

공시일	2018-05-02
기준일	2018-04-30

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)

86

공시일	2018-05-02
기준일	2018-04-30

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

1,104

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

450

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2018-05-02
기준일	2018-04-30

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)

426

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2018-05-02
기준일	2018-04-30

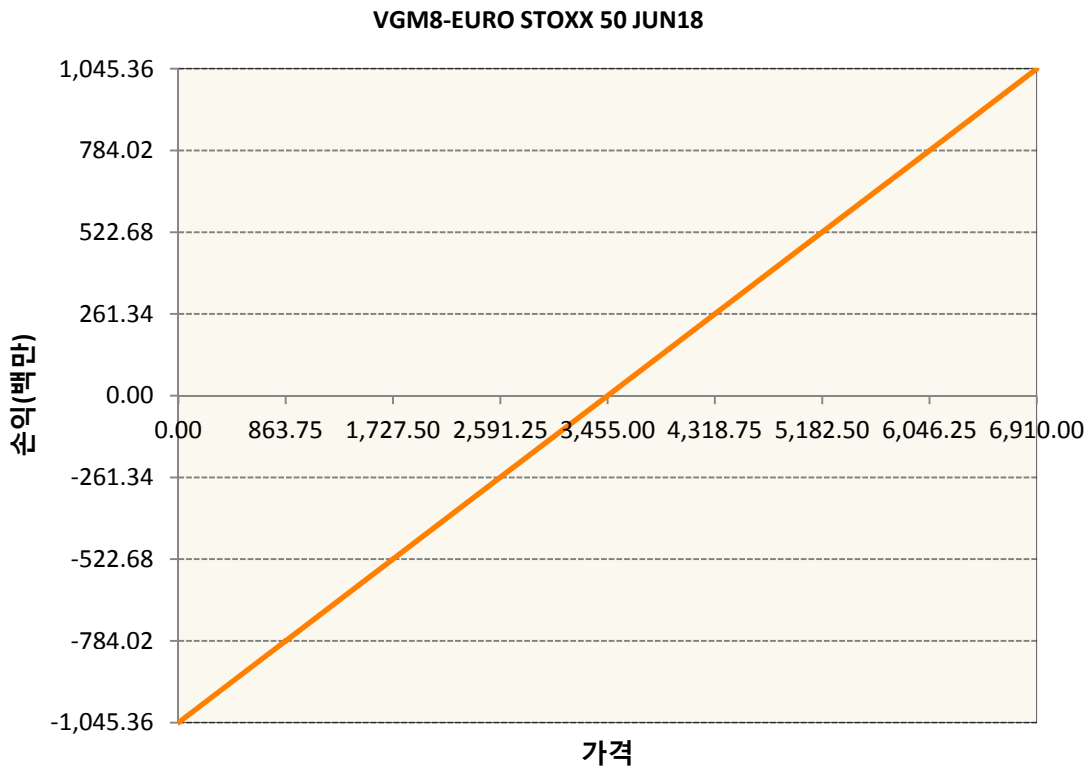
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,045	0	1,045	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGM8	EURO STOXX 50 JUN18	84
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

51

공시일	2018-05-02
기준일	2018-04-30

차이나인덱스모(주식-파생형)

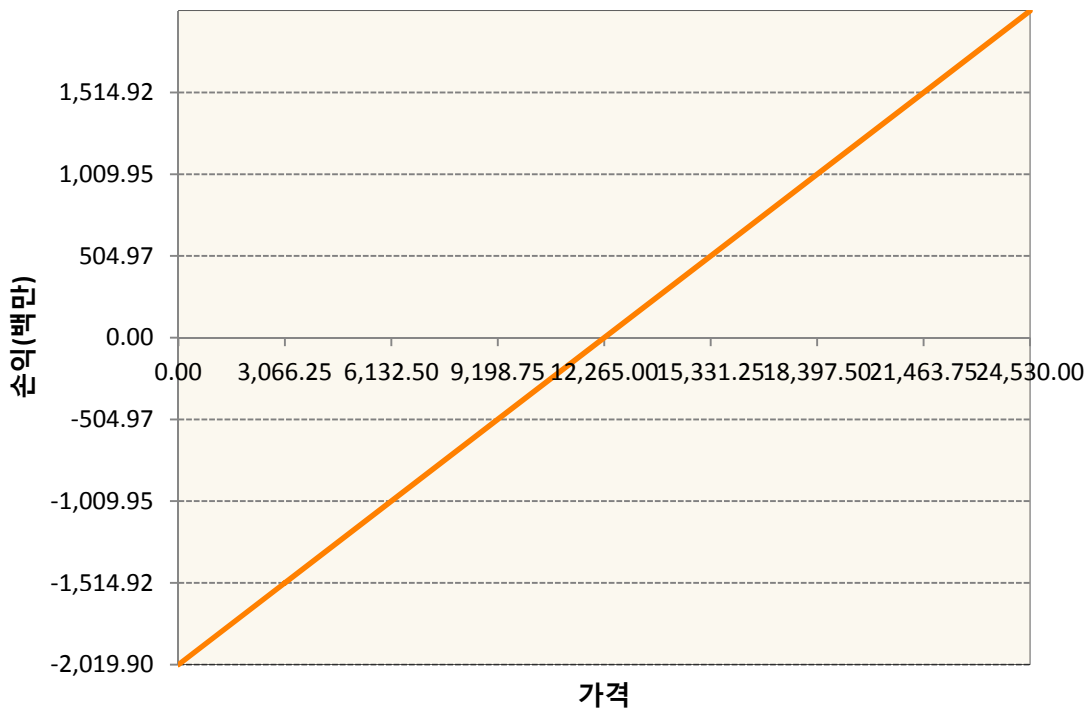
1. 계약금액

(단위:백만원)

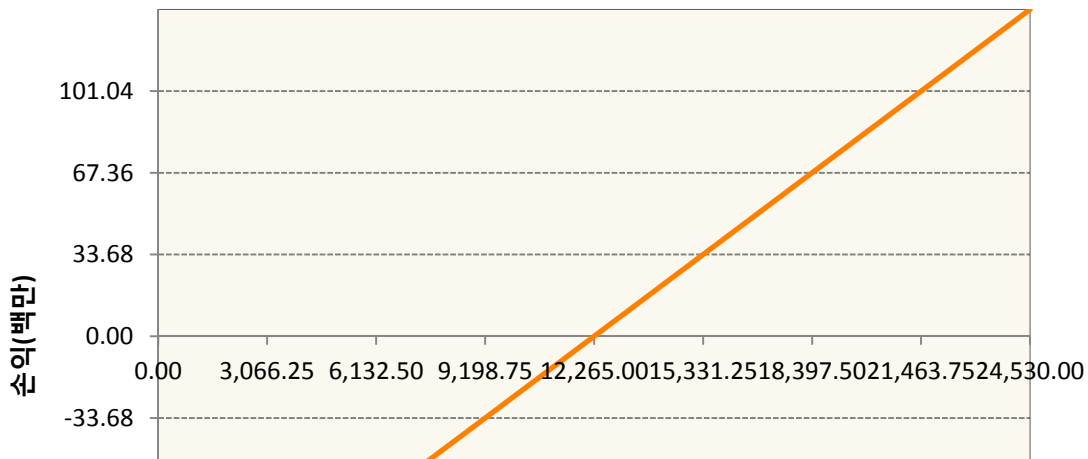
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,155	0	2,155	장내

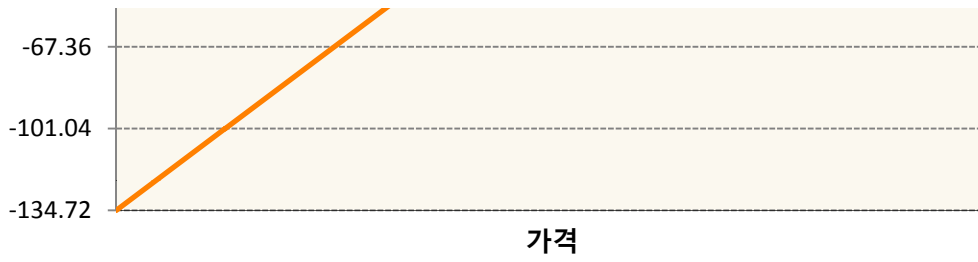
2. 만기시점의 손익구조

HCK8-H-SHARES FUT May18



MHCK8-MINI H-SHR IDX FU May18





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

HCK8	H-SHARES FUT May18	162
MHCK8	MINI H-SHR IDX FU May18	11

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

150

공시일	2018-05-02
기준일	2018-04-30

커버드콜모(주식혼합-파생형)

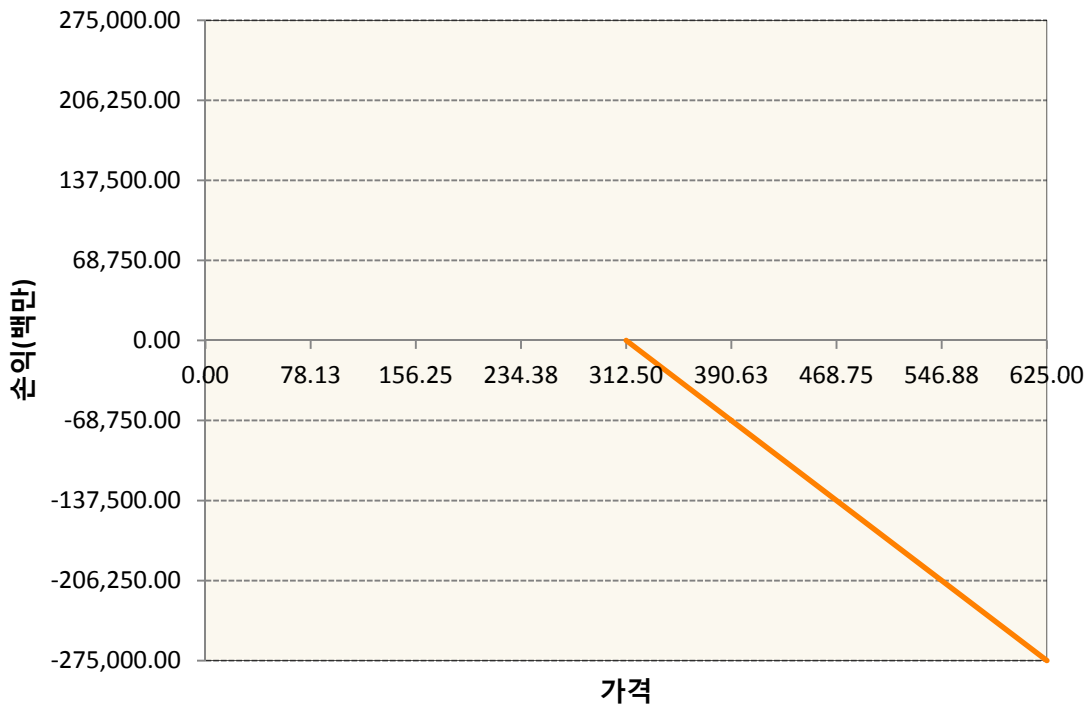
1. 계약금액

(단위:백만원)

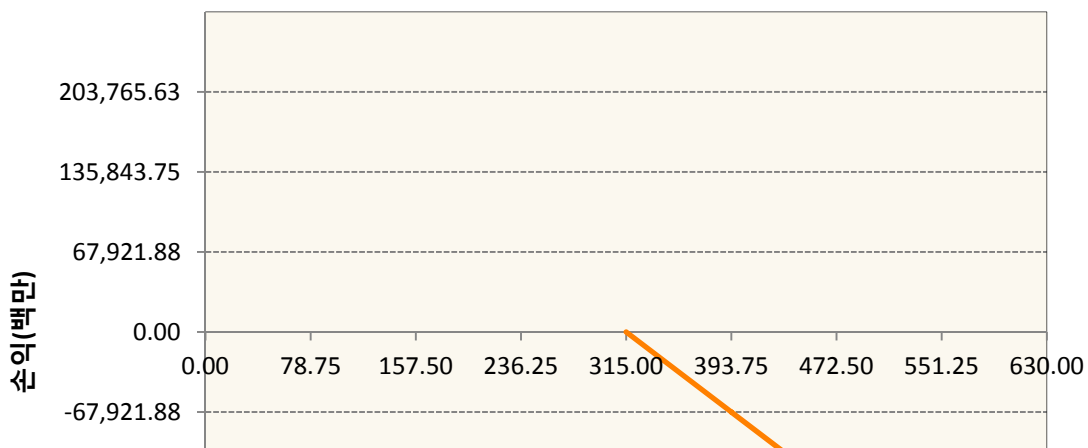
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	15,603	0	15,603	장내
누계	유가증권	옵션	0	913,875	-913,875	장내

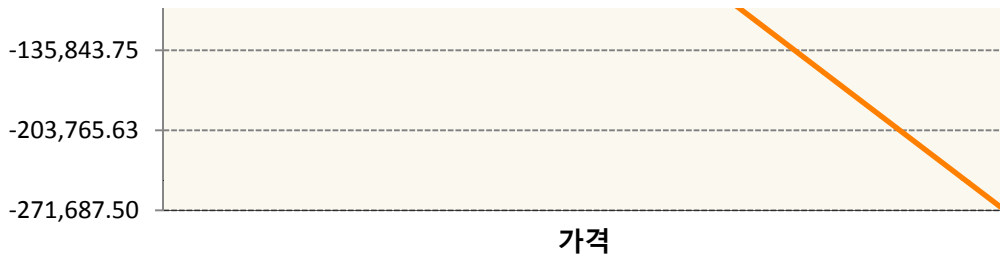
2. 만기시점의 손익구조

KR4201N53127-2018-05 콜312.5

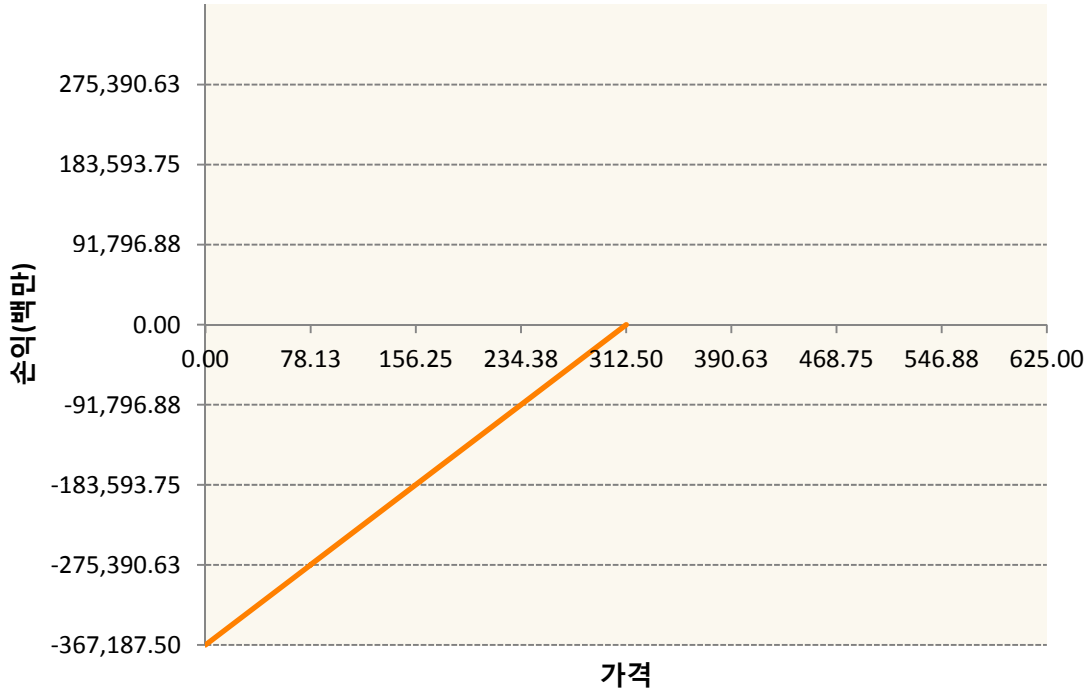


KR4201N53150-2018-05 콜315





KR4301N53125-2018-05 풋312.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4201N5312018-05 콜312.5

21,257

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	11,074	10,905	10,706	10,482	10,235	9,970	9,689
-5.33%	9,768	9,409	9,040	8,664	8,282	7,895	7,504
-2.67%	6,437	6,023	5,608	5,192	4,774	4,356	3,937
0%	881	610	314	0	-330	-672	-1,024
2.67%	-6,063	-6,170	-6,308	-6,475	-6,668	-6,885	-7,123
5.33%	-13,520	-13,546	-13,590	-13,654	-13,740	-13,849	-13,980
8.00%	-21,092	-21,096	-21,106	-21,124	-21,154	-21,198	-21,257

KR4201N5312018-05 콜315

20,346

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	9,393	9,272	9,120	8,942	8,740	8,517	8,275

-5.33%	8,493	8,187	7,865	7,529	7,183	6,828	6,466
-2.67%	5,869	5,453	5,037	4,621	4,205	3,789	3,373
0%	1,010	689	351	0	-361	-730	-1,105
2.67%	-5,494	-5,642	-5,821	-6,029	-6,260	-6,513	-6,784
5.33%	-12,711	-12,753	-12,817	-12,906	-13,018	-13,155	-13,314
8.00%	-20,115	-20,123	-20,139	-20,167	-20,209	-20,268	-20,346
KR4301N5312018-05 풋312.5							17,357
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-17,209	-17,214	-17,225	-17,243	-17,271	-17,308	-17,357
-5.33%	-7,398	-7,535	-7,689	-7,857	-8,038	-8,229	-8,428
-2.67%	-1,056	-1,299	-1,547	-1,798	-2,052	-2,307	-2,565
0%	159	122	69	0	-86	-186	-302
2.67%	197	196	195	191	183	170	150
5.33%	197	197	197	197	197	196	195
8.00%	197	197	197	197	197	197	197

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

(단위:백만원)

56,185

공시일	2018-05-02
기준일	2018-04-30

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생)

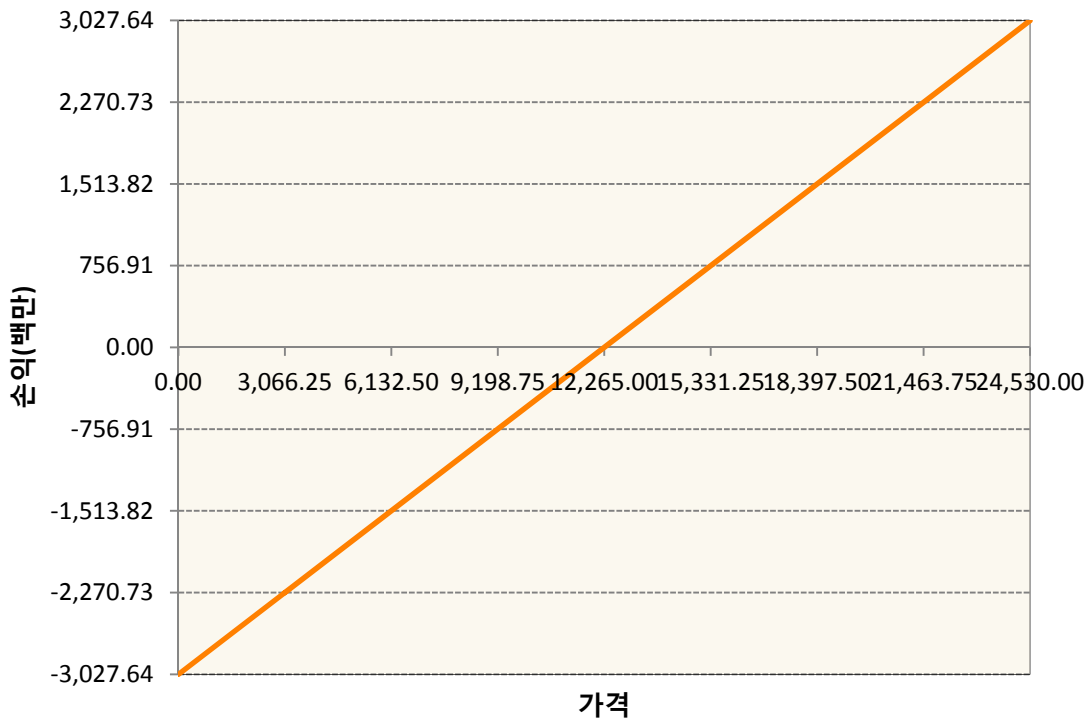
1. 계약금액

(단위:백만원)

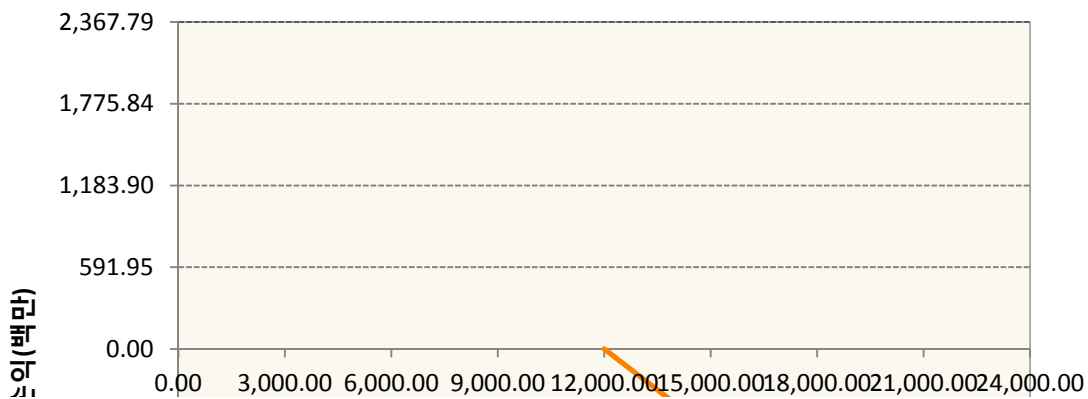
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	3,028	0	3,028	장내
누계	유가증권	옵션	0	7,226	-7,226	장내

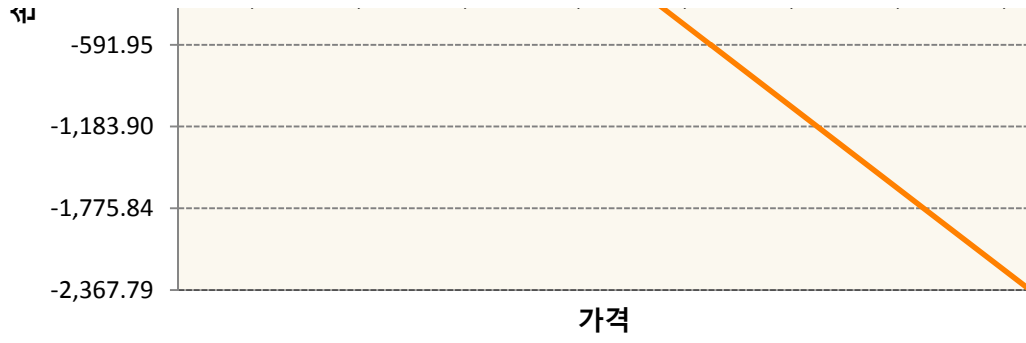
2. 만기시점의 손익구조

HCK8-H-SHARES FUT May18

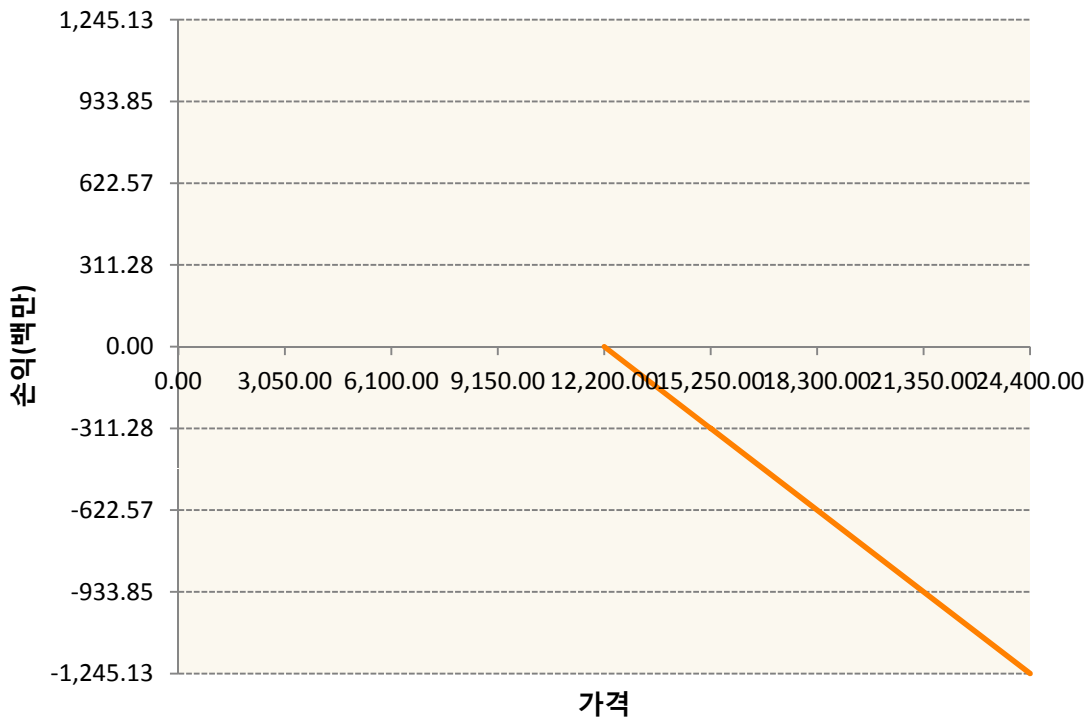


OHHIK8-C120-HSCEI 05/30/18 C12000 Hong Kong Stock Ex

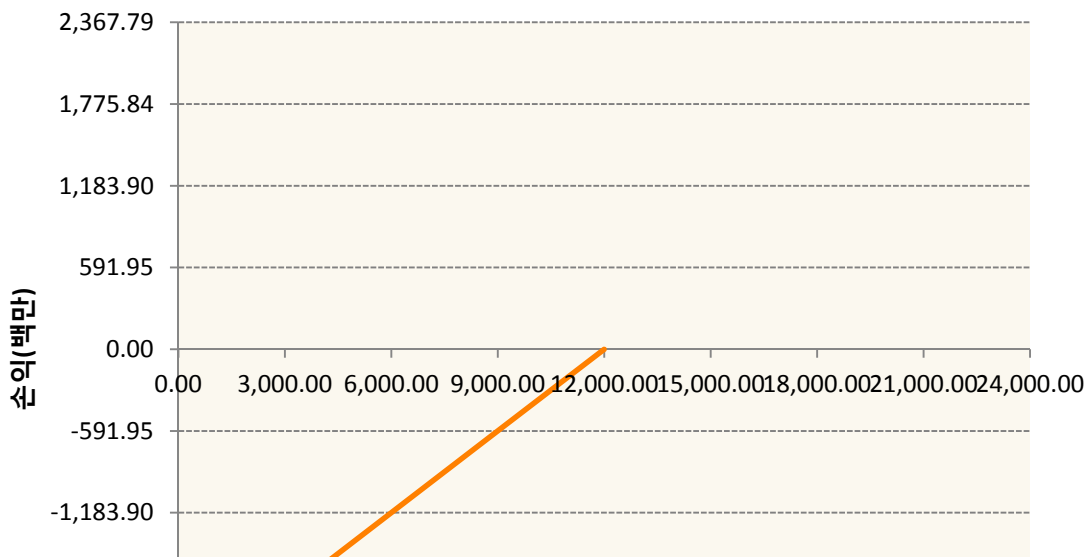


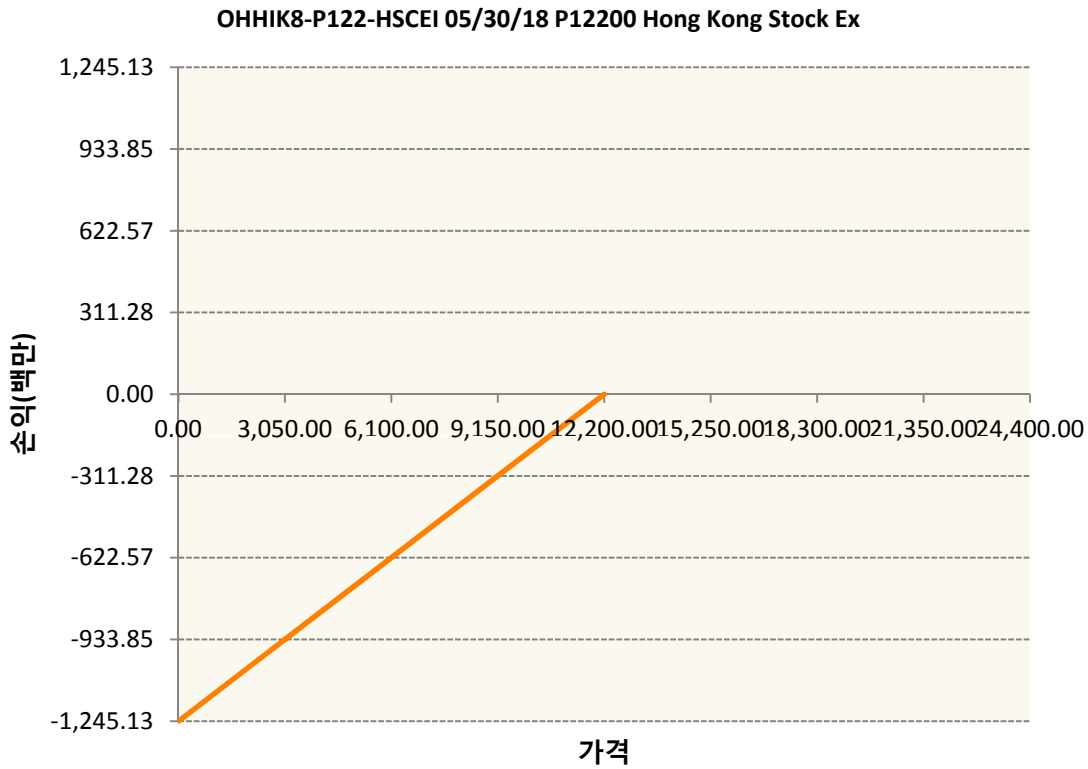
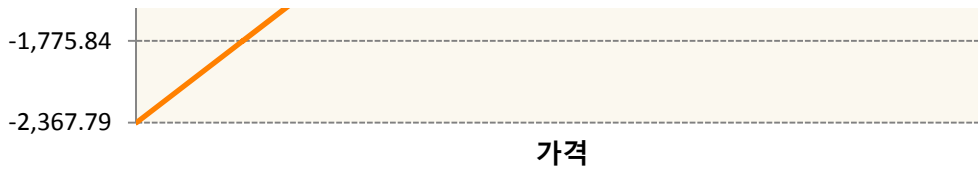


OHHIK8-C122-HSCEI 05/30/18 C12200 Hong Kong Stock Ex



OHHIK8-P120-HSCEI 05/30/18 P12000 Hong Kong Stock Ex





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCK8	H-SHARES FUT May18	242
OHHIK8-C12	HSCEI 05/30/18 C12000 Hong Kong Stock Ex	189
OHHIK8-C12	HSCEI 05/30/18 C12200 Hong Kong Stock Ex	100
OHHIK8-P12	HSCEI 05/30/18 P12000 Hong Kong Stock Ex	189
OHHIK8-P12	HSCEI 05/30/18 P12200 Hong Kong Stock Ex	100

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	714

공시일	2018-05-02
기준일	2018-04-30

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼)

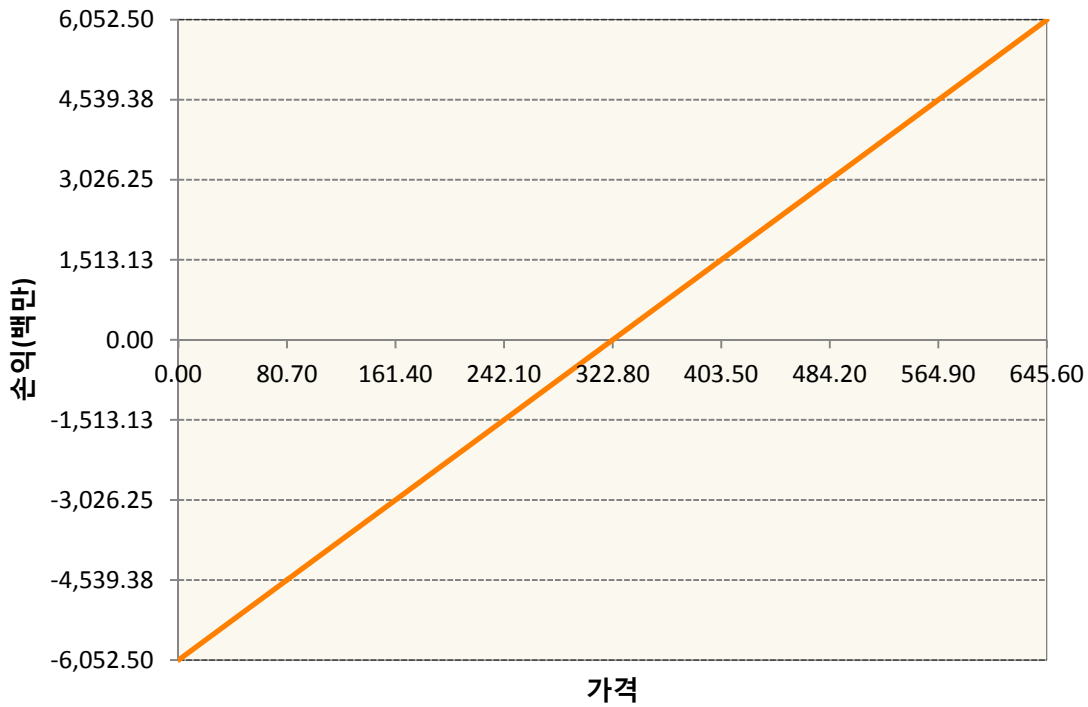
1. 계약금액

(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	6,053	0	6,053	장내
누계	유가증권	스왑	52,200	0	52,200	장외
누계	유가증권	옵션	0	52,629	-52,629	장내

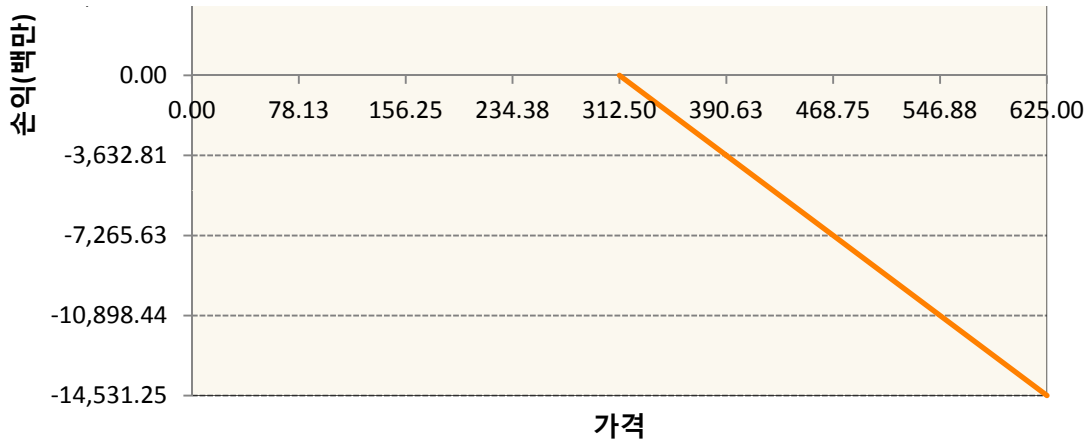
2. 만기시점의 손익구조

KR4101N60009-2018-06 코스피200지수선물

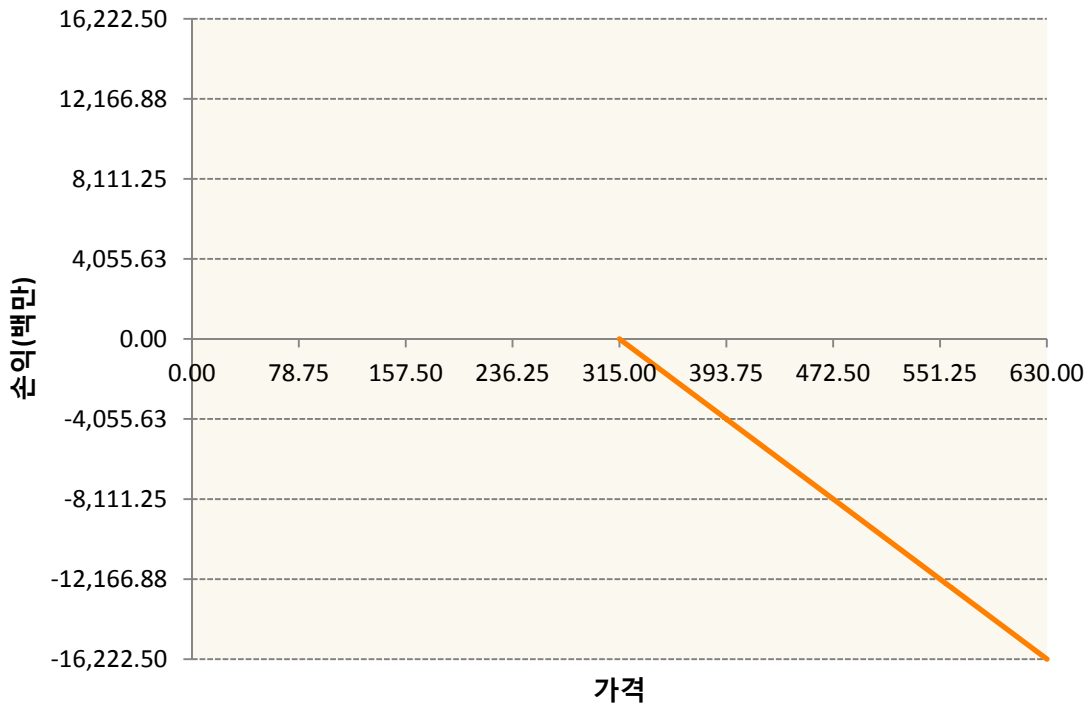


KR4201N53127-2018-05 콜312.5

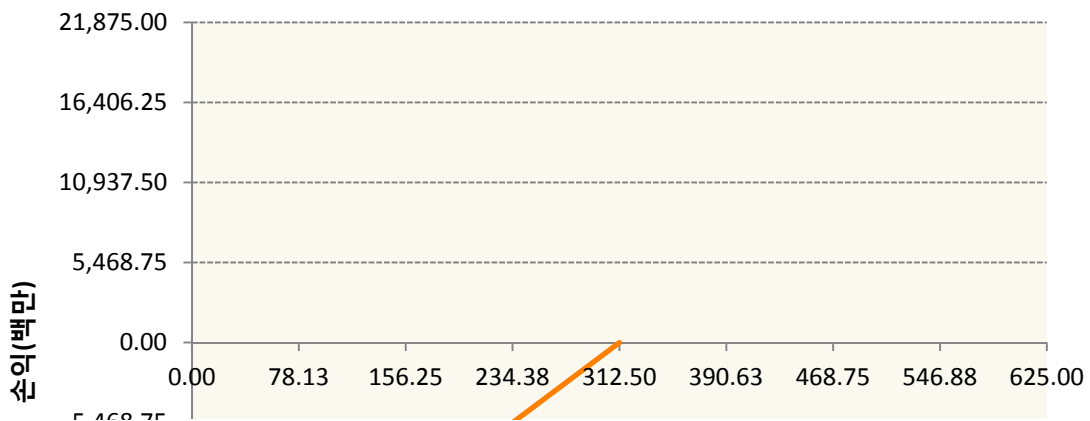




KR4201N53150-2018-05 콜315



KR4301N53125-2018-05 풋312.5





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11 UBSCFXC1 INDEX_2							1,466
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,466	-1,466	-1,466	-1,466	-1,466	-1,466	-1,466
-5.33%	-977	-977	-977	-977	-977	-977	-977
-2.67%	-489	-489	-489	-489	-489	-489	-489
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	489	489	489	489	489	489	489
5.33%	977	977	977	977	977	977	977
8.00%	1,466	1,466	1,466	1,466	1,466	1,466	1,466
2.529E+11 UBSCFXC1 INDEX_3							277
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-277	-277	-277	-277	-277	-277	-277
-5.33%	-185	-185	-185	-185	-185	-185	-185
-2.67%	-92	-92	-92	-92	-92	-92	-92
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	92	92	92	92	92	92	92
5.33%	185	185	185	185	185	185	185
8.00%	277	277	277	277	277	277	277
2.529E+11 UBSCFXC1 INDEX_5							238
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-238	-238	-238	-238	-238	-238	-238
-5.33%	-159	-159	-159	-159	-159	-159	-159
-2.67%	-79	-79	-79	-79	-79	-79	-79
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	79	79	79	79	79	79	79
5.33%	159	159	159	159	159	159	159
8.00%	238	238	238	238	238	238	238
2.529E+11 UBSCFXC1 INDEX_6							198
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%

-8.00%	-198	-198	-198	-198	-198	-198	-198
-5.33%	-132	-132	-132	-132	-132	-132	-132
-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%	132	132	132	132	132	132	132
8.00%	198	198	198	198	198	198	198

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%	-169	-169	-169	-169	-169	-169	-169
-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%	169	169	169	169	169	169	169
8.00%	254	254	254	254	254	254	254

2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_8 469

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-469	-469	-469	-469	-469	-469	-469
-5.33%	-313	-313	-313	-313	-313	-313	-313
-2.67%	-156	-156	-156	-156	-156	-156	-156
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	156	156	156	156	156	156	156
5.33%	313	313	313	313	313	313	313
8.00%	469	469	469	469	469	469	469

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%	-79	-79	-79	-79	-79	-79	-79
-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%	79	79	79	79	79	79	79
8.00%	119	119	119	119	119	119	119

2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_11 634

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-634	-634	-634	-634	-634	-634	-634
-5.33%	-423	-423	-423	-423	-423	-423	-423
-2.67%	-211	-211	-211	-211	-211	-211	-211
0%	0	0	0	0	0	0	0

2.67%	211	211	211	211	211	211	211
5.33%	423	423	423	423	423	423	423
8.00%	634	634	634	634	634	634	634

2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_12 476

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-476	-476	-476	-476	-476	-476	-476
-5.33%	-317	-317	-317	-317	-317	-317	-317
-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%	317	317	317	317	317	317	317
8.00%	476	476	476	476	476	476	476

KR4101N60C 2018-06 코스피200지수선물 485

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-485	-485	-485	-485	-485	-485	-485
-5.33%	-324	-324	-324	-324	-324	-324	-324
-2.67%	-162	-162	-162	-162	-162	-162	-162
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	162	162	162	162	162	162	162
5.33%	324	324	324	324	324	324	324
8.00%	485	485	485	485	485	485	485

KR4201N5312018-05 콜312.5 1,123

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	585	576	566	554	541	527	512
-5.33%	516	497	478	458	438	417	397
-2.67%	340	318	296	274	252	230	208
0%	47	32	17	0	-17	-35	-54
2.67%	-320	-326	-333	-342	-352	-364	-376
5.33%	-714	-716	-718	-722	-726	-732	-739
8.00%	-1,115	-1,115	-1,115	-1,116	-1,118	-1,120	-1,123

KR4201N5312018-05 콜315 1,215

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	561	554	545	534	522	509	494
-5.33%	507	489	470	450	429	408	386
-2.67%	350	326	301	276	251	226	201
0%	60	41	21	0	-22	-44	-66
2.67%	-328	-337	-348	-360	-374	-389	-405
5.33%	-759	-761	-765	-771	-777	-785	-795
8.00%	-1,201	-1,202	-1,202	-1,204	-1,207	-1,210	-1,215

KR4301N5312018-05 풋312.5 1,034

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,025	-1,026	-1,026	-1,027	-1,029	-1,031	-1,034
-5.33%	-441	-449	-458	-468	-479	-490	-502
-2.67%	-63	-77	-92	-107	-122	-137	-153
0%	9	7	4	0	-5	-11	-18
2.67%	12	12	12	11	11	10	9
5.33%	12	12	12	12	12	12	12
8.00%	12	12	12	12	12	12	12

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

(단위:백만원)

7,684

공시일	2018-05-02
기준일	2018-04-30

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

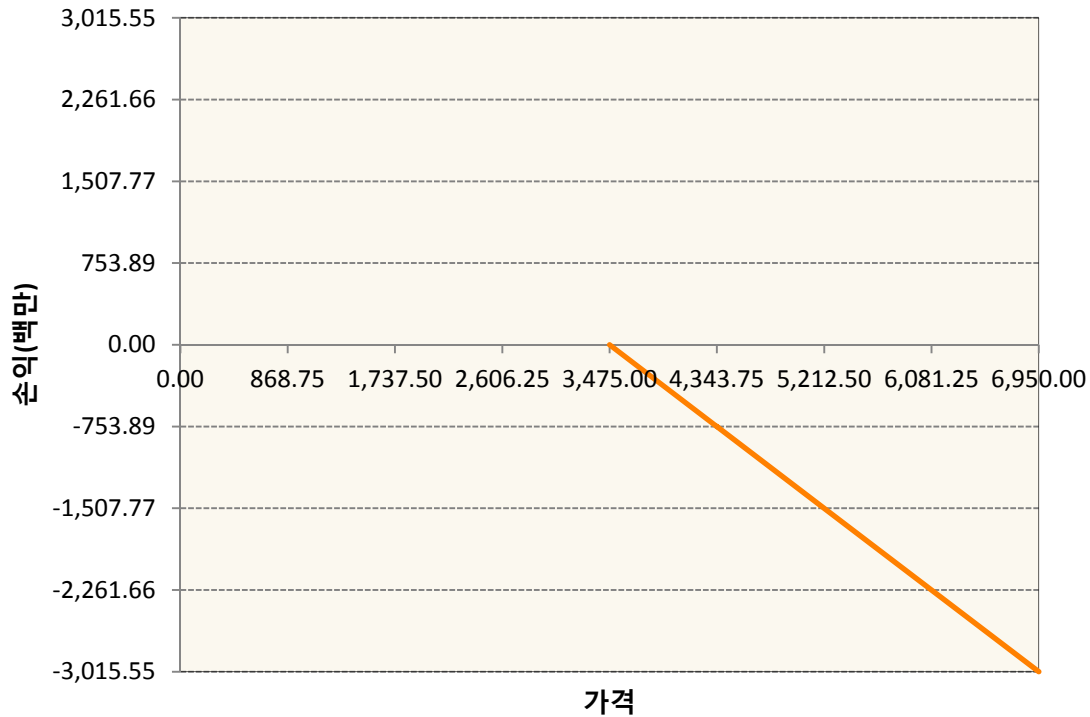
1. 계약금액

(단위:백만원)

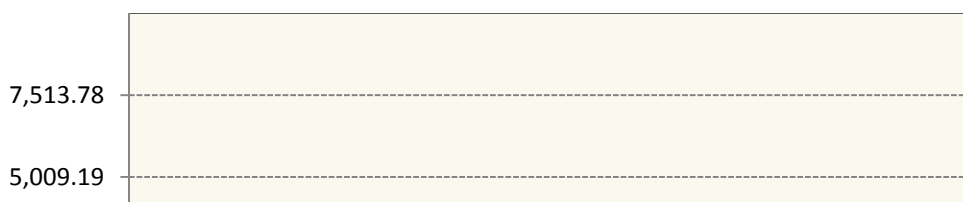
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	4,882	0	4,882	
누계	유가증권	스왑	74,810	0	74,810	장외
누계	유가증권	옵션	0	26,068	-26,068	장내
누계	지수	스왑	51,807	0	51,807	장외

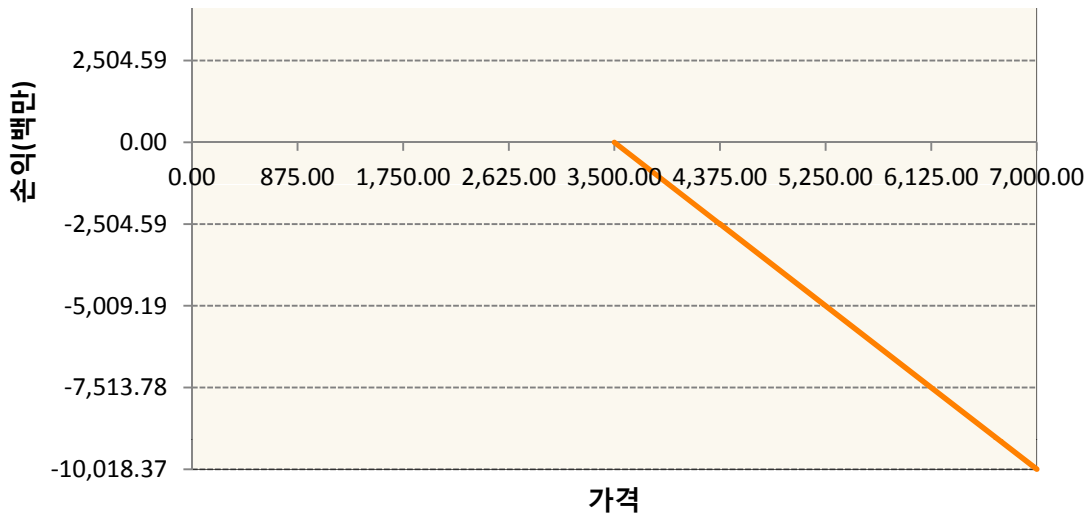
2. 만기시점의 손익구조

OESXK8-C3475-EURO STOXX 50

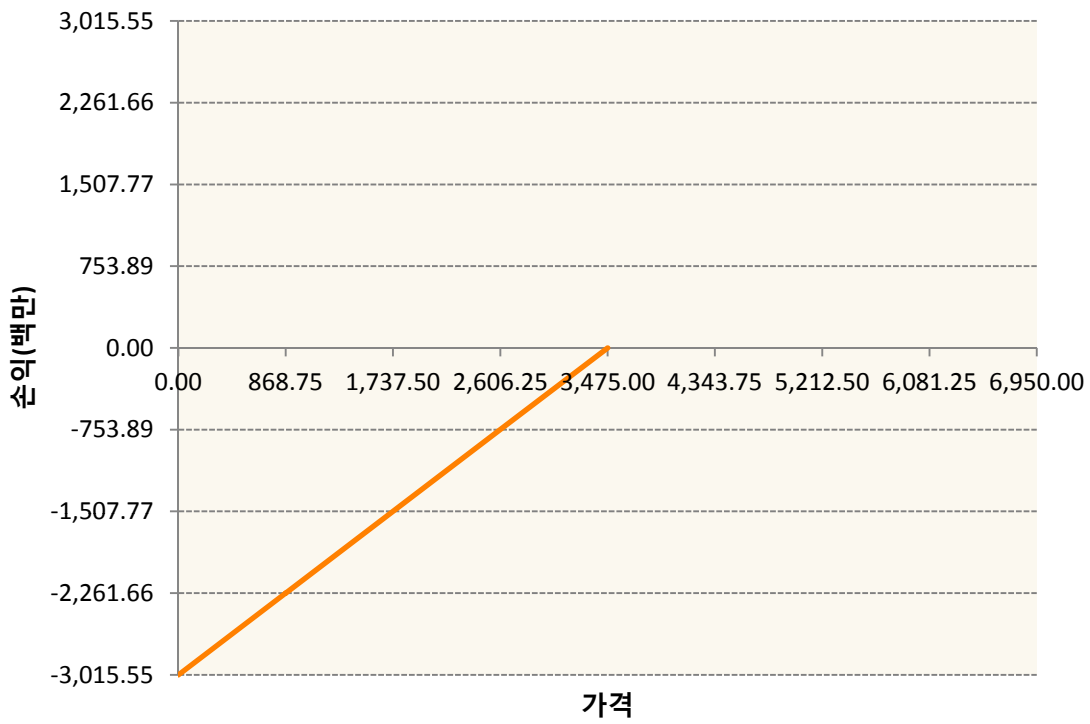


OESXK8-C3500-EURO STOXX 50

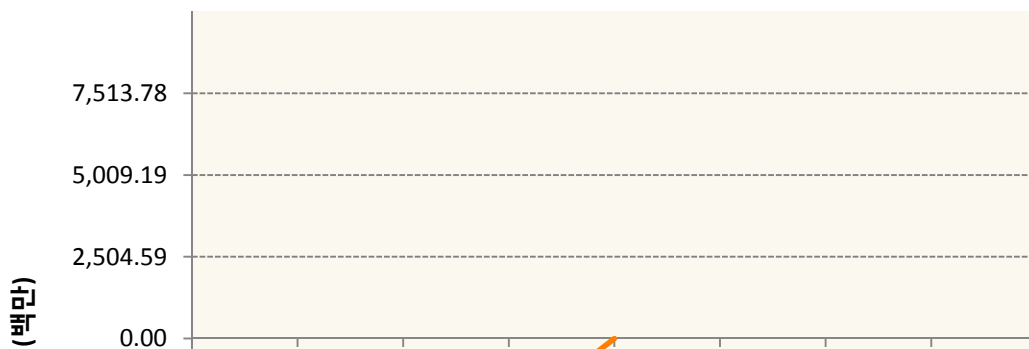


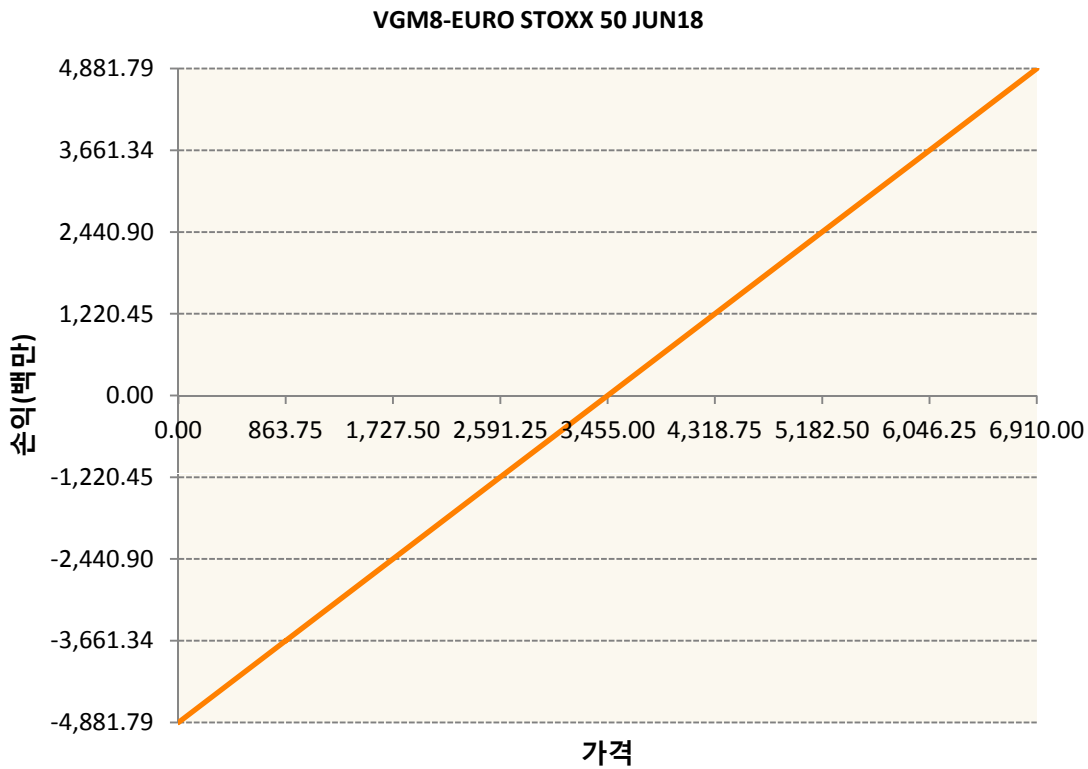
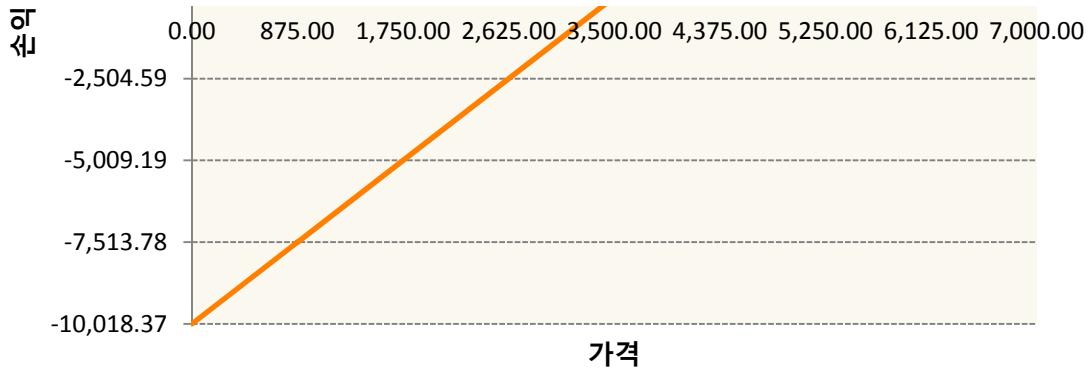


OESXK8-P3475-EURO STOXX 50



OESXK8-P3500-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
260105SGPX SG EURO Covered CALL STRATEGY - 994.569		30
260105SQPX SG EURO Covered CALL STRATEGY		43
OESXK8-C34 EURO STOXX 50		241
OESXK8-C35 EURO STOXX 50		801
OESXK8-P34 EURO STOXX 50		241
OESXK8-P35 EURO STOXX 50		801
VGM8 EURO STOXX 50 JUN18		391

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

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

(단위:백만원)

1,225

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

(단위:백만원)

62

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

(단위:백만원)

100

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

(단위:백만원)

229

공시일	2018-05-02
기준일	2018-04-30

스마트KRX300인덱스목표전환형1

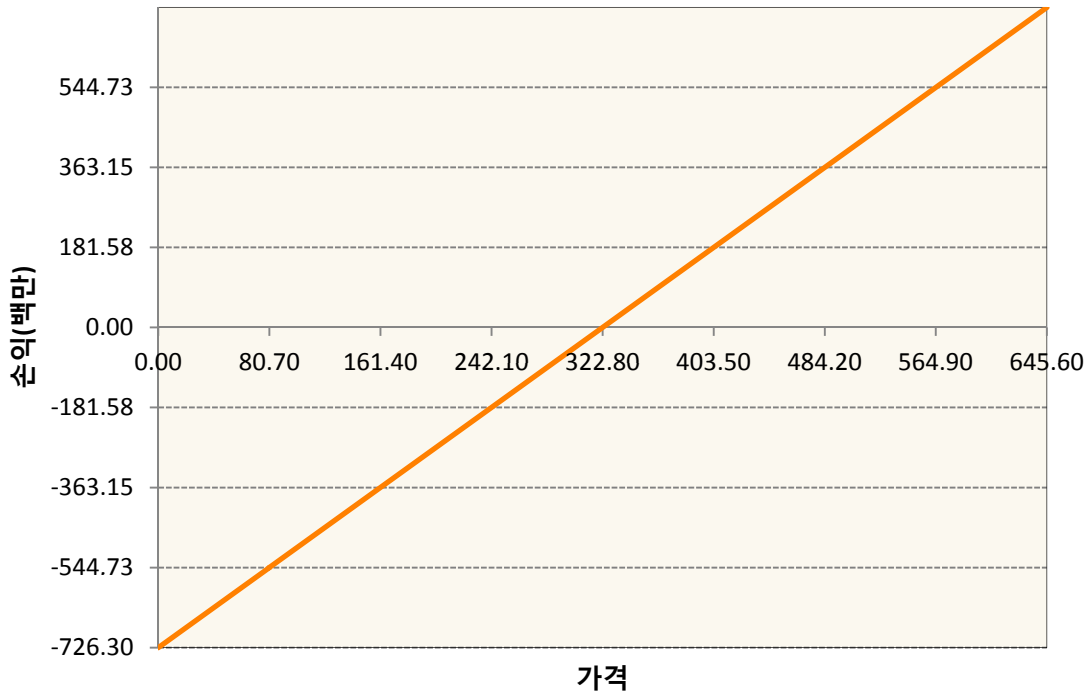
1. 계약금액

(단위:백만원)

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

2. 만기시점의 손익구조

KR4101N60009-2018-06 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101N60C 2018-06 코스피200지수선물

58

가격	기초자산의 변동성						
	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-58	-58	-58	-58	-58	-58	-58
-5.33%	-39	-39	-39	-39	-39	-39	-39
-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%	39	39	39	39	39	39	39
8.00%	58	58	58	58	58	58	58

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

(단위:백만원)

43

공시일	2018-05-02
기준일	2018-04-30

리디파인K200(주식혼합-파생재간

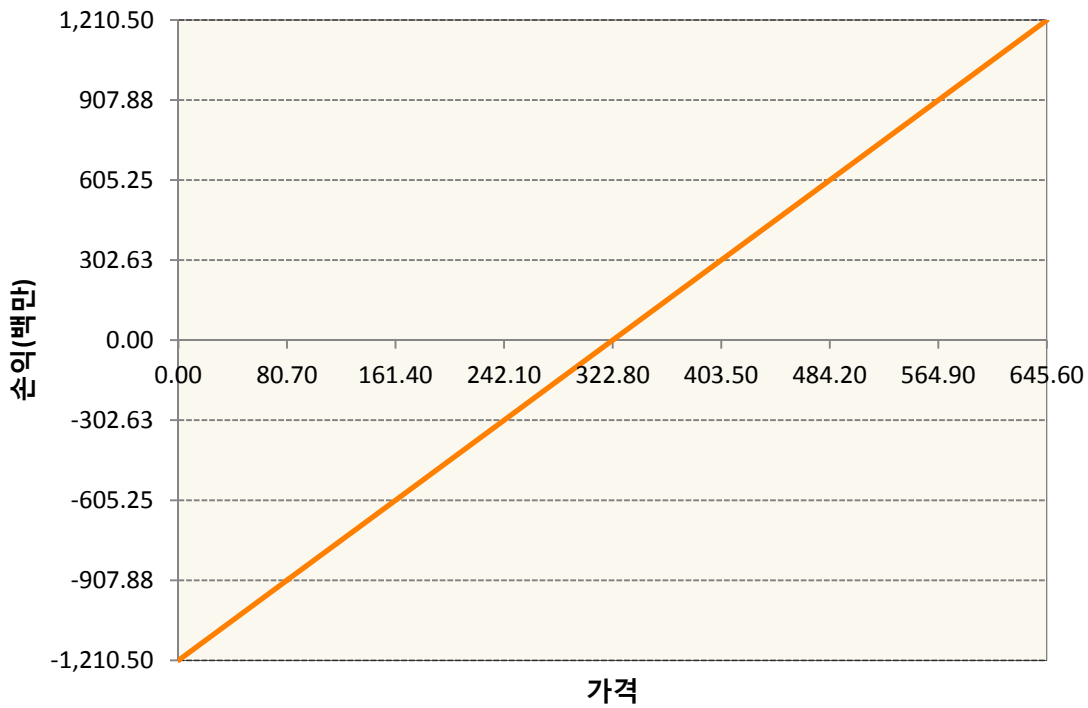
1. 계약금액

(단위:백만원)

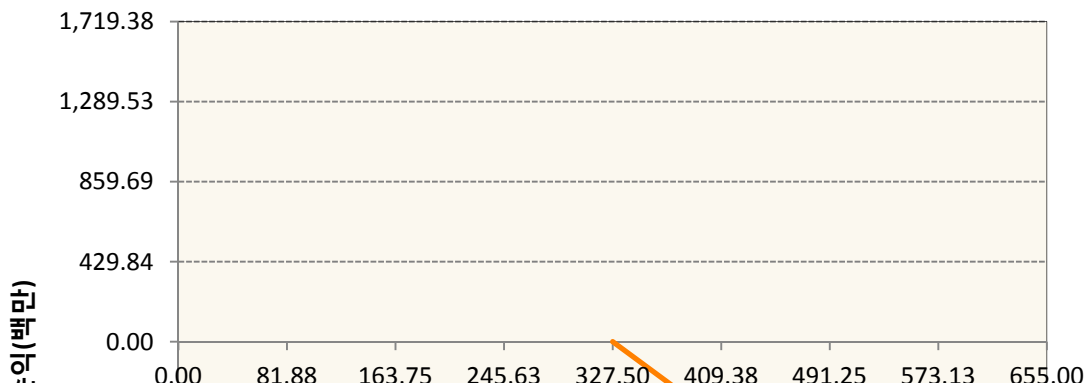
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	246	-246	장내
누계	유가증권	선물	1,211	0	1,211	장내
누계	유가증권	옵션	78	1,719	-1,641	장내

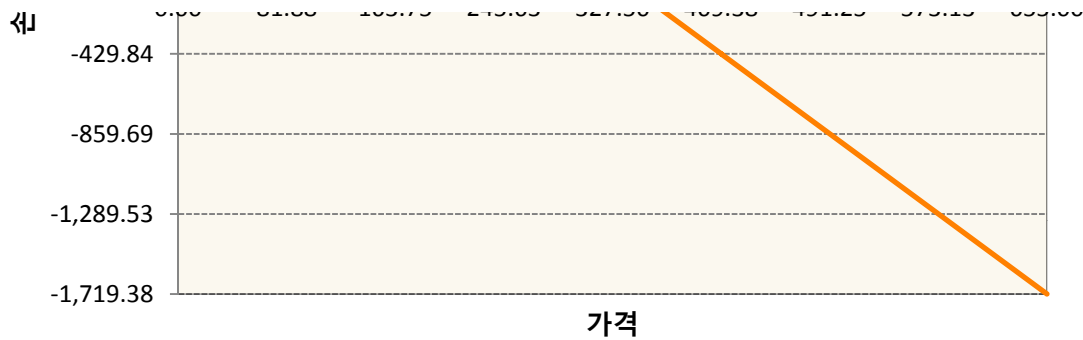
2. 만기시점의 손익구조

KR4101N60009-2018-06 코스피200지수선물

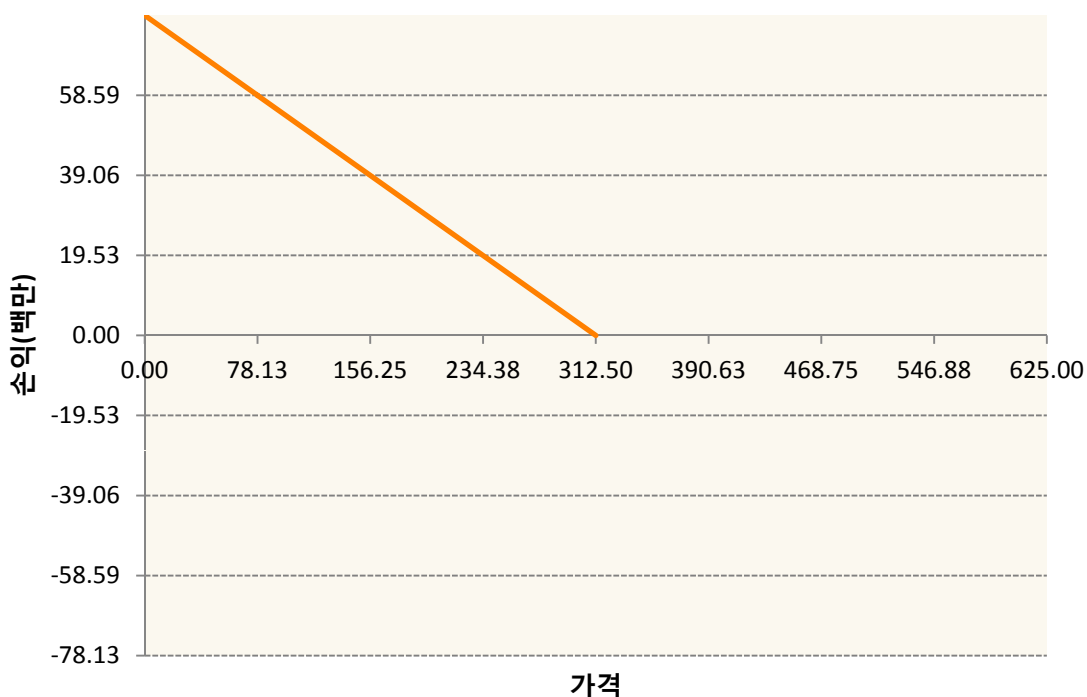


KR4201N53275-2018-05 콜327.5





KR4301N53125-2018-05 풋312.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101N60C 2018-06 코스피200지수선물								97
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-97	-97	-97	-97	-97	-97	-97	-97
-5.33%	-65	-65	-65	-65	-65	-65	-65	-65
-2.67%	-32	-32	-32	-32	-32	-32	-32	-32
0%	0	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	32	32	32	32	32	32	32	32
5.33%	65	65	65	65	65	65	65	65
8.00%	97	97	97	97	97	97	97	97
KR4201N532 2018-05 콜327.5								100
기초자산의 변동성								

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	22	22	22	22	21	21	20
-5.33%	22	21	20	20	19	18	16
-2.67%	18	17	15	14	12	10	8
0%	8	5	3	0	-3	-5	-8
2.67%	-16	-18	-21	-23	-26	-29	-31
5.33%	-51	-53	-55	-56	-58	-60	-62
8.00%	-94	-94	-95	-96	-97	-98	-100

KR4301N5312018-05 풋312.5

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	4	4	4	4	4	4	4
-5.33%	2	2	2	2	2	2	2
-2.67%	0	0	0	0	0	0	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)

172

공시일	2018-05-02
기준일	2018-04-30

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

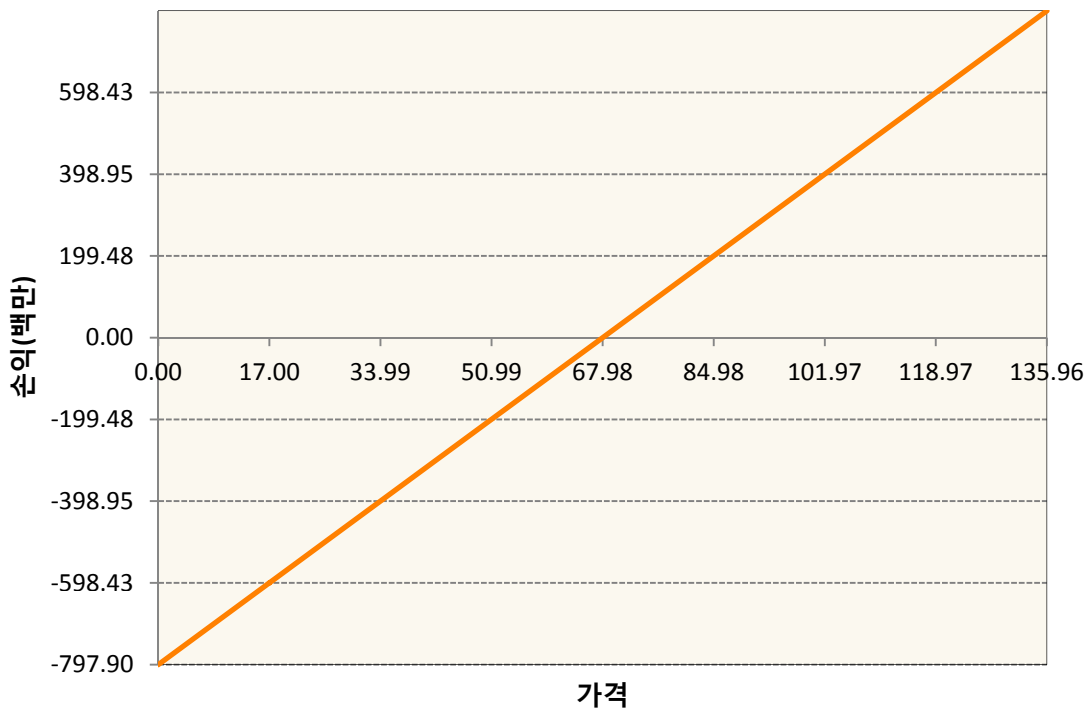
1. 계약금액

(단위:백만원)

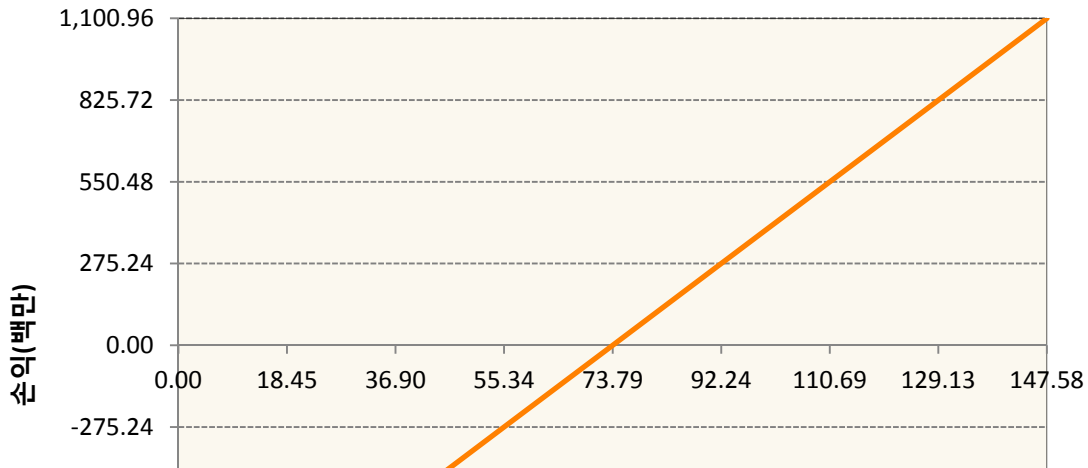
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	4,026	587	3,438	

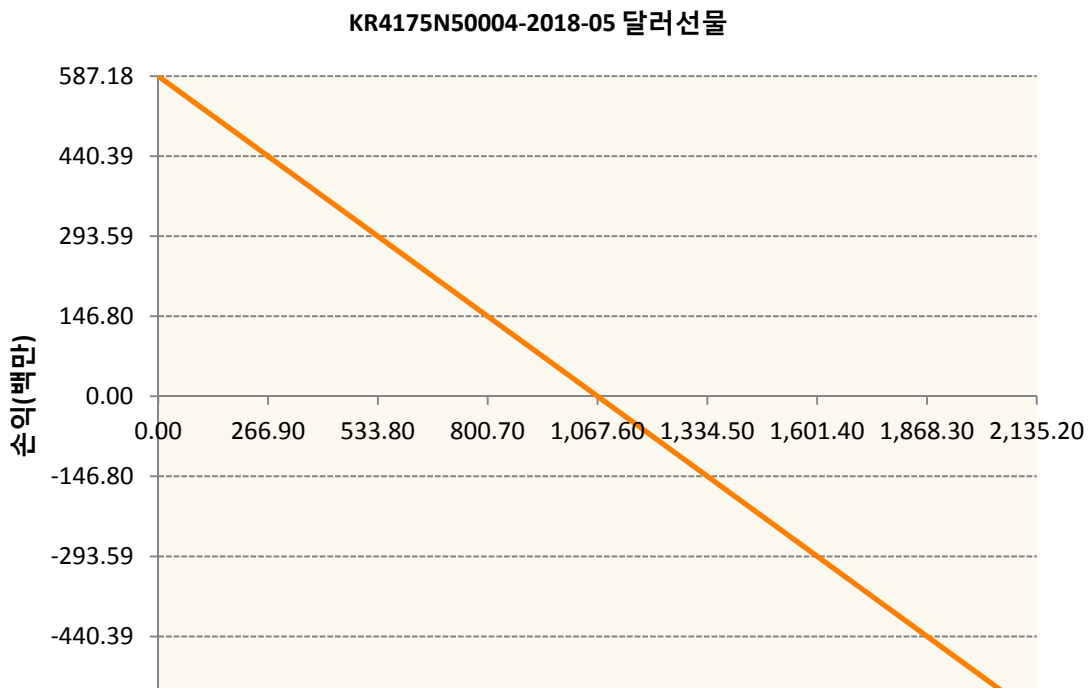
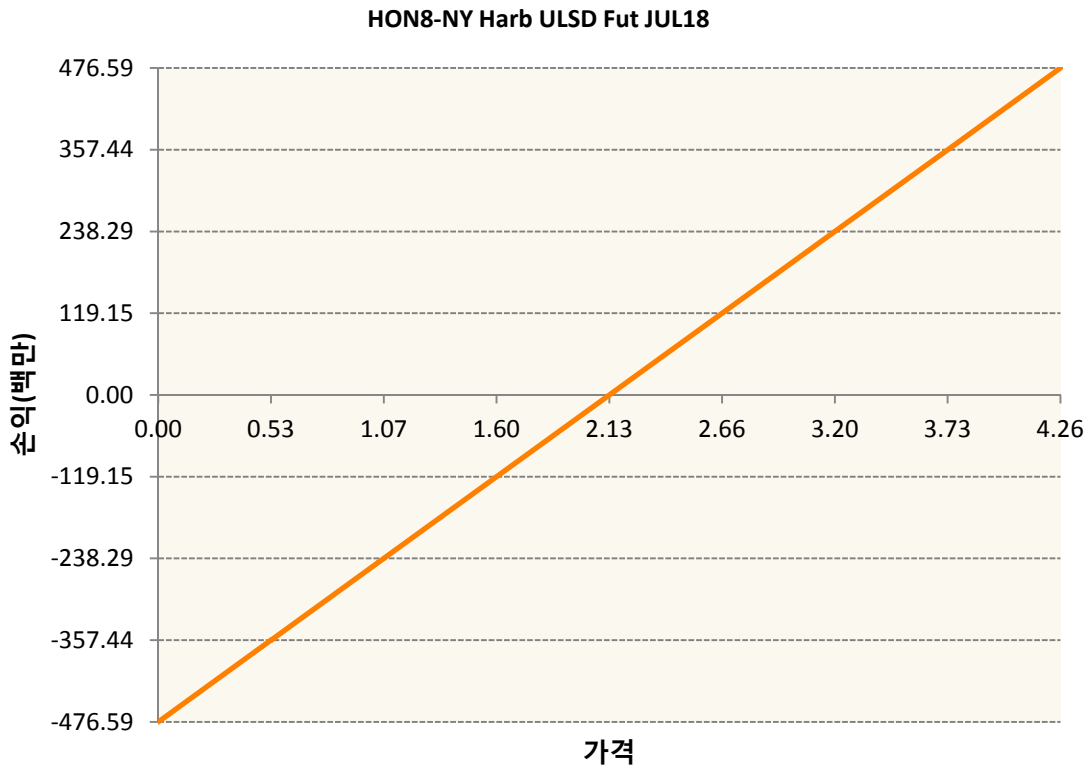
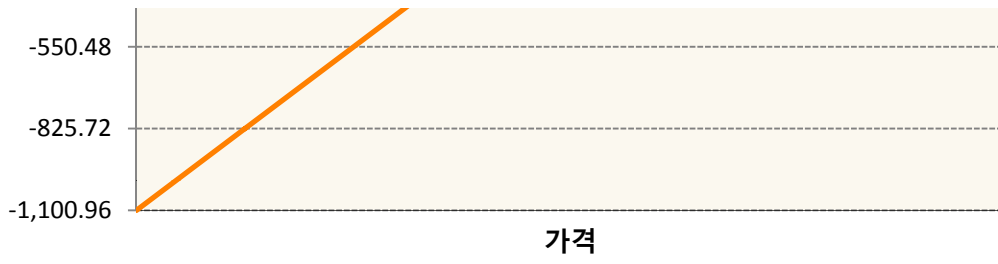
2. 만기시점의 손익구조

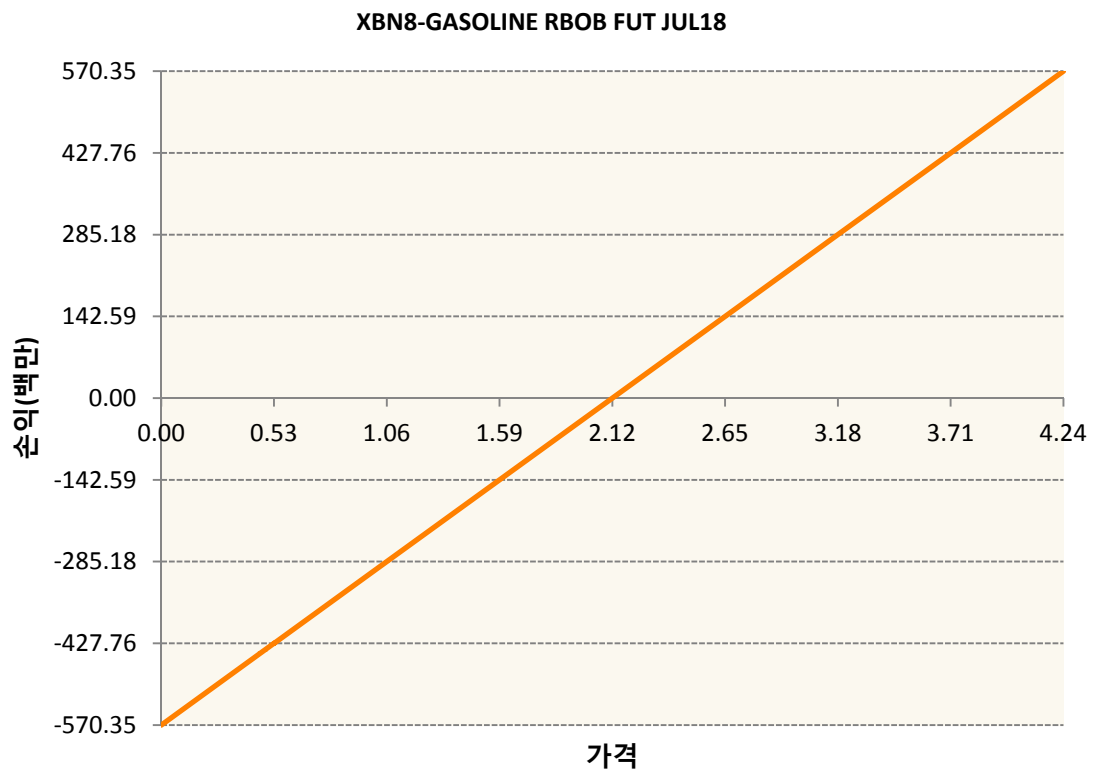
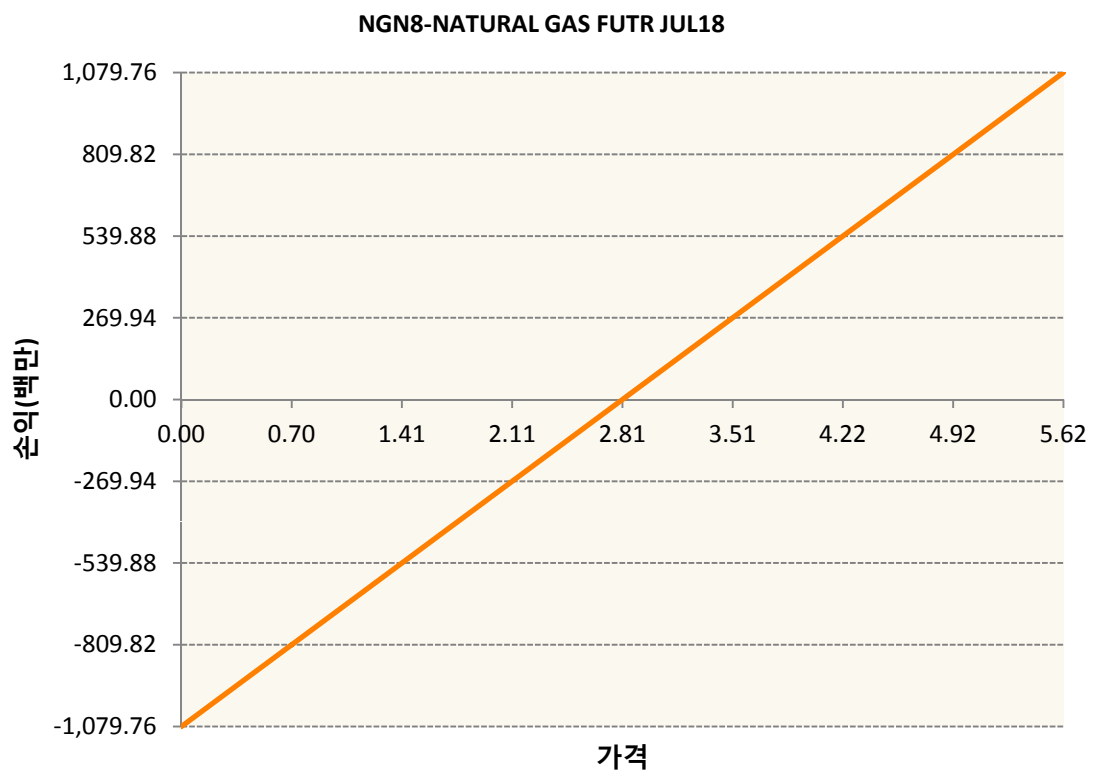
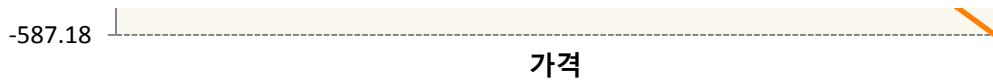
CLN8-WTI CRUDE FUTURE JUL18



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	38
KR4175N50C	2018-05 달러선물	47
NGN8	NATURAL GAS FUTR JUL18	86
XBN8	GASOLINE RBOB FUT JUL18	46

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

498

공시일	2018-05-02
기준일	2018-04-30

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

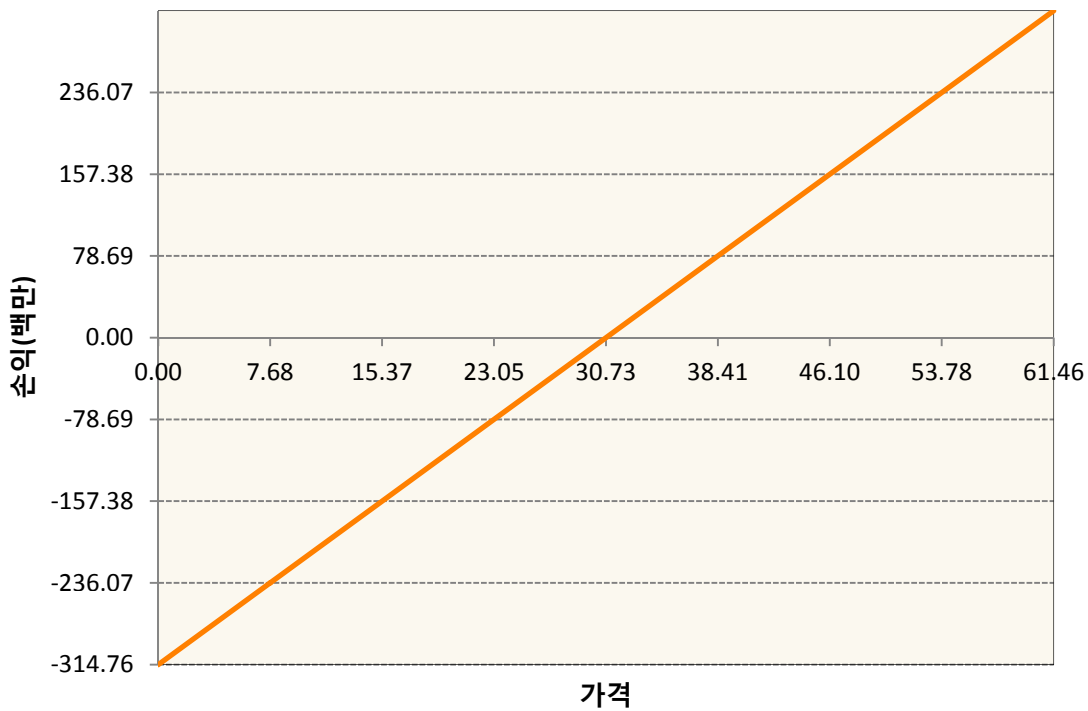
1. 계약금액

(단위:백만원)

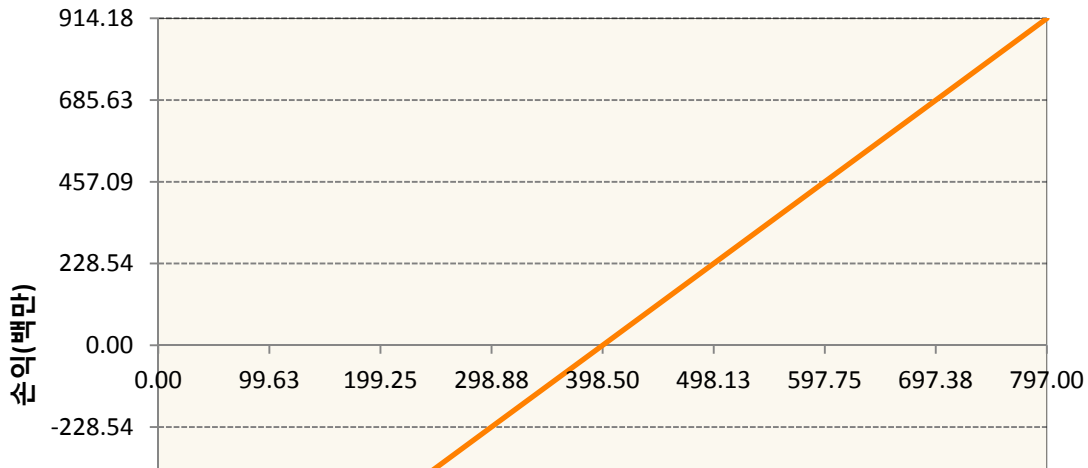
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	4,114	320	3,793	

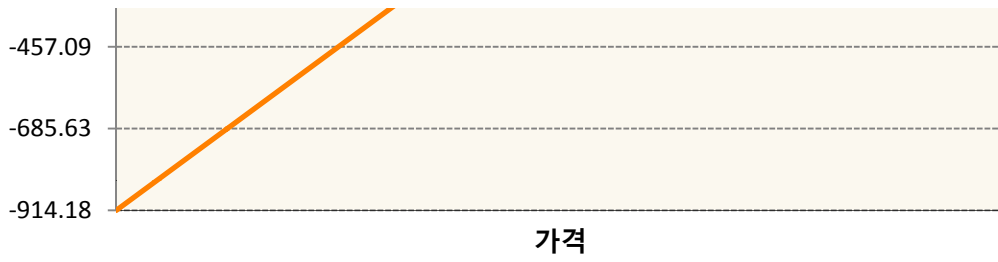
2. 만기시점의 손익구조

BON8-SOYBEAN OIL FUTR JUL18

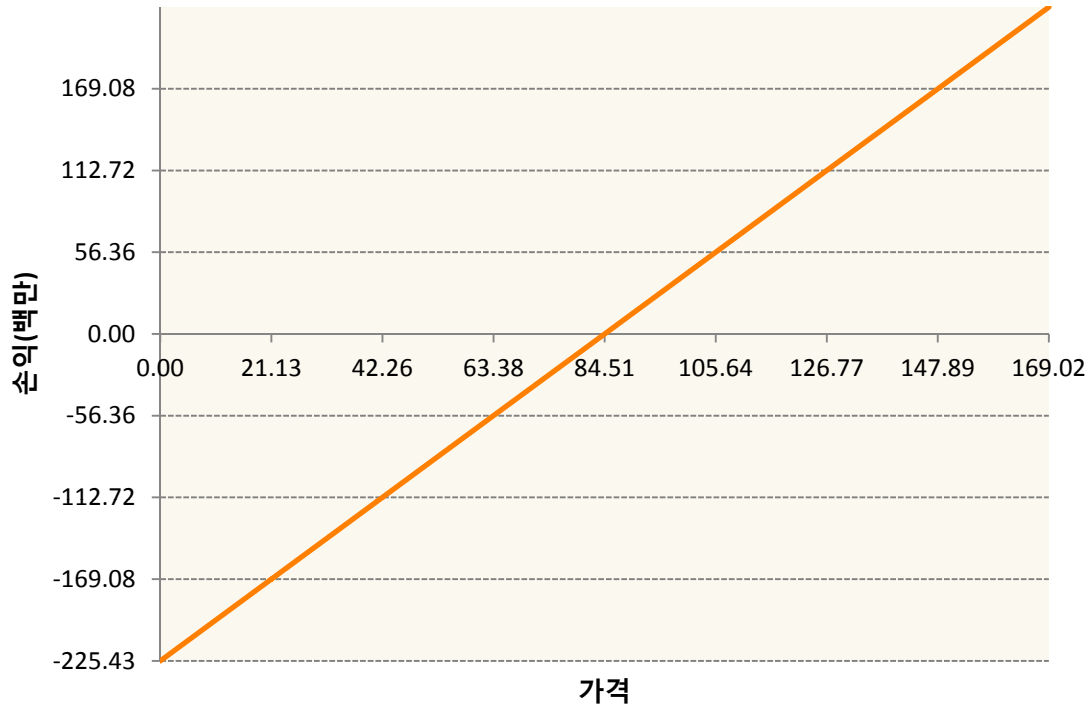


CN8-CORN FUTURE JUL18

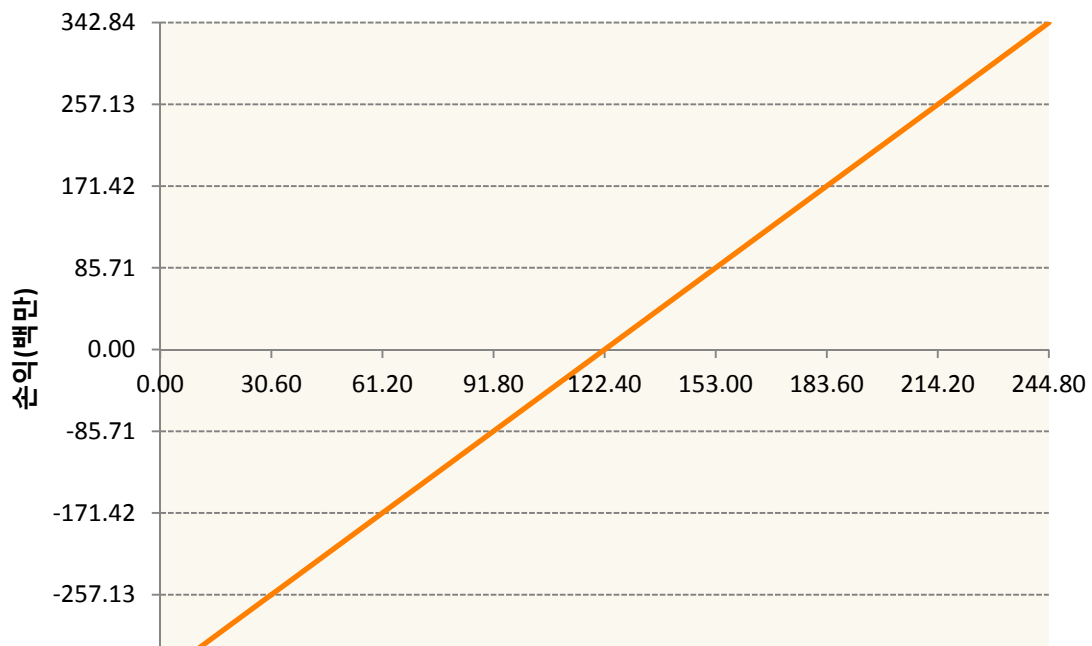


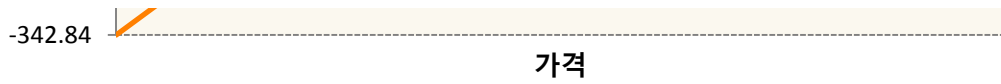


CTN8-COTTON NO.2 FUTR JUL18

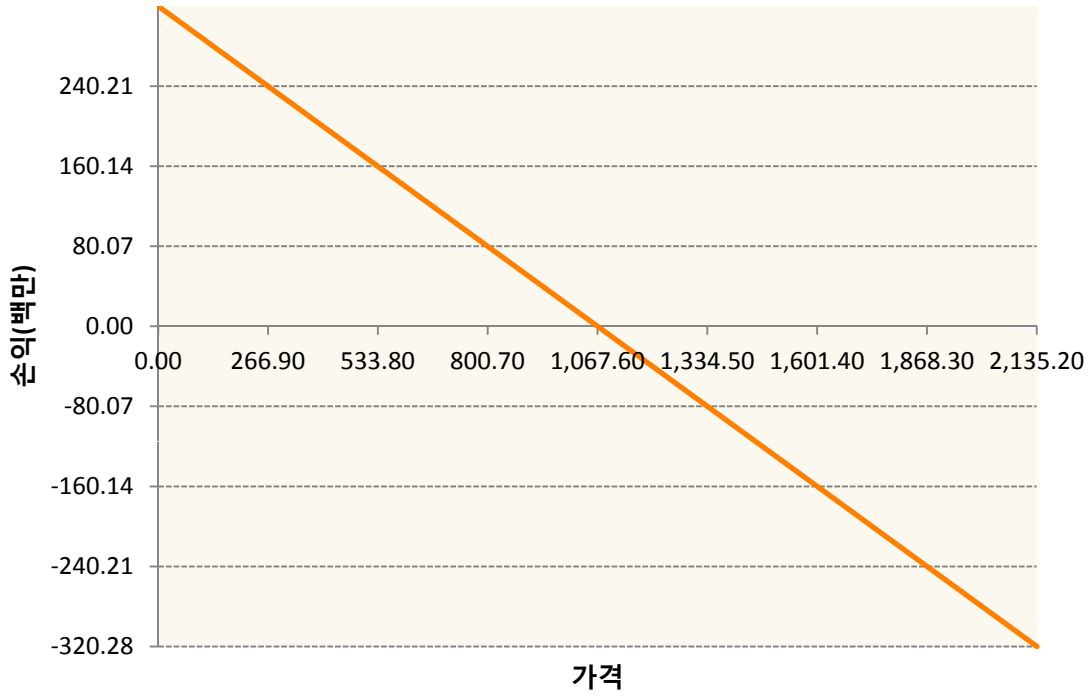


KCN8-COFFEE 'C' FUTURE JUL18

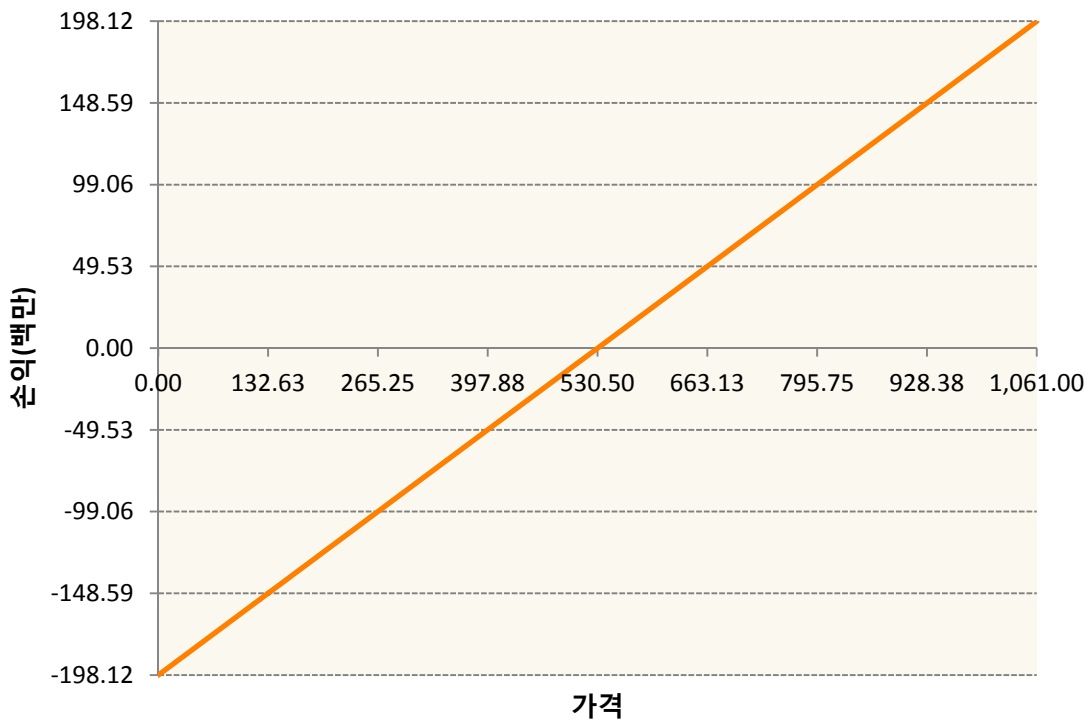




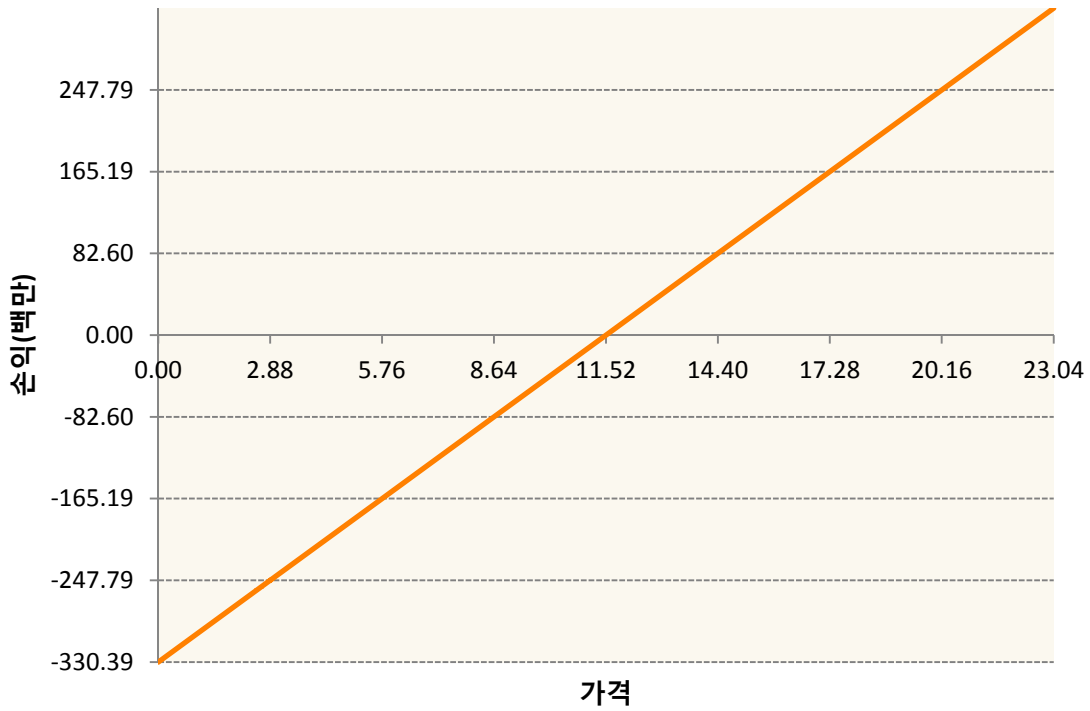
KR4175N50004-2018-05 달러선물



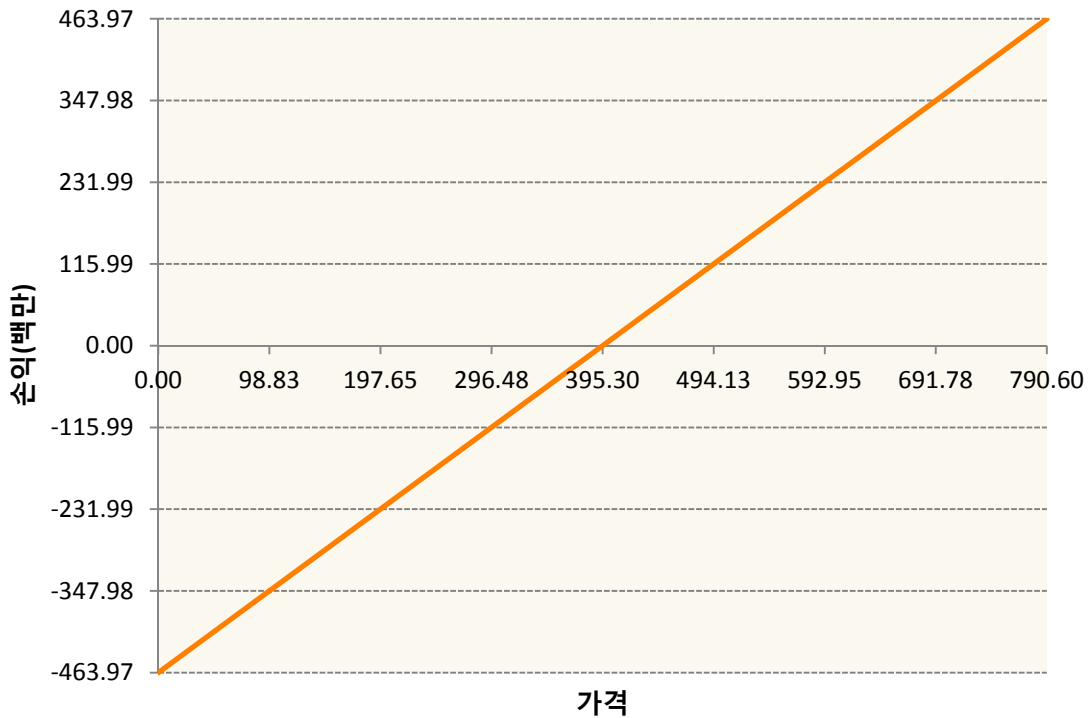
KWN8-KC HRW WHEAT FUT JUL18



SBN8-SUGAR #11 (WORLD) JUL18

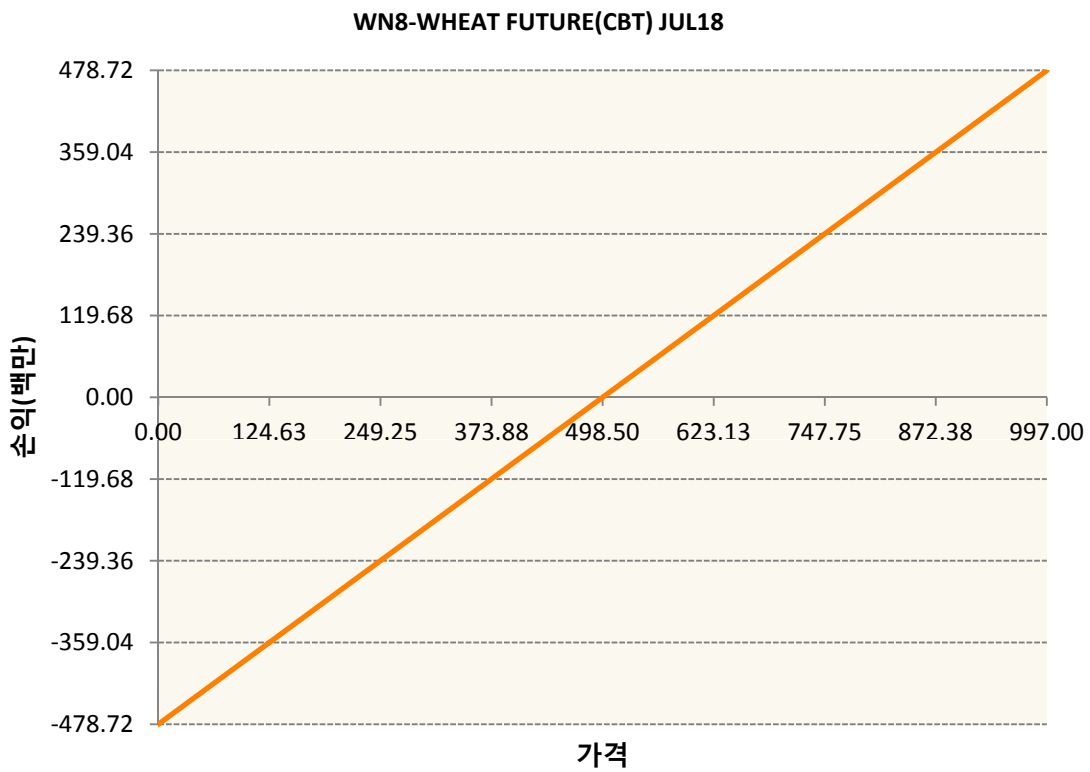
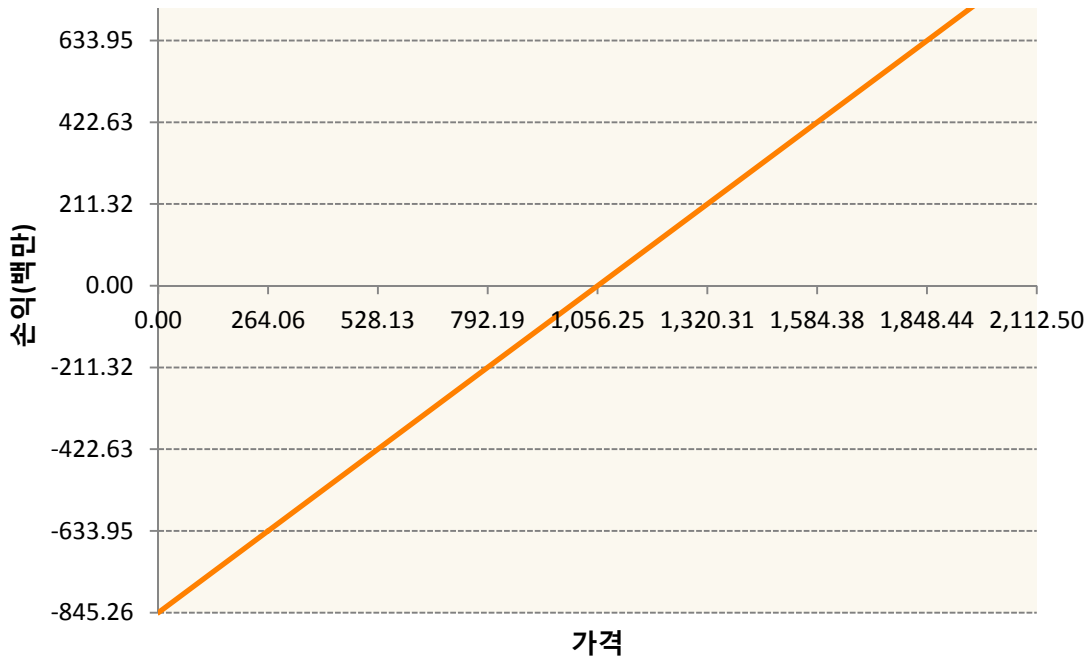


SMN8-SOYBEAN MEAL FUTR JUL18



SN8-SOYBEAN FUTURE JUL18





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
BON8	SOYBEAN OIL FUTR JUL18	25
CN8	CORN FUTURE JUL18	73
CTN8	COTTON NO.2 FUTR JUL18	18
KCN8	COFFEE 'C' FUTURE JUL18	27
KR4175N50(2018-05 달러선물		26

KWN8	KC HRW WHEAT FUT JUL18	16
SBN8	SUGAR #11 (WORLD) JUL18	26
SMN8	SOYBEAN MEAL FUTR JUL18	37
SN8	SOYBEAN FUTURE JUL18	68
WN8	WHEAT FUTURE(CBT) JUL18	38

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

(단위:백만원)

332