공시일	2018-03-30
기준일	2018-03-29

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

공시일	2018-03-30
기준일	2018-03-29

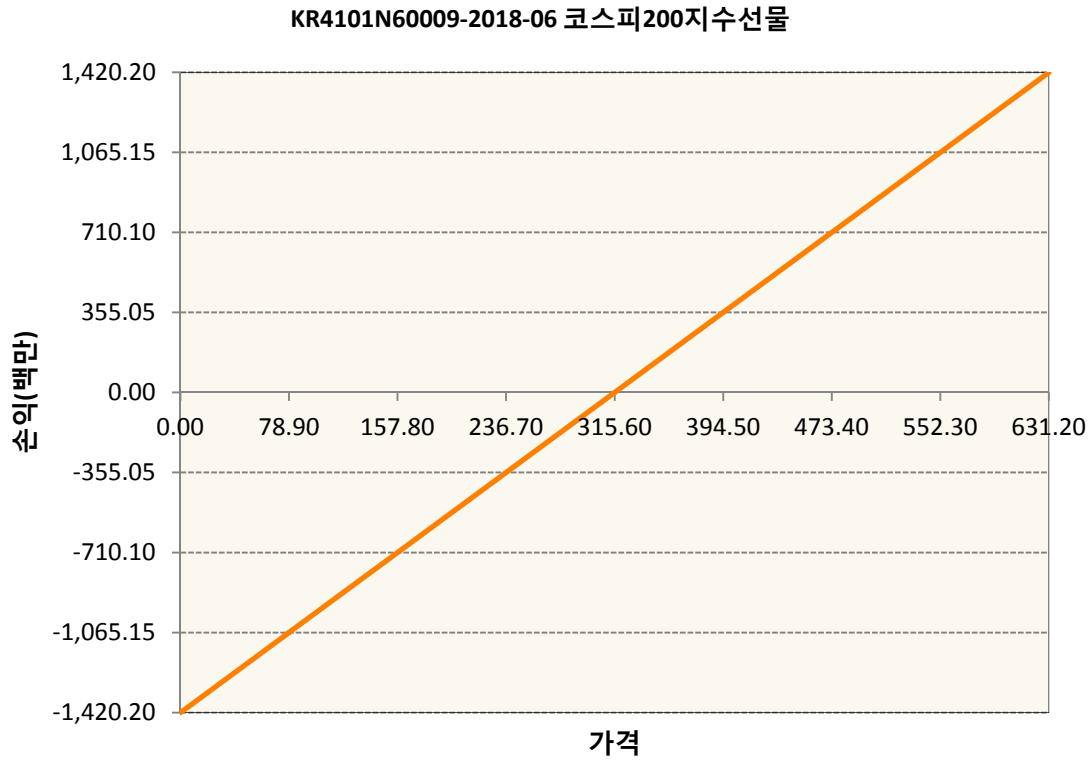
스마트인덱스모

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	1,420	0	1,420	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101N60(2018-06 코스피200지수선물							113
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-113	-113	-113	-113	-113	-113	-113
-5.33%	-75	-75	-75	-75	-75	-75	-75
-2.67%	-38	-38	-38	-38	-38	-38	-38
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	38	38	38	38	38	38	38
5.33%	75	75	75	75	75	75	75
8.00%	113	113	113	113	113	113	113

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

81

공시일	2018-03-30
기준일	2018-03-29

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	1,077

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

423

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2018-03-30
기준일	2018-03-29

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	406

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

436

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2018-03-30
기준일	2018-03-29

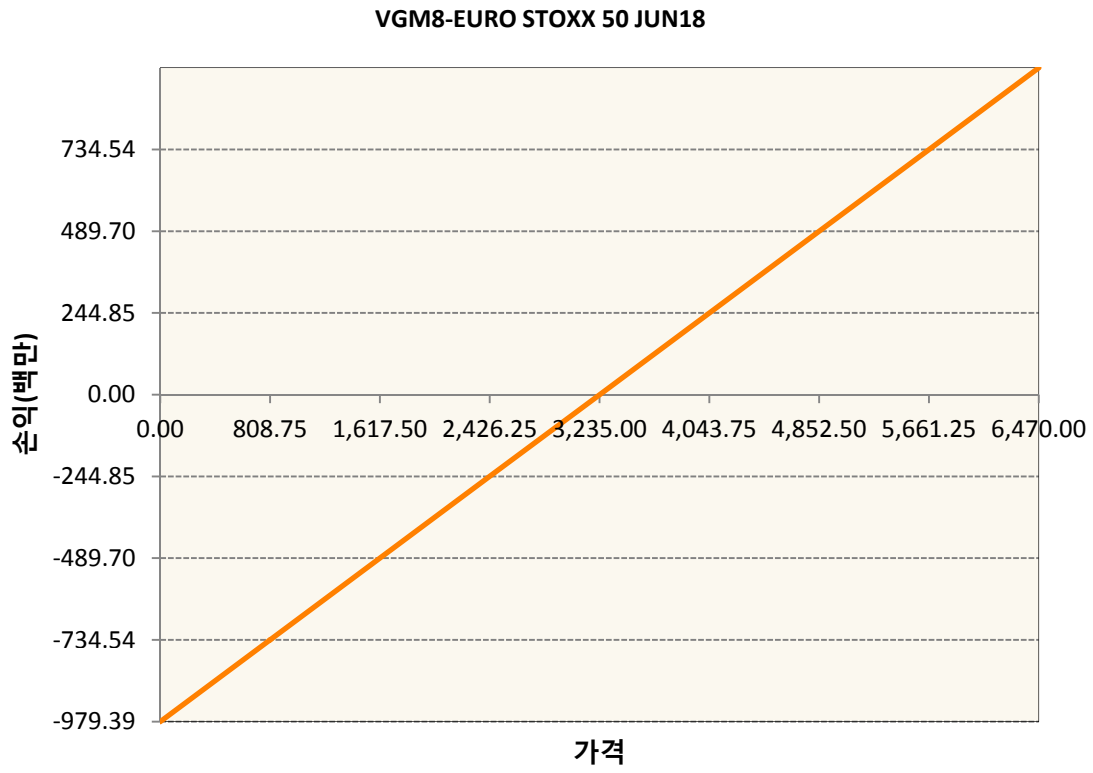
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	979	0	979	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGM8	EURO STOXX 50 JUN18	78

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

(단위:백만원)

47

공시일	2018-03-30
기준일	2018-03-29

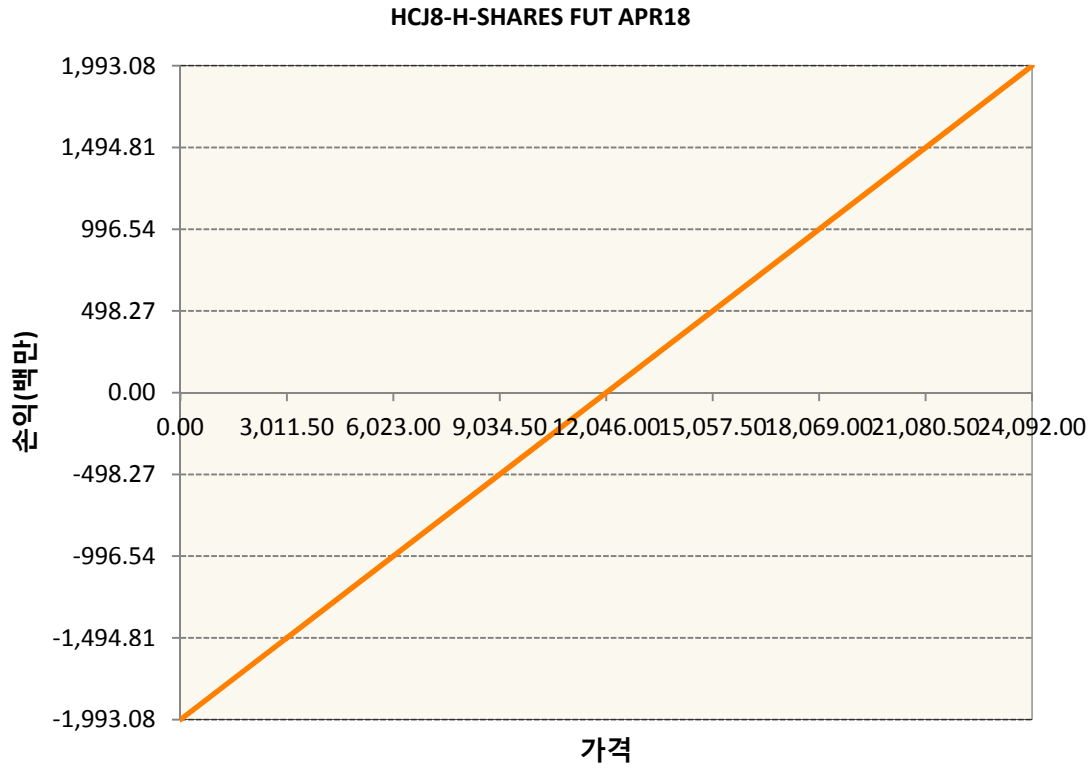
차이나인덱스모(주식-파생형)

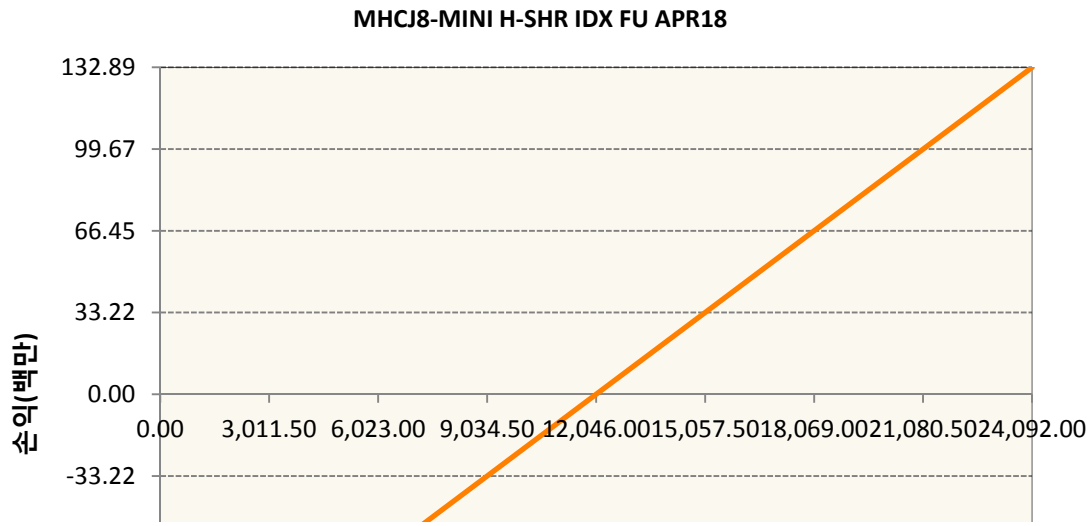
1. 계약금액

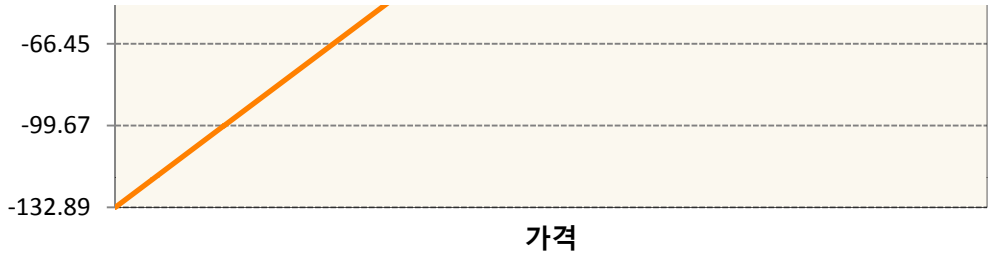
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,126	0	2,126	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCJ8	H-SHARES FUT APR18	159
MHCJ8	MINI H-SHR IDX FU APR18	11

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	149

공시일	2018-03-30
기준일	2018-03-29

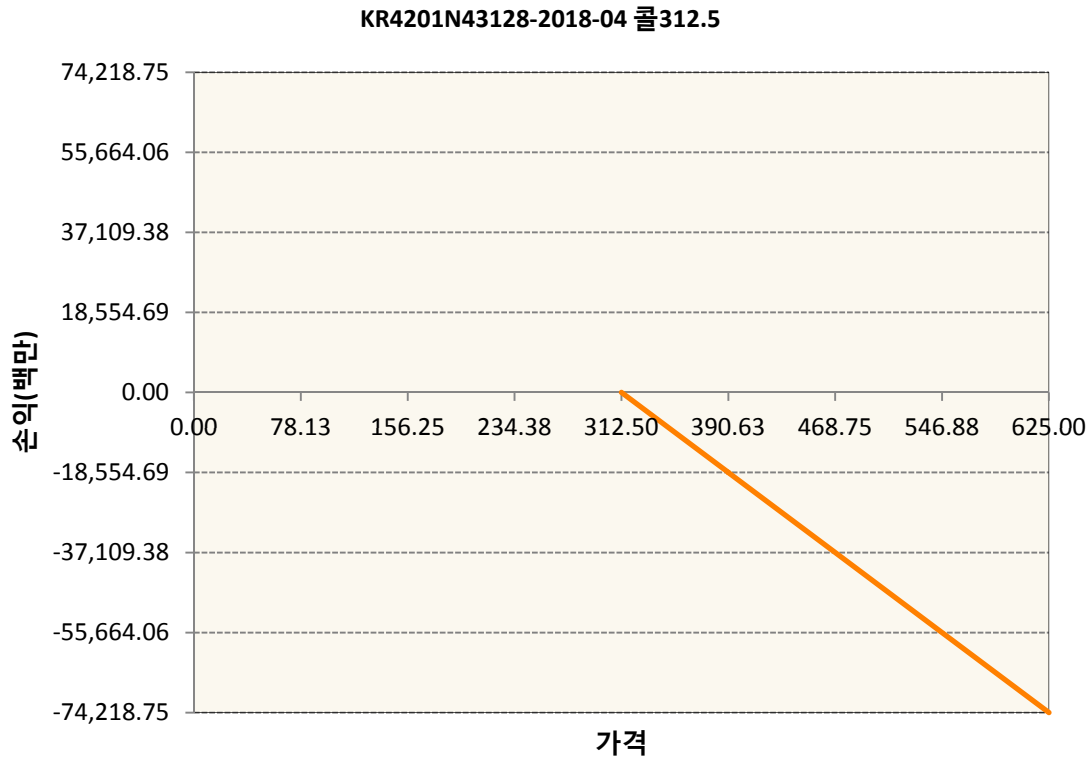
커버드콜모(주식혼합-파생형)

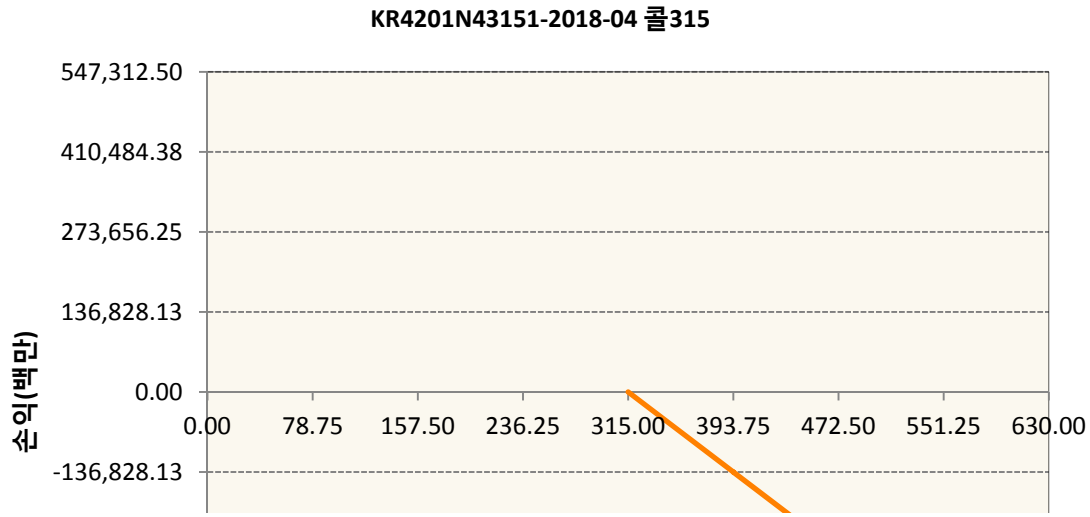
1. 계약금액

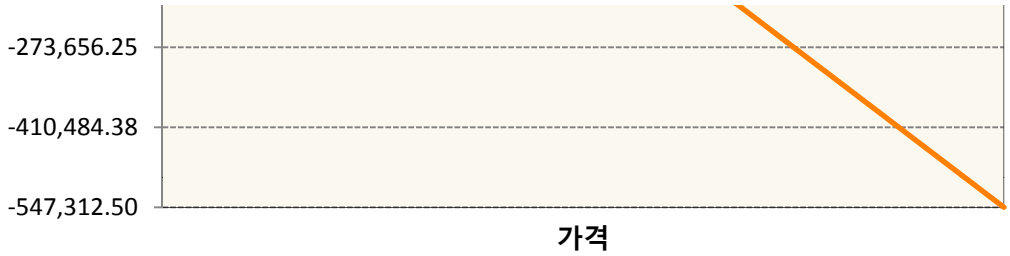
(단위:백만원)

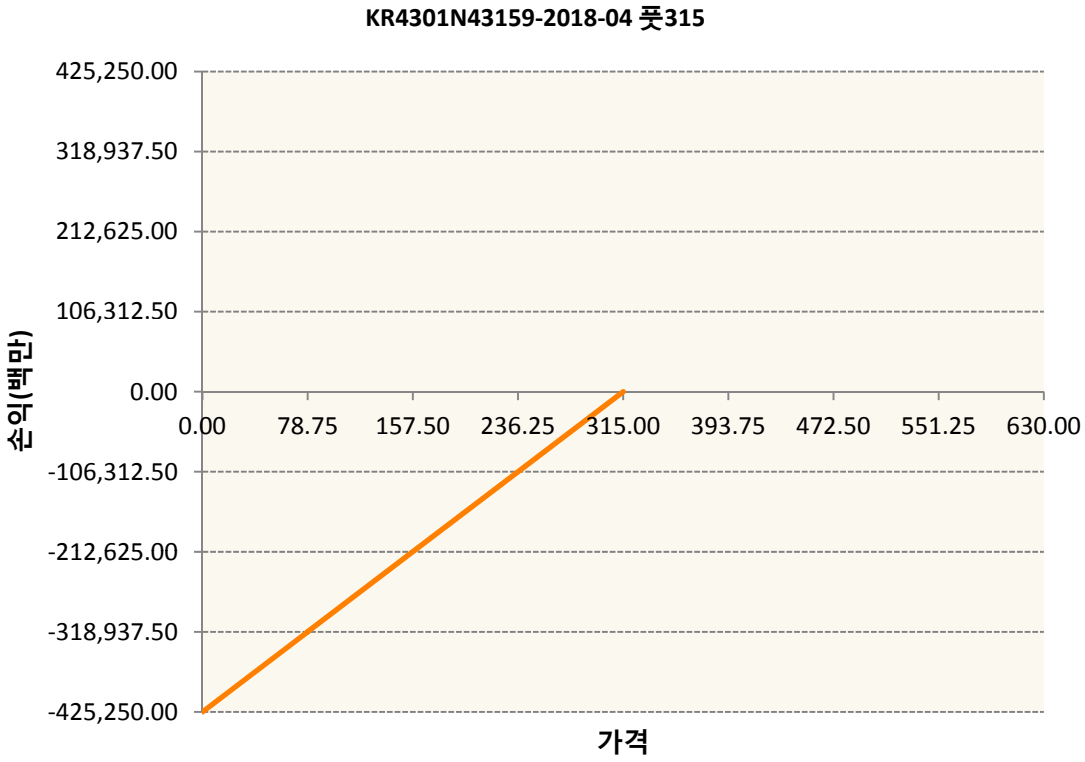
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	1,046,781	-1,046,781	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201N4312018-04 콜312.5							4,774
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,808	1,779	1,742	1,695	1,640	1,578	1,509
-5.33%	1,668	1,596	1,515	1,426	1,332	1,232	1,129
-2.67%	1,261	1,140	1,015	889	760	631	500
0%	419	279	140	0	-140	-279	-419
2.67%	-902	-1,014	-1,132	-1,253	-1,377	-1,503	-1,632
5.33%	-2,586	-2,652	-2,727	-2,811	-2,903	-3,000	-3,103
8.00%	-4,467	-4,495	-4,533	-4,581	-4,637	-4,702	-4,774
KR4201N4312018-04 콜315							33,350
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	11,201	11,051	10,839	10,566	10,233	9,844	9,404

-5.33%	10,494	10,066	9,566	9,006	8,393	7,736	7,041
-2.67%	8,217	7,414	6,576	5,711	4,825	3,921	3,003
0%	3,078	2,053	1,026	0	-1,027	-2,054	-3,081
2.67%	-5,573	-6,491	-7,430	-8,386	-9,355	-10,334	-11,320
5.33%	-17,204	-17,796	-18,453	-19,165	-19,921	-20,713	-21,537
8.00%	-30,627	-30,909	-31,268	-31,699	-32,194	-32,746	-33,350
KR4301N4312018-04 풋315							28,332
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-28,049	-28,059	-28,079	-28,113	-28,165	-28,238	-28,332
-5.33%	-16,855	-16,942	-17,064	-17,220	-17,407	-17,625	-17,871
-2.67%	-6,381	-6,710	-7,069	-7,454	-7,860	-8,282	-8,719
0%	1,635	1,090	546	0	-546	-1,092	-1,639
2.67%	5,820	5,396	4,951	4,489	4,014	3,528	3,034
5.33%	7,133	6,968	6,763	6,520	6,243	5,937	5,606
8.00%	7,367	7,333	7,277	7,194	7,083	6,943	6,774

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

69,133

공시일	2018-03-30
기준일	2018-03-29

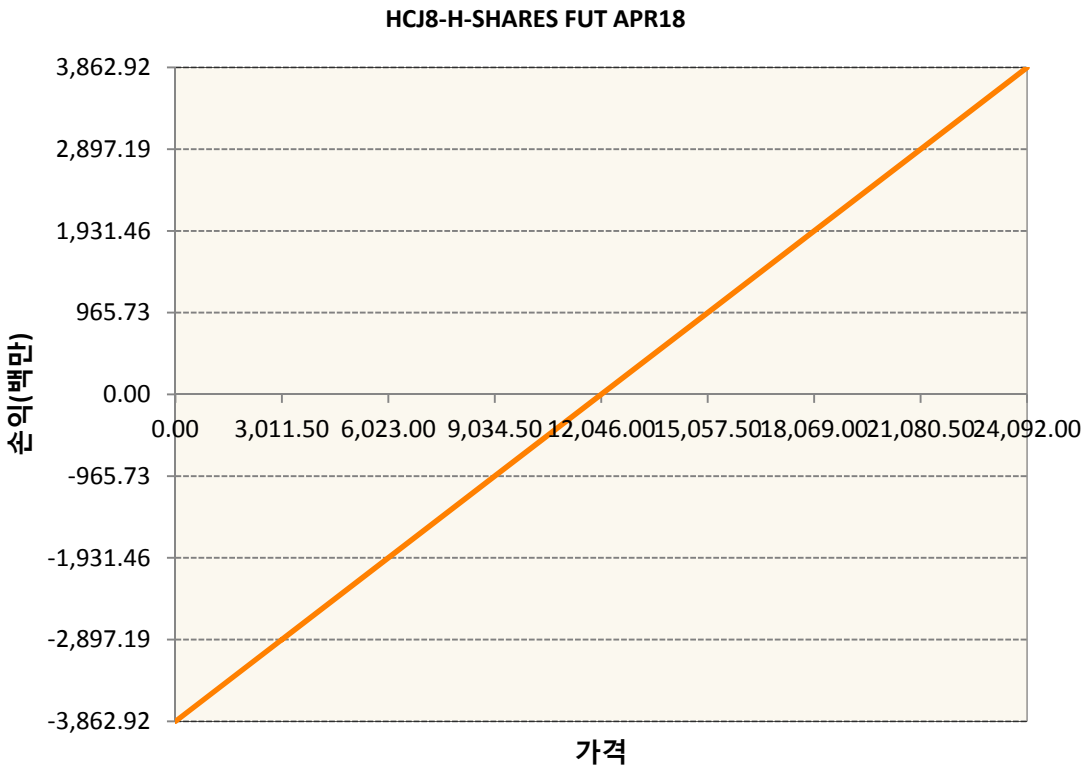
홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생

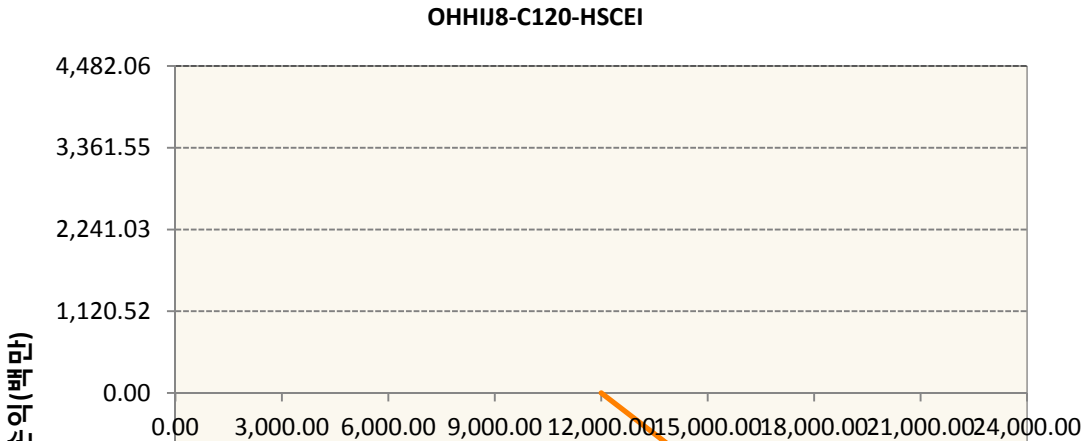
1. 계약금액

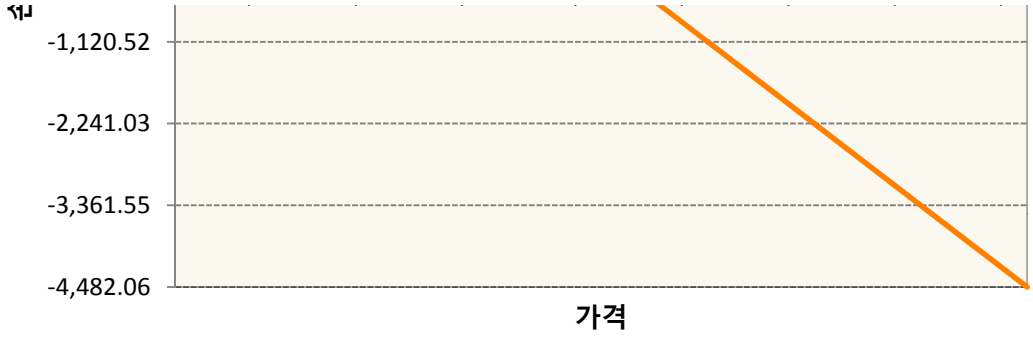
(단위:백만원)

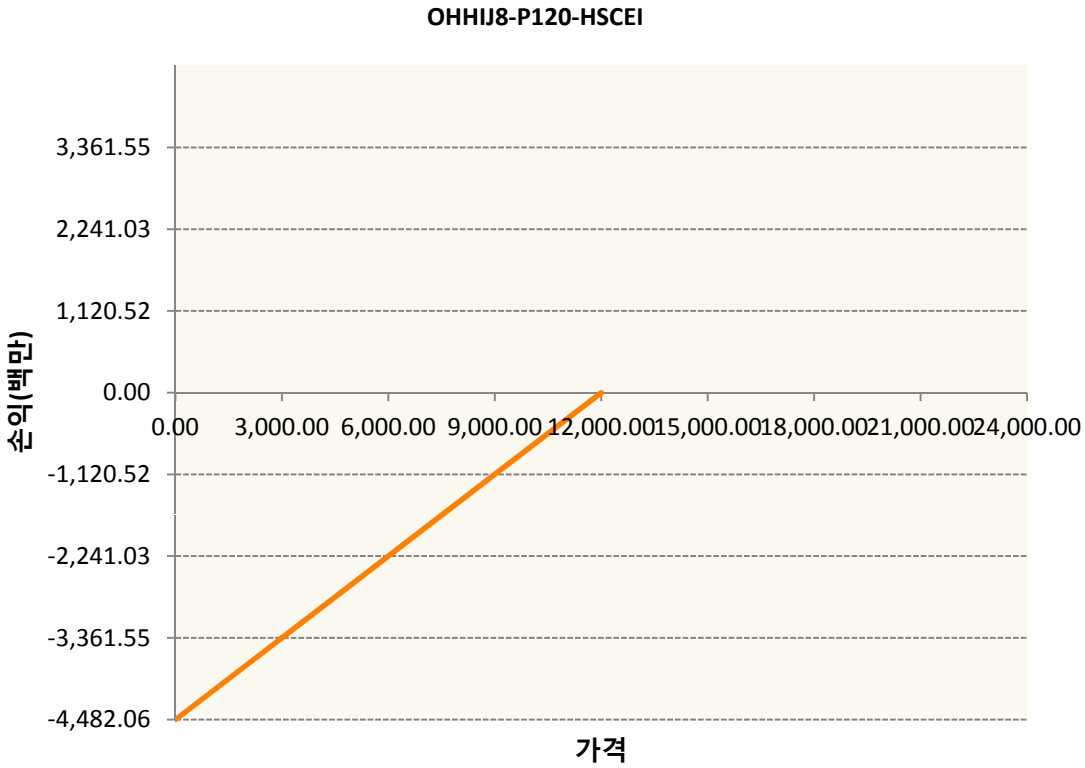
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	3,863	0	3,863	장내
누계	유가증권	옵션	0	8,964	-8,964	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCJ8	H-SHARES FUT APR18	309
OHHIJ8-C12	HSCEI	359
OHHIJ8-P12	HSCEI	359

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	897

공시일	2018-03-30
기준일	2018-03-29

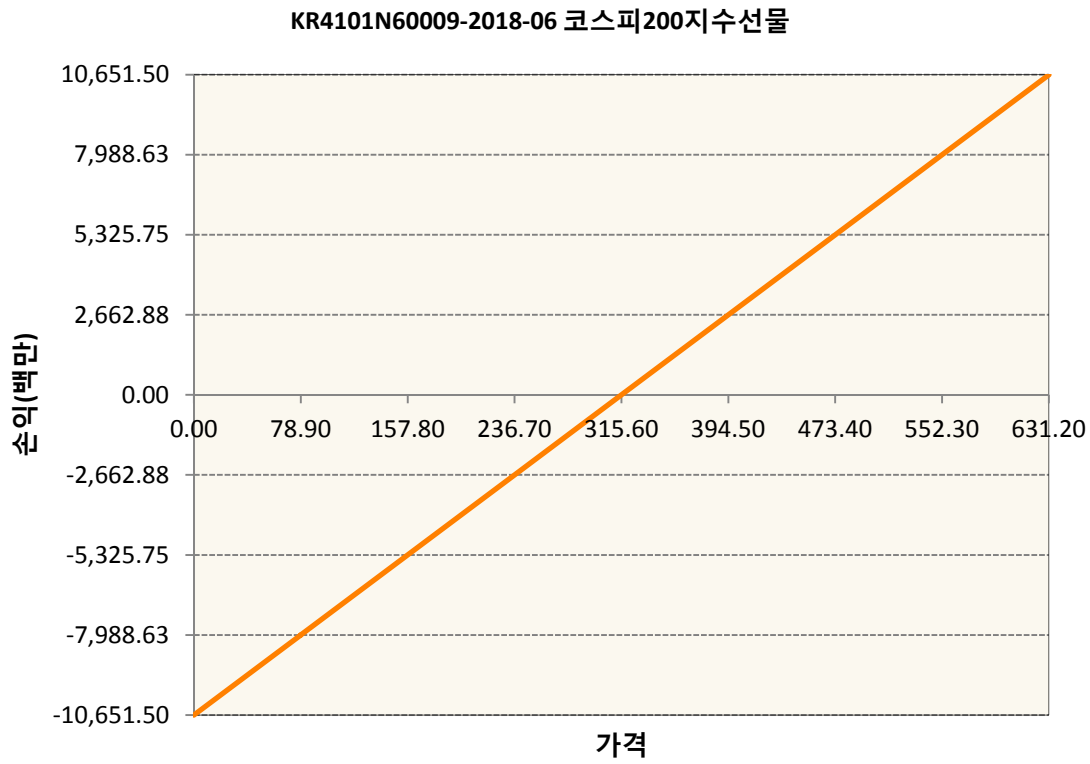
코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼

1. 계약금액

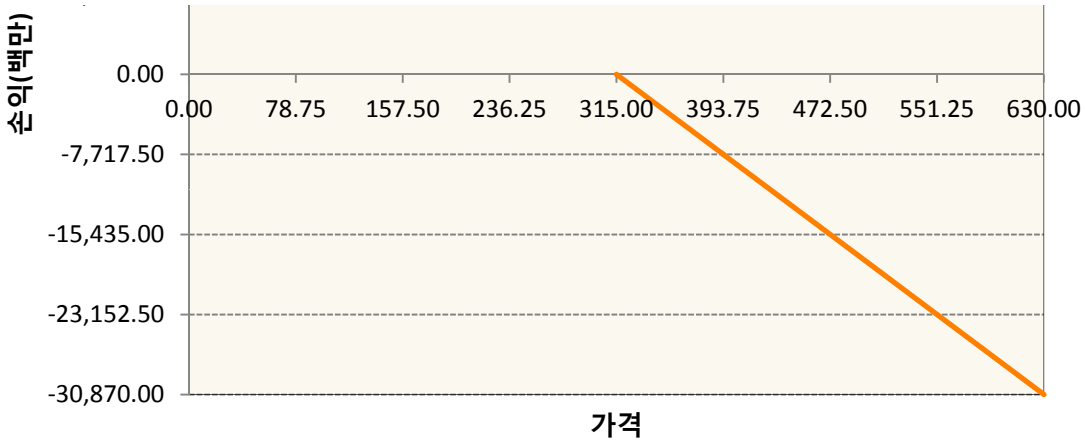
(단위:백만원)

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	10,652	0	10,652	장내
누계	유가증권	스왑	54,200	0	54,200	장외
누계	유가증권	옵션	0	55,718	-55,718	장내

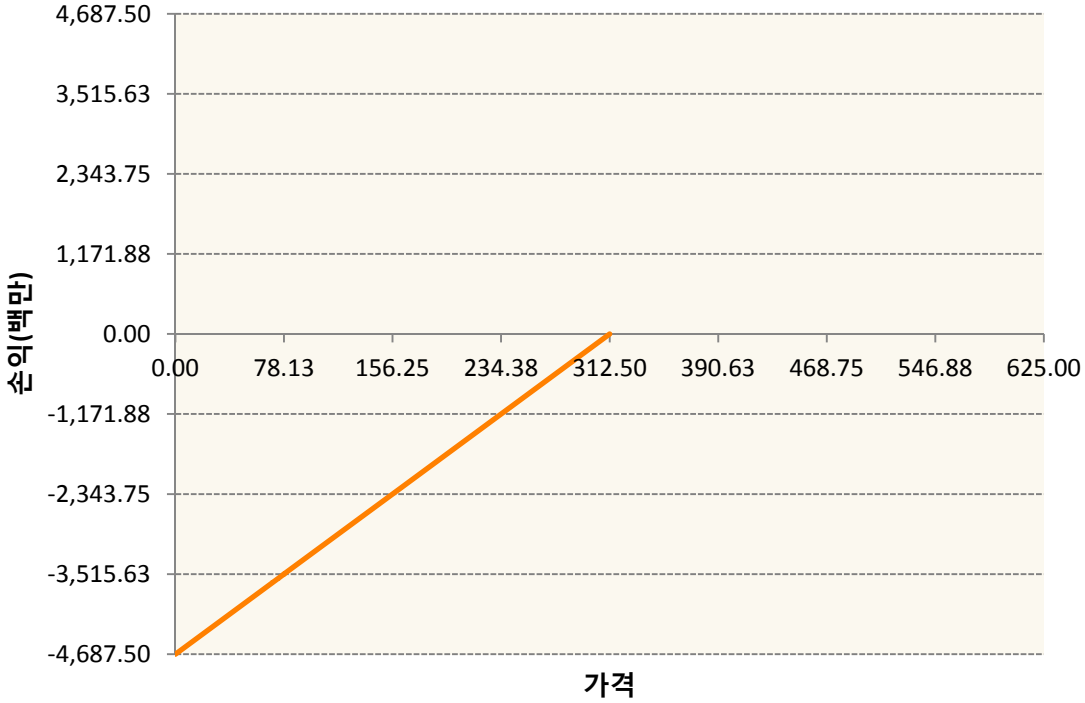
2. 만기시점의 손익구조



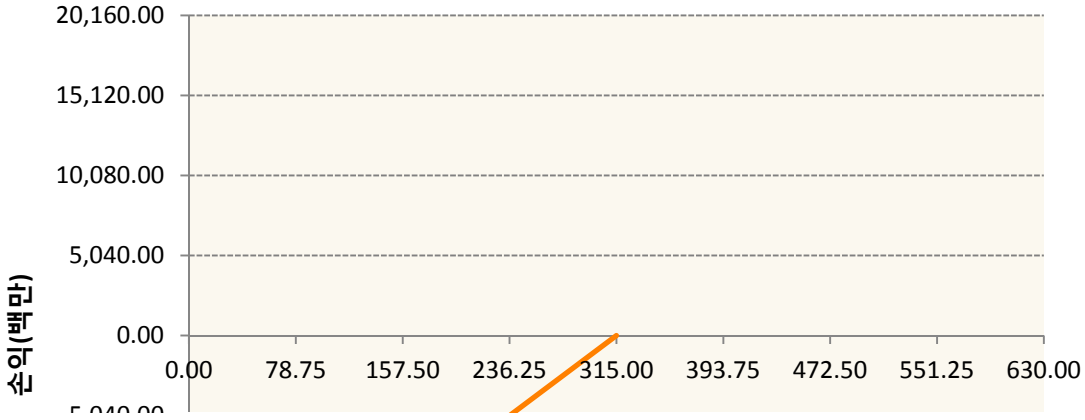




KR4301N43126-2018-04 풋312.5



KR4301N43159-2018-04 풋315





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_2							1,451
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,451	-1,451	-1,451	-1,451	-1,451	-1,451	-1,451
-5.33%	-967	-967	-967	-967	-967	-967	-967
-2.67%	-484	-484	-484	-484	-484	-484	-484
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	484	484	484	484	484	484	484
5.33%	967	967	967	967	967	967	967
8.00%	1,451	1,451	1,451	1,451	1,451	1,451	1,451
2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_3							274
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-274	-274	-274	-274	-274	-274	-274
-5.33%	-183	-183	-183	-183	-183	-183	-183
-2.67%	-91	-91	-91	-91	-91	-91	-91
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	91	91	91	91	91	91	91
5.33%	183	183	183	183	183	183	183
8.00%	274	274	274	274	274	274	274
2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_5							235
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-235	-235	-235	-235	-235	-235	-235
-5.33%	-157	-157	-157	-157	-157	-157	-157
-2.67%	-78	-78	-78	-78	-78	-78	-78
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	78	78	78	78	78	78	78
5.33%	157	157	157	157	157	157	157
8.00%	235	235	235	235	235	235	235
2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_6							196
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%

-8.00%	-196	-196	-196	-196	-196	-196	-196
-5.33%	-131	-131	-131	-131	-131	-131	-131
-2.67%	-65	-65	-65	-65	-65	-65	-65
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	65	65	65	65	65	65	65
5.33%	131	131	131	131	131	131	131
8.00%	196	196	196	196	196	196	196
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_7						251
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-251	-251	-251	-251	-251	-251	-251
-5.33%	-167	-167	-167	-167	-167	-167	-167
-2.67%	-84	-84	-84	-84	-84	-84	-84
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	84	84	84	84	84	84	84
5.33%	167	167	167	167	167	167	167
8.00%	251	251	251	251	251	251	251
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_8						464
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-464	-464	-464	-464	-464	-464	-464
-5.33%	-309	-309	-309	-309	-309	-309	-309
-2.67%	-155	-155	-155	-155	-155	-155	-155
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	155	155	155	155	155	155	155
5.33%	309	309	309	309	309	309	309
8.00%	464	464	464	464	464	464	464
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_10						274
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-274	-274	-274	-274	-274	-274	-274
-5.33%	-183	-183	-183	-183	-183	-183	-183
-2.67%	-91	-91	-91	-91	-91	-91	-91
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	91	91	91	91	91	91	91
5.33%	183	183	183	183	183	183	183
8.00%	274	274	274	274	274	274	274
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_11						627
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-627	-627	-627	-627	-627	-627	-627
-5.33%	-418	-418	-418	-418	-418	-418	-418
-2.67%	-209	-209	-209	-209	-209	-209	-209
0%	0	0	0	0	0	0	0

2.67%	209	209	209	209	209	209	209
5.33%	418	418	418	418	418	418	418
8.00%	627	627	627	627	627	627	627
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_12						470
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-470	-470	-470	-470	-470	-470	-470
-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%	470	470	470	470	470	470	470
	KR4101N60(2018-06 코스피200지수선물						847
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-847	-847	-847	-847	-847	-847	-847
-5.33%	-565	-565	-565	-565	-565	-565	-565
-2.67%	-282	-282	-282	-282	-282	-282	-282
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	282	282	282	282	282	282	282
5.33%	565	565	565	565	565	565	565
8.00%	847	847	847	847	847	847	847
	KR4201N431 2018-04 콜315						1,881
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	632	623	611	596	577	555	530
-5.33%	592	568	540	508	473	436	397
-2.67%	463	418	371	322	272	221	169
0%	174	116	58	0	-58	-116	-174
2.67%	-314	-366	-419	-473	-528	-583	-639
5.33%	-970	-1,004	-1,041	-1,081	-1,124	-1,168	-1,215
8.00%	-1,727	-1,743	-1,764	-1,788	-1,816	-1,847	-1,881
	KR4301N431 2018-04 풋312.5						298
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-293	-293	-294	-294	-295	-296	-298
-5.33%	-170	-171	-173	-176	-178	-181	-185
-2.67%	-59	-64	-68	-73	-78	-84	-89
0%	18	12	6	0	-6	-12	-18
2.67%	53	49	45	40	36	31	26
5.33%	62	61	59	57	55	52	49
8.00%	63	63	63	62	61	60	59
	KR4301N431 2018-04 풋315						1,343

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,330	-1,330	-1,331	-1,333	-1,335	-1,339	-1,343
-5.33%	-799	-803	-809	-816	-825	-836	-847
-2.67%	-303	-318	-335	-353	-373	-393	-413
0%	78	52	26	0	-26	-52	-78
2.67%	276	256	235	213	190	167	144
5.33%	338	330	321	309	296	281	266
8.00%	349	348	345	341	336	329	321

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

8,519

공시일	2018-03-30
기준일	2018-03-29

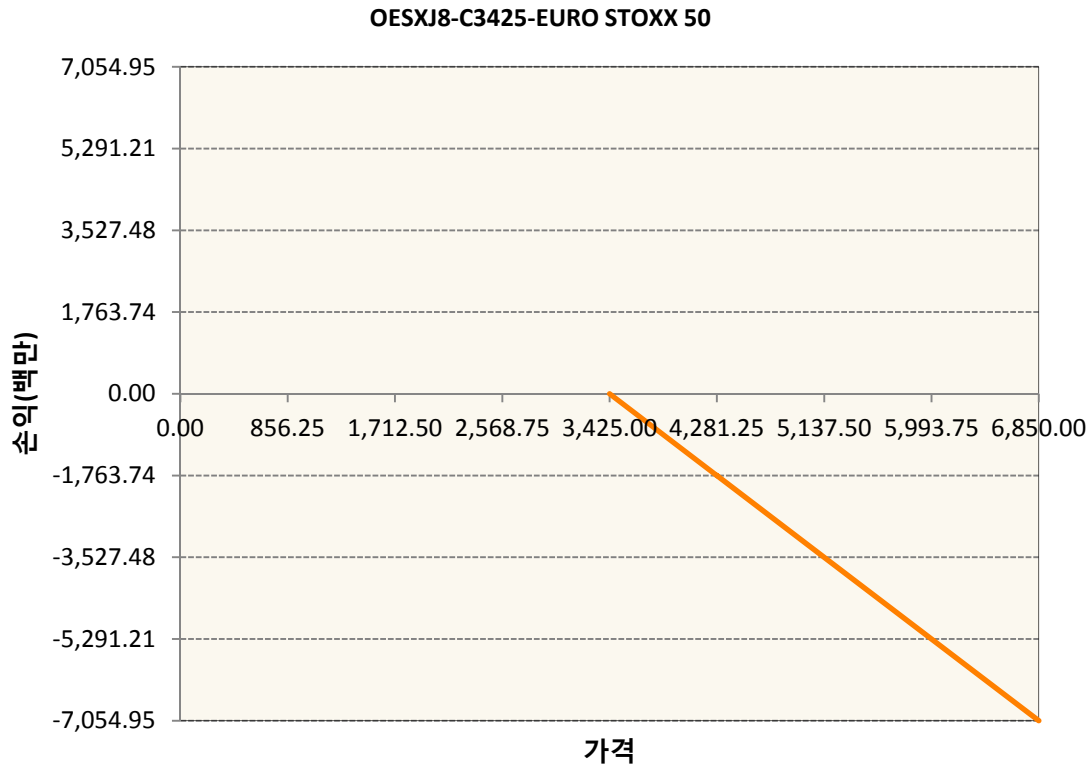
유로커버드콜모(주식혼합-파생형

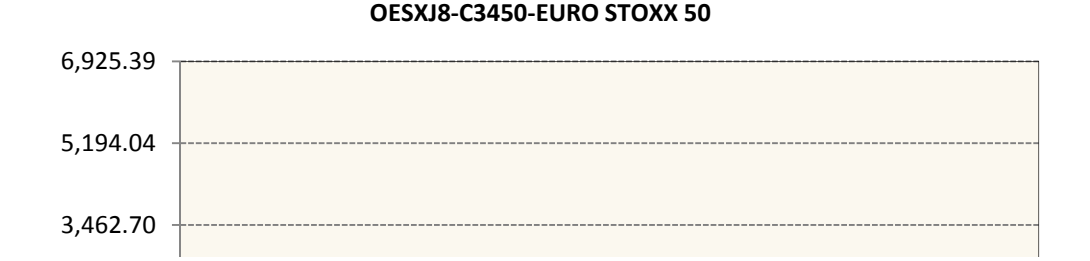
1. 계약금액

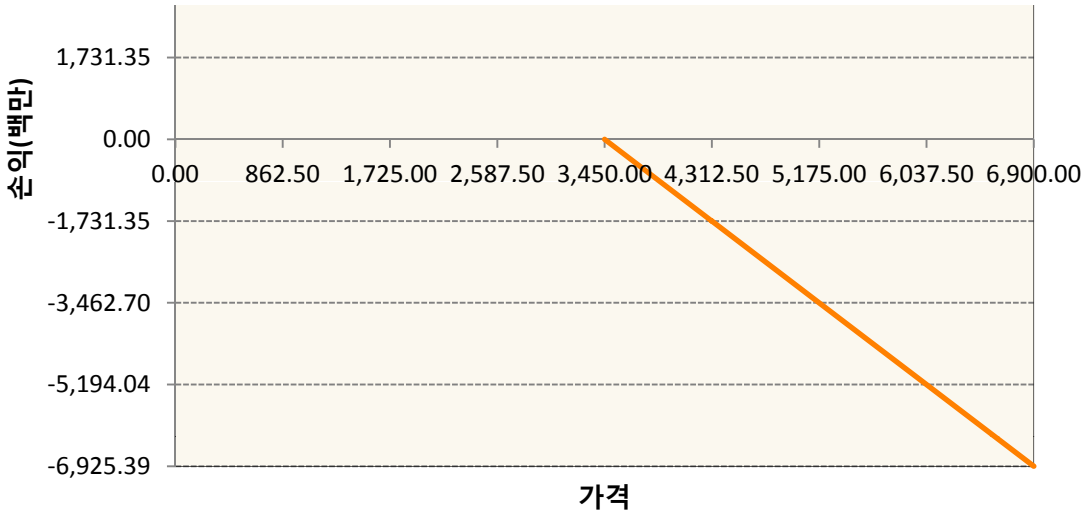
(단위:백만원)

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	5,360	0	5,360	
누계	유가증권	스왑	98,397	0	98,397	장외
누계	유가증권	옵션	0	27,961	-27,961	장내
누계	지수	스왑	52,479	0	52,479	장외

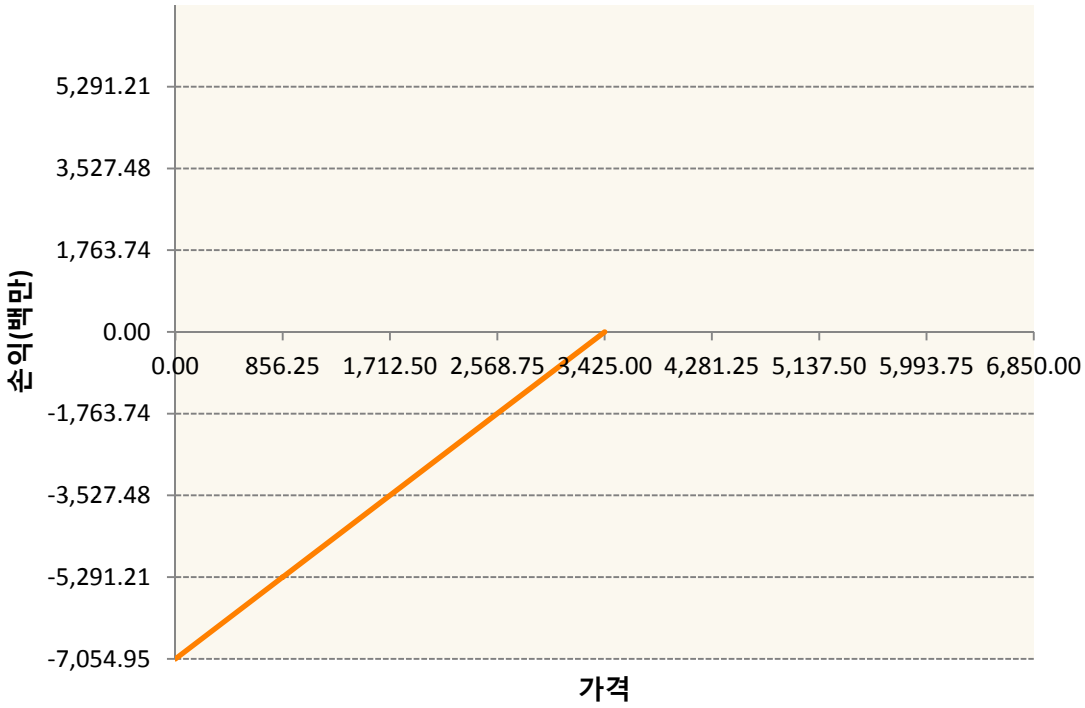
2. 만기시점의 손익구조



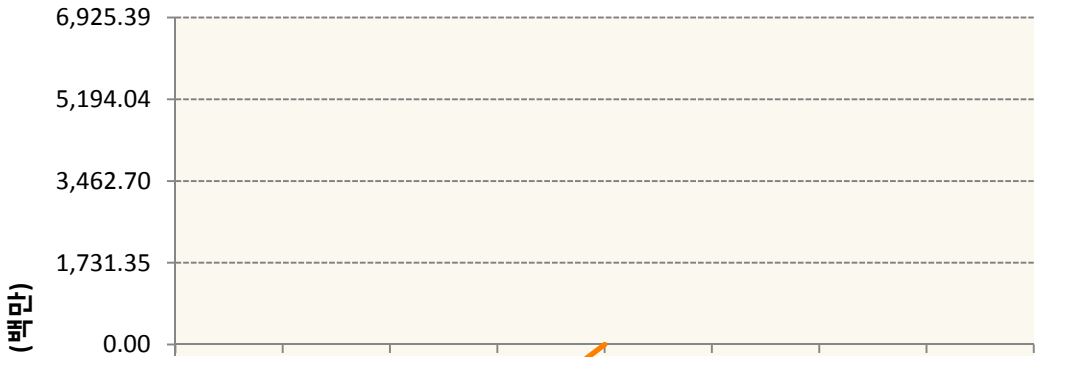


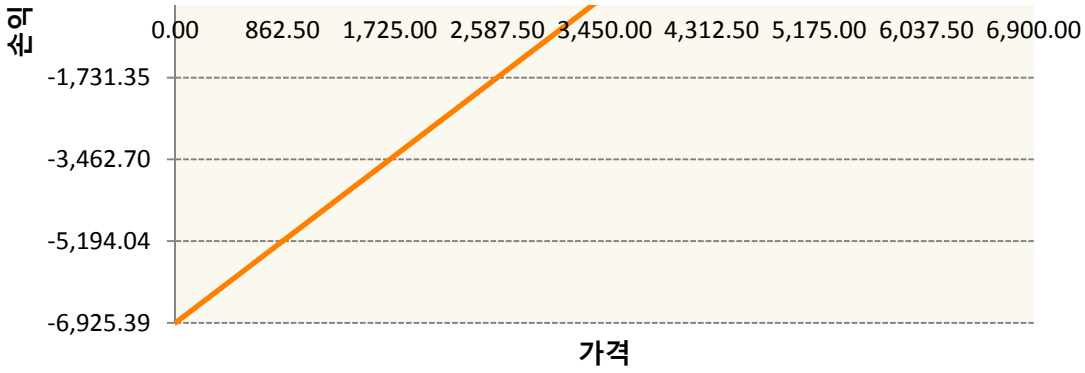


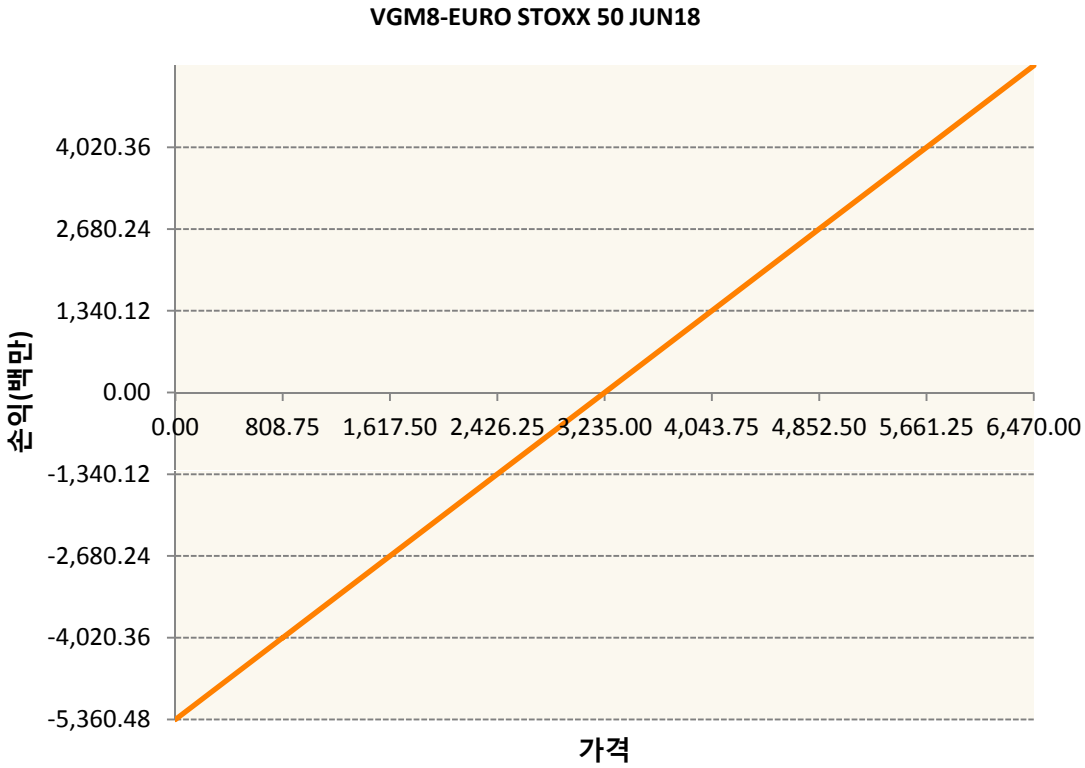
OESXJ8-P3425-EURO STOXX 50



OESXJ8-P3450-EURO STOXX 50







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

260105SGPX SG EURO Covered CALL STRATEGY - 994.569	253
260105SQPX SG EURO Covered CALL STRATEGY	474
OESXJ8-C34 EURO STOXX 50	564
OESXJ8-C34 EURO STOXX 50	554
OESXJ8-P34 EURO STOXX 50	564
OESXJ8-P34 EURO STOXX 50	554
VGM8 EURO STOXX 50 JUN18	429

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

2,147

공시일	2018-03-30
기준일	2018-03-29

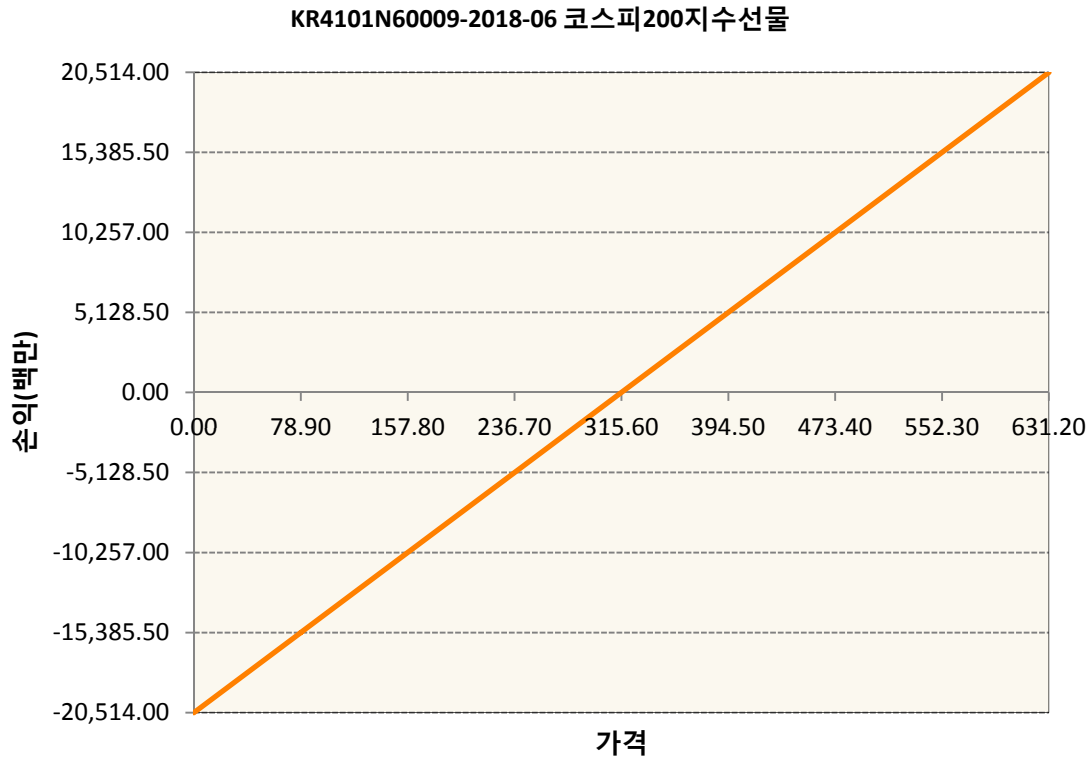
ETF스마트레버리지목표전환형8호

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	20,514	0	20,514	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101N60(2018-06 코스피200지수선물							1,632
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,632	-1,632	-1,632	-1,632	-1,632	-1,632	-1,632
-5.33%	-1,088	-1,088	-1,088	-1,088	-1,088	-1,088	-1,088
-2.67%	-544	-544	-544	-544	-544	-544	-544
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	544	544	544	544	544	544	544
5.33%	1,088	1,088	1,088	1,088	1,088	1,088	1,088
8.00%	1,632	1,632	1,632	1,632	1,632	1,632	1,632

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

1,176

공시일	2018-03-30
기준일	2018-03-29

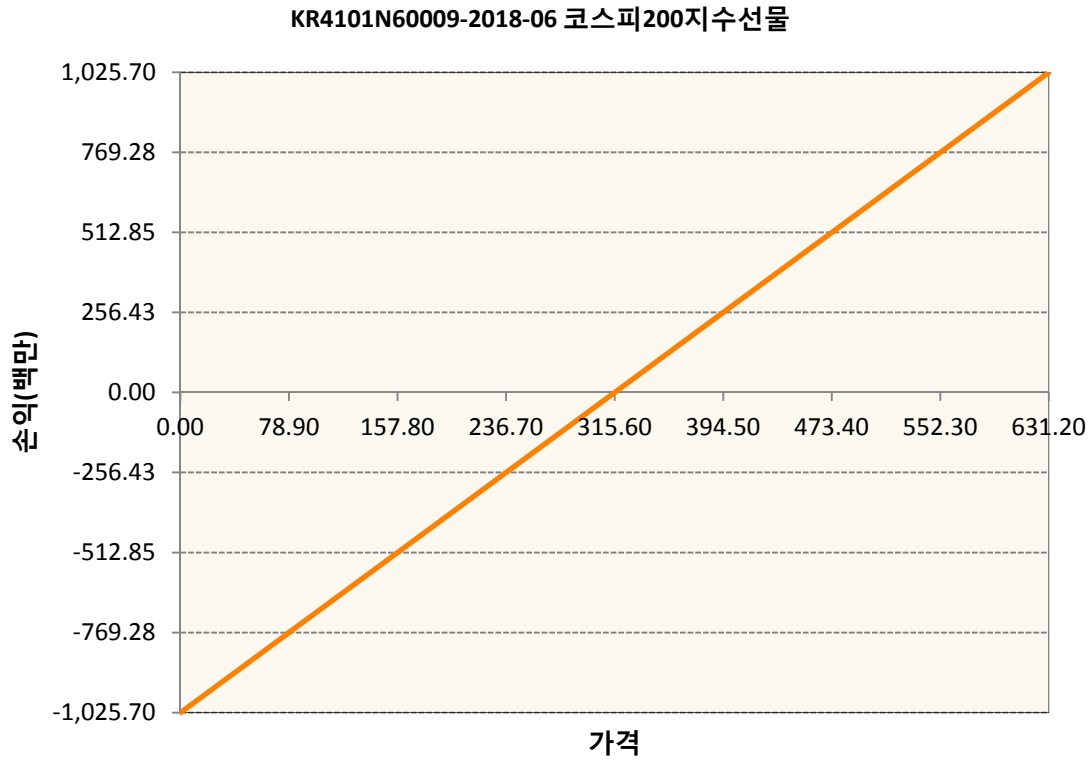
ETF스마트레버리지목표전환형9호

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	1,026	0	1,026	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101N60(2018-06 코스피200지수선물							82
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-82	-82	-82	-82	-82	-82	-82
-5.33%	-54	-54	-54	-54	-54	-54	-54
-2.67%	-27	-27	-27	-27	-27	-27	-27
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	27	27	27	27	27	27	27
5.33%	54	54	54	54	54	54	54
8.00%	82	82	82	82	82	82	82

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

59

공시일	2018-03-30
기준일	2018-03-29

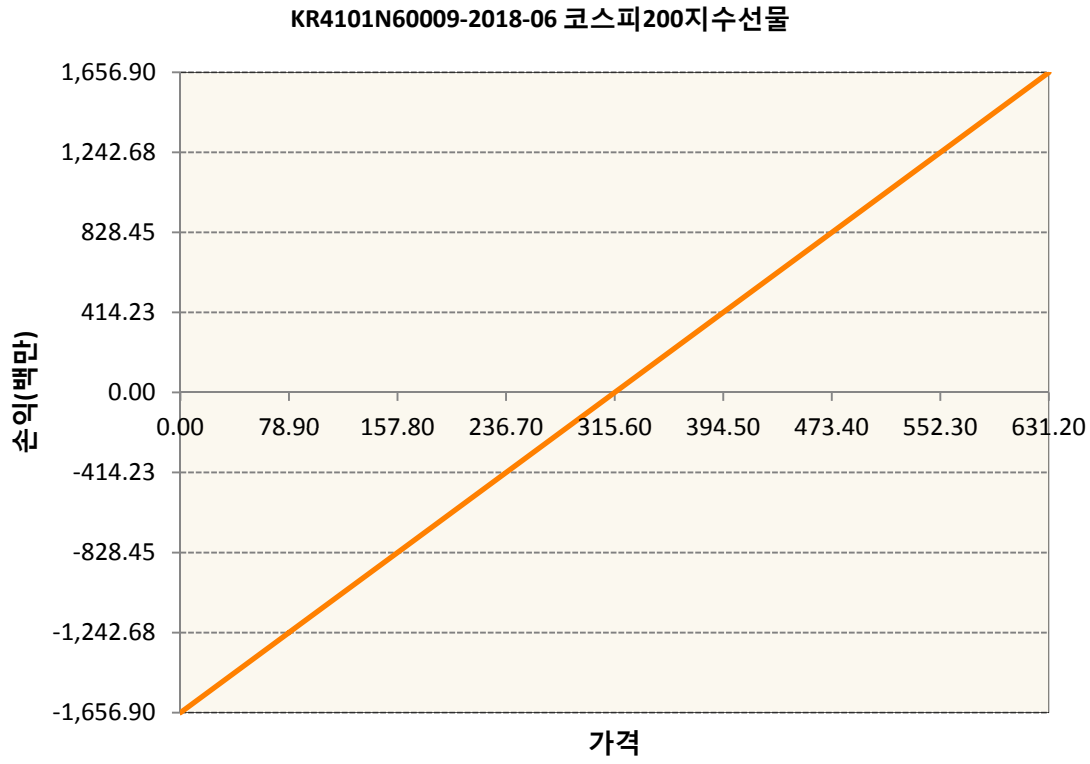
ETF스마트레버리지목표전환형10

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	1,657	0	1,657	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101N60(2018-06 코스피200지수선물							132
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-132	-132	-132	-132	-132	-132	-132
-5.33%	-88	-88	-88	-88	-88	-88	-88
-2.67%	-44	-44	-44	-44	-44	-44	-44
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	44	44	44	44	44	44	44
5.33%	88	88	88	88	88	88	88
8.00%	132	132	132	132	132	132	132

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

95

공시일	2018-03-30
기준일	2018-03-29

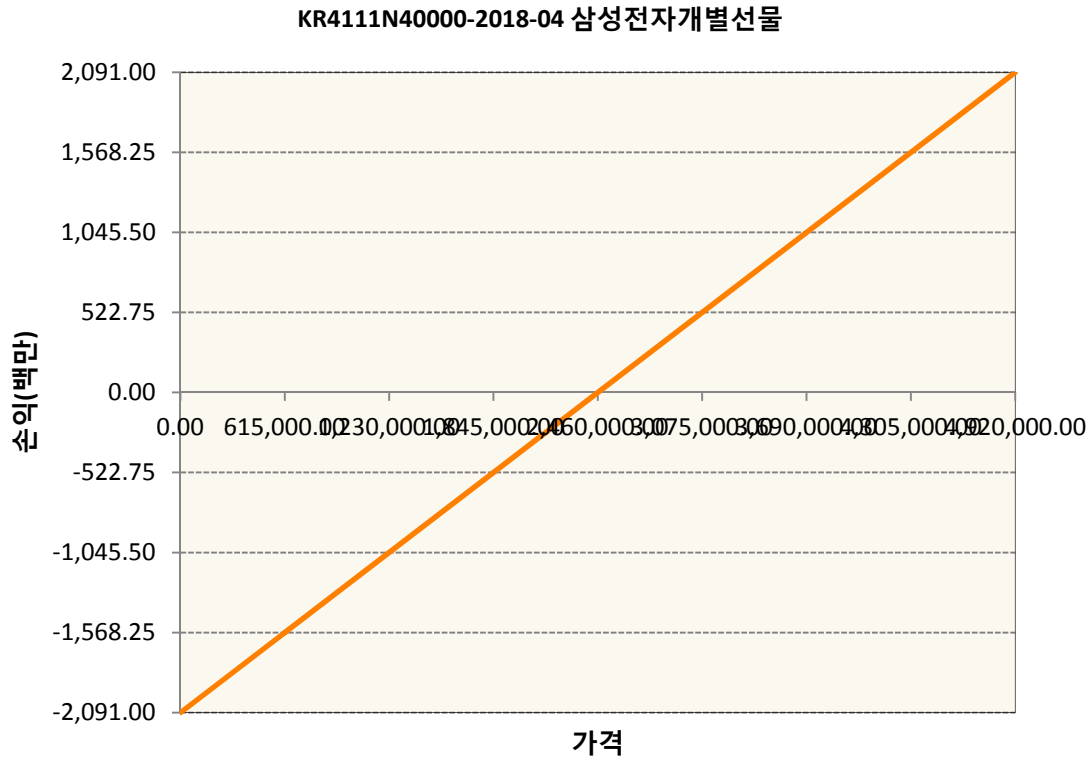
스마트KRX300인덱스1호(주식-파

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	2,091	0	2,091	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4111N40(2018-04 삼성전자개별선물							167
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-167	-167	-167	-167	-167	-167	-167
-5.33%	-111	-111	-111	-111	-111	-111	-111
-2.67%	-56	-56	-56	-56	-56	-56	-56
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	56	56	56	56	56	56	56
5.33%	111	111	111	111	111	111	111
8.00%	167	167	167	167	167	167	167

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

202

공시일	2018-03-30
기준일	2018-03-29

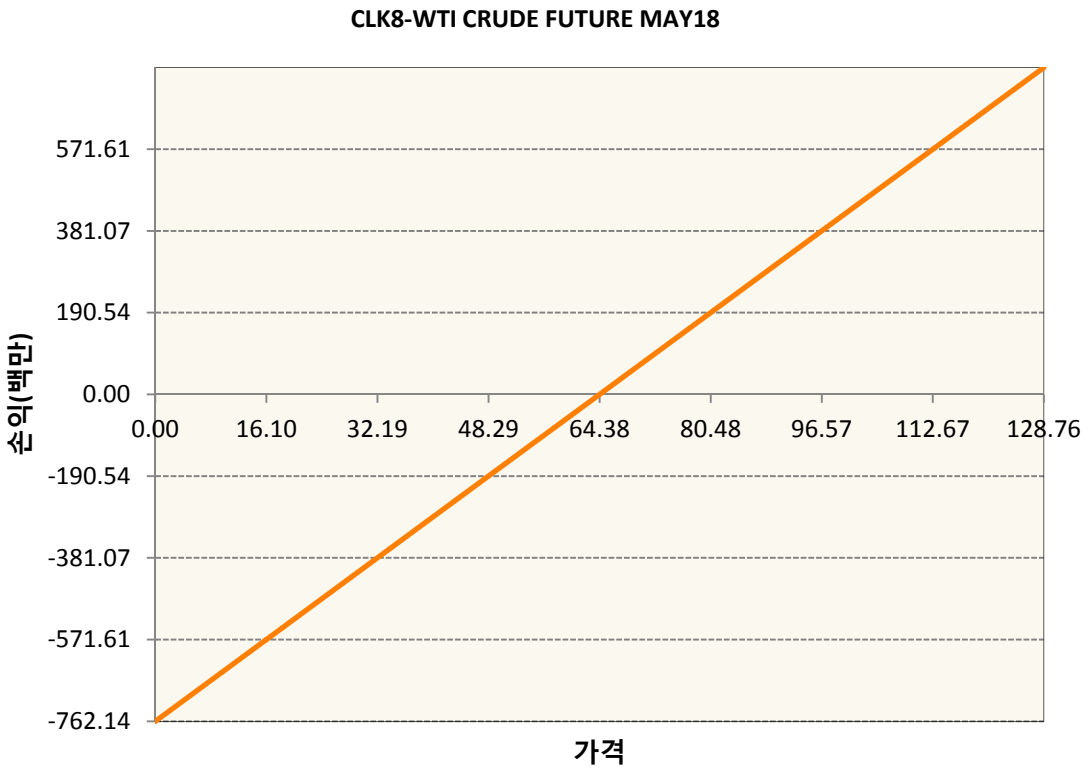
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

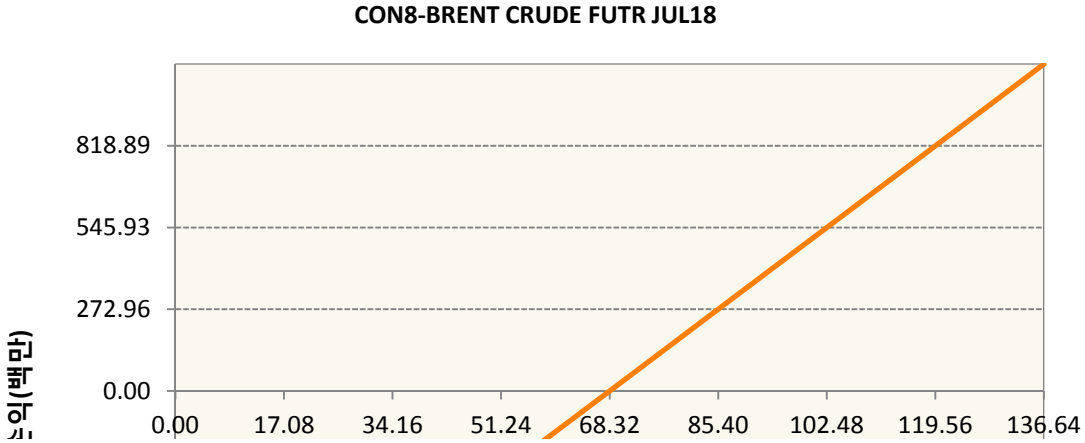
1. 계약금액

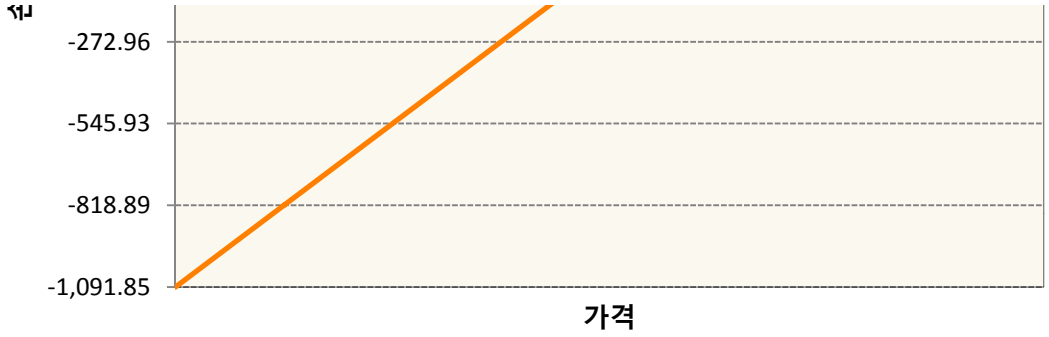
(단위:백만원)

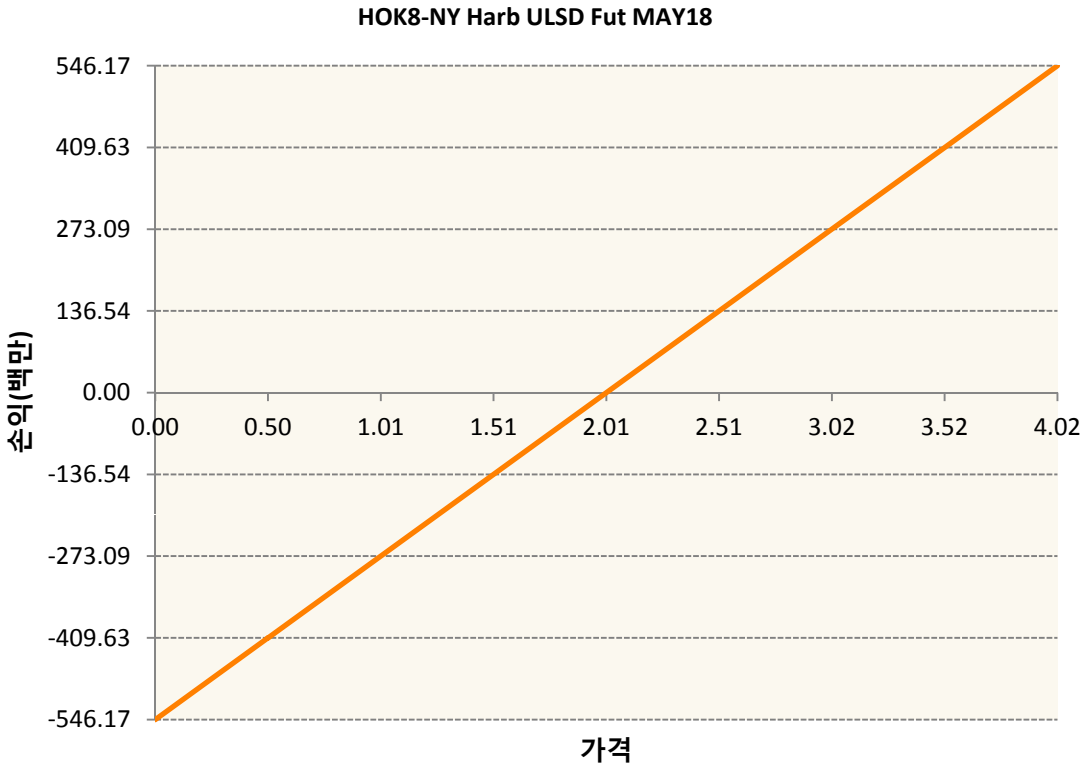
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	선물	유가증권	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	선물	유가증권	762	0	762	
누계	유가증권	선물	3,232	585	2,647	

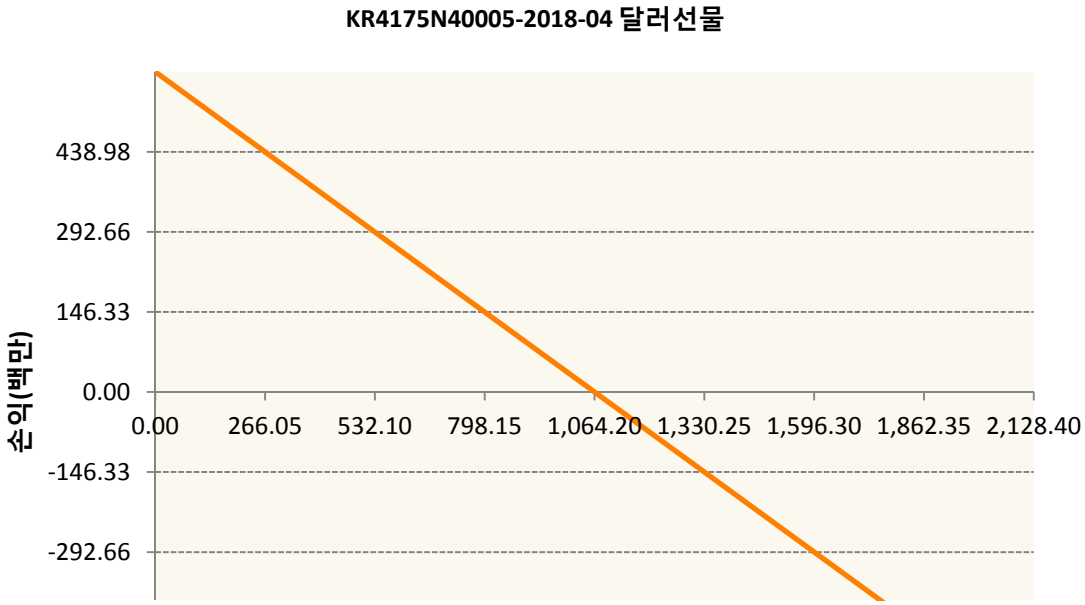
2. 만기시점의 손익구조

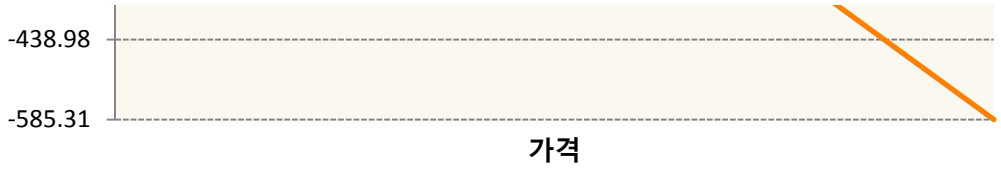


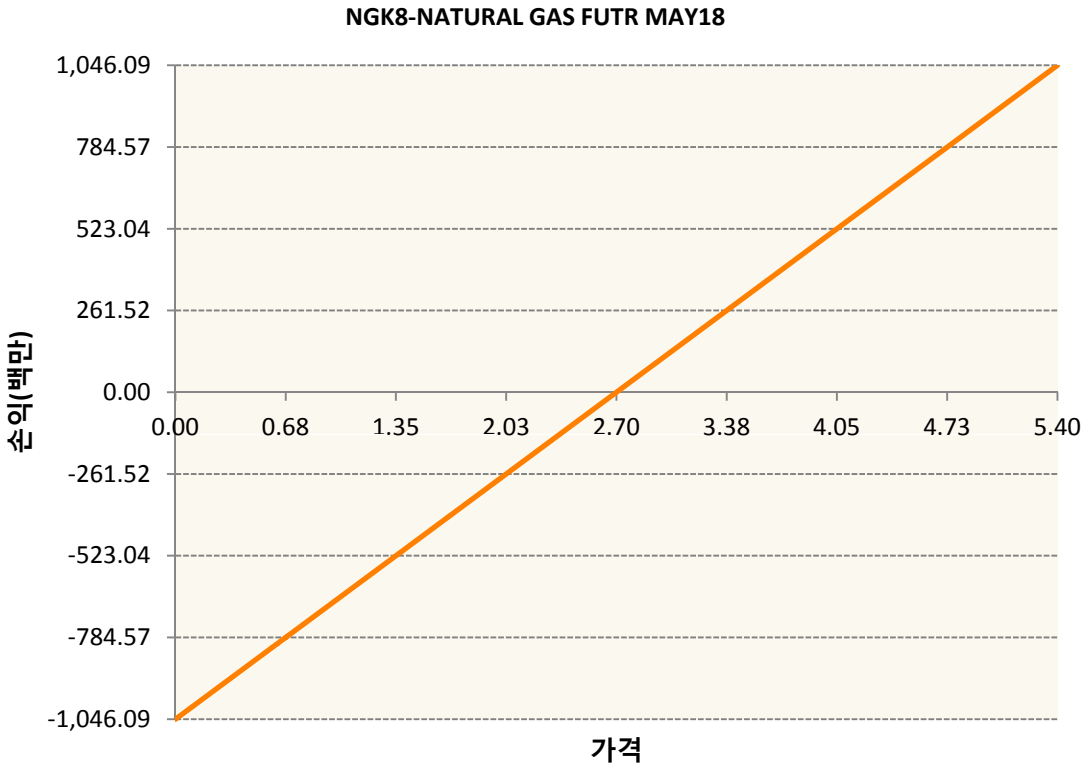


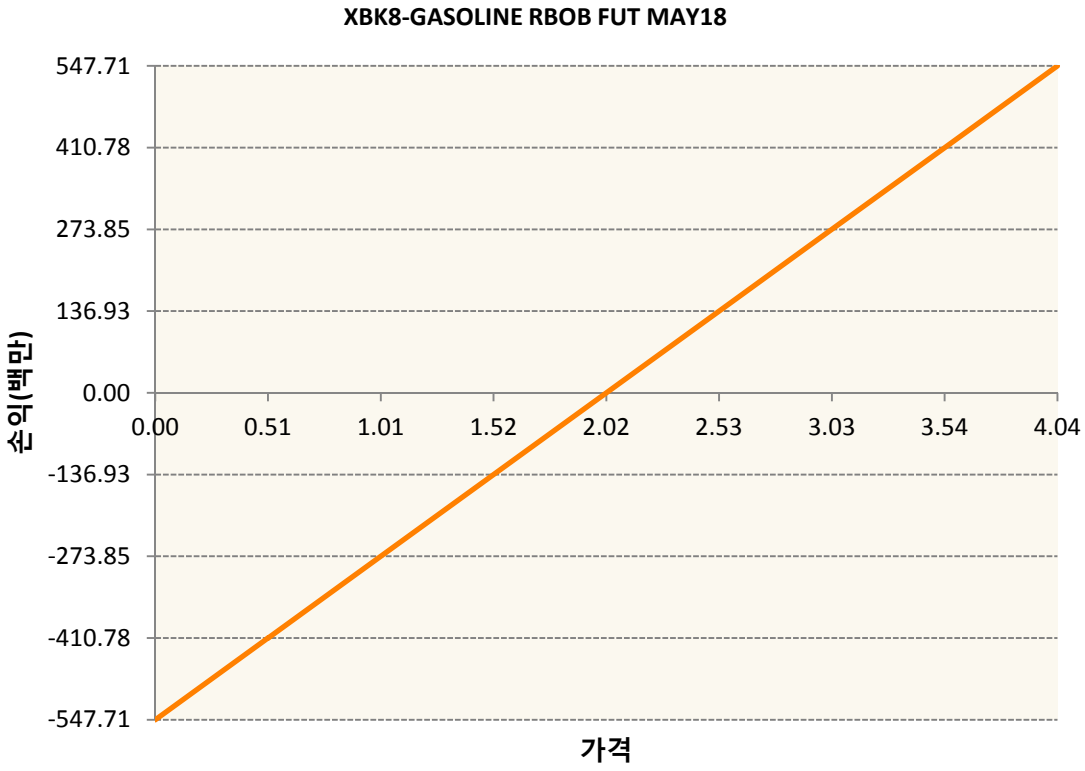

-272.96
-545.93
-818.89
-1,091.85
가격


HOK8-NY Harb ULSD Fut MAY18
546.17
409.63
273.09
136.54
0.00
-136.54
-273.09
-409.63
-546.17
손익(백만)
0.00
0.50
1.01
1.51
2.01
2.51
3.02
3.52
4.02
가격


KR4175N40005-2018-04 달러선물
438.98
292.66
146.33
0.00
-146.33
-292.66
손익(백만)
0.00
266.05
532.10
798.15
1,064.20
1,330.25
1,596.30
1,862.35
2,128.40


-438.98
-585.31
가격


NGK8-NATURAL GAS FUTR MAY18
1,046.09
784.57
523.04
261.52
0.00
-261.52
-523.04
-784.57
-1,046.09
0.00
0.68
1.35
2.03
2.70
3.38
4.05
4.73
5.40
손익(백만)
가격


XBK8-GASOLINE RBOB FUT MAY18
547.71
410.78
273.85
136.93
0.00
-136.93
-273.85
-410.78
-547.71
0.00
0.51
1.01
1.52
2.02
2.53
3.03
3.54
4.04
손익(백만)
가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLK8	WTI CRUDE FUTURE MAY18	61
CON8	BRENT CRUDE FUTR JUL18	87
HOK8	NY Harb ULSD Fut MAY18	44
KR4175N40(	2018-04 달러선물	47
NGK8	NATURAL GAS FUTR MAY18	84
XBK8	GASOLINE RBOB FUT MAY18	44

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

517

공시일	2018-03-30
기준일	2018-03-29

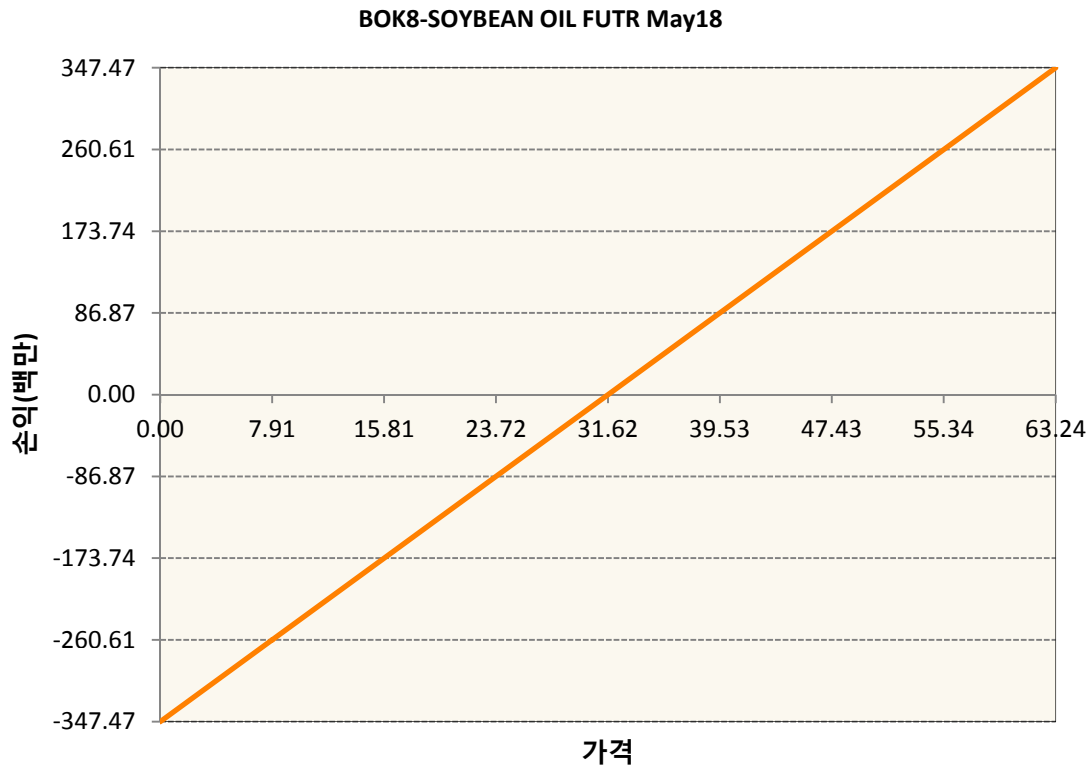
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

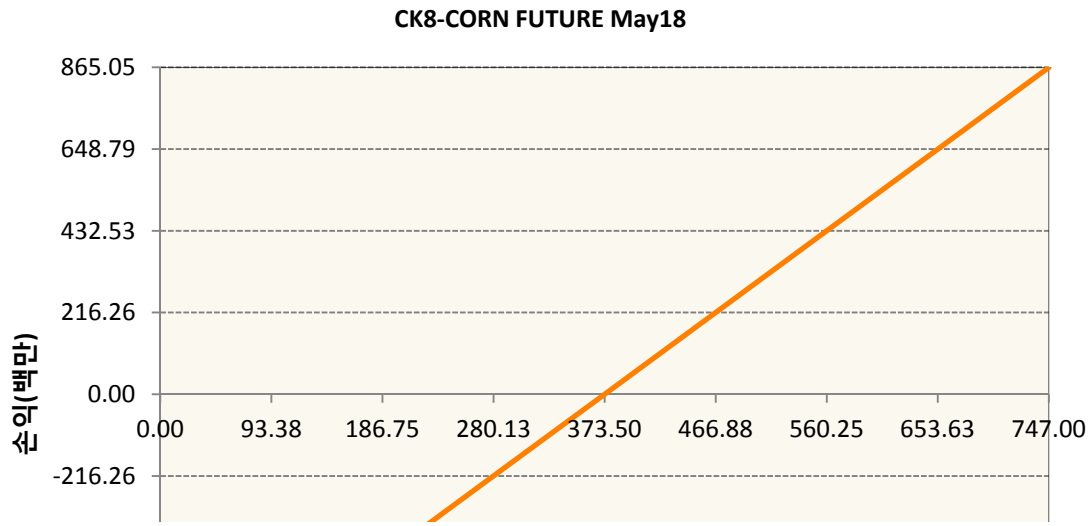
1. 계약금액

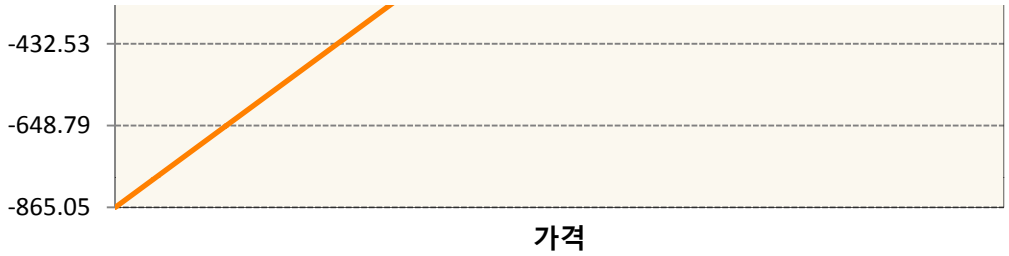
(단위:백만원)

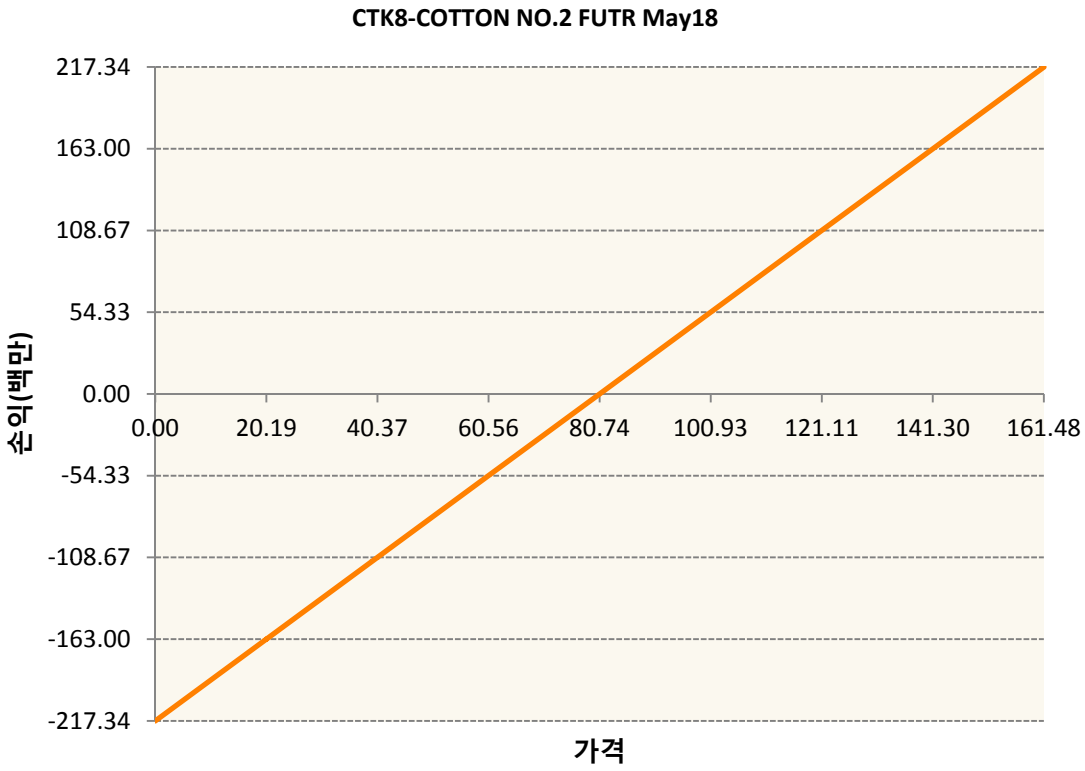
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	4,025	319	3,706	

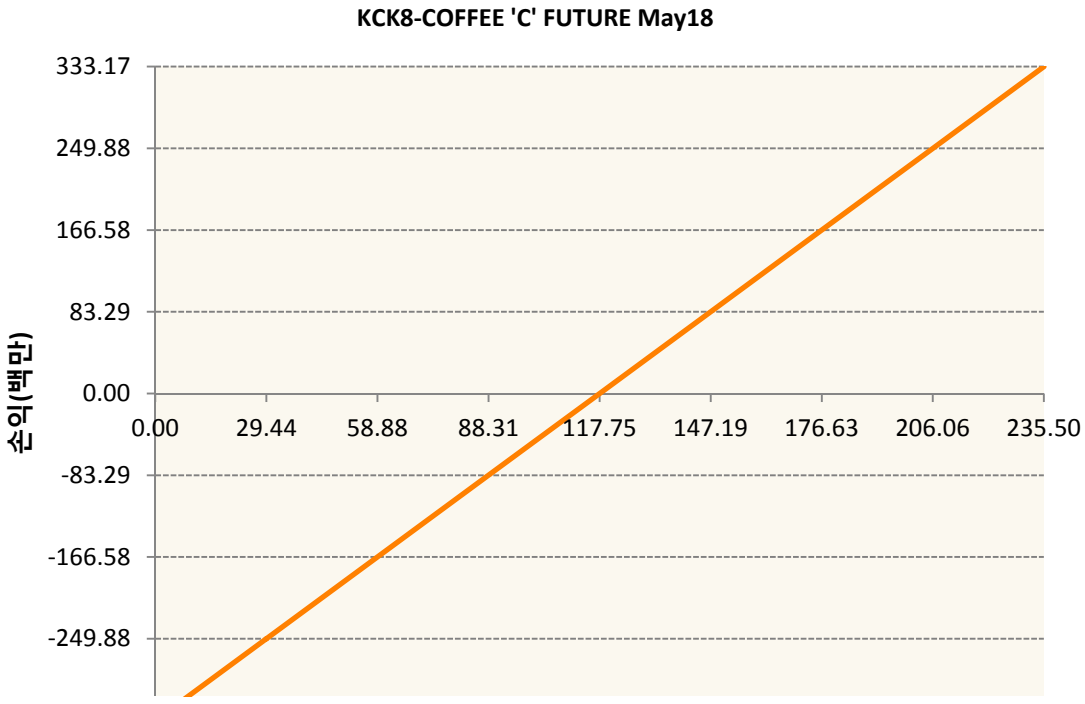
2. 만기시점의 손익구조

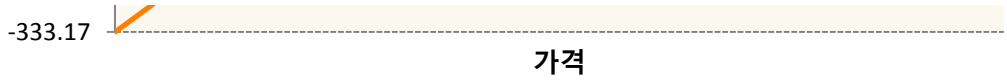


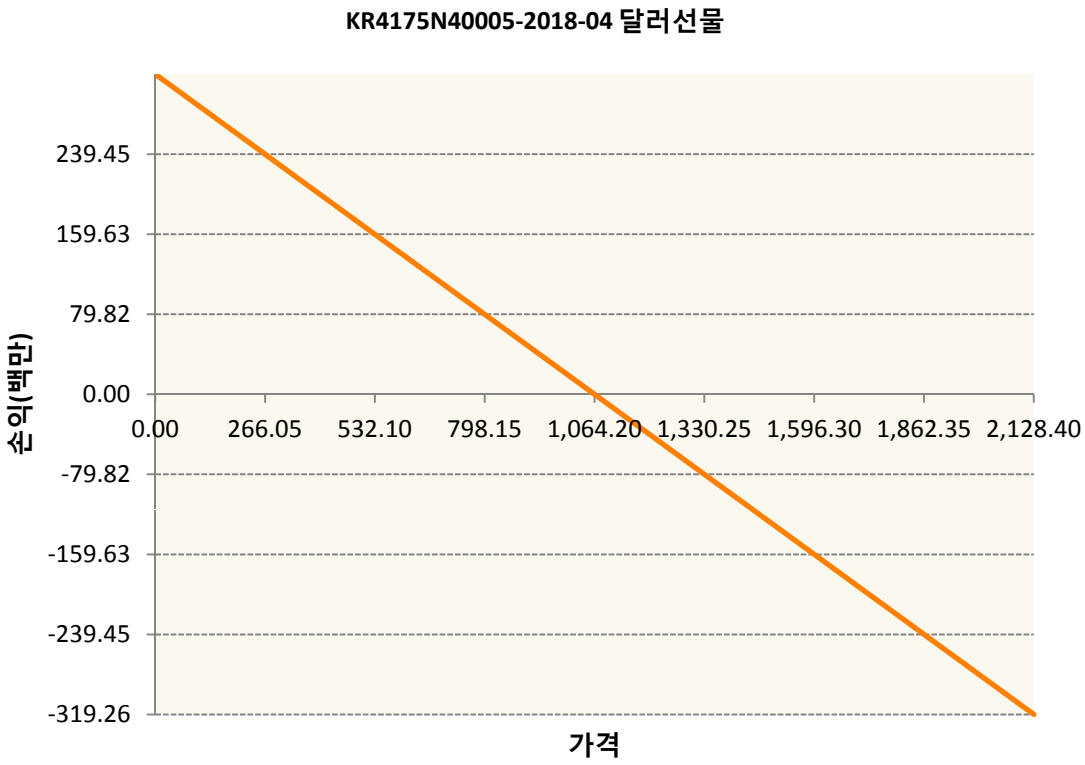


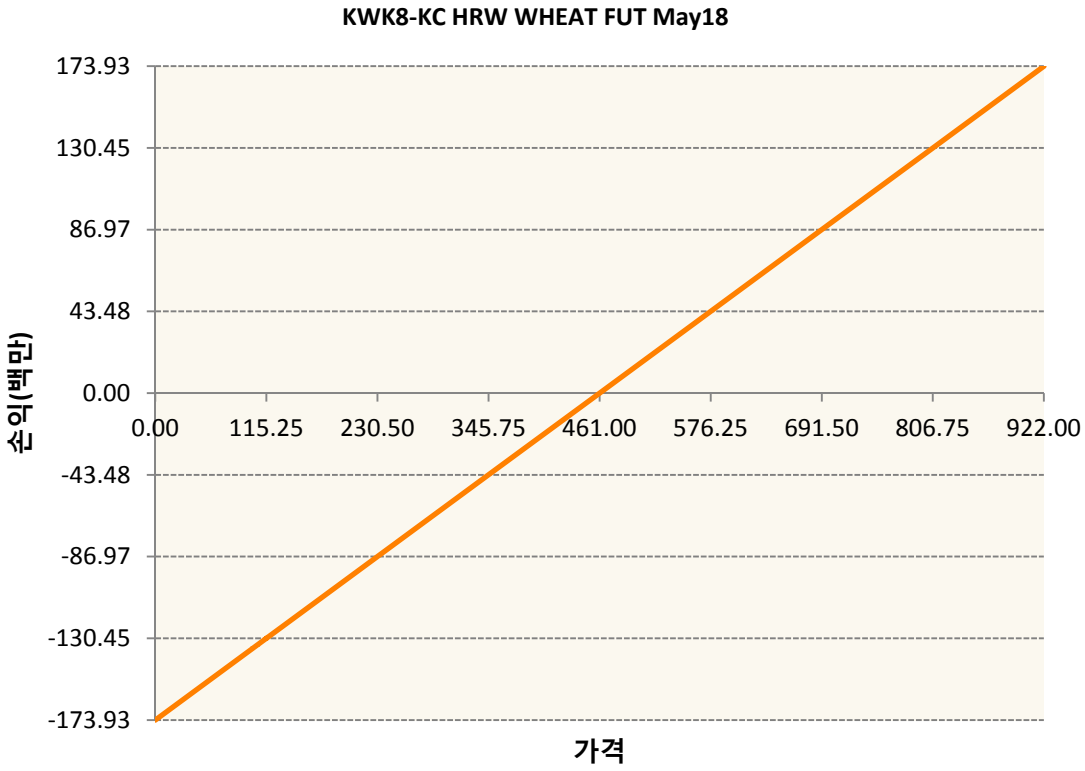

-432.53
-648.79
-865.05
가격

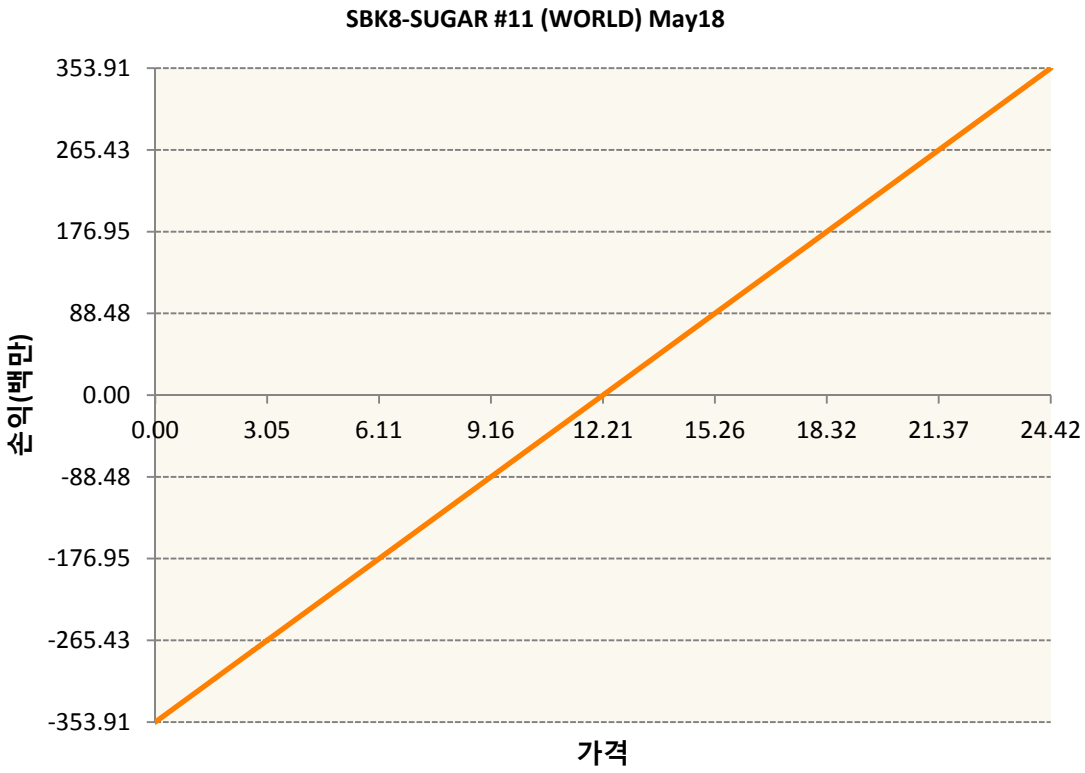

CTK8-COTTON NO.2 FUTR May18
217.34
163.00
108.67
54.33
0.00
-54.33
-108.67
-163.00
-217.34
0.00
20.19
40.37
60.56
80.74
100.93
121.11
141.30
161.48
손익(백만)
가격

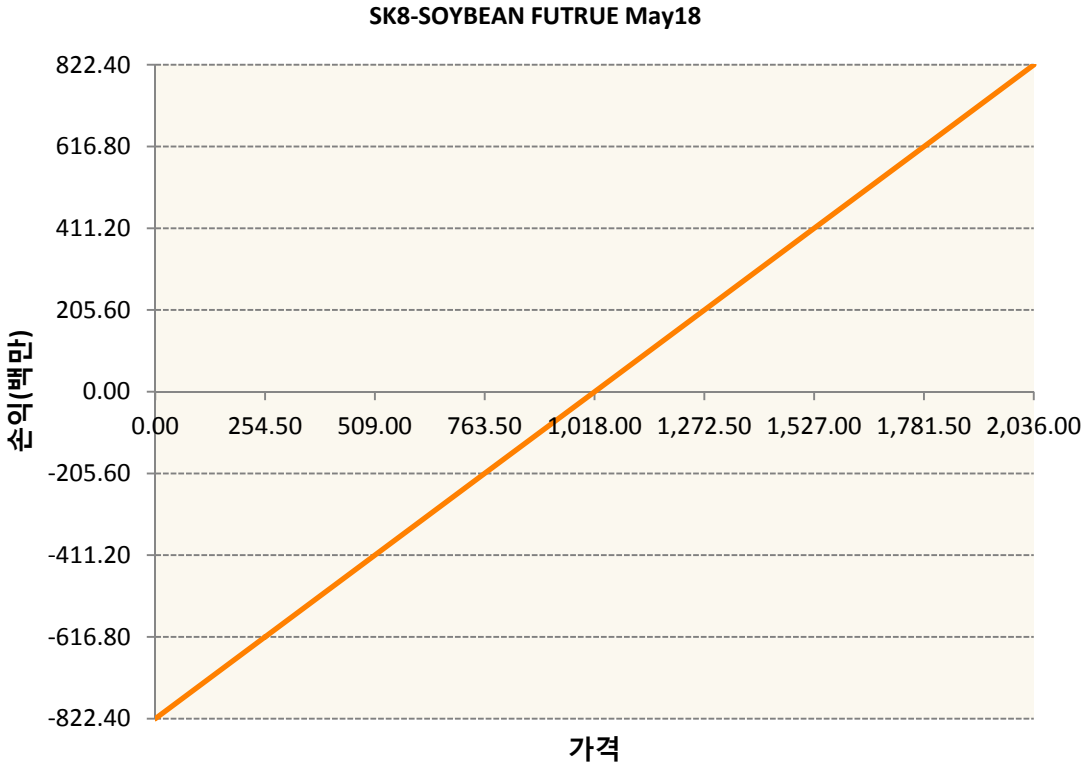

KCK8-COFFEE 'C' FUTURE May18
333.17
249.88
166.58
83.29
0.00
-83.29
-166.58
-249.88
0.00
29.44
58.88
88.31
117.75
147.19
176.63
206.06
235.50
손익(백만)


-333.17
가격

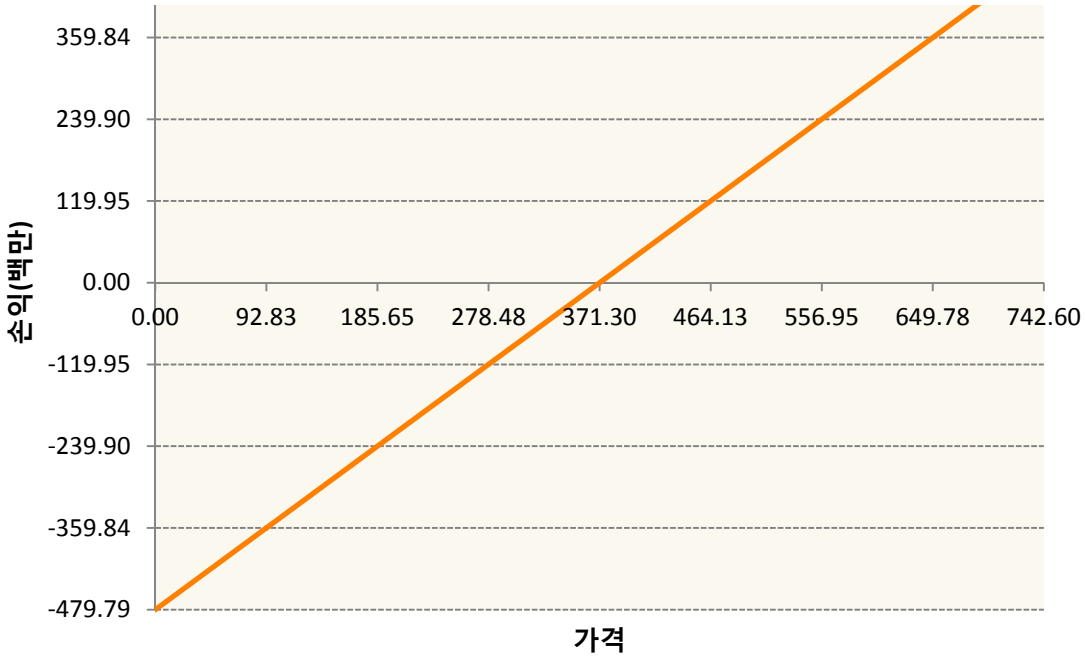

KR4175N40005-2018-04 달러선물
239.45
159.63
79.82
0.00
-79.82
-159.63
-239.45
-319.26
0.00
266.05
532.10
798.15
1,064.20
1,330.25
1,596.30
1,862.35
2,128.40
손익(백만)
가격

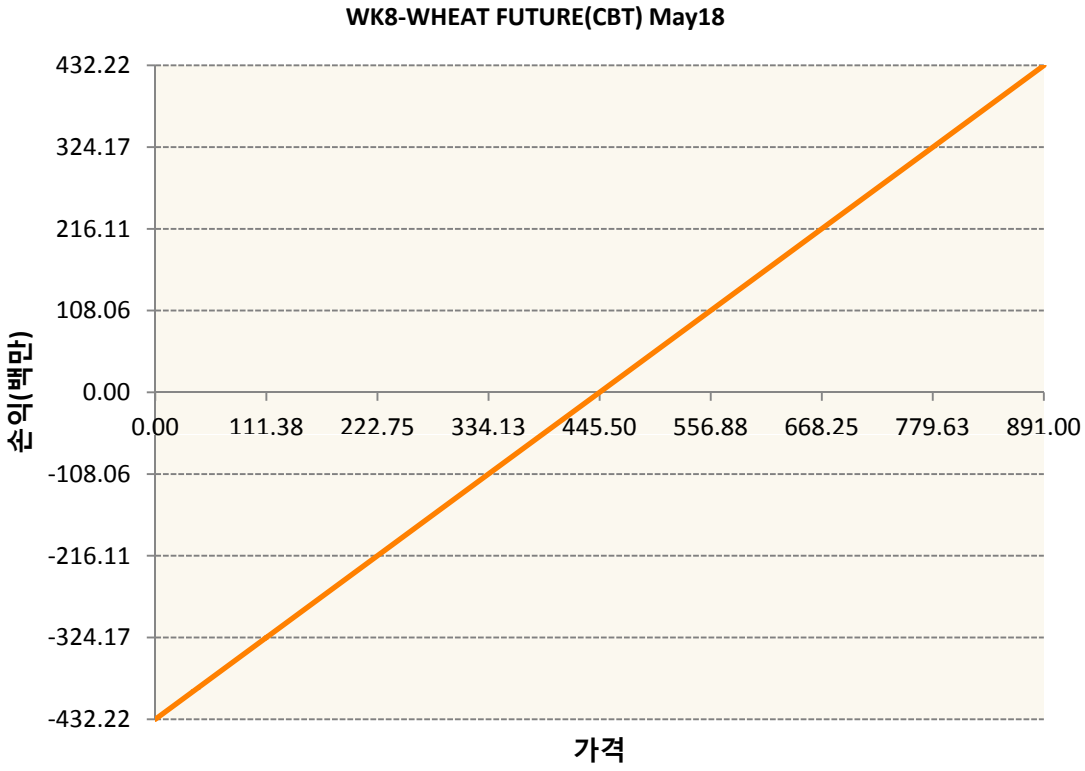

KWK8-KC HRW WHEAT FUT May18
173.93
130.45
86.97
43.48
0.00
-43.48
-86.97
-130.45
-173.93
0.00
115.25
230.50
345.75
461.00
576.25
691.50
806.75
922.00
손익(백만)
가격


SBK8-SUGAR #11 (WORLD) May18
353.91
265.43
176.95
88.48
0.00
-88.48
-176.95
-265.43
-353.91
0.00
3.05
6.11
9.16
12.21
15.26
18.32
21.37
24.42
손익(백만)
가격


SK8-SOYBEAN FUTRUE May18
822.40
616.80
411.20
205.60
0.00
-205.60
-411.20
-616.80
-822.40
0.00
254.50
509.00
763.50
1,018.00
1,272.50
1,527.00
1,781.50
2,036.00
손익(백만)
가격


SMK8-SOYBEAN MEAL FUTR May18





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

BOK8	SOYBEAN OIL FUTR May18	28
CK8	CORN FUTURE May18	69
CTK8	COTTON NO.2 FUTR May18	17
KCK8	COFFEE 'C' FUTURE May18	27
KR4175N40(	2018-04 달러선물	26

KWK8	KC HRW WHEAT FUT May18	14
SBK8	SUGAR #11 (WORLD) May18	28
SK8	SOYBEAN FUTRUE May18	66
SMK8	SOYBEAN MEAL FUTR May18	38
WK8	WHEAT FUTURE(CBT) May18	35

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

325