

공시일	2019-01-24
기준일	2019-01-23

## 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	2019-01-24
기준일	2019-01-23

## 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

1,053

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

597

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-01-24
기준일	2019-01-23

## 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)

SWCSI50000 신한CSI500미래S180910

266
-----

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

397
-----

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-01-24
기준일	2019-01-23

## 유로인덱스모(주식-파생형)

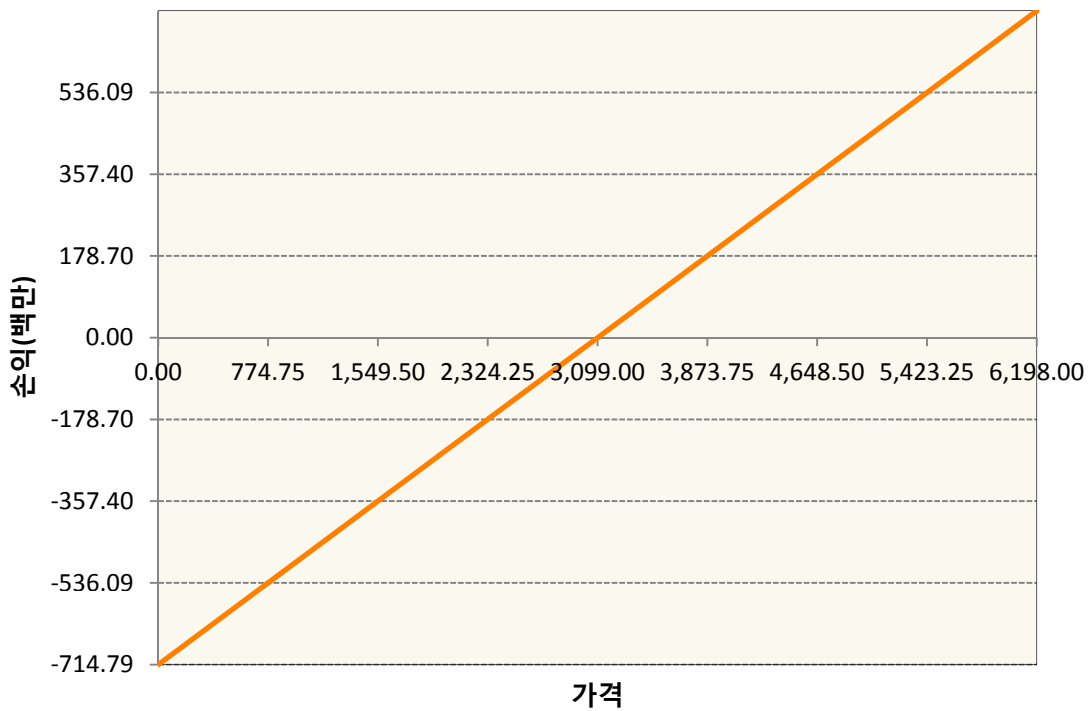
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	715	0	715	

### 2. 만기시점의 손익구조

VGH9-EURO STOXX 50 Mar19



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

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

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

(단위:백만원)

39
----

공시일	2019-01-24
기준일	2019-01-23

## 차이나인덱스모(주식-파생형)

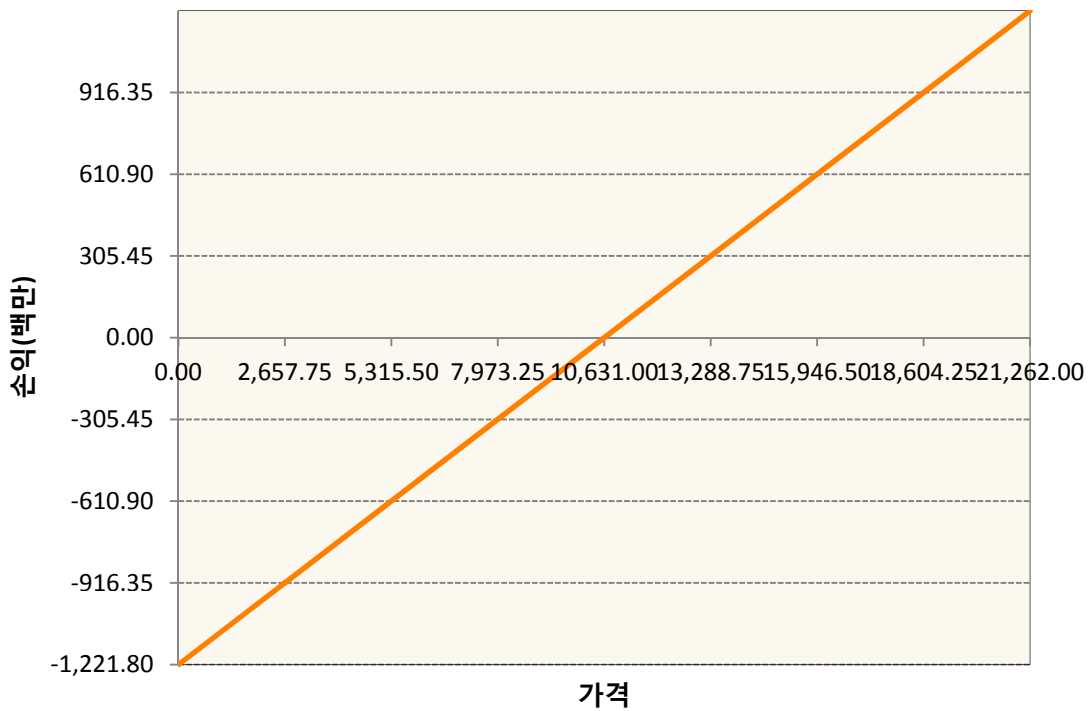
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

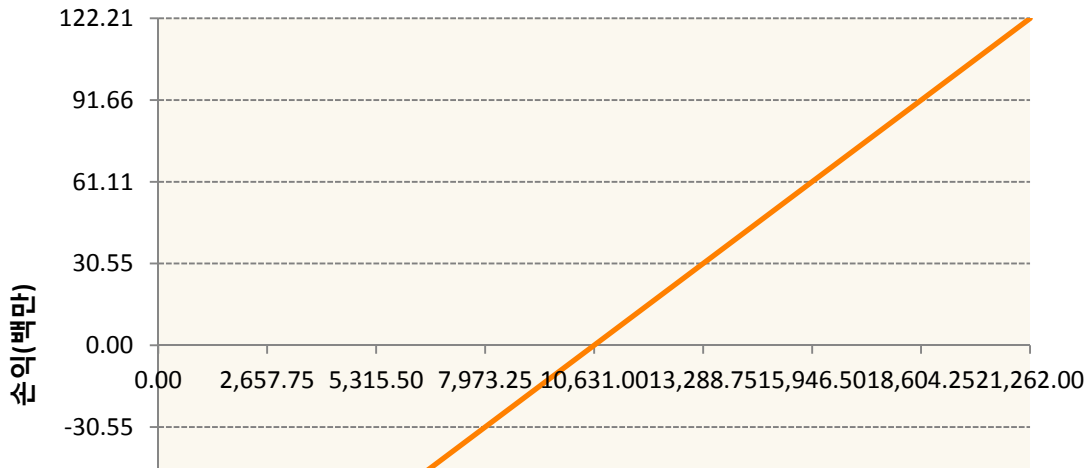
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,344	0	1,344	장내

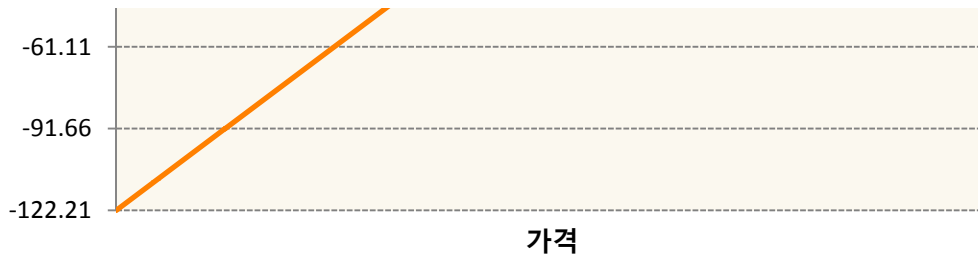
### 2. 만기시점의 손익구조

HCF9-HSCEI FUTURES JAN19



MHCF9-MINI H-SHR IDX FU JAN19





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

HCF9	HSCEI FUTURES JAN19	98
MHCF9	MINI H-SHR IDX FU JAN19	10

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

<b>110</b>
------------

공시일	2019-01-24
기준일	2019-01-23

## 커버드콜모(주식혼합-파생형)

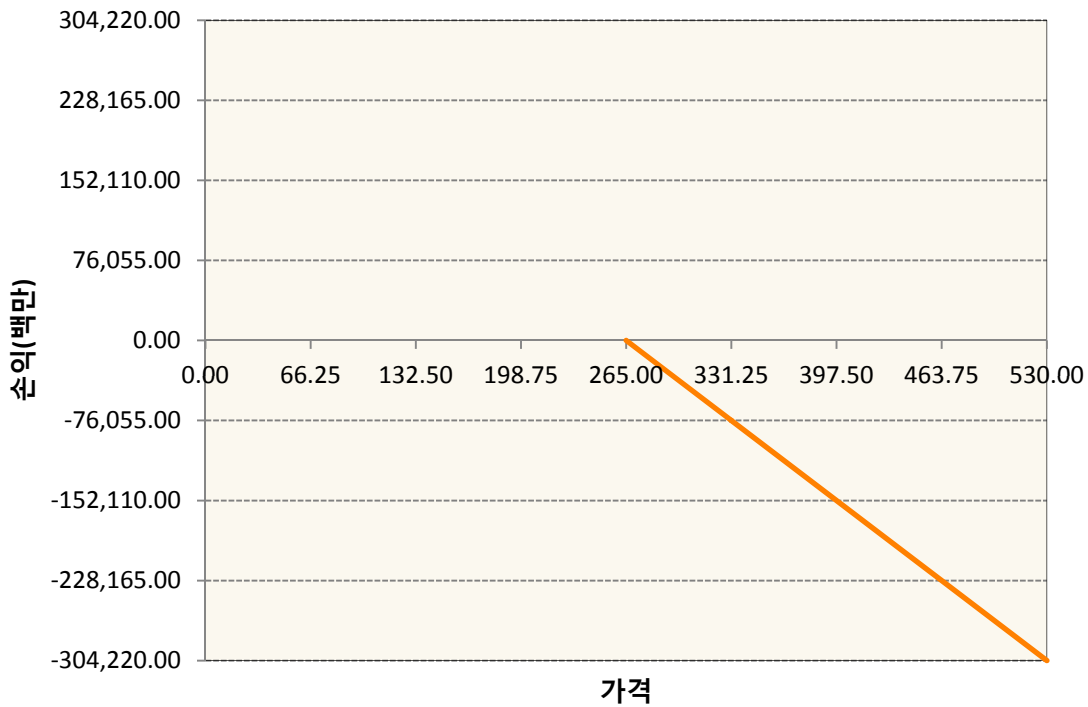
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

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

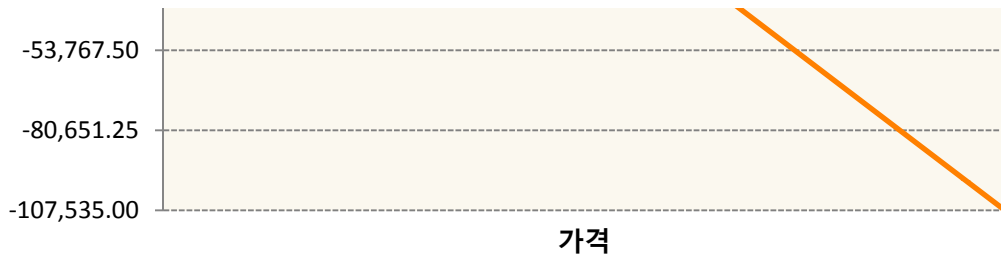
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4201P22655-2019-02 콜265

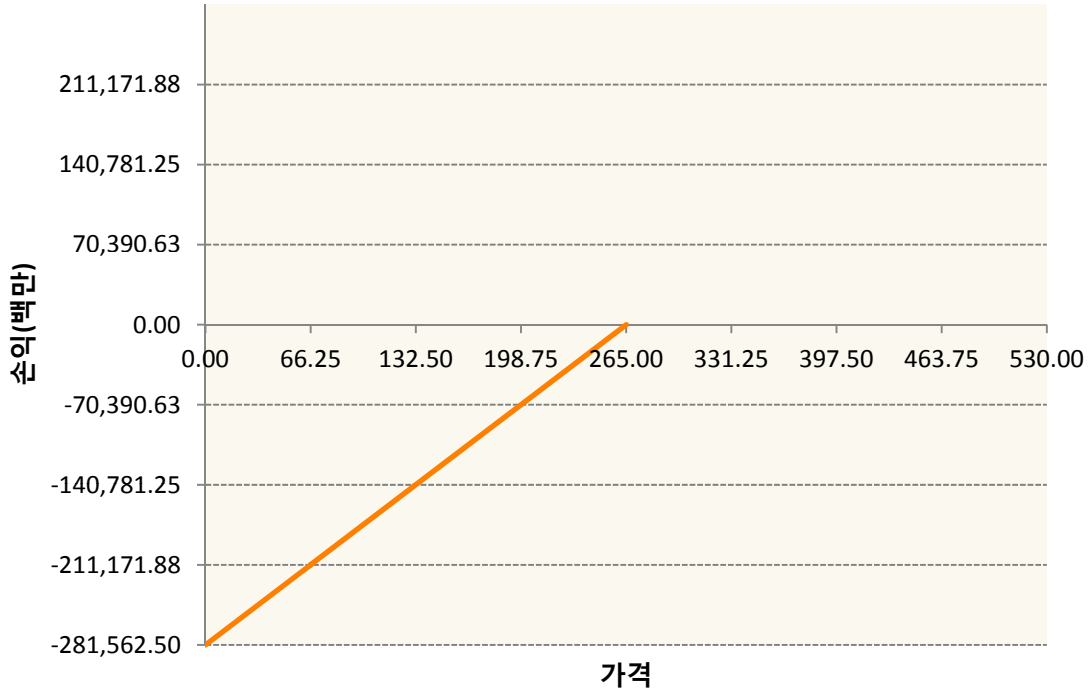


KR4201P22671-2019-02 콜267.5





KR4301P22653-2019-02 풋265



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201P22655		2019-02 콜265					22,334
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	12,921	12,542	12,126	11,682	11,213	10,725	10,220
-5.33%	10,946	10,368	9,780	9,184	8,583	7,977	7,367
-2.67%	7,216	6,577	5,937	5,296	4,655	4,014	3,373
0%	1,635	1,109	563	0	-576	-1,162	-1,756
2.67%	-5,377	-5,706	-6,079	-6,490	-6,932	-7,400	-7,890
5.33%	-13,217	-13,378	-13,585	-13,838	-14,131	-14,461	-14,823
8.00%	-21,424	-21,486	-21,582	-21,714	-21,884	-22,092	-22,334
KR4201P22671		2019-02 콜267.5					7,580
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	3,981	3,873	3,749	3,613	3,467	3,311	3,149

-5.33%	3,452	3,268	3,077	2,881	2,681	2,478	2,273
-2.67%	2,367	2,141	1,915	1,689	1,463	1,237	1,011
0%	628	422	213	0	-215	-432	-651
2.67%	-1,674	-1,816	-1,971	-2,137	-2,311	-2,493	-2,681
5.33%	-4,336	-4,412	-4,506	-4,615	-4,737	-4,872	-5,016
8.00%	-7,176	-7,208	-7,255	-7,315	-7,390	-7,479	-7,580
KR4301P22653                      2019-02 풋265							13,618
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-12,868	-12,940	-13,036	-13,153	-13,290	-13,446	-13,618
-5.33%	-5,938	-6,192	-6,458	-6,735	-7,021	-7,313	-7,611
-2.67%	-1,266	-1,600	-1,935	-2,271	-2,608	-2,946	-3,284
0%	601	422	221	0	-236	-486	-747
2.67%	987	945	884	801	699	576	436
5.33%	1,027	1,022	1,012	994	965	924	869
8.00%	1,029	1,028	1,027	1,025	1,019	1,010	994

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

(단위:백만원)

**42,104**

공시일	2019-01-24
기준일	2019-01-23

## 홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

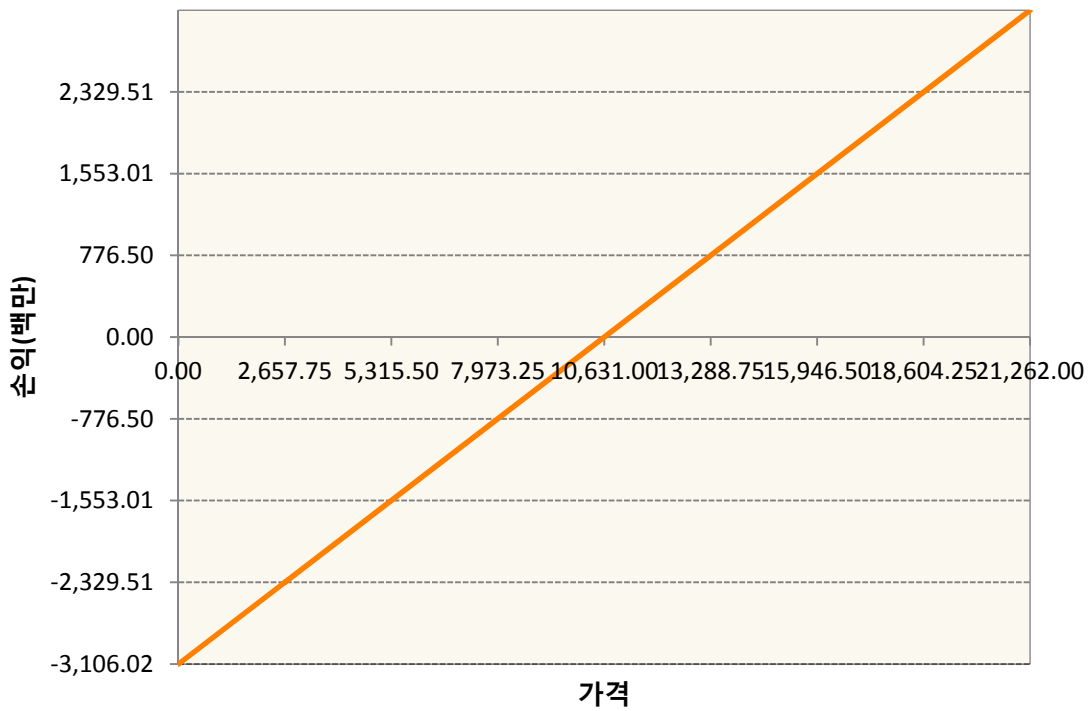
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

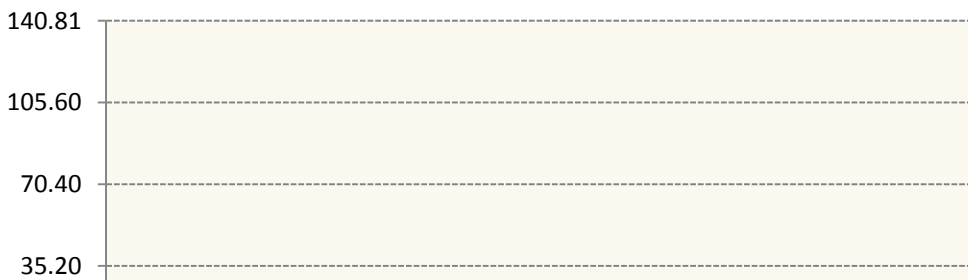
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	3,106	0	3,106	장내
누계	유가증권	옵션	0	7,035	-7,035	장내
누계	통화	선도	0	2,730	-2,730	장외

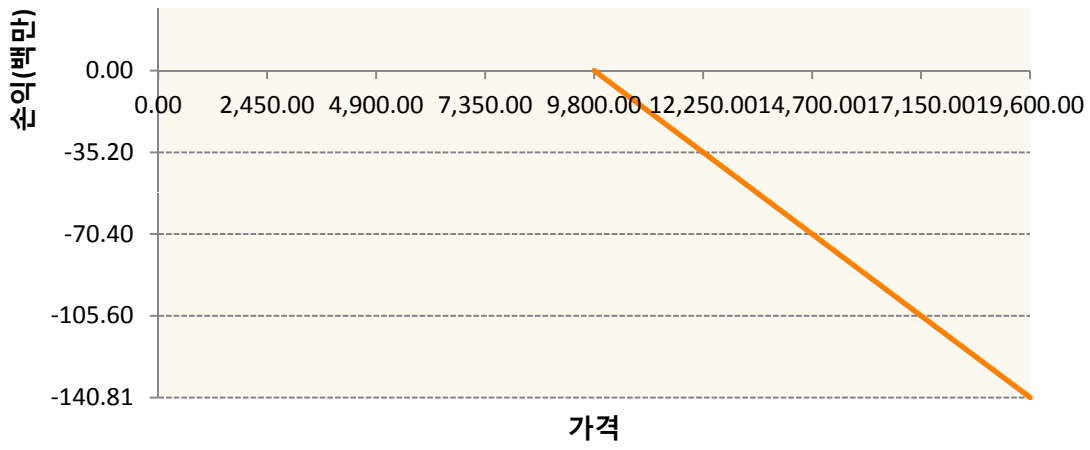
### 2. 만기시점의 손익구조

HCF9-HSCEI FUTURES JAN19

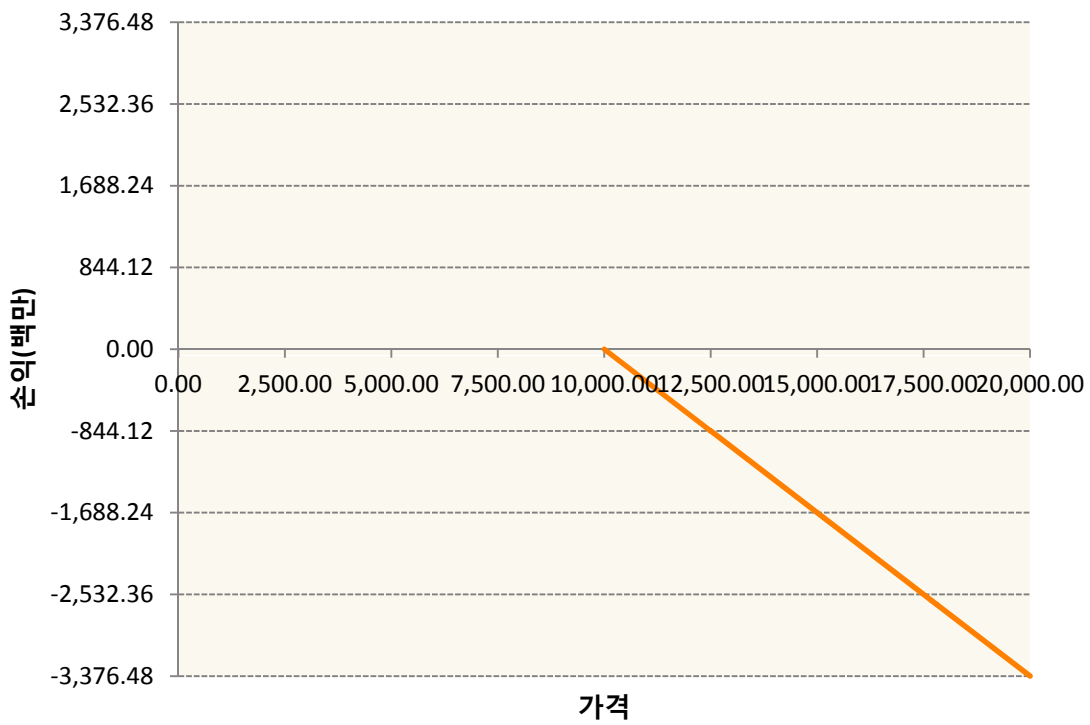


OHHIF9-C098-HSCEI

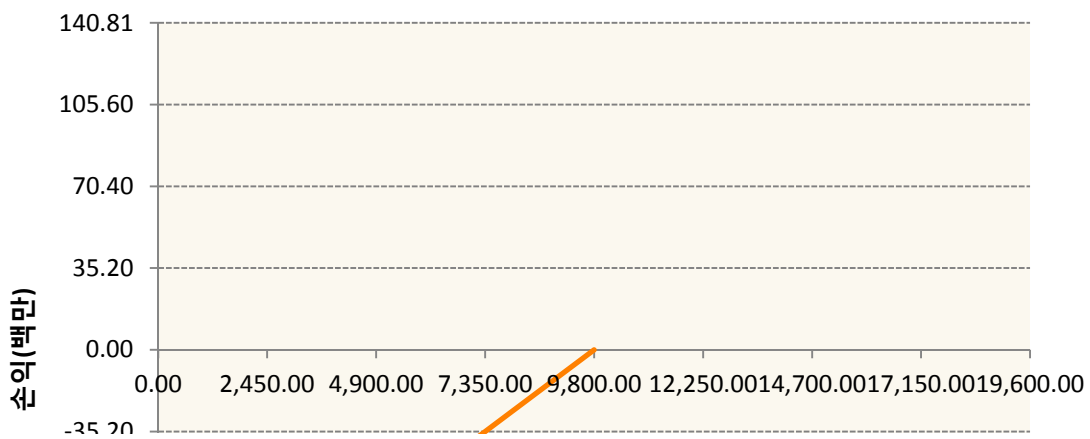


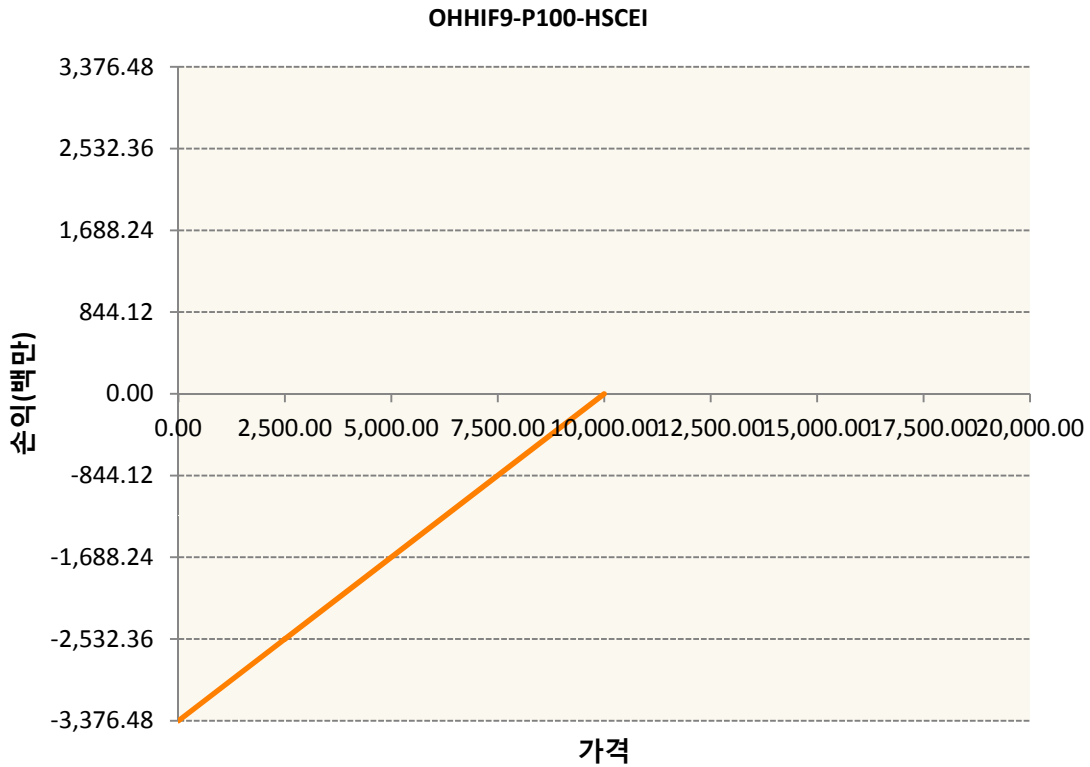
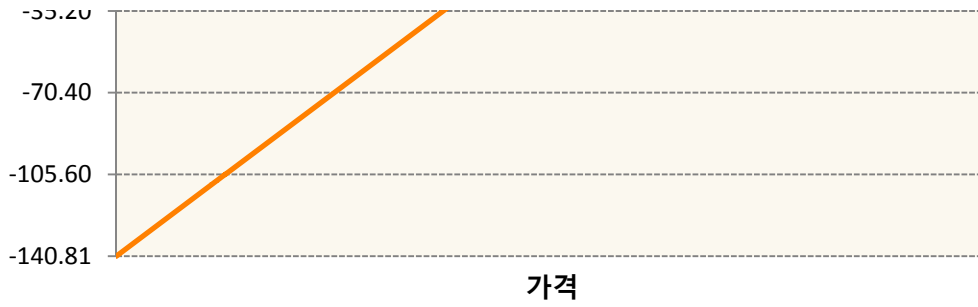


**OHHIF9-C100-HSCEI**



**OHHIF9-P098-HSCEI**





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)	(단위:백만원)
FX21018Z00 KRW/HKD 11-03-19E	218
HCF9 HSCEI FUTURES JAN19	248
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)
	914

공시일	2019-01-24
기준일	2019-01-23

## 코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

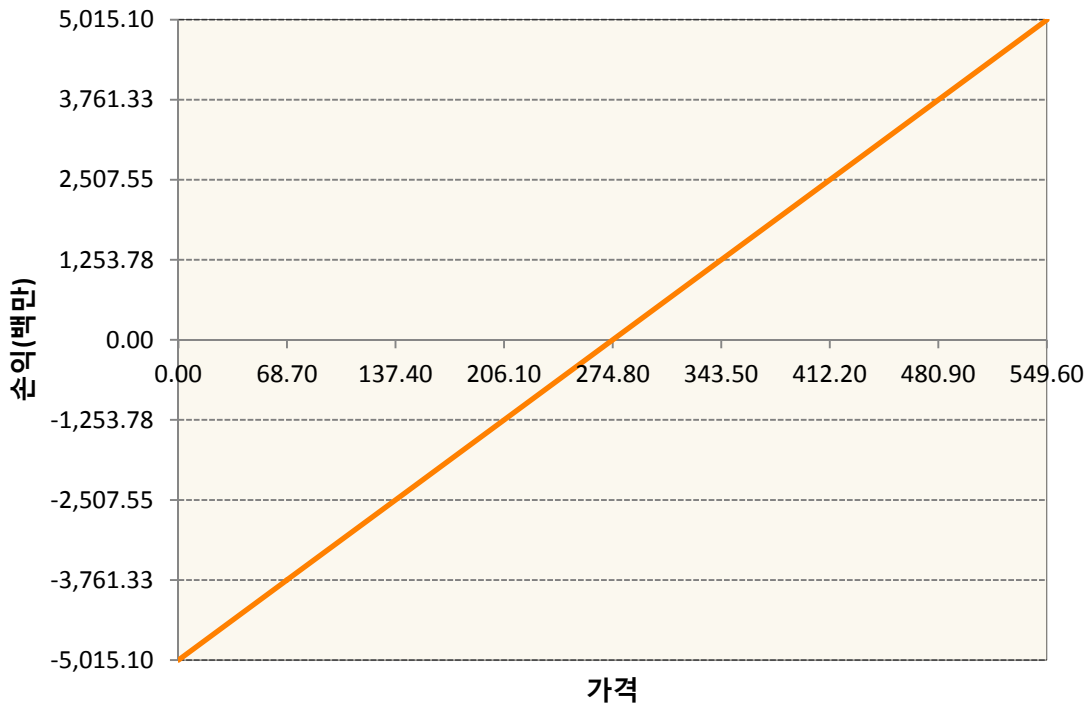
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

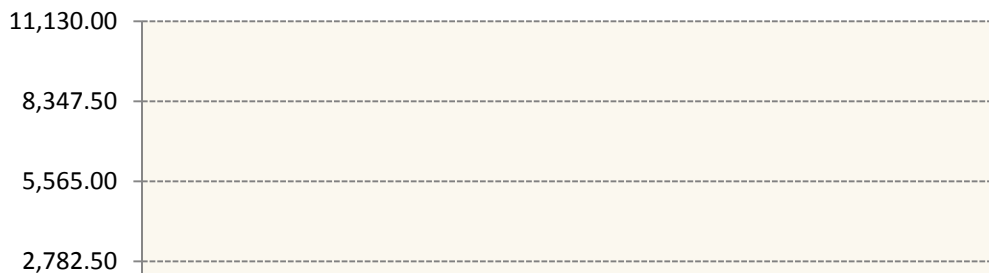
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	206	-206	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	5,015	0	5,015	장내
누계	유가증권	스왑	31,836	0	31,836	장외
누계	유가증권	옵션	0	33,858	-33,858	장내

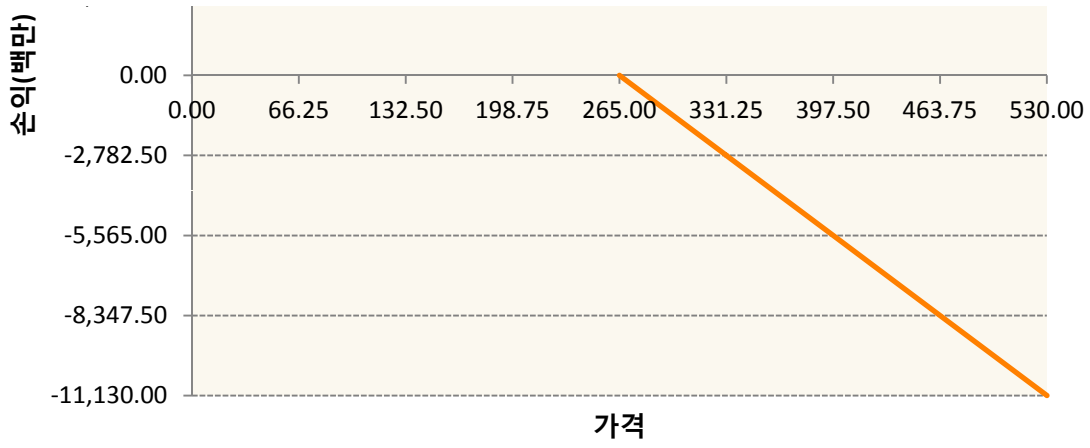
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101P30007-2019-03 코스피200지수선물

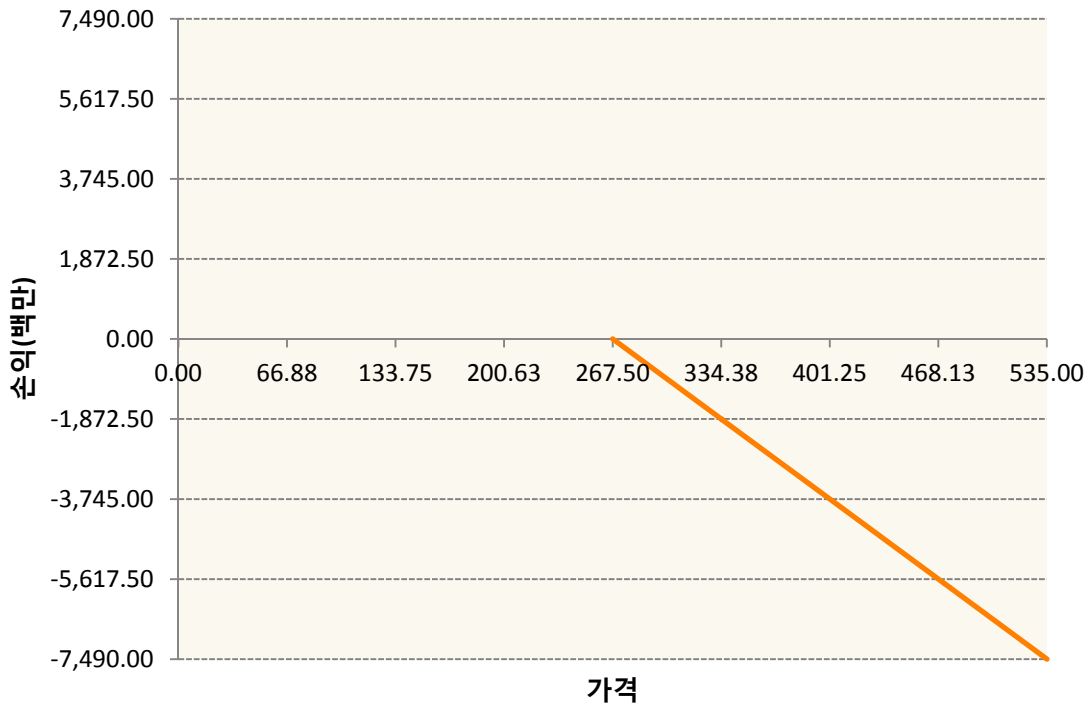


KR4201P22655-2019-02 콜265

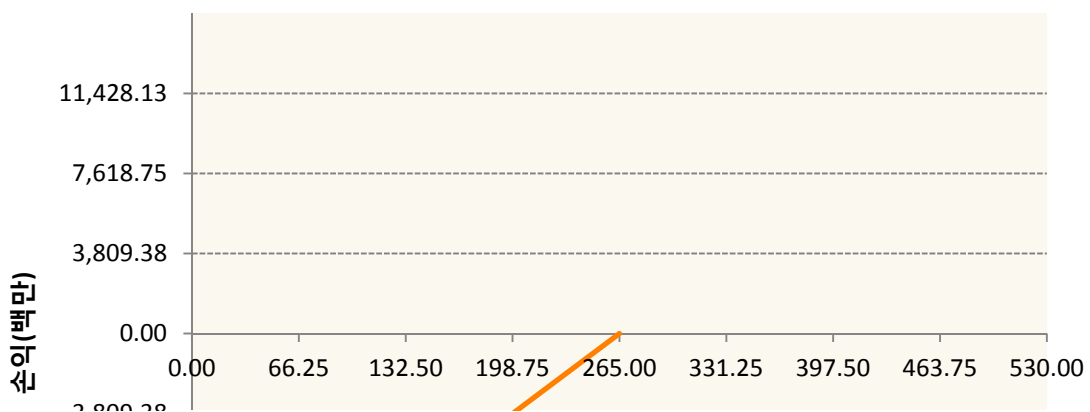


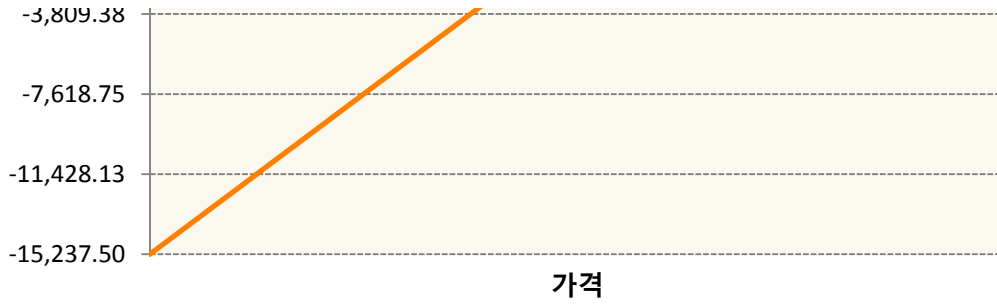


KR4201P22671-2019-02 콜267.5



KR4301P22653-2019-02 풋265





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

2.529E+11		UBCSFXC1 INDEX_14						2,662
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-2,662	-2,662	-2,662	-2,662	-2,662	-2,662	-2,662	
-5.33%	-1,774	-1,774	-1,774	-1,774	-1,774	-1,774	-1,774	
-2.67%	-887	-887	-887	-887	-887	-887	-887	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	887	887	887	887	887	887	887	
5.33%	1,774	1,774	1,774	1,774	1,774	1,774	1,774	
8.00%	2,662	2,662	2,662	2,662	2,662	2,662	2,662	
KR4101P30007		2019-03 코스피200지수선물						400
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-400	-400	-400	-400	-400	-400	-400	
-5.33%	-267	-267	-267	-267	-267	-267	-267	
-2.67%	-133	-133	-133	-133	-133	-133	-133	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	133	133	133	133	133	133	133	
5.33%	267	267	267	267	267	267	267	
8.00%	400	400	400	400	400	400	400	
KR4201P22655		2019-02 콜265						817
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	473	459	444	427	410	392	374	
-5.33%	400	379	358	336	314	292	270	
-2.67%	264	241	217	194	170	147	123	
0%	60	41	21	0	-21	-43	-64	
2.67%	-197	-209	-222	-237	-254	-271	-289	
5.33%	-484	-489	-497	-506	-517	-529	-542	
8.00%	-784	-786	-790	-794	-801	-808	-817	
KR4201P22671		2019-02 콜267.5						528
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	

-8.00%	277	270	261	252	241	231	219
-5.33%	240	228	214	201	187	173	158
-2.67%	165	149	133	118	102	86	70
0%	44	29	15	0	-15	-30	-45
2.67%	-117	-126	-137	-149	-161	-174	-187
5.33%	-302	-307	-314	-321	-330	-339	-349
8.00%	-500	-502	-505	-510	-515	-521	-528
KR4301P22653                      2019-02 풋265							737
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-696	-700	-705	-712	-719	-728	-737
-5.33%	-321	-335	-349	-364	-380	-396	-412
-2.67%	-69	-87	-105	-123	-141	-159	-178
0%	33	23	12	0	-13	-26	-40
2.67%	53	51	48	43	38	31	24
5.33%	56	55	55	54	52	50	47
8.00%	56	56	56	55	55	55	54

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

(단위:백만원)

**5,008**

공시일	2019-01-24
기준일	2019-01-23

## 유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

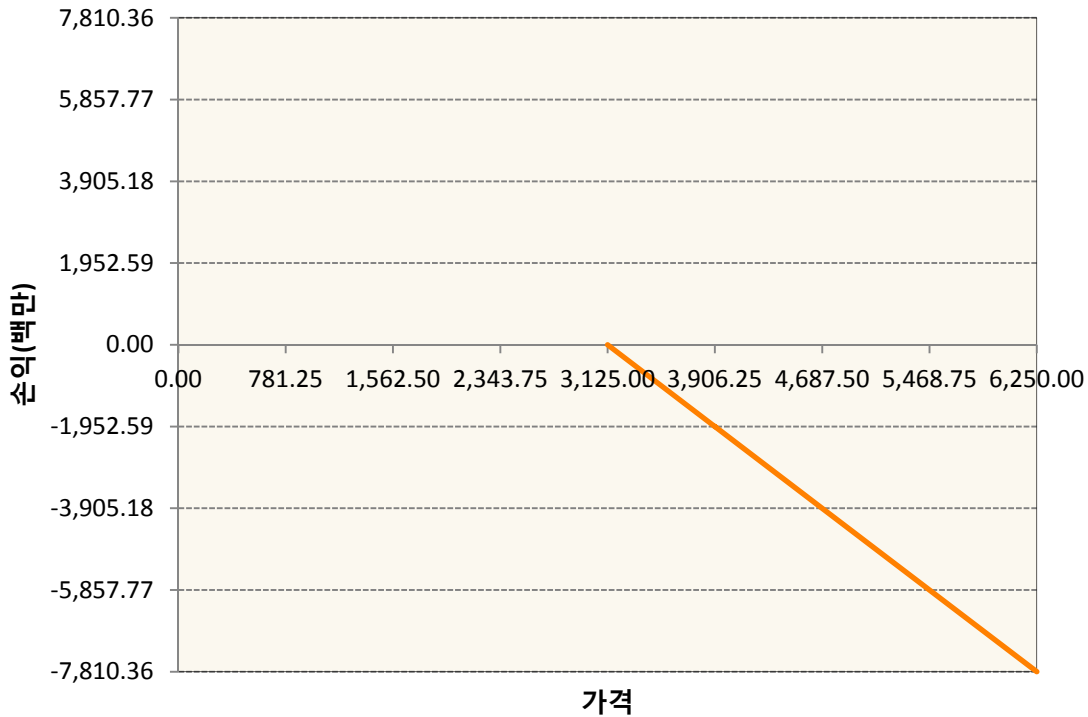
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

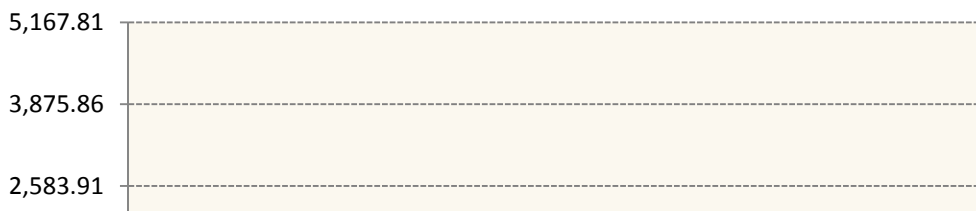
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	6,709	0	6,709	
누계	유가증권	스왑	60,509	0	60,509	장외
누계	유가증권	옵션	0	25,956	-25,956	장내
누계	통화	선도	0	15,380	-15,380	장외

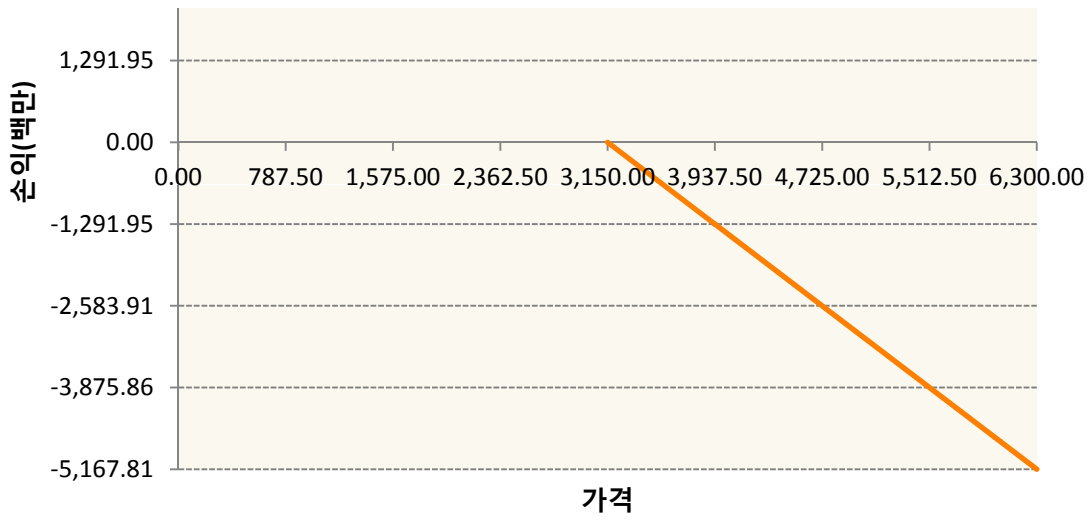
### 2. 만기시점의 손익구조

**OESXG9-C3125-EURO STOXX 50**

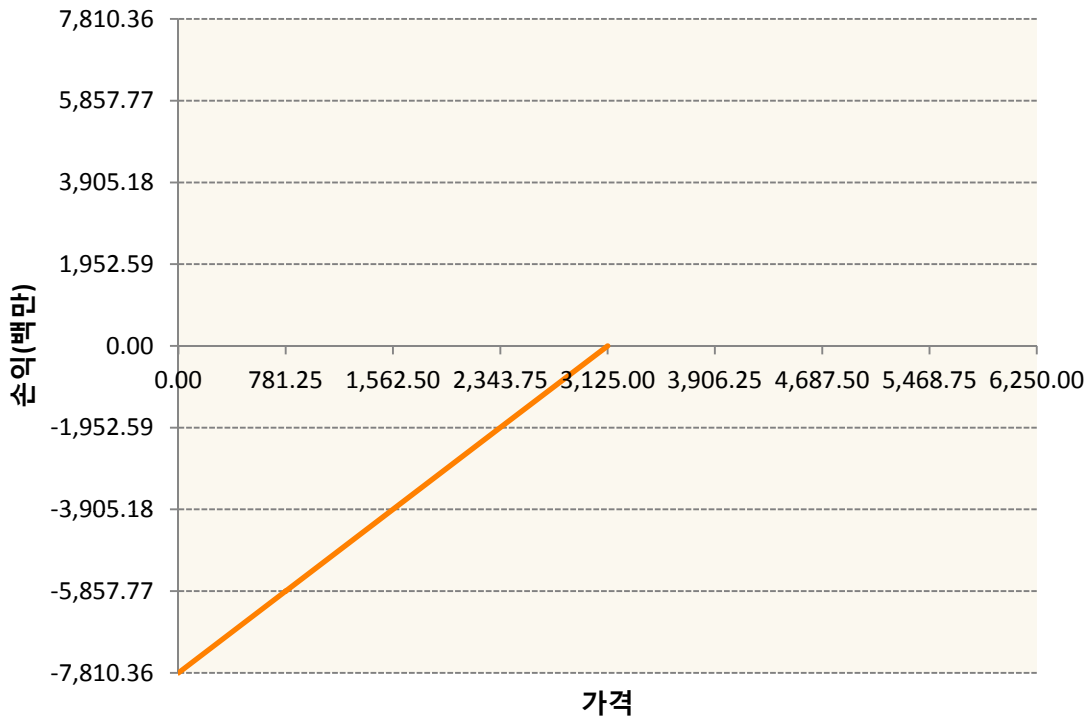


**OESXG9-C3150-EURO STOXX 50**

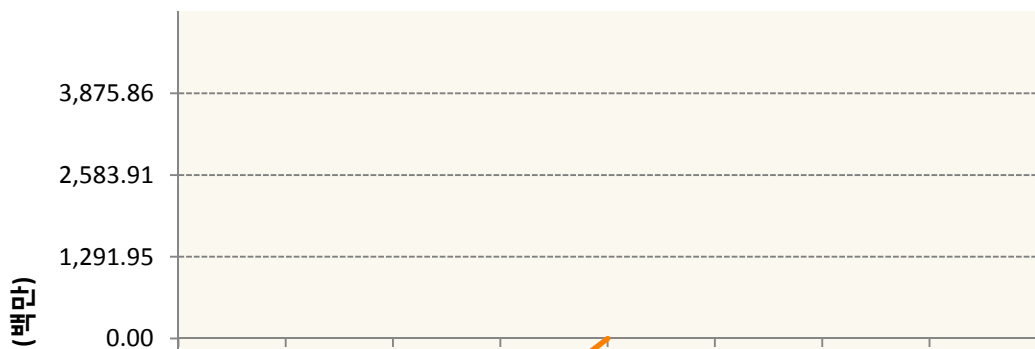


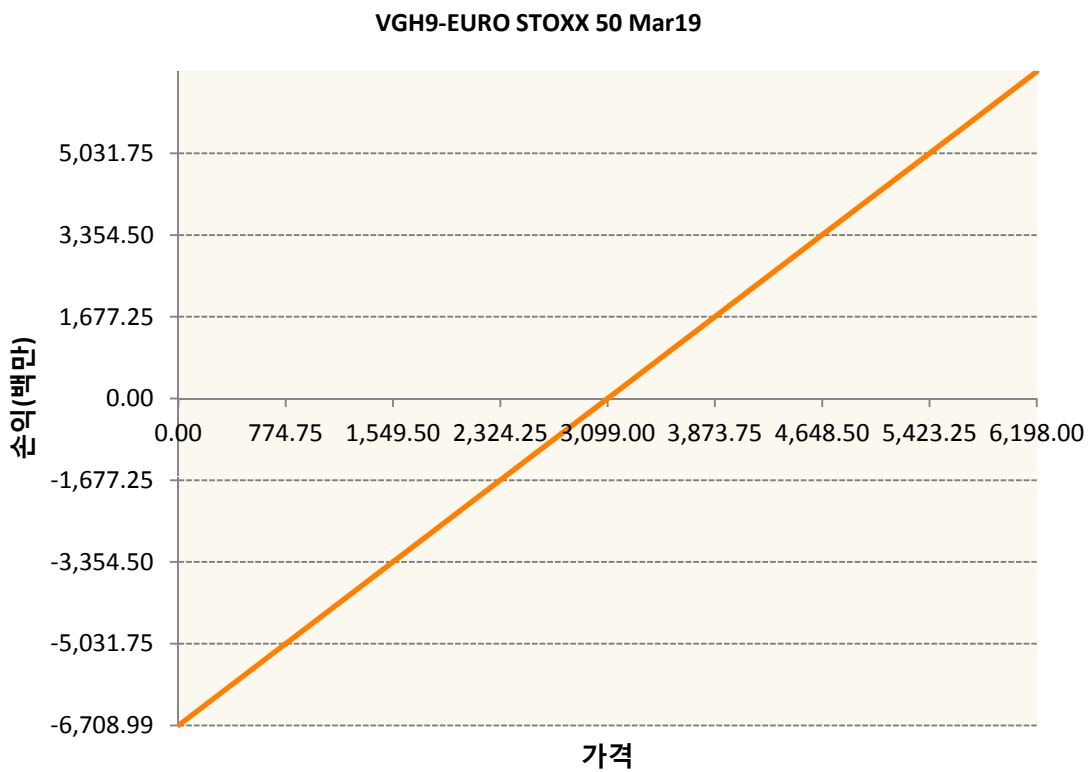
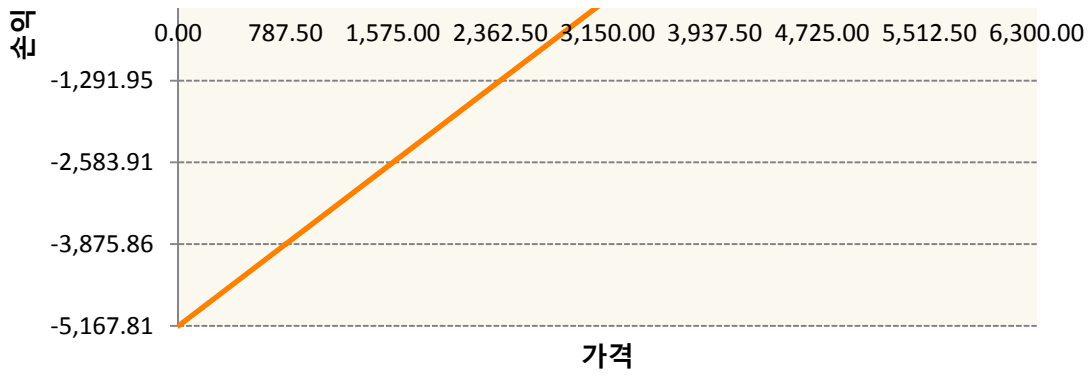


**OESXG9-P3125-EURO STOXX 50**



**OESXG9-P3150-EURO STOXX 50**





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY		18
FX21018X02 KRW/EUR 22-02-19E		410
FX21018Z03 KRW/EUR 22-03-19E		820
OESXG9-C31EURO STOXX 50		625
OESXG9-C31EURO STOXX 50		413
OESXG9-P31EURO STOXX 50		625
OESXG9-P31EURO STOXX 50		413
VGH9	EURO STOXX 50 Mar19	537

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

(단위:백만원)

2,494



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

(단위:백만원)

1,131



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

(단위:백만원)

96



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

(단위:백만원)

144



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

(단위:백만원)

43

공시일	2019-01-24
기준일	2019-01-23

## 리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

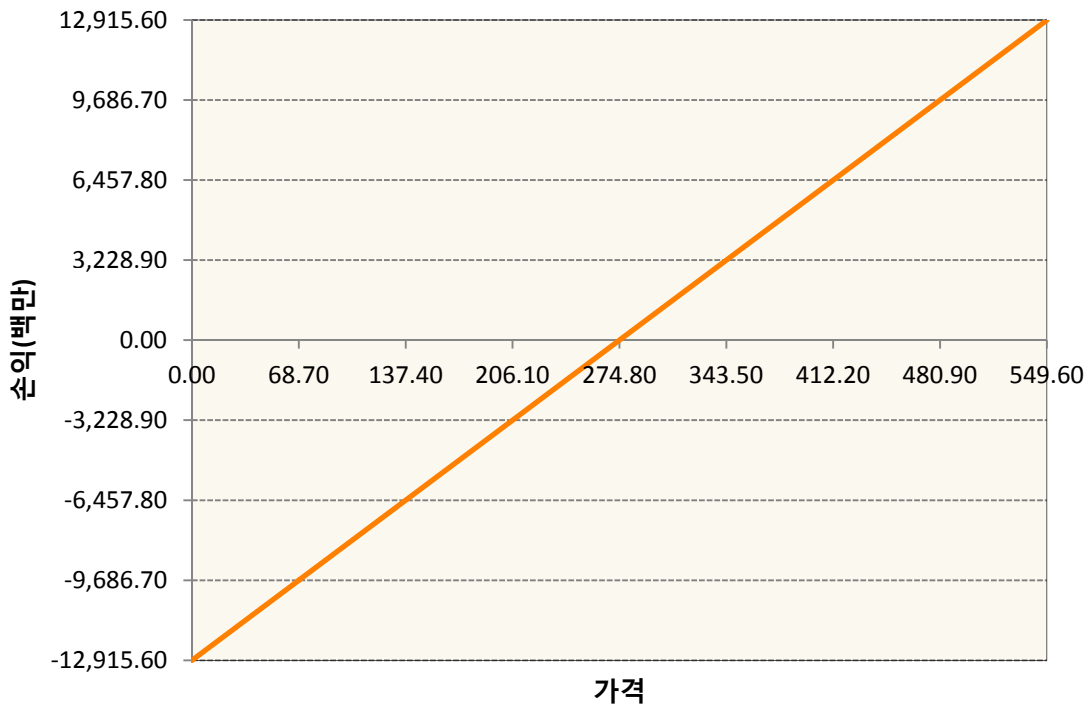
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

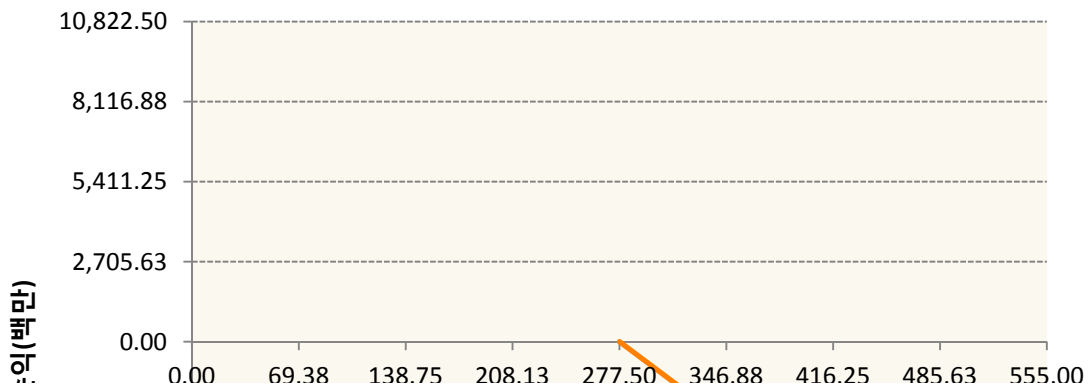
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	12,916	0	12,916	장내
누계	유가증권	옵션	2,523	23,213	-20,690	장내

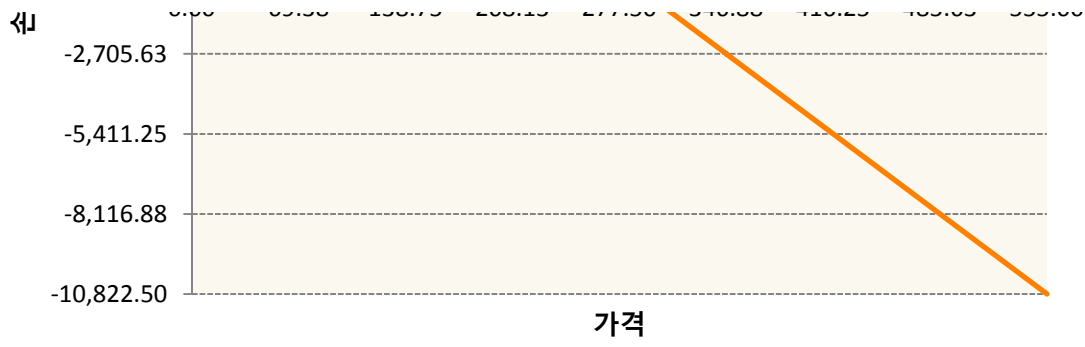
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101P30007-2019-03 코스피200지수선물

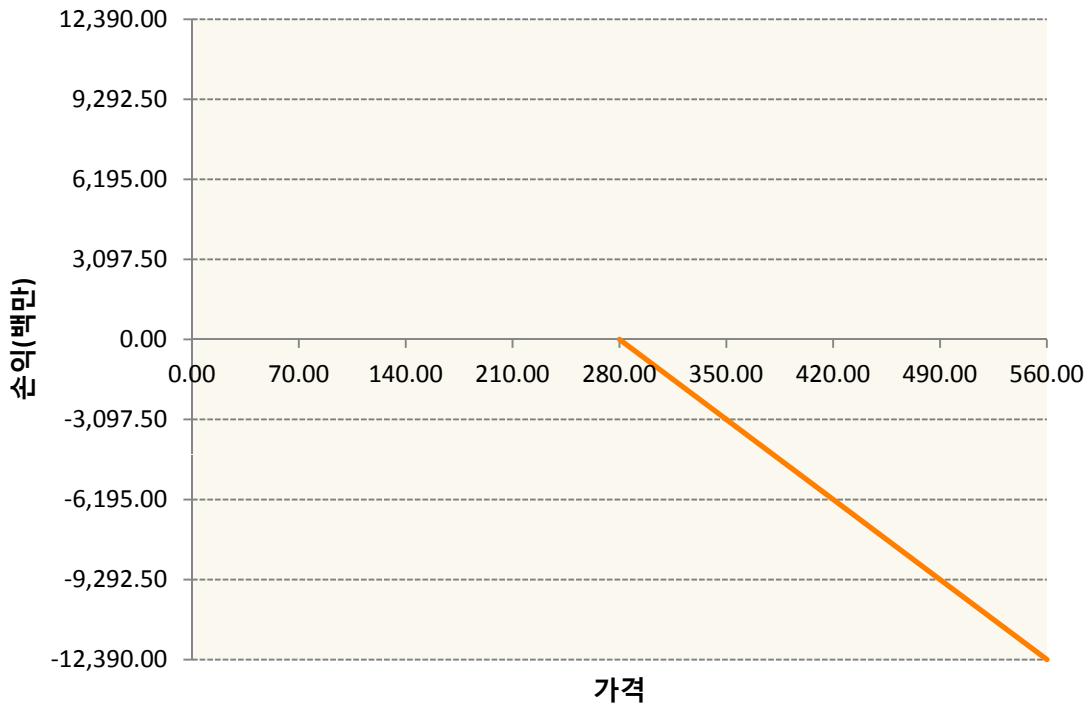


KR4201P22770-2019-02 콜277.5

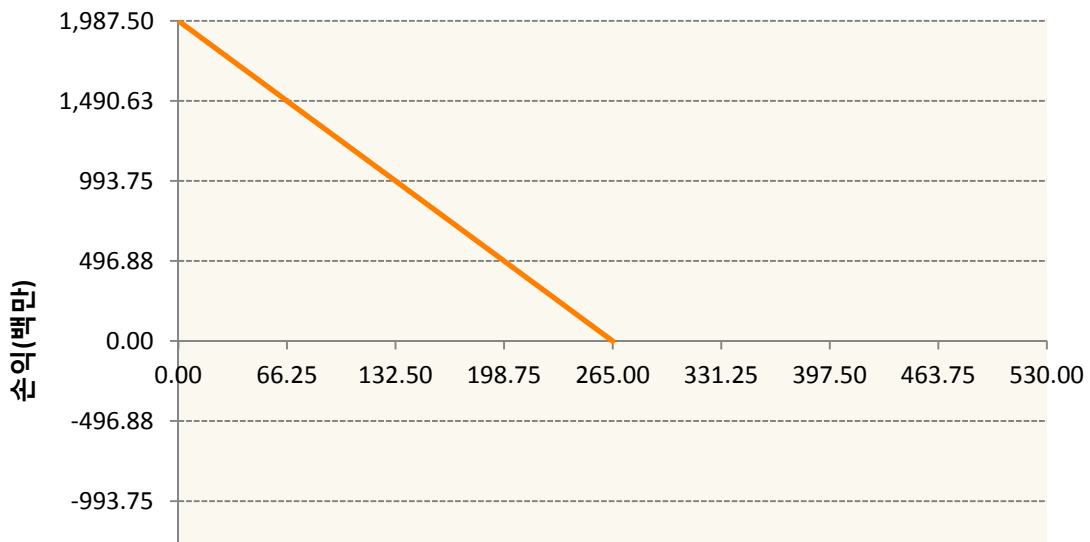


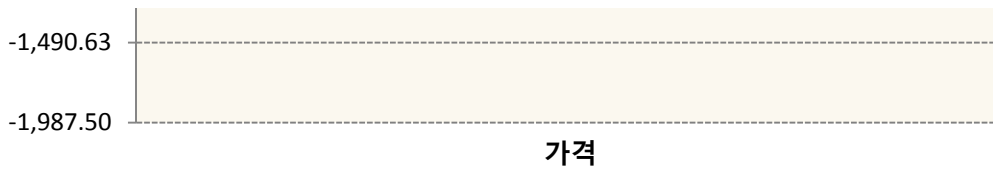


KR4201P22804-2019-02 콜280

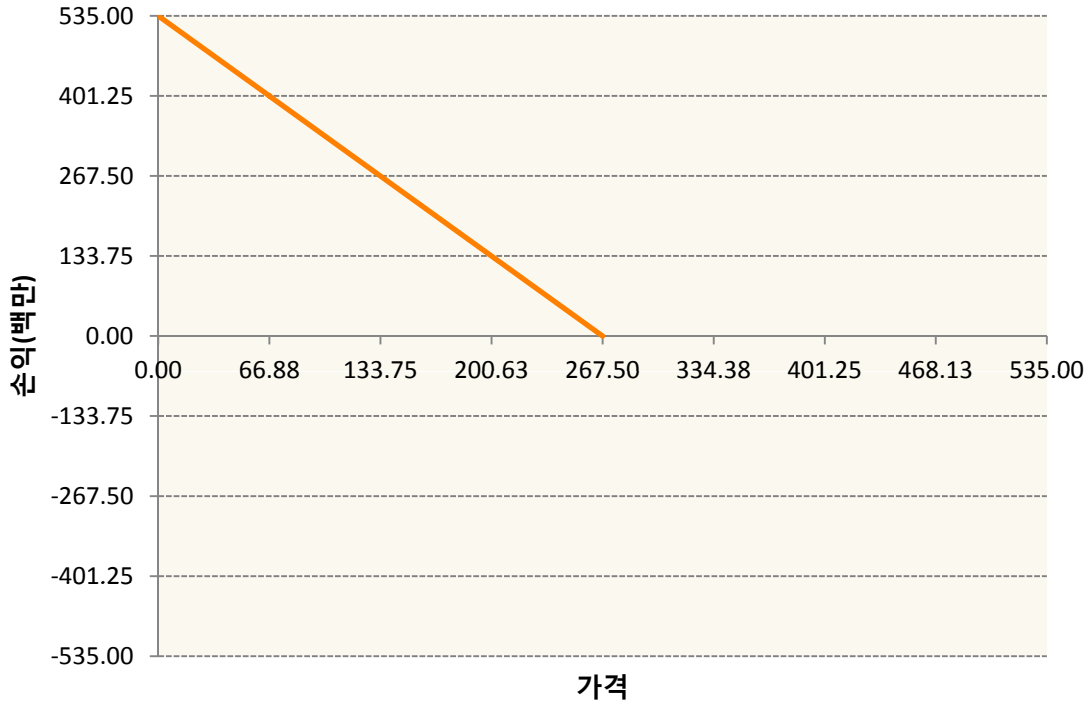


KR4301P22653-2019-02 풋265





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						611
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	204	201	196	190	182	173	163	
-5.33%	191	182	171	159	146	132	117	
-2.67%	152	135	118	100	81	62	43	

0%	66	44	22	0	-22	-45	-67
2.67%	-79	-101	-124	-146	-169	-191	-214
5.33%	-283	-300	-318	-337	-357	-377	-397
8.00%	-528	-538	-551	-564	-579	-595	-611
KR4201P22804                      2019-02 콜280							652
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	191	189	185	179	172	164	154
-5.33%	181	173	164	152	140	125	110
-2.67%	149	133	116	97	78	58	37
0%	72	48	24	0	-24	-49	-74
2.67%	-70	-96	-122	-148	-174	-200	-226
5.33%	-279	-301	-324	-347	-371	-396	-420
8.00%	-543	-557	-574	-592	-611	-631	-652
KR4301P22653                      2019-02 풋265							96
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	91	91	92	93	94	95	96
-5.33%	42	44	46	48	50	52	54
-2.67%	9	11	14	16	18	21	23
0%	-4	-3	-2	0	2	3	5
2.67%	-7	-7	-6	-6	-5	-4	-3
5.33%	-7	-7	-7	-7	-7	-7	-6
8.00%	-7	-7	-7	-7	-7	-7	-7
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	29	29
-5.33%	14	15	15	15	16	16	17
-2.67%	4	4	5	6	6	7	8
0%	-1	-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)

**2,124**

공시일	2019-01-24
기준일	2019-01-23

## 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	626	0	626	

### 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	2019-01-24
기준일	2019-01-23

## H2O글로벌본드(UH)(채권혼합-파

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	101	0	101	
누계	유가증권	수익증권	2,874	0	2,874	

### 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	2019-01-24
기준일	2019-01-23

## H2O글로벌본드(H)(채권혼합-파생)

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	113	0	113	
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	수익증권	5,028	0	5,028	
누계	통화	선도	0	7,035	-7,035	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 KRW/USD 28-02-19E	58
FX21019F01 KRW/USD 28-02-19E	9
FX21019F01 KRW/USD 28-02-19E	32
FX21019F02 KRW/USD 25-02-19E	136

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

(단위:백만원)

213

공시일	2019-01-24
기준일	2019-01-23

## 스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

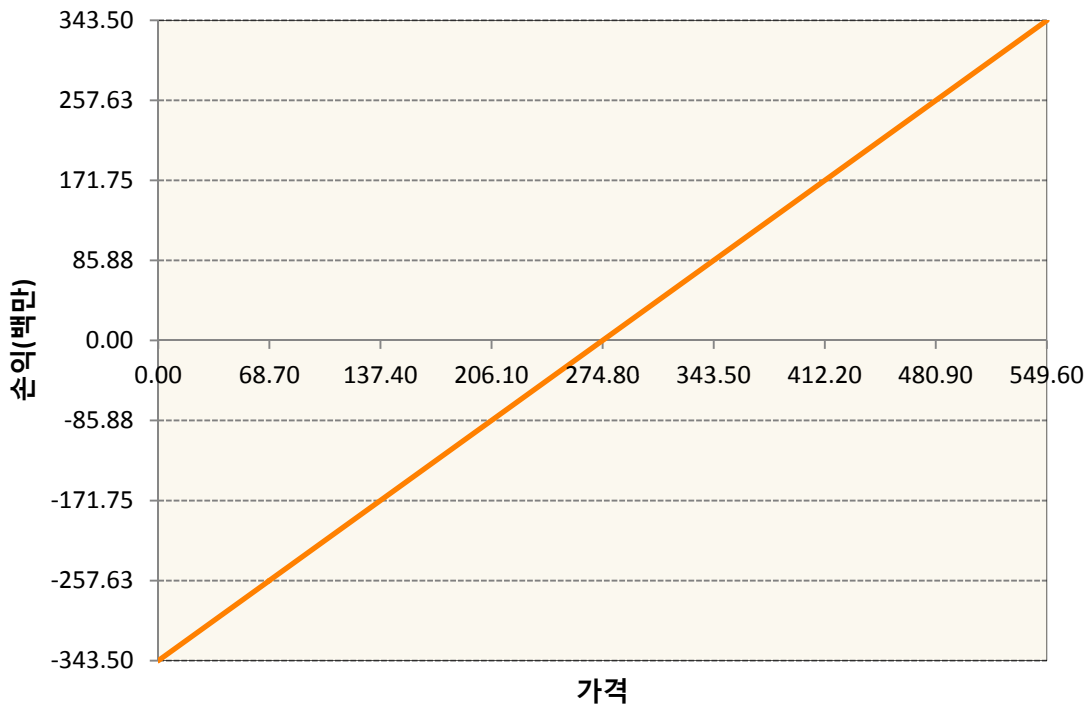
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

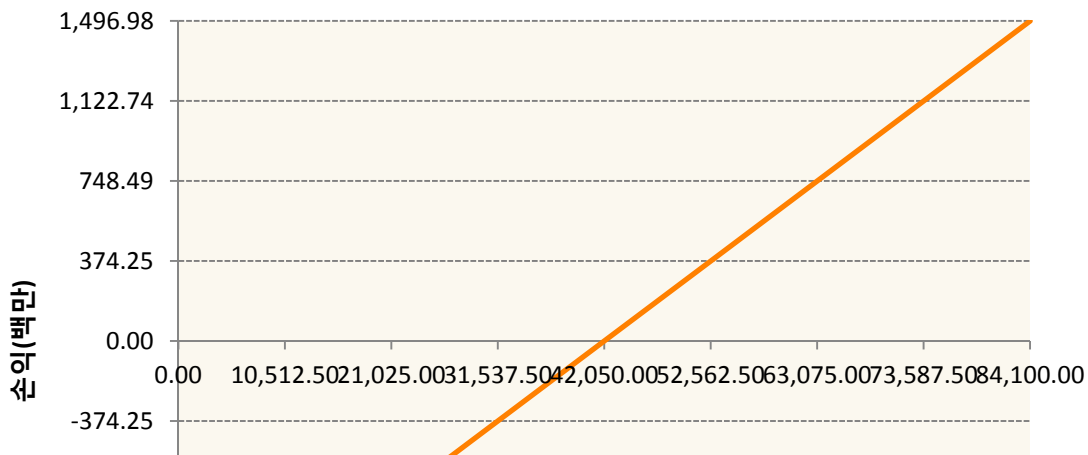
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,840	0	1,840	장내

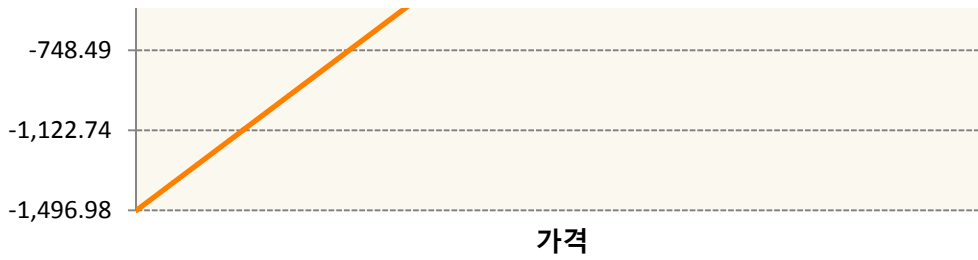
### 2. 만기시점의 손익구조

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						120
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-120	-120	-120	-120	-120	-120	-120	
-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%	120	120	120	120	120	120	120	

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

**160**

공시일	2019-01-24
기준일	2019-01-23

## 에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

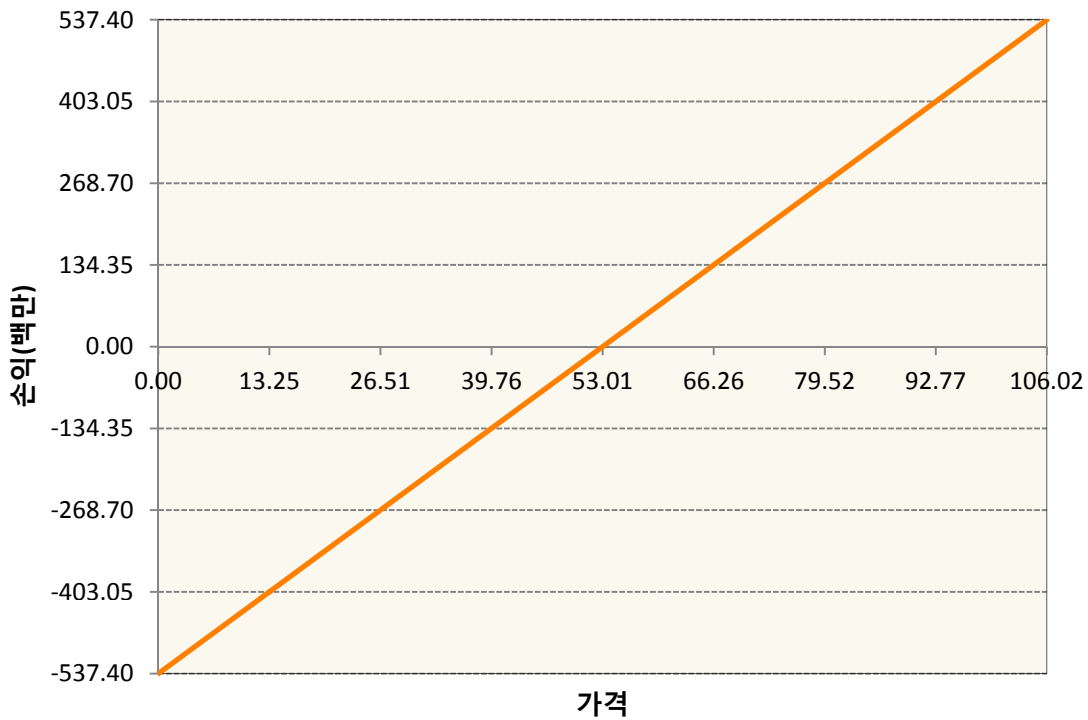
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

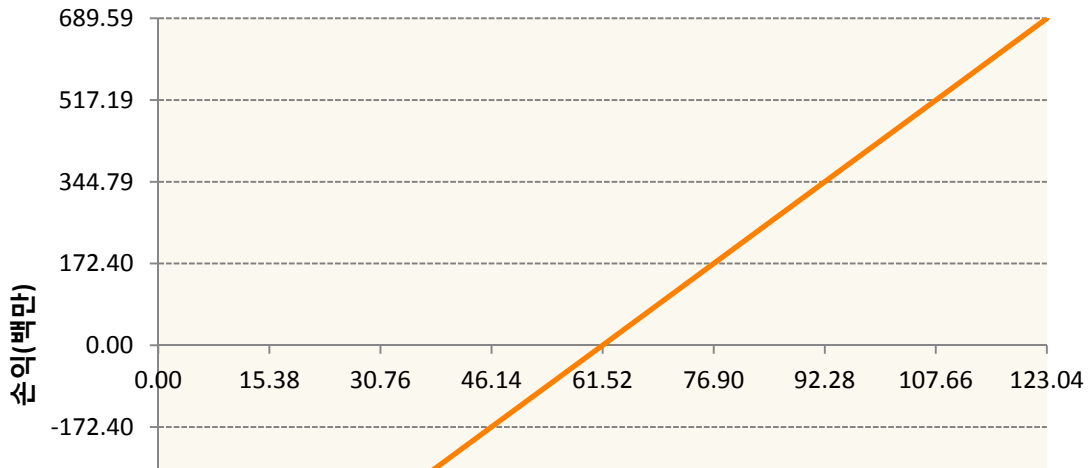
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,730	282	2,448	

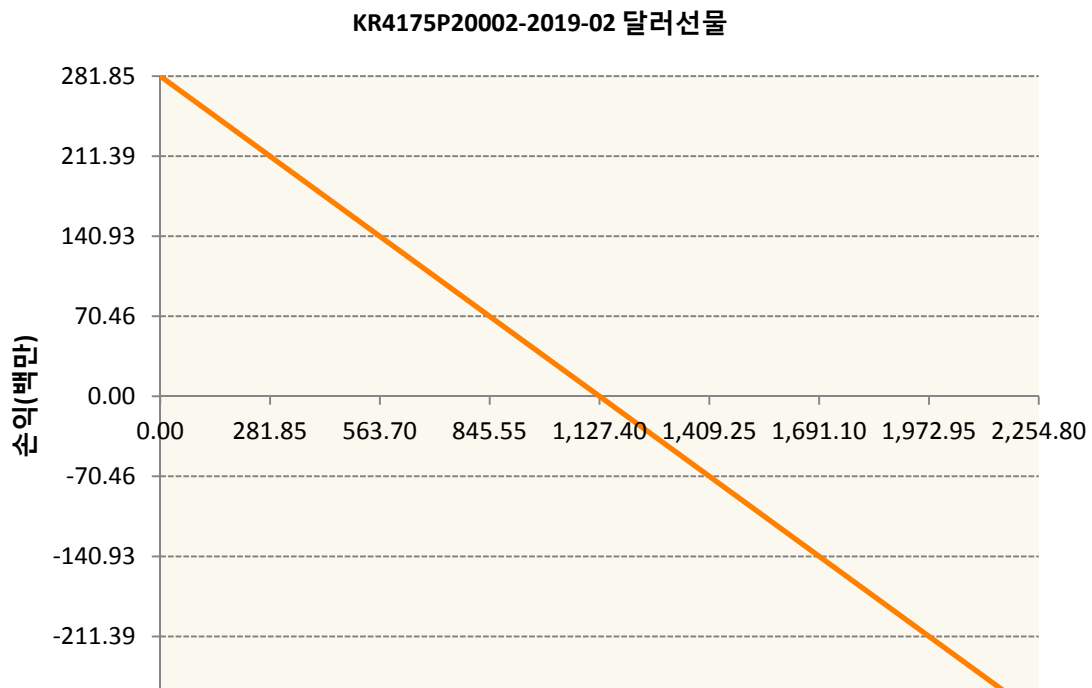
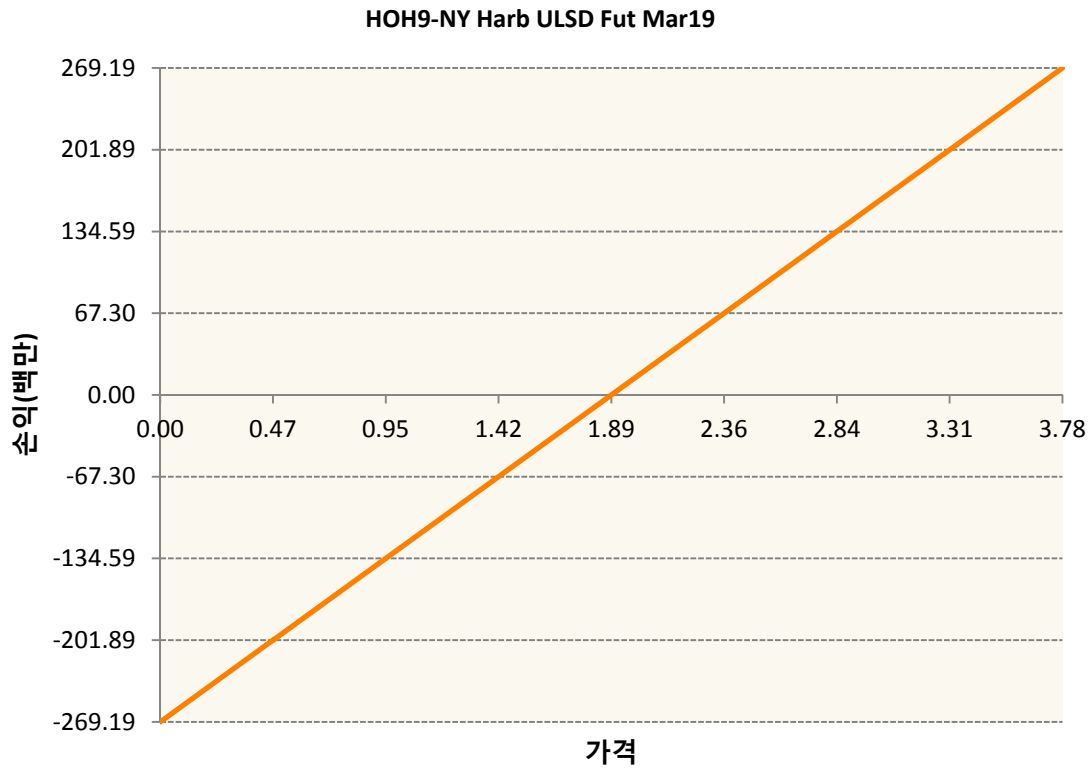
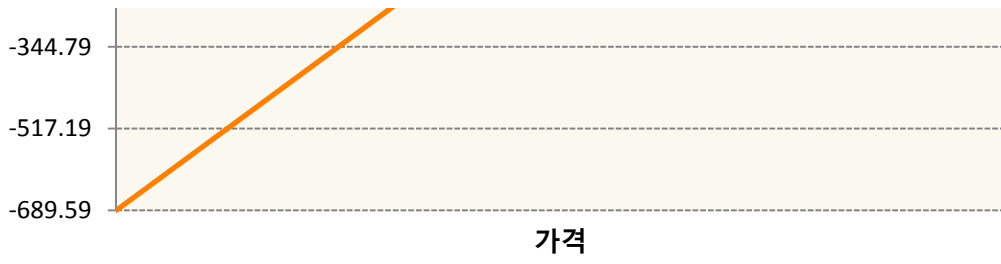
### 2. 만기시점의 손익구조

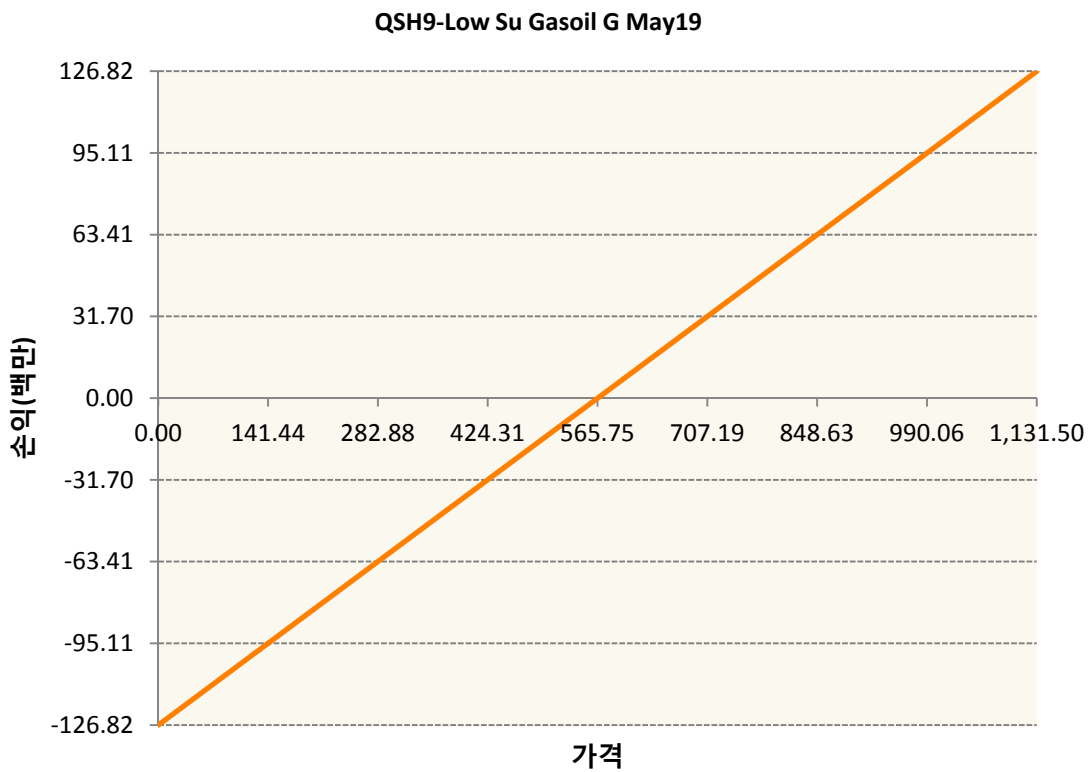
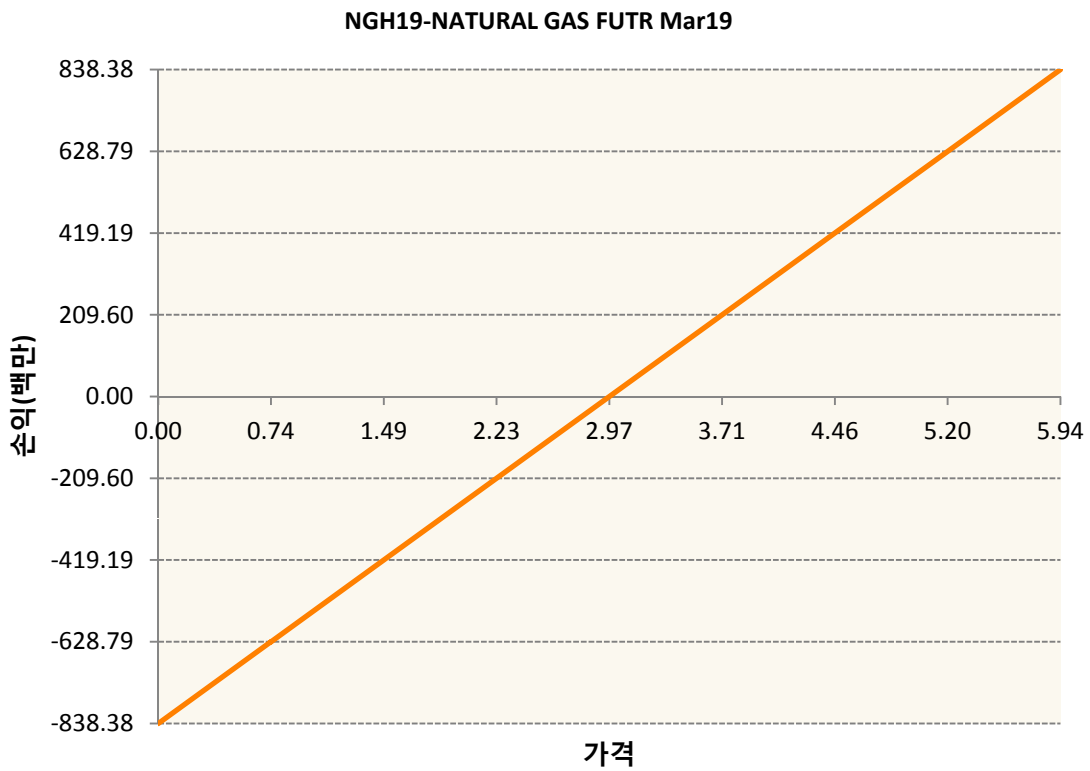
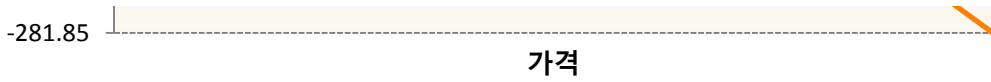
**CLH9-WTI CRUDE FUTURE MAR19**



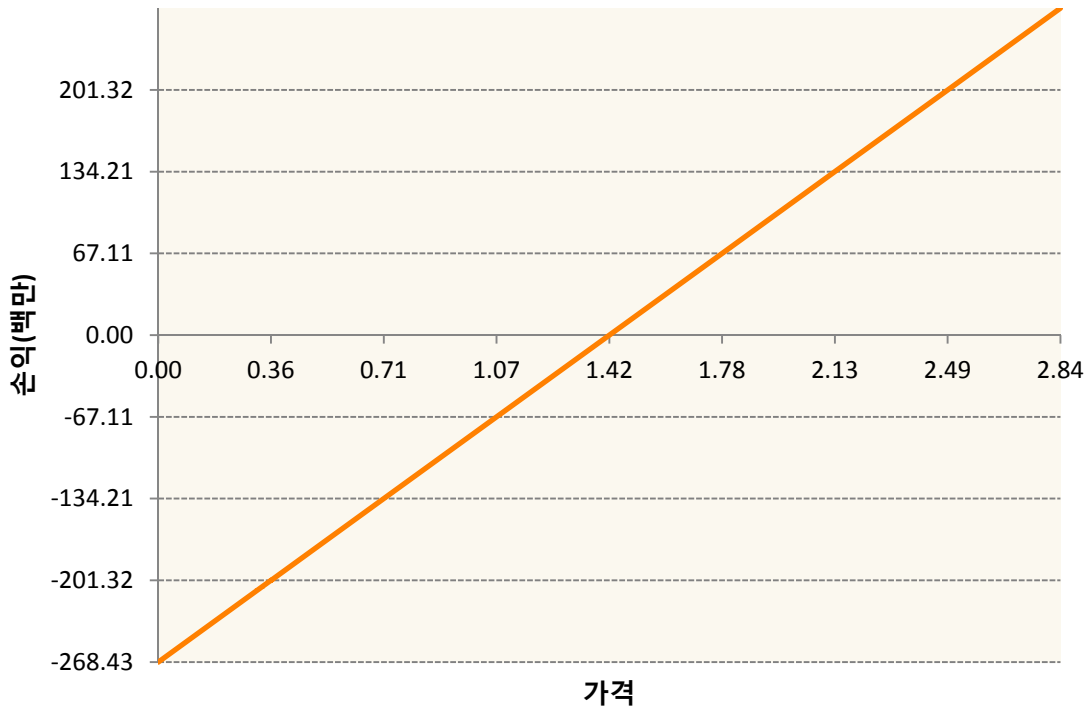
**COK9-BRENT CRUDE FUTR May19**







**XBH9-GASOLINE RBOB FUT Mar19**



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

CLH9	WTI CRUDE FUTURE MAR19	43
COK9	BRENT CRUDE FUTR May19	55
HOH9	NY Harb ULSD Fut Mar19	22
KR4175P200	2019-02 달러선물	23
NGH19	NATURAL GAS FUTR Mar19	67
QSH9	Low Su Gasoil G May19	10
XBH9	GASOLINE RBOB FUT Mar19	21

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

**430**

공시일	2019-01-24
기준일	2019-01-23

## 애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

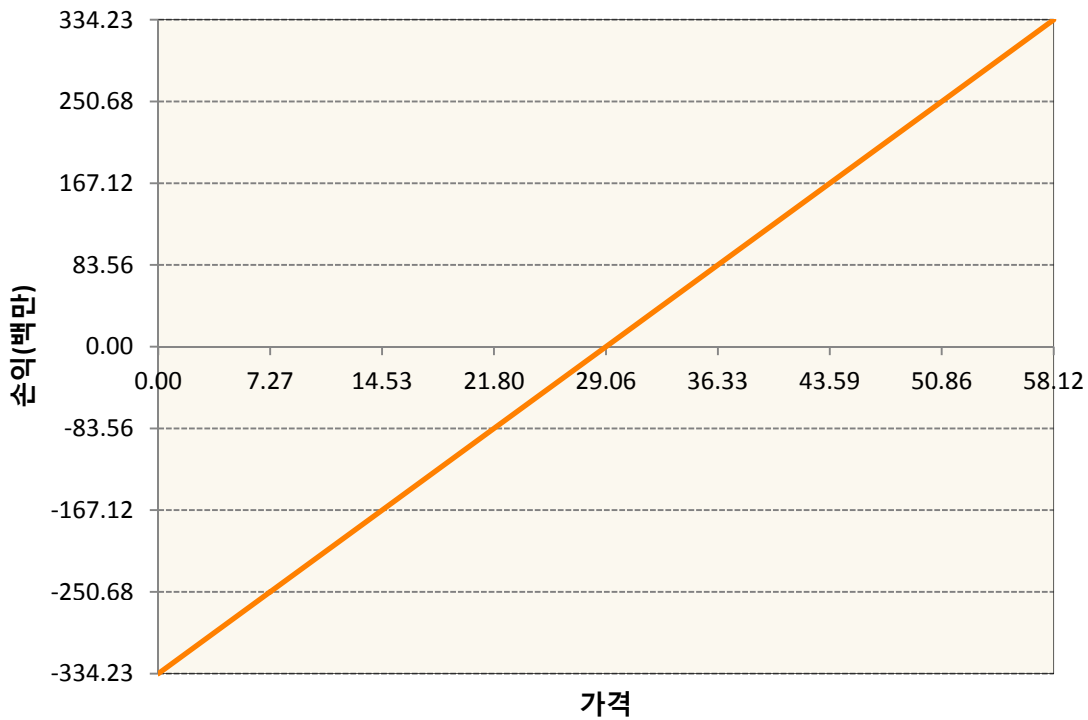
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

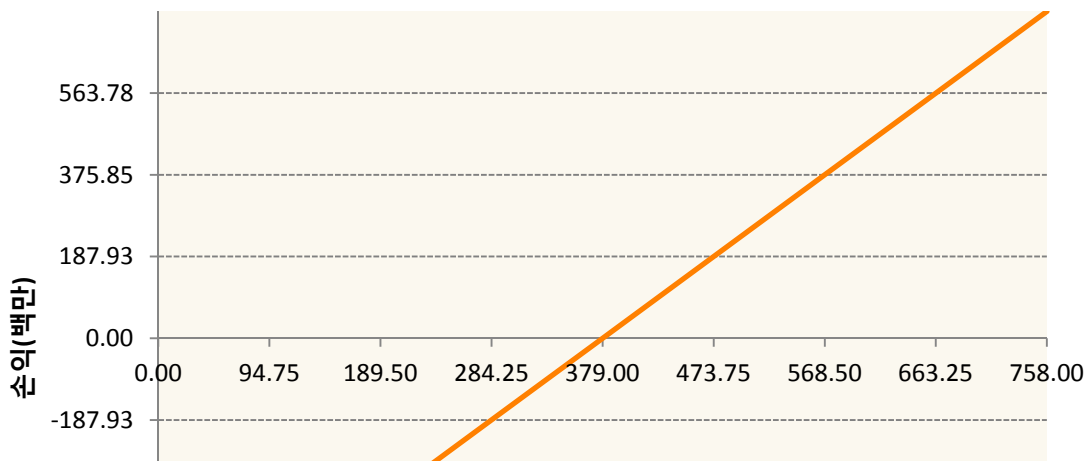
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,583	79	3,504	

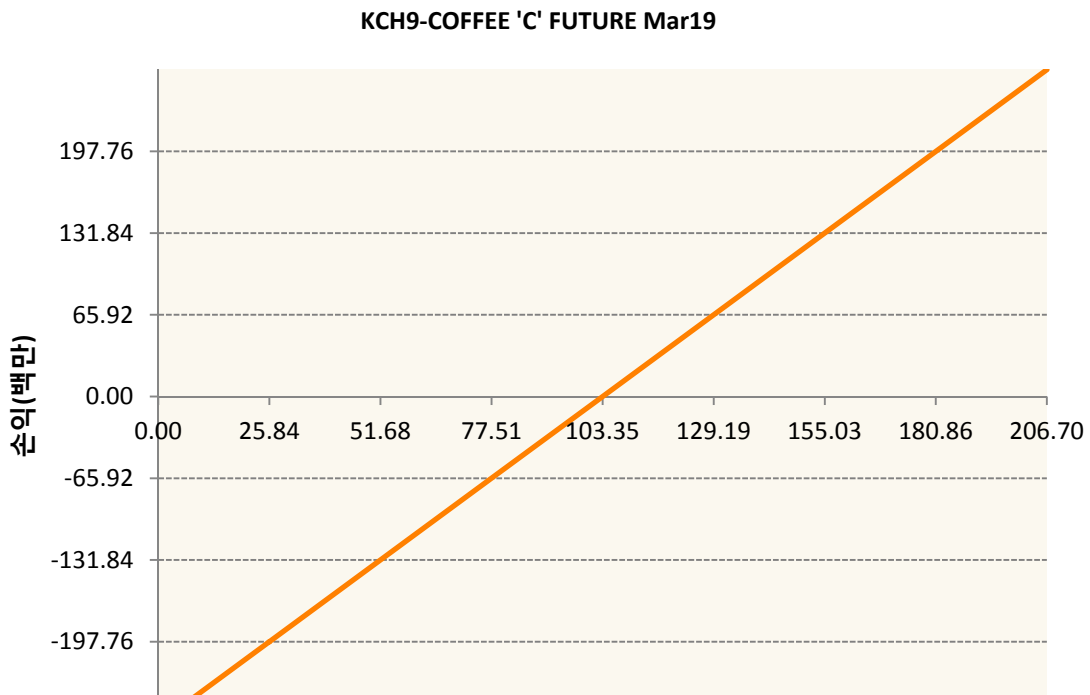
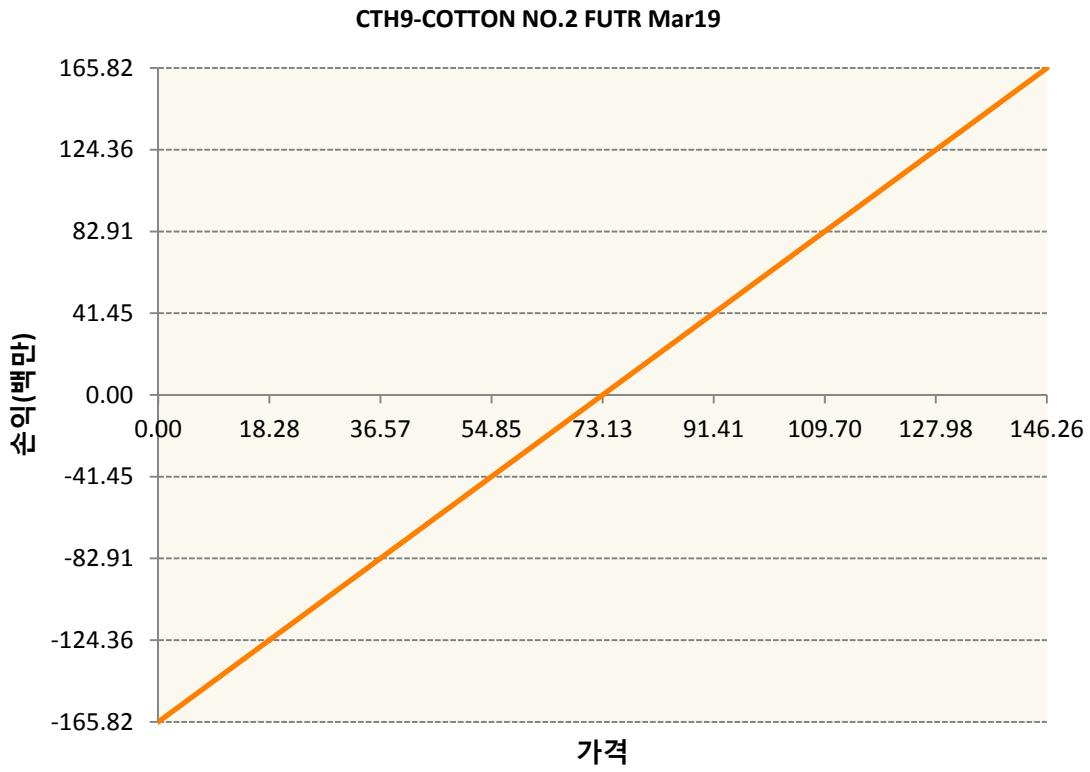
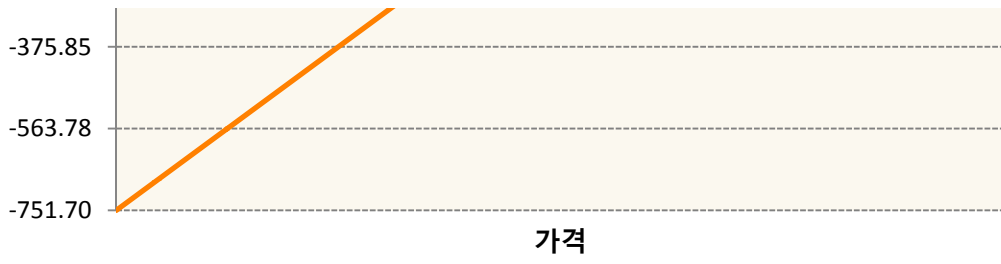
### 2. 만기시점의 손익구조

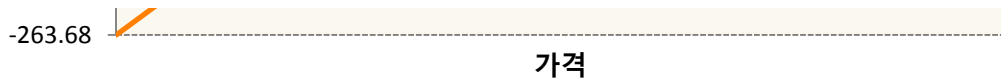
BOH9-SOYBEAN OIL FUTR Mar19



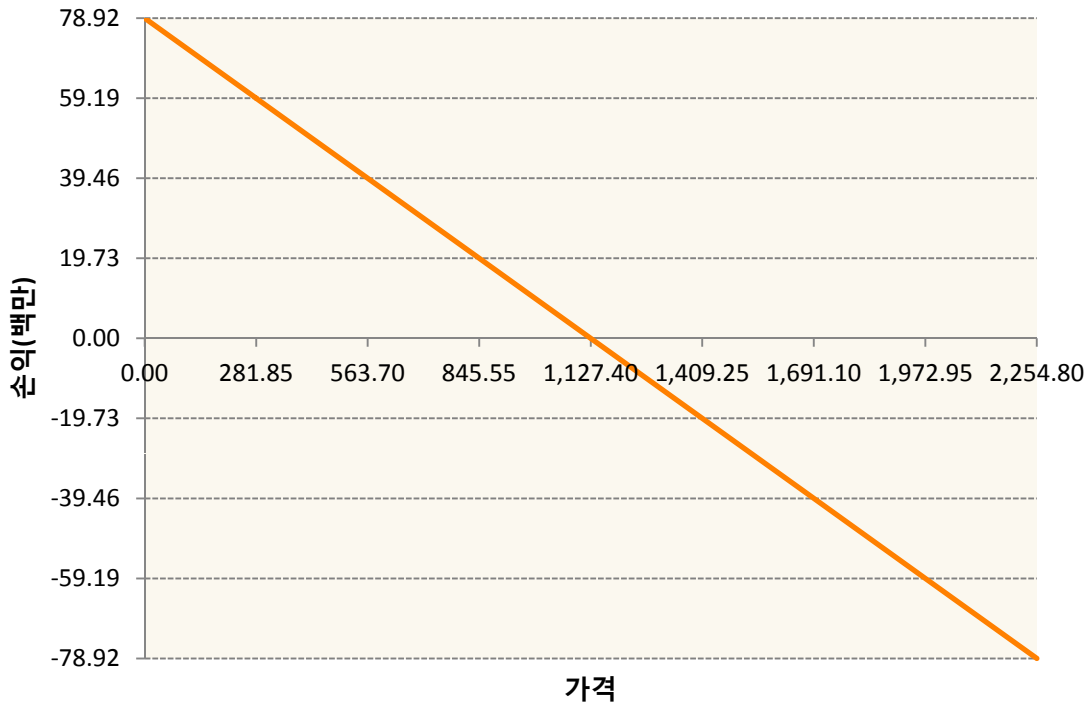
CH9-CORN FUTURE Mar19



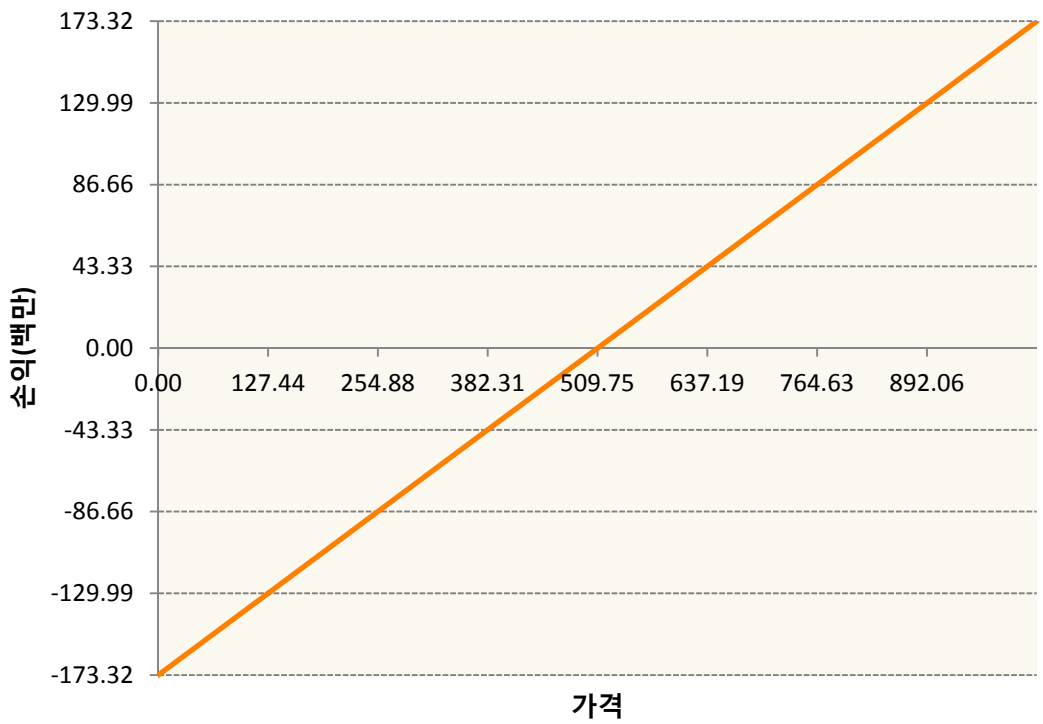




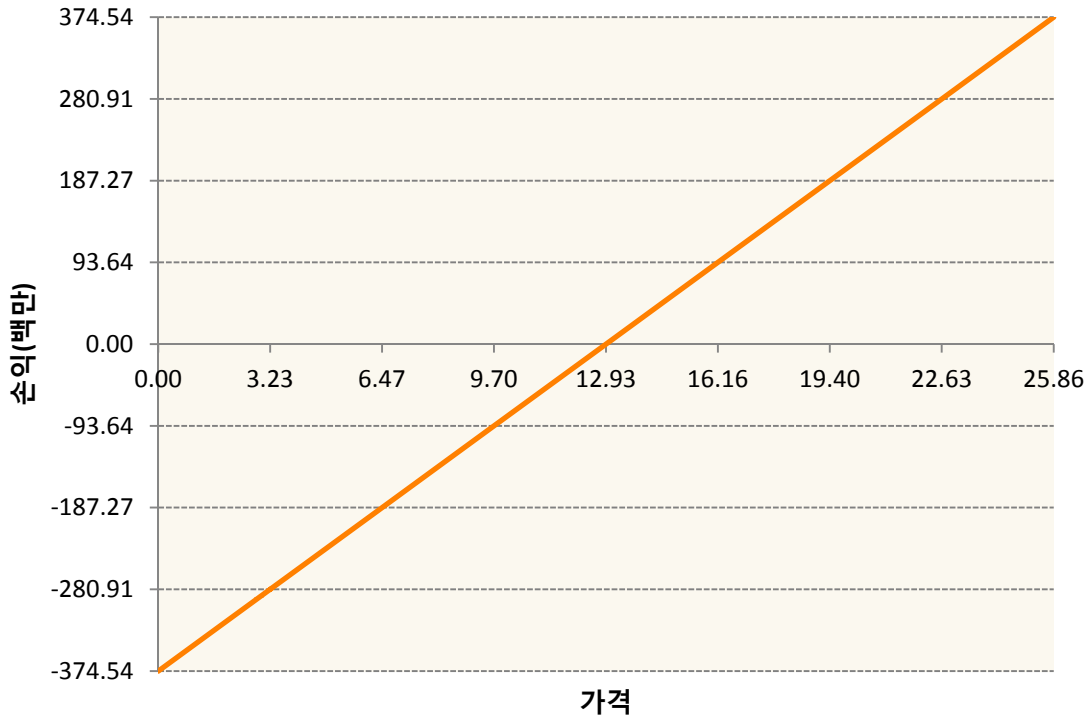
KR4175P20002-2019-02 달러선물



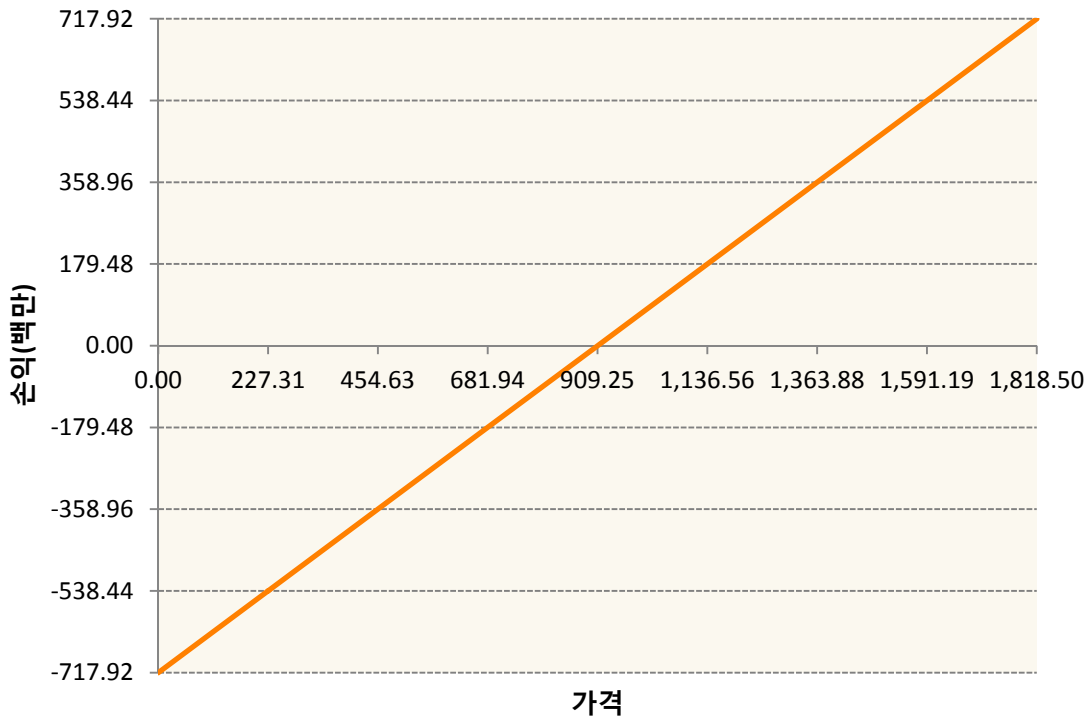
KWH9-KC HRW WHEAT FUT Mar19



SBH9-SUGAR #11 (WORLD) MAR19

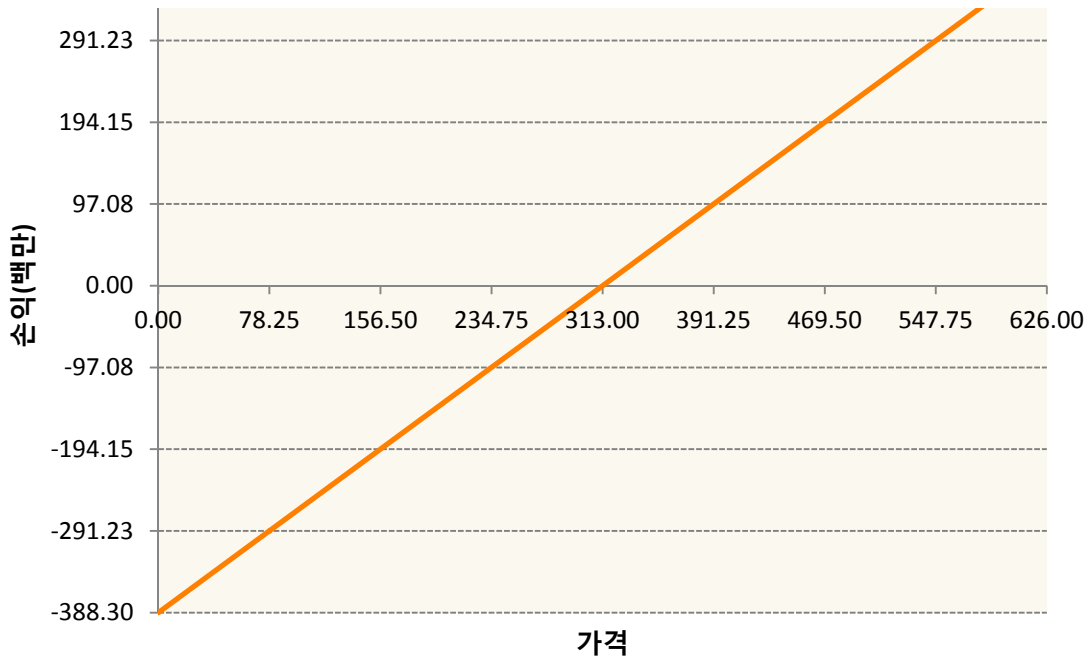


SH9-SOYBEAN FUTURE Mar19

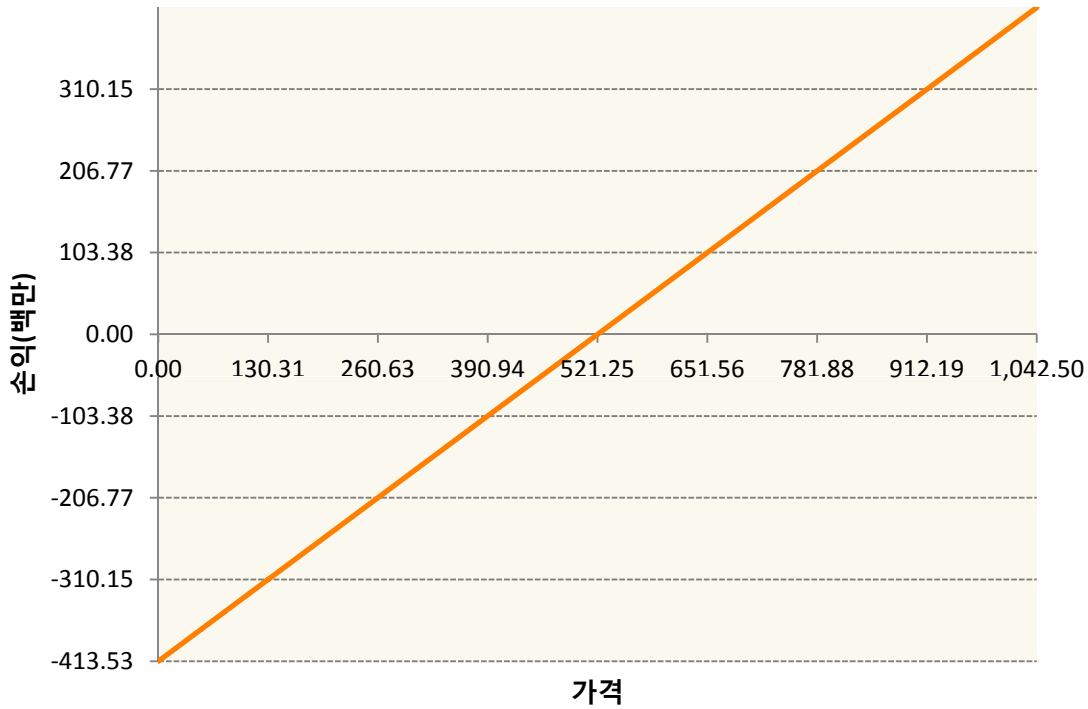


SMH9-SOYBEAN MEAL FUTR Mar19





WH9-WHEAT FUTURE(CBT) Mar19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

BOH9	SOYBEAN OIL FUTR Mar19	27
CH9	CORN FUTURE Mar19	60
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	57
SMH9	SOYBEAN MEAL FUTR Mar19	31
WH9	WHEAT FUTURE(CBT) Mar19	33

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

(단위:백만원)

**294**