

공시일	2018-05-14
기준일	2018-05-11

## 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)

85

공시일	2018-05-14
기준일	2018-05-11

## 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

1,120

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

458

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2018-05-14
기준일	2018-05-11

## 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)

SWCSI500000 신한CSI500미래S180308

399
-----

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

434
-----

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2018-05-14
기준일	2018-05-11

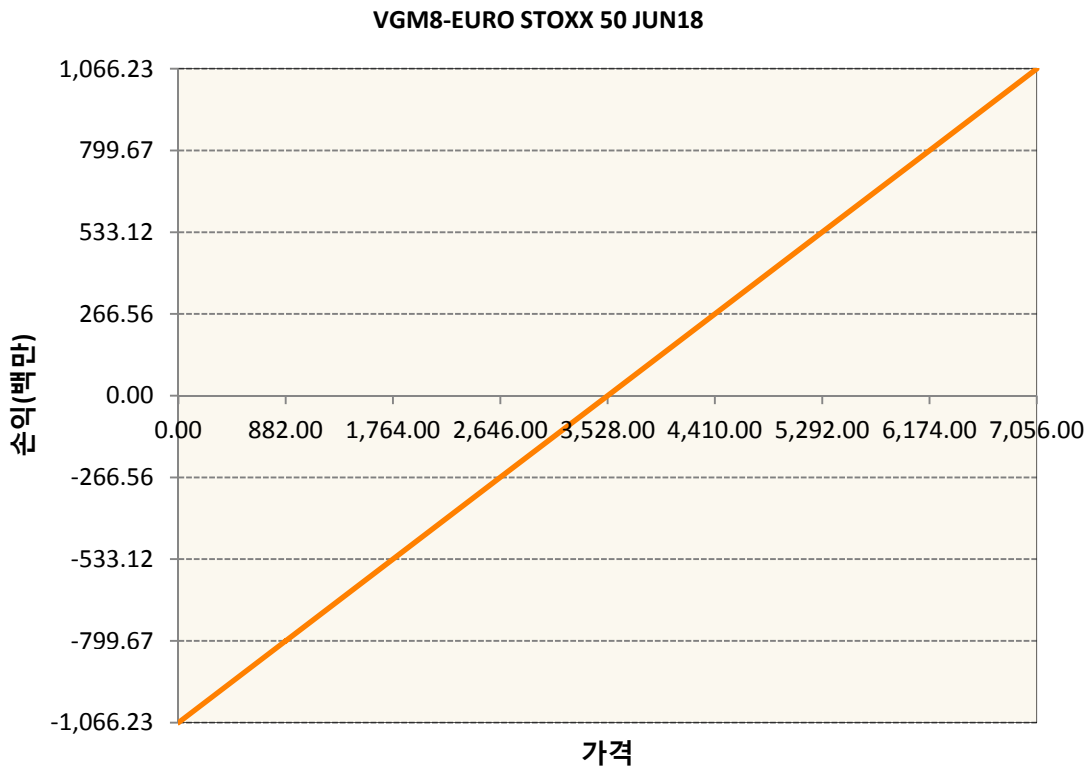
## 유로인덱스모(주식-파생형)

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,066	0	1,066	

### 2. 만기시점의 손익구조



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGM8	EURO STOXX 50 JUN18	85
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

52
----

공시일	2018-05-14
기준일	2018-05-11

## 차이나인덱스모(주식-파생형)

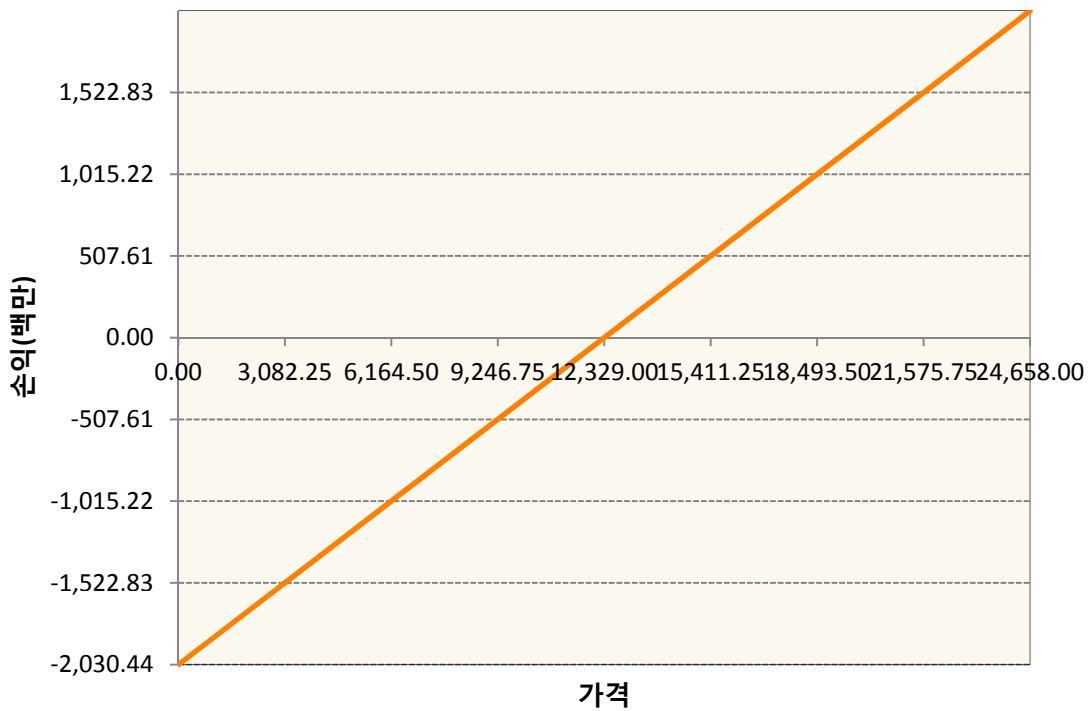
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

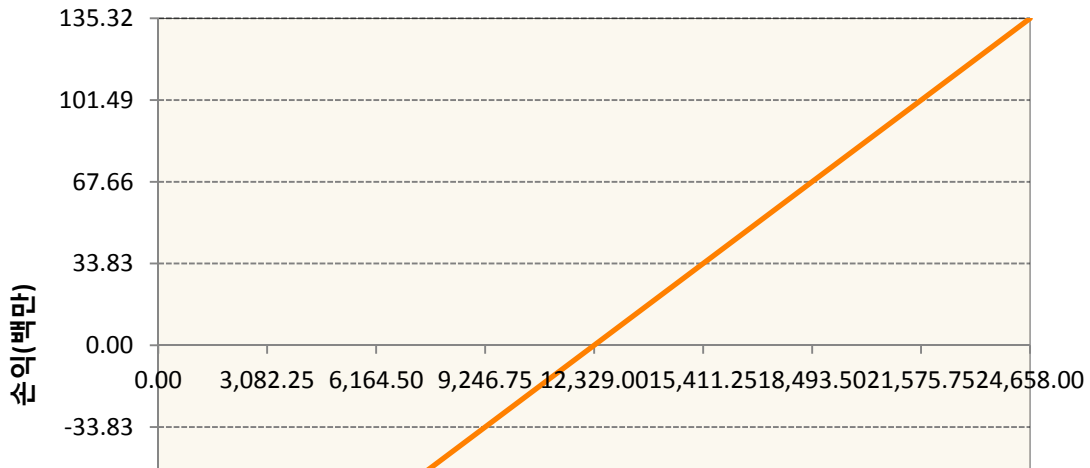
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,166	0	2,166	장내

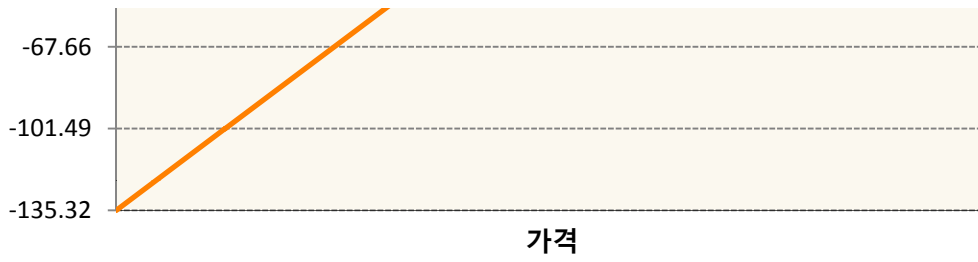
### 2. 만기시점의 손익구조

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)

<b>152</b>
------------

공시일	2018-05-14
기준일	2018-05-11

## 커버드콜모(주식혼합-파생형)

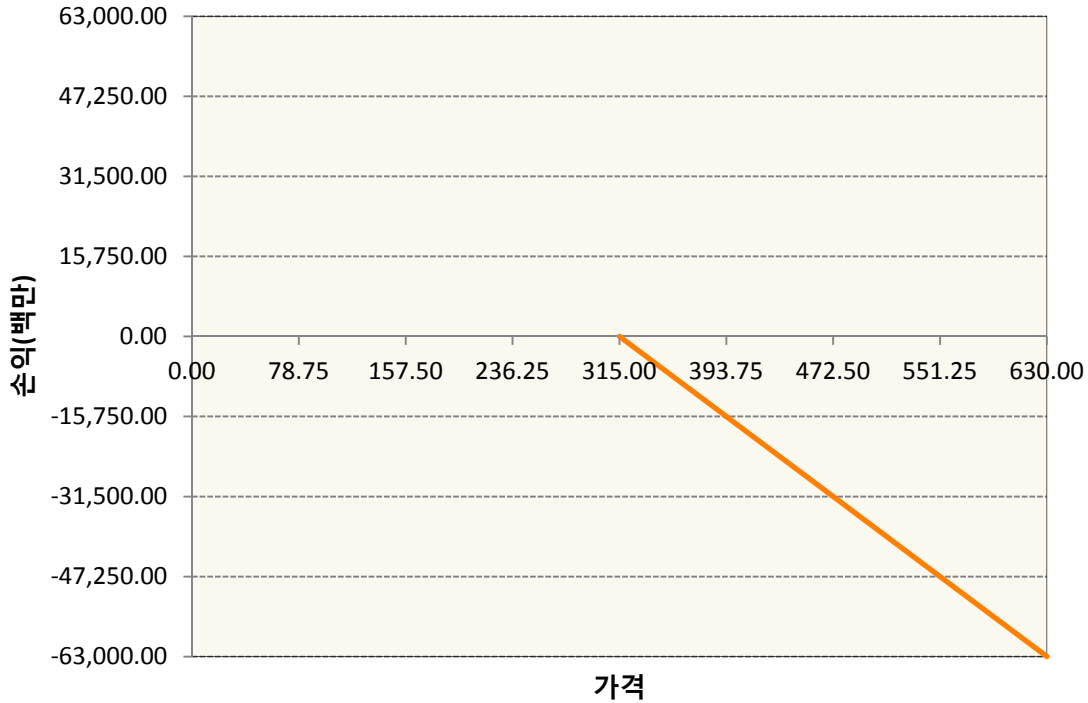
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

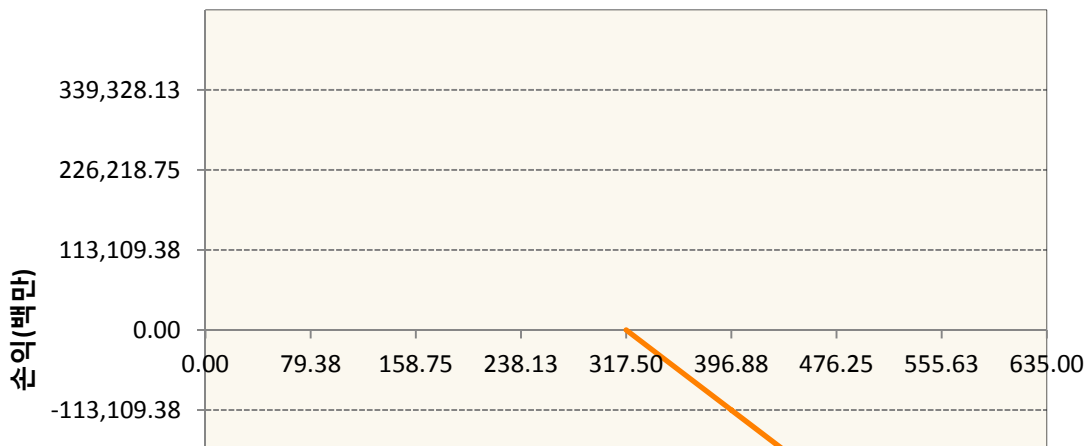
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	38,538	699,596	-661,058	장내
누계	유가증권	옵션	0	832,938	-832,938	장내

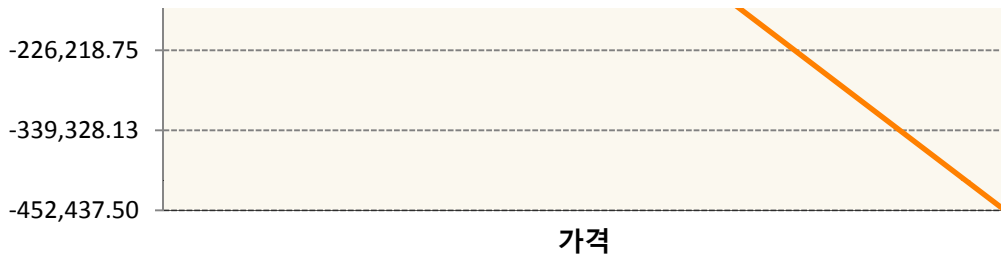
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4201N63159-2018-06 콜315

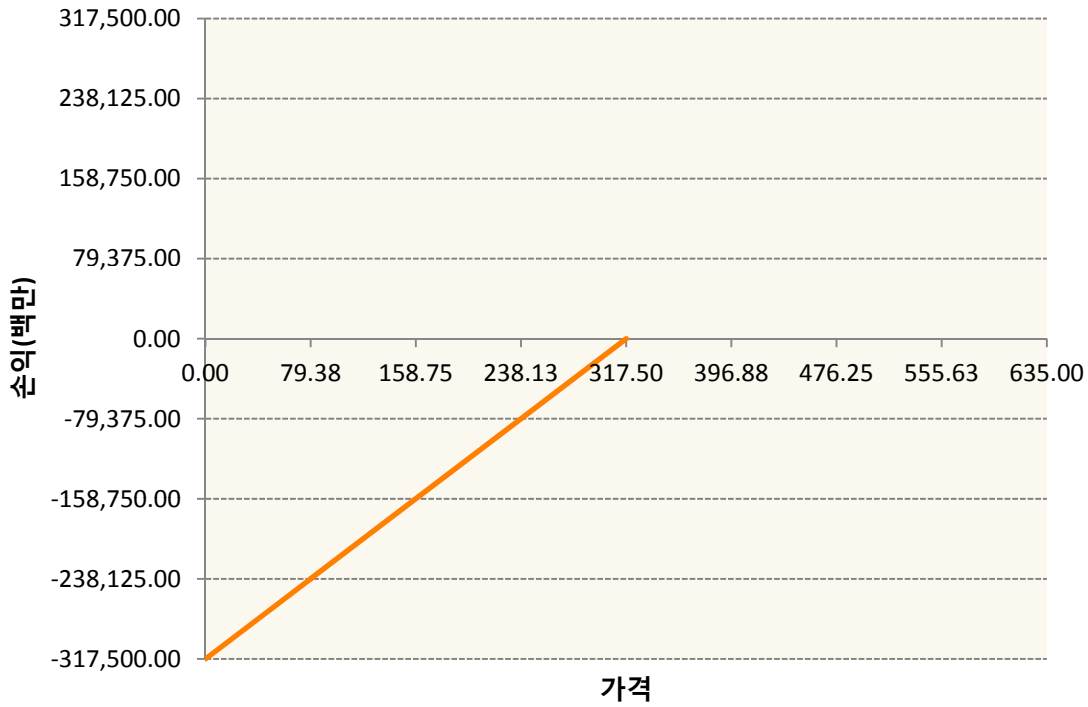


KR4201N63175-2018-06 콜317.5





KR4301N63173-2018-06 풋317.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4201N6312018-06 콜315

4,079

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	2,237	2,145	2,043	1,932	1,814	1,691	1,562
-5.33%	1,920	1,784	1,642	1,496	1,347	1,195	1,041
-2.67%	1,361	1,194	1,026	858	688	519	349
0%	517	345	173	0	-173	-346	-519
2.67%	-607	-757	-912	-1,070	-1,231	-1,394	-1,558
5.33%	-1,961	-2,073	-2,196	-2,326	-2,463	-2,606	-2,752
8.00%	-3,474	-3,548	-3,634	-3,732	-3,840	-3,956	-4,079

KR4201N6312018-06 콜317.5

28,144

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	14,466	13,897	13,247	12,526	11,748	10,920	10,051

-5.33%	12,595	11,703	10,760	9,776	8,761	7,719	6,656
-2.67%	9,150	7,997	6,830	5,654	4,469	3,278	2,082
0%	3,738	2,492	1,246	0	-1,246	-2,492	-3,738
2.67%	-3,701	-4,843	-6,006	-7,185	-8,376	-9,577	-10,787
5.33%	-12,893	-13,791	-14,749	-15,754	-16,798	-17,872	-18,971
8.00%	-23,370	-23,985	-24,688	-25,467	-26,309	-27,204	-28,144
KR4301N6312018-06 풋317.5							20,797
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-20,664	-20,668	-20,676	-20,691	-20,715	-20,750	-20,797
-5.33%	-12,240	-12,292	-12,364	-12,458	-12,573	-12,707	-12,859
-2.67%	-4,427	-4,659	-4,909	-5,174	-5,449	-5,734	-6,027
0%	1,051	701	351	0	-351	-702	-1,054
2.67%	3,260	3,069	2,855	2,623	2,374	2,112	1,839
5.33%	3,690	3,649	3,589	3,507	3,404	3,281	3,140
8.00%	3,728	3,724	3,716	3,700	3,674	3,637	3,586

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

(단위:백만원)

53,079

공시일	2018-05-14
기준일	2018-05-11

## 홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생)

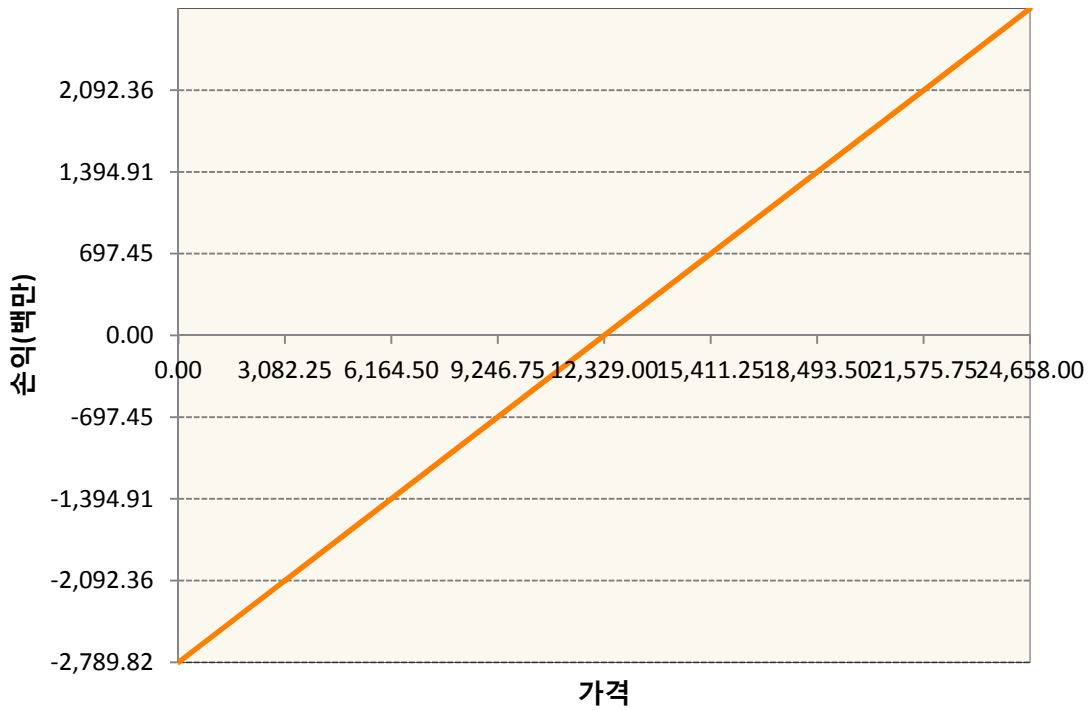
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

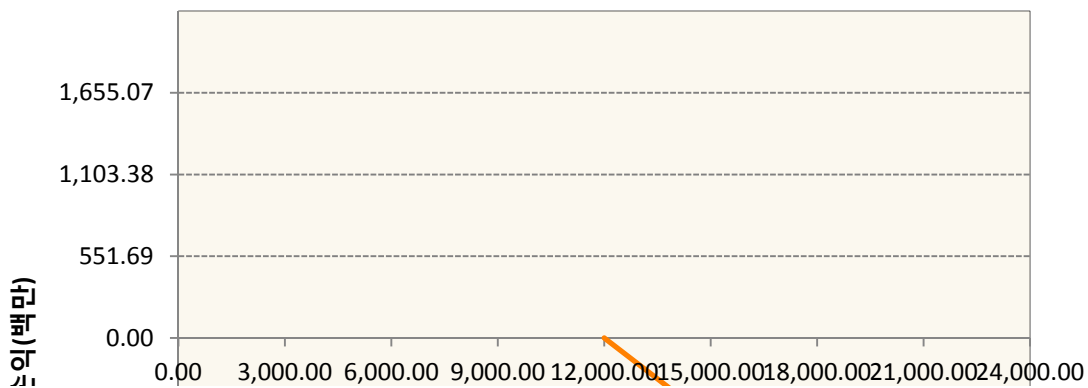
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,790	0	2,790	장내
누계	유가증권	옵션	0	6,740	-6,740	장내

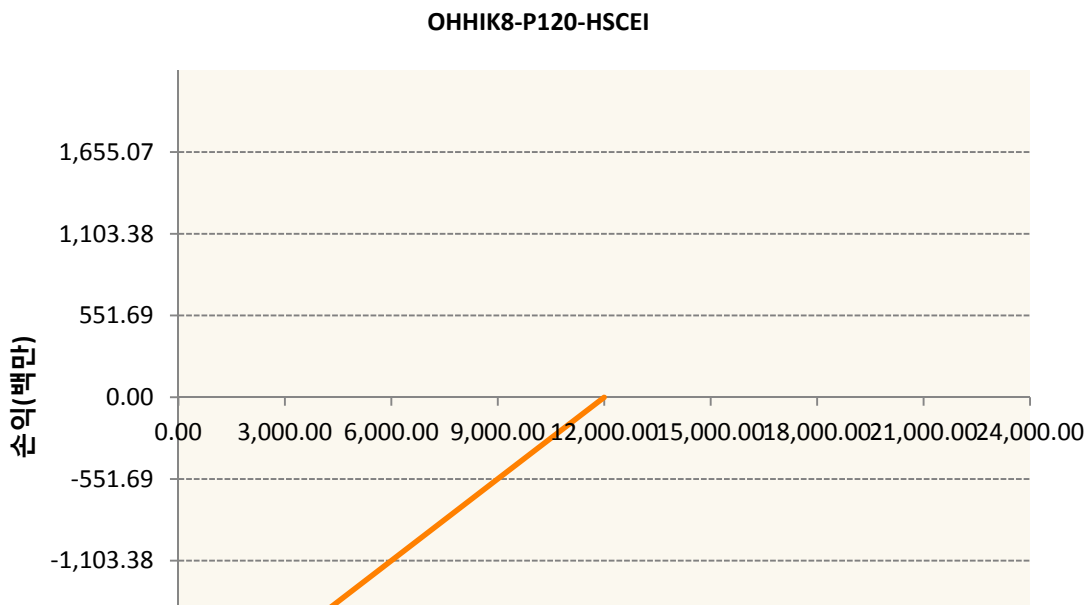
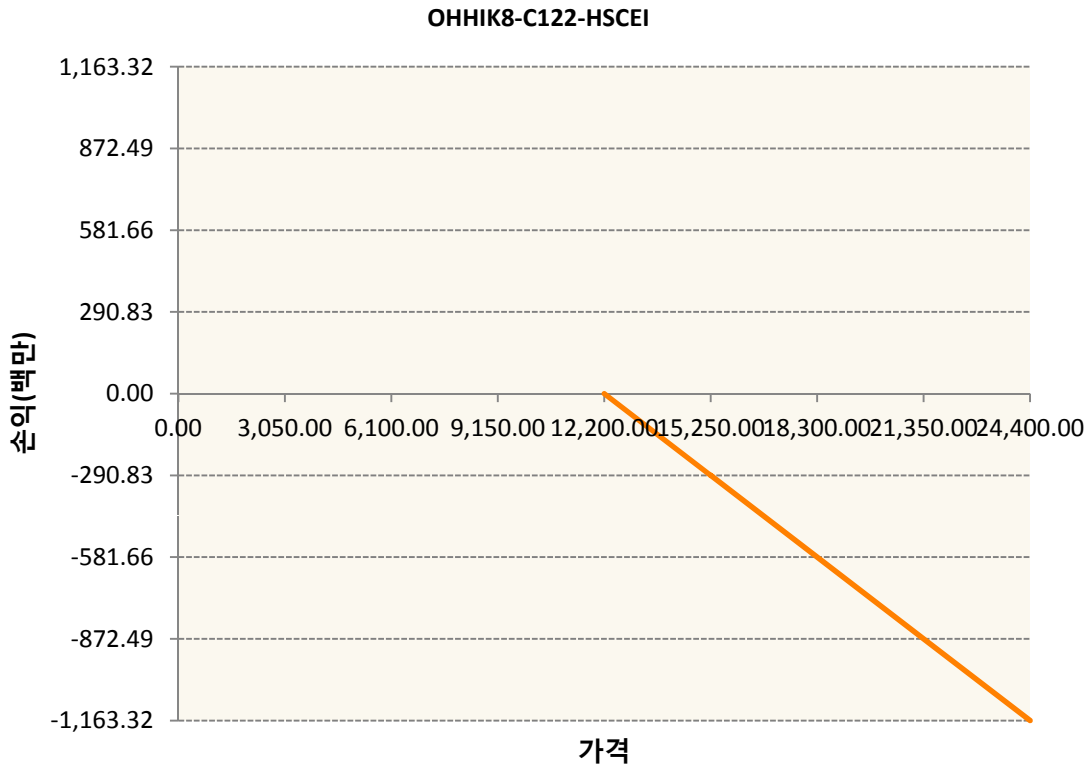
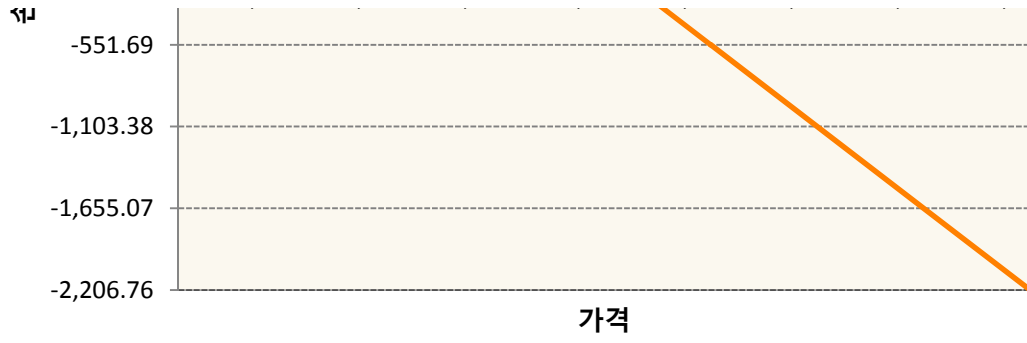
### 2. 만기시점의 손익구조

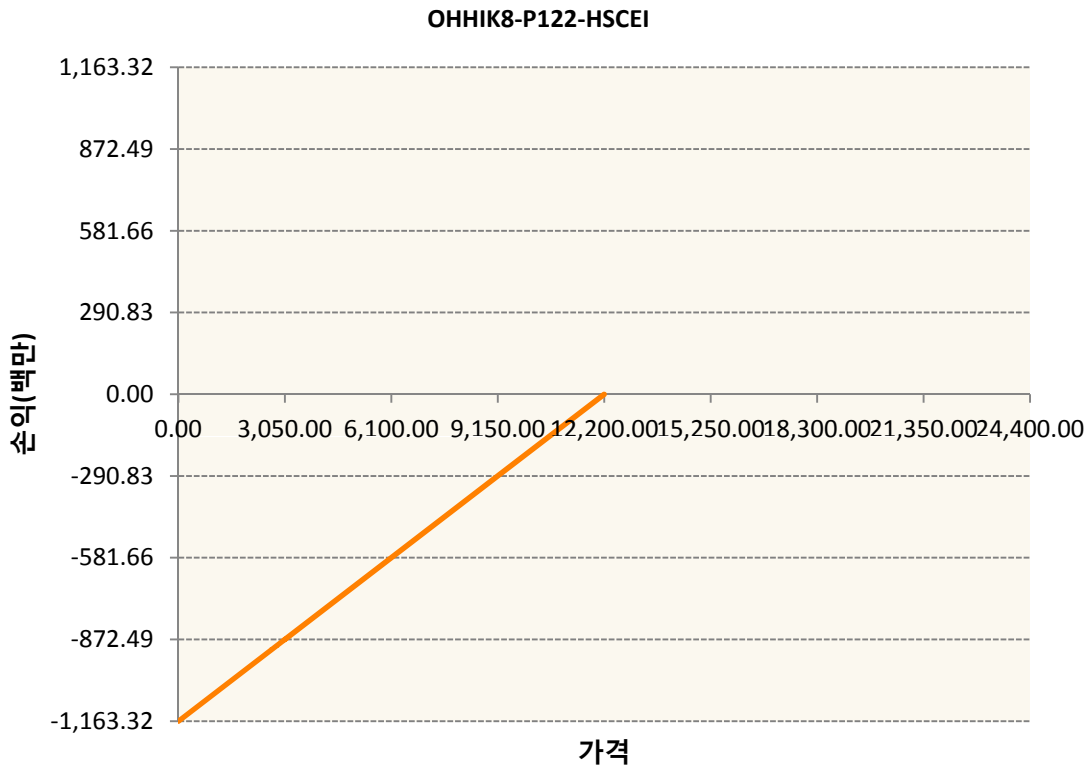
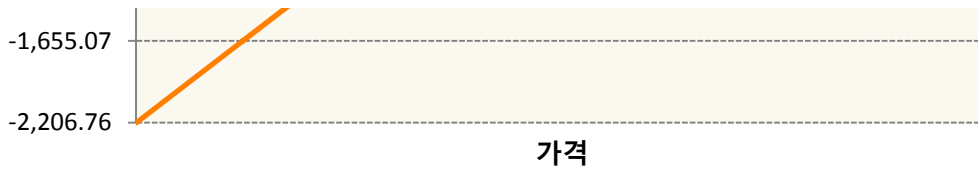
HCK8-H-SHARES FUT May18



OHHK8-C120-HSCEI







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCK8	H-SHARES FUT May18	223
OHHIK8-C12	HSCEI	177
OHHIK8-C12	HSCEI	93
OHHIK8-P12	HSCEI	177
OHHIK8-P12	HSCEI	93

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	<b>668</b>

공시일	2018-05-14
기준일	2018-05-11

## 코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼)

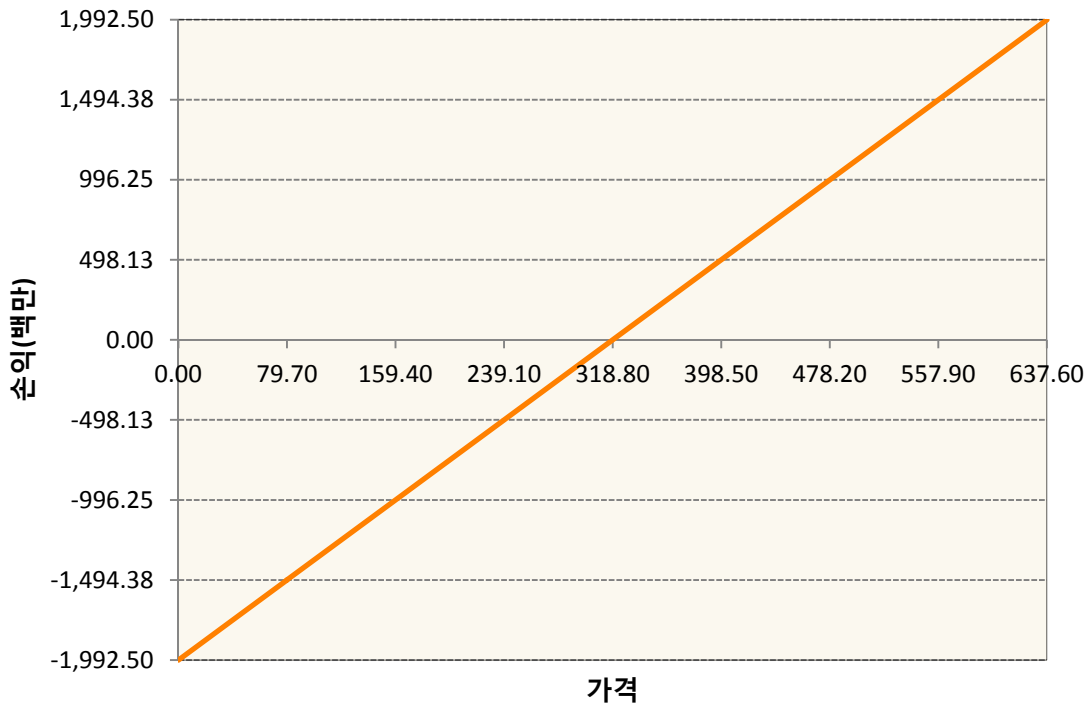
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

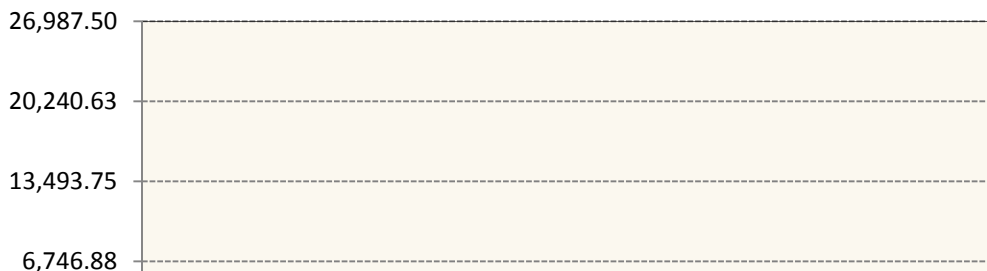
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	47,418	-47,418	장내
누계	유가증권	선물	1,993	0	1,993	장내
누계	유가증권	스왑	48,200	0	48,200	장외
누계	유가증권	옵션	0	46,804	-46,804	장내

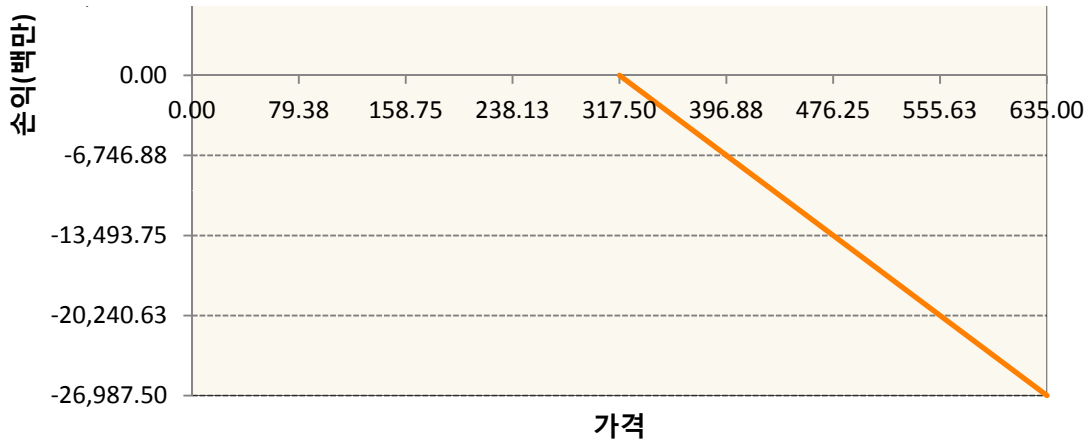
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101N60009-2018-06 코스피200지수선물

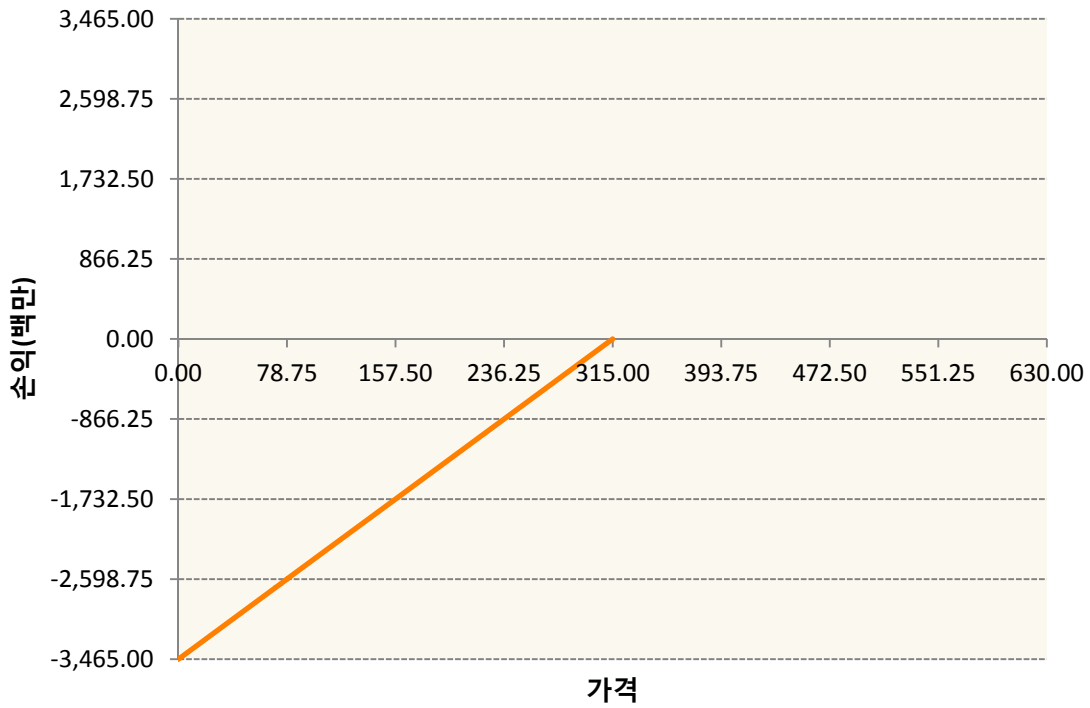


KR4201N63175-2018-06 콜317.5

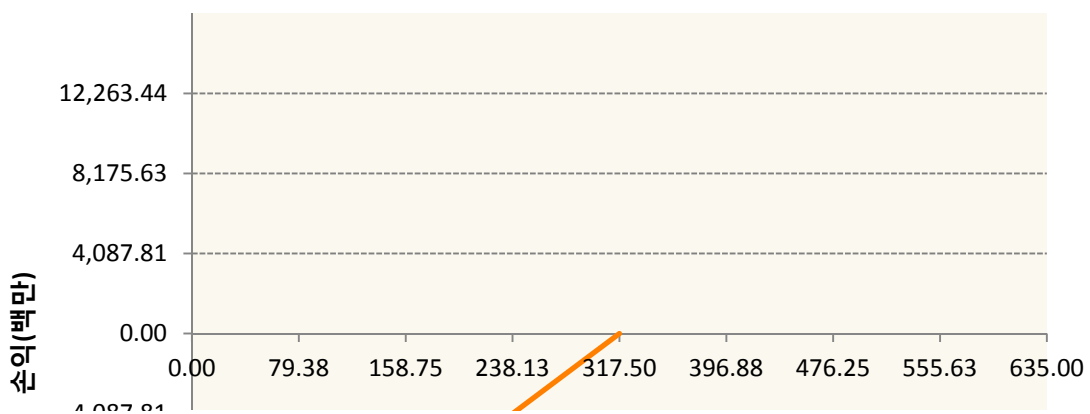


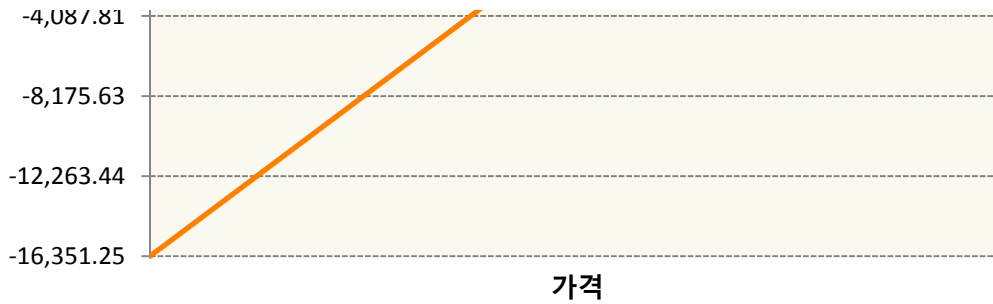


KR4301N63157-2018-06 풋315



KR4301N63173-2018-06 풋317.5





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

2.529E+11 UBSCFXC1 INDEX_2							1,473
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,473	-1,473	-1,473	-1,473	-1,473	-1,473	-1,473
-5.33%	-982	-982	-982	-982	-982	-982	-982
-2.67%	-491	-491	-491	-491	-491	-491	-491
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	491	491	491	491	491	491	491
5.33%	982	982	982	982	982	982	982
8.00%	1,473	1,473	1,473	1,473	1,473	1,473	1,473
2.529E+11 UBSCFXC1 INDEX_3							279
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-279	-279	-279	-279	-279	-279	-279
-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%	279	279	279	279	279	279	279
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_7							255
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%

-8.00%	-255	-255	-255	-255	-255	-255	-255
-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%	255	255	255	255	255	255	255

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\_11 637

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-637	-637	-637	-637	-637	-637	-637
-5.33%	-425	-425	-425	-425	-425	-425	-425
-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%	425	425	425	425	425	425	425
8.00%	637	637	637	637	637	637	637

2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX\_12 478

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-478	-478	-478	-478	-478	-478	-478
-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%	478	478	478	478	478	478	478

KR4101N60C 2018-06 코스피200지수선물 159

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-159	-159	-159	-159	-159	-159	-159
-5.33%	-106	-106	-106	-106	-106	-106	-106
-2.67%	-53	-53	-53	-53	-53	-53	-53
0%	0	0	0	0	0	0	0

2.67%	53	53	53	53	53	53	53
5.33%	106	106	106	106	106	106	106
8.00%	159	159	159	159	159	159	159
KR4201N6312018-06 콜317.5							1,679
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	863	829	790	747	701	651	600
-5.33%	751	698	642	583	523	460	397
-2.67%	546	477	407	337	267	196	124
0%	223	149	74	0	-74	-149	-223
2.67%	-221	-289	-358	-429	-500	-571	-643
5.33%	-769	-823	-880	-940	-1,002	-1,066	-1,132
8.00%	-1,394	-1,431	-1,473	-1,519	-1,569	-1,623	-1,679
KR4301N6312018-06 풋315							214
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-211	-212	-212	-212	-212	-213	-214
-5.33%	-120	-120	-122	-123	-125	-127	-129
-2.67%	-39	-42	-45	-48	-52	-55	-59
0%	11	7	4	0	-4	-7	-11
2.67%	27	25	24	22	20	17	15
5.33%	29	29	29	28	27	26	25
8.00%	29	29	29	29	29	29	29
KR4301N6312018-06 풋317.5							1,071
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,064	-1,064	-1,065	-1,066	-1,067	-1,069	-1,071
-5.33%	-630	-633	-637	-642	-648	-654	-662
-2.67%	-228	-240	-253	-266	-281	-295	-310
0%	54	36	18	0	-18	-36	-54
2.67%	168	158	147	135	122	109	95
5.33%	190	188	185	181	175	169	162
8.00%	192	192	191	191	189	187	185

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

(단위:백만원)

6,923

공시일	2018-05-14
기준일	2018-05-11

## 유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

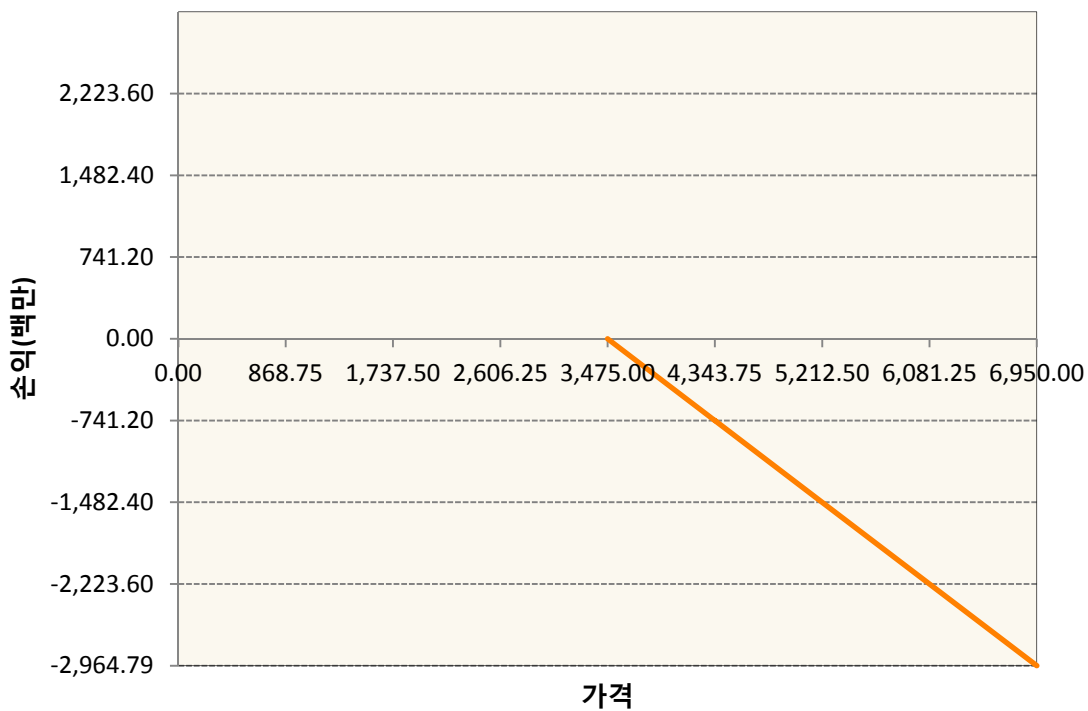
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

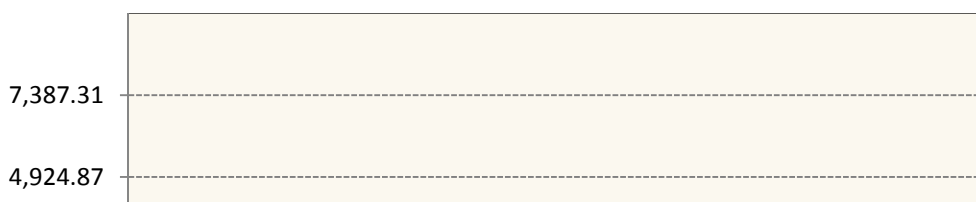
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	8	-8	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	4,979	0	4,979	
누계	유가증권	스왑	63,619	0	63,619	장외
누계	유가증권	옵션	0	33,549	-33,549	장내
누계	지수	스왑	50,936	0	50,936	장외

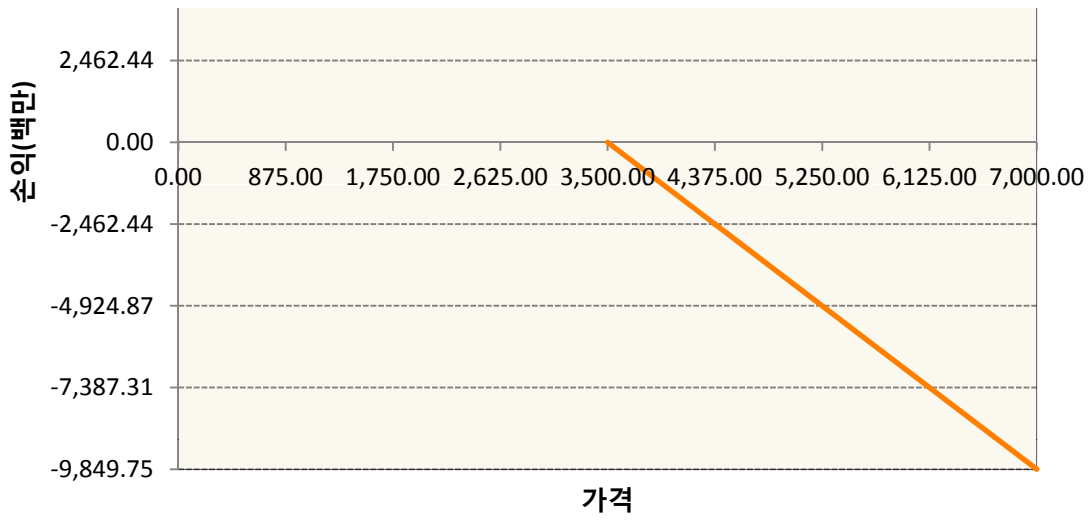
### 2. 만기시점의 손익구조

**OESXK8-C3475-EURO STOXX 50**

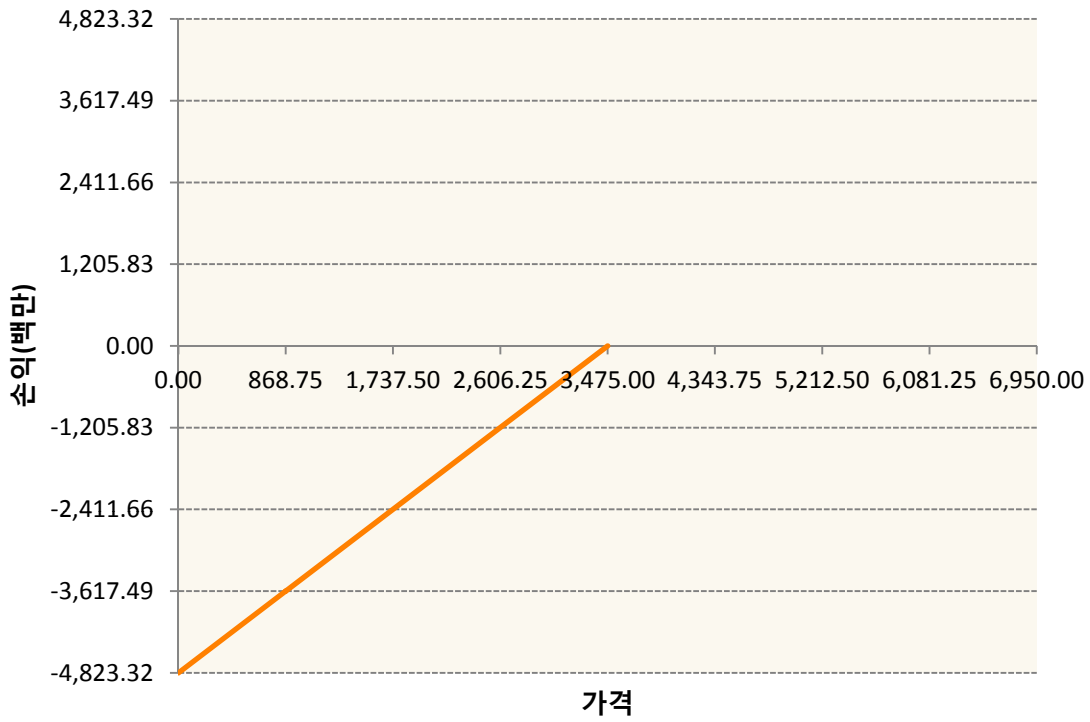


**OESXK8-C3500-EURO STOXX 50**



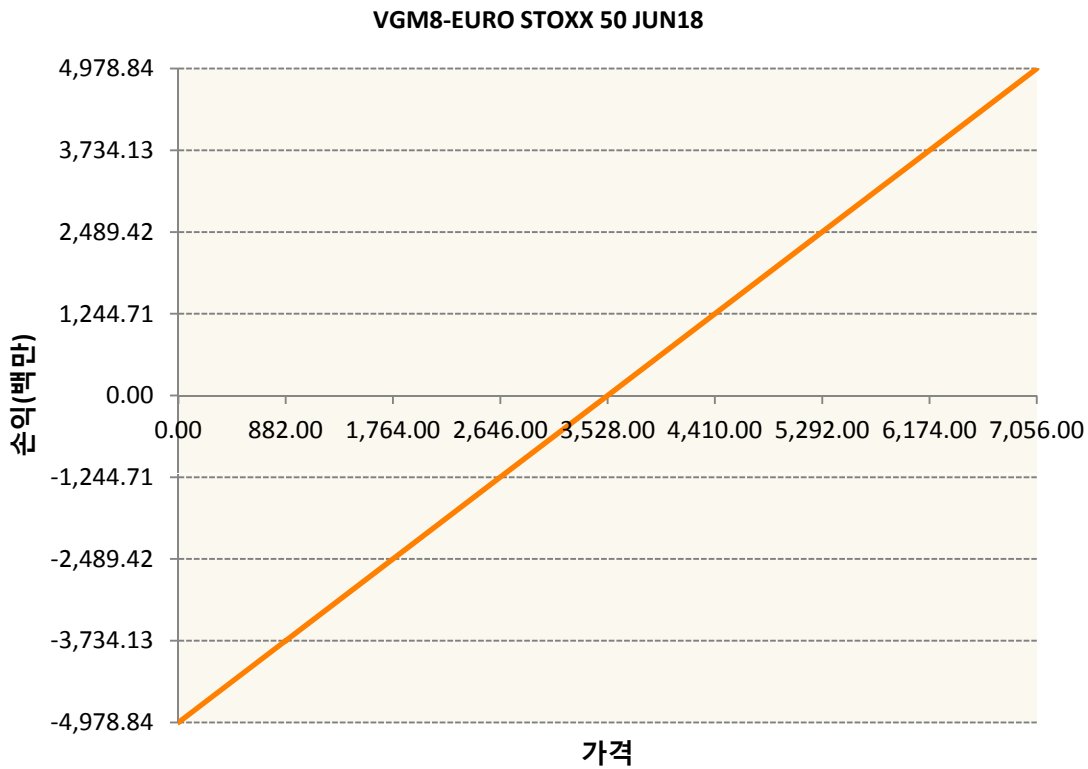
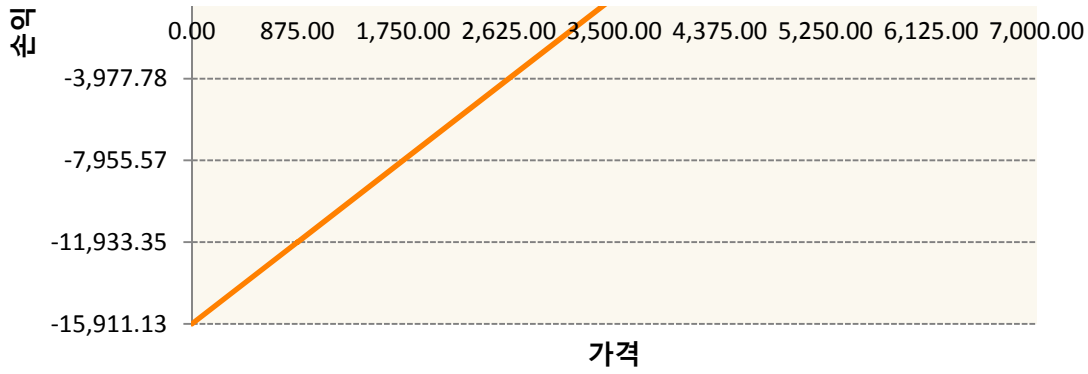


OESXK8-P3475-EURO STOXX 50



OESXK8-P3500-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
260105SGPX SG EURO Covered CALL STRATEGY - 994.569		61
260105SQPX SG EURO Covered CALL STRATEGY		76
OESXK8-C34 EURO STOXX 50		237
OESXK8-C35 EURO STOXX 50		788
OESXK8-P34 EURO STOXX 50		386
OESXK8-P35 EURO STOXX 50		1,273
VGM8 EURO STOXX 50 JUN18		398

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





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

(단위:백만원)

1,207

공시일	2018-05-14
기준일	2018-05-11

## ETF스마트레버리지목표전환형9호

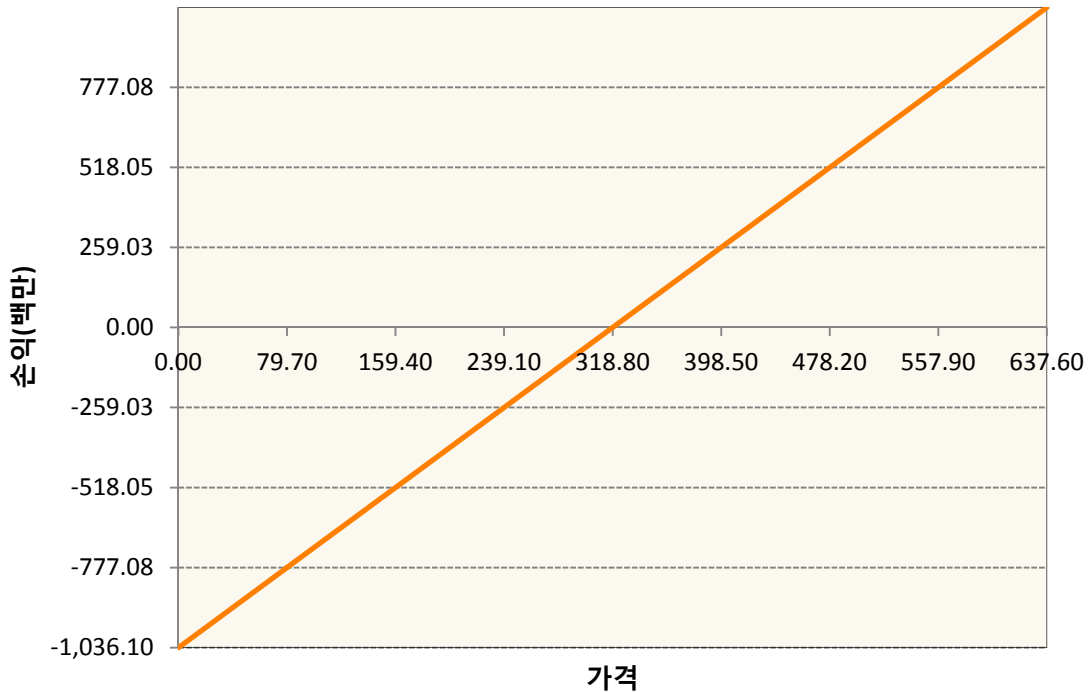
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,036	0	1,036	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)

99



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

(단위:백만원)

221

공시일	2018-05-14
기준일	2018-05-11

## 스마트KRX300인덱스목표전환형1

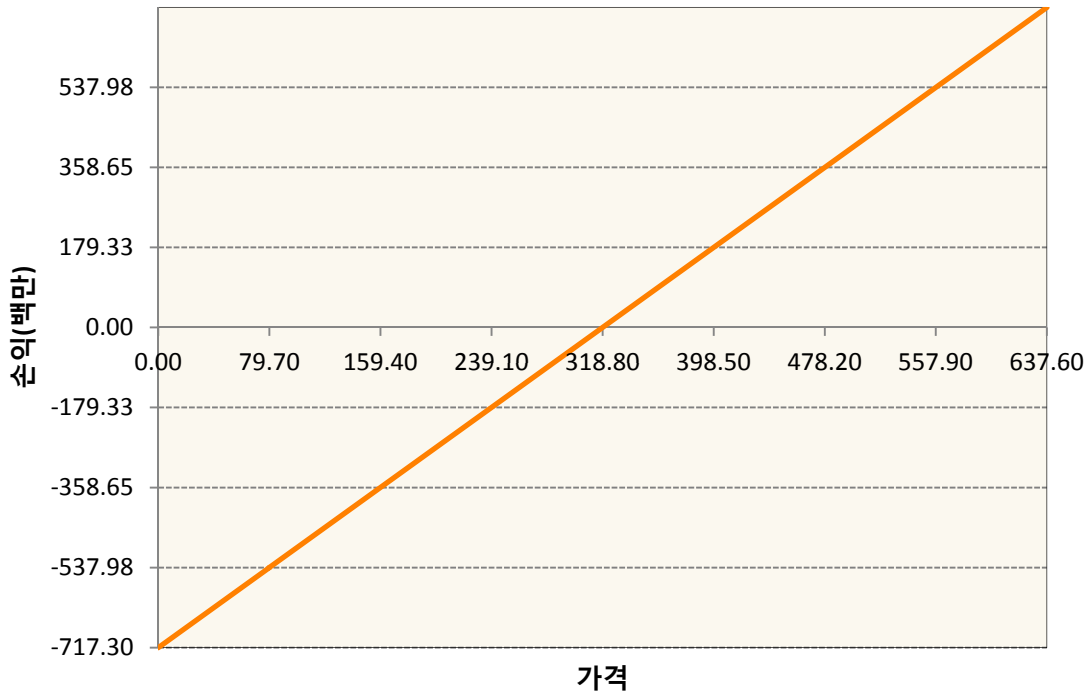
### 1. 계약금액

(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	2018-05-14
기준일	2018-05-11

## 리디파인K200(주식혼합-파생재간

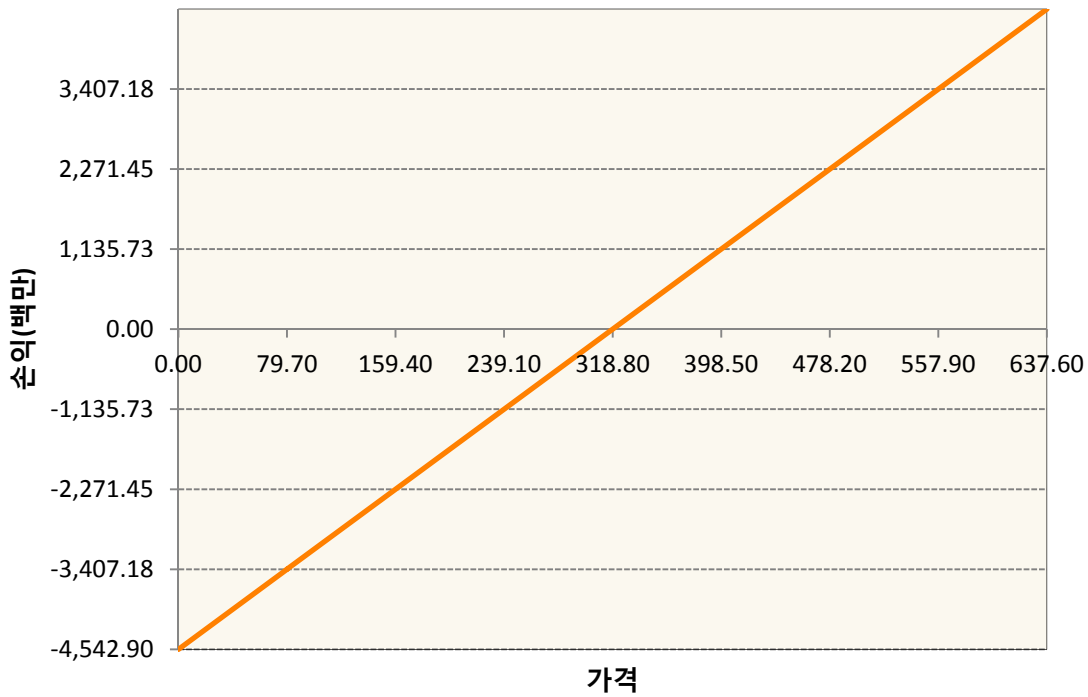
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

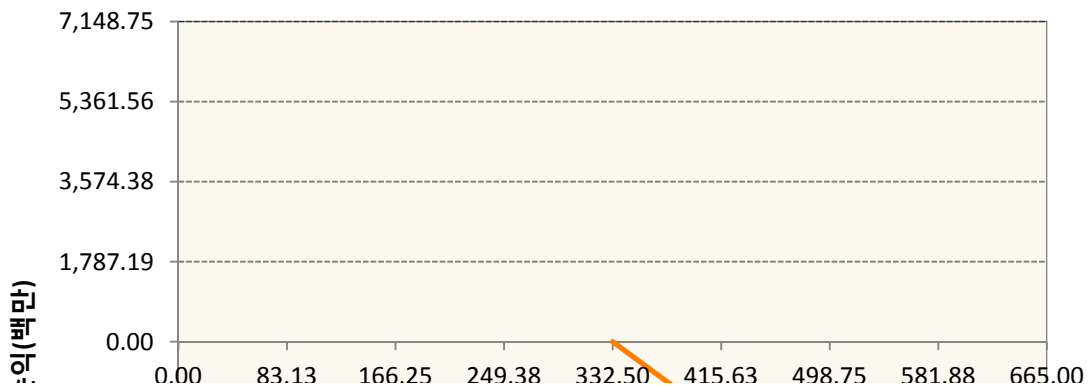
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	943	7,160	-6,216	장내
누계	유가증권	선물	4,543	0	4,543	장내
누계	유가증권	옵션	953	7,149	-6,196	장내

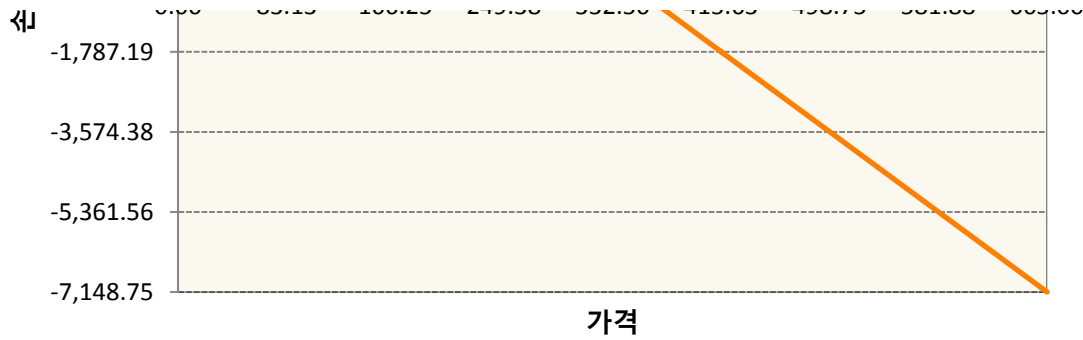
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101N60009-2018-06 코스피200지수선물

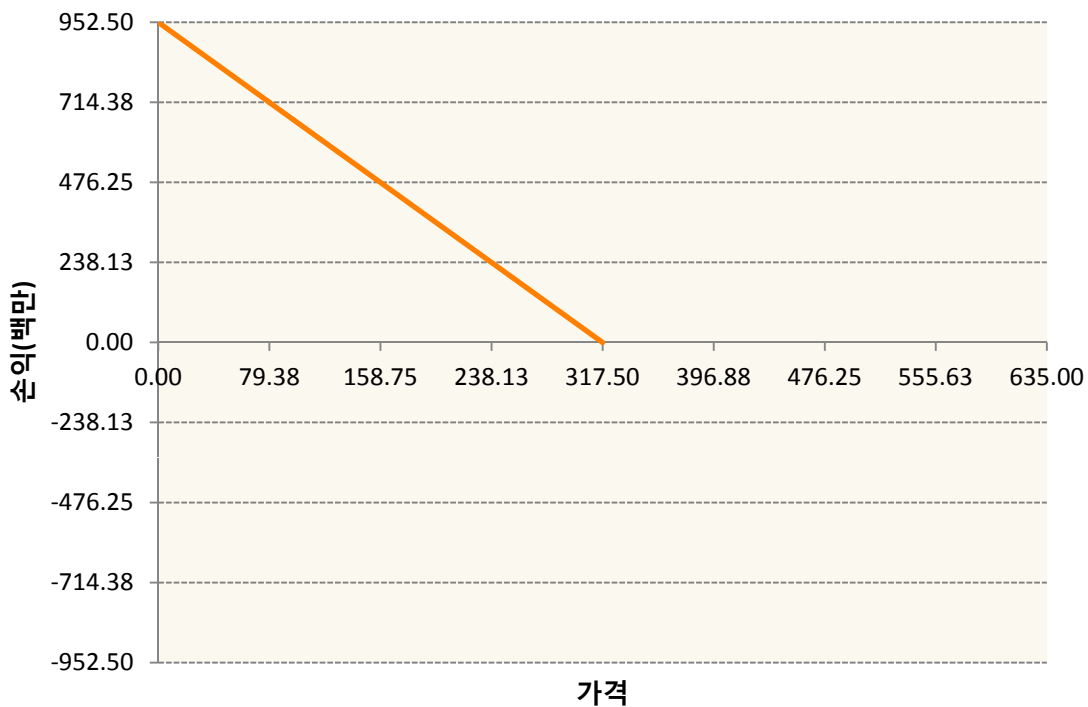


KR4201N63324-2018-06 콜332.5





KR4301N63173-2018-06 풋317.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101N60C 2018-06 코스피200지수선물							363
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-363	-363	-363	-363	-363	-363	-363
-5.33%	-242	-242	-242	-242	-242	-242	-242
-2.67%	-121	-121	-121	-121	-121	-121	-121
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	121	121	121	121	121	121	121
5.33%	242	242	242	242	242	242	242
8.00%	363	363	363	363	363	363	363
KR4201N63E 2018-06 콜332.5							328
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	108	105	101	96	90	82	74
-5.33%	101	95	87	79	69	58	46
-2.67%	84	73	61	48	34	20	5
0%	48	33	17	0	-17	-34	-52
2.67%	-12	-31	-50	-69	-88	-107	-126
5.33%	-101	-120	-140	-160	-179	-199	-219
8.00%	-219	-236	-254	-272	-291	-310	-328

KR4301N6312018-06 풋317.5

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	62	62	62	62	62	62	62
-5.33%	37	37	37	37	38	38	39
-2.67%	13	14	15	16	16	17	18
0%	-3	-2	-1	0	1	2	3
2.67%	-10	-9	-9	-8	-7	-6	-6
5.33%	-11	-11	-11	-11	-10	-10	-9
8.00%	-11	-11	-11	-11	-11	-11	-11

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

(단위:백만원)

572

공시일	2018-05-14
기준일	2018-05-11

## 에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

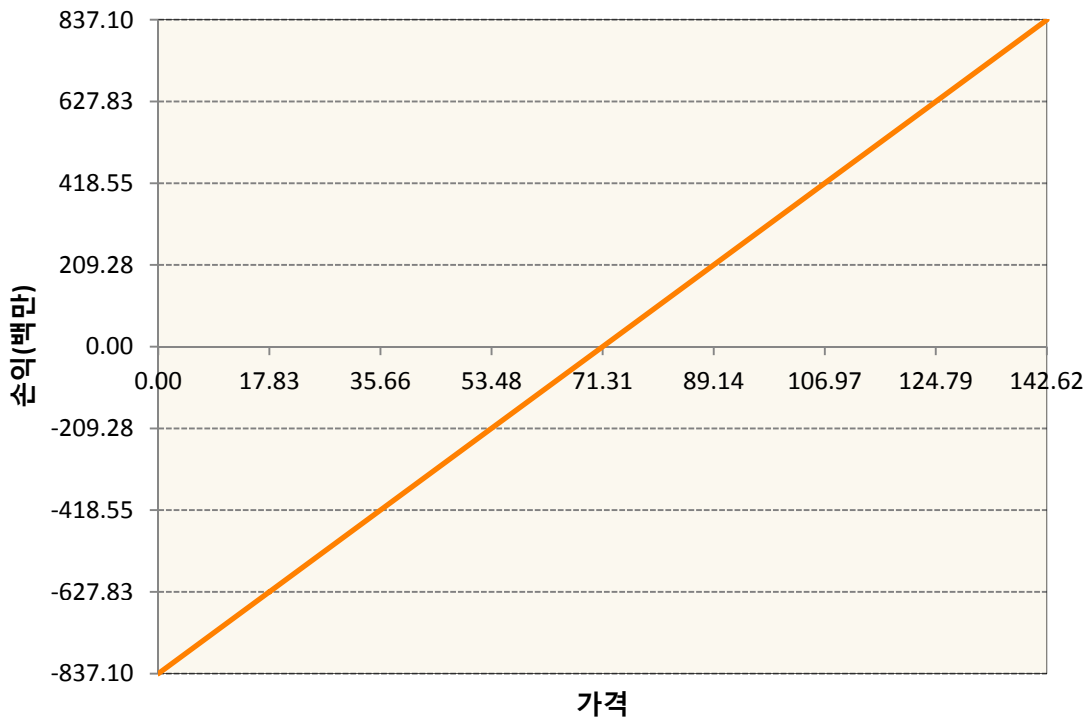
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

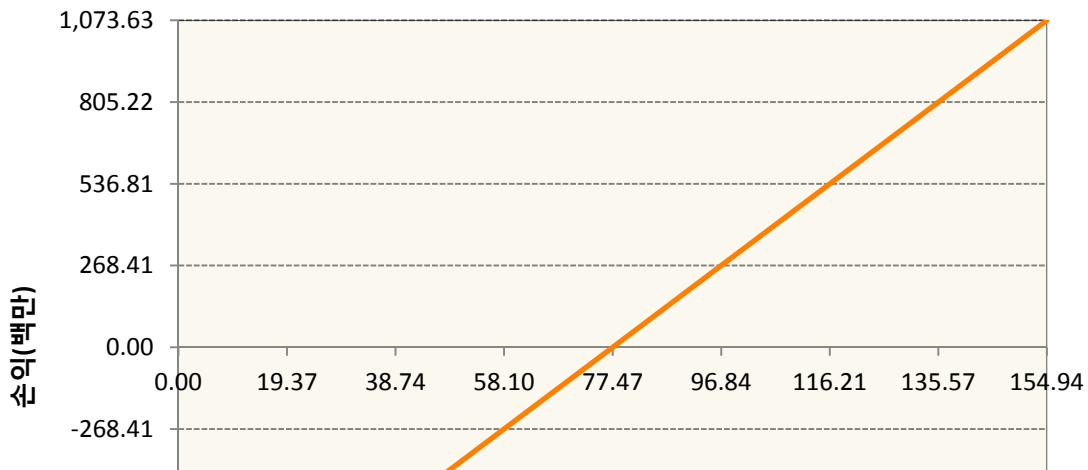
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	4,052	588	3,464	

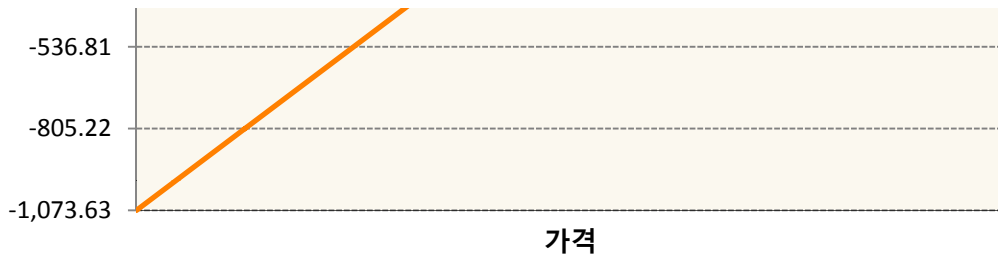
### 2. 만기시점의 손익구조

**CLN8-WTI CRUDE FUTURE JUL18**

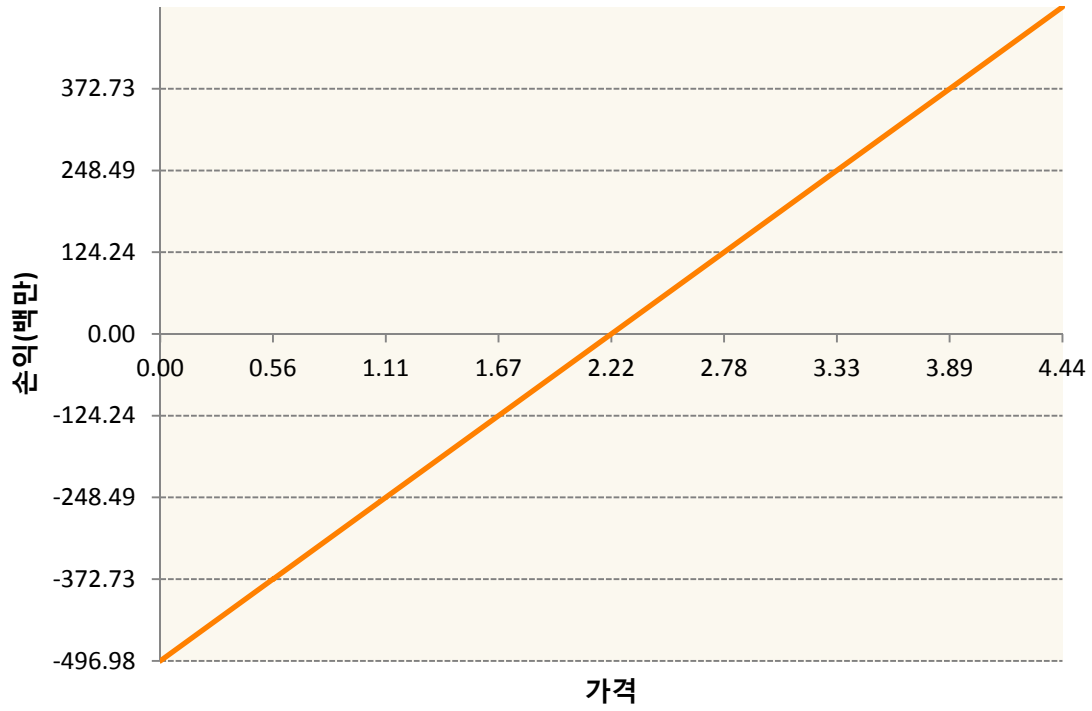


**CON8-BRENT CRUDE FUTR JUL18**

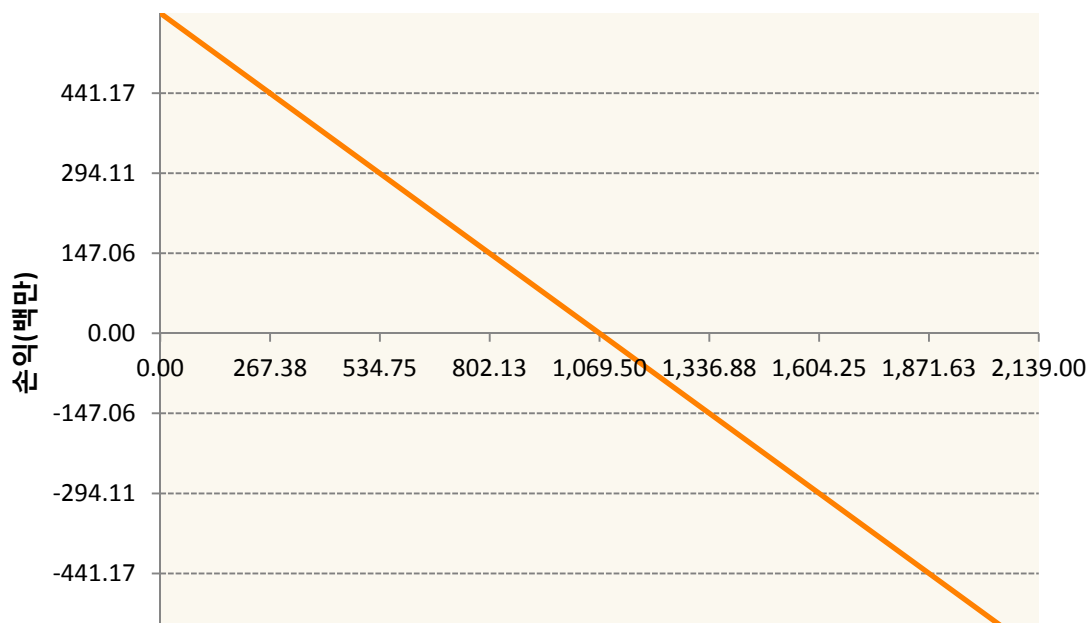


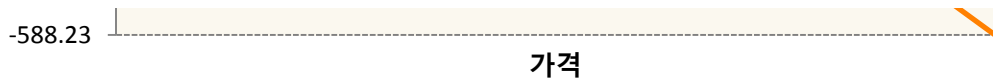


HON8-NY Harb ULSD Fut JUL18

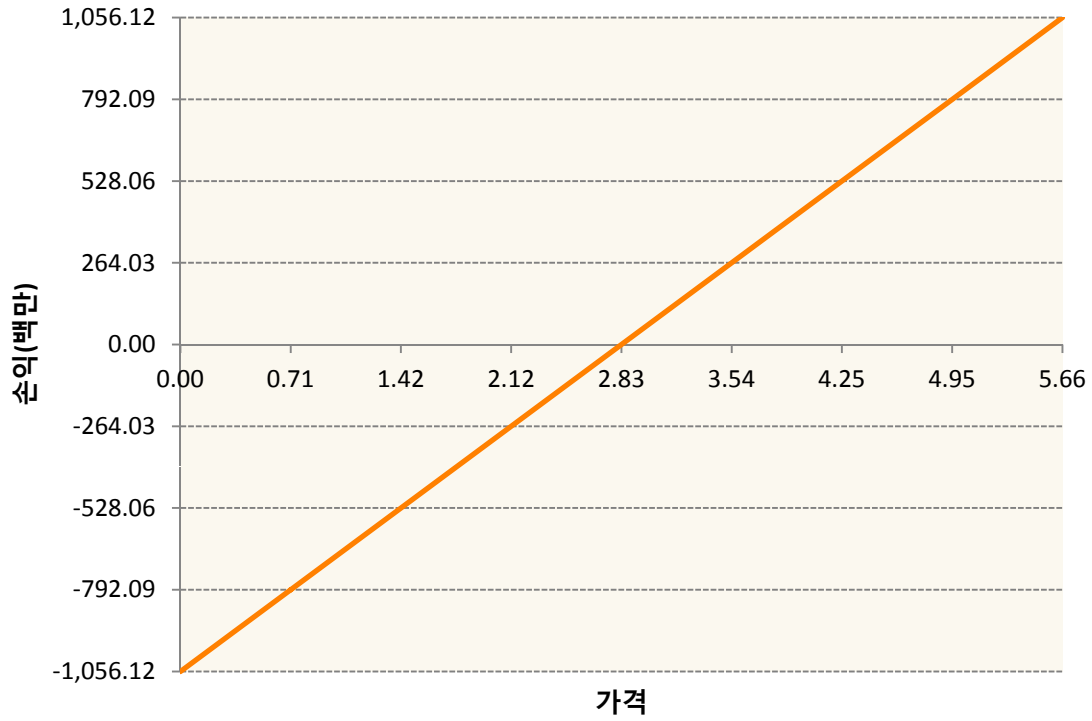


KR4175N50004-2018-05 달러선물

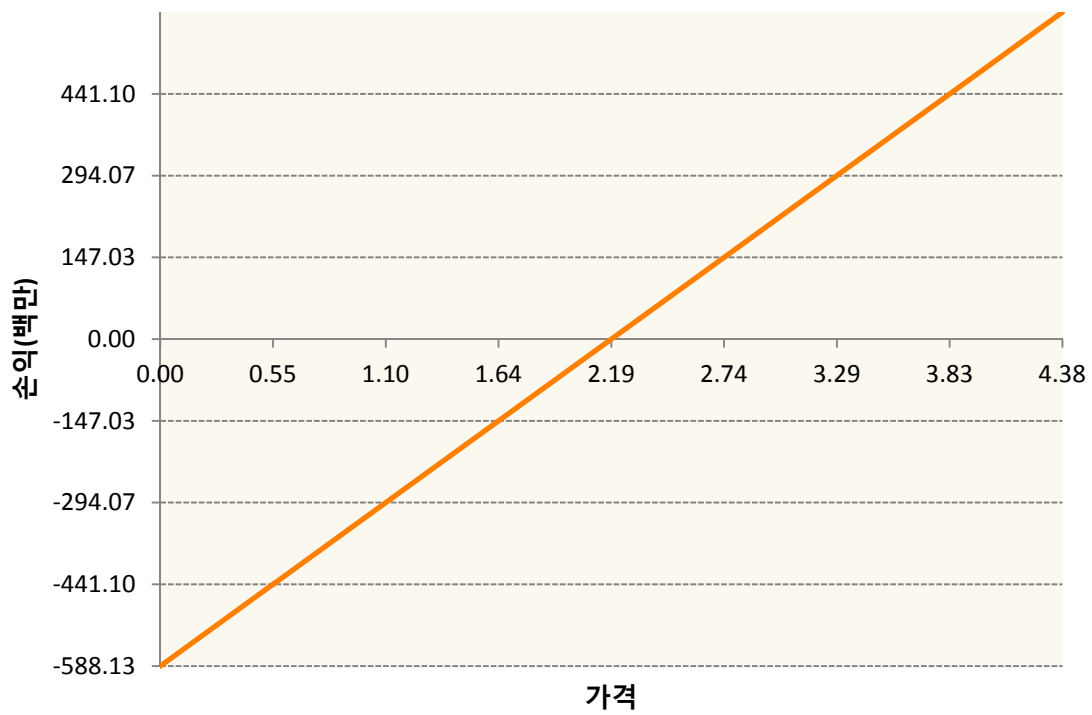




NGN8-NATURAL GAS FUTR JUL18



XBN8-GASOLINE RBOB FUT JUL18



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

CLN8	WTI CRUDE FUTURE JUL18	67
CON8	BRENT CRUDE FUTR JUL18	86
HON8	NY Harb ULSD Fut JUL18	40
KR4175N50C	2018-05 달러선물	47
NGN8	NATURAL GAS FUTR JUL18	84
XBN8	GASOLINE RBOB FUT JUL18	47

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

487

공시일	2018-05-14
기준일	2018-05-11

## 애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

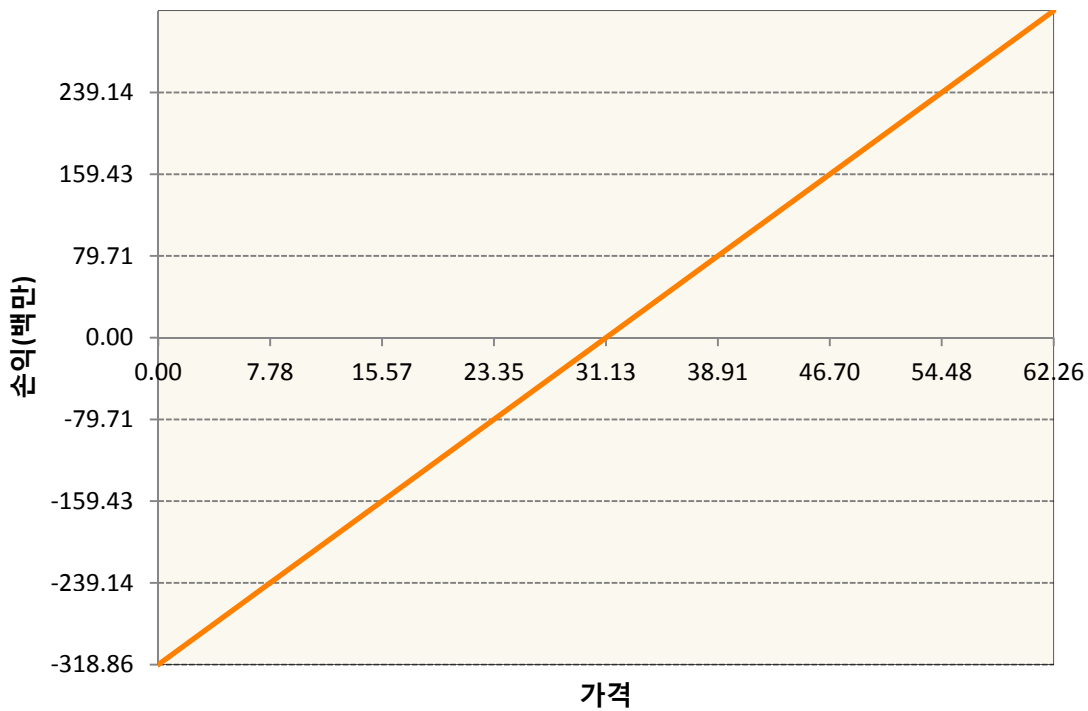
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

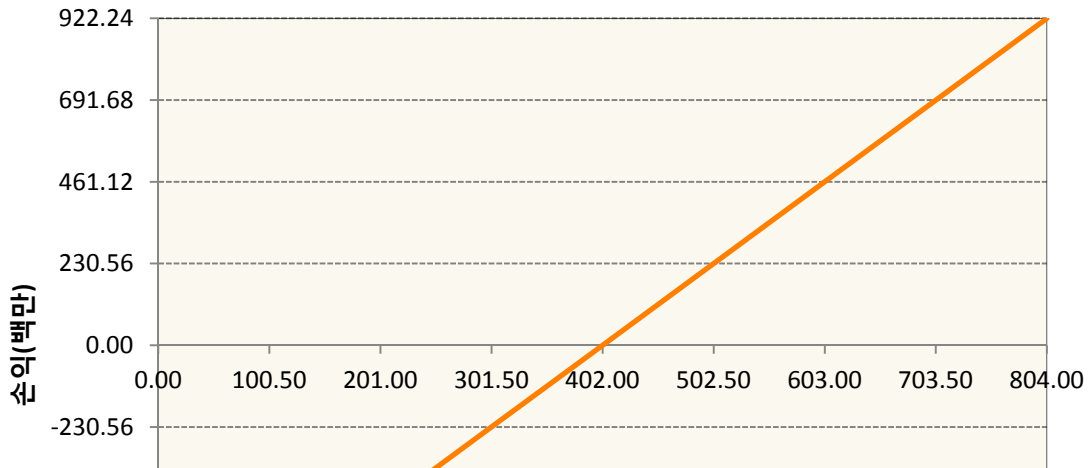
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	4,078	321	3,757	

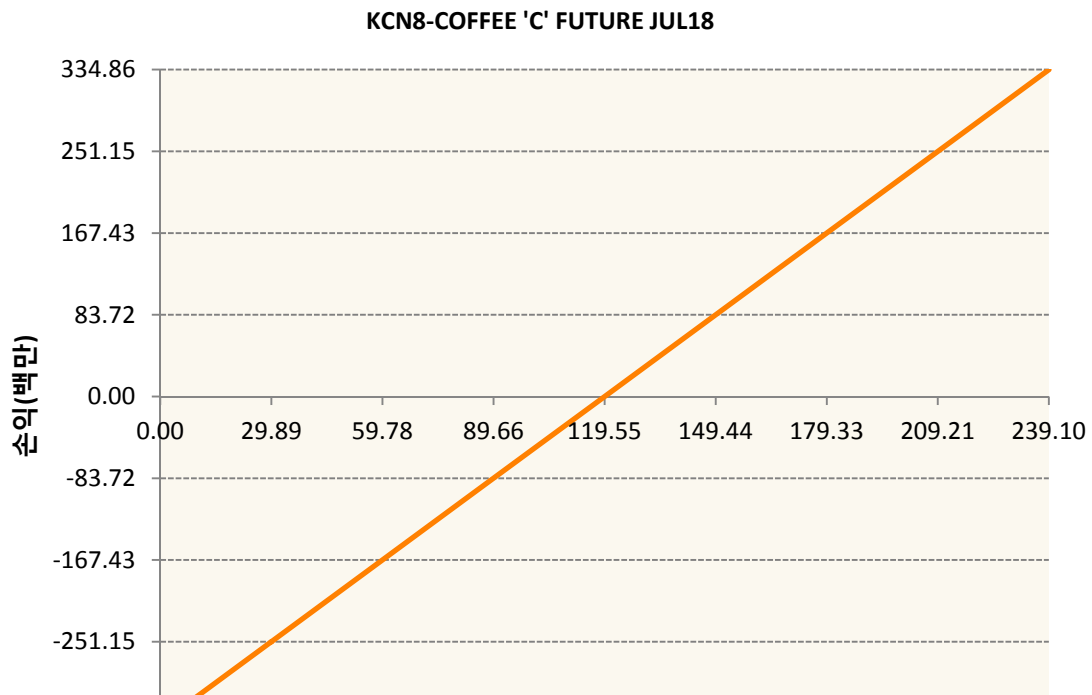
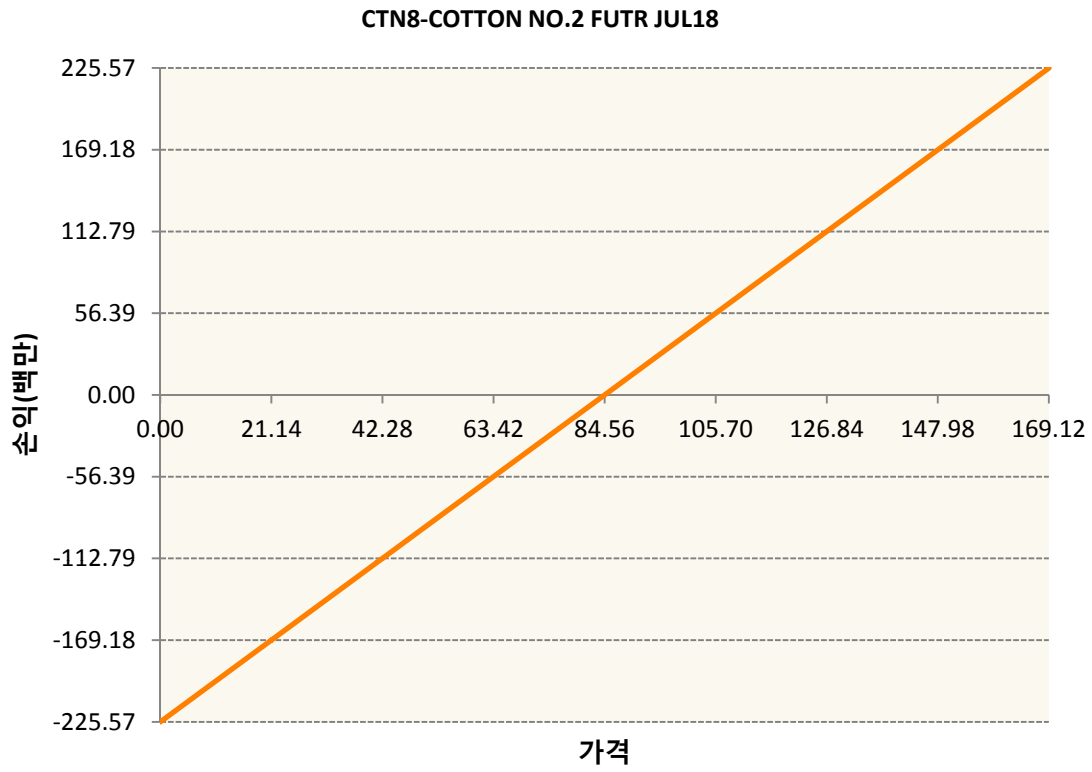
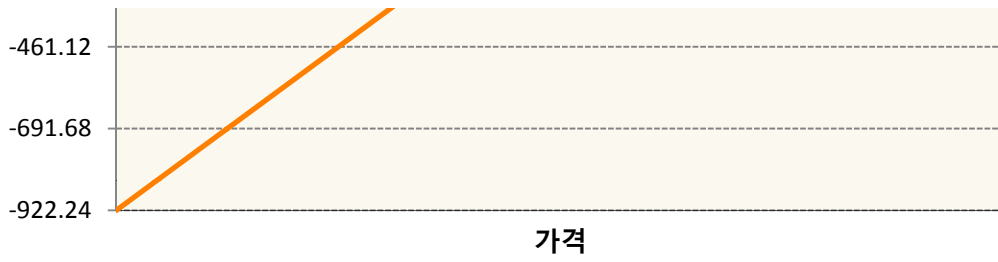
### 2. 만기시점의 손익구조

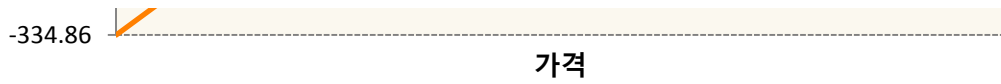
**BON8-SOYBEAN OIL FUTR JUL18**



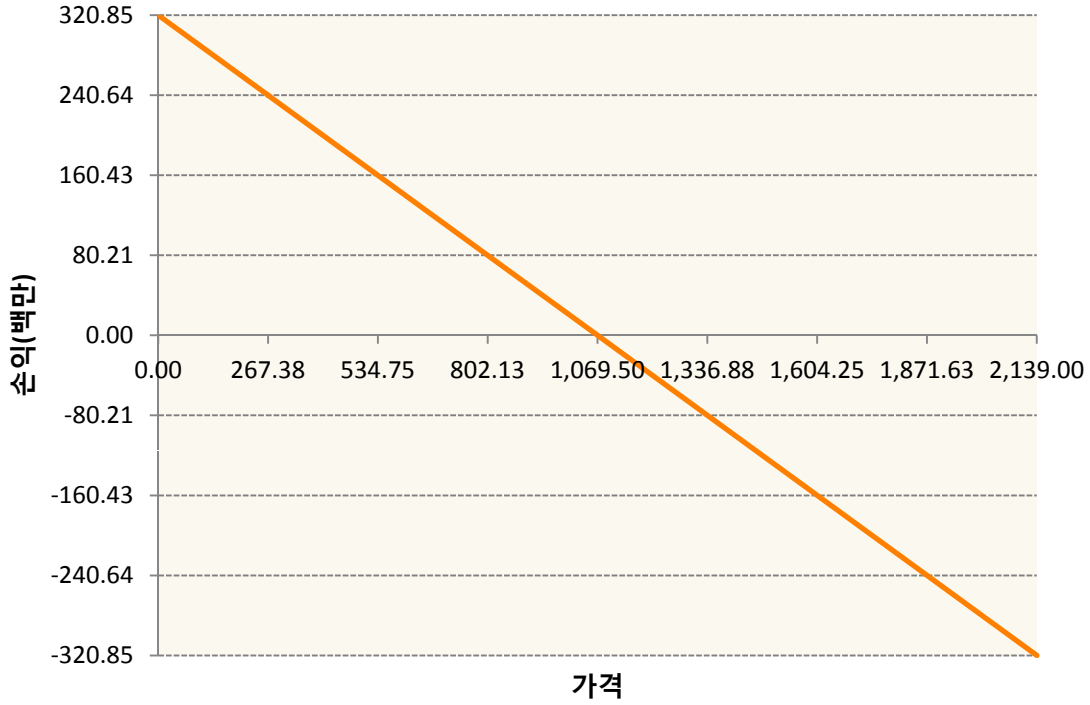
**CN8-CORN FUTURE JUL18**



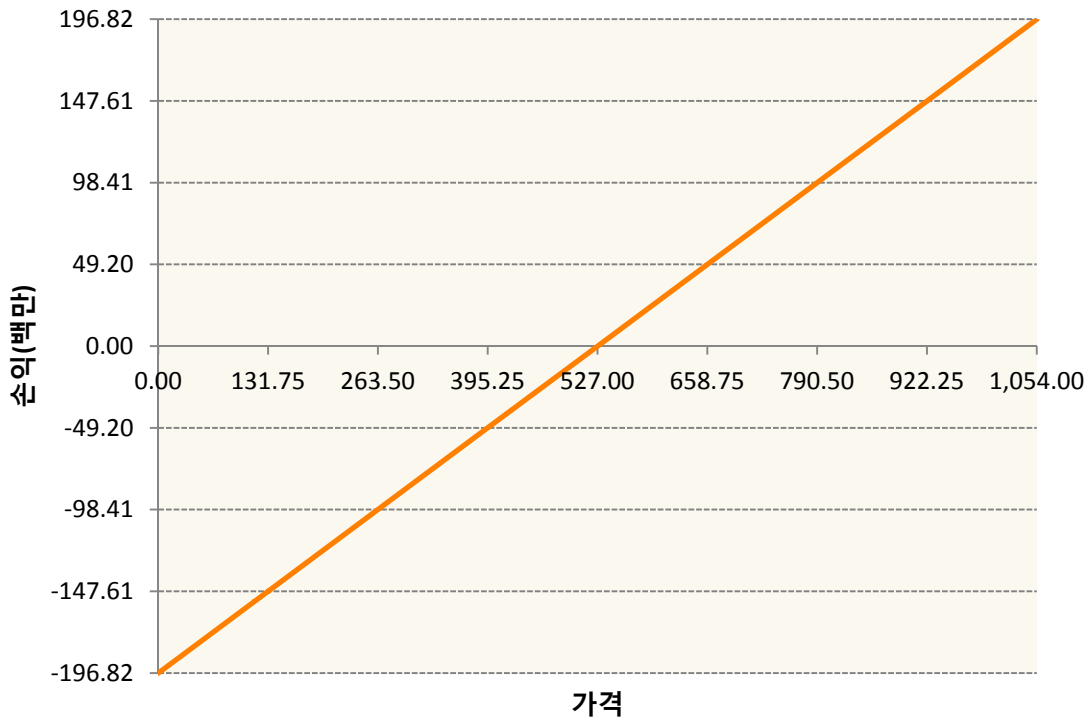




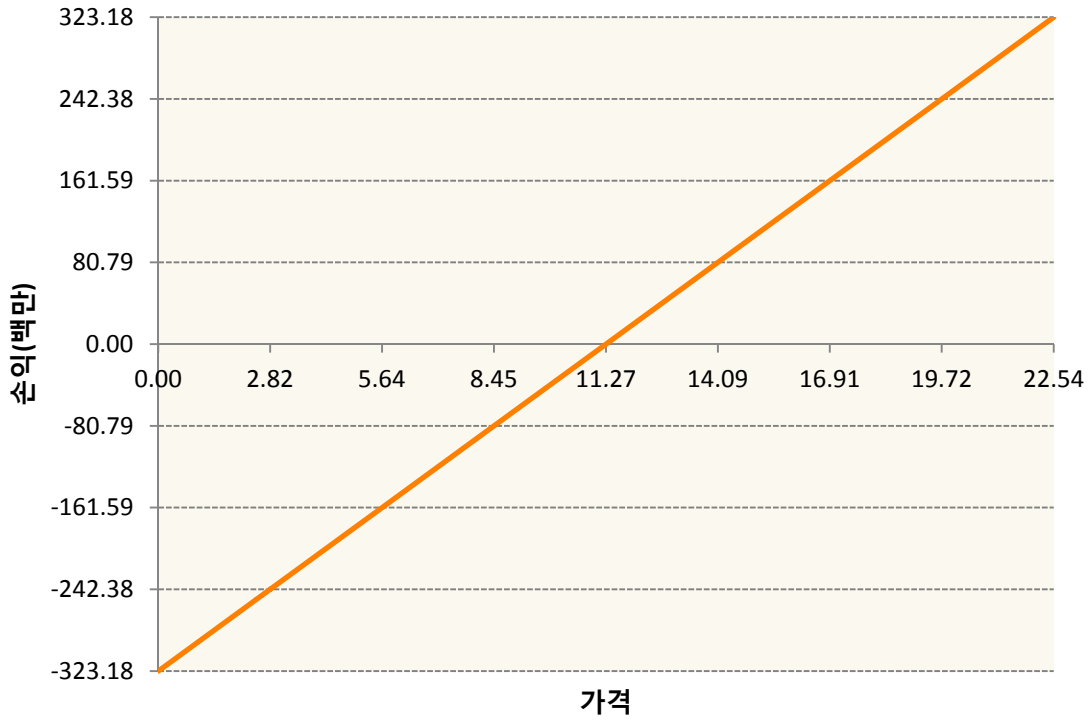
**KR4175N50004-2018-05 달러선물**



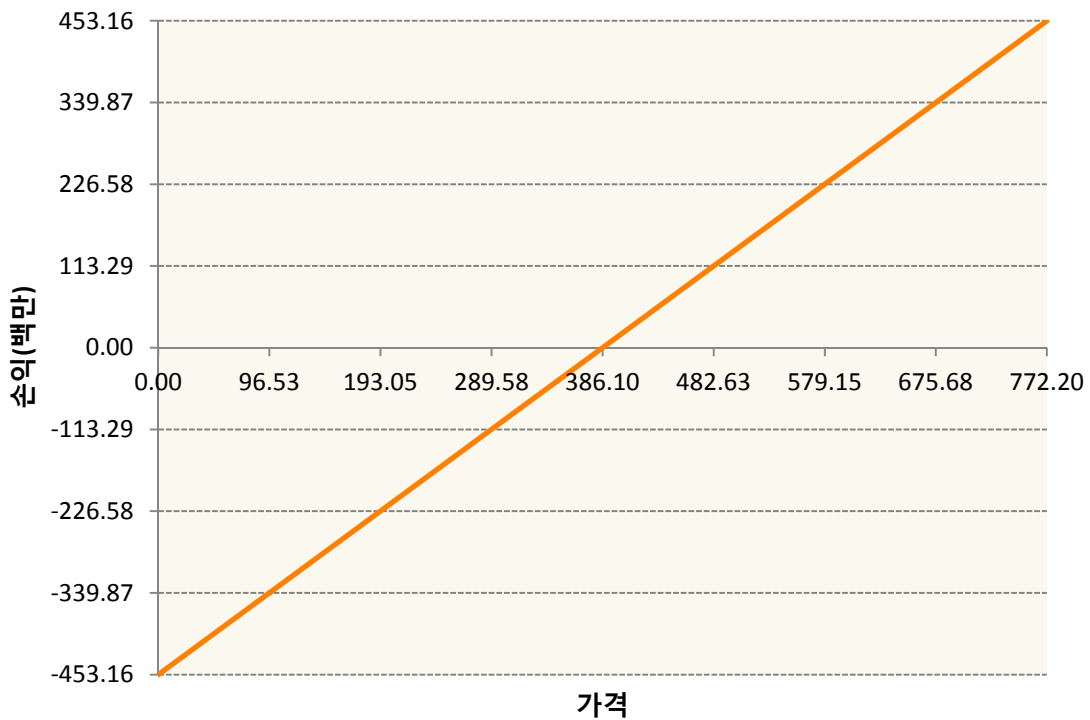
**KWN8-KC HRW WHEAT FUT JUL18**



SBN8-SUGAR #11 (WORLD) JUL18

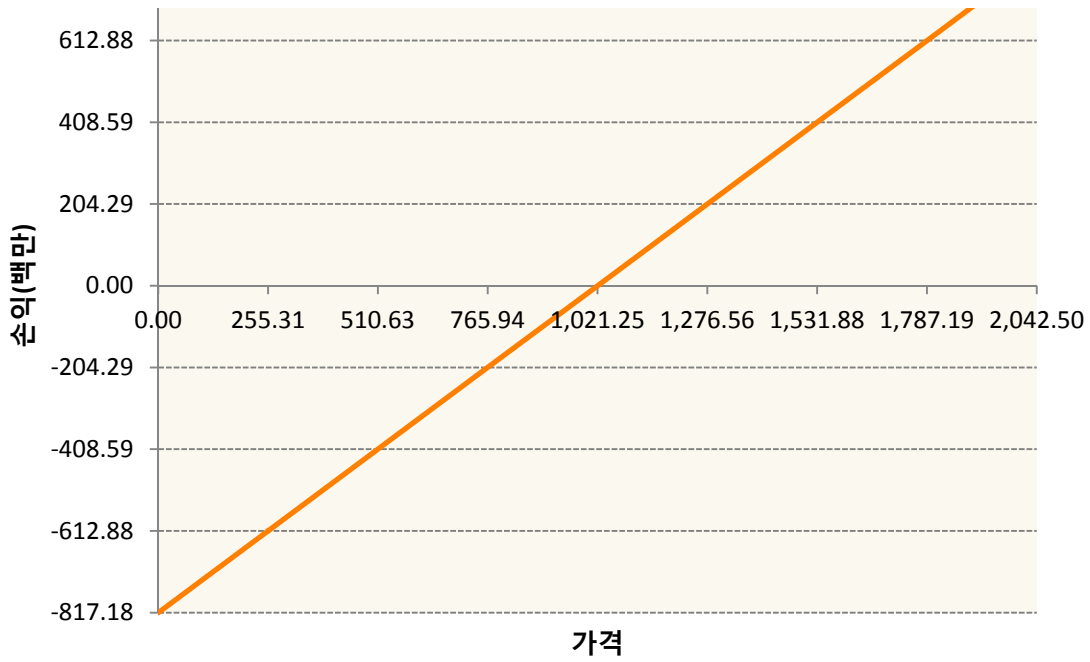


SMN8-SOYBEAN MEAL FUTR JUL18

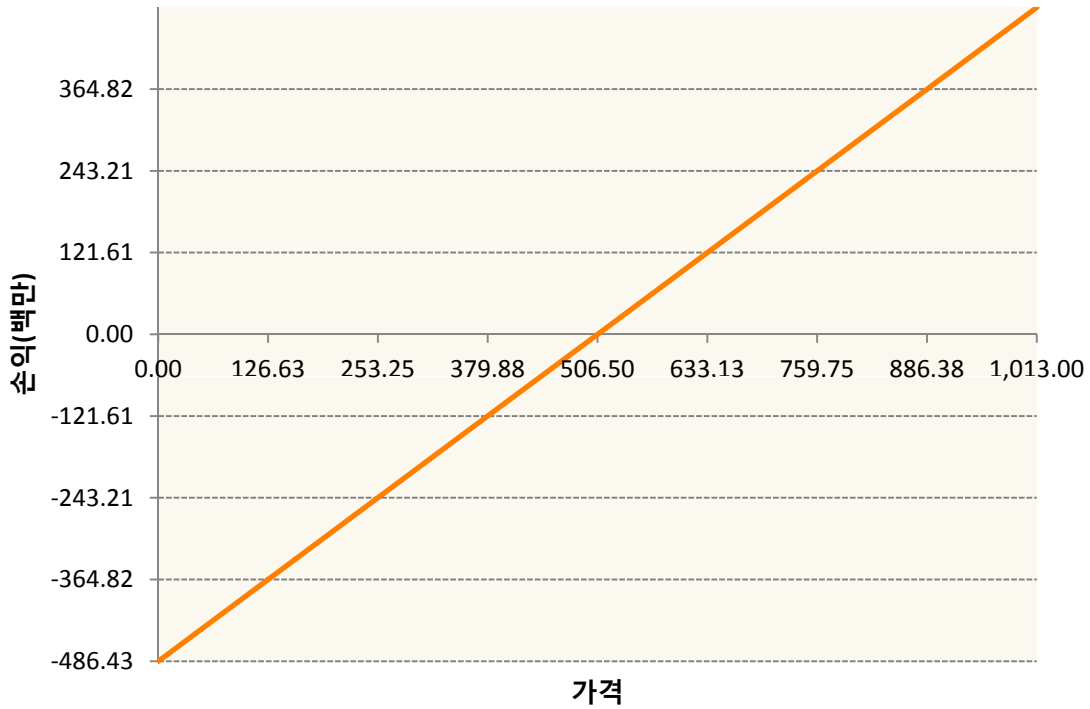


SN8-SOYBEAN FUTURE JUL18





WN8-WHEAT FUTURE(CBT) JUL18



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

BON8	SOYBEAN OIL FUTR JUL18	26
CN8	CORN FUTURE JUL18	74
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	26
SMN8	SOYBEAN MEAL FUTR JUL18	36
SN8	SOYBEAN FUTURE JUL18	65
WN8	WHEAT FUTURE(CBT) JUL18	39

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

(단위:백만원)

**326**