

공시일	2018-12-31
기준일	2018-12-28

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

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

(단위:백만원)

91

공시일	2018-12-31
기준일	2018-12-28

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

991

* 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	2018-12-31
기준일	2018-12-28

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

253

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

375

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2018-12-31
기준일	2018-12-28

유로인덱스모(주식-파생형)

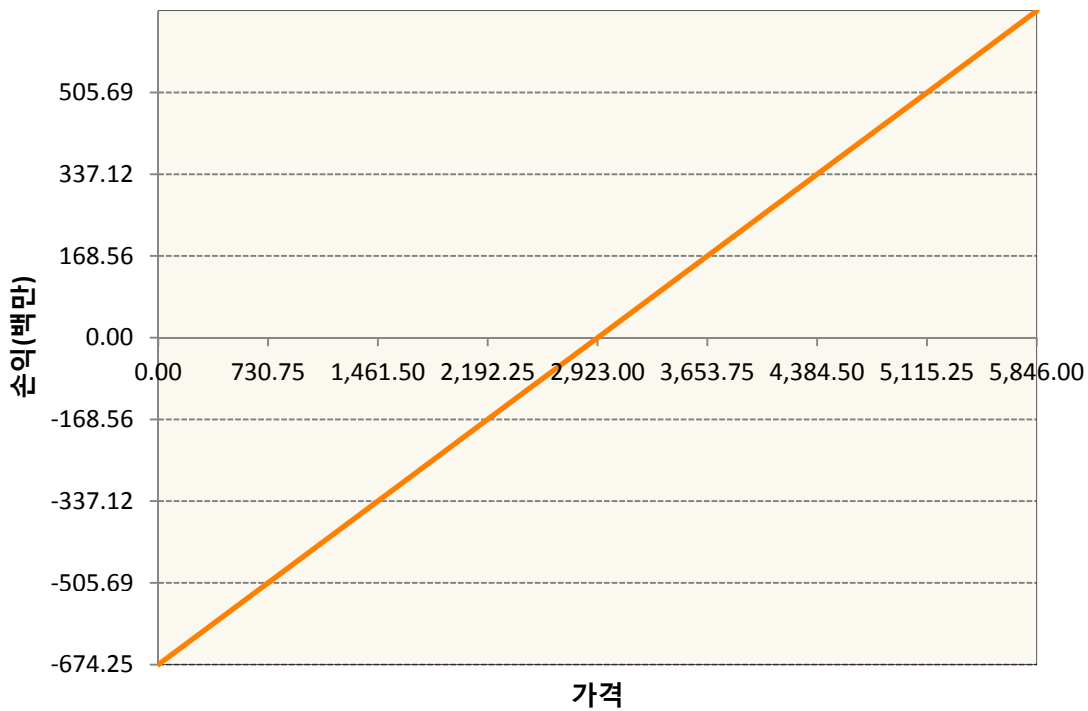
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	674	0	674	

2. 만기시점의 손익구조

VGH9-EURO STOXX 50 Mar19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGH9	EURO STOXX 50 Mar19	54
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

36

공시일	2018-12-31
기준일	2018-12-28

차이나인덱스모(주식-파생형)

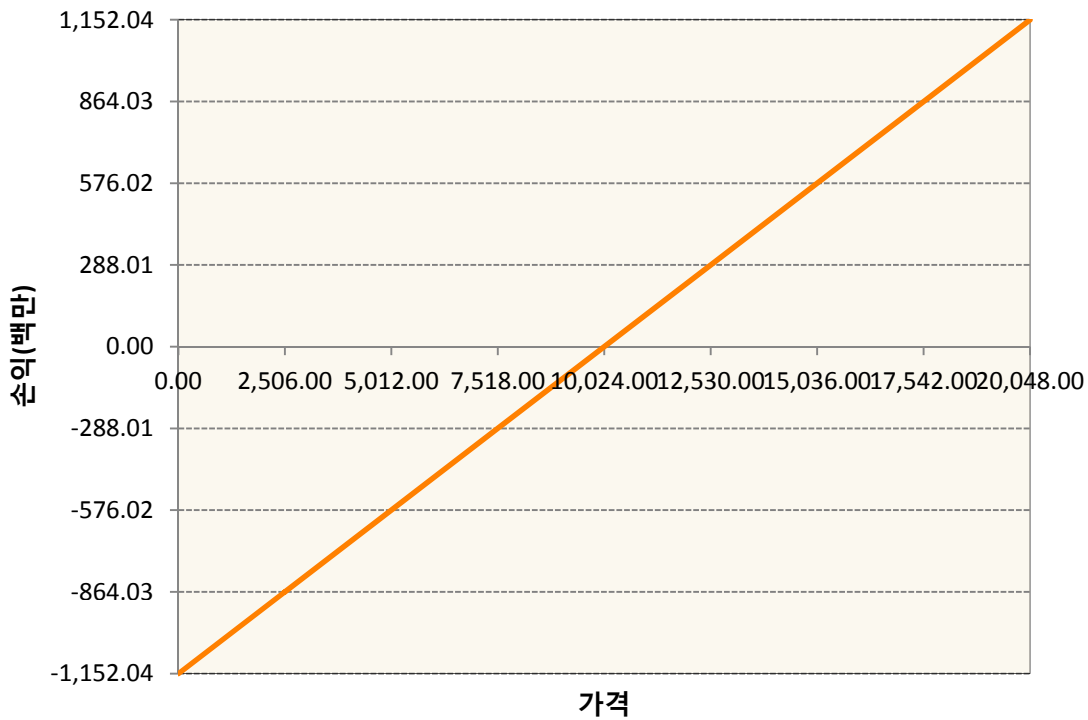
1. 계약금액

(단위:백만원)

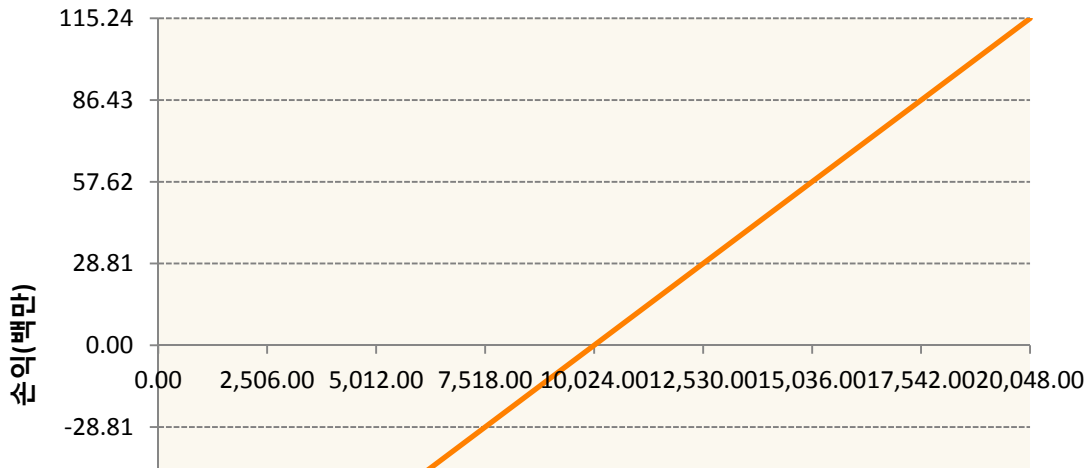
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,267	0	1,267	장내

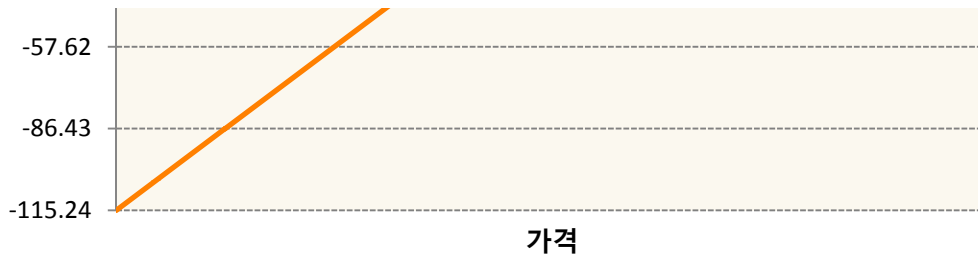
2. 만기시점의 손익구조

HCF9-HSCEI FUTURES JAN19



MHCF9-MINI H-SHR IDX FU JAN19





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

HCF9	HSCEI FUTURES JAN19	92
MHCF9	MINI H-SHR IDX FU JAN19	9

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

102

공시일	2018-12-31
기준일	2018-12-28

커버드콜모(주식혼합-파생형)

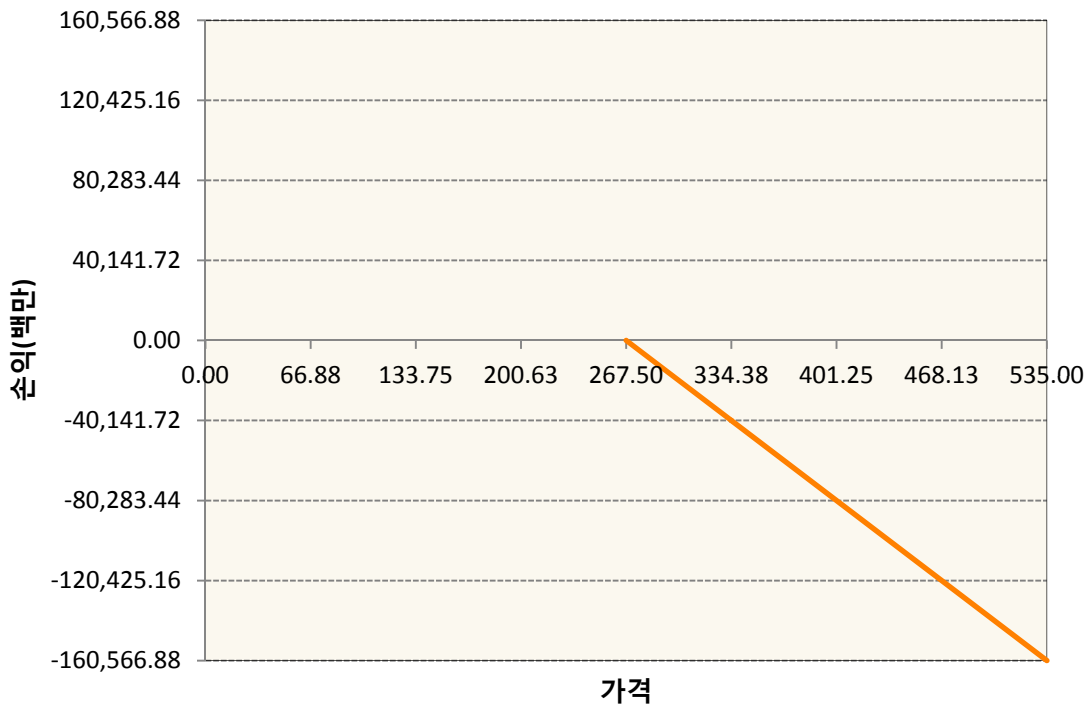
1. 계약금액

(단위:백만원)

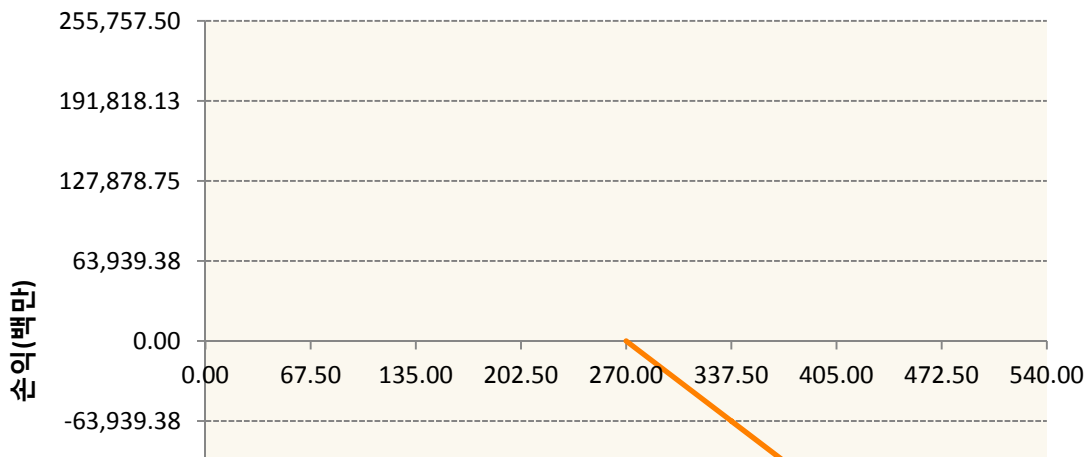
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	24,380	-24,380	장내
누계	유가증권	옵션	0	730,199	-730,199	장내

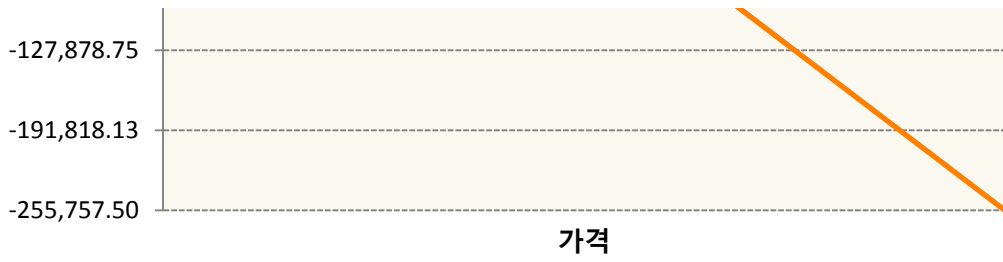
2. 만기시점의 손익구조

KR4201P12672-2019-01 콜267.5

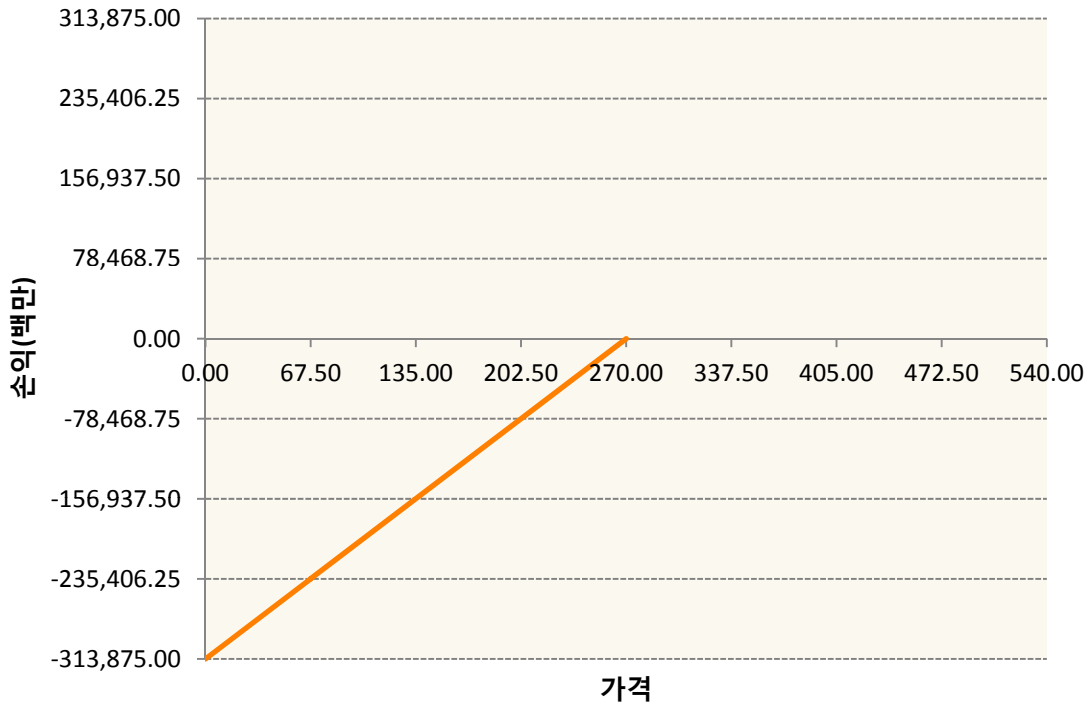


KR4201P12706-2019-01 콜270





KR4301P12704-2019-01 풋270



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201P12672		2019-01 콜267.5					8,505
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,845	1,835	1,818	1,791	1,752	1,702	1,639
-5.33%	1,796	1,750	1,687	1,607	1,511	1,400	1,275
-2.67%	1,545	1,412	1,262	1,096	918	729	532
0%	726	490	247	0	-250	-504	-759
2.67%	-1,072	-1,343	-1,616	-1,888	-2,161	-2,434	-2,707
5.33%	-3,946	-4,153	-4,372	-4,599	-4,834	-5,074	-5,319
8.00%	-7,596	-7,705	-7,834	-7,981	-8,143	-8,318	-8,505
KR4201P12706		2019-01 콜270					12,288
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	2,207	2,199	2,182	2,154	2,111	2,052	1,975

-5.33%	2,167	2,120	2,051	1,958	1,841	1,700	1,537
-2.67%	1,925	1,769	1,582	1,367	1,130	871	595
0%	1,021	696	355	0	-365	-739	-1,120
2.67%	-1,219	-1,651	-2,084	-2,518	-2,951	-3,385	-3,818
5.33%	-5,170	-5,551	-5,943	-6,342	-6,748	-7,158	-7,572
8.00%	-10,555	-10,785	-11,044	-11,328	-11,632	-11,953	-12,288
KR4301P12704 2019-01 풋270							23,005
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-22,970	-22,970	-22,971	-22,974	-22,979	-22,989	-23,005
-5.33%	-14,857	-14,864	-14,877	-14,900	-14,935	-14,984	-15,048
-2.67%	-6,805	-6,864	-6,947	-7,054	-7,183	-7,335	-7,505
0%	751	522	270	0	-285	-583	-891
2.67%	6,562	6,175	5,787	5,399	5,011	4,622	4,233
5.33%	9,600	9,297	8,980	8,650	8,311	7,965	7,612
8.00%	10,546	10,430	10,284	10,112	9,916	9,699	9,464

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

(단위:백만원)

45,067

공시일	2018-12-31
기준일	2018-12-28

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

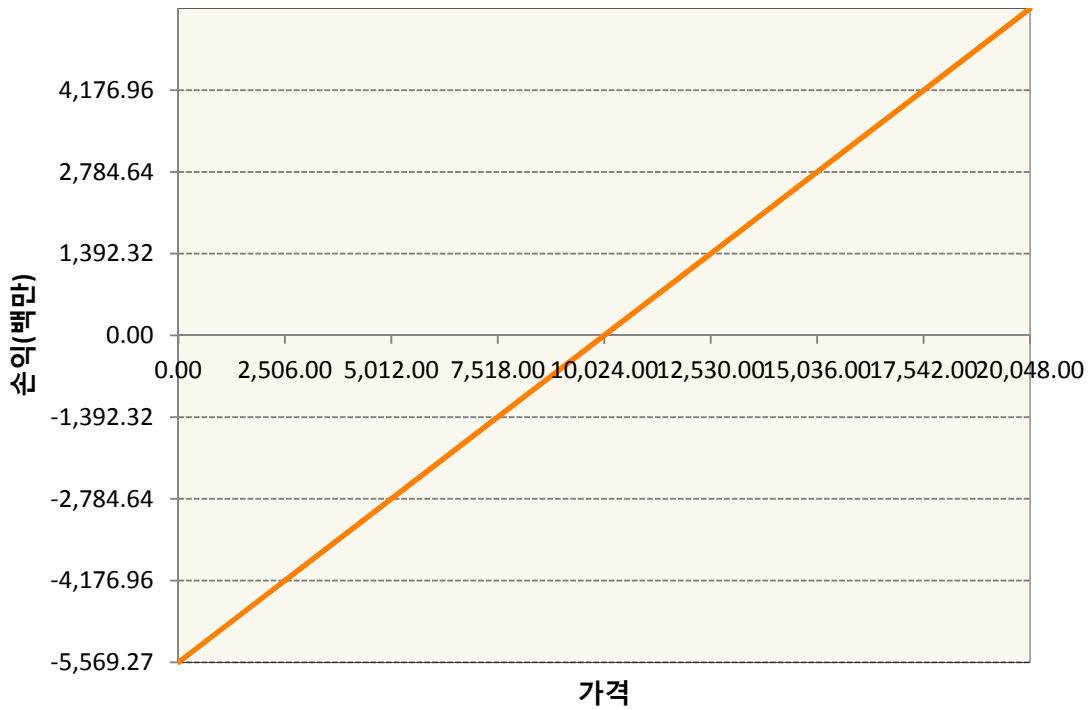
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	1	0	1	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	5,569	0	5,569	장내
누계	통화	선도	0	2,707	-2,707	장외

2. 만기시점의 손익구조

HCF9-HSCEI FUTURES JAN19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FX21018Z00 KRW/HKD 11-03-19E	217
HCF9 HSCEI FUTURES JAN19	446

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

(단위:백만원)

530

공시일	2018-12-31
기준일	2018-12-28

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

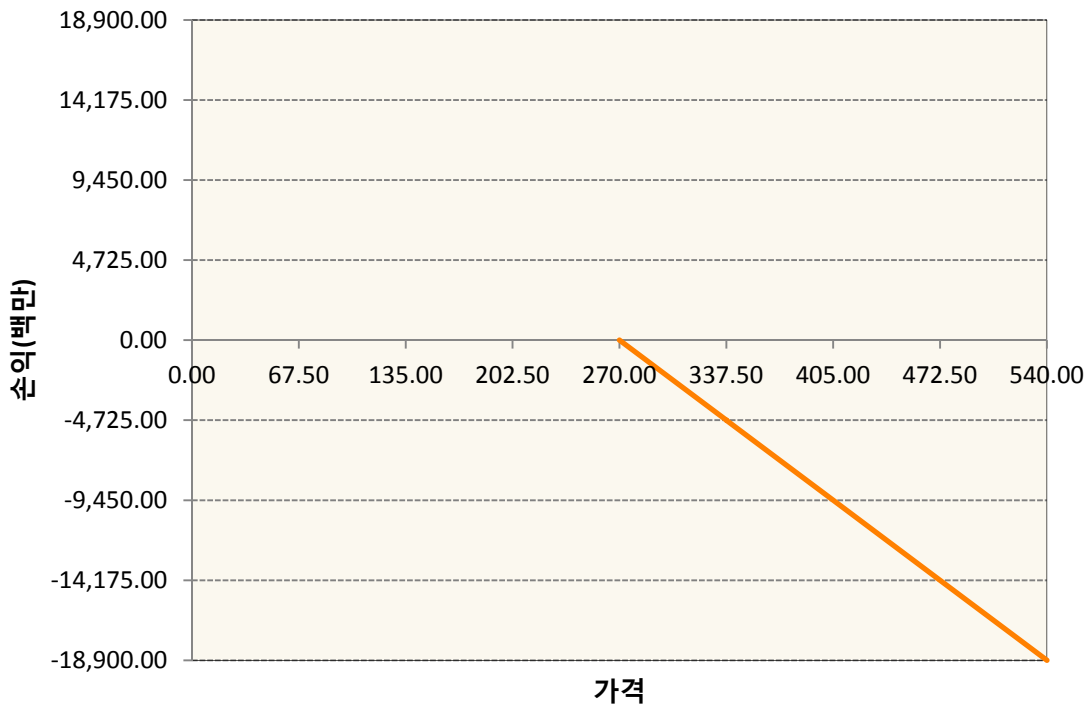
1. 계약금액

(단위:백만원)

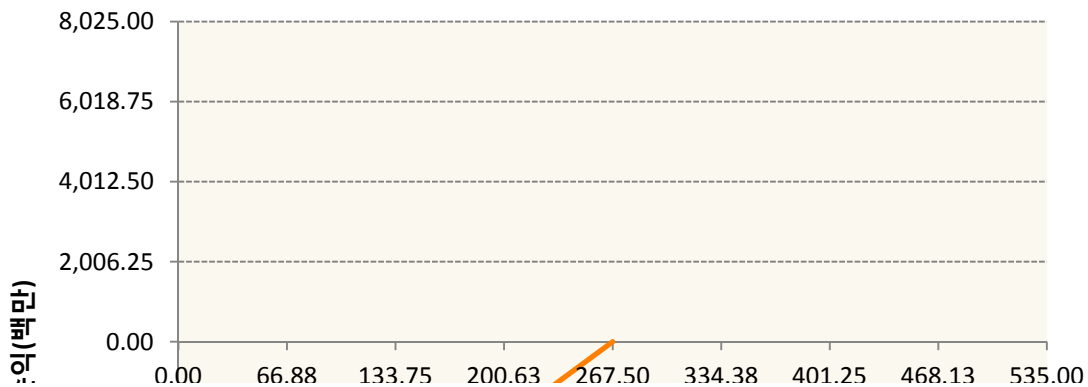
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	스왑	31,836	0	31,836	장외
누계	유가증권	옵션	0	34,350	-34,350	장내

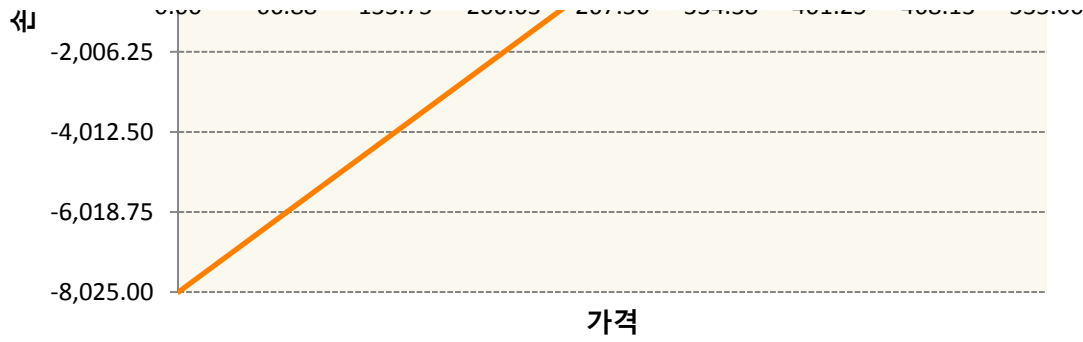
2. 만기시점의 손익구조

KR4201P12706-2019-01 콜270

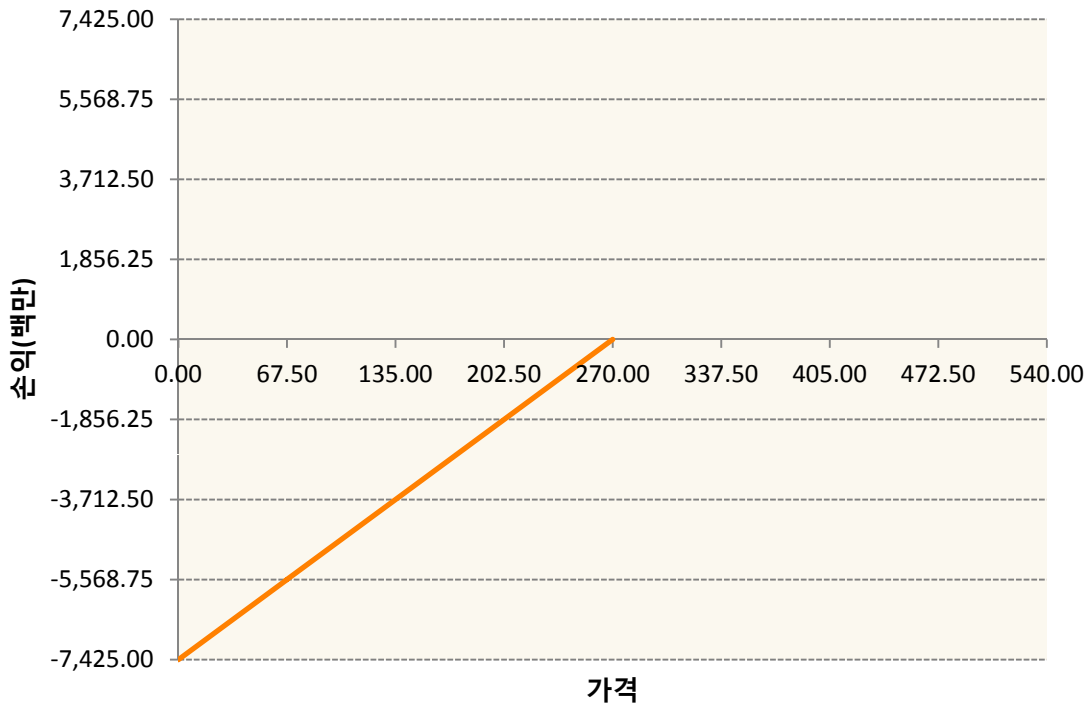


KR4301P12670-2019-01 풋267.5





KR4301P12704-2019-01 콜270



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

	2.529E+11		UBCSFXC1 INDEX_14				2,633	
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-2,633	-2,633	-2,633	-2,633	-2,633	-2,633	-2,633	
-5.33%	-1,755	-1,755	-1,755	-1,755	-1,755	-1,755	-1,755	
-2.67%	-878	-878	-878	-878	-878	-878	-878	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	878	878	878	878	878	878	878	
5.33%	1,755	1,755	1,755	1,755	1,755	1,755	1,755	
8.00%	2,633	2,633	2,633	2,633	2,633	2,633	2,633	
	KR4201P12706		2019-01 콜270				908	
	기초자산의 변동성							

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	163	162	161	159	156	152	146	
-5.33%	160	157	152	145	136	126	114	
-2.67%	142	131	117	101	83	64	44	
0%	75	51	26	0	-27	-55	-83	
2.67%	-90	-122	-154	-186	-218	-250	-282	
5.33%	-382	-410	-439	-469	-499	-529	-560	
8.00%	-780	-797	-816	-837	-860	-883	-908	
KR4301P12670							2019-01 풋267.5	576

기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-575	-575	-575	-575	-575	-576	-576	
-5.33%	-365	-366	-366	-368	-369	-371	-373	
-2.67%	-160	-162	-166	-170	-174	-179	-185	
0%	24	16	8	0	-9	-17	-26	
2.67%	150	140	130	120	110	100	90	
5.33%	204	198	192	185	178	170	162	
8.00%	218	216	214	211	207	203	198	
KR4301P12704							2019-01 풋270	544

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-543	-543	-543	-543	-544	-544	-544
-5.33%	-351	-352	-352	-352	-353	-354	-356
-2.67%	-161	-162	-164	-167	-170	-174	-178
0%	18	12	6	0	-7	-14	-21
2.67%	155	146	137	128	119	109	100
5.33%	227	220	212	205	197	188	180
8.00%	249	247	243	239	235	229	224

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

(단위:백만원)

4,718

공시일	2018-12-31
기준일	2018-12-28

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

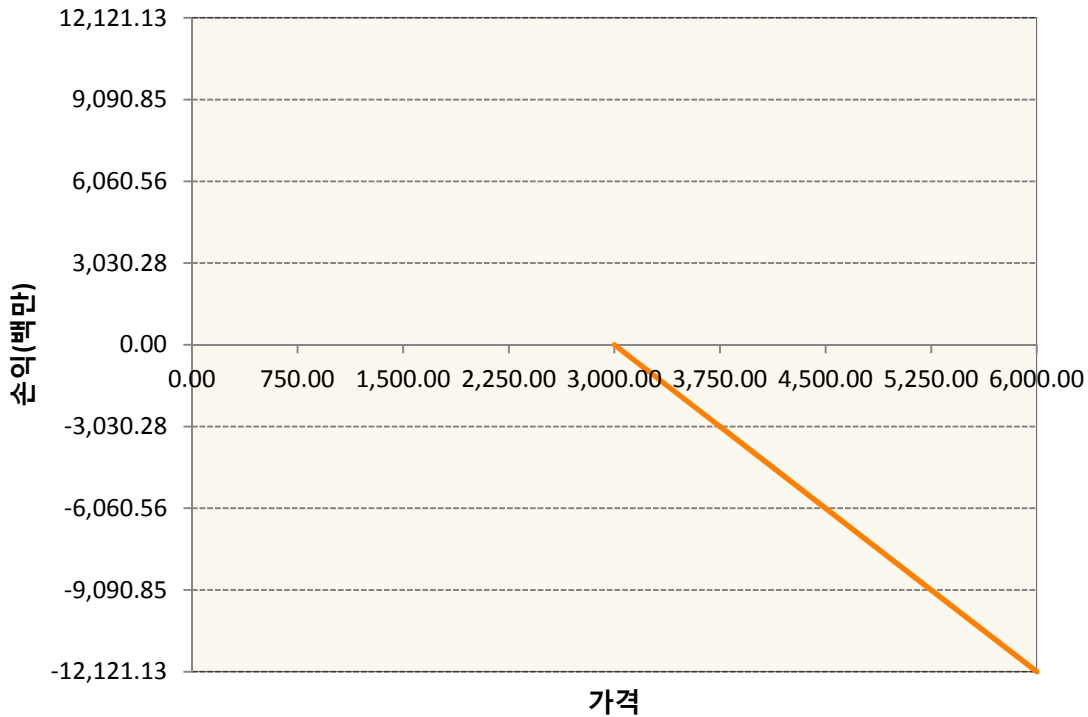
1. 계약금액

(단위:백만원)

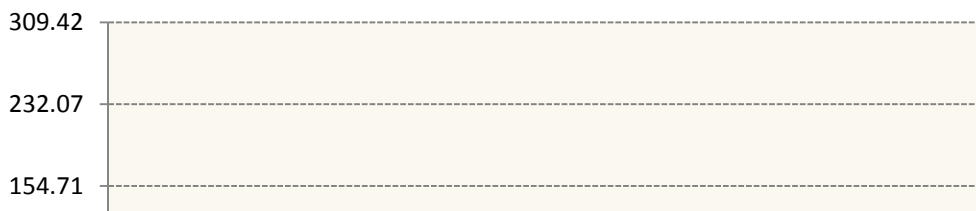
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	6,328	0	6,328	
누계	유가증권	스왑	71,413	0	71,413	장외
누계	유가증권	옵션	0	24,861	-24,861	장내
누계	통화	선도	0	15,343	-15,343	장외

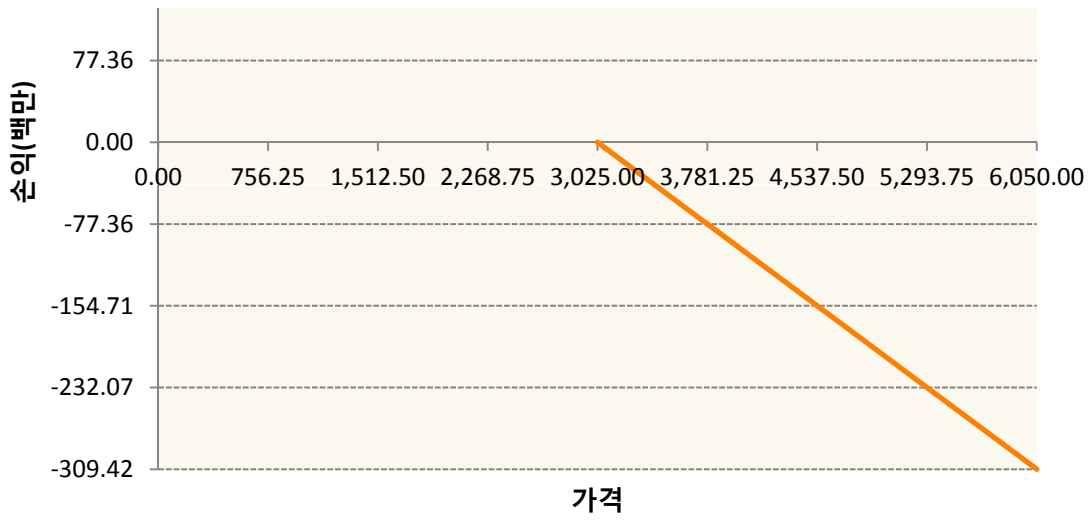
2. 만기시점의 손익구조

OESXF9-C3000-EURO STOXX 50

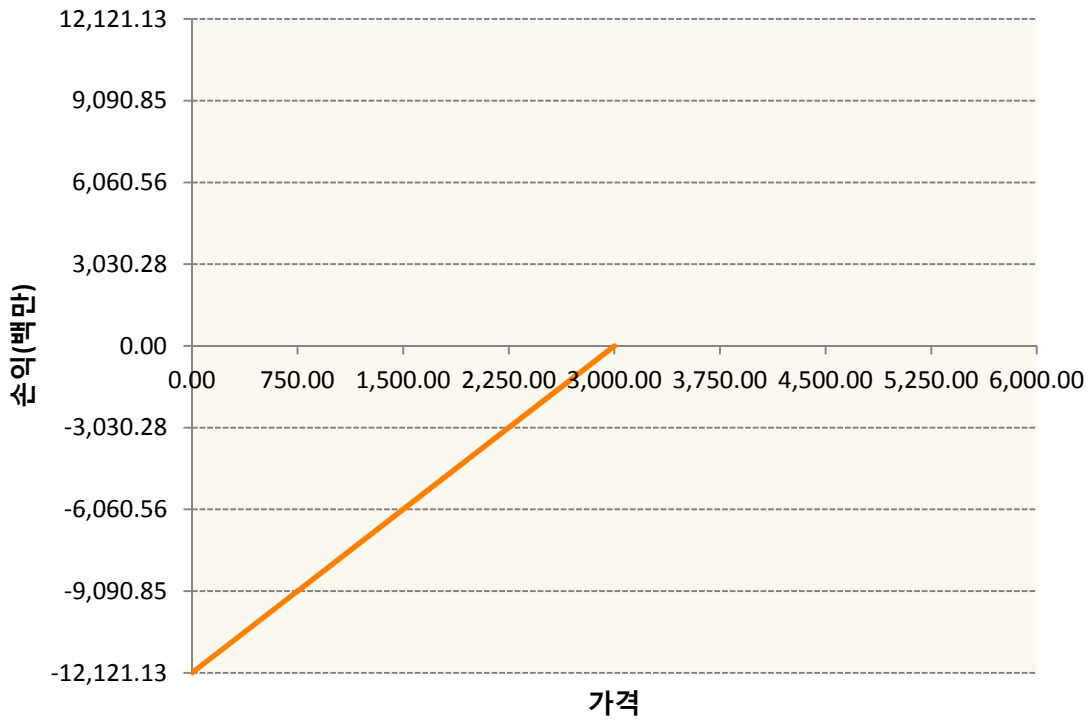


OESXF9-C3025-EURO STOXX 50

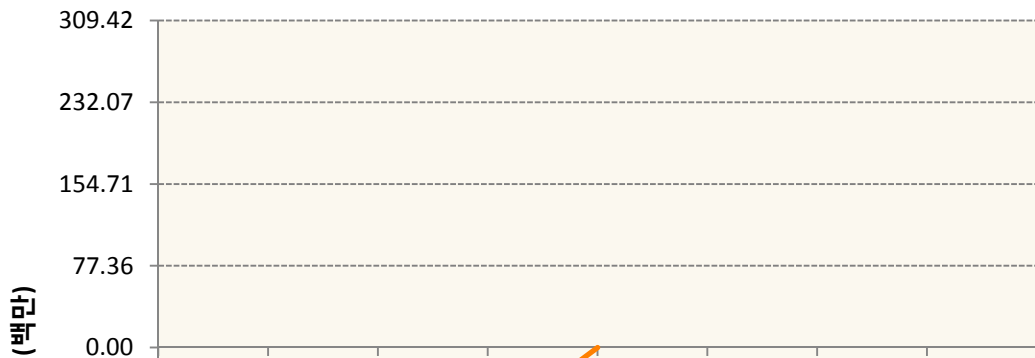


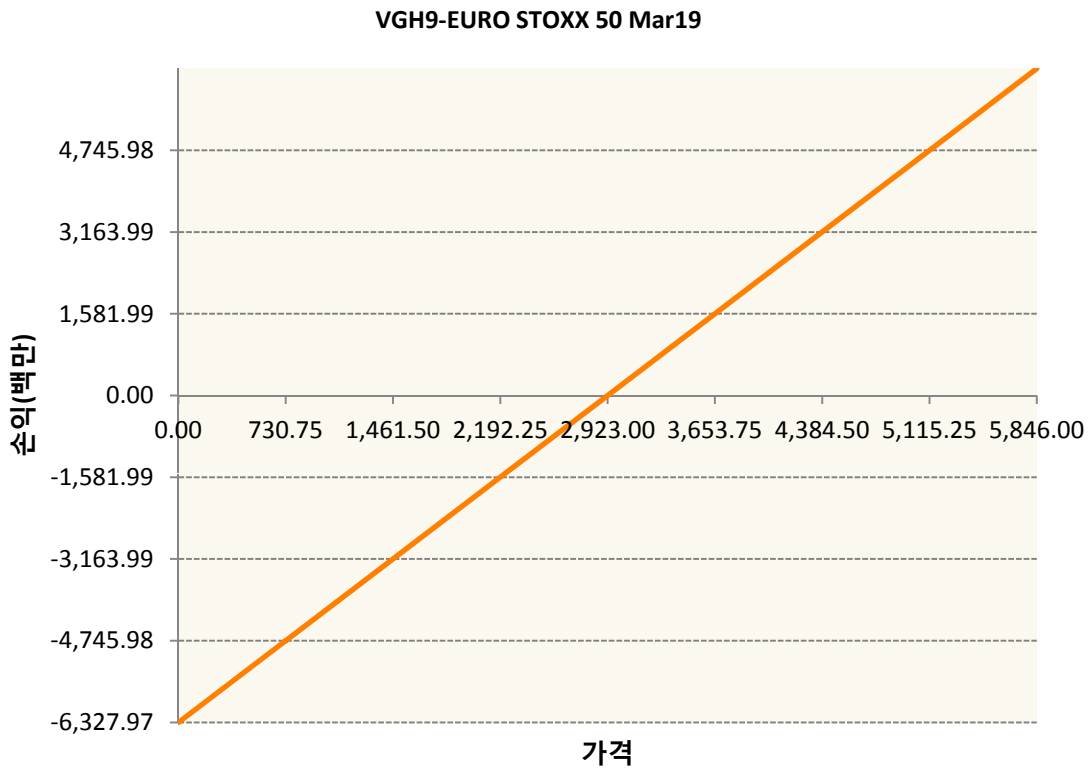
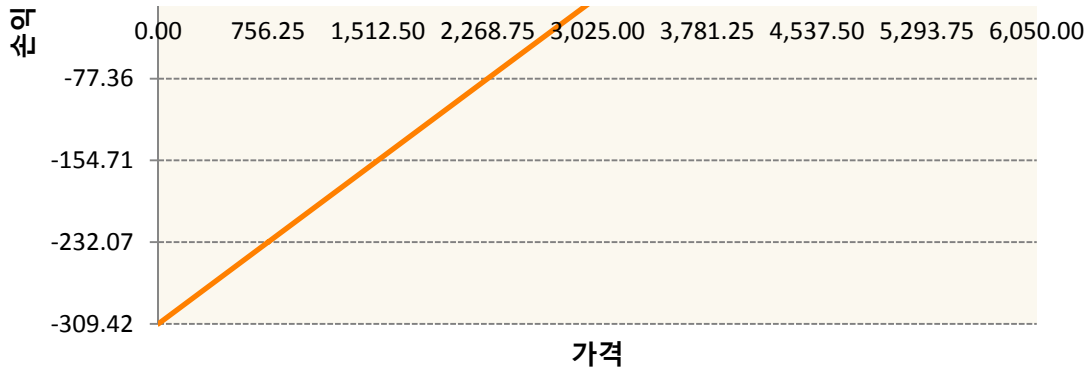


OESXF9-P3000-EURO STOXX 50



OESXF9-P3025-EURO STOXX 50





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

(단위:백만원)

2,649

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

(단위:백만원)

1,067

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

(단위:백만원)

91

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

(단위:백만원)

136

공시일	2018-12-31
기준일	2018-12-28

스마트KRX300인덱스목표전환형1호

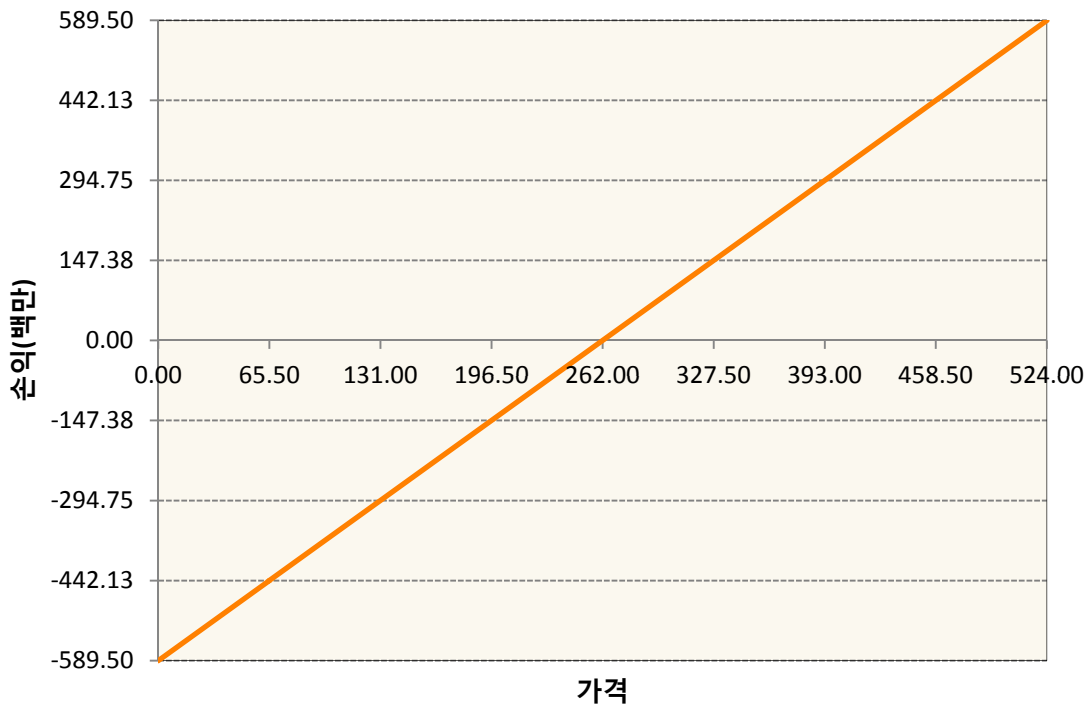
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	590	0	590	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	2018-12-31
기준일	2018-12-28

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

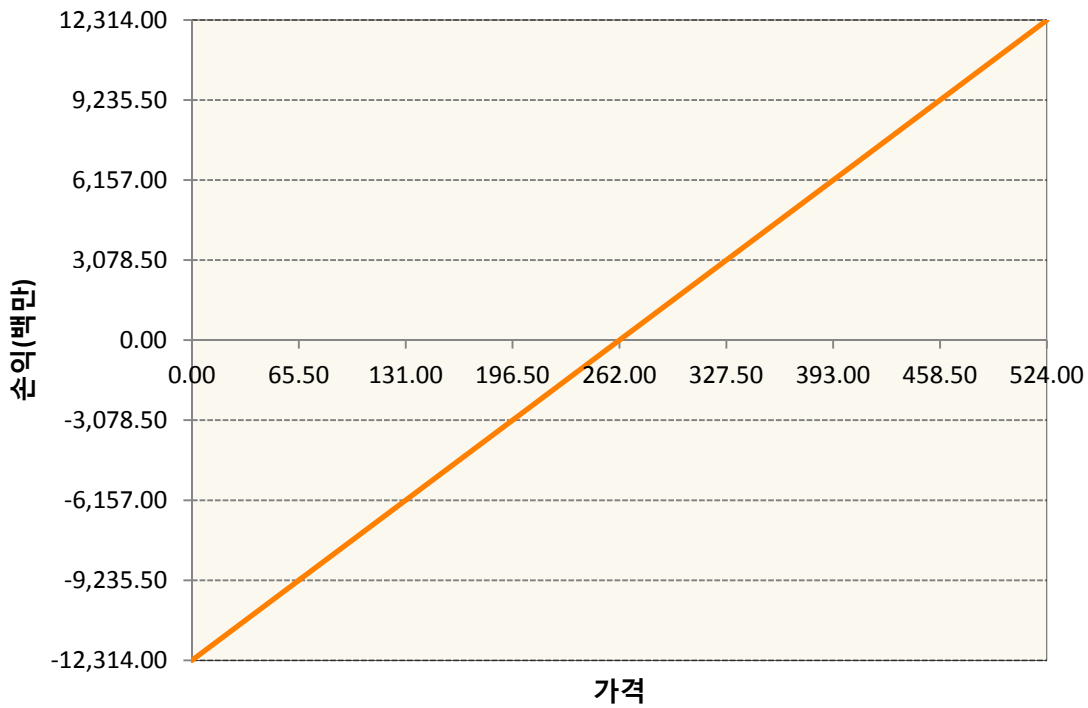
1. 계약금액

(단위:백만원)

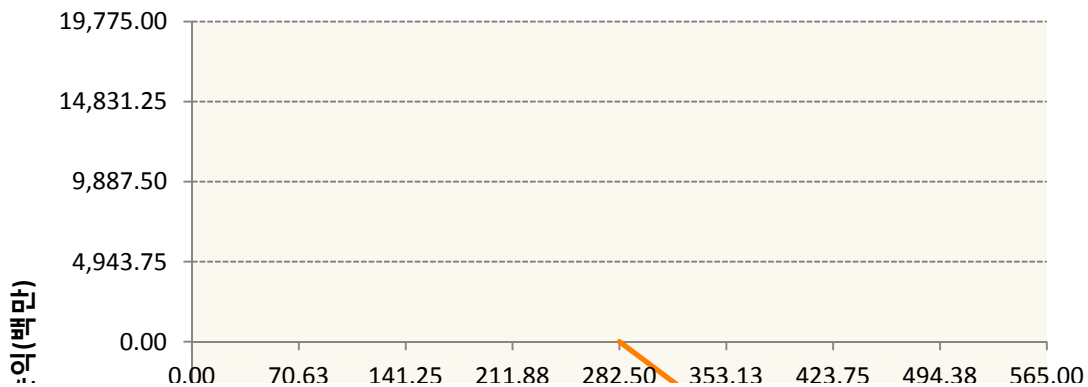
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	12,314	0	12,314	장내
누계	유가증권	옵션	1,145	23,338	-22,193	장내

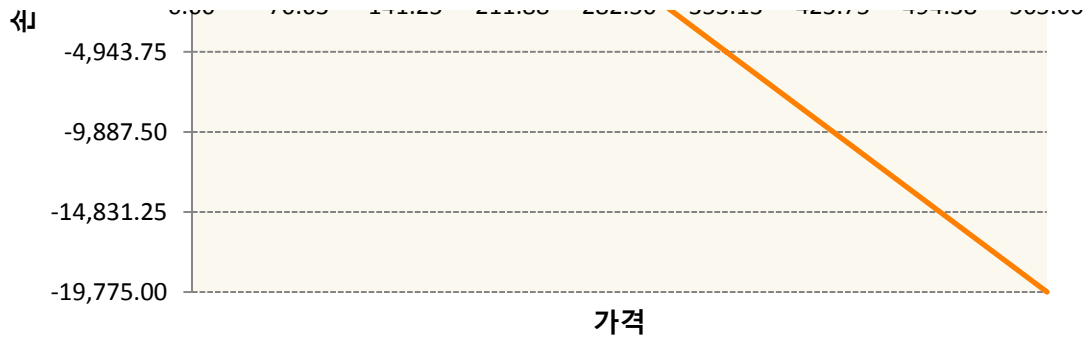
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P30007-2019-03 코스피200지수선물

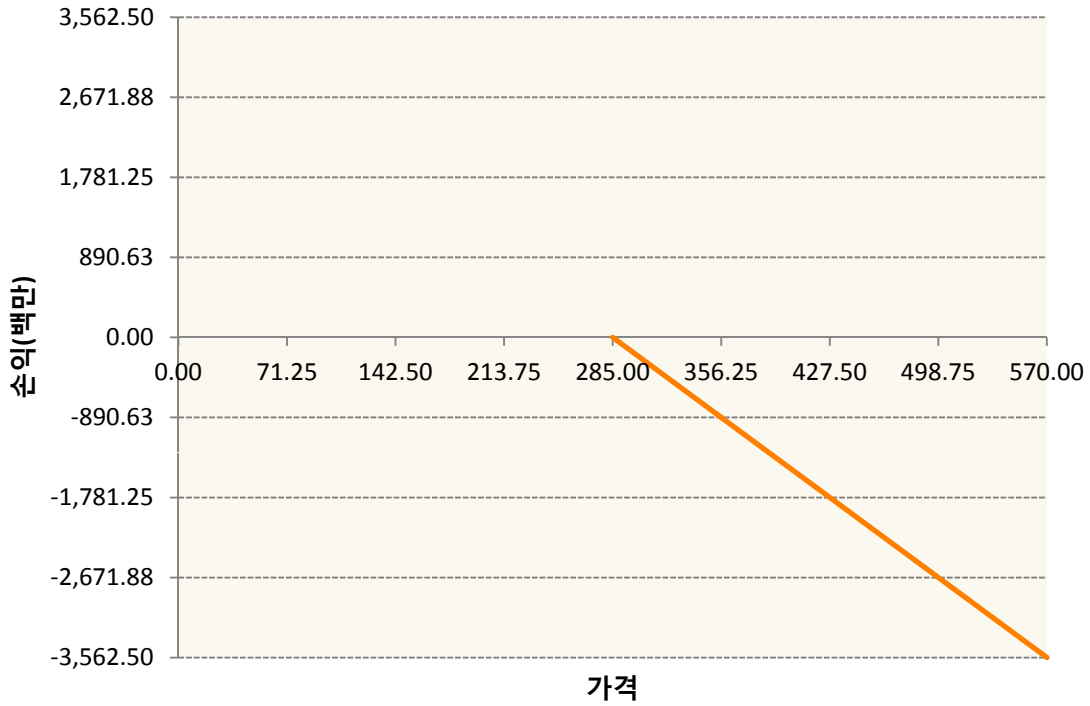


KR4201P12821-2019-01 콜282.5

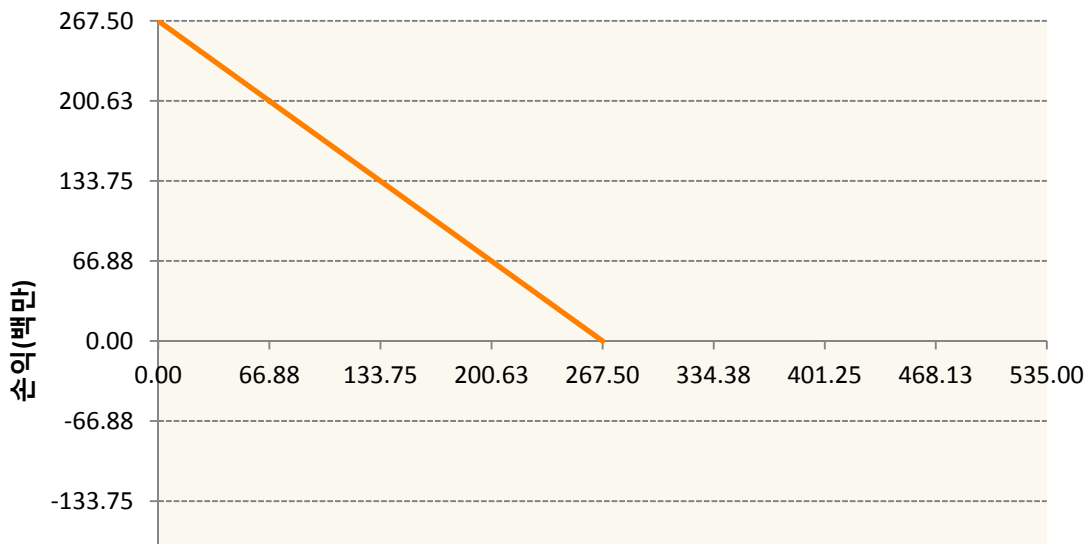


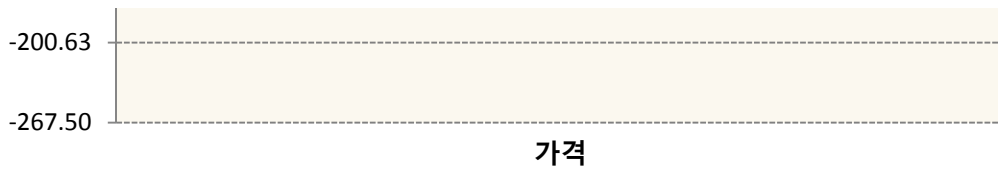


KR4201P12854-2019-01 콜285

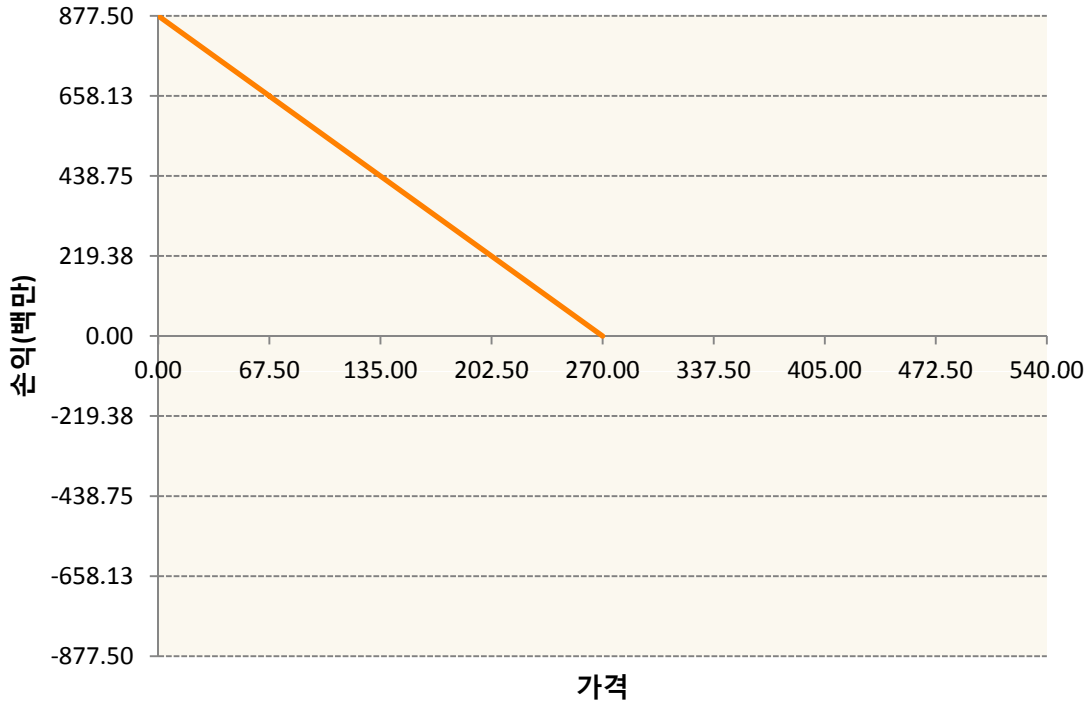


KR4301P12670-2019-01 풋267.5





KR4301P12704-2019-01 풋270



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101P30007		2019-03 코스피200지수선물						985
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-985	-985	-985	-985	-985	-985	-985	
-5.33%	-657	-657	-657	-657	-657	-657	-657	
-2.67%	-328	-328	-328	-328	-328	-328	-328	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	328	328	328	328	328	328	328	
5.33%	657	657	657	657	657	657	657	
8.00%	985	985	985	985	985	985	985	
KR4201P12821		2019-01 콜282.5						490
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	30	30	30	30	30	29	28	
-5.33%	30	30	30	29	27	25	21	
-2.67%	30	28	26	22	17	11	2	

0%	24	18	10	0	-12	-26	-41
2.67%	-5	-21	-39	-58	-80	-103	-127
5.33%	-94	-122	-151	-180	-211	-241	-272
8.00%	-287	-321	-355	-388	-422	-456	-490
KR4201P12854 2019-01 콜285							75
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	4	4	4	4	4	4	3
-5.33%	4	4	4	3	3	3	3
-2.67%	4	3	3	3	2	1	0
0%	3	2	1	0	-2	-4	-6
2.67%	0	-2	-5	-8	-11	-15	-18
5.33%	-11	-16	-20	-25	-30	-35	-40
8.00%	-39	-45	-51	-57	-63	-69	-75
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	6	6	6	6	6
0%	-1	-1	0	0	0	1	1
2.67%	-5	-5	-4	-4	-4	-3	-3
5.33%	-7	-7	-6	-6	-6	-6	-5
8.00%	-7	-7	-7	-7	-7	-7	-7
KR4301P12704 2019-01 풋270							64
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	64	64	64	64	64	64	64
-5.33%	42	42	42	42	42	42	42
-2.67%	19	19	19	20	20	21	21
0%	-2	-1	-1	0	1	2	2
2.67%	-18	-17	-16	-15	-14	-13	-12
5.33%	-27	-26	-25	-24	-23	-22	-21
8.00%	-29	-29	-29	-28	-28	-27	-26

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

(단위:백만원)

1,248

공시일	2018-12-31
기준일	2018-12-28

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	195	0	195	

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	2018-12-31
기준일	2018-12-28

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	1,936	0	1,936	

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	2018-12-31
기준일	2018-12-28

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	1,636	0	1,636	
누계	통화	선도	0	1,997	-1,997	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	27
FX21018Z01 KRW/USD 28-02-19E	9
FX21018Z02 KRW/USD 28-02-19E	39
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	31

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

(단위:백만원)

60

공시일	2018-12-31
기준일	2018-12-28

스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

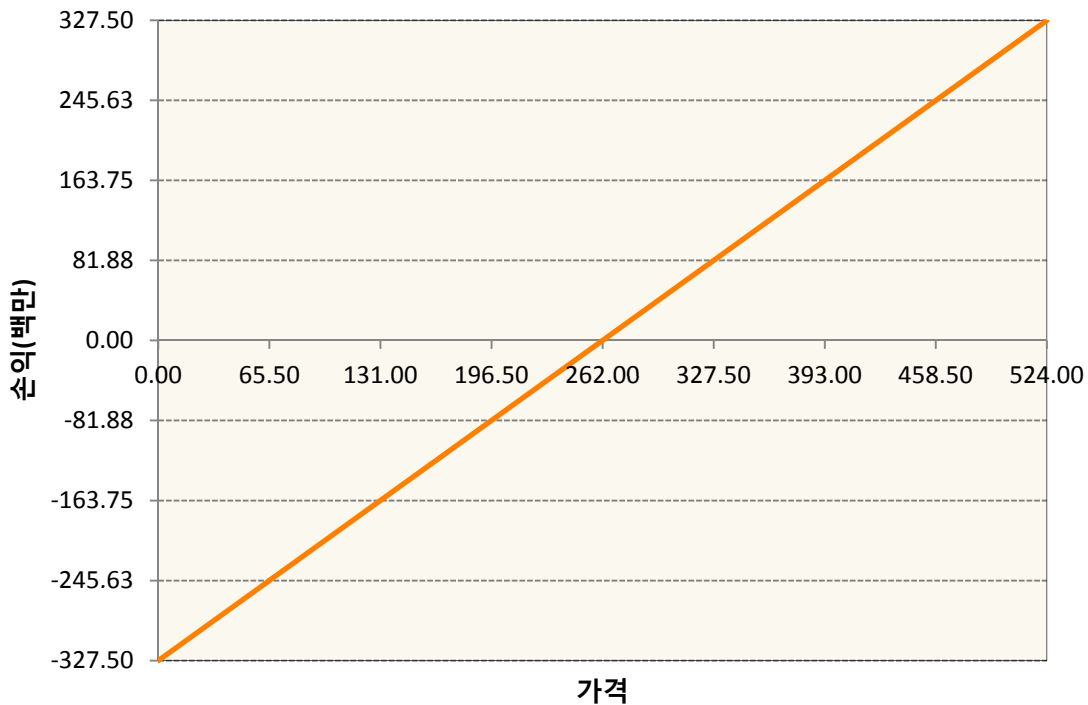
1. 계약금액

(단위:백만원)

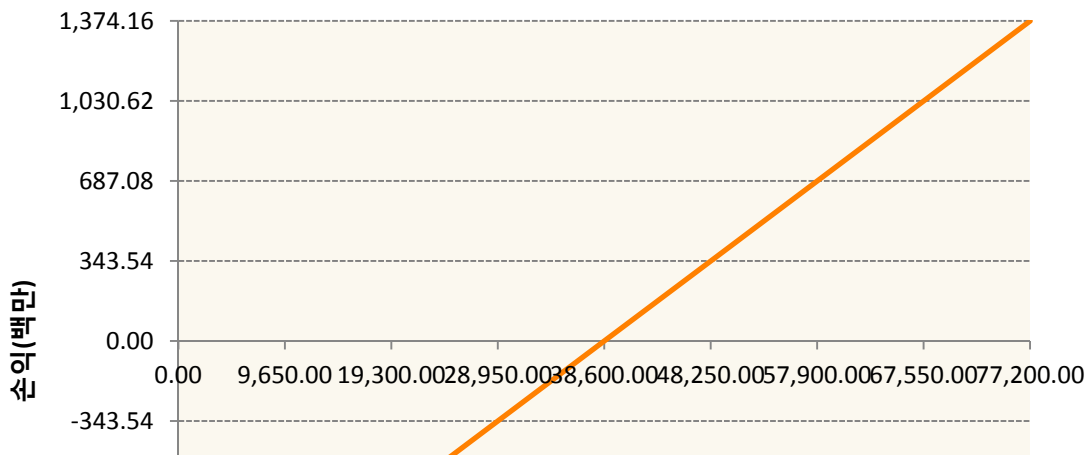
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	329	0	329	장내
누계	유가증권	선물	1,702	0	1,702	장내

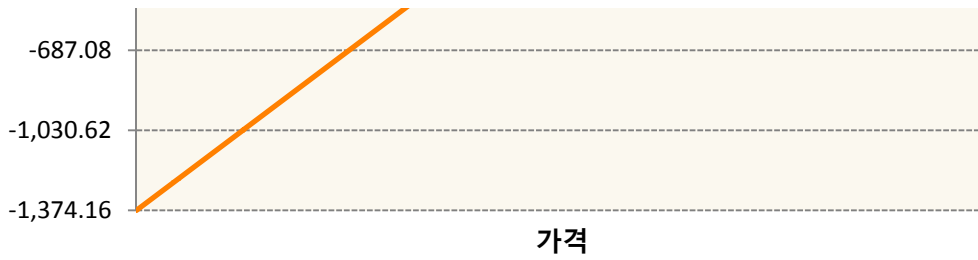
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P30007-2019-03 코스피200지수선물



KR4111P10008-2019-01 삼성전자개별선물





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101P30007		2019-03 코스피200지수선물						26
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-26	-26	-26	-26	-26	-26	-26	
-5.33%	-17	-17	-17	-17	-17	-17	-17	
-2.67%	-9	-9	-9	-9	-9	-9	-9	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	9	9	9	9	9	9	9	
5.33%	17	17	17	17	17	17	17	
8.00%	26	26	26	26	26	26	26	
KR4111P10008		2019-01 삼성전자개별선물						110
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-110	-110	-110	-110	-110	-110	-110	
-5.33%	-73	-73	-73	-73	-73	-73	-73	
-2.67%	-37	-37	-37	-37	-37	-37	-37	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	37	37	37	37	37	37	37	
5.33%	73	73	73	73	73	73	73	
8.00%	110	110	110	110	110	110	110	

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

151

공시일	2018-12-31
기준일	2018-12-28

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

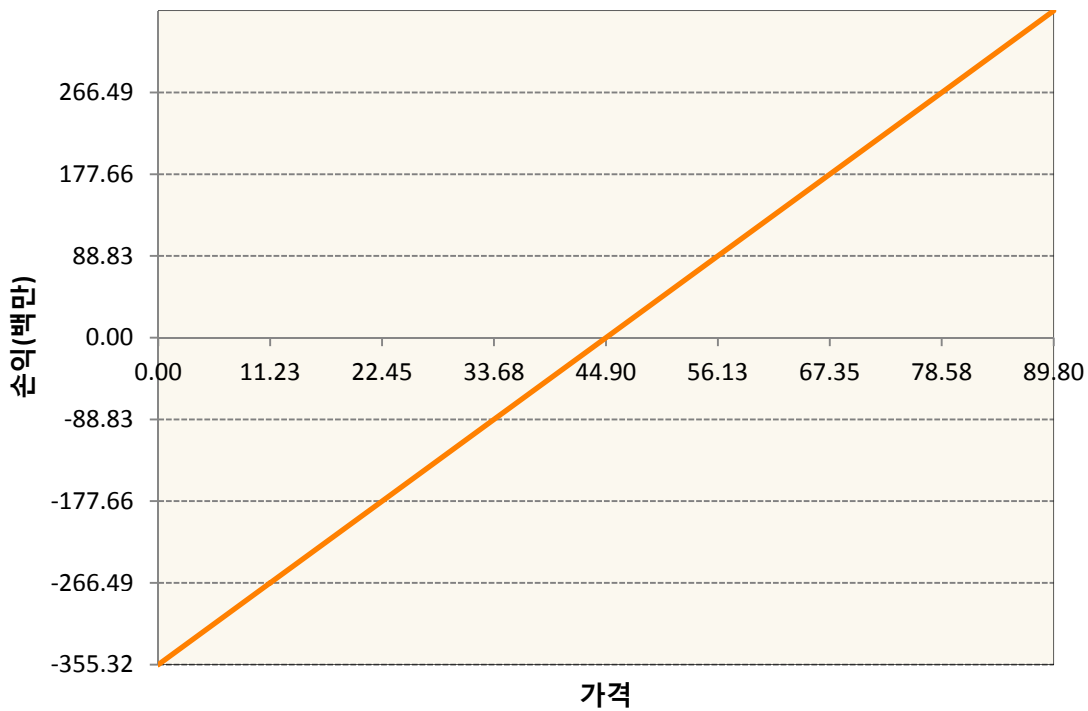
1. 계약금액

(단위:백만원)

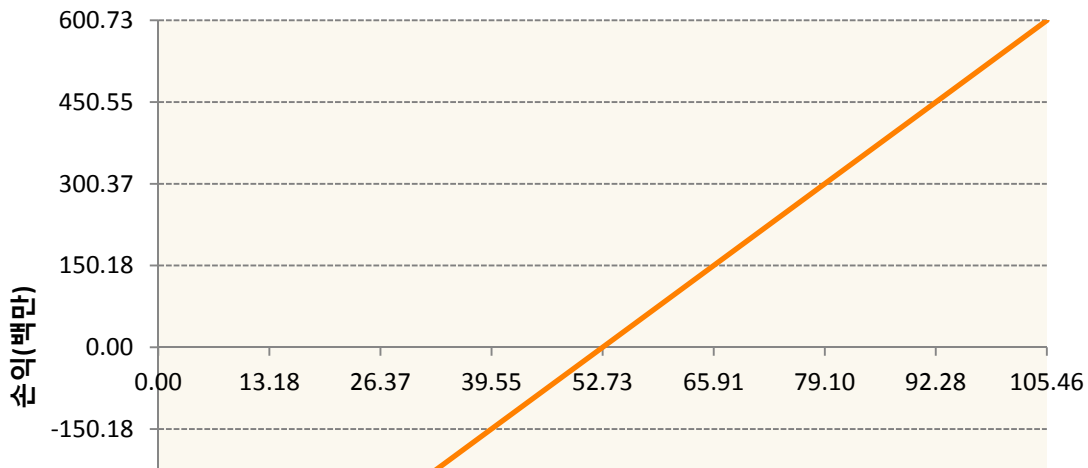
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,465	201	2,264	

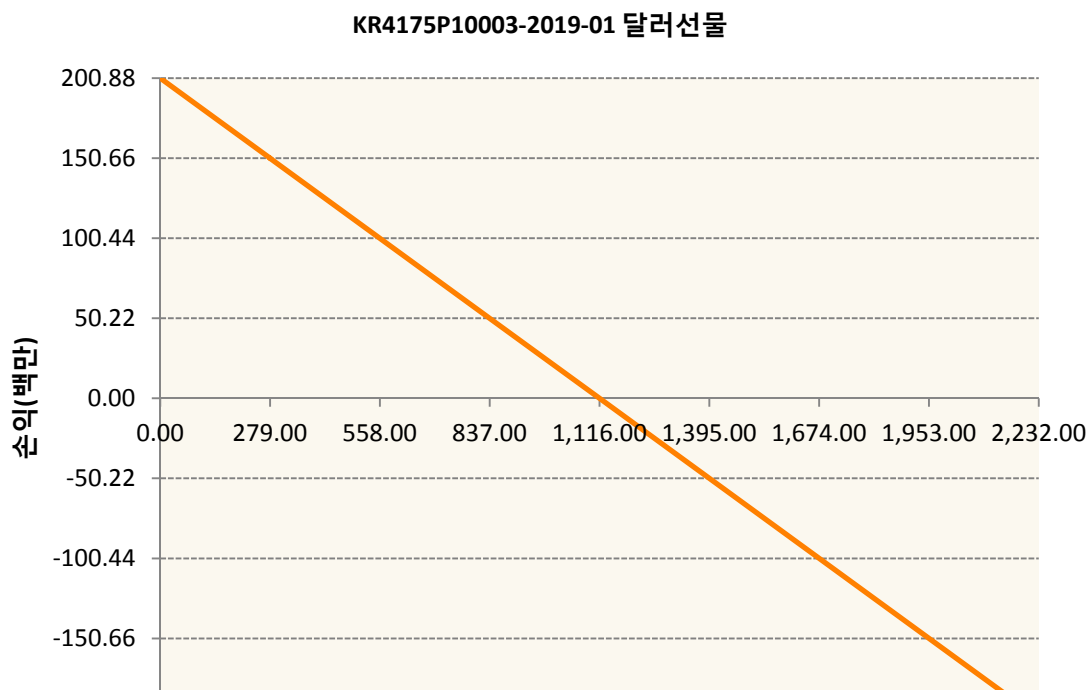
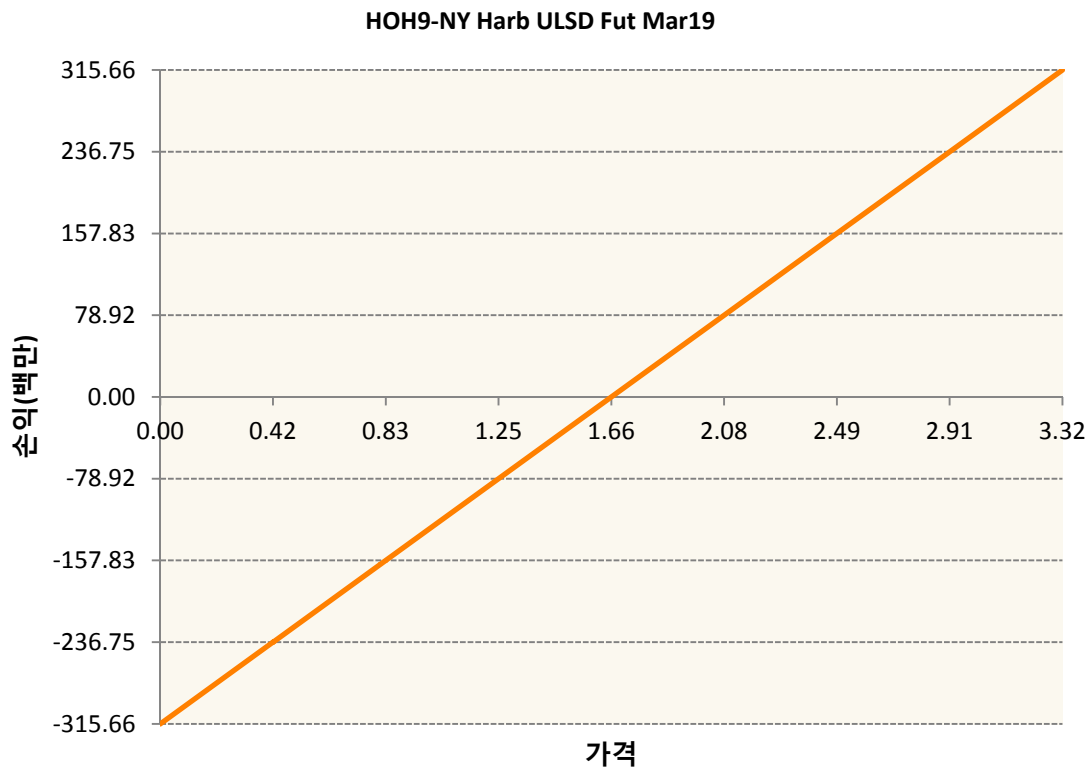
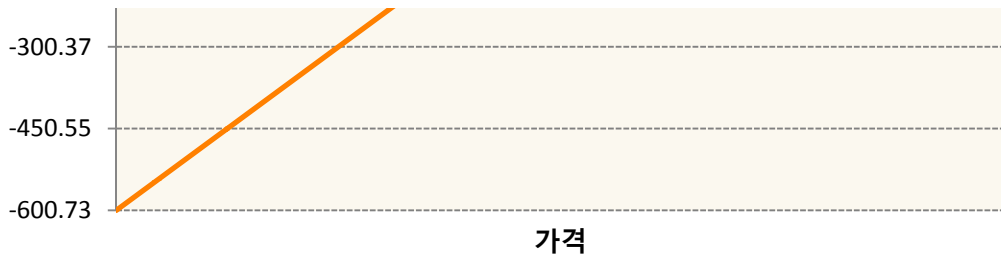
2. 만기시점의 손익구조

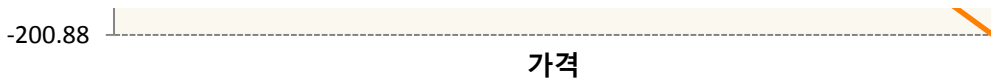
CLH9-WTI CRUDE FUTURE MAR19



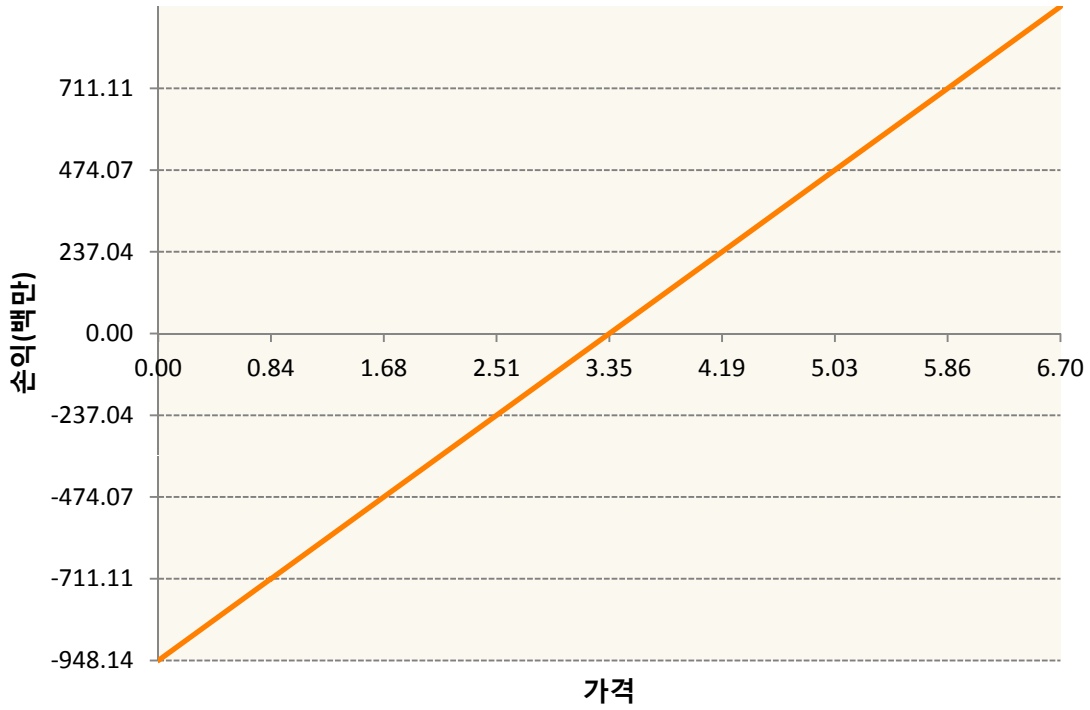
COH9-BRENT CRUDE FUTR Mar19



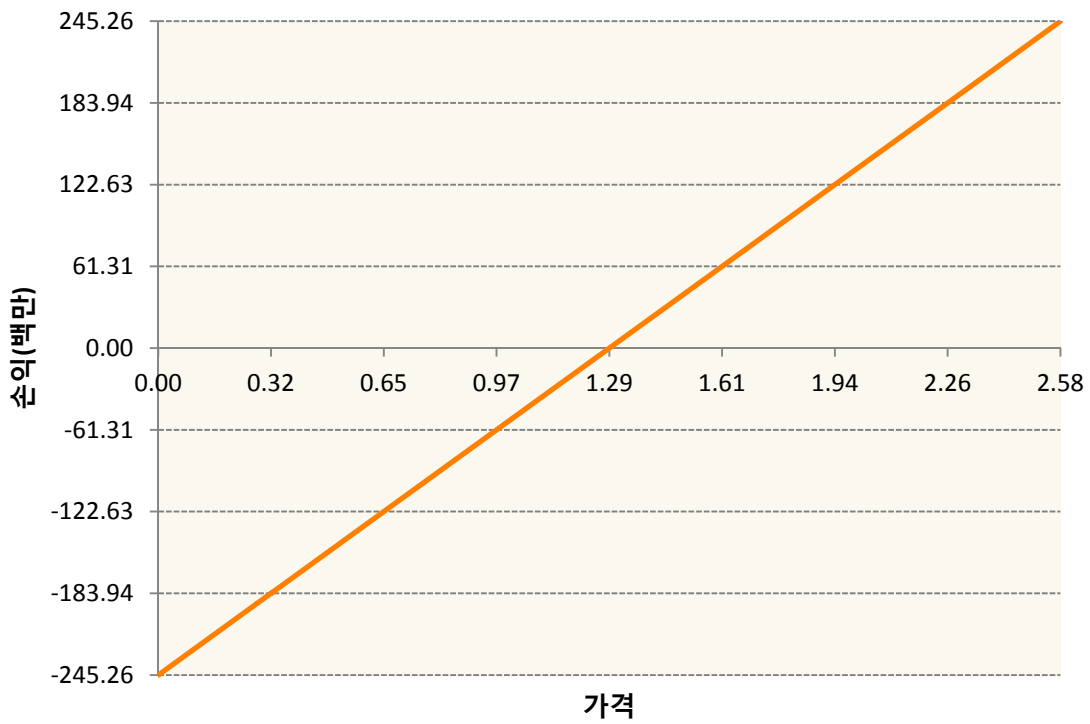




NGH19-NATURAL GAS FUTR Mar19



XBH9-GASOLINE RBOB FUT Mar19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLH9	WTI CRUDE FUTURE MAR19	28
COH9	BRENT CRUDE FUTR Mar19	48
HOH9	NY Harb ULSD Fut Mar19	25
KR4175P100	2019-01 달러선물	16
NGH19	NATURAL GAS FUTR Mar19	76
XBH9	GASOLINE RBOB FUT Mar19	20

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

376

공시일	2018-12-31
기준일	2018-12-28

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

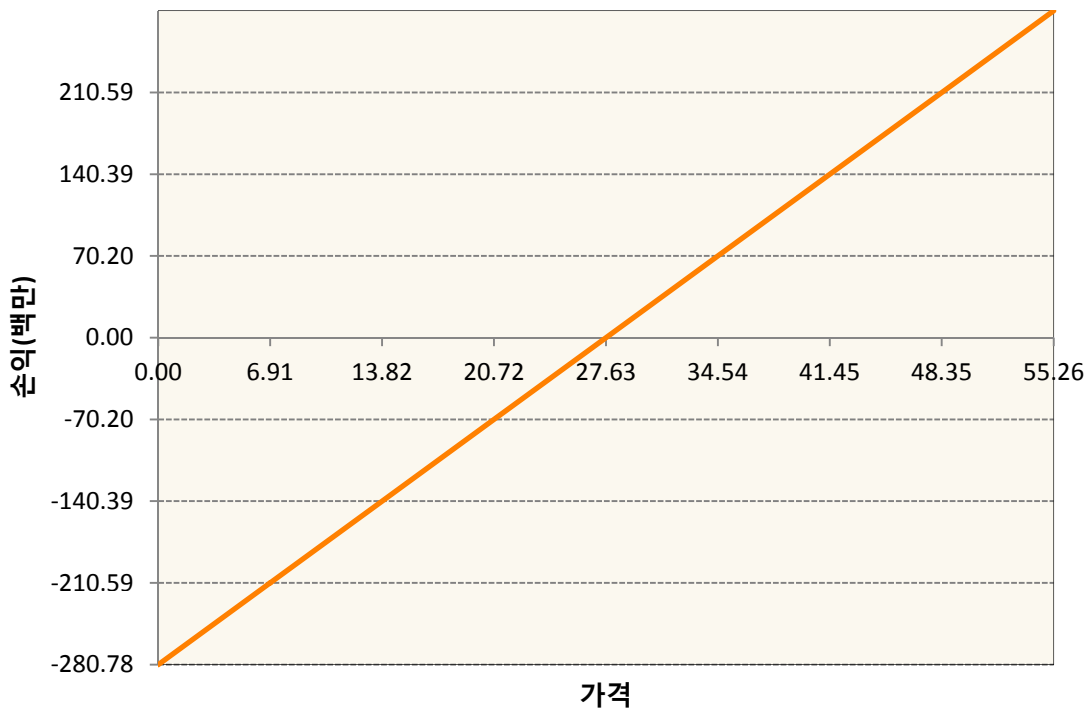
1. 계약금액

(단위:백만원)

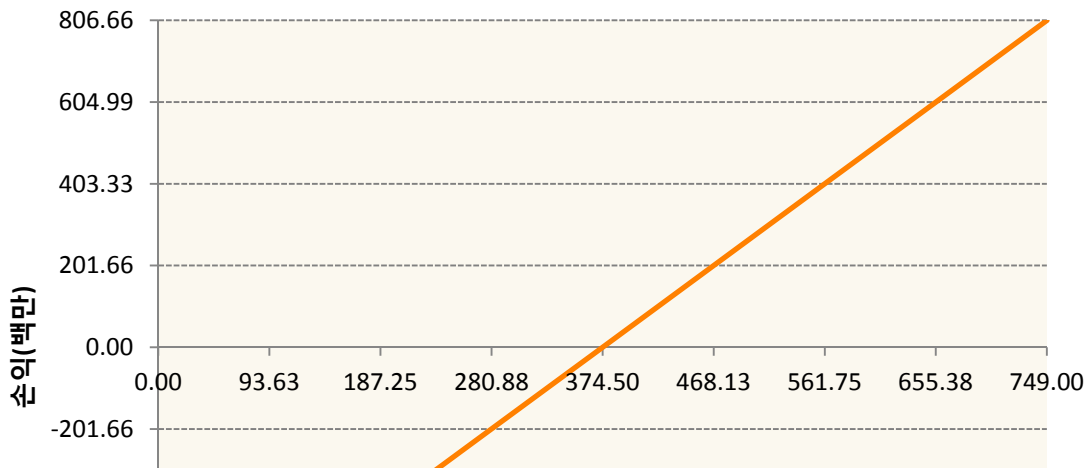
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,571	78	3,493	

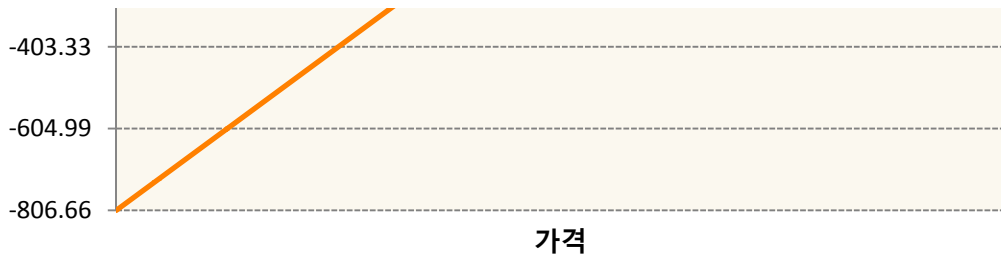
2. 만기시점의 손익구조

BOH9-SOYBEAN OIL FUTR Mar19

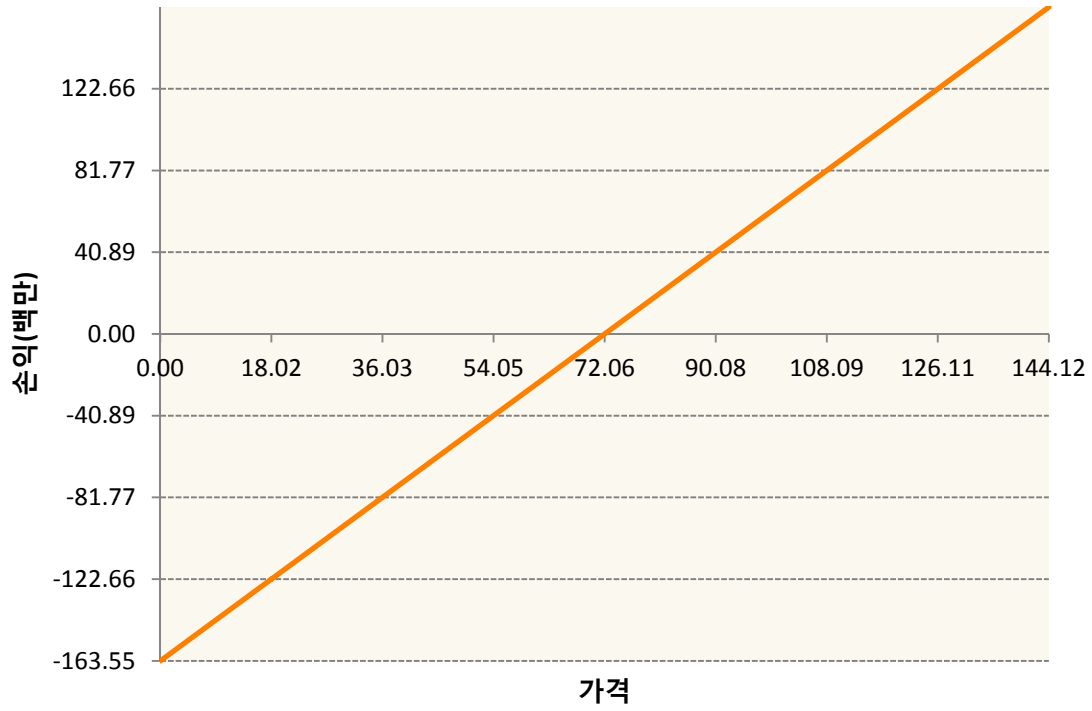


CH9-CORN FUTURE Mar19

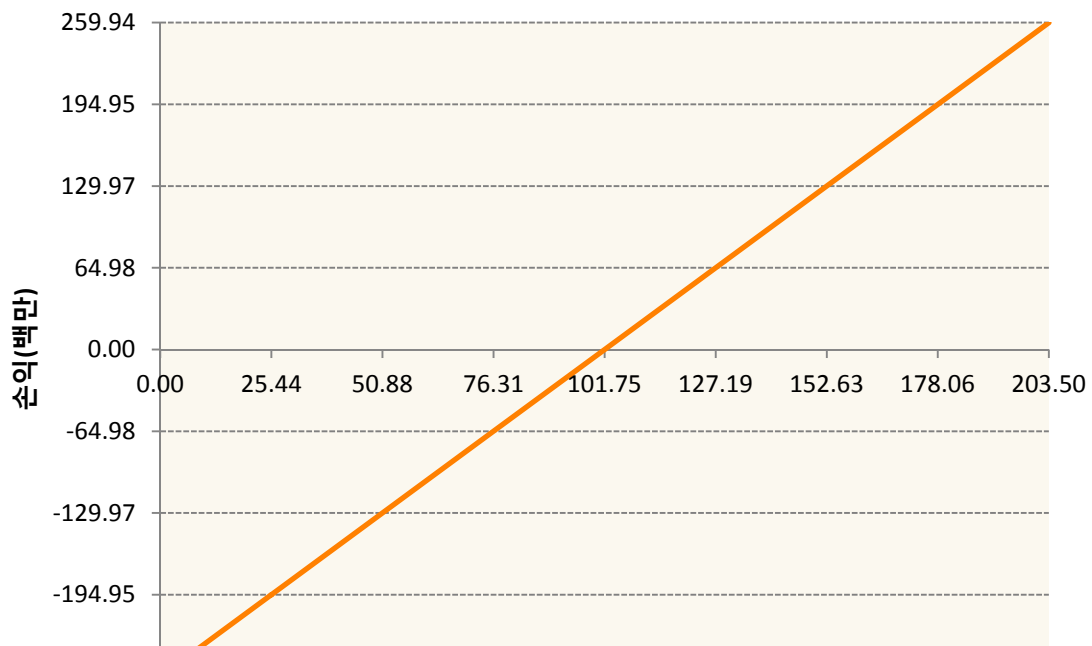


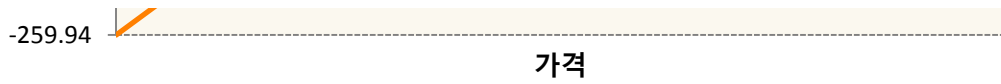


CTH9-COTTON NO.2 FUTR Mar19

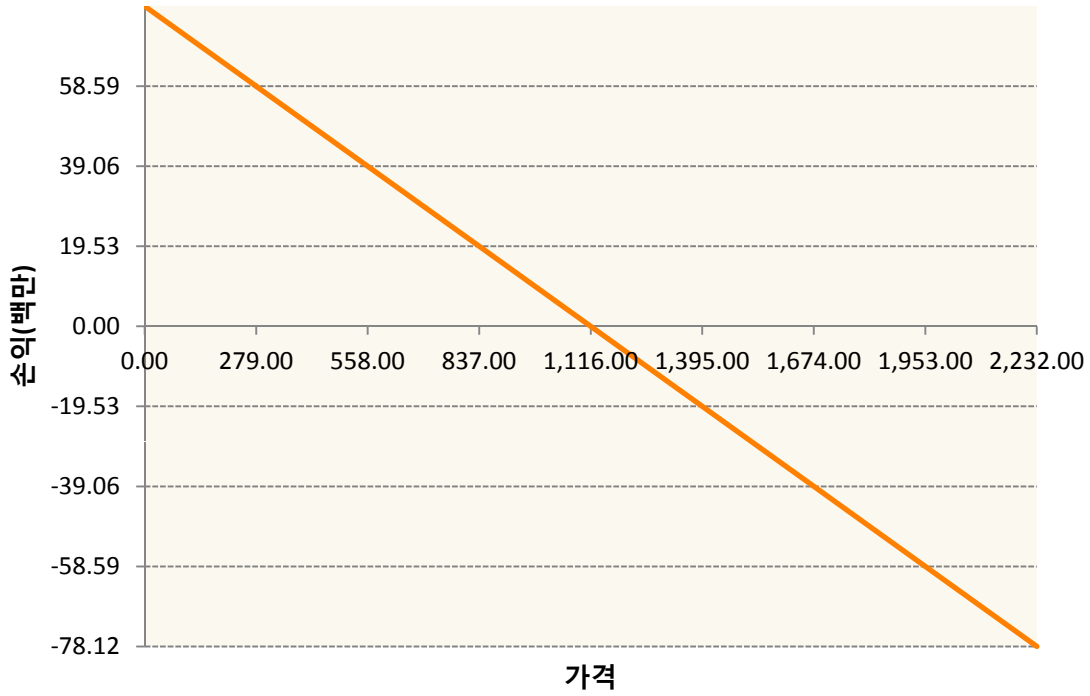


KCH9-COFFEE 'C' FUTURE Mar19

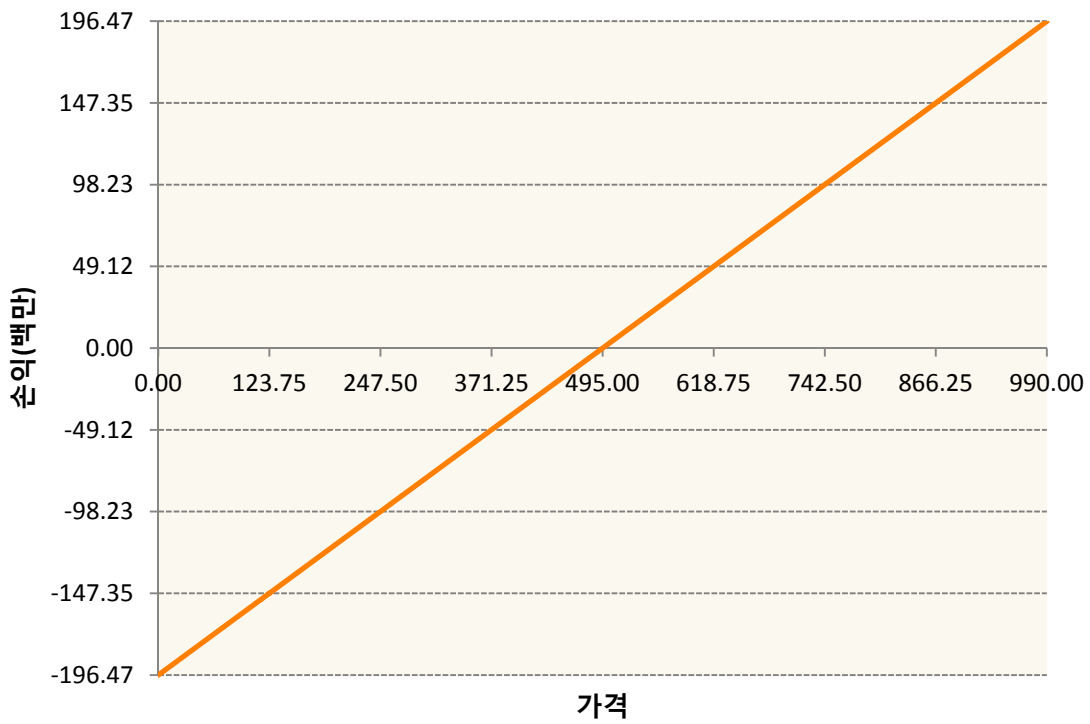




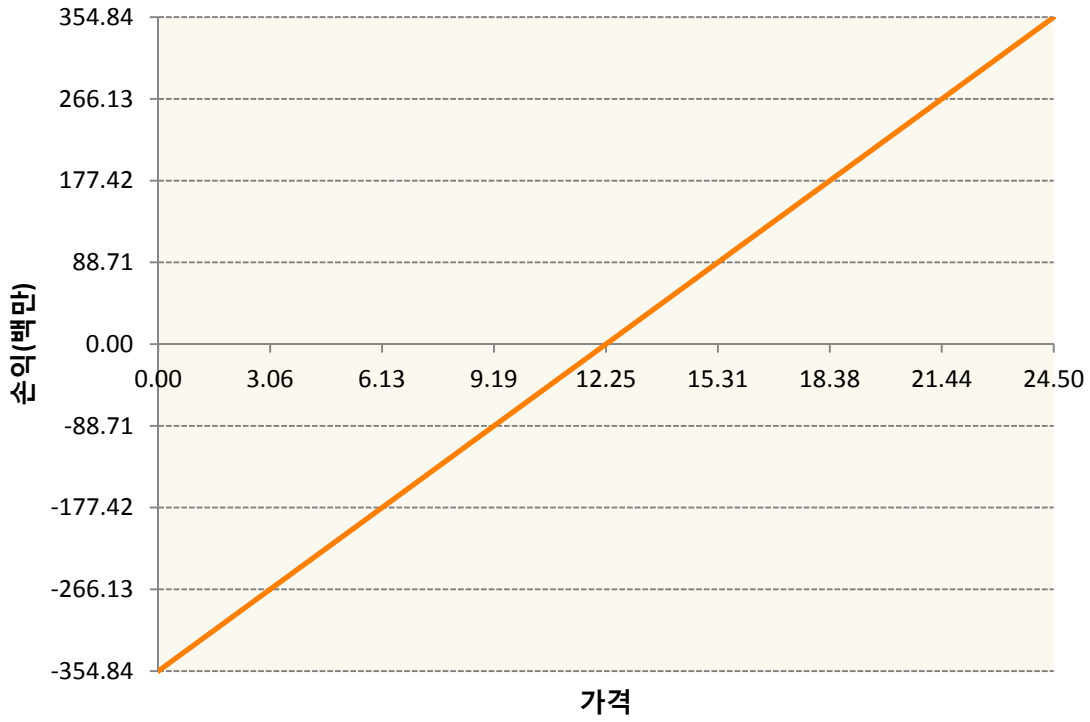
KR4175P10003-2019-01 달러선물



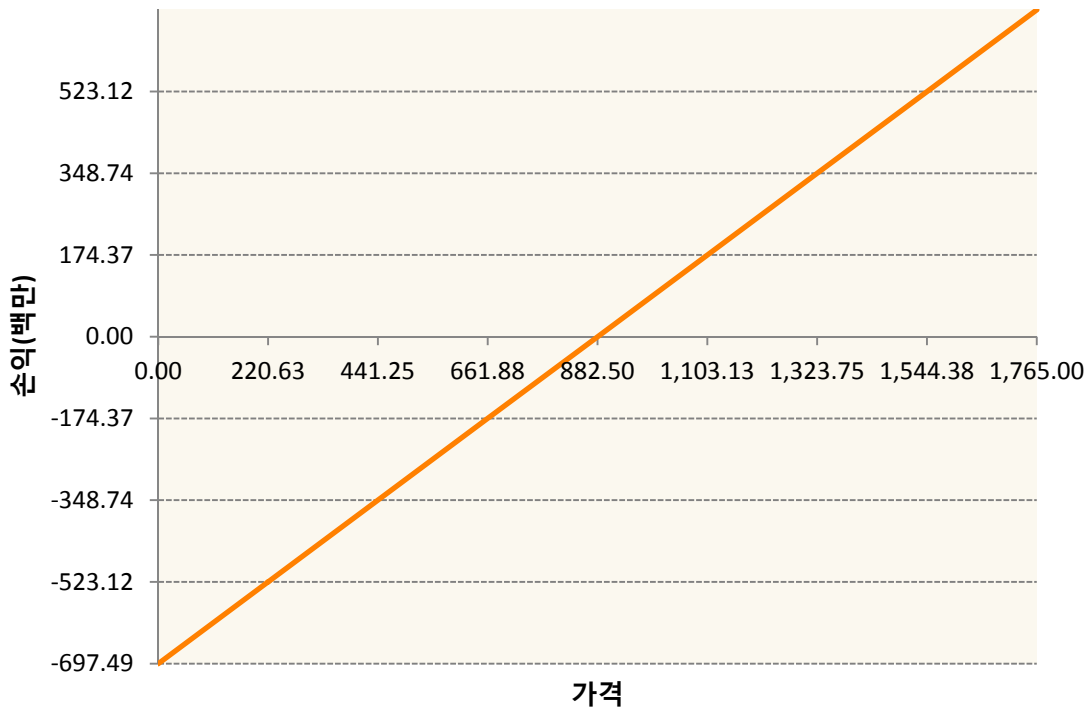
KWH9-KC HRW WHEAT FUT Mar19



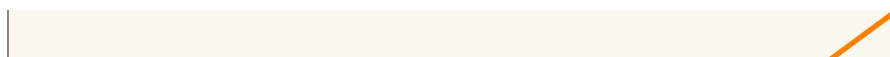
SBH9-SUGAR #11 (WORLD) MAR19

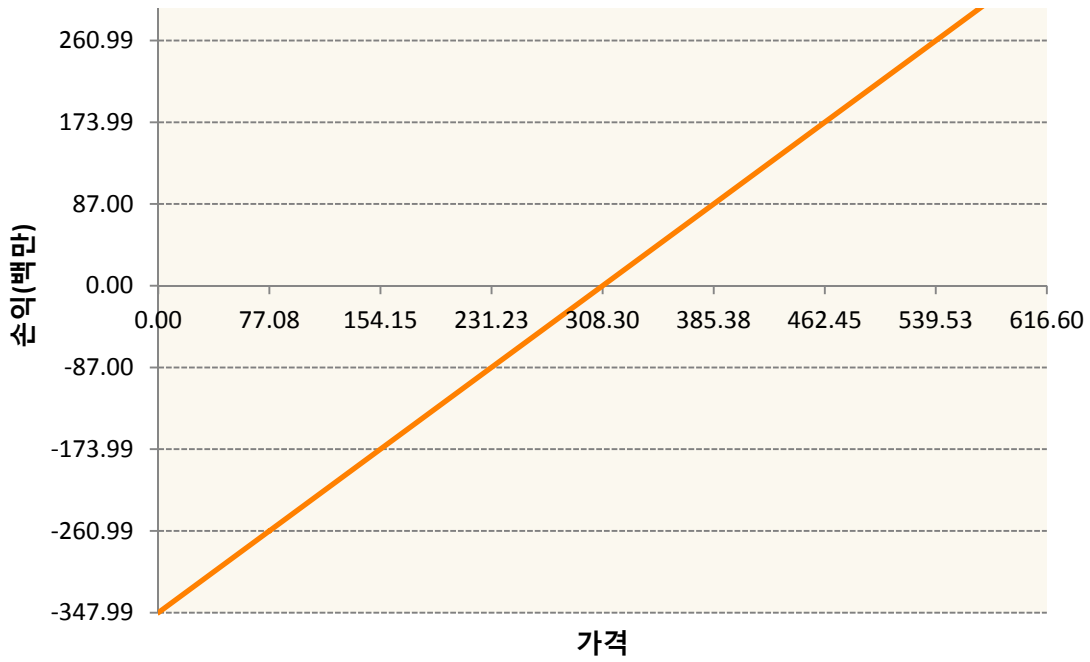


SH9-SOYBEAN FUTURE Mar19

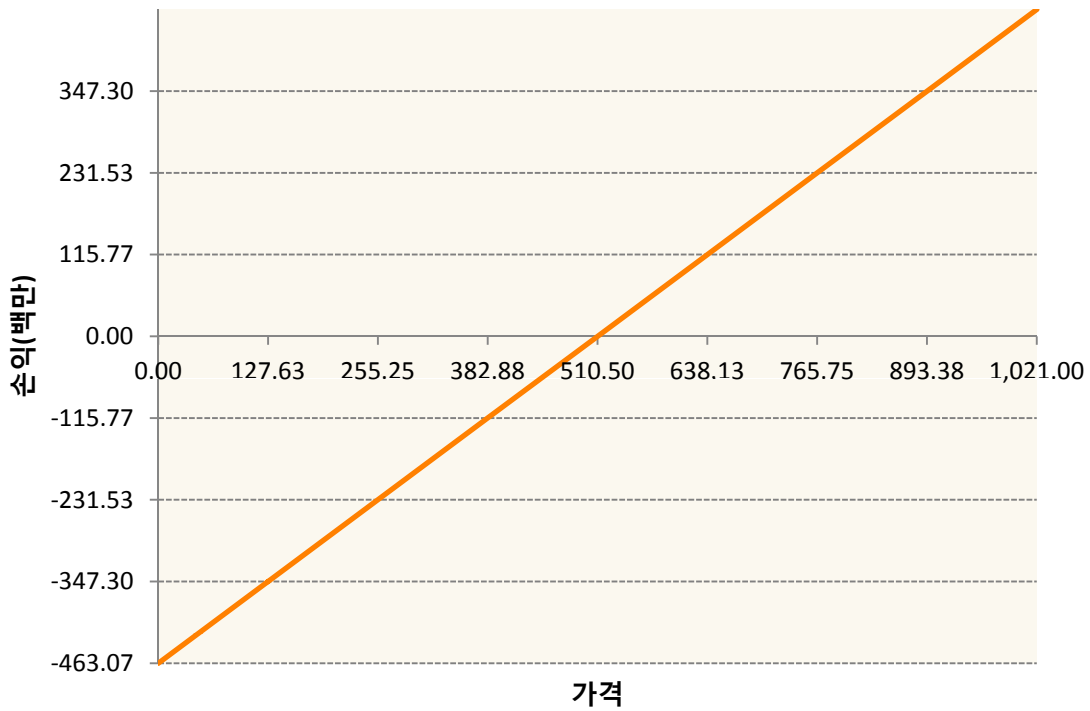


SMH9-SOYBEAN MEAL FUTR Mar19





WH9-WHEAT FUTURE(CBT) Mar19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

BOH9	SOYBEAN OIL FUTR Mar19	22
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	28
SH9	SOYBEAN FUTURE Mar19	56
SMH9	SOYBEAN MEAL FUTR Mar19	28
WH9	WHEAT FUTURE(CBT) Mar19	37

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

(단위:백만원)

300