

공시일	2019-01-14
기준일	2019-01-11

## 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)

94

공시일	2019-01-14
기준일	2019-01-11

## 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

1,042

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

586

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-01-14
기준일	2019-01-11

## 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

268

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

398

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-01-14
기준일	2019-01-11

## 유로인덱스모(주식-파생형)

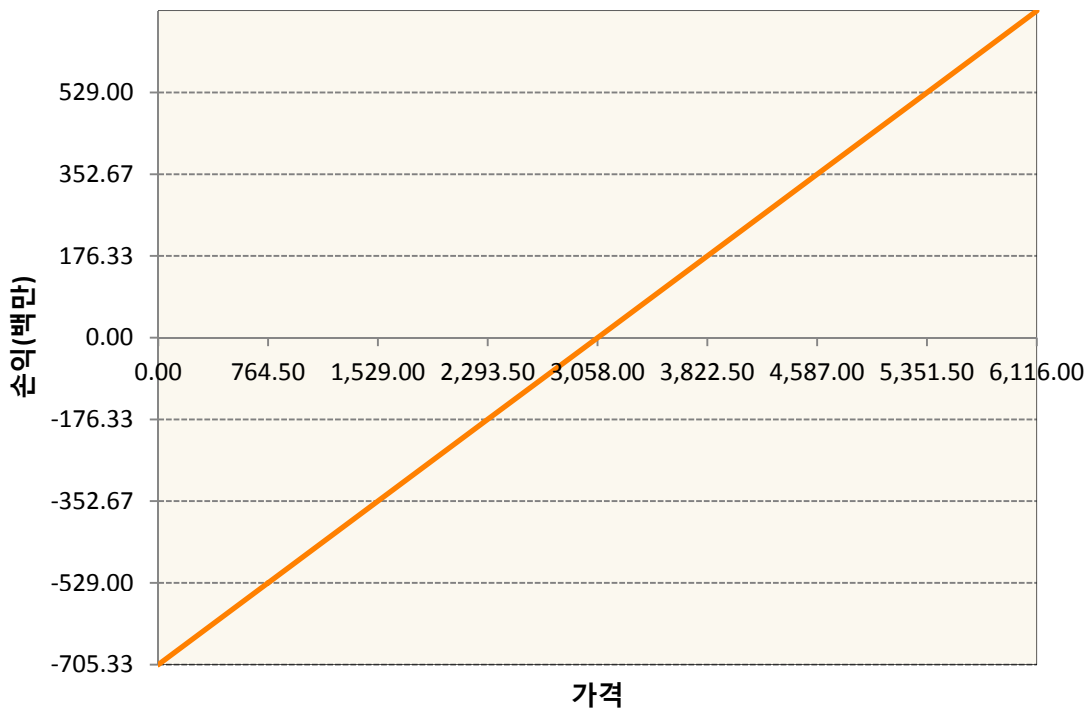
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	705	0	705	

### 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	2019-01-14
기준일	2019-01-11

## 차이나인덱스모(주식-파생형)

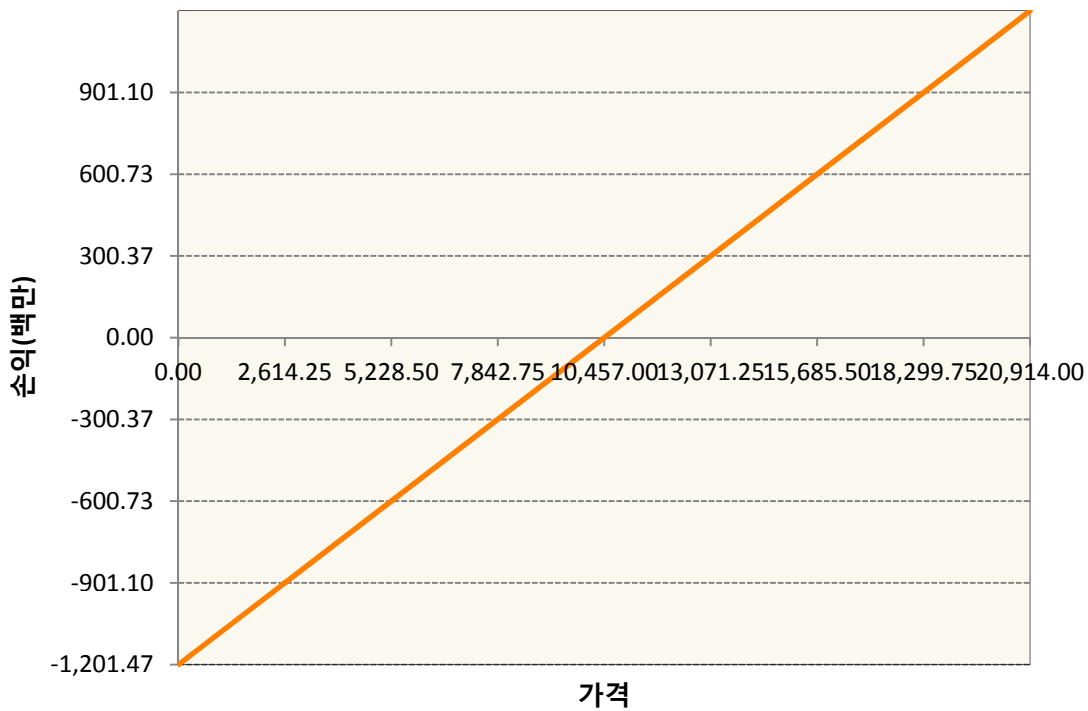
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

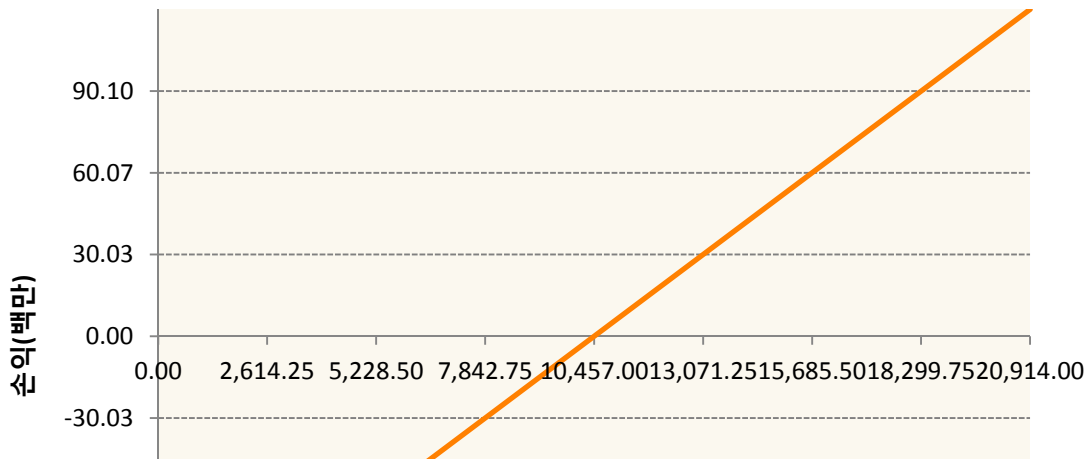
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,322	0	1,322	장내

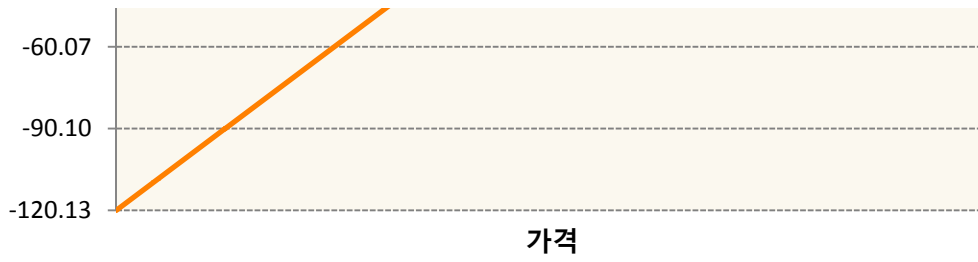
### 2. 만기시점의 손익구조

HCF9-HSCEI FUTURES JAN19



MHCF9-MINI H-SHR IDX FU JAN19





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

HCF9	HSCEI FUTURES JAN19	96
MHCF9	MINI H-SHR IDX FU JAN19	10

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

<b>108</b>
------------

공시일	2019-01-14
기준일	2019-01-11

## 커버드콜모(주식혼합-파생형)

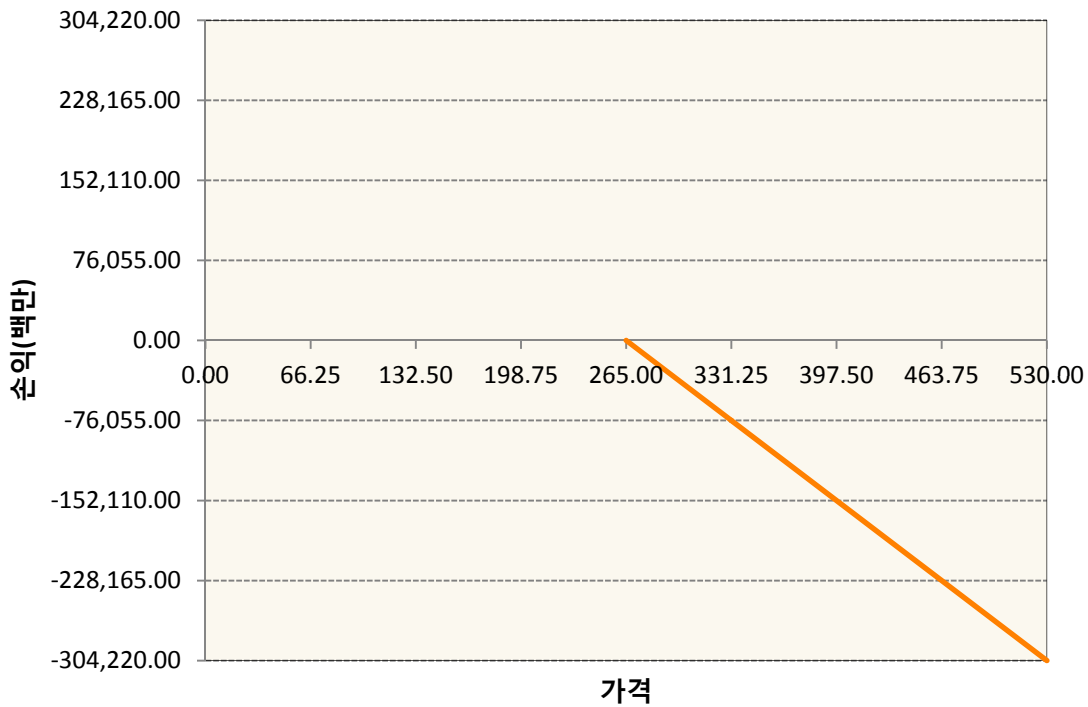
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	637,154	-637,154	장내
누계	유가증권	옵션	0	719,818	-719,818	장내

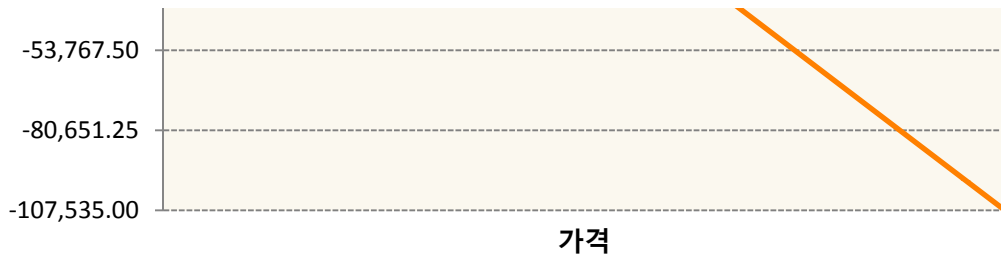
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4201P22655-2019-02 콜265

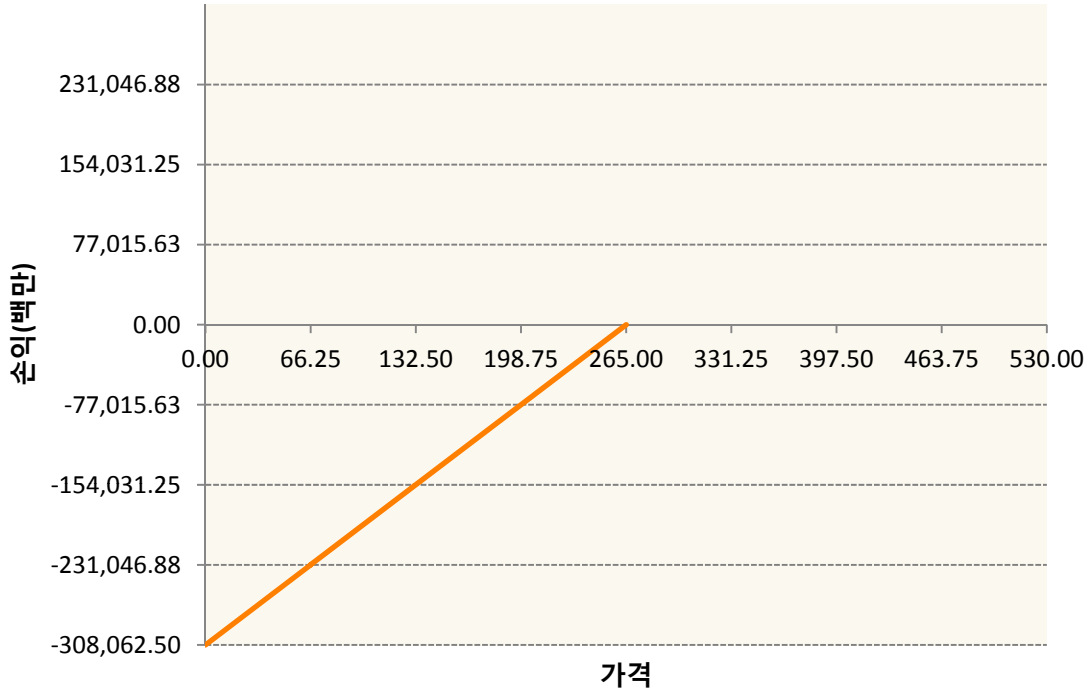


KR4201P22671-2019-02 콜267.5





KR4301P22653-2019-02 풋265



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4201P22655		2019-02 콜265					19,437
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	10,132	9,750	9,316	8,837	8,322	7,776	7,204
-5.33%	8,791	8,192	7,562	6,909	6,236	5,549	4,849
-2.67%	6,304	5,541	4,771	3,997	3,220	2,439	1,657
0%	2,410	1,608	804	0	-805	-1,610	-2,416
2.67%	-2,893	-3,599	-4,325	-5,065	-5,817	-6,578	-7,347
5.33%	-9,362	-9,890	-10,463	-11,073	-11,712	-12,375	-13,059
8.00%	-16,642	-16,982	-17,381	-17,834	-18,332	-18,868	-19,437
KR4201P22671		2019-02 콜267.5					6,532
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	3,132	3,020	2,889	2,741	2,579	2,404	2,218

-5.33%	2,764	2,577	2,376	2,164	1,944	1,716	1,482
-2.67%	2,042	1,788	1,529	1,267	1,002	735	466
0%	854	569	285	0	-285	-569	-854
2.67%	-834	-1,101	-1,371	-1,644	-1,920	-2,197	-2,476
5.33%	-2,964	-3,176	-3,400	-3,635	-3,877	-4,126	-4,380
8.00%	-5,422	-5,567	-5,731	-5,912	-6,107	-6,315	-6,532
KR4301P22653                      2019-02 풋265							18,548
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-17,834	-17,888	-17,968	-18,074	-18,207	-18,366	-18,548
-5.33%	-9,937	-10,140	-10,375	-10,639	-10,926	-11,233	-11,557
-2.67%	-3,180	-3,589	-4,007	-4,433	-4,865	-5,302	-5,742
0%	1,390	929	465	0	-466	-934	-1,402
2.67%	3,602	3,295	2,963	2,609	2,239	1,855	1,459
5.33%	4,326	4,201	4,041	3,849	3,627	3,379	3,108
8.00%	4,483	4,450	4,397	4,320	4,218	4,090	3,937

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

(단위:백만원)

**43,230**

공시일	2019-01-14
기준일	2019-01-11

## 홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

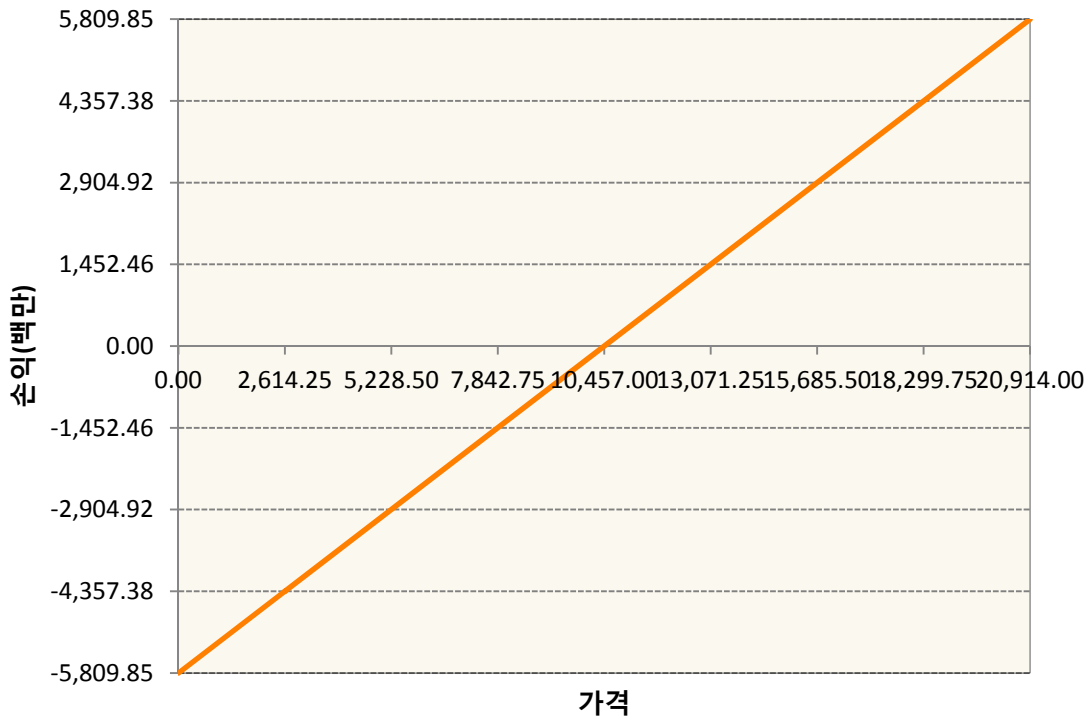
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

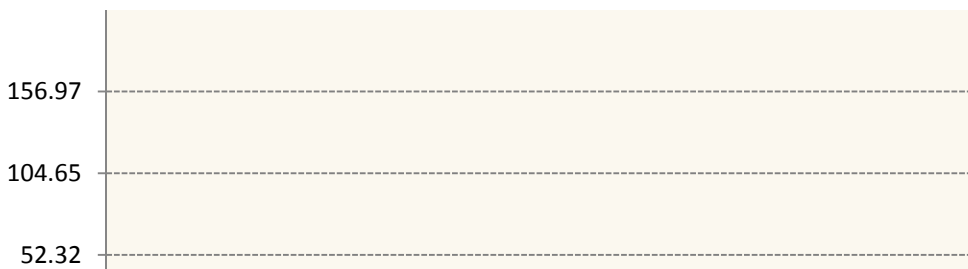
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	5,810	0	5,810	장내
누계	유가증권	옵션	0	12,236	-12,236	장내
누계	통화	선도	0	2,705	-2,705	장외

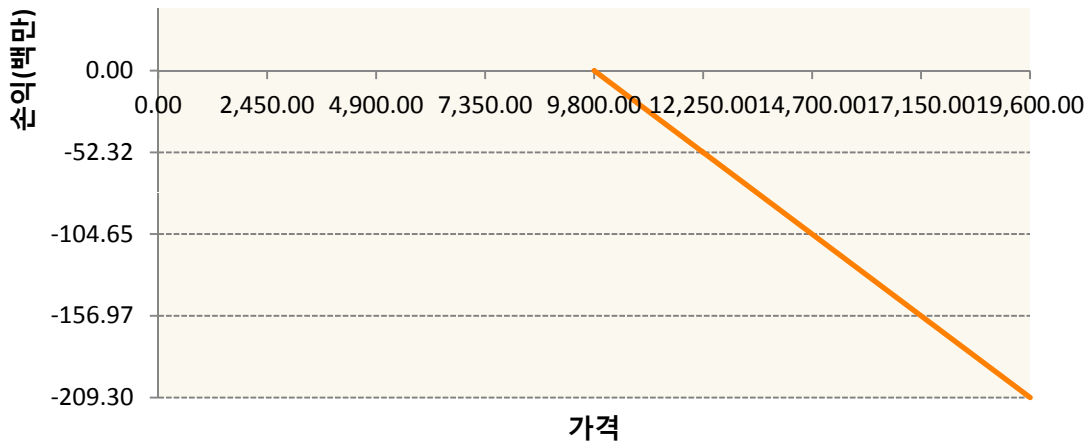
### 2. 만기시점의 손익구조

HCF9-HSCEI FUTURES JAN19

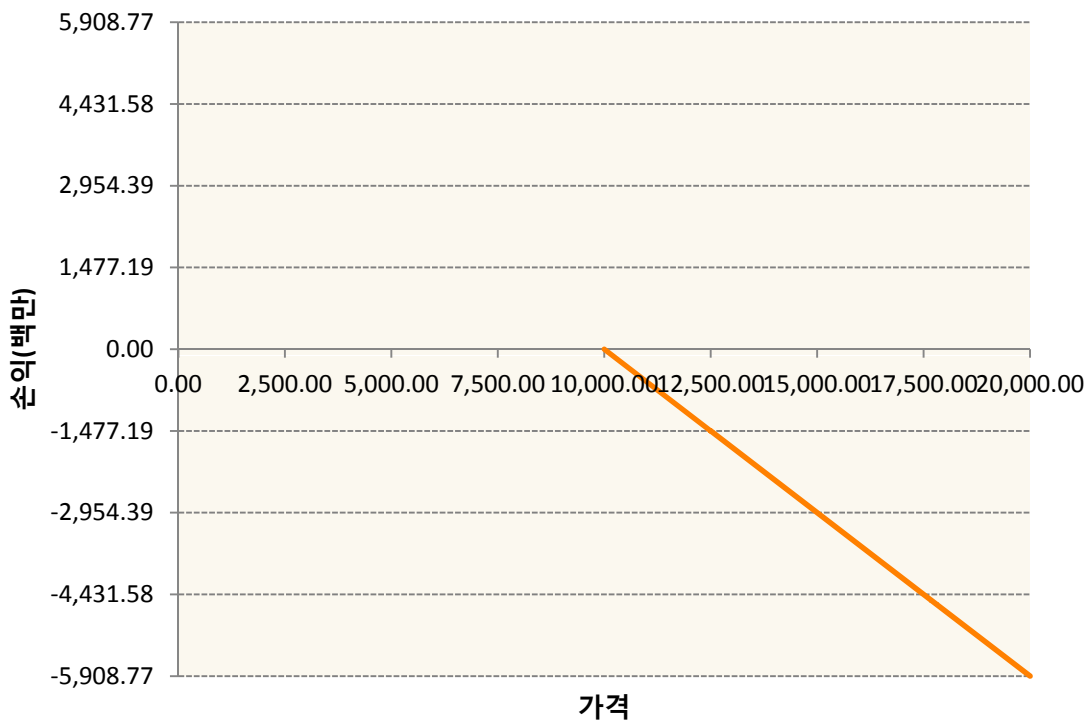


OHHIF9-C098-HSCEI

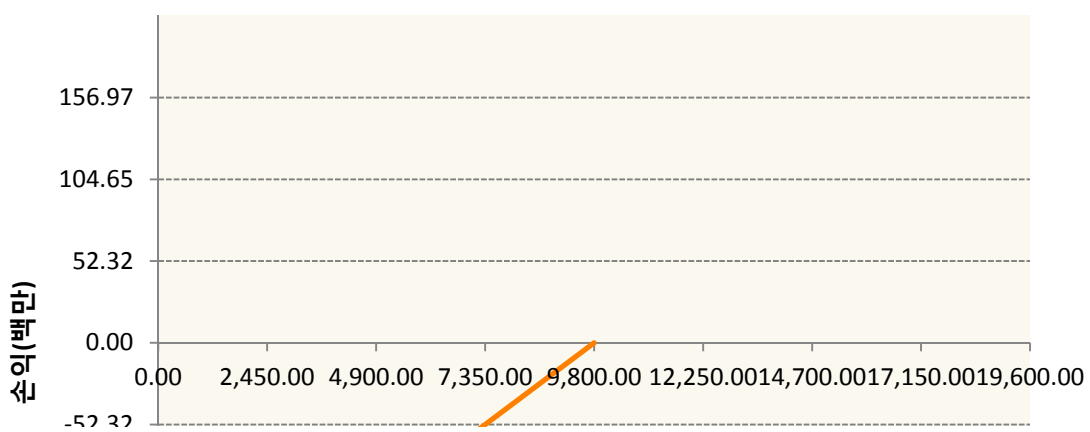


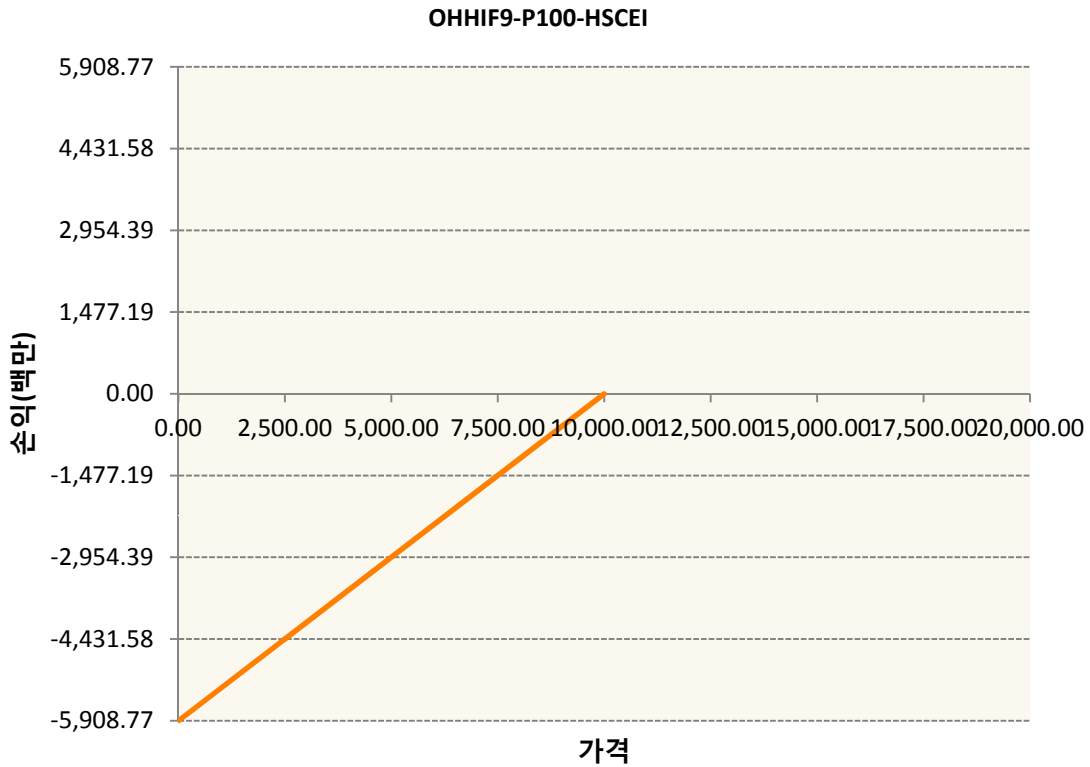
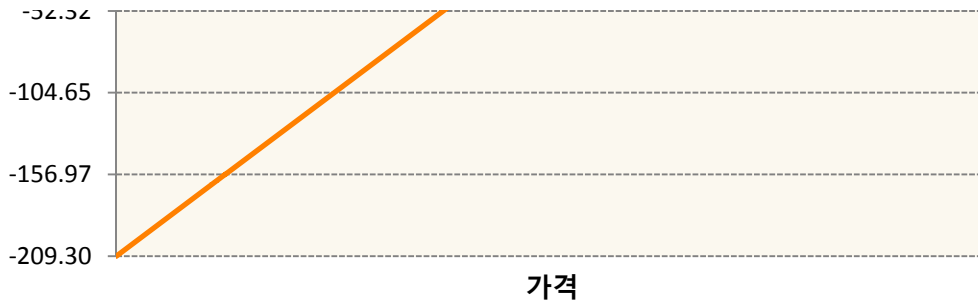


OHHIF9-C100-HSCEI



OHHIF9-P098-HSCEI





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

FX21018Z00 KRW/HKD 11-03-19E	216
HCF9 HSCEI FUTURES JAN19	465
OHHIF9-C09 HSCEI	17
OHHIF9-C10 HSCEI	473
OHHIF9-P09 HSCEI	17
OHHIF9-P10 HSCEI	473

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

**1,558**

공시일	2019-01-14
기준일	2019-01-11

## 코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

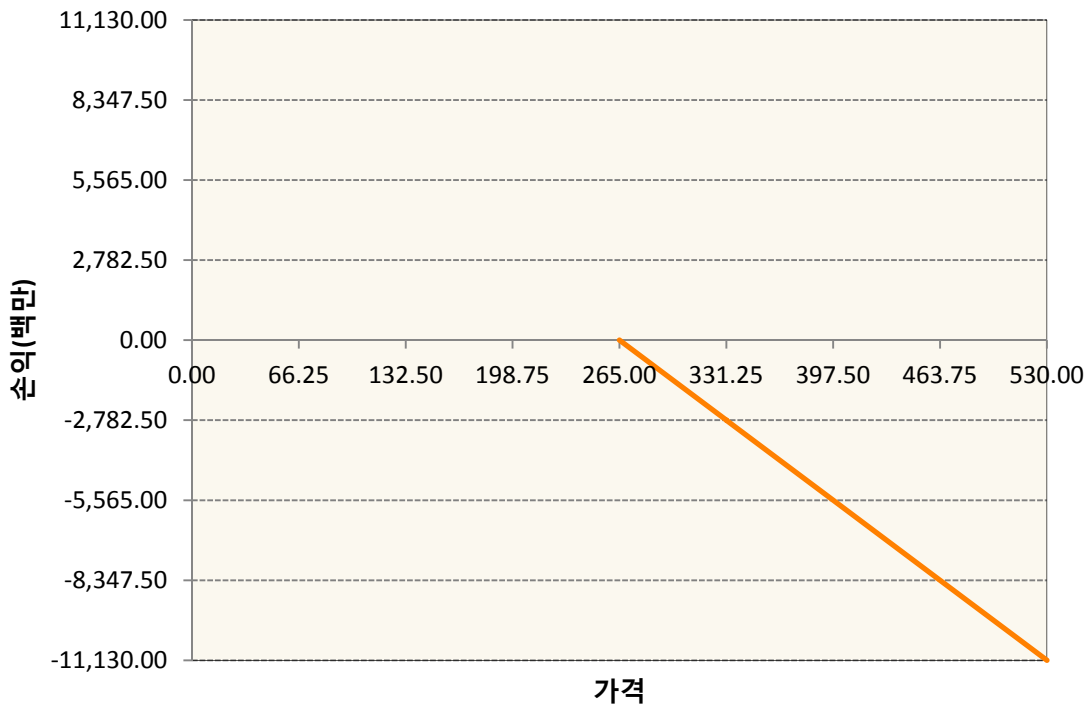
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

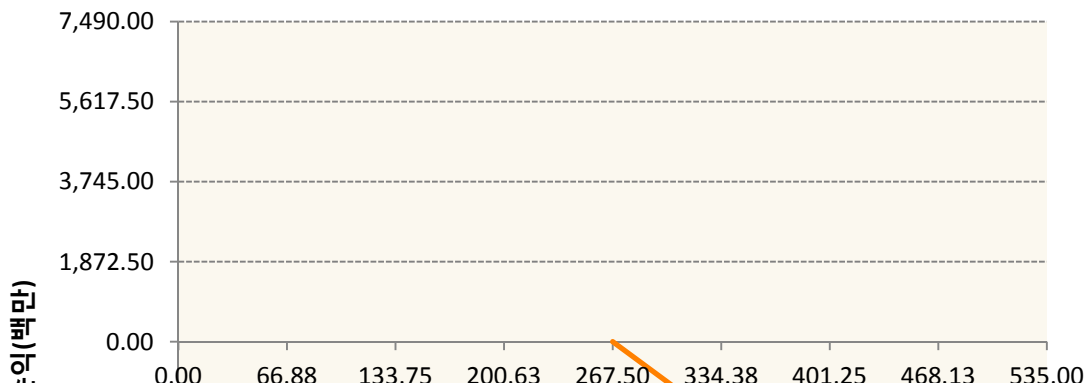
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	34,408	-34,408	장내
누계	유가증권	스왑	31,836	0	31,836	장외
누계	유가증권	옵션	0	33,858	-33,858	장내

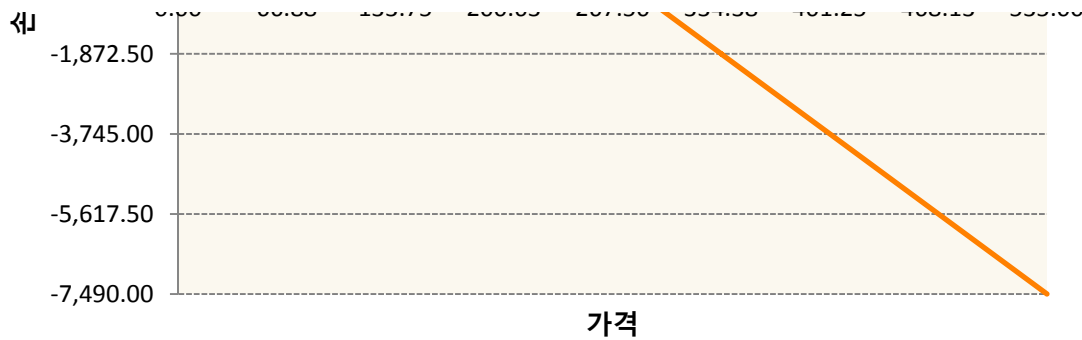
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4201P22655-2019-02 콜265

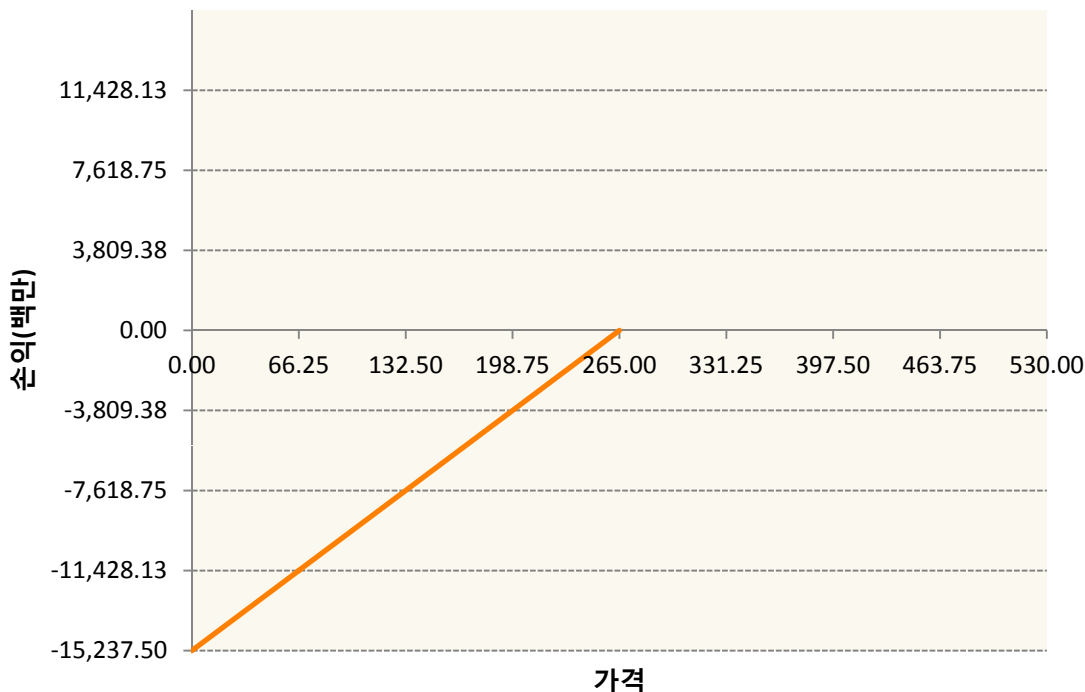


KR4201P22671-2019-02 콜267.5





KR4301P22653-2019-02 풋265



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

	2.529E+11		UBCSFXC1 INDEX_14				2,644
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-2,644	-2,644	-2,644	-2,644	-2,644	-2,644	-2,644
-5.33%	-1,763	-1,763	-1,763	-1,763	-1,763	-1,763	-1,763
-2.67%	-881	-881	-881	-881	-881	-881	-881
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	881	881	881	881	881	881	881
5.33%	1,763	1,763	1,763	1,763	1,763	1,763	1,763
8.00%	2,644	2,644	2,644	2,644	2,644	2,644	2,644
	KR4201P22655		2019-02 풋265				711
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	371	357	341	323	304	284	264
-5.33%	322	300	277	253	228	203	177
-2.67%	231	203	175	146	118	89	61
0%	88	59	29	0	-29	-59	-88
2.67%	-106	-132	-158	-185	-213	-241	-269
5.33%	-343	-362	-383	-405	-428	-453	-478
8.00%	-609	-621	-636	-652	-671	-690	-711
KR4201P22671                      2019-02 콜267.5							455

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	218	210	201	191	180	167	154
-5.33%	192	179	166	151	135	120	103
-2.67%	142	125	107	88	70	51	32
0%	59	40	20	0	-20	-40	-59
2.67%	-58	-77	-95	-115	-134	-153	-172
5.33%	-206	-221	-237	-253	-270	-287	-305
8.00%	-378	-388	-399	-412	-425	-440	-455
KR4301P22653                      2019-02 풋265							917

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-882	-885	-889	-894	-901	-908	-917
-5.33%	-491	-502	-513	-526	-540	-556	-572
-2.67%	-157	-177	-198	-219	-241	-262	-284
0%	69	46	23	0	-23	-46	-69
2.67%	178	163	147	129	111	92	72
5.33%	214	208	200	190	179	167	154
8.00%	222	220	217	214	209	202	195

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

(단위:백만원)

4,668

공시일	2019-01-14
기준일	2019-01-11

## 유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

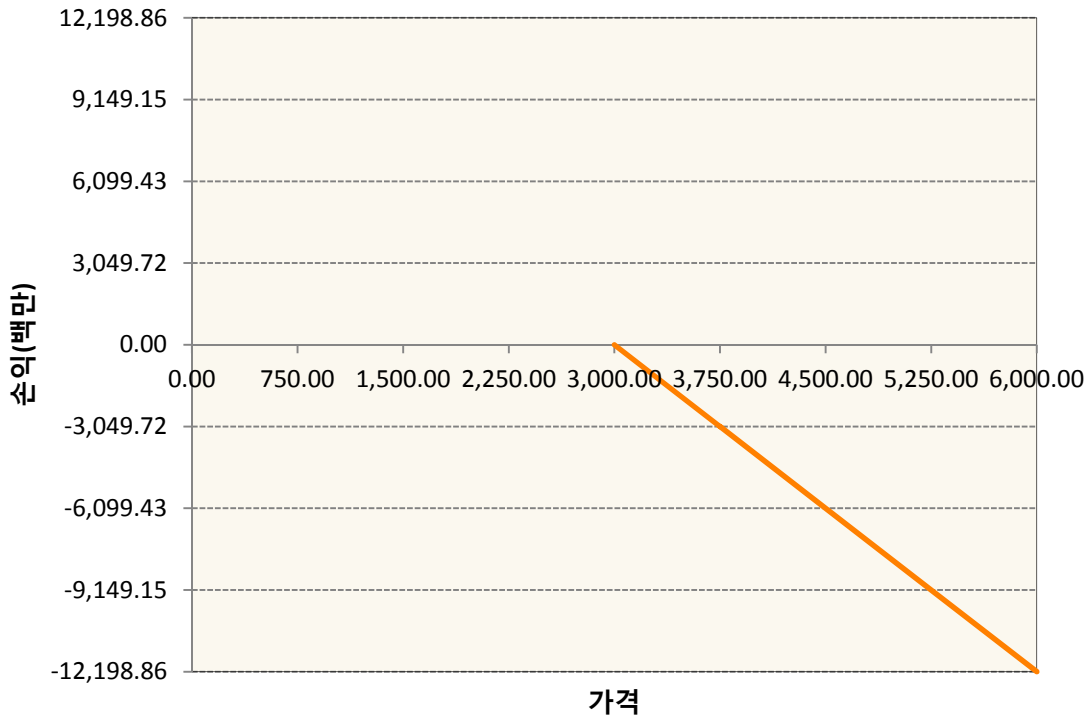
### 1. 계약금액

(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	6,621	0	6,621	
누계	유가증권	스왑	71,873	0	71,873	장외
누계	유가증권	옵션	0	25,021	-25,021	장내
누계	통화	선도	0	15,442	-15,442	장외

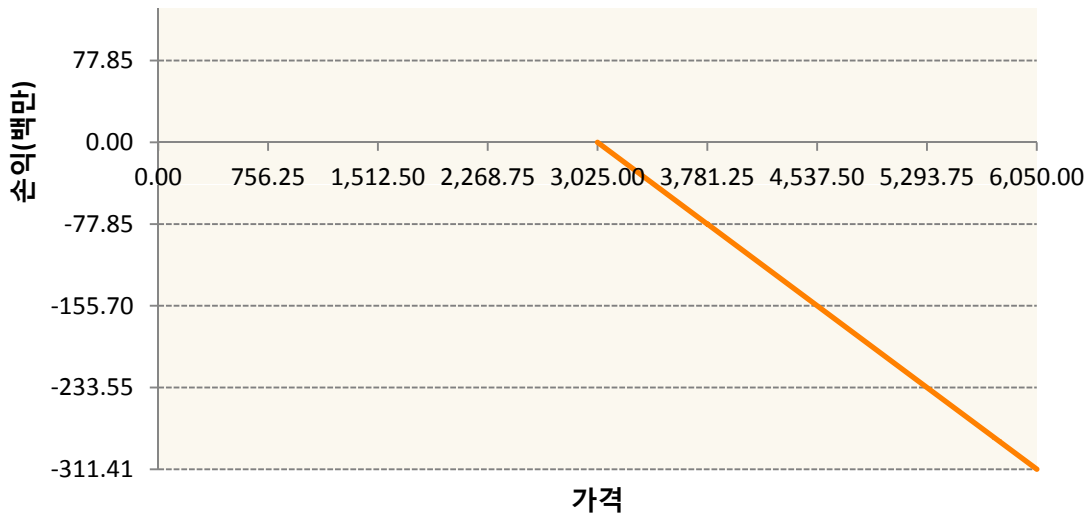
### 2. 만기시점의 손익구조

**OESXF9-C3000-EURO STOXX 50**

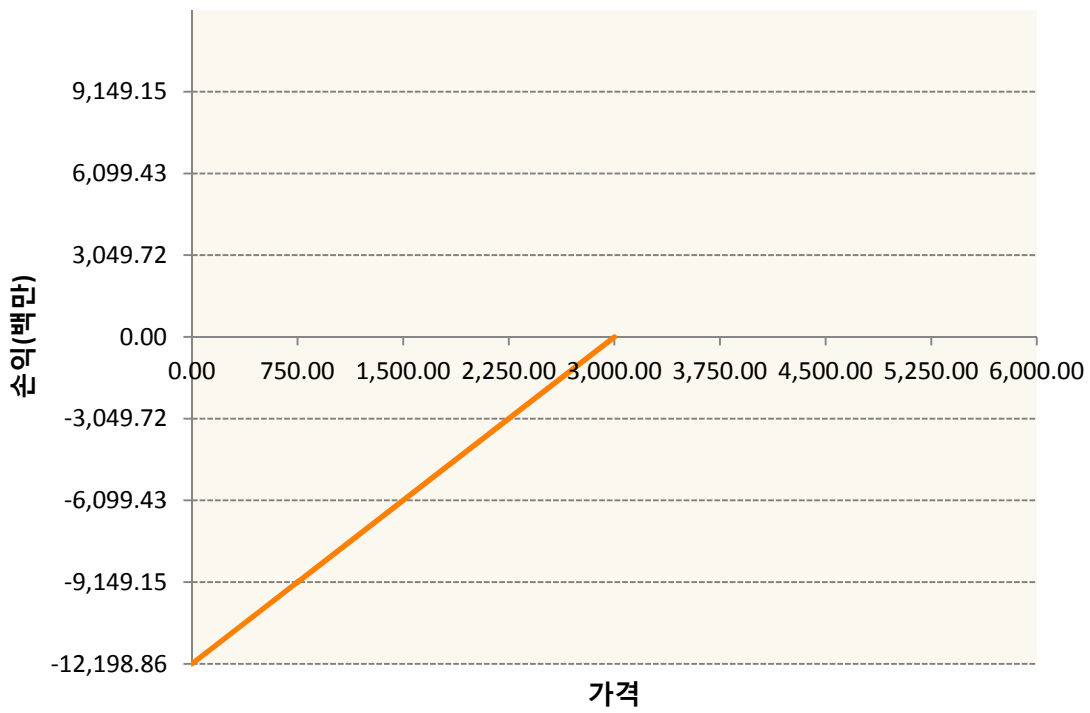


**OESXF9-C3025-EURO STOXX 50**

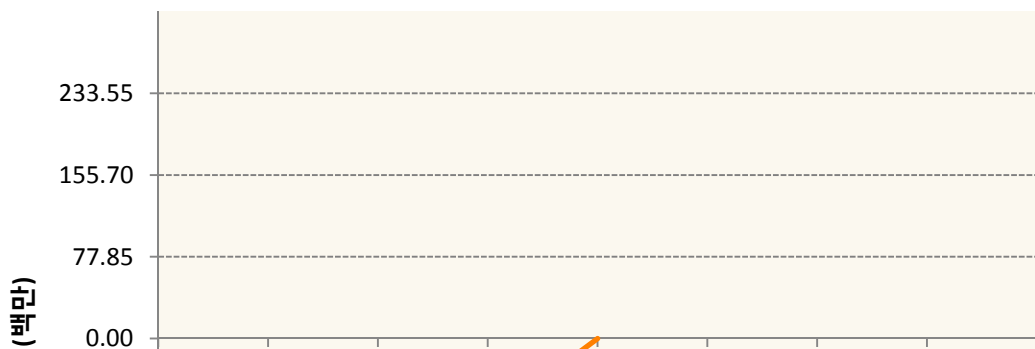


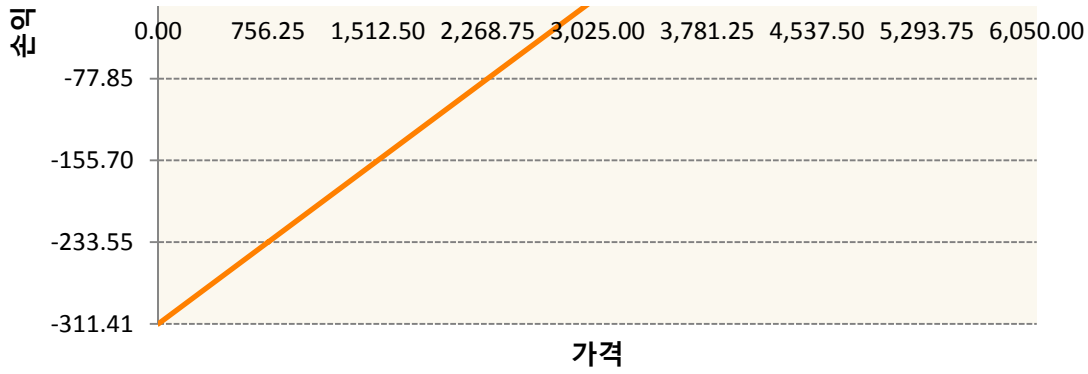


OESXF9-P3000-EURO STOXX 50

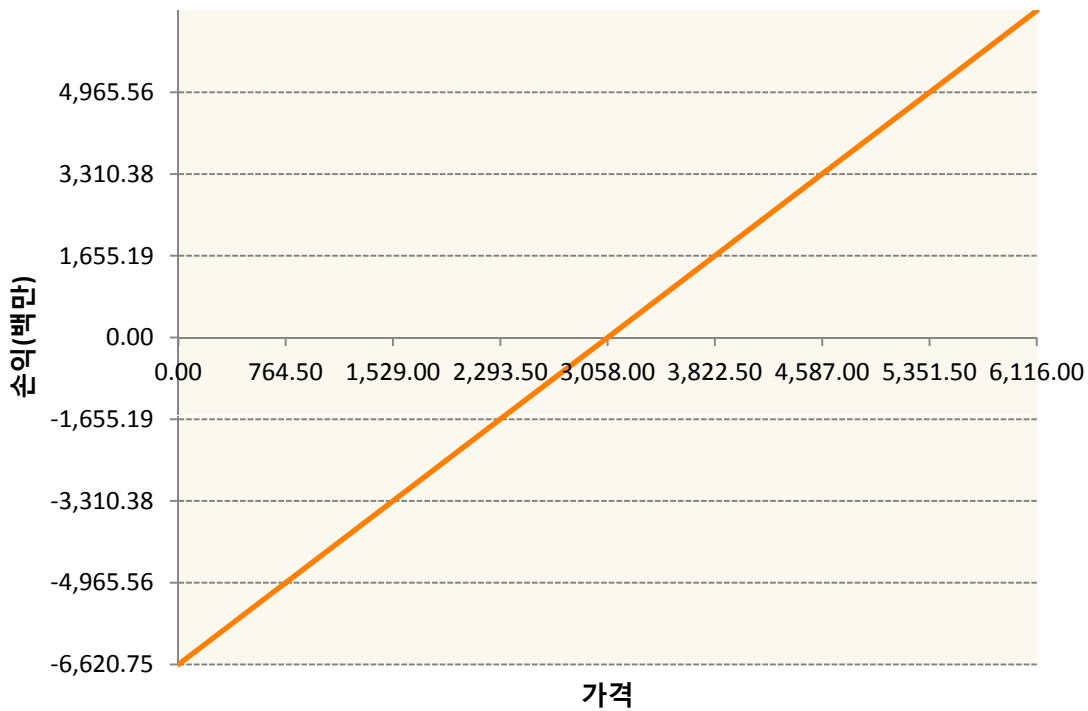


OESXF9-P3025-EURO STOXX 50





VGH9-EURO STOXX 50 Mar19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY	76
FX21018X02 KRW/EUR 22-02-19E	412
FX21018Z03 KRW/EUR 22-03-19E	824
OESXF9-C30 EURO STOXX 50	976
OESXF9-C30 EURO STOXX 50	25
OESXF9-P30 EURO STOXX 50	976
OESXF9-P30 EURO STOXX 50	25
VGH9 EURO STOXX 50 Mar19	530

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

(단위:백만원)

2,504



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

(단위:백만원)

1,100



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

(단위:백만원)

94



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

(단위:백만원)

140

공시일	2019-01-14
기준일	2019-01-11

## 스마트KRX300인덱스목표전환형1호

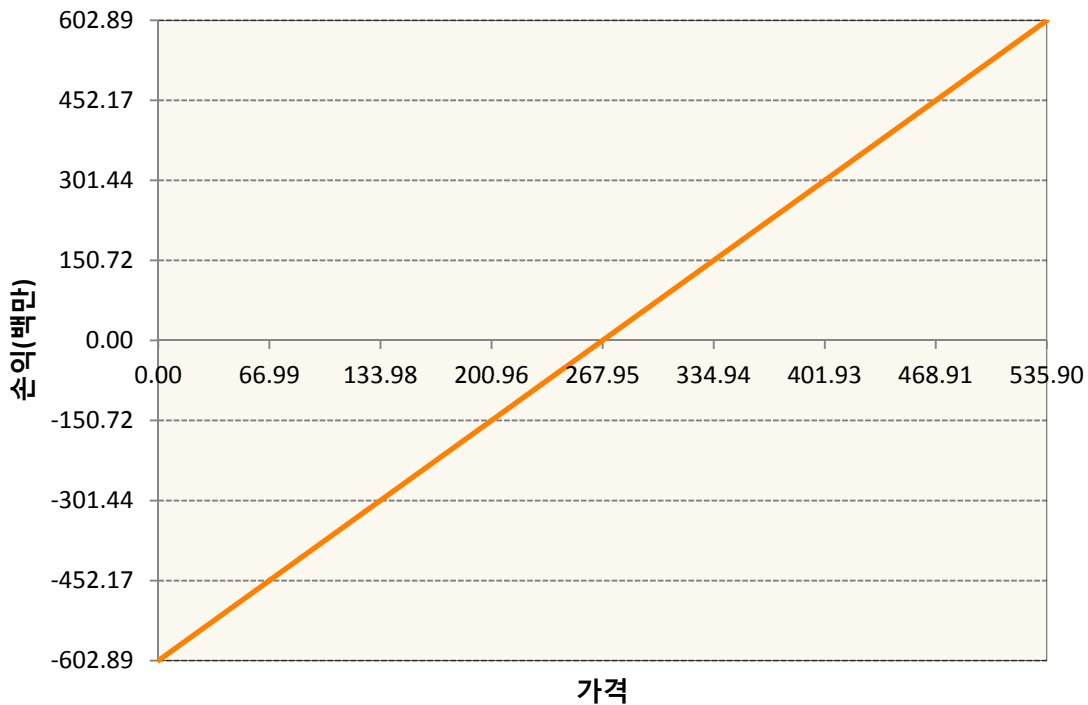
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	603	0	603	장내

### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101P30007-2019-03 코스피200지수선물



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101P30007		2019-03 코스피200지수선물						48
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-48	-48	-48	-48	-48	-48	-48	
-5.33%	-32	-32	-32	-32	-32	-32	-32	
-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%	32	32	32	32	32	32	32	
8.00%	48	48	48	48	48	48	48	

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

(단위:백만원)

42

공시일	2019-01-14
기준일	2019-01-11

## 리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

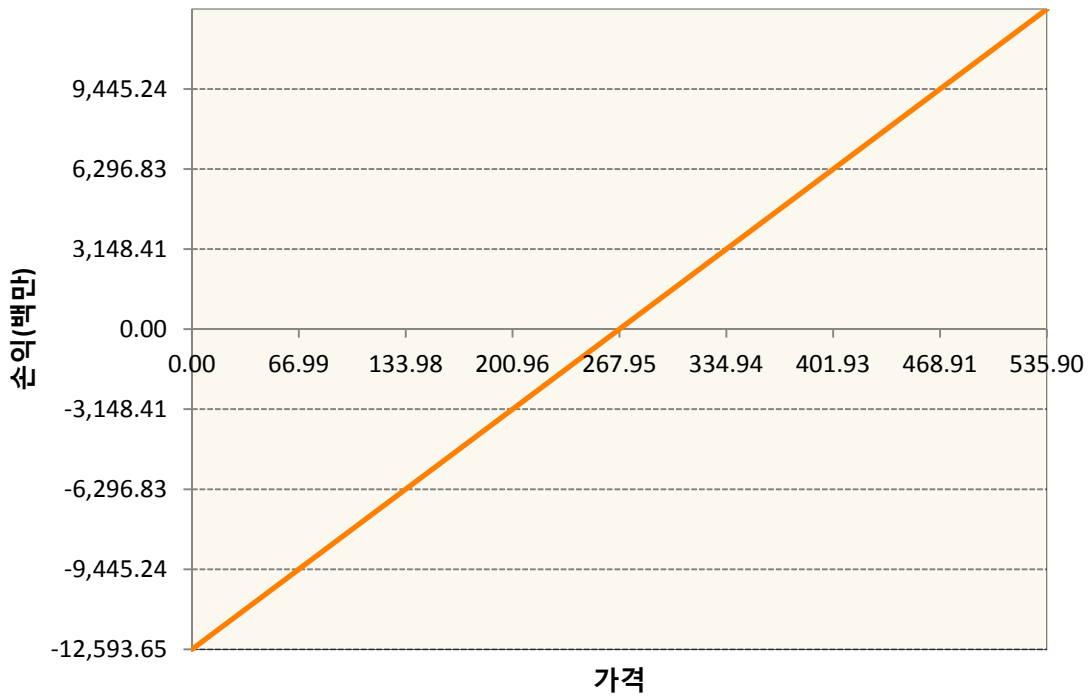
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

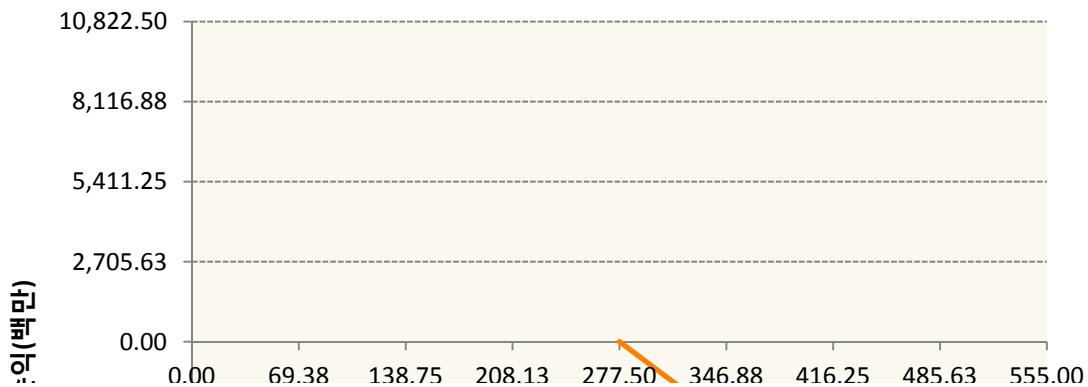
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	5,428	5,895	-467	장내
누계	유가증권	선물	12,594	0	12,594	장내
누계	유가증권	옵션	2,523	23,213	-20,690	장내

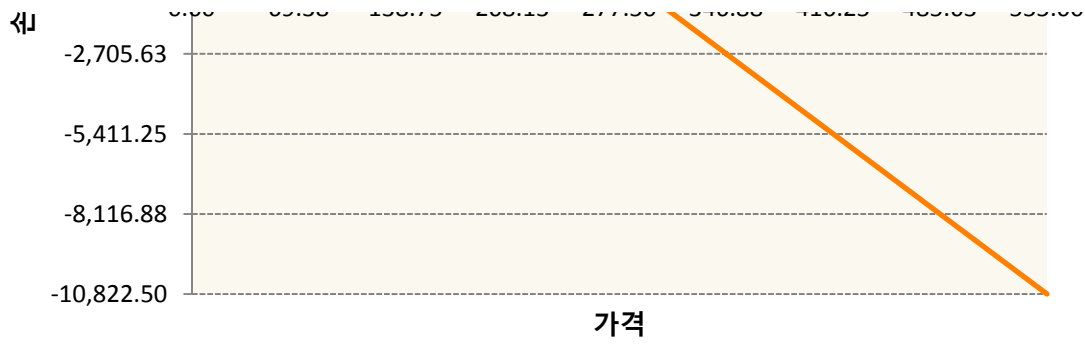
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101P30007-2019-03 코스피200지수선물

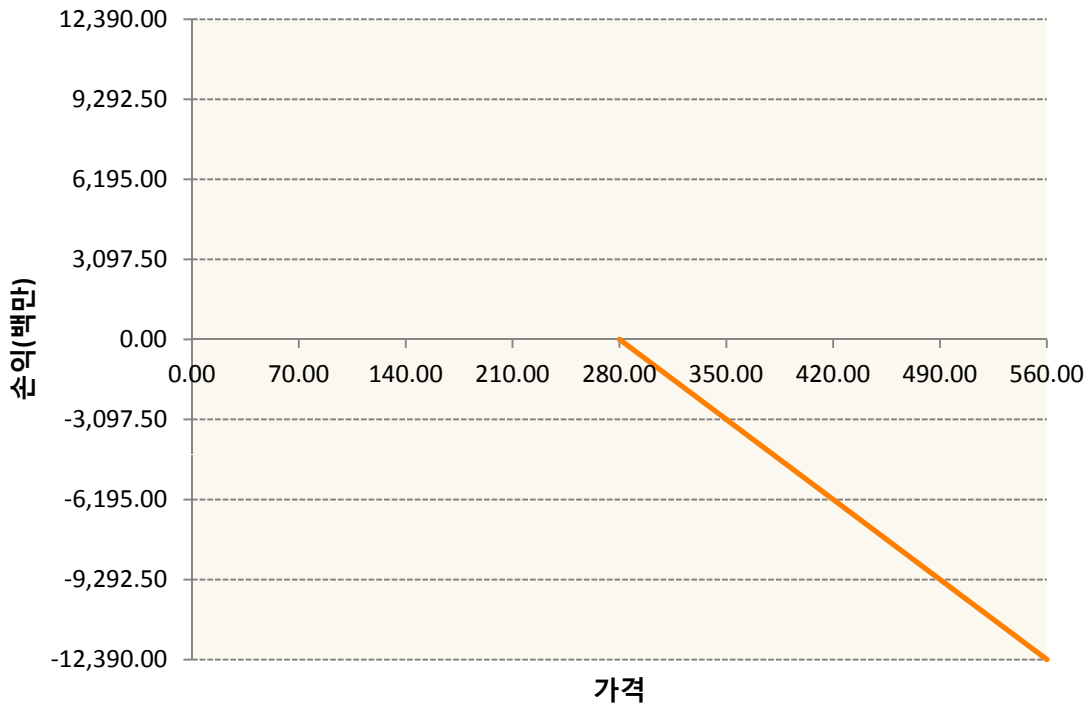


KR4201P22770-2019-02 콜277.5

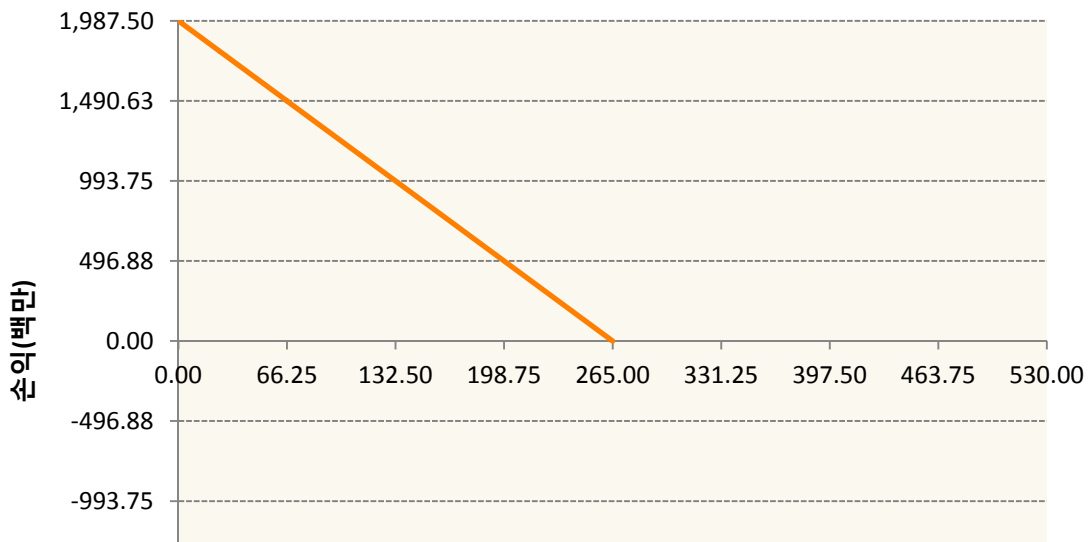


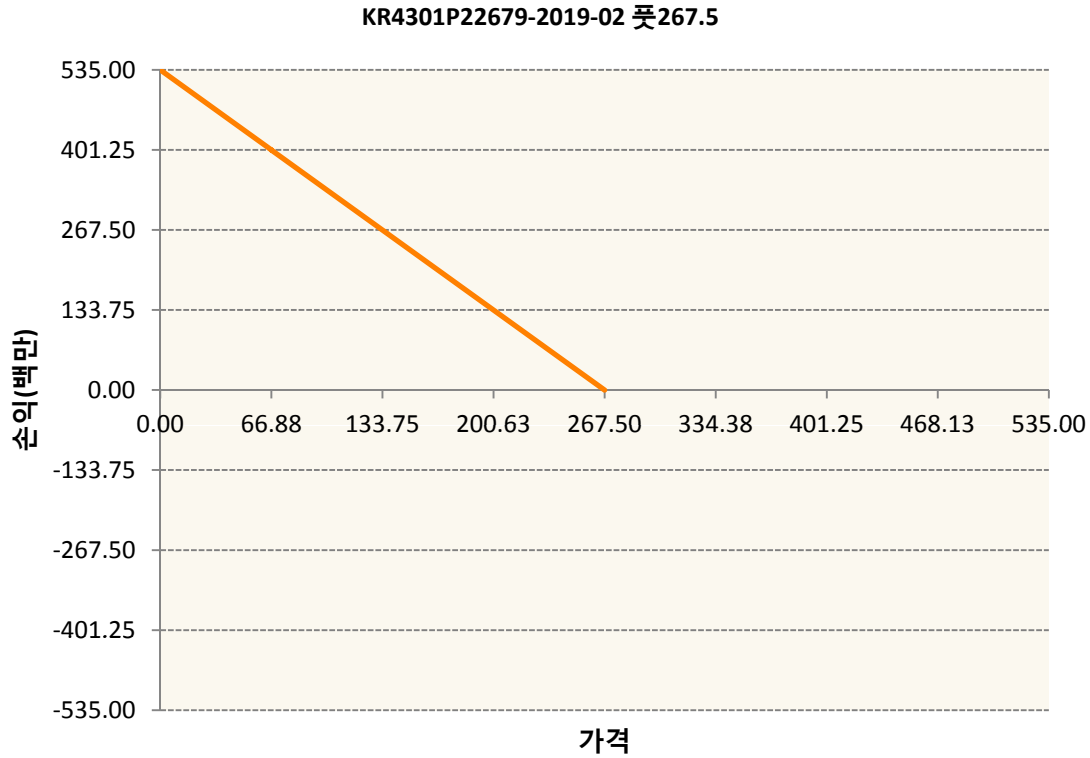
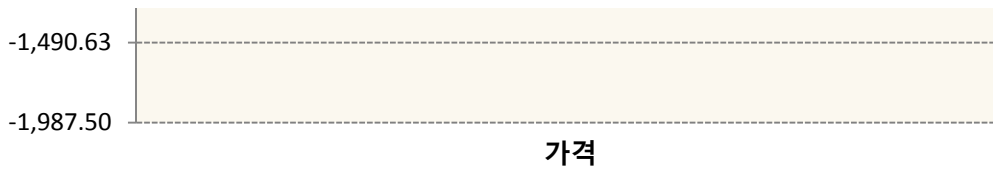


KR4201P22804-2019-02 콜280



KR4301P22653-2019-02 풋265





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

KR4101P30007		2019-03 코스피200지수선물						1,004
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-1,004	-1,004	-1,004	-1,004	-1,004	-1,004	-1,004	
-5.33%	-670	-670	-670	-670	-670	-670	-670	
-2.67%	-335	-335	-335	-335	-335	-335	-335	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	335	335	335	335	335	335	335	
5.33%	670	670	670	670	670	670	670	
8.00%	1,004	1,004	1,004	1,004	1,004	1,004	1,004	
KR4201P22770		2019-02 콜277.5						513
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	169	165	159	151	142	131	119	
-5.33%	158	148	137	124	109	93	76	
-2.67%	130	113	95	76	56	34	12	

0%	73	49	25	0	-25	-51	-77
2.67%	-25	-53	-81	-109	-138	-166	-194
5.33%	-169	-198	-226	-254	-283	-311	-340
8.00%	-358	-382	-407	-433	-459	-486	-513
KR4201P22804                      2019-02 콜280							545
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	162	159	153	146	137	126	114
-5.33%	153	145	134	121	106	90	72
-2.67%	129	113	95	75	54	31	8
0%	76	52	27	0	-27	-55	-84
2.67%	-18	-48	-79	-111	-142	-174	-206
5.33%	-163	-195	-228	-261	-294	-327	-360
8.00%	-360	-389	-420	-451	-482	-513	-545
KR4301P22653                      2019-02 풋265							120
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	115	115	116	117	117	118	120
-5.33%	64	65	67	69	70	72	75
-2.67%	21	23	26	29	31	34	37
0%	-9	-6	-3	0	3	6	9
2.67%	-23	-21	-19	-17	-14	-12	-9
5.33%	-28	-27	-26	-25	-23	-22	-20
8.00%	-29	-29	-28	-28	-27	-26	-25
KR4301P22679                      2019-02 풋267.5							34
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	33	33	33	33	34	34	34
-5.33%	19	20	20	20	21	21	22
-2.67%	7	7	8	9	9	10	11
0%	-2	-2	-1	0	1	2	2
2.67%	-8	-7	-6	-6	-5	-4	-3
5.33%	-10	-9	-9	-8	-8	-7	-7
8.00%	-10	-10	-10	-10	-9	-9	-9

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

(단위:백만원)

**1,840**

공시일	2019-01-14
기준일	2019-01-11

## 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	613	0	613	

### 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	2019-01-14
기준일	2019-01-11

## 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	2,264	0	2,264	

### 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	2019-01-14
기준일	2019-01-11

## 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	2,906	0	2,906	
누계	통화	선도	0	3,238	-3,238	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
FX21019F00 KRW/USD 19-02-19E		13
FX21019F00 KRW/USD 19-02-19E		29

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

(단위:백만원)

98

공시일	2019-01-14
기준일	2019-01-11

## 스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

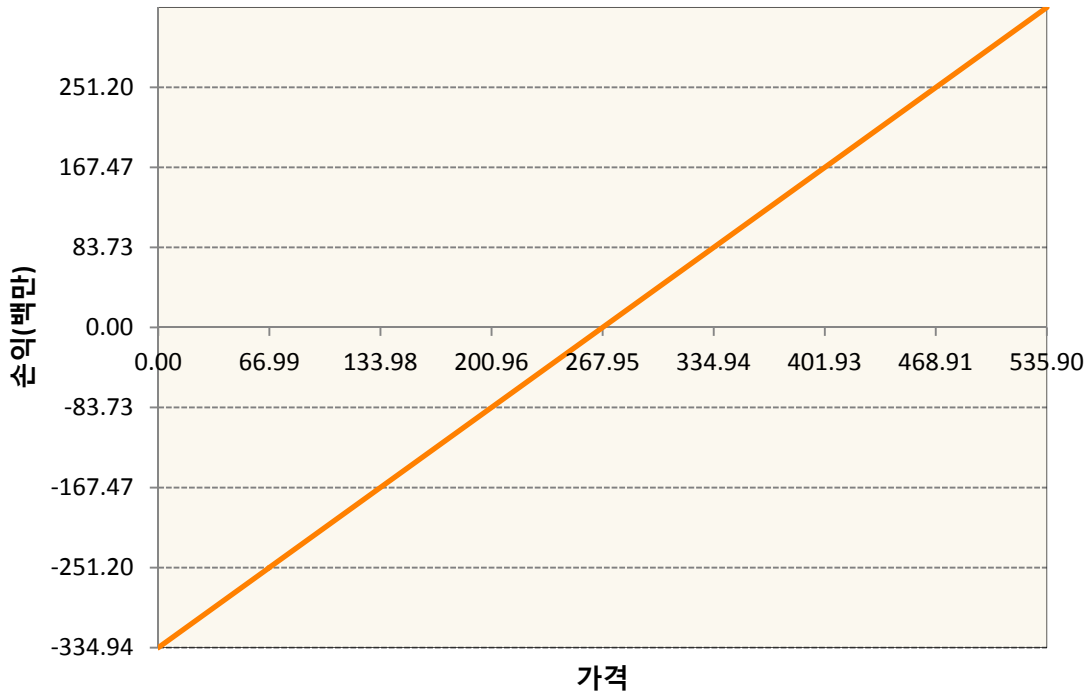
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

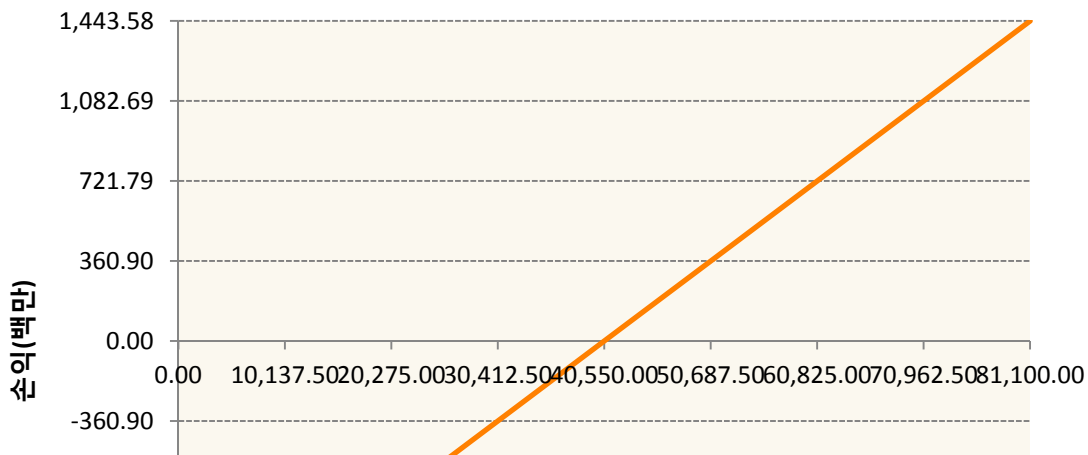
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,779	0	1,779	장내

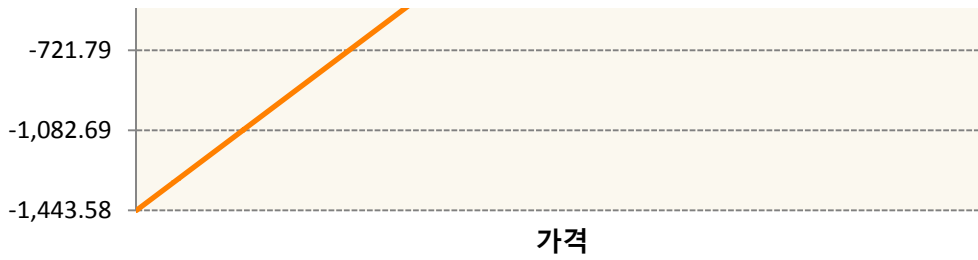
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101P30007-2019-03 코스피200지수선물



KR4111P20007-2019-02 삼성전자개별선물





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

KR4101P30007		2019-03 코스피200지수선물						27
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-27	-27	-27	-27	-27	-27	-27	
-5.33%	-18	-18	-18	-18	-18	-18	-18	
-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%	18	18	18	18	18	18	18	
8.00%	27	27	27	27	27	27	27	
KR4111P20007		2019-02 삼성전자개별선물						115
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-115	-115	-115	-115	-115	-115	-115	
-5.33%	-77	-77	-77	-77	-77	-77	-77	
-2.67%	-38	-38	-38	-38	-38	-38	-38	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	38	38	38	38	38	38	38	
5.33%	77	77	77	77	77	77	77	
8.00%	115	115	115	115	115	115	115	

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

**159**

공시일	2019-01-14
기준일	2019-01-11

## 에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

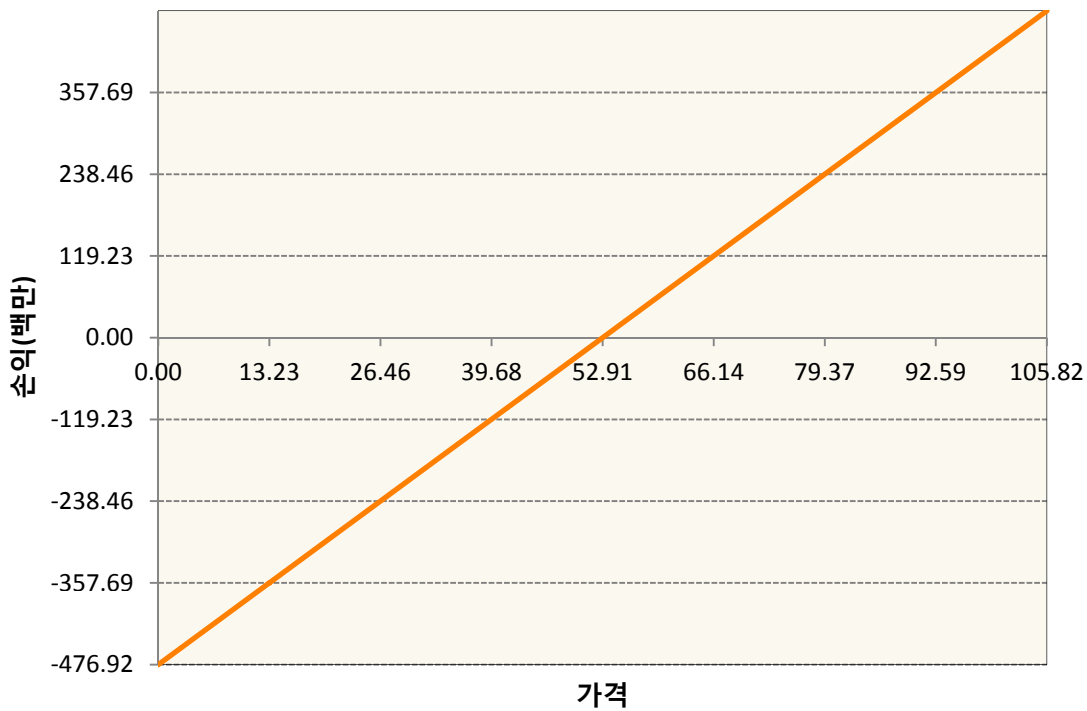
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

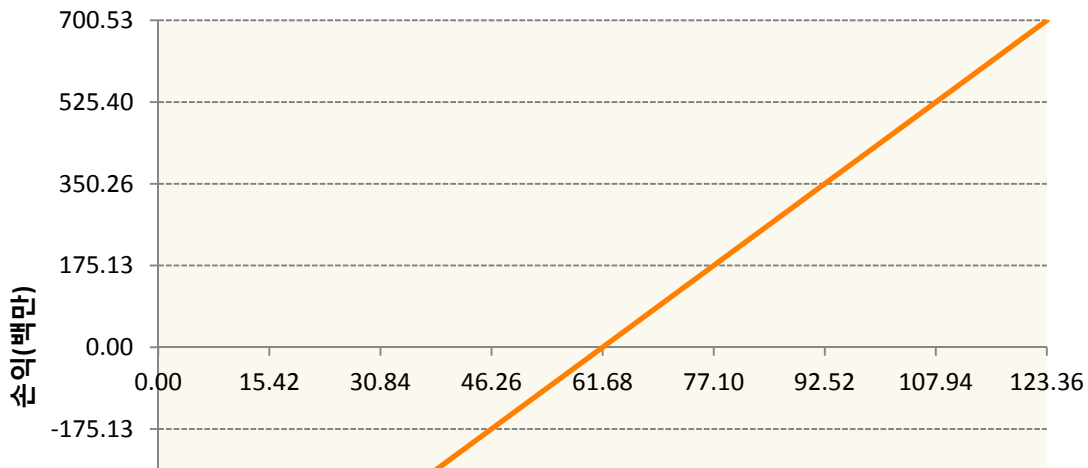
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,640	201	2,439	

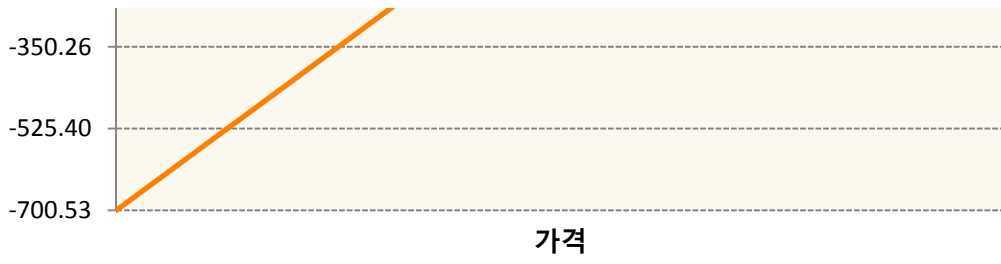
### 2. 만기시점의 손익구조

CLH9-WTI CRUDE FUTURE MAR19

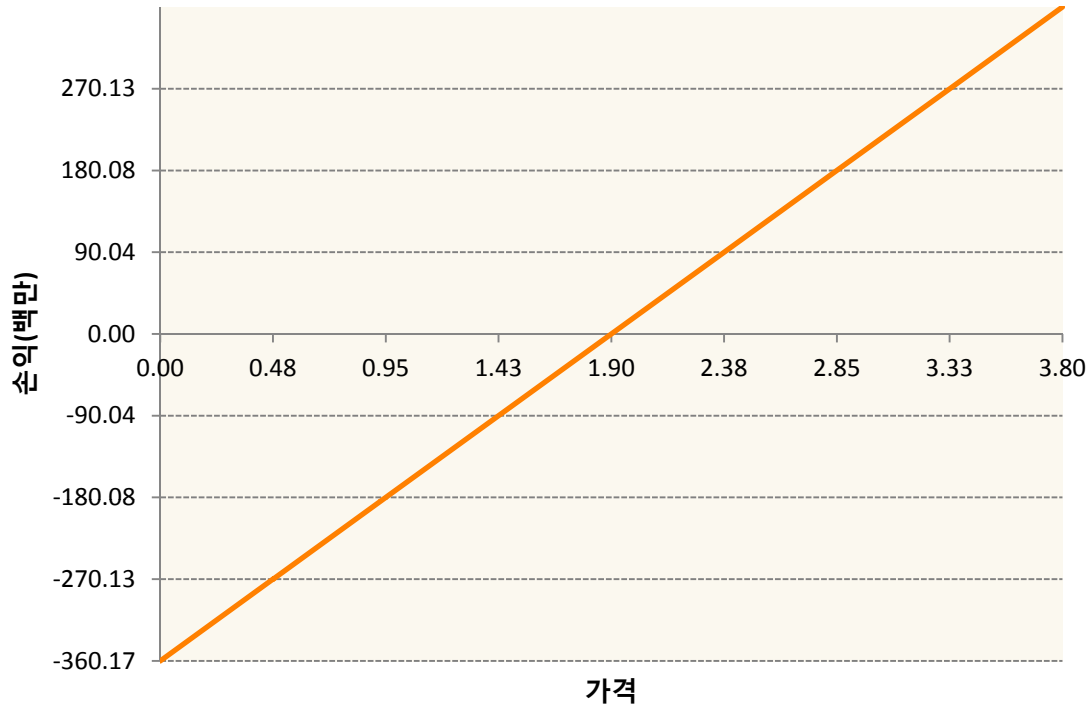


COH9-BRENT CRUDE FUTR Mar19

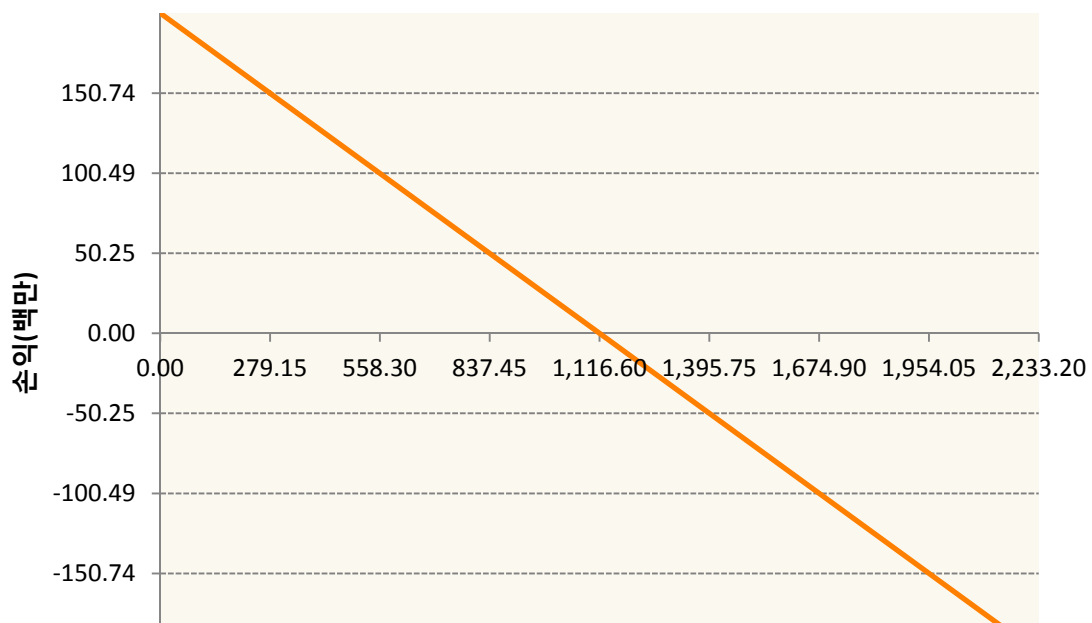


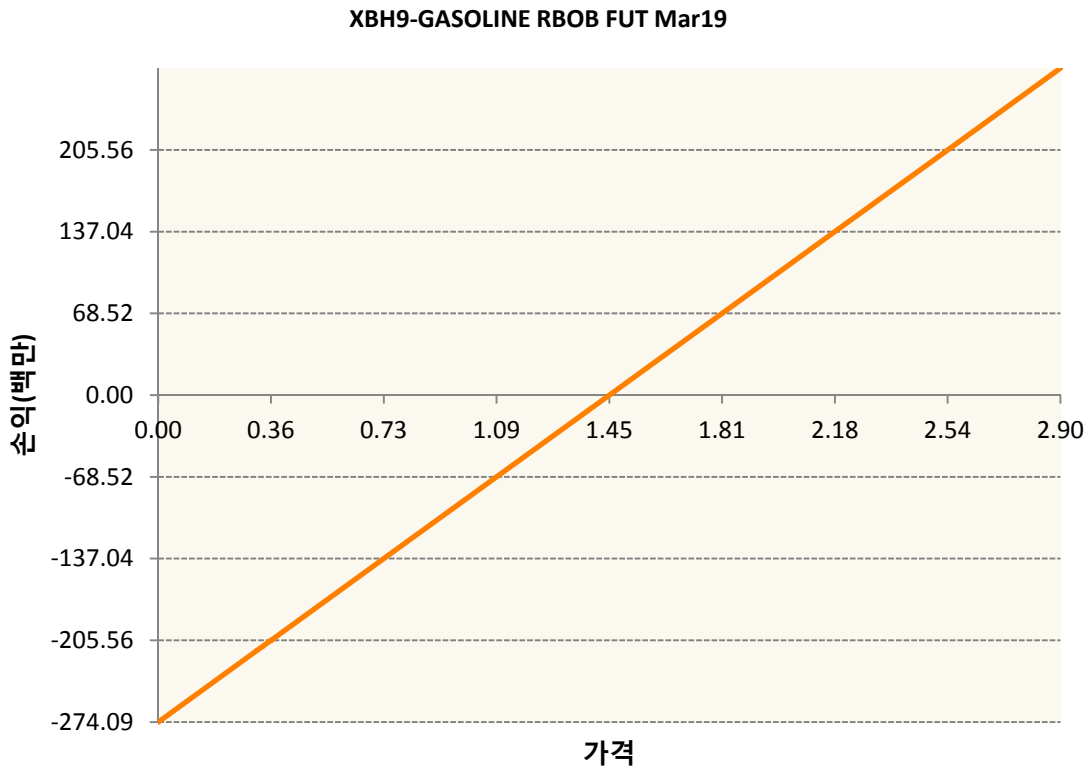
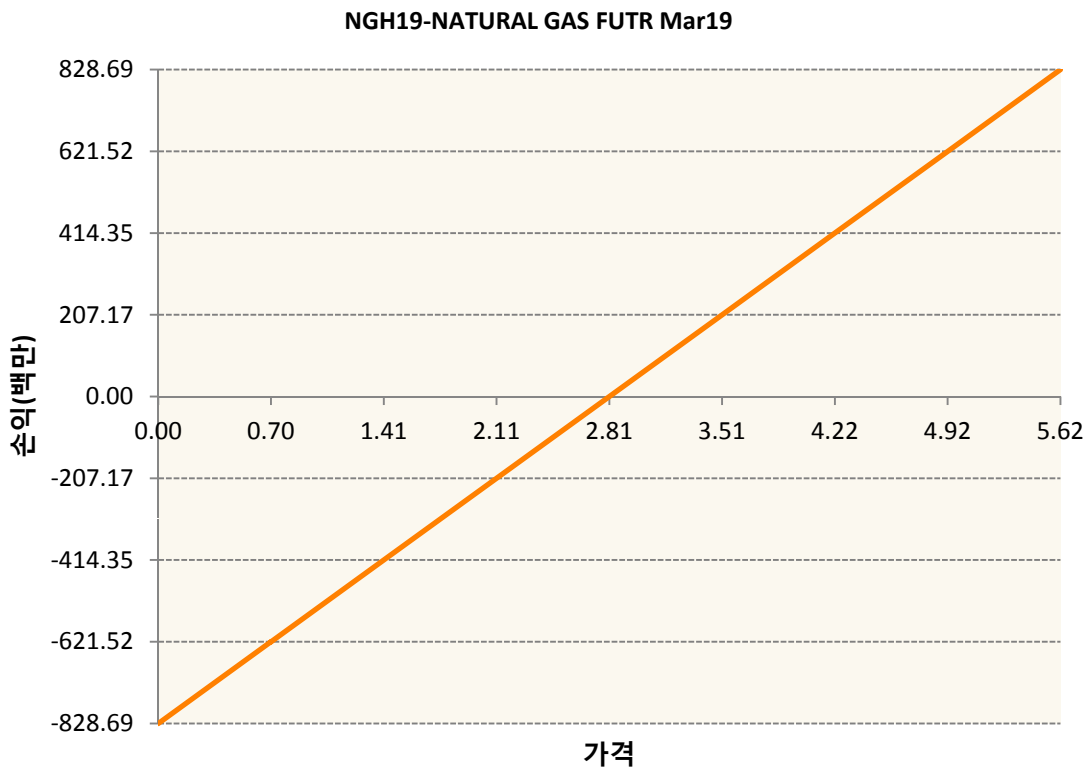
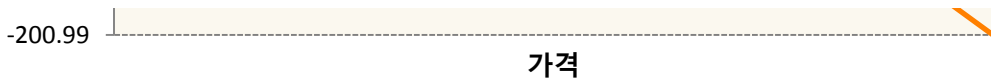


**HOH9-NY Harb ULSD Fut Mar19**



**KR4175P10003-2019-01 달러선물**





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

CLH9	WTI CRUDE FUTURE MAR19	38
COH9	BRENT CRUDE FUTR Mar19	56
HOH9	NY Harb ULSD Fut Mar19	29
KR4175P100	2019-01 달러선물	16
NGH19	NATURAL GAS FUTR Mar19	66
XBH9	GASOLINE RBOB FUT Mar19	22

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

**404**

공시일	2019-01-14
기준일	2019-01-11

## 애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

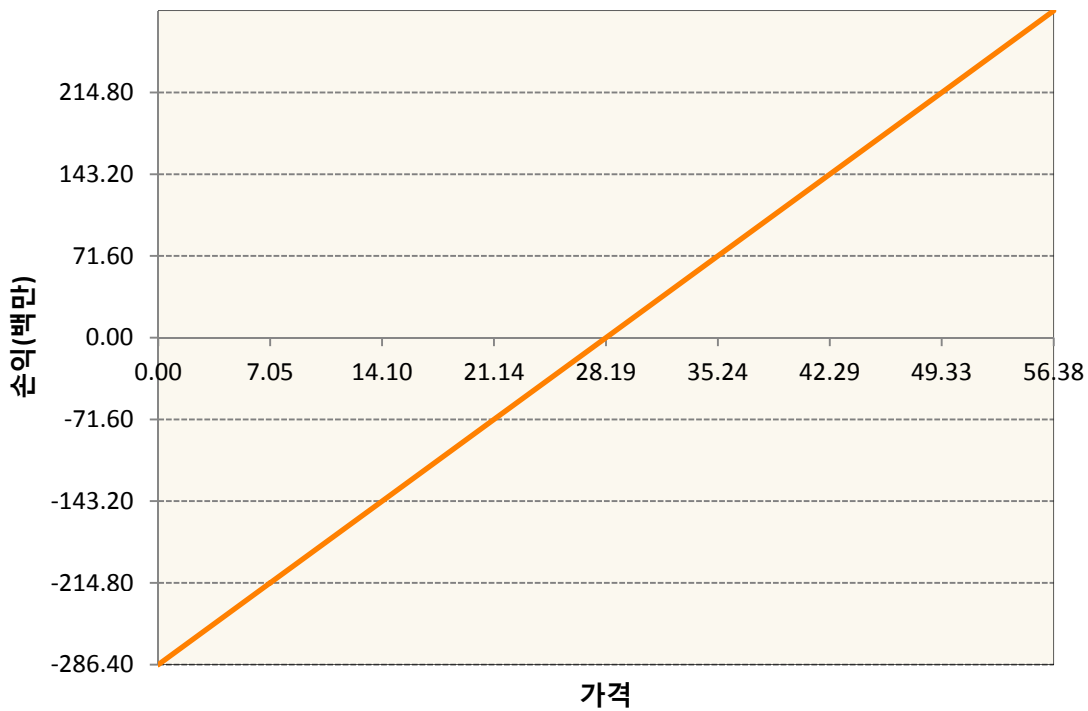
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

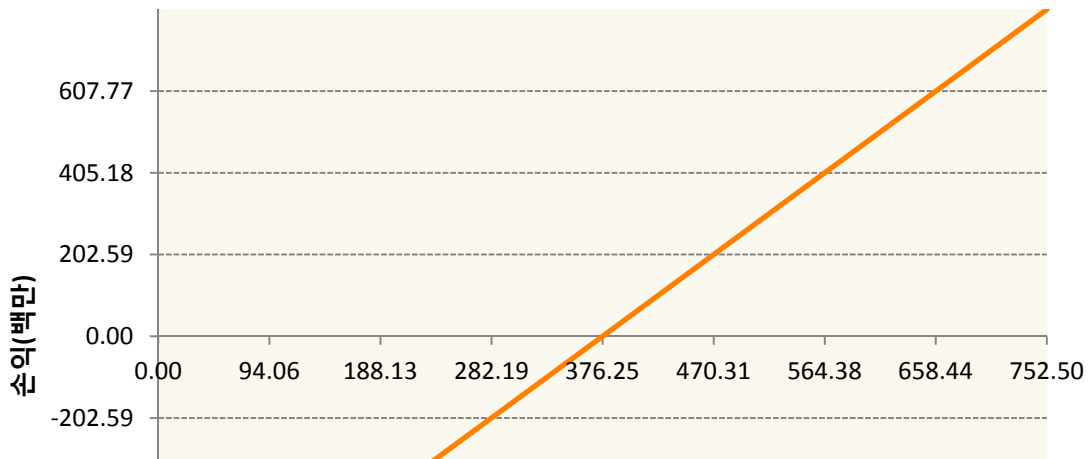
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,582	78	3,504	

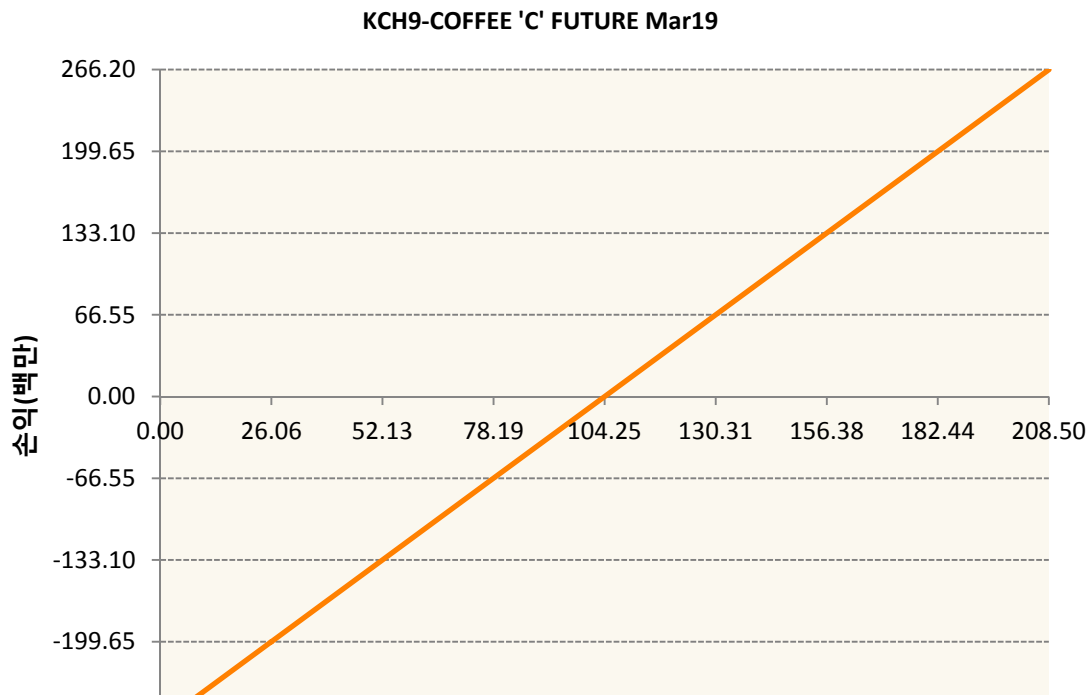
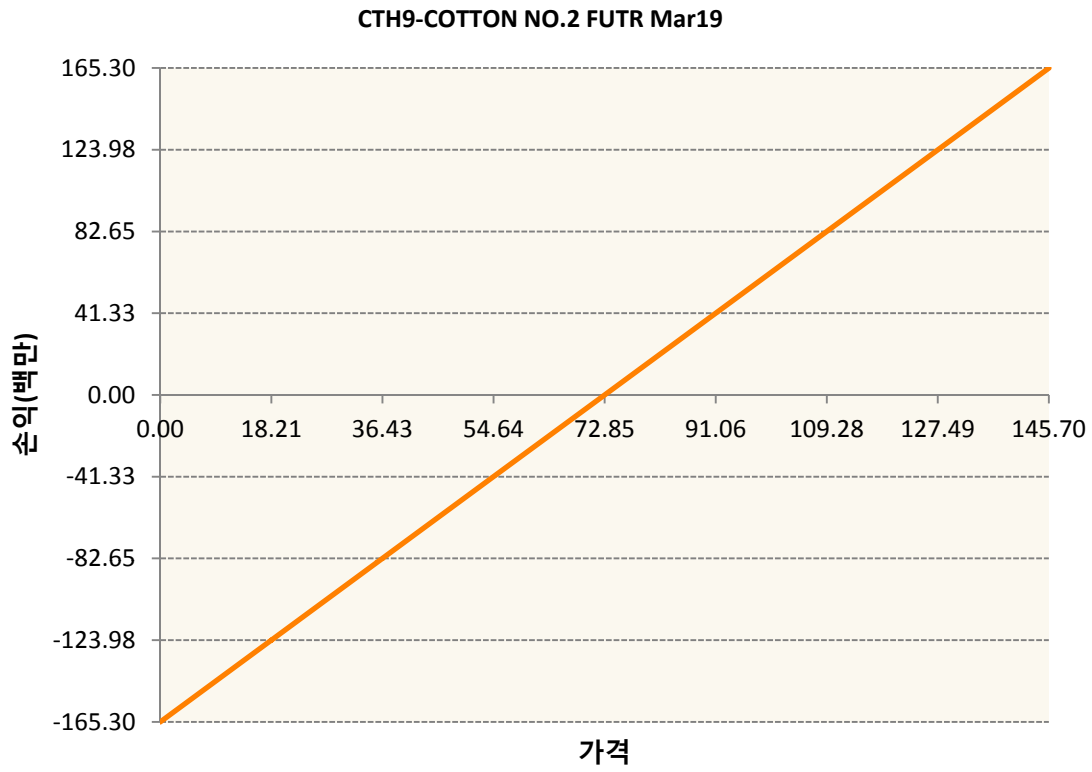
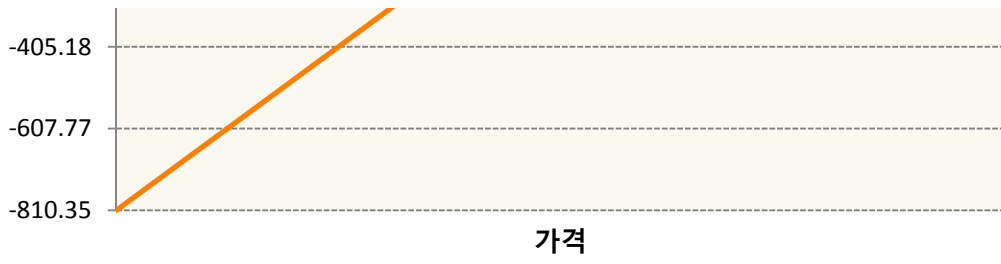
### 2. 만기시점의 손익구조

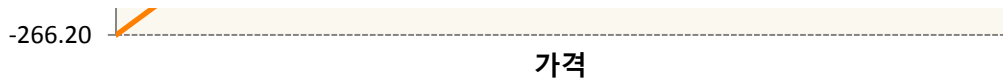
BOH9-SOYBEAN OIL FUTR Mar19



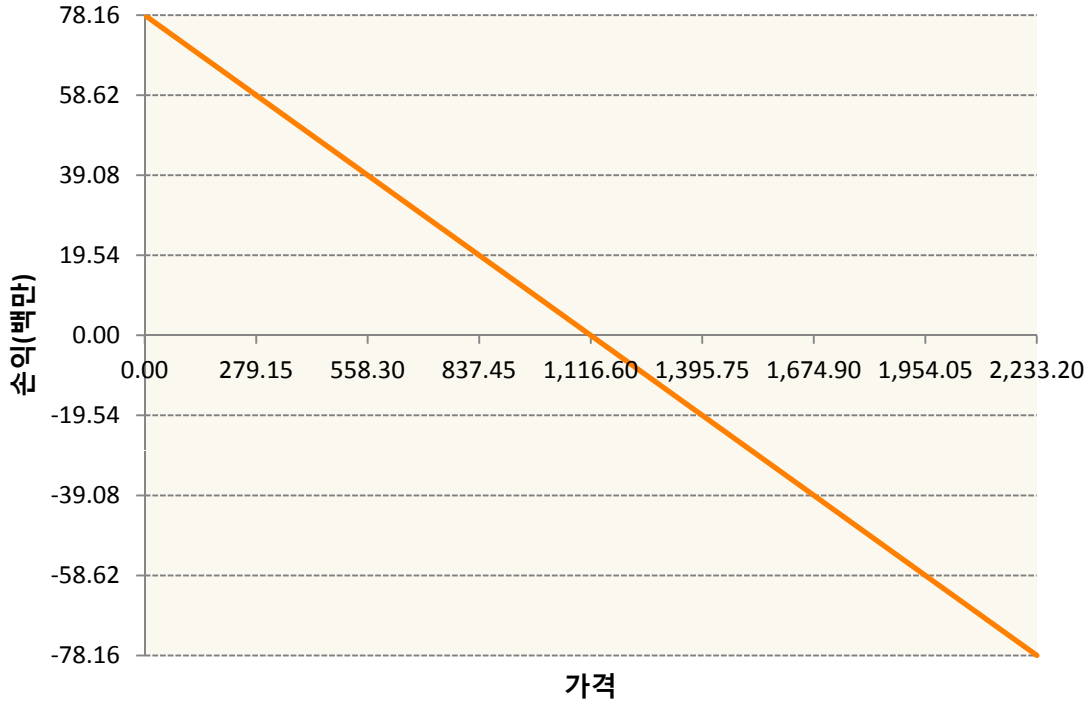
CH9-CORN FUTURE Mar19



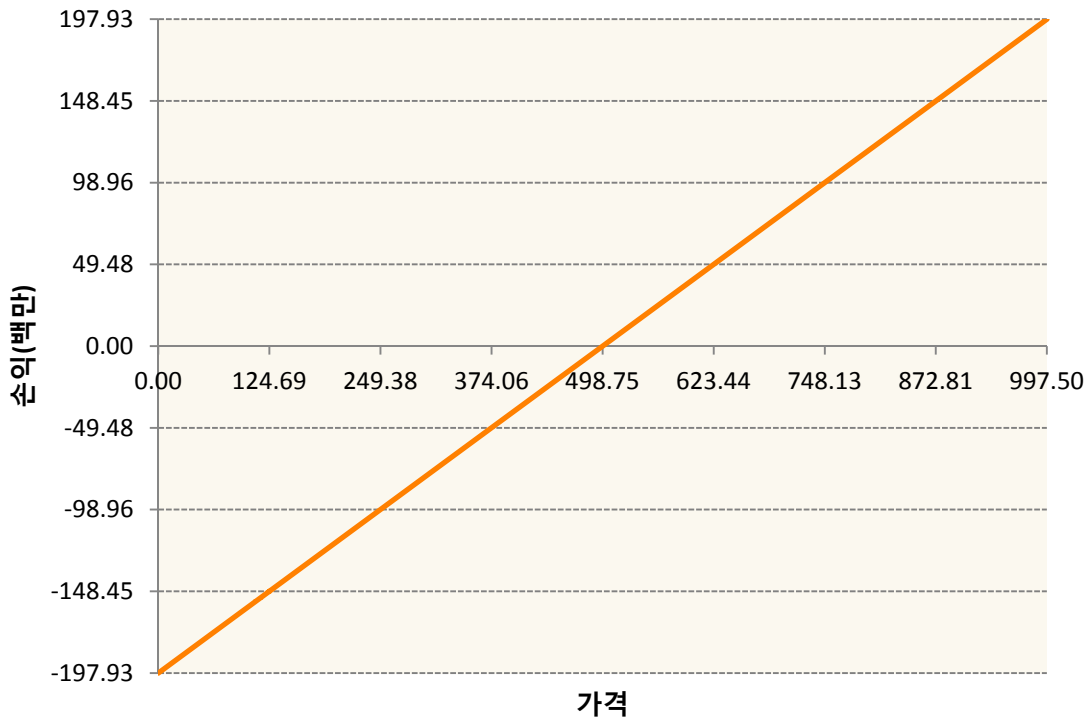




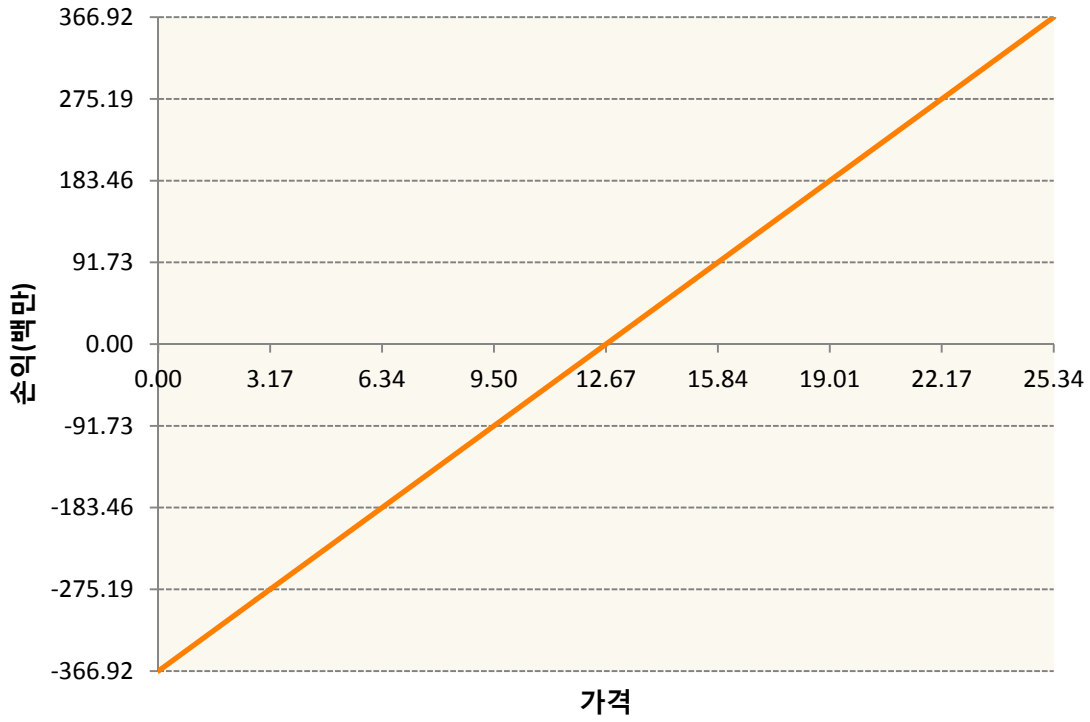
KR4175P10003-2019-01 달러선물



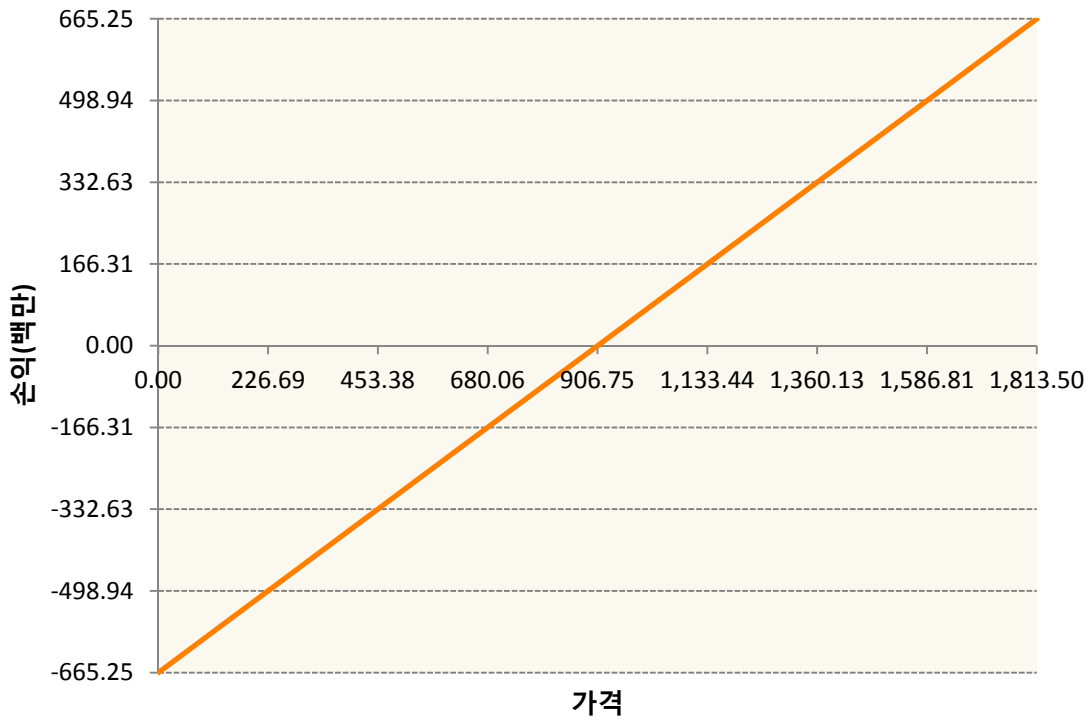
KWH9-KC HRW WHEAT FUT Mar19



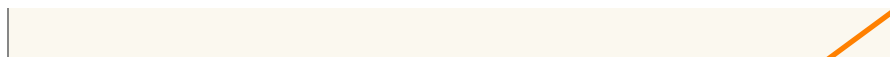
SBH9-SUGAR #11 (WORLD) MAR19

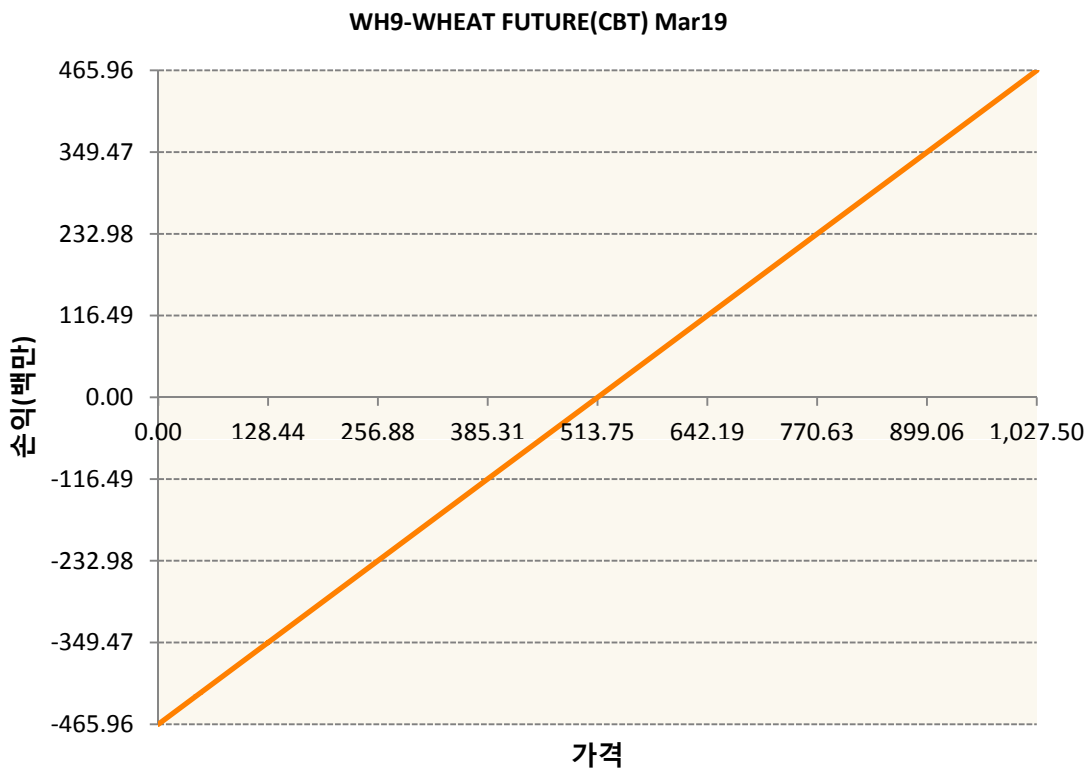
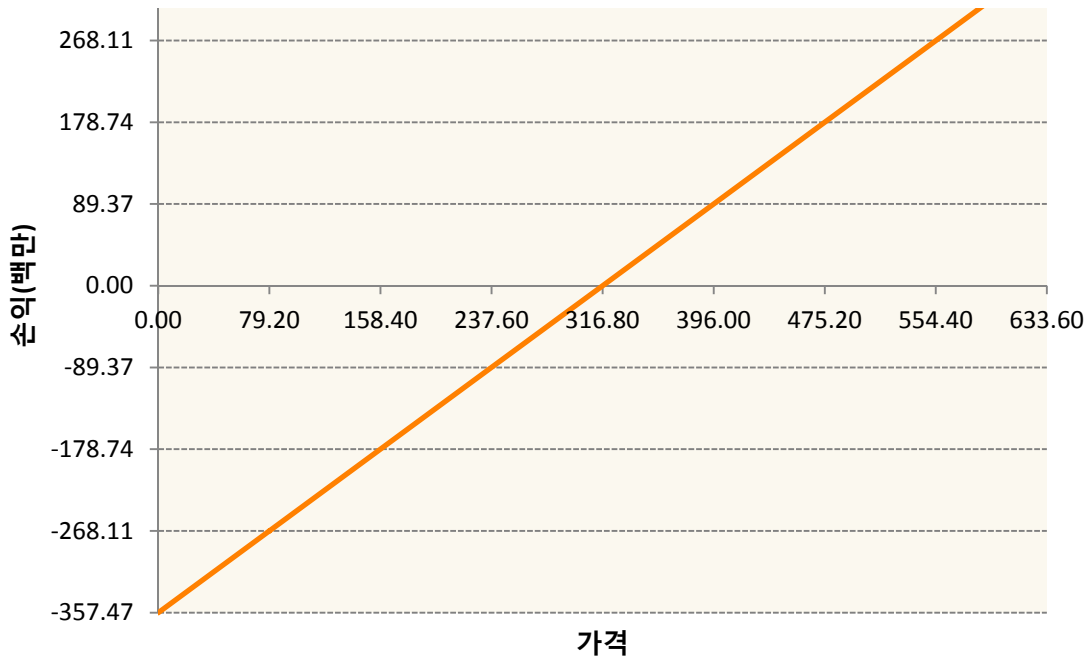


SH9-SOYBEAN FUTURE Mar19



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	29
SH9	SOYBEAN FUTURE Mar19	53
SMH9	SOYBEAN MEAL FUTR Mar19	29
WH9	WHEAT FUTURE(CBT) Mar19	37

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

(단위:백만원)

**301**