

공시일	2019-02-01
기준일	2019-01-31

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)

101

공시일	2019-02-01
기준일	2019-01-31

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

1,070

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

609

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-02-01
기준일	2019-01-31

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	4,357	0	4,357	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI50000 신한CSI500미래S180910	261
SWCSI50000 신한CSI500미래S190129	78

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

506

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-02-01
기준일	2019-01-31

유로인덱스모(주식-파생형)

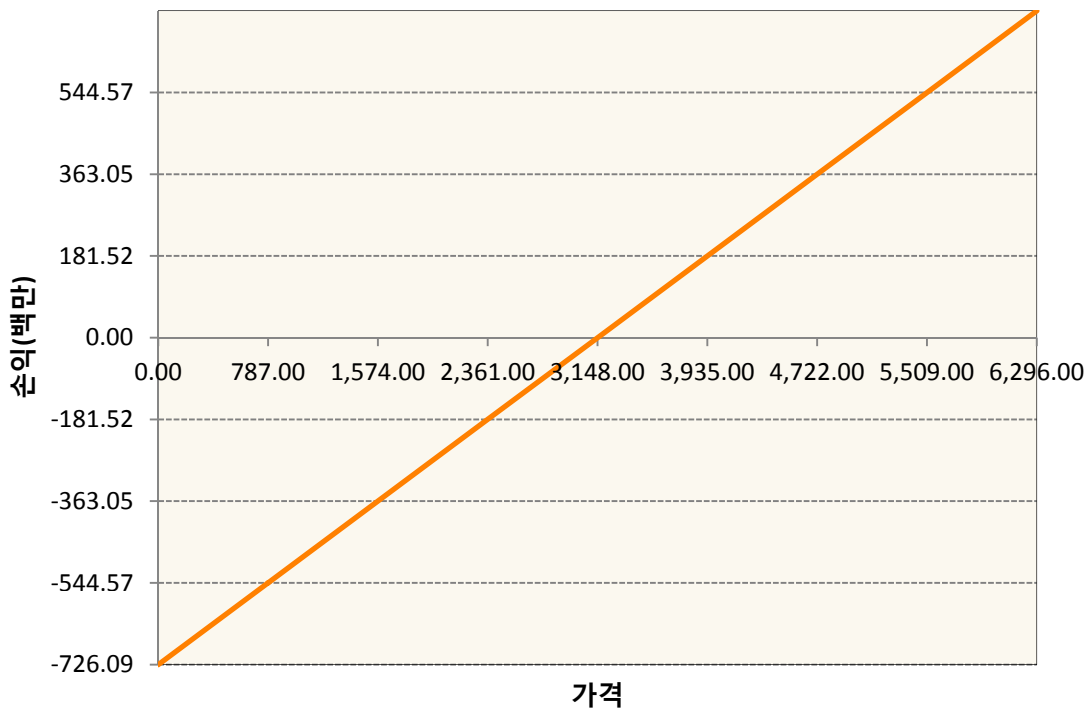
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	726	0	726	

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	2019-02-01
기준일	2019-01-31

차이나인덱스모(주식-파생형)

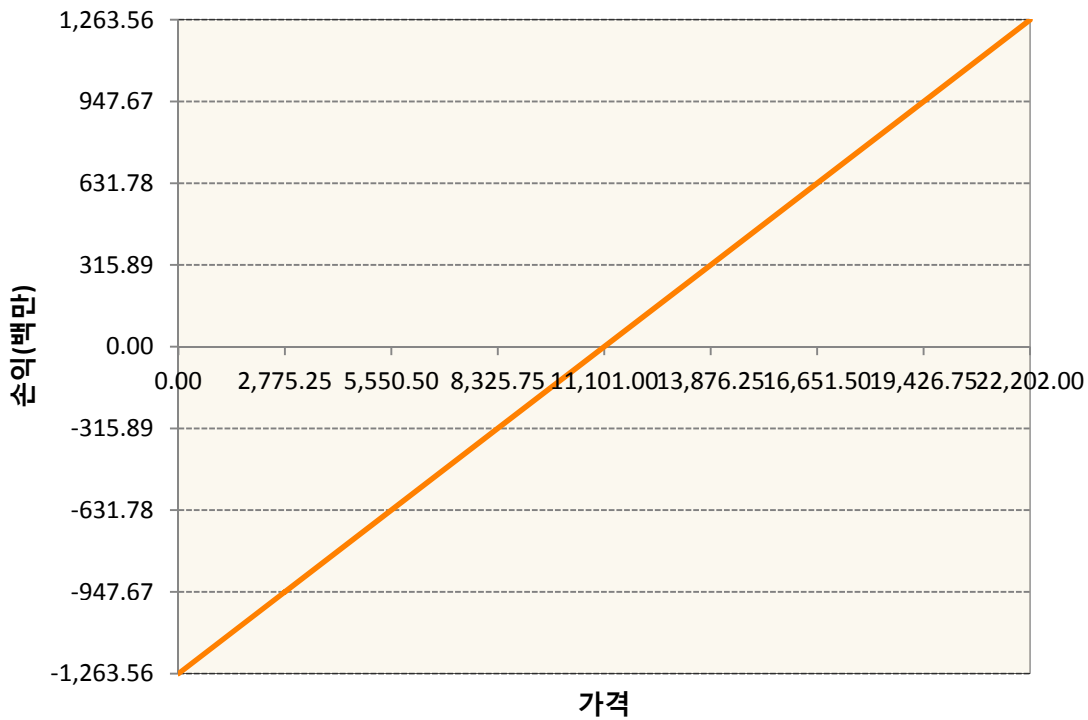
1. 계약금액

(단위:백만원)

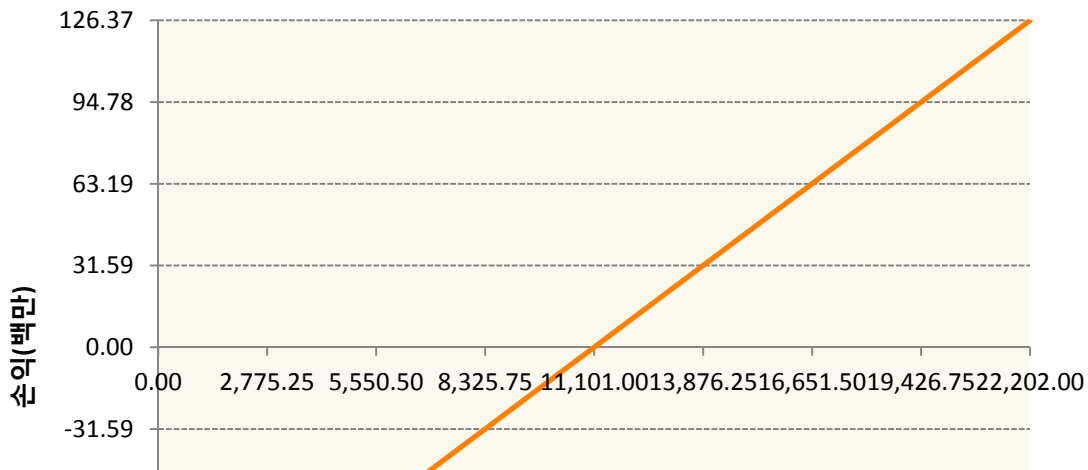
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,390	0	1,390	장내

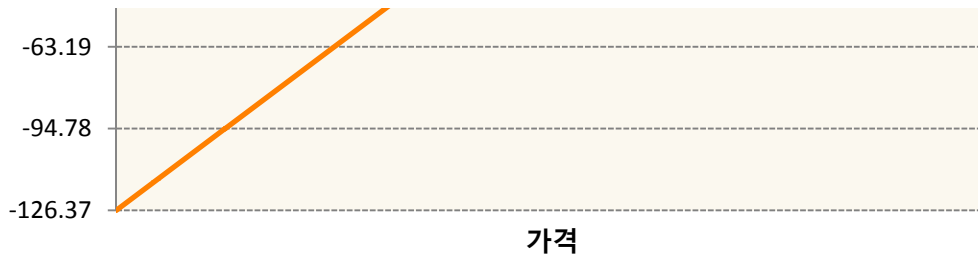
2. 만기시점의 손익구조

HCG9-HSCEI Futures Feb19



MHCG9-MINI H-SHR IDX FU Feb19





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

HCG9	HSCEI Futures Feb19	101
MHCG9	MINI H-SHR IDX FU Feb19	10

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

114

공시일	2019-02-01
기준일	2019-01-31

커버드콜모(주식혼합-파생형)

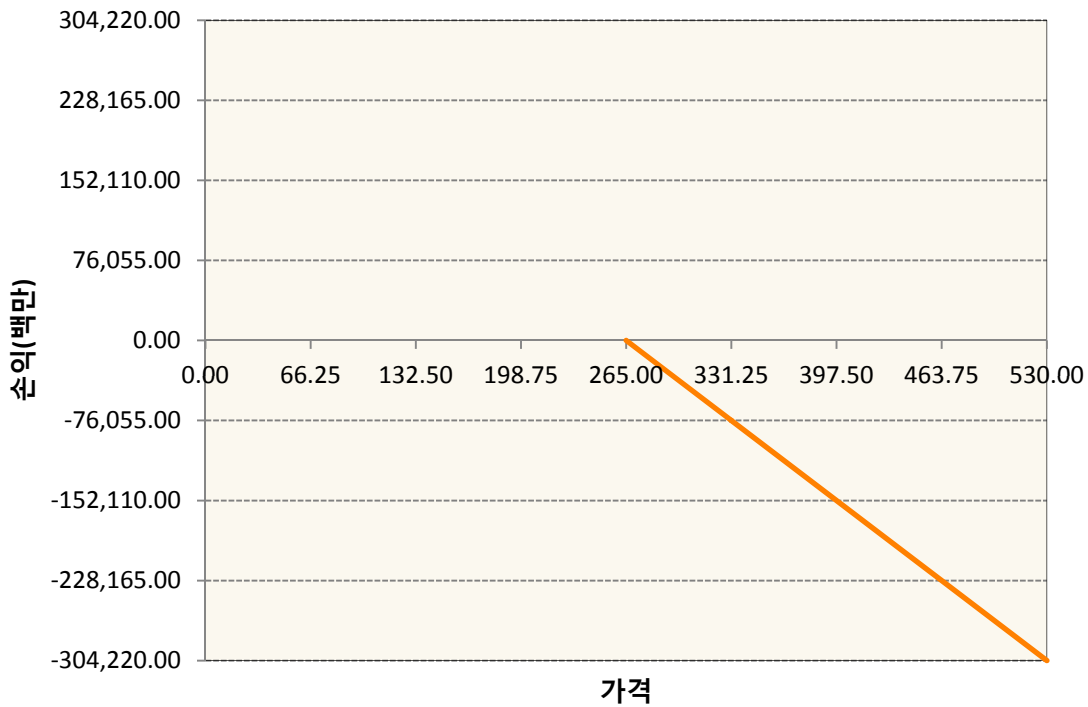
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	6,622	0	6,622	장내
누계	유가증권	옵션	0	646,943	-646,943	장내

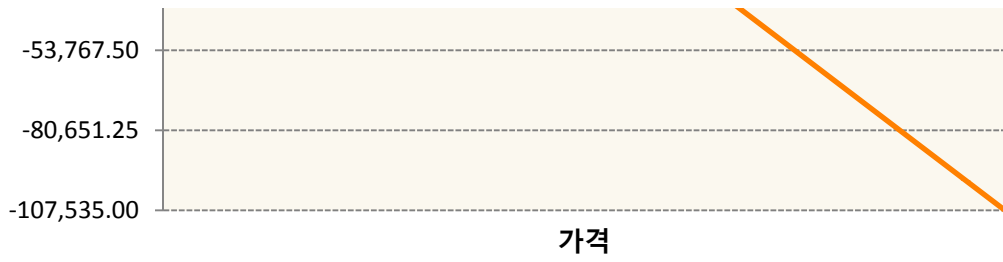
2. 만기시점의 손익구조

KR4201P22655-2019-02 콜265

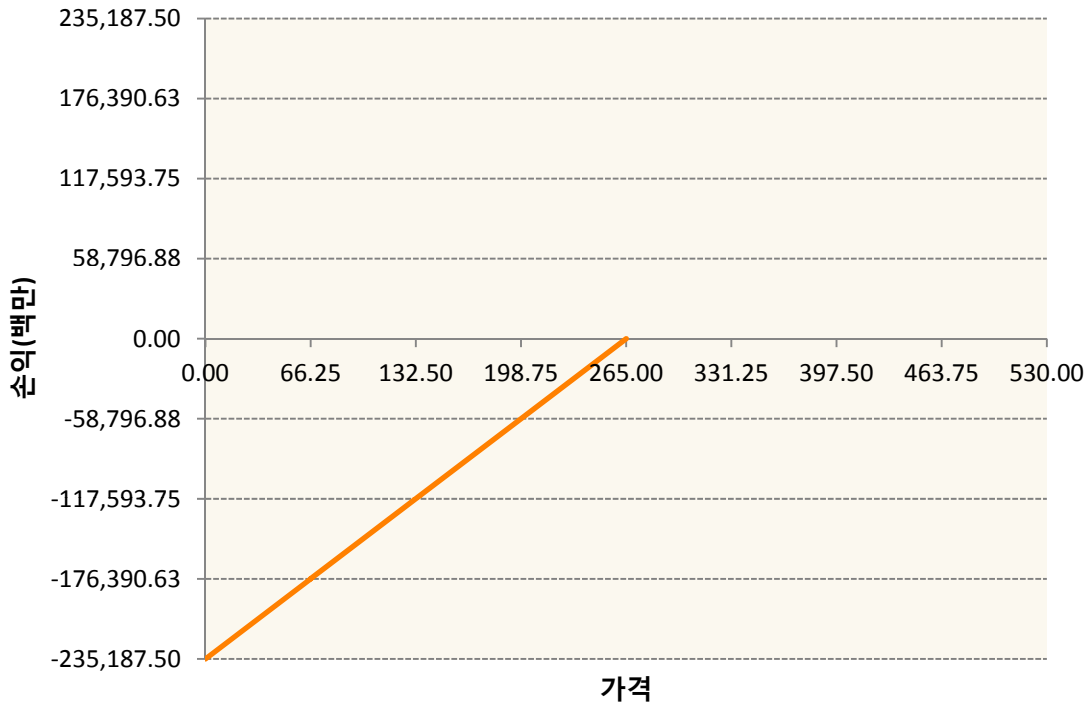


KR4201P22671-2019-02 콜267.5





KR4301P22653-2019-02 풋265



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201P22655		2019-02 콜265					25,815
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	20,890	20,386	19,881	19,374	18,866	18,358	17,850
-5.33%	15,839	15,386	14,922	14,448	13,968	13,483	12,992
-2.67%	8,663	8,410	8,122	7,803	7,459	7,093	6,708
0%	375	284	159	0	-192	-414	-663
2.67%	-8,280	-8,302	-8,341	-8,401	-8,486	-8,596	-8,732
5.33%	-17,014	-17,017	-17,027	-17,044	-17,074	-17,120	-17,183
8.00%	-25,759	-25,760	-25,761	-25,765	-25,774	-25,790	-25,815
KR4201P22671		2019-02 콜267.5					8,965
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	6,766	6,601	6,433	6,263	6,092	5,919	5,745

-5.33%	5,290	5,114	4,938	4,760	4,581	4,402	4,223
-2.67%	2,990	2,876	2,751	2,617	2,476	2,330	2,179
0%	184	136	74	0	-86	-181	-286
2.67%	-2,820	-2,833	-2,855	-2,886	-2,927	-2,978	-3,039
5.33%	-5,873	-5,876	-5,881	-5,891	-5,907	-5,930	-5,960
8.00%	-8,935	-8,935	-8,936	-8,939	-8,944	-8,952	-8,965
KR4301P22653 2019-02 풋265							4,523
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-3,127	-3,356	-3,587	-3,820	-4,053	-4,288	-4,523
-5.33%	-521	-689	-868	-1,056	-1,252	-1,455	-1,662
-2.67%	-18	-51	-99	-161	-239	-330	-435
0%	16	14	9	0	-15	-38	-70
2.67%	17	17	17	16	14	11	5
5.33%	17	17	17	17	17	17	16
8.00%	17	17	17	17	17	17	17

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

(단위:백만원)

37,420

공시일	2019-02-01
기준일	2019-01-31

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

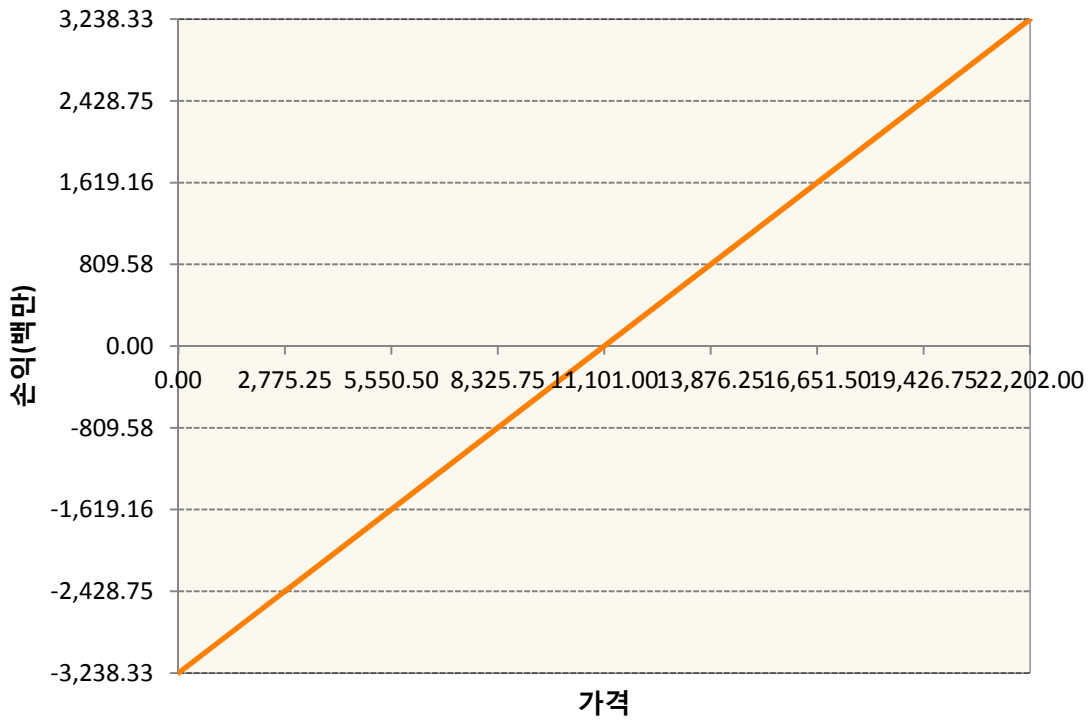
1. 계약금액

(단위:백만원)

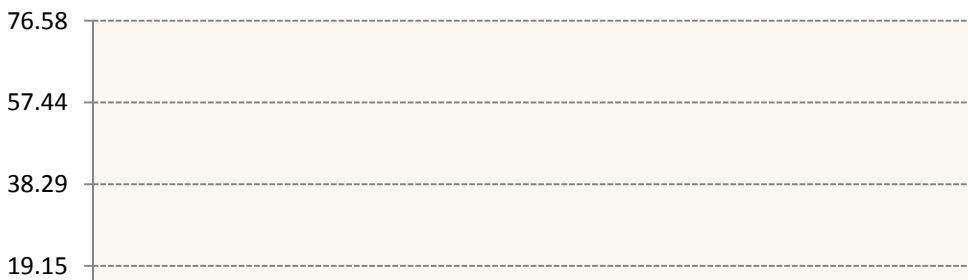
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	3,238	0	3,238	장내
누계	유가증권	옵션	0	7,573	-7,573	장내
누계	통화	선도	0	2,695	-2,695	장외

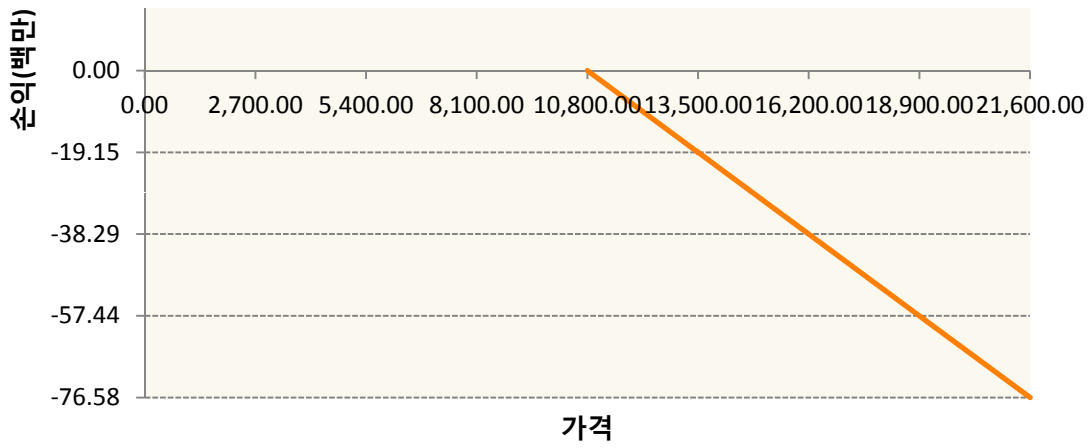
2. 만기시점의 손익구조

HCG9-HSCEI Futures Feb19

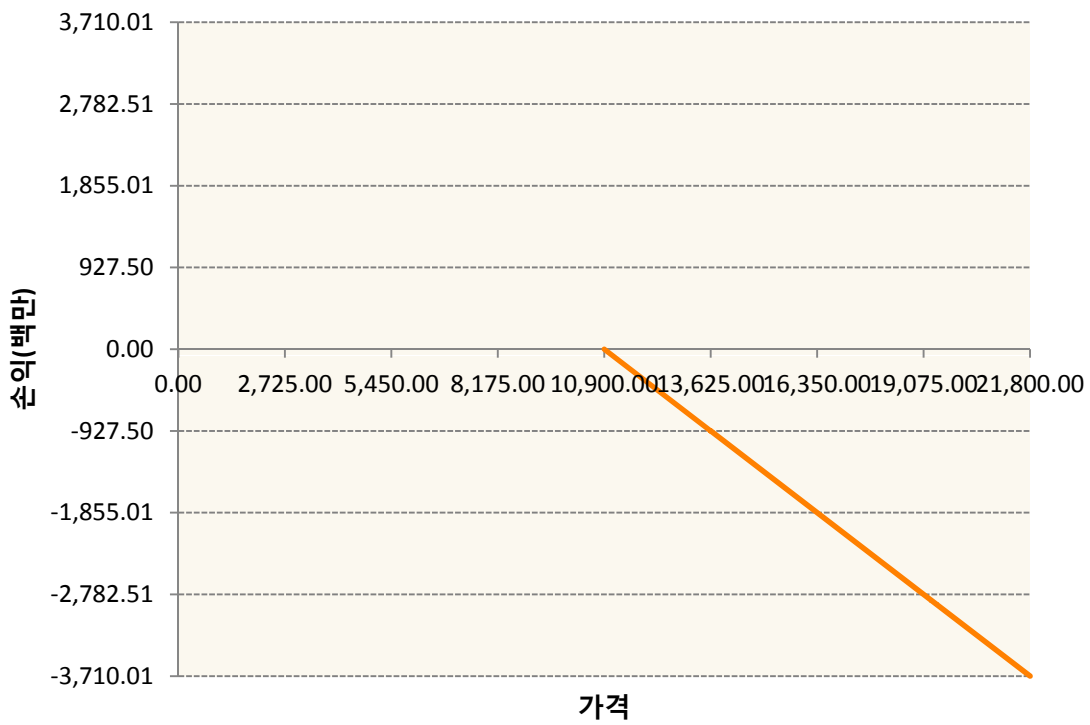


OHHIG9-C108-HSCEI

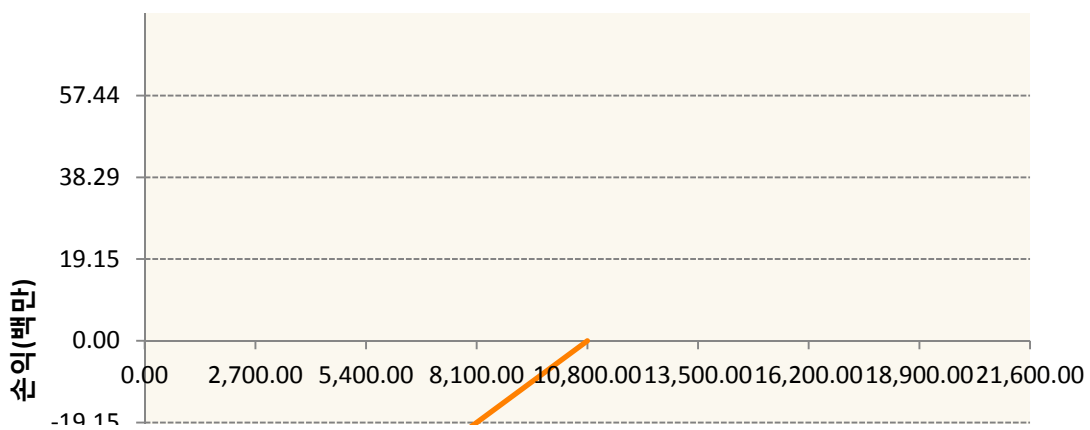


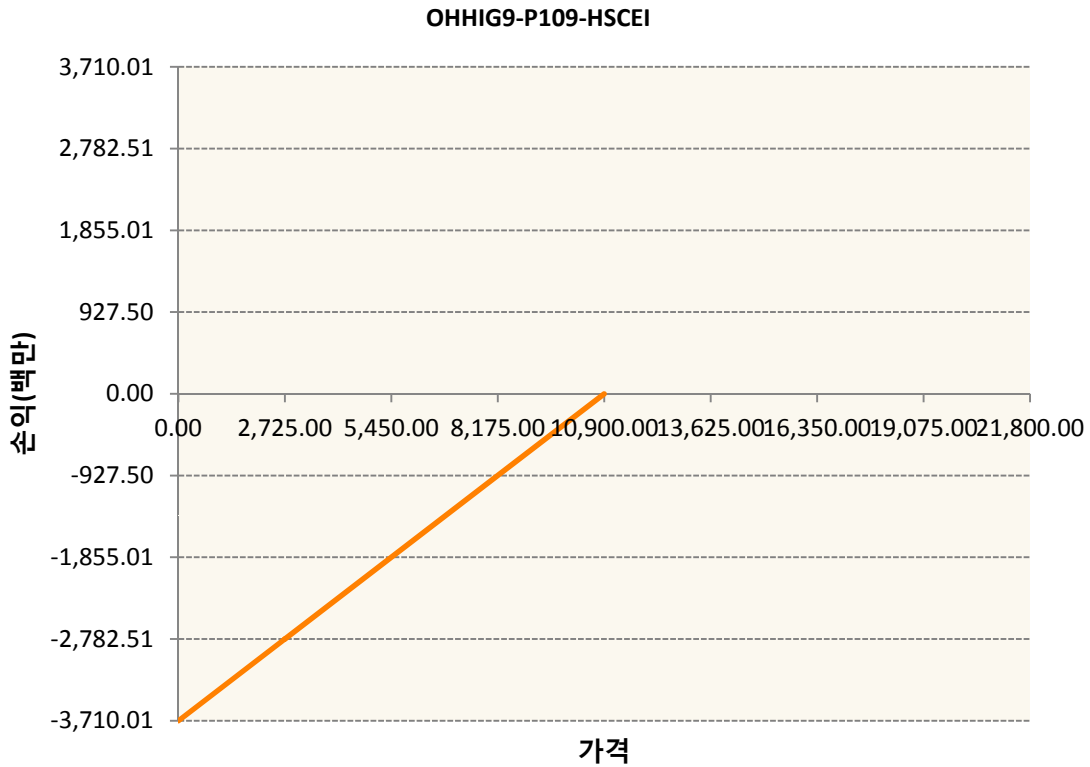
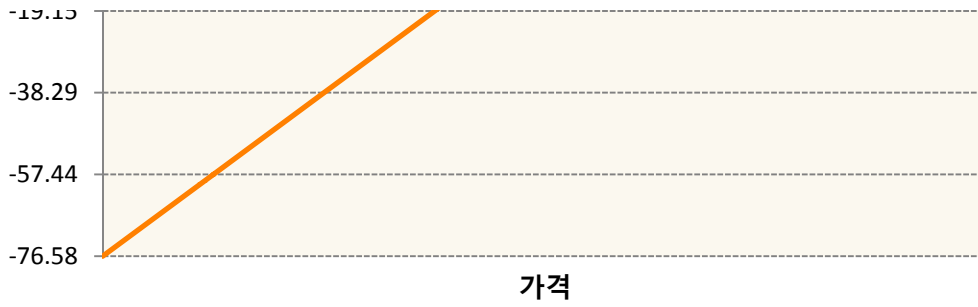


OHHIG9-C109-HSCEI



OHHIG9-P108-HSCEI





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

FX21018Z00 KRW/HKD 11-03-19E	216
HCG9 HSCEI Futures Feb19	259
OHHIG9-C1(HSCEI	6
OHHIG9-C1(HSCEI	297
OHHIG9-P1(HSCEI	6
OHHIG9-P1(HSCEI	297

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

965

공시일	2019-02-01
기준일	2019-01-31

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

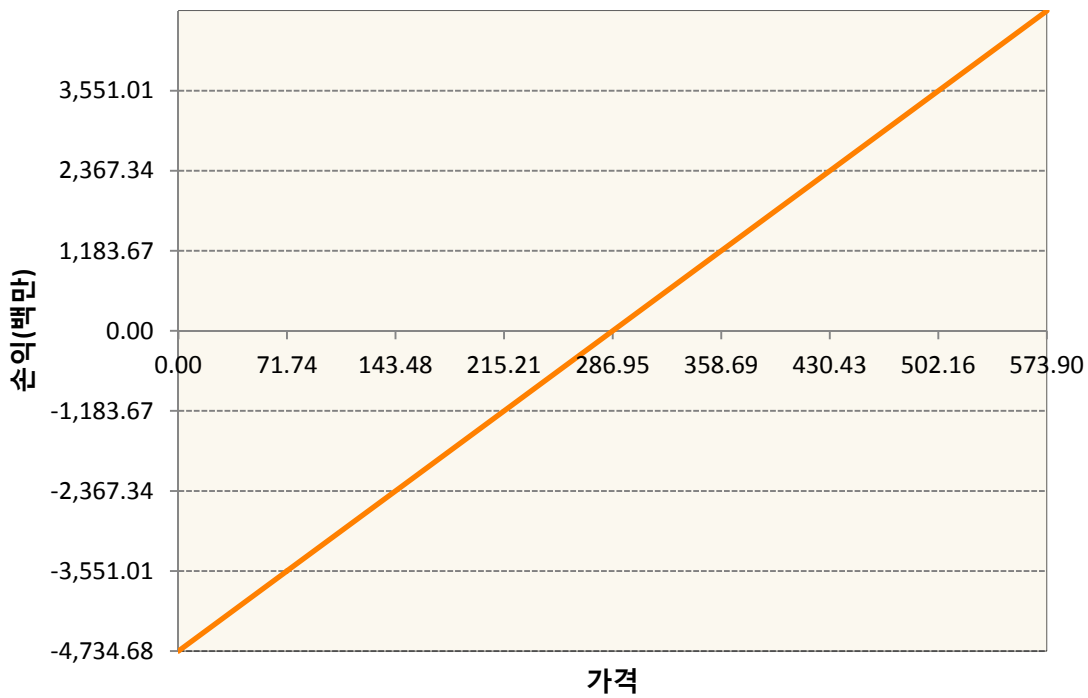
1. 계약금액

(단위:백만원)

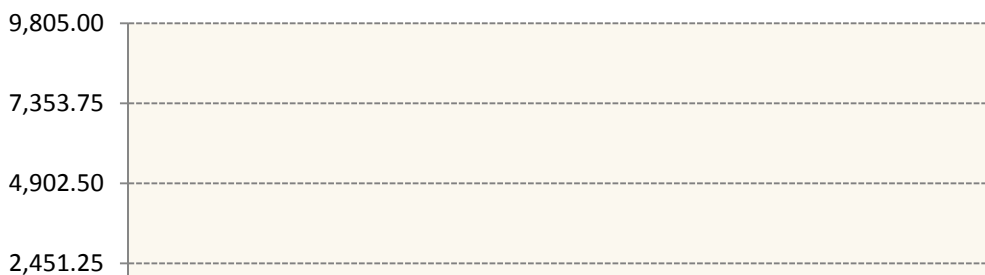
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	72	0	72	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	502	0	502	장내
누계	유가증권	선물	4,735	0	4,735	장내
누계	유가증권	스왑	31,836	0	31,836	장외
누계	유가증권	옵션	0	29,674	-29,674	장내

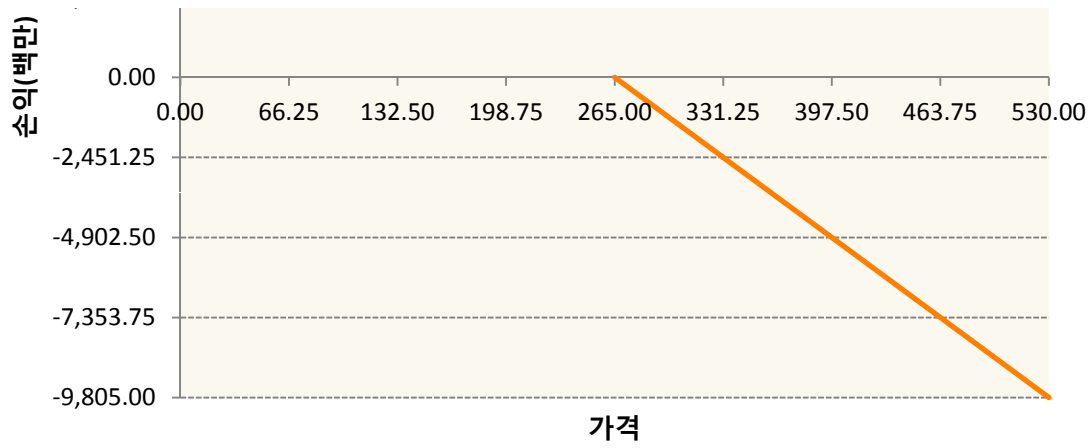
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P30007-2019-03 코스피200지수선물

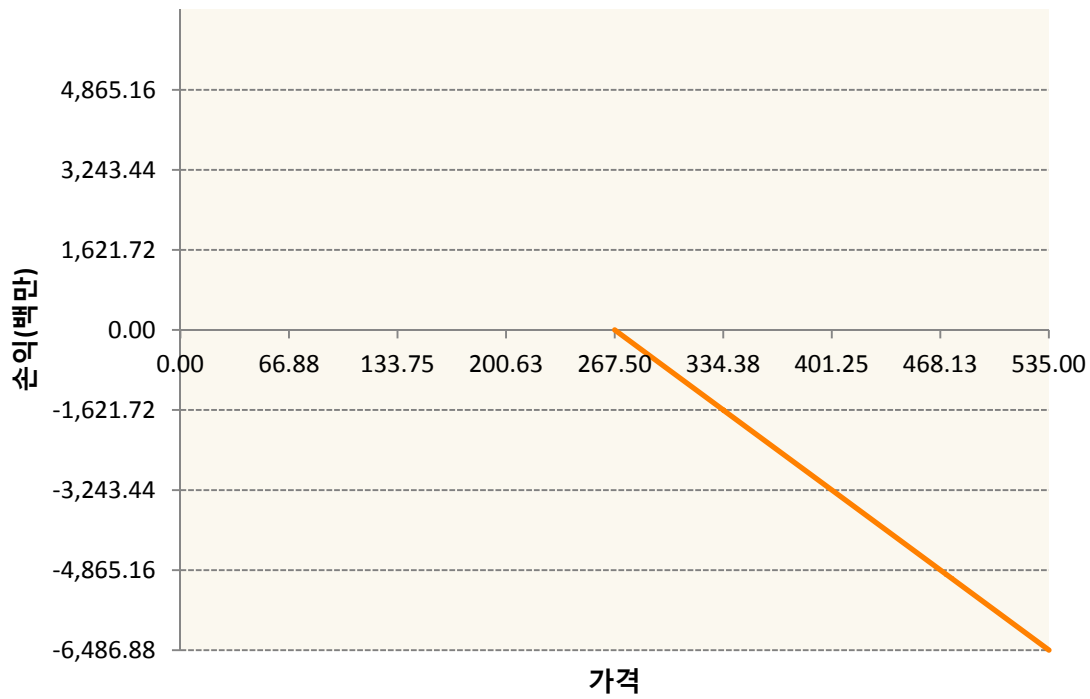


KR4201P22655-2019-02 콜265

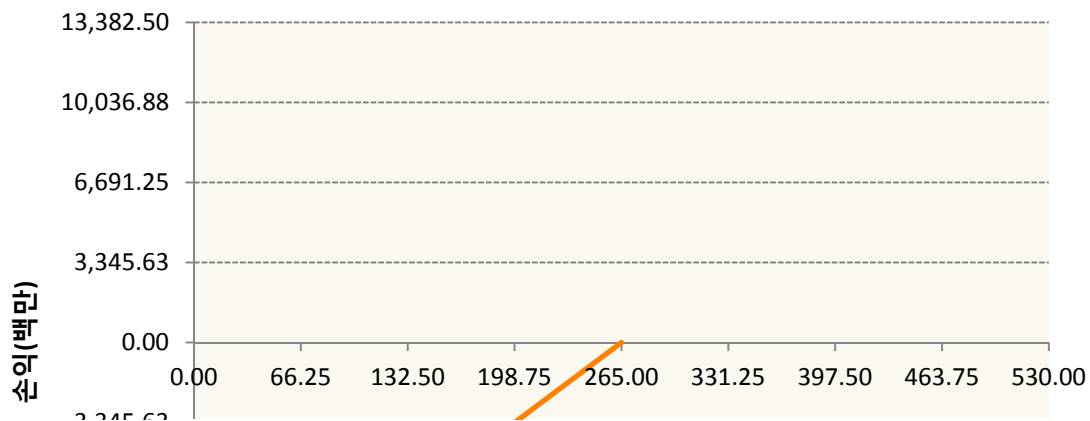


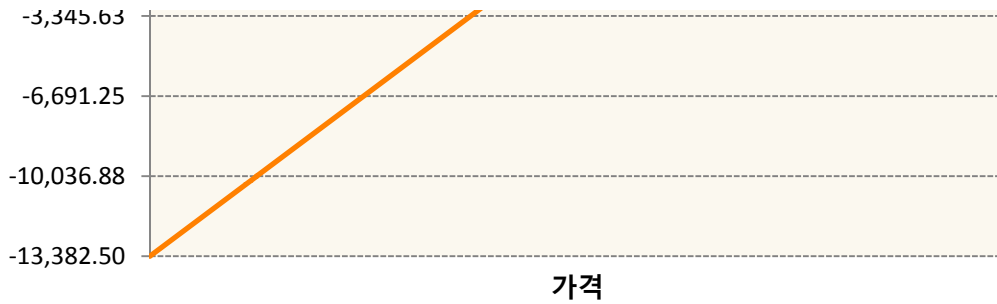


KR4201P22671-2019-02 콜267.5



KR4301P22653-2019-02 풋265





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11		UBCSFXC1 INDEX_14						2,647
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-2,647	-2,647	-2,647	-2,647	-2,647	-2,647	-2,647	
-5.33%	-1,765	-1,765	-1,765	-1,765	-1,765	-1,765	-1,765	
-2.67%	-882	-882	-882	-882	-882	-882	-882	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	882	882	882	882	882	882	882	
5.33%	1,765	1,765	1,765	1,765	1,765	1,765	1,765	
8.00%	2,647	2,647	2,647	2,647	2,647	2,647	2,647	
KR4101P30007		2019-03 코스피200지수선물						377
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-377	-377	-377	-377	-377	-377	-377	
-5.33%	-252	-252	-252	-252	-252	-252	-252	
-2.67%	-126	-126	-126	-126	-126	-126	-126	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	126	126	126	126	126	126	126	
5.33%	252	252	252	252	252	252	252	
8.00%	377	377	377	377	377	377	377	
KR4201P22655		2019-02 콜265						832
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	673	657	641	624	608	592	575	
-5.33%	511	496	481	466	450	435	419	
-2.67%	279	271	262	251	240	229	216	
0%	12	9	5	0	-6	-13	-21	
2.67%	-267	-268	-269	-271	-273	-277	-281	
5.33%	-548	-548	-549	-549	-550	-552	-554	
8.00%	-830	-830	-830	-830	-831	-831	-832	
KR4201P22671		2019-02 콜267.5						541
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	

-8.00%	408	398	388	378	367	357	347
-5.33%	319	309	298	287	276	266	255
-2.67%	180	173	166	158	149	141	131
0%	11	8	4	0	-5	-11	-17
2.67%	-170	-171	-172	-174	-177	-180	-183
5.33%	-354	-354	-355	-355	-356	-358	-360
8.00%	-539	-539	-539	-539	-540	-540	-541
KR4301P22653 2019-02 풋265							257
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-178	-191	-204	-217	-231	-244	-257
-5.33%	-30	-39	-49	-60	-71	-83	-95
-2.67%	-1	-3	-6	-9	-14	-19	-25
0%	1	1	1	0	-1	-2	-4
2.67%	1	1	1	1	1	1	0
5.33%	1	1	1	1	1	1	1
8.00%	1	1	1	1	1	1	1

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

(단위:백만원)

4,478

공시일	2019-02-01
기준일	2019-01-31

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

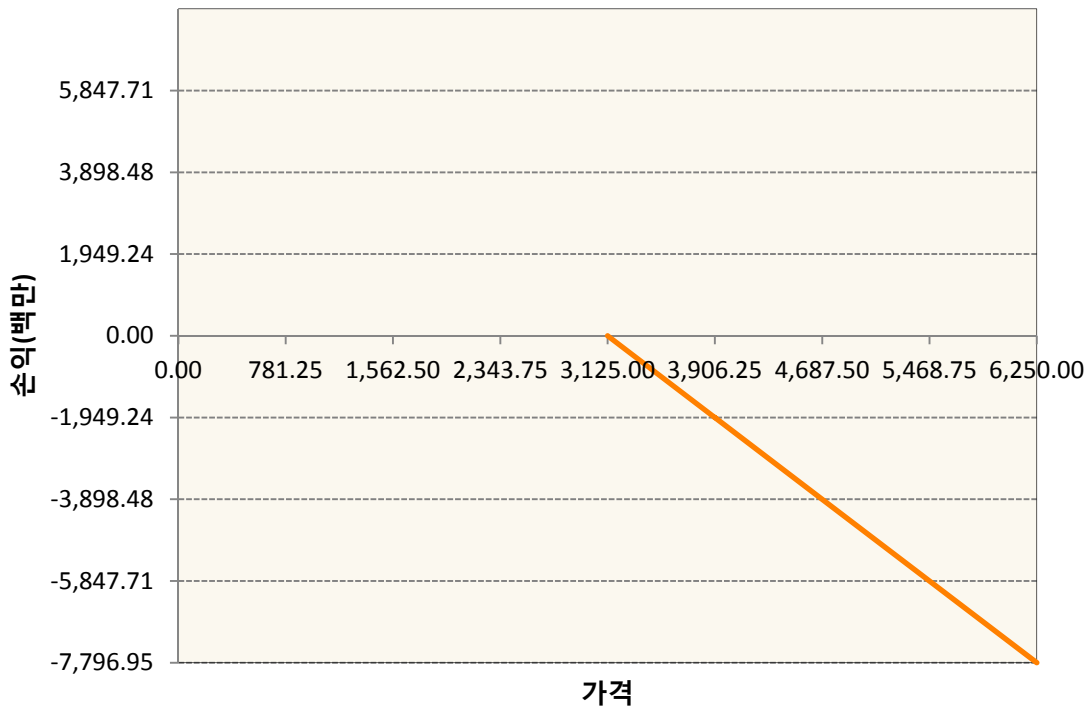
1. 계약금액

(단위:백만원)

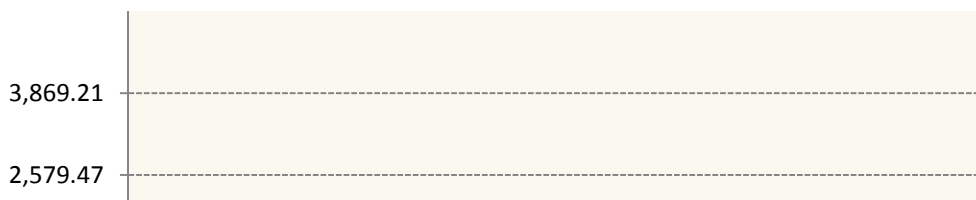
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	6,815	0	6,815	
누계	유가증권	스왑	60,409	0	60,409	장외
누계	유가증권	옵션	0	25,912	-25,912	장내
누계	통화	선도	0	15,355	-15,355	장외

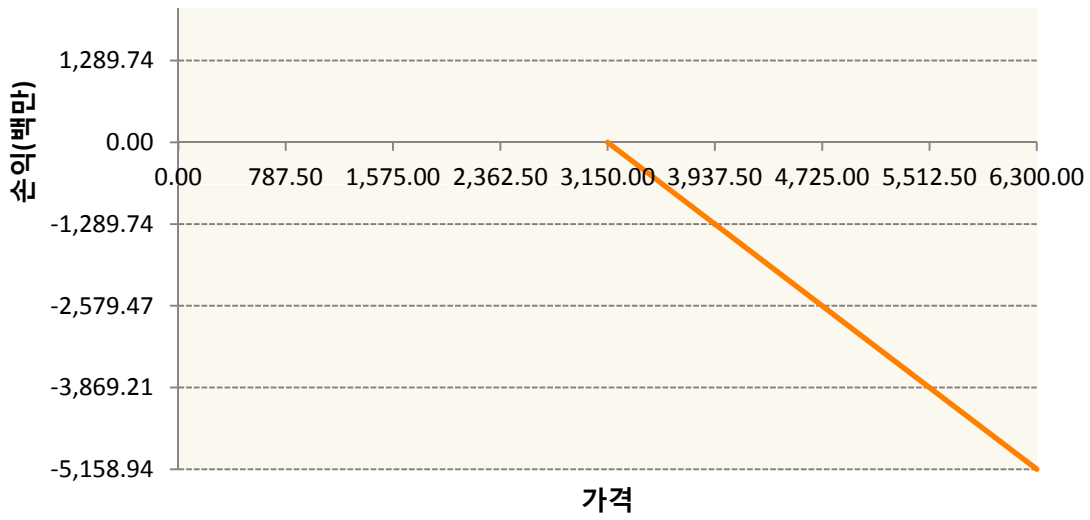
2. 만기시점의 손익구조

OESXG9-C3125-EURO STOXX 50

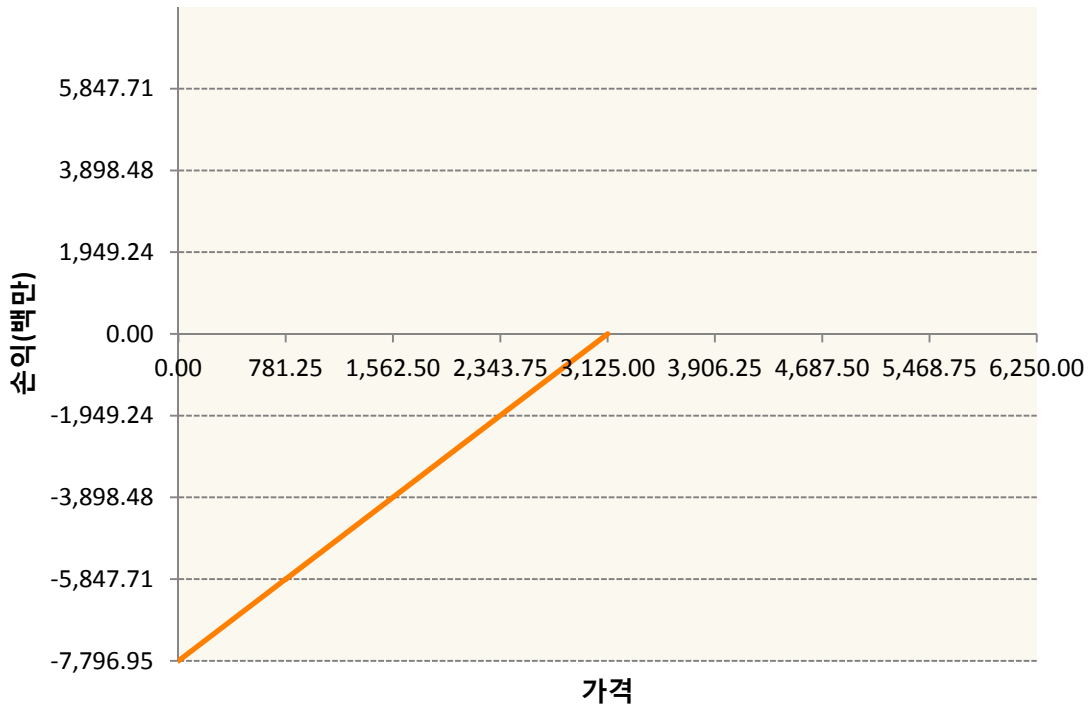


OESXG9-C3150-EURO STOXX 50

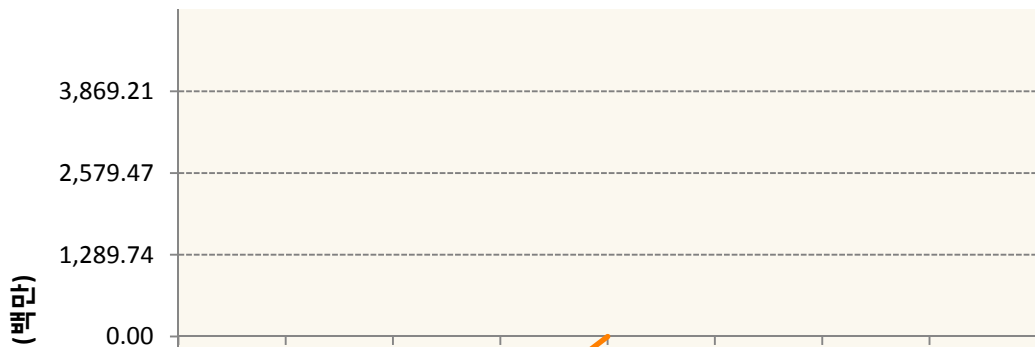


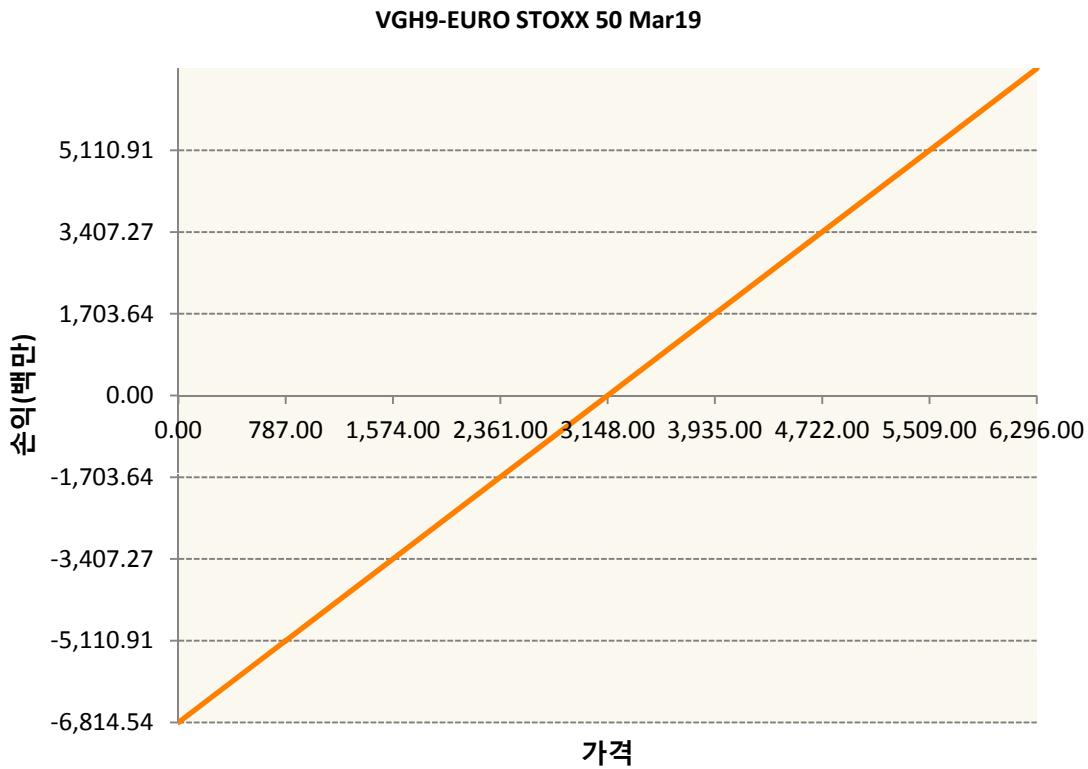
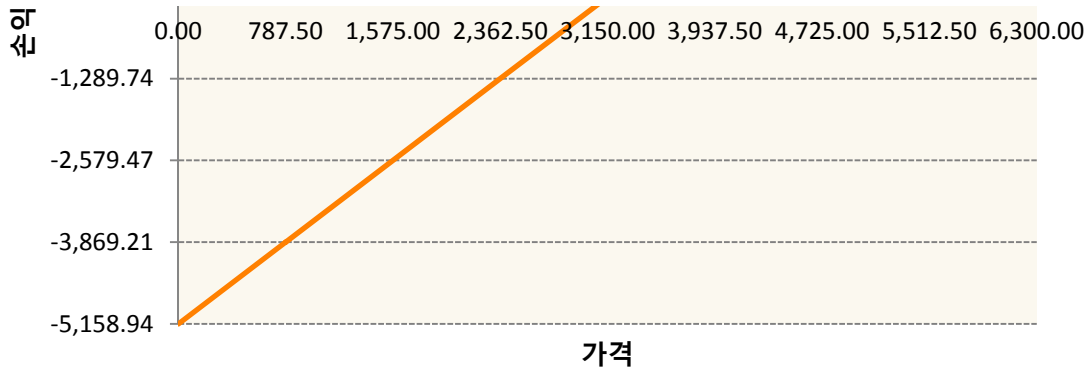


OESXG9-P3125-EURO STOXX 50



OESXG9-P3150-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY		31
FX21018X02 KRW/EUR 22-02-19E		409
FX21018Z03 KRW/EUR 22-03-19E		819
OESXG9-C31EURO STOXX 50		624
OESXG9-C31EURO STOXX 50		413
OESXG9-P31EURO STOXX 50		624
OESXG9-P31EURO STOXX 50		413
VGH9 EURO STOXX 50 Mar19		545

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

(단위:백만원)

2,516

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

(단위:백만원)

1,190

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

(단위:백만원)

101

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

(단위:백만원)

152

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

(단위:백만원)

46

공시일	2019-02-01
기준일	2019-01-31

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

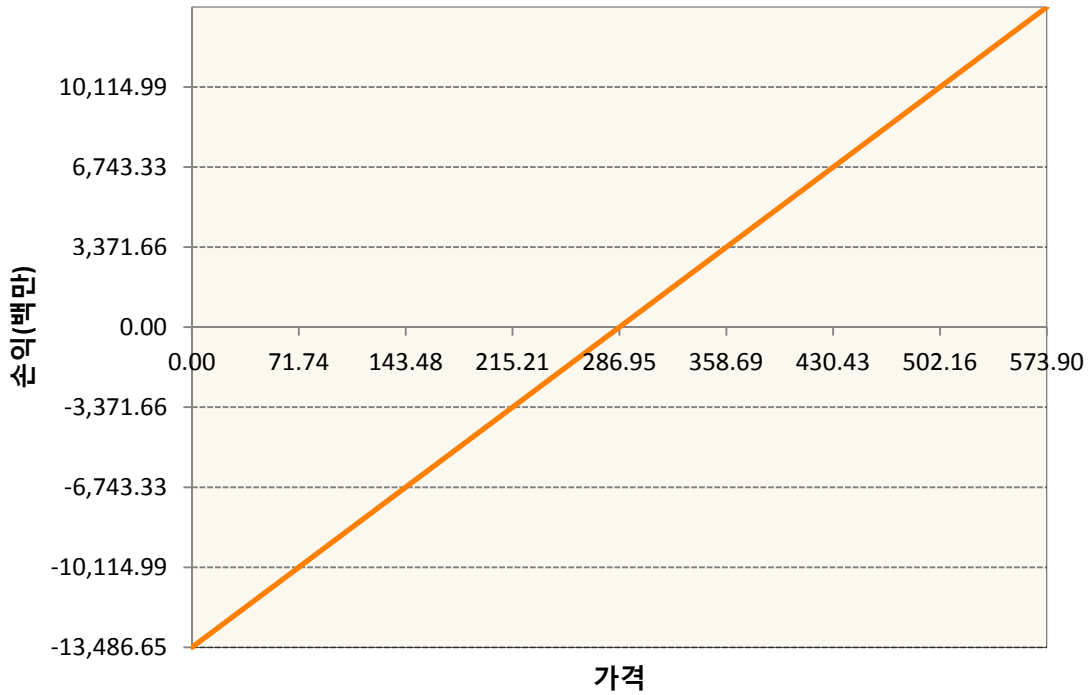
1. 계약금액

(단위:백만원)

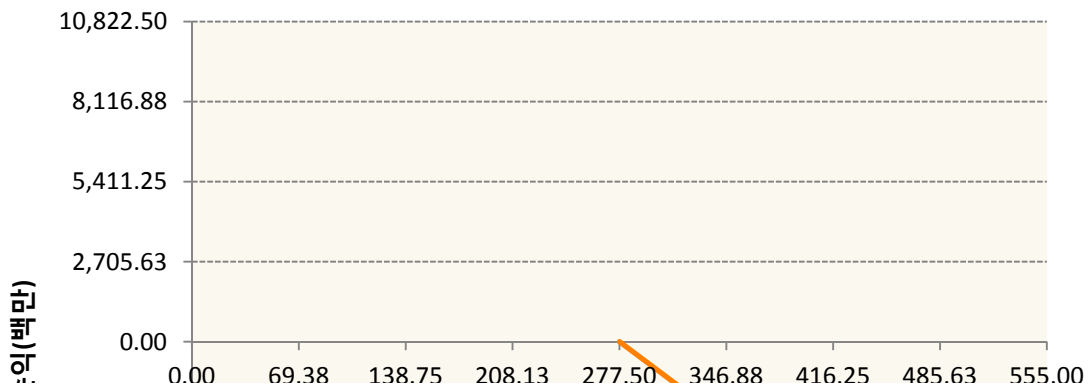
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	13,487	0	13,487	장내
누계	유가증권	옵션	2,523	23,213	-20,690	장내

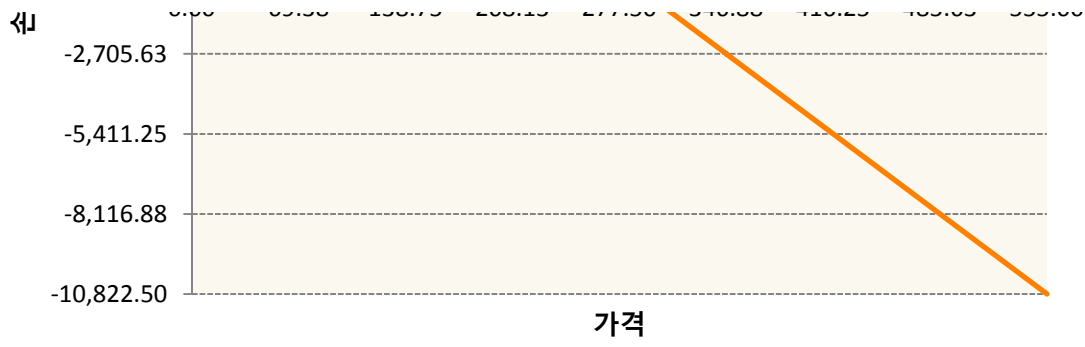
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P30007-2019-03 코스피200지수선물

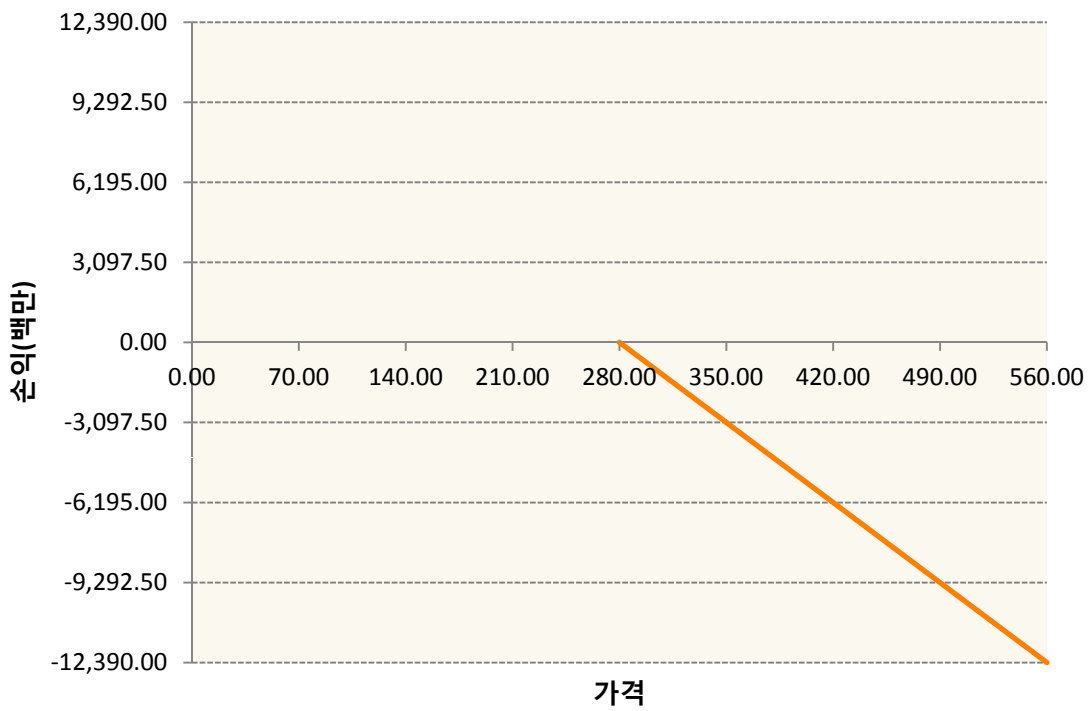


KR4201P22770-2019-02 콜277.5

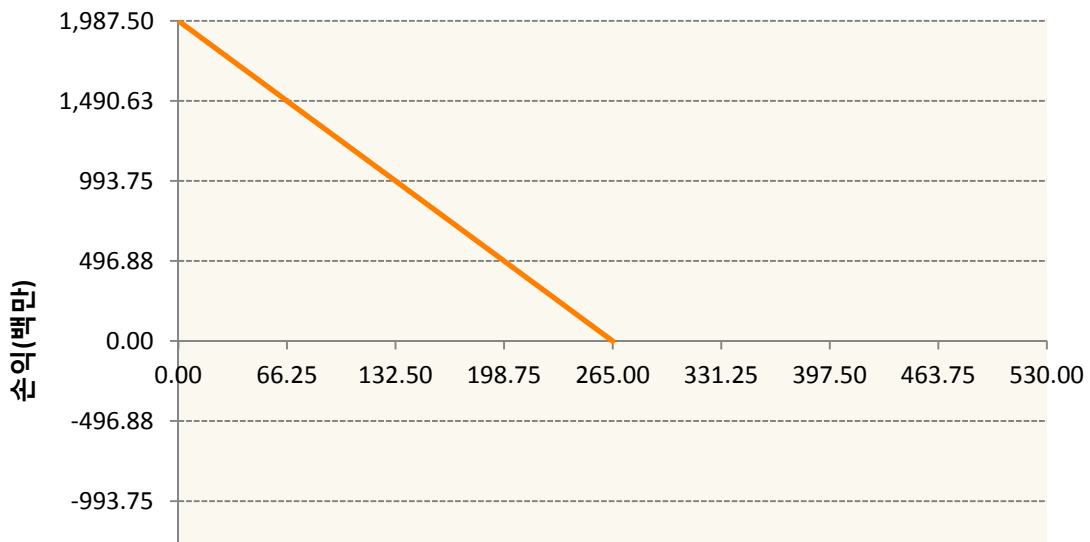


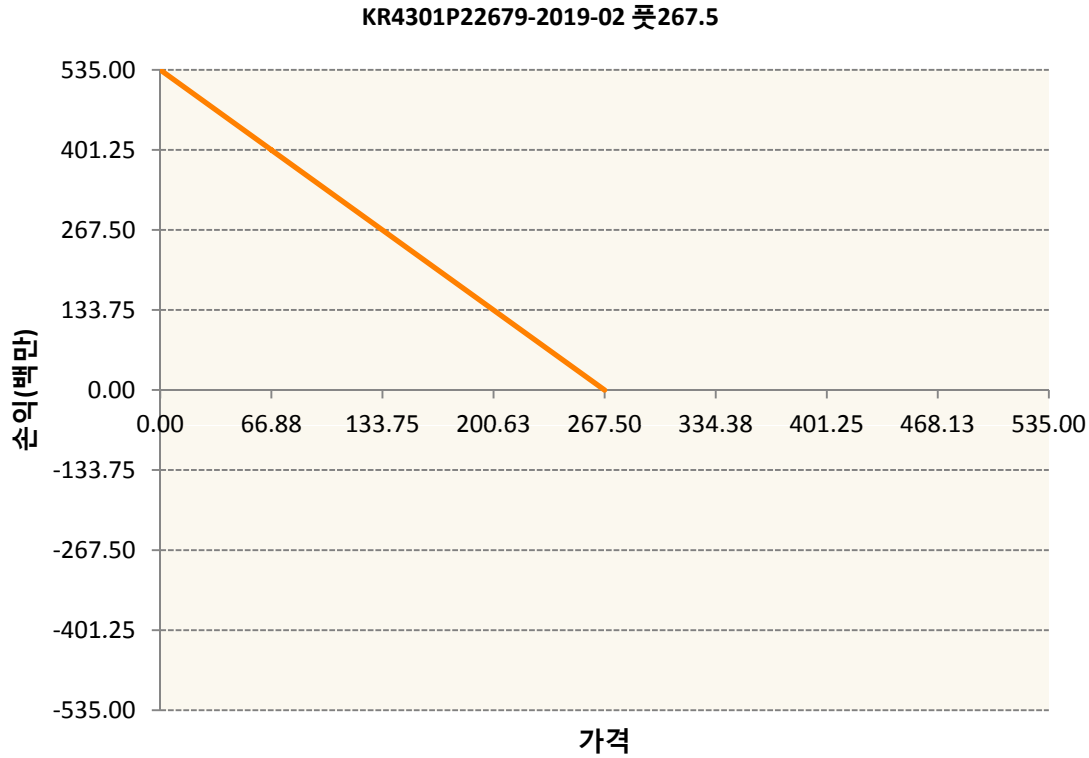
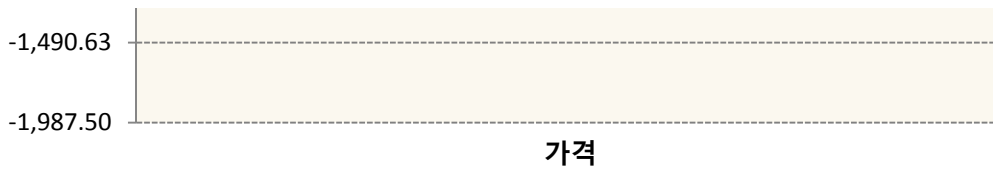


KR4201P22804-2019-02 콜280



KR4301P22653-2019-02 풋265





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101P30007		2019-03 코스피200지수선물						1,075
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-1,075	-1,075	-1,075	-1,075	-1,075	-1,075	-1,075	
-5.33%	-717	-717	-717	-717	-717	-717	-717	
-2.67%	-358	-358	-358	-358	-358	-358	-358	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	358	358	358	358	358	358	358	
5.33%	717	717	717	717	717	717	717	
8.00%	1,075	1,075	1,075	1,075	1,075	1,075	1,075	
KR4201P22770		2019-02 콜277.5						809
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	409	402	393	384	373	361	349	
-5.33%	361	346	331	315	299	282	266	
-2.67%	243	225	207	188	170	152	134	

0%	44	30	15	0	-16	-32	-49
2.67%	-214	-221	-230	-239	-250	-262	-274
5.33%	-500	-503	-506	-511	-517	-524	-532
8.00%	-795	-796	-797	-799	-801	-805	-809
KR4201P22804 2019-02 콜280							889
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	396	390	382	373	363	352	340
-5.33%	358	344	328	312	295	278	260
-2.67%	253	233	212	191	170	150	129
0%	57	38	19	0	-20	-39	-59
2.67%	-218	-229	-241	-254	-269	-284	-300
5.33%	-535	-539	-545	-552	-561	-570	-581
8.00%	-868	-869	-871	-874	-878	-883	-889
KR4301P22653 2019-02 풋265							38
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	26	28	30	32	34	36	38
-5.33%	4	6	7	9	11	12	14
-2.67%	0	0	1	1	2	3	4
0%	0	0	0	0	0	0	1
2.67%	0	0	0	0	0	0	0
5.33%	0	0	0	0	0	0	0
8.00%	0	0	0	0	0	0	0
KR4301P22679 2019-02 풋267.5							13
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	11	11	11	12	12	13	13
-5.33%	2	3	3	4	4	5	5
-2.67%	0	0	0	1	1	1	2
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	0	0	0	0	0	0	0
5.33%	0	0	0	0	0	0	0
8.00%	0	0	0	0	0	0	0

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

(단위:백만원)

2,773

공시일	2019-02-01
기준일	2019-01-31

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	649	0	649	

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	2019-02-01
기준일	2019-01-31

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	3,408	0	3,408	

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	2019-02-01
기준일	2019-01-31

H2O글로벌본드(H)(채권혼합-파생)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	300	0	300	
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	수익증권	14,599	0	14,599	
누계	통화	선도	0	15,701	-15,701	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		27
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		20
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		37
FX21019F01 KRW/USD 28-02-19E		14
FX21019F01 KRW/USD 28-02-19E		57
FX21019F01 KRW/USD 28-02-19E		9
FX21019F01 KRW/USD 28-02-19E		32
FX21019F02 KRW/USD 25-02-19E		134
FX21019F02 KRW/USD 28-03-19E		463
FX21019F02 KRW/USD 28-02-19E		116

FX21019F02(KRW/USD 29-03-19E
FX21019F02(KRW/USD 29-03-19E
FX21019F03(KRW/USD 28-02-19E

24
71
27

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

(단위:백만원)

477

공시일	2019-02-01
기준일	2019-01-31

스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

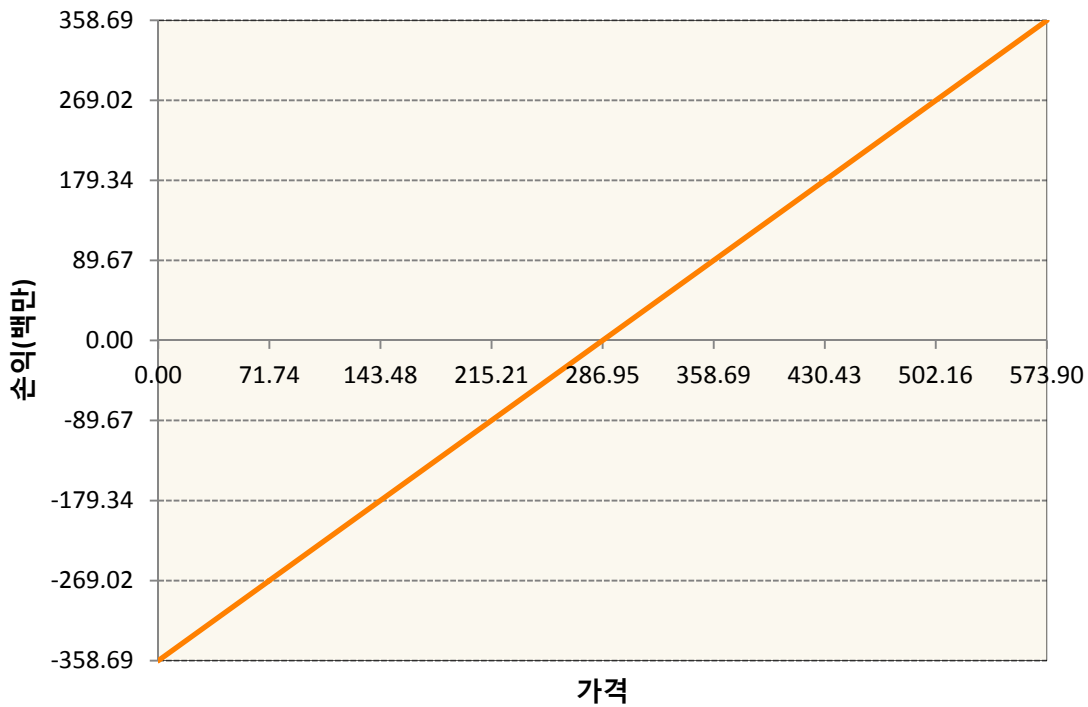
1. 계약금액

(단위:백만원)

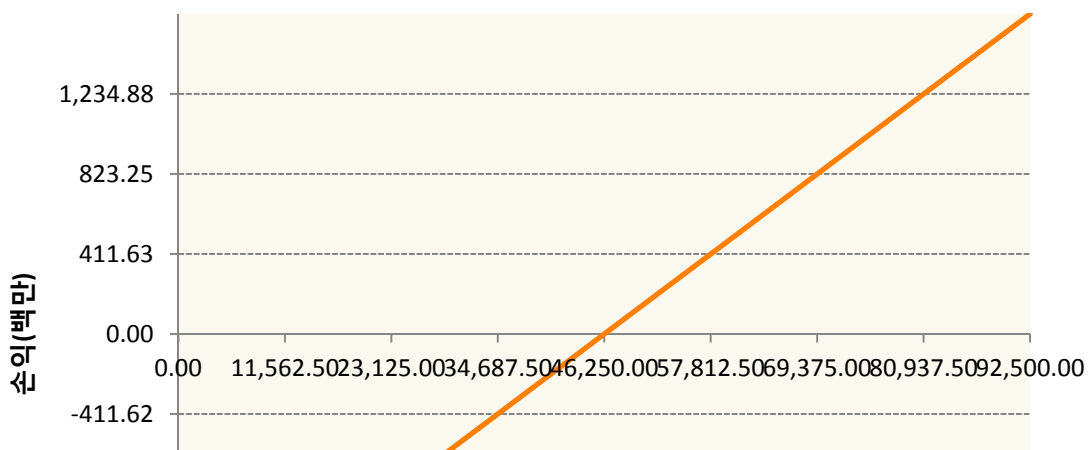
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,005	0	2,005	장내

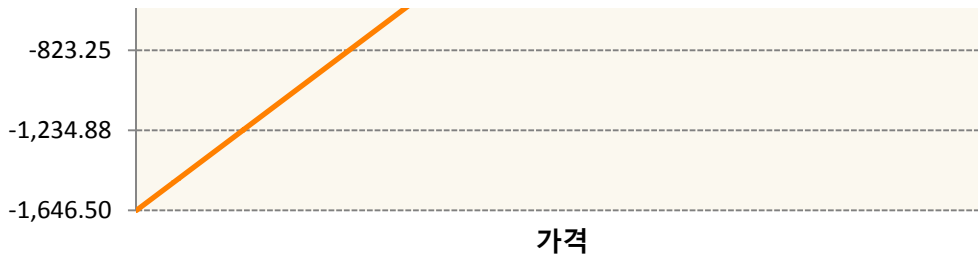
2. 만기시점의 손익구조

KR4101P30007-2019-03 코스피200지수선물



KR4111P20007-2019-02 삼성전자개별선물





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101P30007		2019-03 코스피200지수선물						29
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-29	-29	-29	-29	-29	-29	-29	
-5.33%	-19	-19	-19	-19	-19	-19	-19	
-2.67%	-10	-10	-10	-10	-10	-10	-10	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	10	10	10	10	10	10	10	
5.33%	19	19	19	19	19	19	19	
8.00%	29	29	29	29	29	29	29	
KR4111P20007		2019-02 삼성전자개별선물						131
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-131	-131	-131	-131	-131	-131	-131	
-5.33%	-88	-88	-88	-88	-88	-88	-88	
-2.67%	-44	-44	-44	-44	-44	-44	-44	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	44	44	44	44	44	44	44	
5.33%	88	88	88	88	88	88	88	
8.00%	131	131	131	131	131	131	131	

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

180

공시일	2019-02-01
기준일	2019-01-31

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

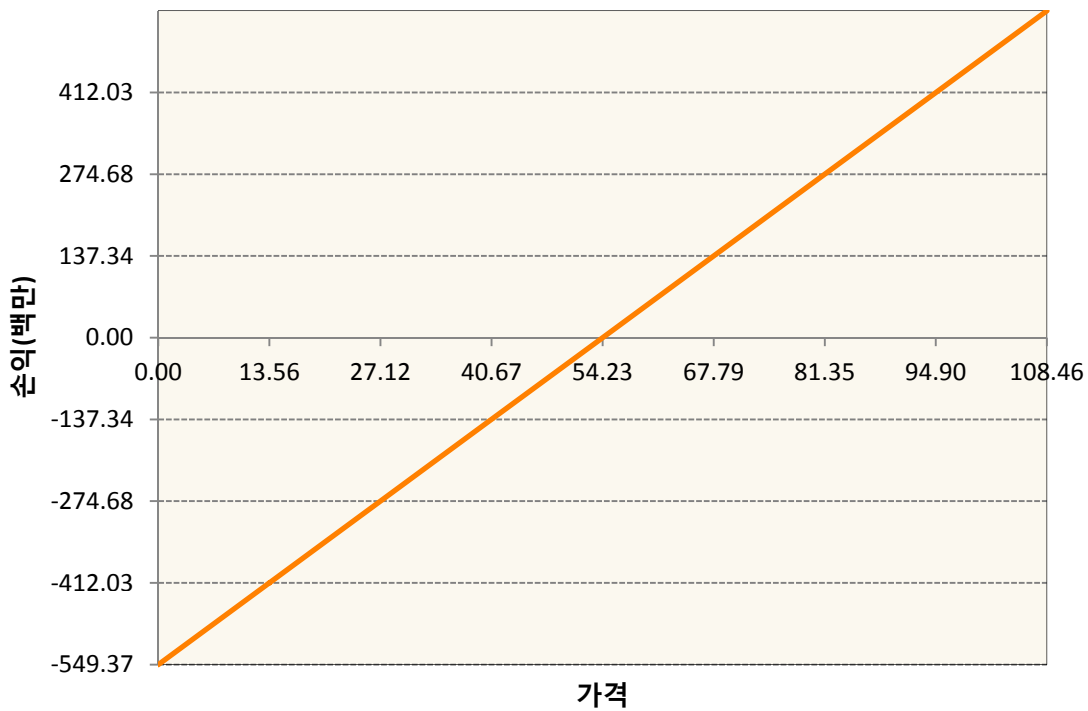
1. 계약금액

(단위:백만원)

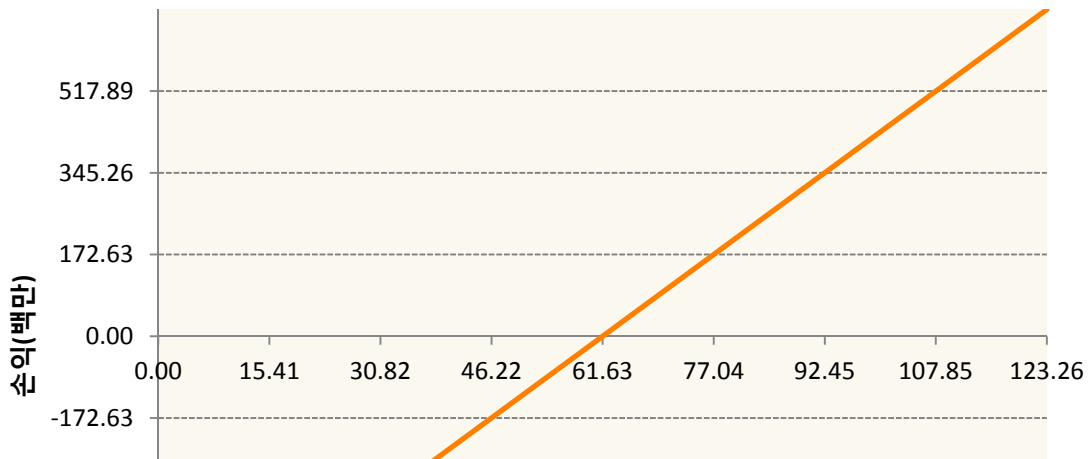
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,714	278	2,436	

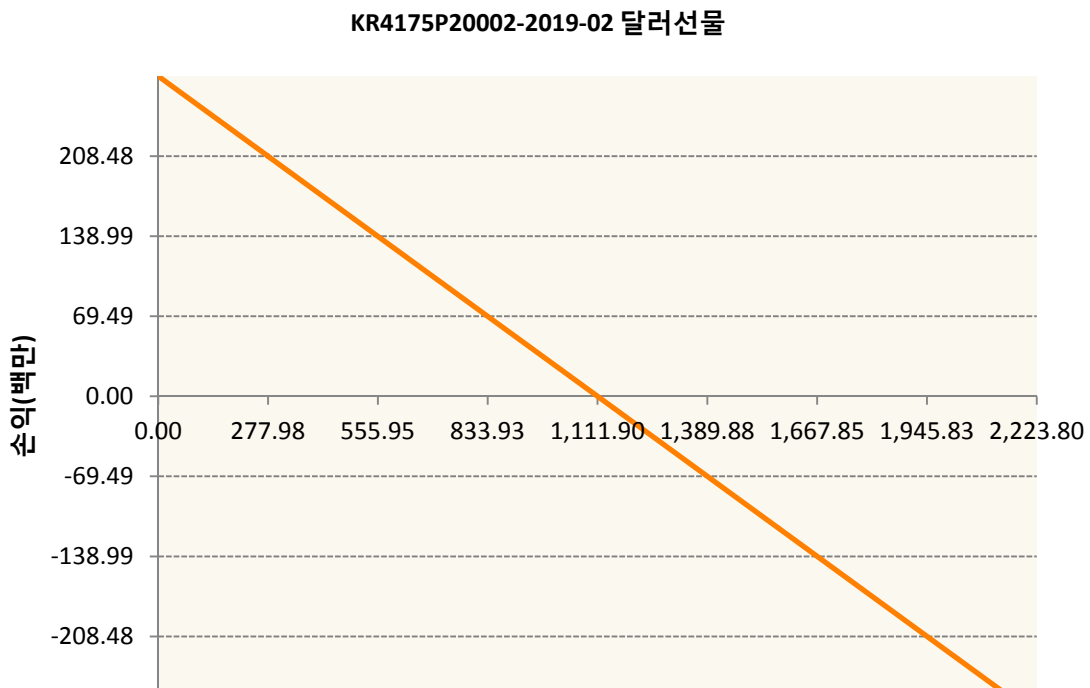
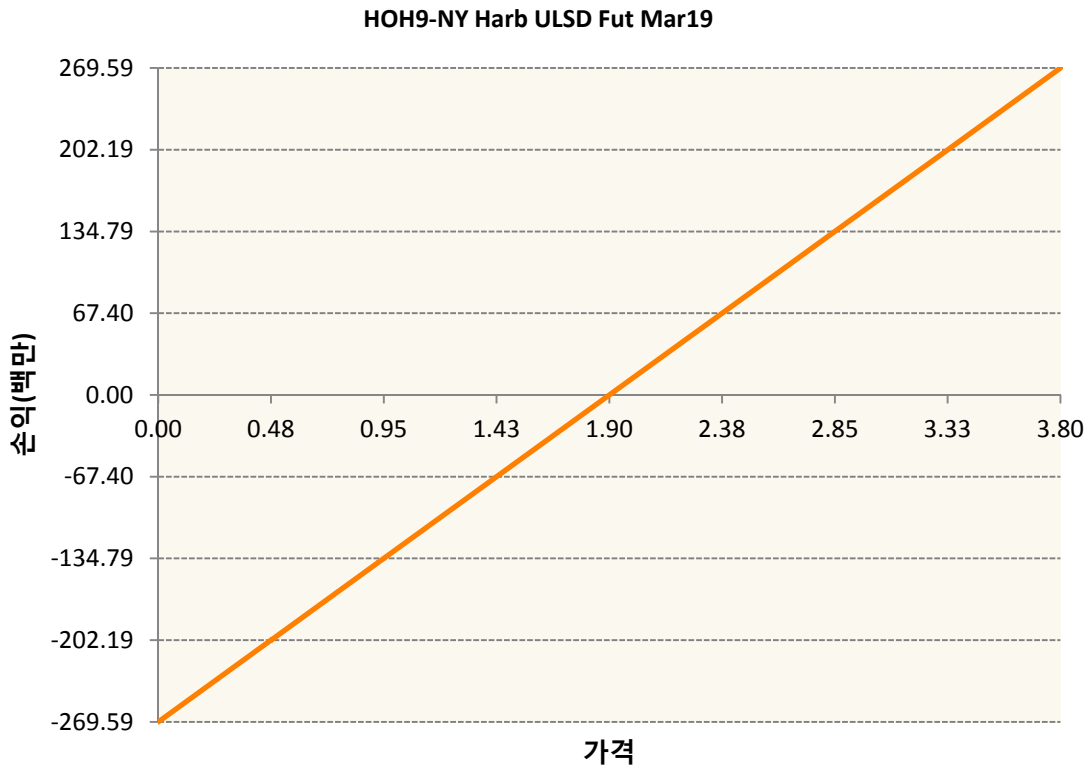
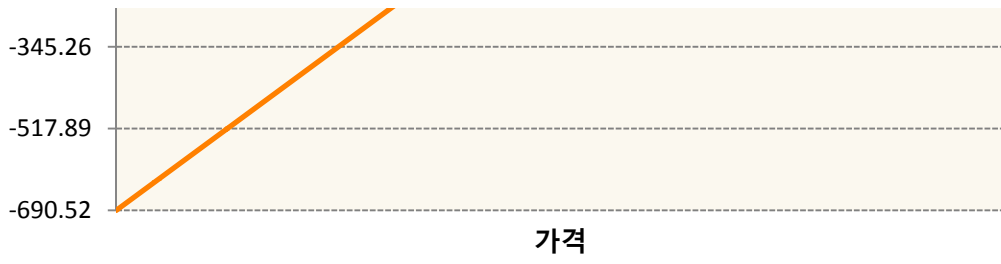
2. 만기시점의 손익구조

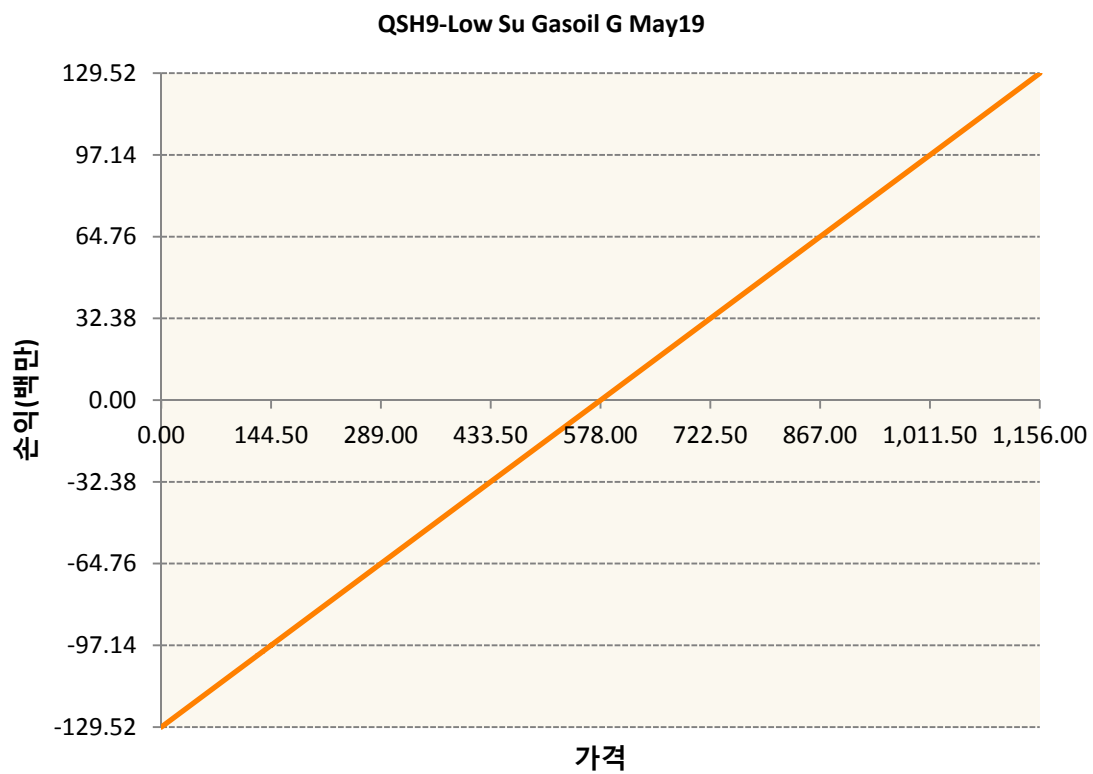
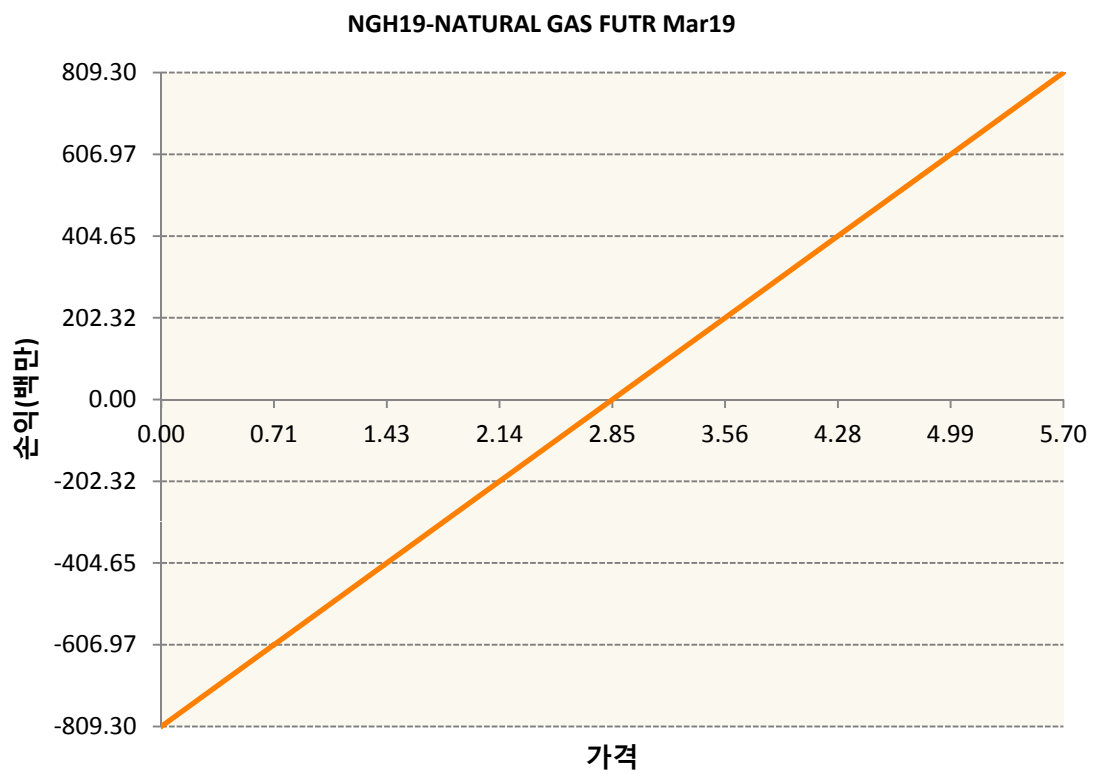
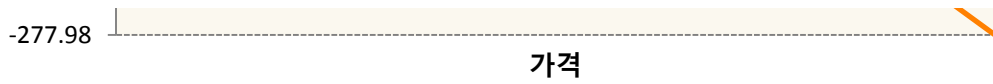
CLH9-WTI CRUDE FUTURE MAR19



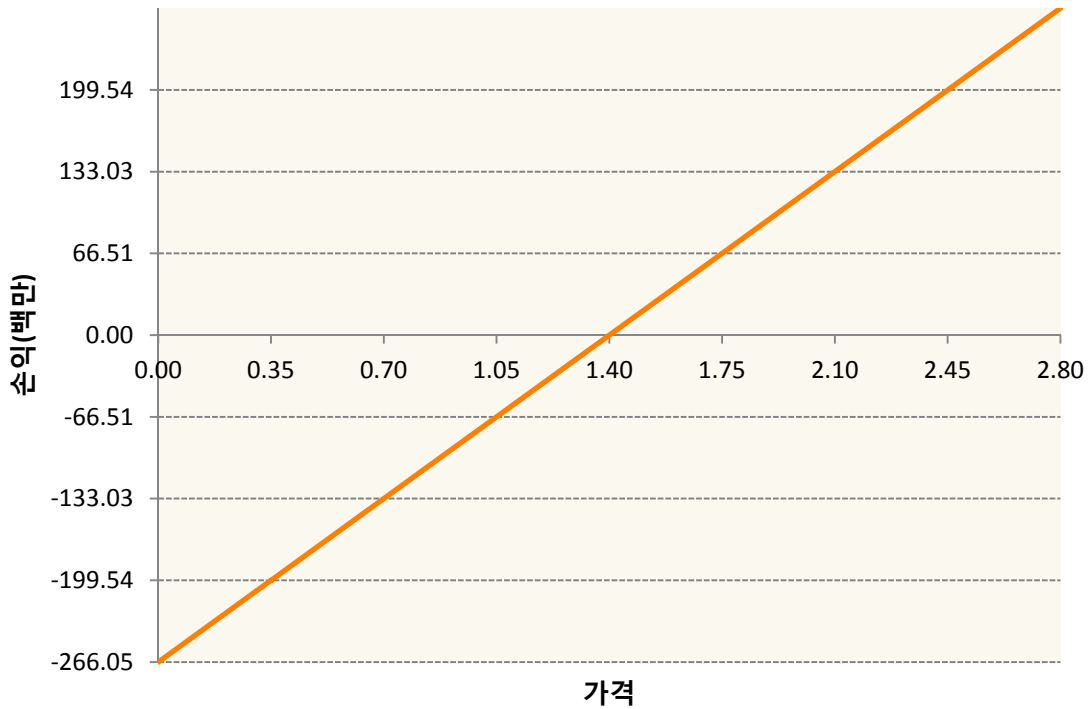
COK9-BRENT CRUDE FUTR May19







XBH9-GASOLINE RBOB FUT Mar19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLH9	WTI CRUDE FUTURE MAR19	44
COK9	BRENT CRUDE FUTR May19	55
HOH9	NY Harb ULSD Fut Mar19	22
KR4175P200	2019-02 달러선물	22
NGH19	NATURAL GAS FUTR Mar19	65
QSH9	Low Su Gasoil G May19	10
XBH9	GASOLINE RBOB FUT Mar19	21

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

429

공시일	2019-02-01
기준일	2019-01-31

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

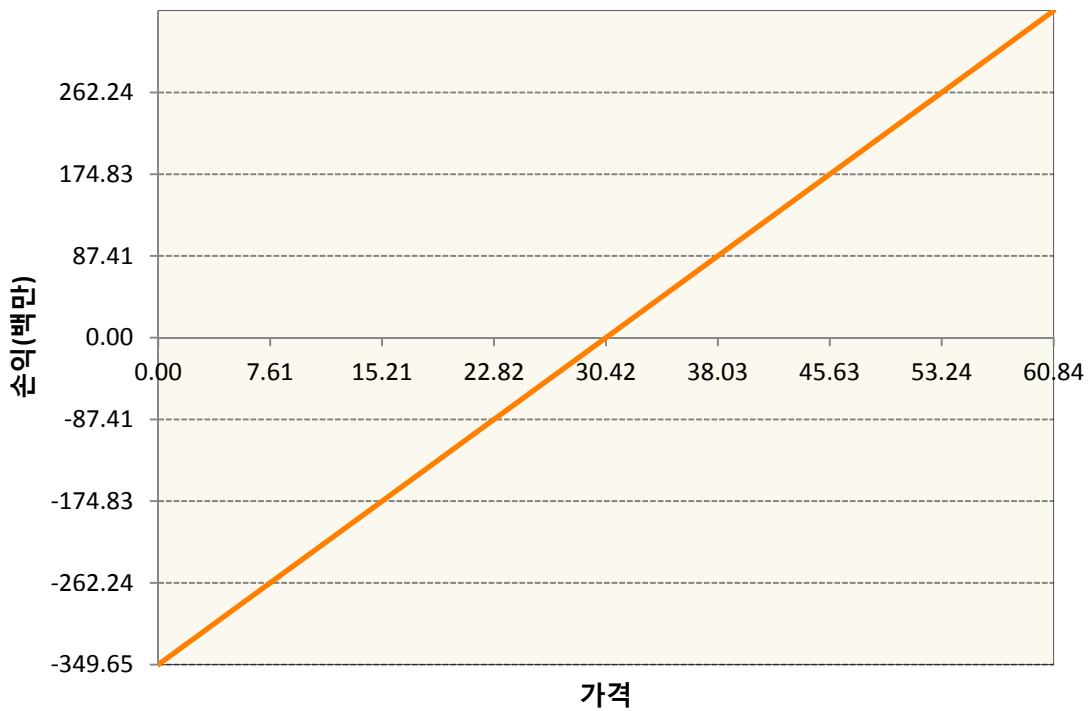
1. 계약금액

(단위:백만원)

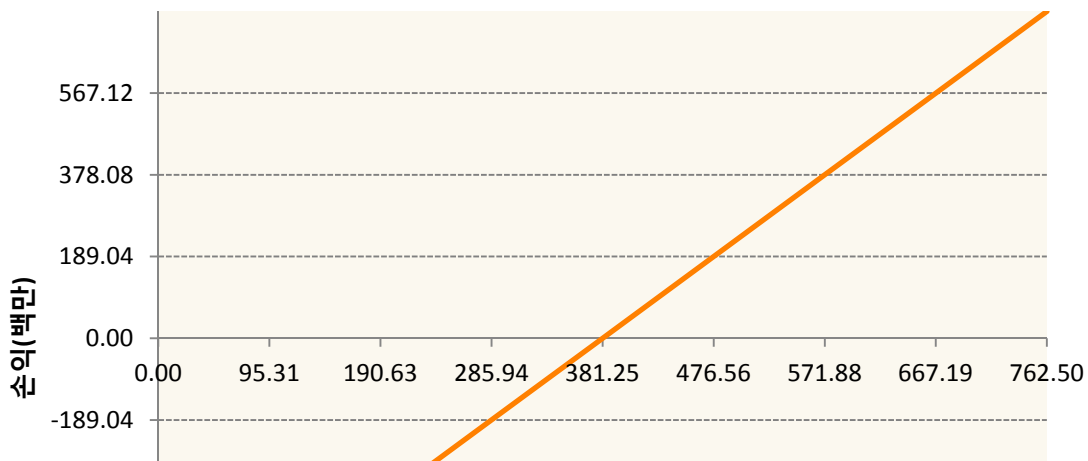
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,592	78	3,515	

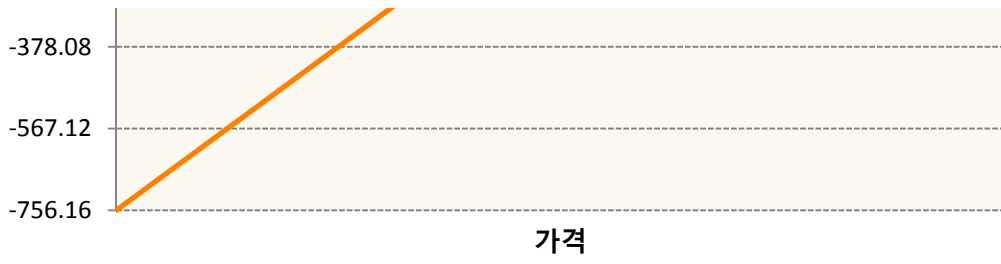
2. 만기시점의 손익구조

BOH9-SOYBEAN OIL FUTR Mar19

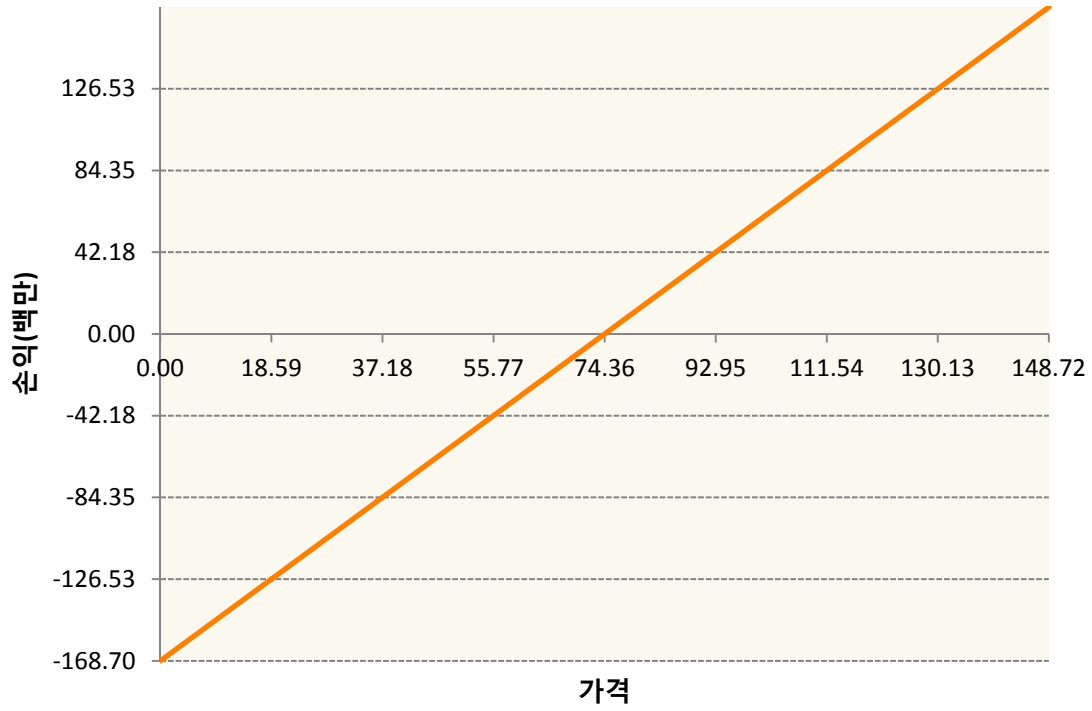


CH9-CORN FUTURE Mar19

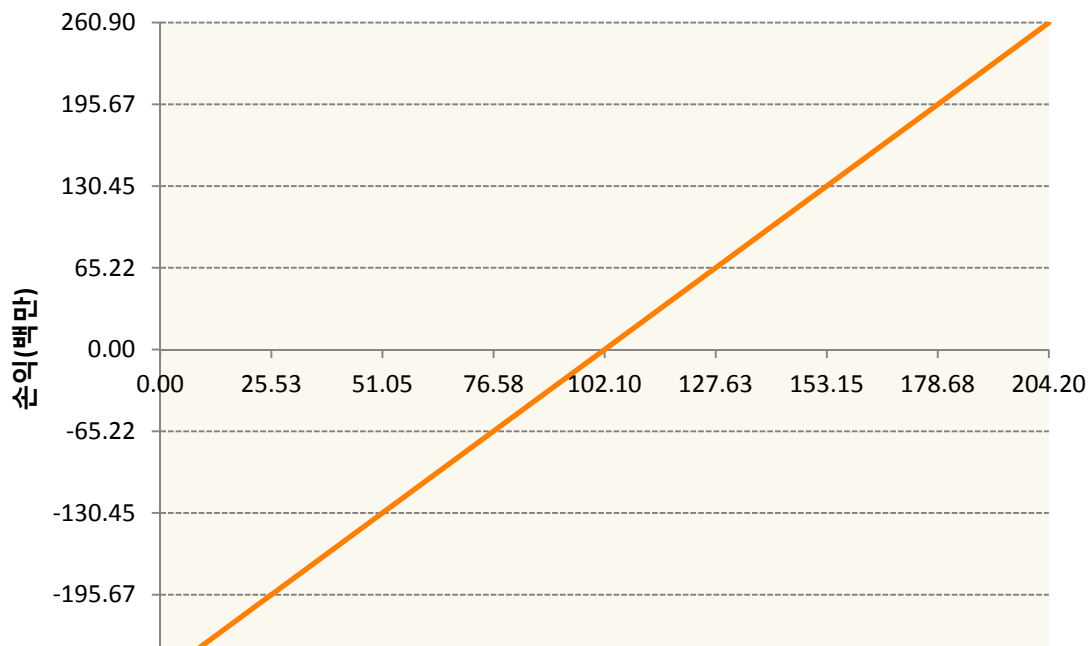


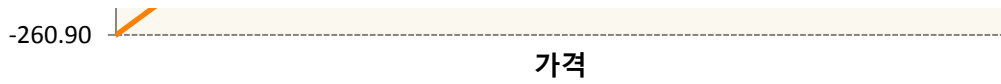


CTH9-COTTON NO.2 FUTR Mar19

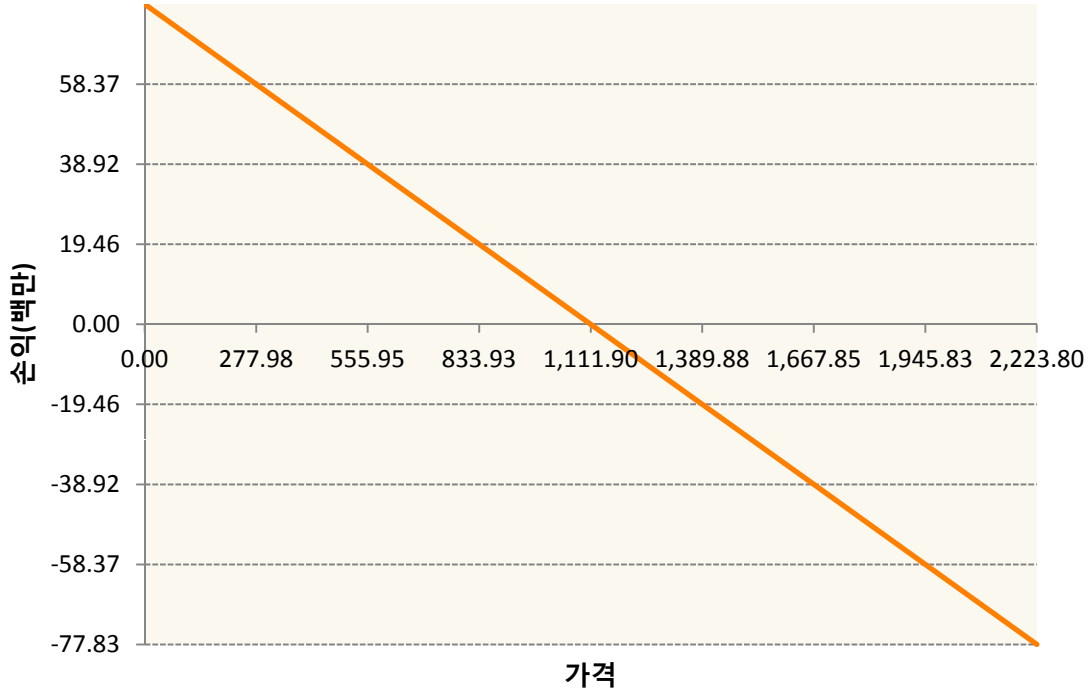


KCH9-COFFEE 'C' FUTURE Mar19

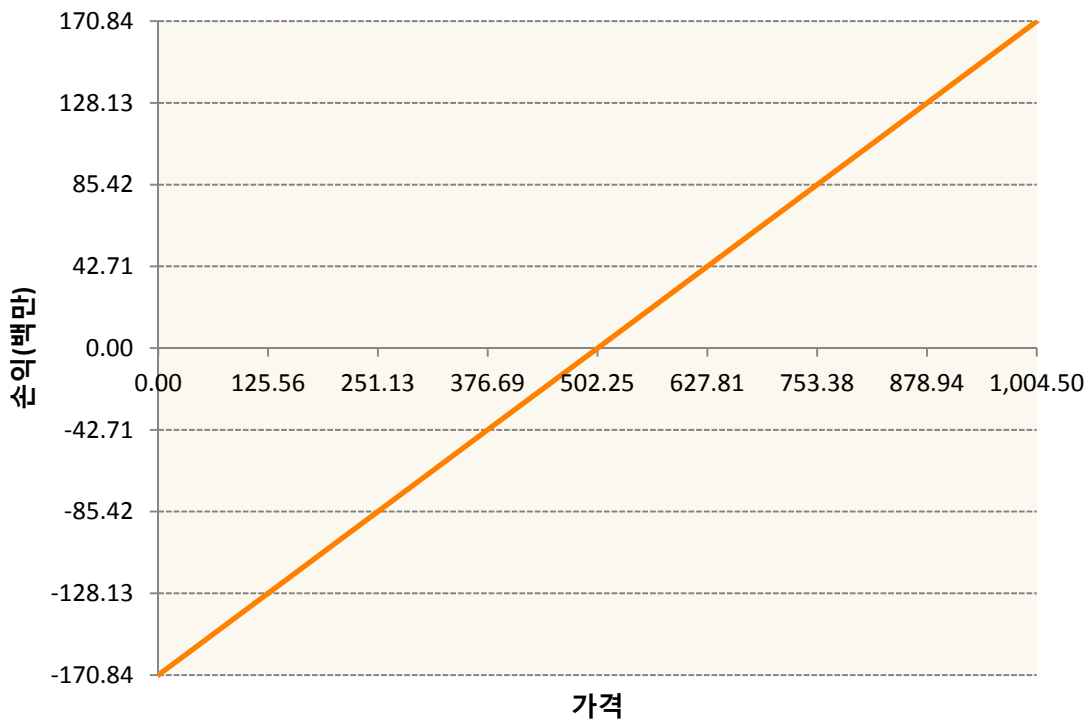




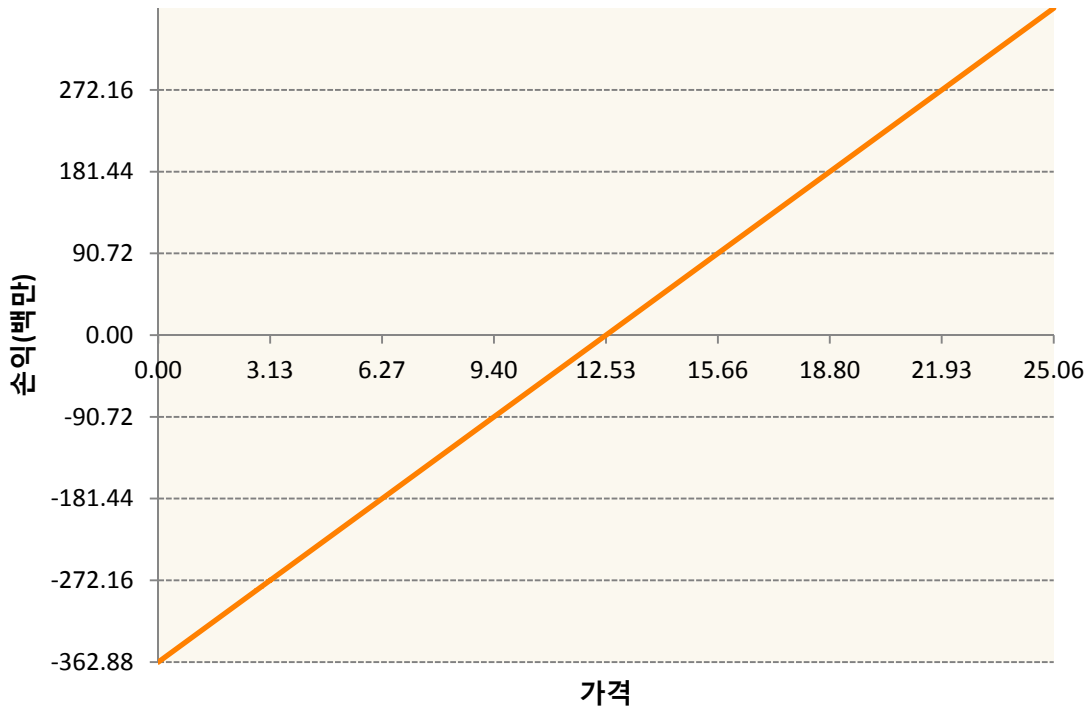
KR4175P20002-2019-02 달러선물



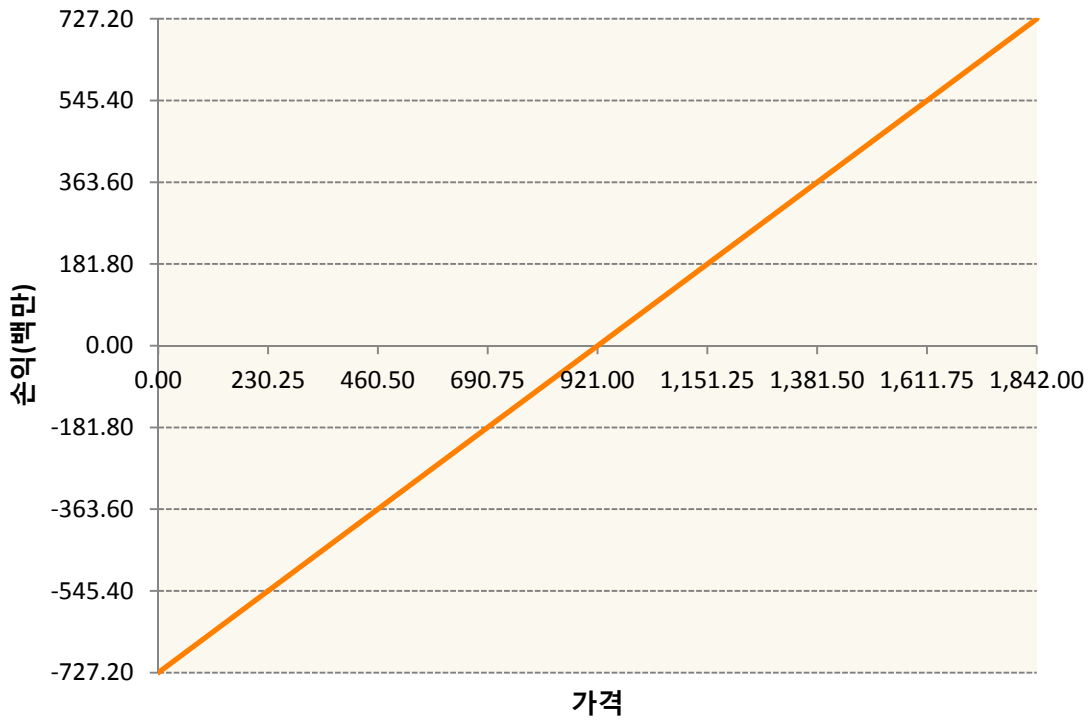
KWH9-KC HRW WHEAT FUT Mar19



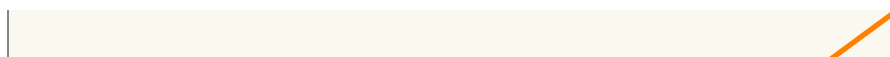
SBH9-SUGAR #11 (WORLD) MAR19

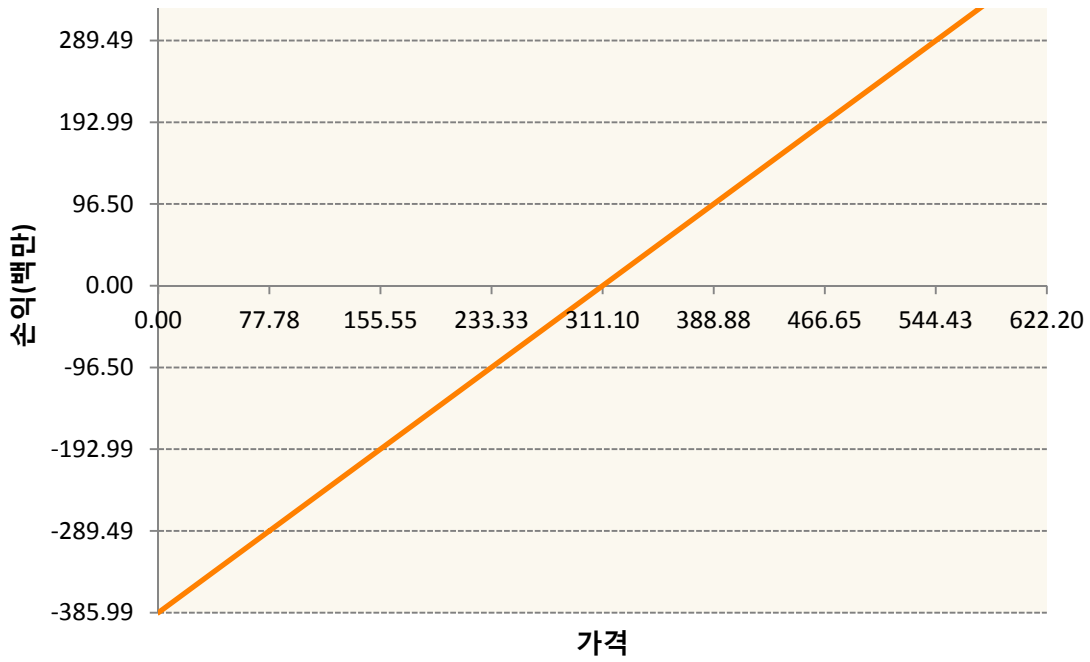


SH9-SOYBEAN FUTURE Mar19

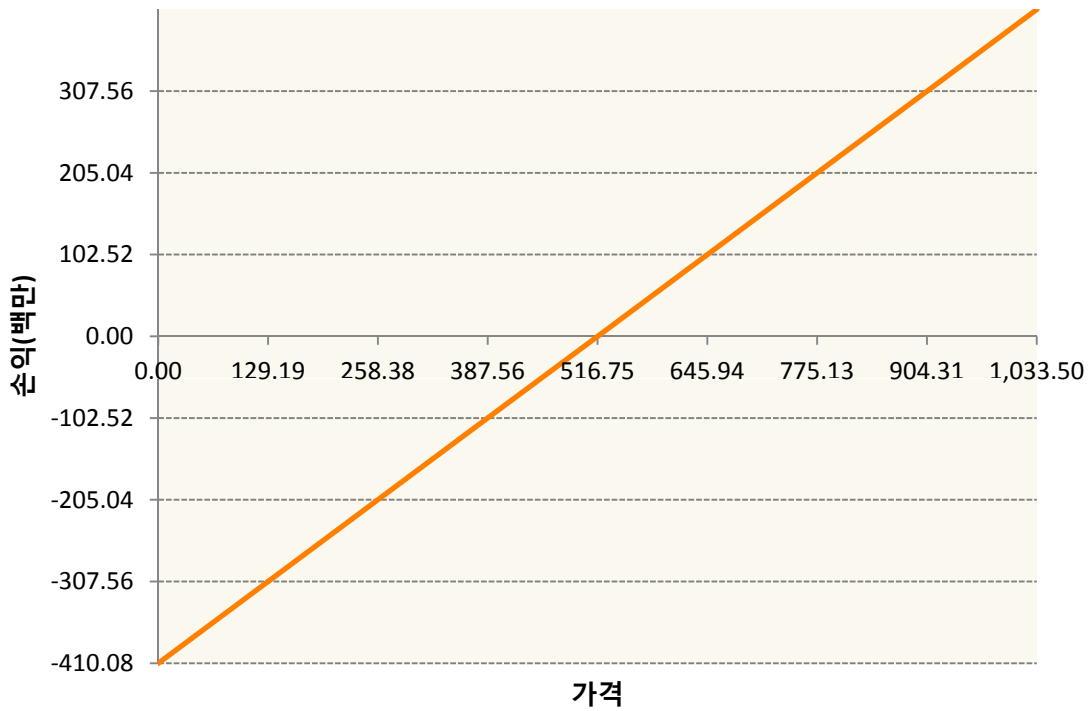


SMH9-SOYBEAN MEAL FUTR Mar19





WH9-WHEAT FUTURE(CBT) Mar19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

BOH9	SOYBEAN OIL FUTR Mar19	28
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	29
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)

293