공시일	2018-04-02
기준일	2018-03-30

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

공시일	2018-04-02
기준일	2018-03-30

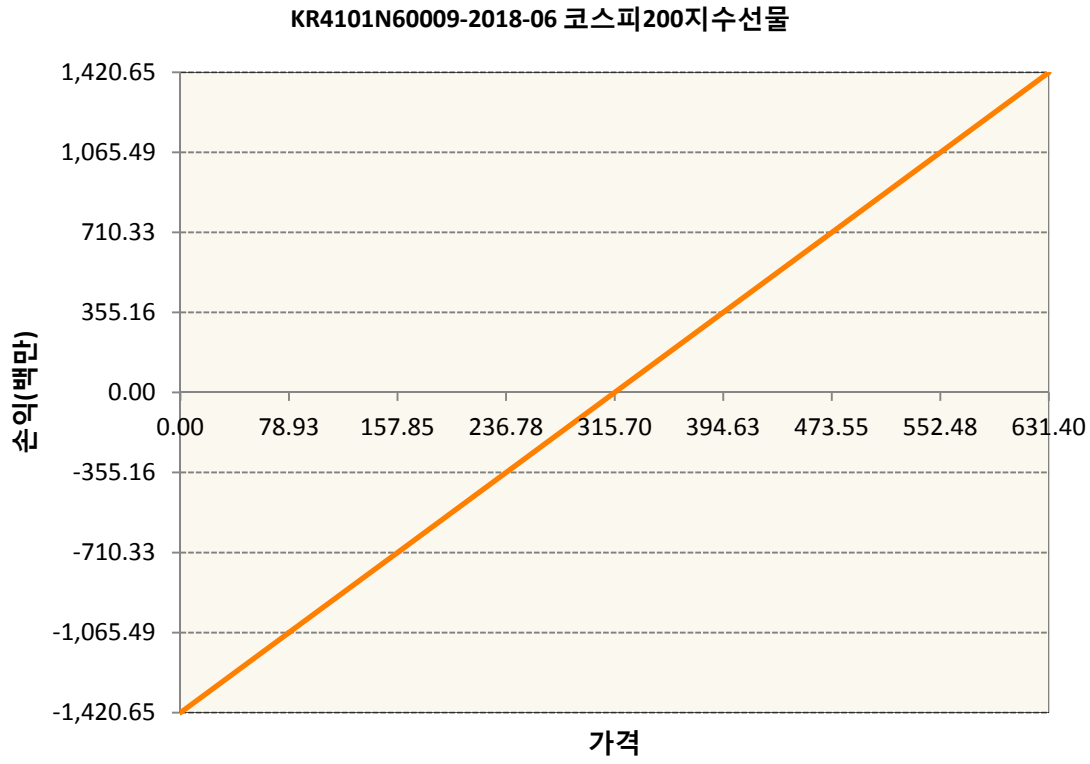
스마트인덱스모

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	1,421	0	1,421	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%	-76	-76	-76	-76	-76	-76	-76
-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%	76	76	76	76	76	76	76
8.00%	113	113	113	113	113	113	113

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

82

공시일	2018-04-02
기준일	2018-03-30

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	1,086

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

428

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2018-04-02
기준일	2018-03-30

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	412

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

443

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2018-04-02
기준일	2018-03-30

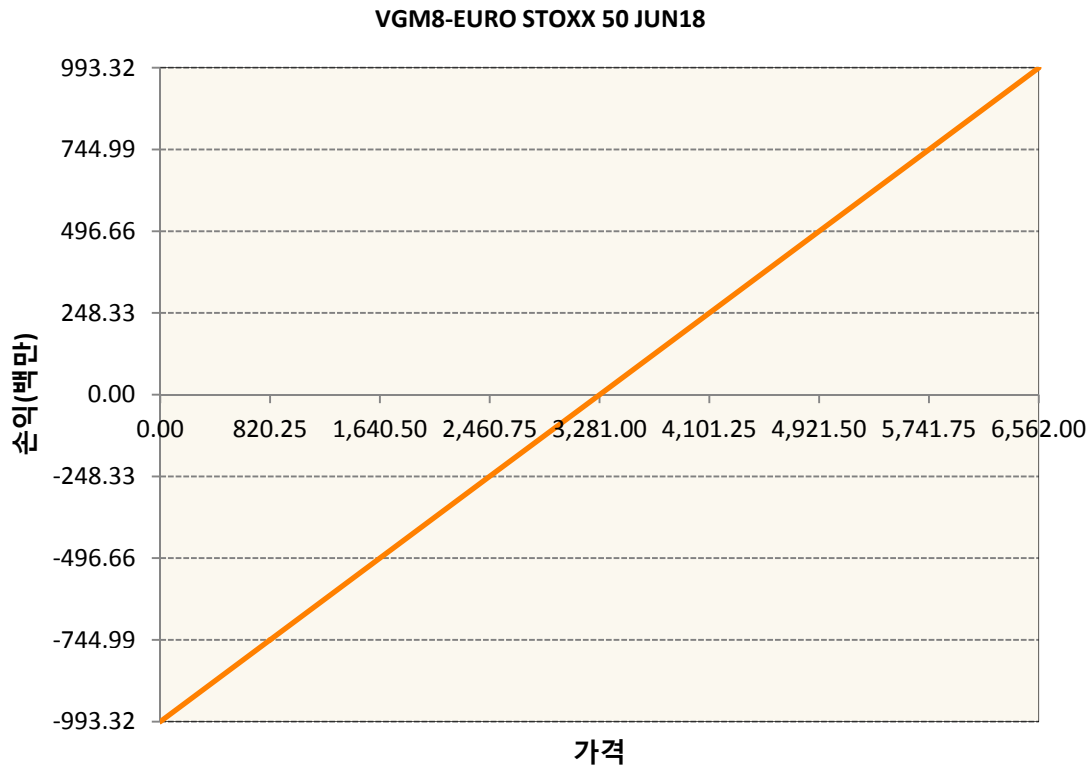
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	993	0	993	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGM8	EURO STOXX 50 JUN18	79

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

(단위:백만원)

48

공시일	2018-04-02
기준일	2018-03-30

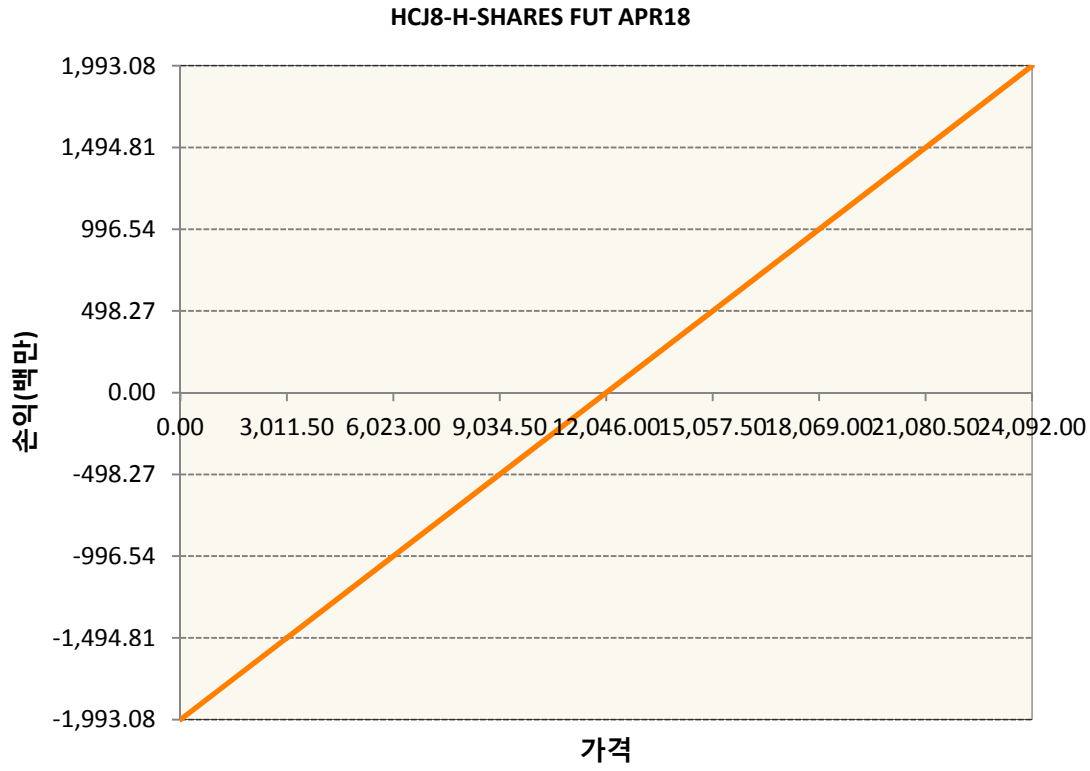
차이나인덱스모(주식-파생형)

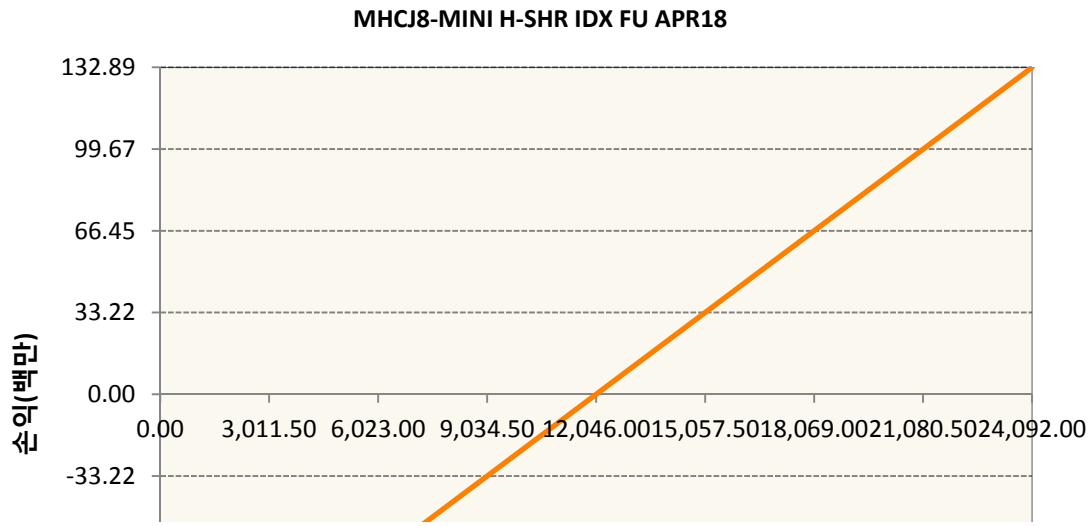
1. 계약금액

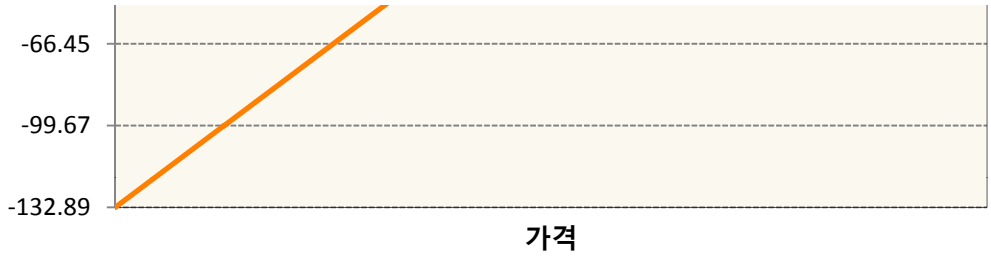
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,126	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)
	148

공시일	2018-04-02
기준일	2018-03-30

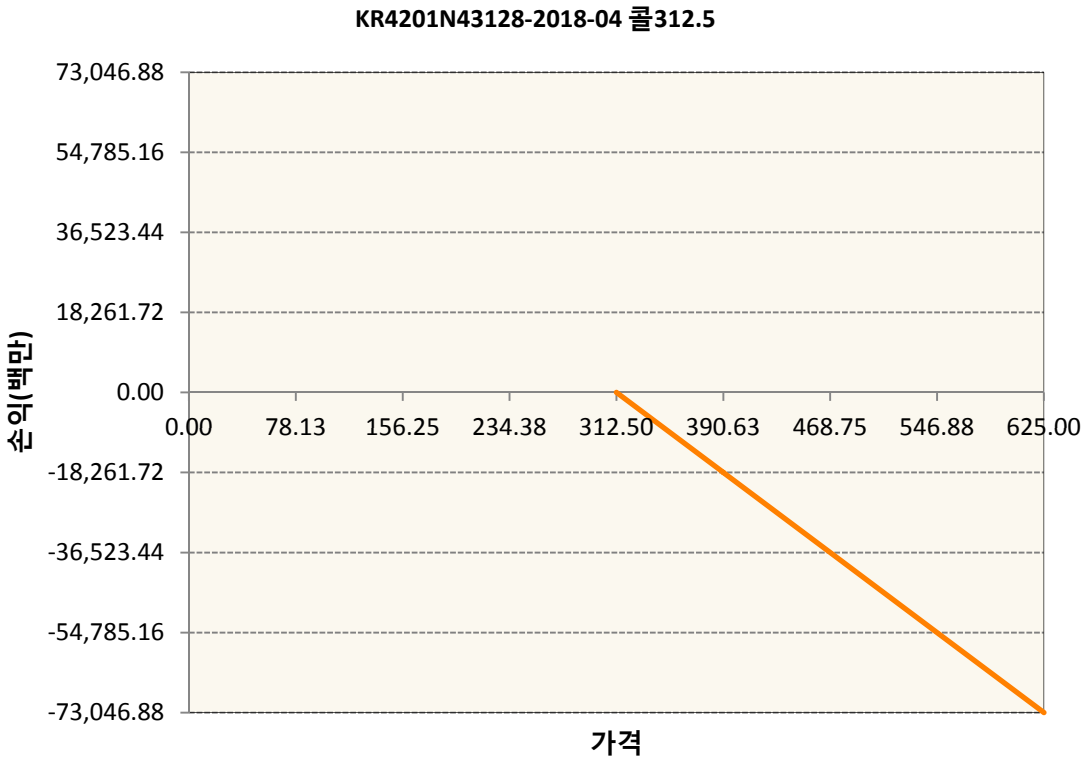
커버드콜모(주식혼합-파생형)

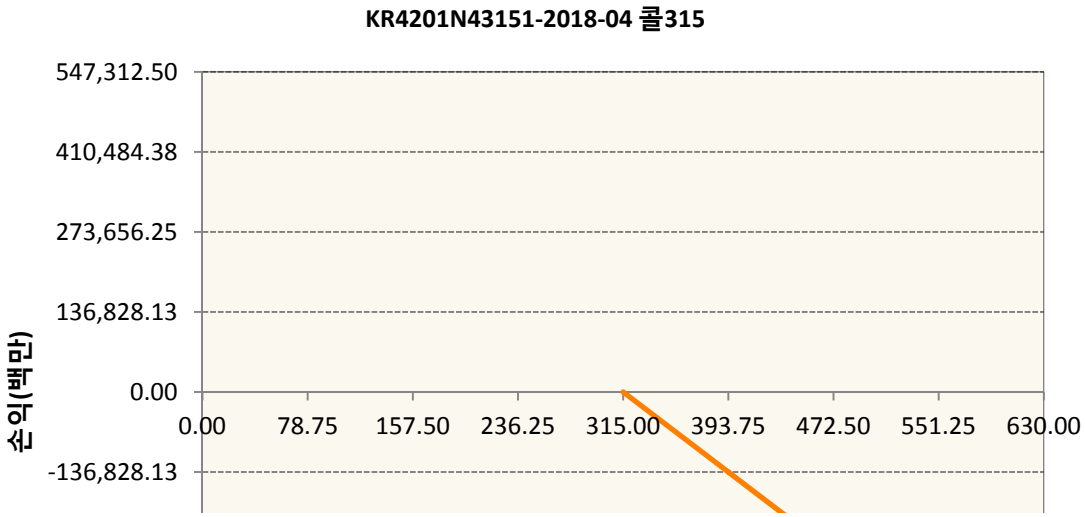
1. 계약금액

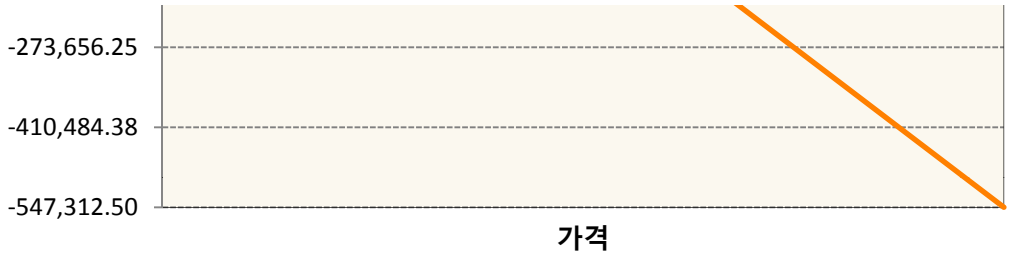
(단위:백만원)

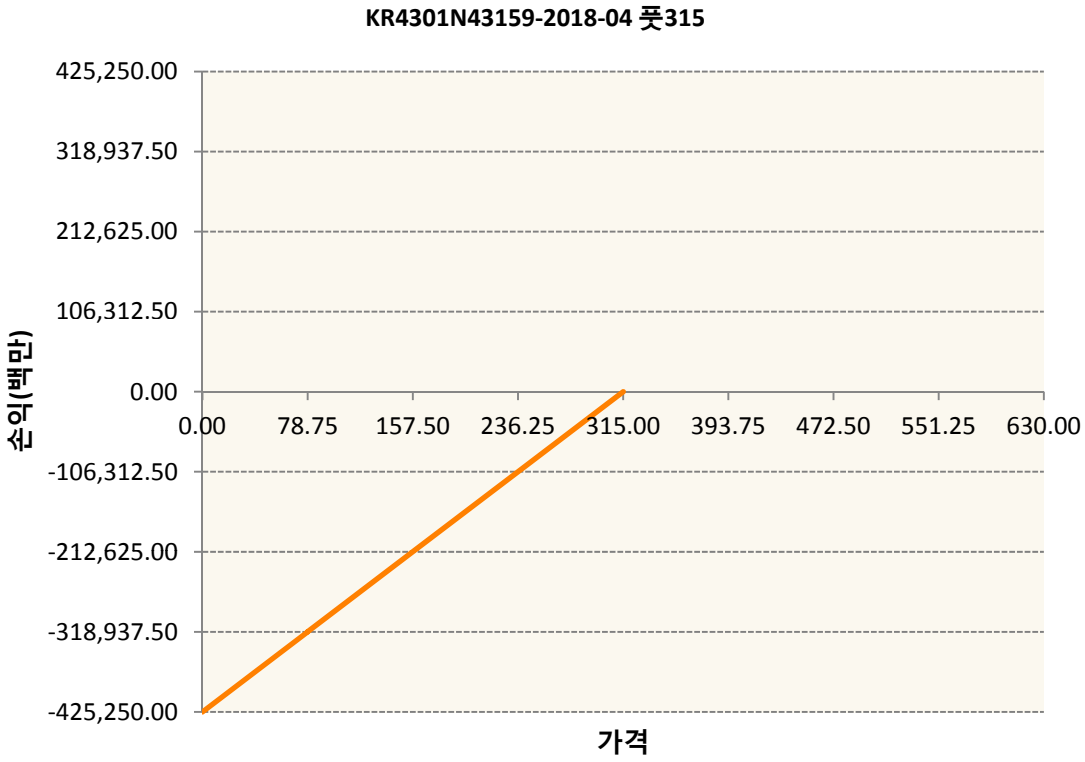
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	1,148	0	1,148	장내
누계	유가증권	옵션	0	1,045,609	-1,045,609	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201N4312018-04 콜312.5							4,811
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,792	1,768	1,736	1,695	1,647	1,591	1,530
-5.33%	1,662	1,595	1,521	1,440	1,352	1,261	1,165
-2.67%	1,254	1,140	1,023	905	785	663	541
0%	386	257	129	0	-129	-258	-387
2.67%	-977	-1,074	-1,176	-1,283	-1,393	-1,506	-1,622
5.33%	-2,692	-2,742	-2,803	-2,872	-2,948	-3,031	-3,119
8.00%	-4,577	-4,596	-4,623	-4,658	-4,702	-4,753	-4,811
KR4201N4312018-04 콜315							34,168
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	11,198	11,072	10,891	10,654	10,361	10,015	9,621

-5.33%	10,545	10,152	9,692	9,174	8,605	7,994	7,347
-2.67%	8,264	7,498	6,701	5,879	5,037	4,180	3,311
0%	2,909	1,939	970	0	-970	-1,939	-2,909
2.67%	-6,180	-7,003	-7,853	-8,723	-9,610	-10,510	-11,421
5.33%	-18,270	-18,753	-19,304	-19,911	-20,567	-21,263	-21,992
8.00%	-32,003	-32,204	-32,474	-32,811	-33,208	-33,663	-34,168
KR4301N4312018-04 풋315							28,578
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-28,425	-28,429	-28,437	-28,454	-28,481	-28,522	-28,578
-5.33%	-17,158	-17,213	-17,293	-17,401	-17,536	-17,698	-17,884
-2.67%	-6,517	-6,792	-7,096	-7,423	-7,769	-8,131	-8,507
0%	1,442	962	481	0	-481	-962	-1,443
2.67%	5,078	4,763	4,422	4,060	3,681	3,288	2,883
5.33%	5,924	5,840	5,725	5,578	5,400	5,195	4,965
8.00%	6,017	6,007	5,987	5,954	5,902	5,831	5,740

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

71,815

공시일	2018-04-02
기준일	2018-03-30

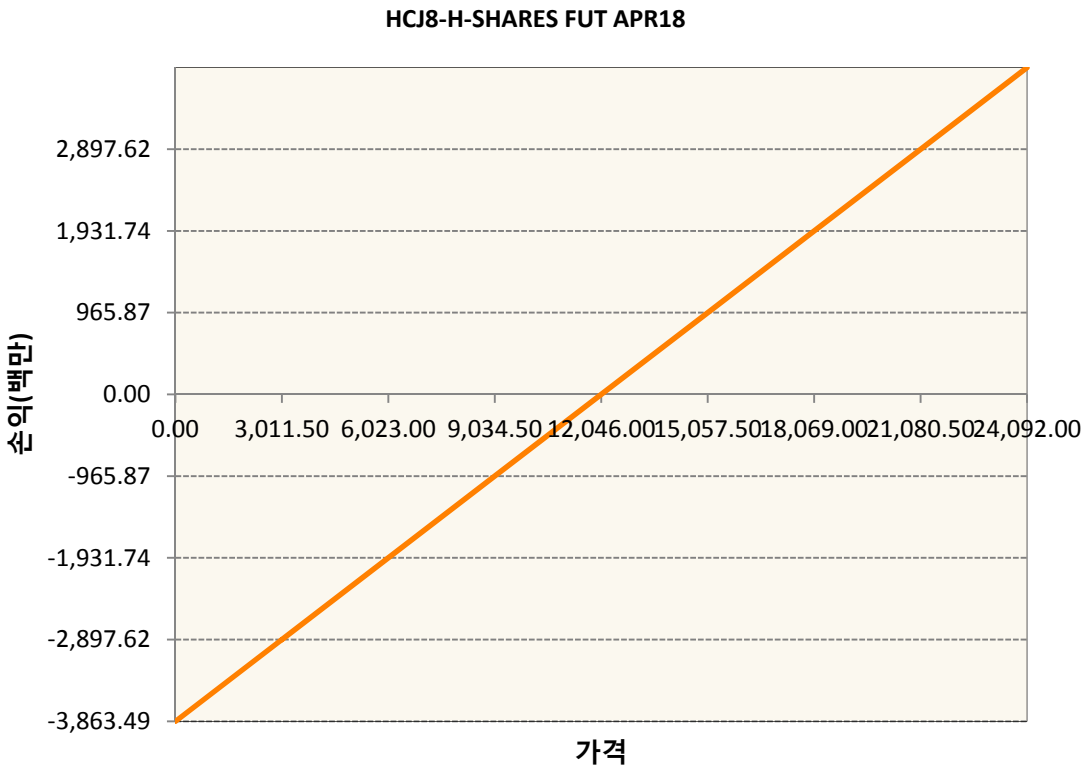
홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생

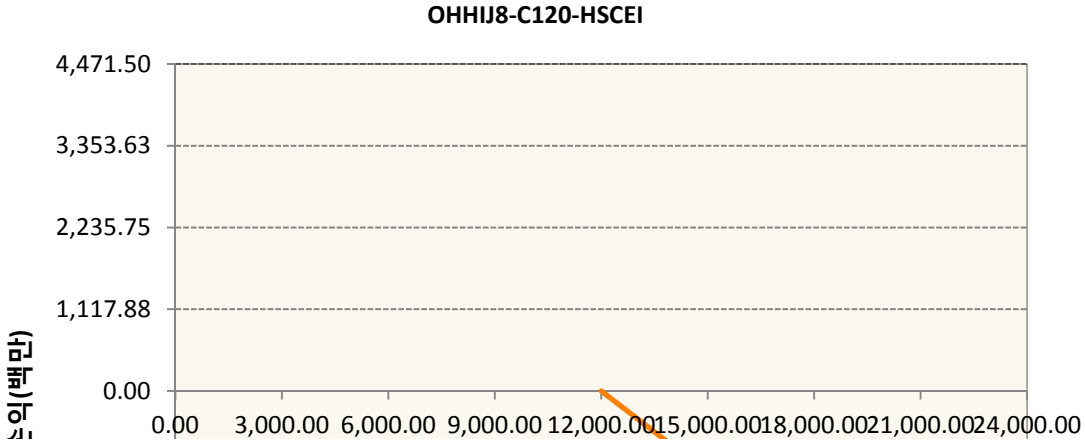
1. 계약금액

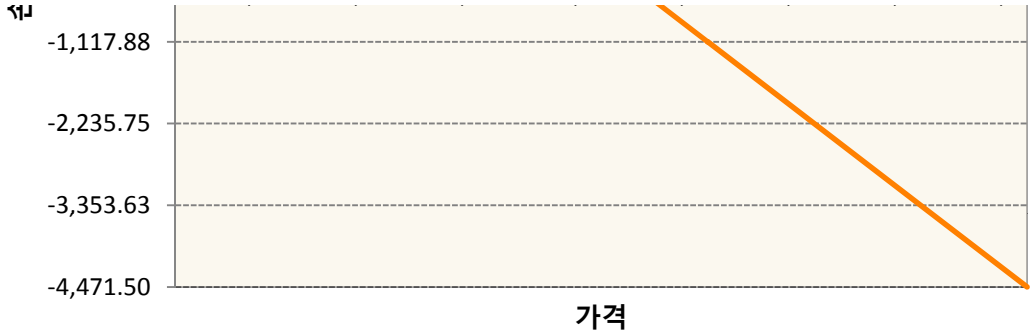
(단위:백만원)

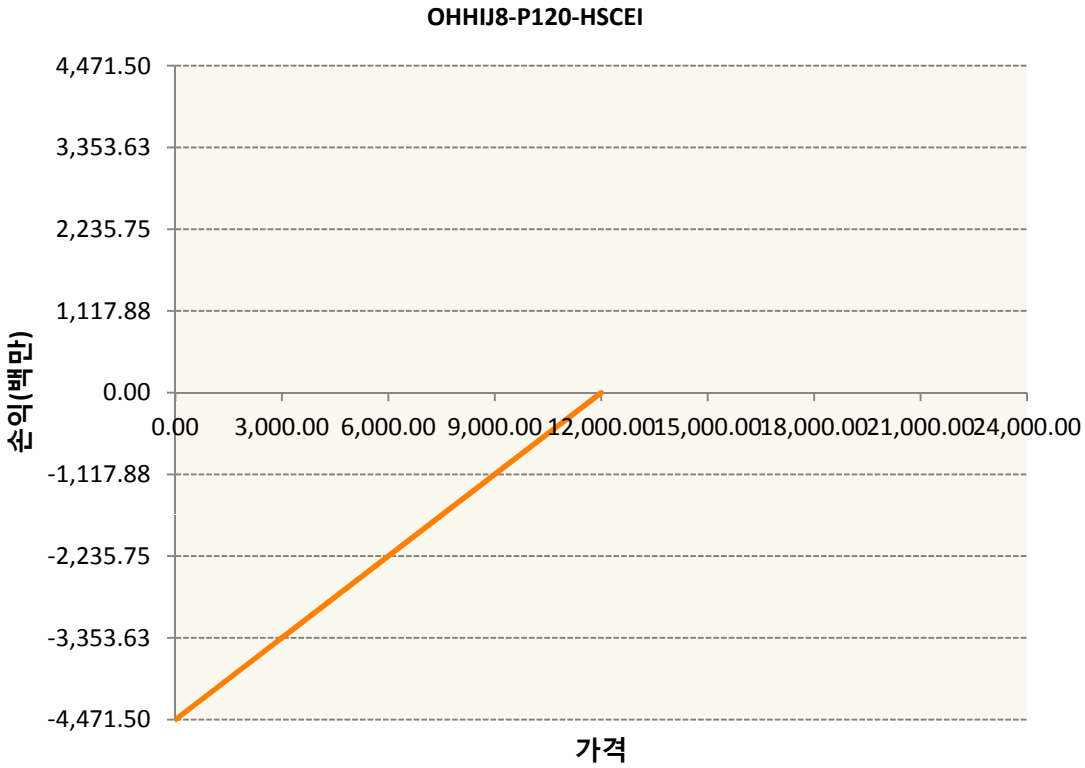
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	3,863	0	3,863	장내
누계	유가증권	옵션	0	8,943	-8,943	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCJ8	H-SHARES FUT APR18	309
OHHIJ8-C12	HSCEI	358
OHHIJ8-P12	HSCEI	358

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	893

공시일	2018-04-02
기준일	2018-03-30

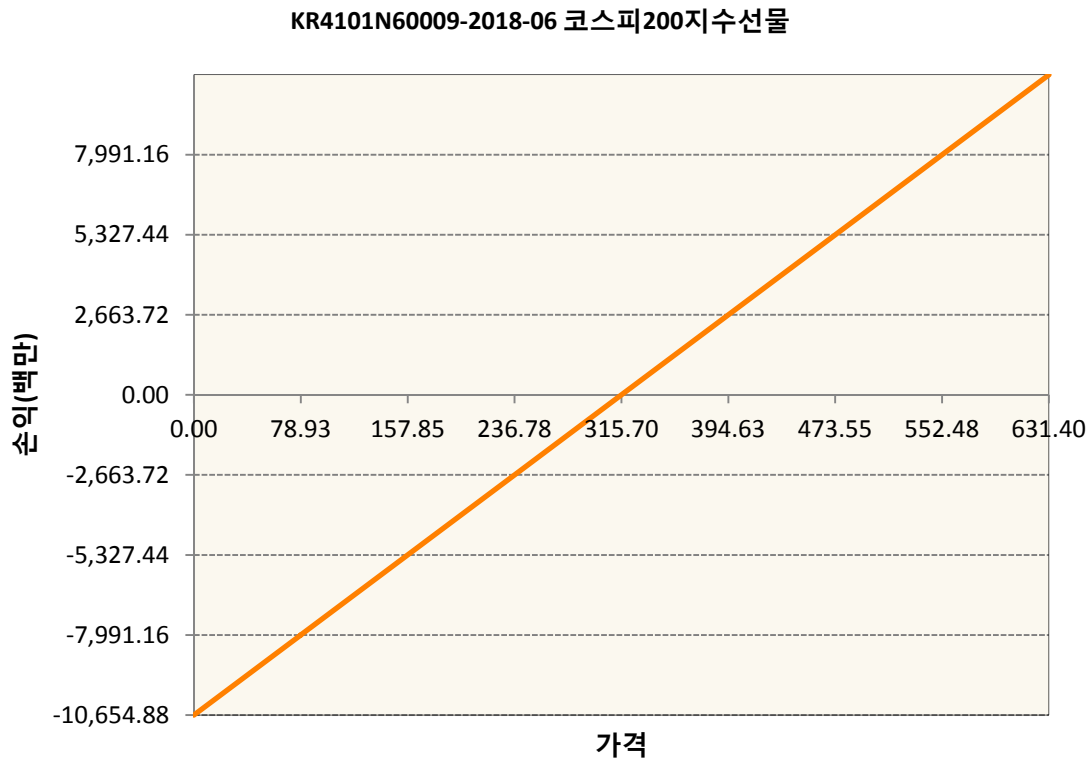
코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼

1. 계약금액

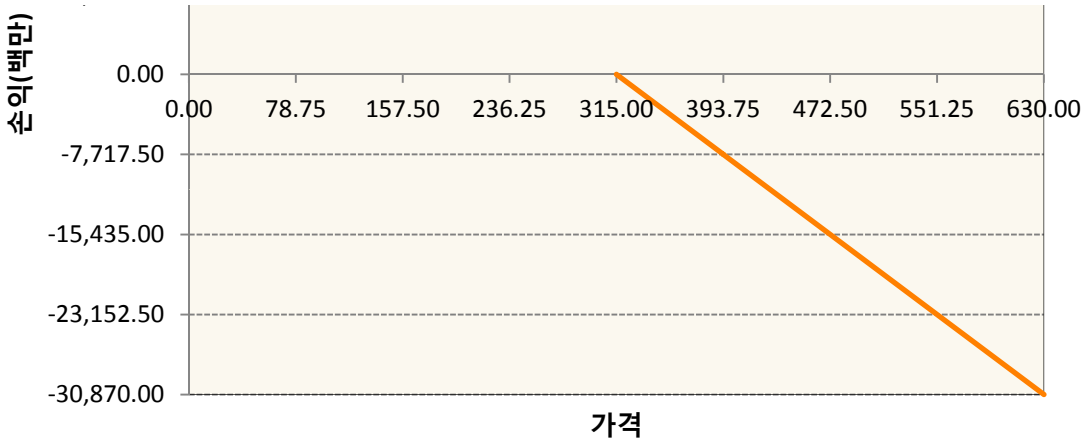
(단위:백만원)

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	10,655	0	10,655	장내
누계	유가증권	스왑	54,200	0	54,200	장외
누계	유가증권	옵션	0	55,718	-55,718	장내

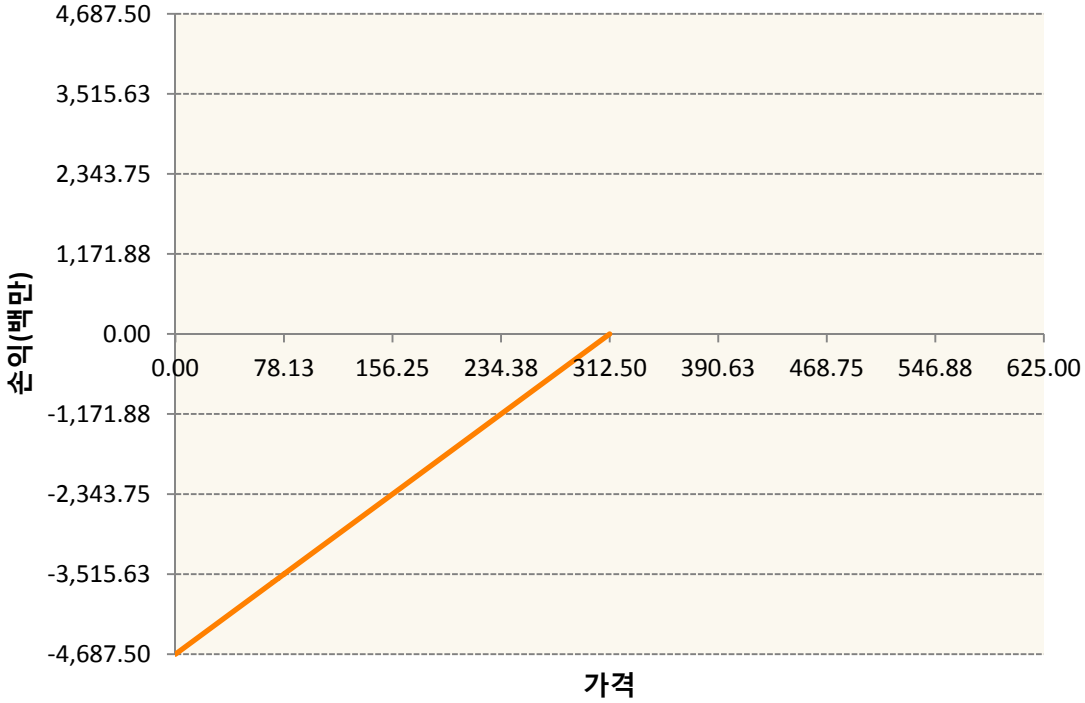
2. 만기시점의 손익구조



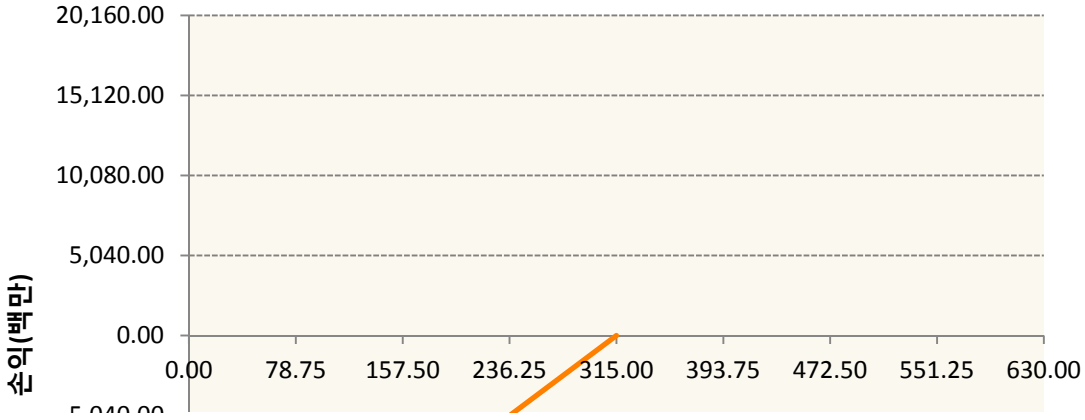




KR4301N43126-2018-04 풋312.5



KR4301N43159-2018-04 풋315





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_2							1,449
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,449	-1,449	-1,449	-1,449	-1,449	-1,449	-1,449
-5.33%	-966	-966	-966	-966	-966	-966	-966
-2.67%	-483	-483	-483	-483	-483	-483	-483
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	483	483	483	483	483	483	483
5.33%	966	966	966	966	966	966	966
8.00%	1,449	1,449	1,449	1,449	1,449	1,449	1,449
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						463
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-463	-463	-463	-463	-463	-463	-463
-5.33%	-309	-309	-309	-309	-309	-309	-309
-2.67%	-154	-154	-154	-154	-154	-154	-154
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	154	154	154	154	154	154	154
5.33%	309	309	309	309	309	309	309
8.00%	463	463	463	463	463	463	463
	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						626
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-626	-626	-626	-626	-626	-626	-626
-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%	626	626	626	626	626	626	626
	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%	-313	-313	-313	-313	-313	-313	-313
-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%	313	313	313	313	313	313	313
8.00%	470	470	470	470	470	470	470
	KR4101N60(2018-06 코스피200지수선물						849
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-849	-849	-849	-849	-849	-849	-849
-5.33%	-566	-566	-566	-566	-566	-566	-566
-2.67%	-283	-283	-283	-283	-283	-283	-283
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	283	283	283	283	283	283	283
5.33%	566	566	566	566	566	566	566
8.00%	849	849	849	849	849	849	849
	KR4201N431 2018-04 콜315						1,927
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	632	625	614	601	584	565	543
-5.33%	595	573	547	517	485	451	414
-2.67%	466	423	378	332	284	236	187
0%	164	109	55	0	-55	-109	-164
2.67%	-349	-395	-443	-492	-542	-593	-644
5.33%	-1,031	-1,058	-1,089	-1,123	-1,160	-1,199	-1,240
8.00%	-1,805	-1,816	-1,832	-1,851	-1,873	-1,899	-1,927
	KR4301N431 2018-04 풋312.5						299
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-296	-296	-296	-297	-297	-298	-299
-5.33%	-172	-173	-174	-176	-178	-180	-183
-2.67%	-59	-63	-67	-72	-76	-81	-85
0%	16	10	5	0	-5	-10	-16
2.67%	44	41	38	35	31	28	24
5.33%	49	48	47	46	45	43	41
8.00%	49	49	49	49	48	48	47
	KR4301N431 2018-04 풋315						1,355

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,348	-1,348	-1,348	-1,349	-1,350	-1,352	-1,355
-5.33%	-813	-816	-820	-825	-831	-839	-848
-2.67%	-309	-322	-336	-352	-368	-385	-403
0%	68	46	23	0	-23	-46	-68
2.67%	241	226	210	192	174	156	137
5.33%	281	277	271	264	256	246	235
8.00%	285	285	284	282	280	276	272

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

8,655

공시일	2018-04-02
기준일	2018-03-30

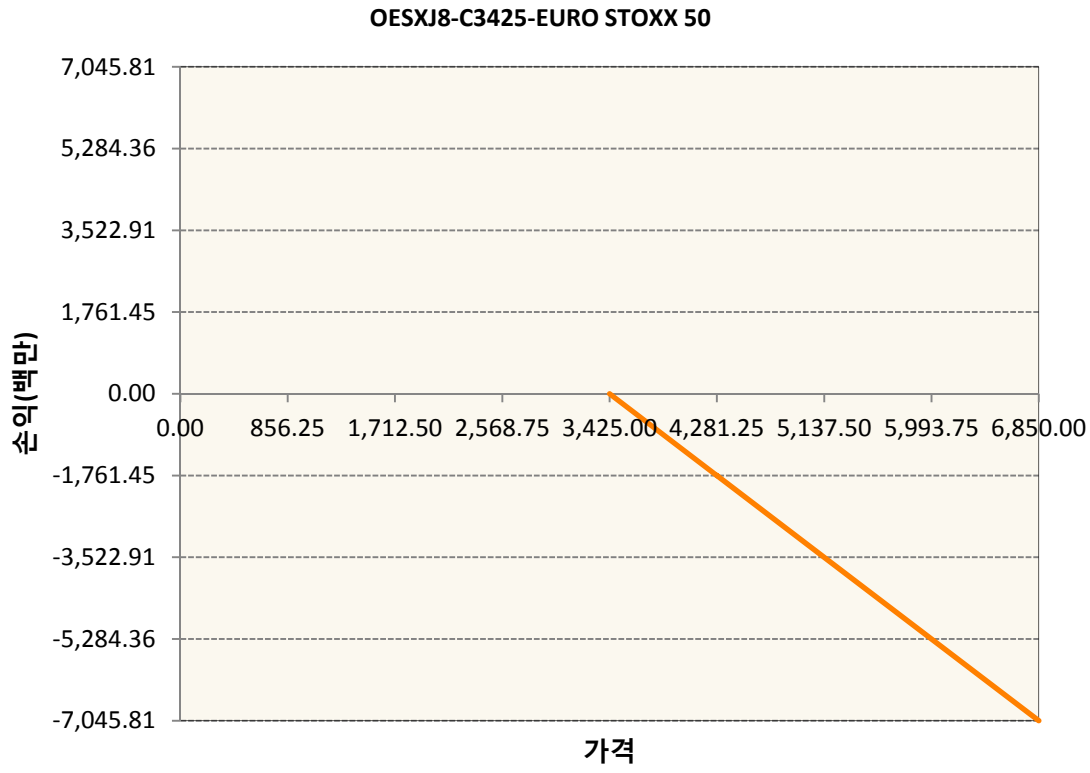
유로커버드콜모(주식혼합-파생형

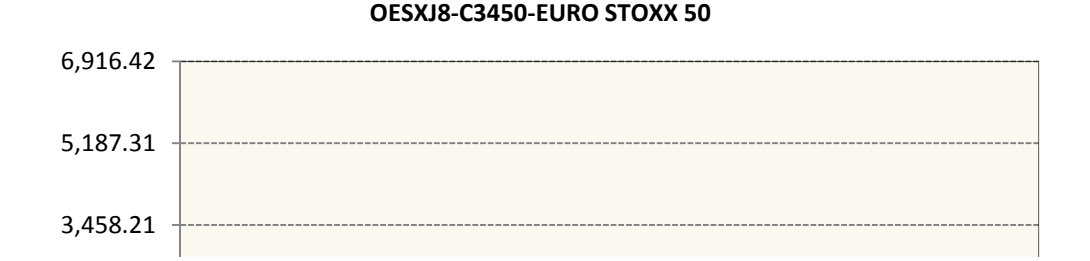
1. 계약금액

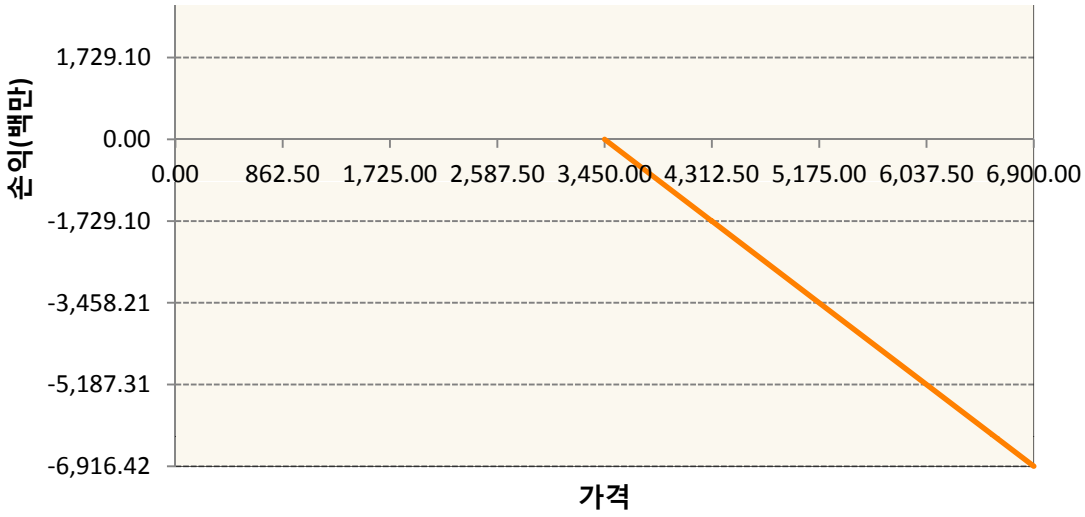
(단위:백만원)

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	5,437	0	5,437	
누계	유가증권	스왑	98,271	0	98,271	장외
누계	유가증권	옵션	0	27,924	-27,924	장내
누계	지수	스왑	52,412	0	52,412	장외

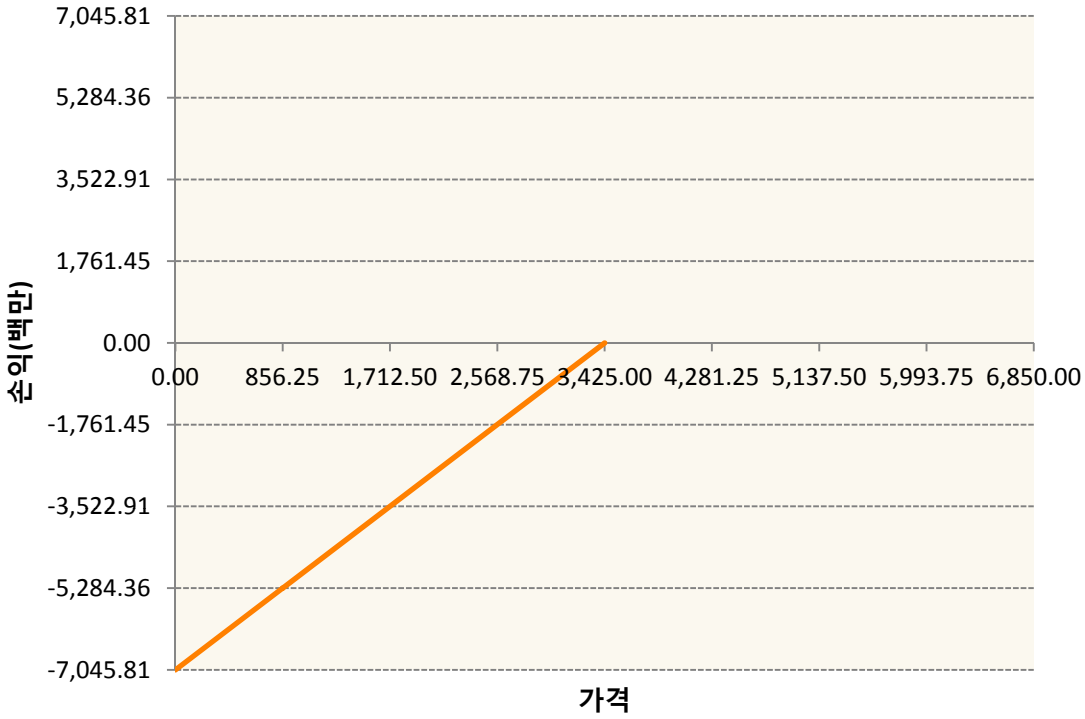
2. 만기시점의 손익구조



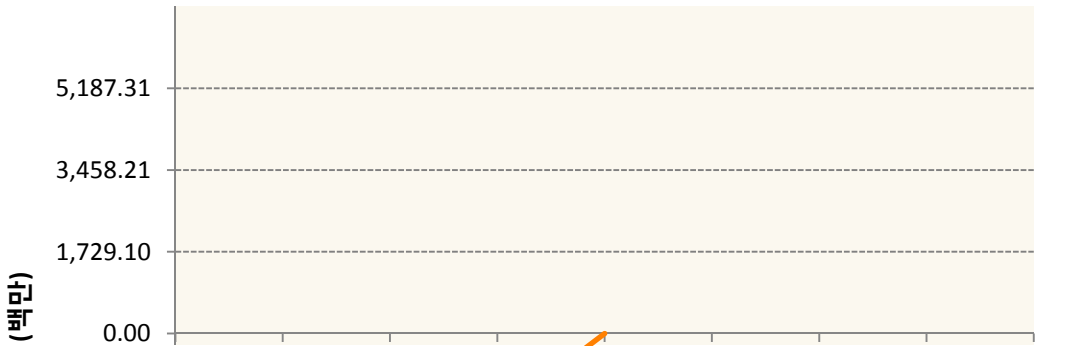


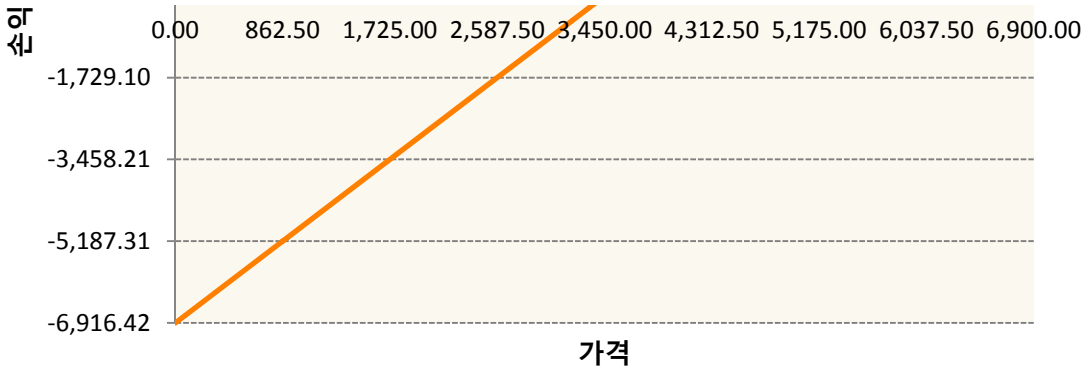


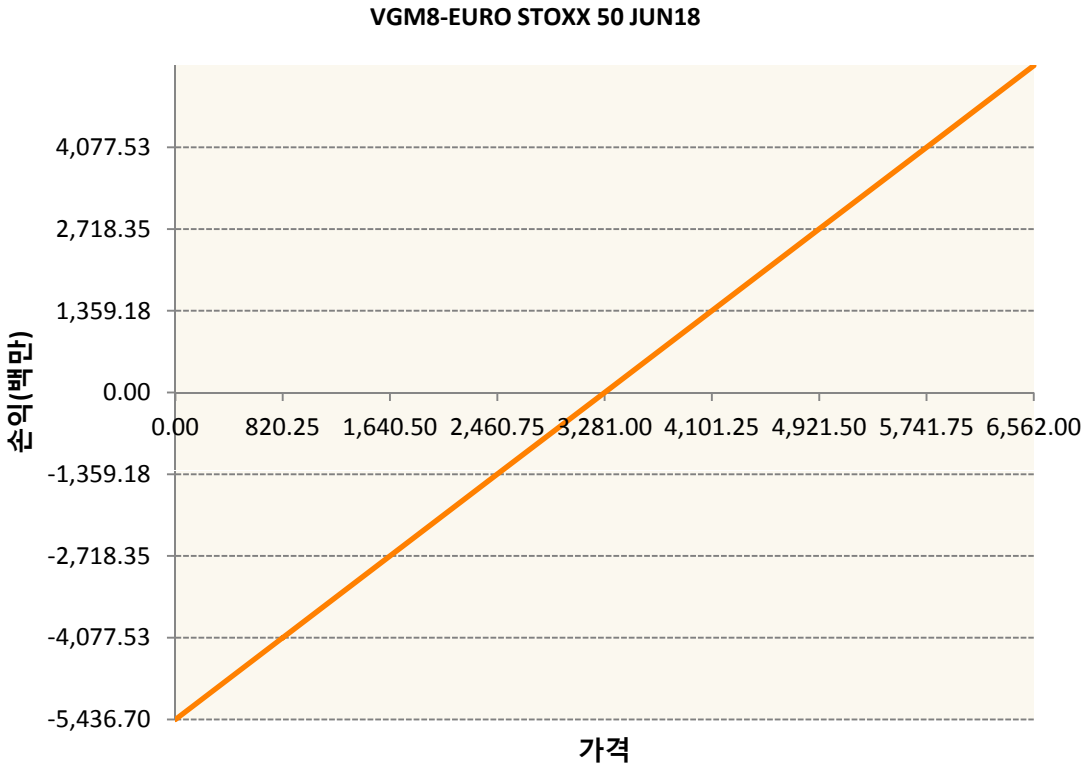
OESXJ8-P3425-EURO STOXX 50



OESXJ8-P3450-EURO STOXX 50







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)	(단위:백만원)
260105SGPX SG EURO Covered CALL STRATEGY - 994.569	205
260105SQPX SG EURO Covered CALL STRATEGY	384
OESXJ8-C34 EURO STOXX 50	564
OESXJ8-C34 EURO STOXX 50	553
OESXJ8-P34 EURO STOXX 50	564
OESXJ8-P34 EURO STOXX 50	553
VGM8 EURO STOXX 50 JUN18	435

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

2,049

공시일	2018-04-02
기준일	2018-03-30

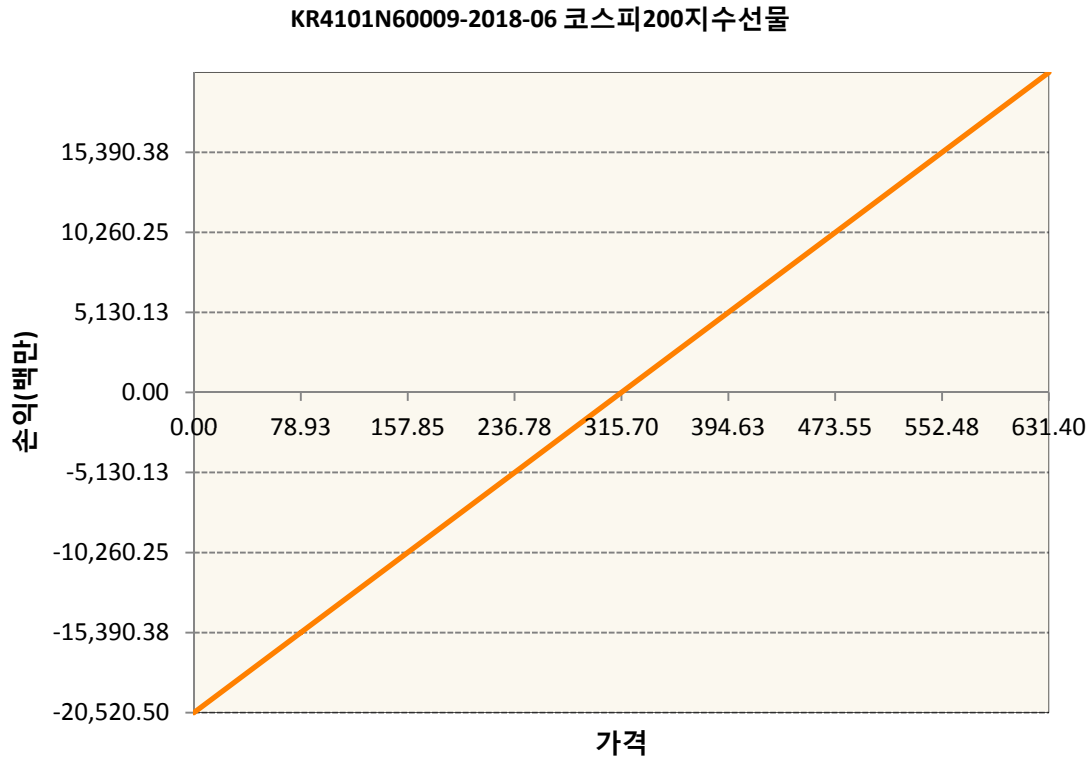
ETF스마트레버리지목표전환형8호

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	20,521	0	20,521	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101N60(2018-06 코스피200지수선물							1,636
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,636	-1,636	-1,636	-1,636	-1,636	-1,636	-1,636
-5.33%	-1,091	-1,091	-1,091	-1,091	-1,091	-1,091	-1,091
-2.67%	-545	-545	-545	-545	-545	-545	-545
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	545	545	545	545	545	545	545
5.33%	1,091	1,091	1,091	1,091	1,091	1,091	1,091
8.00%	1,636	1,636	1,636	1,636	1,636	1,636	1,636

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

1,178

공시일	2018-04-02
기준일	2018-03-30

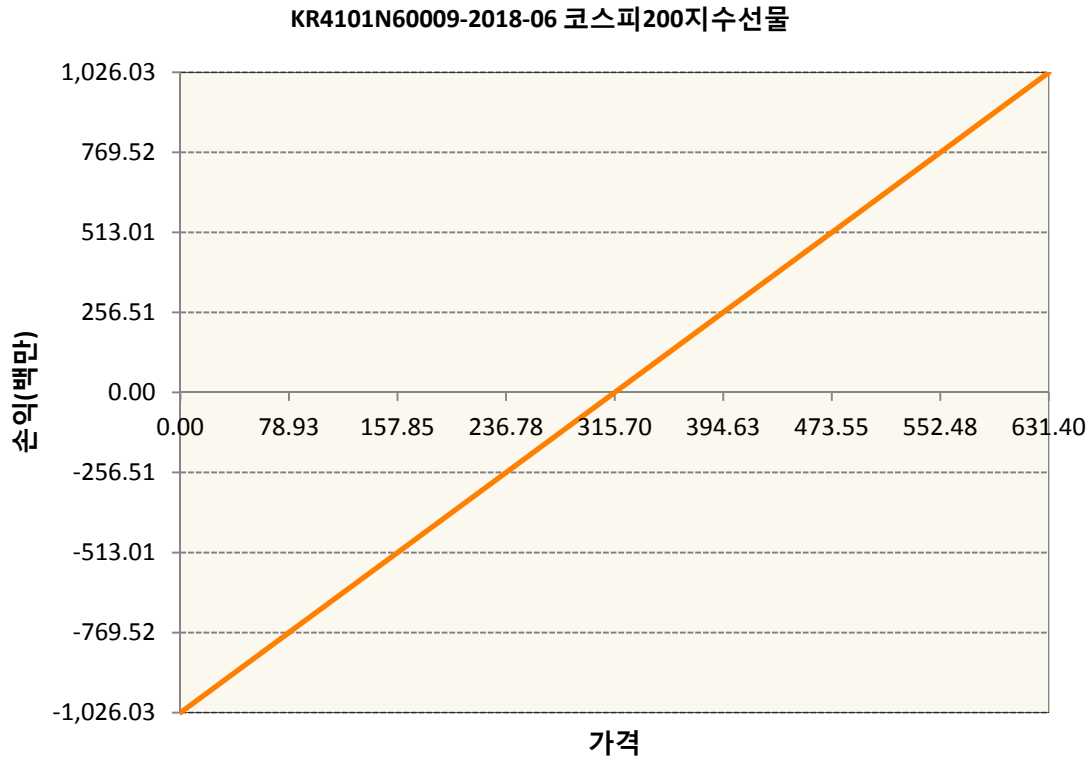
ETF스마트레버리지목표전환형9호

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%	-55	-55	-55	-55	-55	-55	-55
-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%	55	55	55	55	55	55	55
8.00%	82	82	82	82	82	82	82

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

59

공시일	2018-04-02
기준일	2018-03-30

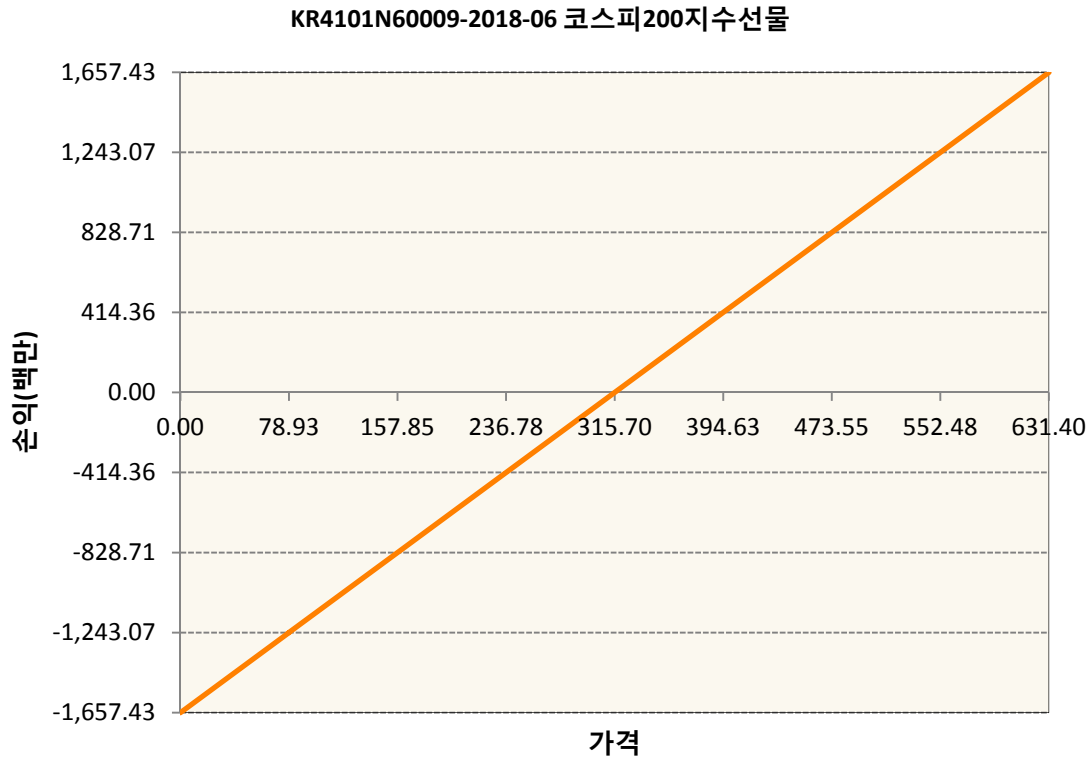
ETF스마트레버리지목표전환형10

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	2018-04-02
기준일	2018-03-30

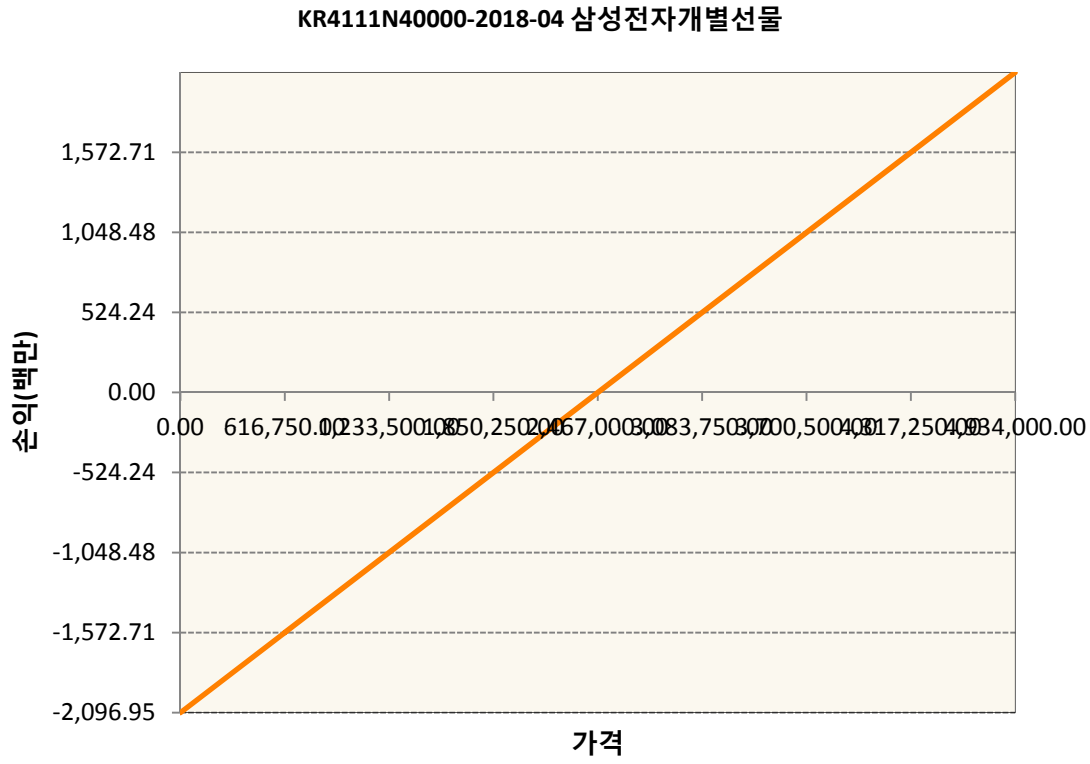
스마트KRX300인덱스1호(주식-파

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	2,097	0	2,097	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%	-112	-112	-112	-112	-112	-112	-112
-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%	112	112	112	112	112	112	112
8.00%	167	167	167	167	167	167	167

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

202

공시일	2018-04-02
기준일	2018-03-30

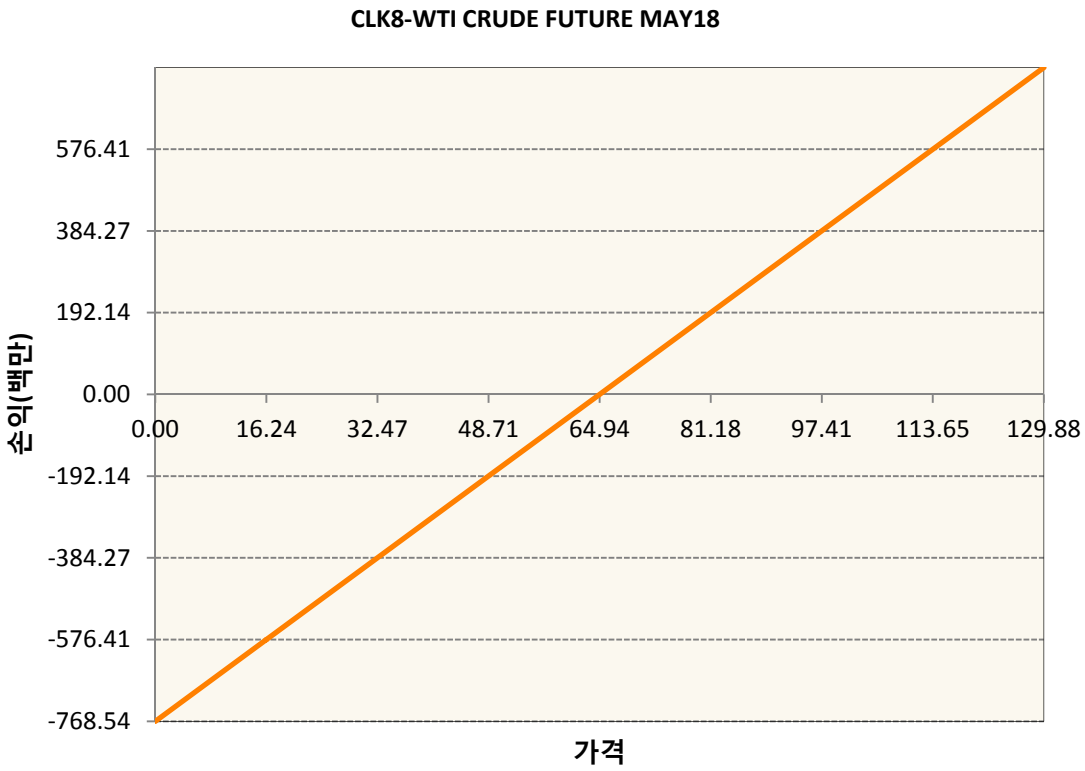
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

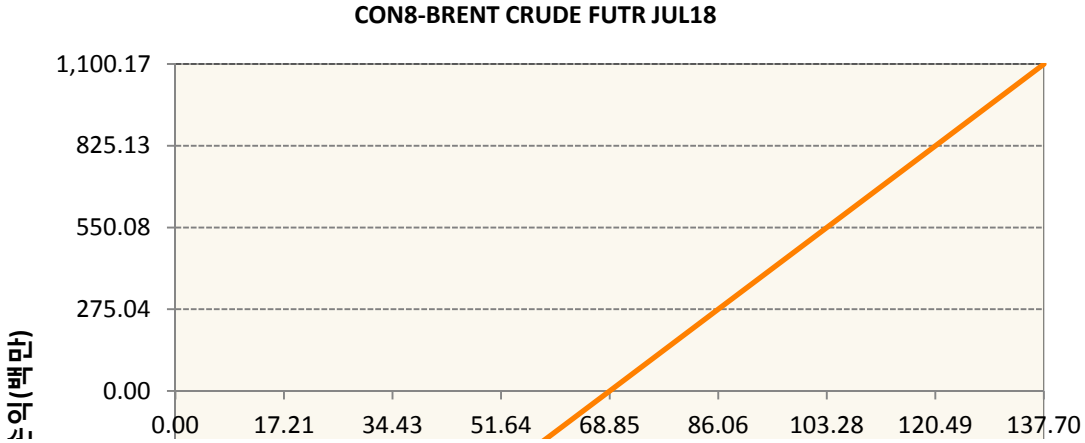
1. 계약금액

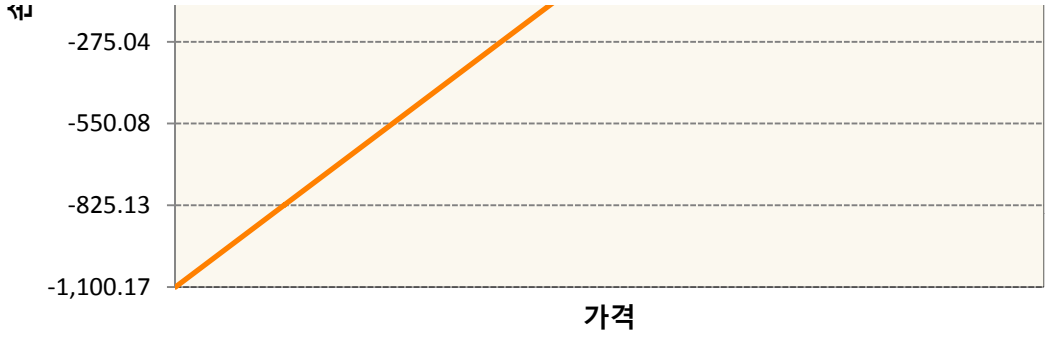
(단위:백만원)

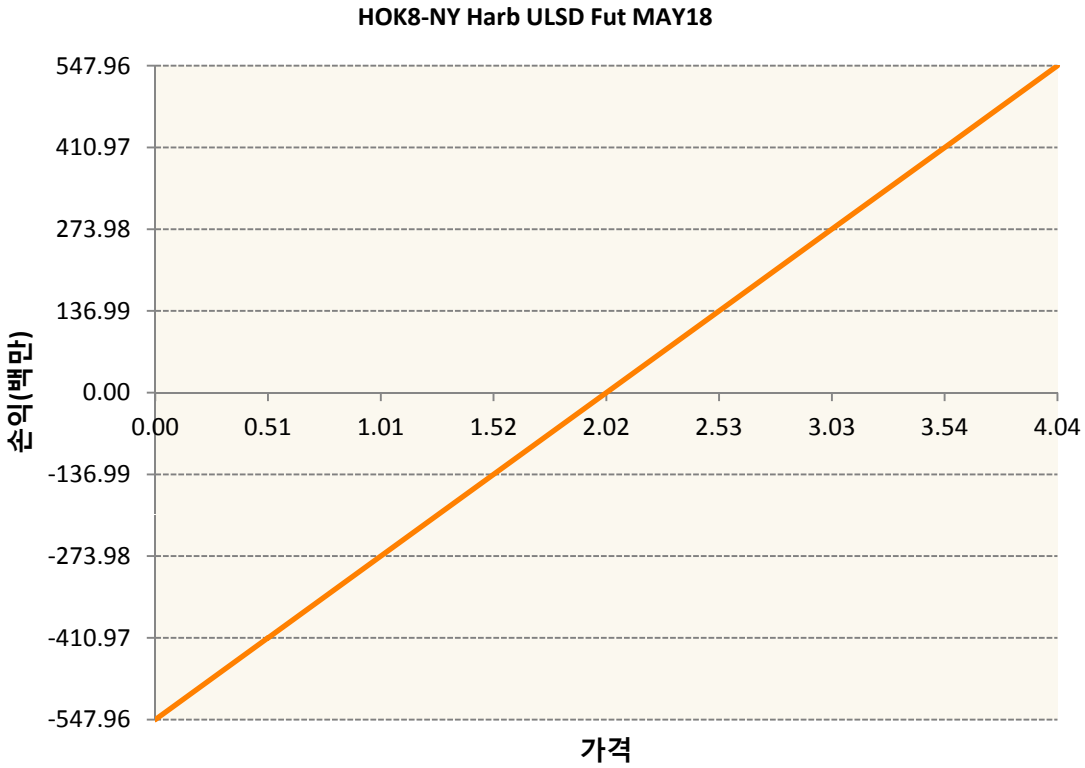
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	선물	유가증권	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	선물	유가증권	769	0	769	
누계	유가증권	선물	3,256	584	2,671	

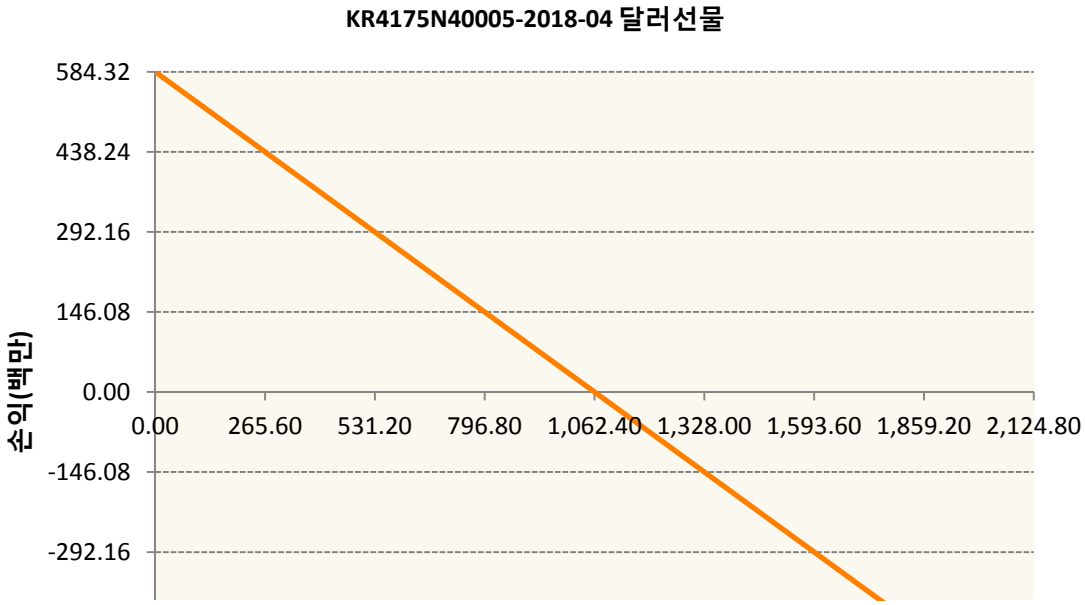
2. 만기시점의 손익구조

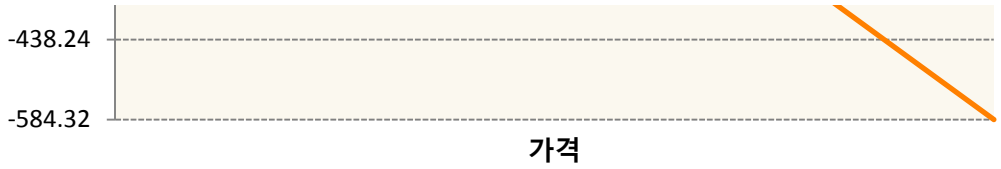


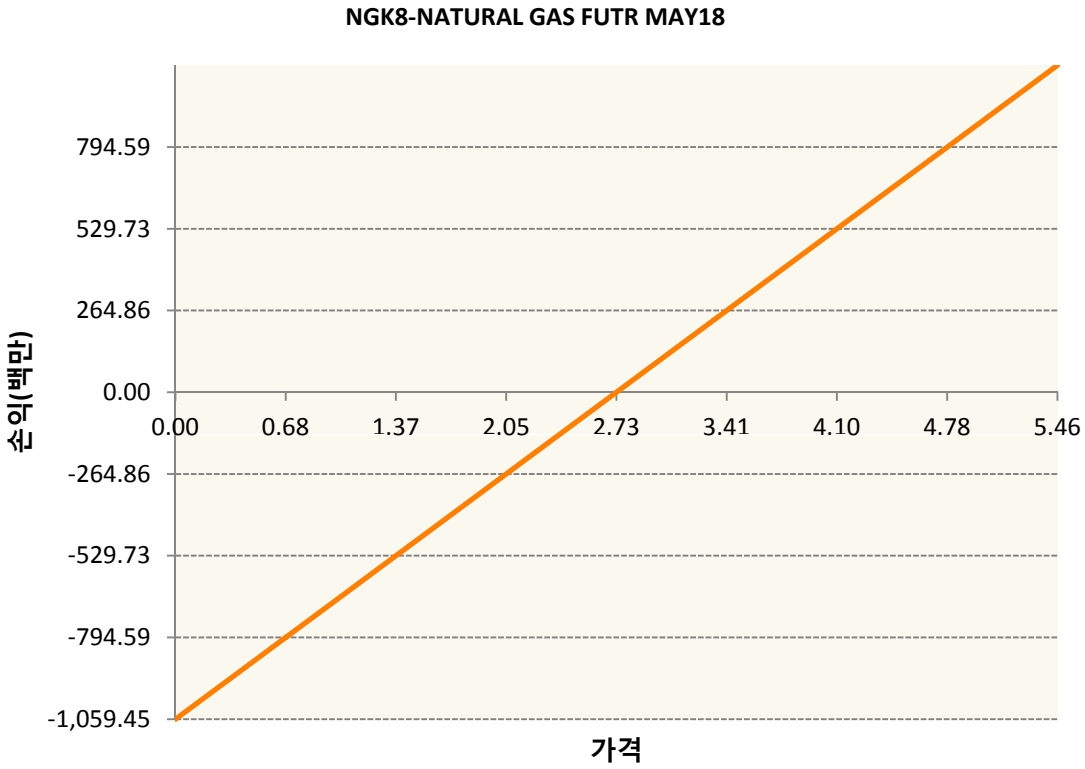


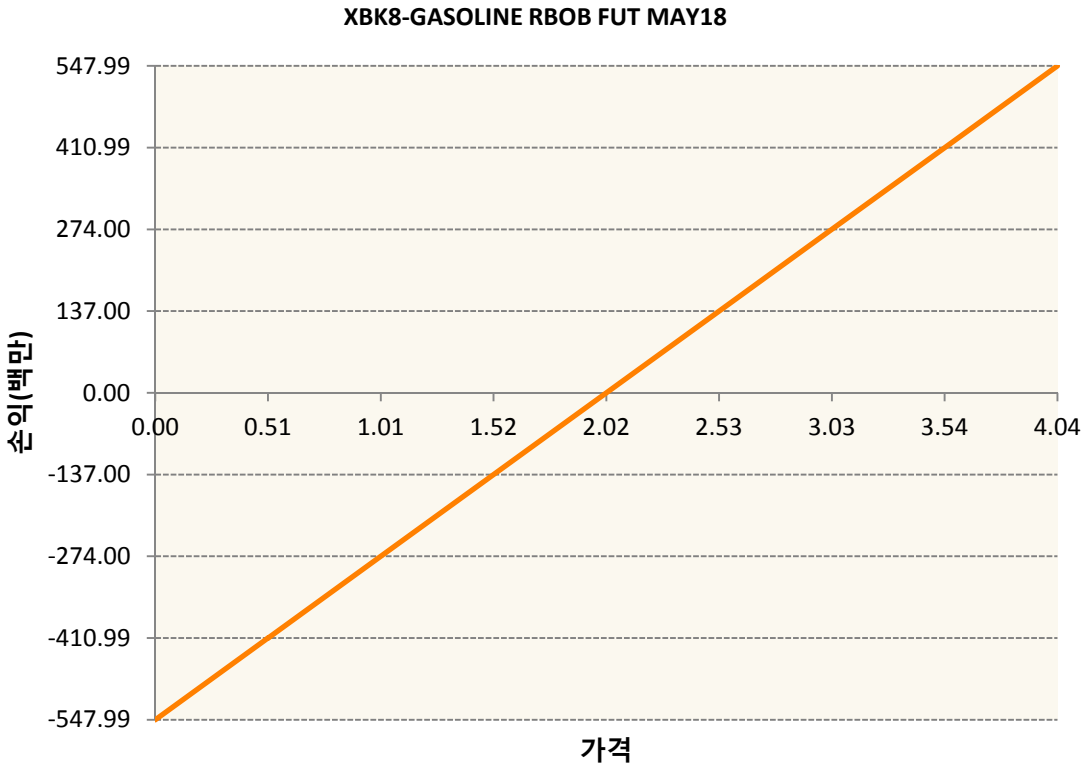

-275.04
-550.08
-825.13
-1,100.17
가격


HOK8-NY Harb ULSD Fut MAY18
547.96
410.97
273.98
136.99
0.00
-136.99
-273.98
-410.97
-547.96
손익(백만)
0.00
0.51
1.01
1.52
2.02
2.53
3.03
3.54
4.04
가격


KR4175N40005-2018-04 달러선물
584.32
438.24
292.16
146.08
0.00
-146.08
-292.16
손익(백만)
0.00
265.60
531.20
796.80
1,062.40
1,328.00
1,593.60
1,859.20
2,124.80


-438.24
-584.32
가격


NGK8-NATURAL GAS FUTR MAY18
794.59
529.73
264.86
0.00
-264.86
-529.73
-794.59
-1,059.45
0.00
0.68
1.37
2.05
2.73
3.41
4.10
4.78
5.46
손익(백만)
가격


XBK8-GASOLINE RBOB FUT MAY18
547.99
410.99
274.00
137.00
0.00
-137.00
-274.00
-410.99
-547.99
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	88
HOK8	NY Harb ULSD Fut MAY18	44
KR4175N40(	2018-04 달러선물	47
NGK8	NATURAL GAS FUTR MAY18	85
XBK8	GASOLINE RBOB FUT MAY18	44

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

520

공시일	2018-04-02
기준일	2018-03-30

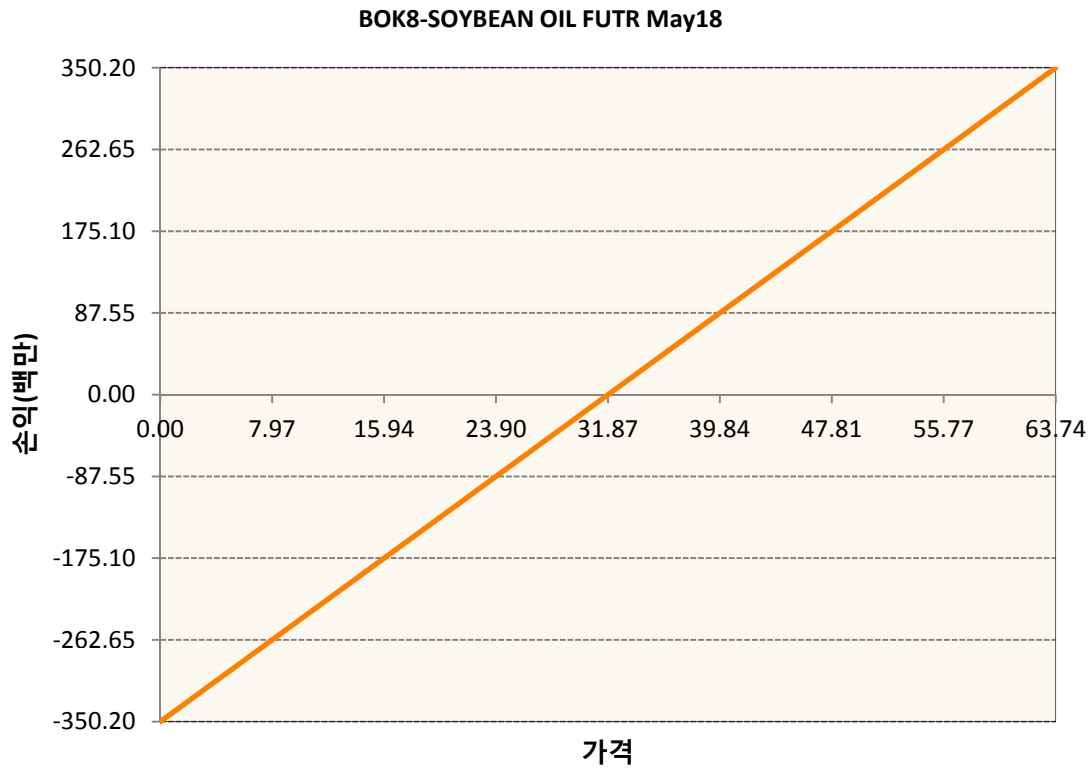
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

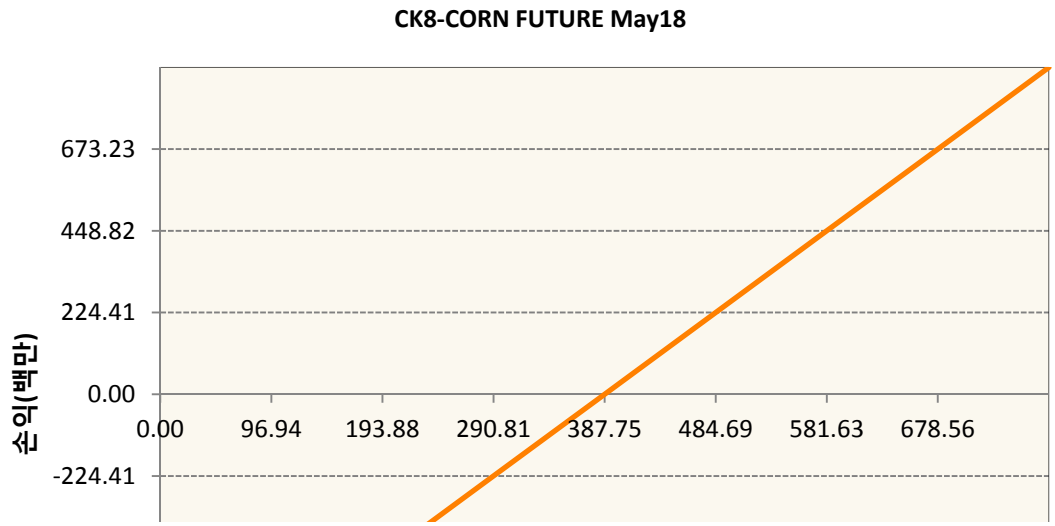
1. 계약금액

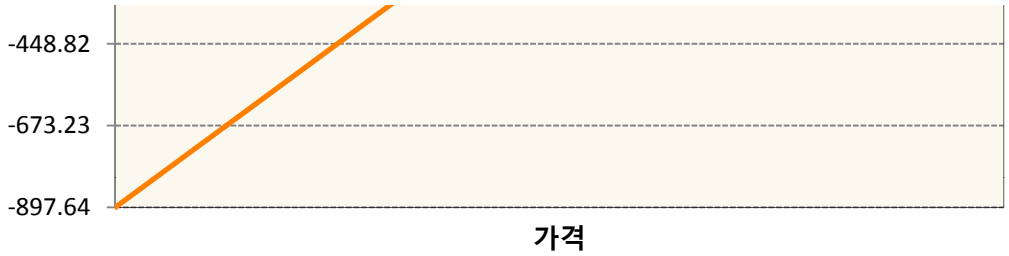
(단위:백만원)

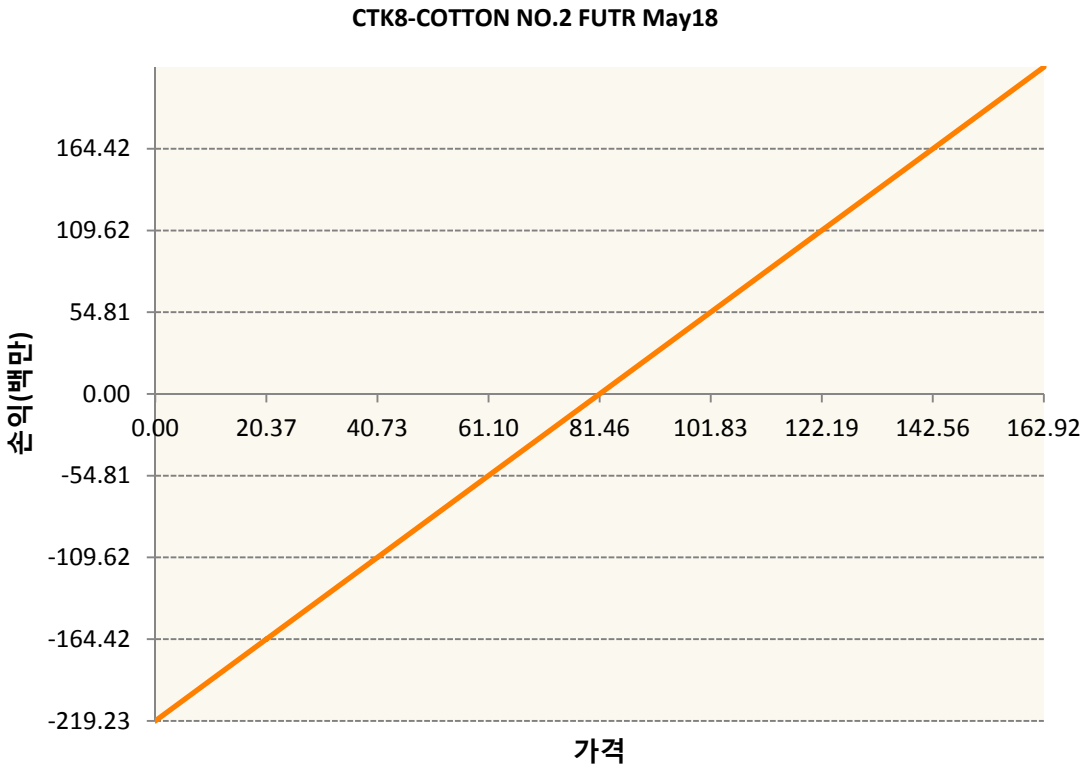
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	4,113	319	3,794	

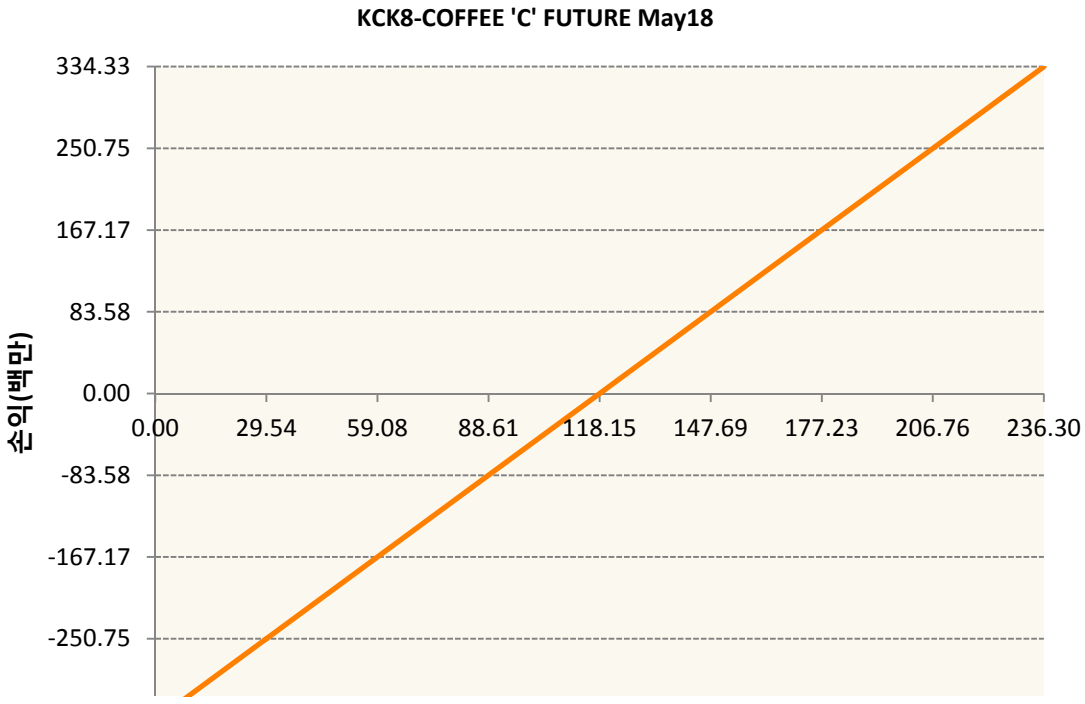
2. 만기시점의 손익구조

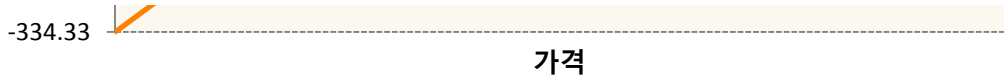


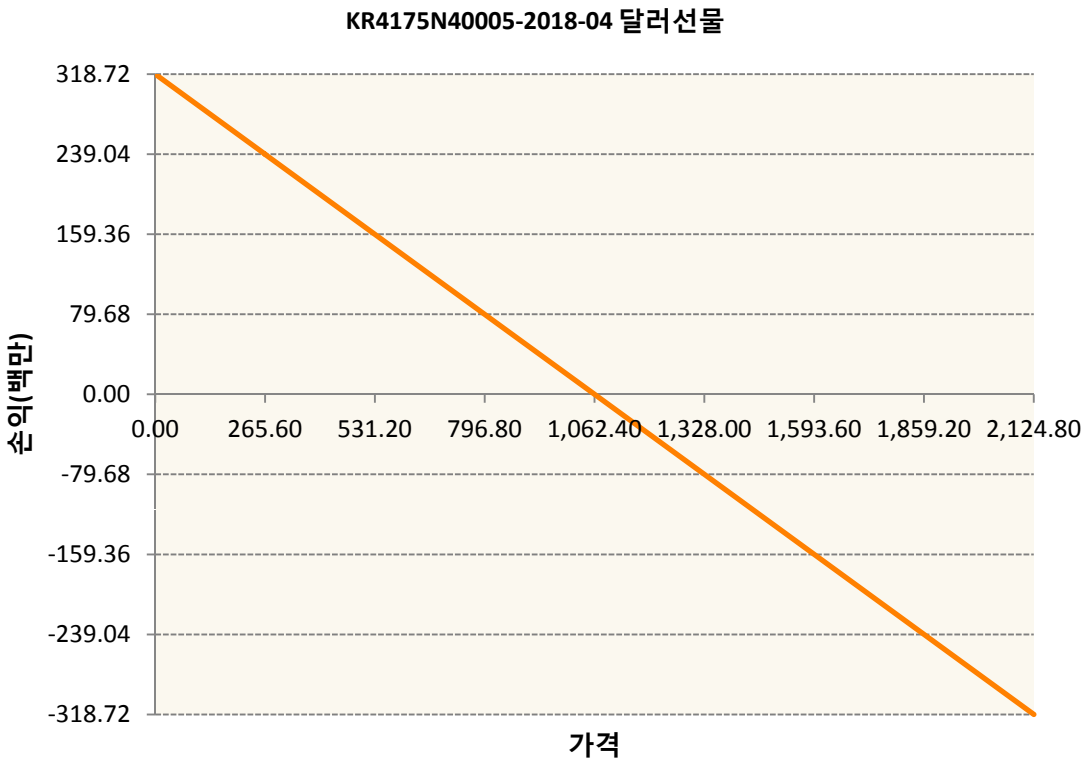


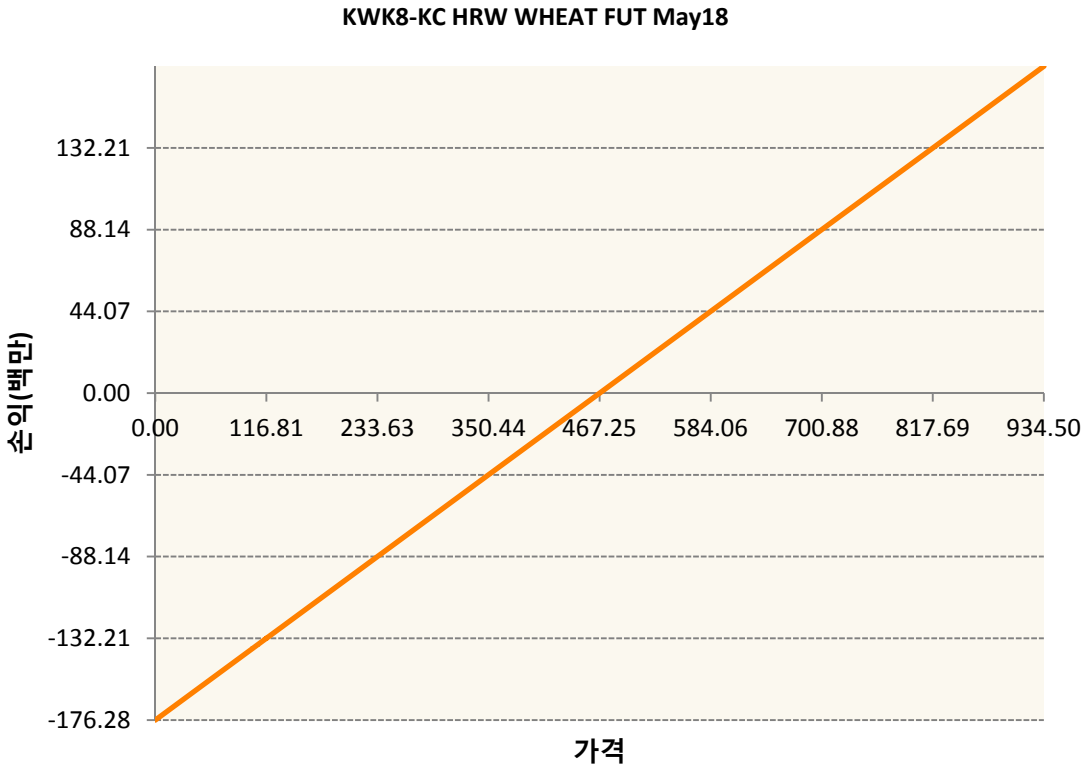

-448.82
-673.23
-897.64
가격

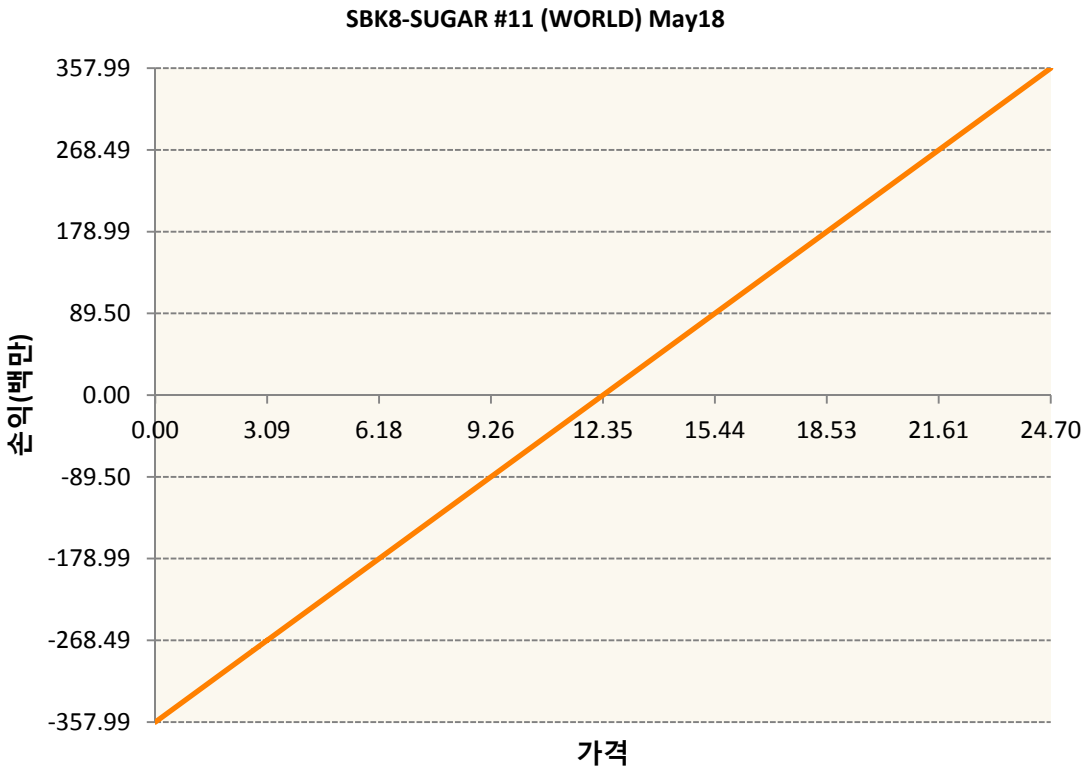

CTK8-COTTON NO.2 FUTR May18
164.42
109.62
54.81
0.00
-54.81
-109.62
-164.42
-219.23
0.00
20.37
40.73
61.10
81.46
101.83
122.19
142.56
162.92
손익(백만)
가격

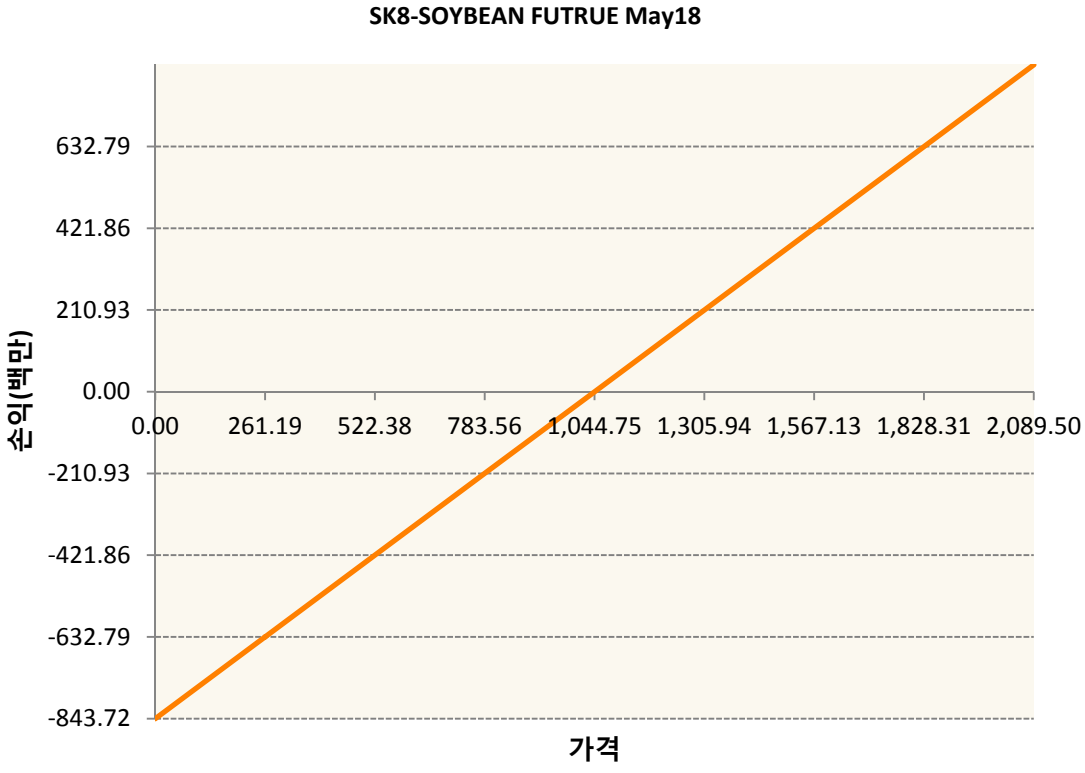

KCK8-COFFEE 'C' FUTURE May18
334.33
250.75
167.17
83.58
0.00
-83.58
-167.17
-250.75
0.00
29.54
59.08
88.61
118.15
147.69
177.23
206.76
236.30
손익(백만)


-334.33
가격

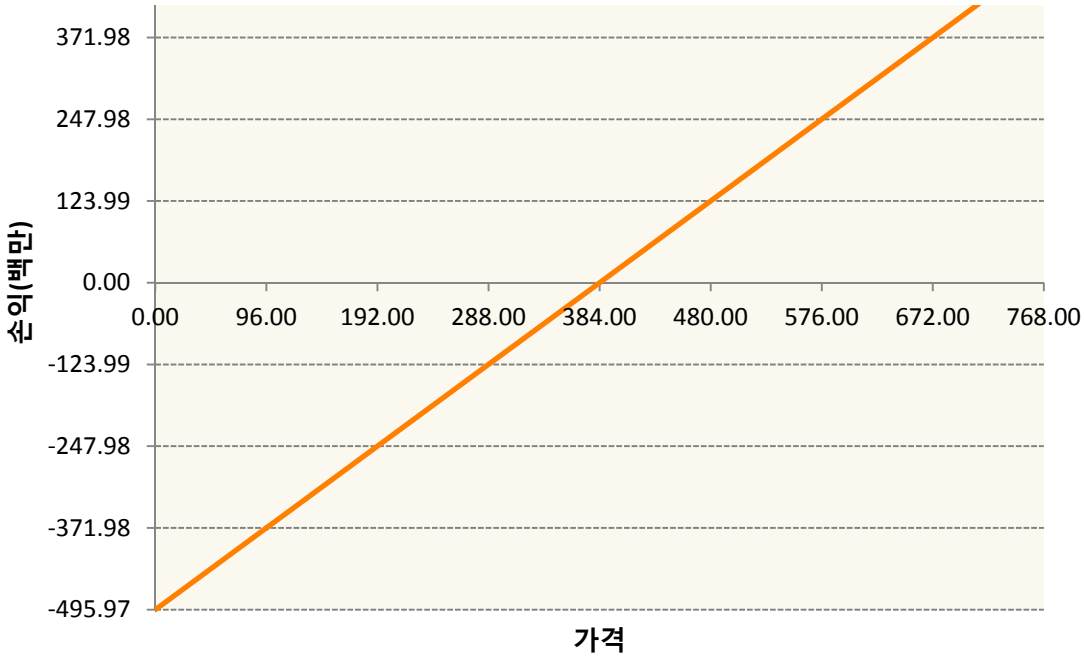

KR4175N40005-2018-04 달러선물
318.72
239.04
159.36
79.68
0.00
-79.68
-159.36
-239.04
-318.72
0.00
265.60
531.20
796.80
1,062.40
1,328.00
1,593.60
1,859.20
2,124.80
손익(백만)
가격


KWK8-KC HRW WHEAT FUT May18
132.21
88.14
44.07
0.00
-44.07
-88.14
-132.21
-176.28
0.00
116.81
233.63
350.44
467.25
584.06
700.88
817.69
934.50
손익(백만)
가격

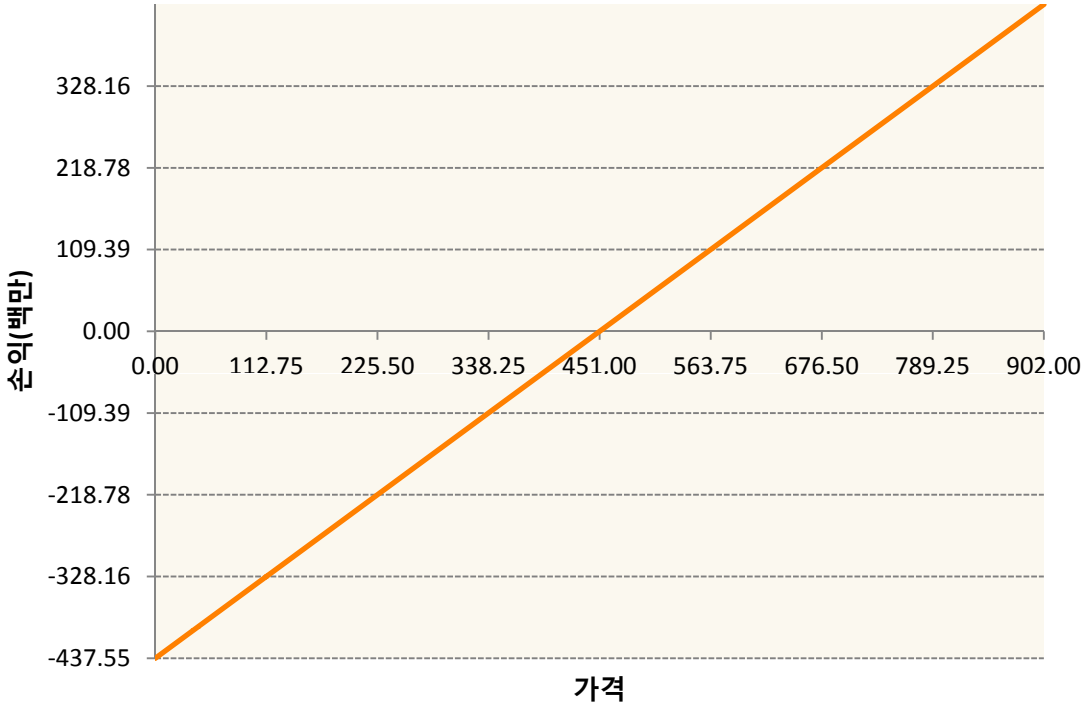

SBK8-SUGAR #11 (WORLD) May18
357.99
268.49
178.99
89.50
0.00
-89.50
-178.99
-268.49
-357.99
0.00
3.09
6.18
9.26
12.35
15.44
18.53
21.61
24.70
손익(백만)
가격


SK8-SOYBEAN FUTRUE May18
632.79
421.86
210.93
0.00
-210.93
-421.86
-632.79
-843.72
0.00
261.19
522.38
783.56
1,044.75
1,305.94
1,567.13
1,828.31
2,089.50
손익(백만)
가격


SMK8-SOYBEAN MEAL FUTR May18
495.97



WK8-WHEAT FUTURE(CBT) May18



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

BOK8	SOYBEAN OIL FUTR May18	28
CK8	CORN FUTURE May18	72
CTK8	COTTON NO.2 FUTR May18	18
KCK8	COFFEE 'C' FUTURE May18	27
KR4175N40(	2018-04 달러선물	25

KWK8	KC HRW WHEAT FUT May18	14
SBK8	SUGAR #11 (WORLD) May18	29
SK8	SOYBEAN FUTRUE May18	67
SMK8	SOYBEAN MEAL FUTR May18	40
WK8	WHEAT FUTURE(CBT) May18	35

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

332