

공시일	2019-01-16
기준일	2019-01-15

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)

95

공시일	2019-01-16
기준일	2019-01-15

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

1,037

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

585

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-01-16
기준일	2019-01-15

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

270

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

401

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-01-16
기준일	2019-01-15

유로인덱스모(주식-파생형)

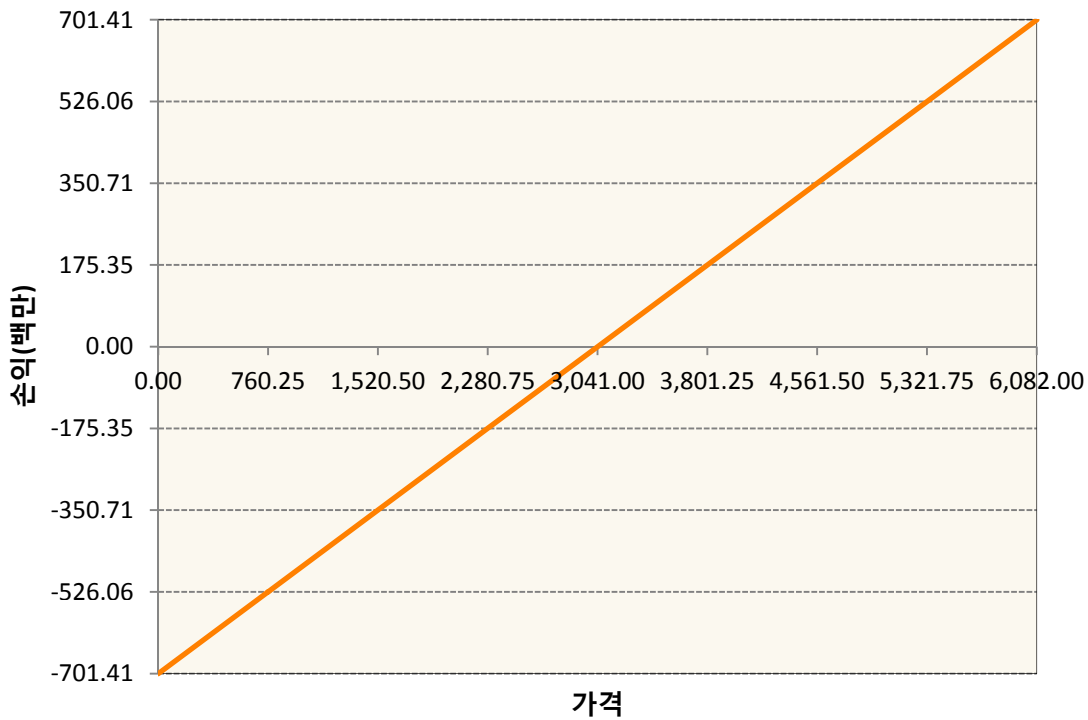
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	701	0	701	

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	2019-01-16
기준일	2019-01-15

차이나인덱스모(주식-파생형)

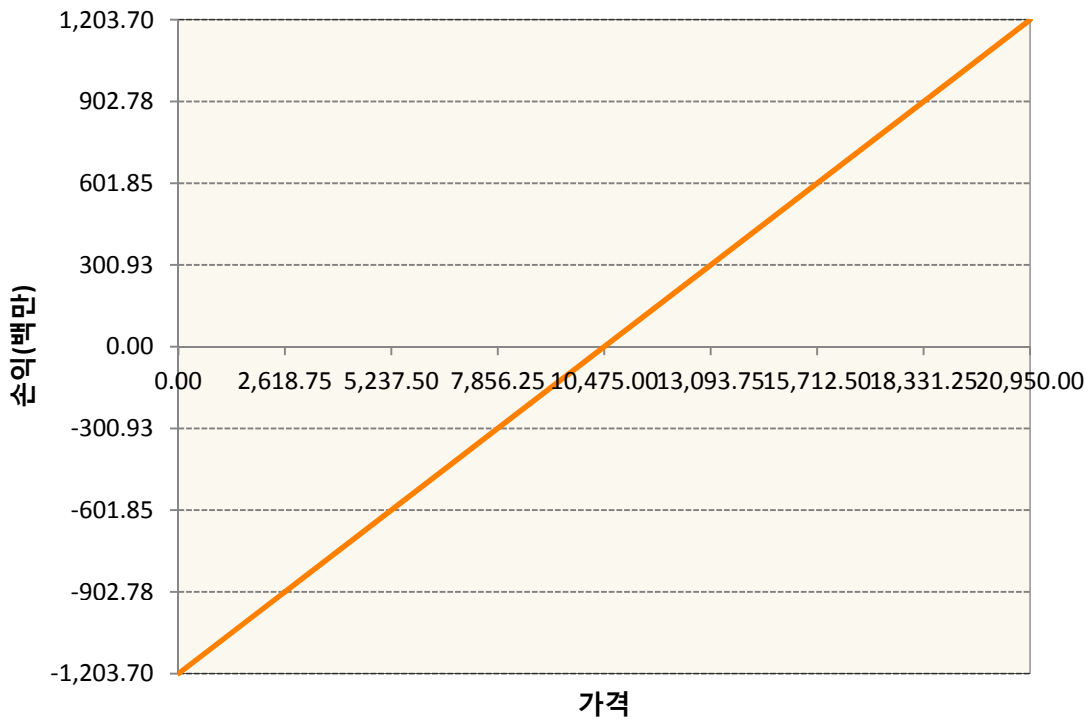
1. 계약금액

(단위:백만원)

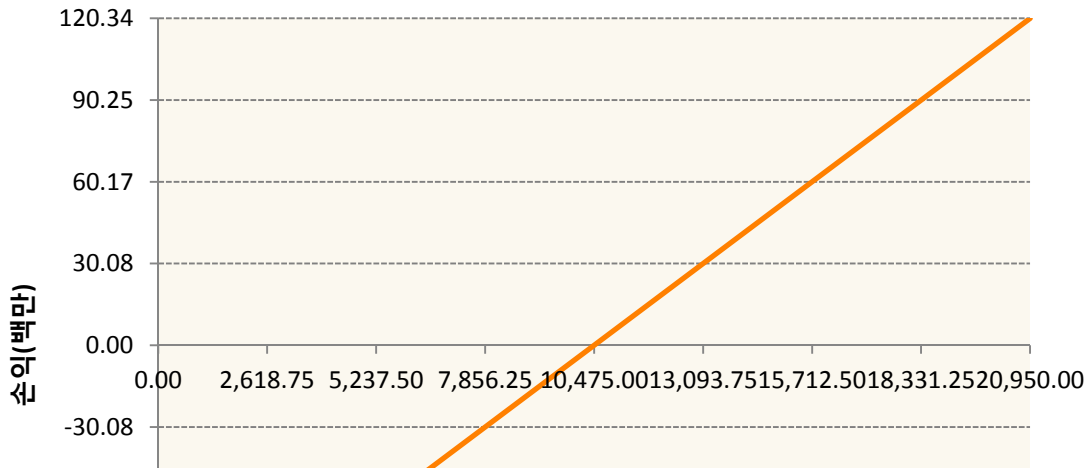
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,324	0	1,324	장내

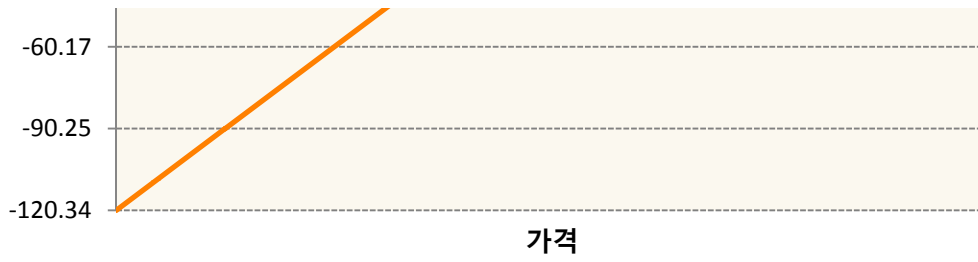
2. 만기시점의 손익구조

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)

108

공시일	2019-01-16
기준일	2019-01-15

커버드콜모(주식혼합-파생형)

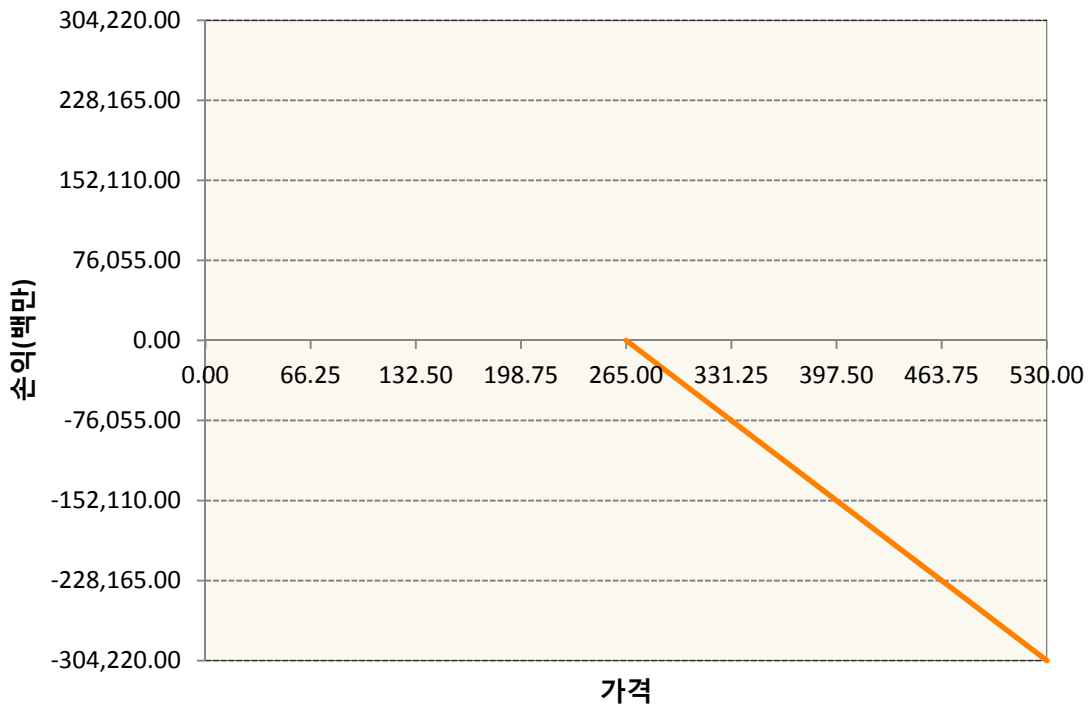
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	3,282	0	3,282	장내
누계	유가증권	옵션	0	716,505	-716,505	장내

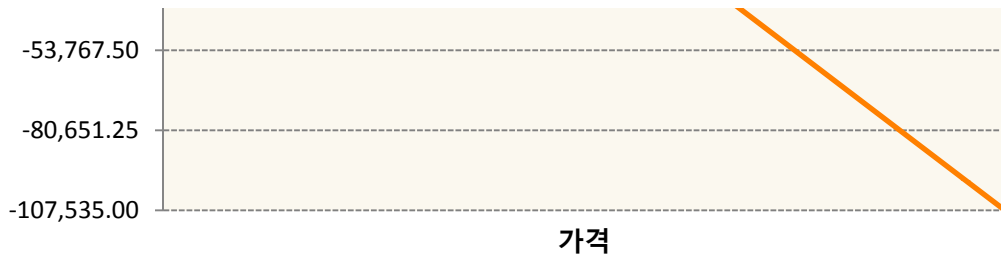
2. 만기시점의 손익구조

KR4201P22655-2019-02 콜265

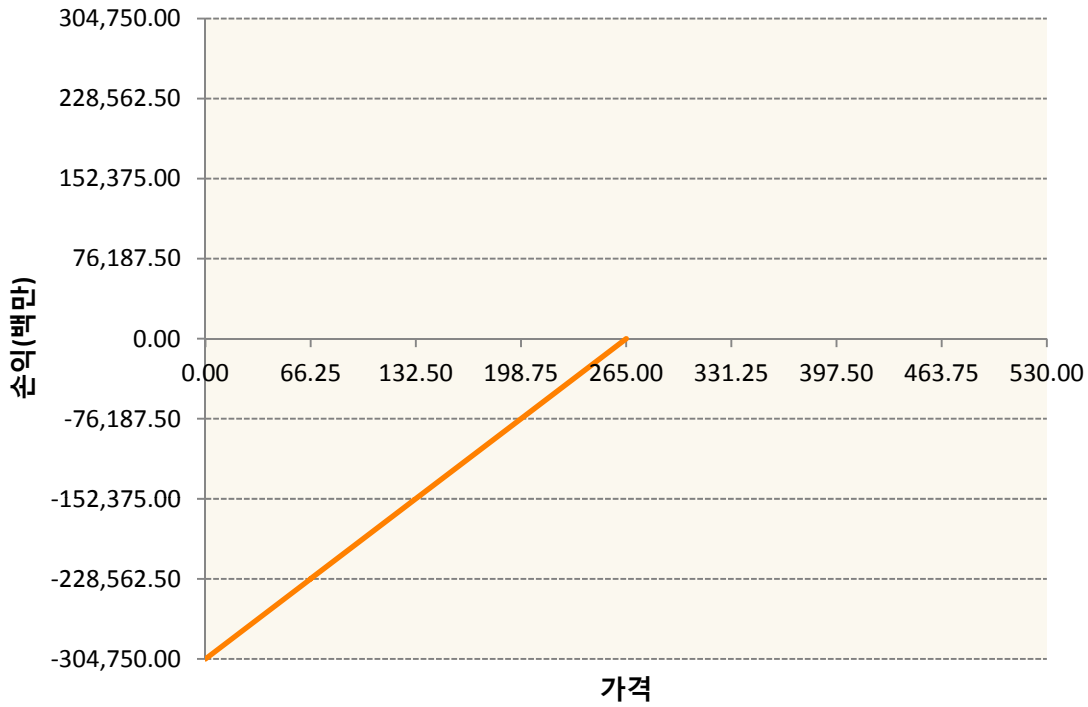


KR4201P22671-2019-02 콜267.5





KR4301P22653-2019-02 풋265



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201P22655		2019-02 콜265					20,558
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	11,268	10,866	10,418	9,932	9,415	8,872	8,306
-5.33%	9,662	9,047	8,411	7,758	7,092	6,417	5,732
-2.67%	6,711	5,966	5,220	4,473	3,726	2,978	2,229
0%	2,195	1,469	737	0	-741	-1,484	-2,230
2.67%	-3,766	-4,345	-4,955	-5,590	-6,244	-6,913	-7,596
5.33%	-10,804	-11,189	-11,626	-12,108	-12,627	-13,177	-13,754
8.00%	-18,502	-18,718	-18,991	-19,317	-19,690	-20,106	-20,558
KR4201P22671		2019-02 콜267.5					6,935
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	3,488	3,371	3,235	3,085	2,921	2,747	2,564

-5.33%	3,048	2,854	2,650	2,436	2,217	1,991	1,762
-2.67%	2,187	1,934	1,679	1,423	1,165	906	647
0%	797	532	266	0	-266	-533	-799
2.67%	-1,123	-1,350	-1,584	-1,825	-2,069	-2,318	-2,569
5.33%	-3,467	-3,629	-3,807	-3,998	-4,200	-4,411	-4,630
8.00%	-6,093	-6,189	-6,306	-6,442	-6,593	-6,758	-6,935
KR4301P22653 2019-02 풋265							17,066
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-16,259	-16,329	-16,425	-16,549	-16,698	-16,871	-17,066
-5.33%	-8,549	-8,793	-9,063	-9,354	-9,664	-9,988	-10,324
-2.67%	-2,408	-2,829	-3,253	-3,678	-4,105	-4,533	-4,961
0%	1,167	788	398	0	-404	-813	-1,226
2.67%	2,533	2,346	2,126	1,879	1,609	1,318	1,011
5.33%	2,859	2,806	2,727	2,622	2,490	2,333	2,153
8.00%	2,907	2,898	2,879	2,847	2,800	2,734	2,649

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

(단위:백만원)

43,249

공시일	2019-01-16
기준일	2019-01-15

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

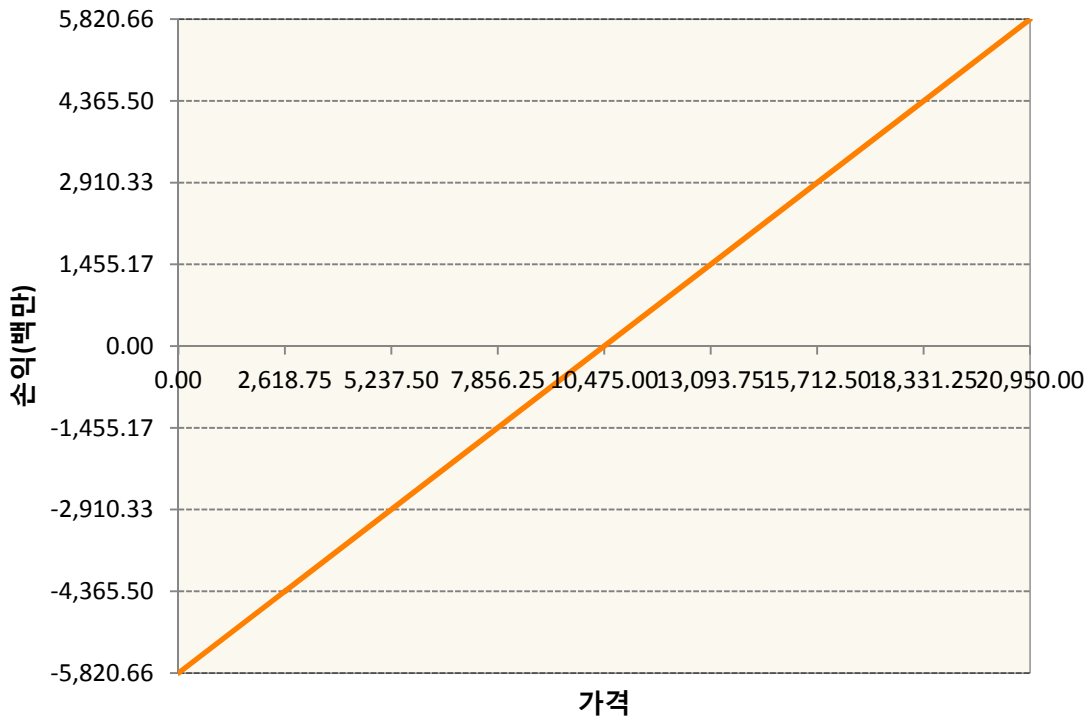
1. 계약금액

(단위:백만원)

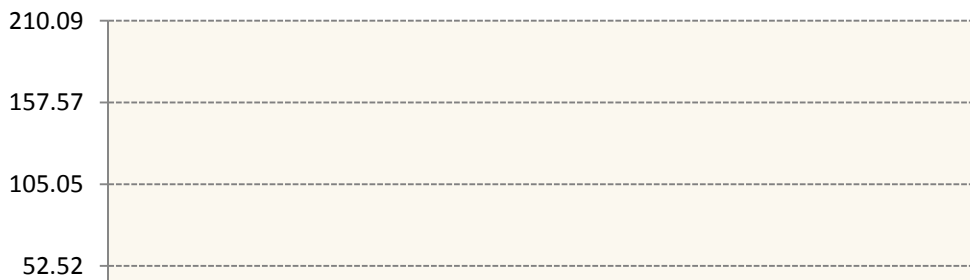
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	5,821	0	5,821	장내
누계	유가증권	옵션	0	12,283	-12,283	장내
누계	통화	선도	0	2,715	-2,715	장외

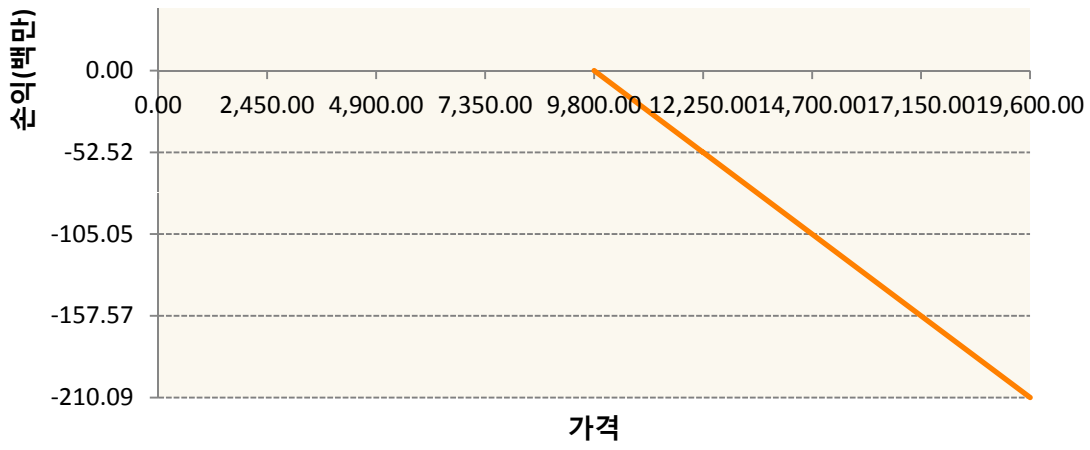
2. 만기시점의 손익구조

HCF9-HSCEI FUTURES JAN19

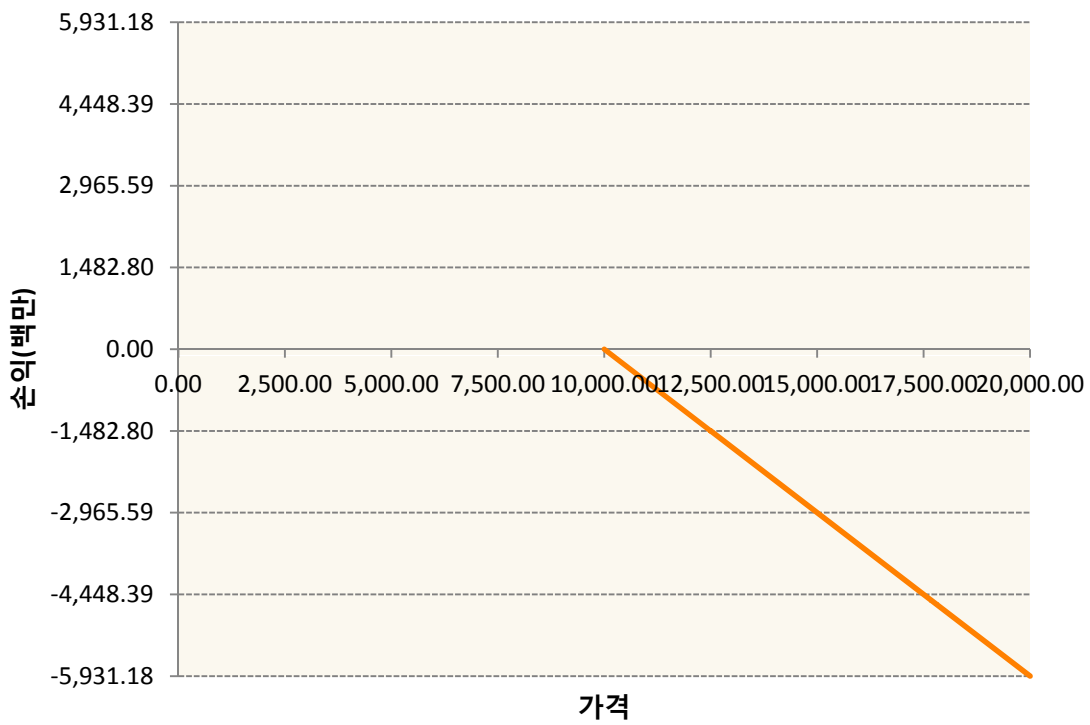


OHHIF9-C098-HSCEI

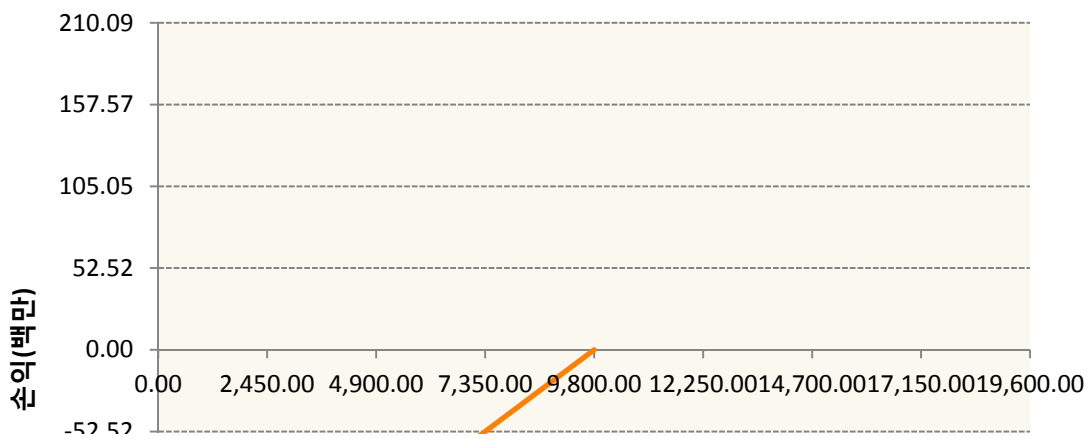


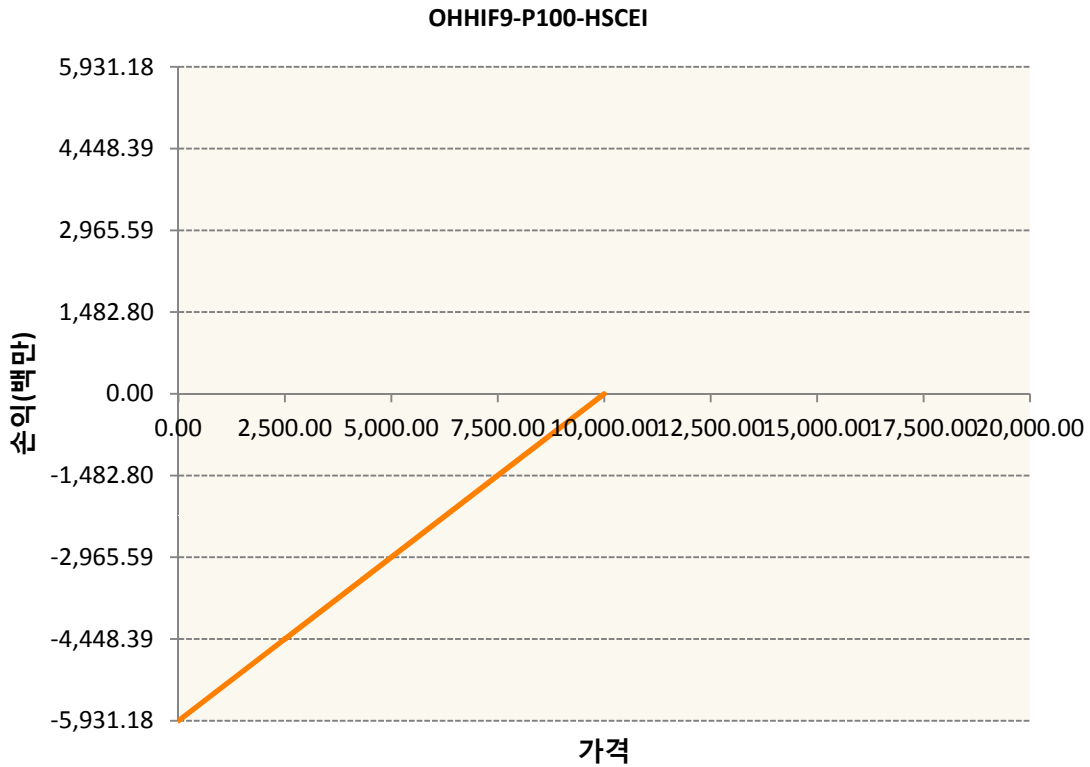
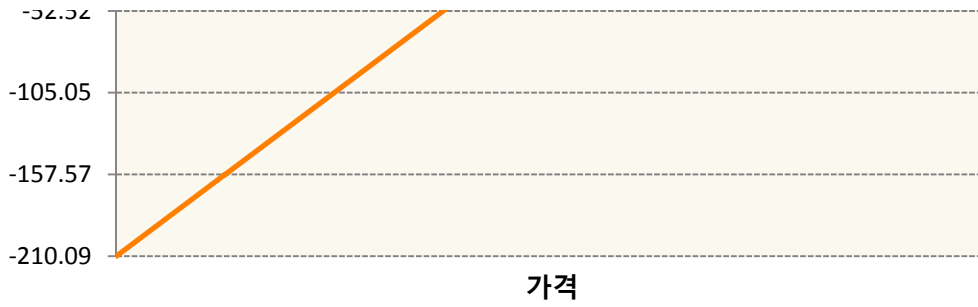


OHHIF9-C100-HSCEI



OHHIF9-P098-HSCEI





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

FX21018Z00 KRW/HKD 11-03-19E	217
HCF9 HSCEI FUTURES JAN19	466
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)

1,564

공시일	2019-01-16
기준일	2019-01-15

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

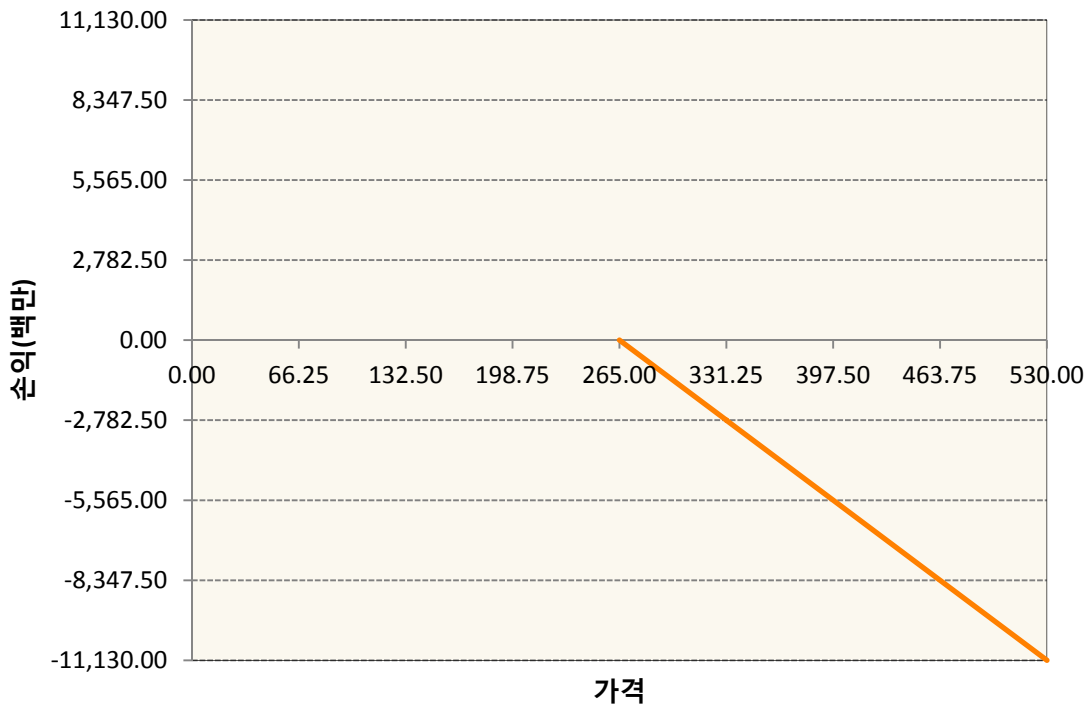
1. 계약금액

(단위:백만원)

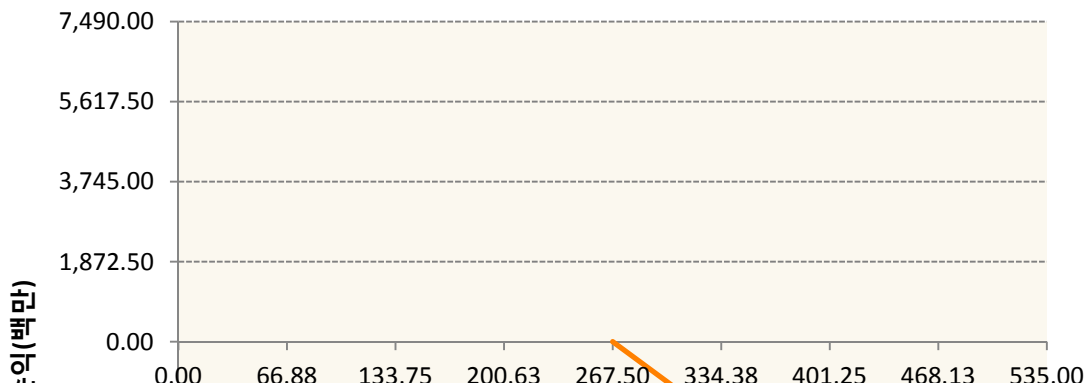
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	스왑	31,836	0	31,836	장외
누계	유가증권	옵션	0	33,858	-33,858	장내

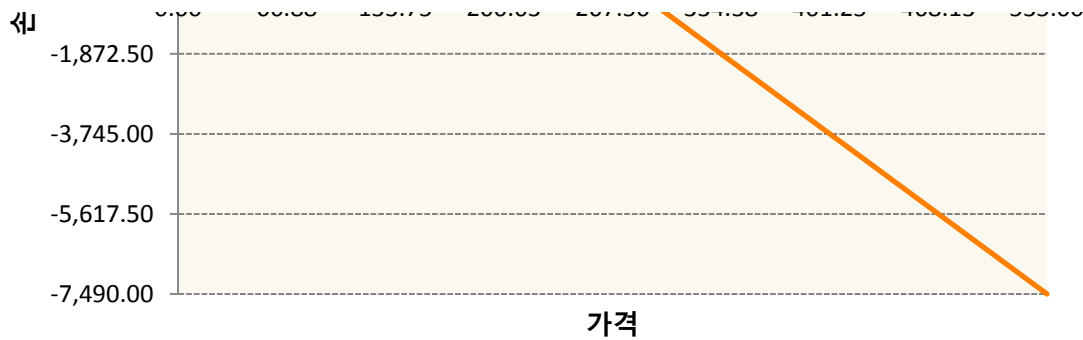
2. 만기시점의 손익구조

KR4201P22655-2019-02 콜265

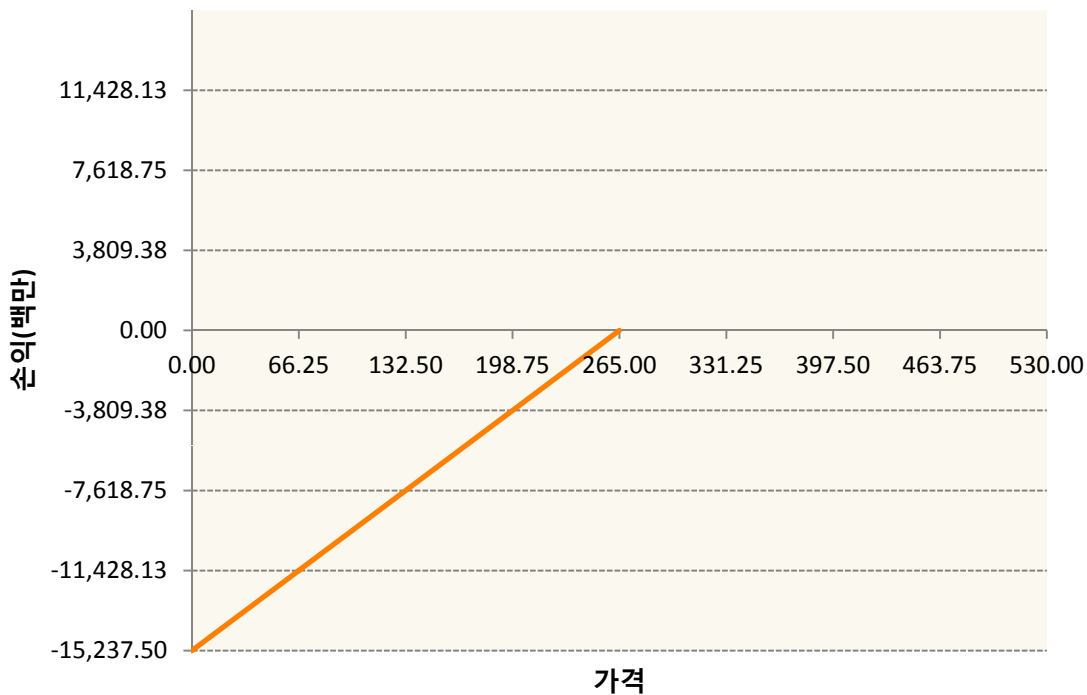


KR4201P22671-2019-02 콜267.5





KR4301P22653-2019-02 풋265



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

	2.529E+11		UBCSFXC1 INDEX_14				2,651
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-2,651	-2,651	-2,651	-2,651	-2,651	-2,651	-2,651
-5.33%	-1,767	-1,767	-1,767	-1,767	-1,767	-1,767	-1,767
-2.67%	-884	-884	-884	-884	-884	-884	-884
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	884	884	884	884	884	884	884
5.33%	1,767	1,767	1,767	1,767	1,767	1,767	1,767
8.00%	2,651	2,651	2,651	2,651	2,651	2,651	2,651
	KR4201P22655		2019-02 풋265				752
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	412	398	381	363	344	325	304	
-5.33%	353	331	308	284	259	235	210	
-2.67%	246	218	191	164	136	109	82	
0%	80	54	27	0	-27	-54	-82	
2.67%	-138	-159	-181	-205	-228	-253	-278	
5.33%	-395	-409	-425	-443	-462	-482	-503	
8.00%	-677	-685	-695	-707	-720	-736	-752	
KR4201P22671							2019-02 콜267.5	483

기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	243	235	225	215	203	191	179	
-5.33%	212	199	185	170	154	139	123	
-2.67%	152	135	117	99	81	63	45	
0%	55	37	19	0	-19	-37	-56	
2.67%	-78	-94	-110	-127	-144	-161	-179	
5.33%	-242	-253	-265	-278	-293	-307	-322	
8.00%	-424	-431	-439	-449	-459	-471	-483	
KR4301P22653							2019-02 풋265	853

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-813	-816	-821	-827	-835	-844	-853
-5.33%	-427	-440	-453	-468	-483	-499	-516
-2.67%	-120	-141	-163	-184	-205	-227	-248
0%	58	39	20	0	-20	-41	-61
2.67%	127	117	106	94	80	66	51
5.33%	143	140	136	131	125	117	108
8.00%	145	145	144	142	140	137	132

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

(단위:백만원)

4,675

공시일	2019-01-16
기준일	2019-01-15

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

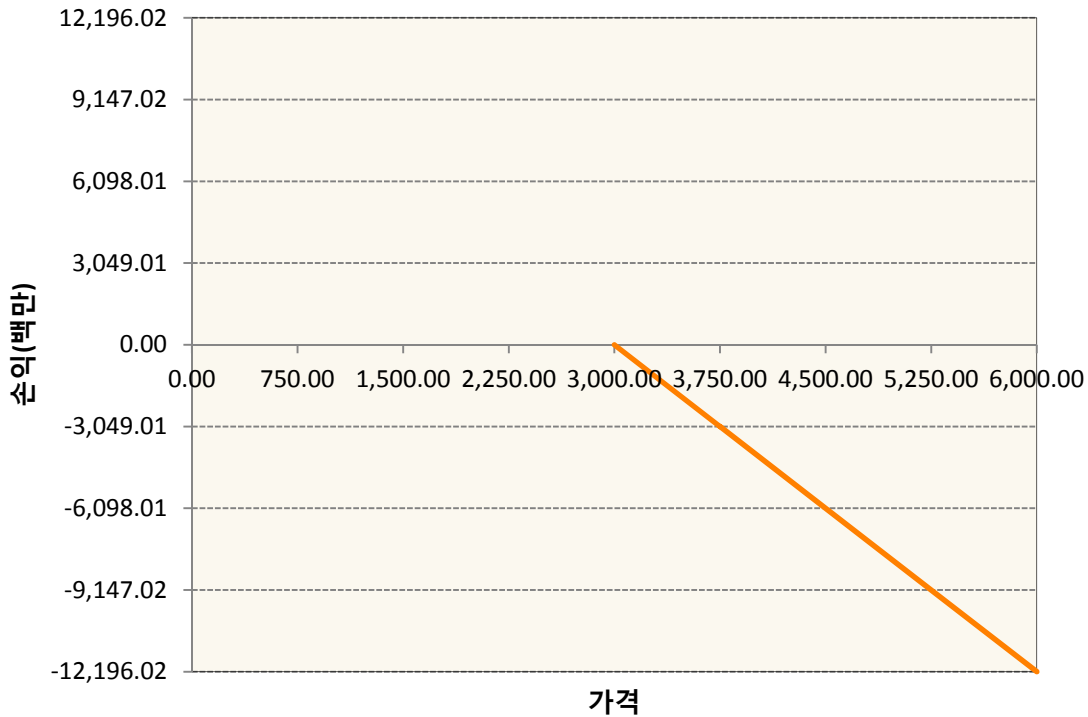
1. 계약금액

(단위:백만원)

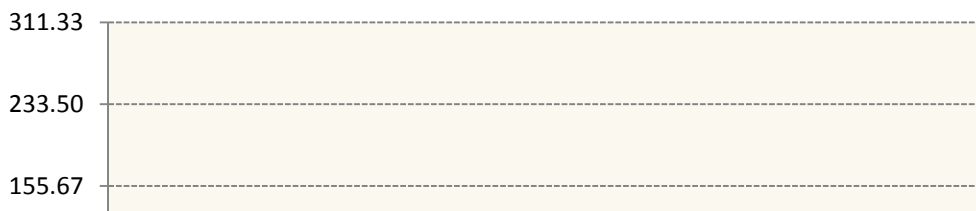
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	6,583	0	6,583	
누계	유가증권	스왑	71,856	0	71,856	장외
누계	유가증권	옵션	0	25,015	-25,015	장내
누계	통화	선도	0	15,438	-15,438	장외

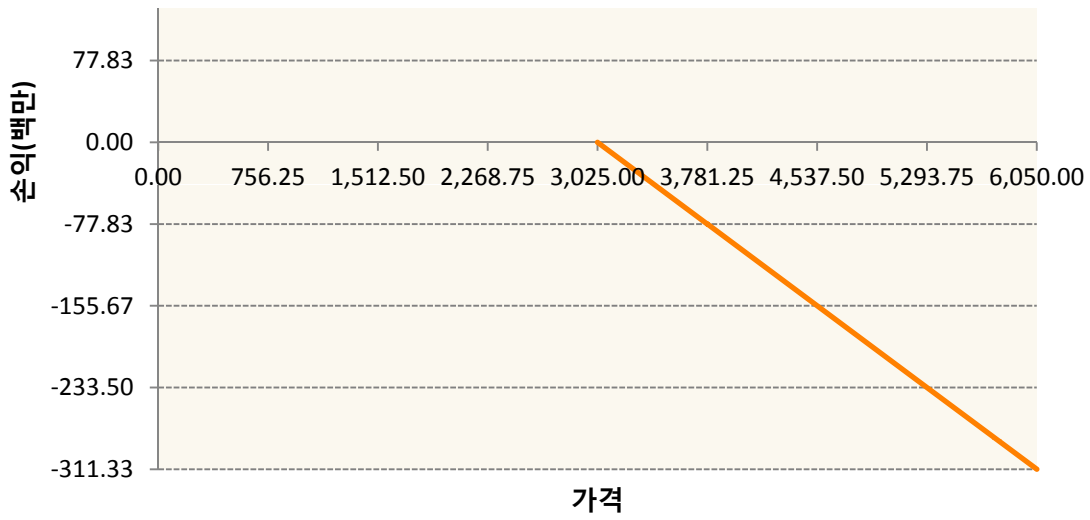
2. 만기시점의 손익구조

OESXF9-C3000-EURO STOXX 50

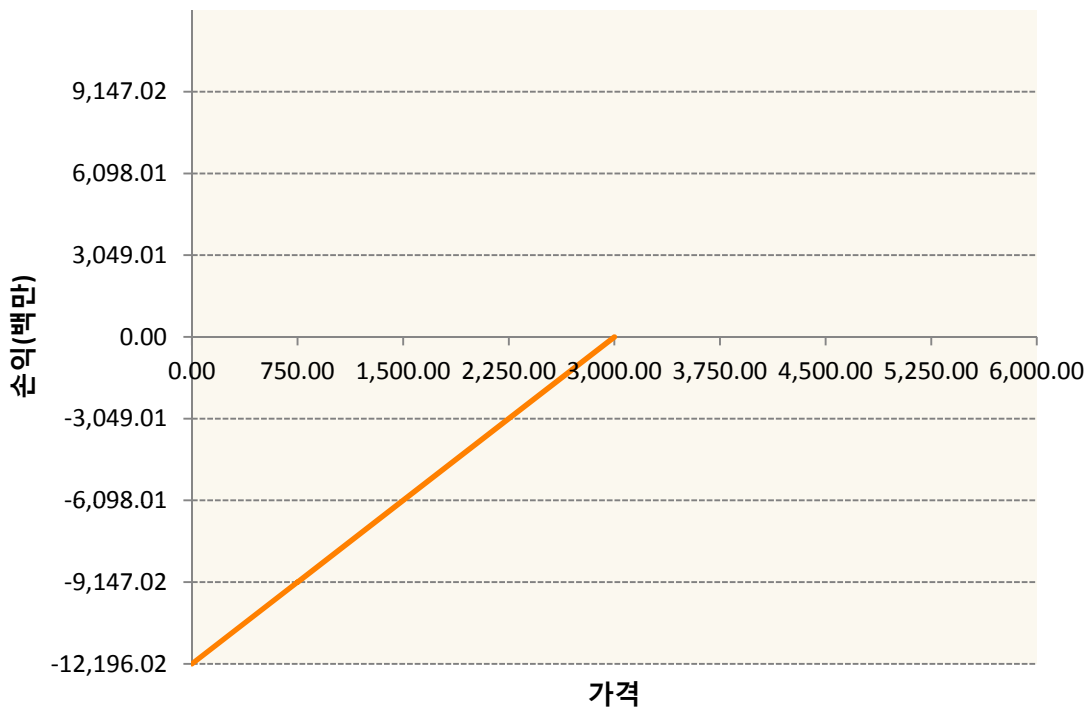


OESXF9-C3025-EURO STOXX 50

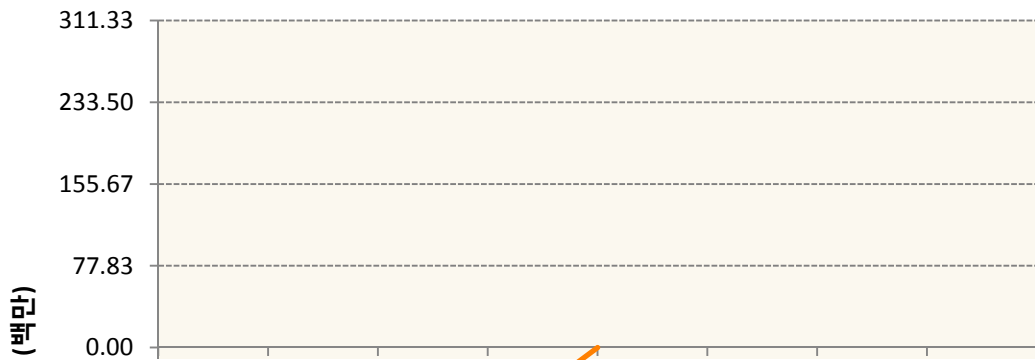


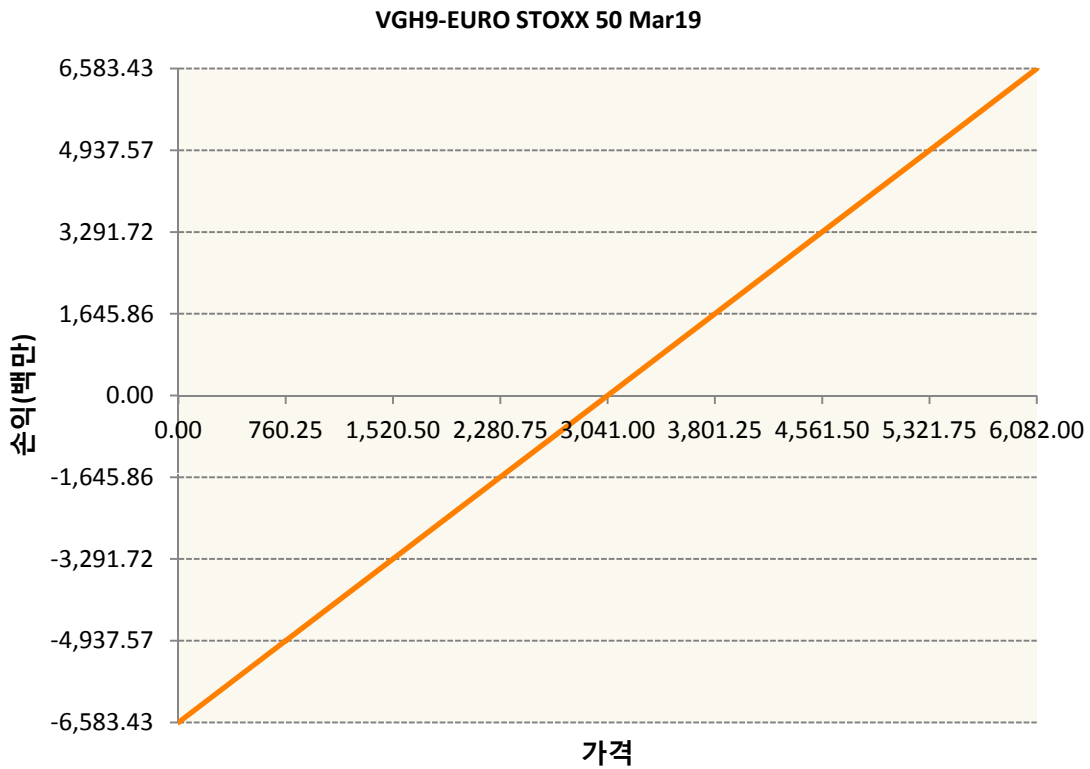
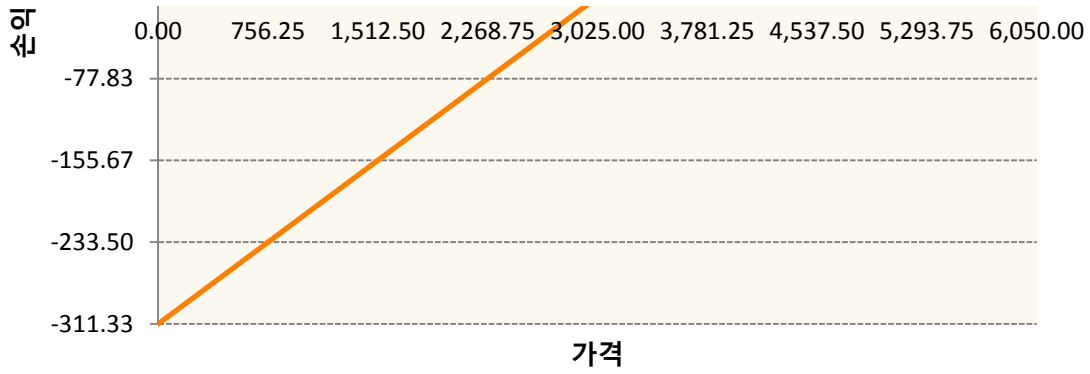


OESXF9-P3000-EURO STOXX 50



OESXF9-P3025-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY		73
FX21018X02 KRW/EUR 22-02-19E		412
FX21018Z03 KRW/EUR 22-03-19E		823
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		527

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

(단위:백만원)

2,495

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

(단위:백만원)

1,115

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

(단위:백만원)

95

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

(단위:백만원)

142

공시일	2019-01-16
기준일	2019-01-15

스마트KRX300인덱스목표전환형1호

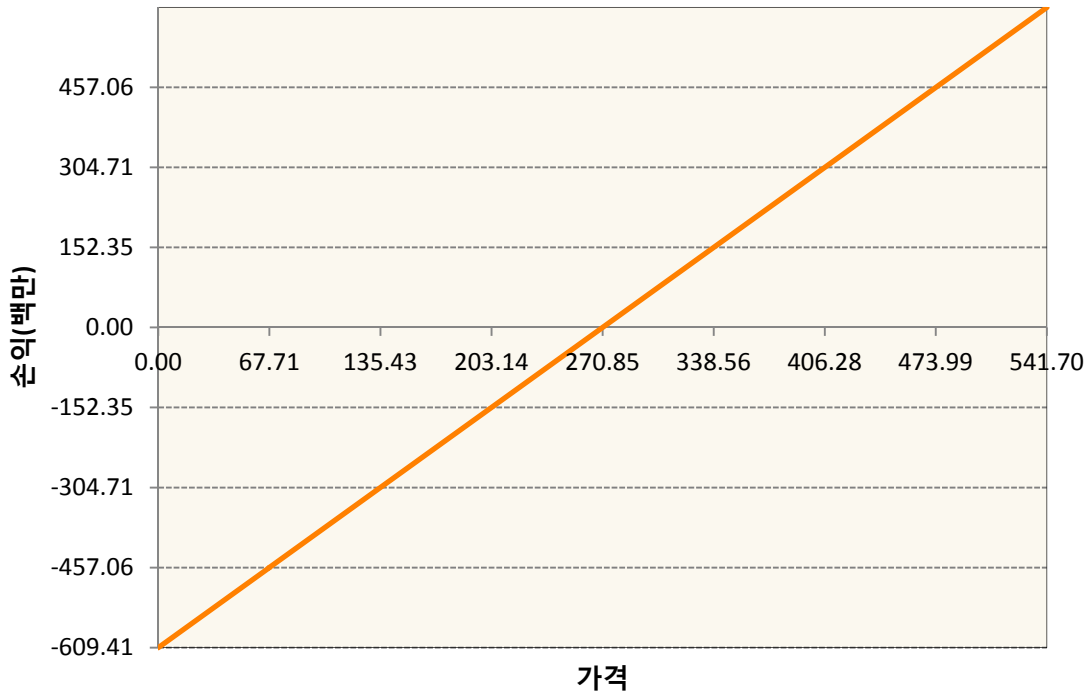
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	609	0	609	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101P30007-2019-03 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101P30007 2019-03 코스피200지수선물 49

가격	기초자산의 변동성						
	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-49	-49	-49	-49	-49	-49	-49
-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%	49	49	49	49	49	49	49

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

(단위:백만원)

43

공시일	2019-01-16
기준일	2019-01-15

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

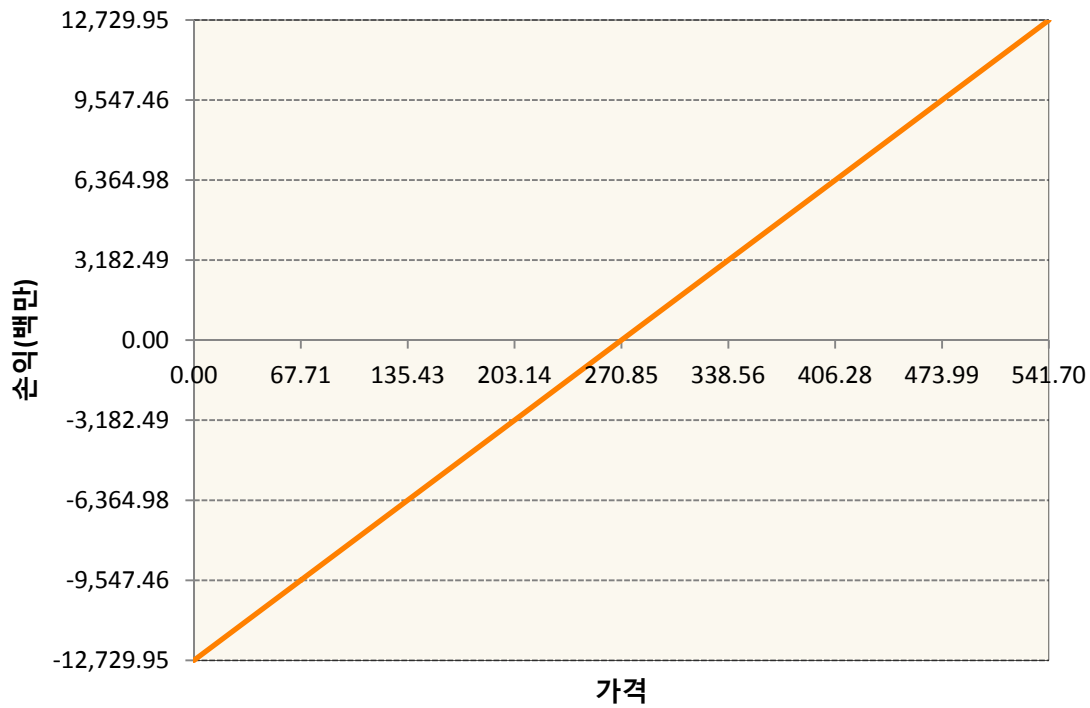
1. 계약금액

(단위:백만원)

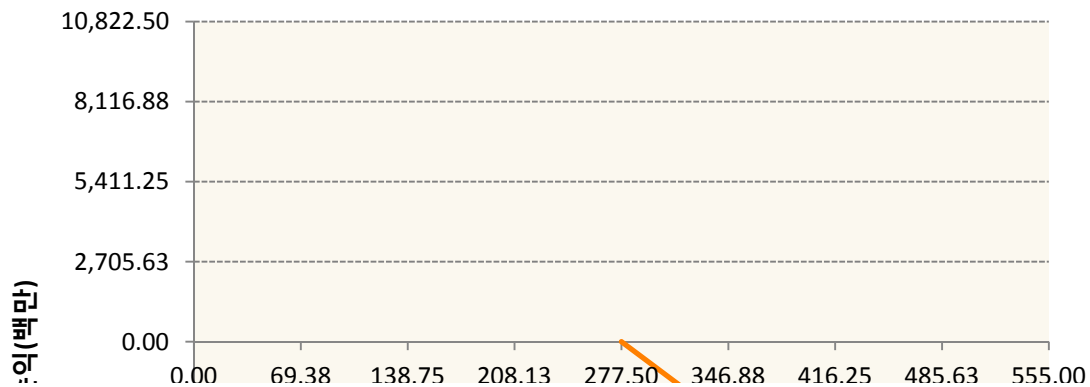
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	12,730	0	12,730	장내
누계	유가증권	옵션	2,523	23,213	-20,690	장내

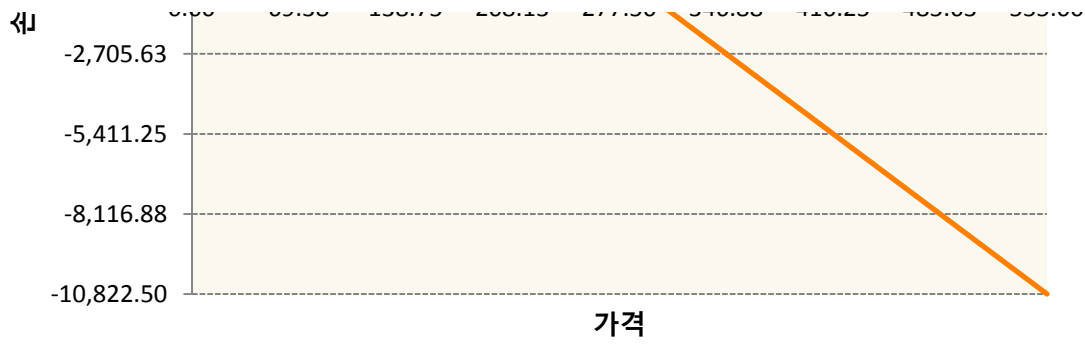
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P30007-2019-03 코스피200지수선물

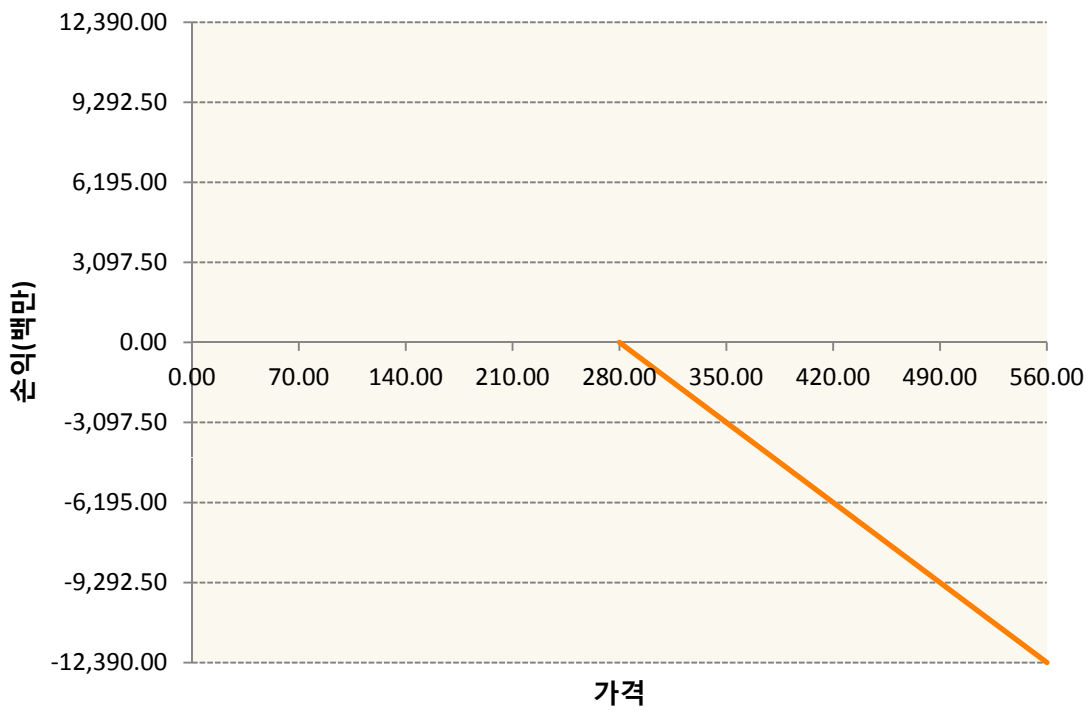


KR4201P22770-2019-02 콜277.5

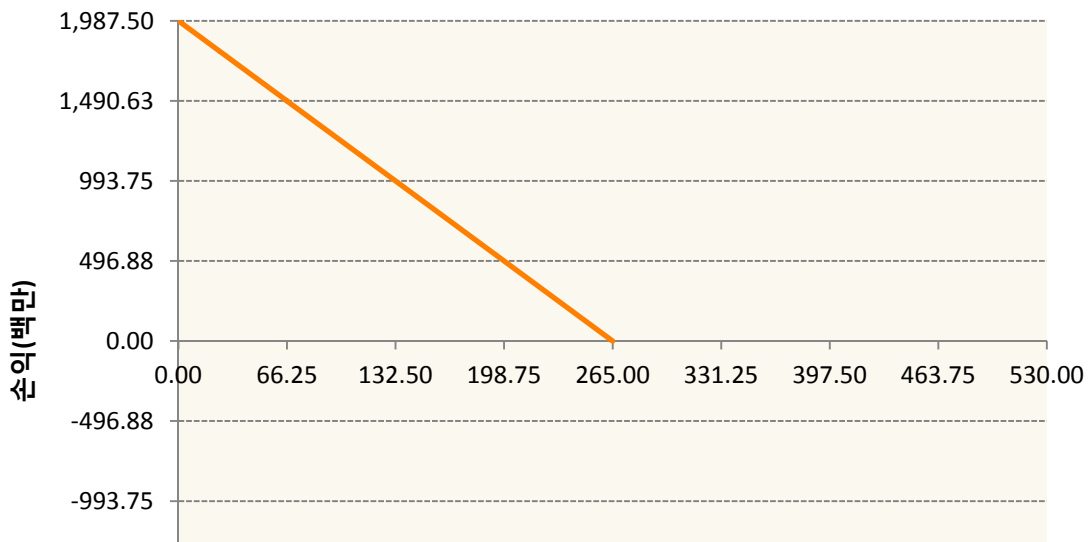


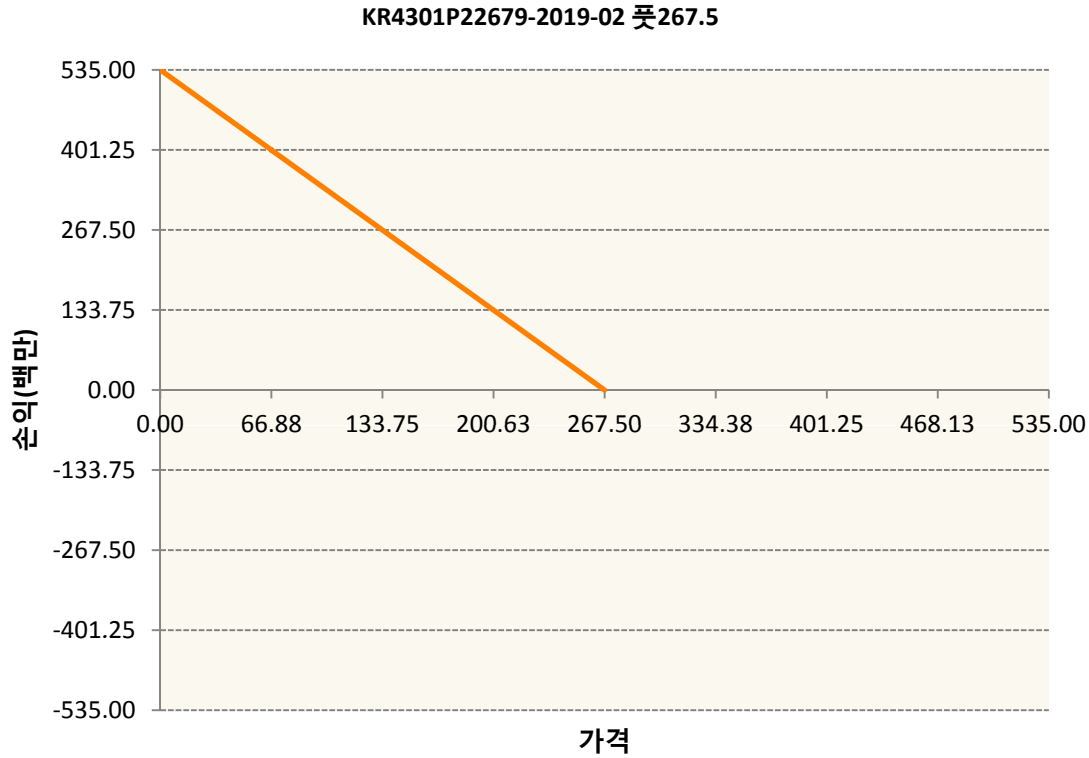
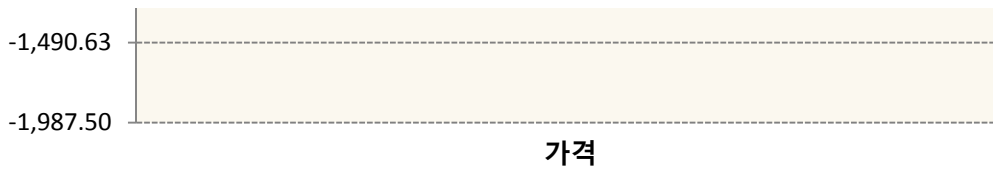


KR4201P22804-2019-02 콜280



KR4301P22653-2019-02 풋265





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101P30007		2019-03 코스피200지수선물						1,015
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-1,015	-1,015	-1,015	-1,015	-1,015	-1,015	-1,015	
-5.33%	-677	-677	-677	-677	-677	-677	-677	
-2.67%	-338	-338	-338	-338	-338	-338	-338	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	338	338	338	338	338	338	338	
5.33%	677	677	677	677	677	677	677	
8.00%	1,015	1,015	1,015	1,015	1,015	1,015	1,015	
KR4201P22770		2019-02 콜277.5						551
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	188	183	177	169	160	150	138	
-5.33%	174	165	153	140	125	109	92	
-2.67%	141	124	105	86	65	44	22	

0%	73	49	25	0	-25	-50	-75
2.67%	-43	-69	-96	-123	-150	-177	-204
5.33%	-209	-234	-259	-285	-311	-337	-363
8.00%	-420	-439	-460	-482	-504	-527	-551
KR4201P22804 2019-02 콜280							587
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	179	176	170	163	154	144	132
-5.33%	169	160	149	136	121	105	87
-2.67%	140	123	105	84	63	41	17
0%	77	52	27	0	-27	-55	-82
2.67%	-34	-64	-95	-125	-155	-186	-216
5.33%	-203	-233	-263	-293	-324	-354	-385
8.00%	-426	-450	-476	-503	-530	-558	-587
KR4301P22653 2019-02 풋265							111
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	106	106	107	108	109	110	111
-5.33%	56	57	59	61	63	65	67
-2.67%	16	18	21	24	27	30	32
0%	-8	-5	-3	0	3	5	8
2.67%	-17	-15	-14	-12	-10	-9	-7
5.33%	-19	-18	-18	-17	-16	-15	-14
8.00%	-19	-19	-19	-19	-18	-18	-17
KR4301P22679 2019-02 풋267.5							32
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	31	31	31	32	32	32	32
-5.33%	17	18	18	19	19	19	20
-2.67%	6	6	7	8	8	9	10
0%	-2	-1	-1	0	1	2	2
2.67%	-6	-5	-5	-4	-4	-3	-2
5.33%	-7	-7	-6	-6	-6	-5	-5
8.00%	-7	-7	-7	-7	-7	-6	-6

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

(단위:백만원)

1,945

공시일	2019-01-16
기준일	2019-01-15

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	617	0	617	

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	2019-01-16
기준일	2019-01-15

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	2,405	0	2,405	

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	2019-01-16
기준일	2019-01-15

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	3,298	0	3,298	
누계	통화	선도	0	3,418	-3,418	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		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
FX21019F00 KRW/USD 19-02-19E		13

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

(단위:백만원)

104

공시일	2019-01-16
기준일	2019-01-15

스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

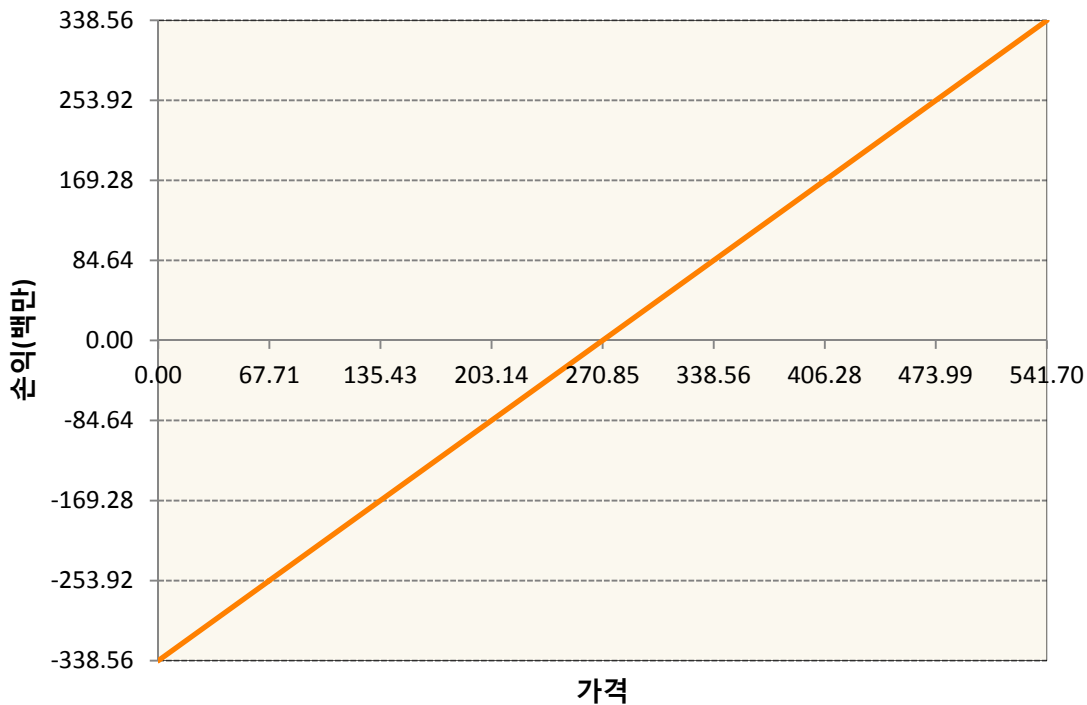
1. 계약금액

(단위:백만원)

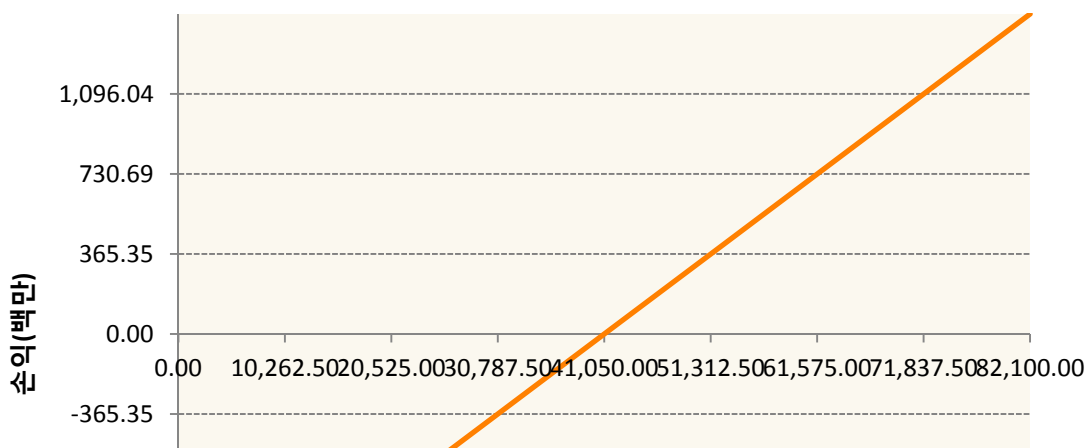
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,800	0	1,800	장내

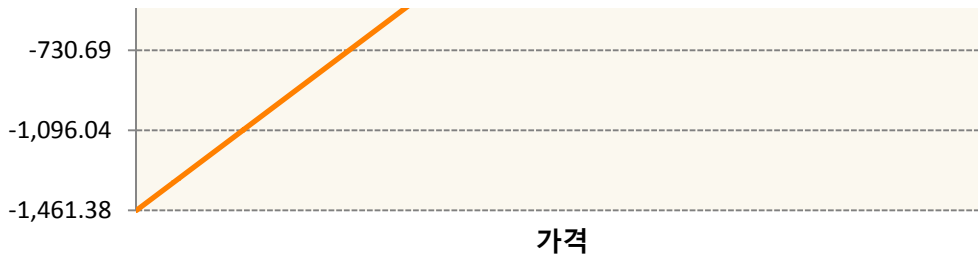
2. 만기시점의 손익구조

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						117
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-117	-117	-117	-117	-117	-117	-117	
-5.33%	-78	-78	-78	-78	-78	-78	-78	
-2.67%	-39	-39	-39	-39	-39	-39	-39	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	39	39	39	39	39	39	39	
5.33%	78	78	78	78	78	78	78	
8.00%	117	117	117	117	117	117	117	

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

160

공시일	2019-01-16
기준일	2019-01-15

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

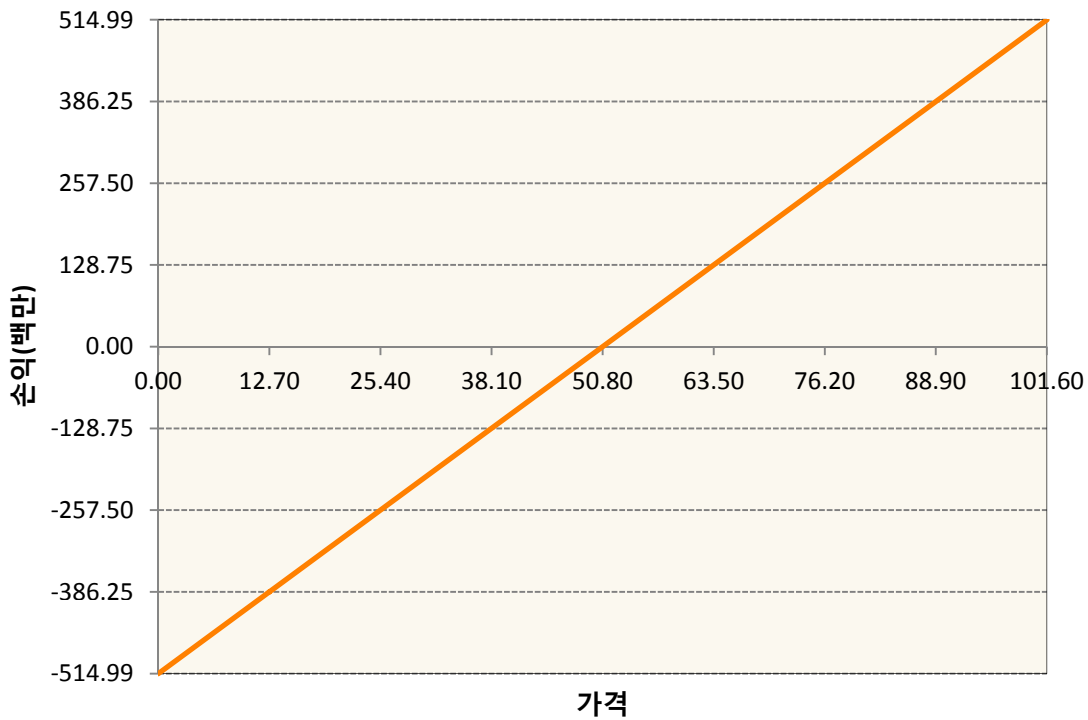
1. 계약금액

(단위:백만원)

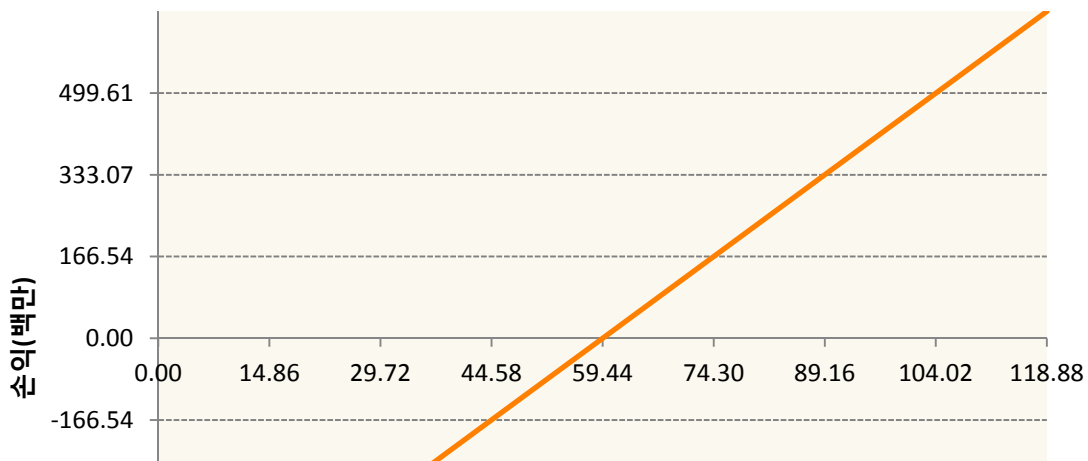
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,761	202	2,560	

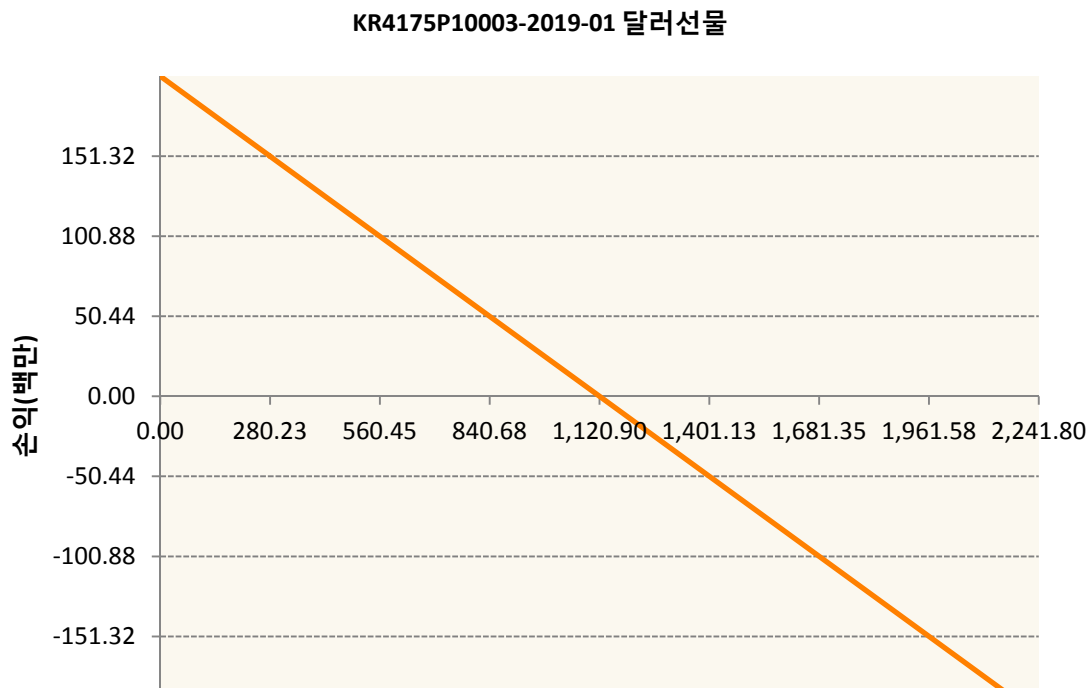
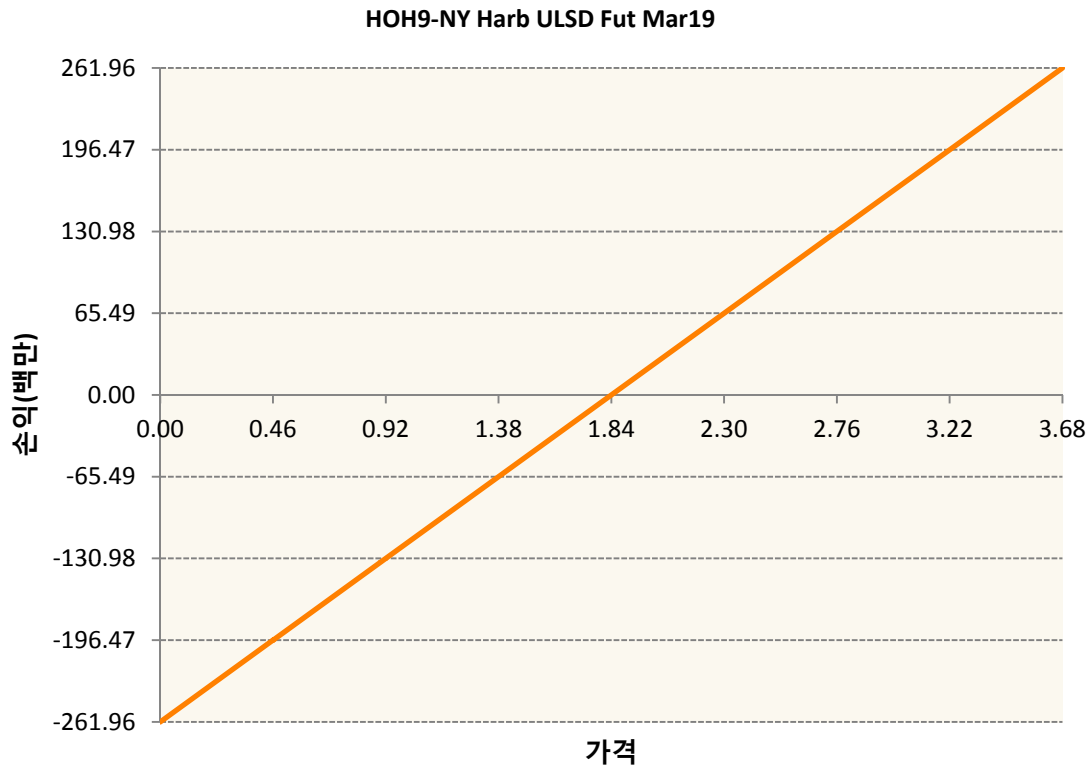
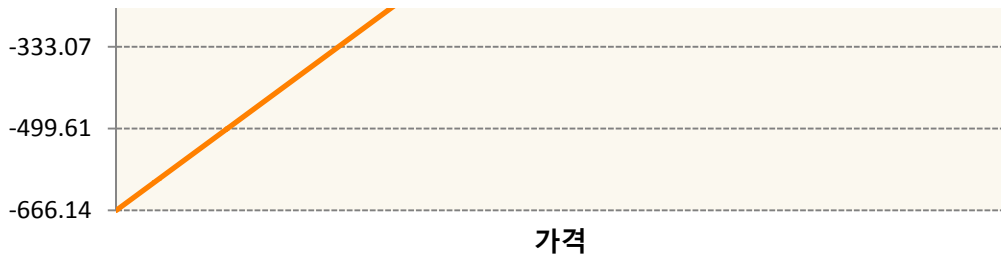
2. 만기시점의 손익구조

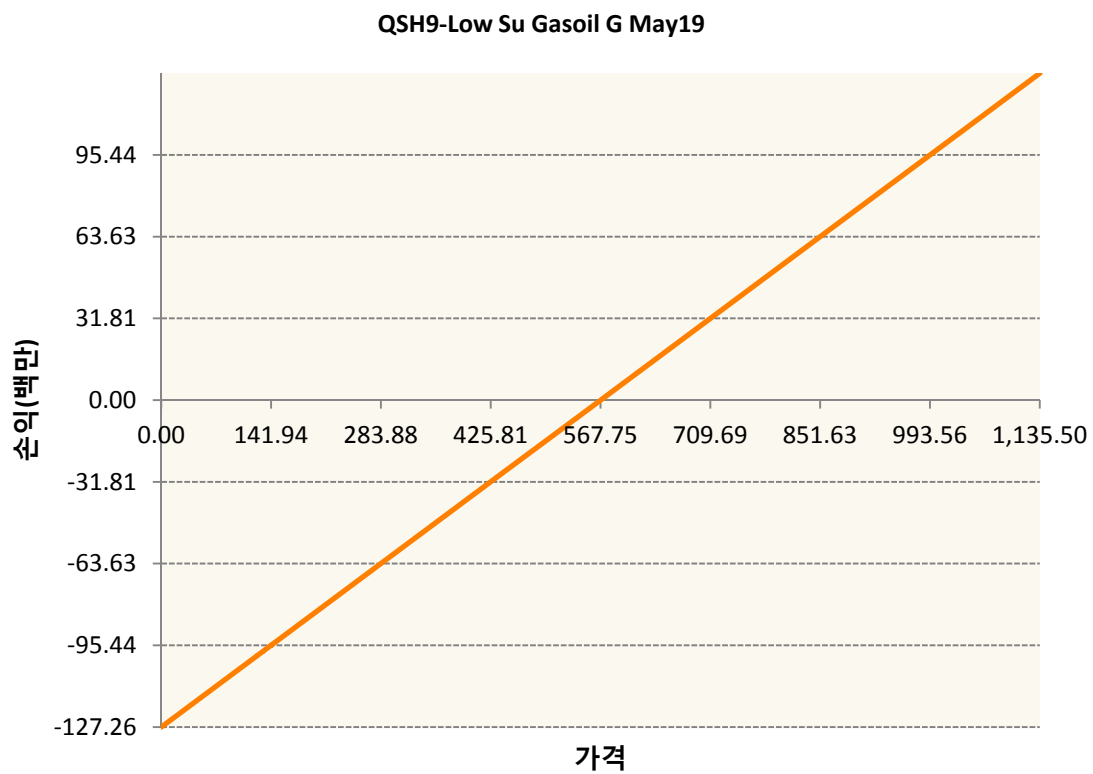
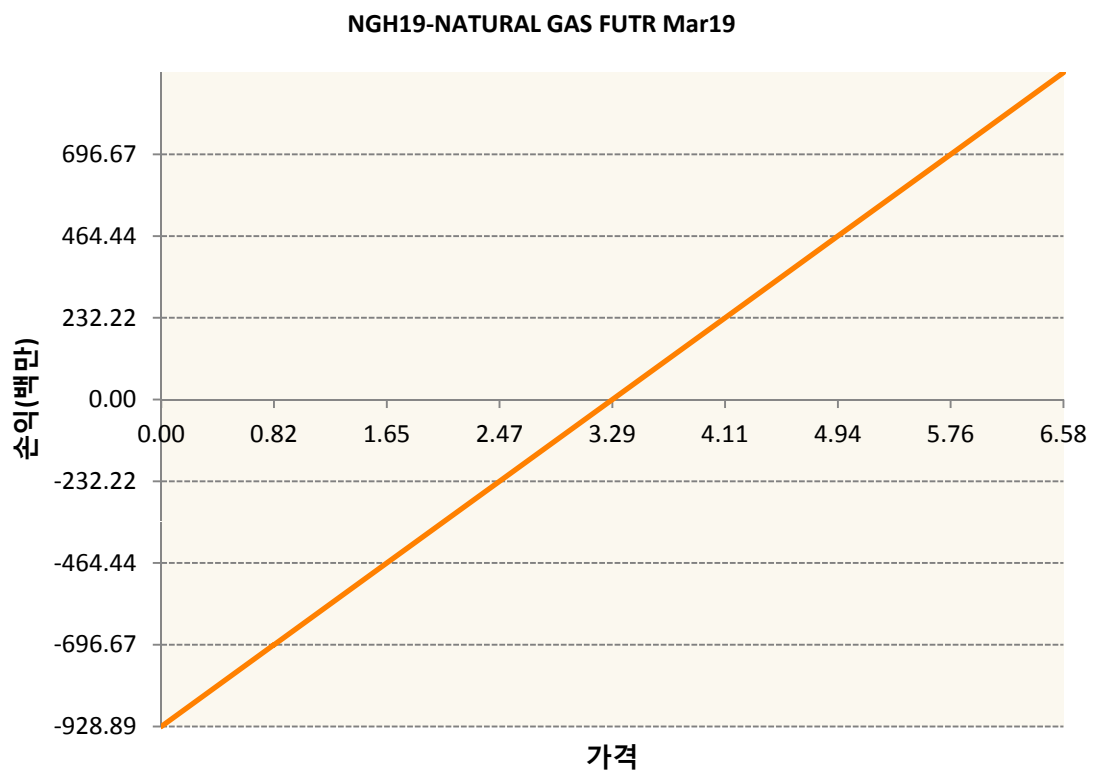
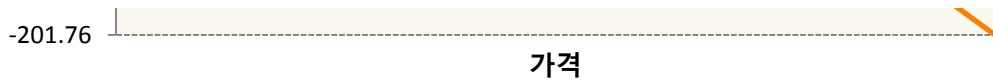
CLH9-WTI CRUDE FUTURE MAR19



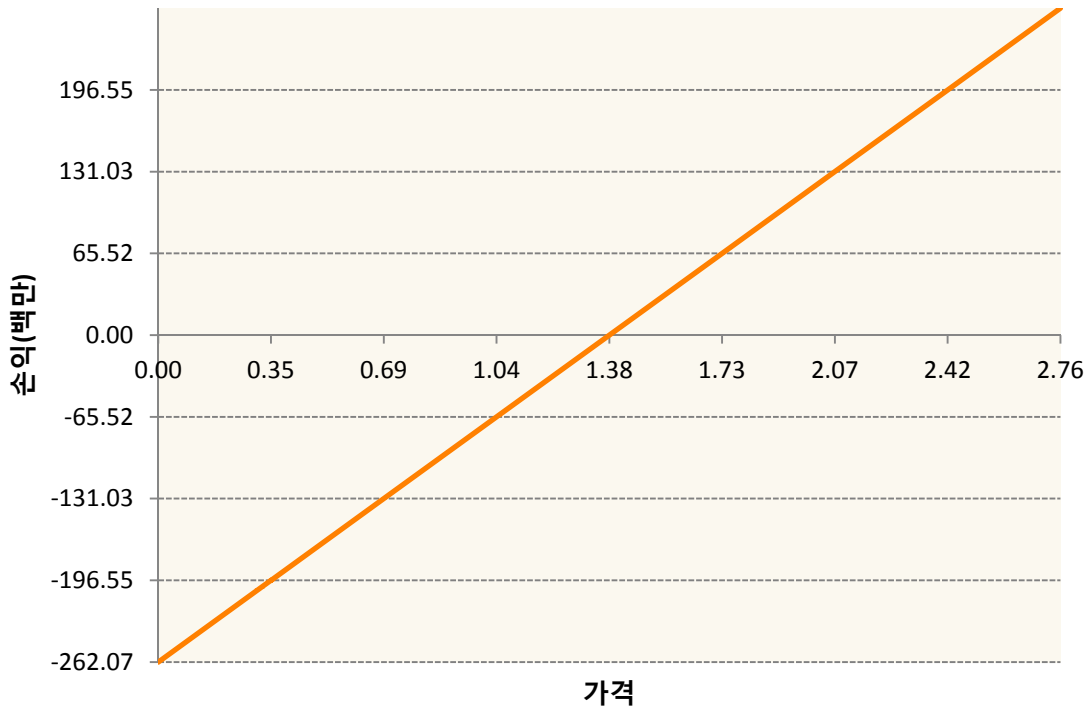
COK9-BRENT CRUDE FUTR May19







XBH9-GASOLINE RBOB FUT Mar19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLH9	WTI CRUDE FUTURE MAR19	41
COK9	BRENT CRUDE FUTR May19	53
HOH9	NY Harb ULSD Fut Mar19	21
KR4175P100	2019-01 달러선물	16
NGH19	NATURAL GAS FUTR Mar19	74
QSH9	Low Su Gasoil G May19	10
XBH9	GASOLINE RBOB FUT Mar19	21

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

431

공시일	2019-01-16
기준일	2019-01-15

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

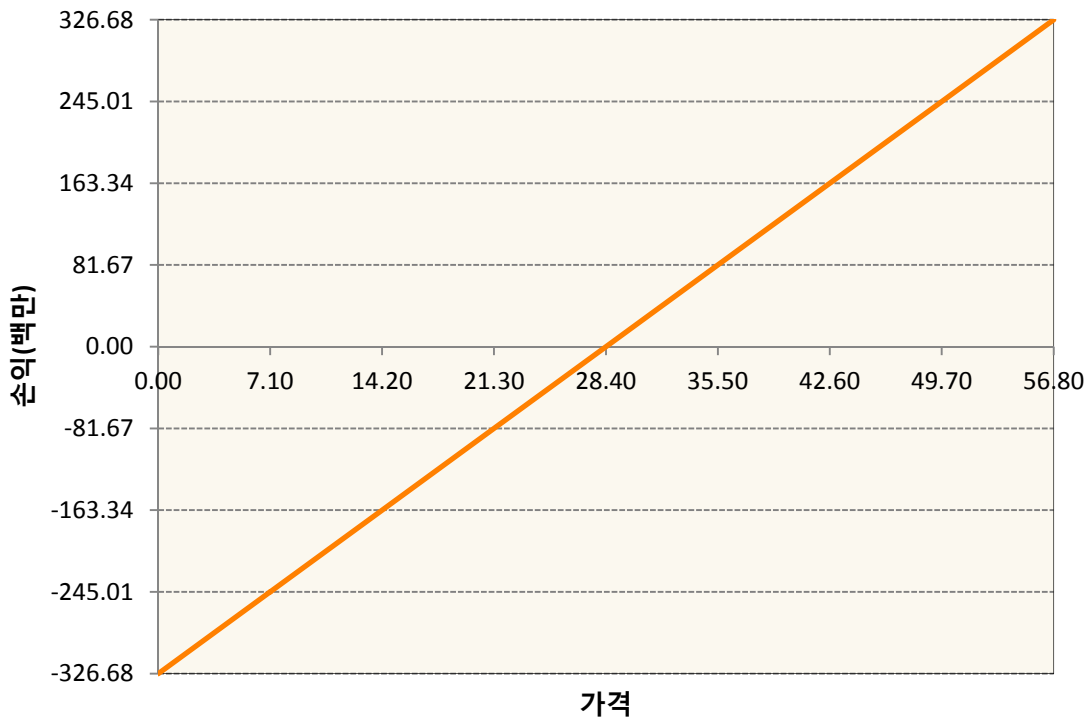
1. 계약금액

(단위:백만원)

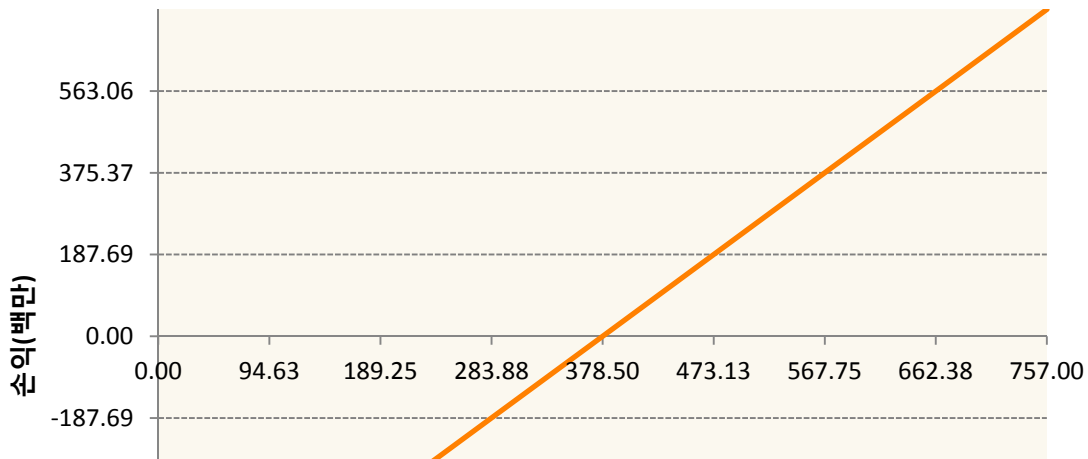
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,553	78	3,474	

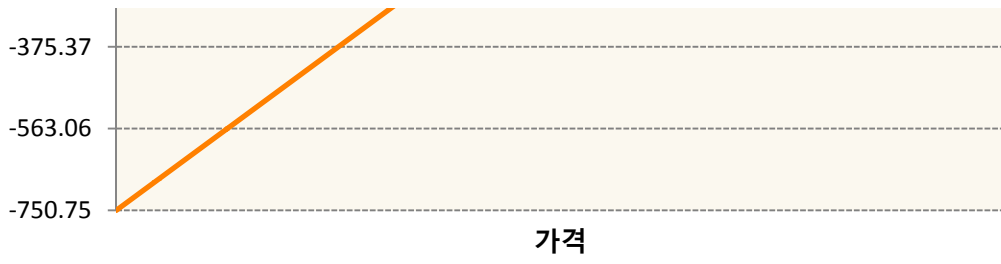
2. 만기시점의 손익구조

BOH9-SOYBEAN OIL FUTR Mar19

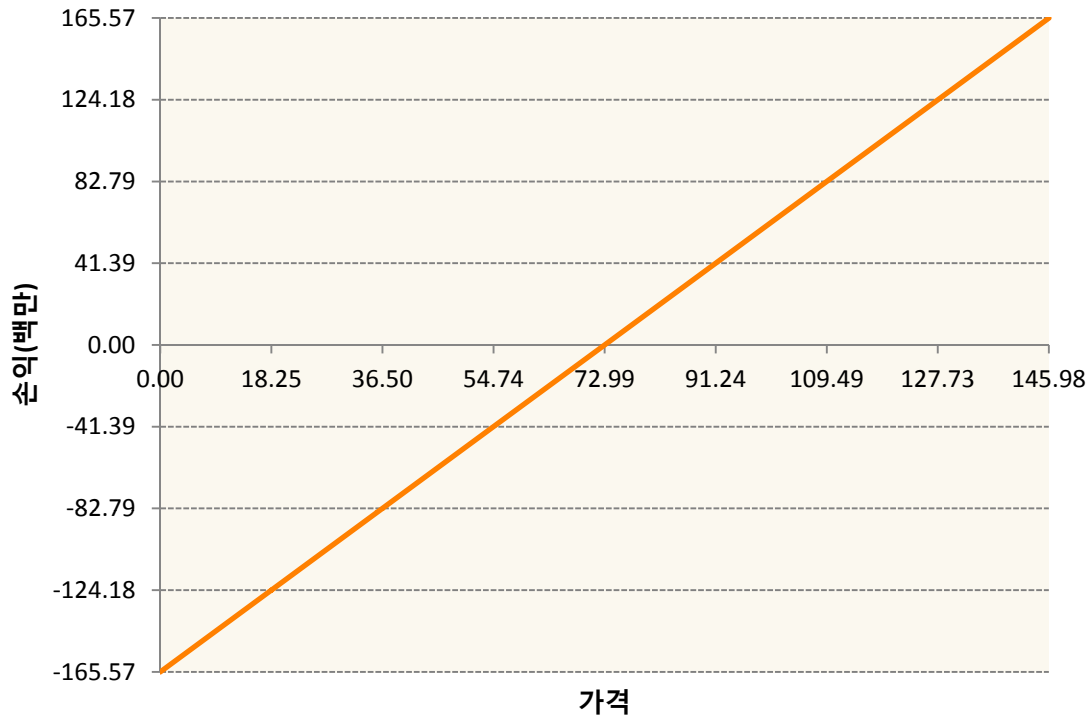


CH9-CORN FUTURE Mar19

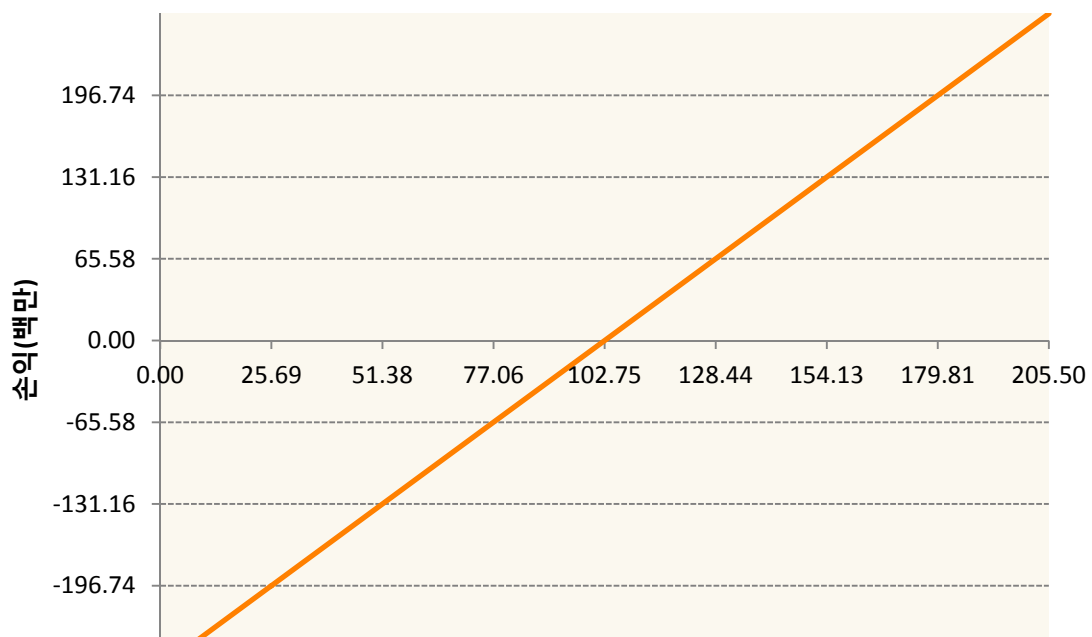


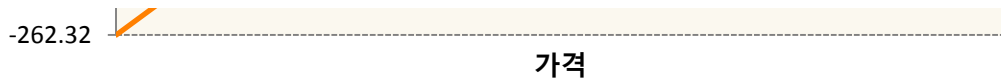


CTH9-COTTON NO.2 FUTR Mar19

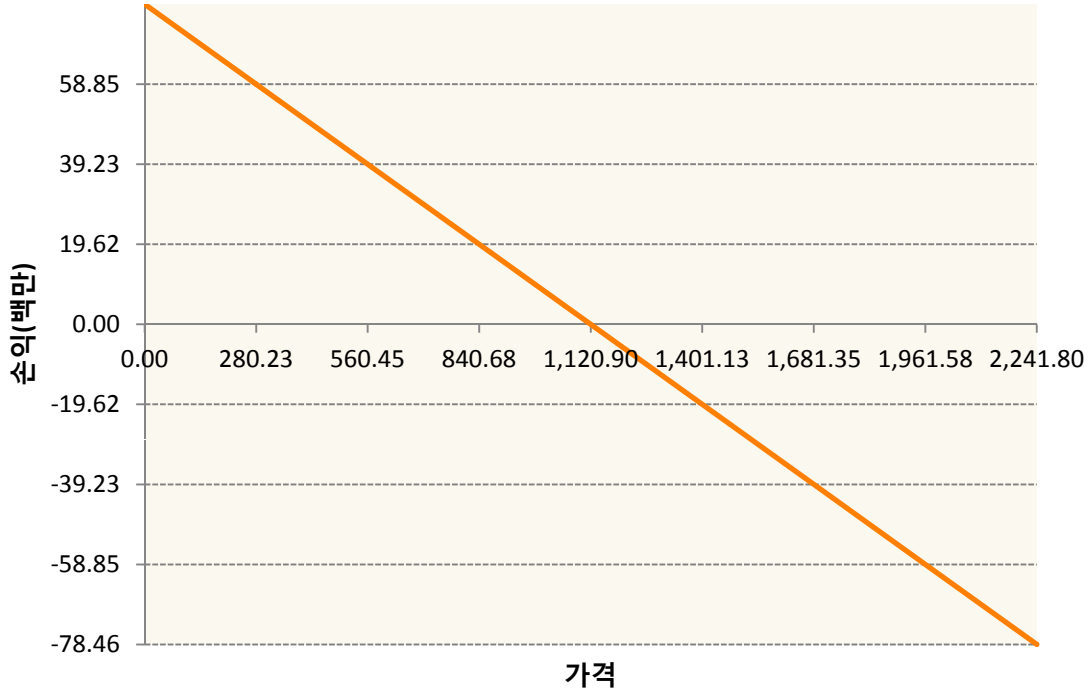


KCH9-COFFEE 'C' FUTURE Mar19

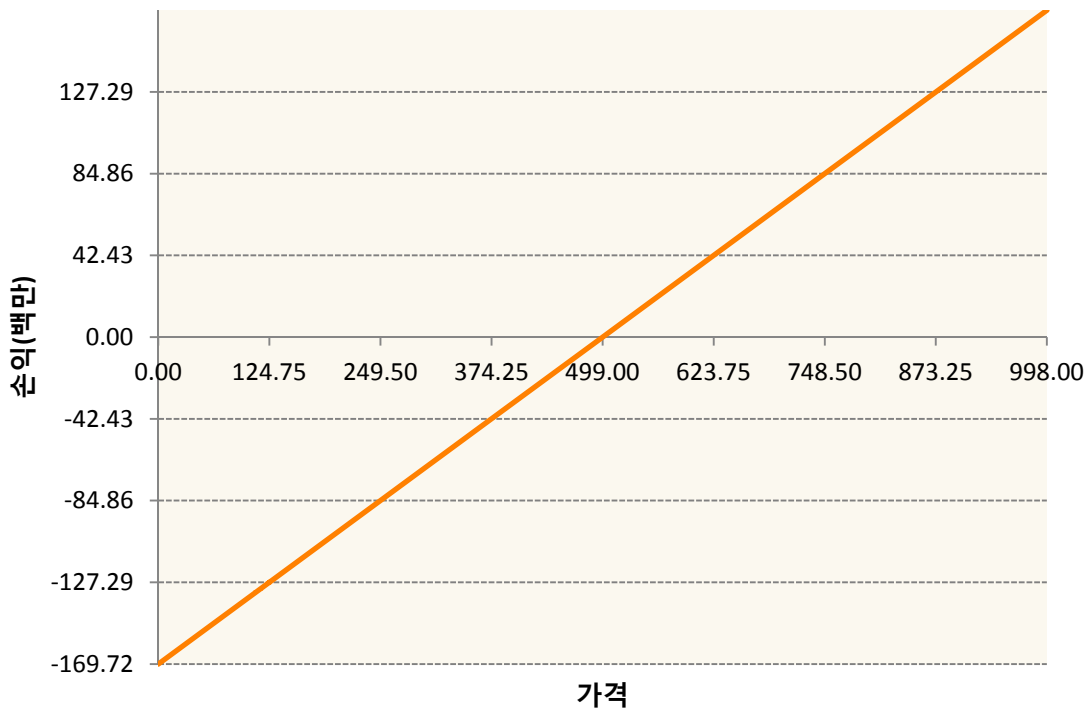




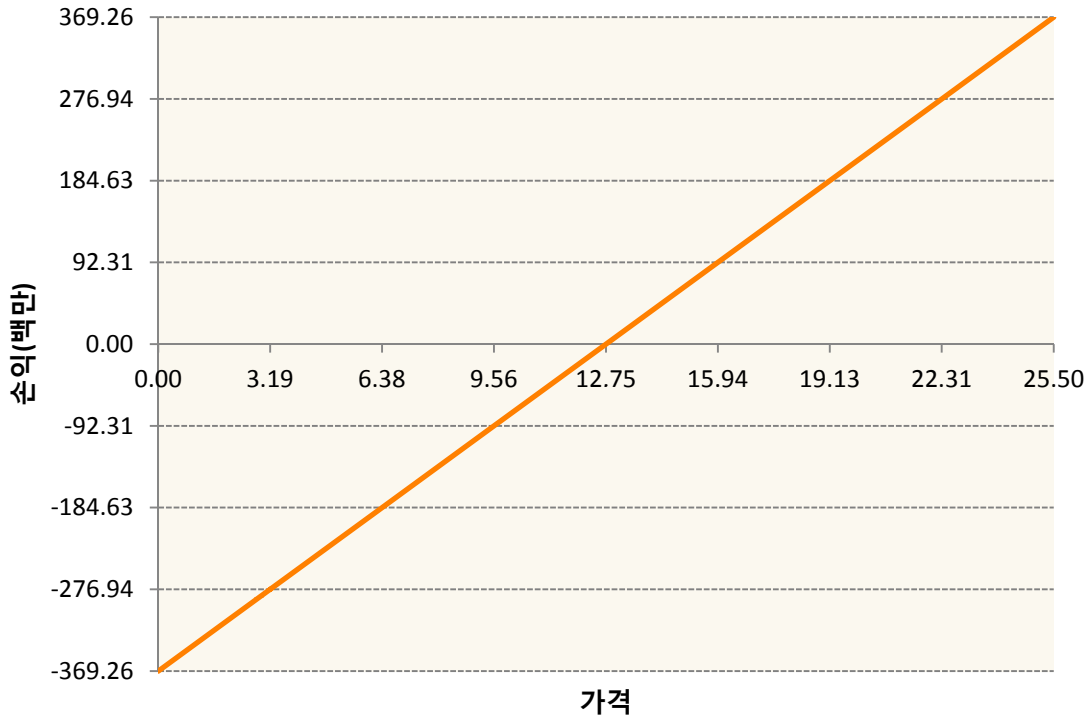
KR4175P10003-2019-01 달러선물



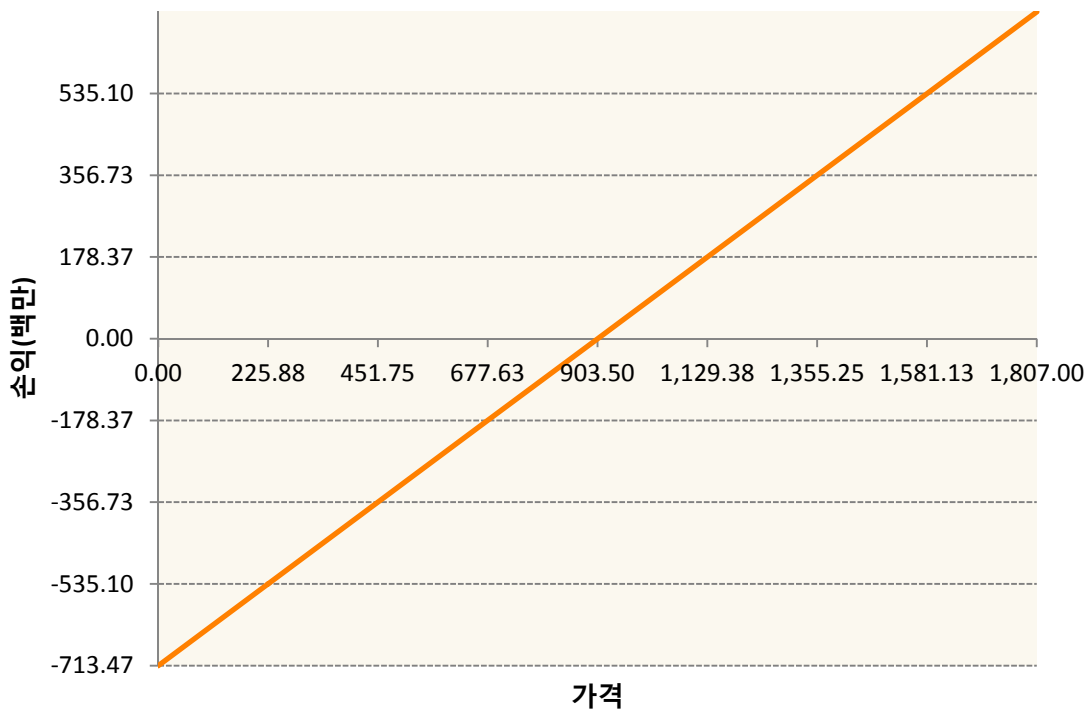
KWH9-KC HRW WHEAT FUT Mar19



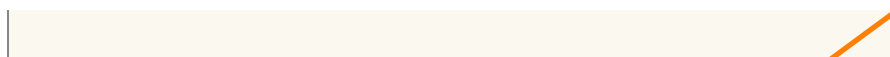
SBH9-SUGAR #11 (WORLD) MAR19

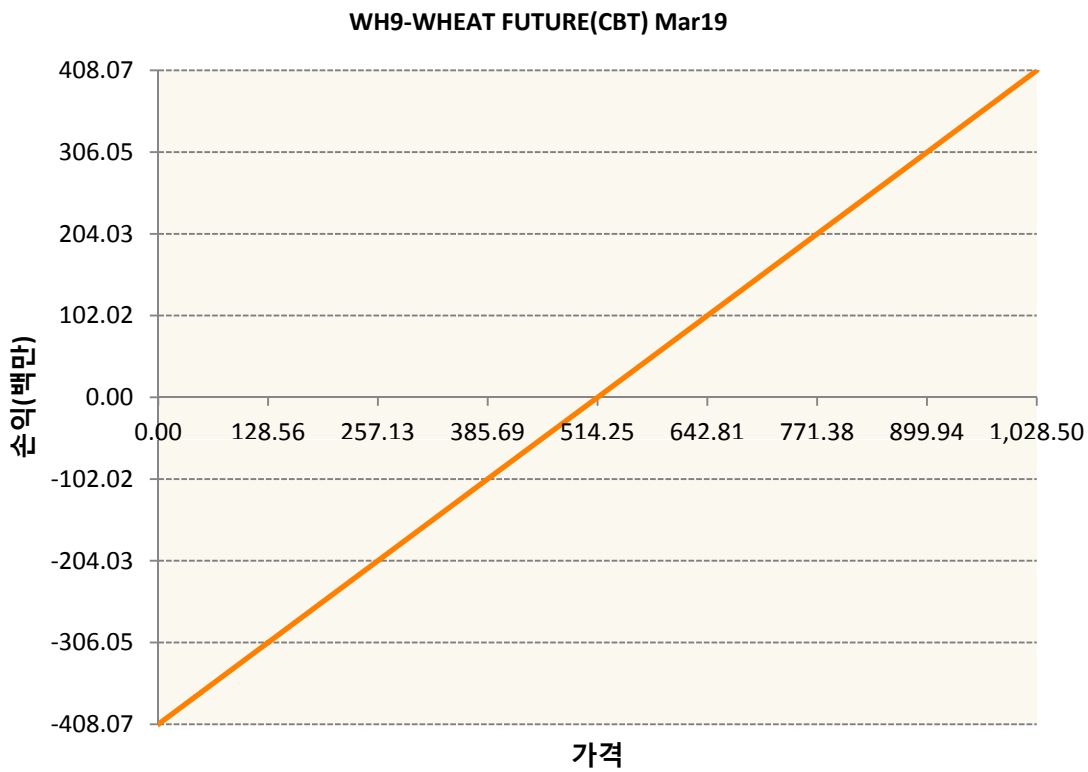
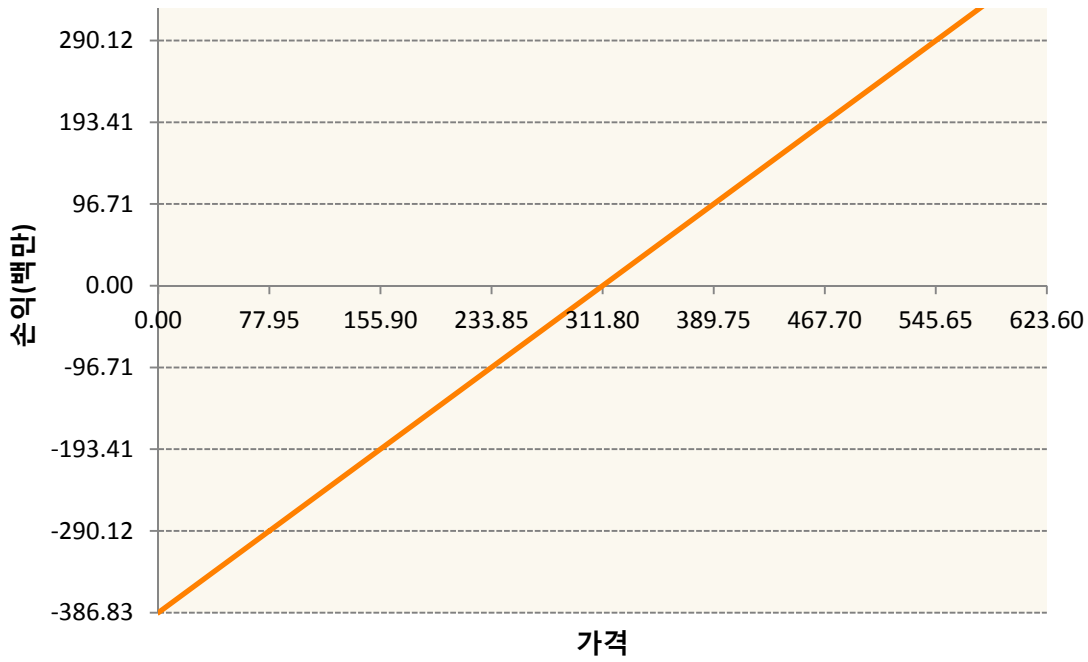


SH9-SOYBEAN FUTURE Mar19



SMH9-SOYBEAN MEAL FUTR Mar19





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

BOH9	SOYBEAN OIL FUTR Mar19	26
CH9	CORN FUTURE Mar19	60
CTH9	COTTON NO.2 FUTR Mar19	13
KCH9	COFFEE 'C' FUTURE Mar19	21
KR4175P100 2019-01	달러선물	6

KWH9	KC HRW WHEAT FUT Mar19	14
SBH9	SUGAR #11 (WORLD) MAR19	30
SH9	SOYBEAN FUTURE Mar19	57
SMH9	SOYBEAN MEAL FUTR Mar19	31
WH9	WHEAT FUTURE(CBT) Mar19	33

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

(단위:백만원)

292