

공시일	2019-02-28
기준일	2019-02-27

## 포커스농산물모(채권-파생형)

### 1. 계약금액

(단위:USD 백만)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	6	0	6	장외

### 2. 만기시점의 손익구조

### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

\* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

\* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음



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

(단위:백만원)

99

공시일	2019-02-28
기준일	2019-02-27

## SMART합성-MSCI선진국증권상장

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	13,865	0	13,865	장외

### 2. 만기시점의 손익구조

### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWMXWO0( 신한MXWO 미래S190222

1,117

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

643

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-02-28
기준일	2019-02-27

## 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	314
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	2019-02-28
기준일	2019-02-27

## 유로인덱스모(주식-파생형)

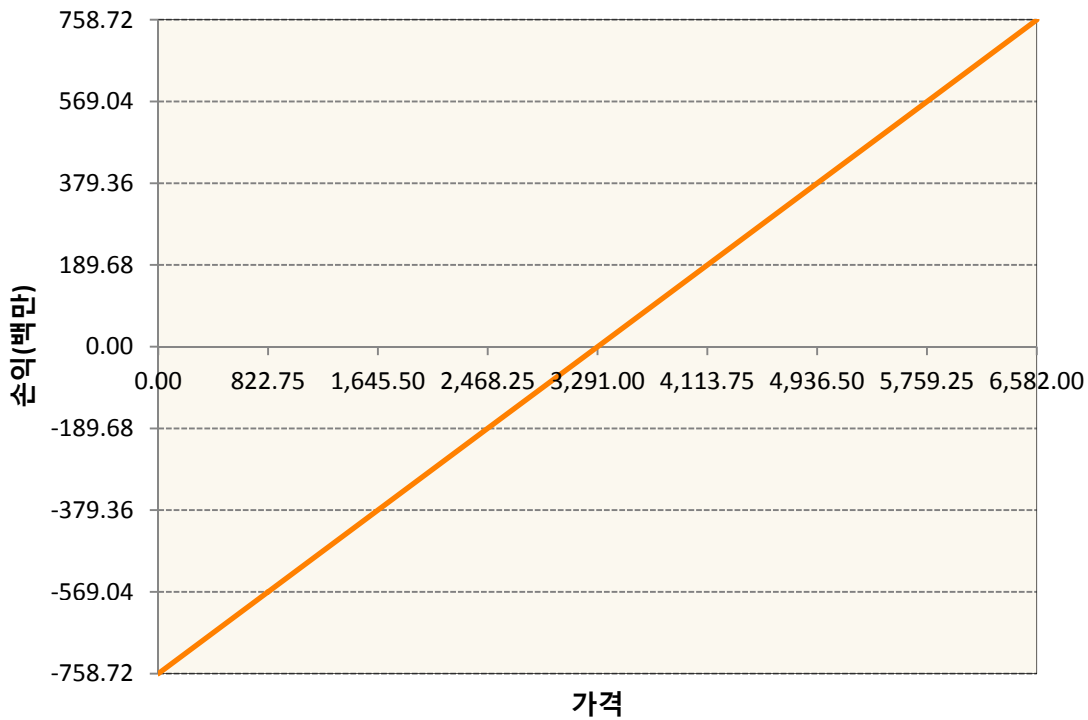
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	759	0	759	

### 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	2019-02-28
기준일	2019-02-27

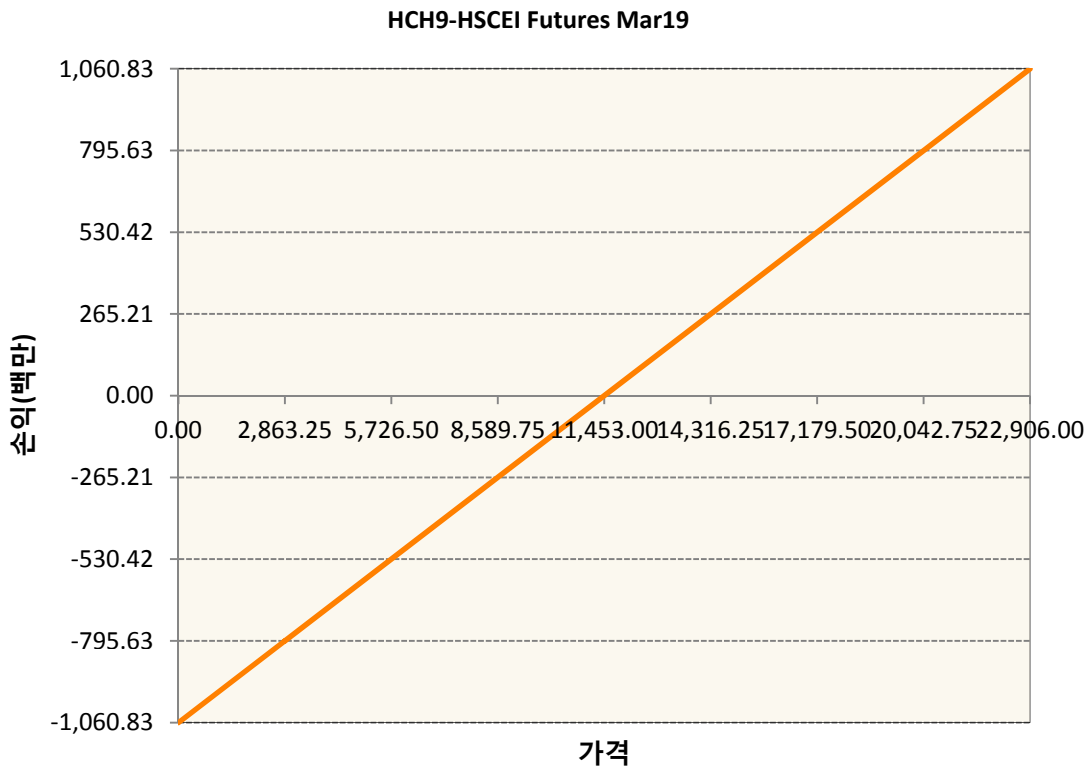
## 차이나인덱스모(주식-파생형)

### 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	1,061	0	1,061	장내

### 2. 만기시점의 손익구조



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

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

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

(단위:백만원)

87
----

공시일	2019-02-28
기준일	2019-02-27

## 커버드콜모(주식혼합-파생형)

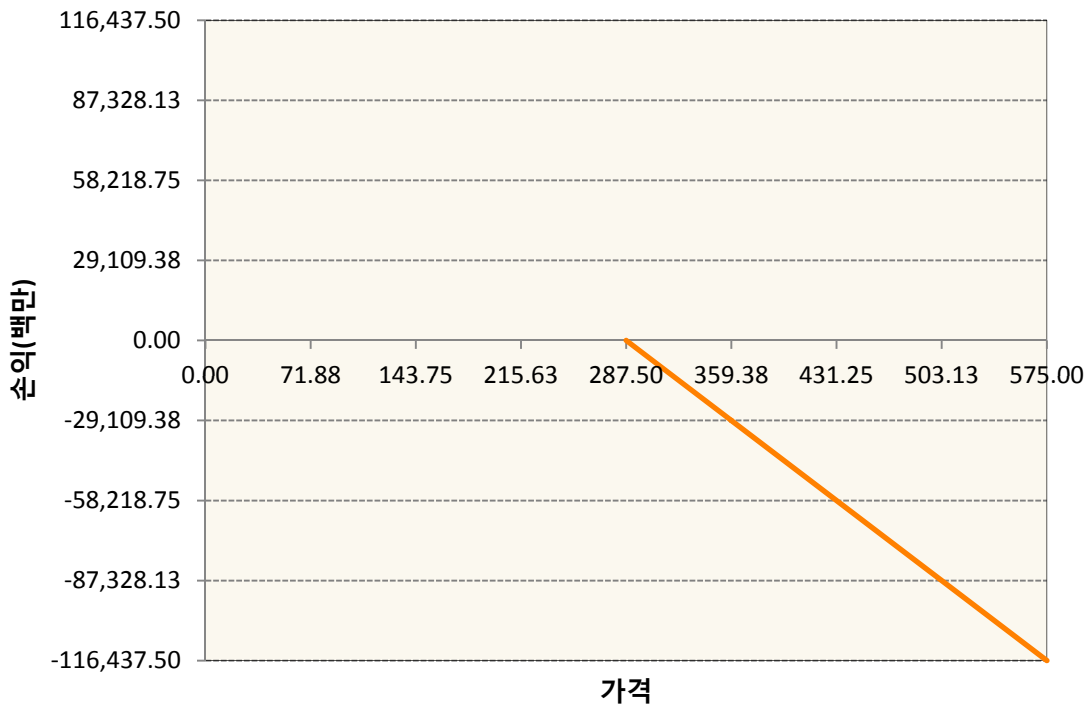
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

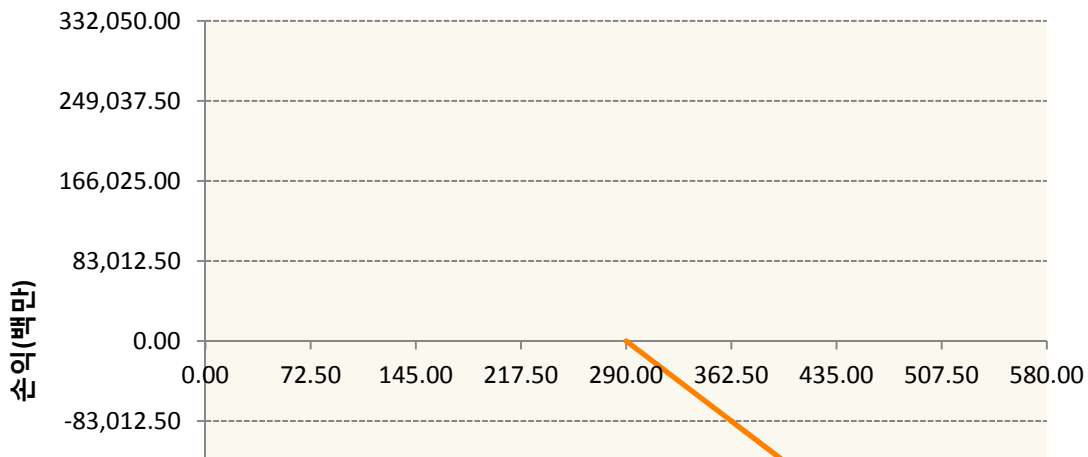
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	692,863	-692,863	장내

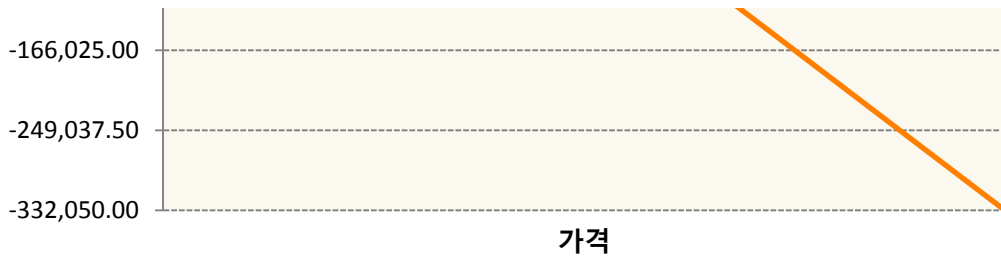
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4201P32878-2019-03 콜287.5

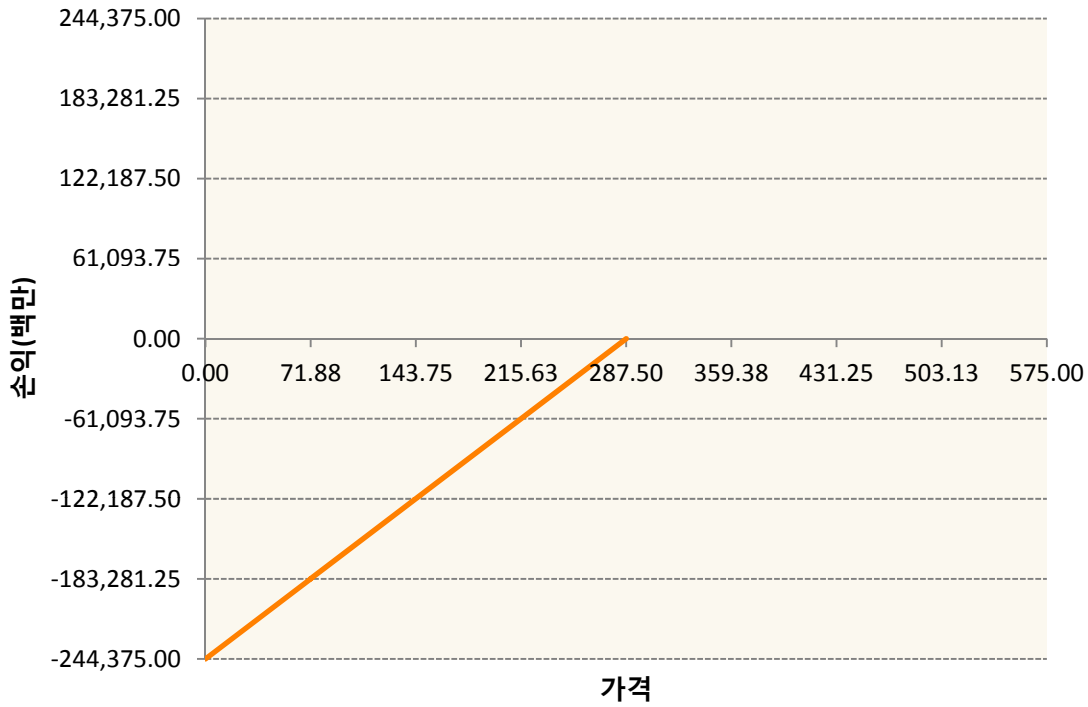


KR4201P32902-2019-03 콜290





KR4301P32876-2019-03 풋287.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201P32878		2019-03 콜287.5					7,551
		기초자산의 변동성					
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	2,679	2,646	2,600	2,542	2,472	2,391	2,299
-5.33%	2,501	2,405	2,295	2,173	2,042	1,903	1,757
-2.67%	1,914	1,740	1,560	1,377	1,192	1,004	814
0%	613	409	204	0	-204	-409	-614
2.67%	-1,488	-1,648	-1,815	-1,988	-2,166	-2,348	-2,533
5.33%	-4,179	-4,264	-4,365	-4,478	-4,604	-4,738	-4,881
8.00%	-7,163	-7,195	-7,241	-7,300	-7,372	-7,456	-7,551
KR4201P32902		2019-03 콜290					20,257
		기초자산의 변동성					
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	6,225	6,163	6,070	5,945	5,788	5,600	5,382

-5.33%	5,903	5,694	5,444	5,158	4,840	4,495	4,126
-2.67%	4,704	4,271	3,815	3,341	2,852	2,353	1,844
0%	1,739	1,160	580	0	-580	-1,161	-1,742
2.67%	-3,493	-4,007	-4,535	-5,072	-5,617	-6,168	-6,725
5.33%	-10,636	-10,949	-11,302	-11,687	-12,098	-12,533	-12,986
8.00%	-18,867	-19,002	-19,180	-19,397	-19,651	-19,939	-20,257
KR4301P32876                      2019-03 풋287.5							16,248
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-16,200	-16,201	-16,203	-16,207	-16,215	-16,228	-16,248
-5.33%	-9,680	-9,702	-9,735	-9,782	-9,841	-9,913	-9,998
-2.67%	-3,536	-3,682	-3,841	-4,011	-4,190	-4,376	-4,568
0%	707	472	236	0	-237	-474	-711
2.67%	2,172	2,070	1,950	1,816	1,669	1,511	1,344
5.33%	2,368	2,355	2,333	2,299	2,254	2,196	2,126
8.00%	2,378	2,377	2,375	2,371	2,364	2,352	2,334

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

(단위:백만원)

**46,677**

공시일	2019-02-28
기준일	2019-02-27

## 홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

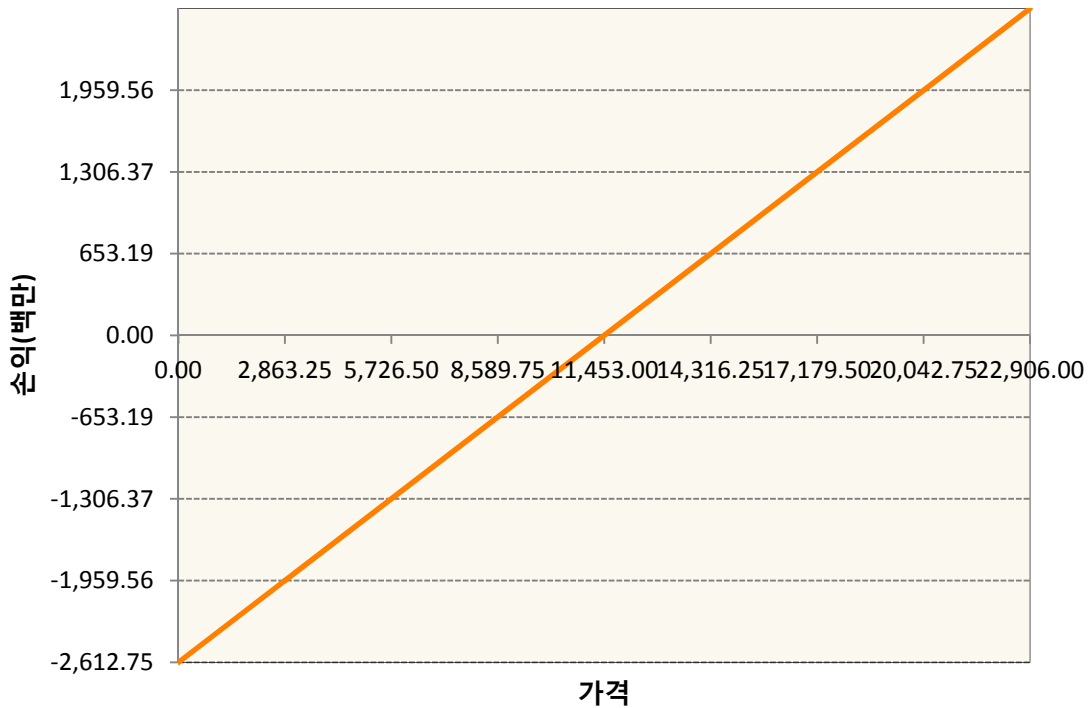
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	2,613	0	2,613	장내
누계	통화	선도	0	2,709	-2,709	장외

### 2. 만기시점의 손익구조

HCH9-HSCEI Futures Mar19



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FX21018Z00 KRW/HKD 11-03-19E	217
HCH9 HSCEI Futures Mar19	209

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

(단위:백만원)

293

공시일	2019-02-28
기준일	2019-02-27

## 코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

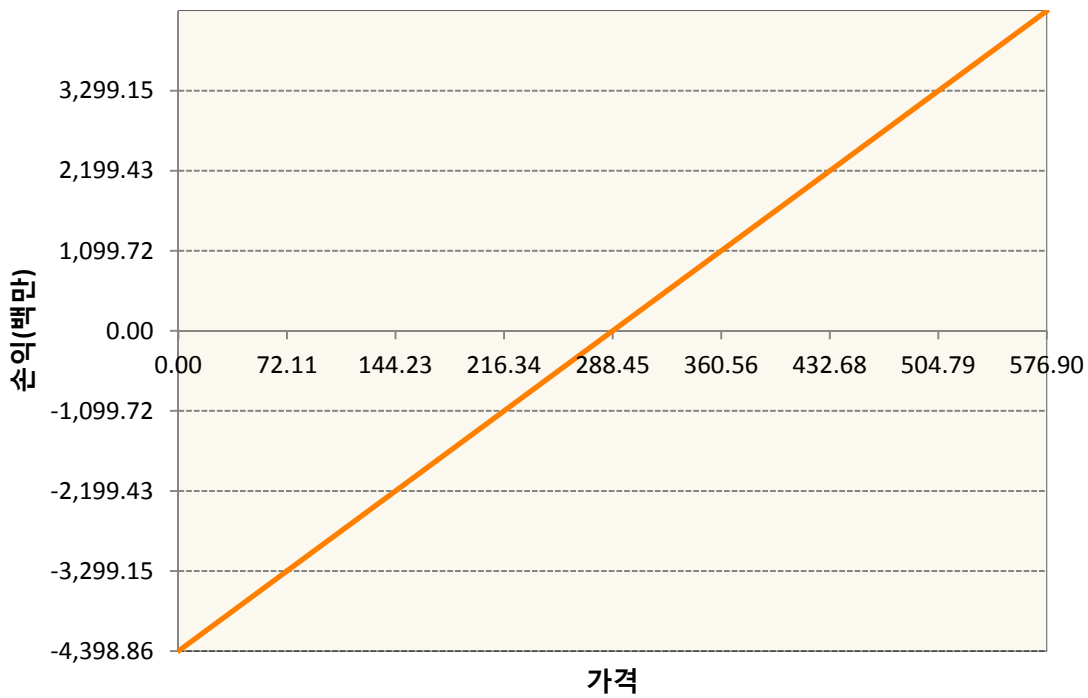
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

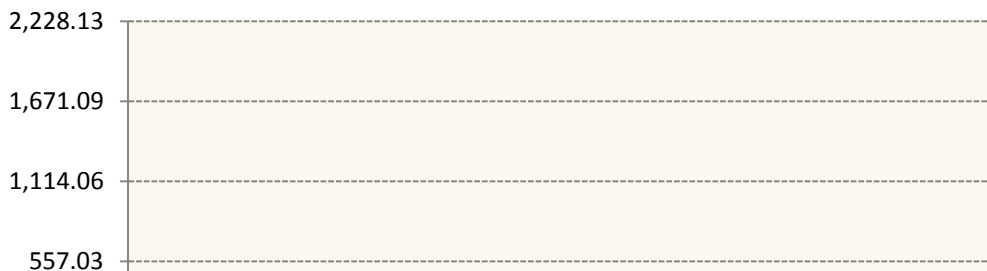
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	214	0	214	장내
누계	유가증권	선물	4,399	0	4,399	장내
누계	유가증권	스왑	28,836	0	28,836	장외
누계	유가증권	옵션	0	29,152	-29,152	장내

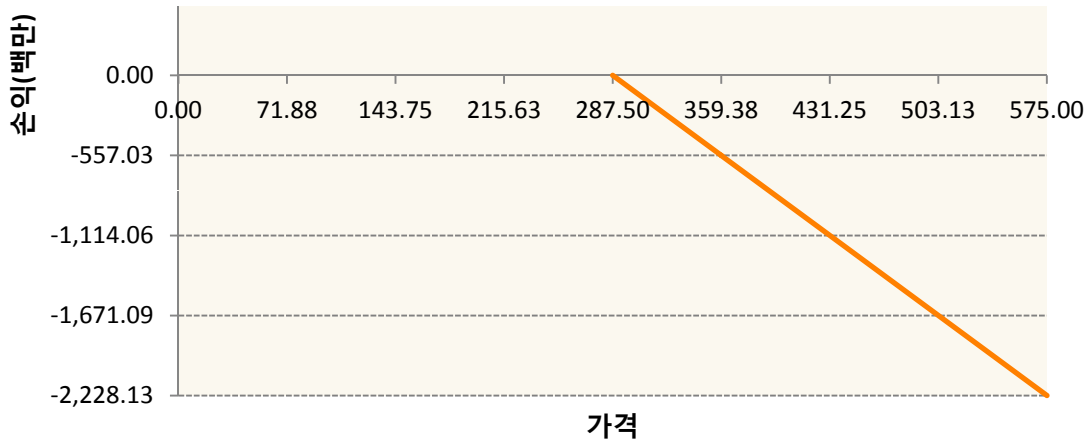
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101P30007-2019-03 코스피200지수선물

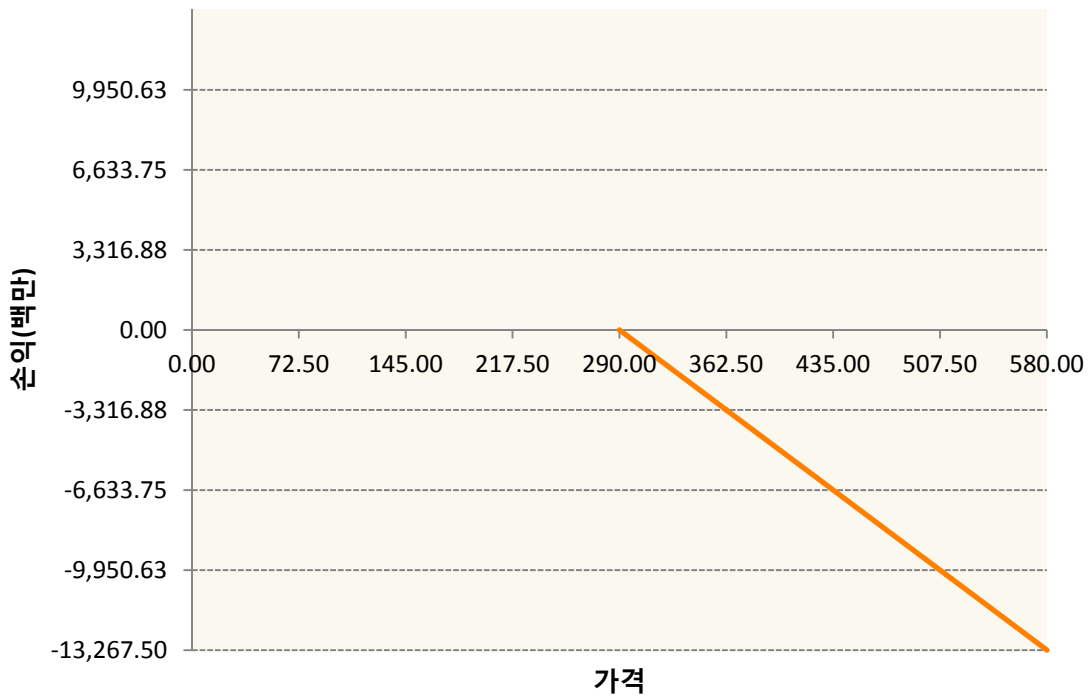


KR4201P32878-2019-03 콜287.5

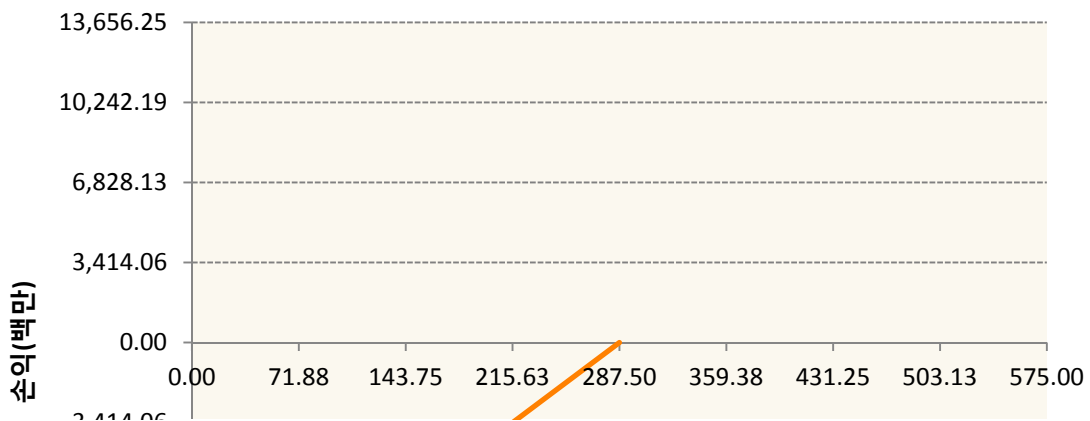


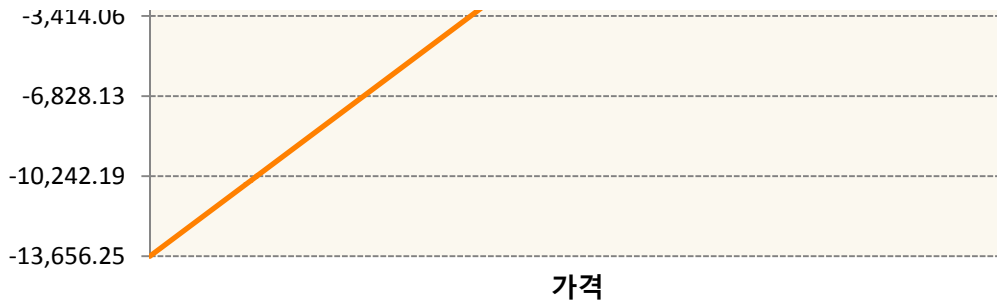


**KR4201P32902-2019-03 콜290**



**KR4301P32876-2019-03 풋287.5**





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

2.529E+11		UBCSFXC1 INDEX_14						2,410
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-2,410	-2,410	-2,410	-2,410	-2,410	-2,410	-2,410	
-5.33%	-1,606	-1,606	-1,606	-1,606	-1,606	-1,606	-1,606	
-2.67%	-803	-803	-803	-803	-803	-803	-803	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	803	803	803	803	803	803	803	
5.33%	1,606	1,606	1,606	1,606	1,606	1,606	1,606	
8.00%	2,410	2,410	2,410	2,410	2,410	2,410	2,410	
KR4101P30007		2019-03 코스피200지수선물						352
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-352	-352	-352	-352	-352	-352	-352	
-5.33%	-235	-235	-235	-235	-235	-235	-235	
-2.67%	-117	-117	-117	-117	-117	-117	-117	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	117	117	117	117	117	117	117	
5.33%	235	235	235	235	235	235	235	
8.00%	352	352	352	352	352	352	352	
KR4201P32878		2019-03 콜287.5						144
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	51	51	50	49	47	46	44	
-5.33%	48	46	44	42	39	36	34	
-2.67%	37	33	30	26	23	19	16	
0%	12	8	4	0	-4	-8	-12	
2.67%	-28	-32	-35	-38	-41	-45	-48	
5.33%	-80	-82	-84	-86	-88	-91	-93	
8.00%	-137	-138	-139	-140	-141	-143	-144	
KR4201P32902		2019-03 콜290						809
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	

-8.00%	249	246	243	238	231	224	215
-5.33%	236	228	218	206	193	180	165
-2.67%	188	171	152	133	114	94	74
0%	69	46	23	0	-23	-46	-70
2.67%	-140	-160	-181	-203	-224	-246	-269
5.33%	-425	-437	-452	-467	-483	-501	-519
8.00%	-754	-759	-766	-775	-785	-797	-809
KR4301P32876                      2019-03 풋287.5							908
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-905	-905	-905	-906	-906	-907	-908
-5.33%	-541	-542	-544	-547	-550	-554	-559
-2.67%	-198	-206	-215	-224	-234	-245	-255
0%	40	26	13	0	-13	-26	-40
2.67%	121	116	109	101	93	84	75
5.33%	132	132	130	128	126	123	119
8.00%	133	133	133	133	132	131	130

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

(단위:백만원)

**4,709**

공시일	2019-02-28
기준일	2019-02-27

## 유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

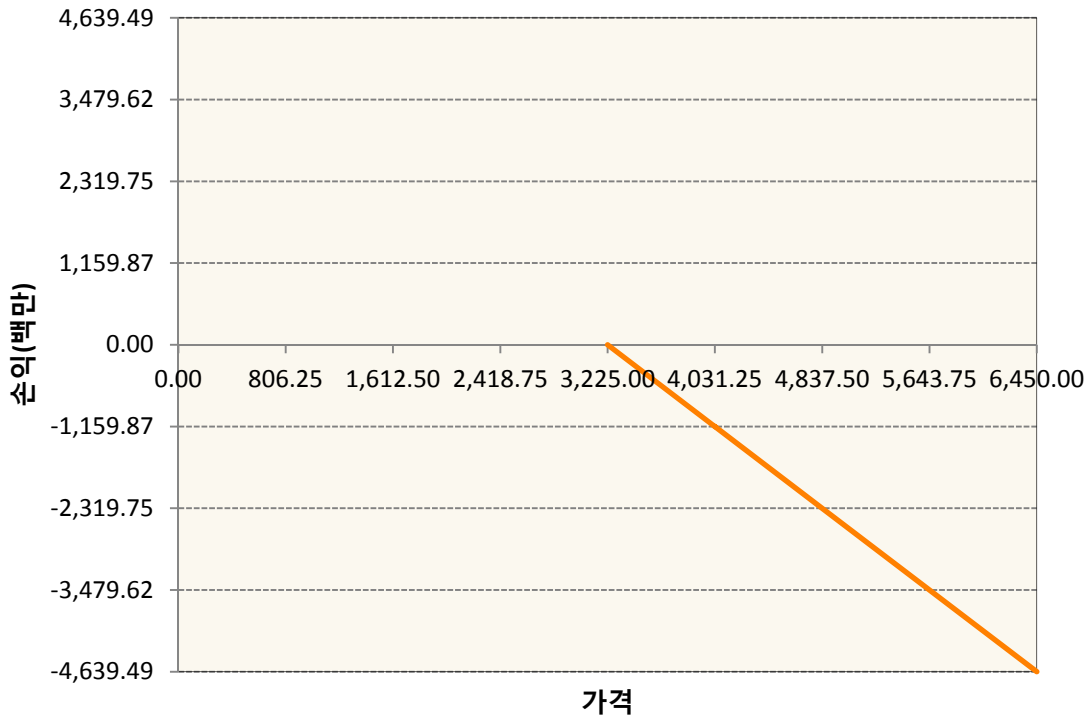
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

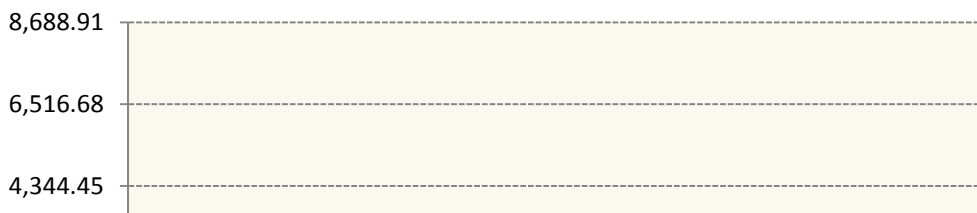
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	7,120	0	7,120	
누계	유가증권	스왑	60,106	0	60,106	장외
누계	유가증권	옵션	0	26,657	-26,657	장내
누계	통화	선도	0	15,278	-15,278	장외

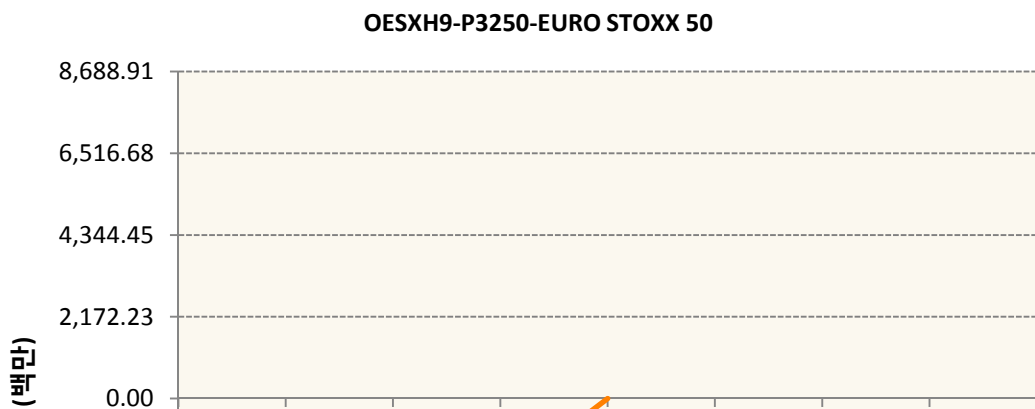
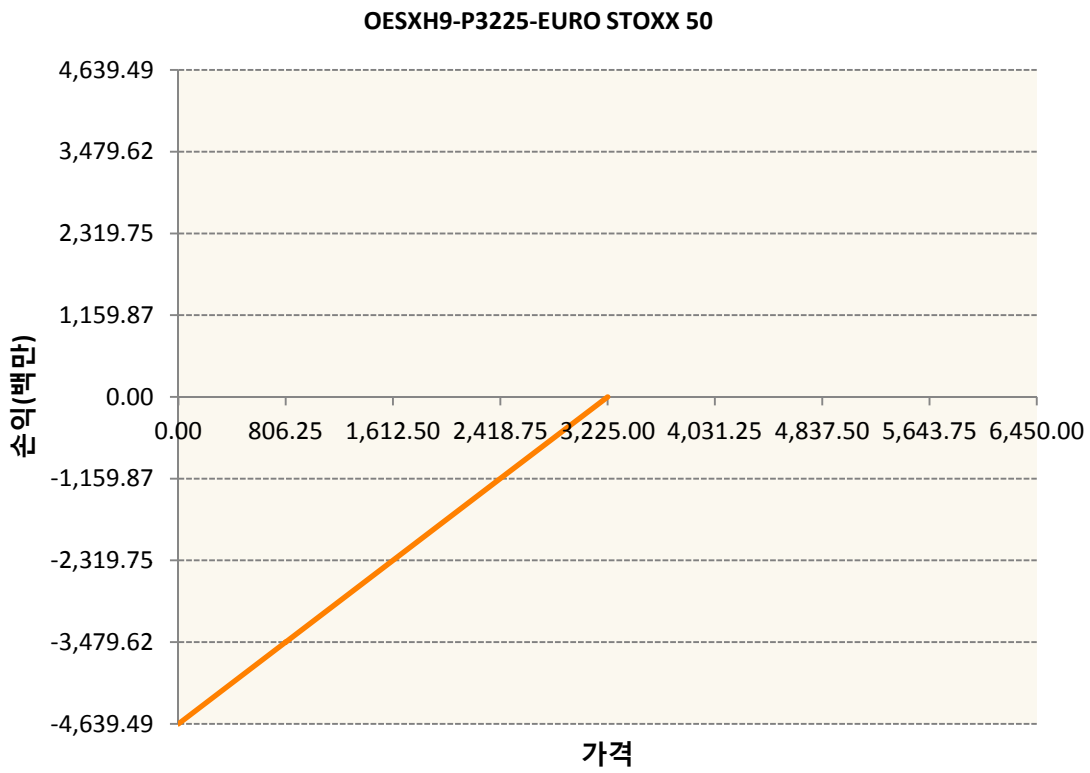
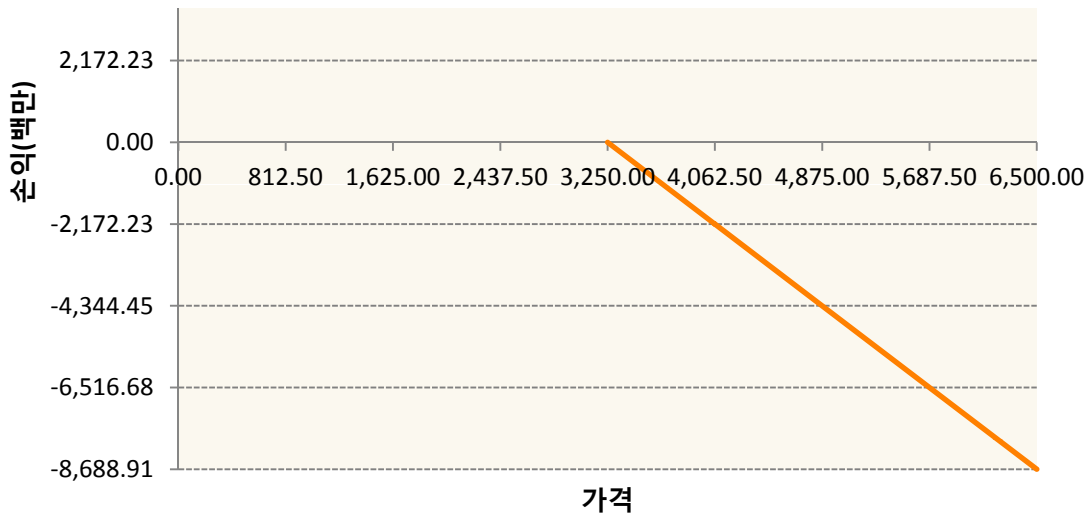
### 2. 만기시점의 손익구조

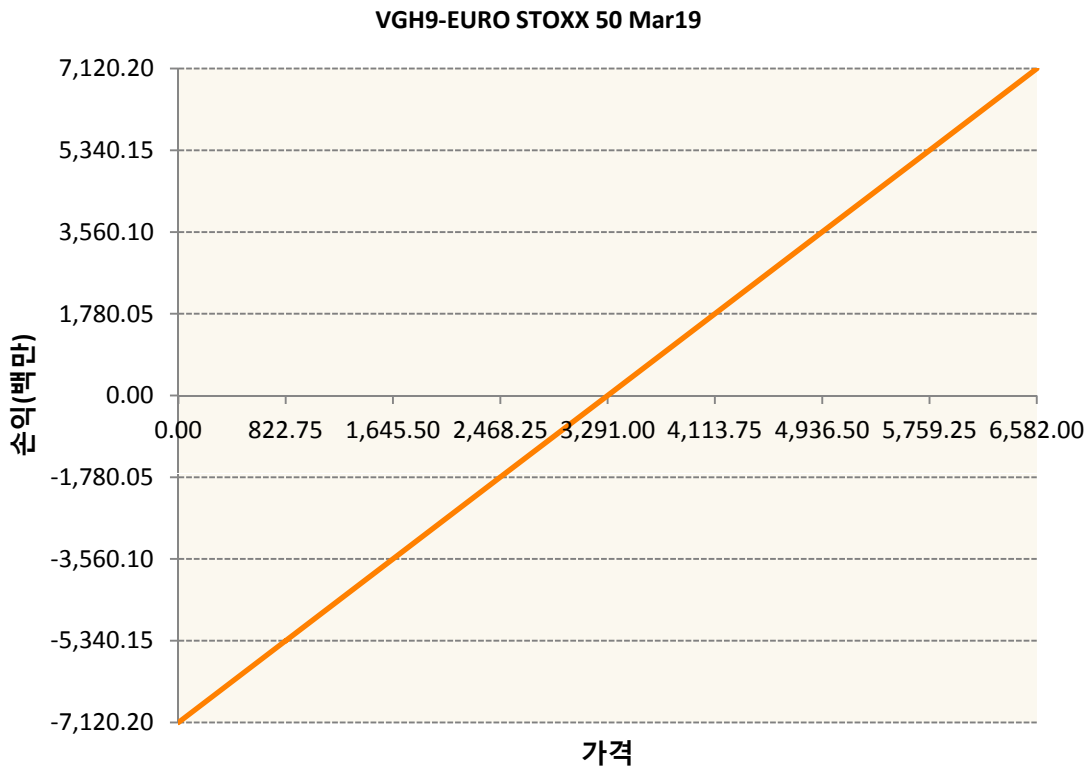
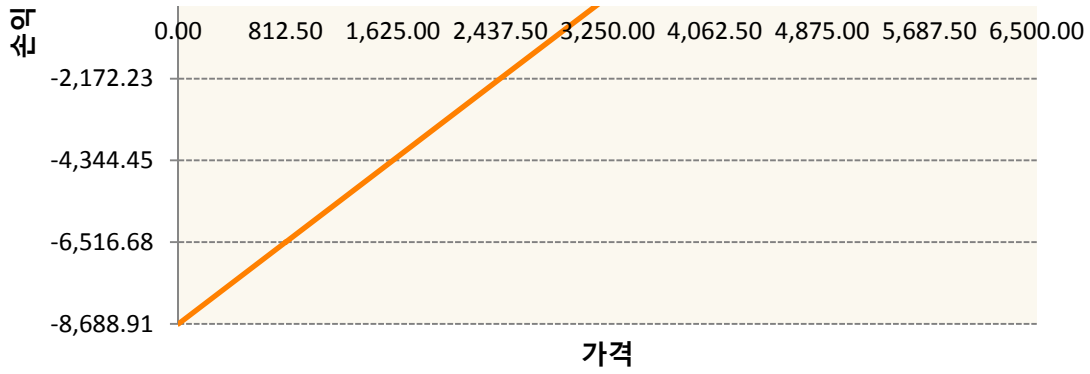
OESXH9-C3225-EURO STOXX 50



OESXH9-C3250-EURO STOXX 50







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY		111
FX21018Z03 KRW/EUR 22-03-19E		815
FX21019G02 KRW/EUR 24-05-19E		407
OESXH9-C32 EURO STOXX 50		371
OESXH9-C32 EURO STOXX 50		695
OESXH9-P32 EURO STOXX 50		371
OESXH9-P32 EURO STOXX 50		695
VGH9 EURO STOXX 50 Mar19		570

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

(단위:백만원)

2,662



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

(단위:백만원)

1,155



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

(단위:백만원)

99



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

(단위:백만원)

143



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

(단위:백만원)

44

공시일	2019-02-28
기준일	2019-02-27

## 리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

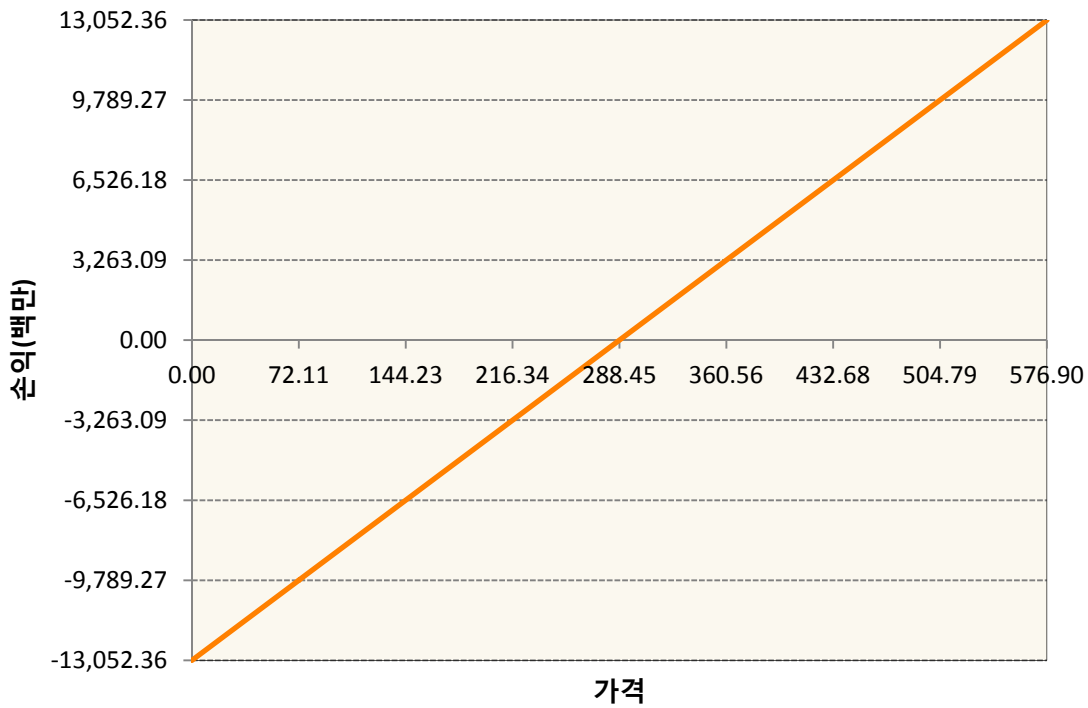
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

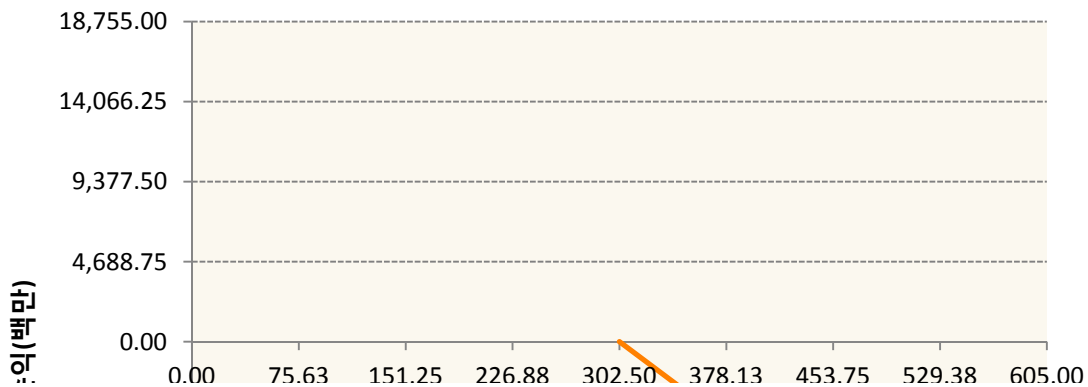
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	13,052	0	13,052	장내
누계	유가증권	옵션	2,165	24,931	-22,766	장내

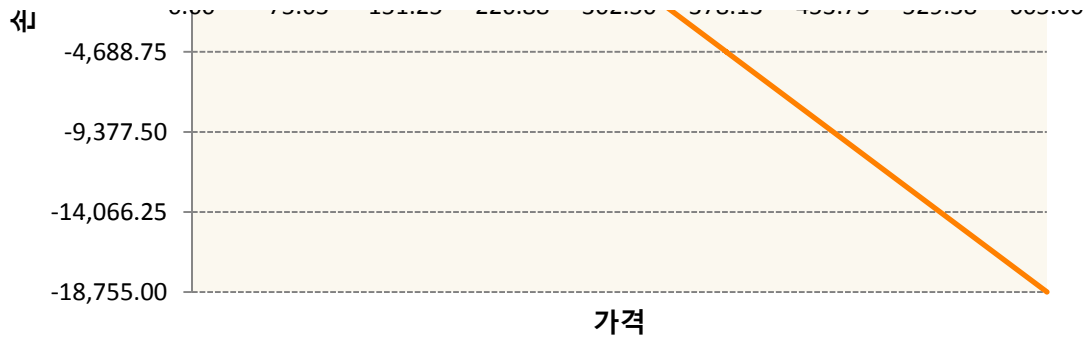
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101P30007-2019-03 코스피200지수선물

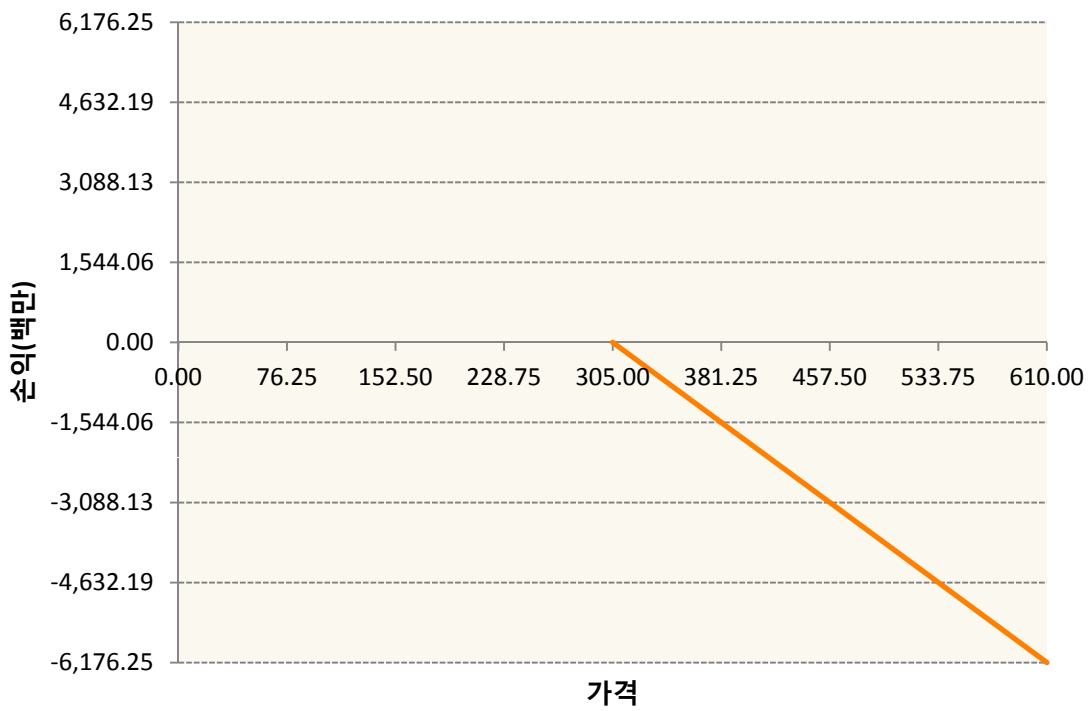


KR4201P33025-2019-03 콜302.5

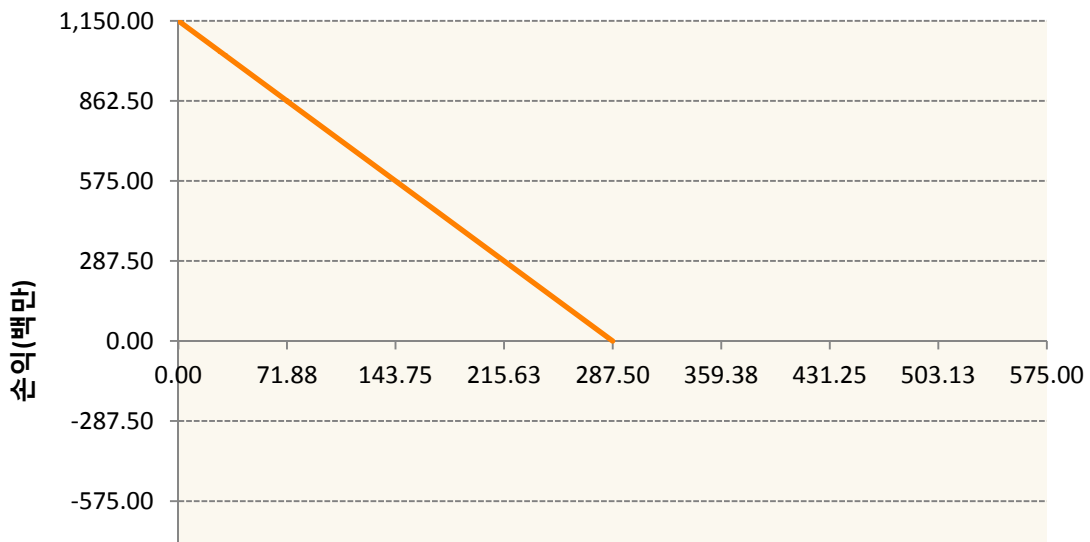


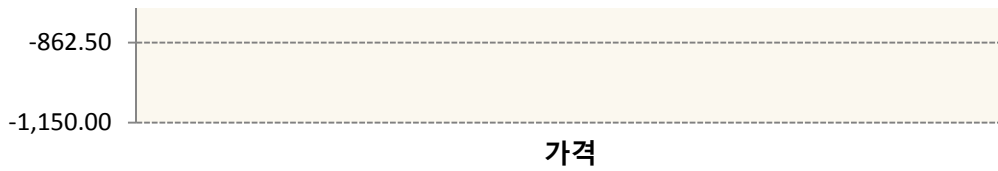


KR4201P33058-2019-03 콜305

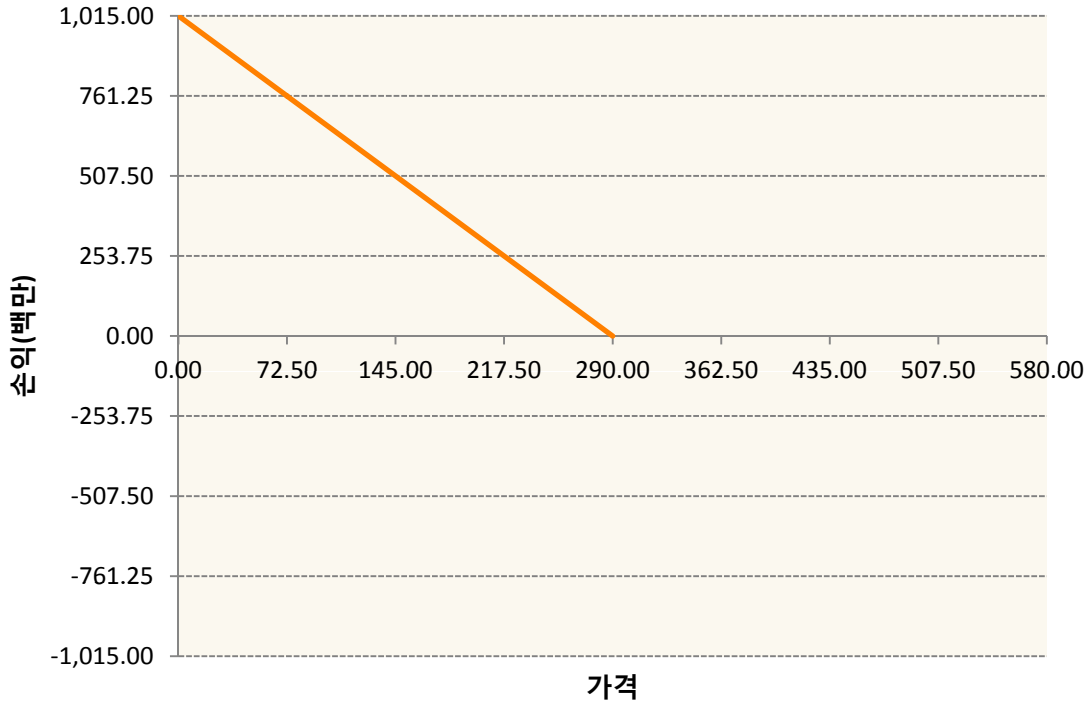


KR4301P32876-2019-03 풋287.5





KR4301P32900-2019-03 풋290



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101P30007		2019-03 코스피200지수선물						1,045
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-1,045	-1,045	-1,045	-1,045	-1,045	-1,045	-1,045	
-5.33%	-697	-697	-697	-697	-697	-697	-697	
-2.67%	-348	-348	-348	-348	-348	-348	-348	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	348	348	348	348	348	348	348	
5.33%	697	697	697	697	697	697	697	
8.00%	1,045	1,045	1,045	1,045	1,045	1,045	1,045	
KR4201P33025		2019-03 콜302.5						742
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	101	100	100	99	97	94	90	
-5.33%	100	98	95	91	85	78	69	
-2.67%	92	85	76	65	52	37	21	

0%	58	40	21	0	-23	-46	-71
2.67%	-42	-71	-101	-131	-162	-192	-223
5.33%	-250	-283	-315	-348	-381	-414	-447
8.00%	-573	-599	-626	-654	-683	-712	-742
KR4201P33058                      2019-03 콜305							218
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	25	25	25	24	24	23	22
-5.33%	25	24	24	23	21	19	17
-2.67%	23	21	19	16	13	9	4
0%	16	11	6	0	-6	-13	-21
2.67%	-9	-17	-26	-35	-45	-54	-64
5.33%	-64	-75	-86	-97	-108	-118	-129
8.00%	-158	-168	-177	-187	-198	-208	-218
KR4301P32876                      2019-03 풋287.5							76
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	76	76	76	76	76	76	76
-5.33%	46	46	46	46	46	47	47
-2.67%	17	17	18	19	20	21	21
0%	-3	-2	-1	0	1	2	3
2.67%	-10	-10	-9	-9	-8	-7	-6
5.33%	-11	-11	-11	-11	-11	-10	-10
8.00%	-11	-11	-11	-11	-11	-11	-11
KR4301P32900                      2019-03 풋290							71
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	71	71	71	71	71	71	71
-5.33%	44	44	44	44	44	45	45
-2.67%	18	18	19	19	20	20	21
0%	-3	-2	-1	0	1	2	3
2.67%	-12	-12	-11	-10	-9	-9	-8
5.33%	-14	-14	-14	-14	-13	-13	-12
8.00%	-14	-14	-14	-14	-14	-14	-14

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

(단위:백만원)

**1,737**

공시일	2019-02-28
기준일	2019-02-27

## 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	979	0	979	

### 2. 만기시점의 손익구조

### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

\* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

\* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

공시일	2019-02-28
기준일	2019-02-27

## H2O글로벌본드(UH)(채권혼합-파)

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	168	0	168	
누계	유가증권	수익증권	5,972	0	5,972	

### 2. 만기시점의 손익구조

### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

\* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

\* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

공시일	2019-02-28
기준일	2019-02-27

## H2O글로벌본드(H)(채권혼합-파생)

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	3,245	0	3,245	
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	수익증권	36,604	0	36,604	
누계	통화	선도	0	41,732	-41,732	장외

### 2. 만기시점의 손익구조

### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음
FX21018X04 KRW/USD 28-02-19E	2
FX21018X04 KRW/USD 28-02-19E	3
FX21018X04 KRW/USD 28-02-19E	1
FX21018Z00 KRW/USD 28-02-19E	17
FX21018Z01 KRW/USD 28-02-19E	2
FX21018Z01 KRW/USD 28-02-19E	27
FX21018Z01 KRW/USD 28-02-19E	9
FX21018Z02 KRW/USD 28-02-19E	39
FX21019F01 KRW/USD 28-02-19E	14
FX21019F01 KRW/USD 28-02-19E	57
FX21019F01 KRW/USD 28-02-19E	9
FX21019F01 KRW/USD 28-02-19E	32
FX21019F02 KRW/USD 28-03-19E	466
FX21019F02 KRW/USD 28-02-19E	116
FX21019F02 KRW/USD 29-03-19E	24
FX21019F02 KRW/USD 29-03-19E	72
FX21019F03 KRW/USD 28-02-19E	27
FX21019G00 KRW/USD 29-03-19E	27
FX21019G00 KRW/USD 29-03-19E	13
FX21019G00 KRW/USD 19-03-19E	49
FX21019G00 KRW/USD 19-03-19E	27
FX21019G01 KRW/USD 19-03-19E	54
FX21019G01 KRW/USD 19-03-19E	105
FX21019G01 KRW/USD 19-03-19E	105
FX21019G01 KRW/USD 19-03-19E	43
FX21019G01 KRW/USD 21-03-19E	421
FX21019G01 KRW/USD 21-03-19E	269

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

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

(단위:백만원)

**1,212**

공시일	2019-02-28
기준일	2019-02-27

## 스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

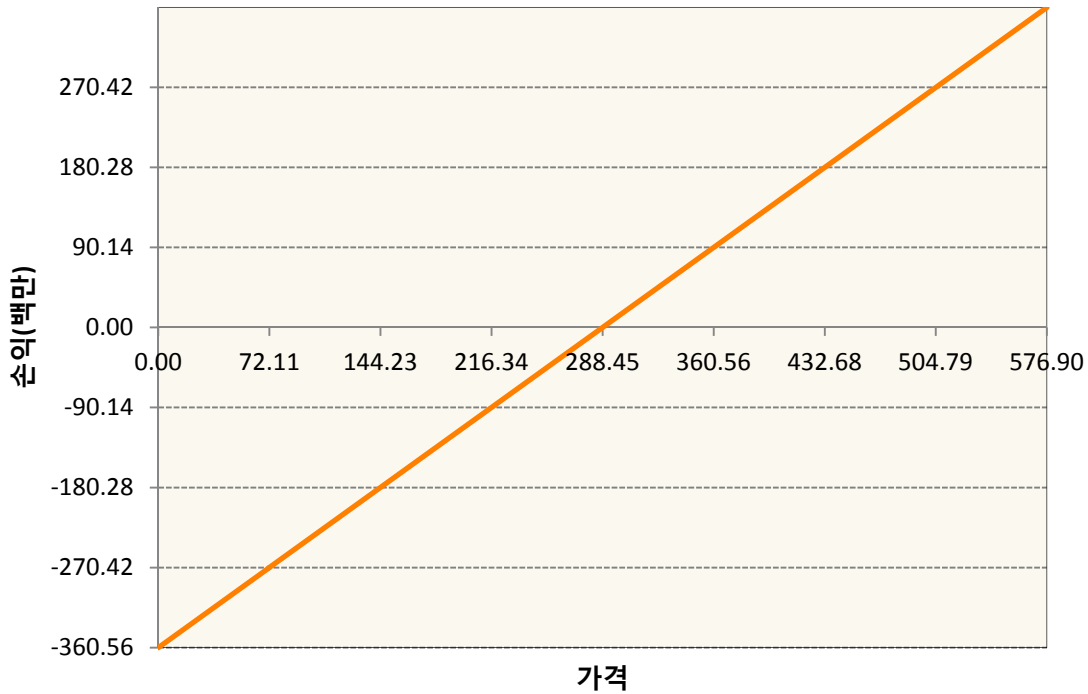
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

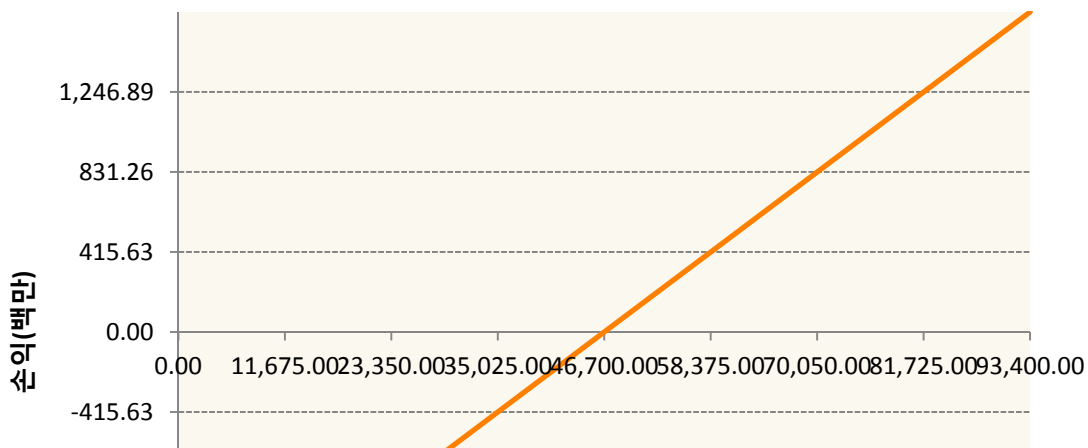
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,023	0	2,023	장내

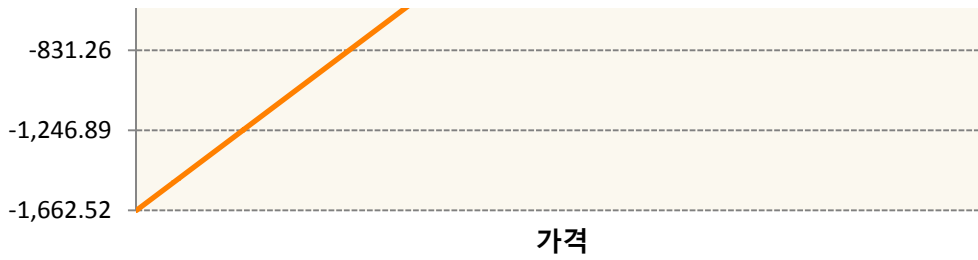
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101P30007-2019-03 코스피200지수선물



KR4111P30006-2019-03 삼성전자개별선물





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

KR4101P30007		2019-03 코스피200지수선물						29
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-29	-29	-29	-29	-29	-29	-29	
-5.33%	-19	-19	-19	-19	-19	-19	-19	
-2.67%	-10	-10	-10	-10	-10	-10	-10	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	10	10	10	10	10	10	10	
5.33%	19	19	19	19	19	19	19	
8.00%	29	29	29	29	29	29	29	

KR4111P30006		2019-03 삼성전자개별선물						133
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-133	-133	-133	-133	-133	-133	-133	
-5.33%	-89	-89	-89	-89	-89	-89	-89	
-2.67%	-44	-44	-44	-44	-44	-44	-44	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	44	44	44	44	44	44	44	
5.33%	89	89	89	89	89	89	89	
8.00%	133	133	133	133	133	133	133	

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

**175**

공시일	2019-02-28
기준일	2019-02-27

## 에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

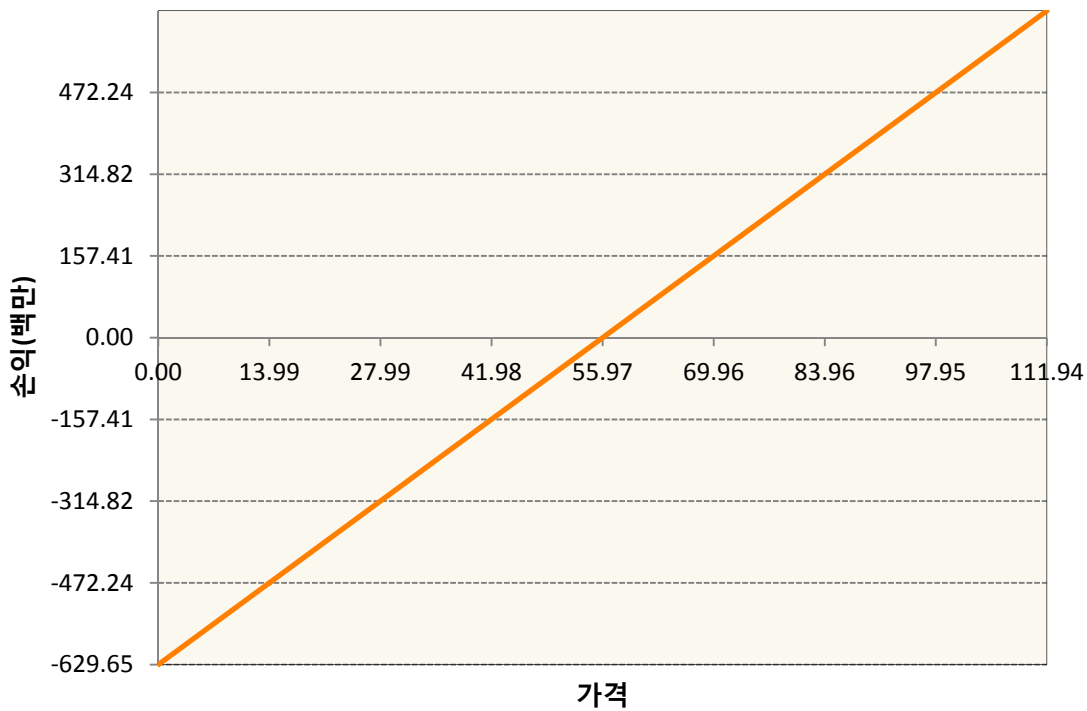
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

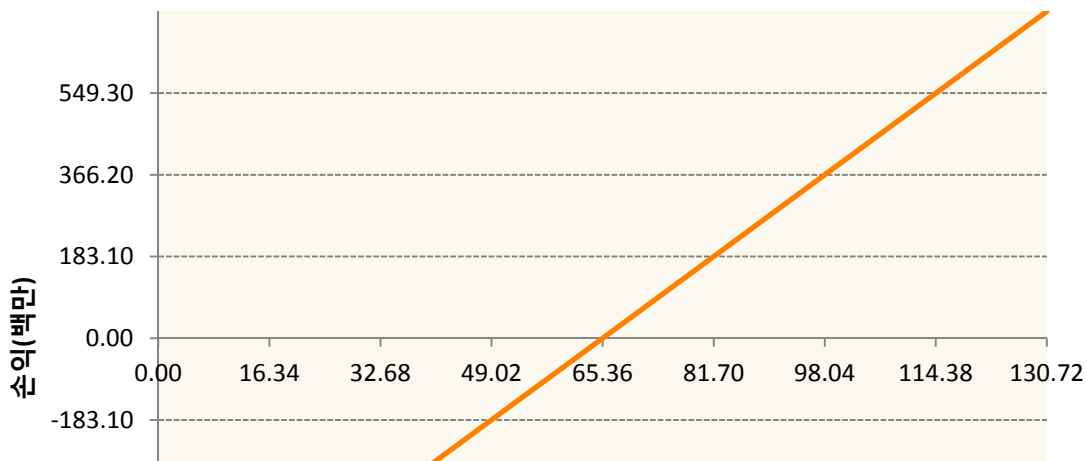
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,799	280	2,519	

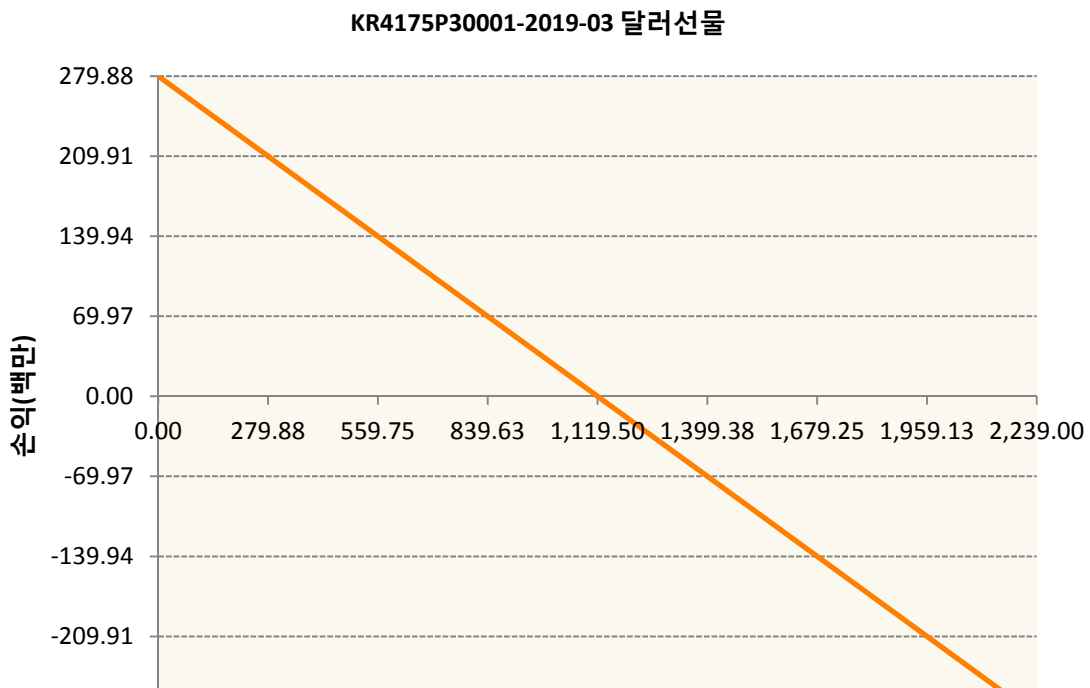
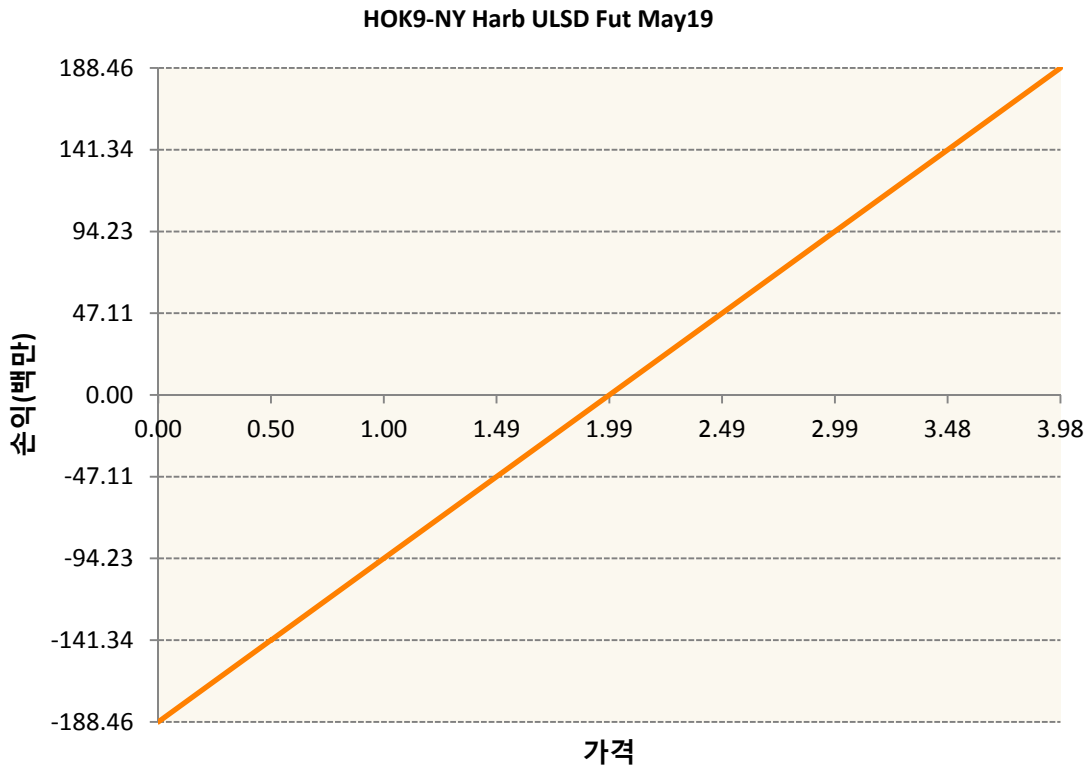
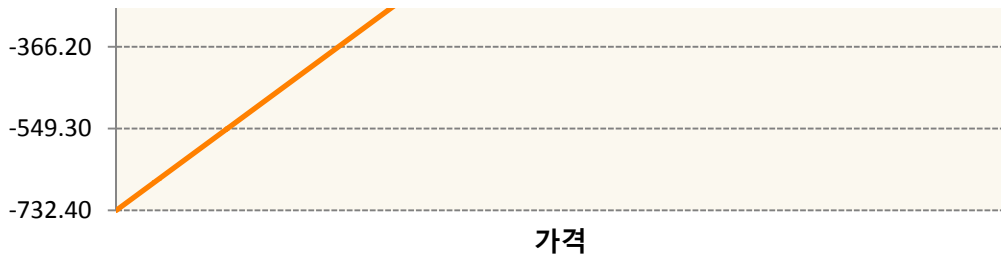
### 2. 만기시점의 손익구조

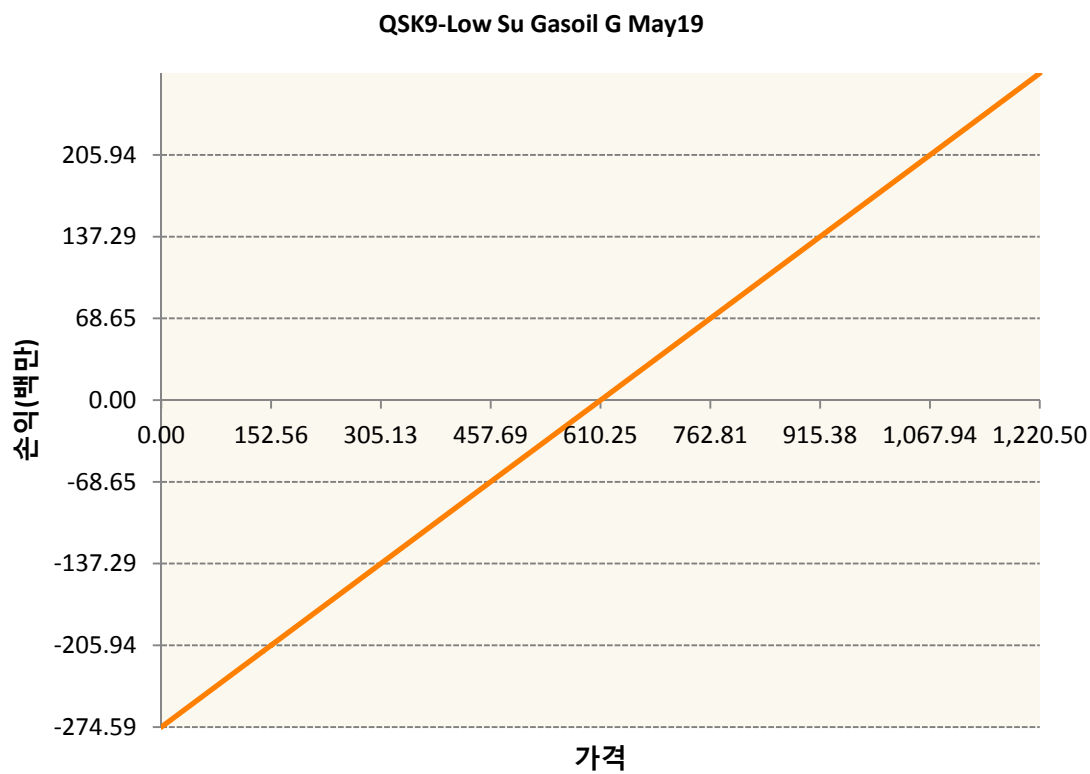
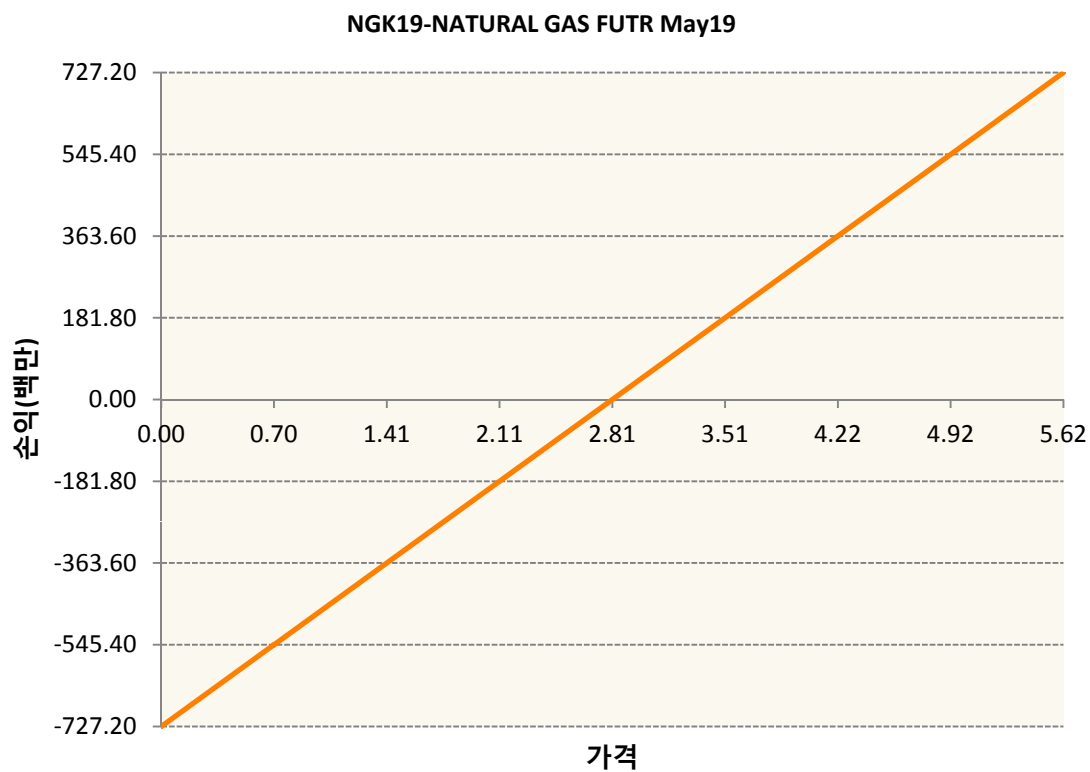
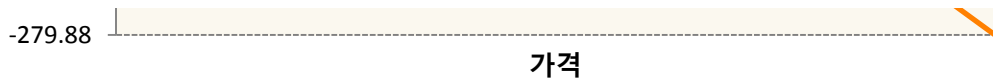
CLK9-WTI CRUDE FUTURE May19



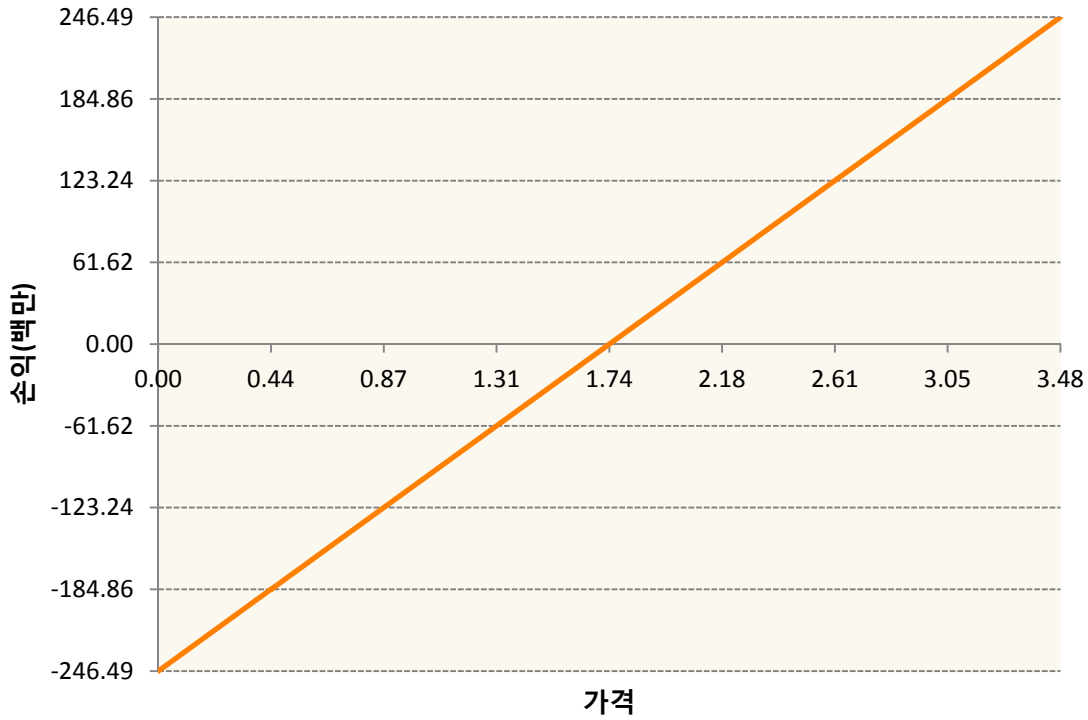
COK9-BRENT CRUDE FUTR May19







**XBK9-GASOLINE RBOB FUT May19**



**3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)**

(단위:백만원)

CLK9	WTI CRUDE FUTURE May19	50
COK9	BRENT CRUDE FUTR May19	59
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)

**429**

공시일	2019-02-28
기준일	2019-02-27

## 애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

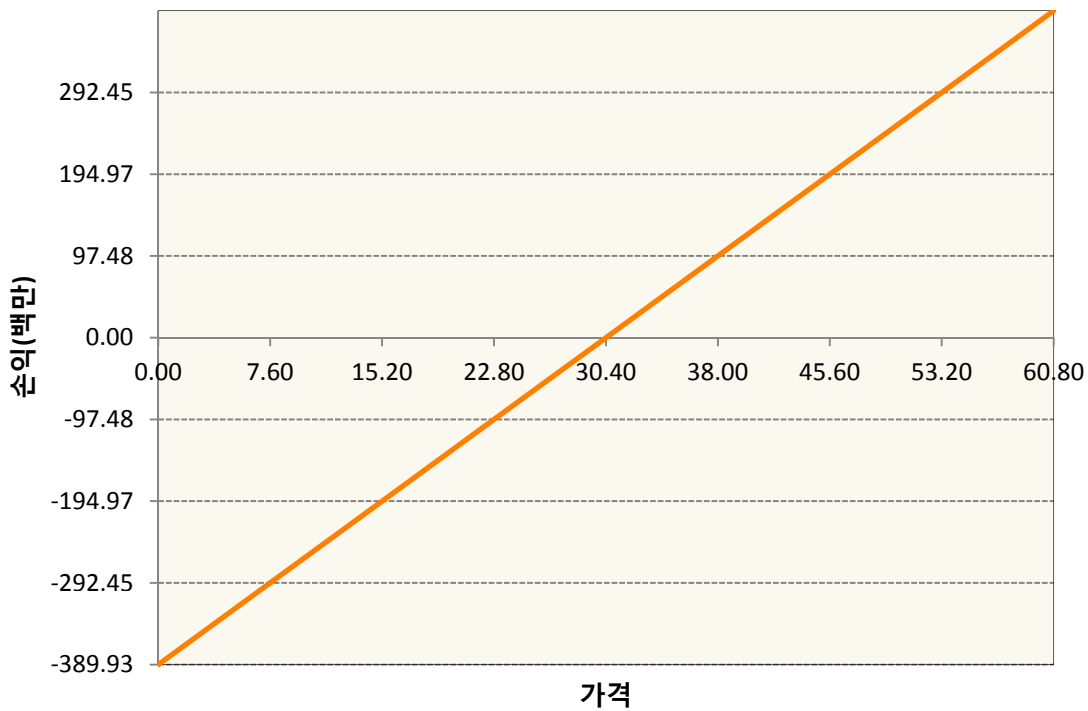
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

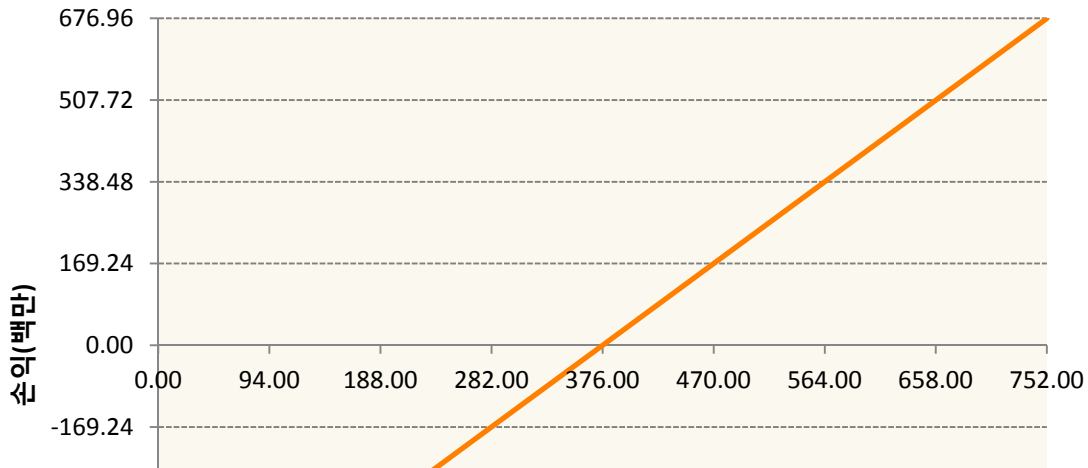
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,417	78	3,338	

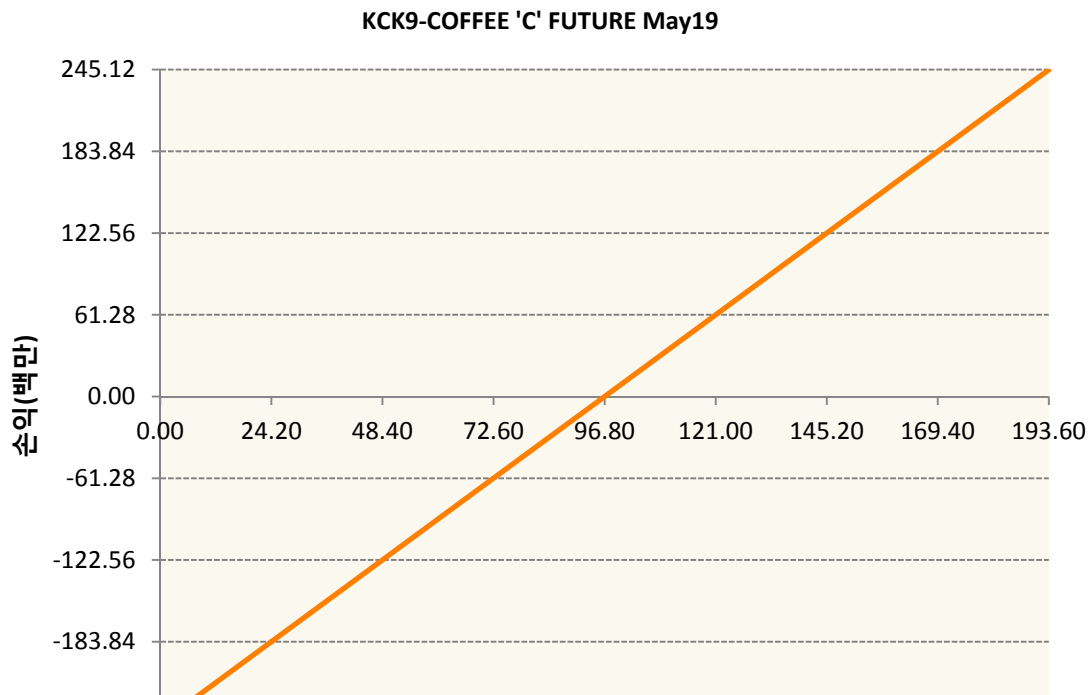
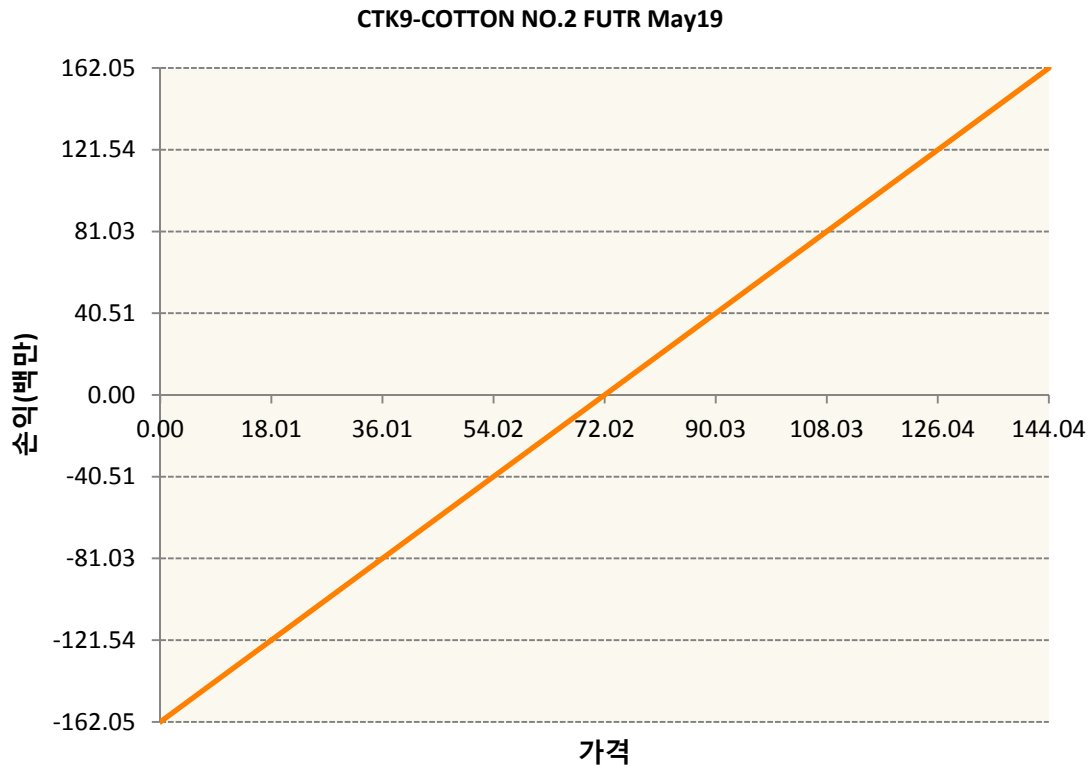
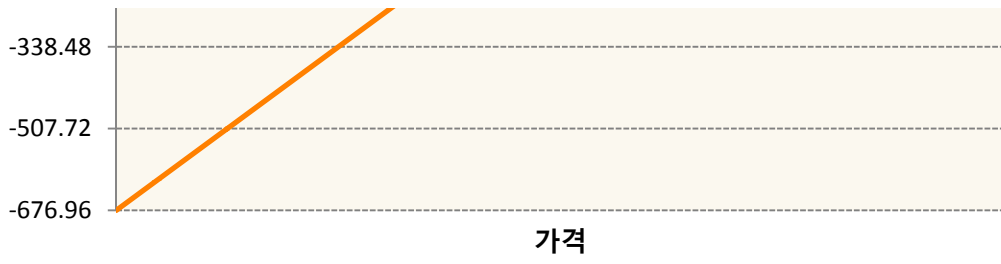
### 2. 만기시점의 손익구조

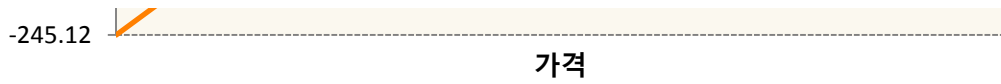
**BOK9-SOYBEAN OIL FUTR May19**



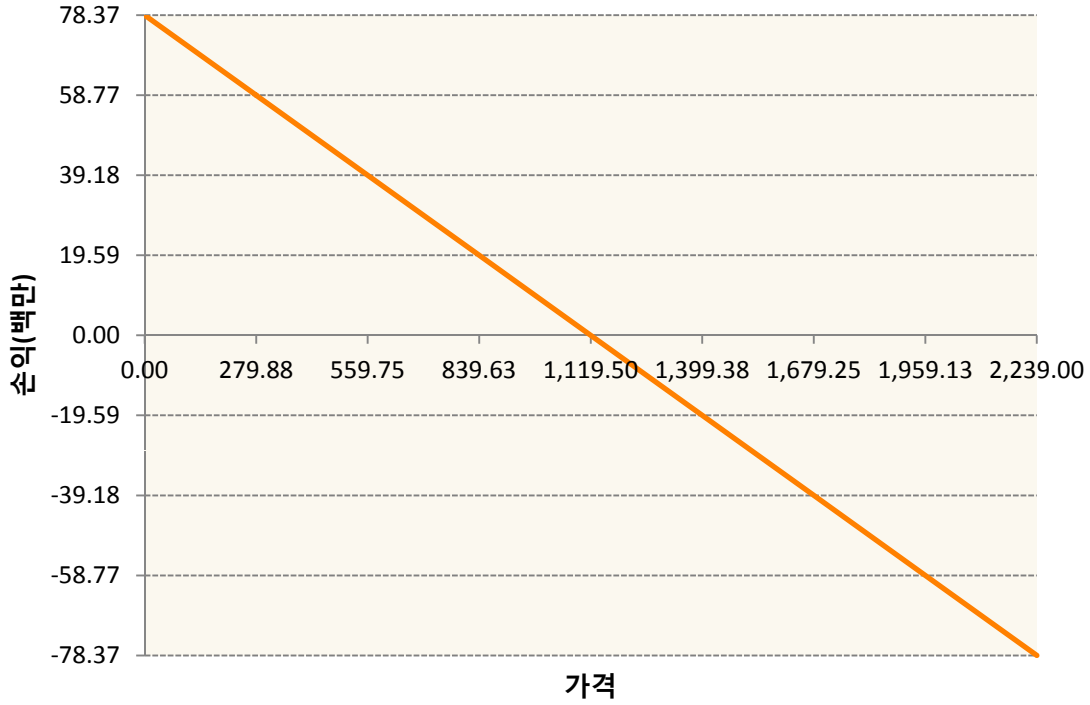
**CK9-CORN FUTURE May19**



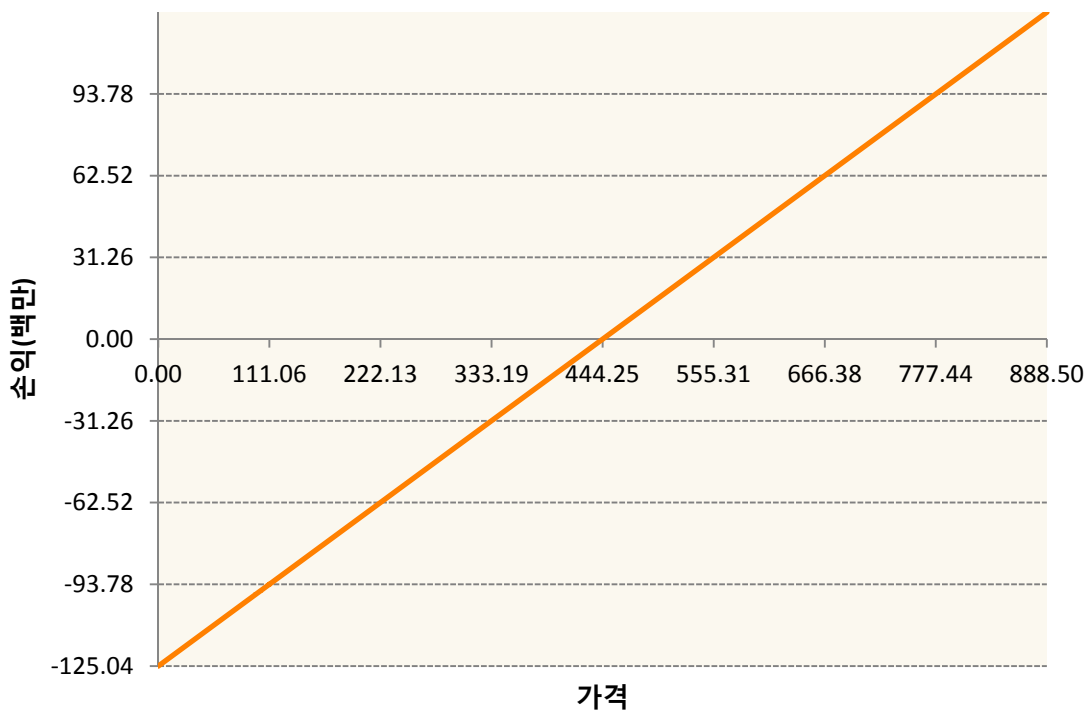




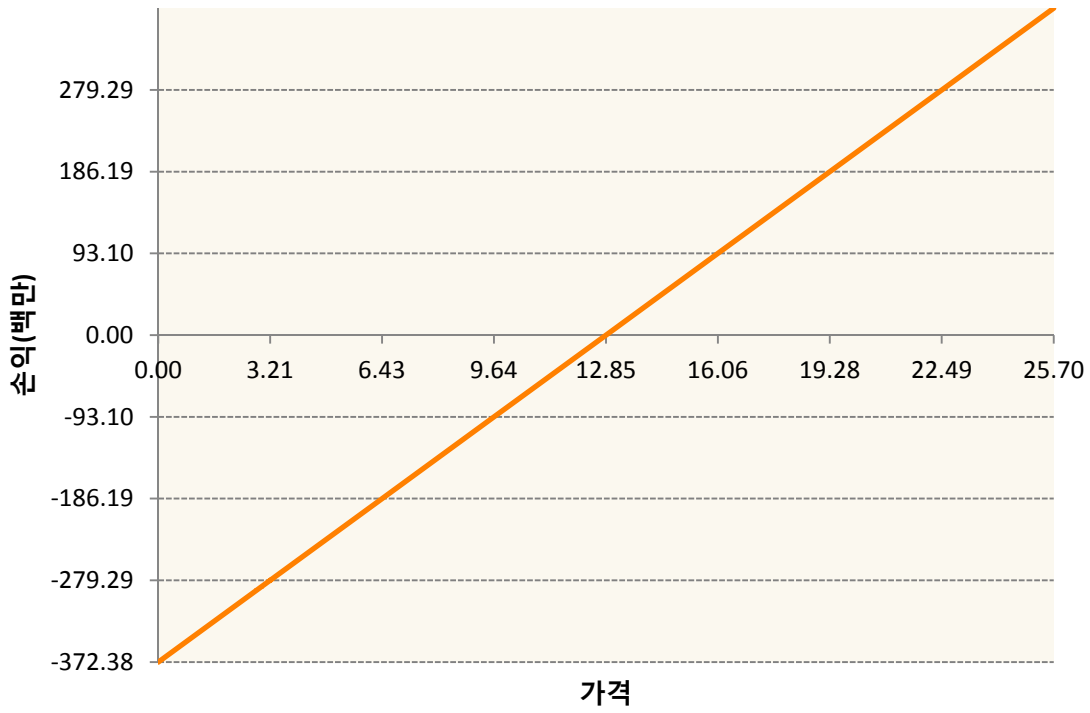
KR4175P30001-2019-03 달러선물



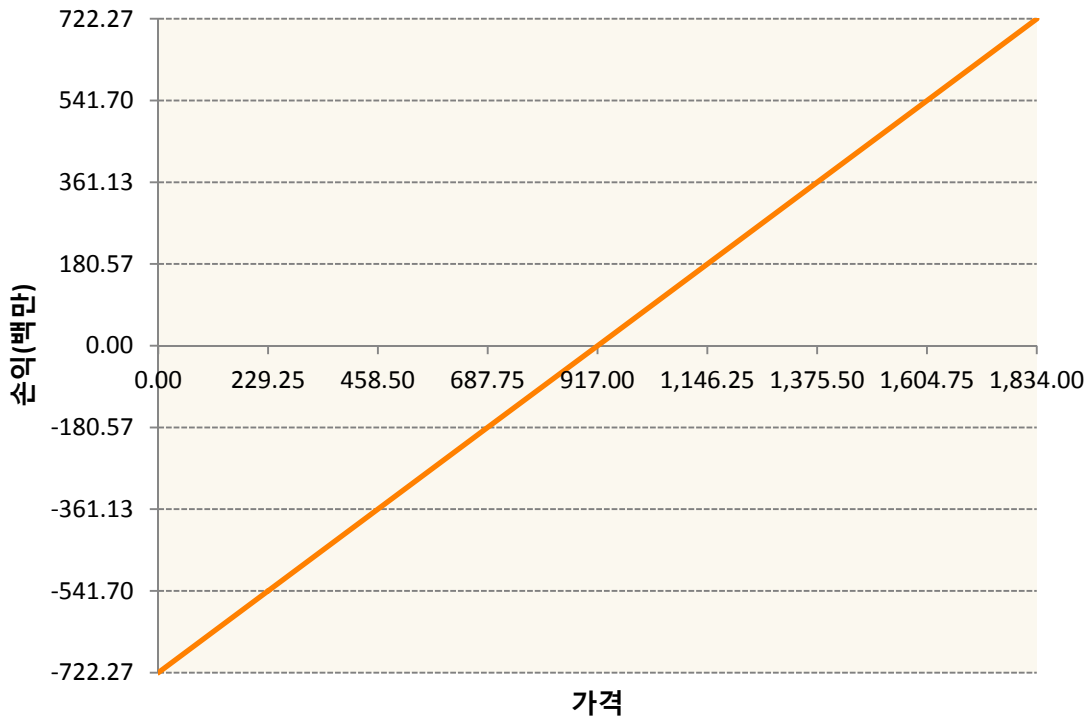
KWK9-KC HRW WHEAT FUT May19



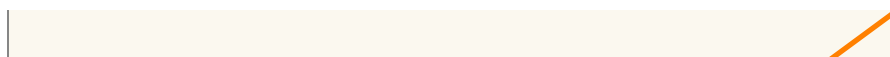
SBK9-SUGAR #11 (WORLD) May19

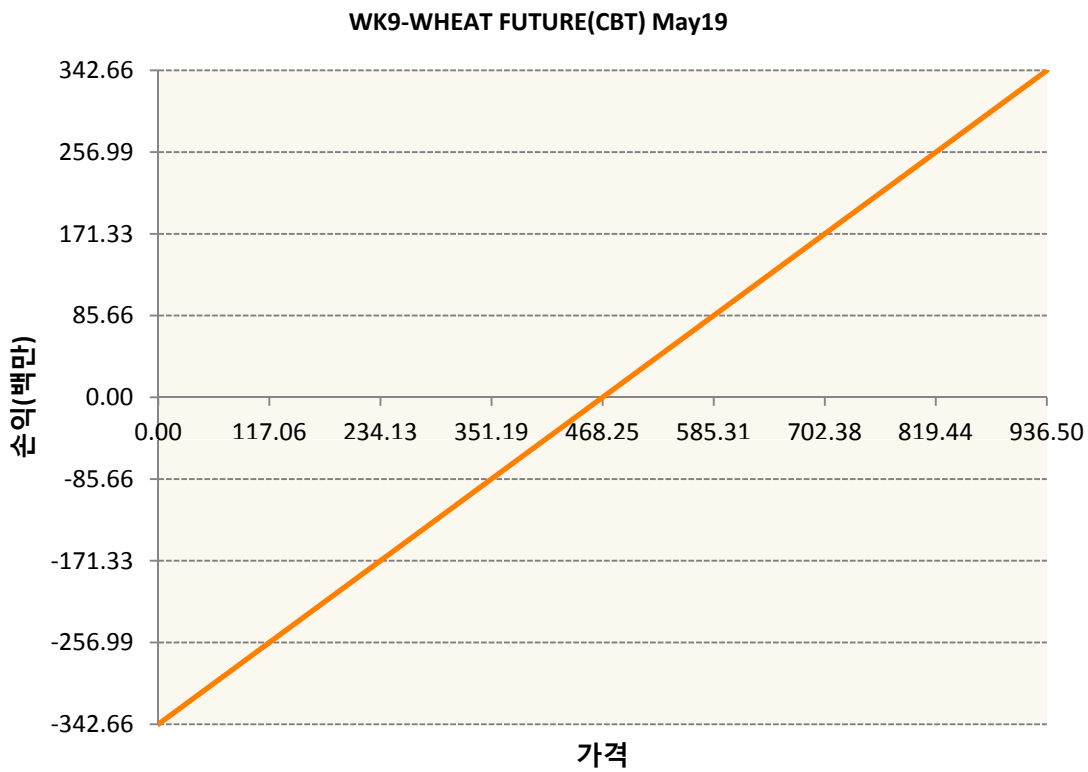
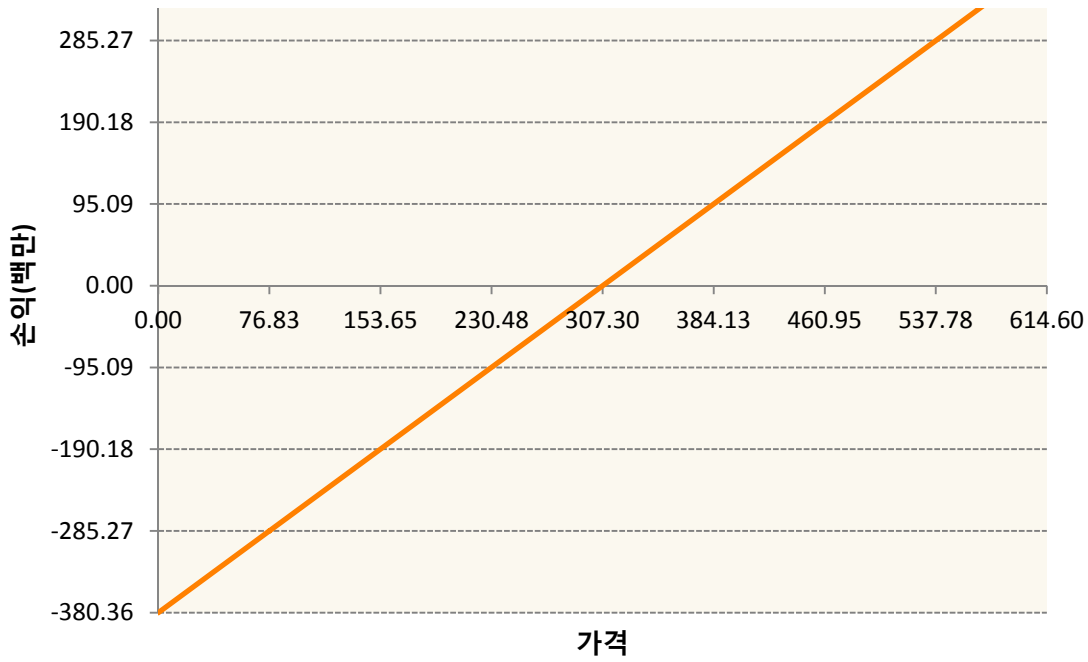


SK9-SOYBEAN FUTURE May19



SMK9-SOYBEAN MEAL FUTR May19





**3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)**

(단위:백만원)

BOK9	SOYBEAN OIL FUTR May19	31
CK9	CORN FUTURE May19	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	30
WK9	WHEAT FUTURE(CBT) May19	27

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

(단위:백만원)

**273**