

공시일	2018-04-27
기준일	2018-04-26

포커스농산물모(채권-파생평)

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	8	0	8	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)

84

공시일	2018-04-27
기준일	2018-04-26

SMART합성-MSCI선진국증권상장지

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	13,869	0	13,869	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWMXWO0(신한MXWO 미래S180222

1,093

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

445

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2018-04-27
기준일	2018-04-26

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	5,081	0	5,081	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI50000 신한CSI500미래S180308

391

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

425

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2018-04-27
기준일	2018-04-26

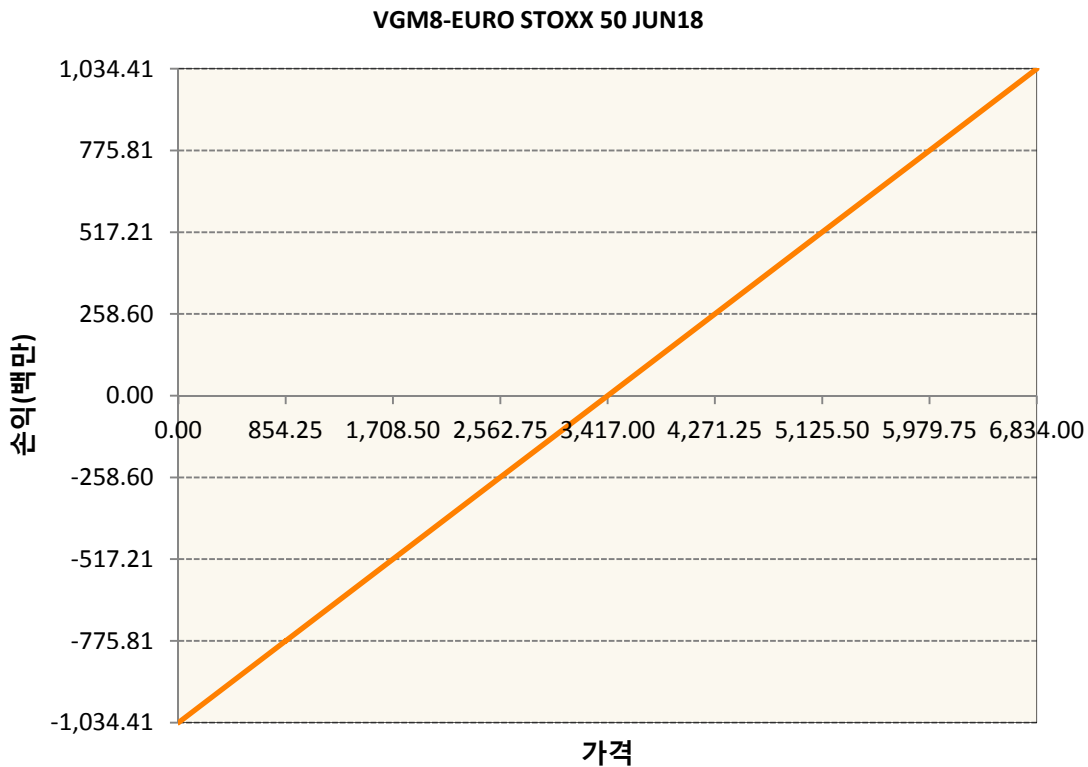
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,034	0	1,034	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGM8	EURO STOXX 50 JUN18	83
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

51

공시일	2018-04-27
기준일	2018-04-26

차이나인덱스모(주식-파생형)

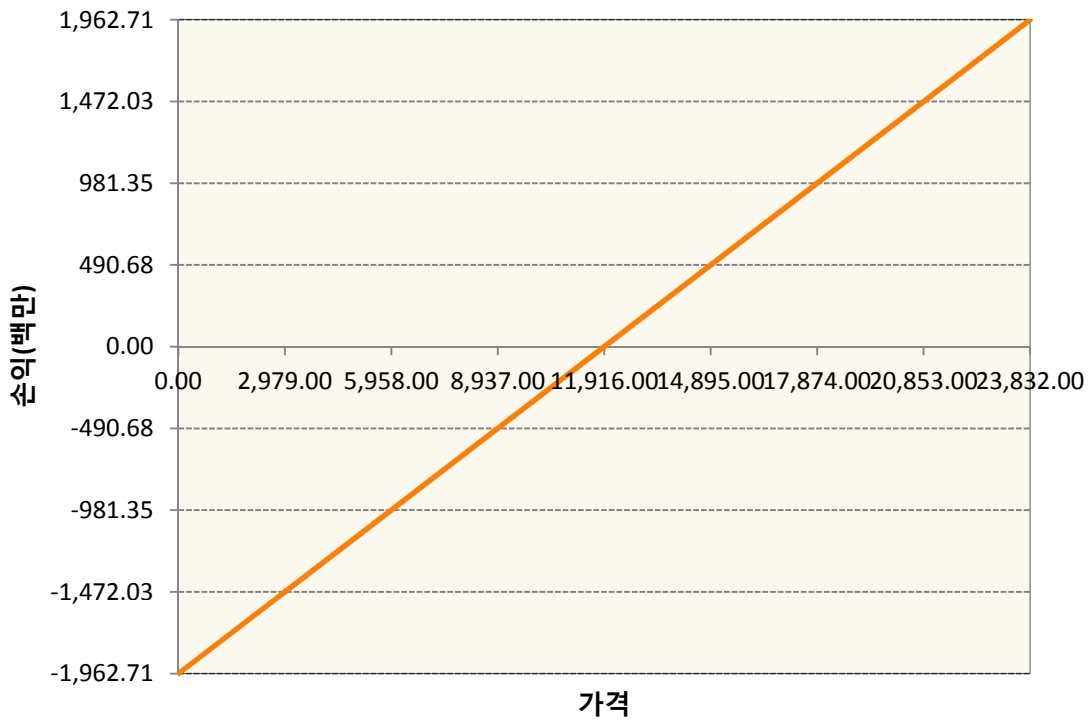
1. 계약금액

(단위:백만원)

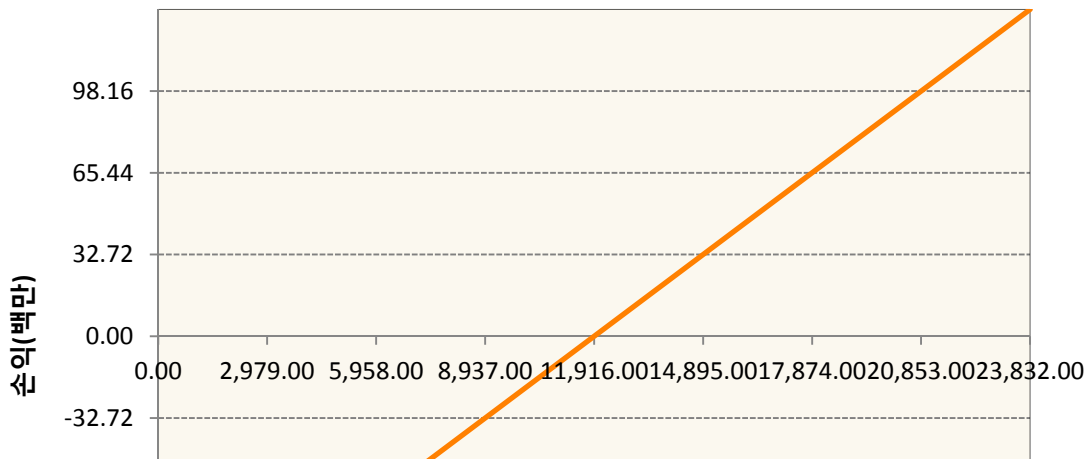
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,094	0	2,094	장내

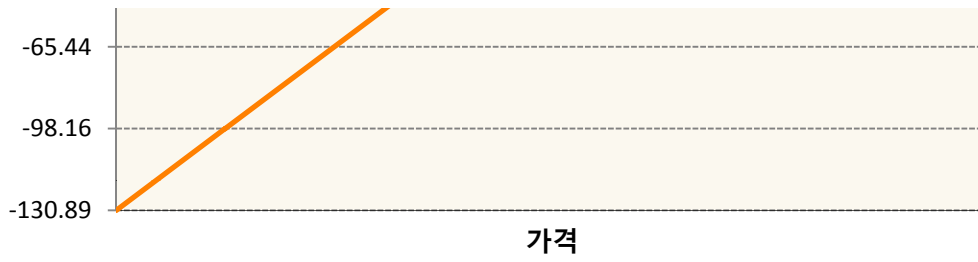
2. 만기시점의 손익구조

HCK8-H-SHARES FUT May18



MHCK8-MINI H-SHR IDX FU May18





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

HCK8	H-SHARES FUT May18	157
MHCK8	MINI H-SHR IDX FU May18	10

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

147

공시일	2018-04-27
기준일	2018-04-26

커버드콜모(주식혼합-파생형)

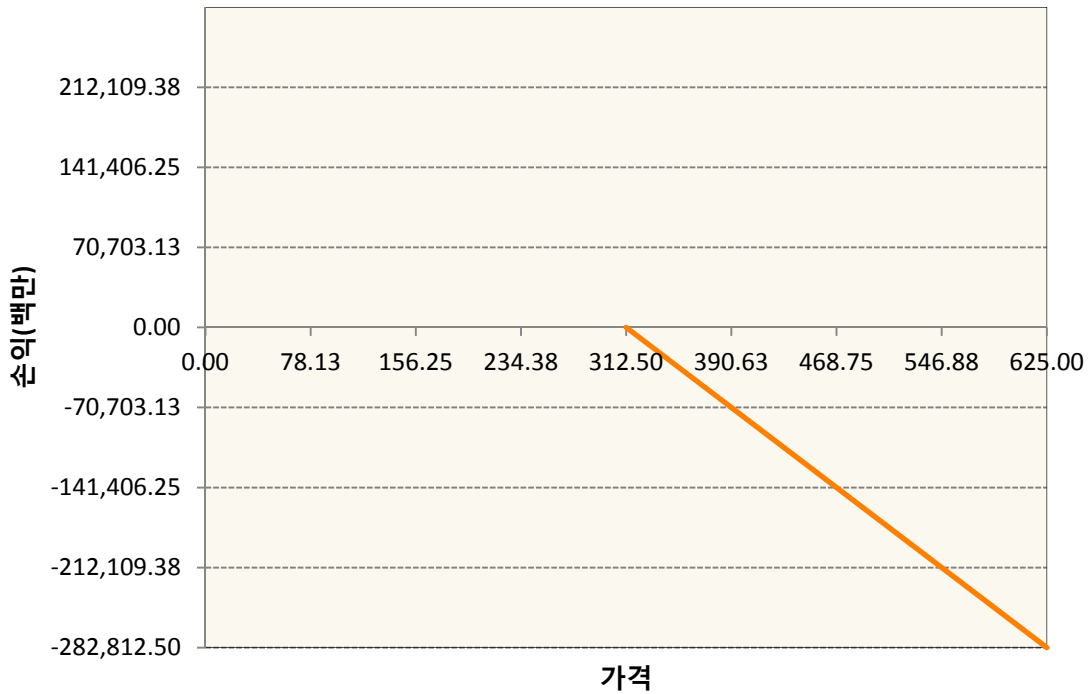
1. 계약금액

(단위:백만원)

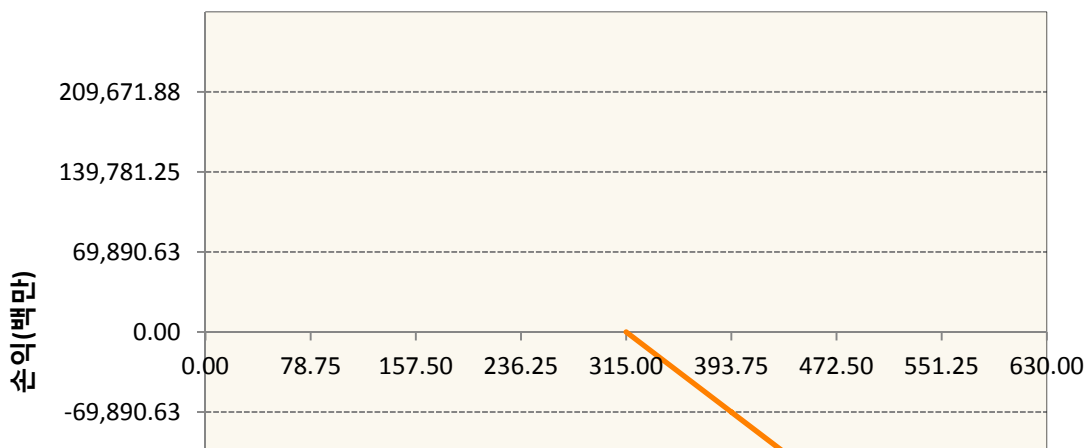
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	945,188	-945,188	장내

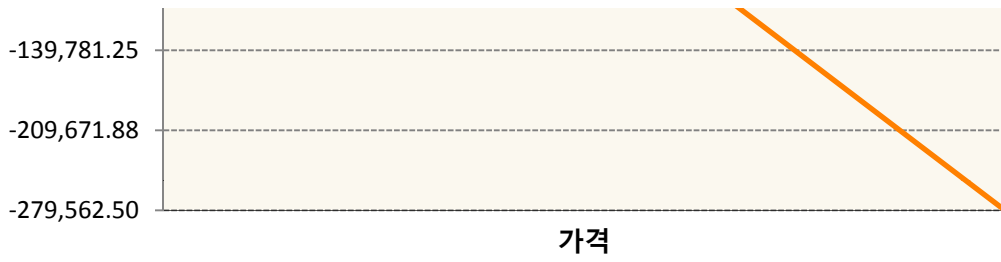
2. 만기시점의 손익구조

KR4201N53127-2018-05 콜312.5

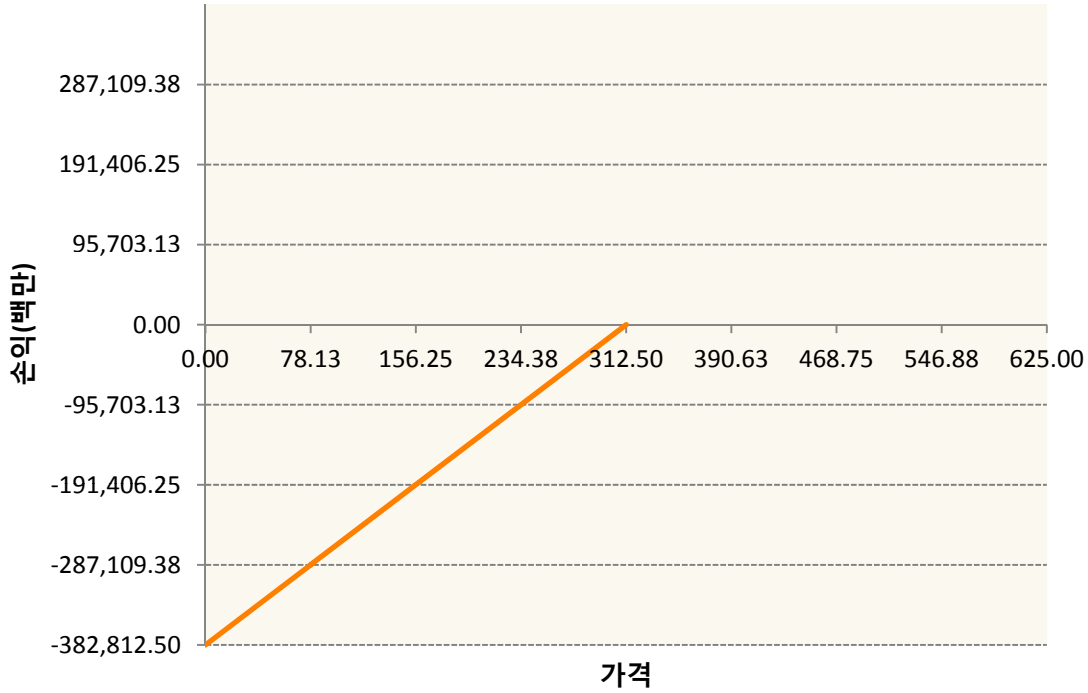


KR4201N53150-2018-05 콜315





KR4301N53125-2018-05 풋312.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4201N5312018-05 콜312.5

19,732

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	8,885	8,721	8,519	8,284	8,020	7,730	7,418
-5.33%	7,985	7,627	7,245	6,844	6,428	6,000	5,561
-2.67%	5,683	5,176	4,667	4,156	3,645	3,132	2,619
0%	1,472	988	497	0	-501	-1,005	-1,512
2.67%	-4,470	-4,791	-5,143	-5,520	-5,918	-6,332	-6,760
5.33%	-11,487	-11,639	-11,831	-12,059	-12,318	-12,607	-12,920
8.00%	-18,971	-19,025	-19,106	-19,217	-19,359	-19,531	-19,732

KR4201N5312018-05 콜315

18,660

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	7,512	7,390	7,233	7,043	6,822	6,575	6,304

-5.33%	6,877	6,579	6,252	5,901	5,529	5,142	4,740
-2.67%	5,085	4,613	4,134	3,649	3,161	2,670	2,177
0%	1,520	1,015	508	0	-510	-1,021	-1,532
2.67%	-3,853	-4,226	-4,623	-5,039	-5,469	-5,912	-6,365
5.33%	-10,482	-10,679	-10,915	-11,185	-11,484	-11,809	-12,156
8.00%	-17,724	-17,800	-17,909	-18,051	-18,224	-18,428	-18,660
KR4301N5312018-05 풋312.5							22,671
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-22,503	-22,508	-22,519	-22,539	-22,570	-22,613	-22,671
-5.33%	-12,252	-12,345	-12,464	-12,606	-12,769	-12,952	-13,152
-2.67%	-3,521	-3,853	-4,190	-4,531	-4,874	-5,221	-5,569
0%	848	580	296	0	-306	-619	-940
2.67%	1,725	1,670	1,593	1,492	1,369	1,225	1,061
5.33%	1,784	1,781	1,773	1,759	1,735	1,699	1,651
8.00%	1,785	1,785	1,785	1,784	1,782	1,777	1,768

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

(단위:백만원)

62,636

공시일	2018-04-27
기준일	2018-04-26

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생)

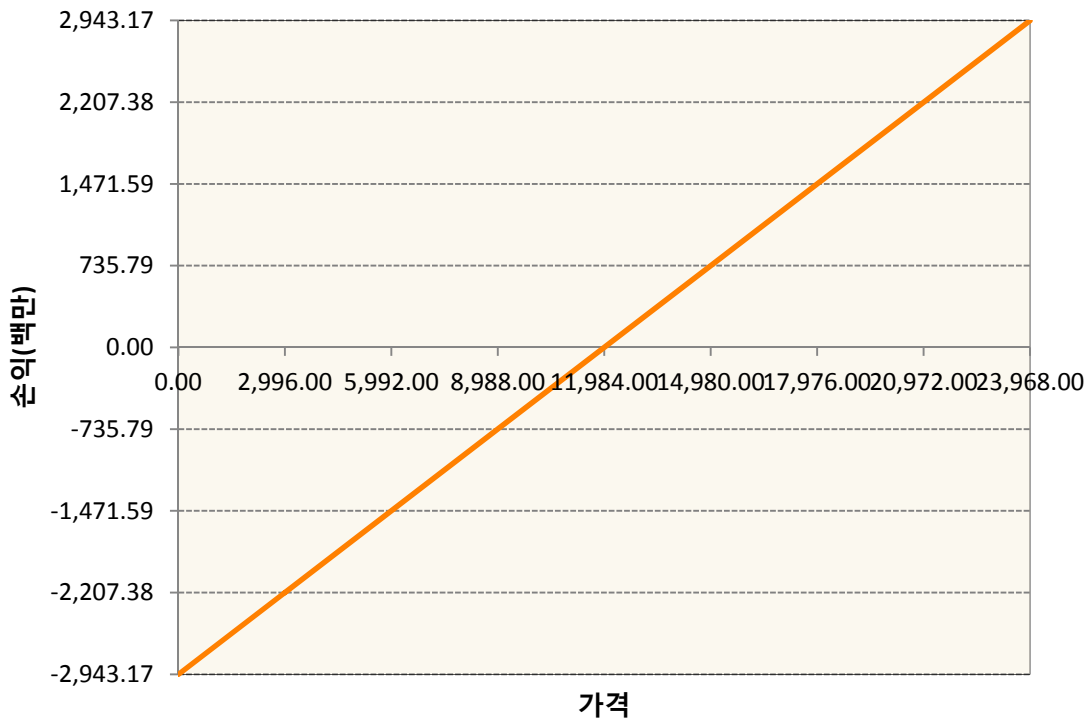
1. 계약금액

(단위:백만원)

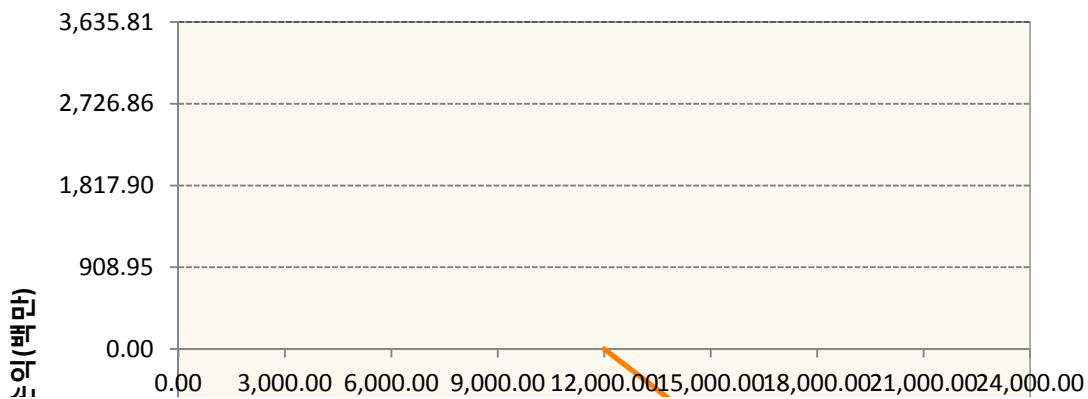
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,943	0	2,943	장내
누계	유가증권	옵션	0	7,272	-7,272	장내

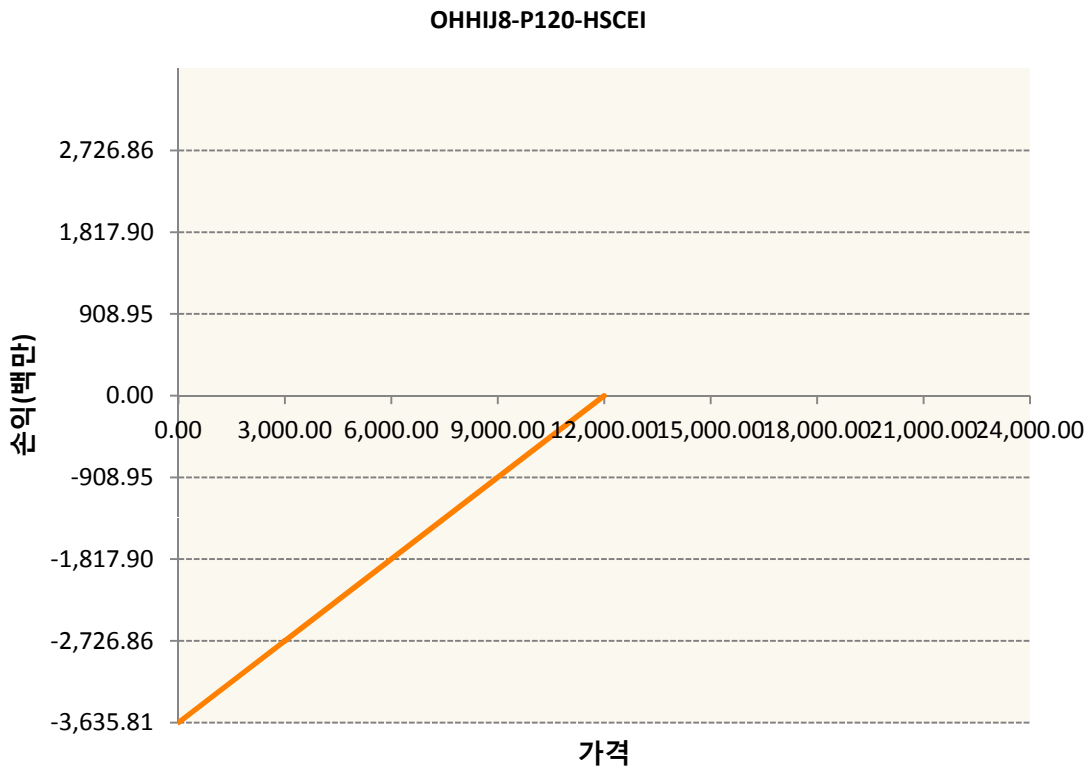
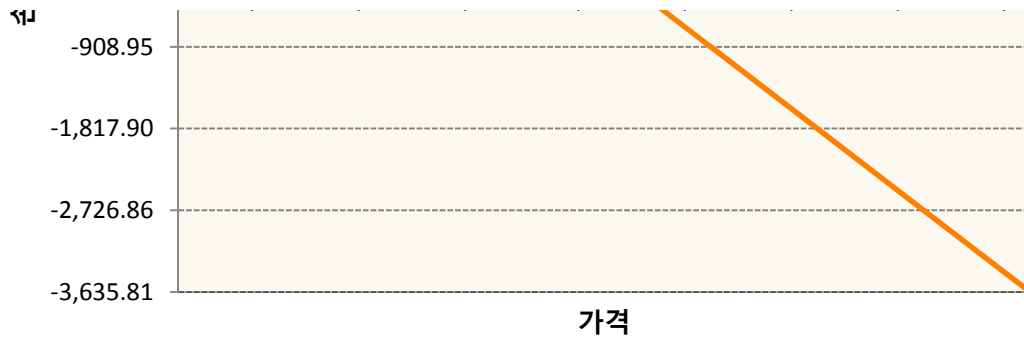
2. 만기시점의 손익구조

HCJ8-H-SHARES FUT APR18



OHJIJ8-C120-HSCEI





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
H CJ8	H-SHARES FUT APR18	235
	OHHIJ8-C12 HSCEI	291
	OHHIJ8-P120 HSCEI	291

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	719

공시일	2018-04-27
기준일	2018-04-26

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼)

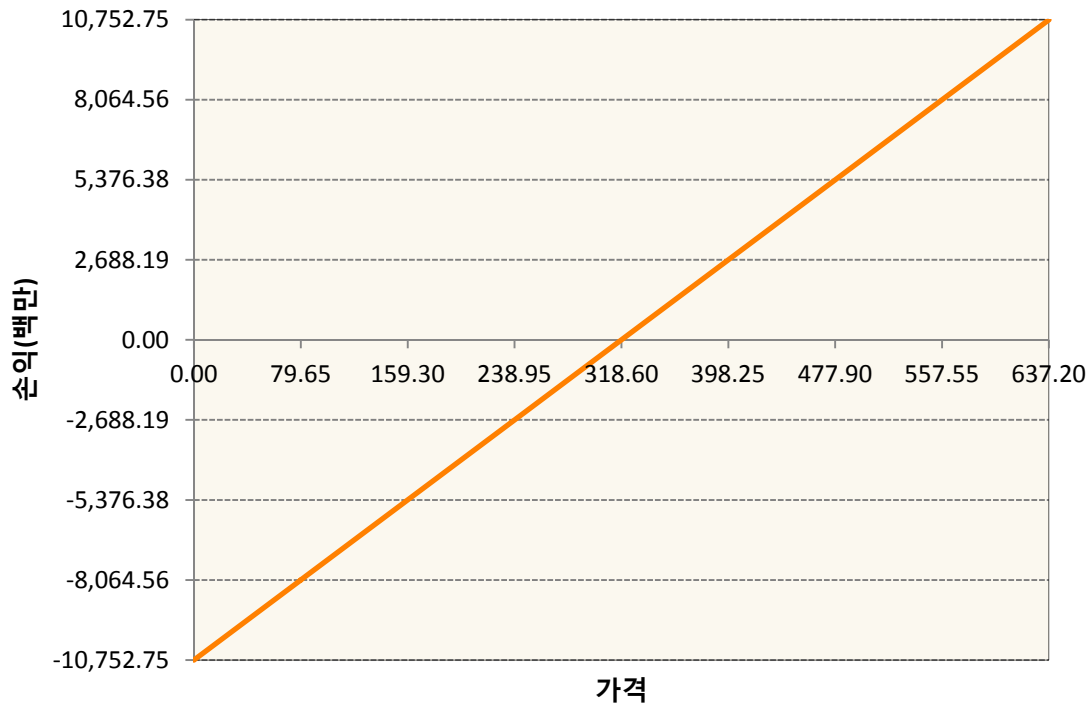
1. 계약금액

(단위:백만원)

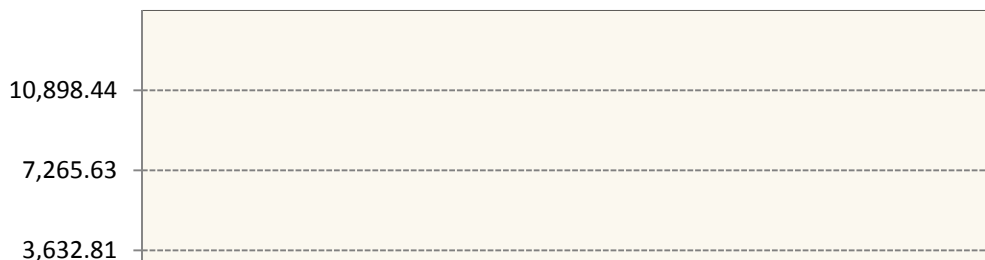
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	10,753	0	10,753	장내
누계	유가증권	스왑	52,200	0	52,200	장외
누계	유가증권	옵션	0	55,754	-55,754	장내

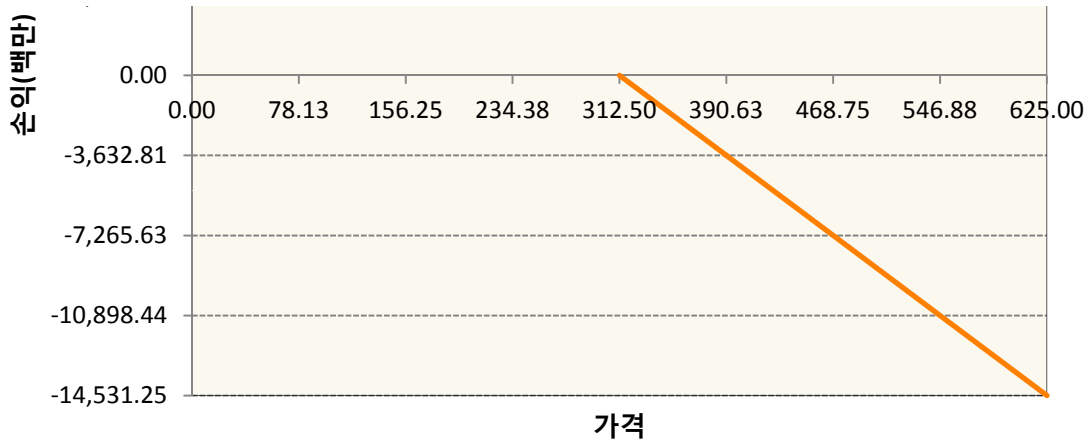
2. 만기시점의 손익구조

KR4101N60009-2018-06 코스피200지수선물

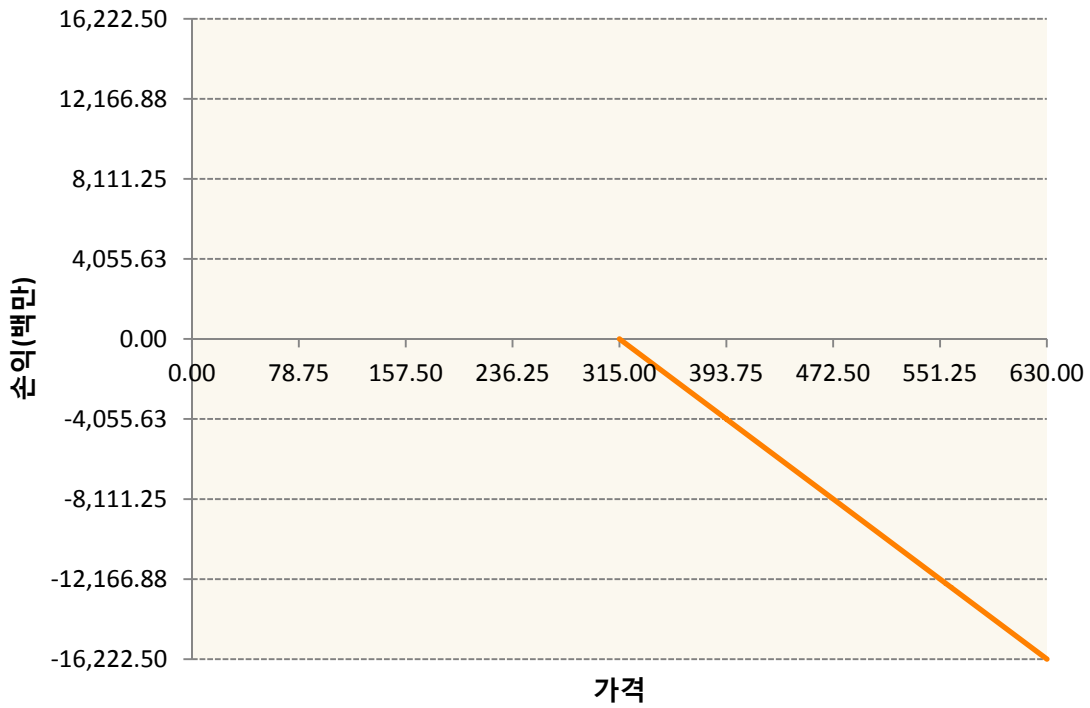


KR4201N53127-2018-05 콜312.5

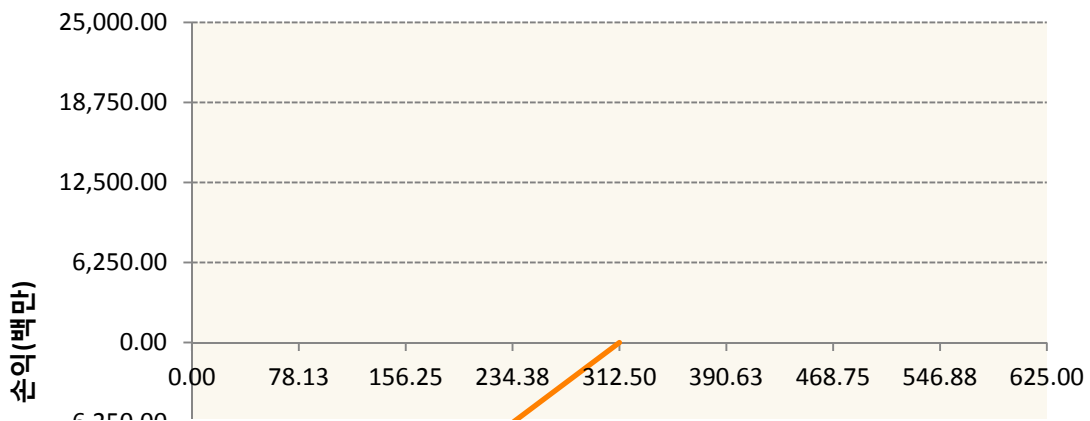


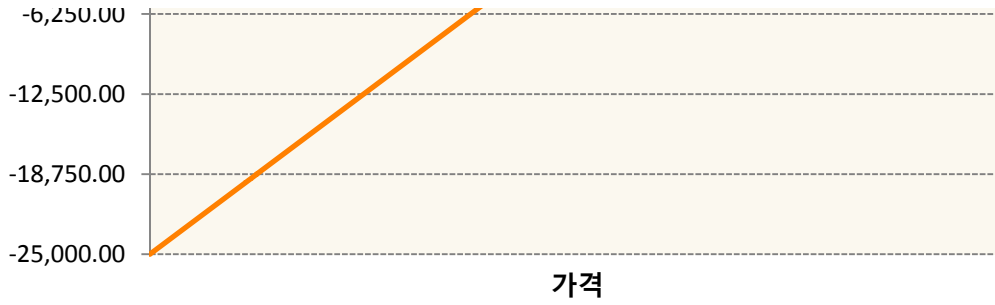


KR4201N53150-2018-05 콜315



KR4301N53125-2018-05 풋312.5





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11 UBSCFXC1 INDEX_2							1,471
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,471	-1,471	-1,471	-1,471	-1,471	-1,471	-1,471
-5.33%	-981	-981	-981	-981	-981	-981	-981
-2.67%	-490	-490	-490	-490	-490	-490	-490
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	490	490	490	490	490	490	490
5.33%	981	981	981	981	981	981	981
8.00%	1,471	1,471	1,471	1,471	1,471	1,471	1,471
2.529E+11 UBSCFXC1 INDEX_3							278
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-278	-278	-278	-278	-278	-278	-278
-5.33%	-186	-186	-186	-186	-186	-186	-186
-2.67%	-93	-93	-93	-93	-93	-93	-93
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	93	93	93	93	93	93	93
5.33%	186	186	186	186	186	186	186
8.00%	278	278	278	278	278	278	278
2.529E+11 UBSCFXC1 INDEX_5							239
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-239	-239	-239	-239	-239	-239	-239
-5.33%	-159	-159	-159	-159	-159	-159	-159
-2.67%	-80	-80	-80	-80	-80	-80	-80
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	80	80	80	80	80	80	80
5.33%	159	159	159	159	159	159	159
8.00%	239	239	239	239	239	239	239
2.529E+11 UBSCFXC1 INDEX_6							199
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%

-8.00%	-199	-199	-199	-199	-199	-199	-199
-5.33%	-133	-133	-133	-133	-133	-133	-133
-2.67%	-66	-66	-66	-66	-66	-66	-66
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	66	66	66	66	66	66	66
5.33%	133	133	133	133	133	133	133
8.00%	199	199	199	199	199	199	199

2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_7 254

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-254	-254	-254	-254	-254	-254	-254
-5.33%	-170	-170	-170	-170	-170	-170	-170
-2.67%	-85	-85	-85	-85	-85	-85	-85
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	85	85	85	85	85	85	85
5.33%	170	170	170	170	170	170	170
8.00%	254	254	254	254	254	254	254

2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_8 471

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-471	-471	-471	-471	-471	-471	-471
-5.33%	-314	-314	-314	-314	-314	-314	-314
-2.67%	-157	-157	-157	-157	-157	-157	-157
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	157	157	157	157	157	157	157
5.33%	314	314	314	314	314	314	314
8.00%	471	471	471	471	471	471	471

2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_10 119

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

2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_11 636

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-636	-636	-636	-636	-636	-636	-636
-5.33%	-424	-424	-424	-424	-424	-424	-424
-2.67%	-212	-212	-212	-212	-212	-212	-212
0%	0	0	0	0	0	0	0

2.67%	212	212	212	212	212	212	212
5.33%	424	424	424	424	424	424	424
8.00%	636	636	636	636	636	636	636

2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_12 477

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-477	-477	-477	-477	-477	-477	-477
-5.33%	-318	-318	-318	-318	-318	-318	-318
-2.67%	-159	-159	-159	-159	-159	-159	-159
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	159	159	159	159	159	159	159
5.33%	318	318	318	318	318	318	318
8.00%	477	477	477	477	477	477	477

KR4101N60C 2018-06 코스피200지수선물 859

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-859	-859	-859	-859	-859	-859	-859
-5.33%	-573	-573	-573	-573	-573	-573	-573
-2.67%	-286	-286	-286	-286	-286	-286	-286
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	286	286	286	286	286	286	286
5.33%	573	573	573	573	573	573	573
8.00%	859	859	859	859	859	859	859

KR4201N5312018-05 콜312.5 1,014

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	457	448	438	426	412	397	381
-5.33%	410	392	372	352	330	308	286
-2.67%	292	266	240	214	187	161	135
0%	76	51	26	0	-26	-52	-78
2.67%	-230	-246	-264	-284	-304	-325	-347
5.33%	-590	-598	-608	-620	-633	-648	-664
8.00%	-975	-978	-982	-987	-995	-1,004	-1,014

KR4201N5312018-05 콜315 1,083

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	436	429	420	409	396	382	366
-5.33%	399	382	363	342	321	298	275
-2.67%	295	268	240	212	183	155	126
0%	88	59	30	0	-30	-59	-89
2.67%	-224	-245	-268	-292	-317	-343	-369
5.33%	-608	-620	-633	-649	-666	-685	-705
8.00%	-1,029	-1,033	-1,039	-1,047	-1,058	-1,069	-1,083

KR4301N5312018-05 풋312.5 1,481

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,470	-1,470	-1,471	-1,472	-1,474	-1,477	-1,481
-5.33%	-800	-806	-814	-823	-834	-846	-859
-2.67%	-230	-252	-274	-296	-318	-341	-364
0%	55	38	19	0	-20	-40	-61
2.67%	113	109	104	97	89	80	69
5.33%	117	116	116	115	113	111	108
8.00%	117	117	117	117	116	116	115

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

(단위:백만원)

8,440

공시일	2018-04-27
기준일	2018-04-26

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

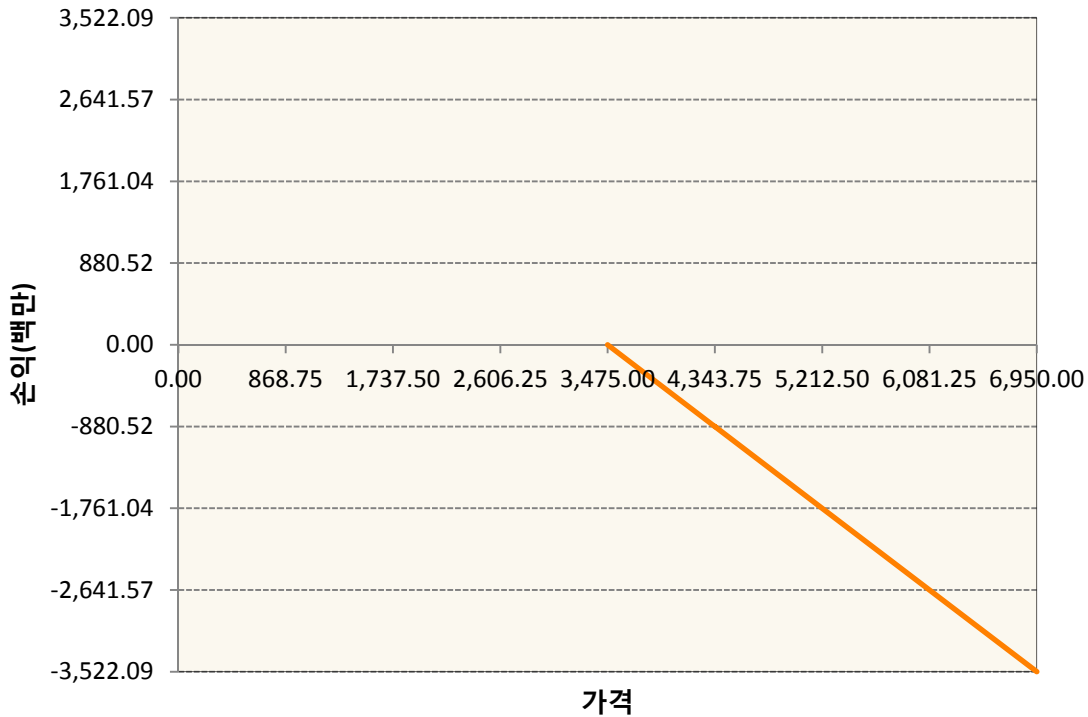
1. 계약금액

(단위:백만원)

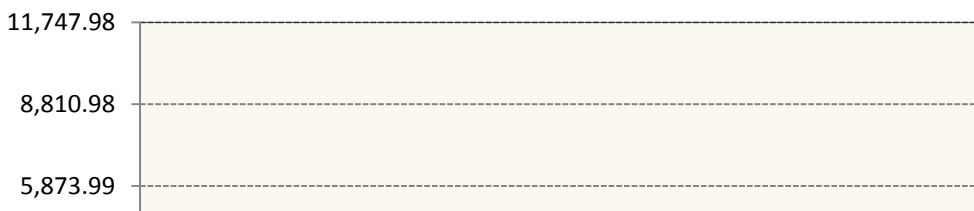
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	6,808	0	6,808	
누계	유가증권	스왑	76,029	0	76,029	장외
누계	유가증권	옵션	0	30,540	-30,540	장내
누계	지수	스왑	52,651	0	52,651	장외

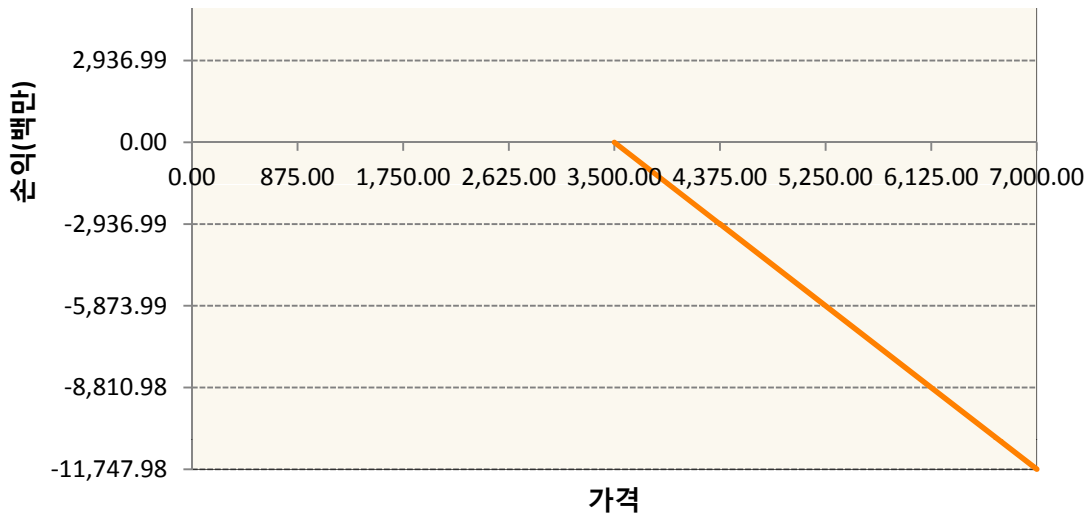
2. 만기시점의 손익구조

OESXK8-C3475-EURO STOXX 50

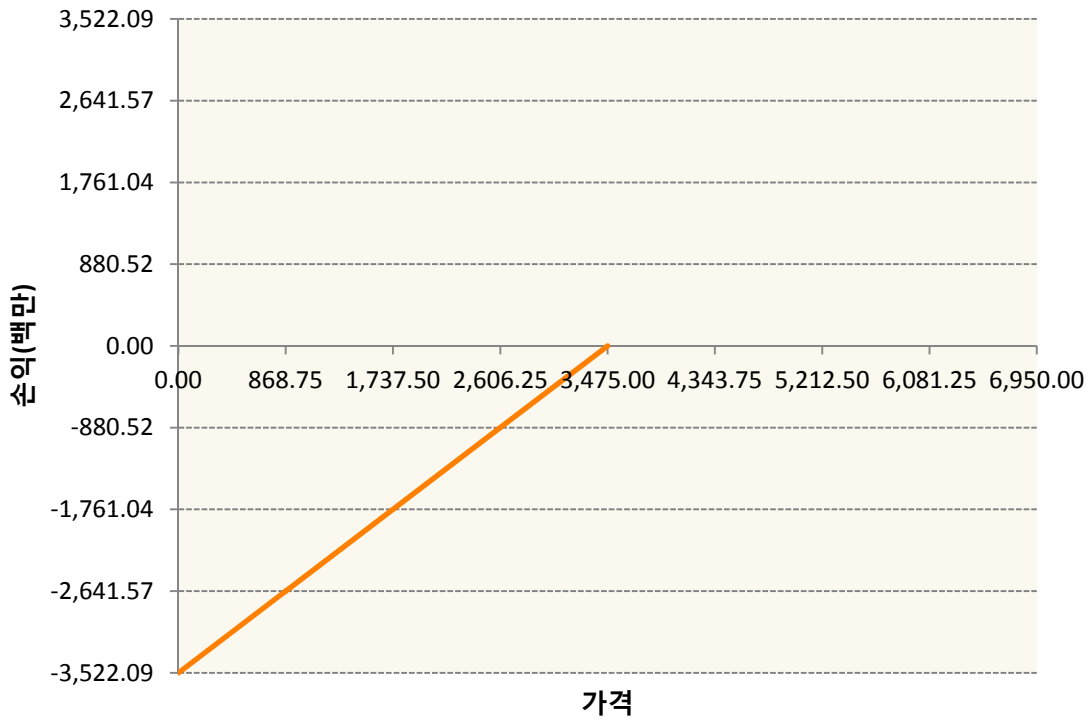


OESXK8-C3500-EURO STOXX 50

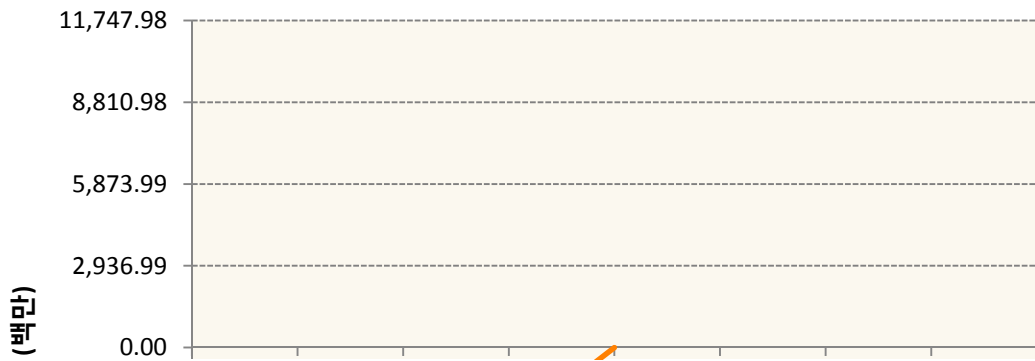


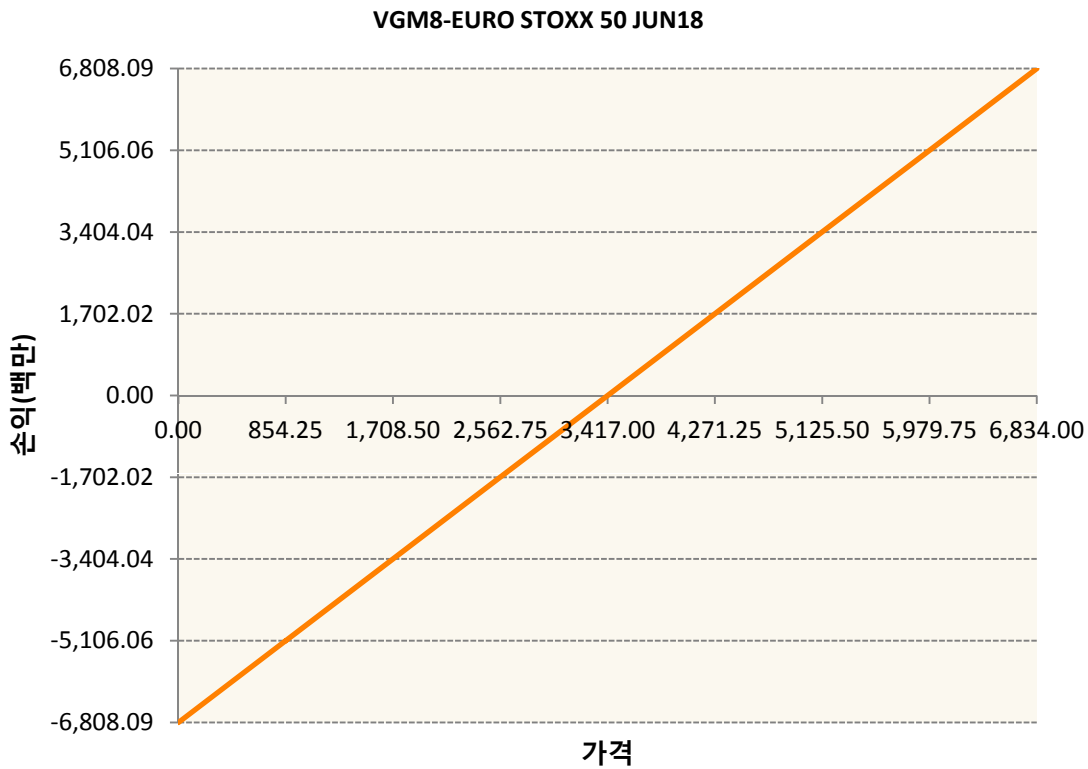
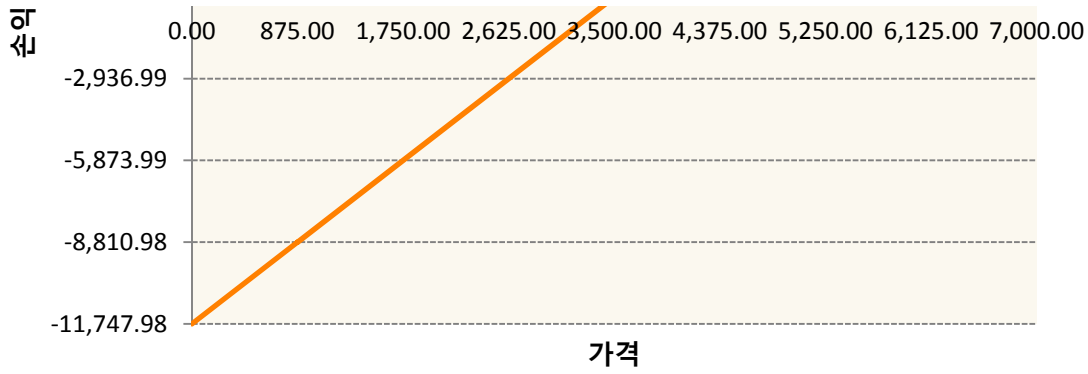


OESXK8-P3475-EURO STOXX 50



OESXK8-P3500-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
260105SGPX SG EURO Covered CALL STRATEGY - 994.569		16
260105SQPX SG EURO Covered CALL STRATEGY		23
OESXK8-C34 EURO STOXX 50		282
OESXK8-C35 EURO STOXX 50		940
OESXK8-P34 EURO STOXX 50		282
OESXK8-P35 EURO STOXX 50		940
VGM8 EURO STOXX 50 JUN18		545

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

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

(단위:백만원)

1,202

공시일	2018-04-27
기준일	2018-04-26

ETF스마트레버리지목표전환형9호

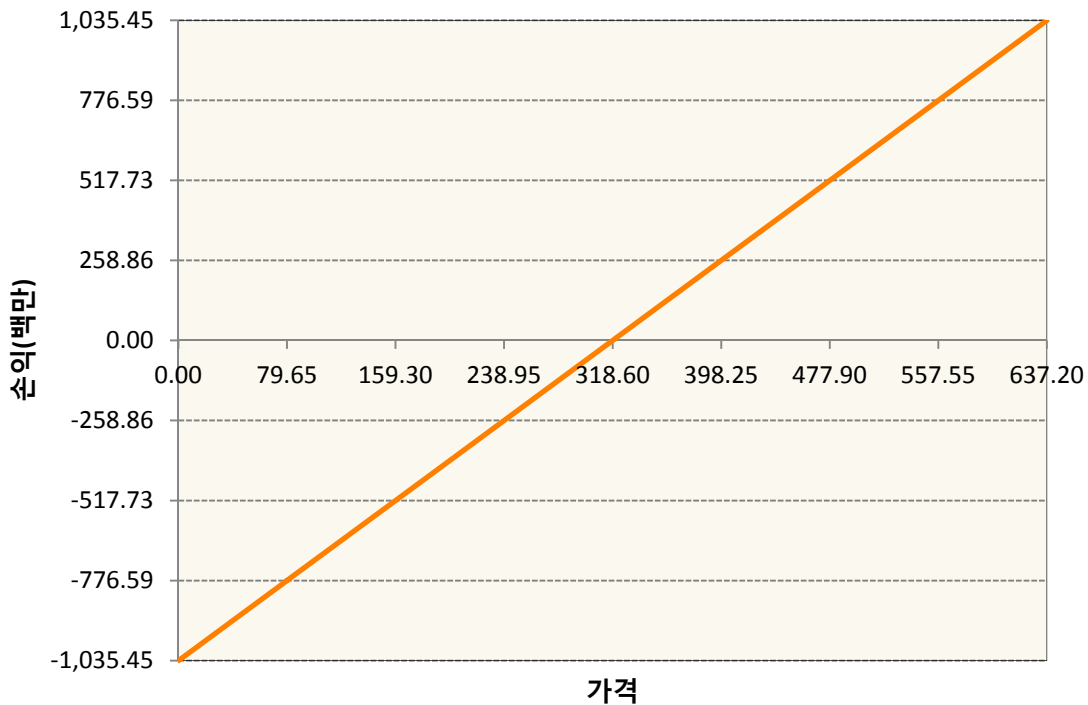
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,035	0	1,035	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101N60009-2018-06 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101N60C 2018-06 코스피200지수선물

83

가격	기초자산의 변동성						
	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-83	-83	-83	-83	-83	-83	-83
-5.33%	-55	-55	-55	-55	-55	-55	-55
-2.67%	-28	-28	-28	-28	-28	-28	-28
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	28	28	28	28	28	28	28
5.33%	55	55	55	55	55	55	55
8.00%	83	83	83	83	83	83	83

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

(단위:백만원)

61

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

(단위:백만원)

98

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

(단위:백만원)

225

공시일	2018-04-27
기준일	2018-04-26

스마트KRX300인덱스목표전환형1

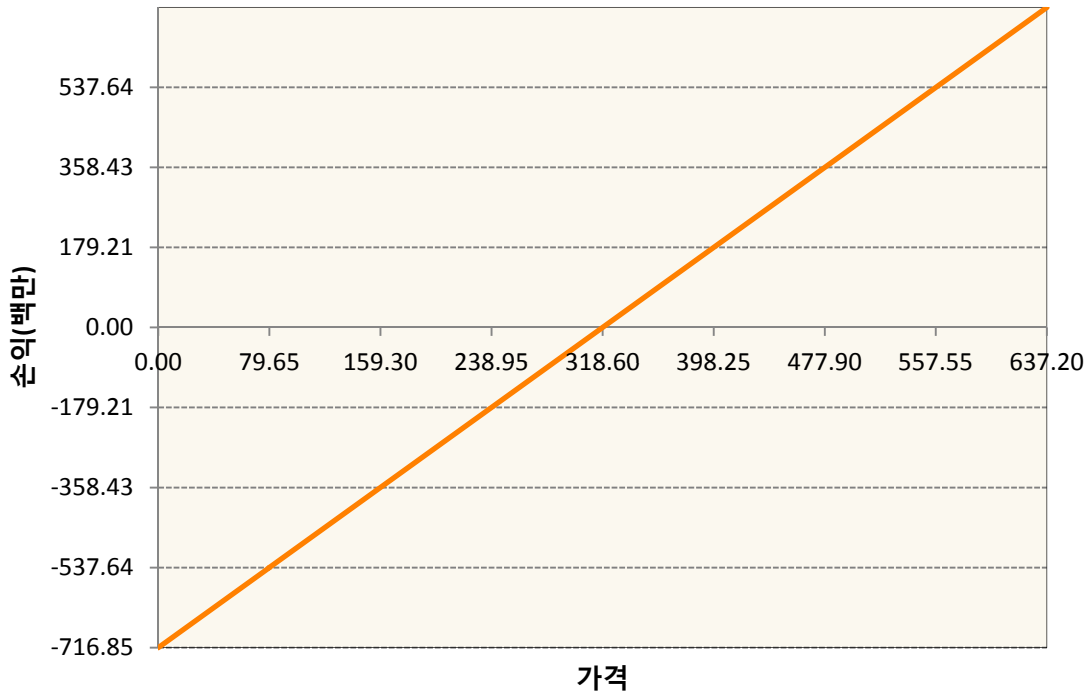
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	717	0	717	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101N60009-2018-06 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101N60C 2018-06 코스피200지수선물

57

가격	기초자산의 변동성						
	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-57	-57	-57	-57	-57	-57	-57
-5.33%	-38	-38	-38	-38	-38	-38	-38
-2.67%	-19	-19	-19	-19	-19	-19	-19
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	19	19	19	19	19	19	19
5.33%	38	38	38	38	38	38	38
8.00%	57	57	57	57	57	57	57

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

(단위:백만원)

42

공시일	2018-04-27
기준일	2018-04-26

리디파인K200(주식혼합-파생재간

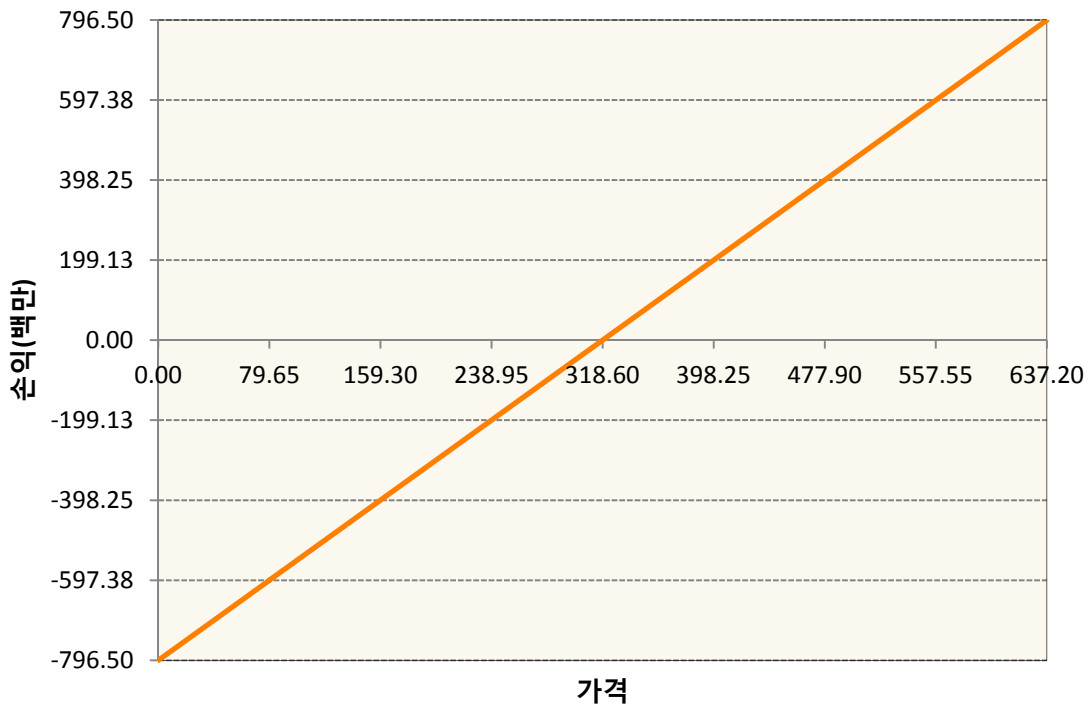
1. 계약금액

(단위:백만원)

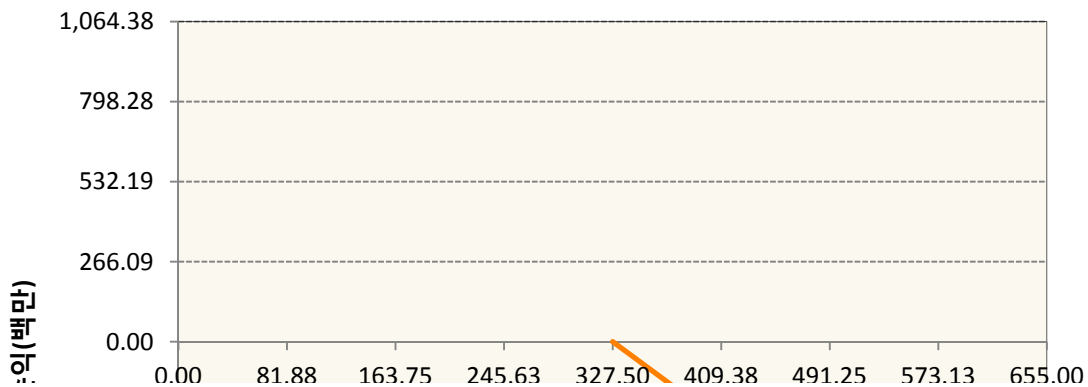
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	246	-246	장내
누계	유가증권	선물	797	0	797	장내
누계	유가증권	옵션	78	1,064	-986	장내

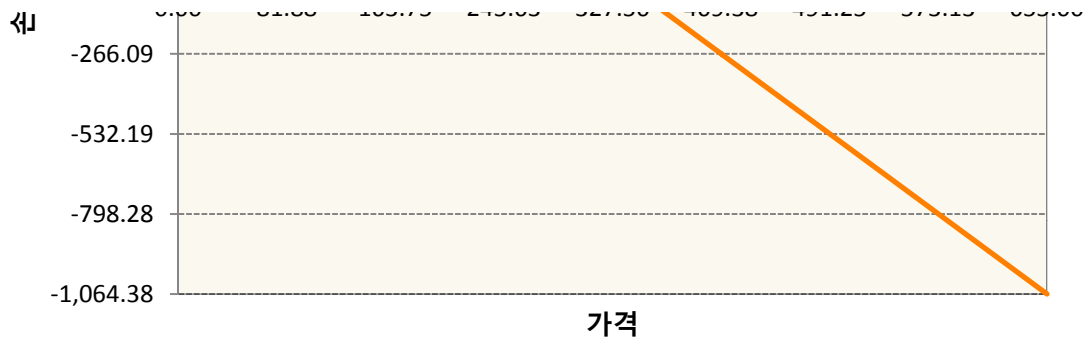
2. 만기시점의 손익구조

KR4101N60009-2018-06 코스피200지수선물

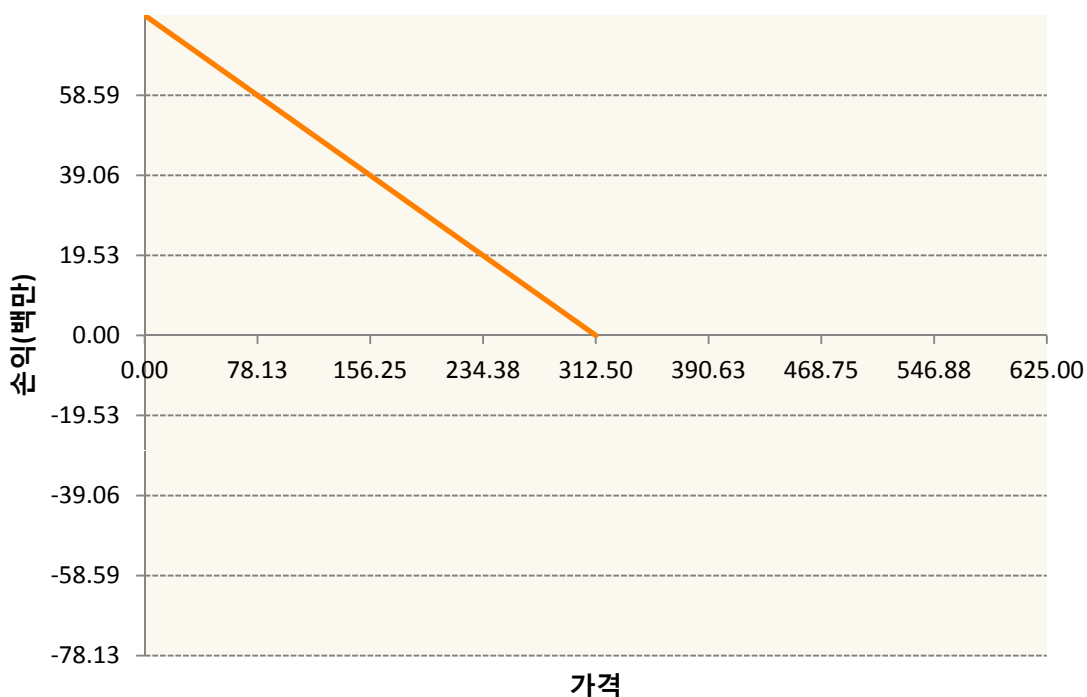


KR4201N53275-2018-05 콜327.5





KR4301N53125-2018-05 풋312.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101N60C 2018-06 코스피200지수선물							64
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-64	-64	-64	-64	-64	-64	-64
-5.33%	-42	-42	-42	-42	-42	-42	-42
-2.67%	-21	-21	-21	-21	-21	-21	-21
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	21	21	21	21	21	21	21
5.33%	42	42	42	42	42	42	42
8.00%	64	64	64	64	64	64	64
KR4201N532 2018-05 콜327.5							52
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	11	11	11	11	10	10	10
-5.33%	11	10	10	9	9	8	7
-2.67%	9	8	7	6	5	4	3
0%	5	3	2	0	-2	-3	-5
2.67%	-5	-7	-9	-11	-13	-15	-17
5.33%	-22	-23	-25	-27	-29	-31	-33
8.00%	-44	-45	-46	-48	-49	-50	-52

KR4301N5312018-05 풋312.5

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	5	5	5	5	5	5	5
-5.33%	3	3	3	3	3	3	3
-2.67%	1	1	1	1	1	1	1
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)

96

공시일	2018-04-27
기준일	2018-04-26

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

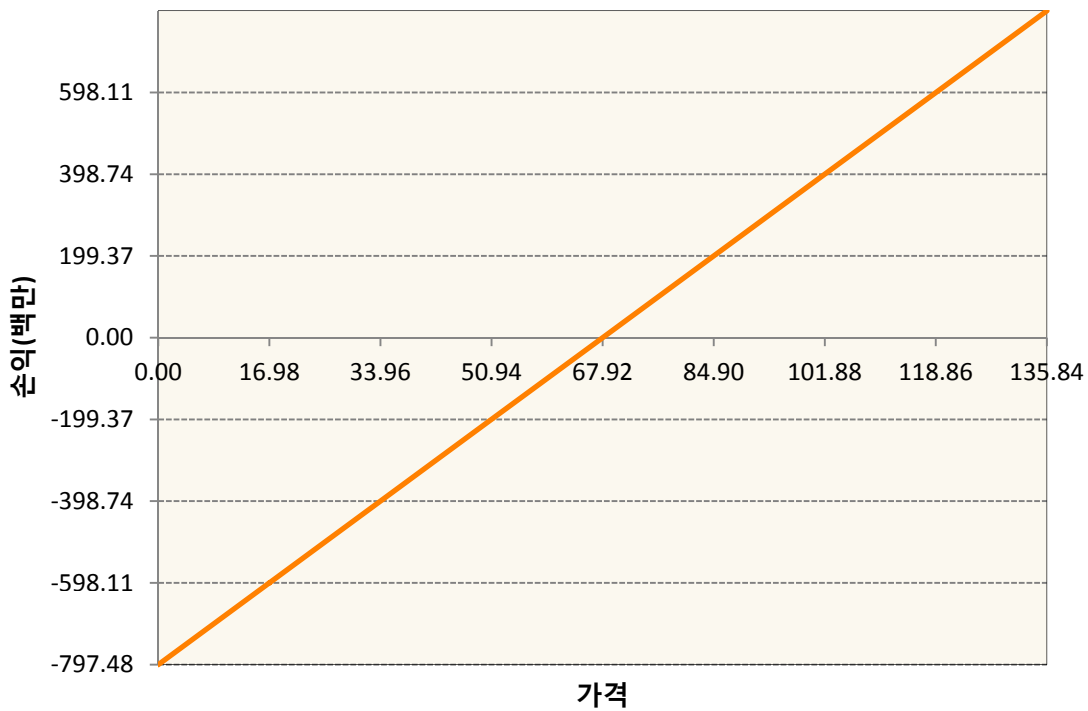
1. 계약금액

(단위:백만원)

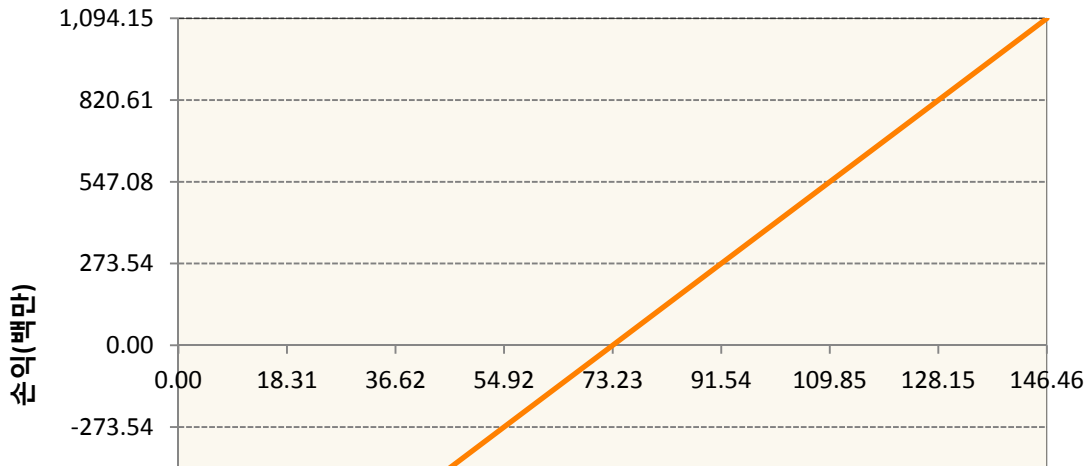
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	4,116	594	3,523	

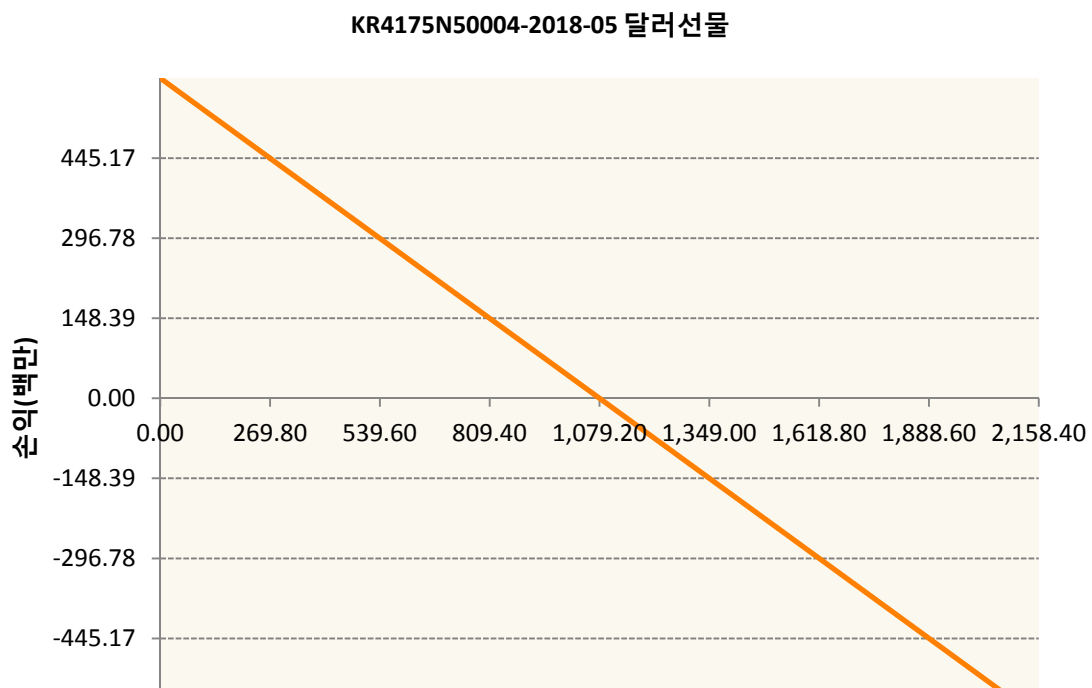
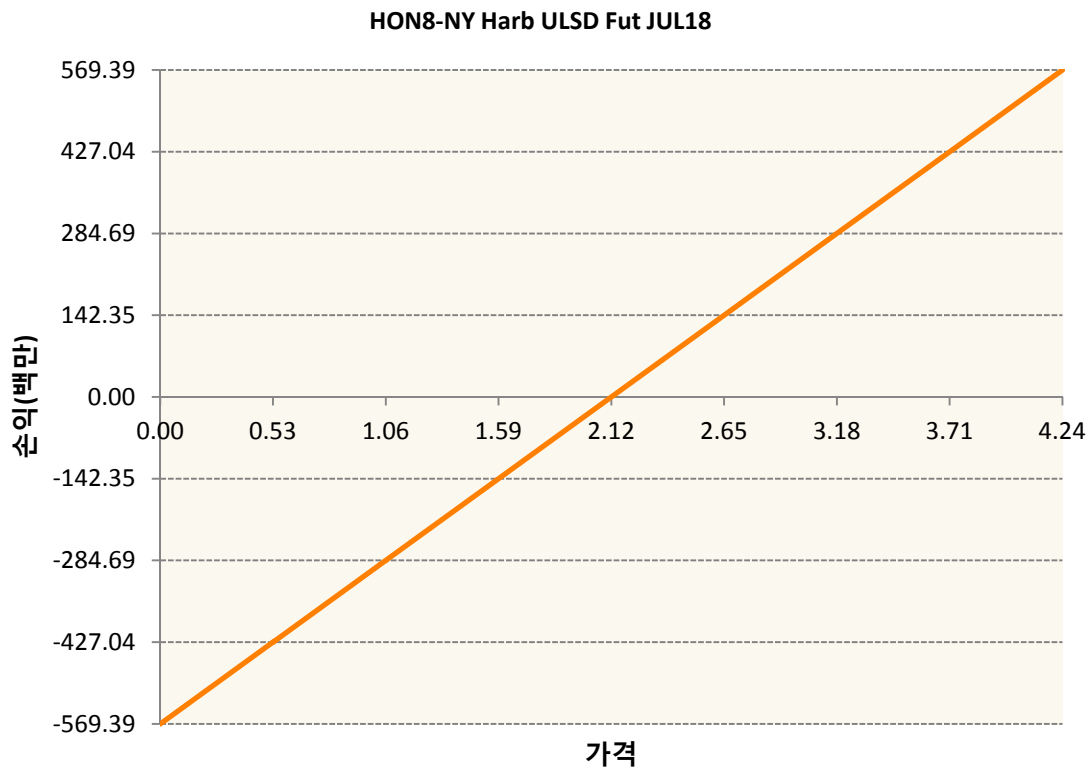
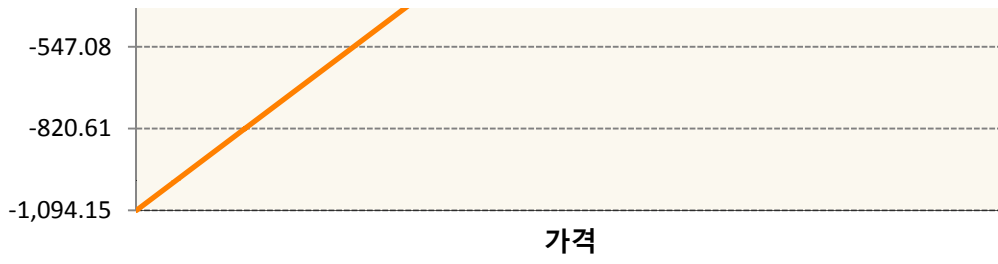
2. 만기시점의 손익구조

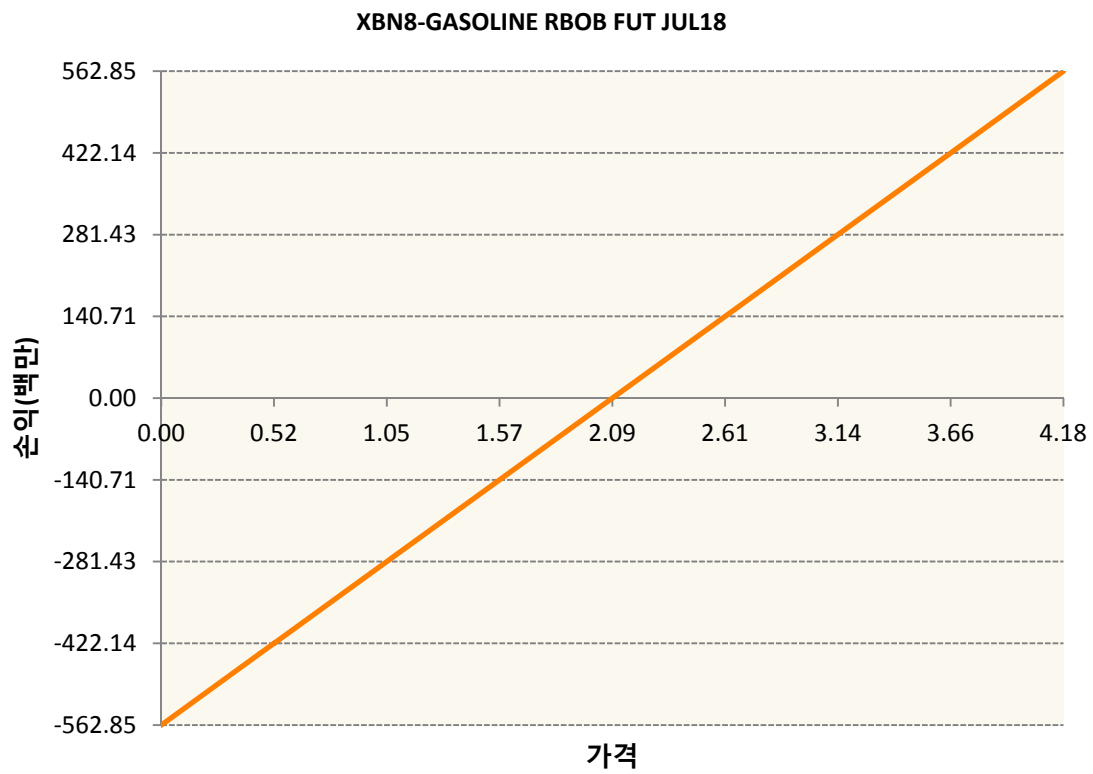
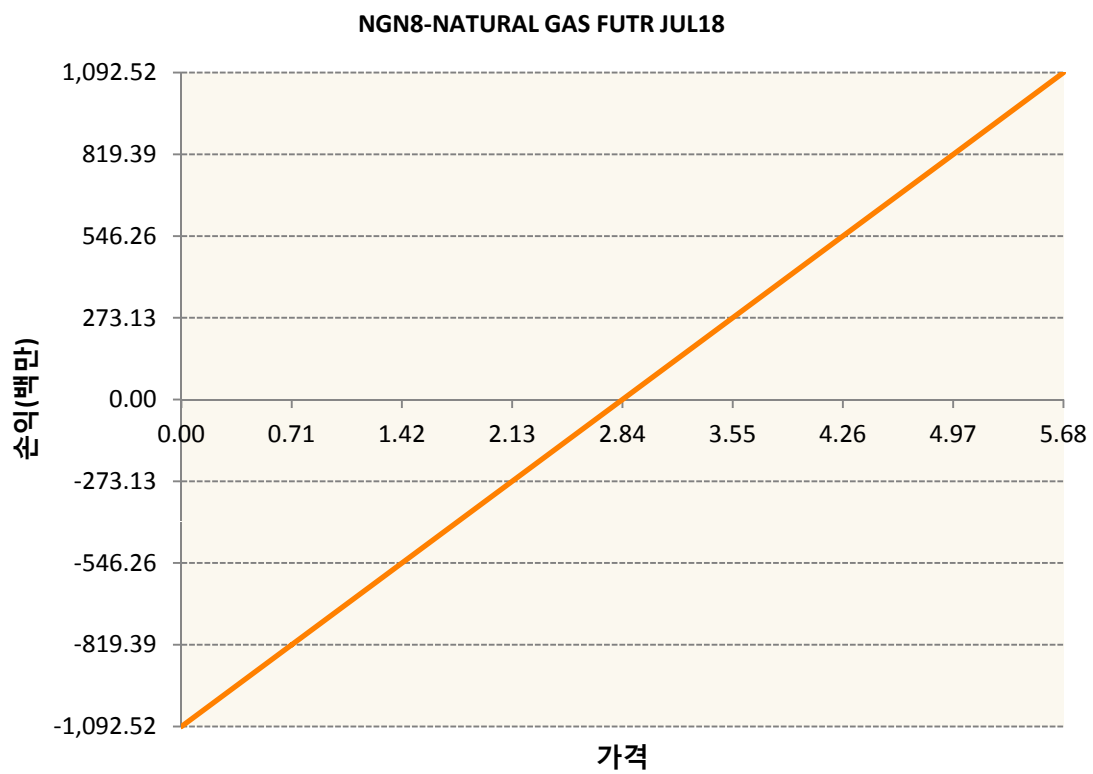
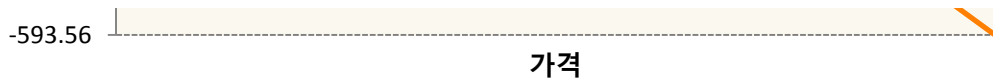
CLN8-WTI CRUDE FUTURE JUL18



CON8-BRENT CRUDE FUTR JUL18







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLN8	WTI CRUDE FUTURE JUL18	64
CON8	BRENT CRUDE FUTR JUL18	88
HON8	NY Harb ULSD Fut JUL18	46
KR4175N50C	2018-05 달러선물	47
NGN8	NATURAL GAS FUTR JUL18	87
XBN8	GASOLINE RBOB FUT JUL18	45

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

510

공시일	2018-04-27
기준일	2018-04-26

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

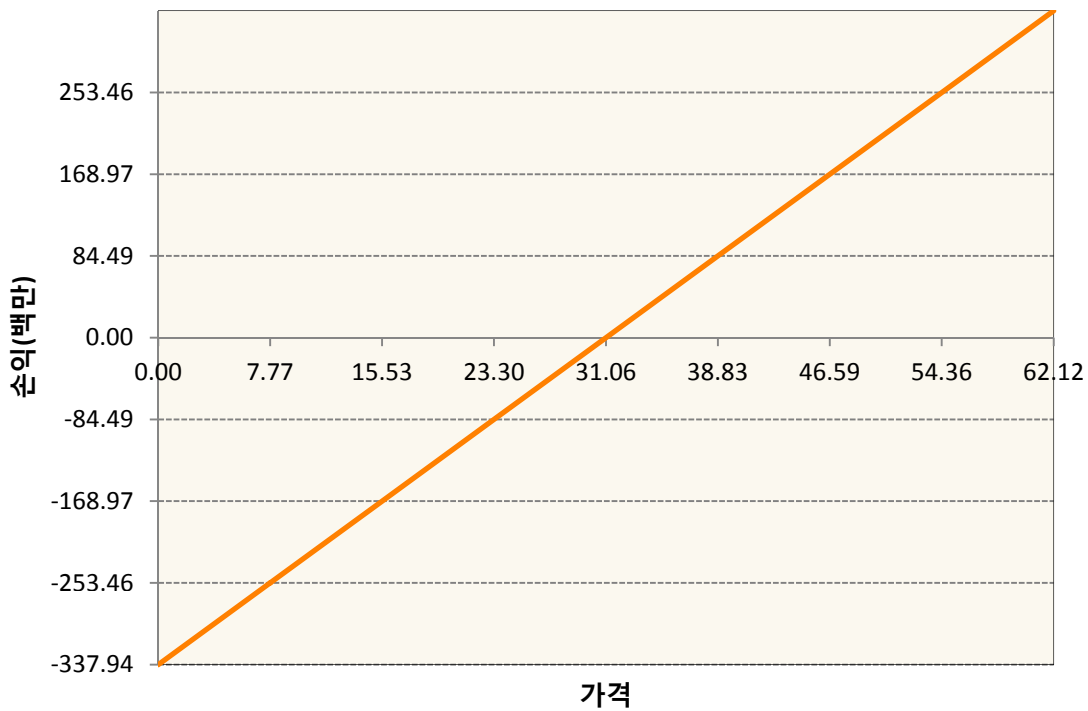
1. 계약금액

(단위:백만원)

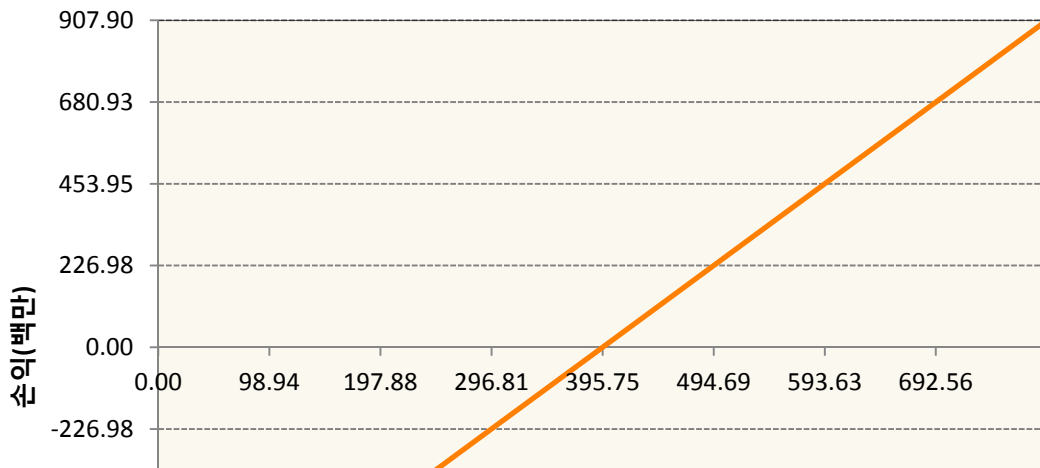
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	4,116	324	3,792	

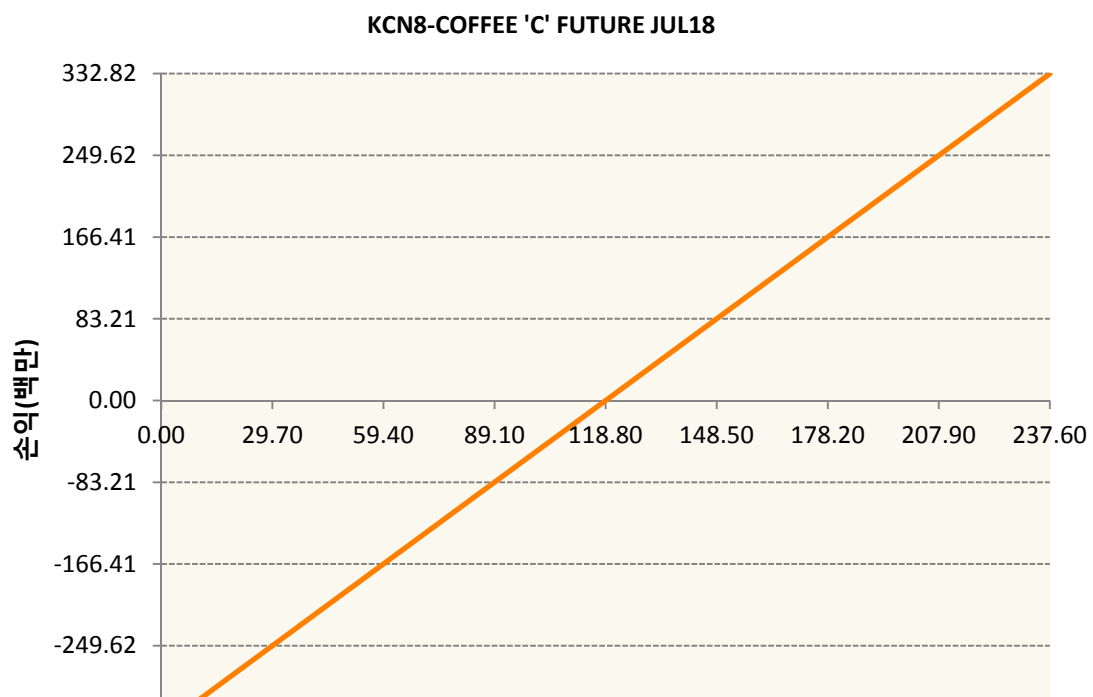
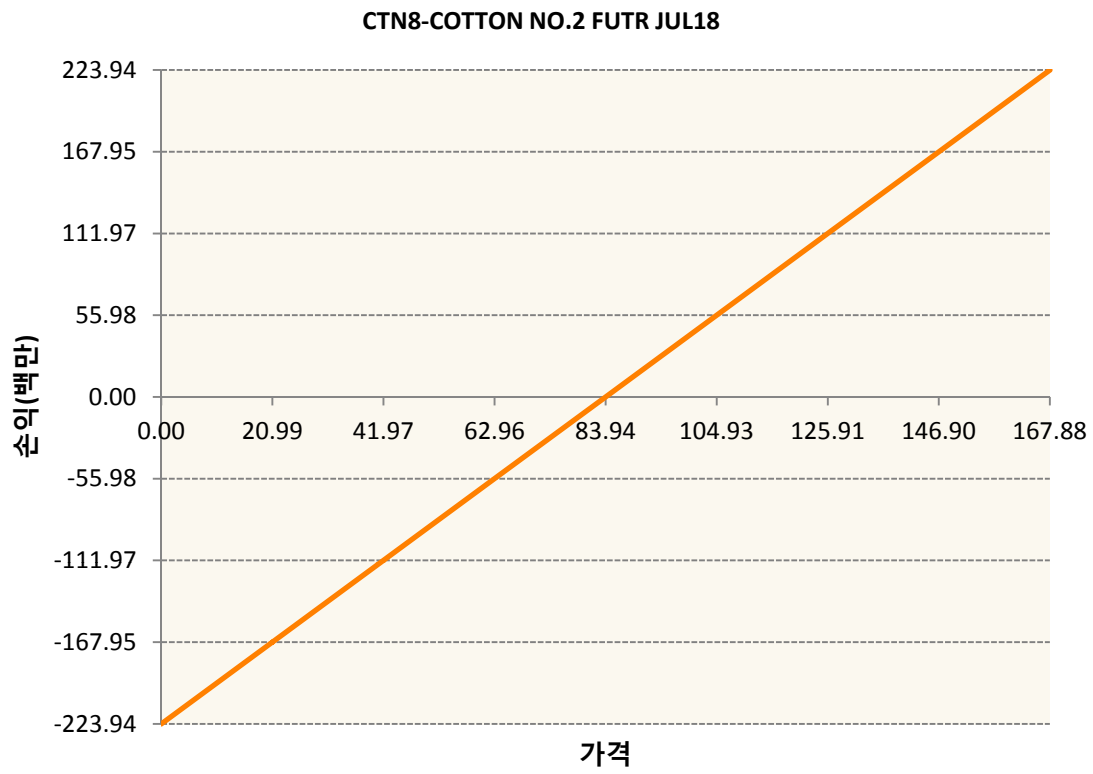
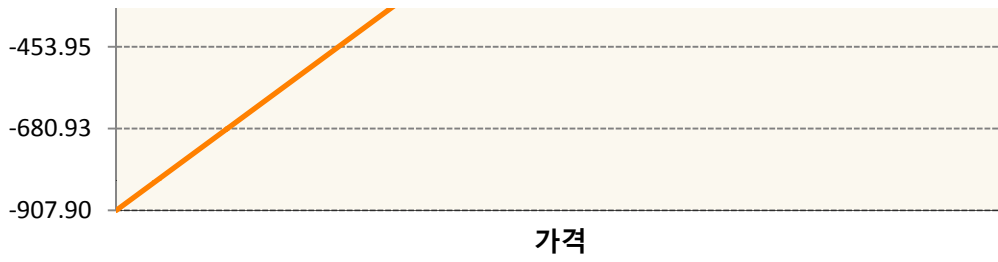
2. 만기시점의 손익구조

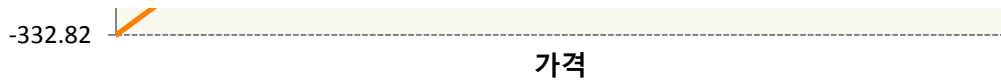
BON8-SOYBEAN OIL FUTR JUL18



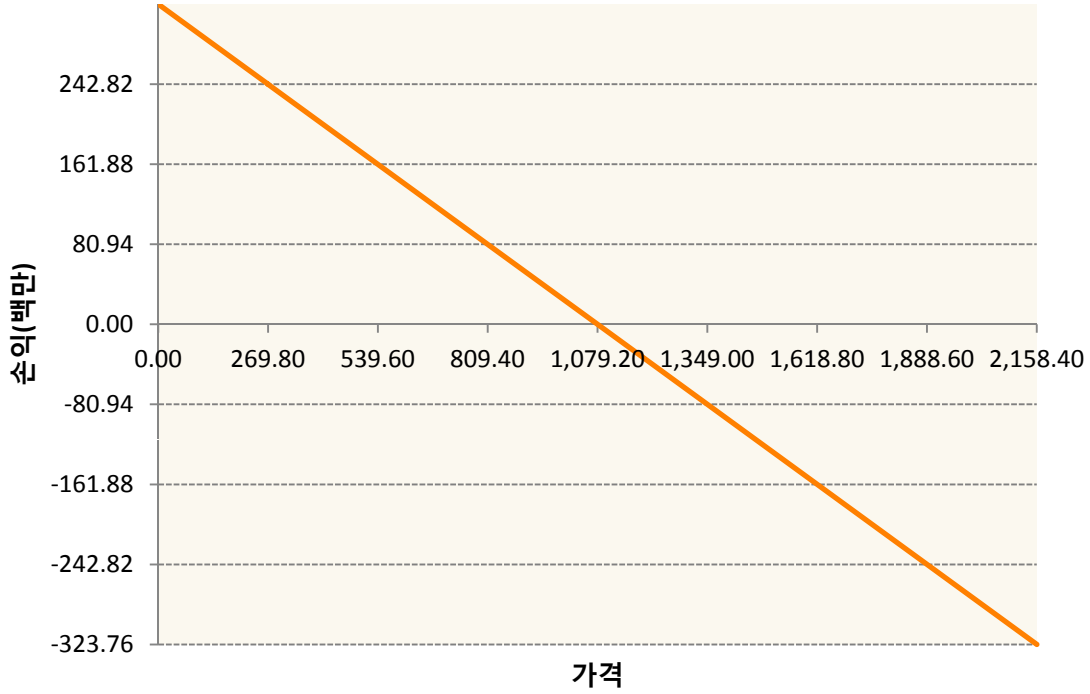
CN8-CORN FUTURE JUL18



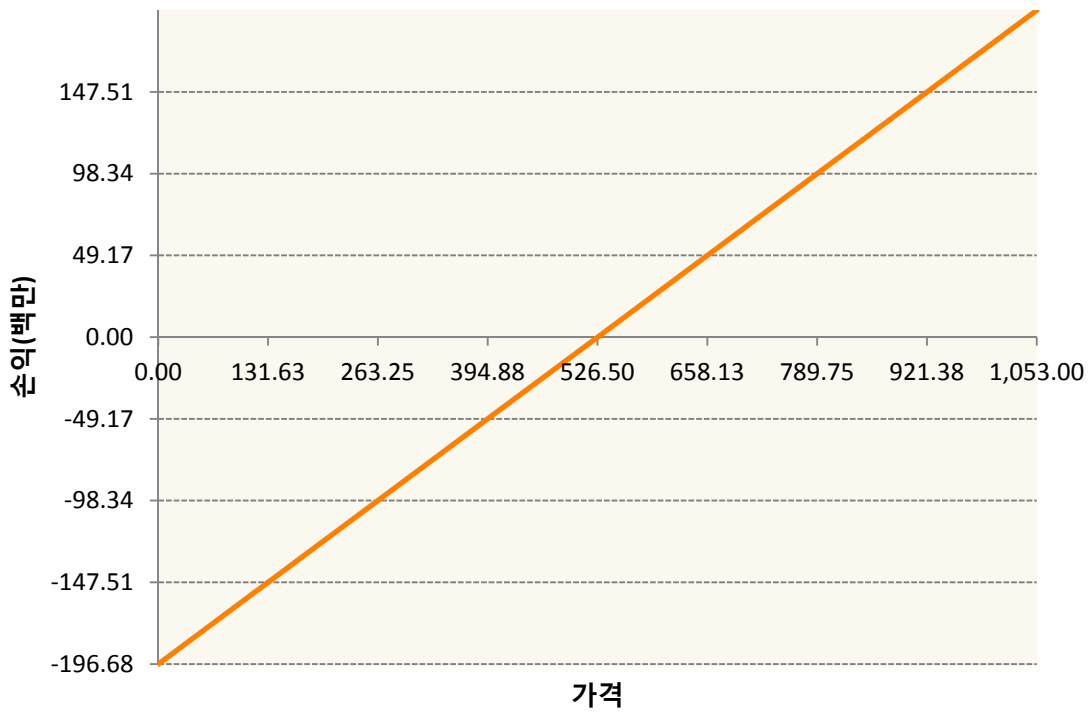




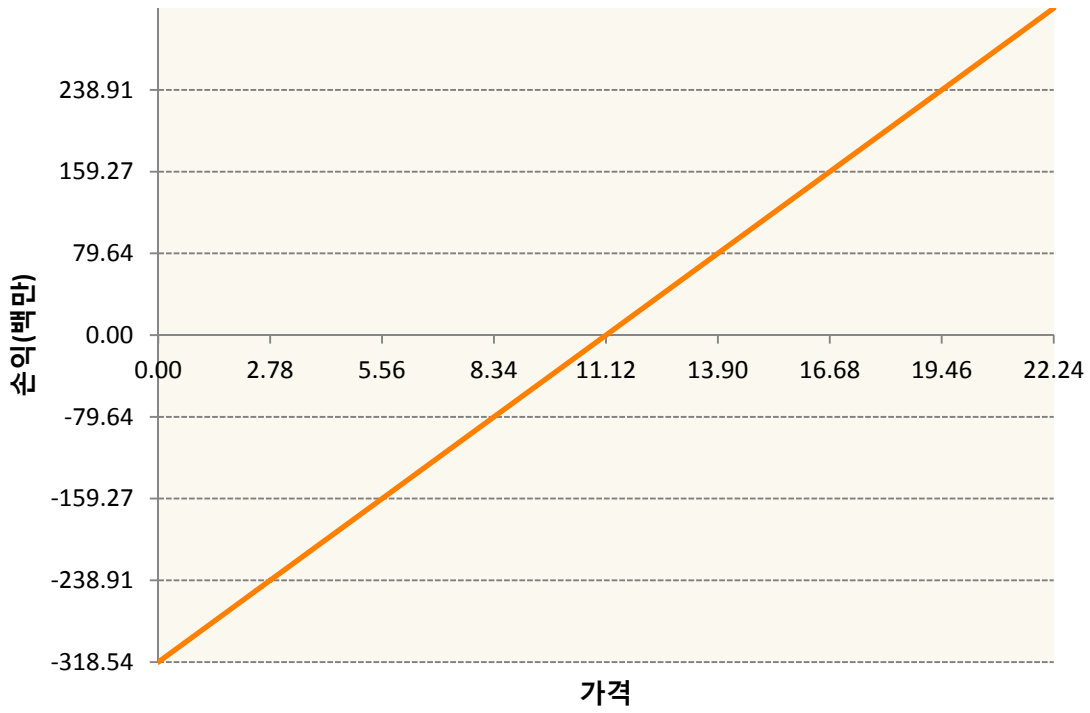
KR4175N50004-2018-05 달러선물



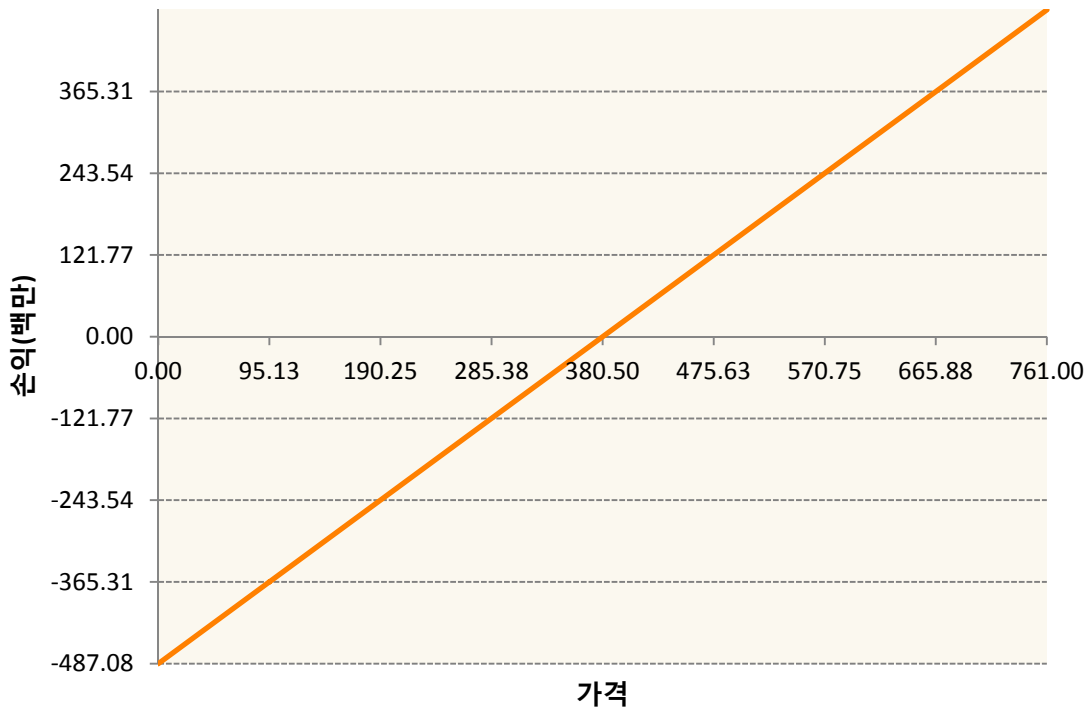
KWN8-KC HRW WHEAT FUT JUL18



SBN8-SUGAR #11 (WORLD) JUL18

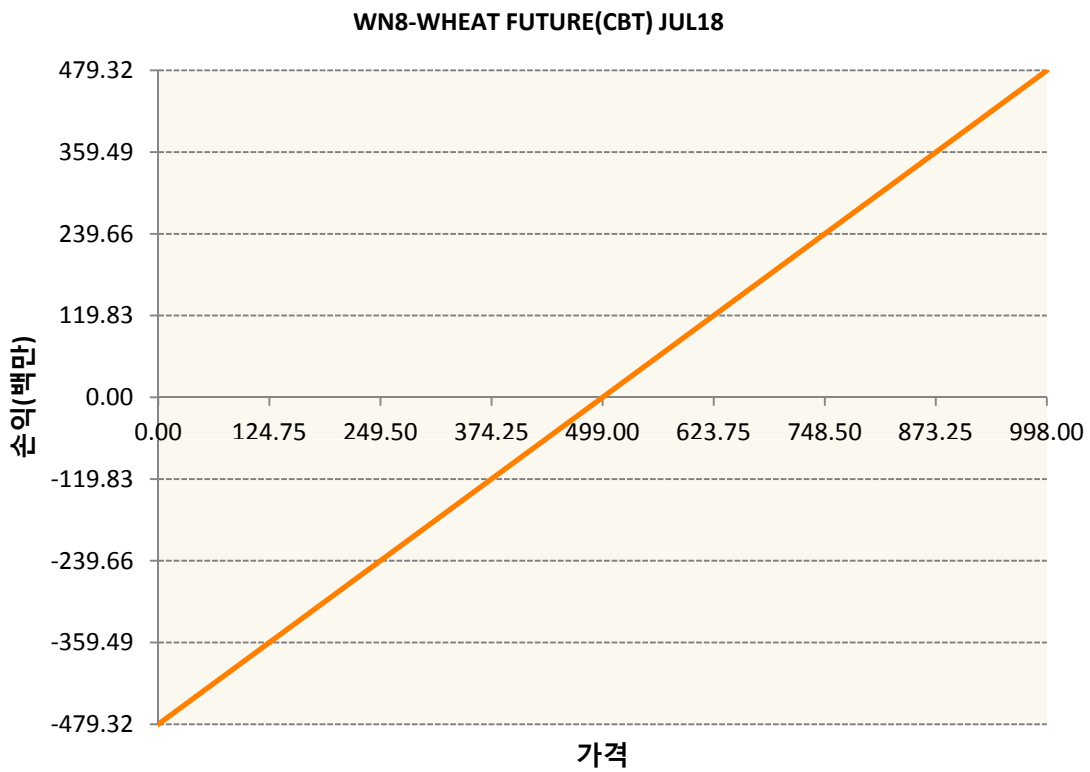
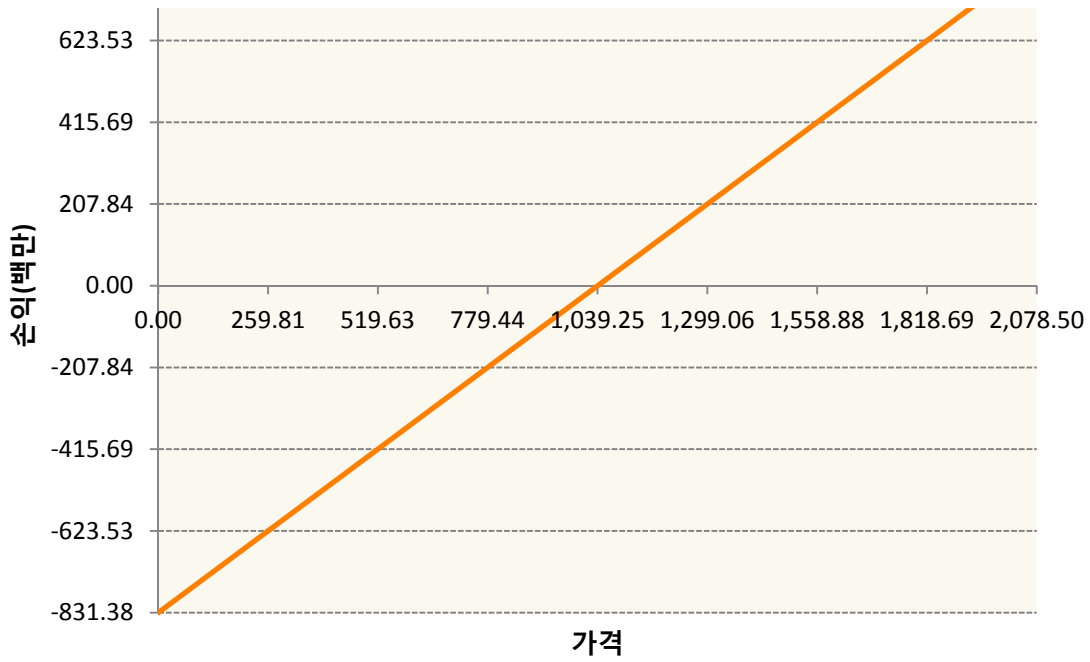


SMN8-SOYBEAN MEAL FUTR JUL18



SN8-SOYBEAN FUTURE JUL18





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

BON8	SOYBEAN OIL FUTR JUL18	27
CN8	CORN FUTURE JUL18	73
CTN8	COTTON NO.2 FUTR JUL18	18
KCN8	COFFEE 'C' FUTURE JUL18	27
KR4175N50C	2018-05 달러선물	26

KWN8	KC HRW WHEAT FUT JUL18	16
SBN8	SUGAR #11 (WORLD) JUL18	25
SMN8	SOYBEAN MEAL FUTR JUL18	39
SN8	SOYBEAN FUTURE JUL18	67
WN8	WHEAT FUTURE(CBT) JUL18	38

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

(단위:백만원)

331