

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2018-06-07 |
| 기준일 | 2018-06-05 |

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)

83

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2018-06-07 |
| 기준일 | 2018-06-05 |

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 | 14,040 | 0 | 14,040 | 장외 |

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWMXWO0(신한MXWO 미래S180523

1,121

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

465

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2018-06-07 |
| 기준일 | 2018-06-05 |

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

382

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

410

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2018-06-07 |
| 기준일 | 2018-06-05 |

유로인덱스모(주식-파생형)

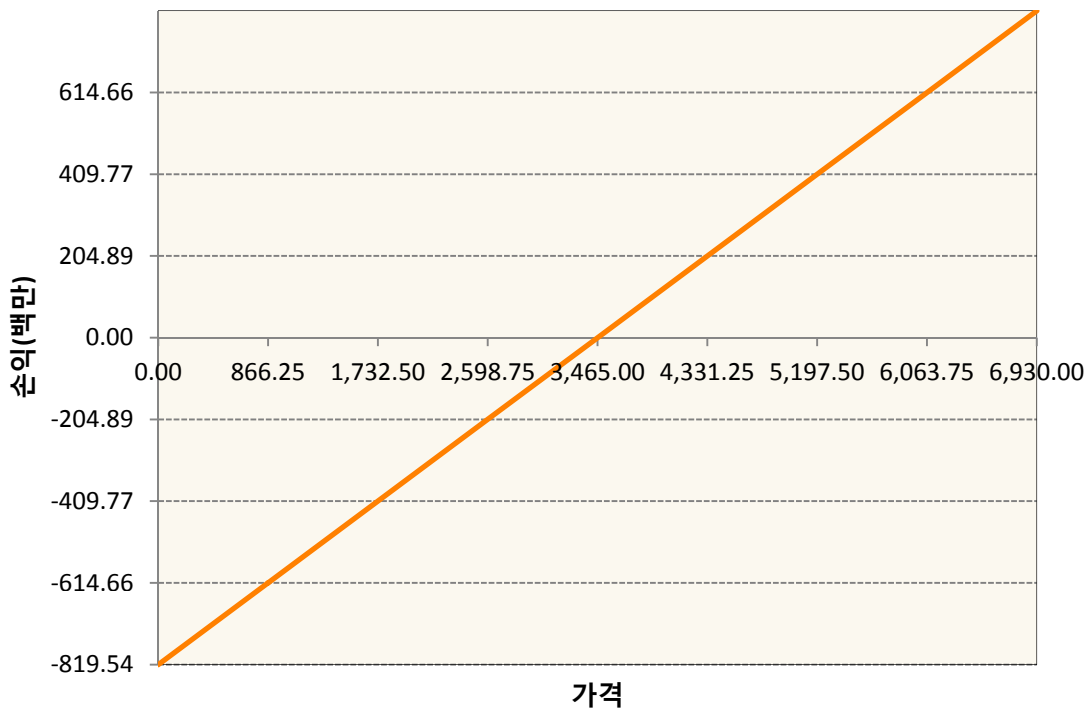
1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 820 | 0 | 820 | |

2. 만기시점의 손익구조

VGM8-EURO STOXX 50 JUN18



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| | | |
|------|---------------------|----|
| VGM8 | EURO STOXX 50 JUN18 | 66 |
|------|---------------------|----|

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

(단위:백만원)

| |
|----|
| 40 |
|----|

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2018-06-07 |
| 기준일 | 2018-06-05 |

차이나인덱스모(주식-파생형)

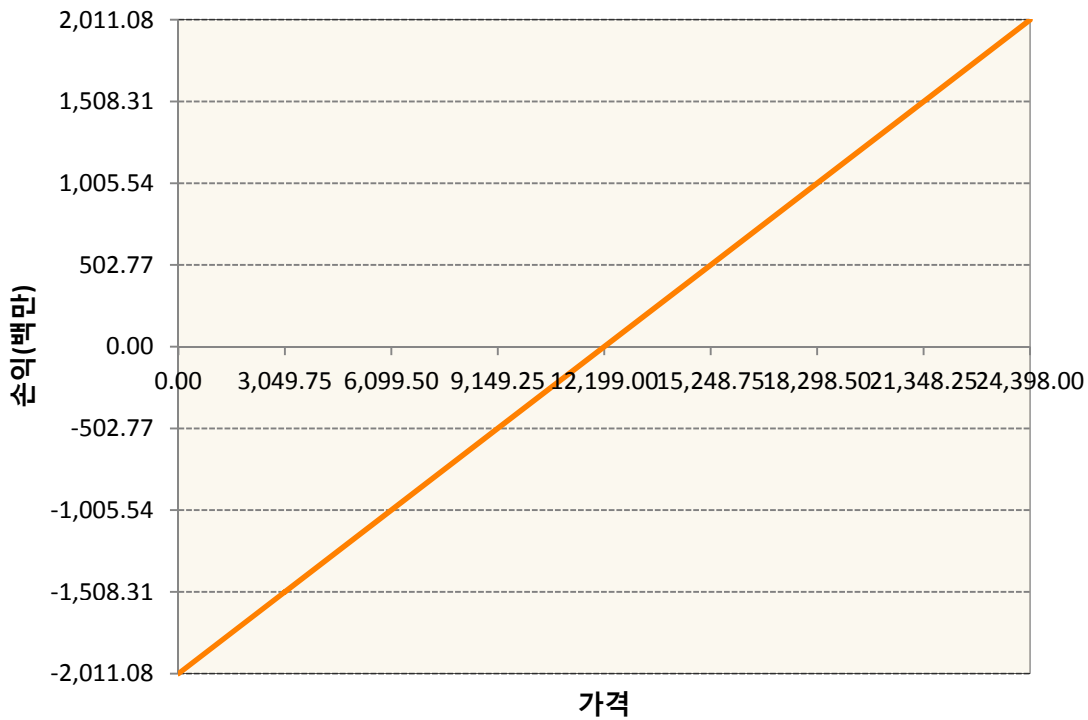
1. 계약금액

(단위:백만원)

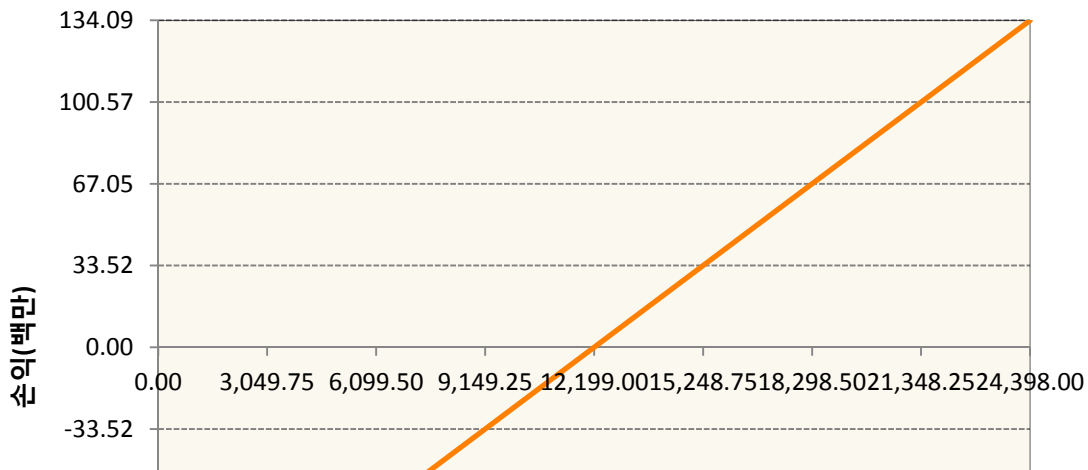
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 2,145 | 0 | 2,145 | 장내 |

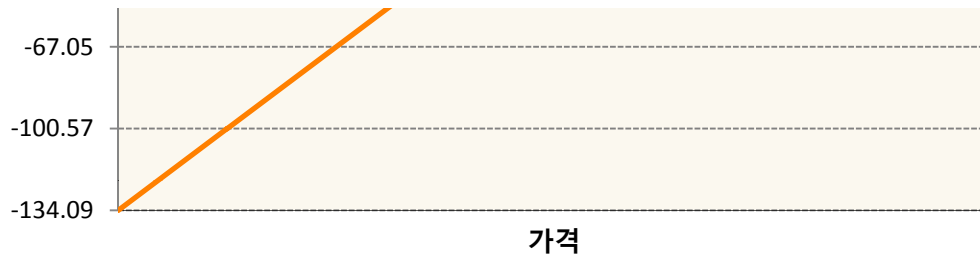
2. 만기시점의 손익구조

HCM8-HSCEI Futures Jun18



MHCM8-MINI H-SHR IDX FU Jun18





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

| | | |
|-------|-------------------------|-----|
| HCM8 | HSCEI Futures Jun18 | 161 |
| MHCM8 | MINI H-SHR IDX FU Jun18 | 11 |

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

| |
|------------|
| 152 |
|------------|

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2018-06-07 |
| 기준일 | 2018-06-05 |

커버드콜모(주식혼합-파생형)

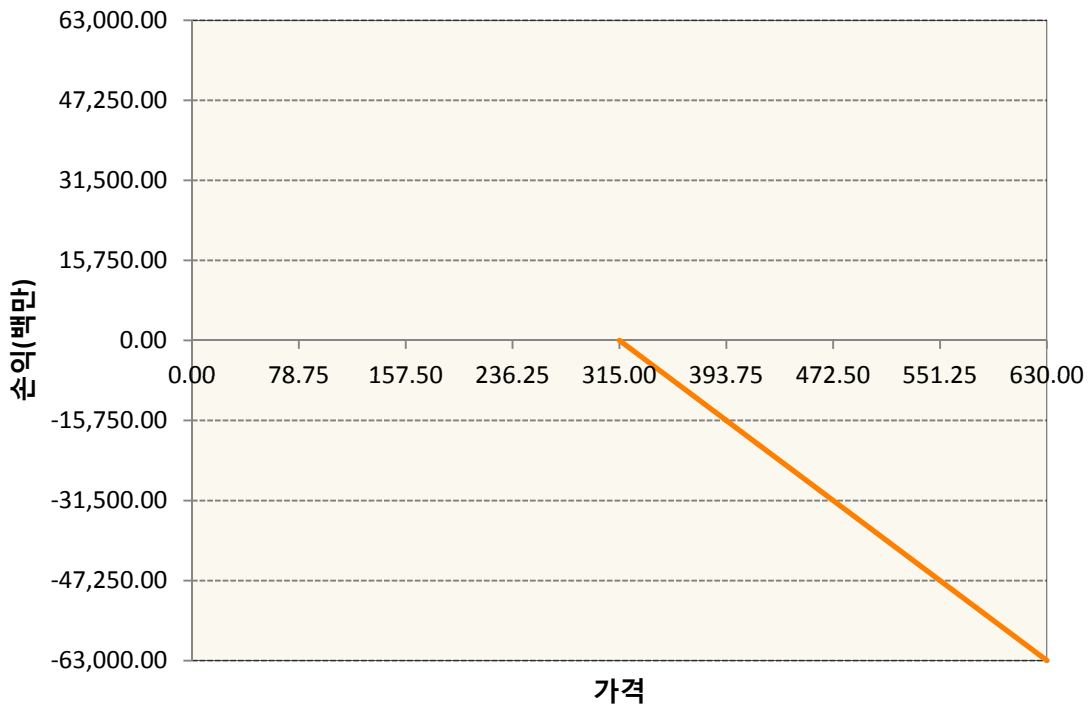
1. 계약금액

(단위:백만원)

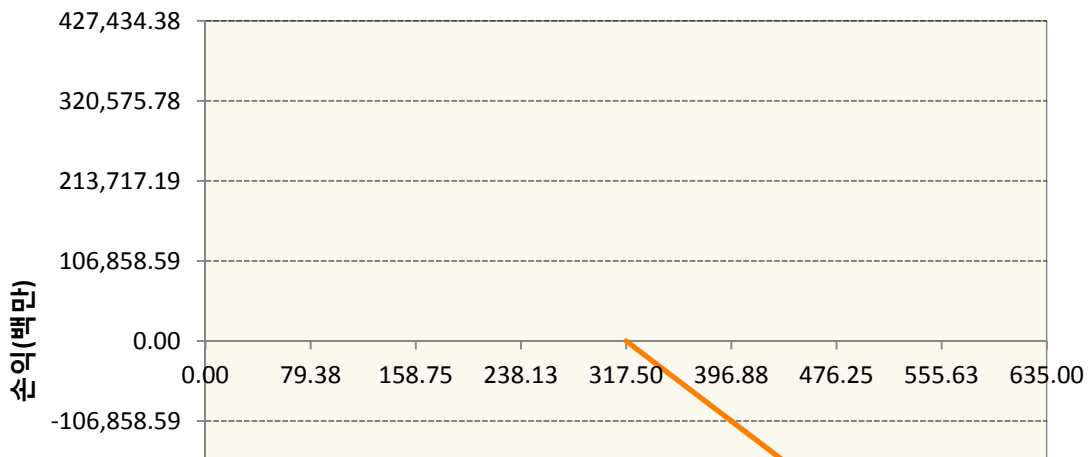
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|---------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 옵션 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션 | 0 | 798,409 | -798,409 | 장내 |

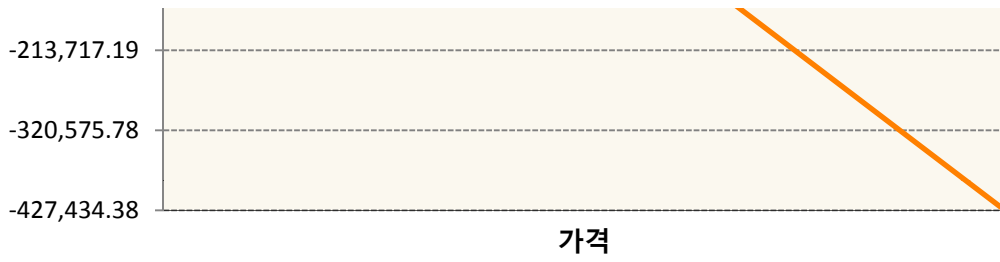
2. 만기시점의 손익구조

KR4201N63159-2018-06 콜315

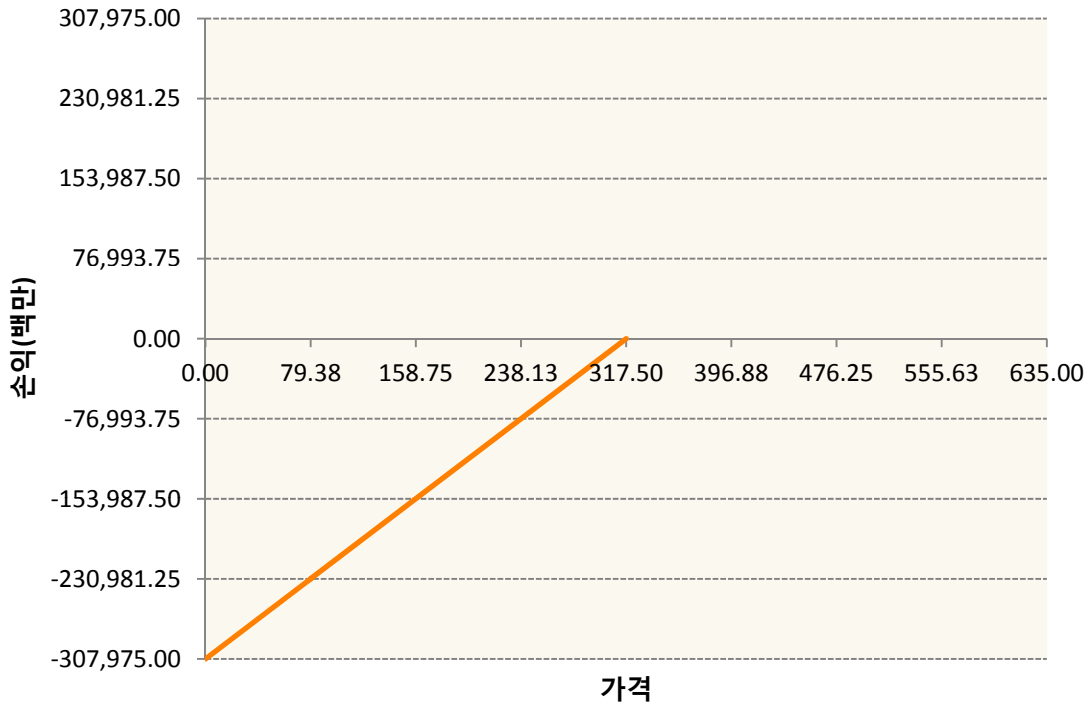


KR4201N63175-2018-06 콜317.5





KR4301N63173-2018-06 풋317.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4201N6312018-06 콜315

4,147

| 기초자산의 변동성 | | | | | | | |
|-----------|---------|---------|--------|--------|--------|--------|--------|
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | 1,163 | 1,158 | 1,149 | 1,136 | 1,119 | 1,097 | 1,070 |
| -5.33% | 1,122 | 1,095 | 1,061 | 1,021 | 976 | 927 | 873 |
| -2.67% | 906 | 836 | 764 | 689 | 612 | 533 | 453 |
| 0% | 272 | 181 | 91 | 0 | -91 | -181 | -272 |
| 2.67% | -882 | -947 | -1,016 | -1,089 | -1,164 | -1,241 | -1,320 |
| 5.33% | -2,392 | -2,419 | -2,452 | -2,491 | -2,536 | -2,586 | -2,641 |
| 8.00% | -4,039 | -4,046 | -4,056 | -4,072 | -4,092 | -4,117 | -4,147 |

KR4201N6312018-06 풋317.5

26,444

| 기초자산의 변동성 | | | | | | | |
|-----------|---------|---------|--------|-------|-------|--------|--------|
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | 6,240 | 6,219 | 6,181 | 6,122 | 6,037 | 5,925 | 5,786 |

| | | | | | | | |
|--------------------------|---------|---------|---------|---------|---------|---------|---------|
| -5.33% | 6,086 | 5,958 | 5,790 | 5,582 | 5,338 | 5,060 | 4,753 |
| -2.67% | 5,117 | 4,731 | 4,312 | 3,867 | 3,400 | 2,915 | 2,416 |
| 0% | 1,821 | 1,216 | 608 | 0 | -609 | -1,219 | -1,829 |
| 2.67% | -4,949 | -5,466 | -6,001 | -6,549 | -7,108 | -7,675 | -8,250 |
| 5.33% | -14,554 | -14,805 | -15,102 | -15,439 | -15,809 | -16,209 | -16,634 |
| 8.00% | -25,467 | -25,540 | -25,648 | -25,793 | -25,975 | -26,193 | -26,444 |
| KR4301N6312018-06 풋317.5 | | | | | | | 22,854 |
| 기초자산의 변동성 | | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | -22,853 | -22,853 | -22,853 | -22,853 | -22,853 | -22,853 | -22,854 |
| -5.33% | -14,689 | -14,690 | -14,690 | -14,691 | -14,693 | -14,698 | -14,705 |
| -2.67% | -6,546 | -6,567 | -6,599 | -6,642 | -6,697 | -6,762 | -6,838 |
| 0% | 566 | 379 | 191 | 0 | -192 | -385 | -578 |
| 2.67% | 3,168 | 3,087 | 2,991 | 2,883 | 2,764 | 2,635 | 2,499 |
| 5.33% | 3,326 | 3,324 | 3,318 | 3,309 | 3,294 | 3,272 | 3,243 |
| 8.00% | 3,327 | 3,327 | 3,327 | 3,327 | 3,326 | 3,325 | 3,323 |

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

(단위:백만원)

62,659

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2018-06-07 |
| 기준일 | 2018-06-05 |

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생)

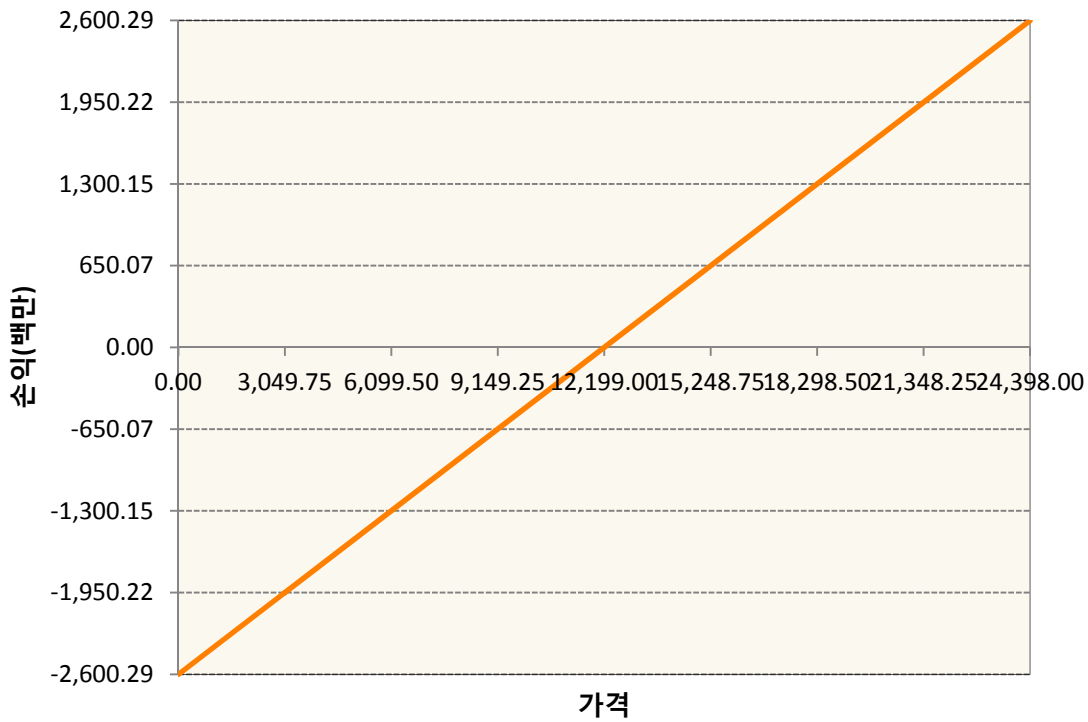
1. 계약금액

(단위:백만원)

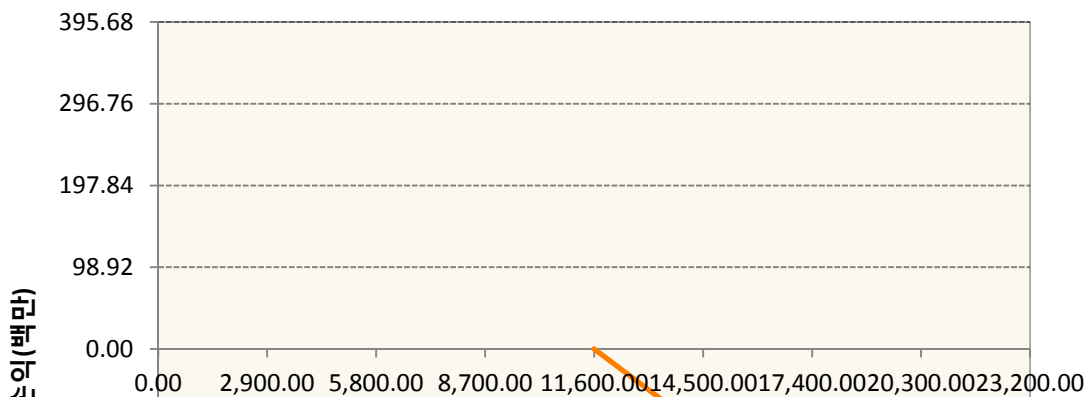
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 신규 | 유가증권 | 옵션 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 2,600 | 0 | 2,600 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션 | 0 | 6,265 | -6,265 | 장내 |

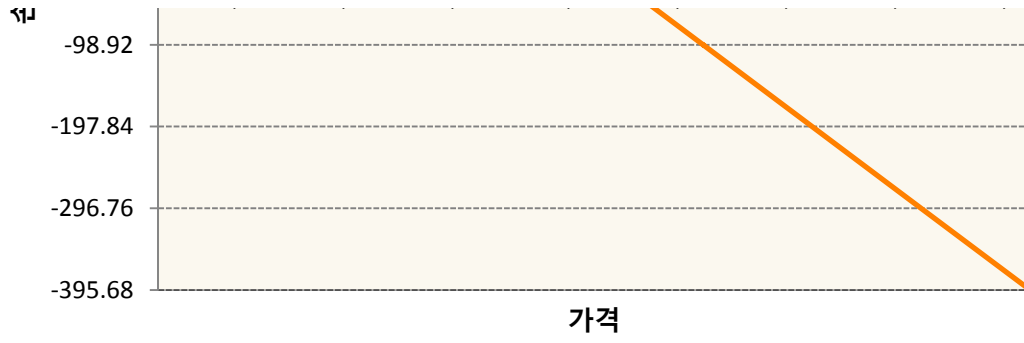
2. 만기시점의 손익구조

HCM8-HSCEI Futures Jun18

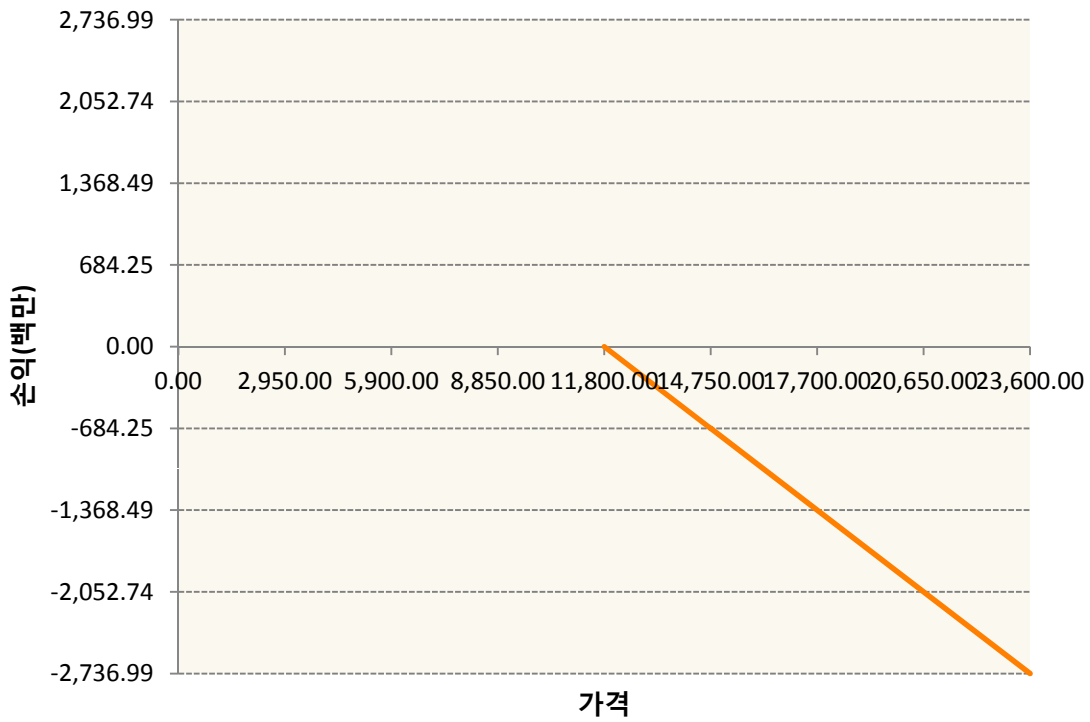


OHHIM8-C116-HSCEI

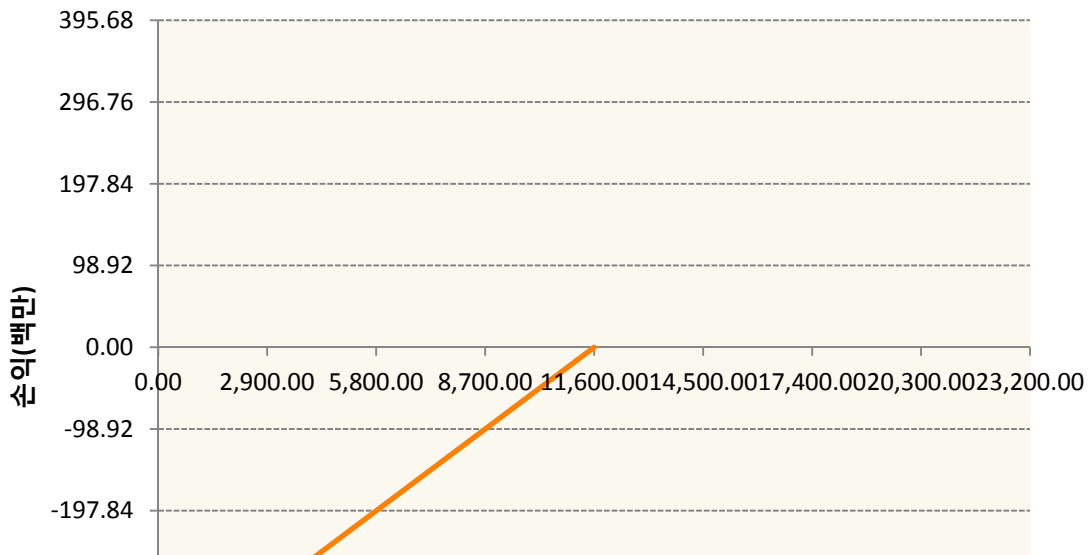


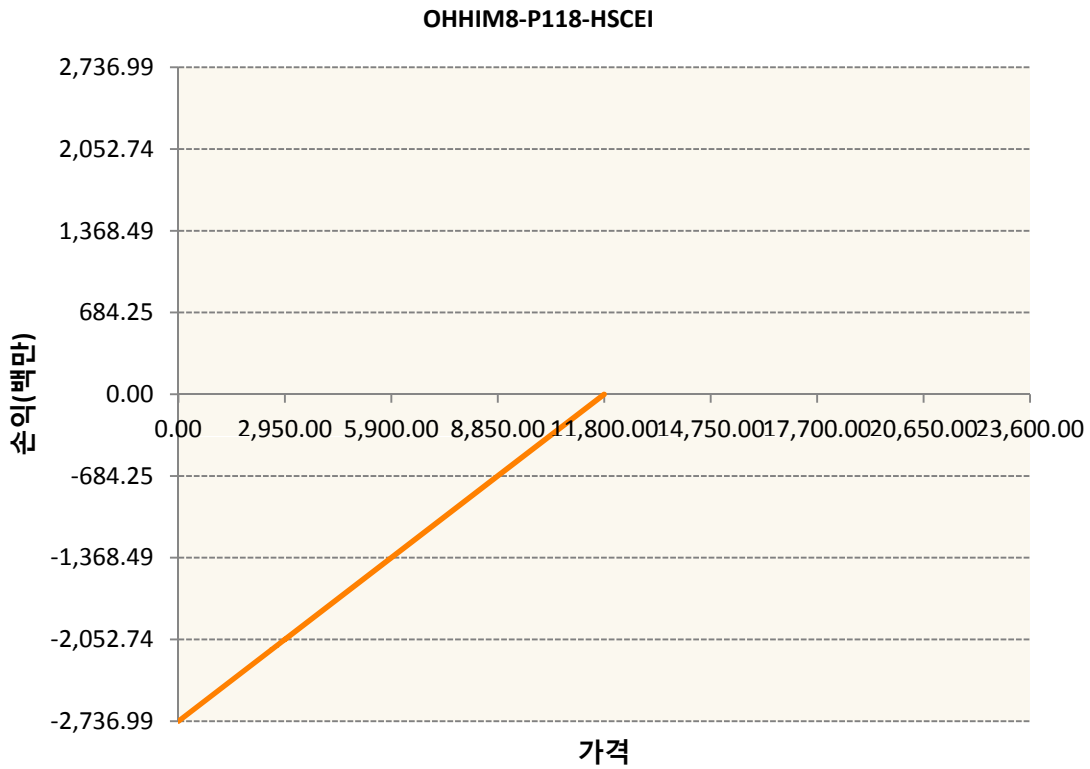
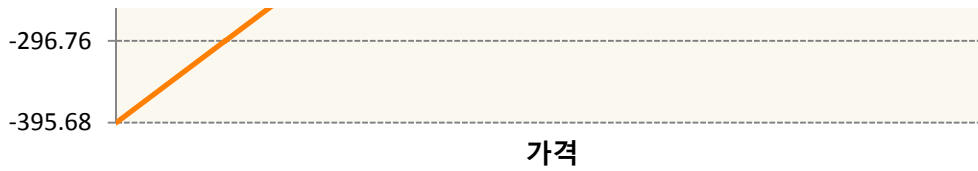


OHHIM8-C118-HSCEI



OHHIM8-P116-HSCEI





| 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) | | (단위:백만원) |
|---------------------------|---------------------|----------|
| HCM8 | HSCEI Futures Jun18 | 208 |
| OHHIM8-C1 | HSCEI | 32 |
| OHHIM8-C1 | HSCEI | 219 |
| OHHIM8-P1 | HSCEI | 32 |
| OHHIM8-P1 | HSCEI | 219 |

| 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) | (단위:백만원) |
|----------------------------------------|----------|
| | 627 |

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2018-06-07 |
| 기준일 | 2018-06-05 |

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼)

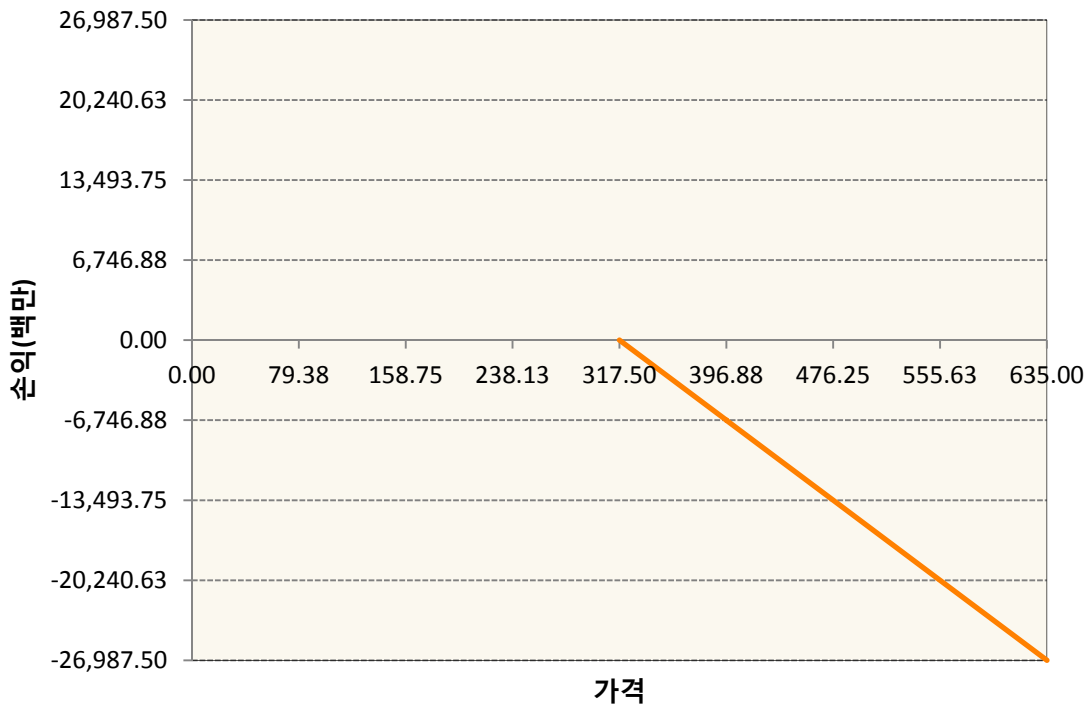
1. 계약금액

(단위:백만원)

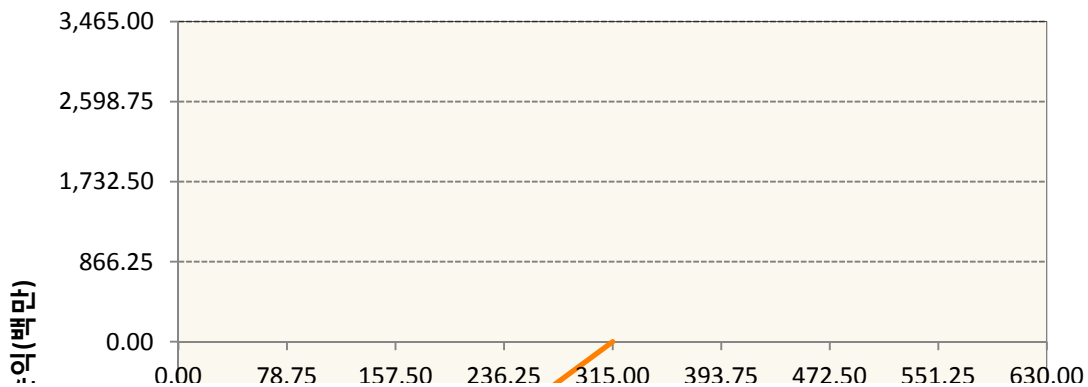
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|--------|--------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 스왑 | 0 | 0 | 0 | 장외 |
| 신규 | 유가증권 | 옵션 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 스왑 | 48,200 | 0 | 48,200 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션 | 0 | 46,804 | -46,804 | 장내 |

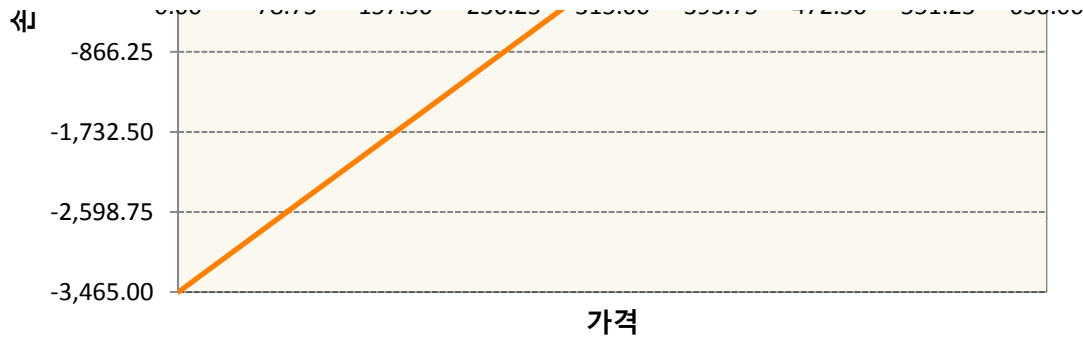
2. 만기시점의 손익구조

KR4201N63175-2018-06 콜317.5

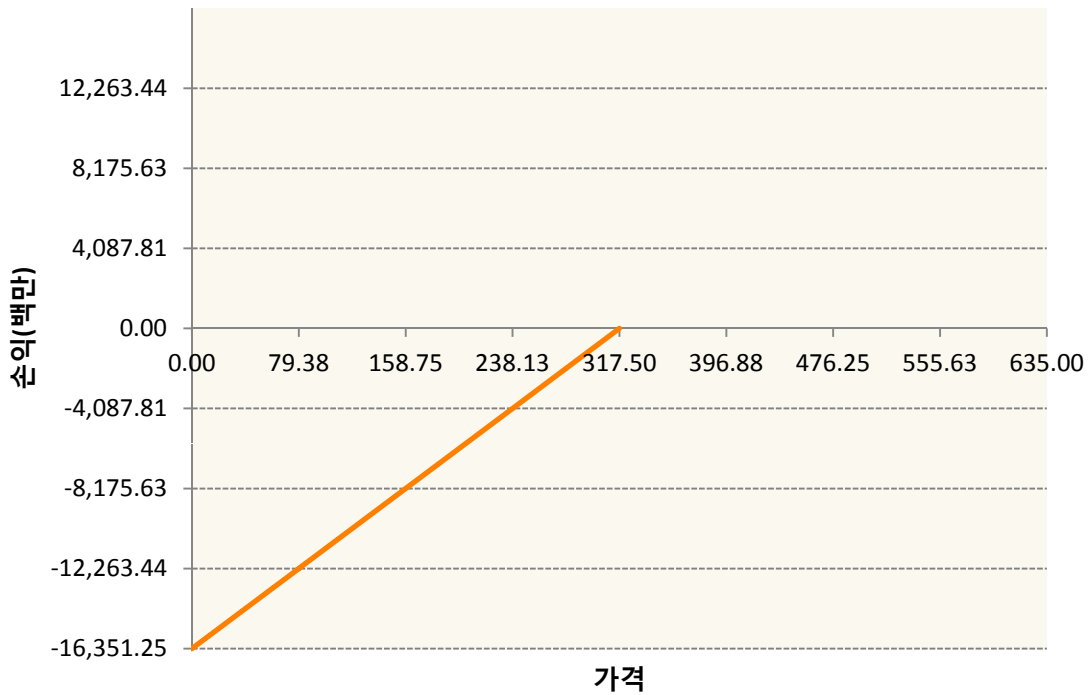


KR4301N63157-2018-06 풋315





KR4301N63173-2018-06 풋317.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4201N6312018-06 콜317.5

1,670

| 가격 | 기초자산의 변동성 | | | | | | |
|--------|-----------|---------|--------|-----|-------|--------|--------|
| | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | 394 | 393 | 390 | 387 | 381 | 374 | 365 |
| -5.33% | 384 | 376 | 366 | 352 | 337 | 319 | 300 |

| | | | | | | | |
|--------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|
| -2.67% | 323 | 299 | 272 | 244 | 215 | 184 | 153 |
| 0% | 115 | 77 | 38 | 0 | -38 | -77 | -115 |
| 2.67% | -312 | -345 | -379 | -413 | -449 | -485 | -521 |
| 5.33% | -919 | -935 | -954 | -975 | -998 | -1,023 | -1,050 |
| 8.00% | -1,608 | -1,613 | -1,619 | -1,629 | -1,640 | -1,654 | -1,670 |

KR4301N6312018-06 풋315

246

| 기초자산의 변동성 | | | | | | | |
|-----------|---------|---------|--------|------|-------|--------|--------|
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | -246 | -246 | -246 | -246 | -246 | -246 | -246 |
| -5.33% | -154 | -154 | -154 | -154 | -154 | -154 | -154 |
| -2.67% | -62 | -63 | -64 | -65 | -66 | -67 | -68 |
| 0% | 7 | 4 | 2 | 0 | -2 | -4 | -7 |
| 2.67% | 23 | 22 | 22 | 21 | 20 | 19 | 18 |
| 5.33% | 23 | 23 | 23 | 23 | 23 | 23 | 23 |
| 8.00% | 23 | 23 | 23 | 23 | 23 | 23 | 23 |

KR4301N6312018-06 풋317.5

1,213

| 기초자산의 변동성 | | | | | | | |
|-----------|---------|---------|--------|--------|--------|--------|--------|
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | -1,213 | -1,213 | -1,213 | -1,213 | -1,213 | -1,213 | -1,213 |
| -5.33% | -780 | -780 | -780 | -780 | -780 | -780 | -781 |
| -2.67% | -348 | -349 | -350 | -353 | -356 | -359 | -363 |
| 0% | 30 | 20 | 10 | 0 | -10 | -20 | -31 |
| 2.67% | 168 | 164 | 159 | 153 | 147 | 140 | 133 |
| 5.33% | 177 | 176 | 176 | 176 | 175 | 174 | 172 |
| 8.00% | 177 | 177 | 177 | 177 | 177 | 177 | 176 |

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

(단위:백만원)

7,527

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2018-06-07 |
| 기준일 | 2018-06-05 |

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

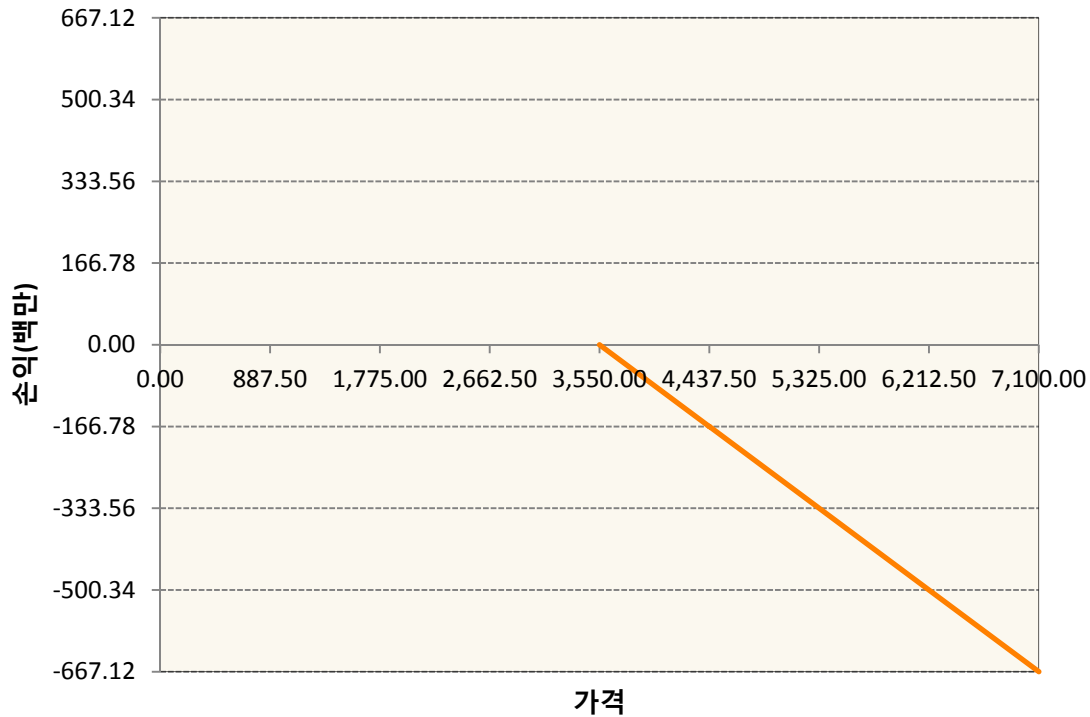
1. 계약금액

(단위:백만원)

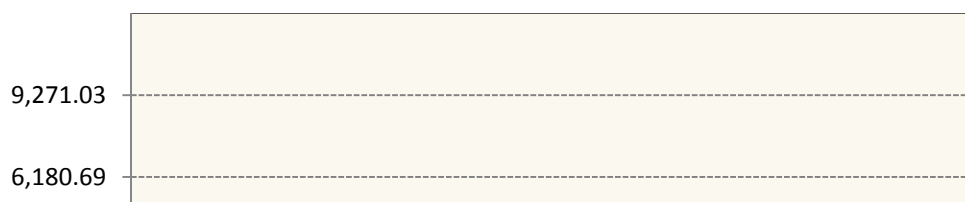
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|--------|--------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | |
| 신규 | 유가증권 | 스왑 | 0 | 0 | 0 | 장외 |
| 신규 | 유가증권 | 옵션 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 신규 | 지수 | 스왑 | 0 | 0 | 0 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 4,945 | 0 | 4,945 | |
| 누계 | 유가증권 | 스왑 | 52,818 | 0 | 52,818 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션 | 0 | 26,057 | -26,057 | 장내 |
| 누계 | 지수 | 스왑 | 50,112 | 0 | 50,112 | 장외 |

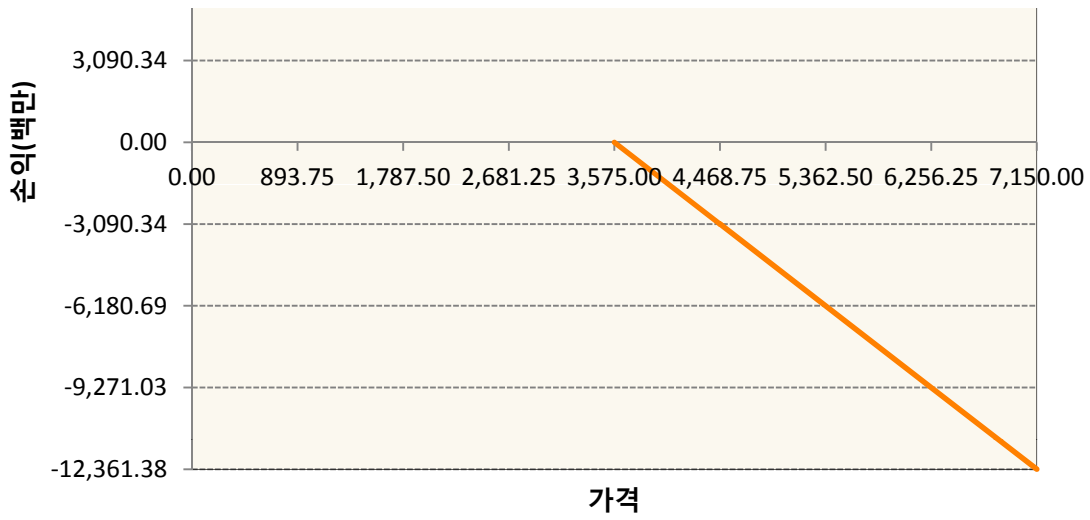
2. 만기시점의 손익구조

OESXM8-C3550-EURO STOXX 50

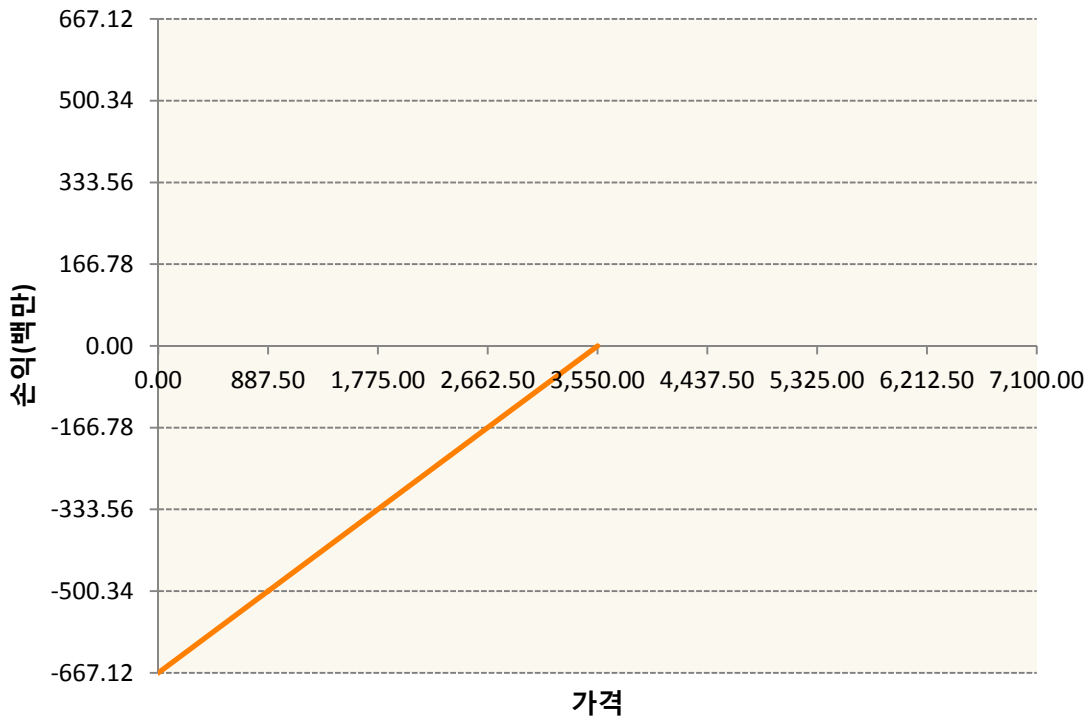


OESXM8-C3575-EURO STOXX 50

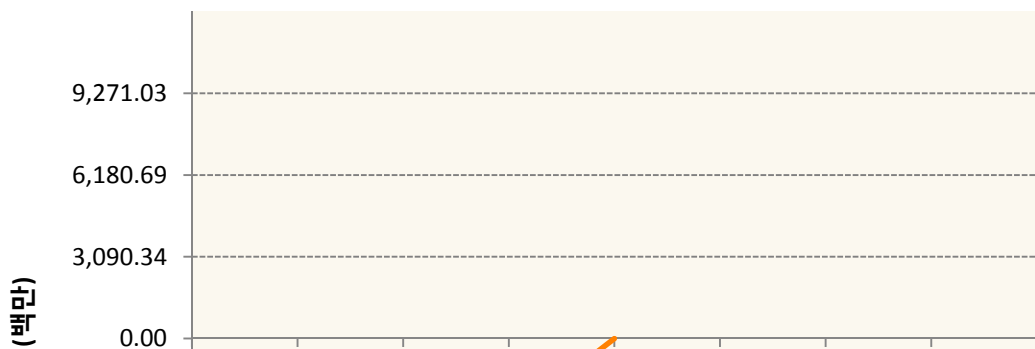


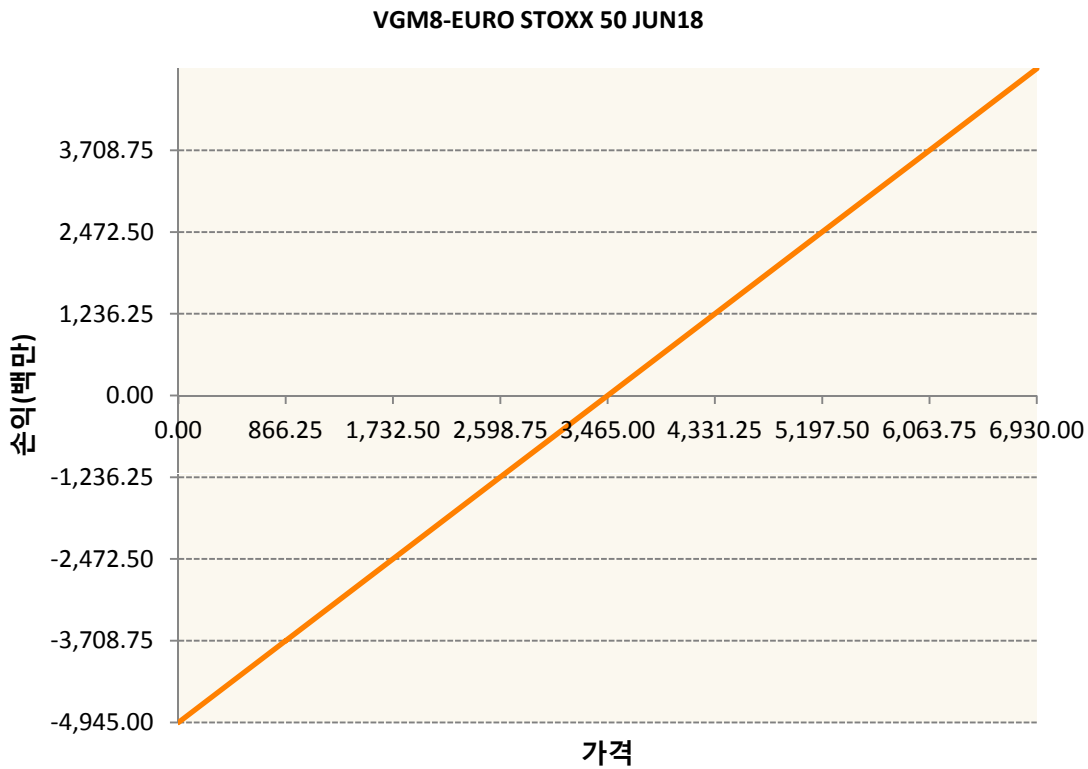
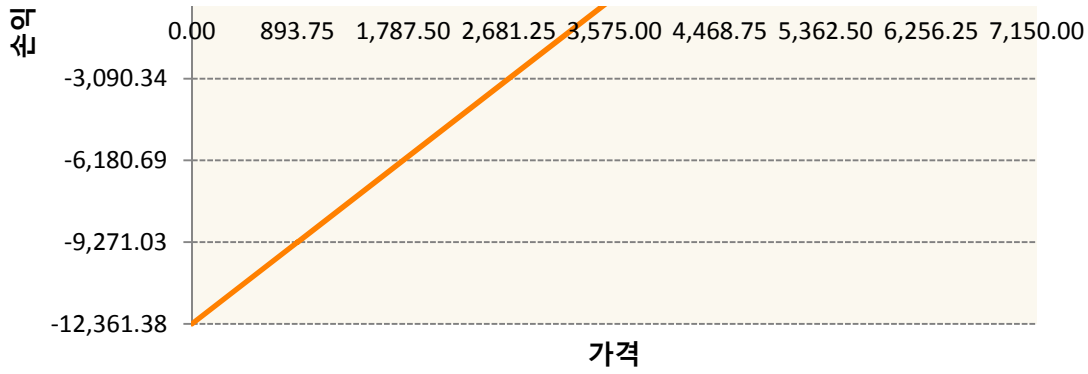


OESXM8-P3550-EURO STOXX 50



OESXM8-P3575-EURO STOXX 50





| 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) | | (단위:백만원) |
|----------------------------------------------------|--|----------|
| 260105SGPX SG EURO Covered CALL STRATEGY - 994.569 | | 6 |
| 260105SQPX SG EURO Covered CALL STRATEGY | | 6 |
| OESXM8-C3 EURO STOXX 50 | | 53 |
| OESXM8-C3 EURO STOXX 50 | | 989 |
| OESXM8-P3! EURO STOXX 50 | | 53 |
| OESXM8-P3! EURO STOXX 50 | | 989 |
| VGM8 EURO STOXX 50 JUN18 | | 396 |

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

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

(단위:백만원)

1,182

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

(단위:백만원)

60

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

(단위:백만원)

97

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

(단위:백만원)

222

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2018-06-07 |
| 기준일 | 2018-06-05 |

스마트KRX300인덱스목표전환형1

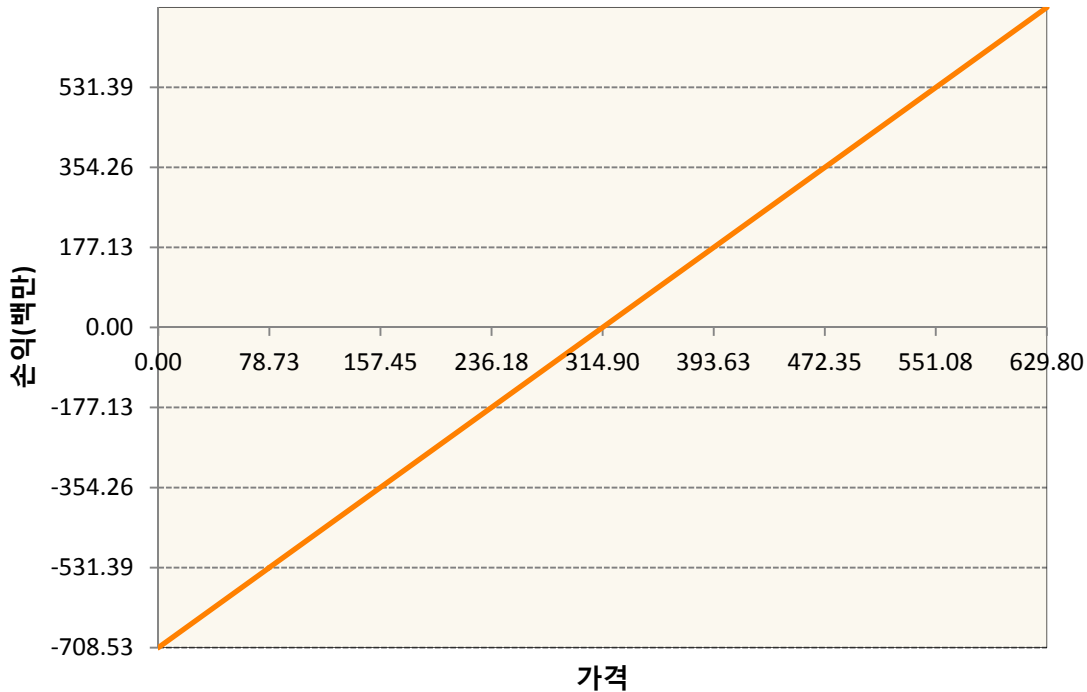
1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 709 | 0 | 709 | 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)

41

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2018-06-07 |
| 기준일 | 2018-06-05 |

리디파인K200(주식혼합-파생재간

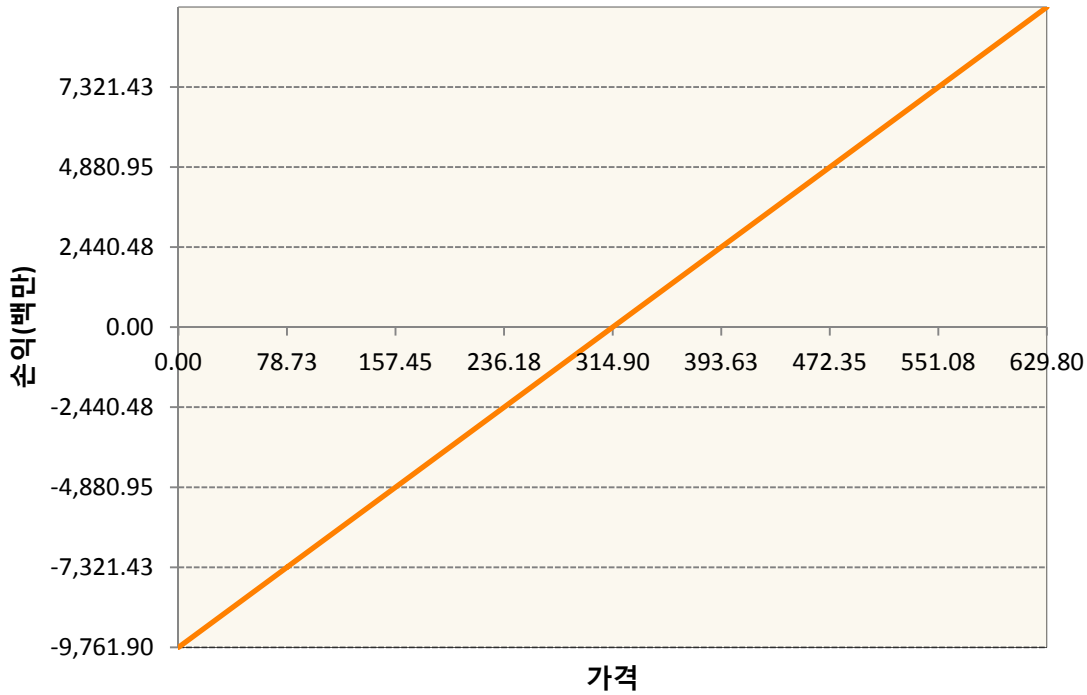
1. 계약금액

(단위:백만원)

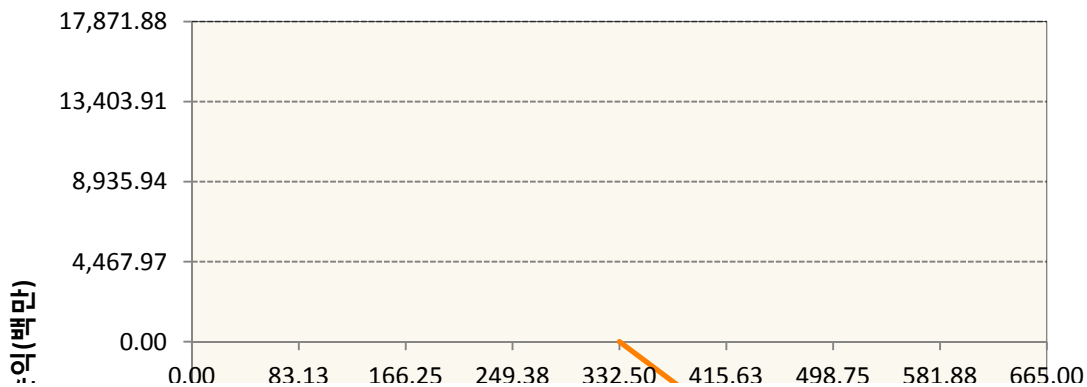
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|--------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 신규 | 유가증권 | 옵션 | 0 | 83 | -83 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 9,762 | 0 | 9,762 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션 | 1,905 | 17,872 | -15,967 | 장내 |

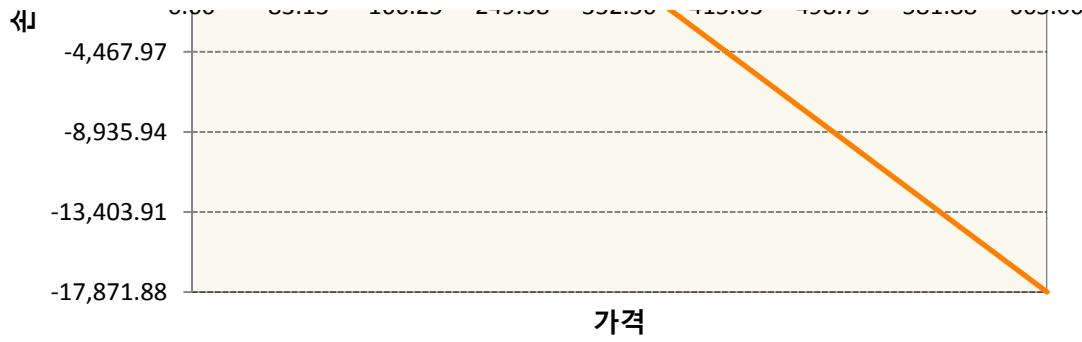
2. 만기시점의 손익구조

KR4101N60009-2018-06 코스피200지수선물

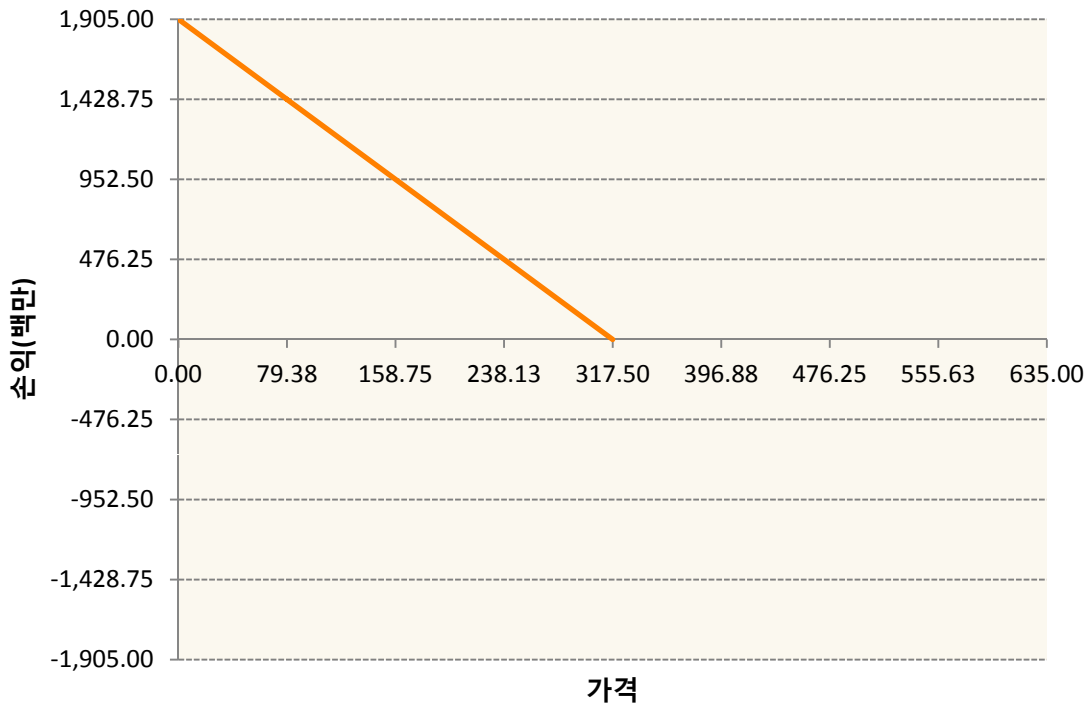


KR4201N63324-2018-06 콜332.5





KR4301N63173-2018-06 풋317.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

| | | | | | | | |
|-------------------------------|-----------|---------|--------|------|-------|--------|--------|
| KR4101N60C 2018-06 코스피200지수선물 | | | | | | | 783 |
| | 기초자산의 변동성 | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | -783 | -783 | -783 | -783 | -783 | -783 | -783 |
| -5.33% | -522 | -522 | -522 | -522 | -522 | -522 | -522 |
| -2.67% | -261 | -261 | -261 | -261 | -261 | -261 | -261 |
| 0% | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 2.67% | 261 | 261 | 261 | 261 | 261 | 261 | 261 |
| 5.33% | 522 | 522 | 522 | 522 | 522 | 522 | 522 |
| 8.00% | 783 | 783 | 783 | 783 | 783 | 783 | 783 |
| KR4201N63E 2018-06 콜332.5 | | | | | | | 619 |
| | 기초자산의 변동성 | | | | | | |

| | | | | | | | |
|--------|---------|---------|--------|------|-------|--------|--------|
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | 43 | 43 | 43 | 43 | 43 | 42 | 41 |
| -5.33% | 43 | 43 | 42 | 41 | 40 | 38 | 34 |
| -2.67% | 42 | 40 | 37 | 33 | 27 | 21 | 13 |
| 0% | 30 | 21 | 12 | 0 | -13 | -27 | -43 |
| 2.67% | -28 | -48 | -68 | -89 | -111 | -133 | -156 |
| 5.33% | -191 | -217 | -243 | -269 | -294 | -320 | -346 |
| 8.00% | -488 | -508 | -529 | -550 | -573 | -595 | -619 |

KR4301N6312018-06 풋317.5

141

| 기초자산의 변동성 | | | | | | | |
|-----------|---------|---------|--------|-----|-------|--------|--------|
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | 141 | 141 | 141 | 141 | 141 | 141 | 141 |
| -5.33% | 91 | 91 | 91 | 91 | 91 | 91 | 91 |
| -2.67% | 40 | 41 | 41 | 41 | 41 | 42 | 42 |
| 0% | -4 | -2 | -1 | 0 | 1 | 2 | 4 |
| 2.67% | -20 | -19 | -19 | -18 | -17 | -16 | -15 |
| 5.33% | -21 | -21 | -21 | -20 | -20 | -20 | -20 |
| 8.00% | -21 | -21 | -21 | -21 | -21 | -21 | -21 |

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

(단위:백만원)

1,100

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2018-06-07 |
| 기준일 | 2018-06-05 |

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

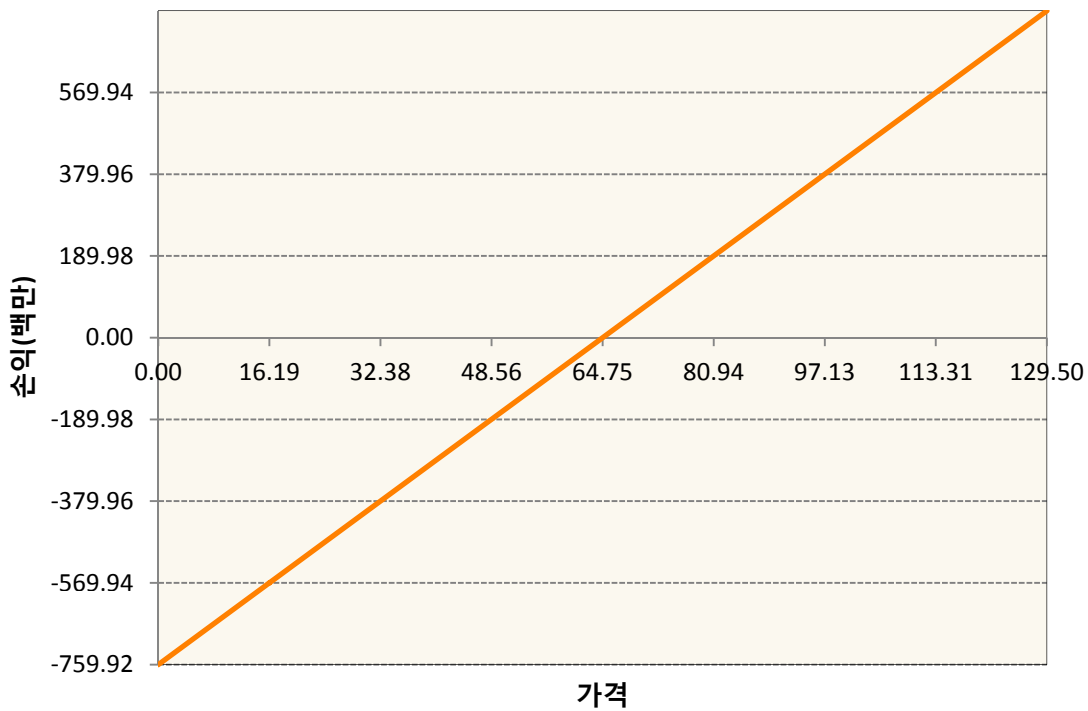
1. 계약금액

(단위:백만원)

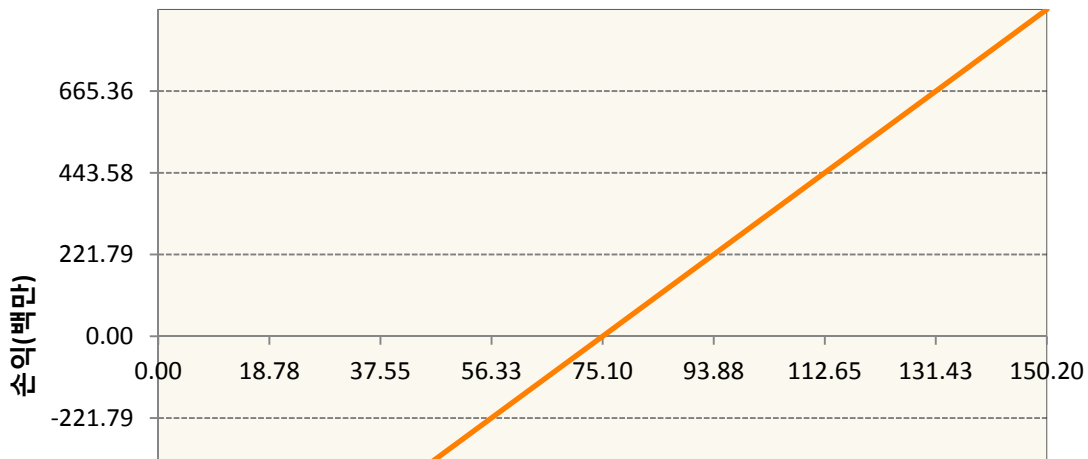
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 3,795 | 589 | 3,206 | |

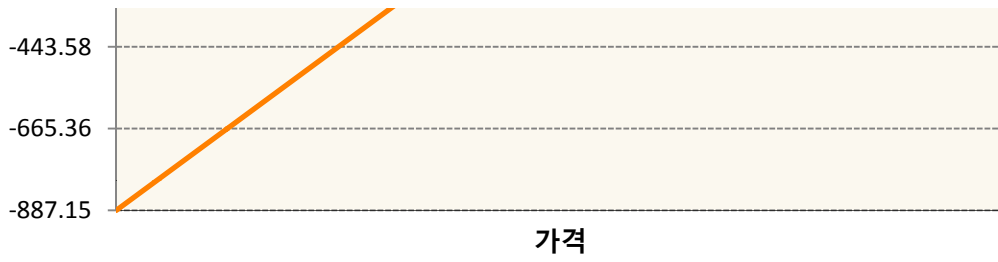
2. 만기시점의 손익구조

CLN8-WTI CRUDE FUTURE JUL18

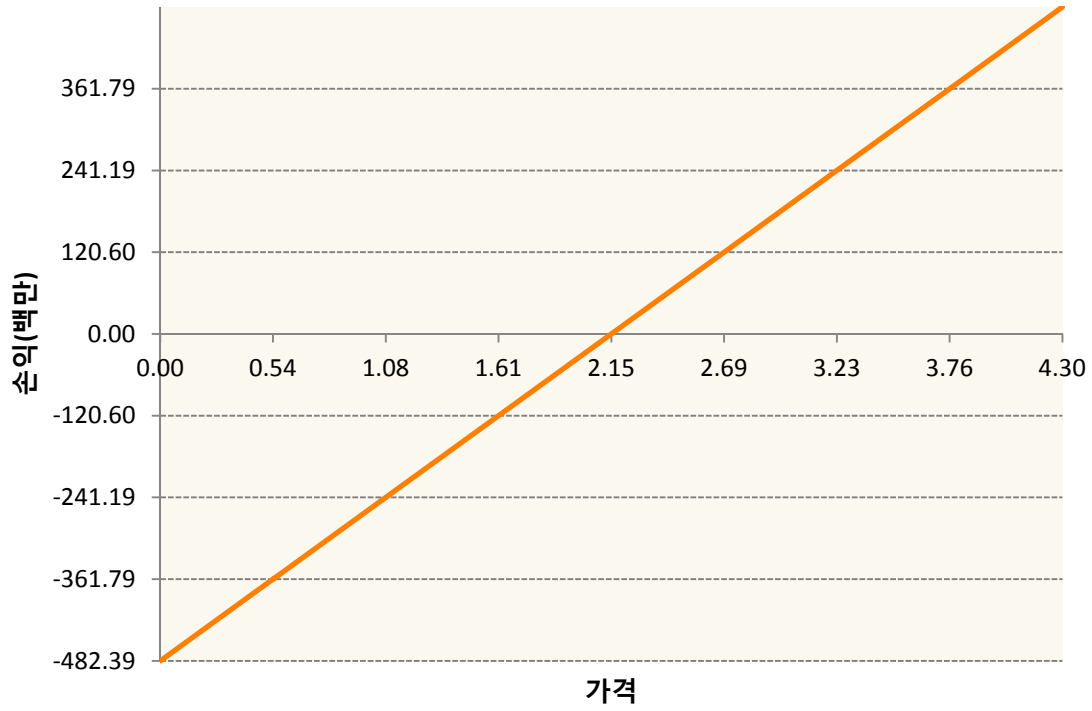


COU8-BRENT CRUDE FUTR SEP18

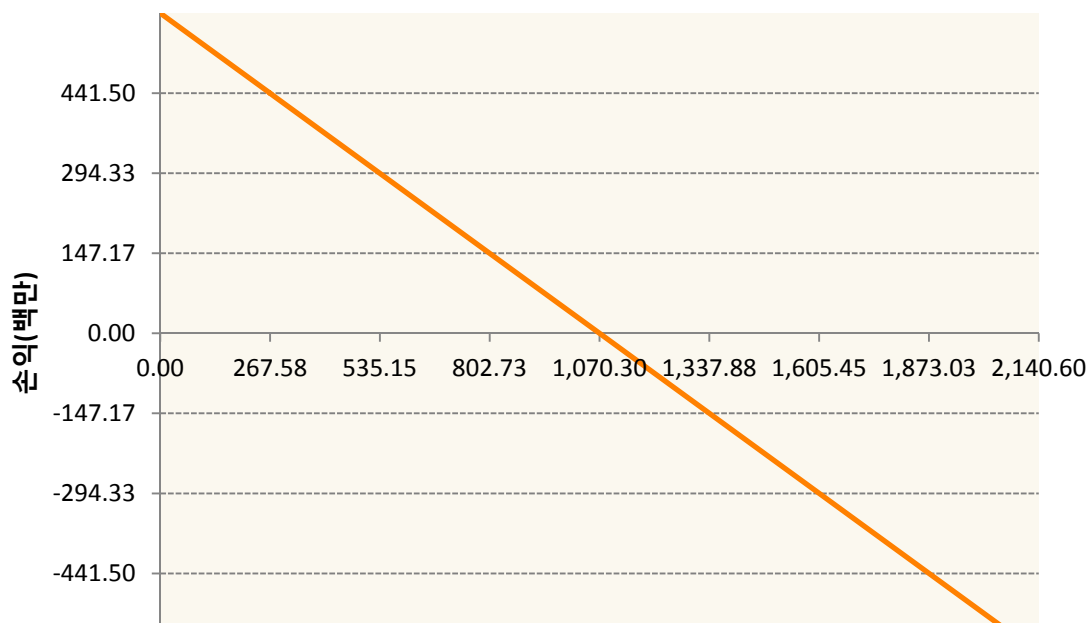


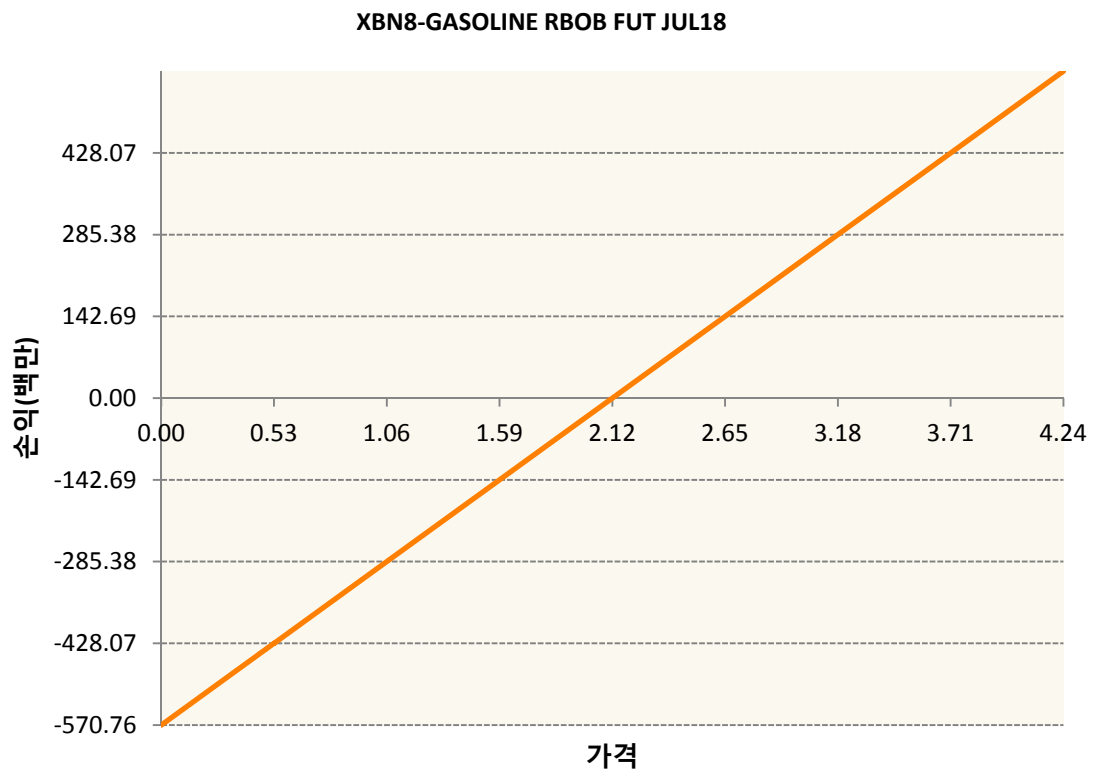
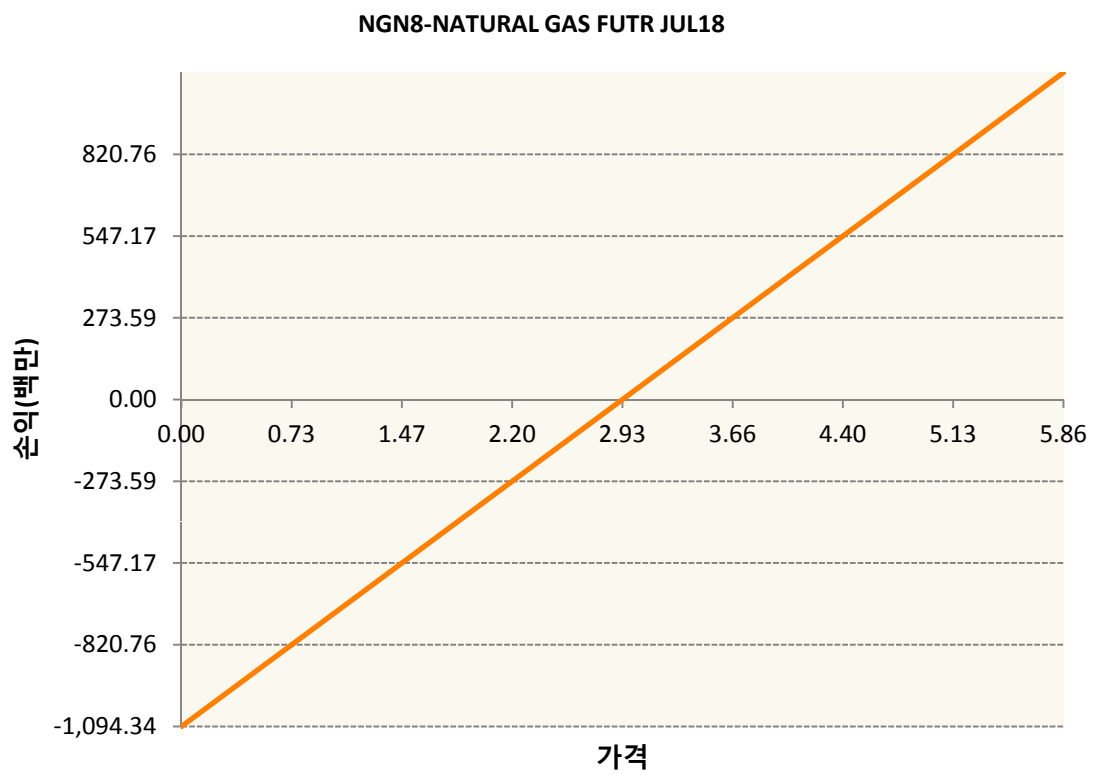
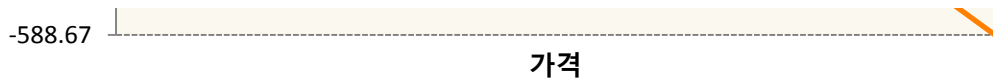


HON8-NY Harb ULSD Fut JUL18



KR4175N60003-2018-06 달러선물





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

| | | |
|------------|-------------------------|----|
| CLN8 | WTI CRUDE FUTURE JUL18 | 61 |
| COU8 | BRENT CRUDE FUTR SEP18 | 71 |
| HON8 | NY Harb ULSD Fut JUL18 | 39 |
| KR4175N60C | 2018-06 달러선물 | 47 |
| NGN8 | NATURAL GAS FUTR JUL18 | 88 |
| XBN8 | GASOLINE RBOB FUT JUL18 | 46 |

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

458

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2018-06-07 |
| 기준일 | 2018-06-05 |

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

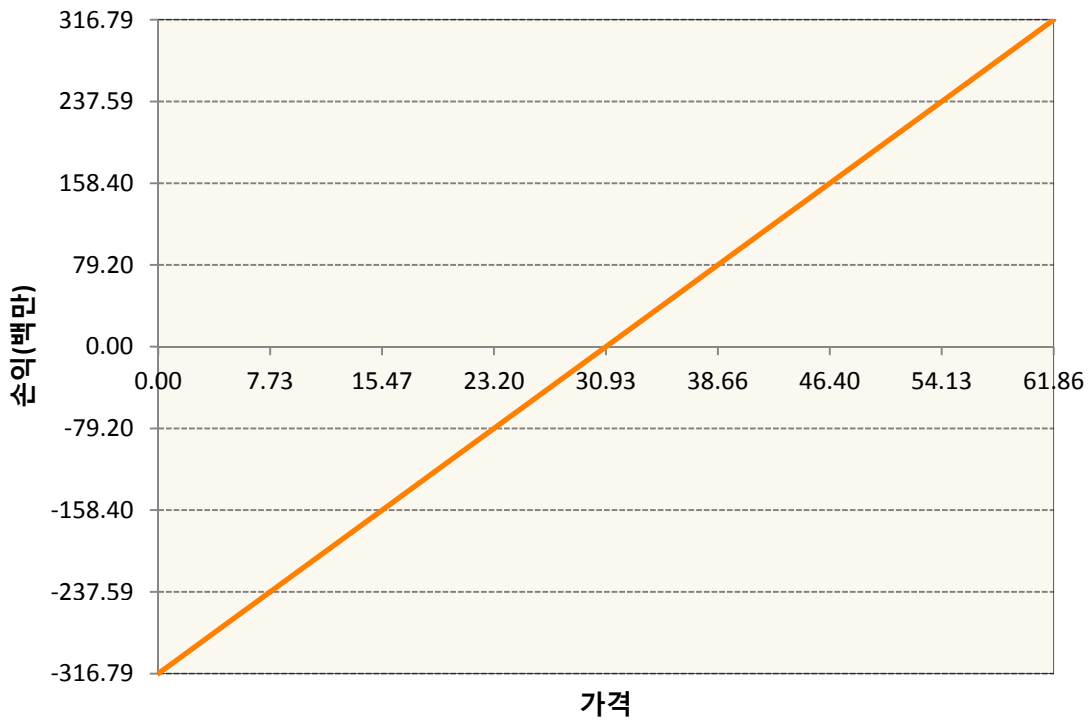
1. 계약금액

(단위:백만원)

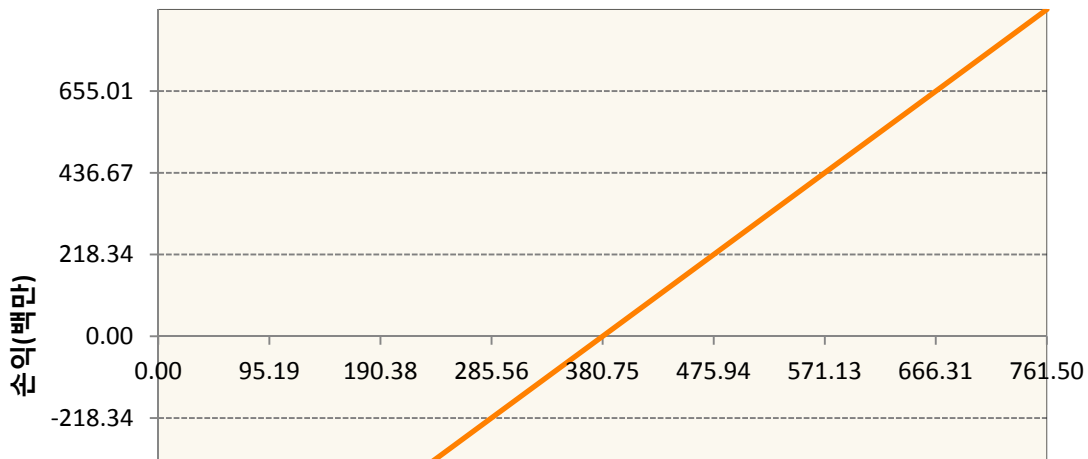
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 4,032 | 321 | 3,711 | |

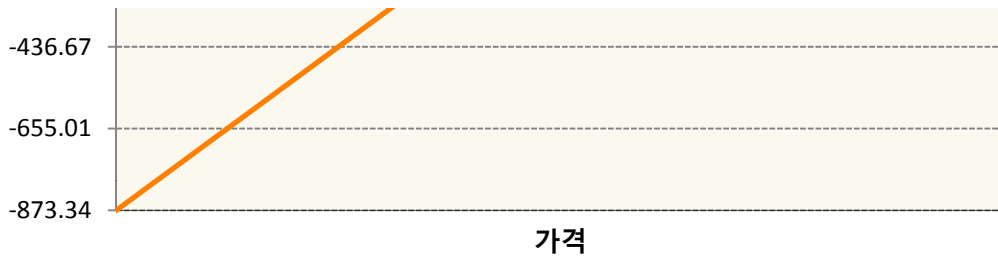
2. 만기시점의 손익구조

BON8-SOYBEAN OIL FUTR JUL18

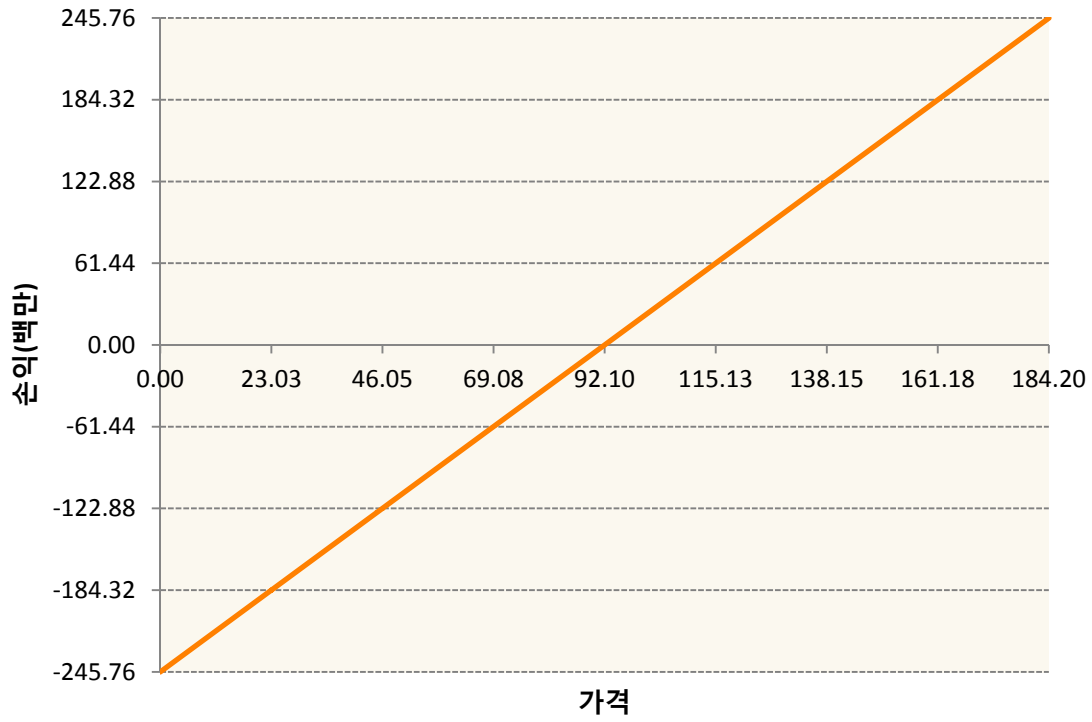


CN8-CORN FUTURE JUL18

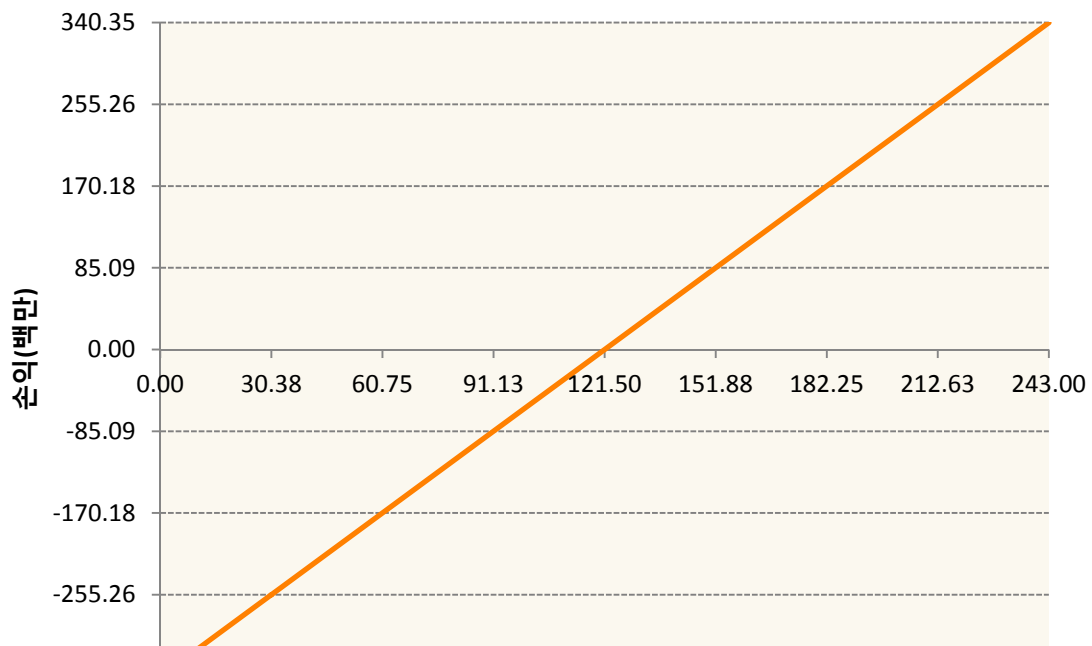


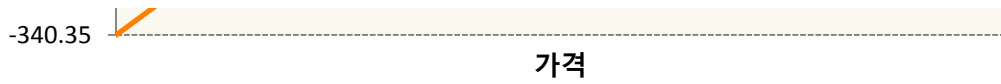


CTN8-COTTON NO.2 FUTR JUL18

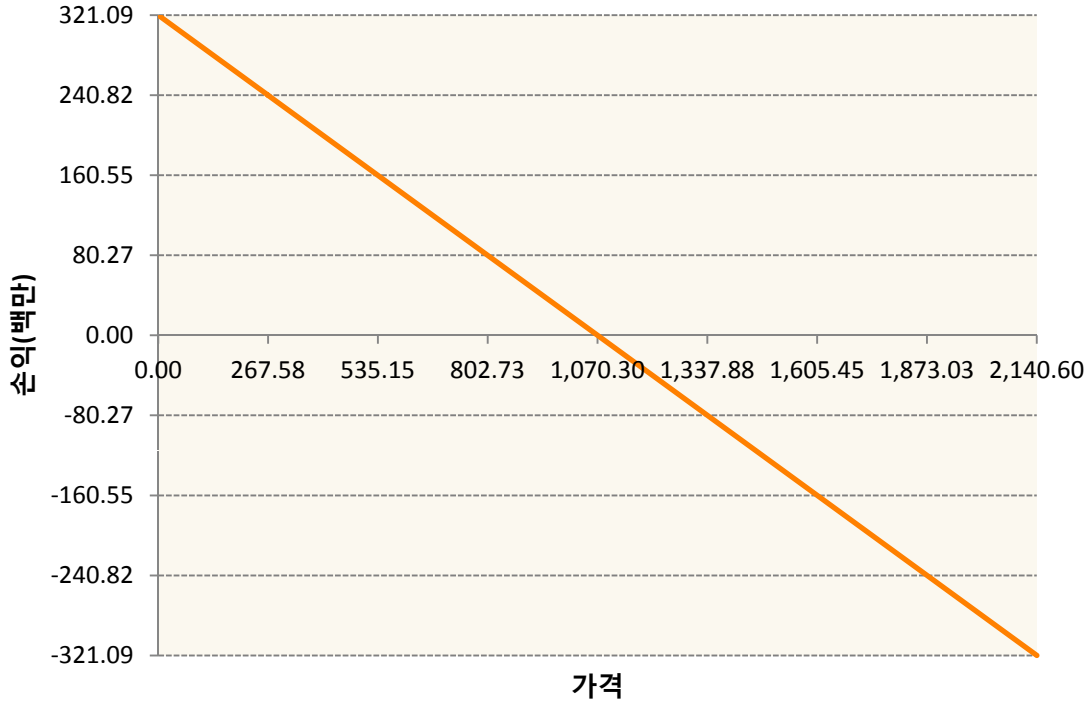


KCN8-COFFEE 'C' FUTURE JUL18

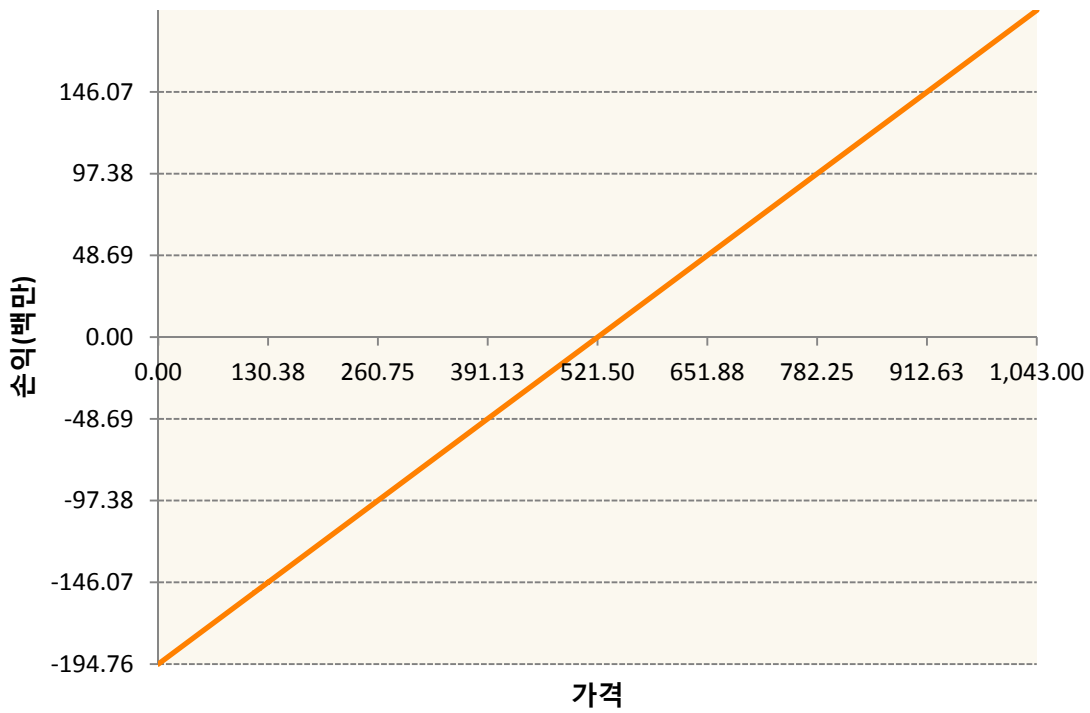




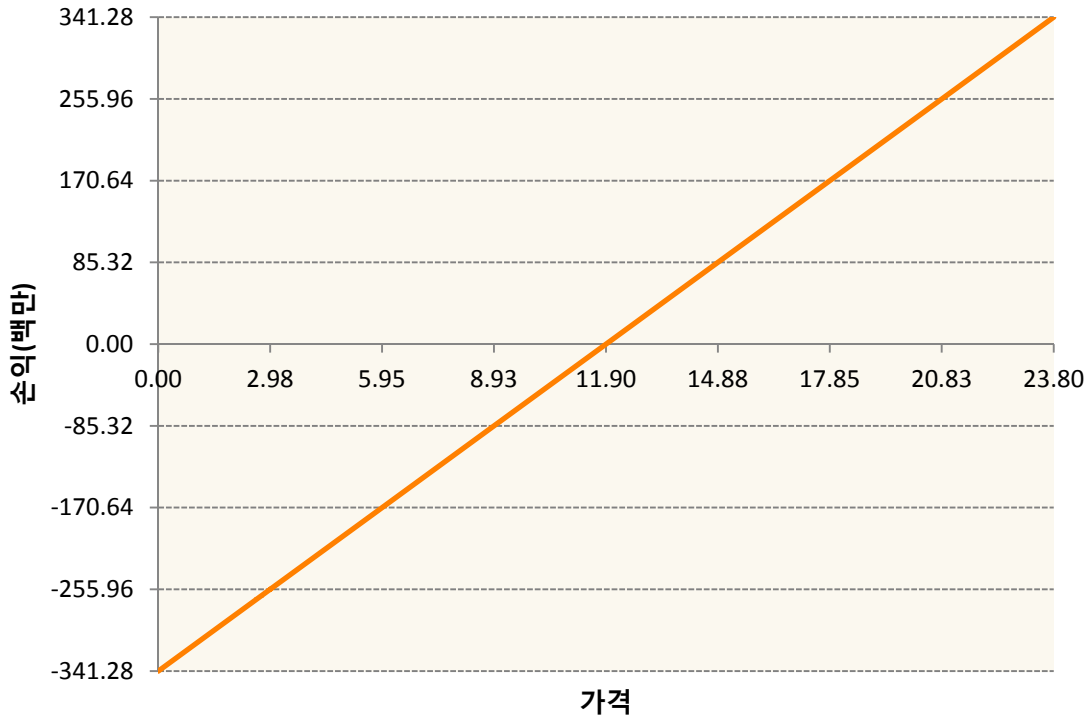
KR4175N60003-2018-06 달러선물



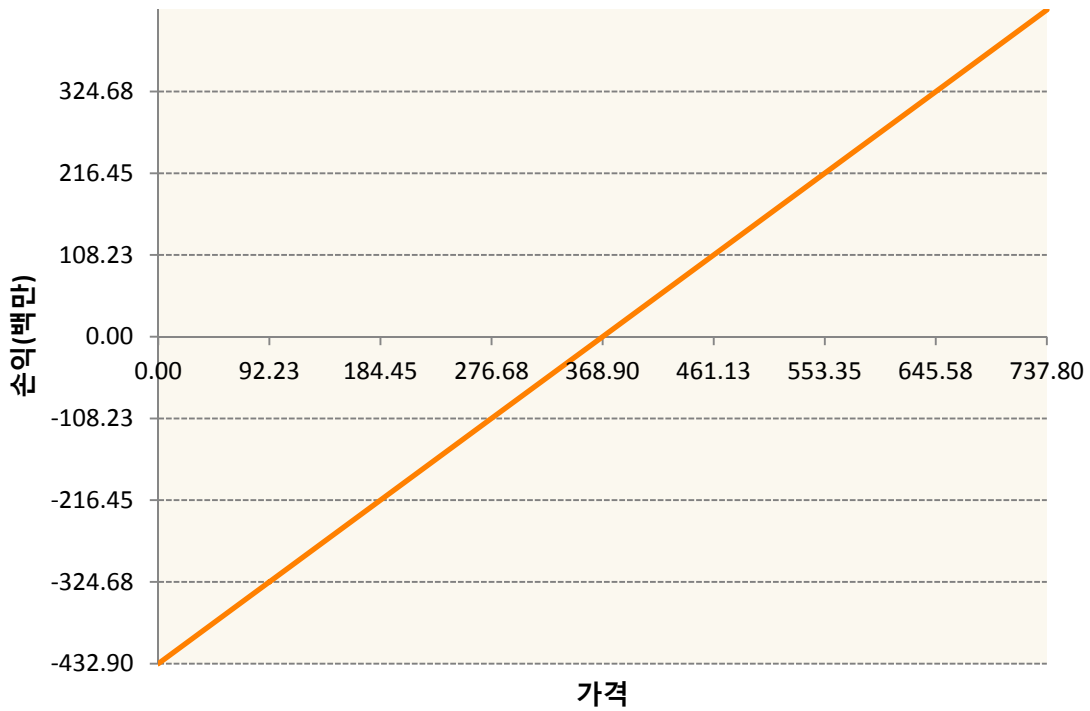
KWN8-KC HRW WHEAT FUT JUL18



SBN8-SUGAR #11 (WORLD) JUL18

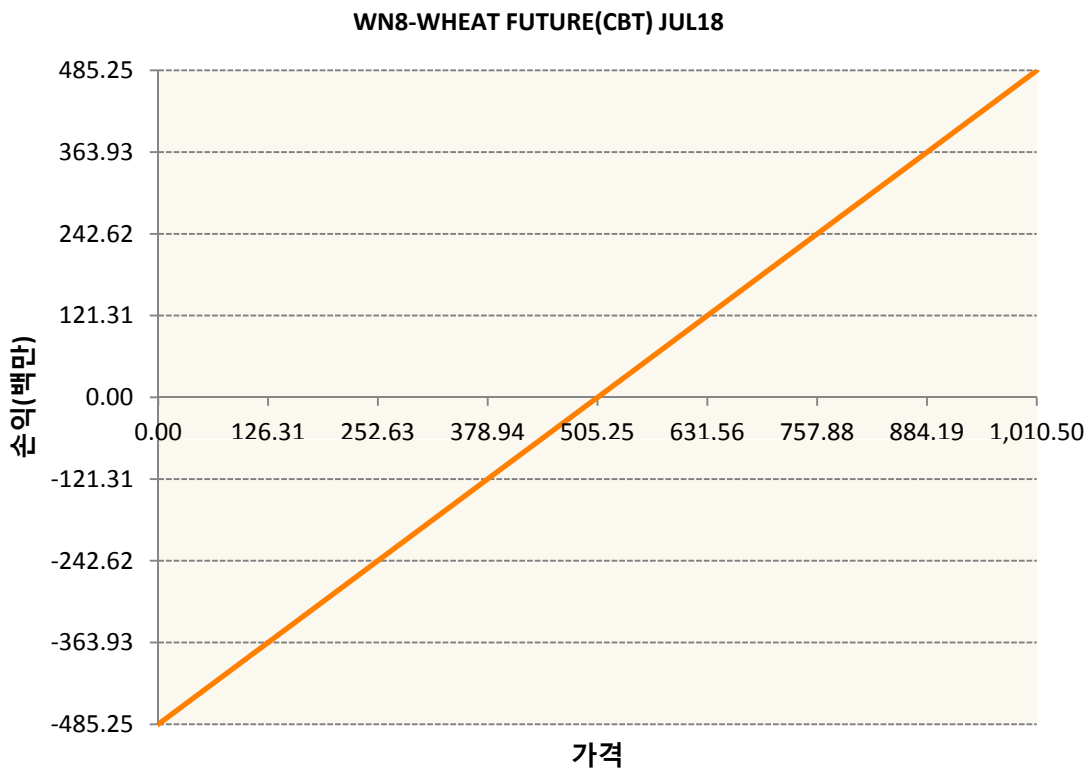
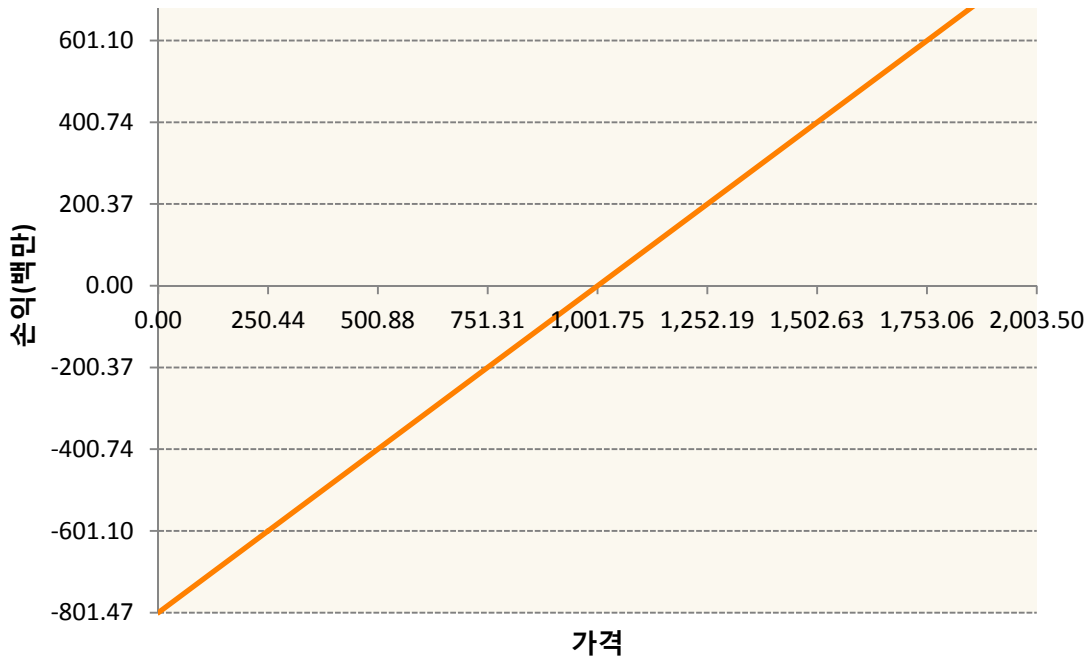


SMN8-SOYBEAN MEAL FUTR JUL18



SN8-SOYBEAN FUTURE JUL18





| 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) | | (단위:백만원) |
|---------------------------|-------------------------|----------|
| BON8 | SOYBEAN OIL FUTR JUL18 | 25 |
| CN8 | CORN FUTURE JUL18 | 70 |
| CTN8 | COTTON NO.2 FUTR JUL18 | 20 |
| KCN8 | COFFEE 'C' FUTURE JUL18 | 27 |
| KR4175N60C 2018-06 달러선물 | | 26 |

| | | |
|------|-------------------------|----|
| KWN8 | KC HRW WHEAT FUT JUL18 | 16 |
| SBN8 | SUGAR #11 (WORLD) JUL18 | 27 |
| SMN8 | SOYBEAN MEAL FUTR JUL18 | 35 |
| SN8 | SOYBEAN FUTURE JUL18 | 64 |
| WN8 | WHEAT FUTURE(CBT) JUL18 | 39 |

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

(단위:백만원)

328