

공시일	2018-12-06
기준일	2018-12-05

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	2018-12-06
기준일	2018-12-05

스마트인덱스모

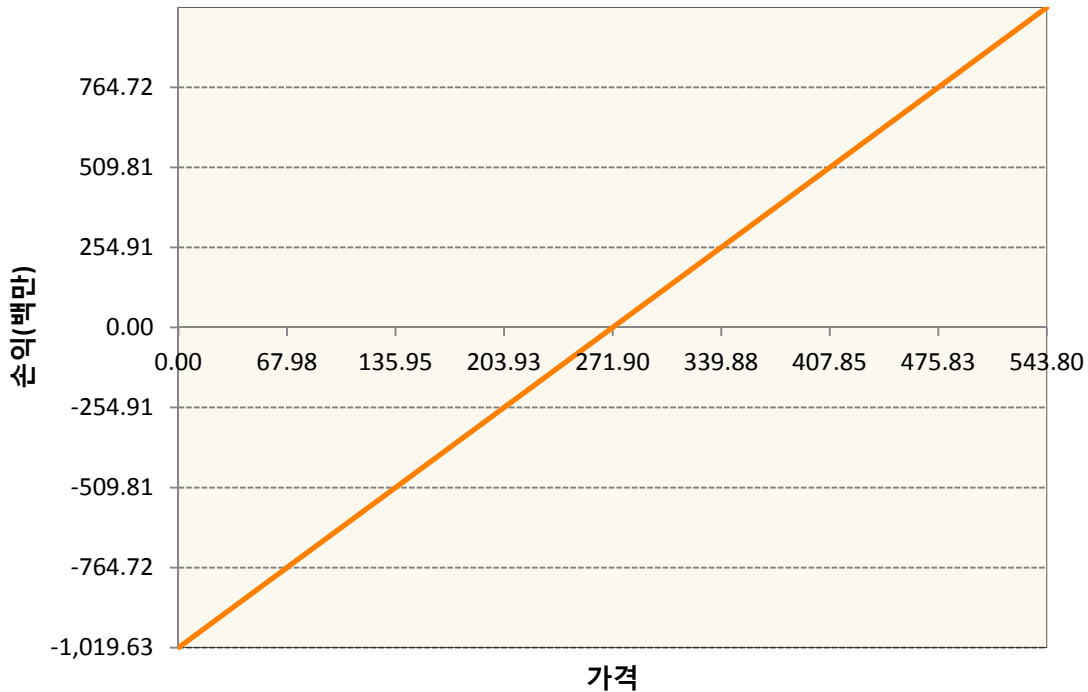
1. 계약금액

(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)

70

공시일	2018-12-06
기준일	2018-12-05

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

1,073

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

542

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2018-12-06
기준일	2018-12-05

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)

406

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2018-12-06
기준일	2018-12-05

유로인덱스모(주식-파생형)

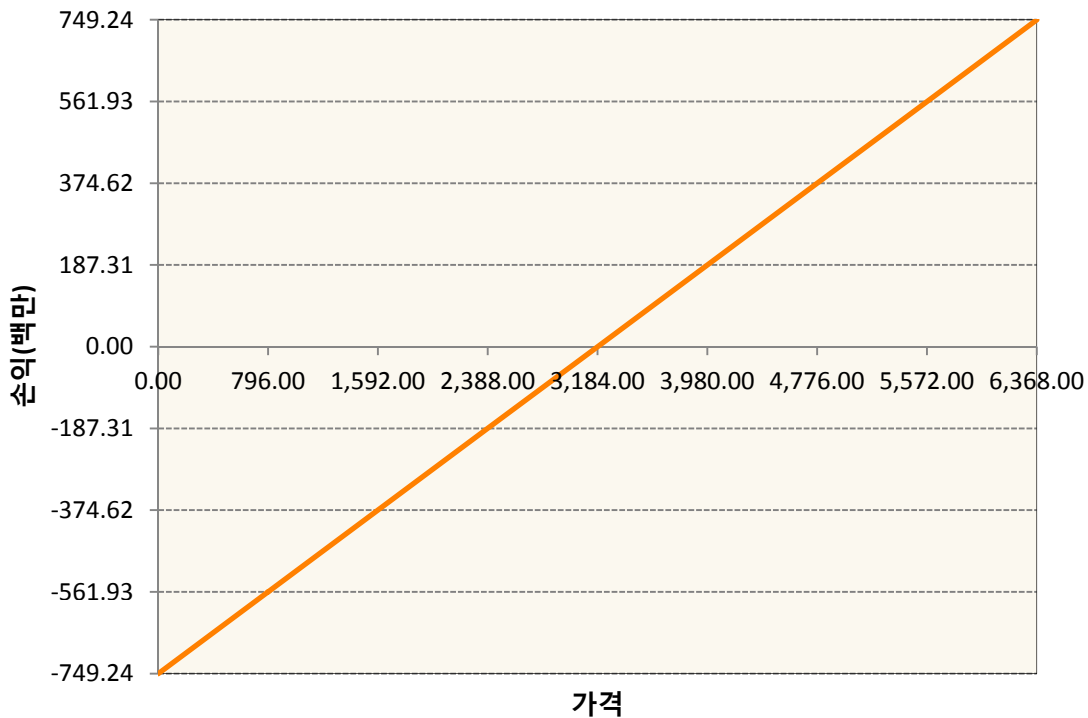
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	749	0	749	

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	2018-12-06
기준일	2018-12-05

차이나인덱스모(주식-파생형)

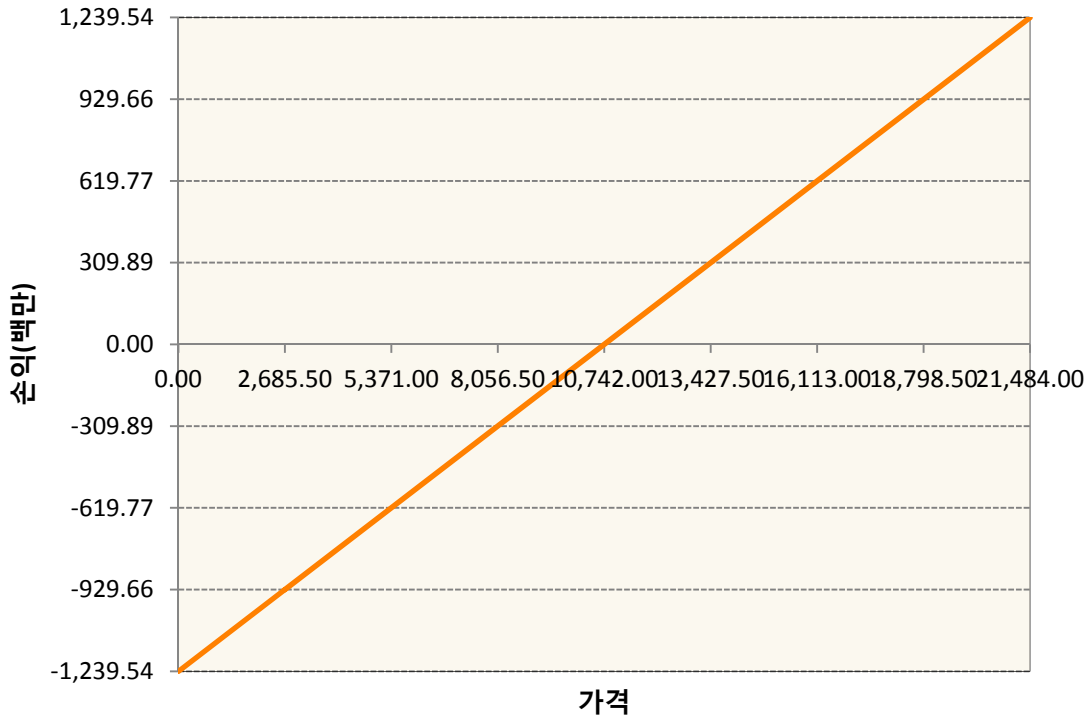
1. 계약금액

(단위:백만원)

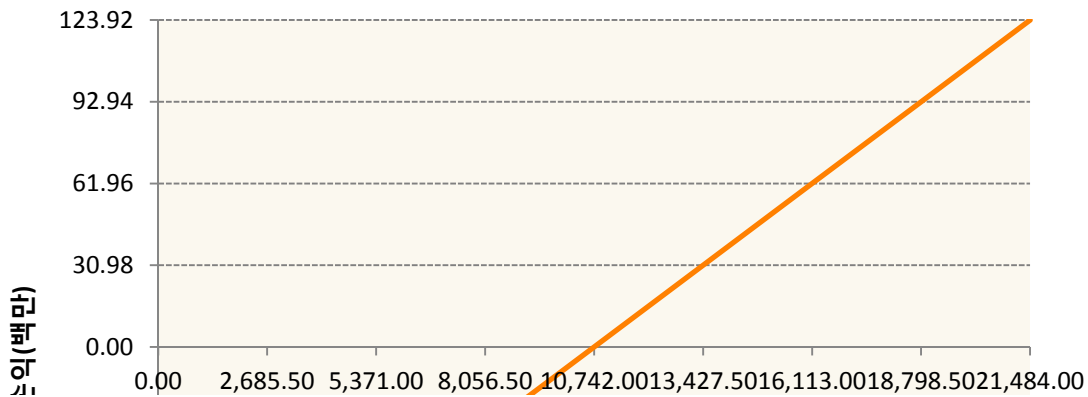
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,240	0	1,240	
누계	유가증권	선물	124	0	124	장내

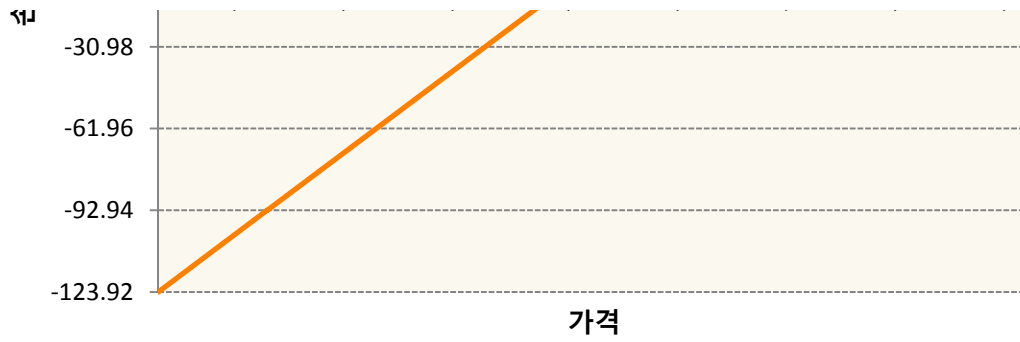
2. 만기시점의 손익구조

HCZ8-HSCEI FUTURES DEC 18



MHCZ8-MINI H-SHR IDX FU DEC18





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

HCZ8	HSCEI FUTURES DEC 18	99
MHCZ8	MINI H-SHR IDX FU DEC18	10

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

98

공시일	2018-12-06
기준일	2018-12-05

커버드콜모(주식혼합-파생형)

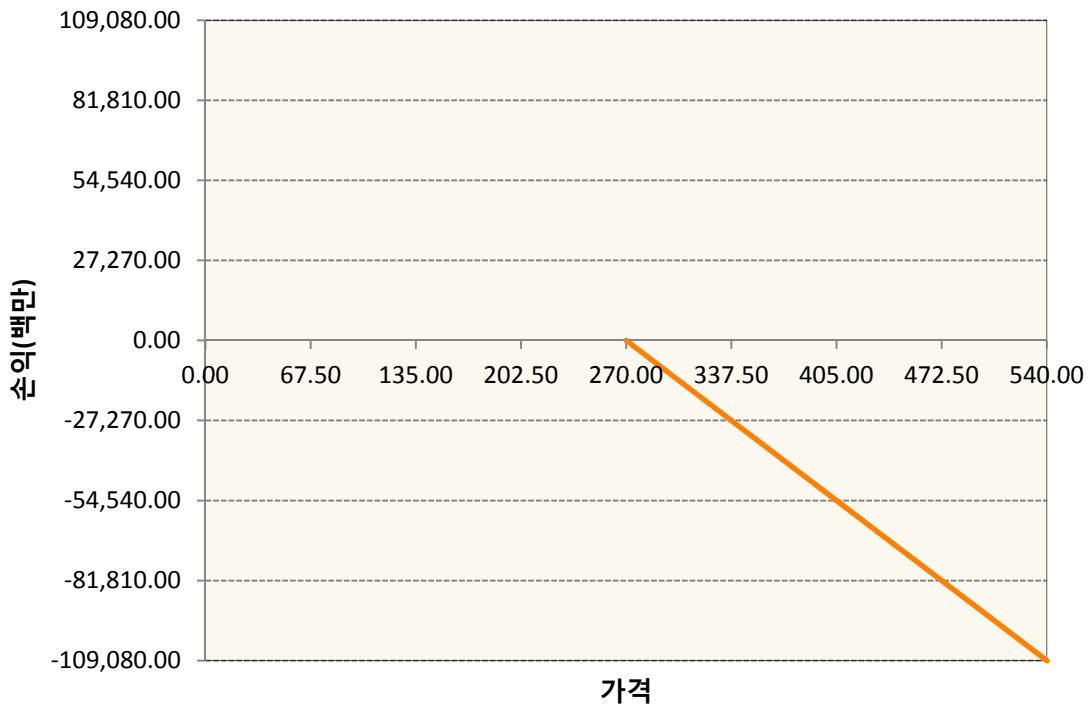
1. 계약금액

(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

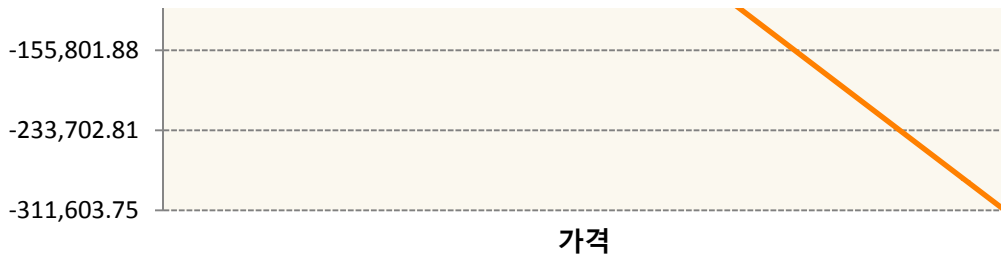
2. 만기시점의 손익구조

KR4201NC2702-2018-12 콜270

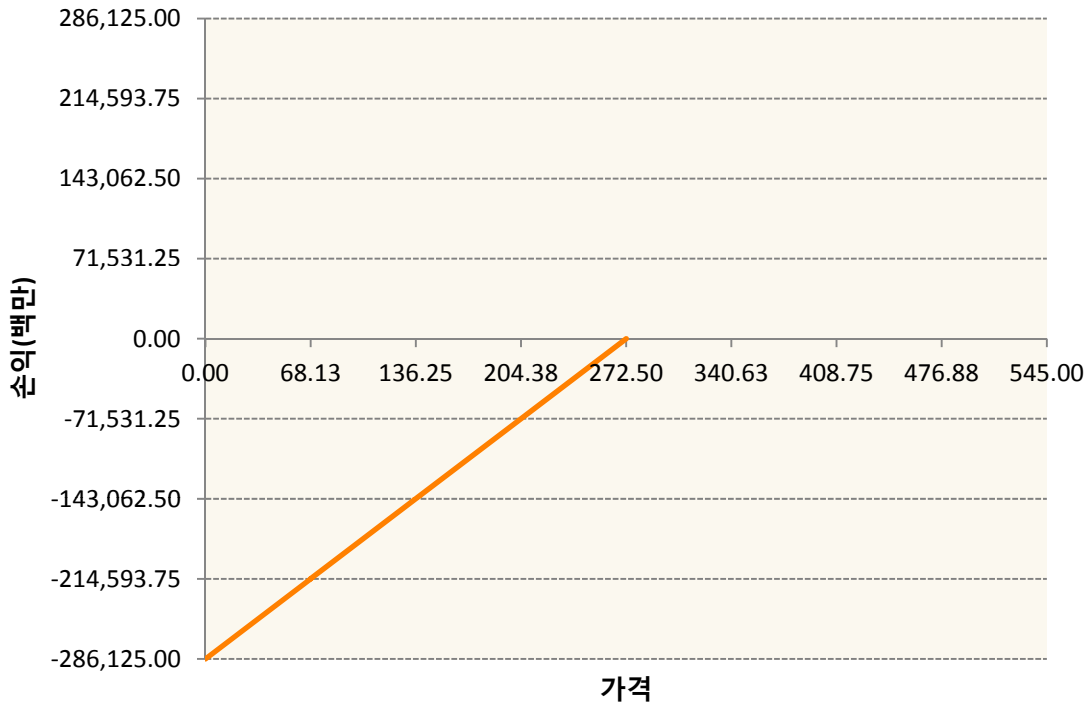


KR4201NC2728-2018-12 콜272.5





KR4301NC2727-2018-12 풋272.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201NC2702		2018-12 콜270					7,398
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	2,084	2,077	2,063	2,044	2,017	1,984	1,943
-5.33%	2,017	1,972	1,916	1,851	1,778	1,697	1,610
-2.67%	1,624	1,507	1,385	1,259	1,131	1,000	867
0%	440	294	147	0	-147	-295	-442
2.67%	-1,685	-1,778	-1,879	-1,988	-2,101	-2,220	-2,342
5.33%	-4,384	-4,416	-4,458	-4,510	-4,572	-4,641	-4,719
8.00%	-7,271	-7,277	-7,288	-7,305	-7,328	-7,359	-7,398
KR4201NC2728		2018-12 콜272.5					19,700
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	4,483	4,472	4,451	4,418	4,368	4,301	4,216

-5.33%	4,390	4,311	4,204	4,071	3,912	3,731	3,528
-2.67%	3,718	3,455	3,168	2,863	2,544	2,211	1,869
0%	1,259	840	420	0	-420	-841	-1,261
2.67%	-3,891	-4,226	-4,577	-4,940	-5,311	-5,691	-6,076
5.33%	-11,106	-11,249	-11,424	-11,628	-11,856	-12,106	-12,375
8.00%	-19,165	-19,200	-19,254	-19,330	-19,431	-19,554	-19,700
KR4301NC2727 2018-12 풋272.5							20,416
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-20,408	-20,408	-20,408	-20,408	-20,409	-20,412	-20,416
-5.33%	-12,812	-12,815	-12,822	-12,836	-12,856	-12,885	-12,924
-2.67%	-5,333	-5,407	-5,498	-5,605	-5,726	-5,860	-6,004
0%	714	477	239	0	-239	-479	-719
2.67%	3,158	3,027	2,879	2,719	2,548	2,368	2,180
5.33%	3,474	3,459	3,435	3,399	3,351	3,290	3,217
8.00%	3,484	3,484	3,483	3,480	3,474	3,464	3,449

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

(단위:백만원)

54,273

공시일	2018-12-06
기준일	2018-12-05

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

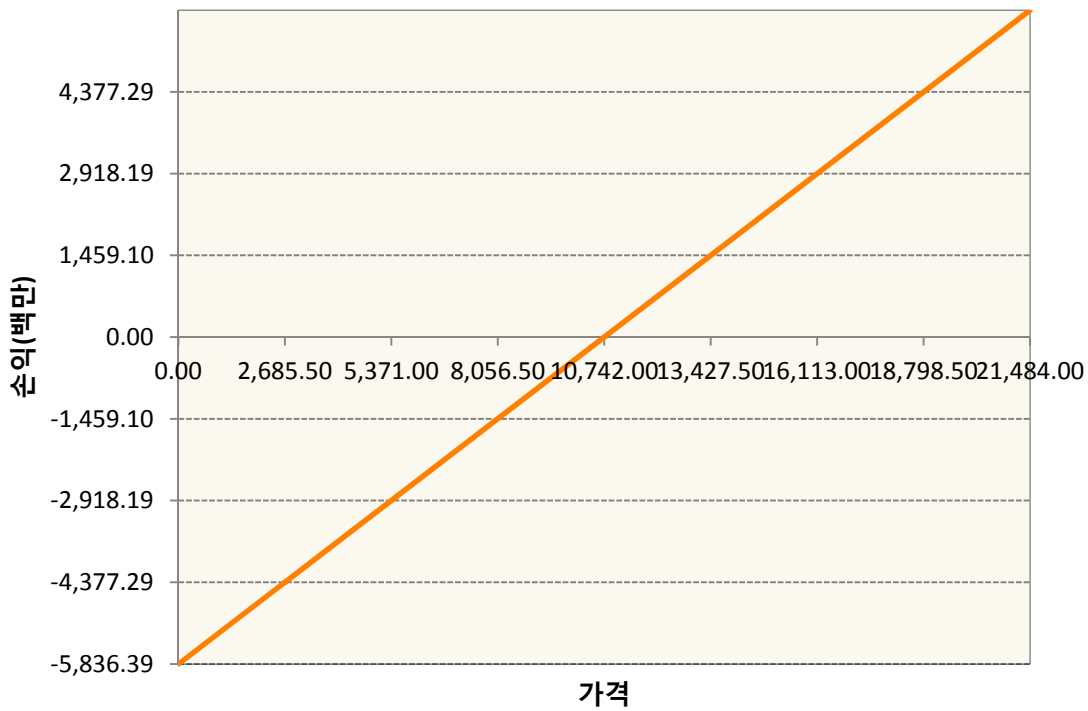
1. 계약금액

(단위:백만원)

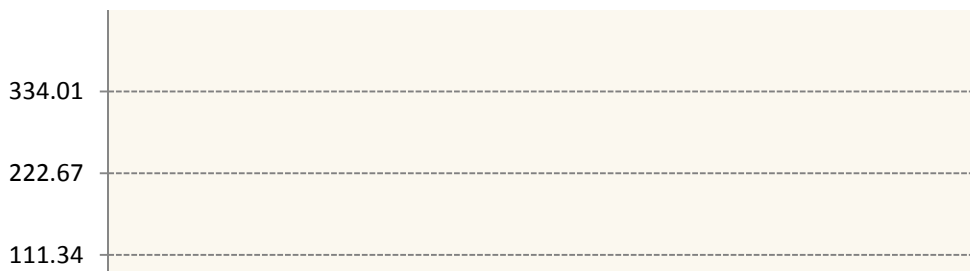
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	5,836	0	5,836	
누계	유가증권	옵션	0	12,692	-12,692	장내
누계	통화	선도	3,141	5,853	-2,712	장외

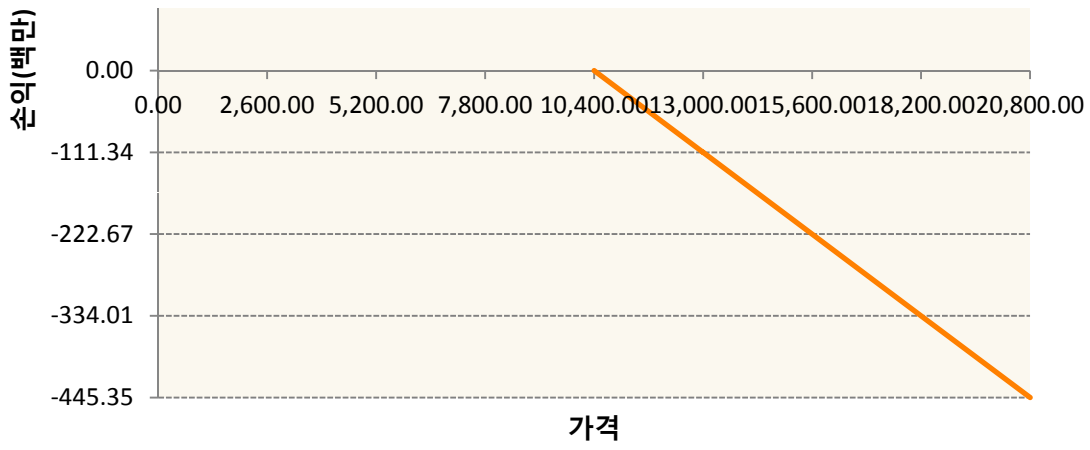
2. 만기시점의 손익구조

HCZ8-HSCEI FUTURES DEC 18

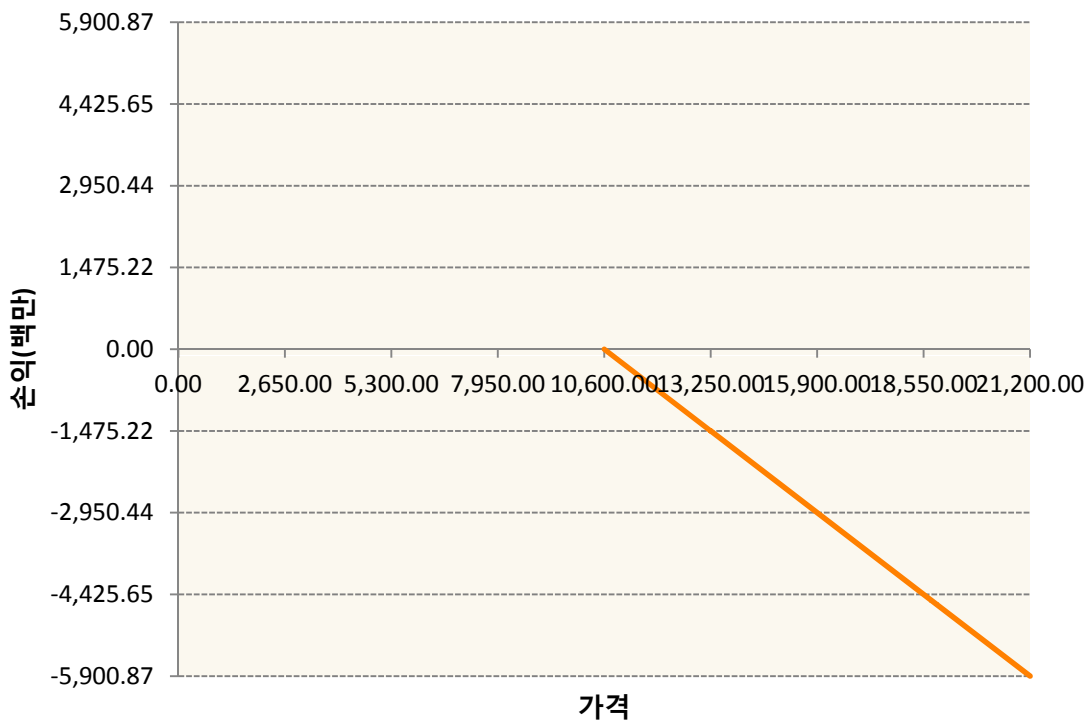


OHHI28-C104-HSCEI

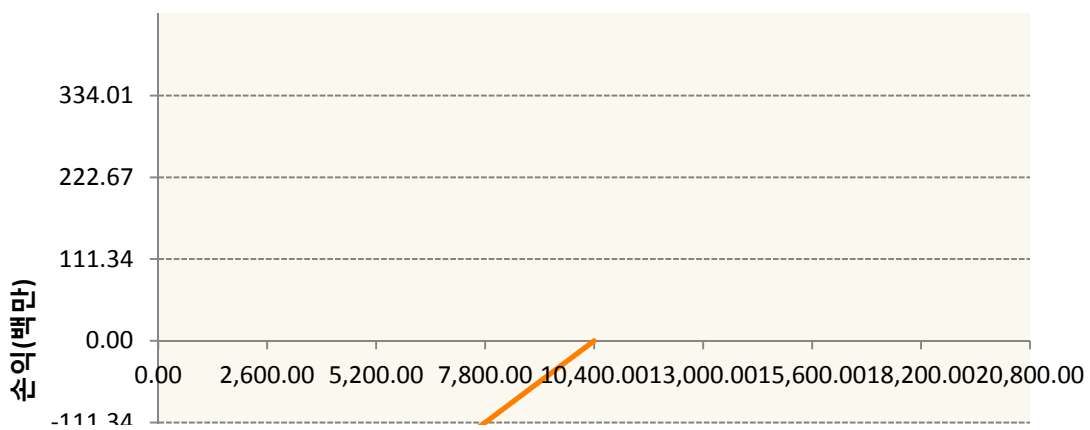


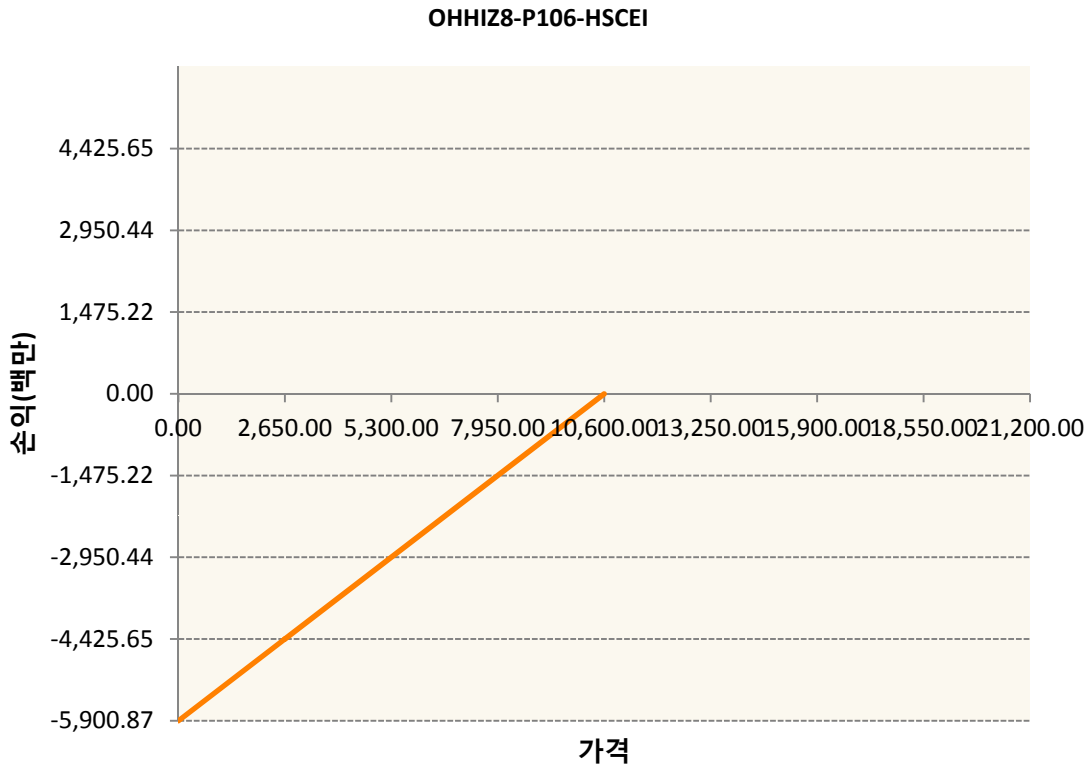
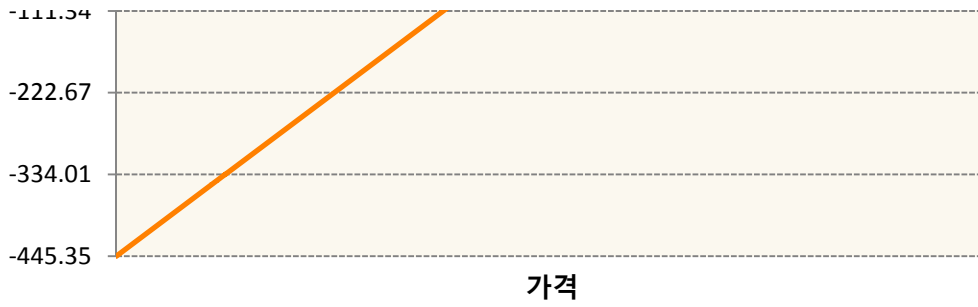


OHHIZ8-C106-HSCEI



OHHIZ8-P104-HSCEI





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FX21018U00 KRW/HKD 10-12-18E	217
FX21018U03 KRW/HKD 10-12-18E	34
FX21018V01 HKD/KRW 10-12-18E	34
FX21018Z00 HKD/KRW 10-12-18E	217
FX21018Z00 KRW/HKD 11-03-19E	217
HCZ8 HSCEI FUTURES DEC 18	467
OHHIZ8-C1C HSCEI	36
OHHIZ8-C1C HSCEI	472
OHHIZ8-P10 HSCEI	36
OHHIZ8-P10 HSCEI	472

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

(단위:백만원)

1,704

공시일	2018-12-06
기준일	2018-12-05

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

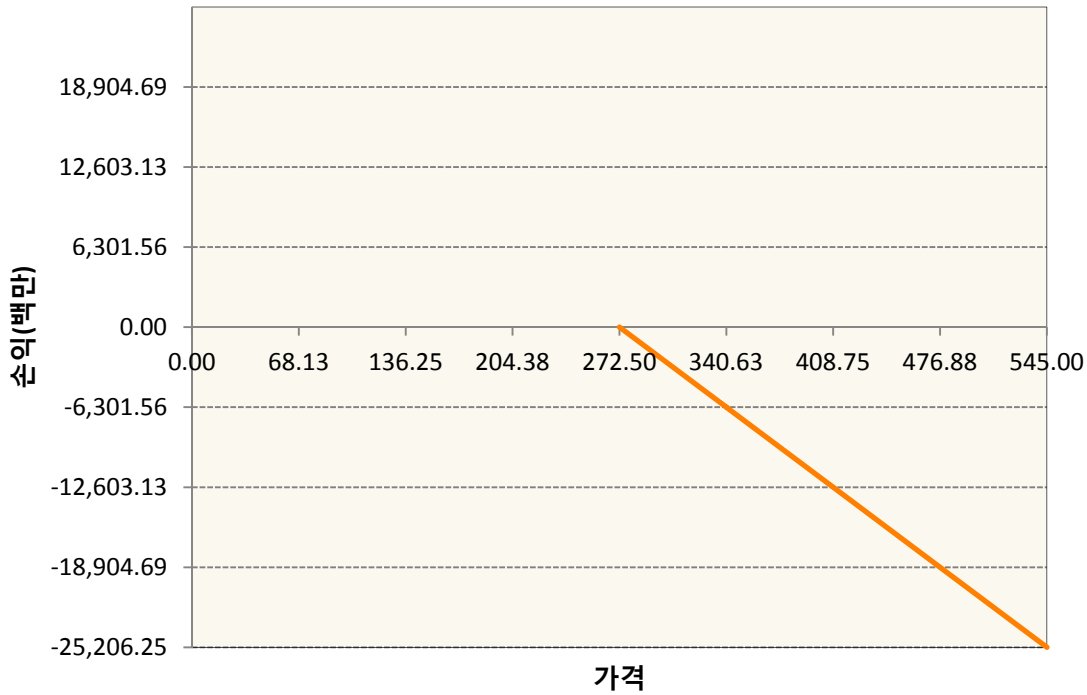
1. 계약금액

(단위:백만원)

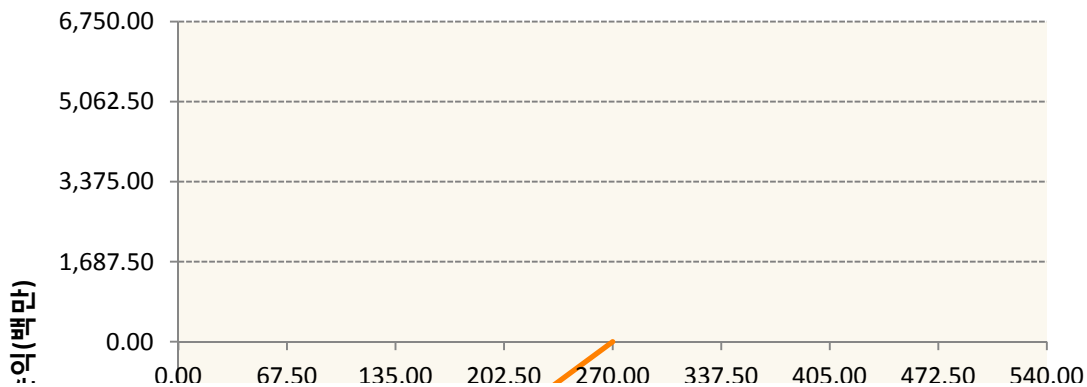
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	스왑	43,836	0	43,836	장외
누계	유가증권	옵션	0	43,538	-43,538	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4201NC2728-2018-12 콜272.5

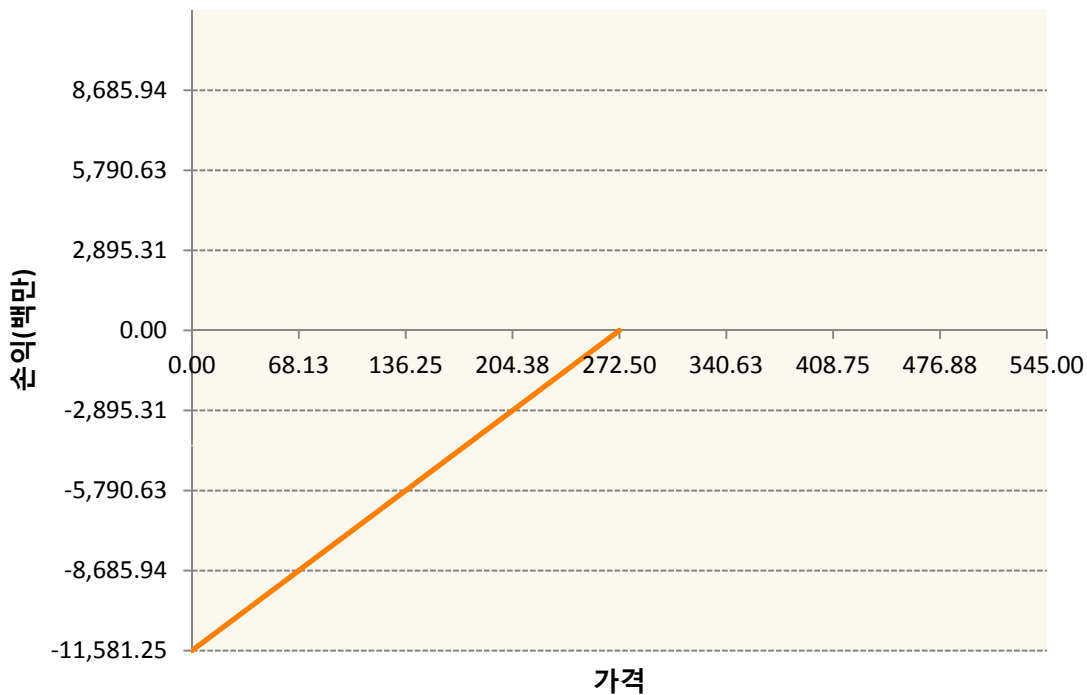


KR4301NC2701-2018-12 풋270





KR4301NC2727-2018-12 풋272.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

	2.529E+11		UBCSFXC1 INDEX_14				3,585
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-3,585	-3,585	-3,585	-3,585	-3,585	-3,585	-3,585
-5.33%	-2,390	-2,390	-2,390	-2,390	-2,390	-2,390	-2,390
-2.67%	-1,195	-1,195	-1,195	-1,195	-1,195	-1,195	-1,195
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	1,195	1,195	1,195	1,195	1,195	1,195	1,195
5.33%	2,390	2,390	2,390	2,390	2,390	2,390	2,390
8.00%	3,585	3,585	3,585	3,585	3,585	3,585	3,585
	KR4201NC2728		2018-12 콜272.5				1,594
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	363	362	360	357	353	348	341
-5.33%	355	349	340	329	316	302	285
-2.67%	301	279	256	232	206	179	151
0%	102	68	34	0	-34	-68	-102
2.67%	-315	-342	-370	-400	-430	-460	-492
5.33%	-898	-910	-924	-941	-959	-979	-1,001
8.00%	-1,550	-1,553	-1,557	-1,564	-1,572	-1,582	-1,594

KR4301NC2701 2018-12 풋270 455

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-454	-454	-454	-454	-454	-455	-455
-5.33%	-274	-274	-274	-275	-276	-277	-279
-2.67%	-101	-104	-107	-111	-115	-119	-124
0%	17	11	6	0	-6	-11	-17
2.67%	49	48	46	43	40	37	34
5.33%	52	52	52	51	51	50	49
8.00%	52	52	52	52	52	52	52

KR4301NC2727 2018-12 풋272.5 826

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-826	-826	-826	-826	-826	-826	-826
-5.33%	-519	-519	-519	-520	-520	-522	-523
-2.67%	-216	-219	-223	-227	-232	-237	-243
0%	29	19	10	0	-10	-19	-29
2.67%	128	123	117	110	103	96	88
5.33%	141	140	139	138	136	133	130
8.00%	141	141	141	141	141	140	140

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

(단위:백만원)

6,836

공시일	2018-12-06
기준일	2018-12-05

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

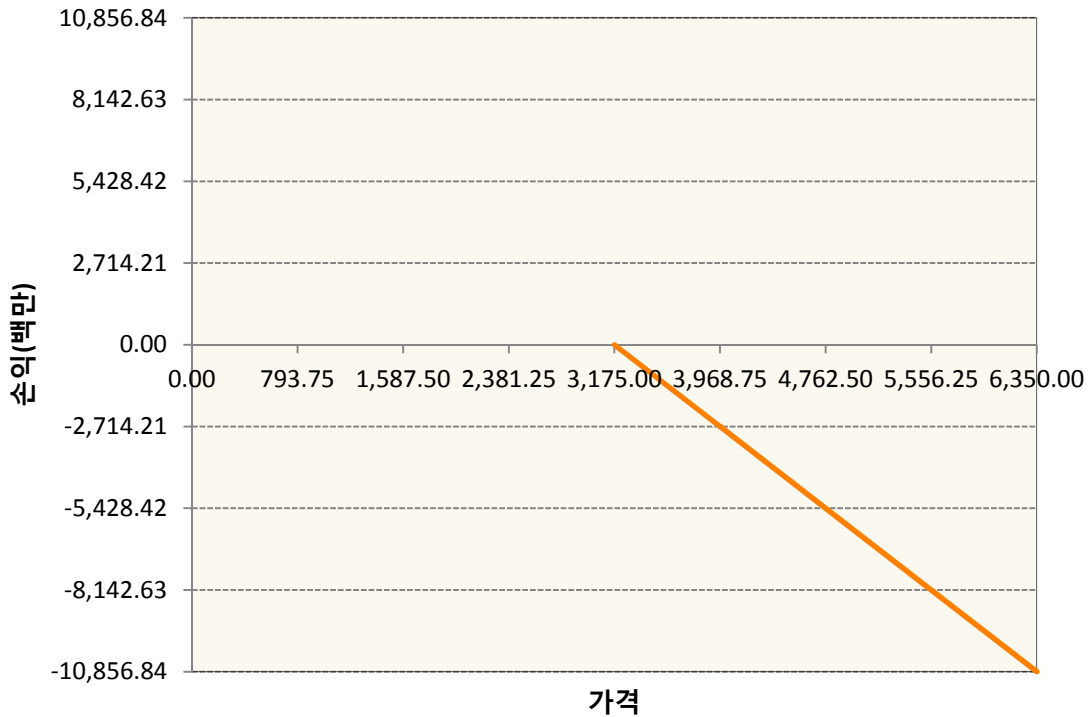
1. 계약금액

(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	8,139	0	8,139	
누계	유가증권	스왑	70,477	0	70,477	장외
누계	유가증권	옵션	0	28,255	-28,255	장내
누계	통화	선도	0	15,142	-15,142	장외

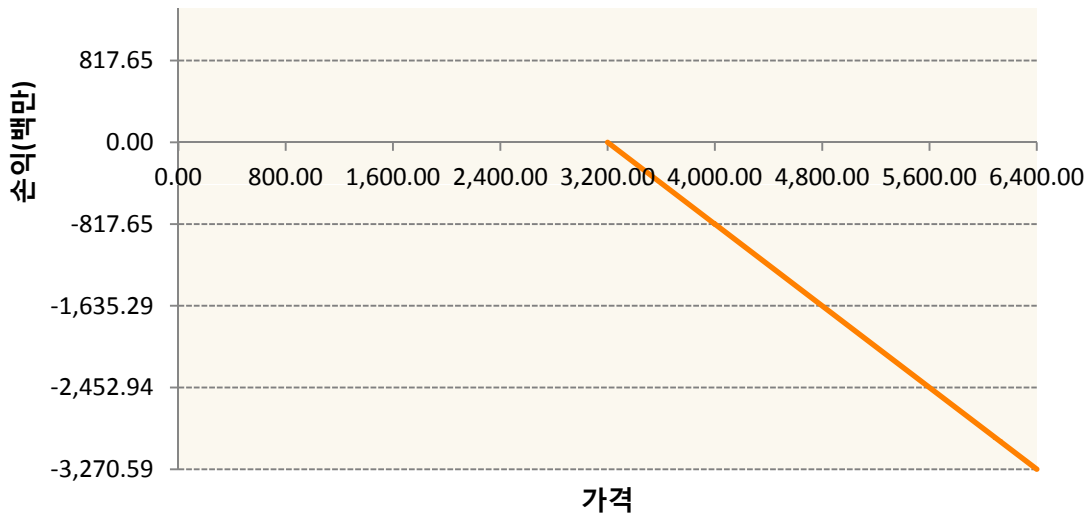
2. 만기시점의 손익구조

OESXZ8-C3175-EURO STOXX 50

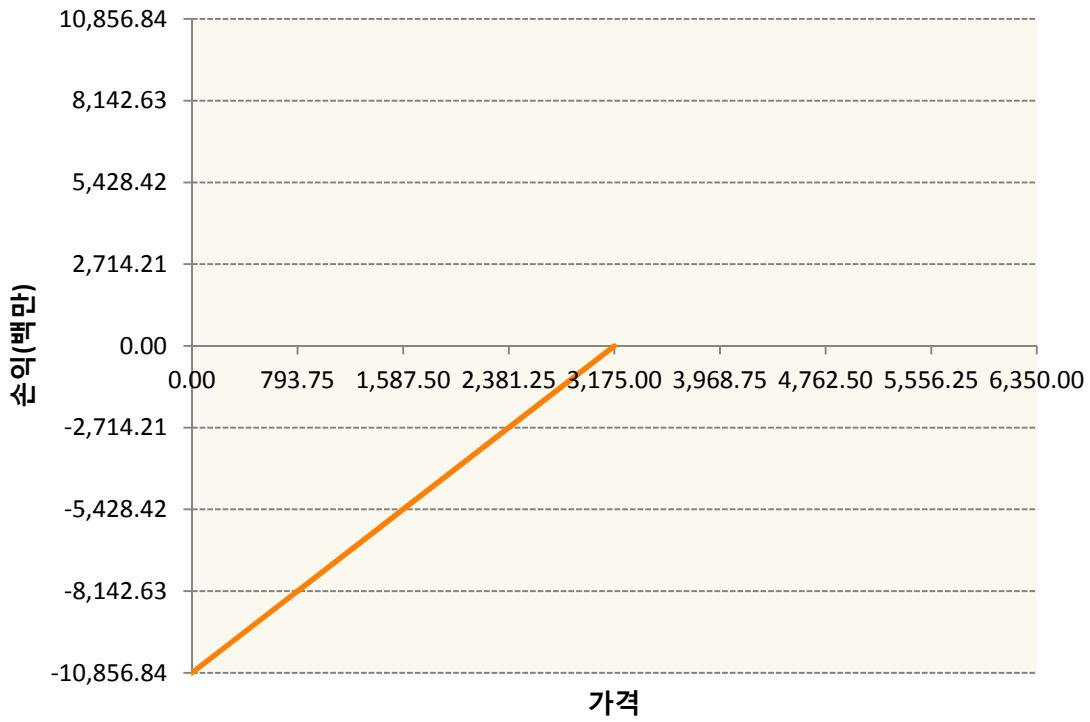


OESXZ8-C3200-EURO STOXX 50

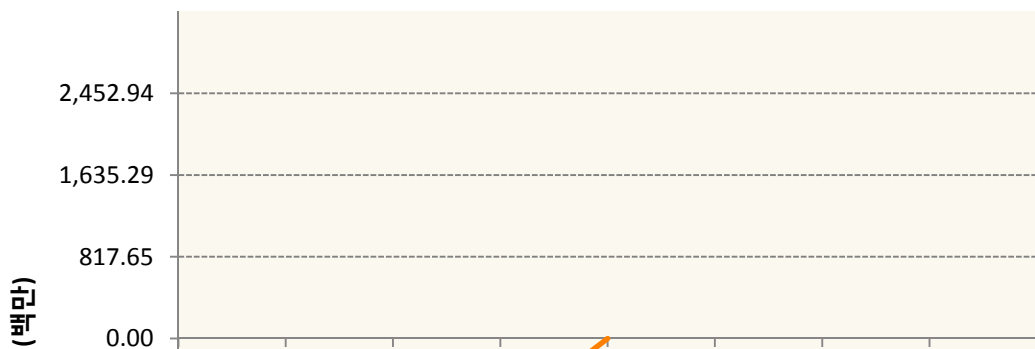


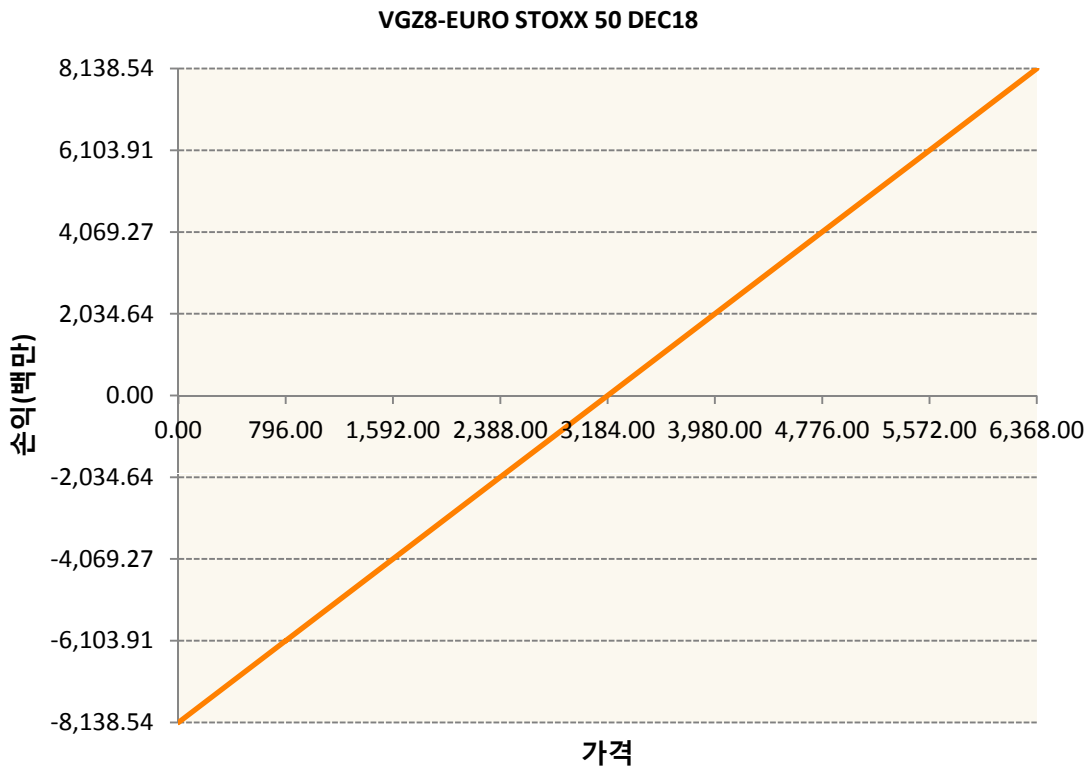
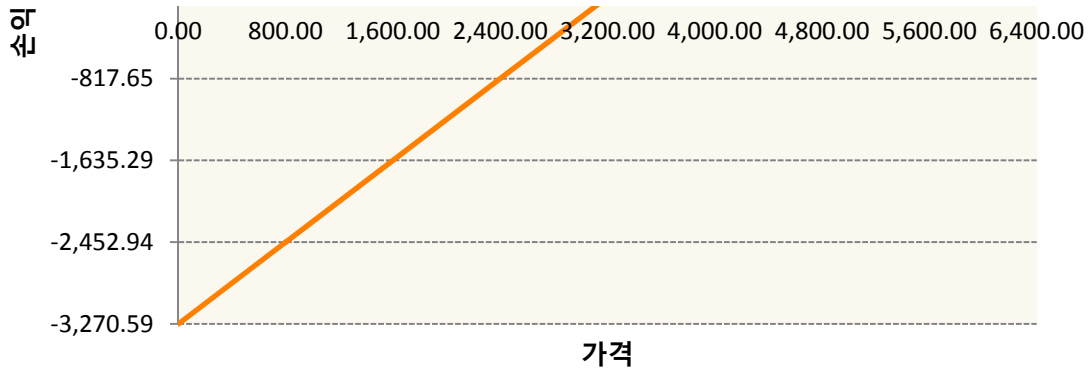


OESXZ8-P3175-EURO STOXX 50



OESXZ8-P3200-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY	87
FX21018U03 KRW/EUR 21-12-18E	808
FX21018X02 KRW/EUR 22-02-19E	404
OESXZ8-C31 EURO STOXX 50	869
OESXZ8-C32 EURO STOXX 50	262
OESXZ8-P31 EURO STOXX 50	869
OESXZ8-P32 EURO STOXX 50	262
VGZ8 EURO STOXX 50 DEC18	651

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

(단위:백만원)

2,622

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

(단위:백만원)

1,106

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

(단위:백만원)

93

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

(단위:백만원)

140

공시일	2018-12-06
기준일	2018-12-05

스마트KRX300인덱스목표전환형1호

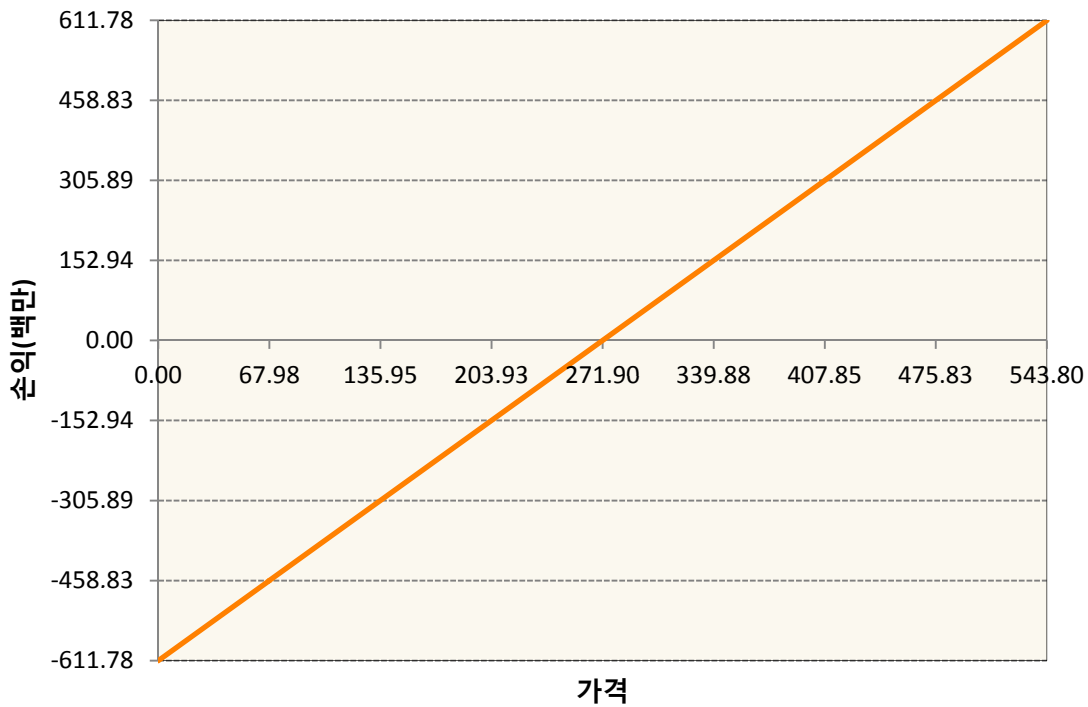
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	612	0	612	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	2018-12-06
기준일	2018-12-05

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

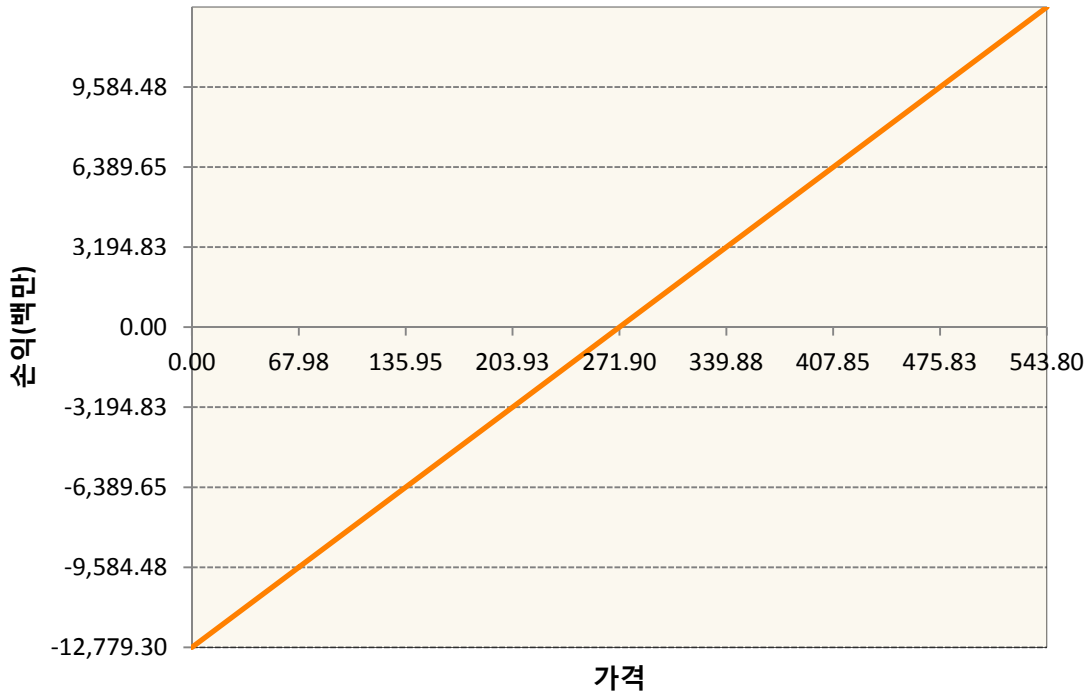
1. 계약금액

(단위:백만원)

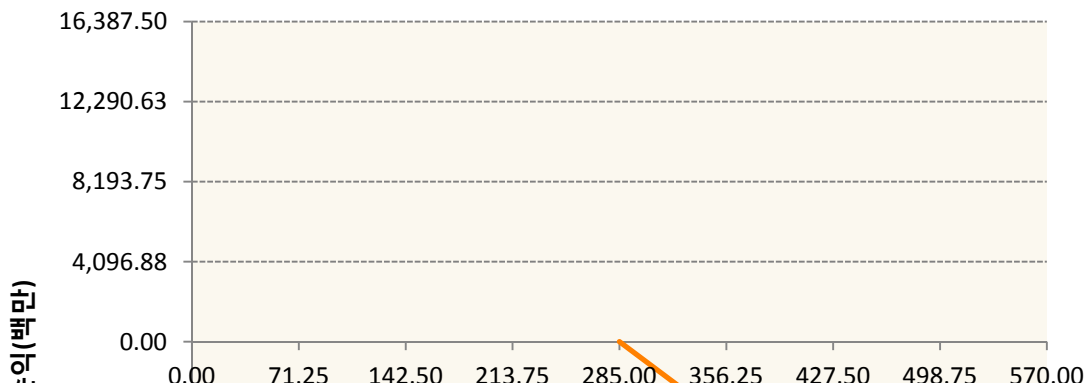
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	12,779	0	12,779	장내
누계	유가증권	옵션	3,743	23,072	-19,329	장내

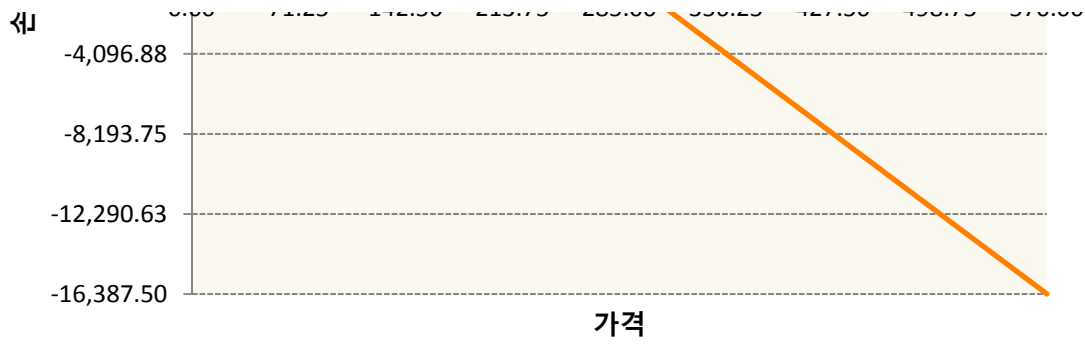
2. 만기시점의 손익구조

KR4101NC0004-2018-12 코스피200지수선물

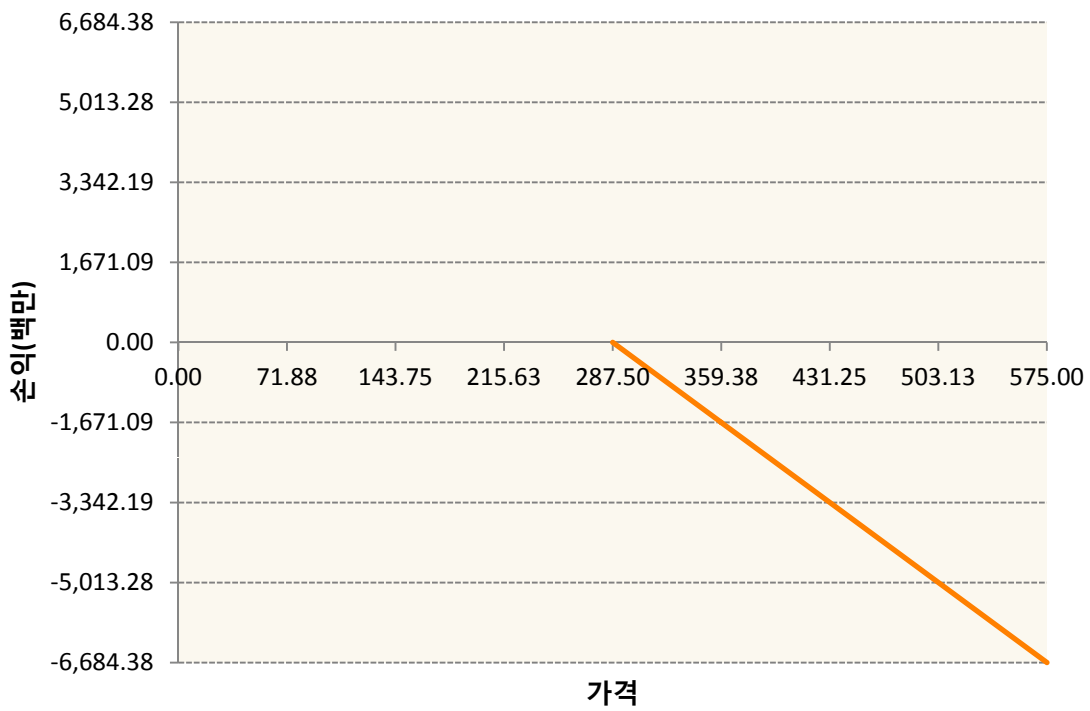


KR4201NC2850-2018-12 콜285

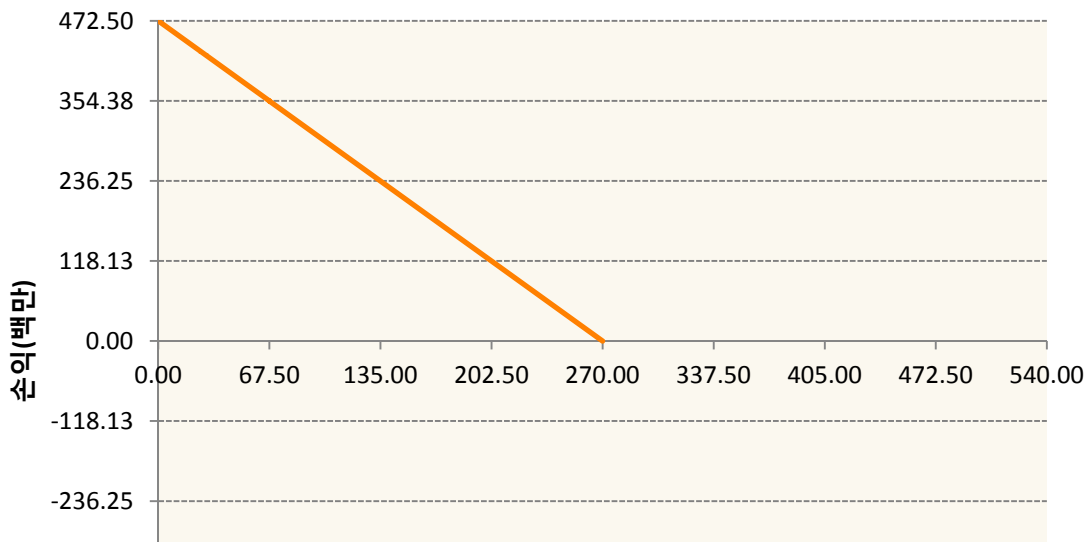


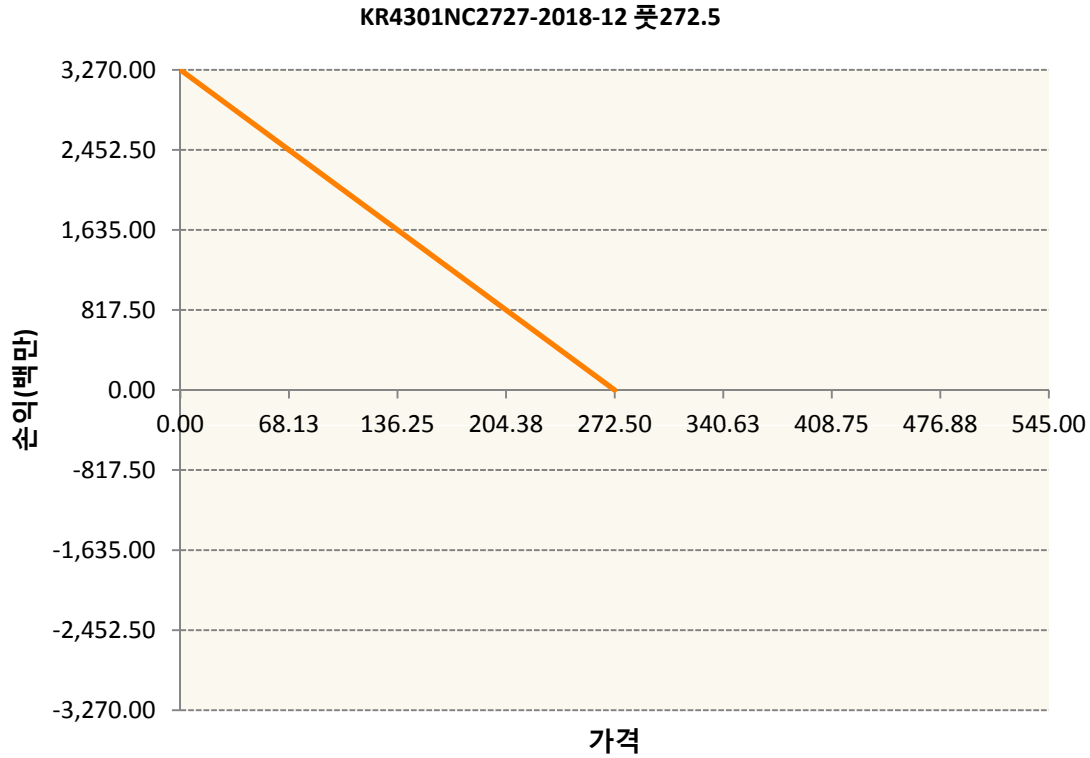
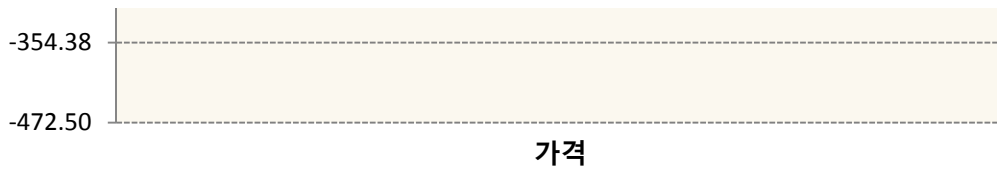


KR4201NC2876-2018-12 콜287.5



KR4301NC2701-2018-12 풋270





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101NC0004		2018-12 코스피200지수선물						1,021
		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						586
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	37	37	37	37	37	37	36	
-5.33%	37	37	37	36	35	33	31	
-2.67%	36	35	32	29	25	19	13	

0%	26	19	10	0	-11	-24	-37
2.67%	-30	-47	-65	-84	-103	-123	-143
5.33%	-191	-213	-236	-258	-280	-302	-324
8.00%	-481	-497	-513	-531	-549	-567	-586
KR4201NC2876 2018-12 콜287.5							204
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	10	10	10	10	10	9	9
-5.33%	10	10	9	9	9	9	8
-2.67%	9	9	9	8	7	5	3
0%	7	5	3	0	-4	-8	-12
2.67%	-7	-12	-18	-25	-32	-39	-46
5.33%	-55	-64	-73	-82	-91	-100	-109
8.00%	-155	-163	-170	-179	-187	-195	-204
KR4301NC2701 2018-12 풋270							32
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	32	32	32	32	32	32	32
-5.33%	19	19	19	19	19	19	20
-2.67%	7	7	8	8	8	8	9
0%	-1	-1	0	0	0	1	1
2.67%	-3	-3	-3	-3	-3	-3	-2
5.33%	-4	-4	-4	-4	-4	-4	-3
8.00%	-4	-4	-4	-4	-4	-4	-4
KR4301NC2727 2018-12 풋272.5							233
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	233	233	233	233	233	233	233
-5.33%	146	146	147	147	147	147	148
-2.67%	61	62	63	64	65	67	69
0%	-8	-5	-3	0	3	5	8
2.67%	-36	-35	-33	-31	-29	-27	-25
5.33%	-40	-40	-39	-39	-38	-38	-37
8.00%	-40	-40	-40	-40	-40	-40	-39

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

(단위:백만원)

1,587

공시일	2018-12-06
기준일	2018-12-05

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	2018-12-06
기준일	2018-12-05

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	1,516	0	1,516	

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	2018-12-06
기준일	2018-12-05

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	193	0	193	
누계	통화	선도	0	402	-402	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
FX21018Z00 KRW/USD 28-02-19E		17

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

(단위:백만원)

12

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

(단위:백만원)

147

공시일	2018-12-06
기준일	2018-12-05

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

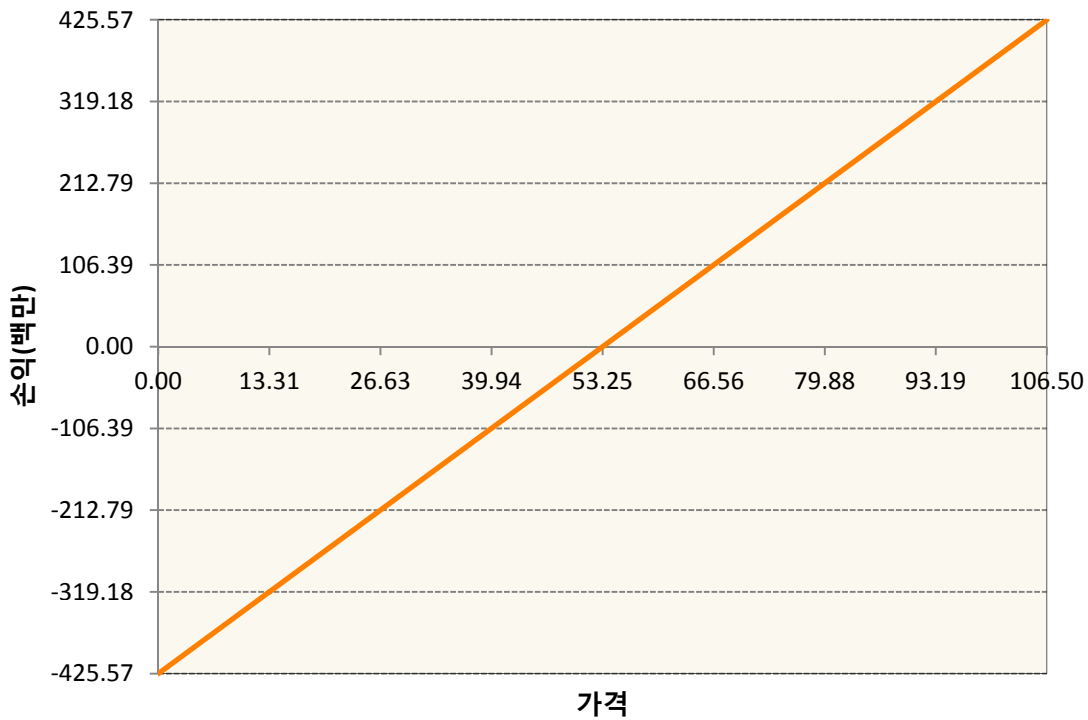
1. 계약금액

(단위:백만원)

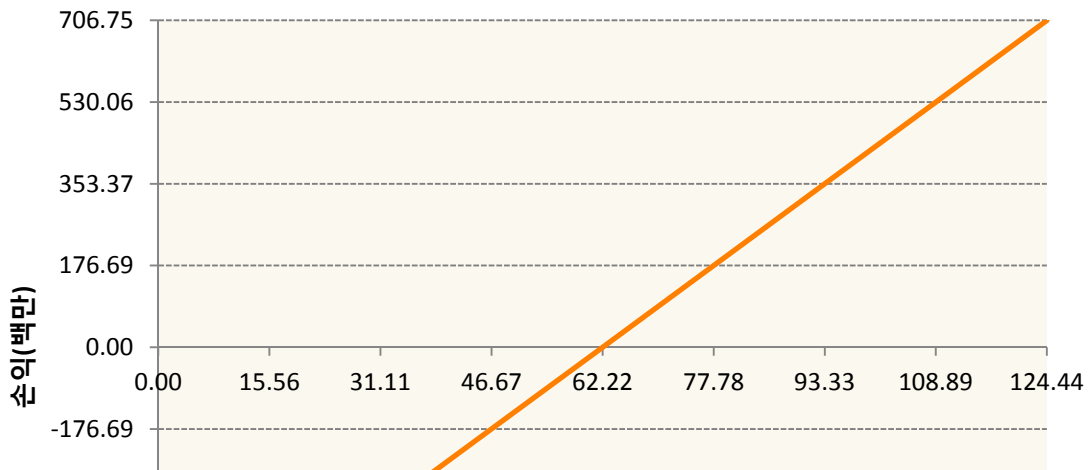
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,033	256	2,777	

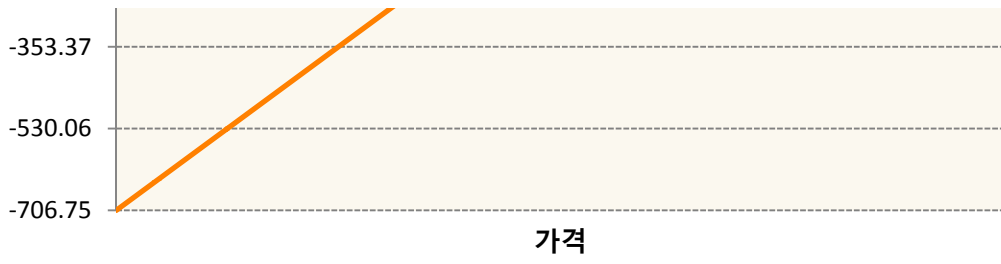
2. 만기시점의 손익구조

CLF9-WTI CRUDE FUTURE Jan19

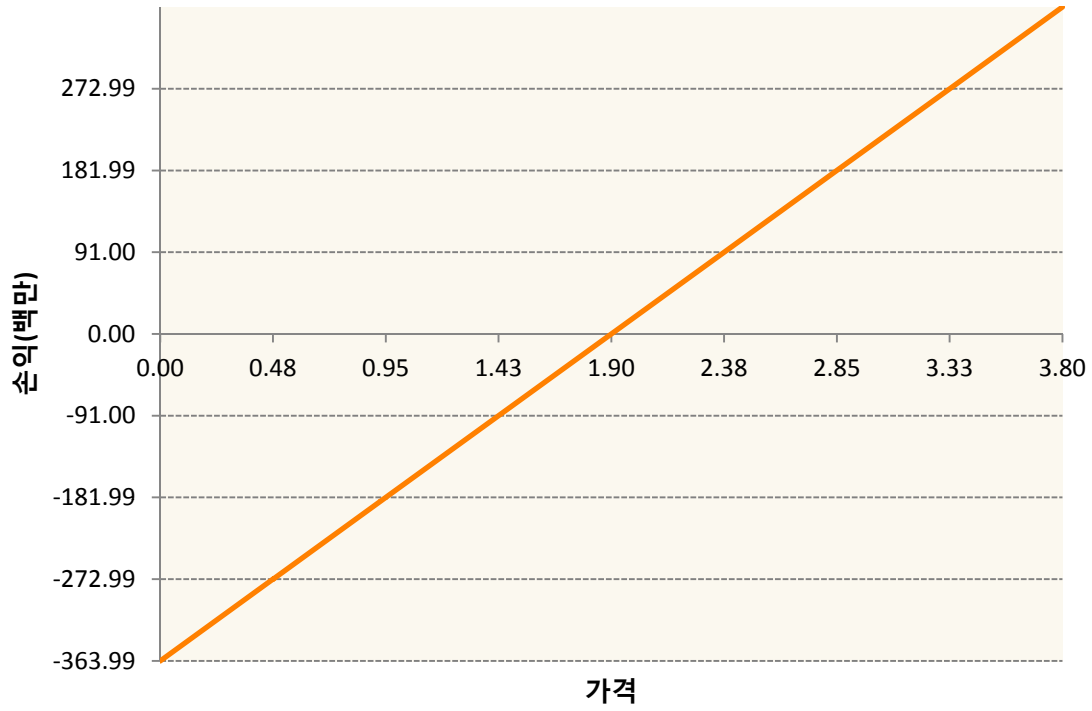


COH9-BRENT CRUDE FUTR Mar19

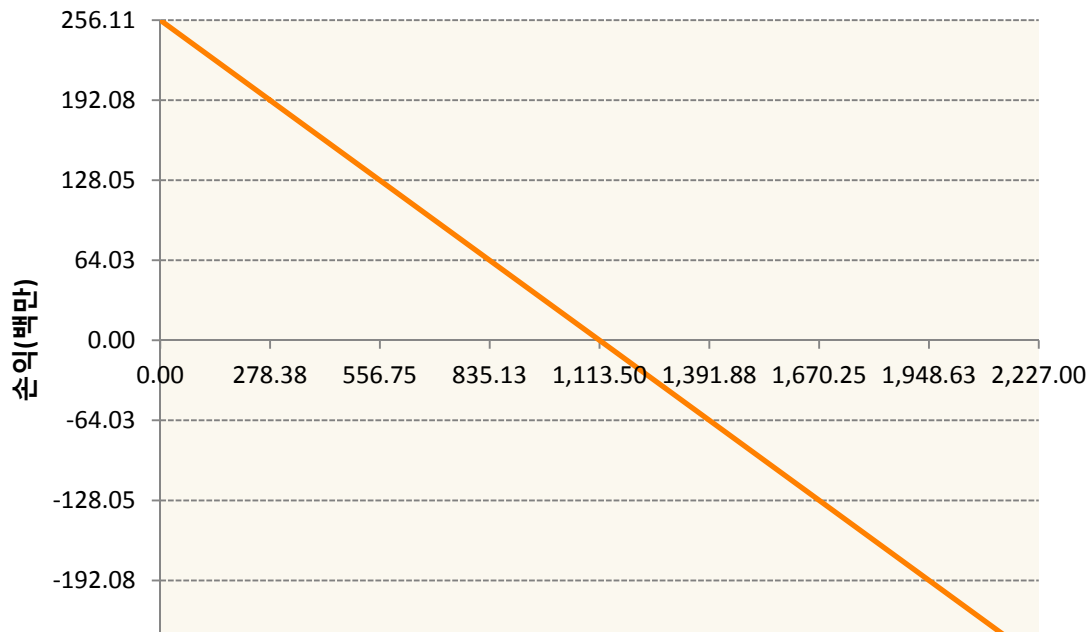


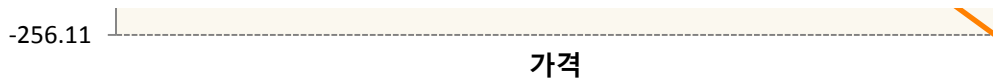


HOF9-NY Harb ULSD Fut Jan19

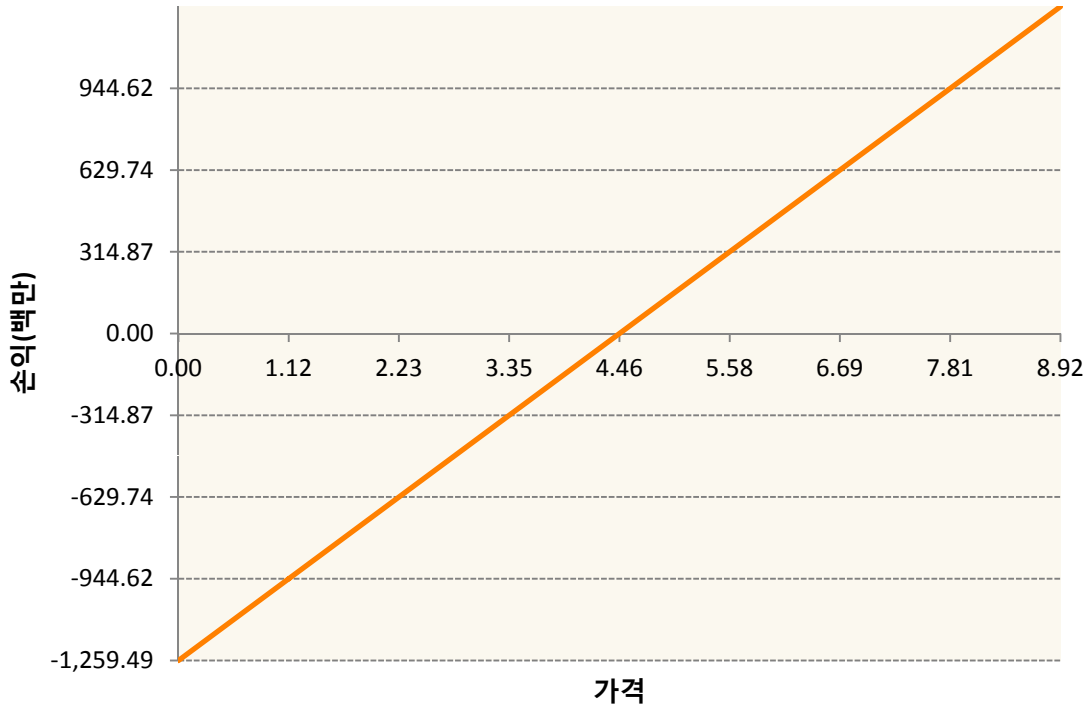


KR4175NC0005-2018-12 달러선물

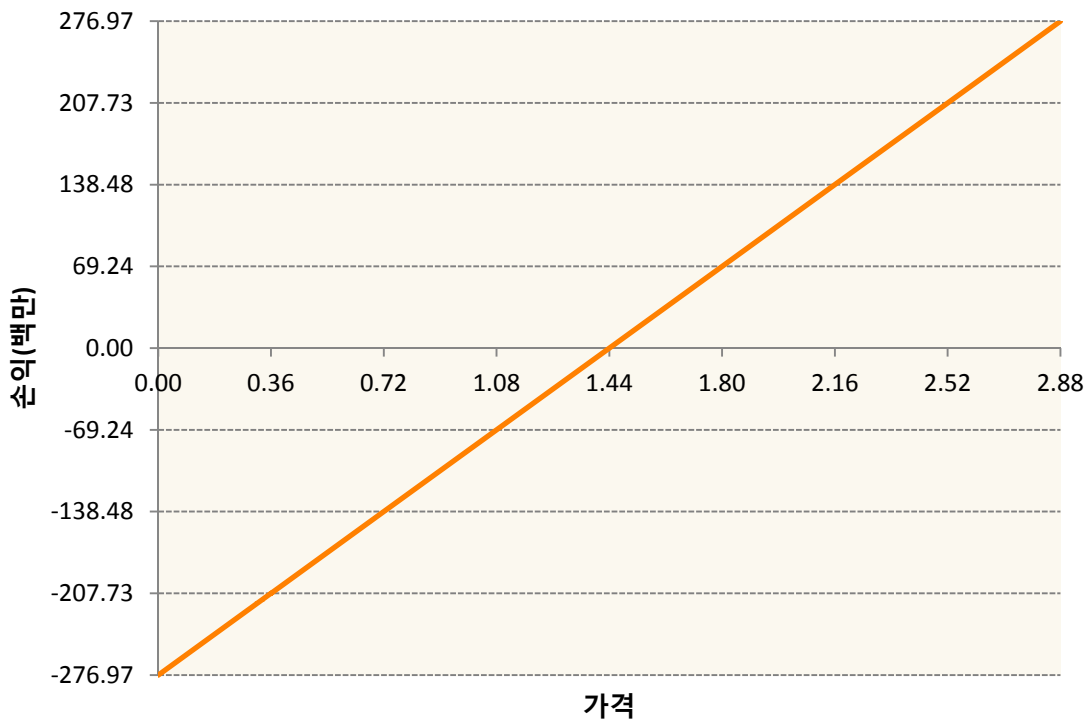




NGF19-NATURAL GAS FUTR Jan19



XBF9-GASOLINE RBOB FUT Jan19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLF9	WTI CRUDE FUTURE Jan19	34
COH9	BRENT CRUDE FUTR Mar19	57
HOF9	NY Harb ULSD Fut Jan19	29
KR4175NC0	(2018-12 달러선물	20
NGF19	NATURAL GAS FUTR Jan19	101
XBF9	GASOLINE RBOB FUT Jan19	22

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

433

공시일	2018-12-06
기준일	2018-12-05

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

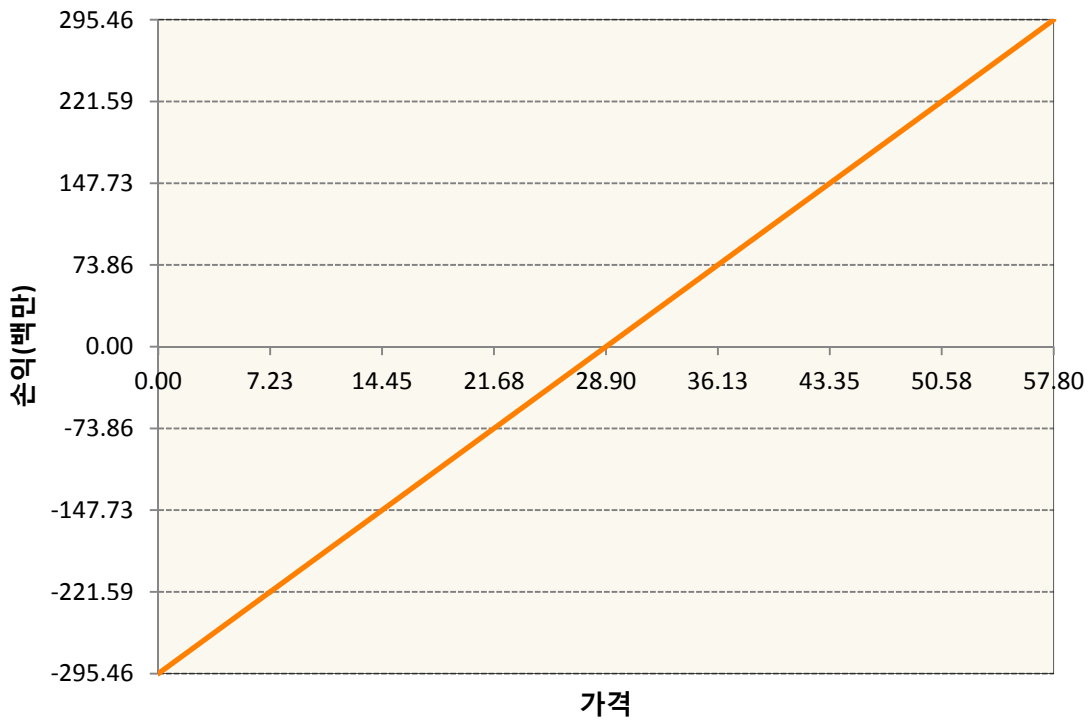
1. 계약금액

(단위:백만원)

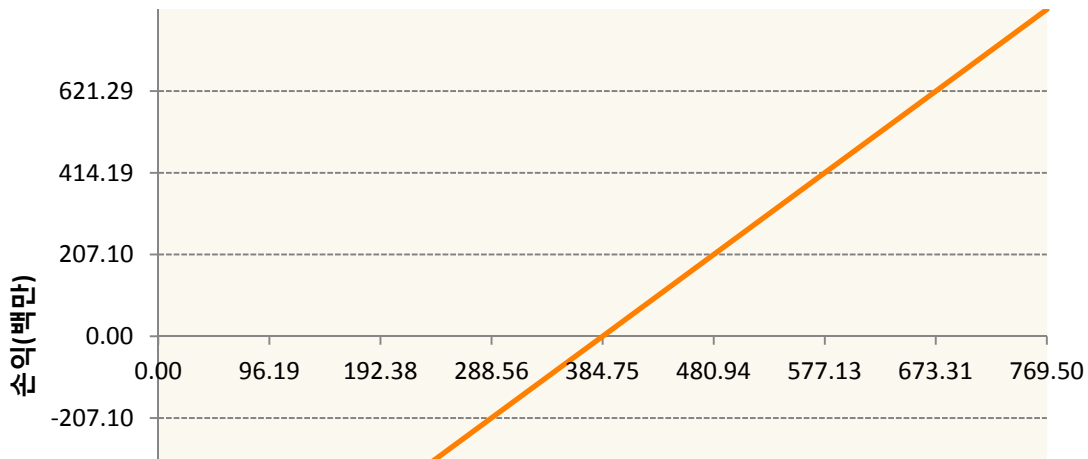
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,702	78	3,624	

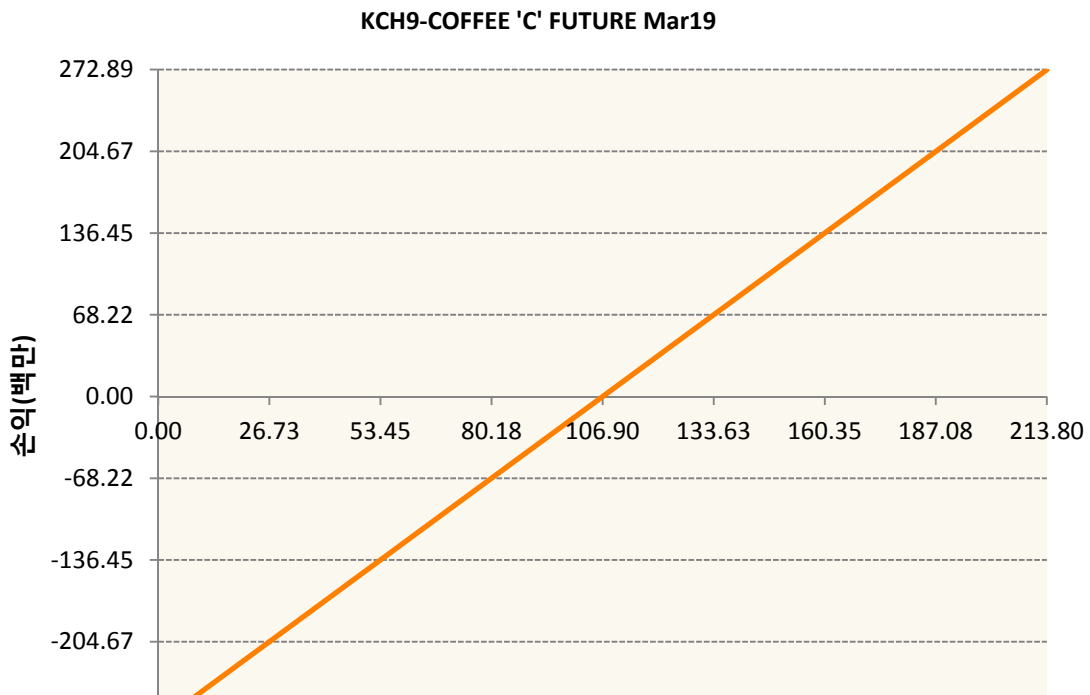
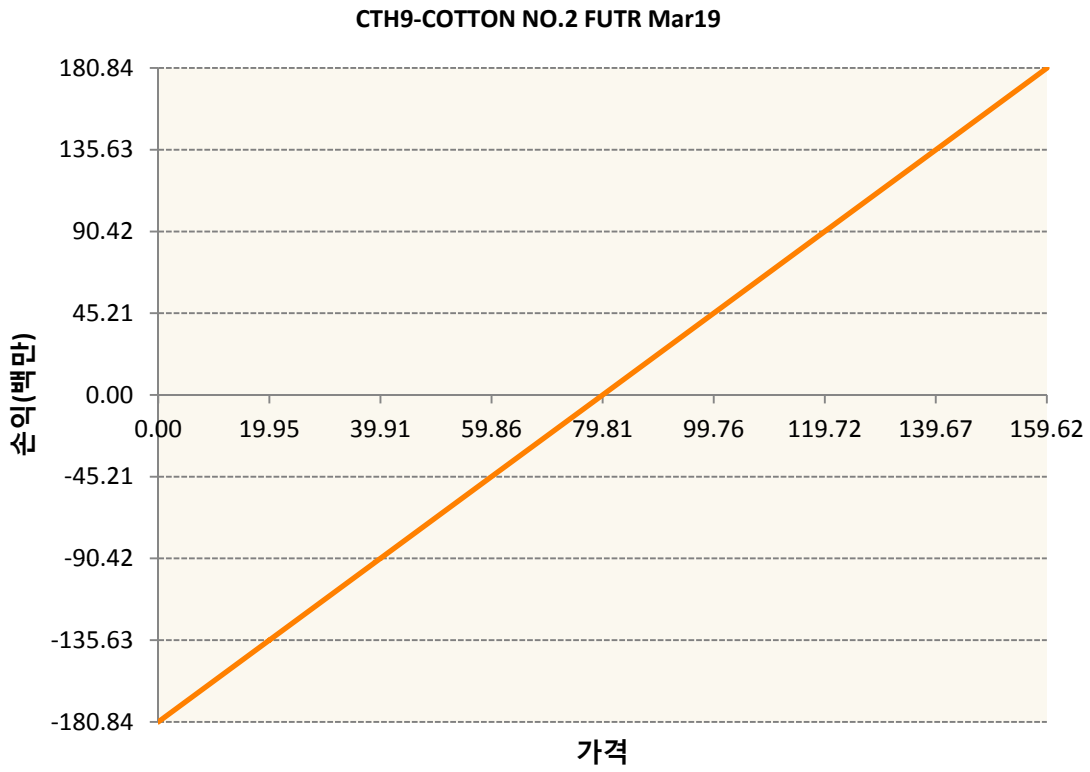
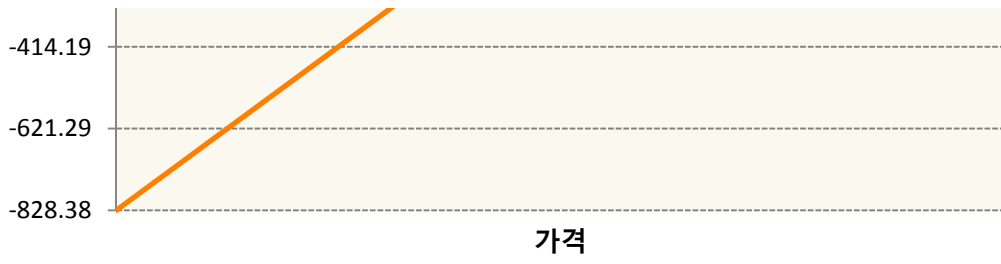
2. 만기시점의 손익구조

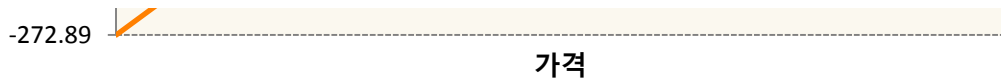
BOF9-SOYBEAN OIL FUTR Jan19



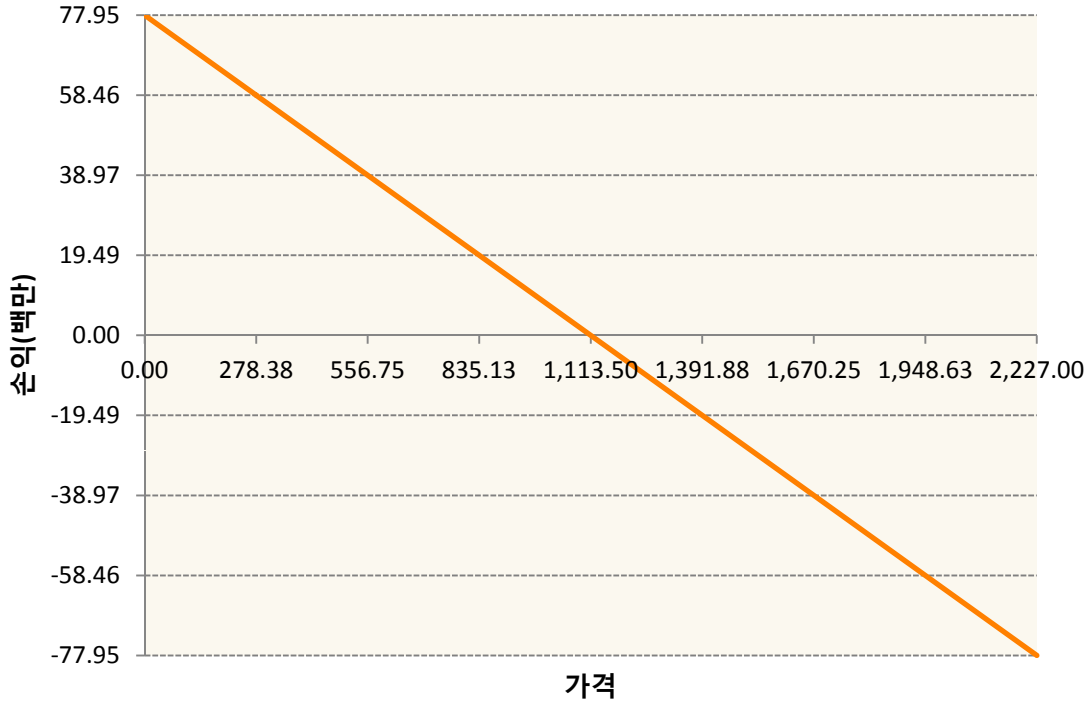
CH9-CORN FUTURE Mar19



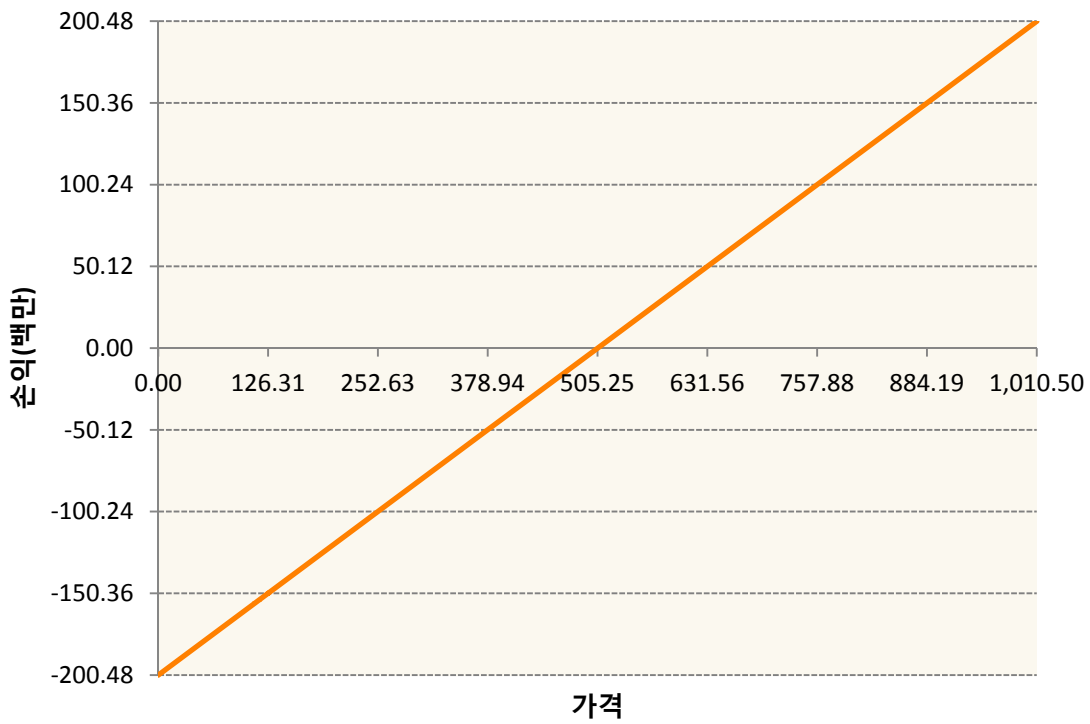




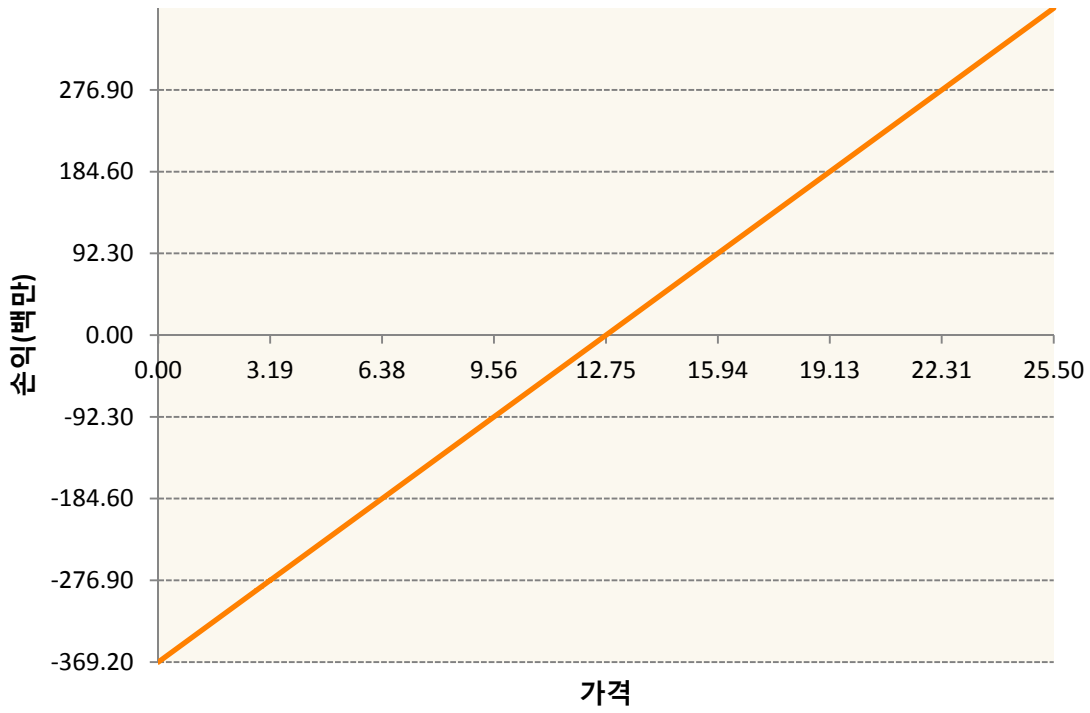
KR4175NC0005-2018-12 달러선물



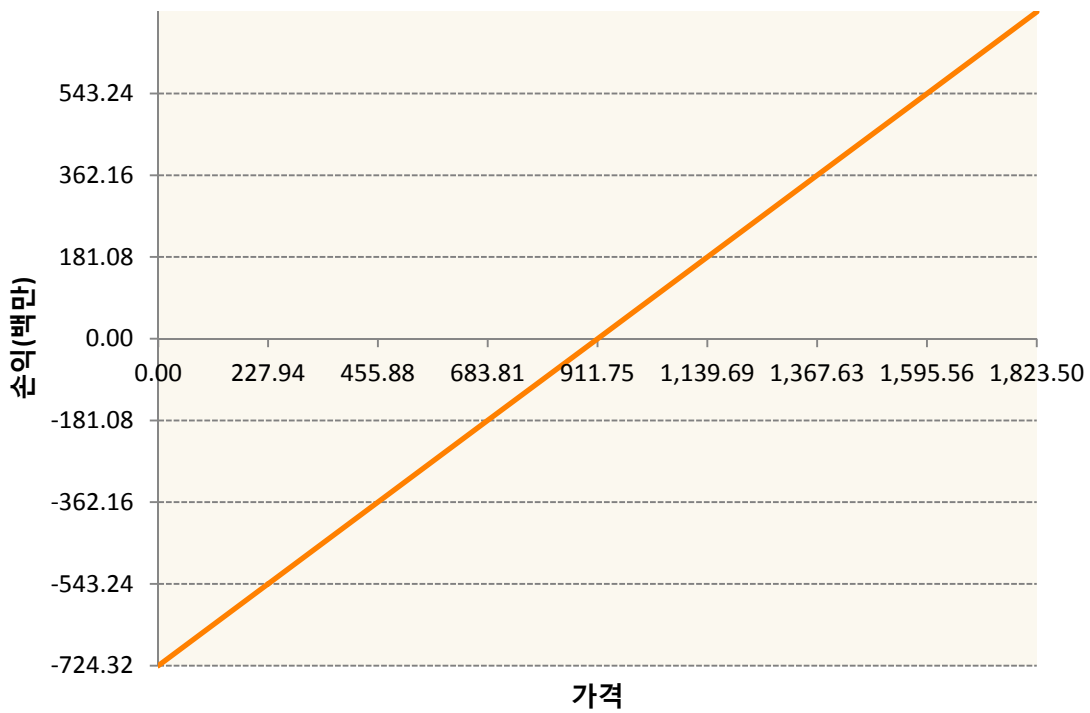
KWH9-KC HRW WHEAT FUT Mar19



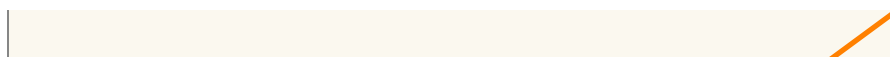
SBH9-SUGAR #11 (WORLD) MAR19

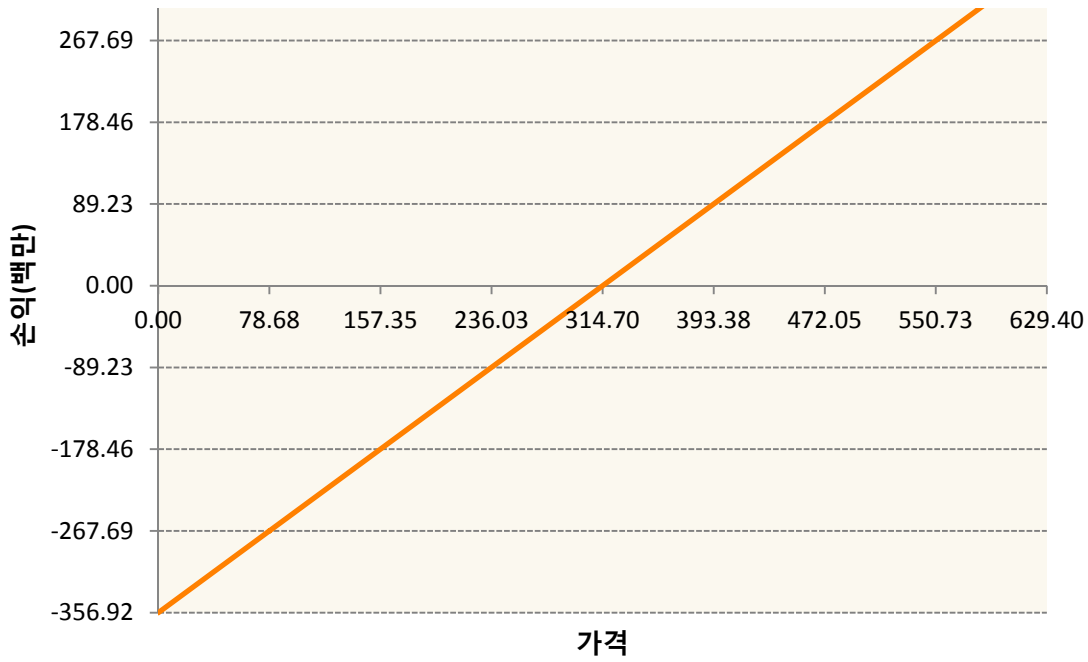


SF9-SOYBEAN FUTURE Jan19

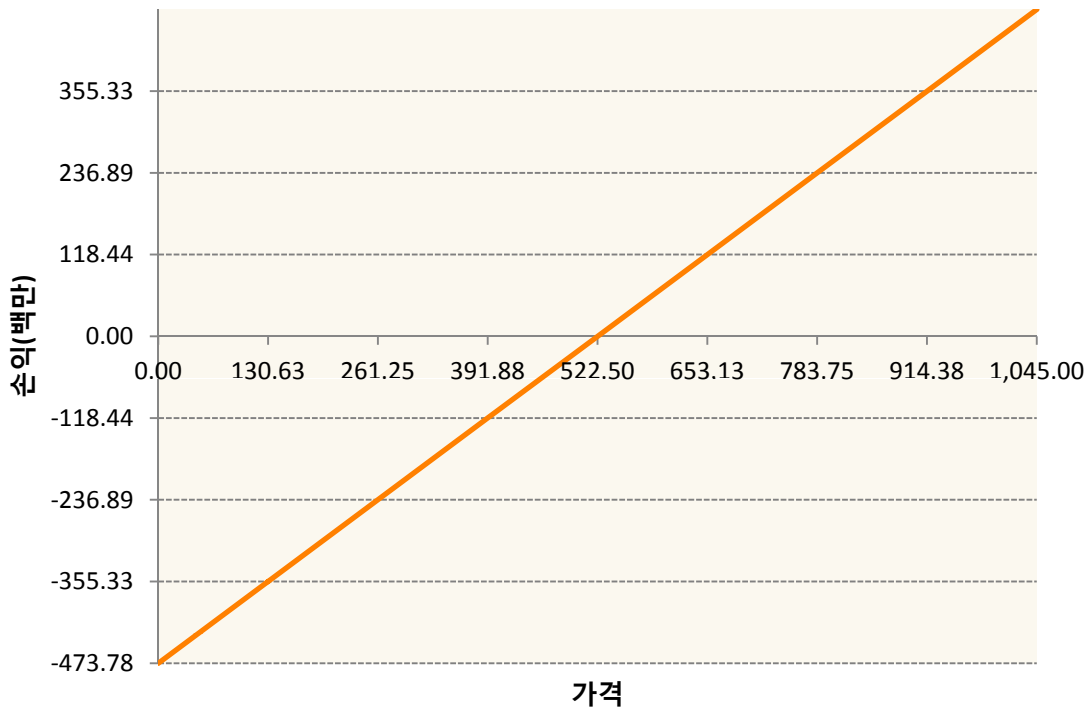


SMF9-SOYBEAN MEAL FUTR Jan19





WH9-WHEAT FUTURE(CBT) Mar19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

BOF9	SOYBEAN OIL FUTR Jan19	24
CH9	CORN FUTURE Mar19	66
CTH9	COTTON NO.2 FUTR Mar19	14
KCH9	COFFEE 'C' FUTURE Mar19	22
KR4175NC0	(2018-12 달러선물	6

KWH9	KC HRW WHEAT FUT Mar19	16
SBH9	SUGAR #11 (WORLD) MAR19	30
SF9	SOYBEAN FUTURE Jan19	58
SMF9	SOYBEAN MEAL FUTR Jan19	29
WH9	WHEAT FUTURE(CBT) Mar19	38

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

(단위:백만원)

318