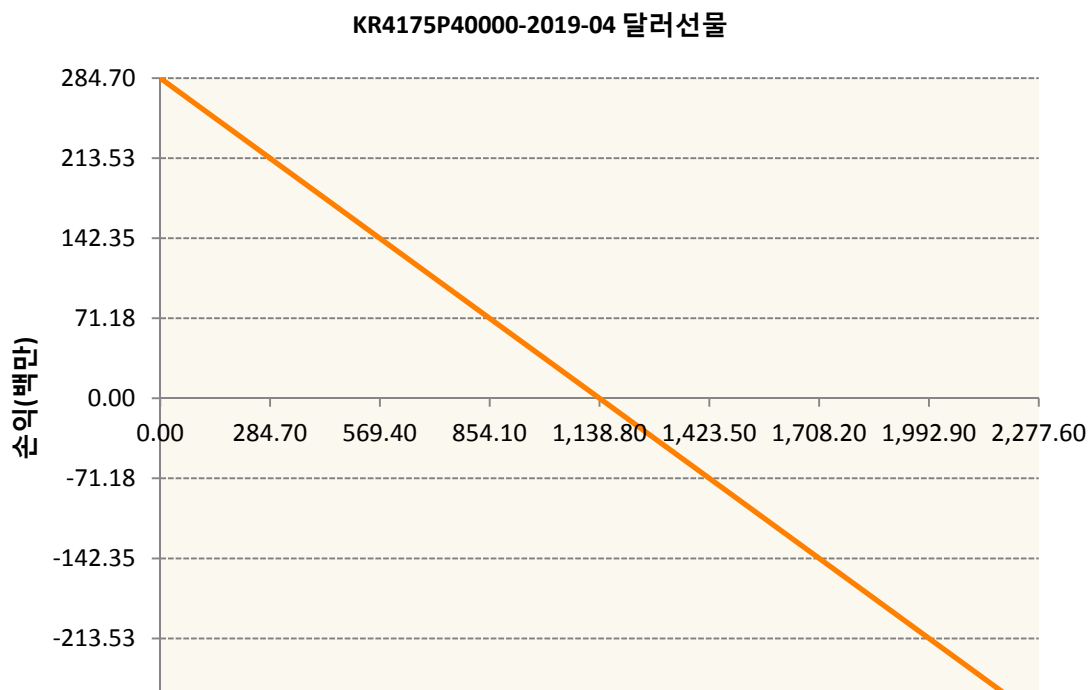
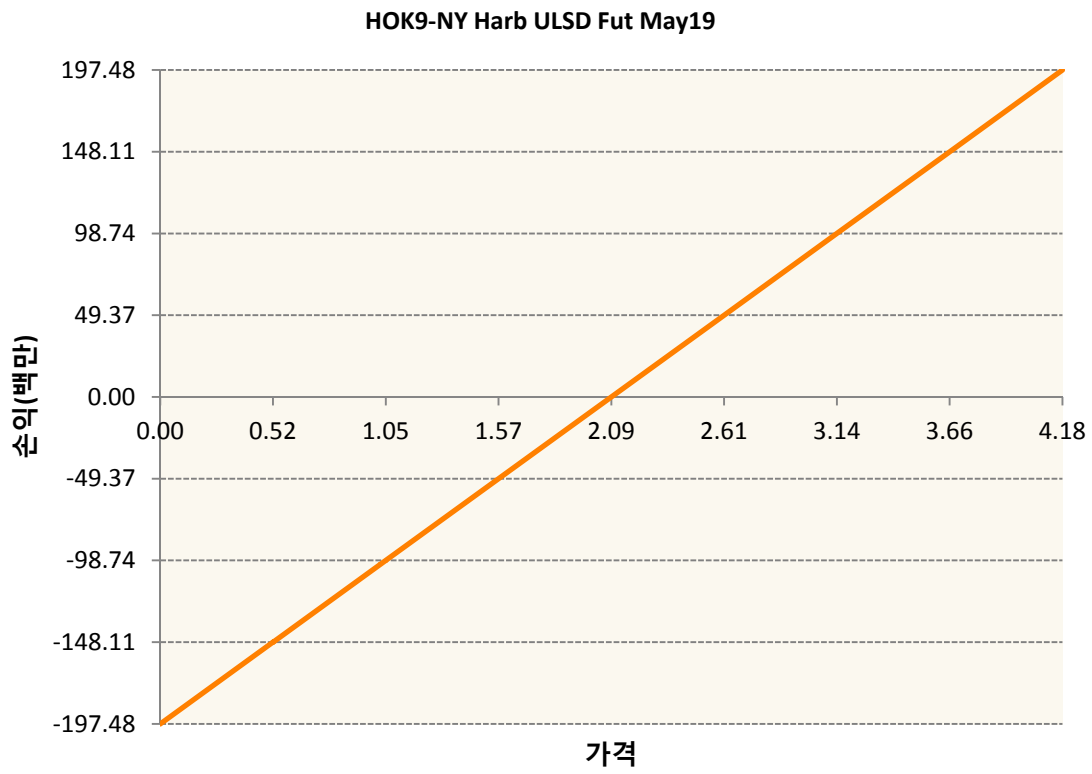
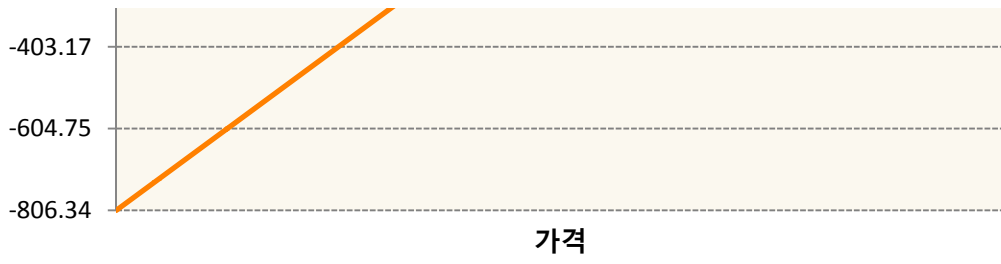
### 2. 만기시점의 손익구조

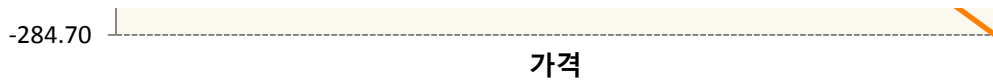
CLK9-WTI CRUDE FUTURE May19



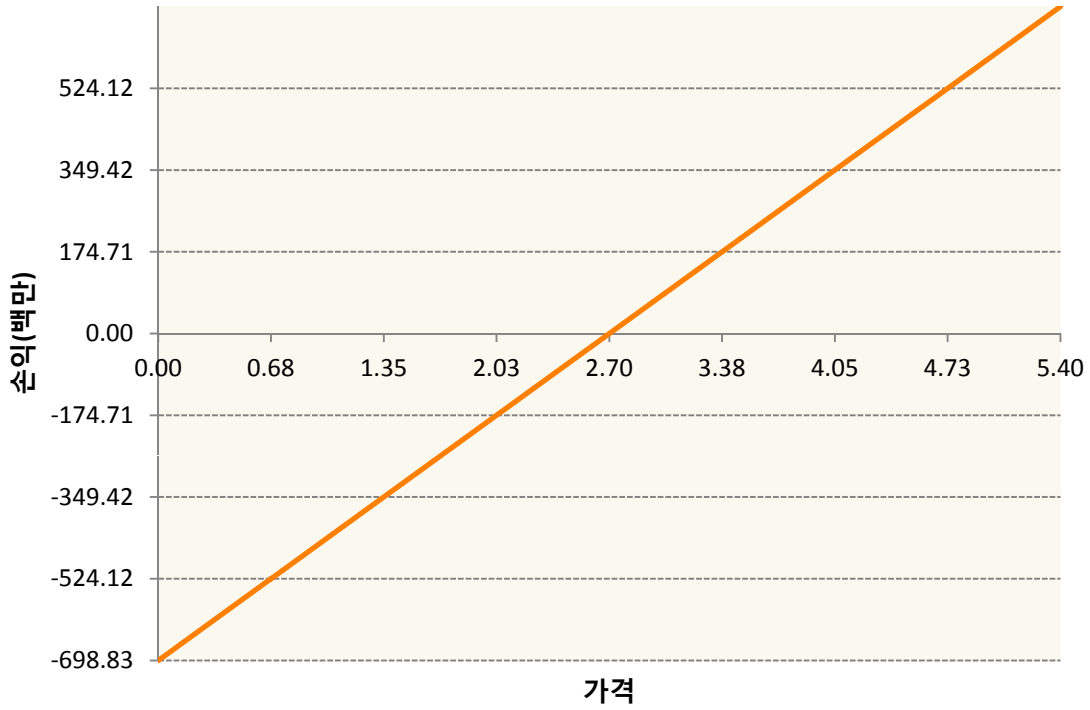
CON9-BRENT CRUDE FUTR Jul19



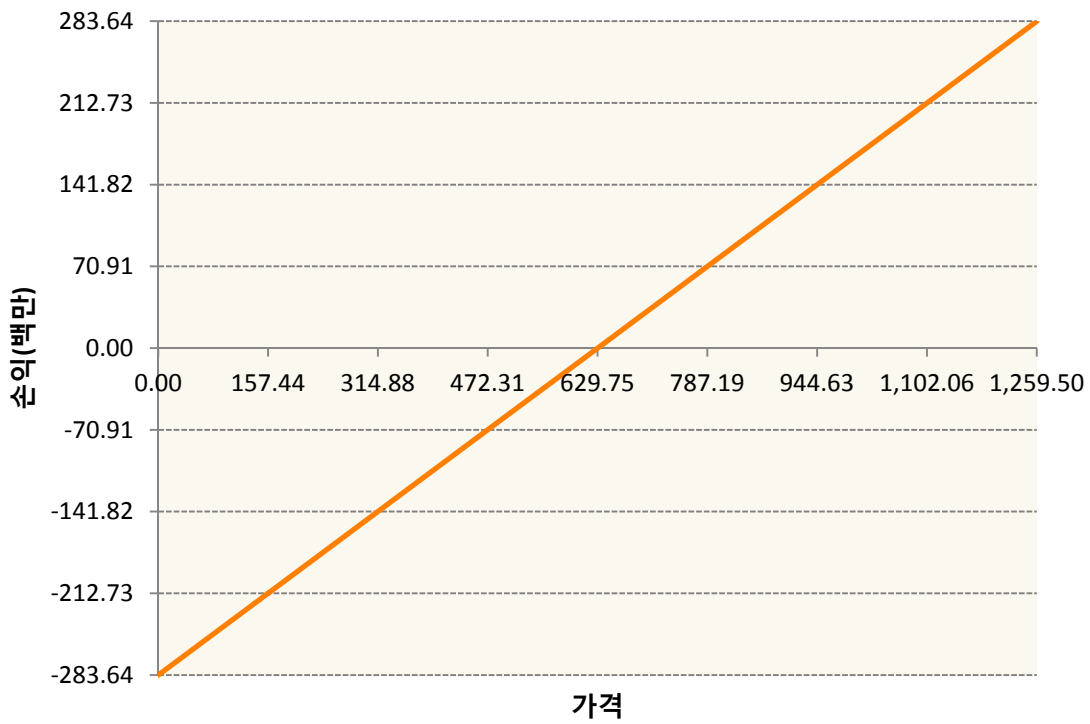




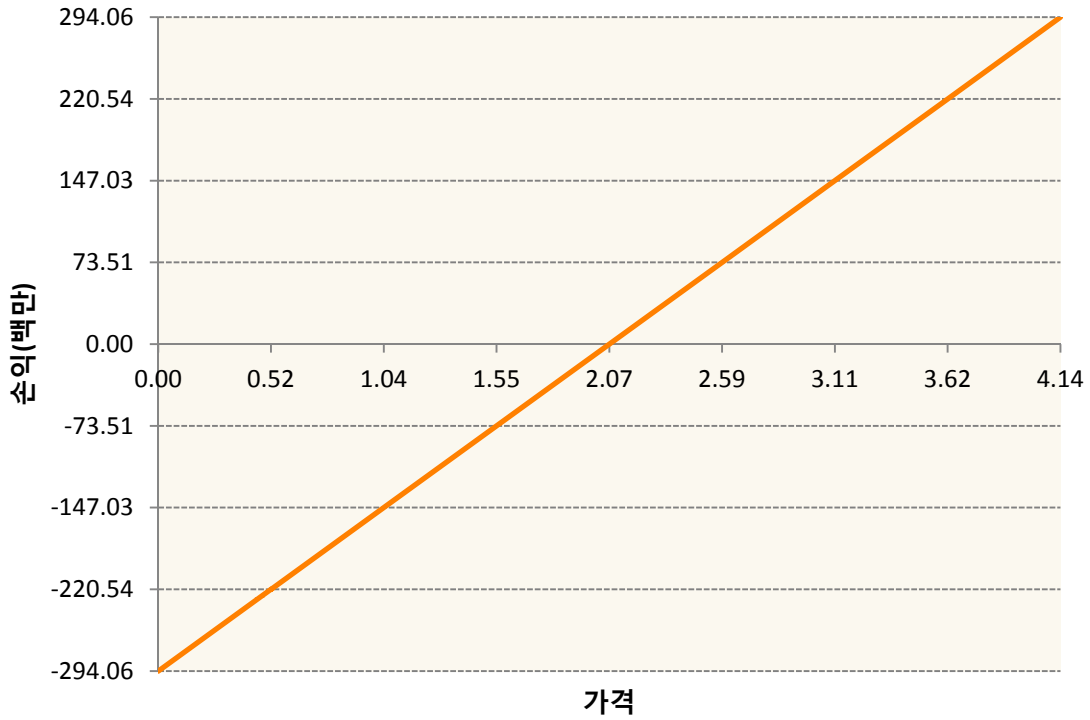
NGK19-NATURAL GAS FUTR May19



QSK9-Low Su Gasoil G May19



**XBK9-GASOLINE RBOB FUT May19**



**3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)**

(단위:백만원)

CLK9	WTI CRUDE FUTURE May19	58
CON9	BRENT CRUDE FUTR Jul19	65
HOK9	NY Harb ULSD Fut May19	16
KR4175P400	2019-04 달러선물	23
NGK19	NATURAL GAS FUTR May19	56
QSK9	Low Su Gasoil G May19	23
XBK9	GASOLINE RBOB FUT May19	24

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

(단위:백만원)

**449**

공시일	2019-04-12
기준일	2019-04-11

## 애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

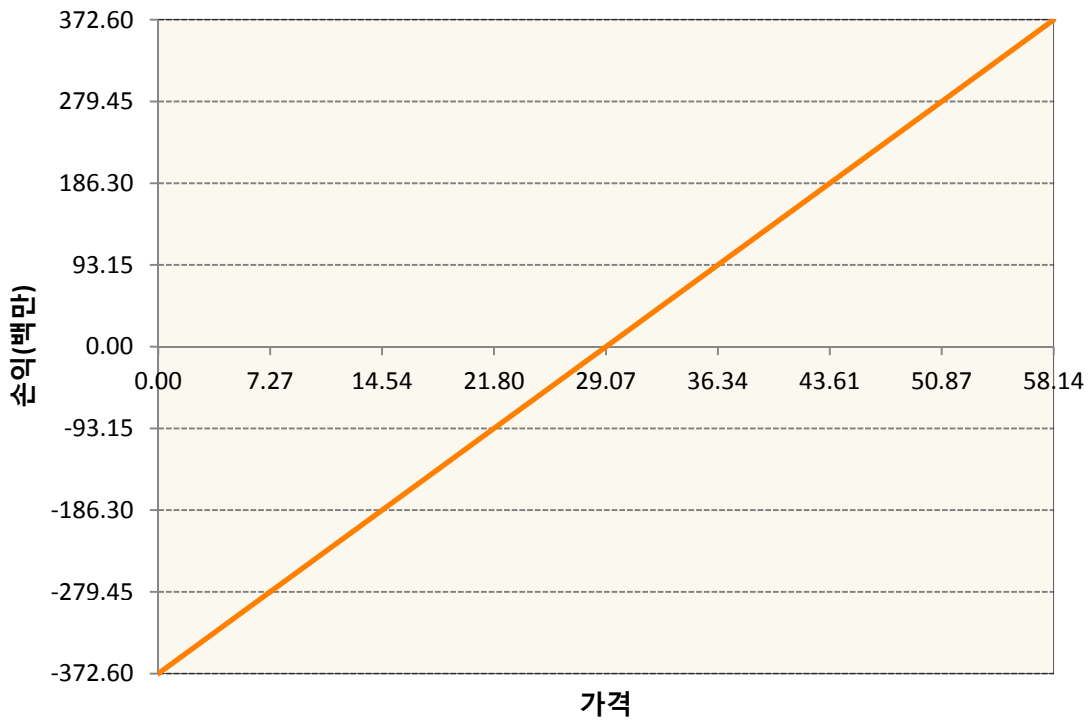
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

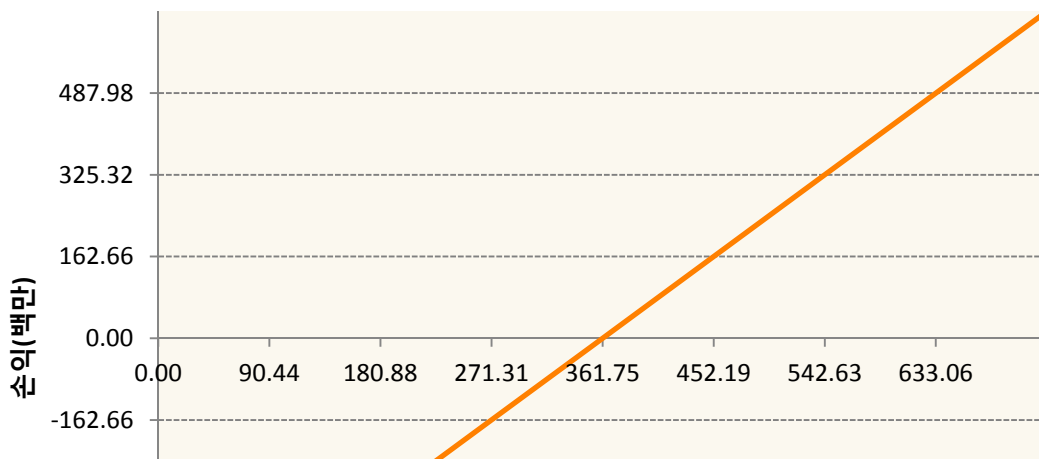
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,356	80	3,276	

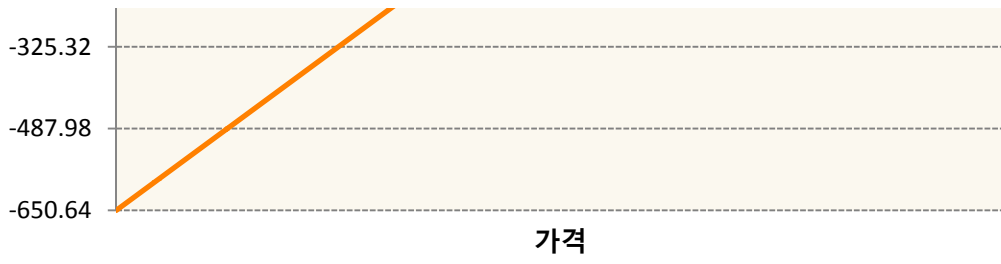
### 2. 만기시점의 손익구조

**BOK9-SOYBEAN OIL FUTR May19**

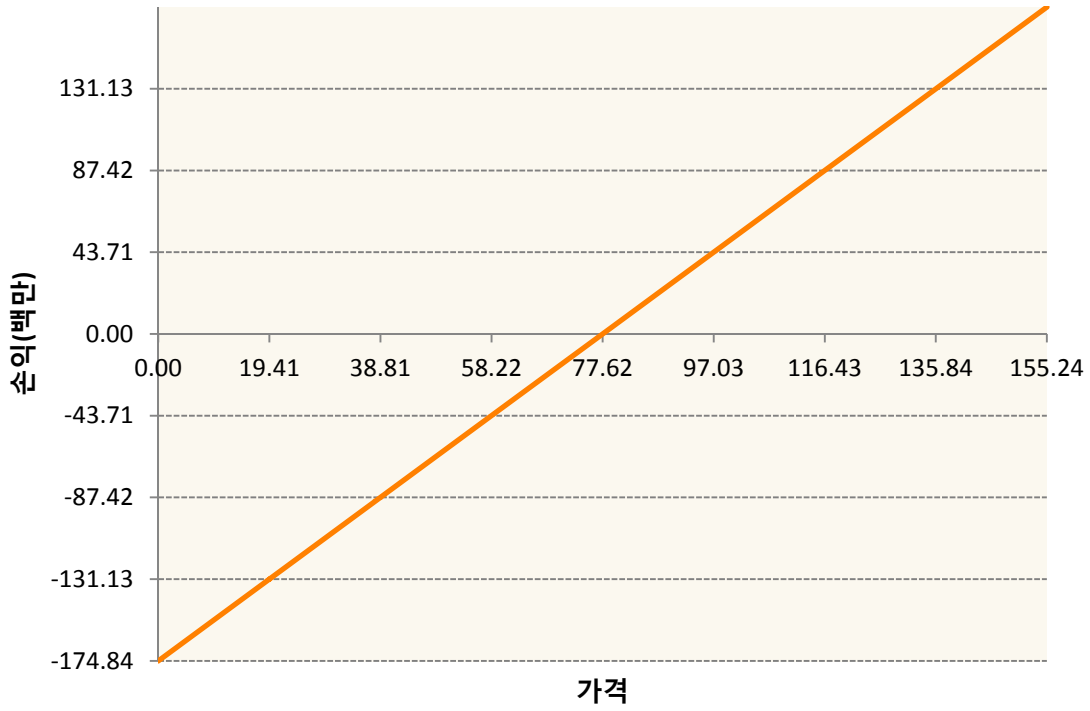


**CK9-CORN FUTURE May19**

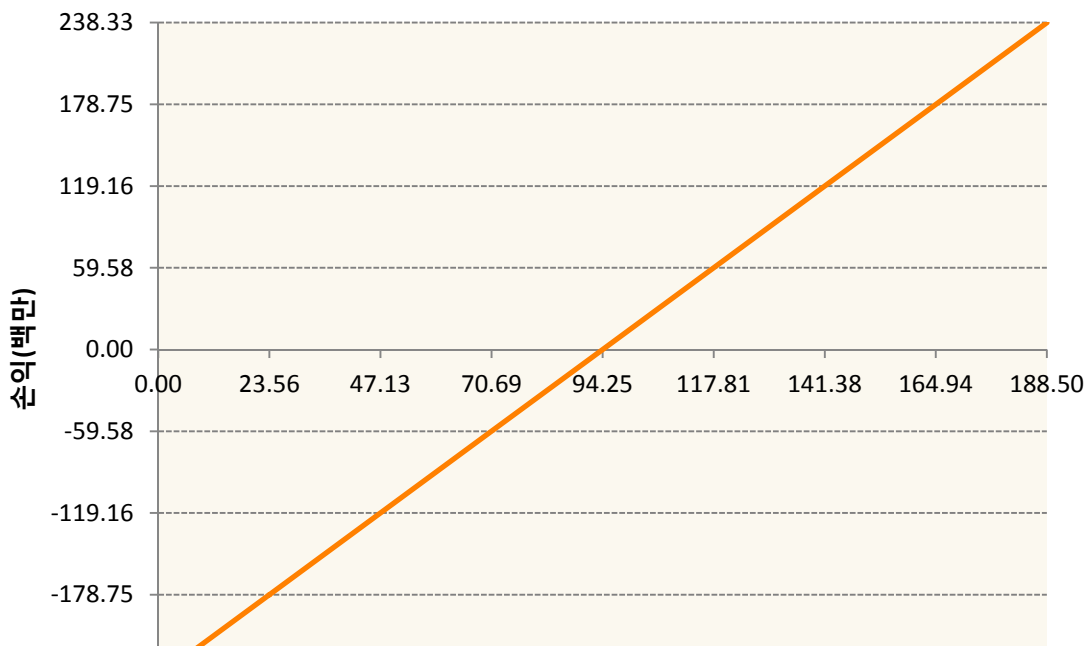


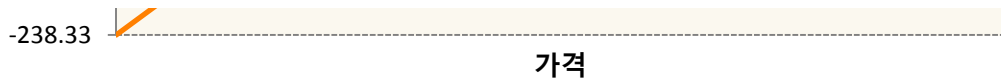


**CTK9-COTTON NO.2 FUTR May19**

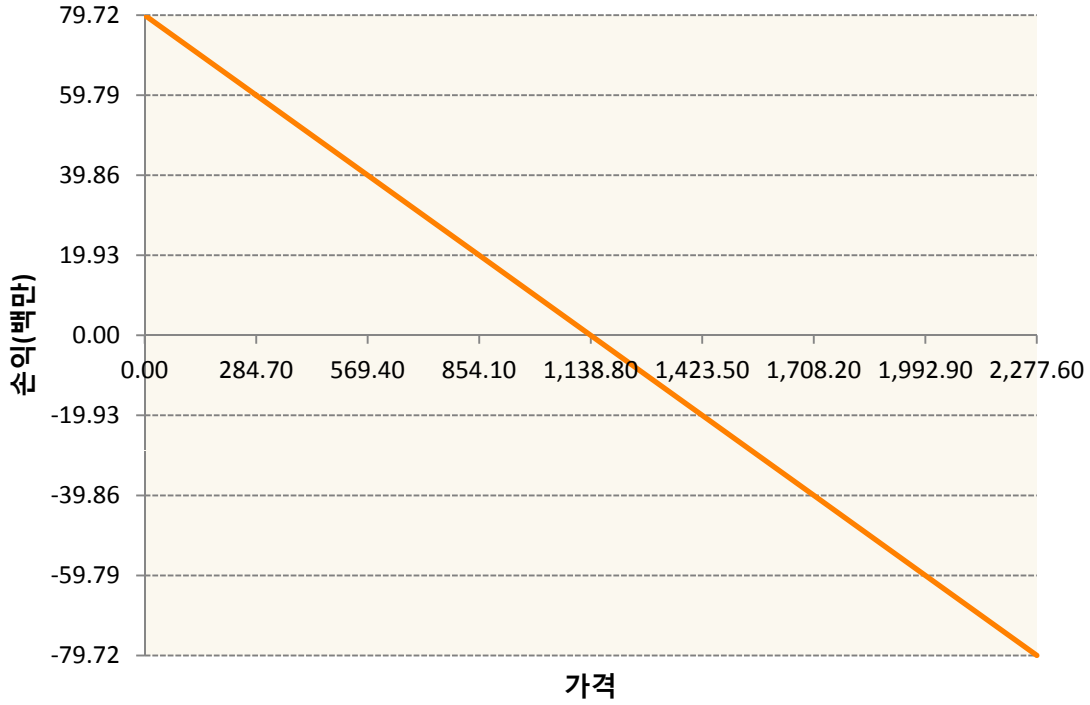


**KCK9-COFFEE 'C' FUTURE May19**

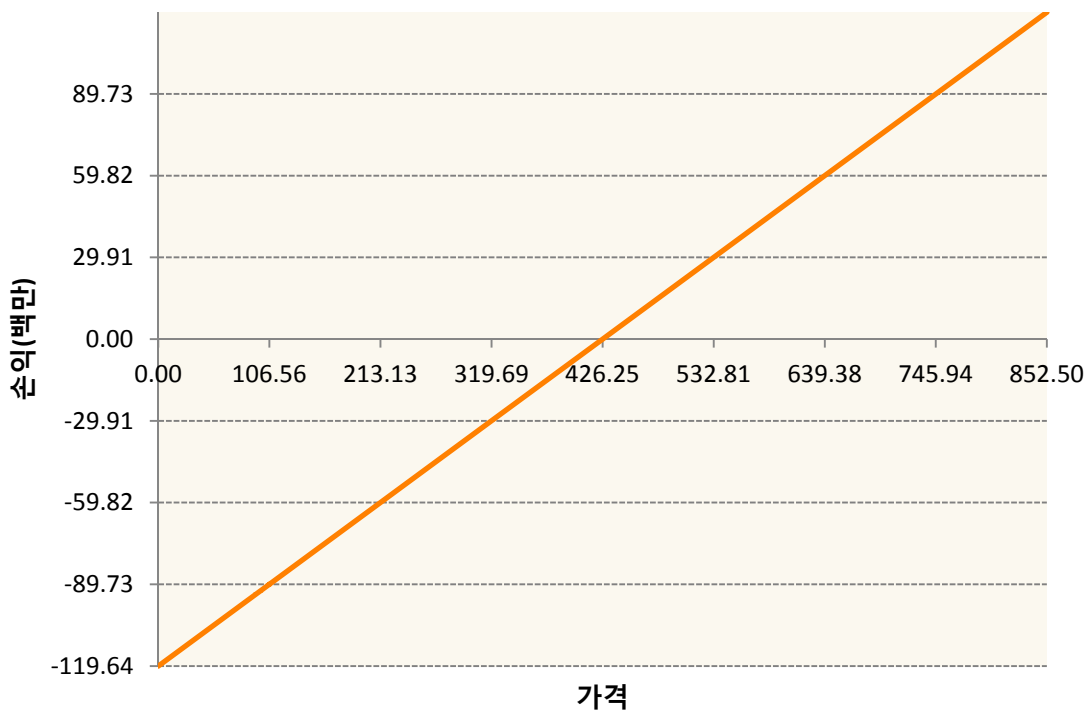




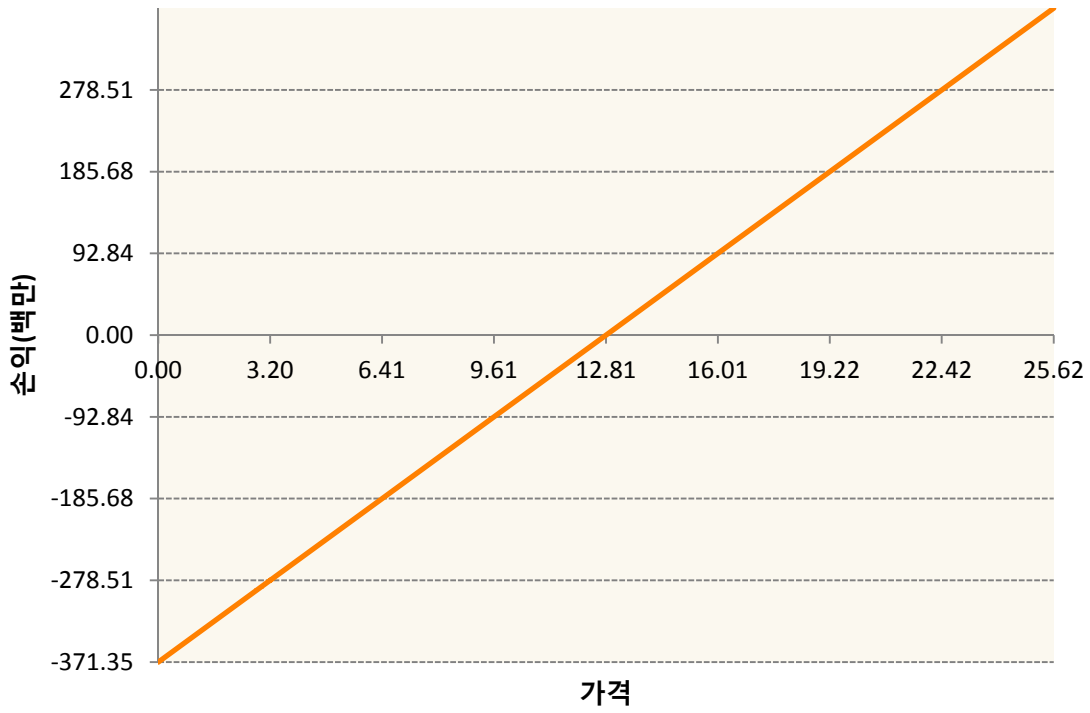
KR4175P40000-2019-04 달러선물



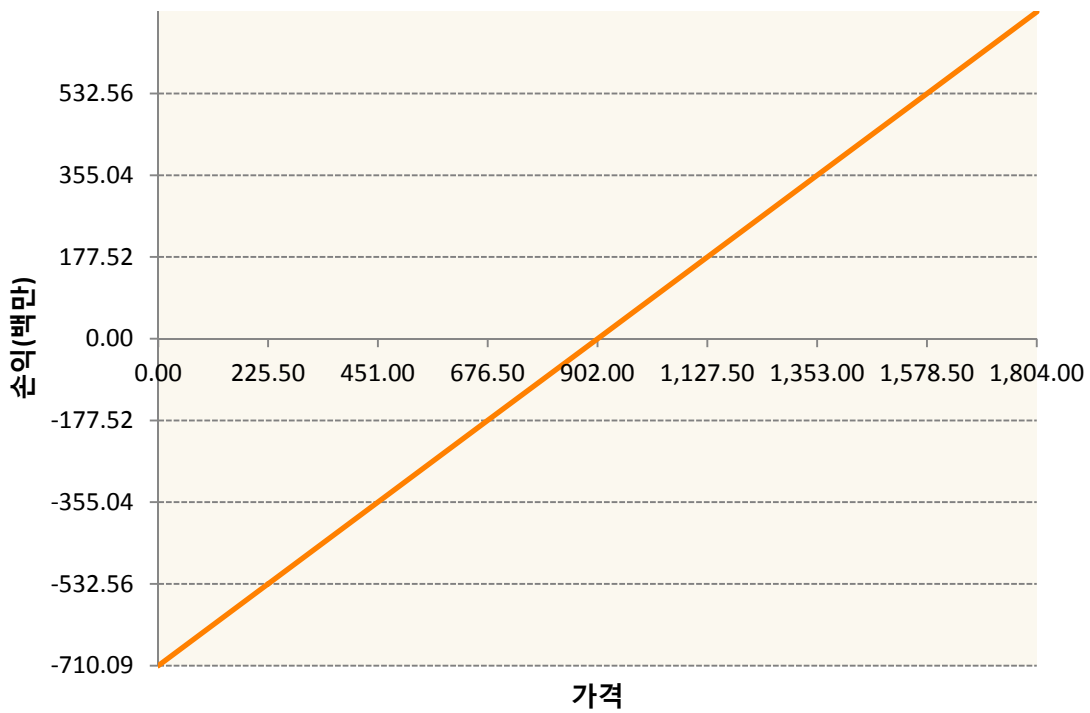
KWK9-KC HRW WHEAT FUT May19



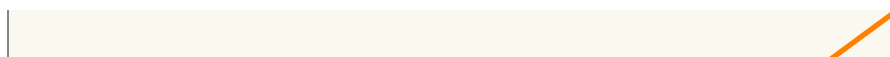
SBK9-SUGAR #11 (WORLD) May19

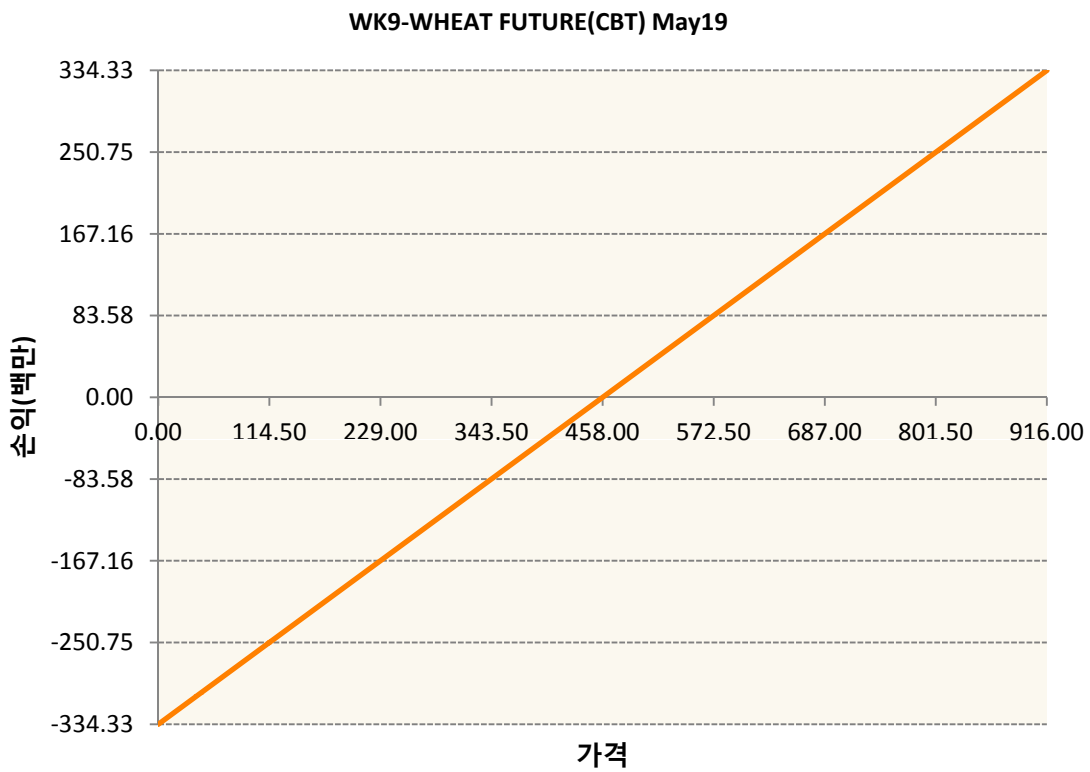
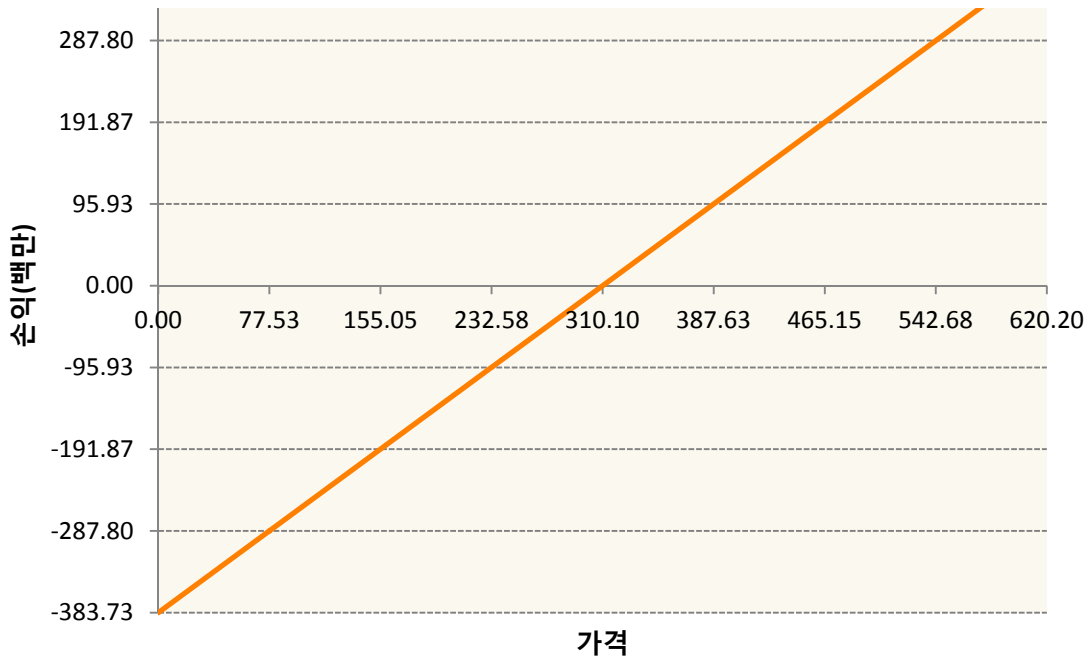


SK9-SOYBEAN FUTURE May19



SMK9-SOYBEAN MEAL FUTR May19





**3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)**

(단위:백만원)

BOK9	SOYBEAN OIL FUTR May19	30
CK9	CORN FUTURE May19	52
CTK9	COTTON NO.2 FUTR May19	14
KCK9	COFFEE 'C' FUTURE May19	19
KR4175P400	2019-04 달러선물	6

KWK9	KC HRW WHEAT FUT May19	10
SBK9	SUGAR #11 (WORLD) May19	30
SK9	SOYBEAN FUTURE May19	57
SMK9	SOYBEAN MEAL FUTR May19	31
WK9	WHEAT FUTURE(CBT) May19	27

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

(단위:백만원)

**270**