

공시일	2019-01-07
기준일	2019-01-04

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	2019-01-07
기준일	2019-01-04

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

986

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

541

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-01-07
기준일	2019-01-04

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)

SWCSI500000 신한CSI500미래S180910

257

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

379

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-01-07
기준일	2019-01-04

유로인덱스모(주식-파생형)

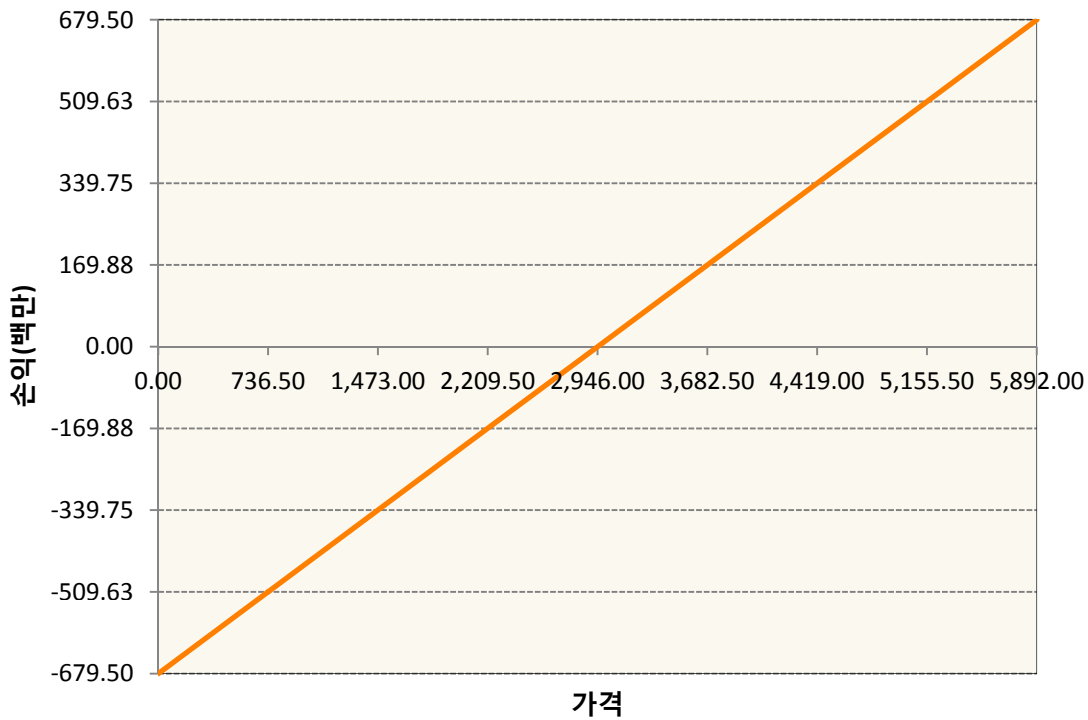
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	680	0	680	

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)

37

공시일	2019-01-07
기준일	2019-01-04

차이나인덱스모(주식-파생형)

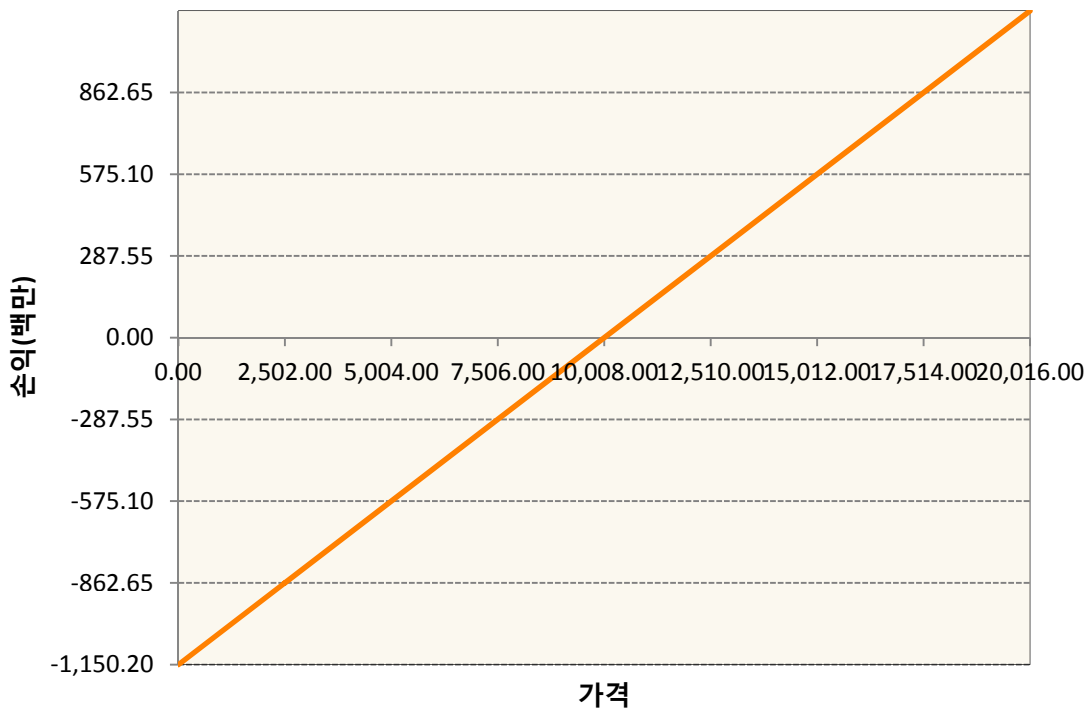
1. 계약금액

(단위:백만원)

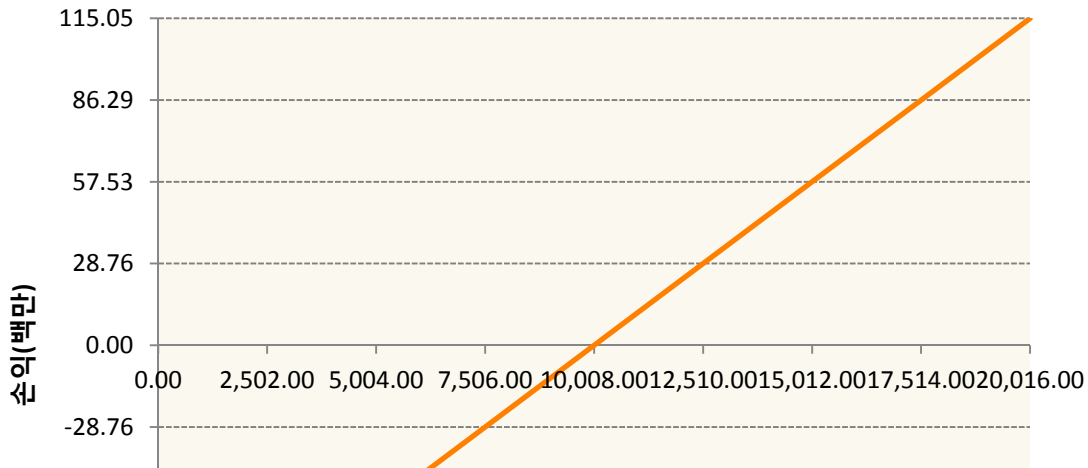
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,265	0	1,265	장내

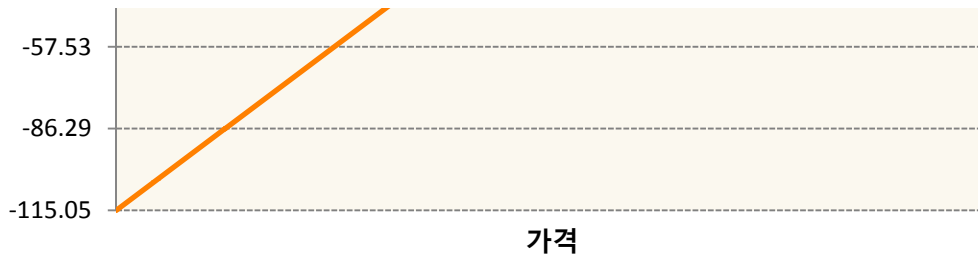
2. 만기시점의 손익구조

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)

103

공시일	2019-01-07
기준일	2019-01-04

커버드콜모(주식혼합-파생형)

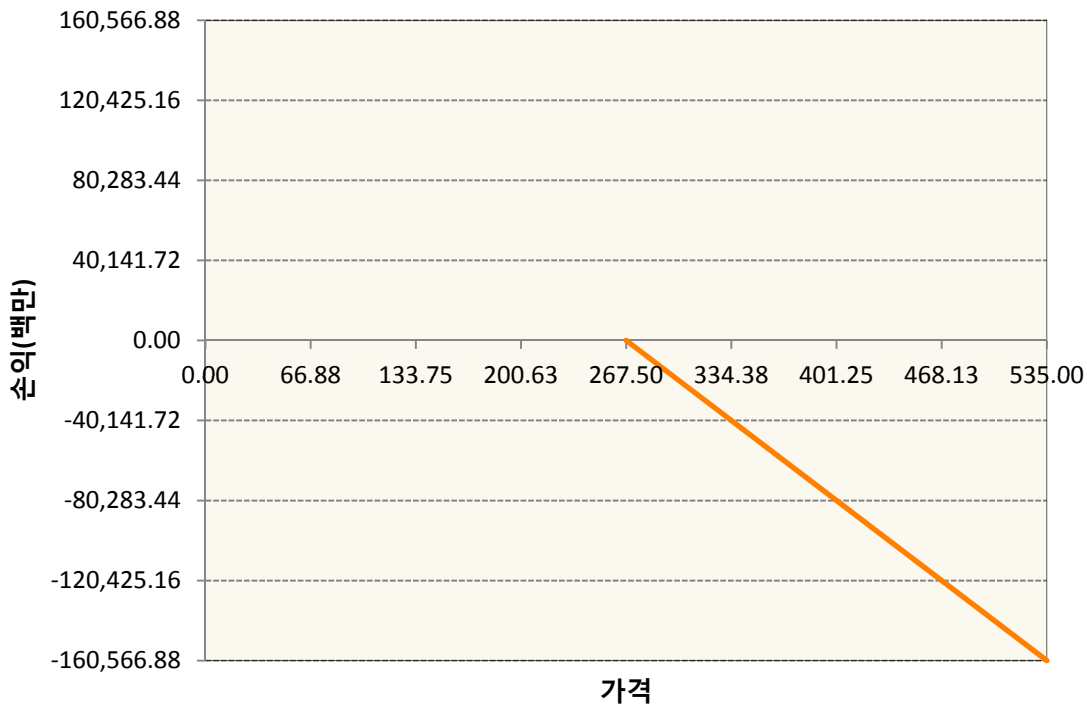
1. 계약금액

(단위:백만원)

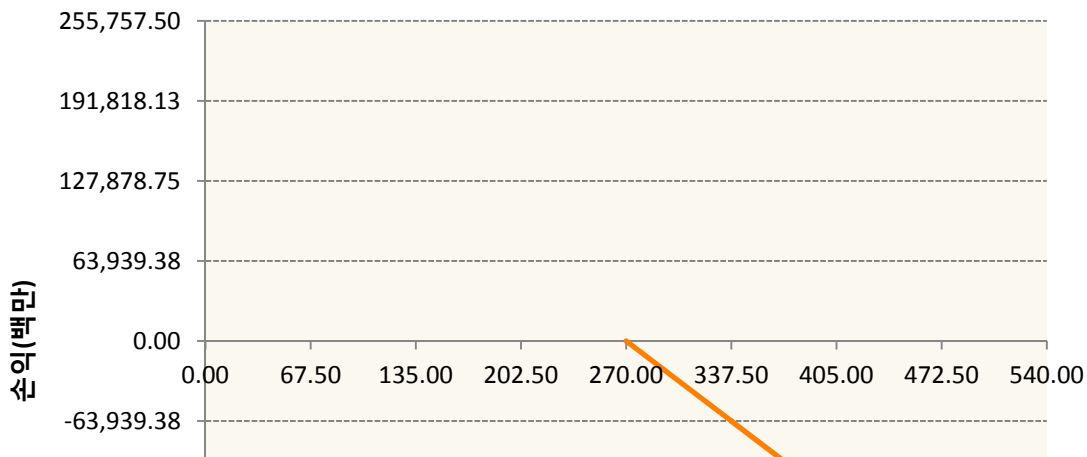
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	730,199	-730,199	장내

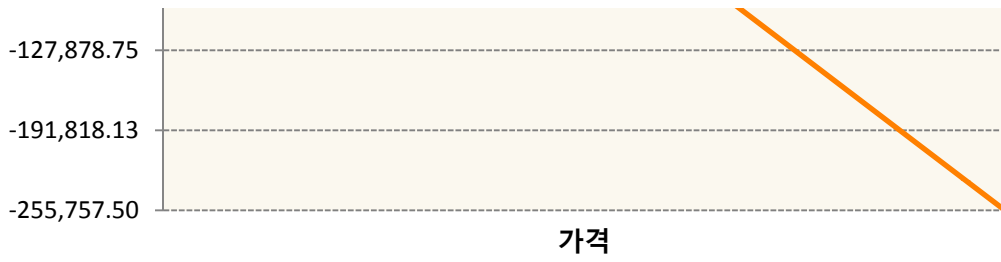
2. 만기시점의 손익구조

KR4201P12672-2019-01 콜267.5

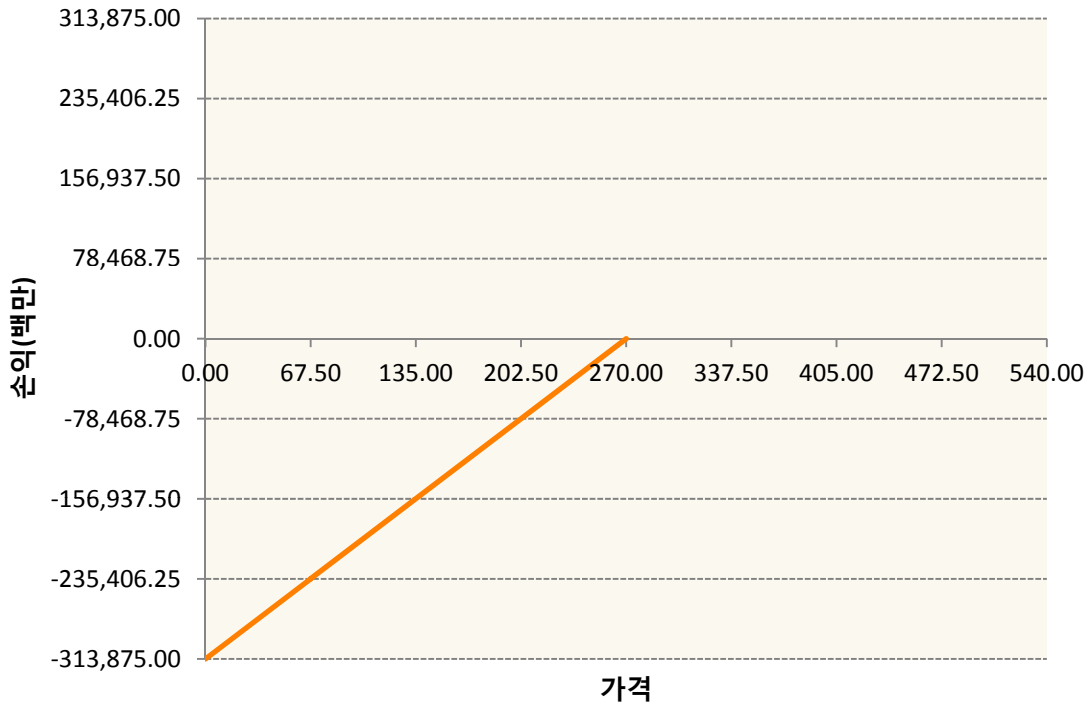


KR4201P12706-2019-01 콜270





KR4301P12704-2019-01 풋270



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201P12672		2019-01 콜267.5					6,881	
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	414	414	414	414	413	411	408	
-5.33%	414	413	411	407	400	388	371	
-2.67%	404	392	371	342	304	256	198	
0%	264	188	100	0	-110	-227	-352	
2.67%	-556	-729	-903	-1,079	-1,257	-1,435	-1,615	
5.33%	-2,799	-2,959	-3,124	-3,292	-3,463	-3,636	-3,811	
8.00%	-6,314	-6,379	-6,457	-6,548	-6,650	-6,761	-6,881	
KR4201P12706		2019-01 콜270					9,267	
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	381	381	381	380	380	379	376	

-5.33%	381	380	379	376	370	360	344
-2.67%	376	367	351	324	287	236	173
0%	277	205	112	0	-130	-275	-434
2.67%	-487	-715	-953	-1,199	-1,452	-1,711	-1,974
5.33%	-3,142	-3,432	-3,722	-4,014	-4,307	-4,600	-4,893
8.00%	-8,080	-8,239	-8,417	-8,611	-8,819	-9,038	-9,267
KR4301P12704 2019-01 풋270							23,876
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-23,876	-23,876	-23,876	-23,876	-23,876	-23,876	-23,876
-5.33%	-15,884	-15,884	-15,884	-15,884	-15,884	-15,884	-15,885
-2.67%	-7,891	-7,892	-7,893	-7,895	-7,900	-7,909	-7,923
0%	87	70	41	0	-54	-122	-203
2.67%	7,644	7,485	7,312	7,126	6,931	6,728	6,518
5.33%	12,647	12,397	12,145	11,891	11,636	11,381	11,124
8.00%	14,048	13,971	13,874	13,759	13,629	13,485	13,328

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

(단위:백만원)

37,817

공시일	2019-01-07
기준일	2019-01-04

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

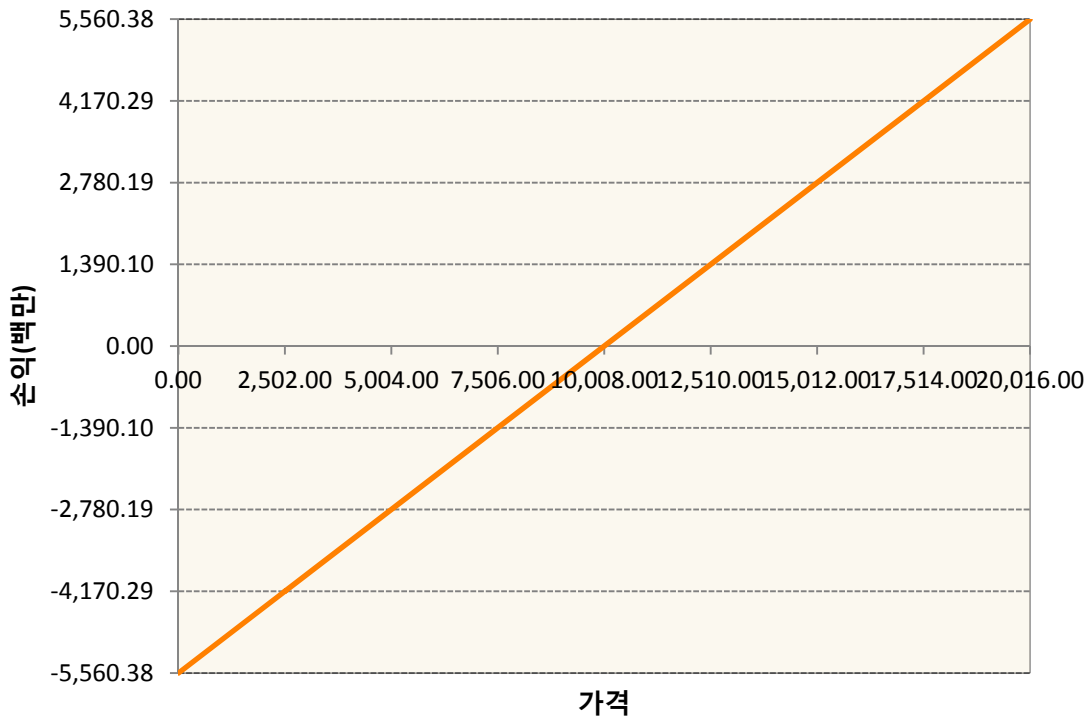
1. 계약금액

(단위:백만원)

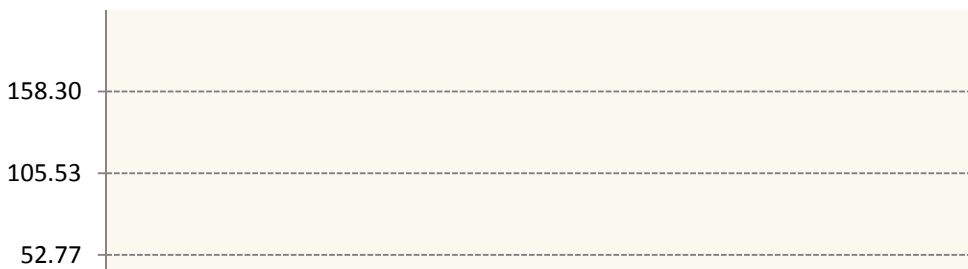
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	5,560	0	5,560	장내
누계	유가증권	옵션	0	12,339	-12,339	장내
누계	통화	선도	0	2,728	-2,728	장외

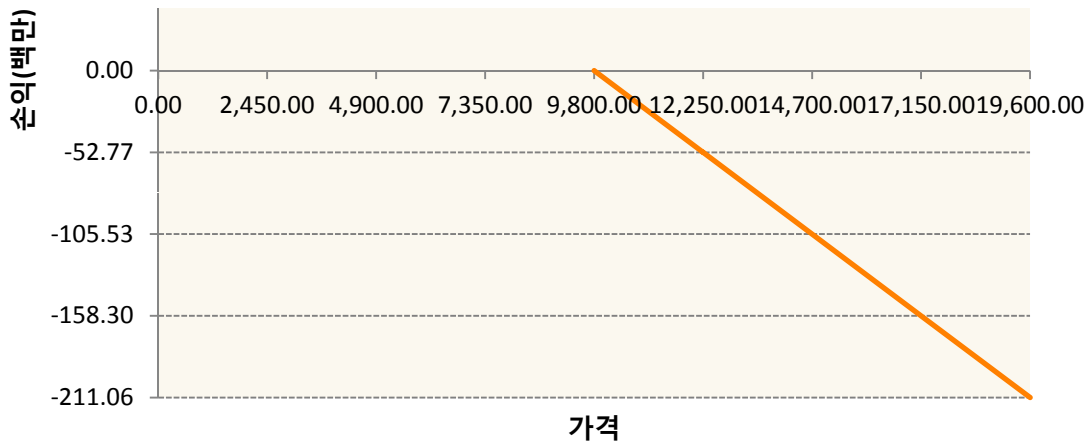
2. 만기시점의 손익구조

HCF9-HSCEI FUTURES JAN19

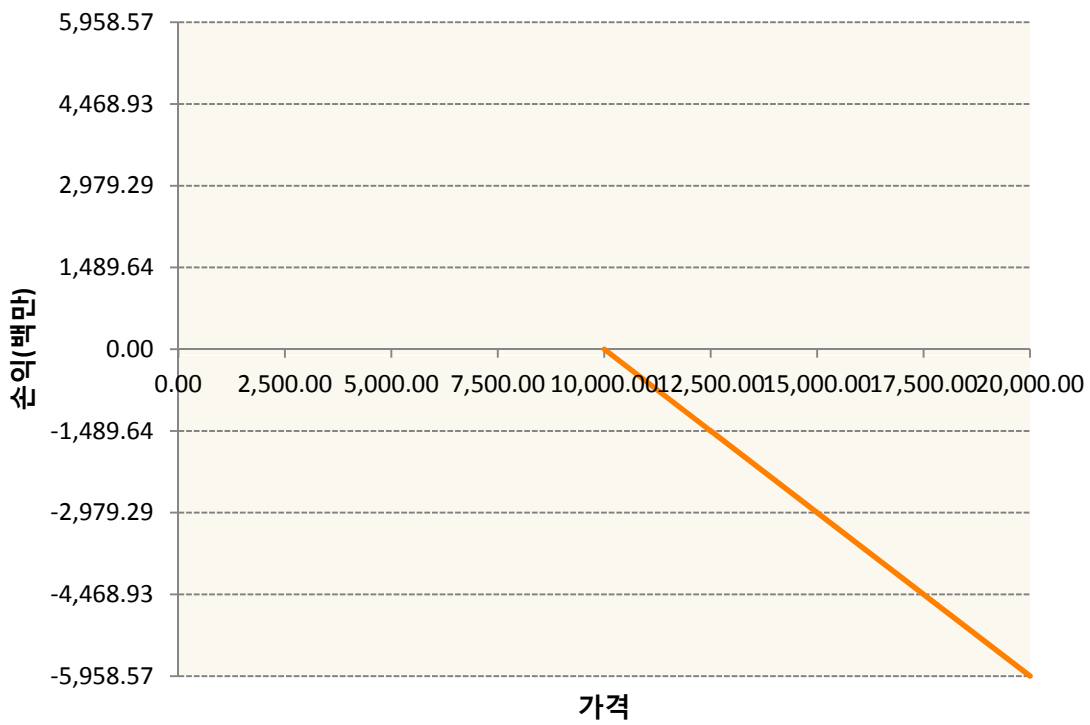


OHHIF9-C098-HSCEI

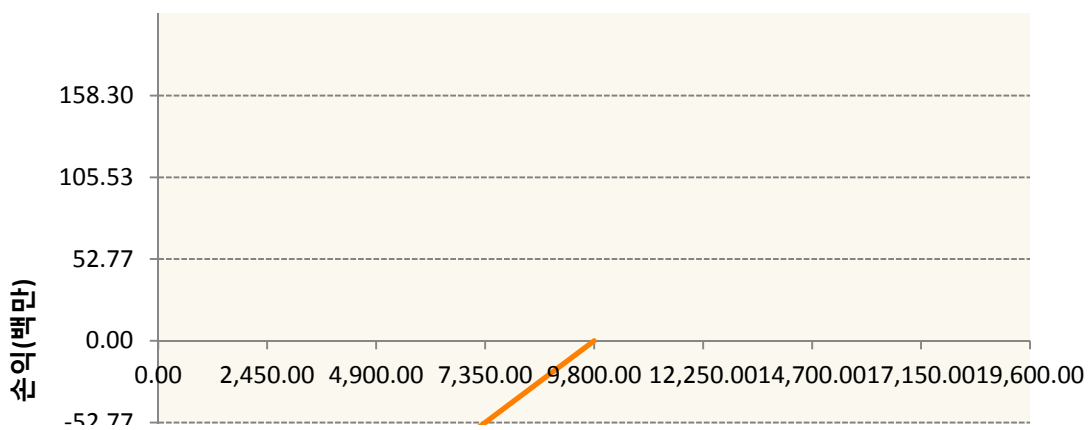


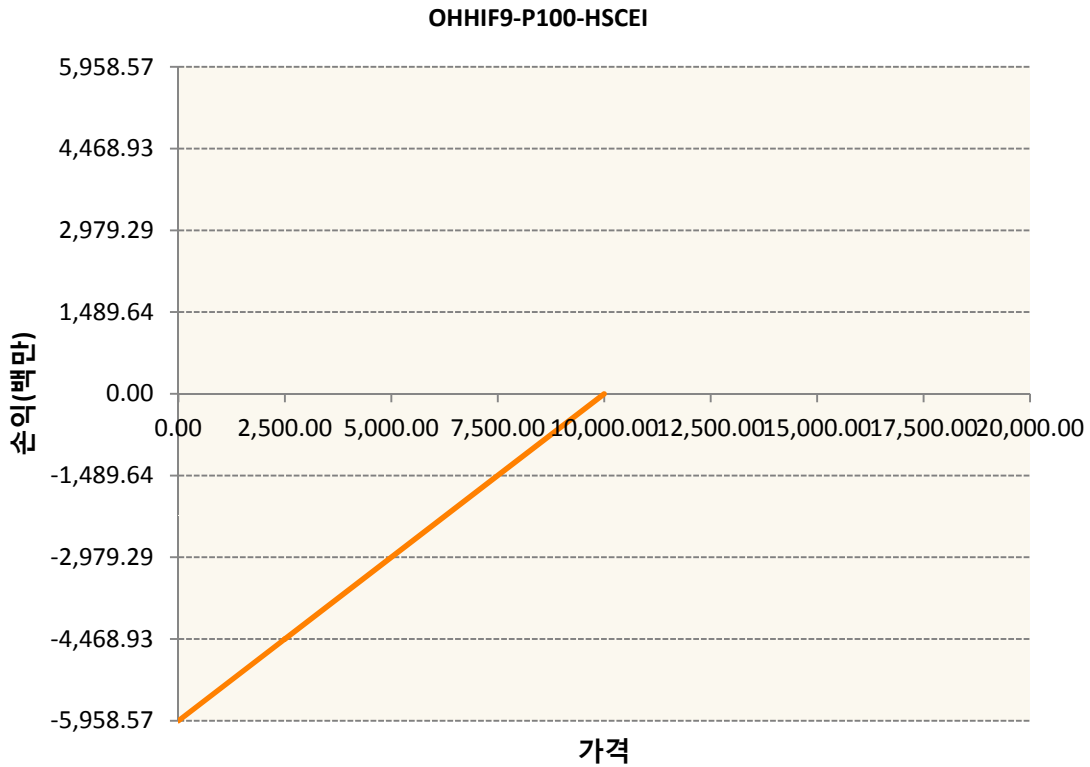
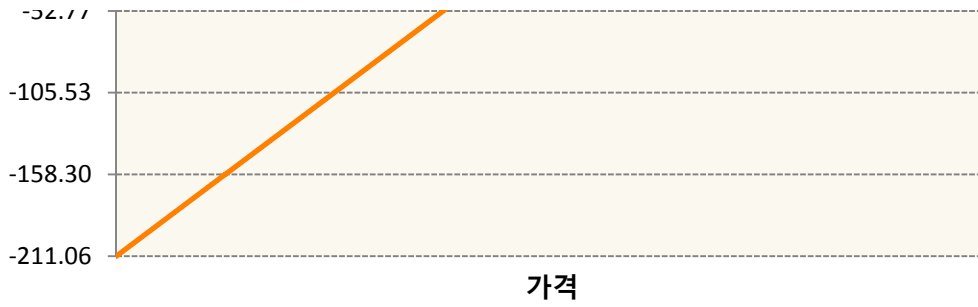


OHHIF9-C100-HSCEI



OHHIF9-P098-HSCEI





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)	(단위:백만원)
FX21018Z00 KRW/HKD 11-03-19E	218
HCF9 HSCEI FUTURES JAN19	445
OHHIF9-C09 HSCEI	17
OHHIF9-C10 HSCEI	477
OHHIF9-P09 HSCEI	17
OHHIF9-P10 HSCEI	477

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,536

공시일	2019-01-07
기준일	2019-01-04

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

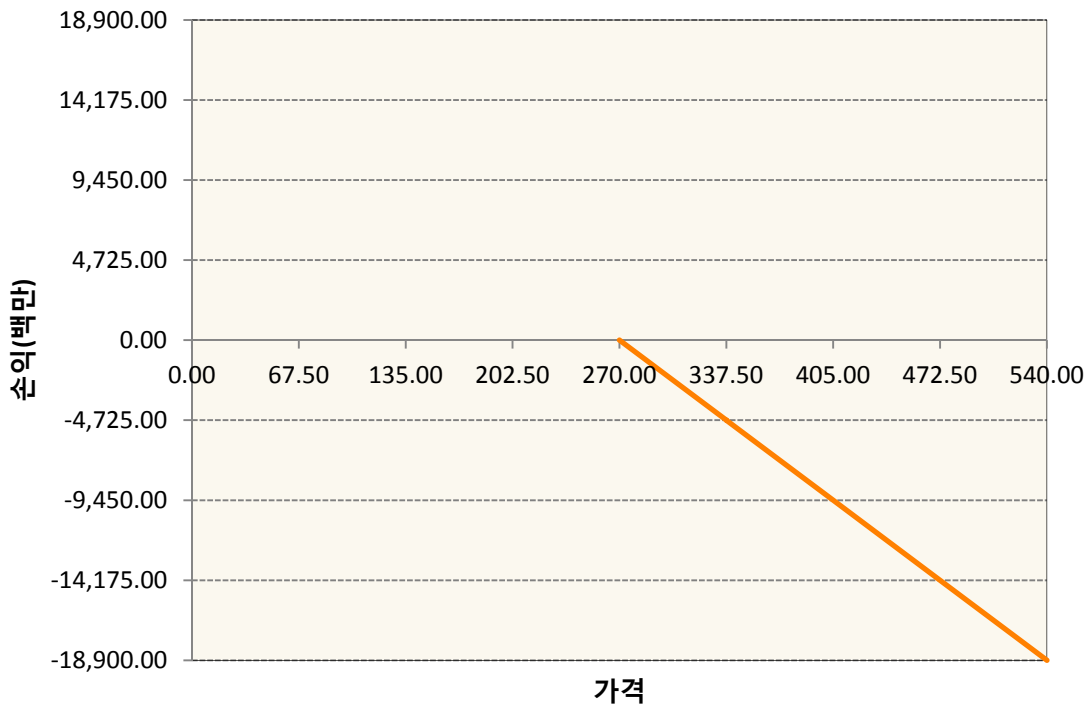
1. 계약금액

(단위:백만원)

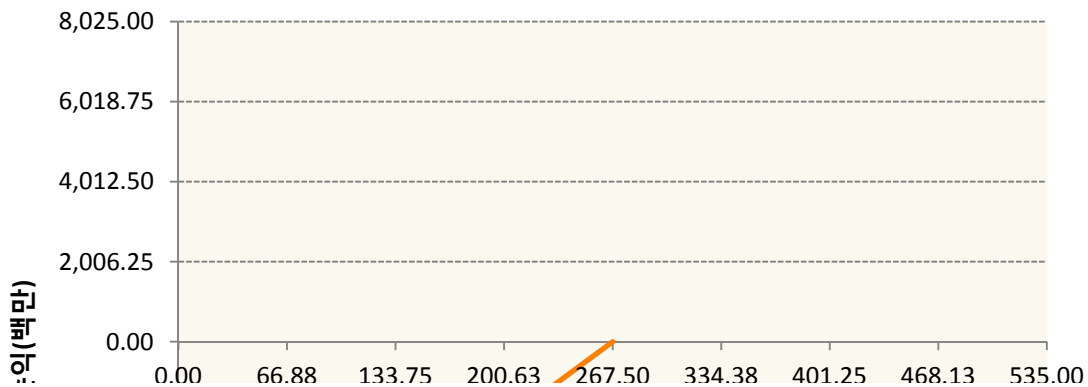
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	스왑	31,836	0	31,836	장외
누계	유가증권	옵션	0	34,350	-34,350	장내

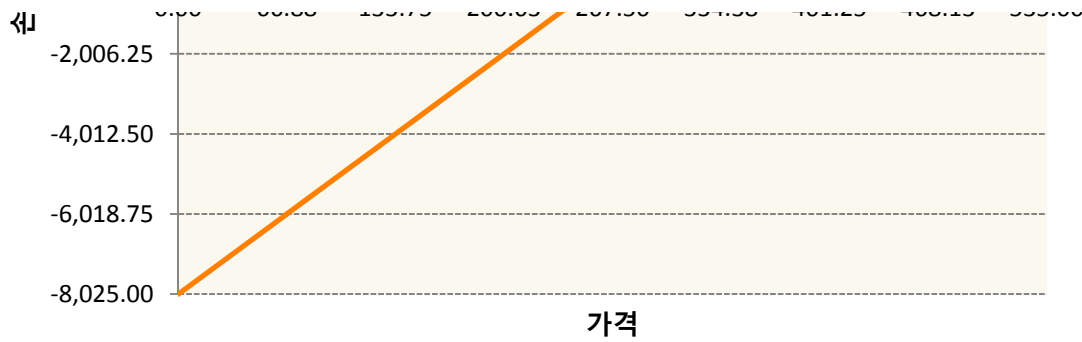
2. 만기시점의 손익구조

KR4201P12706-2019-01 콜270

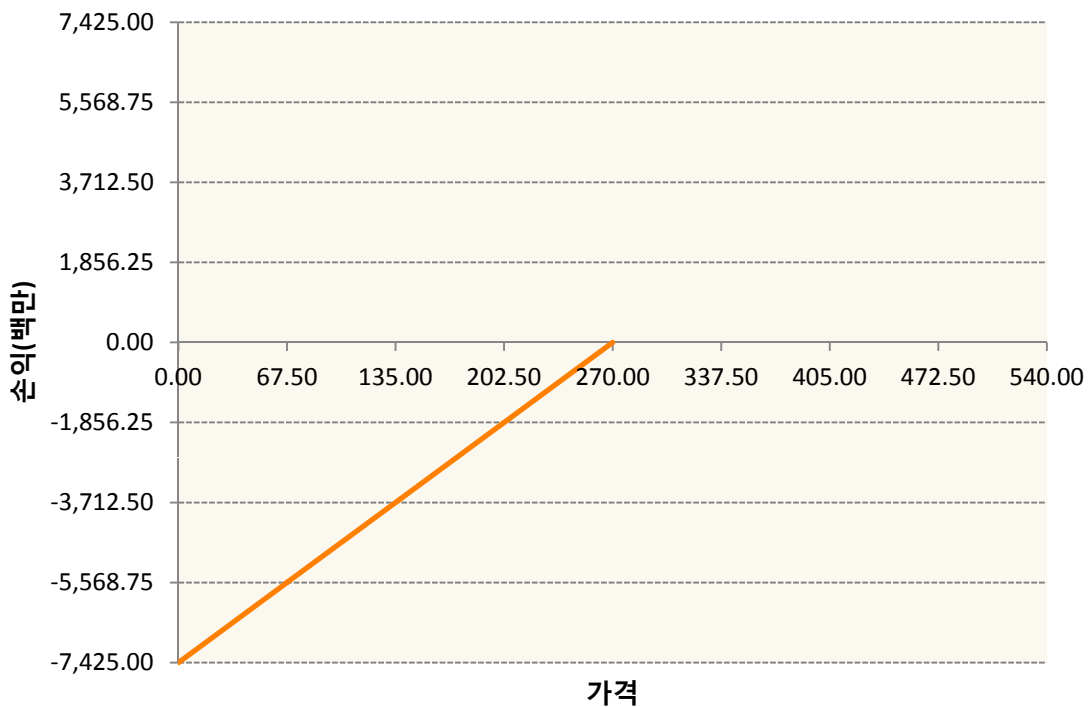


KR4301P12670-2019-01 풋267.5





KR4301P12704-2019-01 풋270



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

	2.529E+11		UBCSFXC1 INDEX_14				2,645	
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-2,645	-2,645	-2,645	-2,645	-2,645	-2,645	-2,645	
-5.33%	-1,763	-1,763	-1,763	-1,763	-1,763	-1,763	-1,763	
-2.67%	-882	-882	-882	-882	-882	-882	-882	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	882	882	882	882	882	882	882	
5.33%	1,763	1,763	1,763	1,763	1,763	1,763	1,763	
8.00%	2,645	2,645	2,645	2,645	2,645	2,645	2,645	
	KR4201P12706		2019-01 풋270				685	
	기초자산의 변동성							

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	28	28	28	28	28	28	28
-5.33%	28	28	28	28	27	27	25
-2.67%	28	27	26	24	21	17	13
0%	20	15	8	0	-10	-20	-32
2.67%	-36	-53	-70	-89	-107	-126	-146
5.33%	-232	-254	-275	-297	-318	-340	-362
8.00%	-597	-609	-622	-636	-652	-668	-685
KR4301P12670 2019-01 풋267.5							612

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-612	-612	-612	-612	-612	-612	-612
-5.33%	-406	-406	-406	-406	-406	-406	-406
-2.67%	-200	-200	-200	-200	-201	-201	-202
0%	5	4	2	0	-2	-5	-8
2.67%	185	179	173	167	161	155	149
5.33%	277	272	267	261	255	250	244
8.00%	294	293	291	290	288	285	283
KR4301P12704 2019-01 풋270							565

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-565	-565	-565	-565	-565	-565	-565
-5.33%	-376	-376	-376	-376	-376	-376	-376
-2.67%	-187	-187	-187	-187	-187	-187	-187
0%	2	2	1	0	-1	-3	-5
2.67%	181	177	173	169	164	159	154
5.33%	299	293	287	281	275	269	263
8.00%	332	330	328	325	322	319	315

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

(단위:백만원)

4,426

공시일	2019-01-07
기준일	2019-01-04

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

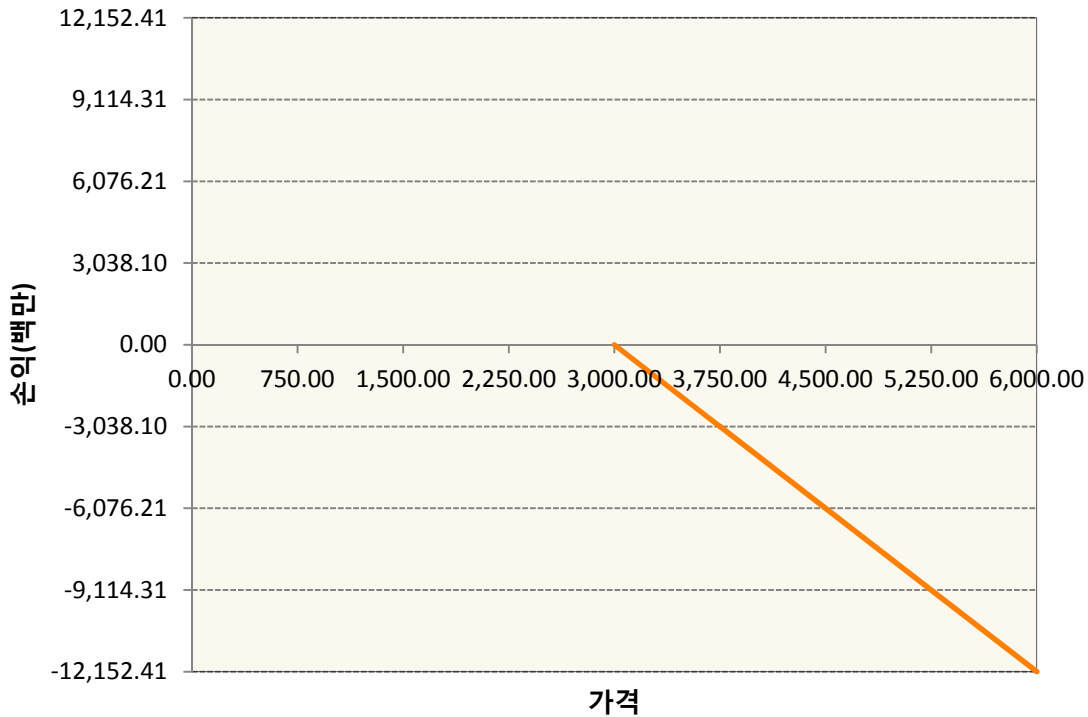
1. 계약금액

(단위:백만원)

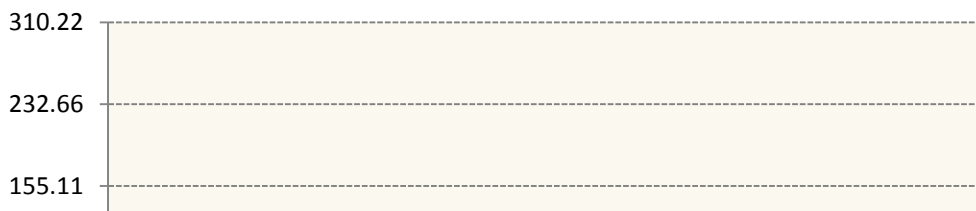
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	6,377	0	6,377	
누계	유가증권	스왑	71,597	0	71,597	장외
누계	유가증권	옵션	0	24,925	-24,925	장내
누계	통화	선도	0	15,382	-15,382	장외

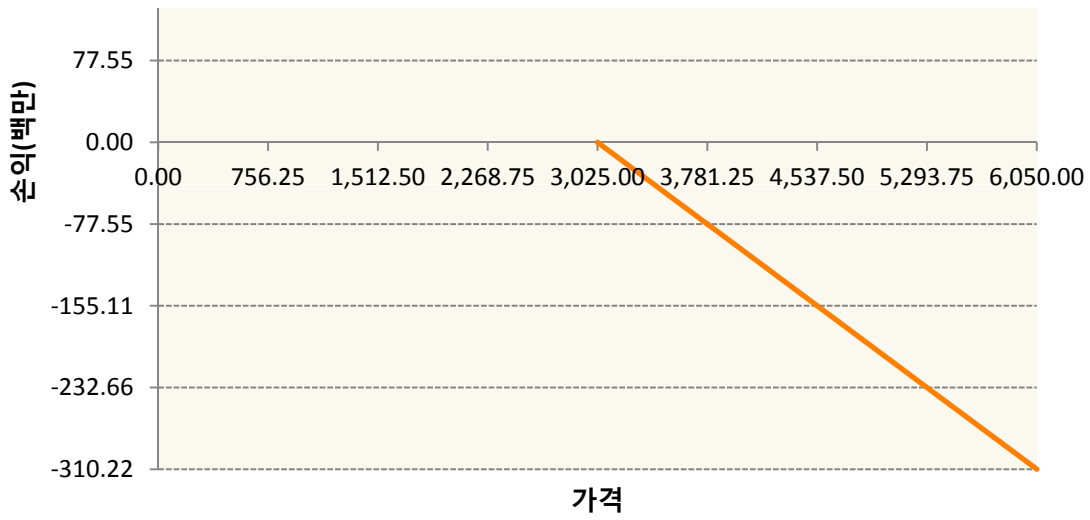
2. 만기시점의 손익구조

OESXF9-C3000-EURO STOXX 50

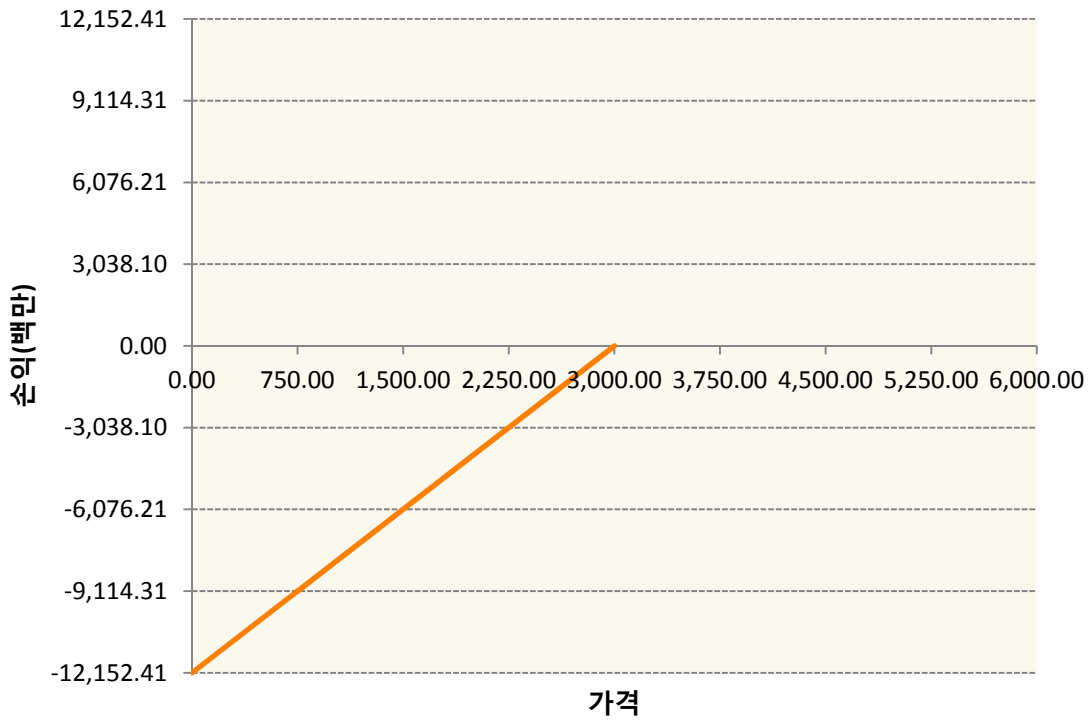


OESXF9-C3025-EURO STOXX 50

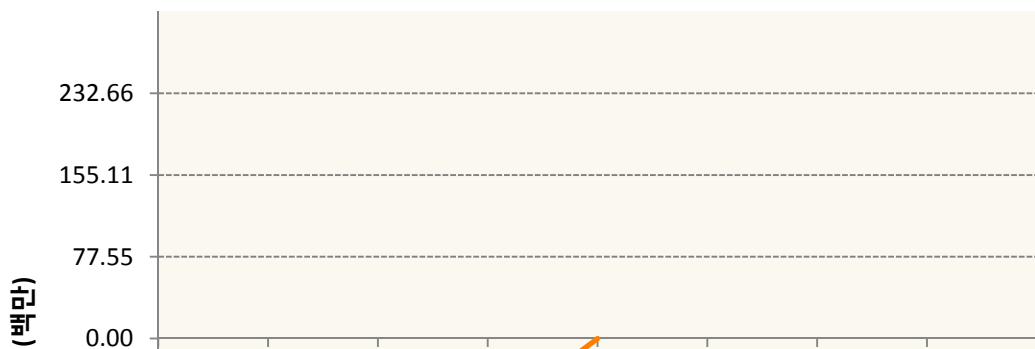


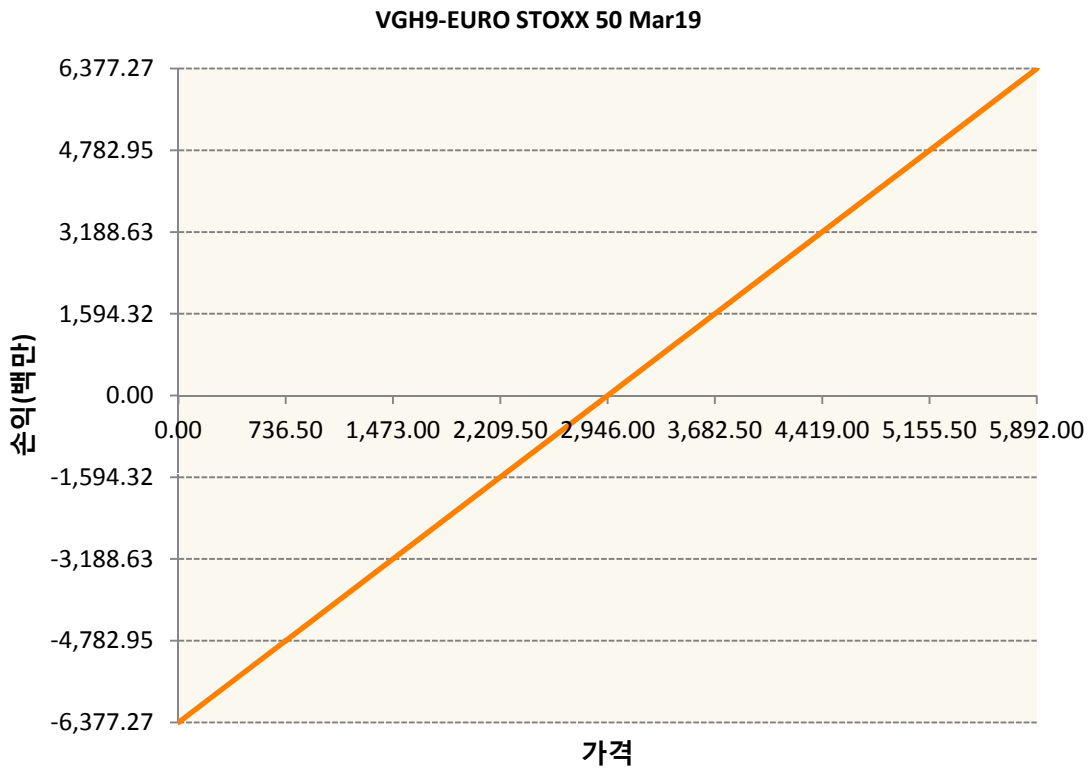
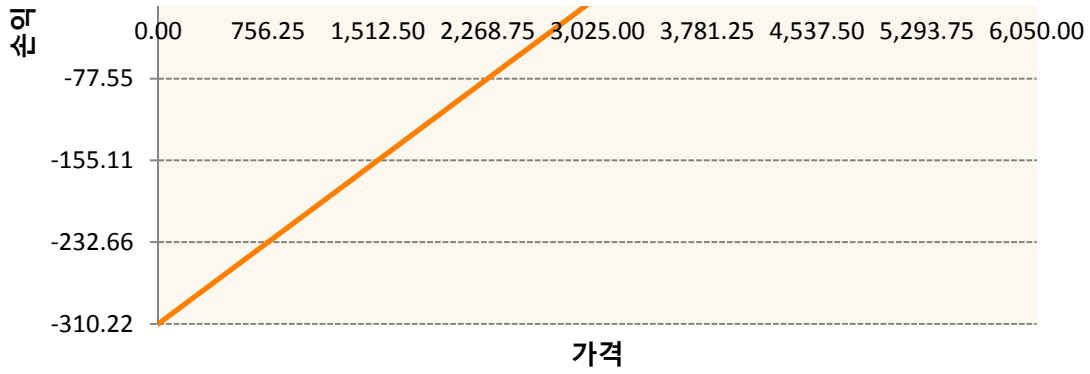


OESXF9-P3000-EURO STOXX 50



OESXF9-P3025-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY	164
FX21018X02 KRW/EUR 22-02-19E	410
FX21018Z03 KRW/EUR 22-03-19E	820
OESXF9-C30 EURO STOXX 50	972
OESXF9-C30 EURO STOXX 50	25
OESXF9-P30 EURO STOXX 50	972
OESXF9-P30 EURO STOXX 50	25
VGH9 EURO STOXX 50 Mar19	510

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

(단위:백만원)

2,577

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

(단위:백만원)

1,049

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

(단위:백만원)

89

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

(단위:백만원)

134

공시일	2019-01-07
기준일	2019-01-04

스마트KRX300인덱스목표전환형1호

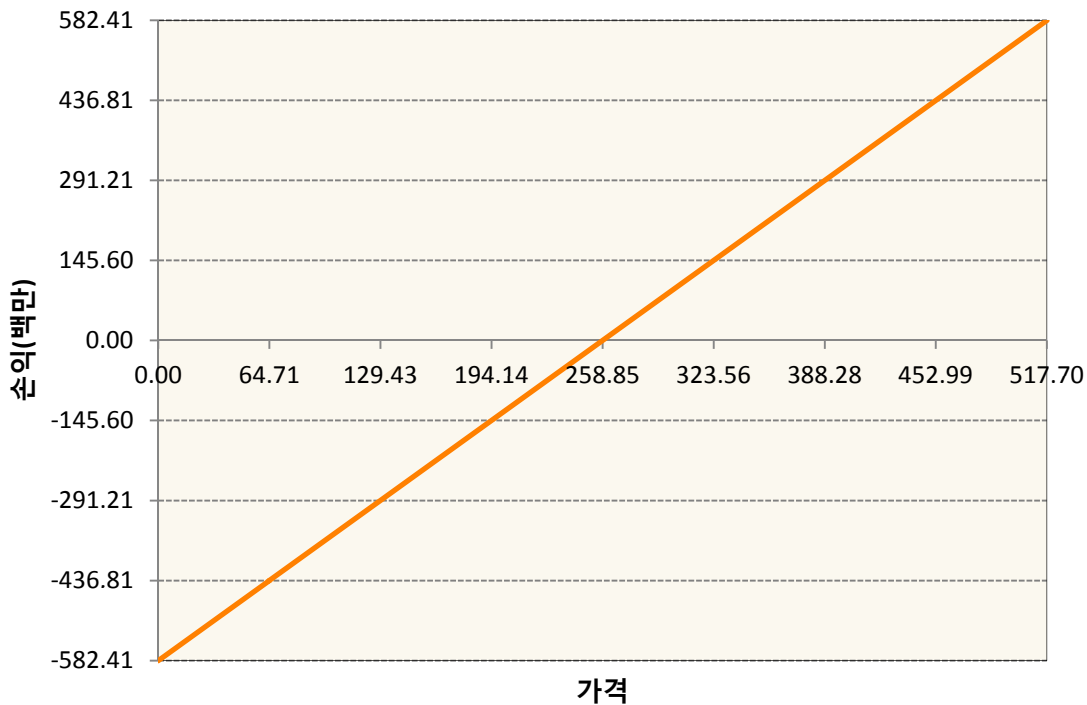
1. 계약금액

(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	2019-01-07
기준일	2019-01-04

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

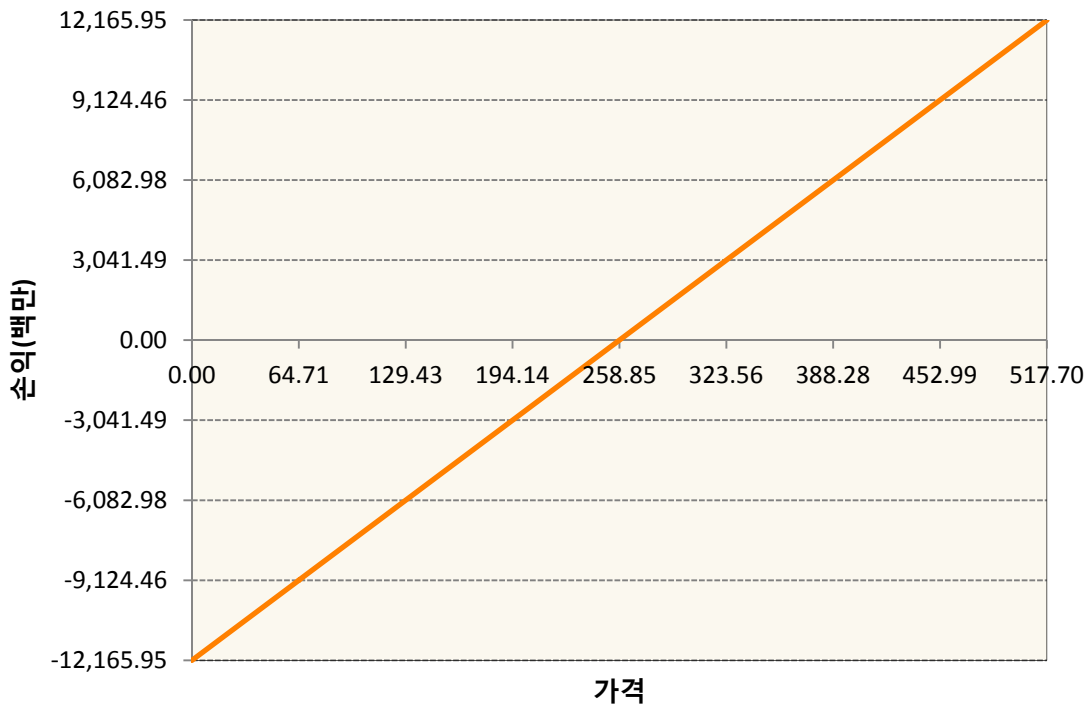
1. 계약금액

(단위:백만원)

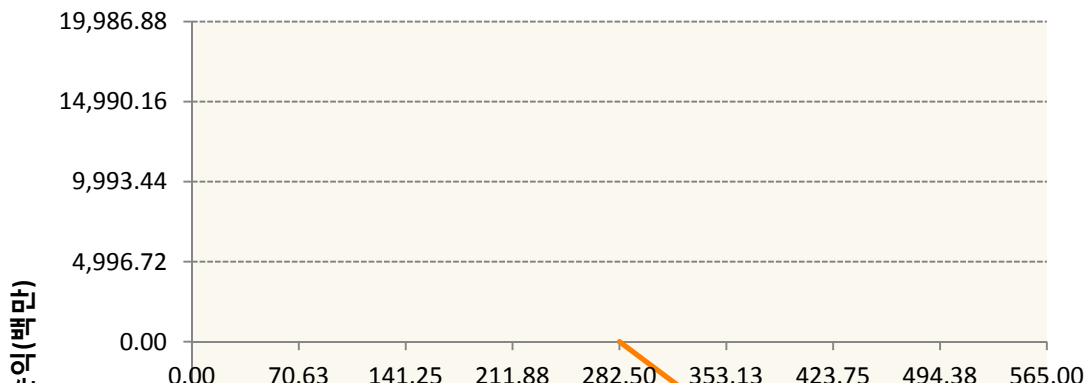
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	12,166	0	12,166	장내
누계	유가증권	옵션	1,145	23,549	-22,404	장내

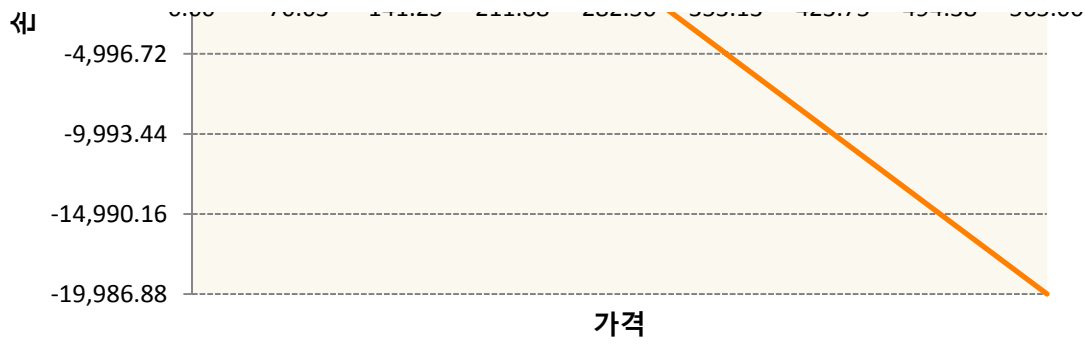
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P30007-2019-03 코스피200지수선물

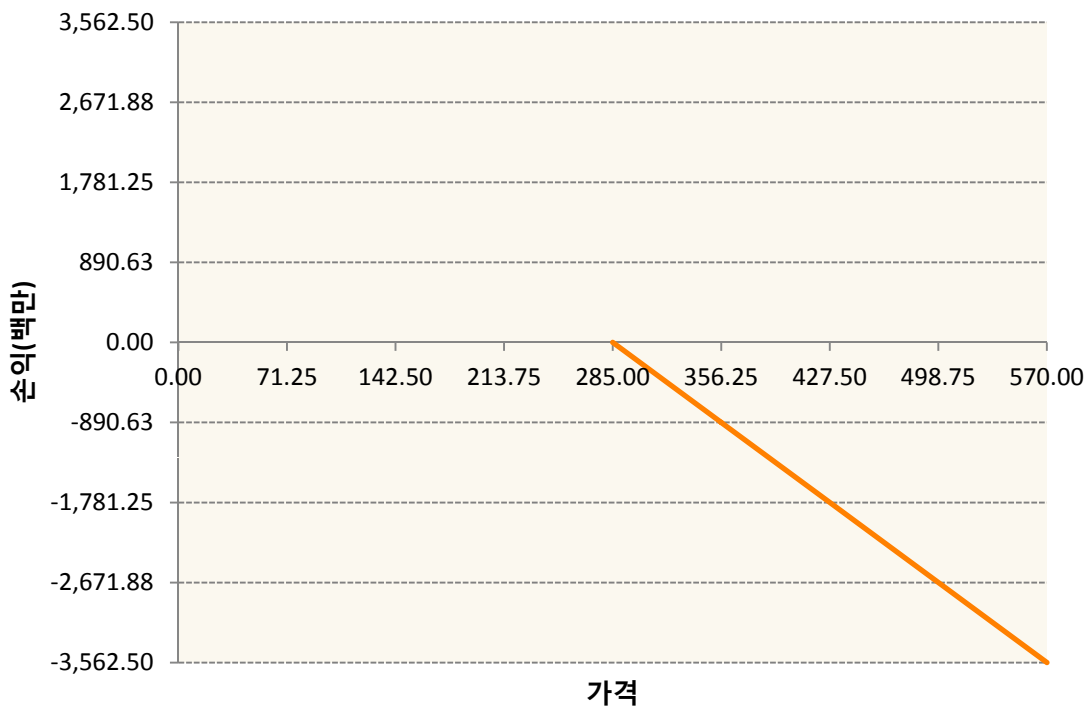


KR4201P12821-2019-01 콜282.5

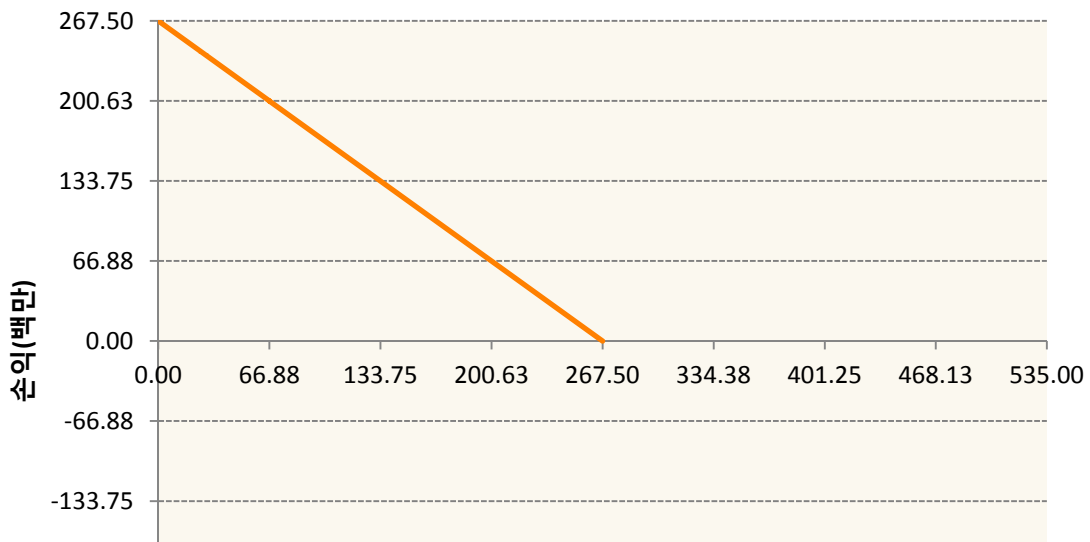


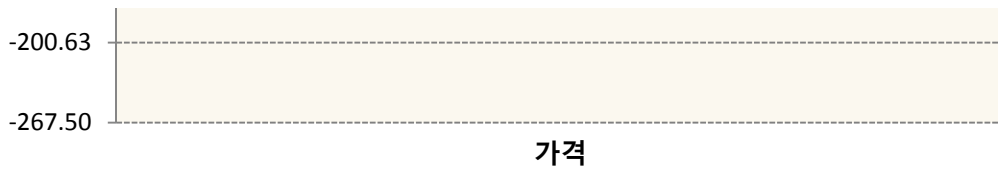


KR4201P12854-2019-01 콜285

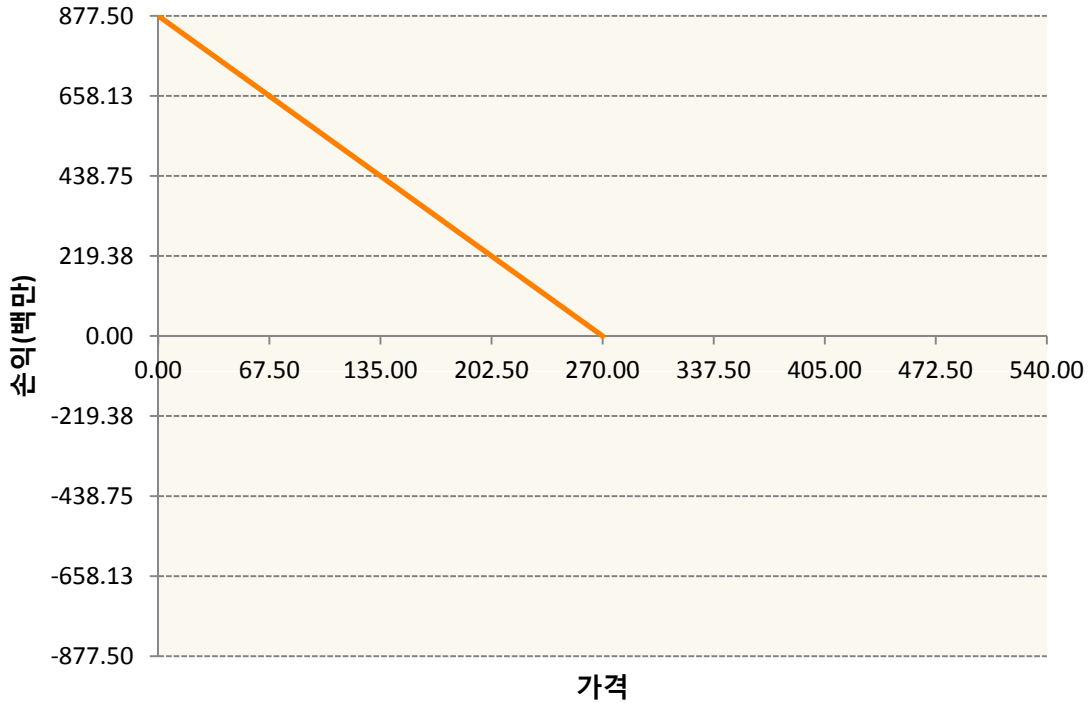


KR4301P12670-2019-01 풋267.5





KR4301P12704-2019-01 풋270



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101P30007		2019-03 코스피200지수선물						970
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-970	-970	-970	-970	-970	-970	-970	
-5.33%	-646	-646	-646	-646	-646	-646	-646	
-2.67%	-323	-323	-323	-323	-323	-323	-323	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	323	323	323	323	323	323	323	
5.33%	646	646	646	646	646	646	646	
8.00%	970	970	970	970	970	970	970	
KR4201P12821		2019-01 콜282.5						221
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	1	1	1	1	1	1	1	
-5.33%	1	1	1	1	1	1	1	
-2.67%	1	1	1	1	1	1	0	

0%	1	1	1	0	-1	-2	-5
2.67%	0	-2	-4	-7	-12	-17	-24
5.33%	-14	-22	-32	-44	-56	-70	-85
8.00%	-95	-115	-135	-156	-178	-199	-221
KR4201P12854 2019-01 콜285							29
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	0	0
2.67%	0	0	0	-1	-1	-2	-3
5.33%	-1	-2	-3	-5	-6	-8	-10
8.00%	-9	-12	-15	-19	-22	-25	-29
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%	14	14	14	14	14	14	14
-2.67%	7	7	7	7	7	7	7
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-6	-6	-6	-6	-5	-5	-5
5.33%	-9	-9	-9	-9	-9	-8	-8
8.00%	-10	-10	-10	-10	-10	-10	-9
KR4301P12704 2019-01 풋270							67
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	67	67	67	67	67	67	67
-5.33%	44	44	44	44	44	44	44
-2.67%	22	22	22	22	22	22	22
0%	0	0	0	0	0	0	1
2.67%	-21	-21	-20	-20	-19	-19	-18
5.33%	-35	-35	-34	-33	-33	-32	-31
8.00%	-39	-39	-39	-38	-38	-38	-37

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

(단위:백만원)

968

공시일	2019-01-07
기준일	2019-01-04

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	173	0	173	

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	2019-01-07
기준일	2019-01-04

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	2,098	0	2,098	

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	2019-01-07
기준일	2019-01-04

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	2,132	0	2,132	
누계	통화	선도	0	2,626	-2,626	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		31
FX21019F00(KRW/USD 19-02-19E		15
FX21019F00(KRW/USD 19-02-19E		8
FX21019F00: KRW/USD 19-02-19E		26

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

(단위:백만원)

80

공시일	2019-01-07
기준일	2019-01-04

스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

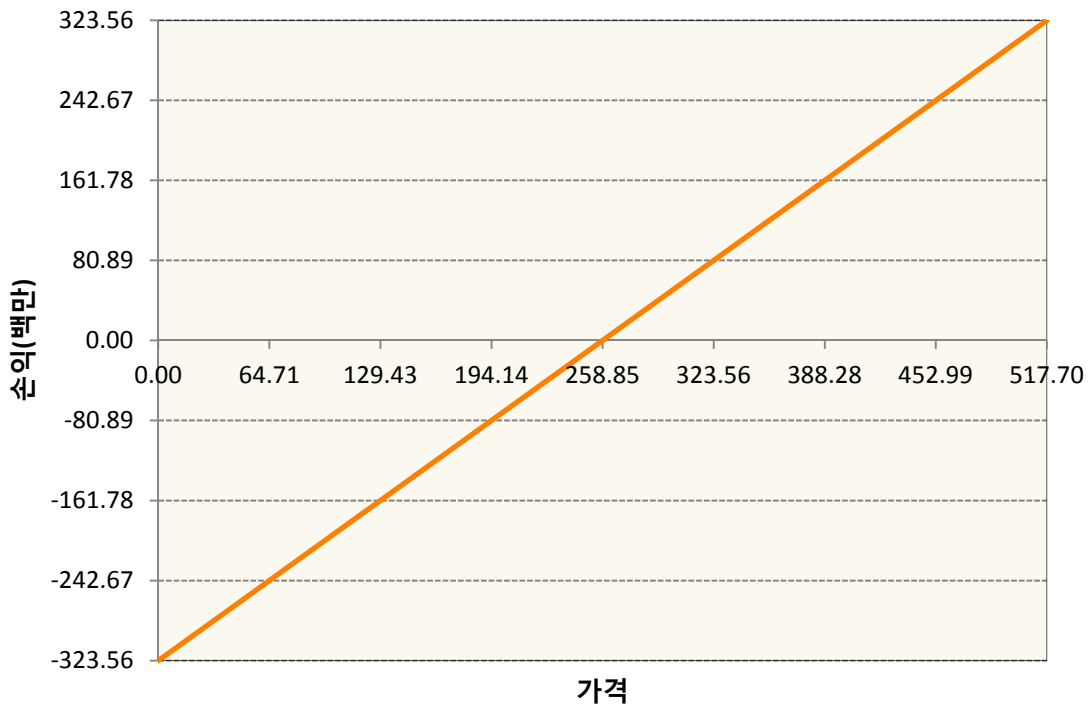
1. 계약금액

(단위:백만원)

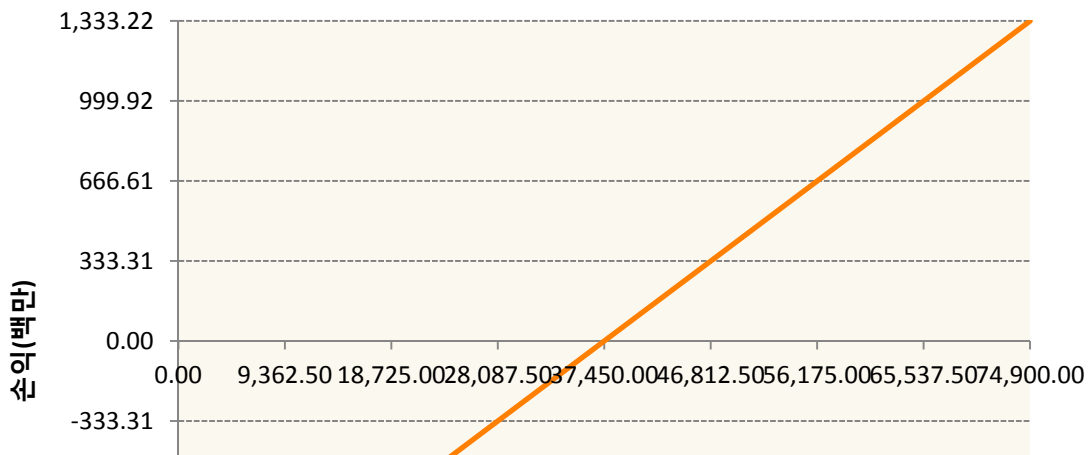
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,657	0	1,657	장내

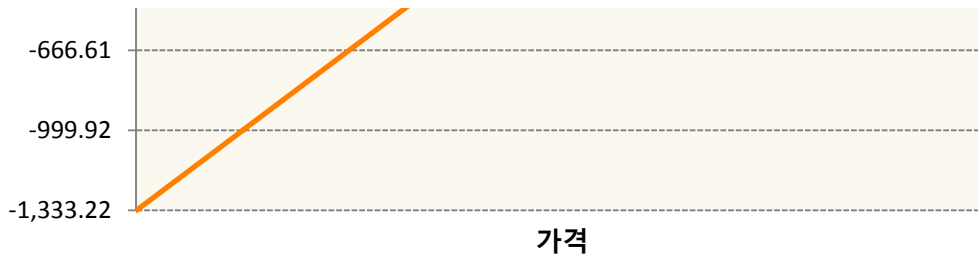
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P30007-2019-03 코스피200지수선물



KR4111P10008-2019-01 삼성전자개별선물





3. 시나리오 별 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						107
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-107	-107	-107	-107	-107	-107	-107	
-5.33%	-71	-71	-71	-71	-71	-71	-71	
-2.67%	-36	-36	-36	-36	-36	-36	-36	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	36	36	36	36	36	36	36	
5.33%	71	71	71	71	71	71	71	
8.00%	107	107	107	107	107	107	107	

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

143

공시일	2019-01-07
기준일	2019-01-04

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

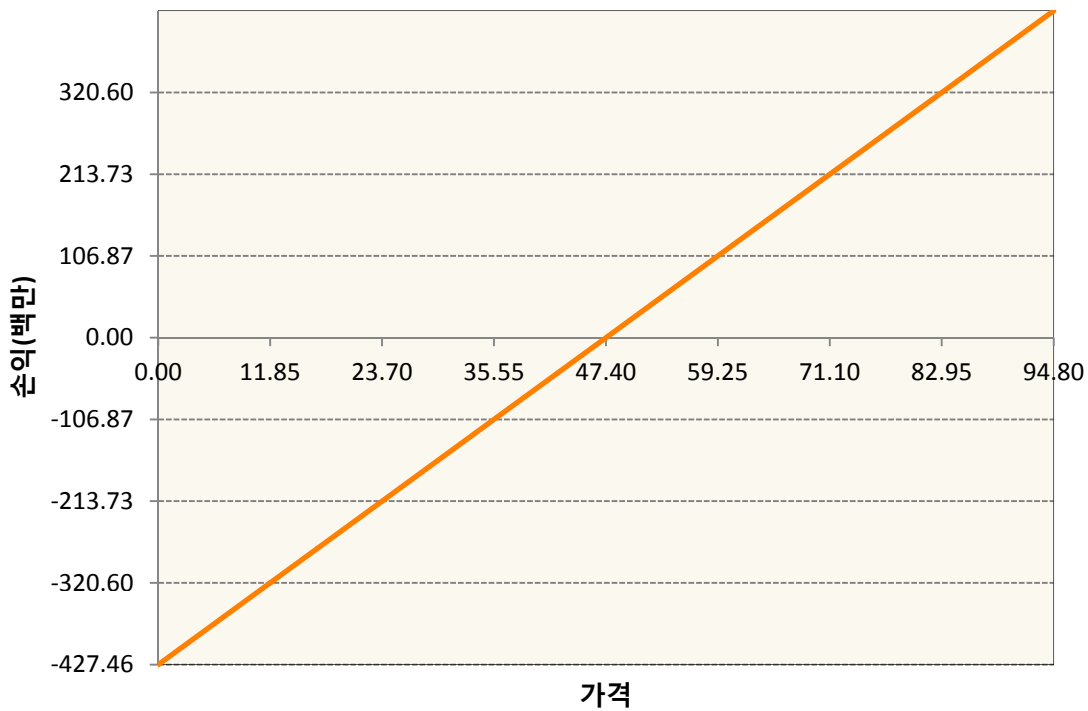
1. 계약금액

(단위:백만원)

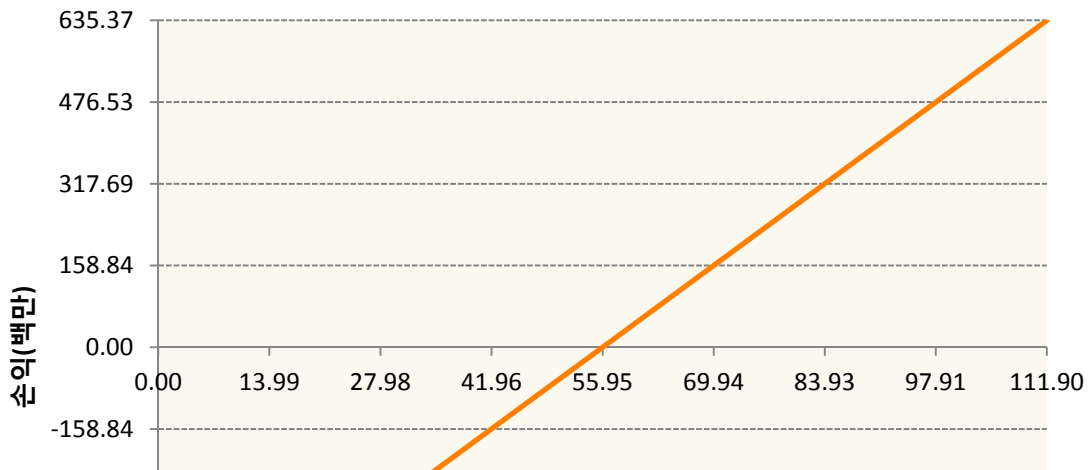
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,475	203	2,272	

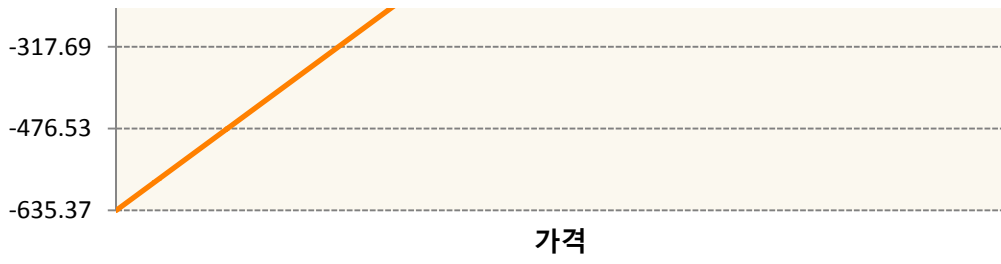
2. 만기시점의 손익구조

CLH9-WTI CRUDE FUTURE MAR19

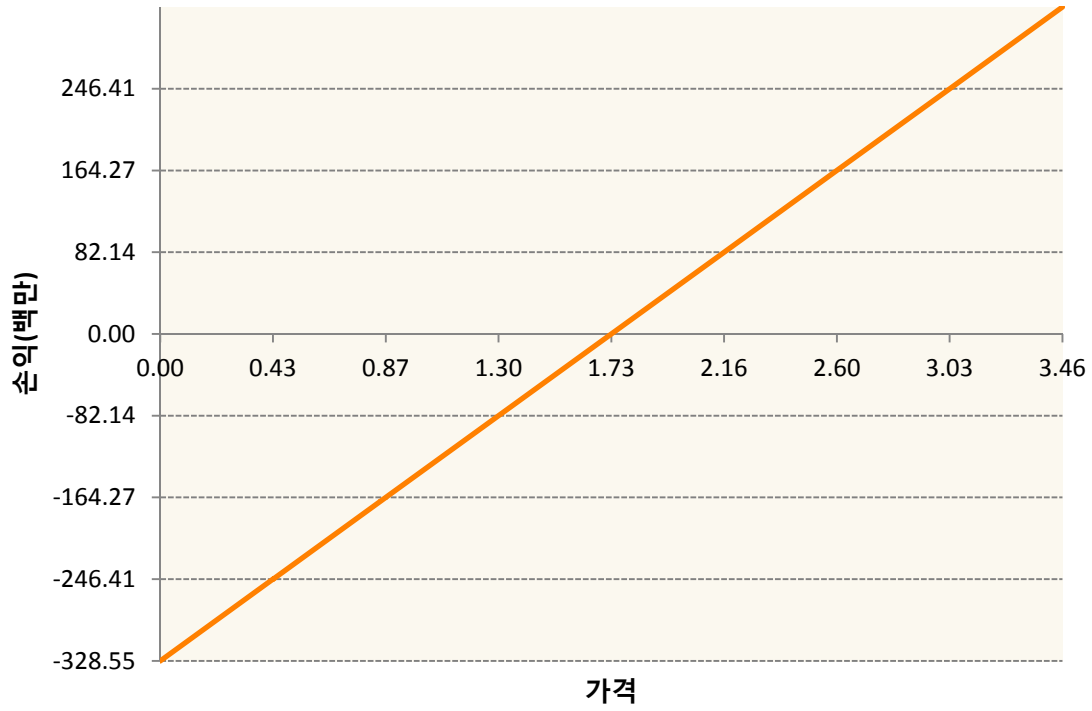


COH9-BRENT CRUDE FUTR Mar19

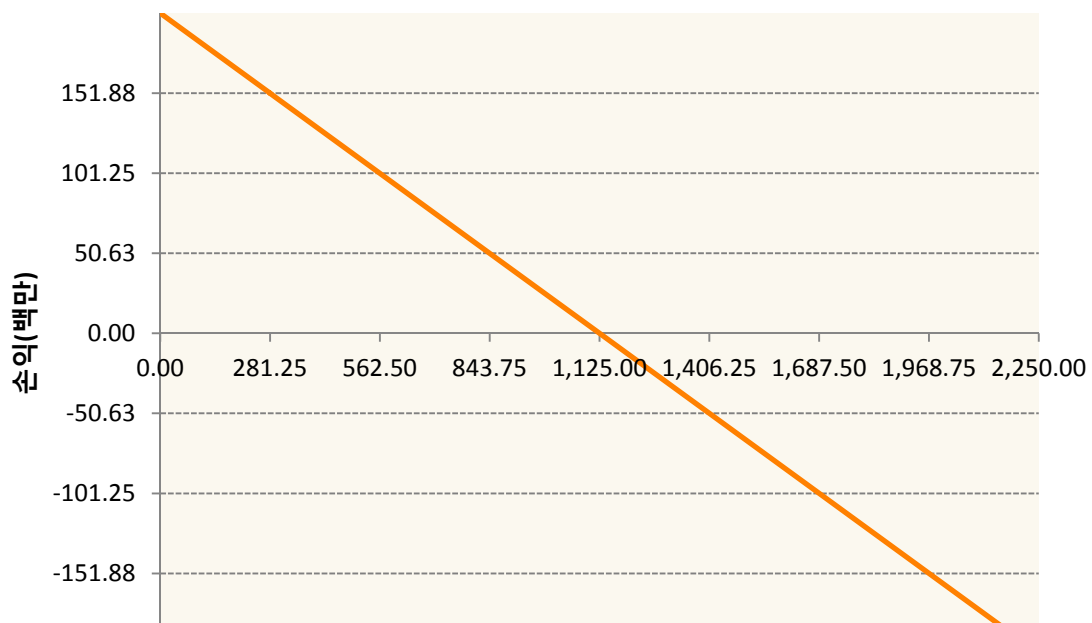


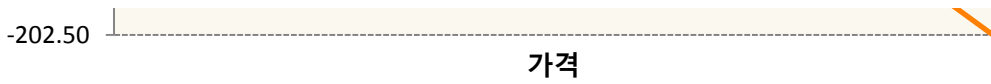


HOH9-NY Harb ULSD Fut Mar19

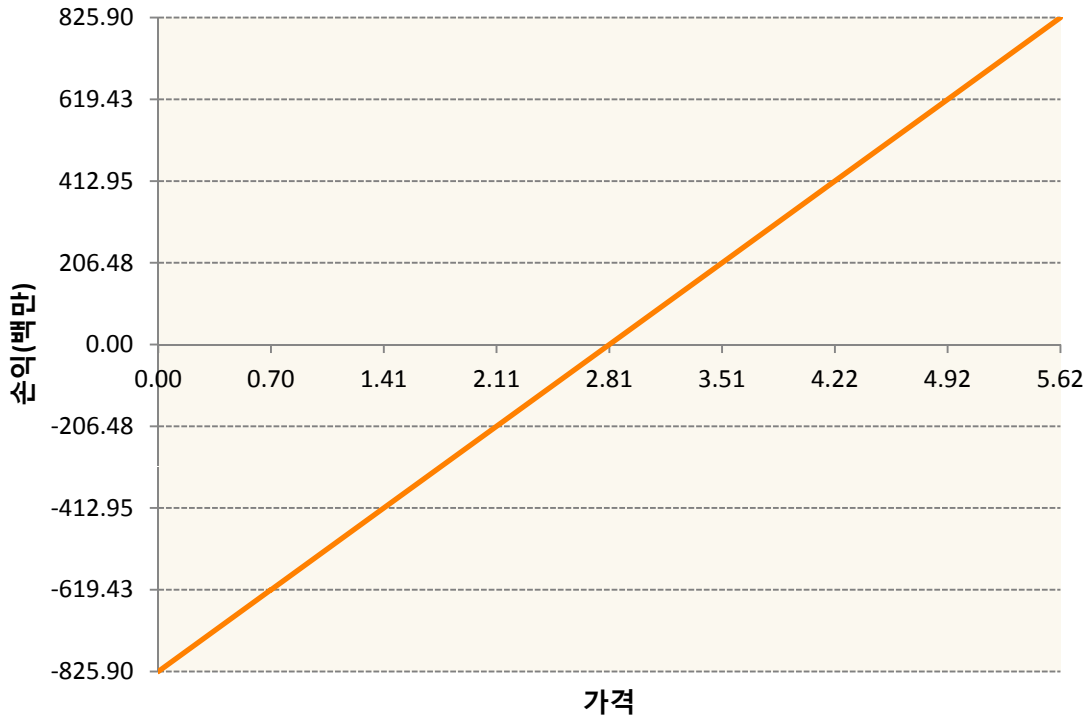


KR4175P10003-2019-01 달러선물

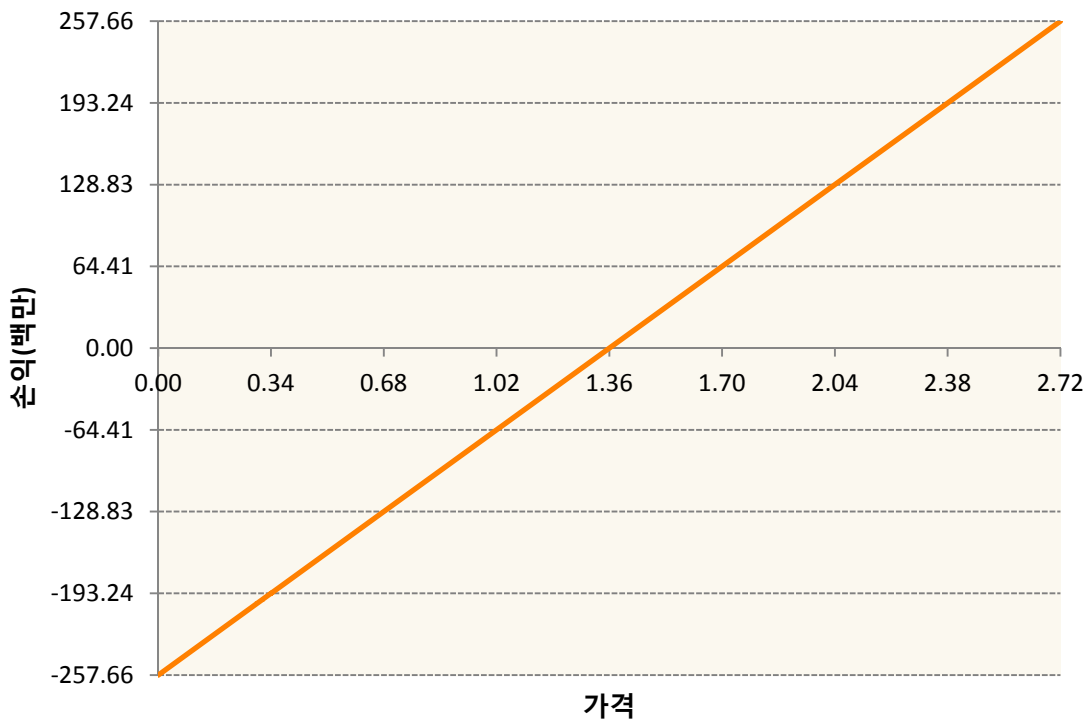




NGH19-NATURAL GAS FUTR Mar19



XBH9-GASOLINE RBOB FUT Mar19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLH9	WTI CRUDE FUTURE MAR19	34
COH9	BRENT CRUDE FUTR Mar19	51
HOH9	NY Harb ULSD Fut Mar19	26
KR4175P100	2019-01 달러선물	16
NGH19	NATURAL GAS FUTR Mar19	66
XBH9	GASOLINE RBOB FUT Mar19	21

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

378

공시일	2019-01-07
기준일	2019-01-04

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

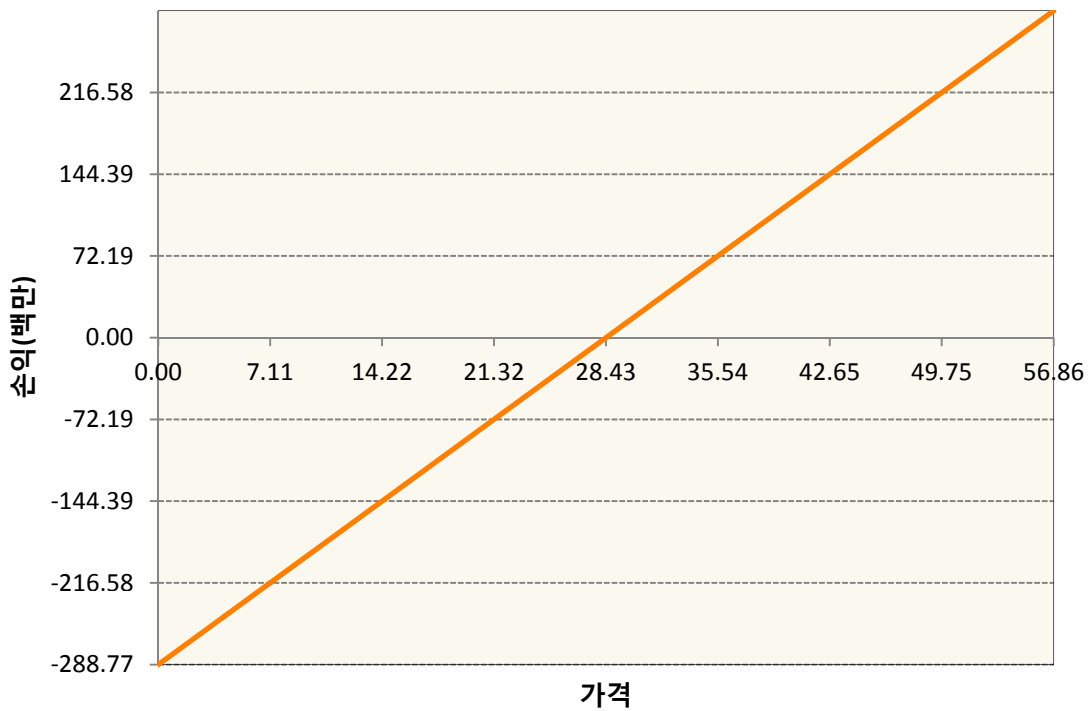
1. 계약금액

(단위:백만원)

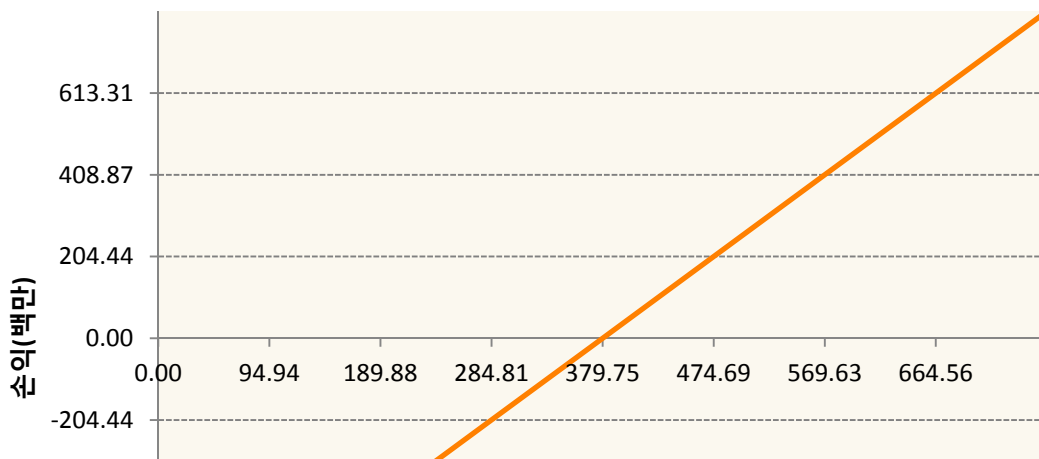
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,559	79	3,480	

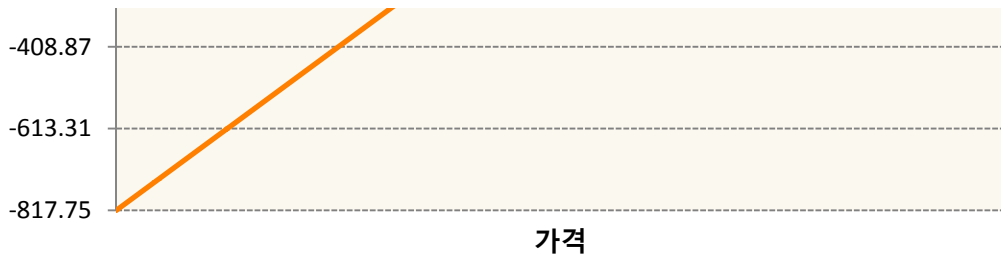
2. 만기시점의 손익구조

BOH9-SOYBEAN OIL FUTR Mar19

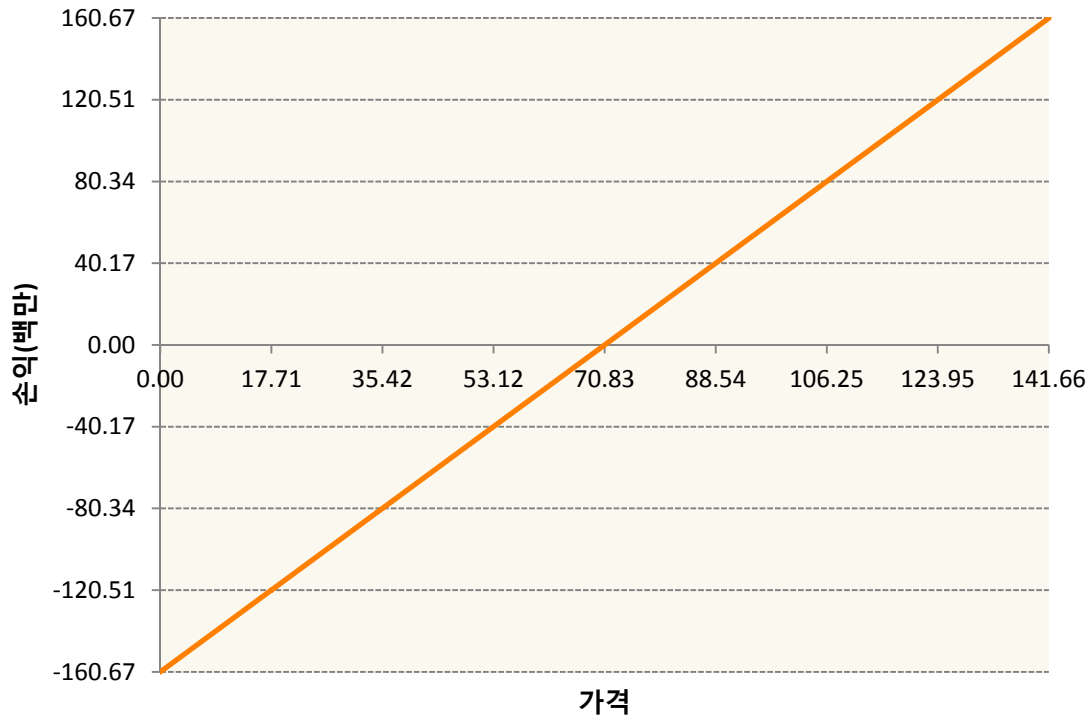


CH9-CORN FUTURE Mar19

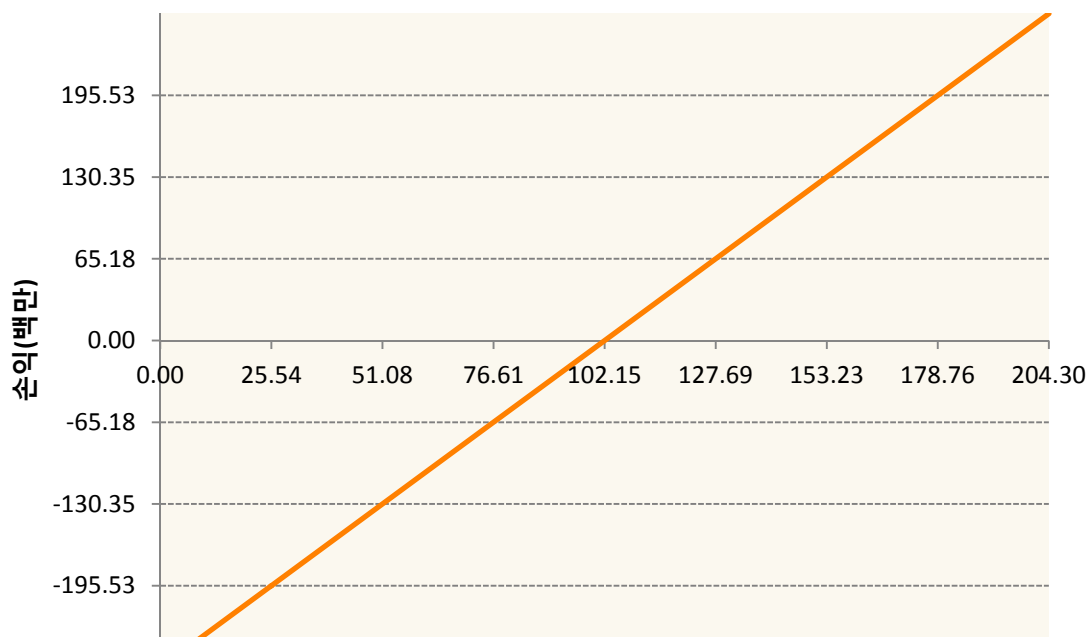


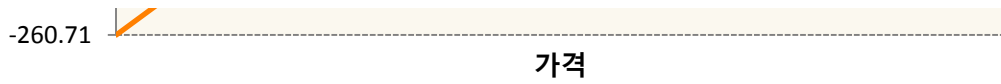


CTH9-COTTON NO.2 FUTR Mar19

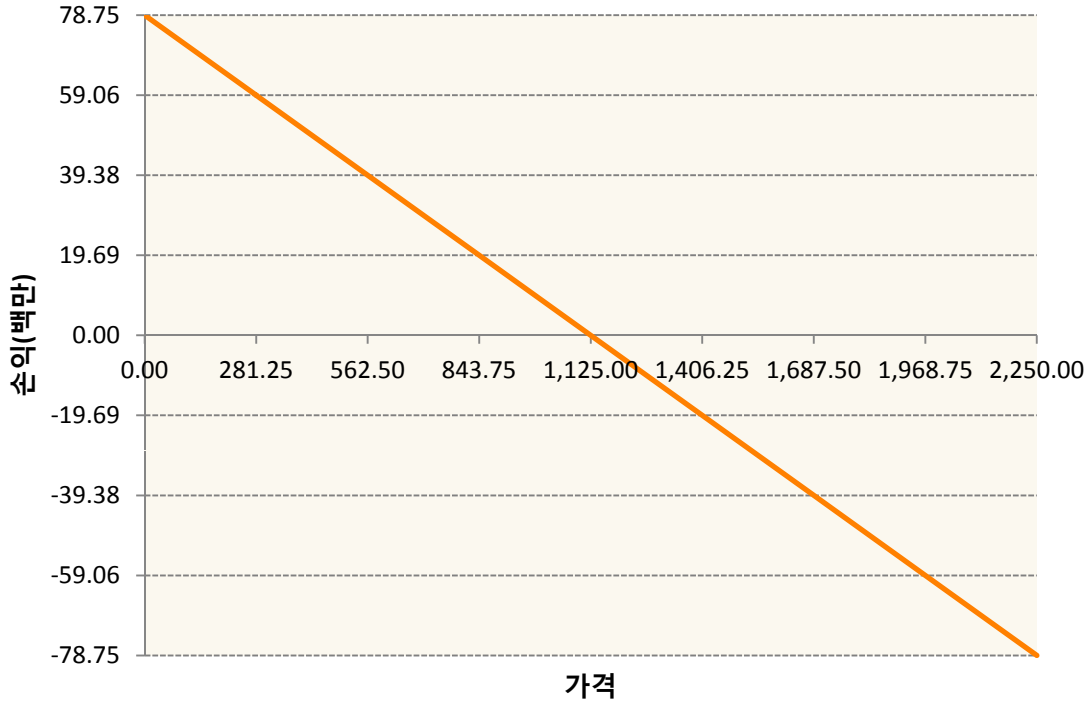


KCH9-COFFEE 'C' FUTURE Mar19

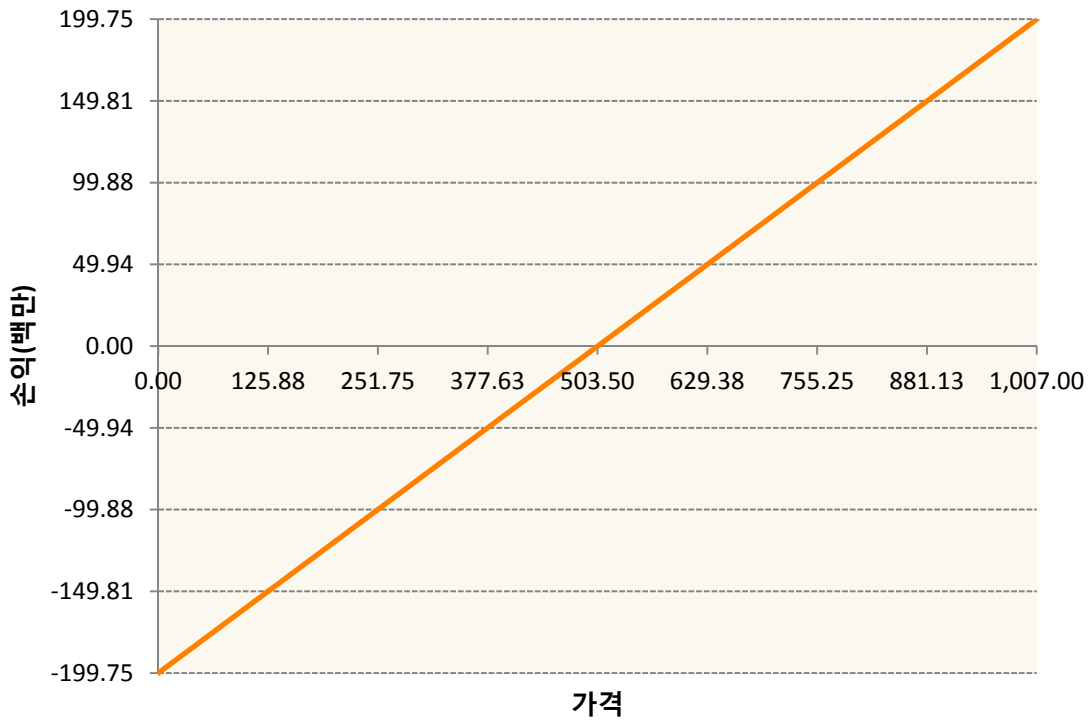




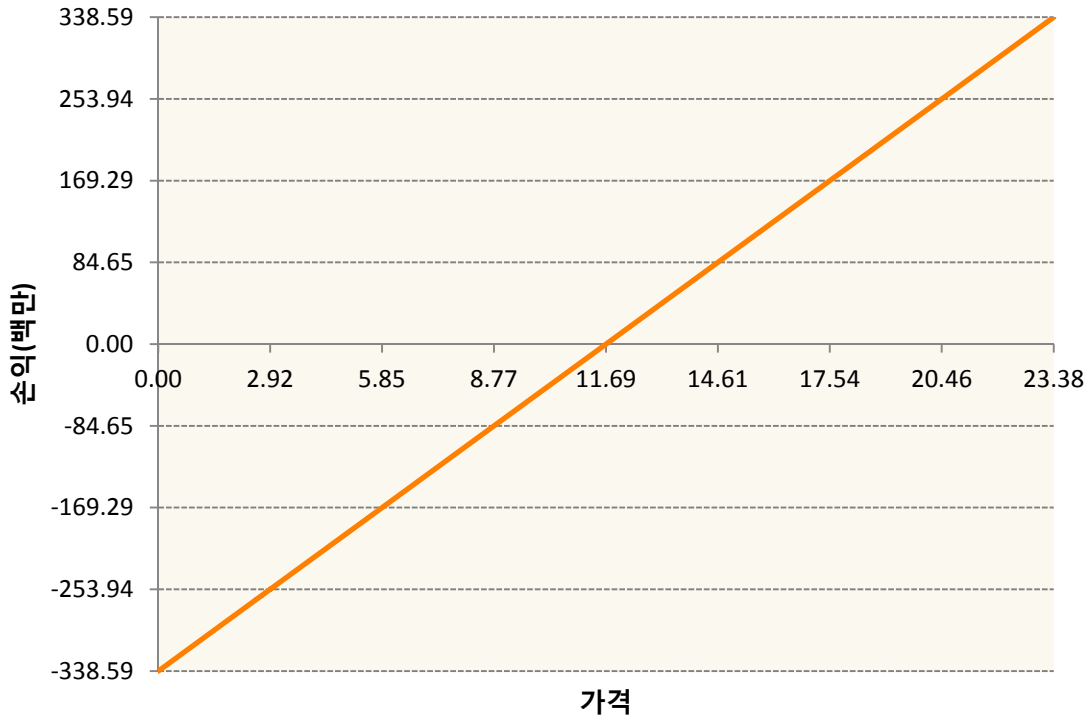
KR4175P10003-2019-01 달러선물



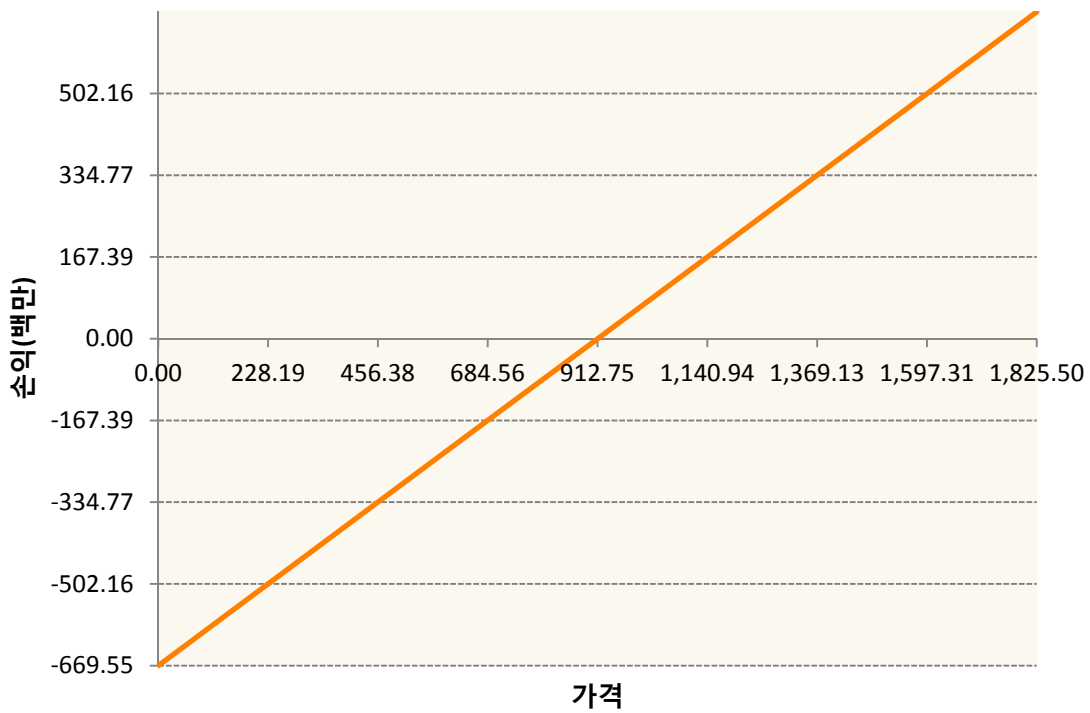
KWH9-KC HRW WHEAT FUT Mar19



SBH9-SUGAR #11 (WORLD) MAR19

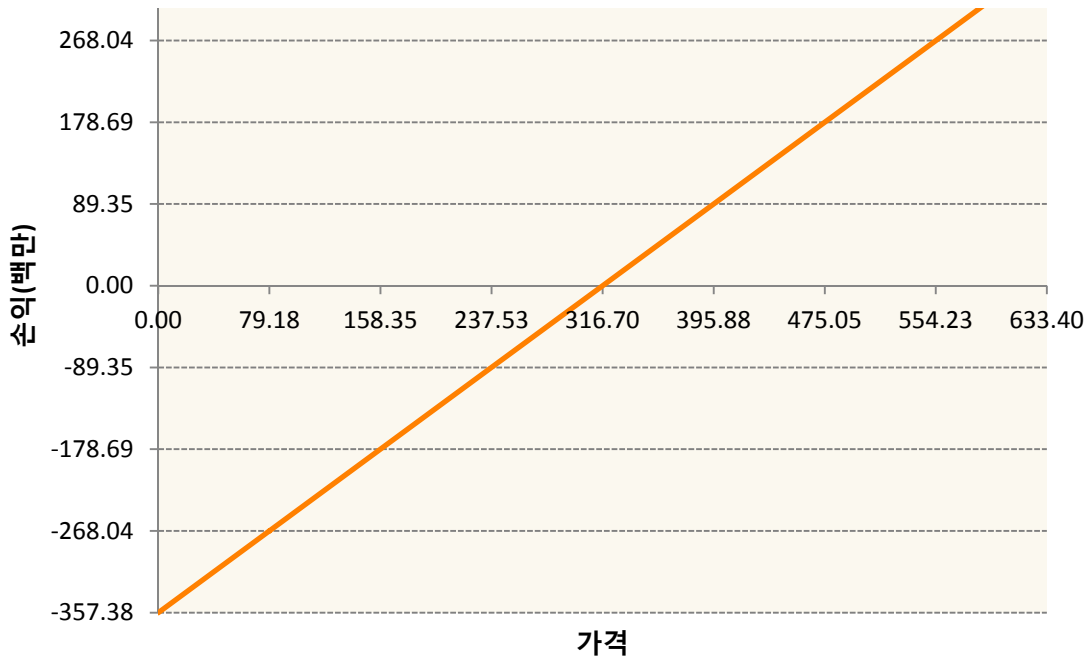


SH9-SOYBEAN FUTURE Mar19

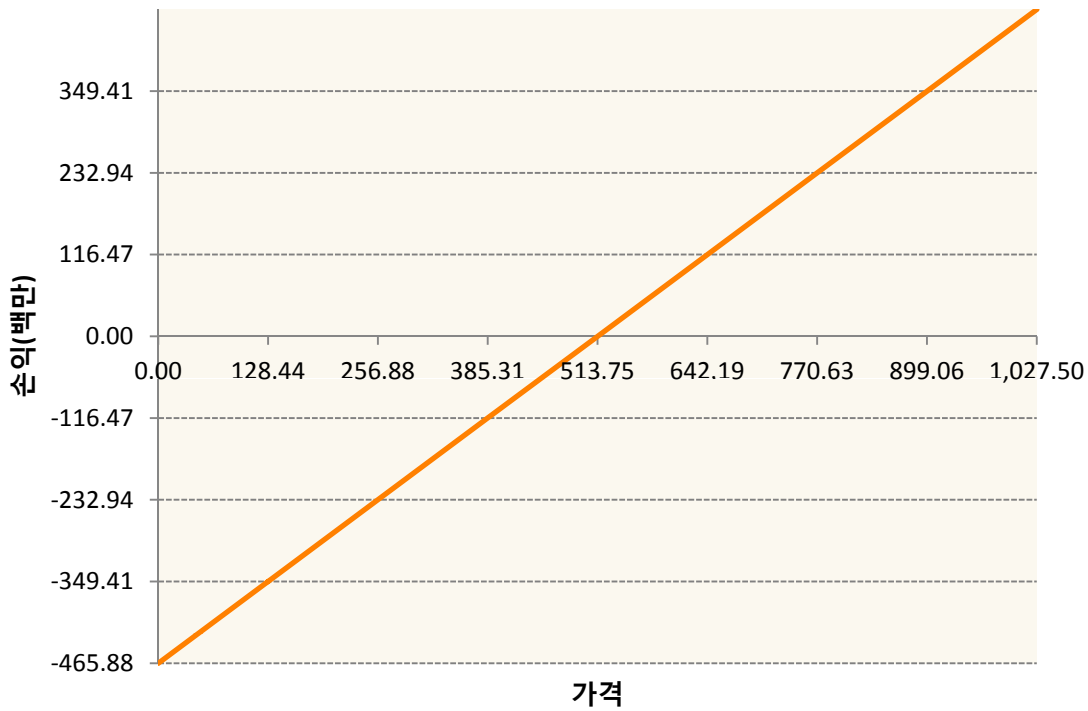


SMH9-SOYBEAN MEAL FUTR Mar19





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	27
SH9	SOYBEAN FUTURE Mar19	54
SMH9	SOYBEAN MEAL FUTR Mar19	29
WH9	WHEAT FUTURE(CBT) Mar19	37

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

(단위:백만원)

297