

공시일	2019-03-08
기준일	2019-03-07

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	2019-03-08
기준일	2019-03-07

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

1,110

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

640

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-03-08
기준일	2019-03-07

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

341

SWCSI50000 신한CSI500미래S190129

102

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

671

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-03-08
기준일	2019-03-07

유로인덱스모(주식-파생형)

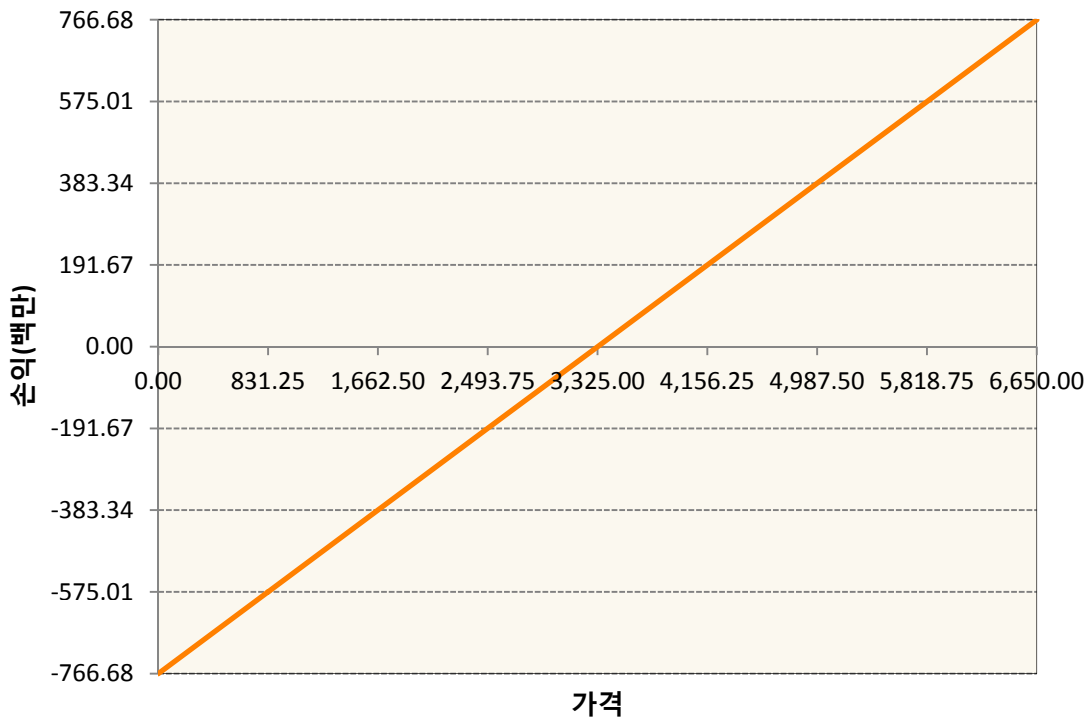
1. 계약금액

(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	2019-03-08
기준일	2019-03-07

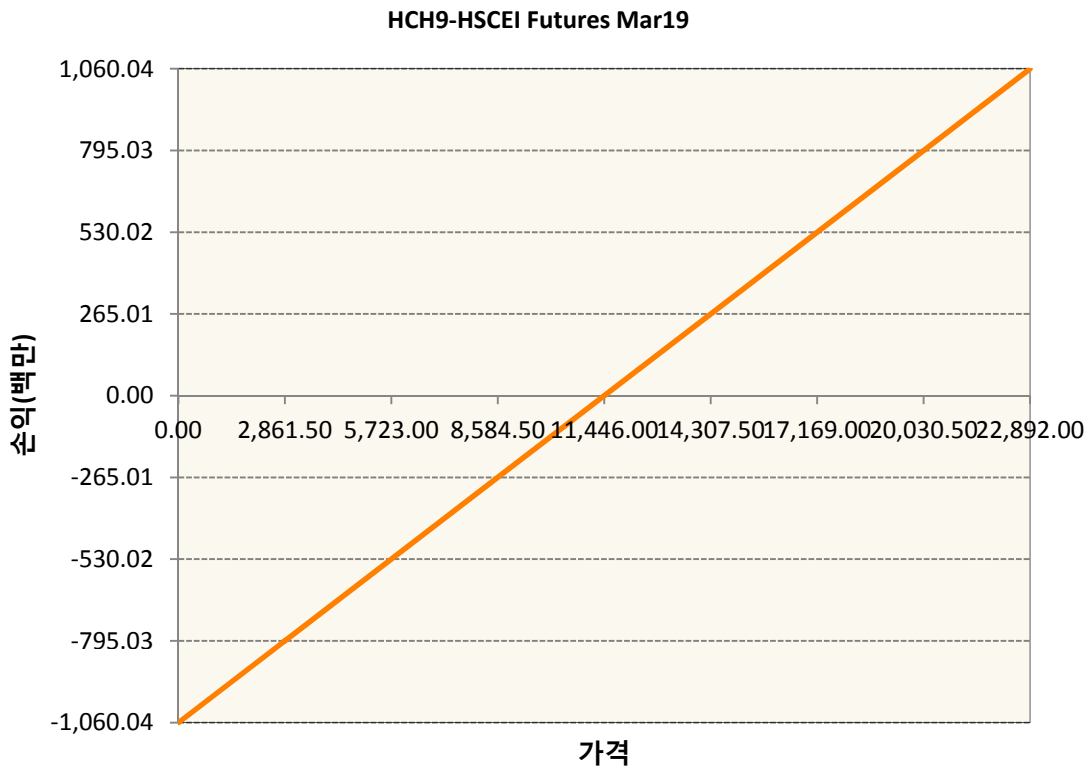
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	1,060	0	1,060	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	2019-03-08
기준일	2019-03-07

커버드콜모(주식혼합-파생형)

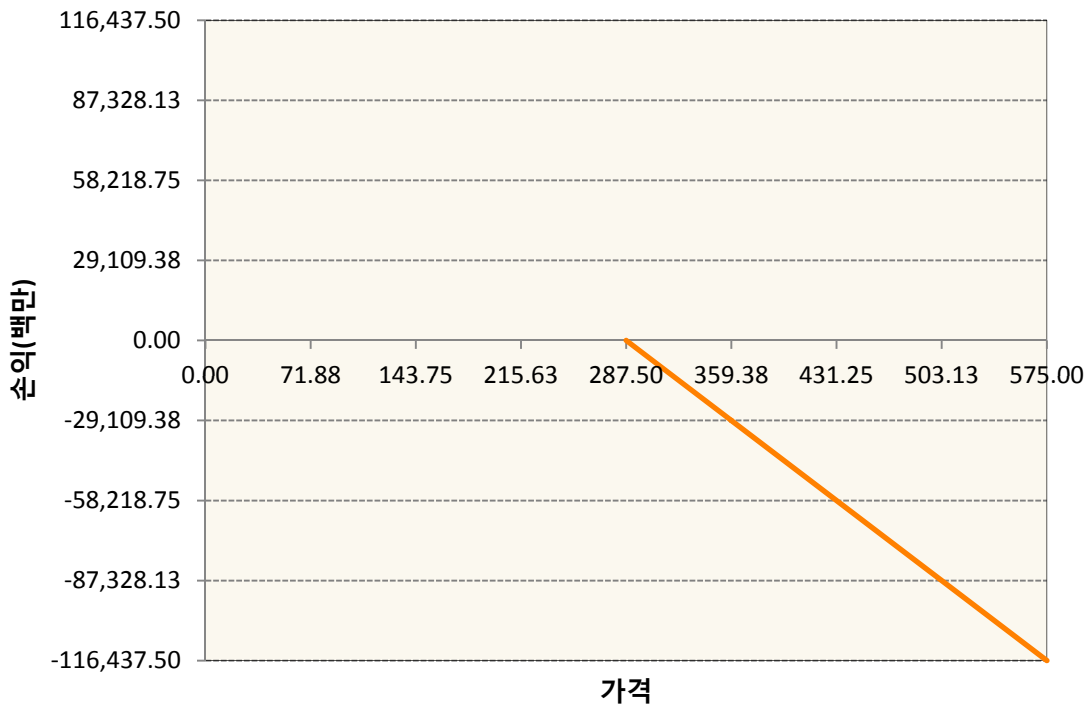
1. 계약금액

(단위:백만원)

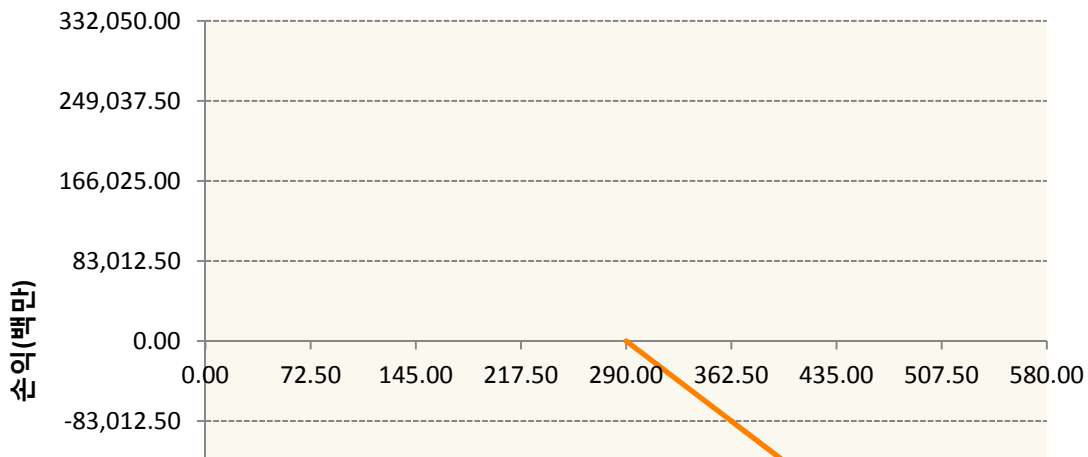
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	701,488	-701,488	장내

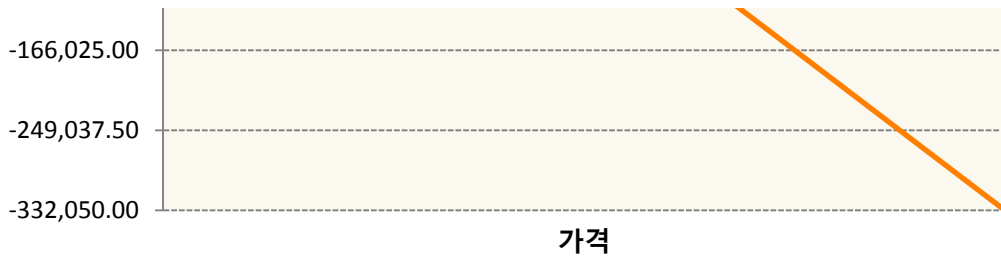
2. 만기시점의 손익구조

KR4201P32878-2019-03 콜287.5

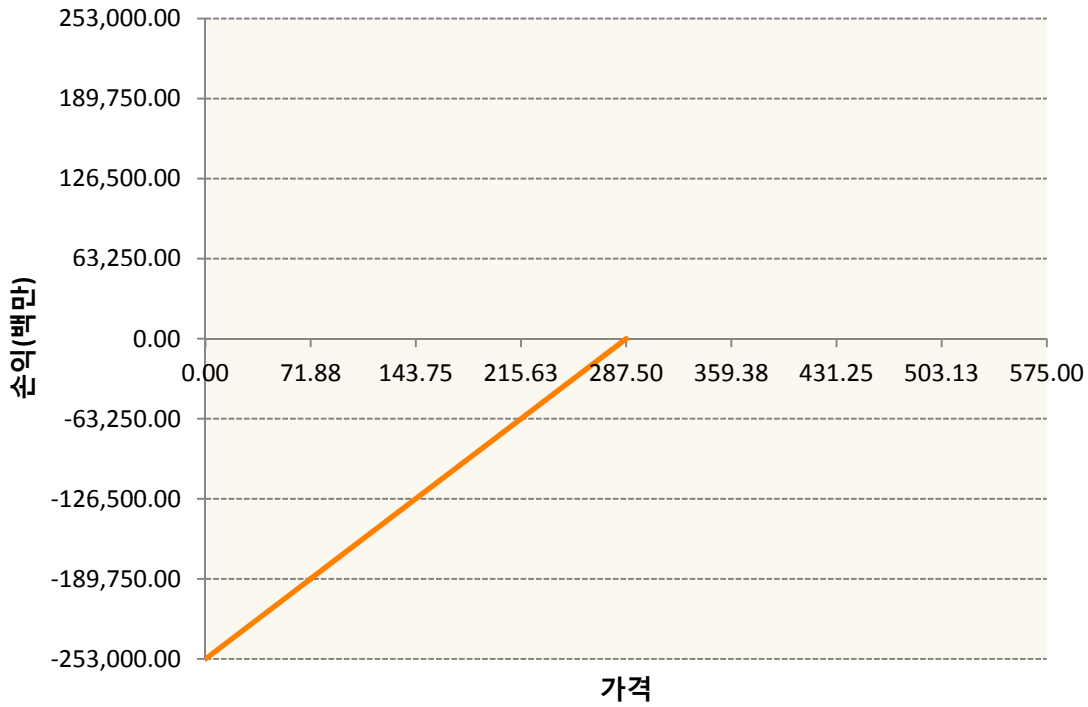


KR4201P32902-2019-03 콜290





KR4301P32876-2019-03 풋287.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201P32878		2019-03 콜287.5					5,494
		기초자산의 변동성					
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	465	465	465	464	462	460	455
-5.33%	464	462	459	452	441	426	406
-2.67%	446	427	401	366	323	273	215
0%	260	181	94	0	-100	-204	-313
2.67%	-566	-705	-844	-983	-1,122	-1,262	-1,401
5.33%	-2,447	-2,555	-2,668	-2,786	-2,907	-3,030	-3,157
8.00%	-5,121	-5,160	-5,210	-5,269	-5,337	-5,412	-5,494
KR4201P32902		2019-03 콜290					13,667
		기초자산의 변동성					
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	844	844	844	843	841	837	829

-5.33%	843	841	837	826	809	782	743
-2.67%	822	795	751	687	604	499	375
0%	546	391	208	0	-229	-477	-741
2.67%	-1,007	-1,366	-1,733	-2,105	-2,480	-2,859	-3,241
5.33%	-5,302	-5,668	-6,040	-6,418	-6,799	-7,183	-7,570
8.00%	-12,269	-12,442	-12,643	-12,870	-13,119	-13,385	-13,667
KR4301P32876 2019-03 풋287.5							19,488
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-19,488	-19,488	-19,488	-19,488	-19,488	-19,488	-19,488
-5.33%	-12,946	-12,946	-12,946	-12,946	-12,946	-12,947	-12,947
-2.67%	-6,405	-6,405	-6,406	-6,408	-6,412	-6,418	-6,427
0%	108	82	46	0	-56	-122	-196
2.67%	5,645	5,483	5,321	5,157	4,993	4,828	4,663
5.33%	7,619	7,551	7,471	7,380	7,280	7,172	7,057
8.00%	7,750	7,748	7,743	7,733	7,719	7,698	7,671

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

(단위:백만원)

38,390

공시일	2019-03-08
기준일	2019-03-07

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

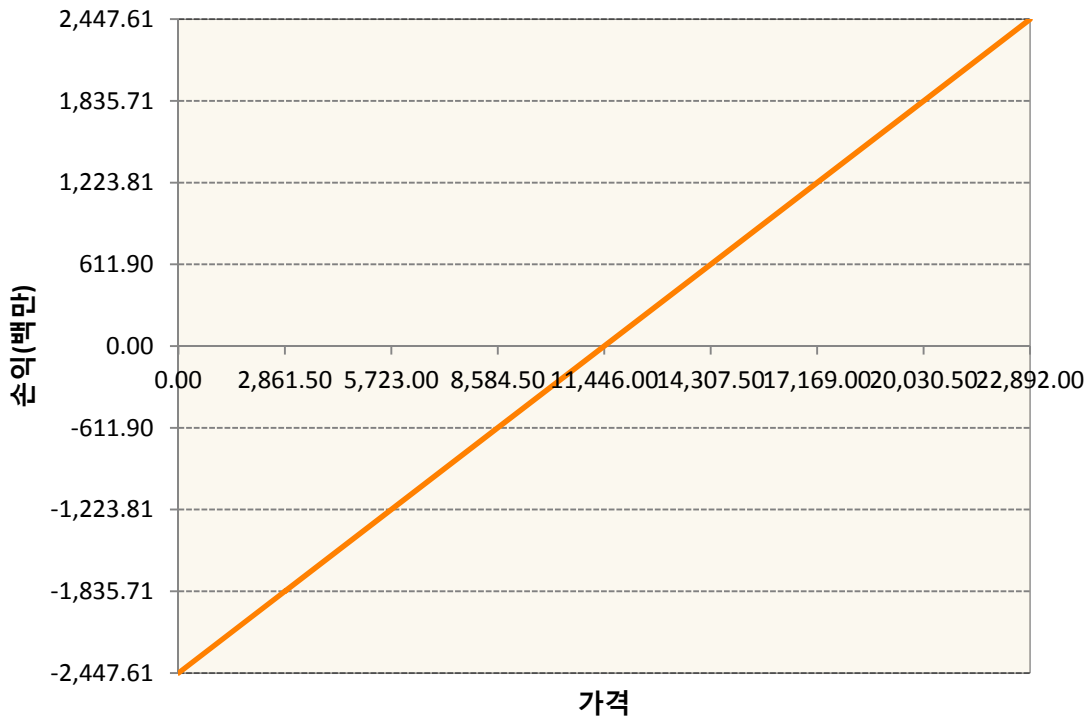
1. 계약금액

(단위:백만원)

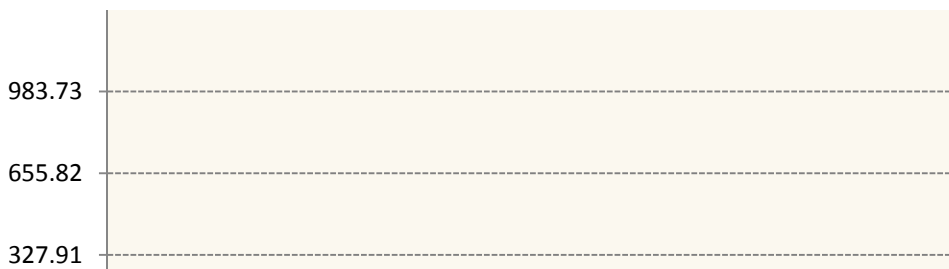
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	2,448	0	2,448	장내
누계	유가증권	옵션	0	6,262	-6,262	장내
누계	통화	선도	0	5,753	-5,753	장외

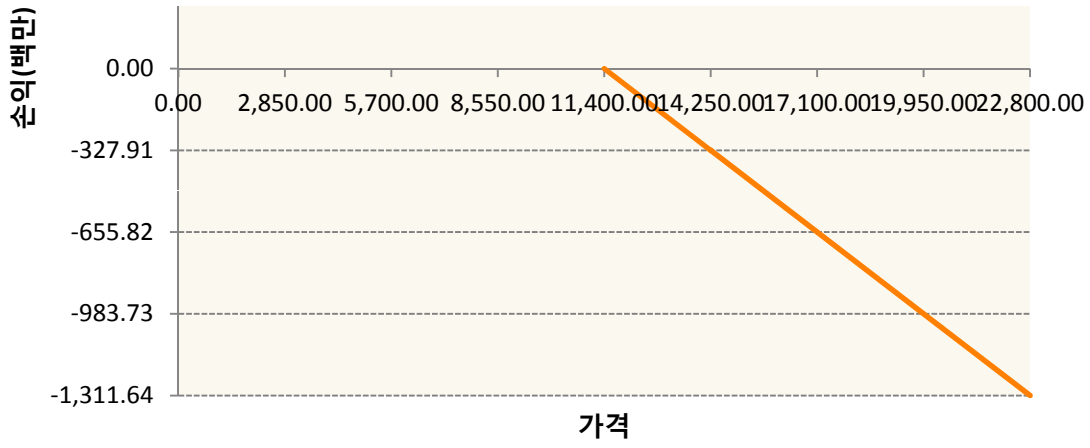
2. 만기시점의 손익구조

HCH9-HSCEI Futures Mar19

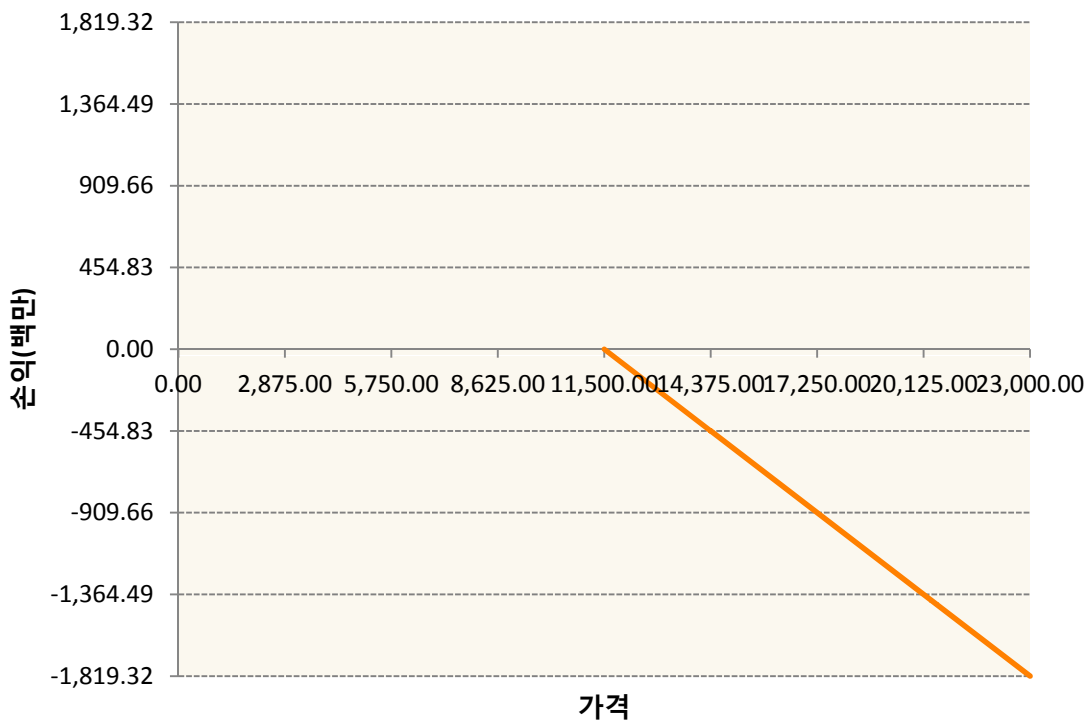


OHHIH9-C114-HSCEI

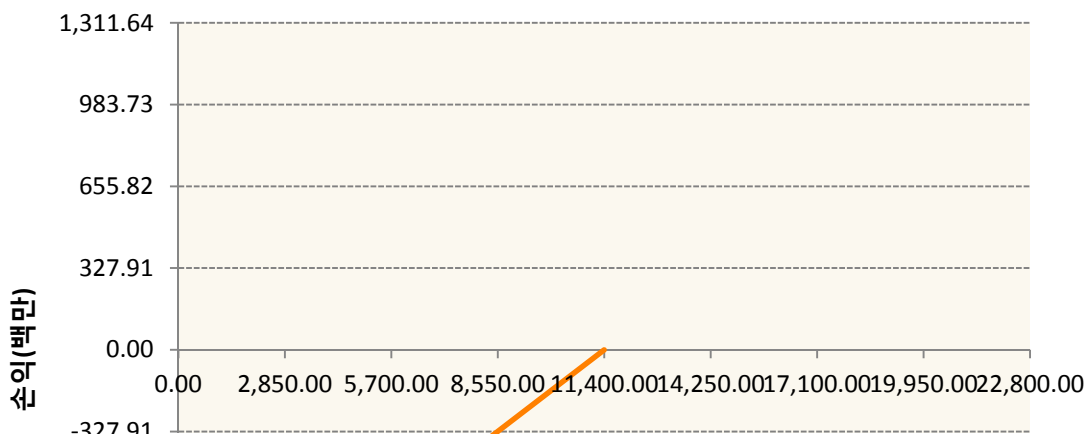


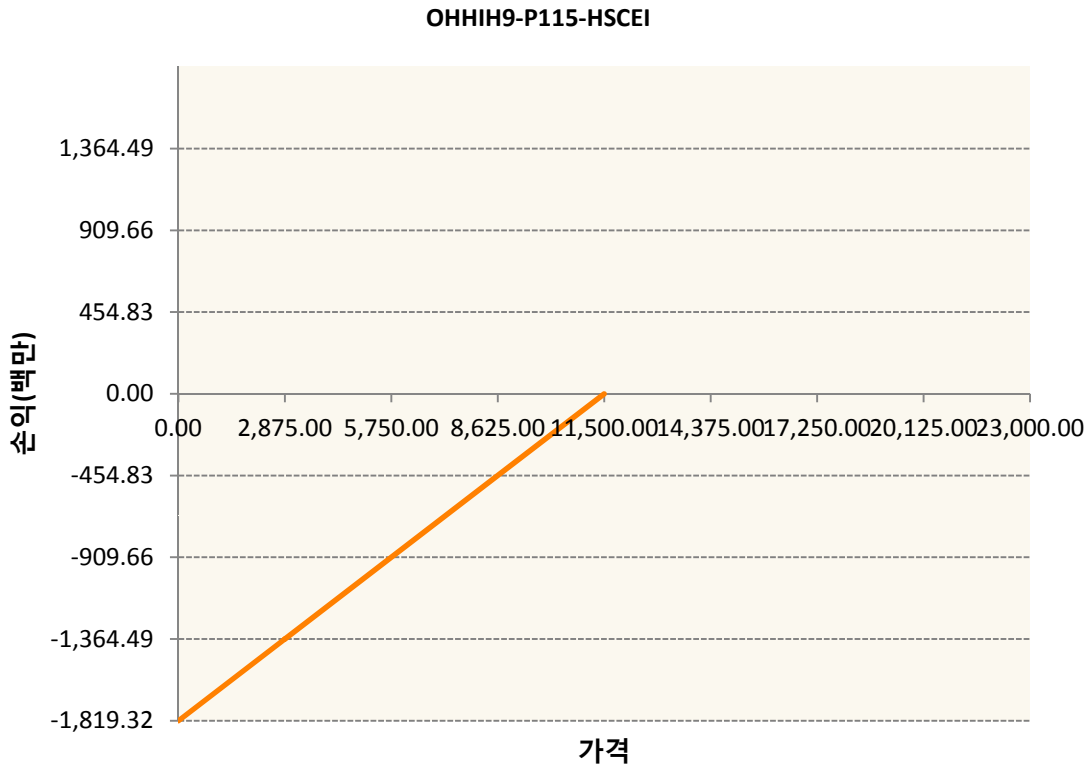


OHHIH9-C115-HSCEI



OHHIH9-P114-HSCEI





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)	(단위:백만원)
FX21018Z00 KRW/HKD 11-03-19E	219
FX21019H01 KRW/HKD 24-05-19E	219
FX21019H01 KRW/HKD 24-05-19E	23
HCH9 HSCEI Futures Mar19	196
OHHIH9-C11 HSCEI	105
OHHIH9-C11 HSCEI	146
OHHIH9-P11 HSCEI	105
OHHIH9-P11 HSCEI	146

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	877

공시일	2019-03-08
기준일	2019-03-07

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

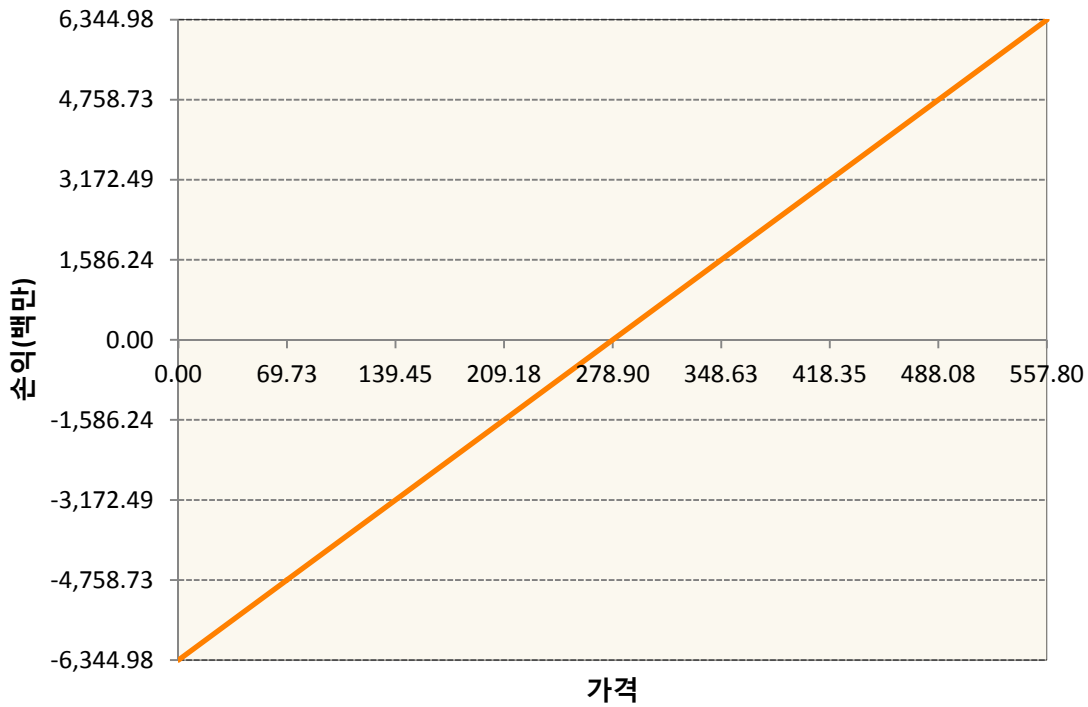
1. 계약금액

(단위:백만원)

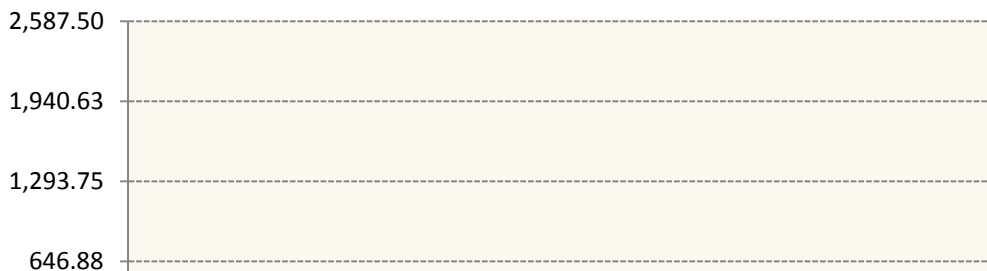
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	7,000	0	7,000	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	6,345	0	6,345	장내
누계	유가증권	스왑	35,836	0	35,836	장외
누계	유가증권	옵션	0	36,139	-36,139	장내

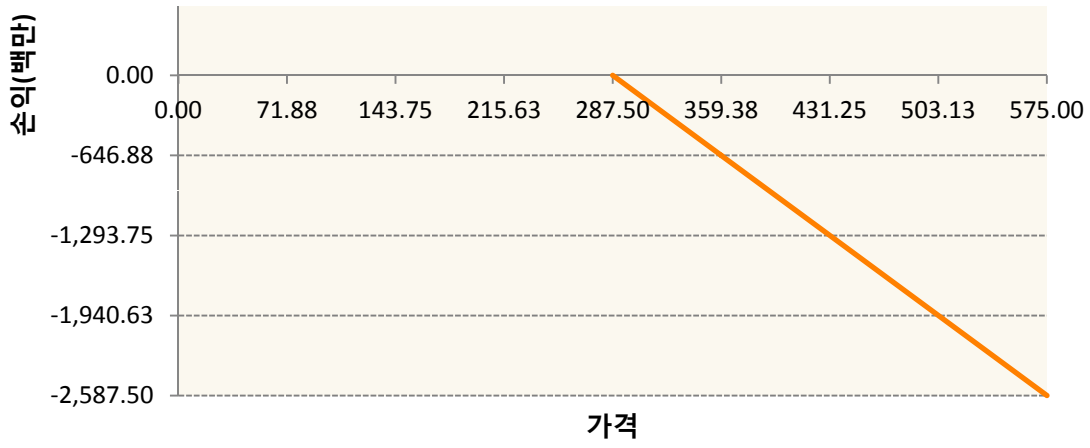
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P30007-2019-03 코스피200지수선물

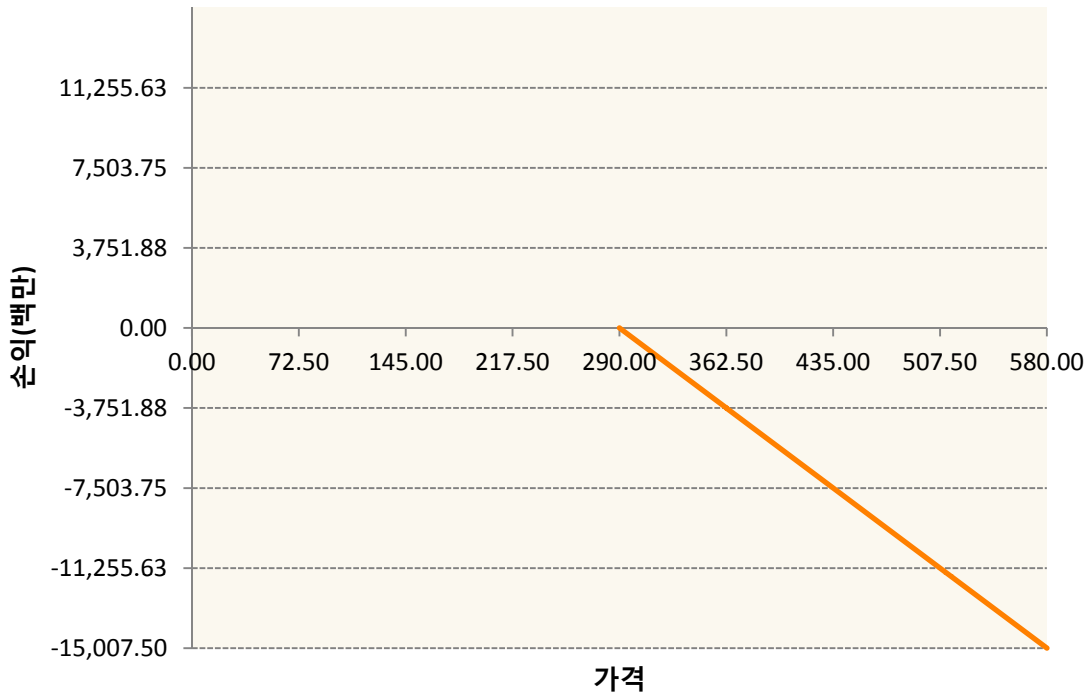


KR4201P32878-2019-03 콜287.5

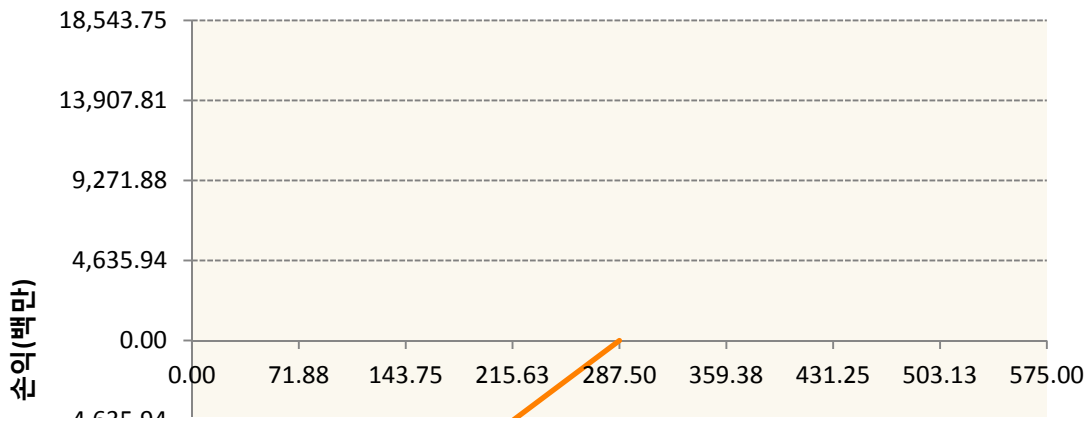


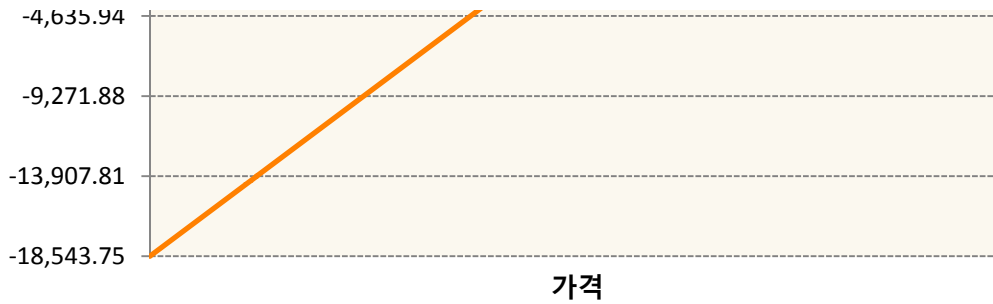


KR4201P32902-2019-03 콜290



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	
2.529E+11		UBCSFXC1 INDEX_15						589
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-589	-589	-589	-589	-589	-589	-589	
-5.33%	-393	-393	-393	-393	-393	-393	-393	
-2.67%	-196	-196	-196	-196	-196	-196	-196	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	196	196	196	196	196	196	196	
5.33%	393	393	393	393	393	393	393	
8.00%	589	589	589	589	589	589	589	
KR4101P30007		2019-03 코스피200지수선물						508
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-508	-508	-508	-508	-508	-508	-508	
-5.33%	-338	-338	-338	-338	-338	-338	-338	
-2.67%	-169	-169	-169	-169	-169	-169	-169	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	169	169	169	169	169	169	169	
5.33%	338	338	338	338	338	338	338	
8.00%	508	508	508	508	508	508	508	
KR4201P32878		2019-03 콜287.5						122
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	10	9	9
-2.67%	10	9	9	8	7	6	5
0%	6	4	2	0	-2	-5	-7
2.67%	-13	-16	-19	-22	-25	-28	-31
5.33%	-54	-57	-59	-62	-65	-67	-70
8.00%	-114	-115	-116	-117	-119	-120	-122
KR4201P32902 2019-03 콜290							618

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	38	38	38	38	38	38	37
-5.33%	38	38	38	37	37	35	34
-2.67%	37	36	34	31	27	23	17
0%	25	18	9	0	-10	-22	-33
2.67%	-45	-62	-78	-95	-112	-129	-146
5.33%	-240	-256	-273	-290	-307	-325	-342
8.00%	-555	-562	-571	-582	-593	-605	-618
KR4301P32876 2019-03 풋287.5							1,428

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,428	-1,428	-1,428	-1,428	-1,428	-1,428	-1,428
-5.33%	-949	-949	-949	-949	-949	-949	-949
-2.67%	-469	-469	-470	-470	-470	-470	-471
0%	8	6	3	0	-4	-9	-14
2.67%	414	402	390	378	366	354	342
5.33%	558	553	548	541	534	526	517
8.00%	568	568	567	567	566	564	562

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

(단위:백만원)

5,716

공시일	2019-03-08
기준일	2019-03-07

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

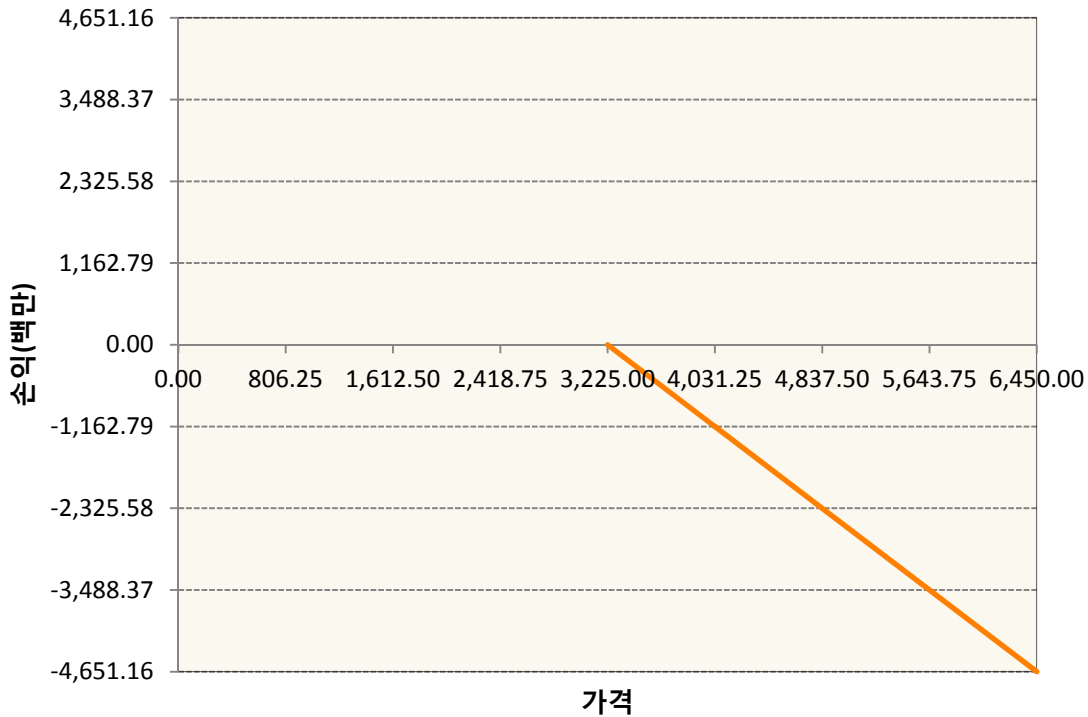
1. 계약금액

(단위:백만원)

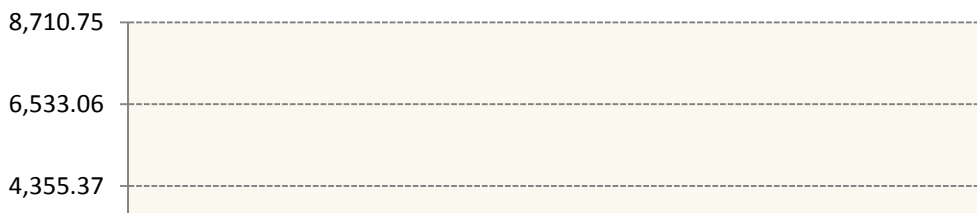
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	7,195	0	7,195	
누계	유가증권	스왑	60,254	0	60,254	장외
누계	유가증권	옵션	0	26,724	-26,724	장내
누계	통화	선도	0	15,315	-15,315	장외

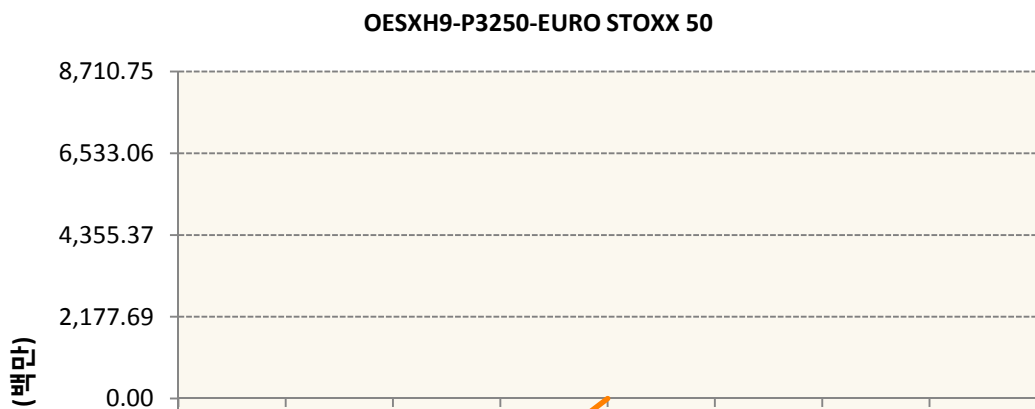
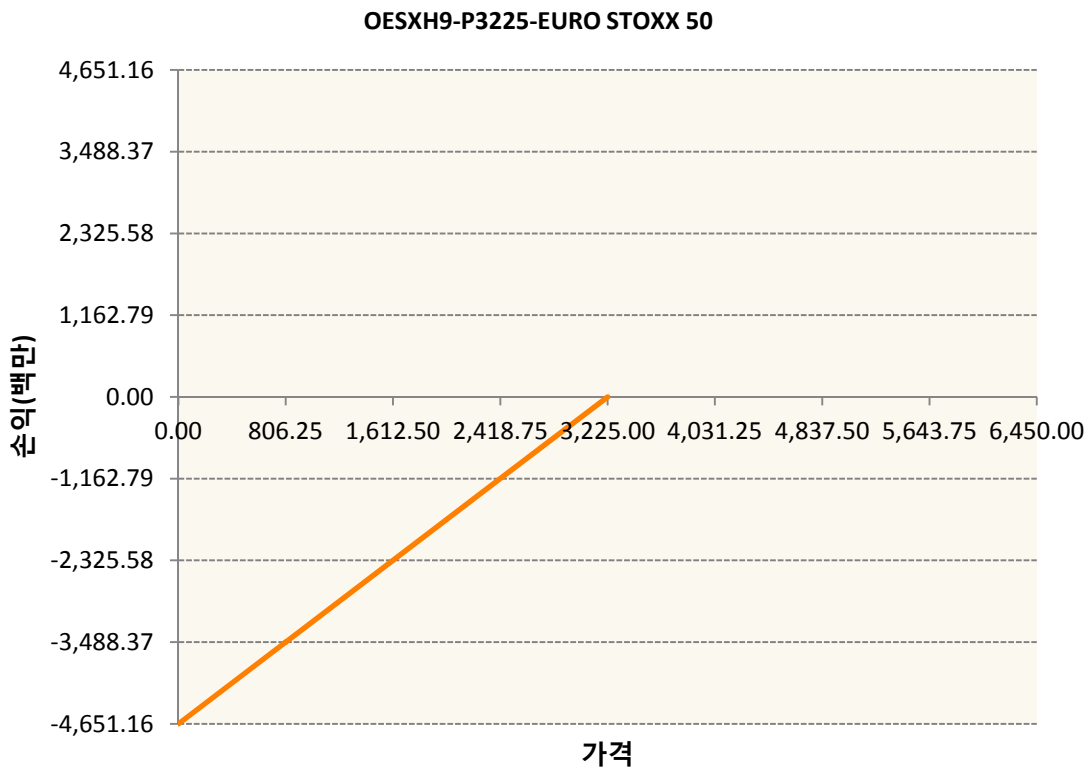
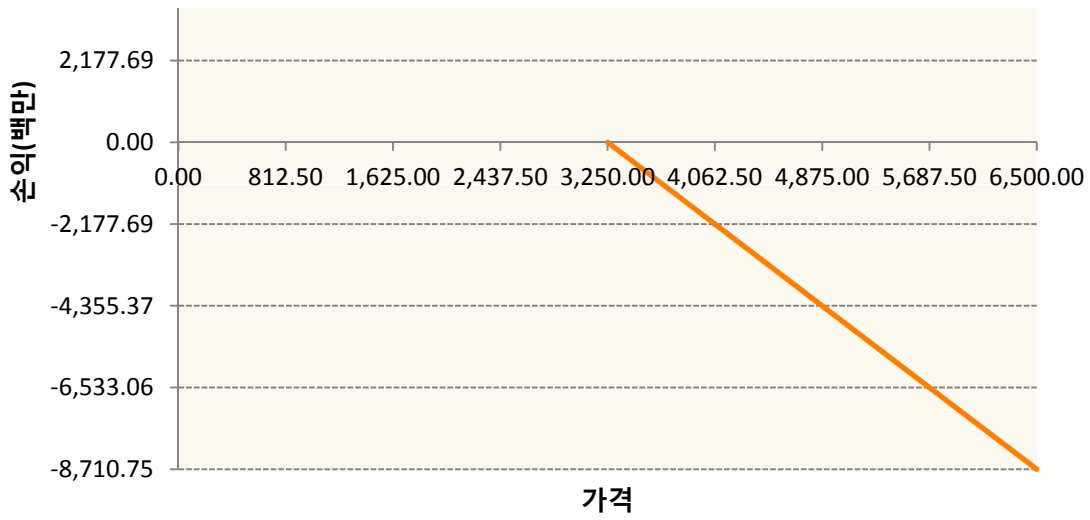
2. 만기시점의 손익구조

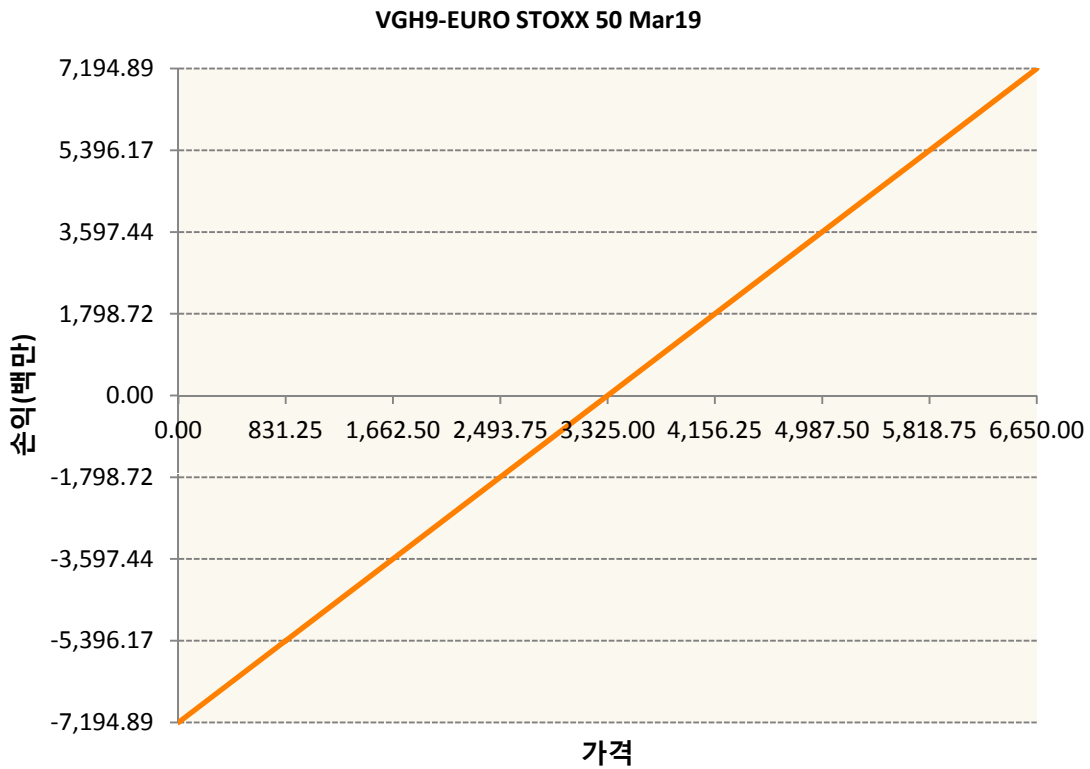
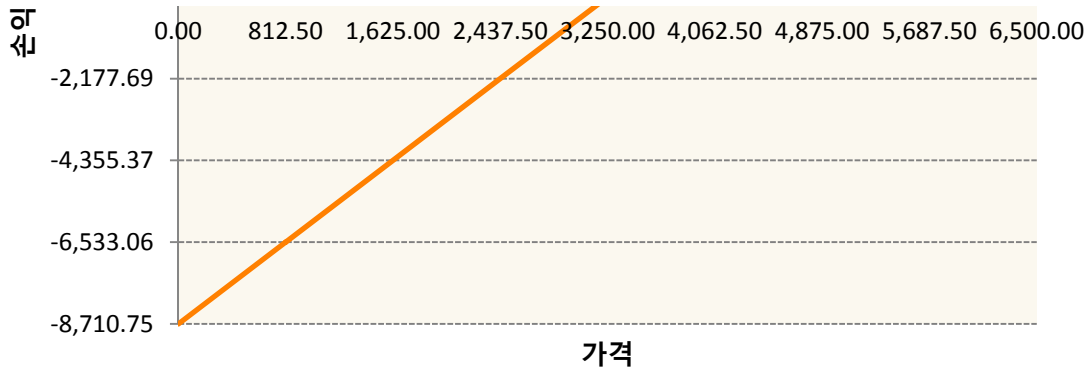
OESXH9-C3225-EURO STOXX 50



OESXH9-C3250-EURO STOXX 50







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY		131
FX21018Z03 KRW/EUR 22-03-19E		817
FX21019G02 KRW/EUR 24-05-19E		408
OESXH9-C32 EURO STOXX 50		372
OESXH9-C32 EURO STOXX 50		697
OESXH9-P32 EURO STOXX 50		372
OESXH9-P32 EURO STOXX 50		697
VGH9 EURO STOXX 50 Mar19		576

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

(단위:백만원)

2,679

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

(단위:백만원)

1,113

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	2019-03-08
기준일	2019-03-07

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

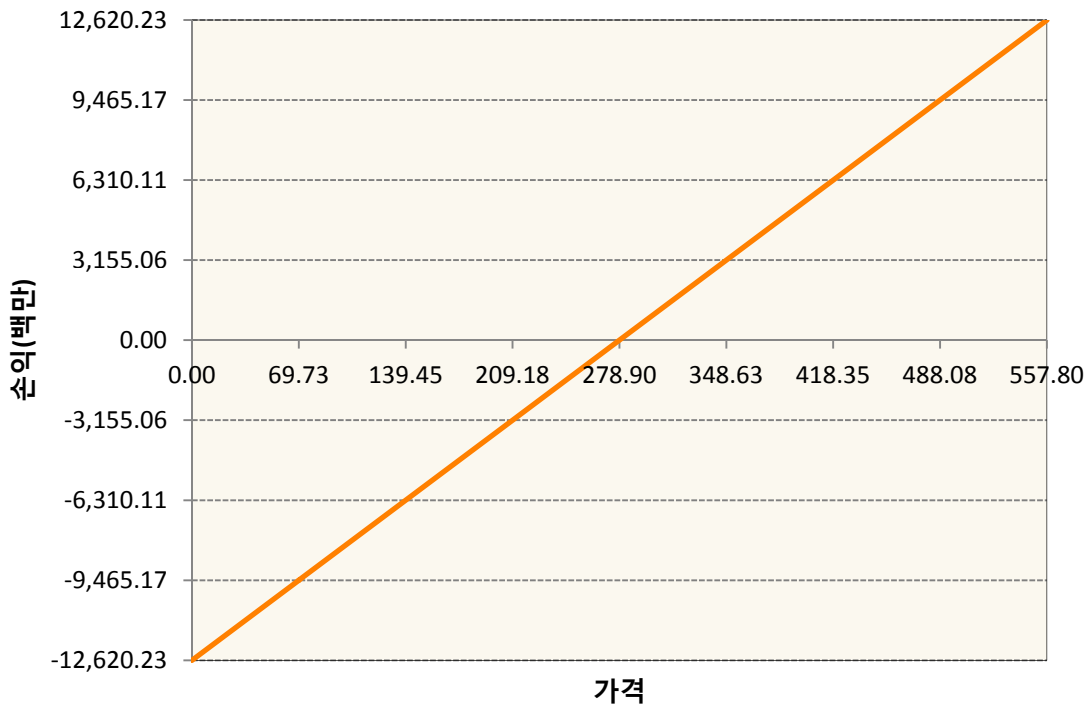
1. 계약금액

(단위:백만원)

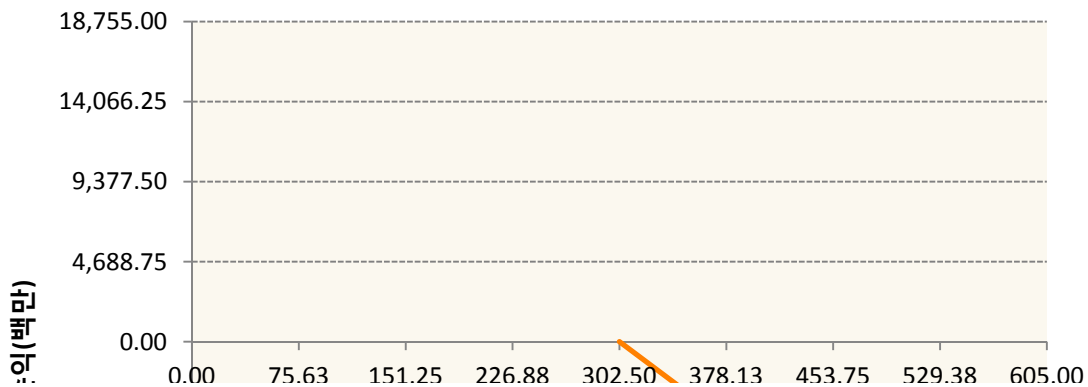
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	12,620	0	12,620	장내
누계	유가증권	옵션	2,165	24,931	-22,766	장내

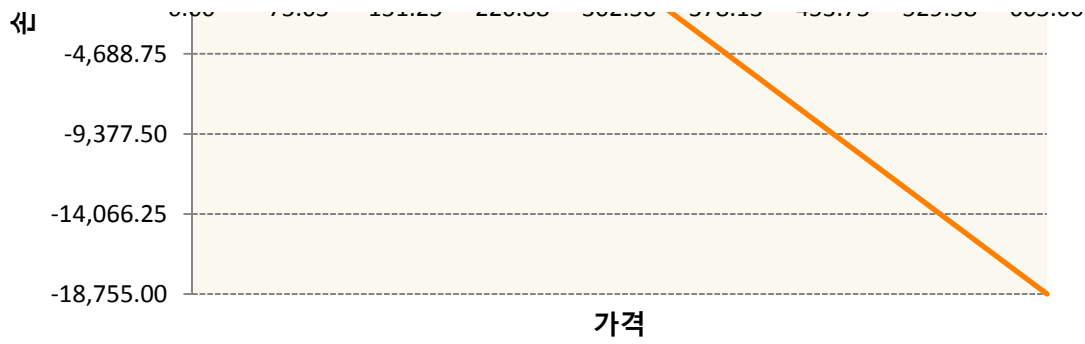
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P30007-2019-03 코스피200지수선물

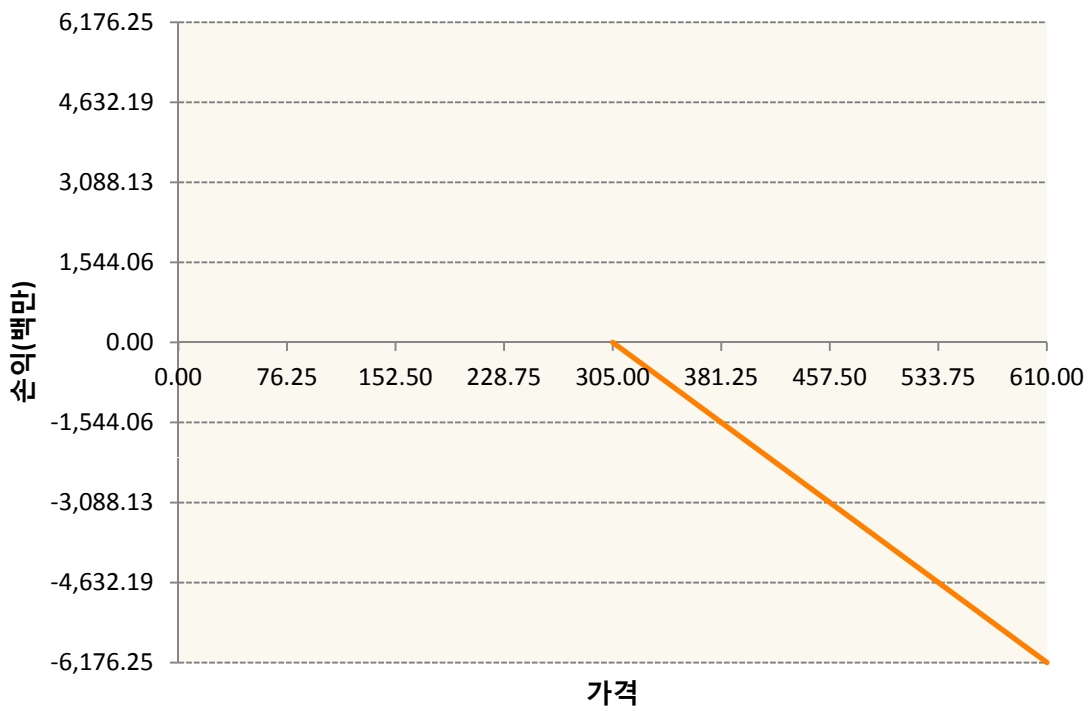


KR4201P33025-2019-03 콜302.5

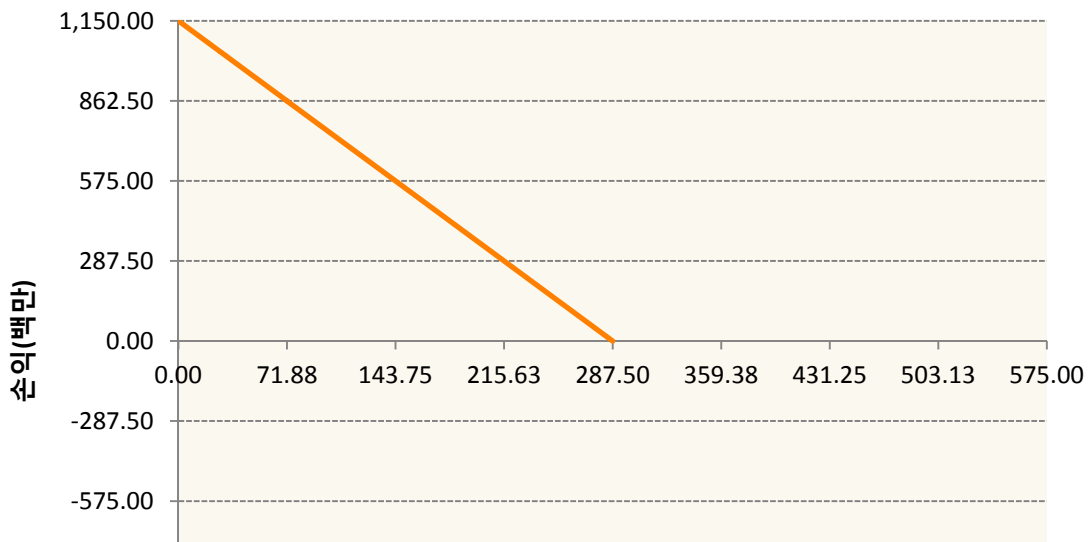


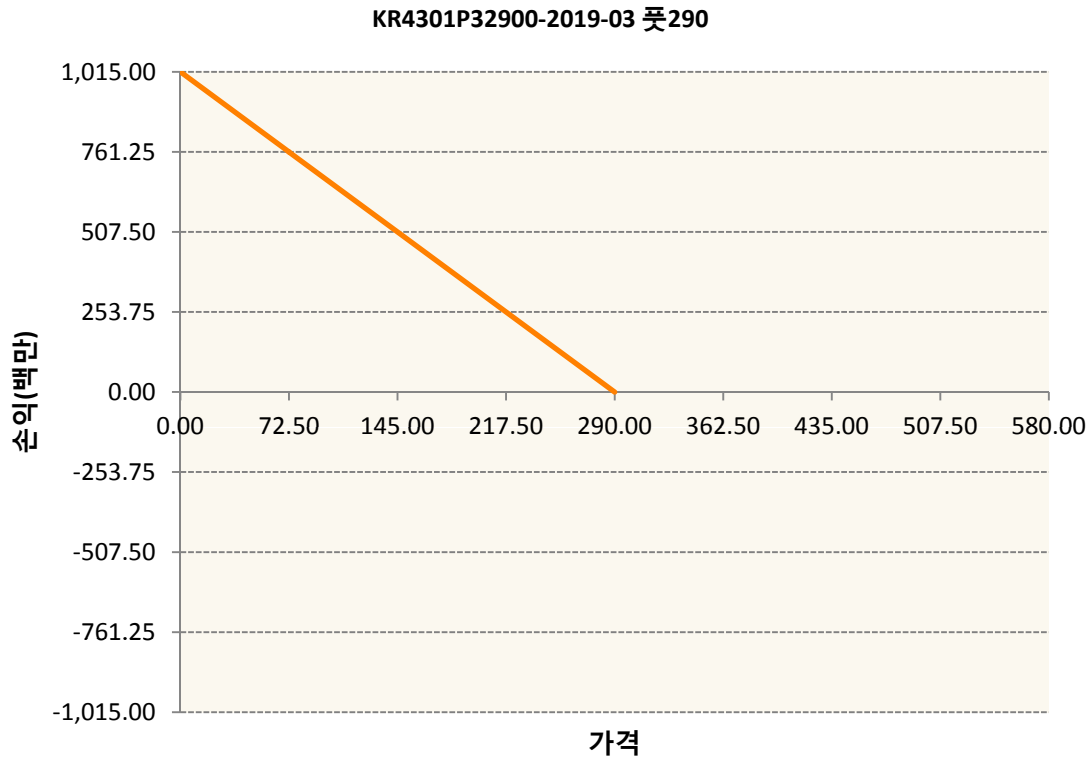
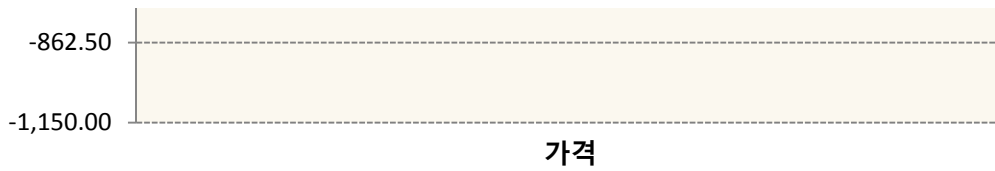


KR4201P33058-2019-03 콜305



KR4301P32876-2019-03 풋287.5





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101P30007		2019-03 코스피200지수선물						1,010
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-1,010	-1,010	-1,010	-1,010	-1,010	-1,010	-1,010	
-5.33%	-673	-673	-673	-673	-673	-673	-673	
-2.67%	-337	-337	-337	-337	-337	-337	-337	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	337	337	337	337	337	337	337	
5.33%	673	673	673	673	673	673	673	
8.00%	1,010	1,010	1,010	1,010	1,010	1,010	1,010	
KR4201P33025		2019-03 콜302.5						296
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	3	3	3	3	3	3	3	
-5.33%	3	3	3	3	3	3	3	
-2.67%	3	3	3	3	2	2	1	

0%	3	2	1	0	-2	-5	-9
2.67%	-1	-5	-10	-16	-23	-32	-42
5.33%	-33	-46	-61	-76	-93	-110	-128
8.00%	-161	-184	-206	-228	-251	-273	-296
KR4201P33058 2019-03 콜305							76
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	0	0	0	0	0	0	0
-5.33%	0	0	0	0	0	0	0
-2.67%	0	0	0	0	0	0	0
0%	0	0	0	0	0	-1	-2
2.67%	0	-1	-2	-3	-5	-7	-10
5.33%	-6	-9	-13	-17	-21	-26	-31
8.00%	-34	-41	-48	-55	-62	-69	-76
KR4301P32876 2019-03 풋287.5							89
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	89	89	89	89	89	89	89
-5.33%	59	59	59	59	59	59	59
-2.67%	29	29	29	29	29	29	29
0%	0	0	0	0	0	1	1
2.67%	-26	-25	-24	-23	-23	-22	-21
5.33%	-35	-34	-34	-34	-33	-33	-32
8.00%	-35	-35	-35	-35	-35	-35	-35
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	0
2.67%	-25	-24	-24	-23	-23	-22	-21
5.33%	-38	-37	-37	-36	-35	-35	-34
8.00%	-39	-39	-39	-39	-39	-39	-38

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

(단위:백만원)

1,122

공시일	2019-03-08
기준일	2019-03-07

H2O글로벌본드(USD)(채권혼합-파

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	0	95	-95	
누계	유가증권	수익증권	901	0	901	

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	2019-03-08
기준일	2019-03-07

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	7,022	0	7,022	

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	2019-03-08
기준일	2019-03-07

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	39,645	0	39,645	
누계	통화	선도	0	40,650	-40,650	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		425
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
FX21019H01 KRW/USD 10-04-19E		99

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

(단위:백만원)

1,152

공시일	2019-03-08
기준일	2019-03-07

스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

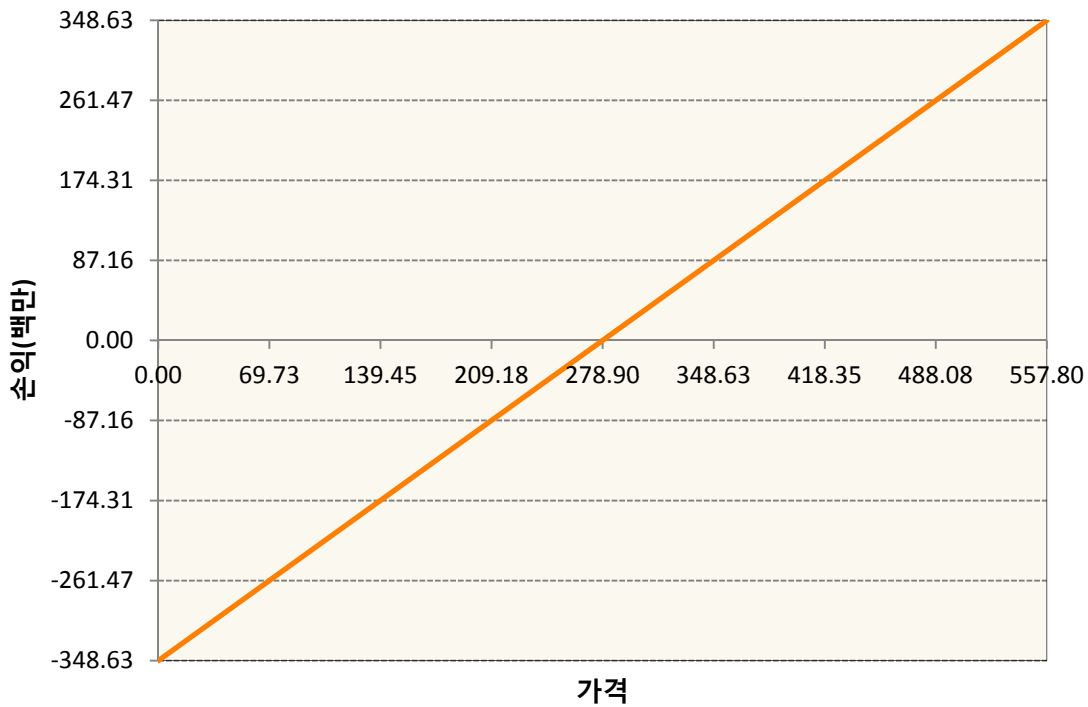
1. 계약금액

(단위:백만원)

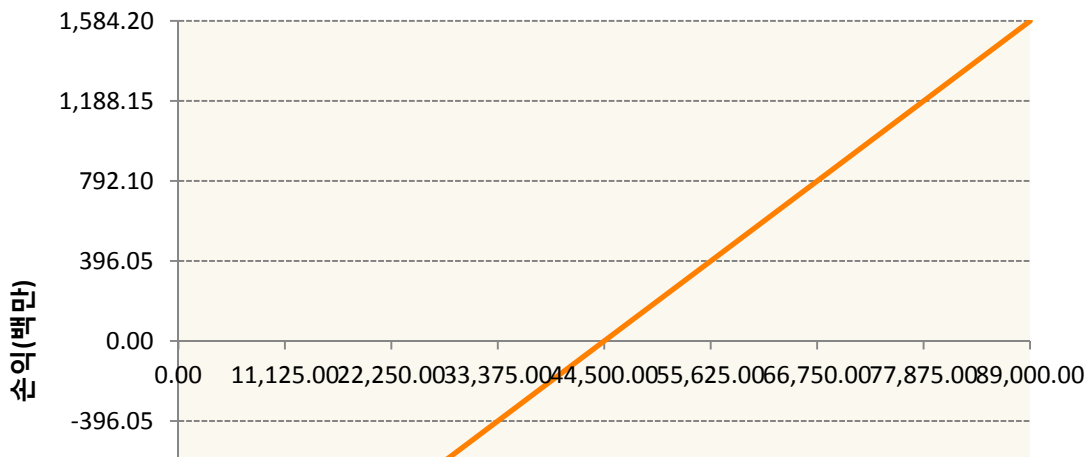
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,933	0	1,933	장내

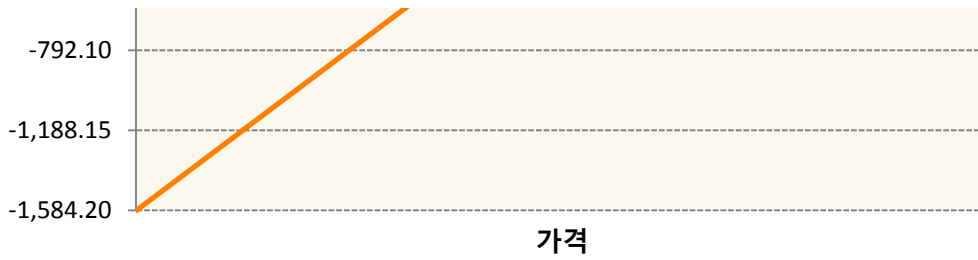
2. 만기시점의 손익구조

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						127
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-127	-127	-127	-127	-127	-127	-127	
-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%	127	127	127	127	127	127	127	

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

169

공시일	2019-03-08
기준일	2019-03-07

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

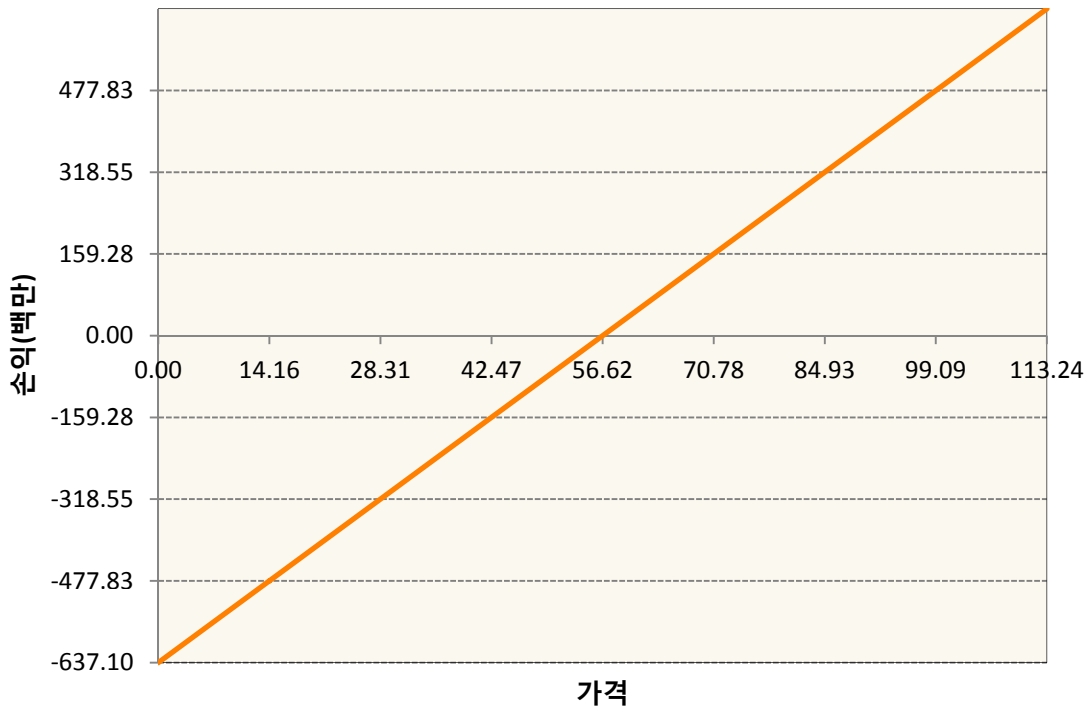
1. 계약금액

(단위:백만원)

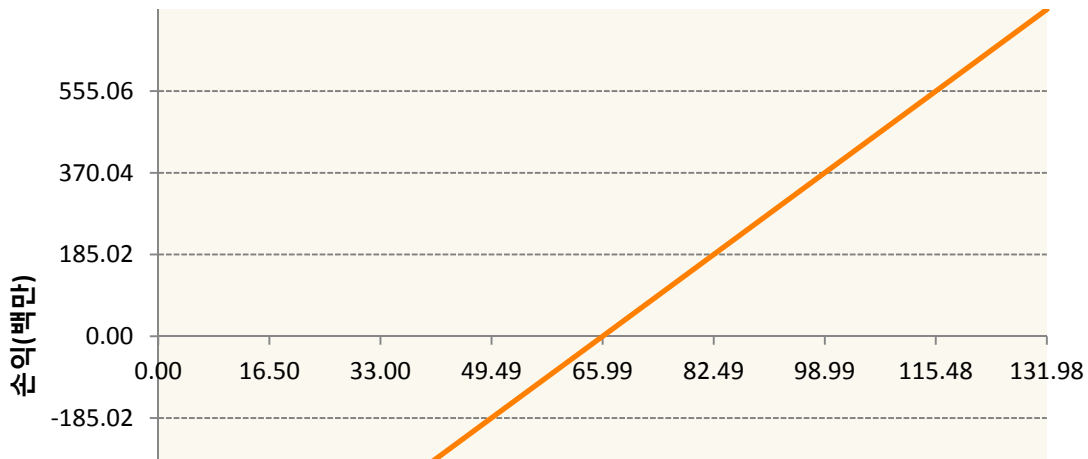
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,835	282	2,553	

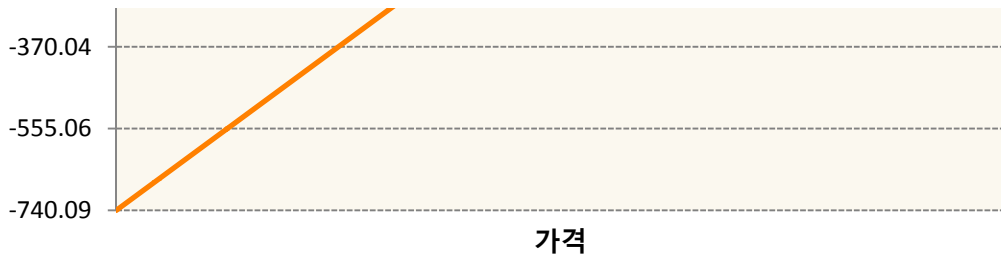
2. 만기시점의 손익구조

CLK9-WTI CRUDE FUTURE May19

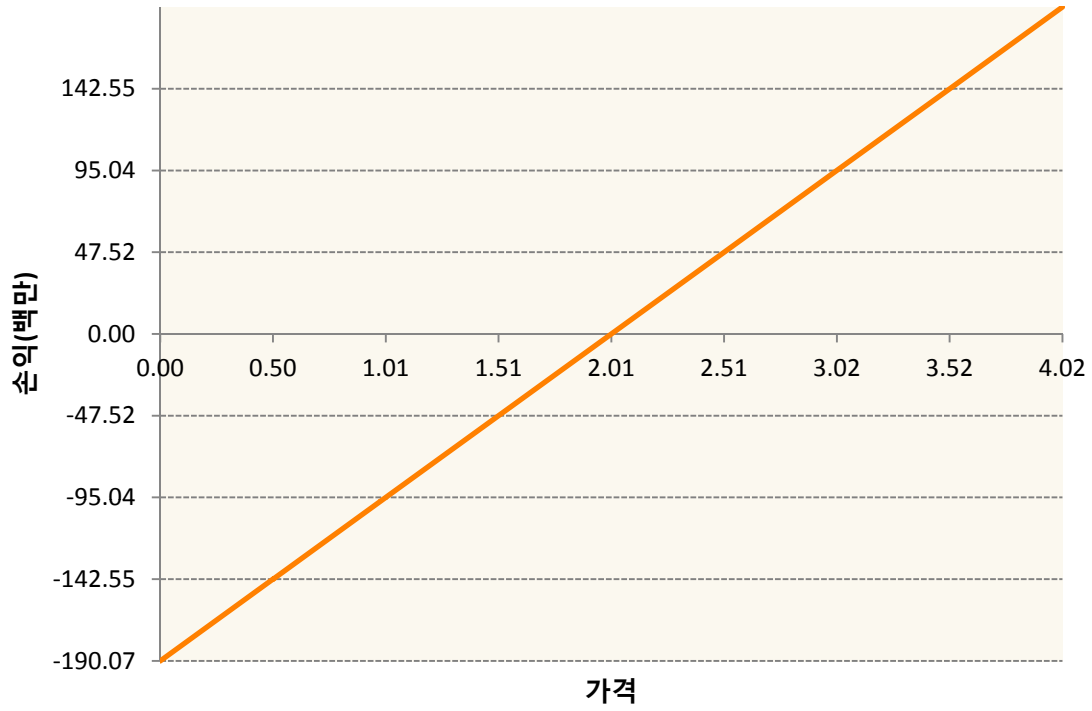


COK9-BRENT CRUDE FUTR May19

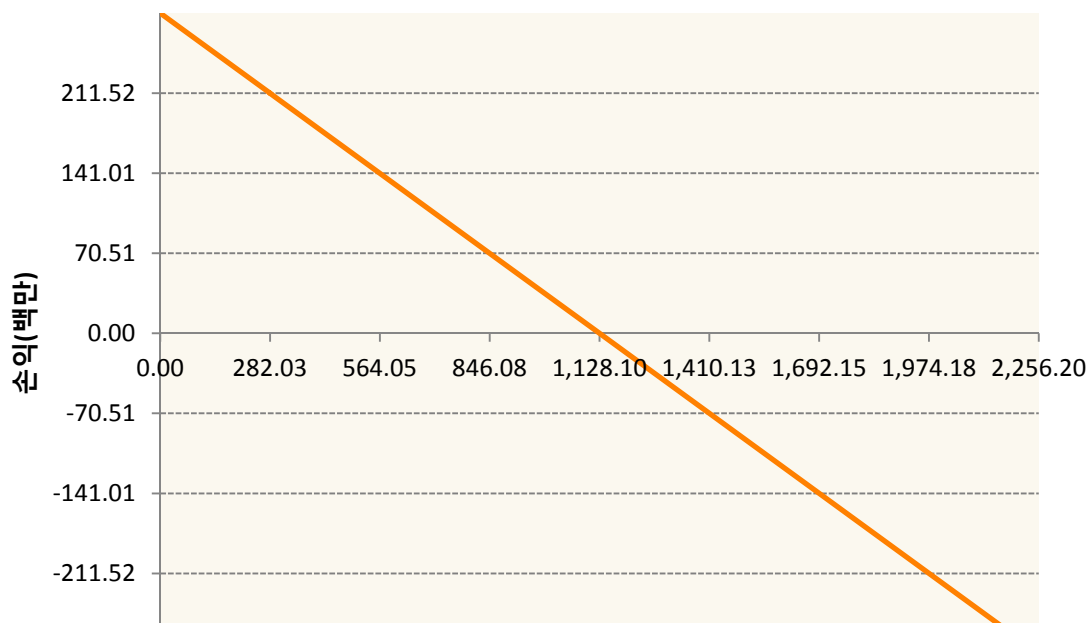


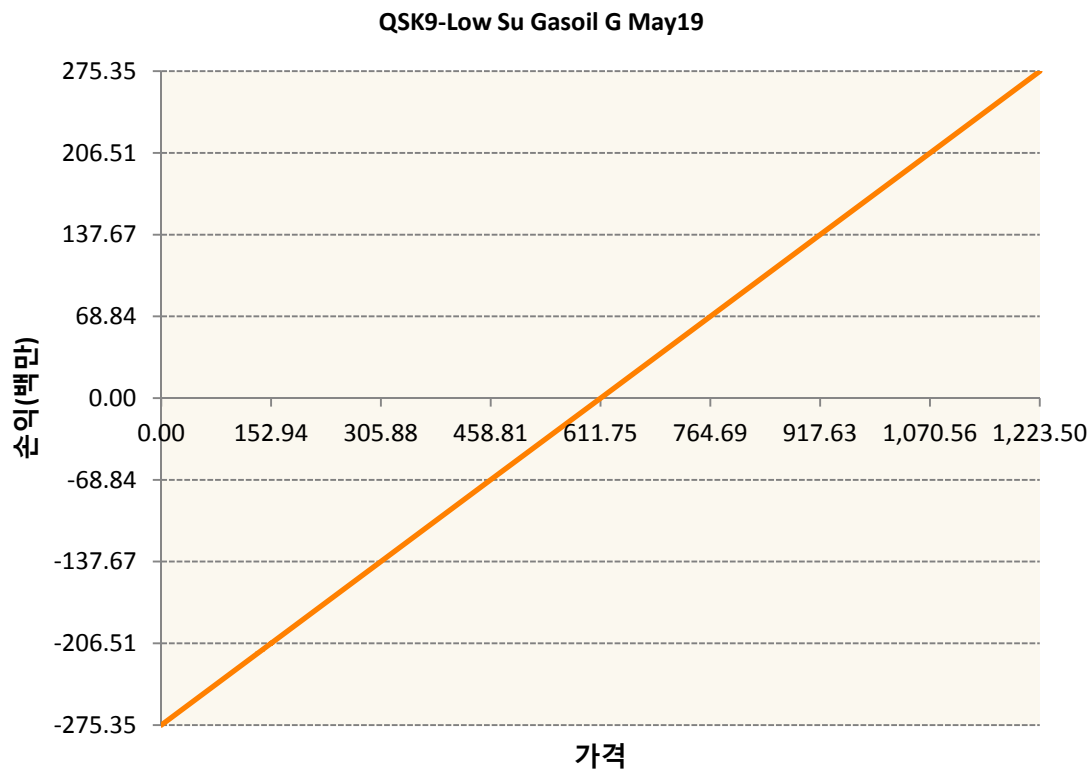
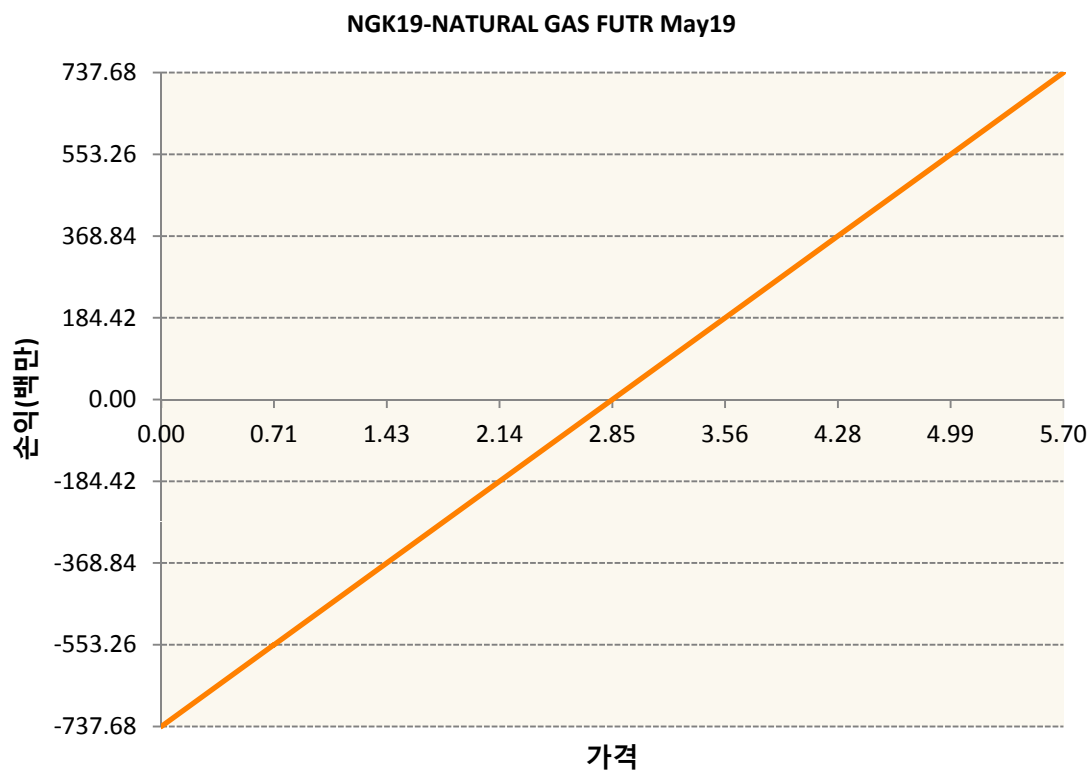
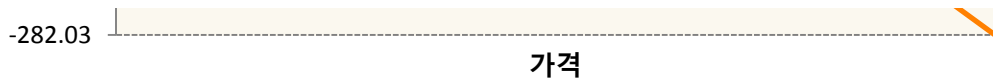


HOK9-NY Harb ULSD Fut May19

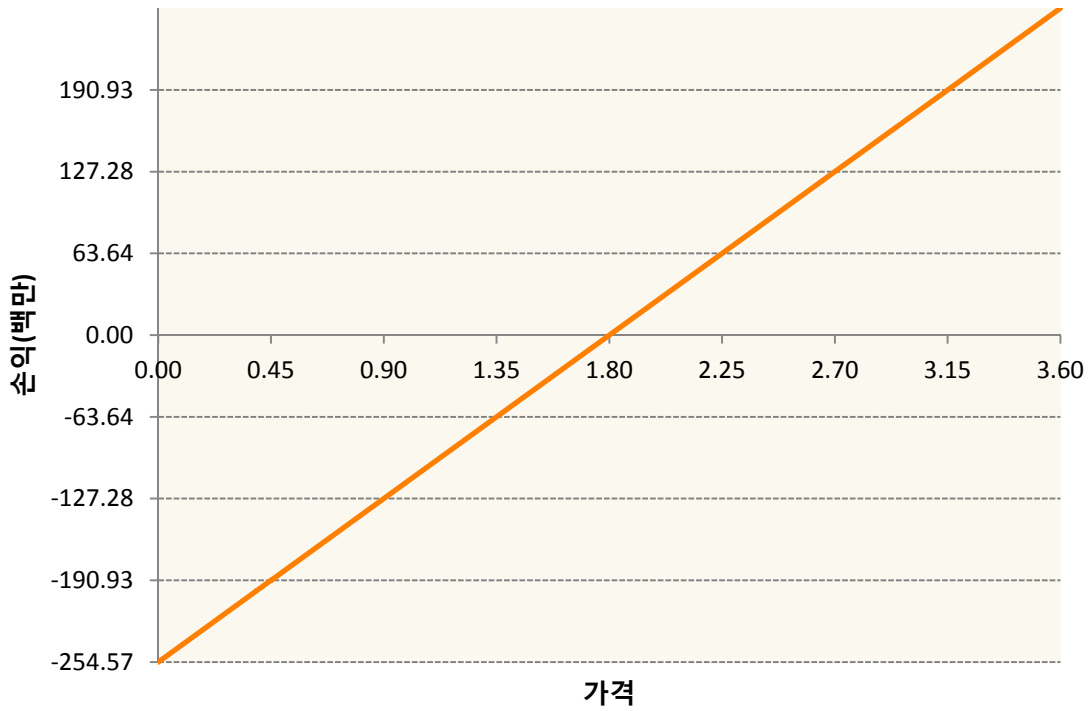


KR4175P30001-2019-03 달러선물





XBK9-GASOLINE RBOB FUT May19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

CLK9	WTI CRUDE FUTURE May19	51
COK9	BRENT CRUDE FUTR May19	59
HOK9	NY Harb ULSD Fut May19	15
KR4175P300	2019-03 달러선물	23
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	2019-03-08
기준일	2019-03-07

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

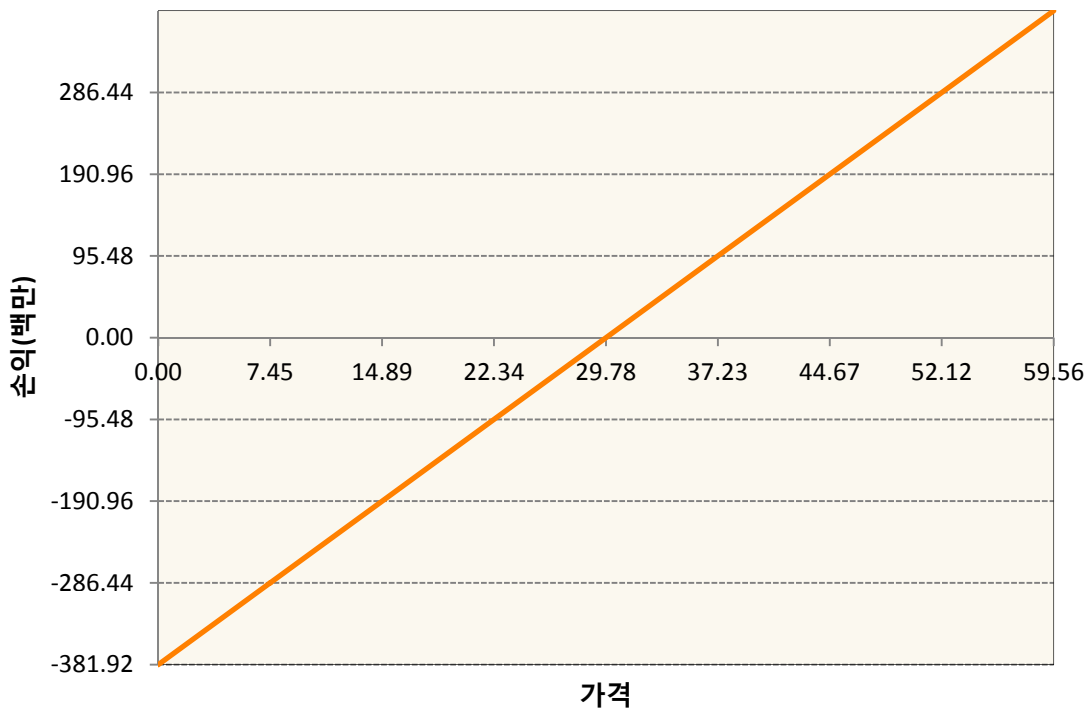
1. 계약금액

(단위:백만원)

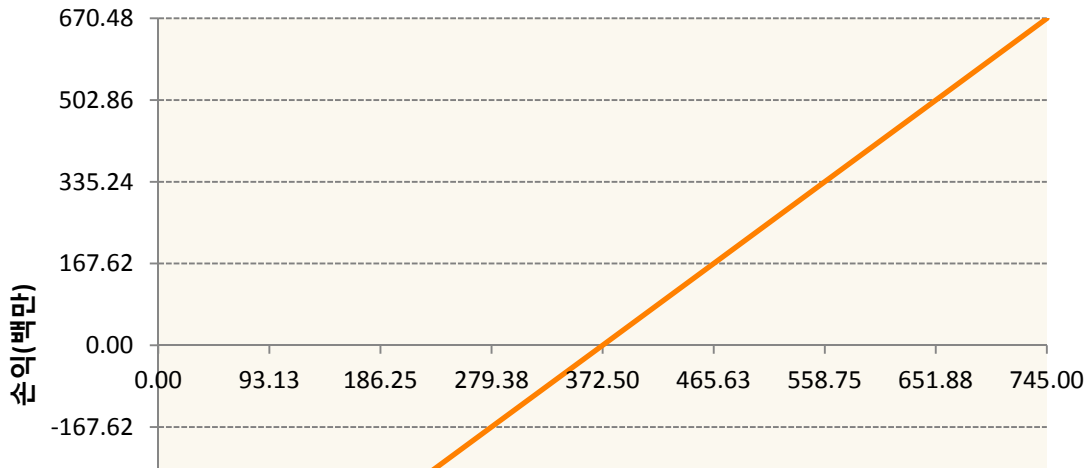
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,363	79	3,284	

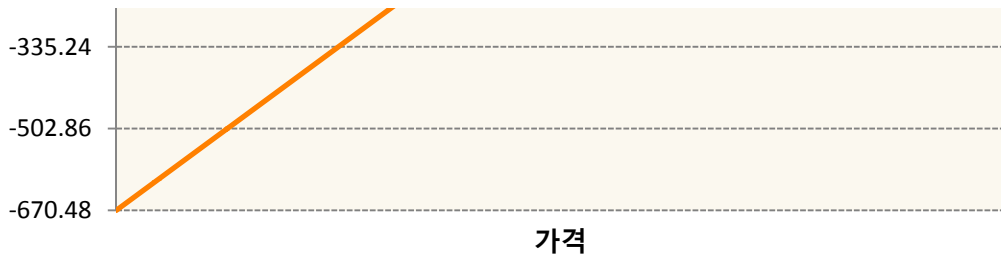
2. 만기시점의 손익구조

BOK9-SOYBEAN OIL FUTR May19

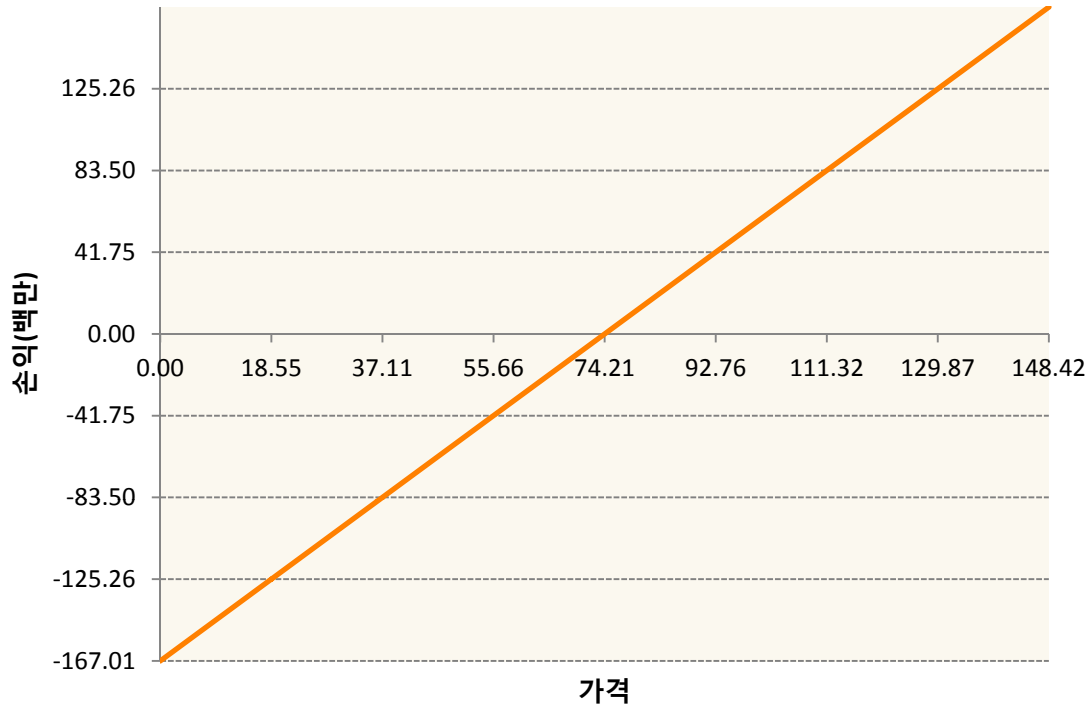


CK9-CORN FUTURE May19

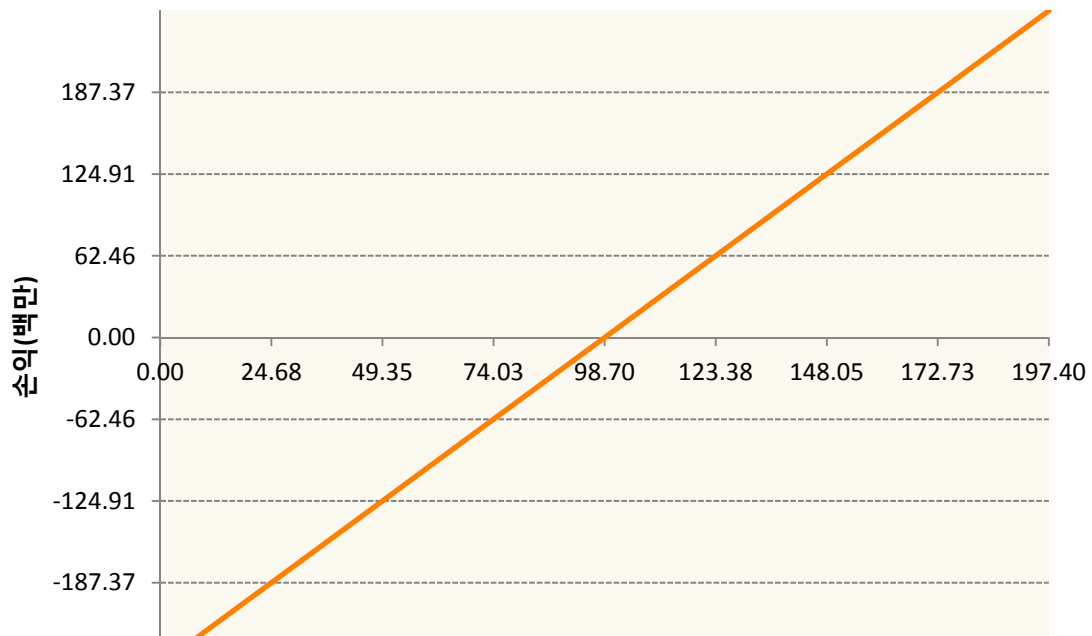


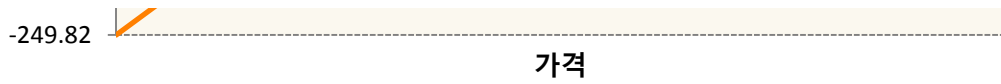


CTK9-COTTON NO.2 FUTR May19

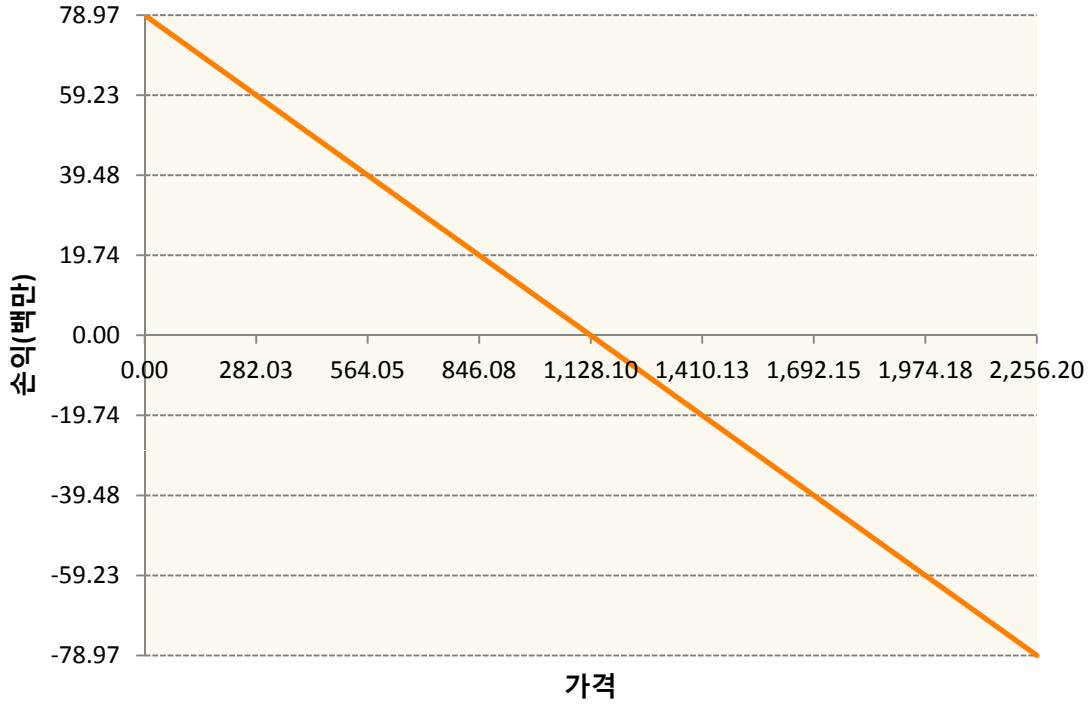


KCK9-COFFEE 'C' FUTURE May19

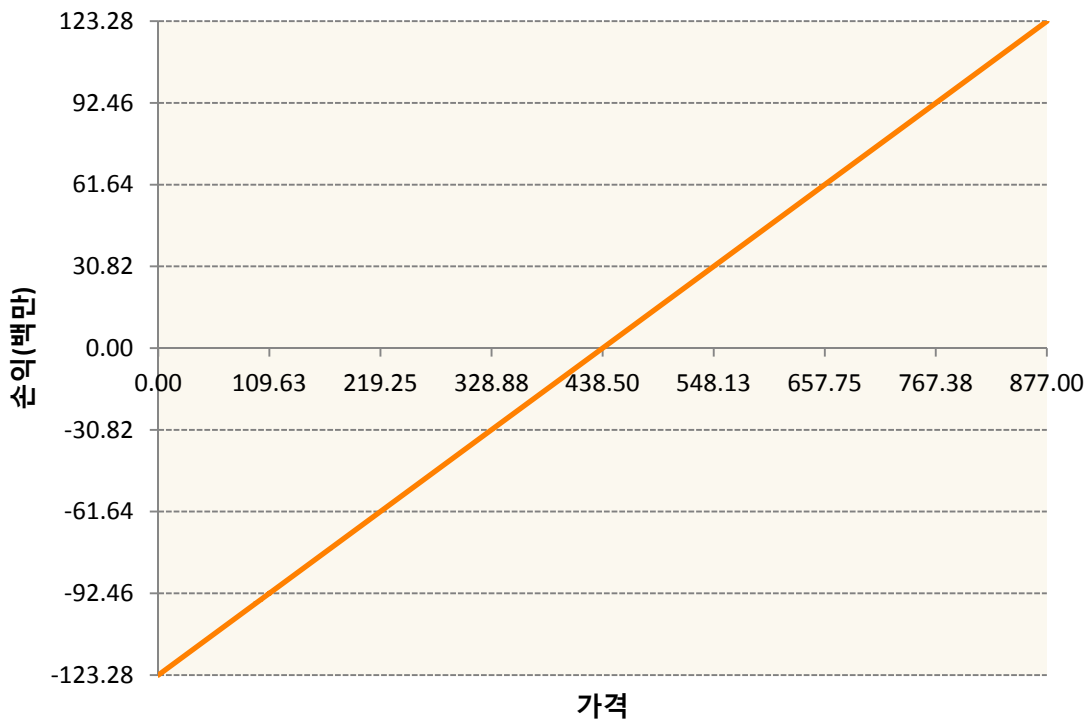




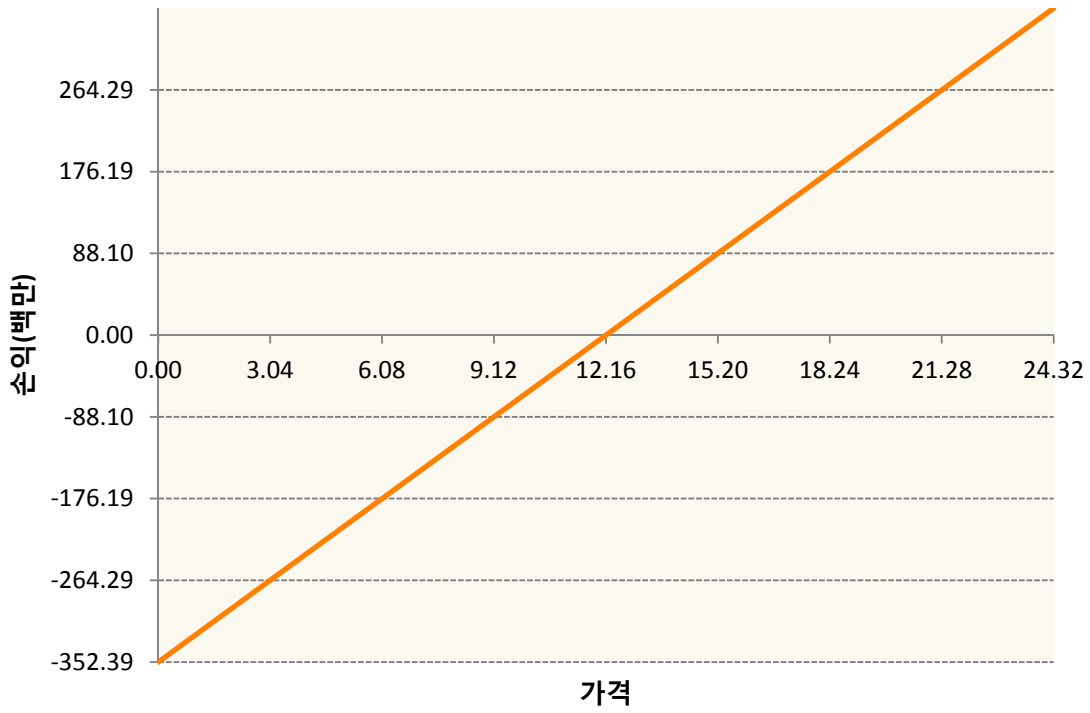
KR4175P30001-2019-03 달러선물



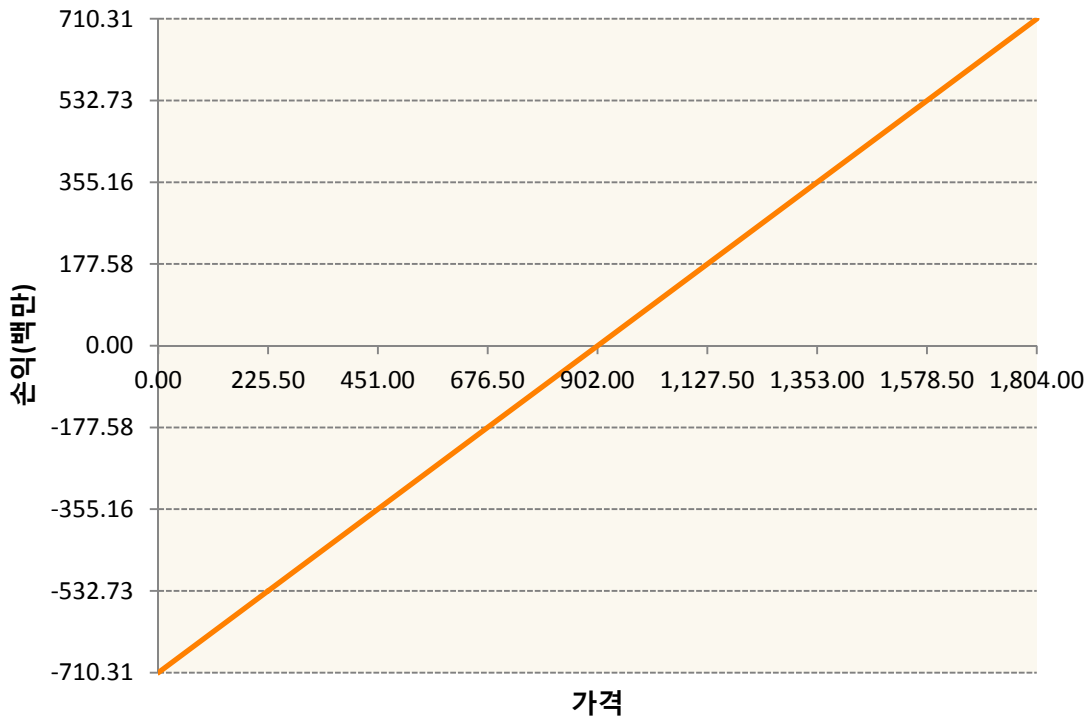
KWK9-KC HRW WHEAT FUT May19



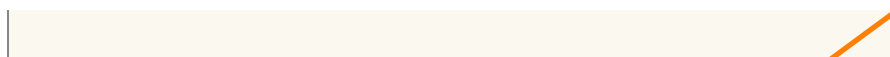
SBK9-SUGAR #11 (WORLD) May19

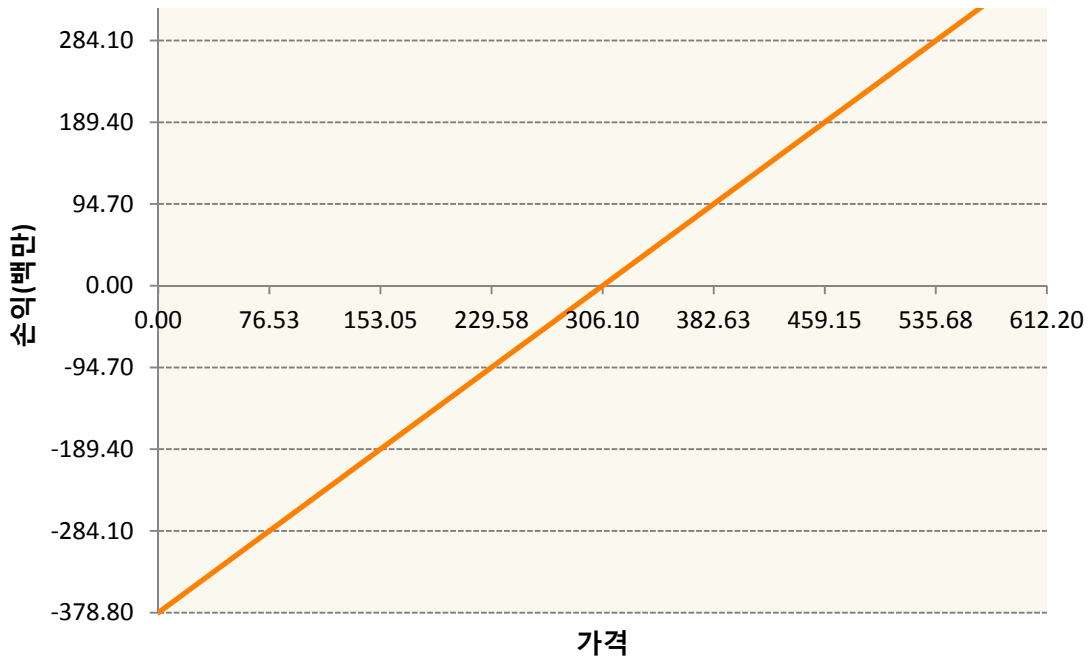


SK9-SOYBEAN FUTURE May19

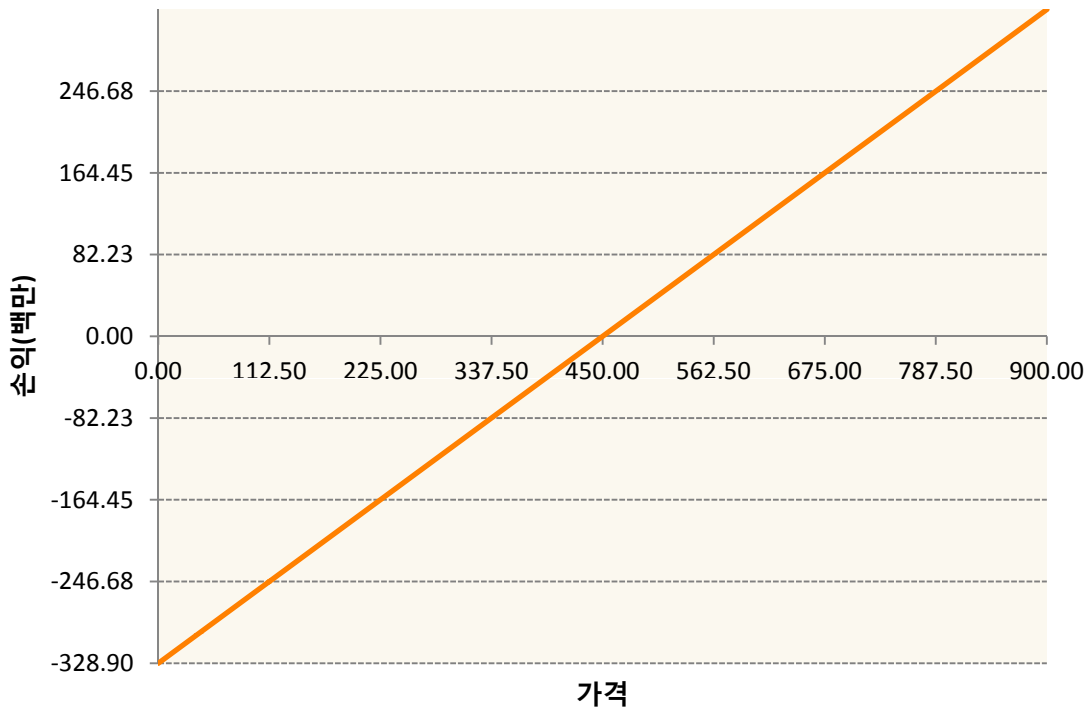


SMK9-SOYBEAN MEAL FUTR May19





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	28
SK9	SOYBEAN FUTURE May19	57
SMK9	SOYBEAN MEAL FUTR May19	30
WK9	WHEAT FUTURE(CBT) May19	26

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

(단위:백만원)

268