

공시일	2019-01-08
기준일	2019-01-07

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	2019-01-08
기준일	2019-01-07

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

1,014

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

568

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-01-08
기준일	2019-01-07

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

262

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

390

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-01-08
기준일	2019-01-07

유로인덱스모(주식-파생형)

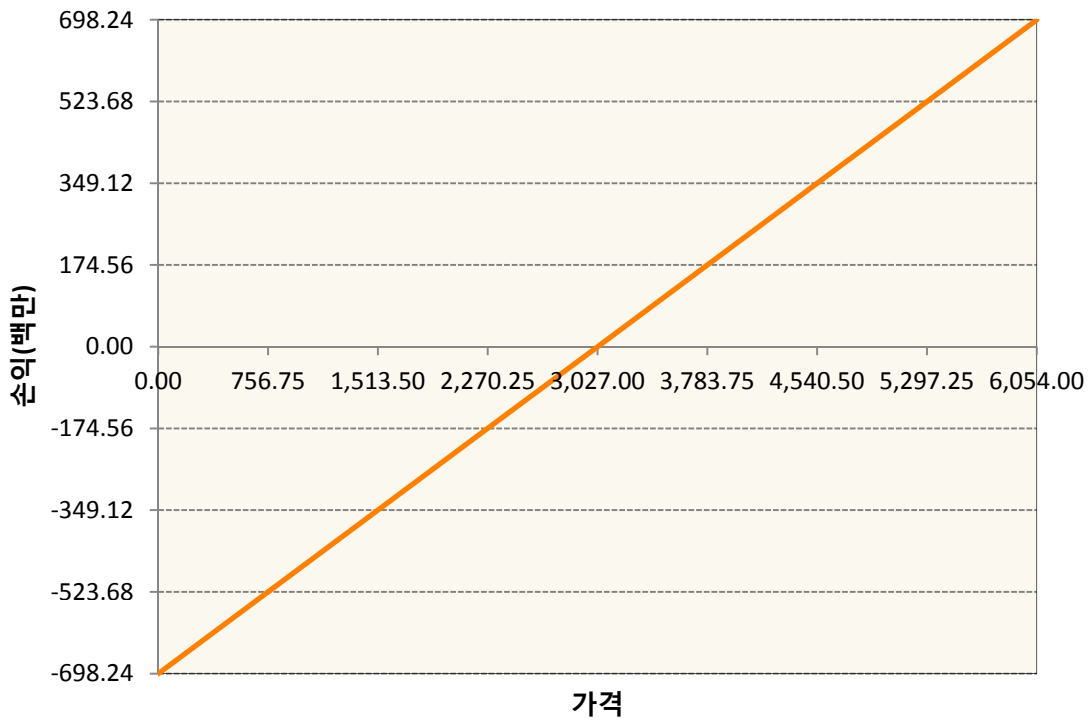
1. 계약금액

(단위:백만원)

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

2. 만기시점의 손익구조

VGH9-EURO STOXX 50 Mar19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGH9	EURO STOXX 50 Mar19	56
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

38

공시일	2019-01-08
기준일	2019-01-07

차이나인덱스모(주식-파생형)

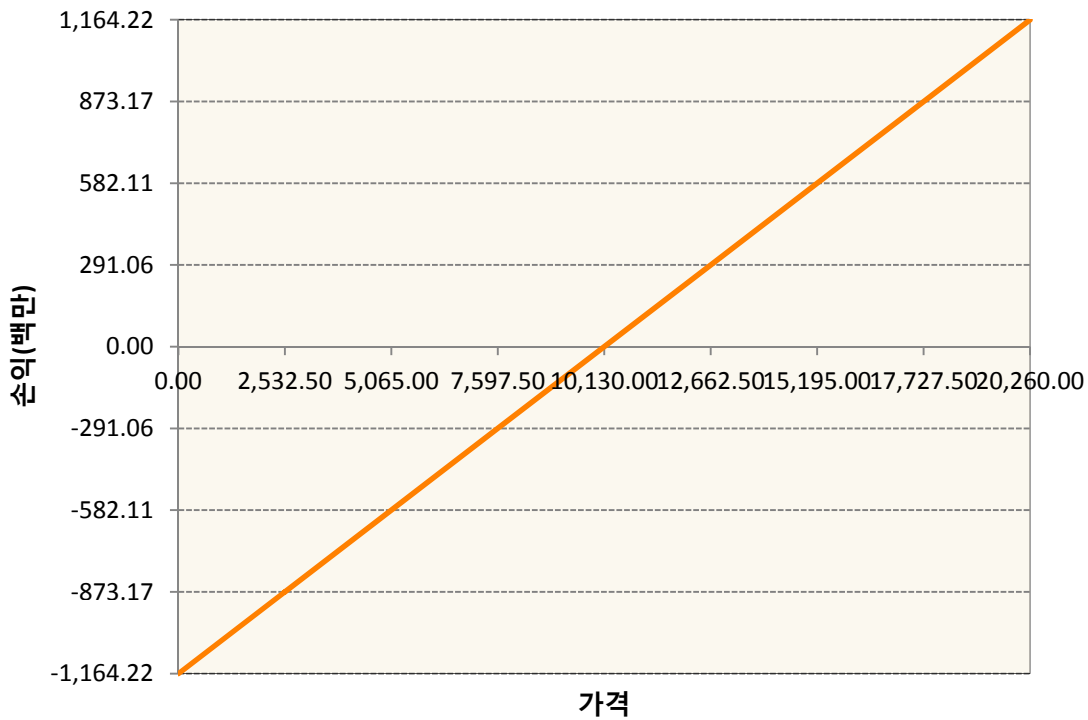
1. 계약금액

(단위:백만원)

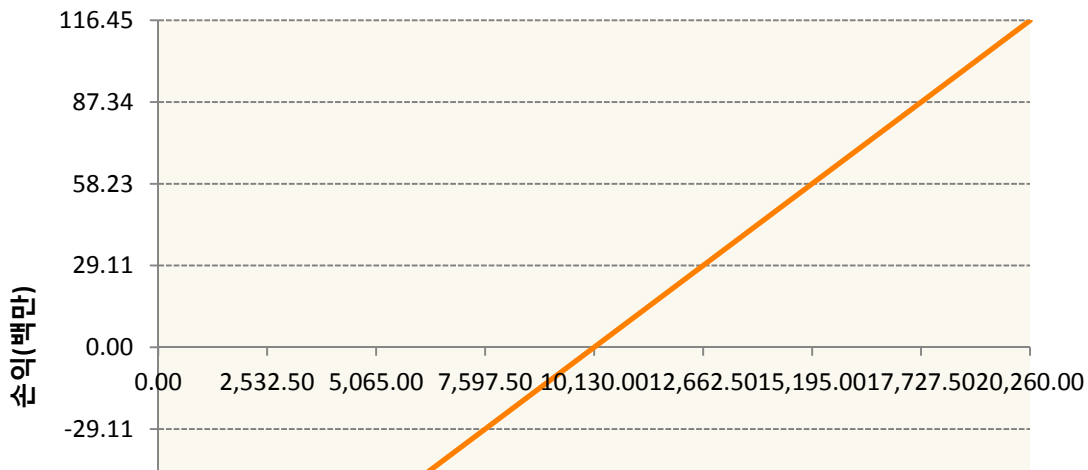
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,281	0	1,281	장내

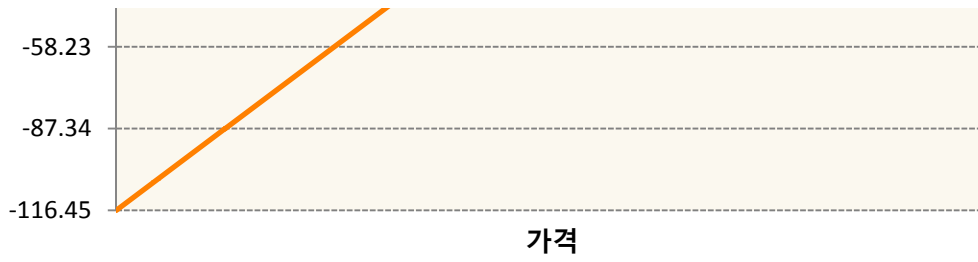
2. 만기시점의 손익구조

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)

104

공시일	2019-01-08
기준일	2019-01-07

커버드콜모(주식혼합-파생형)

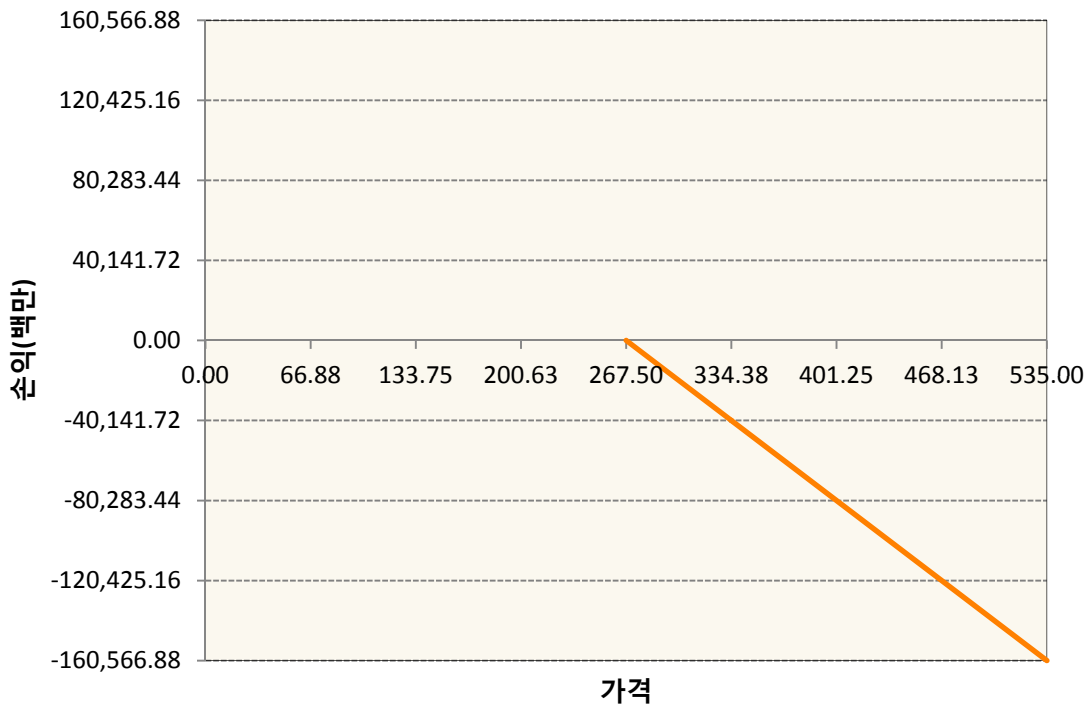
1. 계약금액

(단위:백만원)

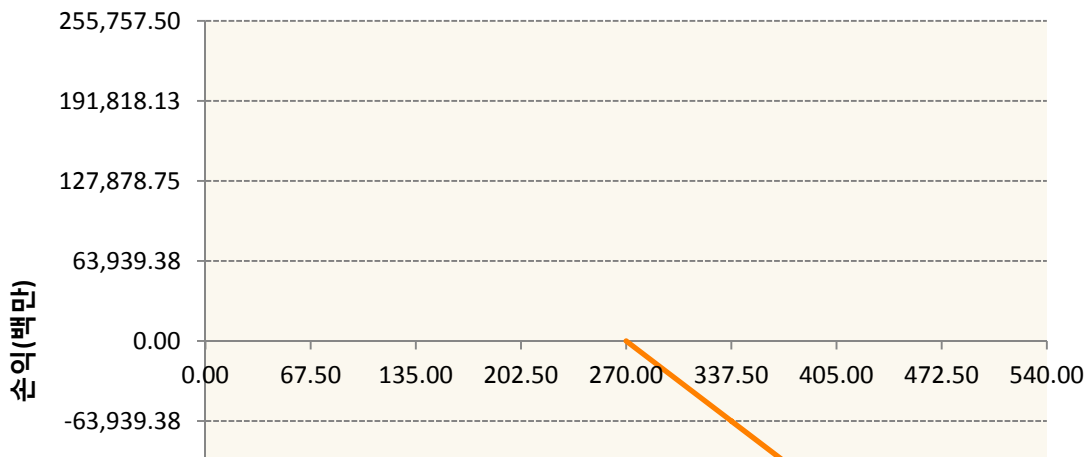
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	730,199	-730,199	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4201P12672-2019-01 콜267.5



KR4201P12706-2019-01 콜270



-5.33%	281	281	281	281	280	279	276
-2.67%	280	278	274	265	251	230	202
0%	203	150	82	0	-94	-199	-314
2.67%	-976	-1,175	-1,375	-1,577	-1,780	-1,983	-2,187
5.33%	-5,271	-5,392	-5,526	-5,671	-5,823	-5,983	-6,149
8.00%	-11,566	-11,580	-11,603	-11,636	-11,680	-11,734	-11,800
KR4301P12704 2019-01 풋270							24,284
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-24,284	-24,284	-24,284	-24,284	-24,284	-24,284	-24,284
-5.33%	-16,176	-16,176	-16,176	-16,176	-16,176	-16,176	-16,176
-2.67%	-8,069	-8,069	-8,069	-8,069	-8,069	-8,070	-8,071
0%	35	29	18	0	-25	-57	-97
2.67%	7,369	7,220	7,069	6,916	6,761	6,605	6,448
5.33%	9,770	9,726	9,670	9,603	9,526	9,441	9,347
8.00%	9,835	9,835	9,834	9,832	9,828	9,822	9,812

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

(단위:백만원)

44,788

공시일	2019-01-08
기준일	2019-01-07

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

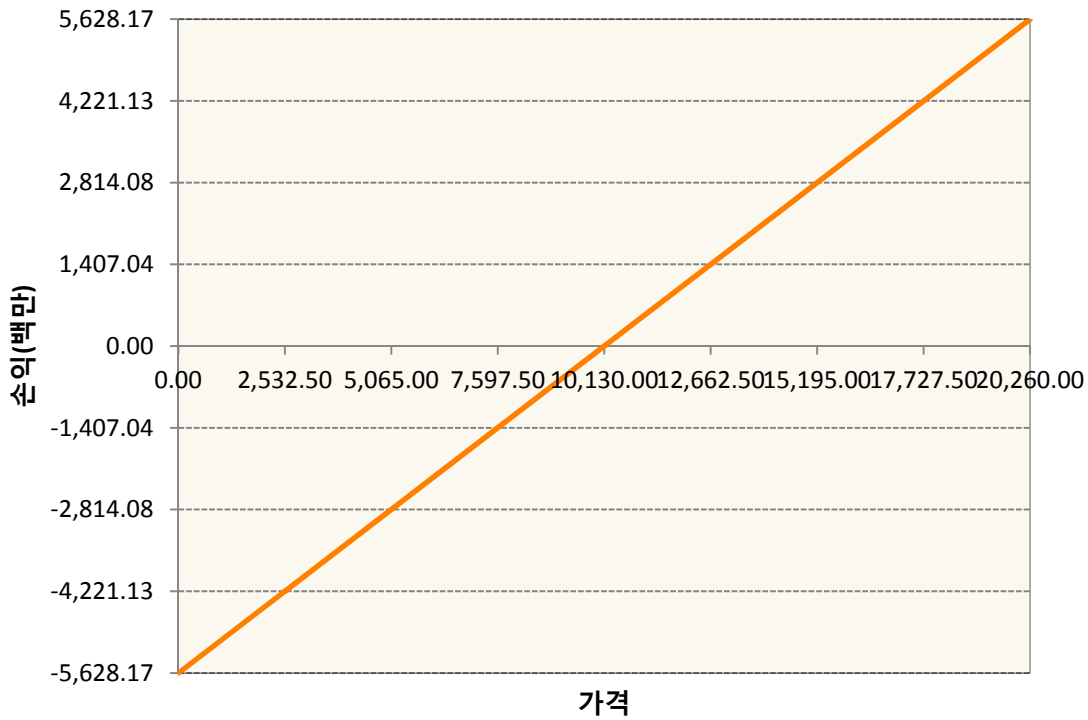
1. 계약금액

(단위:백만원)

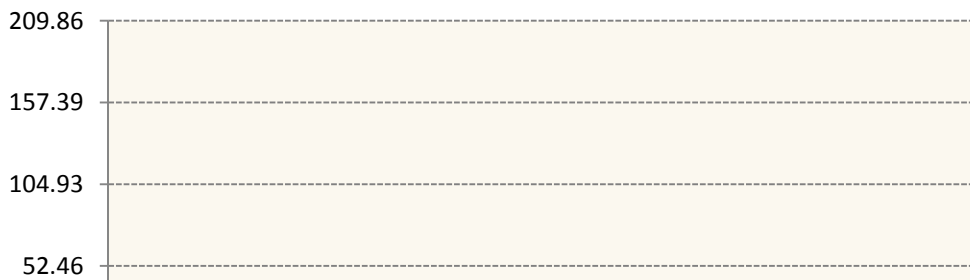
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	5,628	0	5,628	장내
누계	유가증권	옵션	0	12,269	-12,269	장내
누계	통화	선도	0	2,712	-2,712	장외

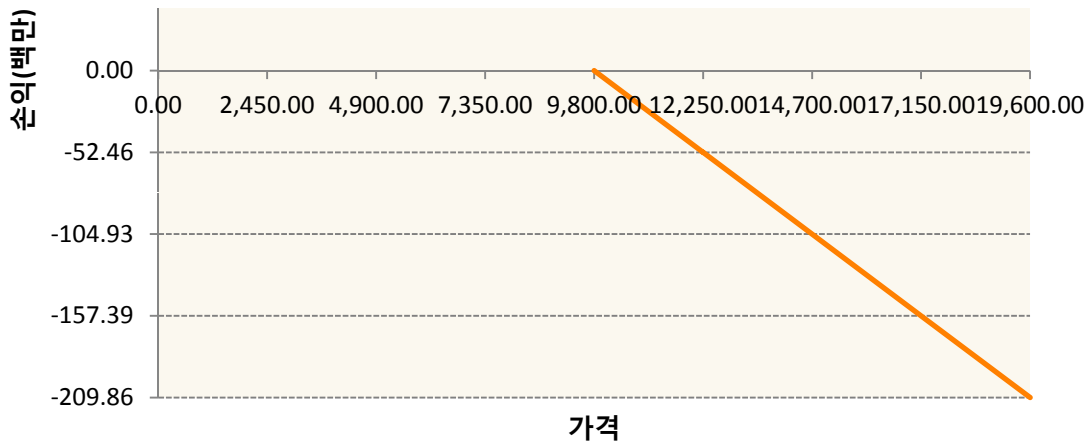
2. 만기시점의 손익구조

HCF9-HSCEI FUTURES JAN19

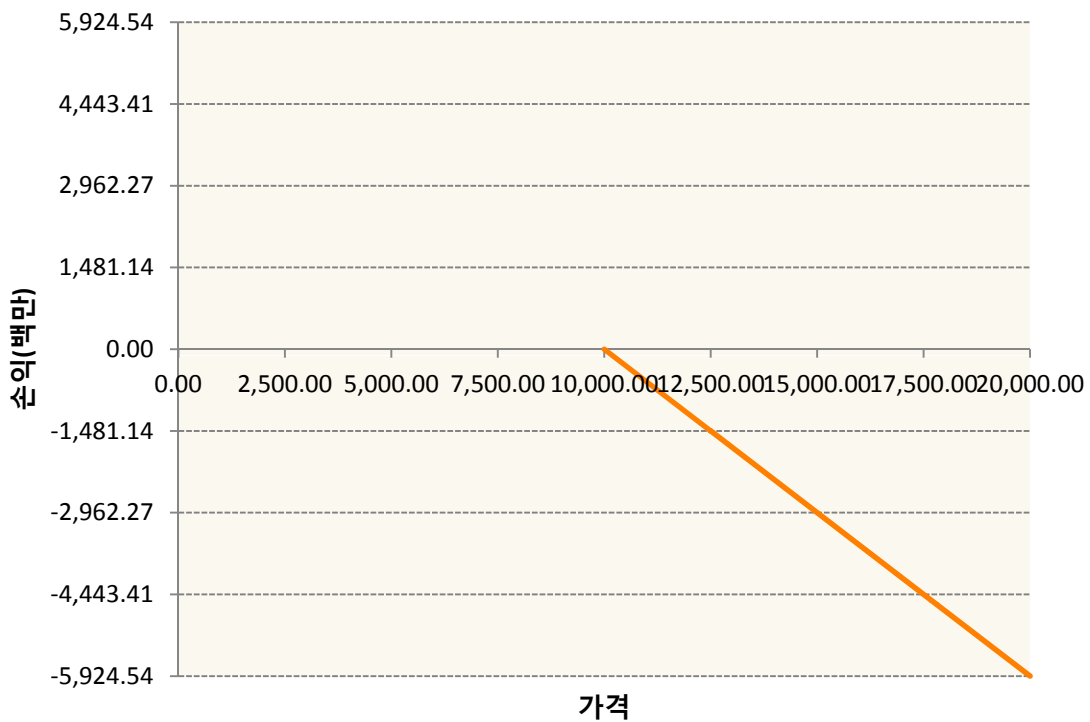


OHHIF9-C098-HSCEI

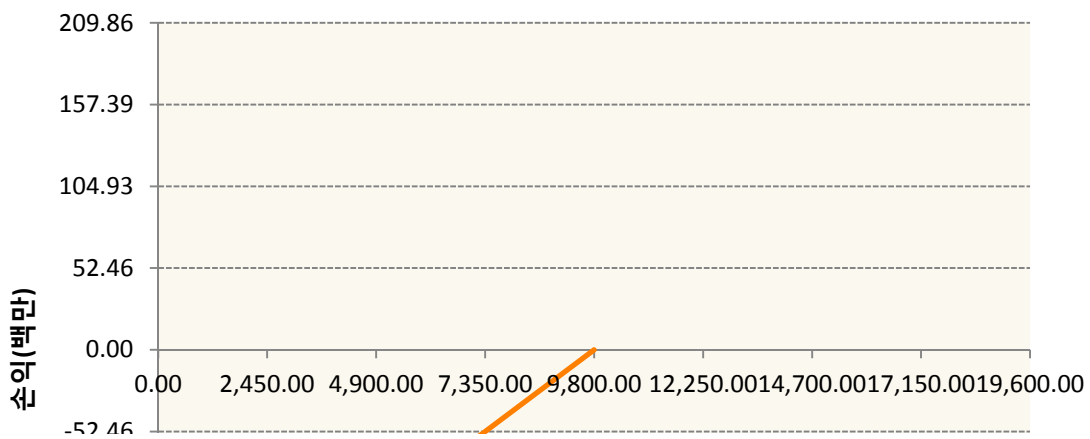


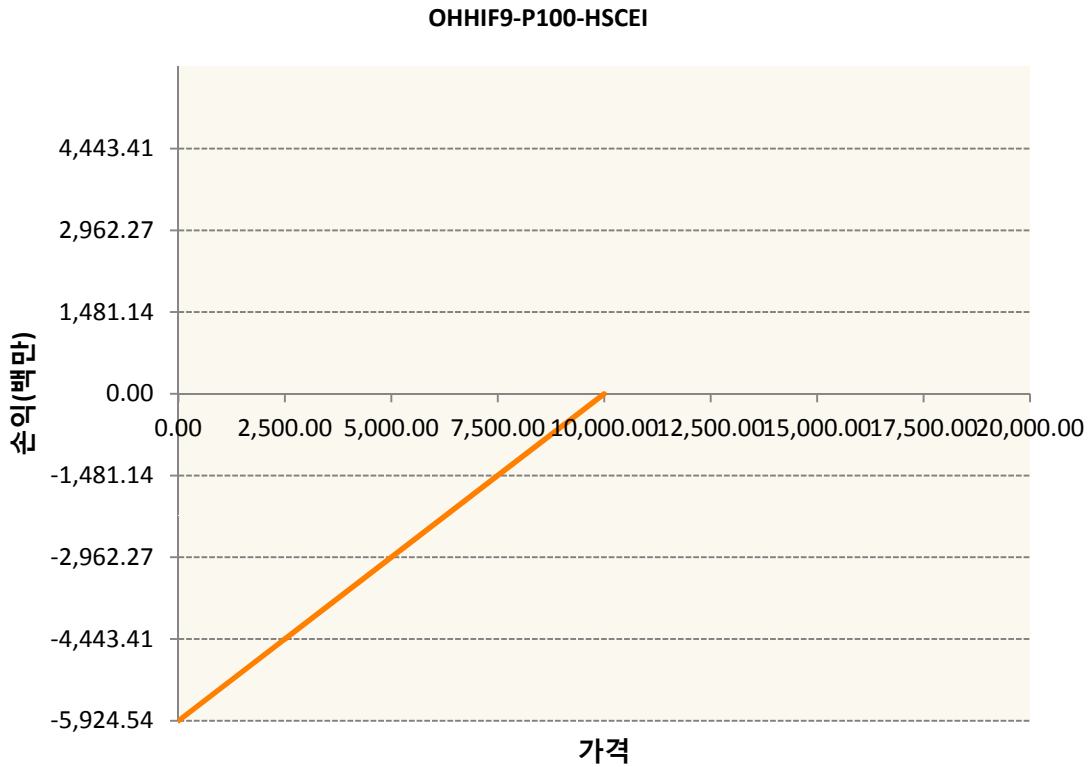
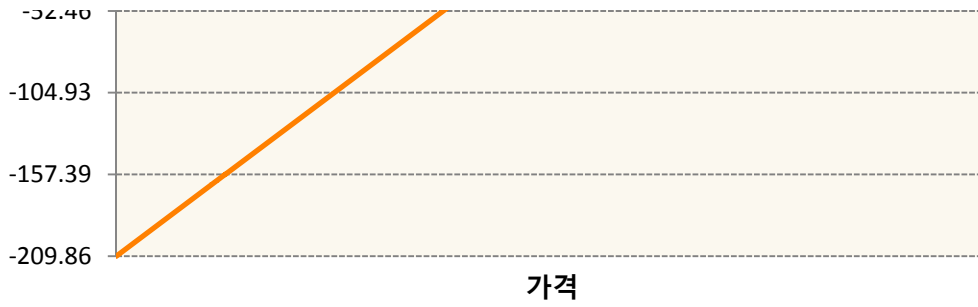


OHHIF9-C100-HSCEI



OHHIF9-P098-HSCEI





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

FX21018Z00 KRW/HKD 11-03-19E	217
HCF9 HSCEI FUTURES JAN19	450
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)

1,539

공시일	2019-01-08
기준일	2019-01-07

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

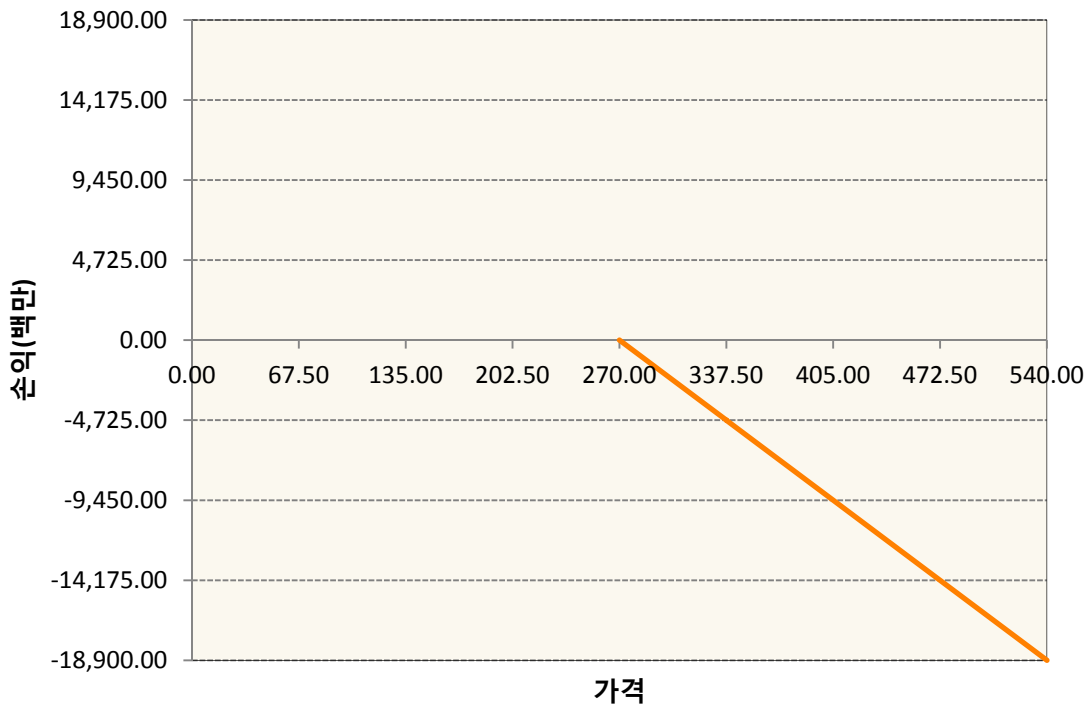
1. 계약금액

(단위:백만원)

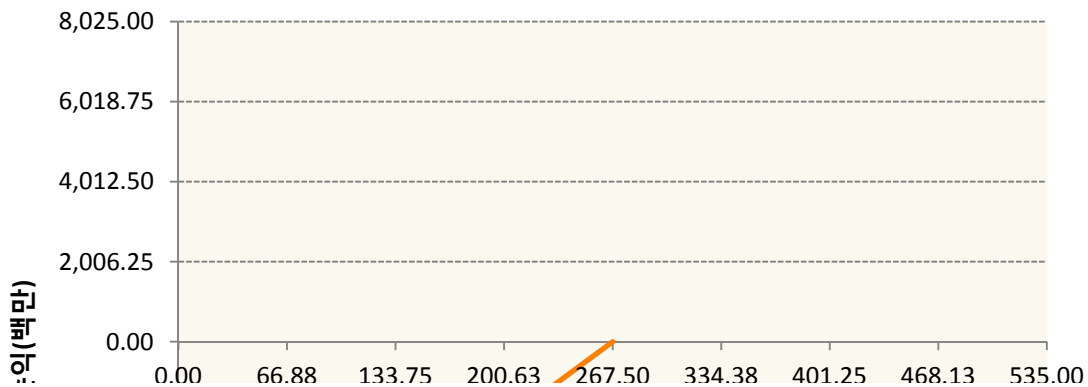
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	스왑	31,836	0	31,836	장외
누계	유가증권	옵션	0	34,350	-34,350	장내

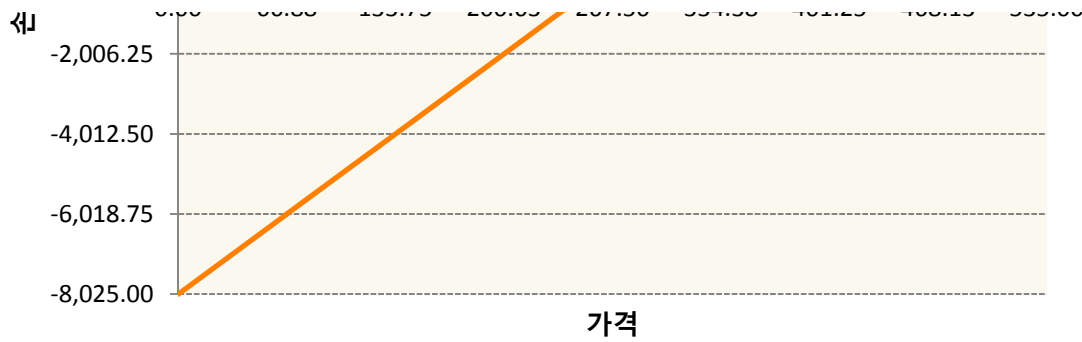
2. 만기시점의 손익구조

KR4201P12706-2019-01 콜270

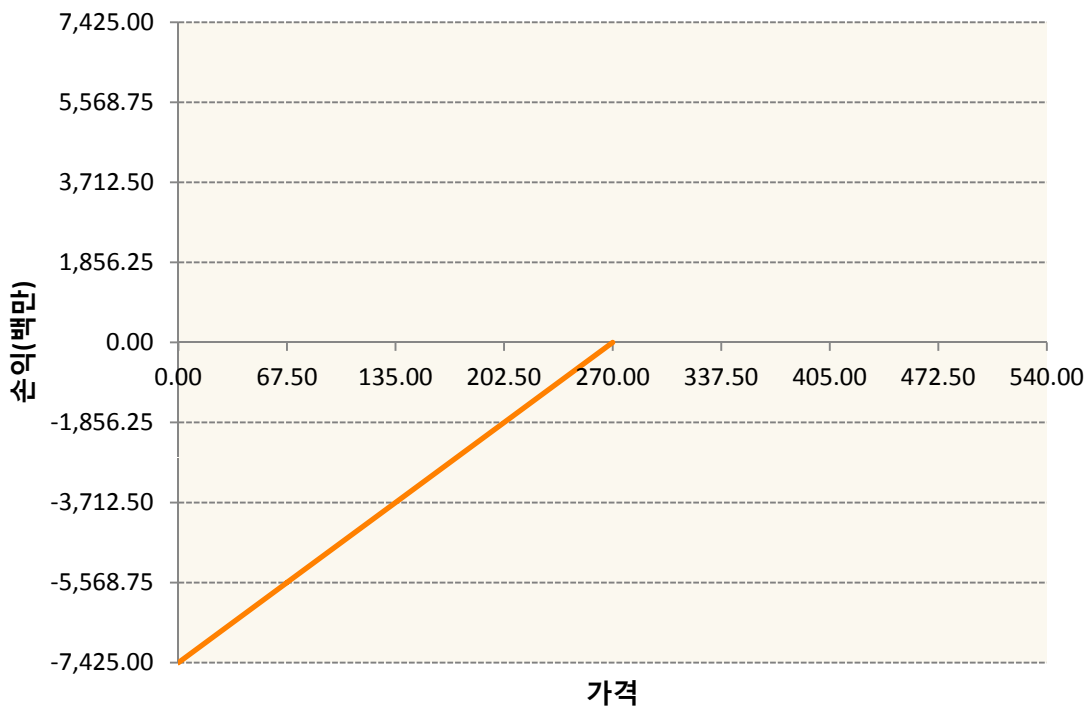


KR4301P12670-2019-01 풋267.5





KR4301P12704-2019-01 풋270



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

	2.529E+11		UBCSFXC1 INDEX_14				2,639	
	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%	-1,759	-1,759	-1,759	-1,759	-1,759	-1,759	-1,759	
-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%	1,759	1,759	1,759	1,759	1,759	1,759	1,759	
8.00%	2,639	2,639	2,639	2,639	2,639	2,639	2,639	
	KR4201P12706		2019-01 풋270				872	
	기초자산의 변동성							

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	21	21	21	21	21	21	21
-5.33%	21	21	21	21	21	21	20
-2.67%	21	21	20	20	19	17	15
0%	15	11	6	0	-7	-15	-23
2.67%	-72	-87	-102	-117	-132	-147	-162
5.33%	-390	-398	-408	-419	-430	-442	-454
8.00%	-855	-856	-857	-860	-863	-867	-872

KR4301P12670 2019-01 풋267.5 623

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-623	-623	-623	-623	-623	-623	-623
-5.33%	-414	-414	-414	-414	-414	-414	-414
-2.67%	-205	-205	-205	-205	-205	-205	-205
0%	3	2	1	0	-2	-3	-6
2.67%	158	154	150	146	142	138	134
5.33%	182	182	181	181	180	179	177
8.00%	182	182	182	182	182	182	182

KR4301P12704 2019-01 풋270 574

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-574	-574	-574	-574	-574	-574	-574
-5.33%	-383	-383	-383	-383	-383	-383	-383
-2.67%	-191	-191	-191	-191	-191	-191	-191
0%	1	1	0	0	-1	-1	-2
2.67%	174	171	167	164	160	156	153
5.33%	231	230	229	227	225	223	221
8.00%	233	233	233	233	232	232	232

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

(단위:백만원)

4,737

공시일	2019-01-08
기준일	2019-01-07

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

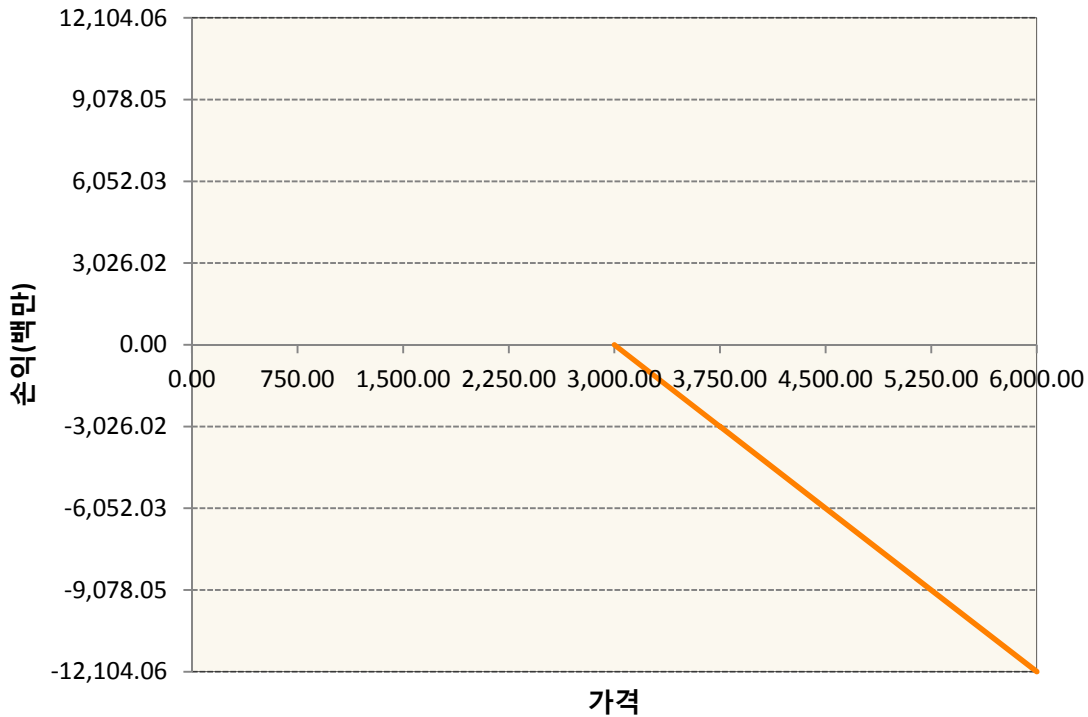
1. 계약금액

(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	6,553	0	6,553	
누계	유가증권	스왑	71,315	0	71,315	장외
누계	유가증권	옵션	0	24,826	-24,826	장내
누계	통화	선도	0	15,322	-15,322	장외

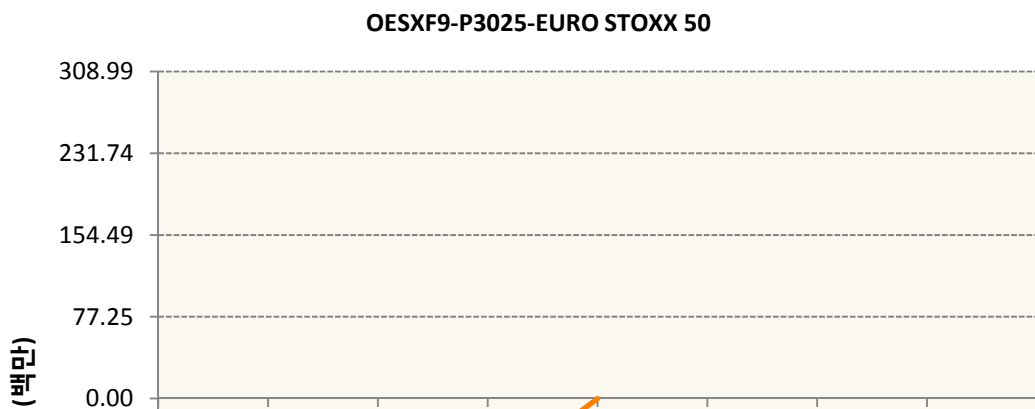
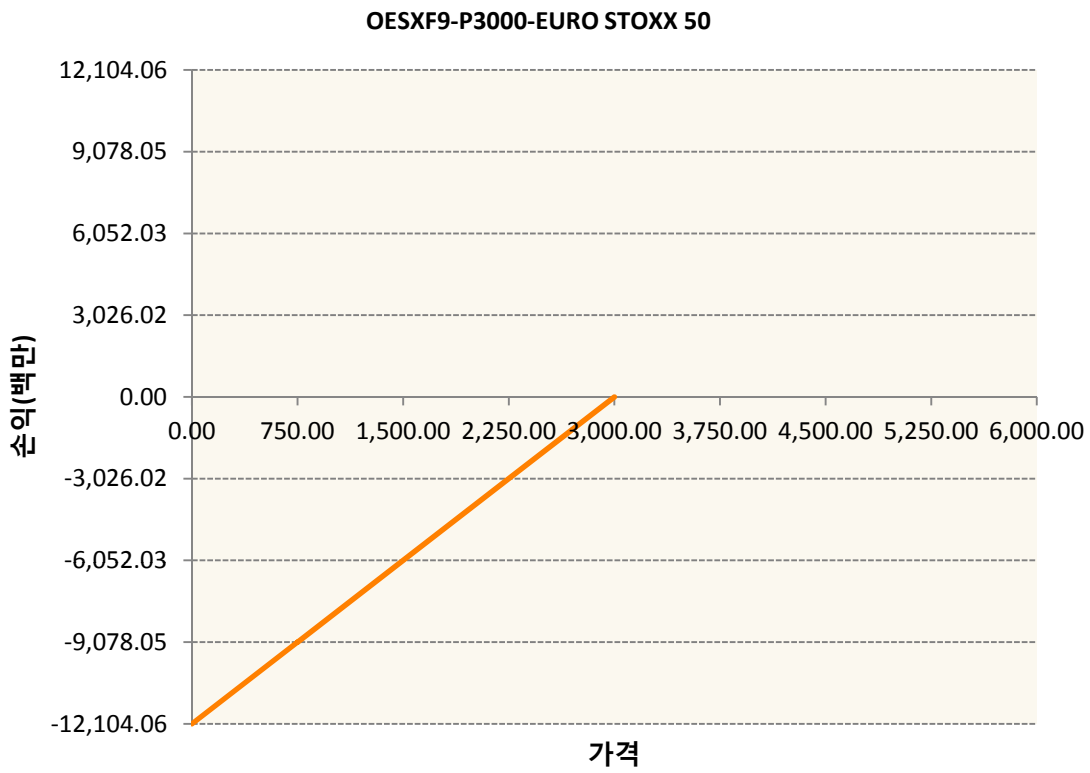
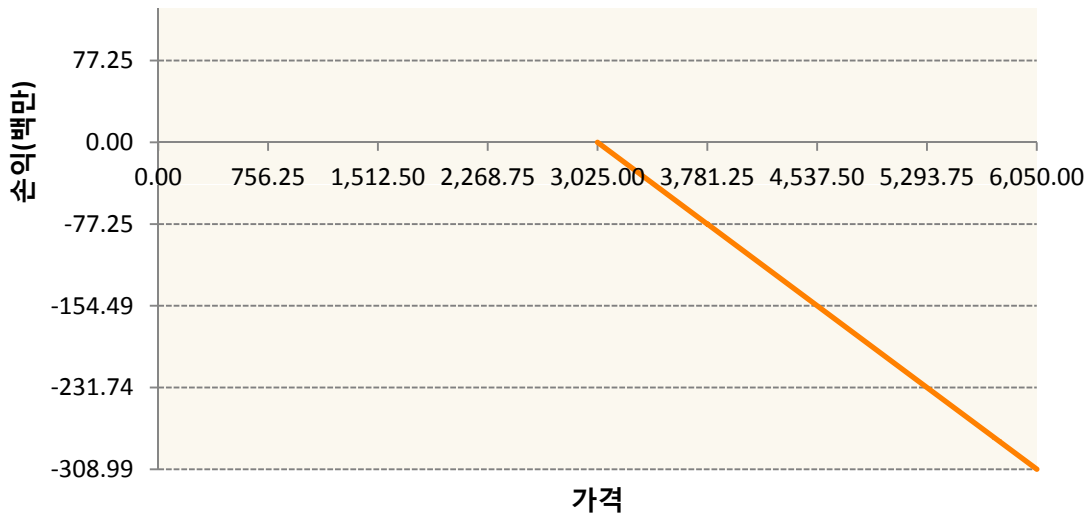
2. 만기시점의 손익구조

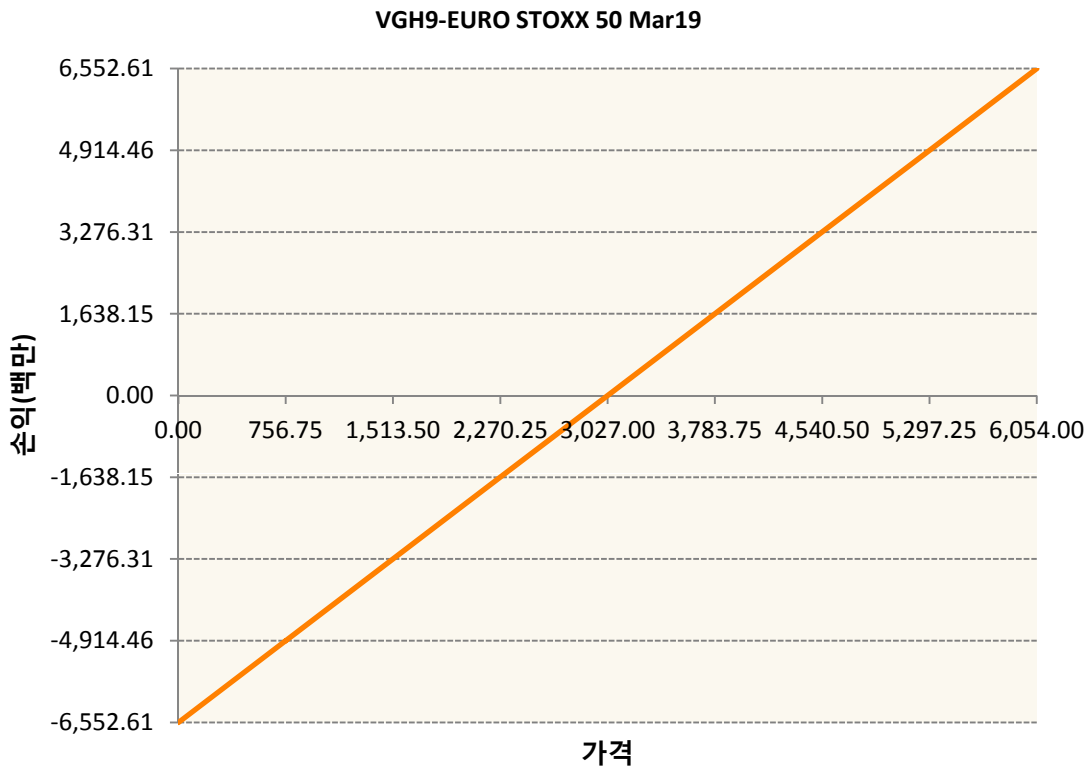
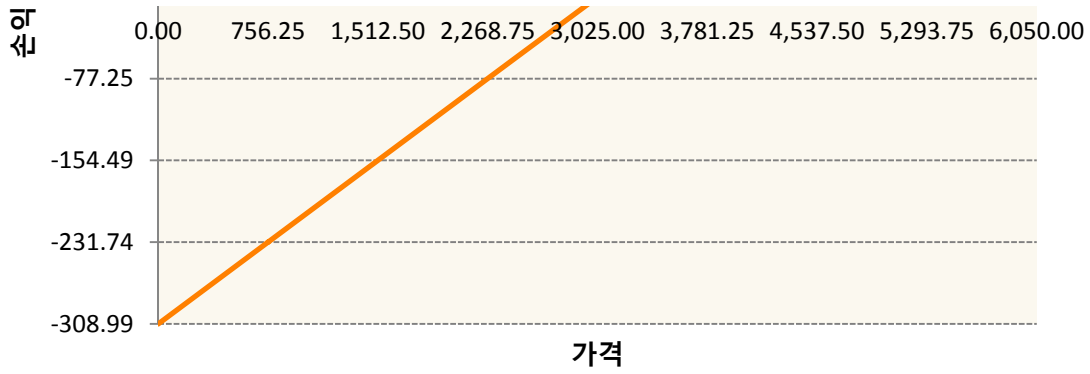
OESXF9-C3000-EURO STOXX 50



OESXF9-C3025-EURO STOXX 50







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY		109
FX21018X02 KRW/EUR 22-02-19E		409
FX21018Z03 KRW/EUR 22-03-19E		817
OESXF9-C30 EURO STOXX 50		968
OESXF9-C30 EURO STOXX 50		25
OESXF9-P30 EURO STOXX 50		968
OESXF9-P30 EURO STOXX 50		25
VGH9 EURO STOXX 50 Mar19		524

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

(단위:백만원)

2,537

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

(단위:백만원)

1,064

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

(단위:백만원)

91

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

(단위:백만원)

136

공시일	2019-01-08
기준일	2019-01-07

스마트KRX300인덱스목표전환형1호

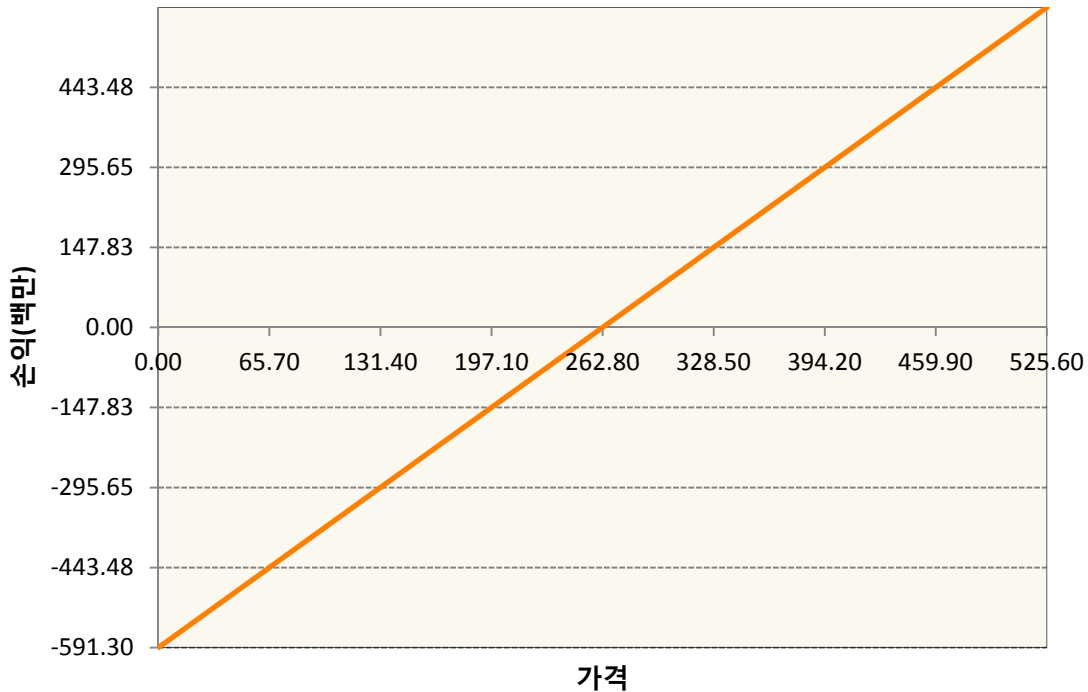
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	591	0	591	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	2019-01-08
기준일	2019-01-07

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

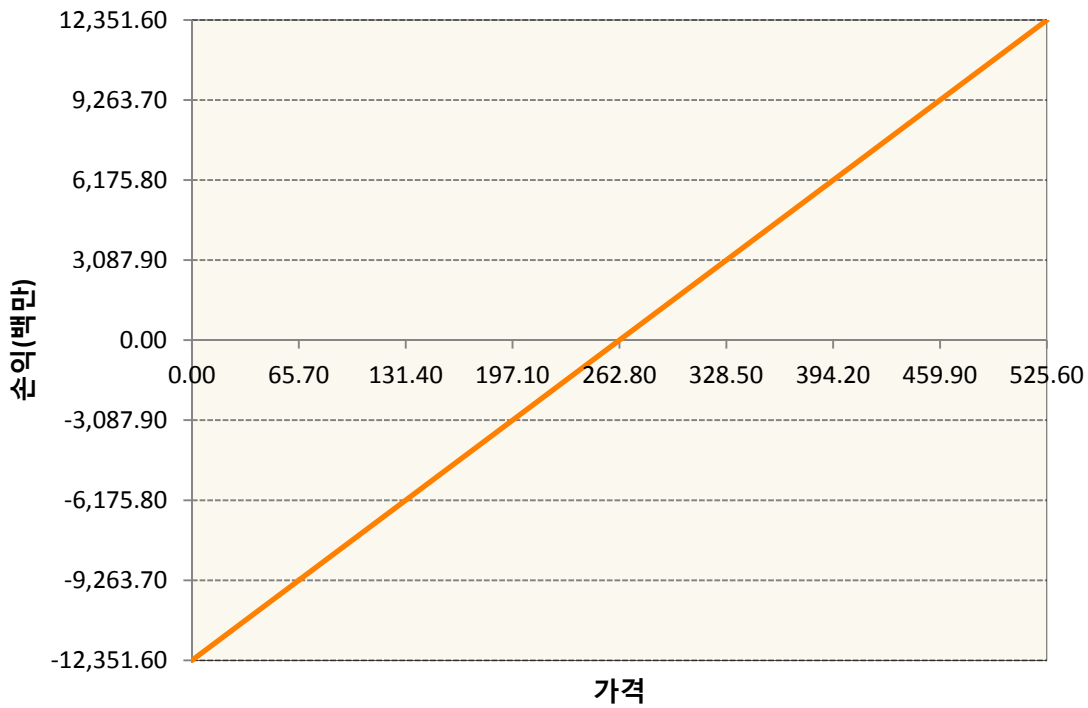
1. 계약금액

(단위:백만원)

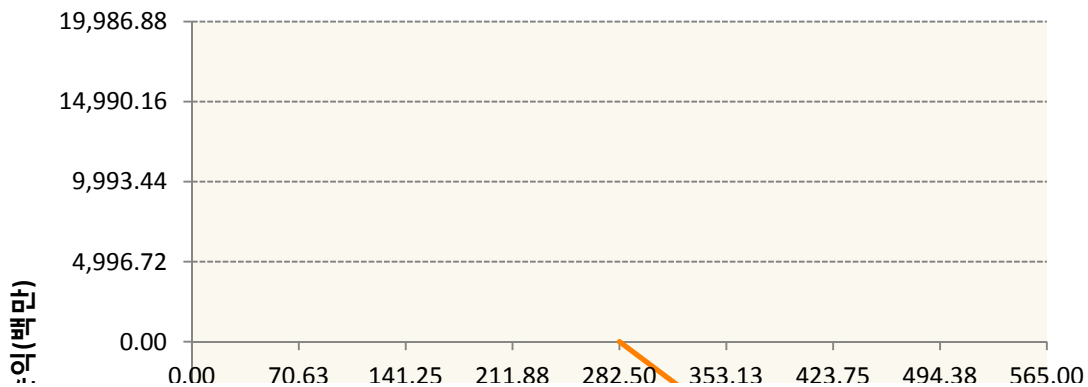
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	12,352	0	12,352	장내
누계	유가증권	옵션	1,145	23,549	-22,404	장내

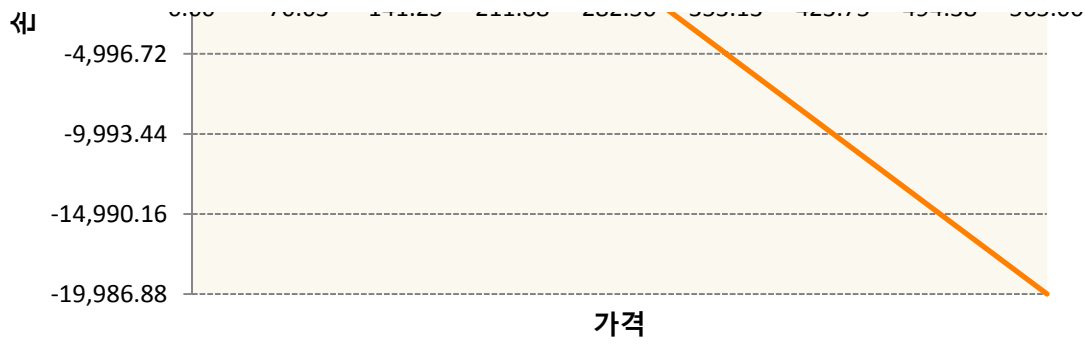
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P30007-2019-03 코스피200지수선물

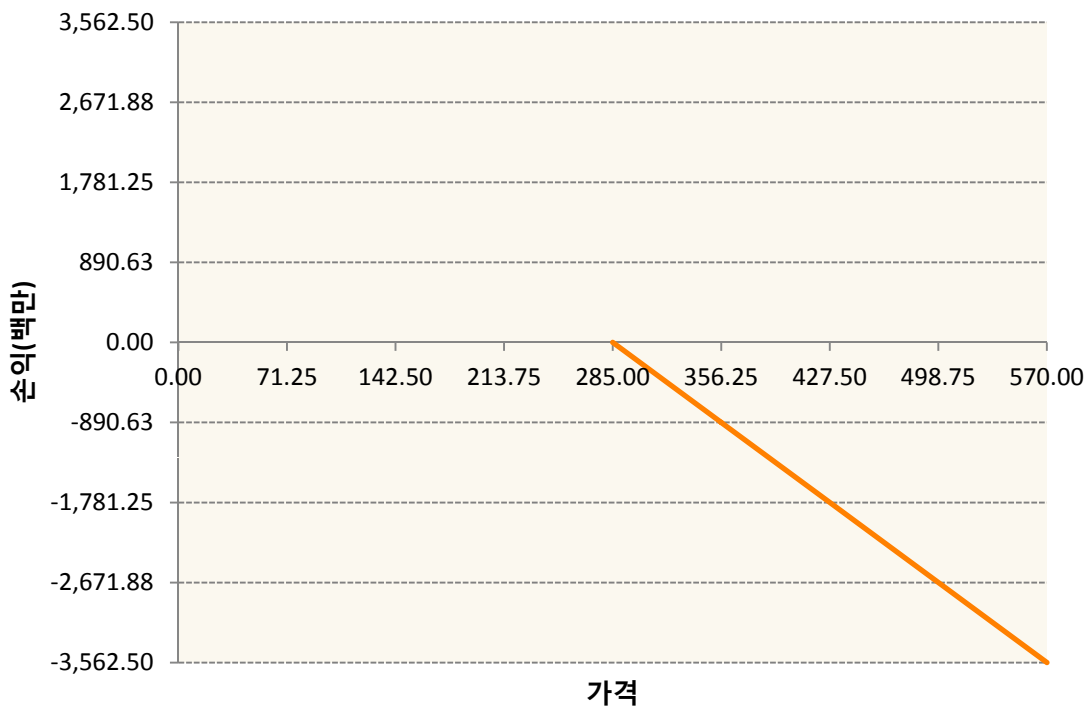


KR4201P12821-2019-01 콜282.5

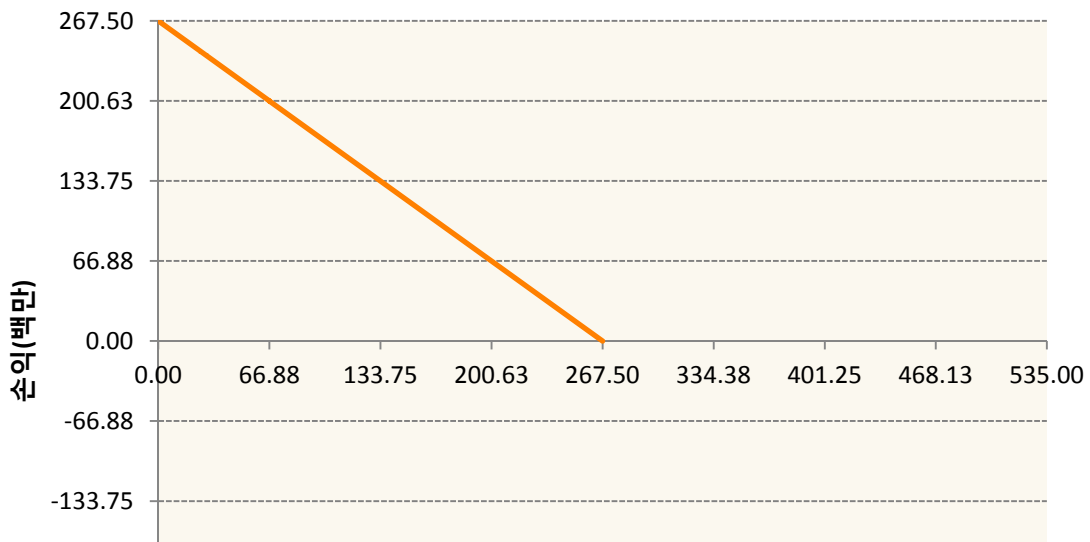


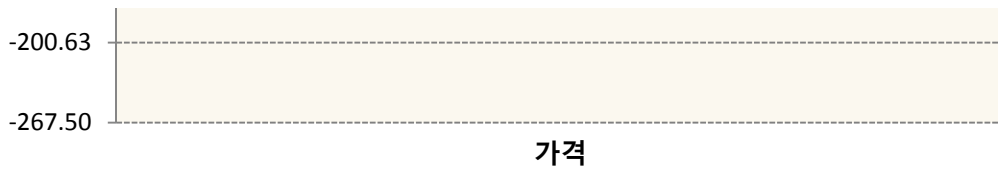


KR4201P12854-2019-01 콜285

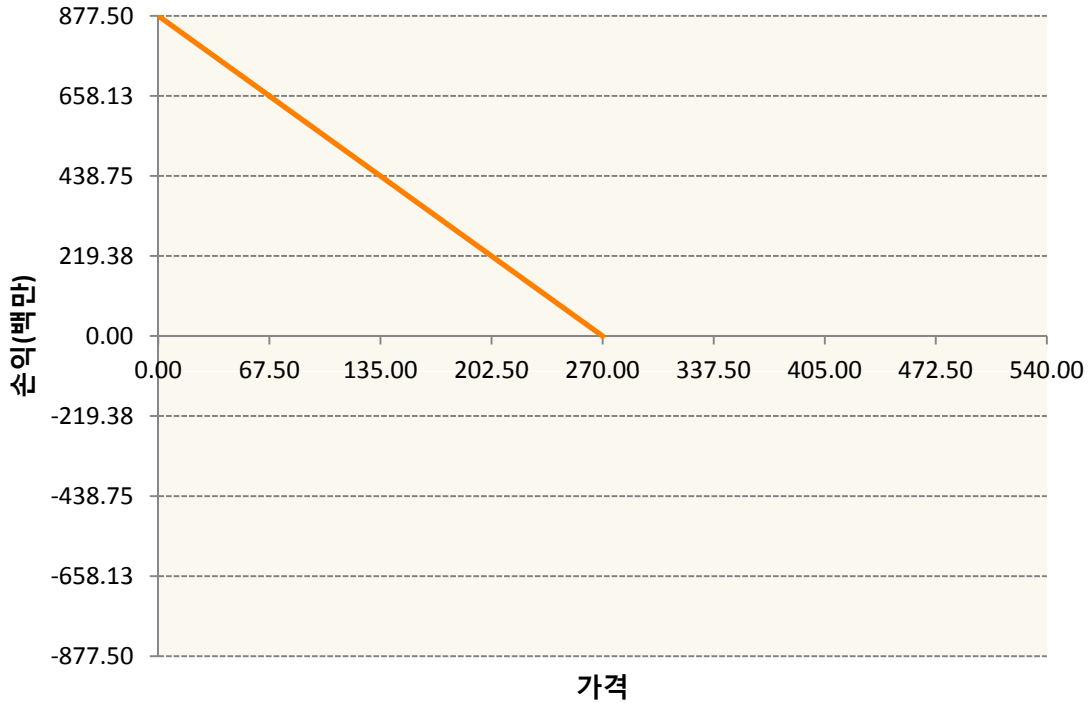


KR4301P12670-2019-01 풋267.5





KR4301P12704-2019-01 풋270



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101P30007		2019-03 코스피200지수선물						984
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-984	-984	-984	-984	-984	-984	-984	
-5.33%	-656	-656	-656	-656	-656	-656	-656	
-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%	656	656	656	656	656	656	656	
8.00%	984	984	984	984	984	984	984	
KR4201P12821		2019-01 콜282.5						243
		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	-1
2.67%	0	-1	-2	-3	-5	-8	-12
5.33%	-14	-21	-29	-38	-48	-59	-70
8.00%	-146	-162	-178	-195	-211	-227	-243
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	0	0	-1	-1
5.33%	-1	-1	-2	-3	-4	-6	-7
8.00%	-13	-16	-18	-21	-24	-27	-29
KR4301P12670 2019-01 풋267.5							21
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	21	21	21	21	21	21	21
-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%	-5	-5	-5	-5	-5	-5	-4
5.33%	-6	-6	-6	-6	-6	-6	-6
8.00%	-6	-6	-6	-6	-6	-6	-6
KR4301P12704 2019-01 풋270							68
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	68	68	68	68	68	68	68
-5.33%	45	45	45	45	45	45	45
-2.67%	23	23	23	23	23	23	23
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-21	-20	-20	-19	-19	-18	-18
5.33%	-27	-27	-27	-27	-27	-26	-26
8.00%	-27	-27	-27	-27	-27	-27	-27

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

(단위:백만원)

954

공시일	2019-01-08
기준일	2019-01-07

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	170	0	170	

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	2019-01-08
기준일	2019-01-07

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	2,067	0	2,067	

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	2019-01-08
기준일	2019-01-07

H2O글로벌본드(H)(채권혼합-파생)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	112	0	112	
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	수익증권	2,211	0	2,211	
누계	통화	선도	0	2,713	-2,713	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
FX21019F00 KRW/USD 19-02-19E	8
FX21019F00 KRW/USD 19-02-19E	26
FX21019F00 KRW/USD 19-02-19E	8

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

(단위:백만원)

82

공시일	2019-01-08
기준일	2019-01-07

스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

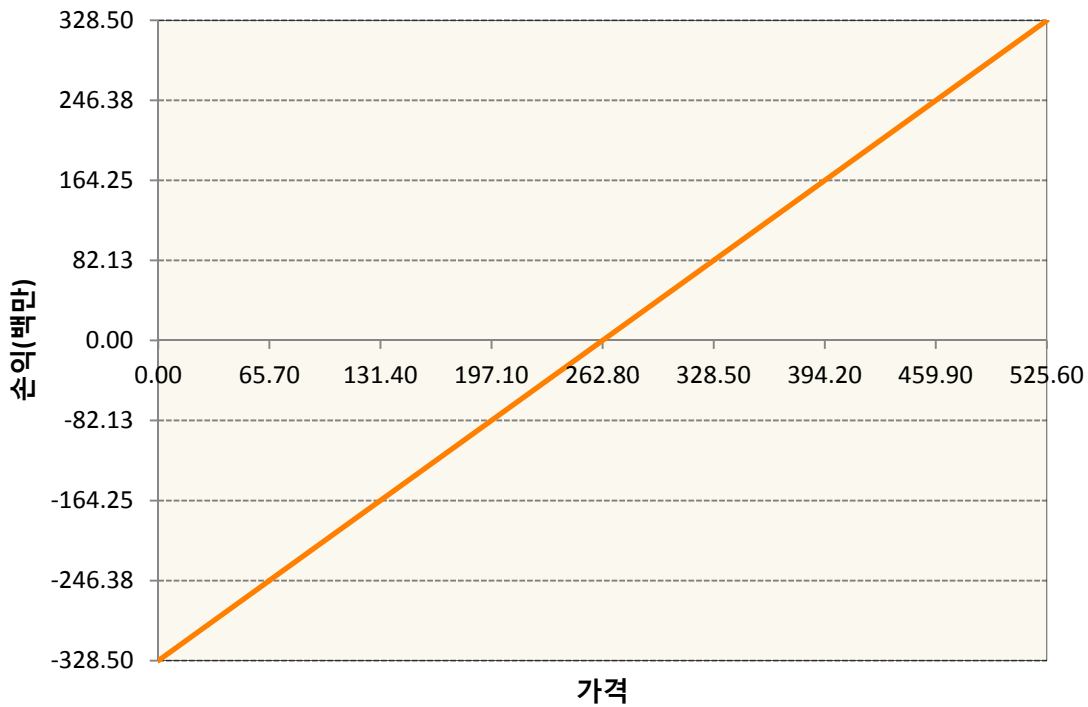
1. 계약금액

(단위:백만원)

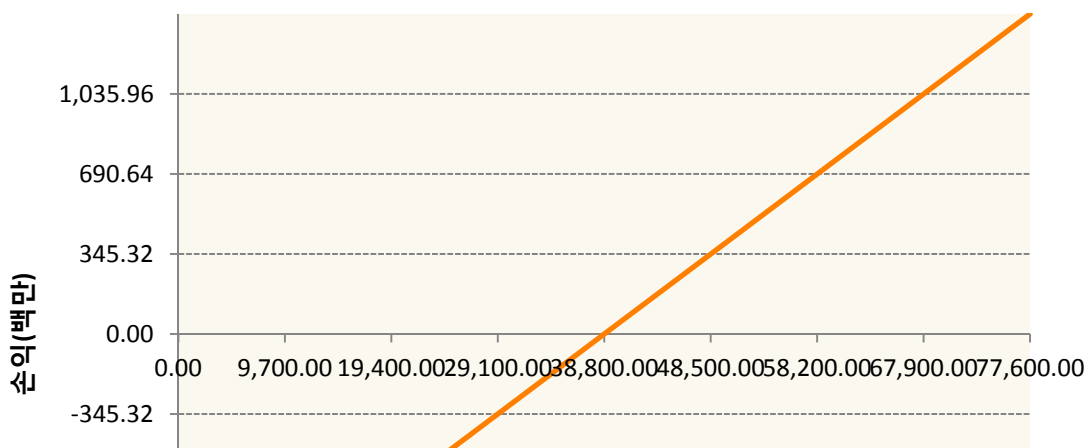
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,710	0	1,710	장내

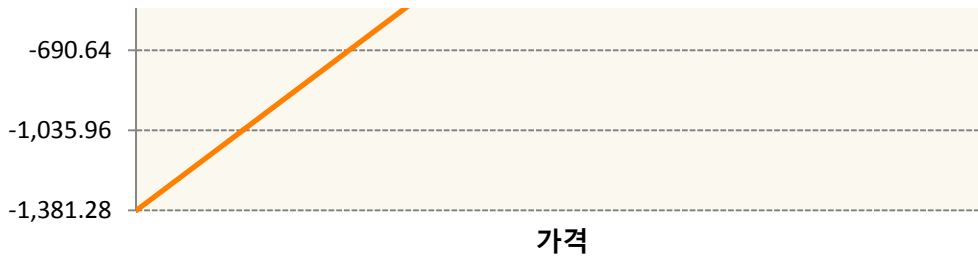
2. 만기시점의 손익구조

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)

149

공시일	2019-01-08
기준일	2019-01-07

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

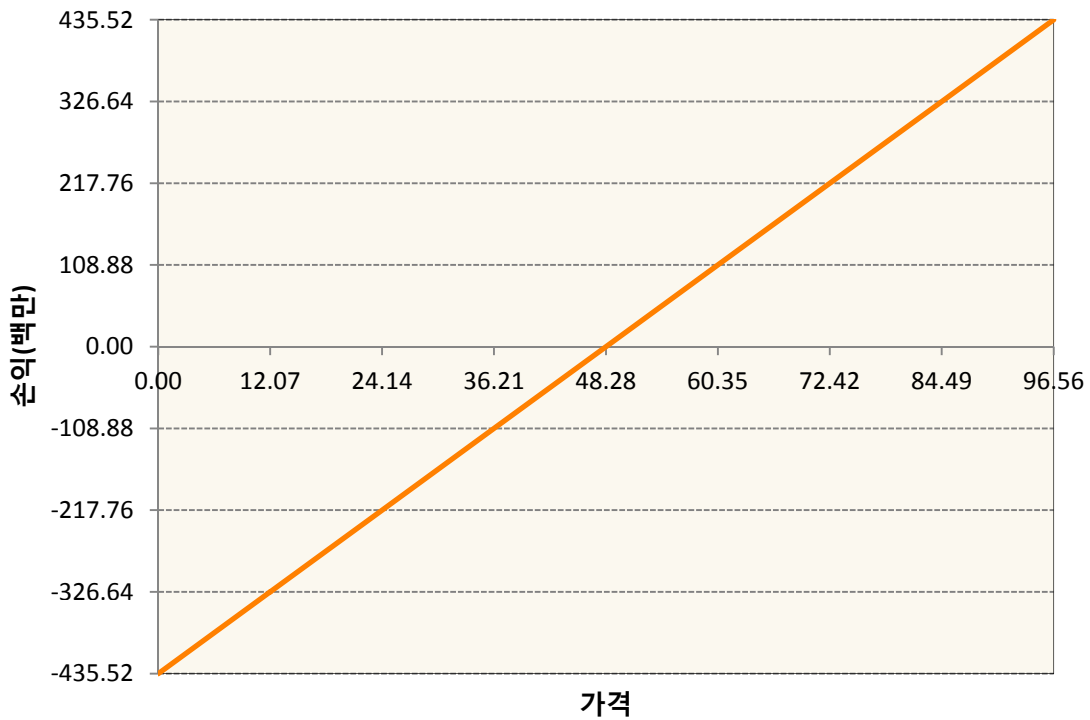
1. 계약금액

(단위:백만원)

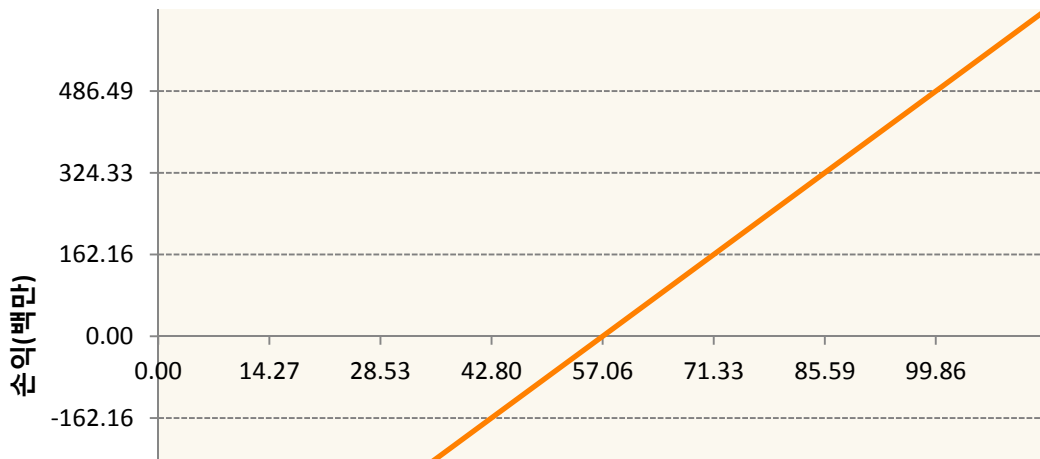
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,531	201	2,330	

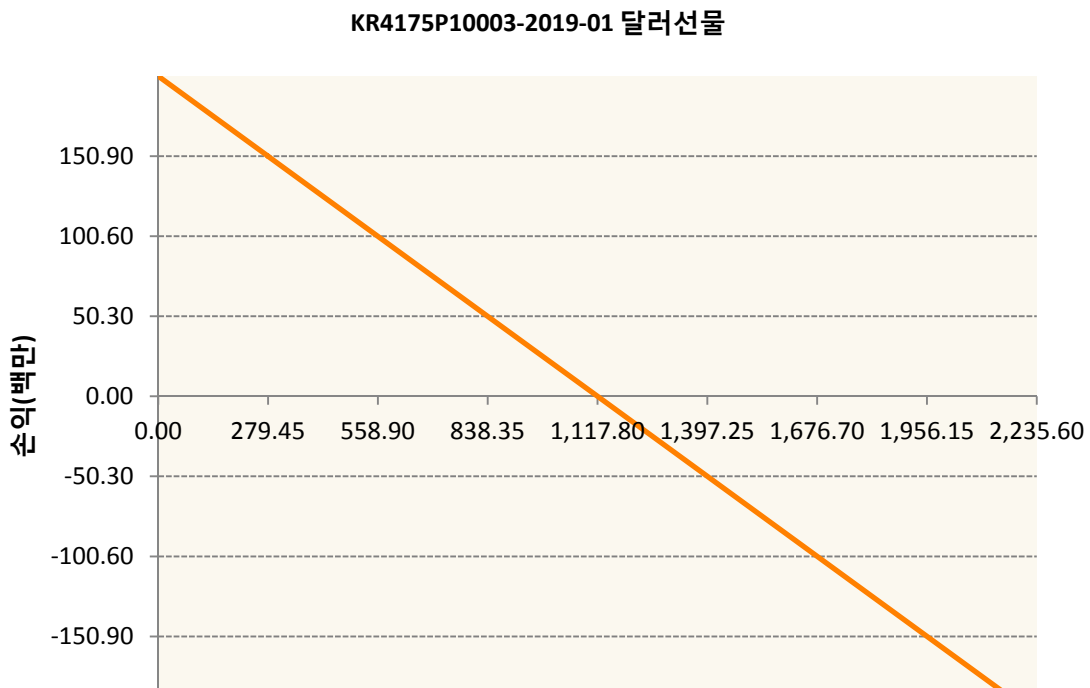
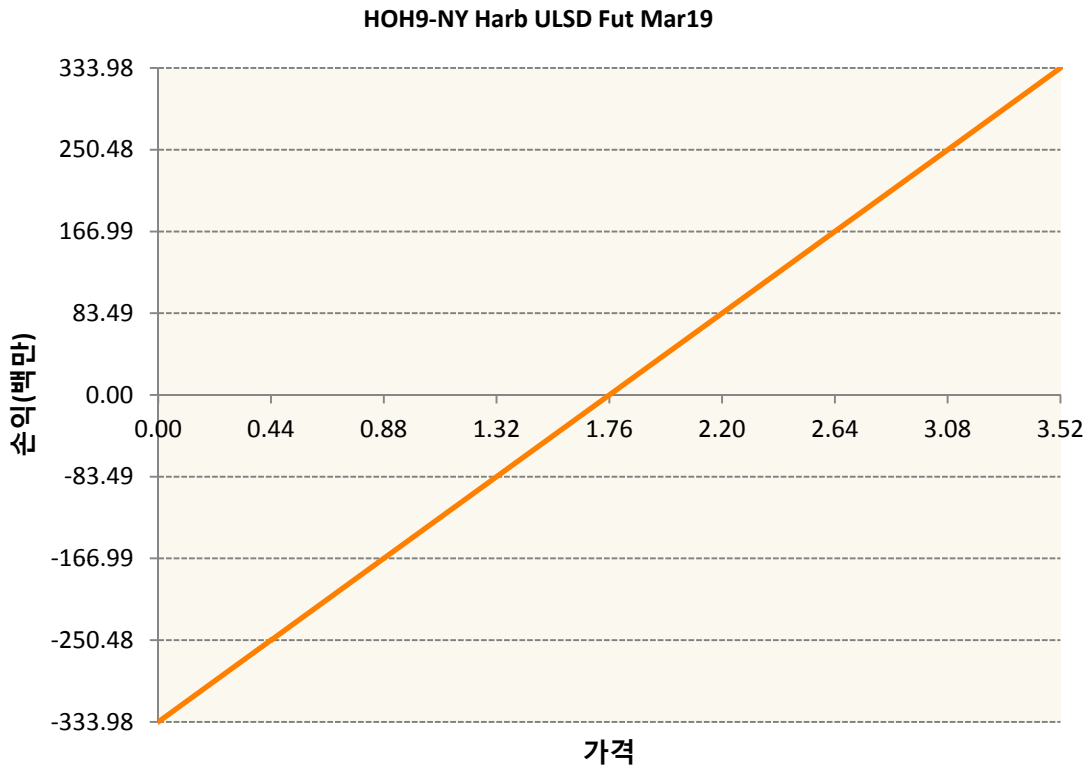
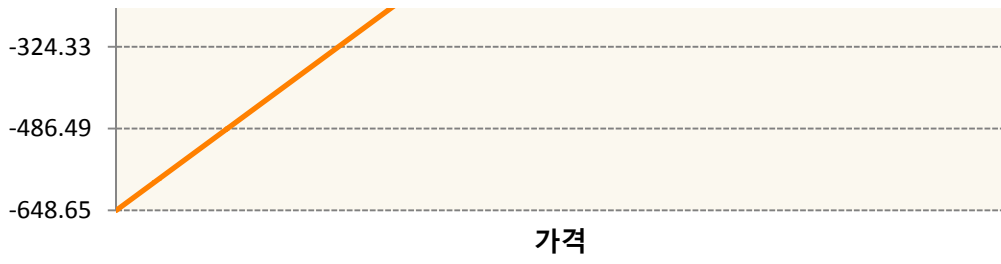
2. 만기시점의 손익구조

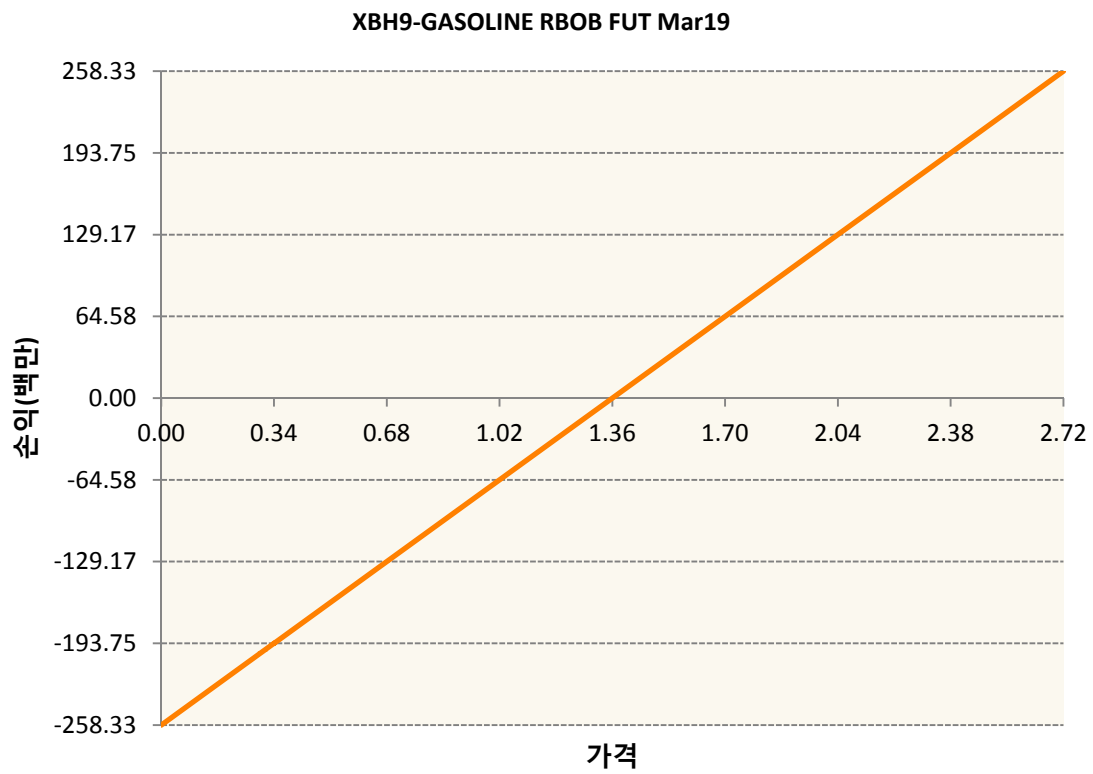
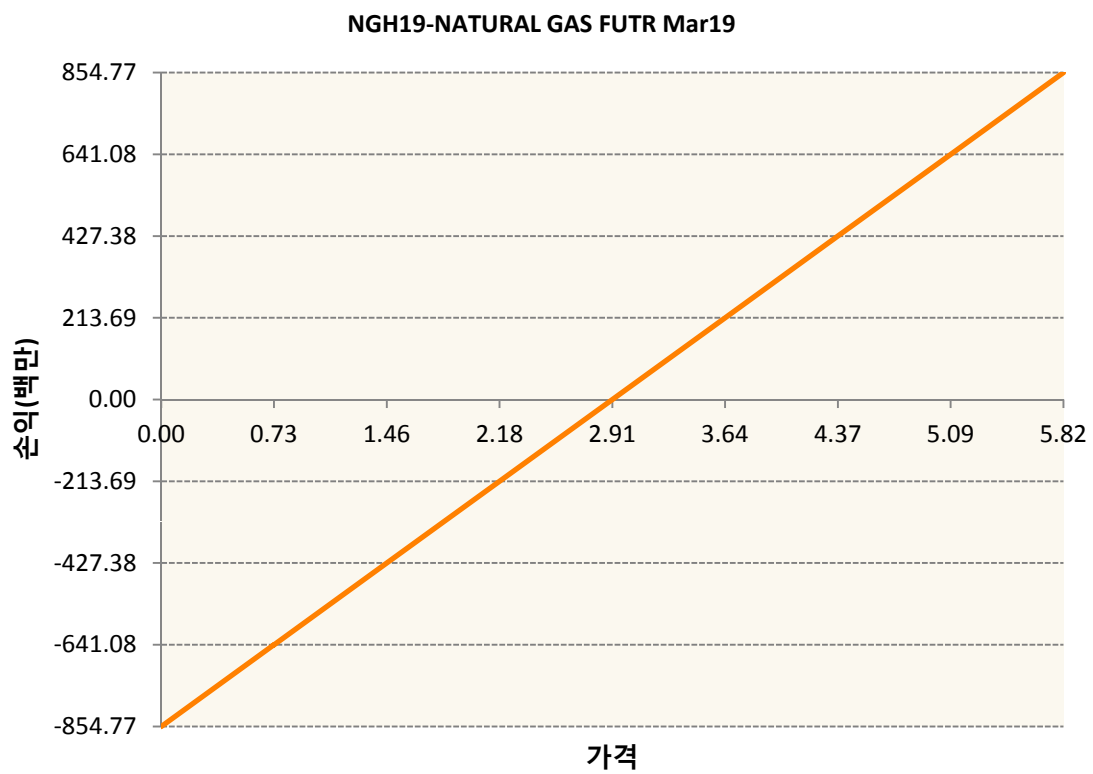
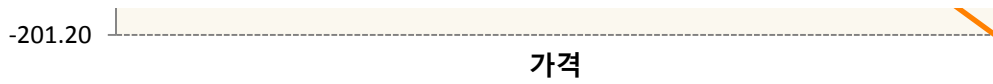
CLH9-WTI CRUDE FUTURE MAR19



COH9-BRENT CRUDE FUTR Mar19







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLH9	WTI CRUDE FUTURE MAR19	35
COH9	BRENT CRUDE FUTR Mar19	52
HOH9	NY Harb ULSD Fut Mar19	27
KR4175P100	2019-01 달러선물	16
NGH19	NATURAL GAS FUTR Mar19	68
XBH9	GASOLINE RBOB FUT Mar19	21

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

388

공시일	2019-01-08
기준일	2019-01-07

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

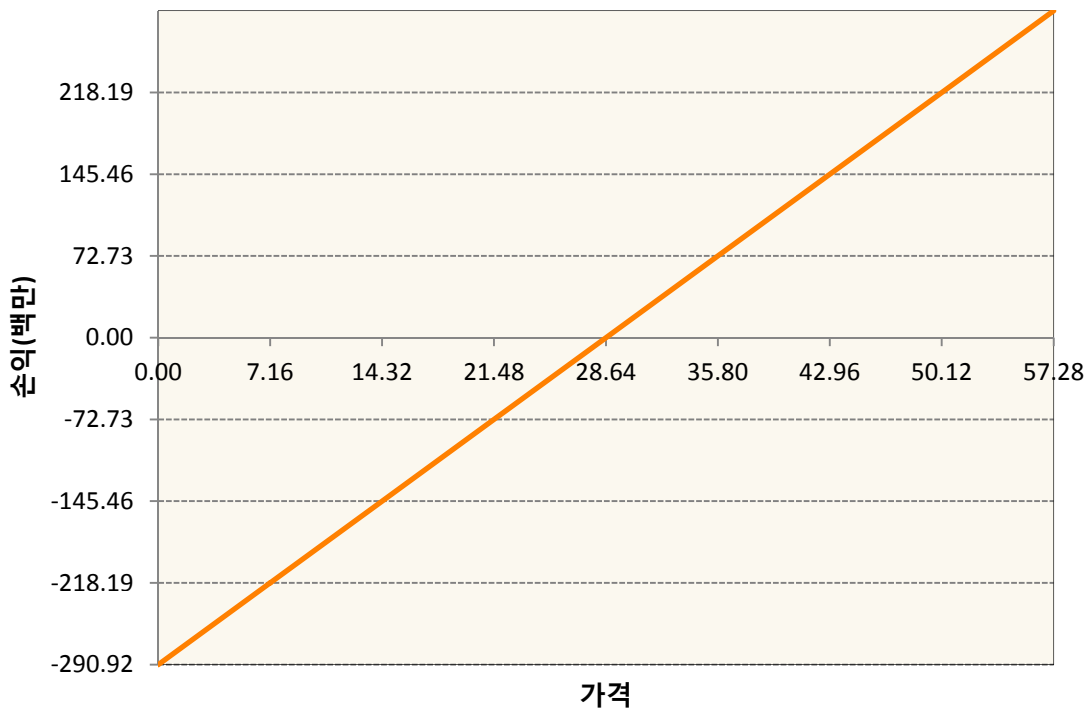
1. 계약금액

(단위:백만원)

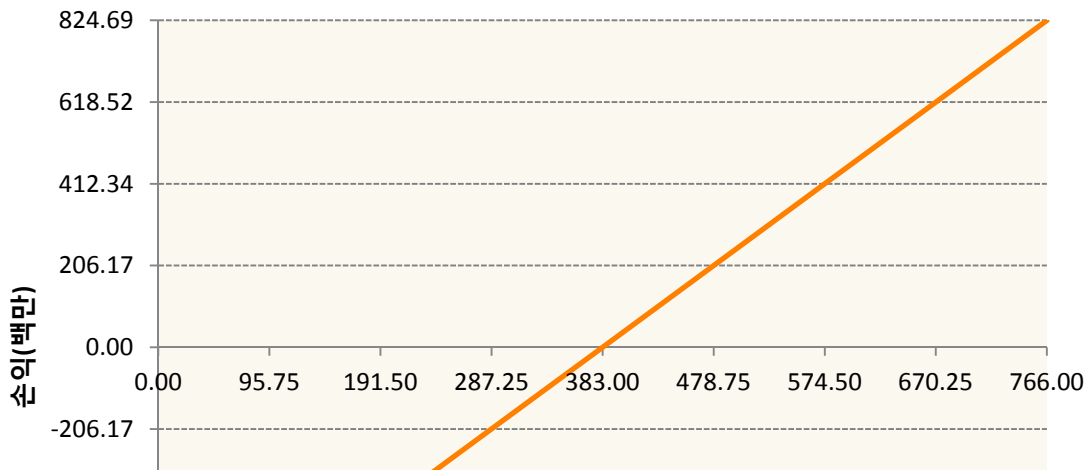
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,591	78	3,512	

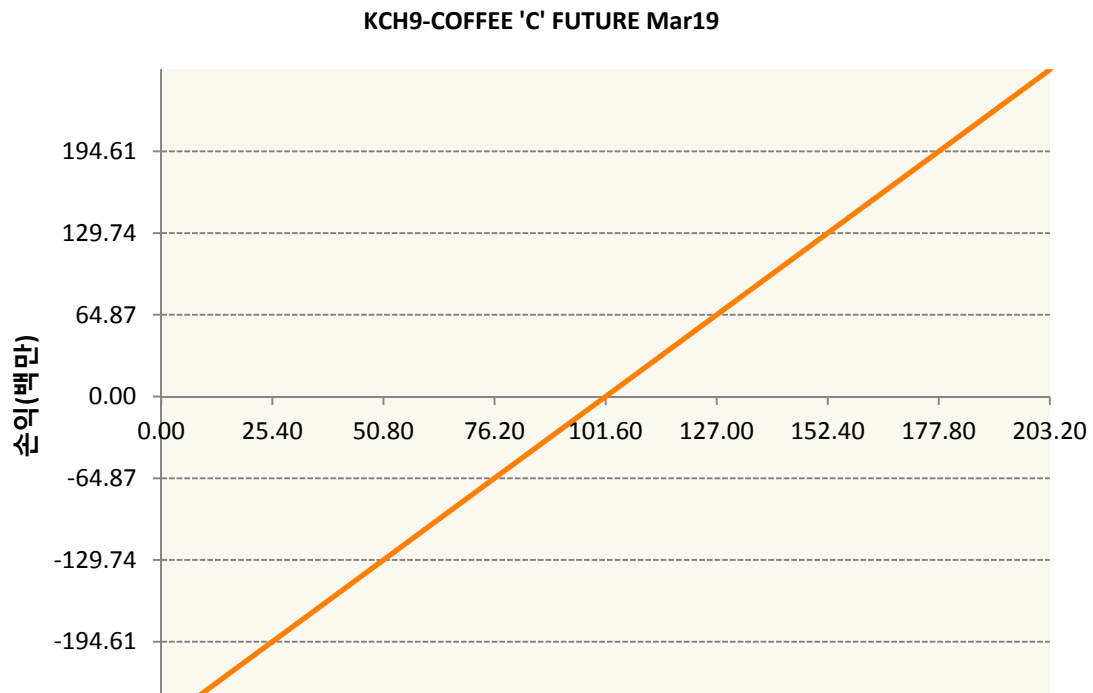
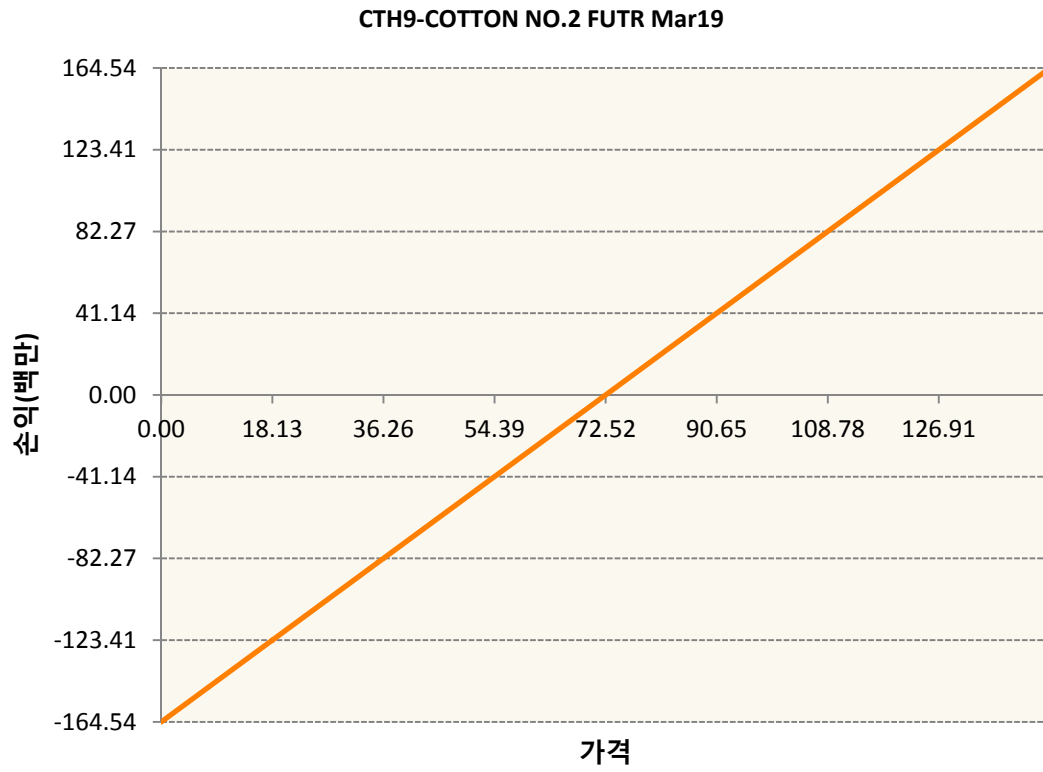
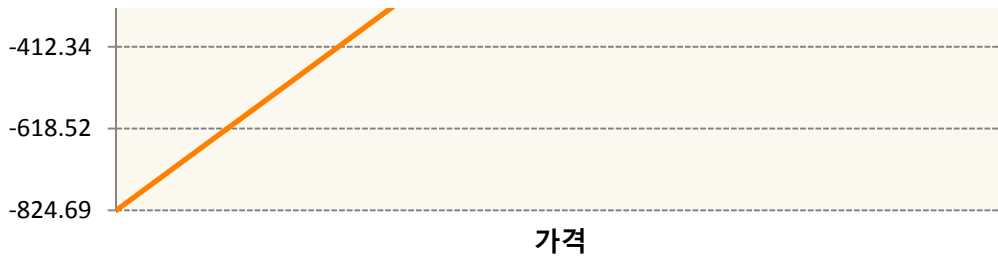
2. 만기시점의 손익구조

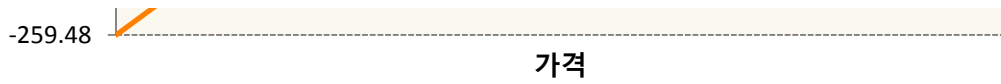
BOH9-SOYBEAN OIL FUTR Mar19



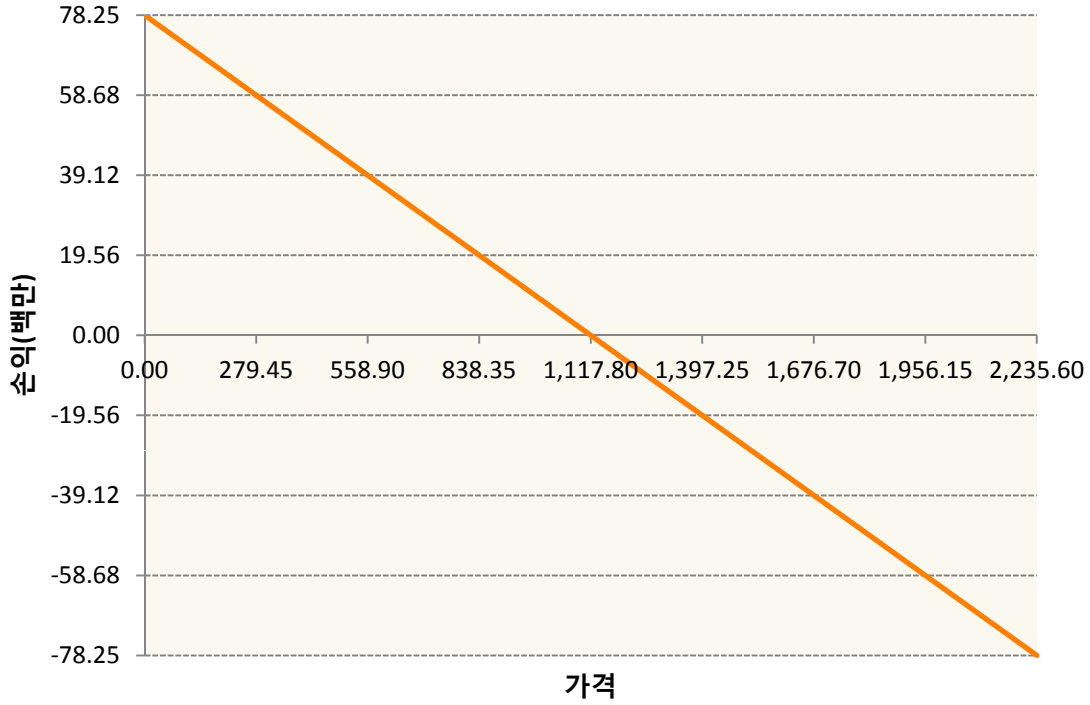
CH9-CORN FUTURE Mar19



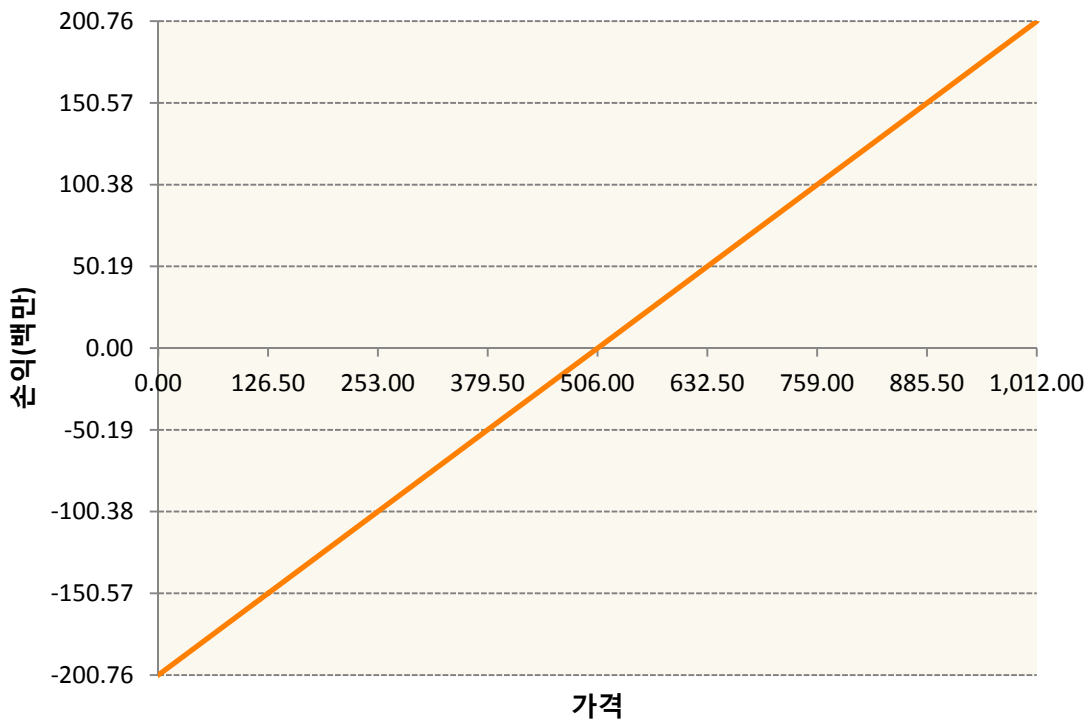




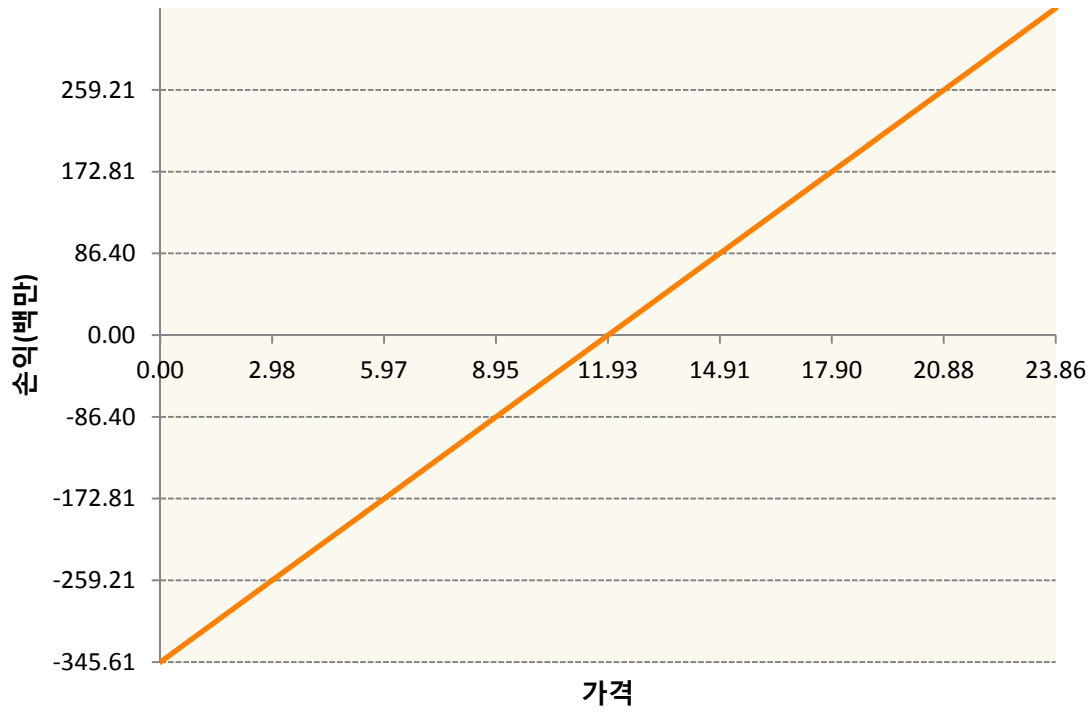
KR4175P10003-2019-01 달러선물



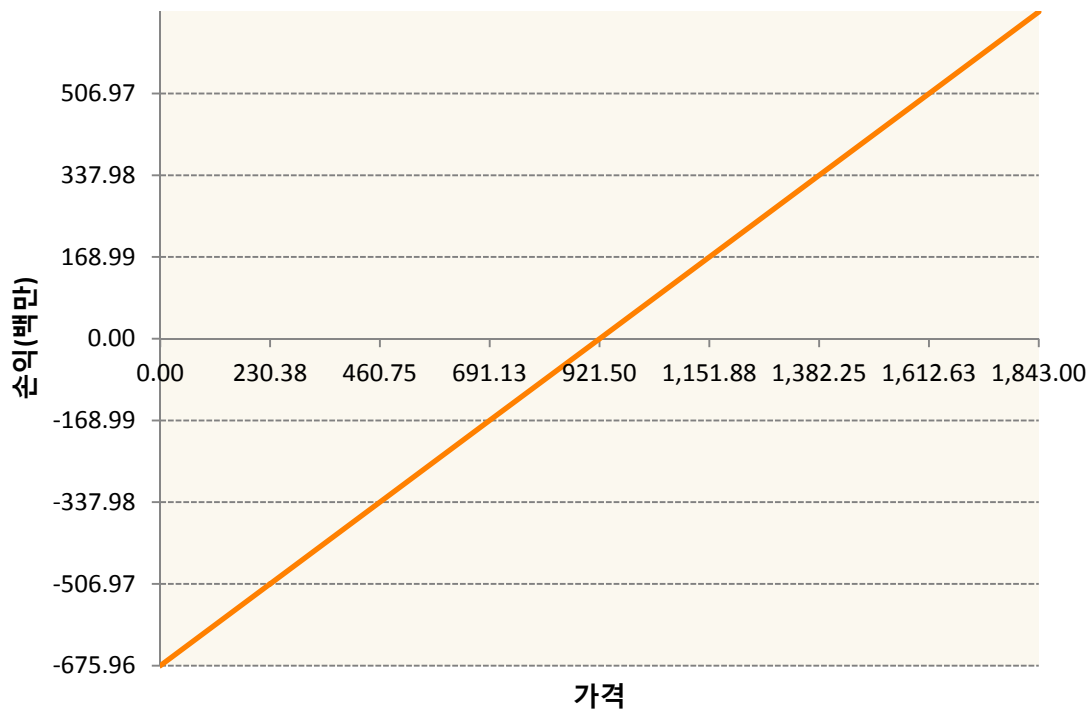
KWH9-KC HRW WHEAT FUT Mar19



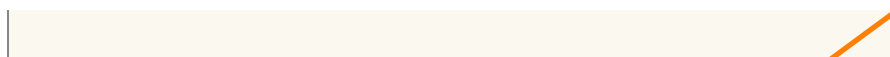
SBH9-SUGAR #11 (WORLD) MAR19

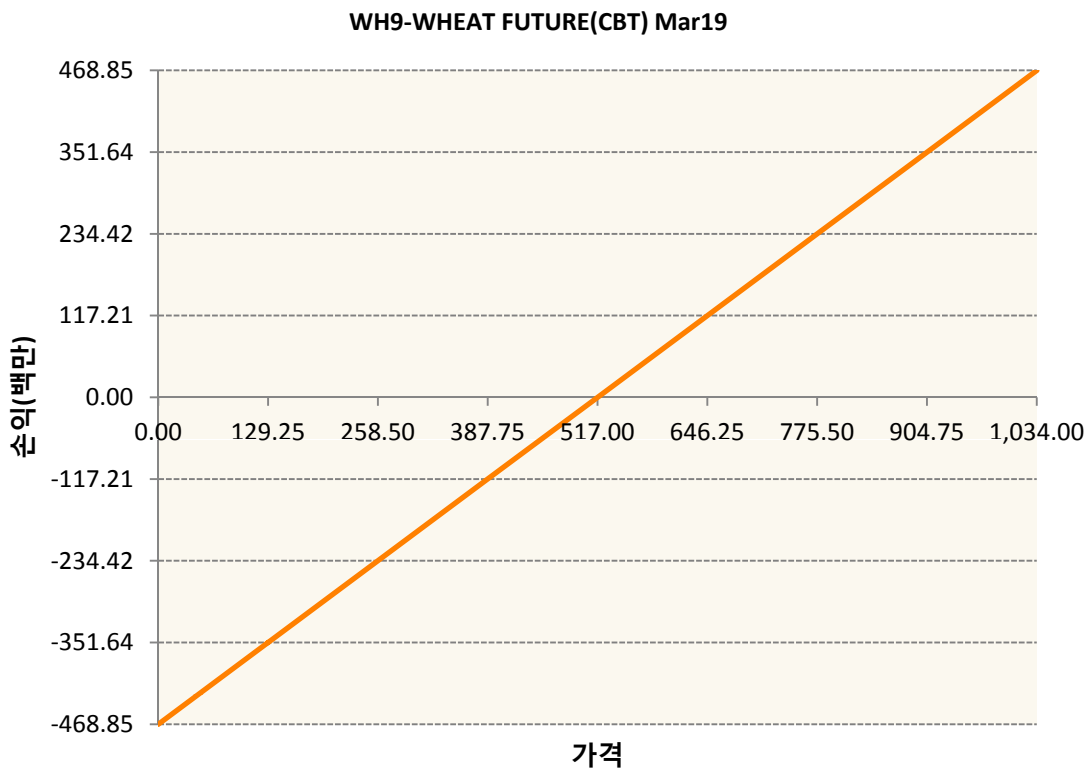
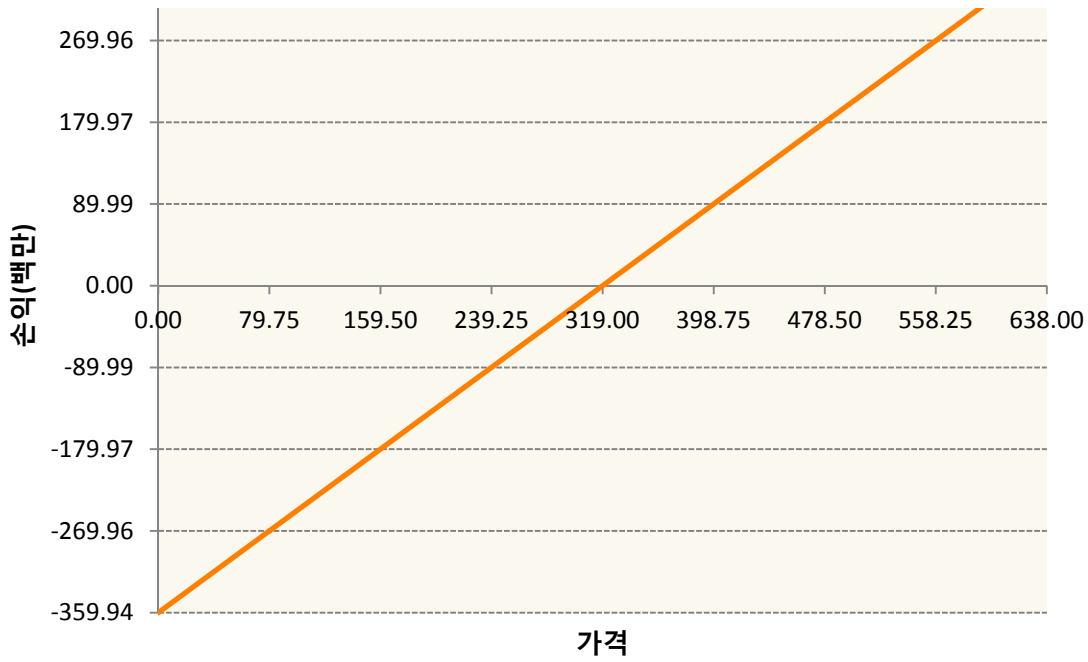


SH9-SOYBEAN FUTURE Mar19



SMH9-SOYBEAN MEAL FUTR Mar19





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

BOH9	SOYBEAN OIL FUTR Mar19	23
CH9	CORN FUTURE Mar19	66
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	54
SMH9	SOYBEAN MEAL FUTR Mar19	29
WH9	WHEAT FUTURE(CBT) Mar19	38

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

(단위:백만원)

300