

공시일	2019-01-17
기준일	2019-01-16

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	2019-01-17
기준일	2019-01-16

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

1,045

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

589

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-01-17
기준일	2019-01-16

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

269

* 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	2019-01-17
기준일	2019-01-16

유로인덱스모(주식-파생형)

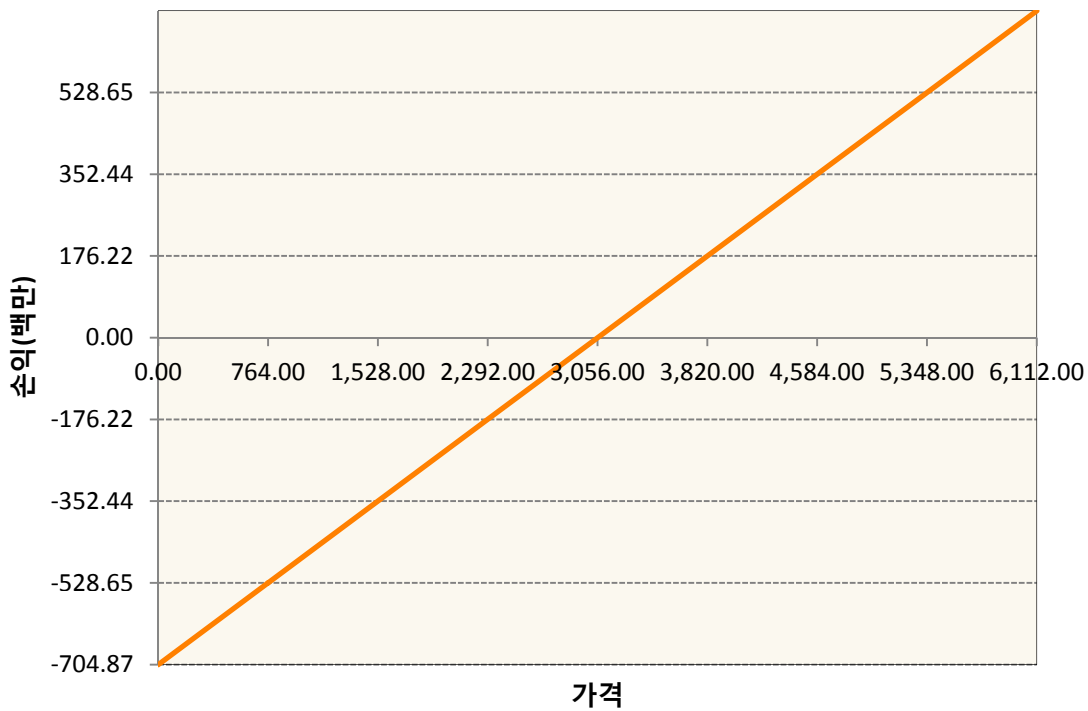
1. 계약금액

(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	2019-01-17
기준일	2019-01-16

차이나인덱스모(주식-파생형)

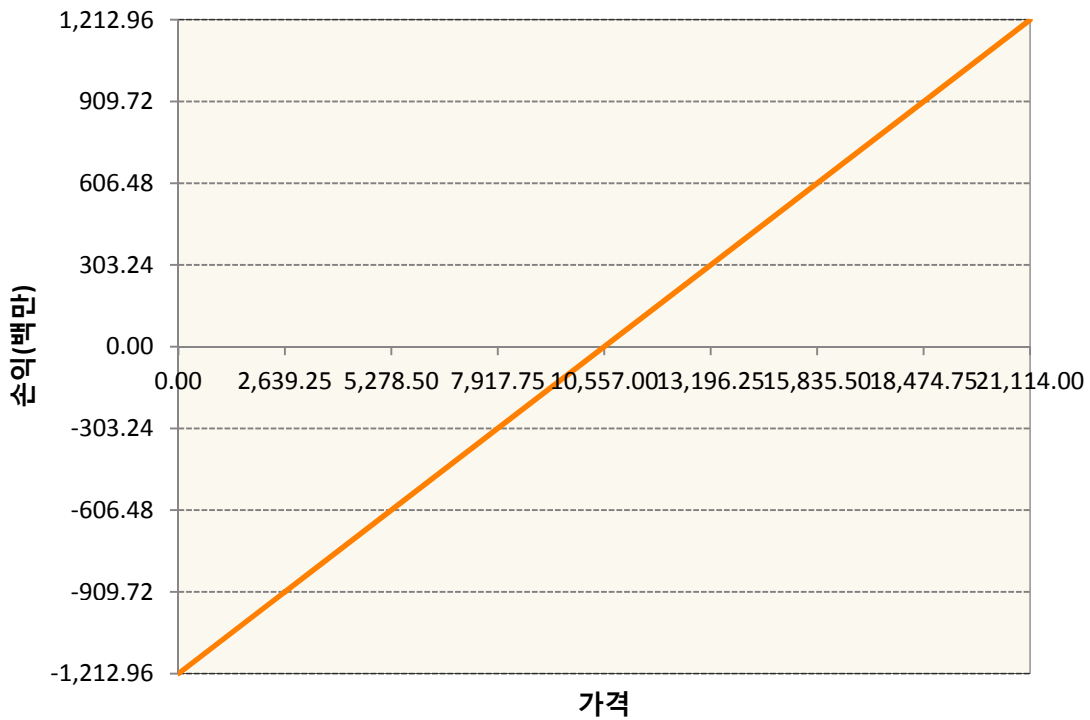
1. 계약금액

(단위:백만원)

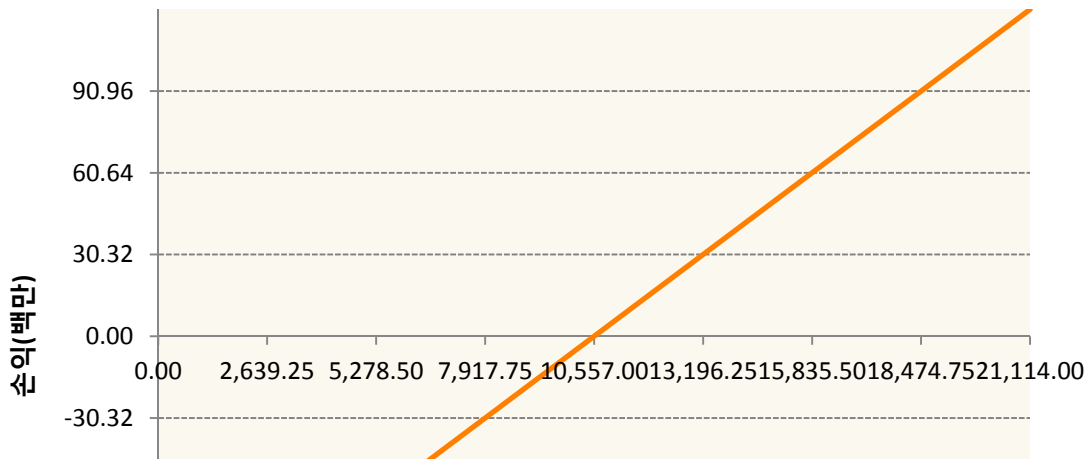
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,334	0	1,334	장내

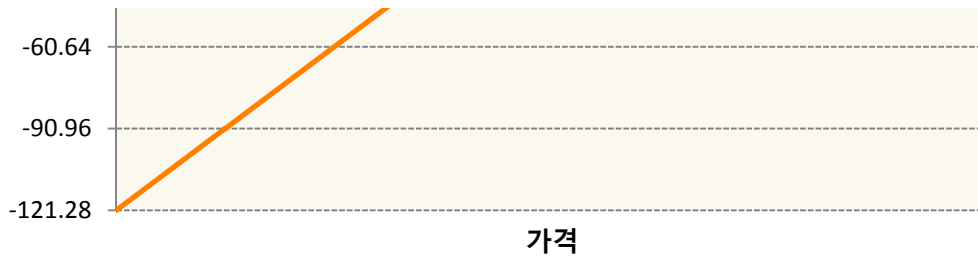
2. 만기시점의 손익구조

HCF9-HSCEI FUTURES JAN19



MHCF9-MINI H-SHR IDX FU JAN19





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

HCF9	HSCEI FUTURES JAN19	97
MHCF9	MINI H-SHR IDX FU JAN19	10

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

109

공시일	2019-01-17
기준일	2019-01-16

커버드콜모(주식혼합-파생형)

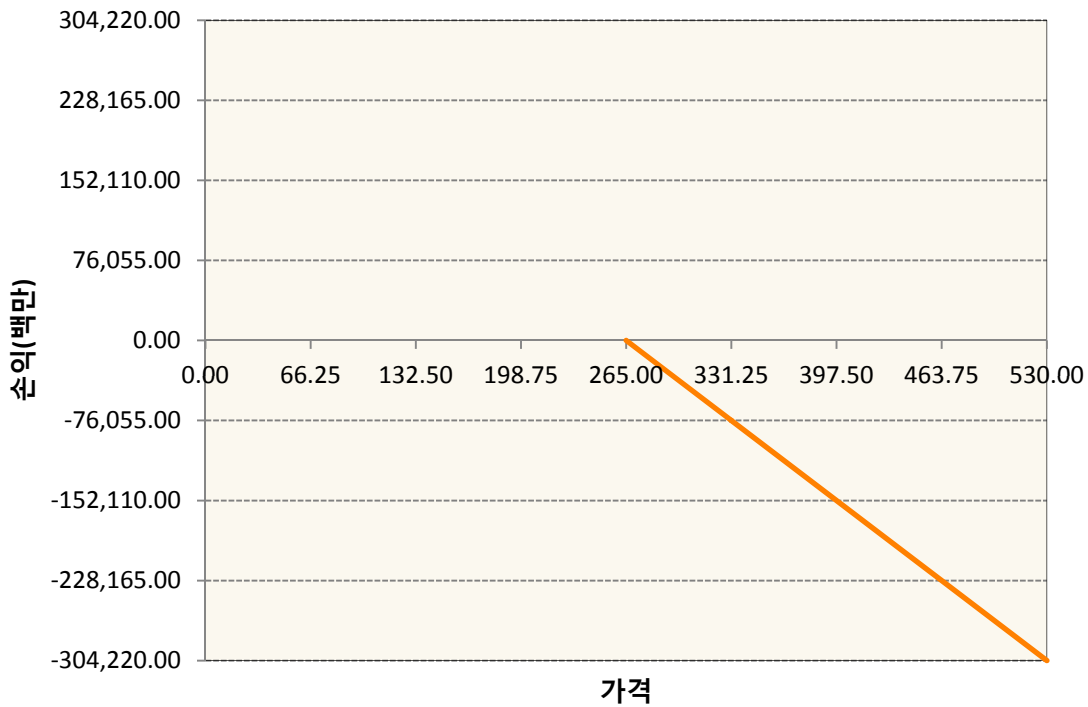
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	3,287	0	3,287	장내
누계	유가증권	옵션	0	713,193	-713,193	장내

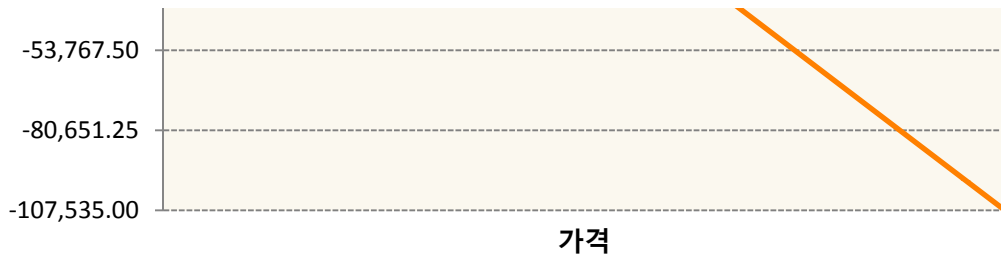
2. 만기시점의 손익구조

KR4201P22655-2019-02 콜265

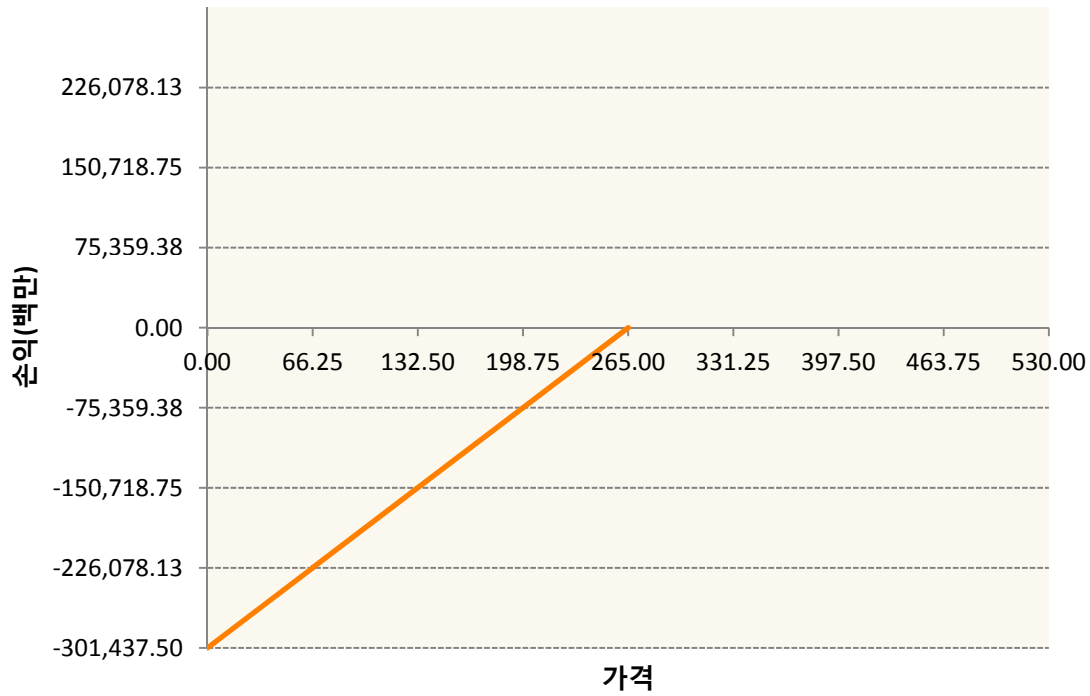


KR4201P22671-2019-02 콜267.5





KR4301P22653-2019-02 풋265



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4201P22655		2019-02 콜265					21,054
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	11,923	11,500	11,033	10,532	10,002	9,448	8,875
-5.33%	10,144	9,512	8,863	8,202	7,530	6,850	6,164
-2.67%	6,930	6,190	5,450	4,710	3,970	3,230	2,490
0%	2,107	1,414	711	0	-717	-1,438	-2,163
2.67%	-4,141	-4,669	-5,233	-5,827	-6,443	-7,078	-7,728
5.33%	-11,400	-11,733	-12,121	-12,556	-13,031	-13,540	-14,078
8.00%	-19,246	-19,423	-19,654	-19,937	-20,268	-20,641	-21,054
KR4201P22671		2019-02 콜267.5					7,118
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	3,703	3,578	3,437	3,280	3,112	2,934	2,747

-5.33%	3,213	3,012	2,801	2,584	2,361	2,133	1,902
-2.67%	2,269	2,015	1,759	1,503	1,246	989	731
0%	774	517	259	0	-260	-520	-781
2.67%	-1,251	-1,461	-1,681	-1,909	-2,142	-2,379	-2,621
5.33%	-3,682	-3,825	-3,985	-4,160	-4,347	-4,544	-4,750
8.00%	-6,368	-6,449	-6,550	-6,670	-6,805	-6,955	-7,118
KR4301P22653 2019-02 풋265							16,168
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-15,277	-15,360	-15,472	-15,610	-15,774	-15,960	-16,168
-5.33%	-7,757	-8,026	-8,318	-8,628	-8,952	-9,288	-9,634
-2.67%	-2,028	-2,449	-2,871	-3,292	-3,714	-4,137	-4,559
0%	1,052	715	364	0	-373	-753	-1,140
2.67%	2,105	1,960	1,783	1,577	1,346	1,094	822
5.33%	2,324	2,288	2,232	2,153	2,050	1,924	1,774
8.00%	2,351	2,346	2,334	2,313	2,279	2,230	2,165

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

(단위:백만원)

42,831

공시일	2019-01-17
기준일	2019-01-16

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

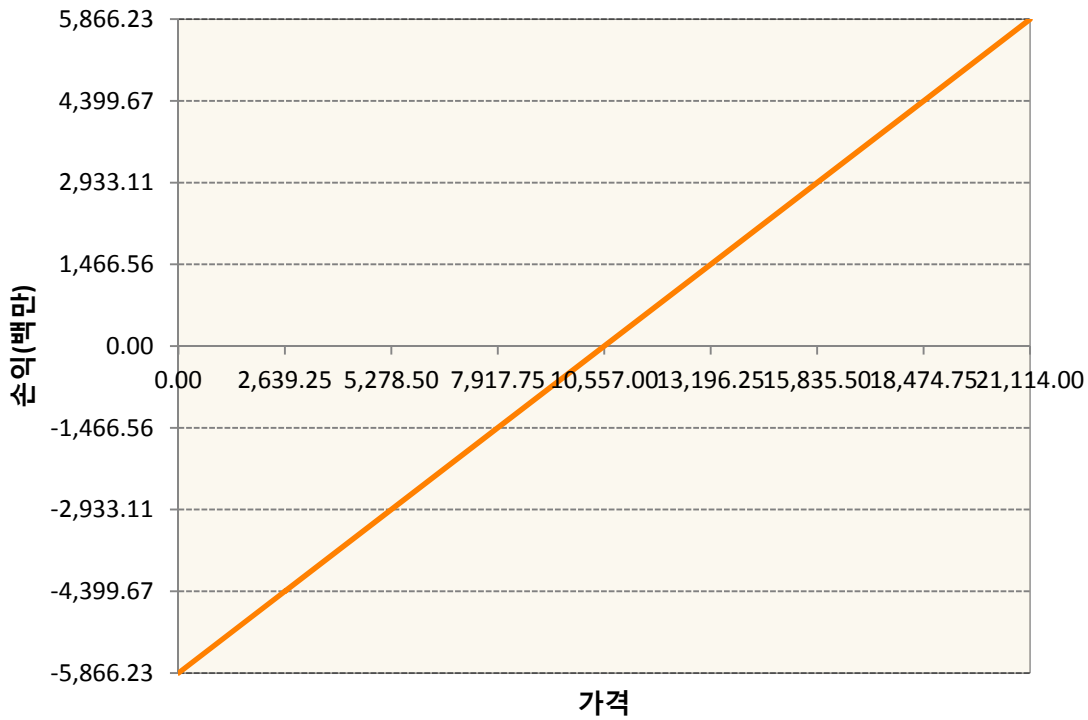
1. 계약금액

(단위:백만원)

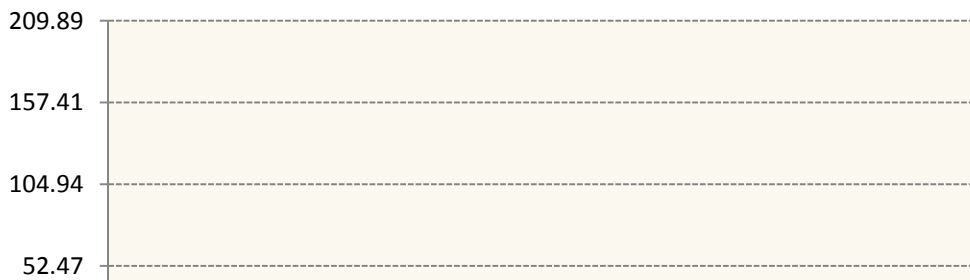
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	5,866	0	5,866	장내
누계	유가증권	옵션	0	12,271	-12,271	장내
누계	통화	선도	0	2,713	-2,713	장외

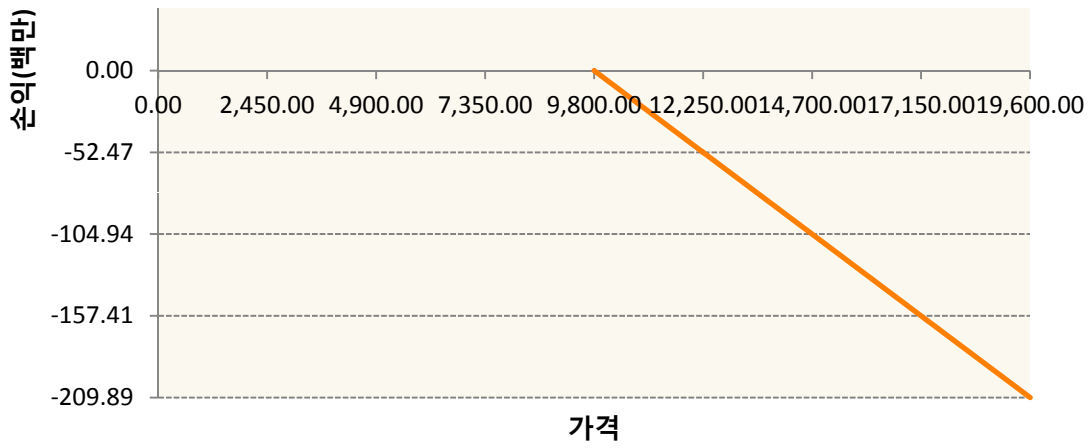
2. 만기시점의 손익구조

HCF9-HSCEI FUTURES JAN19

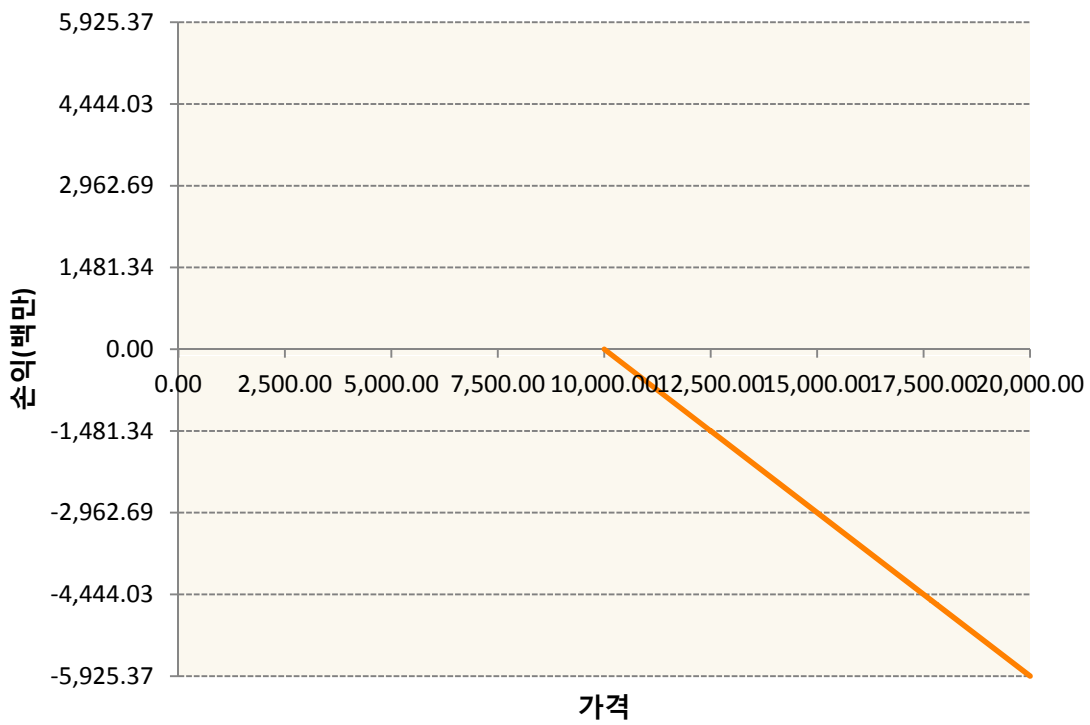


OHHIF9-C098-HSCEI

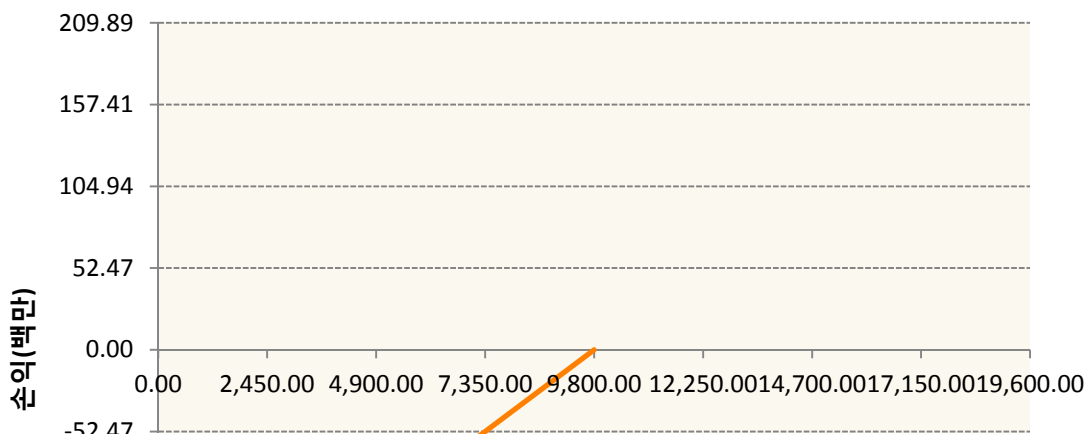


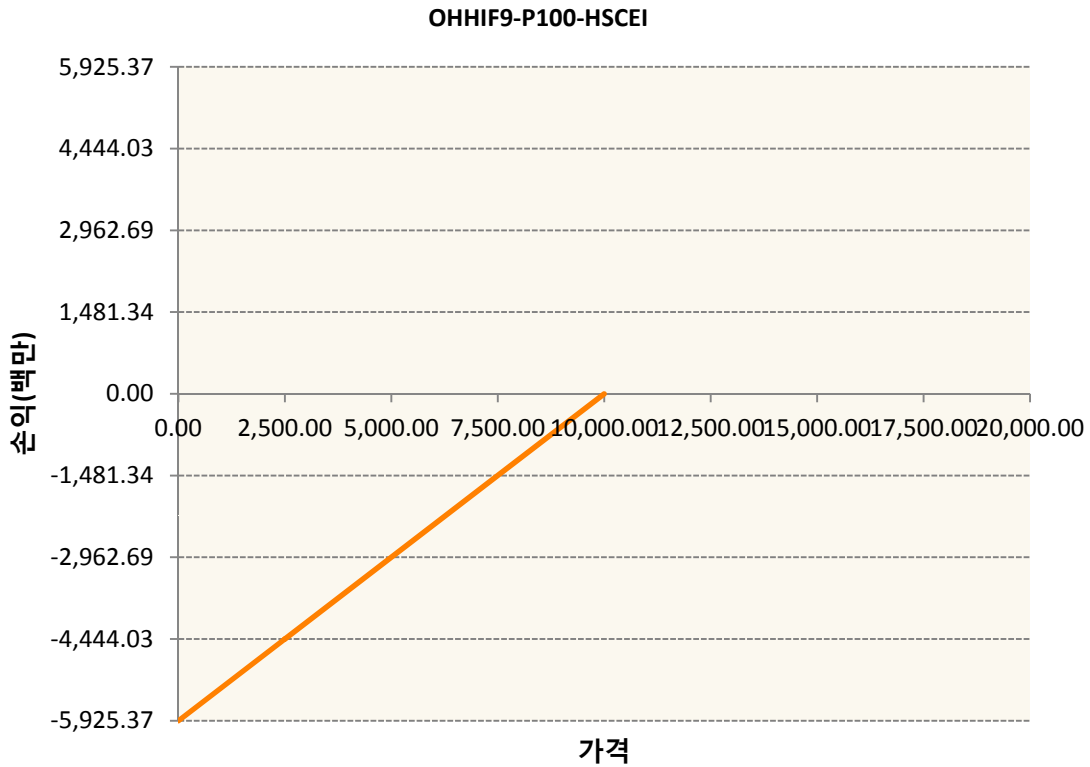


OHHIF9-C100-HSCEI



OHHIF9-P098-HSCEI





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)	(단위:백만원)
FX21018Z00 KRW/HKD 11-03-19E	217
HCF9 HSCEI FUTURES JAN19	469
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)
	1,567

공시일	2019-01-17
기준일	2019-01-16

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

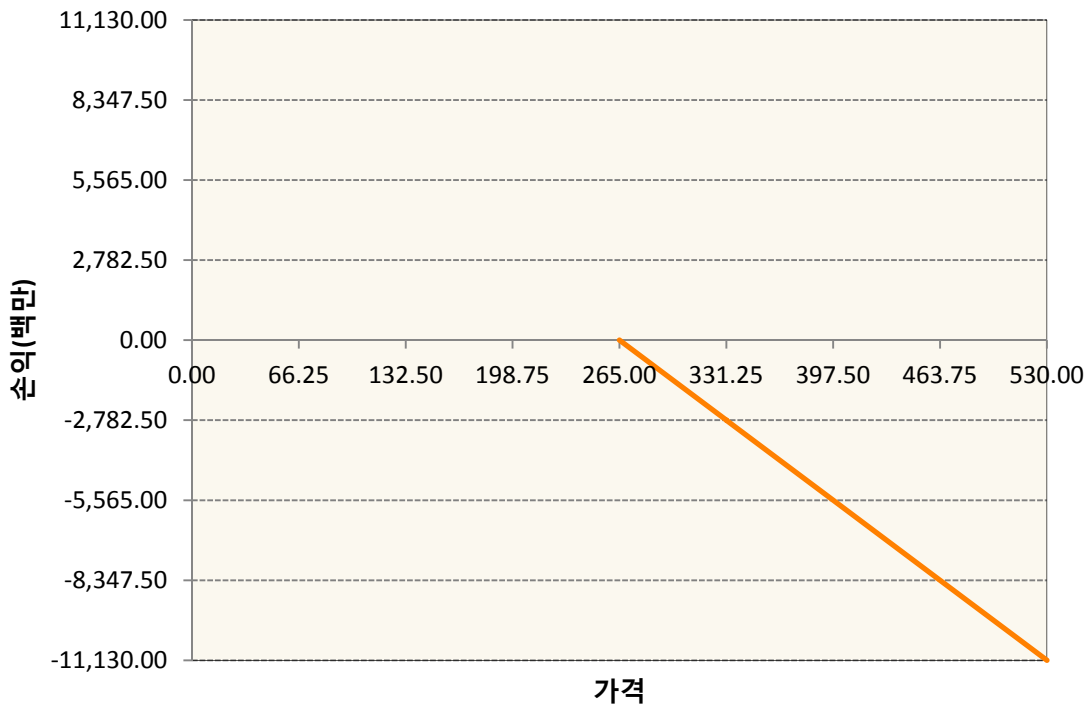
1. 계약금액

(단위:백만원)

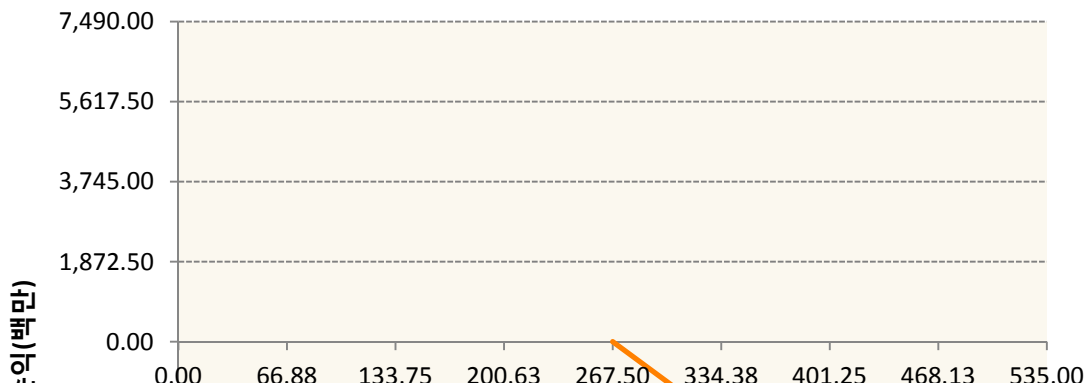
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	스왑	31,836	0	31,836	장외
누계	유가증권	옵션	0	33,858	-33,858	장내

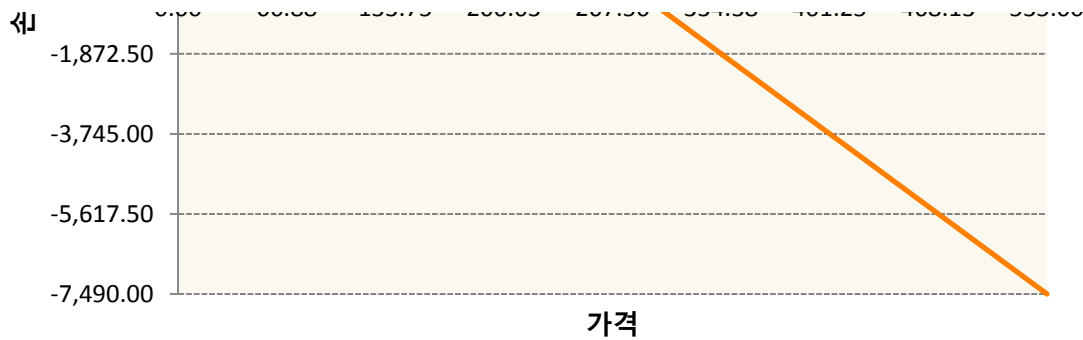
2. 만기시점의 손익구조

KR4201P22655-2019-02 콜265

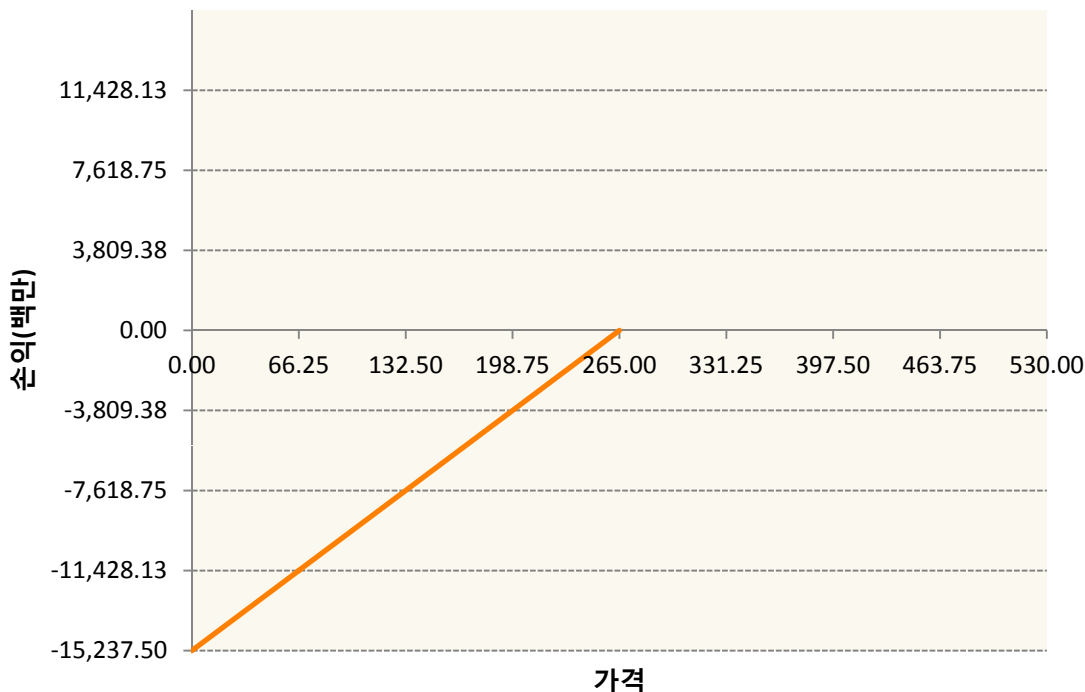


KR4201P22671-2019-02 콜267.5





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				770	
	기초자산의 변동성							

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	436	421	404	385	366	346	325	
-5.33%	371	348	324	300	275	251	226	
-2.67%	254	226	199	172	145	118	91	
0%	77	52	26	0	-26	-53	-79	
2.67%	-151	-171	-191	-213	-236	-259	-283	
5.33%	-417	-429	-443	-459	-477	-495	-515	
8.00%	-704	-711	-719	-729	-741	-755	-770	
KR4201P22671							2019-02 콜267.5	496
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	258	249	239	228	217	204	191	
-5.33%	224	210	195	180	164	149	132	
-2.67%	158	140	123	105	87	69	51	
0%	54	36	18	0	-18	-36	-54	
2.67%	-87	-102	-117	-133	-149	-166	-183	
5.33%	-256	-266	-278	-290	-303	-317	-331	
8.00%	-444	-449	-456	-465	-474	-484	-496	
KR4301P22653							2019-02 풋265	817
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-772	-776	-782	-789	-797	-807	-817	
-5.33%	-392	-406	-420	-436	-453	-470	-487	
-2.67%	-103	-124	-145	-166	-188	-209	-230	
0%	53	36	18	0	-19	-38	-58	
2.67%	106	99	90	80	68	55	42	
5.33%	117	116	113	109	104	97	90	
8.00%	119	119	118	117	115	113	109	

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

(단위:백만원)

4,658

공시일	2019-01-17
기준일	2019-01-16

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

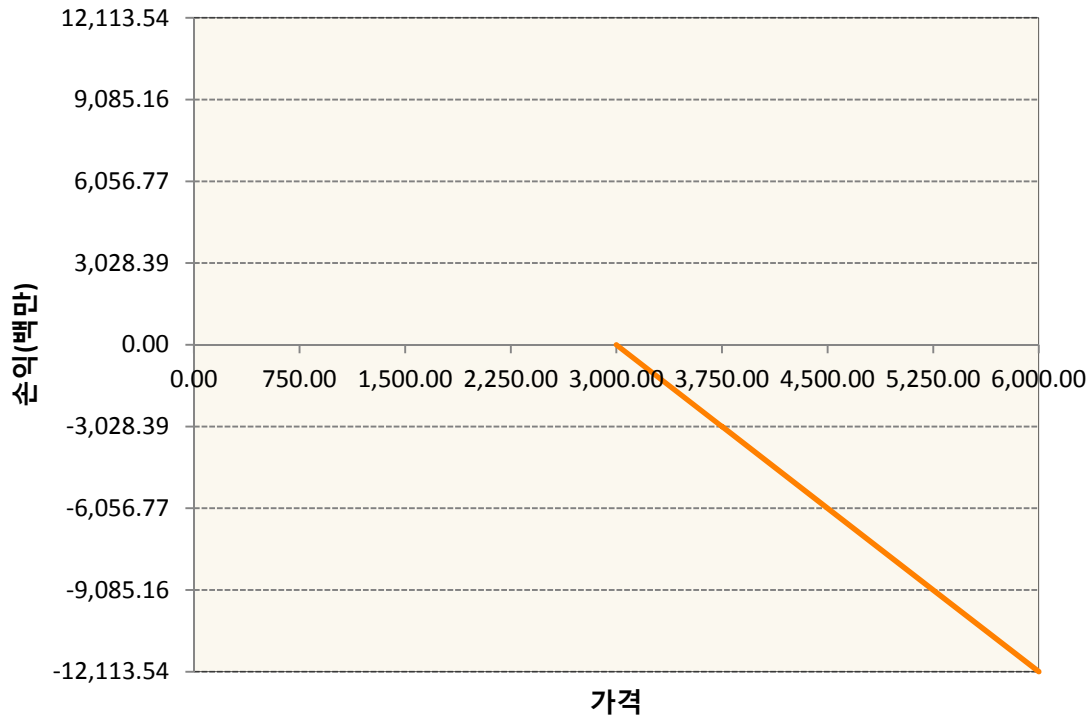
1. 계약금액

(단위:백만원)

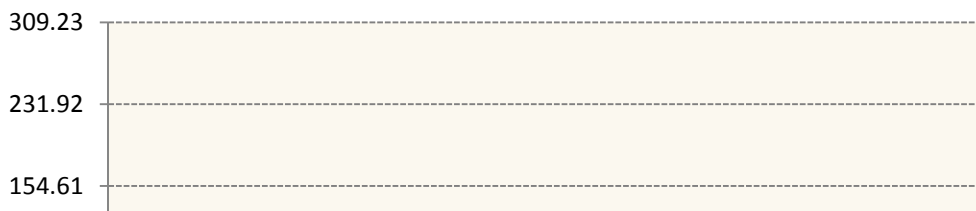
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	6,615	0	6,615	
누계	유가증권	스왑	71,370	0	71,370	장외
누계	유가증권	옵션	0	24,846	-24,846	장내
누계	통화	선도	0	15,334	-15,334	장외

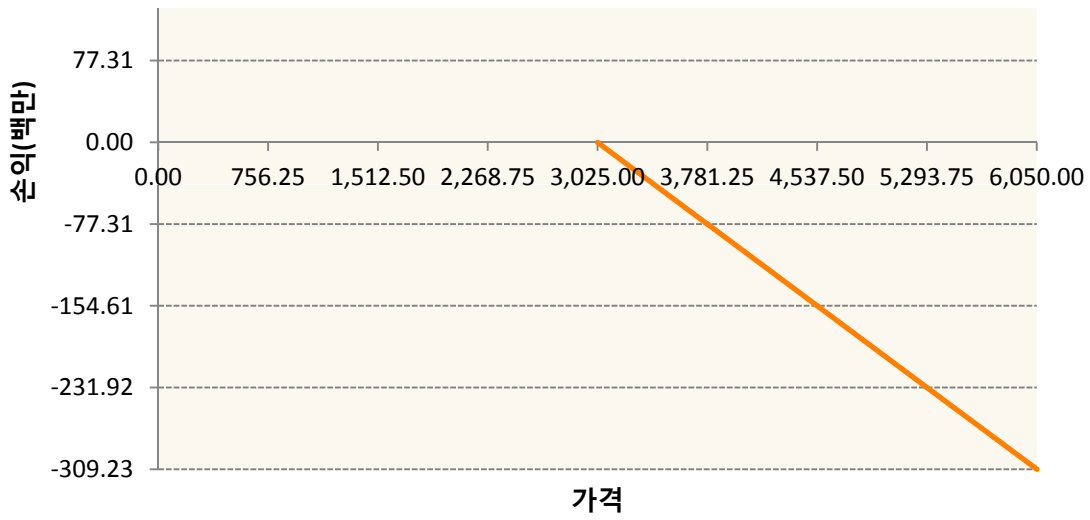
2. 만기시점의 손익구조

OESXF9-C3000-EURO STOXX 50

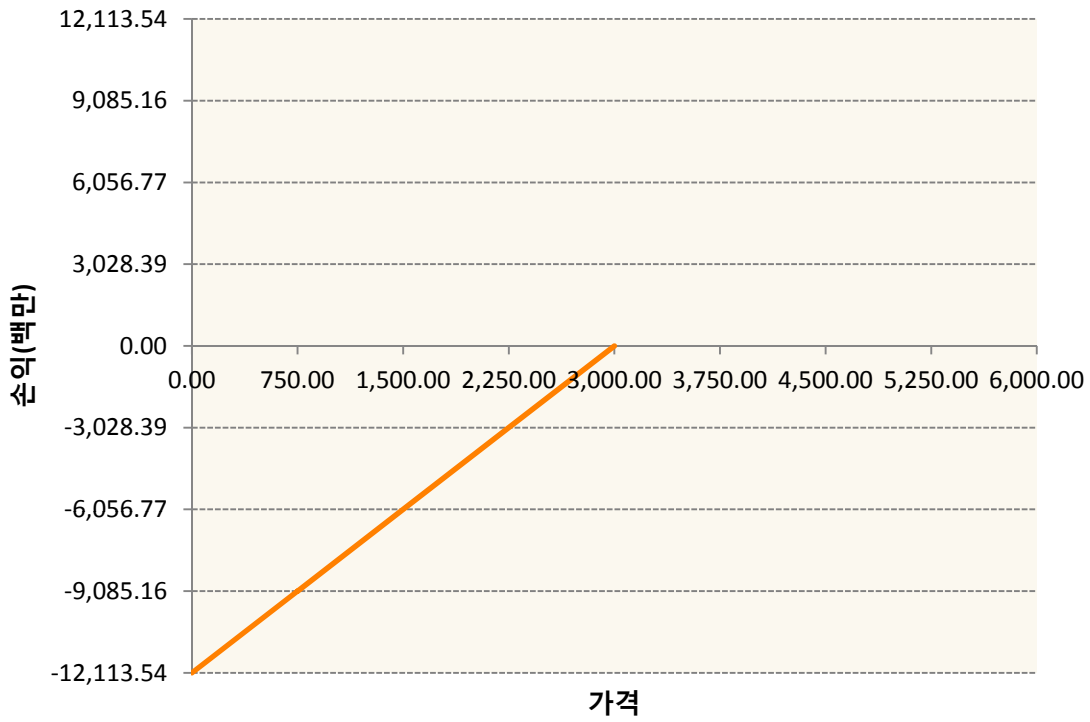


OESXF9-C3025-EURO STOXX 50

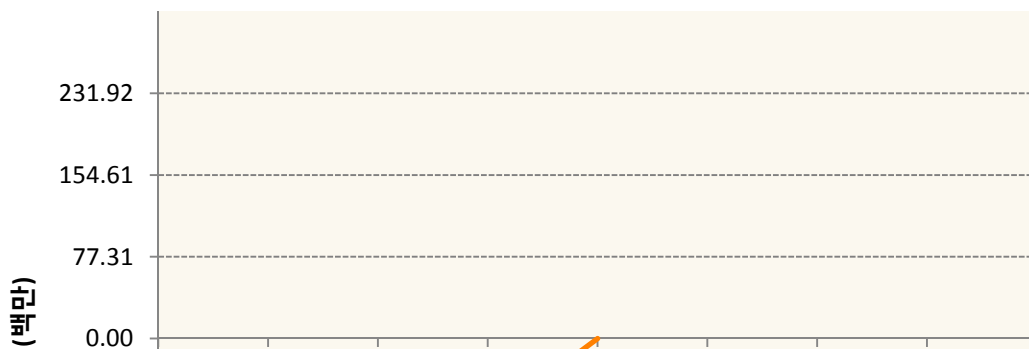


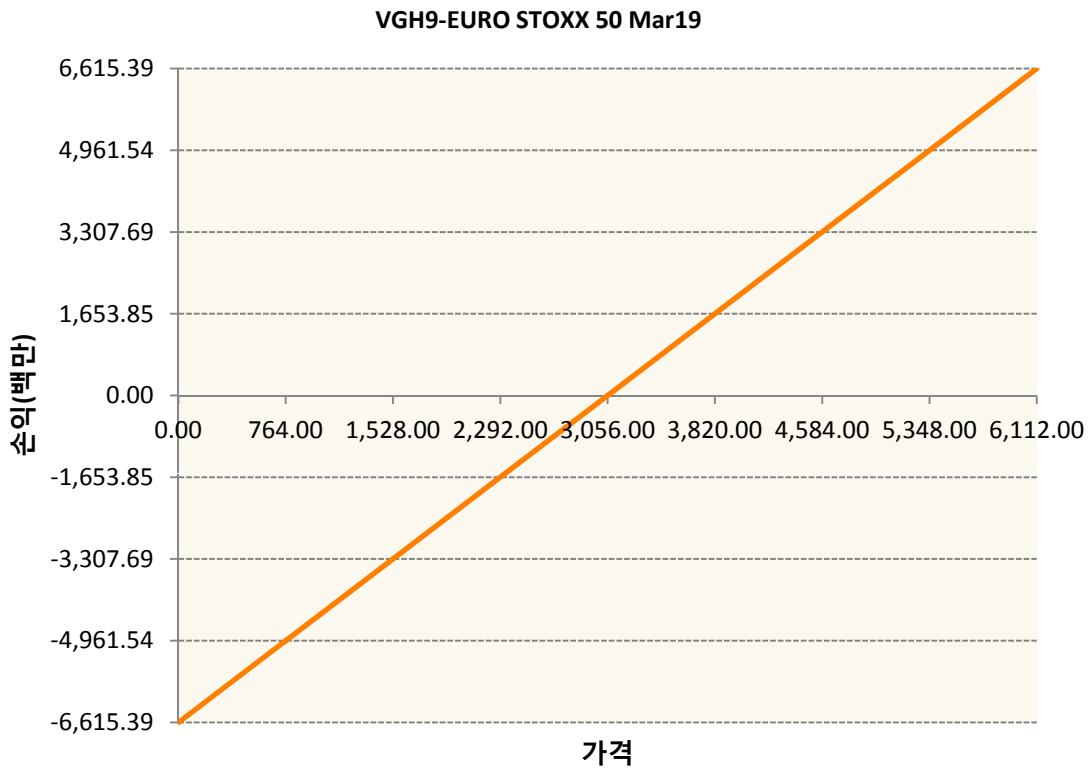
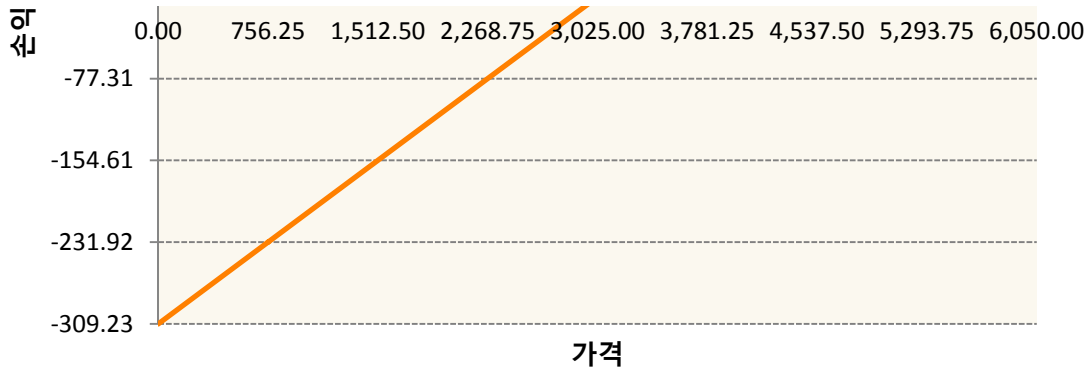


OESXF9-P3000-EURO STOXX 50



OESXF9-P3025-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY		66
FX21018X02 KRW/EUR 22-02-19E		409
FX21018Z03 KRW/EUR 22-03-19E		818
OESXF9-C30 EURO STOXX 50		969
OESXF9-C30 EURO STOXX 50		25
OESXF9-P30 EURO STOXX 50		969
OESXF9-P30 EURO STOXX 50		25
VGH9 EURO STOXX 50 Mar19		529

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

(단위:백만원)

2,476

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

(단위:백만원)

1,121

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

(단위:백만원)

95

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

(단위:백만원)

143

공시일	2019-01-17
기준일	2019-01-16

스마트KRX300인덱스목표전환형1호

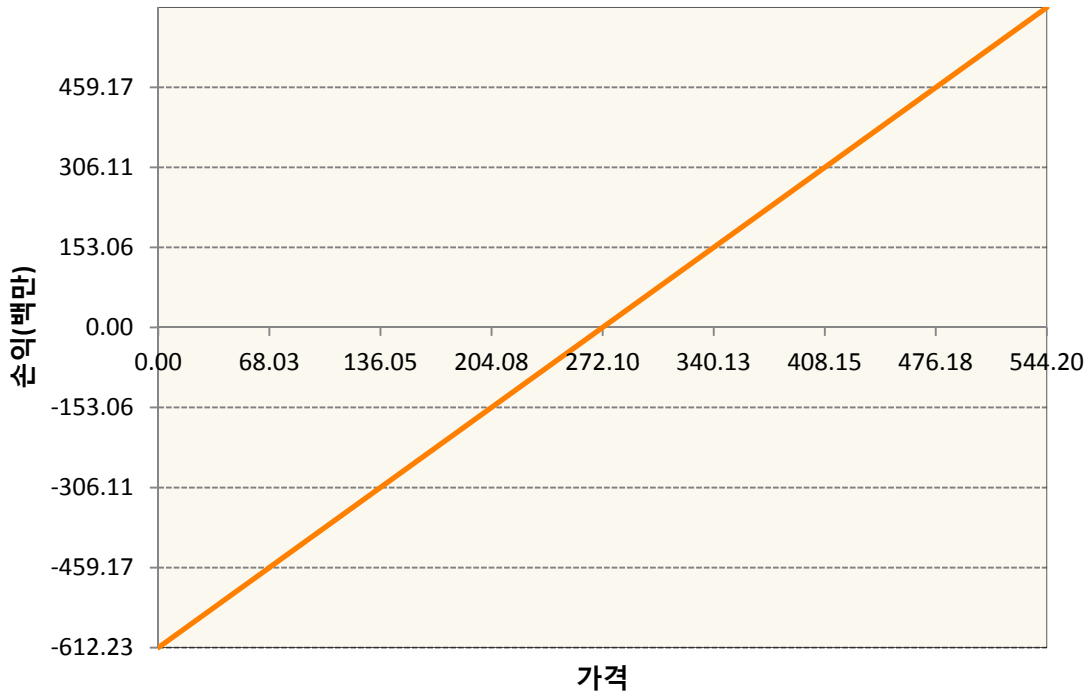
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	612	0	612	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%	-33	-33	-33	-33	-33	-33	-33
-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%	33	33	33	33	33	33	33
8.00%	49	49	49	49	49	49	49

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

(단위:백만원)

43

공시일	2019-01-17
기준일	2019-01-16

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

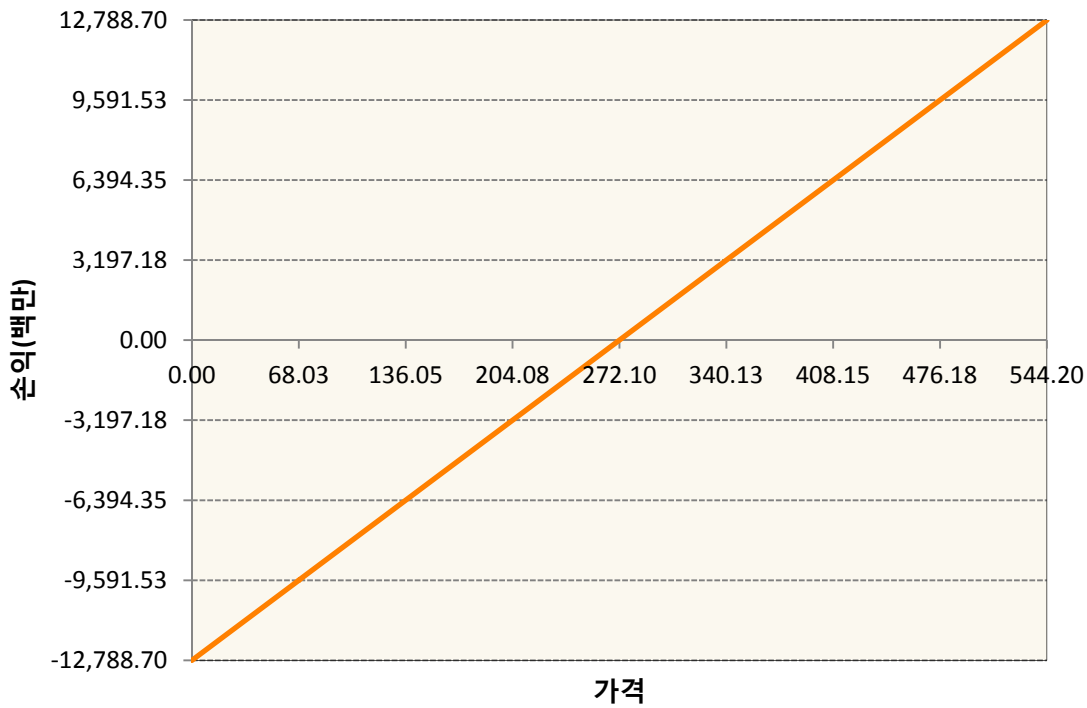
1. 계약금액

(단위:백만원)

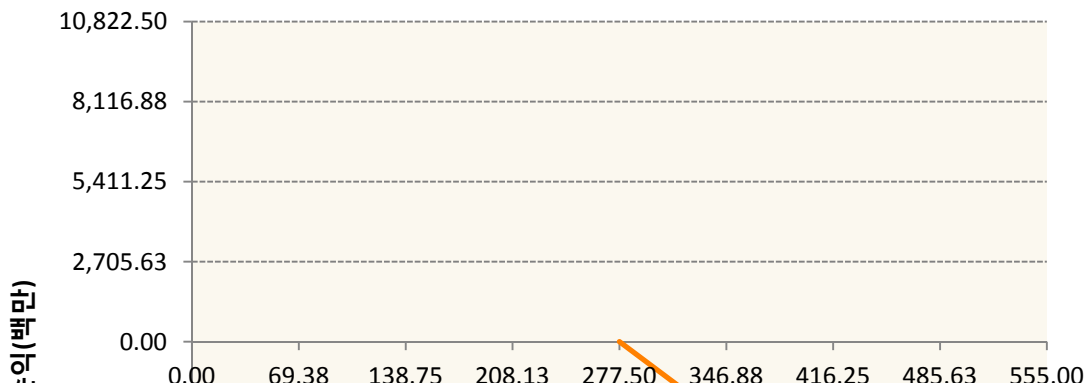
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	12,789	0	12,789	장내
누계	유가증권	옵션	2,523	23,213	-20,690	장내

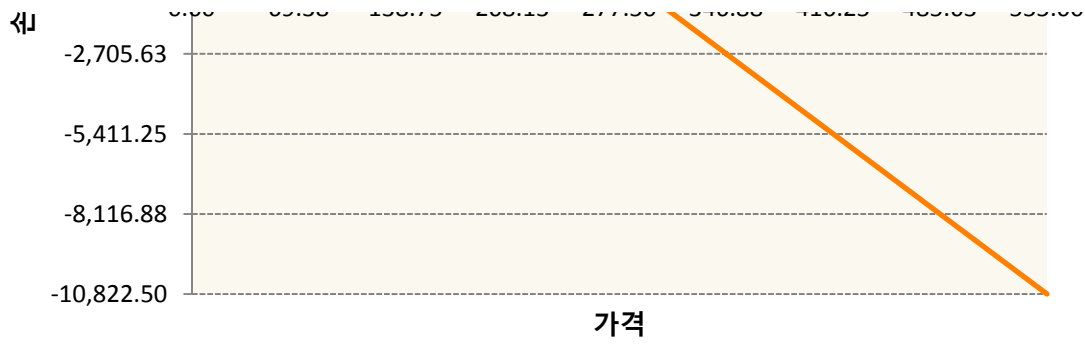
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P30007-2019-03 코스피200지수선물

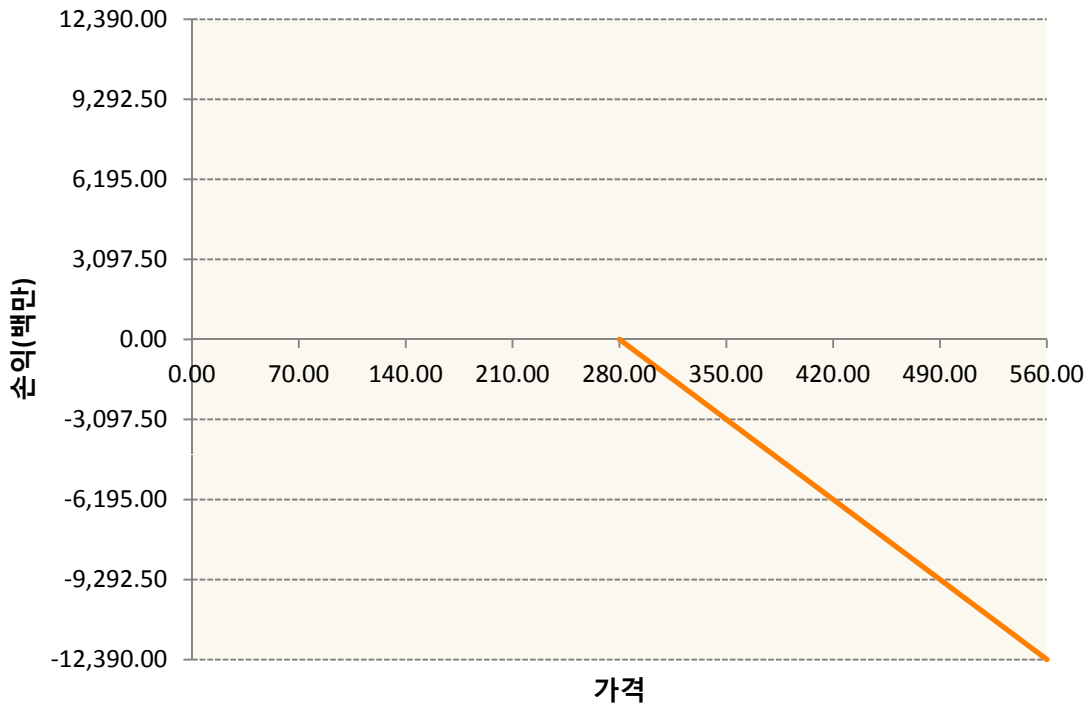


KR4201P22770-2019-02 콜277.5

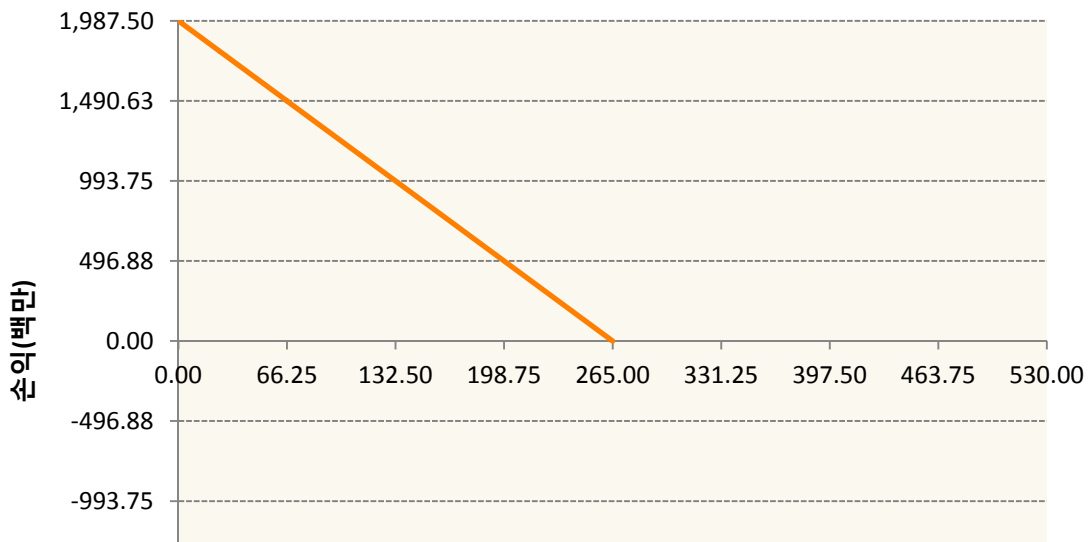


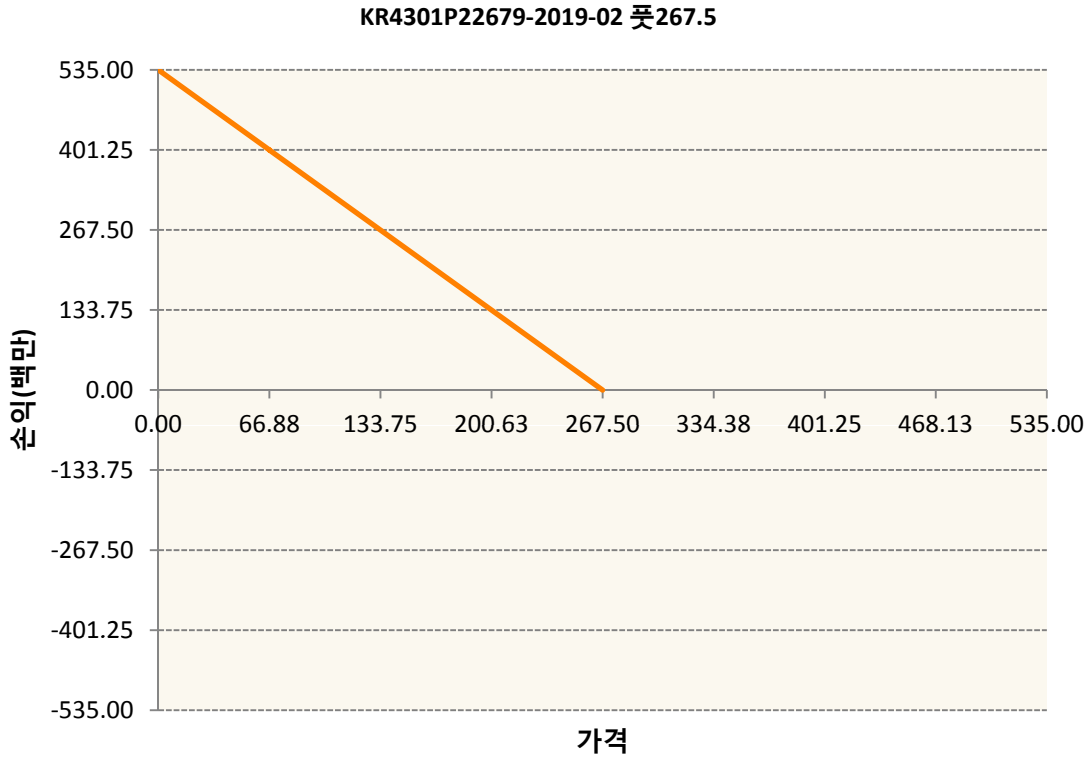
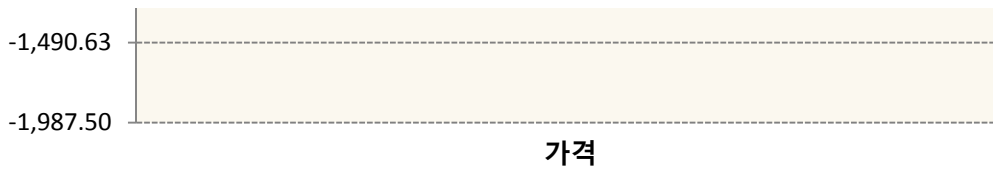


KR4201P22804-2019-02 콜280



KR4301P22653-2019-02 풋265





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101P30007		2019-03 코스피200지수선물						1,020
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-1,020	-1,020	-1,020	-1,020	-1,020	-1,020	-1,020	
-5.33%	-680	-680	-680	-680	-680	-680	-680	
-2.67%	-340	-340	-340	-340	-340	-340	-340	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	340	340	340	340	340	340	340	
5.33%	680	680	680	680	680	680	680	
8.00%	1,020	1,020	1,020	1,020	1,020	1,020	1,020	
KR4201P22770		2019-02 콜277.5						571
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	201	196	190	182	172	161	149	
-5.33%	186	176	163	150	134	118	101	
-2.67%	149	131	112	92	71	49	27	

0%	74	49	25	0	-25	-50	-75
2.67%	-51	-78	-104	-131	-157	-183	-210
5.33%	-228	-252	-276	-300	-325	-350	-376
8.00%	-448	-466	-485	-505	-526	-548	-571
KR4201P22804 2019-02 콜280							609
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	193	189	183	175	166	155	143
-5.33%	181	171	159	146	130	114	96
-2.67%	148	131	111	91	69	46	22
0%	79	53	27	0	-27	-55	-83
2.67%	-43	-73	-103	-133	-163	-193	-223
5.33%	-223	-252	-281	-310	-340	-369	-399
8.00%	-457	-480	-504	-529	-555	-582	-609
KR4301P22653 2019-02 풋265							107
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	101	101	102	103	104	105	107
-5.33%	51	53	55	57	59	61	64
-2.67%	13	16	19	22	24	27	30
0%	-7	-5	-2	0	2	5	8
2.67%	-14	-13	-12	-10	-9	-7	-5
5.33%	-15	-15	-15	-14	-14	-13	-12
8.00%	-16	-15	-15	-15	-15	-15	-14
KR4301P22679 2019-02 풋267.5							31
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	30	30	30	30	31	31	31
-5.33%	16	17	17	18	18	19	19
-2.67%	5	6	6	7	8	8	9
0%	-2	-1	-1	0	1	1	2
2.67%	-5	-5	-4	-4	-3	-3	-2
5.33%	-6	-6	-5	-5	-5	-5	-4
8.00%	-6	-6	-6	-6	-6	-5	-5

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

(단위:백만원)

1,998

공시일	2019-01-17
기준일	2019-01-16

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	2019-01-17
기준일	2019-01-16

H2O글로벌본드(UH)(채권혼합-파)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	202	0	202	
누계	유가증권	수익증권	2,607	0	2,607	

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	2019-01-17
기준일	2019-01-16

H2O글로벌본드(H)(채권혼합-파생)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	168	0	168	
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	수익증권	3,466	0	3,466	
누계	통화	선도	0	3,887	-3,887	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
FX21019F01 KRW/USD 19-02-19E		38

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

(단위:백만원)

118

공시일	2019-01-17
기준일	2019-01-16

스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

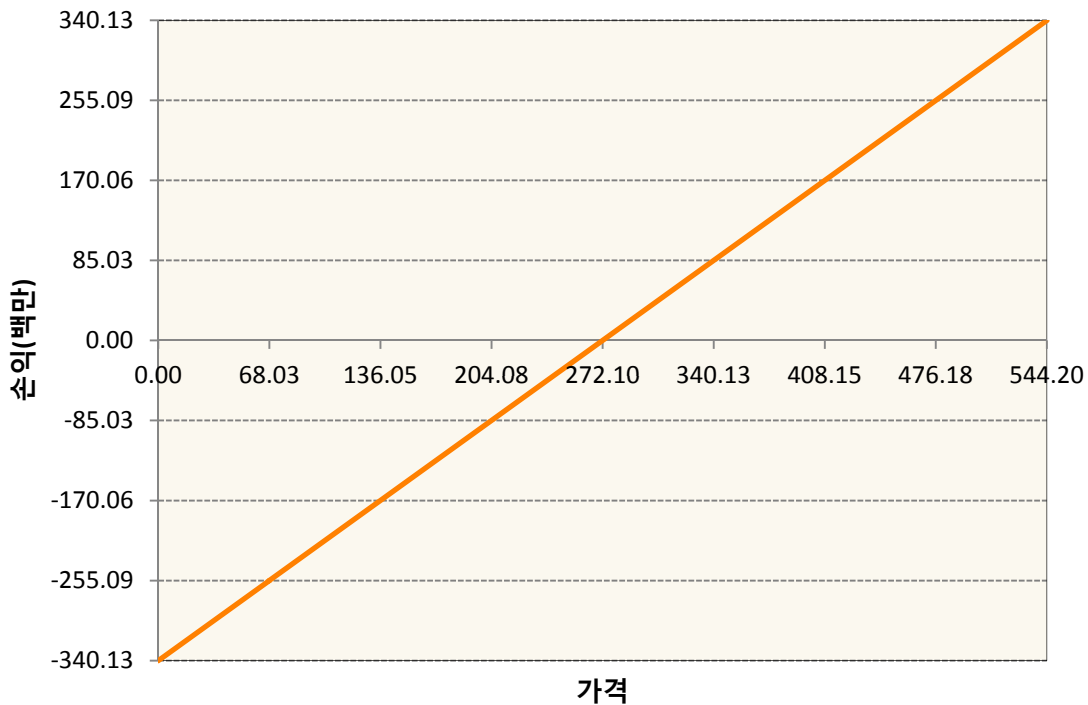
1. 계약금액

(단위:백만원)

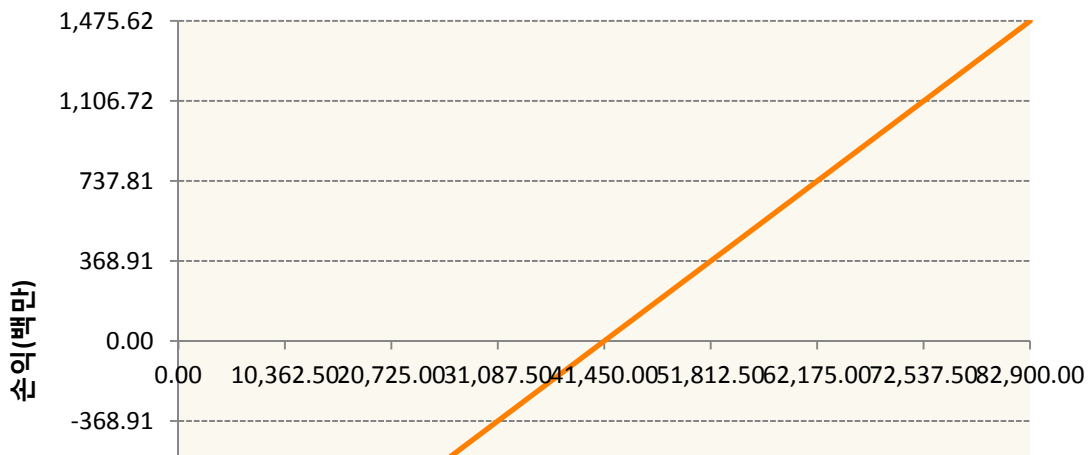
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,816	0	1,816	장내

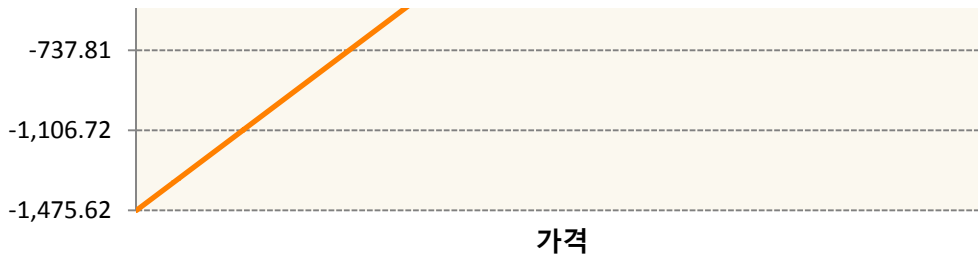
2. 만기시점의 손익구조

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						118
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-118	-118	-118	-118	-118	-118	-118	
-5.33%	-79	-79	-79	-79	-79	-79	-79	
-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%	79	79	79	79	79	79	79	
8.00%	118	118	118	118	118	118	118	

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

161

공시일	2019-01-17
기준일	2019-01-16

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

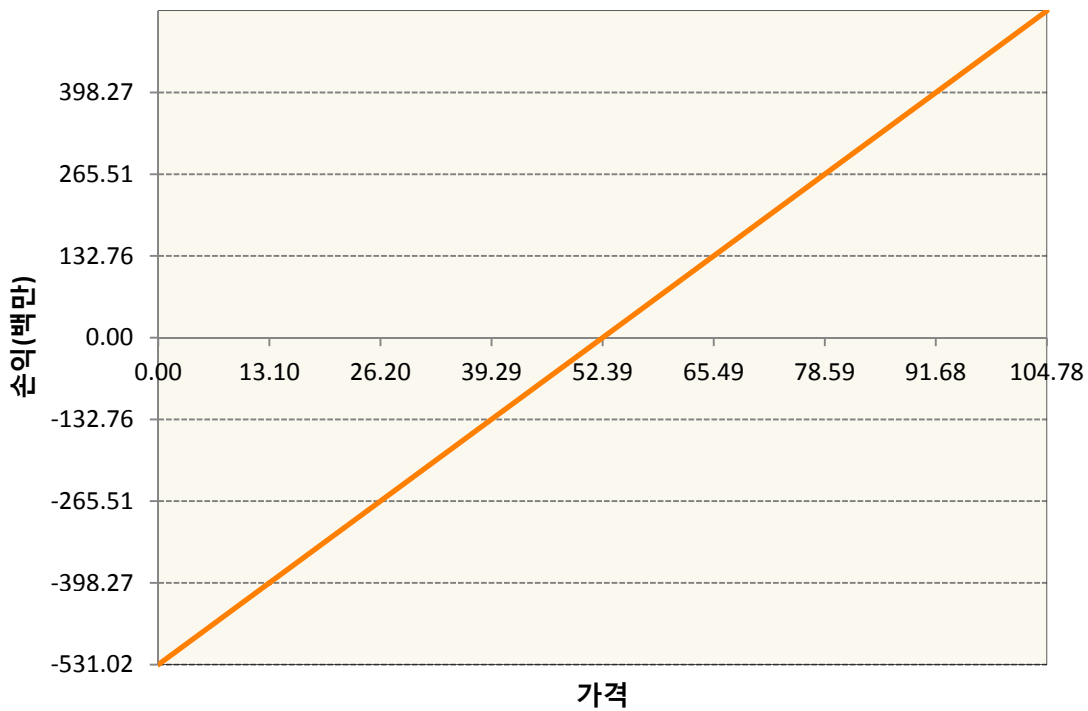
1. 계약금액

(단위:백만원)

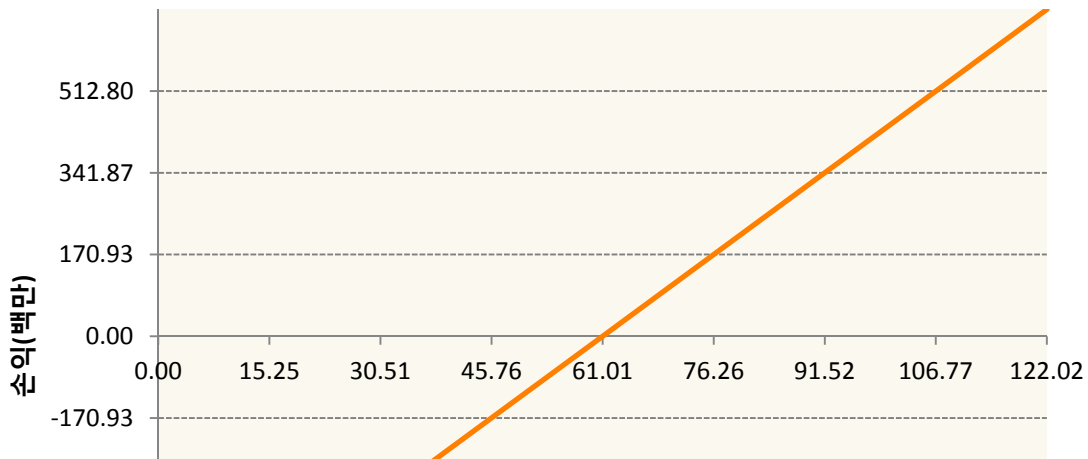
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,793	202	2,592	

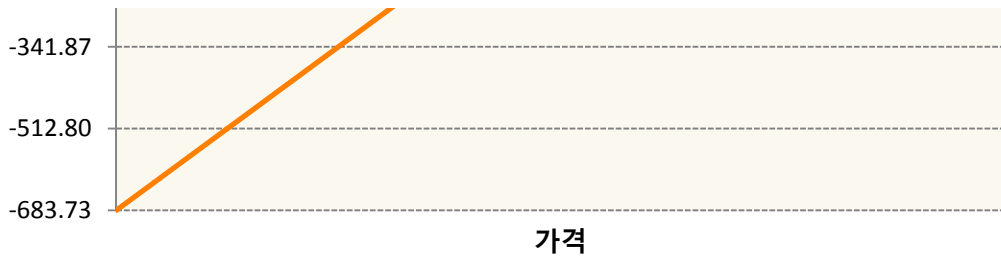
2. 만기시점의 손익구조

CLH9-WTI CRUDE FUTURE MAR19

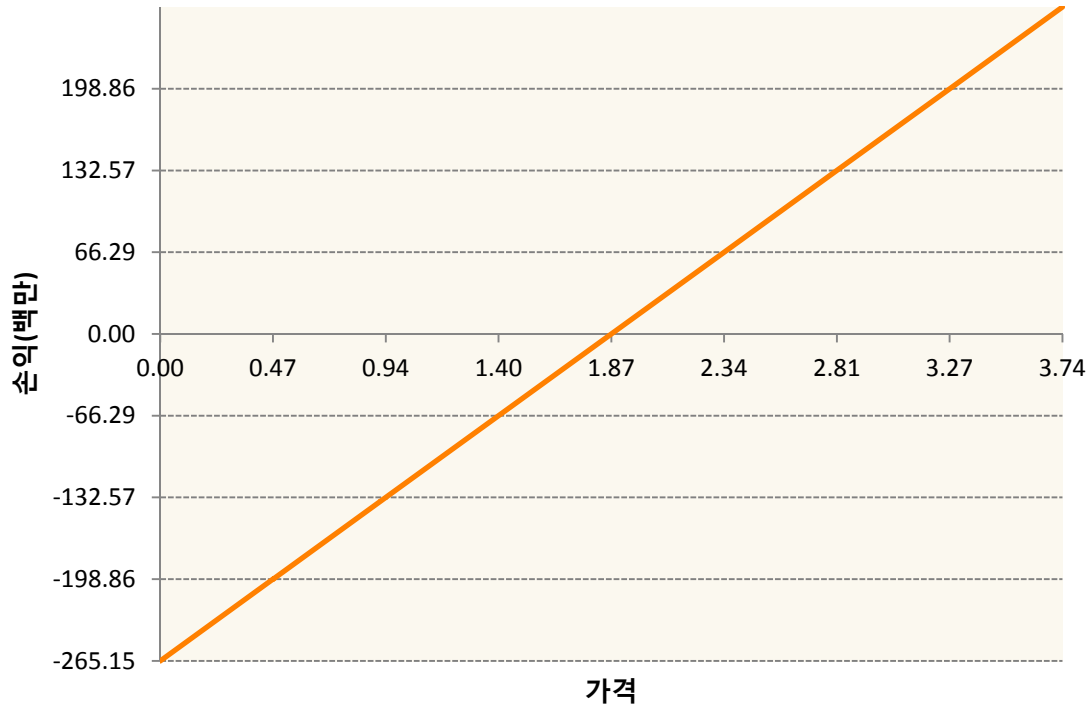


COK9-BRENT CRUDE FUTR May19

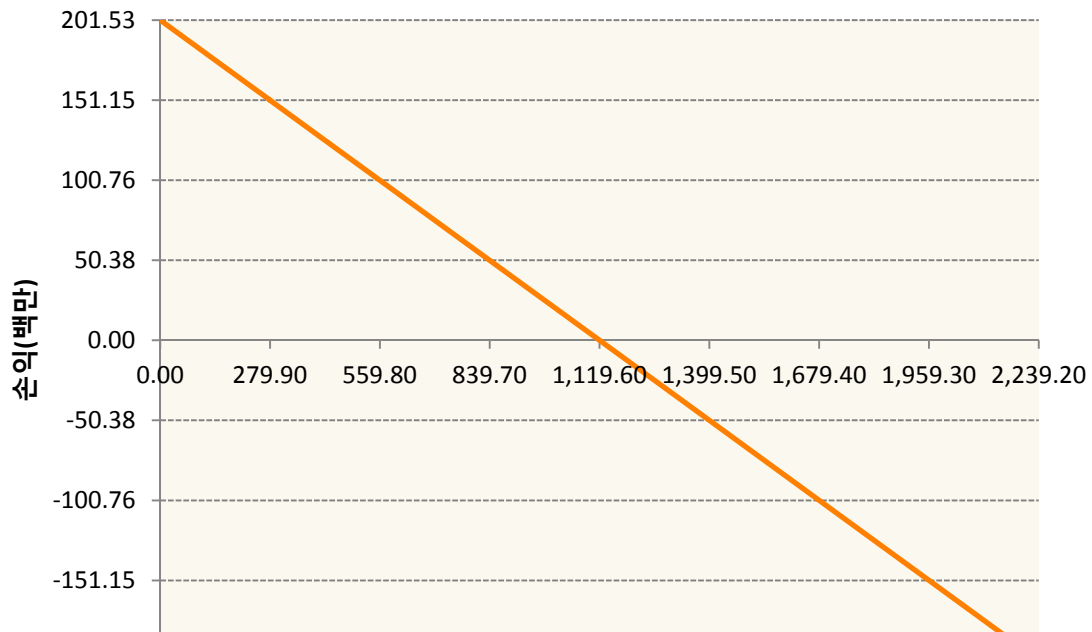


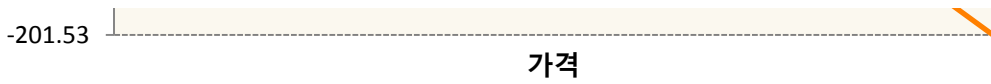


HOH9-NY Harb ULSD Fut Mar19

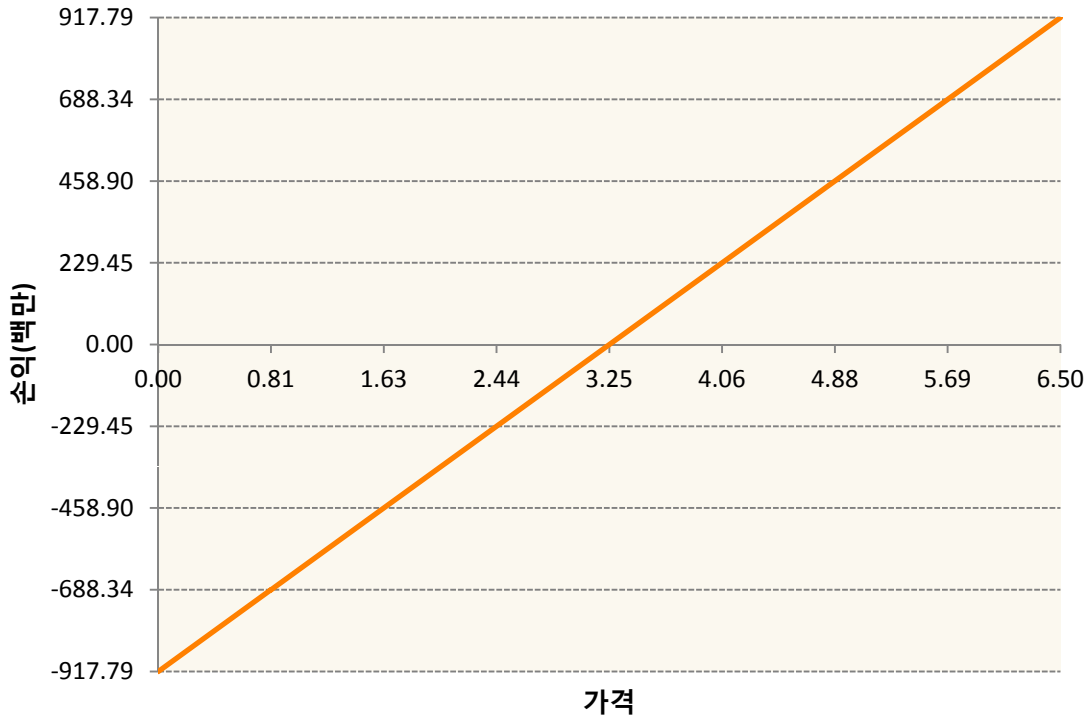


KR4175P10003-2019-01 달러선물

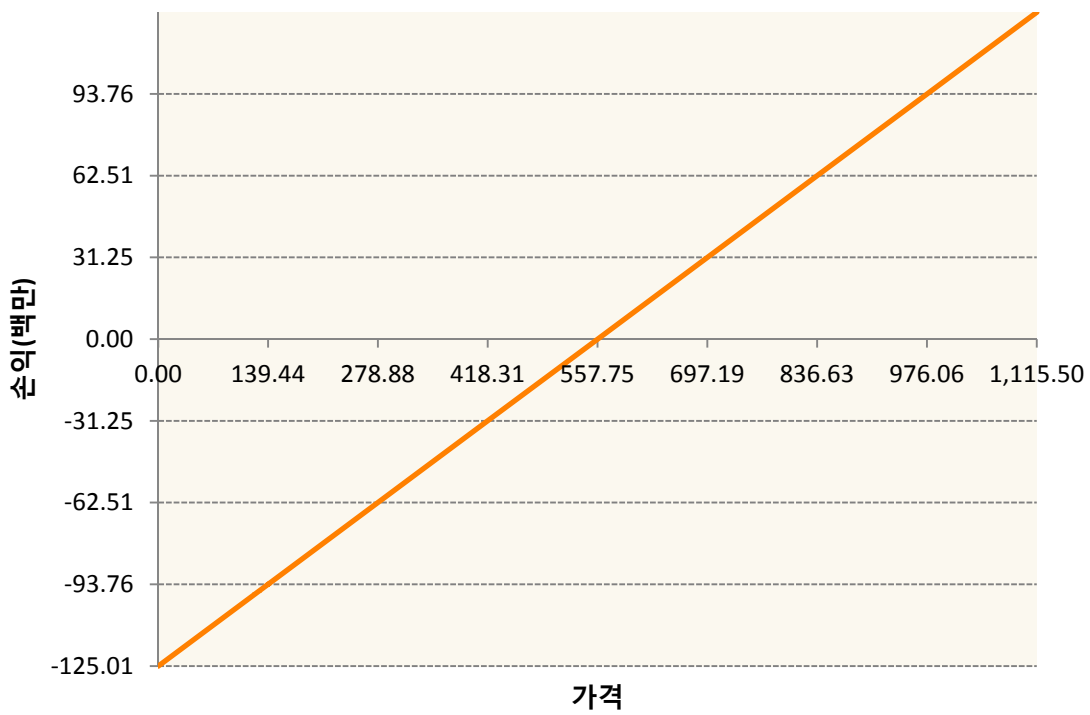




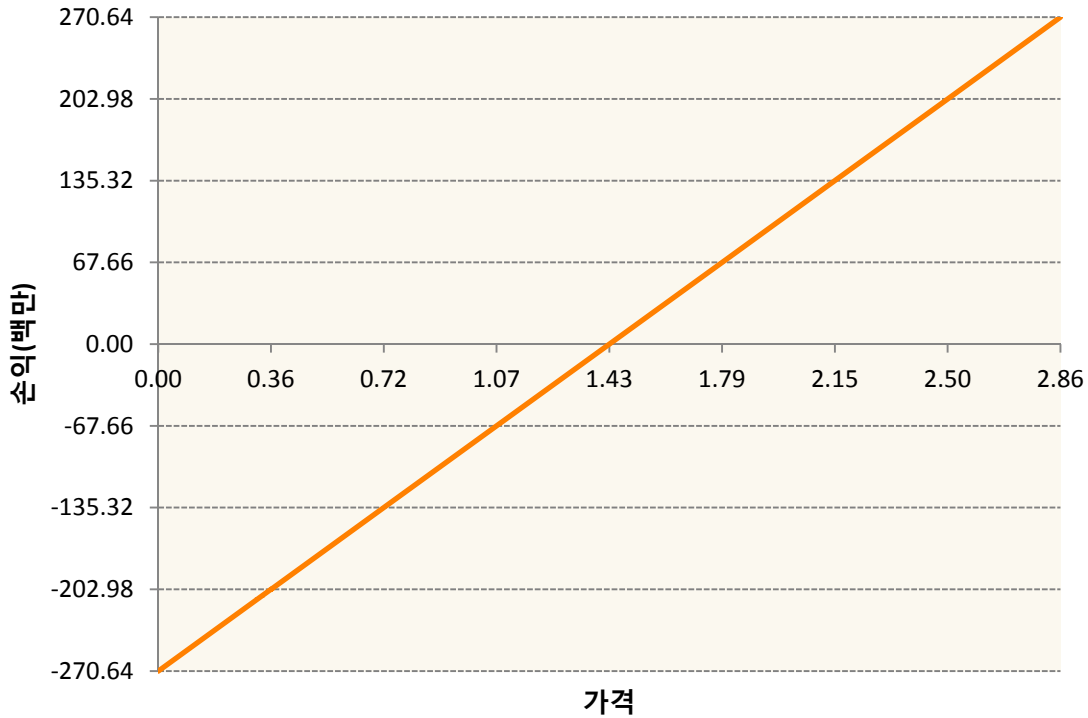
NGH19-NATURAL GAS FUTR Mar19



QSH9-Low Su Gasoil G May19



XBH9-GASOLINE RBOB FUT Mar19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLH9	WTI CRUDE FUTURE MAR19	42
COK9	BRENT CRUDE FUTR May19	55
HOH9	NY Harb ULSD Fut Mar19	21
KR4175P100	2019-01 달러선물	16
NGH19	NATURAL GAS FUTR Mar19	73
QSH9	Low Su Gasoil G May19	10
XBH9	GASOLINE RBOB FUT Mar19	22

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

435

공시일	2019-01-17
기준일	2019-01-16

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

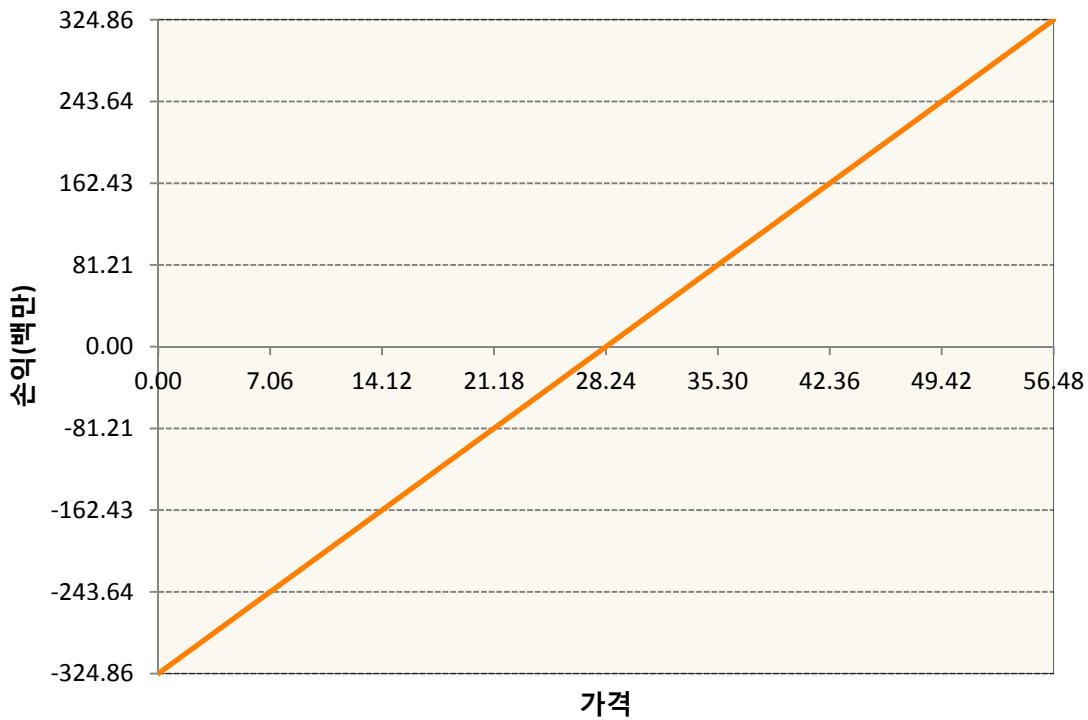
1. 계약금액

(단위:백만원)

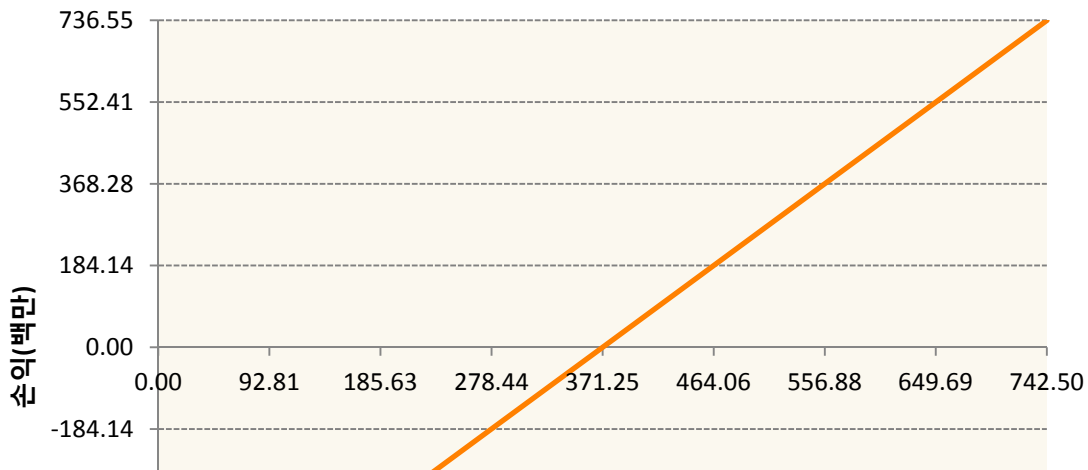
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,529	78	3,450	

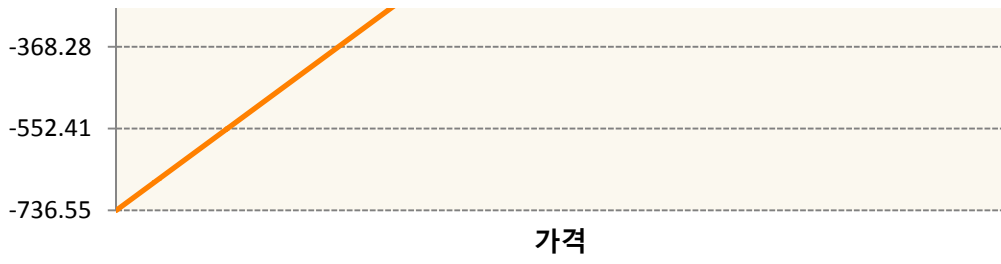
2. 만기시점의 손익구조

BOH9-SOYBEAN OIL FUTR Mar19

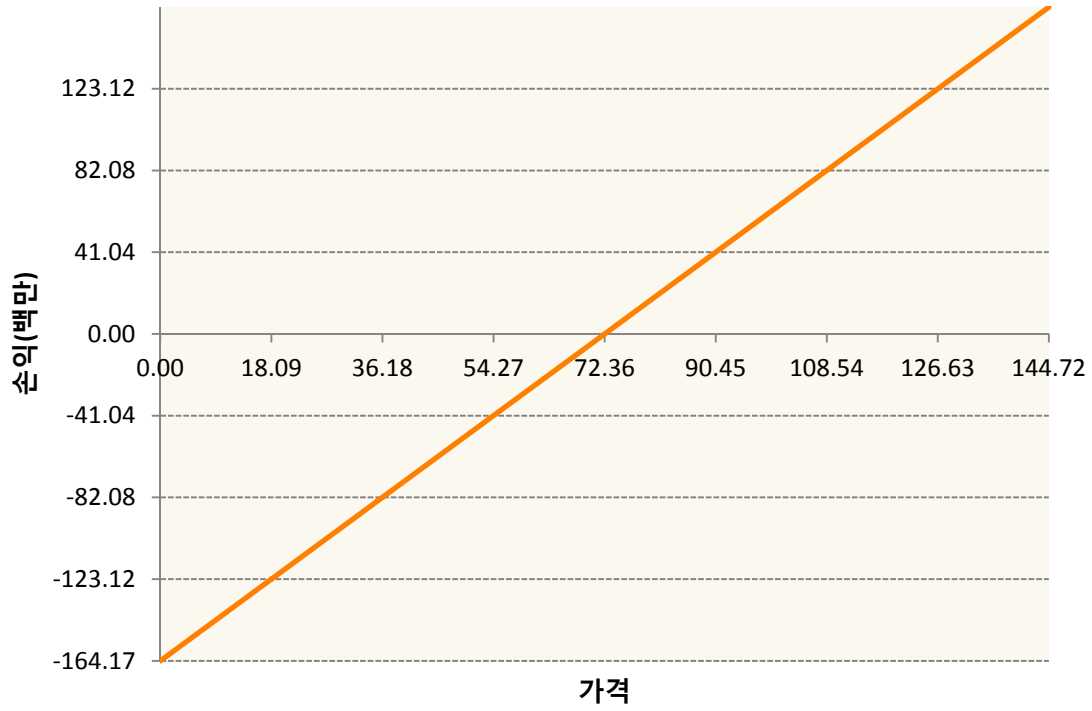


CH9-CORN FUTURE Mar19

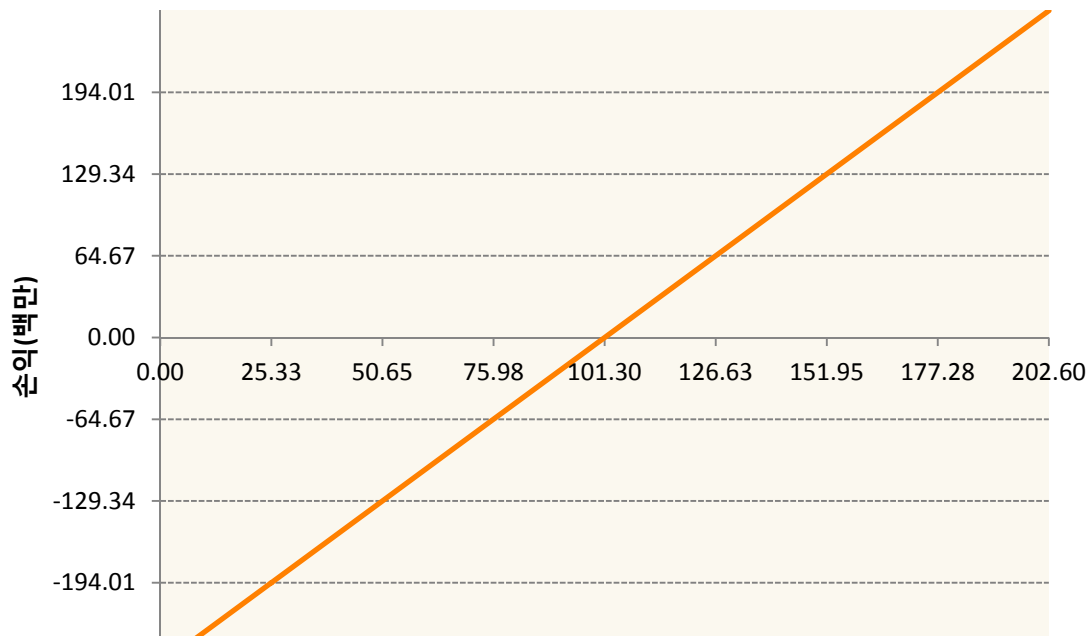


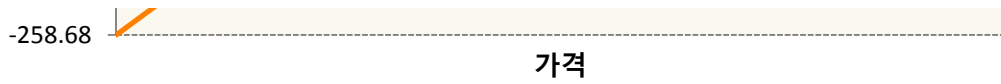


CTH9-COTTON NO.2 FUTR Mar19

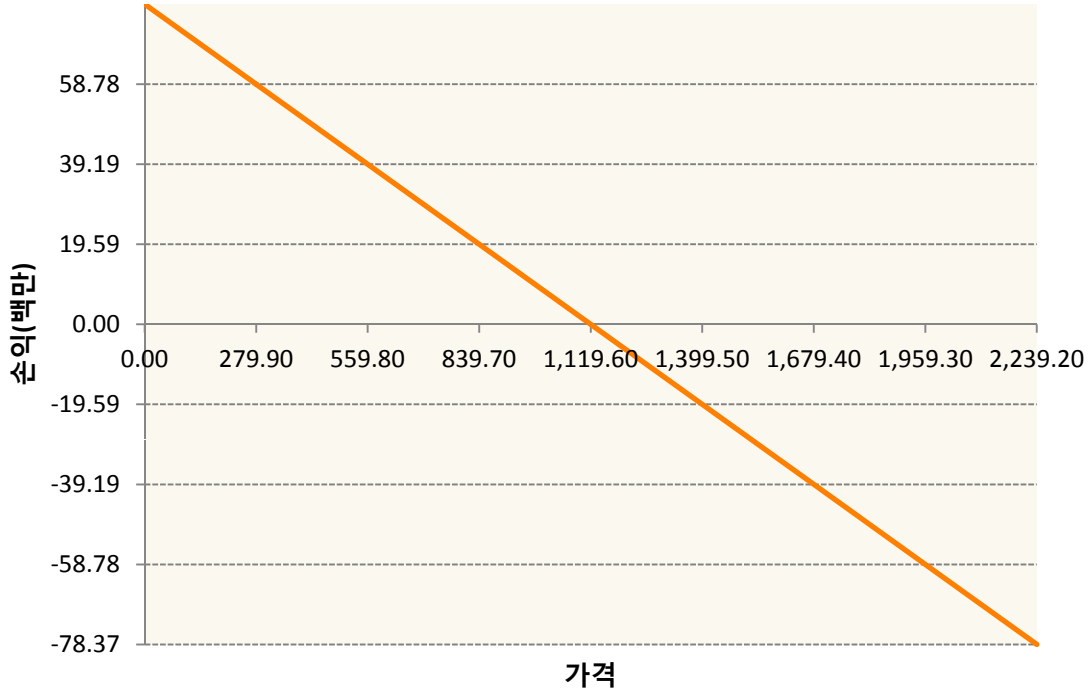


KCH9-COFFEE 'C' FUTURE Mar19

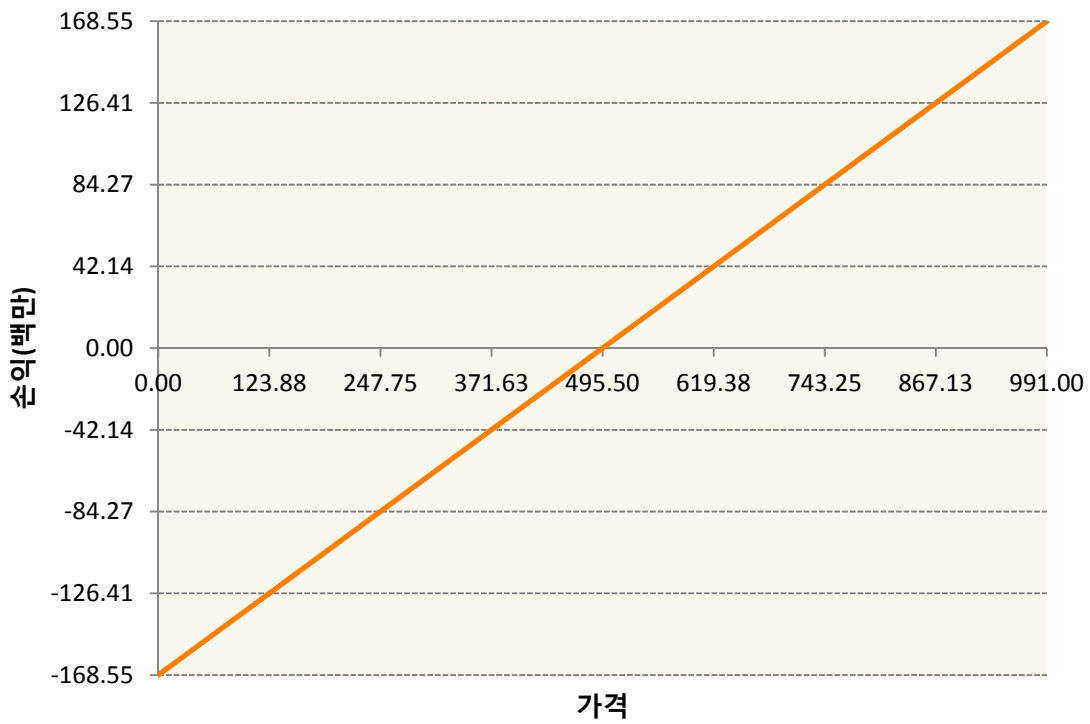




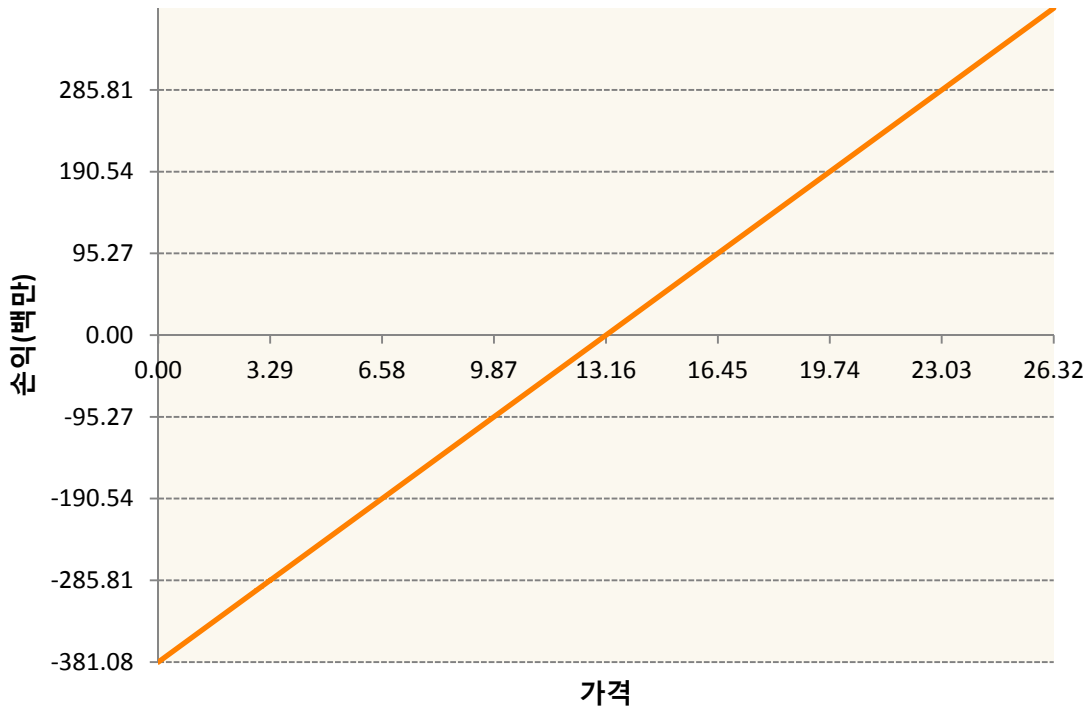
KR4175P10003-2019-01 달러선물



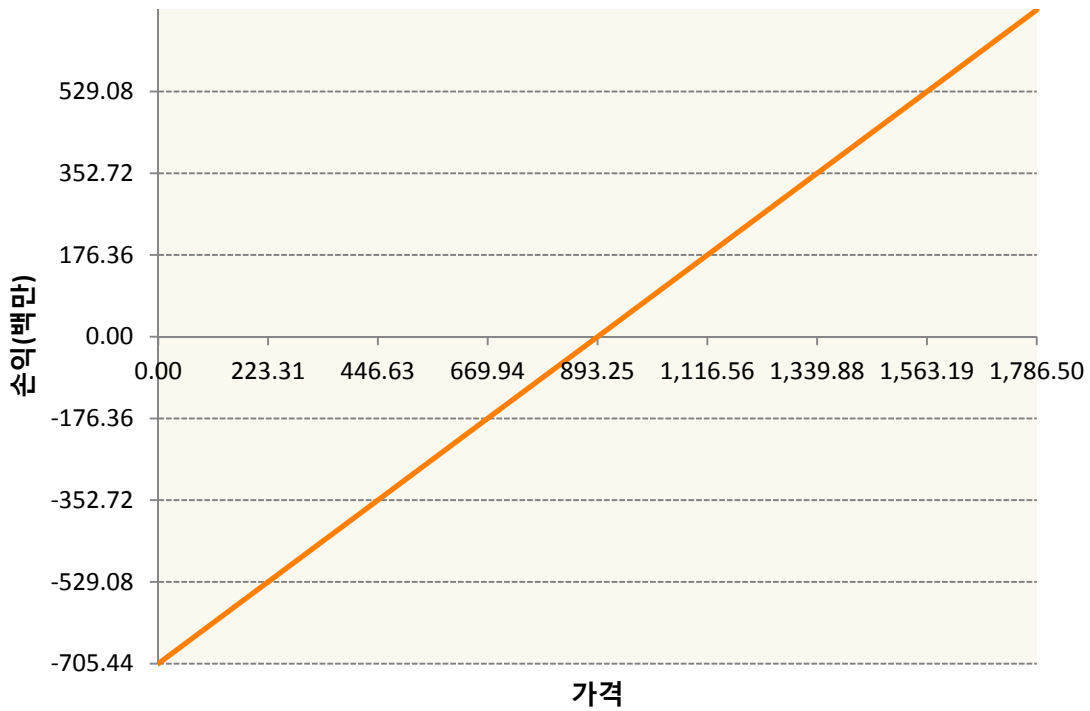
KWH9-KC HRW WHEAT FUT Mar19



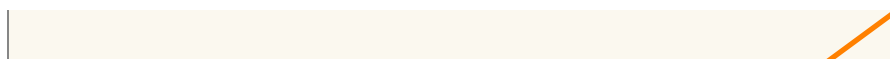
SBH9-SUGAR #11 (WORLD) MAR19

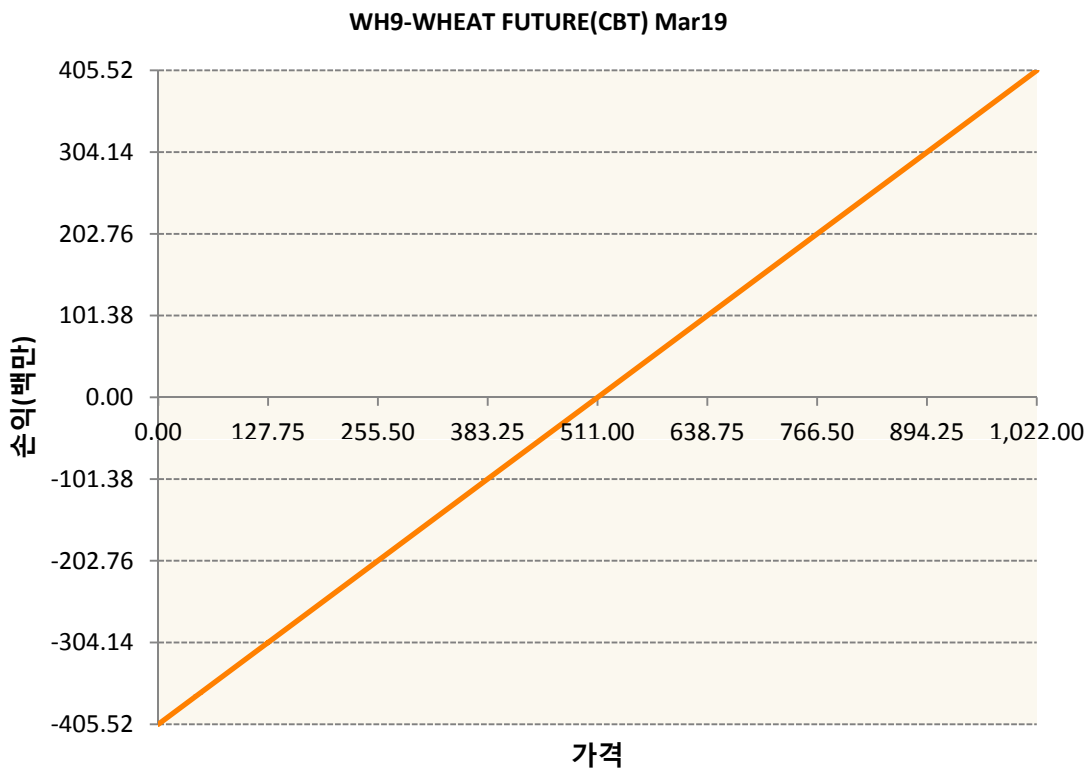
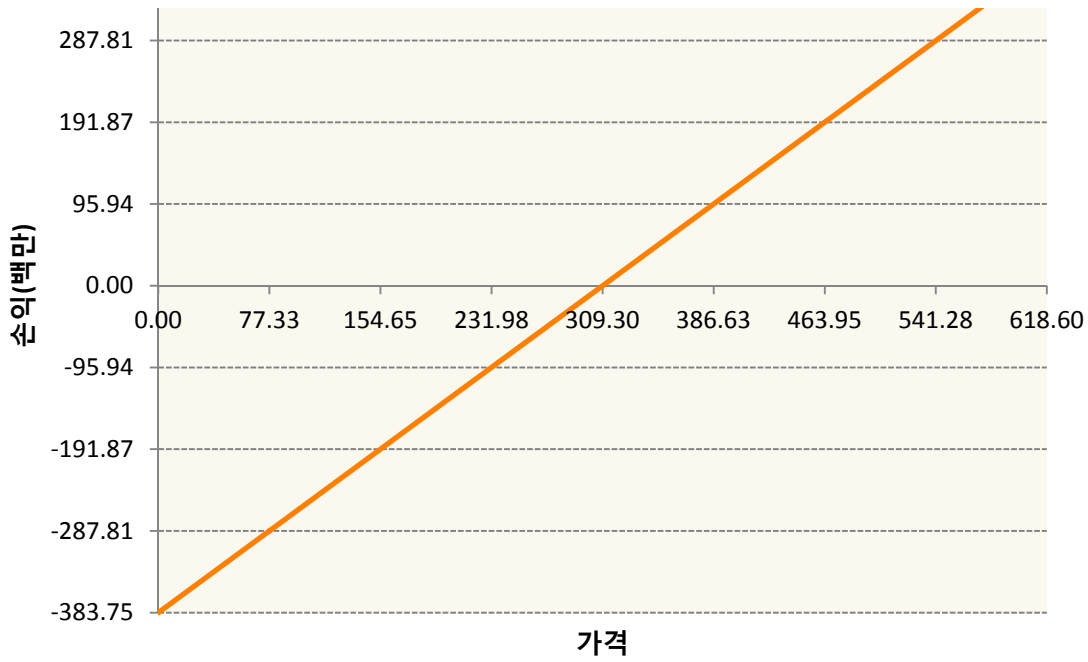


SH9-SOYBEAN FUTURE Mar19



SMH9-SOYBEAN MEAL FUTR Mar19





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

BOH9	SOYBEAN OIL FUTR Mar19	26
CH9	CORN FUTURE Mar19	59
CTH9	COTTON NO.2 FUTR Mar19	13
KCH9	COFFEE 'C' FUTURE Mar19	21
KR4175P100	2019-01 달러선물	6

KWH9	KC HRW WHEAT FUT Mar19	13
SBH9	SUGAR #11 (WORLD) MAR19	30
SH9	SOYBEAN FUTURE Mar19	56
SMH9	SOYBEAN MEAL FUTR Mar19	31
WH9	WHEAT FUTURE(CBT) Mar19	32

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

(단위:백만원)

290