

공시일	2019-03-07
기준일	2019-03-06

포커스농산물모(채권-파생형)

1. 계약금액

(단위:USD 백만)

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

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

95

공시일	2019-03-07
기준일	2019-03-06

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

1,115

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

642

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-03-07
기준일	2019-03-06

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	337
SWCSI50000 신한CSI500미래S190129	101

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

666

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-03-07
기준일	2019-03-06

유로인덱스모(주식-파생형)

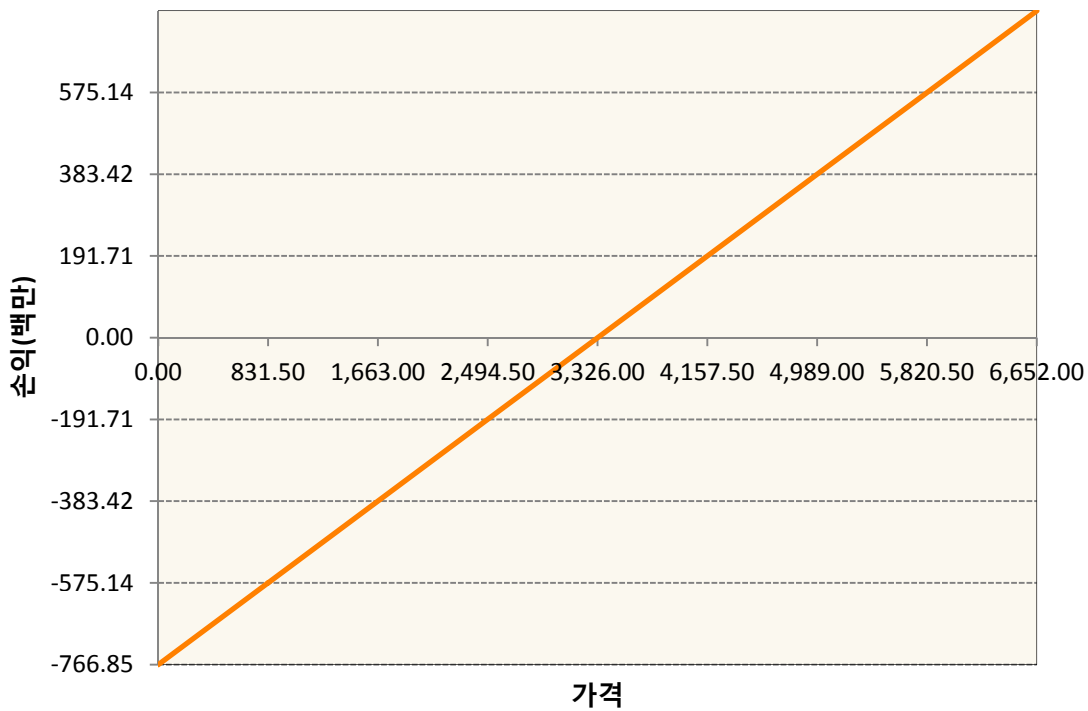
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	767	0	767	

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	2019-03-07
기준일	2019-03-06

차이나인덱스모(주식-파생형)

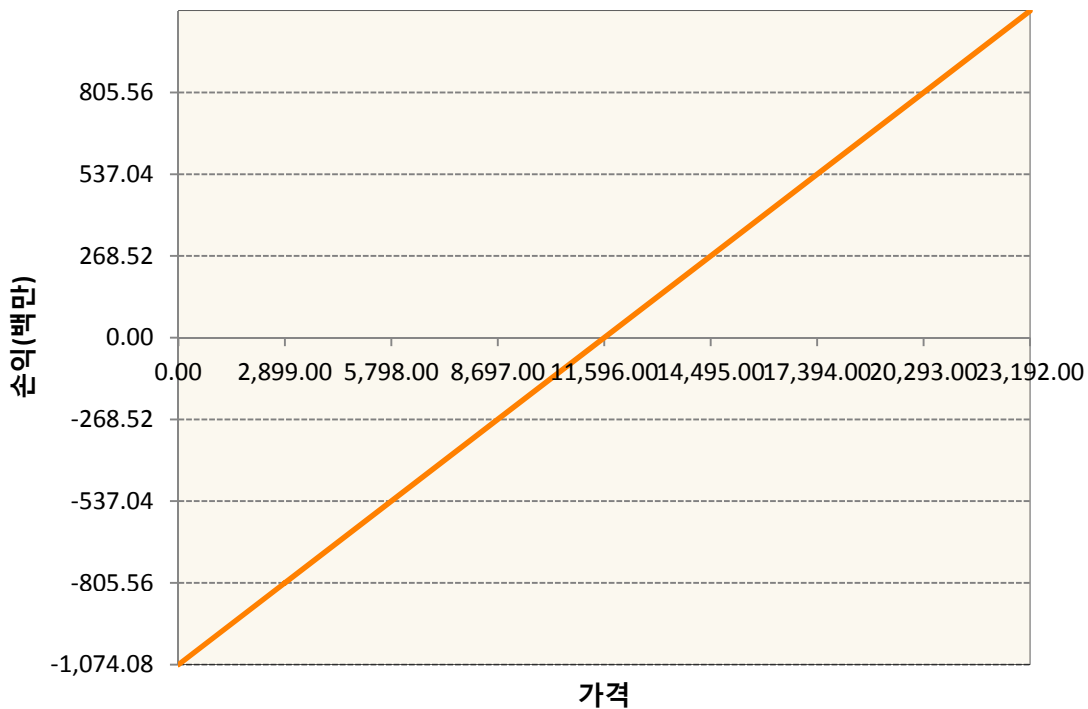
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,074	0	1,074	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	2019-03-07
기준일	2019-03-06

커버드콜모(주식혼합-파생형)

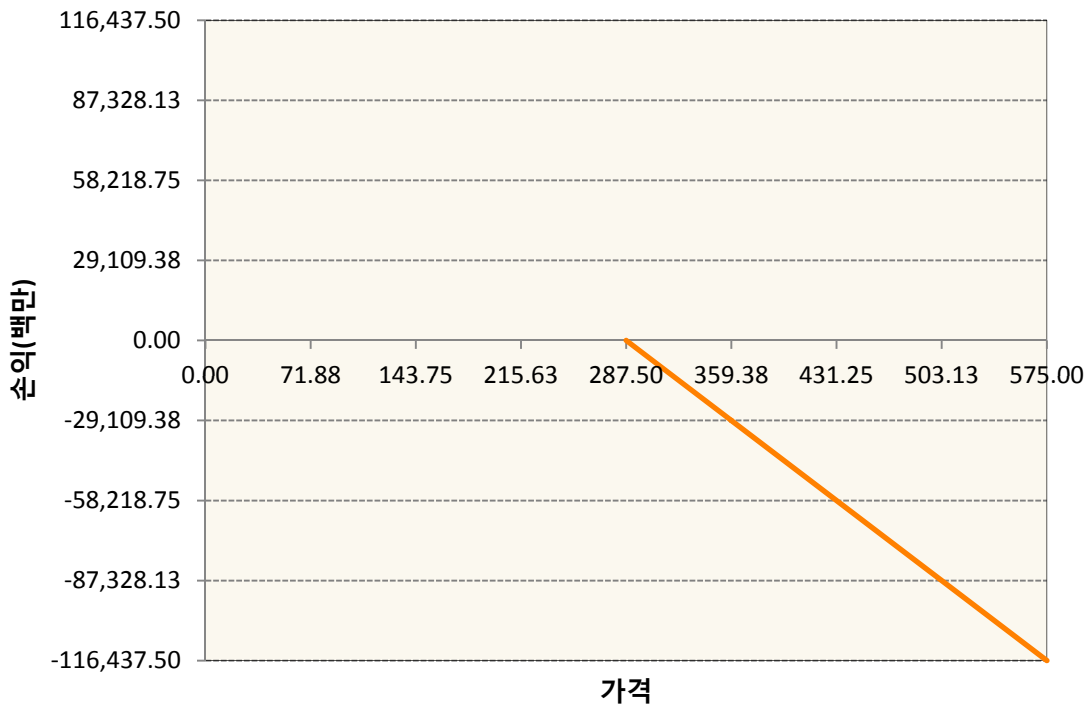
1. 계약금액

(단위:백만원)

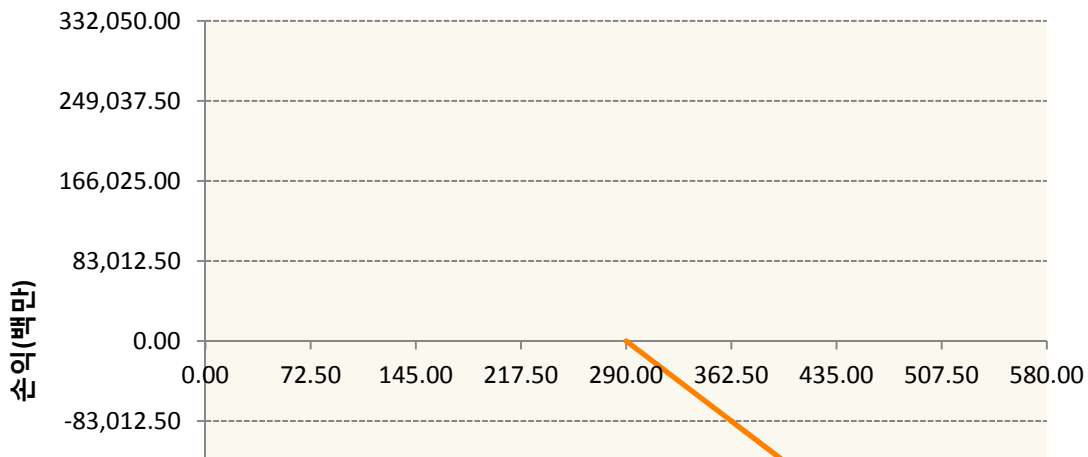
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	701,488	-701,488	장내

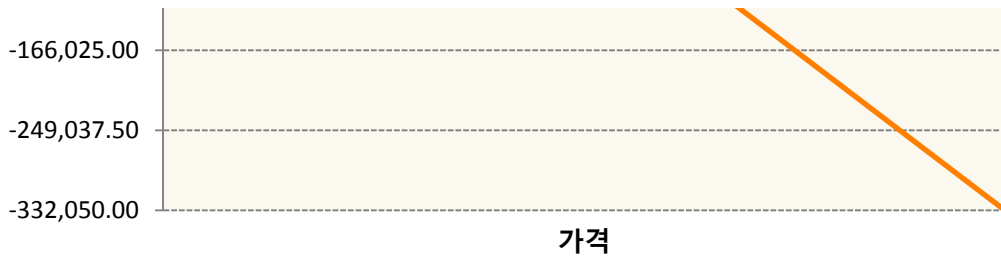
2. 만기시점의 손익구조

KR4201P32878-2019-03 콜287.5

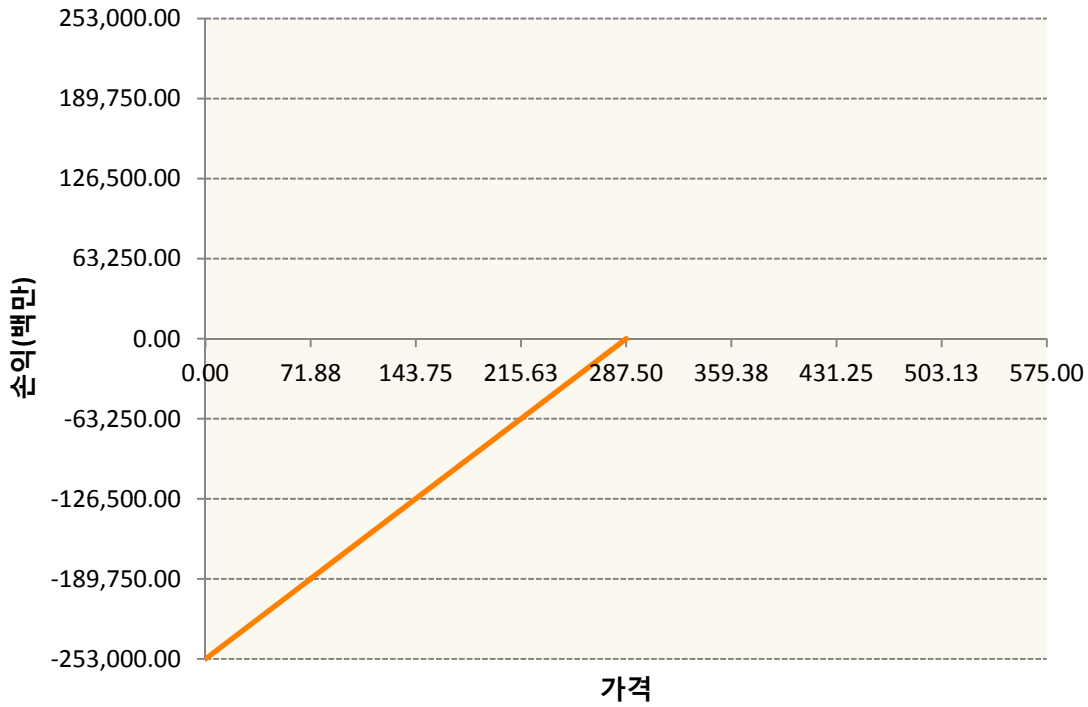


KR4201P32902-2019-03 콜290





KR4301P32876-2019-03 풋287.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201P32878		2019-03 콜287.5					5,771
		기초자산의 변동성					
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	640	640	639	637	634	628	619
-5.33%	638	634	626	613	594	569	538
-2.67%	600	568	527	476	417	349	274
0%	322	222	114	0	-118	-241	-366
2.67%	-668	-818	-968	-1,119	-1,269	-1,419	-1,569
5.33%	-2,667	-2,777	-2,893	-3,015	-3,141	-3,270	-3,402
8.00%	-5,375	-5,416	-5,469	-5,532	-5,604	-5,684	-5,771
KR4201P32902		2019-03 콜290					14,556
		기초자산의 변동성					
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,225	1,225	1,224	1,222	1,216	1,207	1,190

-5.33%	1,223	1,218	1,206	1,184	1,151	1,103	1,039
-2.67%	1,173	1,122	1,046	946	821	673	504
0%	721	507	265	0	-285	-586	-901
2.67%	-1,257	-1,664	-2,074	-2,487	-2,902	-3,319	-3,737
5.33%	-5,966	-6,342	-6,727	-7,120	-7,519	-7,922	-8,329
8.00%	-13,095	-13,273	-13,482	-13,719	-13,979	-14,259	-14,556
KR4301P32876 2019-03 풋287.5							19,432
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-19,432	-19,432	-19,432	-19,432	-19,432	-19,432	-19,432
-5.33%	-12,868	-12,868	-12,868	-12,868	-12,869	-12,869	-12,870
-2.67%	-6,305	-6,306	-6,309	-6,314	-6,323	-6,337	-6,356
0%	185	136	74	0	-84	-178	-280
2.67%	5,302	5,123	4,944	4,764	4,585	4,406	4,226
5.33%	6,908	6,847	6,772	6,686	6,588	6,482	6,368
8.00%	7,013	7,011	7,006	6,996	6,981	6,960	6,932

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

(단위:백만원)

40,884

공시일	2019-03-07
기준일	2019-03-06

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

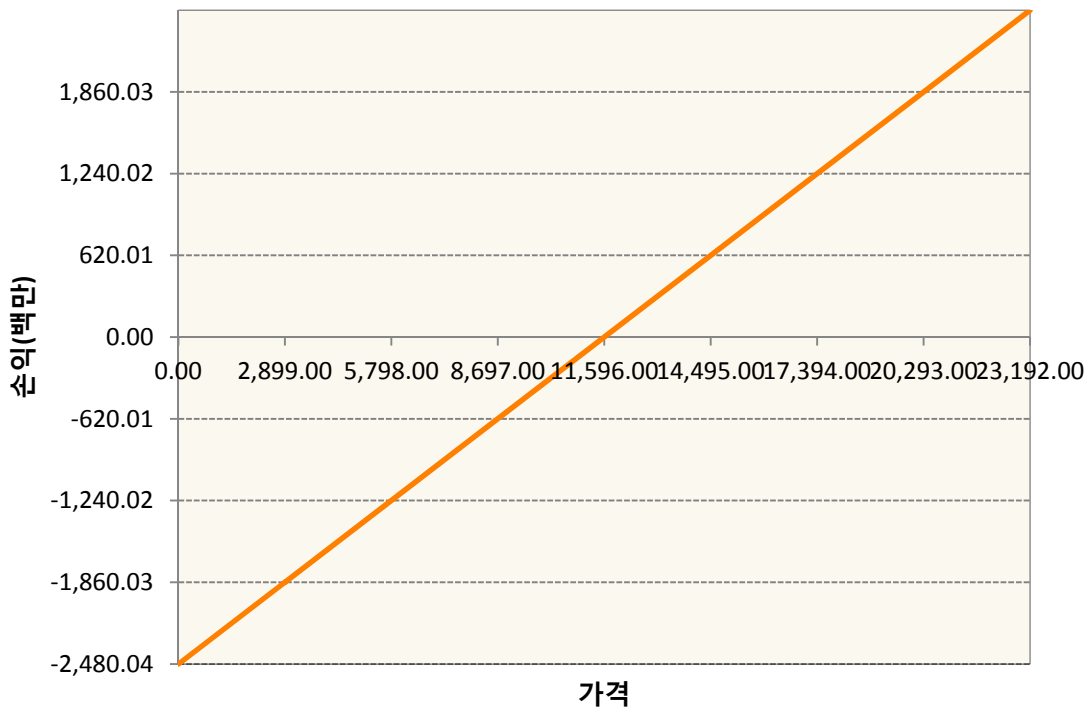
1. 계약금액

(단위:백만원)

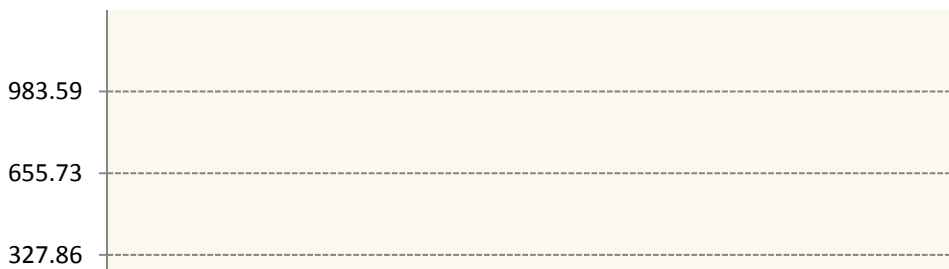
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	2,480	0	2,480	장내
누계	유가증권	옵션	0	6,261	-6,261	장내
누계	통화	선도	0	2,732	-2,732	장외

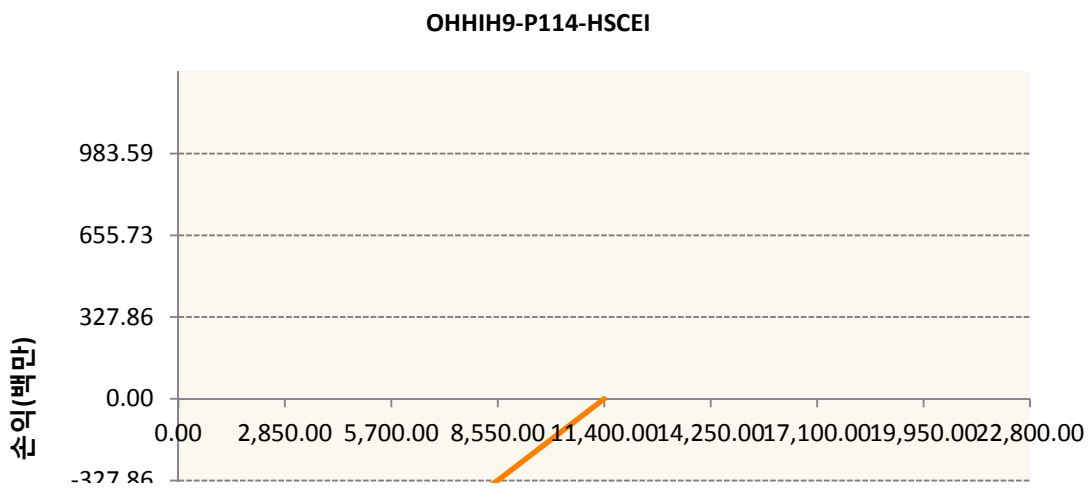
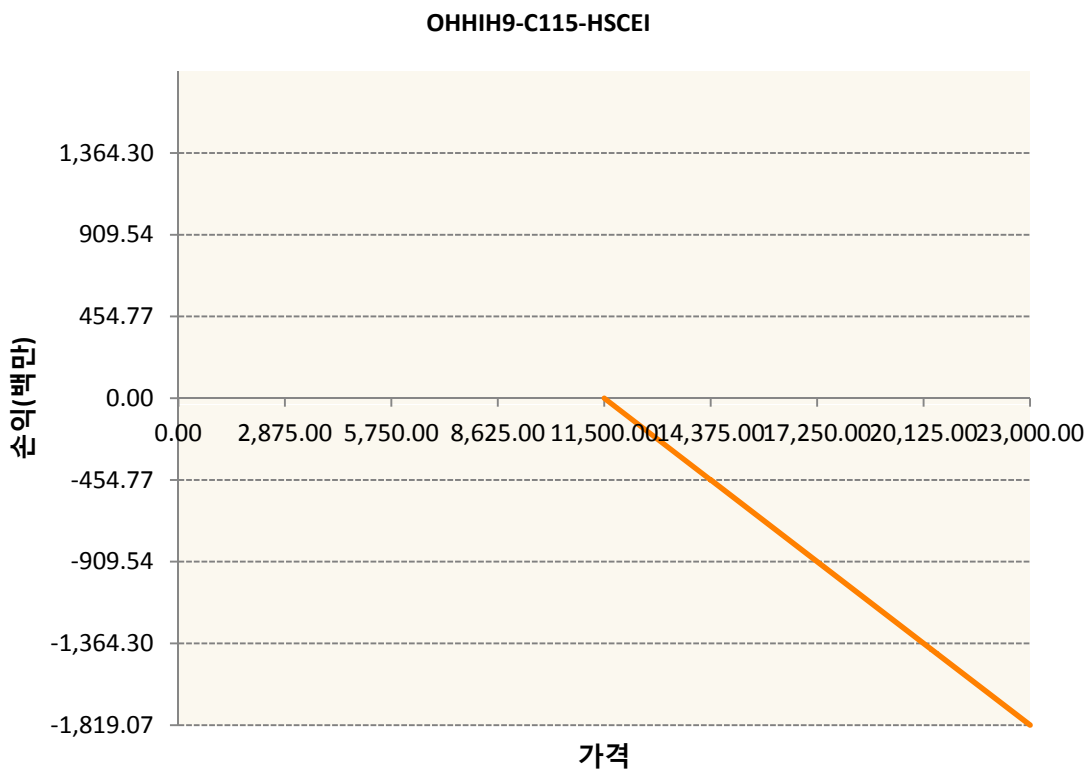
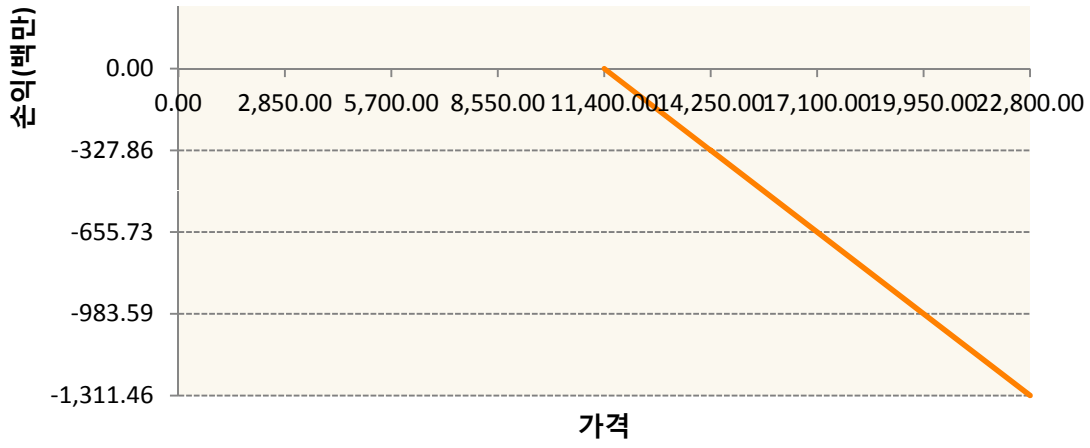
2. 만기시점의 손익구조

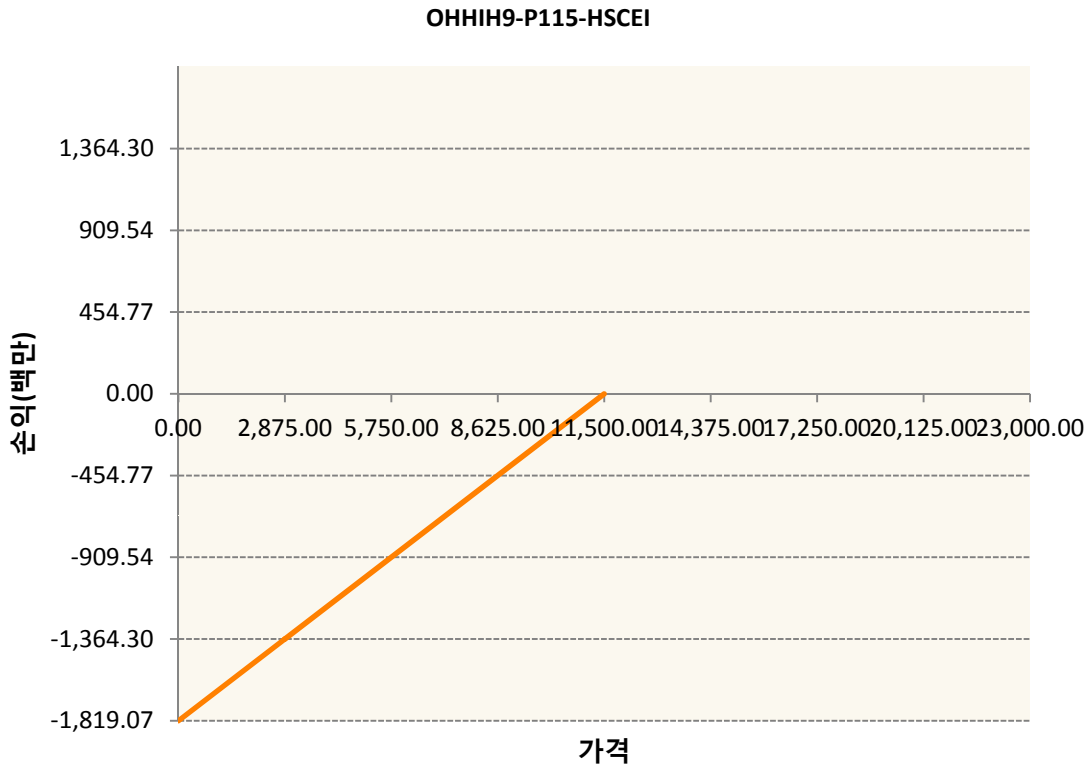
HCH9-HSCEI Futures Mar19



OHHIH9-C114-HSCEI







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

FX21018Z00 KRW/HKD 11-03-19E	219
HCH9 HSCEI Futures Mar19	198
OHHIH9-C11 HSCEI	105
OHHIH9-C11 HSCEI	146
OHHIH9-P11HSCEI	105
OHHIH9-P11HSCEI	146

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

795

공시일	2019-03-07
기준일	2019-03-06

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

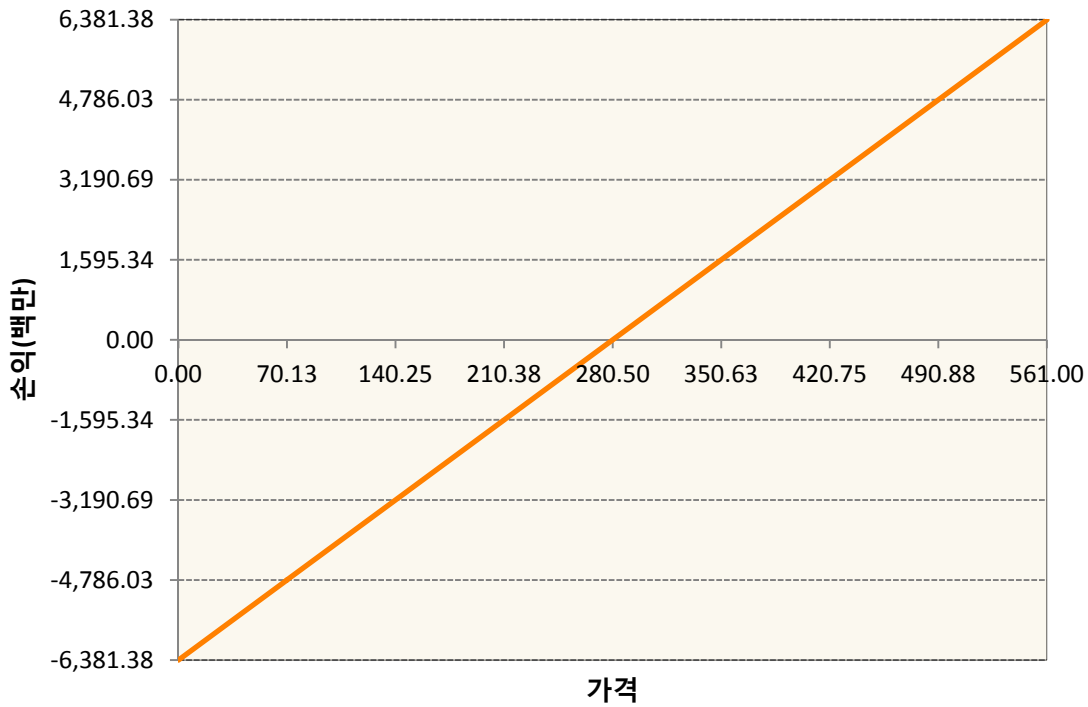
1. 계약금액

(단위:백만원)

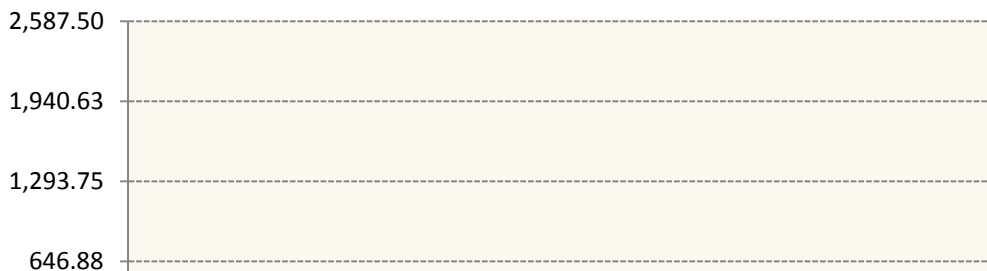
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	6,381	0	6,381	장내
누계	유가증권	스왑	28,836	0	28,836	장외
누계	유가증권	옵션	0	36,139	-36,139	장내

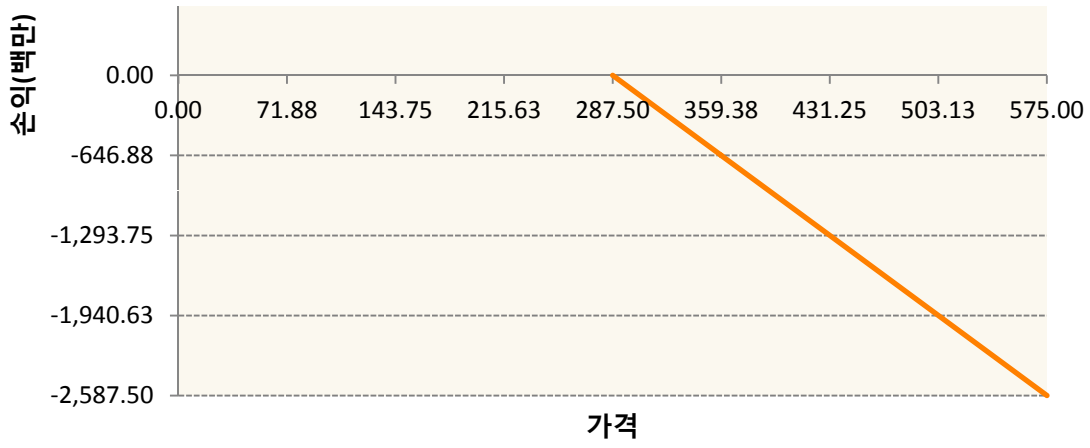
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P30007-2019-03 코스피200지수선물

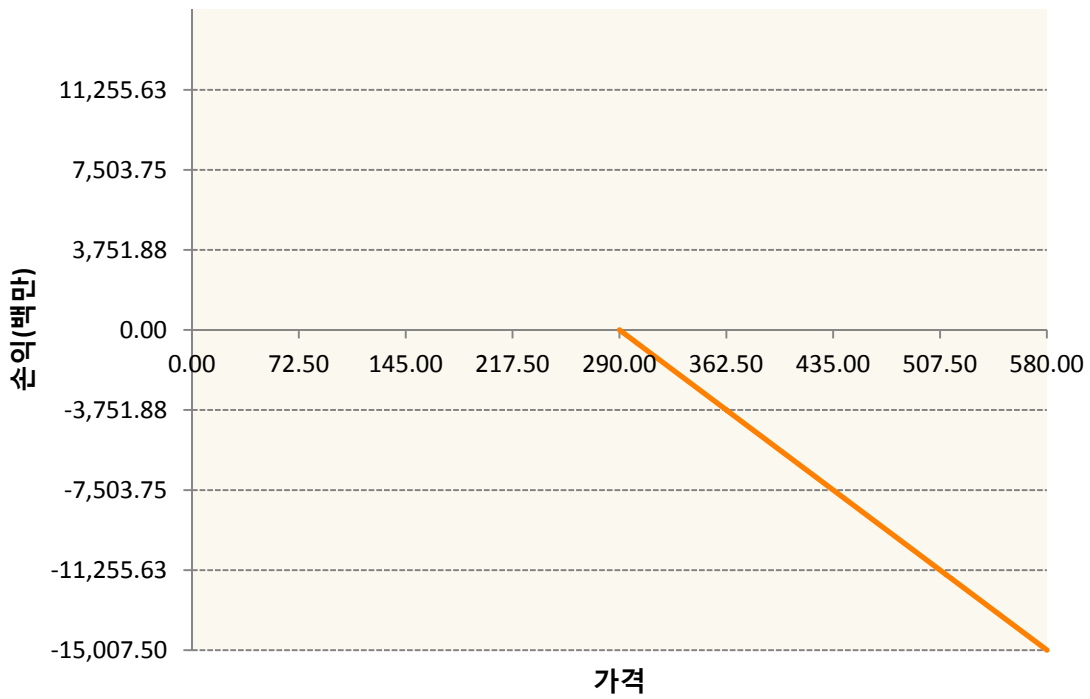


KR4201P32878-2019-03 콜287.5

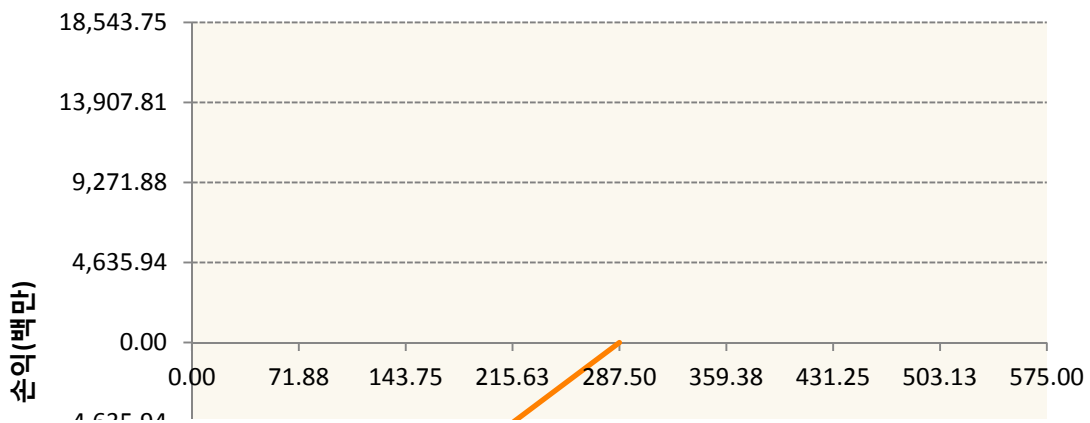


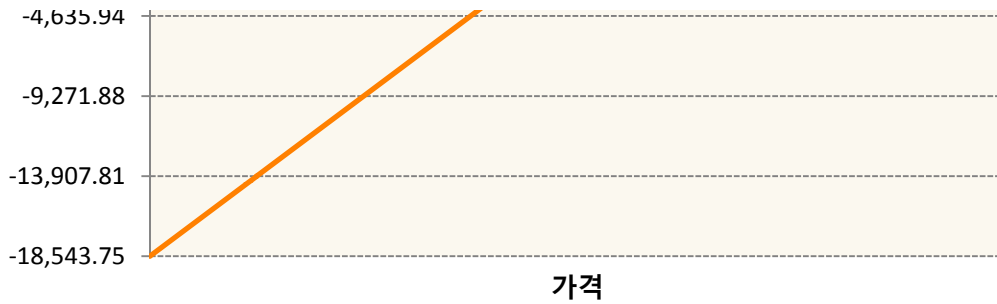


KR4201P32902-2019-03 콜290



KR4301P32876-2019-03 풋287.5





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11		UBCSFXC1 INDEX_14						2,427
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-2,427	-2,427	-2,427	-2,427	-2,427	-2,427	-2,427	
-5.33%	-1,618	-1,618	-1,618	-1,618	-1,618	-1,618	-1,618	
-2.67%	-809	-809	-809	-809	-809	-809	-809	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	809	809	809	809	809	809	809	
5.33%	1,618	1,618	1,618	1,618	1,618	1,618	1,618	
8.00%	2,427	2,427	2,427	2,427	2,427	2,427	2,427	
KR4101P30007		2019-03 코스피200지수선물						509
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-509	-509	-509	-509	-509	-509	-509	
-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%	509	509	509	509	509	509	509	
KR4201P32878		2019-03 콜287.5						128
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	14	14	14	14	14	14	14	
-5.33%	14	14	14	14	13	13	12	
-2.67%	13	13	12	11	9	8	6	
0%	7	5	3	0	-3	-5	-8	
2.67%	-15	-18	-22	-25	-28	-32	-35	
5.33%	-59	-62	-64	-67	-70	-73	-76	
8.00%	-119	-120	-122	-123	-125	-126	-128	
KR4201P32902		2019-03 콜290						658
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	

-8.00%	55	55	55	55	55	55	54
-5.33%	55	55	54	54	52	50	47
-2.67%	53	51	47	43	37	30	23
0%	33	23	12	0	-13	-26	-41
2.67%	-57	-75	-94	-112	-131	-150	-169
5.33%	-270	-287	-304	-322	-340	-358	-376
8.00%	-592	-600	-609	-620	-632	-644	-658
KR4301P32876 2019-03 풋287.5							1,424
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,424	-1,424	-1,424	-1,424	-1,424	-1,424	-1,424
-5.33%	-943	-943	-943	-943	-943	-943	-943
-2.67%	-462	-462	-462	-463	-463	-464	-466
0%	14	10	5	0	-6	-13	-21
2.67%	389	375	362	349	336	323	310
5.33%	506	502	496	490	483	475	467
8.00%	514	514	513	513	512	510	508

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

(단위:백만원)

5,245

공시일	2019-03-07
기준일	2019-03-06

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

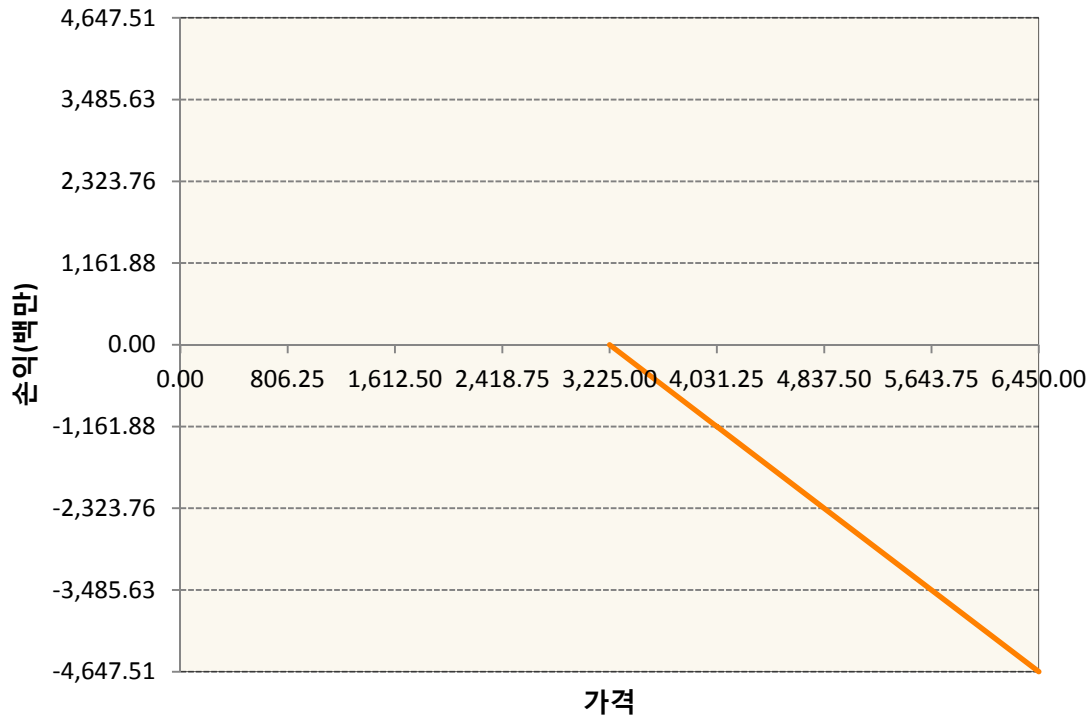
1. 계약금액

(단위:백만원)

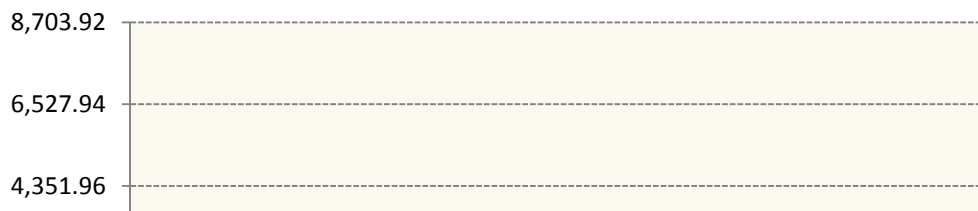
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	7,196	0	7,196	
누계	유가증권	스왑	60,209	0	60,209	장외
누계	유가증권	옵션	0	26,703	-26,703	장내
누계	통화	선도	0	15,304	-15,304	장외

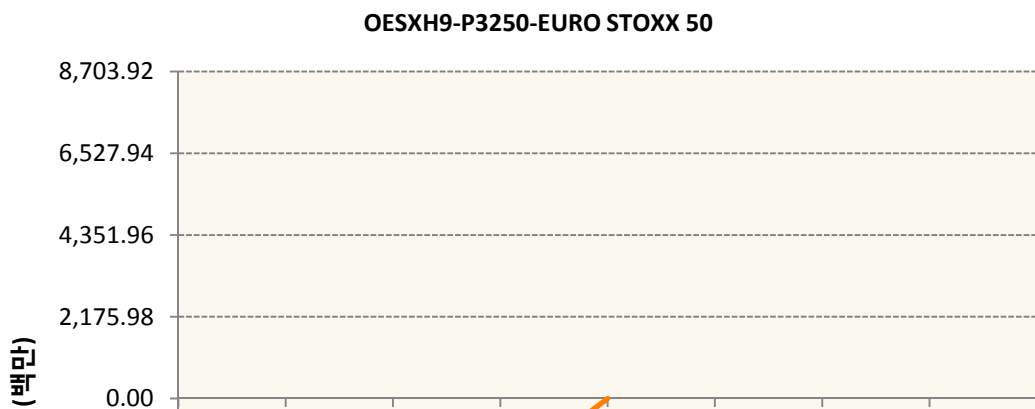
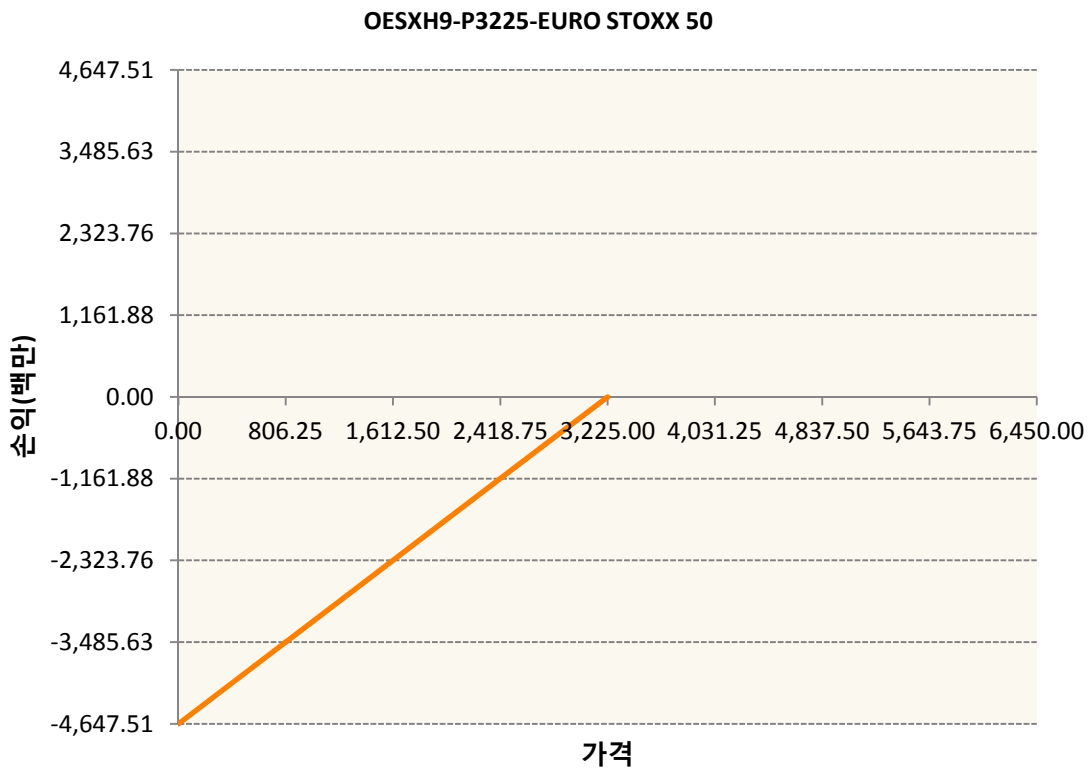
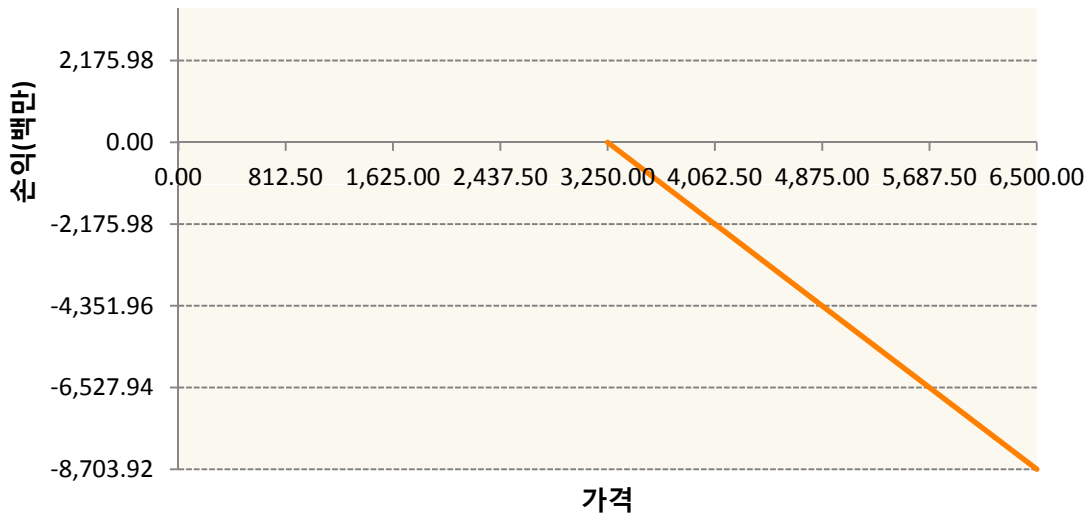
2. 만기시점의 손익구조

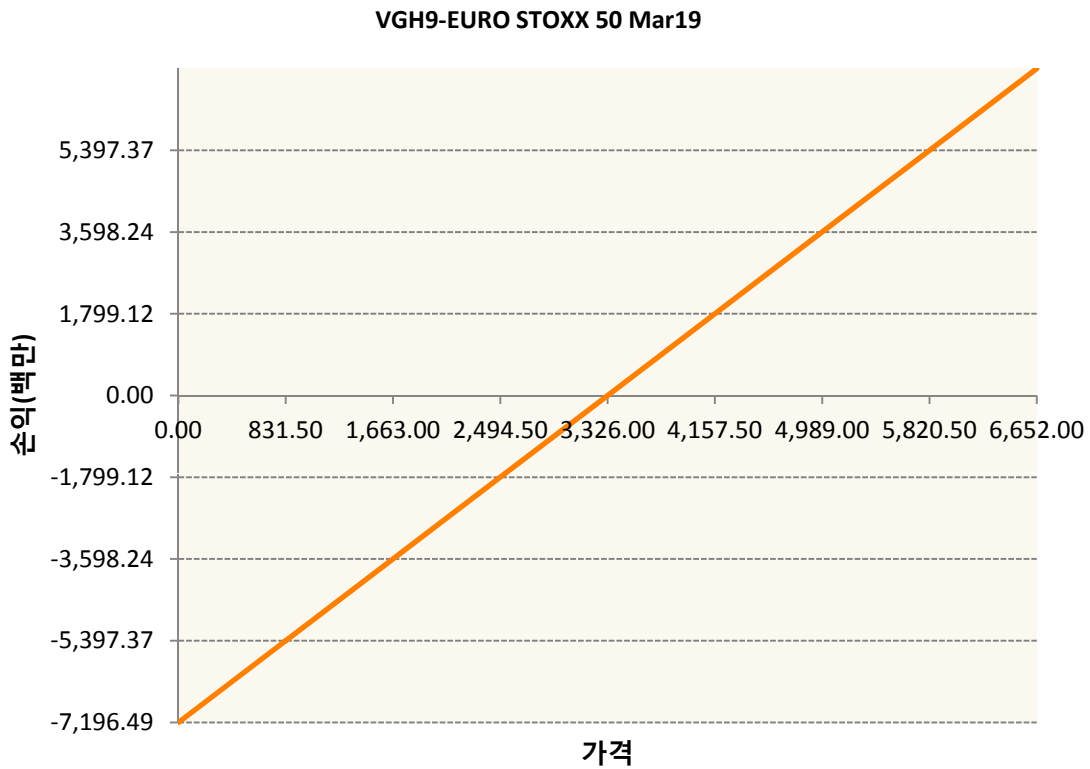
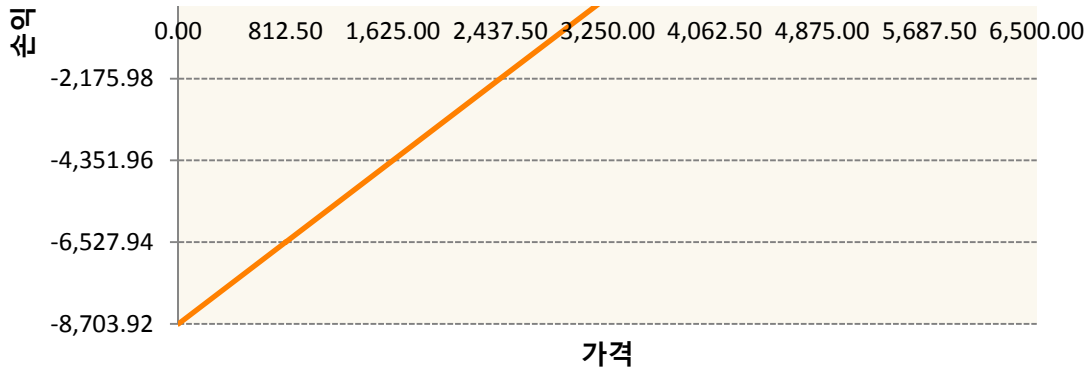
OESXH9-C3225-EURO STOXX 50



OESXH9-C3250-EURO STOXX 50







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY	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	576

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

(단위:백만원)

2,675

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

(단위:백만원)

1,117

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

(단위:백만원)

95

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

(단위:백만원)

138

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

(단위:백만원)

43

공시일	2019-03-07
기준일	2019-03-06

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

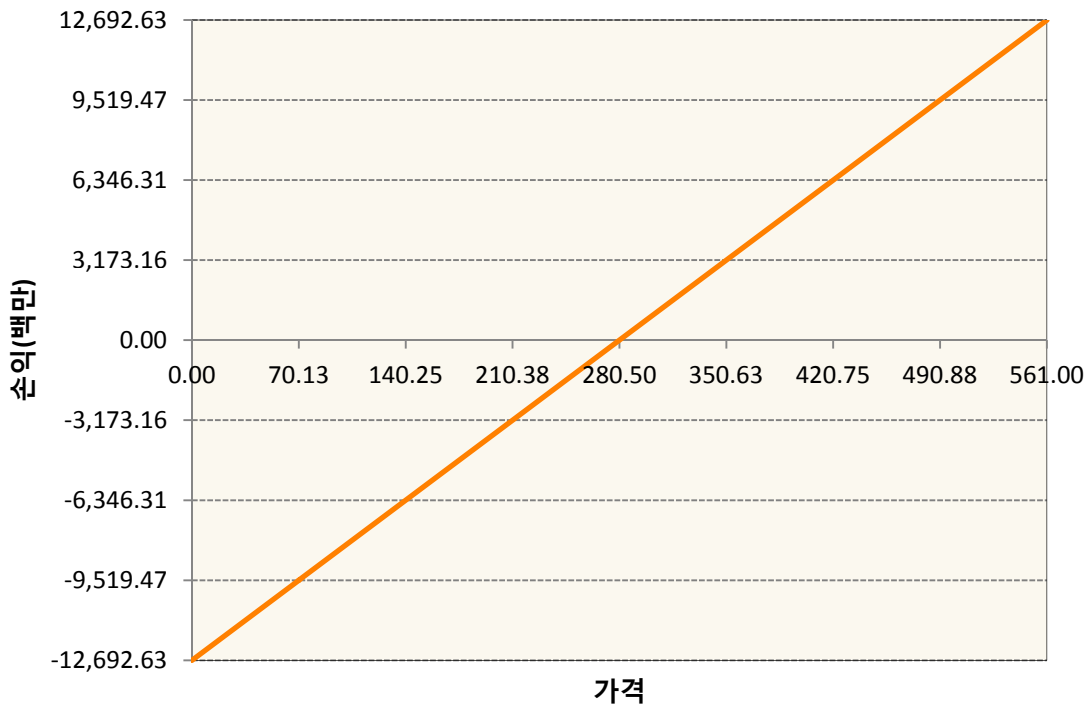
1. 계약금액

(단위:백만원)

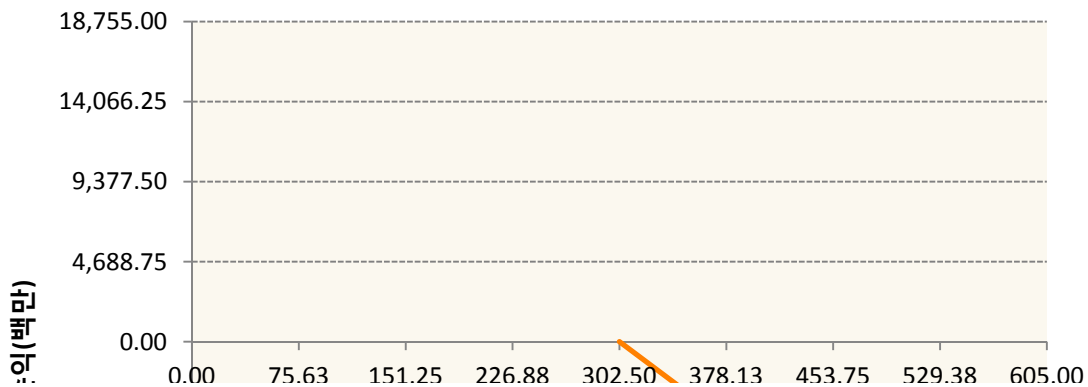
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	12,693	0	12,693	장내
누계	유가증권	옵션	2,165	24,931	-22,766	장내

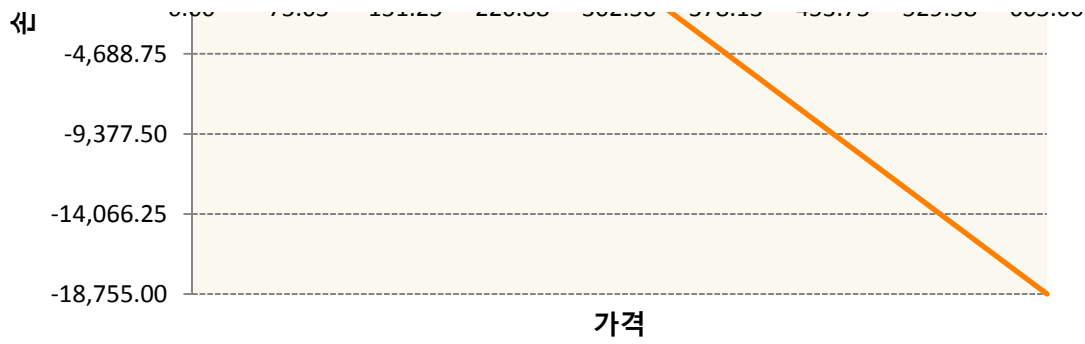
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P30007-2019-03 코스피200지수선물

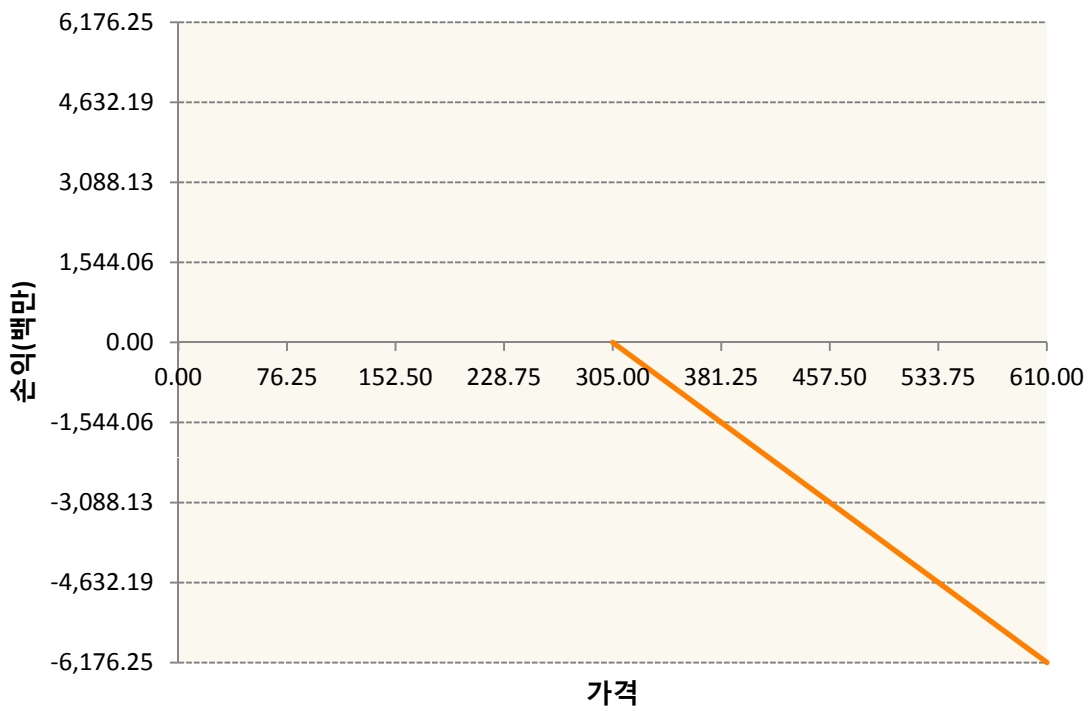


KR4201P33025-2019-03 콜302.5

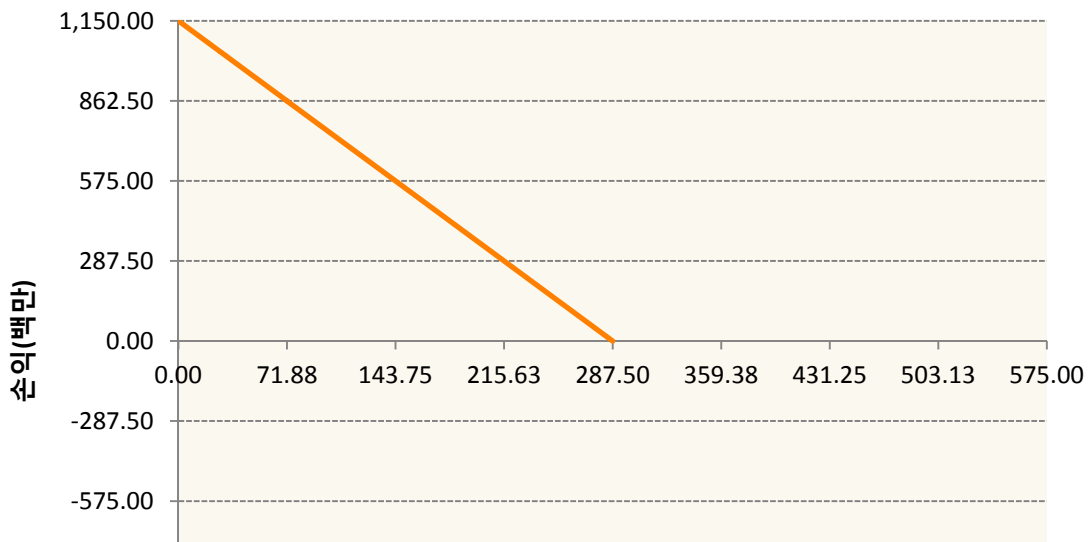


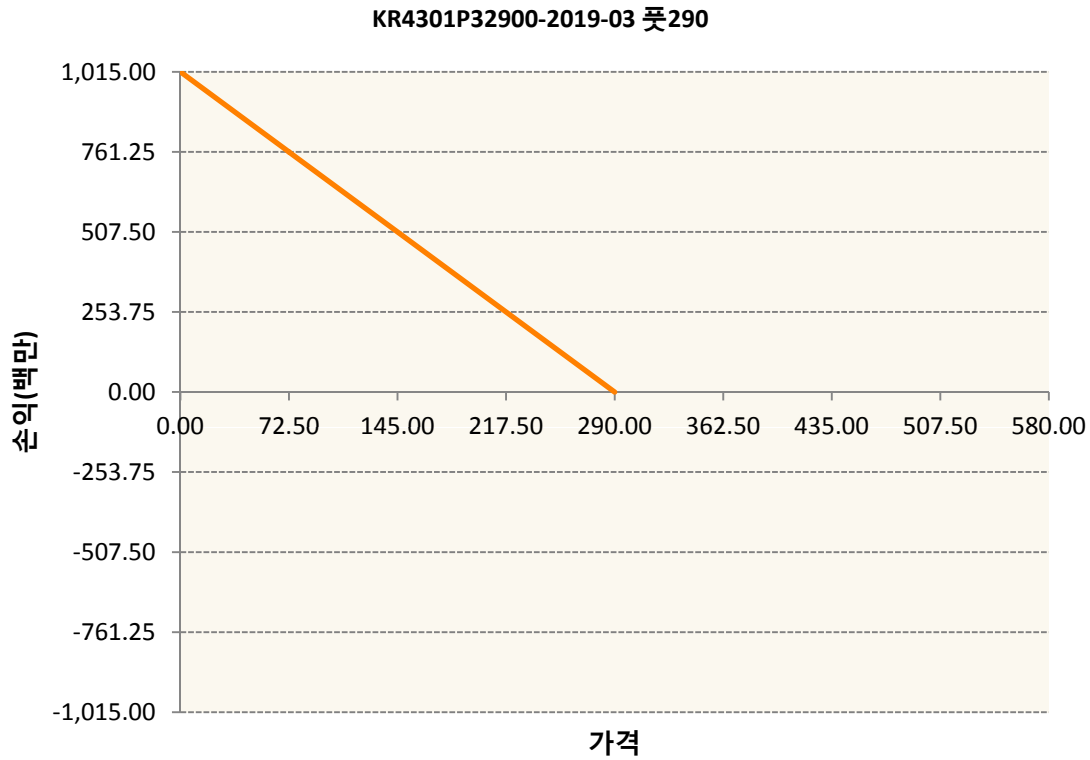
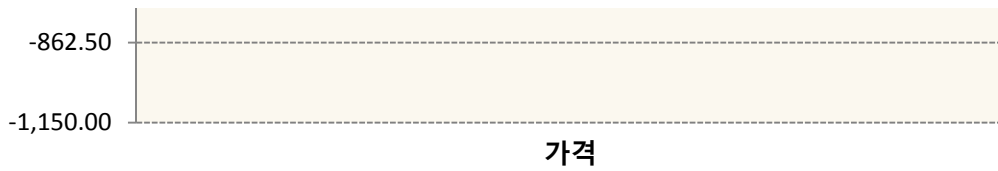


KR4201P33058-2019-03 콜305



KR4301P32876-2019-03 풋287.5





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101P30007		2019-03 코스피200지수선물						1,013
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-1,013	-1,013	-1,013	-1,013	-1,013	-1,013	-1,013	
-5.33%	-675	-675	-675	-675	-675	-675	-675	
-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%	675	675	675	675	675	675	675	
8.00%	1,013	1,013	1,013	1,013	1,013	1,013	1,013	
KR4201P33025		2019-03 콜302.5						348
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	6	6	6	6	6	6	6	
-5.33%	6	6	6	6	6	5	5	
-2.67%	6	6	6	5	4	3	1	

0%	5	4	3	0	-4	-8	-14
2.67%	-2	-8	-16	-25	-35	-47	-60
5.33%	-49	-66	-84	-102	-122	-142	-162
8.00%	-203	-227	-251	-275	-300	-324	-348
KR4201P33058 2019-03 콜305							92
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1	1	1	1	1	1	1
-5.33%	1	1	1	1	1	1	1
-2.67%	1	1	1	1	1	1	0
0%	1	1	1	0	-1	-2	-3
2.67%	0	-1	-3	-5	-8	-11	-14
5.33%	-9	-14	-18	-23	-29	-35	-41
8.00%	-46	-53	-61	-69	-76	-84	-92
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	59
-2.67%	29	29	29	29	29	29	29
0%	-1	-1	0	0	0	1	1
2.67%	-24	-23	-22	-22	-21	-20	-19
5.33%	-31	-31	-31	-30	-30	-29	-29
8.00%	-32	-32	-32	-32	-32	-32	-32
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%	26	26	26	26	26	26	26
0%	0	0	0	0	0	0	1
2.67%	-24	-23	-22	-22	-21	-21	-20
5.33%	-35	-34	-34	-33	-33	-32	-31
8.00%	-36	-36	-36	-36	-36	-36	-35

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

(단위:백만원)

1,175

공시일	2019-03-07
기준일	2019-03-06

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	994	0	994	

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	2019-03-07
기준일	2019-03-06

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	7,007	0	7,007	

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	2019-03-07
기준일	2019-03-06

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	39,560	0	39,560	
누계	통화	선도	0	39,401	-39,401	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음	
FX21019F02: KRW/USD 28-03-19E		470
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		106
FX21019G01 KRW/USD 19-03-19E		106
FX21019G01 KRW/USD 19-03-19E		43
FX21019G01 KRW/USD 21-03-19E		424
FX21019G01 KRW/USD 21-03-19E		271
FX21019G02 KRW/USD 25-03-19E		136
FX21019G02 KRW/USD 25-03-19E		479
FX21019G03 KRW/USD 28-03-19E		253
FX21019G03 KRW/USD 28-03-19E		117
FX21019G03 KRW/USD 29-03-19E		334
FX21019G04 KRW/USD 10-04-19E		72
FX21019H00 KRW/USD 08-04-19E		36
FX21019H00 KRW/USD 10-04-19E		36

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

(단위:백만원)

1,119

공시일	2019-03-07
기준일	2019-03-06

스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

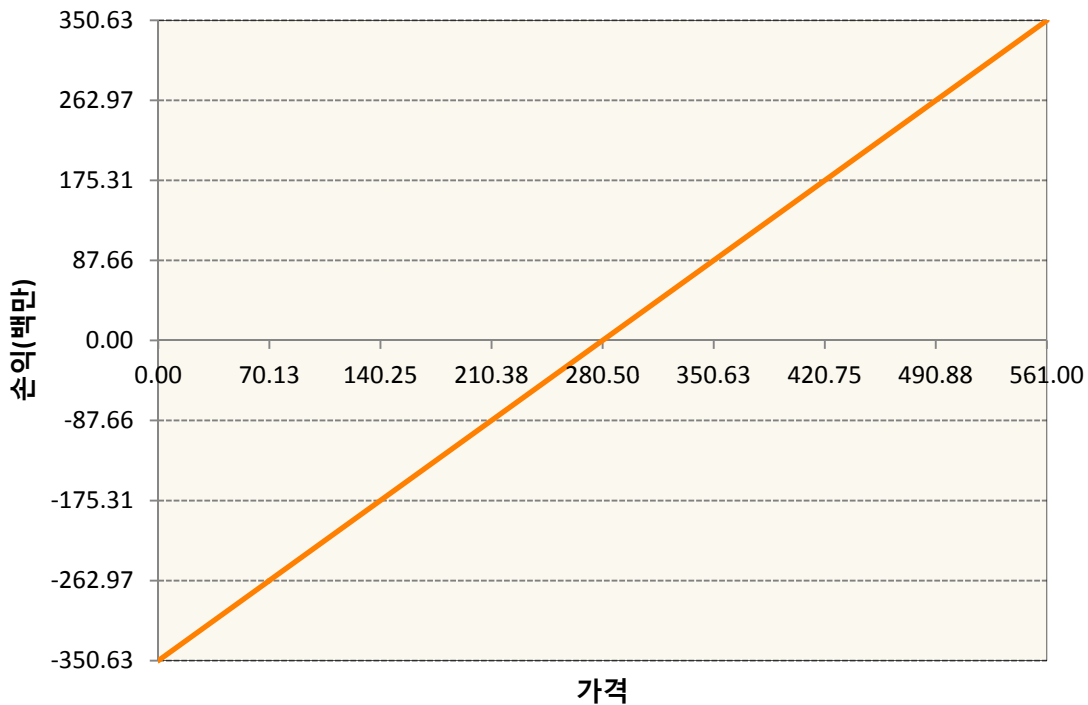
1. 계약금액

(단위:백만원)

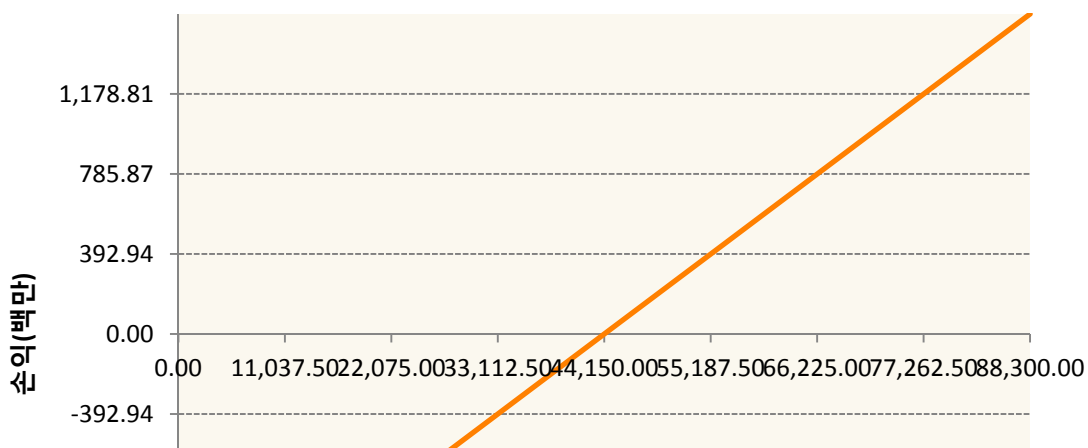
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,922	0	1,922	장내

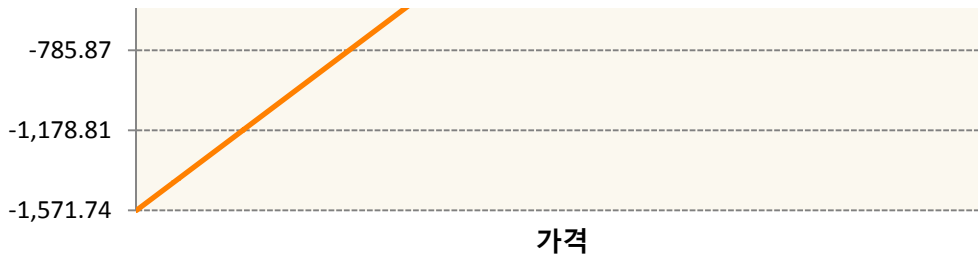
2. 만기시점의 손익구조

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						125
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-125	-125	-125	-125	-125	-125	-125	
-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%	125	125	125	125	125	125	125	

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

168

공시일	2019-03-07
기준일	2019-03-06

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

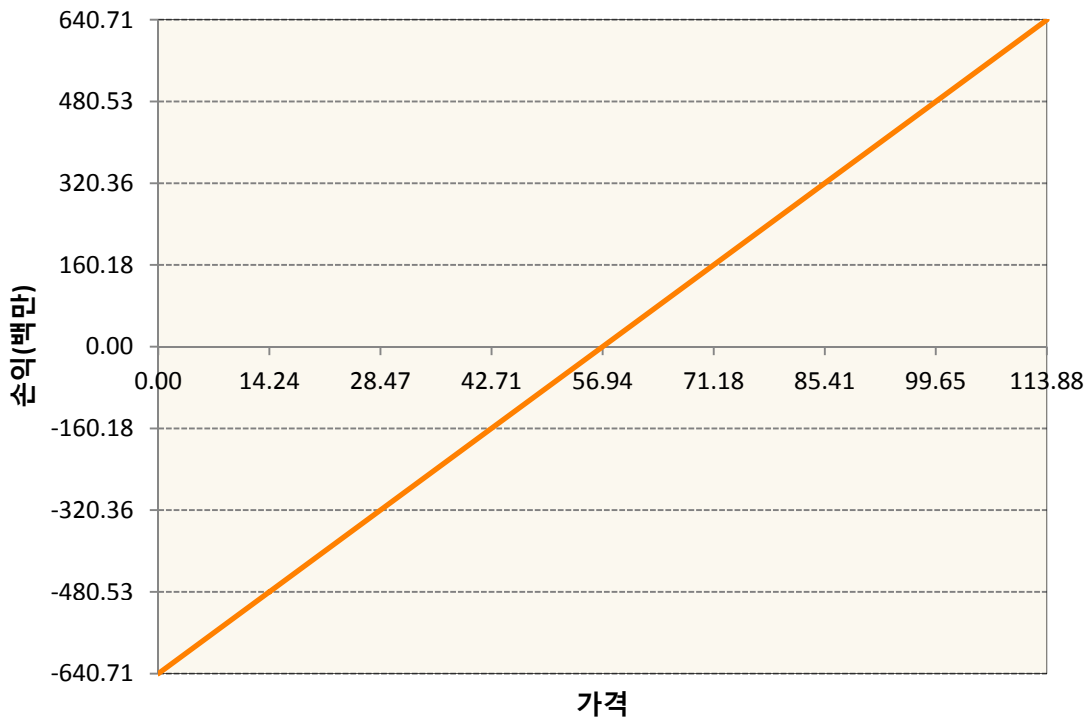
1. 계약금액

(단위:백만원)

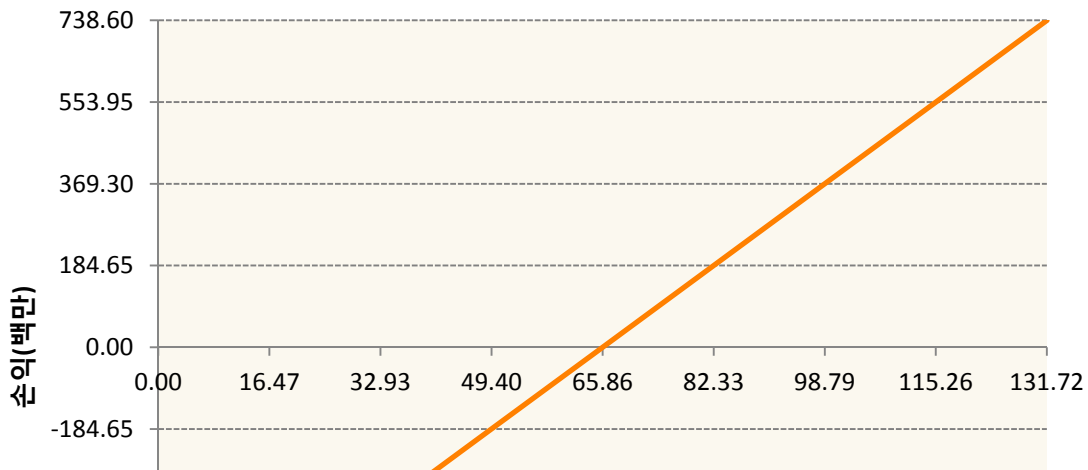
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,844	282	2,562	

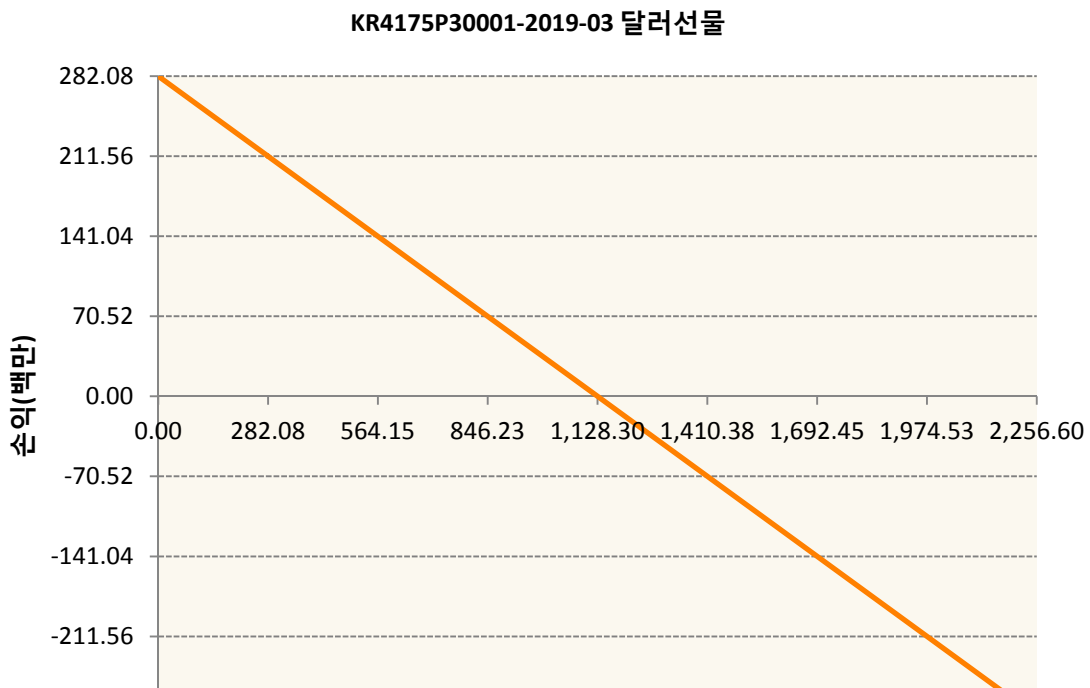
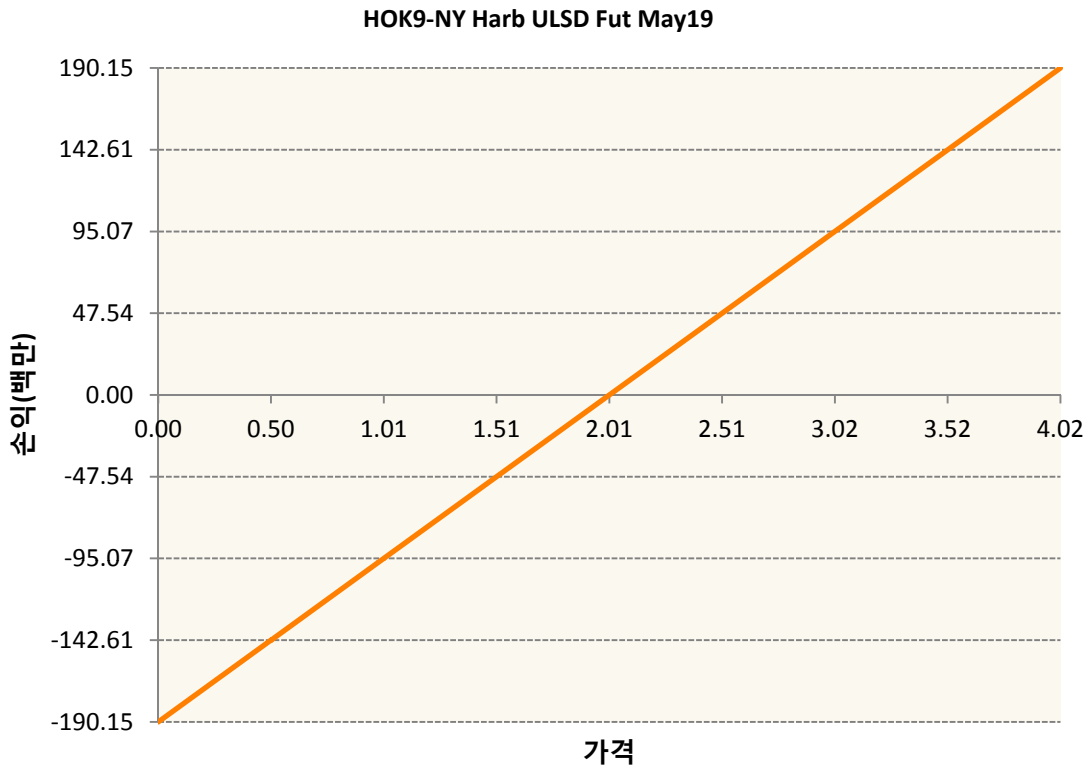
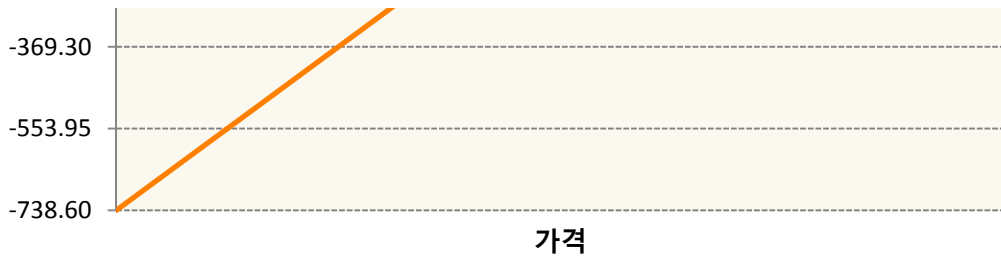
2. 만기시점의 손익구조

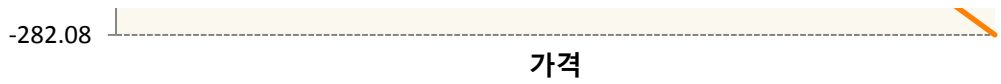
CLK9-WTI CRUDE FUTURE May19



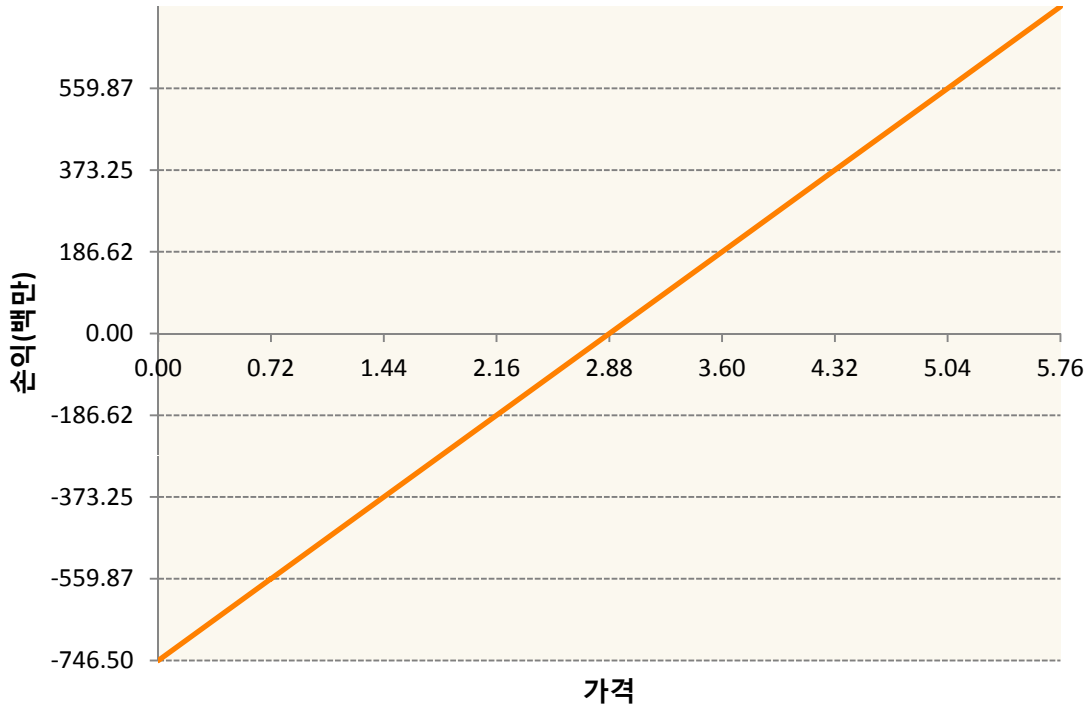
COK9-BRENT CRUDE FUTR May19



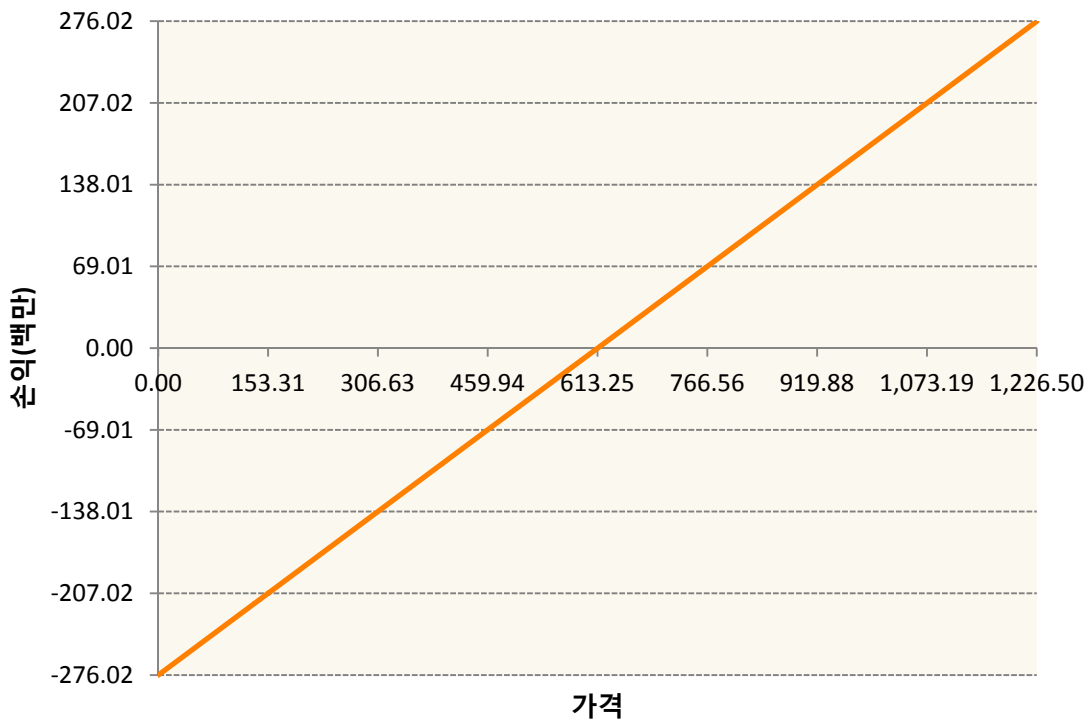




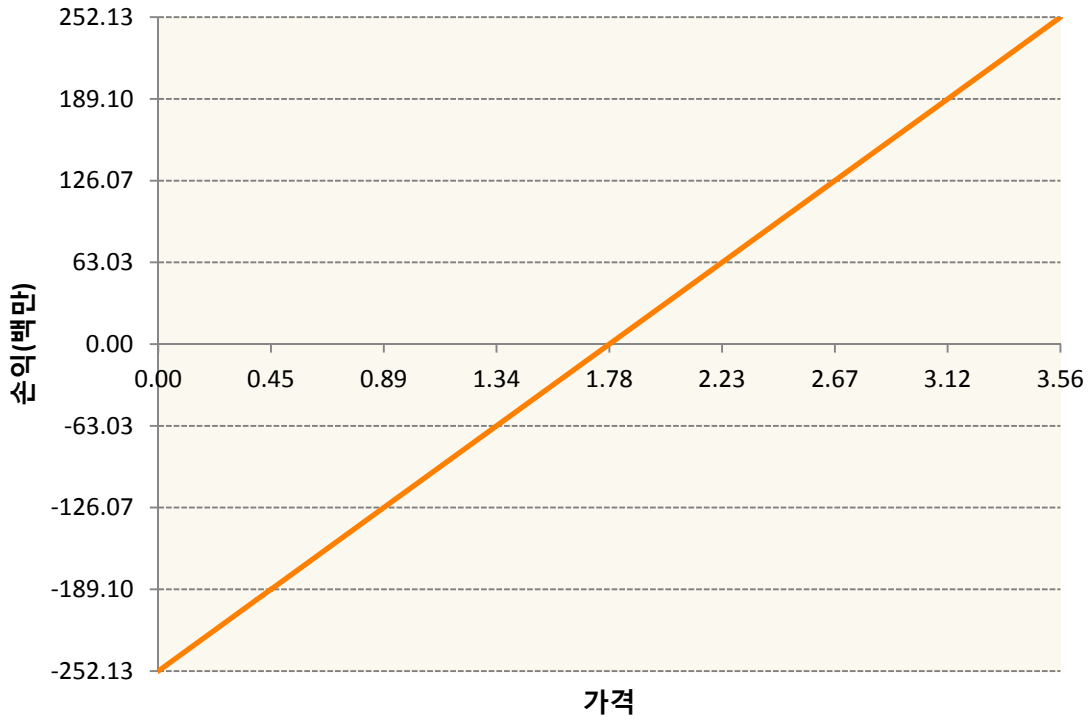
NGK19-NATURAL GAS FUTR May19



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	23
NGK19	NATURAL GAS FUTR May19	60
QSK9	Low Su Gasoil G May19	22
XBK9	GASOLINE RBOB FUT May19	20

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

(단위:백만원)

436

공시일	2019-03-07
기준일	2019-03-06

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

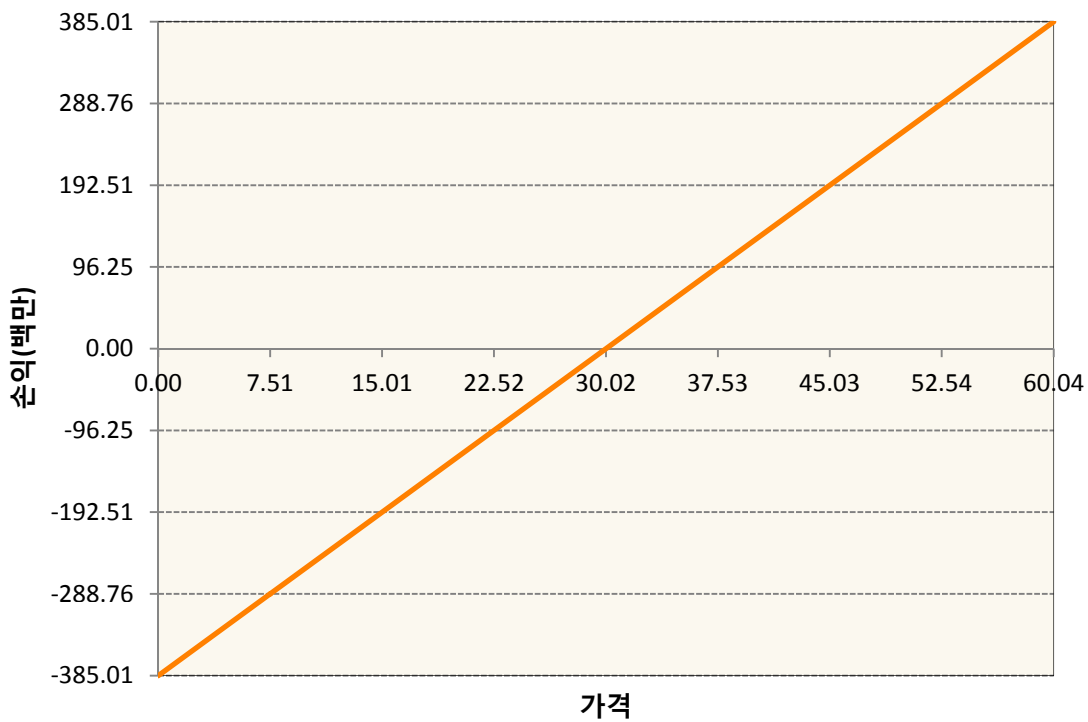
1. 계약금액

(단위:백만원)

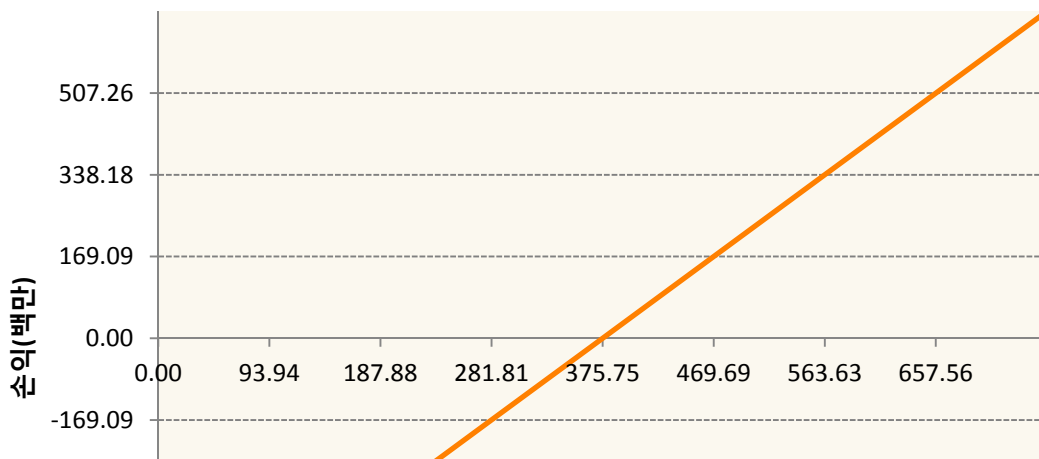
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,410	79	3,331	

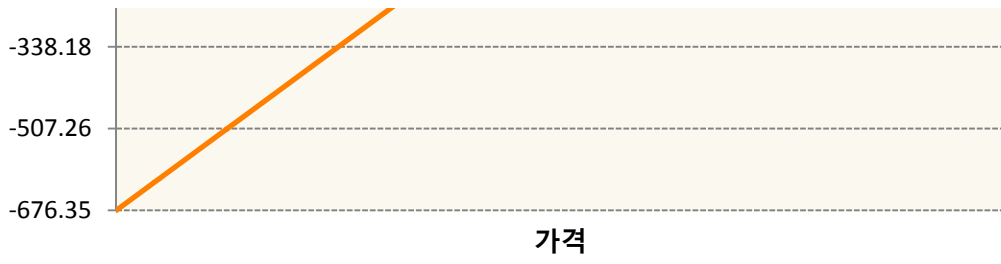
2. 만기시점의 손익구조

BOK9-SOYBEAN OIL FUTR May19

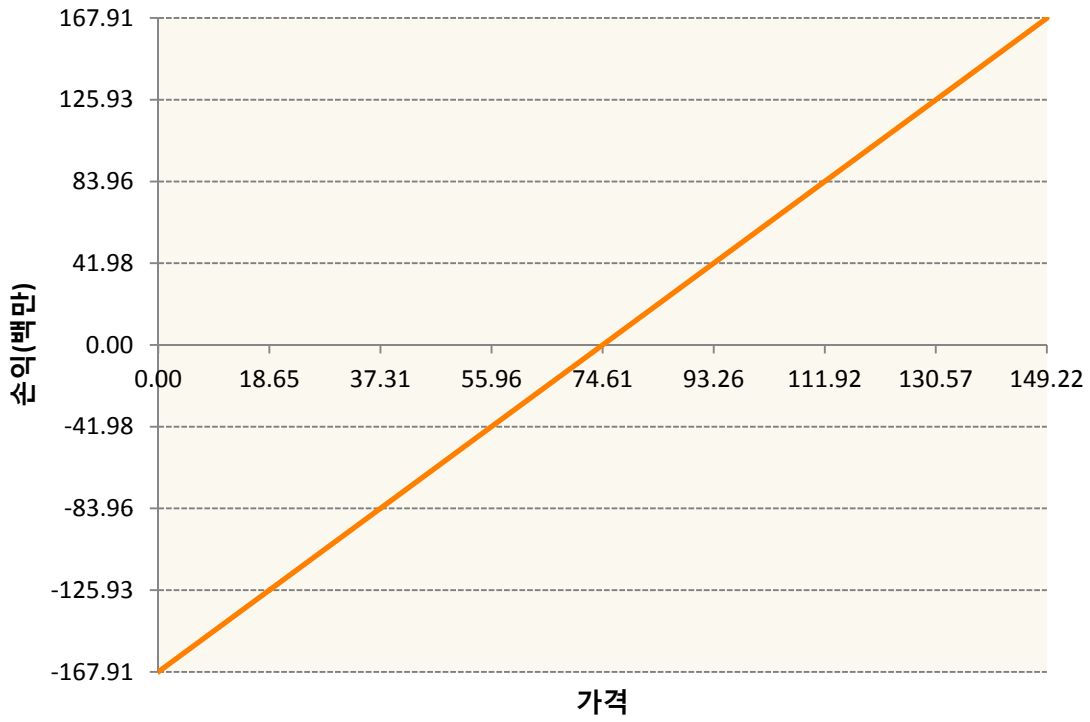


CK9-CORN FUTURE May19

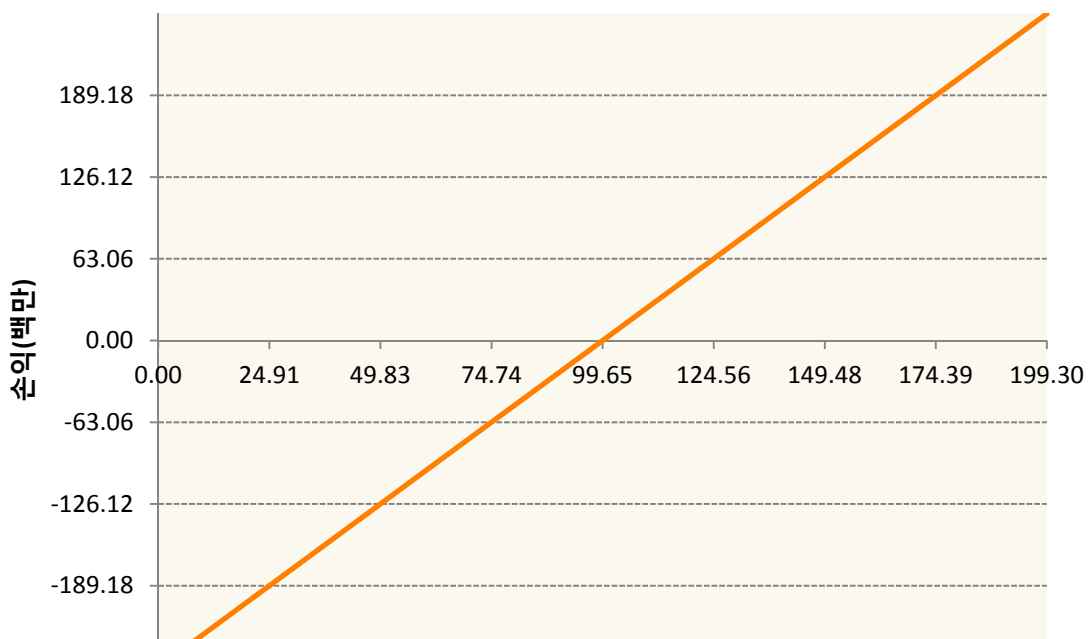


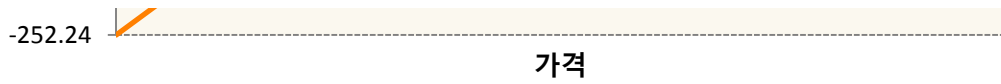


CTK9-COTTON NO.2 FUTR May19

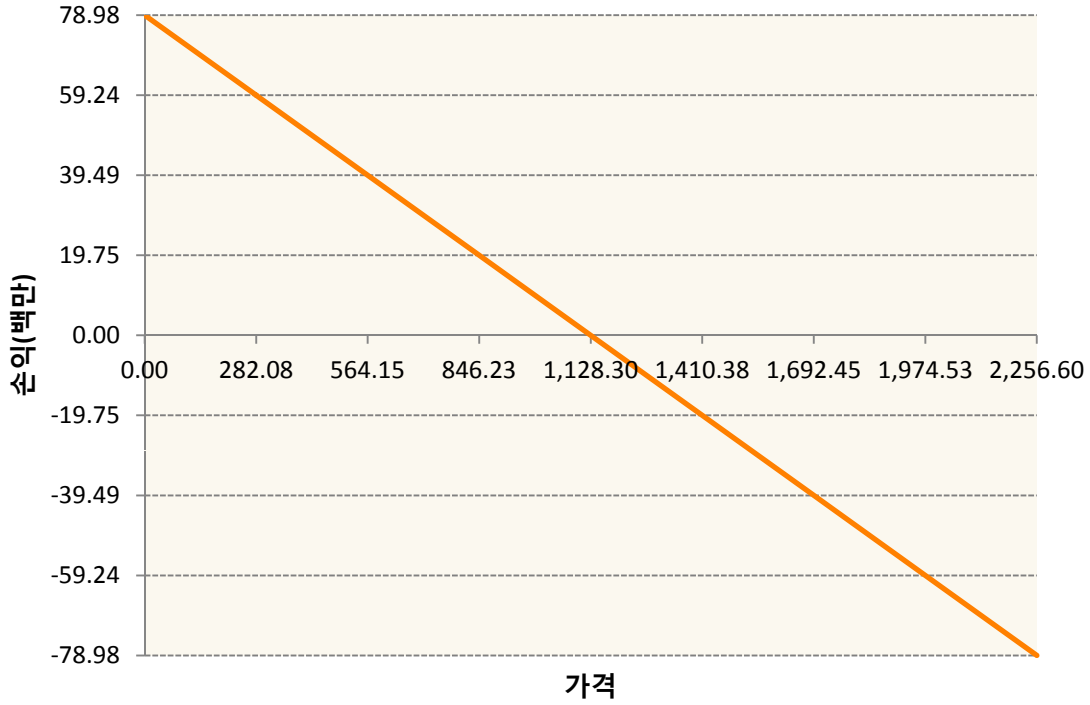


KCK9-COFFEE 'C' FUTURE May19

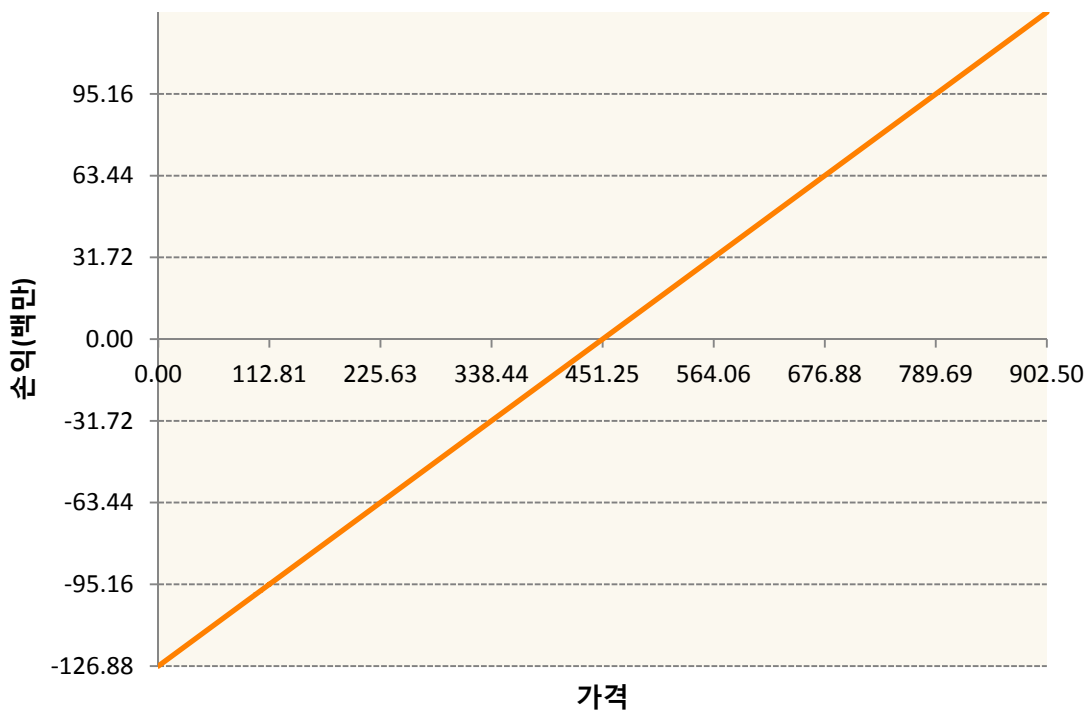




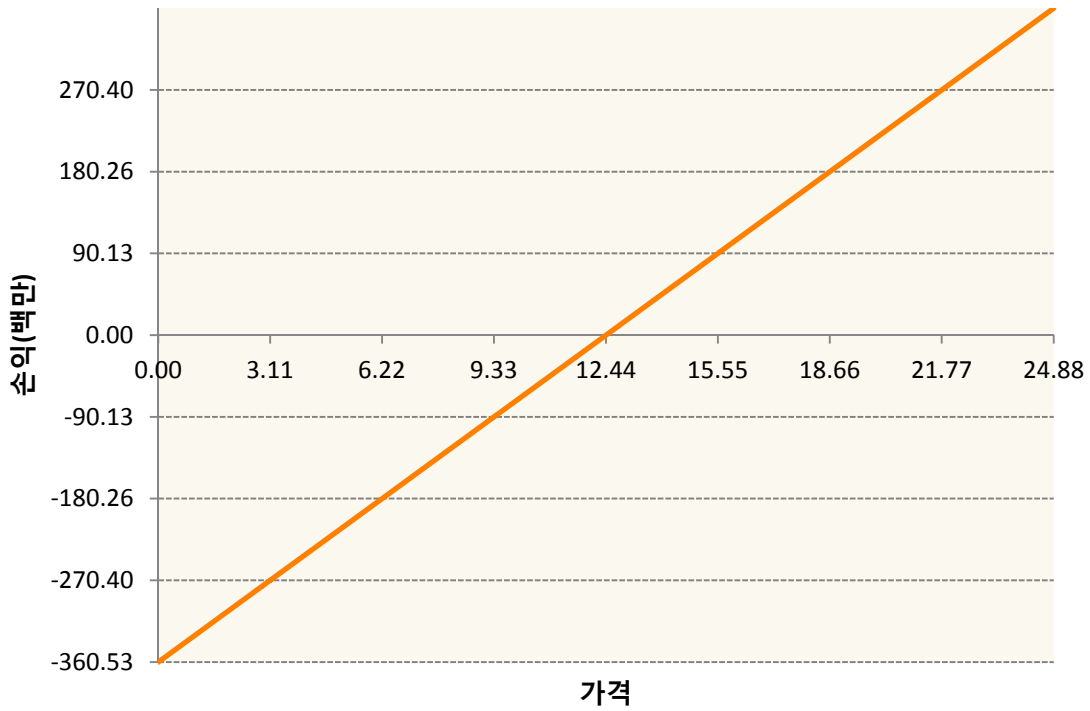
KR4175P30001-2019-03 달러선물



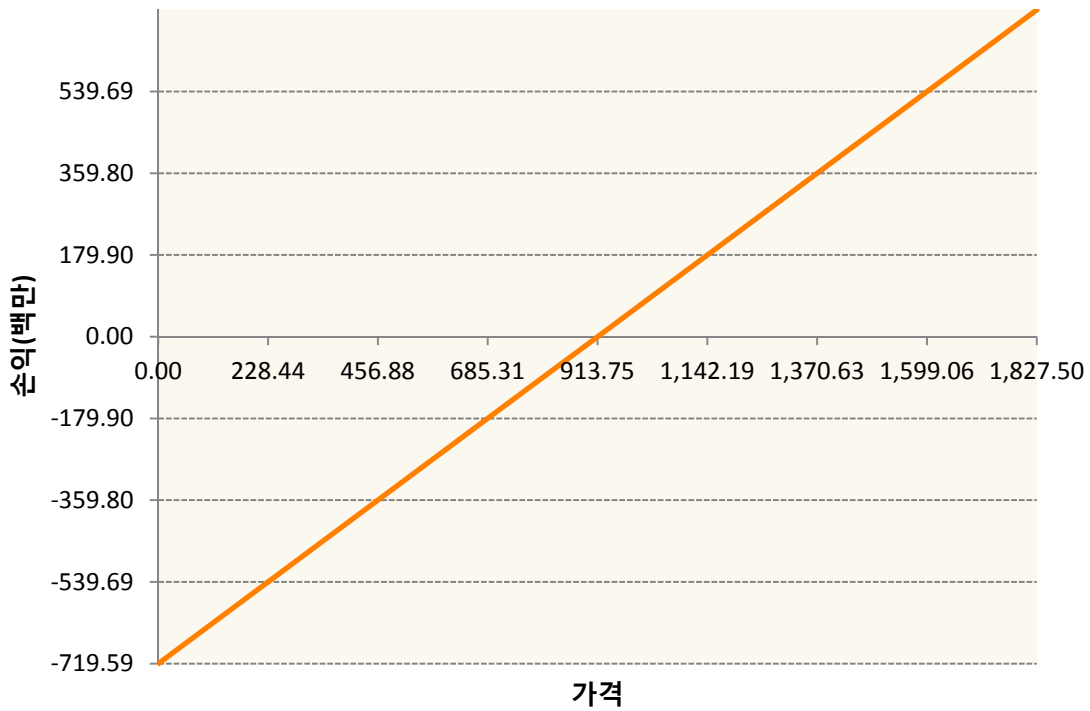
KWK9-KC HRW WHEAT FUT May19



SBK9-SUGAR #11 (WORLD) May19

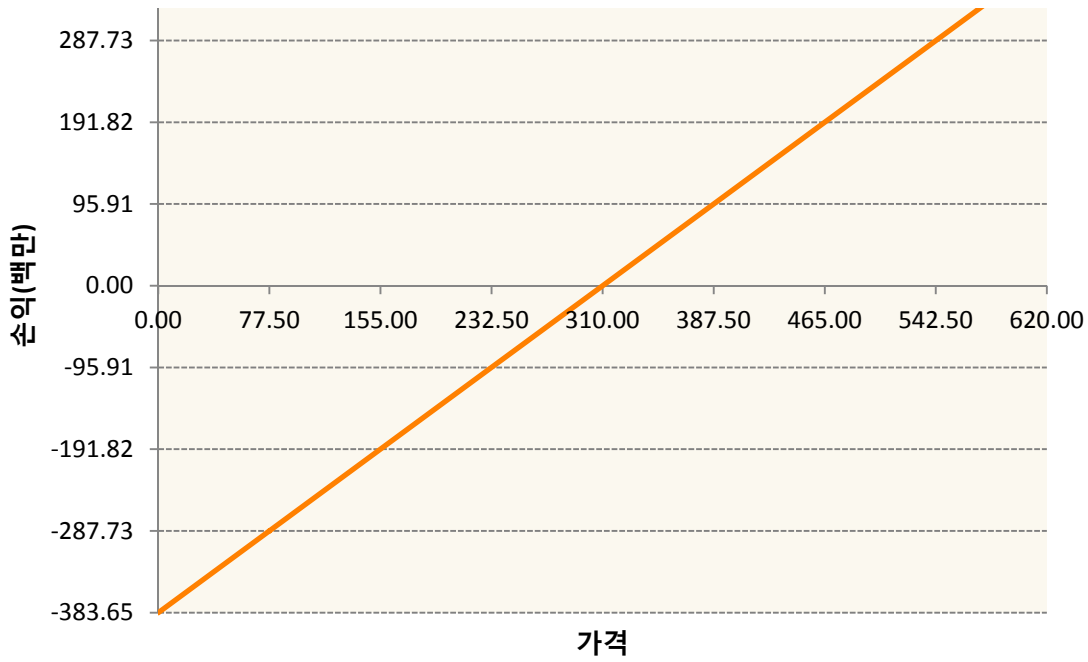


SK9-SOYBEAN FUTURE May19

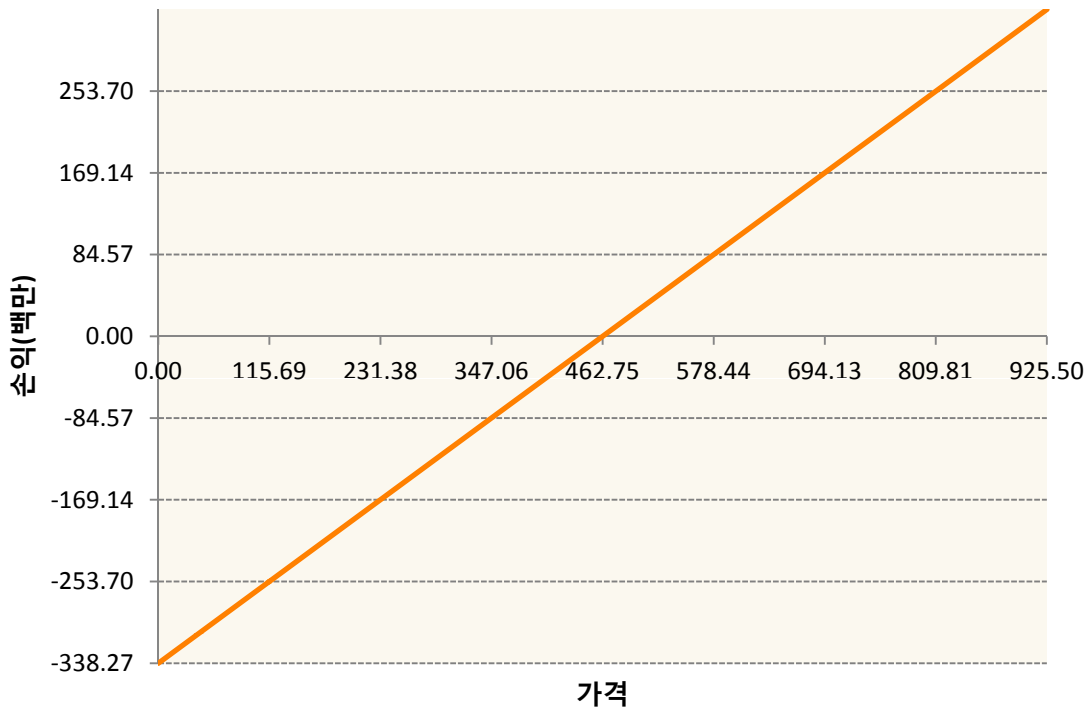


SMK9-SOYBEAN MEAL FUTR May19





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)

272