

공시일	2019-06-14
기준일	2019-06-13

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)

92

공시일	2019-06-14
기준일	2019-06-13

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	14,160	0	14,160	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWMXWO0(신한MXWO 미래S190522

1,142

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

692

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-06-14
기준일	2019-06-13

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	6,210	0	6,210	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI50000 신한CSI500미래S190611(1)	376
SWCSI50000 신한CSI500미래S190611(2)	138

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

867

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-06-14
기준일	2019-06-13

유로인덱스모(주식-파생형)

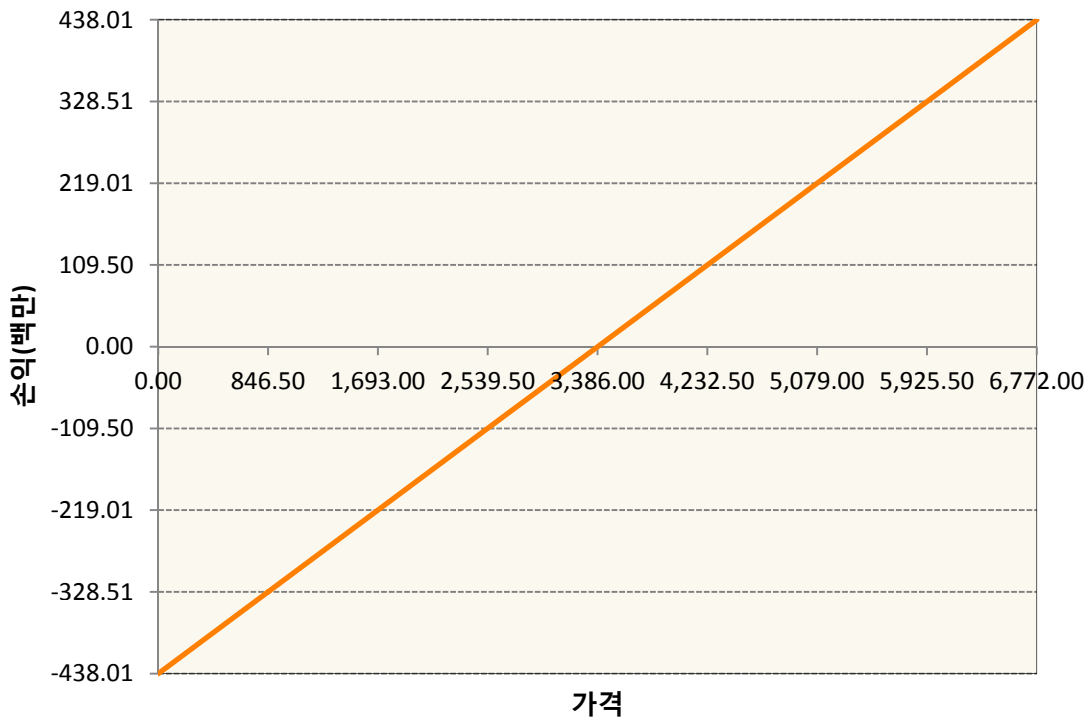
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	438	0	438	

2. 만기시점의 손익구조

VGM9-EURO STOXX 50 JUN19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGM9	EURO STOXX 50 JUN19	35
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

26

공시일	2019-06-14
기준일	2019-06-13

차이나인덱스모(주식-파생형)

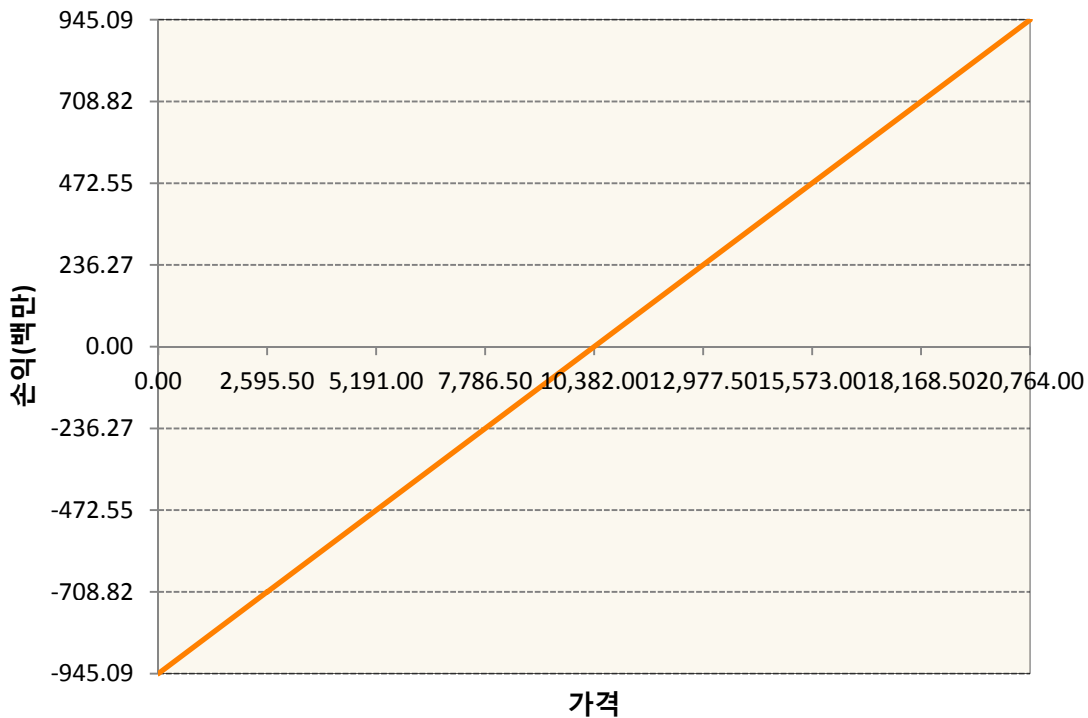
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	945	0	945	장내

2. 만기시점의 손익구조

HCM9-HSCEI Futures Jun19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCM9	HSCEI Futures Jun19	76
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

77

공시일	2019-06-14
기준일	2019-06-13

커버드콜모(주식혼합-파생형)

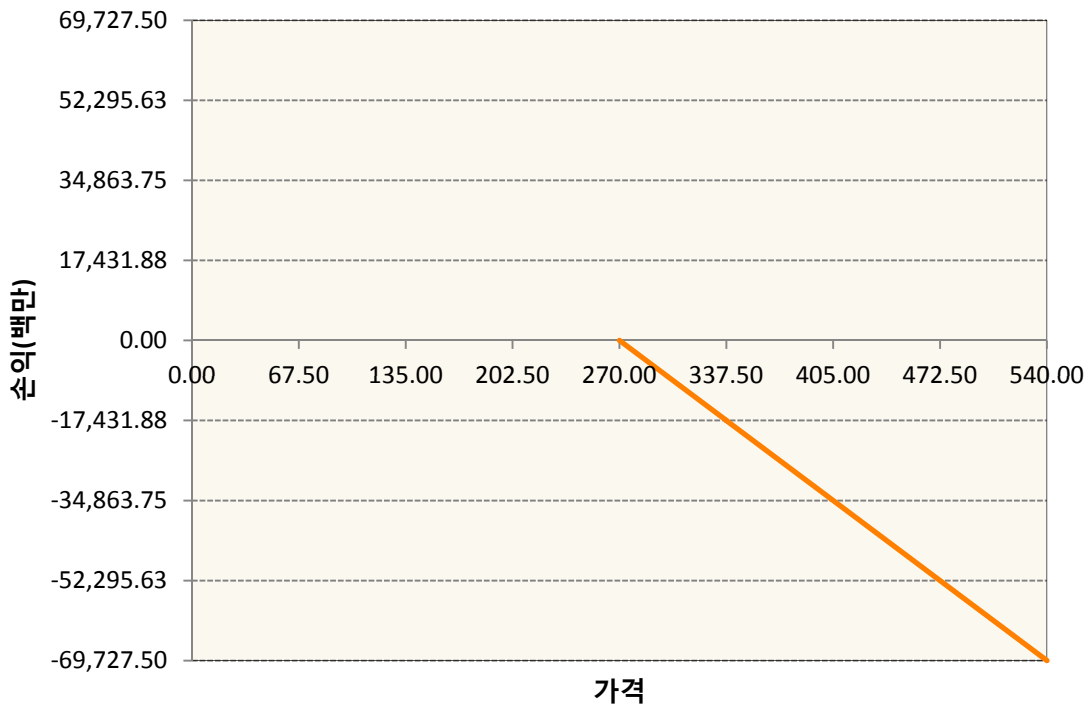
1. 계약금액

(단위:백만원)

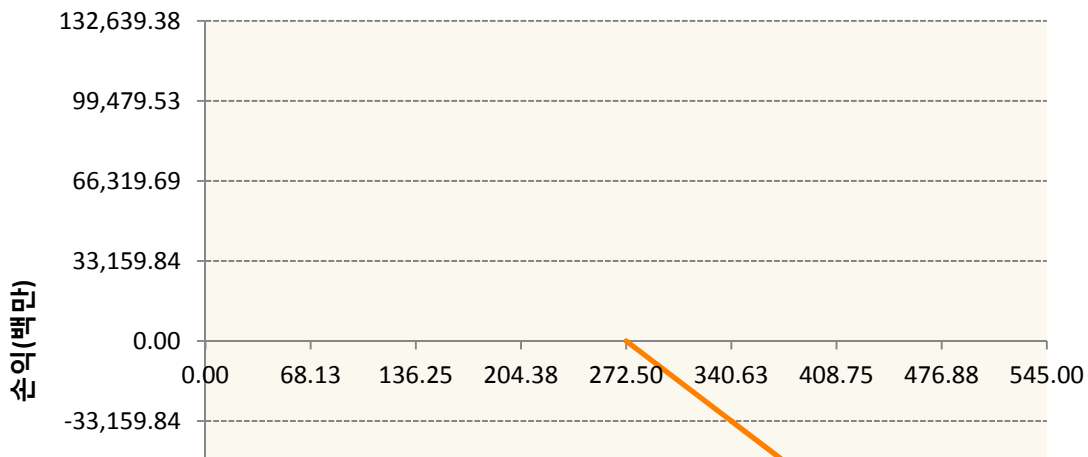
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	171,686	-171,686	장내
누계	유가증권	옵션	0	202,367	-202,367	장내

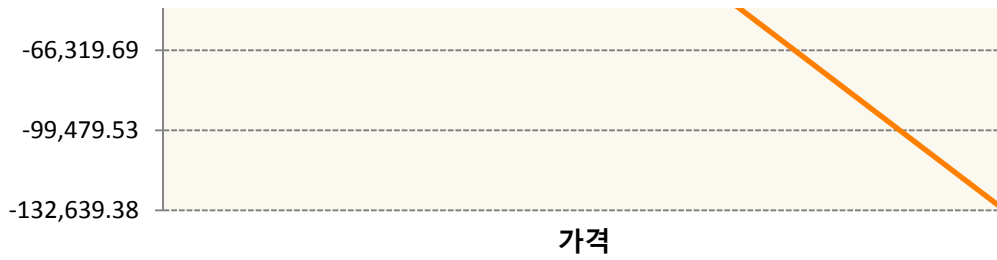
2. 만기시점의 손익구조

KR4201P72700-2019-07 콜270



KR4201P72726-2019-07 콜272.5





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201P72700		2019-07 콜270						4,374
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	1,978	1,922	1,855	1,778	1,692	1,599	1,498	
-5.33%	1,765	1,661	1,550	1,431	1,307	1,179	1,047	
-2.67%	1,300	1,153	1,004	852	700	546	392	
0%	488	325	163	0	-163	-325	-488	
2.67%	-691	-834	-981	-1,130	-1,282	-1,436	-1,591	
5.33%	-2,174	-2,276	-2,387	-2,506	-2,632	-2,763	-2,898	
8.00%	-3,858	-3,918	-3,990	-4,073	-4,165	-4,266	-4,374	
KR4201P72726		2019-07 콜272.5						7,863
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	3,208	3,126	3,023	2,900	2,759	2,603	2,432	
-5.33%	2,912	2,746	2,562	2,362	2,149	1,925	1,693	
-2.67%	2,217	1,961	1,697	1,427	1,152	873	590	
0%	921	614	307	0	-307	-615	-923	
2.67%	-1,066	-1,358	-1,654	-1,952	-2,252	-2,554	-2,858	
5.33%	-3,677	-3,901	-4,140	-4,390	-4,650	-4,916	-5,189	
8.00%	-6,736	-6,877	-7,041	-7,224	-7,424	-7,638	-7,863	

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

11,656

공시일	2019-06-14
기준일	2019-06-13

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

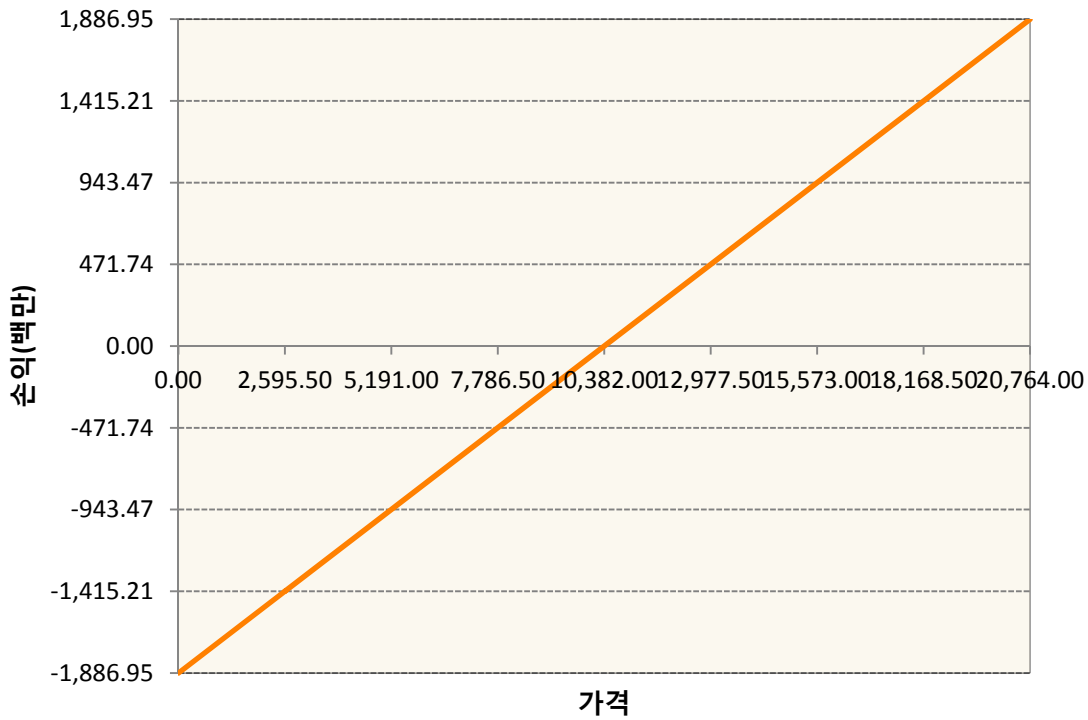
1. 계약금액

(단위:백만원)

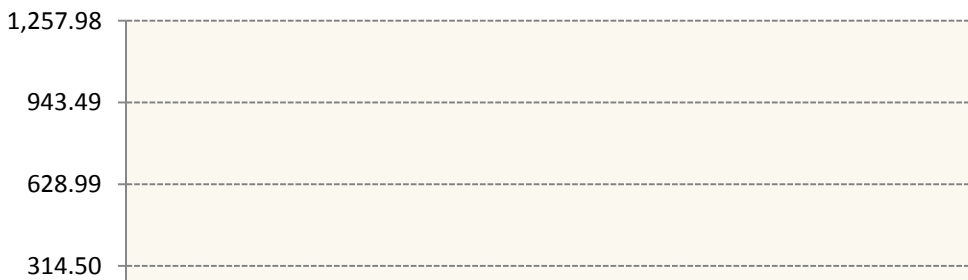
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,887	0	1,887	장내
누계	유가증권	옵션	0	5,056	-5,056	장내
누계	통화	선도	151	3,175	-3,024	장외

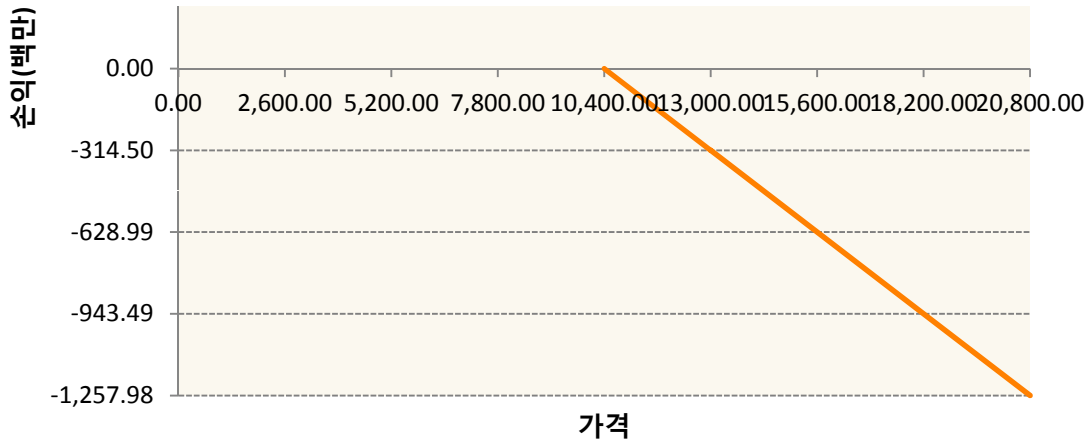
2. 만기시점의 손익구조

HCM9-HSCEI Futures Jun19

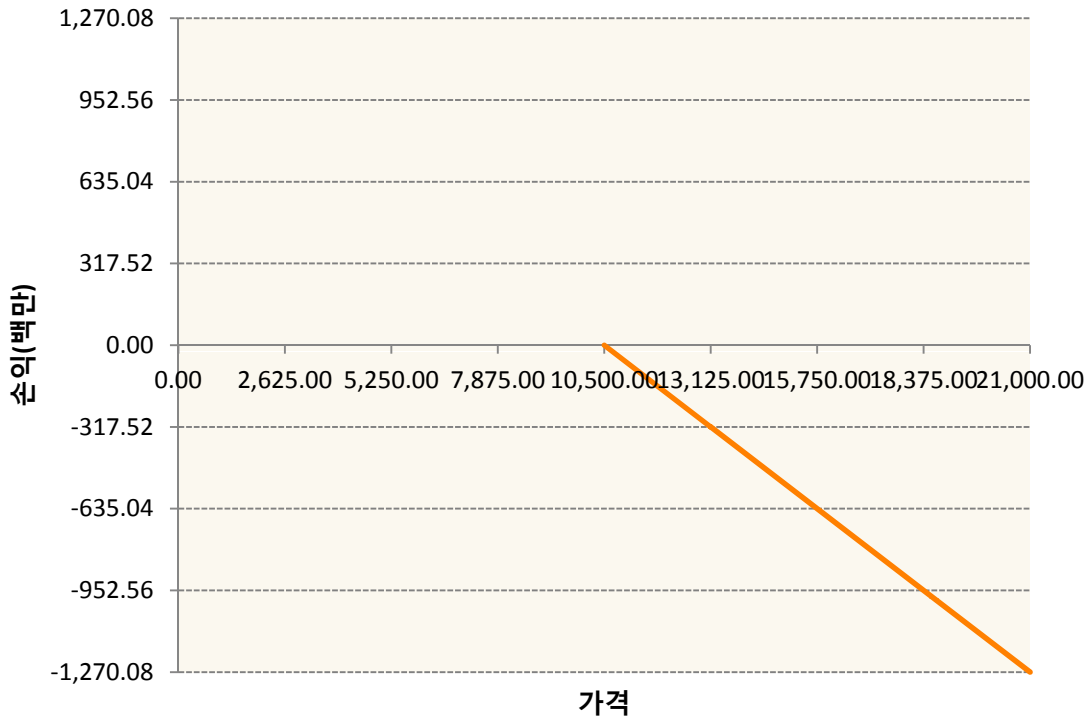


OHHIM9-C104-HSCEI

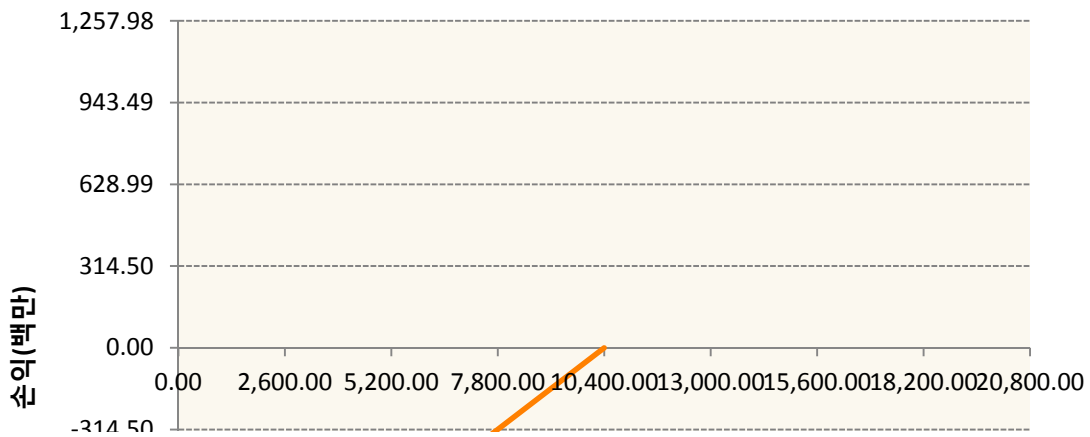


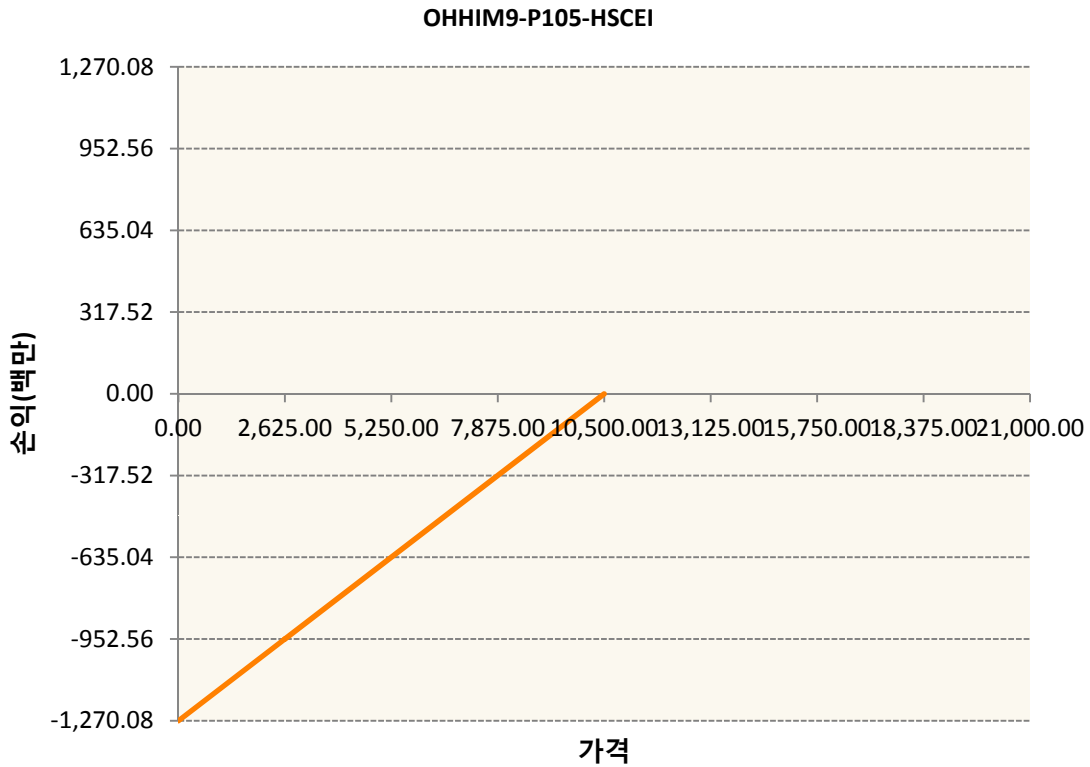
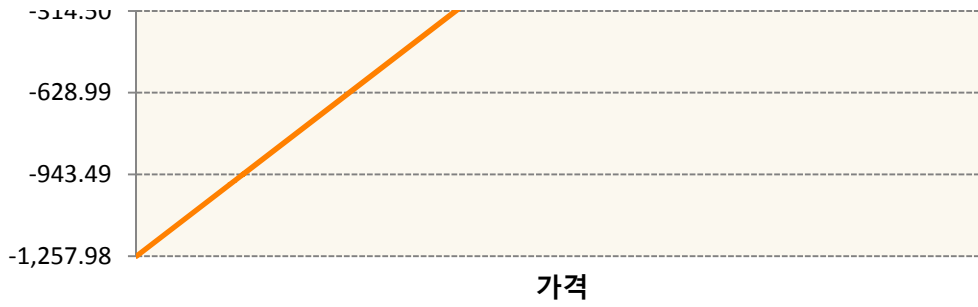


OHHIM9-C105-HSCEI



OHHIM9-P104-HSCEI





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)	(단위:백만원)
FX21019K02 KRW/HKD 23-08-19E	254
FX21019K03 HKD/KRW 23-08-19E	12
HCM9 HSCEI Futures Jun19	151
OHHIM9-C1 HSCEI	101
OHHIM9-C1 HSCEI	102
OHHIM9-P1 HSCEI	101
OHHIM9-P1 HSCEI	102

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	652

5.33%	795	795	795	795	795	795	795
8.00%	1,192	1,192	1,192	1,192	1,192	1,192	1,192
2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_15							603
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-603	-603	-603	-603	-603	-603	-603
-5.33%	-402	-402	-402	-402	-402	-402	-402
-2.67%	-201	-201	-201	-201	-201	-201	-201
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	201	201	201	201	201	201	201
5.33%	402	402	402	402	402	402	402
8.00%	603	603	603	603	603	603	603
KR4101P90001 2019-09 코스피200지수선물							304
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-304	-304	-304	-304	-304	-304	-304
-5.33%	-202	-202	-202	-202	-202	-202	-202
-2.67%	-101	-101	-101	-101	-101	-101	-101
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	101	101	101	101	101	101	101
5.33%	202	202	202	202	202	202	202
8.00%	304	304	304	304	304	304	304

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

(단위:백만원)

2,052

공시일	2019-06-14
기준일	2019-06-13

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

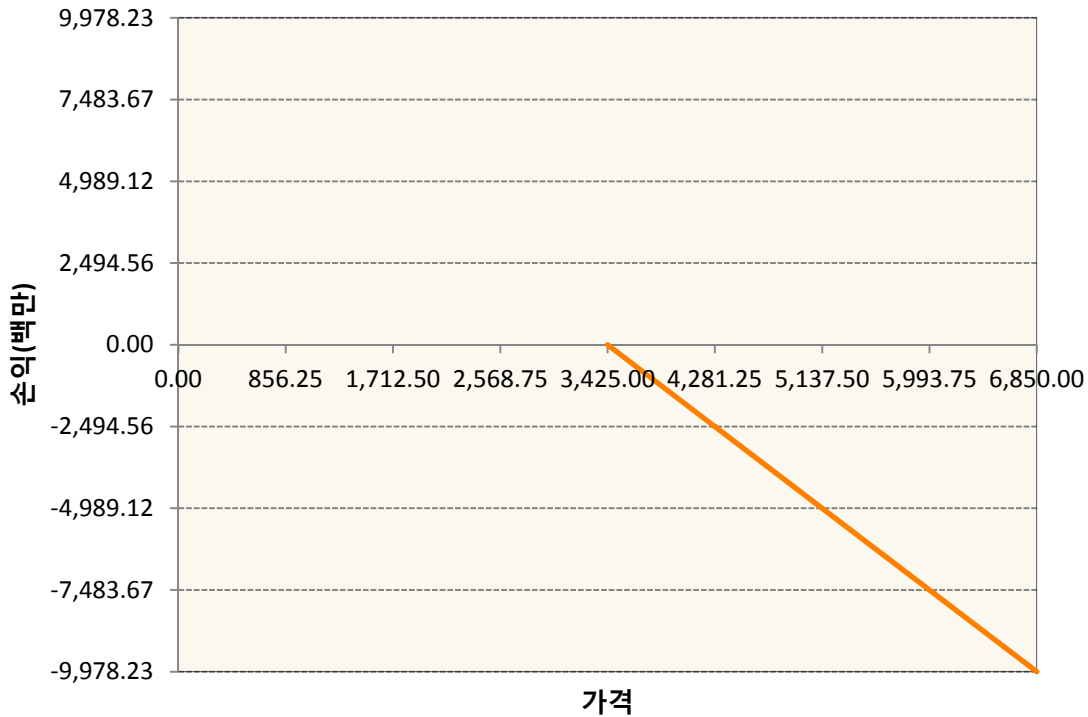
1. 계약금액

(단위:백만원)

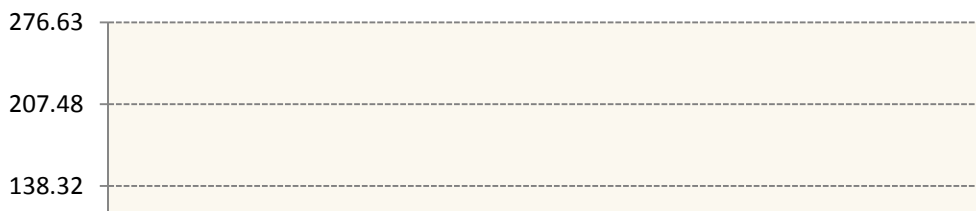
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	3,702	0	3,702	
누계	유가증권	스왑	56,567	0	56,567	장외
누계	유가증권	옵션	0	20,510	-20,510	장내
누계	통화	선도	0	18,709	-18,709	장외

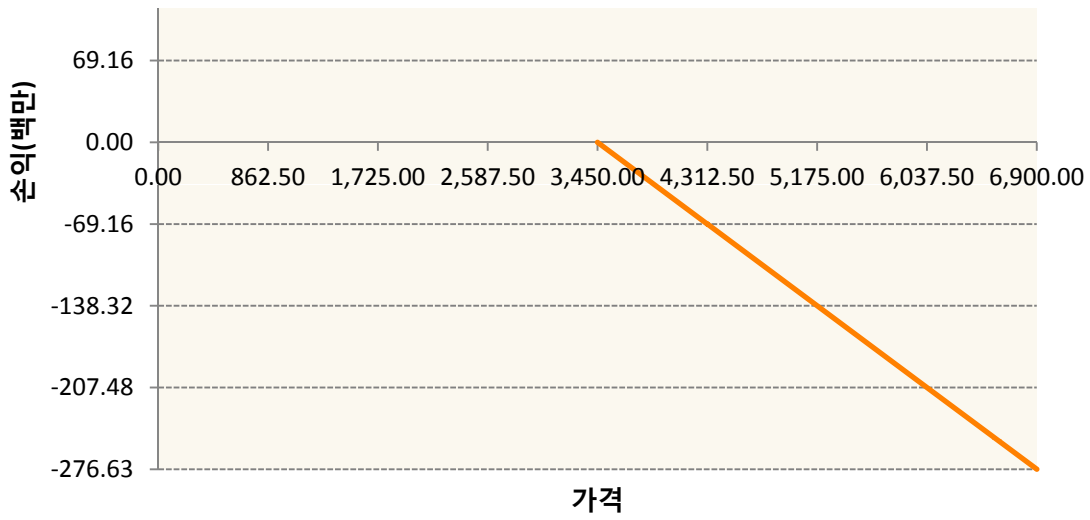
2. 만기시점의 손익구조

OESXM9-C3425-EURO STOXX 50

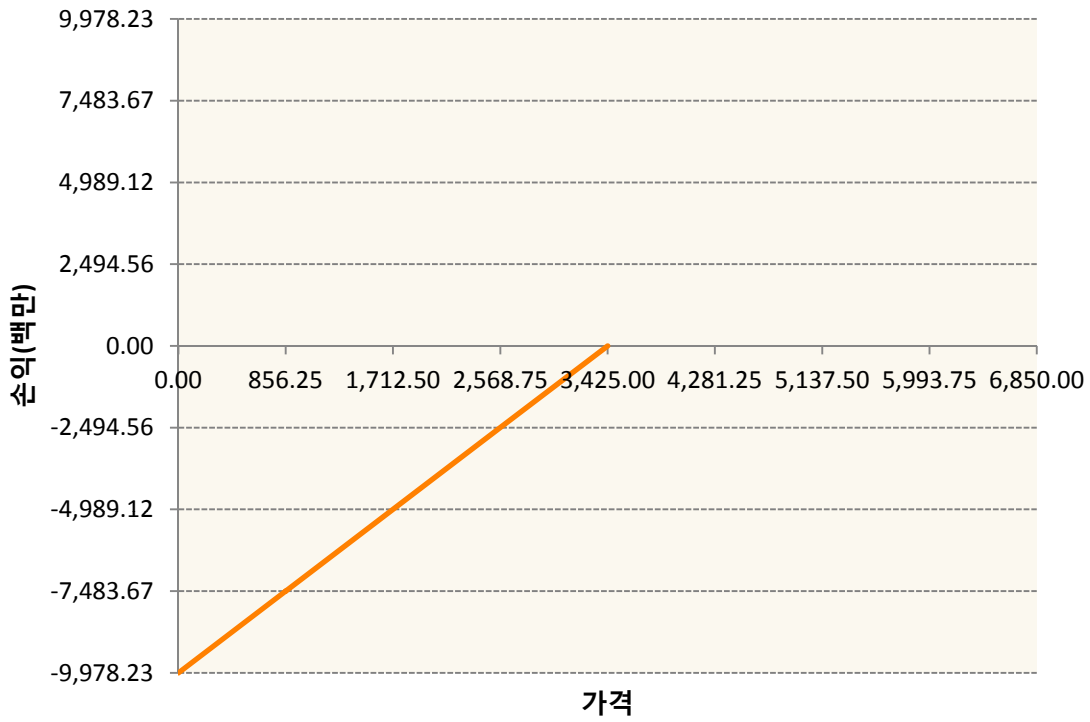


OESXM9-C3450-EURO STOXX 50

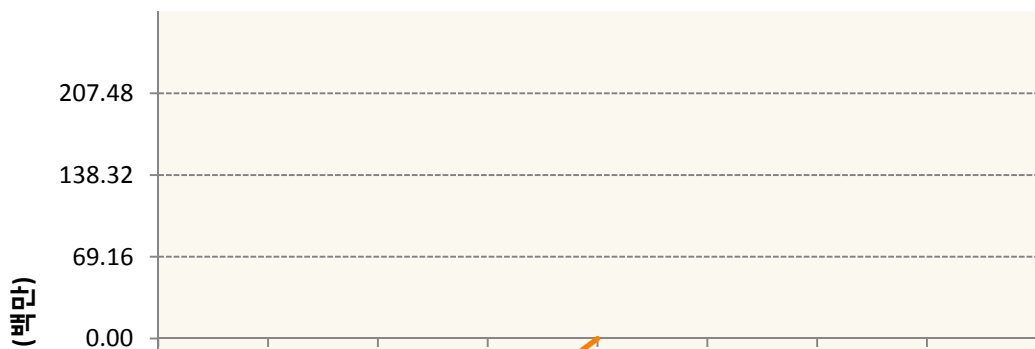


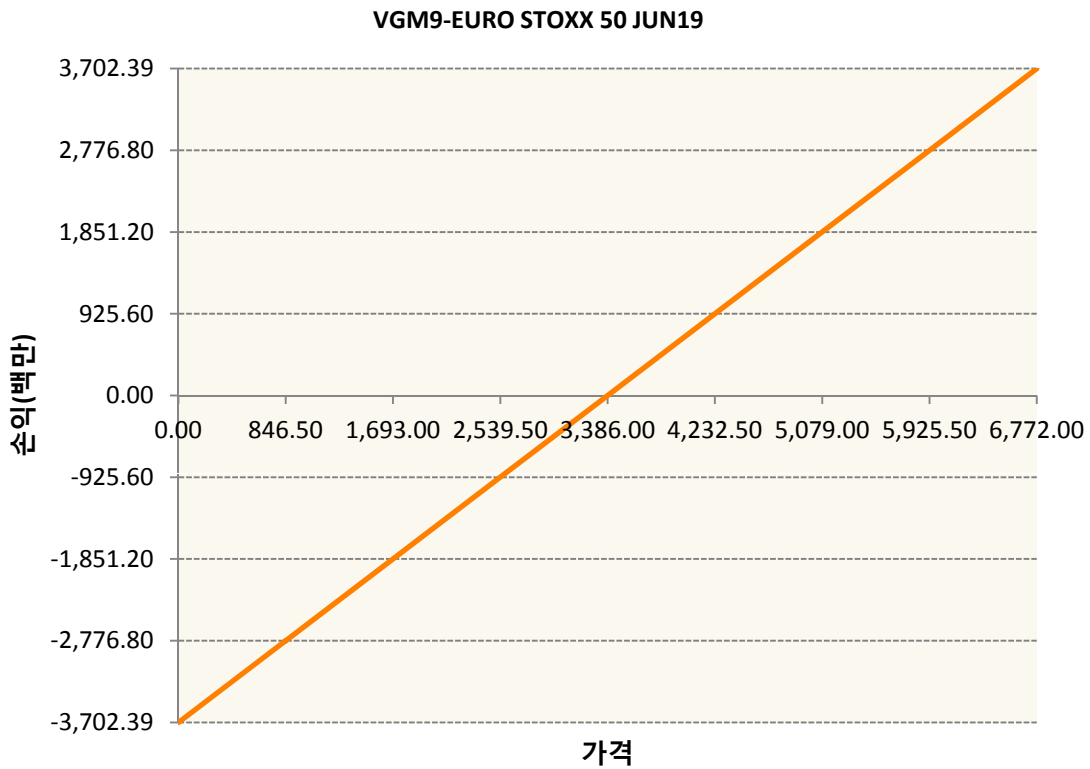
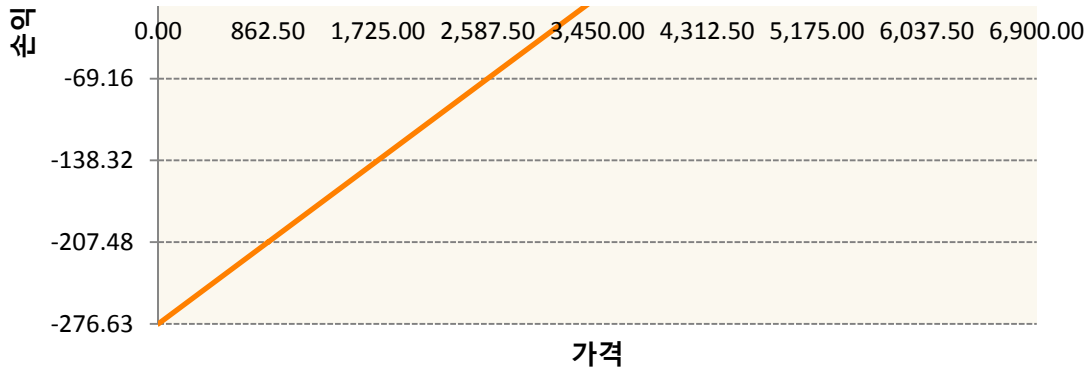


OESXM9-P3425-EURO STOXX 50



OESXM9-P3450-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY	14
FX21019H03 KRW/EUR 28-06-19E	855
FX21019J01: KRW/EUR 28-06-19E	214
FX21019K02 KRW/EUR 23-08-19E	428
OESXM9-C3·EURO STOXX 50	798
OESXM9-C3·EURO STOXX 50	22
OESXM9-P3·EURO STOXX 50	798
OESXM9-P3·EURO STOXX 50	22
VGM9 EURO STOXX 50 JUN19	296

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

(단위:백만원)

2,137

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

(단위:백만원)

1,035

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

(단위:백만원)

92

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

(단위:백만원)

133

공시일	2019-06-14
기준일	2019-06-13

스마트KRX300인덱스목표전환형1호

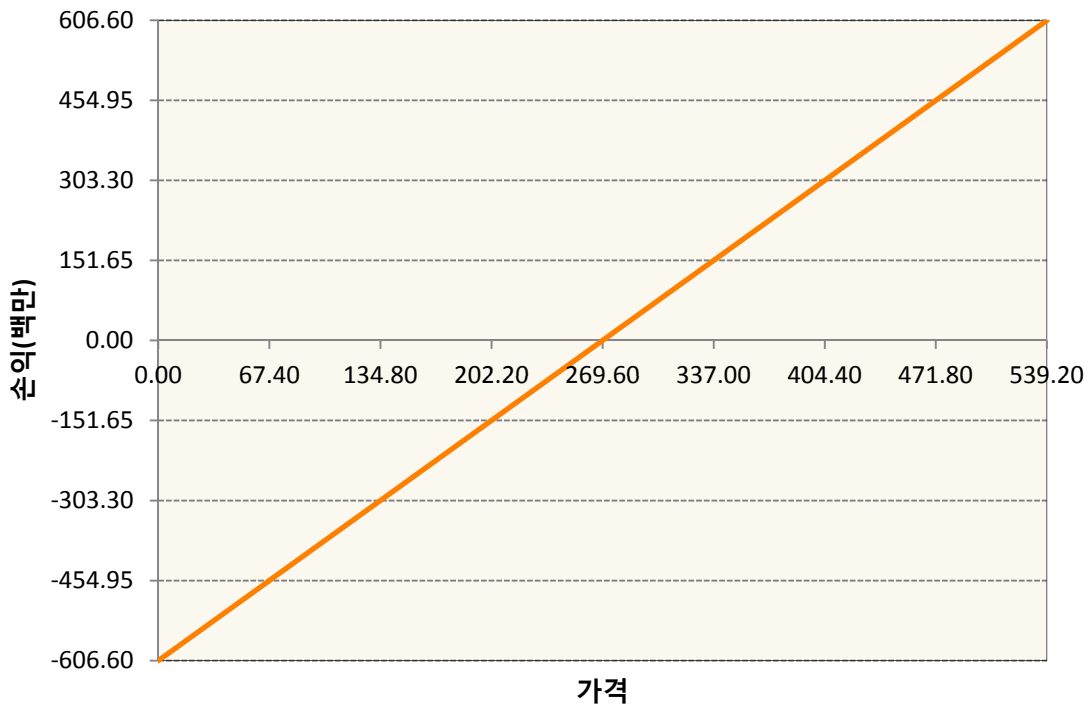
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	338	0	338	장내
누계	유가증권	선물	607	0	607	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101P90001		2019-09 코스피200지수선물						49
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-49	-49	-49	-49	-49	-49	-49	
-5.33%	-33	-33	-33	-33	-33	-33	-33	
-2.67%	-16	-16	-16	-16	-16	-16	-16	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	16	16	16	16	16	16	16	
5.33%	33	33	33	33	33	33	33	
8.00%	49	49	49	49	49	49	49	

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

(단위:백만원)

41

공시일	2019-06-14
기준일	2019-06-13

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

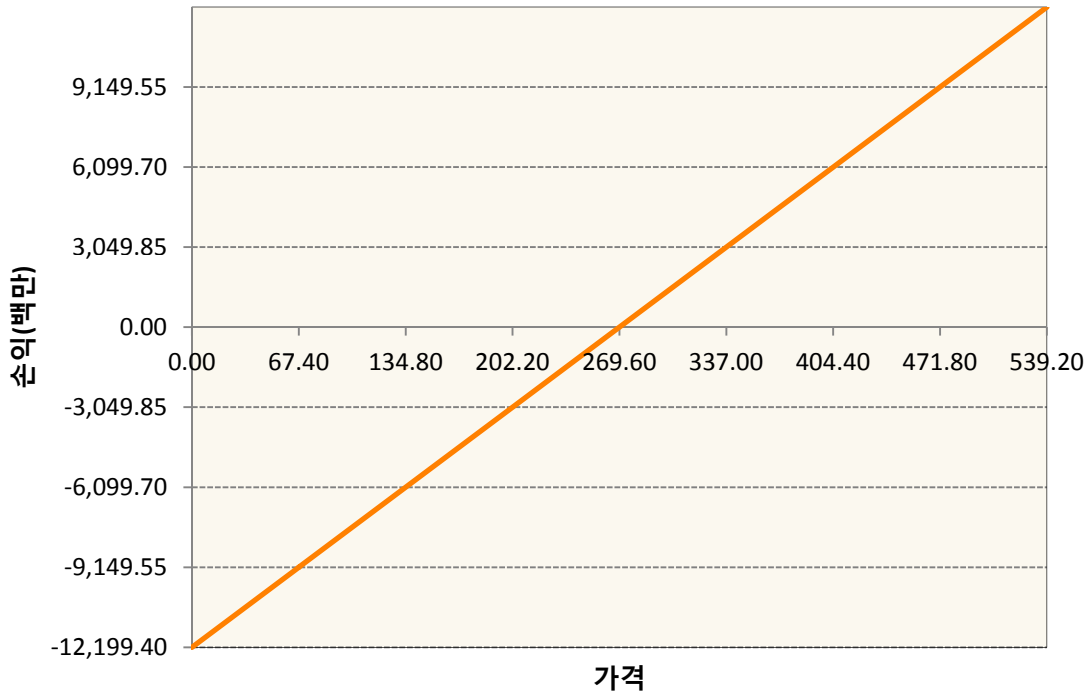
1. 계약금액

(단위:백만원)

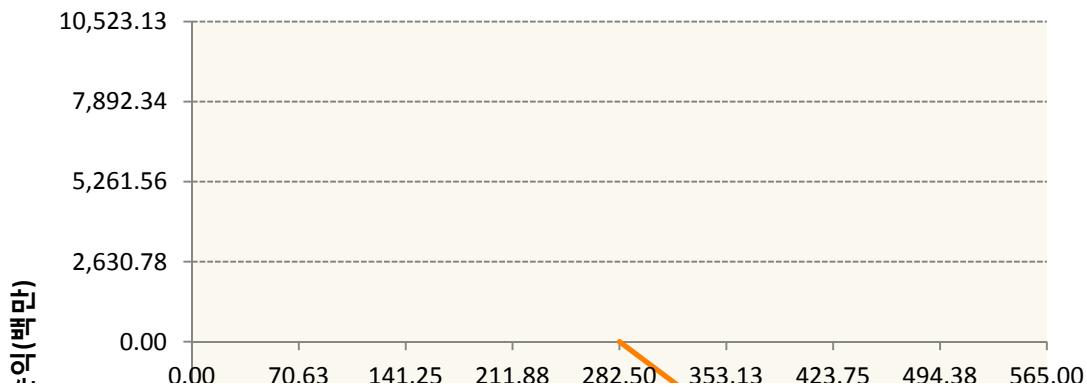
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	6,145	0	6,145	장내
신규	유가증권	옵션	1,397	22,241	-20,844	장내
누계	유가증권	선물	12,199	0	12,199	장내
누계	유가증권	옵션	1,419	22,208	-20,789	장내

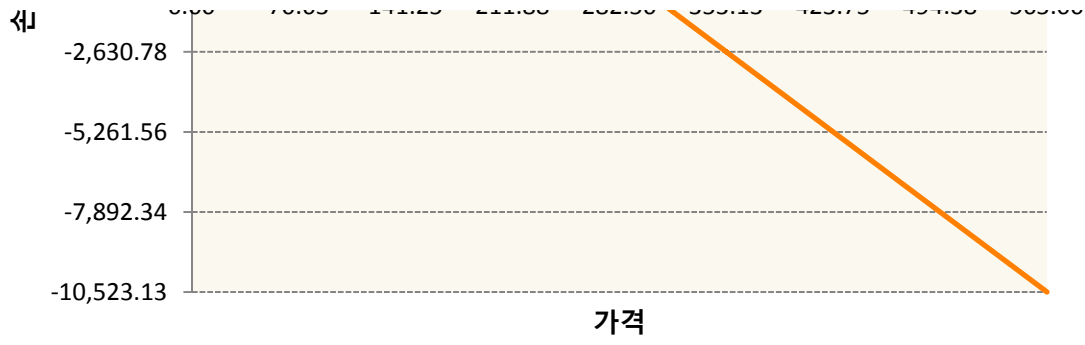
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물

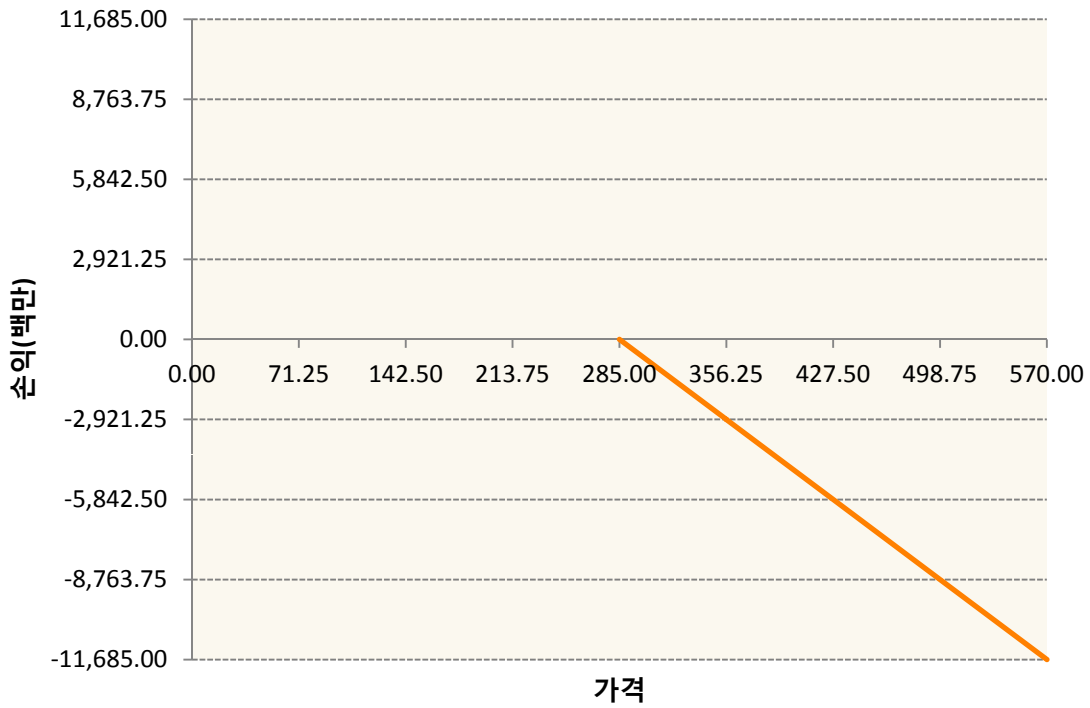


KR4201P72825-2019-07 콜282.5

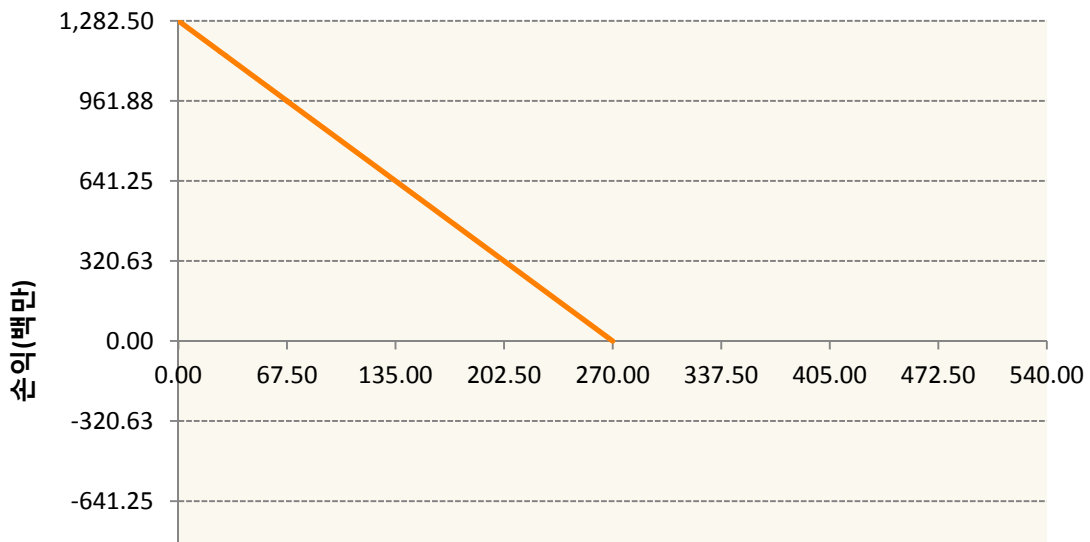


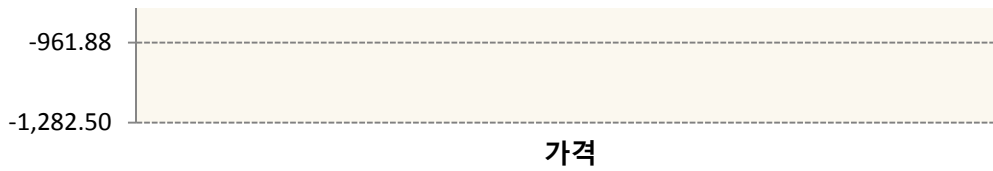


KR4201P72858-2019-07 콜285

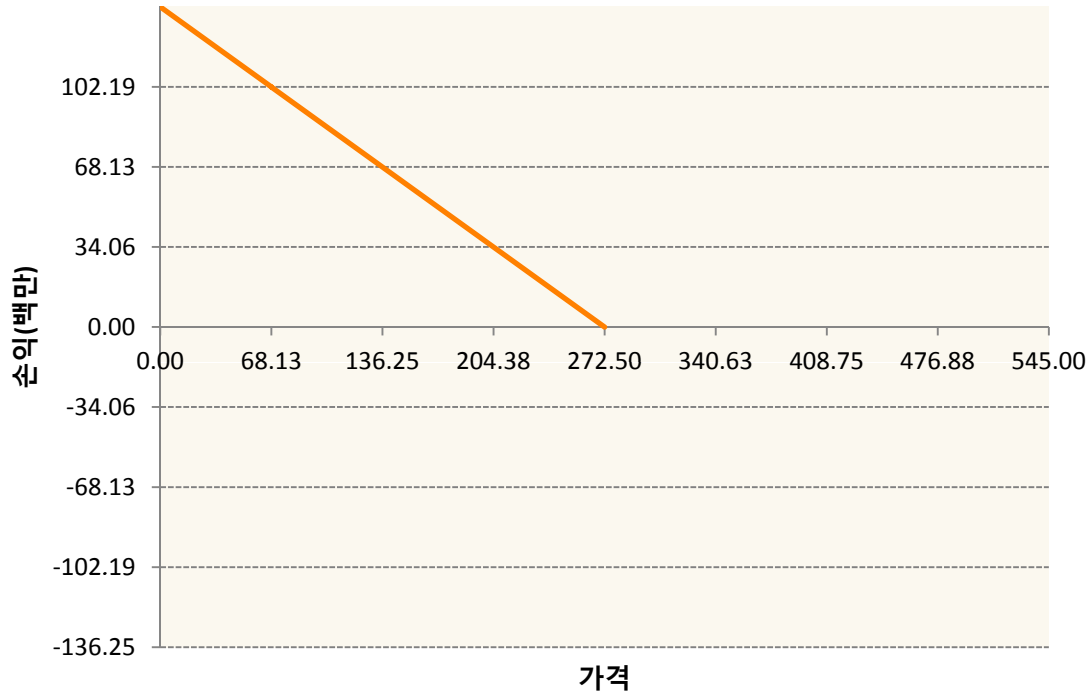


KR4301P72708-2019-07 풋270





KR4301P72724-2019-07 풋272.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101P90001		2019-09 코스피200지수선물						981
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-981	-981	-981	-981	-981	-981	-981	
-5.33%	-654	-654	-654	-654	-654	-654	-654	
-2.67%	-327	-327	-327	-327	-327	-327	-327	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	327	327	327	327	327	327	327	
5.33%	654	654	654	654	654	654	654	
8.00%	981	981	981	981	981	981	981	
KR4201P72825		2019-07 콜282.5						469
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	121	120	117	113	107	101	93	
-5.33%	116	111	104	96	86	75	63	
-2.67%	99	88	75	61	46	30	13	

공시일	2019-06-14
기준일	2019-06-13

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	18,774	0	18,774	

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	2019-06-14
기준일	2019-06-13

H2O글로벌본드(UH)(채권혼합-파)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	0	0	0	
누계	유가증권	수익증권	58,675	0	58,675	

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	2019-06-14
기준일	2019-06-13

H2O글로벌본드(H)(채권혼합-파생)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	20,113	0	20,113	
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	수익증권	376,461	0	376,461	
누계	통화	선도	0	385,217	-385,217	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음	
IE00BHNZKL13	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음	
FX21019J019 KRW/USD 18-06-19E		379
FX21019J024 KRW/USD 24-06-19E		946
FX21019J034 KRW/USD 26-06-19E		379
FX21019J037 KRW/USD 28-06-19E		76
FX21019J037 KRW/USD 28-06-19E		996
FX21019J037 KRW/USD 26-06-19E		1,022
FX21019K00 KRW/USD 18-06-19E		568
FX21019K01 KRW/USD 14-06-19E		663
FX21019K01 KRW/USD 18-06-19E		568
FX21019K01 KRW/USD 18-06-19E		473
FX21019K01 KRW/USD 18-06-19E		568
FX21019K01 KRW/USD 18-06-19E		1,420
FX21019K01 KRW/USD 18-06-19E		1,325
FX21019K01 KRW/USD 22-07-19E		473
FX21019K01 KRW/USD 20-06-19E		795
FX21019K01 KRW/USD 20-06-19E		632
FX21019K02 KRW/USD 22-07-19E		473
FX21019K02 KRW/USD 22-07-19E		379
FX21019K02 KRW/USD 22-07-19E		795
FX21019K02 KRW/USD 24-06-19E		379
FX21019K03 KRW/USD 24-06-19E		946
FX21019K03 KRW/USD 24-06-19E		1,514
FX21019K03 KRW/USD 28-06-19E		284
FX21019K03 KRW/USD 28-06-19E		1,230
FX21019K04 KRW/USD 28-06-19E		1,287
FX21019K04 KRW/USD 03-07-19E		663

FX21019K04 KRW/USD 03-07-19E	568
FX21019K04 KRW/USD 03-07-19E	757
FX21019K04 KRW/USD 03-07-19E	757
FX21019K04 KRW/USD 03-07-19E	473
FX21019M00 KRW/USD 10-07-19E	284
FX21019M00 KRW/USD 10-07-19E	946
FX21019M00 KRW/USD 10-07-19E	189
FX21019M00 KRW/USD 10-07-19E	880
FX21019M00 KRW/USD 10-07-19E	1,051
FX21019M00 KRW/USD 10-07-19E	1,893
FX21019M00 KRW/USD 15-07-19E	473
FX21019M01 KRW/USD 15-07-19E	379
FX21019M01 KRW/USD 15-07-19E	663
FX21019M01 KRW/USD 15-07-19E	946
FX21019M01 KRW/USD 15-07-19E	663
FX21019M01 KRW/USD 15-07-19E	663

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

(단위:백만원)

10,231

공시일	2019-06-14
기준일	2019-06-13

스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

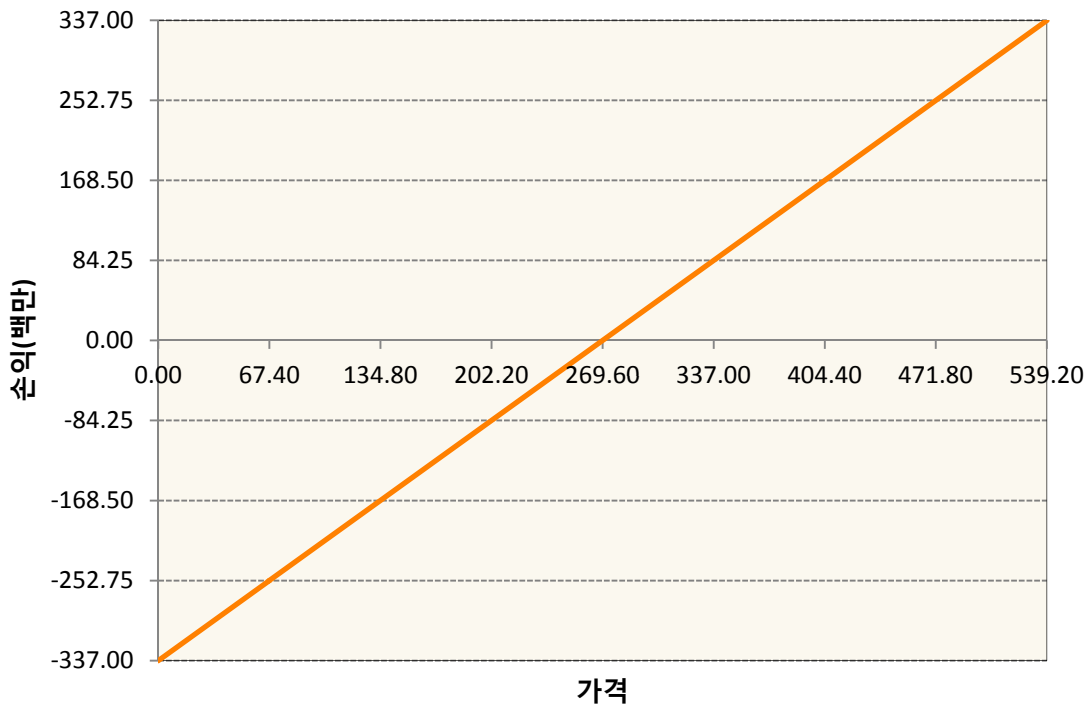
1. 계약금액

(단위:백만원)

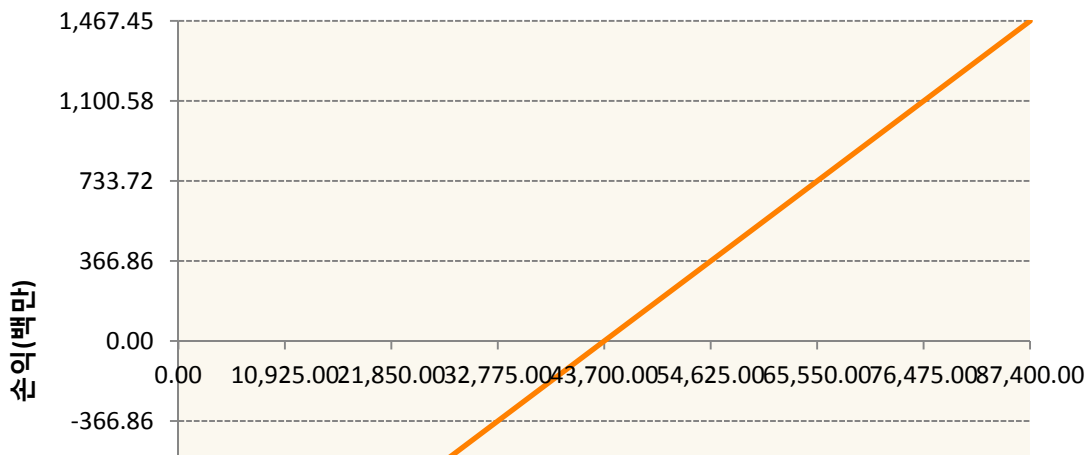
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	203	0	203	장내
누계	유가증권	선물	1,804	0	1,804	장내

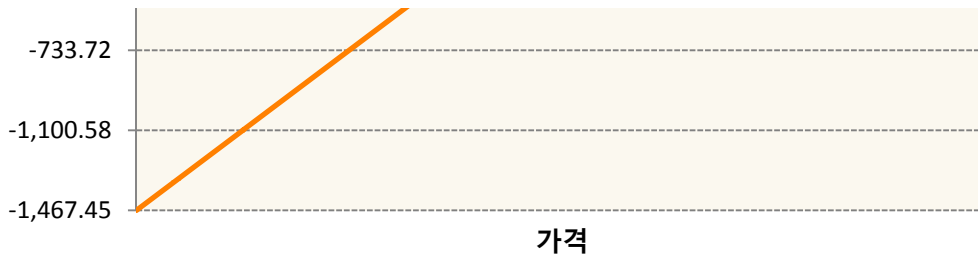
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물



KR4111P70002-2019-07 삼성전자개별선물





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101P90001		2019-09 코스피200지수선물						27
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-27	-27	-27	-27	-27	-27	-27	
-5.33%	-18	-18	-18	-18	-18	-18	-18	
-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%	18	18	18	18	18	18	18	
8.00%	27	27	27	27	27	27	27	
KR4111P70002		2019-07 삼성전자개별선물						118
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-118	-118	-118	-118	-118	-118	-118	
-5.33%	-78	-78	-78	-78	-78	-78	-78	
-2.67%	-39	-39	-39	-39	-39	-39	-39	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	39	39	39	39	39	39	39	
5.33%	78	78	78	78	78	78	78	
8.00%	118	118	118	118	118	118	118	

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

158

공시일	2019-06-14
기준일	2019-06-13

커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

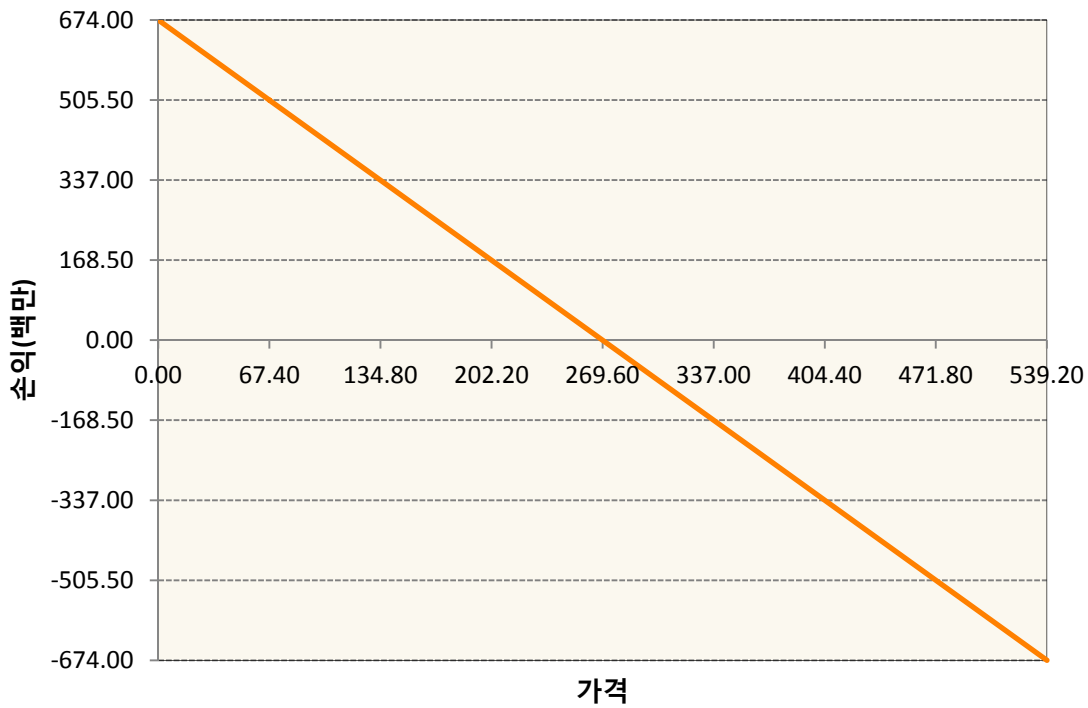
1. 계약금액

(단위:백만원)

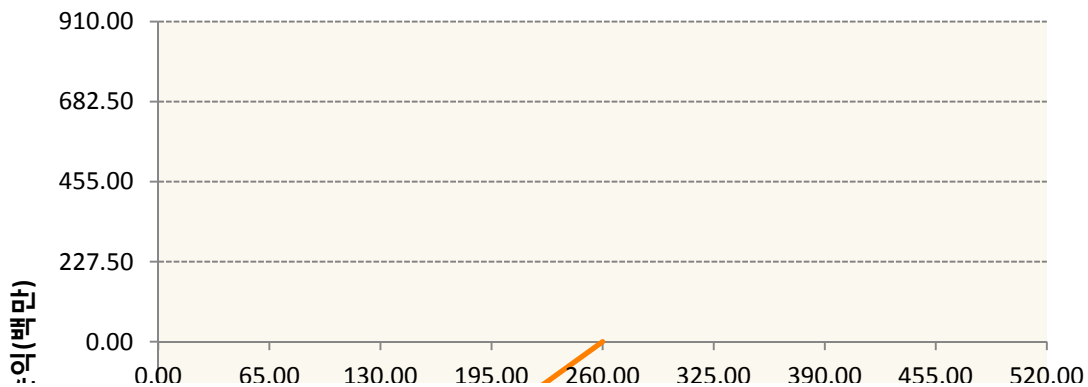
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	677	-677	장내
신규	유가증권	옵션	0	3,357	-3,357	장내
누계	유가증권	선물	0	674	-674	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,338	-3,338	장내

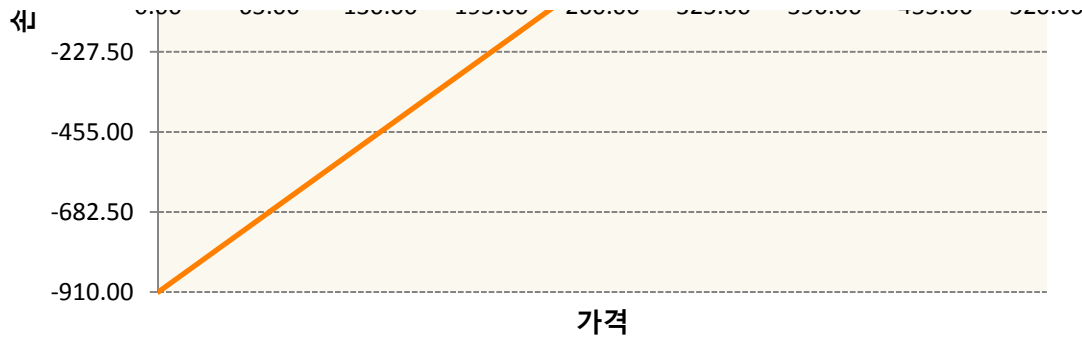
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P90001-2019-09 코스피200지수선물

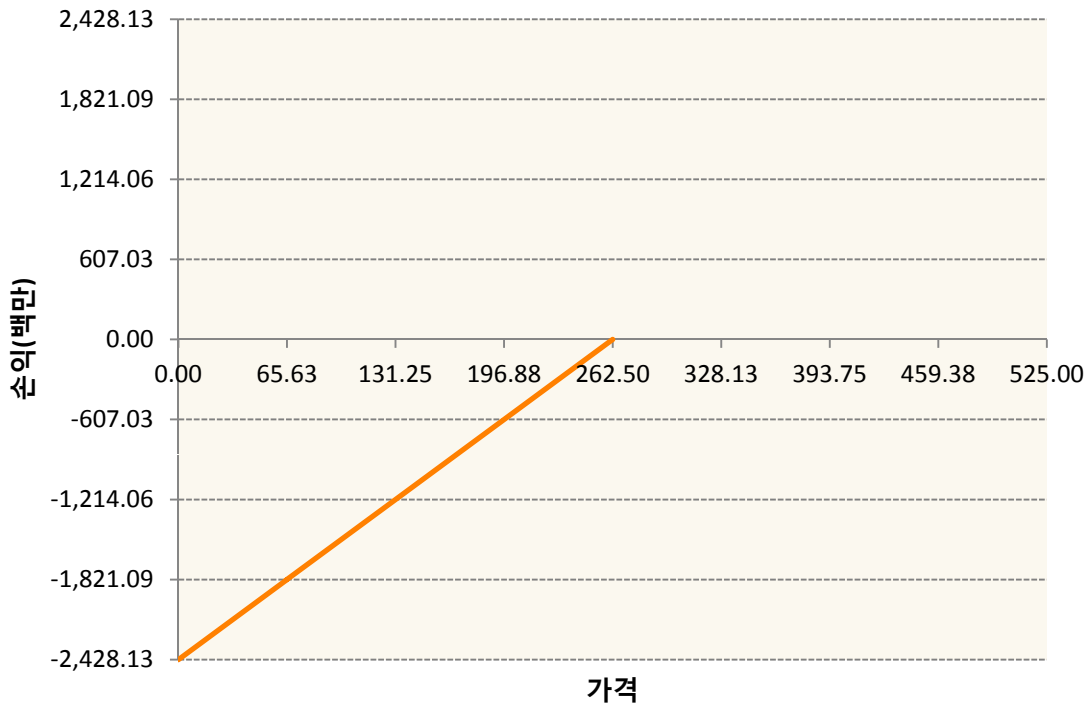


KR4301P72609-2019-07 풋260





KR4301P72625-2019-07 풋262.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101P90001		2019-09 코스피200지수선물						54
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	54	54	54	54	54	54	54	
-5.33%	36	36	36	36	36	36	36	
-2.67%	18	18	18	18	18	18	18	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	-18	-18	-18	-18	-18	-18	-18	
5.33%	-36	-36	-36	-36	-36	-36	-36	
8.00%	-54	-54	-54	-54	-54	-54	-54	
KR4301P72609		2019-07 풋260						40
기초자산의 변동성								

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-36	-36	-37	-37	-38	-39	-40
-5.33%	-15	-16	-17	-19	-20	-21	-22
-2.67%	-3	-4	-5	-6	-7	-9	-10
0%	2	1	1	0	-1	-2	-3
2.67%	3	3	3	2	2	2	1
5.33%	3	3	3	3	3	3	2
8.00%	3	3	3	3	3	3	3

KR4301P72625

2019-07 풋262.5

120

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-111	-112	-113	-114	-116	-118	-120
-5.33%	-52	-55	-58	-60	-63	-66	-69
-2.67%	-12	-15	-18	-22	-25	-28	-31
0%	7	5	2	0	-3	-5	-8
2.67%	12	11	10	9	8	6	5
5.33%	13	12	12	12	11	11	10
8.00%	13	13	13	13	12	12	12

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

(단위:백만원)

180

공시일	2019-06-14
기준일	2019-06-13

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

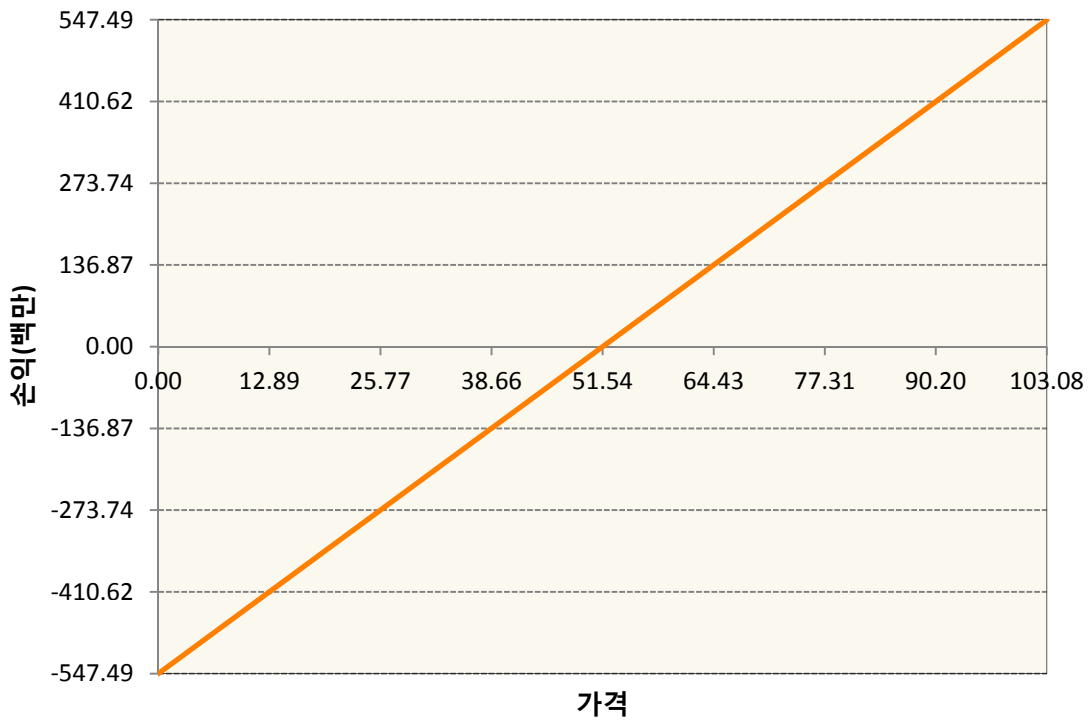
1. 계약금액

(단위:백만원)

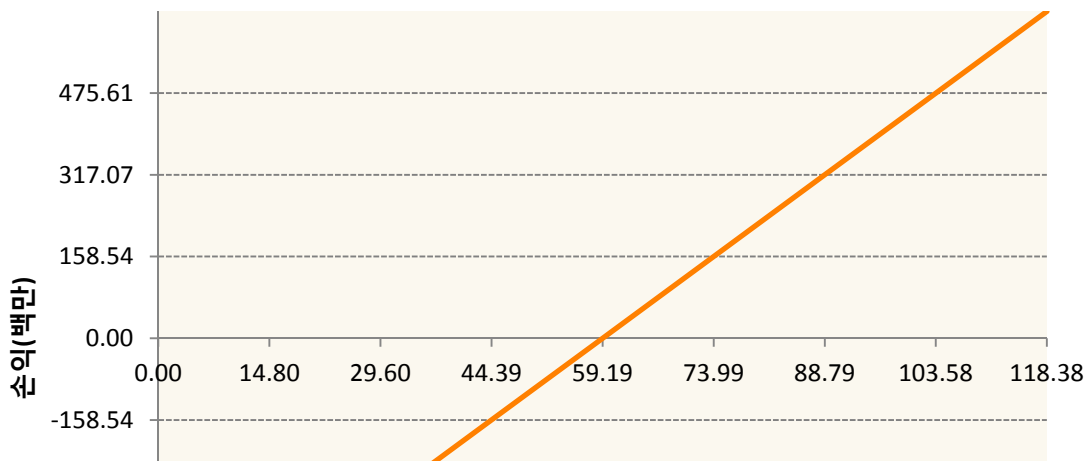
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,451	118	2,333	

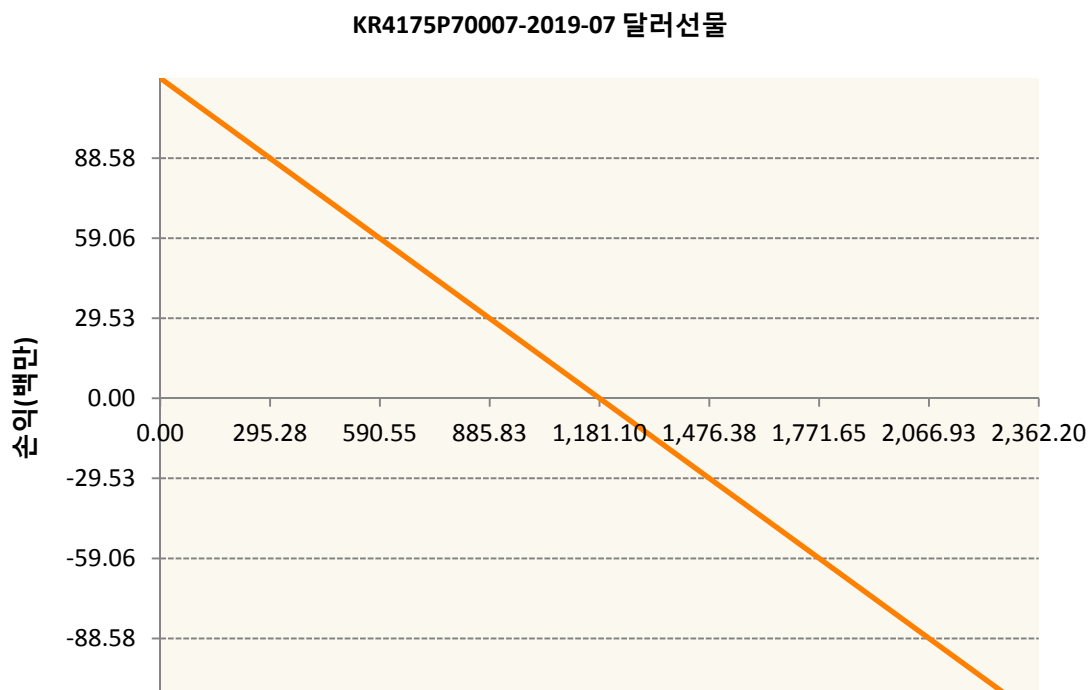
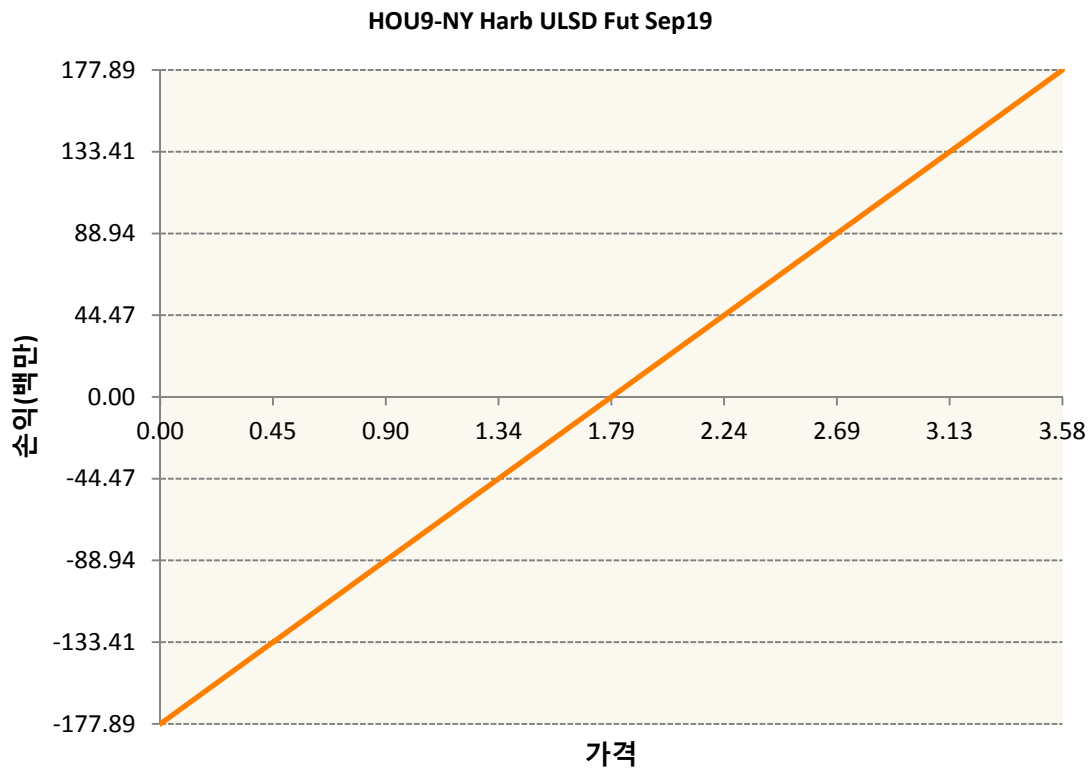
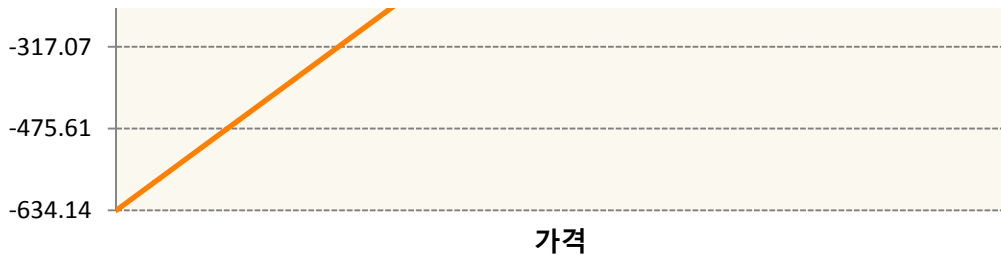
2. 만기시점의 손익구조

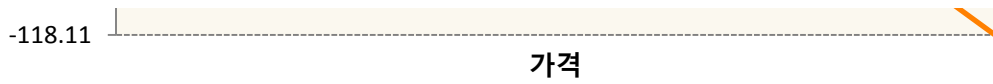
CLU9-WTI CRUDE FUTURE Sep19



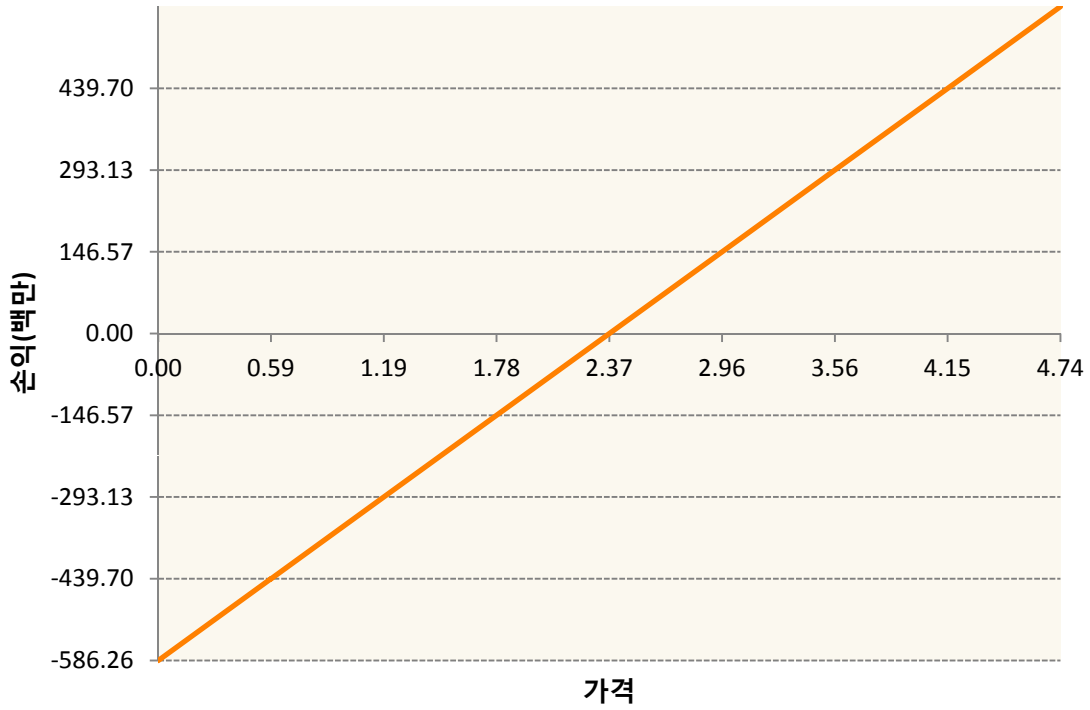
COU9-BRENT CRUDE FUTR Sep19



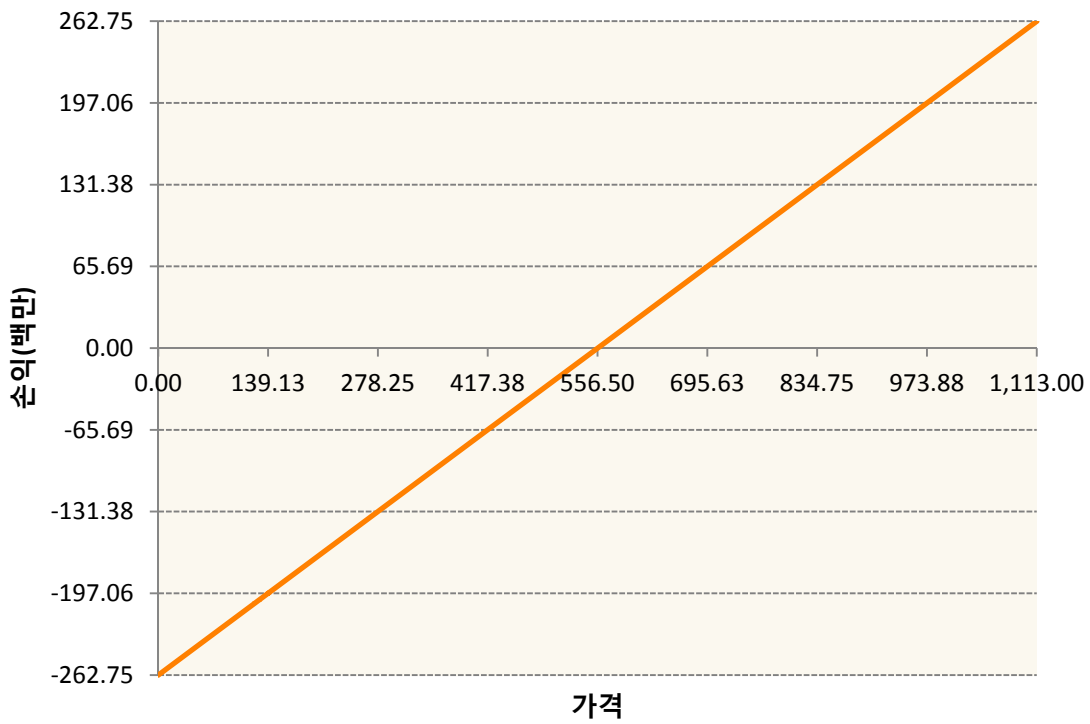




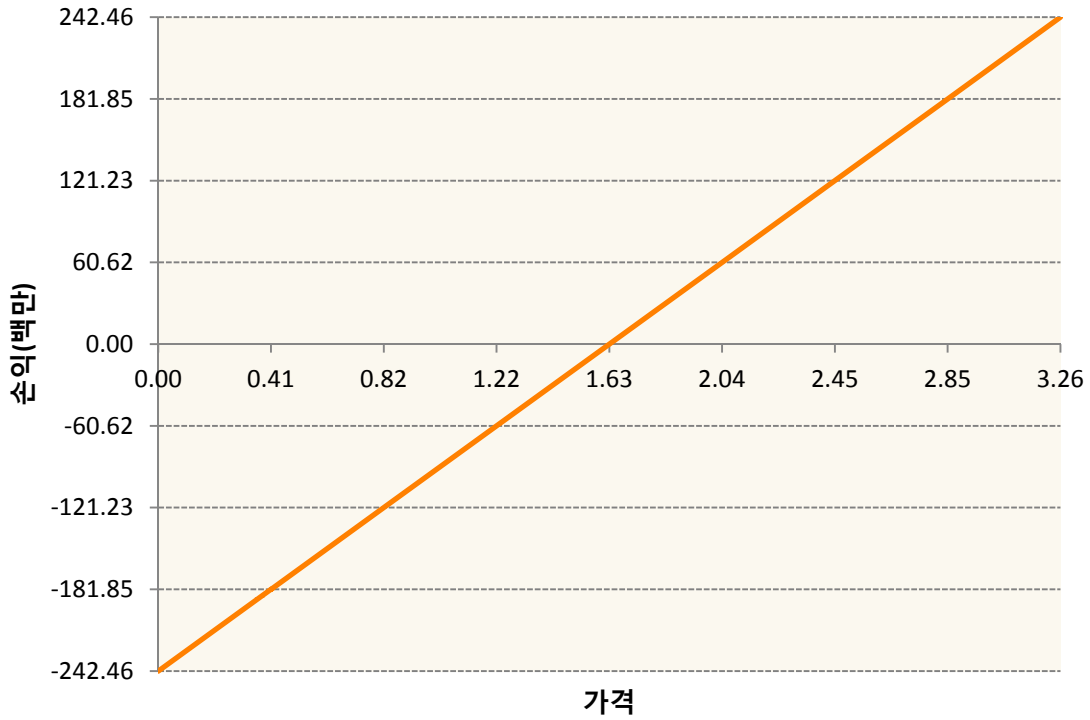
NGU19-NATURAL GAS FUTR Sep19



QSU9-Low Su Gasoil G Sep19



XBU9-GASOLINE RBOB FUT Sep19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

CLU9	WTI CRUDE FUTURE Sep19	44
COU9	BRENT CRUDE FUTR Sep19	51
HOU9	NY Harb ULSD Fut Sep19	14
KR4175P700	2019-07 달러선물	9
NGU19	NATURAL GAS FUTR Sep19	47
QSU9	Low Su Gasoil G Sep19	21
XBU9	GASOLINE RBOB FUT Sep19	19

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

(단위:백만원)

365

공시일	2019-06-14
기준일	2019-06-13

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

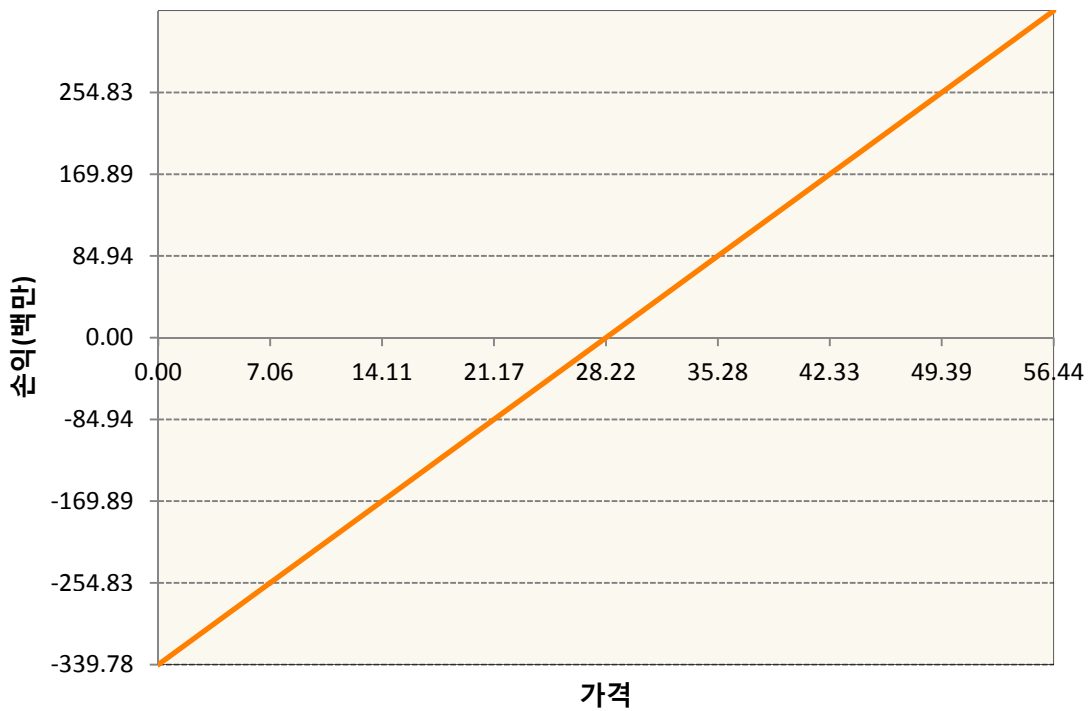
1. 계약금액

(단위:백만원)

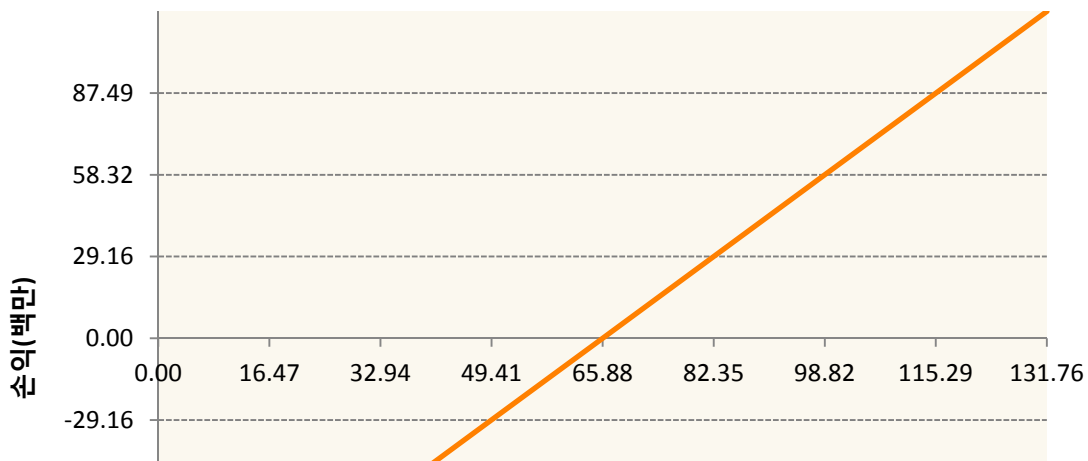
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,276	201	3,075	

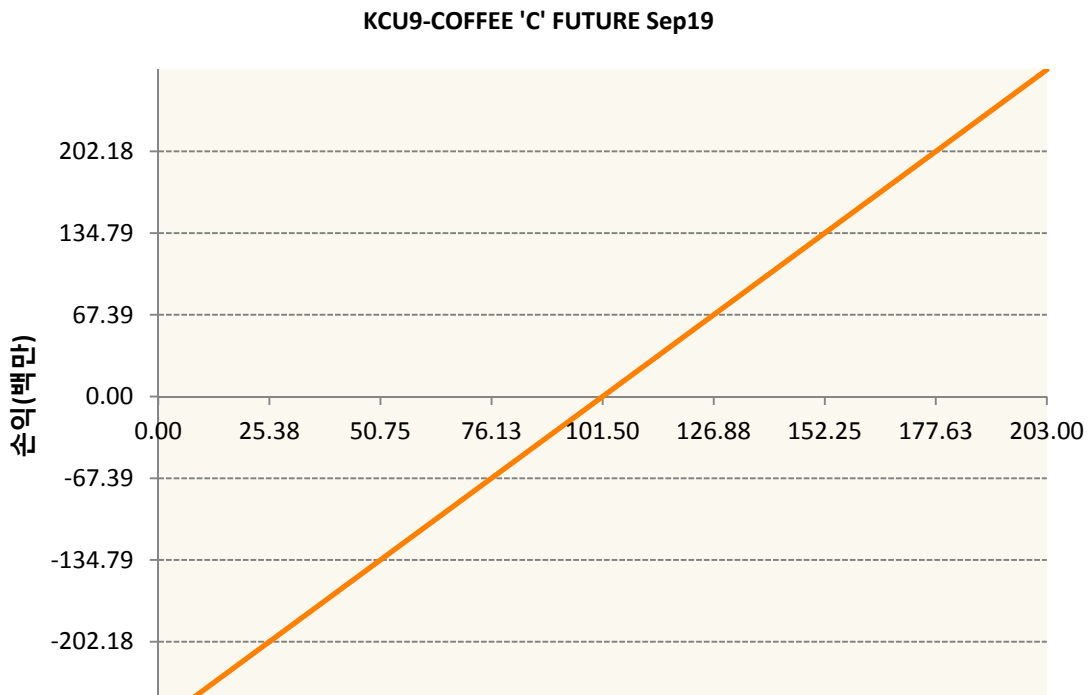
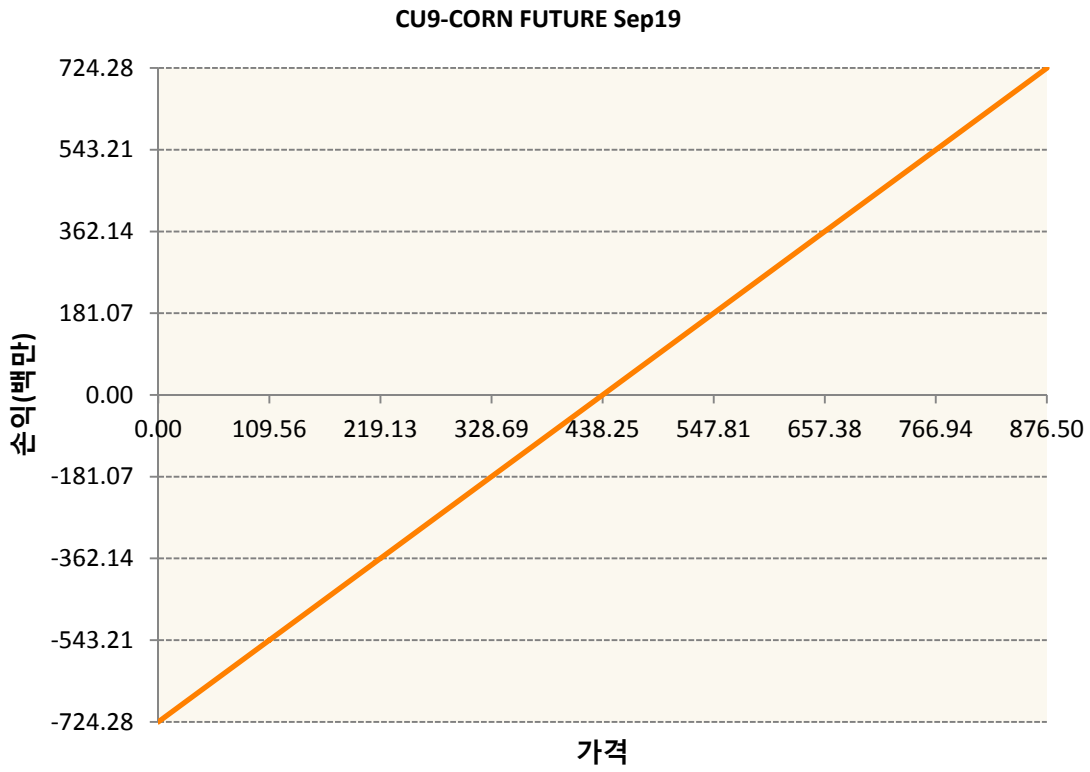
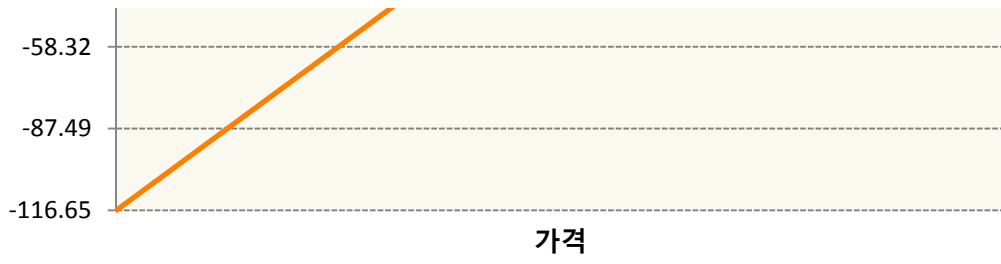
2. 만기시점의 손익구조

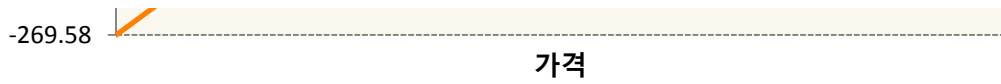
BOZ9-SOYBEAN OIL FUTR Dec19



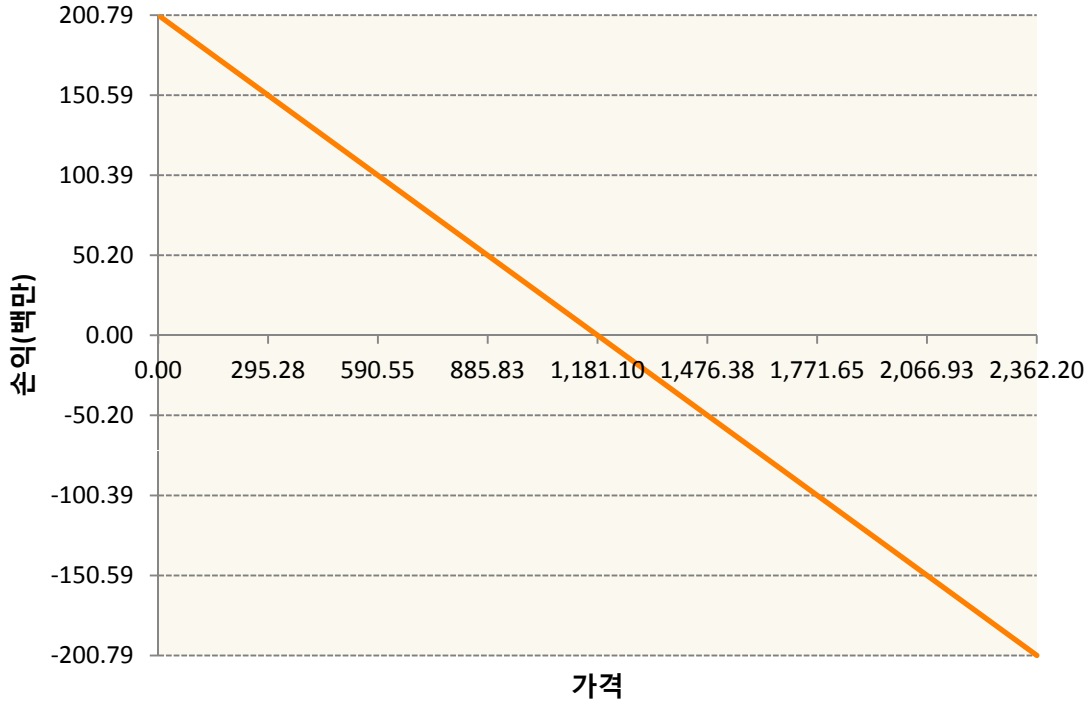
CTZ9-COTTON NO.2 FUTR Dec19



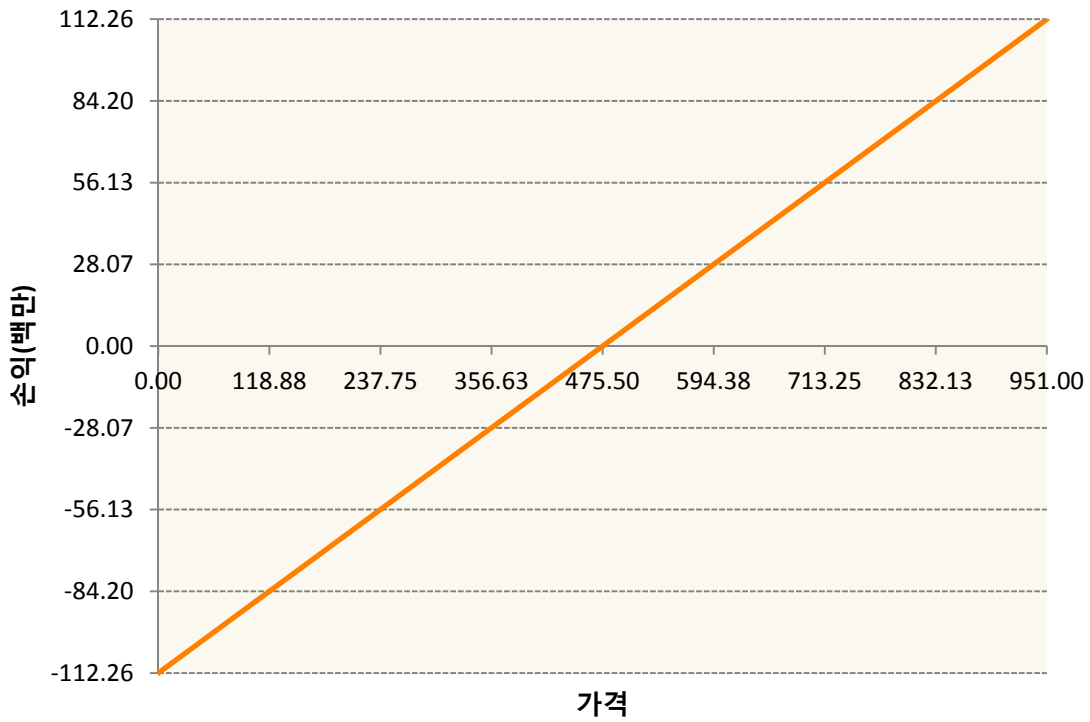




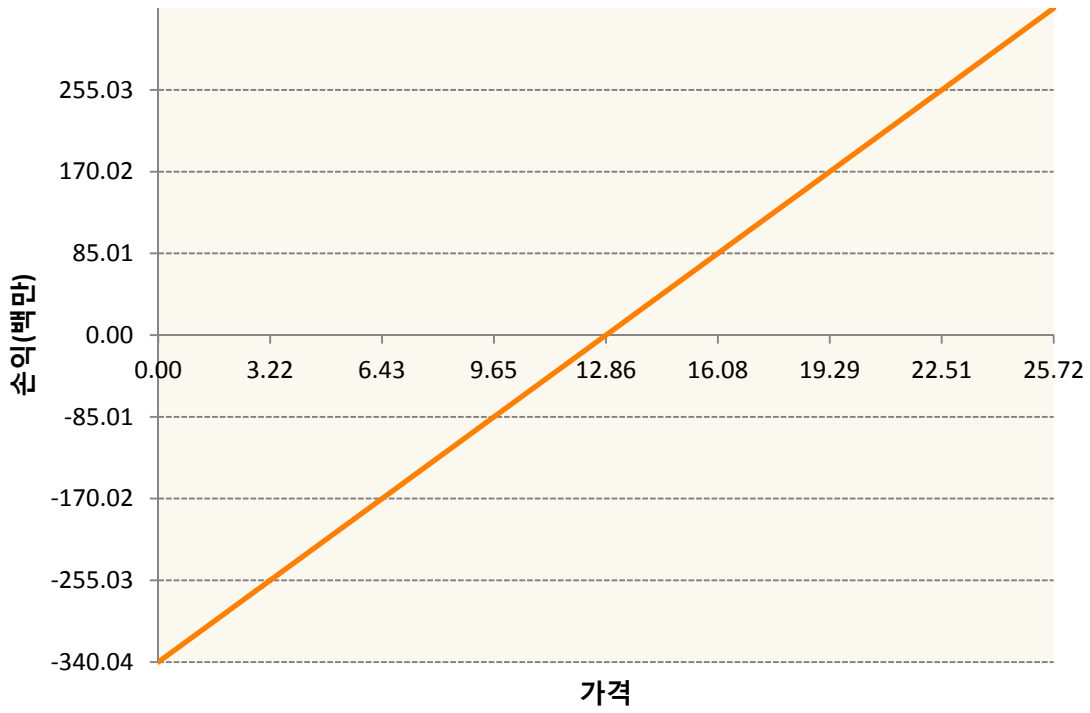
KR4175P70007-2019-07 달러선물



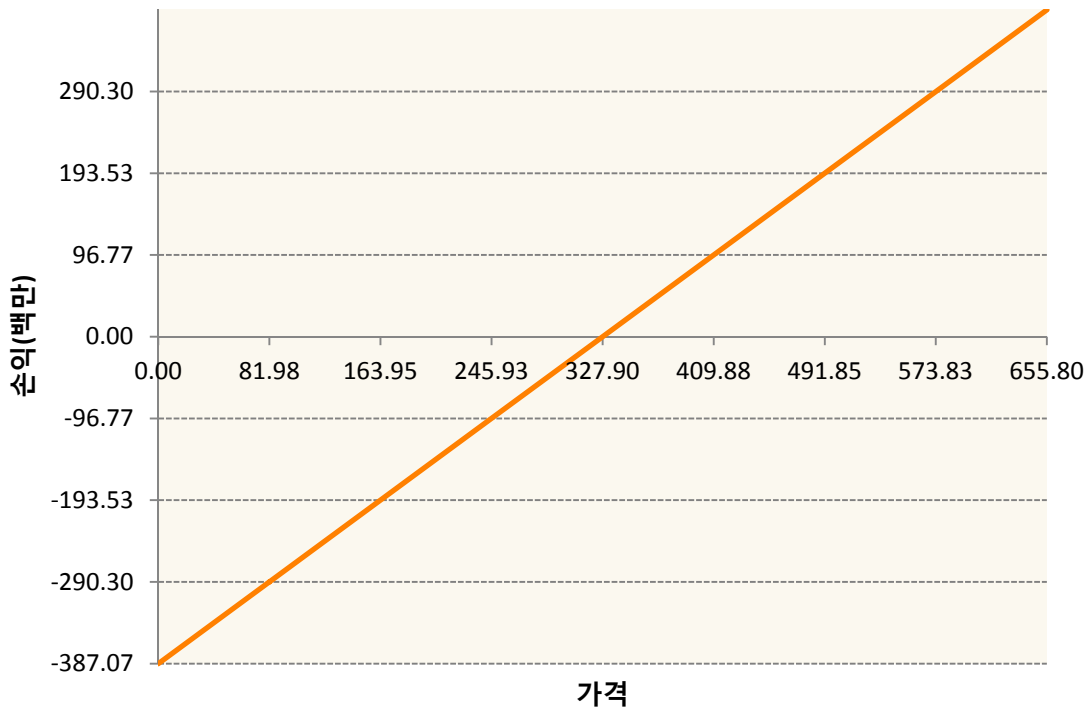
KWU9-KC HRW WHEAT FUT Sep19



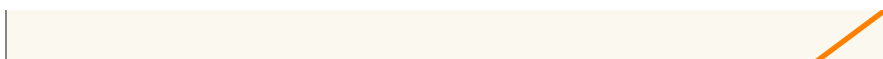
SBV9-SUGAR #11 (WORLD) Oct19

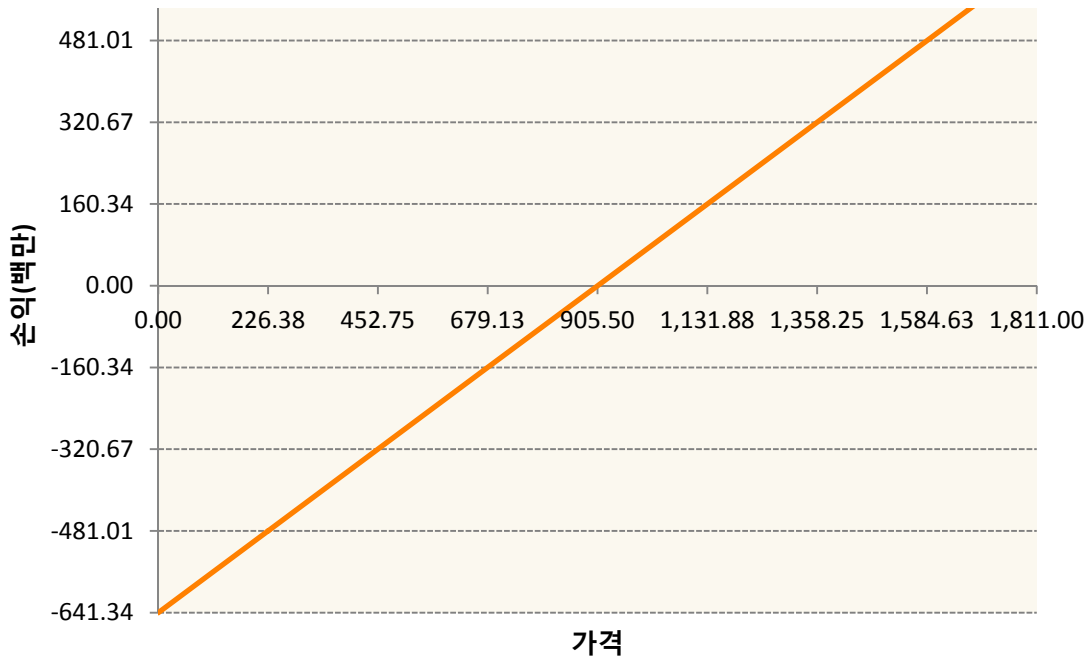


SMZ9-SOYBEAN MEAL FUTR Dec19

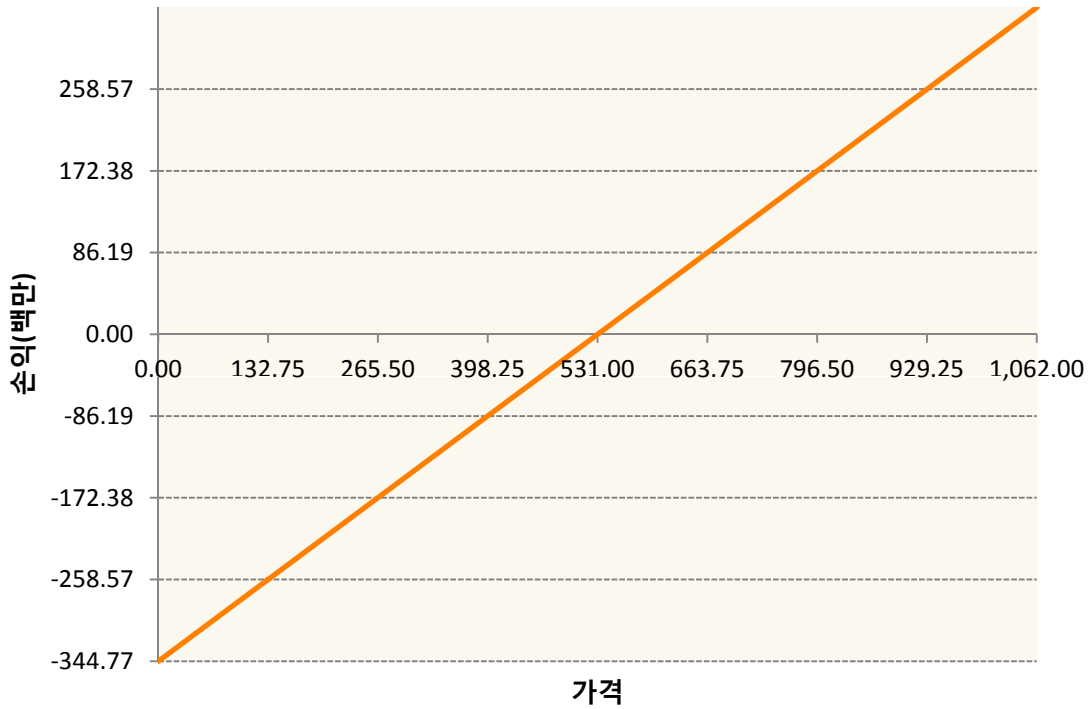


SX9-SOYBEAN FUTURE Nov19





WU9-WHEAT FUTURE(CBT) Sep19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

BOZ9	SOYBEAN OIL FUTR Dec19	27
CTZ9	COTTON NO.2 FUTR Dec19	9
CU9	CORN FUTURE Sep19	58
KCU9	COFFEE 'C' FUTURE Sep19	22
KR4175P700	2019-07 달러선물	16

KWU9	KC HRW WHEAT FUT Sep19	9
SBV9	SUGAR #11 (WORLD) Oct19	27
SMZ9	SOYBEAN MEAL FUTR Dec19	31
SX9	SOYBEAN FUTURE Nov19	51
WU9	WHEAT FUTURE(CBT) Sep19	28

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

(단위:백만원)

281