

공시일	2018-12-03
기준일	2018-11-30

## 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	2018-12-03
기준일	2018-11-30

## 스마트인덱스모

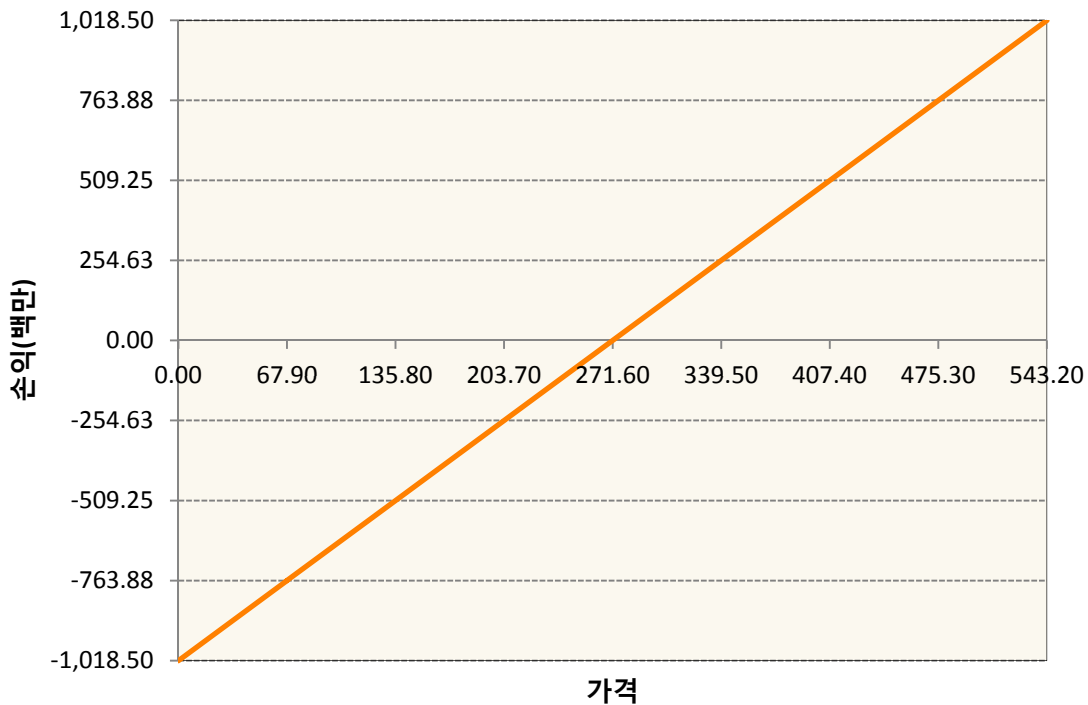
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,019	0	1,019	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)

70

공시일	2018-12-03
기준일	2018-11-30

## 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	13,197	0	13,197	장외

### 2. 만기시점의 손익구조

### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWMXWO0( 신한MXWO 미래S181122

1,082

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

533

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2018-12-03
기준일	2018-11-30

## 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

266
-----

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

386
-----

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2018-12-03
기준일	2018-11-30

## 유로인덱스모(주식-파생형)

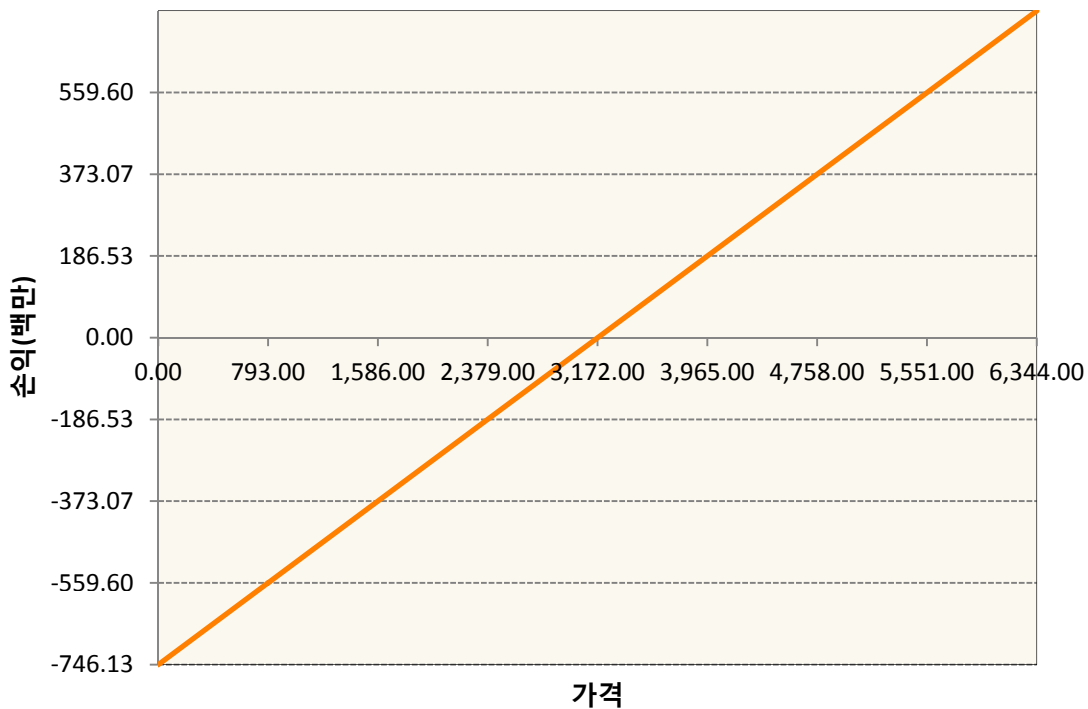
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

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

### 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	2018-12-03
기준일	2018-11-30

## 차이나인덱스모(주식-파생형)

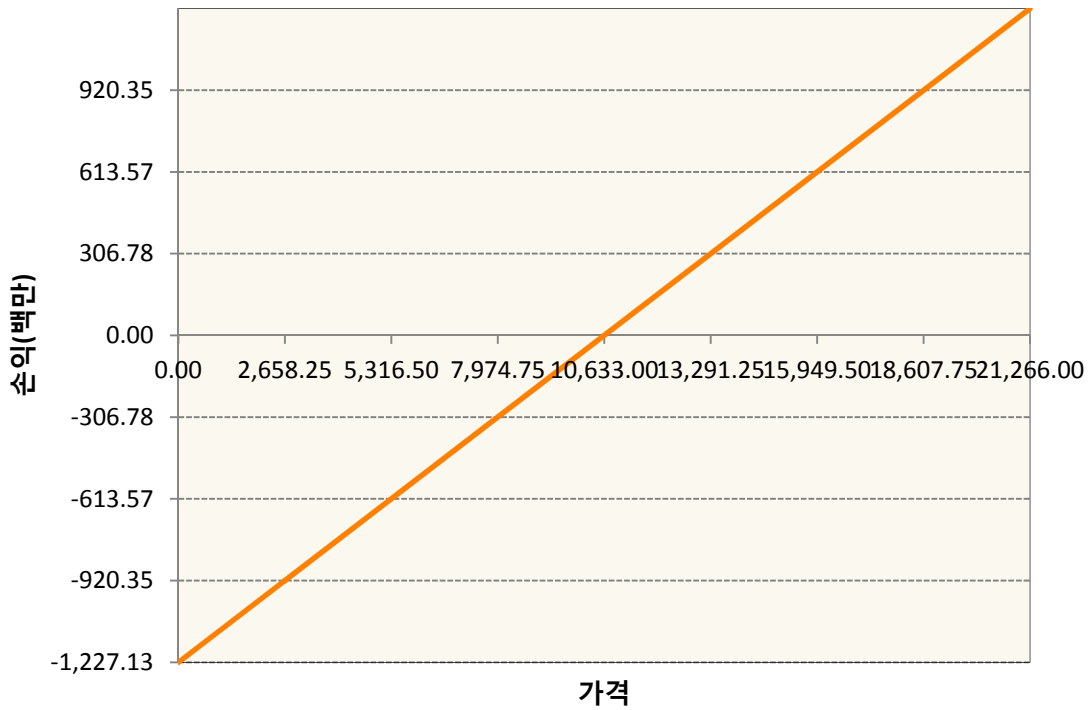
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

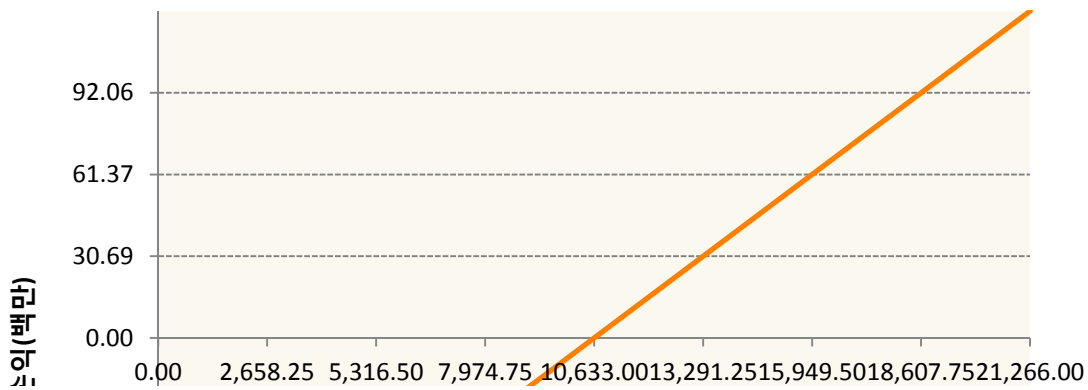
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,227	0	1,227	
누계	유가증권	선물	123	0	123	장내

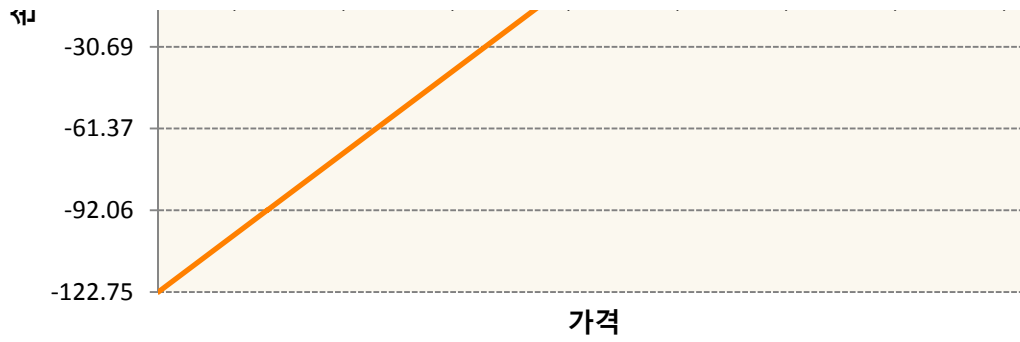
### 2. 만기시점의 손익구조

HCZ8-HSCEI FUTURES DEC 18



MHCZ8-MINI H-SHR IDX FU DEC18





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

HCZ8	HSCEI FUTURES DEC 18	98
MHCZ8	MINI H-SHR IDX FU DEC18	10

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

<b>97</b>
-----------

공시일	2018-12-03
기준일	2018-11-30

## 커버드콜모(주식혼합-파생형)

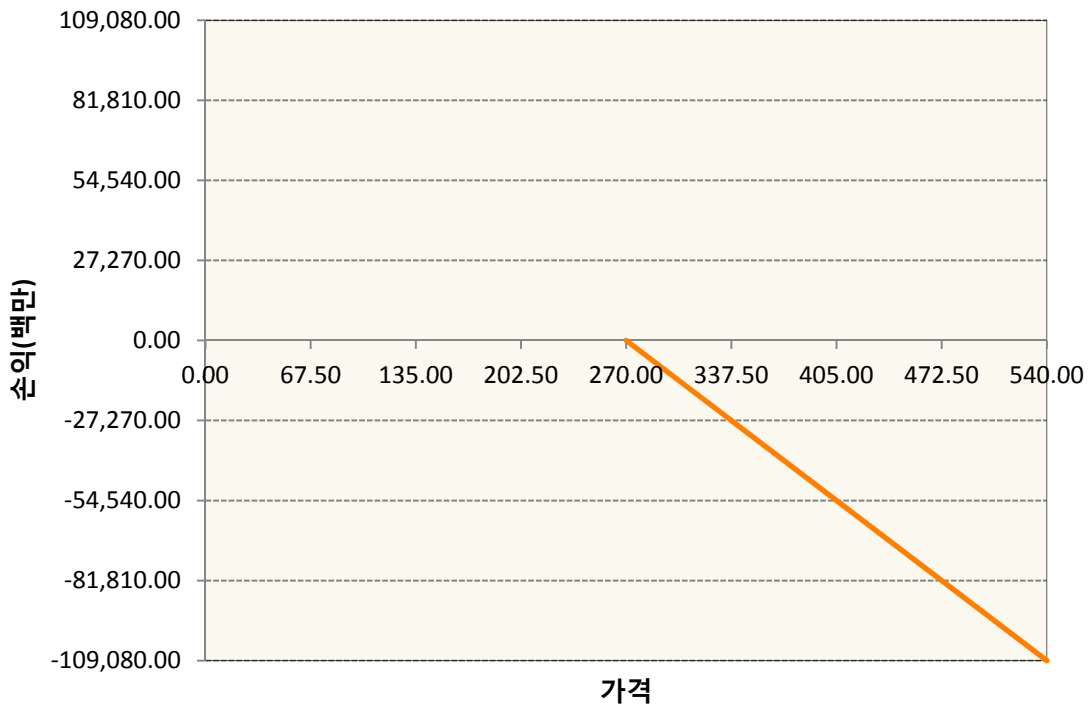
### 1. 계약금액

(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

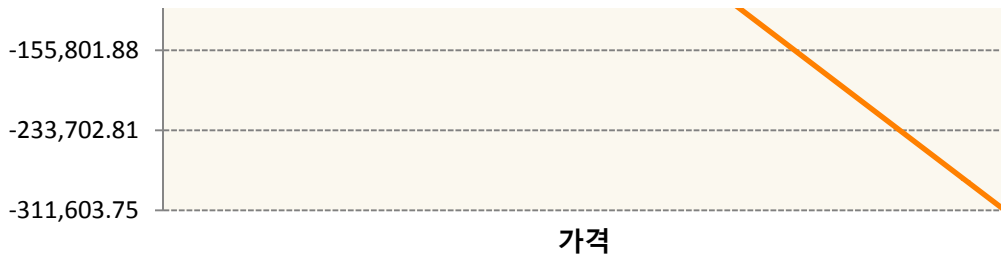
### 2. 만기시점의 손익구조

**KR4201NC2702-2018-12 콜270**

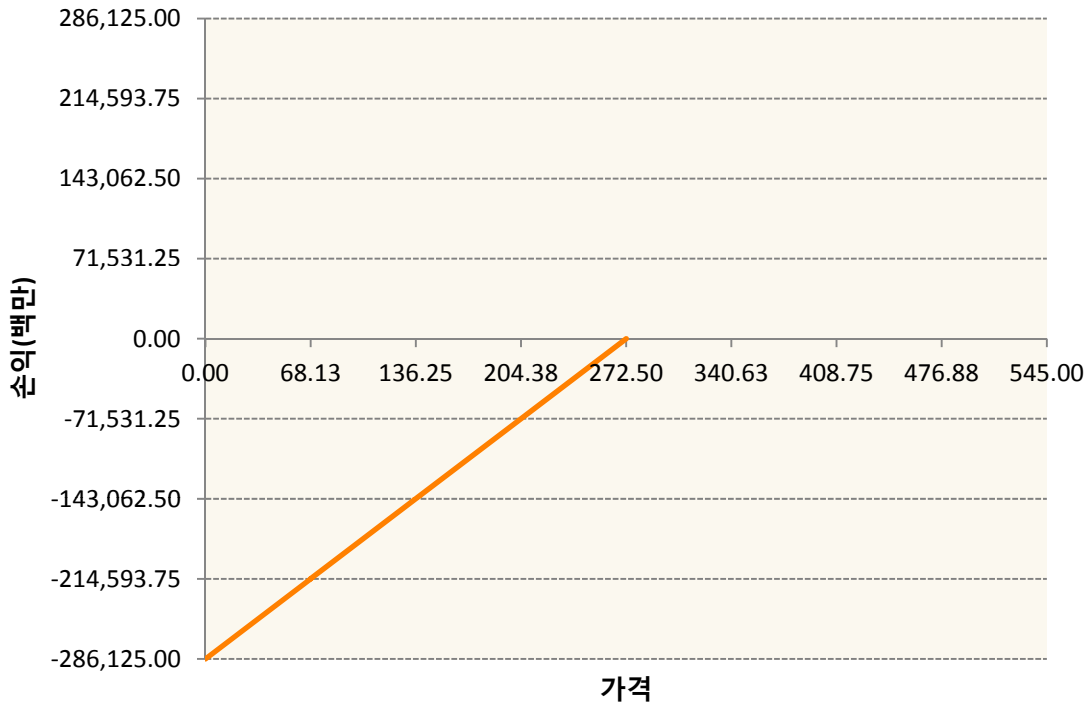


**KR4201NC2728-2018-12 콜272.5**





KR4301NC2727-2018-12 풋272.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201NC2702		2018-12 콜270					7,097
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	2,543	2,511	2,467	2,411	2,344	2,267	2,180
-5.33%	2,370	2,278	2,174	2,059	1,934	1,803	1,665
-2.67%	1,809	1,644	1,475	1,302	1,127	950	772
0%	575	383	192	0	-192	-384	-576
2.67%	-1,407	-1,556	-1,711	-1,873	-2,040	-2,210	-2,383
5.33%	-3,936	-4,015	-4,109	-4,214	-4,331	-4,457	-4,590
8.00%	-6,736	-6,766	-6,808	-6,863	-6,930	-7,008	-7,097
KR4201NC2728		2018-12 콜272.5					19,001
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	5,846	5,787	5,699	5,581	5,433	5,256	5,051

-5.33%	5,542	5,346	5,110	4,841	4,541	4,217	3,869
-2.67%	4,416	4,008	3,579	3,134	2,675	2,205	1,727
0%	1,635	1,090	545	0	-546	-1,092	-1,638
2.67%	-3,270	-3,754	-4,250	-4,756	-5,269	-5,787	-6,311
5.33%	-9,967	-10,263	-10,596	-10,958	-11,346	-11,755	-12,182
8.00%	-17,688	-17,816	-17,984	-18,189	-18,430	-18,701	-19,001
KR4301NC2727                      2018-12 풋272.5							19,439
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-19,329	-19,332	-19,338	-19,350	-19,370	-19,399	-19,439
-5.33%	-11,771	-11,807	-11,861	-11,933	-12,025	-12,134	-12,261
-2.67%	-4,585	-4,763	-4,962	-5,180	-5,411	-5,656	-5,910
0%	1,002	668	335	0	-335	-670	-1,006
2.67%	3,820	3,568	3,301	3,022	2,735	2,441	2,140
5.33%	4,599	4,516	4,408	4,276	4,124	3,953	3,765
8.00%	4,708	4,695	4,672	4,635	4,584	4,516	4,431

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

(단위:백만원)

**48,325**

공시일	2018-12-03
기준일	2018-11-30

## 홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

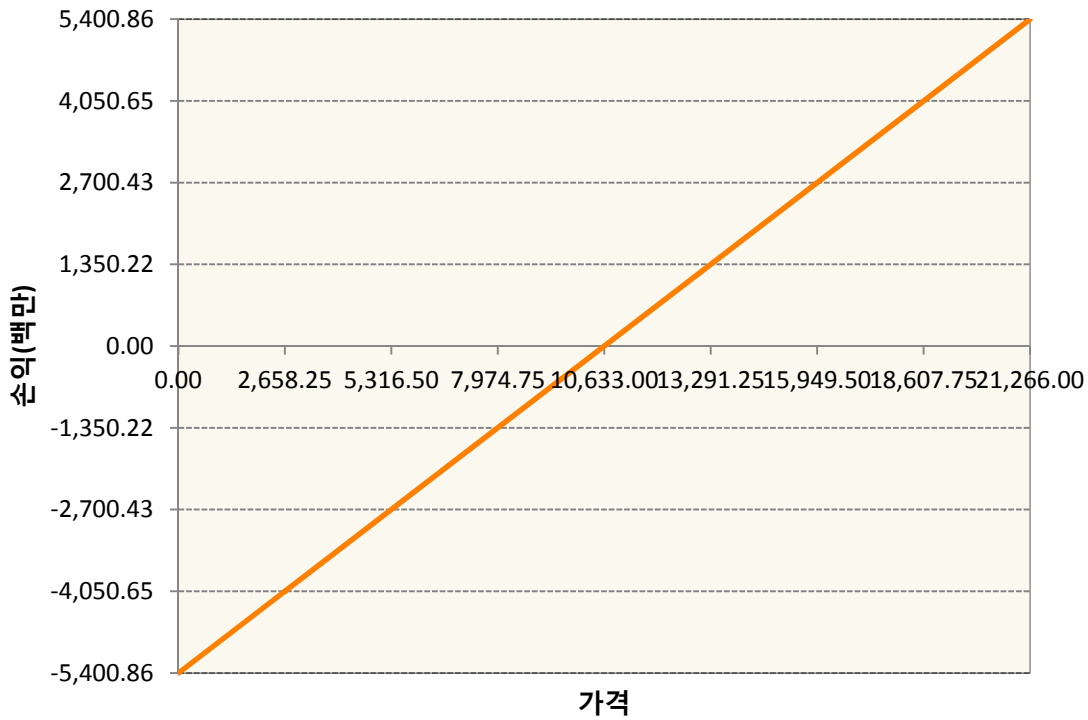
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

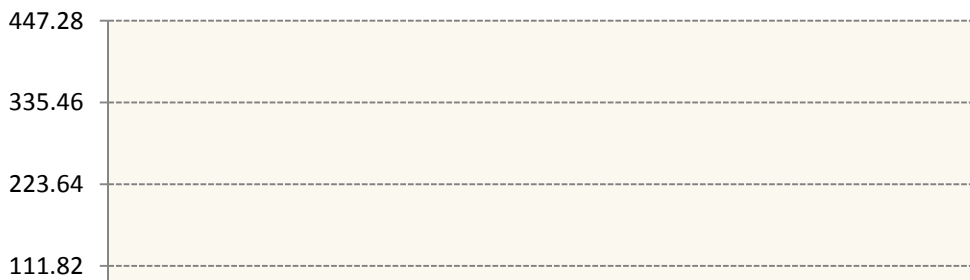
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	5,401	0	5,401	
누계	유가증권	옵션	0	11,988	-11,988	장내
누계	통화	선도	430	3,154	-2,724	장외

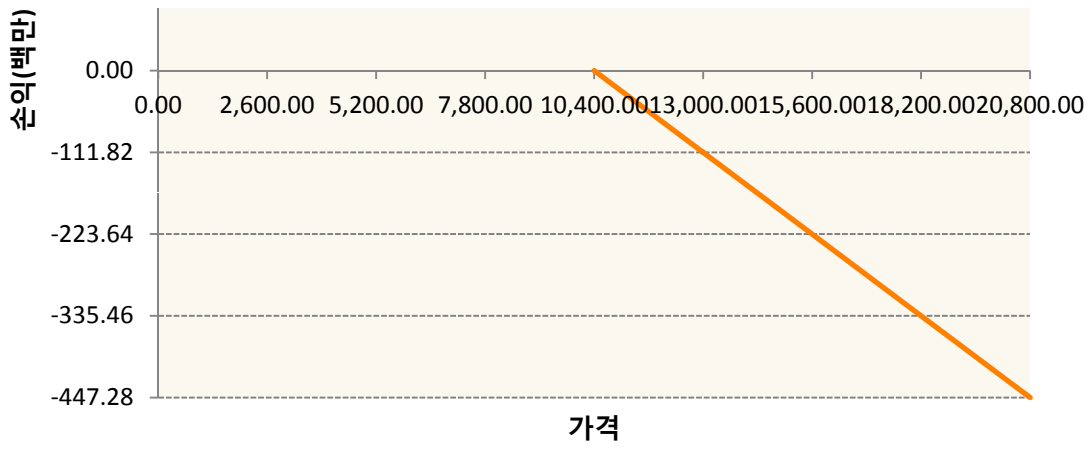
### 2. 만기시점의 손익구조

HCZ8-HSCEI FUTURES DEC 18

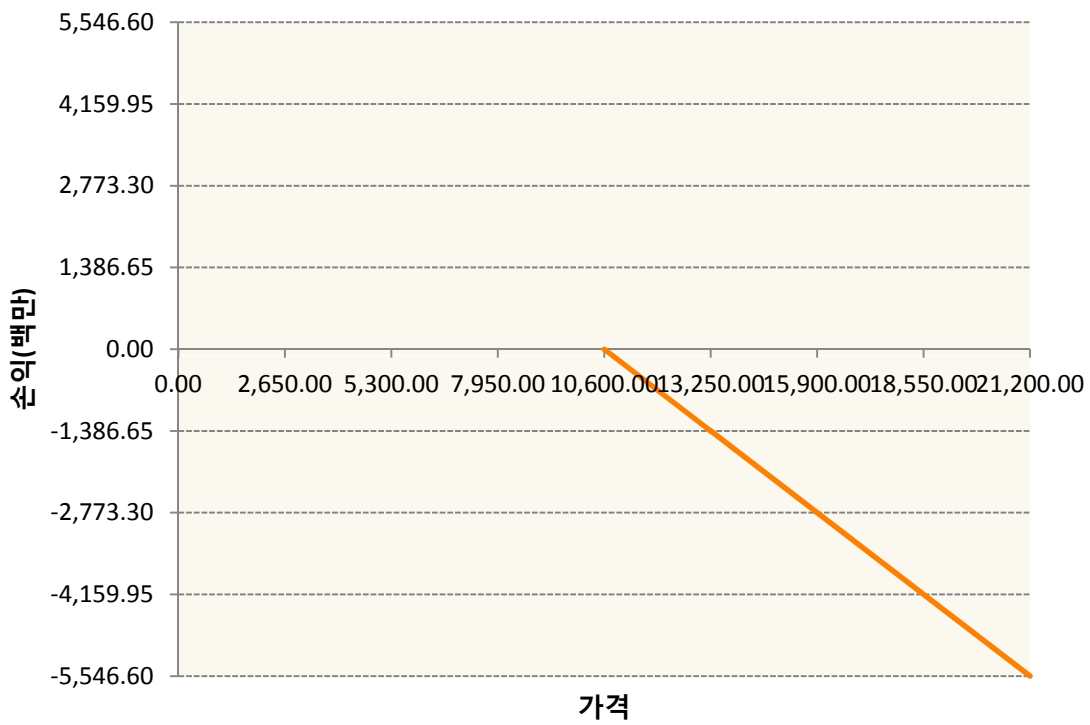


OHHI28-C104-HSCEI

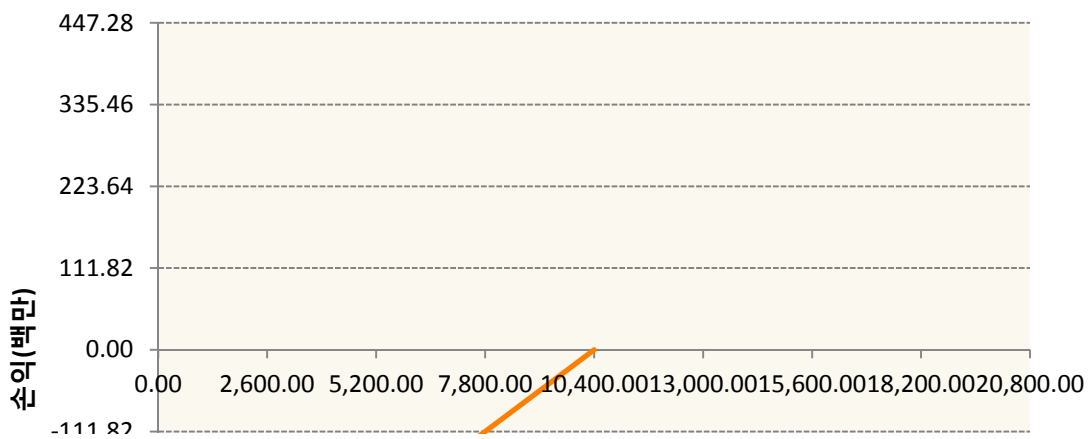


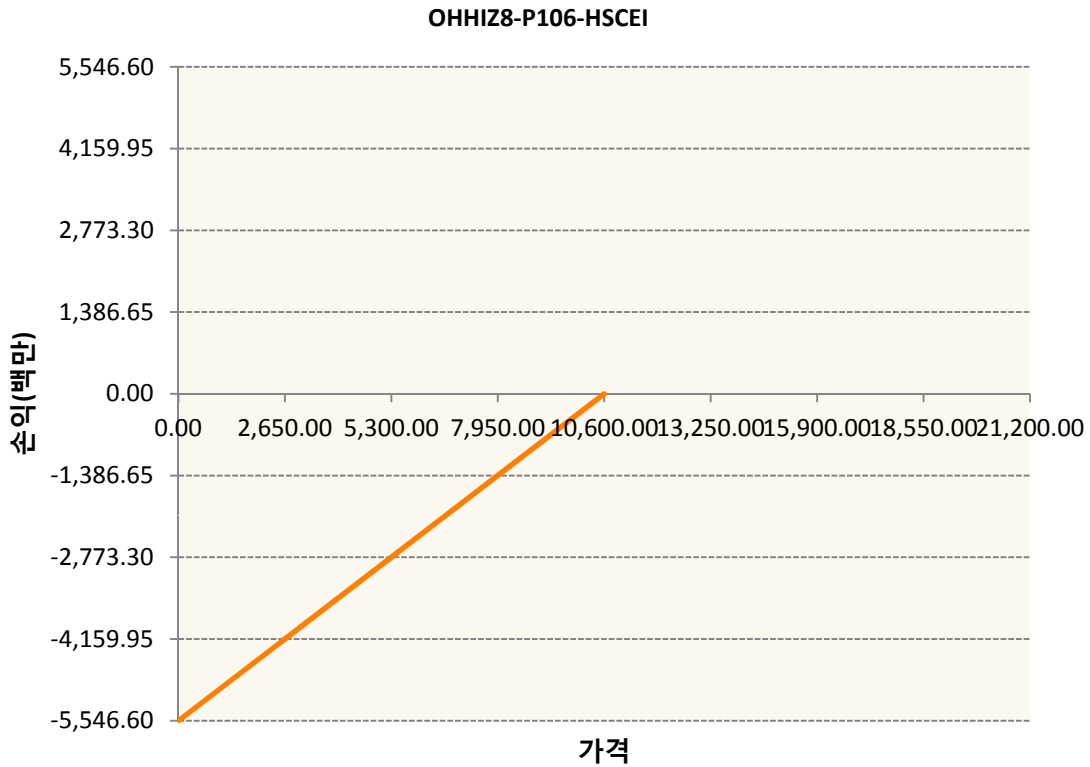
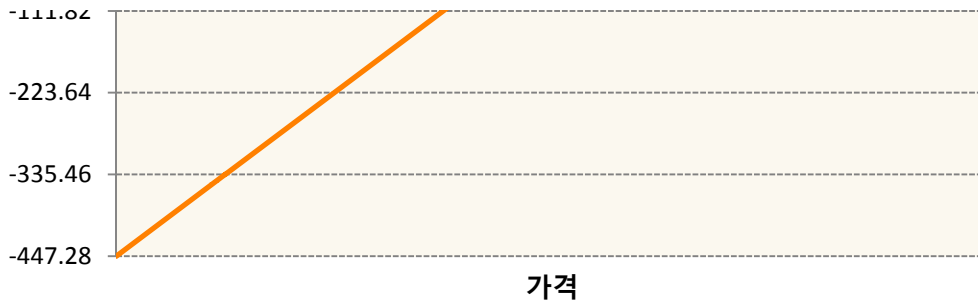


**OHHIZ8-C106-HSCEI**



**OHHIZ8-P104-HSCEI**





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
FX21018U00 KRW/HKD 10-12-18E		218
FX21018U03 KRW/HKD 10-12-18E		34
FX21018V01 HKD/KRW 10-12-18E		34
HCZ8 HSCEI FUTURES DEC 18		432
OHHIZ8-C1C HSCEI		36
OHHIZ8-C1C HSCEI		444
OHHIZ8-P10 HSCEI		36
OHHIZ8-P10 HSCEI		444

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,447

공시일	2018-12-03
기준일	2018-11-30

## 코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

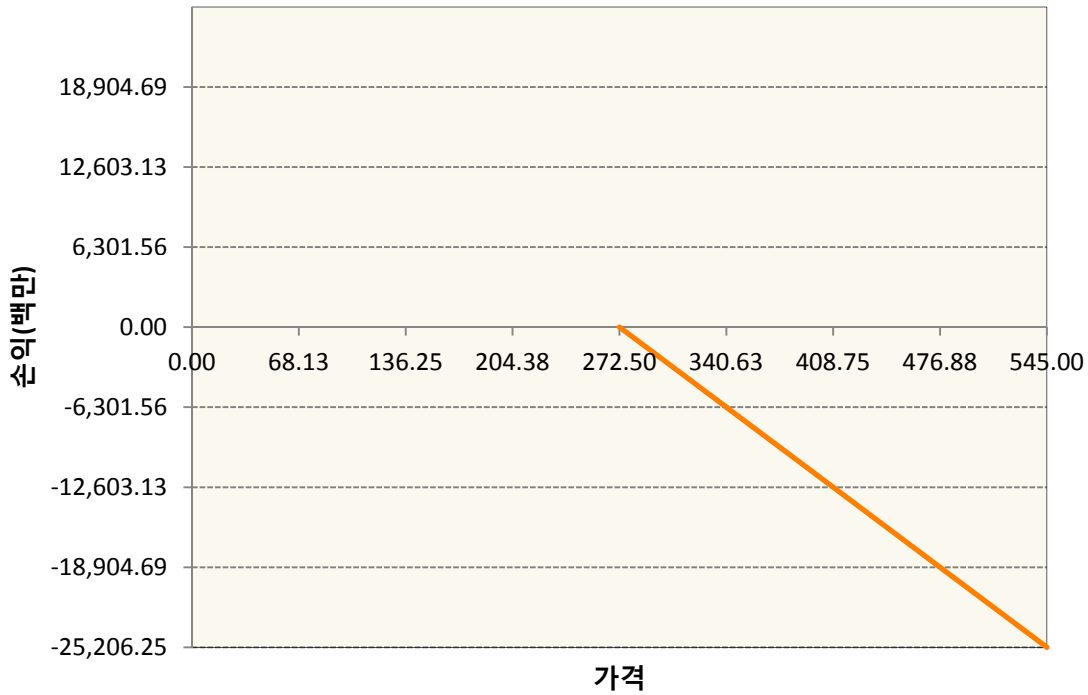
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

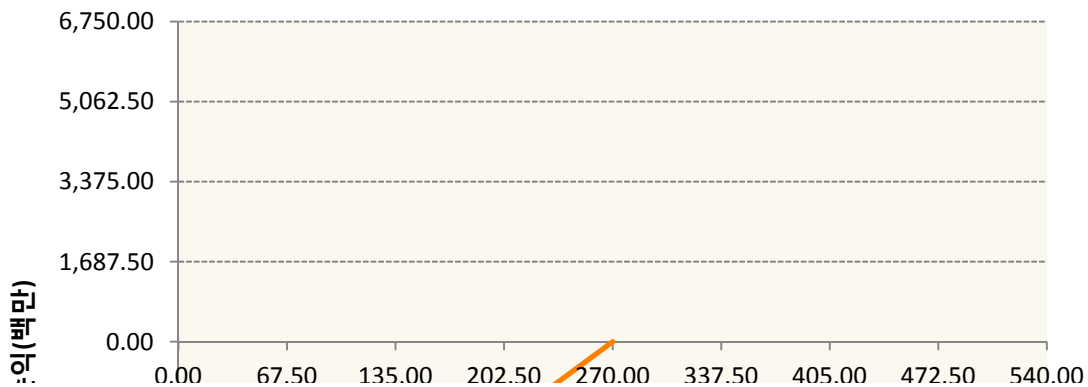
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	스왑	43,836	0	43,836	장외
누계	유가증권	옵션	0	43,538	-43,538	장내

### 2. 만기시점의 손익구조

KR4201NC2728-2018-12 콜272.5

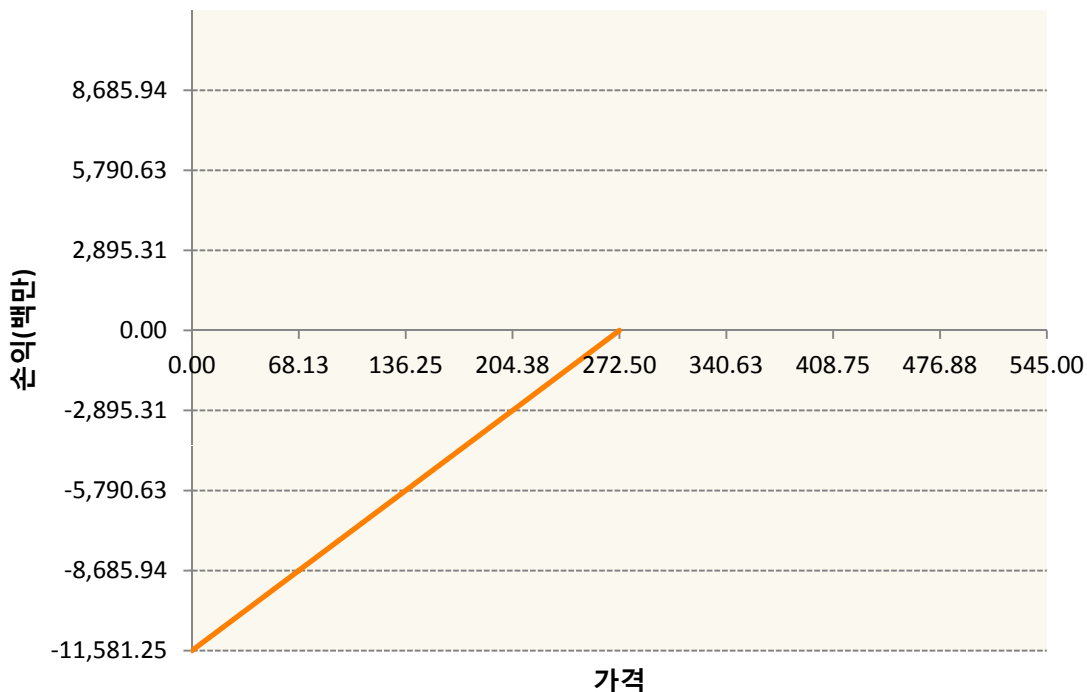


KR4301NC2701-2018-12 풋270





KR4301NC2727-2018-12 풋272.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

	2.529E+11		UBCSFXC1 INDEX_14				3,592
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-3,592	-3,592	-3,592	-3,592	-3,592	-3,592	-3,592
-5.33%	-2,395	-2,395	-2,395	-2,395	-2,395	-2,395	-2,395
-2.67%	-1,197	-1,197	-1,197	-1,197	-1,197	-1,197	-1,197
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	1,197	1,197	1,197	1,197	1,197	1,197	1,197
5.33%	2,395	2,395	2,395	2,395	2,395	2,395	2,395
8.00%	3,592	3,592	3,592	3,592	3,592	3,592	3,592
	KR4201NC2728		2018-12 콜272.5				1,537
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	473	468	461	451	440	425	409
-5.33%	448	432	413	392	367	341	313
-2.67%	357	324	290	254	216	178	140
0%	132	88	44	0	-44	-88	-132
2.67%	-265	-304	-344	-385	-426	-468	-510
5.33%	-806	-830	-857	-886	-918	-951	-985
8.00%	-1,431	-1,441	-1,455	-1,471	-1,491	-1,513	-1,537

KR4301NC2701                      2018-12 풋270                      434

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-429	-430	-430	-430	-431	-432	-434
-5.33%	-251	-252	-254	-257	-260	-264	-268
-2.67%	-88	-94	-100	-106	-113	-120	-126
0%	24	16	8	0	-8	-16	-24
2.67%	70	65	60	55	49	43	37
5.33%	80	79	77	75	72	69	66
8.00%	81	81	80	80	79	78	77

KR4301NC2727                      2018-12 풋272.5                      787

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-782	-782	-783	-783	-784	-785	-787
-5.33%	-476	-478	-480	-483	-487	-491	-496
-2.67%	-186	-193	-201	-210	-219	-229	-239
0%	41	27	14	0	-14	-27	-41
2.67%	155	144	134	122	111	99	87
5.33%	186	183	178	173	167	160	152
8.00%	191	190	189	188	186	183	179

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

(단위:백만원)

**6,496**

공시일	2018-12-03
기준일	2018-11-30

## 유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

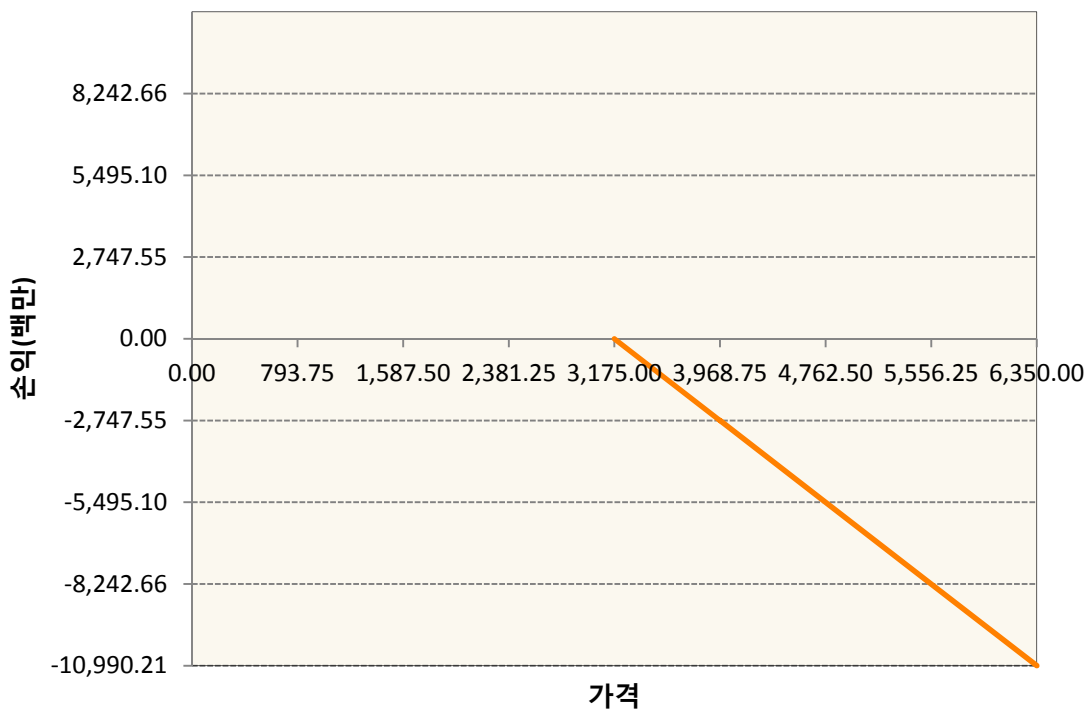
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

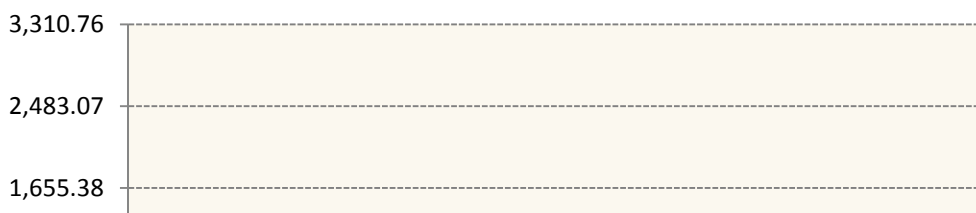
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	8,107	0	8,107	
누계	유가증권	스왑	71,340	0	71,340	장외
누계	유가증권	옵션	0	28,602	-28,602	장내
누계	통화	선도	0	15,327	-15,327	장외

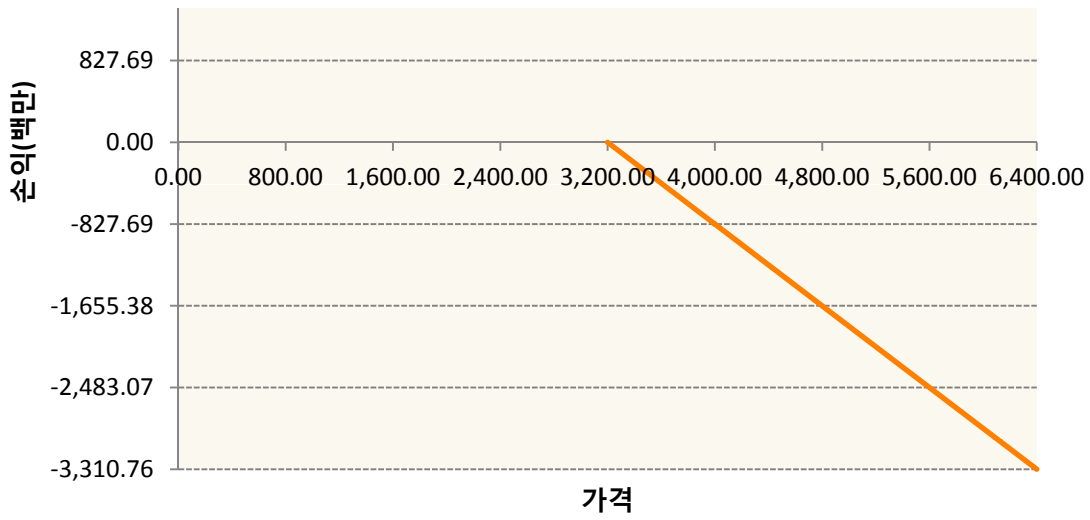
### 2. 만기시점의 손익구조

**OESXZ8-C3175-EURO STOXX 50**

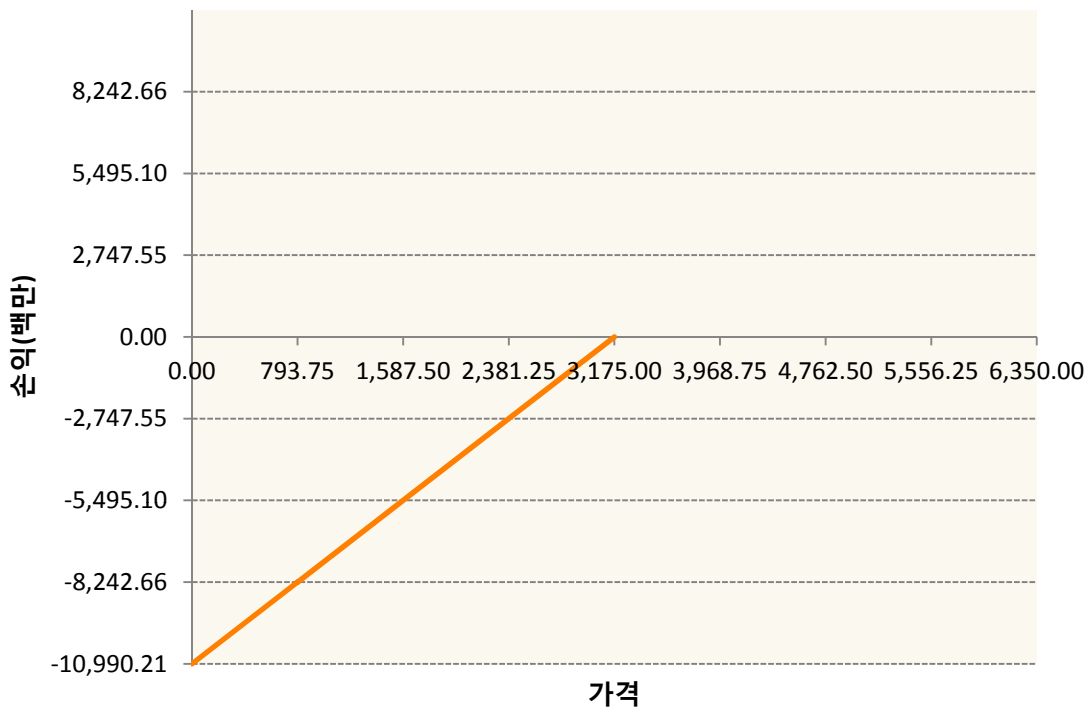


**OESXZ8-C3200-EURO STOXX 50**

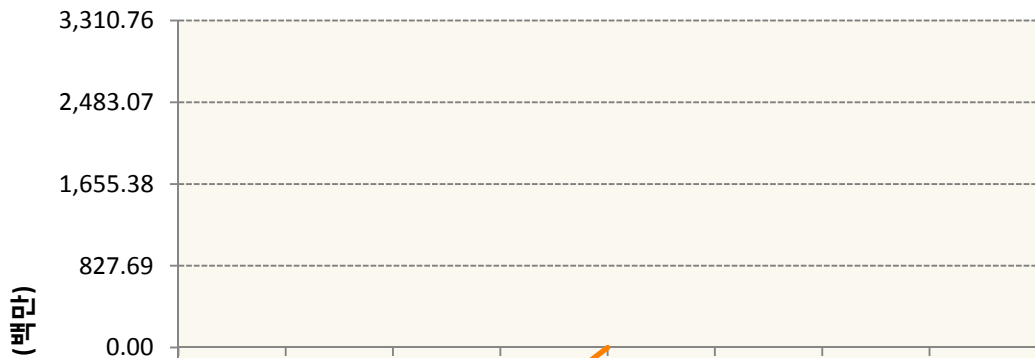


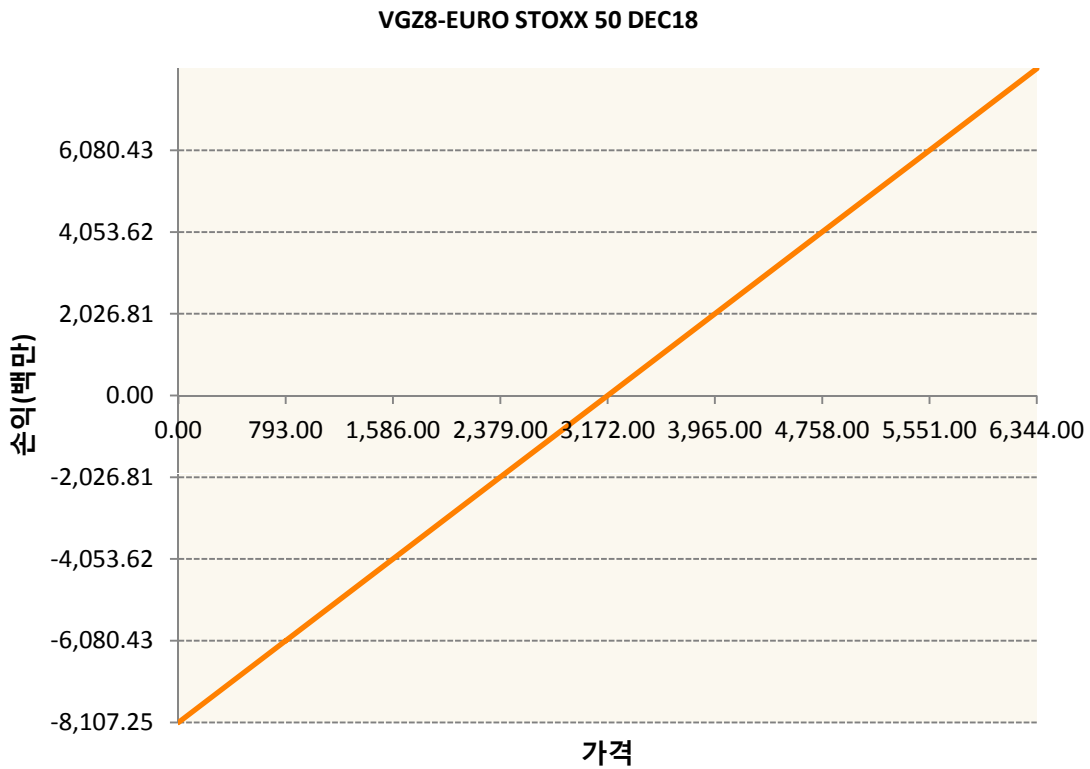
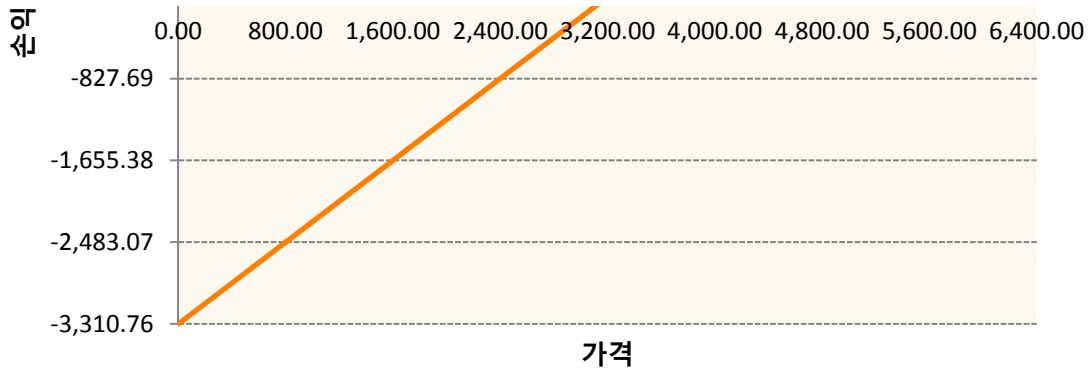


OESXZ8-P3175-EURO STOXX 50



OESXZ8-P3200-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY		56
FX21018U03 KRW/EUR 21-12-18E		817
FX21018X02 KRW/EUR 22-02-19E		409
OESXZ8-C31 EURO STOXX 50		879
OESXZ8-C32 EURO STOXX 50		265
OESXZ8-P31 EURO STOXX 50		879
OESXZ8-P32 EURO STOXX 50		265
VGZ8	EURO STOXX 50 DEC18	649

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

(단위:백만원)

2,601



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

(단위:백만원)

1,102



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

(단위:백만원)

93



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

(단위:백만원)

139

공시일	2018-12-03
기준일	2018-11-30

## 스마트KRX300인덱스목표전환형1호

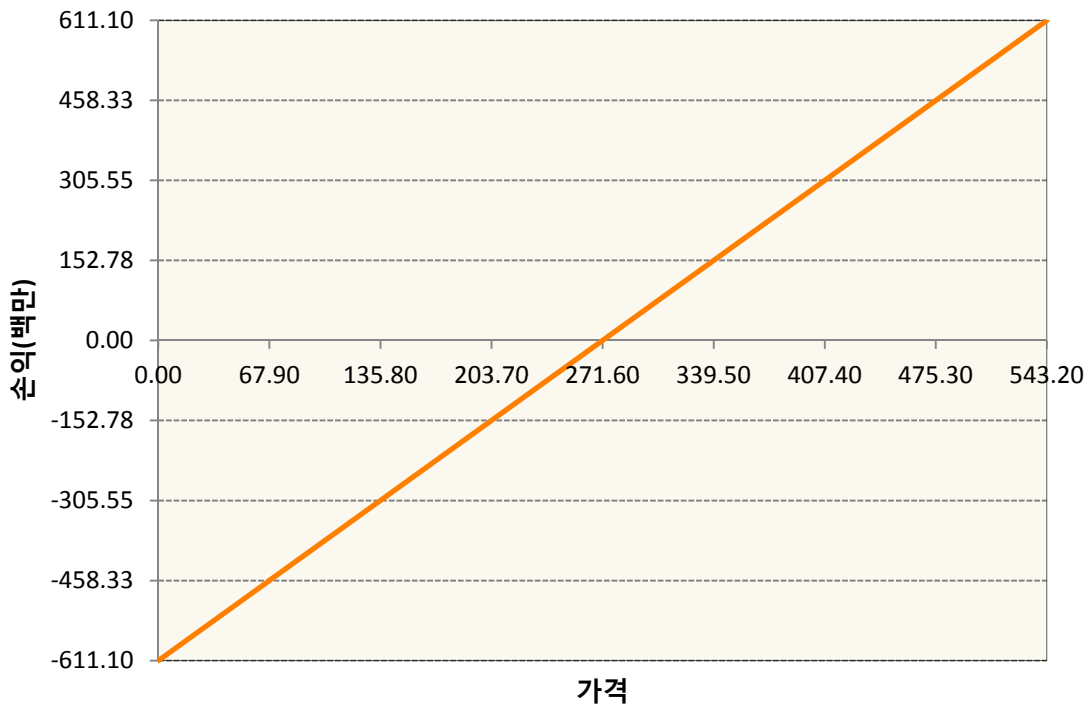
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	611	0	611	장내

### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101NC0004-2018-12 코스피200지수선물



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101NC0004		2018-12 코스피200지수선물						49
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-49	-49	-49	-49	-49	-49	-49	
-5.33%	-33	-33	-33	-33	-33	-33	-33	
-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%	33	33	33	33	33	33	33	
8.00%	49	49	49	49	49	49	49	

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

(단위:백만원)

42

공시일	2018-12-03
기준일	2018-11-30

## 리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

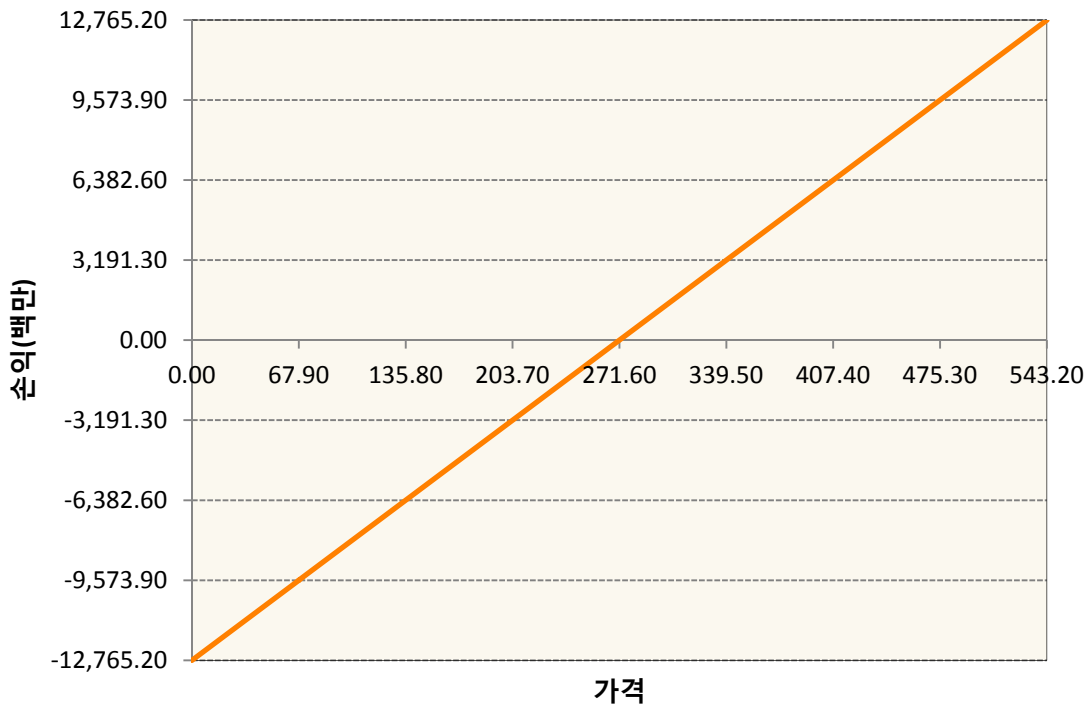
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

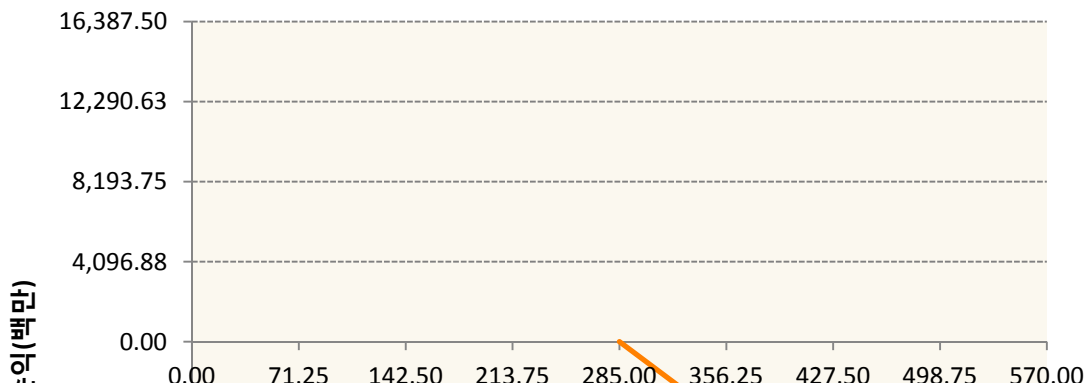
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	12,765	0	12,765	장내
누계	유가증권	옵션	3,743	23,072	-19,329	장내

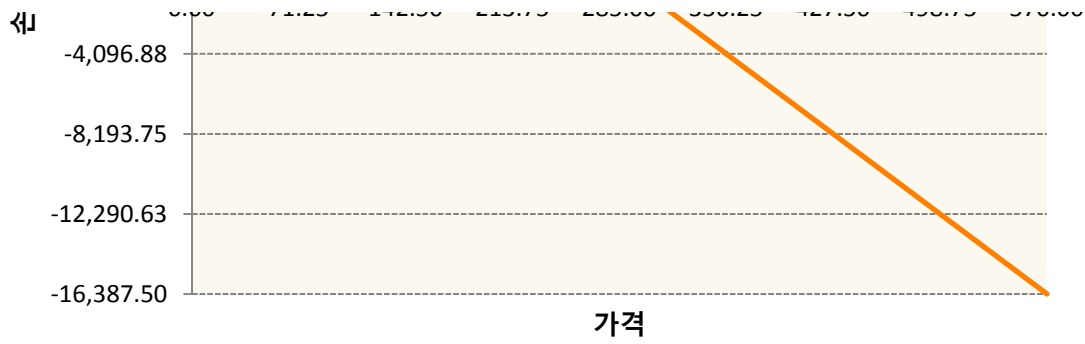
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101NC0004-2018-12 코스피200지수선물

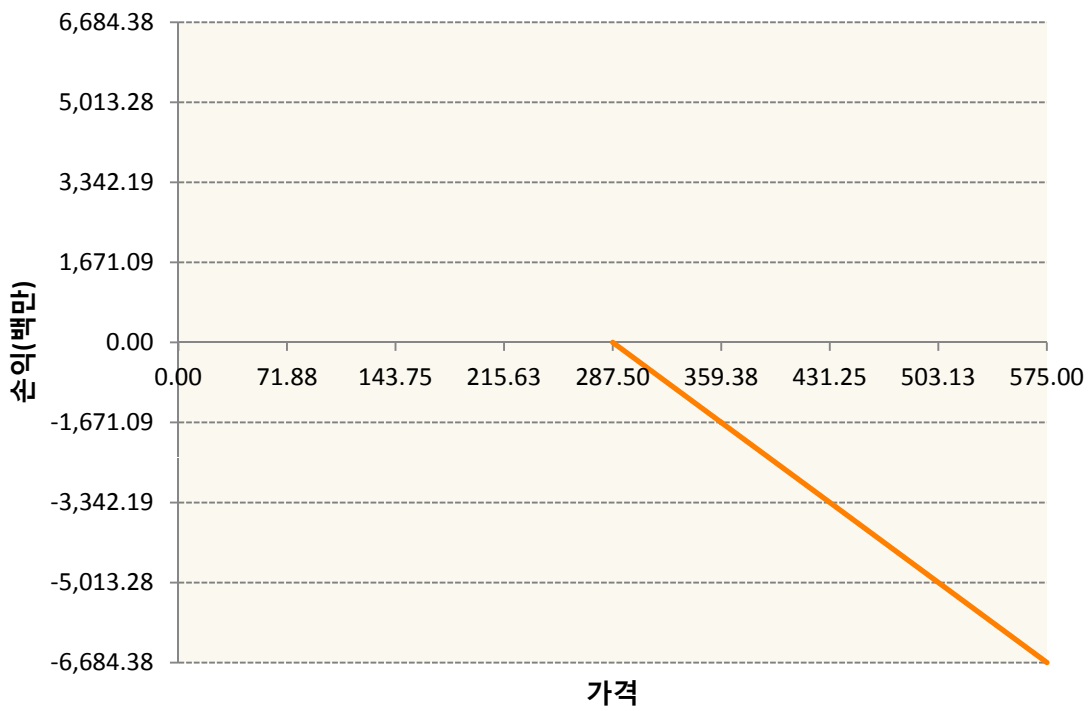


KR4201NC2850-2018-12 콜285

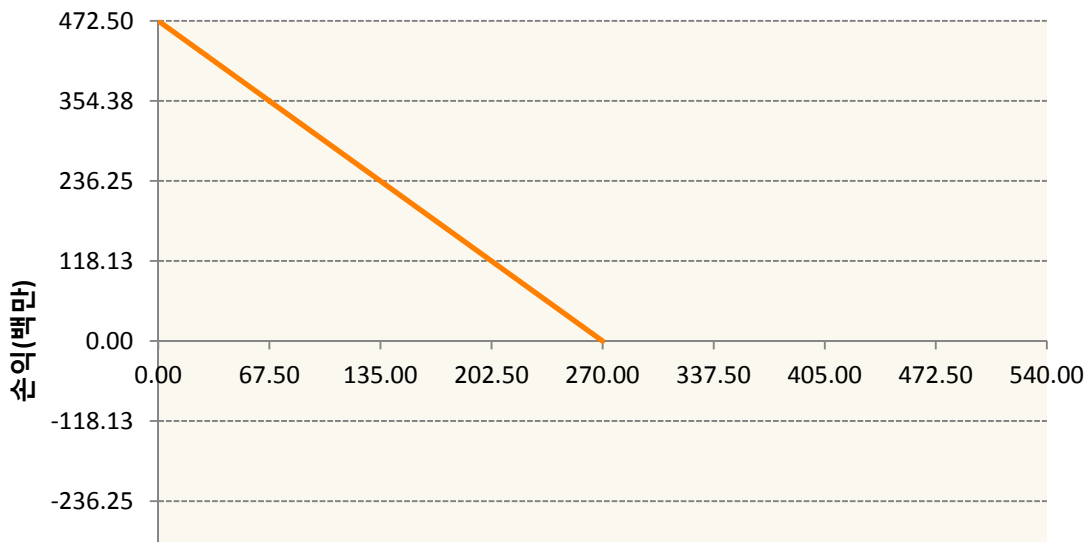


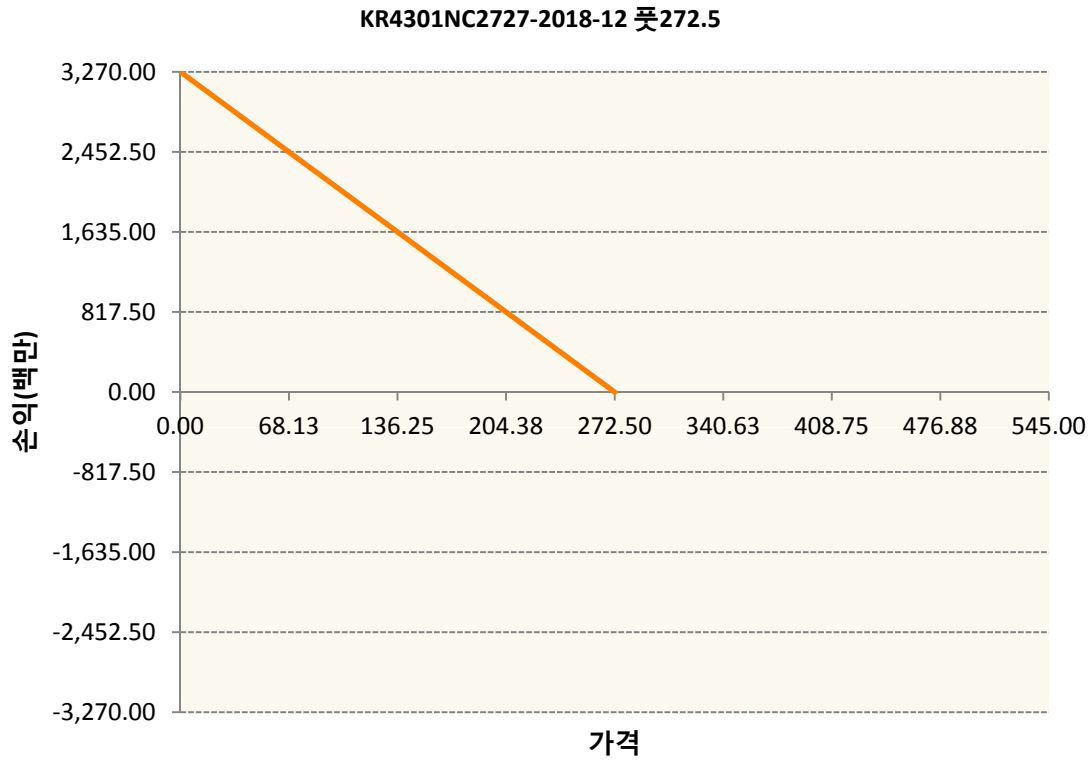
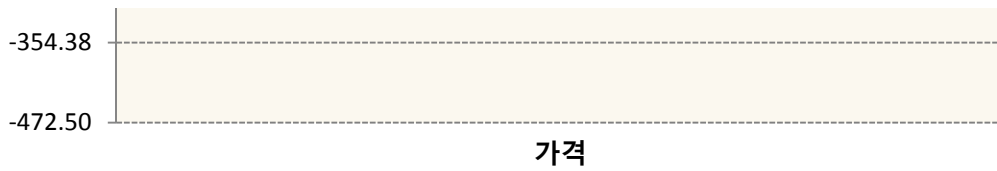


**KR4201NC2876-2018-12 콜287.5**



**KR4301NC2701-2018-12 풋270**





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

KR4101NC0004		2018-12 코스피200지수선물						1,020
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-1,020	-1,020	-1,020	-1,020	-1,020	-1,020	-1,020	
-5.33%	-680	-680	-680	-680	-680	-680	-680	
-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%	680	680	680	680	680	680	680	
8.00%	1,020	1,020	1,020	1,020	1,020	1,020	1,020	
KR4201NC2850		2018-12 콜285						626
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	80	80	80	79	77	75	72	
-5.33%	80	78	76	73	68	62	55	
-2.67%	74	69	61	52	42	30	16	

0%	48	34	18	0	-19	-39	-60
2.67%	-32	-57	-82	-108	-134	-160	-187
5.33%	-202	-231	-260	-289	-317	-346	-375
8.00%	-474	-497	-522	-547	-573	-599	-626
KR4201NC2876                      2018-12 콜287.5							225
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	24	24	24	23	23	22	21
-5.33%	24	23	23	22	20	19	16
-2.67%	22	21	19	16	13	9	4
0%	16	11	6	0	-7	-14	-21
2.67%	-8	-16	-26	-35	-45	-55	-65
5.33%	-63	-74	-86	-98	-109	-121	-133
8.00%	-159	-170	-180	-192	-203	-214	-225
KR4301NC2701                      2018-12 풋270							30
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	30	30	30	30	30	30	30
-5.33%	18	18	18	18	18	18	19
-2.67%	6	7	7	7	8	8	9
0%	-2	-1	-1	0	1	1	2
2.67%	-5	-5	-4	-4	-3	-3	-3
5.33%	-6	-5	-5	-5	-5	-5	-5
8.00%	-6	-6	-6	-6	-6	-5	-5
KR4301NC2727                      2018-12 풋272.5							222
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	221	221	221	221	221	222	222
-5.33%	135	135	136	136	137	139	140
-2.67%	52	54	57	59	62	65	68
0%	-11	-8	-4	0	4	8	11
2.67%	-44	-41	-38	-35	-31	-28	-24
5.33%	-53	-52	-50	-49	-47	-45	-43
8.00%	-54	-54	-53	-53	-52	-52	-51

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

(단위:백만원)

1,686

공시일	2018-12-03
기준일	2018-11-30

## 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	125	0	125	

### 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	2018-12-03
기준일	2018-11-30

## 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	1,451	0	1,451	

### 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	2018-12-03
기준일	2018-11-30

## 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	182	0	182	
누계	통화	선도	0	190	-190	장외

### 2. 만기시점의 손익구조

### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음	
FX21018X01 KRW/USD 13-12-18E		9
FX21018X04 KRW/USD 28-02-19E		2
FX21018X04 KRW/USD 28-02-19E		3
FX21018X04 KRW/USD 28-02-19E		1

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

(단위:백만원)

6
---



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

(단위:백만원)

146

공시일	2018-12-03
기준일	2018-11-30

## 에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

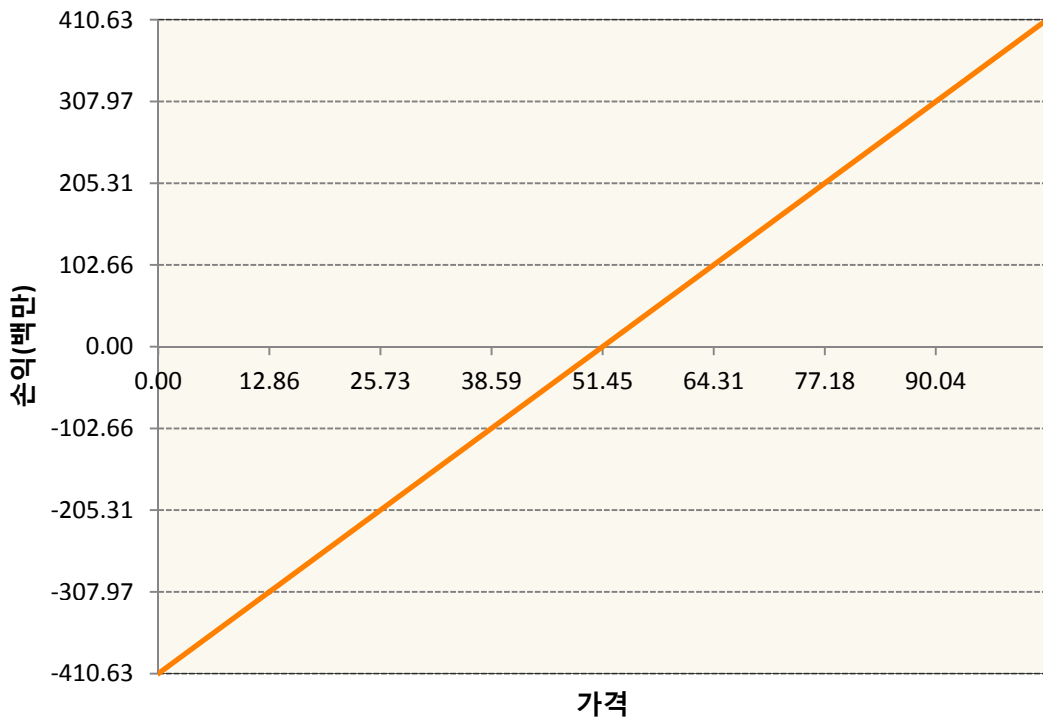
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

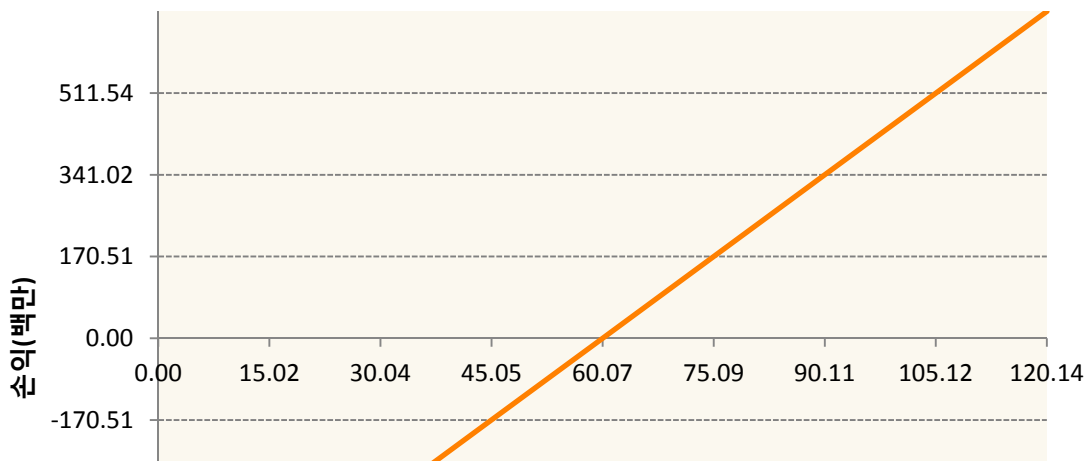
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,033	258	2,775	

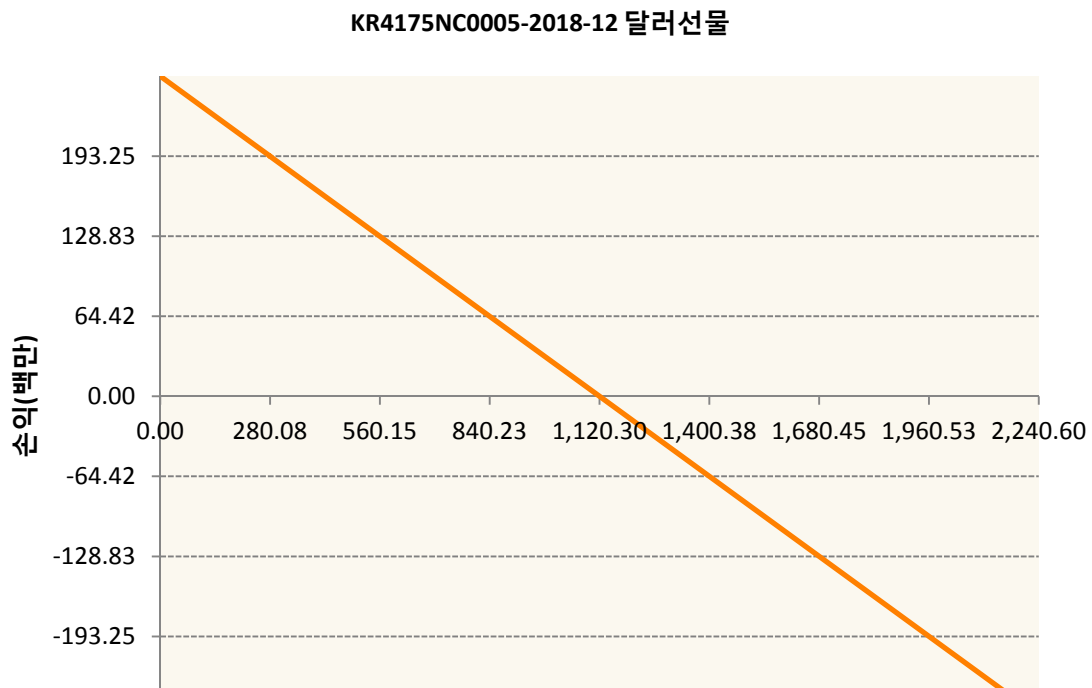
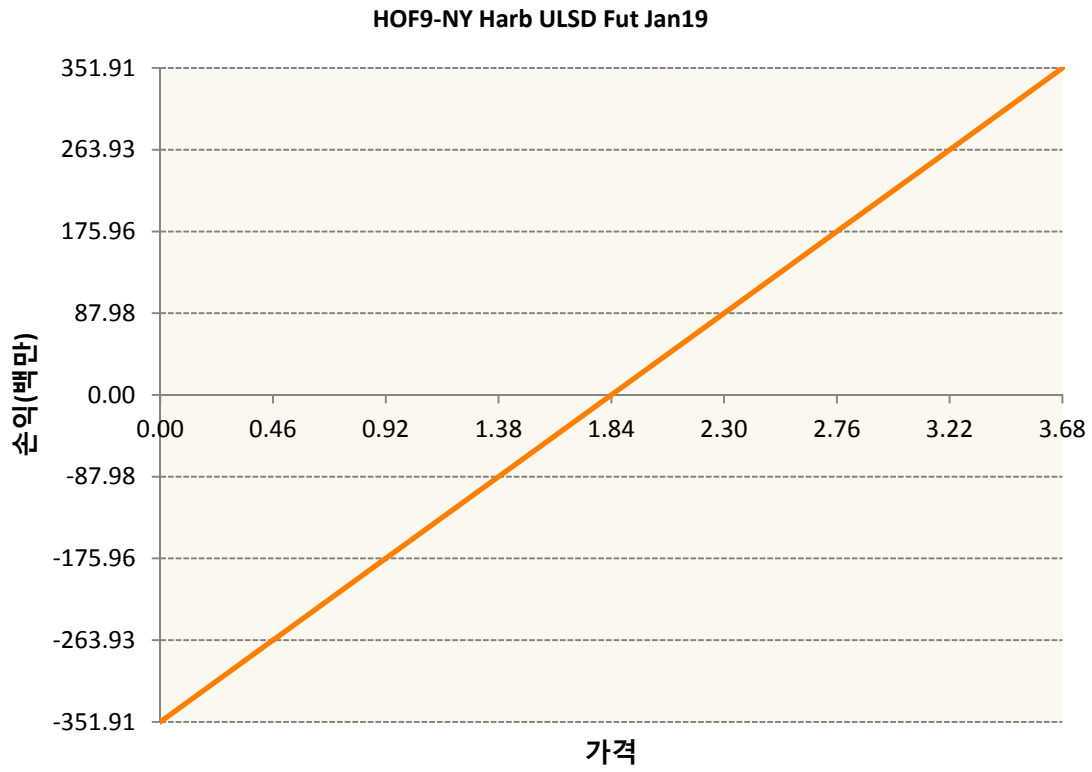
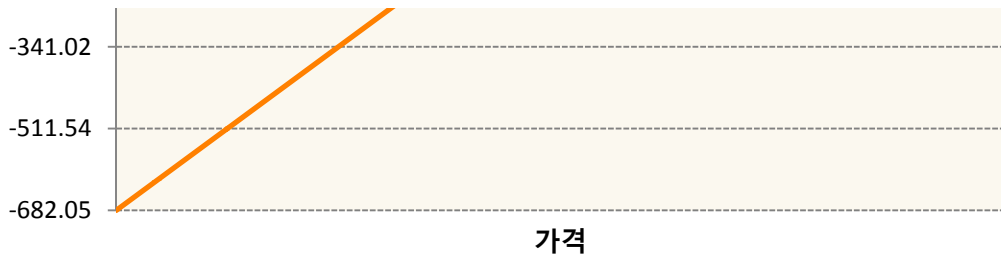
### 2. 만기시점의 손익구조

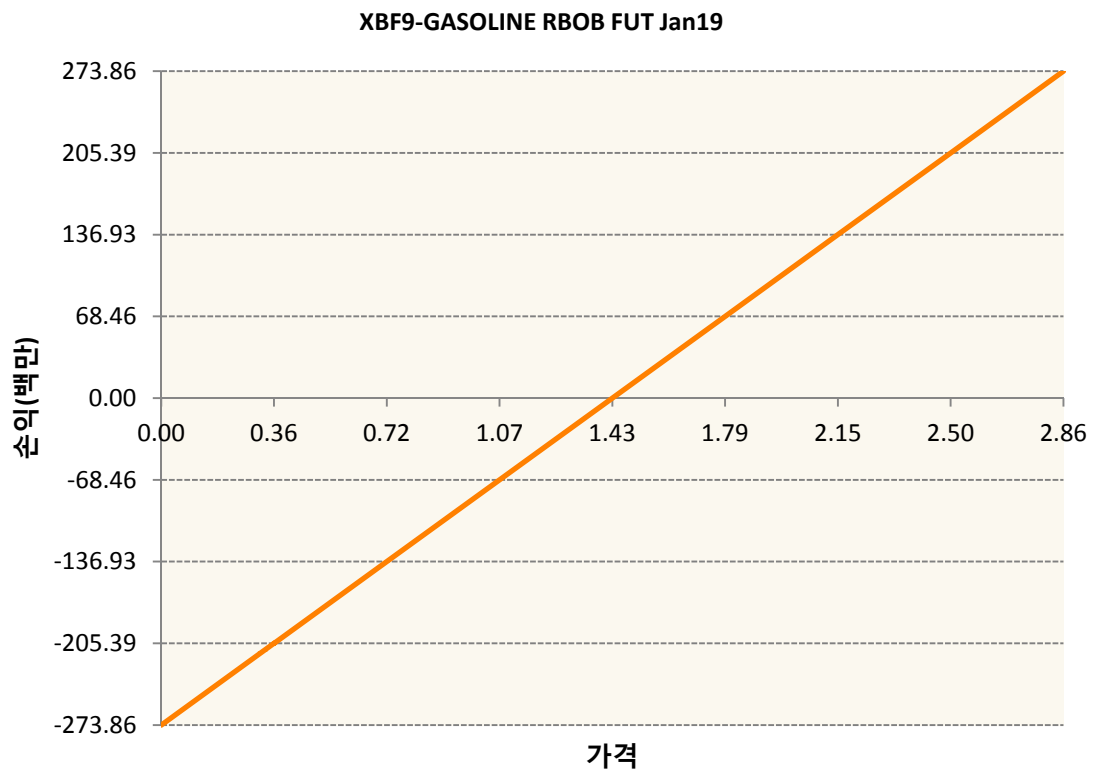
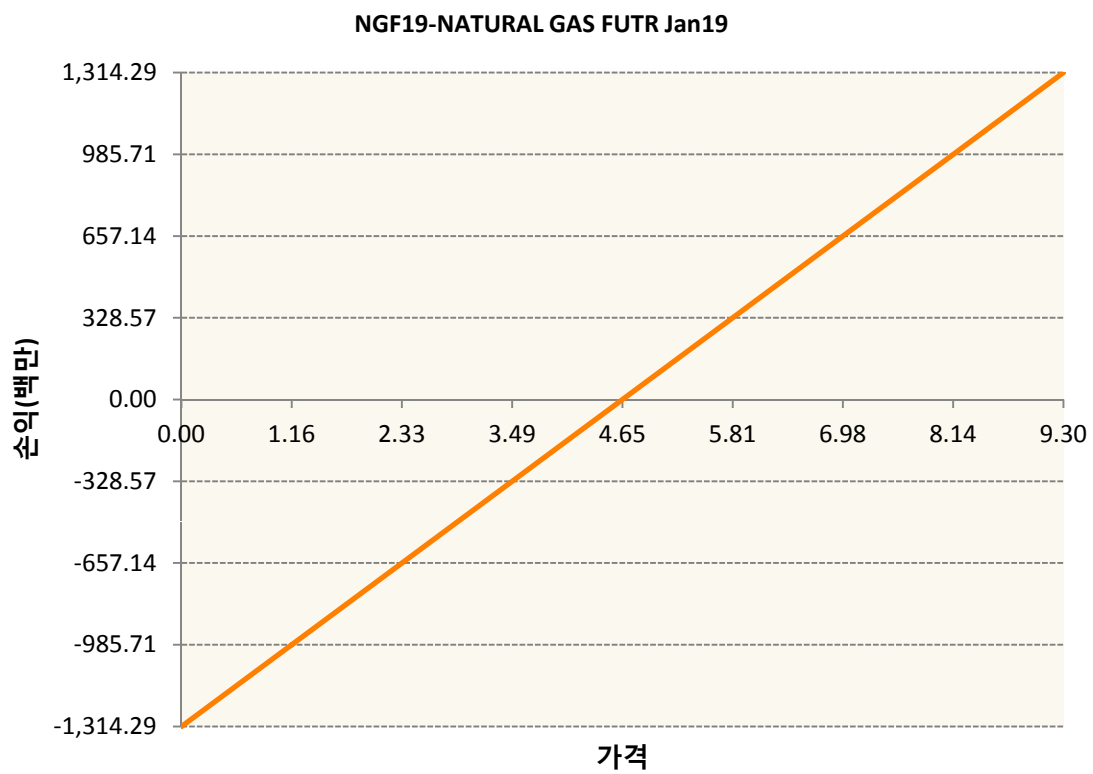
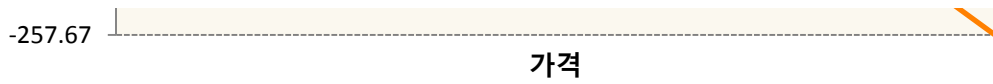
CLF9-WTI CRUDE FUTURE Jan19



COH9-BRENT CRUDE FUTR Mar19







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

CLF9	WTI CRUDE FUTURE Jan19	33
COH9	BRENT CRUDE FUTR Mar19	55
HOF9	NY Harb ULSD Fut Jan19	28
KR4175NC0	(2018-12 달러선물	21
NGF19	NATURAL GAS FUTR Jan19	105
XBF9	GASOLINE RBOB FUT Jan19	22

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

432

공시일	2018-12-03
기준일	2018-11-30

## 애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

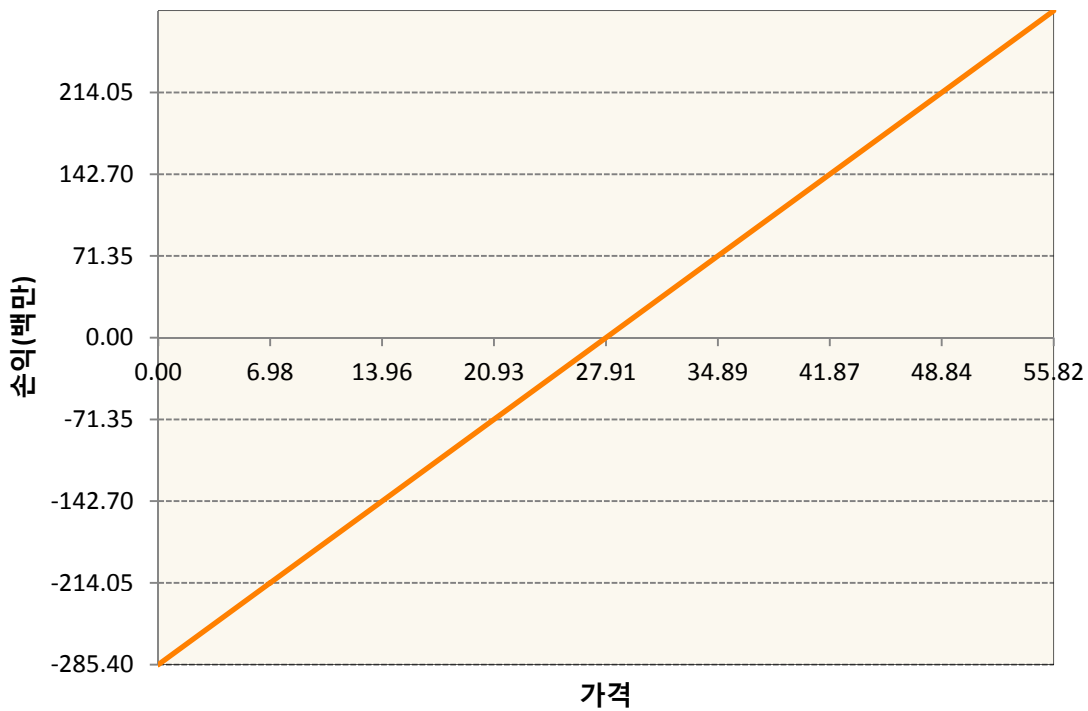
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

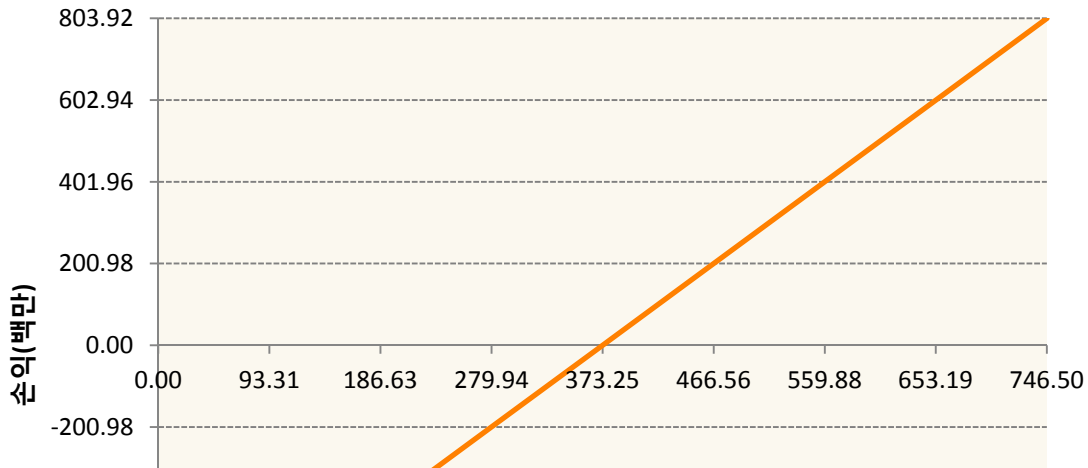
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,639	78	3,561	

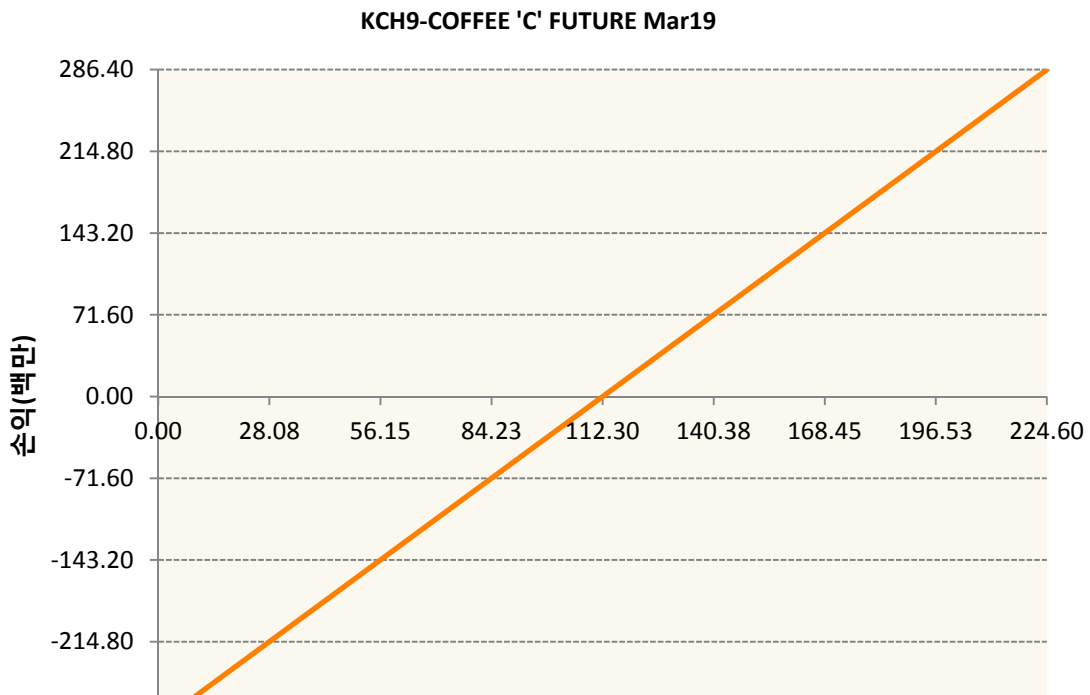
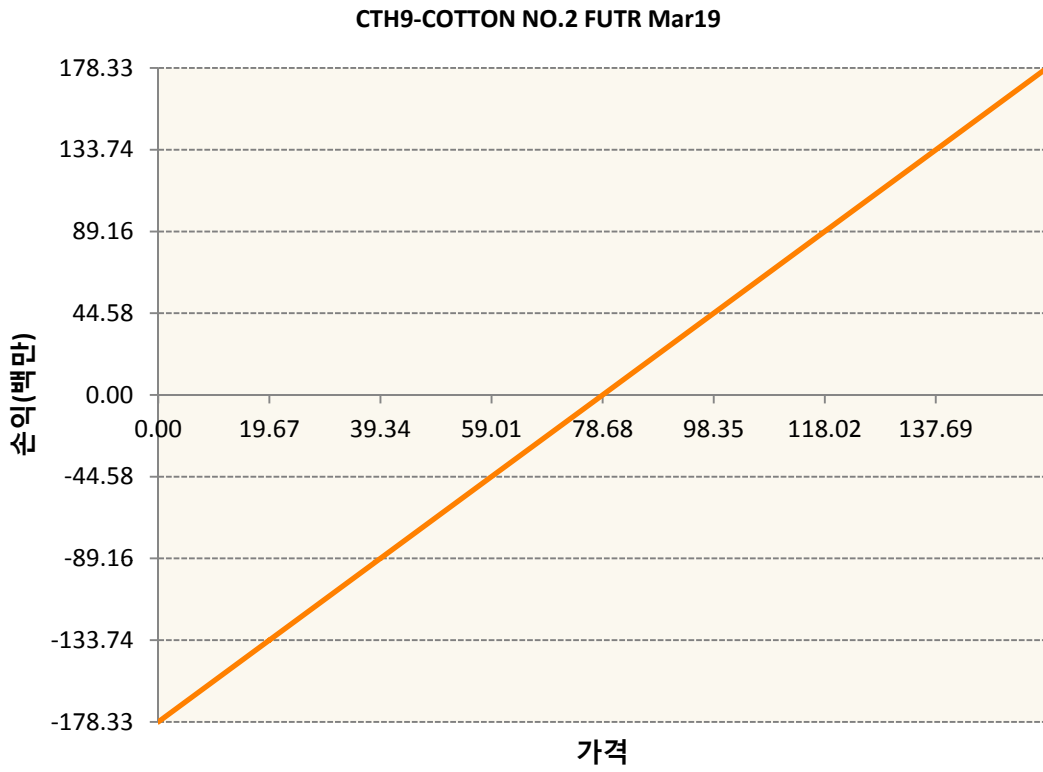
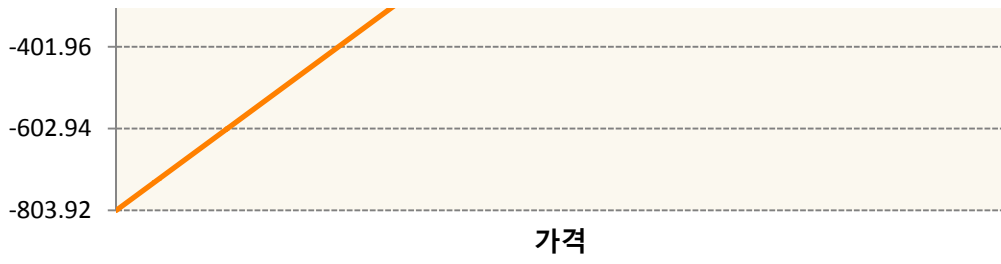
### 2. 만기시점의 손익구조

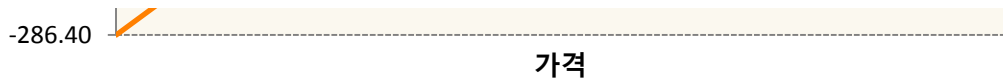
**BOF9-SOYBEAN OIL FUTR Jan19**



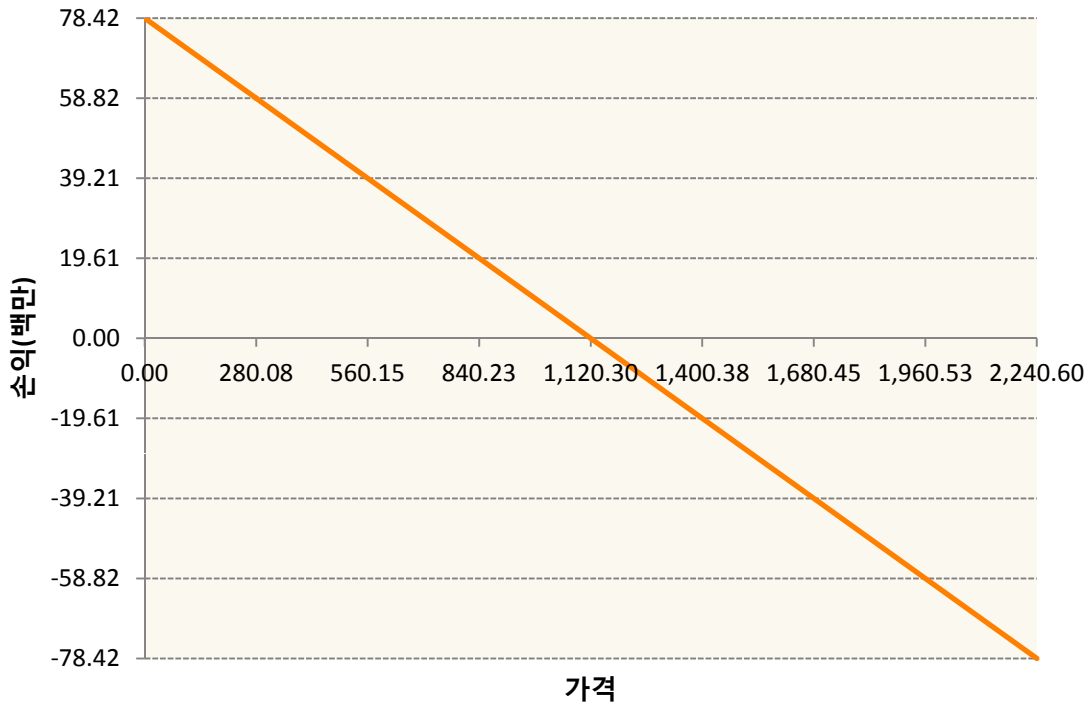
**CH9-CORN FUTURE Mar19**



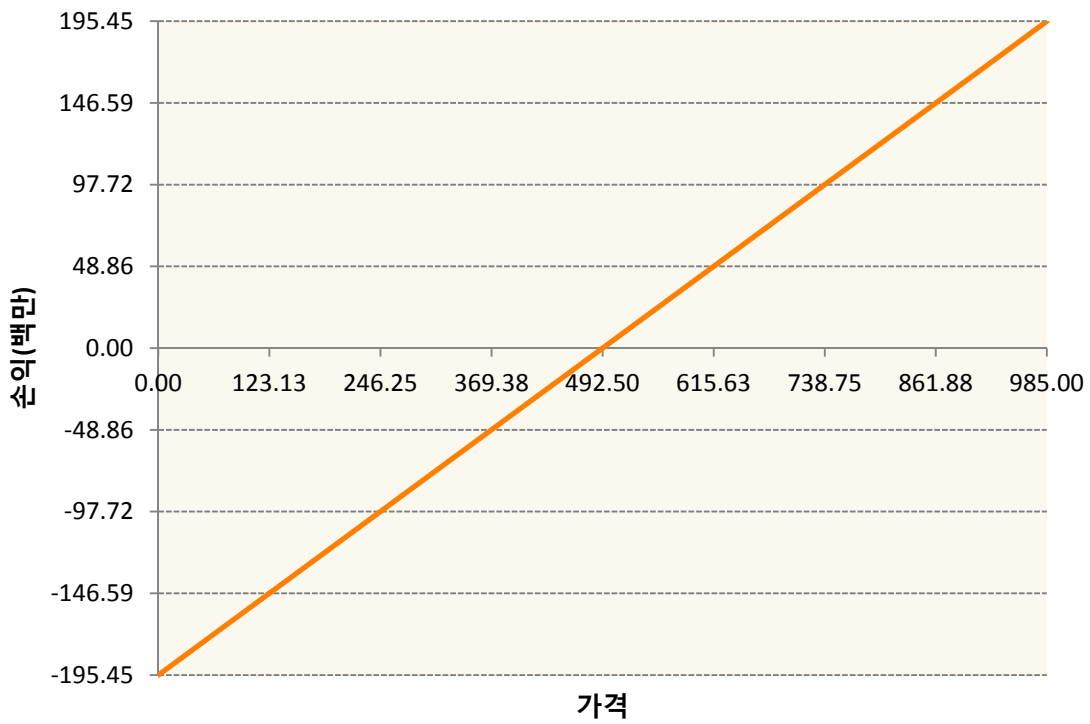




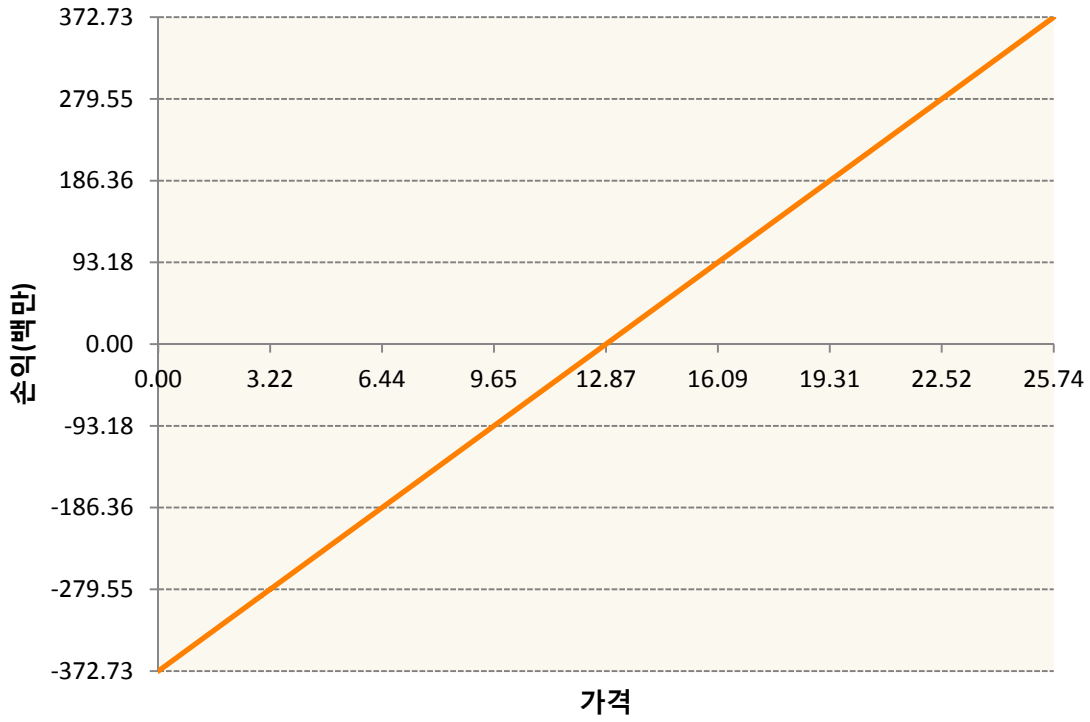
**KR4175NC0005-2018-12 달러선물**



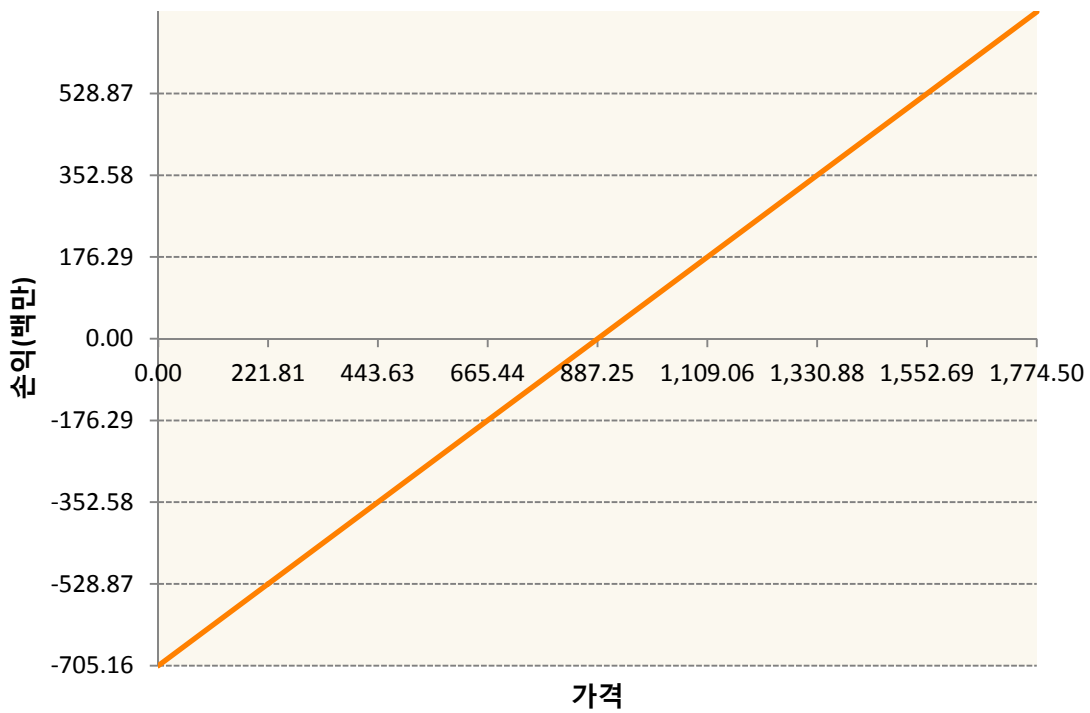
**KWH9-KC HRW WHEAT FUT Mar19**



SBH9-SUGAR #11 (WORLD) MAR19

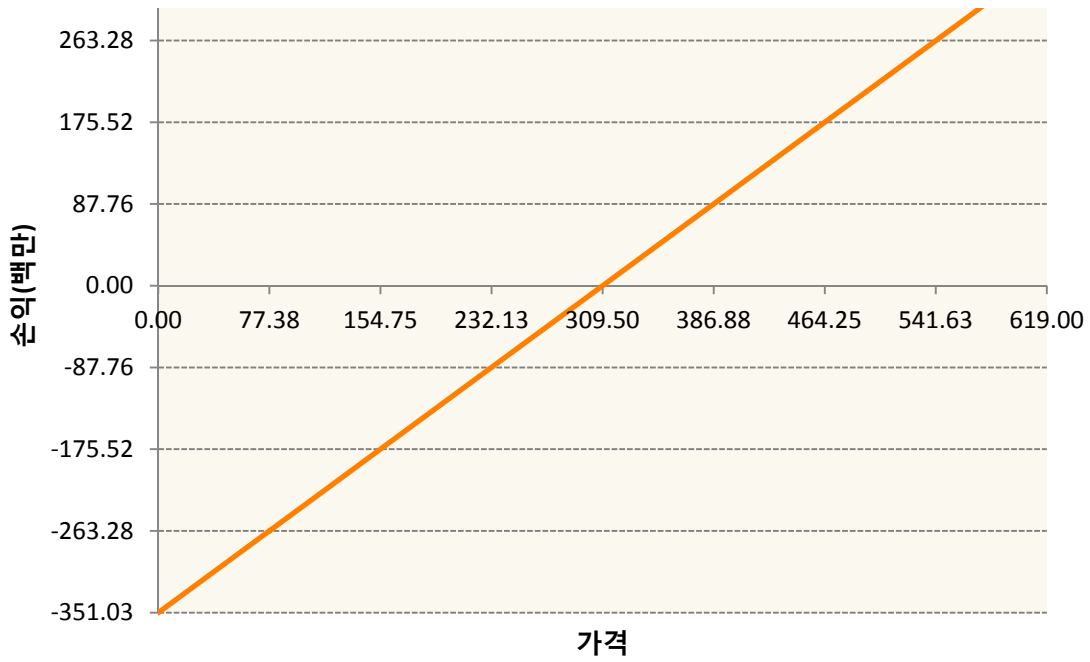


SF9-SOYBEAN FUTURE Jan19

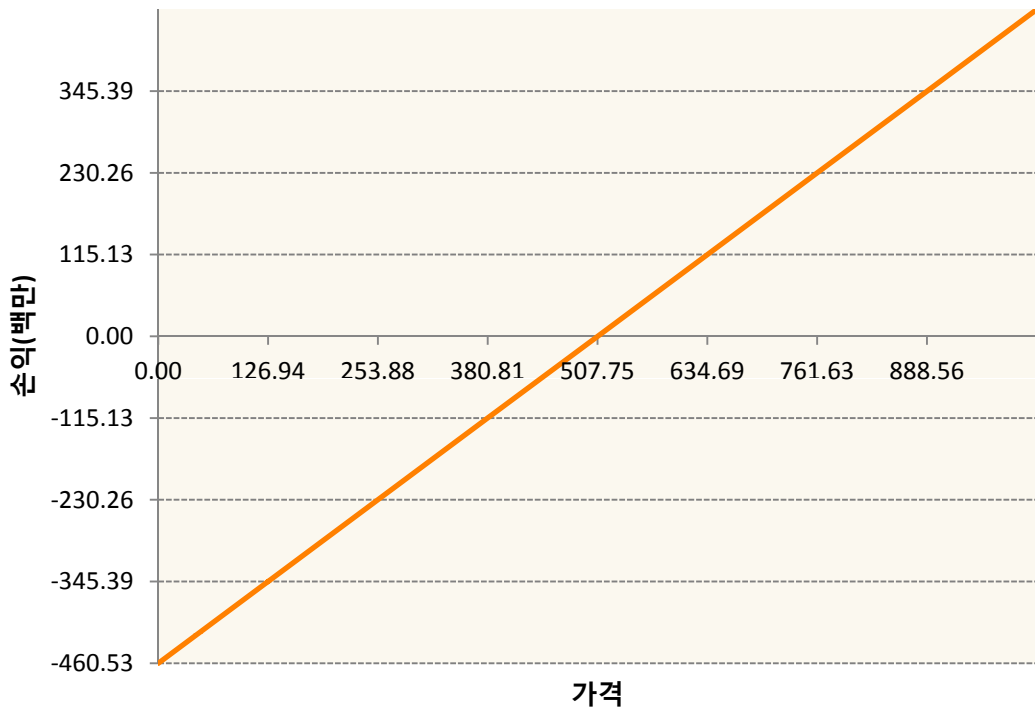


SMF9-SOYBEAN MEAL FUTR Jan19





WH9-WHEAT FUTURE(CBT) Mar19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

BOF9	SOYBEAN OIL FUTR Jan19	23
CH9	CORN FUTURE Mar19	64
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	30
SF9	SOYBEAN FUTURE Jan19	56
SMF9	SOYBEAN MEAL FUTR Jan19	28
WH9	WHEAT FUTURE(CBT) Mar19	37

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

(단위:백만원)

**317**