

공시일	2019-01-22
기준일	2019-01-21

## 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	2019-01-22
기준일	2019-01-21

## 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

1,065

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

603

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-01-22
기준일	2019-01-21

## 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)

403

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-01-22
기준일	2019-01-21

## 유로인덱스모(주식-파생형)

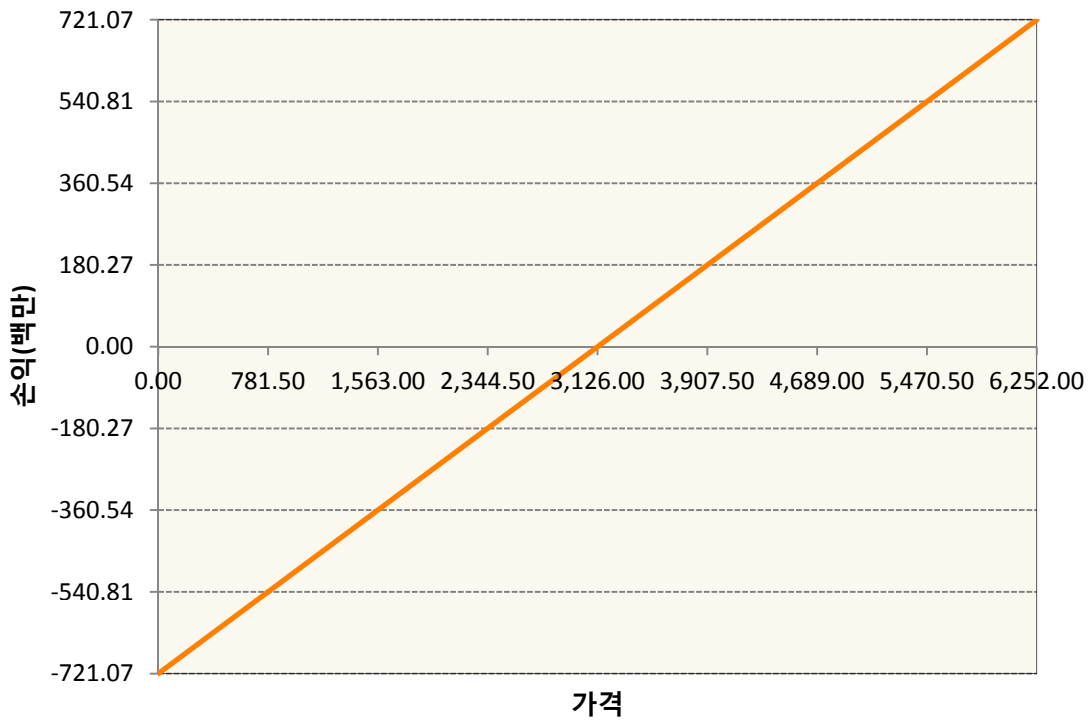
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	721	0	721	

### 2. 만기시점의 손익구조

VGH9-EURO STOXX 50 Mar19



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGH9	EURO STOXX 50 Mar19	58
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

40
----

공시일	2019-01-22
기준일	2019-01-21

## 차이나인덱스모(주식-파생형)

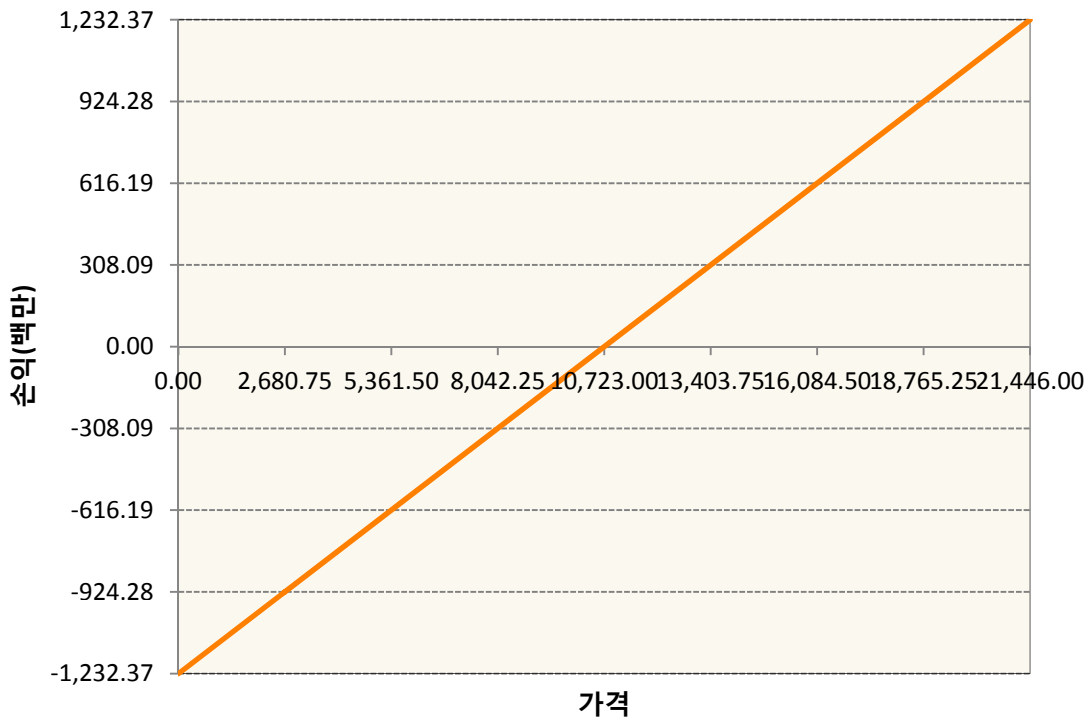
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

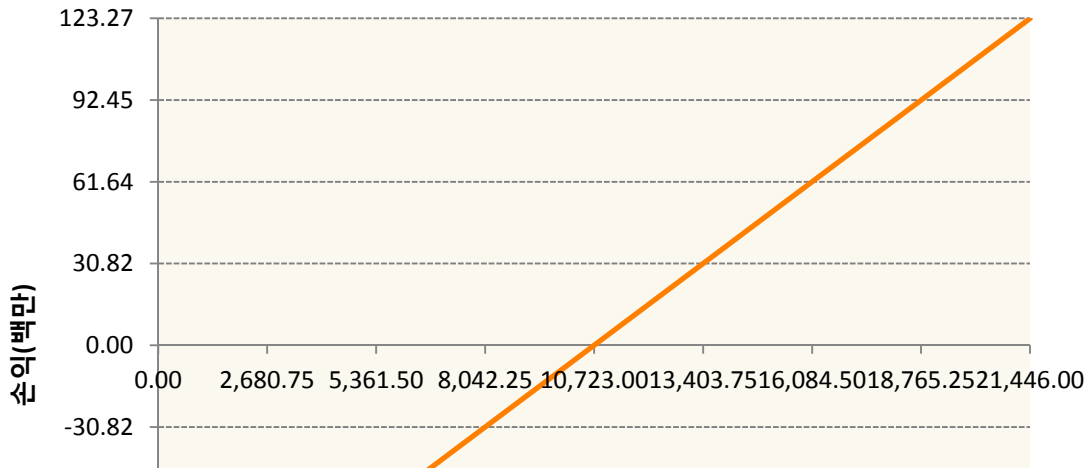
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,356	0	1,356	장내

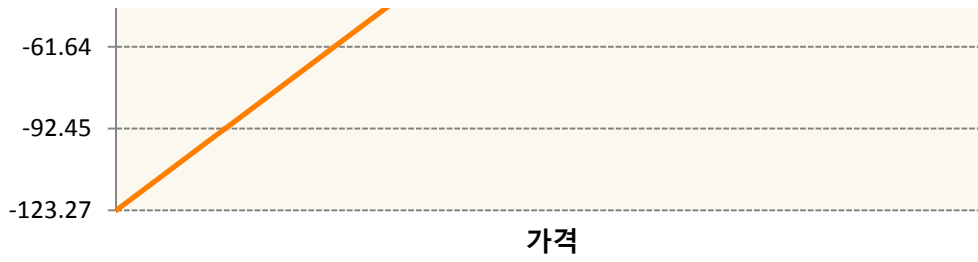
### 2. 만기시점의 손익구조

**HCF9-HSCEI FUTURES JAN19**



**MHCF9-MINI H-SHR IDX FU JAN19**





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

HCF9	HSCEI FUTURES JAN19	99
MHCF9	MINI H-SHR IDX FU JAN19	10

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

<b>111</b>
------------

공시일	2019-01-22
기준일	2019-01-21

## 커버드콜모(주식혼합-파생형)

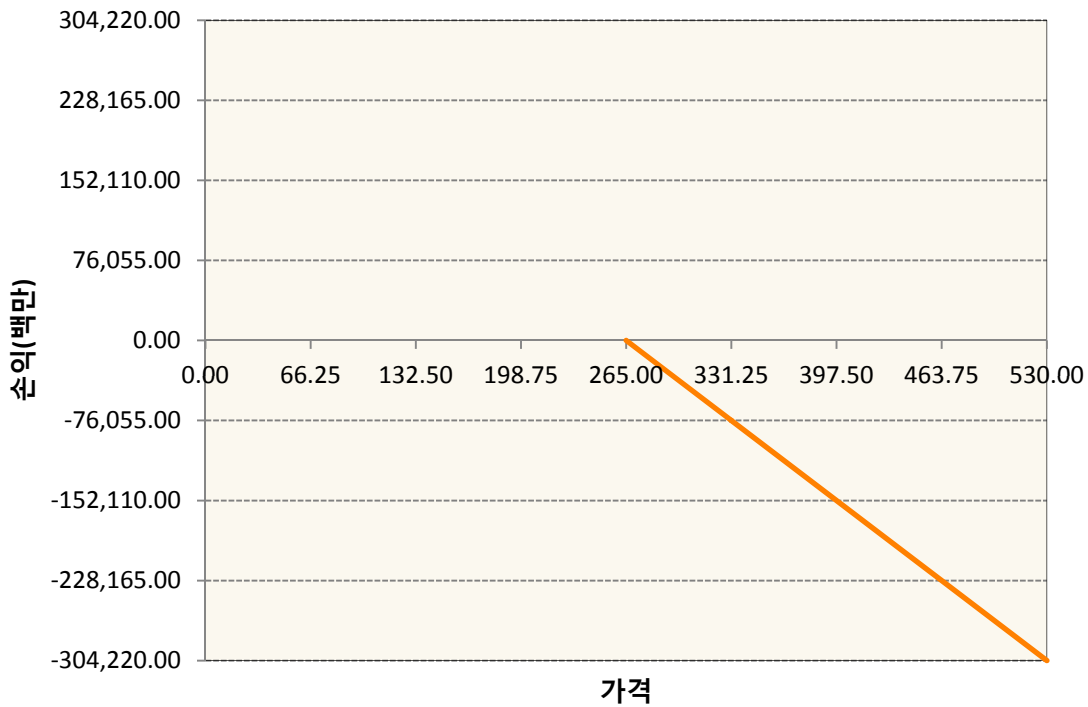
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	6,595	0	6,595	장내
누계	유가증권	옵션	0	693,318	-693,318	장내

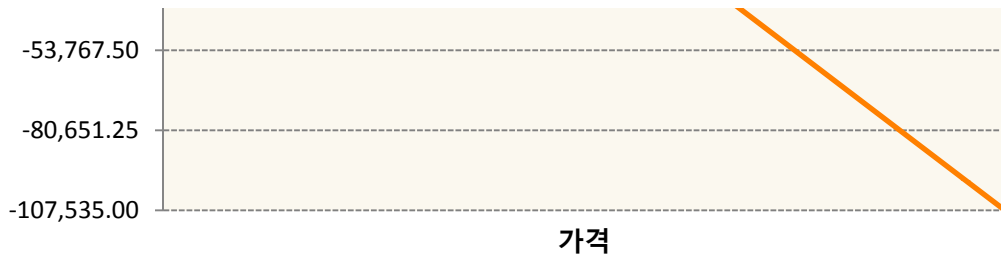
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4201P22655-2019-02 콜265

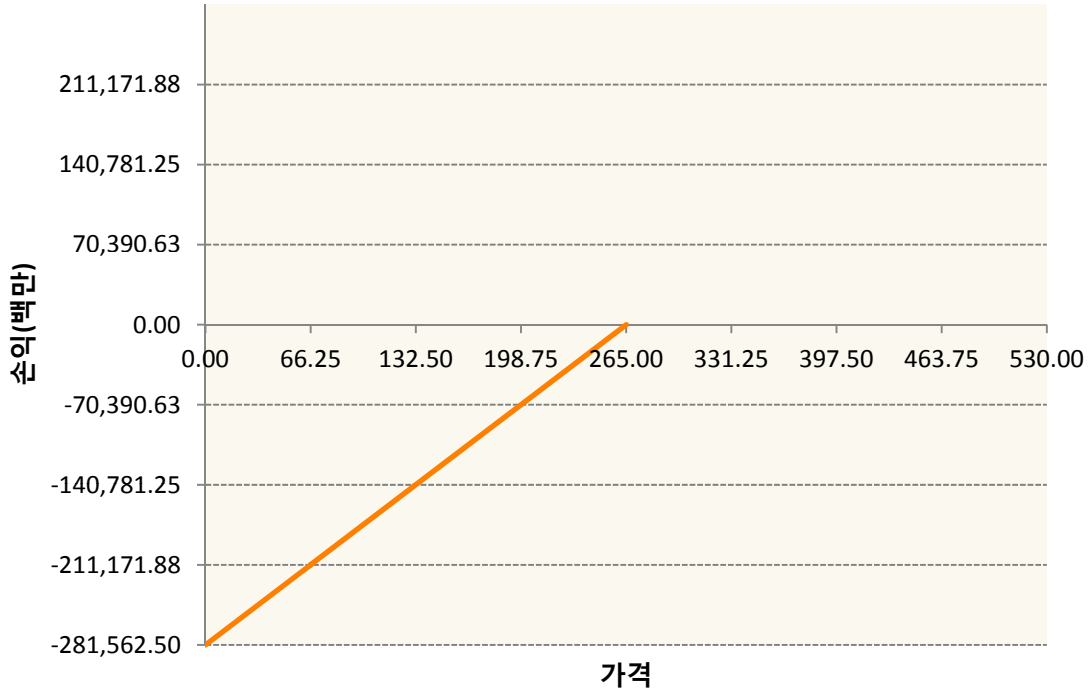


KR4201P22671-2019-02 콜267.5





KR4301P22653-2019-02 풋265



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201P22655		2019-02 콜265					22,247
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	13,168	12,750	12,297	11,815	11,311	10,787	10,247
-5.33%	11,081	10,469	9,848	9,220	8,587	7,950	7,309
-2.67%	7,291	6,623	5,954	5,284	4,614	3,944	3,273
0%	1,728	1,171	594	0	-606	-1,223	-1,848
2.67%	-5,224	-5,585	-5,992	-6,436	-6,911	-7,412	-7,936
5.33%	-13,009	-13,196	-13,433	-13,717	-14,043	-14,407	-14,803
8.00%	-21,185	-21,263	-21,380	-21,537	-21,735	-21,973	-22,247
KR4201P22671		2019-02 콜267.5					7,554
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	4,085	3,963	3,826	3,677	3,517	3,349	3,174

-5.33%	3,516	3,319	3,116	2,908	2,696	2,481	2,264
-2.67%	2,402	2,165	1,928	1,692	1,455	1,219	982
0%	659	443	223	0	-226	-454	-683
2.67%	-1,624	-1,777	-1,944	-2,122	-2,308	-2,502	-2,701
5.33%	-4,265	-4,352	-4,456	-4,577	-4,711	-4,858	-5,015
8.00%	-7,091	-7,130	-7,185	-7,256	-7,342	-7,441	-7,554
KR4301P22653                      2019-02 풋265							13,532
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-12,656	-12,746	-12,861	-12,999	-13,159	-13,337	-13,532
-5.33%	-5,832	-6,109	-6,398	-6,697	-7,003	-7,316	-7,635
-2.67%	-1,246	-1,597	-1,949	-2,302	-2,655	-3,010	-3,365
0%	655	459	239	0	-255	-523	-802
2.67%	1,089	1,037	962	865	746	606	447
5.33%	1,141	1,134	1,120	1,095	1,058	1,006	938
8.00%	1,144	1,144	1,142	1,138	1,130	1,116	1,094

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

(단위:백만원)

**41,701**

공시일	2019-01-22
기준일	2019-01-21

## 홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

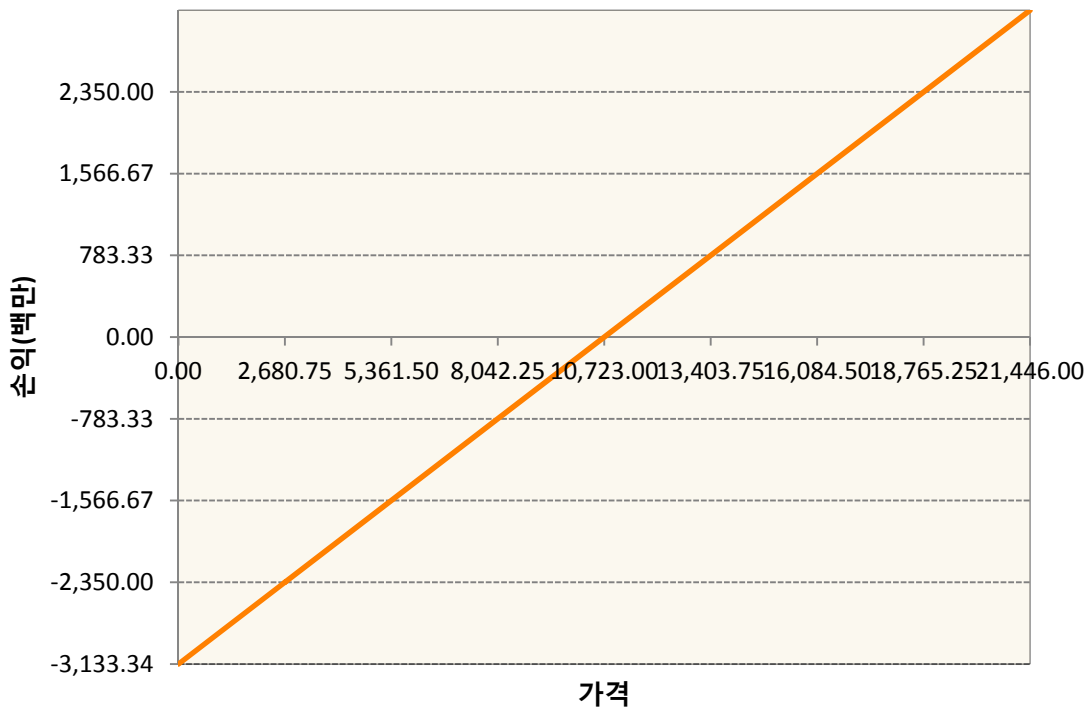
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

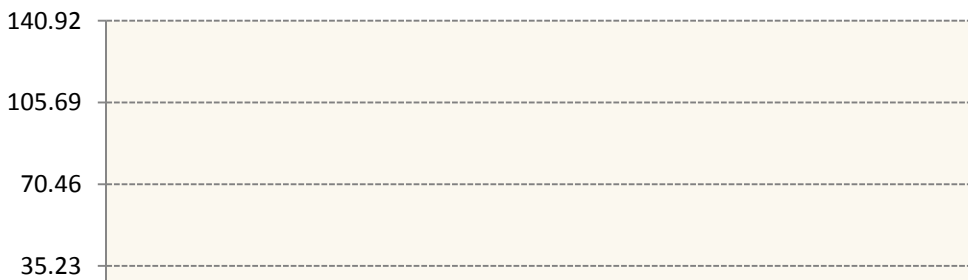
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	3,133	0	3,133	장내
누계	유가증권	옵션	0	7,040	-7,040	장내
누계	통화	선도	0	2,732	-2,732	장외

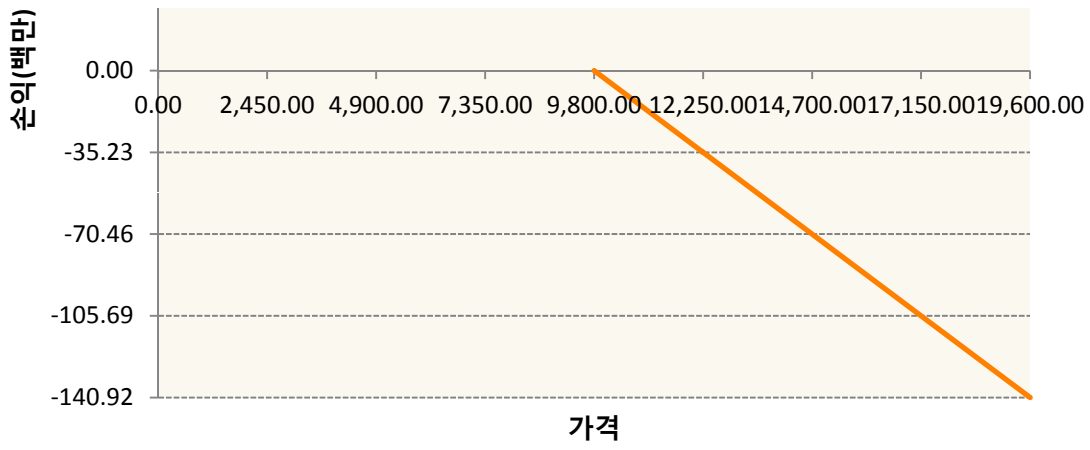
### 2. 만기시점의 손익구조

HCF9-HSCEI FUTURES JAN19

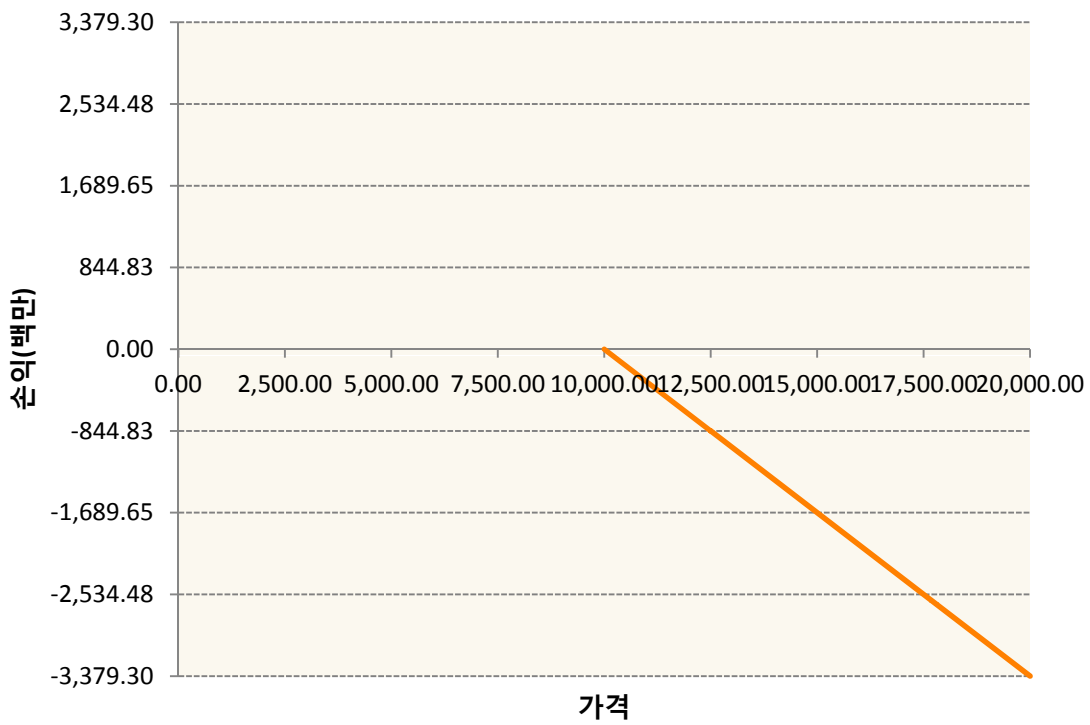


OHHIF9-C098-HSCEI

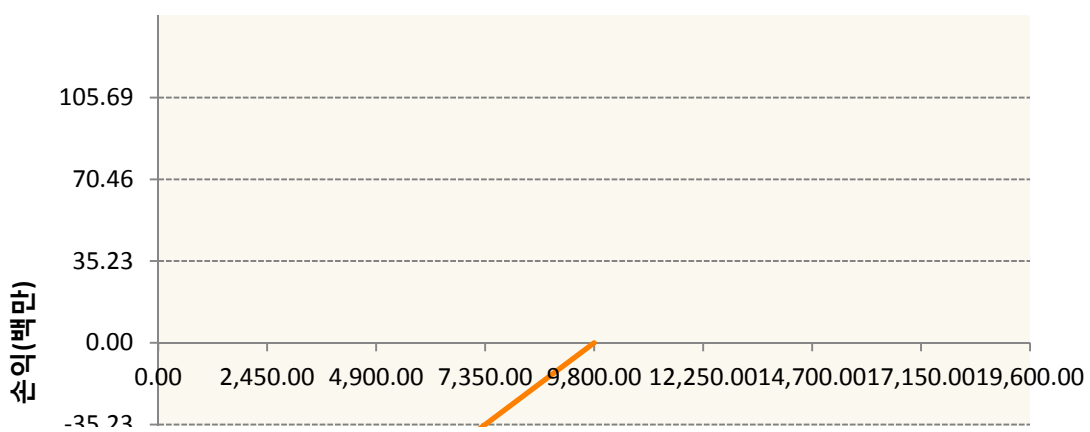


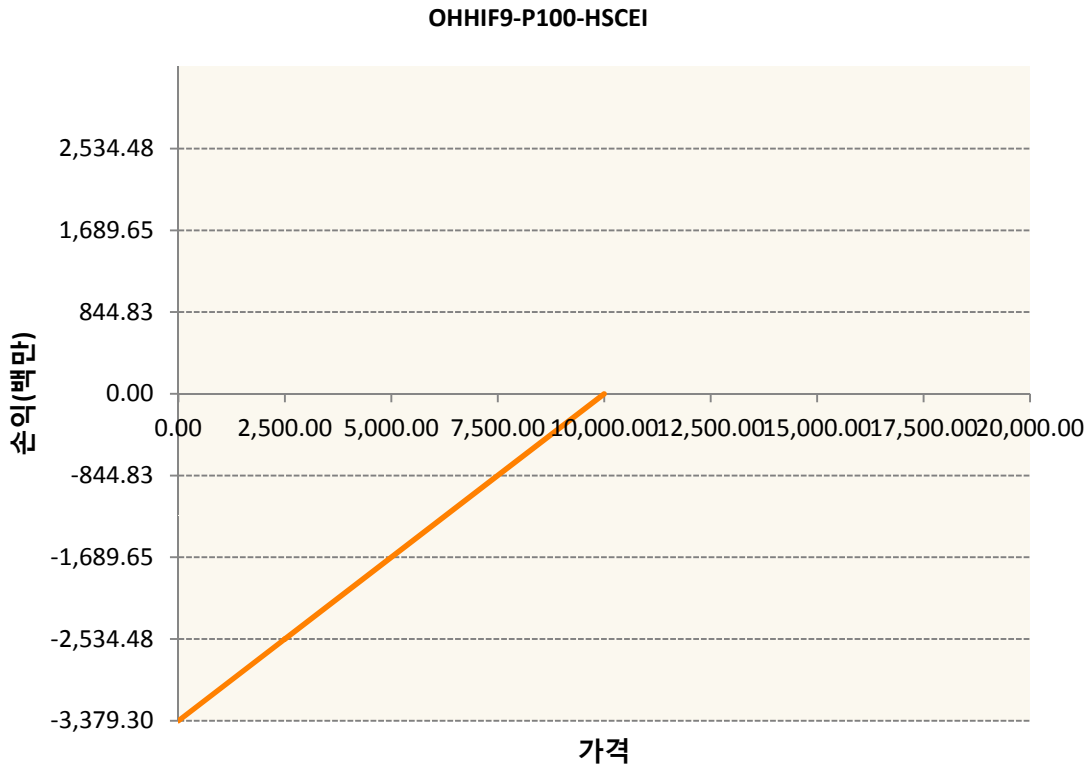
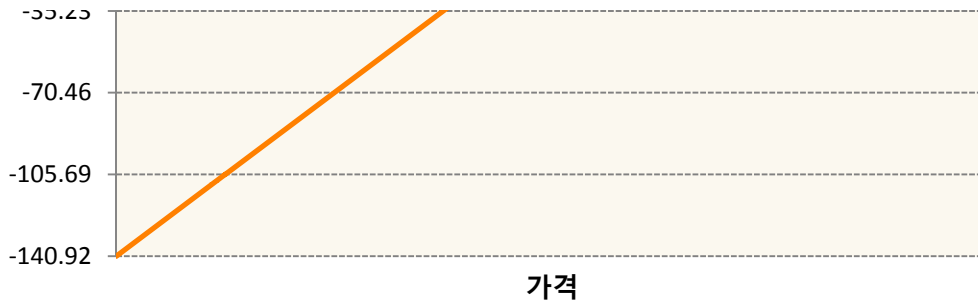


**OHHIF9-C100-HSCEI**



**OHHIF9-P098-HSCEI**





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

FX21018Z00 KRW/HKD 11-03-19E	219
HCF9 HSCEI FUTURES JAN19	251
OHHIF9-C09 HSCEI	11
OHHIF9-C10 HSCEI	270
OHHIF9-P09 HSCEI	11
OHHIF9-P10 HSCEI	270

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

**917**

공시일	2019-01-22
기준일	2019-01-21

## 코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

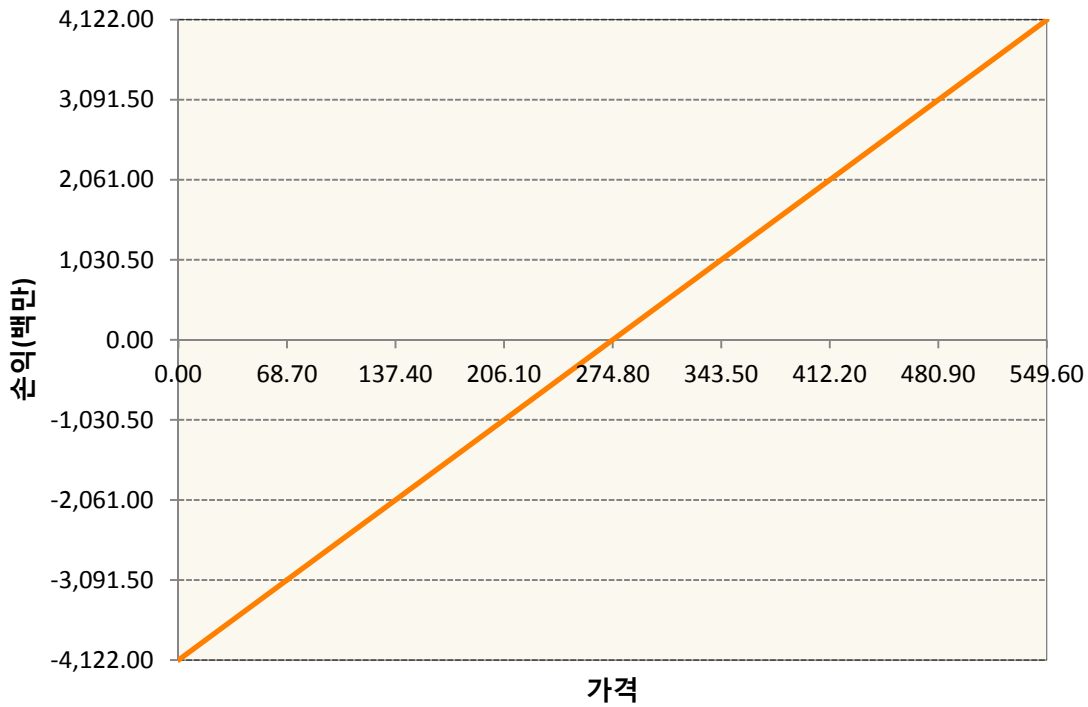
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

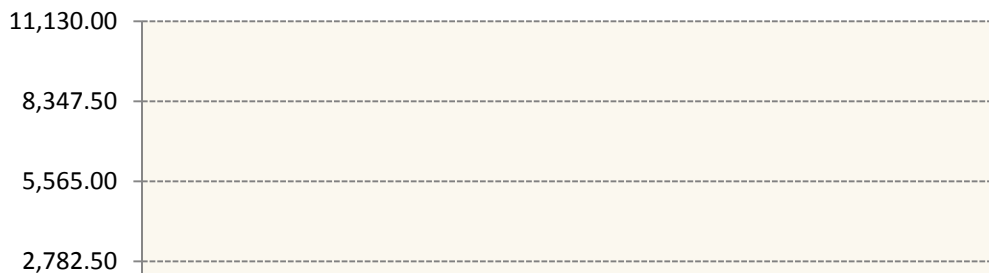
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	1,372	0	1,372	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	4,122	0	4,122	장내
누계	유가증권	스왑	31,836	0	31,836	장외
누계	유가증권	옵션	0	33,858	-33,858	장내

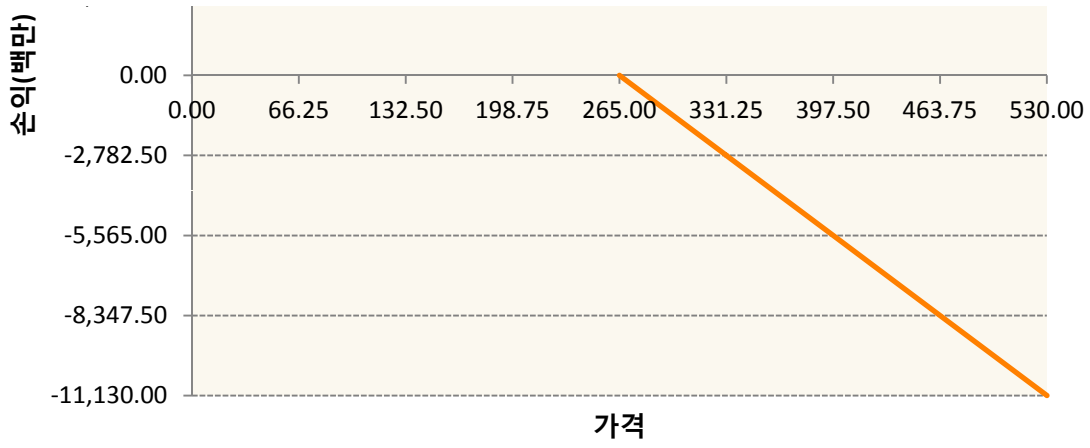
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101P30007-2019-03 코스피200지수선물

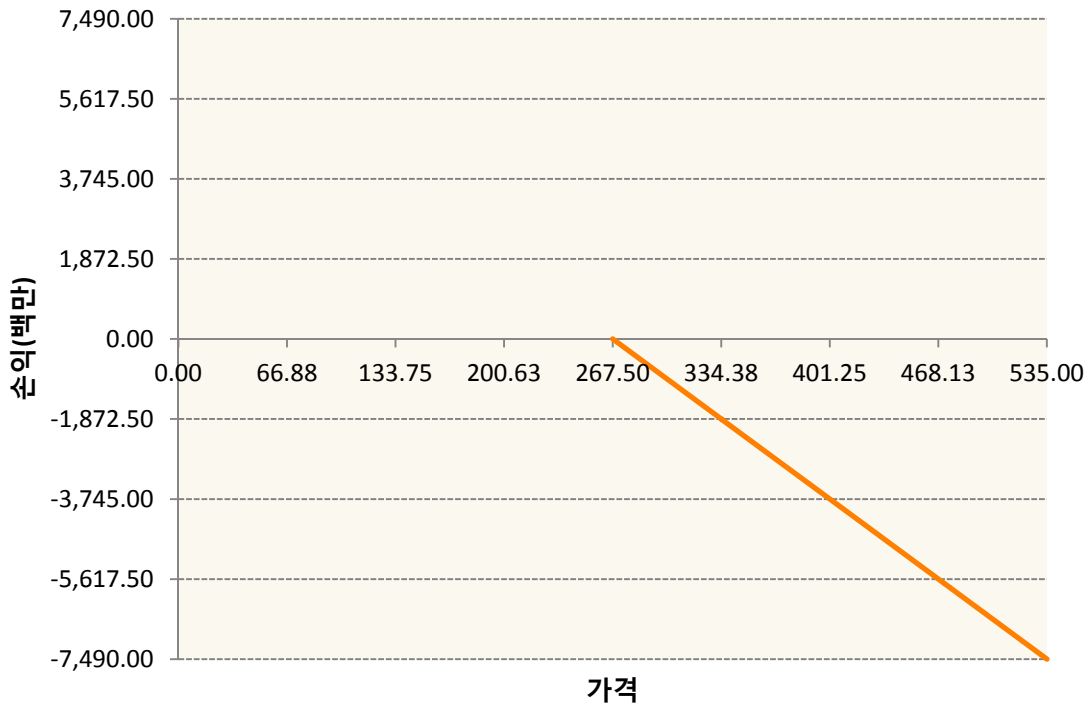


KR4201P22655-2019-02 콜265

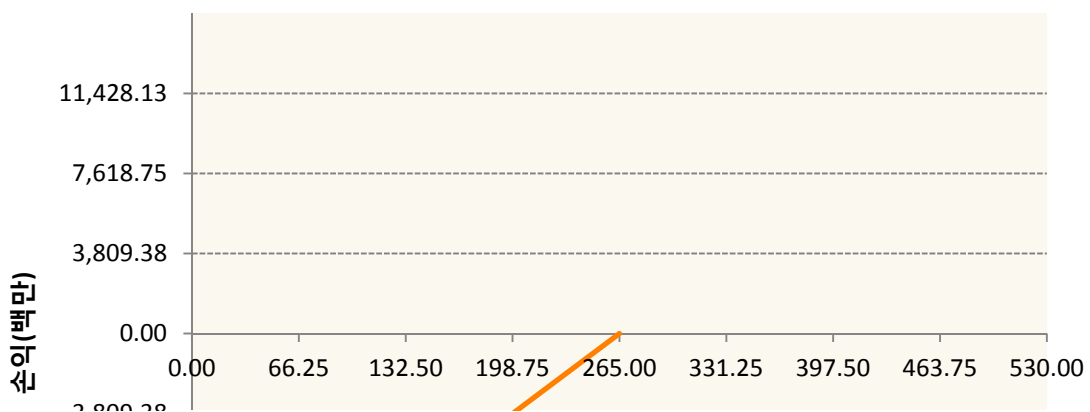


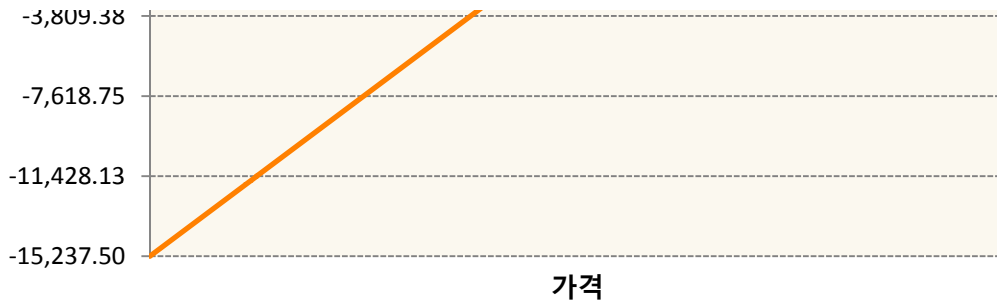


KR4201P22671-2019-02 콜267.5



KR4301P22653-2019-02 풋265





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

2.529E+11		UBCSFXC1 INDEX_14						2,659
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-2,659	-2,659	-2,659	-2,659	-2,659	-2,659	-2,659	
-5.33%	-1,773	-1,773	-1,773	-1,773	-1,773	-1,773	-1,773	
-2.67%	-886	-886	-886	-886	-886	-886	-886	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	886	886	886	886	886	886	886	
5.33%	1,773	1,773	1,773	1,773	1,773	1,773	1,773	
8.00%	2,659	2,659	2,659	2,659	2,659	2,659	2,659	
KR4101P30007		2019-03 코스피200지수선물						329
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-329	-329	-329	-329	-329	-329	-329	
-5.33%	-219	-219	-219	-219	-219	-219	-219	
-2.67%	-110	-110	-110	-110	-110	-110	-110	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	110	110	110	110	110	110	110	
5.33%	219	219	219	219	219	219	219	
8.00%	329	329	329	329	329	329	329	
KR4201P22655		2019-02 콜265						814
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	482	466	450	432	414	395	375	
-5.33%	405	383	360	337	314	291	267	
-2.67%	267	242	218	193	169	144	120	
0%	63	43	22	0	-22	-45	-68	
2.67%	-191	-204	-219	-235	-253	-271	-290	
5.33%	-476	-483	-491	-502	-514	-527	-542	
8.00%	-775	-778	-782	-788	-795	-804	-814	
KR4201P22671		2019-02 콜267.5						526
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	

-8.00%	285	276	266	256	245	233	221
-5.33%	245	231	217	203	188	173	158
-2.67%	167	151	134	118	101	85	68
0%	46	31	16	0	-16	-32	-48
2.67%	-113	-124	-135	-148	-161	-174	-188
5.33%	-297	-303	-310	-319	-328	-338	-349
8.00%	-494	-497	-500	-505	-511	-518	-526
KR4301P22653                      2019-02 풋265							732
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-685	-690	-696	-703	-712	-722	-732
-5.33%	-316	-331	-346	-362	-379	-396	-413
-2.67%	-67	-86	-105	-125	-144	-163	-182
0%	35	25	13	0	-14	-28	-43
2.67%	59	56	52	47	40	33	24
5.33%	62	61	61	59	57	54	51
8.00%	62	62	62	62	61	60	59

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

(단위:백만원)

**4,925**

공시일	2019-01-22
기준일	2019-01-21

## 유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

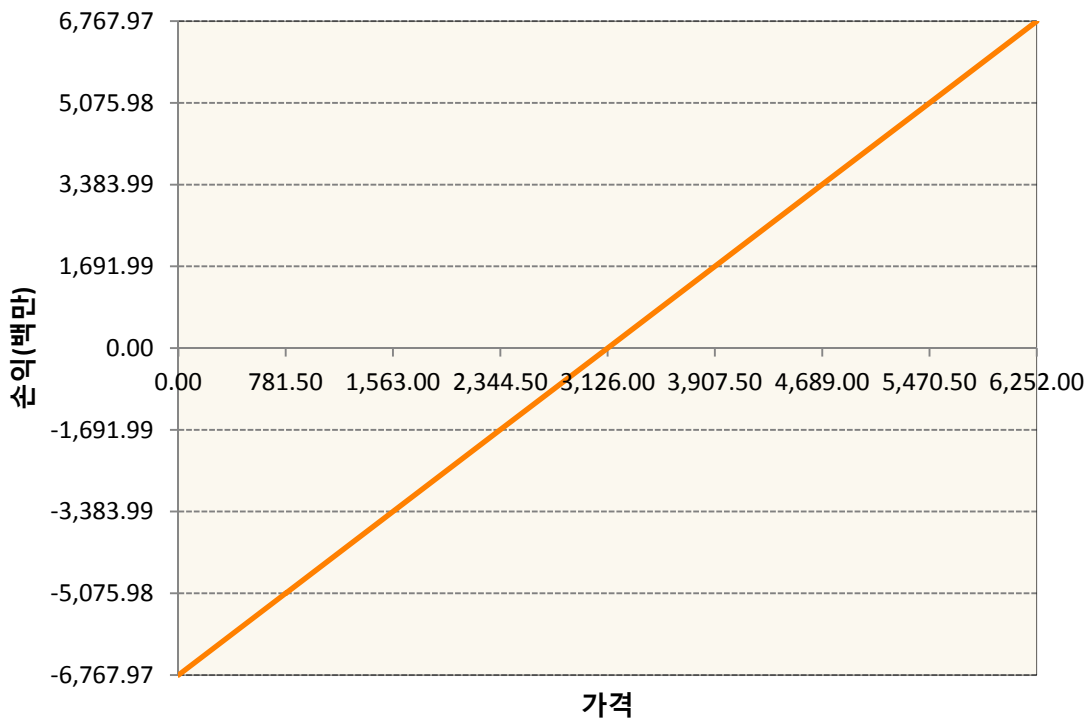
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	9	-9	장외
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	6,768	0	6,768	
누계	유가증권	스왑	60,632	0	60,632	장외
누계	통화	선도	0	15,411	-15,411	장외

### 2. 만기시점의 손익구조

VGH9-EURO STOXX 50 Mar19



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

260105SQP×SG EURO Covered CALL STRATEGY	0
FX21018X02 KRW/EUR 22-02-19E	411
FX21018Z03 KRW/EUR 22-03-19E	822
VGH9 EURO STOXX 50 Mar19	541

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

(단위:백만원)

1,057



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

(단위:백만원)

1,132



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

(단위:백만원)

96



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

(단위:백만원)

145

공시일	2019-01-22
기준일	2019-01-21

## 스마트KRX300인덱스목표전환형1호

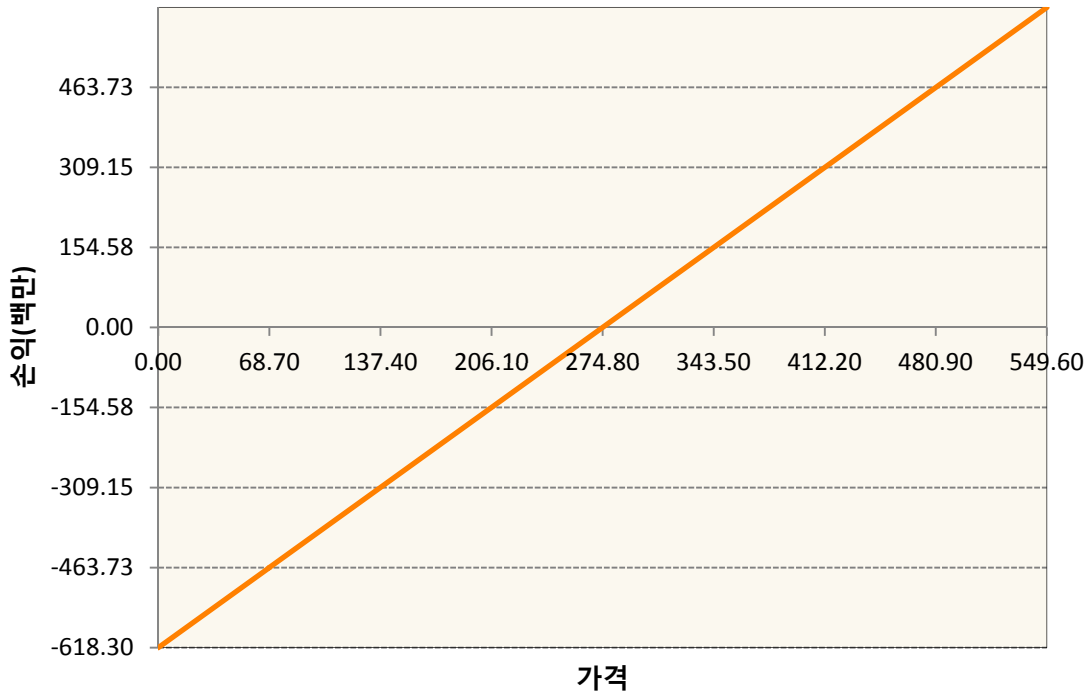
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	618	0	618	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	2019-01-22
기준일	2019-01-21

## 리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

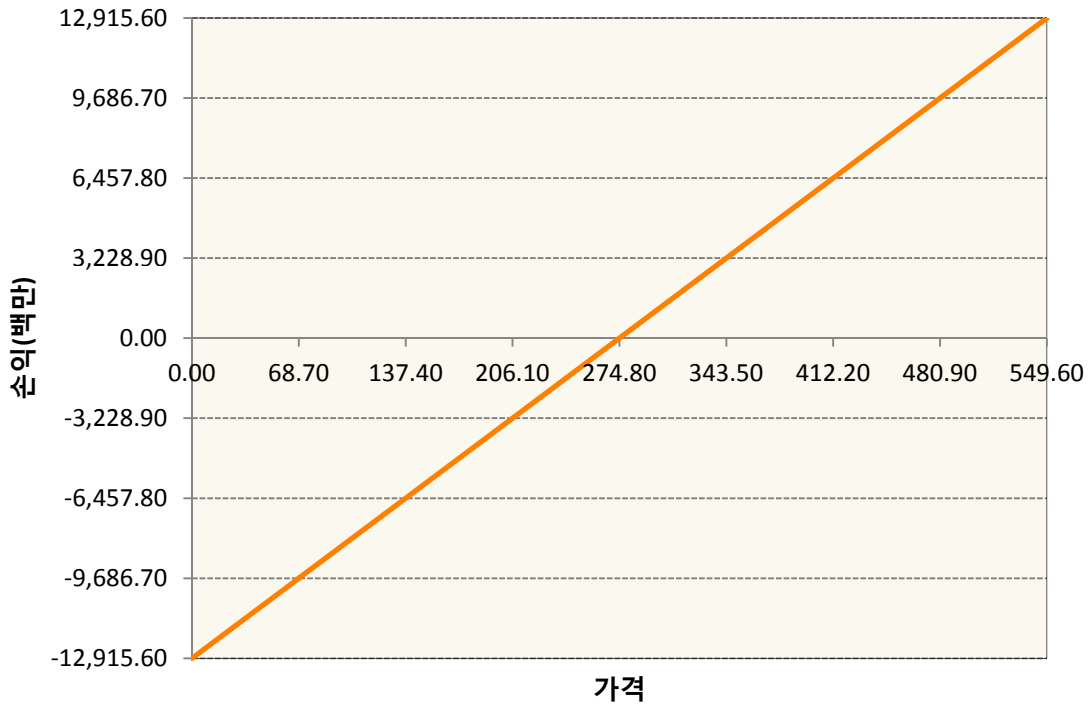
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

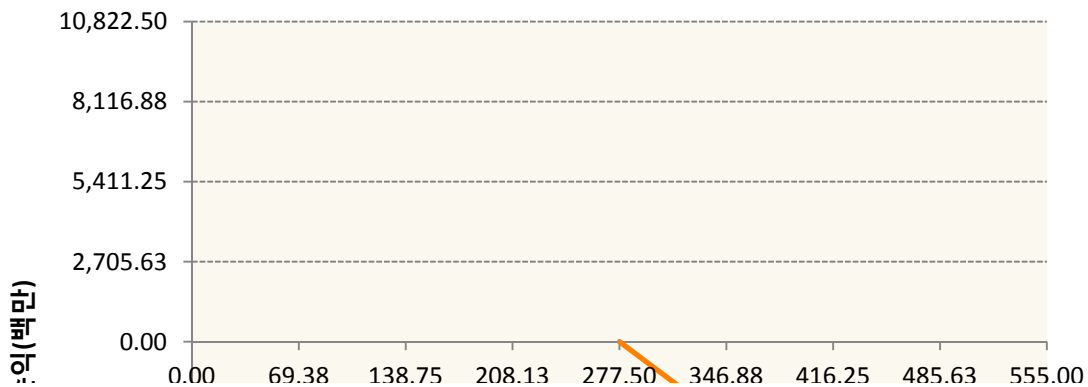
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	12,916	0	12,916	장내
누계	유가증권	옵션	2,523	23,213	-20,690	장내

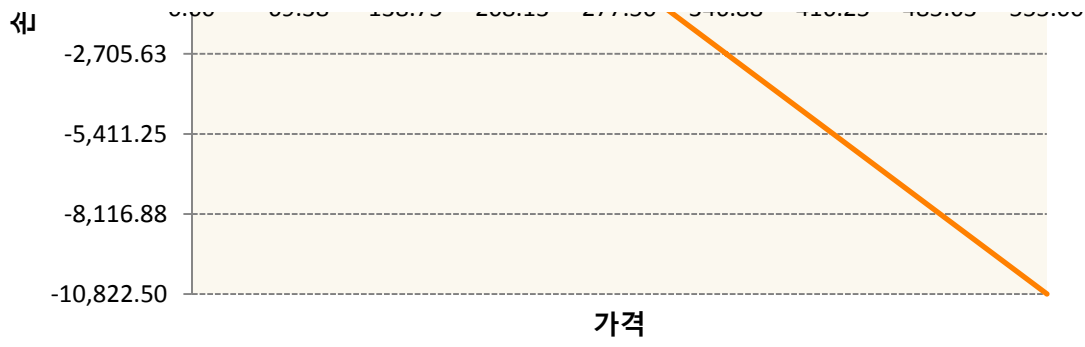
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101P30007-2019-03 코스피200지수선물

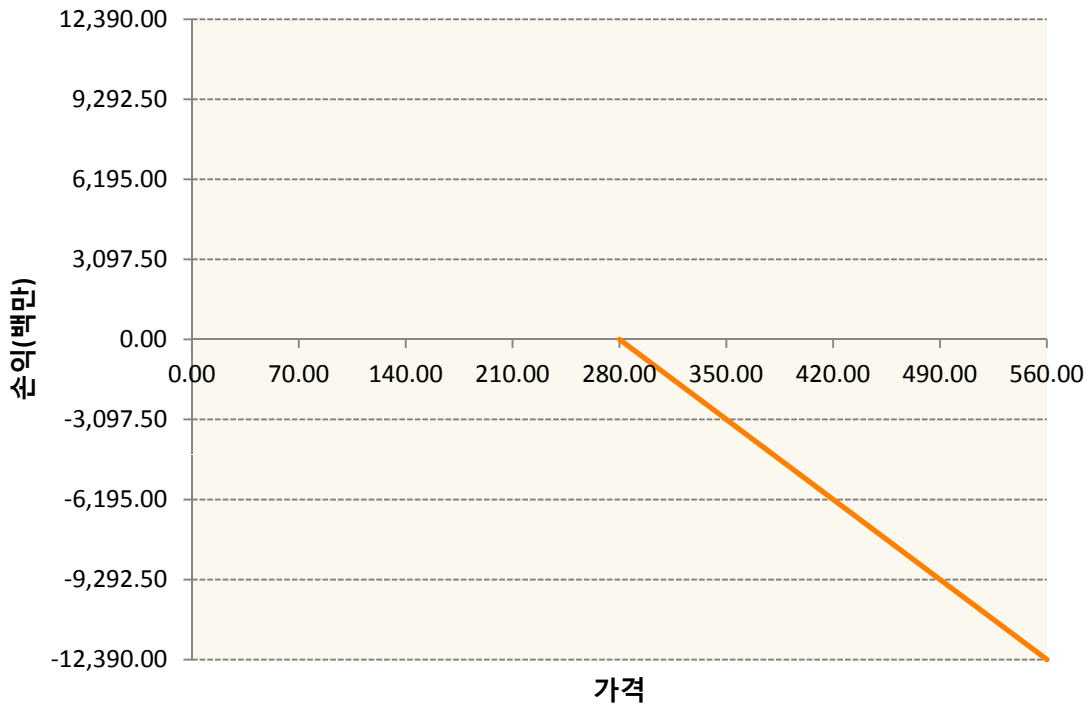


KR4201P22770-2019-02 콜277.5

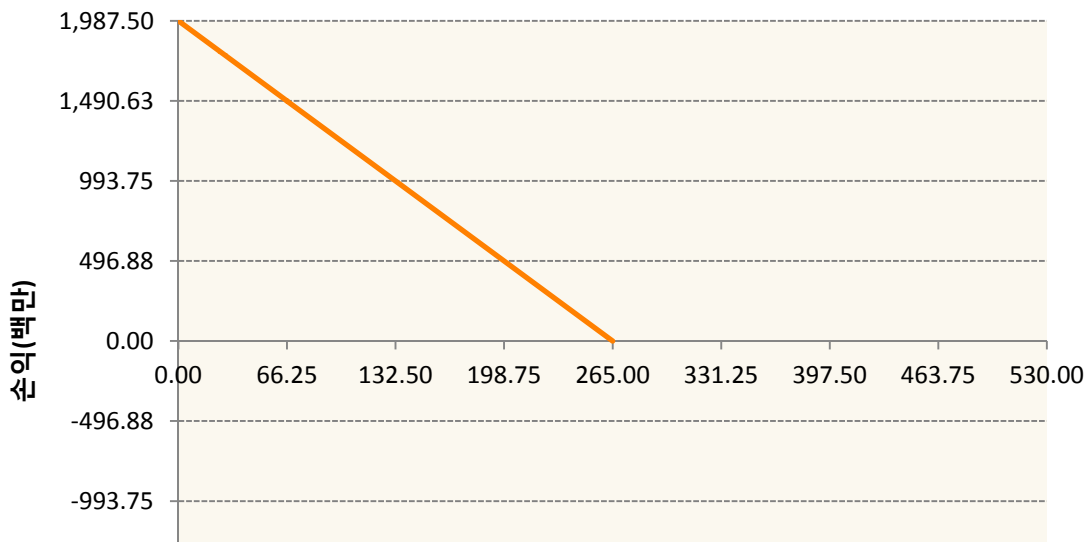


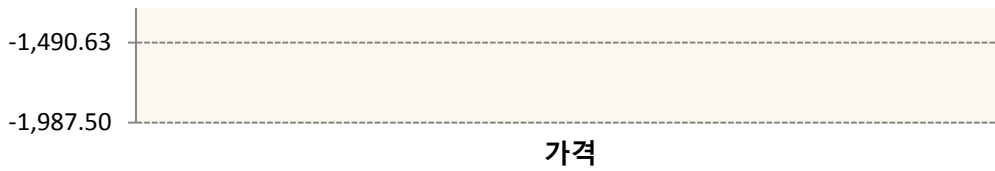


KR4201P22804-2019-02 콜280

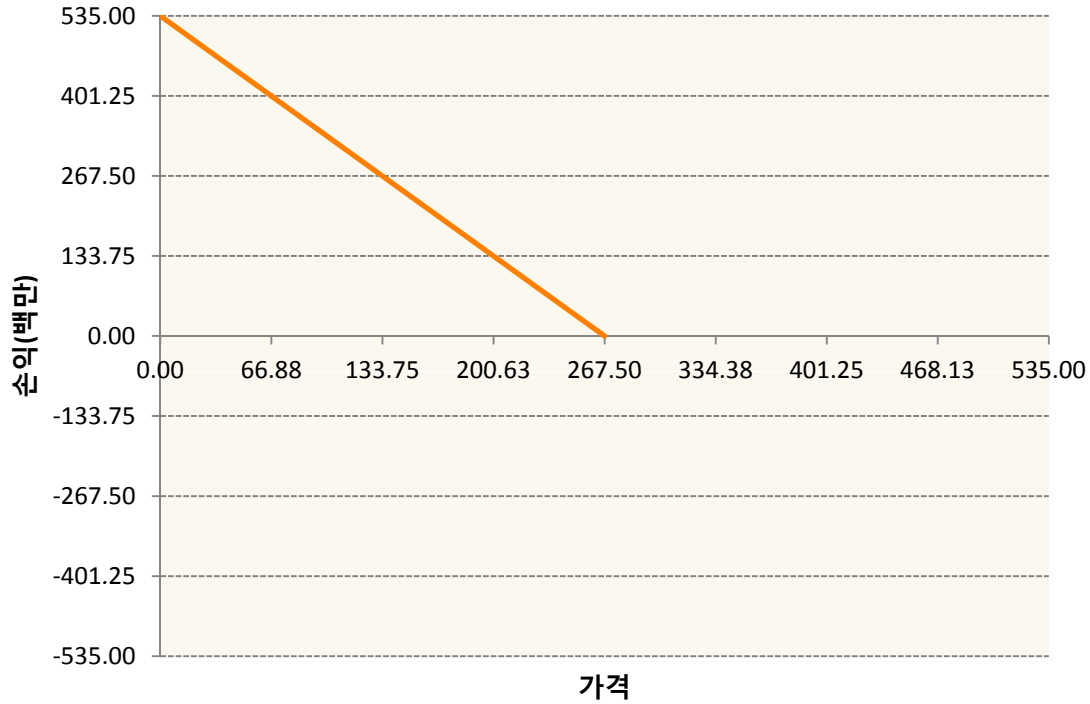


KR4301P22653-2019-02 풋265





KR4301P22679-2019-02 풋267.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101P30007		2019-03 코스피200지수선물						1,030
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-1,030	-1,030	-1,030	-1,030	-1,030	-1,030	-1,030	
-5.33%	-687	-687	-687	-687	-687	-687	-687	
-2.67%	-343	-343	-343	-343	-343	-343	-343	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	343	343	343	343	343	343	343	
5.33%	687	687	687	687	687	687	687	
8.00%	1,030	1,030	1,030	1,030	1,030	1,030	1,030	
KR4201P22770		2019-02 콜277.5						613
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	217	213	207	200	191	181	170	
-5.33%	201	191	179	166	152	136	120	
-2.67%	158	141	122	103	83	63	42	

0%	69	46	23	0	-23	-47	-70
2.67%	-77	-100	-124	-147	-171	-194	-218
5.33%	-279	-298	-317	-337	-358	-379	-401
8.00%	-523	-534	-548	-562	-578	-595	-613
KR4201P22804                      2019-02 콜280							655
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	206	202	197	191	182	173	162
-5.33%	194	184	173	160	146	131	114
-2.67%	157	140	121	101	80	58	36
0%	76	51	26	0	-26	-52	-78
2.67%	-68	-95	-122	-150	-177	-204	-232
5.33%	-277	-300	-324	-349	-374	-400	-426
8.00%	-538	-555	-572	-592	-612	-633	-655
KR4301P22653                      2019-02 풋265							96
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	89	90	91	92	93	94	96
-5.33%	41	43	45	47	49	52	54
-2.67%	9	11	14	16	19	21	24
0%	-5	-3	-2	0	2	4	6
2.67%	-8	-7	-7	-6	-5	-4	-3
5.33%	-8	-8	-8	-8	-7	-7	-7
8.00%	-8	-8	-8	-8	-8	-8	-8
KR4301P22679                      2019-02 풋267.5							29
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	28	28	28	28	28	28	29
-5.33%	14	14	15	15	16	16	17
-2.67%	4	4	5	6	6	7	8
0%	-2	-1	-1	0	1	1	2
2.67%	-3	-3	-3	-2	-2	-2	-1
5.33%	-3	-3	-3	-3	-3	-3	-3
8.00%	-3	-3	-3	-3	-3	-3	-3

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

(단위:백만원)

**2,125**

공시일	2019-01-22
기준일	2019-01-21

## 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	627	0	627	

### 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	2019-01-22
기준일	2019-01-21

## 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	2,763	0	2,763	

### 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	2019-01-22
기준일	2019-01-21

## H2O글로벌본드(H)(채권혼합-파생)

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	180	0	180	
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	수익증권	4,180	0	4,180	
누계	통화	선도	180	4,930	-4,750	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	32
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	14
FX21019F00 KRW/USD 19-02-19E	29
FX21019F00 KRW/USD 19-02-19E	14
FX21019F01 KRW/USD 19-02-19E	38
FX21019F01 KRW/USD 28-02-19E	14
FX21019F01 USD/KRW 22-01-19E	14
FX21019F01 KRW/USD 28-02-19E	58
FX21019F01 KRW/USD 28-02-19E	9



공시일	2019-01-22
기준일	2019-01-21

## 스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

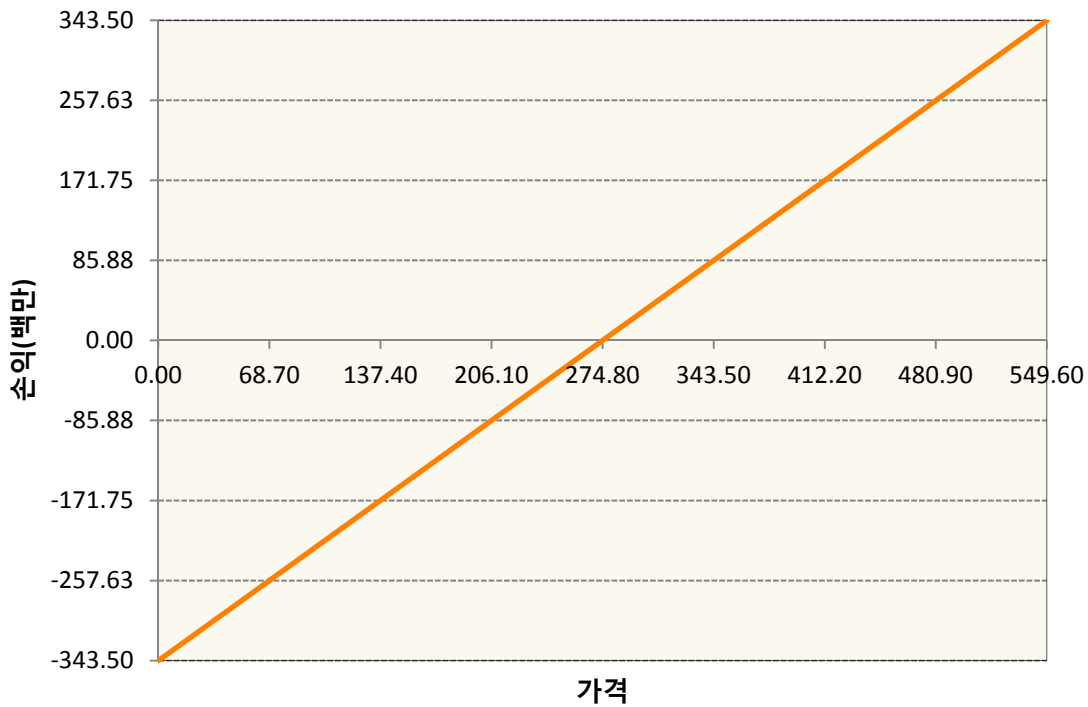
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

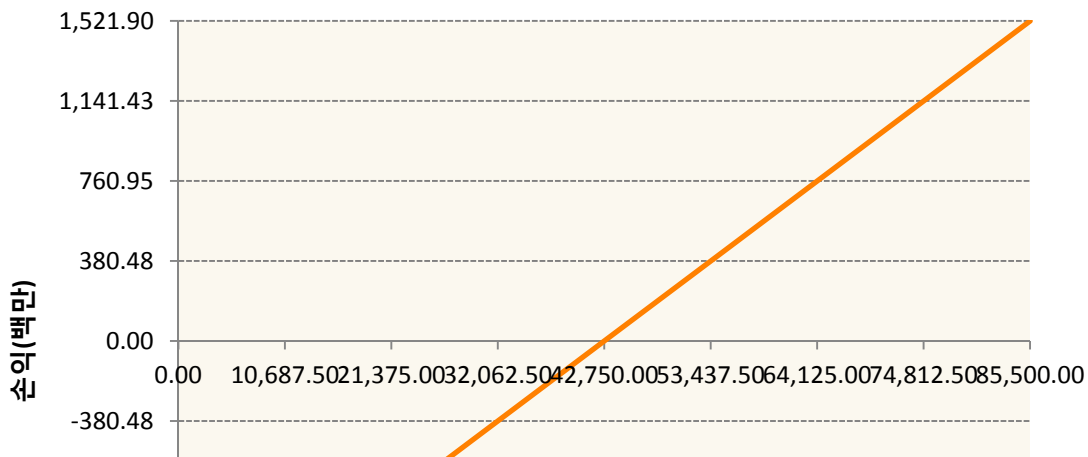
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,865	0	1,865	장내

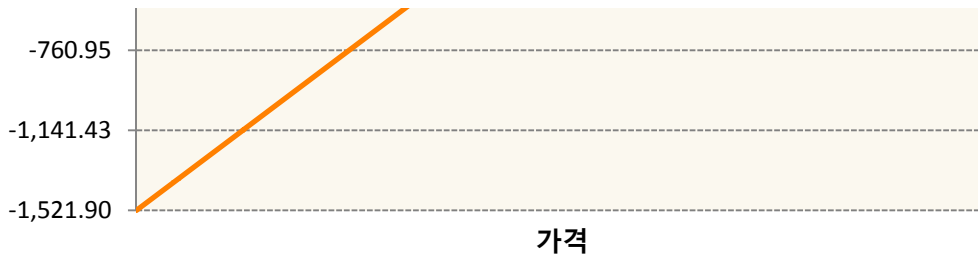
### 2. 만기시점의 손익구조

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						122
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-122	-122	-122	-122	-122	-122	-122	
-5.33%	-81	-81	-81	-81	-81	-81	-81	
-2.67%	-41	-41	-41	-41	-41	-41	-41	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	41	41	41	41	41	41	41	
5.33%	81	81	81	81	81	81	81	
8.00%	122	122	122	122	122	122	122	

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

**165**

공시일	2019-01-22
기준일	2019-01-21

## 에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

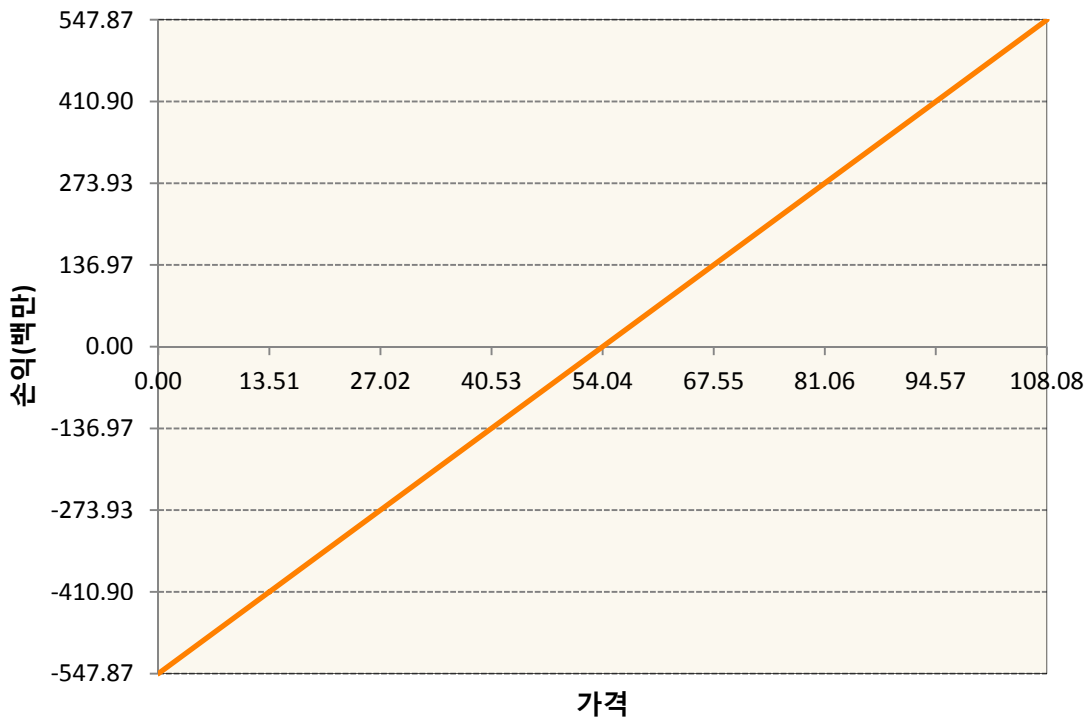
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

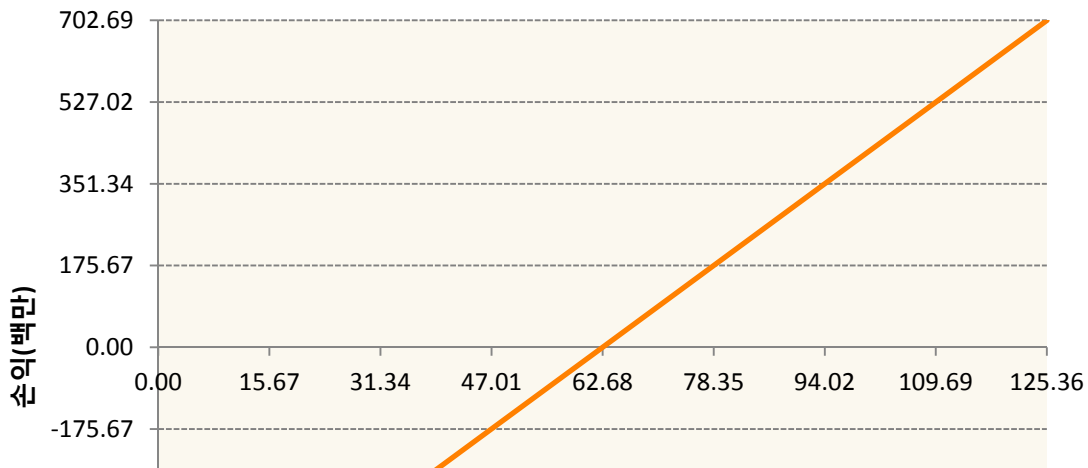
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,842	282	2,560	

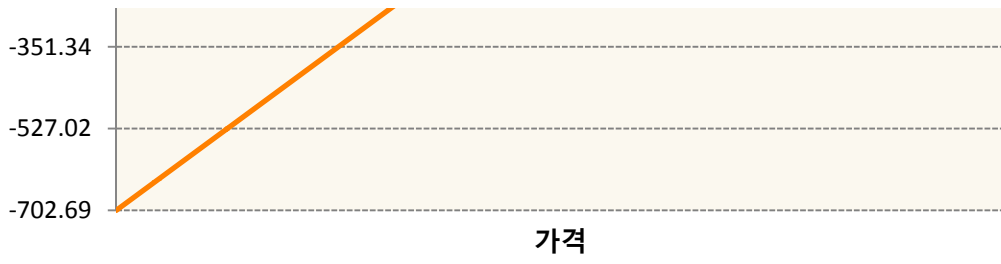
### 2. 만기시점의 손익구조

**CLH9-WTI CRUDE FUTURE MAR19**

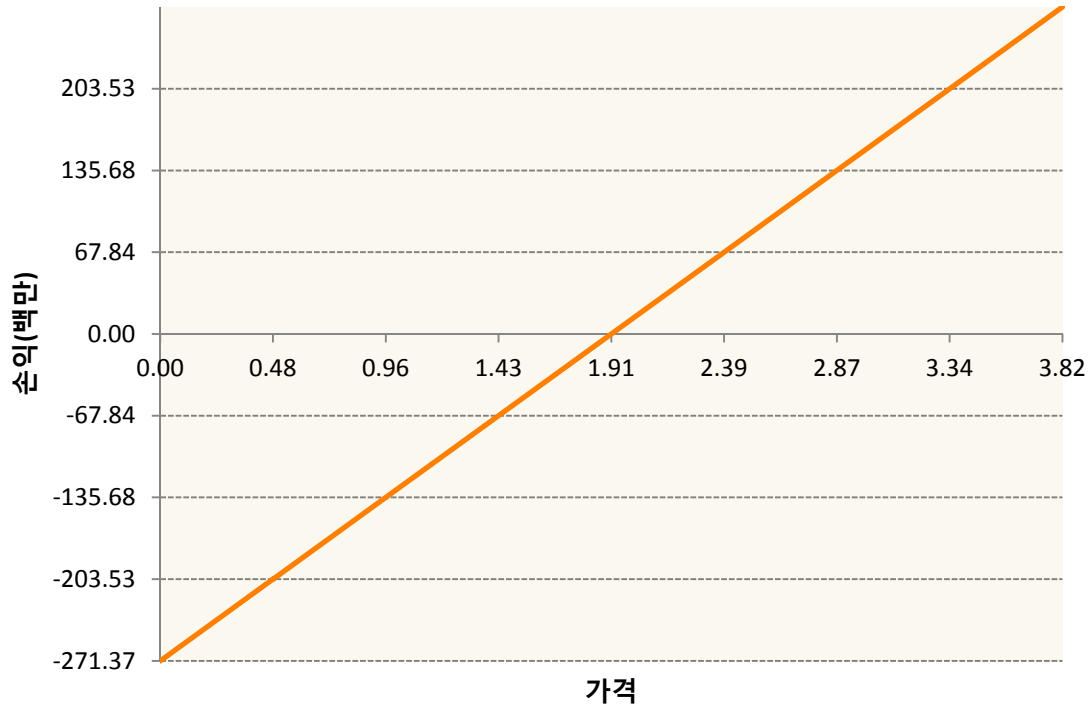


**COK9-BRENT CRUDE FUTR May19**

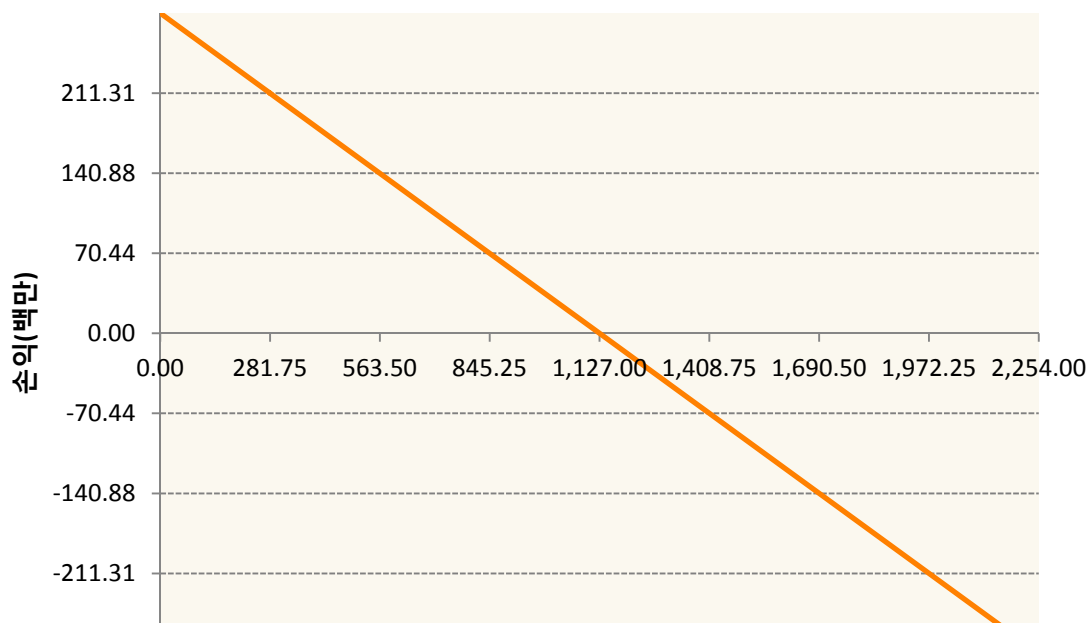


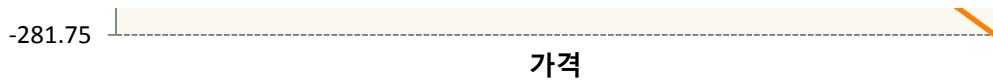


**HOH9-NY Harb ULSD Fut Mar19**



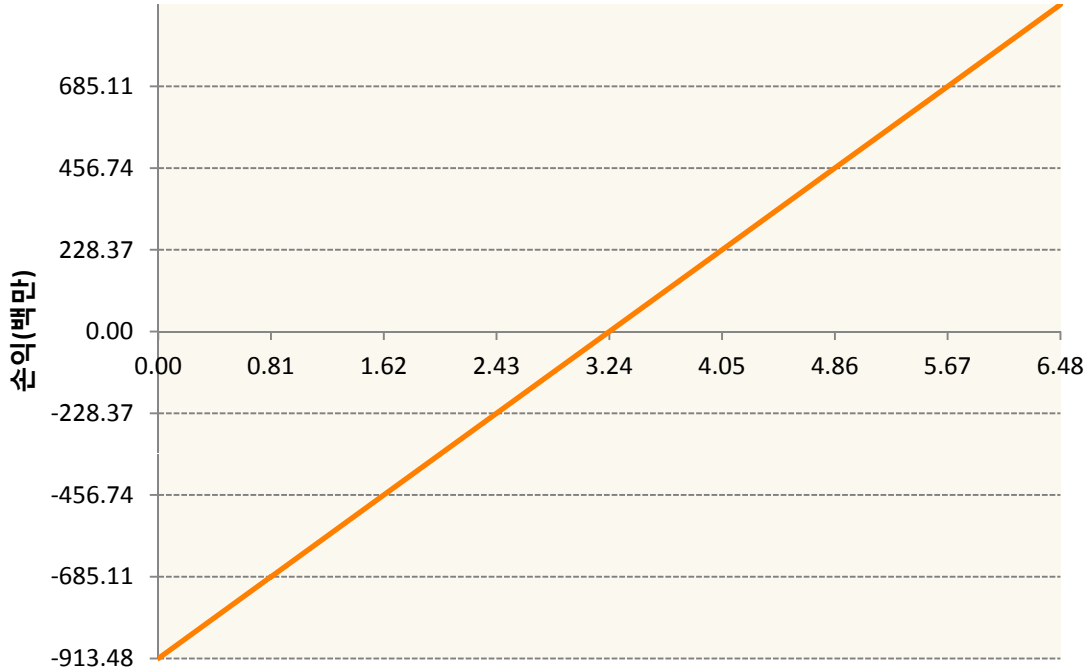
**KR4175P20002-2019-02 달러선물**





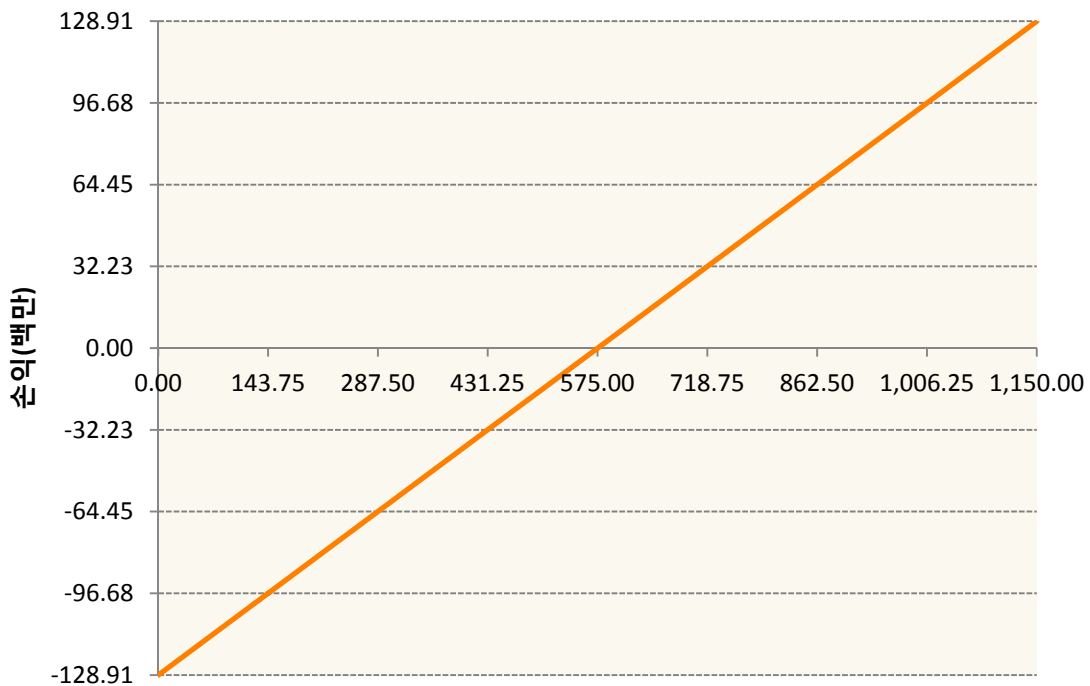
가격

NGH19-NATURAL GAS FUTR Mar19



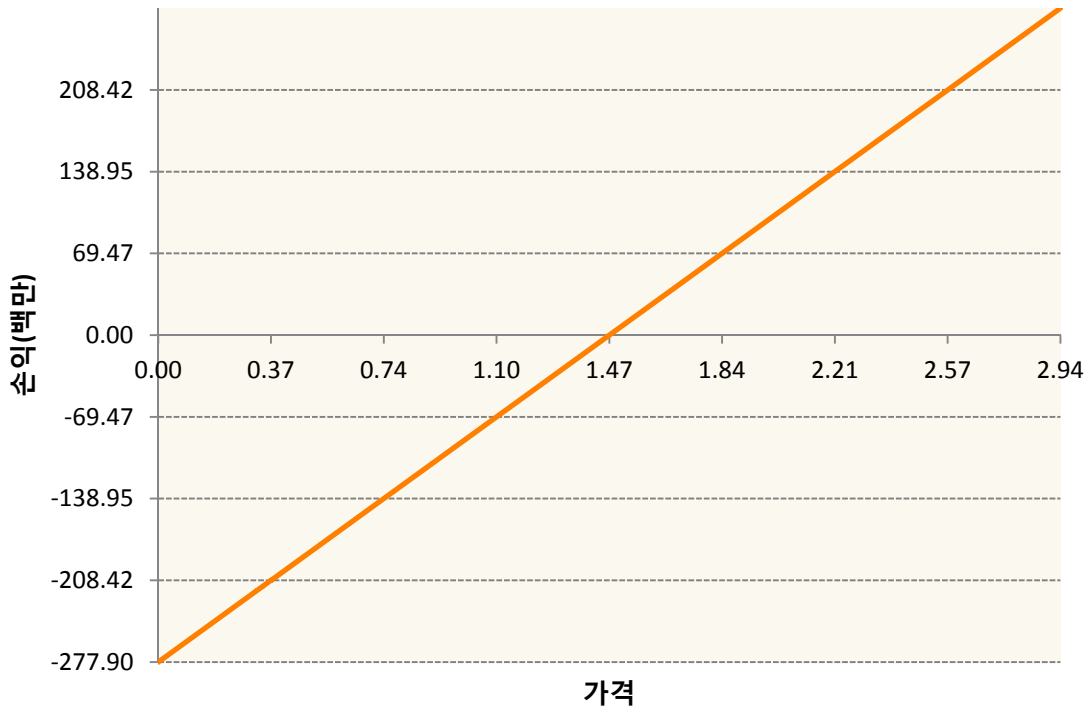
가격

QSH9-Low Su Gasoil G May19



가격

**XBH9-GASOLINE RBOB FUT Mar19**



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

CLH9	WTI CRUDE FUTURE MAR19	44
COK9	BRENT CRUDE FUTR May19	56
HOH9	NY Harb ULSD Fut Mar19	22
KR4175P200	2019-02 달러선물	23
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)**

**445**

공시일	2019-01-22
기준일	2019-01-21

## 애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

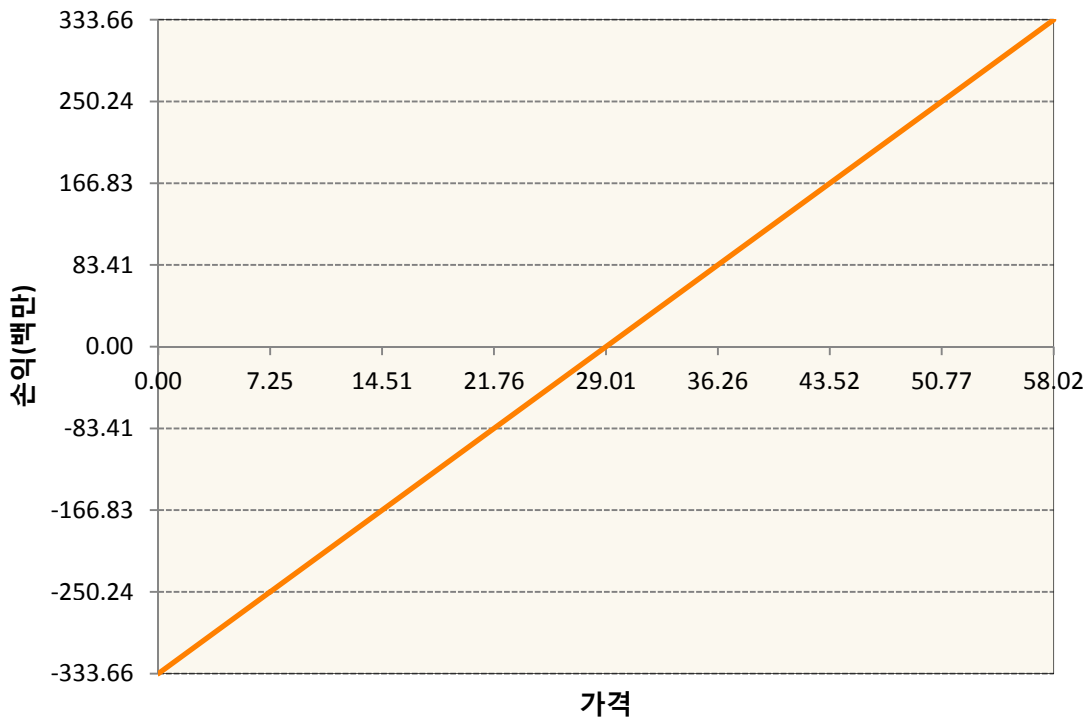
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

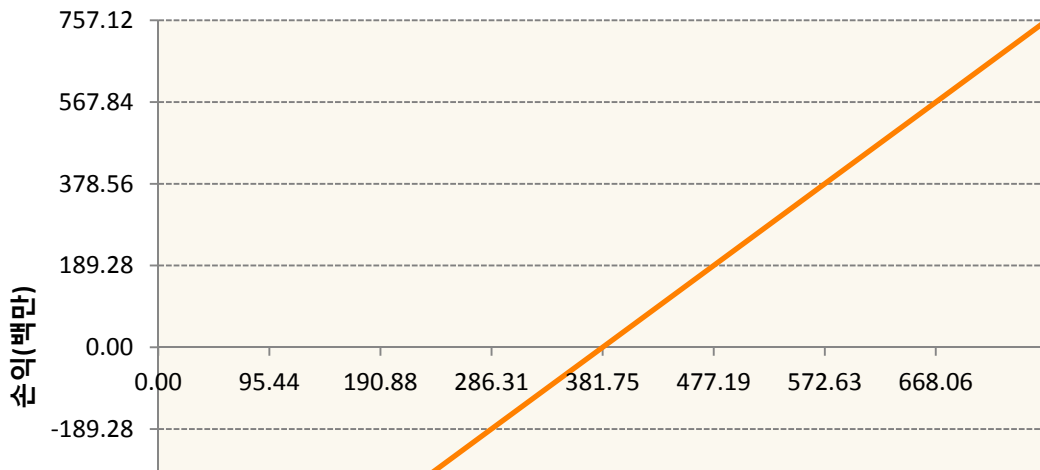
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,601	79	3,522	

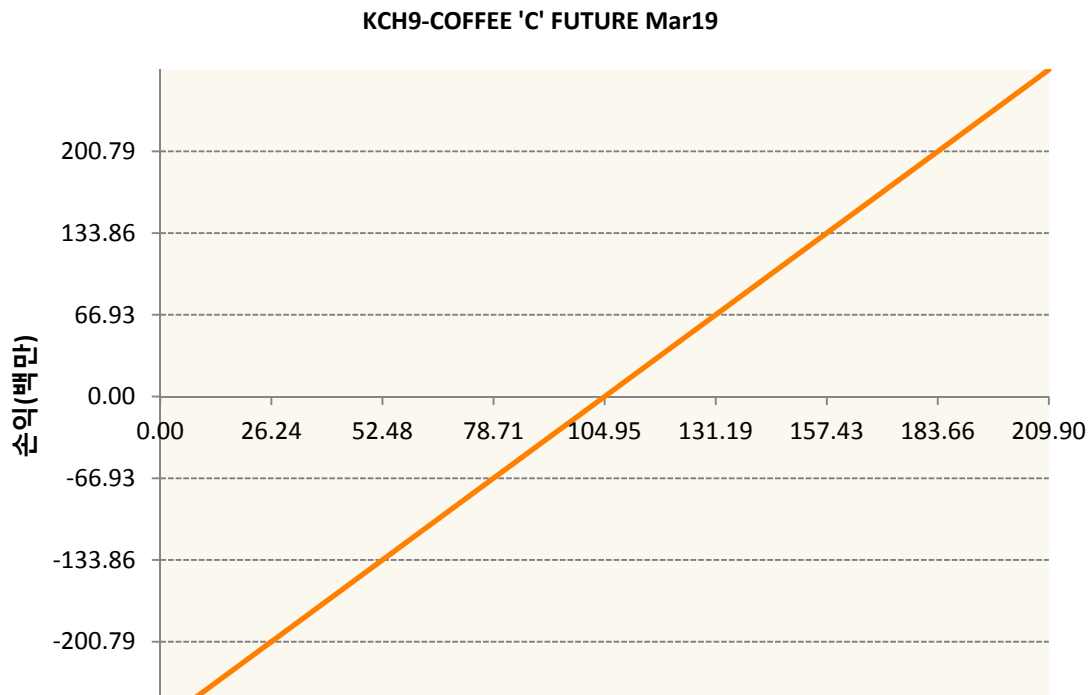
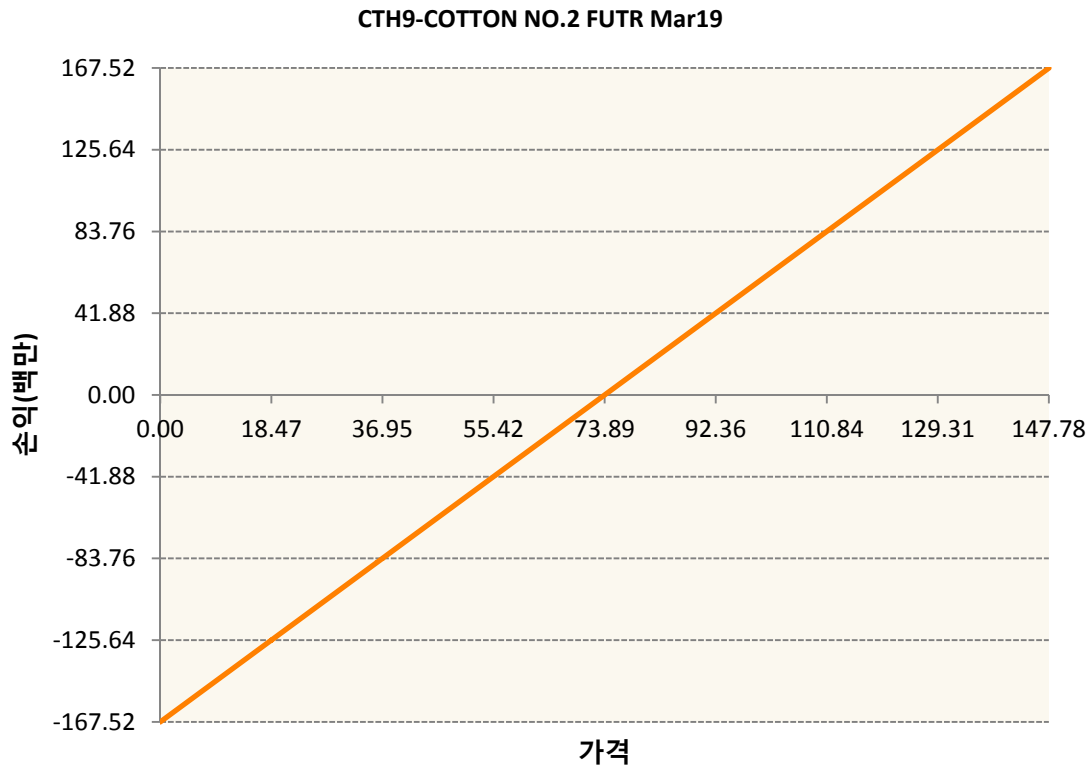
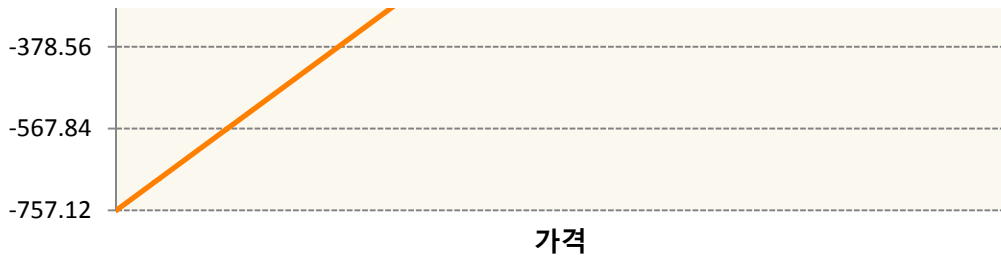
### 2. 만기시점의 손익구조

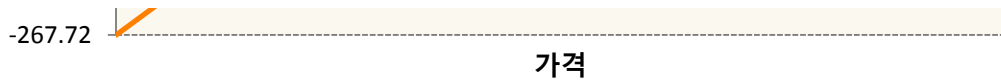
**BOH9-SOYBEAN OIL FUTR Mar19**



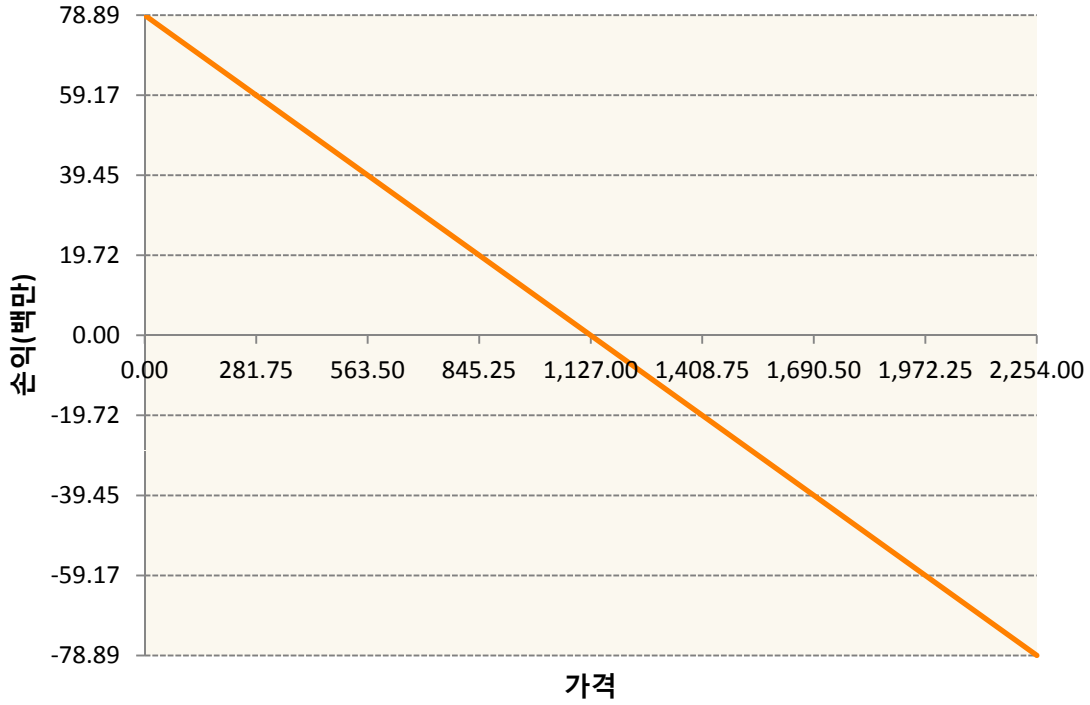
**CH9-CORN FUTURE Mar19**



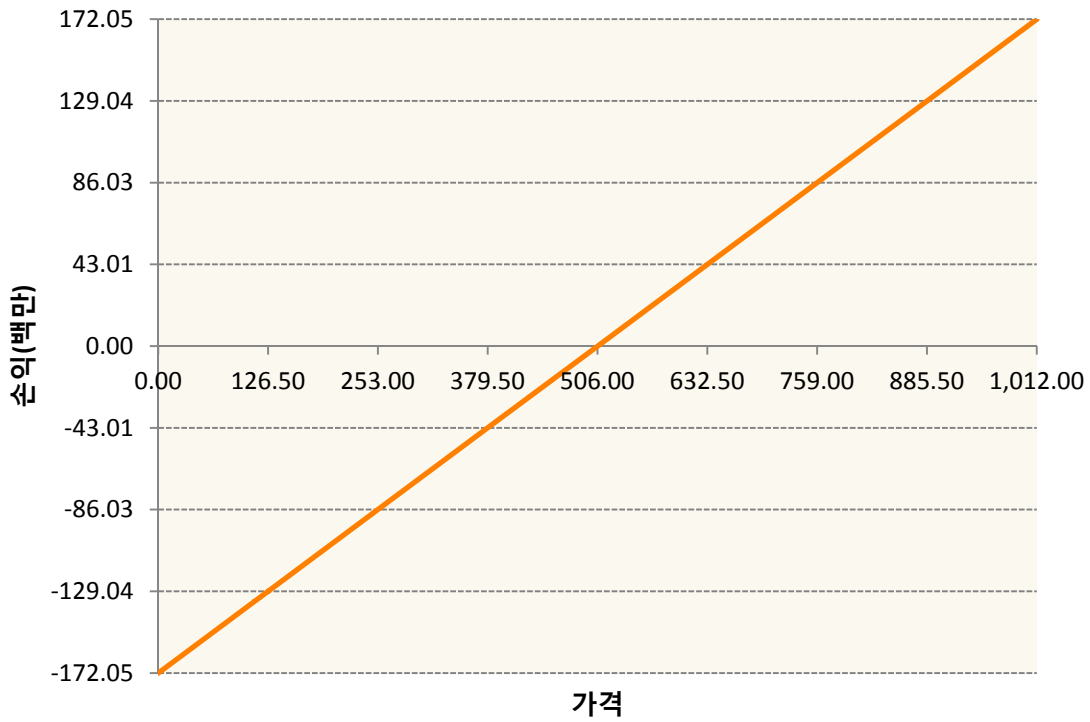




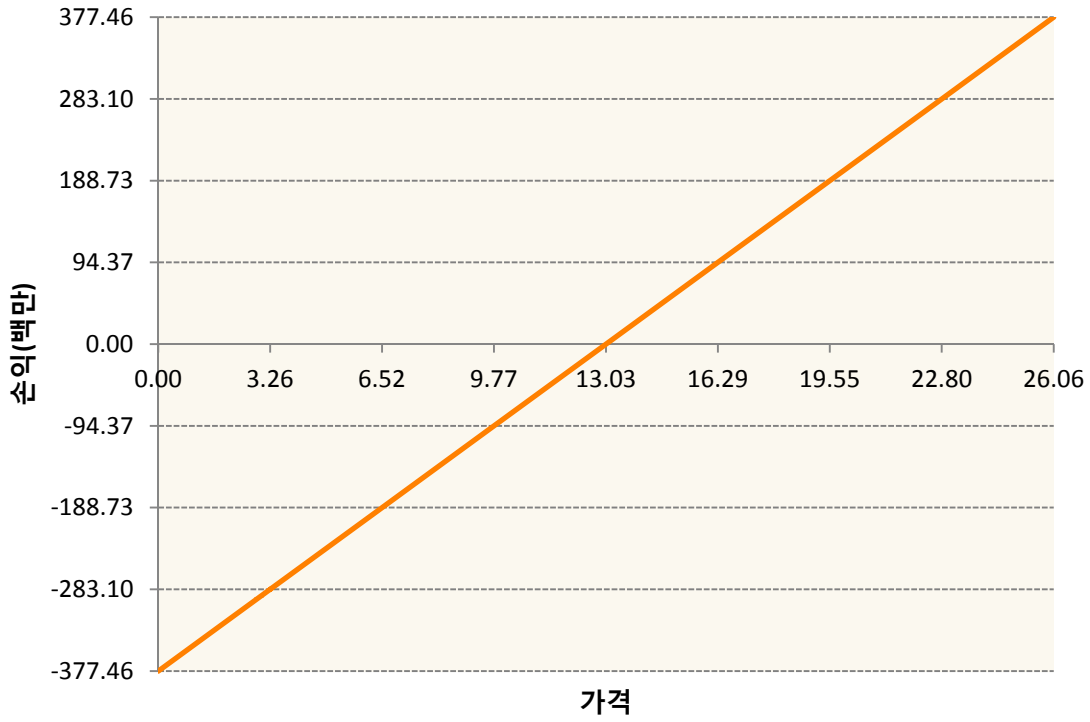
KR4175P20002-2019-02 달러선물



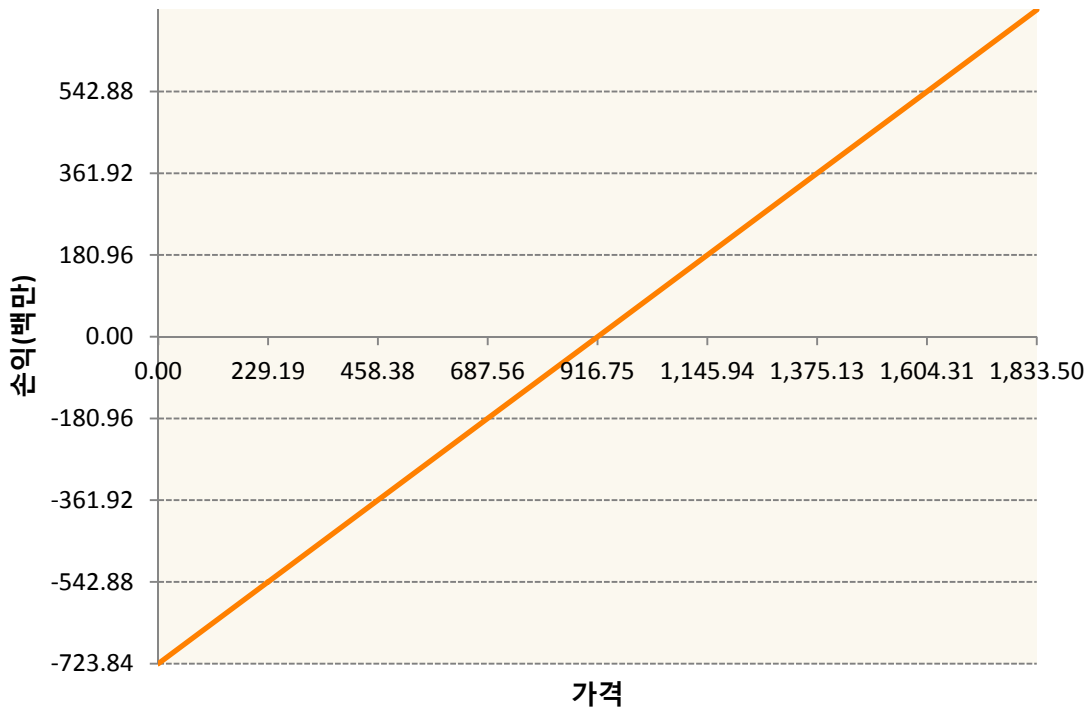
KWH9-KC HRW WHEAT FUT Mar19



SBH9-SUGAR #11 (WORLD) MAR19

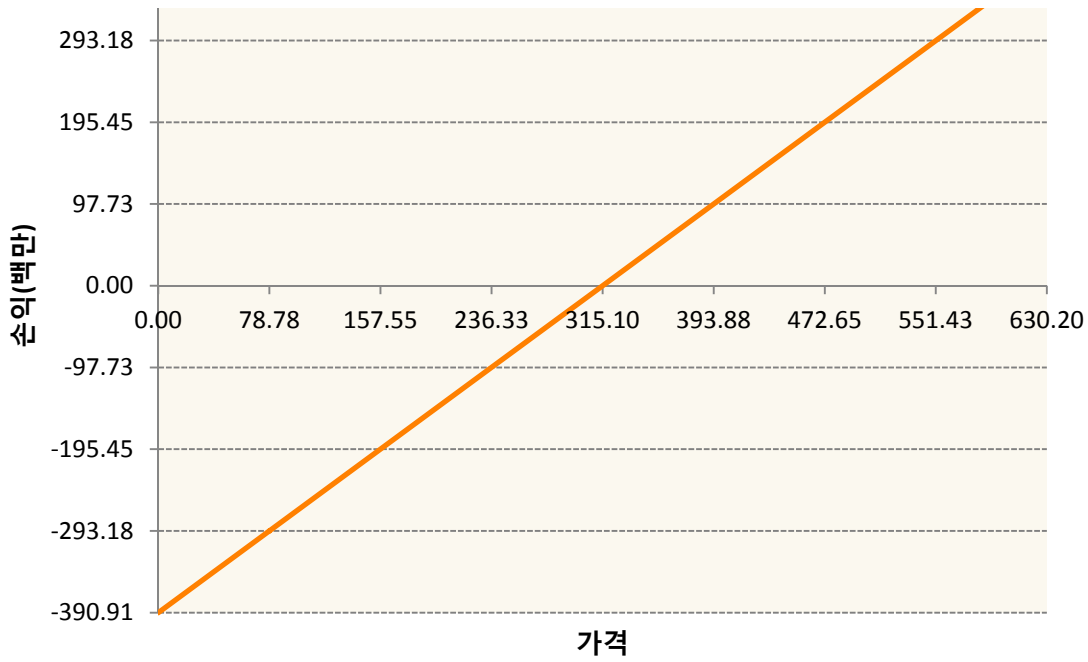


SH9-SOYBEAN FUTURE Mar19

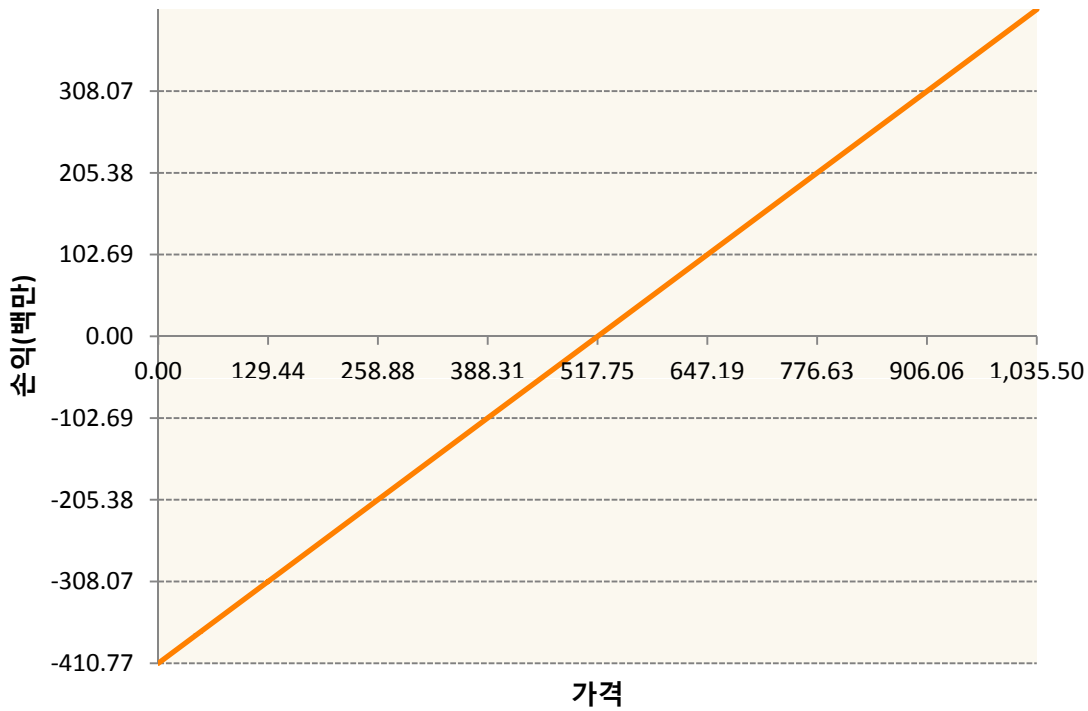


SMH9-SOYBEAN MEAL FUTR Mar19





WH9-WHEAT FUTURE(CBT) Mar19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

BOH9	SOYBEAN OIL FUTR Mar19	27
CH9	CORN FUTURE Mar19	61
CTH9	COTTON NO.2 FUTR Mar19	13
KCH9	COFFEE 'C' FUTURE Mar19	21
KR4175P200	2019-02 달러선물	6

KWH9	KC HRW WHEAT FUT Mar19	14
SBH9	SUGAR #11 (WORLD) MAR19	30
SH9	SOYBEAN FUTURE Mar19	58
SMH9	SOYBEAN MEAL FUTR Mar19	31
WH9	WHEAT FUTURE(CBT) Mar19	33

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

(단위:백만원)

**295**