

공시일	2019-03-05
기준일	2019-03-04

포커스농산물모(채권-파생형)

1. 계약금액

(단위:USD 백만)

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

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

97

공시일	2019-03-05
기준일	2019-03-04

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

1,120

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

645

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-03-05
기준일	2019-03-04

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	323
SWCSI50000 신한CSI500미래S190129	96

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

634

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-03-05
기준일	2019-03-04

유로인덱스모(주식-파생형)

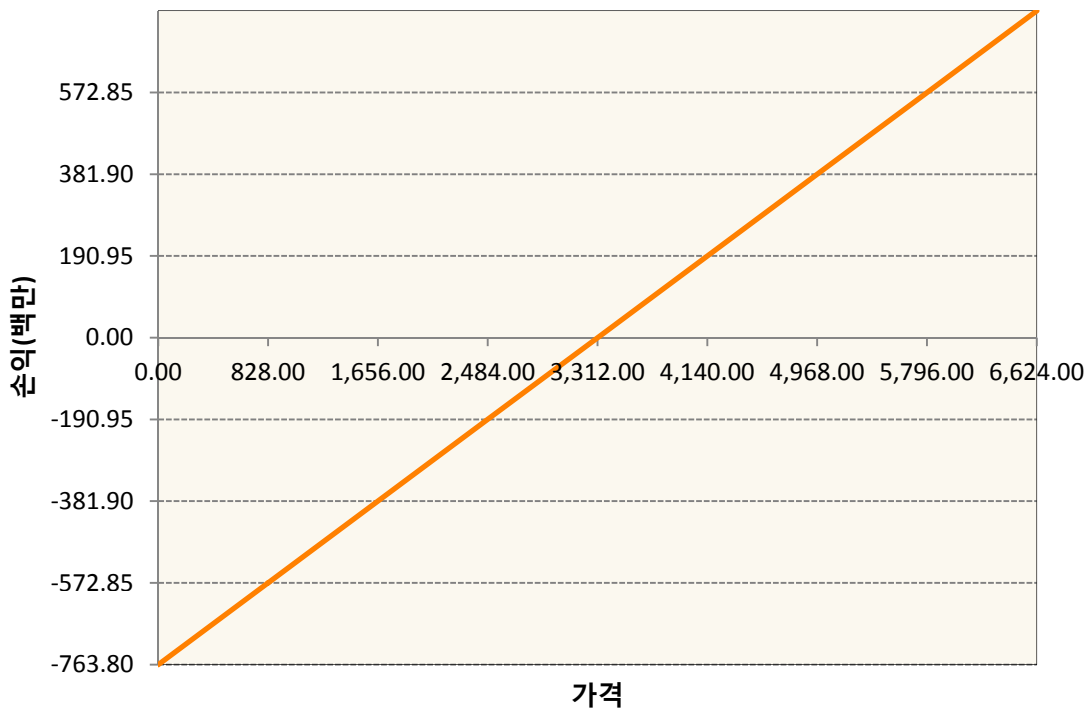
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	764	0	764	

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)

43

공시일	2019-03-05
기준일	2019-03-04

차이나인덱스모(주식-파생형)

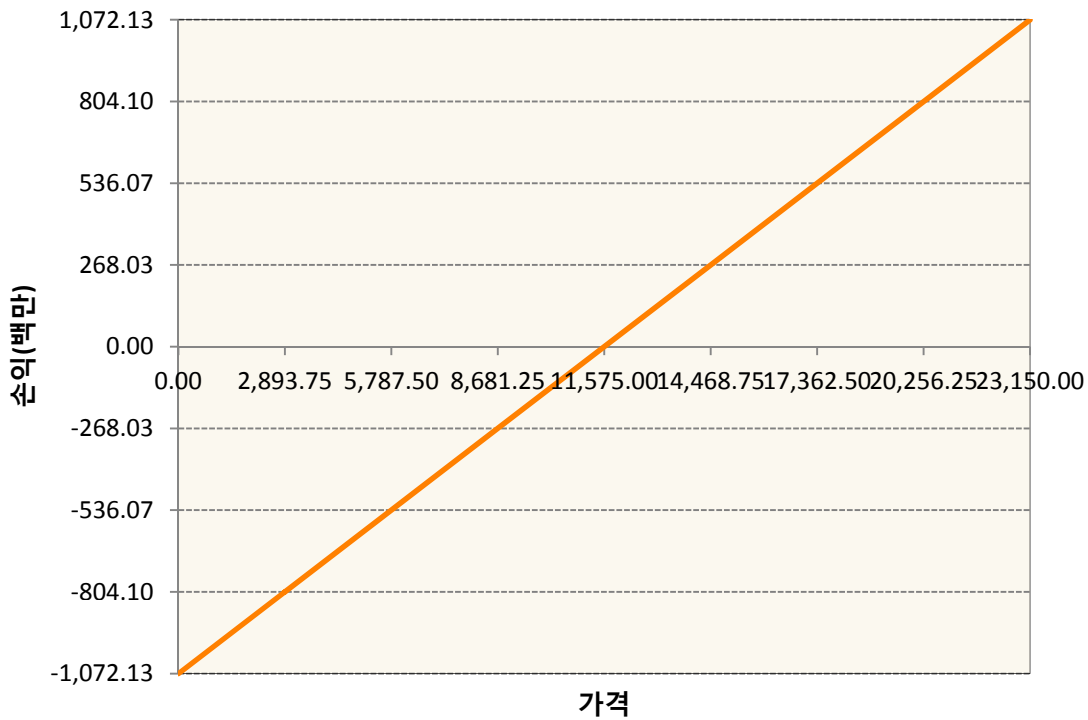
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,072	0	1,072	장내

2. 만기시점의 손익구조

HCH9-HSCEI Futures Mar19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCH9	HSCEI Futures Mar19	86
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

88

공시일	2019-03-05
기준일	2019-03-04

커버드콜모(주식혼합-파생형)

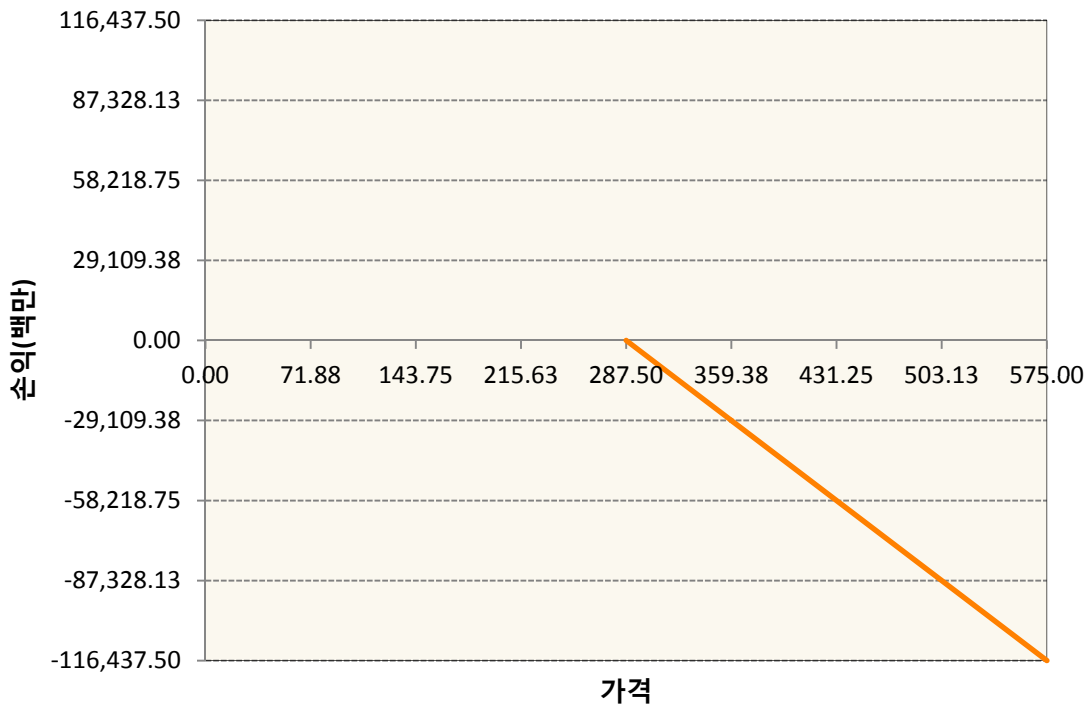
1. 계약금액

(단위:백만원)

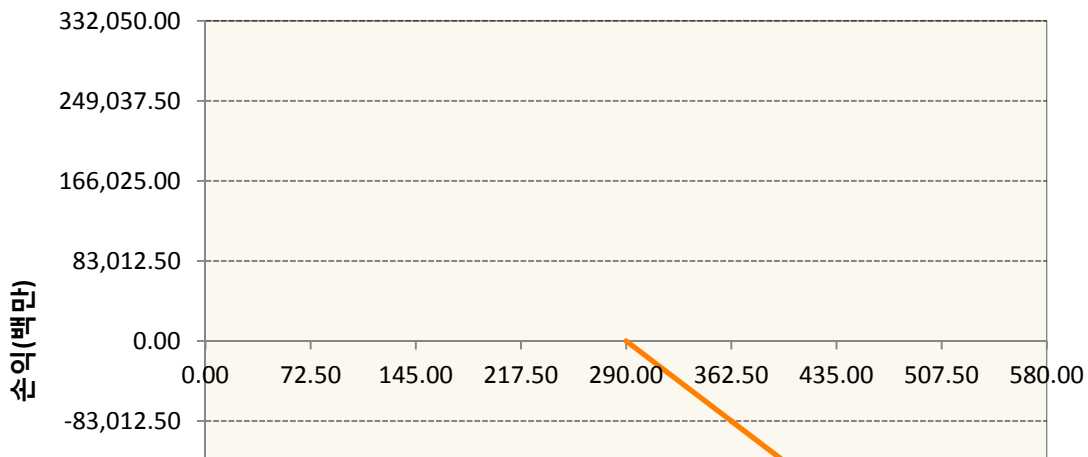
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	689,269	-689,269	장내

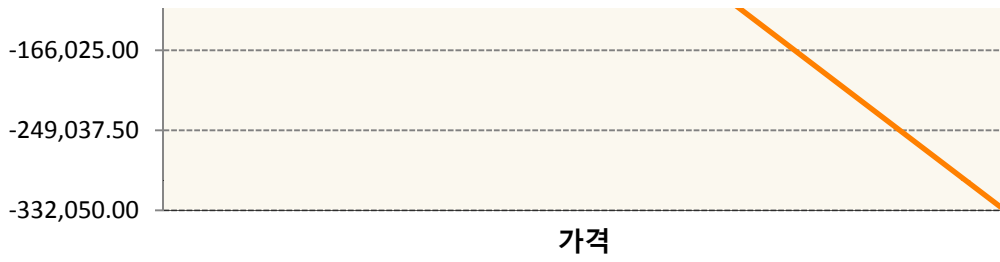
2. 만기시점의 손익구조

KR4201P32878-2019-03 콜287.5

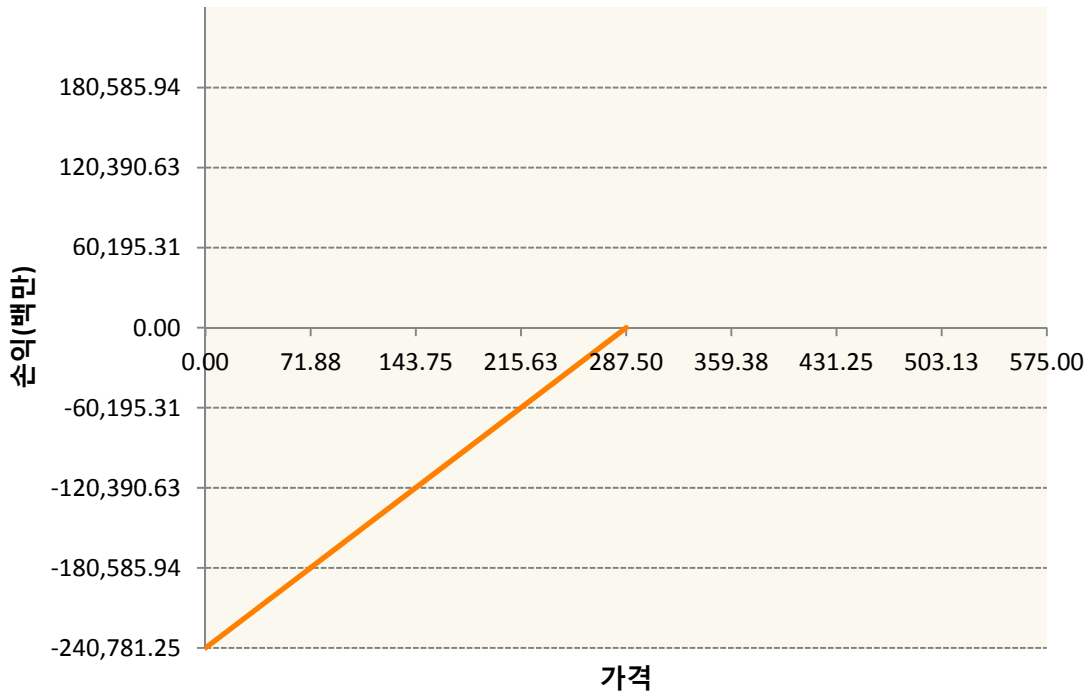


KR4201P32902-2019-03 콜290





KR4301P32876-2019-03 풋287.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201P32878		2019-03 콜287.5					6,423
		기초자산의 변동성					
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,140	1,138	1,133	1,125	1,112	1,093	1,068
-5.33%	1,125	1,107	1,081	1,046	1,001	947	885
-2.67%	997	927	845	753	652	545	431
0%	447	301	152	0	-154	-310	-467
2.67%	-937	-1,100	-1,264	-1,429	-1,594	-1,760	-1,926
5.33%	-3,212	-3,315	-3,428	-3,550	-3,677	-3,810	-3,948
8.00%	-6,025	-6,064	-6,115	-6,177	-6,250	-6,332	-6,423
KR4201P32902		2019-03 콜290					16,617
		기초자산의 변동성					
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	2,370	2,367	2,360	2,346	2,322	2,286	2,235

-5.33%	2,350	2,321	2,274	2,206	2,114	1,999	1,860
-2.67%	2,148	2,009	1,836	1,631	1,400	1,144	866
0%	1,109	757	386	0	-398	-806	-1,223
2.67%	-1,940	-2,418	-2,896	-3,375	-3,853	-4,331	-4,809
5.33%	-7,598	-7,964	-8,350	-8,750	-9,162	-9,584	-10,013
8.00%	-15,164	-15,329	-15,530	-15,763	-16,024	-16,310	-16,617
KR4301P32876 2019-03 풋287.5							18,112
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-18,111	-18,111	-18,111	-18,111	-18,111	-18,111	-18,112
-5.33%	-11,805	-11,806	-11,806	-11,808	-11,811	-11,817	-11,827
-2.67%	-5,510	-5,524	-5,546	-5,577	-5,618	-5,670	-5,731
0%	413	284	146	0	-153	-311	-473
2.67%	4,097	3,919	3,738	3,554	3,369	3,182	2,993
5.33%	4,958	4,916	4,861	4,793	4,713	4,621	4,520
8.00%	5,010	5,009	5,004	4,996	4,982	4,963	4,936

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

(단위:백만원)

44,231

공시일	2019-03-05
기준일	2019-03-04

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

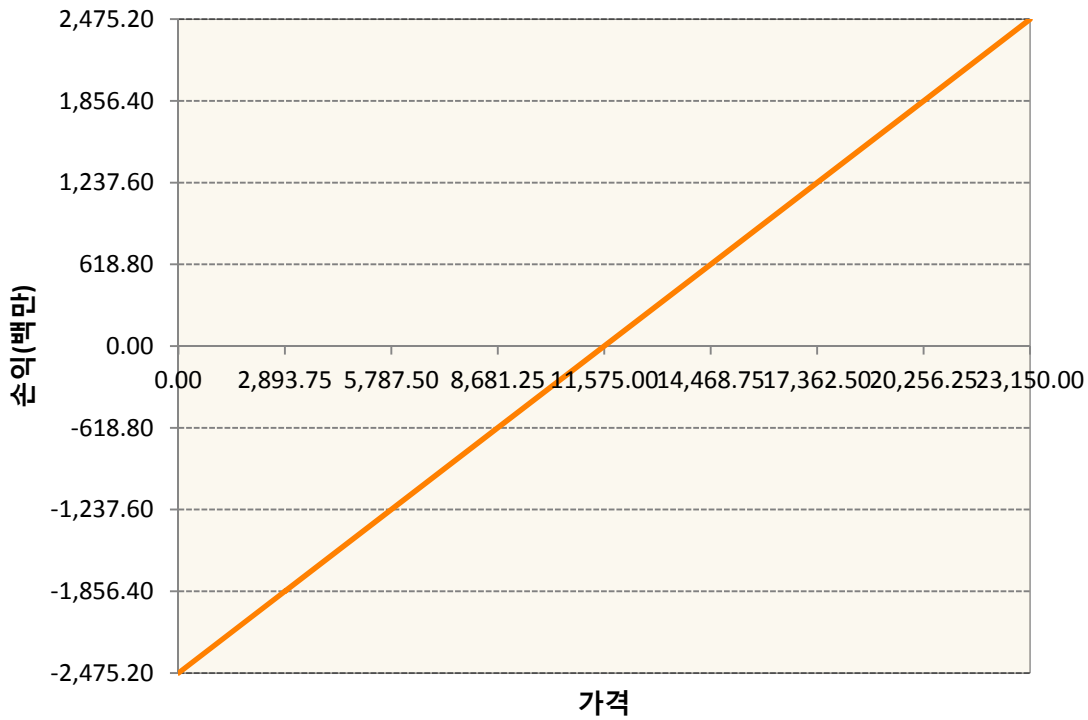
1. 계약금액

(단위:백만원)

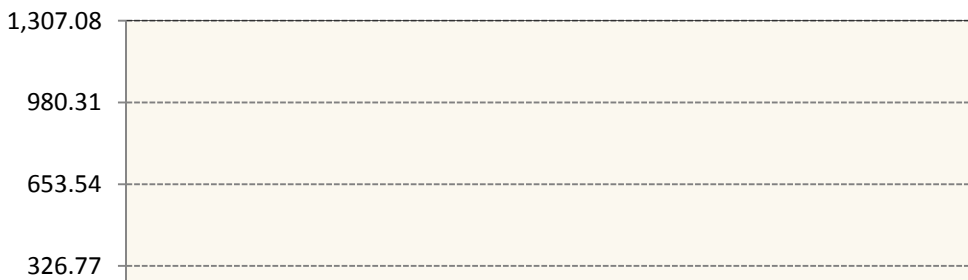
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	2,475	0	2,475	장내
누계	유가증권	옵션	0	6,240	-6,240	장내
누계	통화	선도	0	2,723	-2,723	장외

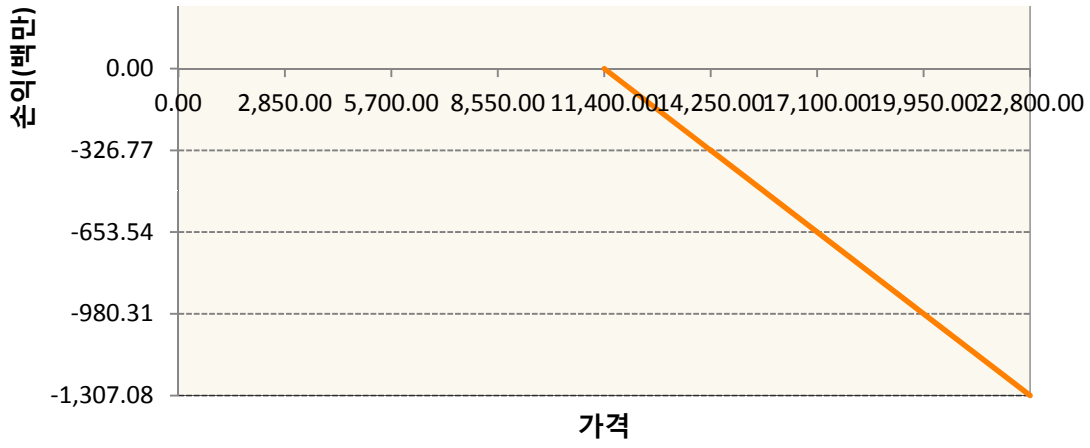
2. 만기시점의 손익구조

HCH9-HSCEI Futures Mar19

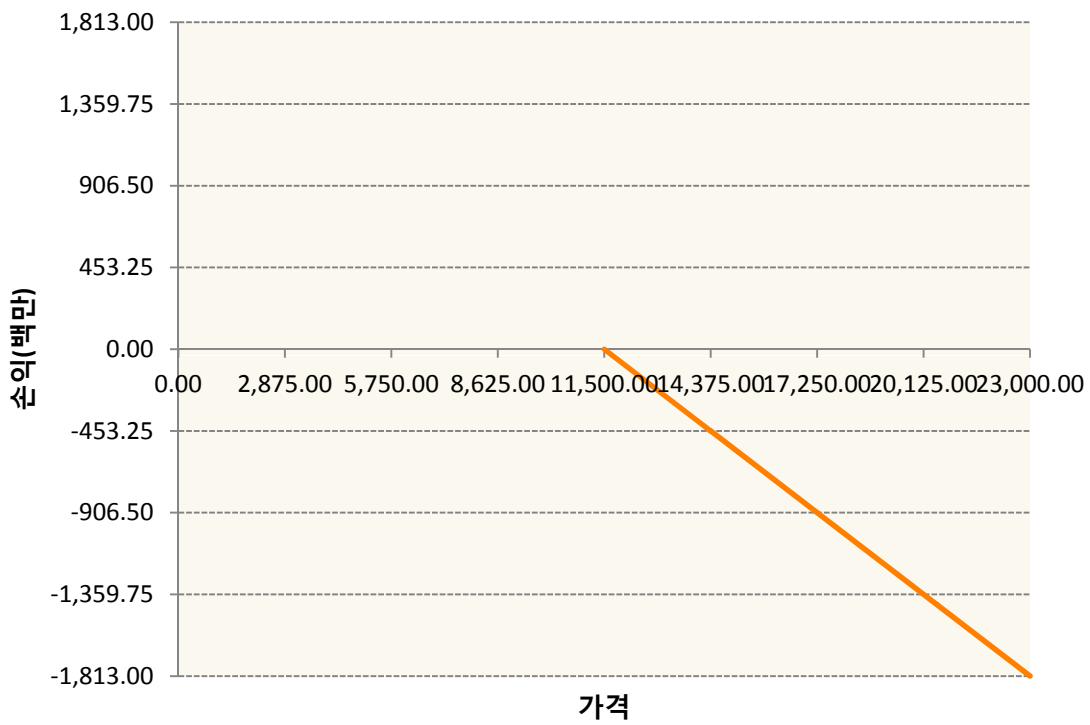


OHHIH9-C114-HSCEI

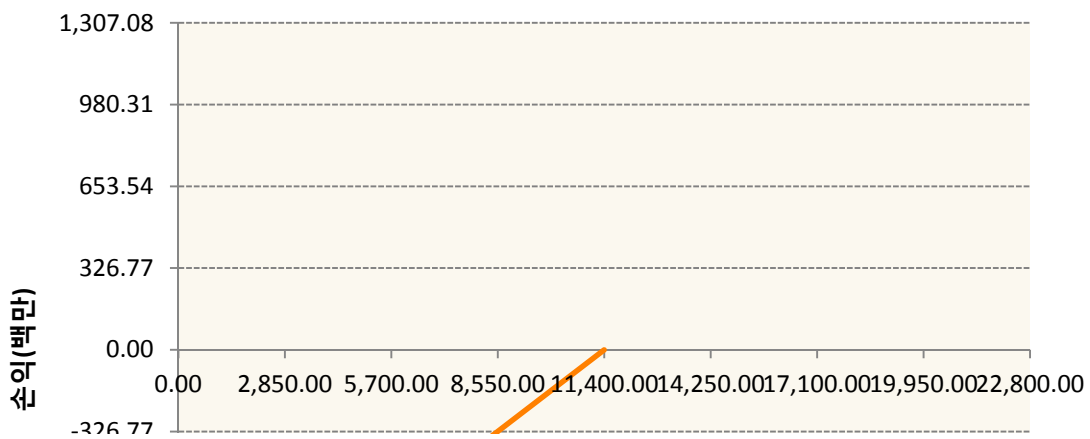


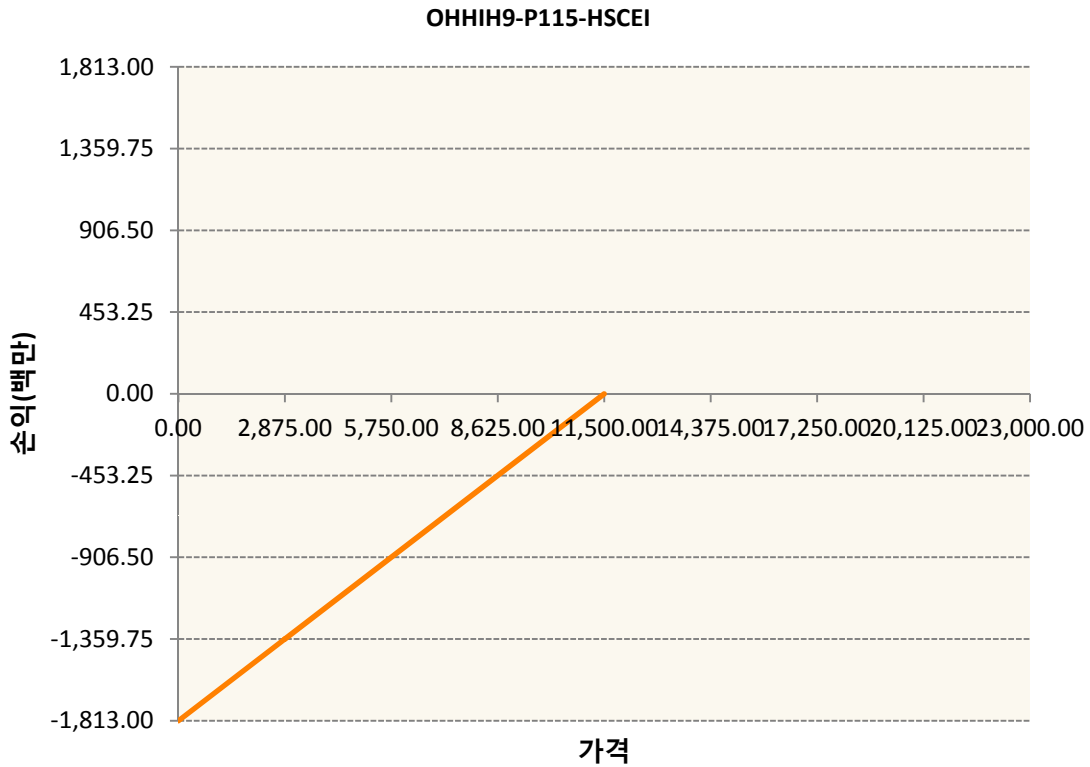


OHHIH9-C115-HSCEI



OHHIH9-P114-HSCEI





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)	(단위:백만원)
FX21018Z00 KRW/HKD 11-03-19E	218
HCH9 HSCEI Futures Mar19	198
OHHIH9-C11 HSCEI	105
OHHIH9-C11 HSCEI	145
OHHIH9-P11 HSCEI	105
OHHIH9-P11 HSCEI	145

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	793

공시일	2019-03-05
기준일	2019-03-04

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

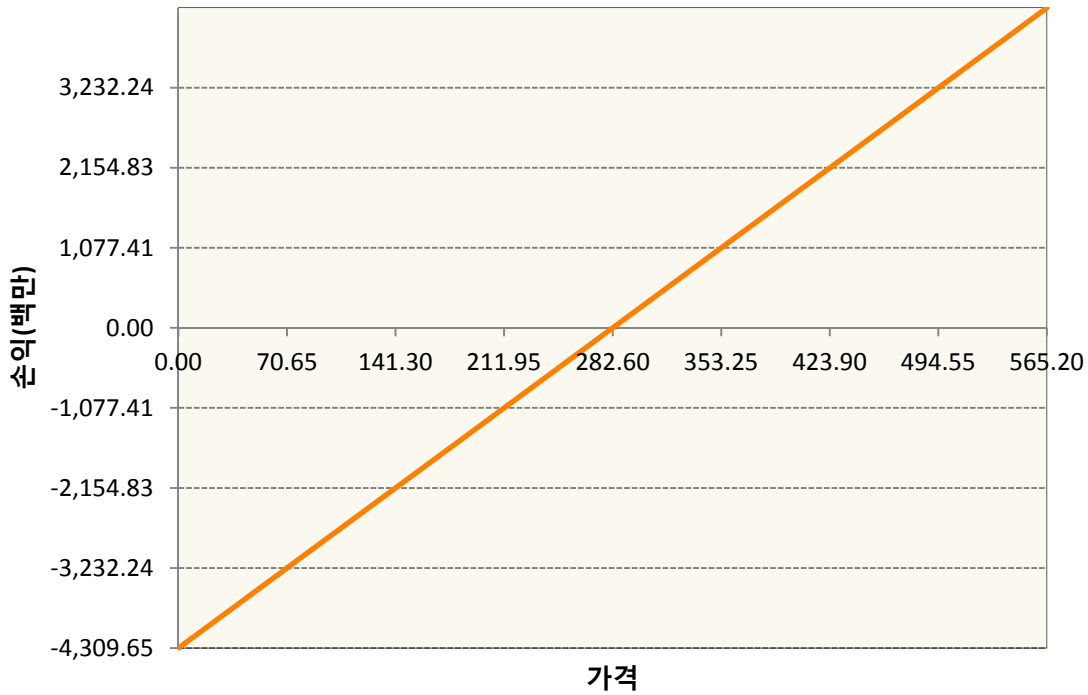
1. 계약금액

(단위:백만원)

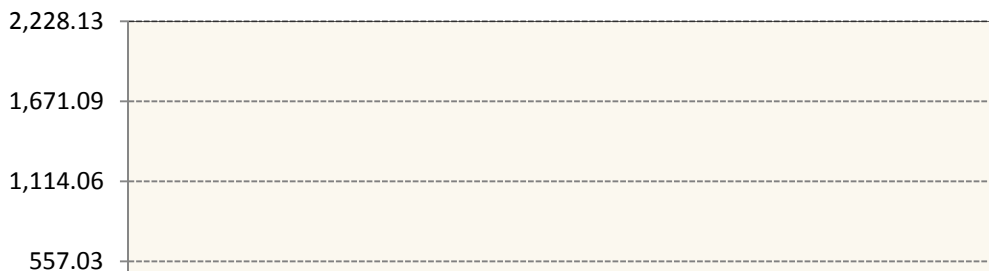
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	214	0	214	장내
누계	유가증권	선물	4,310	0	4,310	장내
누계	유가증권	스왑	28,836	0	28,836	장외
누계	유가증권	옵션	0	28,936	-28,936	장내

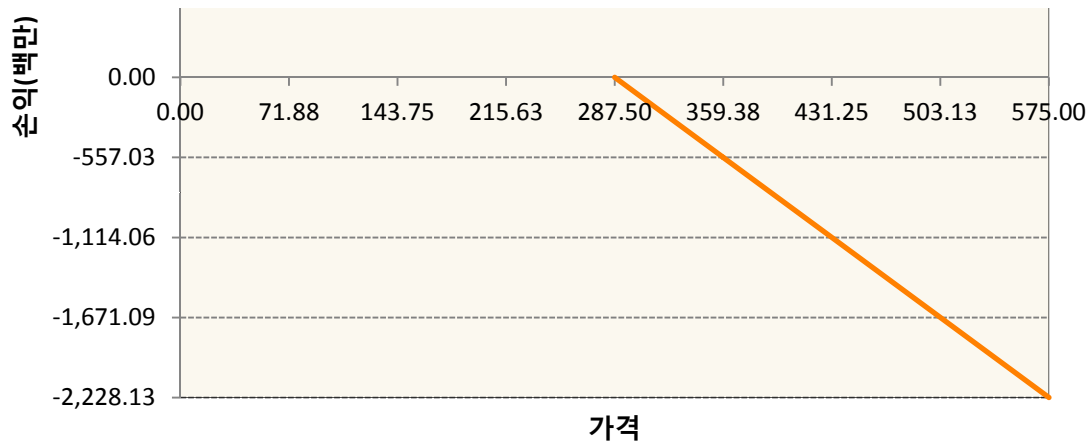
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P30007-2019-03 코스피200지수선물

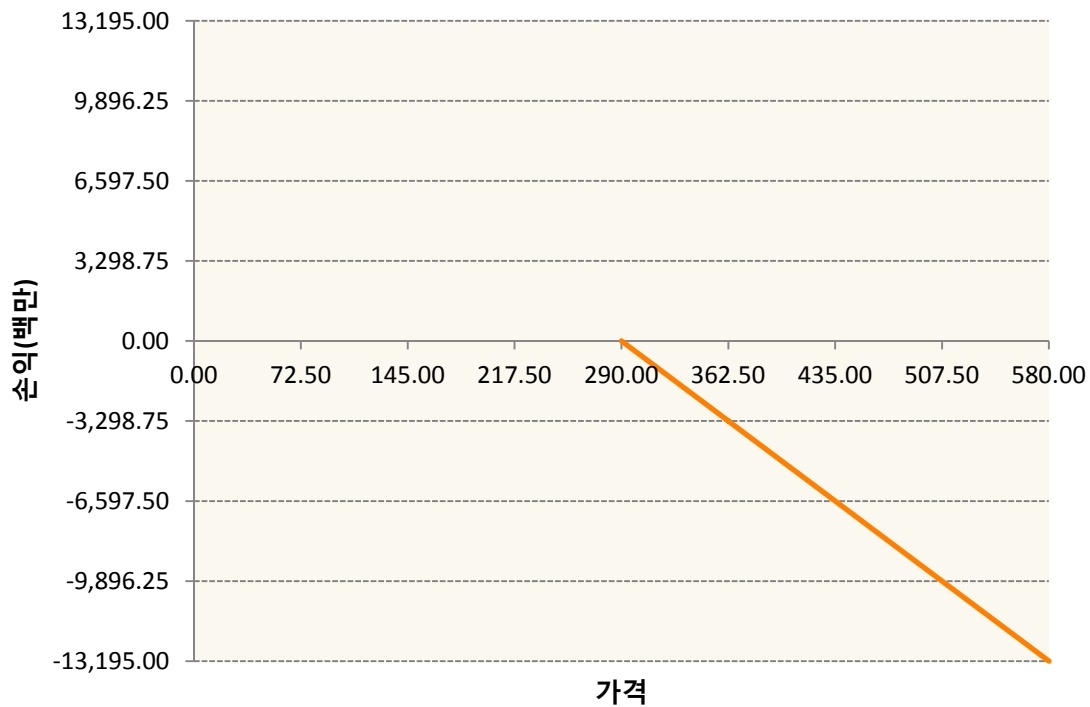


KR4201P32878-2019-03 콜287.5

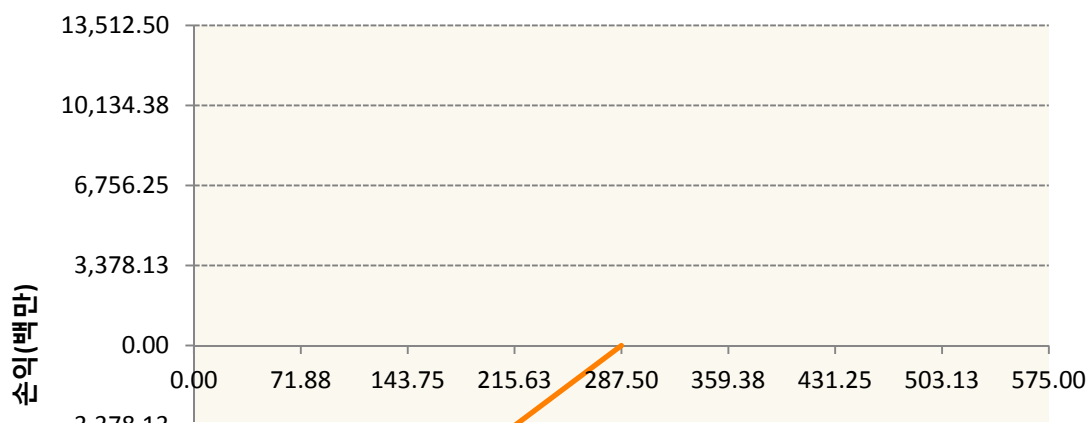


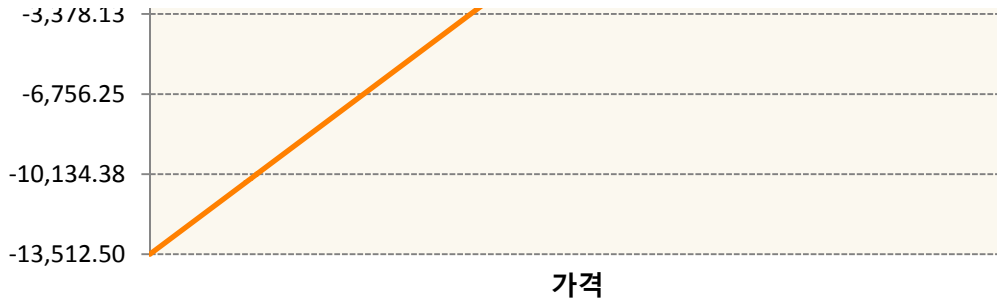


KR4201P32902-2019-03 콜290



KR4301P32876-2019-03 풋287.5





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11		UBCSFXC1 INDEX_14						2,419
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-2,419	-2,419	-2,419	-2,419	-2,419	-2,419	-2,419	
-5.33%	-1,612	-1,612	-1,612	-1,612	-1,612	-1,612	-1,612	
-2.67%	-806	-806	-806	-806	-806	-806	-806	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	806	806	806	806	806	806	806	
5.33%	1,612	1,612	1,612	1,612	1,612	1,612	1,612	
8.00%	2,419	2,419	2,419	2,419	2,419	2,419	2,419	
KR4101P30007		2019-03 코스피200지수선물						345
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-345	-345	-345	-345	-345	-345	-345	
-5.33%	-230	-230	-230	-230	-230	-230	-230	
-2.67%	-115	-115	-115	-115	-115	-115	-115	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	115	115	115	115	115	115	115	
5.33%	230	230	230	230	230	230	230	
8.00%	345	345	345	345	345	345	345	
KR4201P32878		2019-03 콜287.5						123
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	22	22	22	22	21	21	20	
-5.33%	22	21	21	20	19	18	17	
-2.67%	19	18	16	14	12	10	8	
0%	9	6	3	0	-3	-6	-9	
2.67%	-18	-21	-24	-27	-31	-34	-37	
5.33%	-61	-63	-66	-68	-70	-73	-76	
8.00%	-115	-116	-117	-118	-120	-121	-123	
KR4201P32902		2019-03 콜290						660
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	

-8.00%	94	94	94	93	92	91	89
-5.33%	93	92	90	88	84	79	74
-2.67%	85	80	73	65	56	45	34
0%	44	30	15	0	-16	-32	-49
2.67%	-77	-96	-115	-134	-153	-172	-191
5.33%	-302	-316	-332	-348	-364	-381	-398
8.00%	-603	-609	-617	-626	-637	-648	-660
KR4301P32876 2019-03 풋287.5							1,016
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,016	-1,016	-1,016	-1,016	-1,016	-1,016	-1,016
-5.33%	-663	-663	-663	-663	-663	-663	-664
-2.67%	-309	-310	-311	-313	-315	-318	-322
0%	23	16	8	0	-9	-17	-27
2.67%	230	220	210	199	189	179	168
5.33%	278	276	273	269	264	259	254
8.00%	281	281	281	280	280	278	277

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

(단위:백만원)

4,711

공시일	2019-03-05
기준일	2019-03-04

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

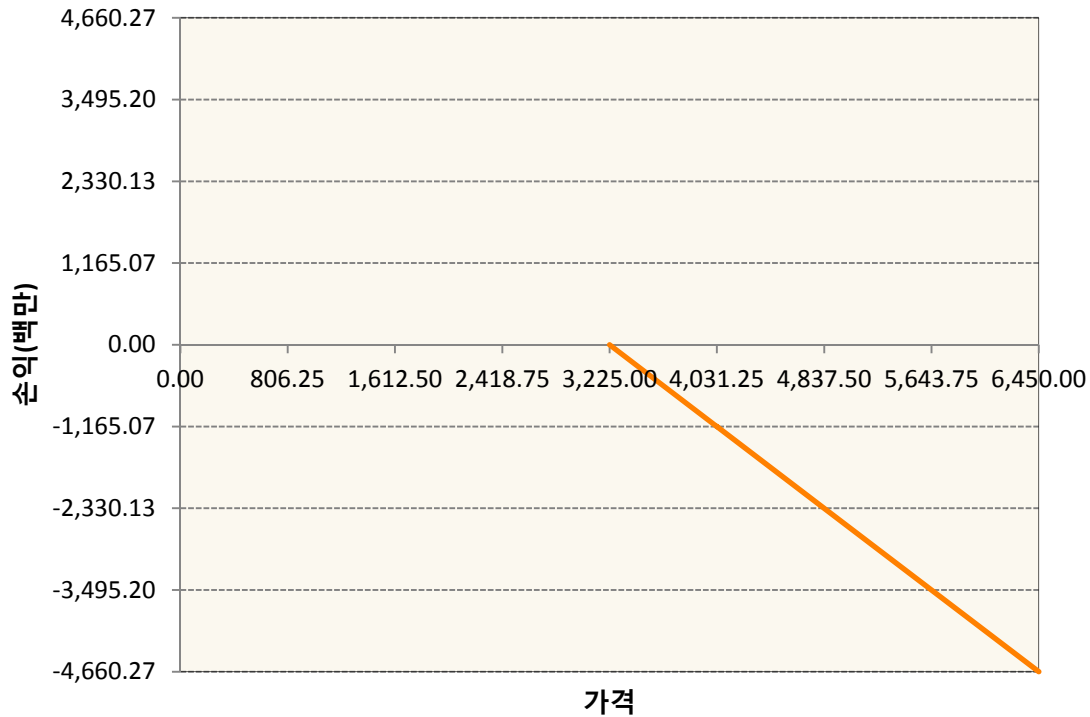
1. 계약금액

(단위:백만원)

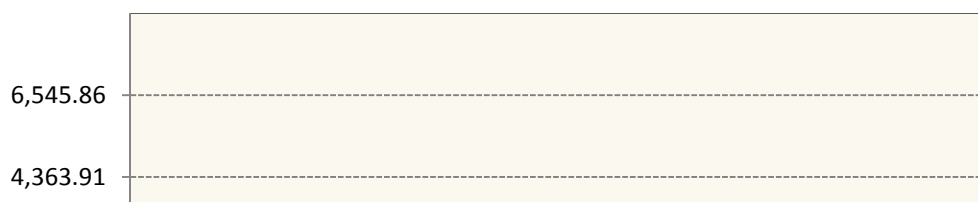
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	7,168	0	7,168	
누계	유가증권	스왑	60,373	0	60,373	장외
누계	유가증권	옵션	0	26,776	-26,776	장내
누계	통화	선도	0	15,345	-15,345	장외

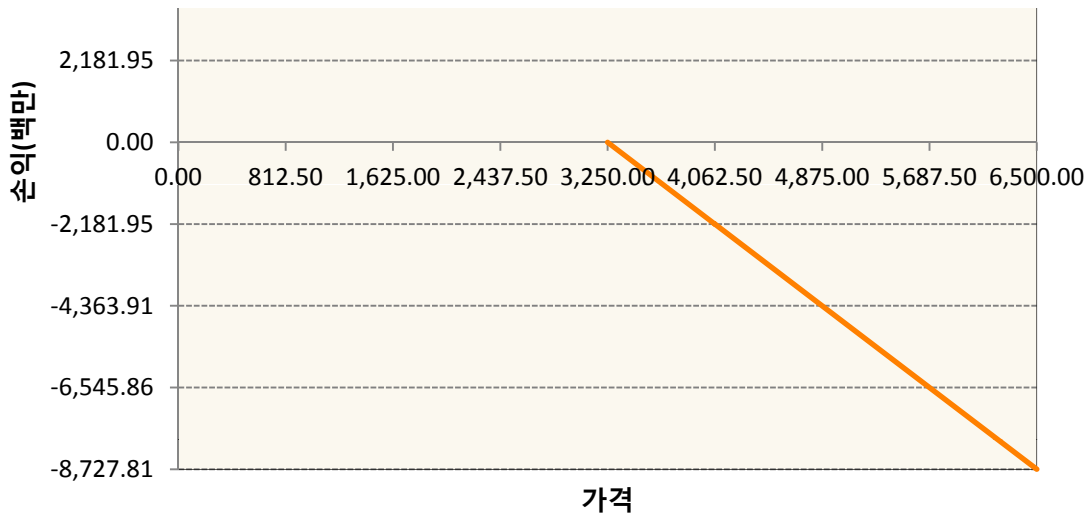
2. 만기시점의 손익구조

OESXH9-C3225-EURO STOXX 50

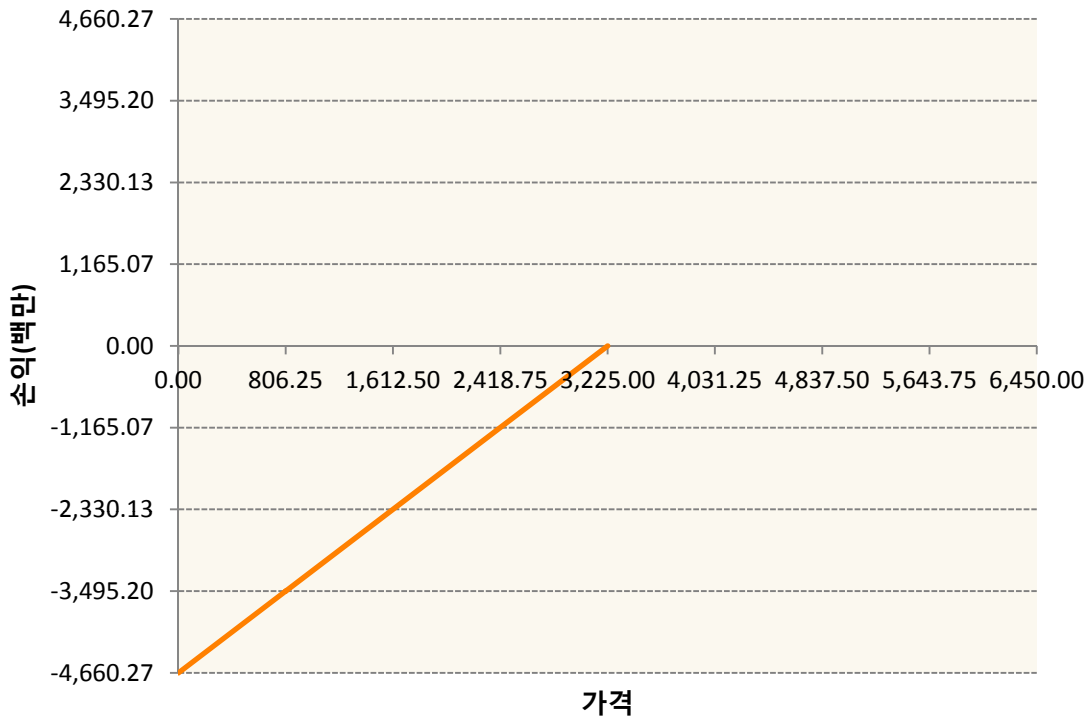


OESXH9-C3250-EURO STOXX 50

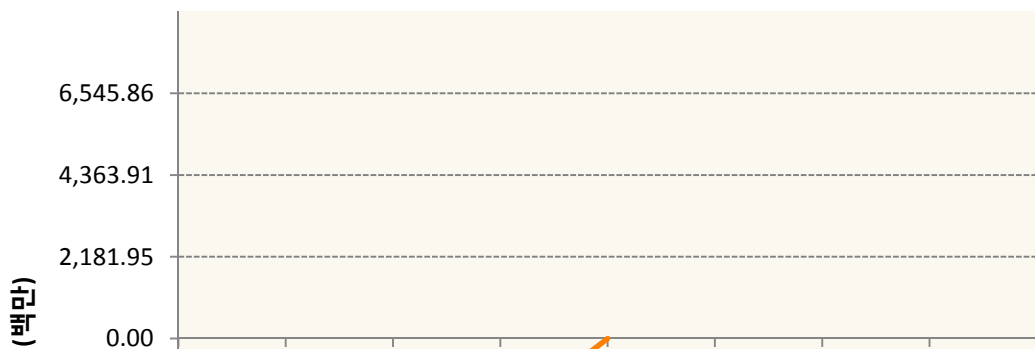


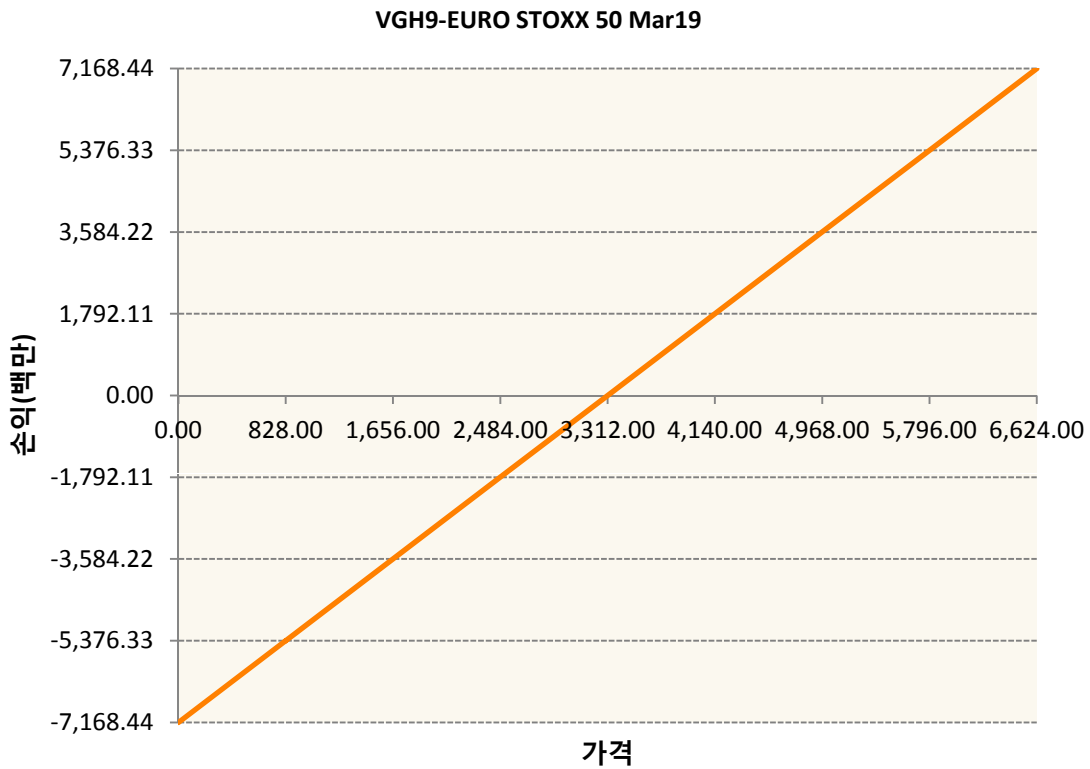
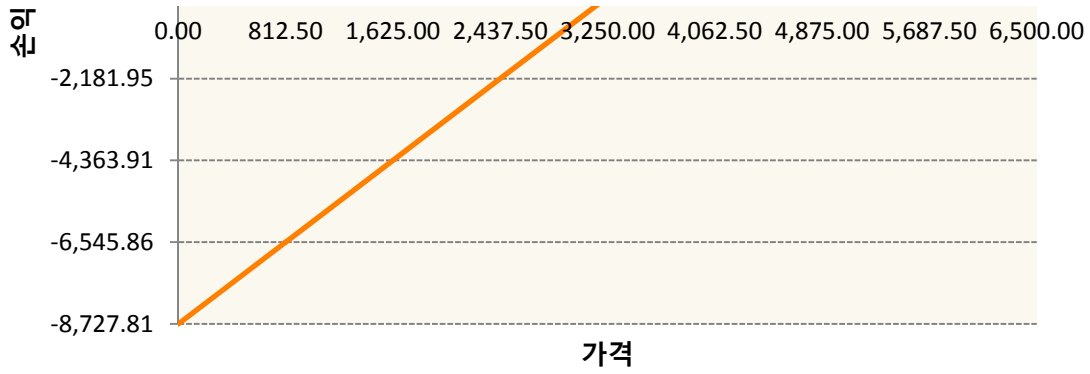


OESXH9-P3225-EURO STOXX 50



OESXH9-P3250-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY		125
FX21018Z03 KRW/EUR 22-03-19E		818
FX21019G02 KRW/EUR 24-05-19E		409
OESXH9-C32 EURO STOXX 50		373
OESXH9-C32 EURO STOXX 50		698
OESXH9-P32 EURO STOXX 50		373
OESXH9-P32 EURO STOXX 50		698
VGH9 EURO STOXX 50 Mar19		573

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

(단위:백만원)

2,684

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

(단위:백만원)

1,134

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

(단위:백만원)

97

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

(단위:백만원)

140

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

(단위:백만원)

44

공시일	2019-03-05
기준일	2019-03-04

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

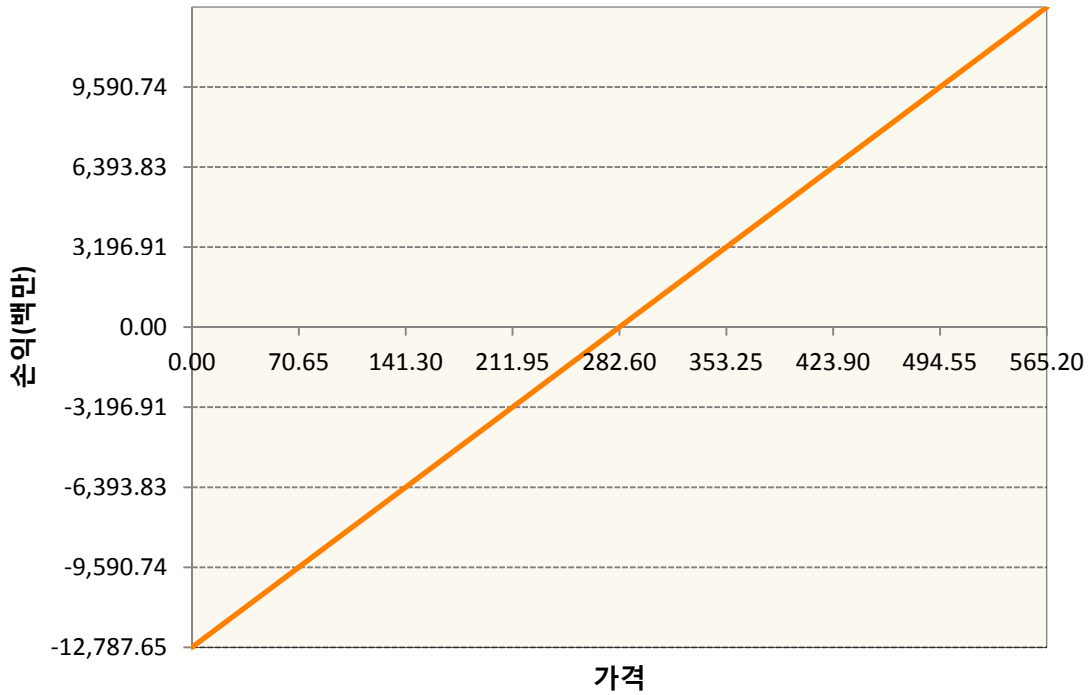
1. 계약금액

(단위:백만원)

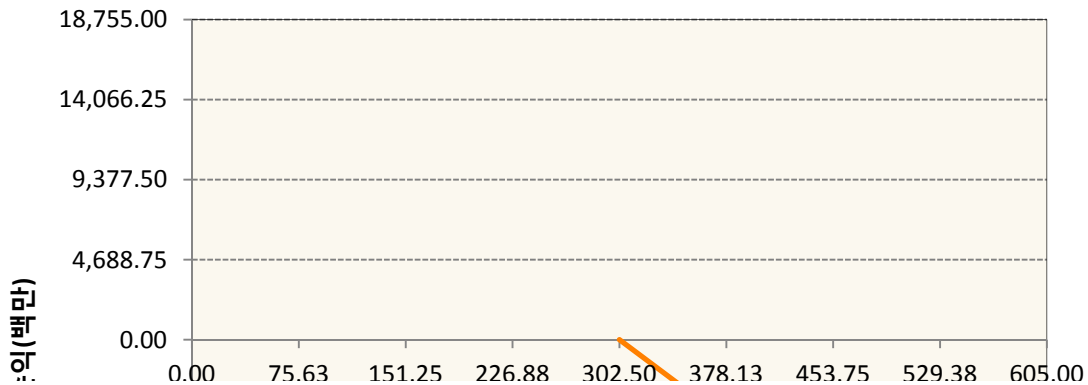
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	12,788	0	12,788	장내
누계	유가증권	옵션	2,165	24,931	-22,766	장내

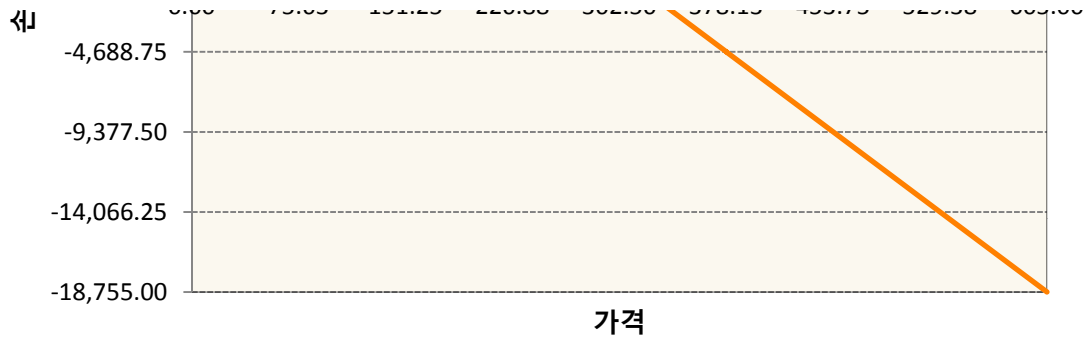
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P30007-2019-03 코스피200지수선물

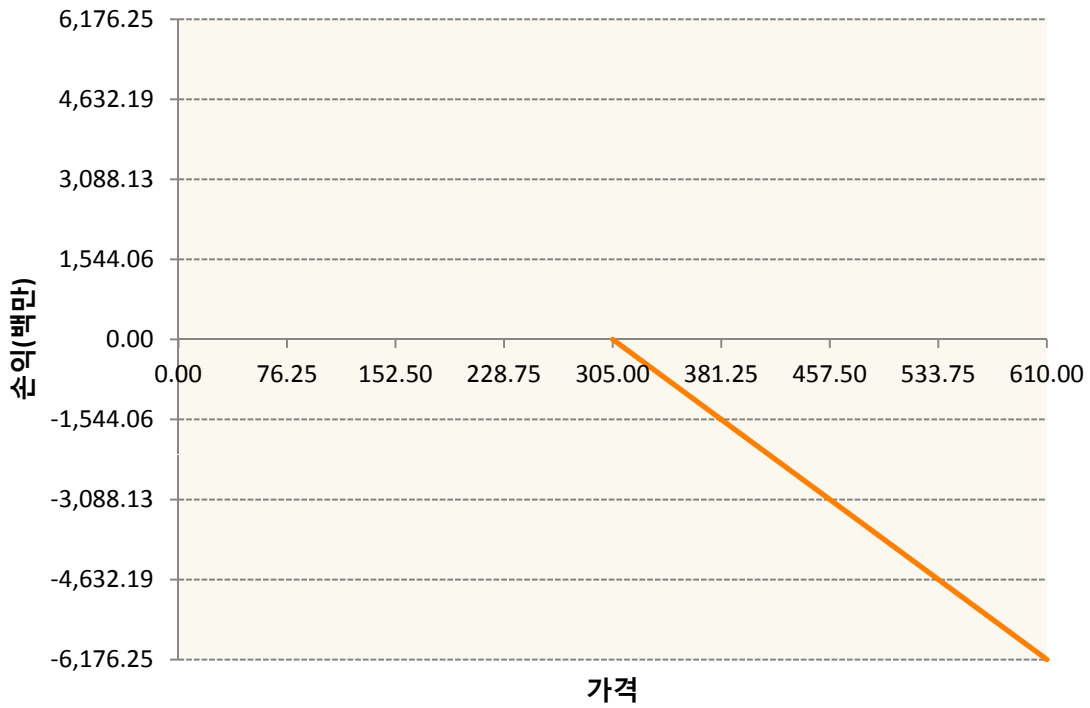


KR4201P33025-2019-03 콜302.5

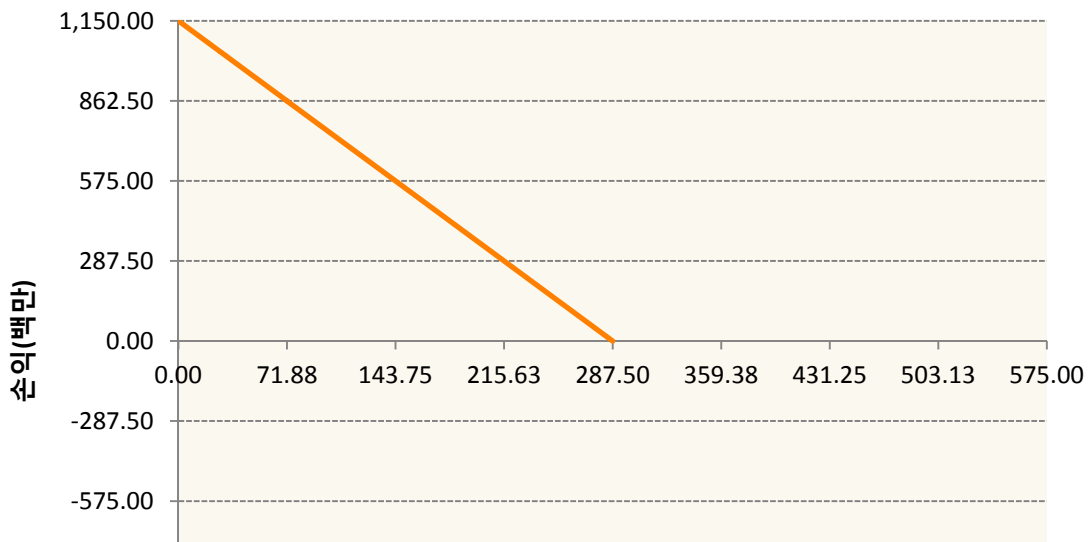


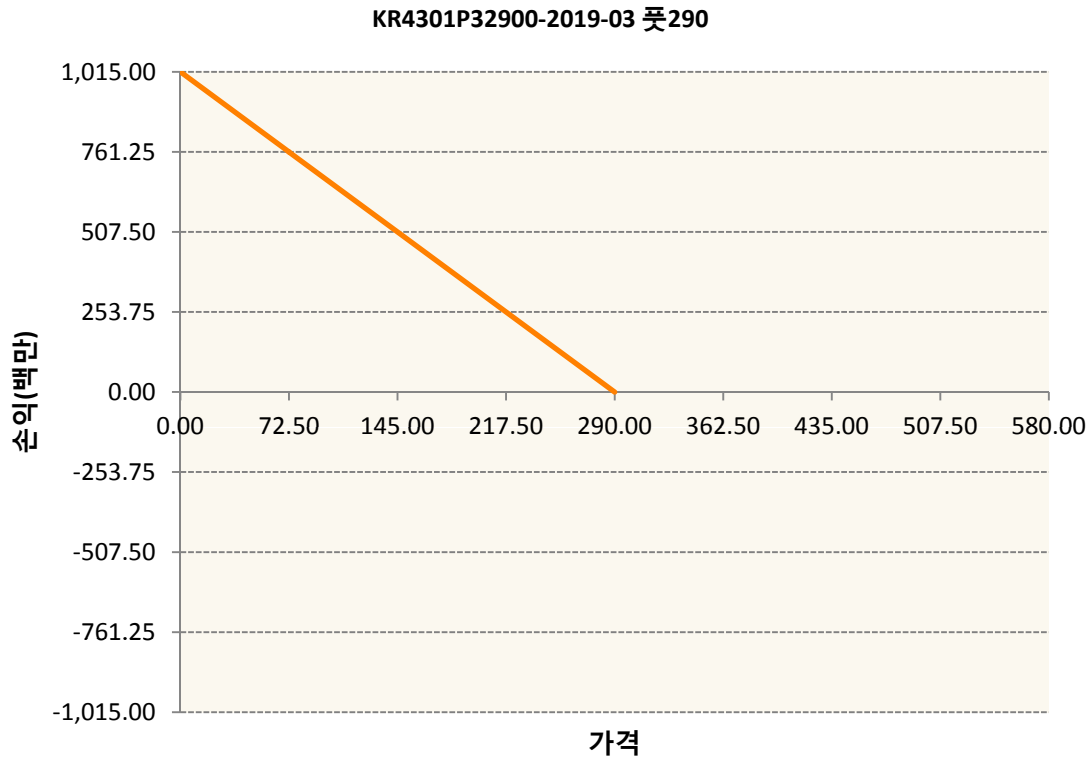
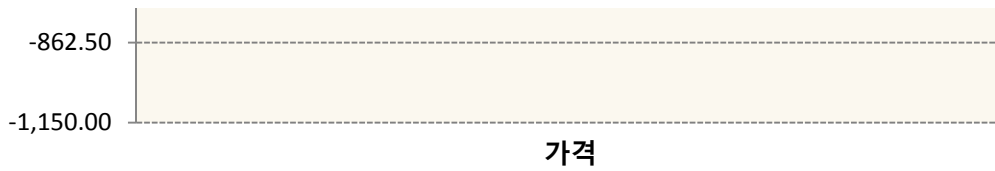


KR4201P33058-2019-03 콜305



KR4301P32876-2019-03 풋287.5





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101P30007		2019-03 코스피200지수선물						1,023
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-1,023	-1,023	-1,023	-1,023	-1,023	-1,023	-1,023	
-5.33%	-682	-682	-682	-682	-682	-682	-682	
-2.67%	-341	-341	-341	-341	-341	-341	-341	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	341	341	341	341	341	341	341	
5.33%	682	682	682	682	682	682	682	
8.00%	1,023	1,023	1,023	1,023	1,023	1,023	1,023	
KR4201P33025		2019-03 콜302.5						473
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	19	19	19	19	19	19	18	
-5.33%	19	19	19	19	18	17	15	
-2.67%	19	18	17	15	13	9	4	

0%	15	12	7	0	-8	-18	-29
2.67%	-8	-21	-35	-51	-68	-86	-105
5.33%	-99	-123	-147	-172	-197	-222	-248
8.00%	-313	-339	-366	-392	-419	-446	-473
KR4201P33058 2019-03 콜305							130
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	4	4	4	4	4	4	4
-5.33%	4	4	4	4	4	4	3
-2.67%	4	4	4	3	3	2	1
0%	3	3	2	0	-2	-5	-7
2.67%	-1	-4	-8	-12	-16	-22	-27
5.33%	-22	-28	-35	-43	-50	-58	-66
8.00%	-77	-86	-95	-104	-112	-121	-130
KR4301P32876 2019-03 풋287.5							87
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	87	87	87	87	87	87	87
-5.33%	56	56	56	56	56	56	56
-2.67%	26	26	26	27	27	27	27
0%	-2	-1	-1	0	1	1	2
2.67%	-20	-19	-18	-17	-16	-15	-14
5.33%	-24	-23	-23	-23	-23	-22	-22
8.00%	-24	-24	-24	-24	-24	-24	-24
KR4301P32900 2019-03 풋290							77
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	77	77	77	77	77	77	77
-5.33%	51	51	51	51	51	51	51
-2.67%	25	25	25	25	25	25	25
0%	-1	-1	0	0	0	1	2
2.67%	-21	-20	-19	-18	-17	-17	-16
5.33%	-27	-27	-27	-26	-26	-25	-25
8.00%	-28	-28	-28	-28	-28	-28	-27

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

(단위:백만원)

1,332

공시일	2019-03-05
기준일	2019-03-04

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	988	0	988	

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	2019-03-05
기준일	2019-03-04

H2O글로벌본드(UH)(채권혼합-파)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	675	0	675	
누계	유가증권	수익증권	6,967	0	6,967	

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	2019-03-05
기준일	2019-03-04

H2O글로벌본드(H)(채권혼합-파생)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	0	0	0	
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	수익증권	38,431	0	38,431	
누계	통화	선도	0	38,365	-38,365	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음	
FX21019F02: KRW/USD 28-03-19E		468
FX21019F02: KRW/USD 29-03-19E		24
FX21019F02: KRW/USD 29-03-19E		72
FX21019G00 KRW/USD 29-03-19E		27
FX21019G00 KRW/USD 29-03-19E		13
FX21019G00 KRW/USD 19-03-19E		49
FX21019G00 KRW/USD 19-03-19E		27
FX21019G01 KRW/USD 19-03-19E		54
FX21019G01 KRW/USD 19-03-19E		105
FX21019G01 KRW/USD 19-03-19E		106
FX21019G01 KRW/USD 19-03-19E		43
FX21019G01 KRW/USD 21-03-19E		423
FX21019G01 KRW/USD 21-03-19E		270
FX21019G02 KRW/USD 25-03-19E		136
FX21019G02 KRW/USD 25-03-19E		477
FX21019G03 KRW/USD 28-03-19E		252
FX21019G03 KRW/USD 28-03-19E		117
FX21019G03 KRW/USD 29-03-19E		333
FX21019G04 KRW/USD 10-04-19E		72

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

(단위:백만원)

1,096

공시일	2019-03-05
기준일	2019-03-04

스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

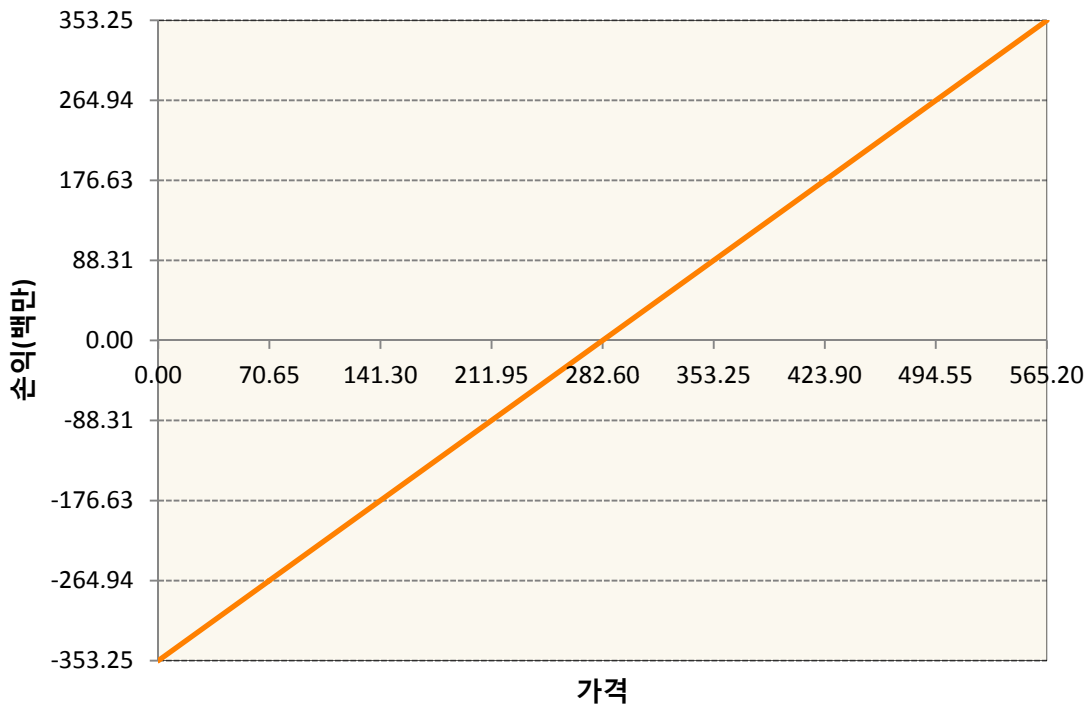
1. 계약금액

(단위:백만원)

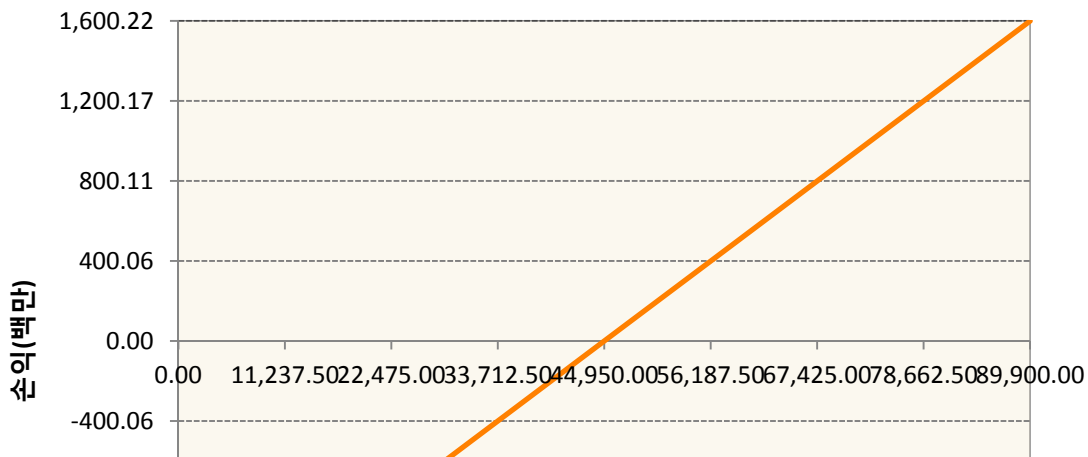
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,953	0	1,953	장내

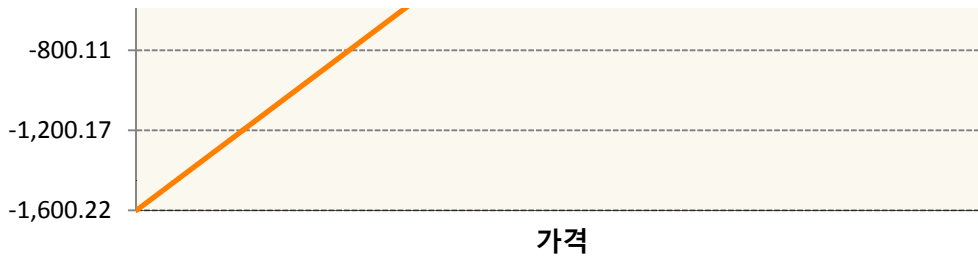
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P30007-2019-03 코스피200지수선물



KR4111P30006-2019-03 삼성전자개별선물





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101P30007		2019-03 코스피200지수선물						28
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-28	-28	-28	-28	-28	-28	-28	
-5.33%	-19	-19	-19	-19	-19	-19	-19	
-2.67%	-9	-9	-9	-9	-9	-9	-9	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	9	9	9	9	9	9	9	
5.33%	19	19	19	19	19	19	19	
8.00%	28	28	28	28	28	28	28	

KR4111P30006		2019-03 삼성전자개별선물						128
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-128	-128	-128	-128	-128	-128	-128	
-5.33%	-85	-85	-85	-85	-85	-85	-85	
-2.67%	-43	-43	-43	-43	-43	-43	-43	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	43	43	43	43	43	43	43	
5.33%	85	85	85	85	85	85	85	
8.00%	128	128	128	128	128	128	128	

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

171

공시일	2019-03-05
기준일	2019-03-04

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

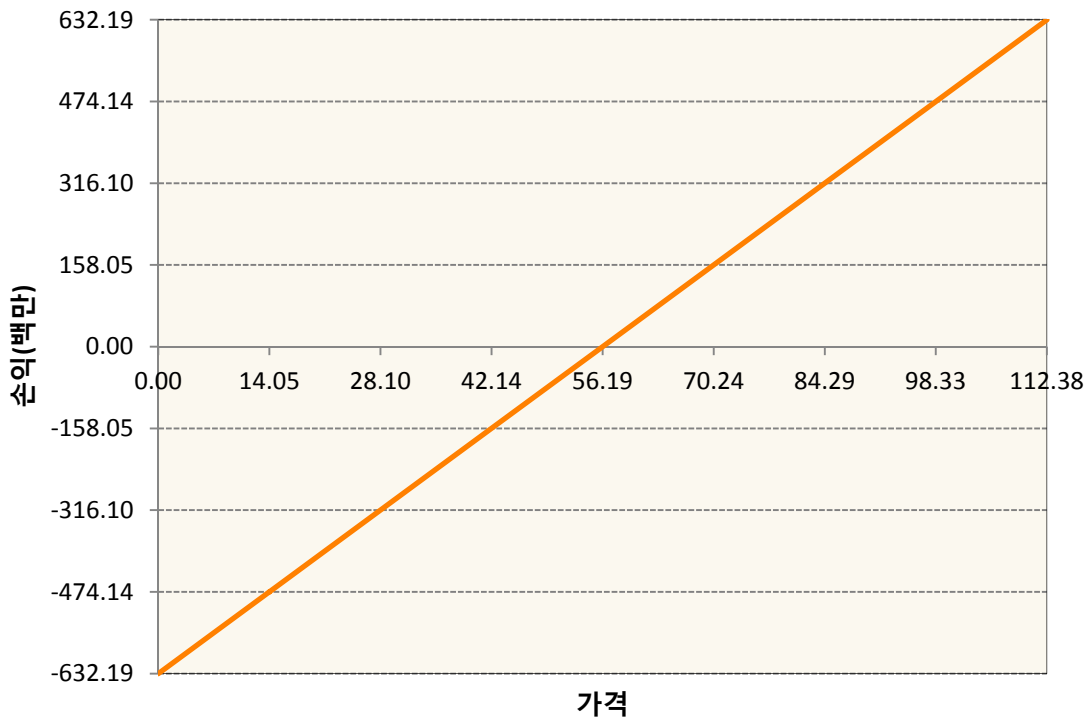
1. 계약금액

(단위:백만원)

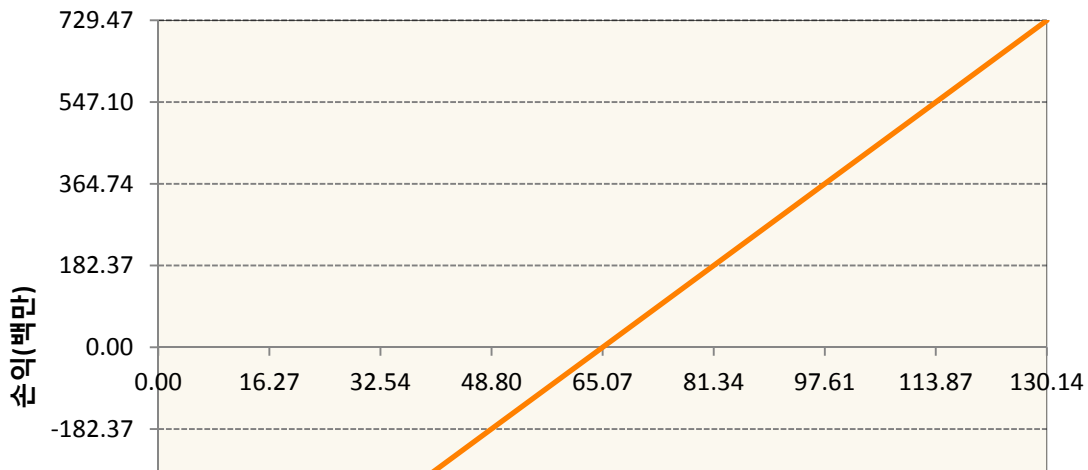
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,812	281	2,531	

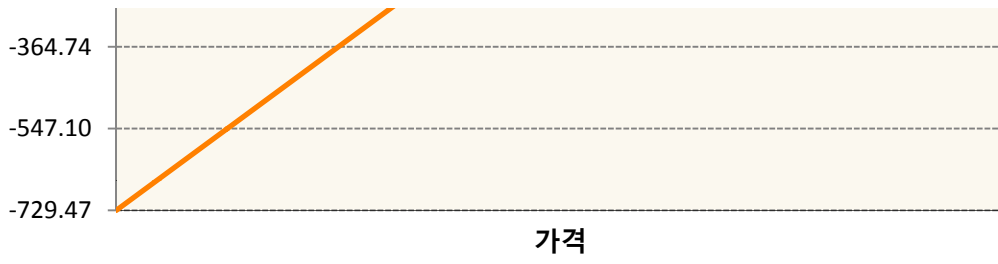
2. 만기시점의 손익구조

CLK9-WTI CRUDE FUTURE May19

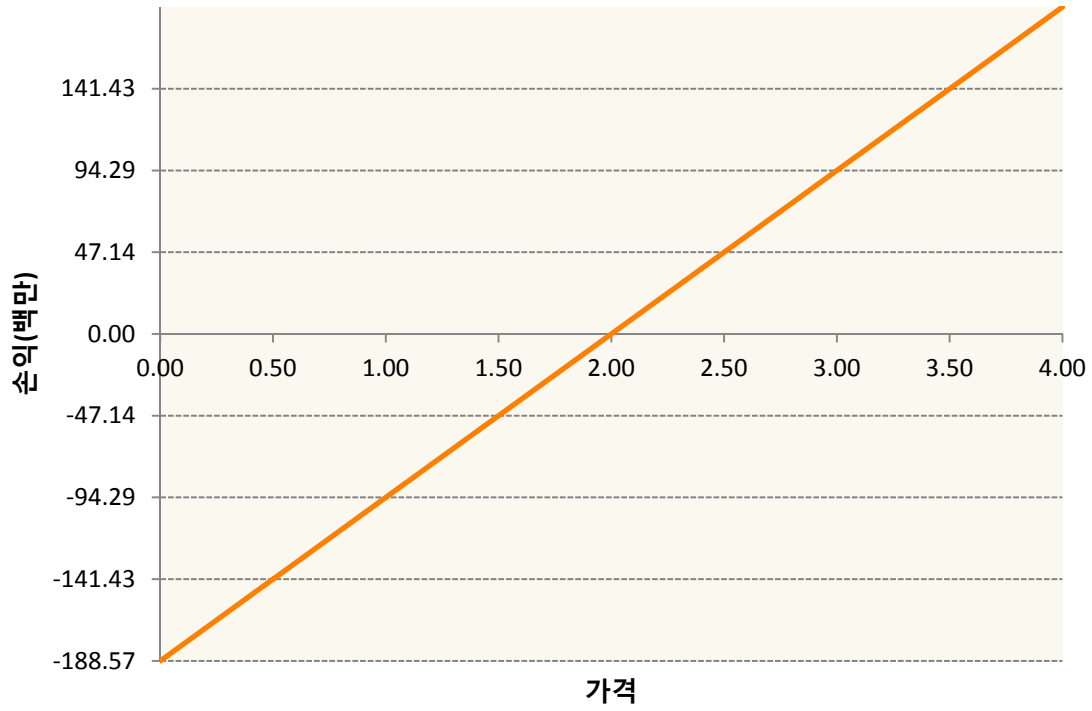


COK9-BRENT CRUDE FUTR May19

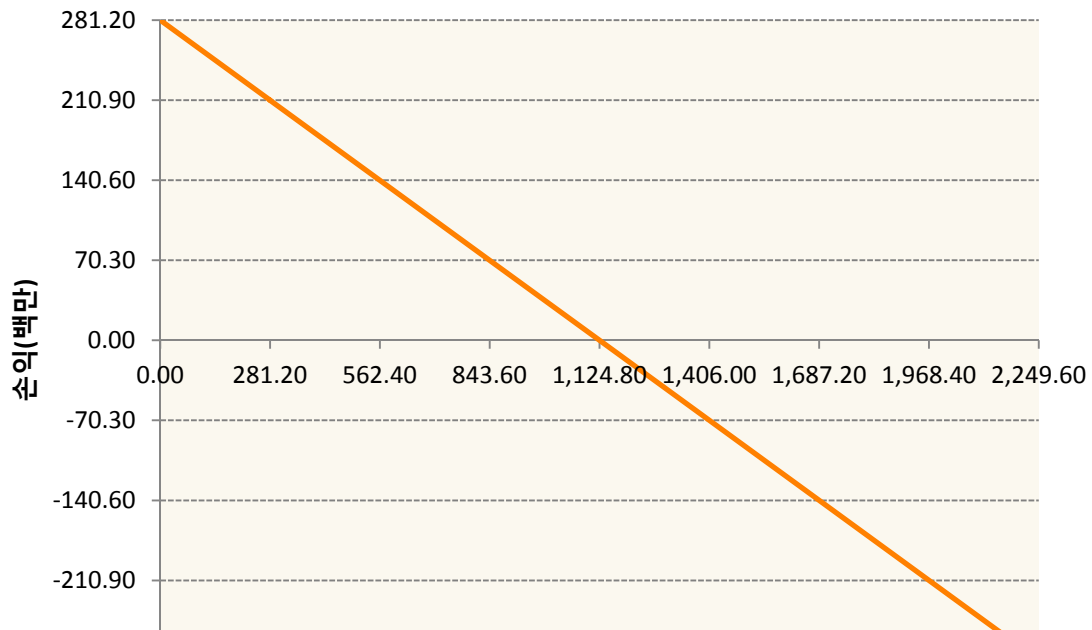


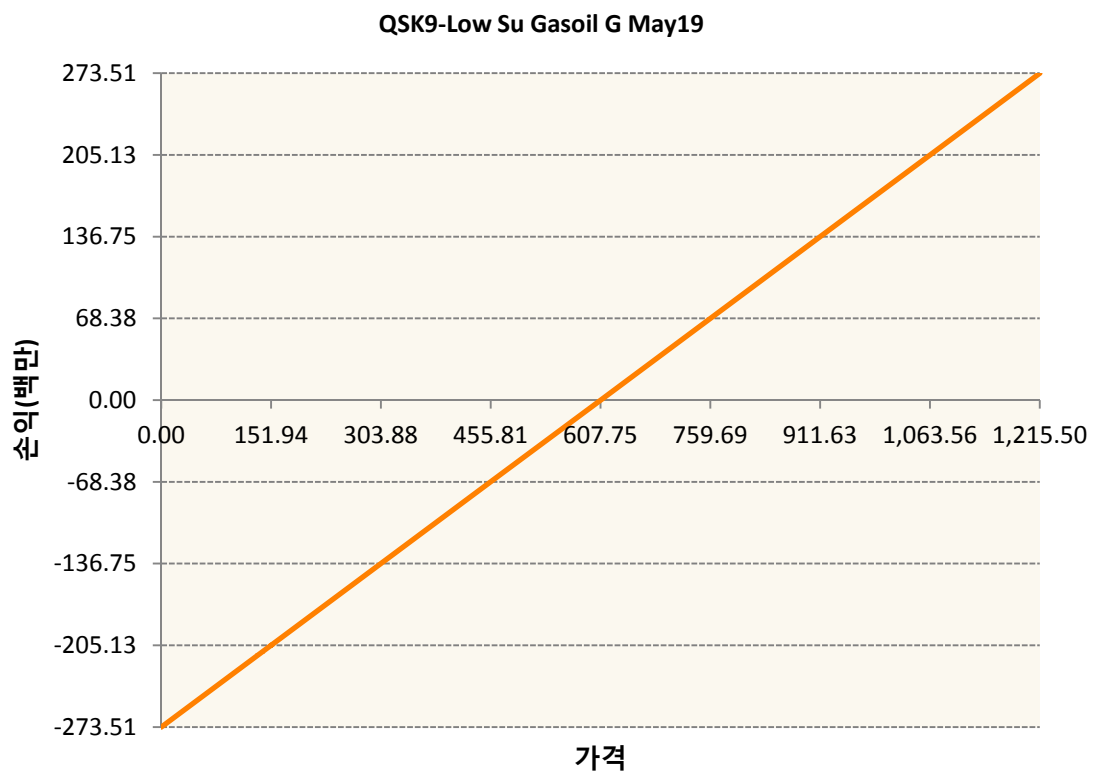
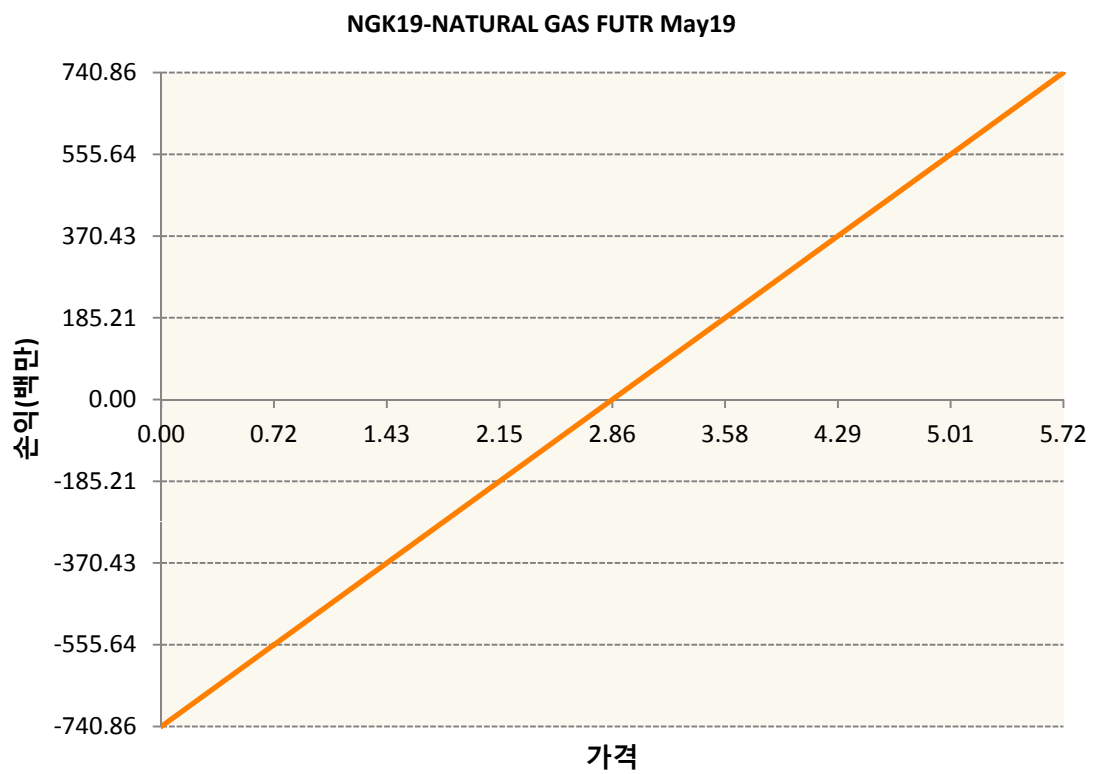
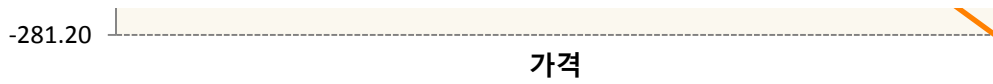


HOK9-NY Harb ULSD Fut May19

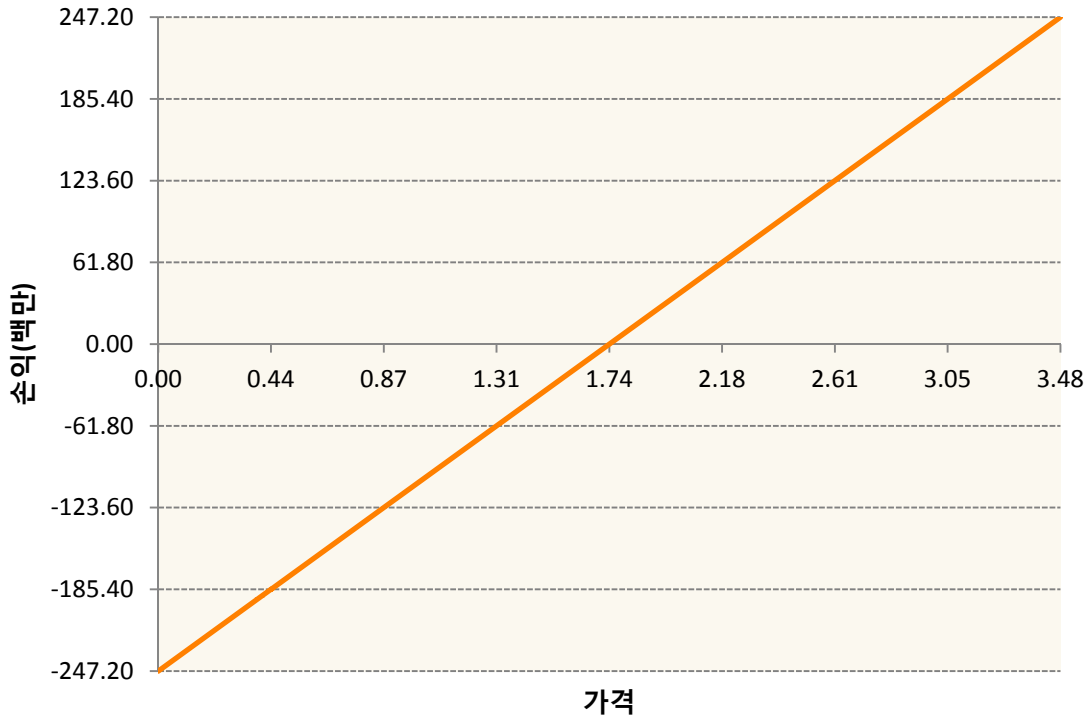


KR4175P30001-2019-03 달러선물





XBK9-GASOLINE RBOB FUT May19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

CLK9	WTI CRUDE FUTURE May19	51
COK9	BRENT CRUDE FUTR May19	58
HOK9	NY Harb ULSD Fut May19	15
KR4175P300	2019-03 달러선물	22
NGK19	NATURAL GAS FUTR May19	59
QSK9	Low Su Gasoil G May19	22
XBK9	GASOLINE RBOB FUT May19	20

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

(단위:백만원)

432

공시일	2019-03-05
기준일	2019-03-04

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

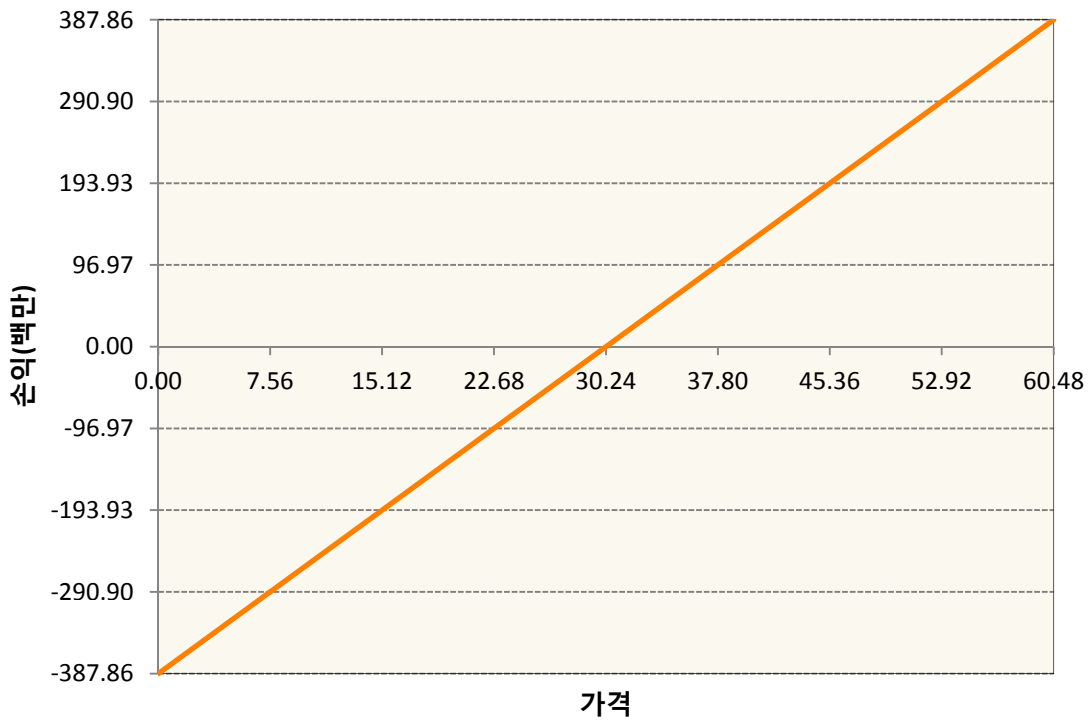
1. 계약금액

(단위:백만원)

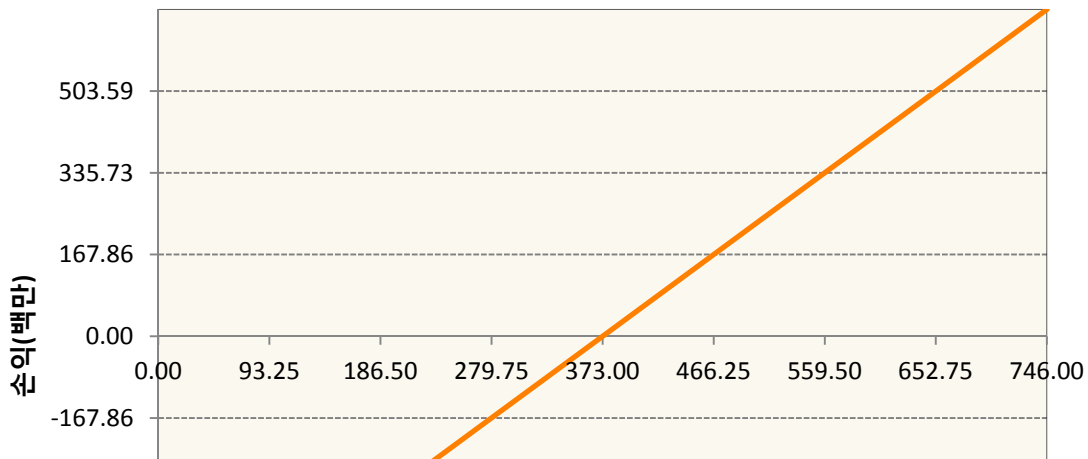
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,403	79	3,324	

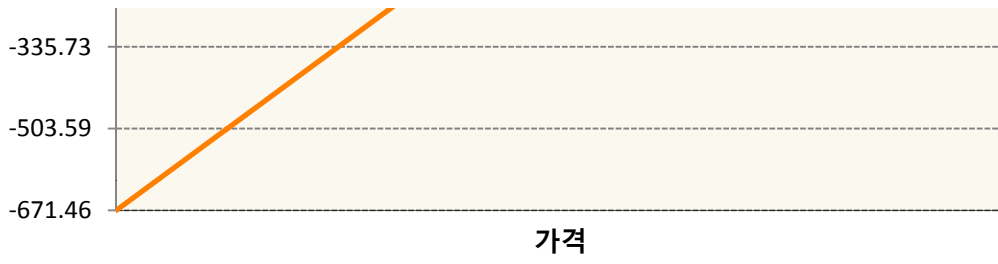
2. 만기시점의 손익구조

BOK9-SOYBEAN OIL FUTR May19

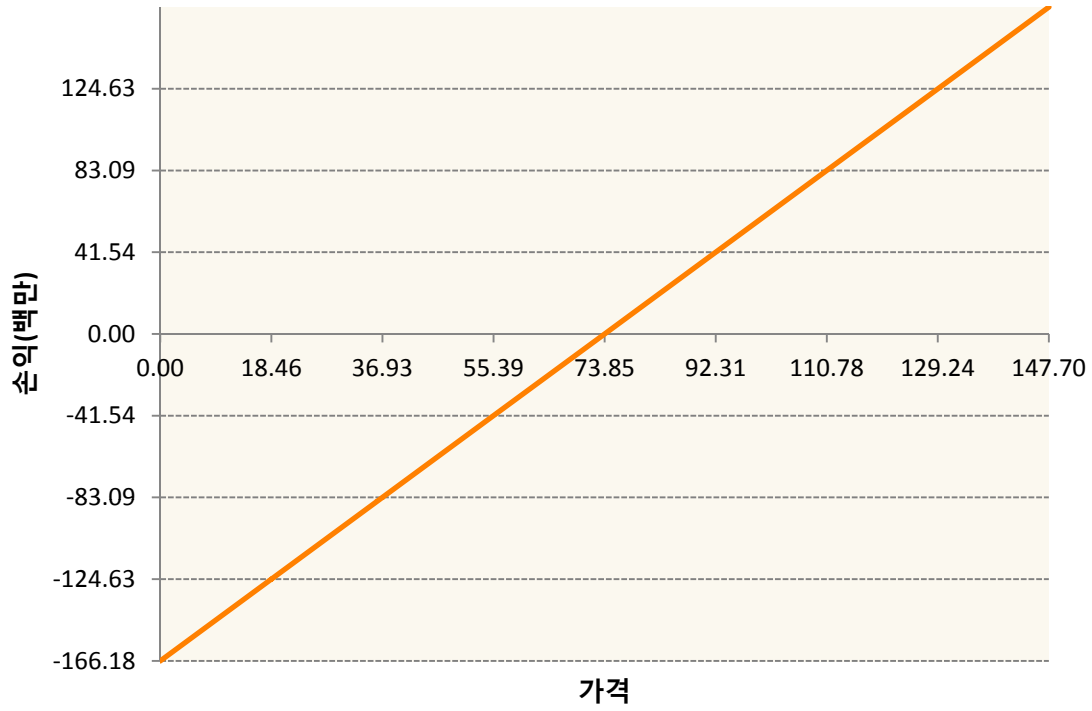


CK9-CORN FUTURE May19

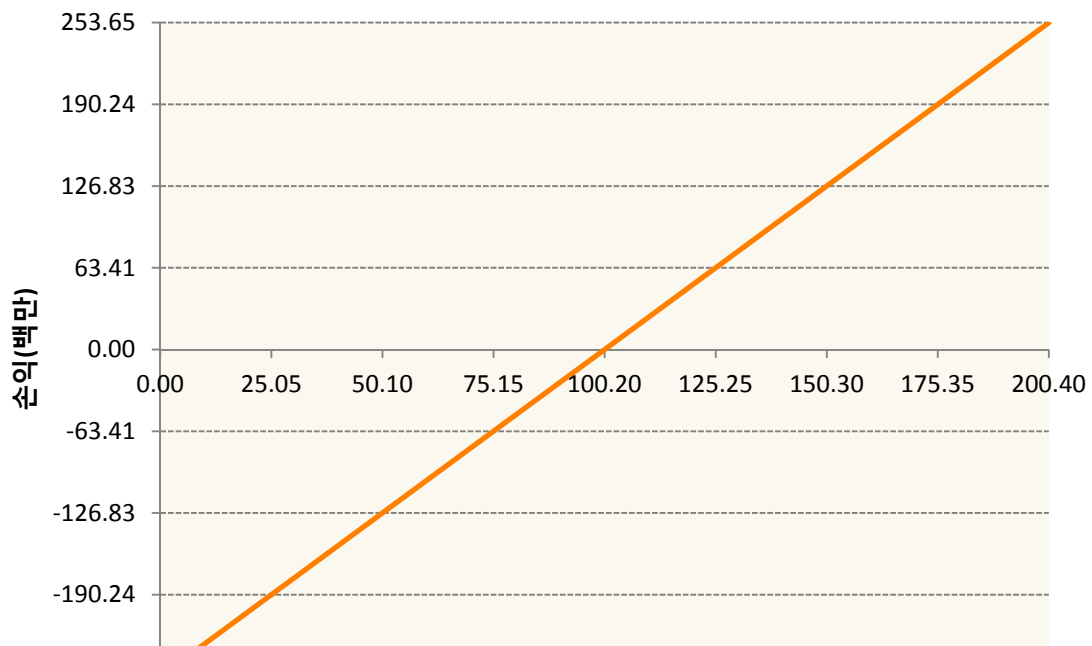


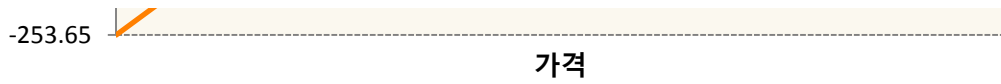


CTK9-COTTON NO.2 FUTR May19

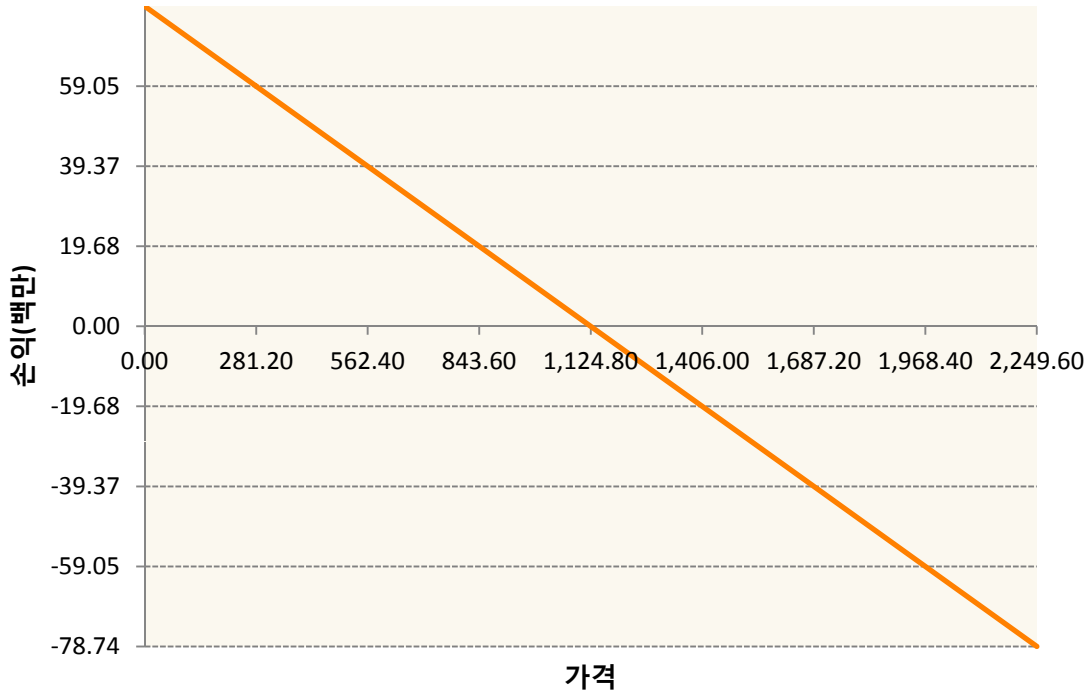


KCK9-COFFEE 'C' FUTURE May19

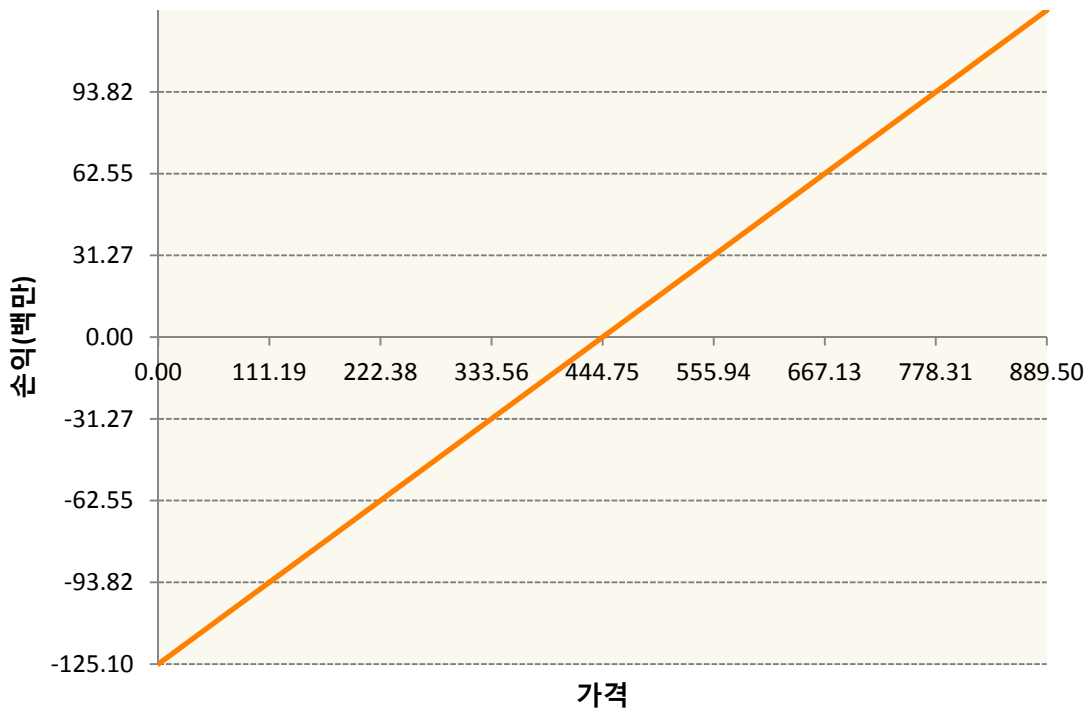




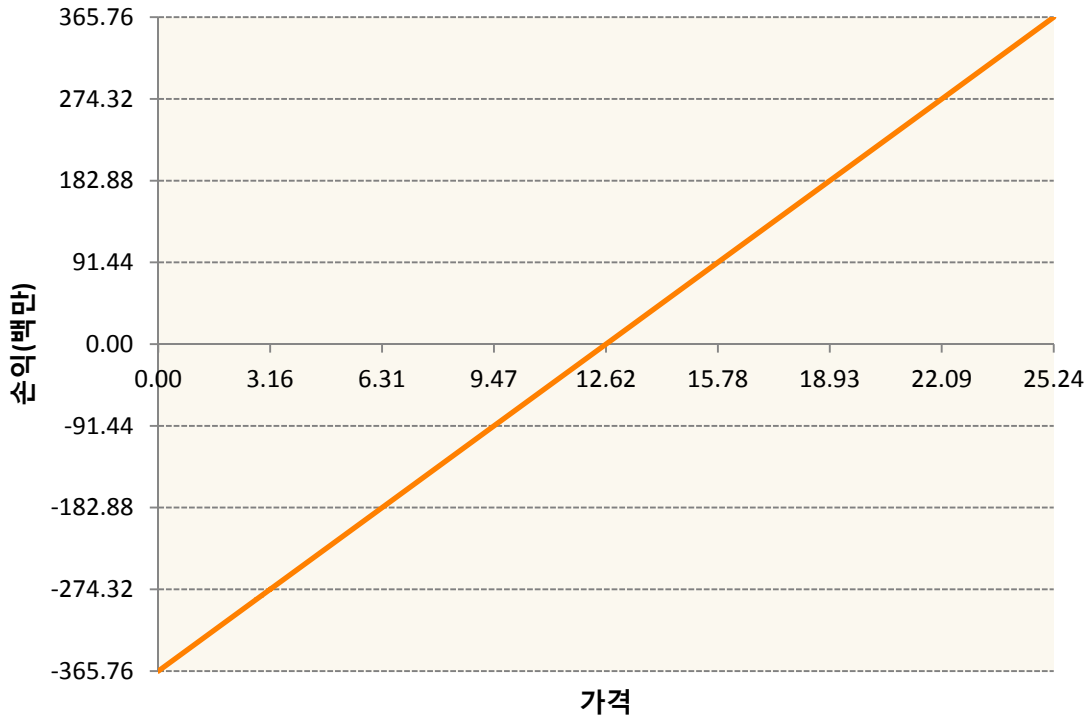
KR4175P30001-2019-03 달러선물



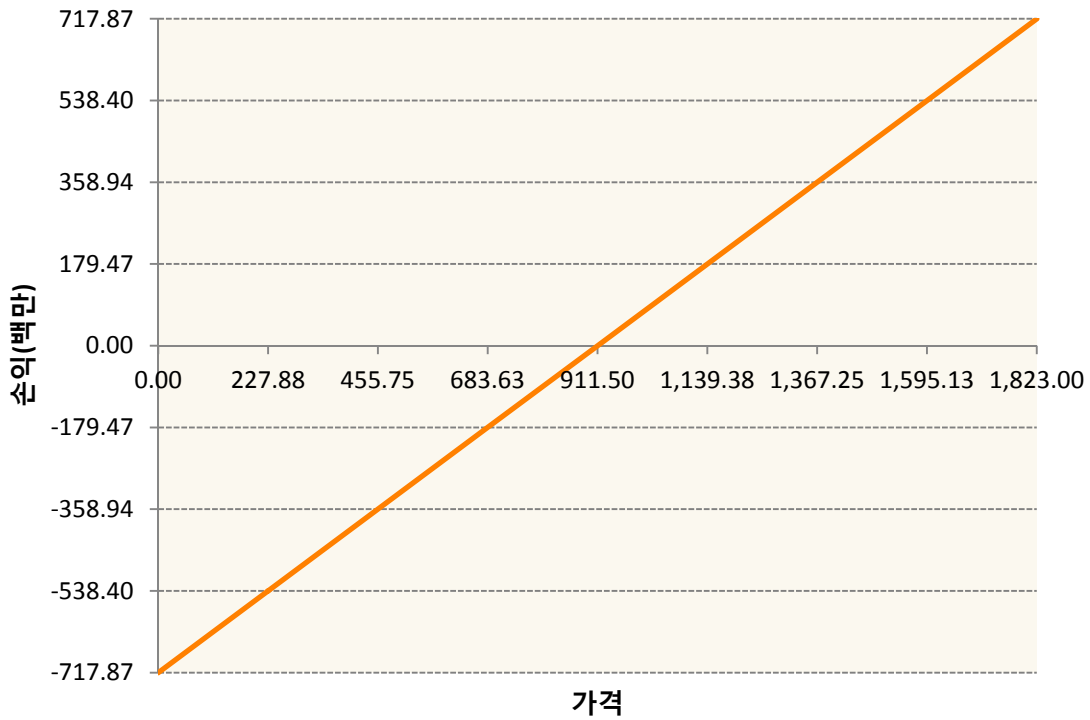
KWK9-KC HRW WHEAT FUT May19



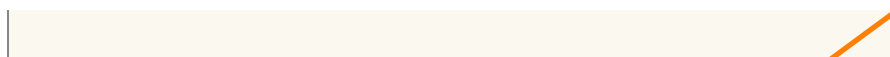
SBK9-SUGAR #11 (WORLD) May19

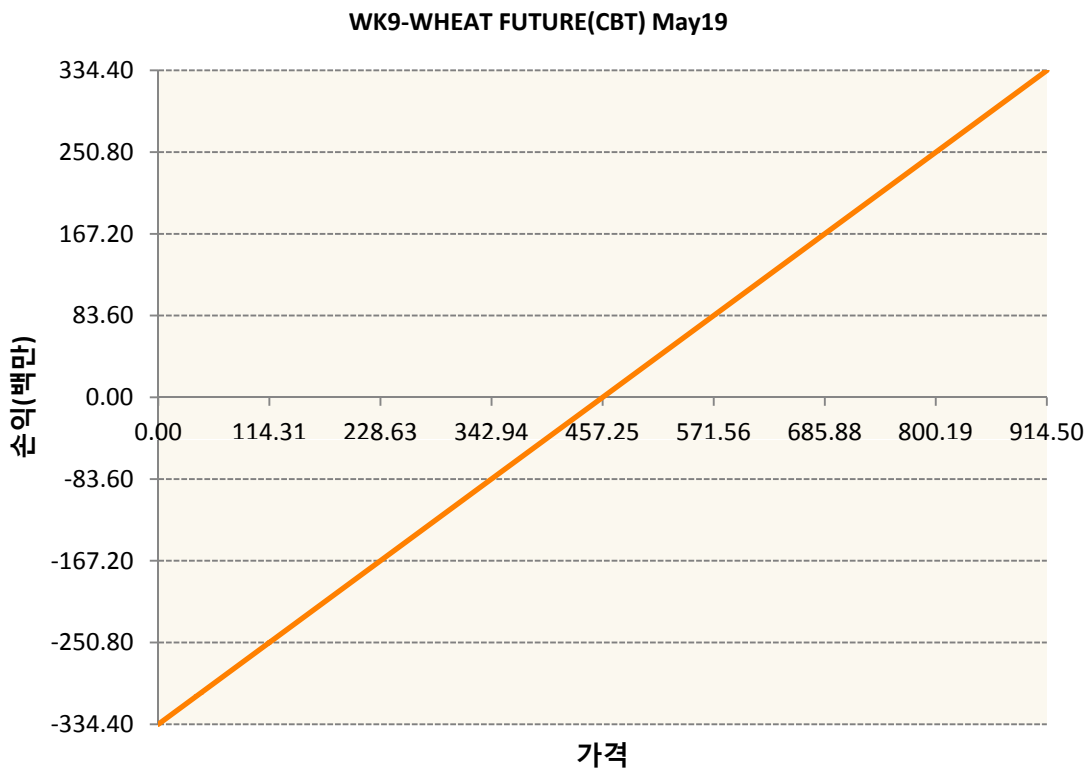
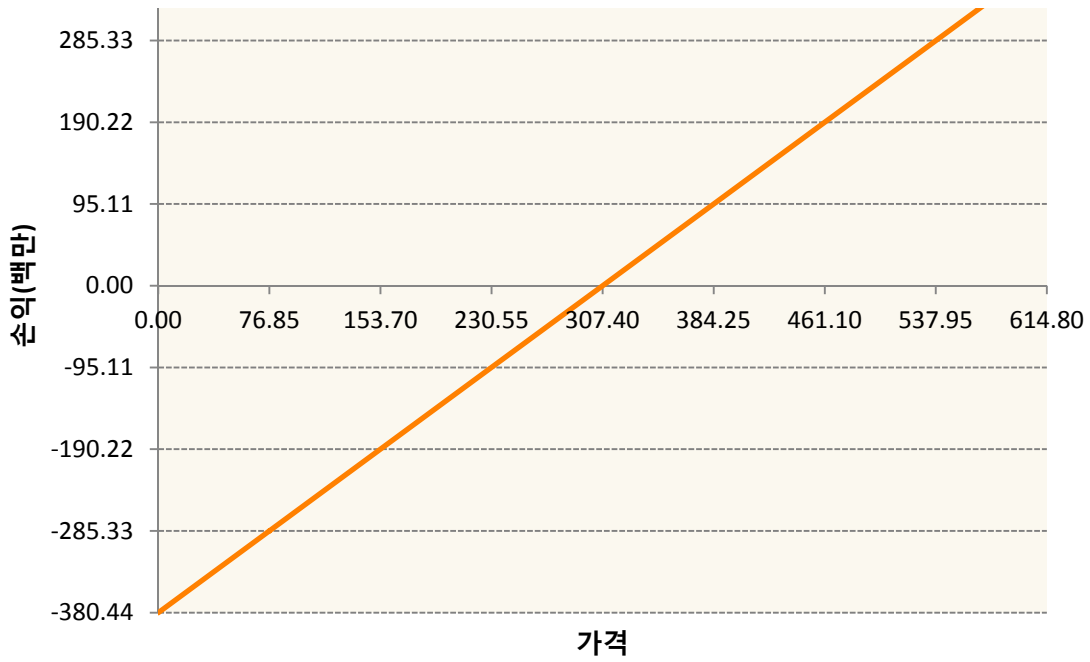


SK9-SOYBEAN FUTURE May19



SMK9-SOYBEAN MEAL FUTR May19





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	29
SK9	SOYBEAN FUTURE May19	57
SMK9	SOYBEAN MEAL FUTR May19	30
WK9	WHEAT FUTURE(CBT) May19	27

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

(단위:백만원)

271