

공시일	2018-11-16
기준일	2018-11-15

## 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

공시일	2018-11-16
기준일	2018-11-15

## 좋은아침펀더멘탈인덱스모(주식)

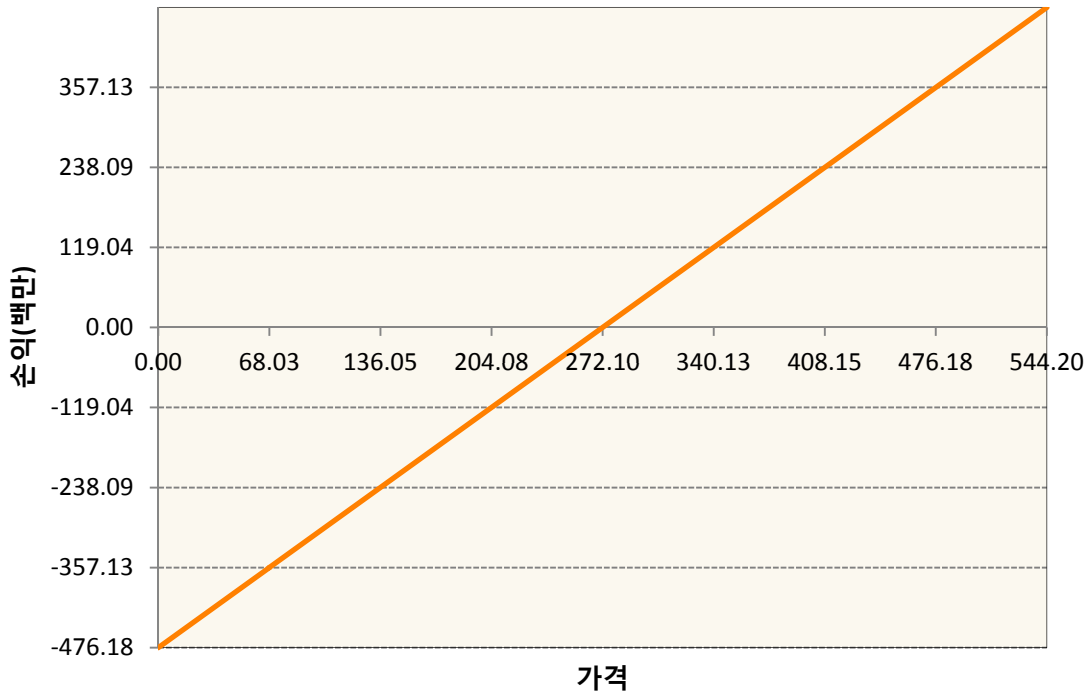
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

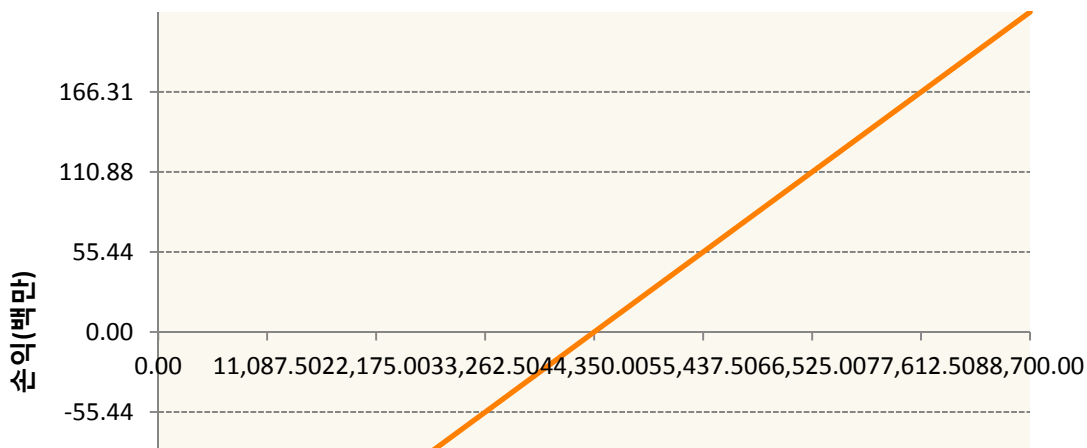
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	698	0	698	장내

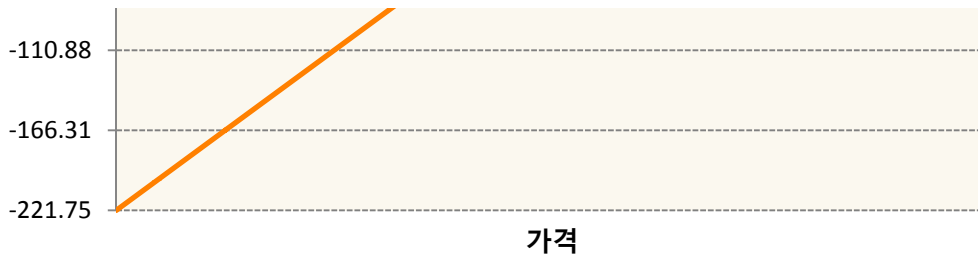
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101NC0004-2018-12 코스피200지수선물



KR4111NC0002-2018-12 삼성전자개별선물





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

KR4101NC0004		2018-12 코스피200지수선물						38
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-38	-38	-38	-38	-38	-38	-38	
-5.33%	-25	-25	-25	-25	-25	-25	-25	
-2.67%	-13	-13	-13	-13	-13	-13	-13	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	13	13	13	13	13	13	13	
5.33%	25	25	25	25	25	25	25	
8.00%	38	38	38	38	38	38	38	
KR4111NC0002		2018-12 삼성전자개별선물						18
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-18	-18	-18	-18	-18	-18	-18	
-5.33%	-12	-12	-12	-12	-12	-12	-12	
-2.67%	-6	-6	-6	-6	-6	-6	-6	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	6	6	6	6	6	6	6	
5.33%	12	12	12	12	12	12	12	
8.00%	18	18	18	18	18	18	18	

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

52

공시일	2018-11-16
기준일	2018-11-15

## 스마트인덱스모

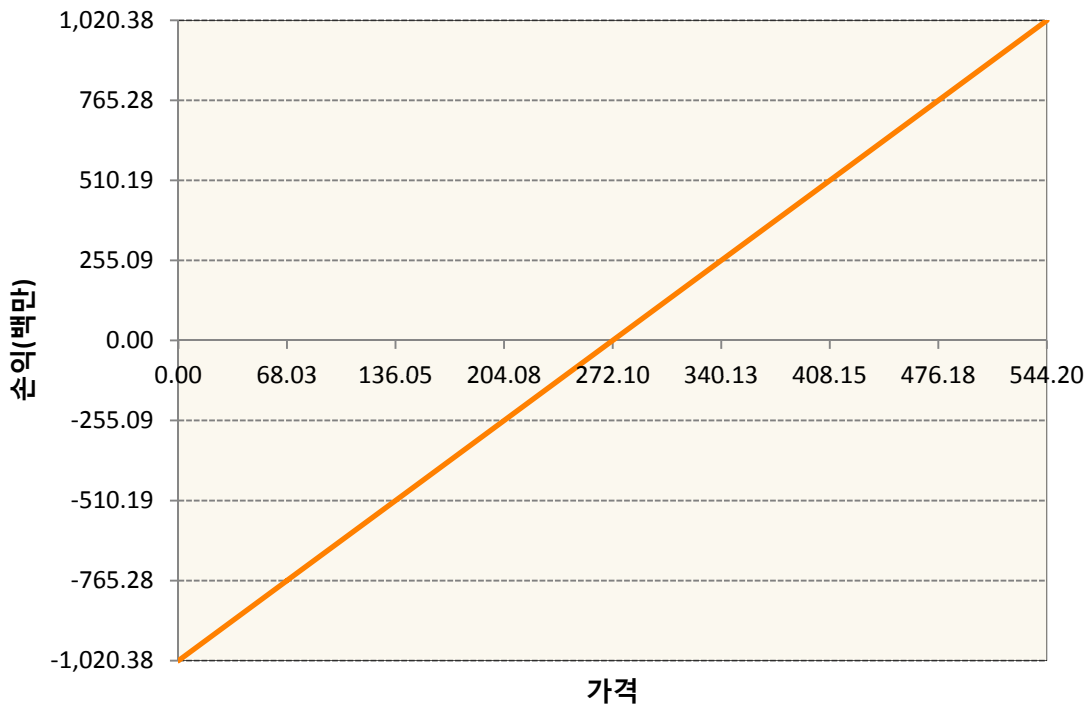
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,020	0	1,020	장내

### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101NC0004-2018-12 코스피200지수선물



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101NC0004		2018-12 코스피200지수선물						81
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-81	-81	-81	-81	-81	-81	-81	
-5.33%	-54	-54	-54	-54	-54	-54	-54	
-2.67%	-27	-27	-27	-27	-27	-27	-27	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	27	27	27	27	27	27	27	
5.33%	54	54	54	54	54	54	54	
8.00%	81	81	81	81	81	81	81	

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

(단위:백만원)

69

공시일	2018-11-16
기준일	2018-11-15

## 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	14,259	0	14,259	장외

### 2. 만기시점의 손익구조

### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWMXWO0( 신한MXWO 미래S180822

1,070

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

514

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2018-11-16
기준일	2018-11-15

## 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	3,685	0	3,685	장외

### 2. 만기시점의 손익구조

### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI50000 신한CSI500미래S180910

281

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

402

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2018-11-16
기준일	2018-11-15

## 유로인덱스모(주식-파생형)

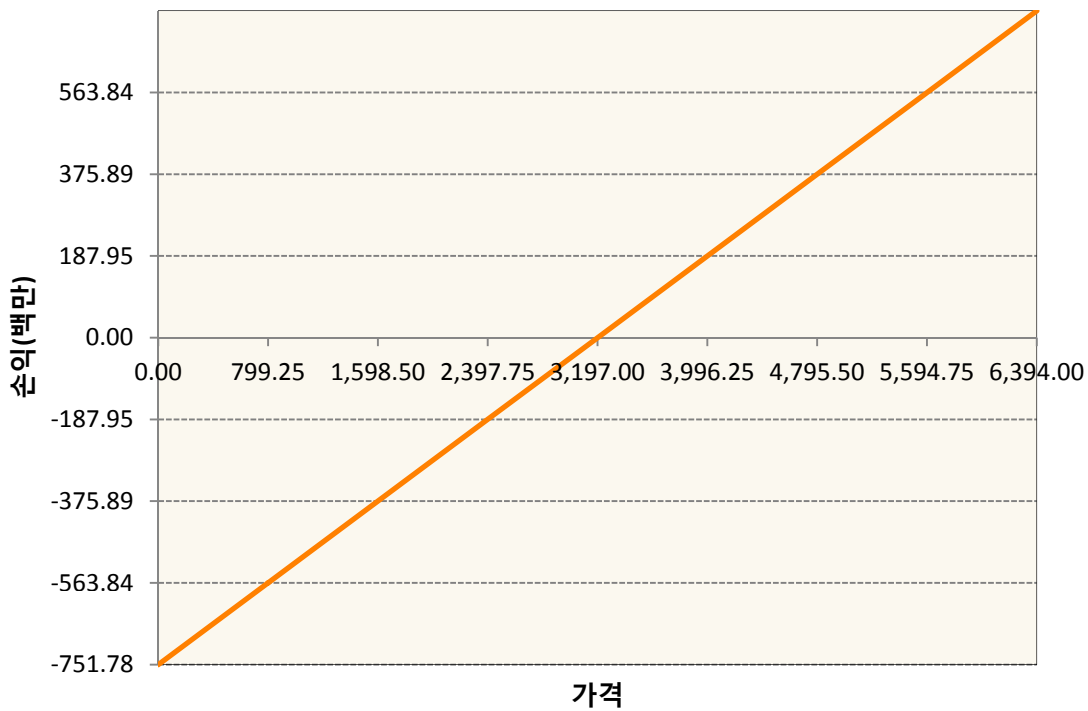
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	752	0	752	

### 2. 만기시점의 손익구조

VGZ8-EURO STOXX 50 DEC18



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGZ8	EURO STOXX 50 DEC18	60
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

38
----

공시일	2018-11-16
기준일	2018-11-15

## 차이나인덱스모(주식-파생형)

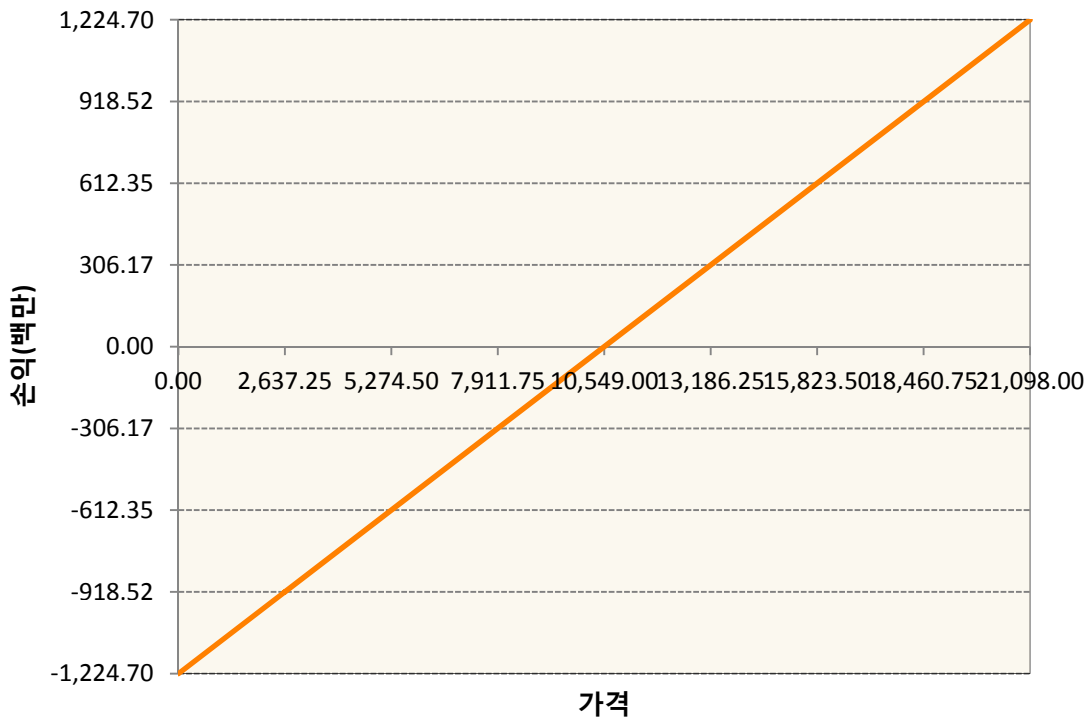
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

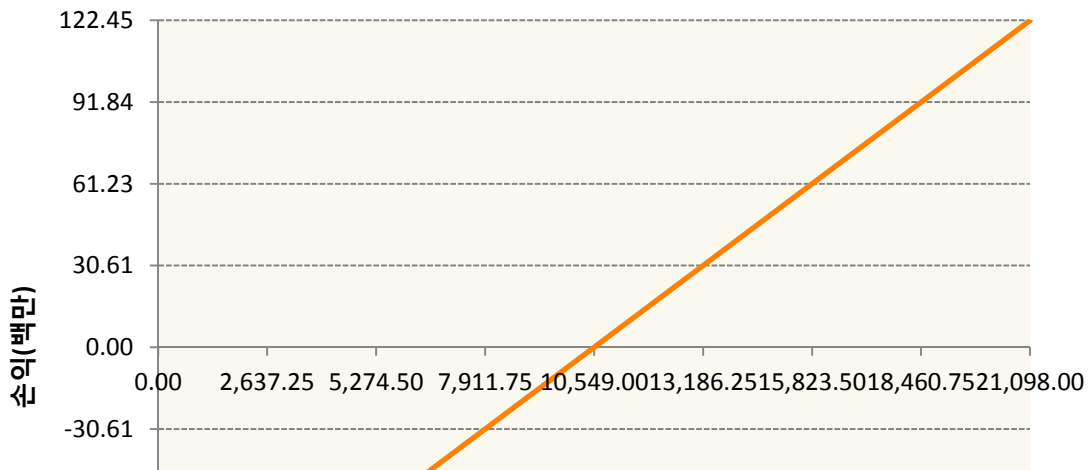
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,347	0	1,347	장내

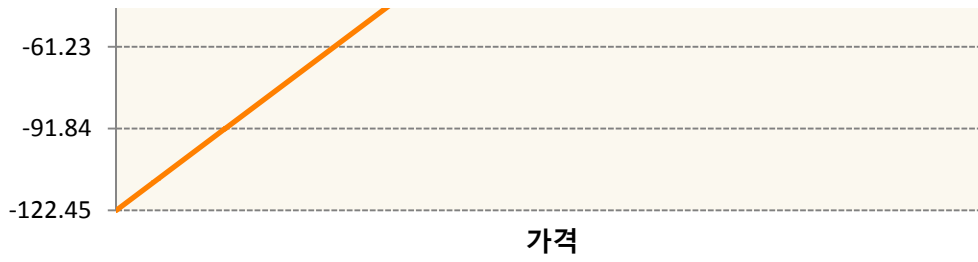
### 2. 만기시점의 손익구조

HCX8-HSCEI FUTURES NOV 18



MHCX8-MINI H-SHR IDX FU NOV 18





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

HCX8	HSCEI FUTURES NOV 18	98
MHCX8	MINI H-SHR IDX FU NOV 18	10

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

<b>107</b>
------------

공시일	2018-11-16
기준일	2018-11-15

## 커버드콜모(주식혼합-파생형)

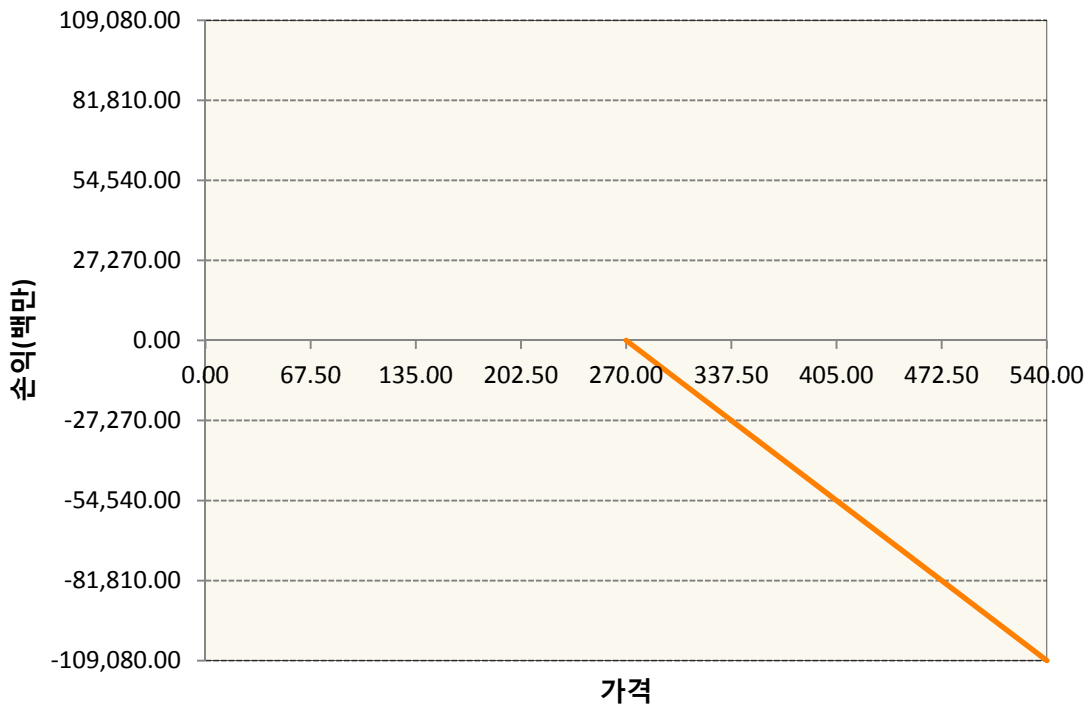
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

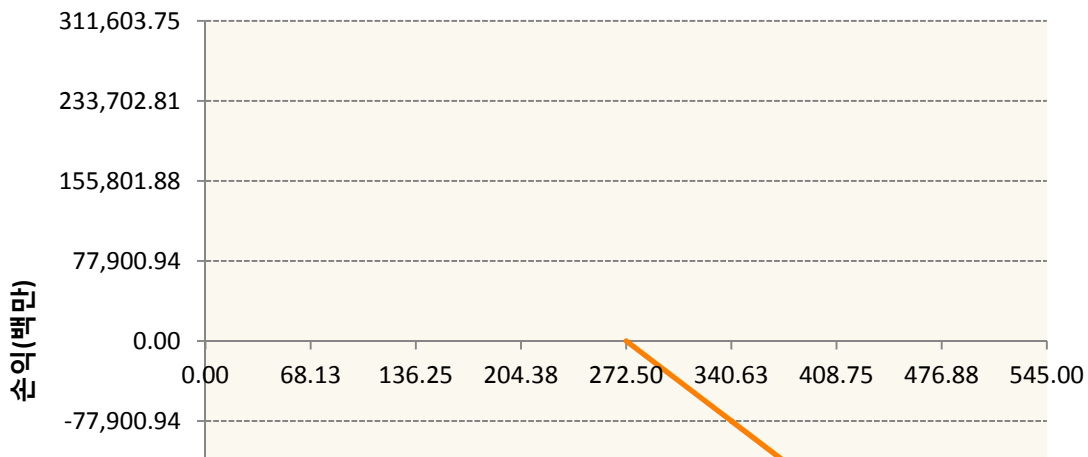
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	706,809	-706,809	장내

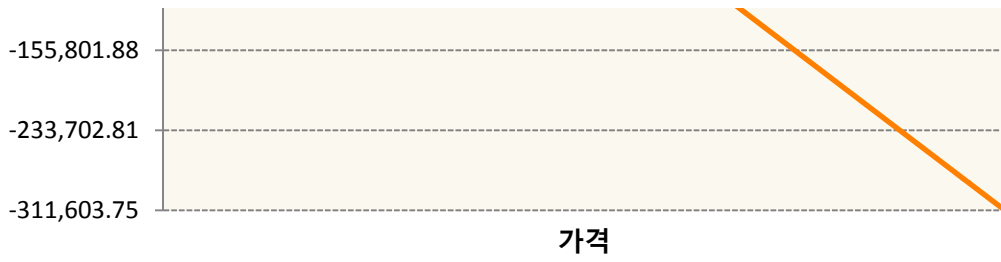
### 2. 만기시점의 손익구조

**KR4201NC2702-2018-12 콜270**

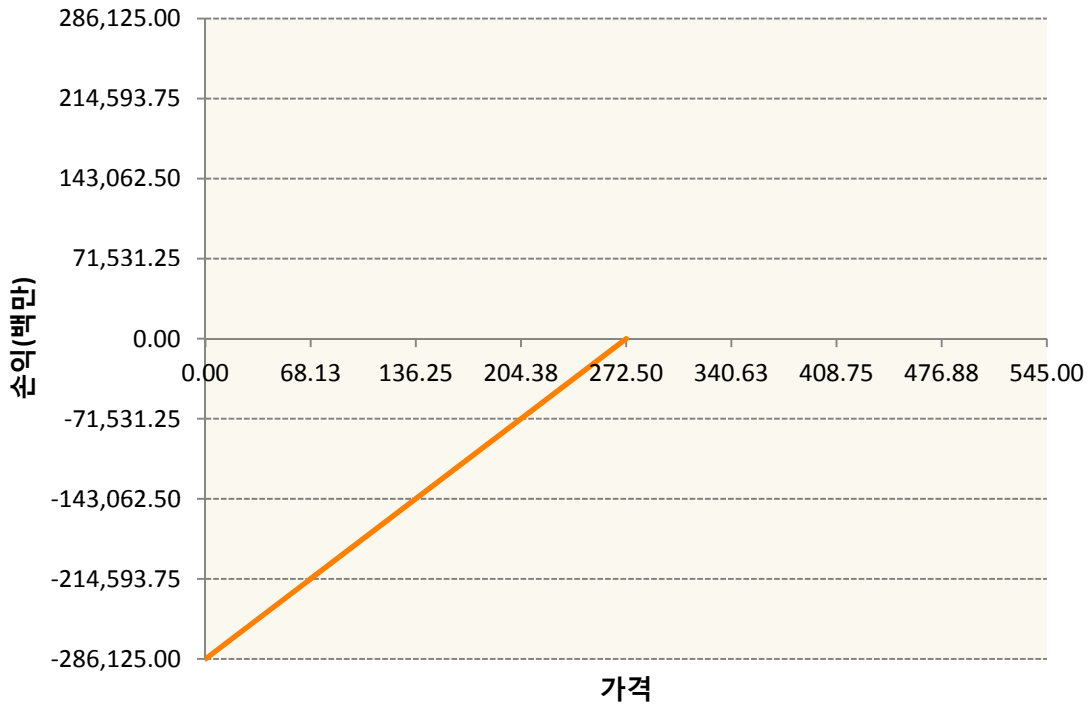


**KR4201NC2728-2018-12 콜272.5**





KR4301NC2727-2018-12 풋272.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4201NC2702		2018-12 콜270					6,880
		기초자산의 변동성					
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	3,369	3,256	3,123	2,975	2,812	2,639	2,455
-5.33%	2,960	2,769	2,566	2,354	2,133	1,907	1,675
-2.67%	2,151	1,896	1,638	1,378	1,117	853	589
0%	825	550	275	0	-275	-550	-825
2.67%	-1,034	-1,277	-1,527	-1,781	-2,039	-2,300	-2,563
5.33%	-3,336	-3,516	-3,711	-3,919	-4,137	-4,363	-4,596
8.00%	-5,943	-6,056	-6,189	-6,341	-6,508	-6,688	-6,880
KR4201NC2728		2018-12 콜272.5					18,642
		기초자산의 변동성					
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	8,341	8,080	7,763	7,397	6,989	6,544	6,066

-5.33%	7,453	6,981	6,465	5,915	5,337	4,735	4,114
-2.67%	5,583	4,907	4,213	3,507	2,791	2,067	1,337
0%	2,348	1,565	783	0	-783	-1,566	-2,348
2.67%	-2,403	-3,144	-3,895	-4,653	-5,416	-6,183	-6,954
5.33%	-8,512	-9,097	-9,717	-10,364	-11,033	-11,720	-12,422
8.00%	-15,622	-16,012	-16,458	-16,950	-17,483	-18,048	-18,642
KR4301NC2727                      2018-12 풋272.5							18,106
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-17,387	-17,440	-17,519	-17,626	-17,760	-17,921	-18,106
-5.33%	-10,075	-10,254	-10,469	-10,714	-10,987	-11,283	-11,599
-2.67%	-3,525	-3,897	-4,289	-4,696	-5,115	-5,543	-5,980
0%	1,490	994	497	0	-497	-995	-1,492
2.67%	4,540	4,102	3,653	3,195	2,730	2,260	1,785
5.33%	5,945	5,682	5,384	5,059	4,710	4,342	3,957
8.00%	6,425	6,314	6,166	5,984	5,771	5,529	5,261

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

(단위:백만원)

**42,520**

공시일	2018-11-16
기준일	2018-11-15

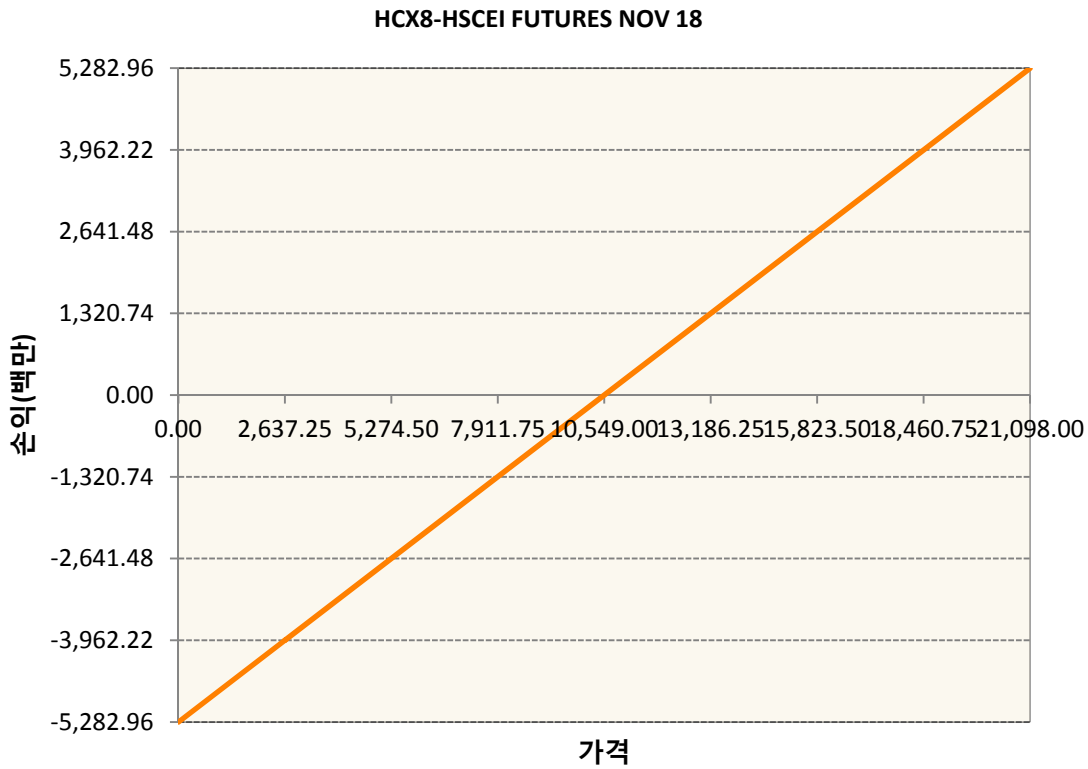
## 홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

### 1. 계약금액

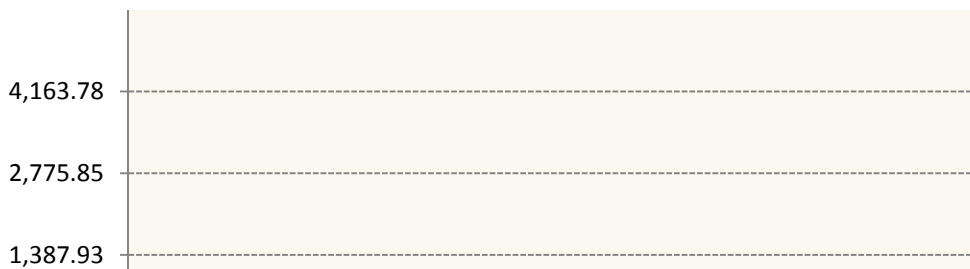
(단위:백만원)

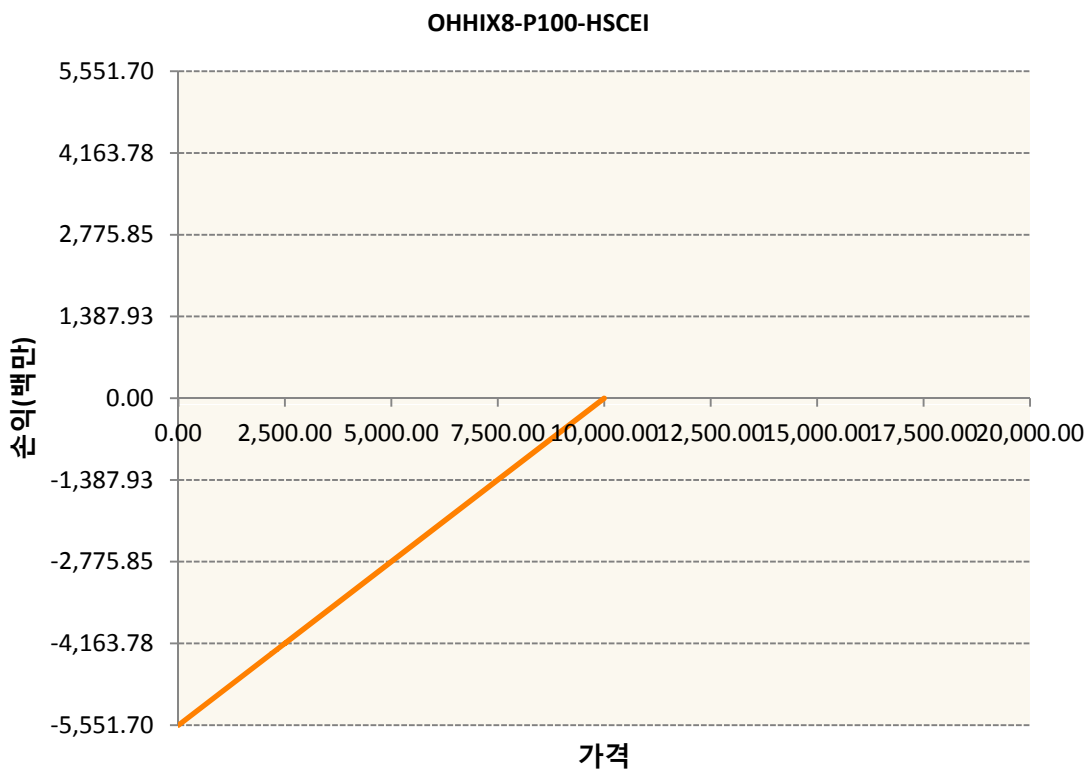
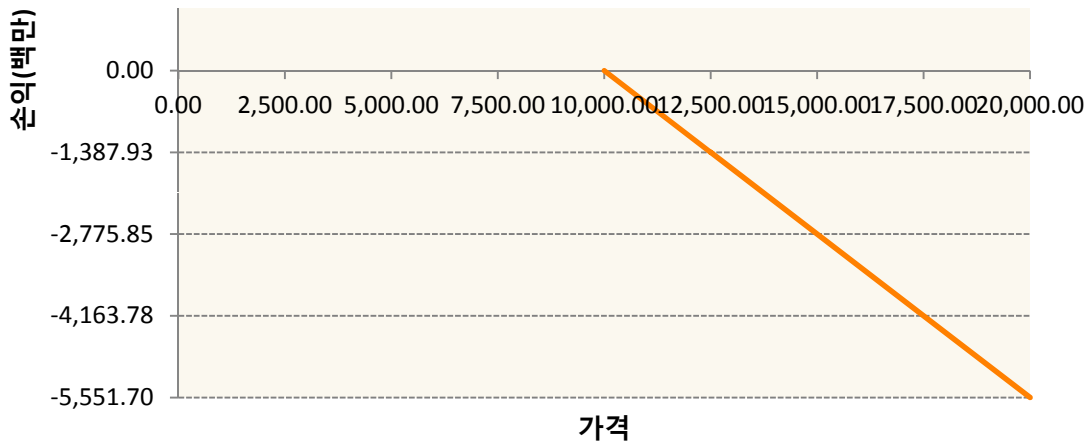
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	5,283	0	5,283	장내
누계	유가증권	옵션	0	11,103	-11,103	장내
누계	통화	선도	433	3,173	-2,740	장외

### 2. 만기시점의 손익구조



**OHHIX8-C100-HSCEI**





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
FX21018U00 KRW/HKD 10-12-18E		219
FX21018U03 KRW/HKD 10-12-18E		35
FX21018V01 HKD/KRW 10-12-18E		35
HCX8 HSCEI FUTURES NOV 18		423
OHHIX8-C1C HSCEI		444
OHHIX8-P10 HSCEI		444

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



공시일	2018-11-16
기준일	2018-11-15

## 코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

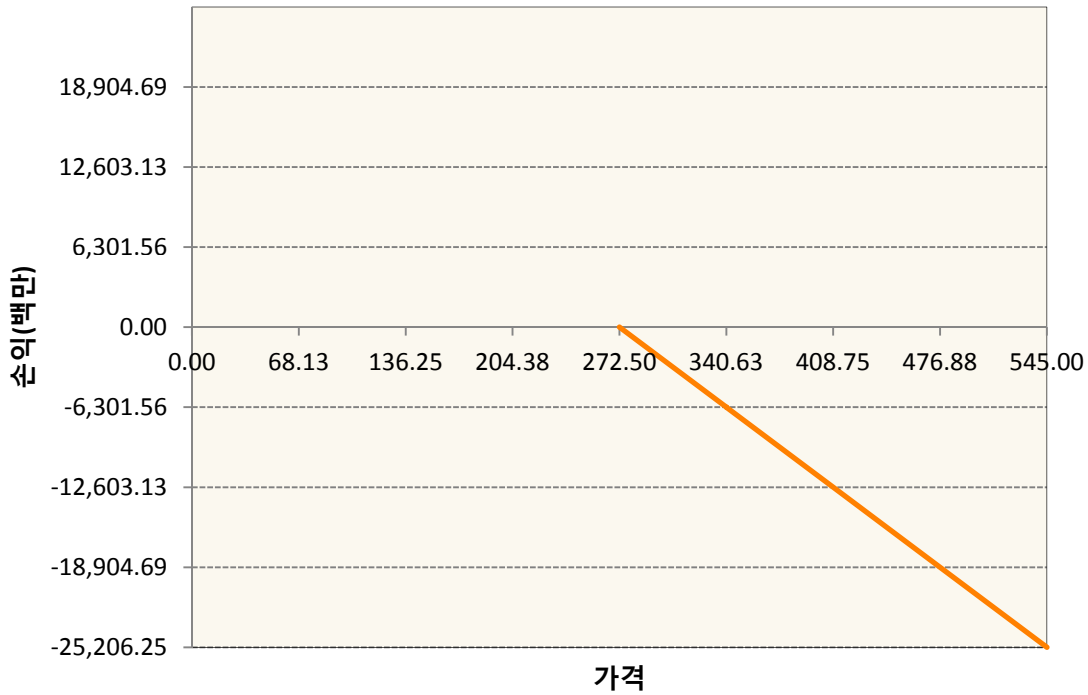
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

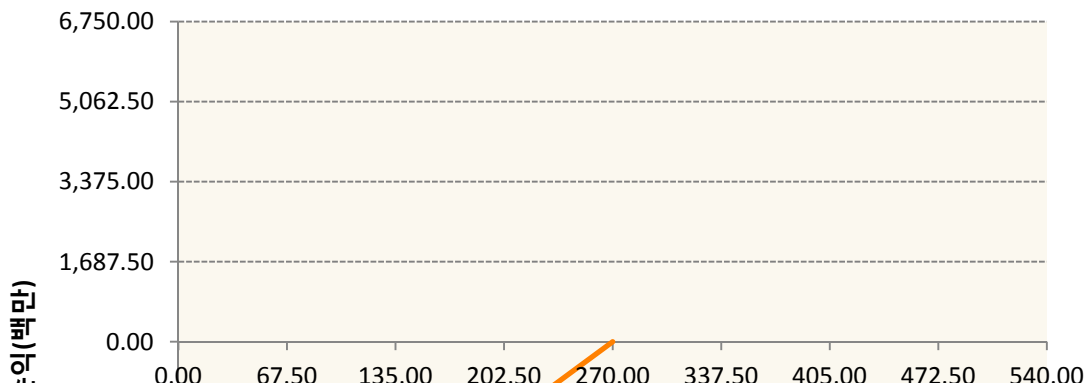
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	스왑	43,836	0	43,836	장외
누계	유가증권	옵션	0	43,538	-43,538	장내

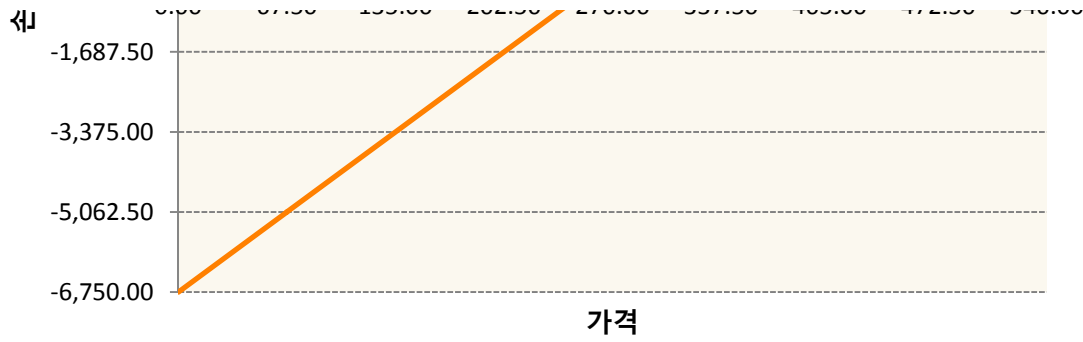
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4201NC2728-2018-12 콜272.5

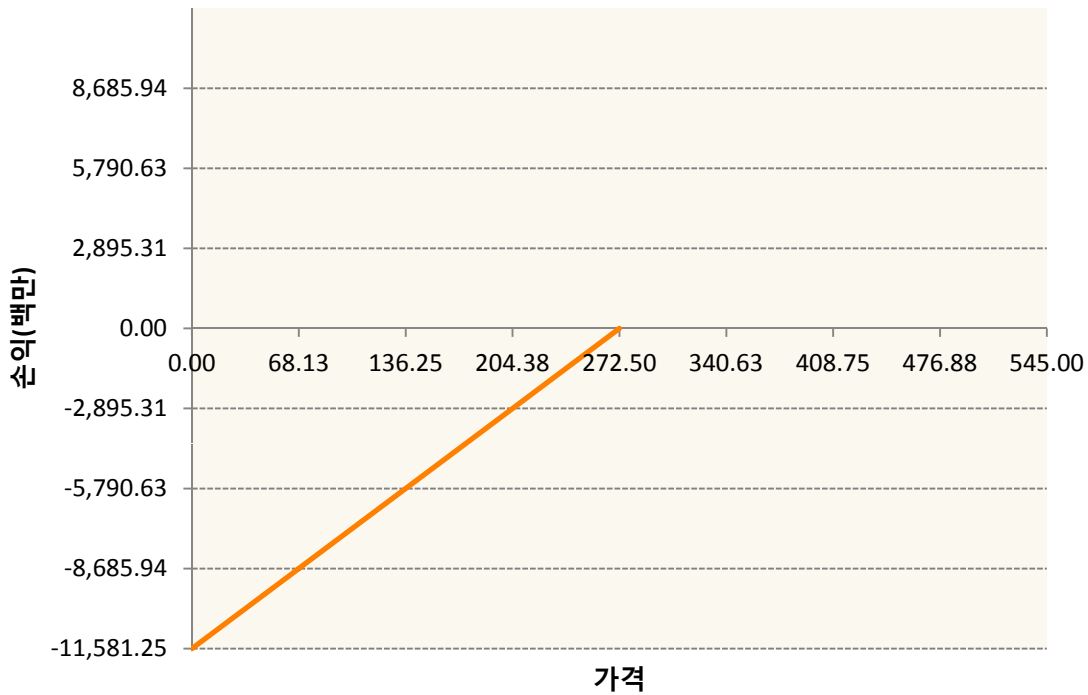


KR4301NC2701-2018-12 풋270





KR4301NC2727-2018-12 풋272.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

	2.529E+11		UBCSFXC1 INDEX_14				3,602
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-3,602	-3,602	-3,602	-3,602	-3,602	-3,602	-3,602
-5.33%	-2,401	-2,401	-2,401	-2,401	-2,401	-2,401	-2,401
-2.67%	-1,201	-1,201	-1,201	-1,201	-1,201	-1,201	-1,201
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	1,201	1,201	1,201	1,201	1,201	1,201	1,201
5.33%	2,401	2,401	2,401	2,401	2,401	2,401	2,401
8.00%	3,602	3,602	3,602	3,602	3,602	3,602	3,602
	KR4201NC2728		2018-12 풋272.5				1,508
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	675	654	628	598	565	529	491
-5.33%	603	565	523	478	432	383	333
-2.67%	452	397	341	284	226	167	108
0%	190	127	63	0	-63	-127	-190
2.67%	-194	-254	-315	-376	-438	-500	-563
5.33%	-689	-736	-786	-838	-893	-948	-1,005
8.00%	-1,264	-1,295	-1,331	-1,371	-1,414	-1,460	-1,508

KR4301NC2701                      2018-12 풋270                      406

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-384	-386	-389	-392	-396	-401	-406
-5.33%	-214	-220	-226	-233	-241	-249	-258
-2.67%	-68	-79	-89	-100	-110	-121	-132
0%	35	23	12	0	-12	-24	-35
2.67%	92	83	74	64	54	44	33
5.33%	116	111	106	99	92	85	76
8.00%	123	121	119	116	112	107	102

KR4301NC2727                      2018-12 풋272.5                      733

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-704	-706	-709	-713	-719	-725	-733
-5.33%	-408	-415	-424	-434	-445	-457	-469
-2.67%	-143	-158	-174	-190	-207	-224	-242
0%	60	40	20	0	-20	-40	-60
2.67%	184	166	148	129	111	91	72
5.33%	241	230	218	205	191	176	160
8.00%	260	256	250	242	234	224	213

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

(단위:백만원)

**6,168**

공시일	2018-11-16
기준일	2018-11-15

## 유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

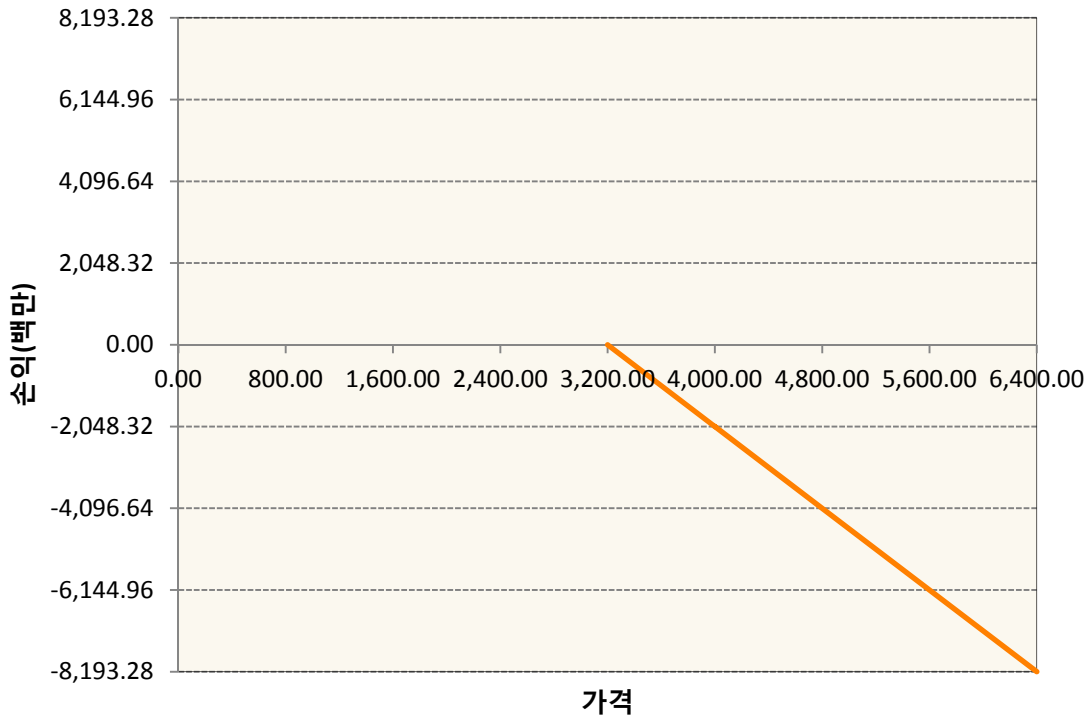
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

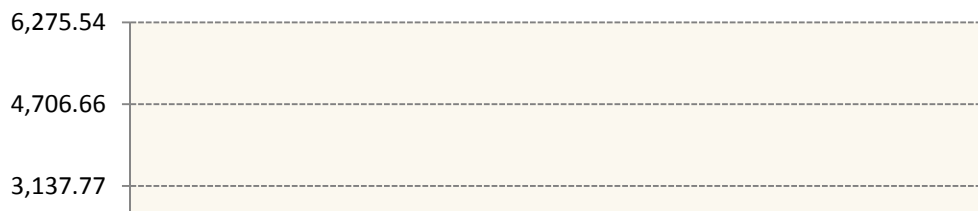
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	8,170	0	8,170	
누계	유가증권	스왑	71,502	0	71,502	장외
누계	유가증권	옵션	0	28,938	-28,938	장내
누계	통화	선도	0	15,362	-15,362	장외

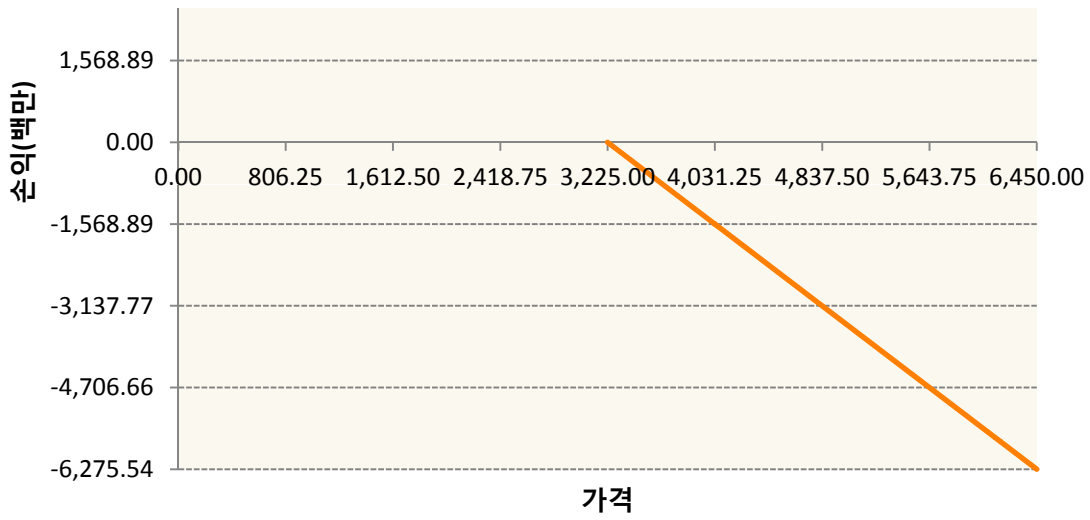
### 2. 만기시점의 손익구조

**OESXX8-C3200-EURO STOXX 50**

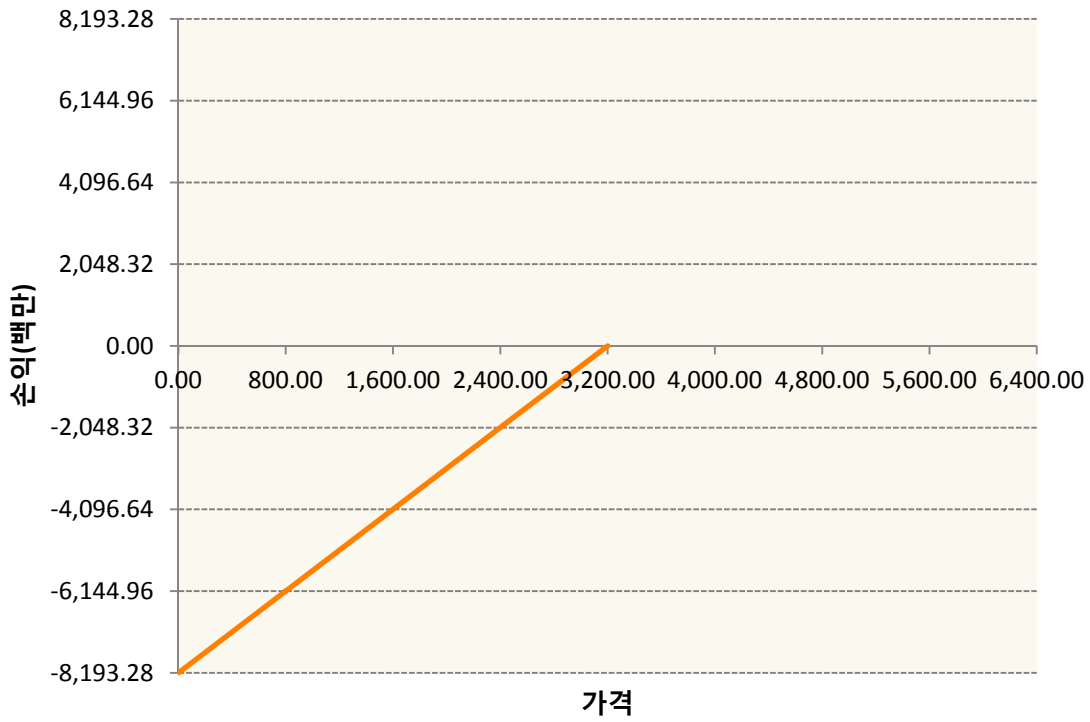


**OESXX8-C3225-EURO STOXX 50**

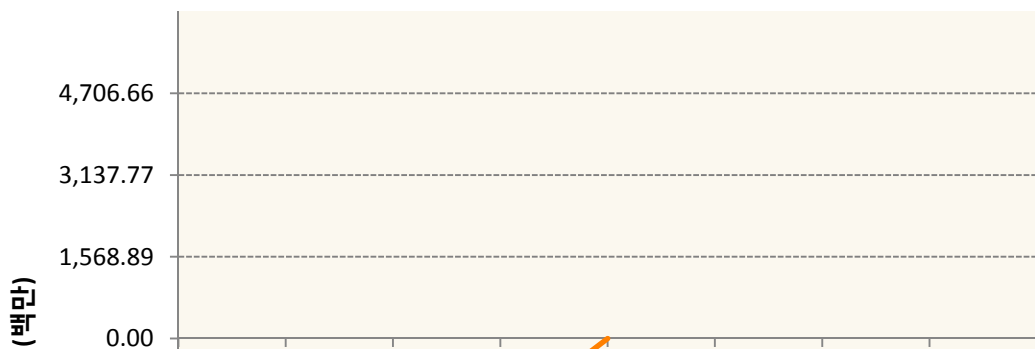


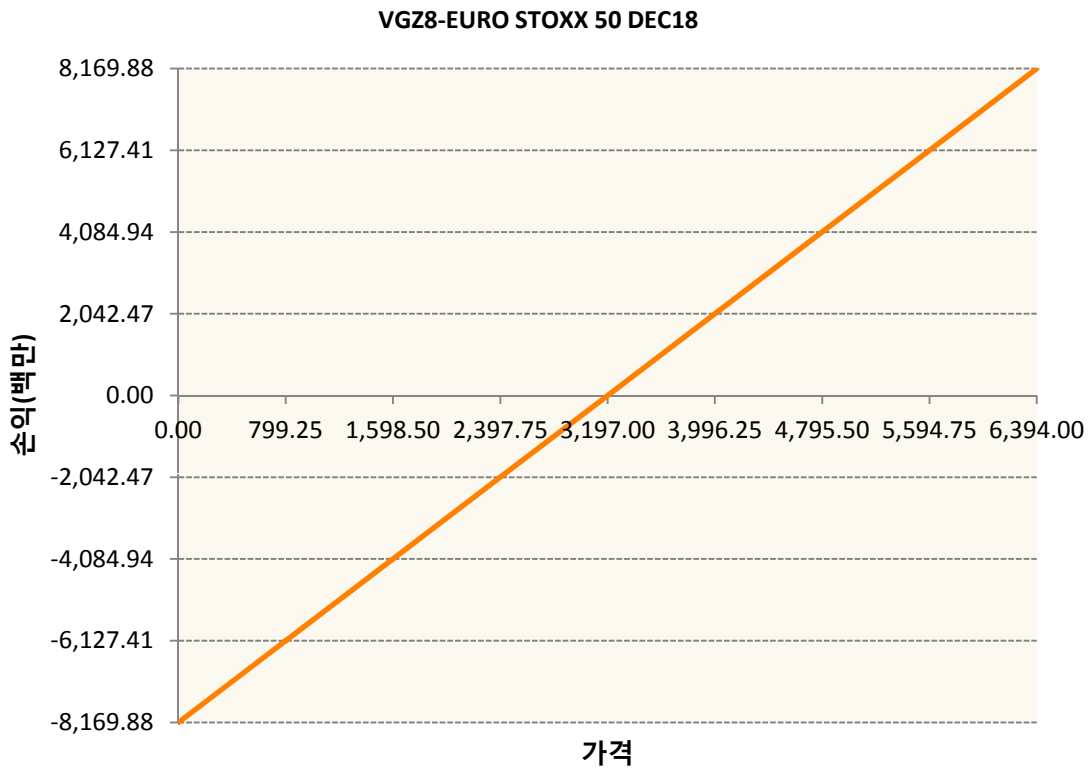
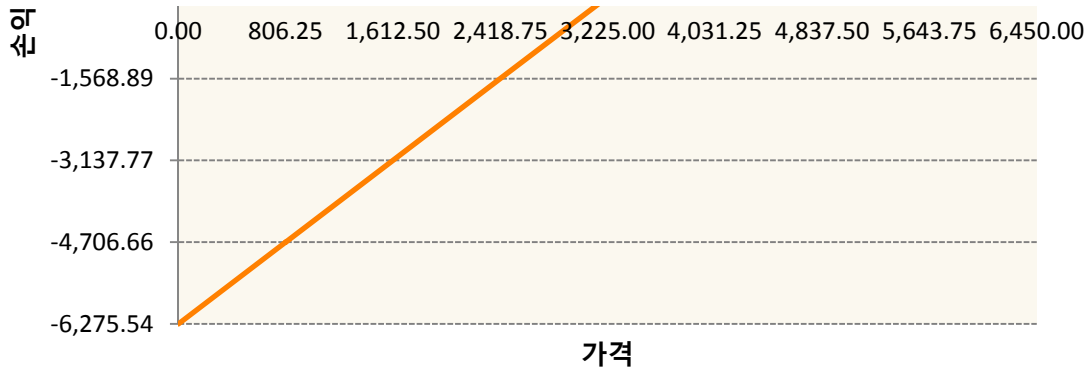


**OESXX8-P3200-EURO STOXX 50**



**OESXX8-P3225-EURO STOXX 50**





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

260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY	76
FX21018Q01 KRW/EUR 23-11-18E	205
FX21018Q02 KRW/EUR 23-11-18E	205
FX21018U03 KRW/EUR 21-12-18E	819
OESXX8-C32 EURO STOXX 50	655
OESXX8-C32 EURO STOXX 50	502
OESXX8-P32 EURO STOXX 50	655
OESXX8-P32 EURO STOXX 50	502
VGZ8 EURO STOXX 50 DEC18	654

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

(단위:백만원)

2,654



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

(단위:백만원)

1,152



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

(단위:백만원)

92



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

(단위:백만원)

138



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

(단위:백만원)

41

공시일	2018-11-16
기준일	2018-11-15

## 리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

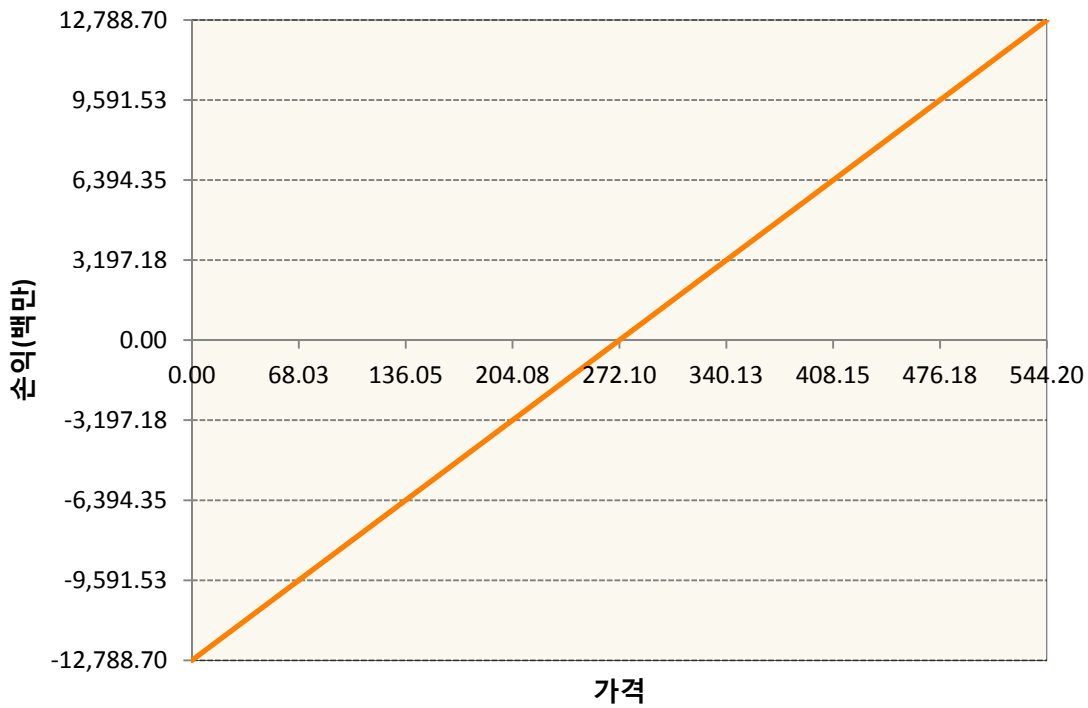
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

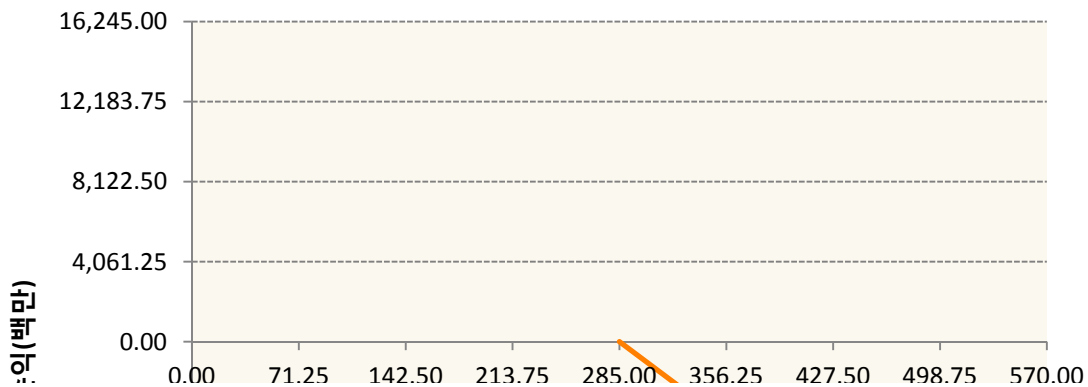
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	12,789	0	12,789	장내
누계	유가증권	옵션	3,743	22,858	-19,115	장내

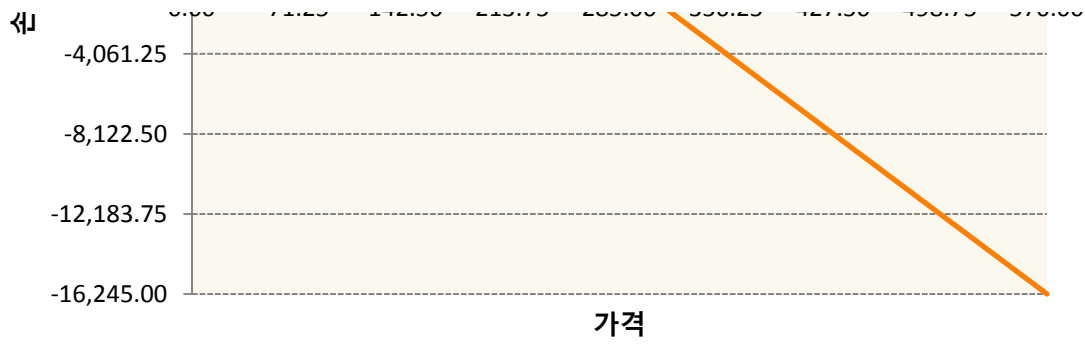
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101NC0004-2018-12 코스피200지수선물

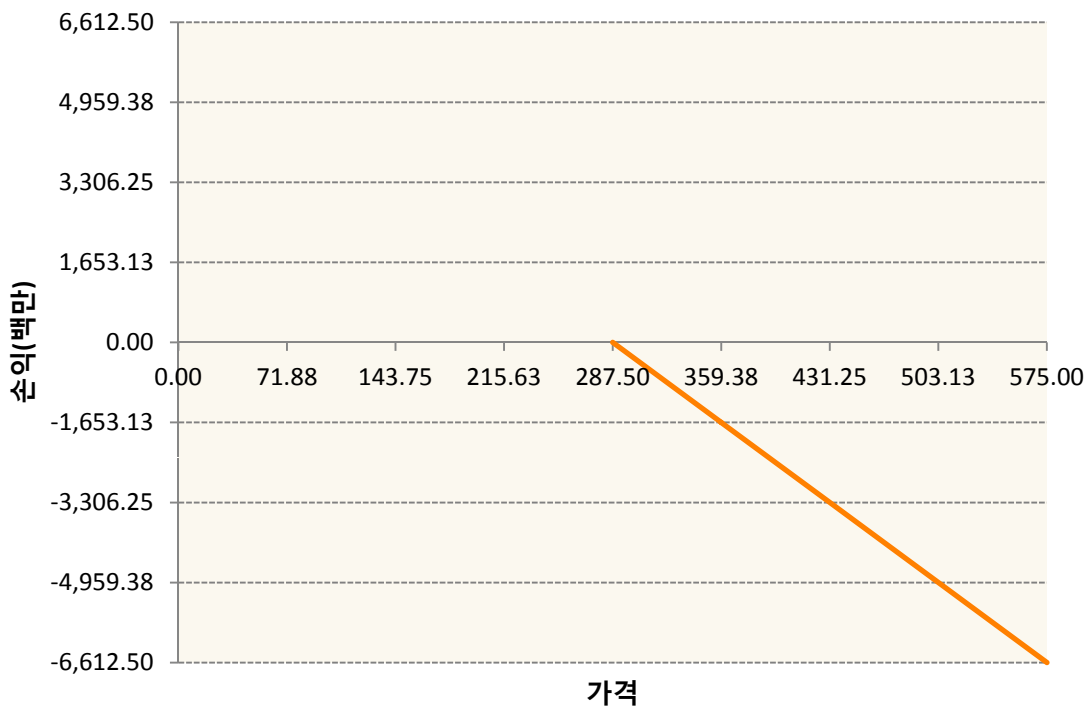


KR4201NC2850-2018-12 콜285

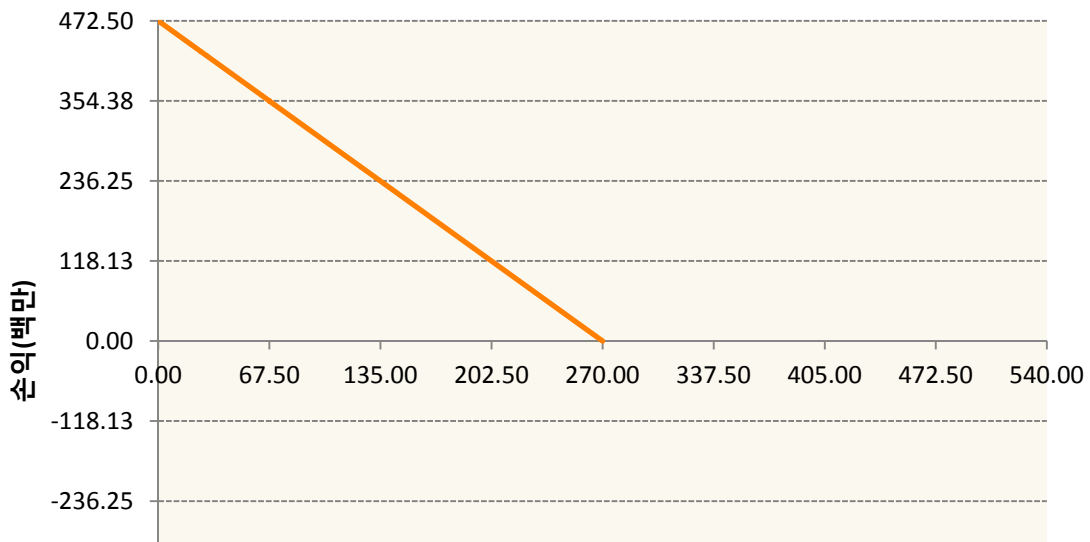


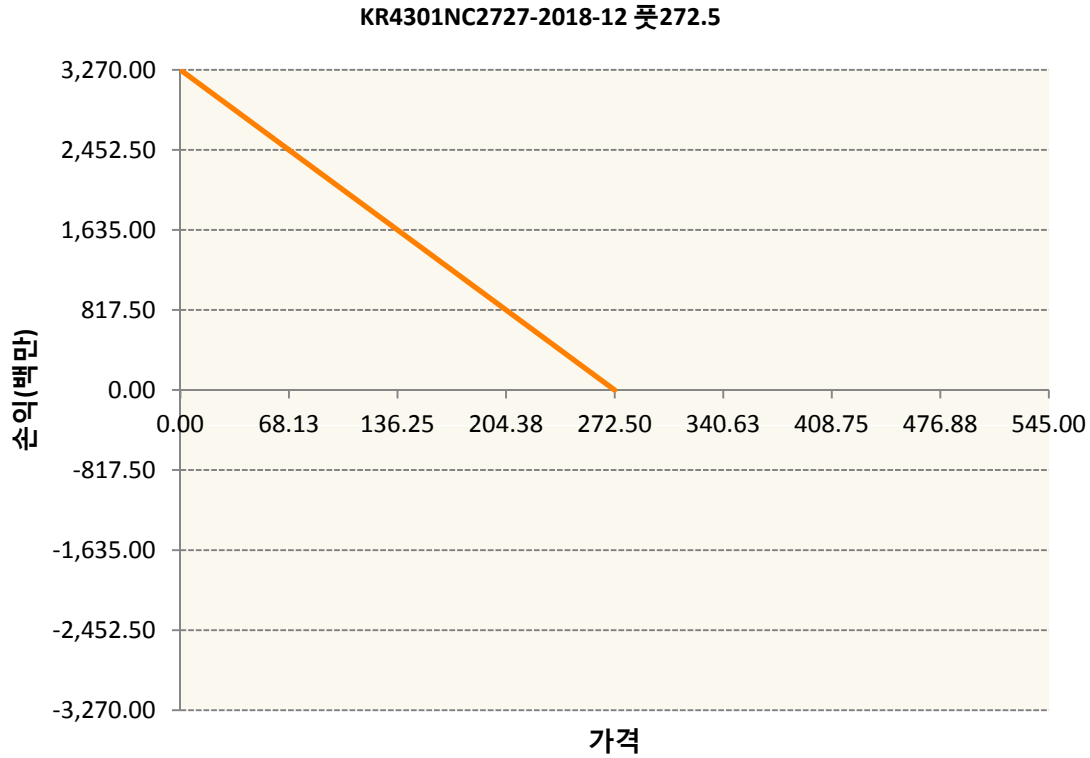
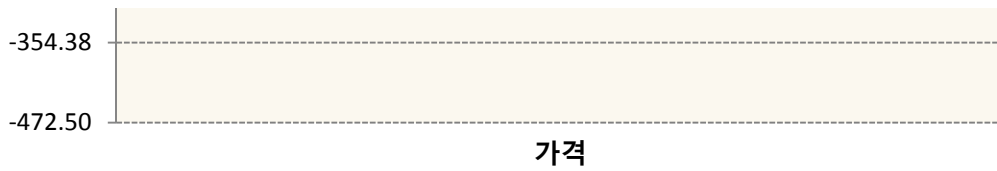


KR4201NC2876-2018-12 콜287.5



KR4301NC2701-2018-12 풋270





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

KR4101NC0004		2018-12 코스피200지수선물						1,021
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-1,021	-1,021	-1,021	-1,021	-1,021	-1,021	-1,021	
-5.33%	-681	-681	-681	-681	-681	-681	-681	
-2.67%	-340	-340	-340	-340	-340	-340	-340	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	340	340	340	340	340	340	340	
5.33%	681	681	681	681	681	681	681	
8.00%	1,021	1,021	1,021	1,021	1,021	1,021	1,021	
KR4201NC2850		2018-12 콜285						692
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	186	183	177	170	160	149	135	
-5.33%	177	168	157	143	126	108	87	
-2.67%	151	133	113	90	65	38	10	

0%	91	62	32	0	-33	-67	-102
2.67%	-23	-61	-99	-138	-176	-216	-255
5.33%	-206	-247	-288	-329	-370	-411	-452
8.00%	-461	-498	-536	-575	-614	-653	-692
KR4201NC2876                      2018-12 콜287.5							259
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	62	61	60	57	54	50	45
-5.33%	60	57	53	48	43	36	29
-2.67%	52	46	39	31	22	12	2
0%	33	23	12	0	-12	-25	-39
2.67%	-5	-19	-34	-49	-64	-79	-95
5.33%	-69	-85	-102	-119	-135	-152	-168
8.00%	-162	-178	-194	-210	-226	-243	-259
KR4301NC2701                      2018-12 풋270							28
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	27	27	27	27	28	28	28
-5.33%	15	15	16	16	17	17	18
-2.67%	5	6	6	7	8	8	9
0%	-2	-2	-1	0	1	2	2
2.67%	-6	-6	-5	-4	-4	-3	-2
5.33%	-8	-8	-7	-7	-6	-6	-5
8.00%	-9	-8	-8	-8	-8	-7	-7
KR4301NC2727                      2018-12 풋272.5							207
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	199	199	200	201	203	205	207
-5.33%	115	117	120	122	126	129	133
-2.67%	40	45	49	54	58	63	68
0%	-17	-11	-6	0	6	11	17
2.67%	-52	-47	-42	-37	-31	-26	-20
5.33%	-68	-65	-62	-58	-54	-50	-45
8.00%	-73	-72	-70	-68	-66	-63	-60

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

(단위:백만원)

**1,777**

공시일	2018-11-16
기준일	2018-11-15

## 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	319	0	319	

### 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	2018-11-16
기준일	2018-11-15

## H2O글로벌본드(H)(채권혼합-파생)

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	29	0	29	
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	수익증권	142	0	142	
누계	통화	선도	0	174	-174	장외

### 2. 만기시점의 손익구조

### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음	
FX21018X01 KRW/USD 13-12-18E		9
FX21018X01 KRW/USD 30-11-18E		2
FX21018X01 KRW/USD 30-11-18E		3

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

(단위:백만원)

5



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

(단위:백만원)

153

공시일	2018-11-16
기준일	2018-11-15

## 에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

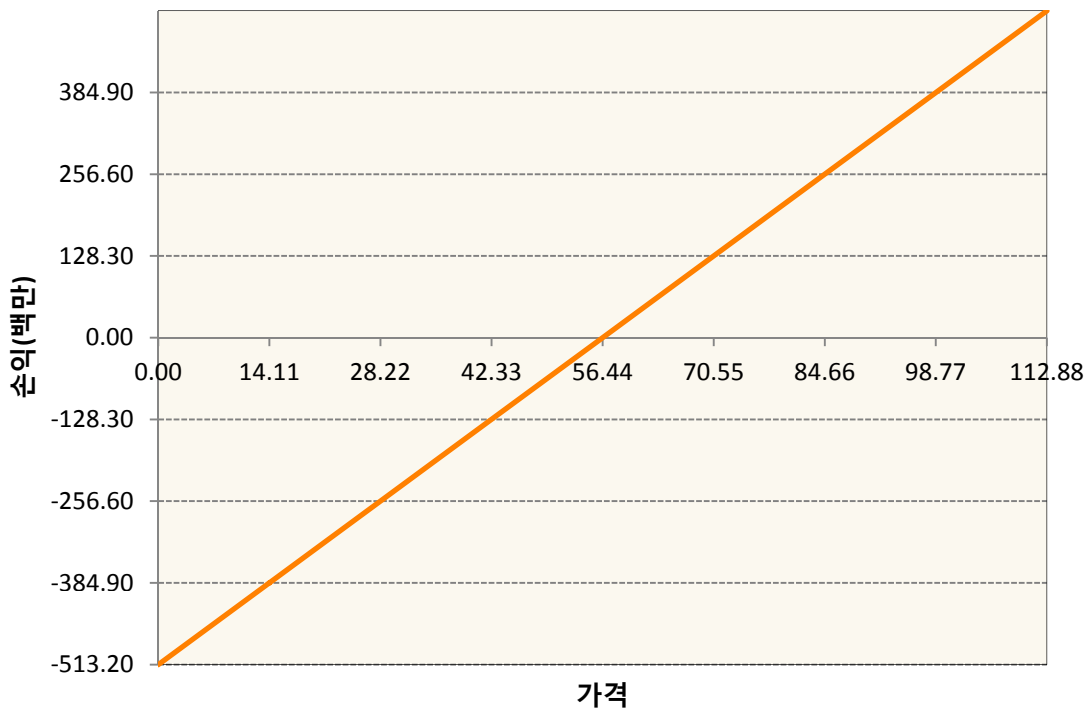
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

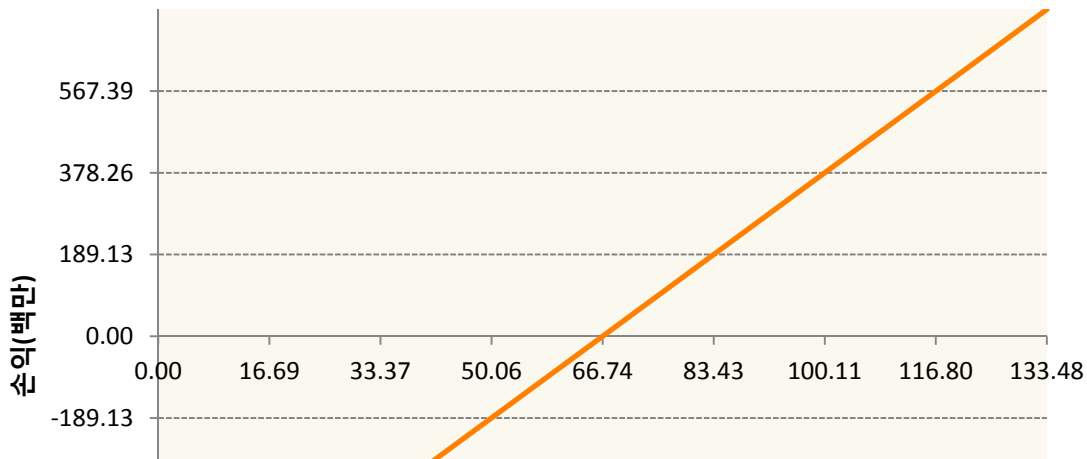
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,351	407	2,945	

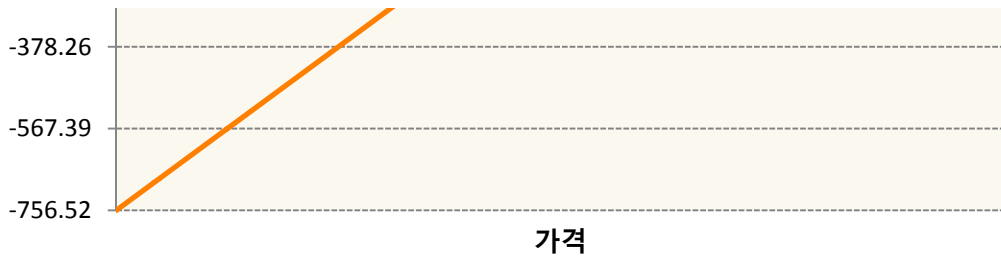
### 2. 만기시점의 손익구조

CLF9-WTI CRUDE FUTURE Jan19

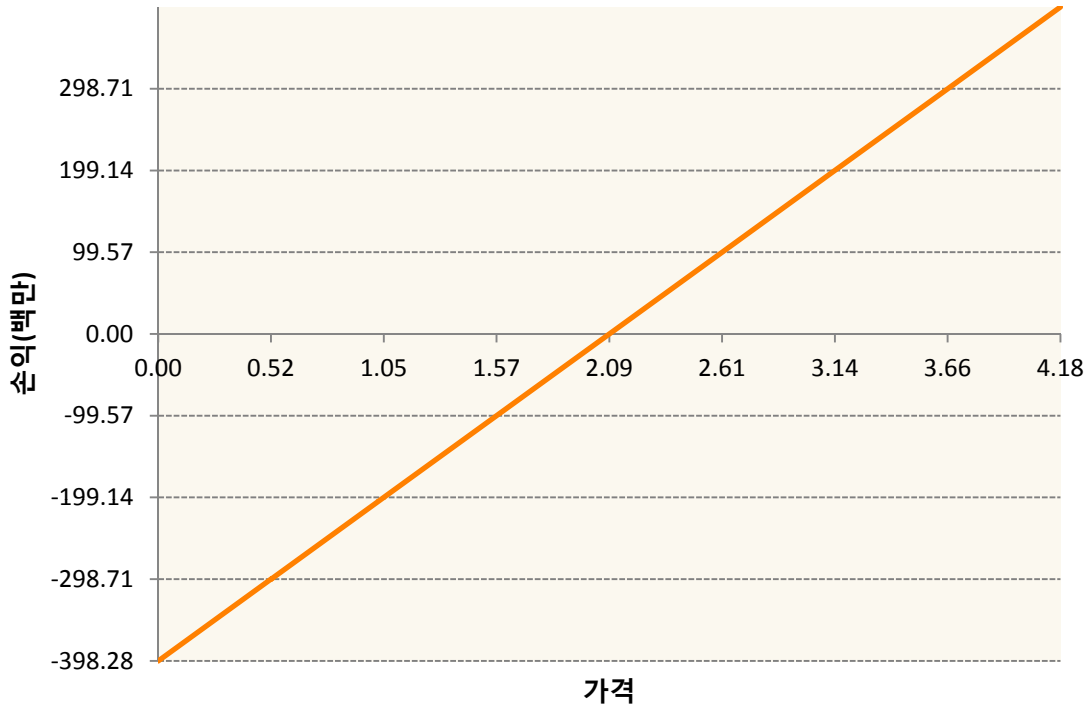


COH9-BRENT CRUDE FUTR Mar19

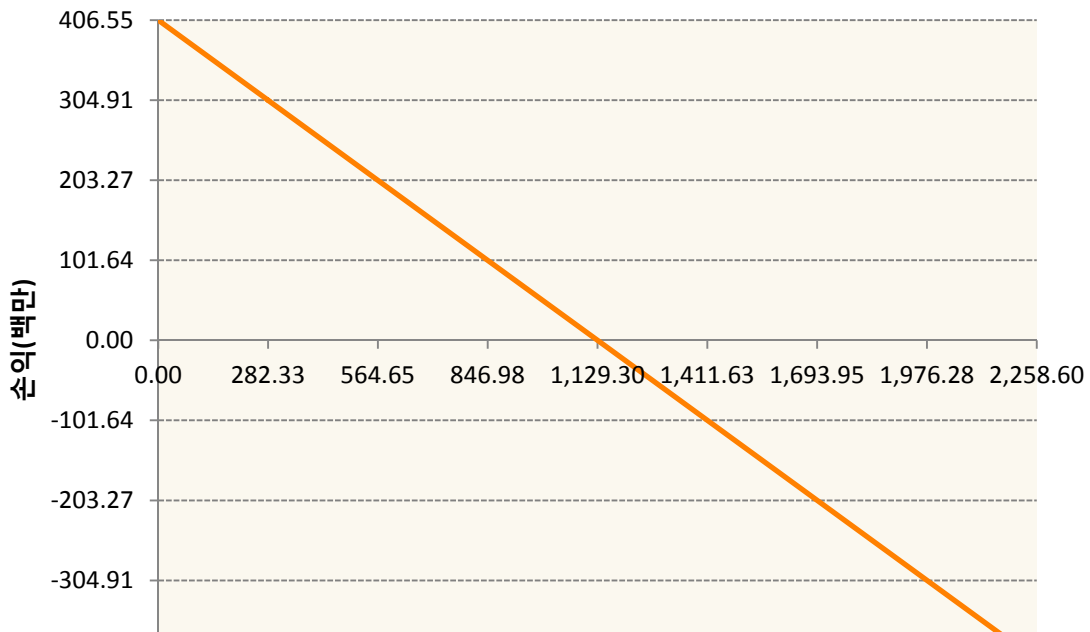


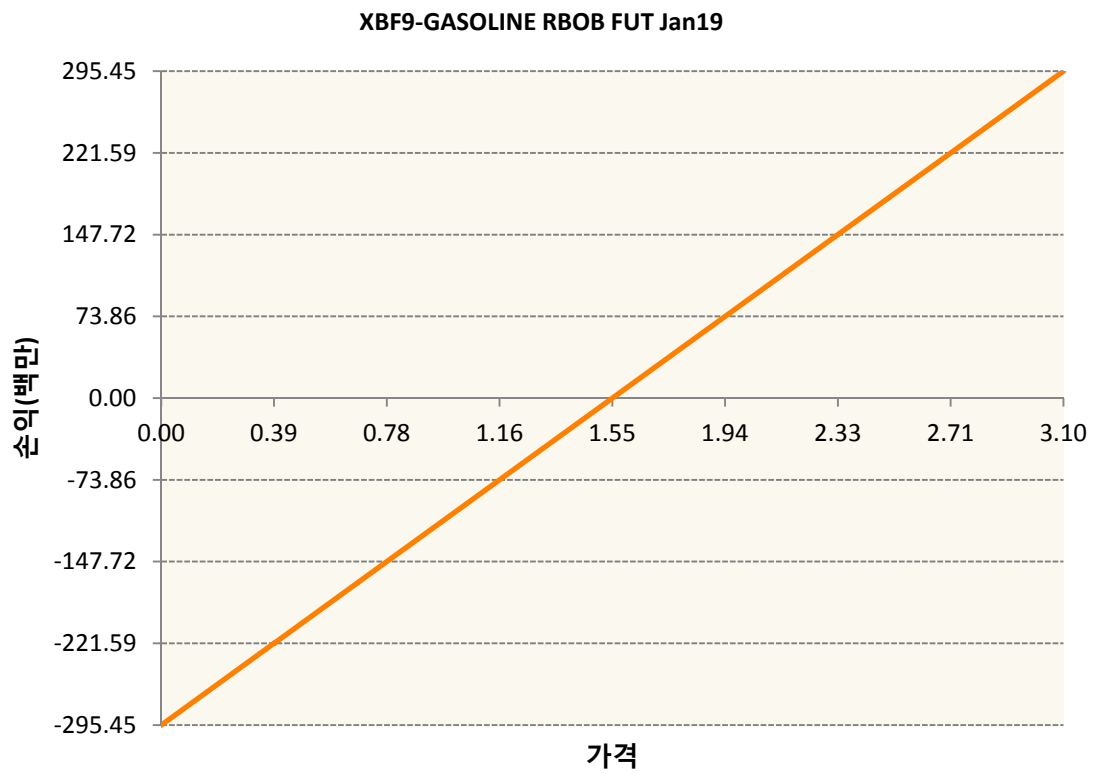
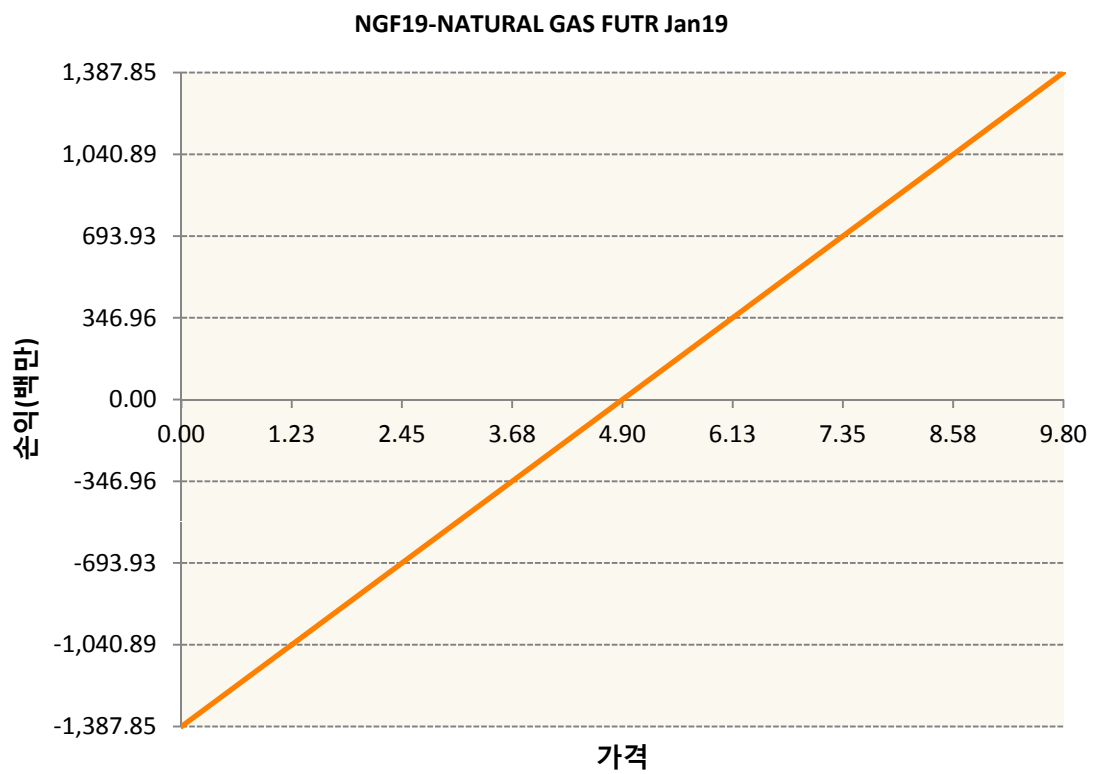
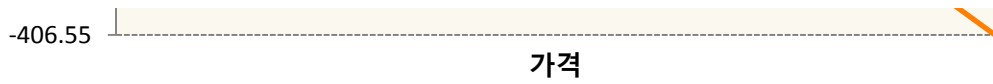


HOF9-NY Harb ULSD Fut Jan19



KR4175NB0006-2018-11 달러선물





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

CLF9	WTI CRUDE FUTURE Jan19	41
COH9	BRENT CRUDE FUTR Mar19	61
HOF9	NY Harb ULSD Fut Jan19	32
KR4175NB00	2018-11 달러선물	33
NGF19	NATURAL GAS FUTR Jan19	111
XBF9	GASOLINE RBOB FUT Jan19	24

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

**439**

공시일	2018-11-16
기준일	2018-11-15

## 애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

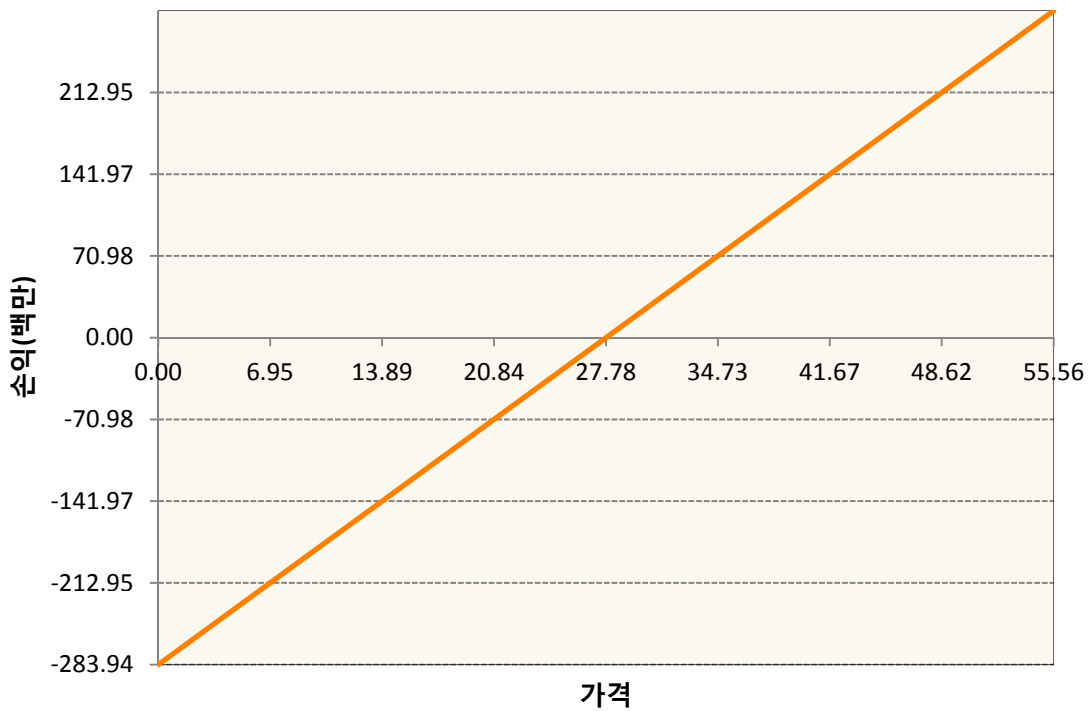
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

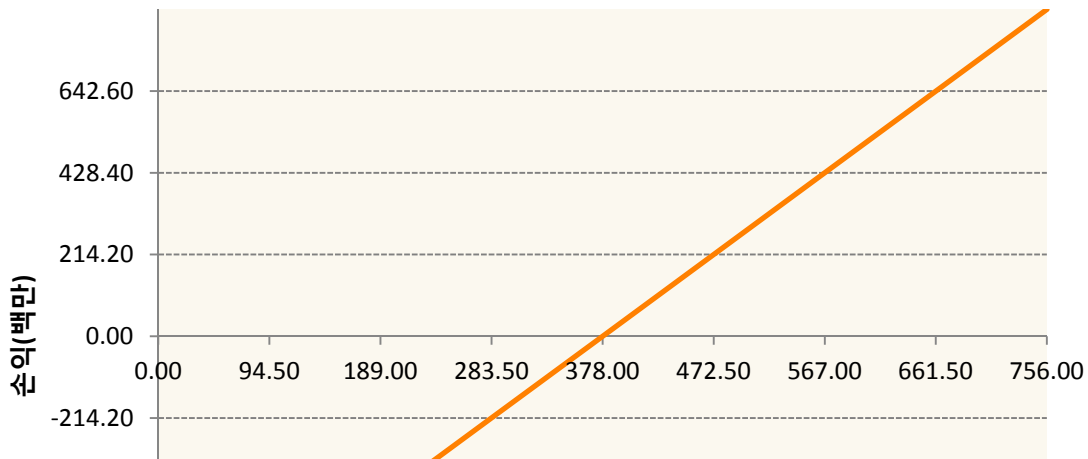
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,691	79	3,612	

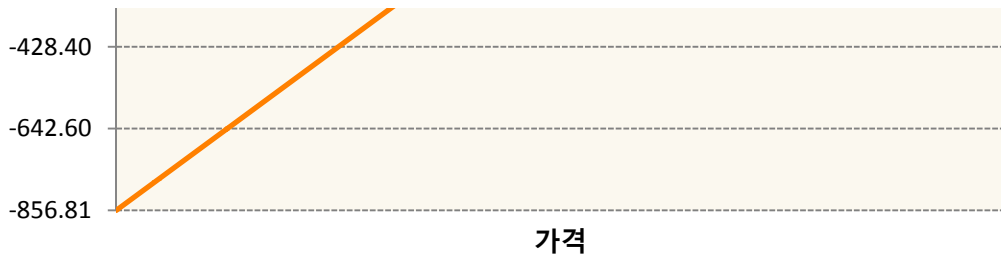
### 2. 만기시점의 손익구조

BOF9-SOYBEAN OIL FUTR Jan19

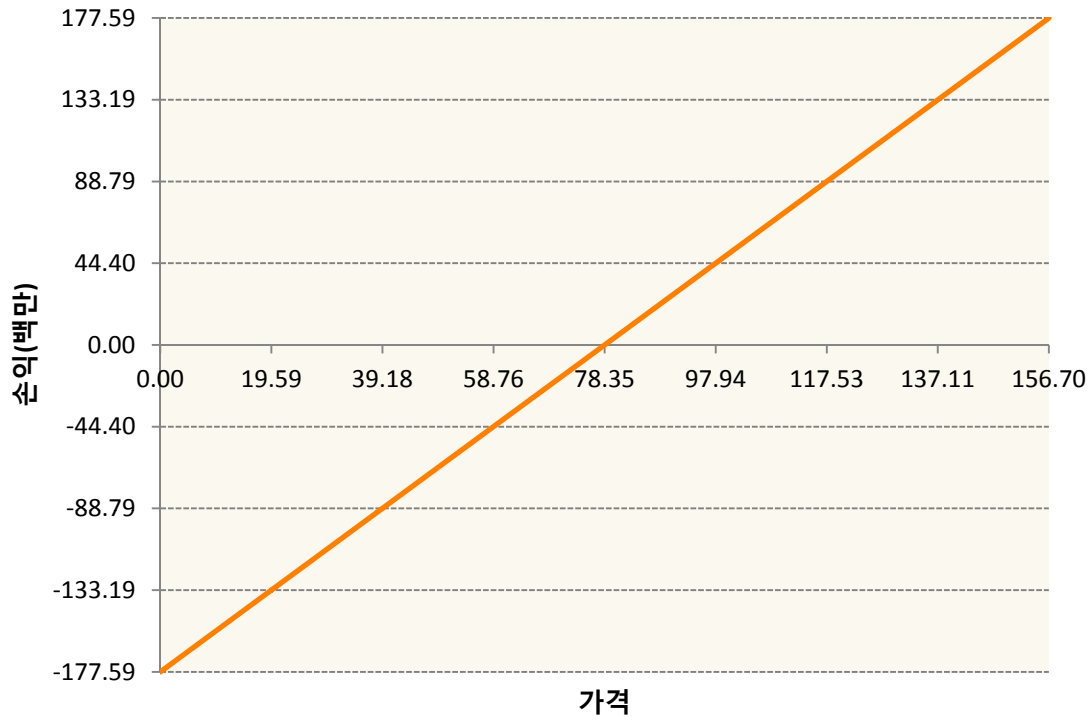


CH9-CORN FUTURE Mar19

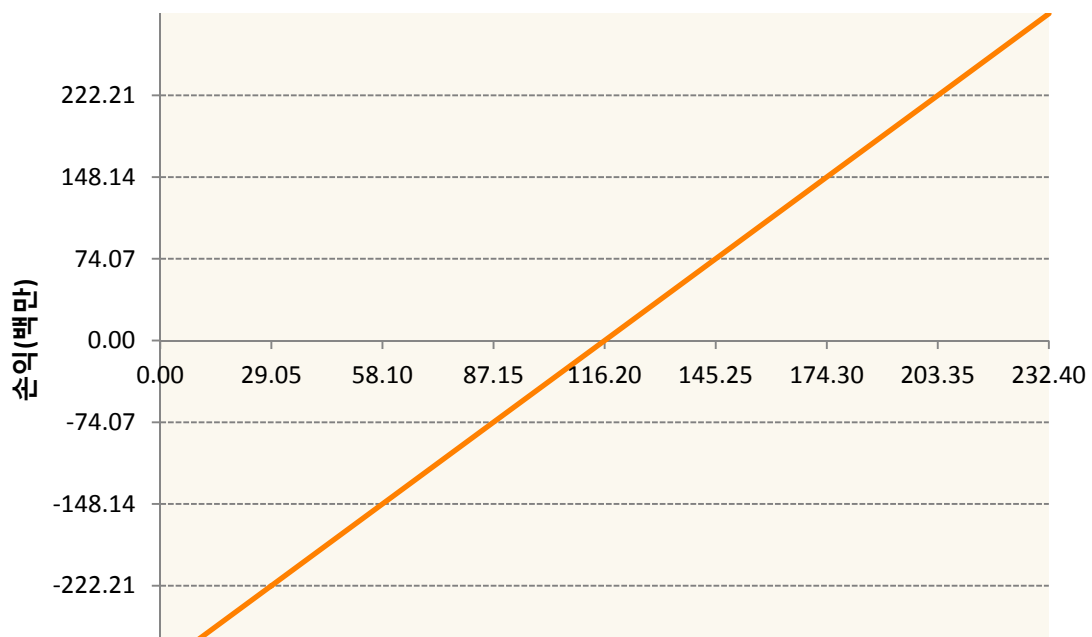


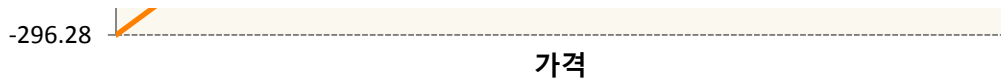


**CTH9-COTTON NO.2 FUTR Mar19**

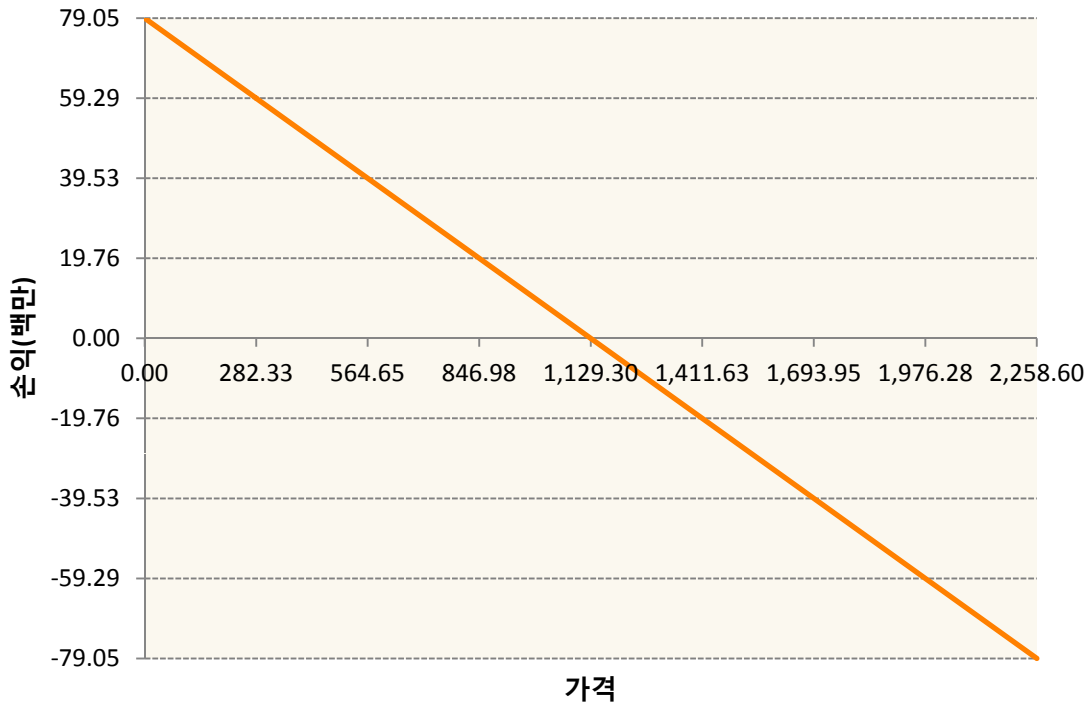


**KCH9-COFFEE 'C' FUTURE Mar19**

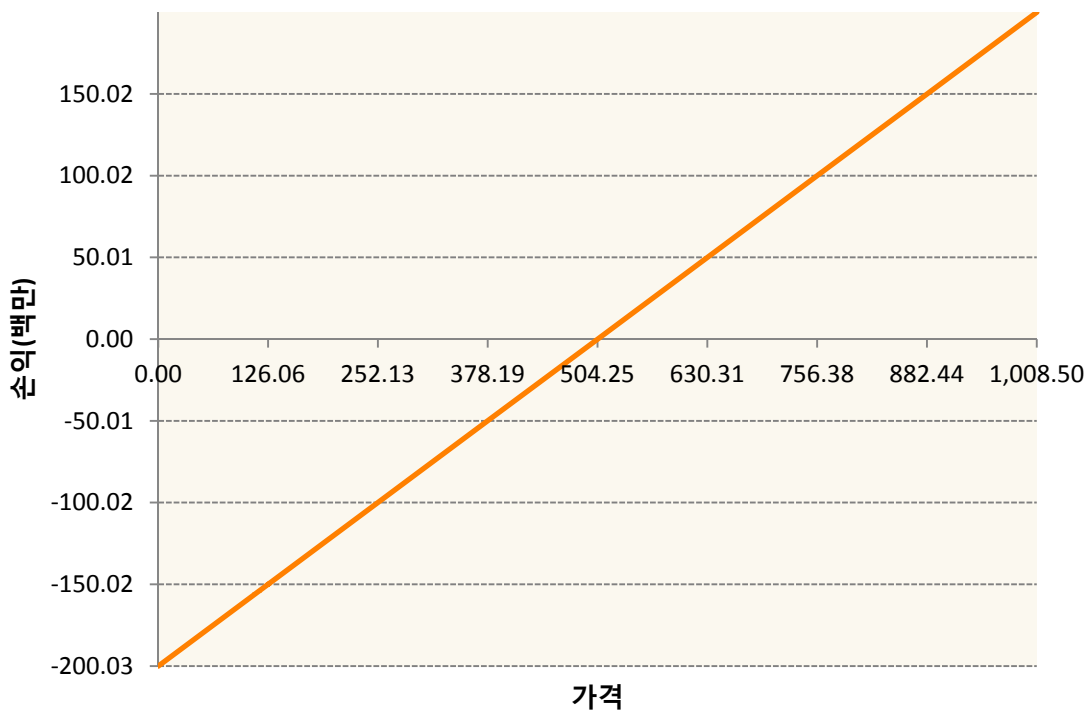




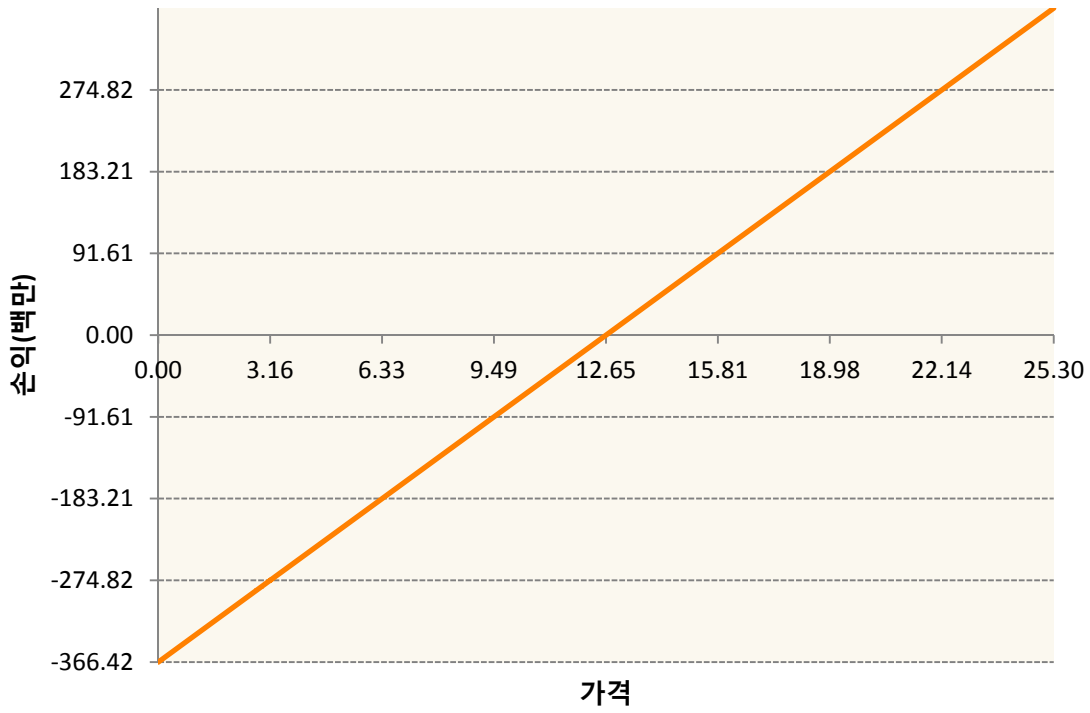
KR4175NB0006-2018-11 달러선물



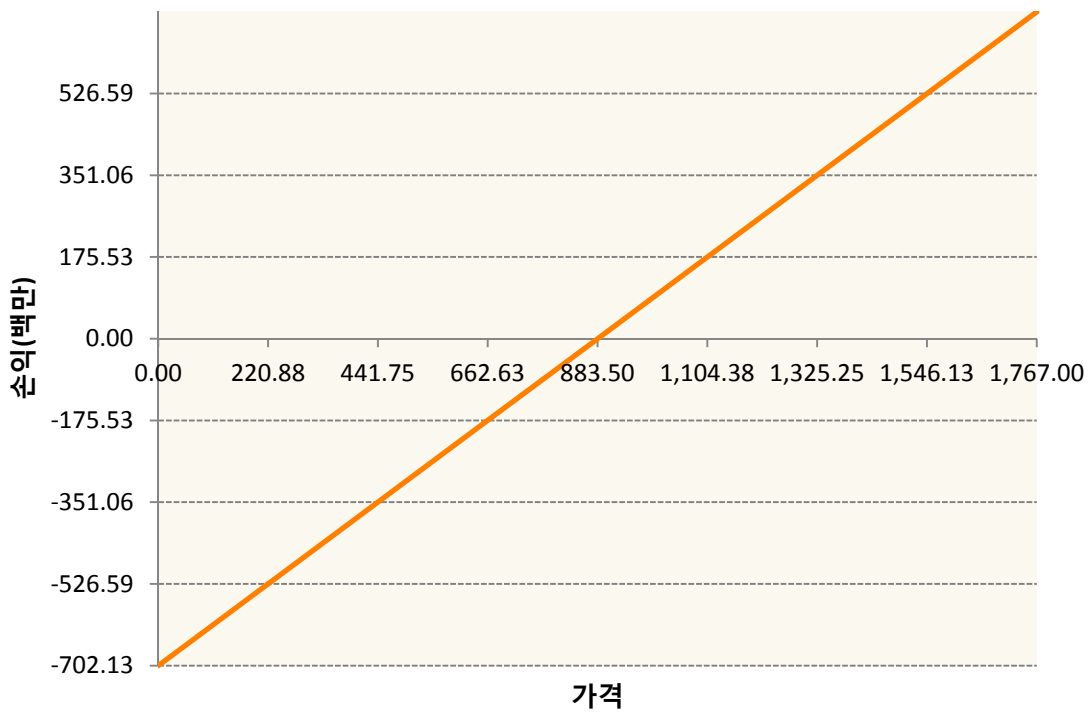
KWH9-KC HRW WHEAT FUT Mar19



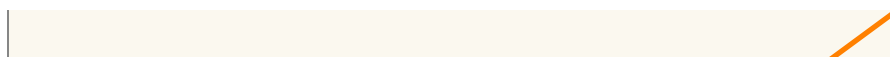
SBH9-SUGAR #11 (WORLD) MAR19

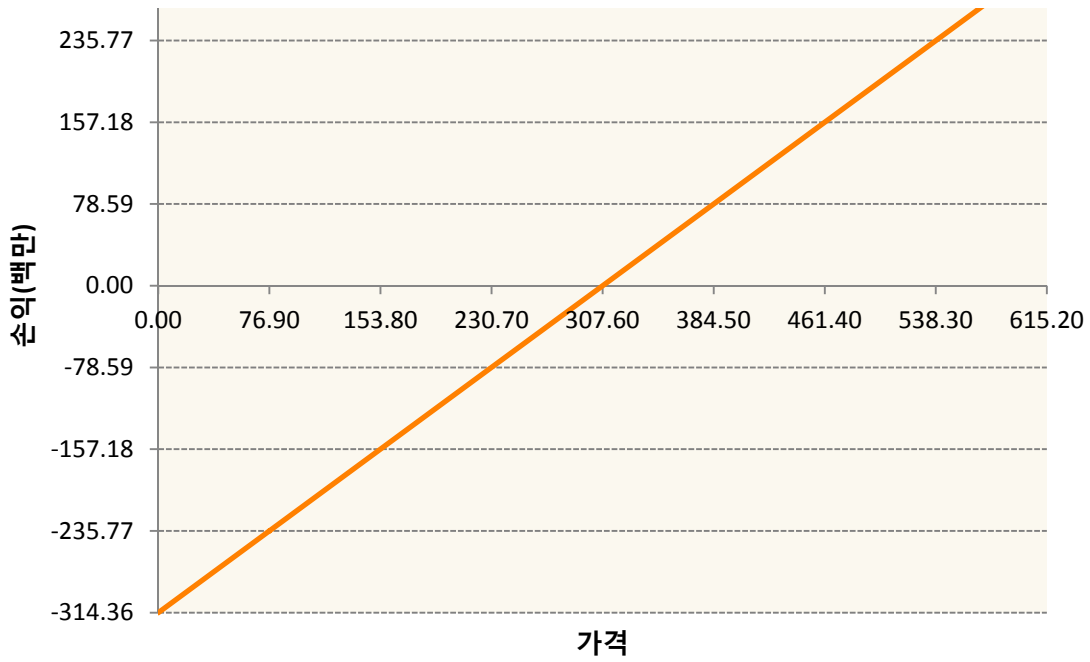


SF9-SOYBEAN FUTURE Jan19

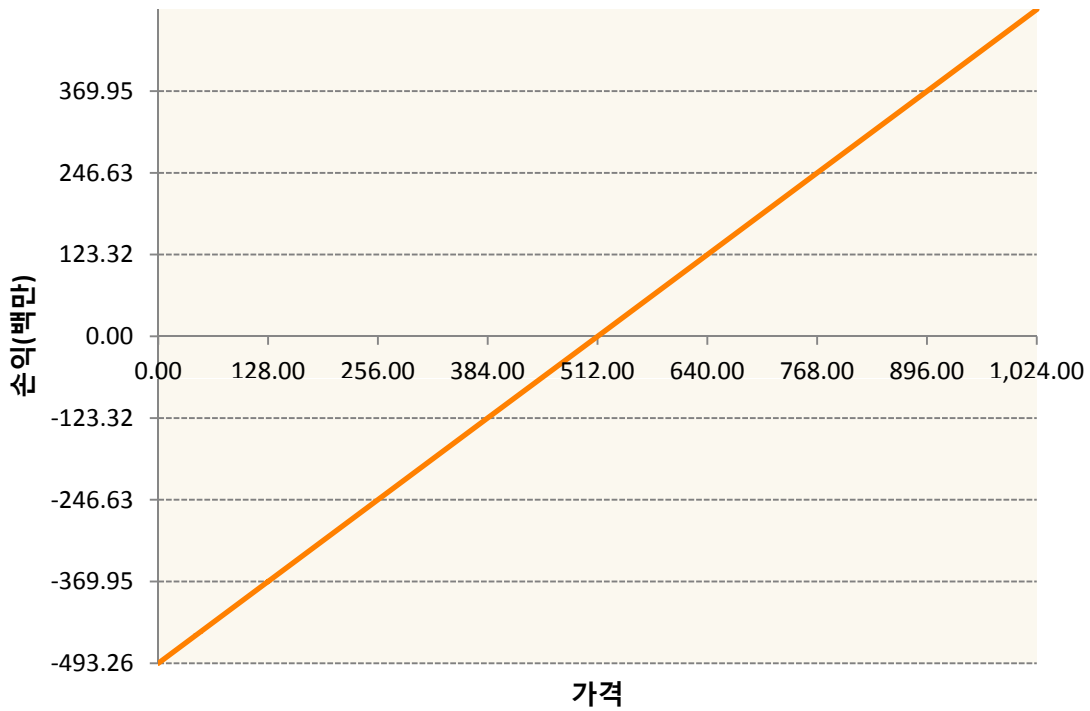


SMF9-SOYBEAN MEAL FUTR Jan19





WH9-WHEAT FUTURE(CBT) Mar19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

BOF9	SOYBEAN OIL FUTR Jan19	23
CH9	CORN FUTURE Mar19	69
CTH9	COTTON NO.2 FUTR Mar19	14
KCH9	COFFEE 'C' FUTURE Mar19	24
KR4175NB0	2018-11 달러선물	6

KWH9	KC HRW WHEAT FUT Mar19	16
SBH9	SUGAR #11 (WORLD) MAR19	29
SF9	SOYBEAN FUTURE Jan19	56
SMF9	SOYBEAN MEAL FUTR Jan19	25
WH9	WHEAT FUTURE(CBT) Mar19	39

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

(단위:백만원)

**324**