

공시일	2018-12-07
기준일	2018-12-06

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	2018-12-07
기준일	2018-12-06

스마트인덱스모

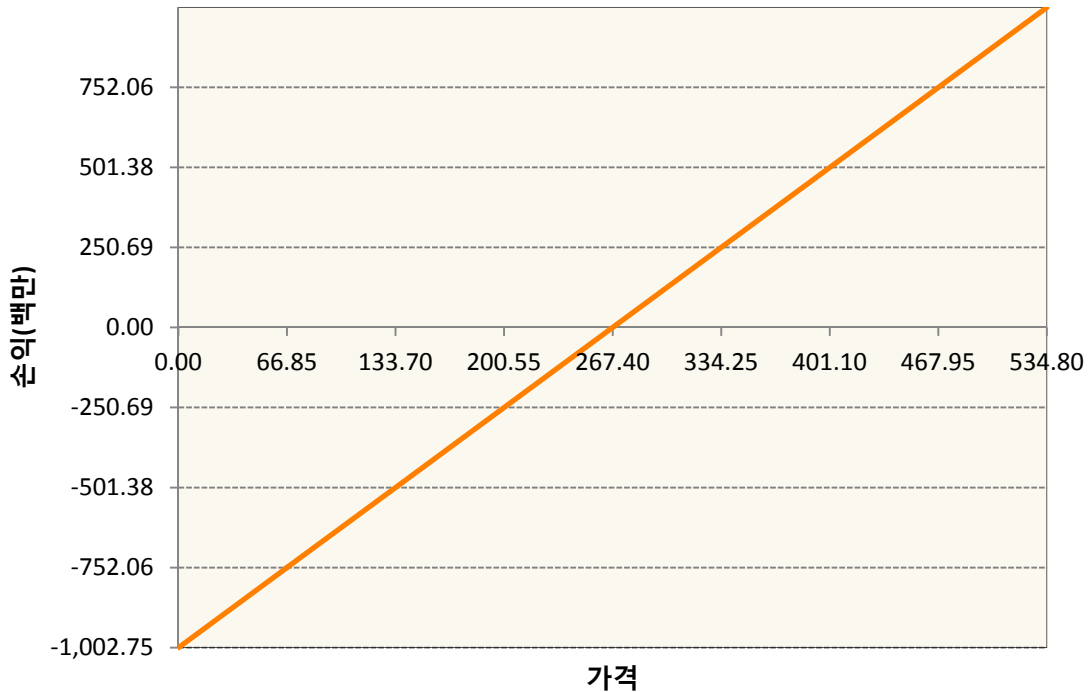
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,003	0	1,003	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101NC0004-2018-12 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101NC0004		2018-12 코스피200지수선물						80
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-80	-80	-80	-80	-80	-80	-80	
-5.33%	-53	-53	-53	-53	-53	-53	-53	
-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%	53	53	53	53	53	53	53	
8.00%	80	80	80	80	80	80	80	

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

(단위:백만원)

69

공시일	2018-12-07
기준일	2018-12-06

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

1,068

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

540

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2018-12-07
기준일	2018-12-06

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)

SWCSI500000 신한CSI500미래S180910

270

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

396

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2018-12-07
기준일	2018-12-06

유로인덱스모(주식-파생형)

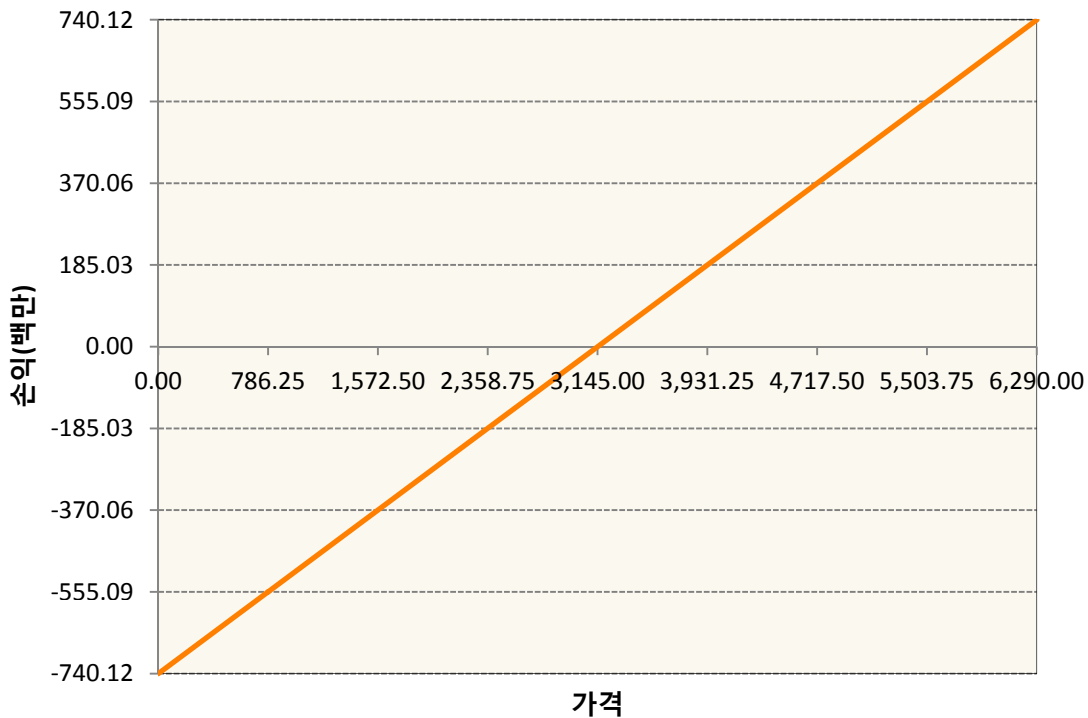
1. 계약금액

(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	2018-12-07
기준일	2018-12-06

차이나인덱스모(주식-파생형)

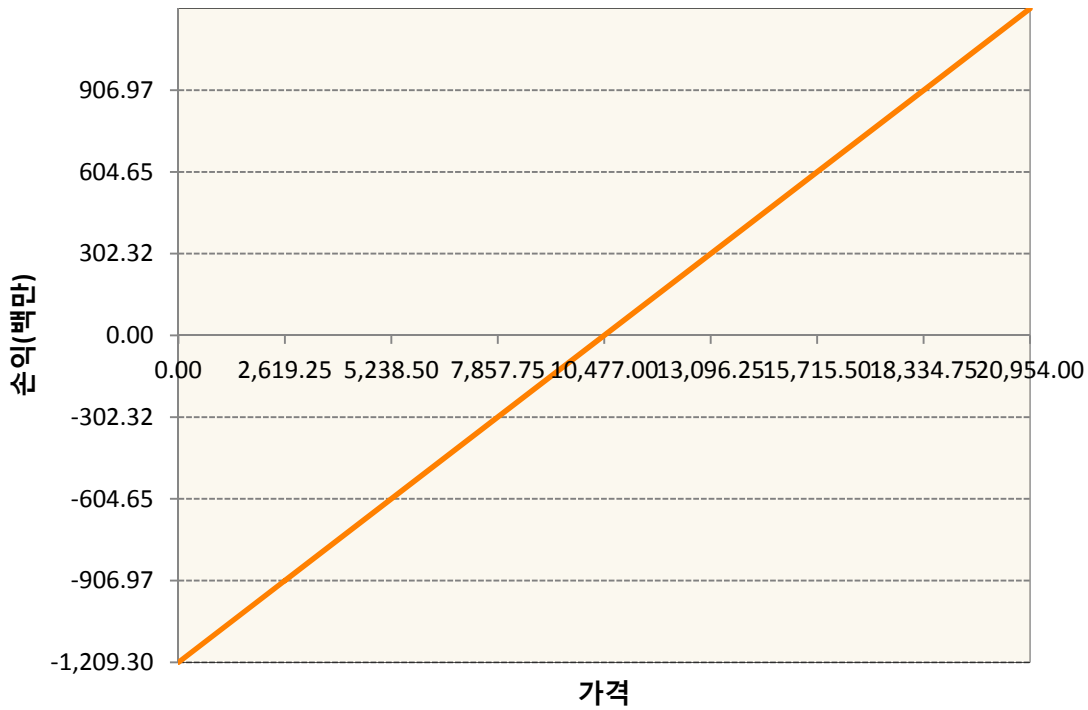
1. 계약금액

(단위:백만원)

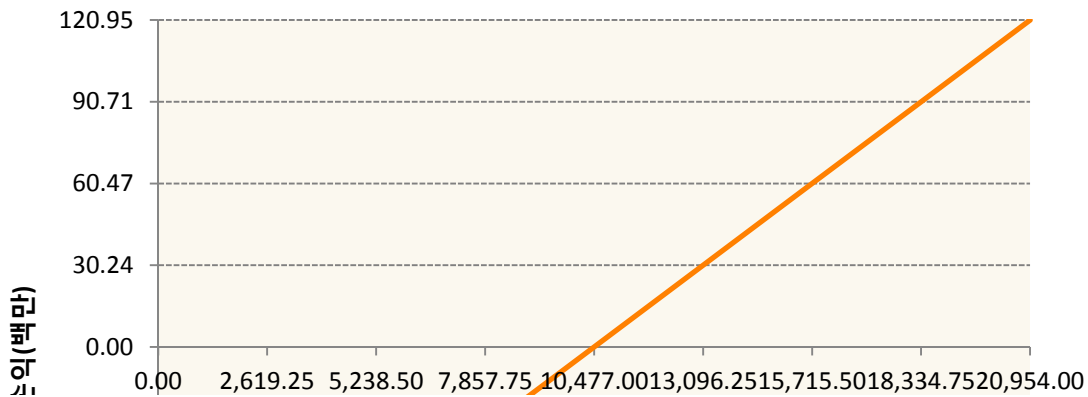
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,209	0	1,209	
누계	유가증권	선물	121	0	121	장내

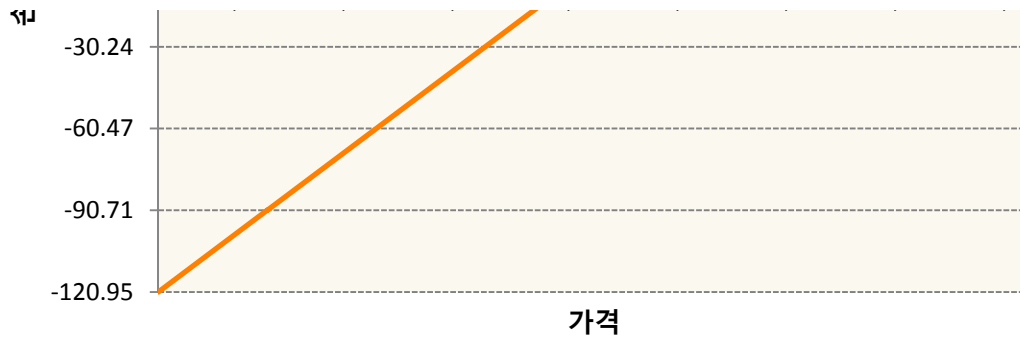
2. 만기시점의 손익구조

HCZ8-HSCEI FUTURES DEC 18



MHCZ8-MINI H-SHR IDX FU DEC18





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

HCZ8	HSCEI FUTURES DEC 18	97
MHCZ8	MINI H-SHR IDX FU DEC18	10

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

96

공시일	2018-12-07
기준일	2018-12-06

커버드콜모(주식혼합-파생형)

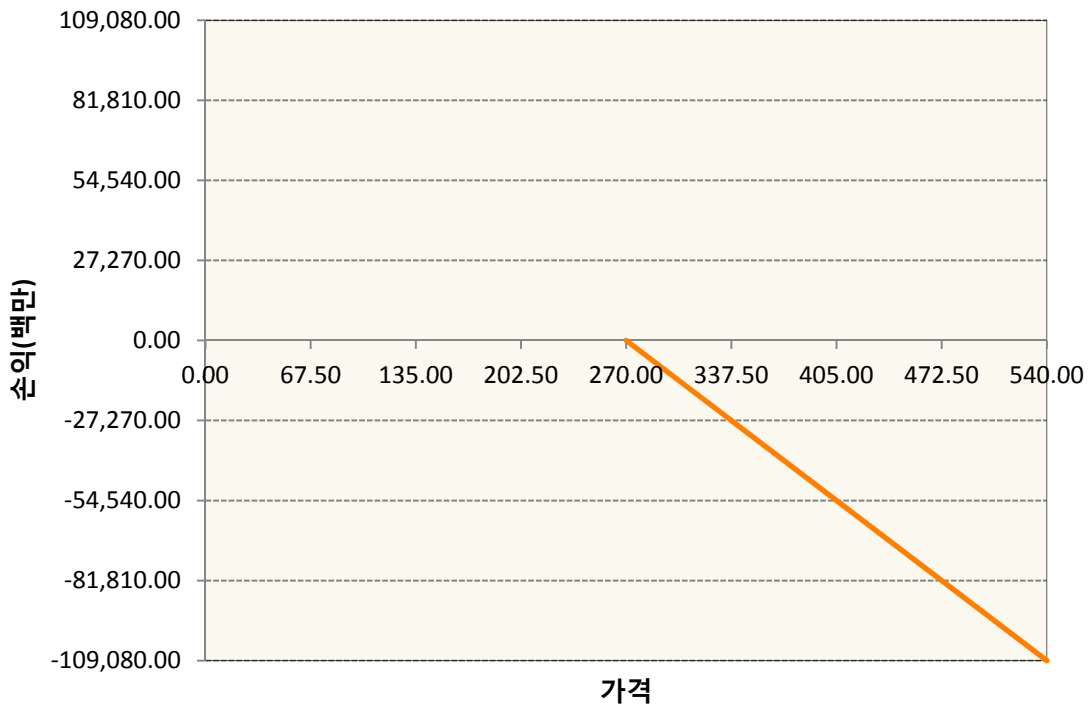
1. 계약금액

(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

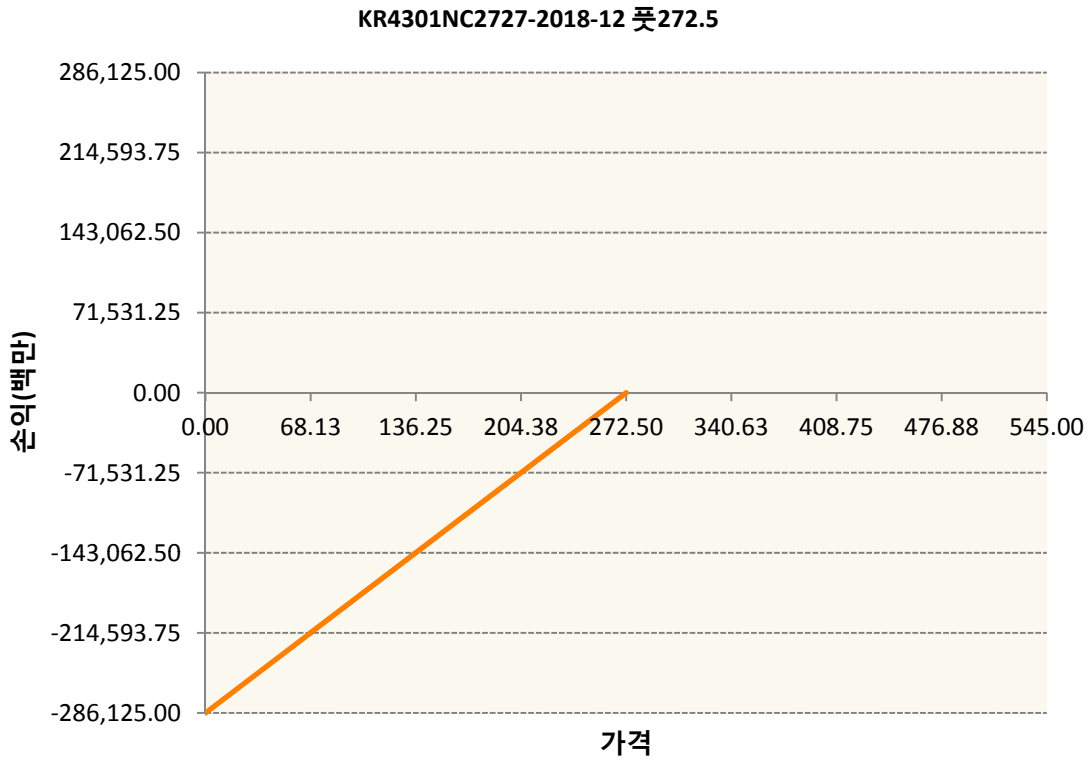
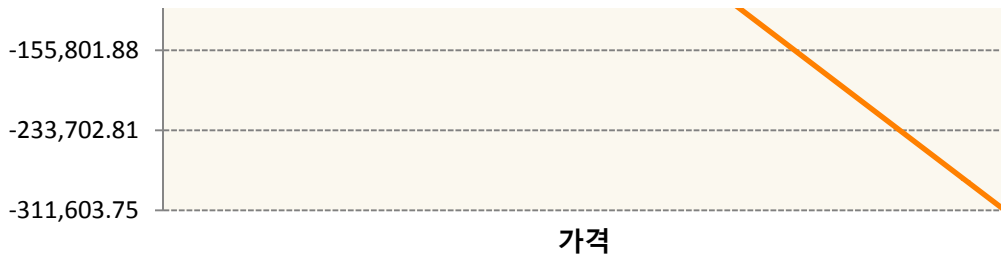
2. 만기시점의 손익구조

KR4201NC2702-2018-12 콜270



KR4201NC2728-2018-12 콜272.5





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201NC2702		2018-12 콜270					6,522
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,180	1,178	1,175	1,169	1,160	1,146	1,127
-5.33%	1,166	1,151	1,129	1,099	1,061	1,016	963
-2.67%	1,031	965	889	805	714	617	516
0%	403	270	136	0	-136	-274	-411
2.67%	-1,149	-1,275	-1,404	-1,535	-1,668	-1,802	-1,937
5.33%	-3,539	-3,599	-3,669	-3,748	-3,834	-3,928	-4,027
8.00%	-6,312	-6,327	-6,350	-6,380	-6,419	-6,467	-6,522
KR4201NC2728		2018-12 콜272.5					16,888
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	2,363	2,362	2,358	2,349	2,333	2,308	2,272

-5.33%	2,348	2,327	2,290	2,236	2,163	2,070	1,957
-2.67%	2,154	2,028	1,873	1,691	1,487	1,262	1,019
0%	1,015	688	349	0	-357	-719	-1,087
2.67%	-2,398	-2,796	-3,195	-3,596	-3,998	-4,400	-4,803
5.33%	-8,449	-8,690	-8,955	-9,240	-9,543	-9,858	-10,186
8.00%	-16,039	-16,115	-16,219	-16,350	-16,507	-16,686	-16,888
KR4301NC2727 2018-12 풋272.5							21,382
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-21,379	-21,379	-21,379	-21,379	-21,379	-21,380	-21,382
-5.33%	-13,901	-13,902	-13,904	-13,908	-13,916	-13,929	-13,948
-2.67%	-6,445	-6,469	-6,506	-6,557	-6,622	-6,701	-6,793
0%	543	374	193	0	-201	-410	-624
2.67%	5,144	4,895	4,644	4,392	4,138	3,883	3,628
5.33%	6,525	6,438	6,332	6,208	6,068	5,916	5,752
8.00%	6,669	6,661	6,646	6,621	6,586	6,538	6,479

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

(단위:백만원)

49,209

공시일	2018-12-07
기준일	2018-12-06

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

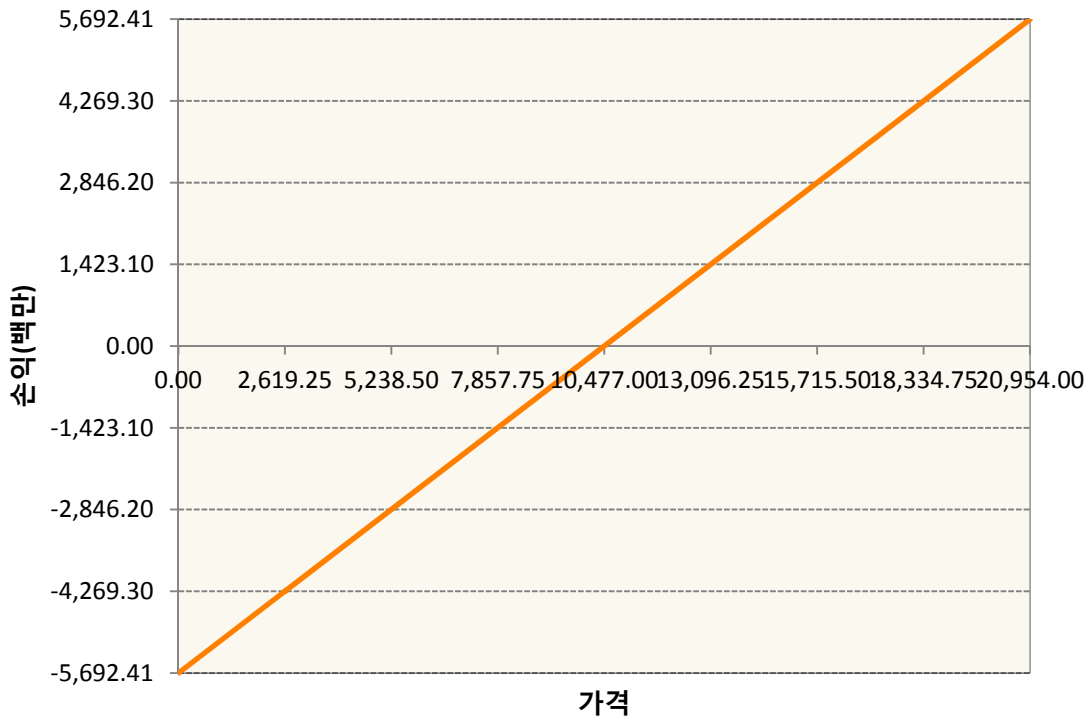
1. 계약금액

(단위:백만원)

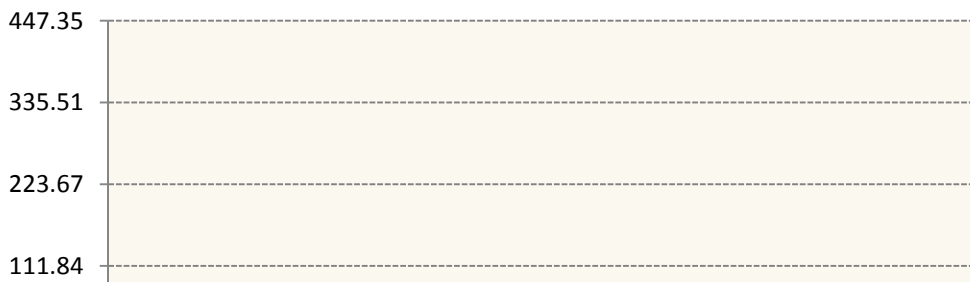
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	5,692	0	5,692	
누계	유가증권	옵션	0	12,749	-12,749	장내
누계	통화	선도	3,154	5,879	-2,724	장외

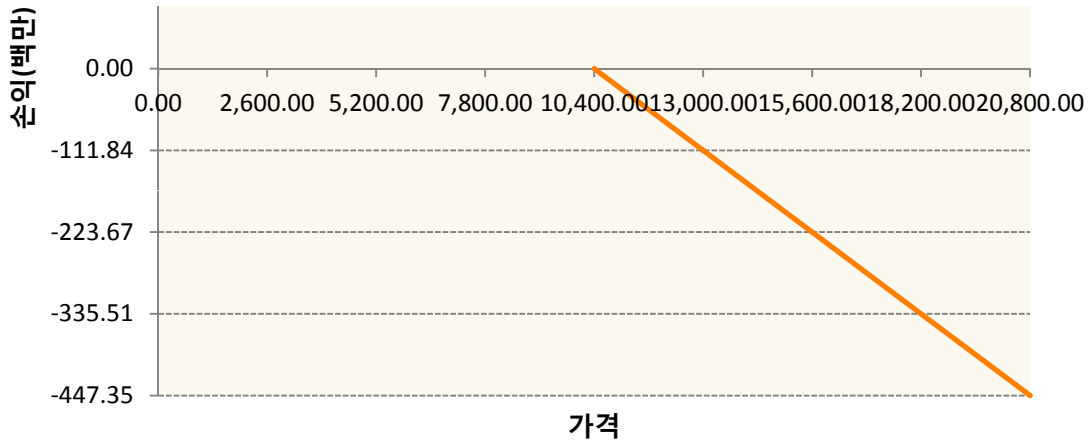
2. 만기시점의 손익구조

HCZ8-HSCEI FUTURES DEC 18

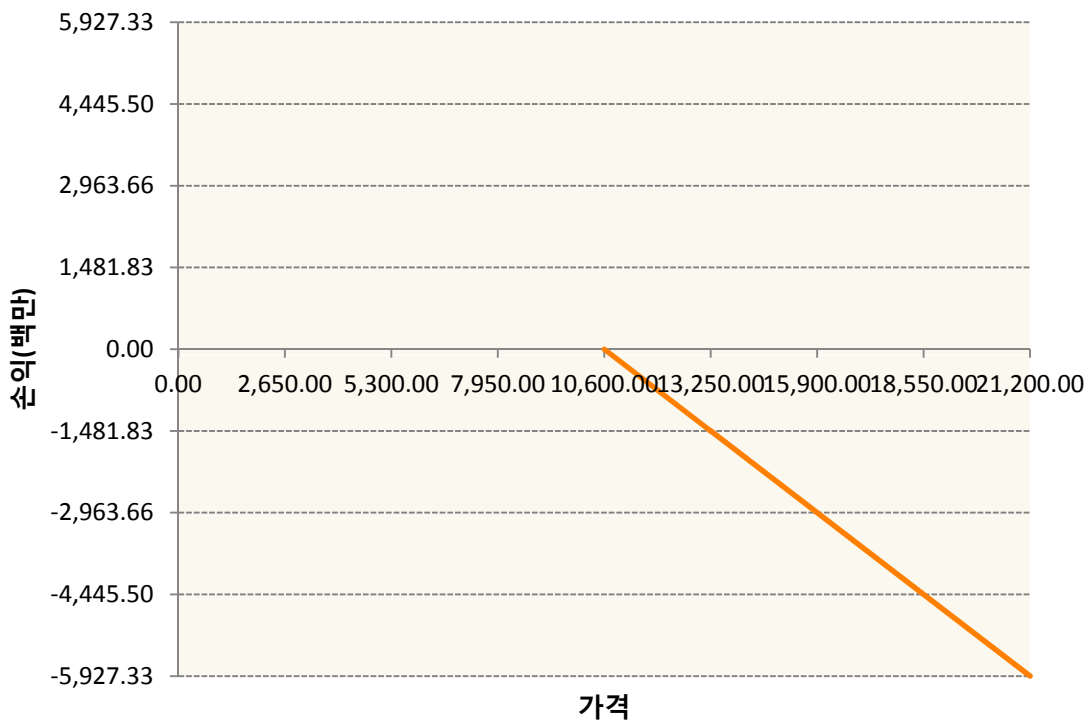


OHHIZ8-C104-HSCEI

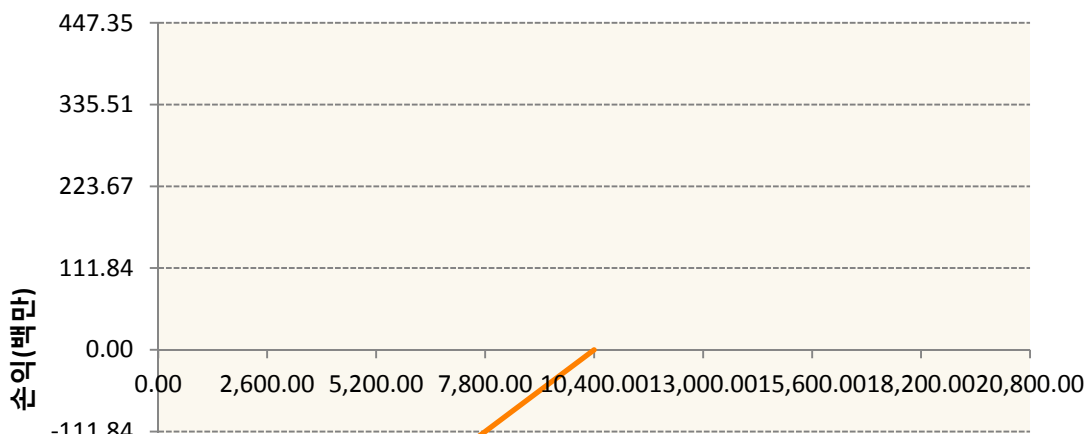


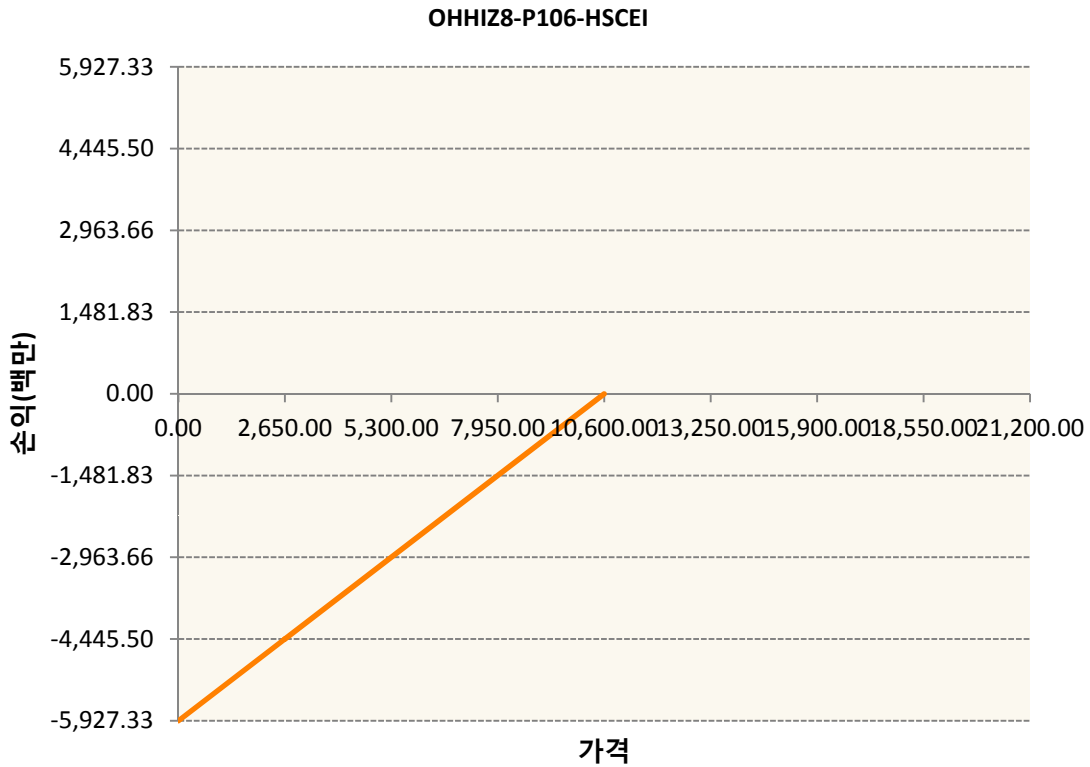


OHHIZ8-C106-HSCEI



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
FX21018Z00 HKD/KRW 10-12-18E	218
FX21018Z00 KRW/HKD 11-03-19E	218
HCZ8 HSCEI FUTURES DEC 18	455
OHHIZ8-C1C HSCEI	36
OHHIZ8-C1C HSCEI	474
OHHIZ8-P10 HSCEI	36
OHHIZ8-P10 HSCEI	474

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

(단위:백만원)

1,704

공시일	2018-12-07
기준일	2018-12-06

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

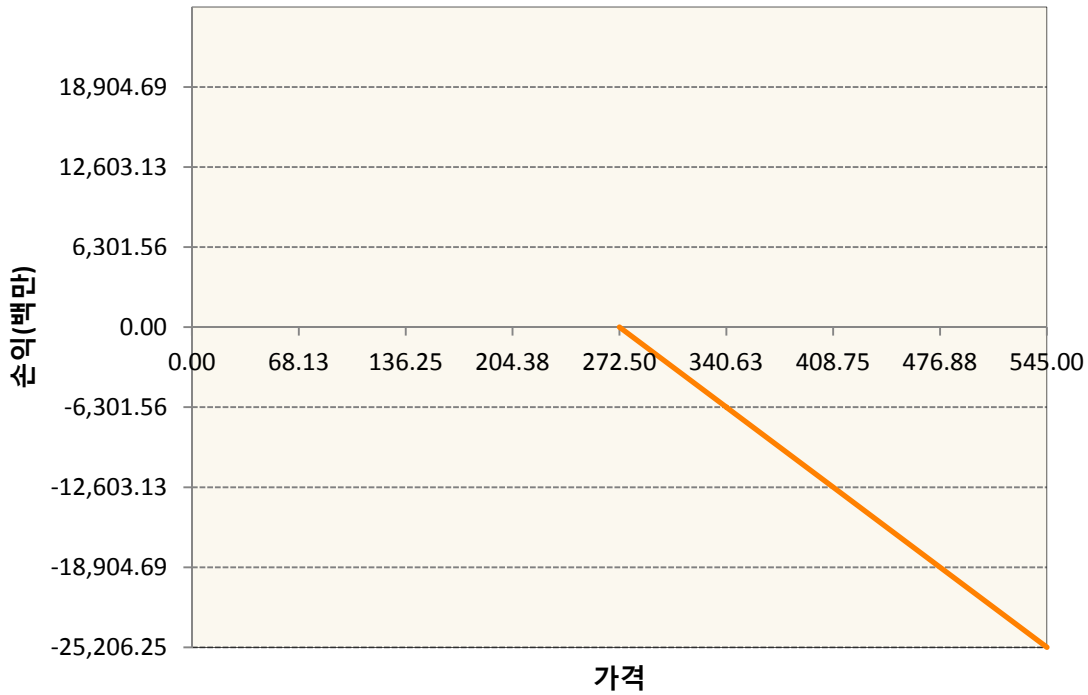
1. 계약금액

(단위:백만원)

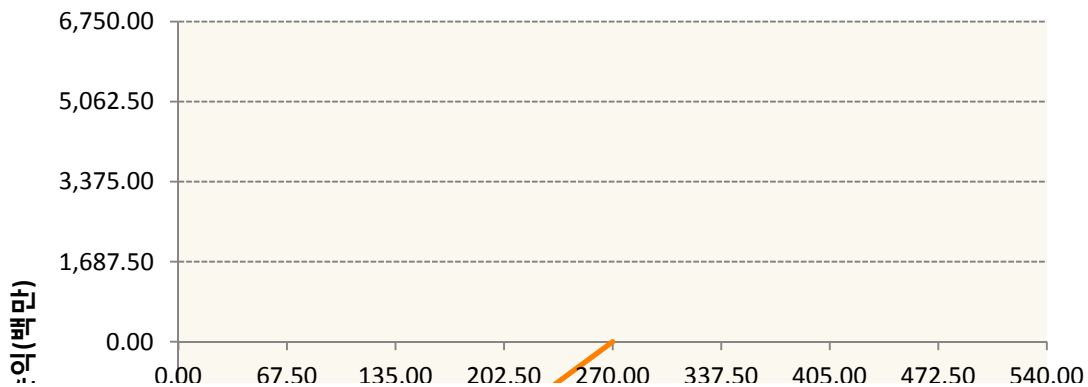
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	스왑	43,836	0	43,836	장외
누계	유가증권	옵션	0	43,538	-43,538	장내

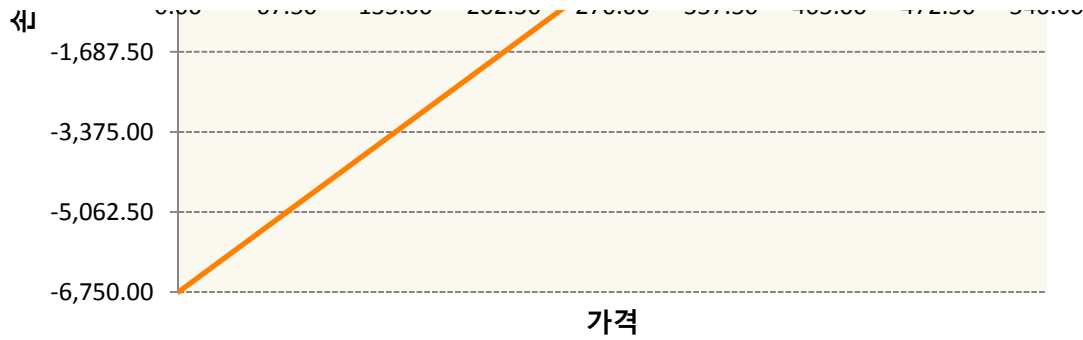
2. 만기시점의 손익구조

KR4201NC2728-2018-12 콜272.5

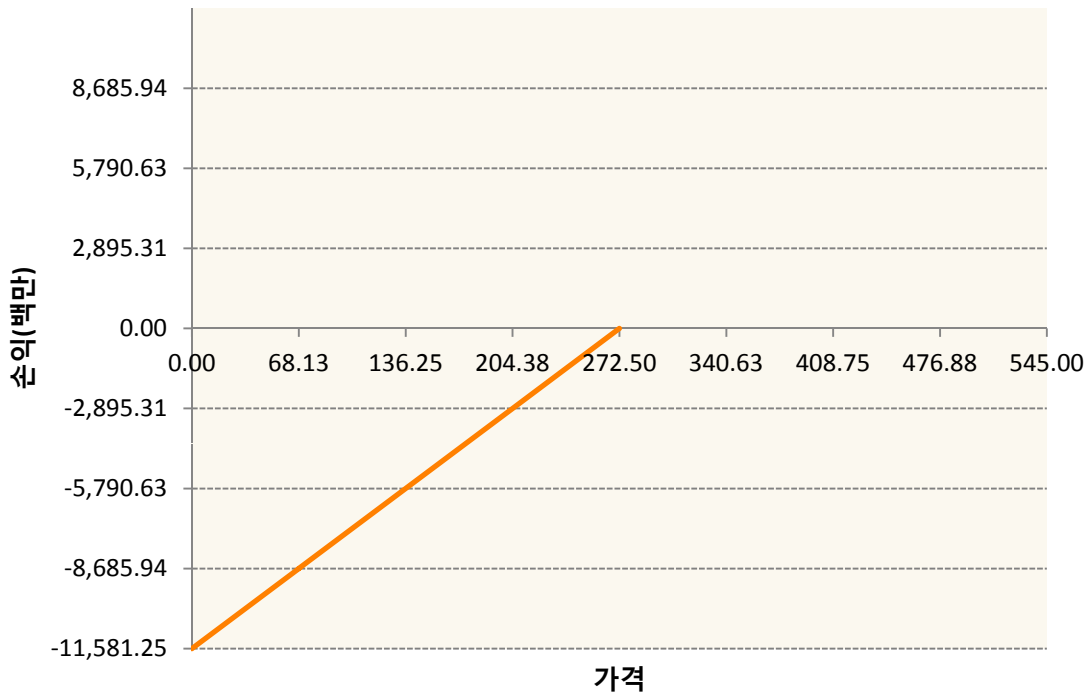


KR4301NC2701-2018-12 풋270





KR4301NC2727-2018-12 풋272.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

	2.529E+11		UBCSFXC1 INDEX_14				3,596
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-3,596	-3,596	-3,596	-3,596	-3,596	-3,596	-3,596
-5.33%	-2,397	-2,397	-2,397	-2,397	-2,397	-2,397	-2,397
-2.67%	-1,199	-1,199	-1,199	-1,199	-1,199	-1,199	-1,199
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	1,199	1,199	1,199	1,199	1,199	1,199	1,199
5.33%	2,397	2,397	2,397	2,397	2,397	2,397	2,397
8.00%	3,596	3,596	3,596	3,596	3,596	3,596	3,596
	KR4201NC2728		2018-12 콜272.5				1,366
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	191	191	191	190	189	187	184
-5.33%	190	188	185	181	175	167	158
-2.67%	174	164	151	137	120	102	82
0%	82	56	28	0	-29	-58	-88
2.67%	-194	-226	-258	-291	-323	-356	-389
5.33%	-683	-703	-724	-747	-772	-797	-824
8.00%	-1,297	-1,304	-1,312	-1,323	-1,335	-1,350	-1,366
KR4301NC2701 2018-12 풋270							491
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-491	-491	-491	-491	-491	-491	-491
-5.33%	-313	-313	-313	-314	-314	-315	-316
-2.67%	-137	-138	-140	-142	-145	-147	-151
0%	17	11	6	0	-6	-11	-17
2.67%	96	92	87	82	76	71	65
5.33%	113	112	111	109	107	104	101
8.00%	114	114	114	114	113	113	112
KR4301NC2727 2018-12 풋272.5							865
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-865	-865	-865	-865	-865	-865	-865
-5.33%	-563	-563	-563	-563	-563	-564	-565
-2.67%	-261	-262	-263	-265	-268	-271	-275
0%	22	15	8	0	-8	-17	-25
2.67%	208	198	188	178	167	157	147
5.33%	264	261	256	251	246	239	233
8.00%	270	270	269	268	267	265	262

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

(단위:백만원)

6,583

공시일	2018-12-07
기준일	2018-12-06

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

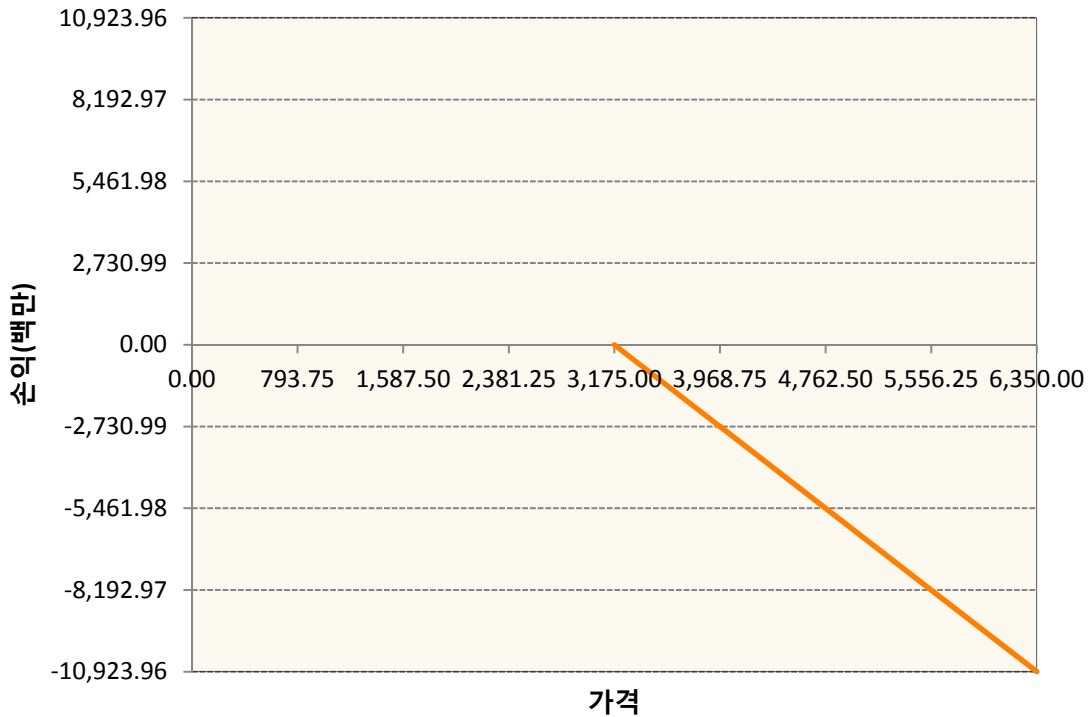
1. 계약금액

(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	8,041	0	8,041	
누계	유가증권	스왑	70,910	0	70,910	장외
누계	유가증권	옵션	0	28,430	-28,430	장내
누계	통화	선도	0	15,235	-15,235	장외

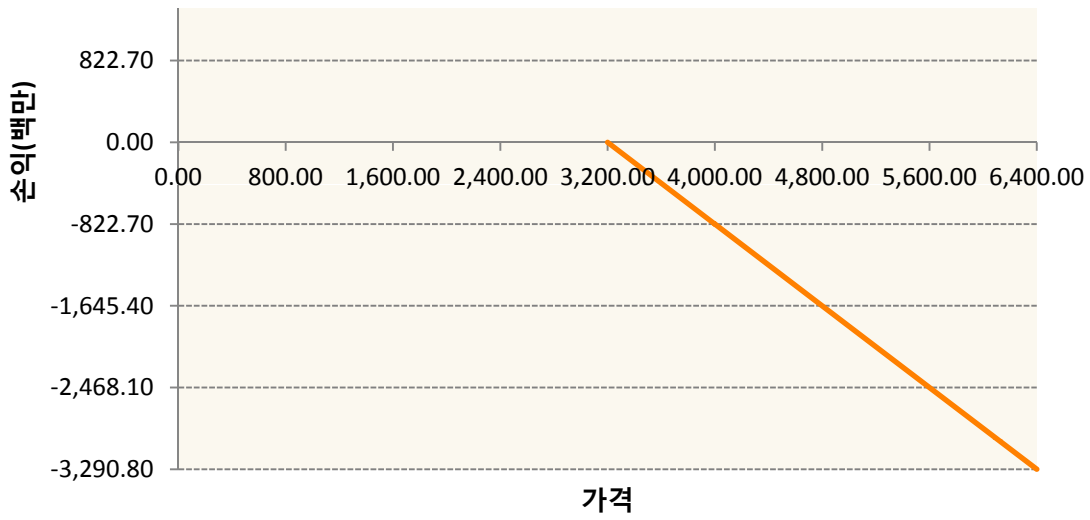
2. 만기시점의 손익구조

OESXZ8-C3175-EURO STOXX 50

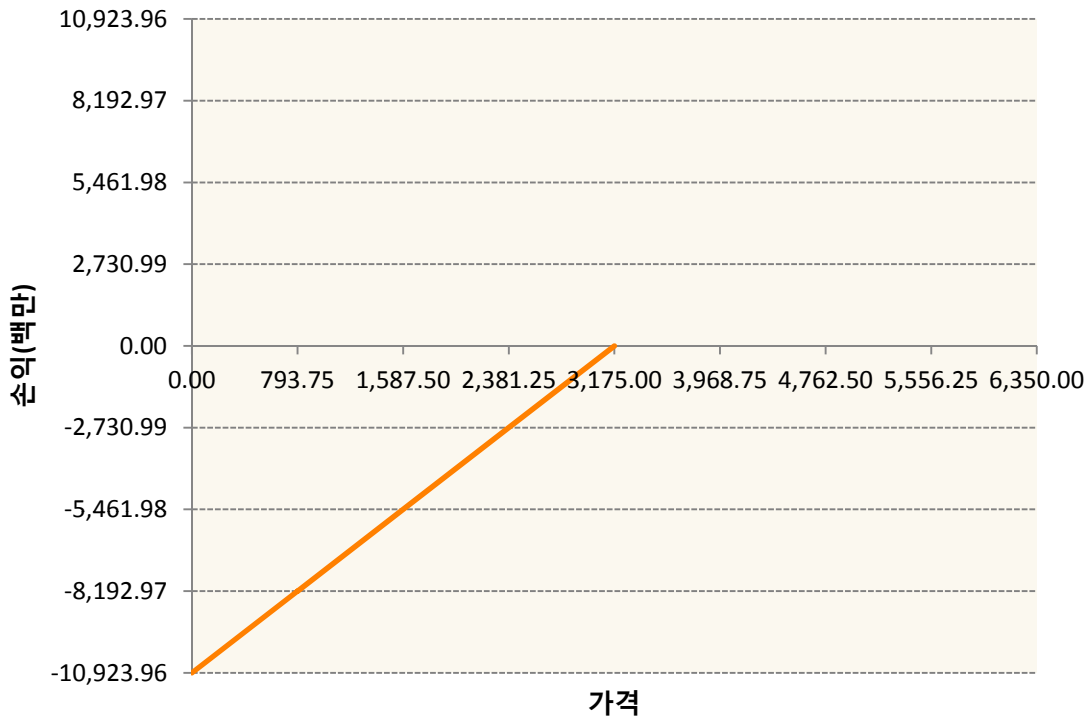


OESXZ8-C3200-EURO STOXX 50

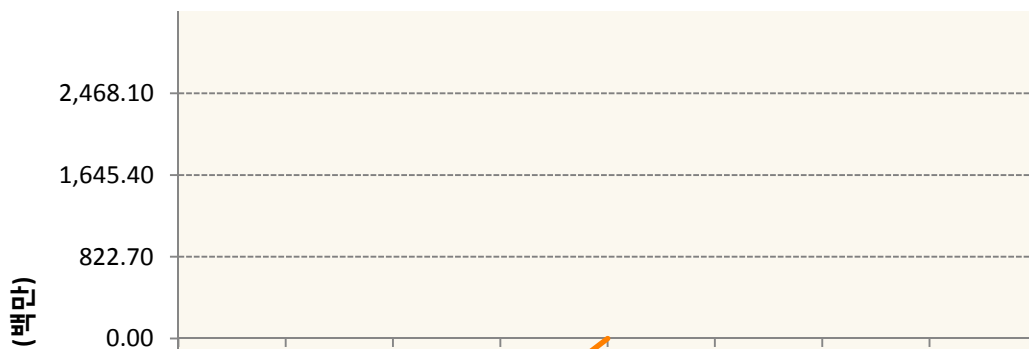


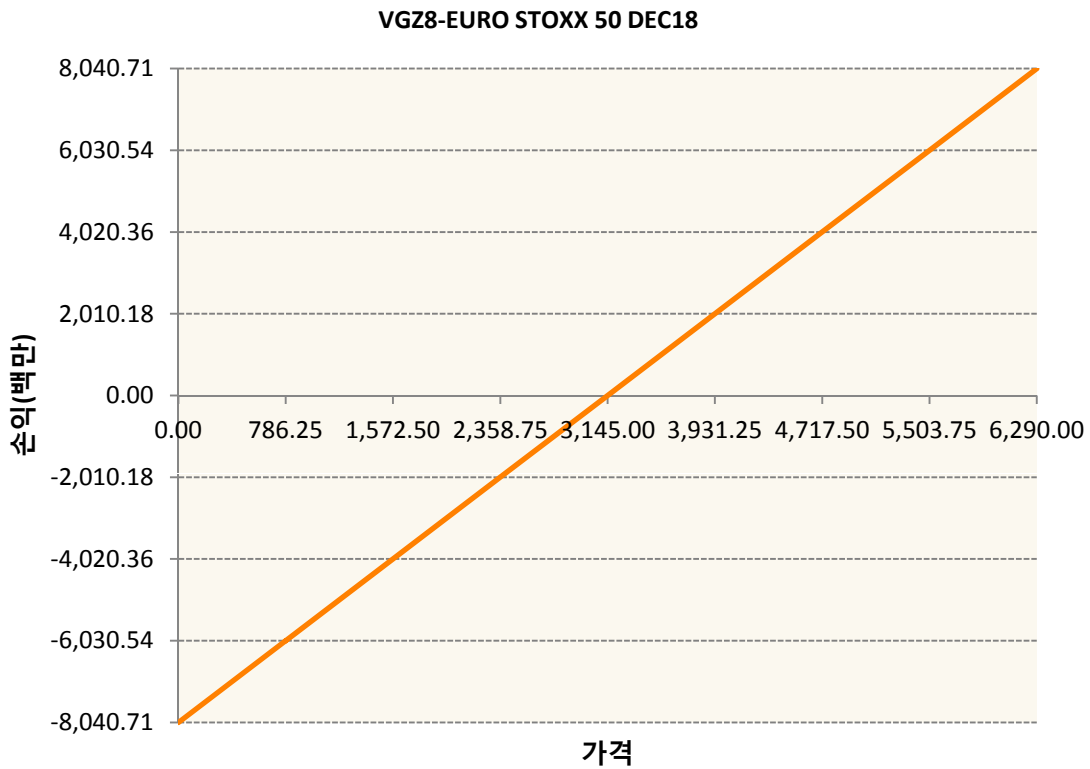
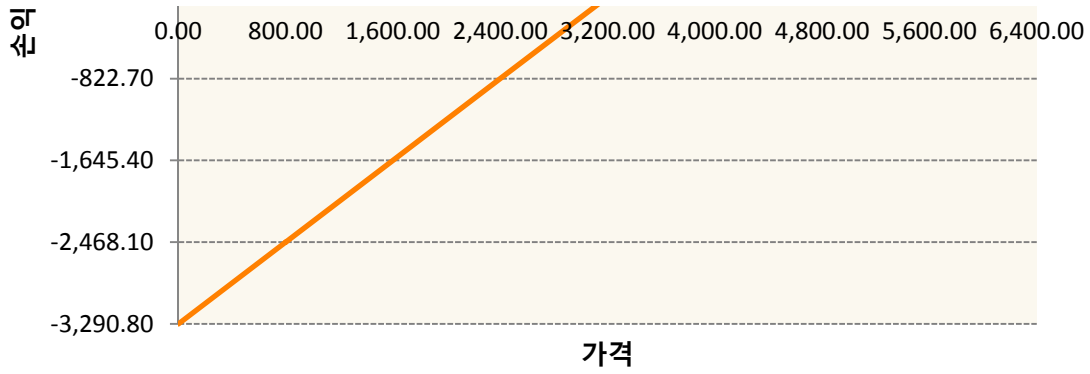


OESXZ8-P3175-EURO STOXX 50



OESXZ8-P3200-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY		42
FX21018U03 KRW/EUR 21-12-18E		813
FX21018X02 KRW/EUR 22-02-19E		406
OESXZ8-C31 EURO STOXX 50		874
OESXZ8-C32 EURO STOXX 50		263
OESXZ8-P31 EURO STOXX 50		874
OESXZ8-P32 EURO STOXX 50		263
VGZ8	EURO STOXX 50 DEC18	643

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

(단위:백만원)

2,576

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

(단위:백만원)

1,094

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

(단위:백만원)

92

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

(단위:백만원)

138

공시일	2018-12-07
기준일	2018-12-06

스마트KRX300인덱스목표전환형1호

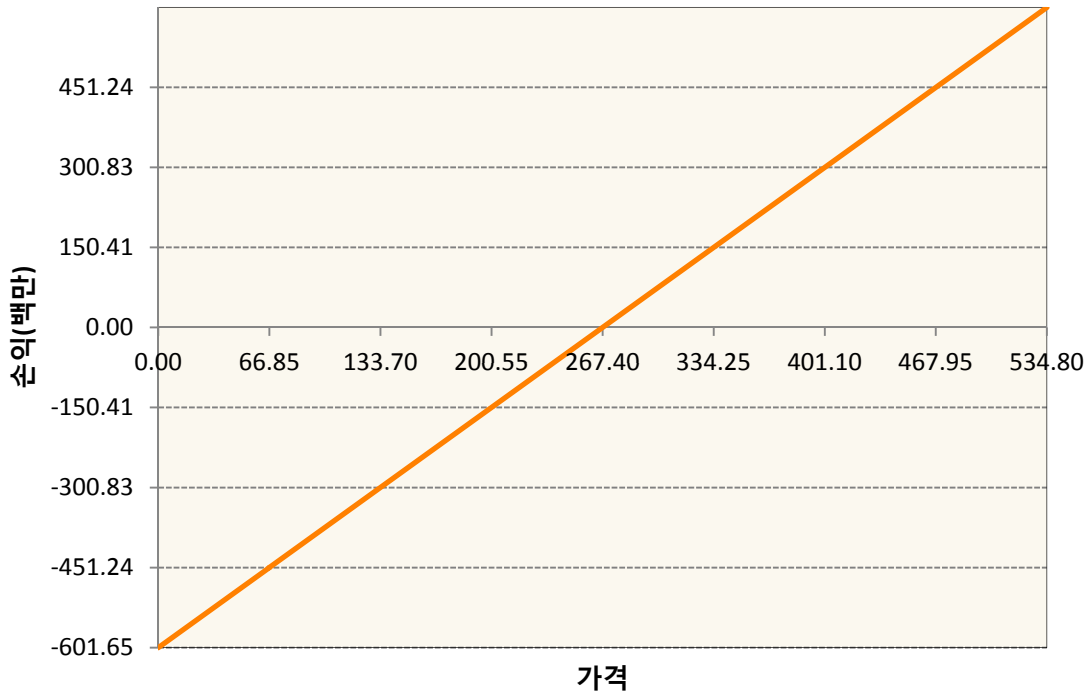
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	602	0	602	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)

42

공시일	2018-12-07
기준일	2018-12-06

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

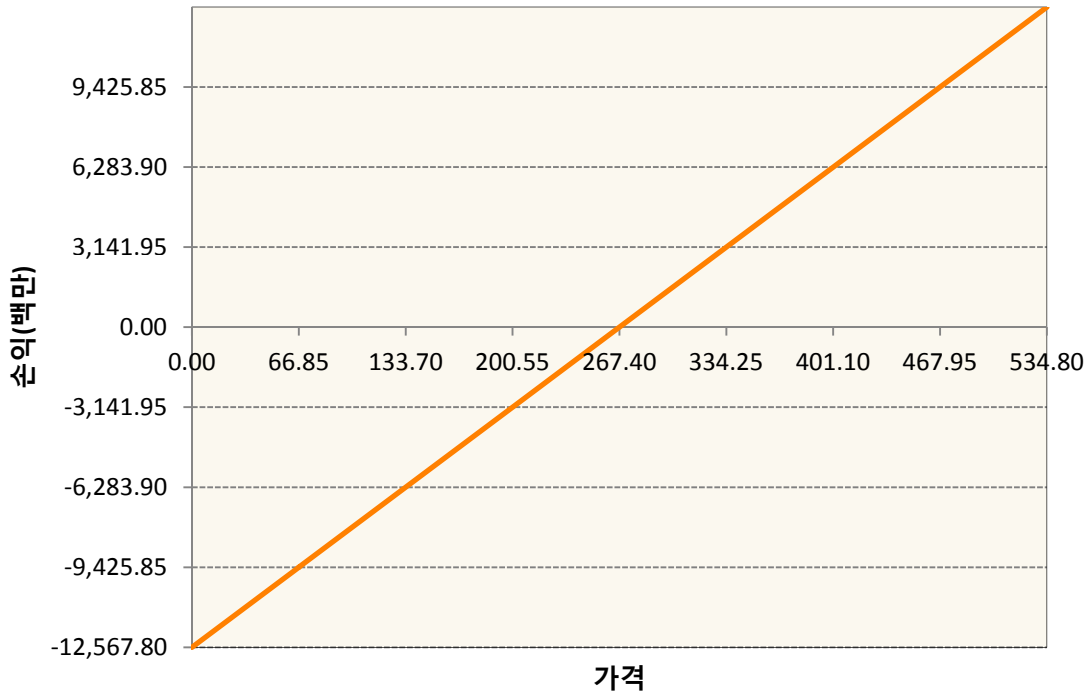
1. 계약금액

(단위:백만원)

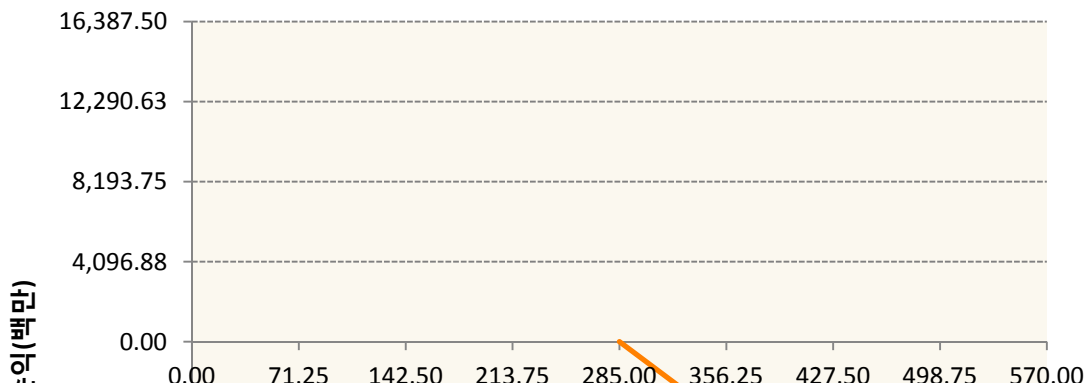
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	12,568	0	12,568	장내
누계	유가증권	옵션	3,743	23,072	-19,329	장내

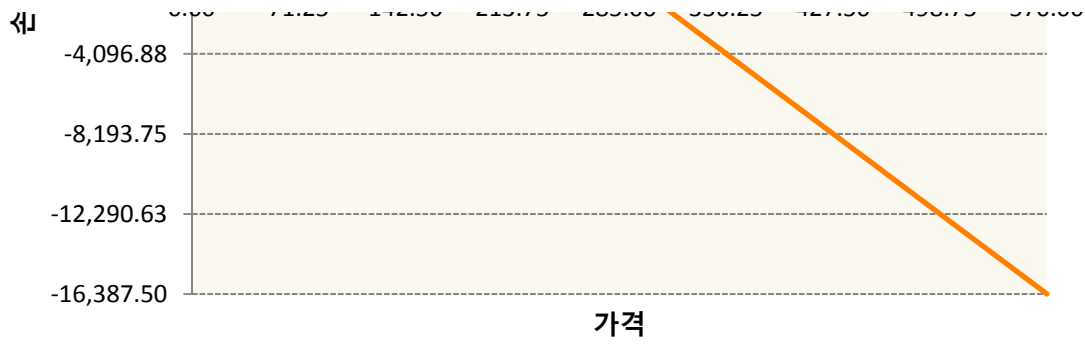
2. 만기시점의 손익구조

KR4101NC0004-2018-12 코스피200지수선물

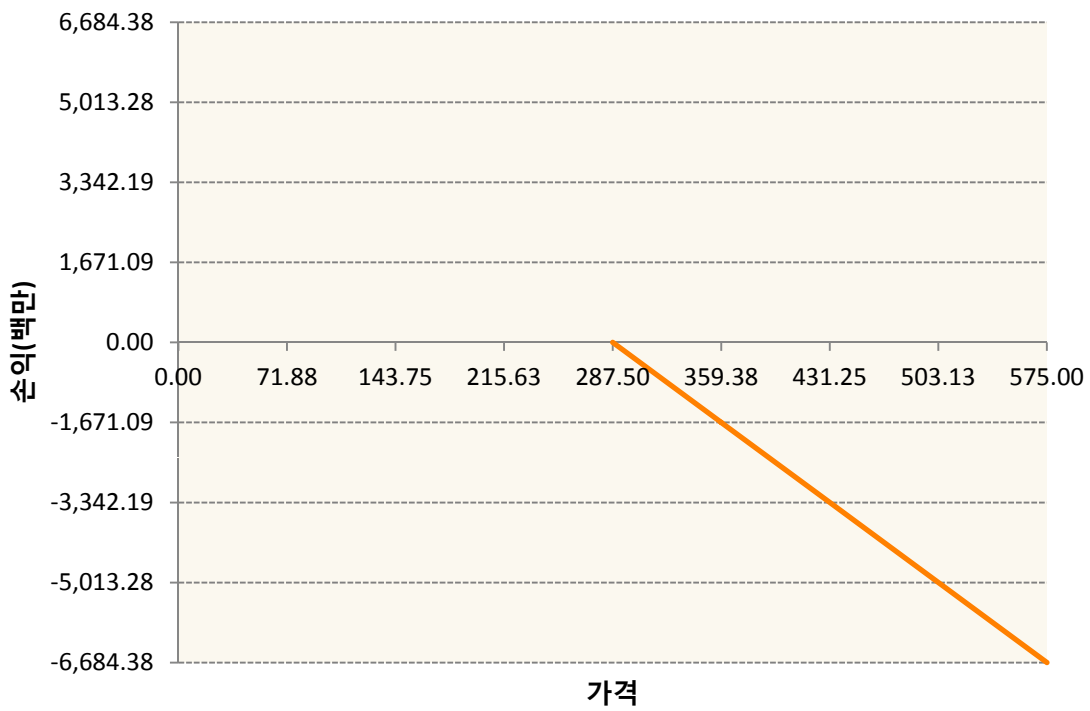


KR4201NC2850-2018-12 콜285

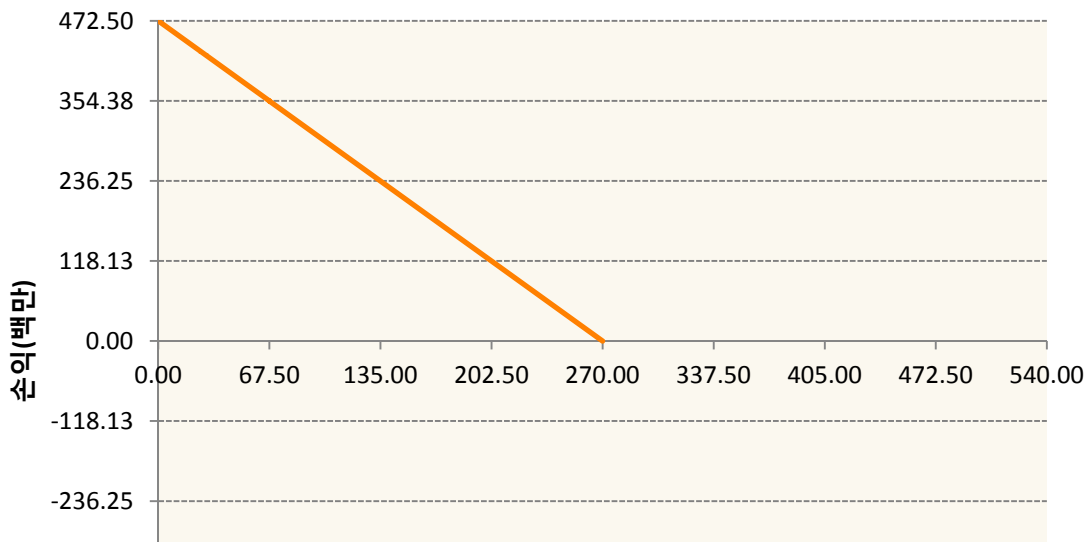


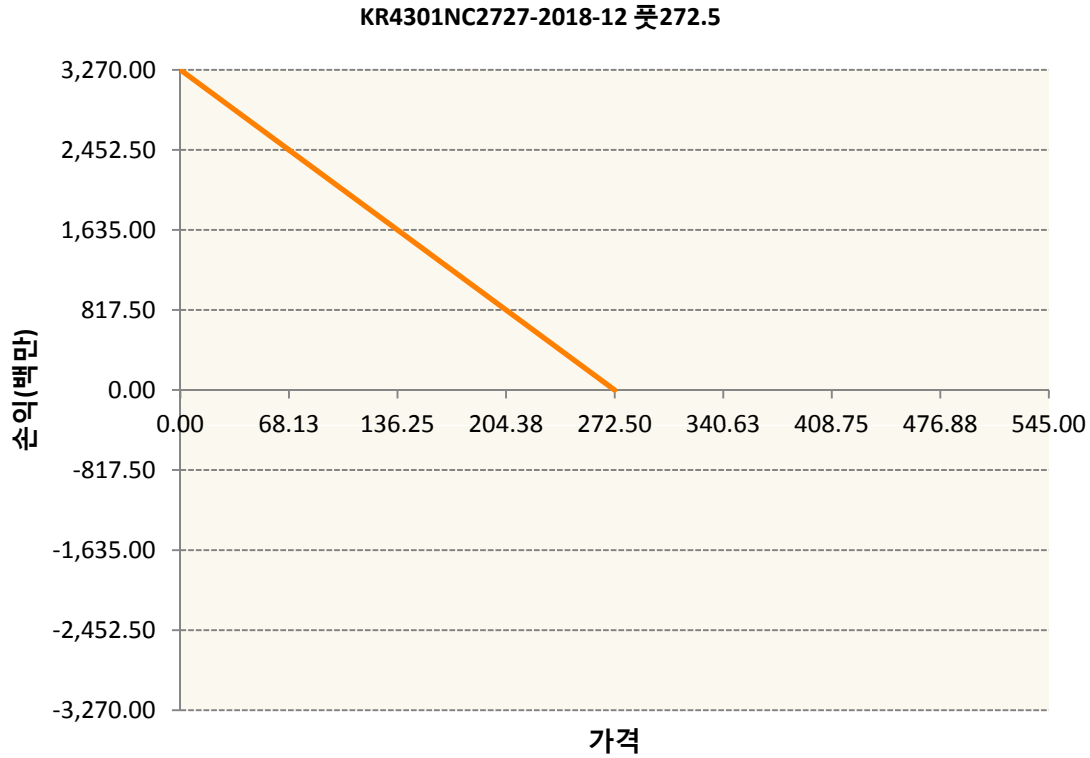
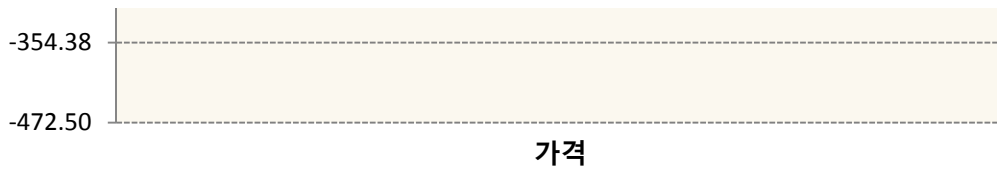


KR4201NC2876-2018-12 콜287.5



KR4301NC2701-2018-12 풋270





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101NC0004		2018-12 코스피200지수선물						1,005
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-1,005	-1,005	-1,005	-1,005	-1,005	-1,005	-1,005	
-5.33%	-670	-670	-670	-670	-670	-670	-670	
-2.67%	-335	-335	-335	-335	-335	-335	-335	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	335	335	335	335	335	335	335	
5.33%	670	670	670	670	670	670	670	
8.00%	1,005	1,005	1,005	1,005	1,005	1,005	1,005	
KR4201NC2850		2018-12 콜285						420
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	13	13	13	13	13	13	12	
-5.33%	13	13	13	13	12	12	11	
-2.67%	13	12	12	11	9	7	4	

0%	10	8	5	0	-6	-13	-21
2.67%	-8	-18	-29	-42	-55	-69	-84
5.33%	-92	-111	-131	-151	-171	-192	-212
8.00%	-298	-318	-338	-358	-379	-400	-420
KR4201NC2876 2018-12 콜287.5							140
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	-4	-6
2.67%	-1	-4	-7	-11	-16	-20	-26
5.33%	-23	-30	-37	-44	-52	-60	-67
8.00%	-88	-97	-105	-114	-123	-131	-140
KR4301NC2701 2018-12 풋270							34
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	34	34	34	34	34	34	34
-5.33%	22	22	22	22	22	22	22
-2.67%	10	10	10	10	10	10	11
0%	-1	-1	0	0	0	1	1
2.67%	-7	-6	-6	-6	-5	-5	-5
5.33%	-8	-8	-8	-8	-7	-7	-7
8.00%	-8	-8	-8	-8	-8	-8	-8
KR4301NC2727 2018-12 풋272.5							244
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	244	244	244	244	244	244	244
-5.33%	159	159	159	159	159	159	159
-2.67%	74	74	74	75	76	77	78
0%	-6	-4	-2	0	2	5	7
2.67%	-59	-56	-53	-50	-47	-44	-41
5.33%	-75	-74	-72	-71	-69	-68	-66
8.00%	-76	-76	-76	-76	-75	-75	-74

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

(단위:백만원)

1,363

공시일	2018-12-07
기준일	2018-12-06

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	2018-12-07
기준일	2018-12-06

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	1,519	0	1,519	

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	2018-12-07
기준일	2018-12-06

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	404	-404	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)

144

공시일	2018-12-07
기준일	2018-12-06

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

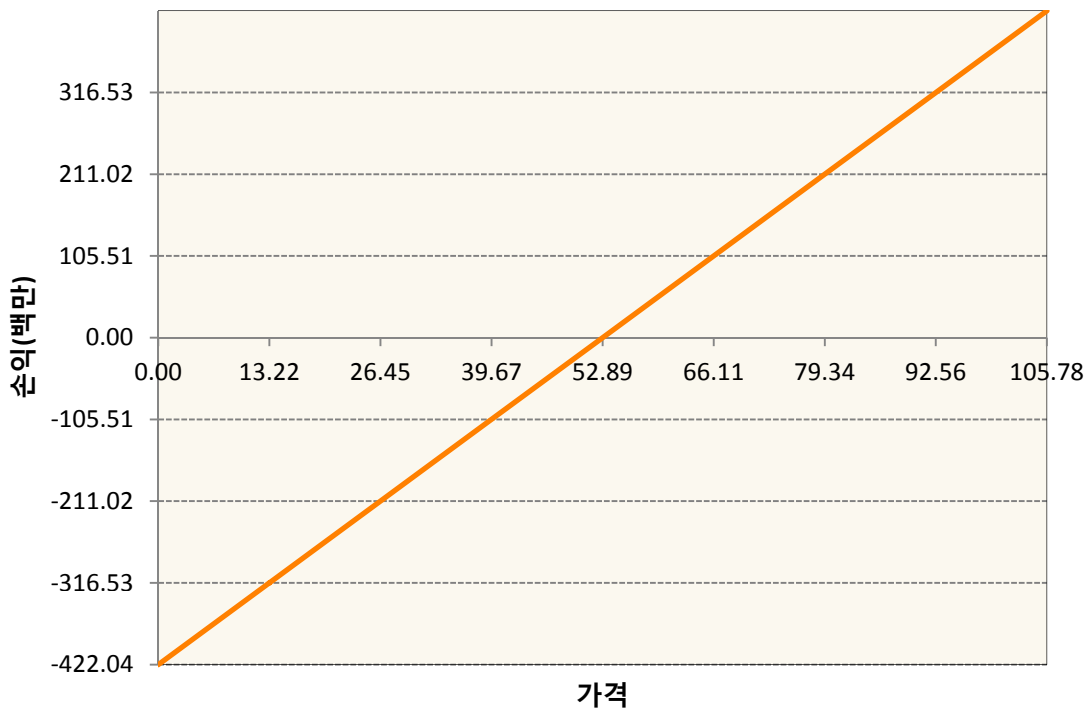
1. 계약금액

(단위:백만원)

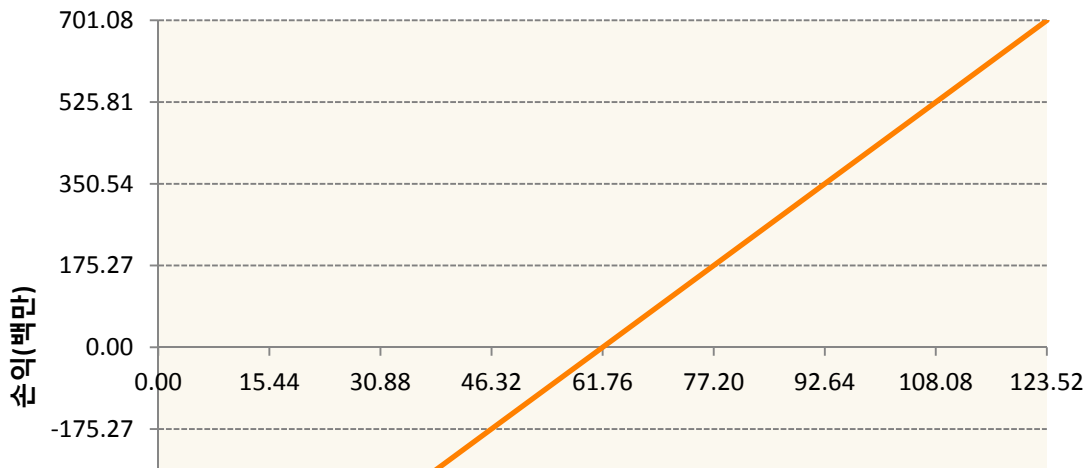
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,026	258	2,768	

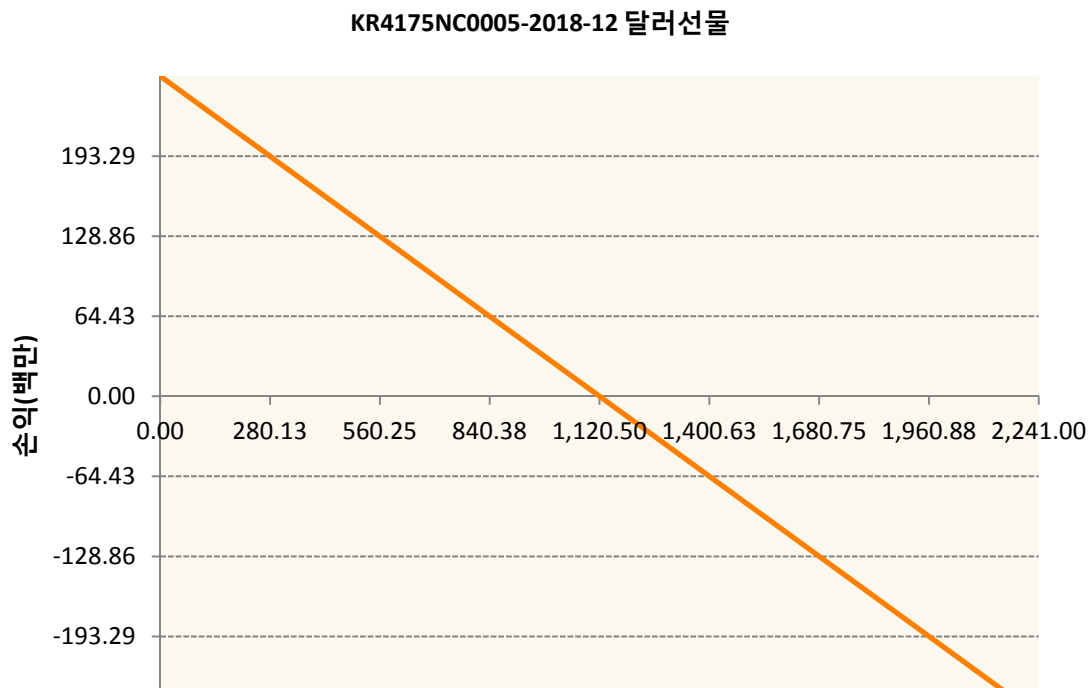
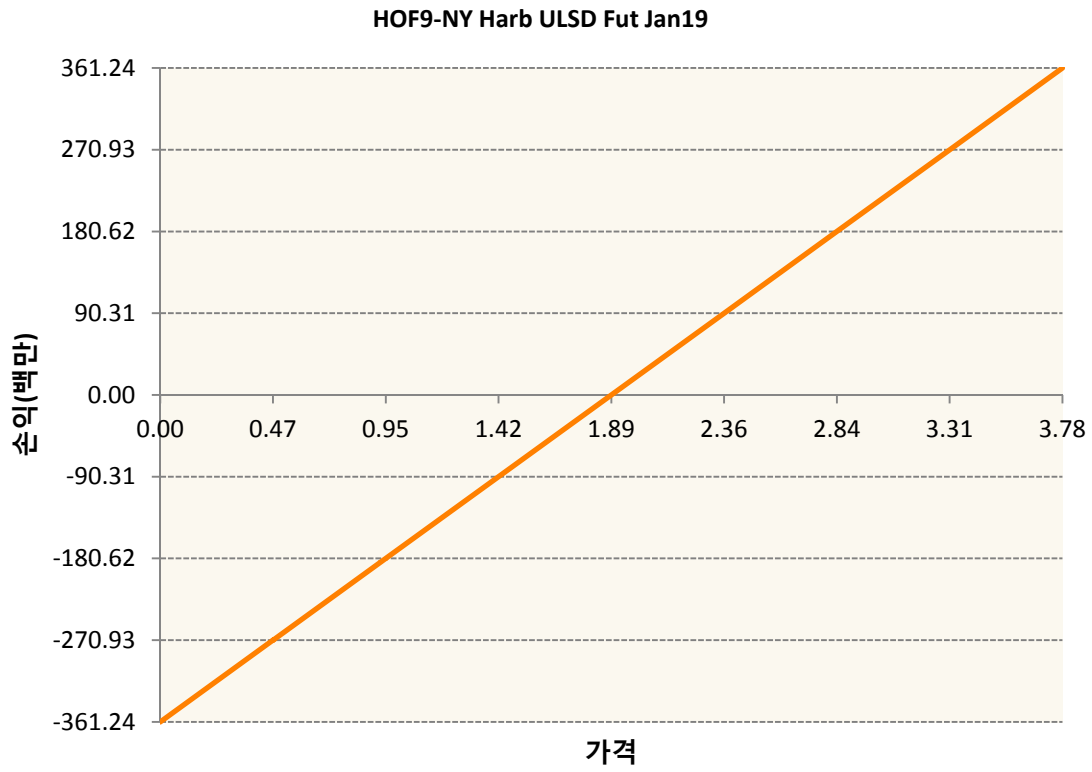
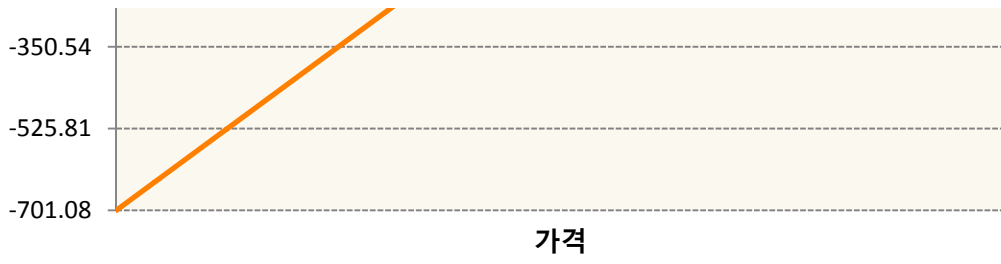
2. 만기시점의 손익구조

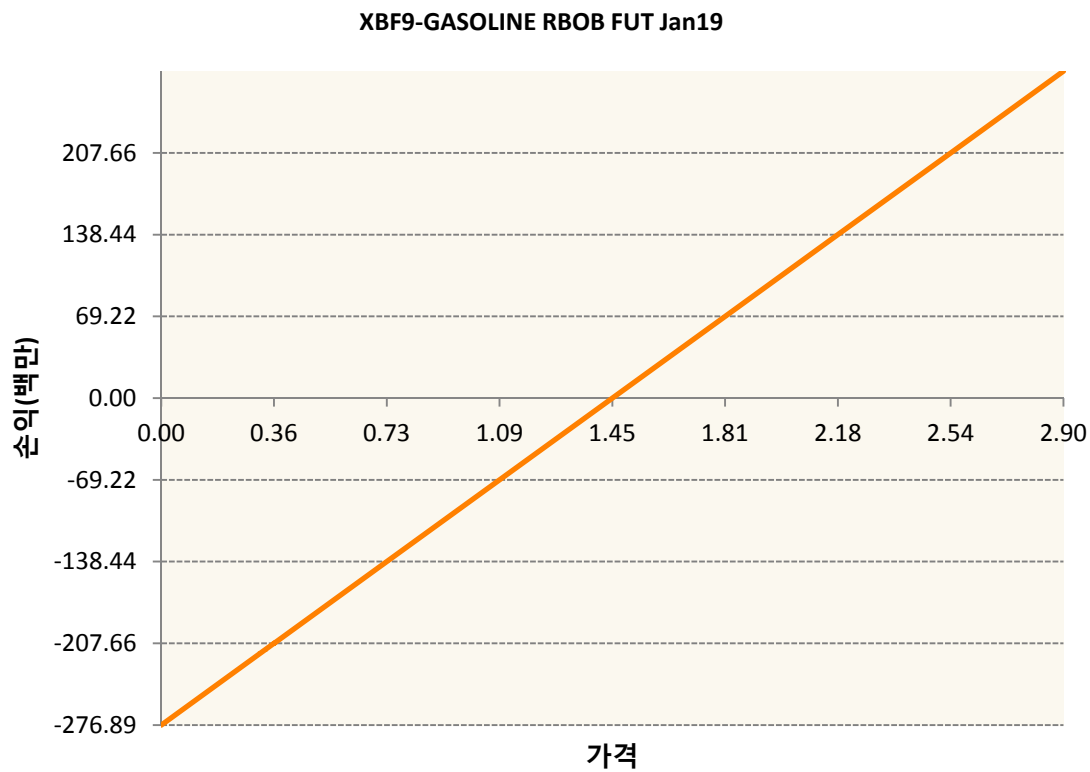
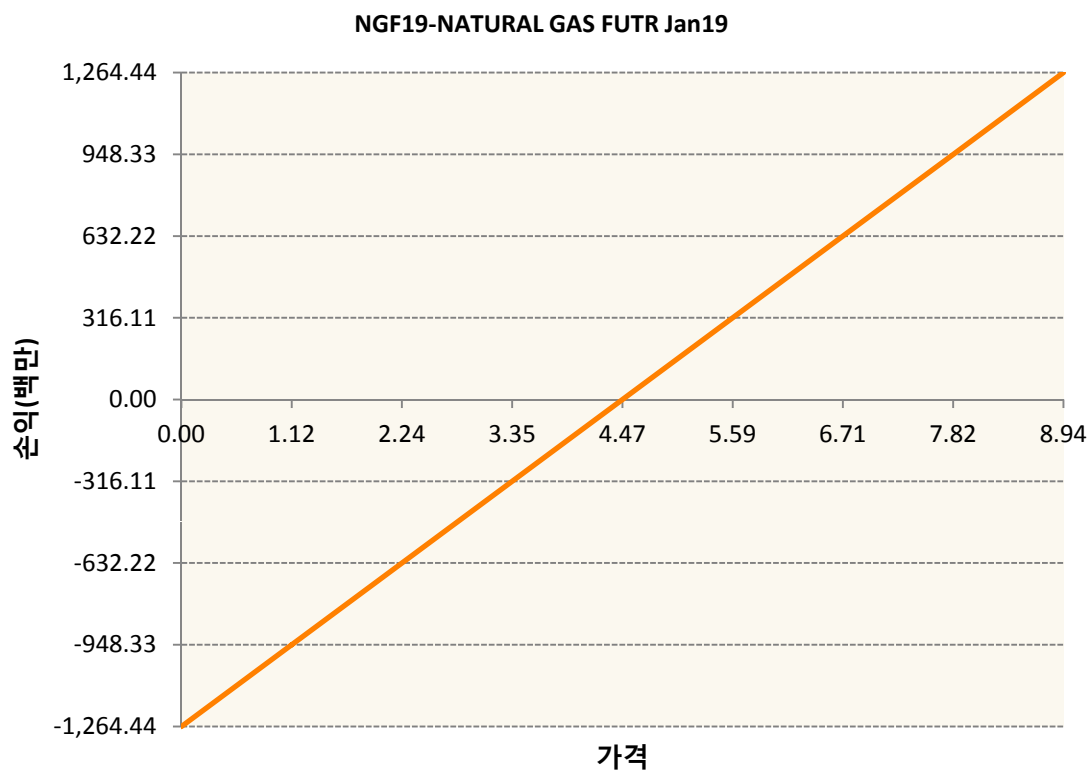
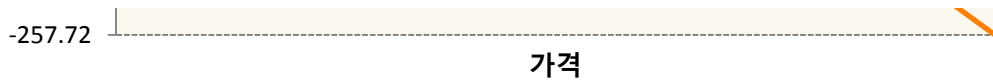
CLF9-WTI CRUDE FUTURE Jan19



COH9-BRENT CRUDE FUTR Mar19







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLF9	WTI CRUDE FUTURE Jan19	34
COH9	BRENT CRUDE FUTR Mar19	56
HOF9	NY Harb ULSD Fut Jan19	29
KR4175NC0	(2018-12 달러선물	21
NGF19	NATURAL GAS FUTR Jan19	101
XBF9	GASOLINE RBOB FUT Jan19	22

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

431

공시일	2018-12-07
기준일	2018-12-06

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

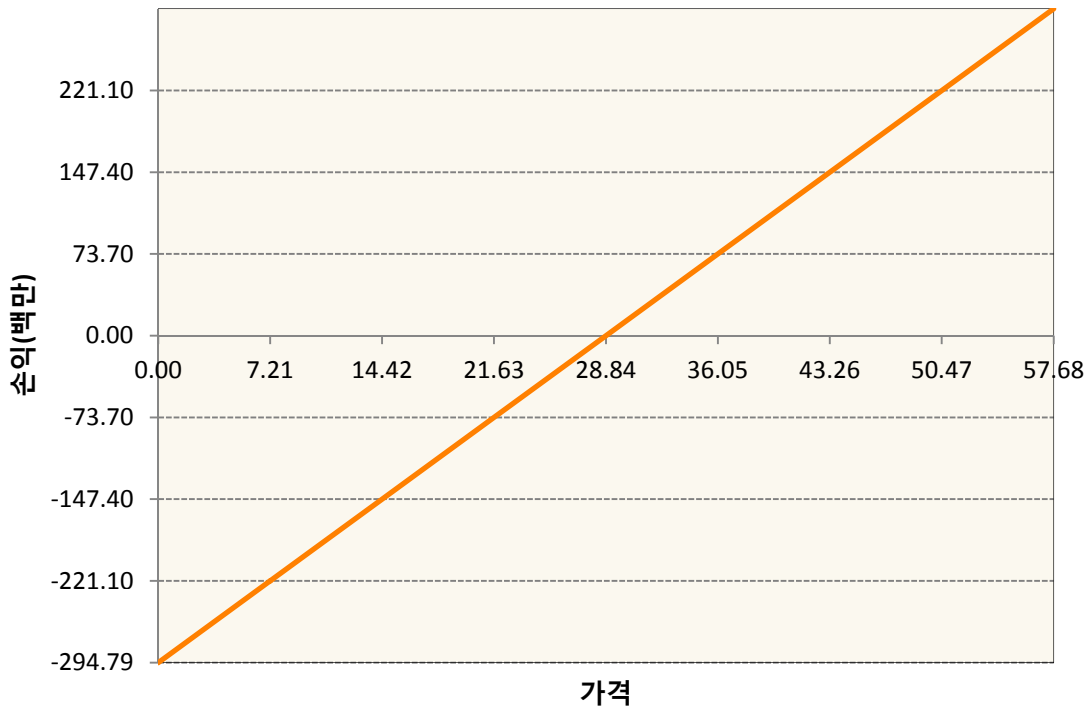
1. 계약금액

(단위:백만원)

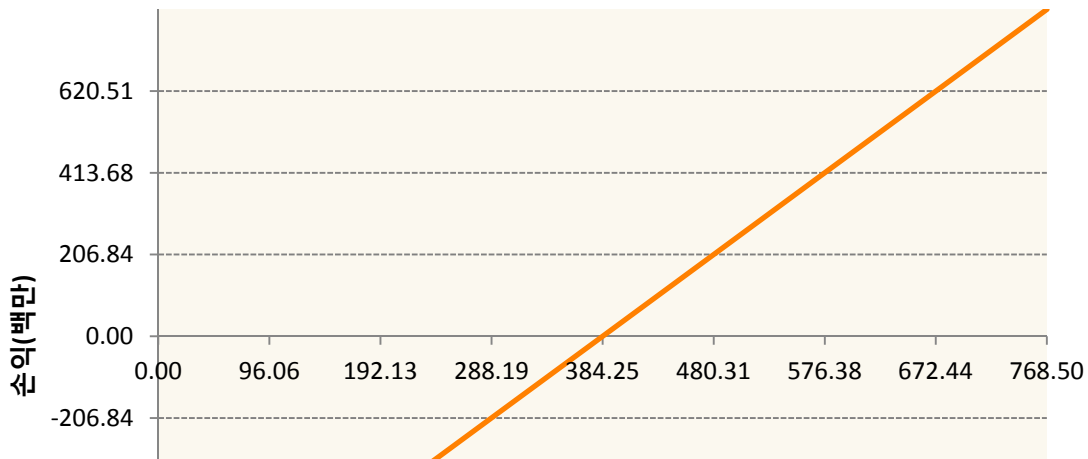
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,694	78	3,615	

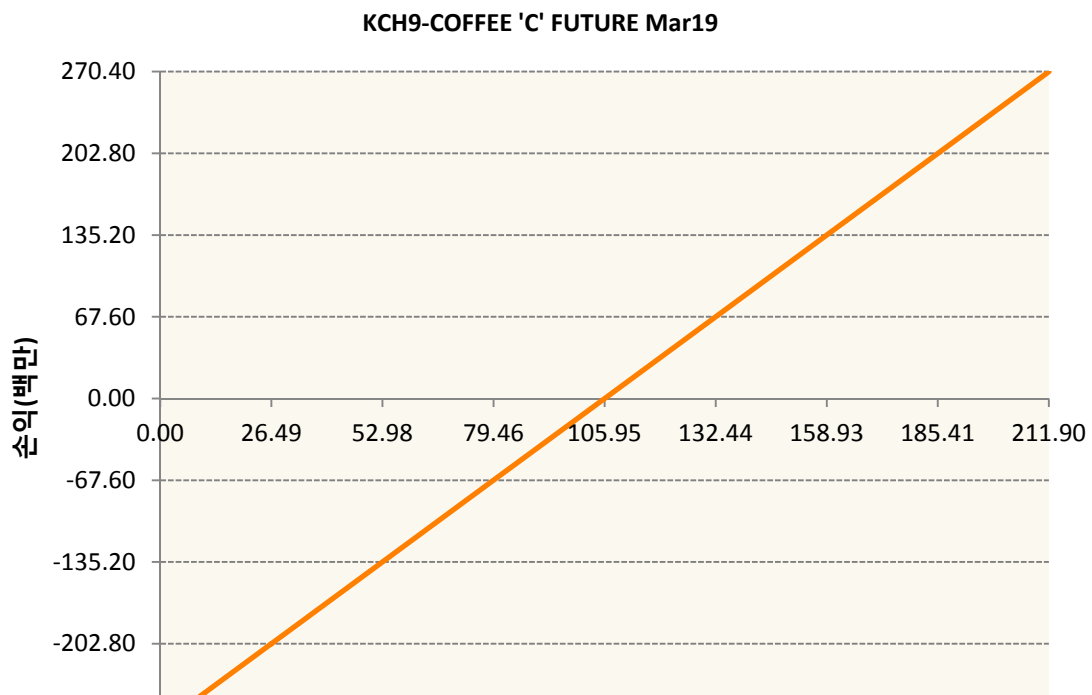
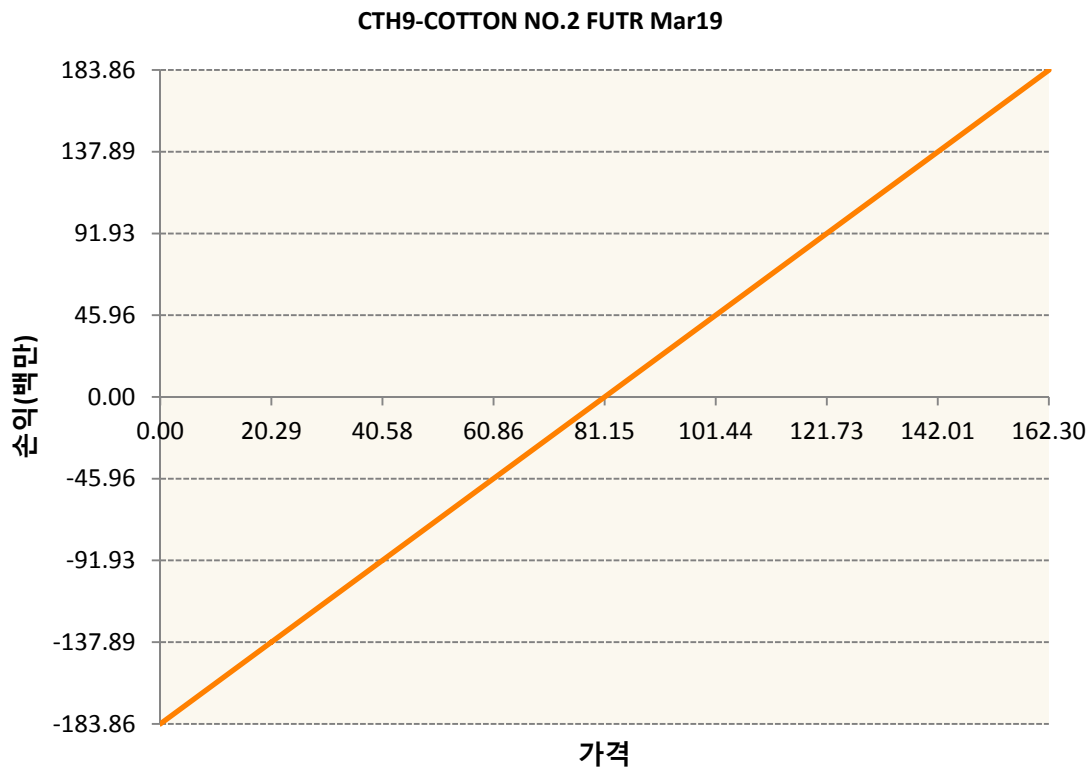
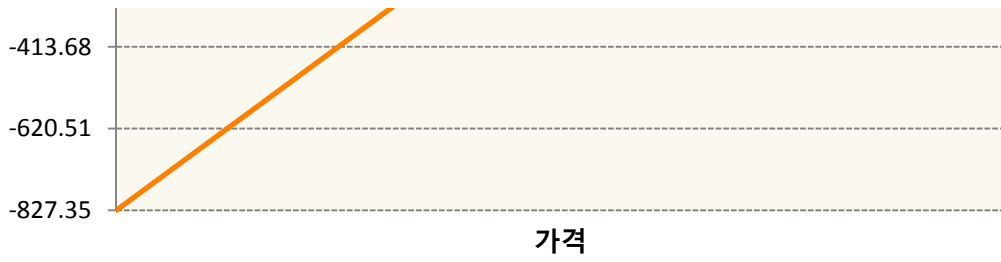
2. 만기시점의 손익구조

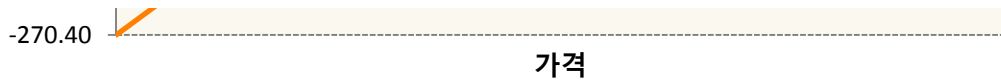
BOF9-SOYBEAN OIL FUTR Jan19



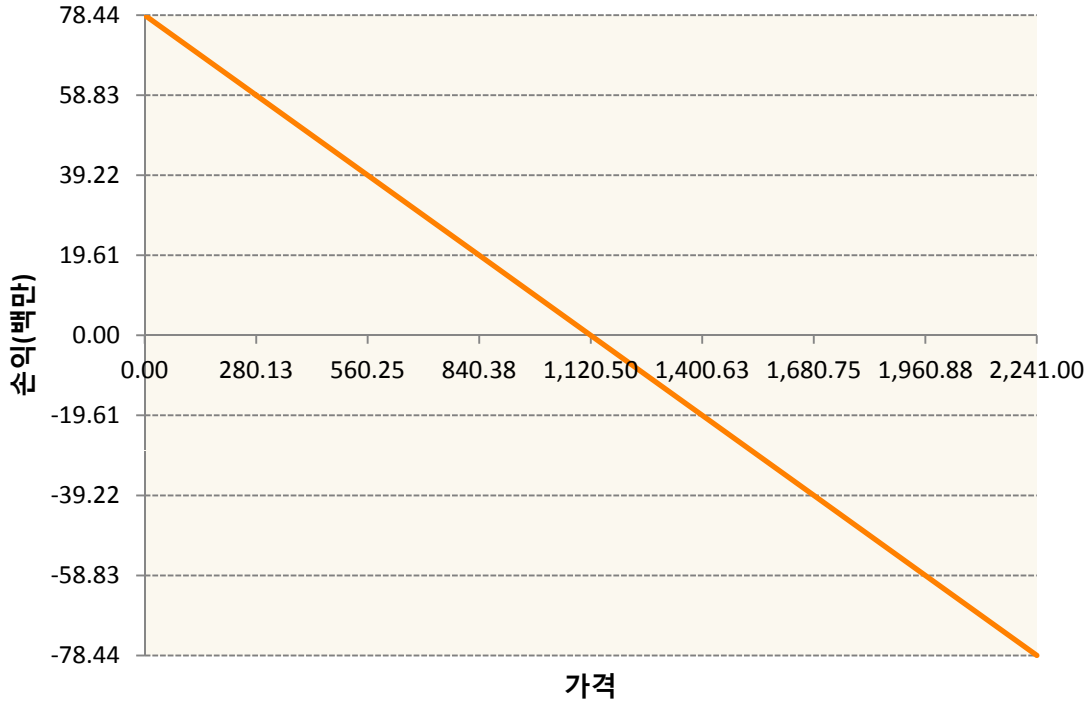
CH9-CORN FUTURE Mar19



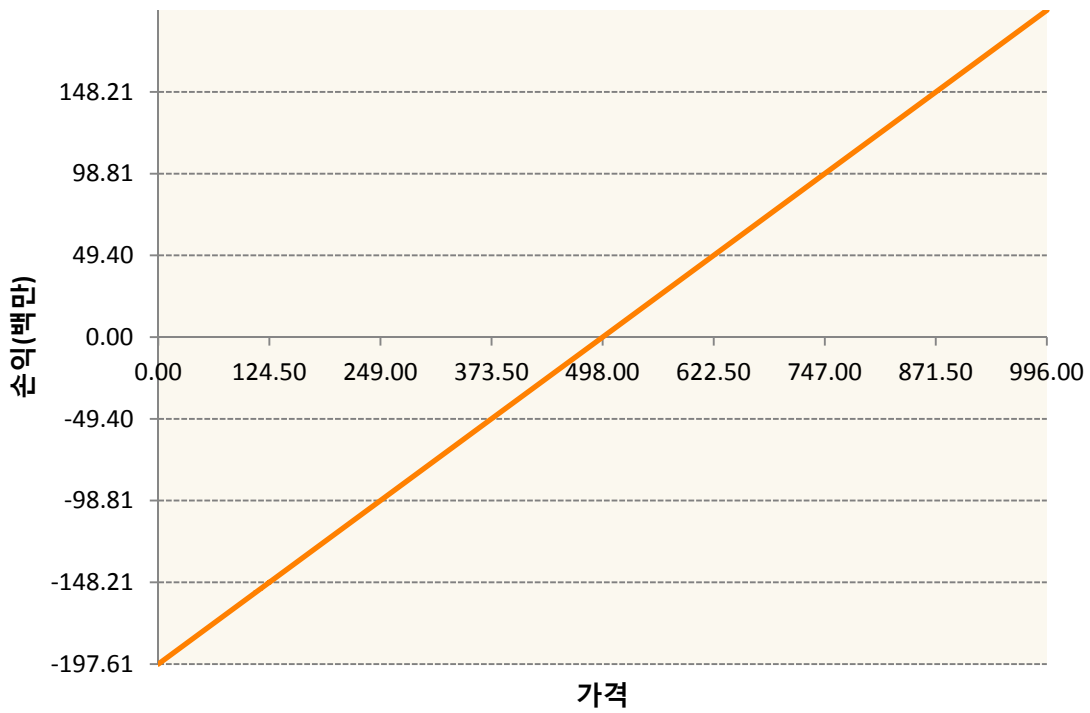




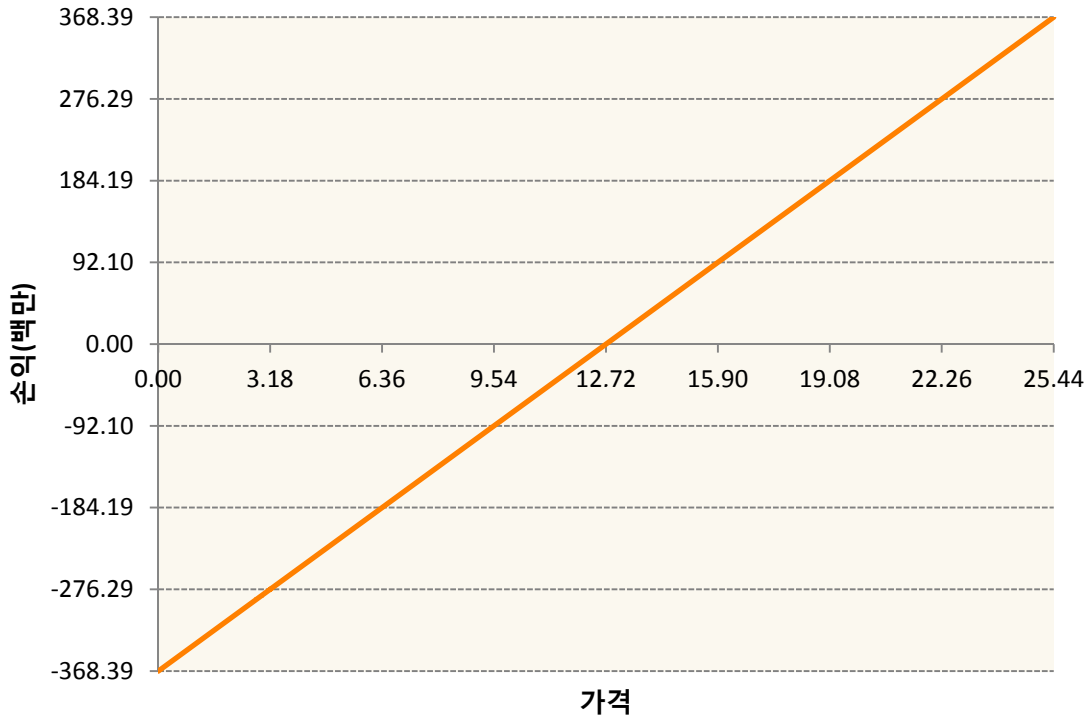
KR4175NC0005-2018-12 달러선물



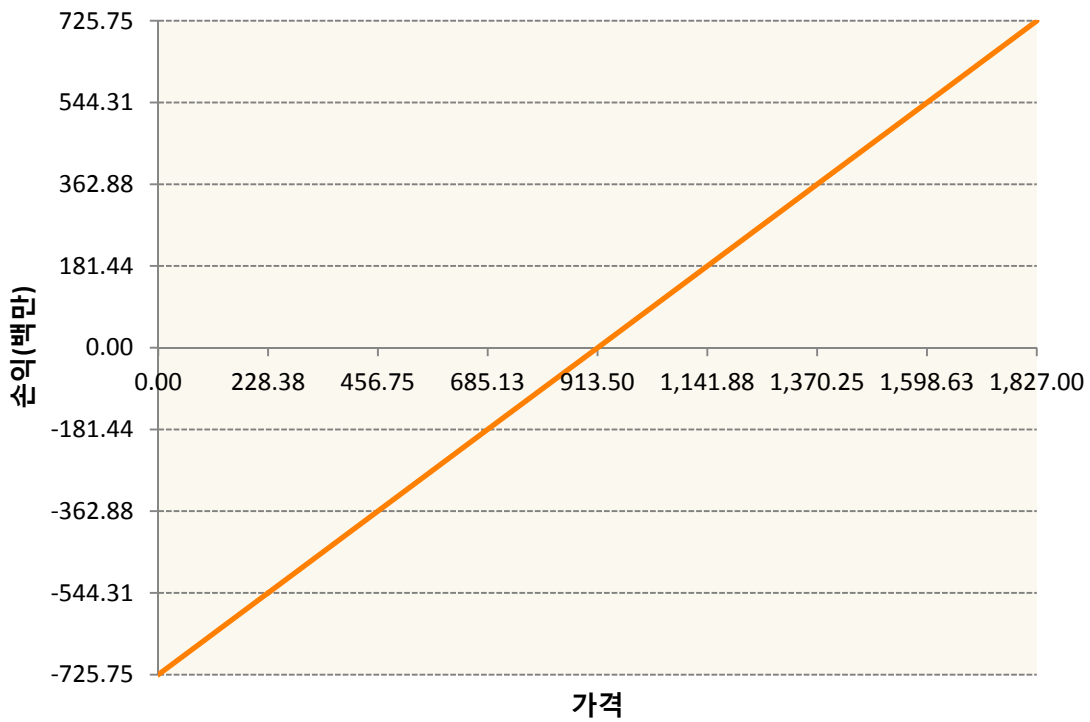
KWH9-KC HRW WHEAT FUT Mar19



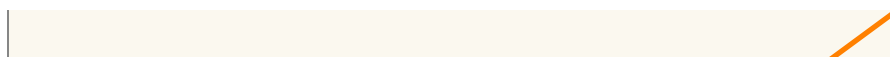
SBH9-SUGAR #11 (WORLD) MAR19

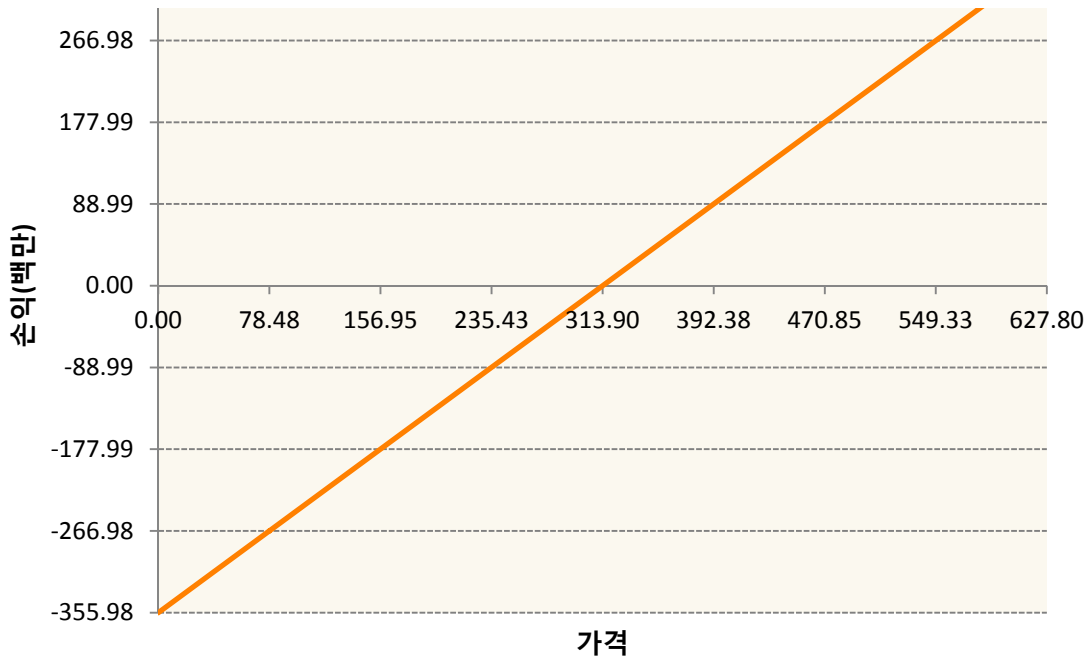


SF9-SOYBEAN FUTURE Jan19

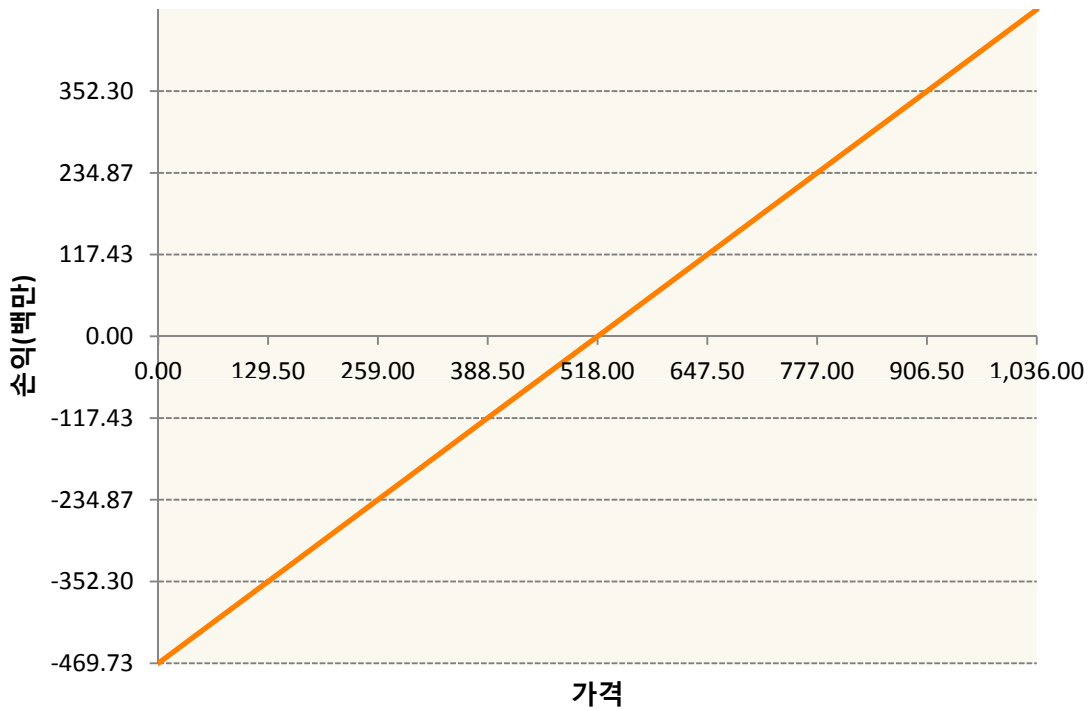


SMF9-SOYBEAN MEAL FUTR Jan19





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	15
KCH9	COFFEE 'C' FUTURE Mar19	22
KR4175NC0	(2018-12 달러선물)	6

KWH9	KC HRW WHEAT FUT Mar19	16
SBH9	SUGAR #11 (WORLD) MAR19	29
SF9	SOYBEAN FUTURE Jan19	58
SMF9	SOYBEAN MEAL FUTR Jan19	28
WH9	WHEAT FUTURE(CBT) Mar19	38

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

(단위:백만원)

316