

공시일	2019-01-03
기준일	2019-01-02

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)

89

공시일	2019-01-03
기준일	2019-01-02

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

1,003

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

549

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-01-03
기준일	2019-01-02

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	2019-01-03
기준일	2019-01-02

유로인덱스모(주식-파생형)

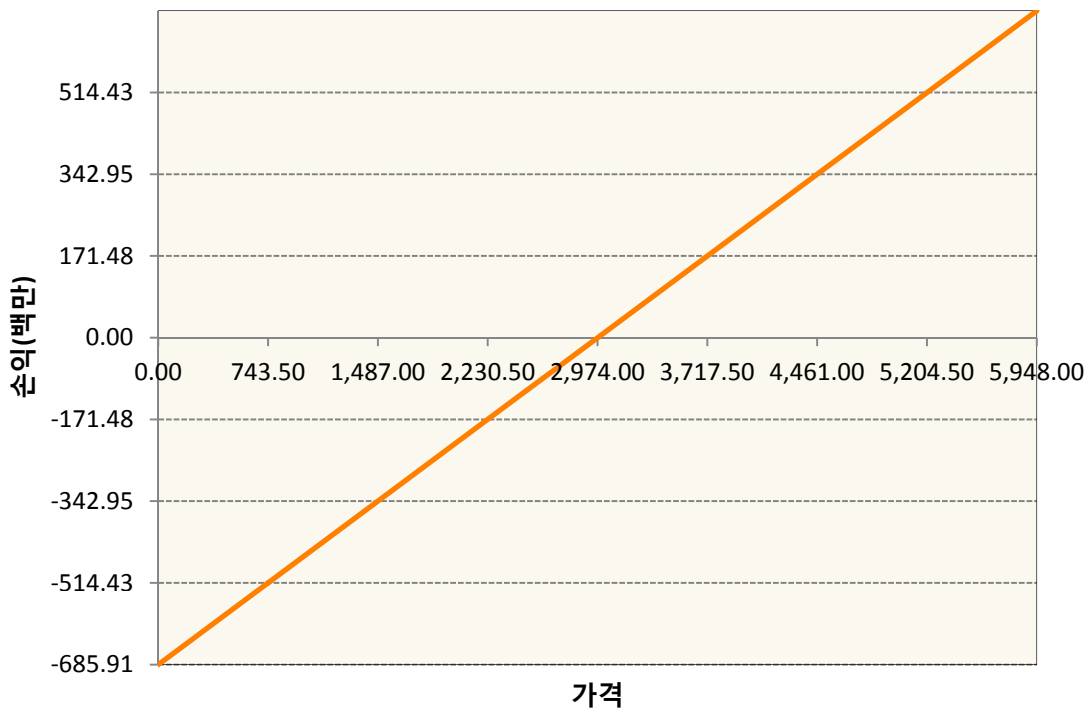
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	686	0	686	

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	2019-01-03
기준일	2019-01-02

차이나인덱스모(주식-파생형)

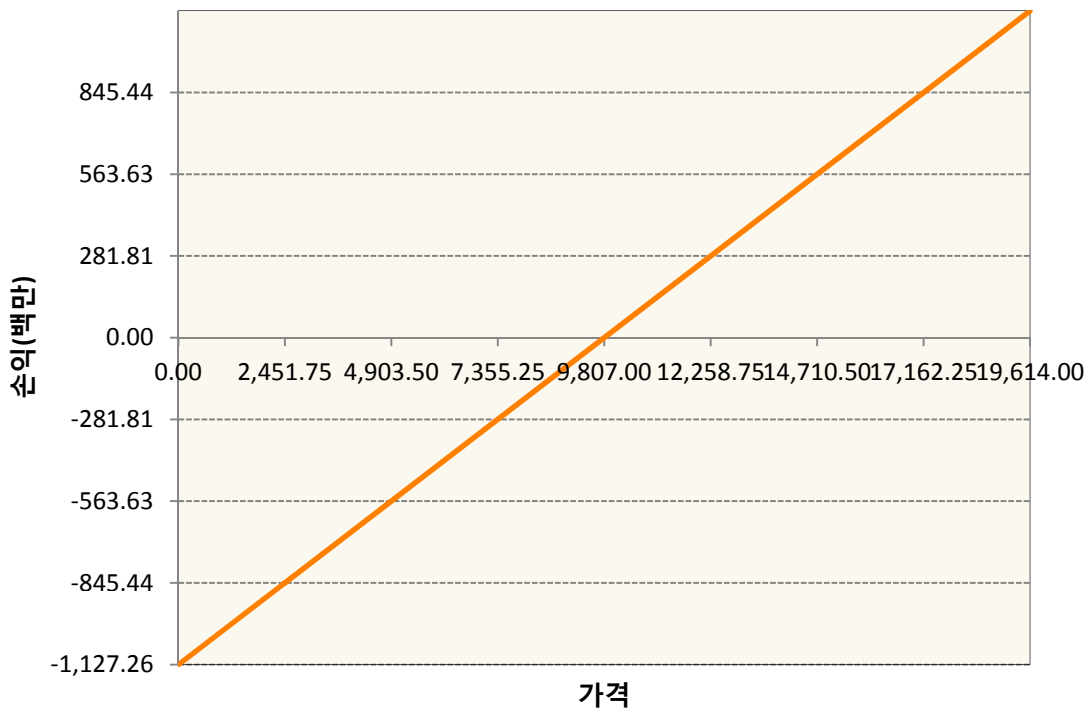
1. 계약금액

(단위:백만원)

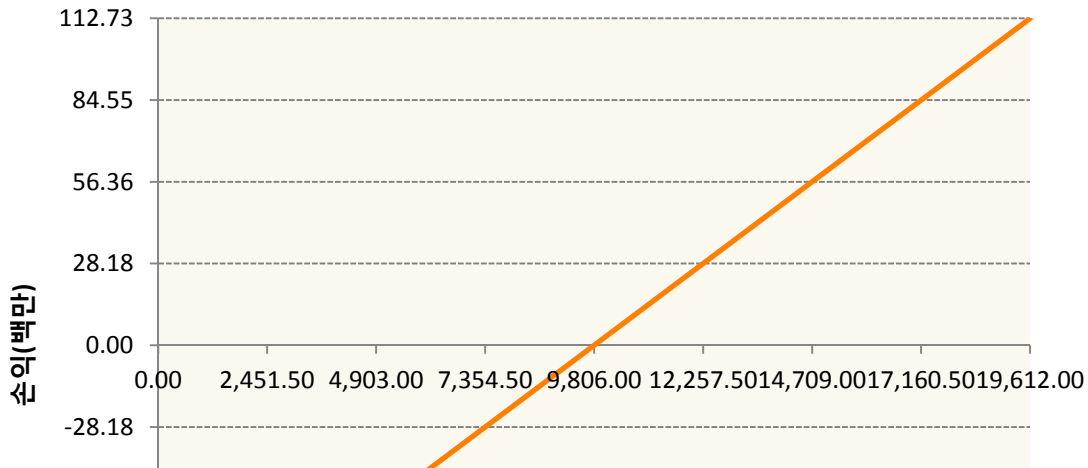
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,240	0	1,240	장내

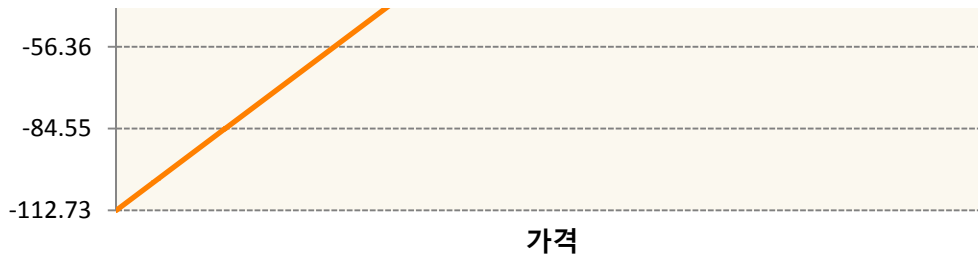
2. 만기시점의 손익구조

HCF9-HSCEI FUTURES JAN19



MHCF9-MINI H-SHR IDX FU JAN19





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

HCF9	HSCEI FUTURES JAN19	90
MHCF9	MINI H-SHR IDX FU JAN19	9

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

100

공시일	2019-01-03
기준일	2019-01-02

커버드콜모(주식혼합-파생형)

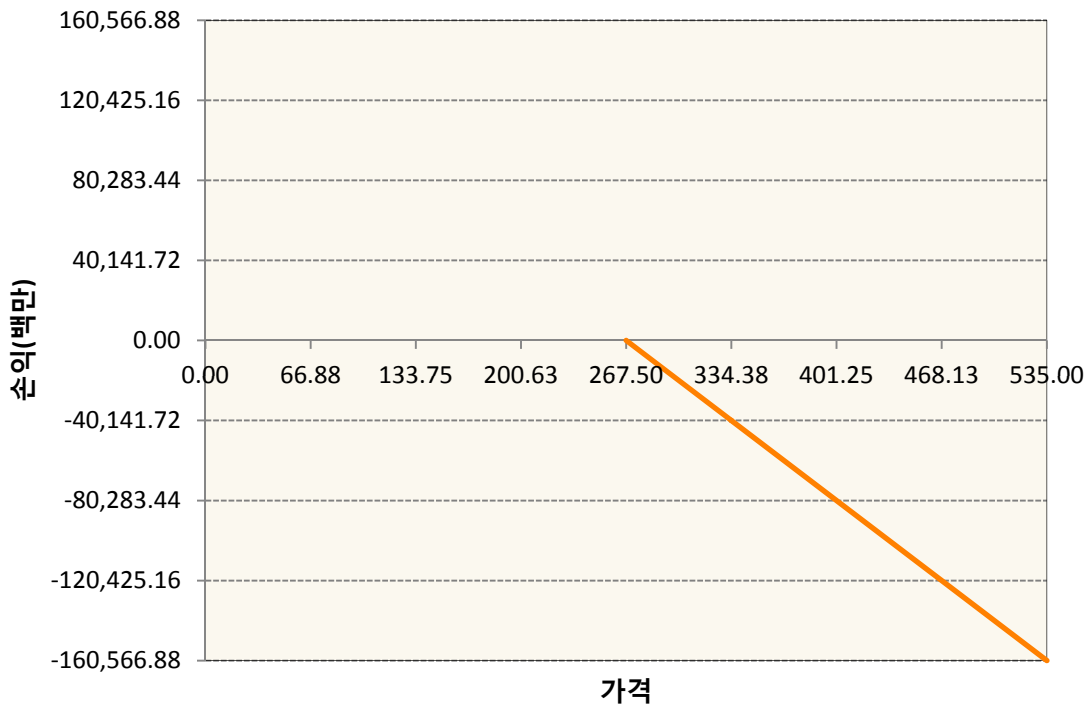
1. 계약금액

(단위:백만원)

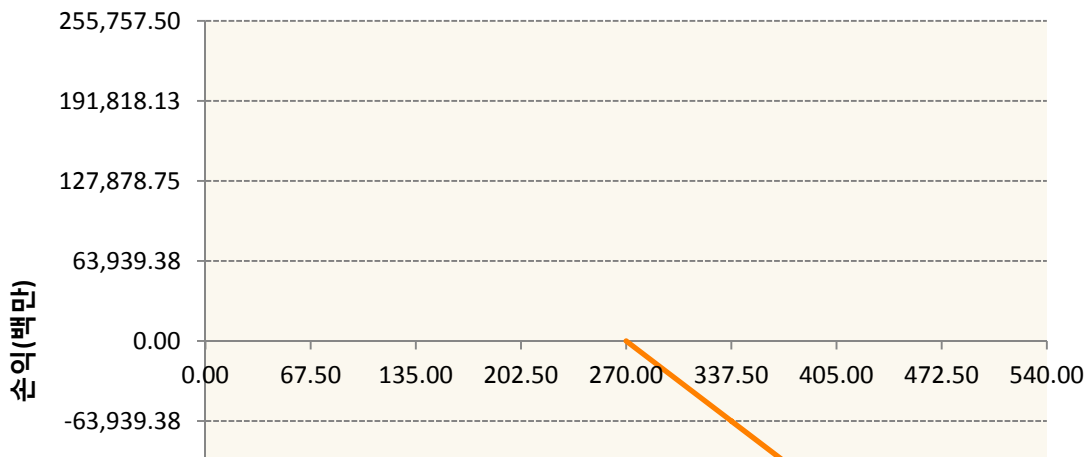
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	730,199	-730,199	장내

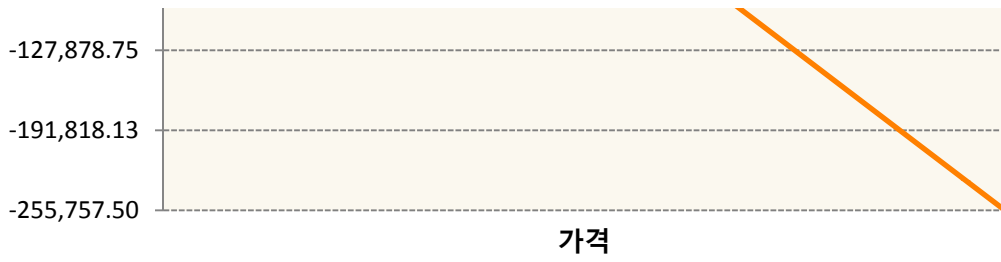
2. 만기시점의 손익구조

KR4201P12672-2019-01 콜267.5

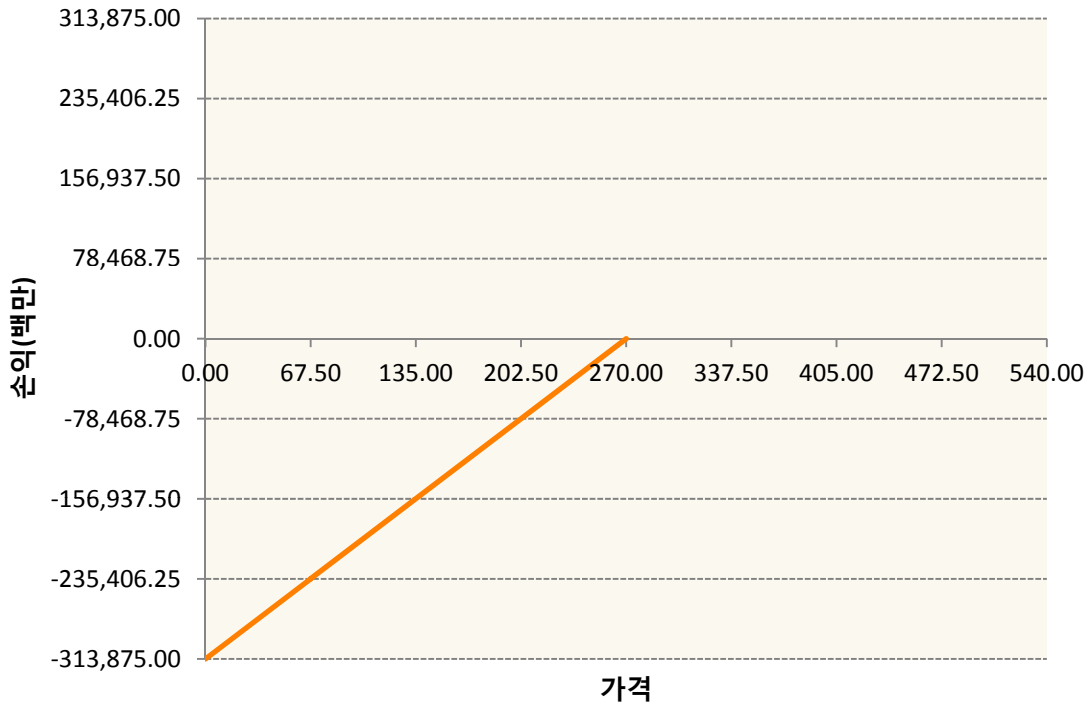


KR4201P12706-2019-01 콜270





KR4301P12704-2019-01 풋270



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201P12672		2019-01 콜267.5					7,121	
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	692	692	691	689	685	677	666	
-5.33%	690	686	677	662	640	609	570	
-2.67%	655	622	576	516	444	360	264	
0%	392	274	143	0	-152	-311	-477	
2.67%	-630	-839	-1,049	-1,260	-1,473	-1,686	-1,899	
5.33%	-2,926	-3,118	-3,315	-3,516	-3,719	-3,925	-4,133	
8.00%	-6,345	-6,442	-6,555	-6,681	-6,818	-6,966	-7,121	
KR4201P12706		2019-01 콜270					9,823	
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	714	714	713	712	708	701	690	

-5.33%	713	710	703	690	668	636	592
-2.67%	689	660	615	552	471	371	254
0%	465	334	178	0	-196	-408	-634
2.67%	-606	-899	-1,201	-1,510	-1,824	-2,142	-2,463
5.33%	-3,465	-3,804	-4,145	-4,488	-4,831	-5,175	-5,519
8.00%	-8,302	-8,515	-8,749	-8,999	-9,263	-9,538	-9,823
KR4301P12704 2019-01 풋270							23,677
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-23,675	-23,675	-23,675	-23,675	-23,675	-23,676	-23,677
-5.33%	-15,673	-15,673	-15,673	-15,675	-15,678	-15,683	-15,693
-2.67%	-7,673	-7,677	-7,688	-7,706	-7,734	-7,774	-7,826
0%	253	190	105	0	-125	-267	-426
2.67%	7,424	7,178	6,920	6,652	6,376	6,093	5,806
5.33%	12,079	11,767	11,451	11,134	10,816	10,496	10,175
8.00%	13,718	13,577	13,414	13,229	13,028	12,812	12,583

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

(단위:백만원)

39,726

공시일	2019-01-03
기준일	2019-01-02

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

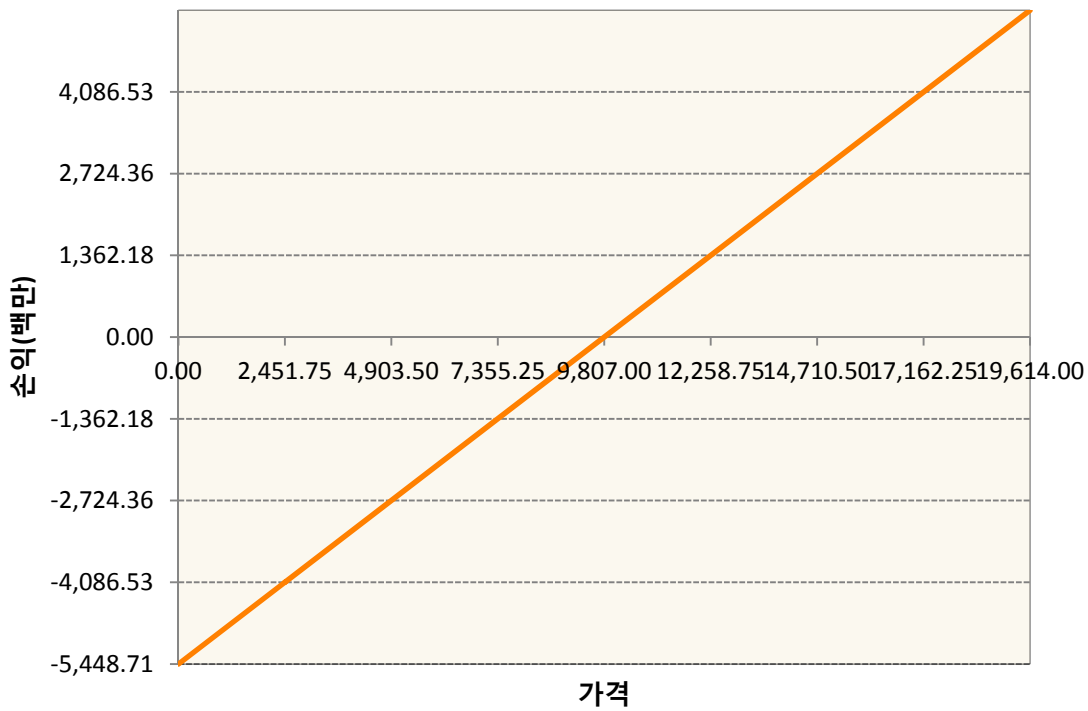
1. 계약금액

(단위:백만원)

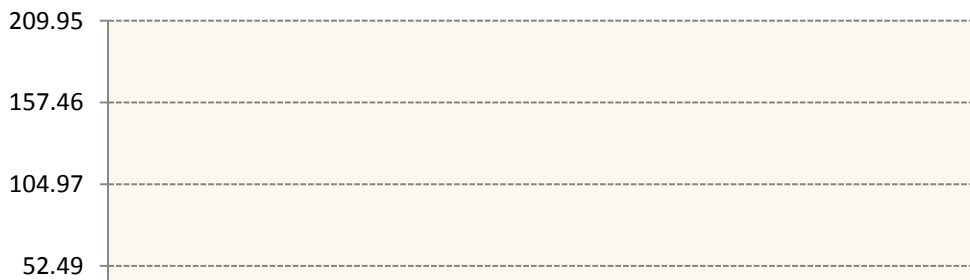
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	5,449	0	5,449	장내
누계	유가증권	옵션	0	12,274	-12,274	장내
누계	통화	선도	0	2,714	-2,714	장외

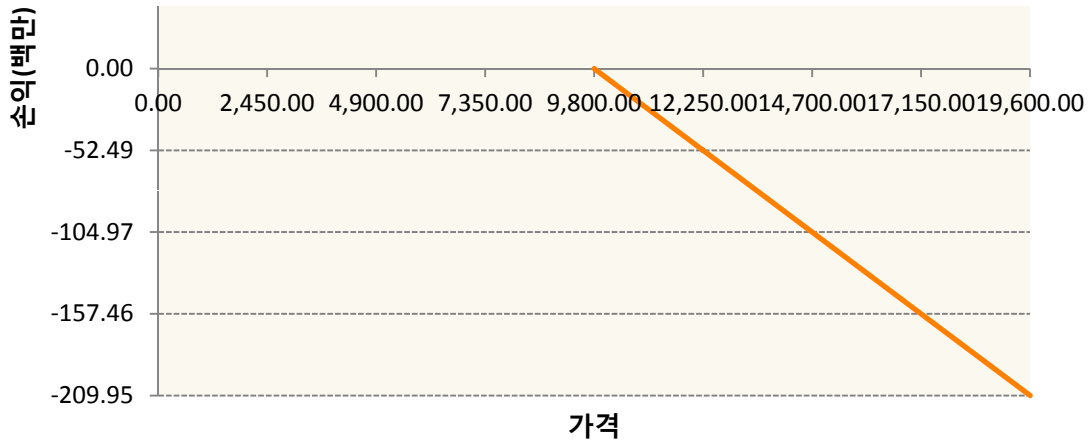
2. 만기시점의 손익구조

HCF9-HSCEI FUTURES JAN19

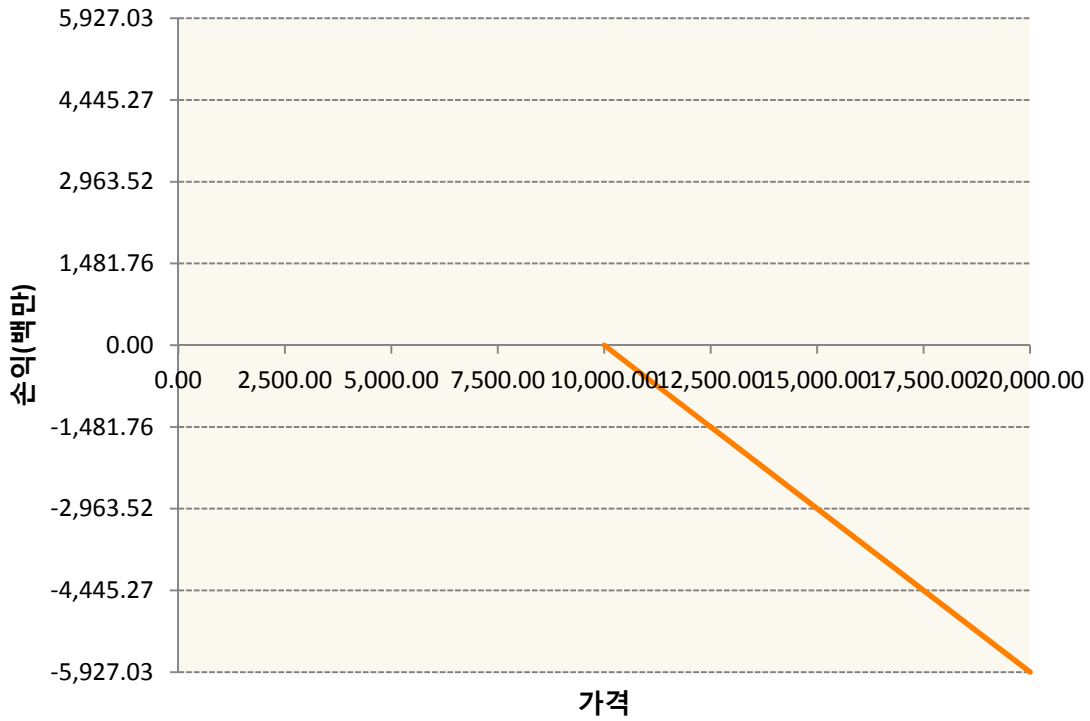


OHHIF9-C098-HSCEI

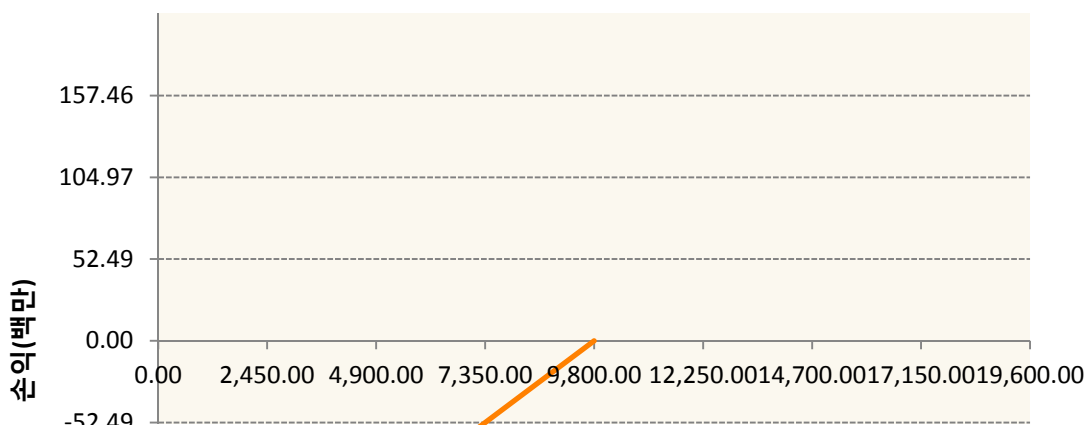


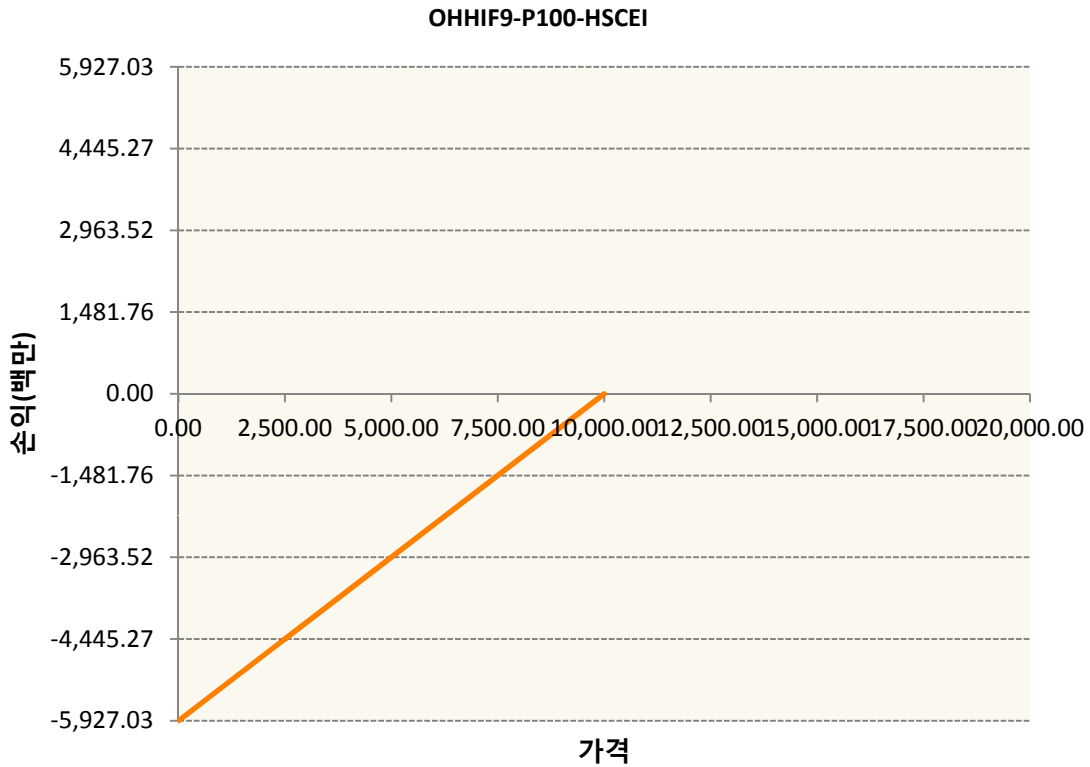


OHHIF9-C100-HSCEI



OHHIF9-P098-HSCEI





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

FX21018Z00 KRW/HKD 11-03-19E	217
HCF9 HSCEI FUTURES JAN19	436
OHHIF9-C09 HSCEI	17
OHHIF9-C10 HSCEI	474
OHHIF9-P09 HSCEI	17
OHHIF9-P10 HSCEI	474

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

1,510

공시일	2019-01-03
기준일	2019-01-02

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

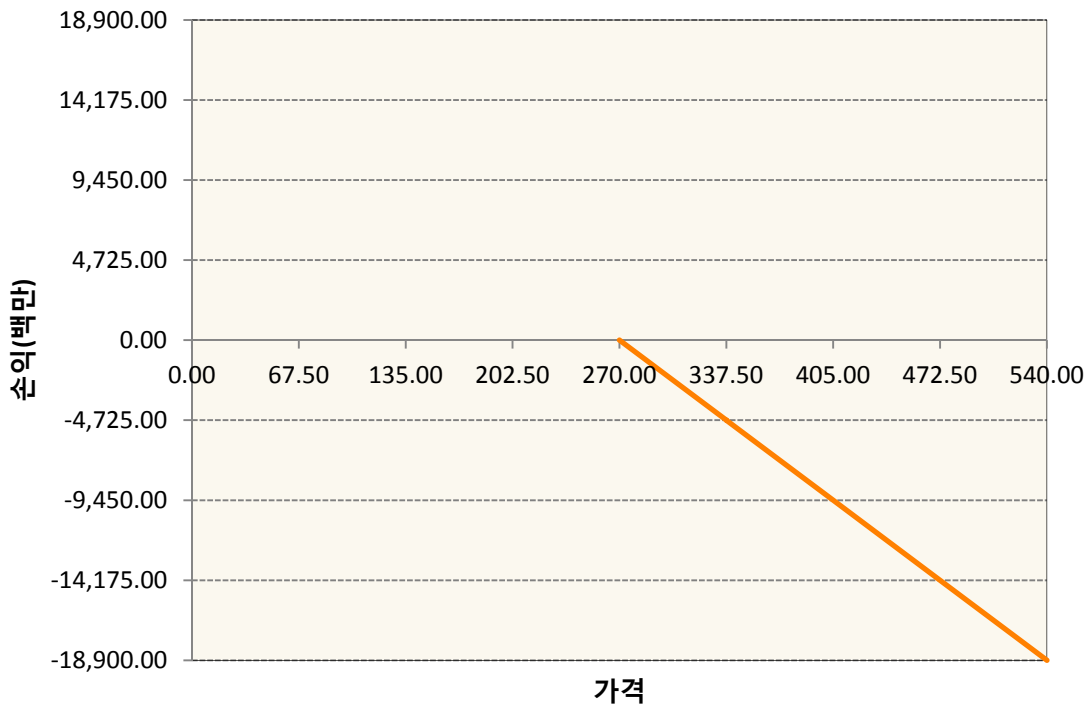
1. 계약금액

(단위:백만원)

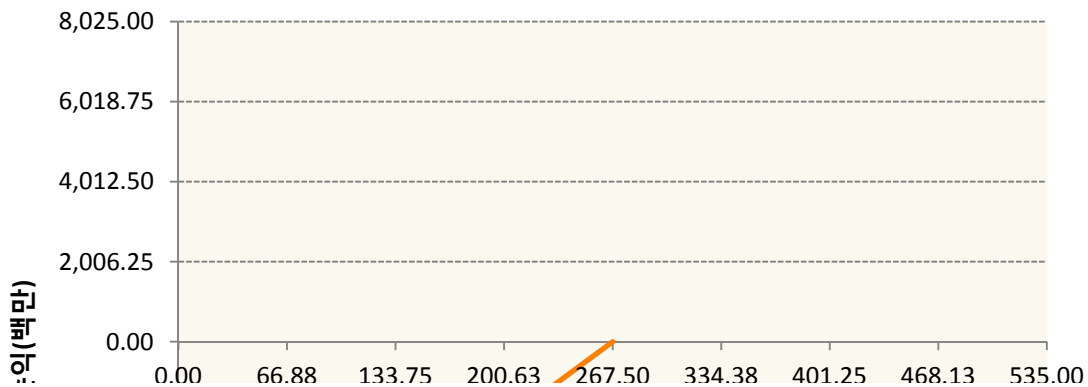
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	스왑	31,836	0	31,836	장외
누계	유가증권	옵션	0	34,350	-34,350	장내

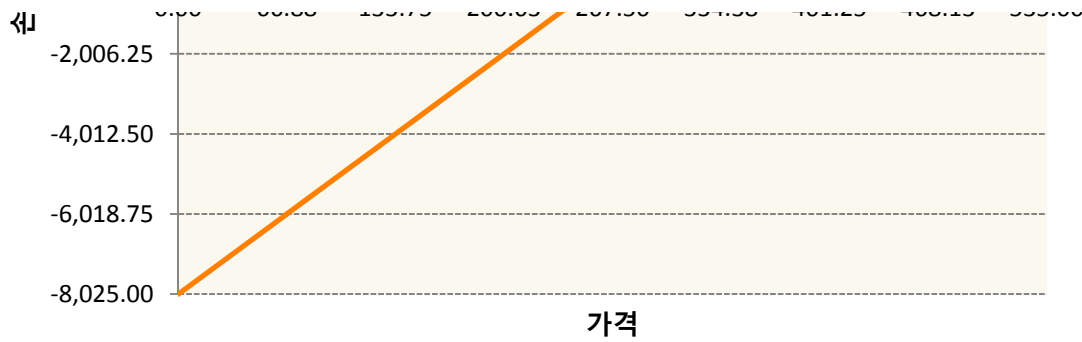
2. 만기시점의 손익구조

KR4201P12706-2019-01 콜270

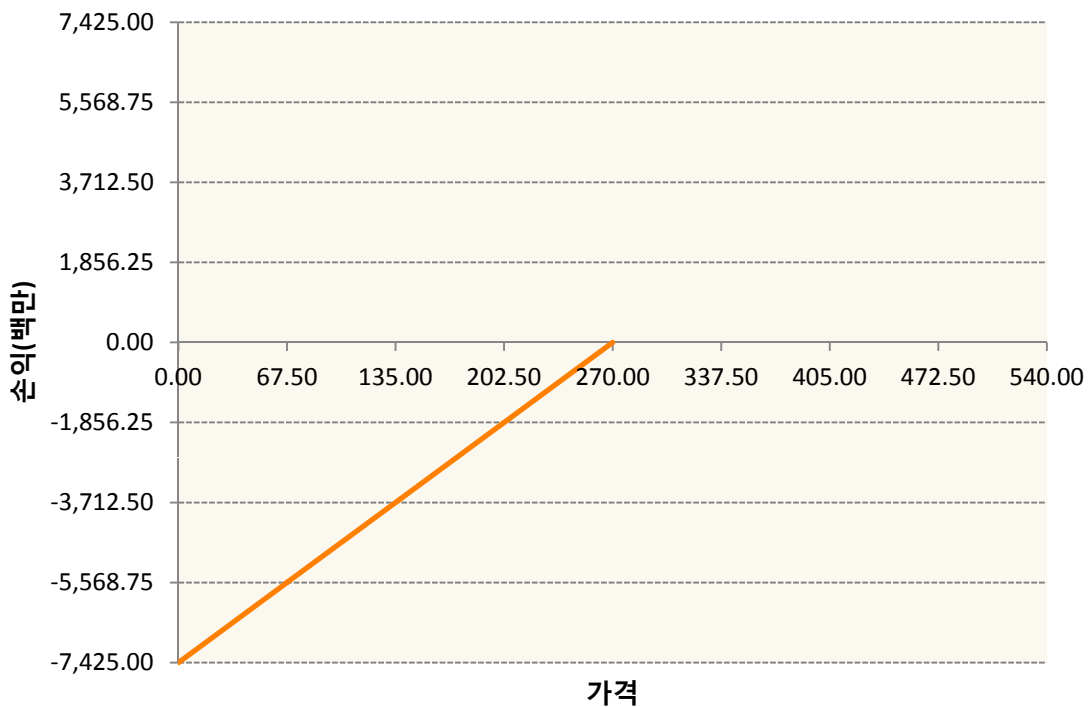


KR4301P12670-2019-01 풋267.5





KR4301P12704-2019-01 풋270



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

	2.529E+11		UBCSFXC1 INDEX_14				2,636
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-2,636	-2,636	-2,636	-2,636	-2,636	-2,636	-2,636
-5.33%	-1,757	-1,757	-1,757	-1,757	-1,757	-1,757	-1,757
-2.67%	-879	-879	-879	-879	-879	-879	-879
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	879	879	879	879	879	879	879
5.33%	1,757	1,757	1,757	1,757	1,757	1,757	1,757
8.00%	2,636	2,636	2,636	2,636	2,636	2,636	2,636
	KR4201P12706		2019-01 콜270				726
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	53	53	53	53	52	52	51
-5.33%	53	52	52	51	49	47	44
-2.67%	51	49	45	41	35	27	19
0%	34	25	13	0	-14	-30	-47
2.67%	-45	-66	-89	-112	-135	-158	-182
5.33%	-256	-281	-306	-332	-357	-382	-408
8.00%	-614	-629	-647	-665	-685	-705	-726
KR4301P12670 2019-01 풋267.5							604

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-604	-604	-604	-604	-604	-604	-604
-5.33%	-397	-397	-397	-397	-397	-398	-398
-2.67%	-191	-191	-192	-193	-194	-196	-198
0%	11	8	4	0	-5	-9	-15
2.67%	178	170	162	155	147	139	130
5.33%	267	261	254	246	239	232	224
8.00%	291	289	286	283	279	275	270
KR4301P12704 2019-01 풋270							560

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-560	-560	-560	-560	-560	-560	-560
-5.33%	-371	-371	-371	-371	-371	-371	-371
-2.67%	-182	-182	-182	-182	-183	-184	-185
0%	6	4	2	0	-3	-6	-10
2.67%	176	170	164	157	151	144	137
5.33%	286	278	271	263	256	248	241
8.00%	325	321	317	313	308	303	298

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

(단위:백만원)

4,497

공시일	2019-01-03
기준일	2019-01-02

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

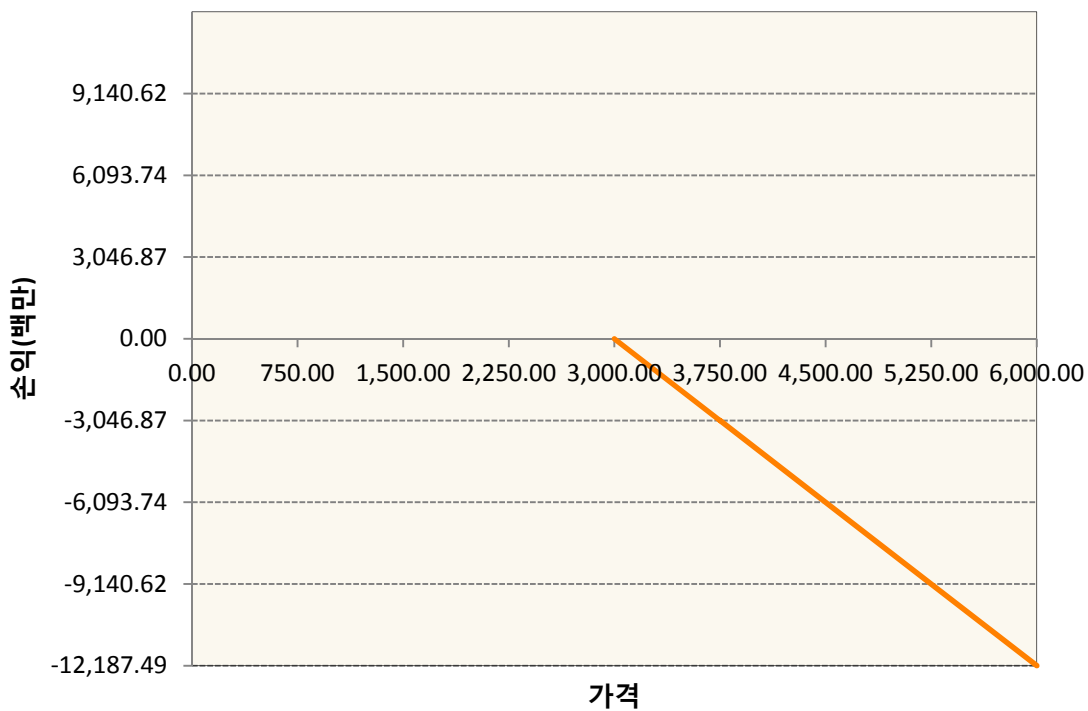
1. 계약금액

(단위:백만원)

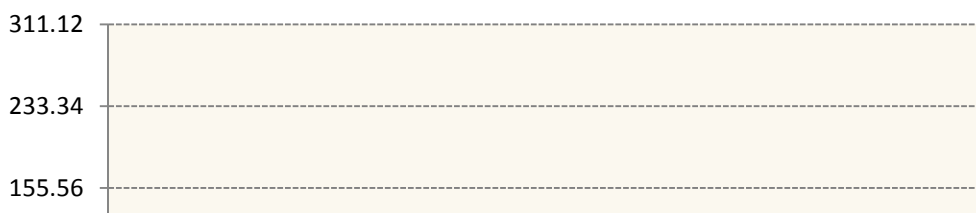
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	6,438	0	6,438	
누계	유가증권	스왑	71,803	0	71,803	장외
누계	유가증권	옵션	0	24,997	-24,997	장내
누계	통화	선도	0	15,427	-15,427	장외

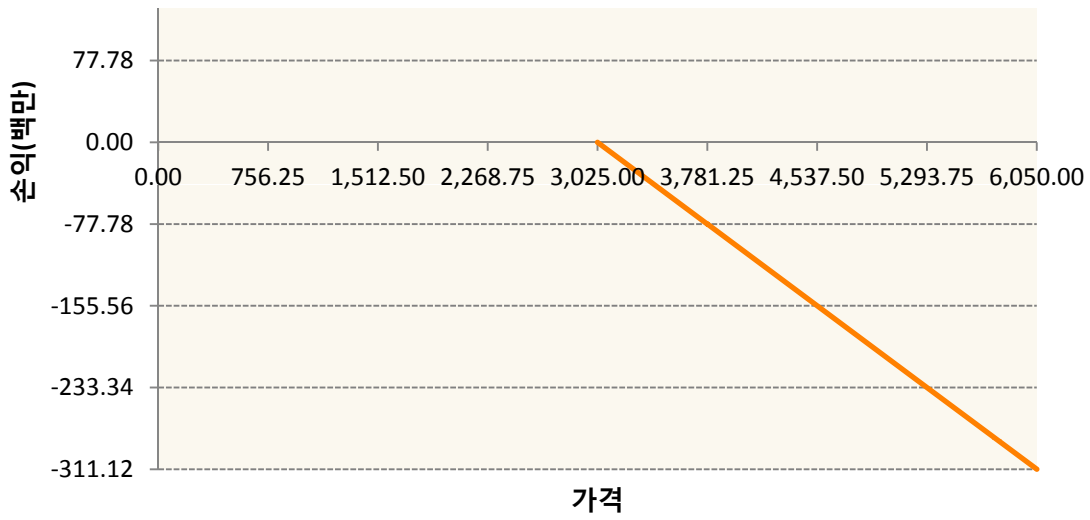
2. 만기시점의 손익구조

OESXF9-C3000-EURO STOXX 50

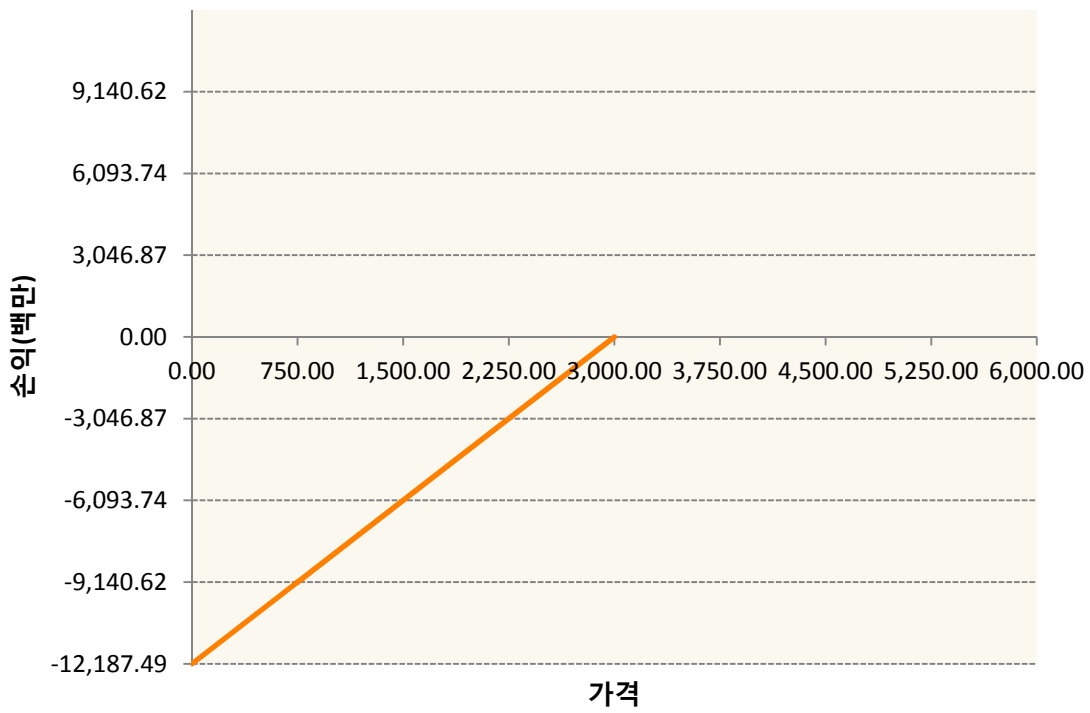


OESXF9-C3025-EURO STOXX 50

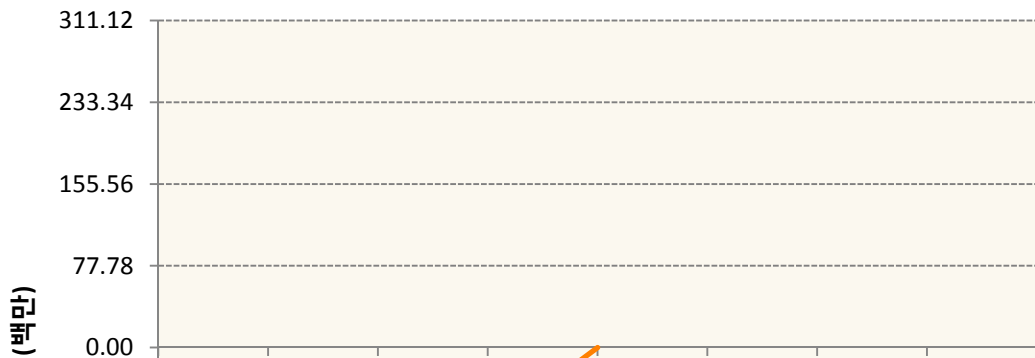


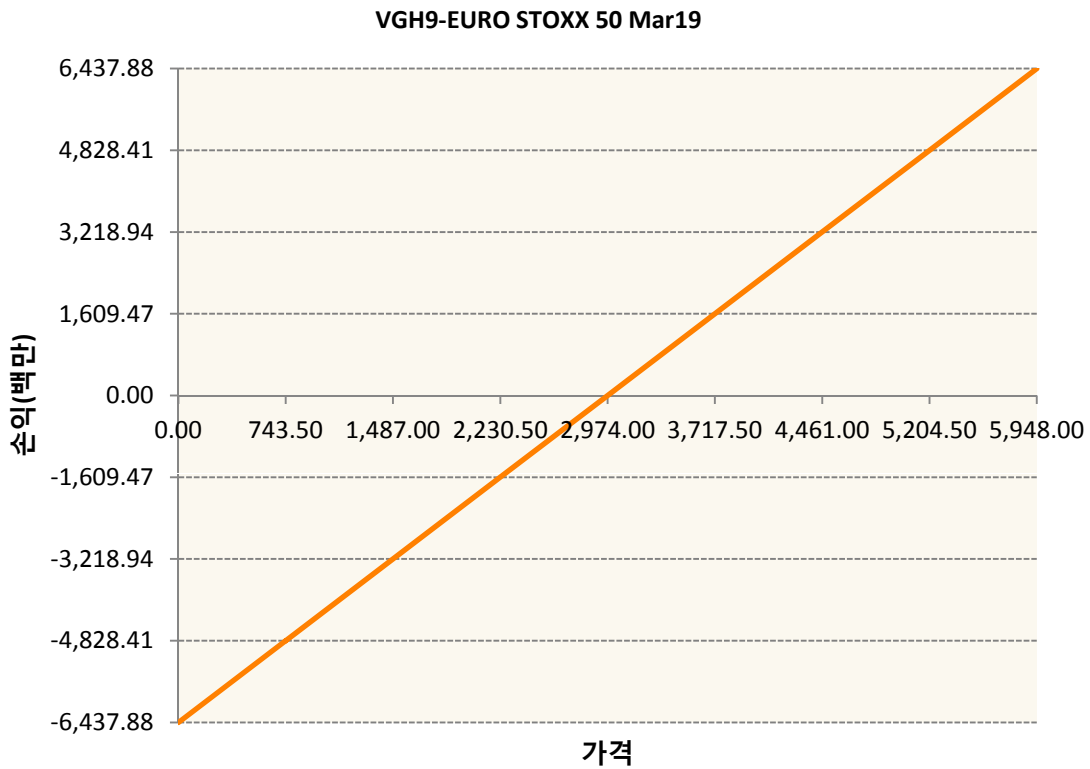
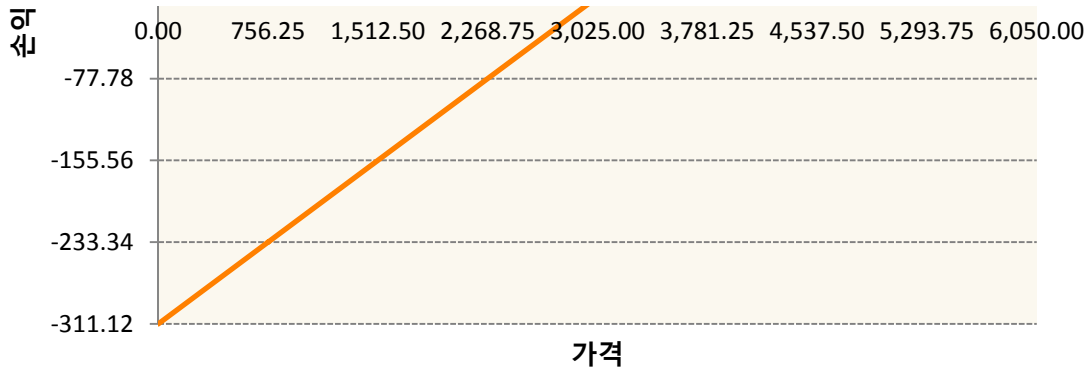


OESXF9-P3000-EURO STOXX 50



OESXF9-P3025-EURO STOXX 50





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

(단위:백만원)

2,605

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

(단위:백만원)

1,048

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

(단위:백만원)

89

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

(단위:백만원)

134

공시일	2019-01-03
기준일	2019-01-02

스마트KRX300인덱스목표전환형1호

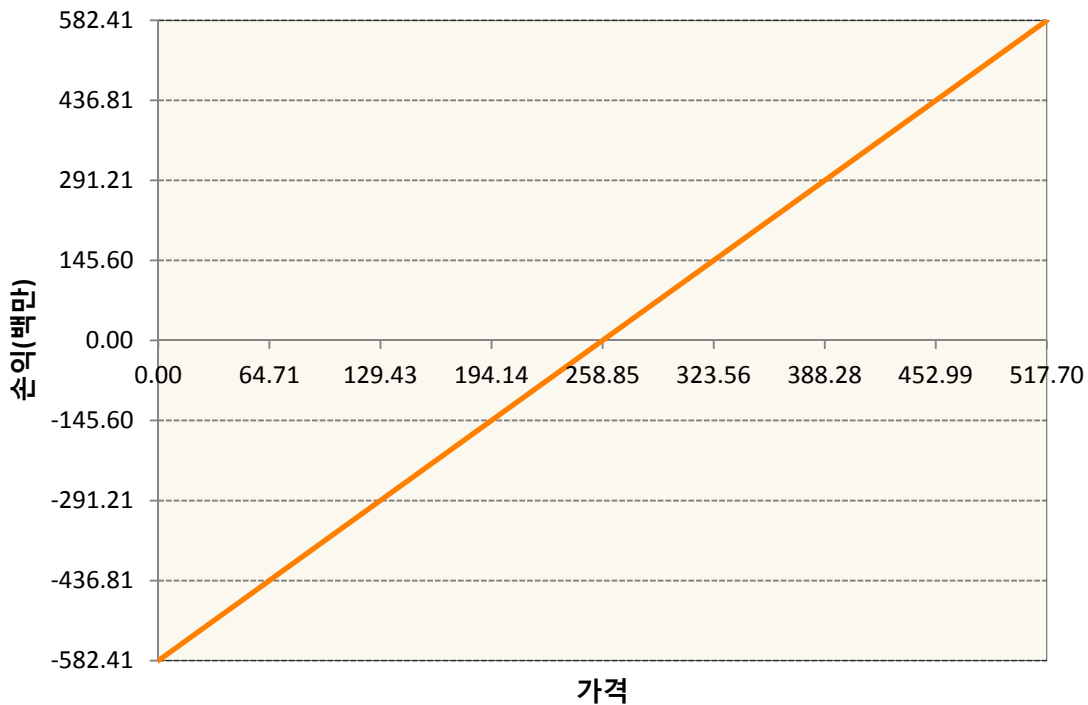
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	582	0	582	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101P30007-2019-03 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101P30007		2019-03 코스피200지수선물						46
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-46	-46	-46	-46	-46	-46	-46	
-5.33%	-31	-31	-31	-31	-31	-31	-31	
-2.67%	-15	-15	-15	-15	-15	-15	-15	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	15	15	15	15	15	15	15	
5.33%	31	31	31	31	31	31	31	
8.00%	46	46	46	46	46	46	46	

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

(단위:백만원)

40

공시일	2019-01-03
기준일	2019-01-02

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

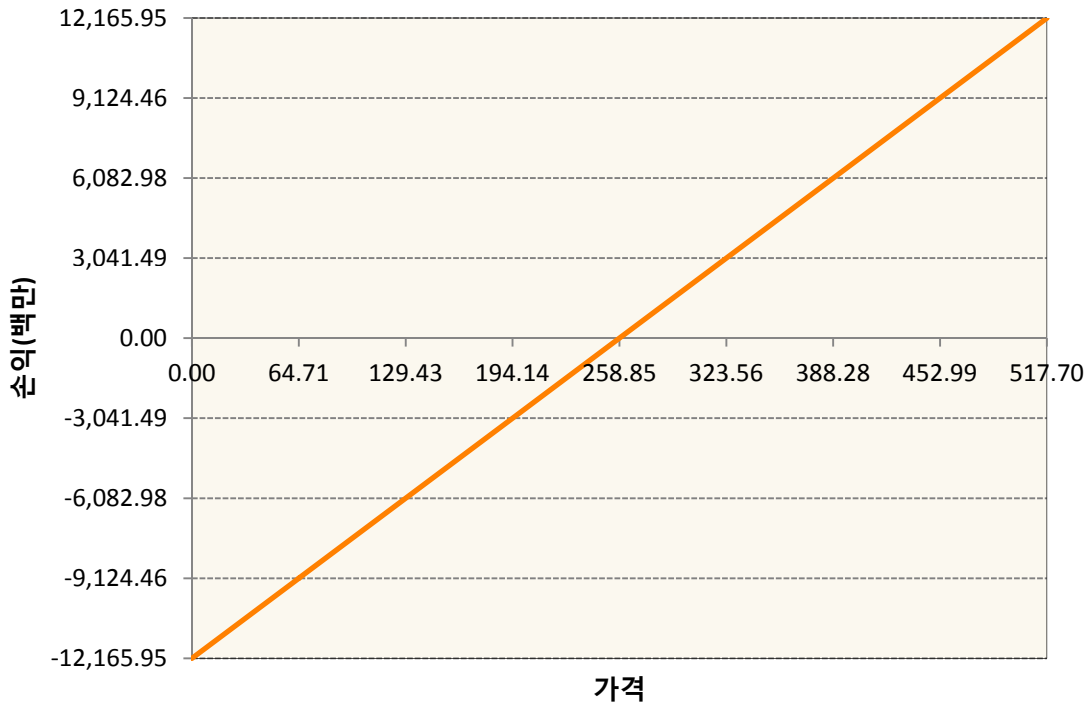
1. 계약금액

(단위:백만원)

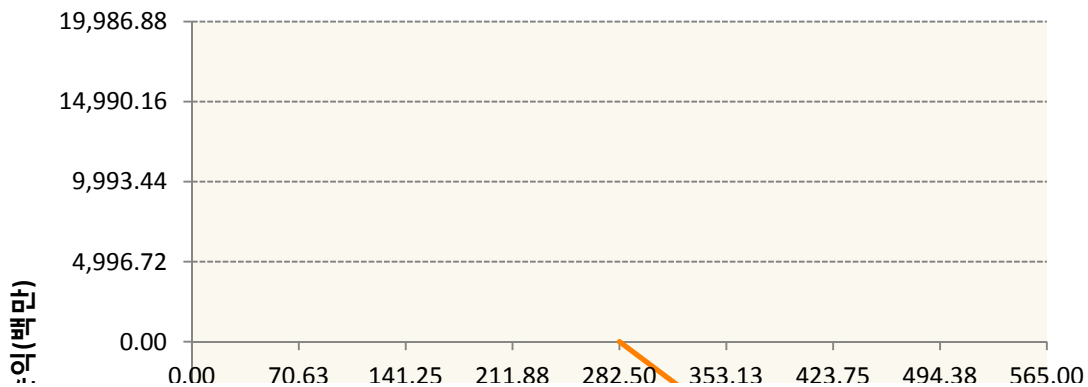
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	212	-212	장내
누계	유가증권	선물	12,166	0	12,166	장내
누계	유가증권	옵션	1,145	23,549	-22,404	장내

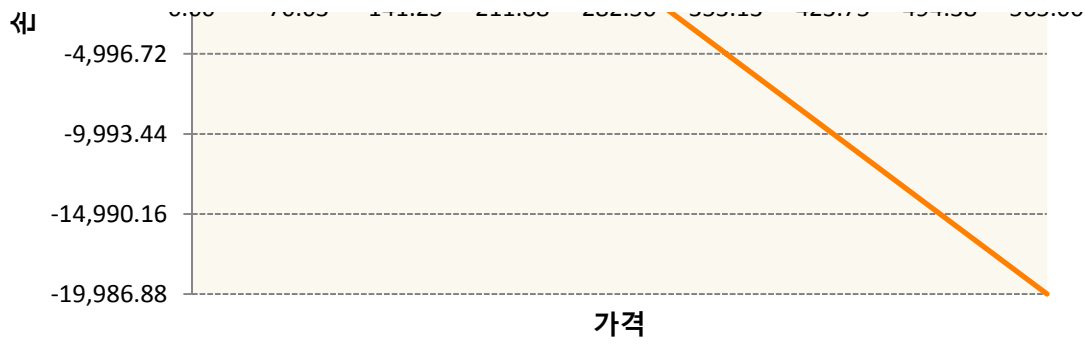
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P30007-2019-03 코스피200지수선물

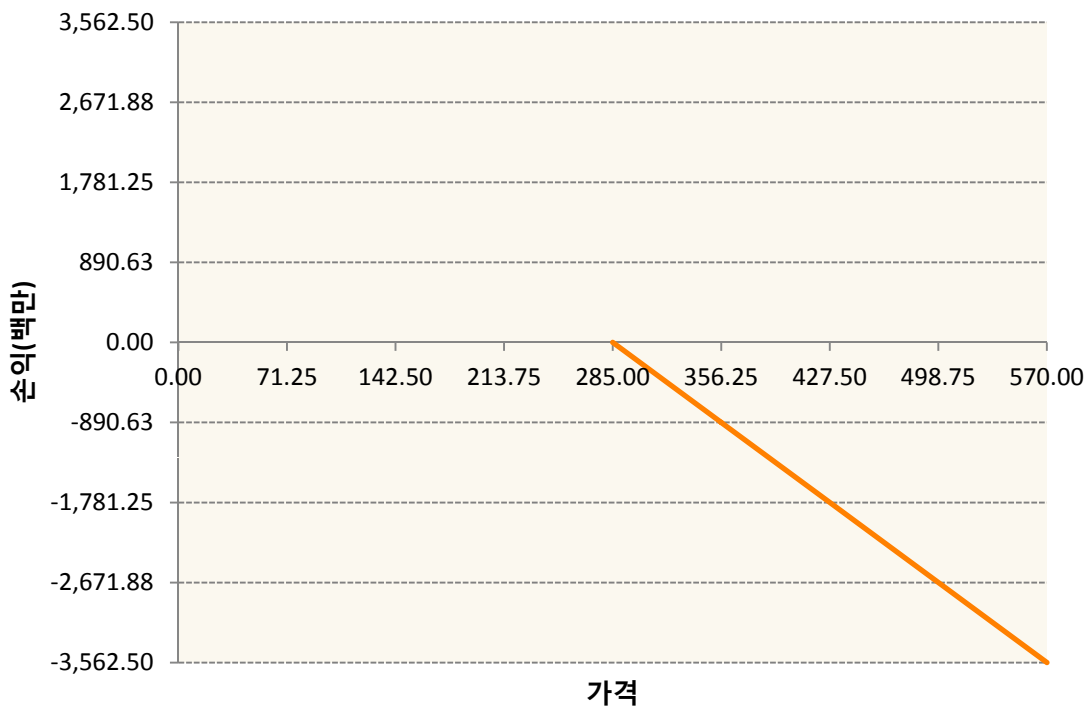


KR4201P12821-2019-01 콜282.5

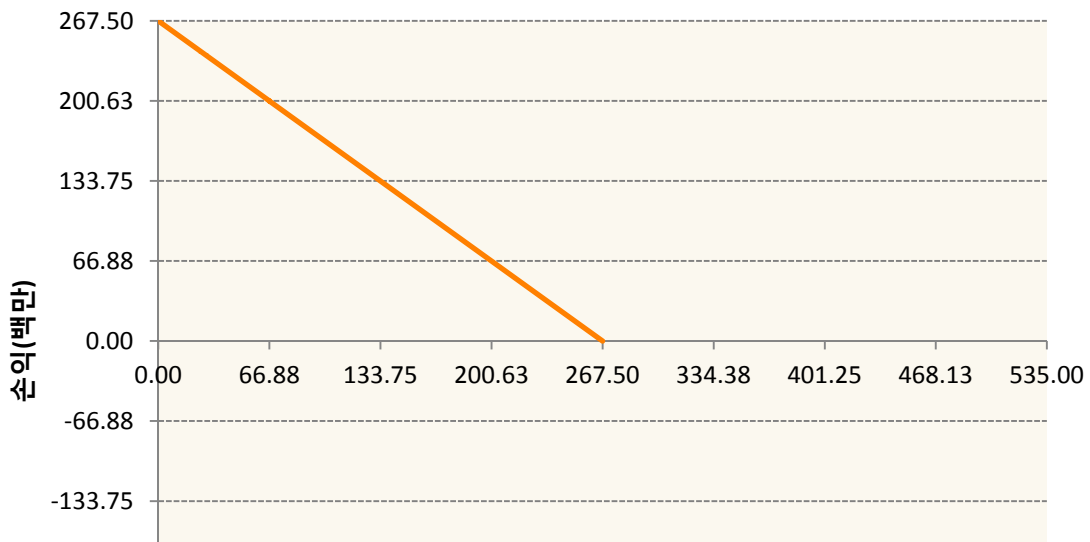


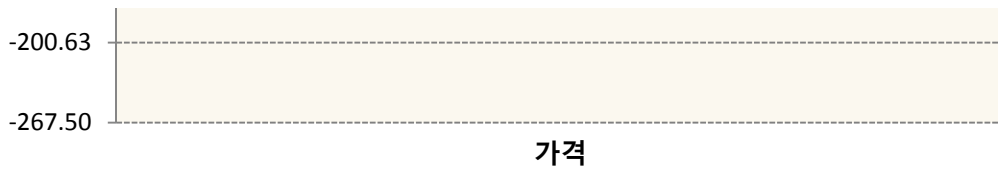


KR4201P12854-2019-01 콜285

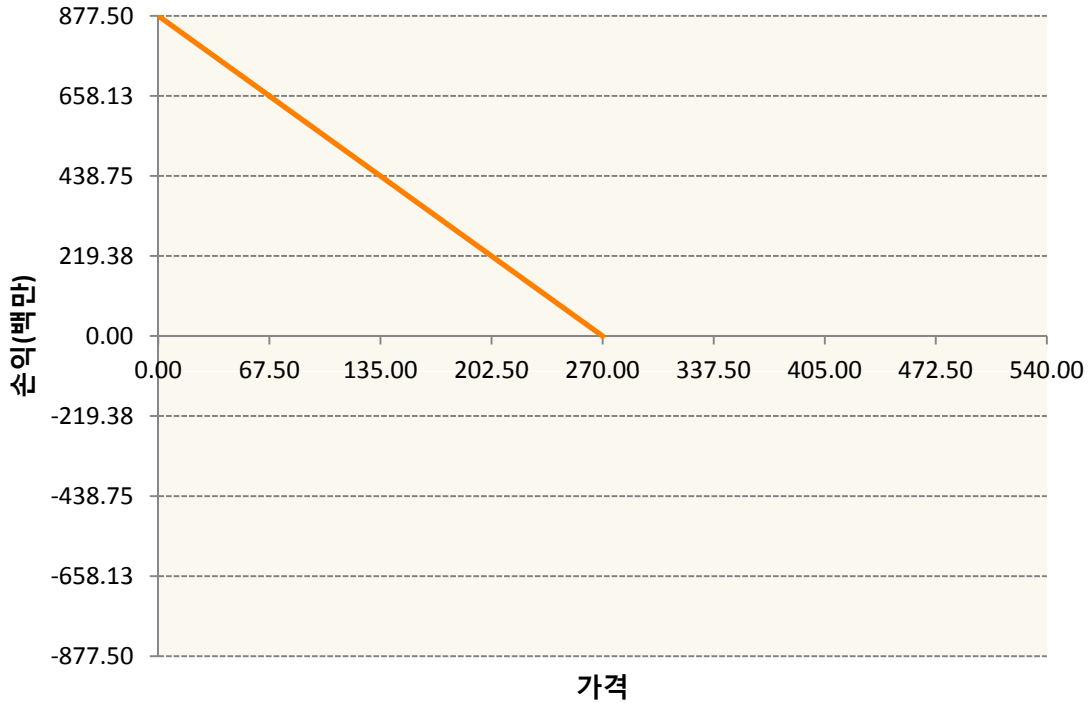


KR4301P12670-2019-01 풋267.5





KR4301P12704-2019-01 풋270



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101P30007		2019-03 코스피200지수선물						971
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-971	-971	-971	-971	-971	-971	-971	
-5.33%	-647	-647	-647	-647	-647	-647	-647	
-2.67%	-324	-324	-324	-324	-324	-324	-324	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	324	324	324	324	324	324	324	
5.33%	647	647	647	647	647	647	647	
8.00%	971	971	971	971	971	971	971	
KR4201P12821		2019-01 콜282.5						286
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	4	4	4	4	4	4	4	
-5.33%	4	4	4	4	4	4	3	
-2.67%	4	4	4	3	3	2	0	

0%	4	3	2	0	-3	-7	-12
2.67%	0	-4	-10	-17	-25	-35	-47
5.33%	-28	-41	-56	-73	-91	-110	-130
8.00%	-132	-157	-183	-208	-234	-260	-286
KR4201P12854 2019-01 콜285							40
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	0	0	0	0	0	0	0
-5.33%	0	0	0	0	0	0	0
-2.67%	0	0	0	0	0	0	0
0%	0	0	0	0	0	-1	-1
2.67%	0	0	-1	-2	-3	-4	-6
5.33%	-3	-4	-6	-9	-11	-14	-17
8.00%	-15	-19	-23	-27	-31	-35	-40
KR4301P12670 2019-01 풋267.5							20
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	20	20	20	20	20	20	20
-5.33%	13	13	13	13	13	13	13
-2.67%	6	6	6	6	6	7	7
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-6	-6	-5	-5	-5	-5	-4
5.33%	-9	-9	-8	-8	-8	-8	-7
8.00%	-10	-10	-10	-9	-9	-9	-9
KR4301P12704 2019-01 풋270							66
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	66	66	66	66	66	66	66
-5.33%	44	44	44	44	44	44	44
-2.67%	21	21	21	22	22	22	22
0%	-1	-1	0	0	0	1	1
2.67%	-21	-20	-19	-19	-18	-17	-16
5.33%	-34	-33	-32	-31	-30	-29	-28
8.00%	-38	-38	-38	-37	-36	-36	-35

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

(단위:백만원)

1,020

공시일	2019-01-03
기준일	2019-01-02

H2O글로벌본드(USD)(채권혼합-파

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	0	25	-25	
누계	유가증권	수익증권	171	0	171	

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	2019-01-03
기준일	2019-01-02

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	2,028	0	2,028	

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	2019-01-03
기준일	2019-01-02

H2O글로벌본드(H)(채권혼합-파생)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	392	0	392	
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	수익증권	2,040	0	2,040	
누계	통화	선도	0	2,194	-2,194	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
FX21019F00 KRW/USD 19-02-19E	15

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

(단위:백만원)

66

공시일	2019-01-03
기준일	2019-01-02

스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

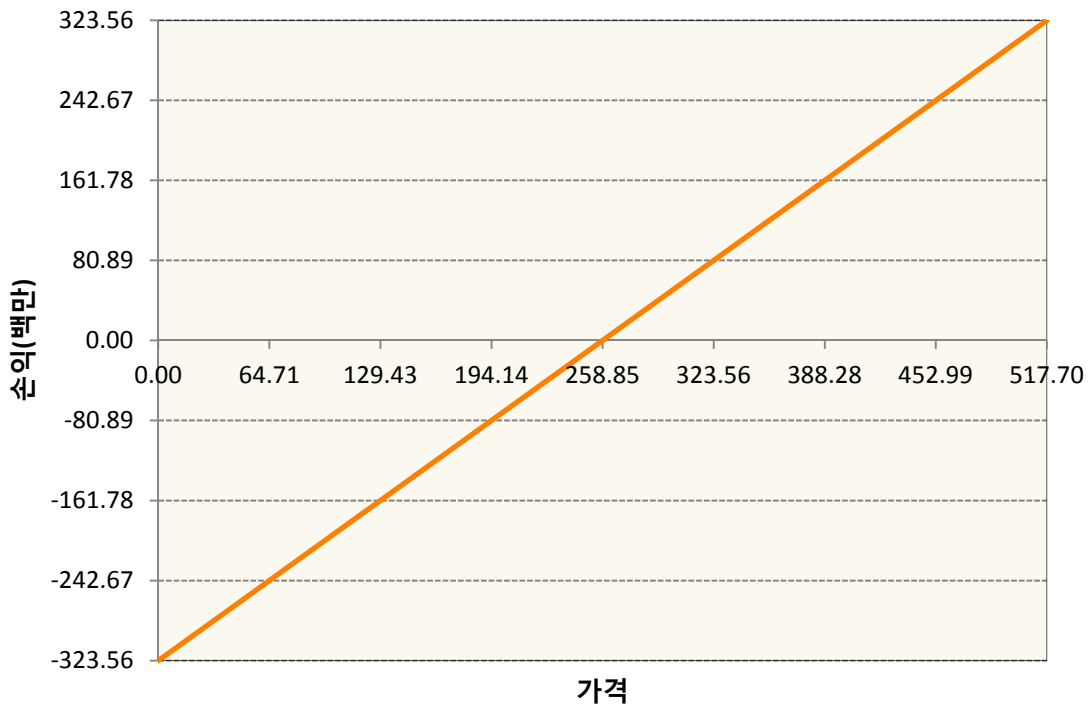
1. 계약금액

(단위:백만원)

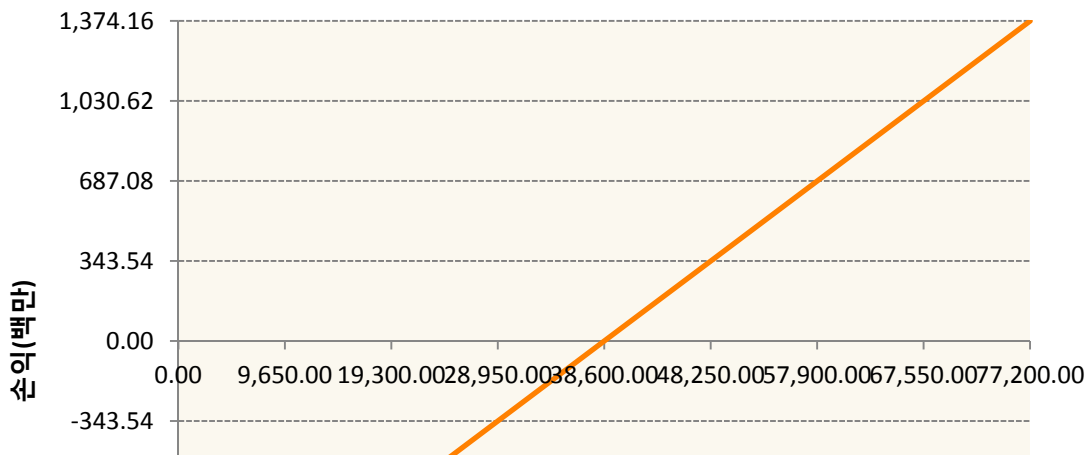
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,698	0	1,698	장내

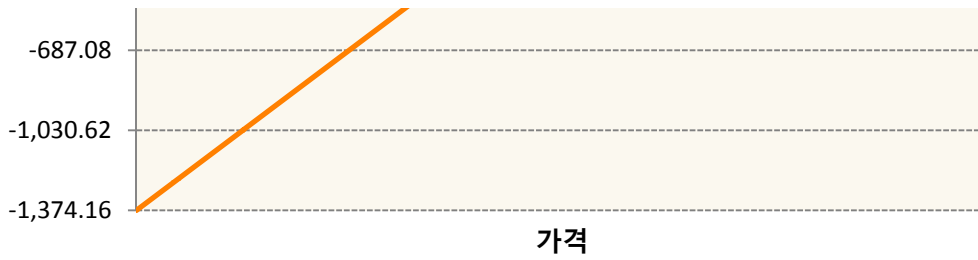
2. 만기시점의 손익구조

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%	-74	-74	-74	-74	-74	-74	-74	
-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%	74	74	74	74	74	74	74	
8.00%	110	110	110	110	110	110	110	

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

147

공시일	2019-01-03
기준일	2019-01-02

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

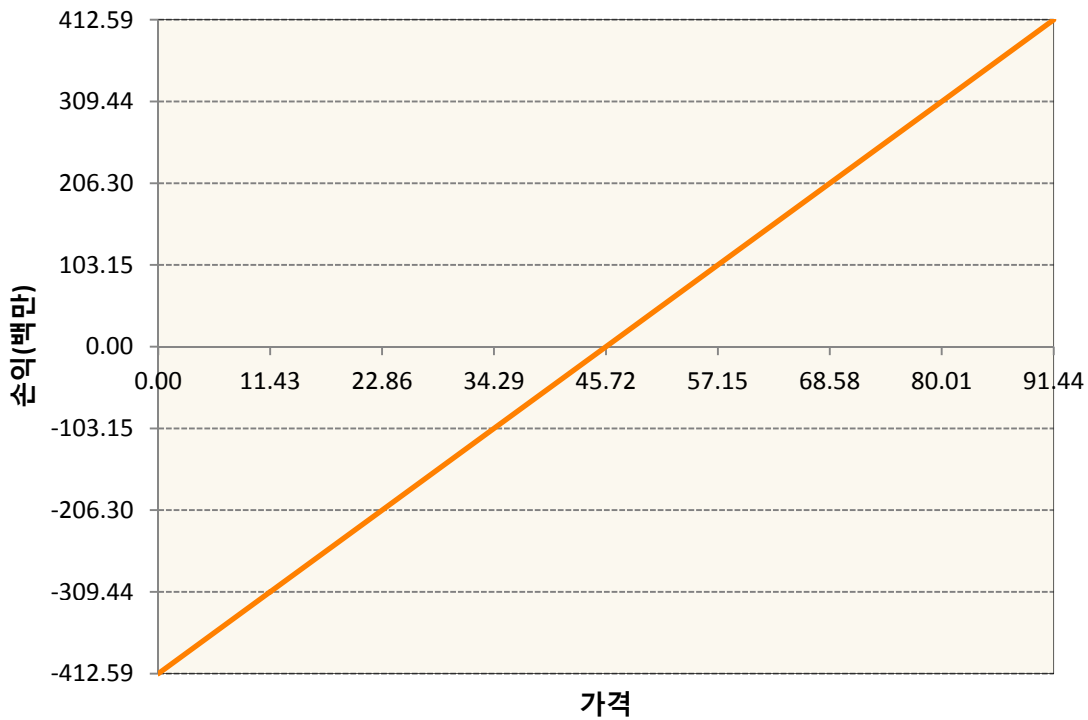
1. 계약금액

(단위:백만원)

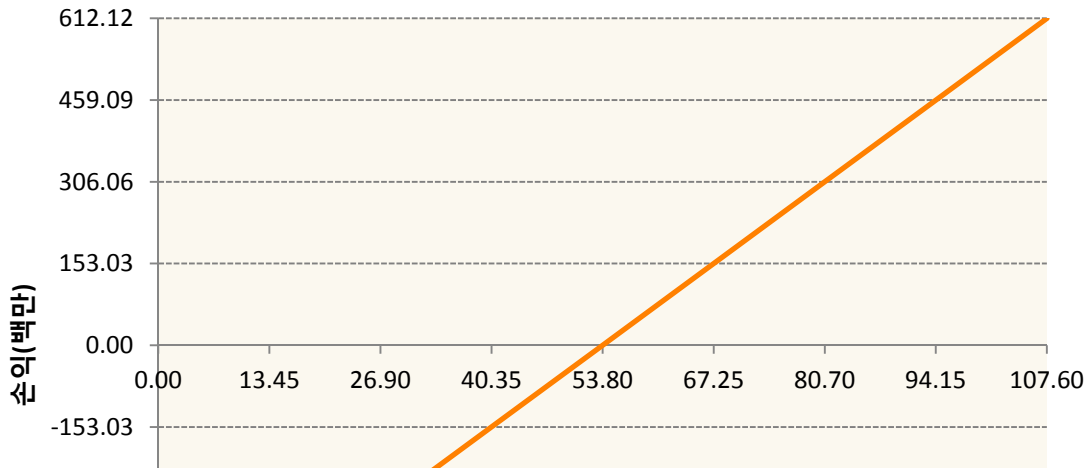
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,429	201	2,228	

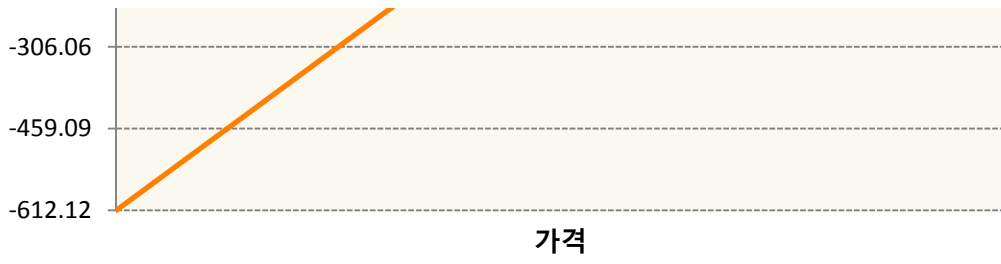
2. 만기시점의 손익구조

CLH9-WTI CRUDE FUTURE MAR19

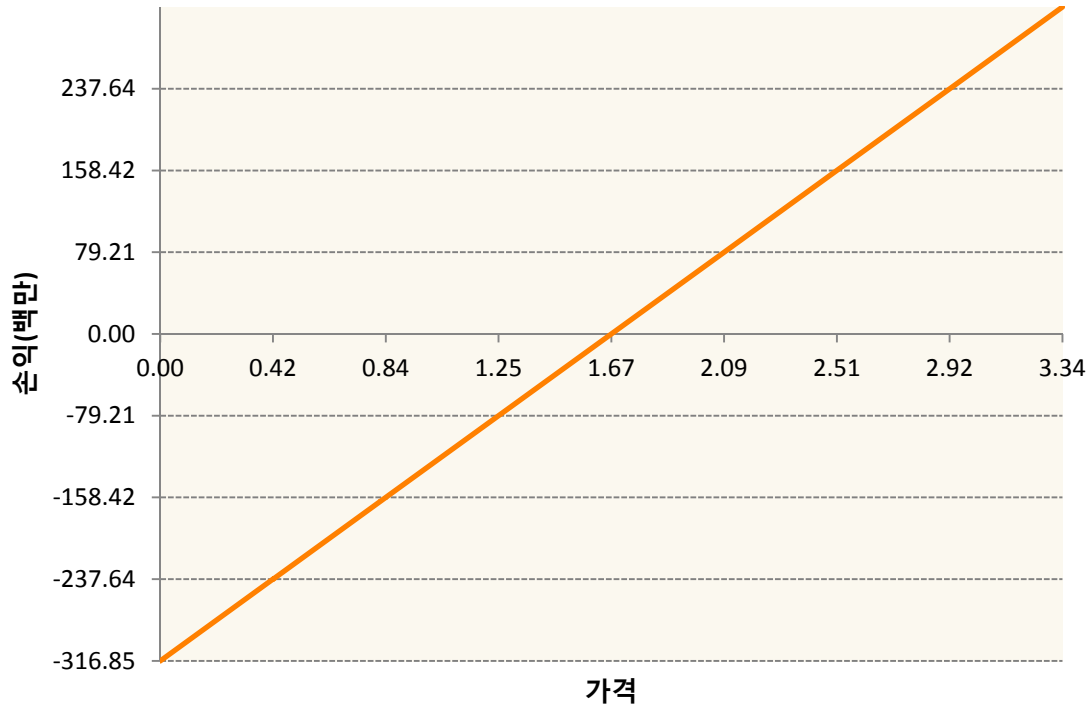


COH9-BRENT CRUDE FUTR Mar19

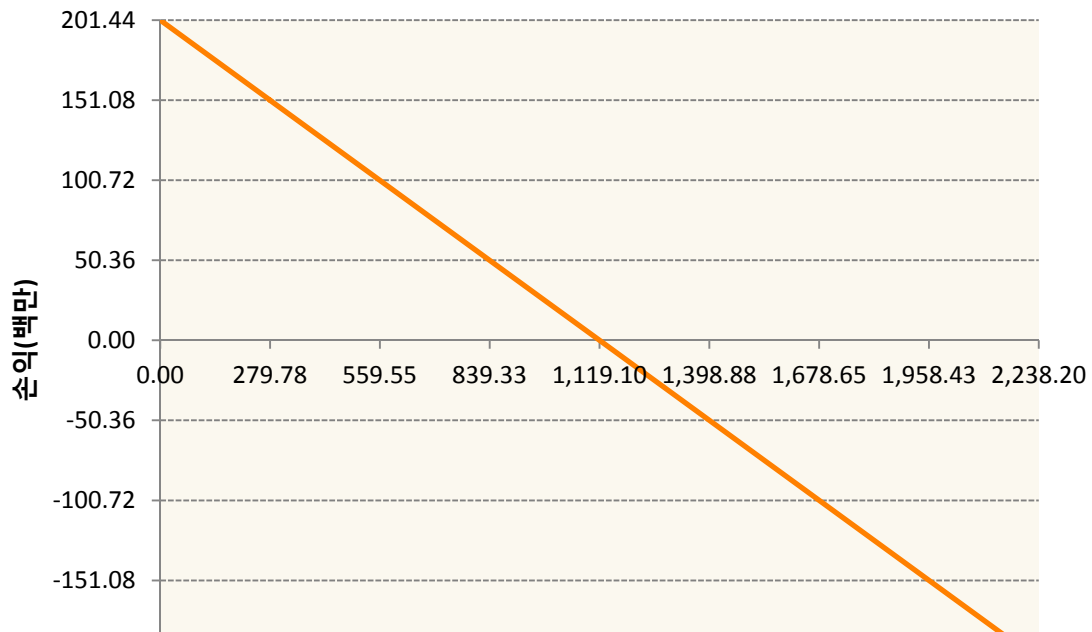


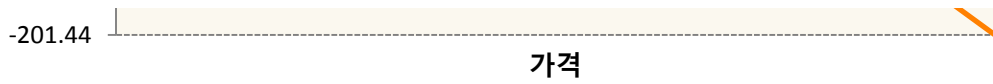


HOH9-NY Harb ULSD Fut Mar19

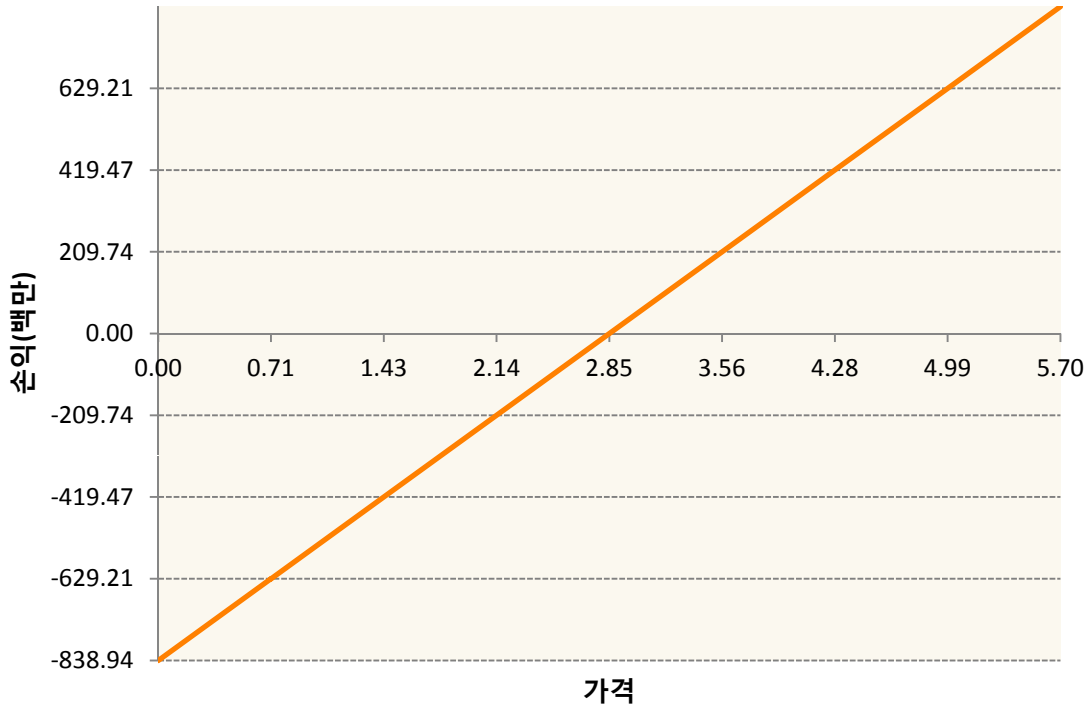


KR4175P10003-2019-01 달러선물

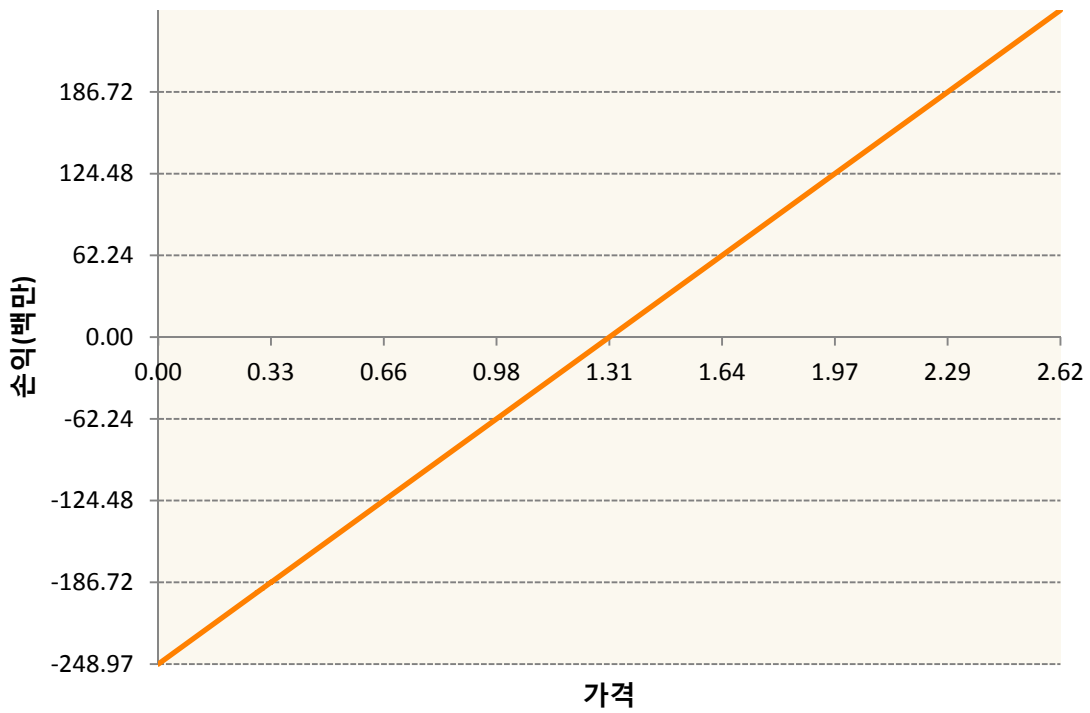




NGH19-NATURAL GAS FUTR Mar19



XBH9-GASOLINE RBOB FUT Mar19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLH9	WTI CRUDE FUTURE MAR19	33
COH9	BRENT CRUDE FUTR Mar19	49
HOH9	NY Harb ULSD Fut Mar19	25
KR4175P100	2019-01 달러선물	16
NGH19	NATURAL GAS FUTR Mar19	67
XBH9	GASOLINE RBOB FUT Mar19	20

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

370

공시일	2019-01-03
기준일	2019-01-02

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

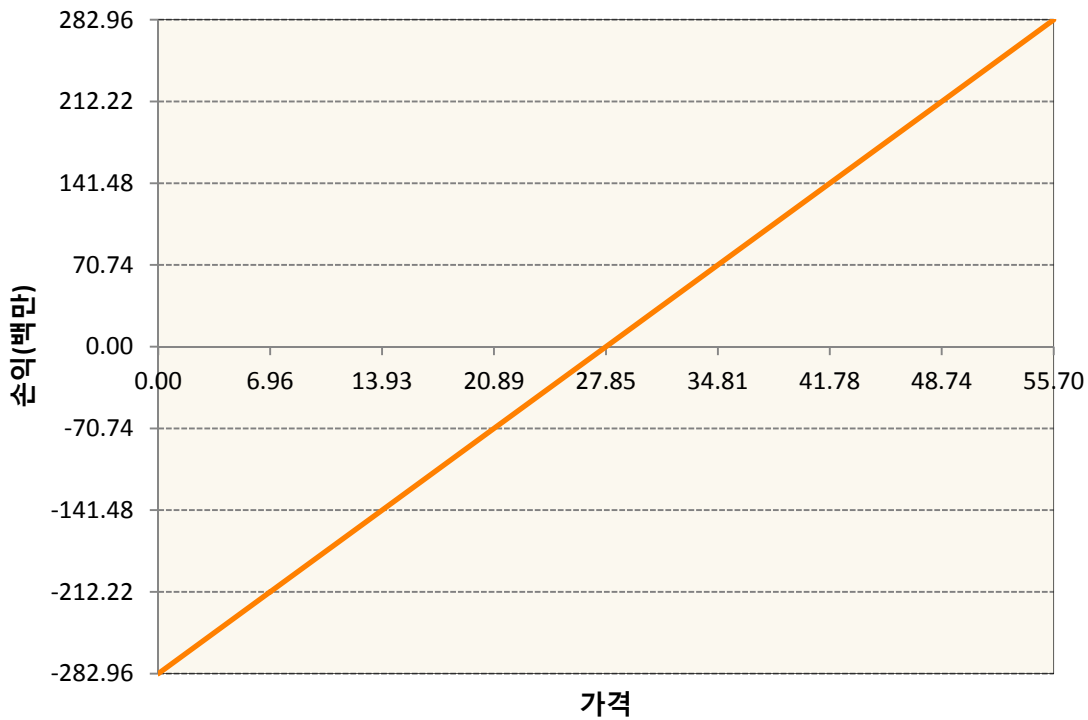
1. 계약금액

(단위:백만원)

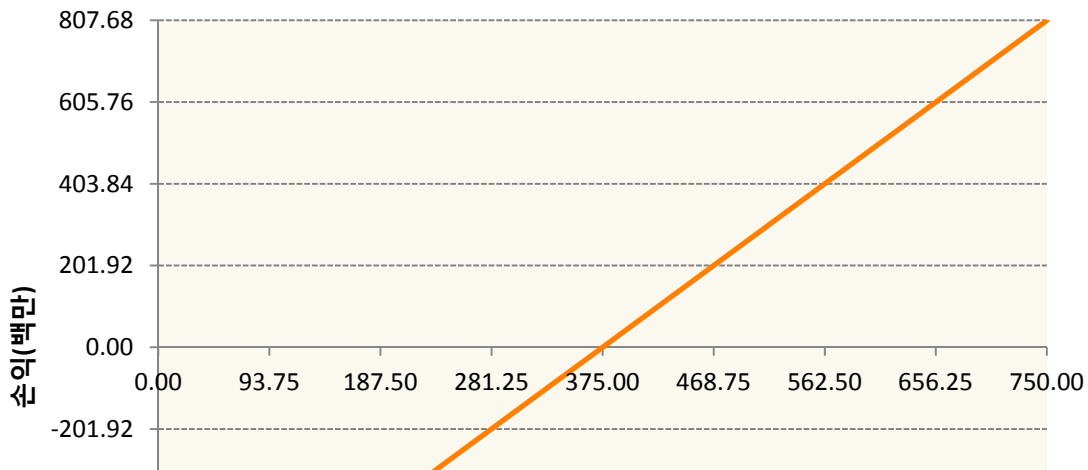
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,520	78	3,442	

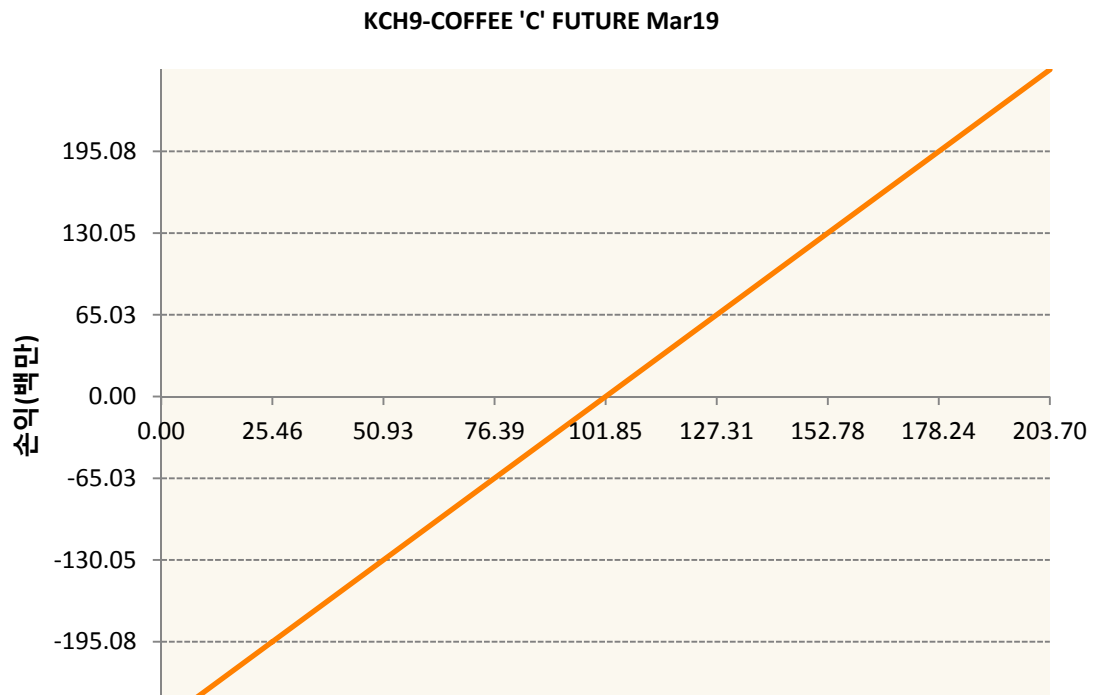
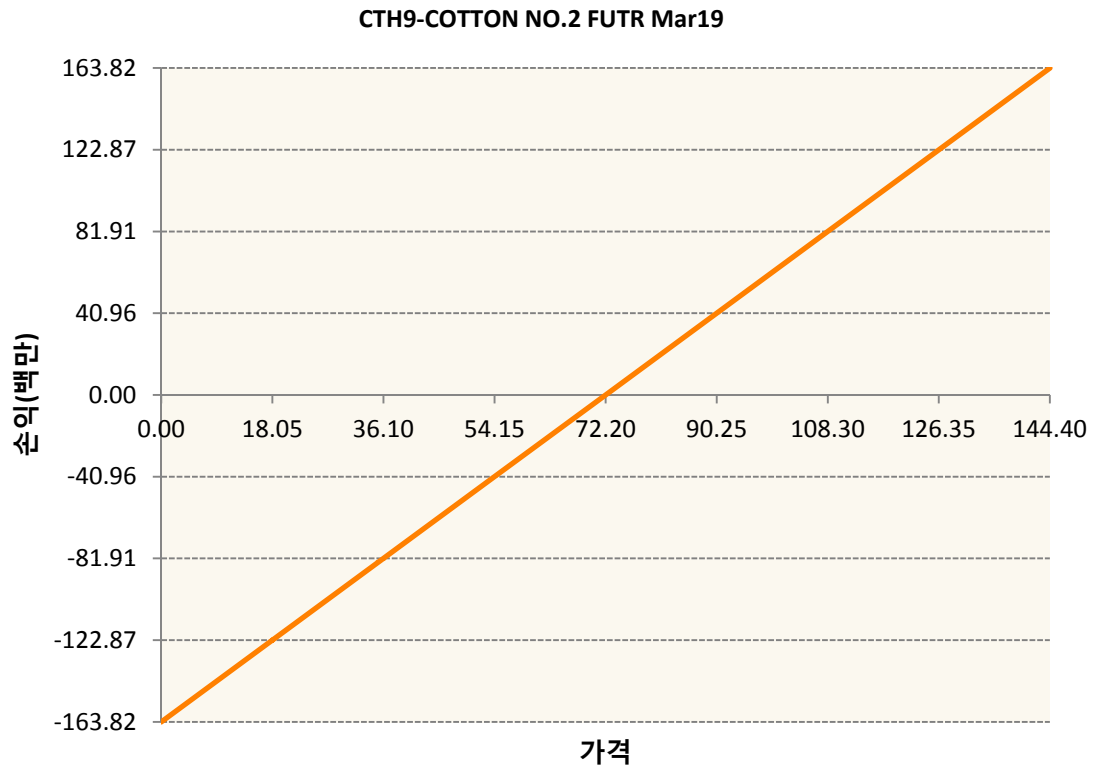
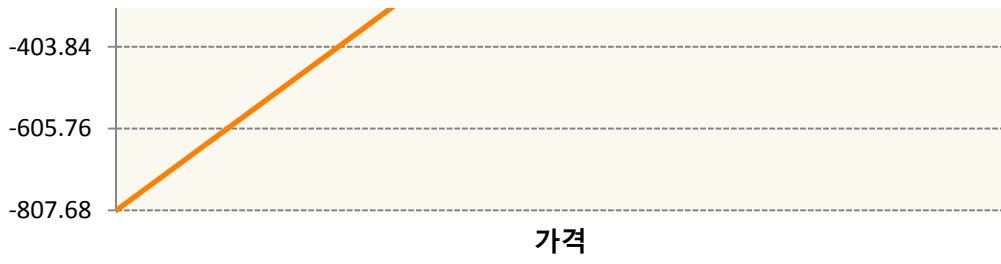
2. 만기시점의 손익구조

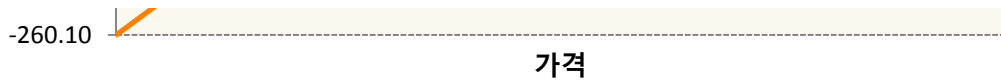
BOH9-SOYBEAN OIL FUTR Mar19



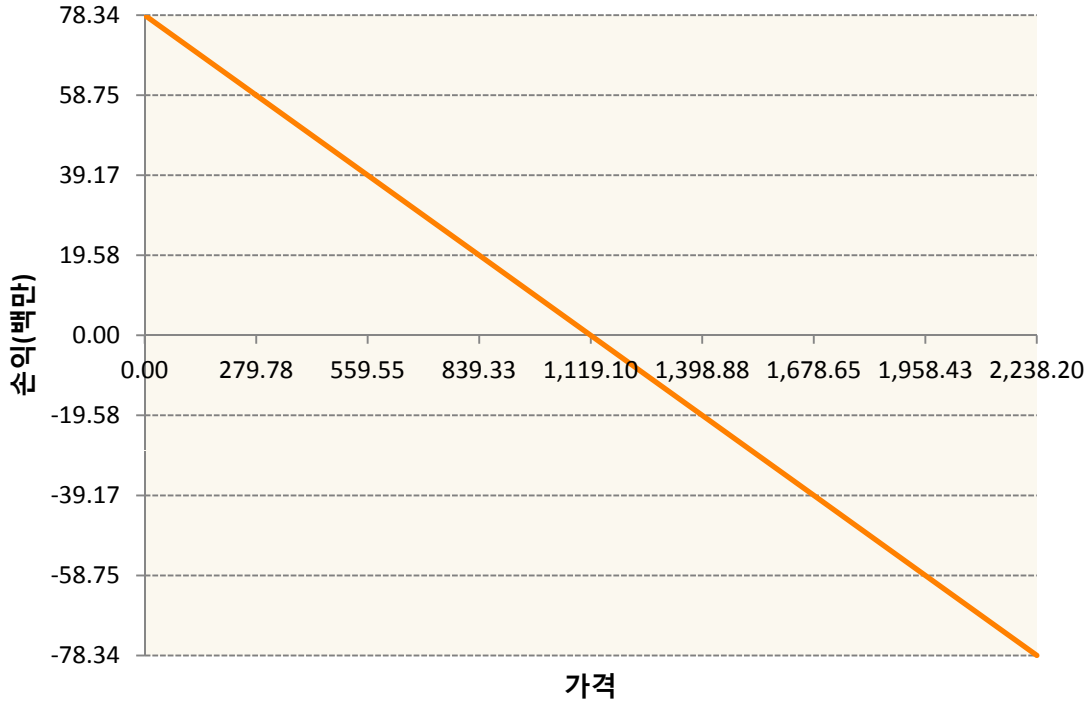
CH9-CORN FUTURE Mar19



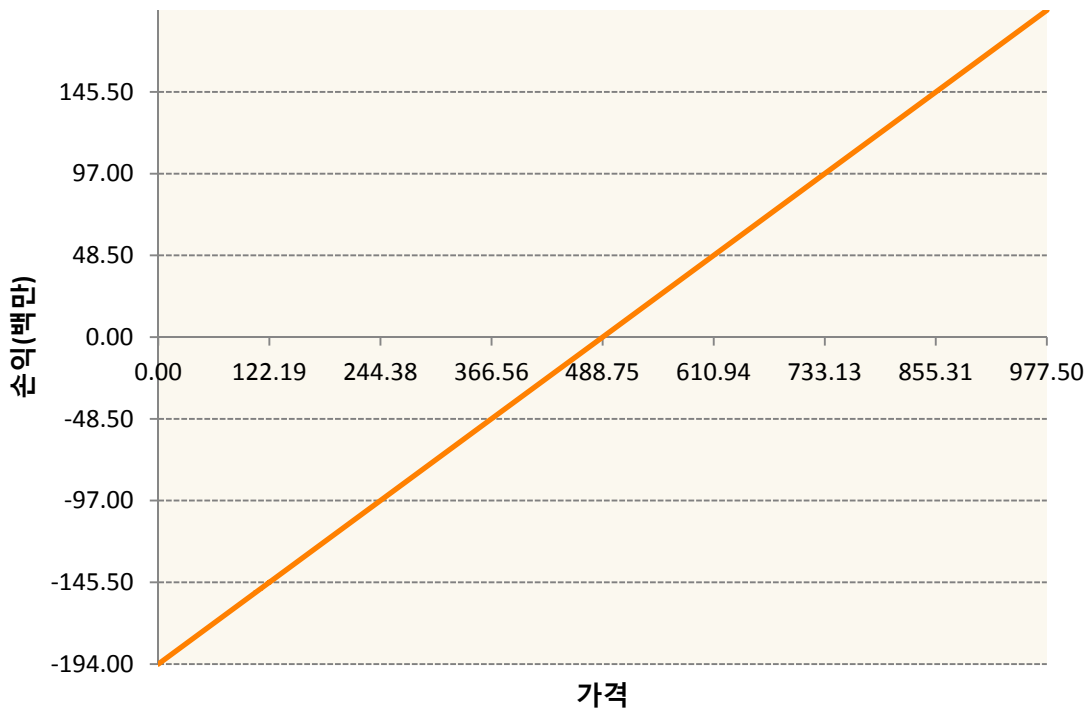




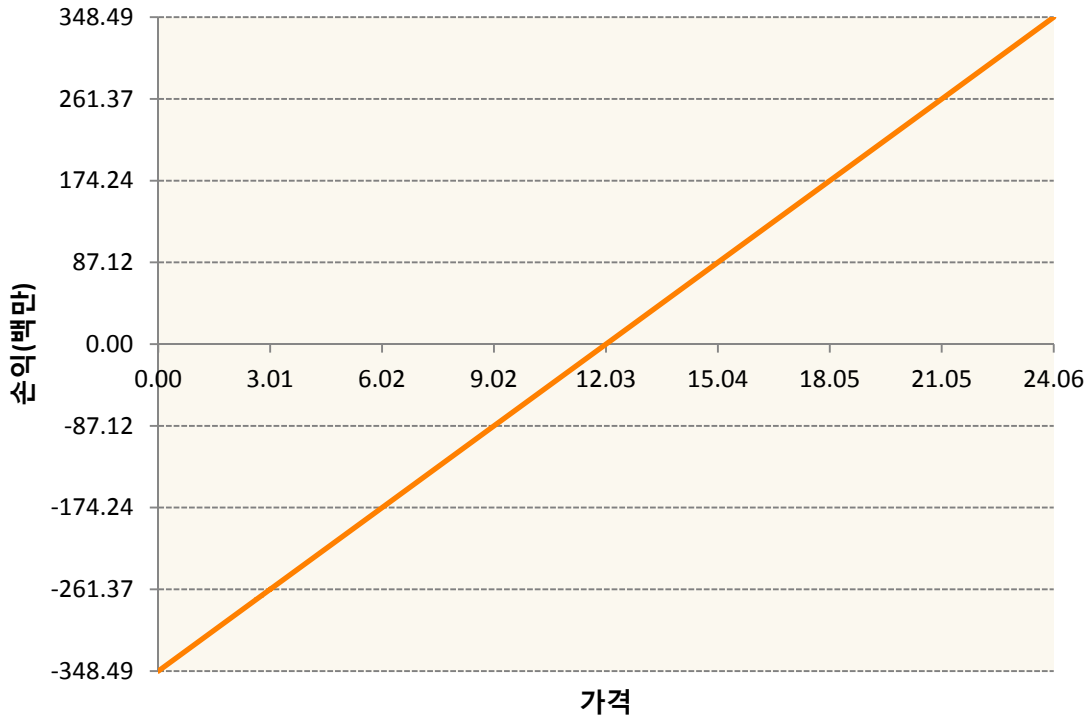
KR4175P10003-2019-01 달러선물



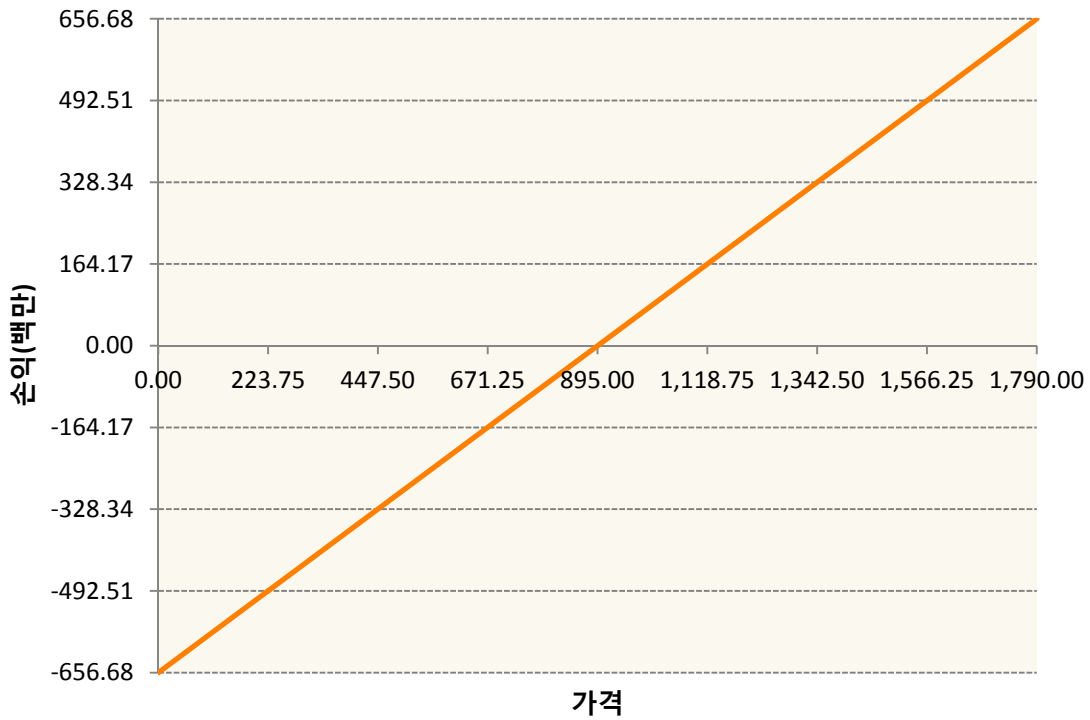
KWH9-KC HRW WHEAT FUT Mar19



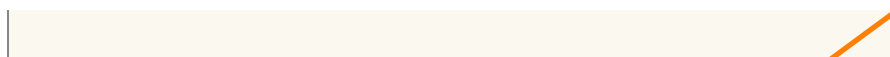
SBH9-SUGAR #11 (WORLD) MAR19

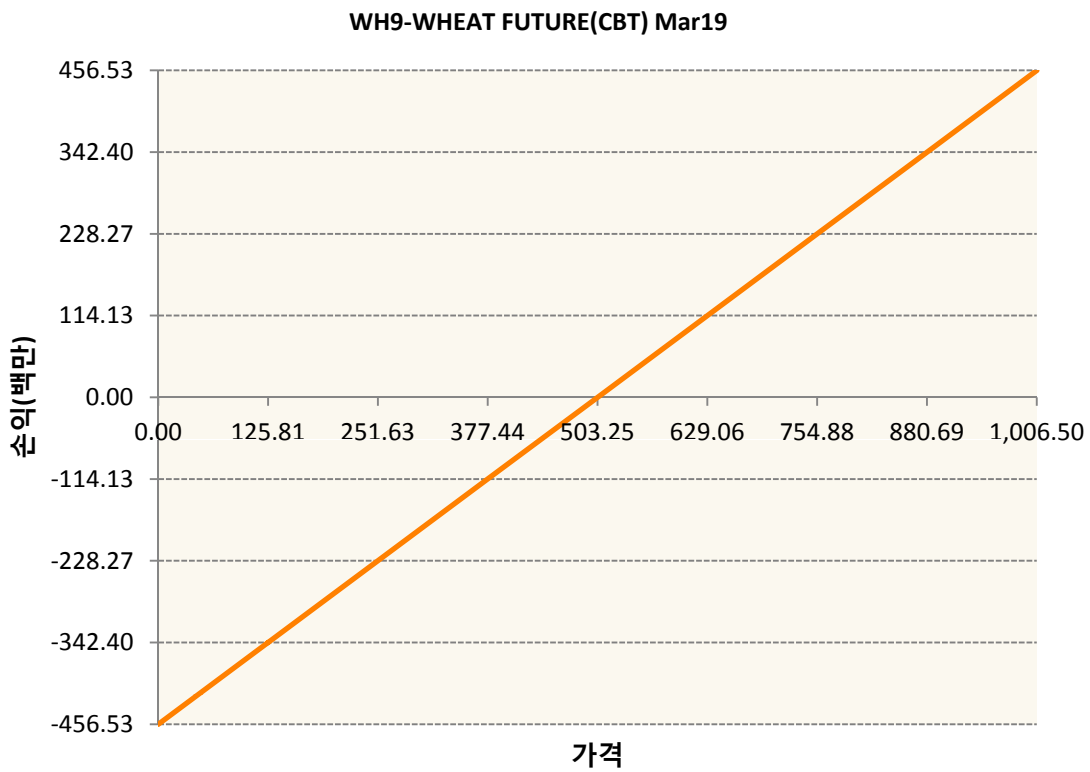
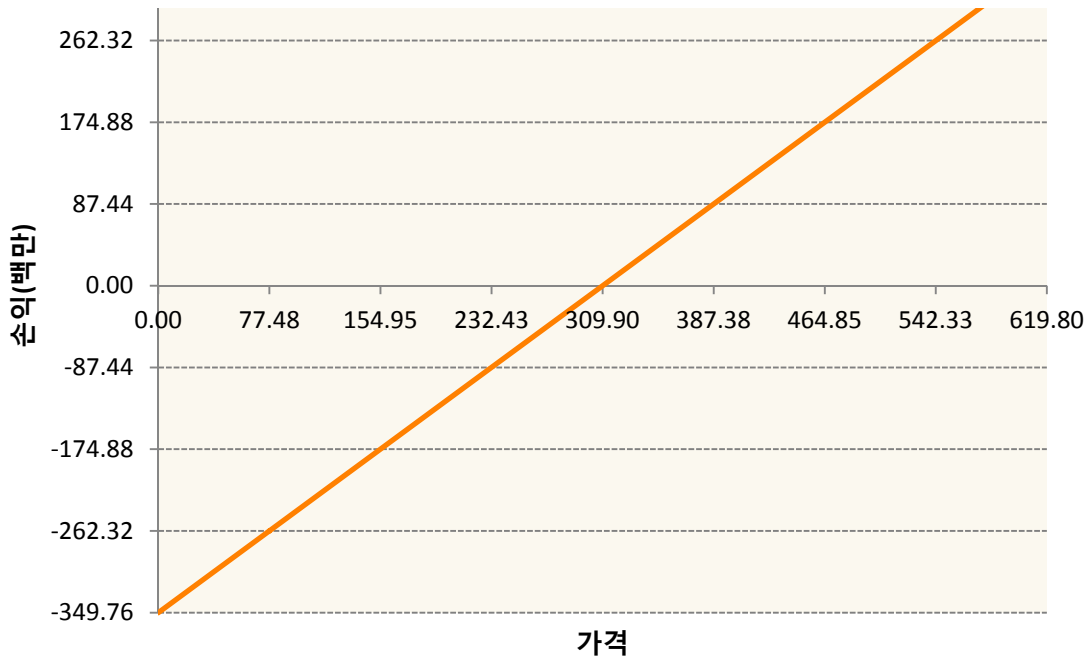


SH9-SOYBEAN FUTURE Mar19



SMH9-SOYBEAN MEAL FUTR Mar19





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	28
SH9	SOYBEAN FUTURE Mar19	53
SMH9	SOYBEAN MEAL FUTR Mar19	28
WH9	WHEAT FUTURE(CBT) Mar19	37

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

(단위:백만원)

296