

공시일	2019-03-06
기준일	2019-03-05

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)

96

공시일	2019-03-06
기준일	2019-03-05

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

1,116

* 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	2019-03-06
기준일	2019-03-05

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	331
SWCSI50000 신한CSI500미래S190129	99

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

652

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-03-06
기준일	2019-03-05

유로인덱스모(주식-파생형)

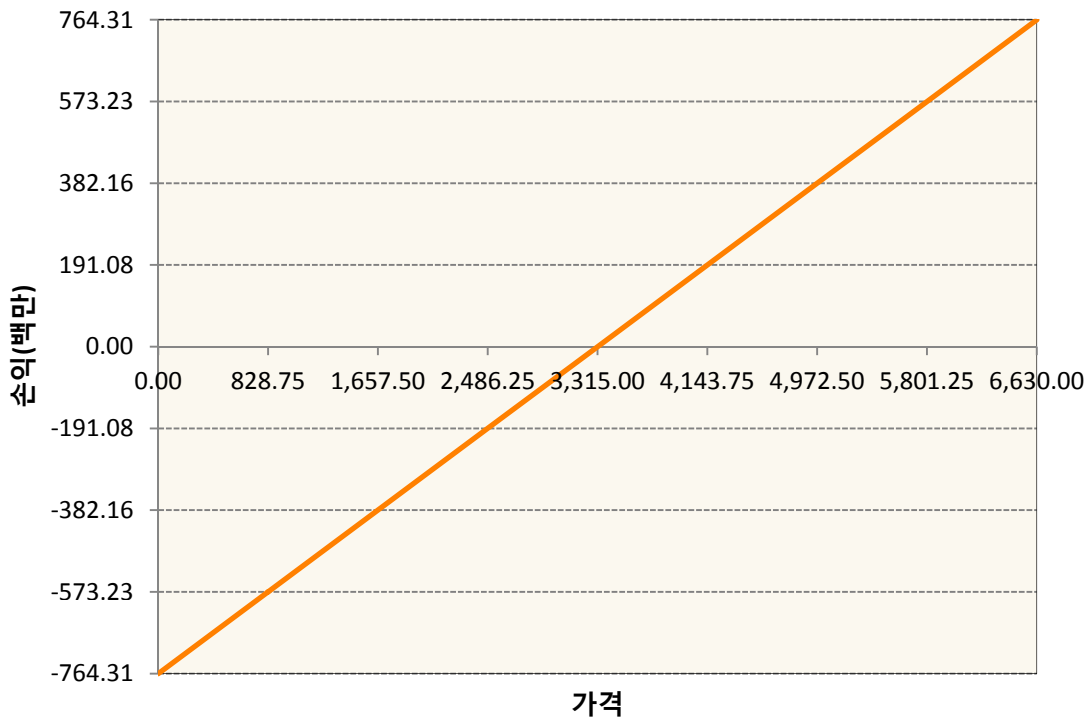
1. 계약금액

(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	2019-03-06
기준일	2019-03-05

차이나인덱스모(주식-파생형)

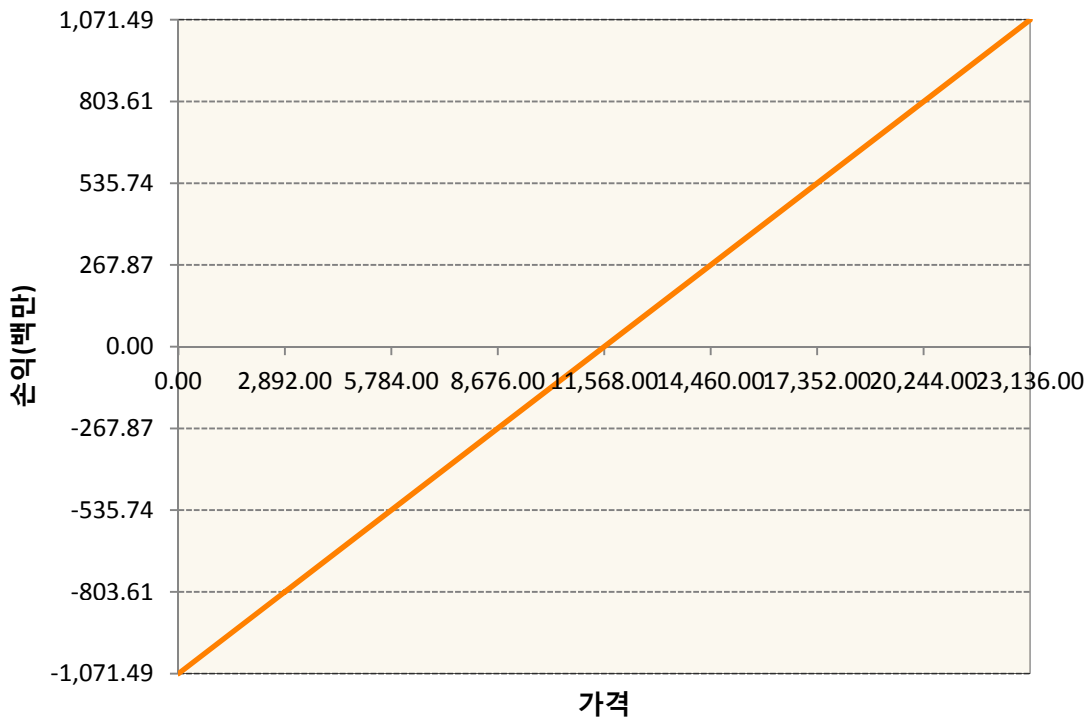
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,071	0	1,071	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	2019-03-06
기준일	2019-03-05

커버드콜모(주식혼합-파생형)

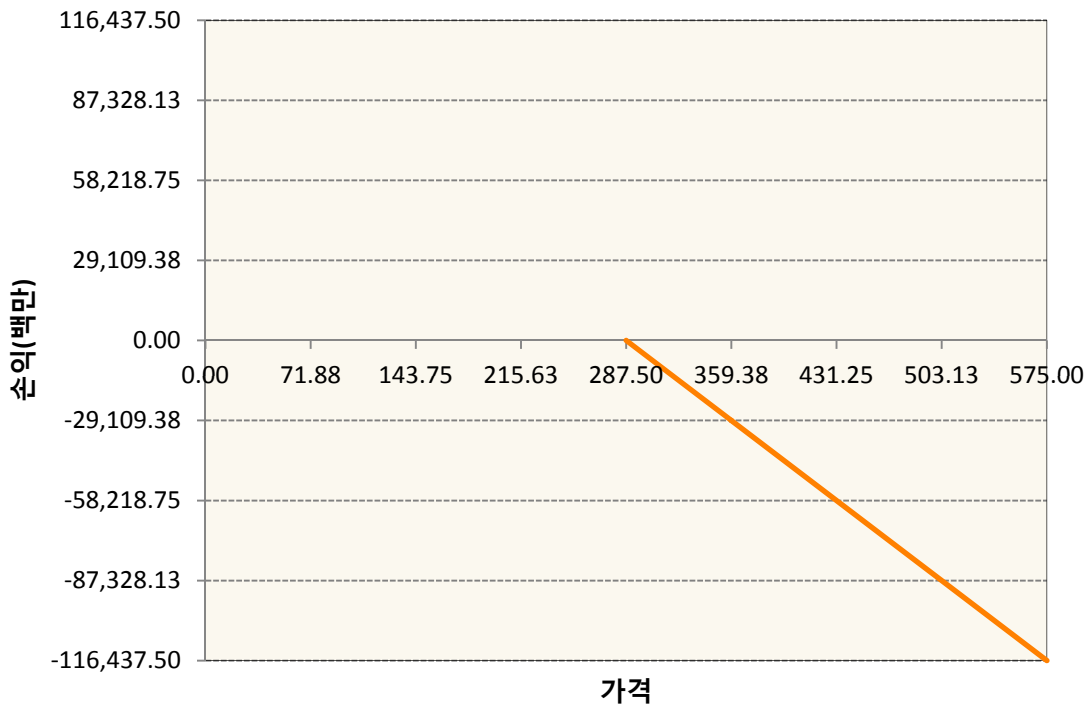
1. 계약금액

(단위:백만원)

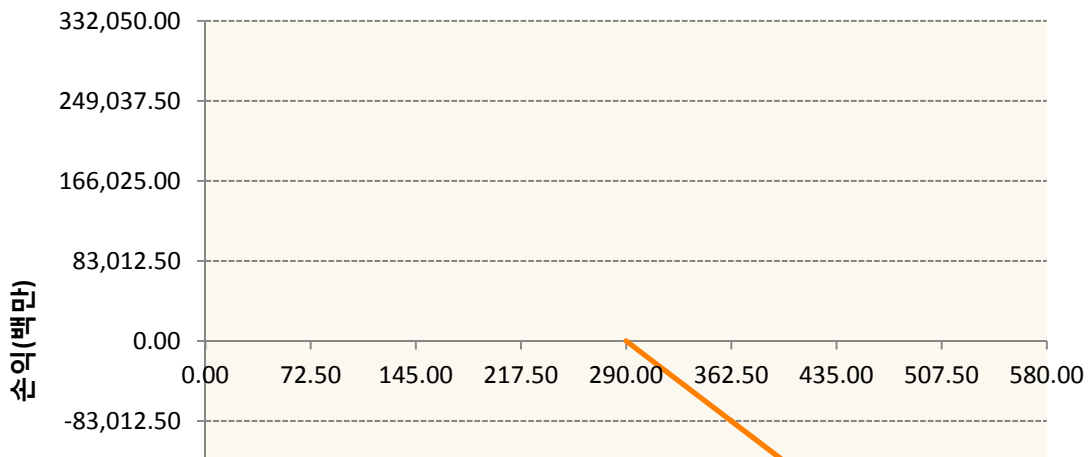
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	12,517	-12,517	장내
누계	유가증권	옵션	0	701,488	-701,488	장내

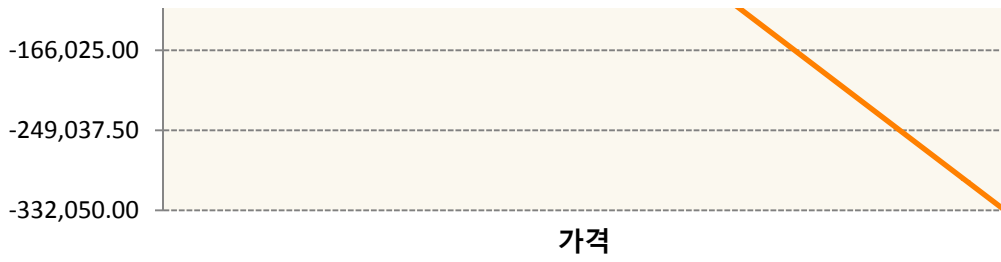
2. 만기시점의 손익구조

KR4201P32878-2019-03 콜287.5

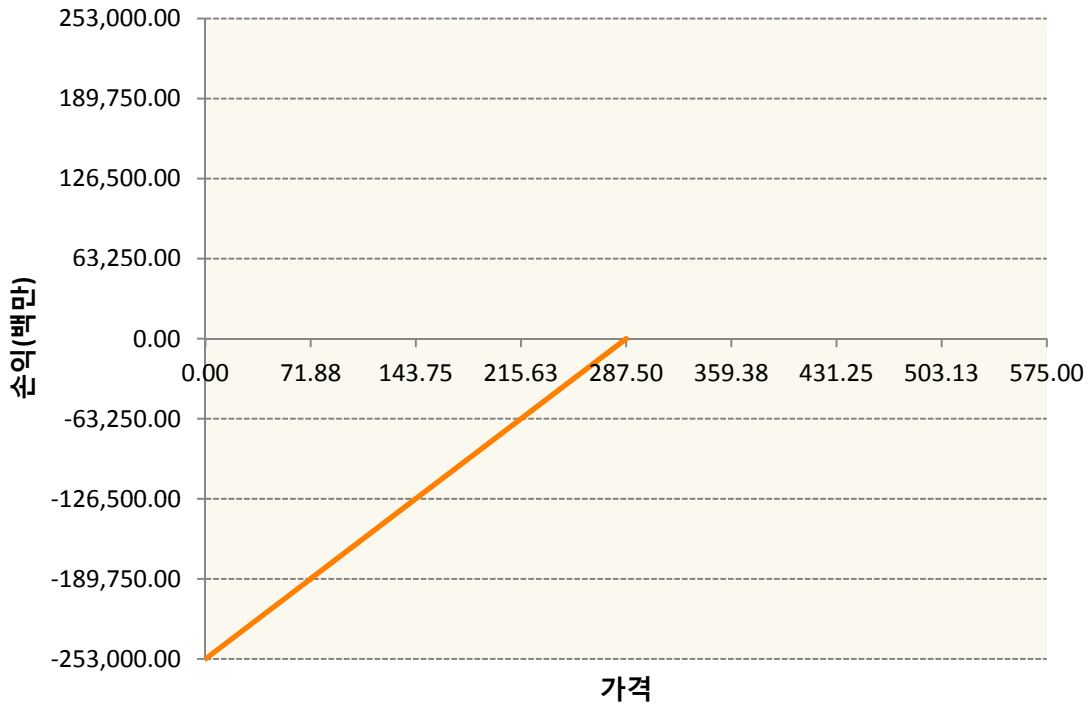


KR4201P32902-2019-03 콜290





KR4301P32876-2019-03 풋287.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201P32878		2019-03 콜287.5					5,925	
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	798	797	796	792	785	775	761	
-5.33%	793	785	771	751	723	687	644	
-2.67%	730	686	630	564	489	405	314	
0%	372	254	130	0	-134	-271	-410	
2.67%	-725	-885	-1,045	-1,205	-1,365	-1,525	-1,685	
5.33%	-2,777	-2,892	-3,015	-3,143	-3,277	-3,414	-3,554	
8.00%	-5,488	-5,534	-5,593	-5,662	-5,742	-5,829	-5,925	
KR4201P32902		2019-03 콜290					15,088	
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	1,588	1,587	1,585	1,579	1,569	1,550	1,522	

-5.33%	1,582	1,570	1,548	1,512	1,458	1,386	1,295
-2.67%	1,493	1,413	1,304	1,166	1,002	812	600
0%	870	605	313	0	-331	-677	-1,035
2.67%	-1,413	-1,857	-2,302	-2,749	-3,198	-3,647	-4,097
5.33%	-6,338	-6,732	-7,137	-7,550	-7,971	-8,397	-8,827
8.00%	-13,508	-13,702	-13,929	-14,185	-14,466	-14,768	-15,088
KR4301P32876 2019-03 풋287.5							19,312
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-19,311	-19,311	-19,311	-19,311	-19,311	-19,311	-19,312
-5.33%	-12,734	-12,734	-12,734	-12,734	-12,735	-12,737	-12,740
-2.67%	-6,158	-6,162	-6,169	-6,182	-6,201	-6,227	-6,262
0%	272	194	103	0	-114	-236	-367
2.67%	5,058	4,863	4,667	4,472	4,276	4,081	3,886
5.33%	6,534	6,466	6,384	6,289	6,182	6,066	5,941
8.00%	6,649	6,645	6,638	6,624	6,604	6,576	6,540

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

(단위:백만원)

42,071

공시일	2019-03-06
기준일	2019-03-05

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

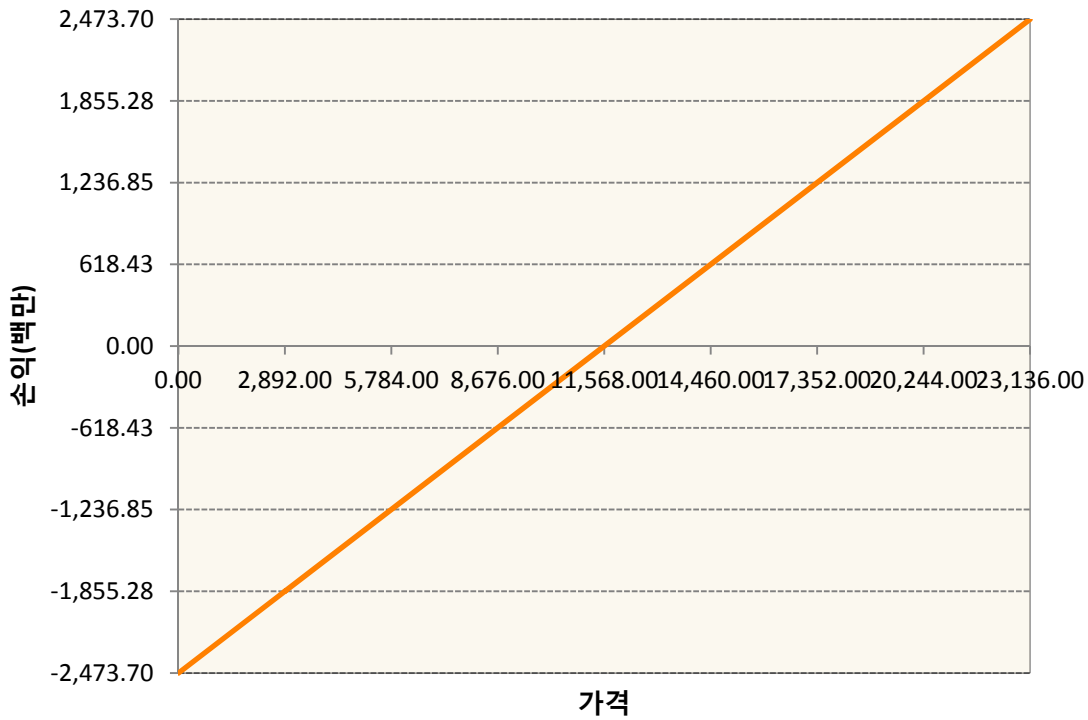
1. 계약금액

(단위:백만원)

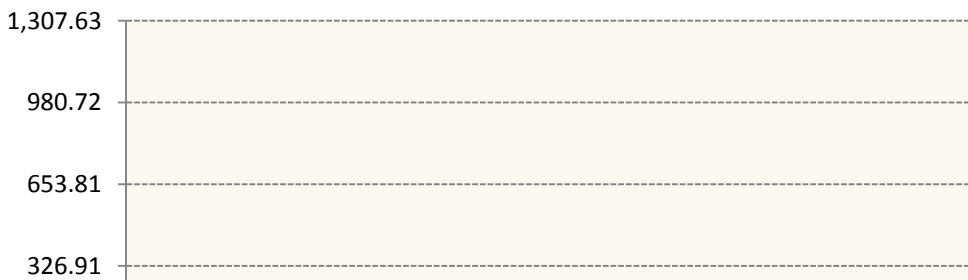
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	2,474	0	2,474	장내
누계	유가증권	옵션	0	6,243	-6,243	장내
누계	통화	선도	0	2,724	-2,724	장외

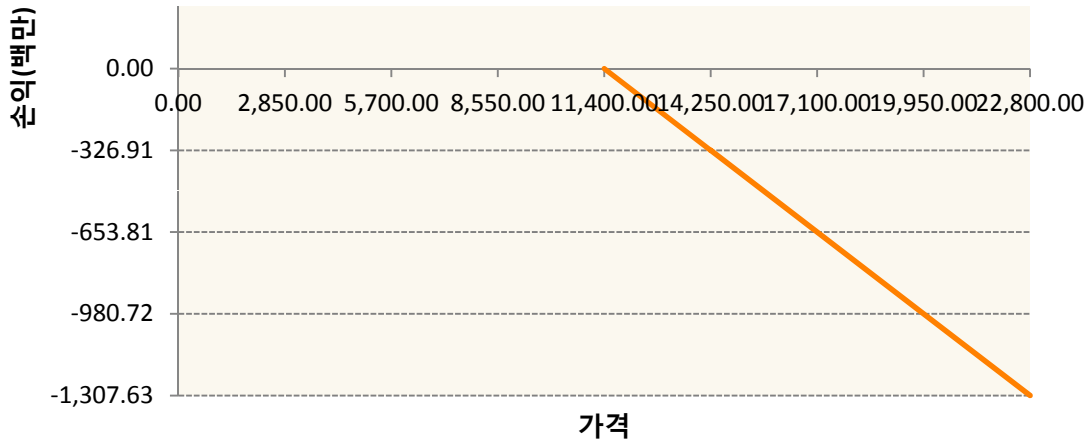
2. 만기시점의 손익구조

HCH9-HSCEI Futures Mar19

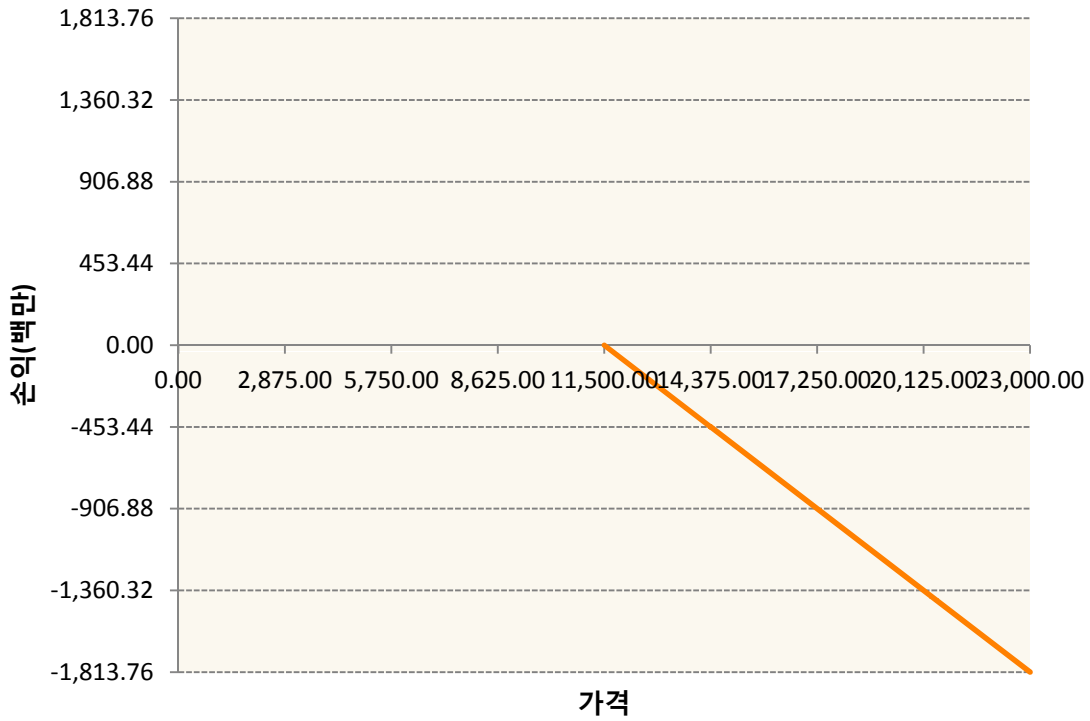


OHHIH9-C114-HSCEI

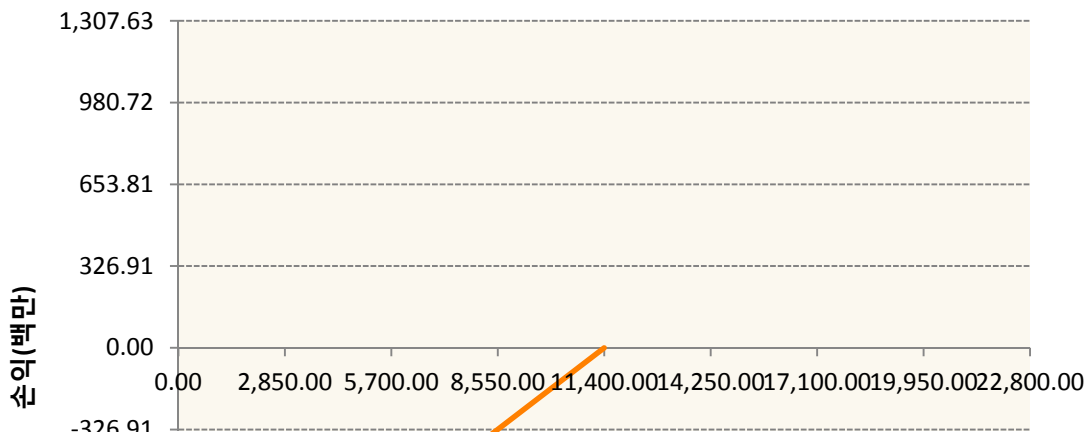


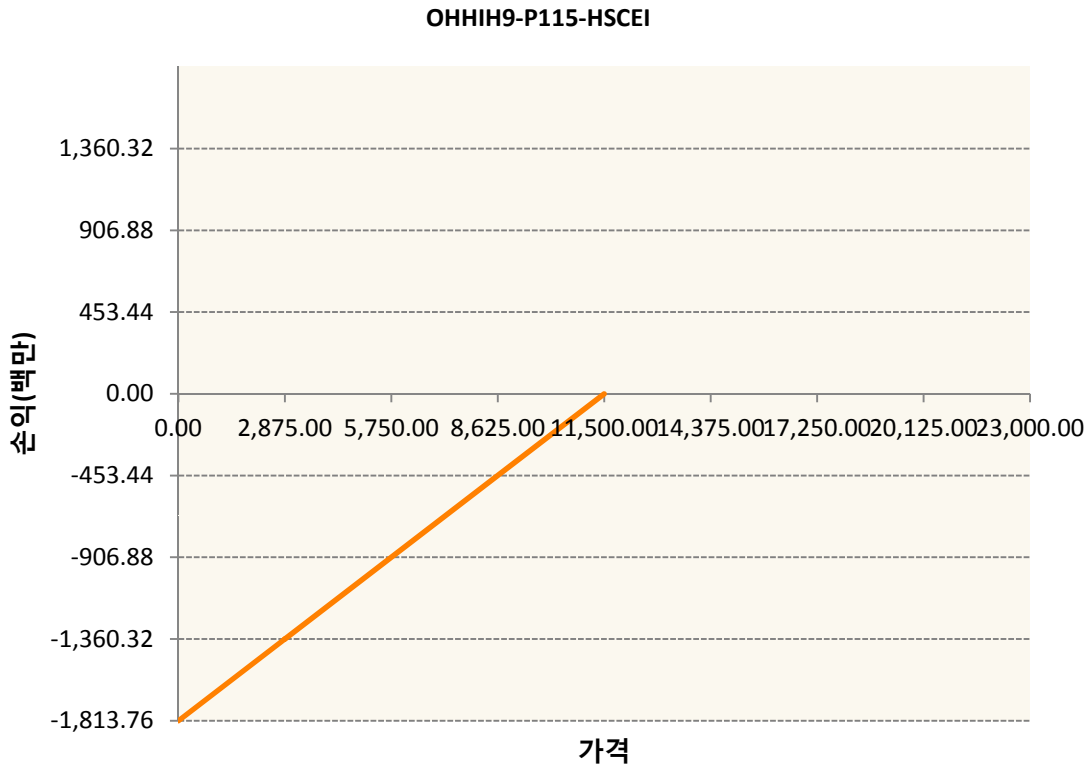


OHHIH9-C115-HSCEI



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-P11HSCEI	105
OHHIH9-P11HSCEI	145

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

794

공시일	2019-03-06
기준일	2019-03-05

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

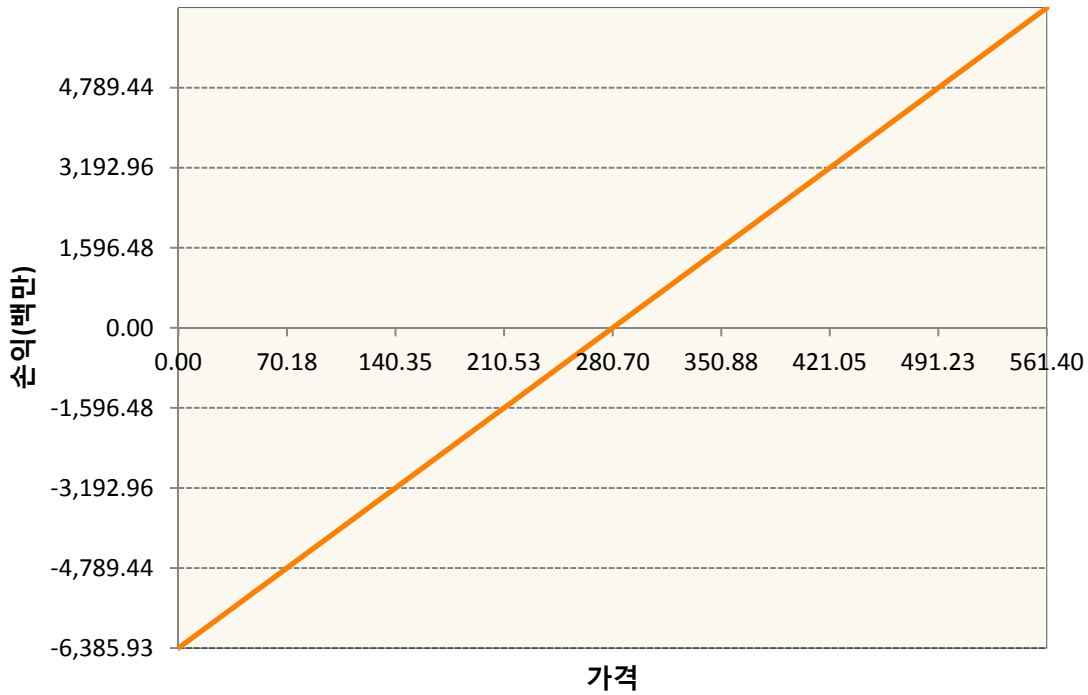
1. 계약금액

(단위:백만원)

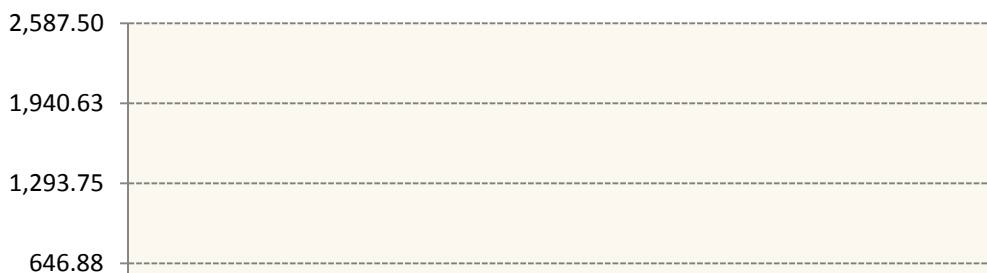
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	2,107	0	2,107	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	7,327	-7,327	장내
누계	유가증권	선물	6,386	0	6,386	장내
누계	유가증권	스왑	28,836	0	28,836	장외
누계	유가증권	옵션	0	36,139	-36,139	장내

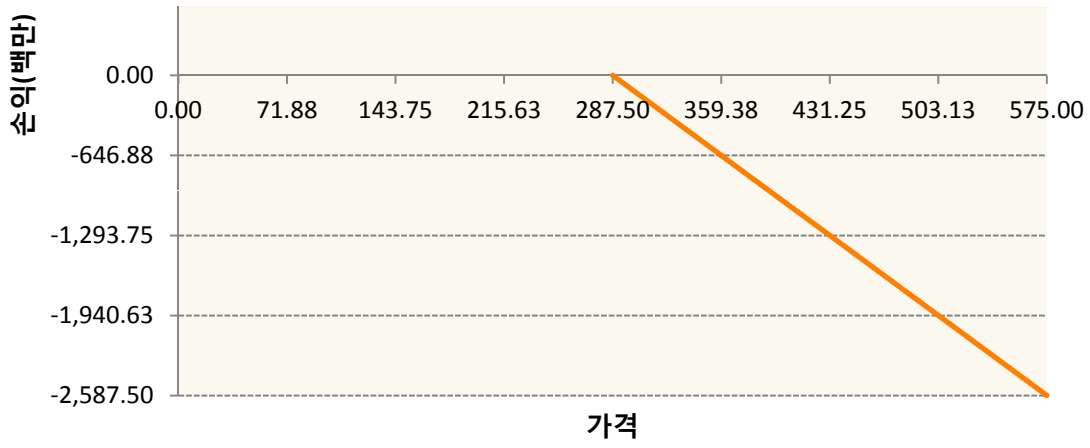
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P30007-2019-03 코스피200지수선물

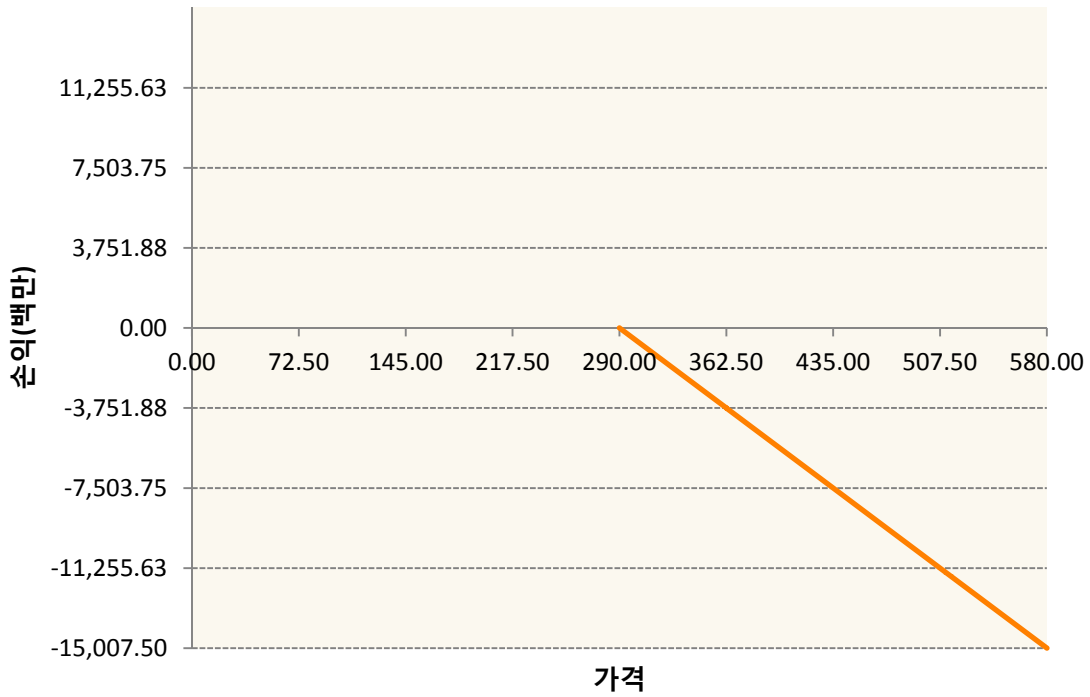


KR4201P32878-2019-03 콜287.5

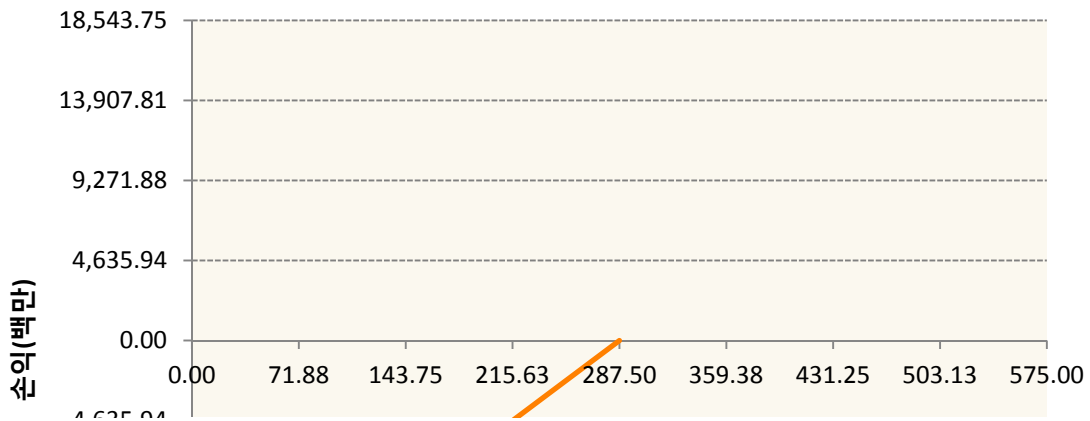


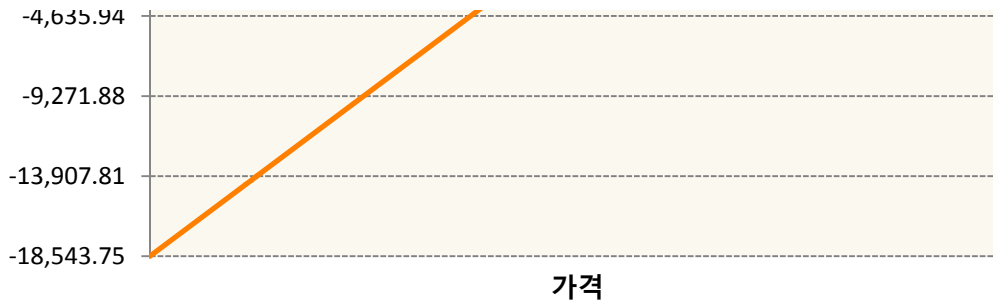


KR4201P32902-2019-03 콜290



KR4301P32876-2019-03 풋287.5





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11		UBCSFXC1 INDEX_14					2,420	
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-2,420	-2,420	-2,420	-2,420	-2,420	-2,420	-2,420	
-5.33%	-1,613	-1,613	-1,613	-1,613	-1,613	-1,613	-1,613	
-2.67%	-807	-807	-807	-807	-807	-807	-807	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	807	807	807	807	807	807	807	
5.33%	1,613	1,613	1,613	1,613	1,613	1,613	1,613	
8.00%	2,420	2,420	2,420	2,420	2,420	2,420	2,420	
KR4101P30007		2019-03 코스피200지수선물					510	
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-510	-510	-510	-510	-510	-510	-510	
-5.33%	-340	-340	-340	-340	-340	-340	-340	
-2.67%	-170	-170	-170	-170	-170	-170	-170	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	170	170	170	170	170	170	170	
5.33%	340	340	340	340	340	340	340	
8.00%	510	510	510	510	510	510	510	
KR4201P32878		2019-03 콜287.5					132	
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	18	18	18	18	17	17	17	
-5.33%	18	17	17	17	16	15	14	
-2.67%	16	15	14	13	11	9	7	
0%	8	6	3	0	-3	-6	-9	
2.67%	-16	-20	-23	-27	-30	-34	-37	
5.33%	-62	-64	-67	-70	-73	-76	-79	
8.00%	-122	-123	-124	-126	-128	-130	-132	
KR4201P32902		2019-03 콜290					682	
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	

-8.00%	72	72	72	71	71	70	69
-5.33%	72	71	70	68	66	63	59
-2.67%	67	64	59	53	45	37	27
0%	39	27	14	0	-15	-31	-47
2.67%	-64	-84	-104	-124	-145	-165	-185
5.33%	-286	-304	-323	-341	-360	-380	-399
8.00%	-610	-619	-630	-641	-654	-667	-682
KR4301P32876 2019-03 풋287.5							1,415
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,415	-1,415	-1,415	-1,415	-1,415	-1,415	-1,415
-5.33%	-933	-933	-933	-933	-933	-934	-934
-2.67%	-451	-452	-452	-453	-454	-456	-459
0%	20	14	8	0	-8	-17	-27
2.67%	371	356	342	328	313	299	285
5.33%	479	474	468	461	453	445	435
8.00%	487	487	487	486	484	482	479

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

(단위:백만원)

5,291

공시일	2019-03-06
기준일	2019-03-05

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

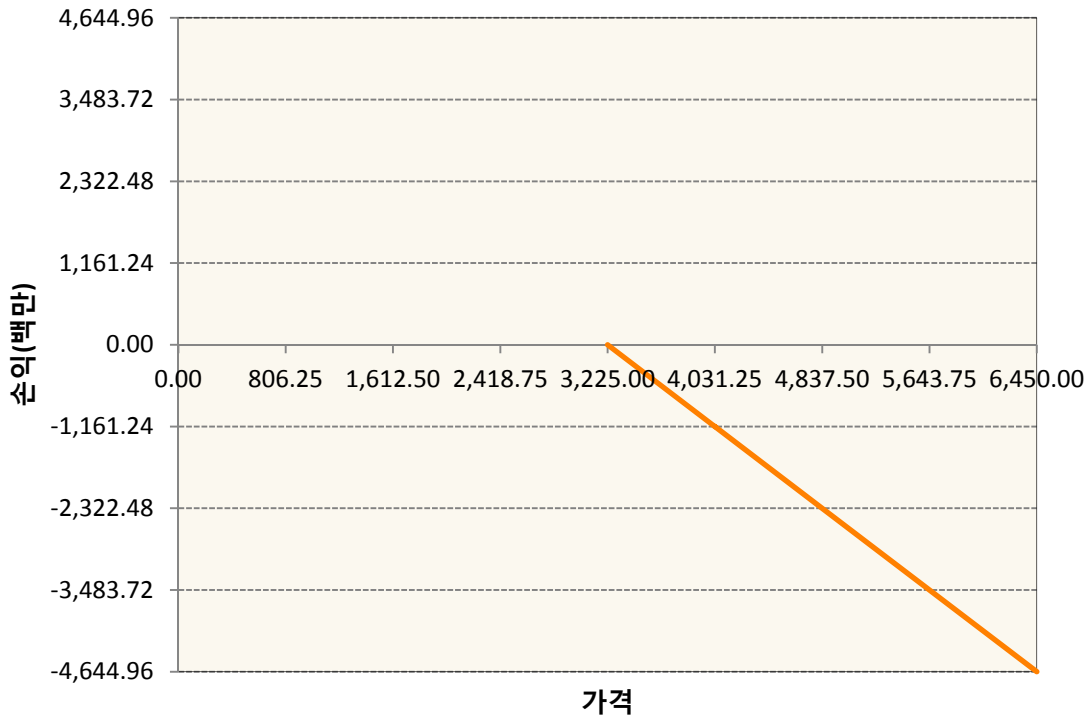
1. 계약금액

(단위:백만원)

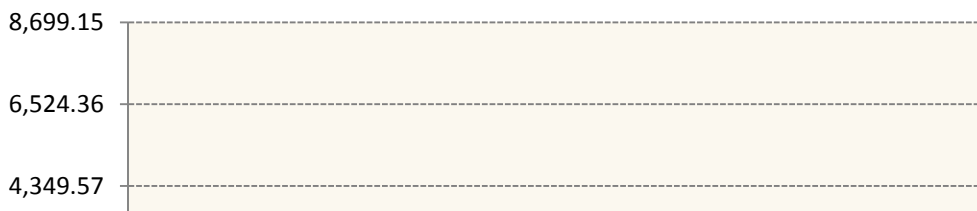
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	7,173	0	7,173	
누계	유가증권	스왑	60,174	0	60,174	장외
누계	유가증권	옵션	0	26,688	-26,688	장내
누계	통화	선도	0	15,295	-15,295	장외

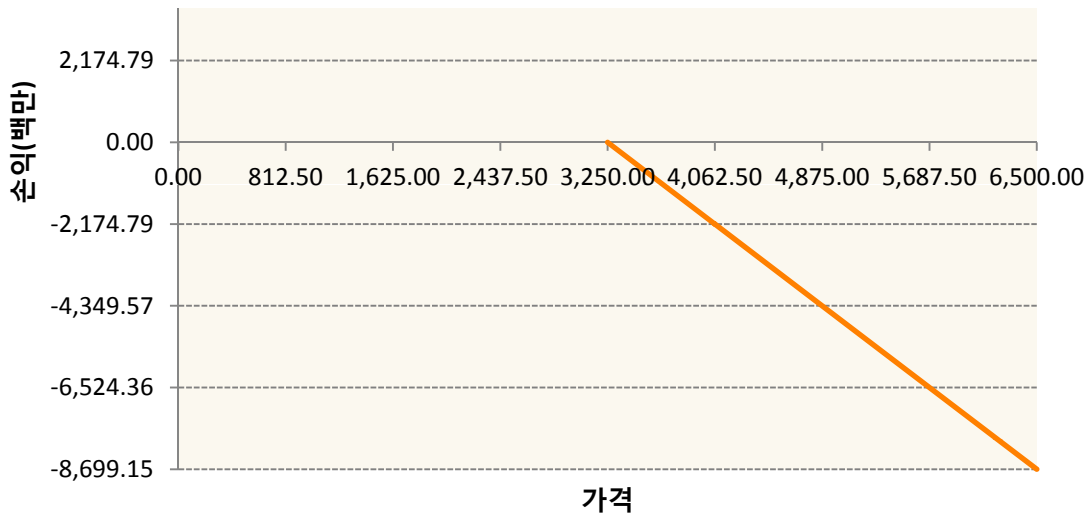
2. 만기시점의 손익구조

OESXH9-C3225-EURO STOXX 50

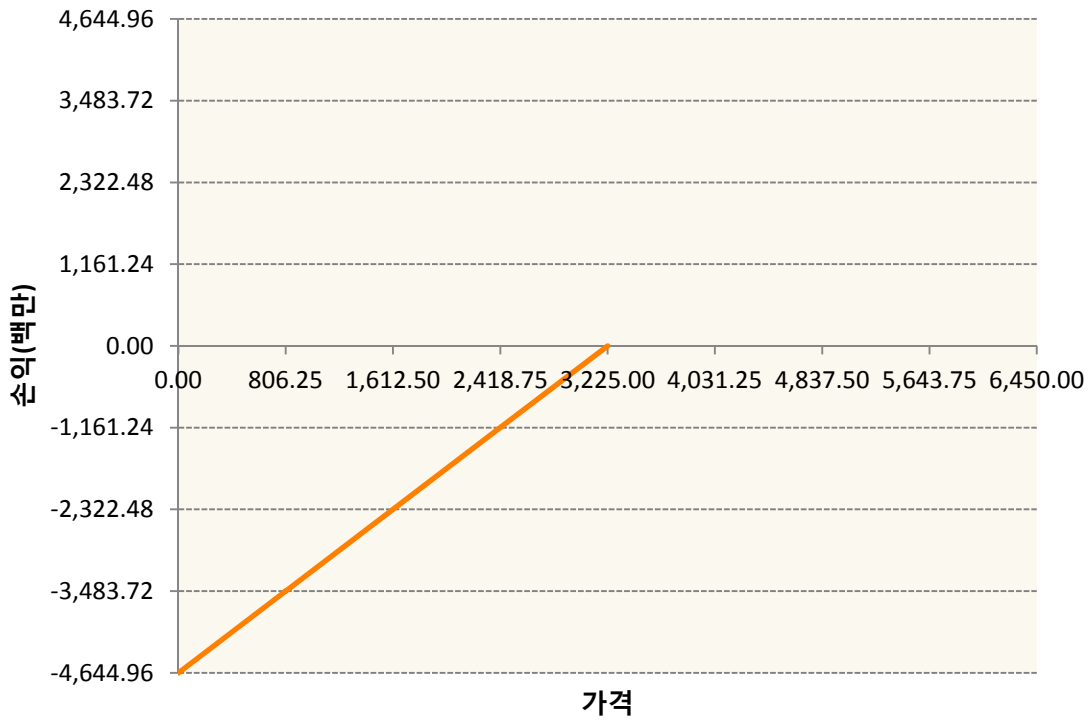


OESXH9-C3250-EURO STOXX 50

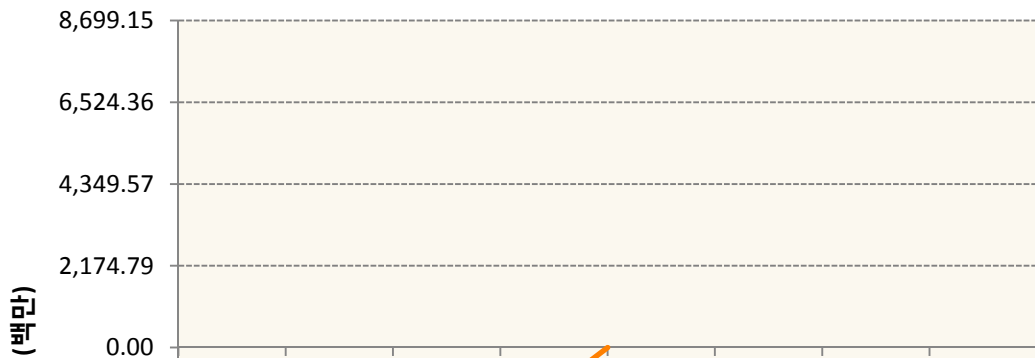


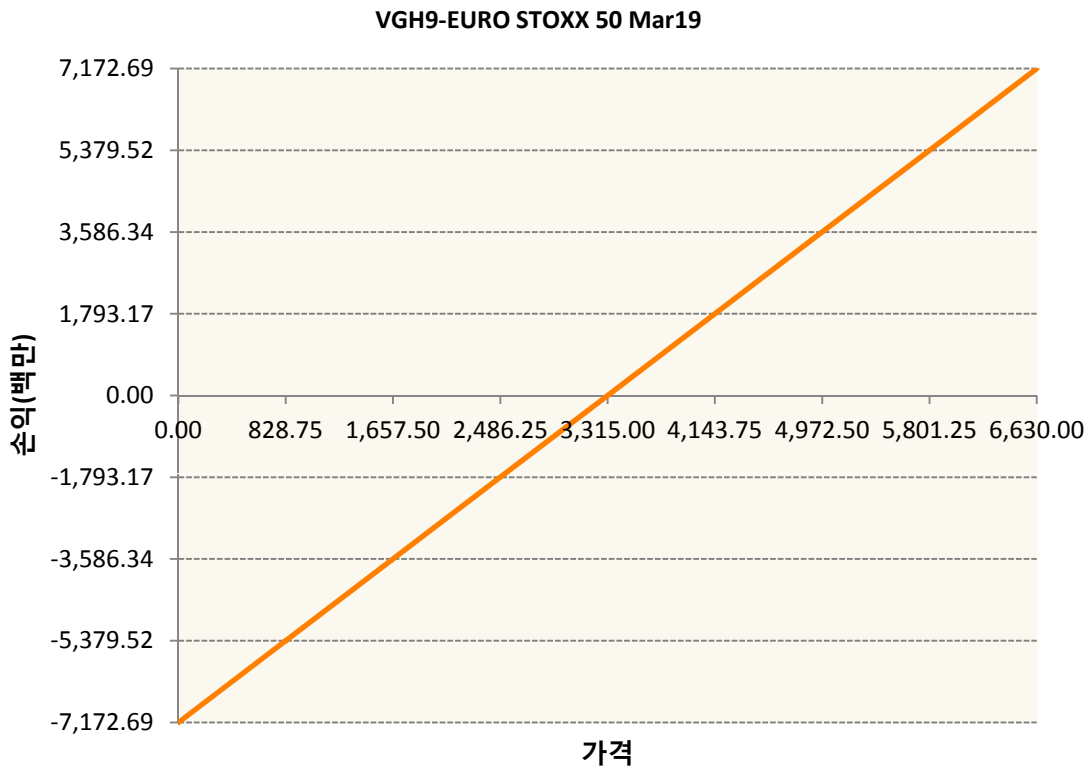
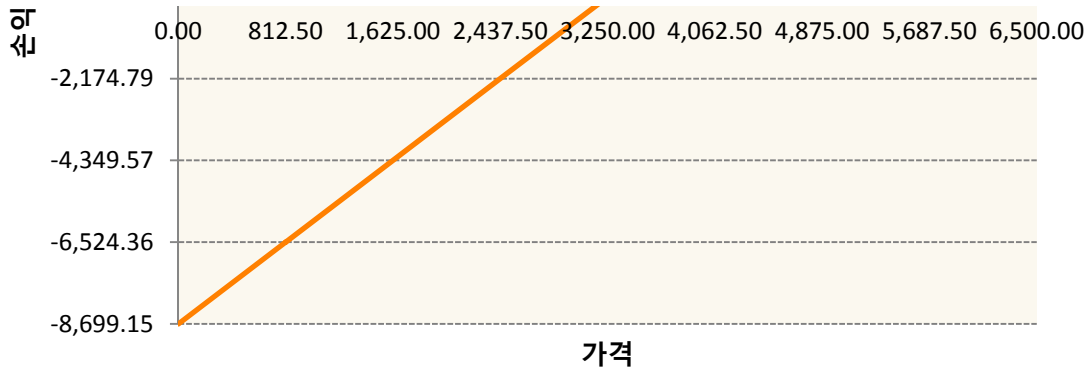


OESXH9-P3225-EURO STOXX 50



OESXH9-P3250-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY		127
FX21018Z03 KRW/EUR 22-03-19E		816
FX21019G02 KRW/EUR 24-05-19E		408
OESXH9-C32 EURO STOXX 50		372
OESXH9-C32 EURO STOXX 50		696
OESXH9-P32 EURO STOXX 50		372
OESXH9-P32 EURO STOXX 50		696
VGH9 EURO STOXX 50 Mar19		574

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

(단위:백만원)

2,679

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

(단위:백만원)

1,125

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

(단위:백만원)

96

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

(단위:백만원)

139

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

(단위:백만원)

43

공시일	2019-03-06
기준일	2019-03-05

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

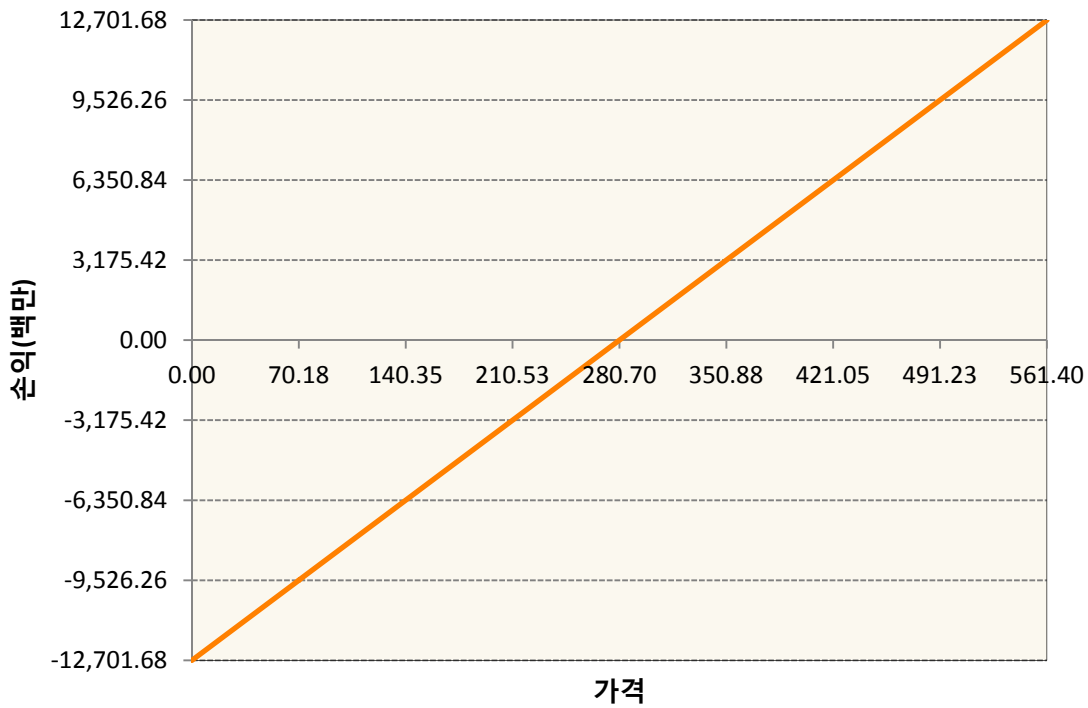
1. 계약금액

(단위:백만원)

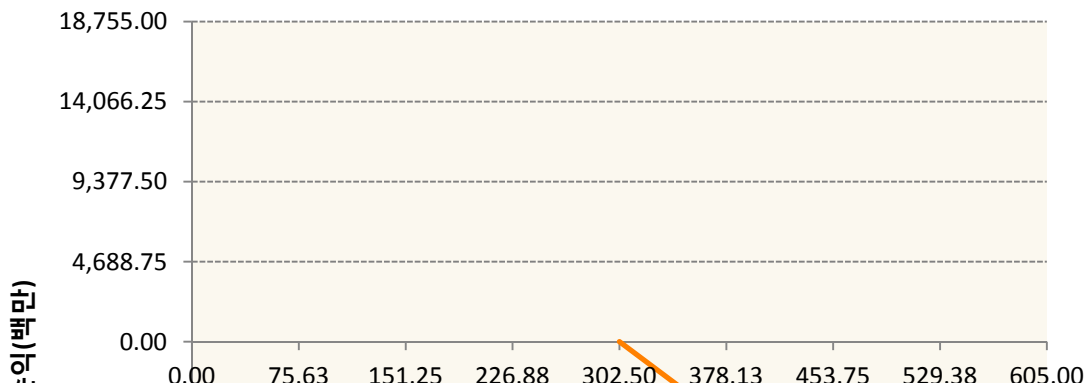
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	12,702	0	12,702	장내
누계	유가증권	옵션	2,165	24,931	-22,766	장내

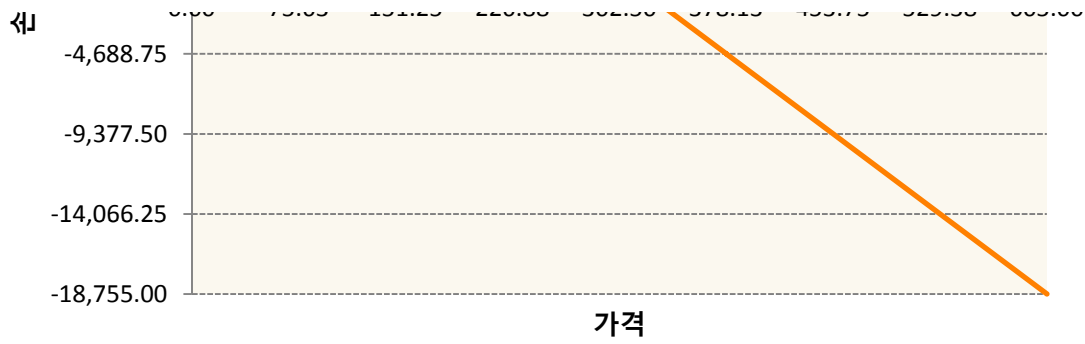
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P30007-2019-03 코스피200지수선물

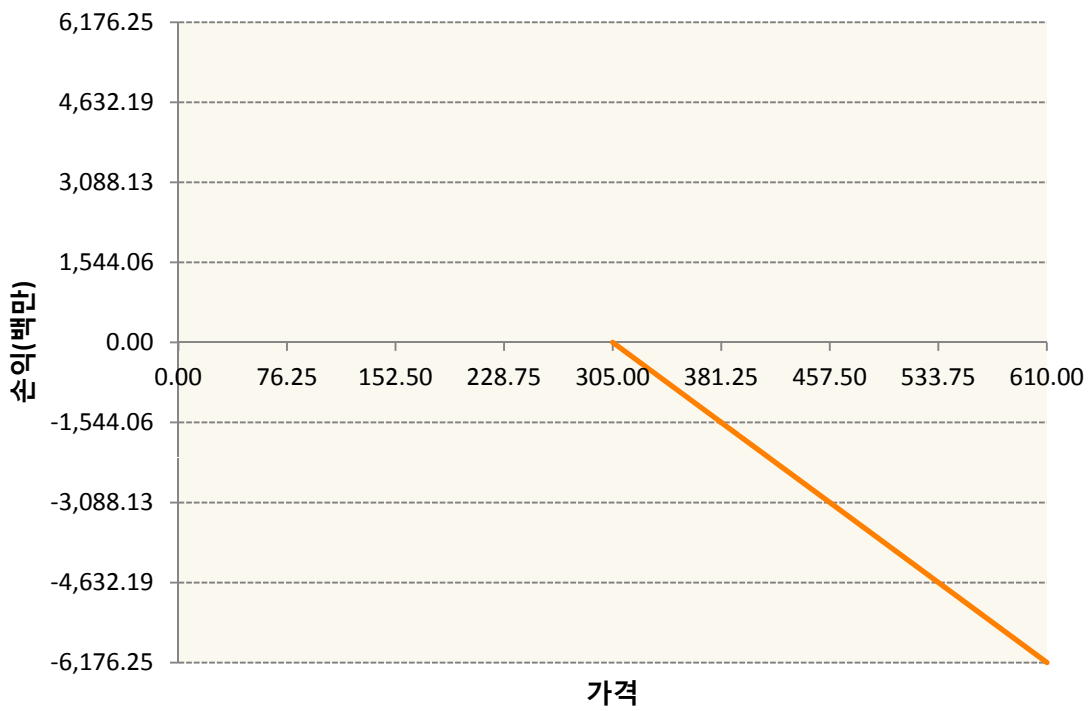


KR4201P33025-2019-03 콜302.5

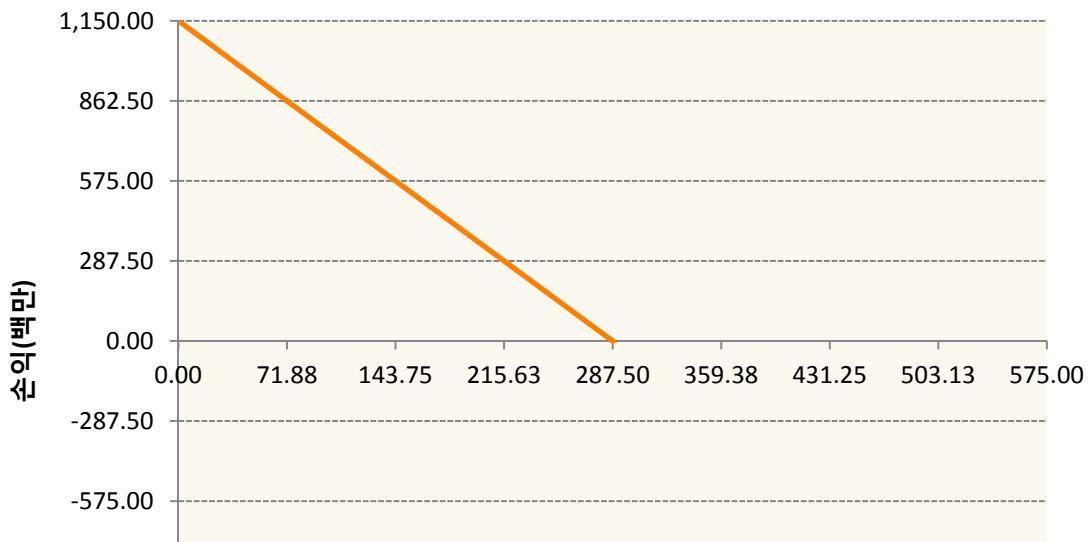


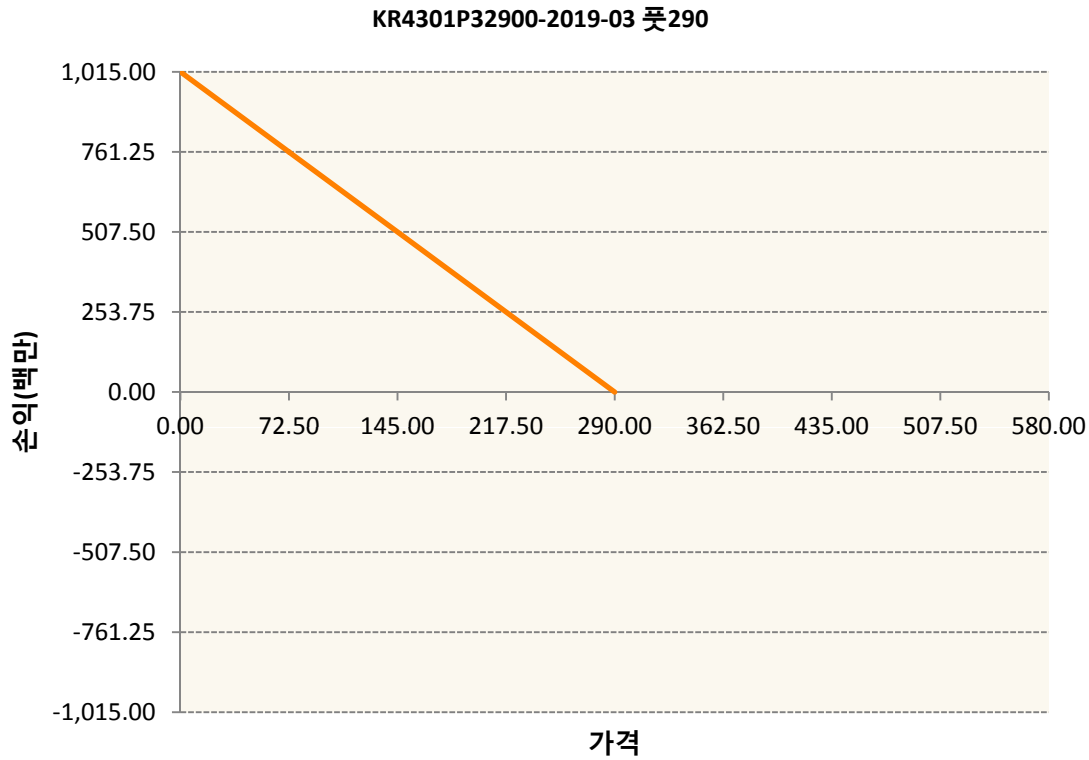
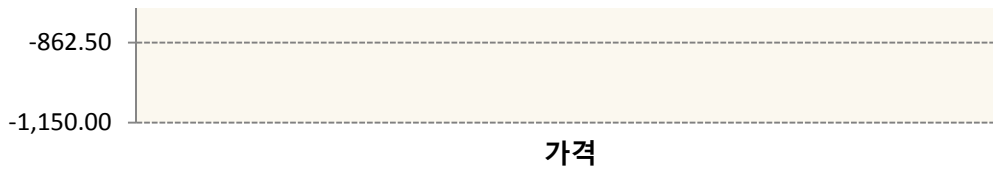


KR4201P33058-2019-03 콜305



KR4301P32876-2019-03 풋287.5





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101P30007		2019-03 코스피200지수선물						1,015
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-1,015	-1,015	-1,015	-1,015	-1,015	-1,015	-1,015	
-5.33%	-677	-677	-677	-677	-677	-677	-677	
-2.67%	-338	-338	-338	-338	-338	-338	-338	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	338	338	338	338	338	338	338	
5.33%	677	677	677	677	677	677	677	
8.00%	1,015	1,015	1,015	1,015	1,015	1,015	1,015	
KR4201P33025		2019-03 콜302.5						388
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	10	10	10	10	10	10	10	
-5.33%	10	10	10	10	9	9	8	
-2.67%	10	10	9	8	7	5	2	

0%	8	7	4	0	-5	-12	-20
2.67%	-4	-12	-21	-33	-46	-60	-76
5.33%	-63	-83	-103	-124	-146	-169	-191
8.00%	-233	-259	-285	-311	-337	-362	-388
KR4201P33058 2019-03 콜305							104
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	2	2	2	2	2	2	2
-5.33%	2	2	2	2	2	2	2
-2.67%	2	2	2	2	1	1	0
0%	2	1	1	0	-1	-3	-5
2.67%	0	-2	-4	-7	-11	-14	-19
5.33%	-13	-18	-24	-30	-36	-43	-49
8.00%	-54	-63	-71	-79	-88	-96	-104
KR4301P32876 2019-03 풋287.5							88
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	88	88	88	88	88	88	88
-5.33%	58	58	58	58	58	58	58
-2.67%	28	28	28	28	28	28	28
0%	-1	-1	0	0	1	1	2
2.67%	-23	-22	-21	-20	-19	-19	-18
5.33%	-30	-29	-29	-29	-28	-28	-27
8.00%	-30	-30	-30	-30	-30	-30	-30
KR4301P32900 2019-03 풋290							78
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	78	78	78	78	78	78	78
-5.33%	52	52	52	52	52	52	52
-2.67%	25	25	25	25	25	26	26
0%	-1	0	0	0	0	1	1
2.67%	-23	-22	-22	-21	-20	-19	-19
5.33%	-33	-32	-32	-31	-31	-30	-30
8.00%	-34	-34	-34	-34	-34	-34	-33

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

(단위:백만원)

1,229

공시일	2019-03-06
기준일	2019-03-05

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	991	0	991	

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	2019-03-06
기준일	2019-03-05

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	6,987	0	6,987	

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	2019-03-06
기준일	2019-03-05

H2O글로벌본드(H)(채권혼합-파생)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	900	0	900	
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	수익증권	39,445	0	39,445	
누계	통화	선도	0	38,385	-38,385	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		14
FX21019G00 KRW/USD 19-03-19E		50
FX21019G00 KRW/USD 19-03-19E		27
FX21019G01 KRW/USD 19-03-19E		54
FX21019G01 KRW/USD 19-03-19E		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)

1,097

공시일	2019-03-06
기준일	2019-03-05

스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

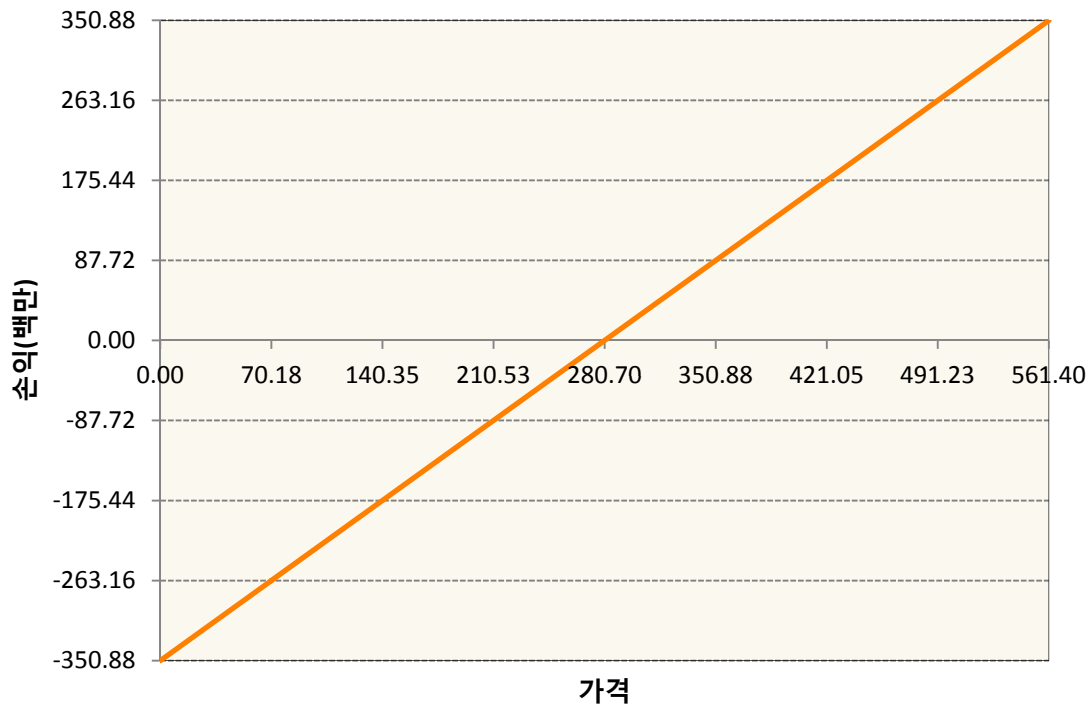
1. 계약금액

(단위:백만원)

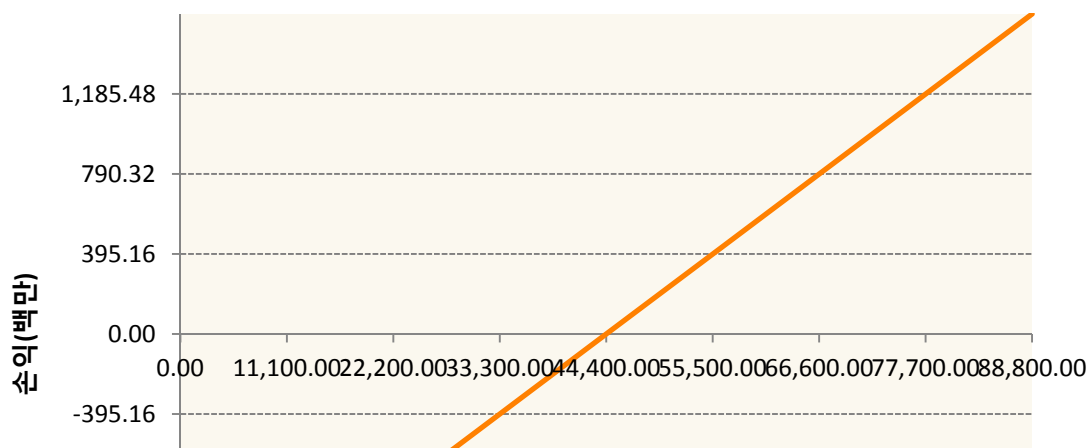
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,932	0	1,932	장내

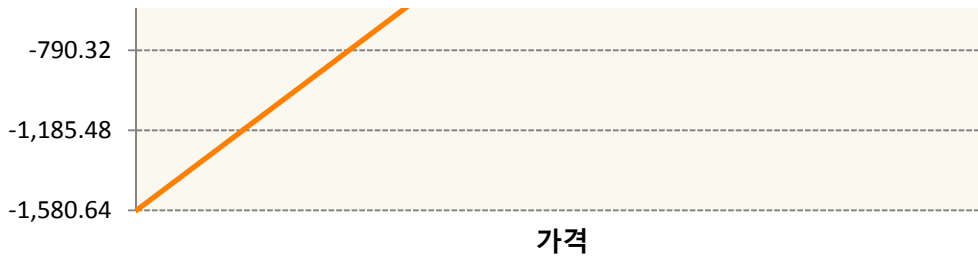
2. 만기시점의 손익구조

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						126
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-126	-126	-126	-126	-126	-126	-126	
-5.33%	-84	-84	-84	-84	-84	-84	-84	
-2.67%	-42	-42	-42	-42	-42	-42	-42	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	42	42	42	42	42	42	42	
5.33%	84	84	84	84	84	84	84	
8.00%	126	126	126	126	126	126	126	

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

170

공시일	2019-03-06
기준일	2019-03-05

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

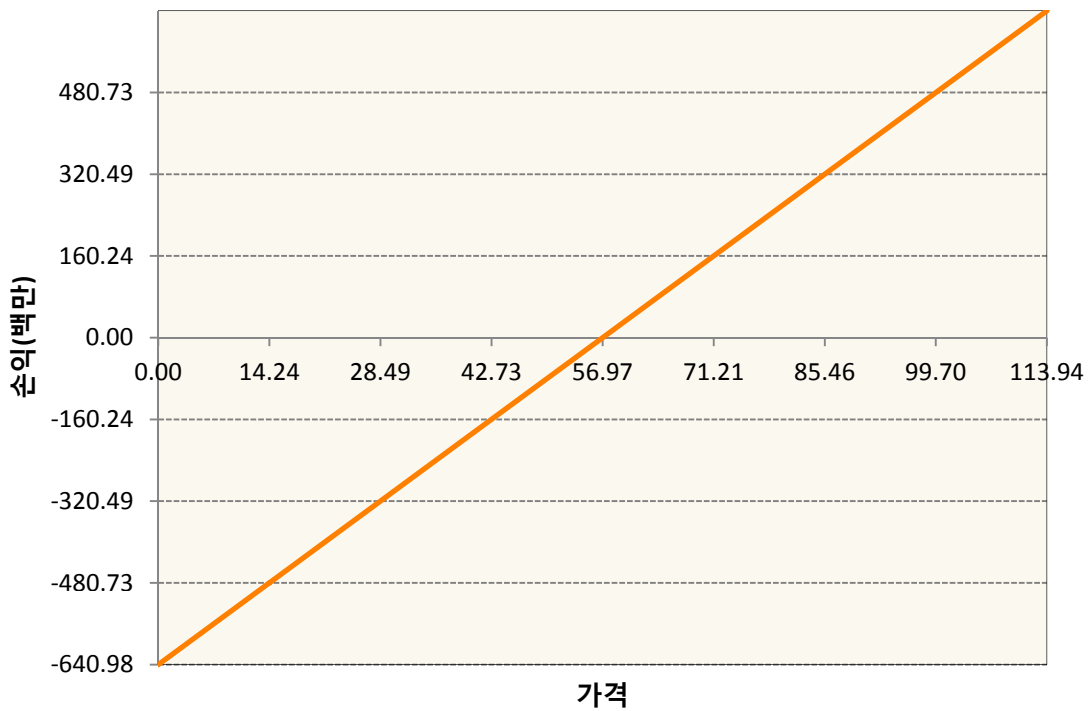
1. 계약금액

(단위:백만원)

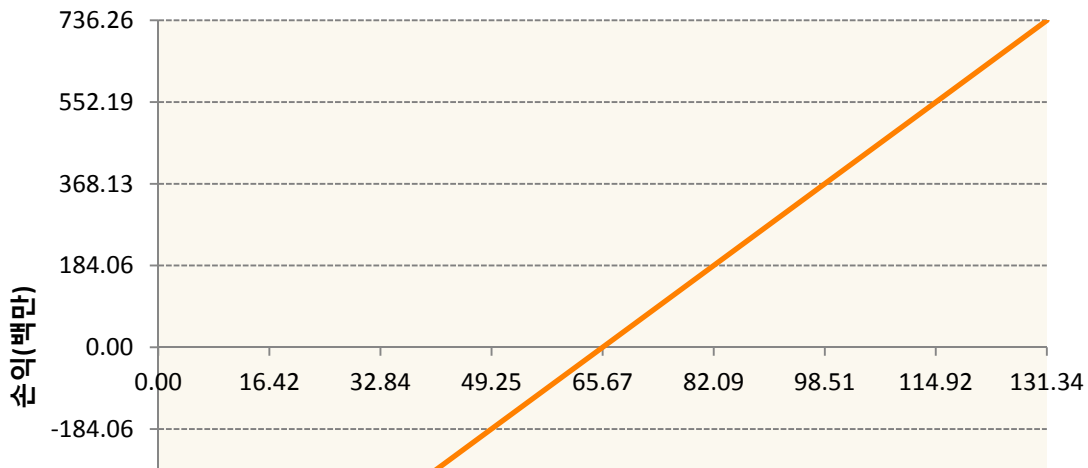
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,833	281	2,552	

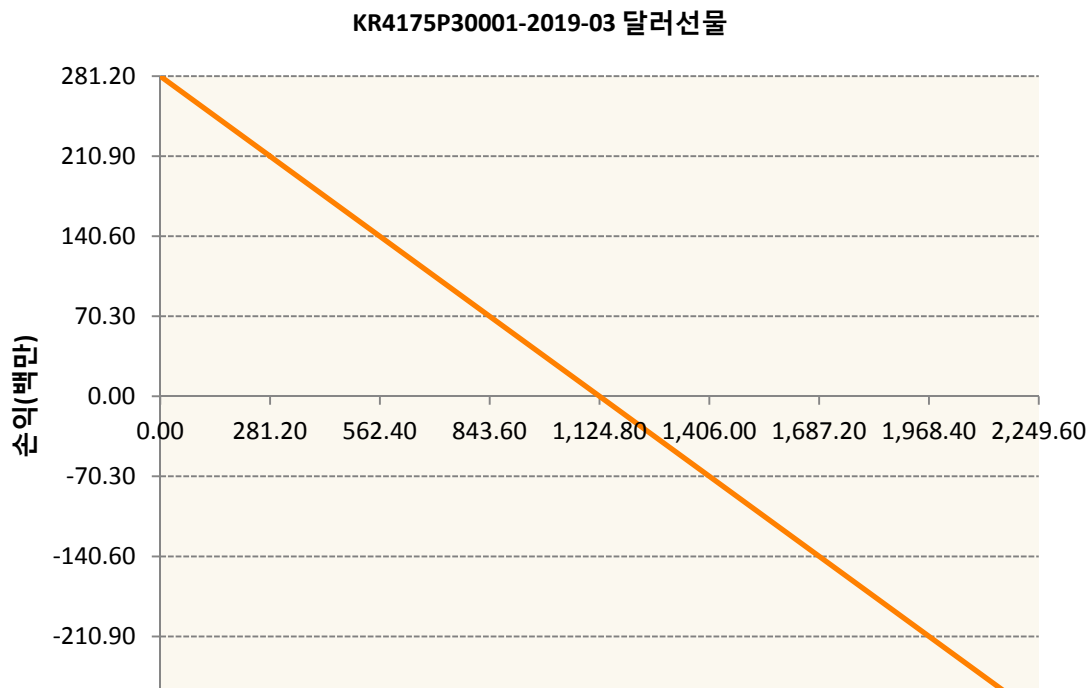
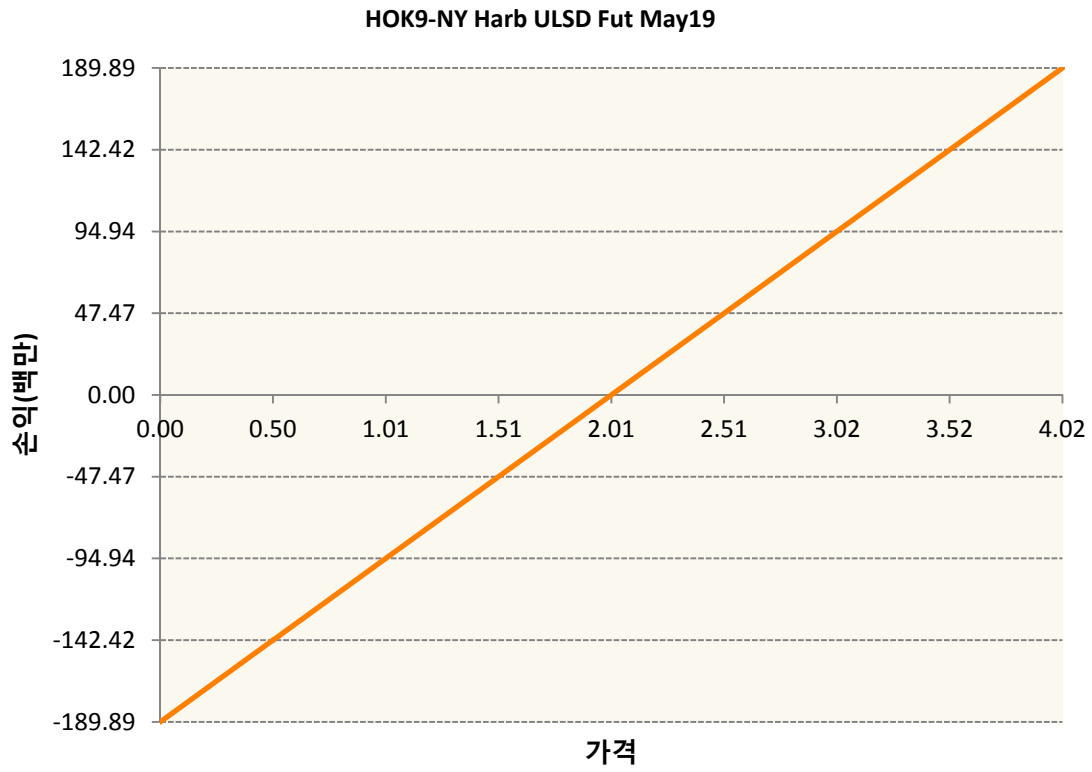
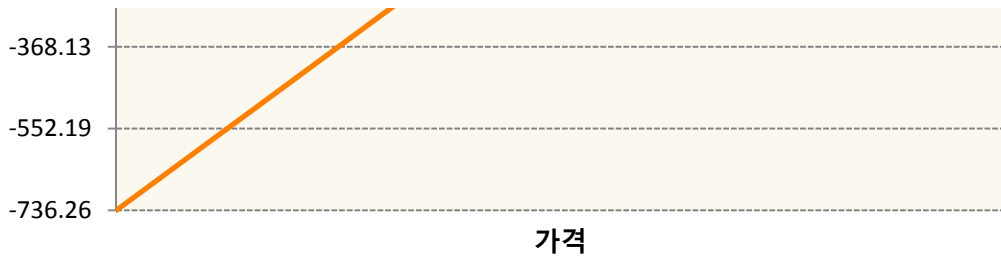
2. 만기시점의 손익구조

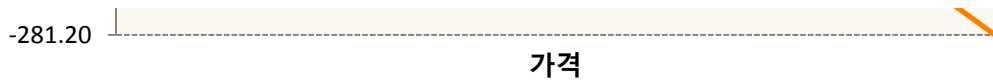
CLK9-WTI CRUDE FUTURE May19



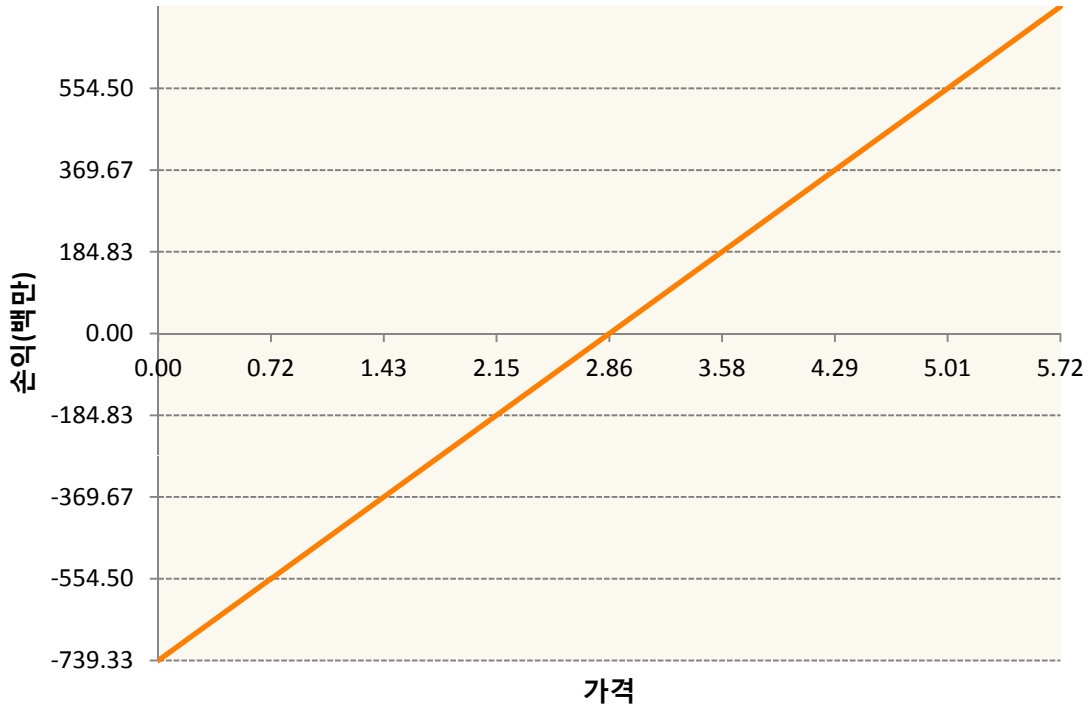
COK9-BRENT CRUDE FUTR May19



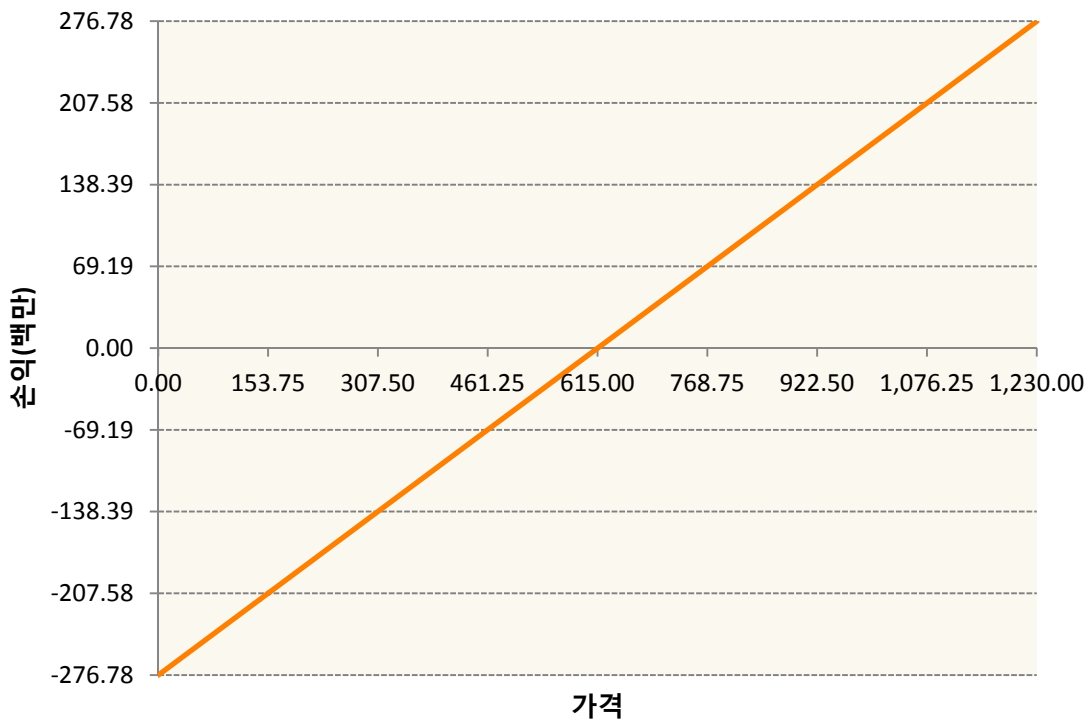




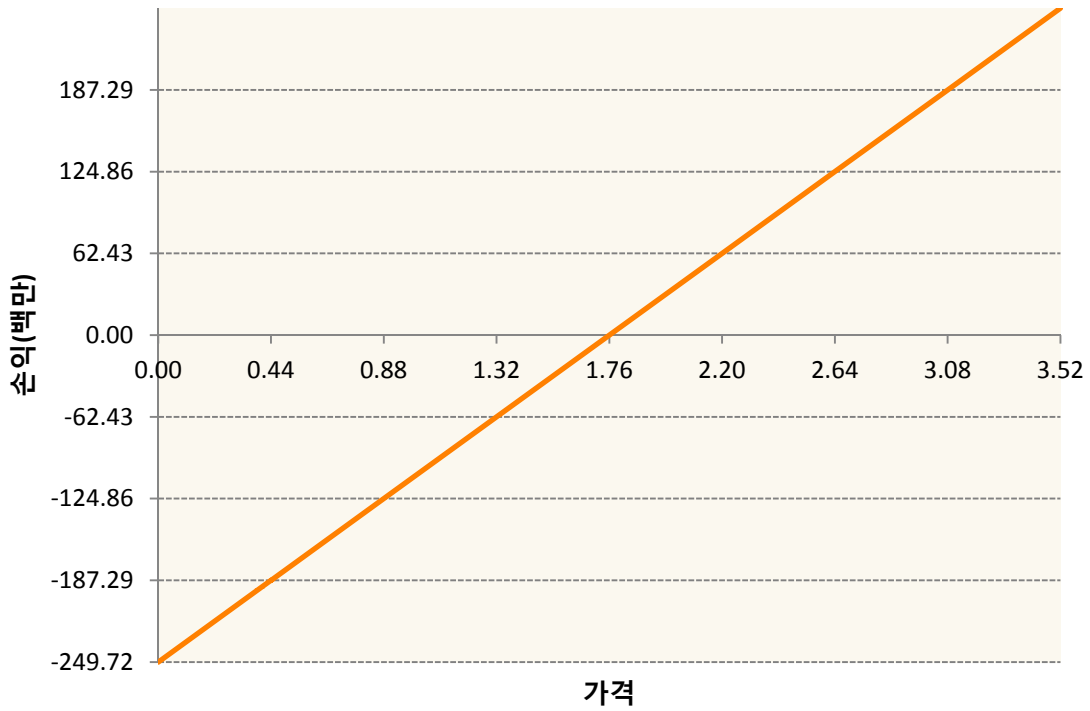
NGK19-NATURAL GAS FUTR May19



QSK9-Low Su Gasoil G May19



XBK9-GASOLINE RBOB FUT May19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

CLK9	WTI CRUDE FUTURE May19	51
COK9	BRENT CRUDE FUTR May19	59
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)

434

공시일	2019-03-06
기준일	2019-03-05

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

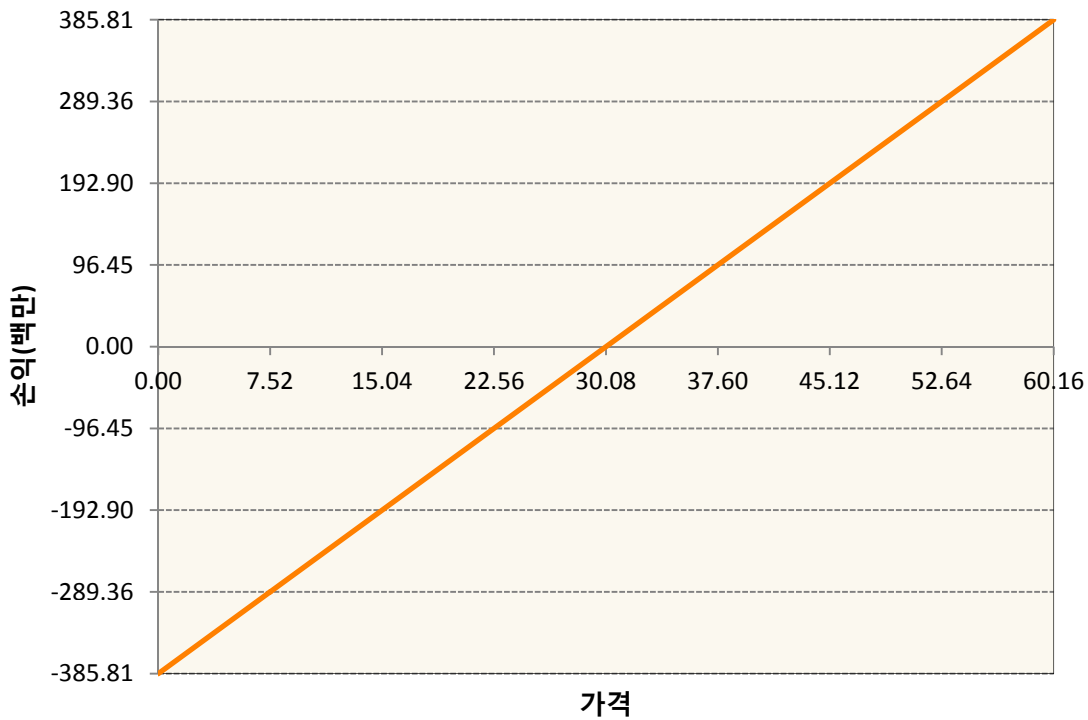
1. 계약금액

(단위:백만원)

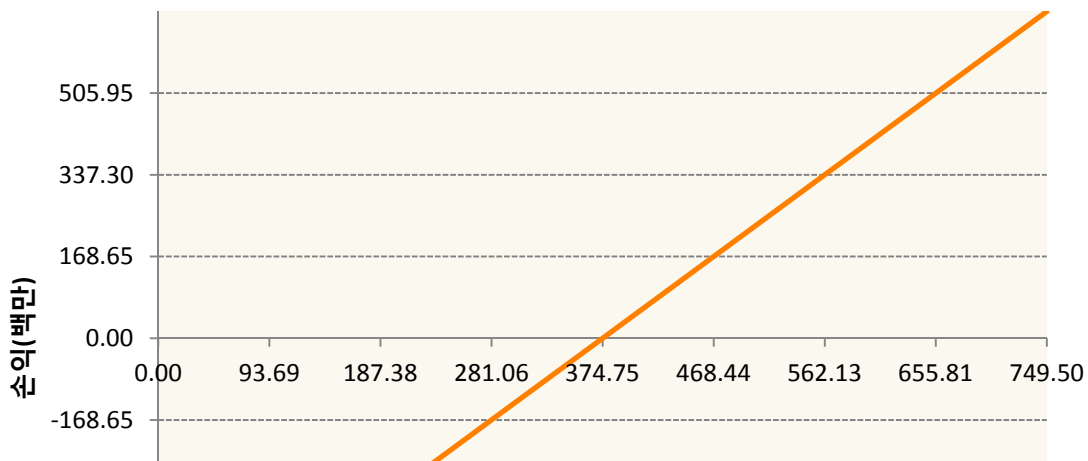
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,393	79	3,314	

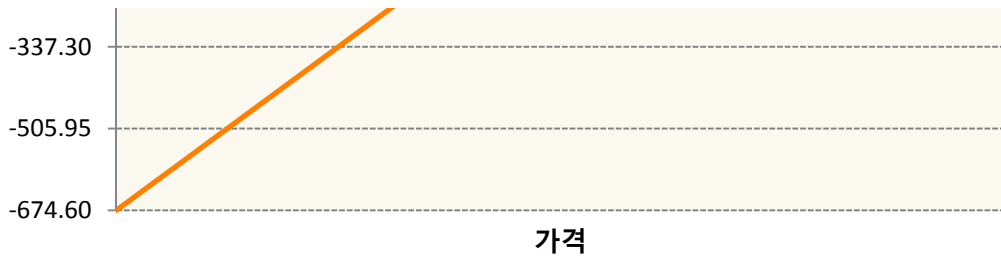
2. 만기시점의 손익구조

BOK9-SOYBEAN OIL FUTR May19

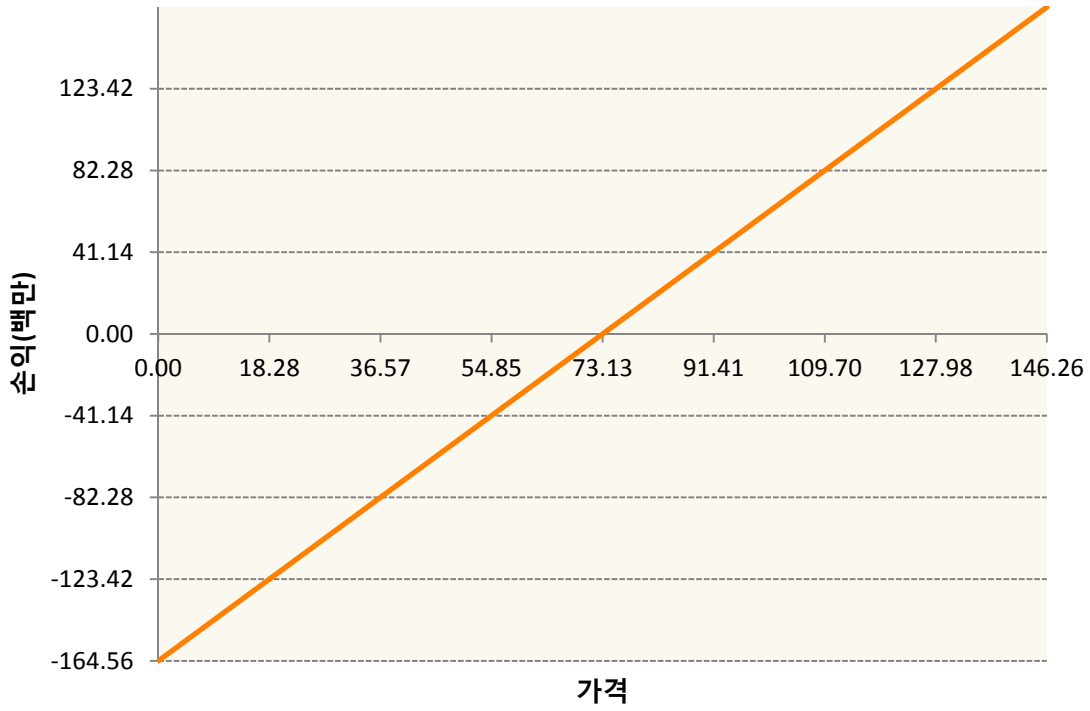


CK9-CORN FUTURE May19

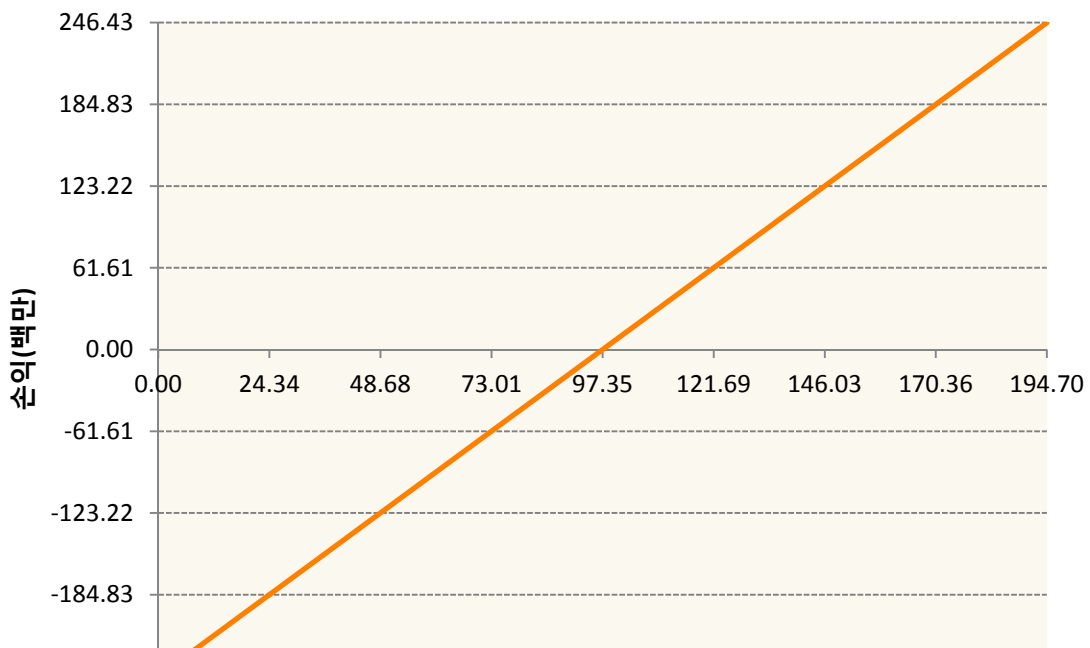


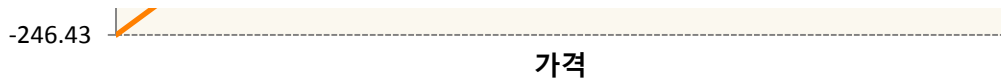


CTK9-COTTON NO.2 FUTR May19

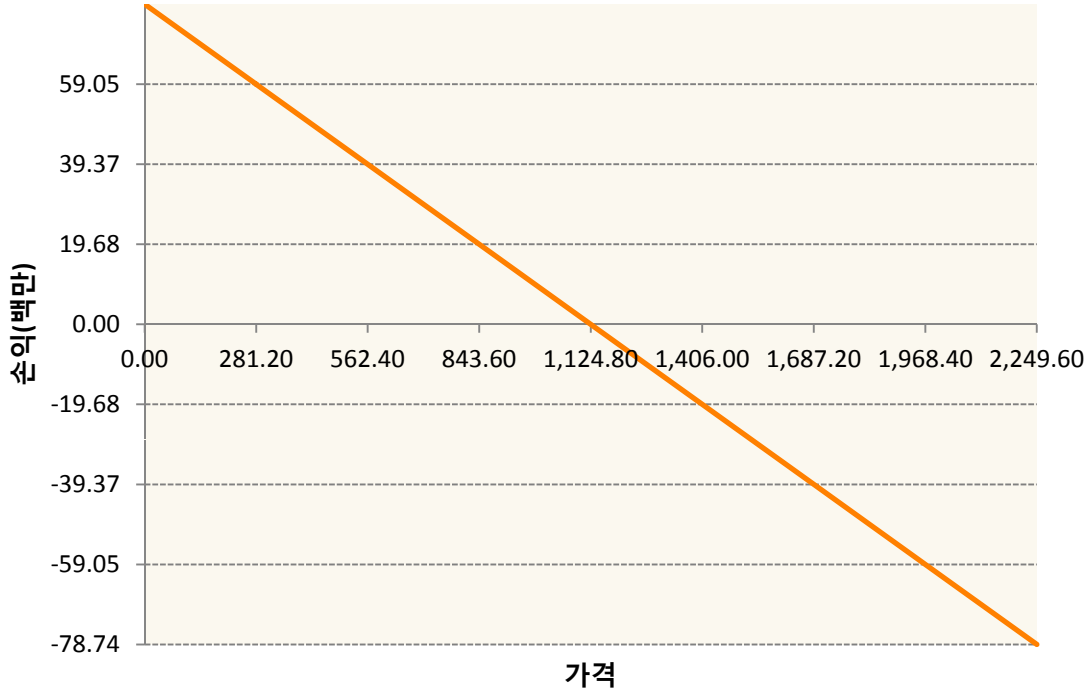


KCK9-COFFEE 'C' FUTURE May19

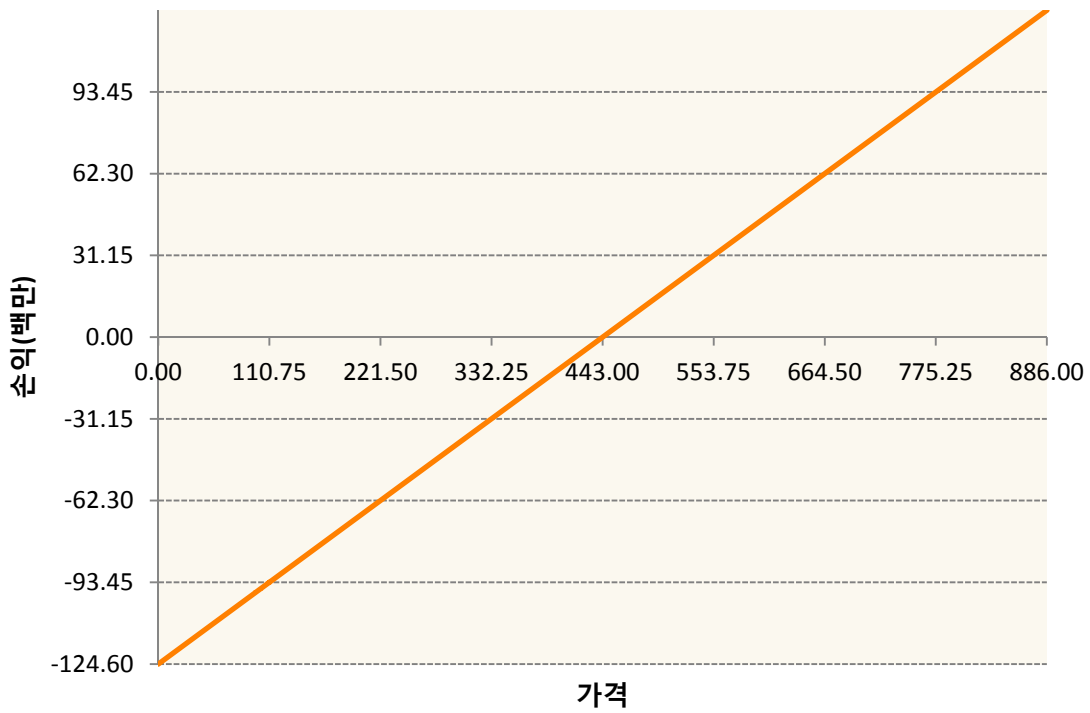




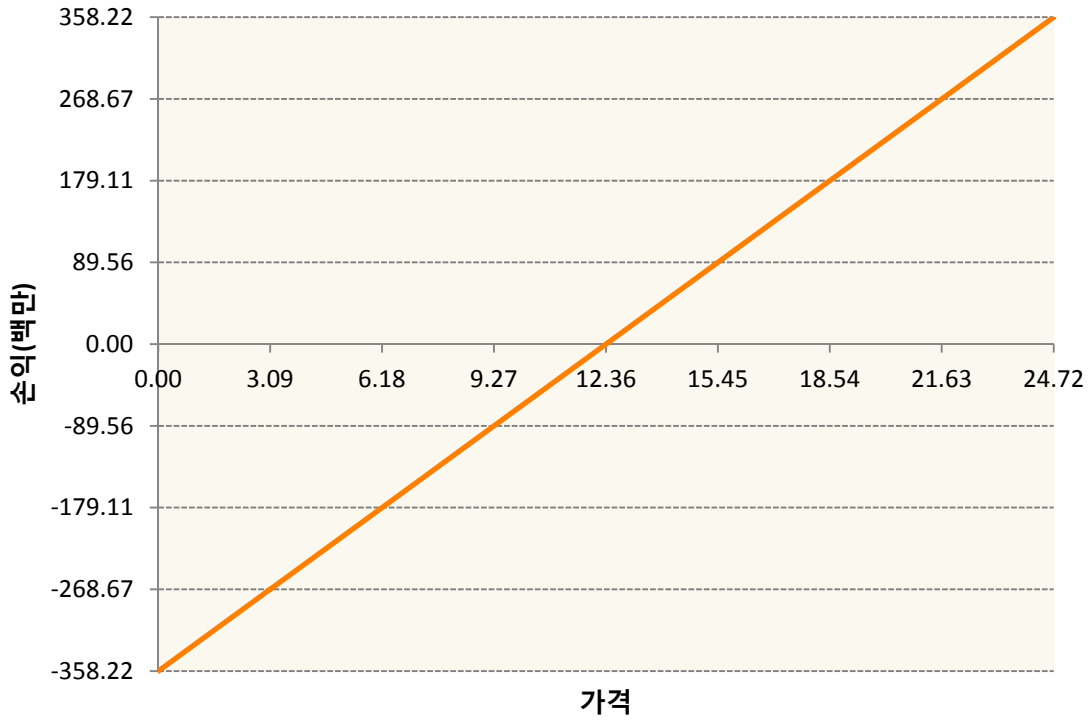
KR4175P30001-2019-03 달러선물



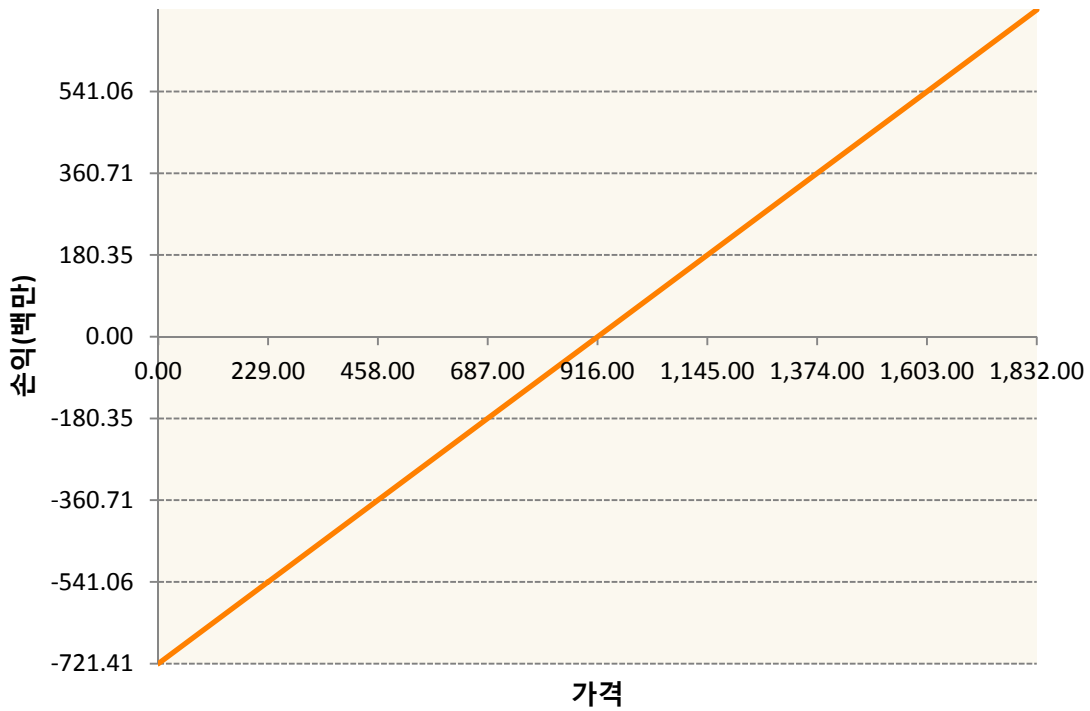
KWK9-KC HRW WHEAT FUT May19



SBK9-SUGAR #11 (WORLD) May19

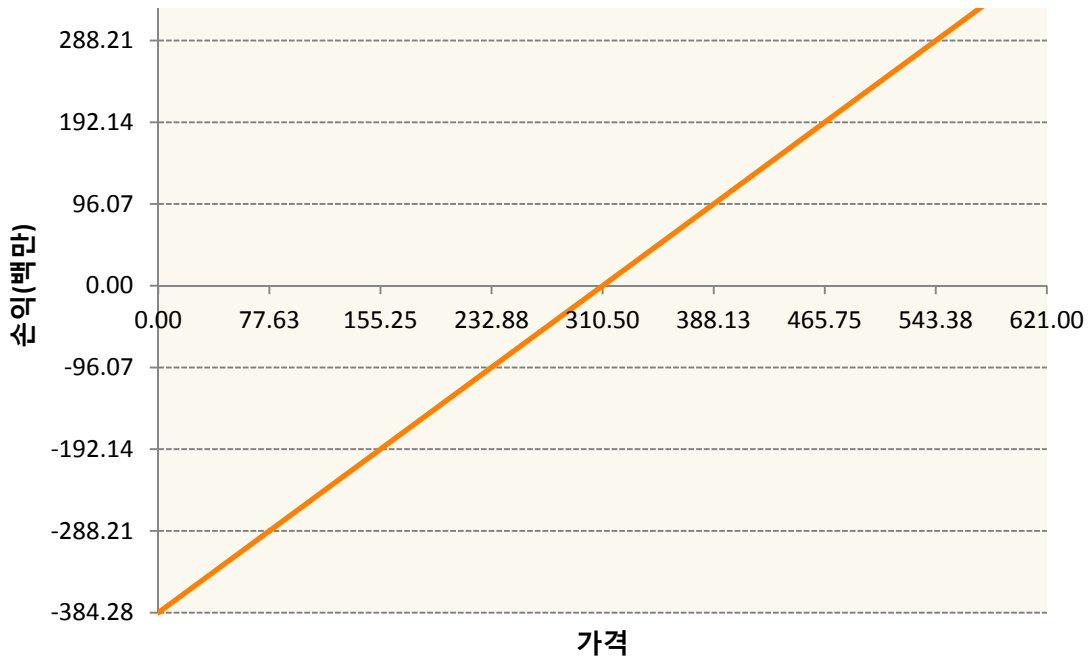


SK9-SOYBEAN FUTURE May19

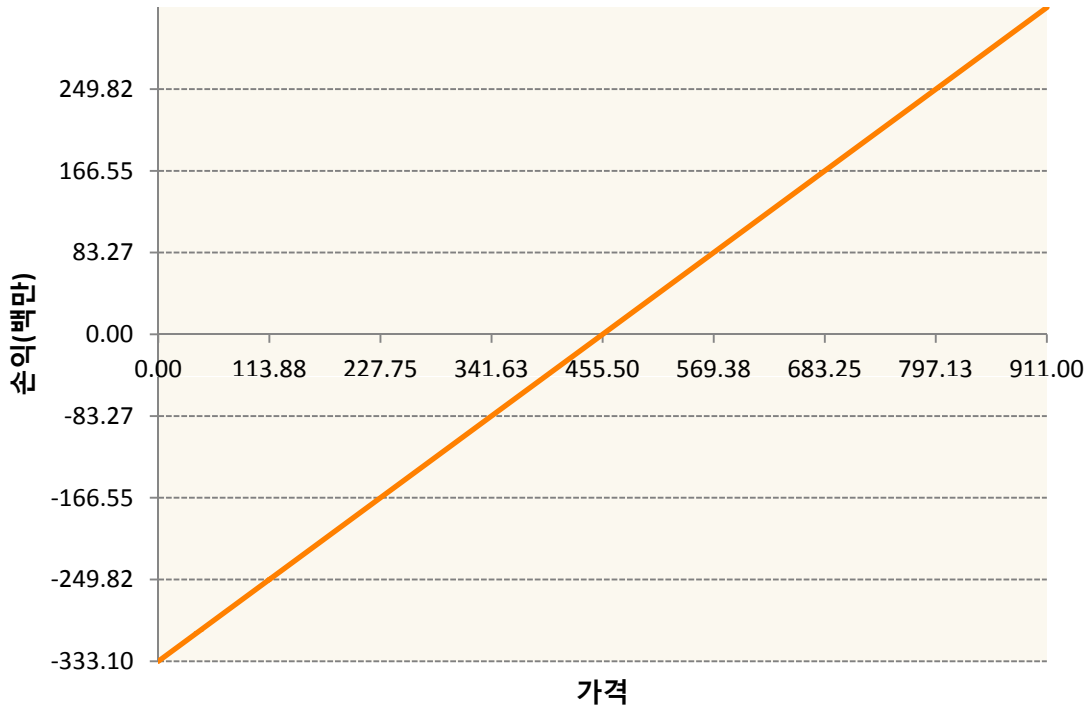


SMK9-SOYBEAN MEAL FUTR May19





WK9-WHEAT FUTURE(CBT) May19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

BOK9	SOYBEAN OIL FUTR May19	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	58
SMK9	SOYBEAN MEAL FUTR May19	31
WK9	WHEAT FUTURE(CBT) May19	27

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

(단위:백만원)

270