

공시일	2018-11-23
기준일	2018-11-22

## 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	2018-11-23
기준일	2018-11-22

## 스마트인덱스모

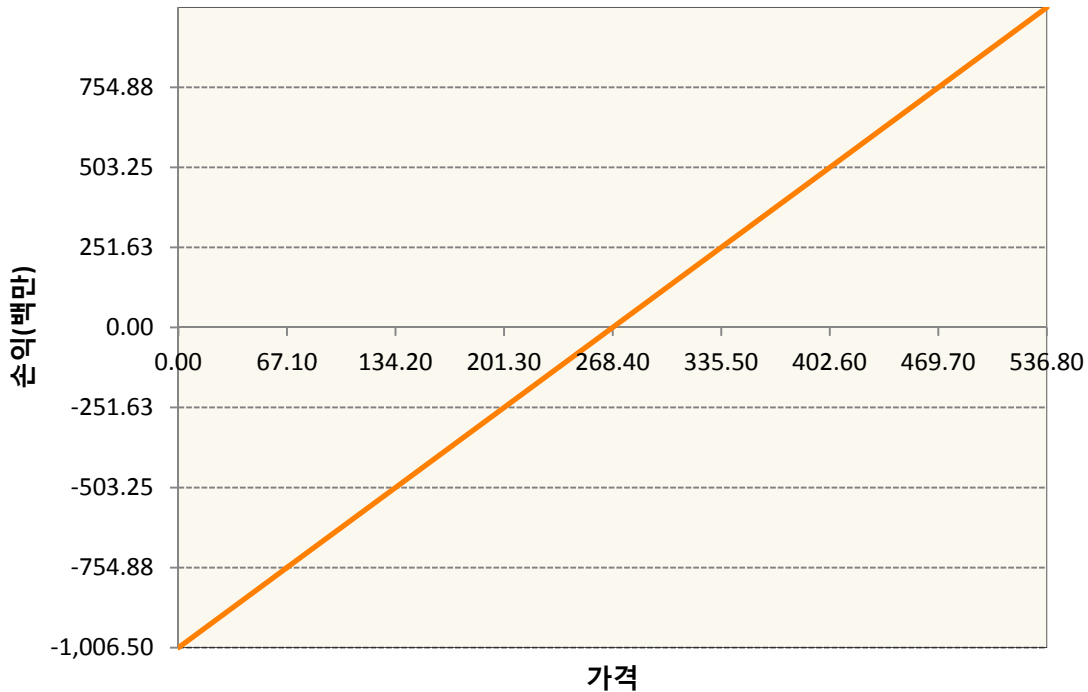
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,007	0	1,007	장내

### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101NC0004-2018-12 코스피200지수선물



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101NC0004		2018-12 코스피200지수선물						80
가격	기초자산의 변동성							
	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-80	-80	-80	-80	-80	-80	-80	
-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%	80	80	80	80	80	80	80	



공시일	2018-11-23
기준일	2018-11-22

## SMART합성-MSCI선진국증권상장

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	13,197	0	13,197	장외
누계	지수	스왑	13,197	0	13,197	장외

### 2. 만기시점의 손익구조

### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWMXWO0( 신한MXWO 미래S181122

1,056

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

515

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2018-11-23
기준일	2018-11-22

## 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

276

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

399

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2018-11-23
기준일	2018-11-22

## 유로인덱스모(주식-파생형)

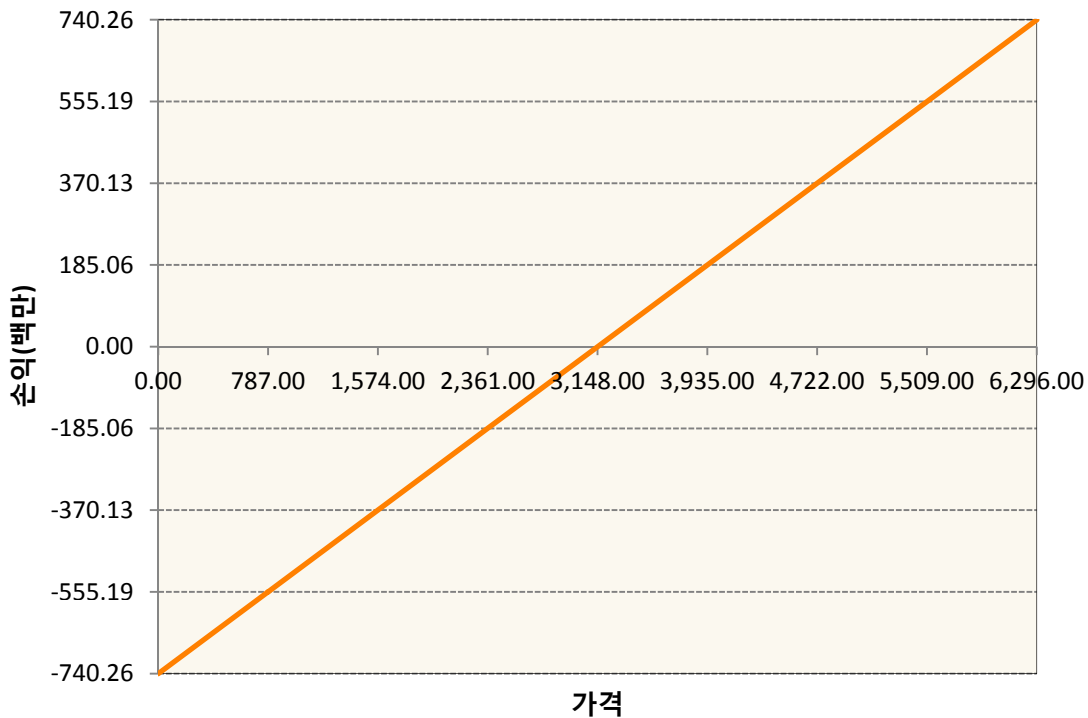
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	740	0	740	

### 2. 만기시점의 손익구조

VGZ8-EURO STOXX 50 DEC18



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGZ8	EURO STOXX 50 DEC18	59
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

38
----

공시일	2018-11-23
기준일	2018-11-22

## 차이나인덱스모(주식-파생형)

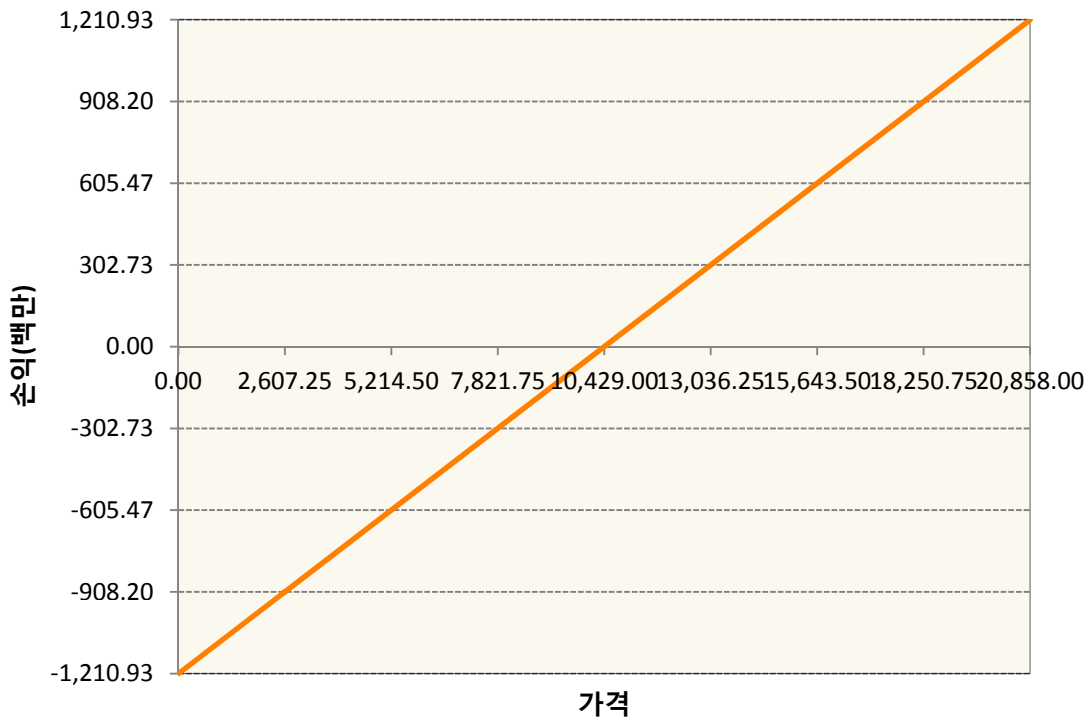
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

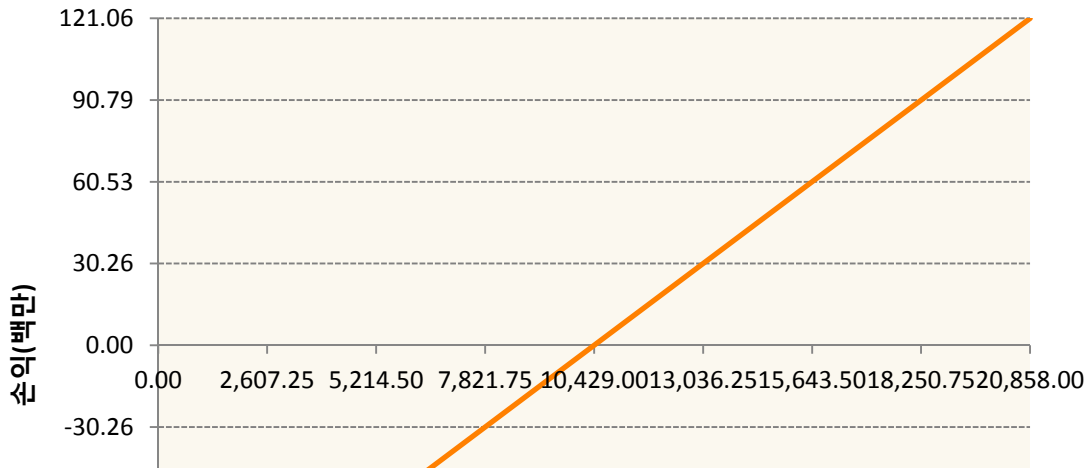
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,332	0	1,332	장내

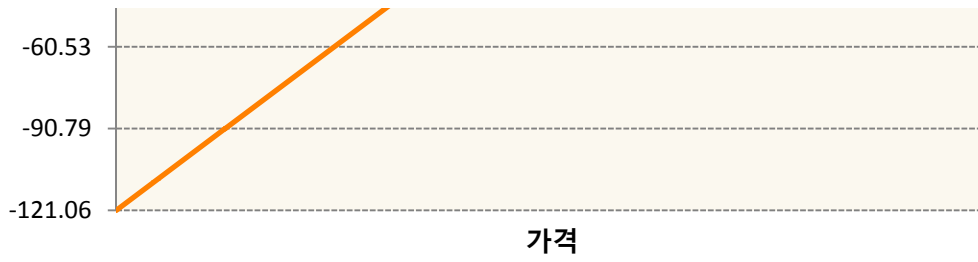
### 2. 만기시점의 손익구조

HCX8-HSCEI FUTURES NOV 18



MHCX8-MINI H-SHR IDX FU NOV 18





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

HCX8	HSCEI FUTURES NOV 18	97
MHCX8	MINI H-SHR IDX FU NOV 18	10

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

<b>106</b>
------------

공시일	2018-11-23
기준일	2018-11-22

## 커버드콜모(주식혼합-파생형)

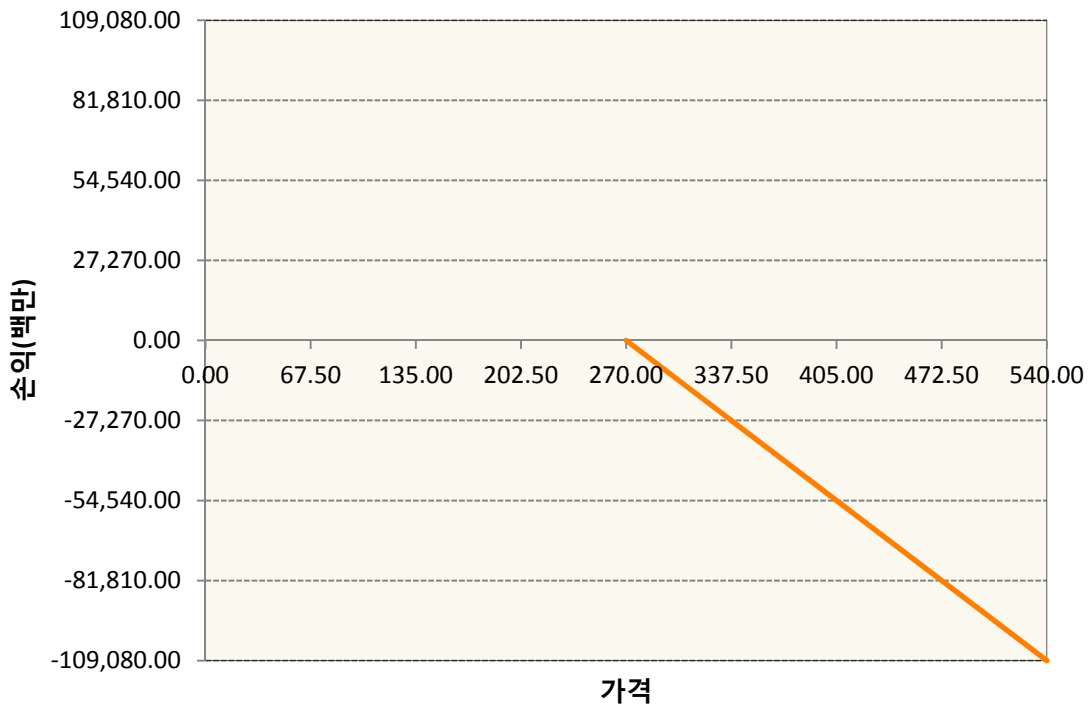
### 1. 계약금액

(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

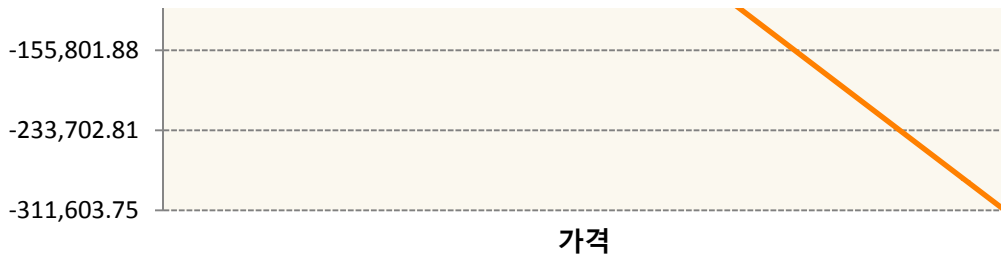
### 2. 만기시점의 손익구조

**KR4201NC2702-2018-12 콜270**

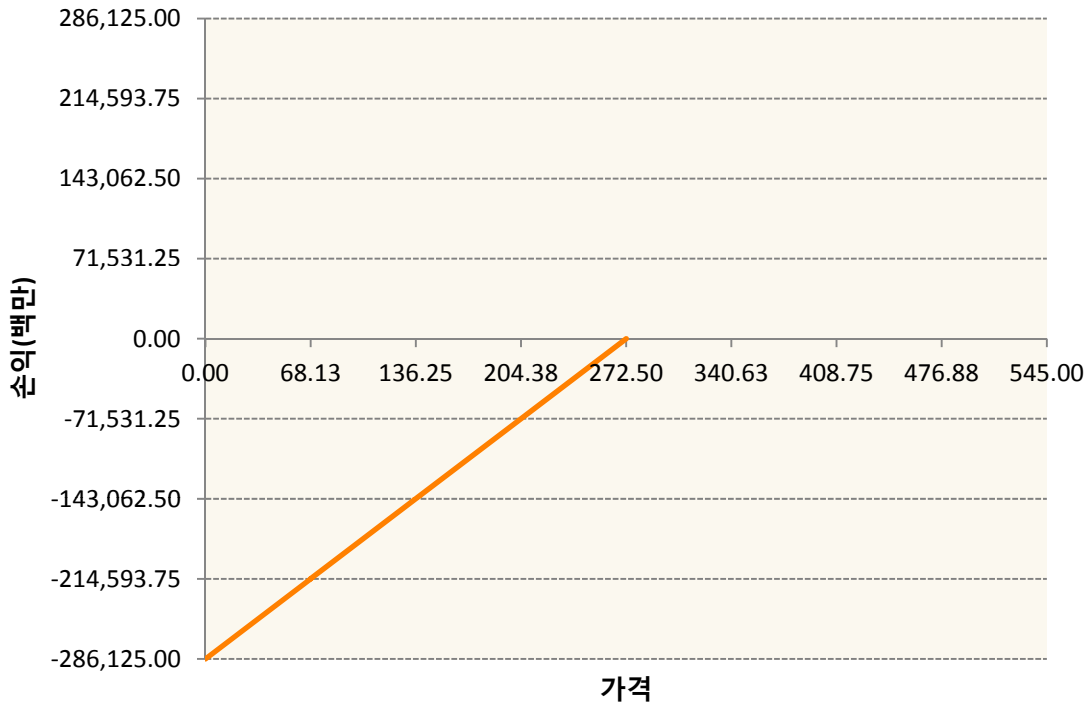


**KR4201NC2728-2018-12 콜272.5**





KR4301NC2727-2018-12 풋272.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201NC2702		2018-12 콜270					6,349
		기초자산의 변동성					
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	2,416	2,362	2,292	2,205	2,105	1,992	1,867
-5.33%	2,217	2,099	1,964	1,816	1,657	1,489	1,313
-2.67%	1,714	1,520	1,319	1,111	899	683	463
0%	726	485	243	0	-243	-486	-729
2.67%	-844	-1,079	-1,316	-1,555	-1,795	-2,037	-2,279
5.33%	-2,952	-3,133	-3,326	-3,527	-3,735	-3,949	-4,168
8.00%	-5,449	-5,562	-5,693	-5,840	-5,999	-6,170	-6,349
KR4201NC2728		2018-12 콜272.5					16,968
		기초자산의 변동성					
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	5,748	5,635	5,479	5,281	5,042	4,765	4,454

-5.33%	5,354	5,083	4,763	4,401	4,002	3,572	3,116
-2.67%	4,274	3,790	3,275	2,734	2,174	1,596	1,006
0%	1,993	1,335	670	0	-674	-1,351	-2,030
2.67%	-1,870	-2,566	-3,264	-3,963	-4,663	-5,364	-6,065
5.33%	-7,330	-7,914	-8,520	-9,142	-9,778	-10,424	-11,079
8.00%	-14,051	-14,446	-14,886	-15,365	-15,875	-16,411	-16,968
KR4301NC2727                      2018-12 풋272.5							19,730
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-19,515	-19,522	-19,537	-19,563	-19,603	-19,658	-19,730
-5.33%	-12,077	-12,128	-12,203	-12,303	-12,427	-12,574	-12,743
-2.67%	-4,940	-5,129	-5,347	-5,590	-5,854	-6,136	-6,433
0%	1,145	771	389	0	-394	-792	-1,194
2.67%	5,242	4,824	4,405	3,983	3,561	3,137	2,713
5.33%	7,216	6,940	6,641	6,323	5,989	5,642	5,284
8.00%	7,859	7,747	7,604	7,432	7,233	7,009	6,765

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

(단위:백만원)

**43,102**

공시일	2018-11-23
기준일	2018-11-22

## 홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

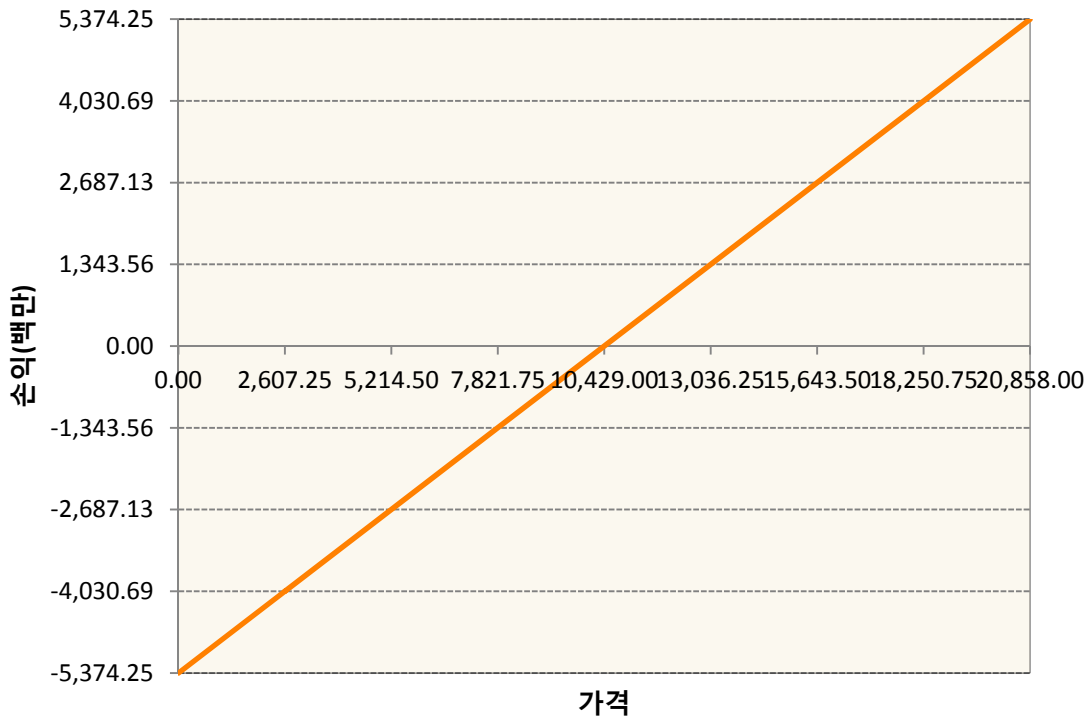
### 1. 계약금액

(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	5,374	0	5,374	장내
누계	유가증권	옵션	0	11,392	-11,392	장내
누계	통화	선도	433	3,172	-2,740	장외

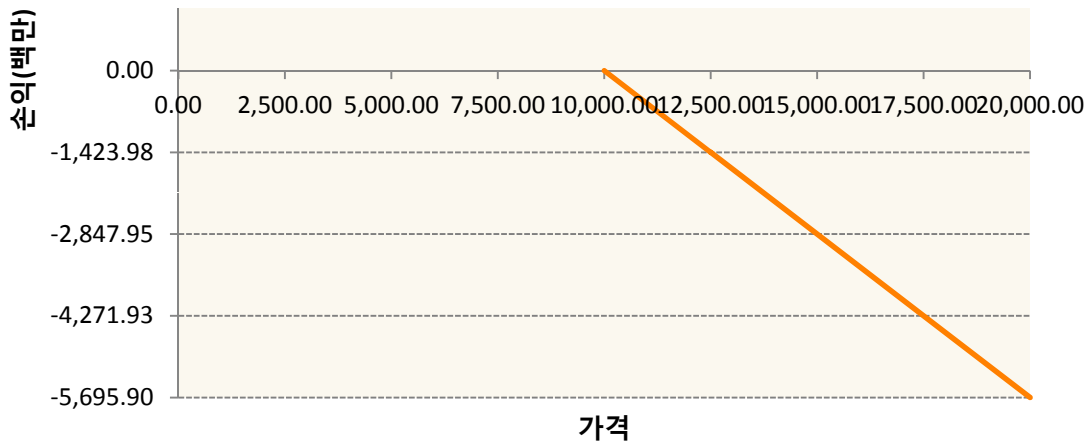
### 2. 만기시점의 손익구조

HCX8-HSCEI FUTURES NOV 18

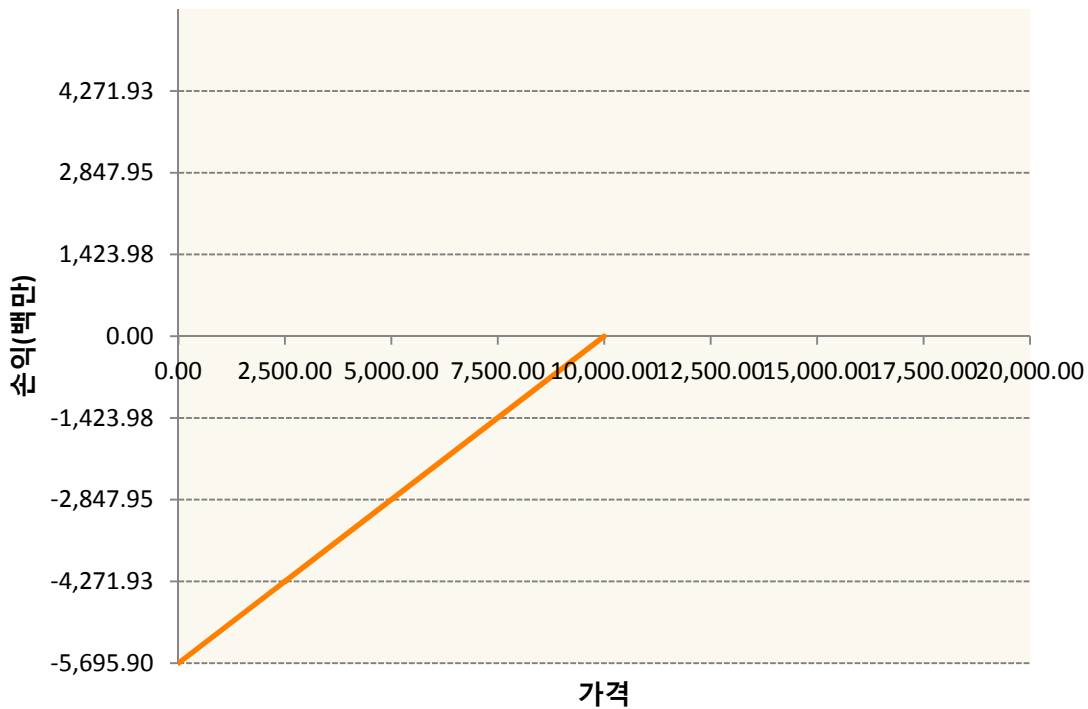


OHHIX8-C100-HSCEI





OHHIX8-P100-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	430
OHHIX8-C1C HSCEI	456
OHHIX8-P10 HSCEI	456

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

(단위:백만원)



공시일	2018-11-23
기준일	2018-11-22

## 코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

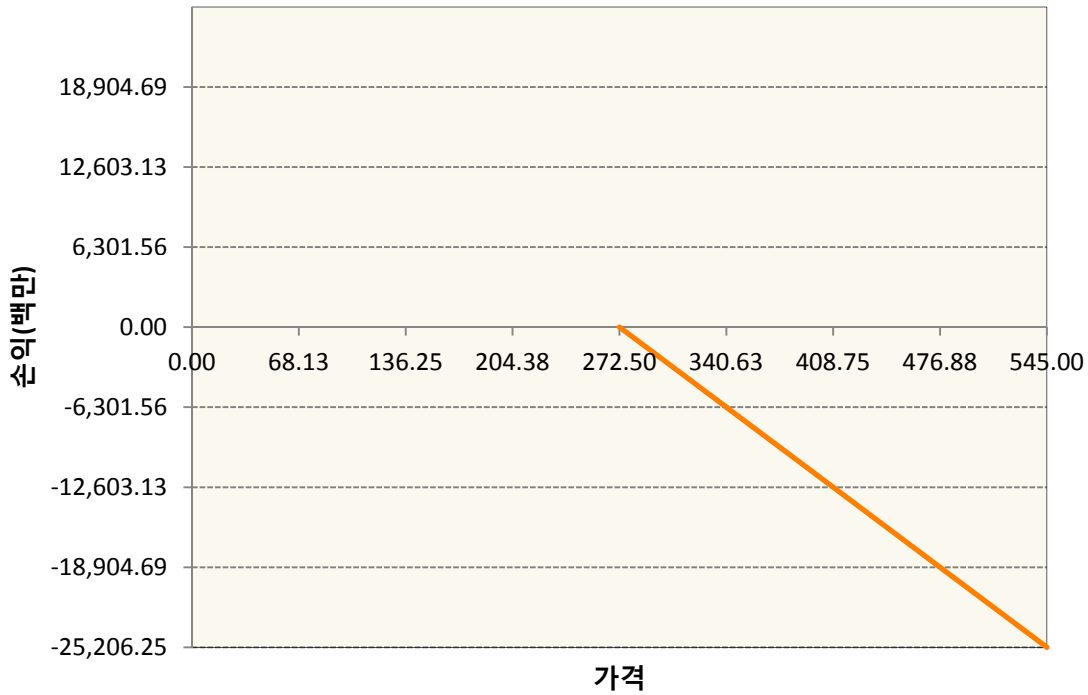
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

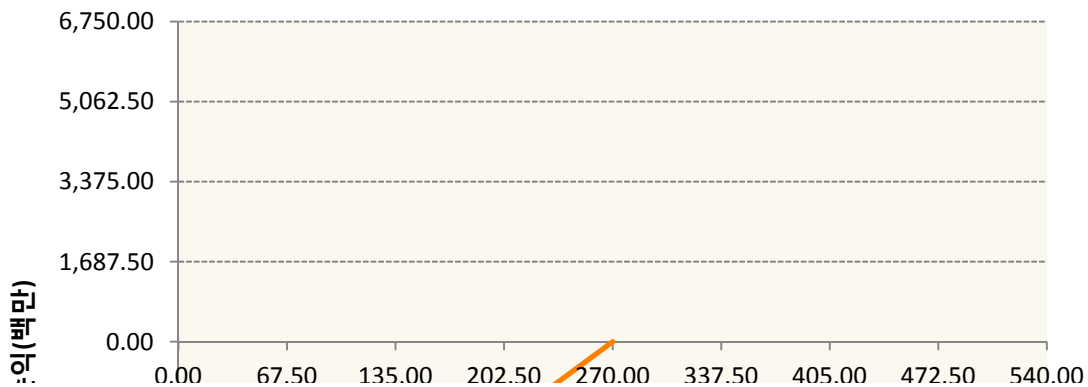
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	스왑	43,836	0	43,836	장외
누계	유가증권	옵션	0	43,538	-43,538	장내

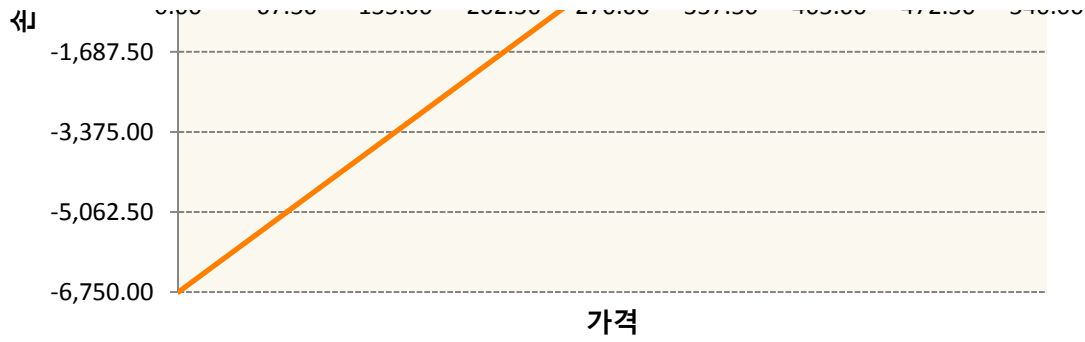
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4201NC2728-2018-12 콜272.5

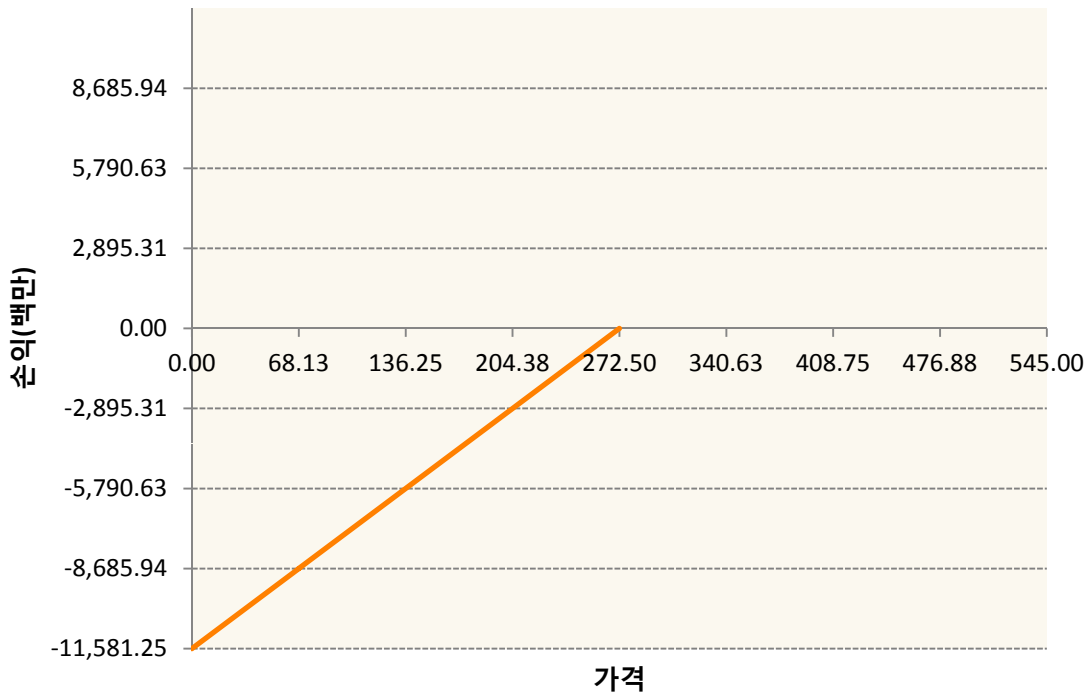


KR4301NC2701-2018-12 풋270





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 콜272.5				1,373
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	465	456	443	427	408	385	360
-5.33%	433	411	385	356	324	289	252
-2.67%	346	307	265	221	176	129	81
0%	161	108	54	0	-55	-109	-164
2.67%	-151	-208	-264	-321	-377	-434	-491
5.33%	-593	-640	-689	-740	-791	-843	-896
8.00%	-1,137	-1,169	-1,204	-1,243	-1,284	-1,327	-1,373
KR4301NC2701                      2018-12 풋270							449
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-441	-442	-442	-443	-445	-447	-449
-5.33%	-265	-267	-270	-273	-277	-282	-287
-2.67%	-101	-107	-114	-121	-128	-136	-144
0%	29	20	10	0	-10	-20	-30
2.67%	108	99	90	81	71	61	52
5.33%	141	136	130	124	117	110	103
8.00%	150	148	146	143	139	135	131
KR4301NC2727                      2018-12 풋272.5							799
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-790	-790	-791	-792	-793	-796	-799
-5.33%	-489	-491	-494	-498	-503	-509	-516
-2.67%	-200	-208	-216	-226	-237	-248	-260
0%	46	31	16	0	-16	-32	-48
2.67%	212	195	178	161	144	127	110
5.33%	292	281	269	256	242	228	214
8.00%	318	314	308	301	293	284	274

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

(단위:백만원)

6,217

공시일	2018-11-23
기준일	2018-11-22

## 유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

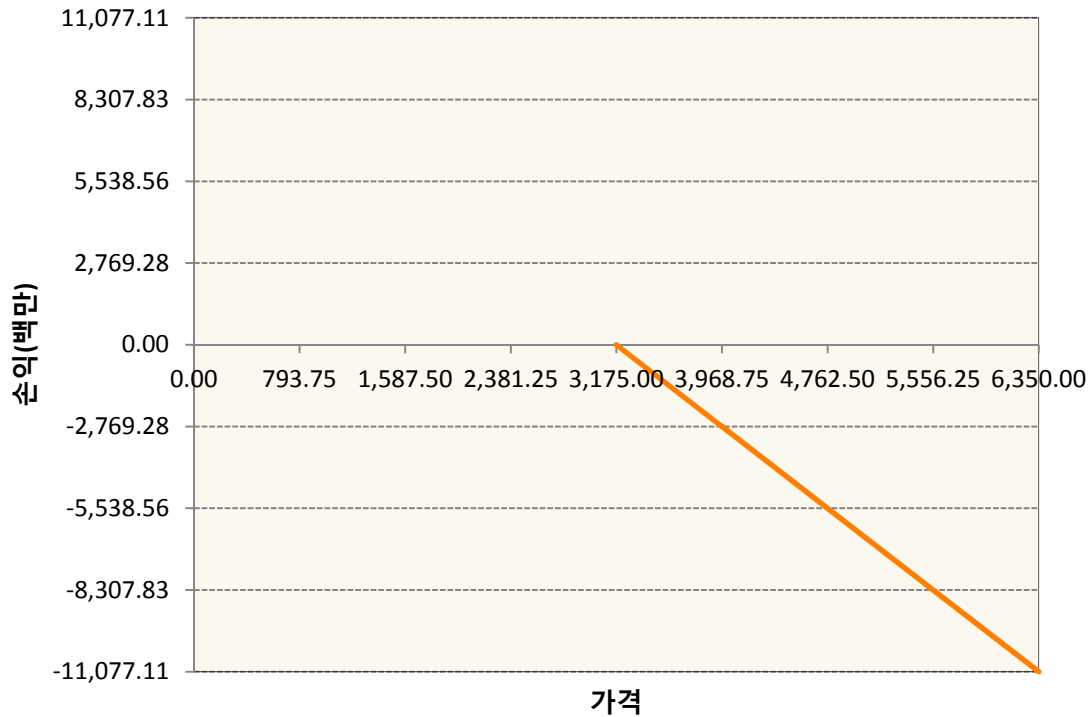
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

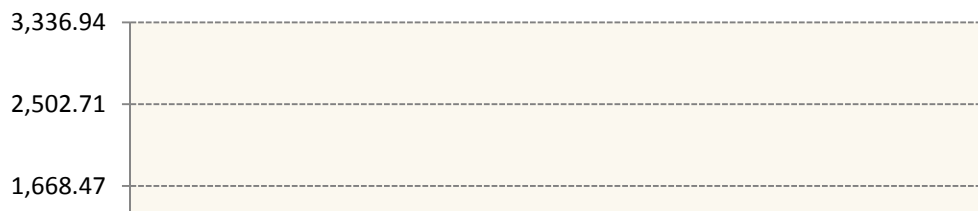
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	8,045	0	8,045	
누계	유가증권	스왑	71,905	0	71,905	장외
누계	유가증권	옵션	0	28,828	-28,828	장내
누계	통화	선도	0	20,598	-20,598	장외

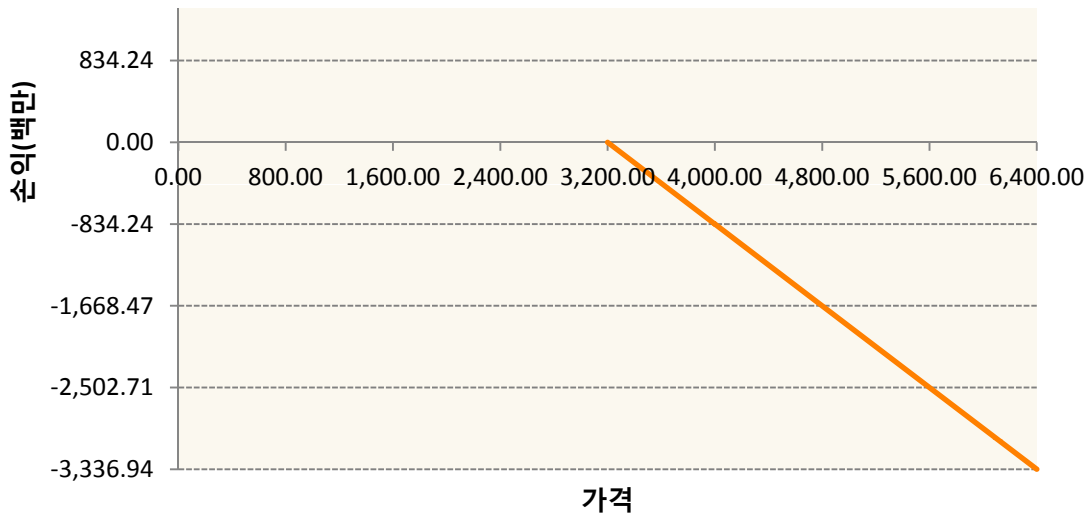
### 2. 만기시점의 손익구조

**OESXZ8-C3175-EURO STOXX 50**

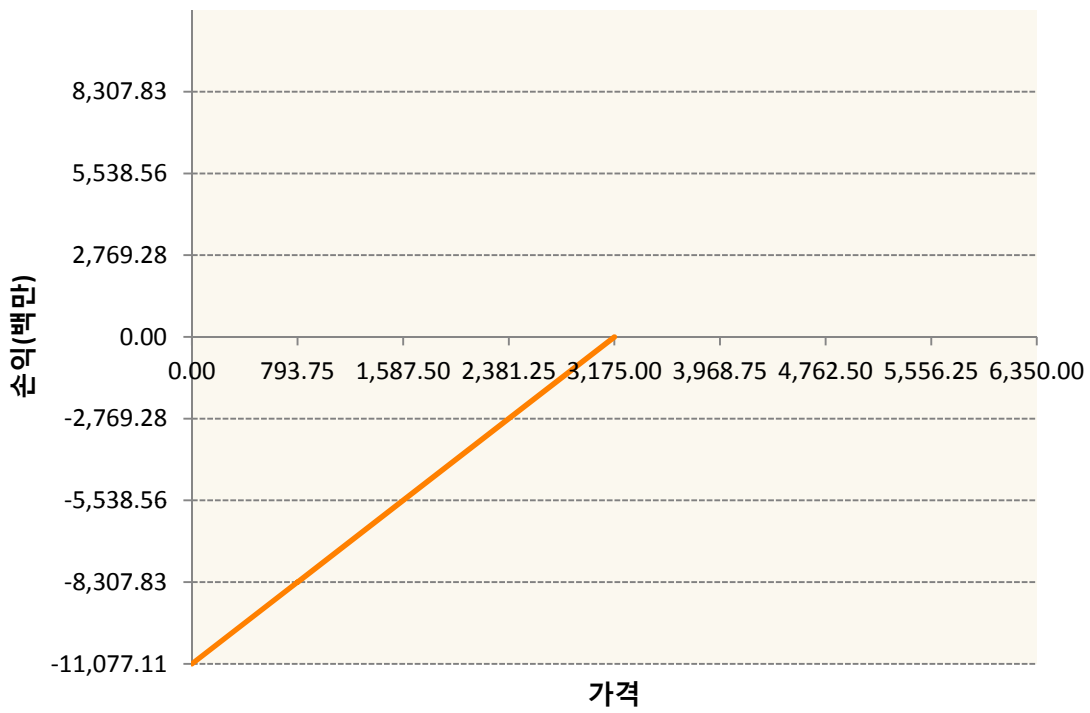


**OESXZ8-C3200-EURO STOXX 50**

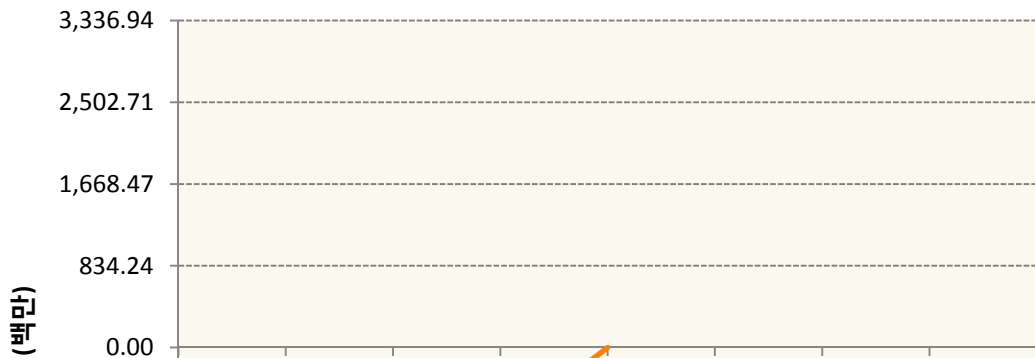


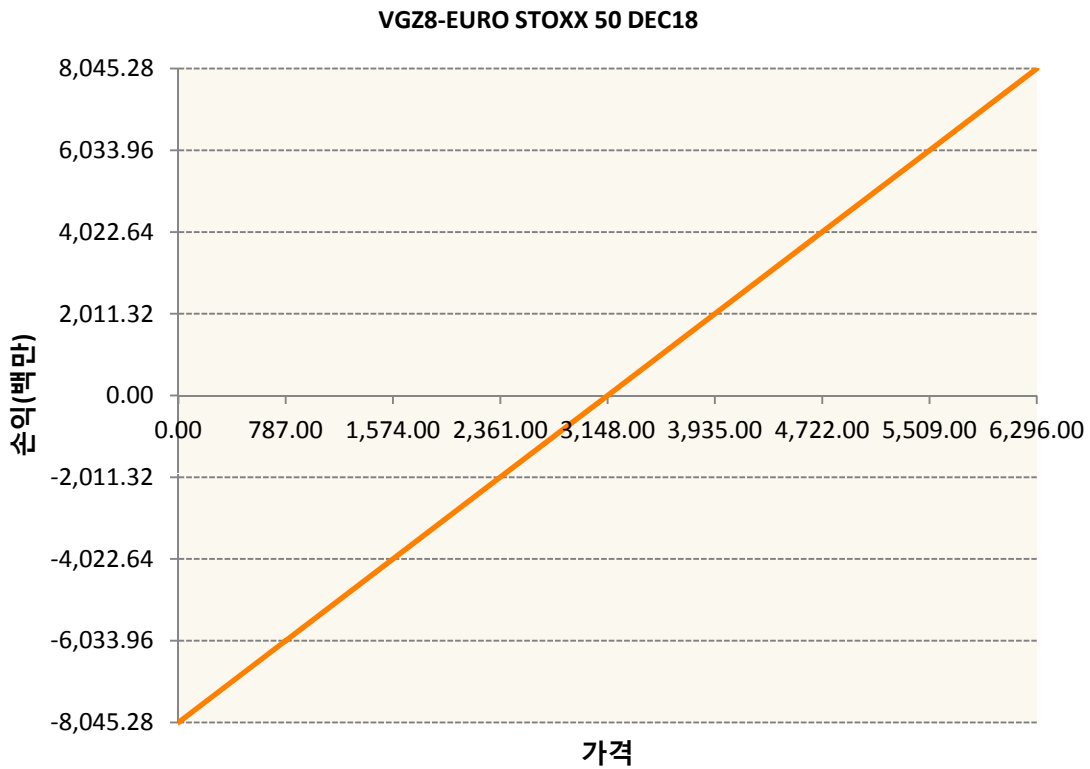
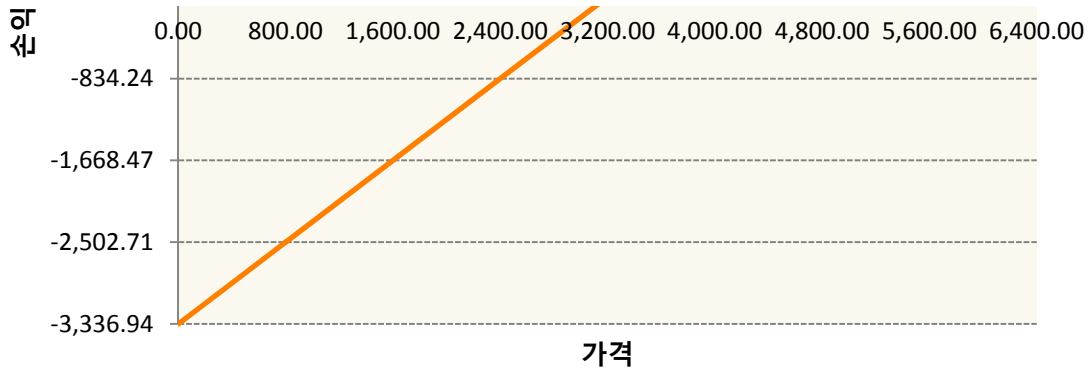


OESXZ8-P3175-EURO STOXX 50



OESXZ8-P3200-EURO STOXX 50





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

260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY	30
FX21018Q01 KRW/EUR 23-11-18E	206
FX21018Q02 KRW/EUR 23-11-18E	206
FX21018U03 KRW/EUR 21-12-18E	824
FX21018X02 KRW/EUR 22-02-19E	412
OESXZ8-C31 EURO STOXX 50	886
OESXZ8-C32 EURO STOXX 50	267
OESXZ8-P31 EURO STOXX 50	886
OESXZ8-P32 EURO STOXX 50	267
VGZ8            EURO STOXX 50 DEC18	644

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

(단위:백만원)

2,828



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

(단위:백만원)

1,079



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

(단위:백만원)

91



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

(단위:백만원)

137

공시일	2018-11-23
기준일	2018-11-22

## 스마트KRX300인덱스목표전환형1호

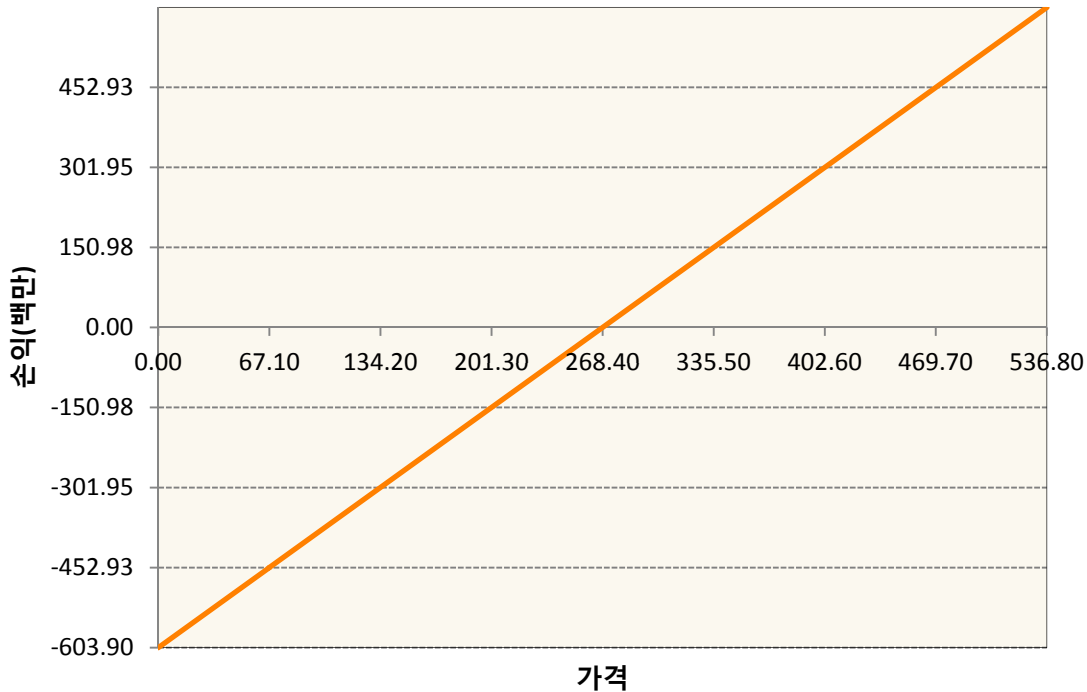
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	604	0	604	장내

### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101NC0004-2018-12 코스피200지수선물



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101NC0004		2018-12 코스피200지수선물						48
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-48	-48	-48	-48	-48	-48	-48	
-5.33%	-32	-32	-32	-32	-32	-32	-32	
-2.67%	-16	-16	-16	-16	-16	-16	-16	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	16	16	16	16	16	16	16	
5.33%	32	32	32	32	32	32	32	
8.00%	48	48	48	48	48	48	48	

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

(단위:백만원)

41

공시일	2018-11-23
기준일	2018-11-22

## 리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

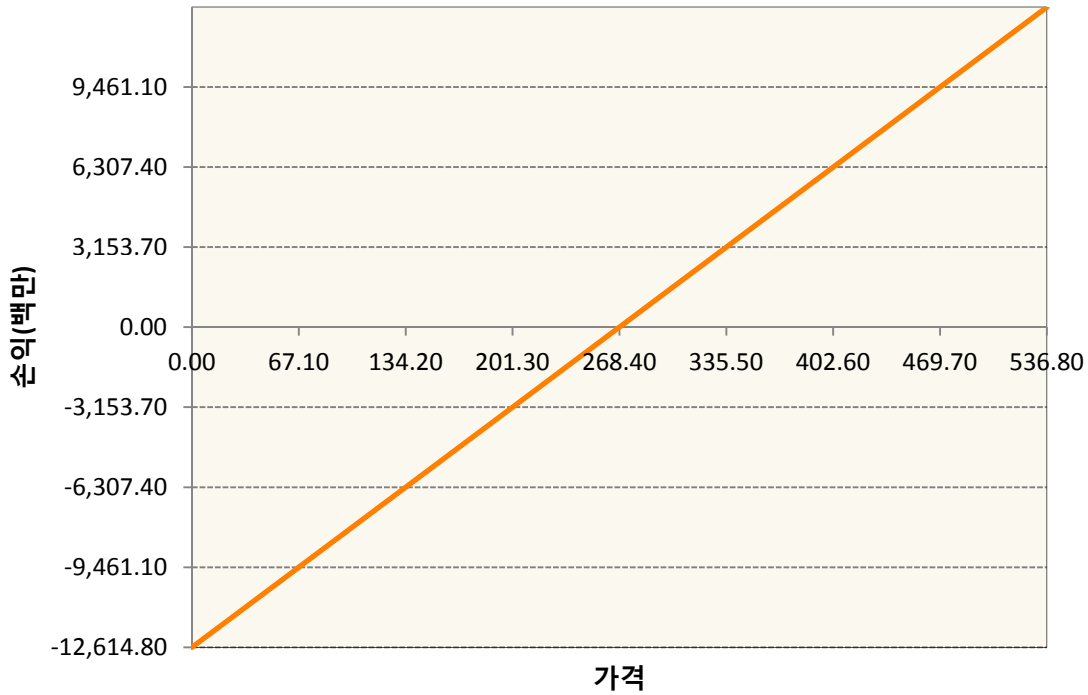
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

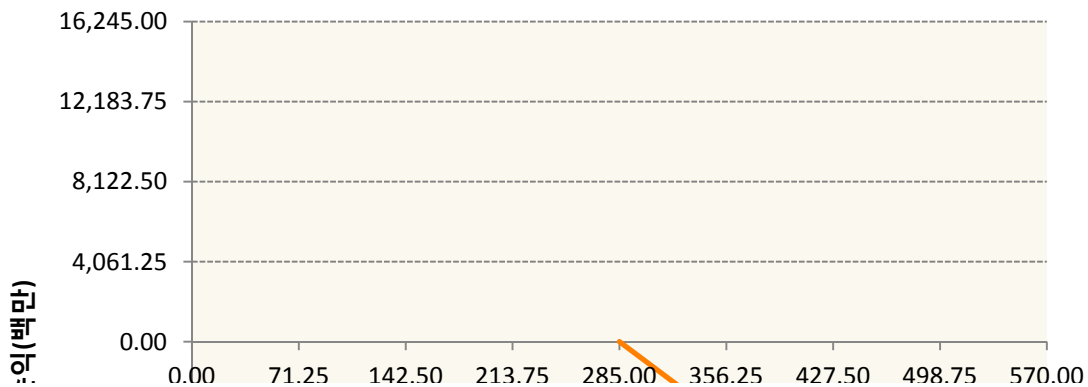
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	12,615	0	12,615	장내
누계	유가증권	옵션	3,743	22,858	-19,115	장내

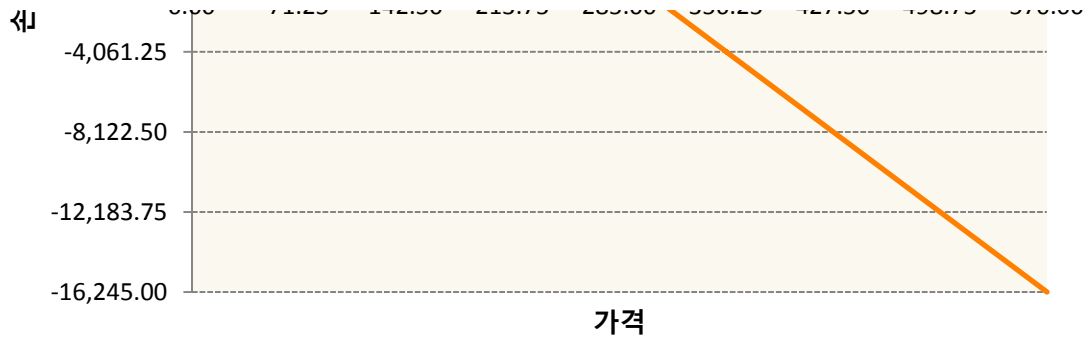
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101NC0004-2018-12 코스피200지수선물

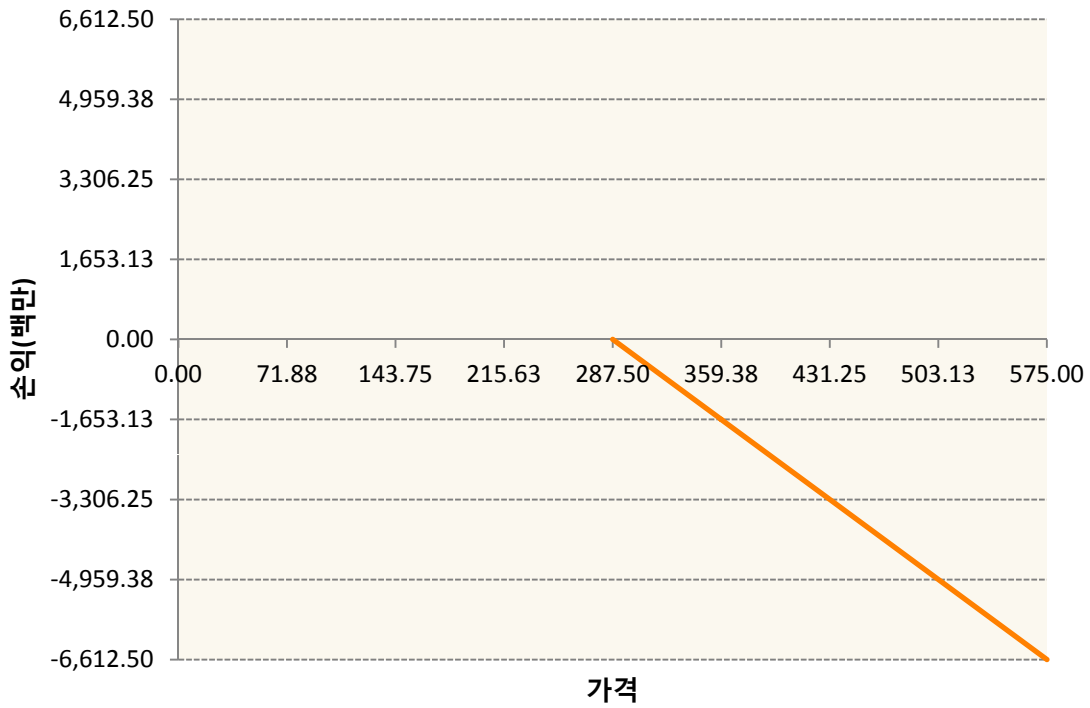


KR4201NC2850-2018-12 콜285

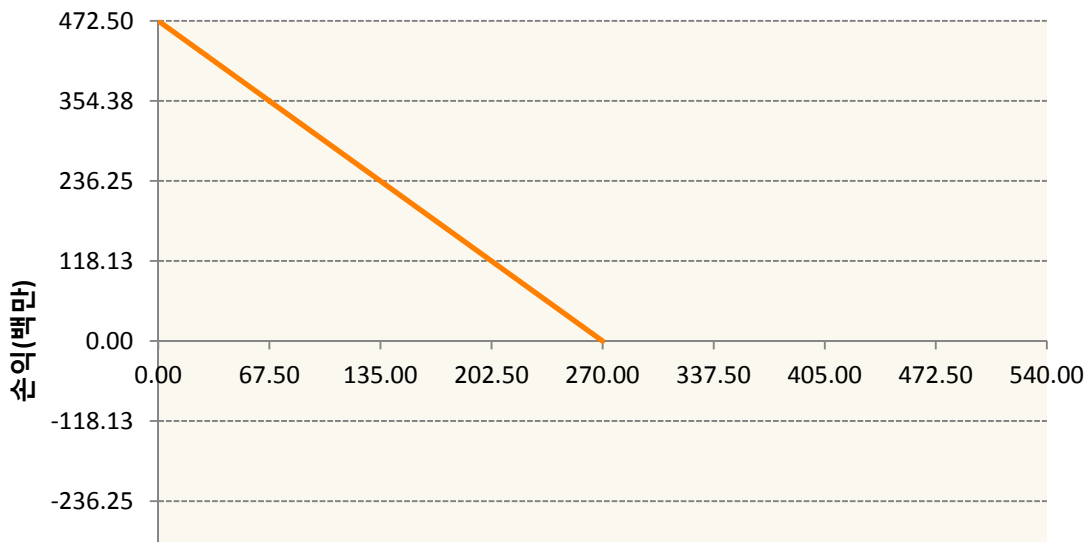


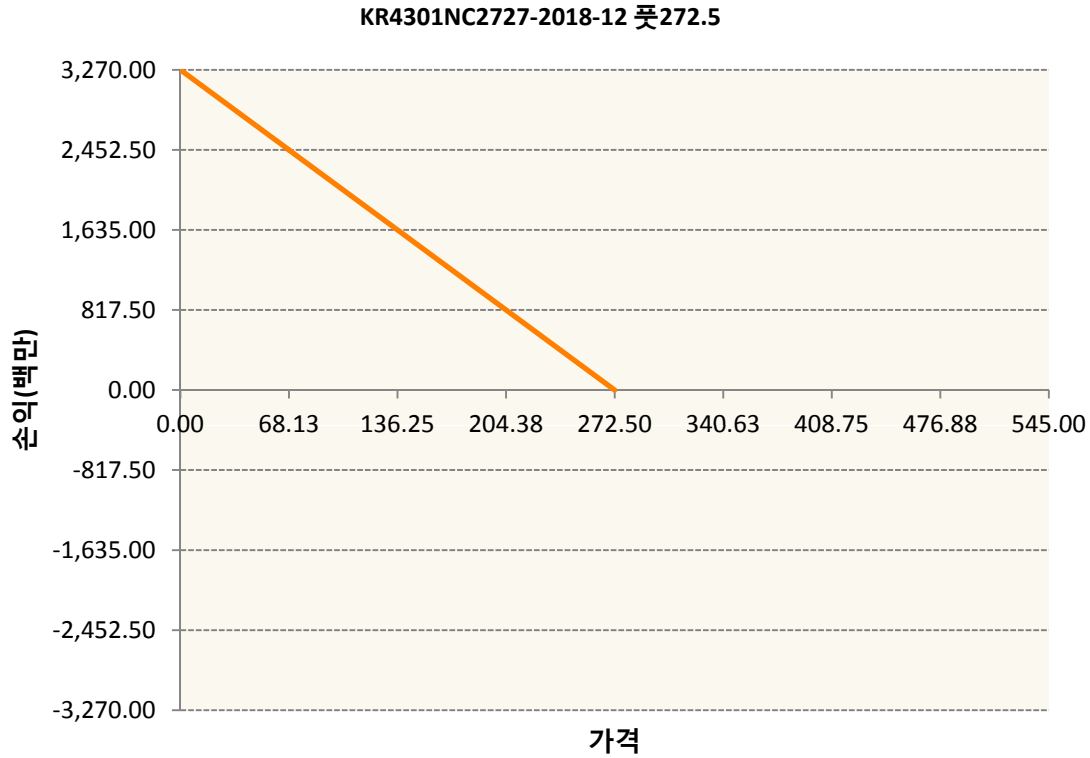
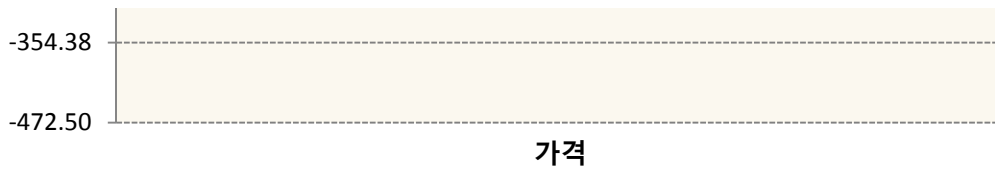


KR4201NC2876-2018-12 콜287.5



KR4301NC2701-2018-12 풋270





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

KR4101NC0004		2018-12 코스피200지수선물						1,007
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-1,007	-1,007	-1,007	-1,007	-1,007	-1,007	-1,007	
-5.33%	-671	-671	-671	-671	-671	-671	-671	
-2.67%	-336	-336	-336	-336	-336	-336	-336	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	336	336	336	336	336	336	336	
5.33%	671	671	671	671	671	671	671	
8.00%	1,007	1,007	1,007	1,007	1,007	1,007	1,007	
KR4201NC2850		2018-12 콜285						574
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	102	101	99	97	93	87	80	
-5.33%	100	97	92	85	76	66	53	
-2.67%	90	81	70	57	41	24	4	

0%	60	43	22	0	-24	-49	-76
2.67%	-10	-39	-69	-99	-131	-163	-195
5.33%	-146	-181	-217	-253	-289	-325	-361
8.00%	-358	-394	-430	-466	-502	-538	-574
KR4201NC2876                      2018-12 콜287.5							210
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	32	32	32	31	30	28	26
-5.33%	32	31	30	27	25	21	17
-2.67%	29	27	23	19	13	7	0
0%	21	15	8	0	-9	-18	-28
2.67%	-1	-11	-22	-34	-46	-58	-70
5.33%	-46	-60	-74	-88	-102	-116	-131
8.00%	-121	-136	-151	-166	-180	-195	-210
KR4301NC2701                      2018-12 풋270							31
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	31	31	31	31	31	31	31
-5.33%	19	19	19	19	19	20	20
-2.67%	7	8	8	8	9	10	10
0%	-2	-1	-1	0	1	1	2
2.67%	-8	-7	-6	-6	-5	-4	-4
5.33%	-10	-10	-9	-9	-8	-8	-7
8.00%	-11	-10	-10	-10	-10	-9	-9
KR4301NC2727                      2018-12 풋272.5							225
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	223	223	223	224	224	225	225
-5.33%	138	139	139	141	142	144	146
-2.67%	56	59	61	64	67	70	74
0%	-13	-9	-4	0	5	9	14
2.67%	-60	-55	-50	-46	-41	-36	-31
5.33%	-82	-79	-76	-72	-68	-64	-60
8.00%	-90	-89	-87	-85	-83	-80	-77

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

(단위:백만원)

**1,618**

공시일	2018-11-23
기준일	2018-11-22

## 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	119	0	119	

### 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	2018-11-23
기준일	2018-11-22

## 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	1,366	0	1,366	

### 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	2018-11-23
기준일	2018-11-22

## 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	179	0	179	
누계	통화	선도	3	181	-179	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
FX21018X02 KRW/USD 30-11-18E		1
FX21018X03 USD/KRW 30-11-18E		0.2

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

(단위:백만원)

6
---



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

(단위:백만원)

149

공시일	2018-11-23
기준일	2018-11-22

## 에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

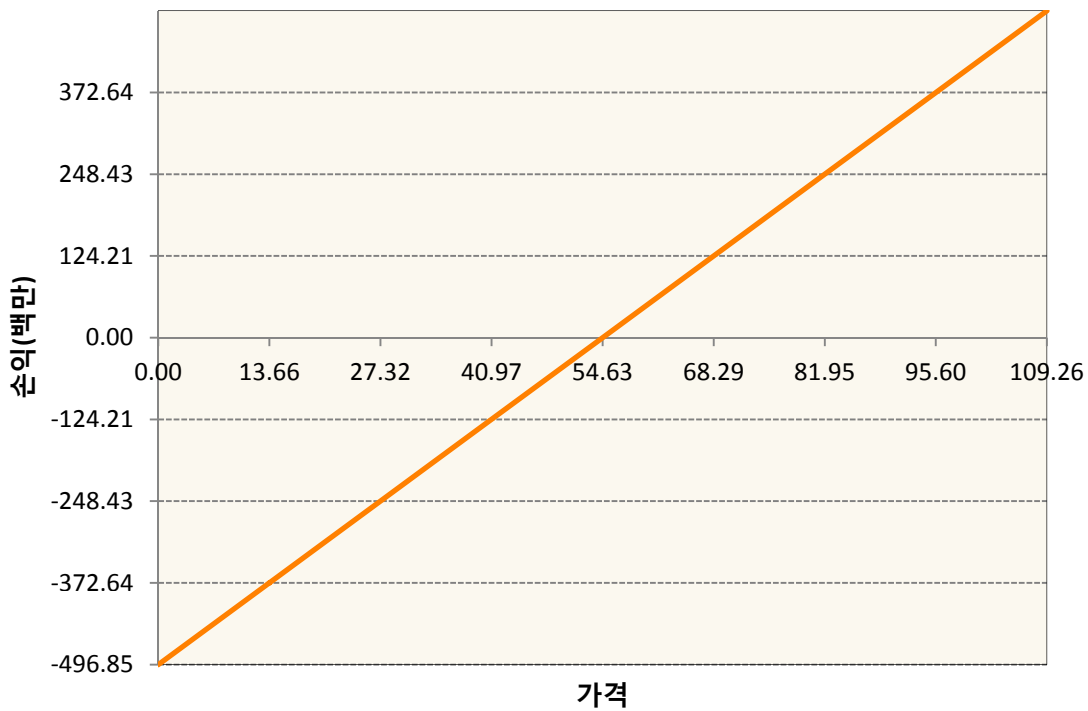
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

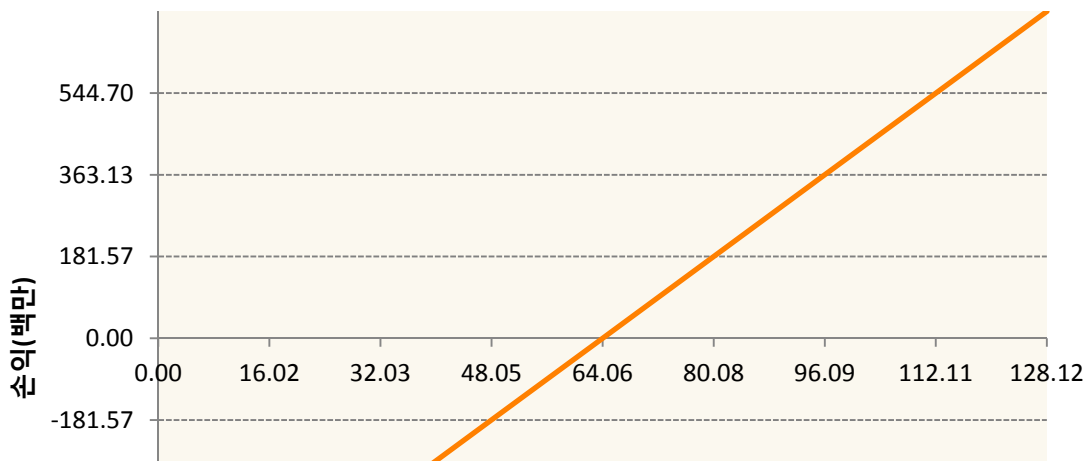
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,152	406	2,746	

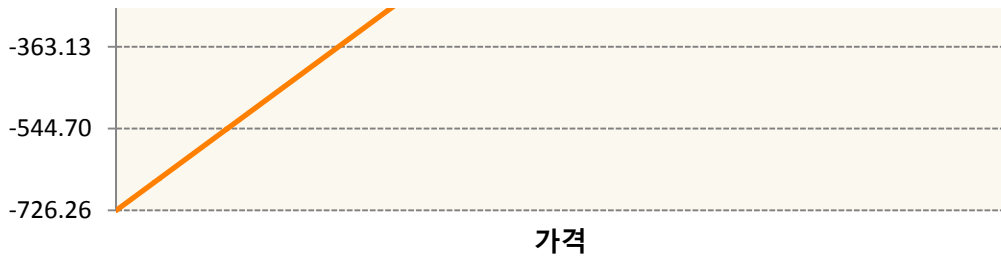
### 2. 만기시점의 손익구조

CLF9-WTI CRUDE FUTURE Jan19

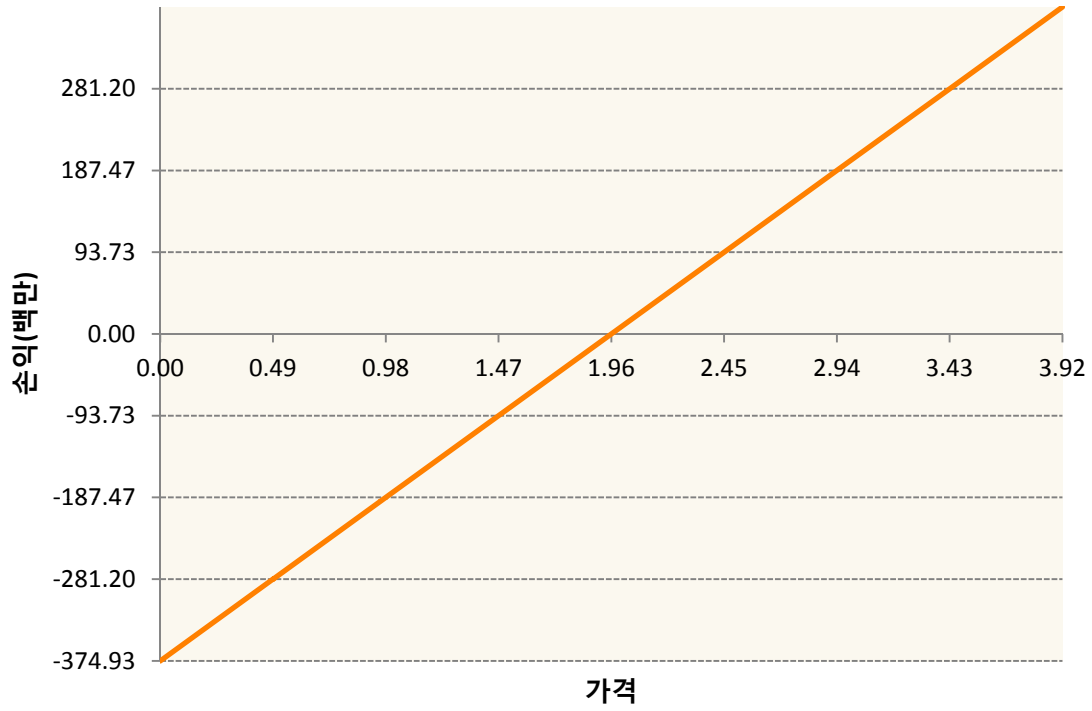


COH9-BRENT CRUDE FUTR Mar19

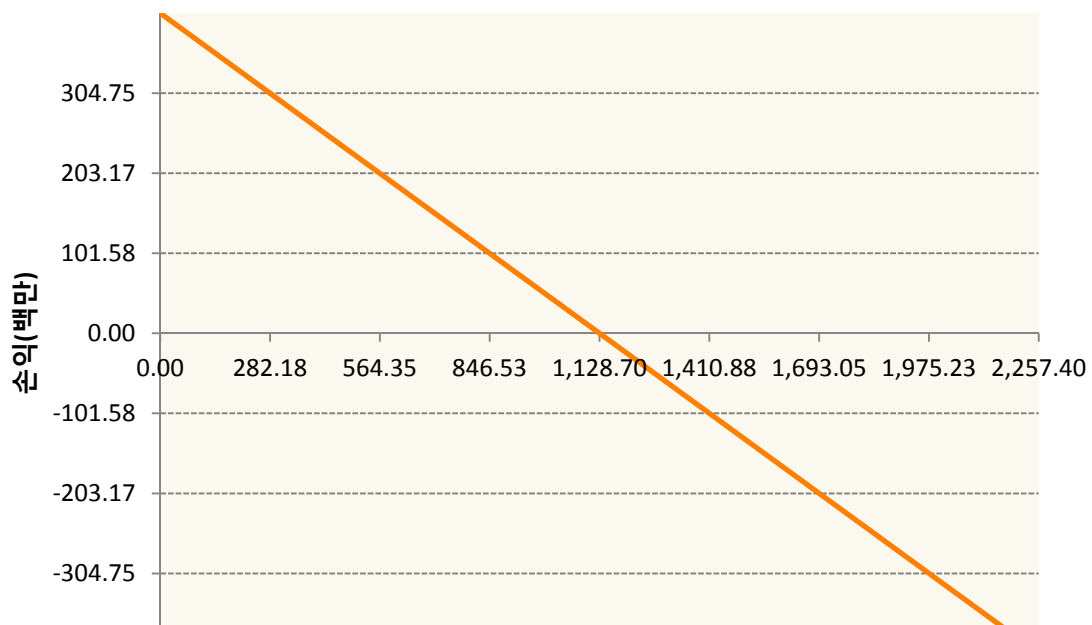


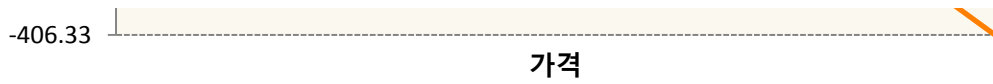


HOF9-NY Harb ULSD Fut Jan19

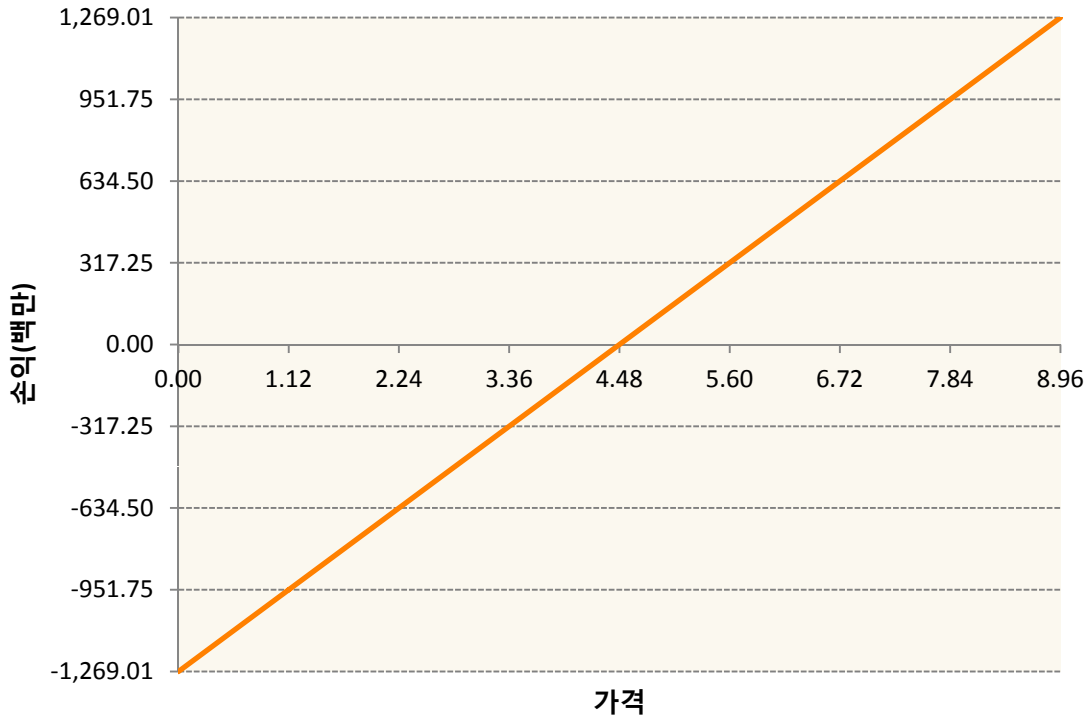


KR4175NC0005-2018-12 달러선물

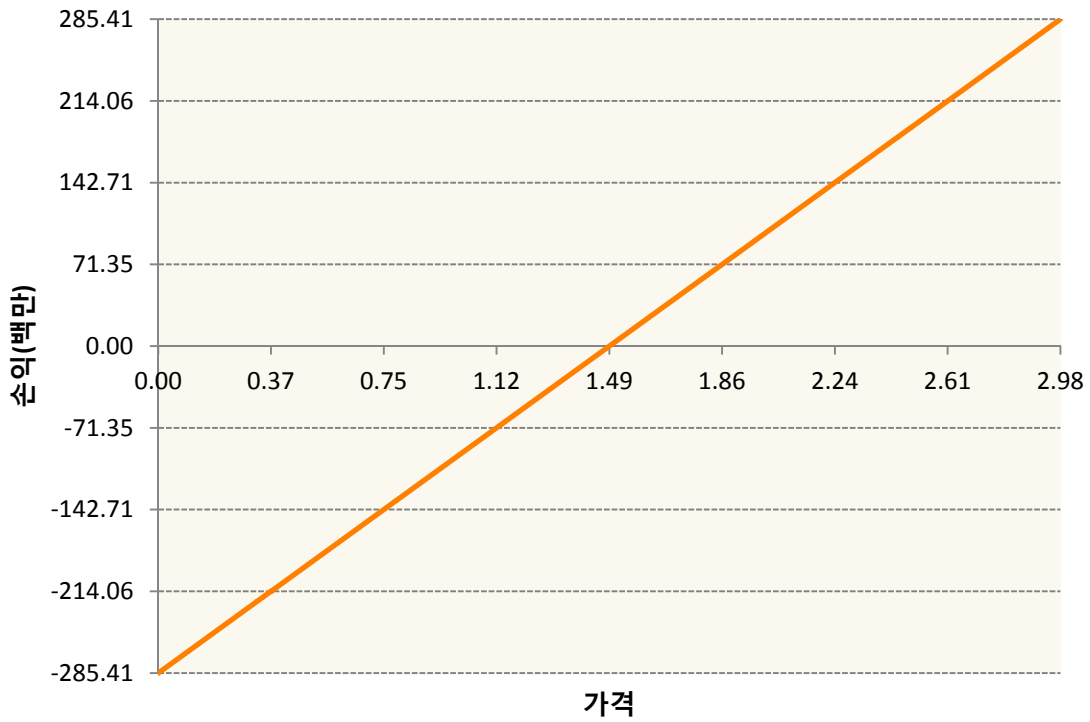




NGF19-NATURAL GAS FUTR Jan19



XBF9-GASOLINE RBOB FUT Jan19



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

CLF9	WTI CRUDE FUTURE Jan19	40
COH9	BRENT CRUDE FUTR Mar19	58
HOF9	NY Harb ULSD Fut Jan19	30
KR4175NC0	(2018-12 달러선물	33
NGF19	NATURAL GAS FUTR Jan19	102
XBF9	GASOLINE RBOB FUT Jan19	23

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

436

공시일	2018-11-23
기준일	2018-11-22

## 애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

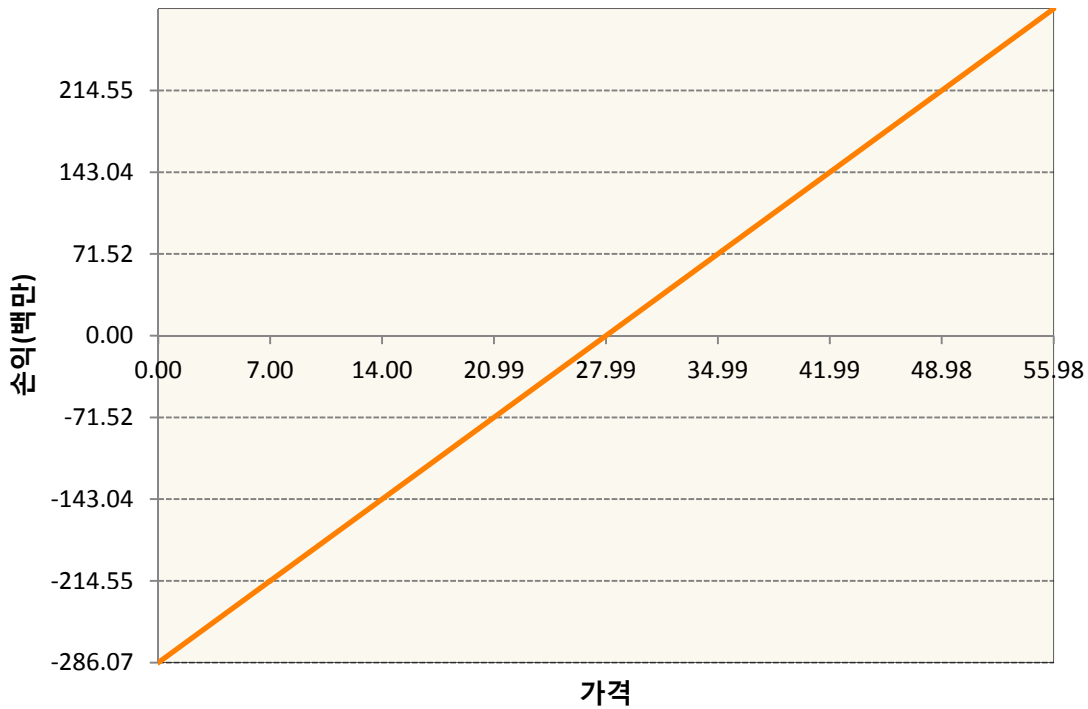
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

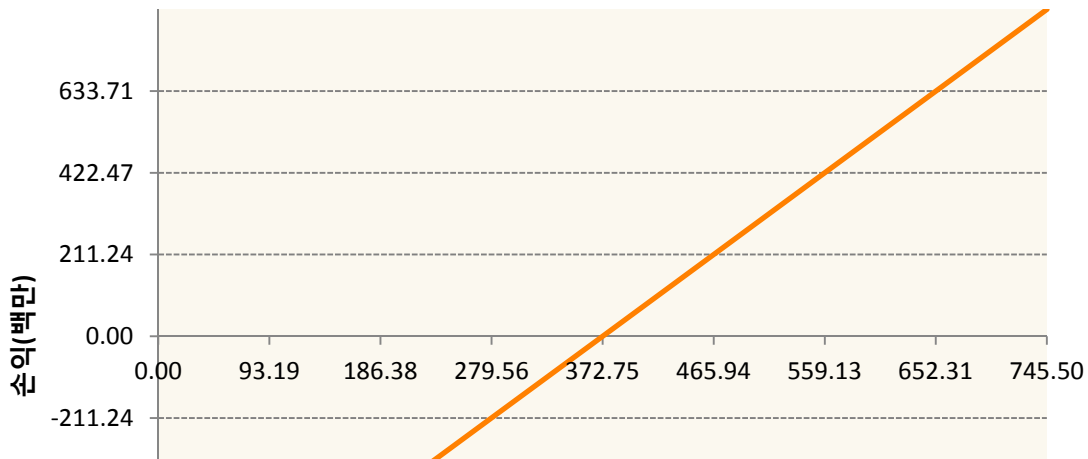
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,669	79	3,590	

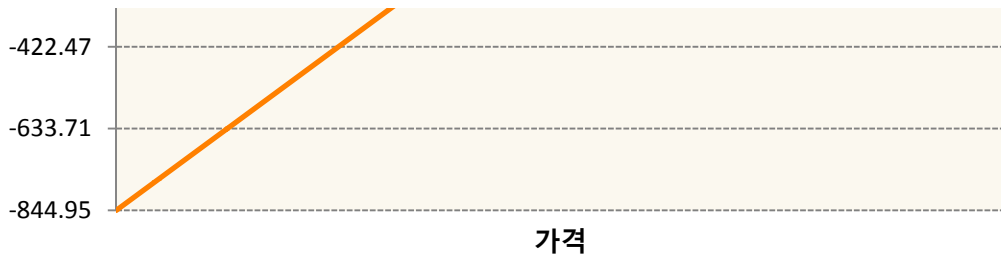
### 2. 만기시점의 손익구조

**BOF9-SOYBEAN OIL FUTR Jan19**

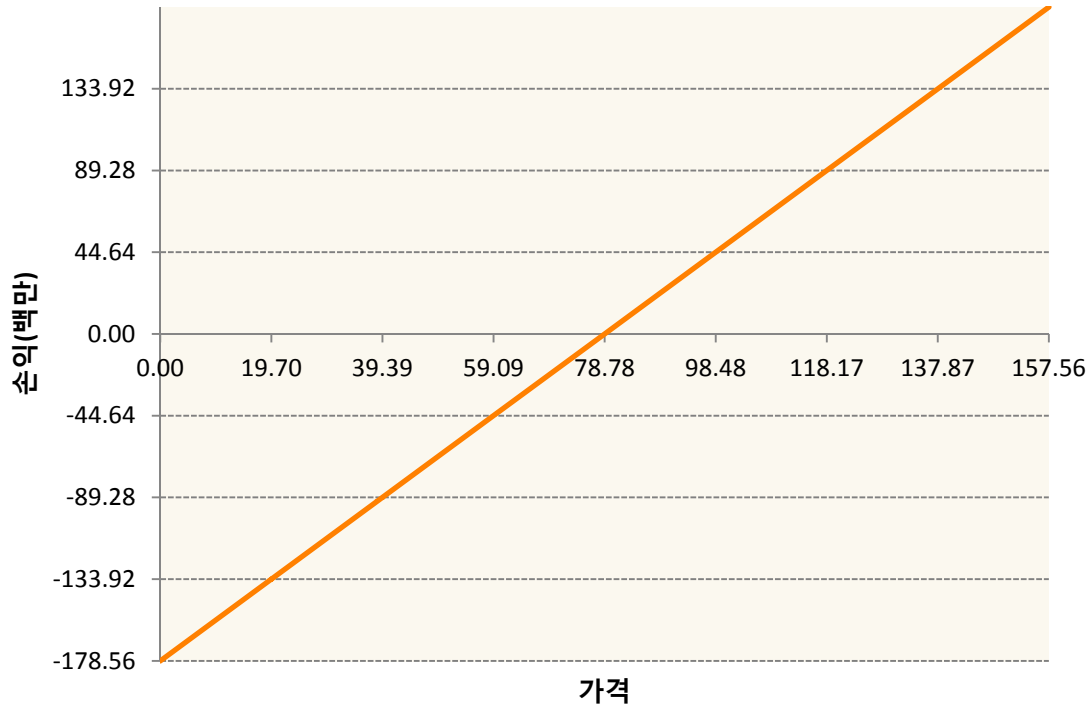


**CH9-CORN FUTURE Mar19**

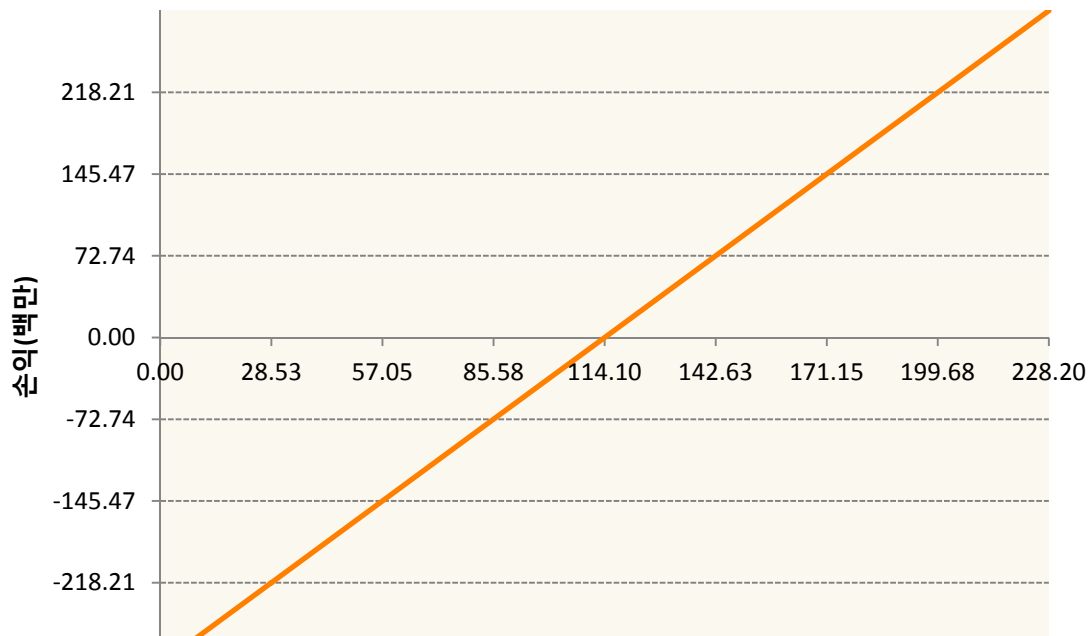


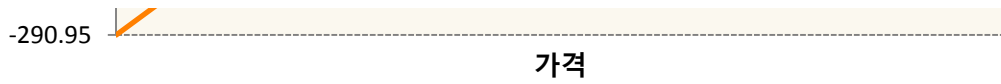


CTH9-COTTON NO.2 FUTR Mar19

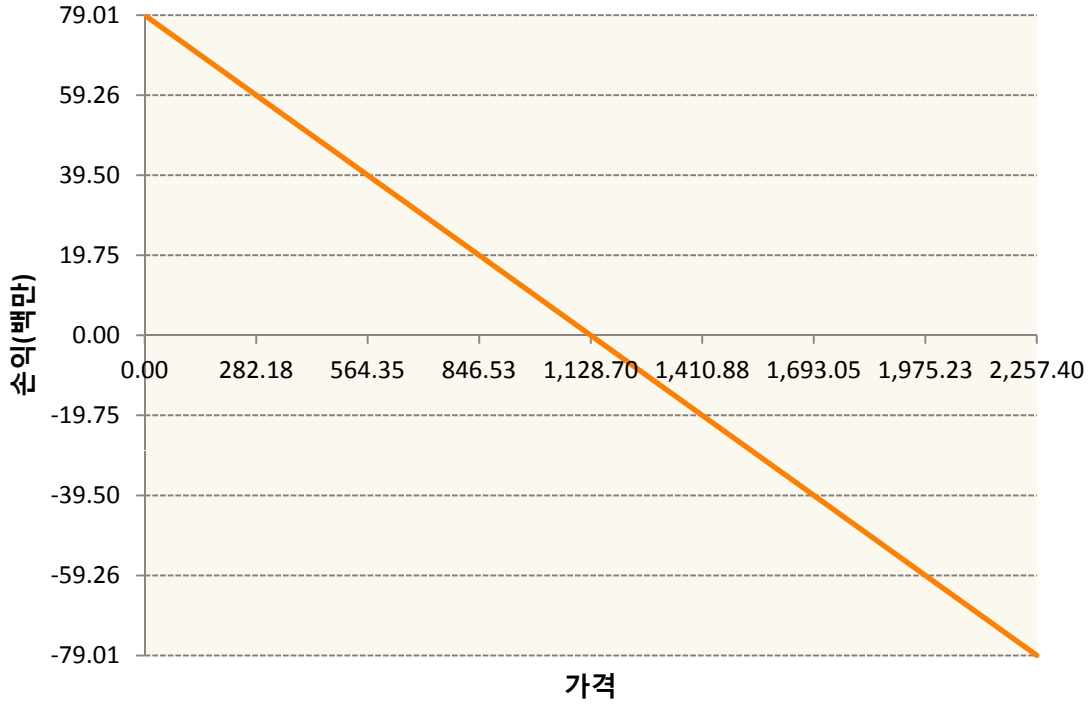


KCH9-COFFEE 'C' FUTURE Mar19

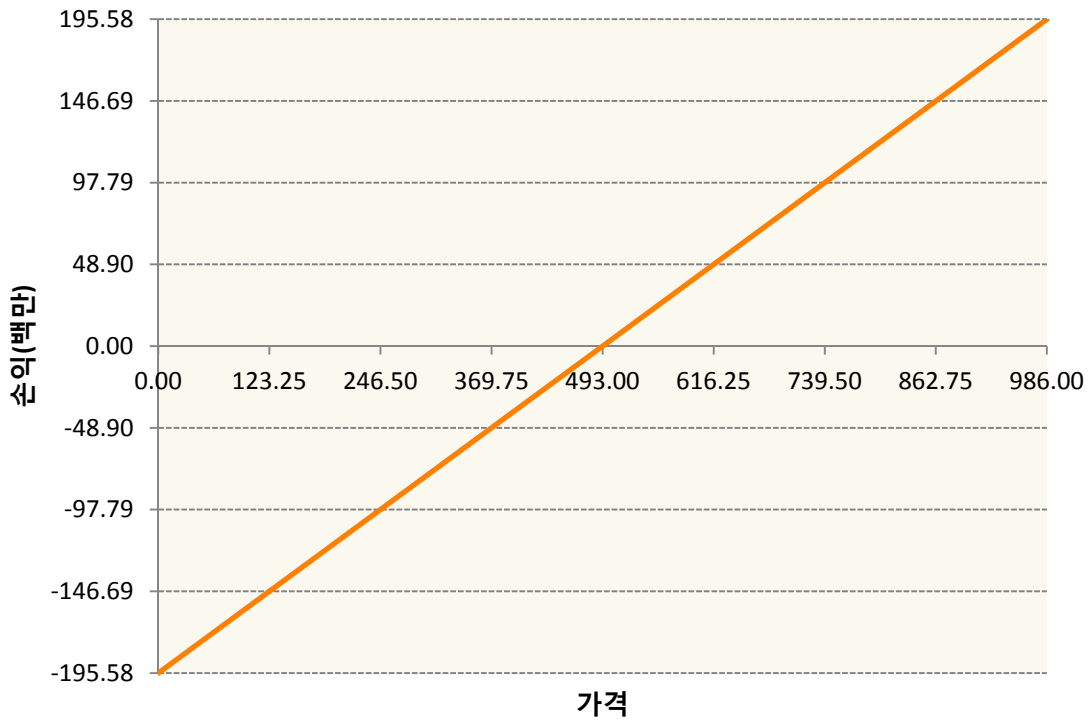




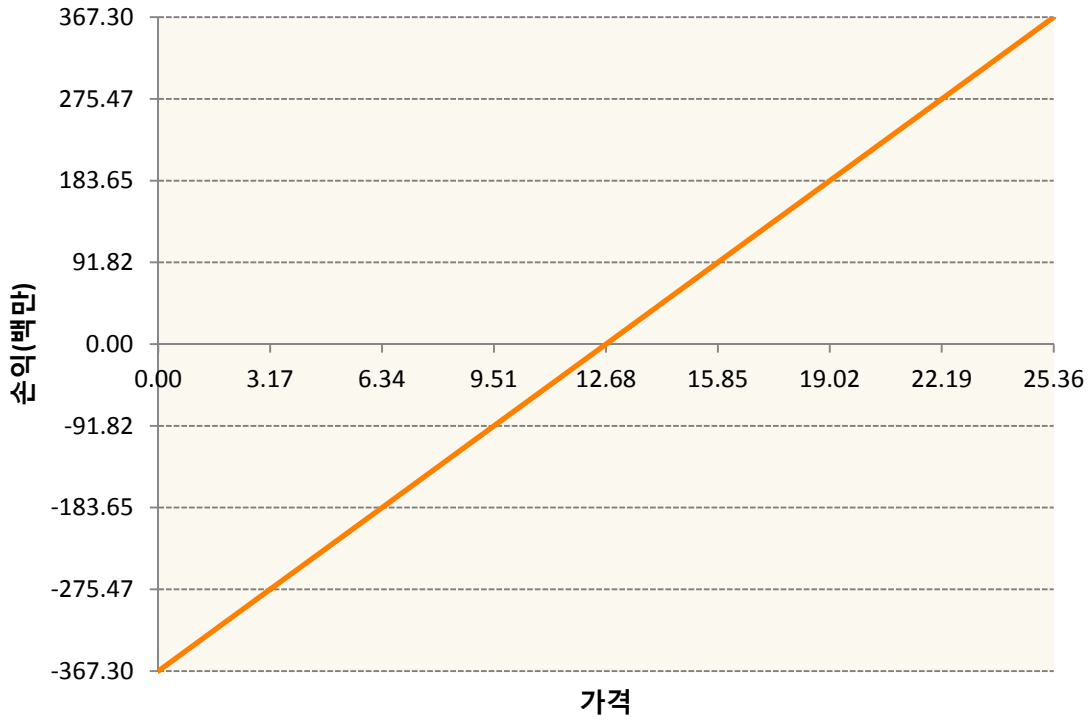
KR4175NC0005-2018-12 달러선물



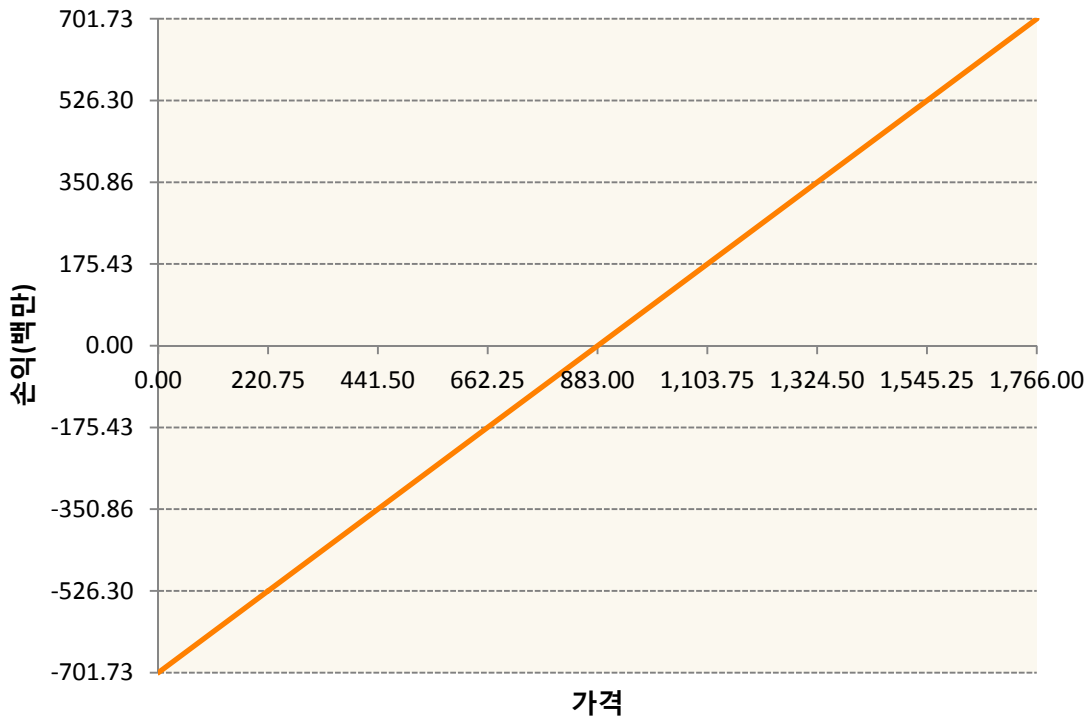
KWH9-KC HRW WHEAT FUT Mar19



SBH9-SUGAR #11 (WORLD) MAR19

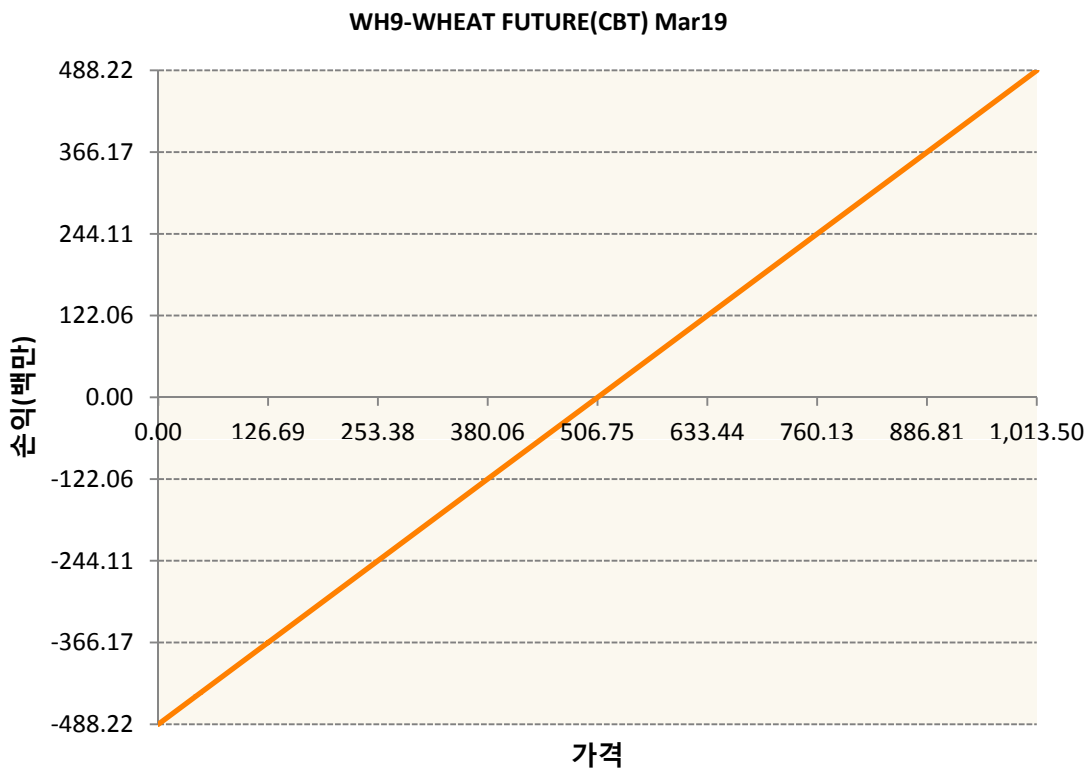
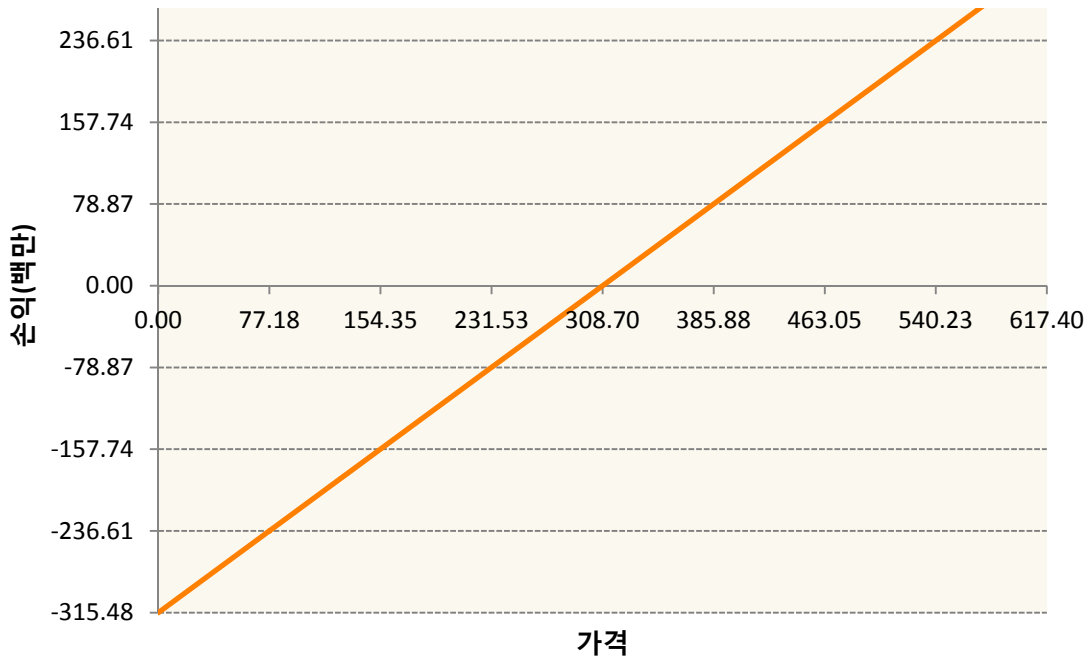


SF9-SOYBEAN FUTURE Jan19



SMF9-SOYBEAN MEAL FUTR Jan19





**3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)**

(단위:백만원)

BOF9	SOYBEAN OIL FUTR Jan19	23
CH9	CORN FUTURE Mar19	68
CTH9	COTTON NO.2 FUTR Mar19	14
KCH9	COFFEE 'C' FUTURE Mar19	23
KR4175NC0	(2018-12 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)

**321**