

공시일	2018-12-27
기준일	2018-12-26

## 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	2018-12-27
기준일	2018-12-26

## 스마트인덱스모

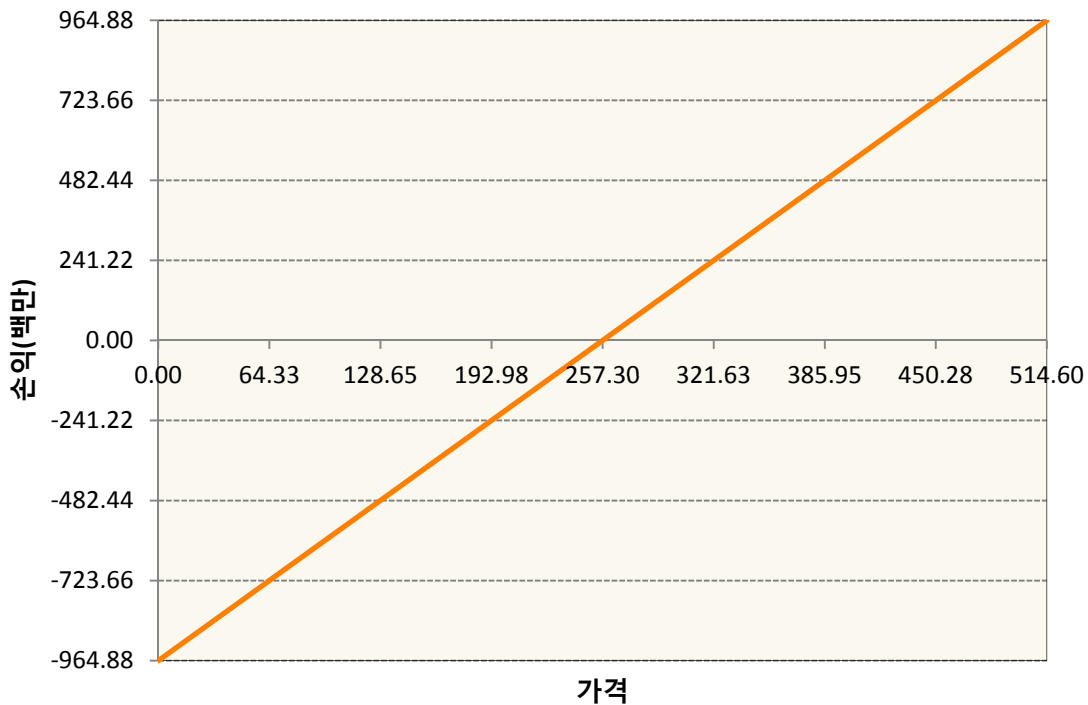
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	965	0	965	장내

### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101P30007-2019-03 코스피200지수선물



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101P30007		2019-03 코스피200지수선물						78
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-78	-78	-78	-78	-78	-78	-78	
-5.33%	-52	-52	-52	-52	-52	-52	-52	
-2.67%	-26	-26	-26	-26	-26	-26	-26	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	26	26	26	26	26	26	26	
5.33%	52	52	52	52	52	52	52	
8.00%	78	78	78	78	78	78	78	

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

(단위:백만원)

68

공시일	2018-12-27
기준일	2018-12-26

## 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

955

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

509

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2018-12-27
기준일	2018-12-26

## 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	3,355	0	3,355	장외

### 2. 만기시점의 손익구조

#### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI50000 신한CSI500미래S180910

256

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

378

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2018-12-27
기준일	2018-12-26

## 유로인덱스모(주식-파생형)

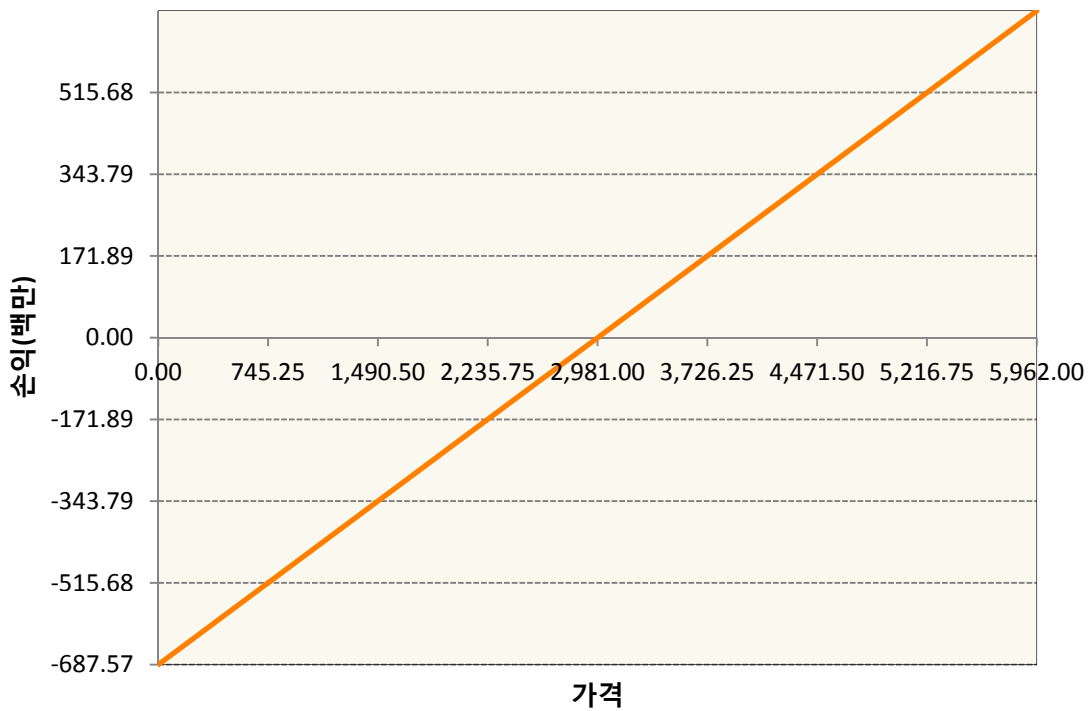
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	688	0	688	

### 2. 만기시점의 손익구조

VGH9-EURO STOXX 50 Mar19



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGH9	EURO STOXX 50 Mar19	55
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

37
----

공시일	2018-12-27
기준일	2018-12-26

## 차이나인덱스모(주식-파생형)

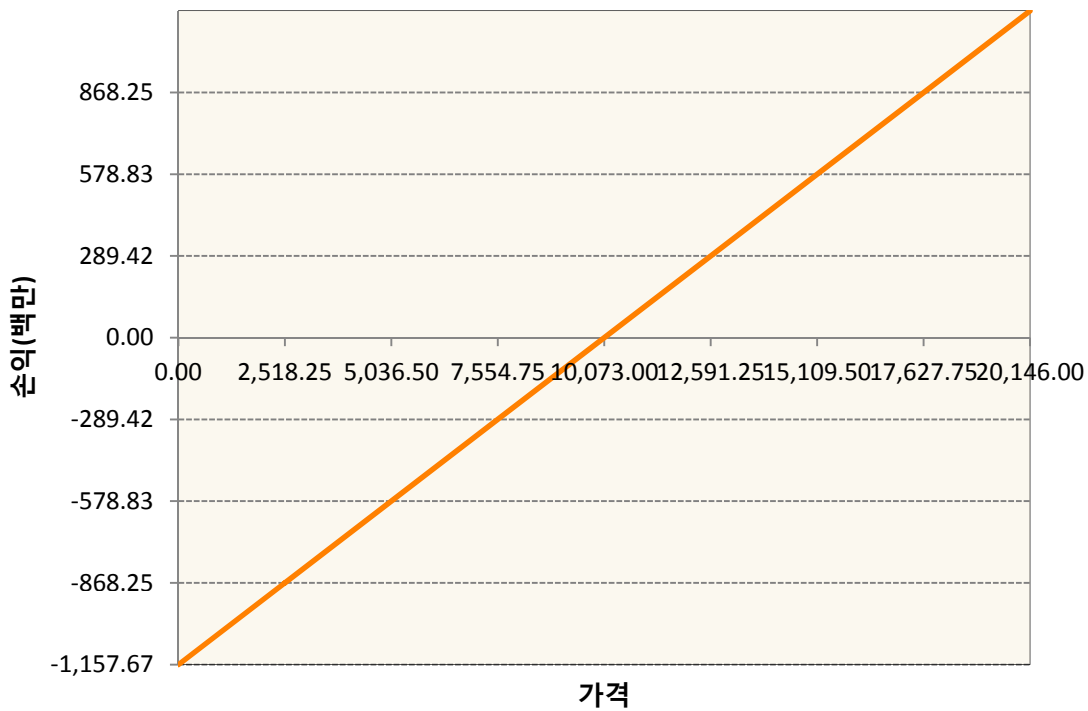
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

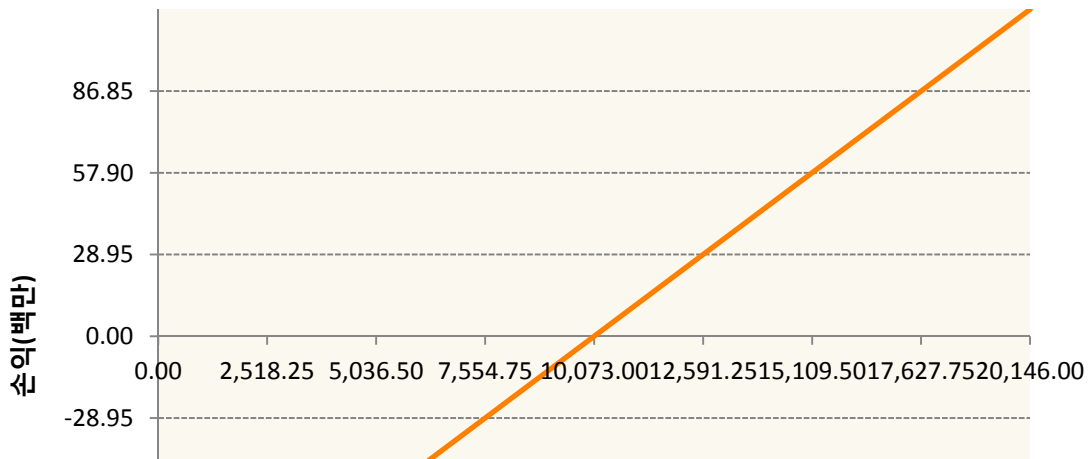
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,273	0	1,273	장내

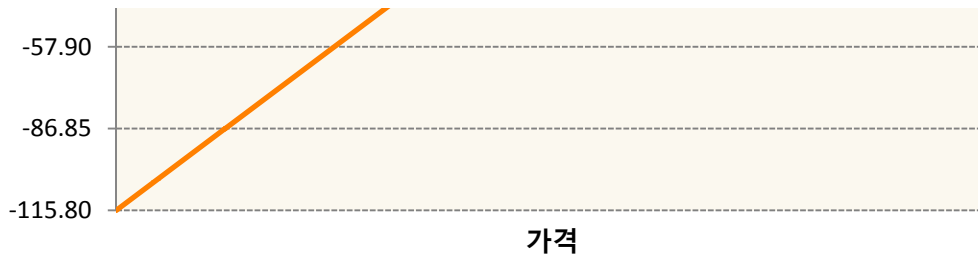
### 2. 만기시점의 손익구조

HCF9-HSCEI FUTURES JAN19



MHCF9-MINI H-SHR IDX FU JAN19





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

HCF9	HSCEI FUTURES JAN19	93
MHCF9	MINI H-SHR IDX FU JAN19	9

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

<b>103</b>
------------

공시일	2018-12-27
기준일	2018-12-26

## 커버드콜모(주식혼합-파생형)

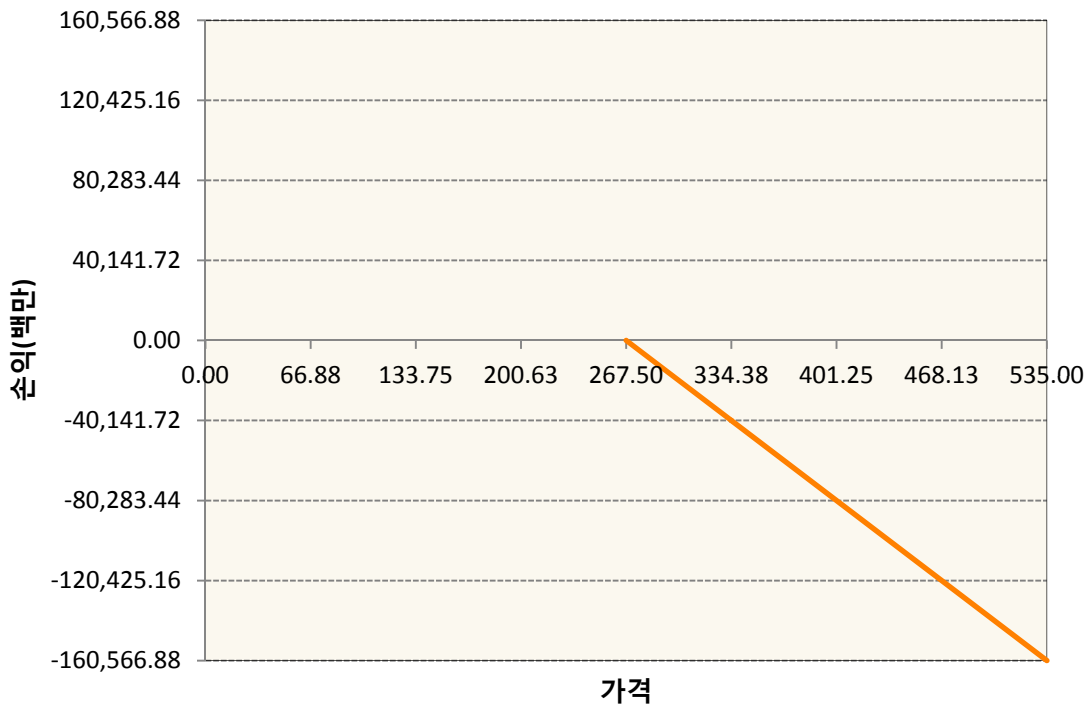
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

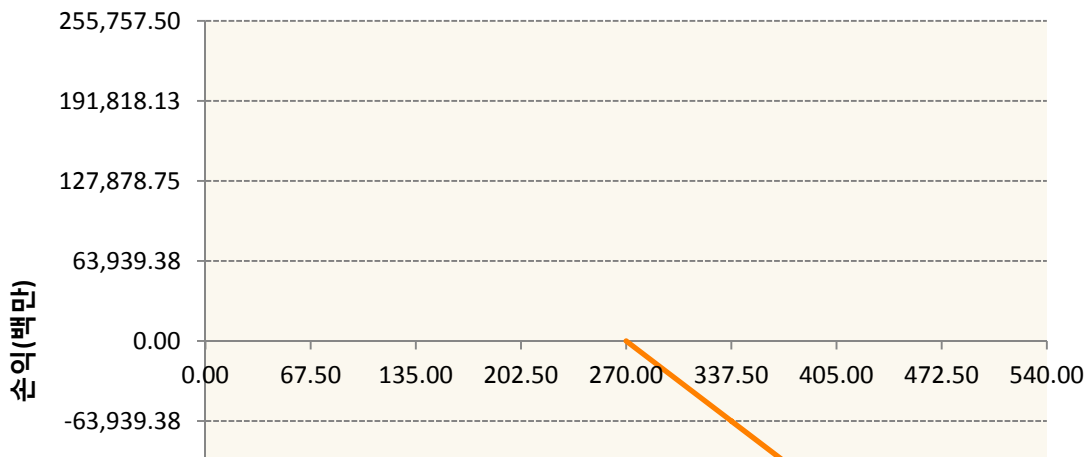
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	699,824	-699,824	장내

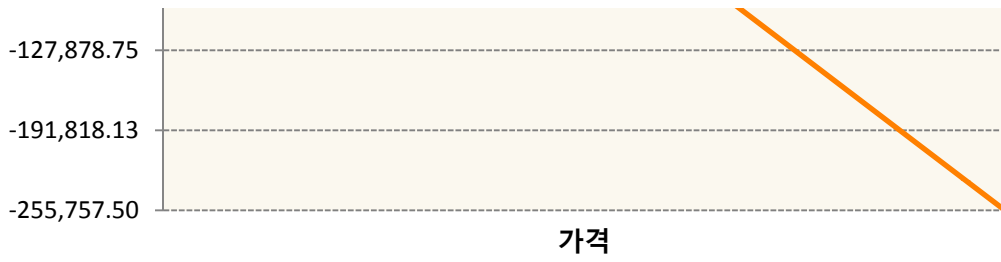
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4201P12672-2019-01 콜267.5

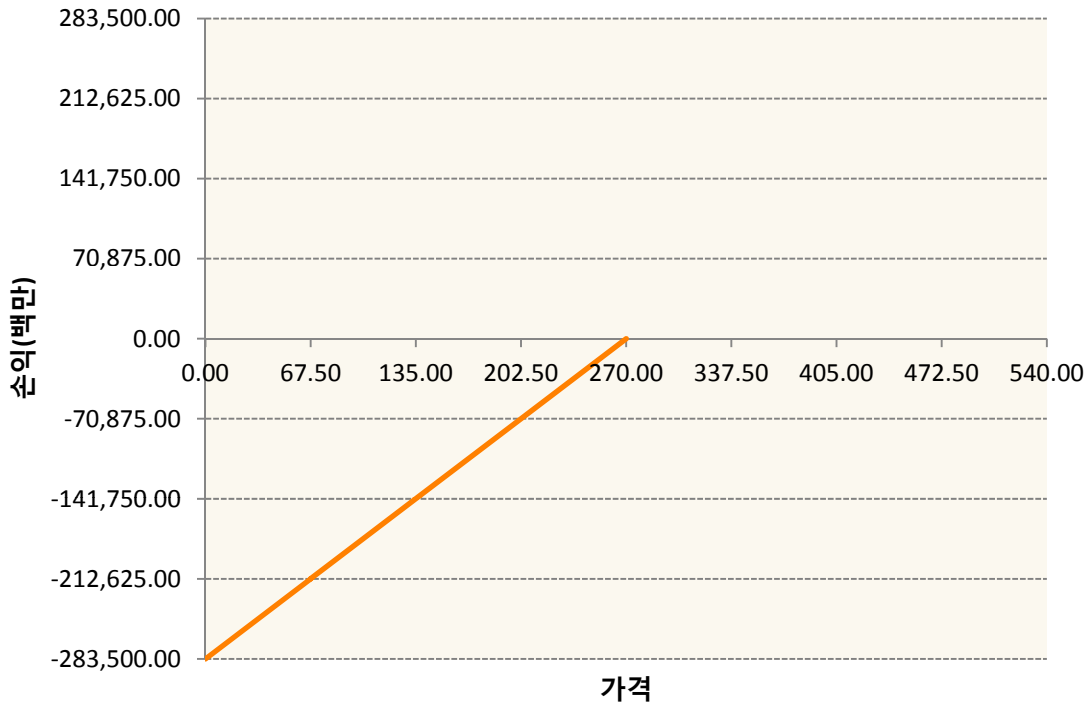


KR4201P12706-2019-01 콜270





KR4301P12704-2019-01 풋270



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4201P12672		2019-01 콜267.5					8,189
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,941	1,925	1,898	1,859	1,805	1,737	1,655
-5.33%	1,874	1,814	1,734	1,635	1,518	1,384	1,236
-2.67%	1,594	1,444	1,273	1,086	886	674	453
0%	789	533	269	0	-273	-550	-830
2.67%	-884	-1,187	-1,490	-1,793	-2,096	-2,399	-2,702
5.33%	-3,541	-3,798	-4,062	-4,334	-4,610	-4,891	-5,175
8.00%	-6,986	-7,145	-7,325	-7,521	-7,733	-7,956	-8,189
KR4201P12706		2019-01 콜270					11,871
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	2,382	2,367	2,340	2,296	2,233	2,149	2,045

-5.33%	2,322	2,257	2,165	2,044	1,896	1,722	1,523
-2.67%	2,037	1,852	1,634	1,386	1,113	818	505
0%	1,116	762	389	0	-401	-811	-1,229
2.67%	-995	-1,468	-1,942	-2,417	-2,893	-3,370	-3,847
5.33%	-4,640	-5,091	-5,547	-6,009	-6,474	-6,942	-7,413
8.00%	-9,675	-9,988	-10,329	-10,691	-11,071	-11,465	-11,871
KR4301P12704                      2019-01 풋270							20,351
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-20,244	-20,246	-20,251	-20,262	-20,281	-20,310	-20,351
-5.33%	-12,956	-12,976	-13,010	-13,061	-13,131	-13,222	-13,333
-2.67%	-5,779	-5,877	-6,004	-6,160	-6,340	-6,543	-6,767
0%	869	601	310	0	-325	-662	-1,009
2.67%	6,130	5,713	5,294	4,874	4,453	4,031	3,608
5.33%	9,325	8,941	8,549	8,150	7,746	7,338	6,927
8.00%	10,704	10,486	10,239	9,968	9,675	9,365	9,041

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

(단위:백만원)

**40,139**

공시일	2018-12-27
기준일	2018-12-26

## 홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

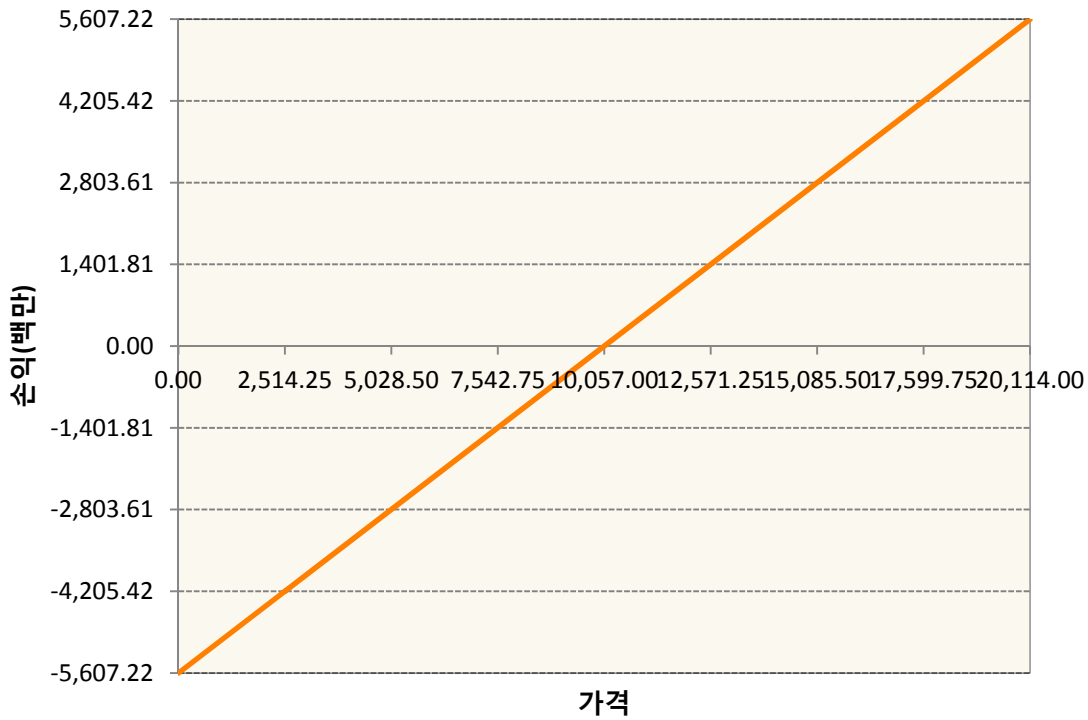
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

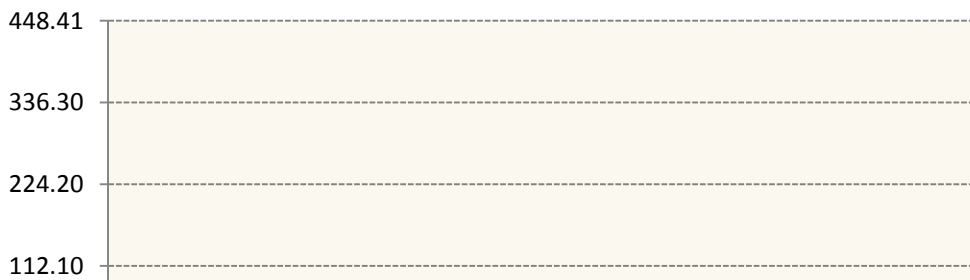
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	5,607	0	5,607	
누계	유가증권	옵션	0	13,084	-13,084	장내
누계	통화	선도	0	2,731	-2,731	장외

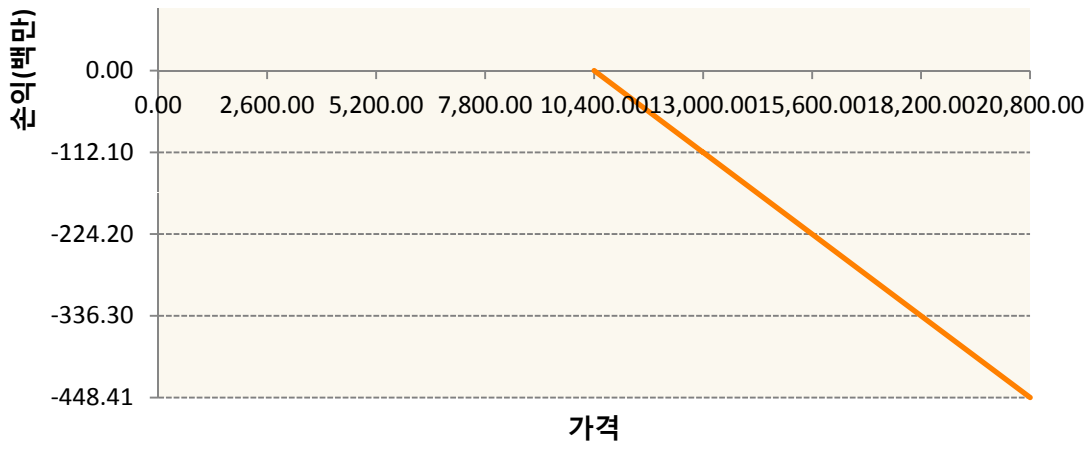
### 2. 만기시점의 손익구조

HCZ8-HSCEI FUTURES DEC 18

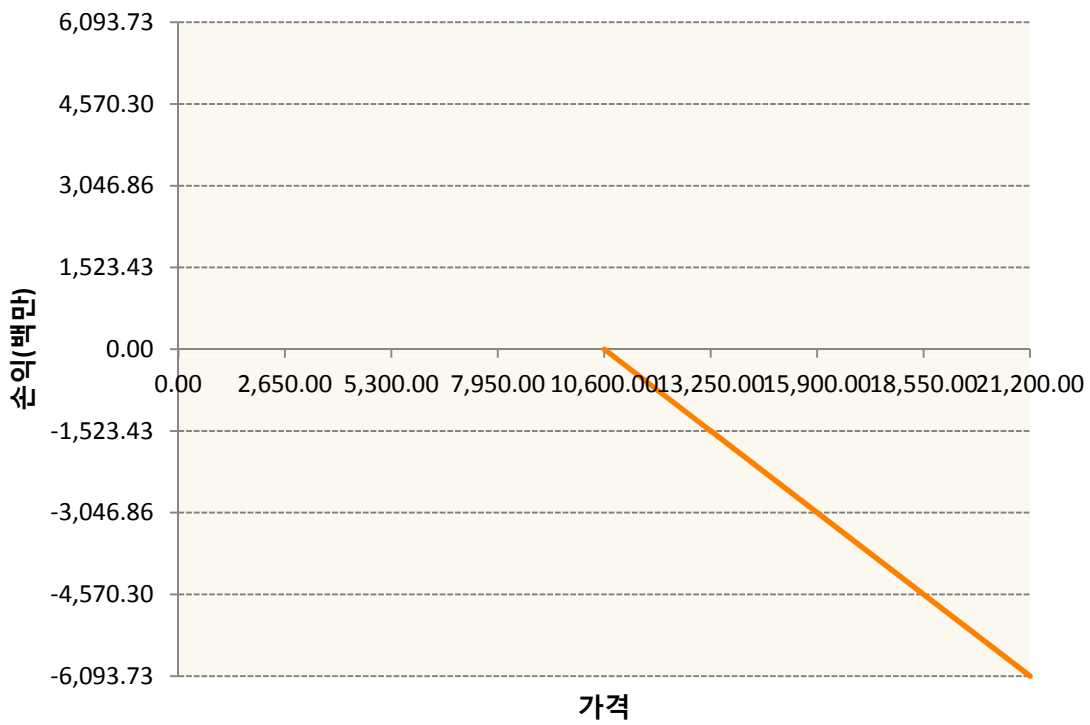


OHHI28-C104-HSCEI

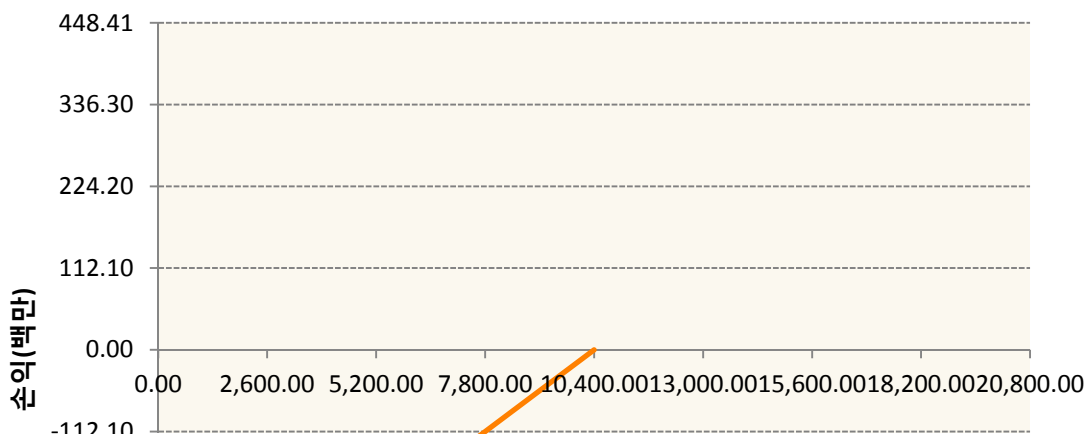


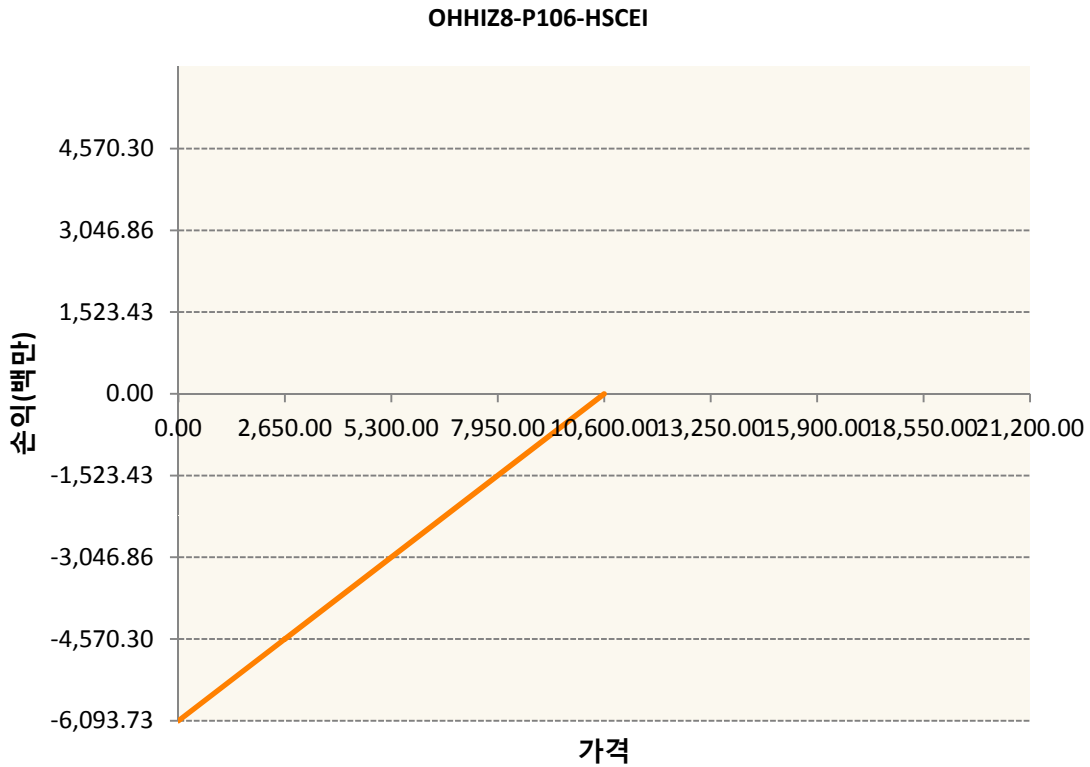


**OHHIZ8-C106-HSCEI**



**OHHIZ8-P104-HSCEI**





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)	(단위:백만원)
FX21018Z00 KRW/HKD 11-03-19E	218
HCZ8 HSCEI FUTURES DEC 18	449
OHHIZ8-C1C HSCEI	36
OHHIZ8-C1C HSCEI	488
OHHIZ8-P10 HSCEI	36
OHHIZ8-P10 HSCEI	488

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	<b>1,541</b>

공시일	2018-12-27
기준일	2018-12-26

## 코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

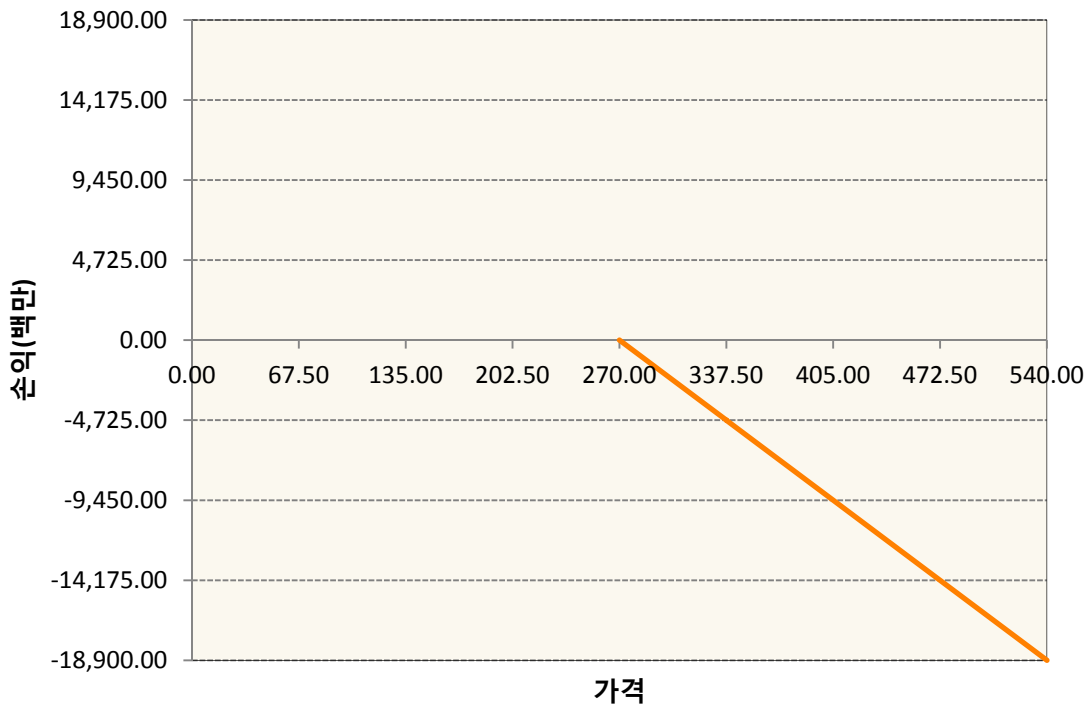
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

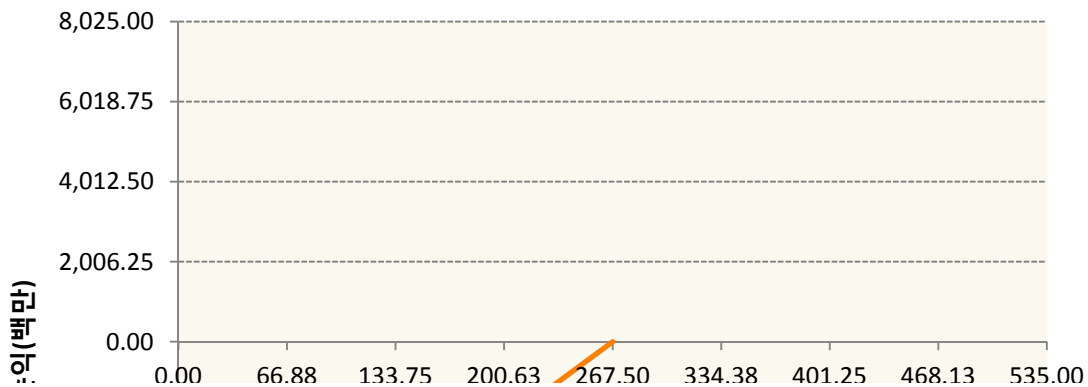
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	스왑	31,836	0	31,836	장외
누계	유가증권	옵션	0	34,350	-34,350	장내

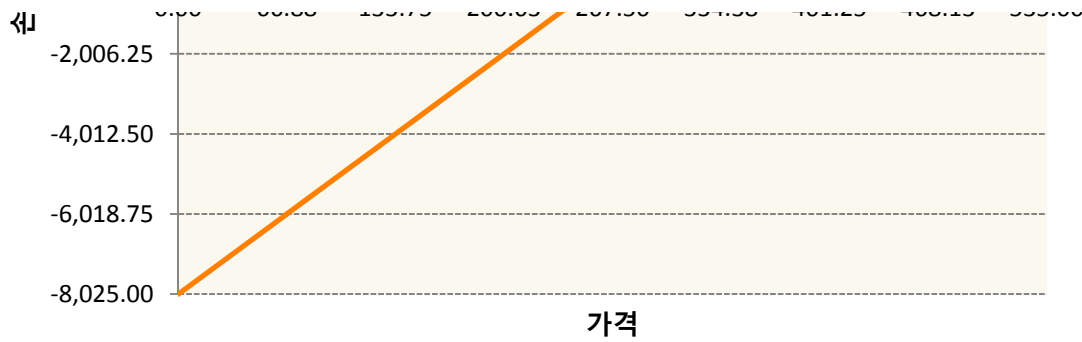
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4201P12706-2019-01 콜270

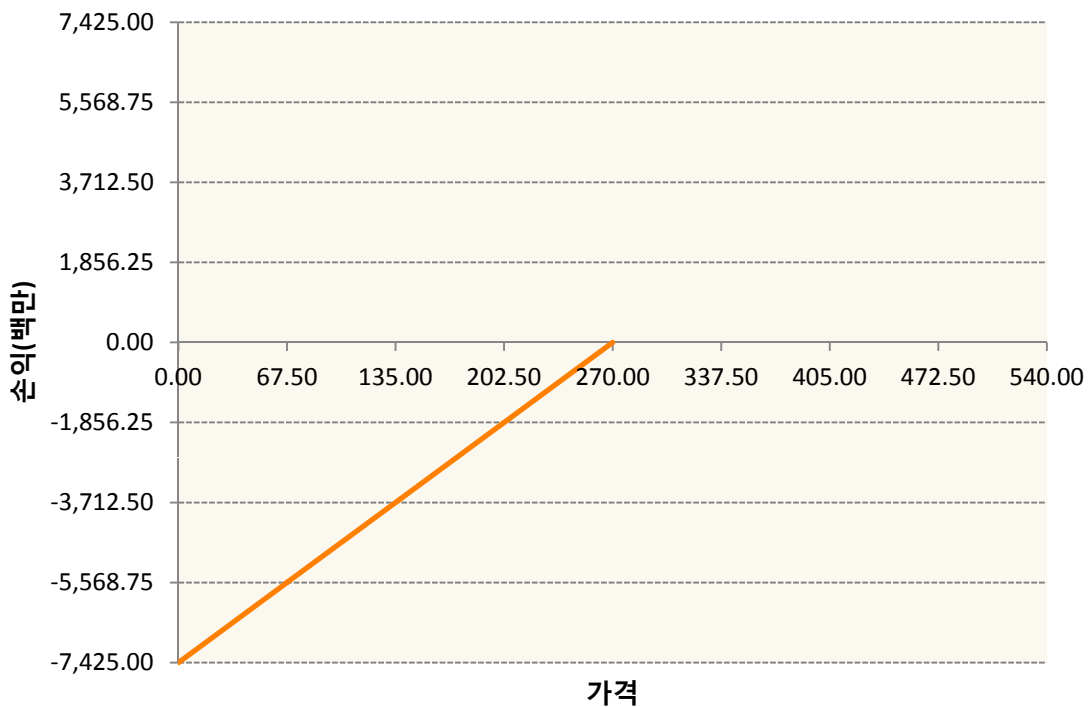


KR4301P12670-2019-01 풋267.5





KR4301P12704-2019-01 콜270



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

	2.529E+11		UBCSFXC1 INDEX_14				2,639
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-2,639	-2,639	-2,639	-2,639	-2,639	-2,639	-2,639
-5.33%	-1,760	-1,760	-1,760	-1,760	-1,760	-1,760	-1,760
-2.67%	-880	-880	-880	-880	-880	-880	-880
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	880	880	880	880	880	880	880
5.33%	1,760	1,760	1,760	1,760	1,760	1,760	1,760
8.00%	2,639	2,639	2,639	2,639	2,639	2,639	2,639
	KR4201P12706		2019-01 콜270				877
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	176	175	173	170	165	159	151
-5.33%	172	167	160	151	140	127	113
-2.67%	151	137	121	102	82	60	37
0%	83	56	29	0	-30	-60	-91
2.67%	-74	-108	-144	-179	-214	-249	-284
5.33%	-343	-376	-410	-444	-478	-513	-548
8.00%	-715	-738	-763	-790	-818	-847	-877

KR4301P12670                      2019-01 풋267.5                      564

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-560	-560	-560	-561	-561	-563	-564
-5.33%	-352	-353	-354	-357	-360	-363	-367
-2.67%	-150	-154	-159	-165	-171	-178	-186
0%	29	20	10	0	-10	-21	-32
2.67%	160	148	136	123	111	99	87
5.33%	230	221	211	201	190	180	169
8.00%	256	252	246	240	233	226	218

KR4301P12704                      2019-01 풋270                      533

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-530	-530	-530	-531	-531	-532	-533
-5.33%	-339	-340	-341	-342	-344	-346	-349
-2.67%	-151	-154	-157	-161	-166	-171	-177
0%	23	16	8	0	-9	-17	-26
2.67%	161	150	139	128	117	106	94
5.33%	244	234	224	213	203	192	181
8.00%	280	275	268	261	253	245	237

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

(단위:백만원)

**4,606**

공시일	2018-12-27
기준일	2018-12-26

## 유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

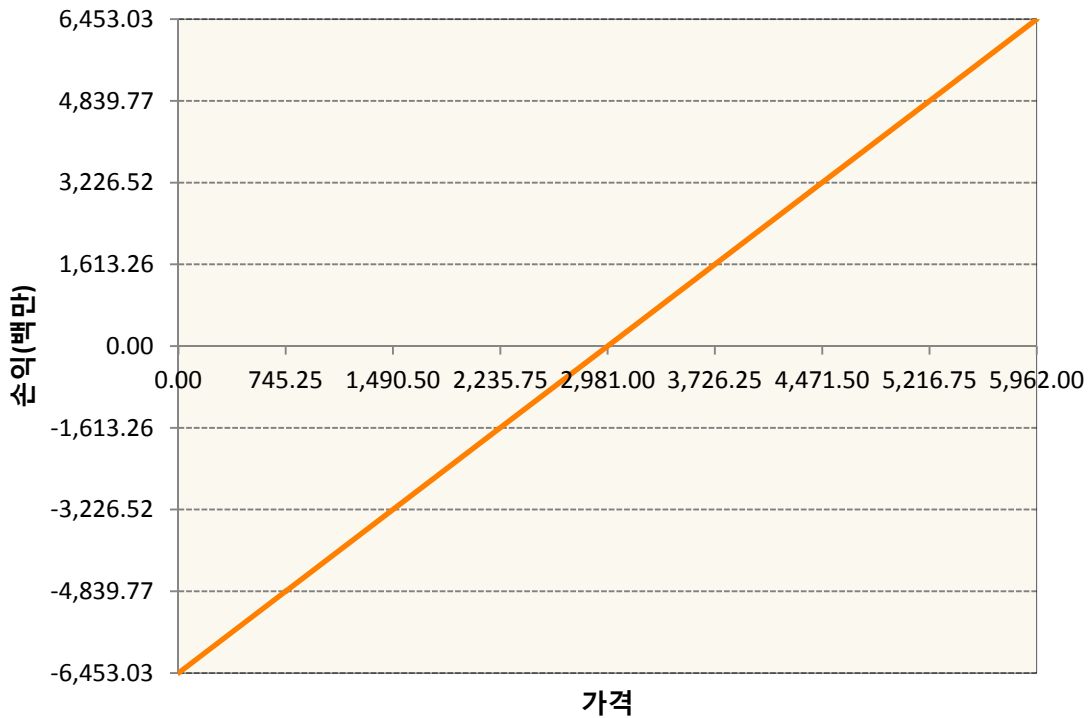
### 1. 계약금액

(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	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	6,453	0	6,453	
누계	유가증권	스왑	71,692	0	71,692	장외
누계	통화	선도	0	15,403	-15,403	장외

### 2. 만기시점의 손익구조

VGH9-EURO STOXX 50 Mar19



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

260105SQP×SG EURO Covered CALL STRATEGY	167
FX21018X02 KRW/EUR 22-02-19E	411
FX21018Z03 KRW/EUR 22-03-19E	821
VGH9 EURO STOXX 50 Mar19	516

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

(단위:백만원)

1,221



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

(단위:백만원)

1,062



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

(단위:백만원)

90



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

(단위:백만원)

136

공시일	2018-12-27
기준일	2018-12-26

## 스마트KRX300인덱스목표전환형1호

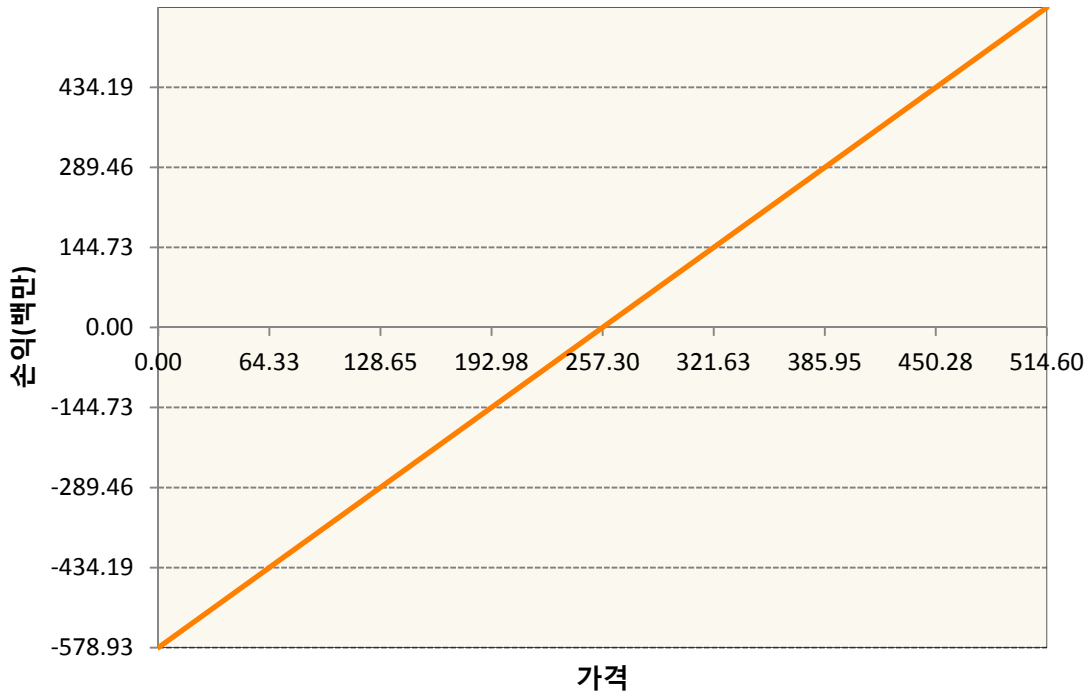
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	579	0	579	장내

### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101P30007-2019-03 코스피200지수선물



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101P30007		2019-03 코스피200지수선물						47
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-47	-47	-47	-47	-47	-47	-47	
-5.33%	-31	-31	-31	-31	-31	-31	-31	
-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%	31	31	31	31	31	31	31	
8.00%	47	47	47	47	47	47	47	

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

(단위:백만원)

41

공시일	2018-12-27
기준일	2018-12-26

## 리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

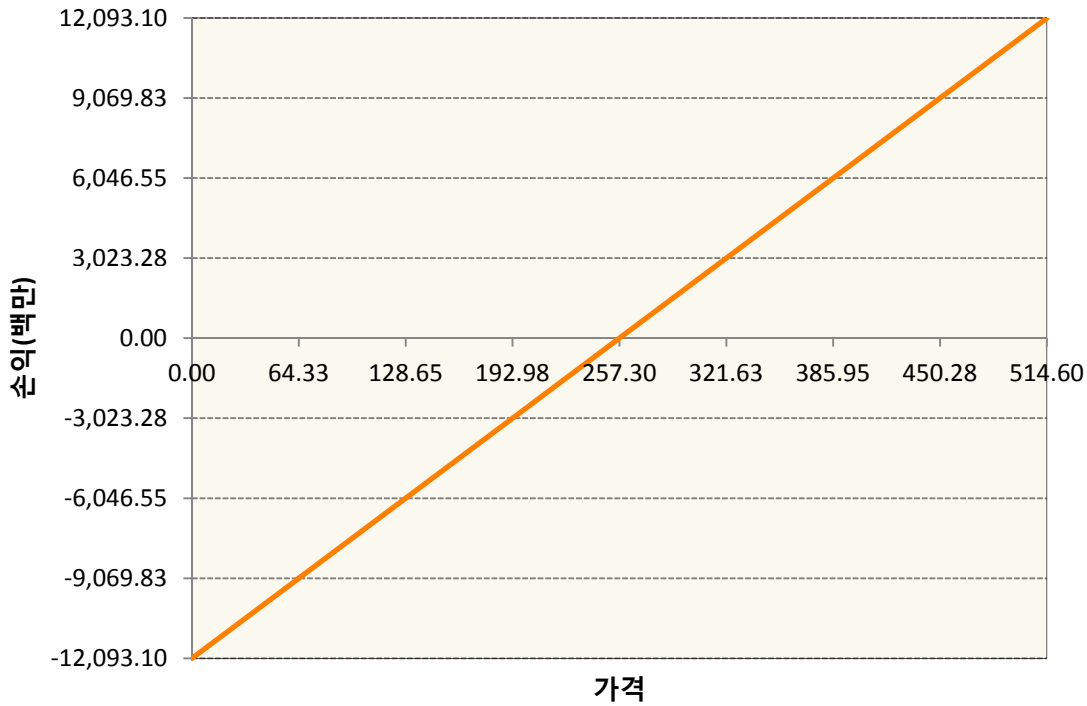
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

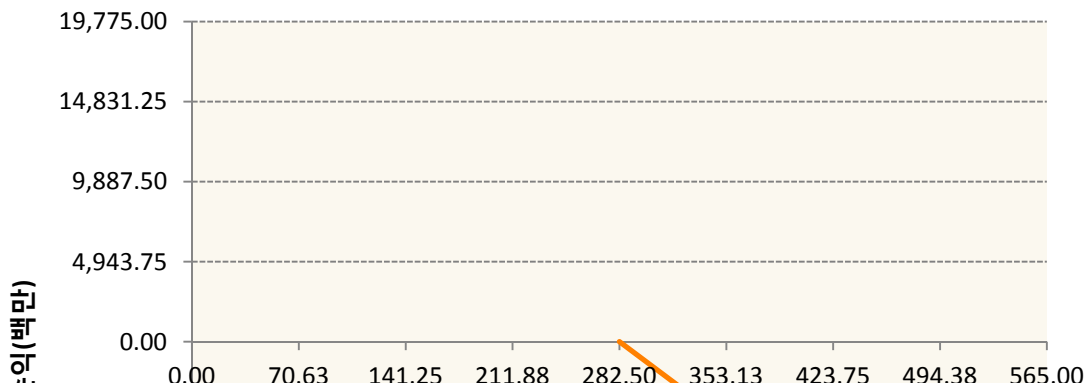
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	12,093	0	12,093	장내
누계	유가증권	옵션	1,145	23,338	-22,193	장내

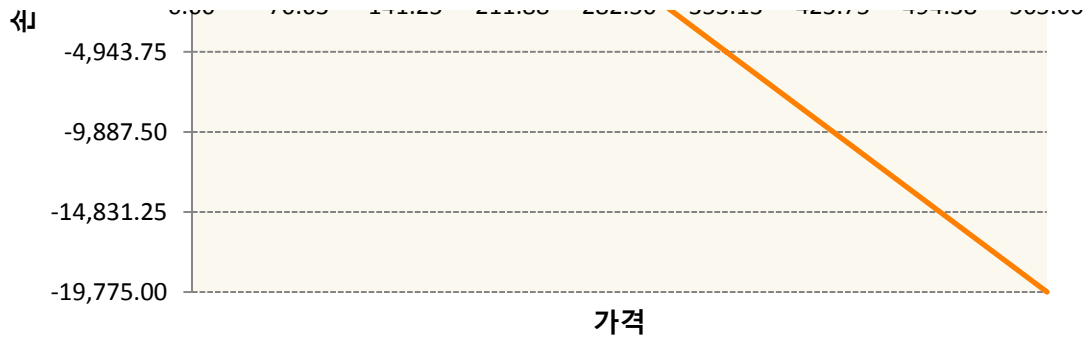
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101P30007-2019-03 코스피200지수선물

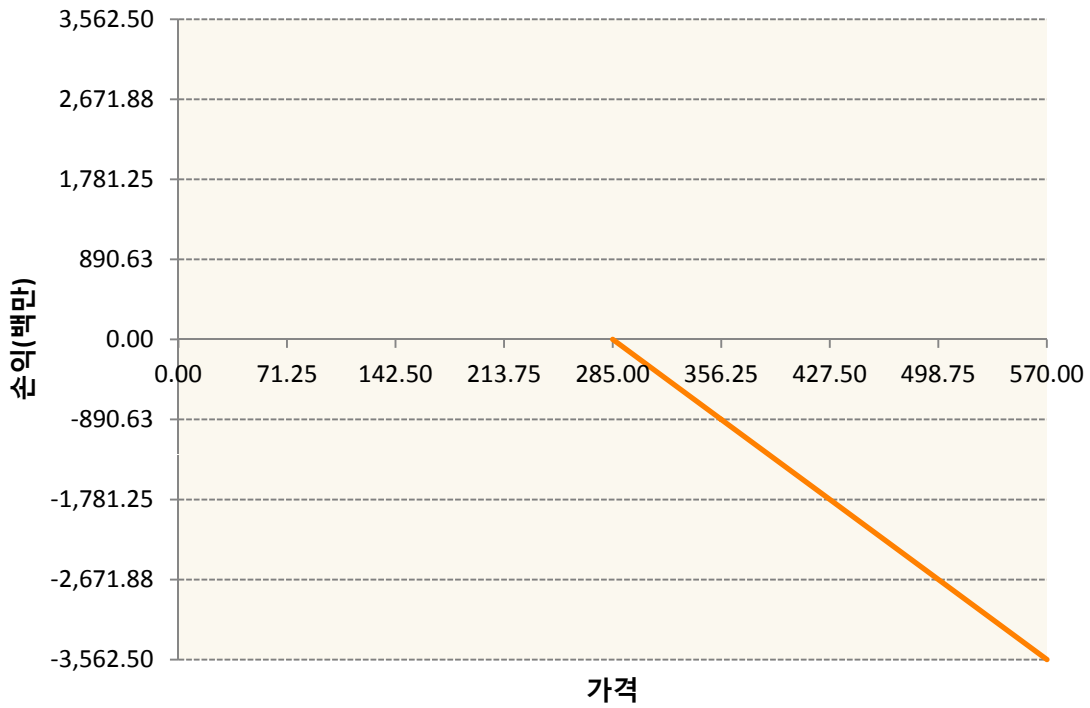


KR4201P12821-2019-01 콜282.5

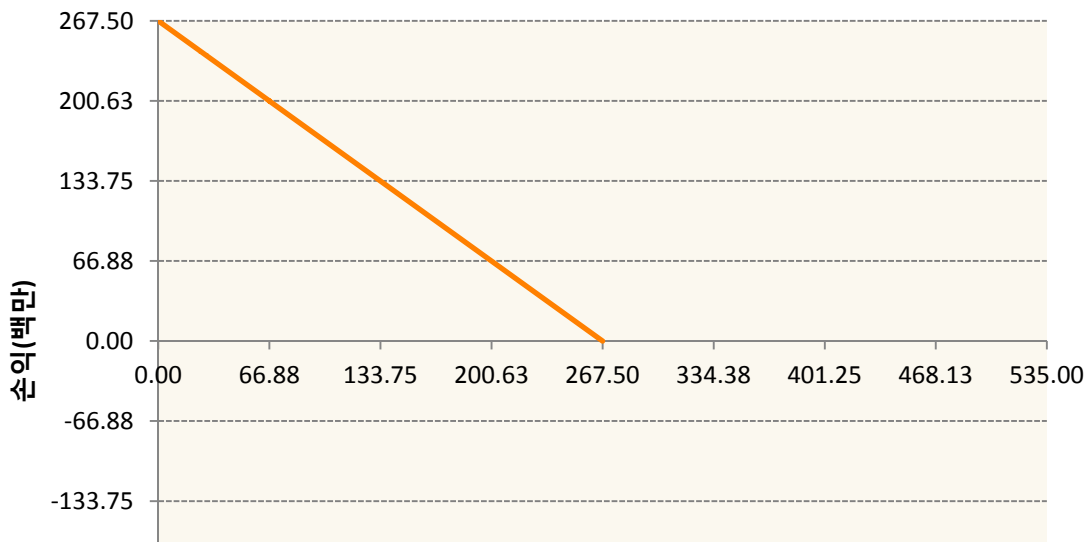


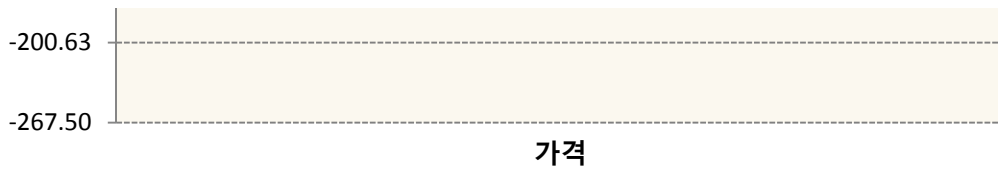


KR4201P12854-2019-01 콜285

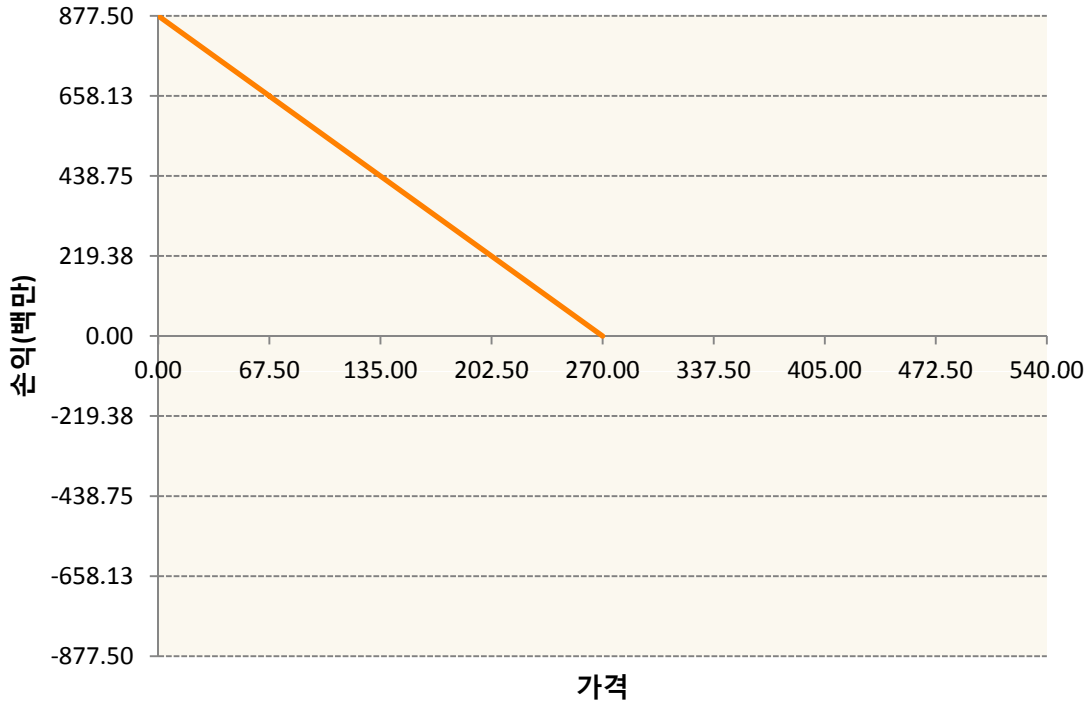


KR4301P12670-2019-01 풋267.5





KR4301P12704-2019-01 풋270



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101P30007		2019-03 코스피200지수선물						981
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-981	-981	-981	-981	-981	-981	-981	
-5.33%	-654	-654	-654	-654	-654	-654	-654	
-2.67%	-327	-327	-327	-327	-327	-327	-327	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	327	327	327	327	327	327	327	
5.33%	654	654	654	654	654	654	654	
8.00%	981	981	981	981	981	981	981	
KR4201P12821		2019-01 콜282.5						494
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	39	39	39	39	38	37	35	
-5.33%	39	39	38	36	34	30	25	
-2.67%	38	36	32	27	20	11	1	

0%	30	22	12	0	-15	-31	-49
2.67%	-2	-20	-40	-63	-87	-113	-140
5.33%	-90	-120	-152	-184	-217	-251	-285
8.00%	-271	-308	-345	-383	-420	-457	-494
KR4201P12854                      2019-01 콜285							76
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	5	5	5	5	5	5	4
-5.33%	5	5	5	5	4	4	3
-2.67%	5	5	4	3	3	1	0
0%	4	3	2	0	-2	-5	-7
2.67%	0	-2	-5	-9	-12	-16	-21
5.33%	-11	-16	-21	-26	-32	-37	-43
8.00%	-37	-44	-50	-57	-63	-70	-76
KR4301P12670                      2019-01 풋267.5							19
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	19	19	19	19	19	19	19
-5.33%	12	12	12	12	12	12	12
-2.67%	5	5	5	5	6	6	6
0%	-1	-1	0	0	0	1	1
2.67%	-5	-5	-5	-4	-4	-3	-3
5.33%	-8	-7	-7	-7	-6	-6	-6
8.00%	-9	-8	-8	-8	-8	-8	-7
KR4301P12704                      2019-01 풋270							63
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	63	63	63	63	63	63	63
-5.33%	40	40	40	40	41	41	41
-2.67%	18	18	19	19	20	20	21
0%	-3	-2	-1	0	1	2	3
2.67%	-19	-18	-16	-15	-14	-12	-11
5.33%	-29	-28	-26	-25	-24	-23	-21
8.00%	-33	-32	-32	-31	-30	-29	-28

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

(단위:백만원)

1,258

공시일	2018-12-27
기준일	2018-12-26

## 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	197	0	197	

### 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	2018-12-27
기준일	2018-12-26

## H2O글로벌본드(UH)(채권혼합-파)

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	62	0	62	
누계	유가증권	수익증권	1,953	0	1,953	

### 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	2018-12-27
기준일	2018-12-26

## 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	1,650	0	1,650	
누계	통화	선도	0	2,015	-2,015	장외

### 2. 만기시점의 손익구조

### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음
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
FX21018Z01 KRW/USD 28-02-19E	2
FX21018Z01 KRW/USD 28-02-19E	28
FX21018Z01 KRW/USD 28-02-19E	9
FX21018Z02 KRW/USD 28-02-19E	40
FX21018Z02 KRW/USD 19-02-19E	2
FX21018Z02 KRW/USD 19-02-19E	5
FX21018Z03 KRW/USD 19-02-19E	21
FX21018Z03 KRW/USD 19-02-19E	32

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

(단위:백만원)

<b>61</b>
-----------



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

(단위:백만원)

128

공시일	2018-12-27
기준일	2018-12-26

## 에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

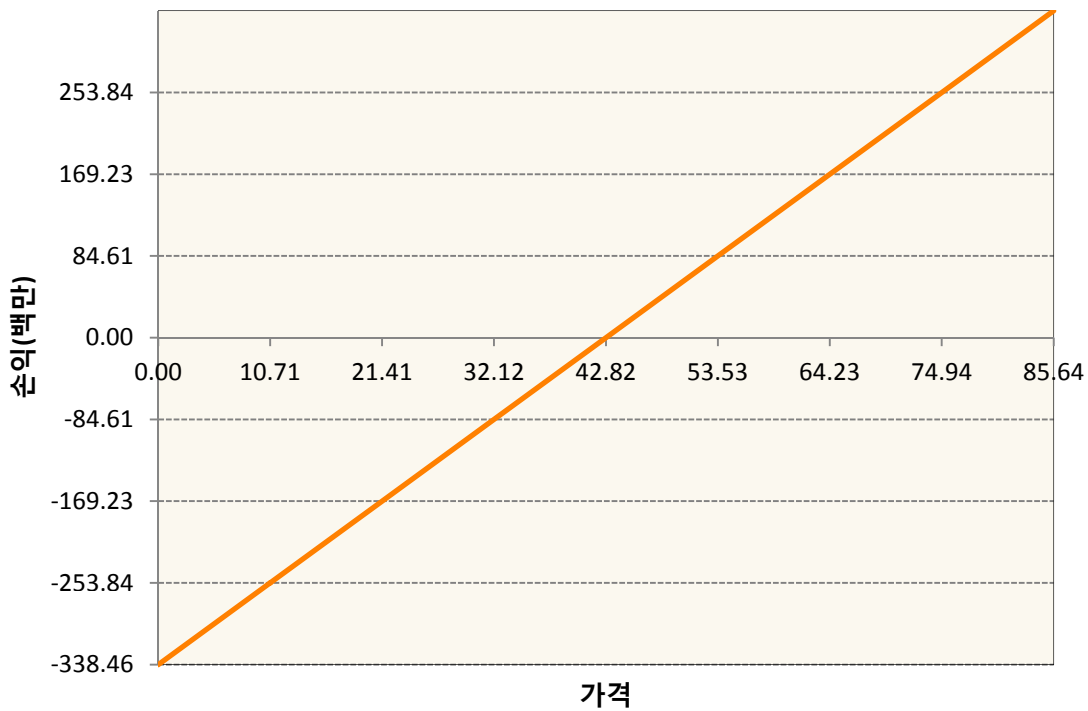
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

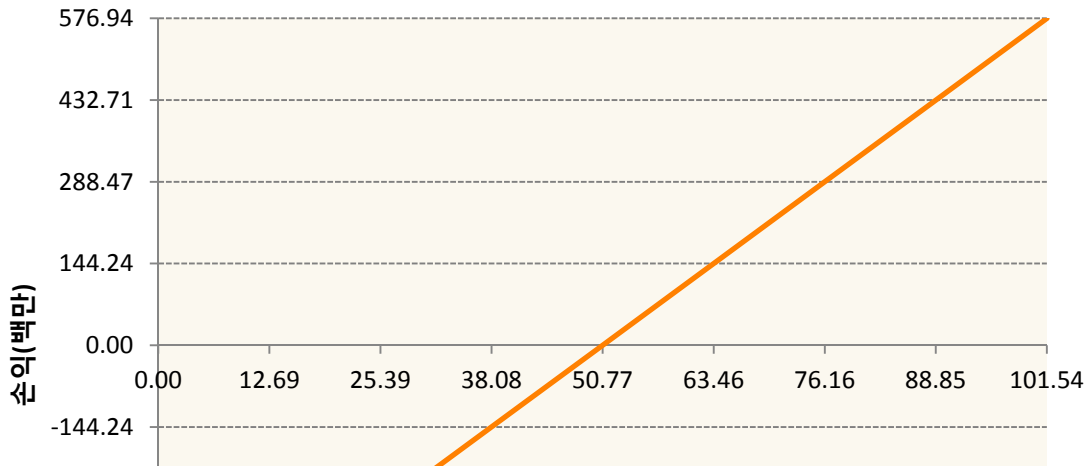
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,385	203	2,182	

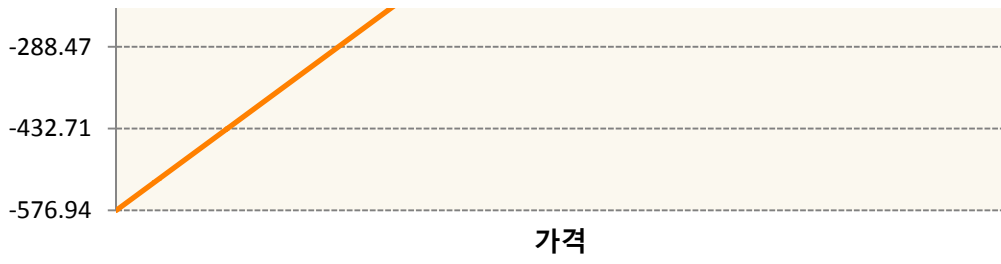
### 2. 만기시점의 손익구조

CLH9-WTI CRUDE FUTURE MAR19

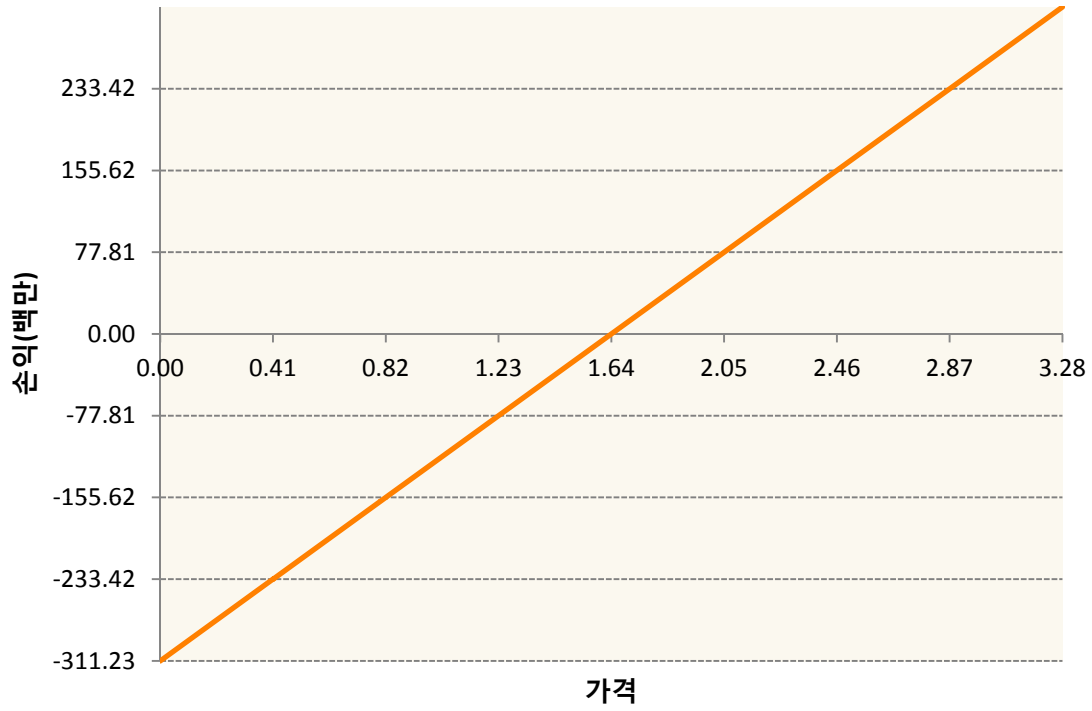


COH9-BRENT CRUDE FUTR Mar19

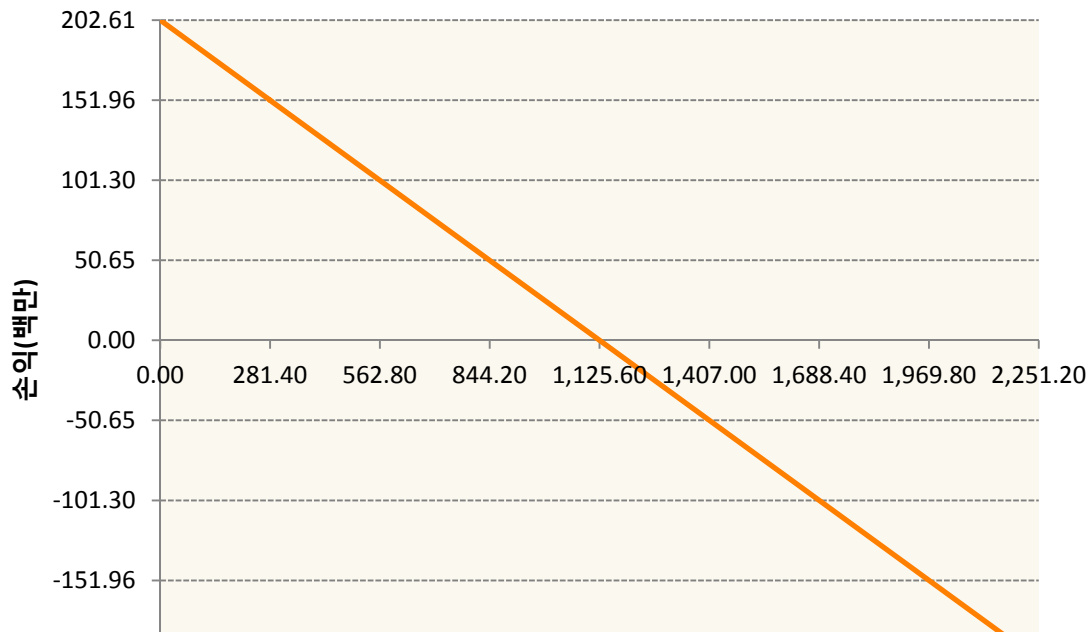


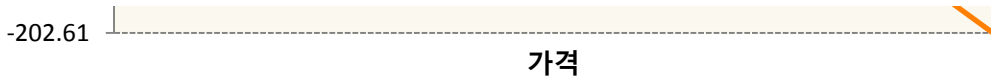


**HOH9-NY Harb ULSD Fut Mar19**

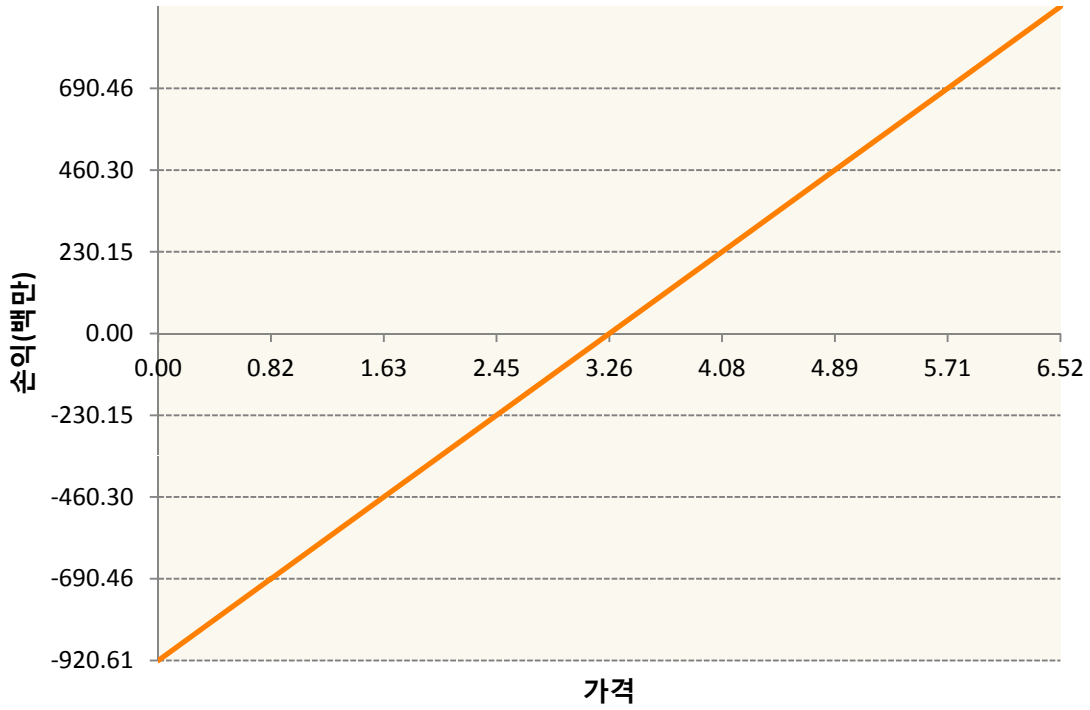


**KR4175P10003-2019-01 달러선물**

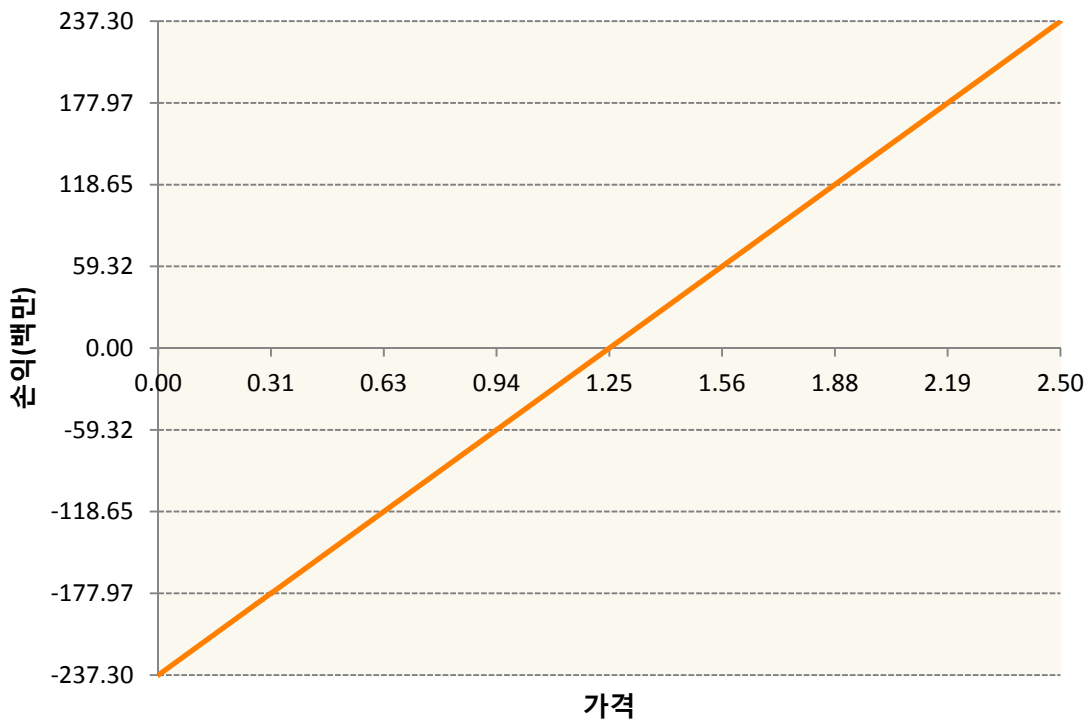




NGH19-NATURAL GAS FUTR Mar19



XBH9-GASOLINE RBOB FUT Mar19



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

CLH9	WTI CRUDE FUTURE MAR19	27
COH9	BRENT CRUDE FUTR Mar19	46
HOH9	NY Harb ULSD Fut Mar19	25
KR4175P100	2019-01 달러선물	16
NGH19	NATURAL GAS FUTR Mar19	74
XBH9	GASOLINE RBOB FUT Mar19	19

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

355

공시일	2018-12-27
기준일	2018-12-26

## 애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

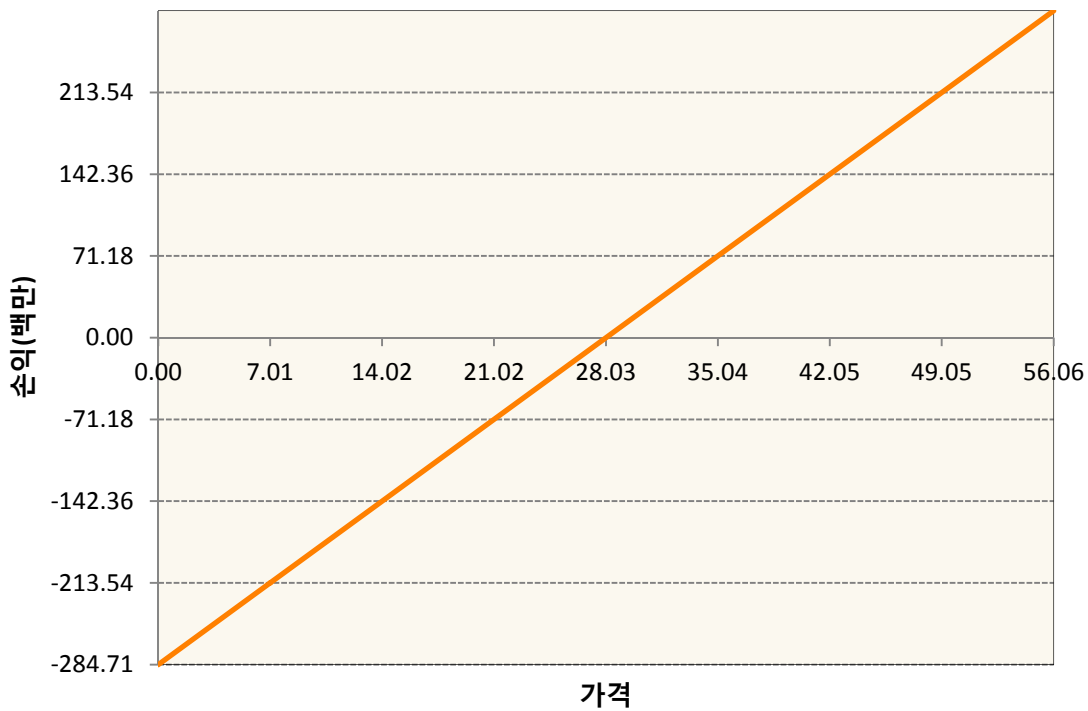
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

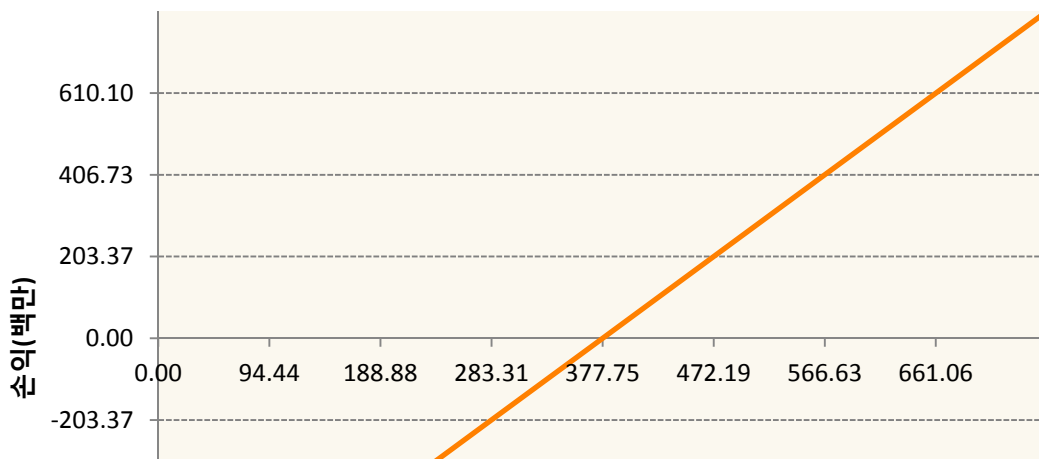
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,611	79	3,532	

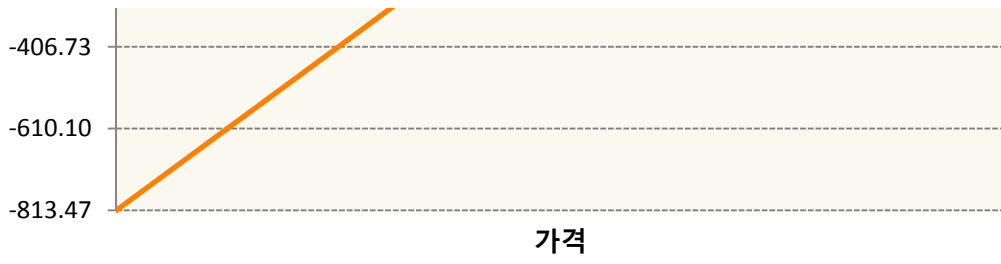
### 2. 만기시점의 손익구조

**BOH9-SOYBEAN OIL FUTR Mar19**

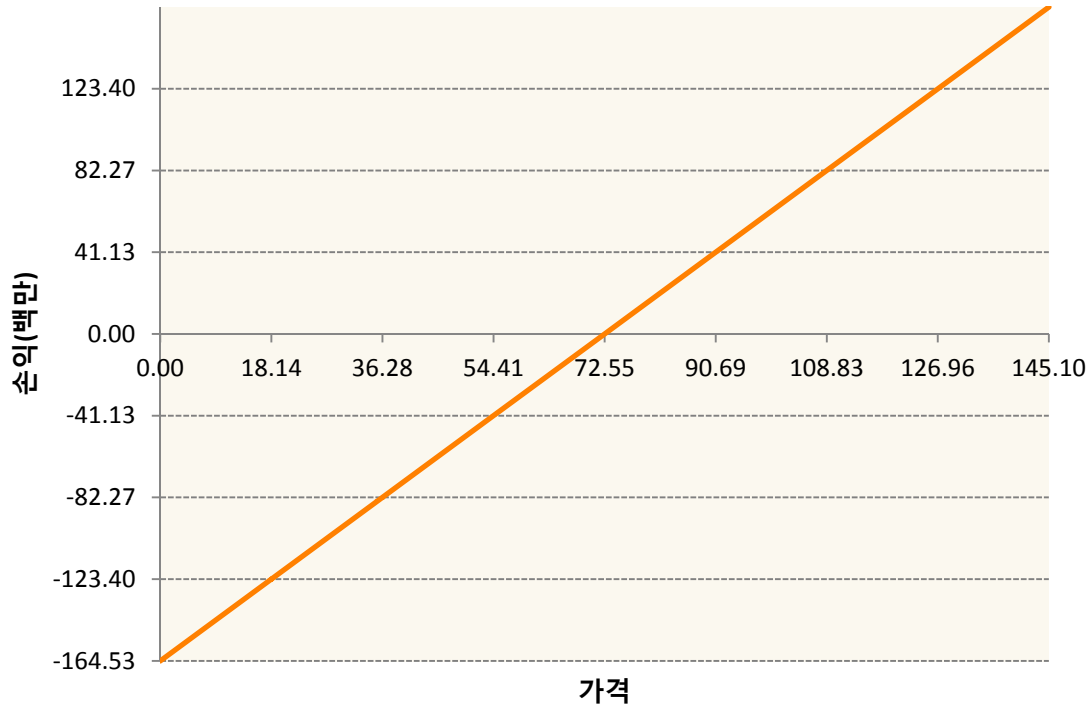


**CH9-CORN FUTURE Mar19**

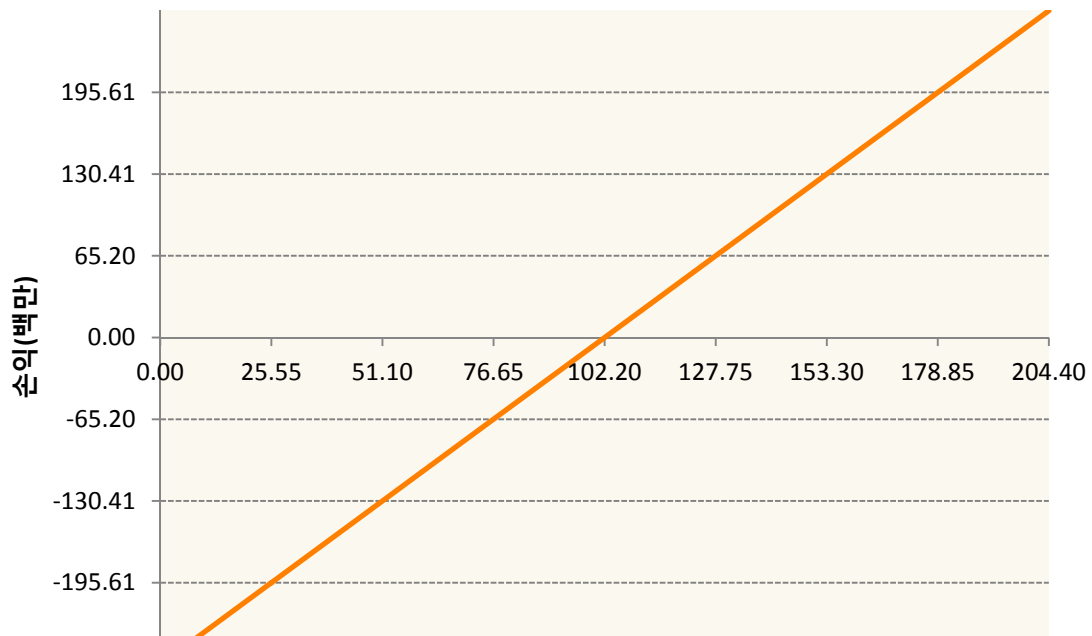


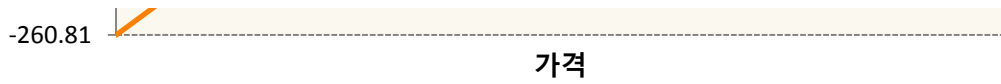


**CTH9-COTTON NO.2 FUTR Mar19**

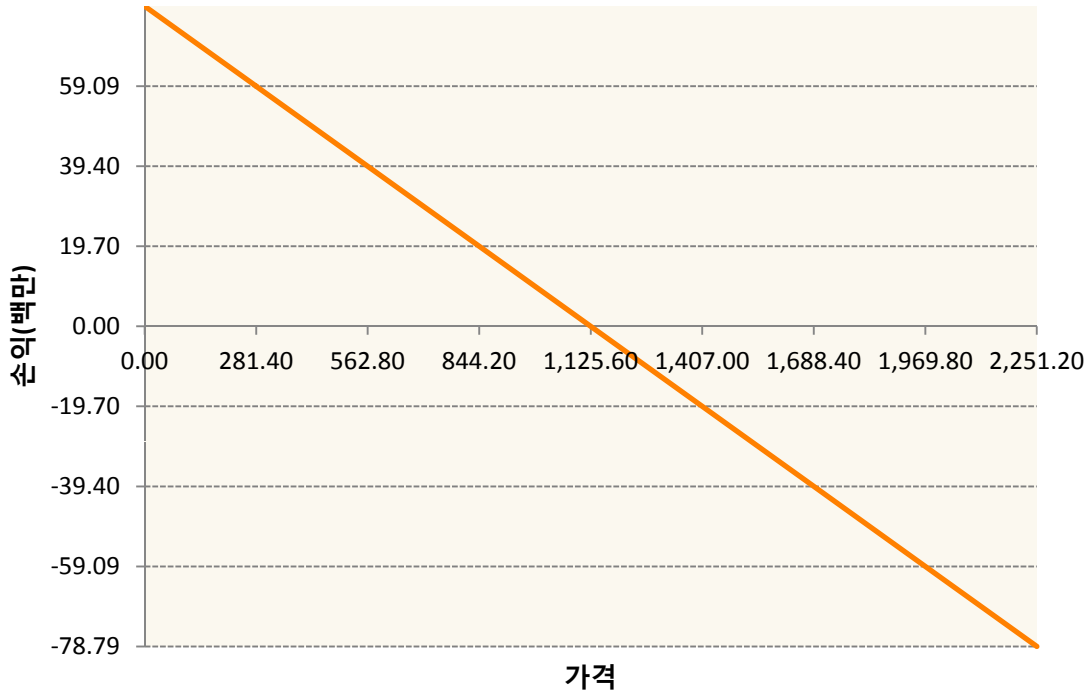


**KCH9-COFFEE 'C' FUTURE Mar19**

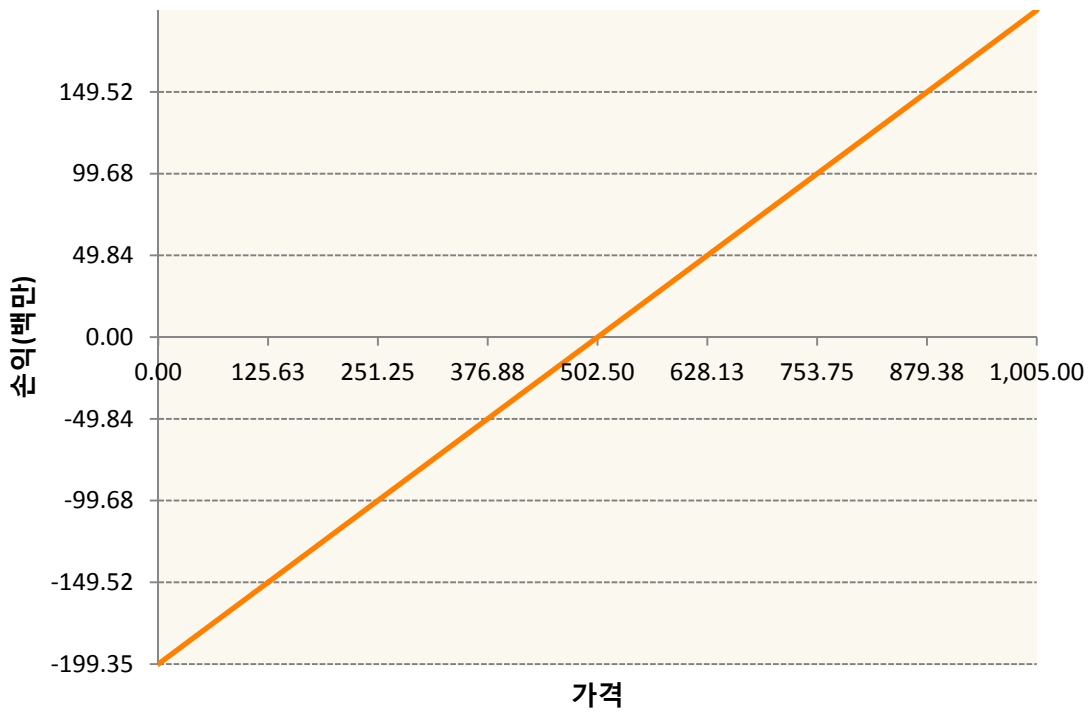




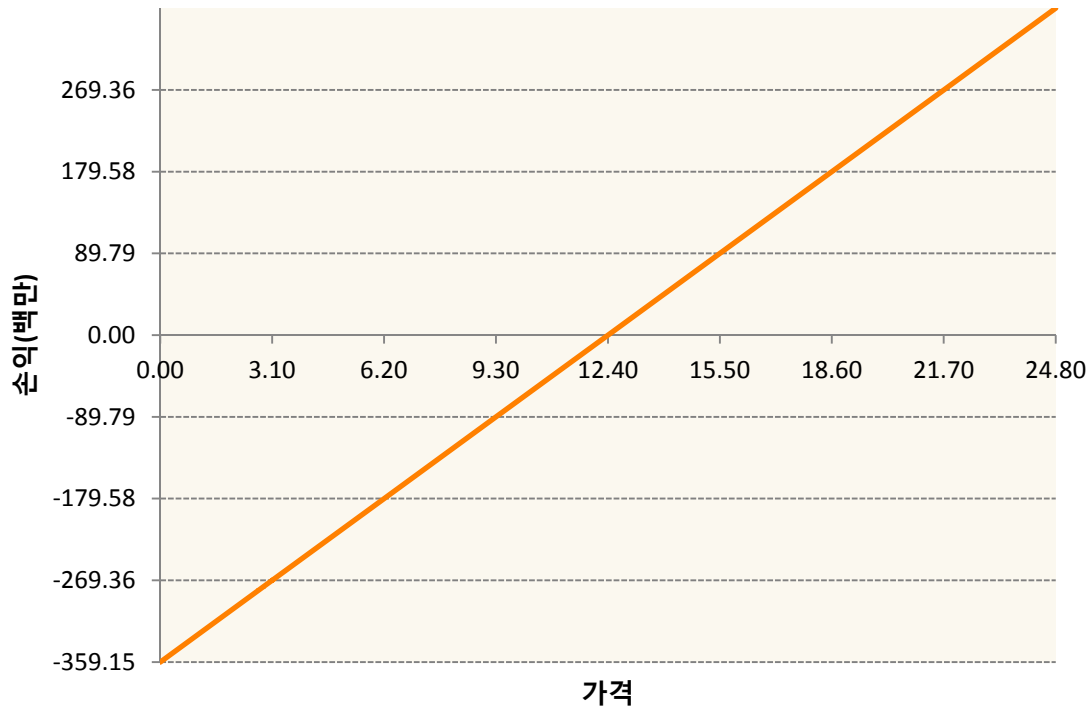
KR4175P10003-2019-01 달러선물



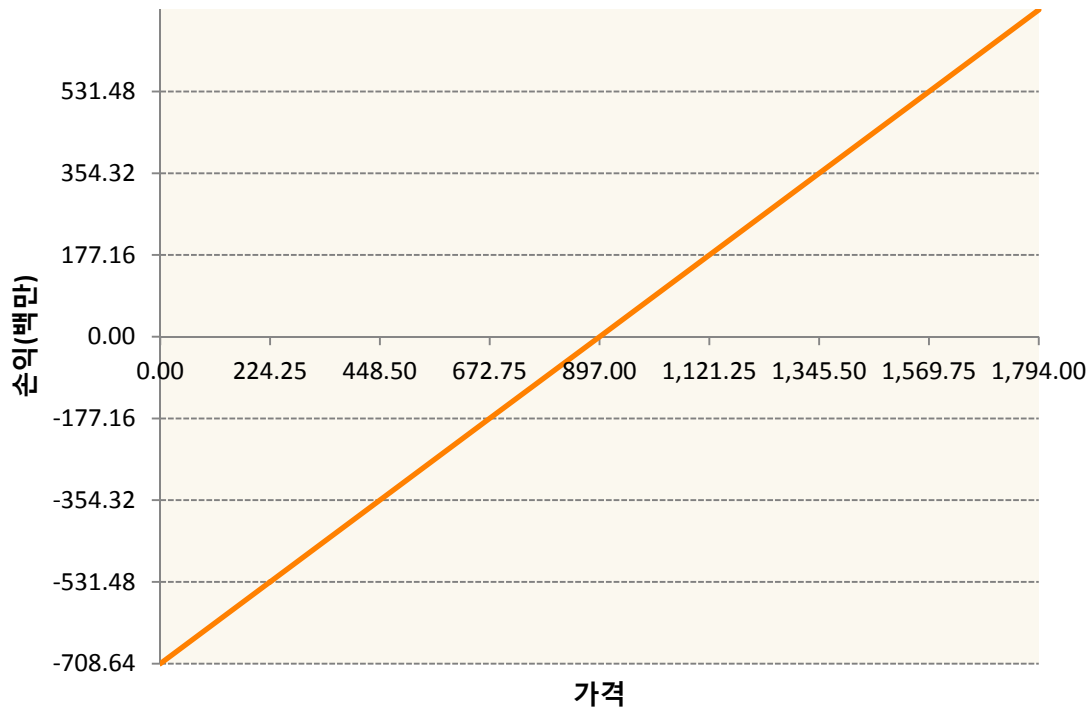
KWH9-KC HRW WHEAT FUT Mar19



SBH9-SUGAR #11 (WORLD) MAR19

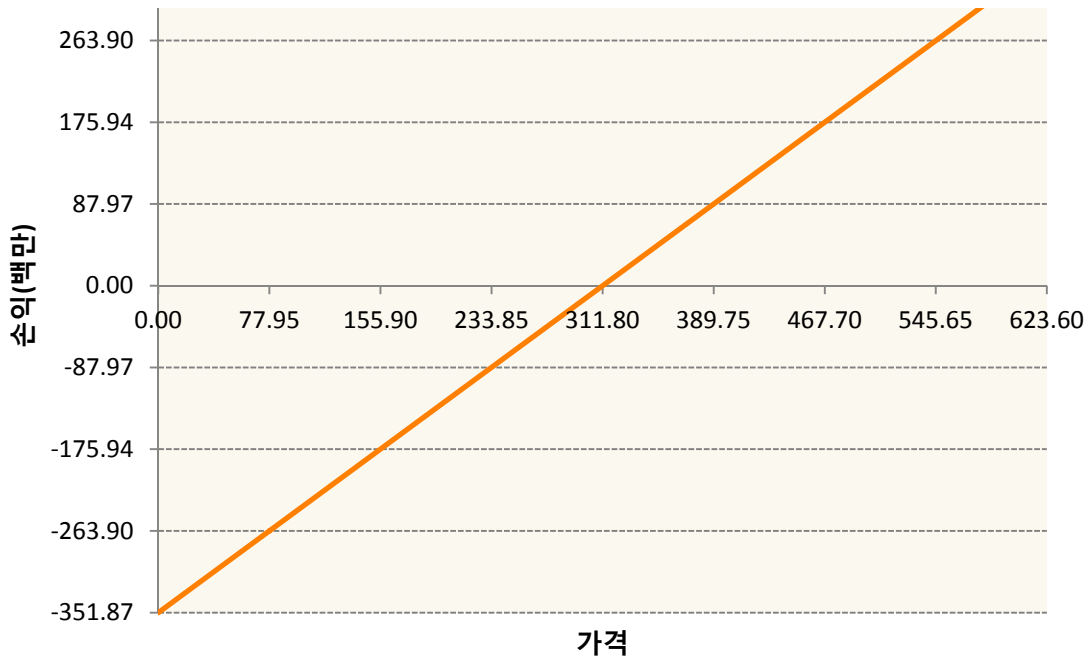


SH9-SOYBEAN FUTURE Mar19

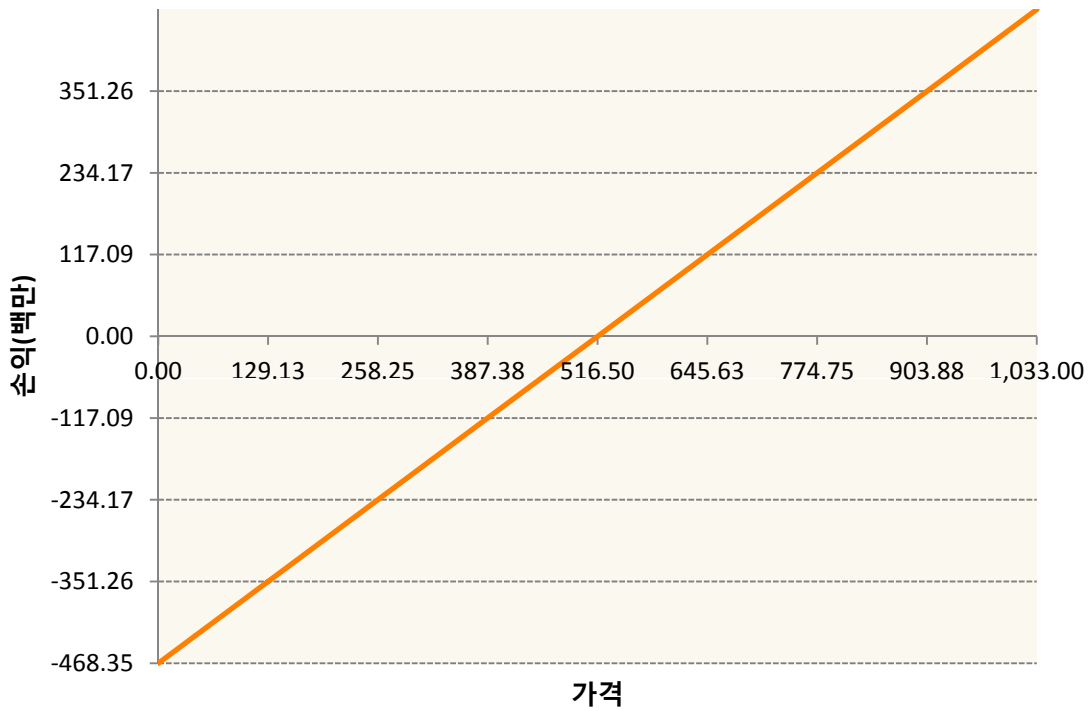


SMH9-SOYBEAN MEAL FUTR Mar19





WH9-WHEAT FUTURE(CBT) Mar19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

BOH9	SOYBEAN OIL FUTR Mar19	23
CH9	CORN FUTURE Mar19	65
CTH9	COTTON NO.2 FUTR Mar19	13
KCH9	COFFEE 'C' FUTURE Mar19	21
KR4175P100 2019-01	달러선물	6

KWH9	KC HRW WHEAT FUT Mar19	16
SBH9	SUGAR #11 (WORLD) MAR19	29
SH9	SOYBEAN FUTURE Mar19	57
SMH9	SOYBEAN MEAL FUTR Mar19	28
WH9	WHEAT FUTURE(CBT) Mar19	37

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

(단위:백만원)

**304**