

공시일	2019-01-18
기준일	2019-01-17

## 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)

96

공시일	2019-01-18
기준일	2019-01-17

## 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

1,046

\* 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	2019-01-18
기준일	2019-01-17

## 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

266
-----

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

396
-----

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-01-18
기준일	2019-01-17

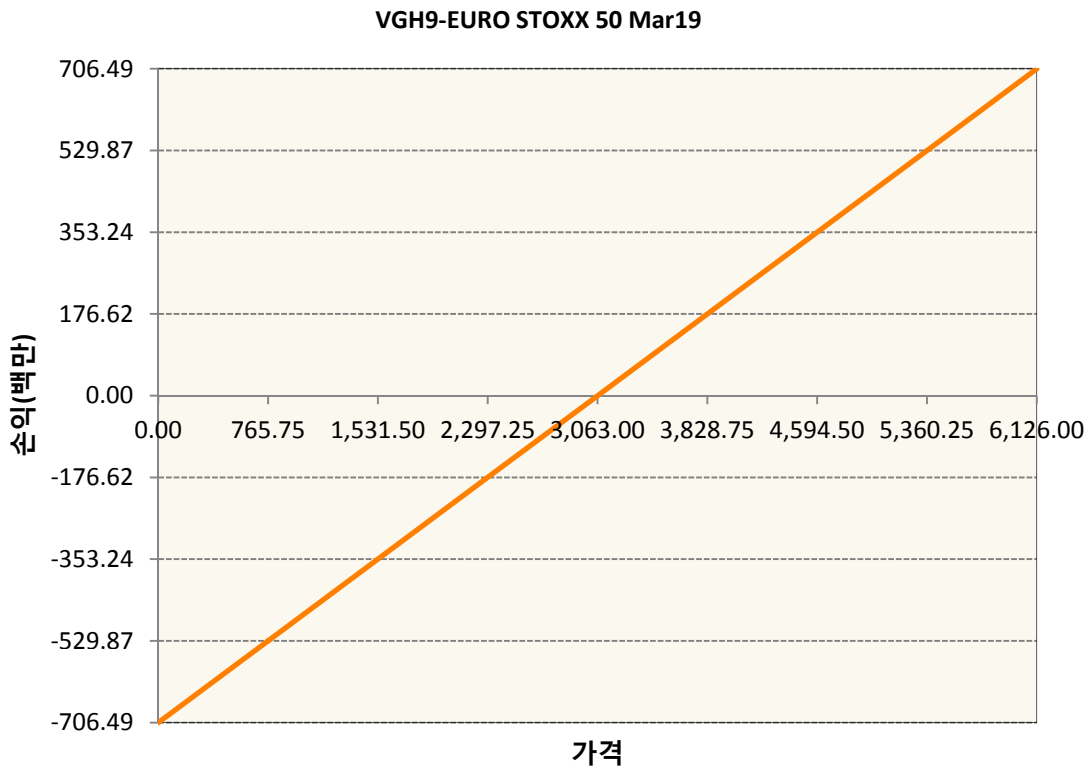
## 유로인덱스모(주식-파생형)

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	706	0	706	

### 2. 만기시점의 손익구조



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGH9	EURO STOXX 50 Mar19	57
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

38
----

공시일	2019-01-18
기준일	2019-01-17

## 차이나인덱스모(주식-파생형)

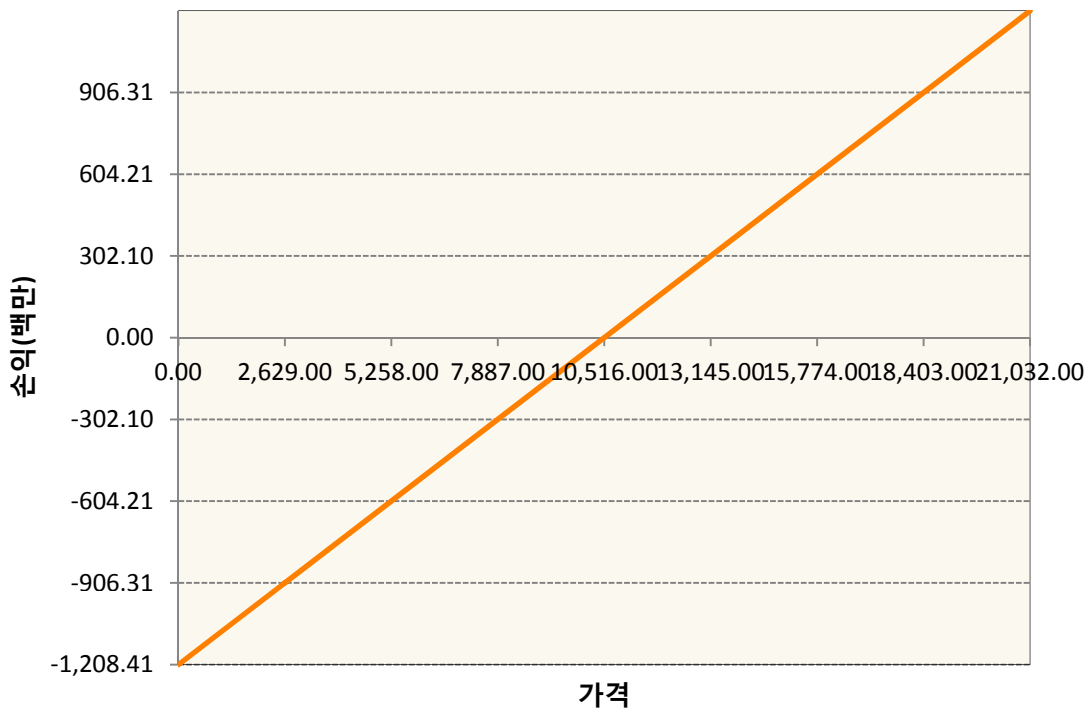
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

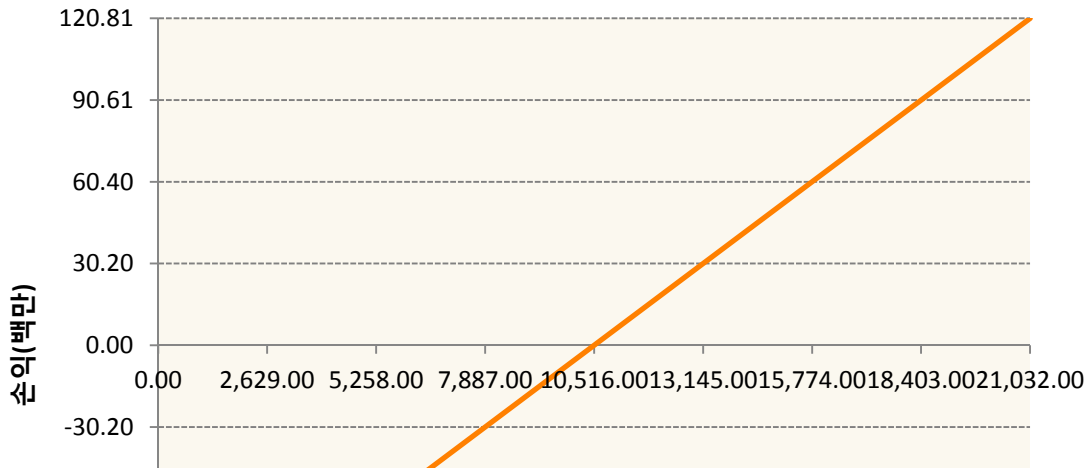
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,329	0	1,329	장내

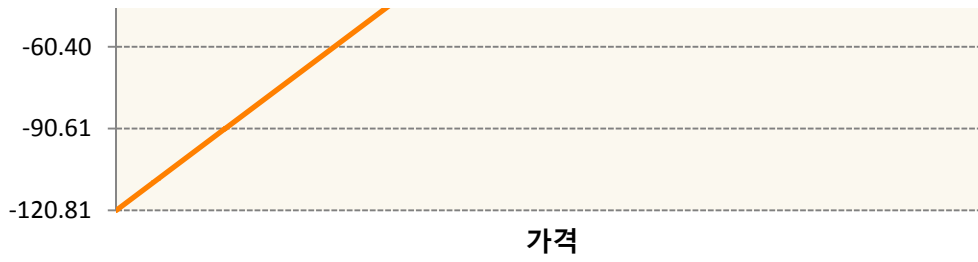
### 2. 만기시점의 손익구조

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)

<b>109</b>
------------

공시일	2019-01-18
기준일	2019-01-17

## 커버드콜모(주식혼합-파생형)

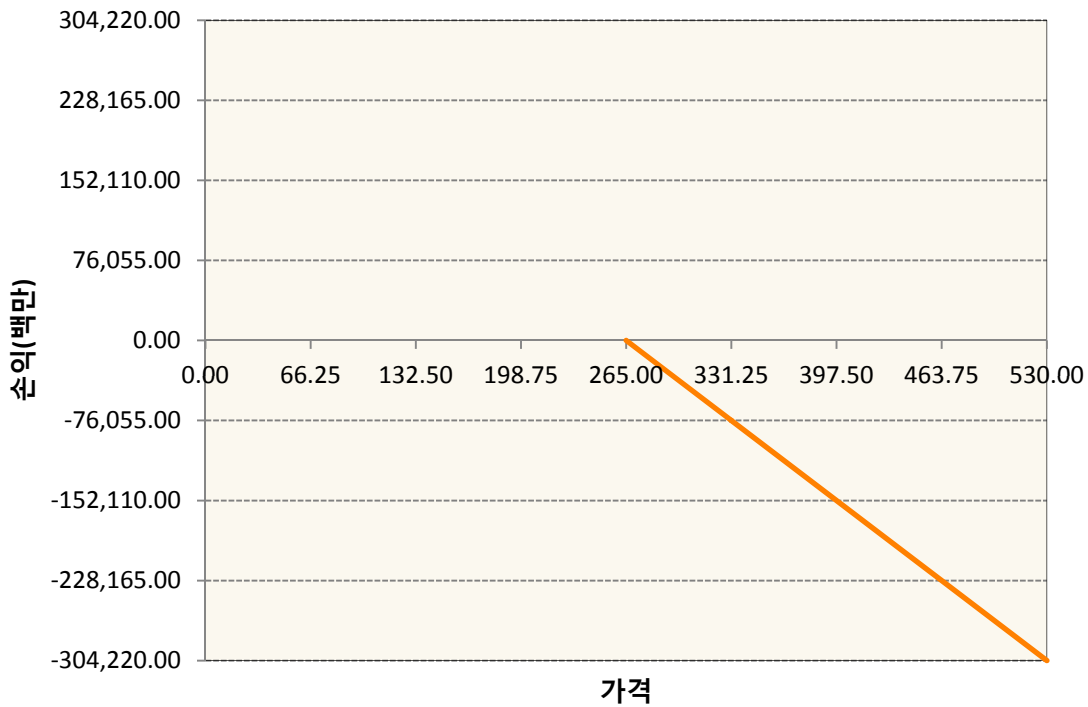
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	13,160	0	13,160	장내
누계	유가증권	옵션	0	699,943	-699,943	장내

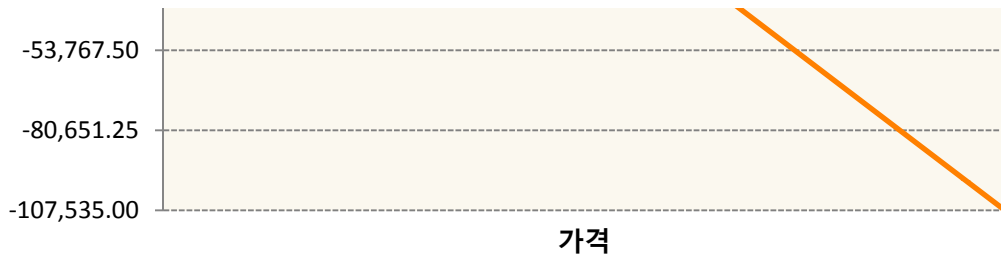
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4201P22655-2019-02 콜265

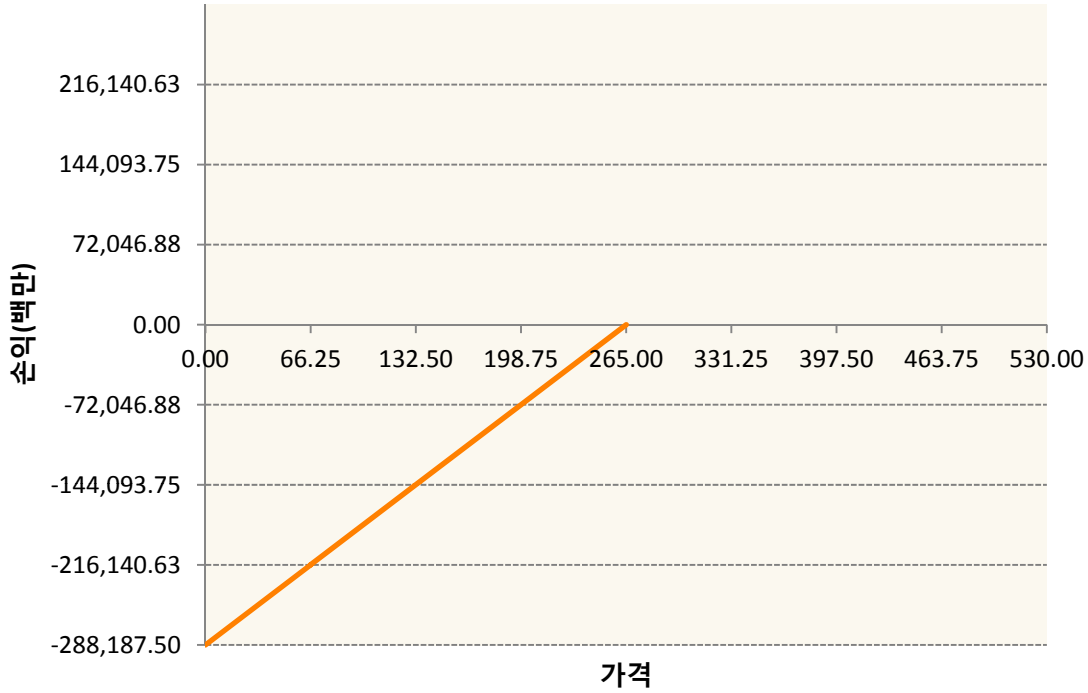


KR4201P22671-2019-02 콜267.5





KR4301P22653-2019-02 풋265



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4201P22655		2019-02 콜265					21,327
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	12,200	11,776	11,312	10,814	10,289	9,741	9,174
-5.33%	10,353	9,724	9,080	8,425	7,760	7,089	6,412
-2.67%	7,014	6,288	5,562	4,836	4,110	3,384	2,659
0%	2,027	1,363	686	0	-693	-1,393	-2,097
2.67%	-4,383	-4,874	-5,403	-5,963	-6,549	-7,155	-7,777
5.33%	-11,771	-12,069	-12,421	-12,821	-13,262	-13,737	-14,244
8.00%	-19,703	-19,853	-20,055	-20,307	-20,606	-20,947	-21,327
KR4201P22671		2019-02 콜267.5					7,217
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	3,788	3,664	3,523	3,368	3,201	3,025	2,840

-5.33%	3,280	3,080	2,870	2,655	2,434	2,209	1,980
-2.67%	2,300	2,049	1,797	1,544	1,292	1,038	785
0%	750	502	252	0	-253	-506	-761
2.67%	-1,333	-1,531	-1,739	-1,956	-2,179	-2,407	-2,639
5.33%	-3,815	-3,944	-4,091	-4,254	-4,429	-4,615	-4,810
8.00%	-6,536	-6,607	-6,696	-6,804	-6,928	-7,066	-7,217
KR4301P22653                      2019-02 풋265							15,106
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-14,229	-14,314	-14,425	-14,562	-14,723	-14,905	-15,106
-5.33%	-7,088	-7,354	-7,641	-7,943	-8,257	-8,581	-8,914
-2.67%	-1,780	-2,178	-2,576	-2,974	-3,373	-3,771	-4,170
0%	940	642	328	0	-338	-686	-1,040
2.67%	1,804	1,687	1,539	1,365	1,166	945	706
5.33%	1,968	1,942	1,899	1,837	1,753	1,648	1,522
8.00%	1,986	1,983	1,975	1,959	1,934	1,895	1,843

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

(단위:백만원)

**42,167**

공시일	2019-01-18
기준일	2019-01-17

## 홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

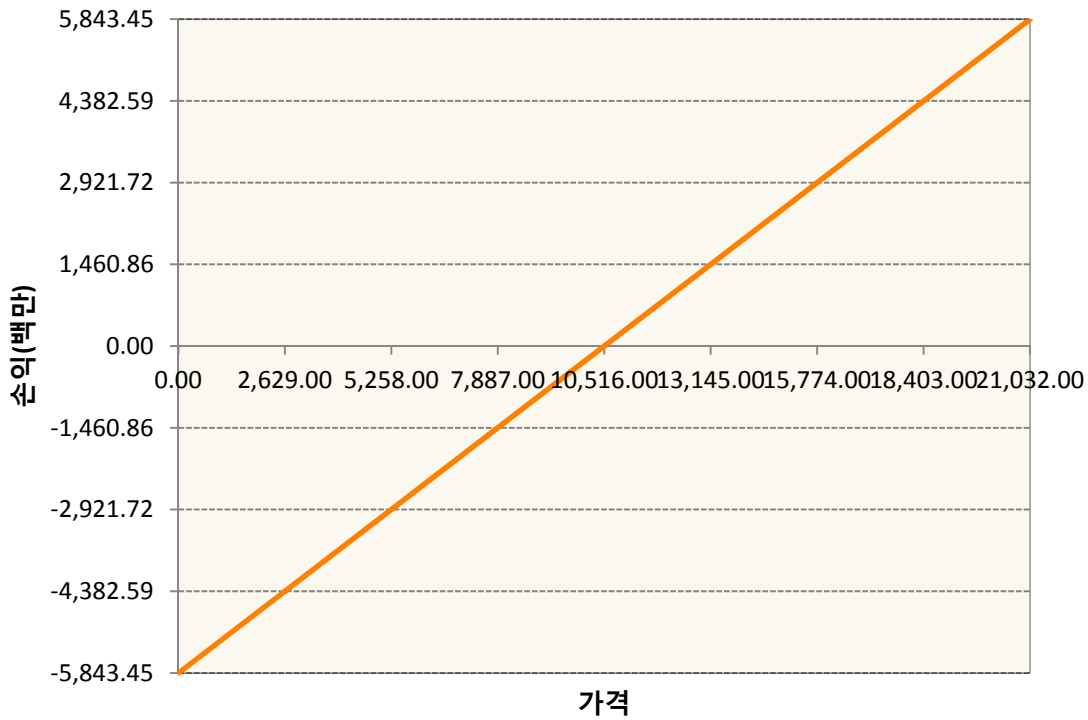
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

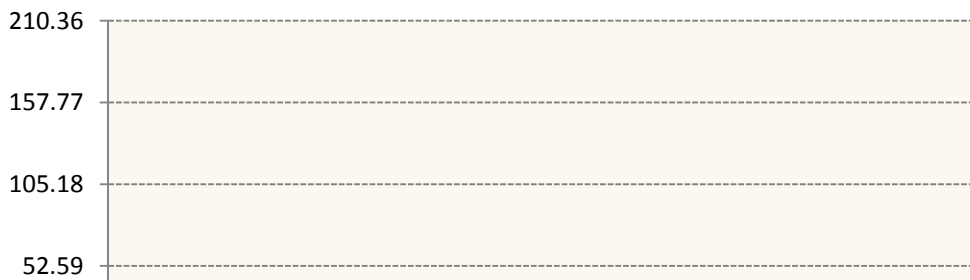
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	5,843	0	5,843	장내
누계	유가증권	옵션	0	12,298	-12,298	장내
누계	통화	선도	0	2,719	-2,719	장외

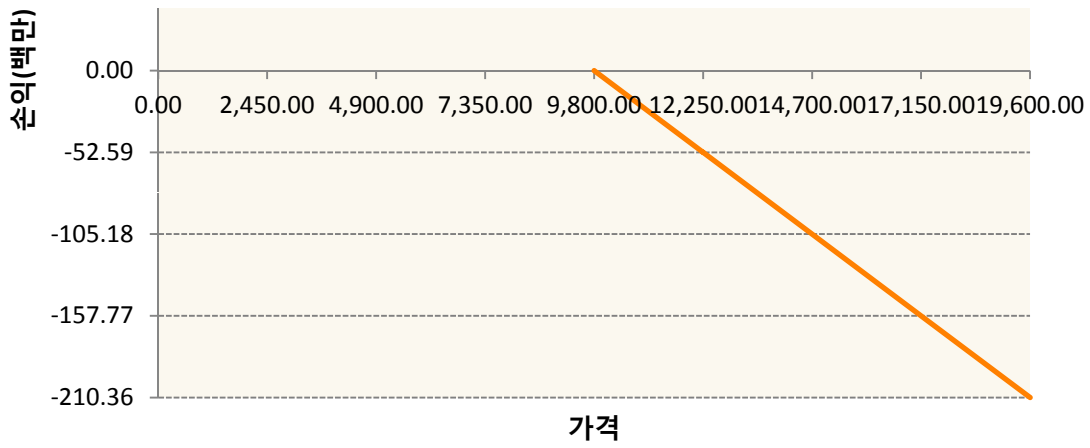
### 2. 만기시점의 손익구조

HCF9-HSCEI FUTURES JAN19

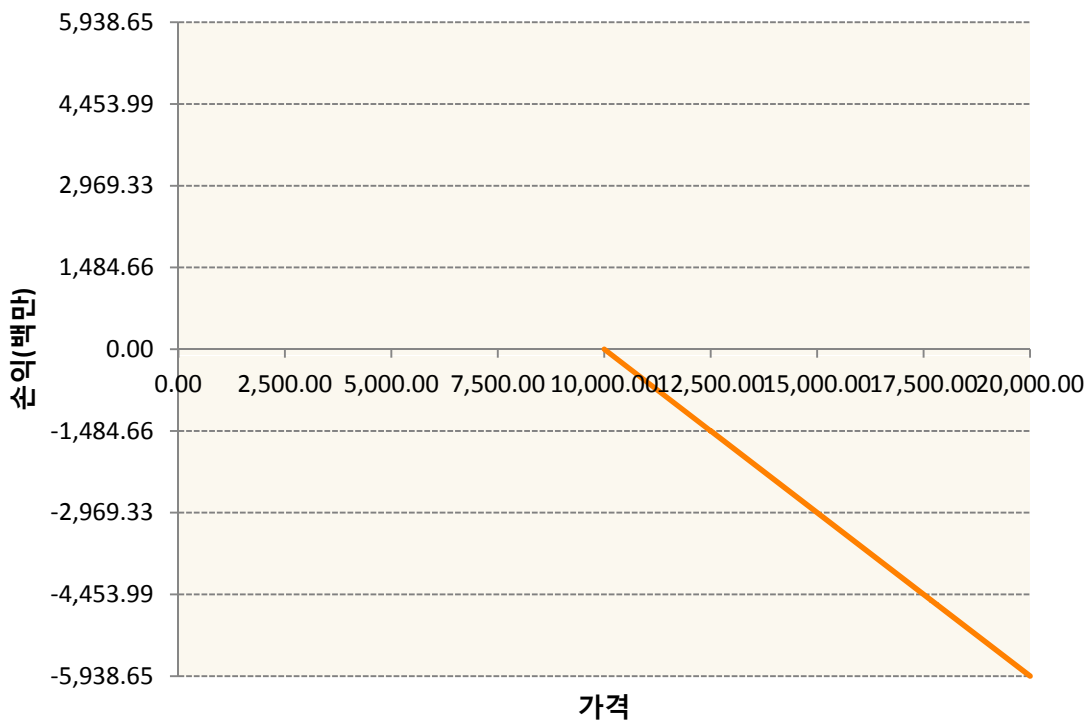


OHHIF9-C098-HSCEI

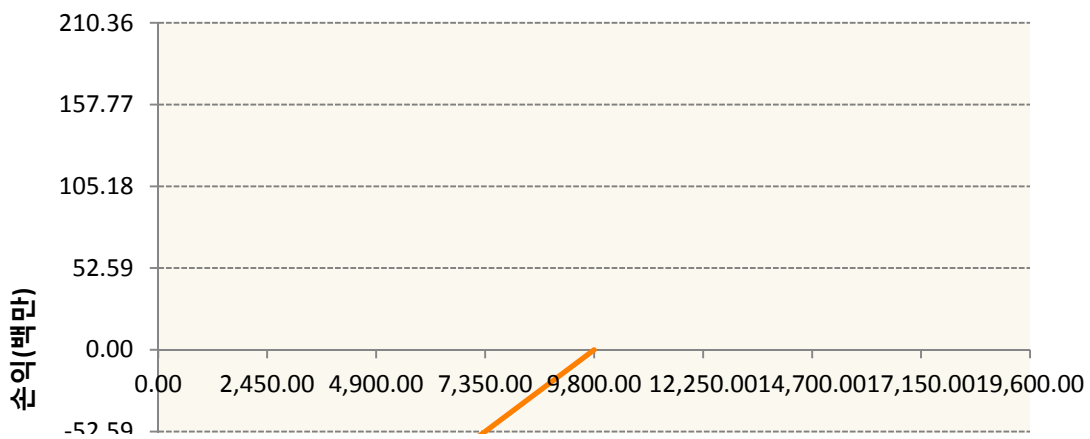


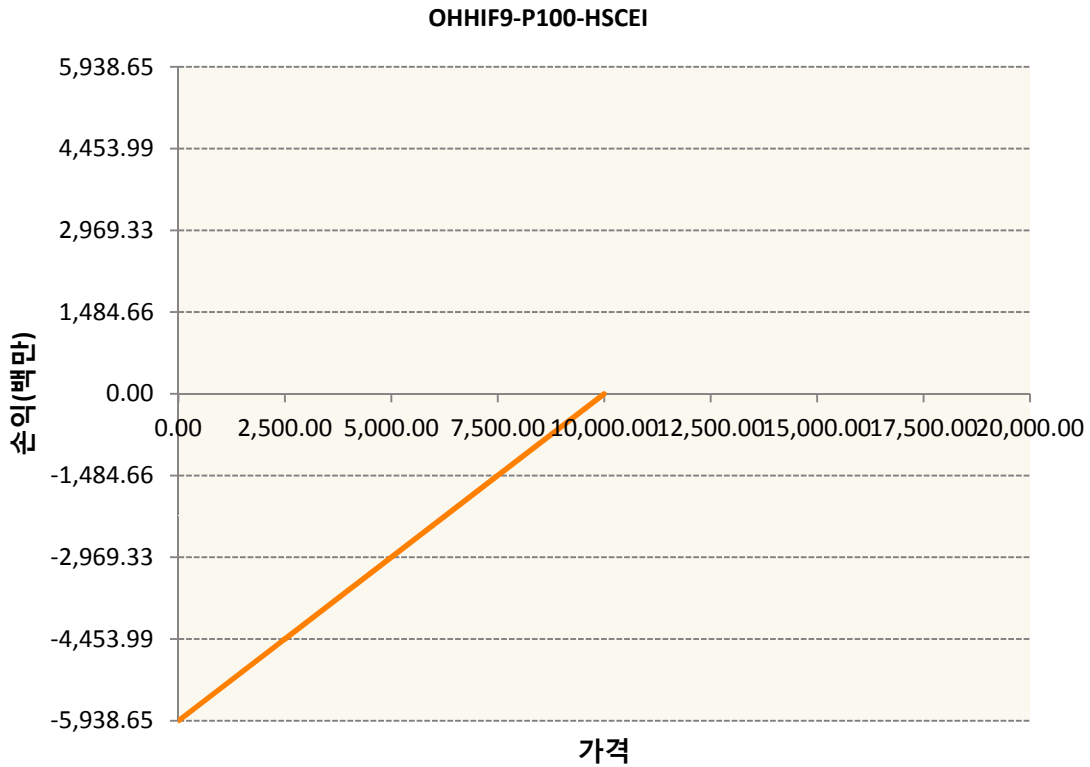


**OHHIF9-C100-HSCEI**



**OHHIF9-P098-HSCEI**





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)	(단위:백만원)
FX21018Z00 KRW/HKD 11-03-19E	217
HCF9 HSCEI FUTURES JAN19	468
OHHIF9-C09 HSCEI	17
OHHIF9-C10 HSCEI	475
OHHIF9-P09 HSCEI	17
OHHIF9-P10 HSCEI	475

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,567

공시일	2019-01-18
기준일	2019-01-17

## 코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

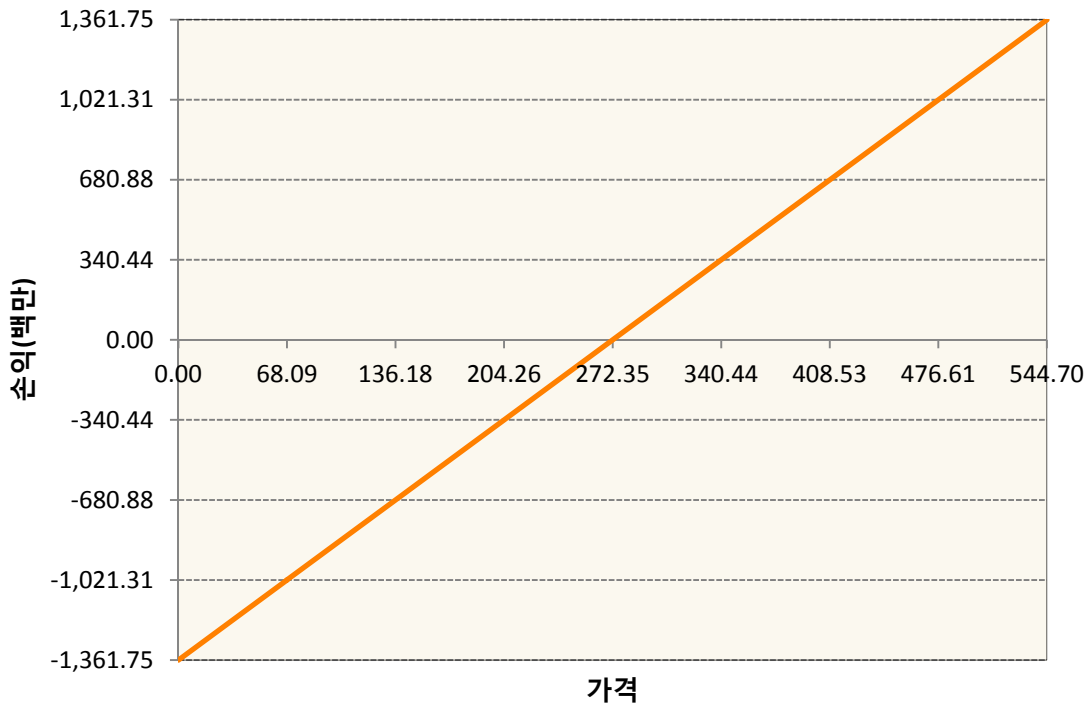
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

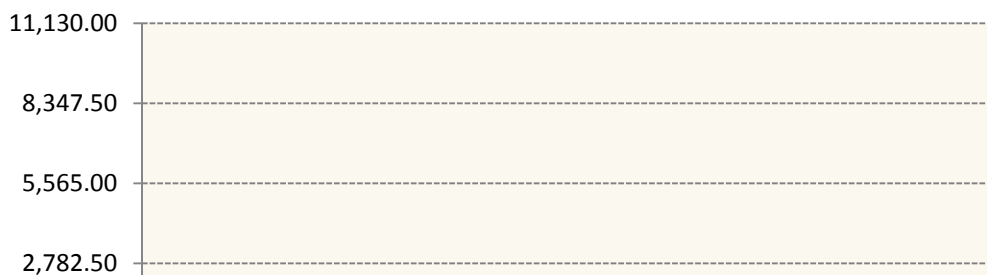
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	1,364	0	1,364	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,362	0	1,362	장내
누계	유가증권	스왑	31,836	0	31,836	장외
누계	유가증권	옵션	0	33,858	-33,858	장내

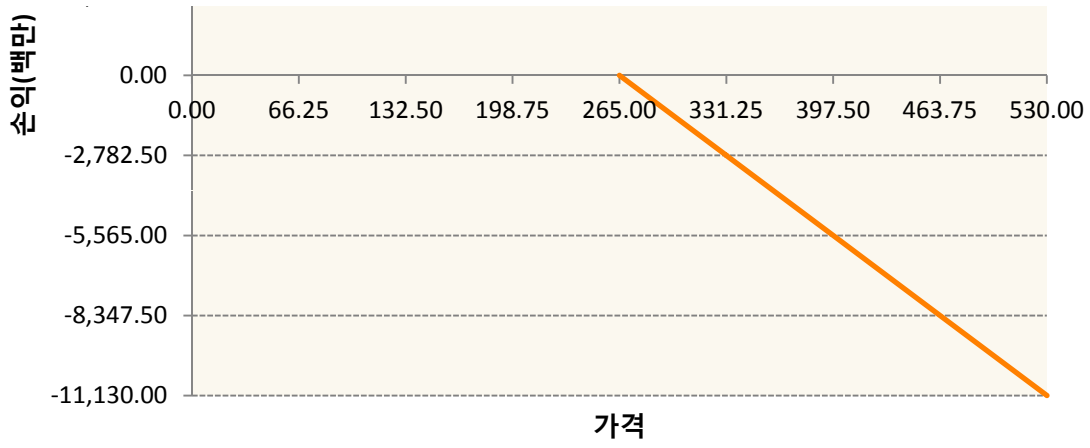
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101P30007-2019-03 코스피200지수선물

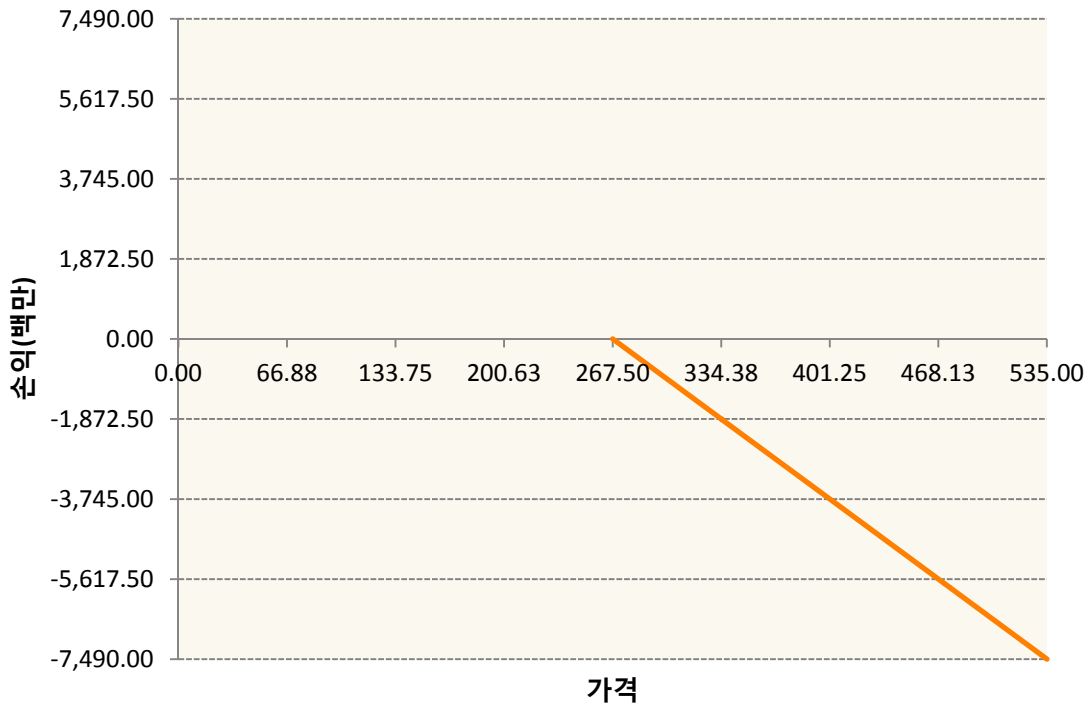


KR4201P22655-2019-02 콜265

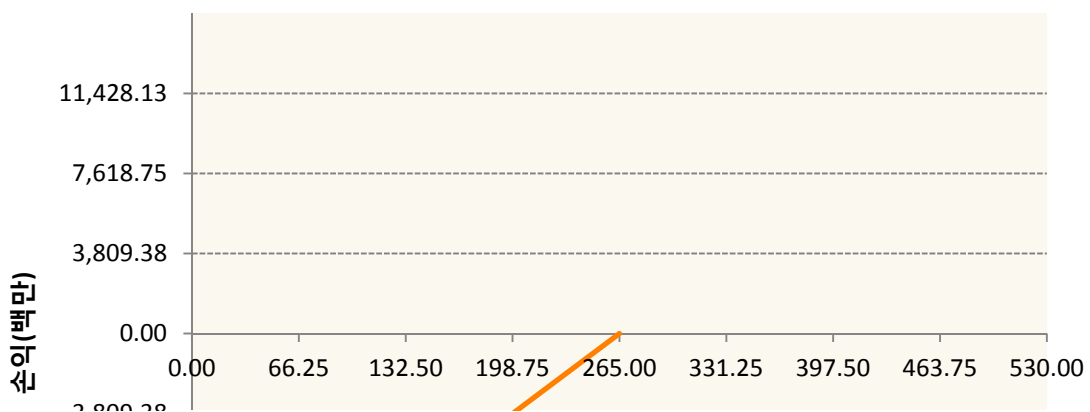


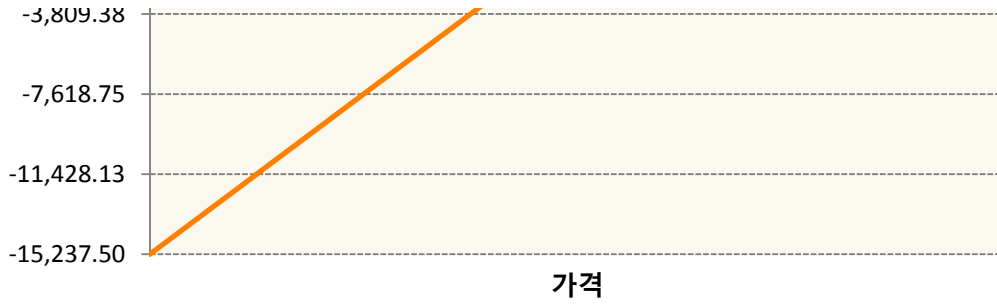


**KR4201P22671-2019-02 콜267.5**



**KR4301P22653-2019-02 풋265**





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

2.529E+11		UBCSFXC1 INDEX_14						2,652
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-2,652	-2,652	-2,652	-2,652	-2,652	-2,652	-2,652	
-5.33%	-1,768	-1,768	-1,768	-1,768	-1,768	-1,768	-1,768	
-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%	1,768	1,768	1,768	1,768	1,768	1,768	1,768	
8.00%	2,652	2,652	2,652	2,652	2,652	2,652	2,652	
KR4101P30007		2019-03 코스피200지수선물						109
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-109	-109	-109	-109	-109	-109	-109	
-5.33%	-73	-73	-73	-73	-73	-73	-73	
-2.67%	-36	-36	-36	-36	-36	-36	-36	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	36	36	36	36	36	36	36	
5.33%	73	73	73	73	73	73	73	
8.00%	109	109	109	109	109	109	109	
KR4201P22655		2019-02 콜265						780
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	446	431	414	396	376	356	336	
-5.33%	379	356	332	308	284	259	235	
-2.67%	257	230	203	177	150	124	97	
0%	74	50	25	0	-25	-51	-77	
2.67%	-160	-178	-198	-218	-240	-262	-285	
5.33%	-431	-442	-454	-469	-485	-503	-521	
8.00%	-721	-726	-734	-743	-754	-766	-780	
KR4201P22671		2019-02 콜267.5						503
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	

-8.00%	264	255	245	235	223	211	198
-5.33%	228	214	200	185	170	154	138
-2.67%	160	143	125	108	90	72	55
0%	52	35	18	0	-18	-35	-53
2.67%	-93	-107	-121	-136	-152	-168	-184
5.33%	-266	-275	-285	-296	-309	-321	-335
8.00%	-455	-460	-466	-474	-483	-492	-503
KR4301P22653                      2019-02 풋265							799
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-752	-757	-763	-770	-778	-788	-799
-5.33%	-375	-389	-404	-420	-437	-454	-471
-2.67%	-94	-115	-136	-157	-178	-199	-220
0%	50	34	17	0	-18	-36	-55
2.67%	95	89	81	72	62	50	37
5.33%	104	103	100	97	93	87	80
8.00%	105	105	104	104	102	100	97

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

(단위:백만원)

**4,750**

공시일	2019-01-18
기준일	2019-01-17

## 유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

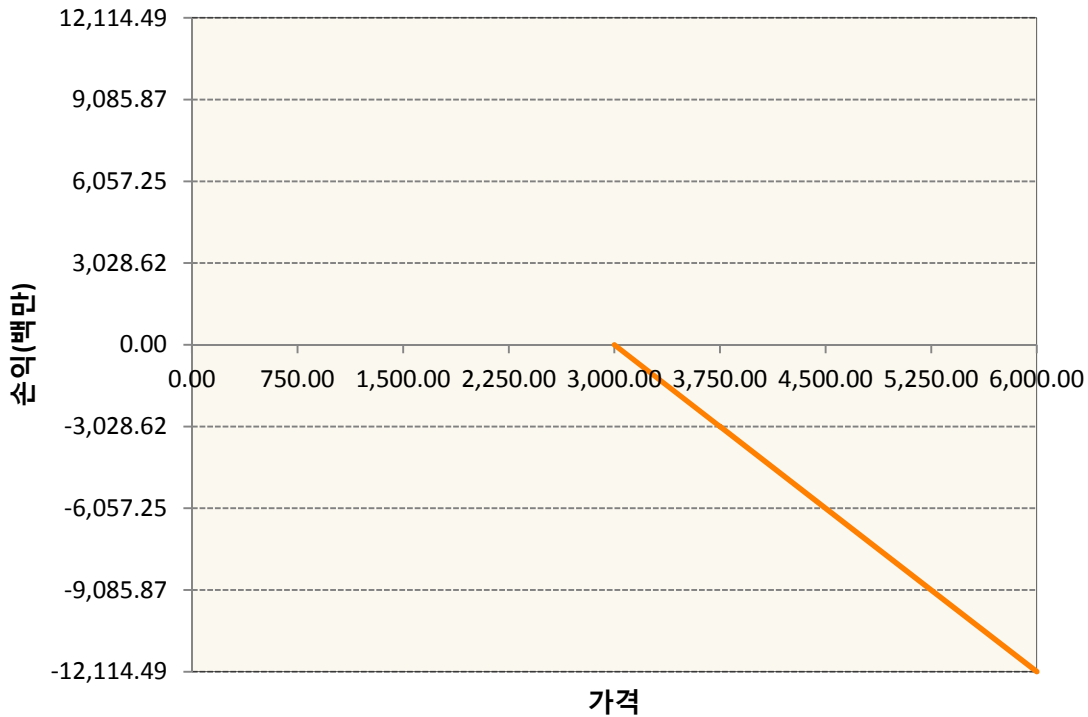
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

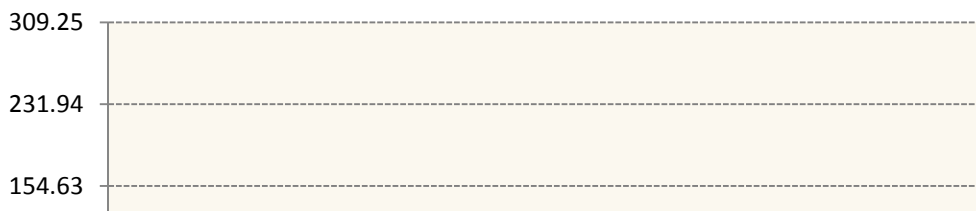
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	6,630	0	6,630	
누계	유가증권	스왑	71,372	0	71,372	장외
누계	유가증권	옵션	0	24,847	-24,847	장내
누계	통화	선도	0	15,334	-15,334	장외

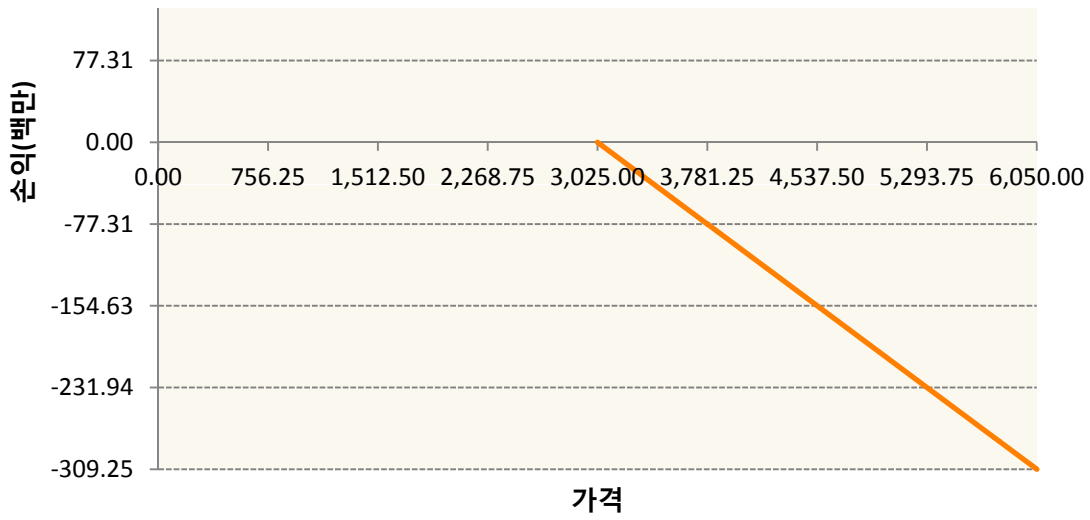
### 2. 만기시점의 손익구조

OESXF9-C3000-EURO STOXX 50

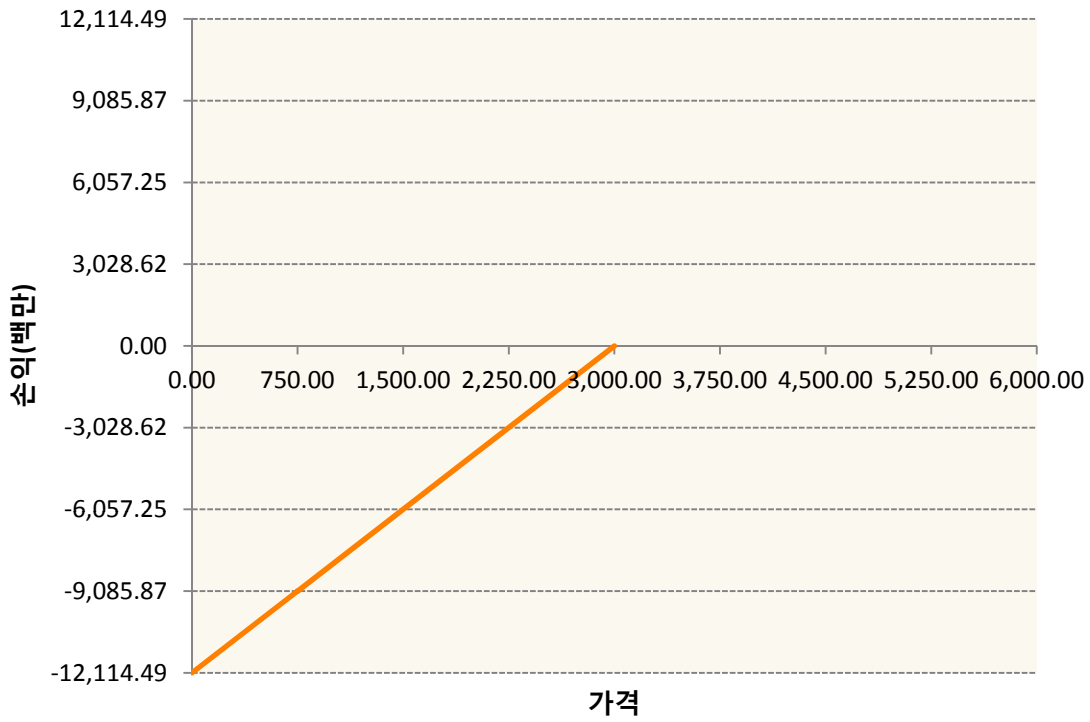


OESXF9-C3025-EURO STOXX 50

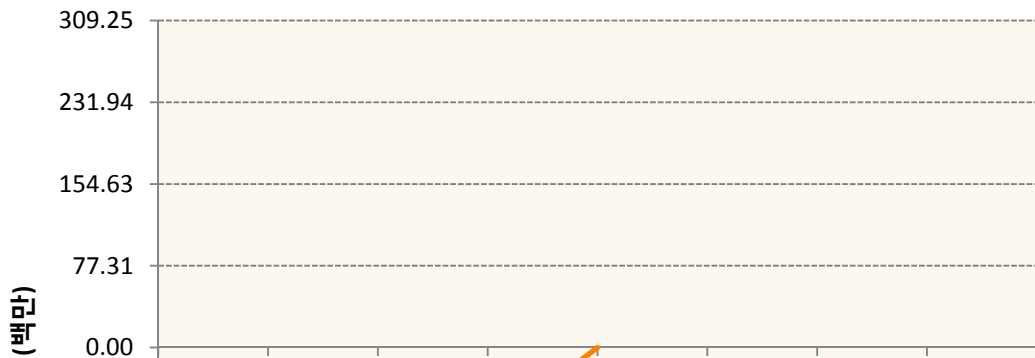


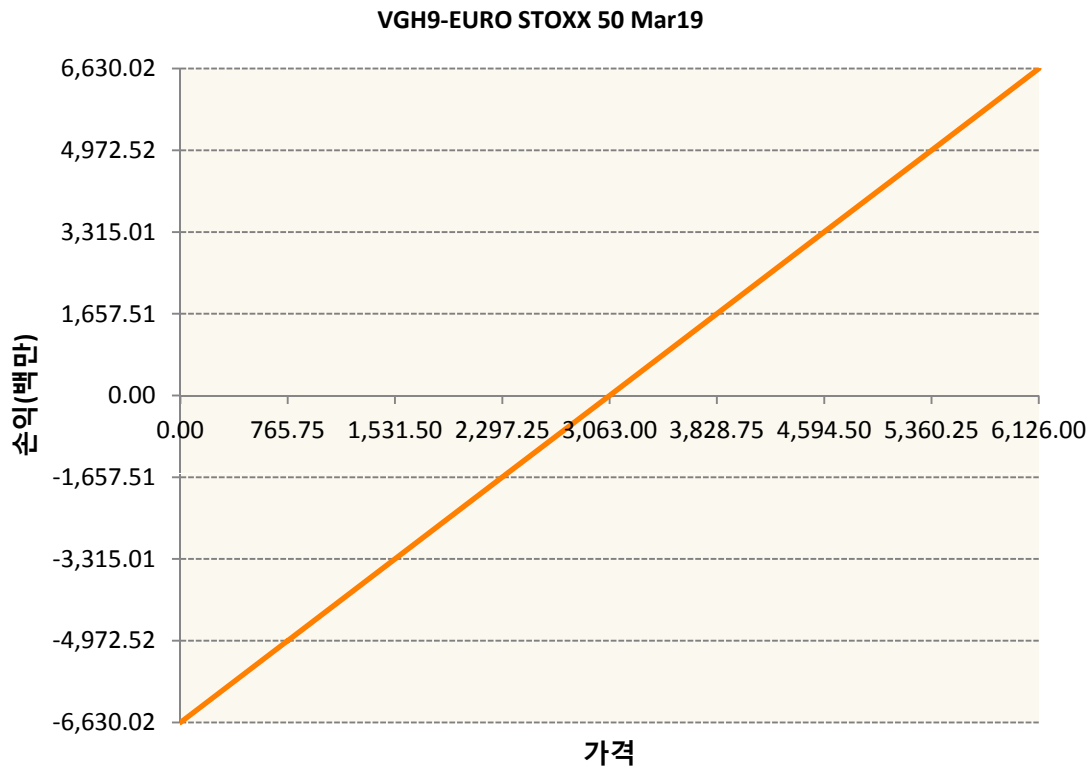
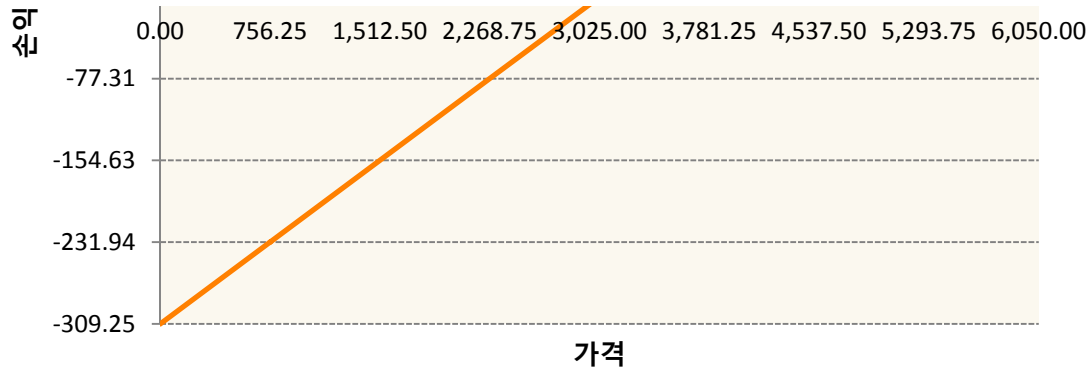


OESXF9-P3000-EURO STOXX 50



OESXF9-P3025-EURO STOXX 50





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

(단위:백만원)

2,477



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

(단위:백만원)

1,123



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

(단위:백만원)

96



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

(단위:백만원)

143



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

(단위:백만원)

43

공시일	2019-01-18
기준일	2019-01-17

## 리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

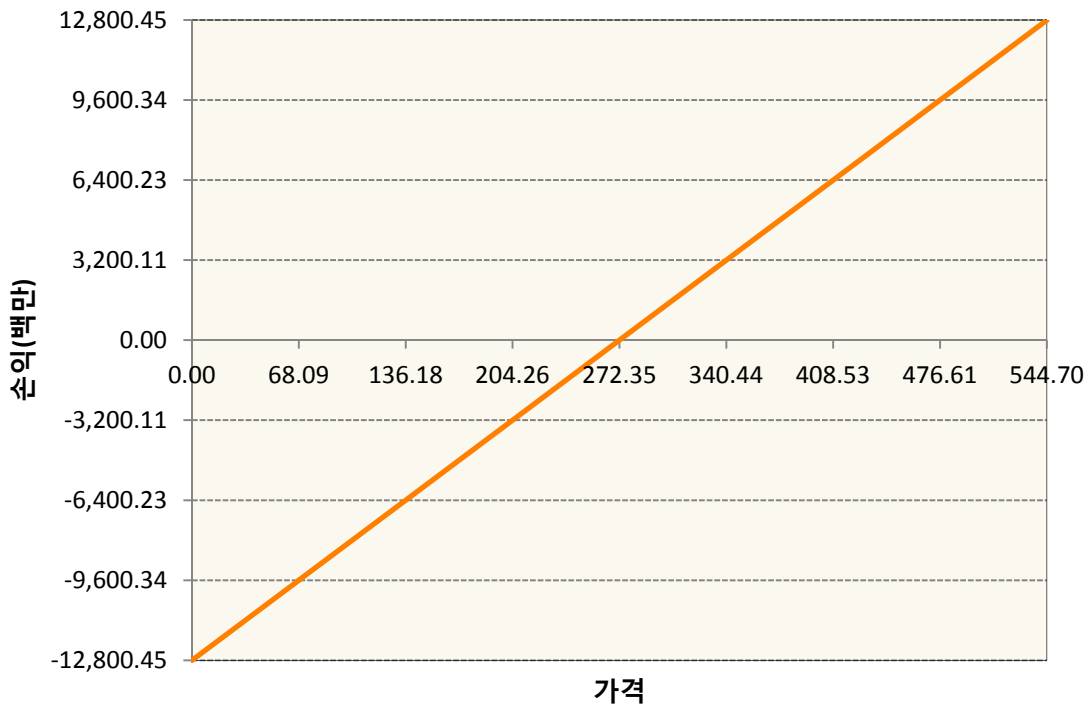
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

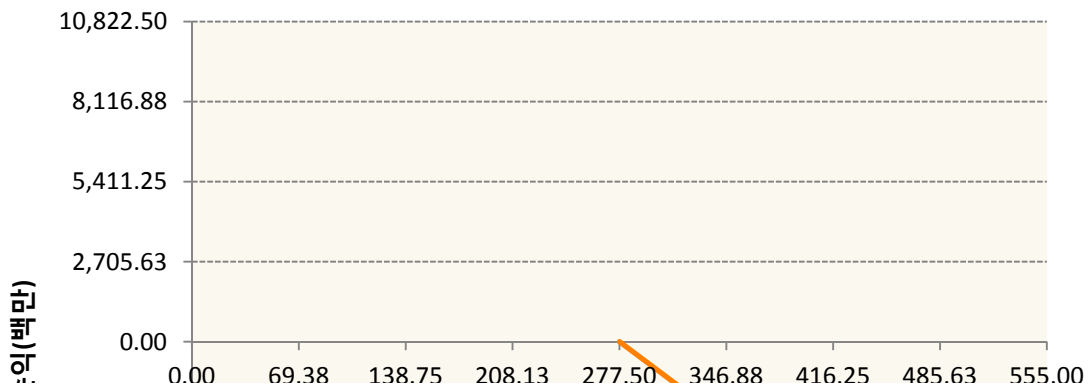
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	12,800	0	12,800	장내
누계	유가증권	옵션	2,523	23,213	-20,690	장내

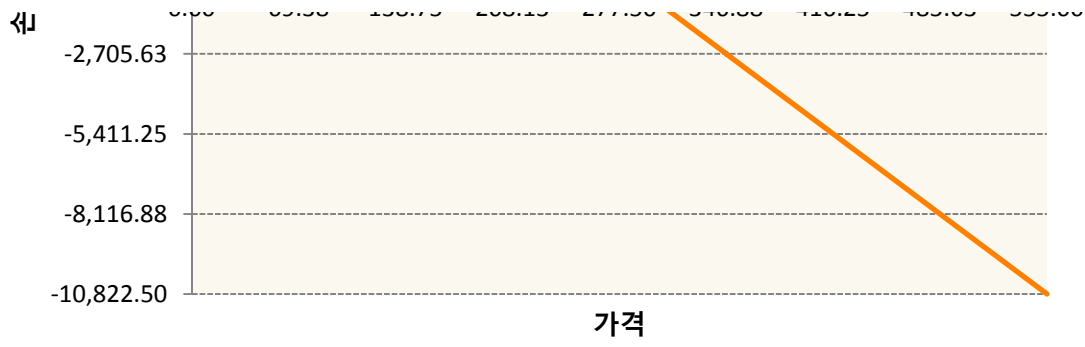
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101P30007-2019-03 코스피200지수선물

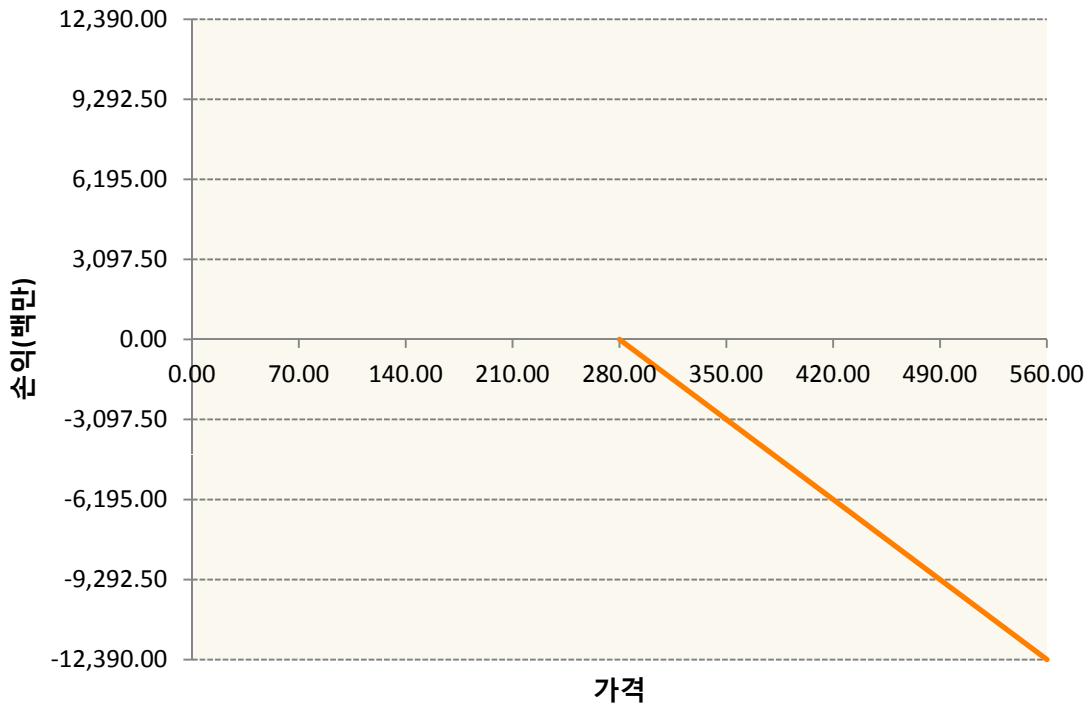


KR4201P22770-2019-02 콜277.5

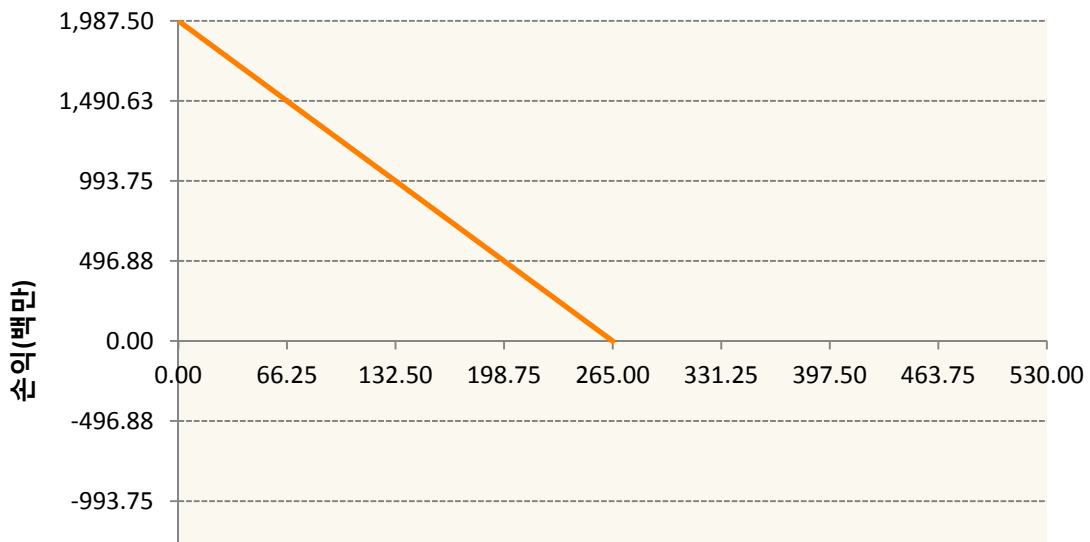


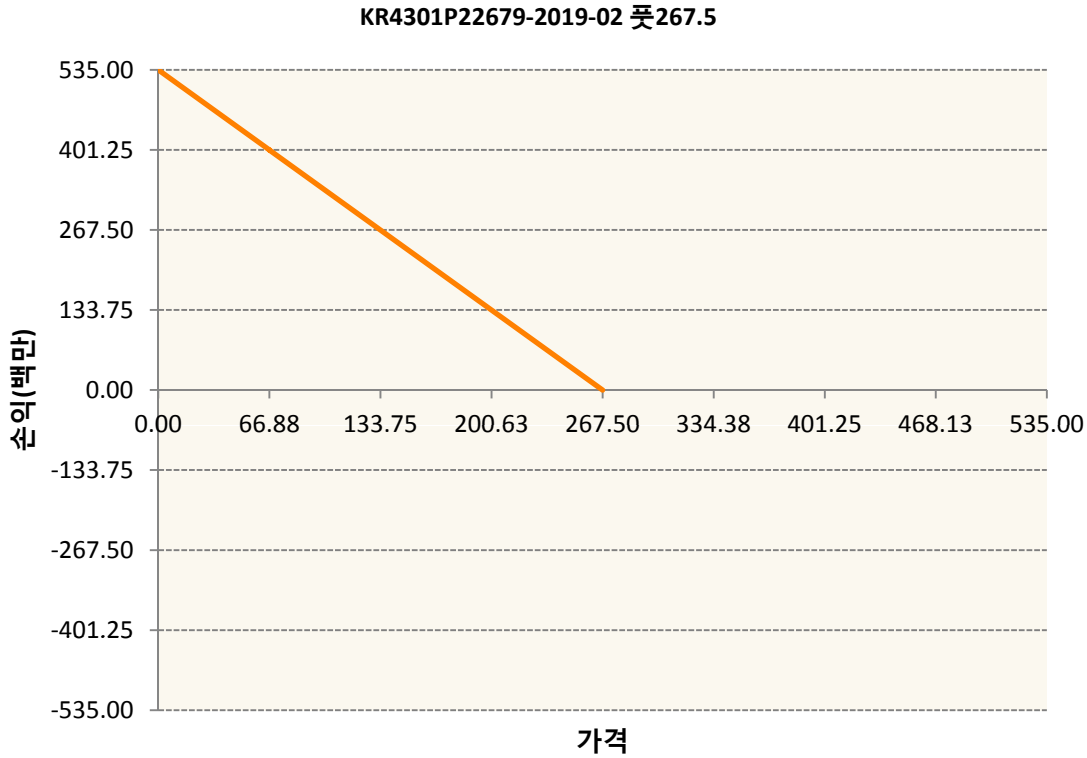
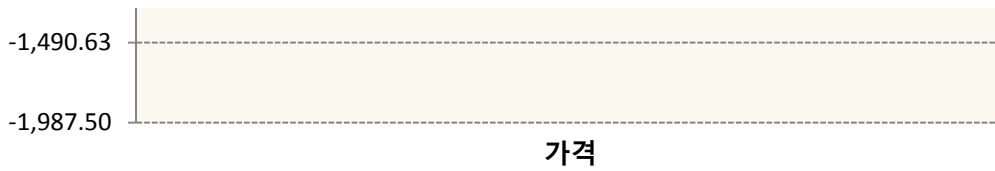


KR4201P22804-2019-02 콜280



KR4301P22653-2019-02 풋265





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

KR4101P30007		2019-03 코스피200지수선물						1,022
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-1,022	-1,022	-1,022	-1,022	-1,022	-1,022	-1,022	
-5.33%	-682	-682	-682	-682	-682	-682	-682	
-2.67%	-341	-341	-341	-341	-341	-341	-341	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	341	341	341	341	341	341	341	
5.33%	682	682	682	682	682	682	682	
8.00%	1,022	1,022	1,022	1,022	1,022	1,022	1,022	
KR4201P22770		2019-02 콜277.5						580
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	205	200	194	186	177	166	154	
-5.33%	190	179	167	153	138	122	105	
-2.67%	151	133	114	94	74	52	30	

0%	73	49	24	0	-25	-49	-74
2.67%	-57	-83	-108	-134	-160	-186	-212
5.33%	-239	-262	-285	-308	-332	-357	-381
8.00%	-465	-481	-499	-518	-538	-559	-580
KR4201P22804                      2019-02 콜280							619
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	196	192	186	179	170	159	147
-5.33%	184	174	163	149	134	117	100
-2.67%	150	133	113	93	71	49	25
0%	78	53	27	0	-27	-54	-82
2.67%	-48	-78	-107	-137	-166	-196	-225
5.33%	-235	-262	-290	-319	-347	-376	-405
8.00%	-475	-496	-519	-543	-568	-593	-619
KR4301P22653                      2019-02 풋265							104
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	98	99	99	100	102	103	104
-5.33%	49	51	53	55	57	59	61
-2.67%	12	15	18	21	23	26	29
0%	-6	-4	-2	0	2	5	7
2.67%	-12	-12	-11	-9	-8	-7	-5
5.33%	-14	-13	-13	-13	-12	-11	-10
8.00%	-14	-14	-14	-14	-13	-13	-13
KR4301P22679                      2019-02 풋267.5							31
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	29	30	30	30	30	30	31
-5.33%	16	16	17	17	18	18	19
-2.67%	5	5	6	7	7	8	9
0%	-2	-1	-1	0	1	1	2
2.67%	-5	-4	-4	-3	-3	-2	-2
5.33%	-5	-5	-5	-5	-5	-4	-4
8.00%	-5	-5	-5	-5	-5	-5	-5

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

(단위:백만원)

**2,025**

공시일	2019-01-18
기준일	2019-01-17

## 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	618	0	618	

### 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	2019-01-18
기준일	2019-01-17

## 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	2,611	0	2,611	

### 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	2019-01-18
기준일	2019-01-17

## 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	3,473	0	3,473	
누계	통화	선도	180	4,075	-3,895	장외

### 2. 만기시점의 손익구조

### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음	
FX21018X04 KRW/USD 28-02-19E		2
FX21018X04 KRW/USD 28-02-19E		3
FX21018X04 KRW/USD 28-02-19E		1
FX21018Z00 KRW/USD 28-02-19E		17
FX21018Z01 KRW/USD 28-02-19E		2
FX21018Z01 KRW/USD 28-02-19E		28
FX21018Z01 KRW/USD 28-02-19E		9
FX21018Z02 KRW/USD 28-02-19E		40
FX21018Z02 KRW/USD 19-02-19E		2
FX21018Z02 KRW/USD 19-02-19E		5
FX21018Z03 KRW/USD 19-02-19E		21
FX21018Z03 KRW/USD 19-02-19E		31
FX21019F00 KRW/USD 19-02-19E		15
FX21019F00 KRW/USD 19-02-19E		8
FX21019F00 KRW/USD 19-02-19E		26
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
FX21019F01 KRW/USD 28-02-19E		14
FX21019F01 USD/KRW 22-01-19E		14

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

(단위:백만원)

129

공시일	2019-01-18
기준일	2019-01-17

## 스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

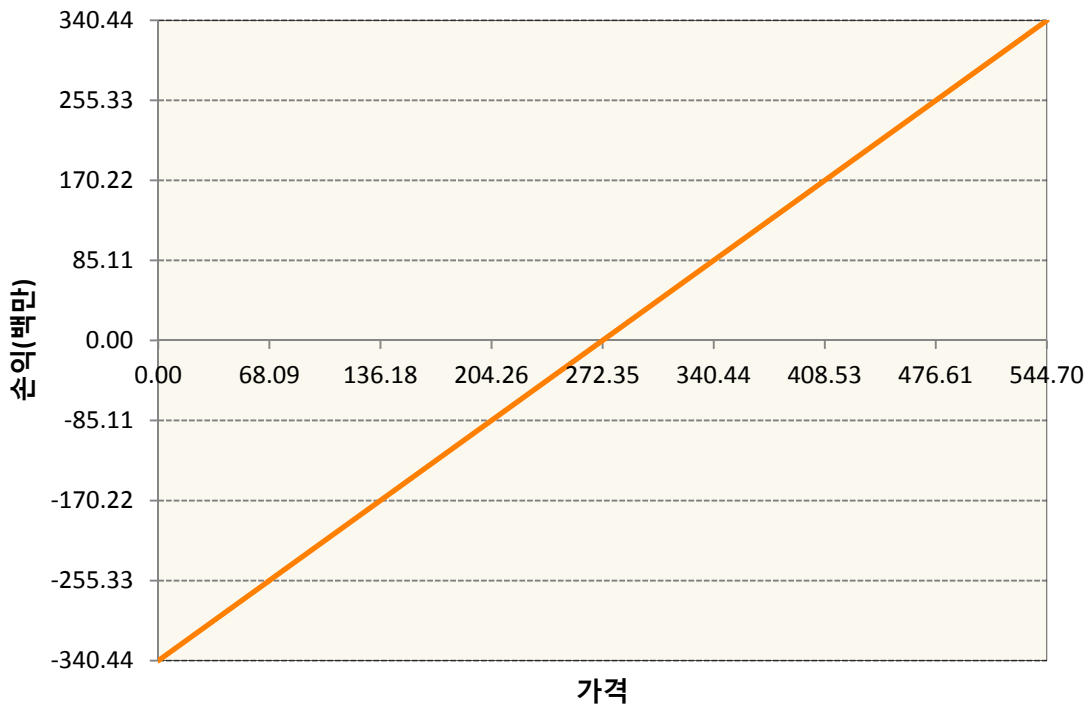
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

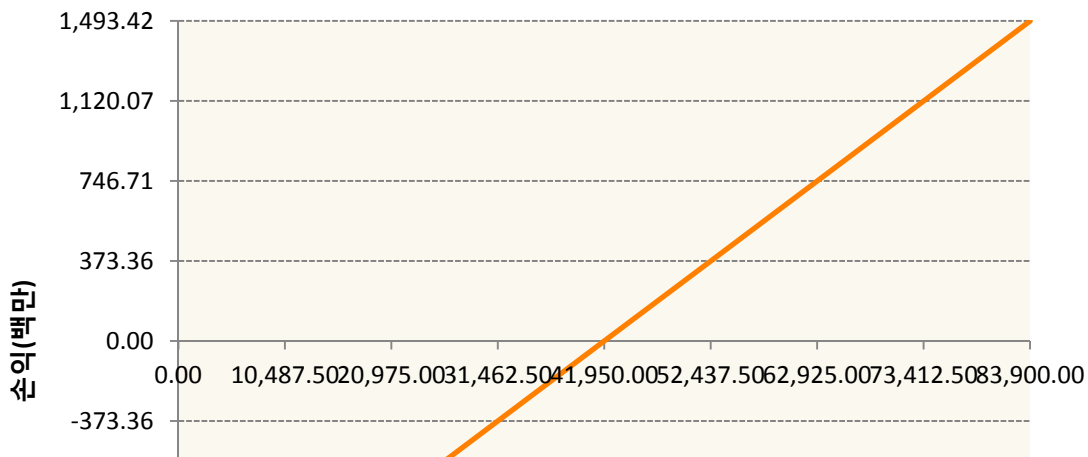
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,834	0	1,834	장내

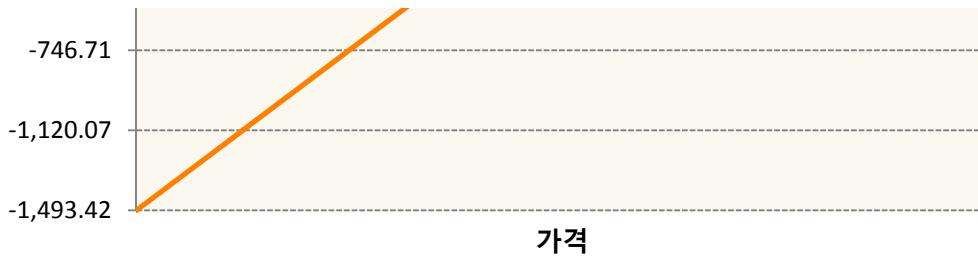
### 2. 만기시점의 손익구조

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						119
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-119	-119	-119	-119	-119	-119	-119	
-5.33%	-80	-80	-80	-80	-80	-80	-80	
-2.67%	-40	-40	-40	-40	-40	-40	-40	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	40	40	40	40	40	40	40	
5.33%	80	80	80	80	80	80	80	
8.00%	119	119	119	119	119	119	119	

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

**163**

공시일	2019-01-18
기준일	2019-01-17

## 에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

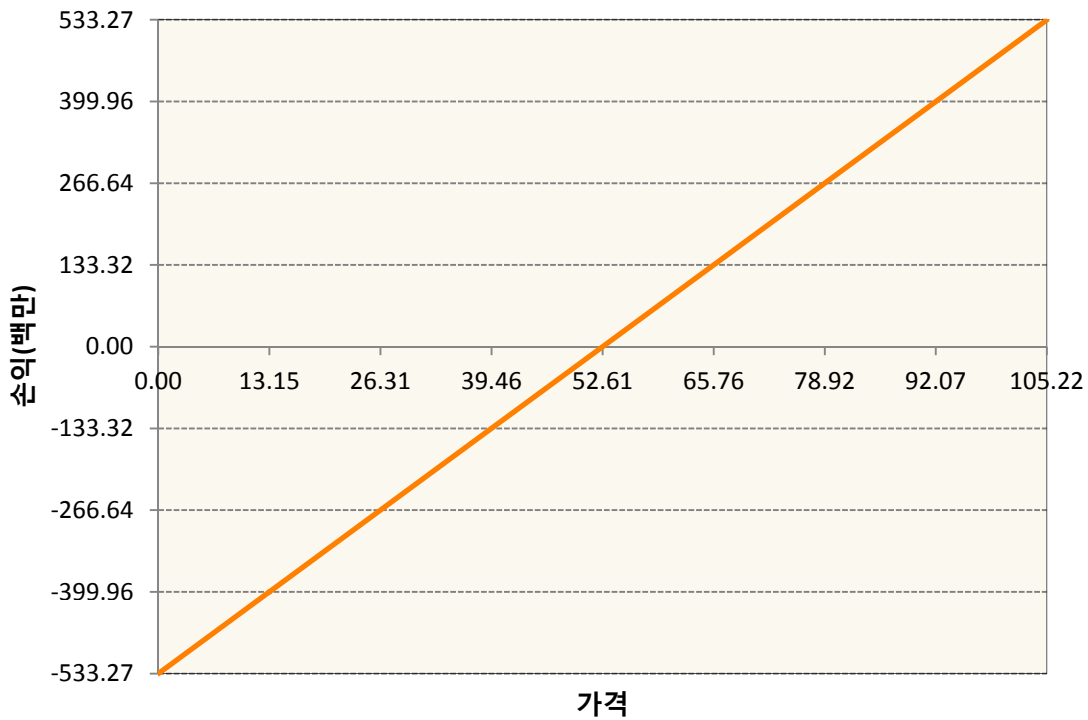
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

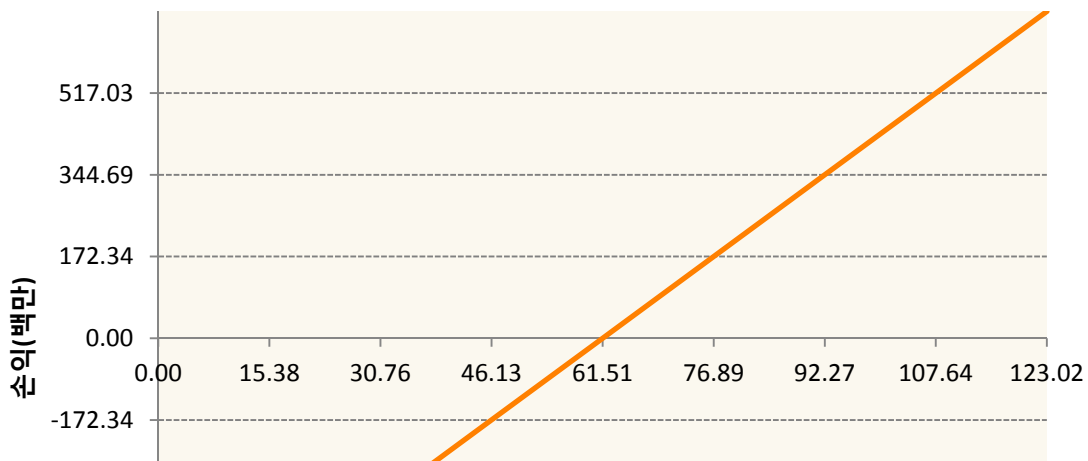
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,779	280	2,499	

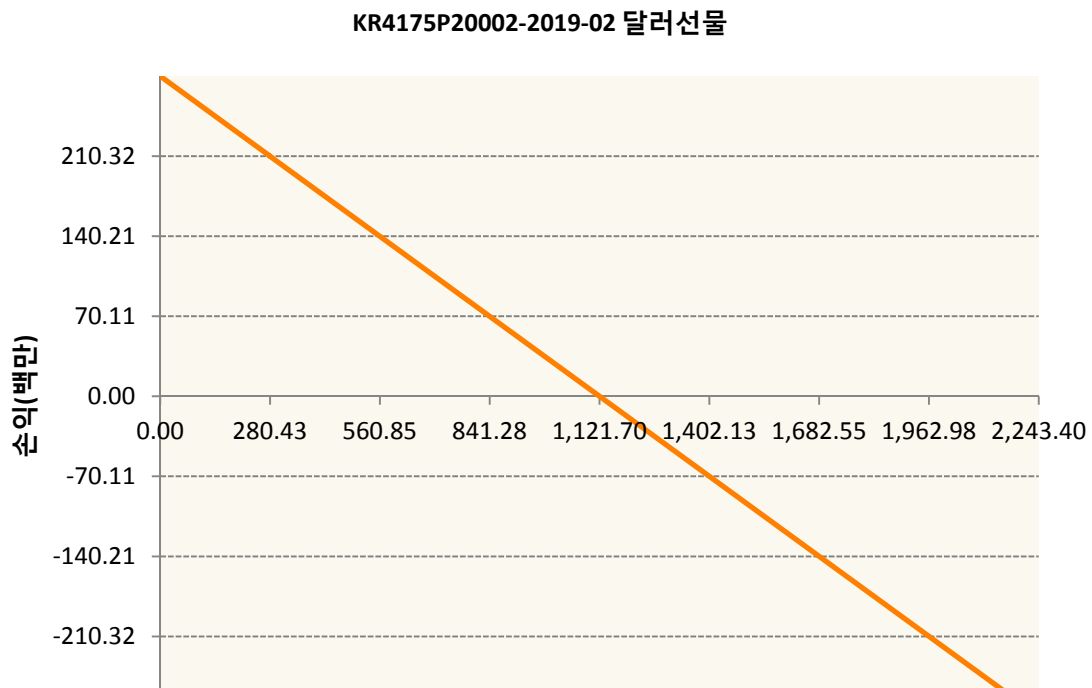
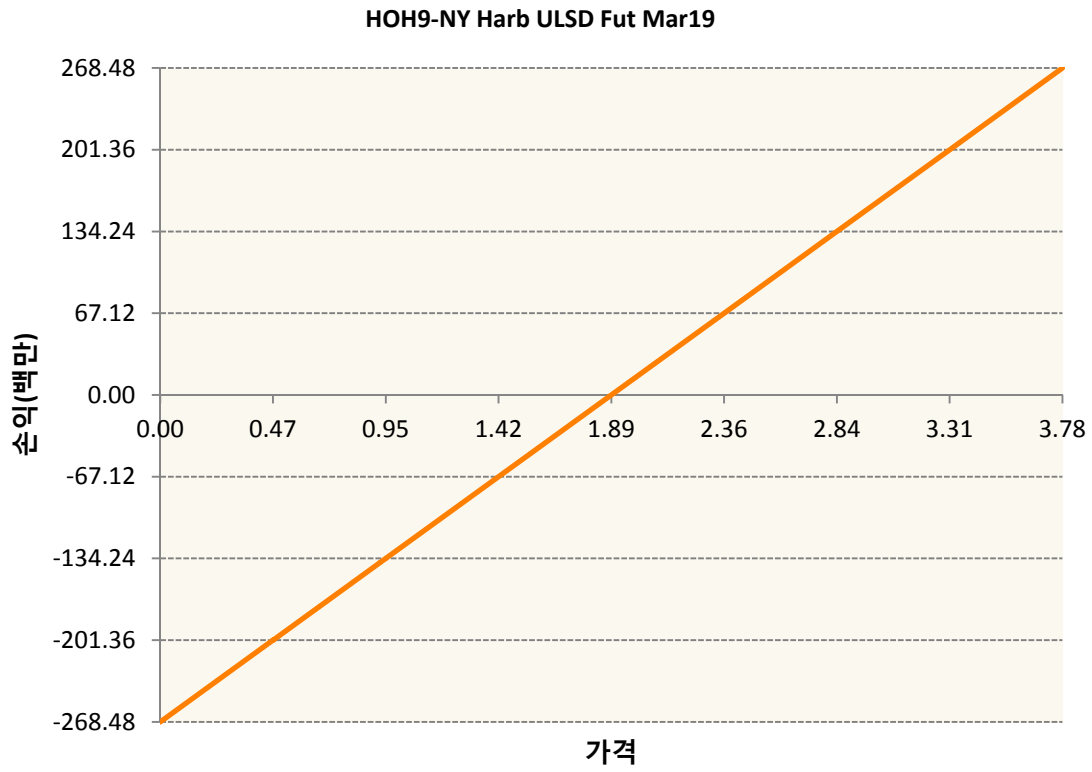
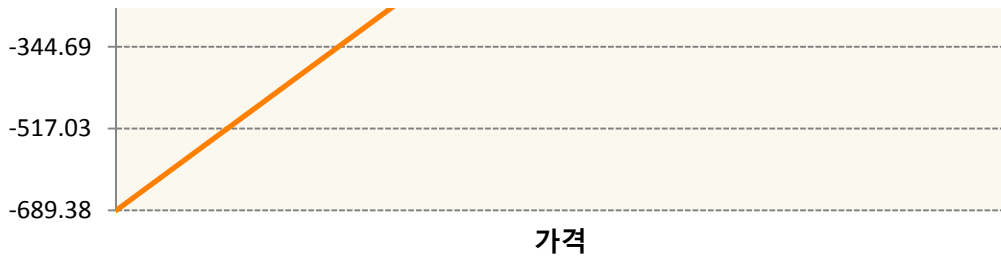
### 2. 만기시점의 손익구조

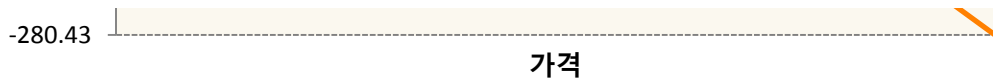
**CLH9-WTI CRUDE FUTURE MAR19**



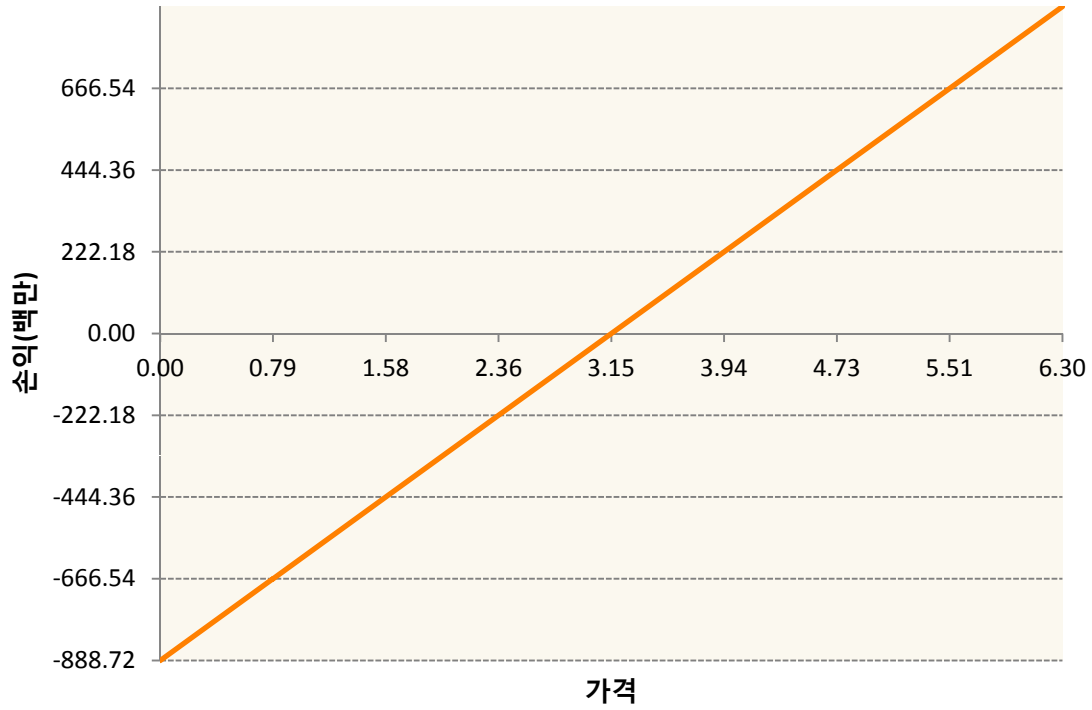
**COK9-BRENT CRUDE FUTR May19**



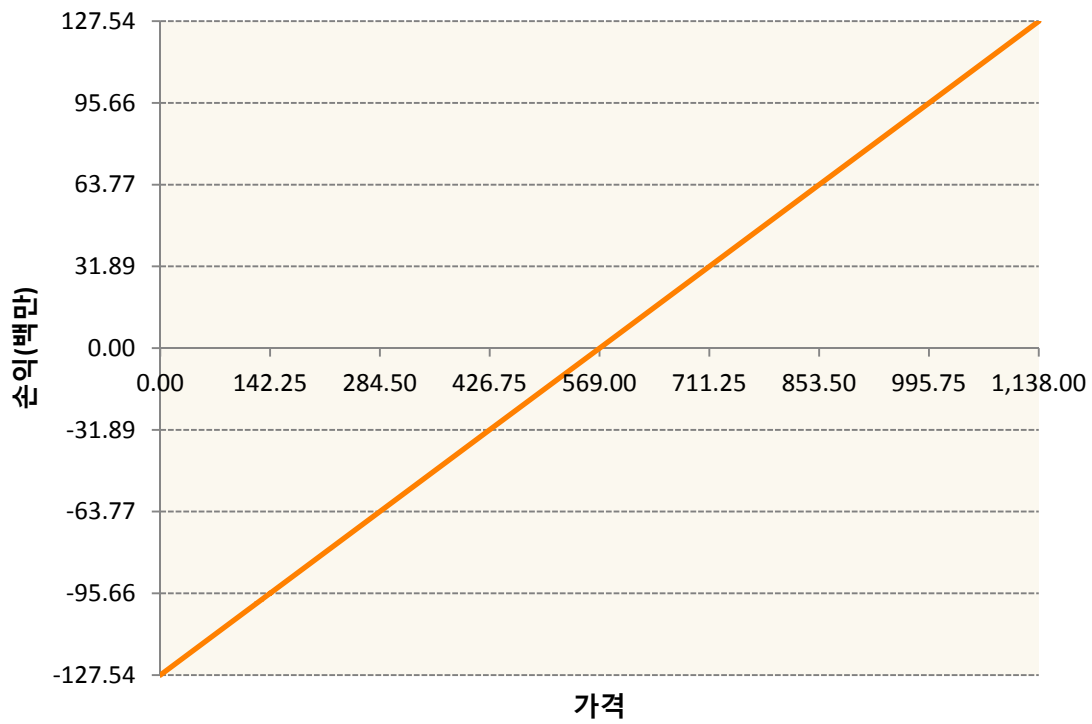




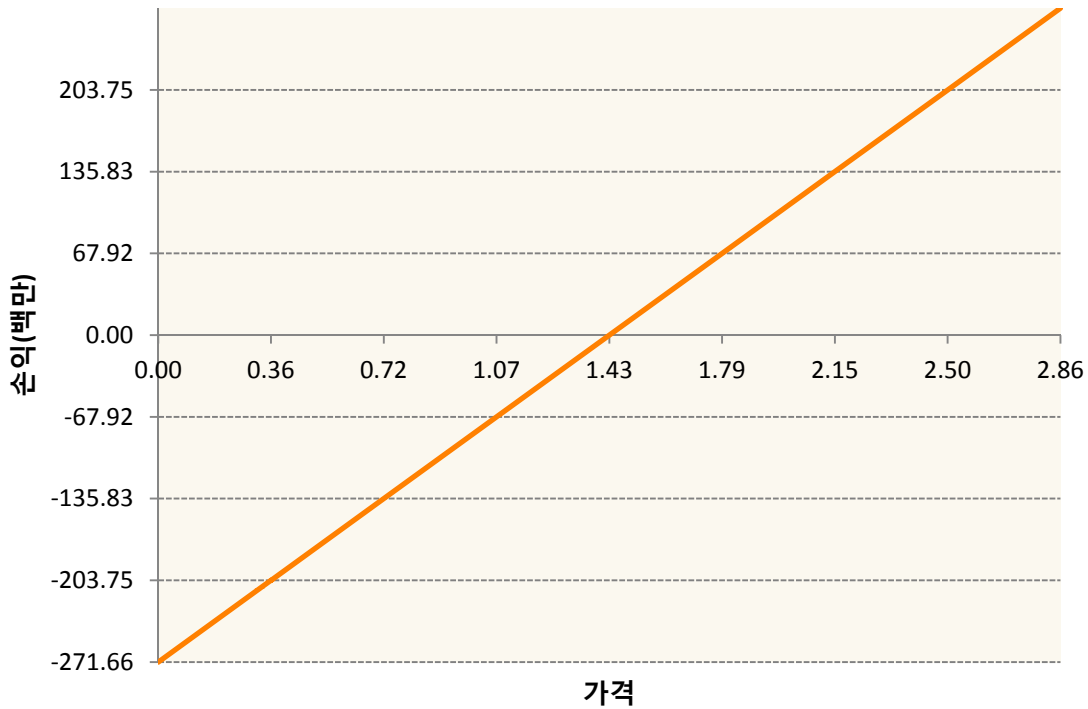
NGH19-NATURAL GAS FUTR Mar19



QSH9-Low Su Gasoil G May19



**XBH9-GASOLINE RBOB FUT Mar19**



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

CLH9	WTI CRUDE FUTURE MAR19	43
COK9	BRENT CRUDE FUTR May19	55
HOH9	NY Harb ULSD Fut Mar19	21
KR4175P200	2019-02 달러선물	22
NGH19	NATURAL GAS FUTR Mar19	71
QSH9	Low Su Gasoil G May19	10
XBH9	GASOLINE RBOB FUT Mar19	22

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

**434**

공시일	2019-01-18
기준일	2019-01-17

## 애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

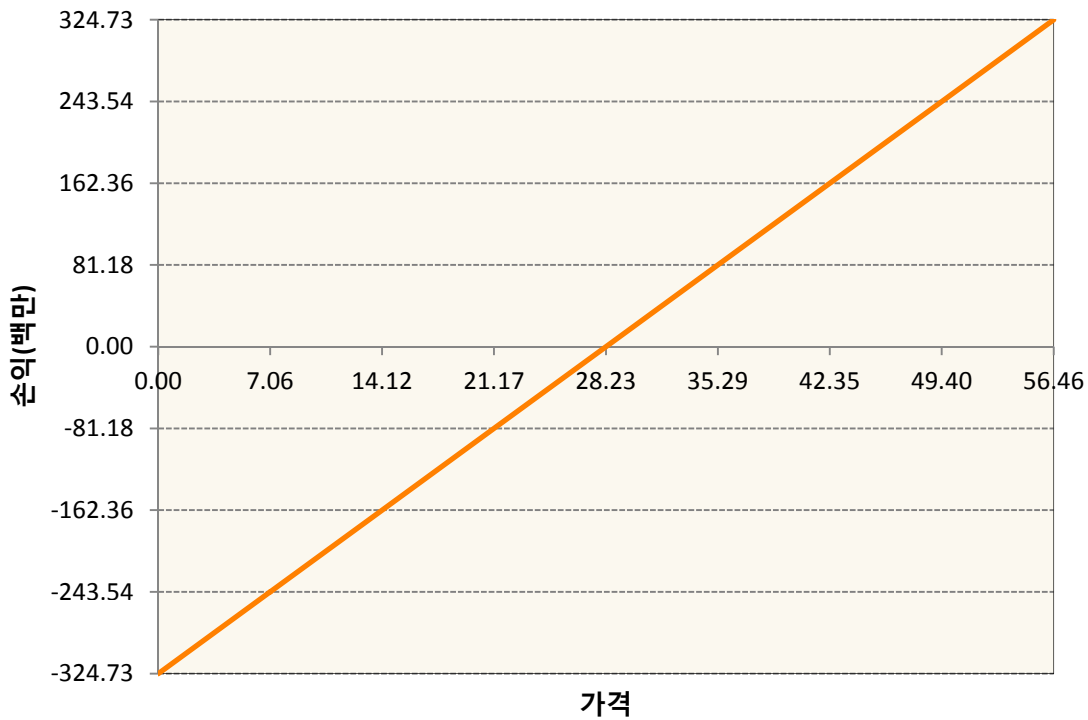
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

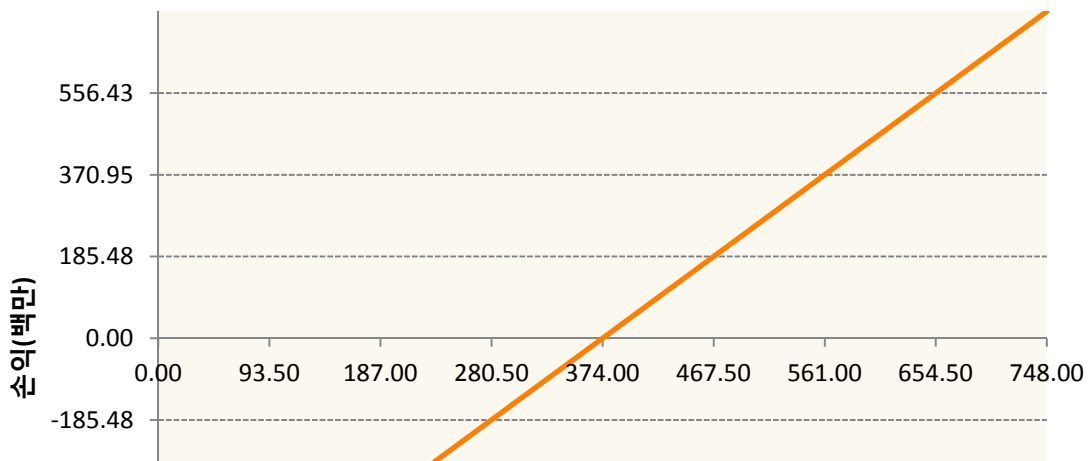
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,542	79	3,463	

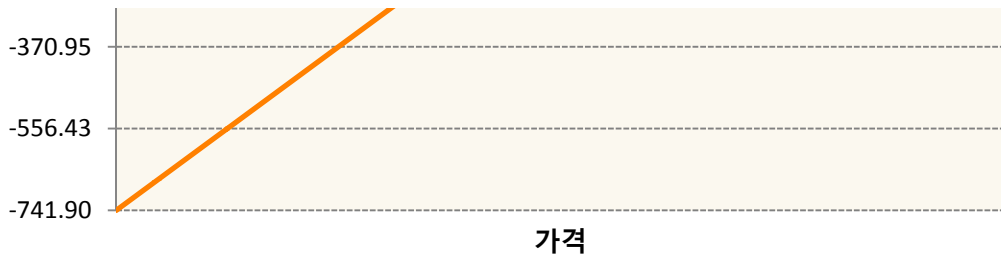
### 2. 만기시점의 손익구조

**BOH9-SOYBEAN OIL FUTR Mar19**

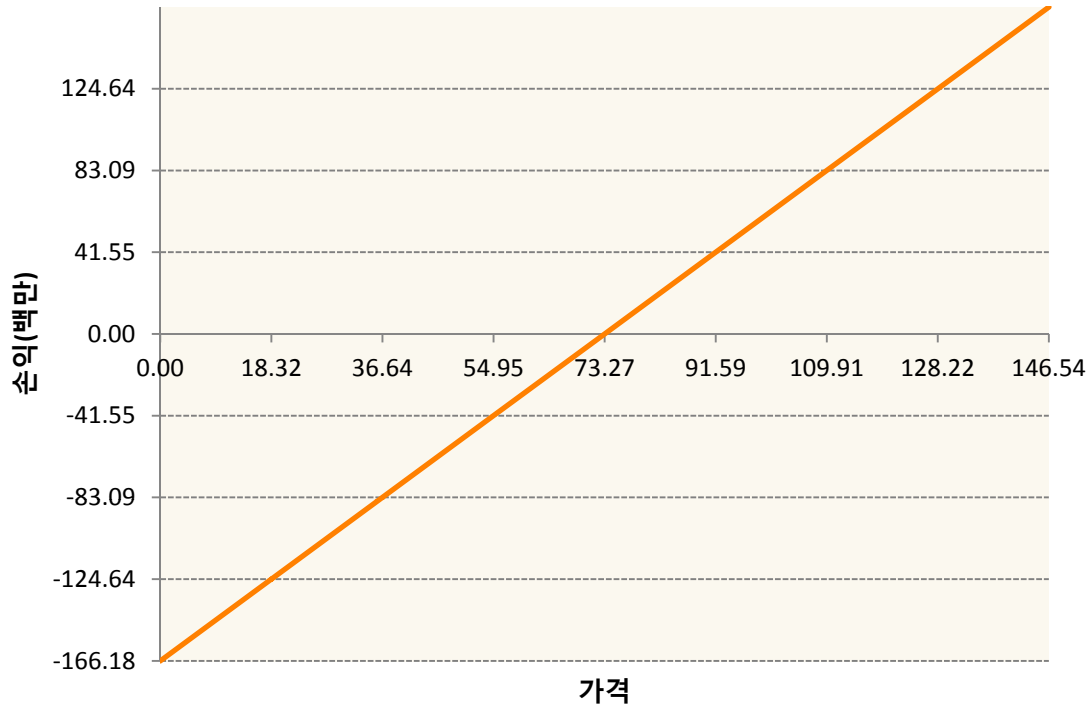


**CH9-CORN FUTURE Mar19**

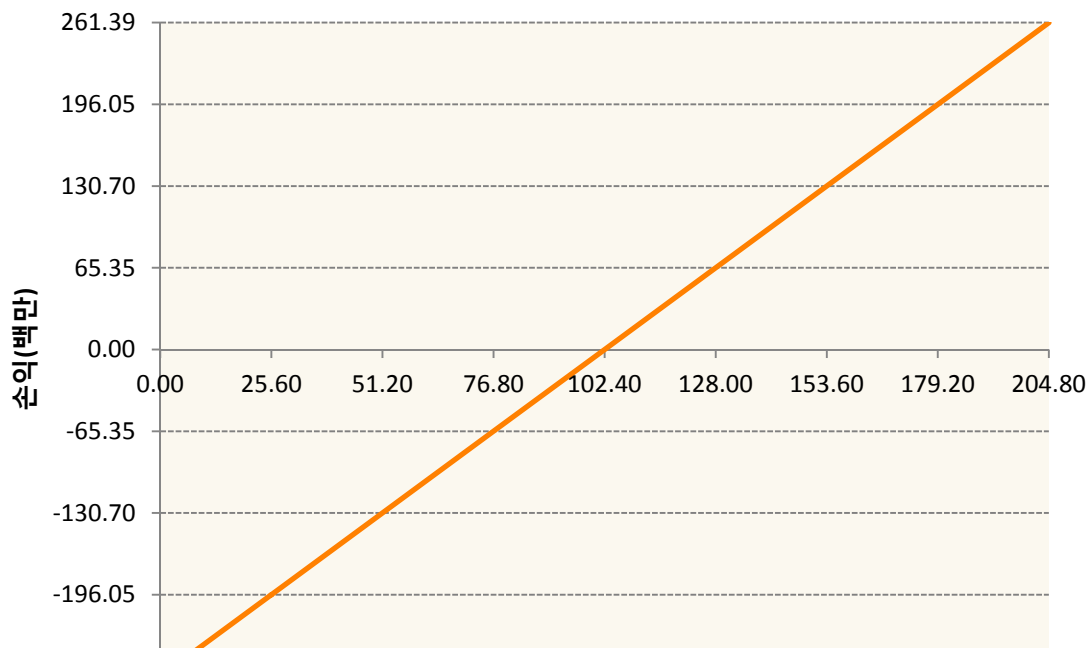


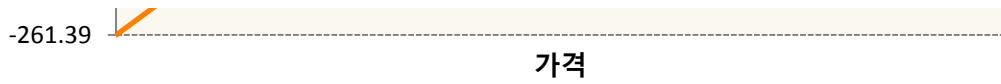


CTH9-COTTON NO.2 FUTR Mar19

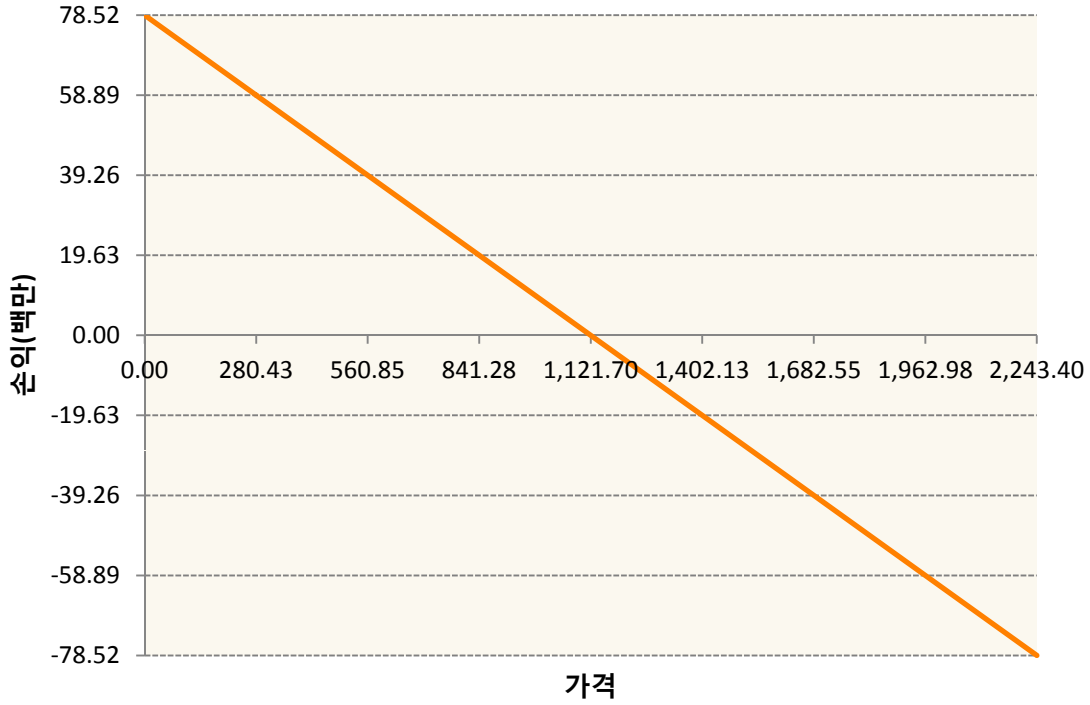


KCH9-COFFEE 'C' FUTURE Mar19

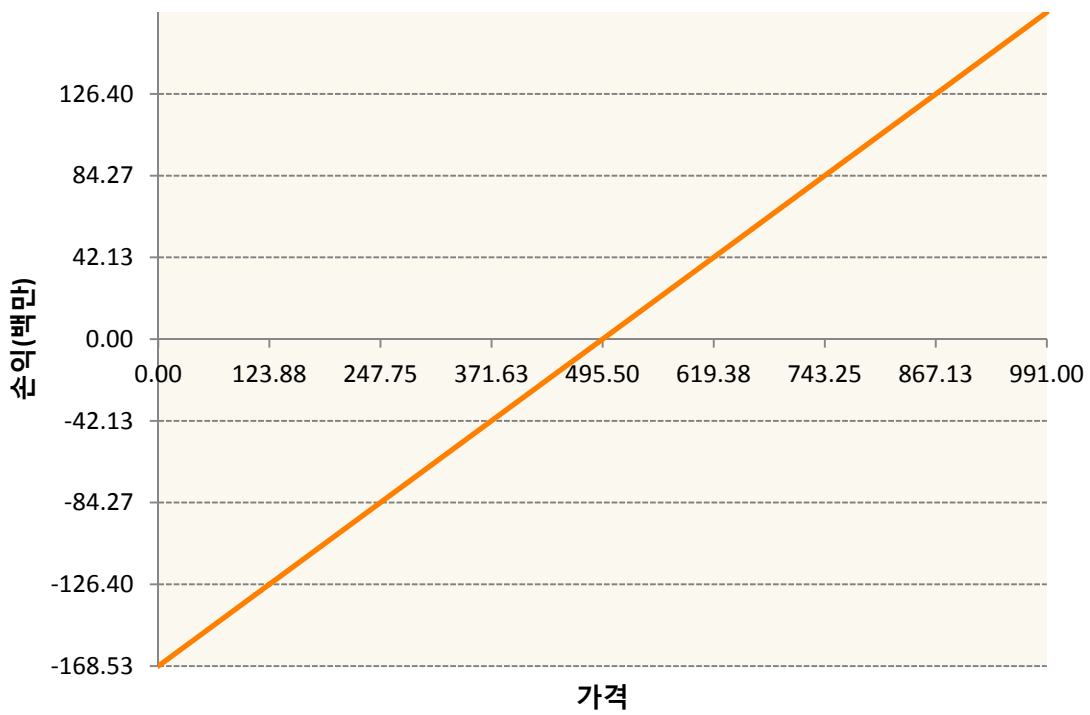




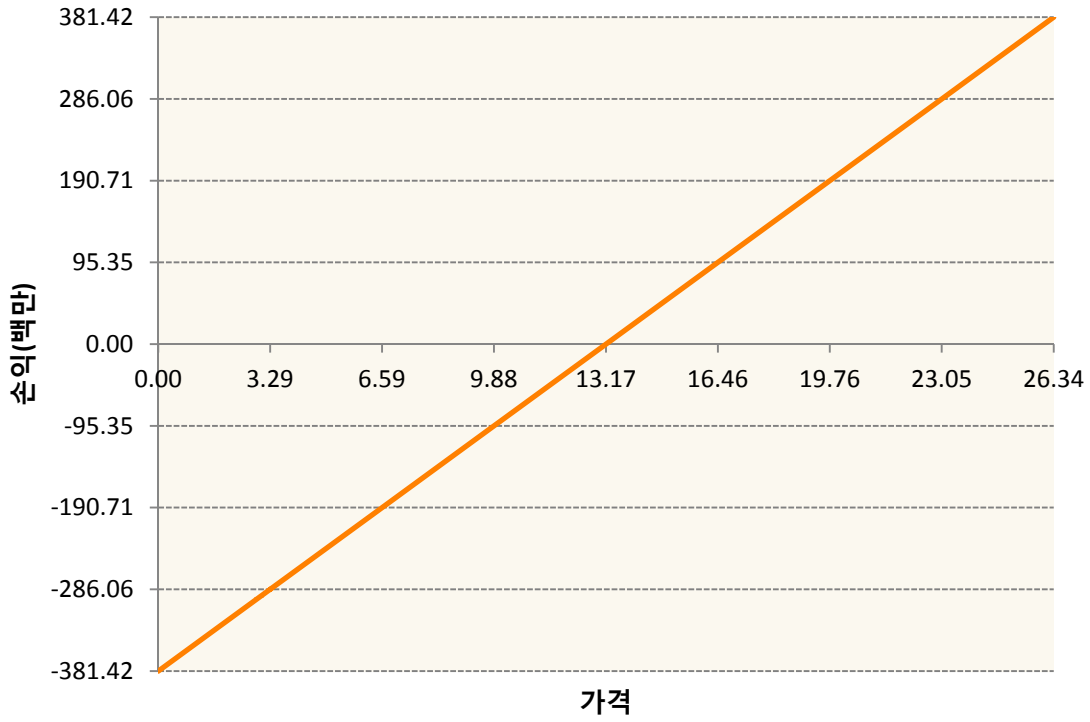
KR4175P20002-2019-02 달러선물



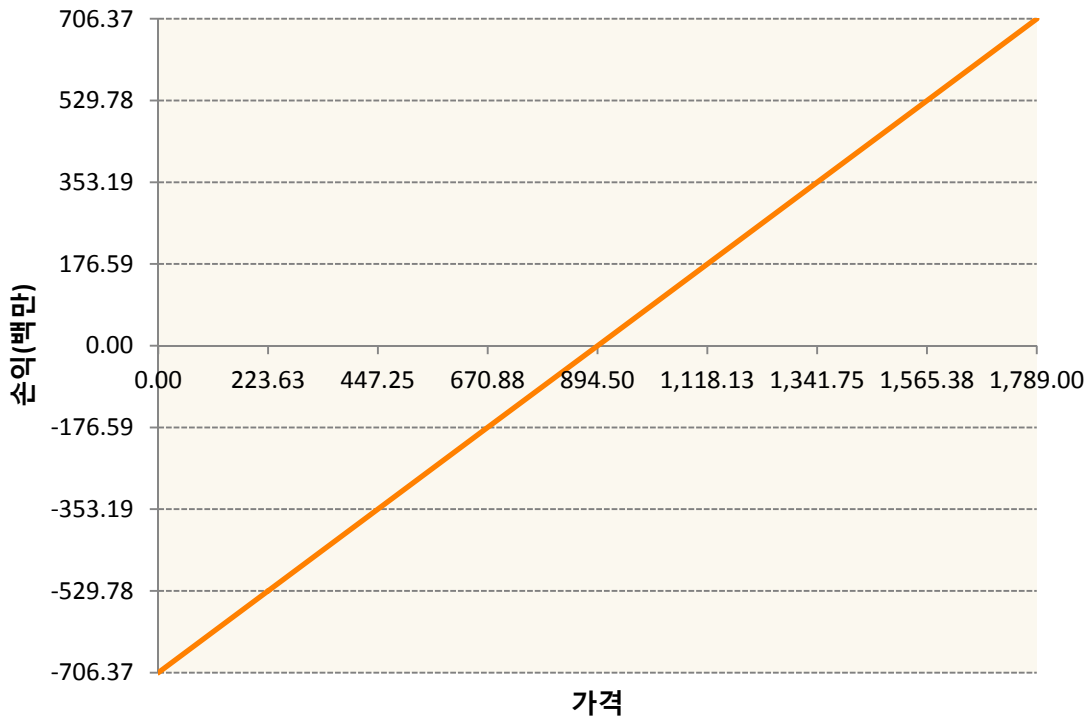
KWH9-KC HRW WHEAT FUT Mar19



SBH9-SUGAR #11 (WORLD) MAR19

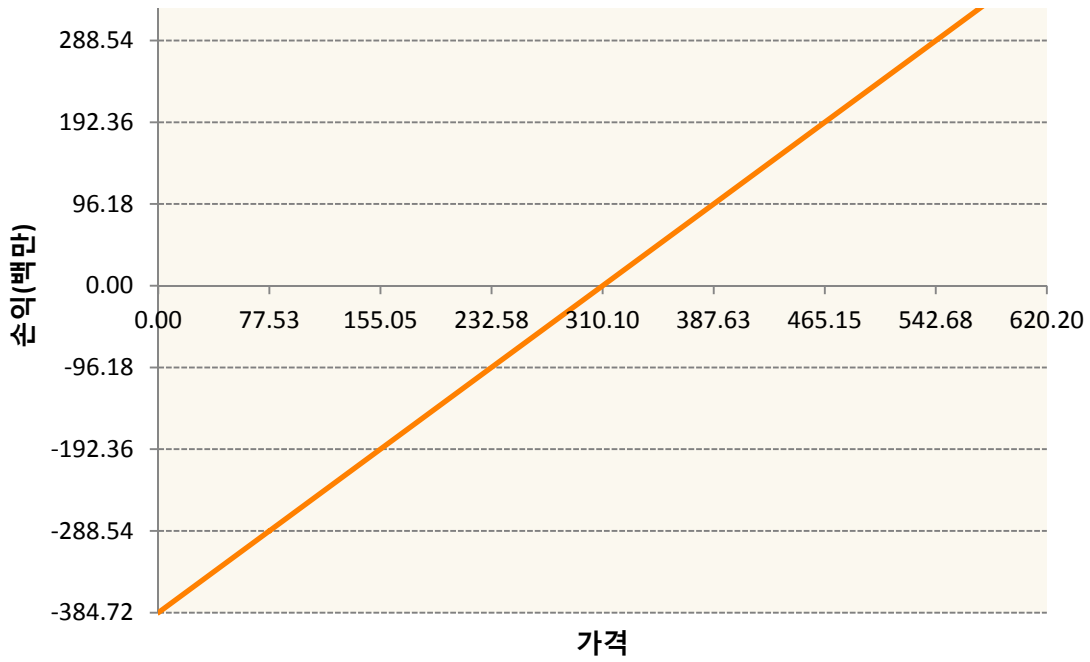


SH9-SOYBEAN FUTURE Mar19

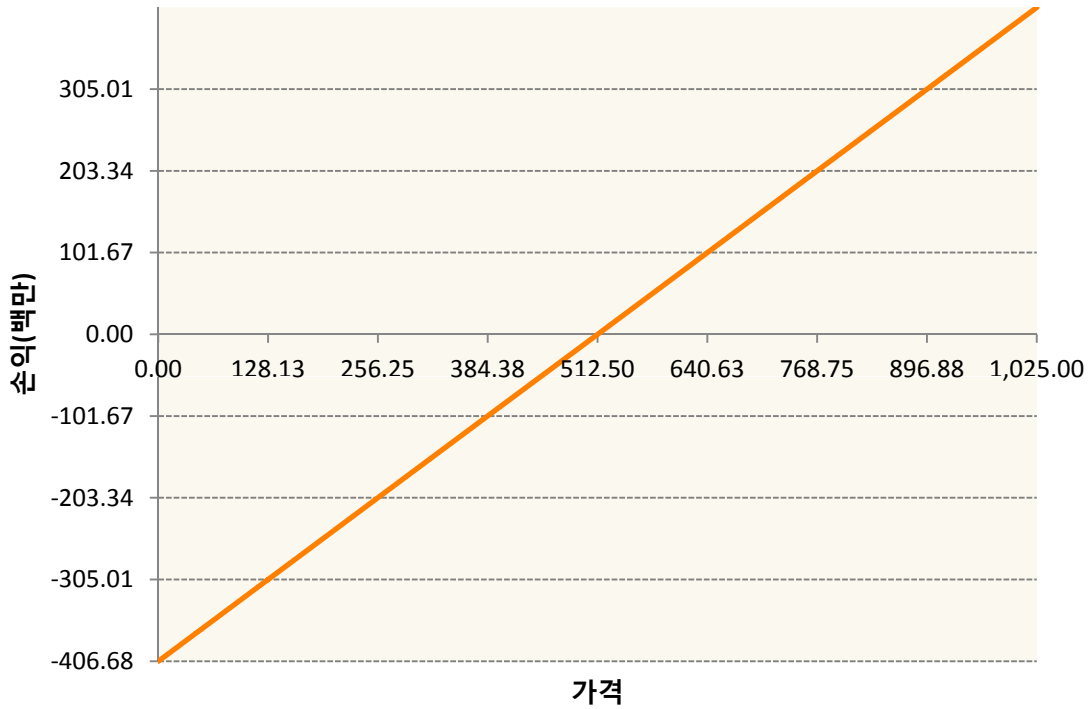


SMH9-SOYBEAN MEAL FUTR Mar19





WH9-WHEAT FUTURE(CBT) Mar19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

BOH9	SOYBEAN OIL FUTR Mar19	26
CH9	CORN FUTURE Mar19	59
CTH9	COTTON NO.2 FUTR Mar19	13
KCH9	COFFEE 'C' FUTURE Mar19	21
KR4175P200	2019-02 달러선물	6

KWH9	KC HRW WHEAT FUT Mar19	13
SBH9	SUGAR #11 (WORLD) MAR19	31
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)

**291**