공시일	2018-04-04
기준일	2018-04-03

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	2018-04-04
기준일	2018-04-03

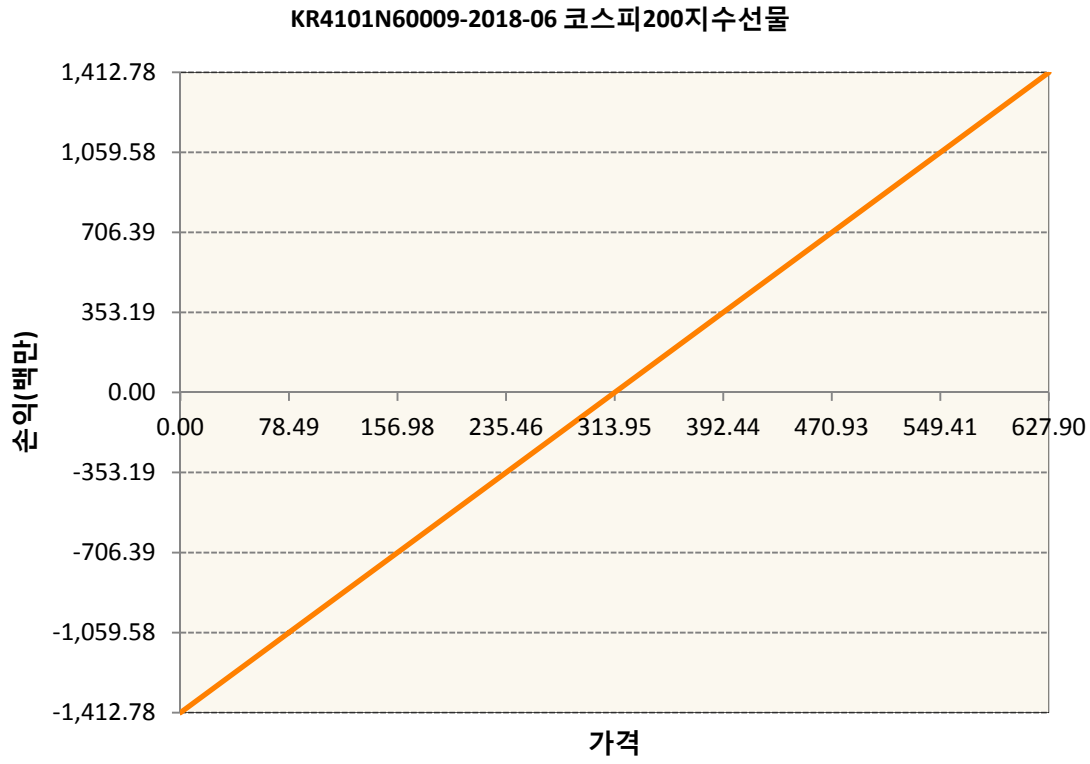
스마트인덱스모

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	1,413	0	1,413	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	2018-04-04
기준일	2018-04-03

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	1,072

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

426

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2018-04-04
기준일	2018-04-03

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	407

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

439

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2018-04-04
기준일	2018-04-03

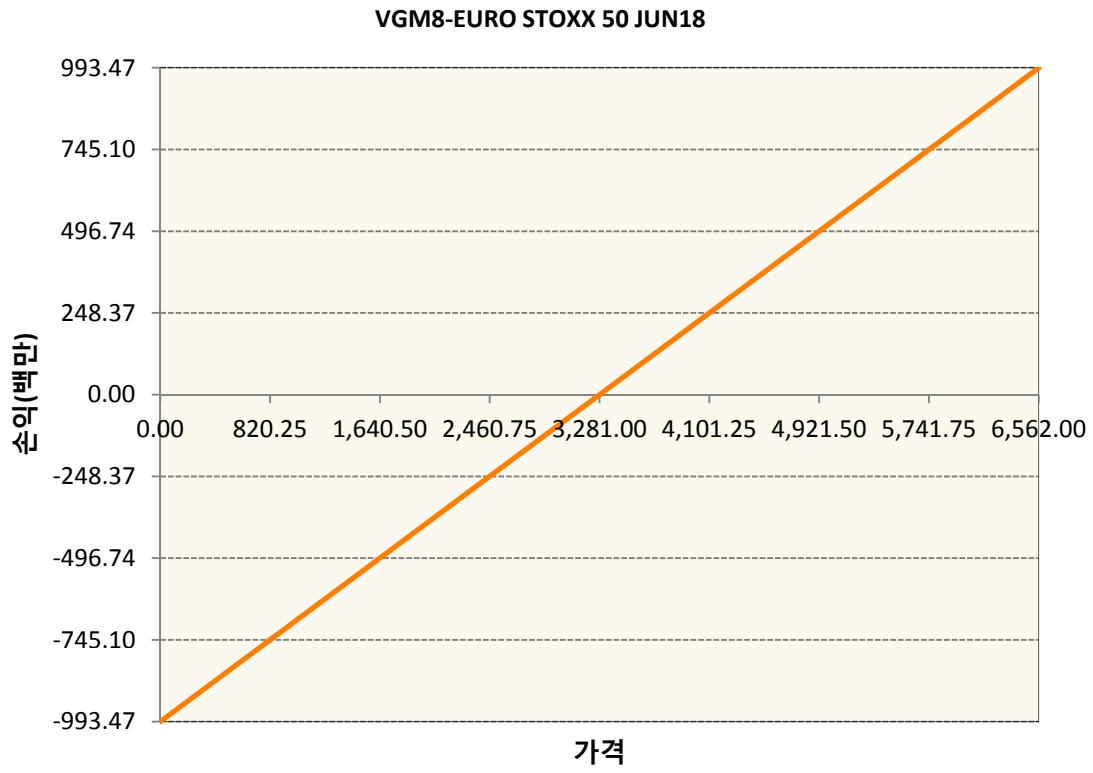
유로인덱스모(주식-파생형)

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	2018-04-04
기준일	2018-04-03

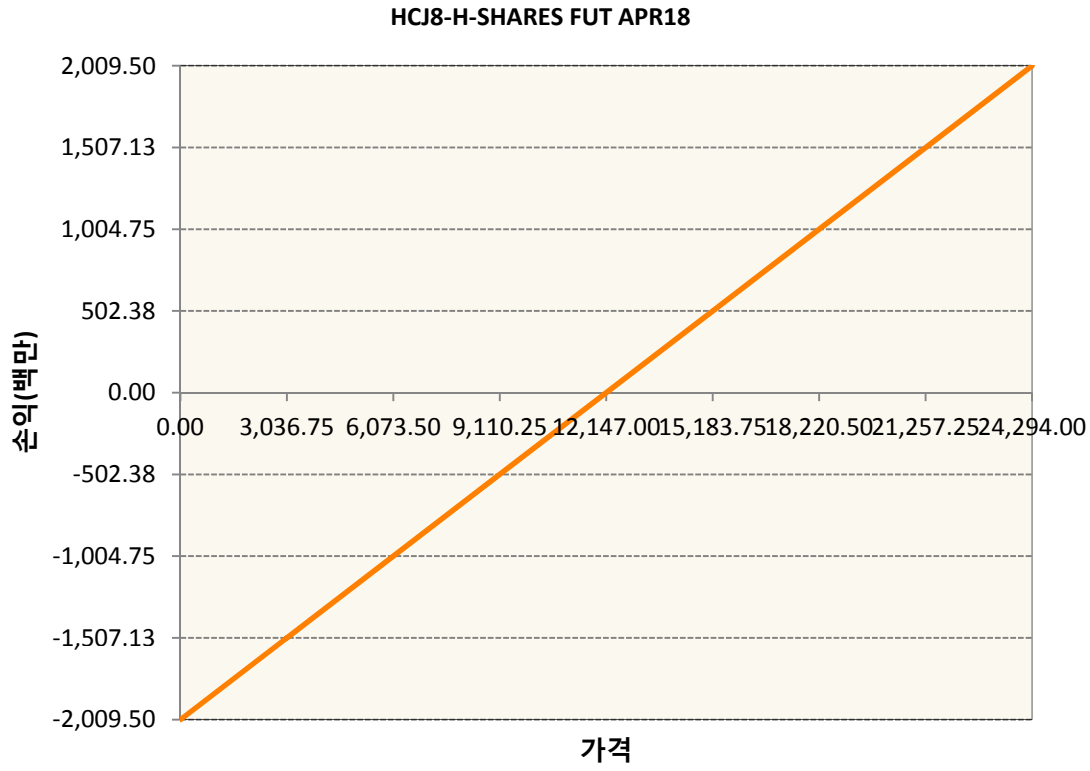
차이나인덱스모(주식-파생형)

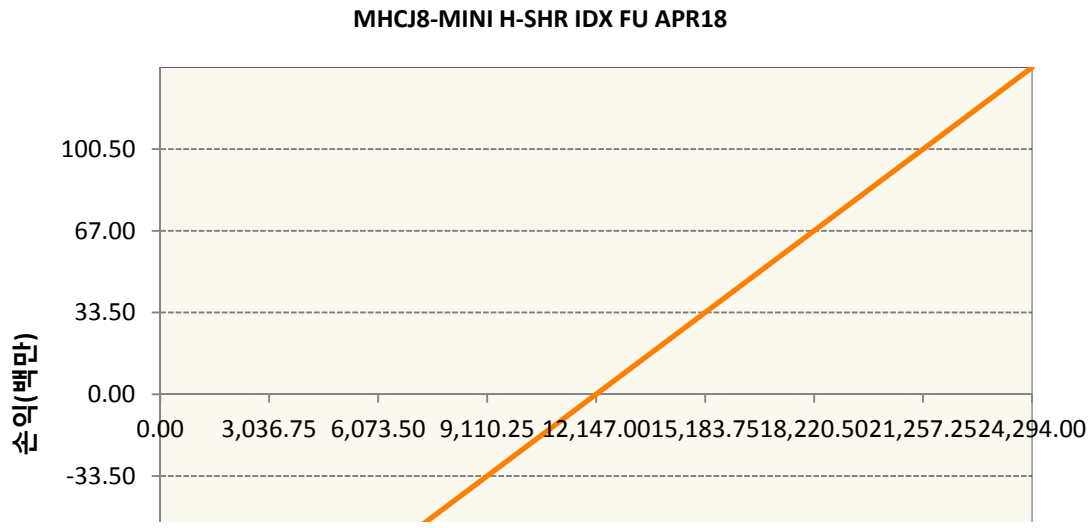
1. 계약금액

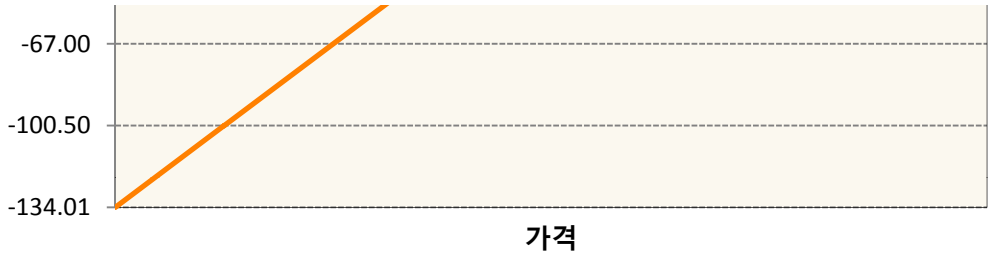
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,144	0	2,144	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCJ8	H-SHARES FUT APR18	161
MHCJ8	MINI H-SHR IDX FU APR18	11

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

공시일	2018-04-04
기준일	2018-04-03

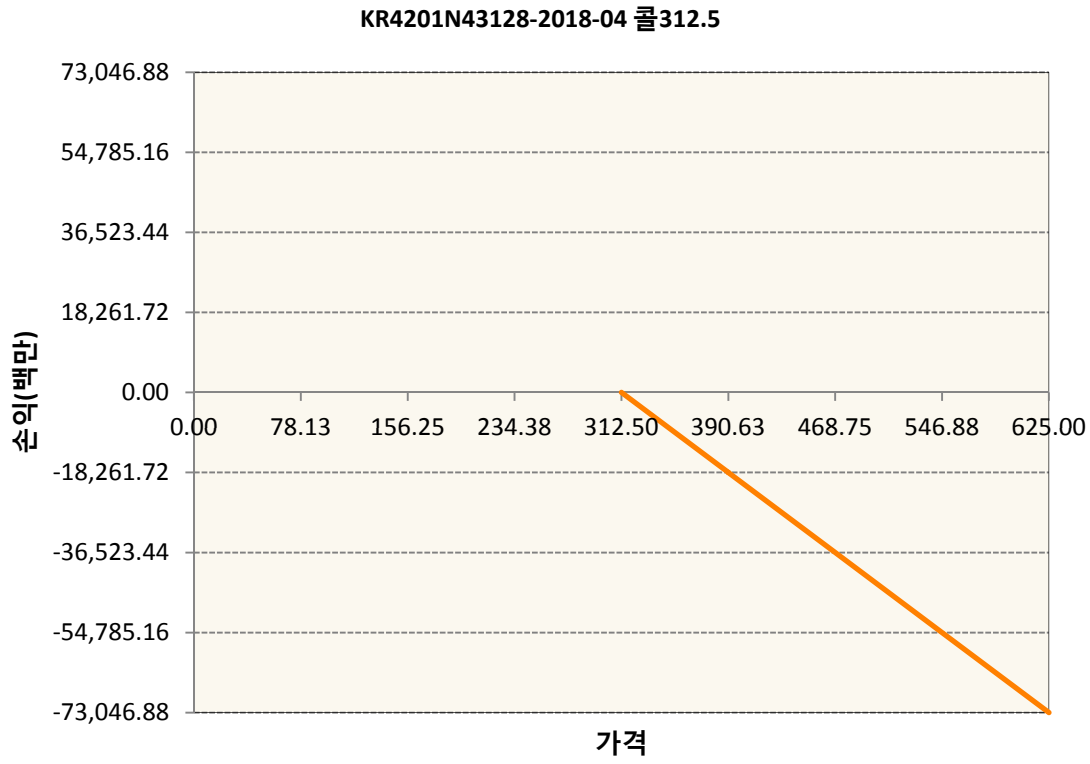
커버드콜모(주식혼합-파생형)

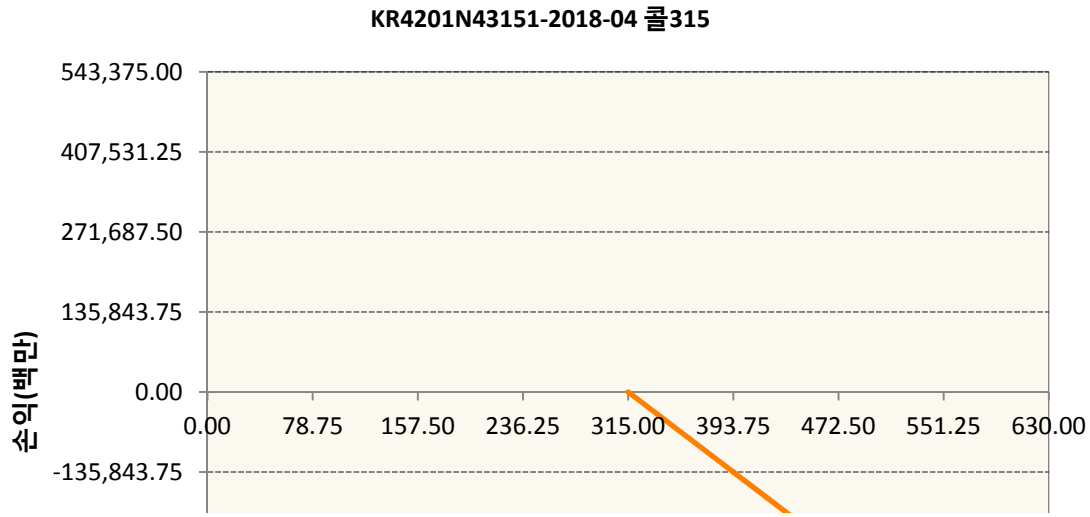
1. 계약금액

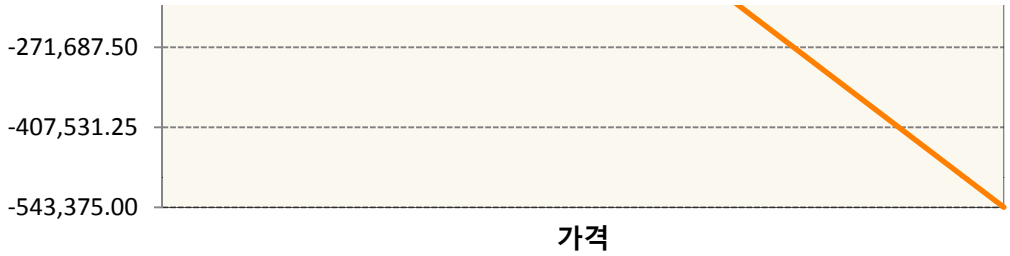
(단위:백만원)

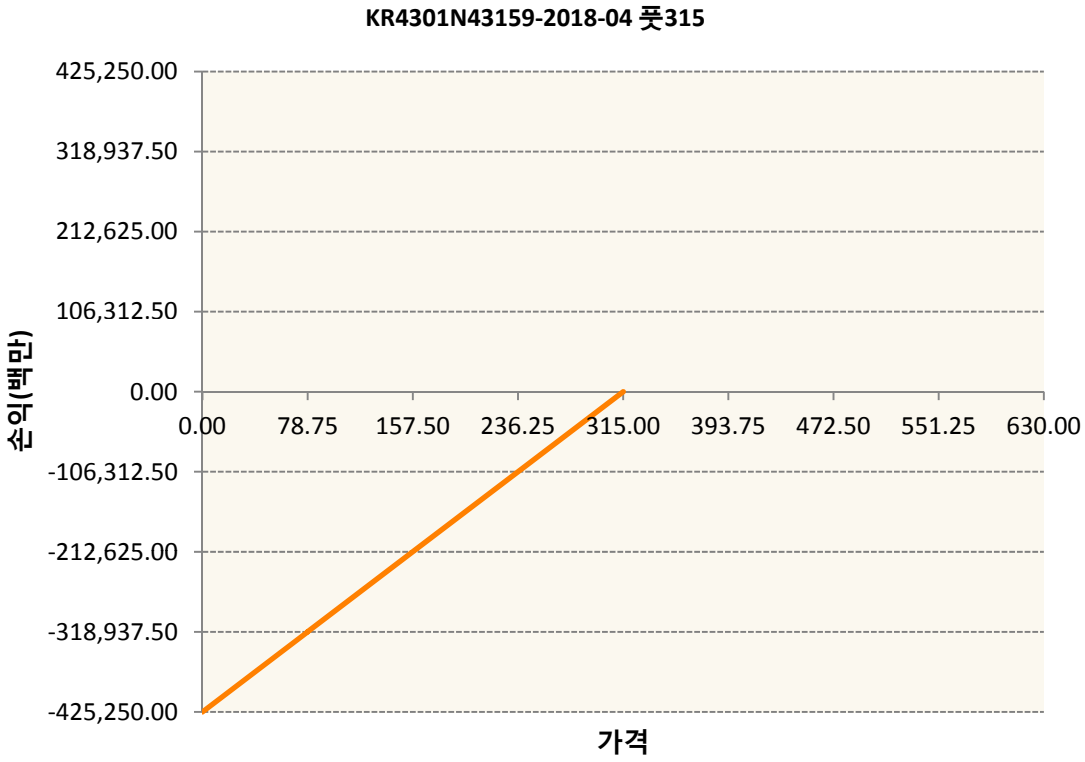
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	1,041,672	-1,041,672	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201N4312018-04 콜312.5							4,787
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,433	1,424	1,410	1,390	1,365	1,334	1,297
-5.33%	1,372	1,333	1,287	1,233	1,174	1,109	1,039
-2.67%	1,090	1,003	911	817	721	623	523
0%	332	222	111	0	-111	-222	-333
2.67%	-1,000	-1,081	-1,168	-1,258	-1,351	-1,447	-1,545
5.33%	-2,734	-2,770	-2,815	-2,867	-2,926	-2,990	-3,060
8.00%	-4,636	-4,646	-4,662	-4,683	-4,712	-4,746	-4,787
KR4201N4312018-04 콜315							33,509
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	8,531	8,491	8,422	8,320	8,179	7,999	7,781

-5.33%	8,265	8,061	7,801	7,486	7,124	6,718	6,273
-2.67%	6,841	6,293	5,706	5,085	4,439	3,771	3,085
0%	2,449	1,634	818	0	-818	-1,637	-2,457
2.67%	-6,166	-6,868	-7,592	-8,334	-9,089	-9,855	-10,629
5.33%	-18,250	-18,614	-19,039	-19,516	-20,036	-20,593	-21,183
8.00%	-32,034	-32,153	-32,323	-32,546	-32,820	-33,142	-33,509
KR4301N4312018-04 풋315							29,839

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-29,794	-29,795	-29,796	-29,799	-29,807	-29,819	-29,839
-5.33%	-18,528	-18,544	-18,574	-18,619	-18,683	-18,766	-18,869
-2.67%	-7,557	-7,721	-7,915	-8,135	-8,378	-8,640	-8,919
0%	1,237	826	414	0	-415	-830	-1,246
2.67%	5,317	5,033	4,727	4,404	4,066	3,718	3,360
5.33%	6,135	6,075	5,989	5,876	5,738	5,575	5,390
8.00%	6,197	6,193	6,183	6,164	6,134	6,090	6,030

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

75,063

공시일	2018-04-04
기준일	2018-04-03

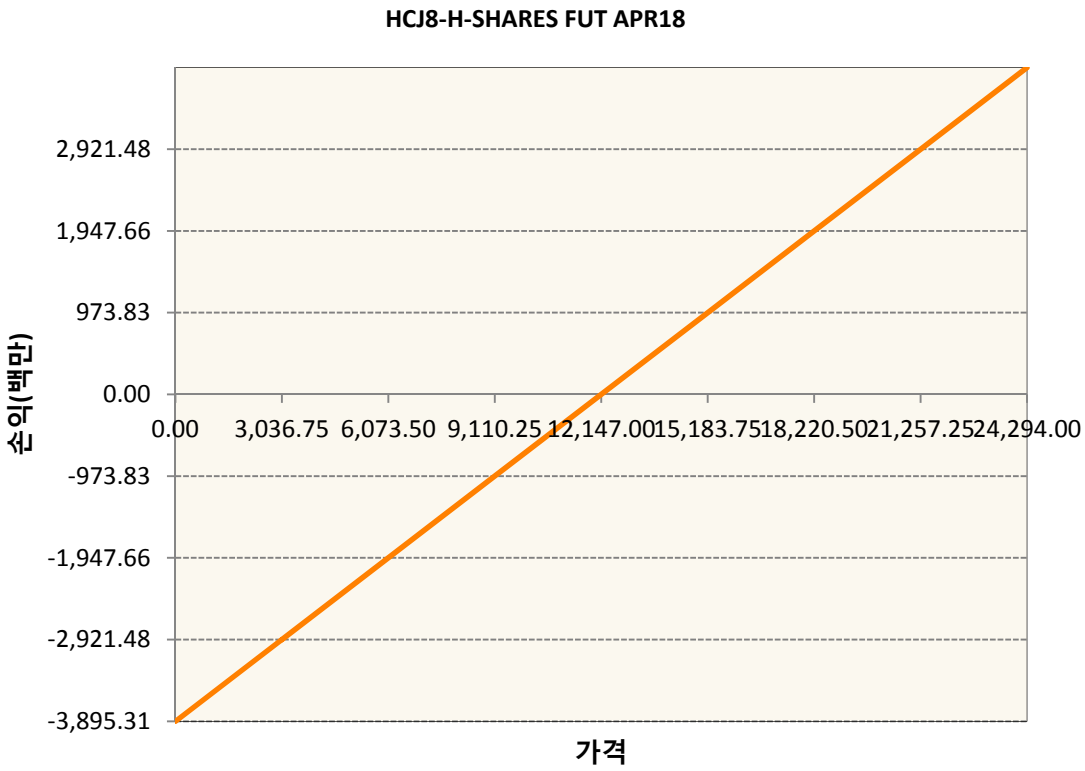
홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생

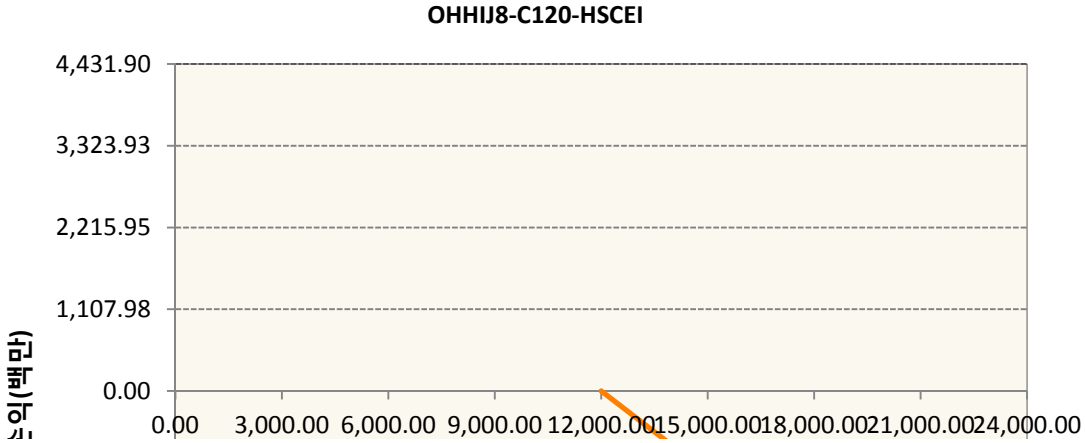
1. 계약금액

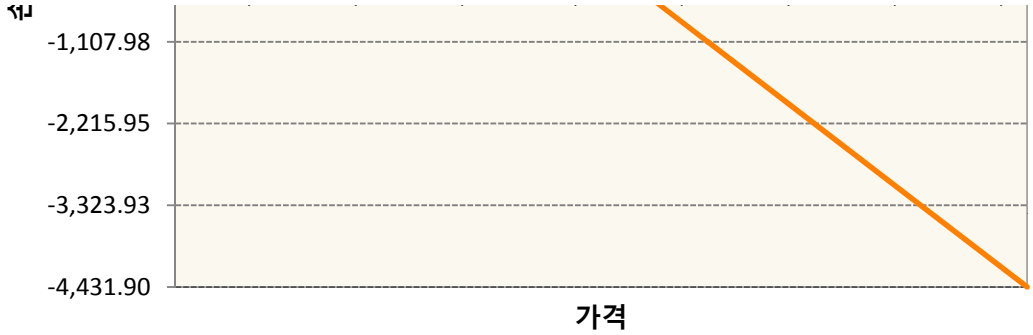
(단위:백만원)

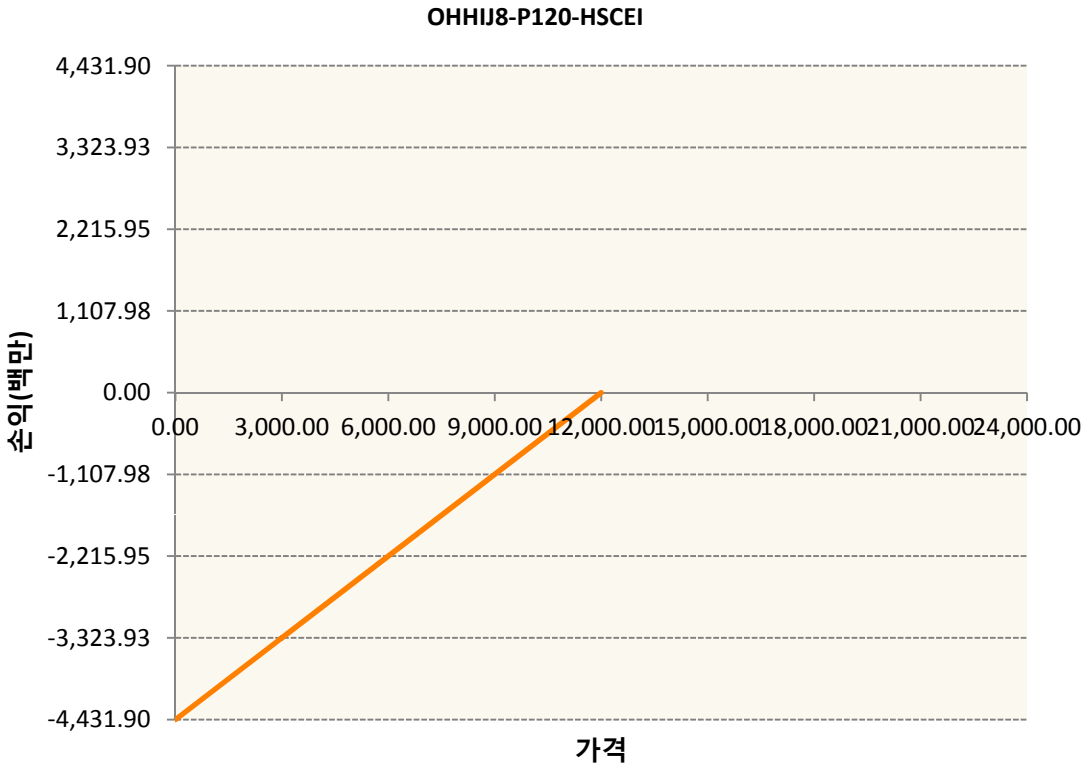
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	3,895	0	3,895	장내
누계	유가증권	옵션	0	8,864	-8,864	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCJ8	H-SHARES FUT APR18	312
OHHIJ8-C12	HSCEI	355
OHHIJ8-P12	HSCEI	355

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	890

공시일	2018-04-04
기준일	2018-04-03

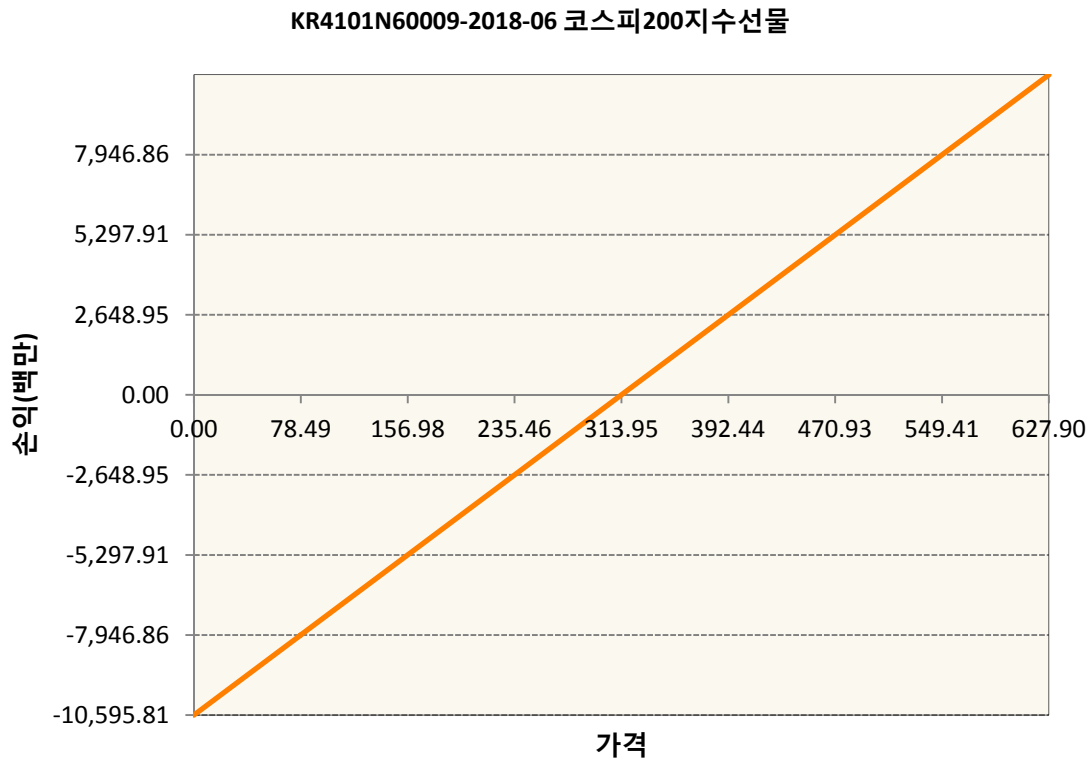
코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼

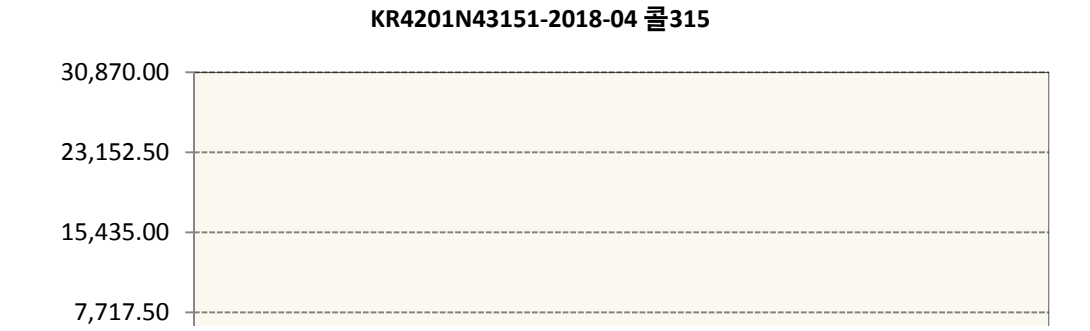
1. 계약금액

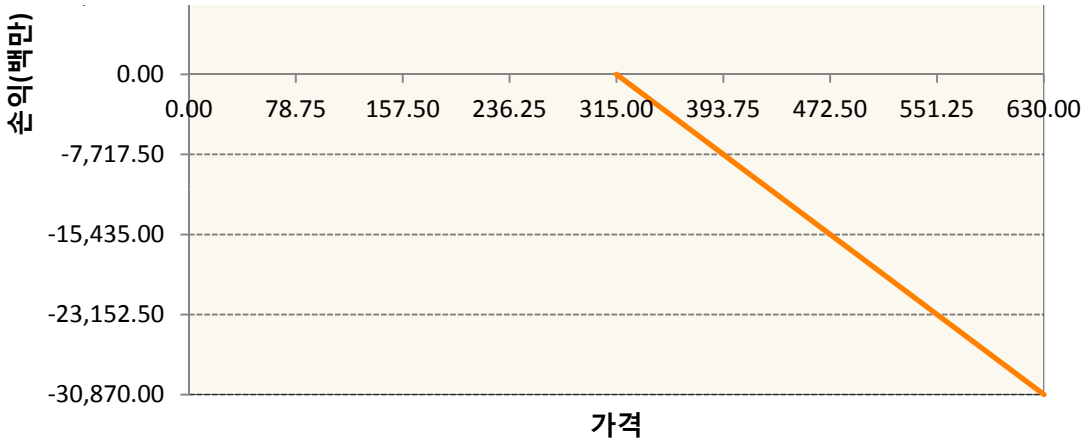
(단위:백만원)

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	10,596	0	10,596	장내
누계	유가증권	스왑	54,200	0	54,200	장외
누계	유가증권	옵션	0	55,718	-55,718	장내

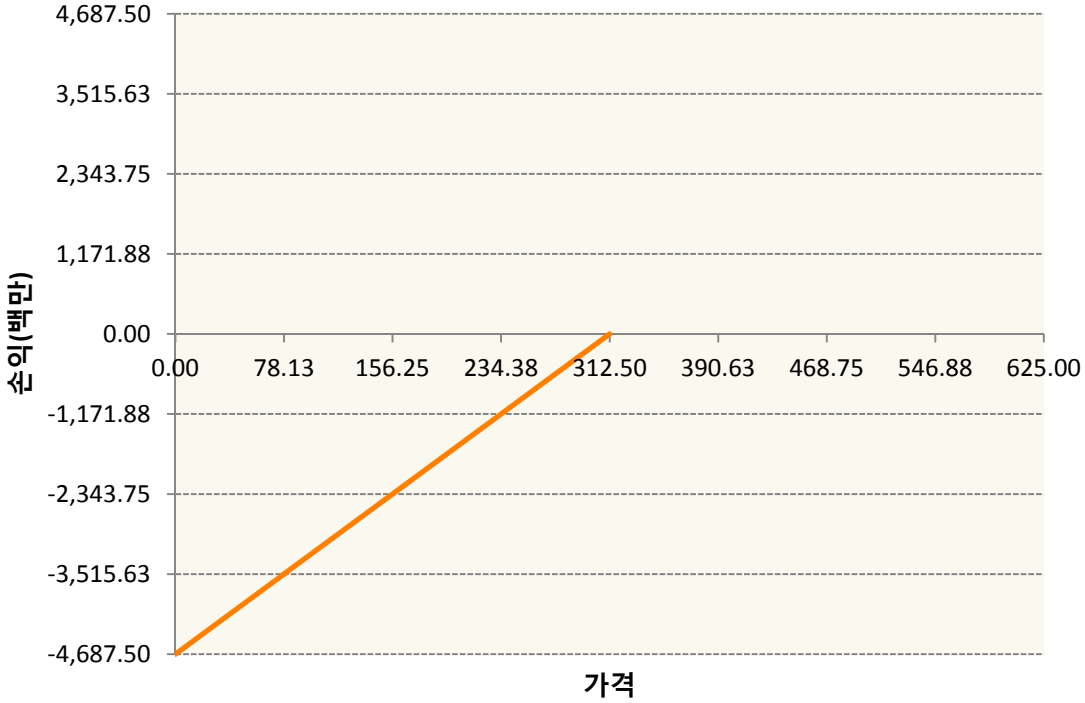
2. 만기시점의 손익구조



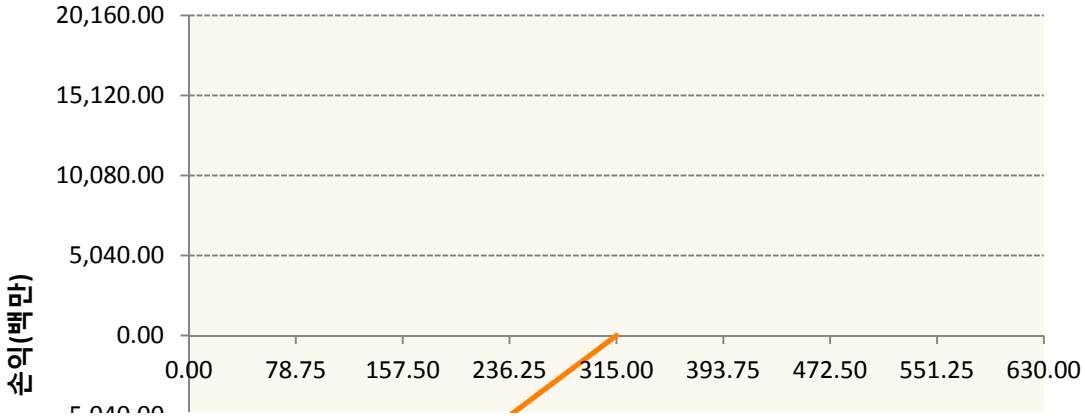




KR4301N43126-2018-04 풋312.5



KR4301N43159-2018-04 풋315





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_2							1,444
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,444	-1,444	-1,444	-1,444	-1,444	-1,444	-1,444
-5.33%	-963	-963	-963	-963	-963	-963	-963
-2.67%	-481	-481	-481	-481	-481	-481	-481
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	481	481	481	481	481	481	481
5.33%	963	963	963	963	963	963	963
8.00%	1,444	1,444	1,444	1,444	1,444	1,444	1,444
2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_3							273
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-273	-273	-273	-273	-273	-273	-273
-5.33%	-182	-182	-182	-182	-182	-182	-182
-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%	182	182	182	182	182	182	182
8.00%	273	273	273	273	273	273	273
2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_5							234
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-234	-234	-234	-234	-234	-234	-234
-5.33%	-156	-156	-156	-156	-156	-156	-156
-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%	156	156	156	156	156	156	156
8.00%	234	234	234	234	234	234	234
2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_6							195
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%

-8.00%	-195	-195	-195	-195	-195	-195	-195
-5.33%	-130	-130	-130	-130	-130	-130	-130
-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%	130	130	130	130	130	130	130
8.00%	195	195	195	195	195	195	195
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_7						250
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-250	-250	-250	-250	-250	-250	-250
-5.33%	-167	-167	-167	-167	-167	-167	-167
-2.67%	-83	-83	-83	-83	-83	-83	-83
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	83	83	83	83	83	83	83
5.33%	167	167	167	167	167	167	167
8.00%	250	250	250	250	250	250	250
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_8						462
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-462	-462	-462	-462	-462	-462	-462
-5.33%	-308	-308	-308	-308	-308	-308	-308
-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%	308	308	308	308	308	308	308
8.00%	462	462	462	462	462	462	462
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_10						273
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-273	-273	-273	-273	-273	-273	-273
-5.33%	-182	-182	-182	-182	-182	-182	-182
-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%	182	182	182	182	182	182	182
8.00%	273	273	273	273	273	273	273
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_11						624
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-624	-624	-624	-624	-624	-624	-624
-5.33%	-416	-416	-416	-416	-416	-416	-416
-2.67%	-208	-208	-208	-208	-208	-208	-208
0%	0	0	0	0	0	0	0

2.67%	208	208	208	208	208	208	208
5.33%	416	416	416	416	416	416	416
8.00%	624	624	624	624	624	624	624
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_12						468
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-468	-468	-468	-468	-468	-468	-468
-5.33%	-312	-312	-312	-312	-312	-312	-312
-2.67%	-156	-156	-156	-156	-156	-156	-156
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	156	156	156	156	156	156	156
5.33%	312	312	312	312	312	312	312
8.00%	468	468	468	468	468	468	468
	KR4101N60(2018-06 코스피200지수선물						846
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-846	-846	-846	-846	-846	-846	-846
-5.33%	-564	-564	-564	-564	-564	-564	-564
-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%	564	564	564	564	564	564	564
8.00%	846	846	846	846	846	846	846
	KR4201N431 2018-04 콜315						1,904
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	485	482	478	473	465	454	442
-5.33%	470	458	443	425	405	382	356
-2.67%	389	358	324	289	252	214	175
0%	139	93	46	0	-46	-93	-140
2.67%	-350	-390	-431	-473	-516	-560	-604
5.33%	-1,037	-1,058	-1,082	-1,109	-1,138	-1,170	-1,203
8.00%	-1,820	-1,827	-1,836	-1,849	-1,865	-1,883	-1,904
	KR4301N431 2018-04 풋312.5						314
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-313	-313	-313	-313	-313	-314	-314
-5.33%	-188	-189	-189	-190	-191	-193	-194
-2.67%	-70	-73	-76	-79	-82	-86	-89
0%	14	9	5	0	-5	-9	-14
2.67%	45	42	40	37	34	31	27
5.33%	49	49	48	47	46	45	44
8.00%	49	49	49	49	49	49	48
	KR4301N431 2018-04 풋315						1,415

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,412	-1,412	-1,413	-1,413	-1,413	-1,414	-1,415
-5.33%	-878	-879	-881	-883	-886	-890	-895
-2.67%	-358	-366	-375	-386	-397	-410	-423
0%	59	39	20	0	-20	-39	-59
2.67%	252	239	224	209	193	176	159
5.33%	291	288	284	279	272	264	256
8.00%	294	294	293	292	291	289	286

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

8,838

공시일	2018-04-04
기준일	2018-04-03

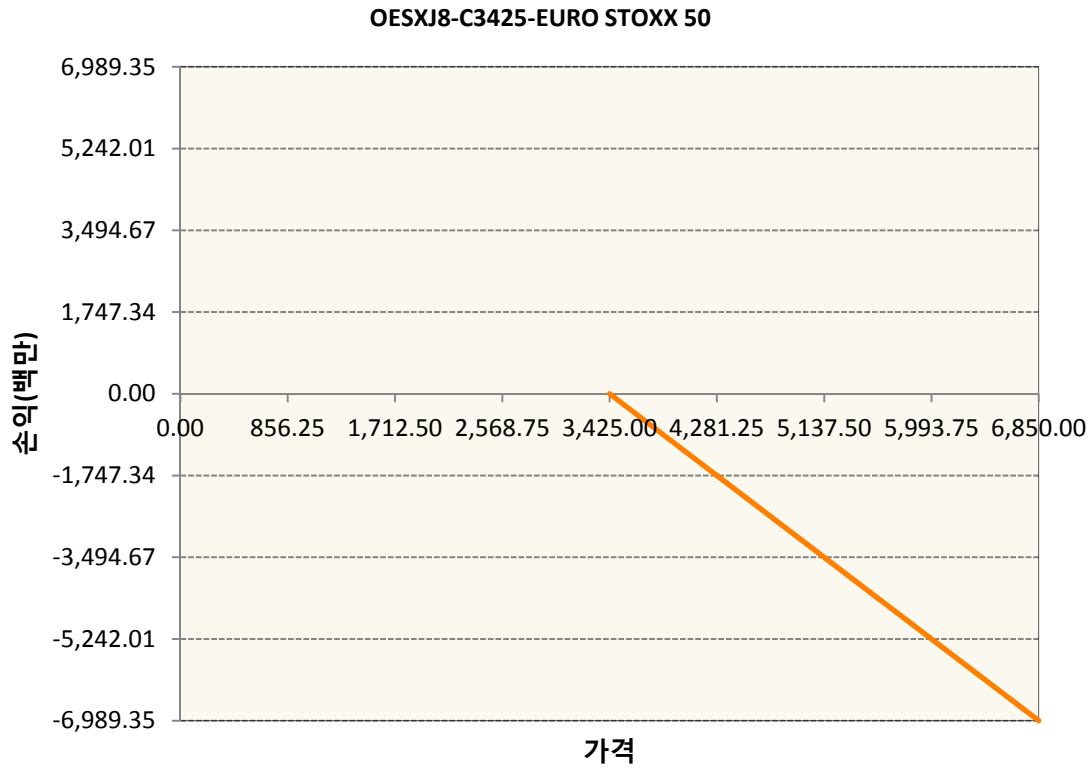
유로커버드콜모(주식혼합-파생형

1. 계약금액

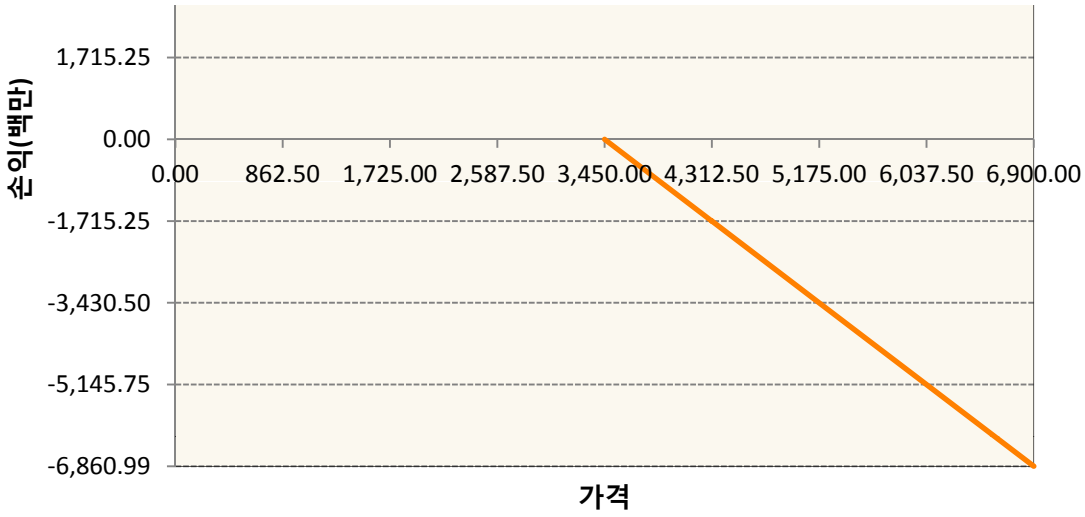
(단위:백만원)

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	5,438	0	5,438	
누계	유가증권	스왑	97,487	0	97,487	장외
누계	유가증권	옵션	0	27,701	-27,701	장내
누계	지수	스왑	51,994	0	51,994	장외

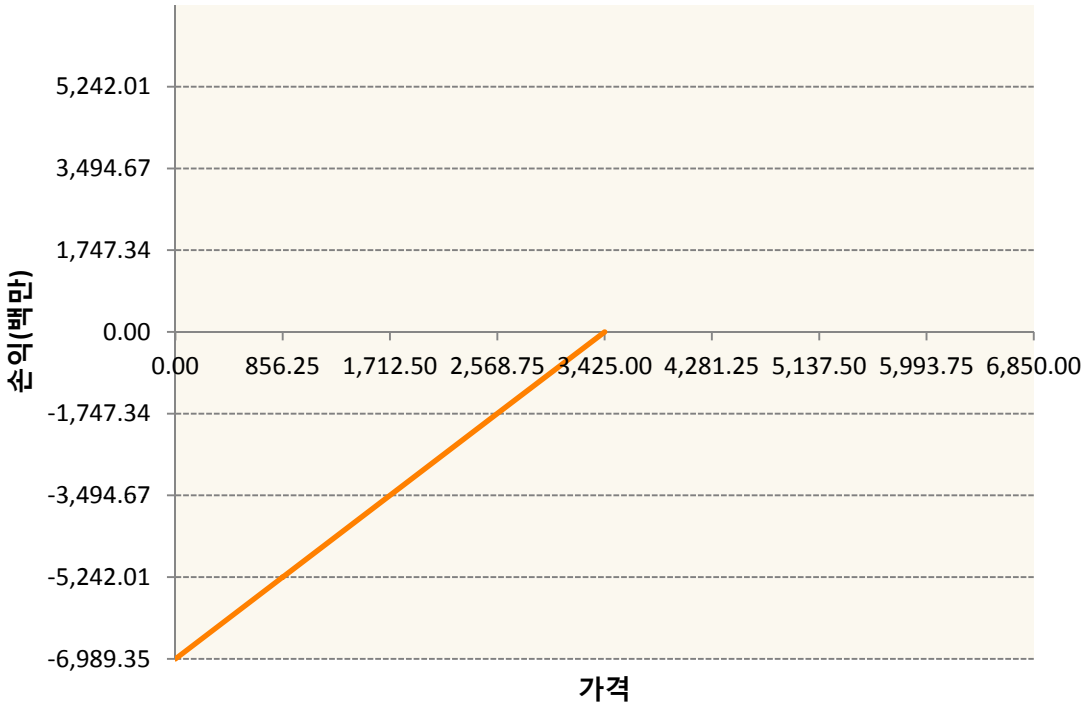
2. 만기시점의 손익구조



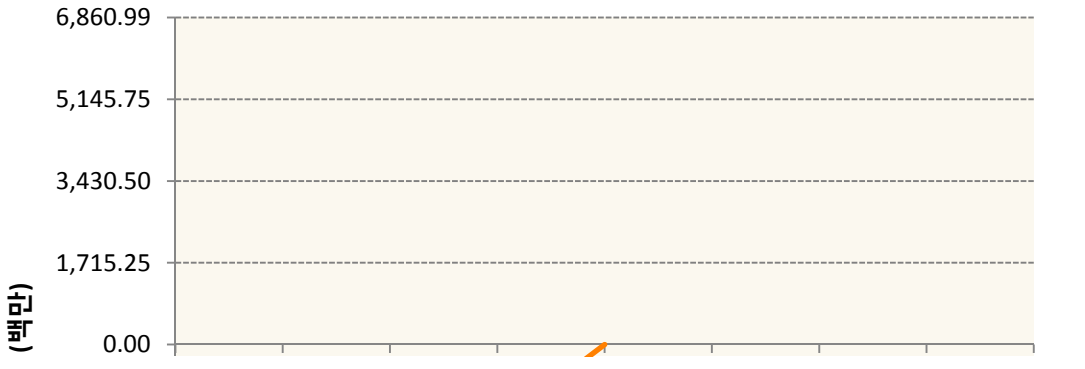


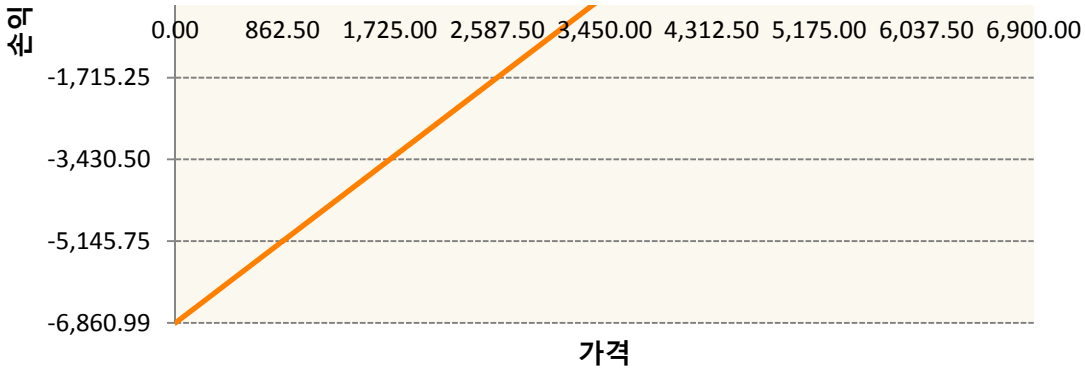


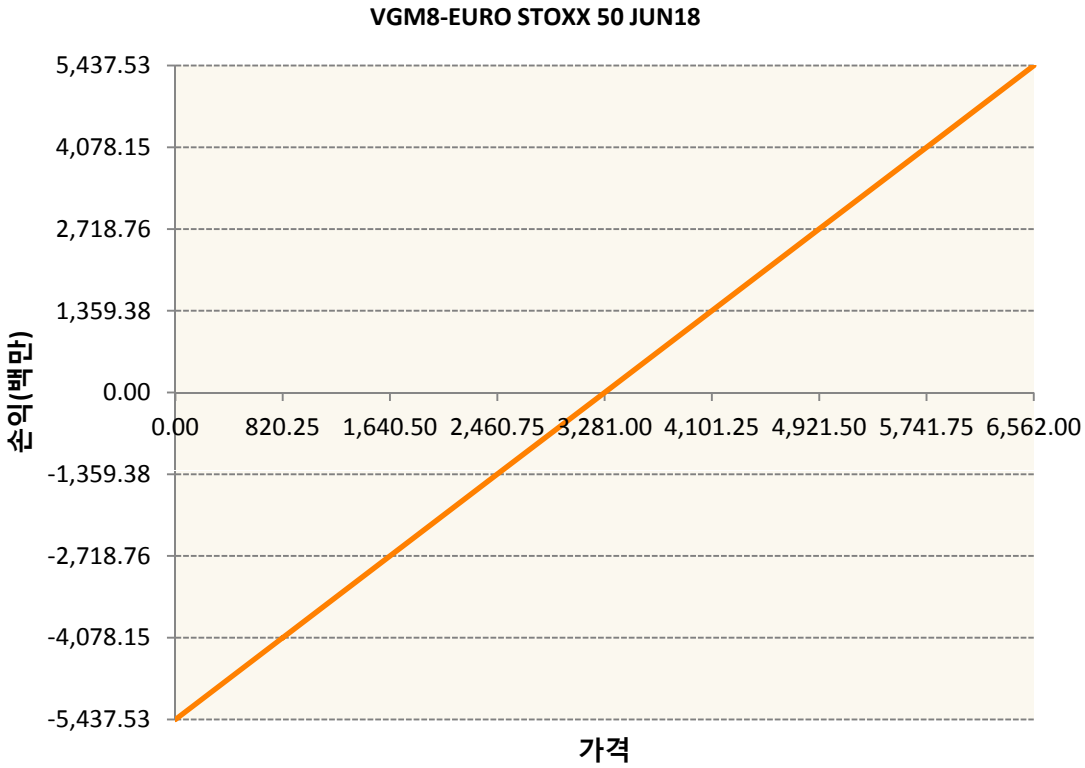
OESXJ8-P3425-EURO STOXX 50



OESXJ8-P3450-EURO STOXX 50







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)	(단위:백만원)
260105SGPX SG EURO Covered CALL STRATEGY - 994.569	203
260105SQPX SG EURO Covered CALL STRATEGY	381
OESXJ8-C34 EURO STOXX 50	559
OESXJ8-C34 EURO STOXX 50	549
OESXJ8-P34 EURO STOXX 50	559
OESXJ8-P34 EURO STOXX 50	549
VGM8 EURO STOXX 50 JUN18	435

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

2,034

공시일	2018-04-04
기준일	2018-04-03

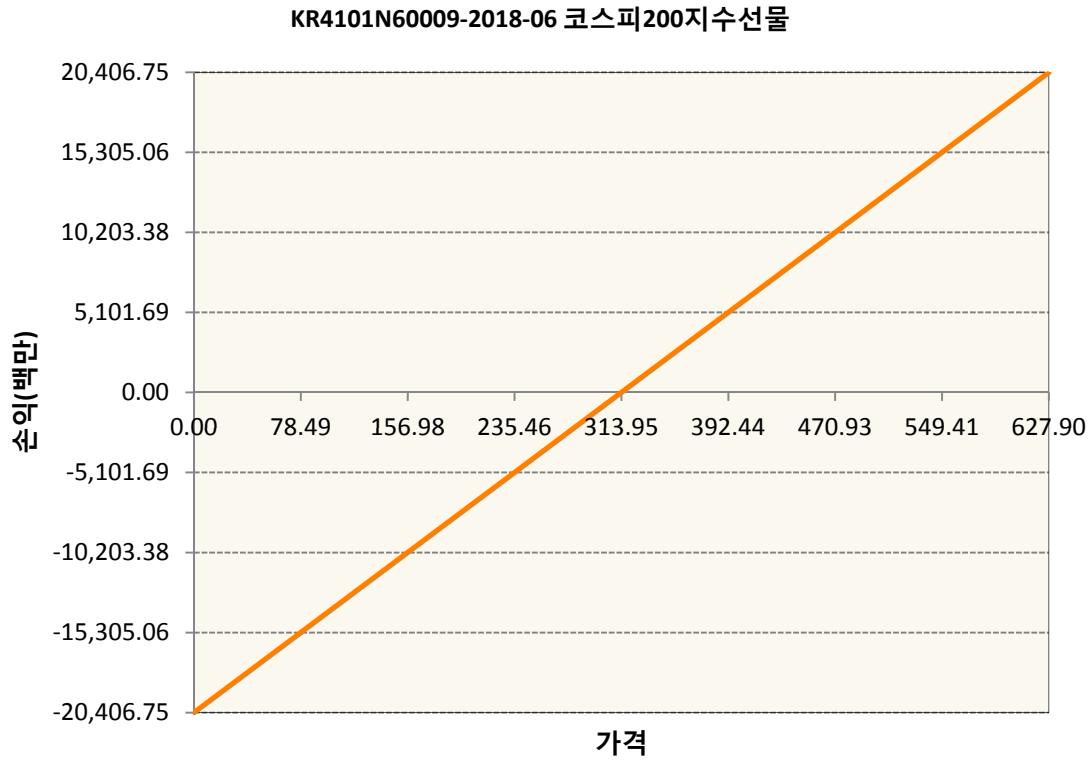
ETF스마트레버리지목표전환형8호

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	20,407	0	20,407	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101N60(2018-06 코스피200지수선물							1,630
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,630	-1,630	-1,630	-1,630	-1,630	-1,630	-1,630
-5.33%	-1,086	-1,086	-1,086	-1,086	-1,086	-1,086	-1,086
-2.67%	-543	-543	-543	-543	-543	-543	-543
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	543	543	543	543	543	543	543
5.33%	1,086	1,086	1,086	1,086	1,086	1,086	1,086
8.00%	1,630	1,630	1,630	1,630	1,630	1,630	1,630

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

1,174

공시일	2018-04-04
기준일	2018-04-03

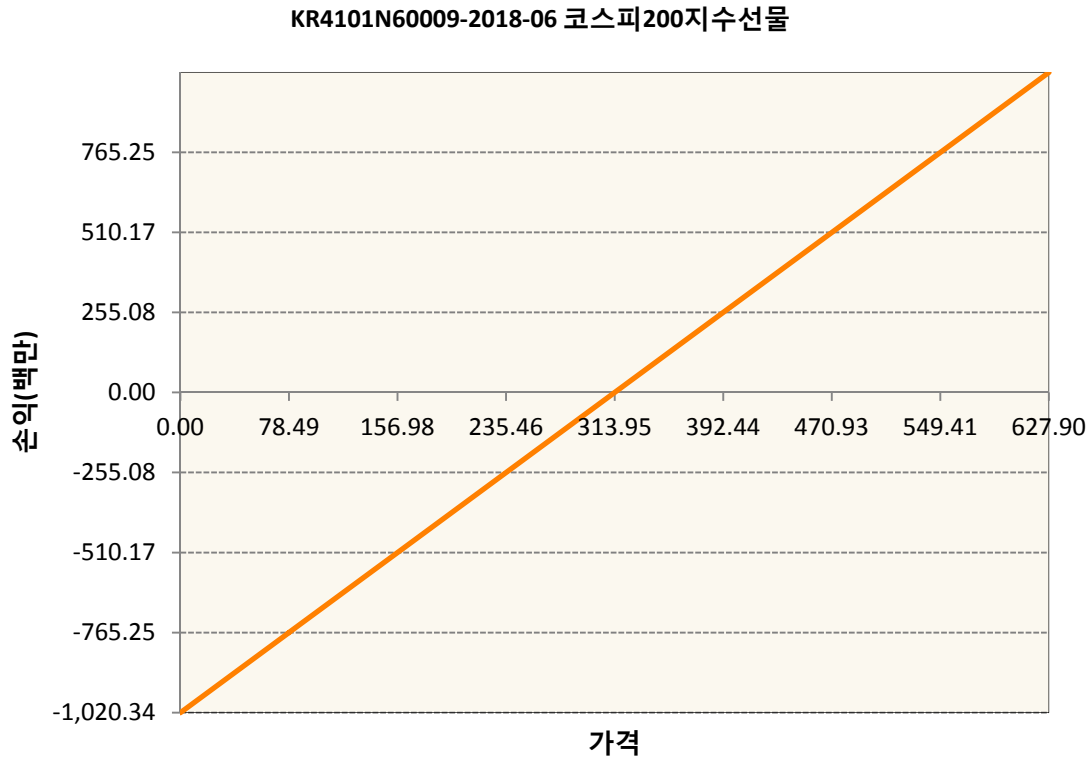
ETF스마트레버리지목표전환형9호

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	1,020	0	1,020	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101N60(2018-06 코스피200지수선물							81
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-81	-81	-81	-81	-81	-81	-81
-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%	81	81	81	81	81	81	81

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

59

공시일	2018-04-04
기준일	2018-04-03

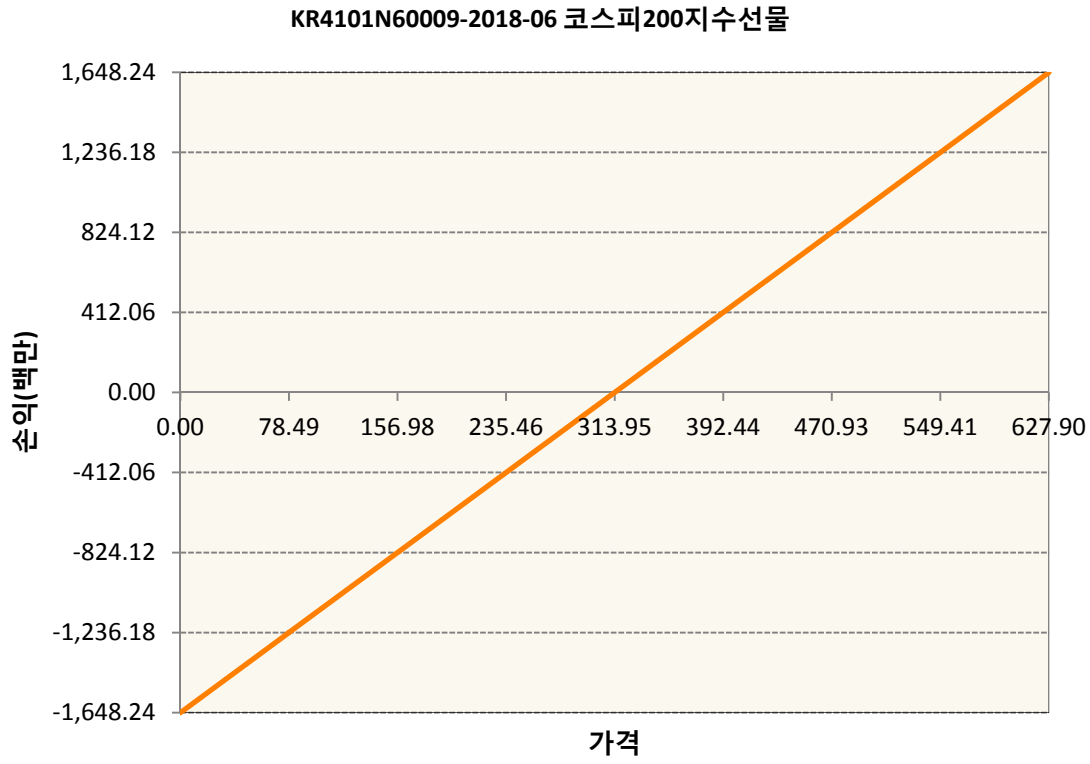
ETF스마트레버리지목표전환형10

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	1,648	0	1,648	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	2018-04-04
기준일	2018-04-03

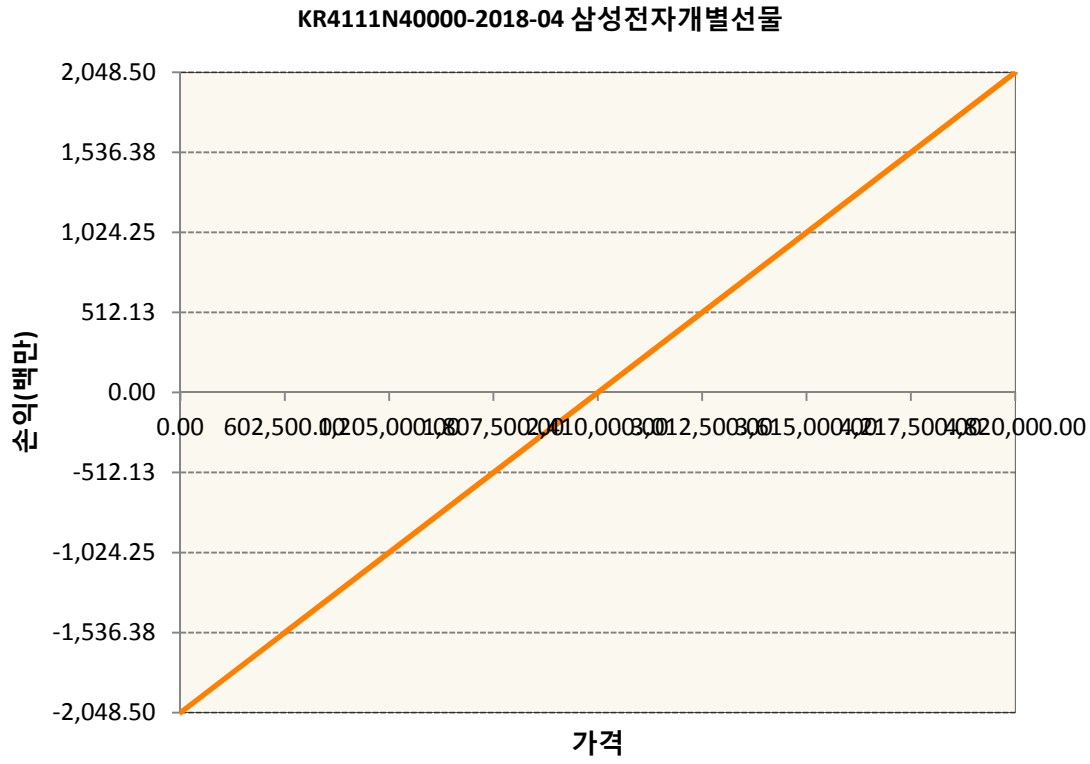
스마트KRX300인덱스1호(주식-파

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	2,049	0	2,049	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4111N40(2018-04 삼성전자개별선물							164
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-164	-164	-164	-164	-164	-164	-164
-5.33%	-109	-109	-109	-109	-109	-109	-109
-2.67%	-55	-55	-55	-55	-55	-55	-55
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	55	55	55	55	55	55	55
5.33%	109	109	109	109	109	109	109
8.00%	164	164	164	164	164	164	164

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

198

공시일	2018-04-04
기준일	2018-04-03

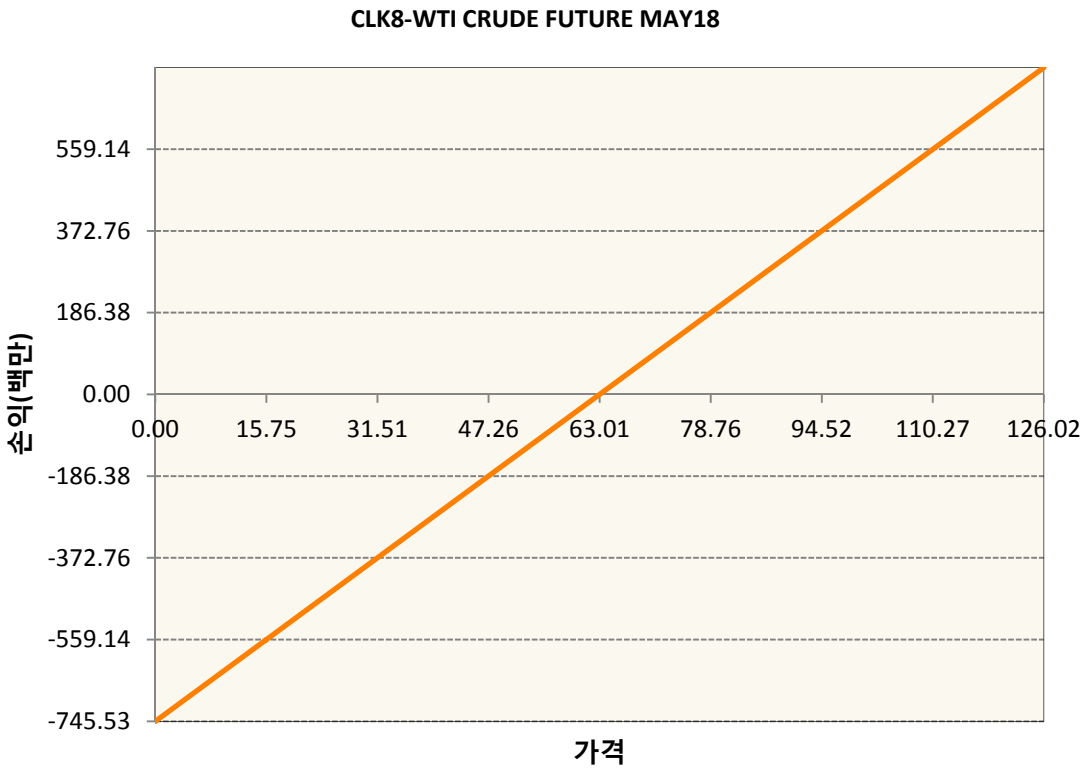
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

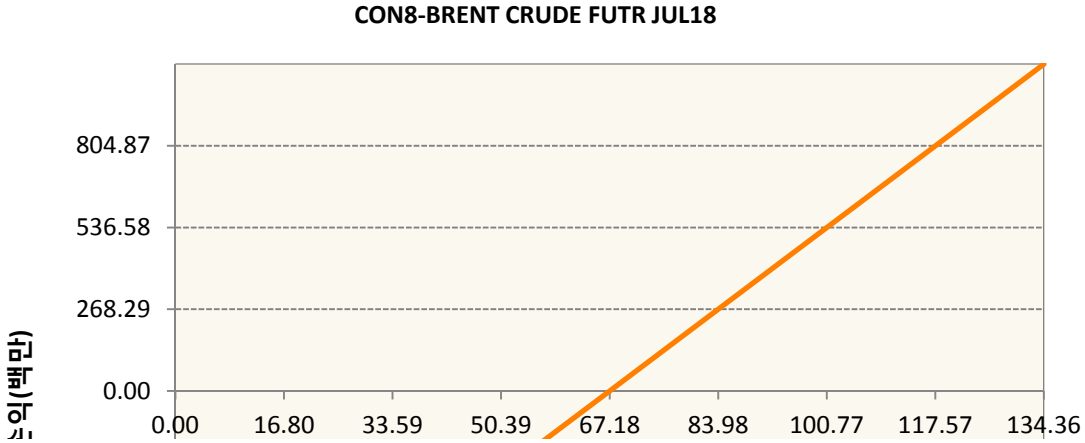
1. 계약금액

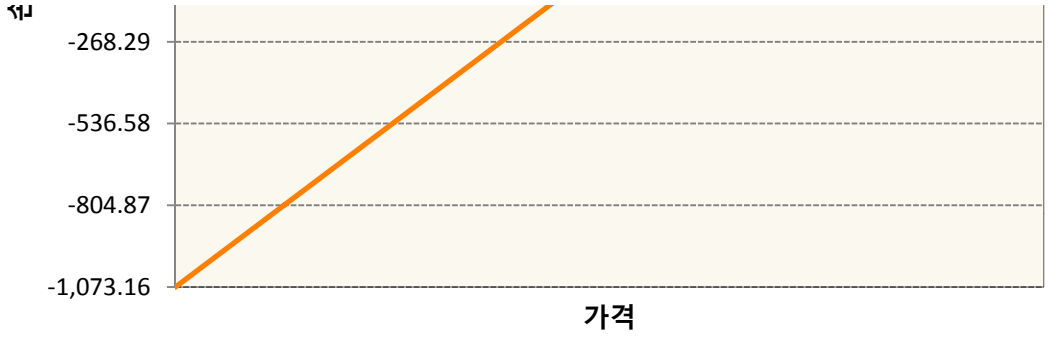
(단위:백만원)

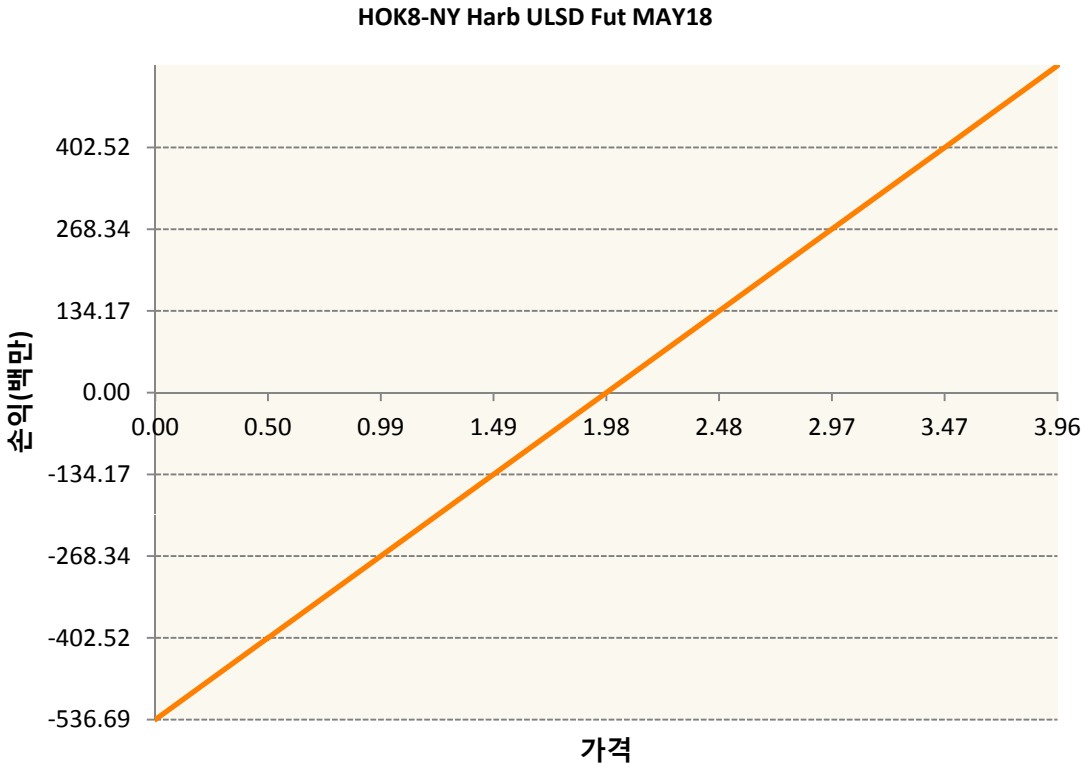
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	선물	유가증권	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	선물	유가증권	746	0	746	
누계	유가증권	선물	3,183	580	2,603	

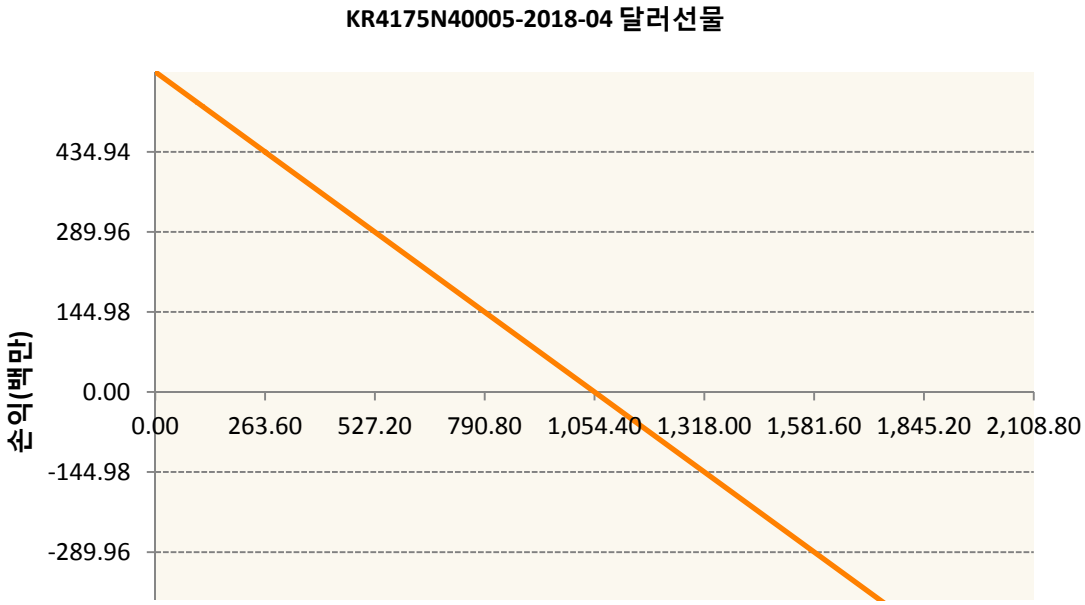
2. 만기시점의 손익구조

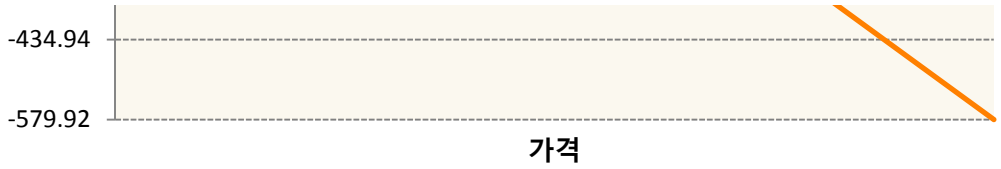


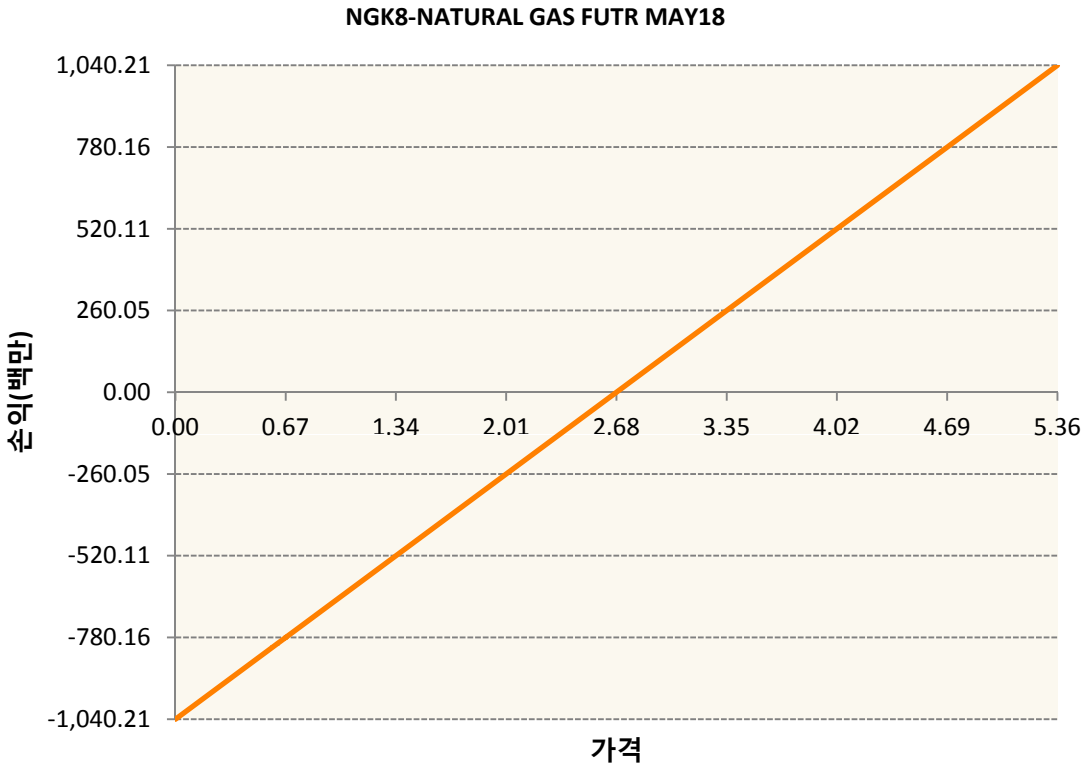


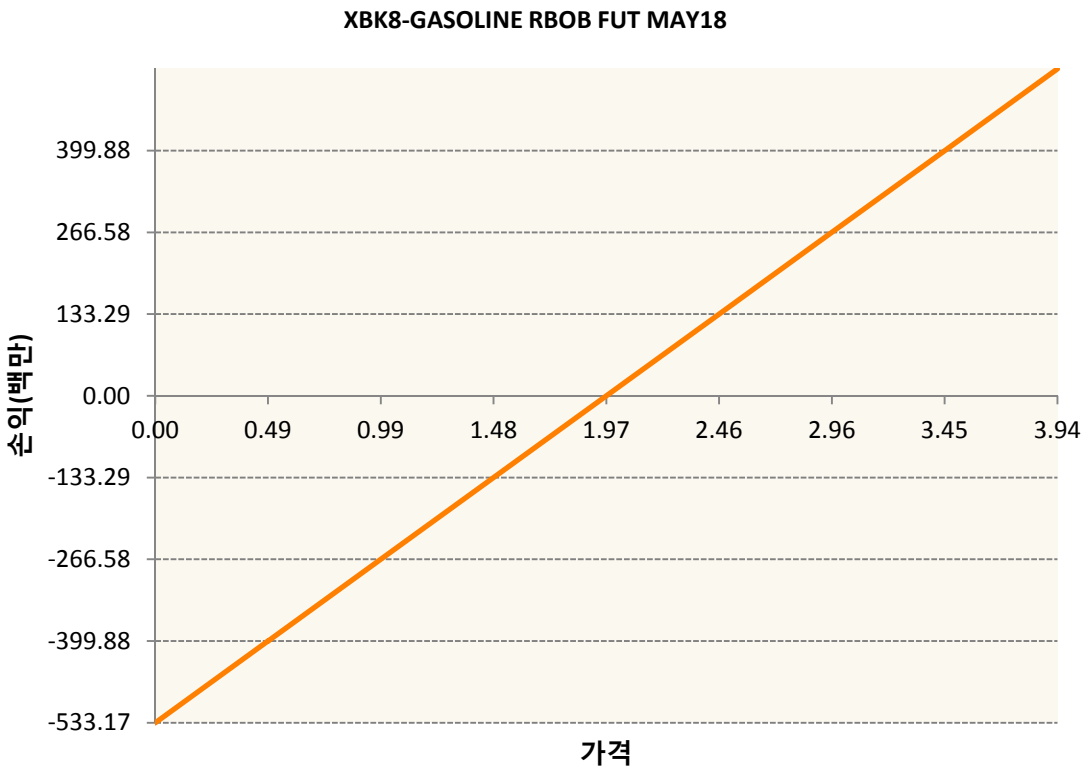

-268.29
-536.58
-804.87
-1,073.16
가격


HOK8-NY Harb ULSD Fut MAY18
402.52
268.34
134.17
0.00
-134.17
-268.34
-402.52
-536.69
0.00
0.50
0.99
1.49
1.98
2.48
2.97
3.47
3.96
손익(백만)
가격


KR4175N40005-2018-04 달러선물
434.94
289.96
144.98
0.00
-144.98
-289.96
0.00
263.60
527.20
790.80
1,054.40
1,318.00
1,581.60
1,845.20
2,108.80
손익(백만)


-434.94
-579.92
가격


NGK8-NATURAL GAS FUTR MAY18
1,040.21
780.16
520.11
260.05
0.00
-260.05
-520.11
-780.16
-1,040.21
손익(백만)
0.00
0.67
1.34
2.01
2.68
3.35
4.02
4.69
5.36
가격


XBK8-GASOLINE RBOB FUT MAY18
399.88
266.58
133.29
0.00
-133.29
-266.58
-399.88
-533.17
손익(백만)
0.00
0.49
0.99
1.48
1.97
2.46
2.96
3.45
3.94
가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLK8	WTI CRUDE FUTURE MAY18	60
CON8	BRENT CRUDE FUTR JUL18	86
HOK8	NY Harb ULSD Fut MAY18	43
KR4175N40(	2018-04 달러선물	46
NGK8	NATURAL GAS FUTR MAY18	83
XBK8	GASOLINE RBOB FUT MAY18	43

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

508

공시일	2018-04-04
기준일	2018-04-03

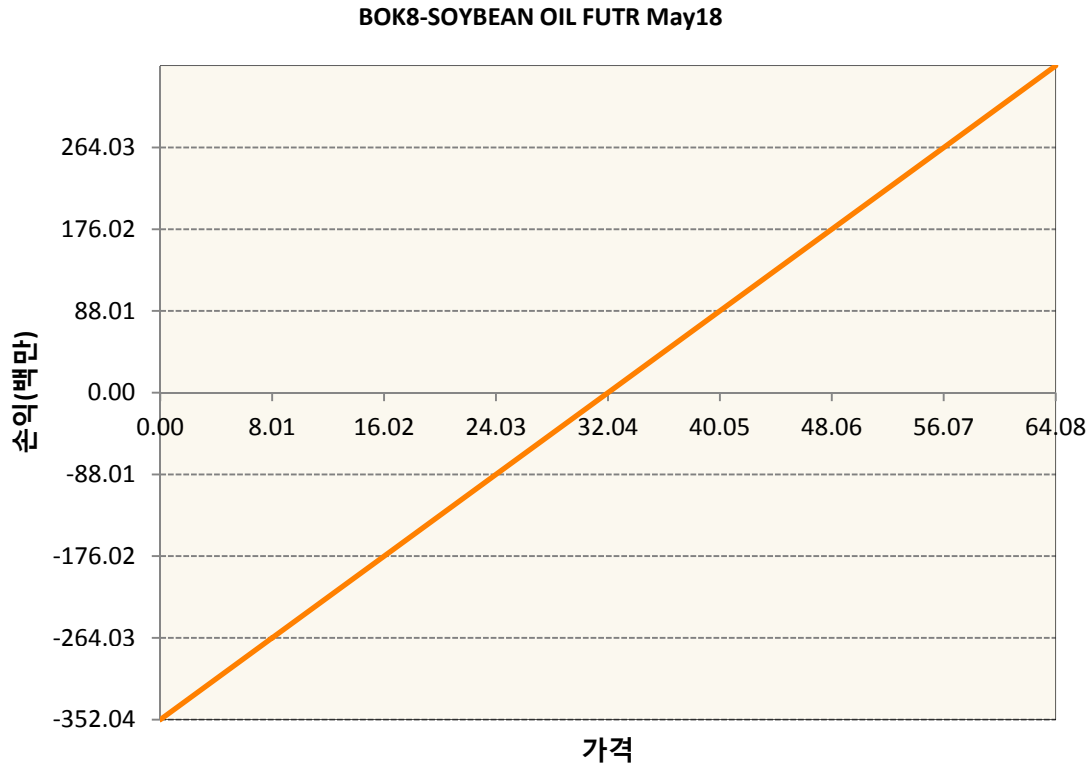
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

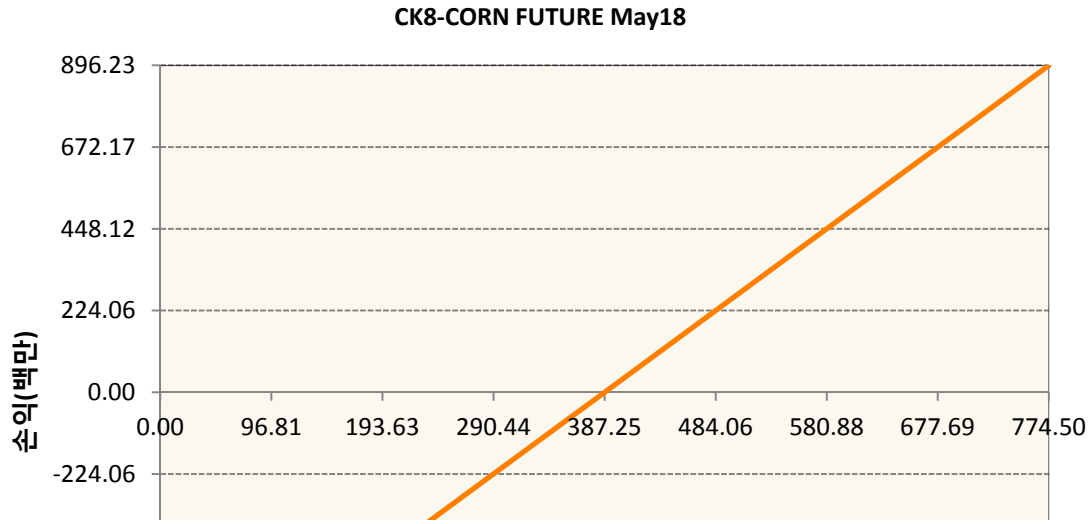
1. 계약금액

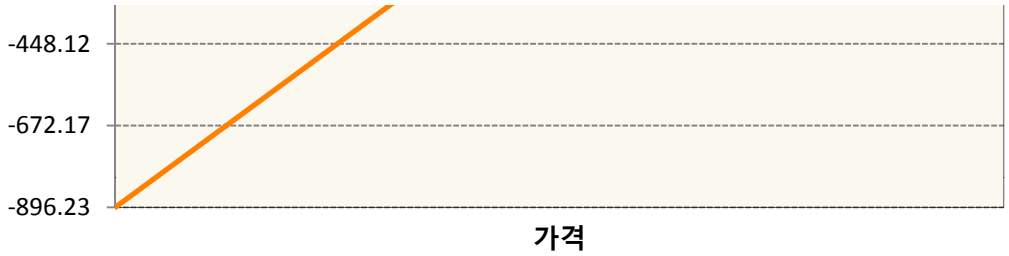
(단위:백만원)

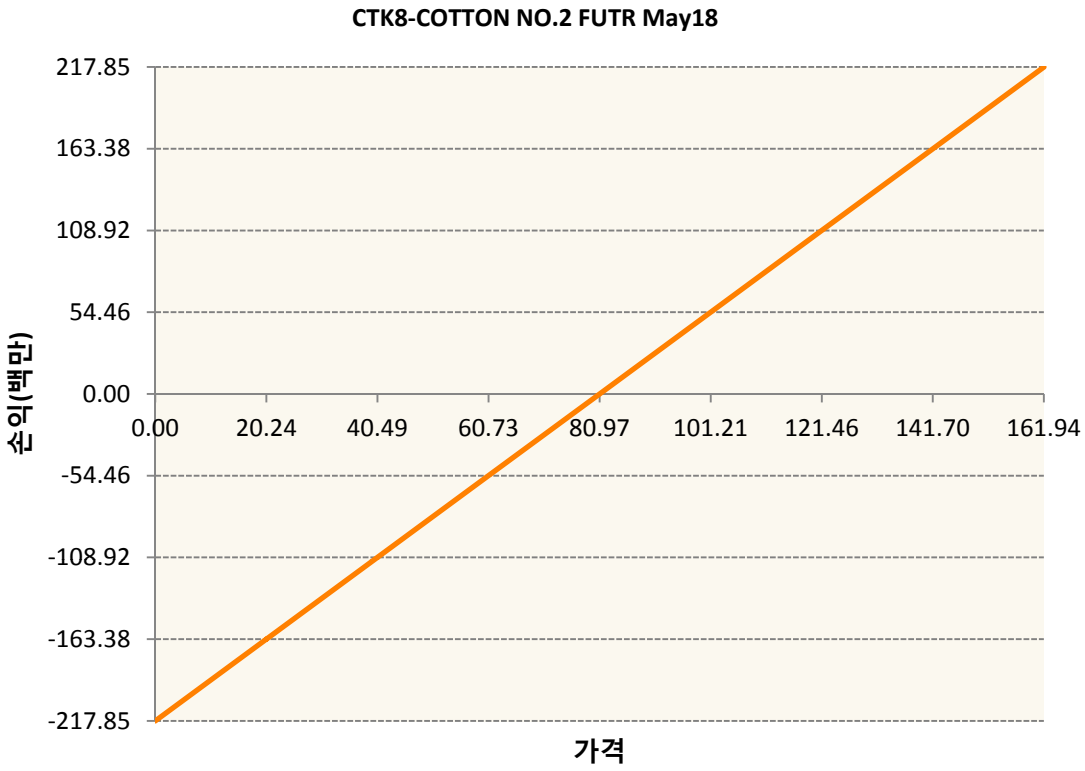
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	4,092	316	3,776	

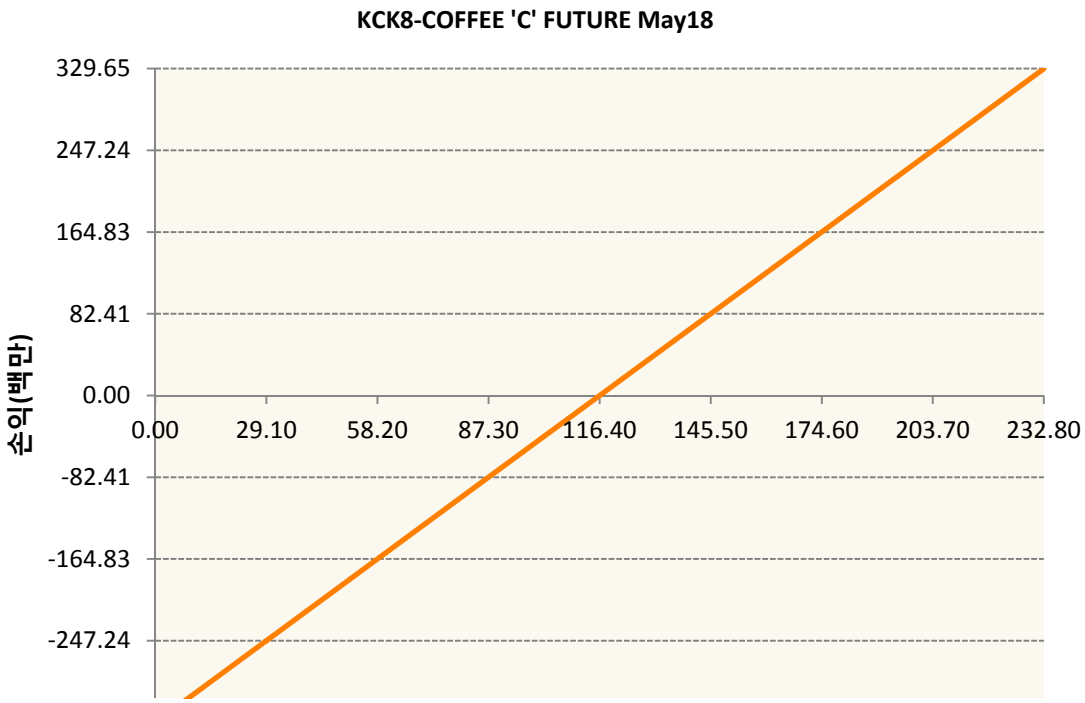
2. 만기시점의 손익구조

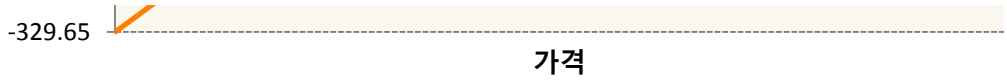


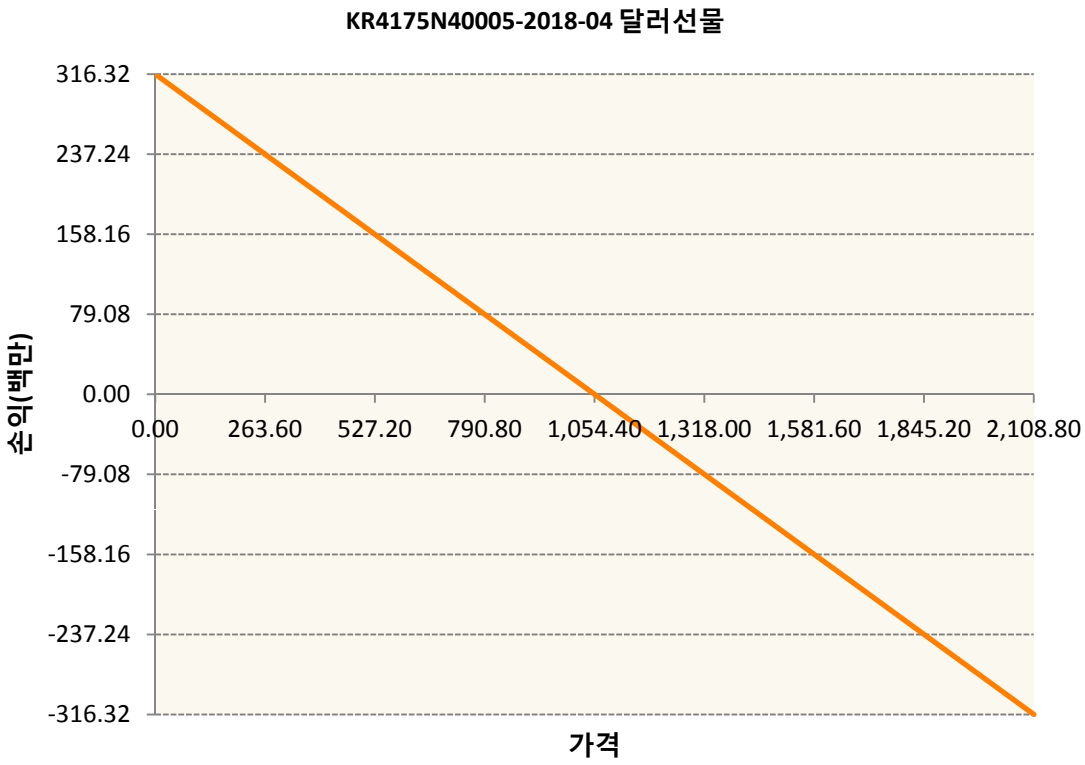


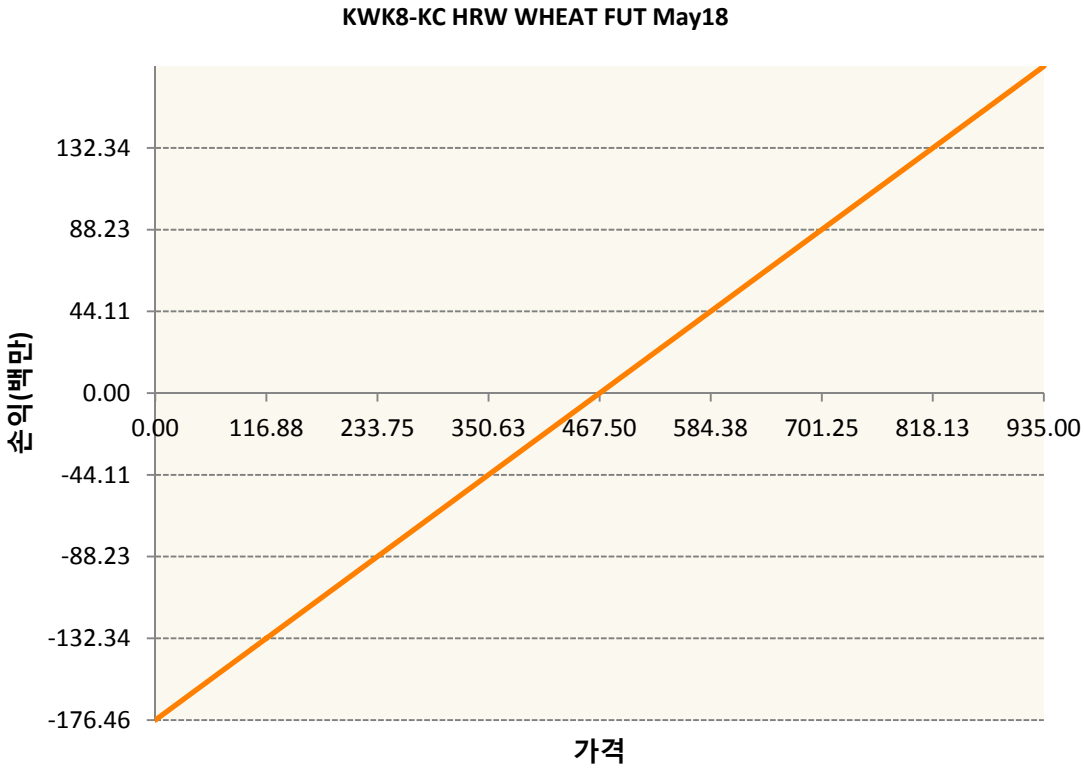

-448.12
-672.17
-896.23
가격


CTK8-COTTON NO.2 FUTR May18
217.85
163.38
108.92
54.46
0.00
-54.46
-108.92
-163.38
-217.85
손익(백만)
0.00
20.24
40.49
60.73
80.97
101.21
121.46
141.70
161.94
가격

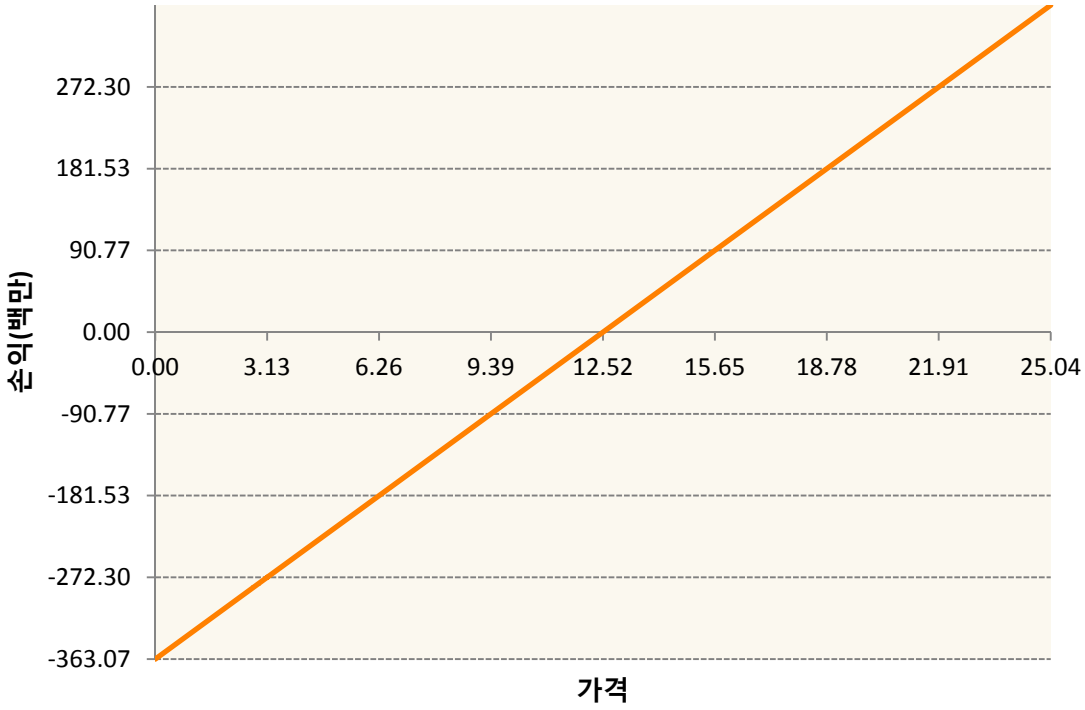

KCK8-COFFEE 'C' FUTURE May18
329.65
247.24
164.83
82.41
0.00
-82.41
-164.83
-247.24
손익(백만)
0.00
29.10
58.20
87.30
116.40
145.50
174.60
203.70
232.80


-329.65
가격

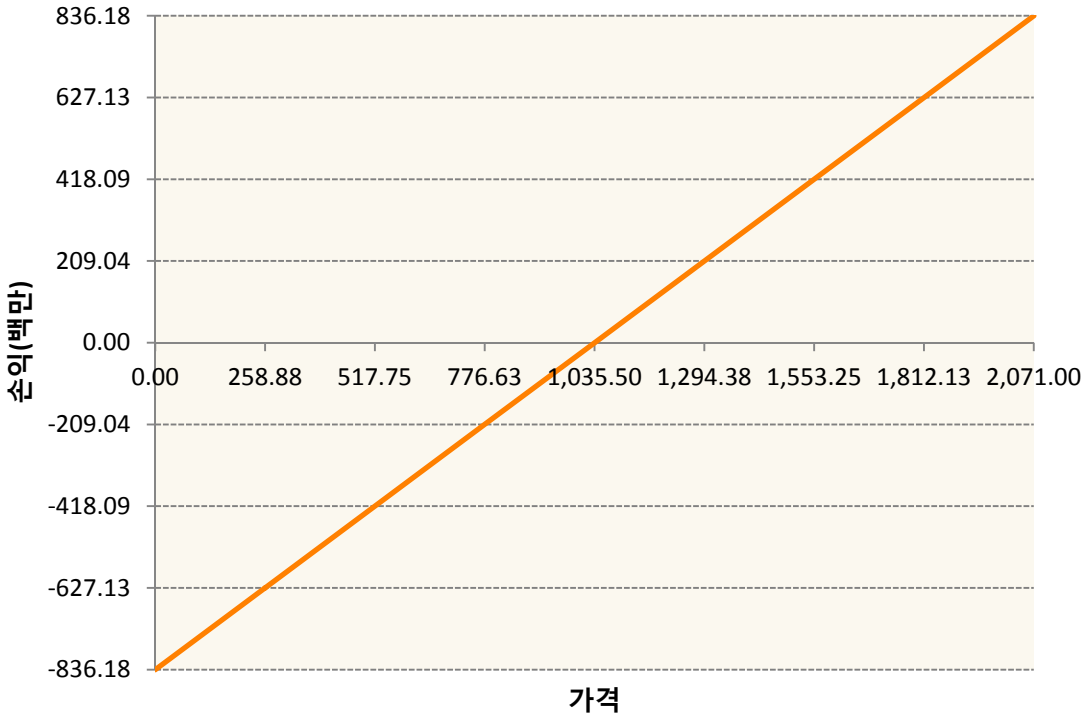

KR4175N40005-2018-04 달러선물
316.32
237.24
158.16
79.08
0.00
-79.08
-158.16
-237.24
-316.32
0.00
263.60
527.20
790.80
1,054.40
1,318.00
1,581.60
1,845.20
2,108.80
손익(백만)
가격


KWK8-KC HRW WHEAT FUT May18
132.34
88.23
44.11
0.00
-44.11
-88.23
-132.34
-176.46
0.00
116.88
233.75
350.63
467.50
584.38
701.25
818.13
935.00
손익(백만)
가격

SBK8-SUGAR #11 (WORLD) May18

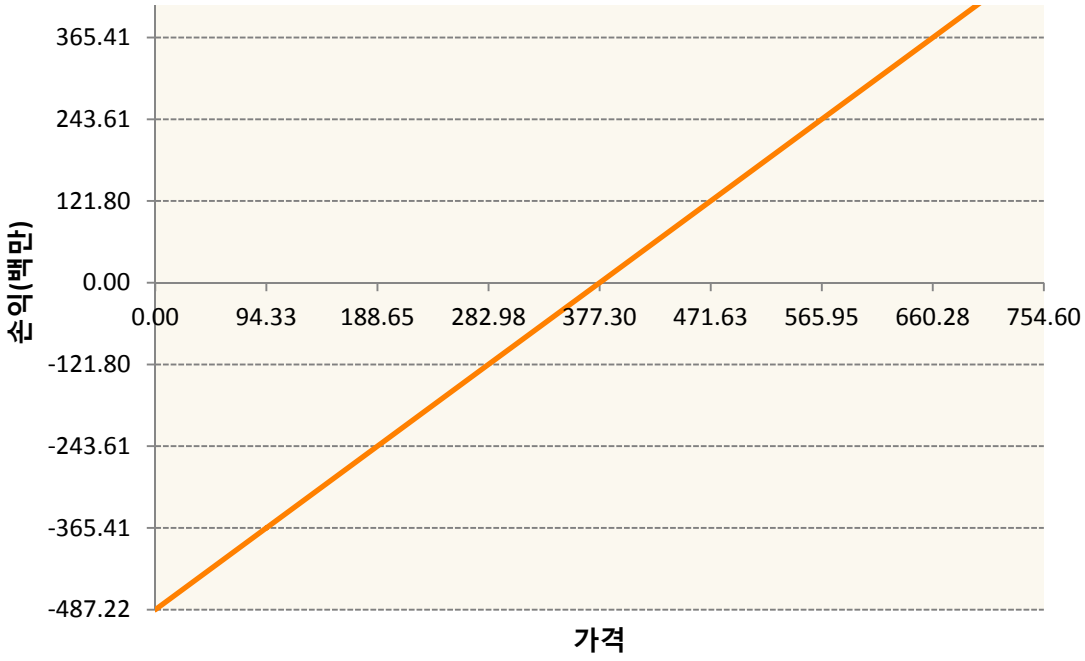


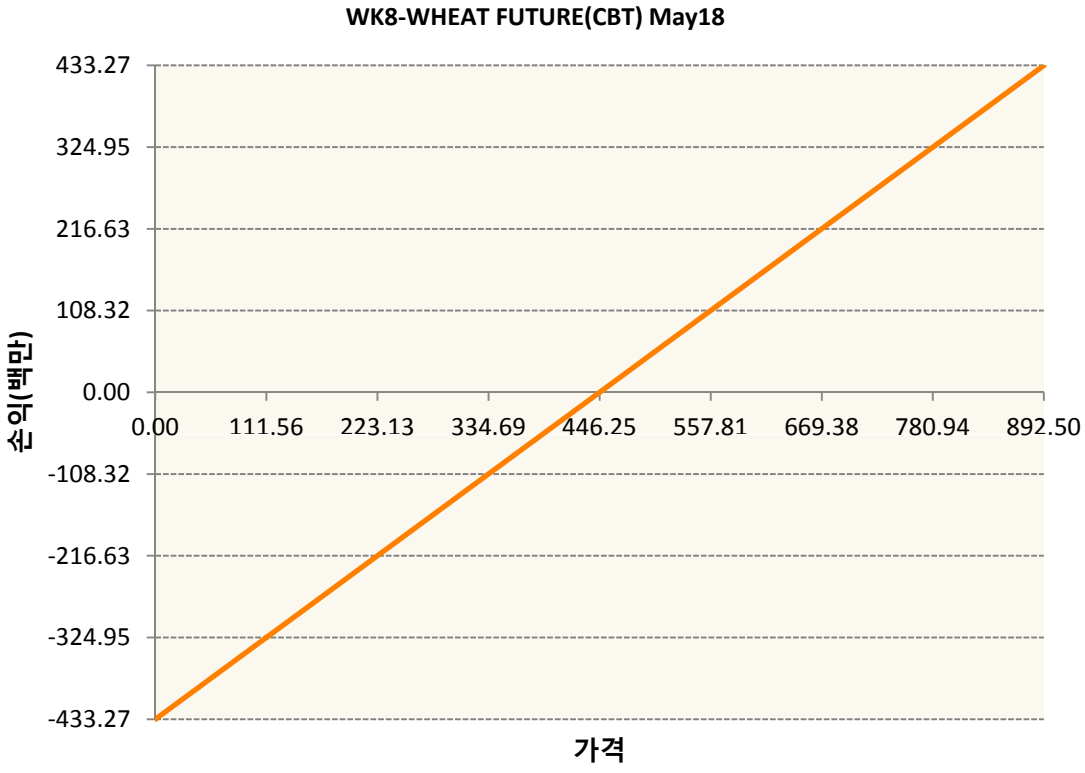
SK8-SOYBEAN FUTRUE May18



SMK8-SOYBEAN MEAL FUTR May18







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

BOK8	SOYBEAN OIL FUTR May18	28
CK8	CORN FUTURE May18	72
CTK8	COTTON NO.2 FUTR May18	17
KCK8	COFFEE 'C' FUTURE May18	26
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	39
WK8	WHEAT FUTURE(CBT) May18	35

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

330