

공시일	2020-01-10
기준일	2020-01-09

## 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	5	0	5	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)

14
----

공시일	2020-01-10
기준일	2020-01-09

## 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	13,582	0	13,582	장외

### 2. 만기시점의 손익구조

### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWMXWO0( 신한MXWO 미래S191122

1,133

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

649

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2020-01-10
기준일	2020-01-09

## 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	6,551	0	6,551	장외

### 2. 만기시점의 손익구조

### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI50000 신한CSI500미래S191210(1)	426
SWCSI50000 신한CSI500미래S191210(2)	156

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

**810**

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2020-01-10
기준일	2020-01-09

## 유로인덱스모(주식-파생형)

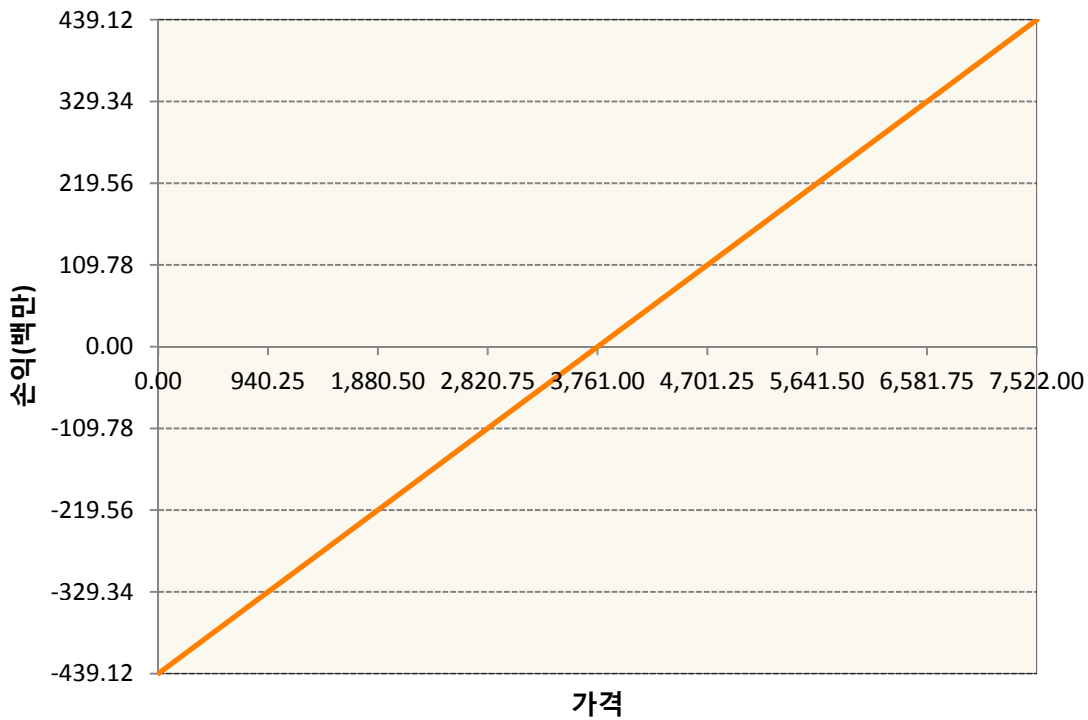
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	439	0	439	

### 2. 만기시점의 손익구조

VGH0-EURO STOXX 50 Mar20



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGH0	EURO STOXX 50 Mar20	35
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

24
----

공시일	2020-01-10
기준일	2020-01-09

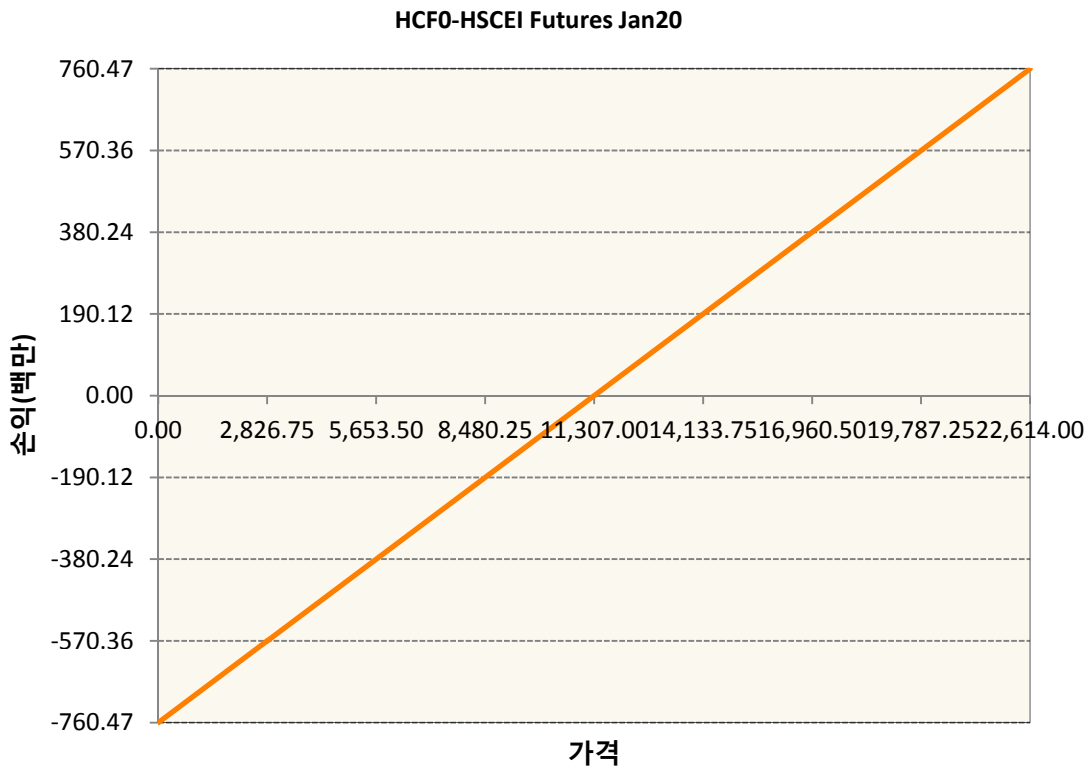
## 차이나인덱스모(주식-파생형)

### 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	760	0	760	장내

### 2. 만기시점의 손익구조



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCF0	HSCEI Futures Jan20	61
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

53
----

공시일	2020-01-10
기준일	2020-01-09

## 커버드콜모(주식혼합-파생형)

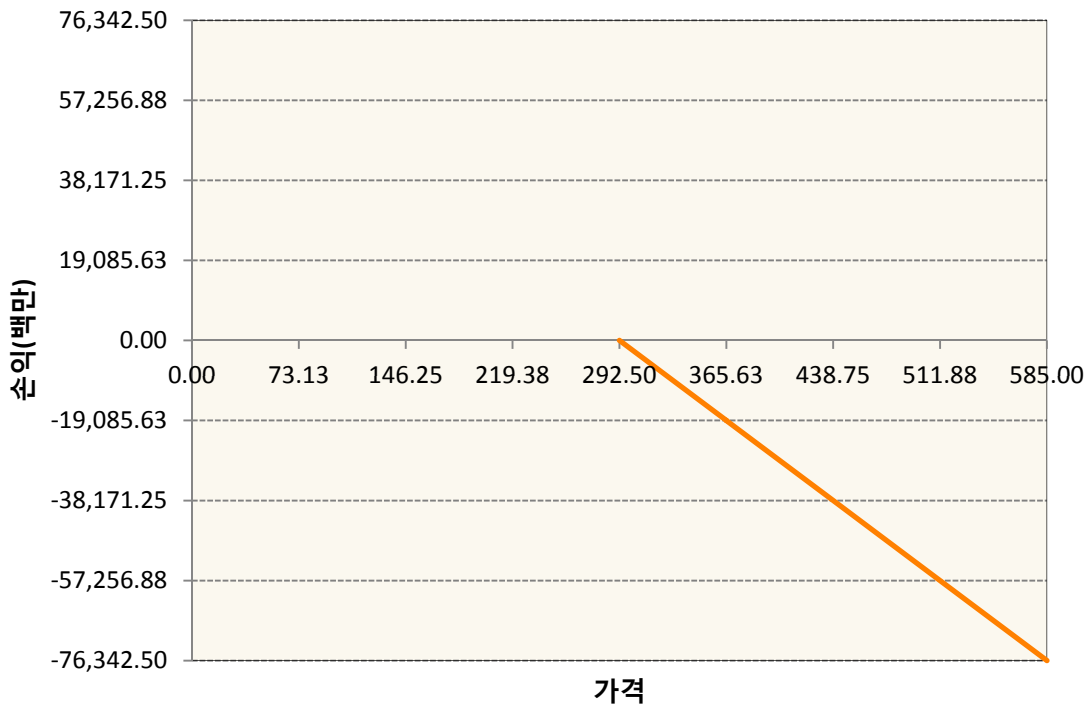
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

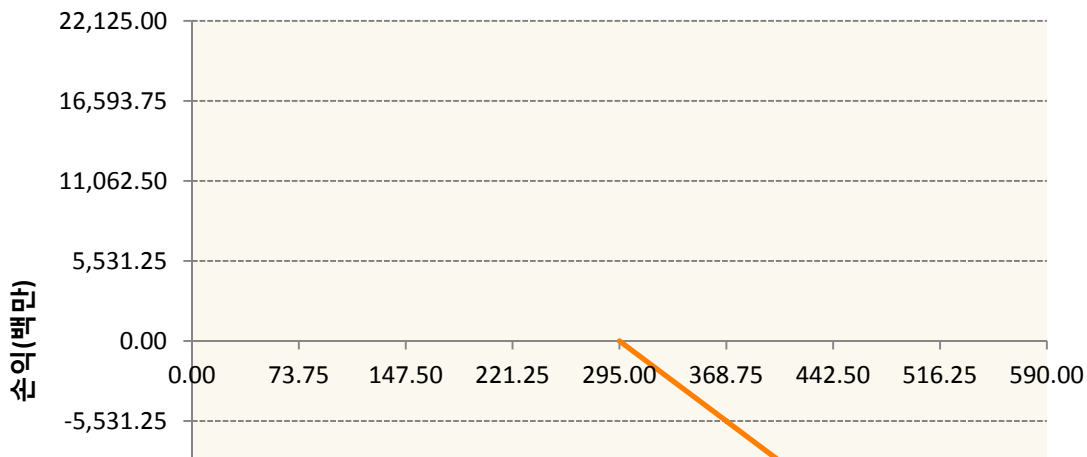
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	100,213	-100,213	장내
누계	유가증권	옵션	0	98,468	-98,468	장내

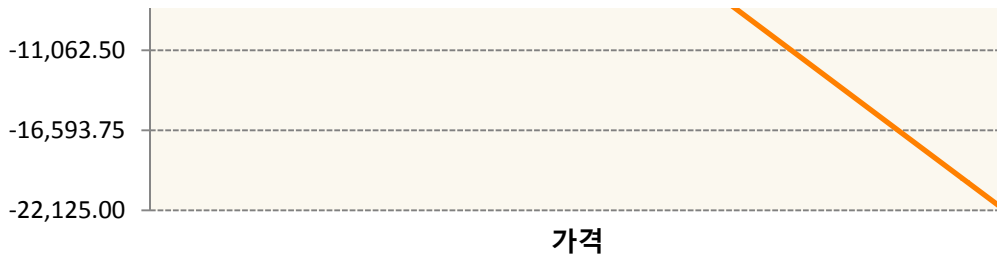
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4201Q22927-2020-02 콜292.5



KR4201Q22950-2020-02 콜295





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

KR4201Q22927		2020-02 콜292.5						4,821
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	2,649	2,532	2,401	2,259	2,107	1,948	1,783	
-5.33%	2,276	2,104	1,925	1,740	1,550	1,356	1,160	
-2.67%	1,634	1,422	1,208	993	778	561	344	
0%	671	447	224	0	-224	-448	-671	
2.67%	-614	-818	-1,025	-1,236	-1,450	-1,665	-1,882	
5.33%	-2,175	-2,337	-2,511	-2,692	-2,880	-3,074	-3,272	
8.00%	-3,942	-4,056	-4,187	-4,330	-4,485	-4,649	-4,821	
KR4201Q22950		2020-02 콜295						1,338
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	689	659	626	588	548	505	460	
-5.33%	600	555	507	457	405	351	297	
-2.67%	441	383	323	263	202	141	80	
0%	194	129	65	0	-65	-129	-194	
2.67%	-146	-208	-270	-333	-397	-460	-524	
5.33%	-570	-622	-676	-732	-789	-848	-907	
8.00%	-1,061	-1,098	-1,141	-1,186	-1,234	-1,285	-1,338	

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

**5,653**

공시일	2020-01-10
기준일	2020-01-09

## 홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

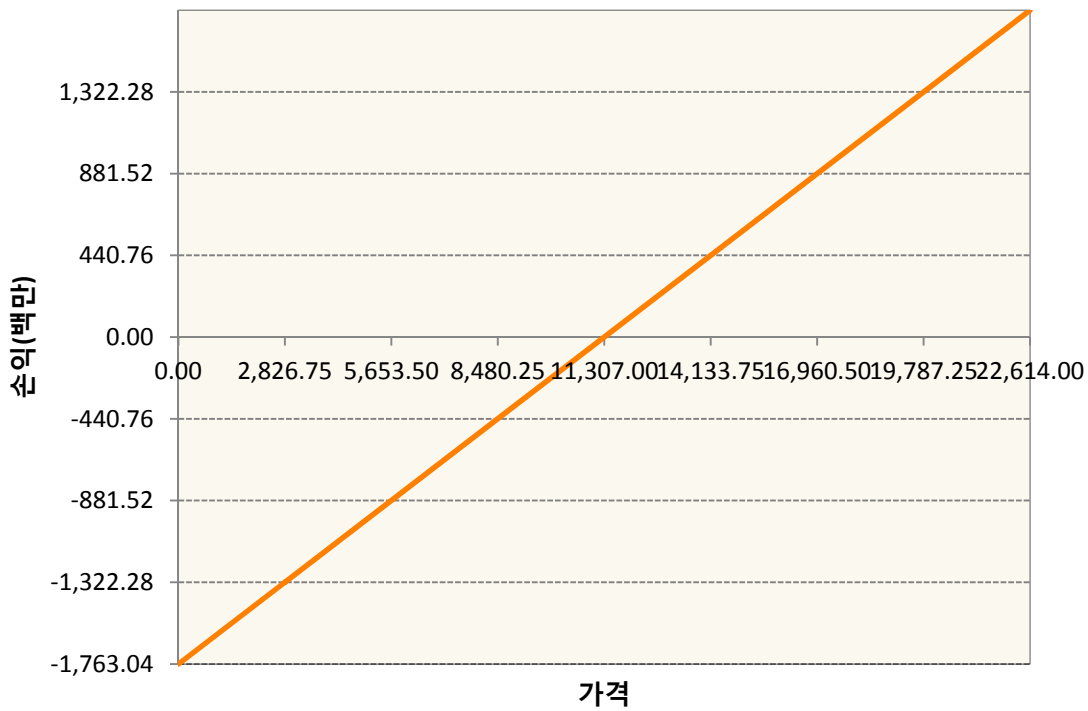
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

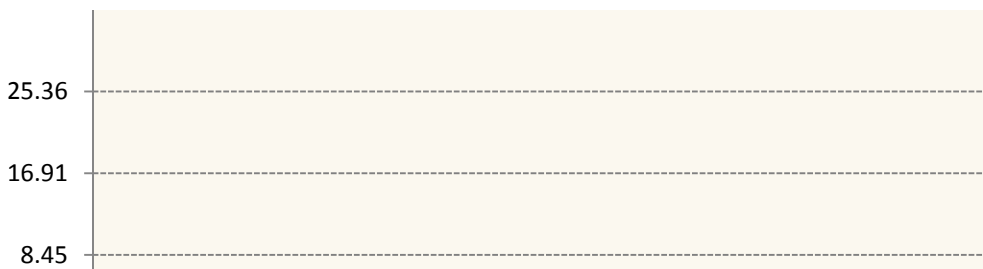
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,763	0	1,763	장내
누계	유가증권	옵션	0	70	-70	장내
누계	통화	선도	0	2,099	-2,099	장외

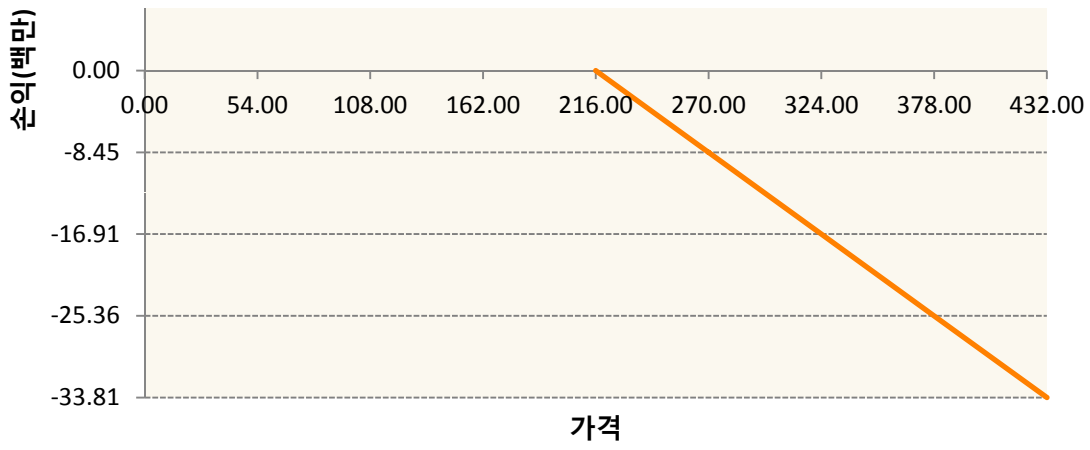
### 2. 만기시점의 손익구조

HCFO-HSCEI Futures Jan20

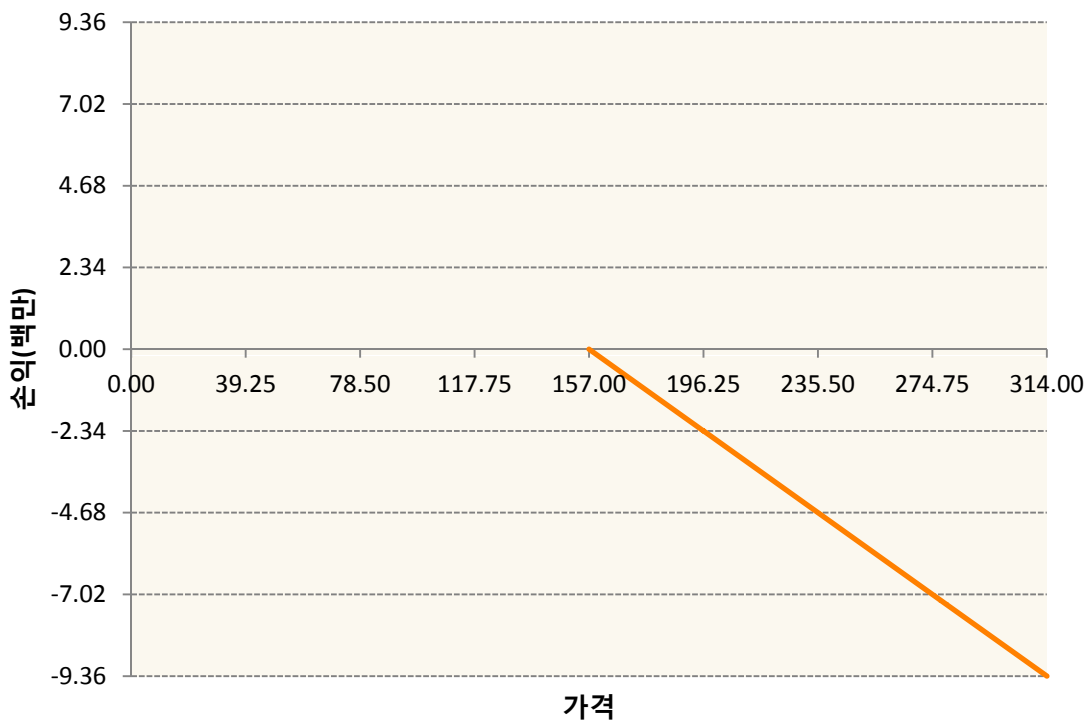


OHHIF0-C112-HSCEI

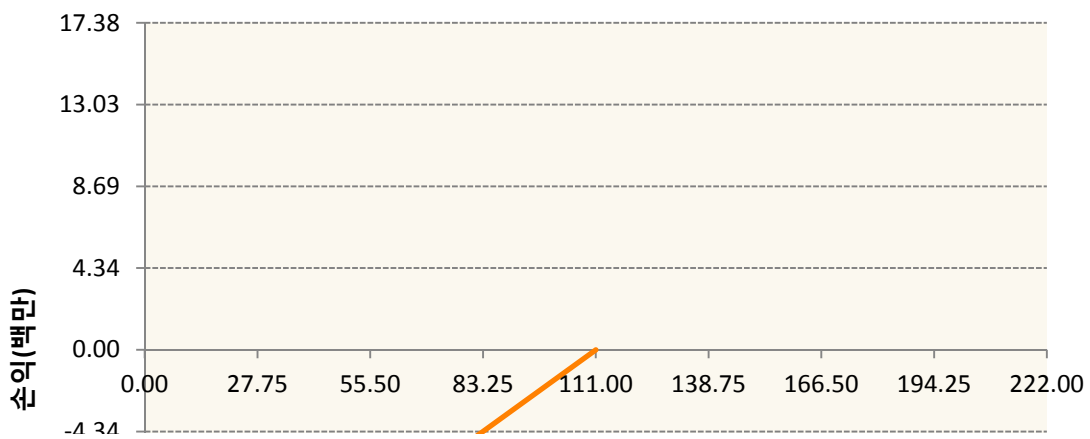


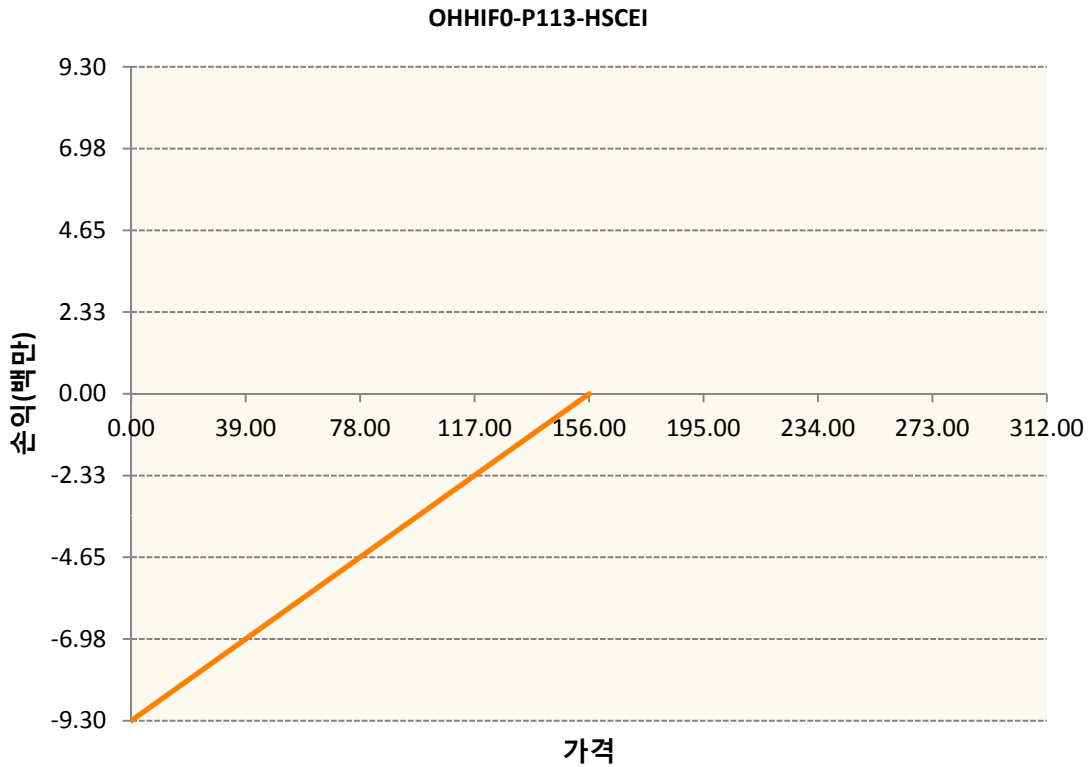


**OHHIF0-C113-HSCEI**



**OHHIF0-P112-HSCEI**





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)	(단위:백만원)
FX21019X02 KRW/HKD 21-02-20E	168
HCF0 HSCEI Futures Jan20	141
OHHIF0-C11 HSCEI	3
OHHIF0-C11 HSCEI	1
OHHIF0-P11 HSCEI	1
OHHIF0-P11 HSCEI	1

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	<b>182</b>



5.33%	263	263	263	263	263	263	263
8.00%	394	394	394	394	394	394	394
KR4101Q30005                      2020-03 코스피200지수선물							200
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-200	-200	-200	-200	-200	-200	-200
-5.33%	-133	-133	-133	-133	-133	-133	-133
-2.67%	-67	-67	-67	-67	-67	-67	-67
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	67	67	67	67	67	67	67
5.33%	133	133	133	133	133	133	133
8.00%	200	200	200	200	200	200	200

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

(단위:백만원)

**551**

공시일	2020-01-10
기준일	2020-01-09

## 유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

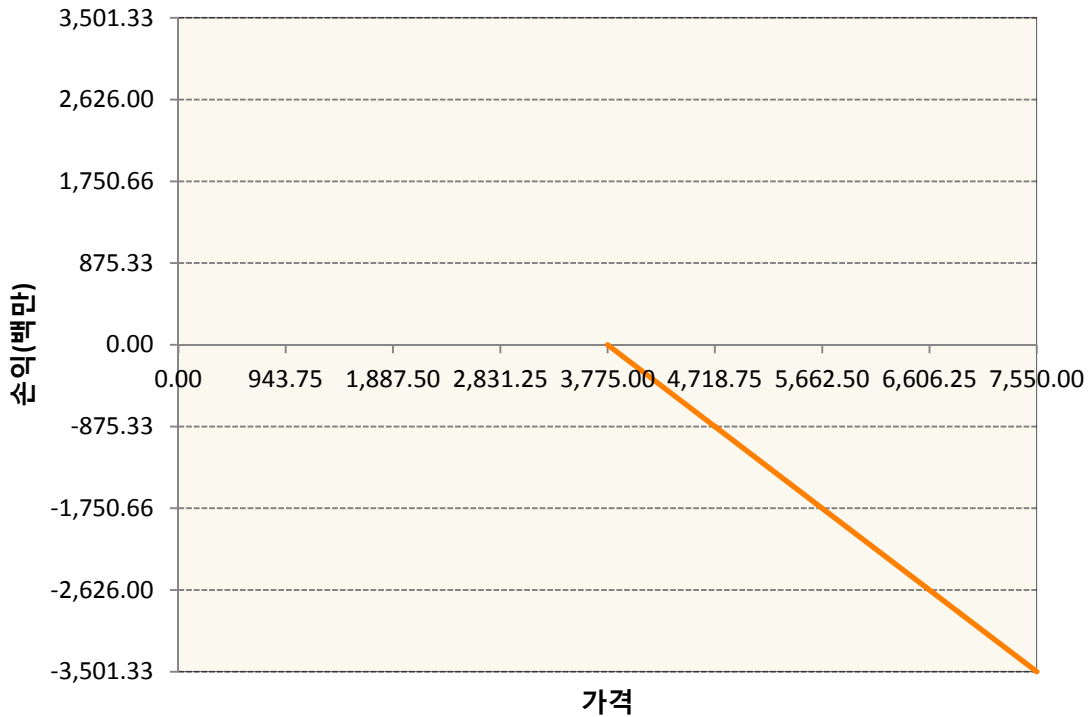
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

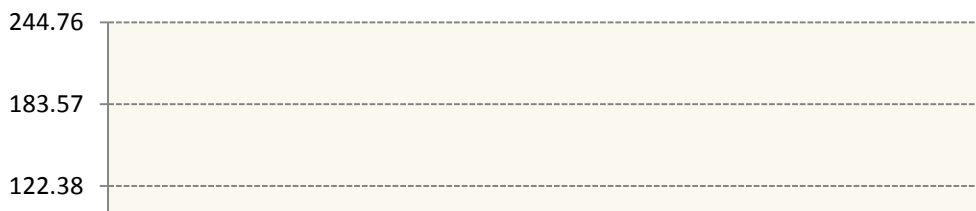
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	682	0	682	
누계	유가증권	스왑	15,645	0	15,645	장외
누계	유가증권	옵션	0	7,492	-7,492	장내
누계	통화	선도	0	3,380	-3,380	장외

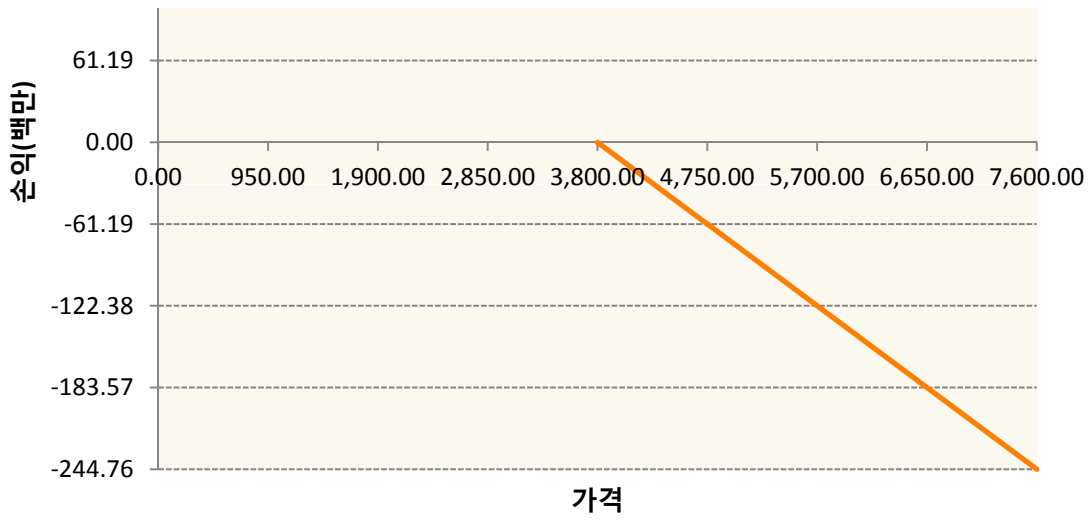
### 2. 만기시점의 손익구조

**OESXF0-C3775-EURO STOXX 50**

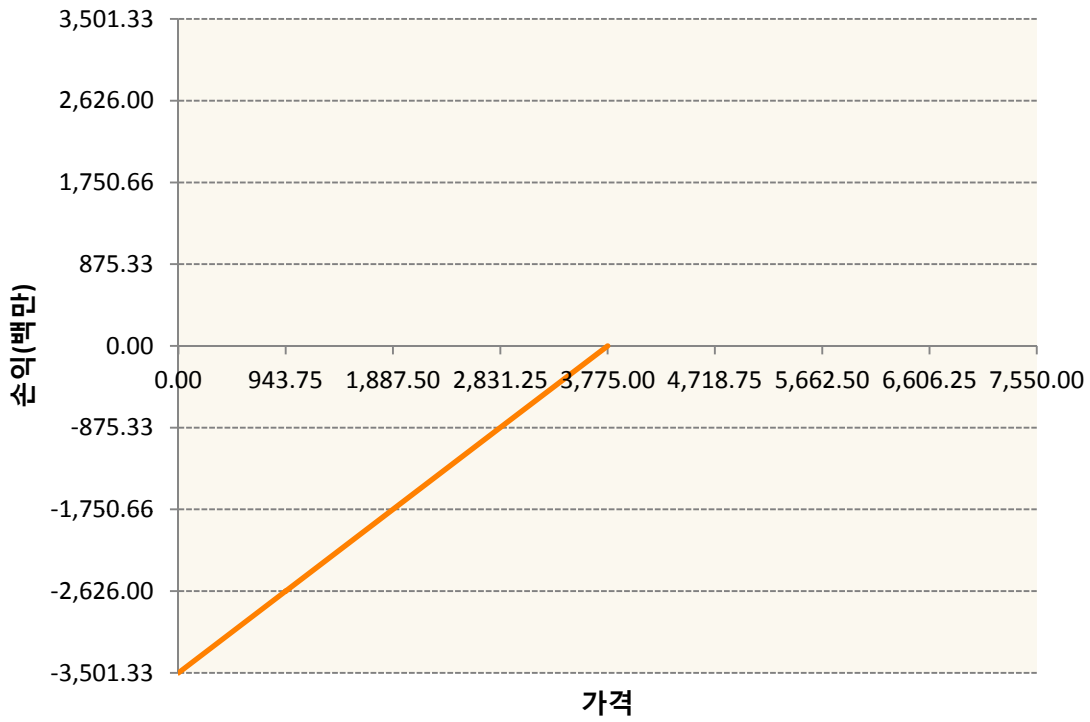


**OESXF0-C3800-EURO STOXX 50**

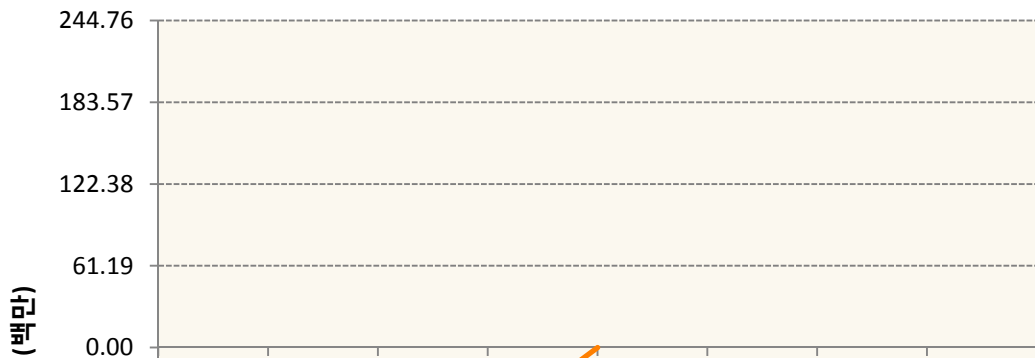


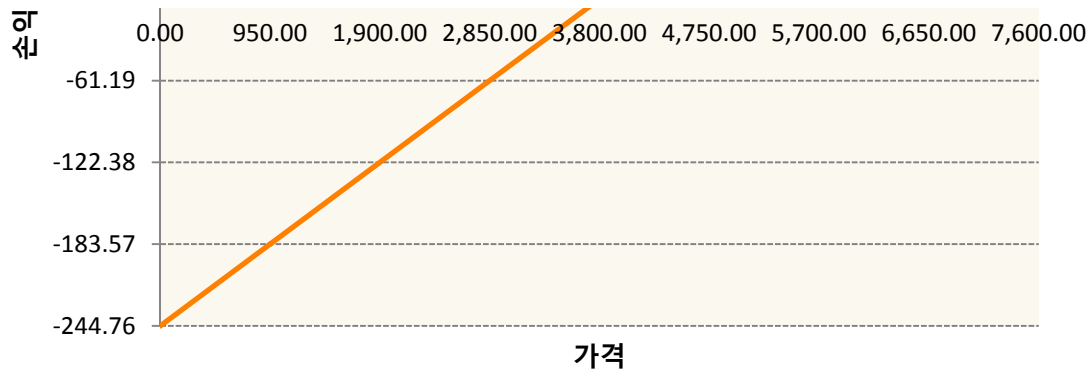


**OESXF0-P3775-EURO STOXX 50**

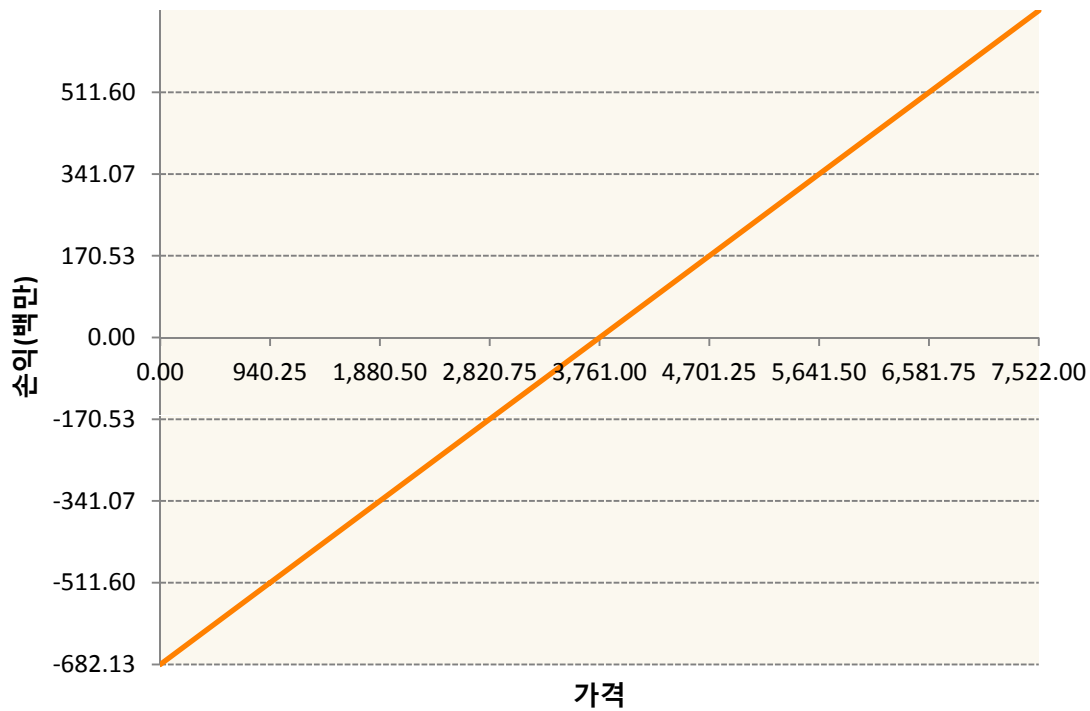


**OESXF0-P3800-EURO STOXX 50**





VGH0-EURO STOXX 50 Mar20



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

260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY	35
FX21019Z04 KRW/EUR 27-03-20E	270
OESXF0-C37 EURO STOXX 50	280
OESXF0-C38 EURO STOXX 50	20
OESXF0-P37 EURO STOXX 50	280
OESXF0-P38 EURO STOXX 50	20
VGH0 EURO STOXX 50 Mar20	55

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





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

(단위:백만원)

919



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

(단위:백만원)

78



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

(단위:백만원)

115

공시일	2020-01-10
기준일	2020-01-09

## 스마트KRX300인덱스목표전환형1호

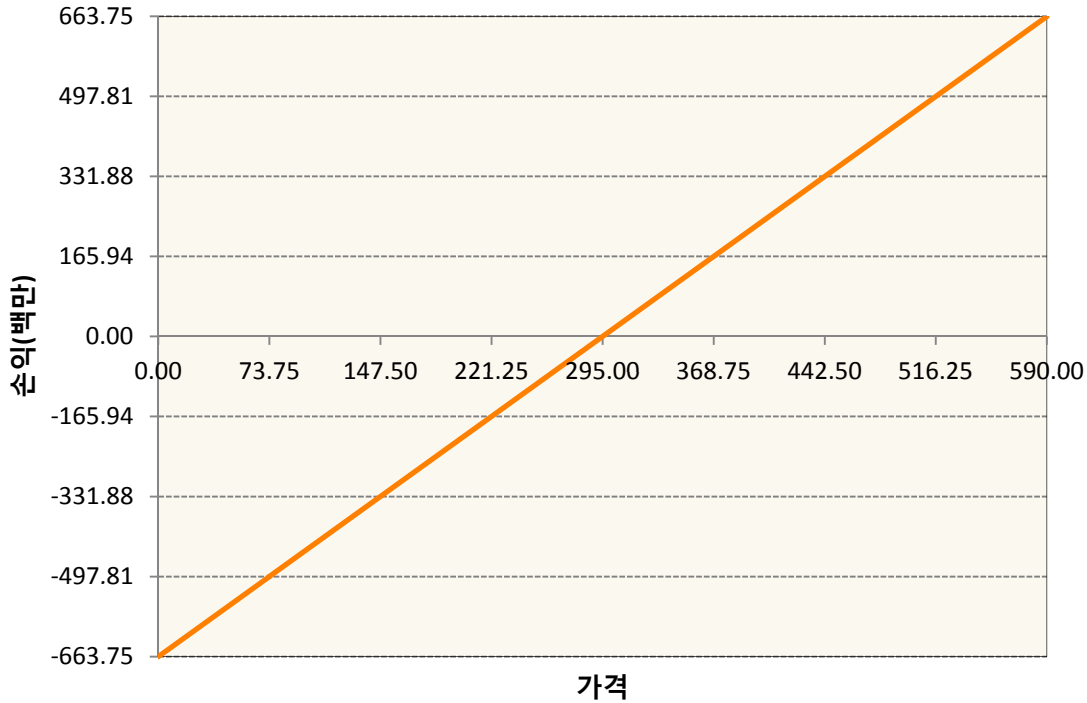
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	664	0	664	장내

### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q30005-2020-03 코스피200지수선물



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101Q30005		2020-03 코스피200지수선물						53
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-53	-53	-53	-53	-53	-53	-53	
-5.33%	-35	-35	-35	-35	-35	-35	-35	
-2.67%	-18	-18	-18	-18	-18	-18	-18	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	18	18	18	18	18	18	18	
5.33%	35	35	35	35	35	35	35	
8.00%	53	53	53	53	53	53	53	

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

(단위:백만원)

42

공시일	2020-01-10
기준일	2020-01-09

## 리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

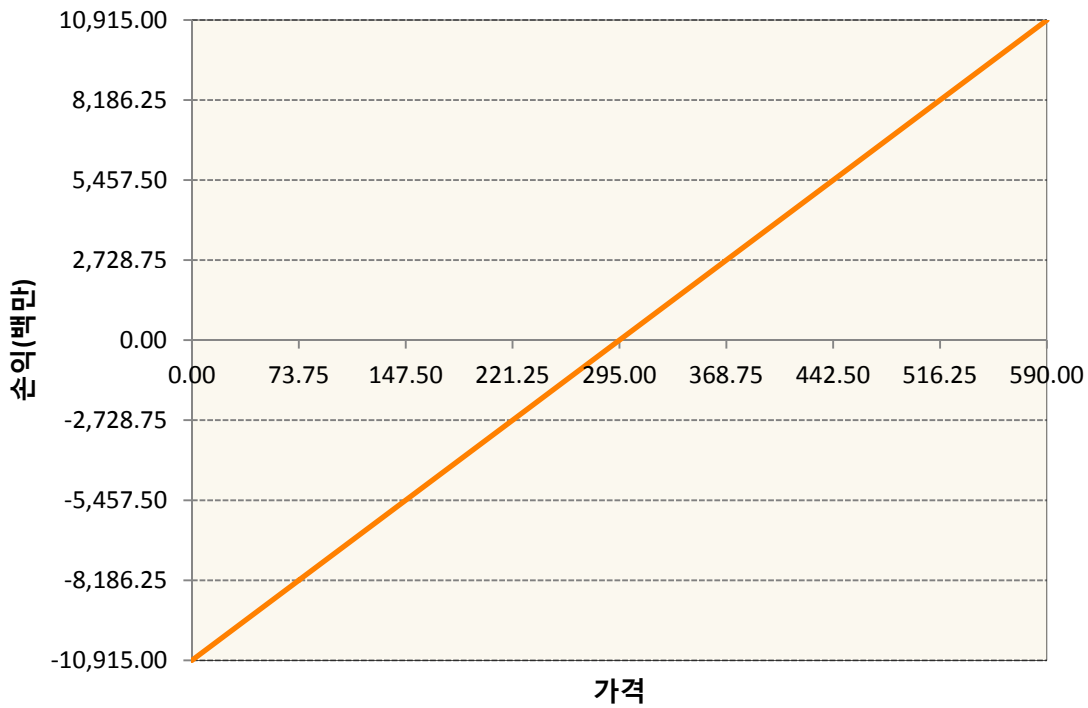
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

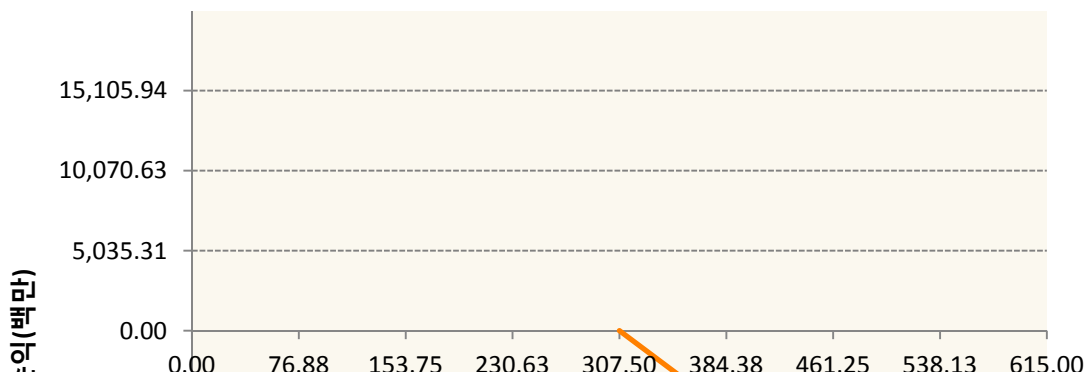
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	2,884	21,660	-18,776	장내
누계	유가증권	선물	10,915	0	10,915	장내
누계	유가증권	옵션	2,930	21,614	-18,684	장내

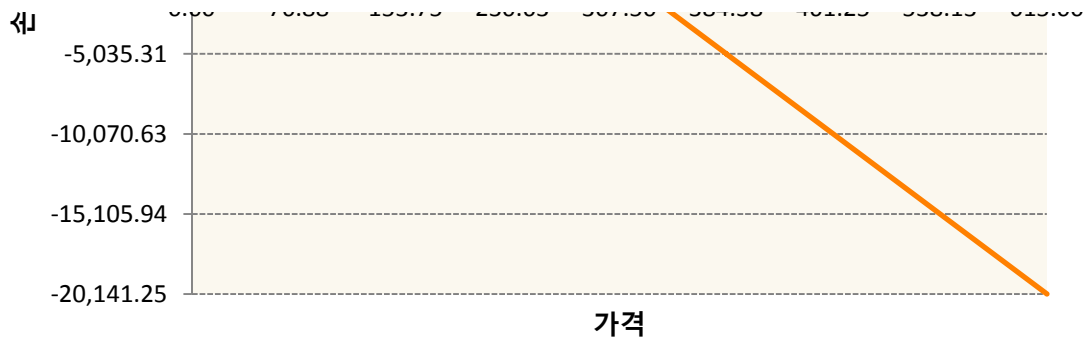
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q30005-2020-03 코스피200지수선물

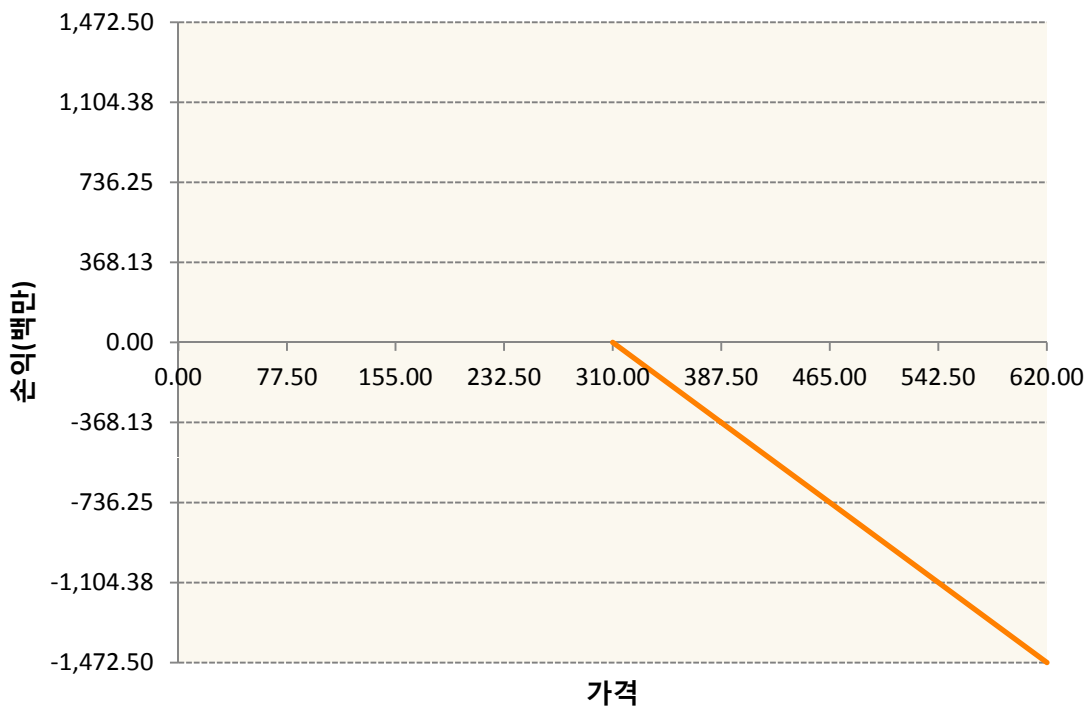


KR4201Q23073-2020-02 콜307.5

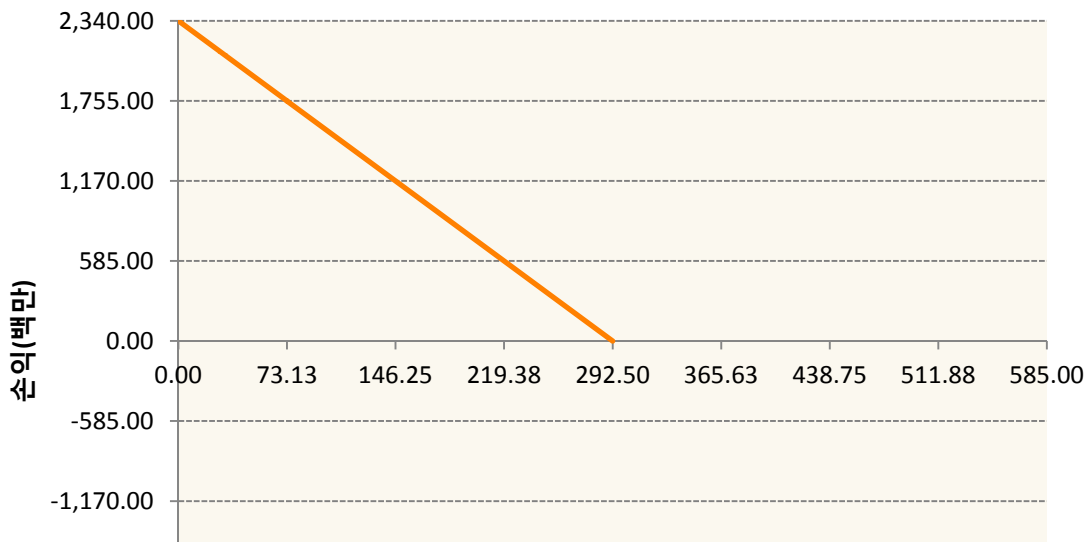


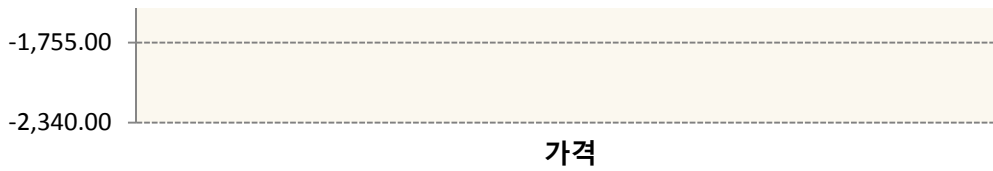


KR4201Q23107-2020-02 콜310

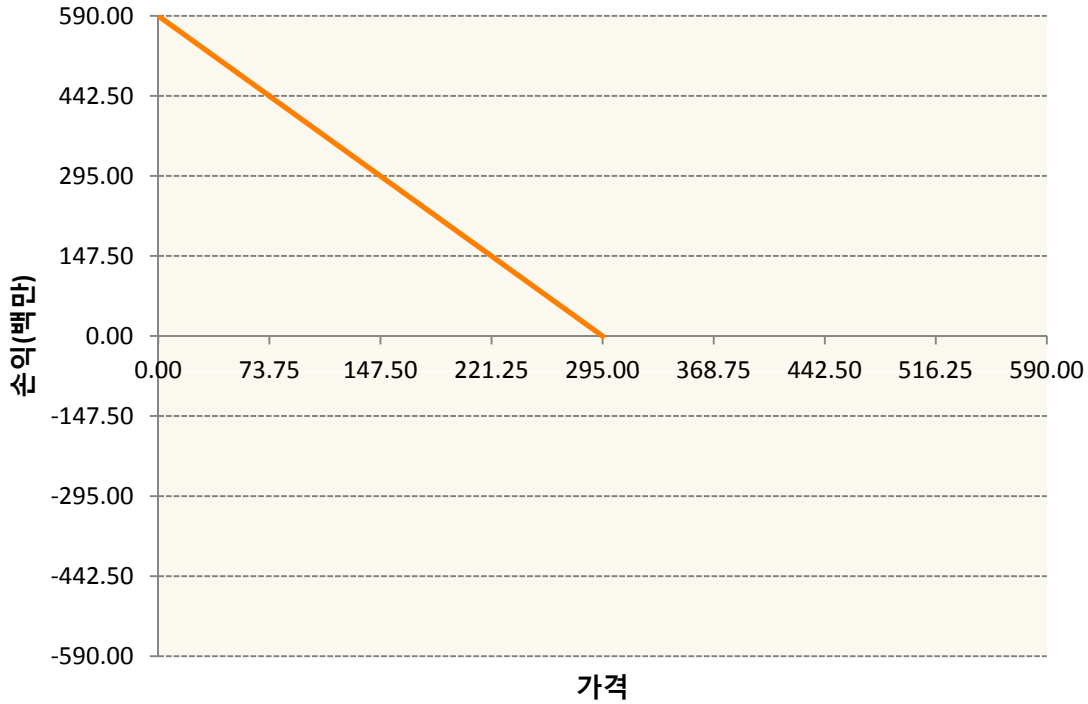


KR4301Q22925-2020-02 풋292.5





KR4301Q22958-2020-02 풋295



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101Q30005		2020-03 코스피200지수선물						871
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-871	-871	-871	-871	-871	-871	-871	
-5.33%	-581	-581	-581	-581	-581	-581	-581	
-2.67%	-290	-290	-290	-290	-290	-290	-290	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	290	290	290	290	290	290	290	
5.33%	581	581	581	581	581	581	581	
8.00%	871	871	871	871	871	871	871	
KR4201Q23073		2020-02 콜307.5						935
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	333	323	308	290	269	245	217	
-5.33%	308	287	262	234	202	168	131	
-2.67%	252	218	181	141	98	54	9	

0%	147	100	51	0	-52	-104	-157
2.67%	-25	-82	-139	-196	-254	-311	-369
5.33%	-275	-334	-393	-452	-511	-570	-629
8.00%	-601	-655	-709	-765	-821	-878	-935
KR4201Q23107 2020-02 콜310							64
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	21	20	20	18	17	16	14
-5.33%	20	18	17	15	13	11	8
-2.67%	16	14	12	9	6	3	0
0%	10	7	3	0	-4	-7	-11
2.67%	-1	-5	-9	-13	-17	-21	-25
5.33%	-17	-21	-26	-30	-34	-39	-43
8.00%	-39	-43	-47	-52	-56	-60	-64
KR4301Q22925 2020-02 풋292.5							144
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	140	140	141	141	142	143	144
-5.33%	79	81	82	84	85	87	90
-2.67%	26	29	32	35	38	41	44
0%	-10	-7	-3	0	3	7	10
2.67%	-27	-25	-23	-20	-17	-15	-12
5.33%	-32	-31	-30	-29	-28	-26	-24
8.00%	-33	-33	-33	-32	-32	-31	-30
KR4301Q22958 2020-02 풋295							38
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	38	38	38	38	38	38	38
-5.33%	22	22	23	23	23	24	24
-2.67%	8	9	9	10	11	11	12
0%	-3	-2	-1	0	1	2	3
2.67%	-8	-8	-7	-6	-5	-5	-4
5.33%	-10	-10	-10	-9	-9	-8	-8
8.00%	-11	-11	-11	-10	-10	-10	-10

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

(단위:백만원)

1,598

공시일	2020-01-10
기준일	2020-01-09

## 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	204,772	0	204,772	

### 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	2020-01-10
기준일	2020-01-09

## 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	213,742	0	213,742	

### 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	2020-01-10
기준일	2020-01-09

## 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	527,519	0	527,519	
누계	통화	선도	0	527,506	-527,506	장외

### 2. 만기시점의 손익구조

### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FX21019V02 KRW/USD 23-01-20E	1,391
FX21019V02 KRW/USD 23-01-20E	1,493
FX21019X02 KRW/USD 21-01-20E	1,855
FX21019X02 KRW/USD 21-01-20E	3,190
FX21019X02 KRW/USD 28-01-20E	4,729
FX21019X03 KRW/USD 31-01-20E	185
FX21019X03 KRW/USD 31-01-20E	2,782
FX21019X03 KRW/USD 31-01-20E	2,782
FX21019Z00 KRW/USD 06-02-20E	2,318
FX21019Z00 KRW/USD 06-02-20E	2,504
FX21019Z00 KRW/USD 10-02-20E	1,613
FX21019Z00 KRW/USD 10-01-20E	1,113
FX21019Z01 KRW/USD 12-02-20E	1,521
FX21019Z01 KRW/USD 12-02-20E	927
FX21019Z02 KRW/USD 16-01-20E	1,669
FX21019Z02 KRW/USD 18-02-20E	185
FX21019Z02 KRW/USD 18-02-20E	1,984
FX21019Z02 KRW/USD 18-02-20E	927
FX21019Z03 KRW/USD 24-02-20E	3,709
FX21019Z04 KRW/USD 26-02-20E	1,855
FX21019Z04 KRW/USD 26-02-20E	1,984
FX21019Z04 KRW/USD 26-02-20E	185
FX21020F00 KRW/USD 10-02-20E	185
FX21020F00 KRW/USD 10-02-20E	1,113

IE00BD8RGM75

\* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

IE00BHNZKL13

\* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

13,591



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

(단위:백만원)

210

공시일	2020-01-10
기준일	2020-01-09

## 커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

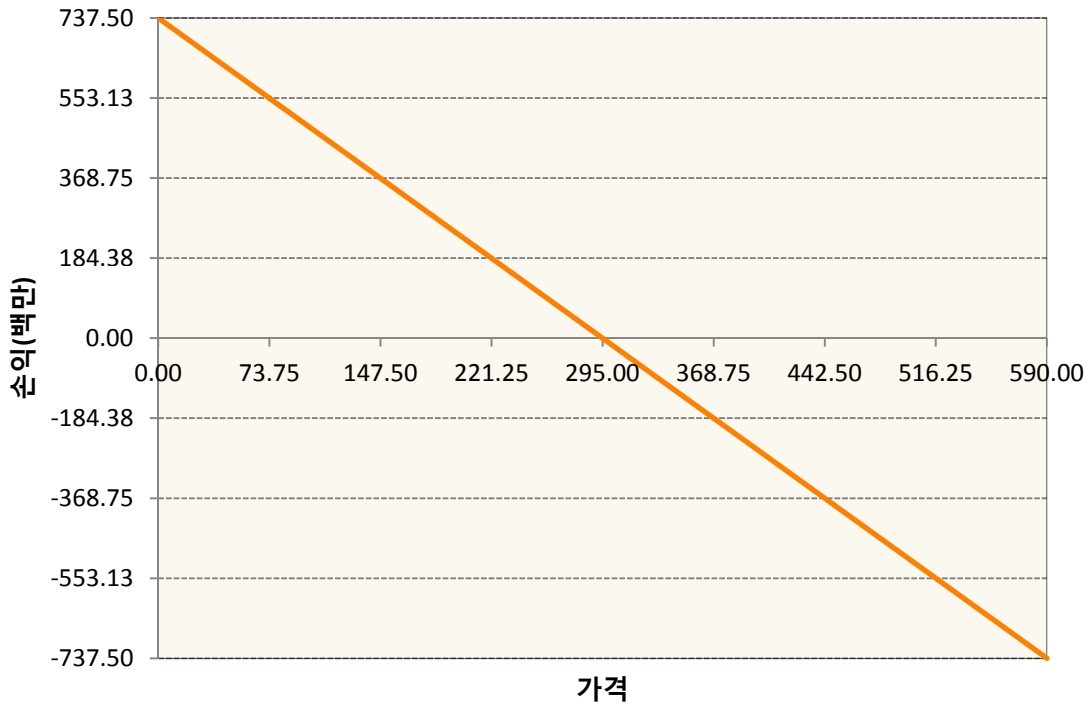
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

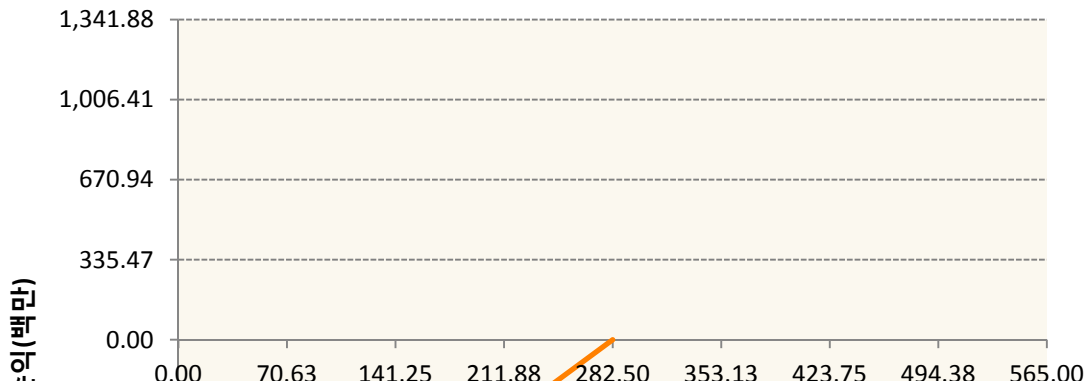
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	3,930	-3,930	장내
누계	유가증권	선물	0	738	-738	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,907	-3,907	장내

### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q30005-2020-03 코스피200지수선물

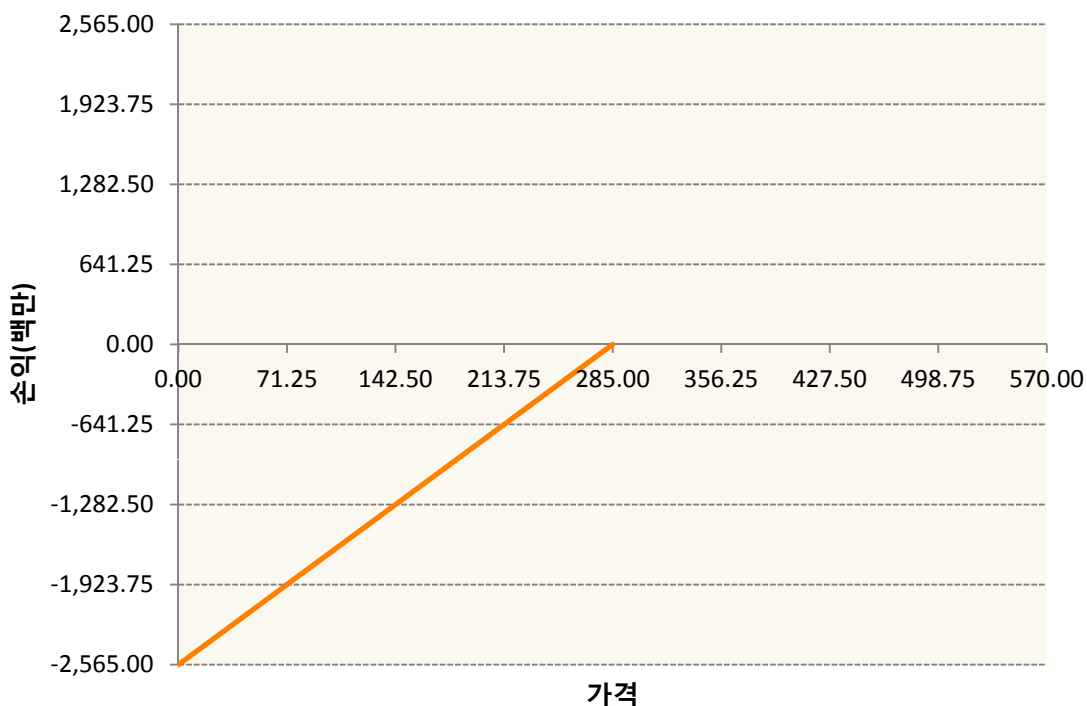


KR4301Q22826-2020-02 풋282.5





KR4301Q22859-2020-02 풋285



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101Q30005		2020-03 코스피200지수선물						59
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	59	59	59	59	59	59	59	
-5.33%	39	39	39	39	39	39	39	
-2.67%	20	20	20	20	20	20	20	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	-20	-20	-20	-20	-20	-20	-20	
5.33%	-39	-39	-39	-39	-39	-39	-39	
8.00%	-59	-59	-59	-59	-59	-59	-59	
KR4301Q22826		2020-02 풋282.5						59
기초자산의 변동성								



공시일	2020-01-10
기준일	2020-01-09

## H2O트리오(H)(채권혼합-파생재간접형)

### 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	13,549	0	13,549	
누계	통화	선도	939	16,227	-15,289	장외

### 2. 만기시점의 손익구조

### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FX21019X01 KRW/USD 13-01-20E	227
FX21019X02 KRW/USD 28-01-20E	287
FX21019X03 KRW/USD 31-01-20E	288
FX21019Z00 KRW/USD 10-02-20E	343
FX21019Z02 USD/KRW 13-01-20E	28
FX21019Z03 USD/KRW 13-01-20E	19
FX21019Z04 USD/KRW 13-01-20E	28
FX21020F00! KRW/USD 13-02-20E	124
FX21020F00! KRW/USD 14-01-20E	28
IE00BD8RGM75	

\* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

442
-----

공시일	2020-01-10
기준일	2020-01-09

## 스마트베트남VN30인덱스(주식혼합)

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	스왑	2,006	0	2,006	장외
누계	통화	선도	309	657	-348	장외

### 2. 만기시점의 손익구조

### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

2.55E+11 E1VFN30 VN ETF(EUR)	36
2.55E+11 E1VFN30 VN ETF(EUR)	18
2.55E+11 E1VFN30 VN ETF(EUR)	24
2.55E+11 VN30TR Index(EUR)	81
FX21019V04 KRW/EUR 31-01-20E	3
FX21019X00 KRW/EUR 31-01-20E	3
FX21019X00 KRW/EUR 31-01-20E	6
FX21019X01 KRW/EUR 31-01-20E	5
FX21019X02 KRW/EUR 31-01-20E	5
FX21019X03 EUR/KRW 31-01-20E	19
FX21019X03 EUR/KRW 31-01-20E	3
FX21019Z00 KRW/EUR 28-02-20E	6
FX21019Z00 EUR/KRW 28-02-20E	3
FX21019Z02 KRW/EUR 28-02-20E	3
FX21019Z04 KRW/EUR 27-03-20E	3
FX21019Z04 KRW/EUR 27-03-20E	3
FX21019Z04 KRW/EUR 27-03-20E	3
FX21020F00 KRW/EUR 27-03-20E	6
FX21020F00 KRW/EUR 27-03-20E	6

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

(단위:백만원)

<b>140</b>
------------

공시일	2020-01-10
기준일	2020-01-09

## 에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

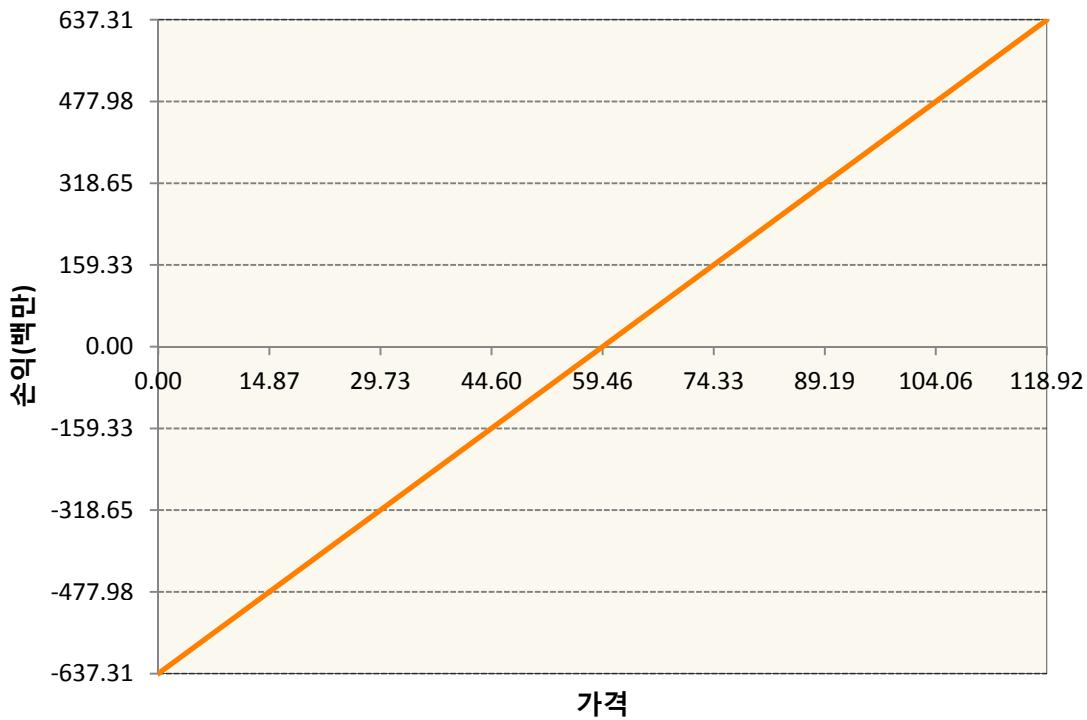
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

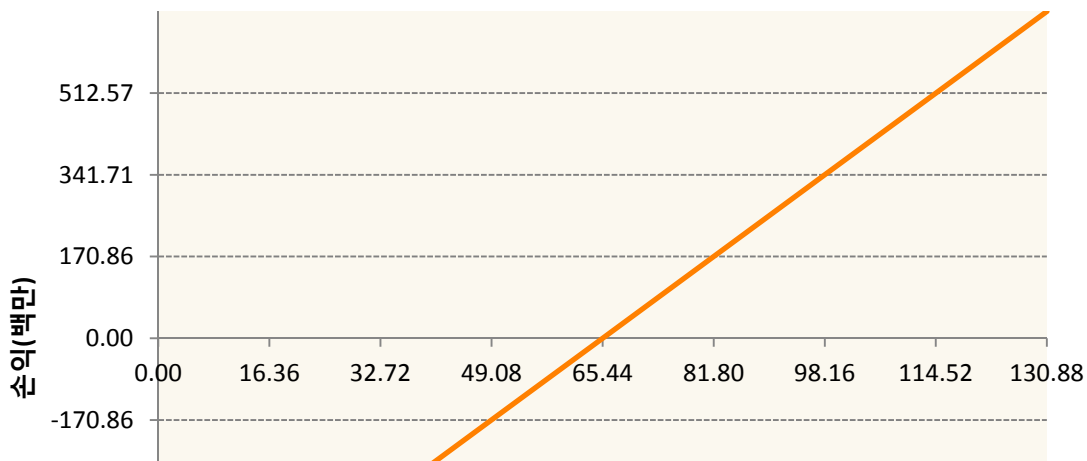
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,466	290	2,177	

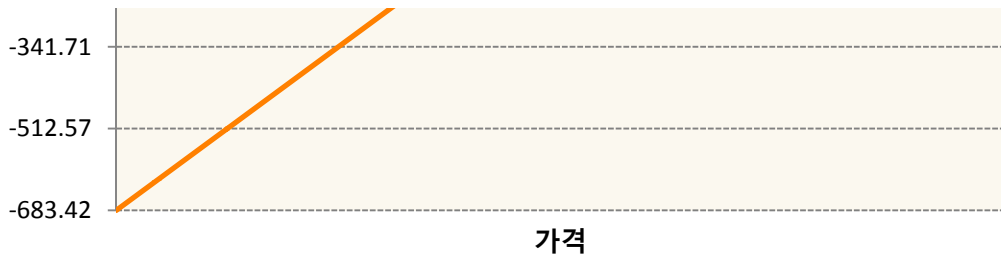
### 2. 만기시점의 손익구조

CLH0-WTI CRUDE FUTURE Mar20

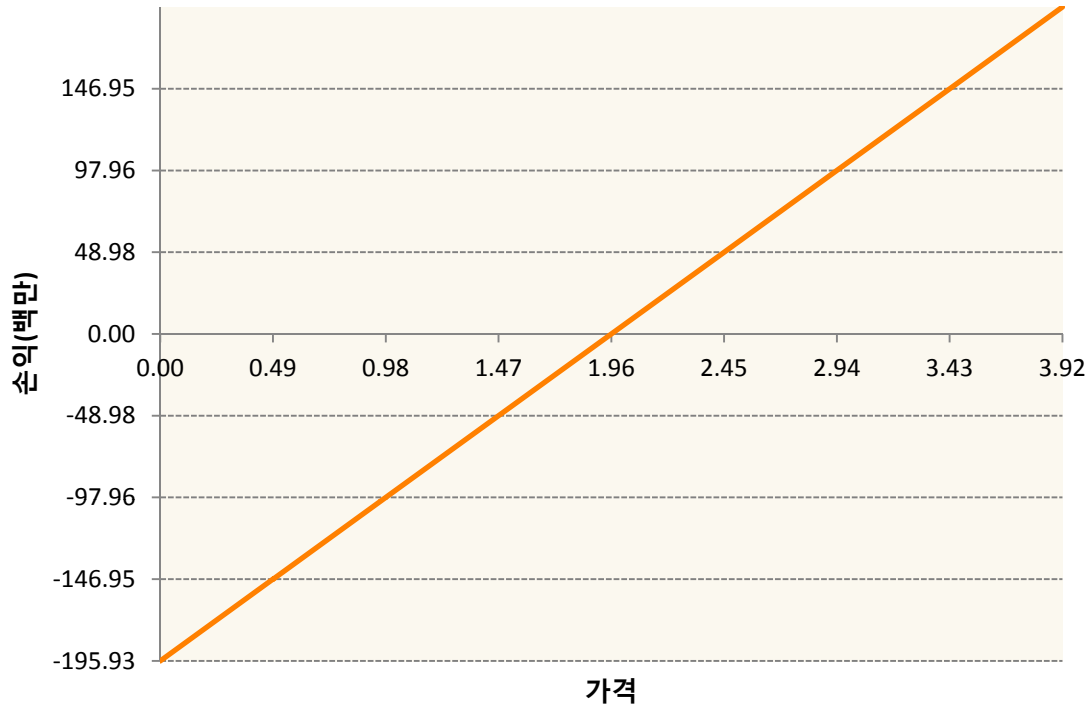


COH0-BRENT CRUDE FUTR Mar20

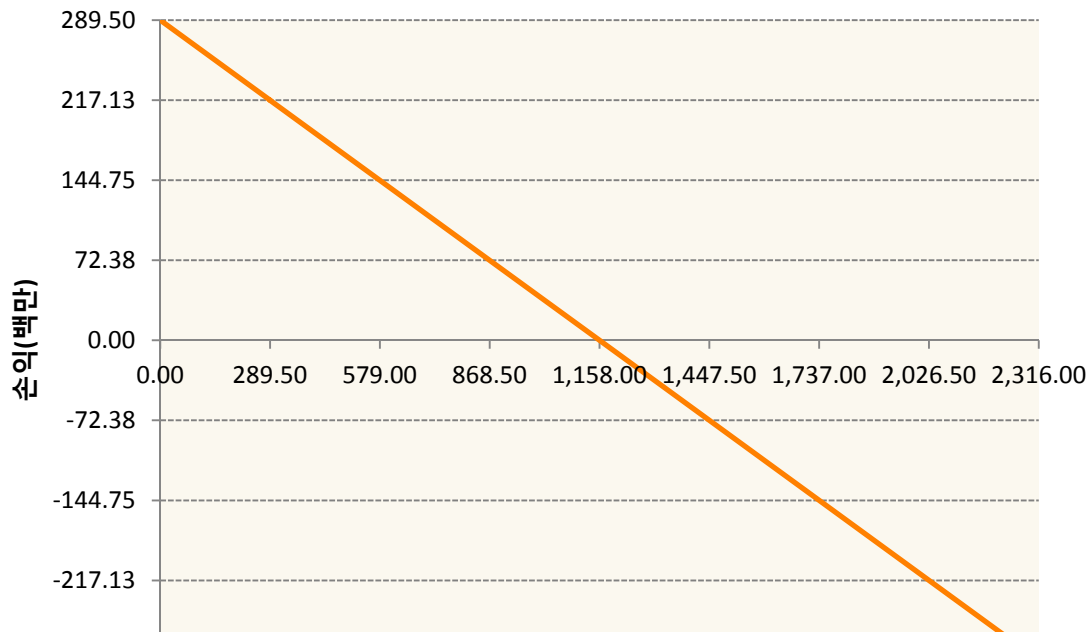


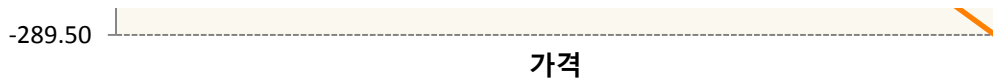


**HOH0-NY Harb ULSD Fut Mar20**

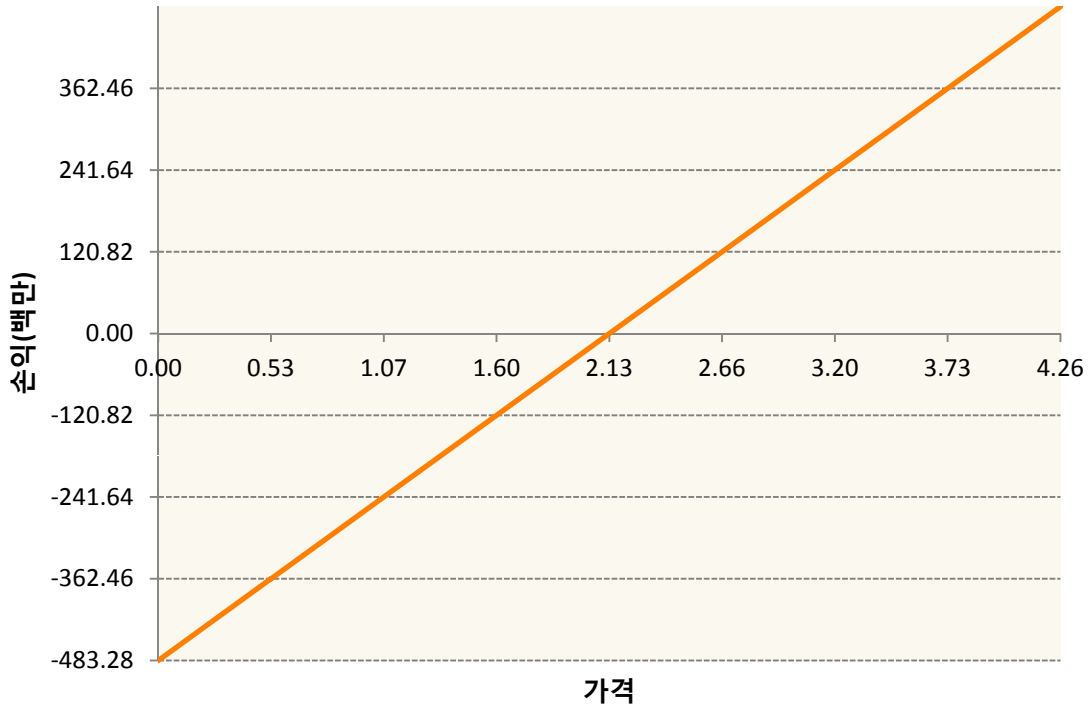


**KR4175Q10001-2020-01 달러선물**

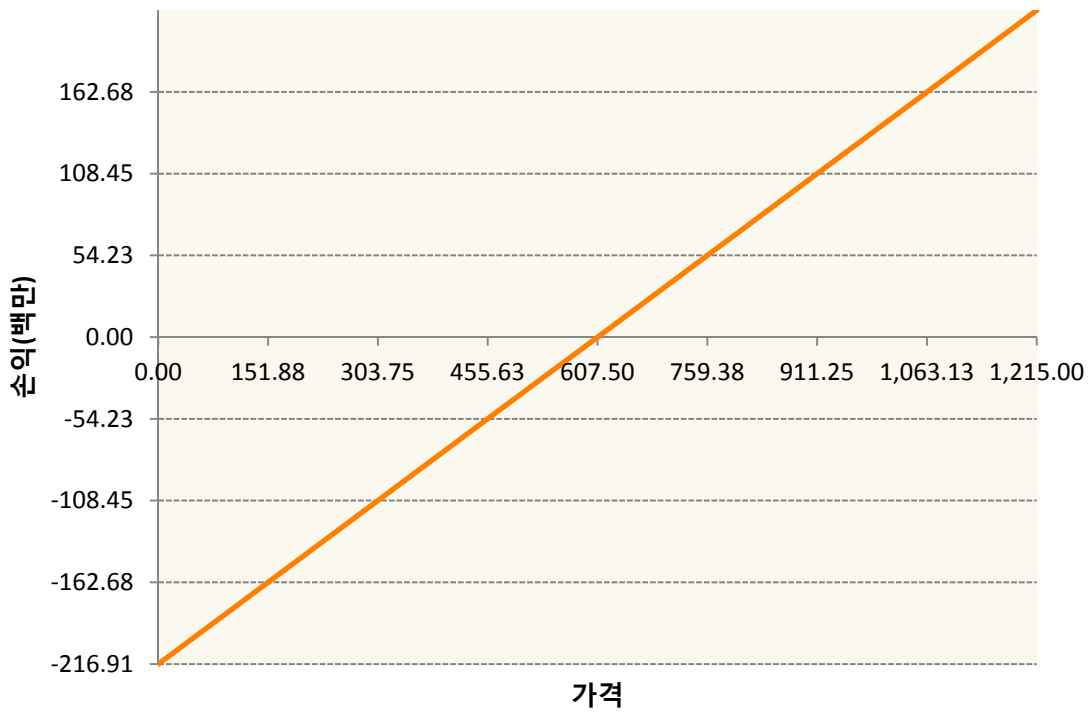




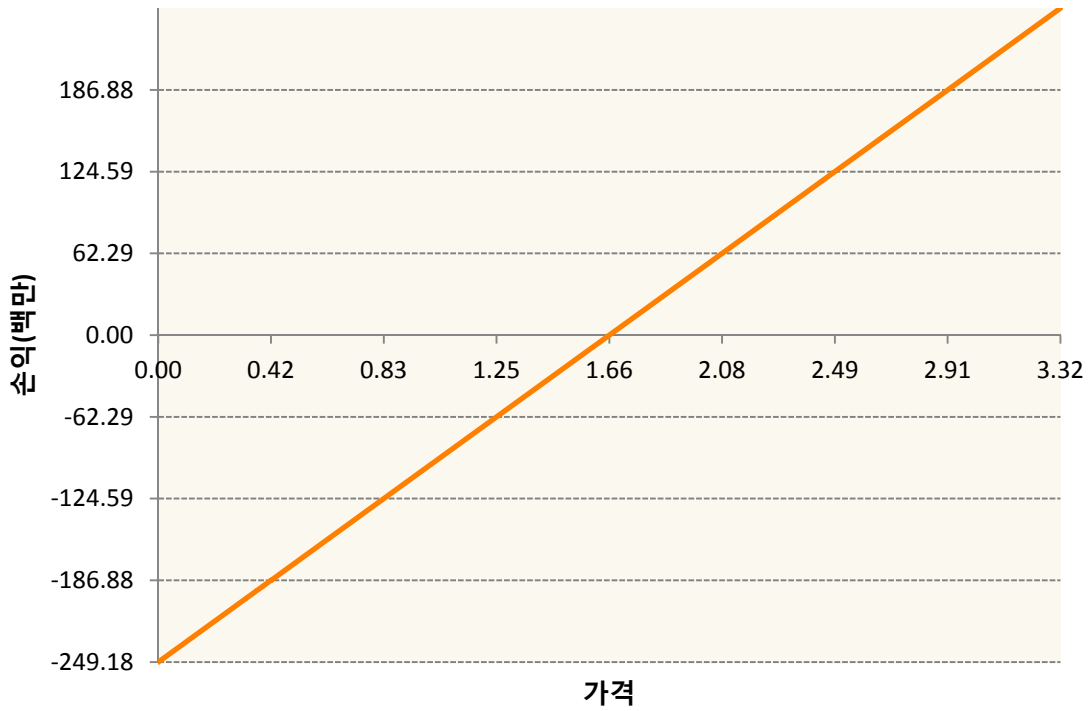
NGH20-NATURAL GAS FUTR Mar20



QSH0-Low Su Gasoil G Mar20



**XBH0-GASOLINE RBOB FUT Mar20**



**3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)**

(단위:백만원)

CLH0	WTI CRUDE FUTURE Mar20	51
COH0	BRENT CRUDE FUTR Mar20	55
HOH0	NY Harb ULSD Fut Mar20	16
KR4175Q10C	2020-01 달러선물	23
NGH20	NATURAL GAS FUTR Mar20	39
QSH0	Low Su Gasoil G Mar20	17
XBH0	GASOLINE RBOB FUT Mar20	20

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

(단위:백만원)

**382**

공시일	2020-01-10
기준일	2020-01-09

## 애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

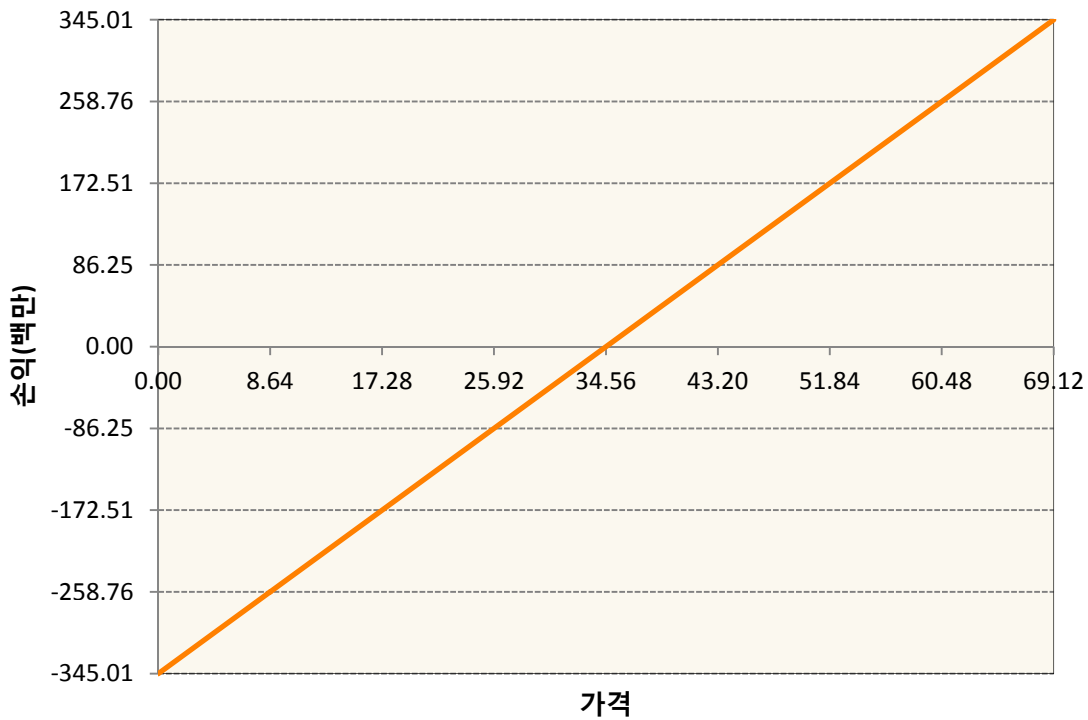
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

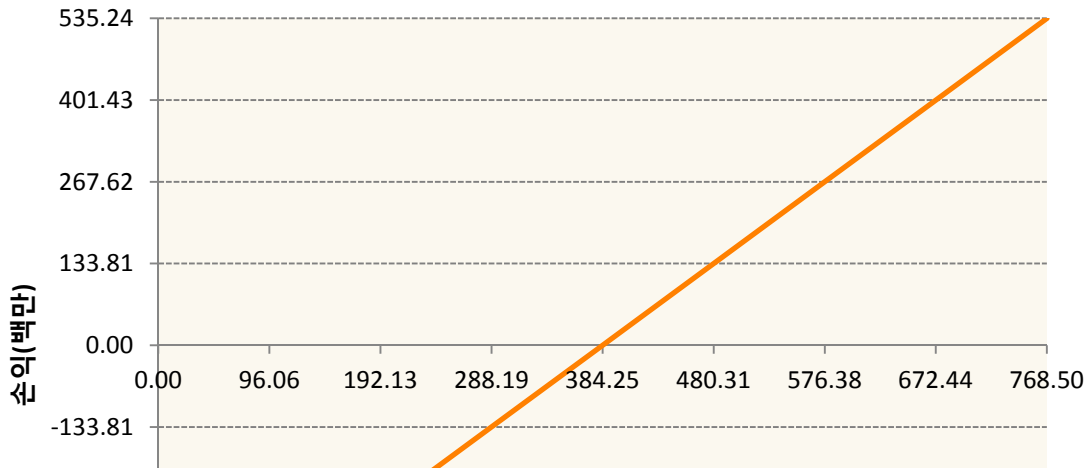
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,835	151	2,685	

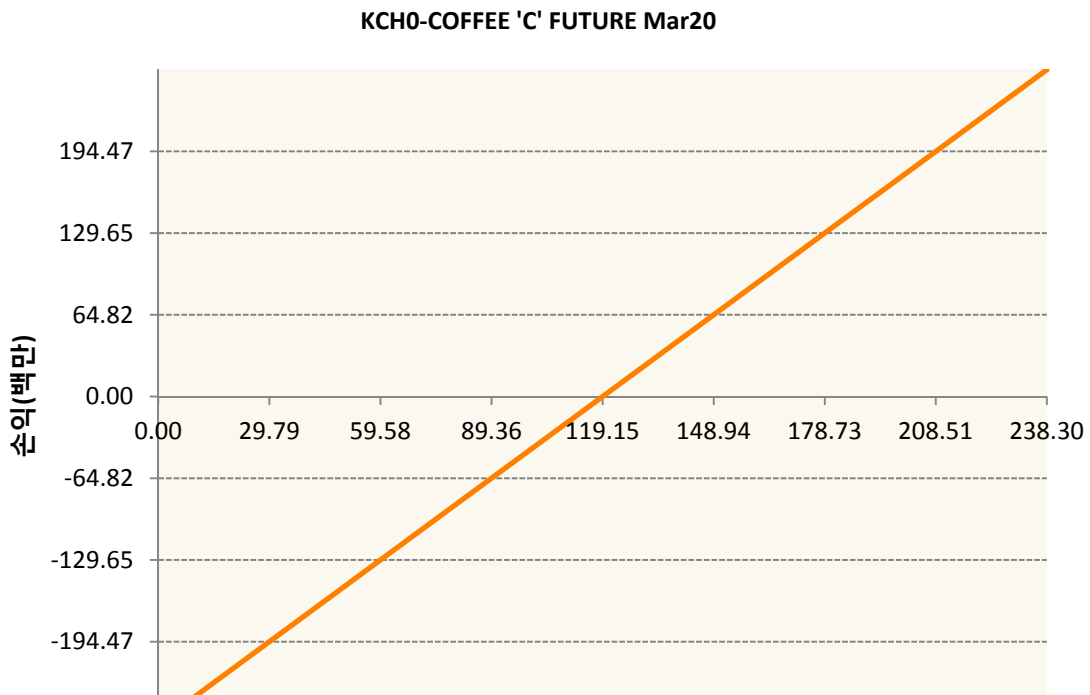
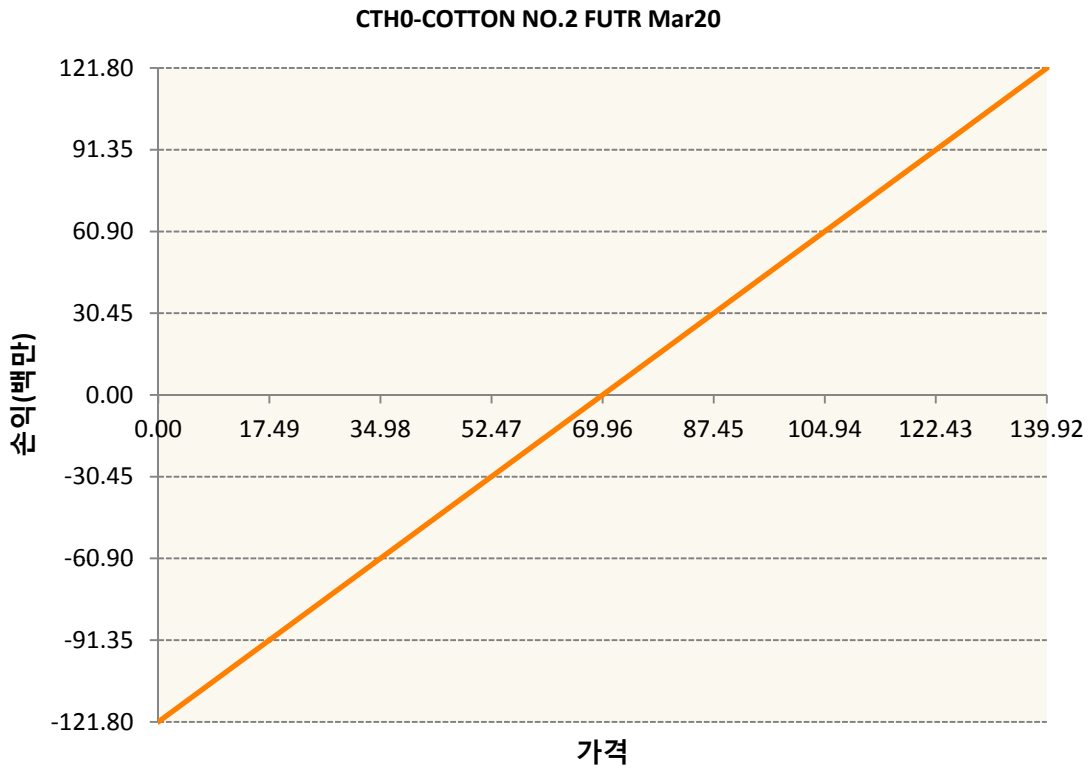
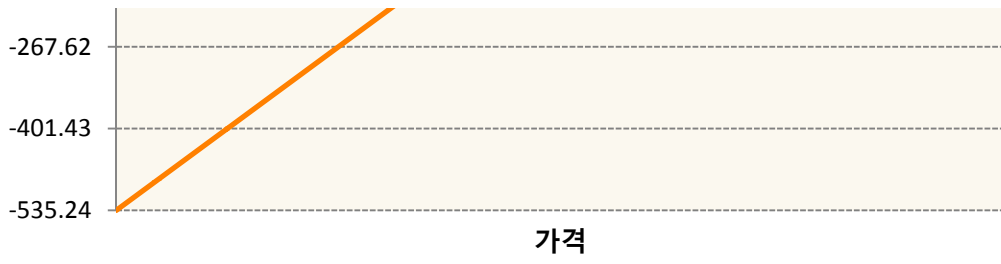
### 2. 만기시점의 손익구조

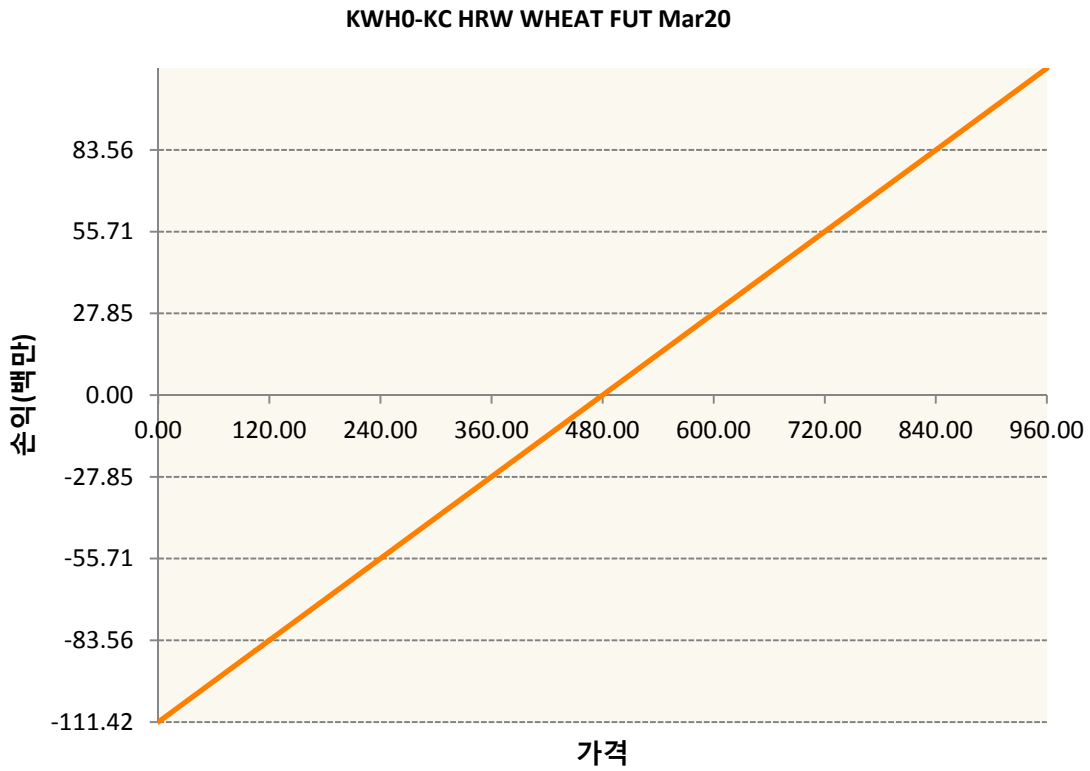
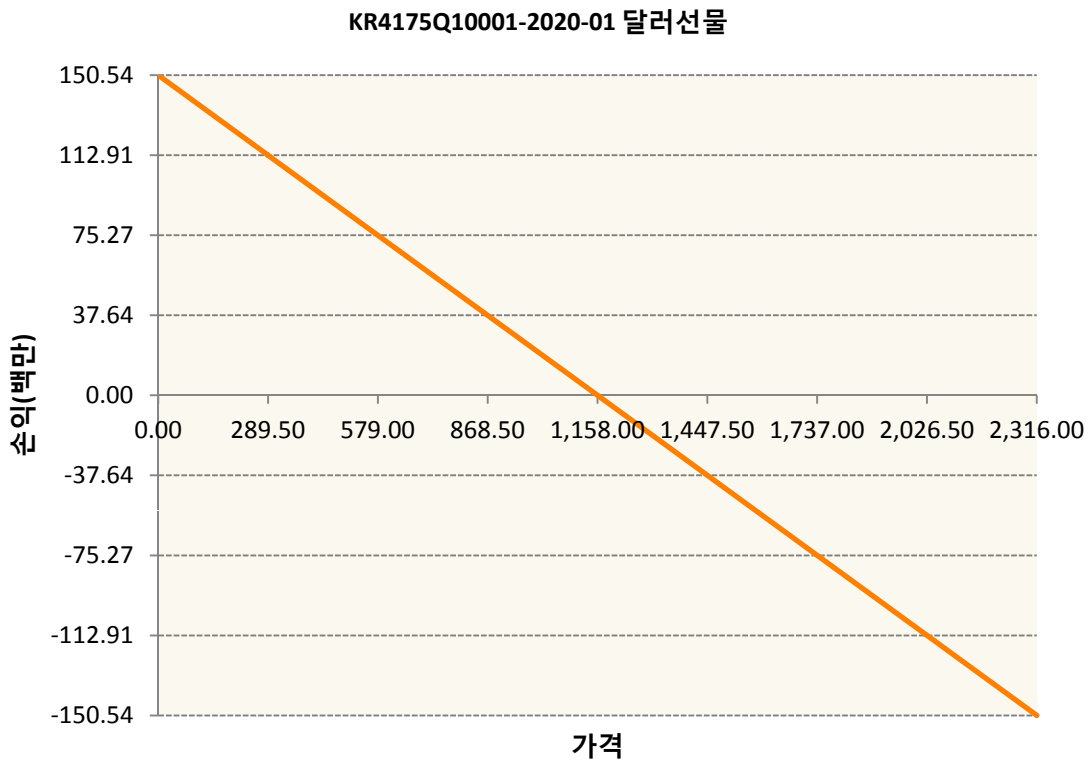
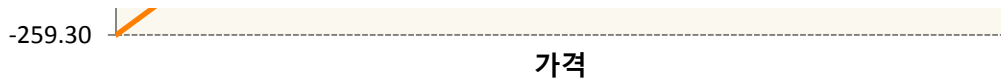
**BOH0-SOYBEAN OIL FUTR Mar20**



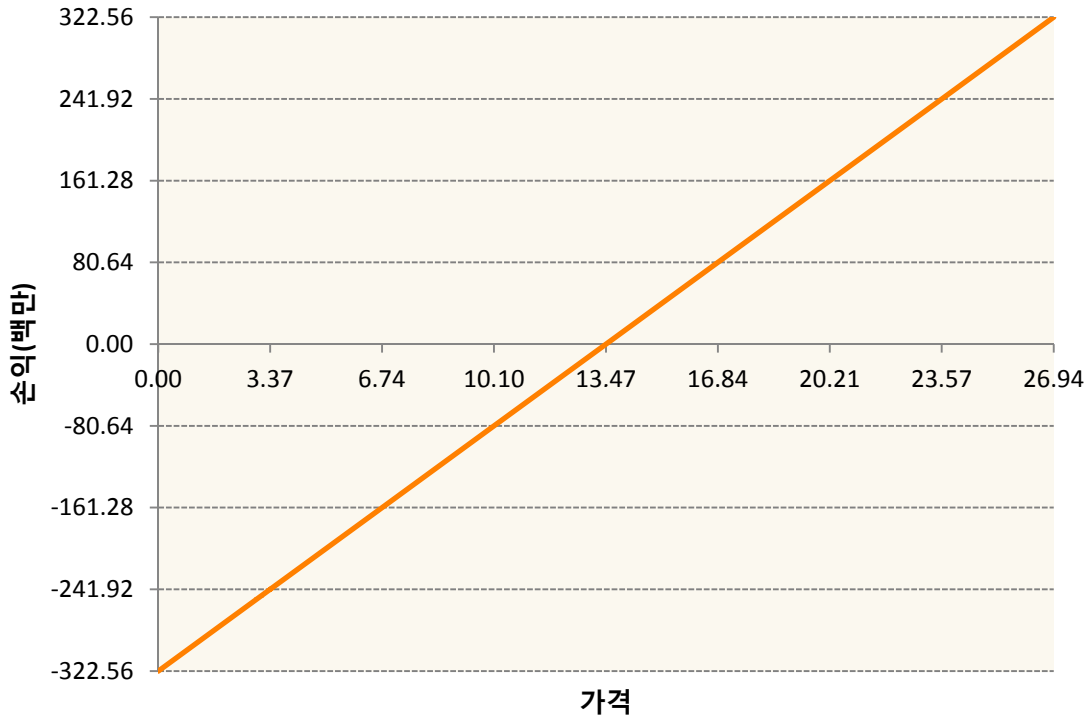
**CH0-CORN FUTURE Mar20**



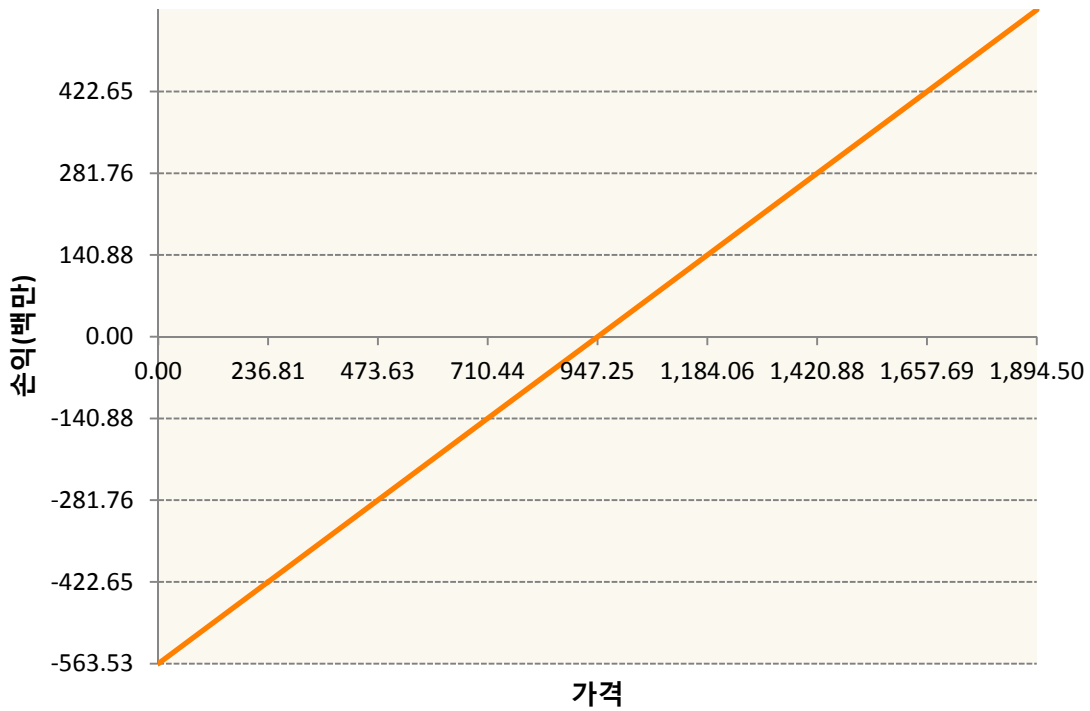




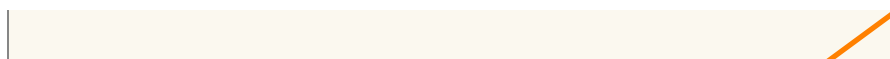
SBH0-Sugar Mar20

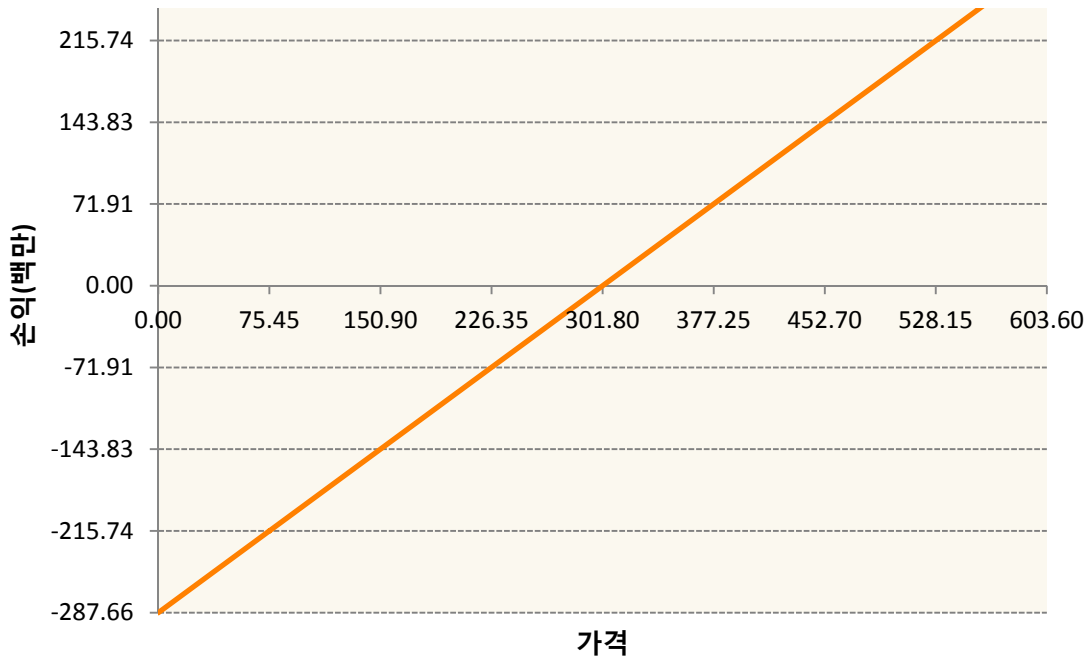


SH0-SOYBEAN FUTURE Mar20

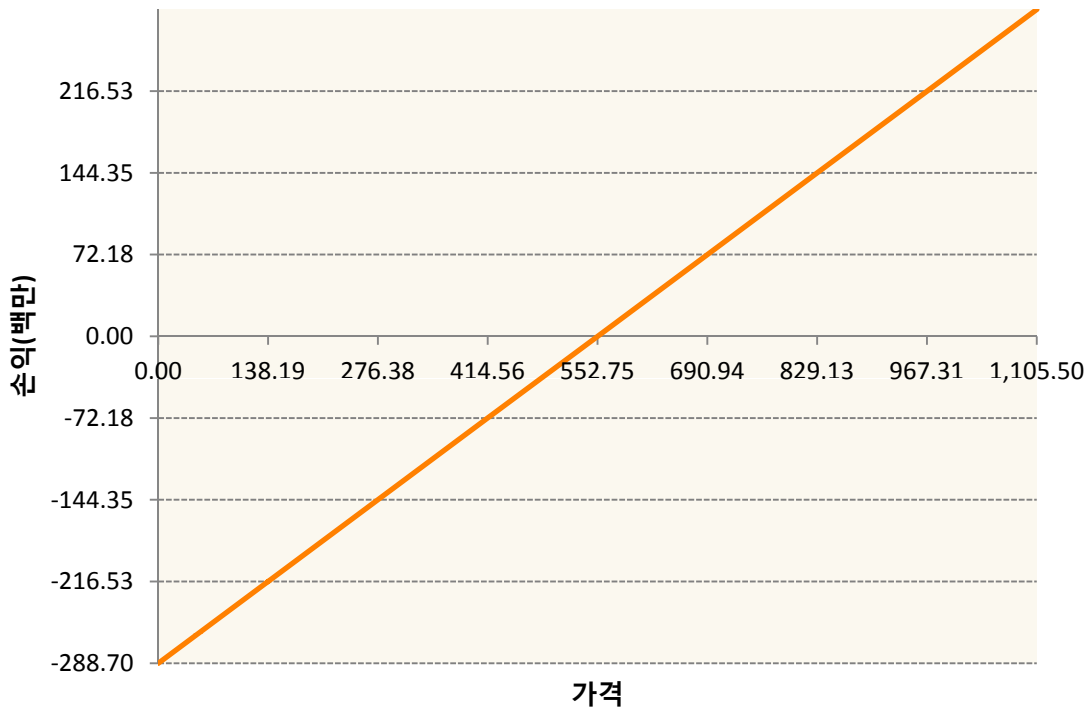


SMH0-SOYBEAN MEAL FUTR Mar20





WHO-WHEAT FUTURE(CBT) Mar20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

BOH0	SOYBEAN OIL FUTR Mar20	28
CH0	CORN FUTURE Mar20	43
CTH0	COTTON NO.2 FUTR Mar20	10
KCH0	COFFEE 'C' FUTURE Mar20	21
KR4175Q10C	2020-01 달러선물	12

KWH0	KC HRW WHEAT FUT Mar20	9
SBH0	Sugar Mar20	26
SH0	SOYBEAN FUTURE Mar20	45
SMH0	SOYBEAN MEAL FUTR Mar20	23
WH0	WHEAT FUTURE(CBT) Mar20	23

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

(단위:백만원)

**247**