공시일	2018-04-05
기준일	2018-04-04

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	2018-04-05
기준일	2018-04-04

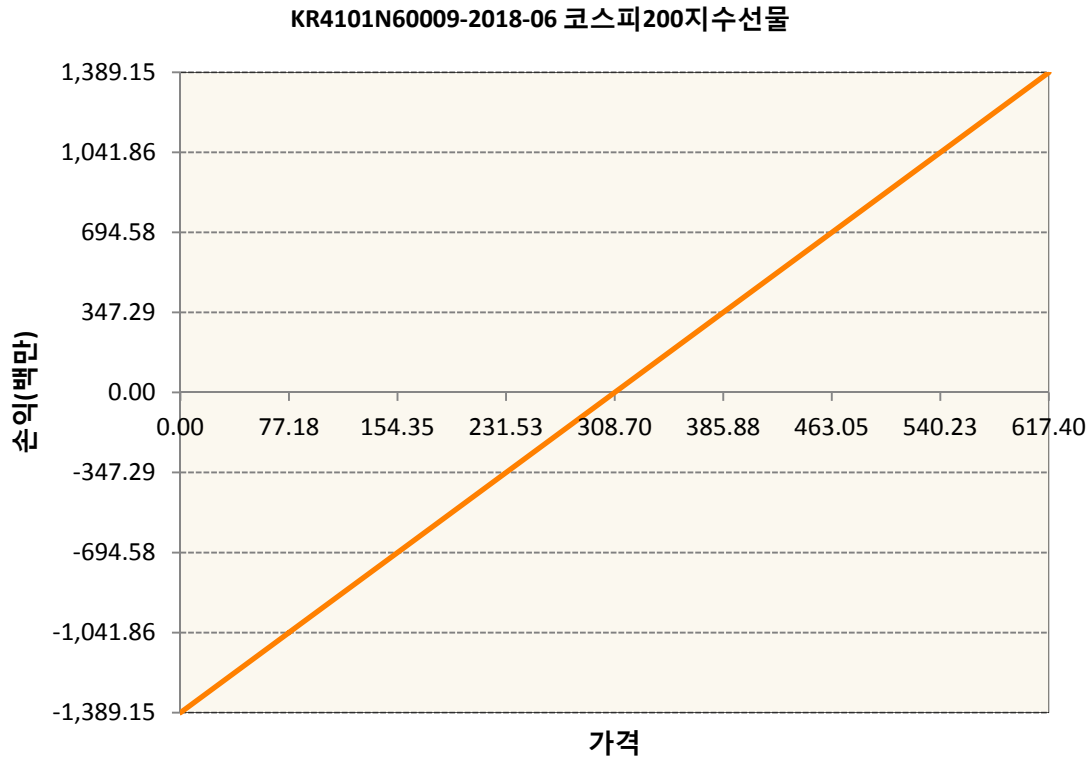
스마트인덱스모

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	1,389	0	1,389	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101N60(2018-06 코스피200지수선물							111
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-111	-111	-111	-111	-111	-111	-111
-5.33%	-74	-74	-74	-74	-74	-74	-74
-2.67%	-37	-37	-37	-37	-37	-37	-37
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	37	37	37	37	37	37	37
5.33%	74	74	74	74	74	74	74
8.00%	111	111	111	111	111	111	111

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

81

공시일	2018-04-05
기준일	2018-04-04

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	1,078

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

429

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2018-04-05
기준일	2018-04-04

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	404

* 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	2018-04-05
기준일	2018-04-04

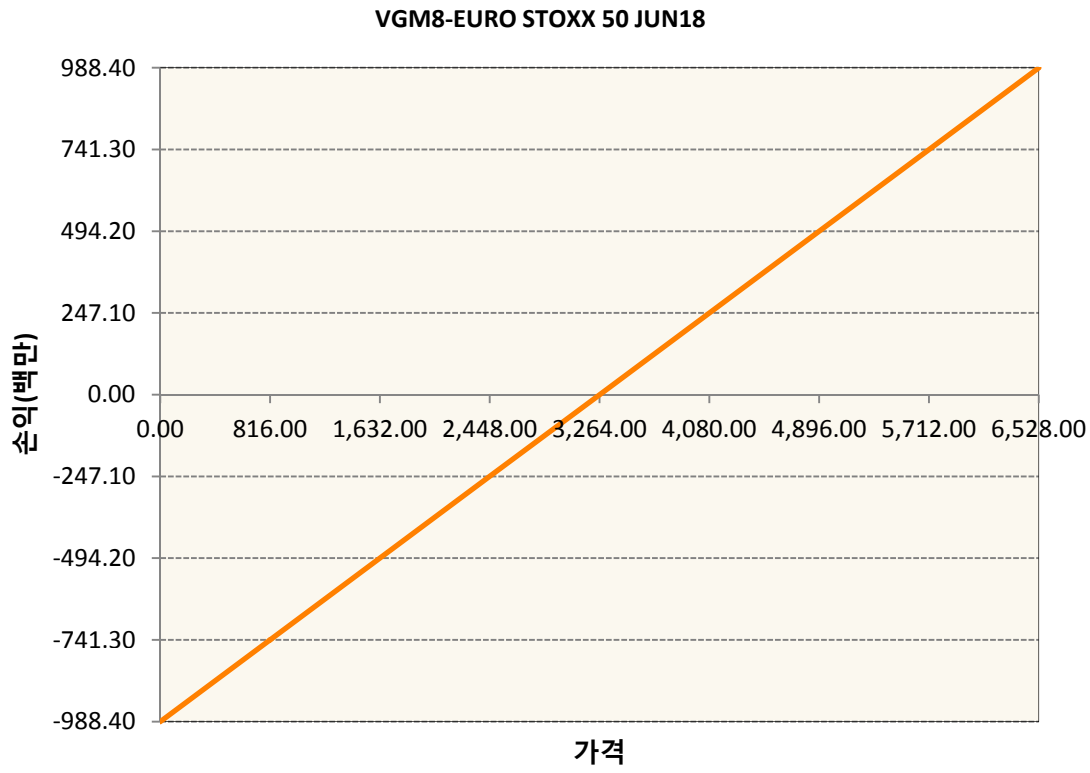
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	988	0	988	

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	2018-04-05
기준일	2018-04-04

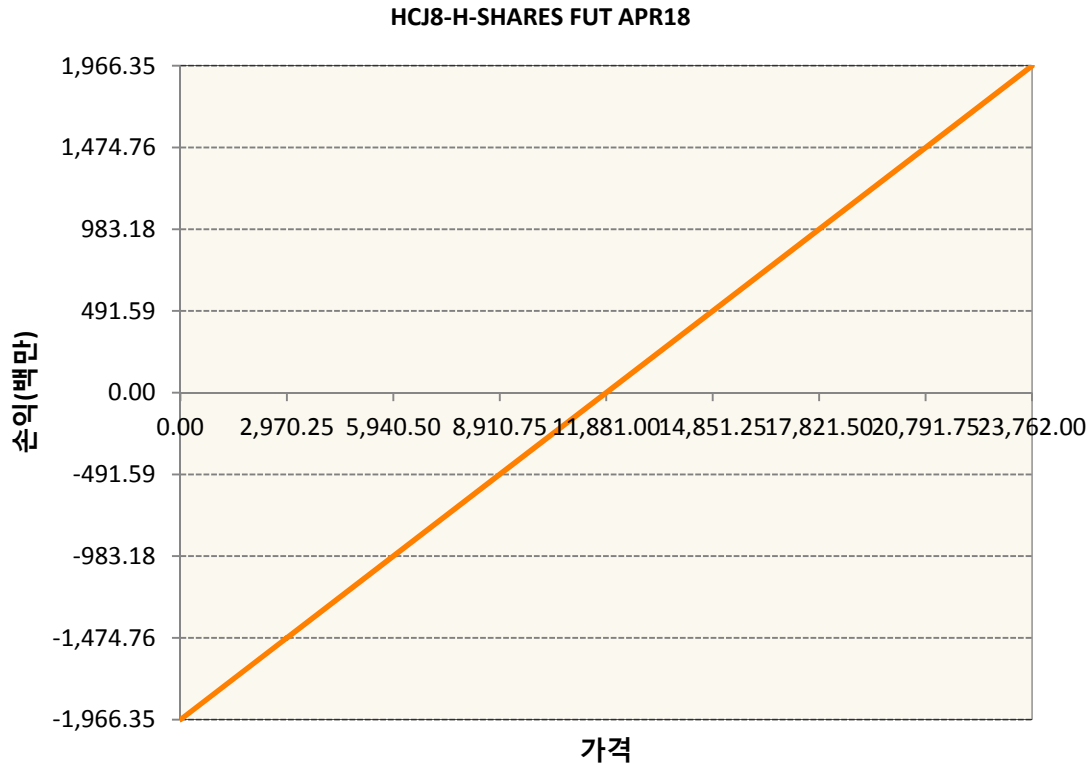
차이나인덱스모(주식-파생형)

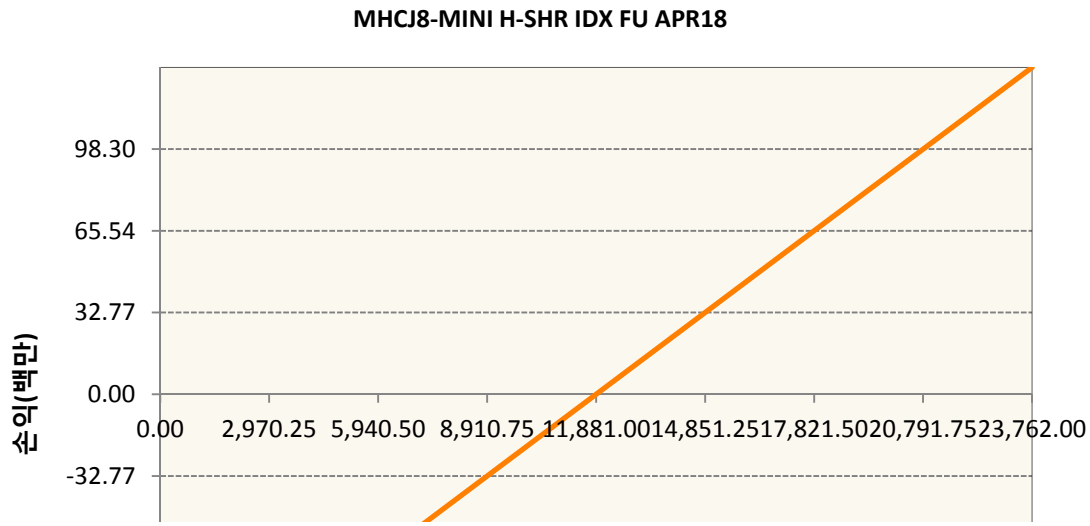
1. 계약금액

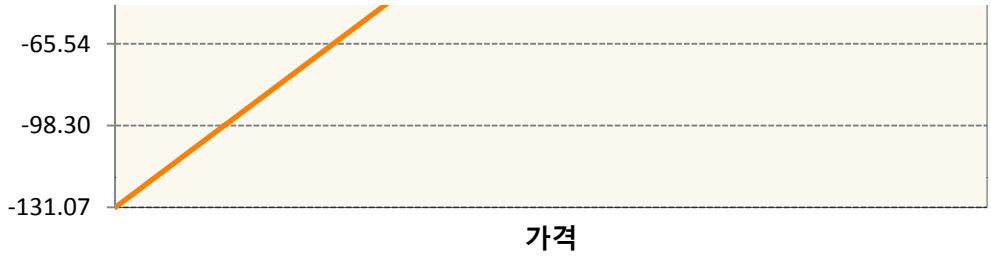
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,097	0	2,097	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCJ8	H-SHARES FUT APR18	157
MHCJ8	MINI H-SHR IDX FU APR18	10

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	146

공시일	2018-04-05
기준일	2018-04-04

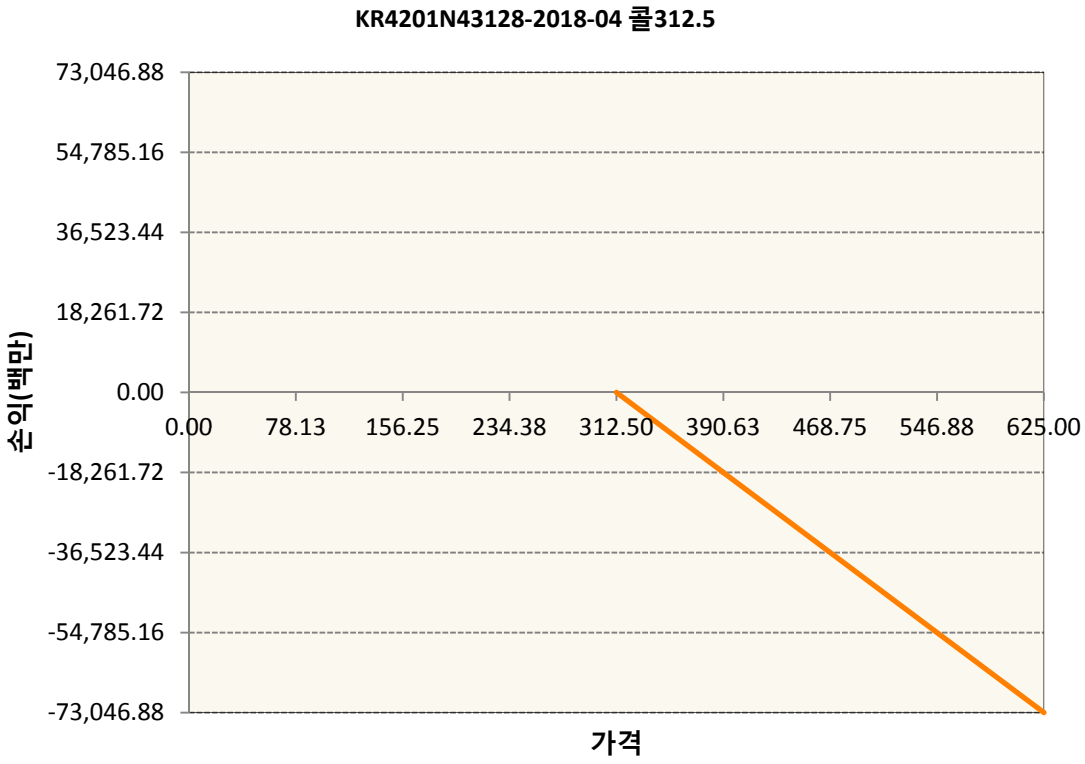
커버드콜모(주식혼합-파생형)

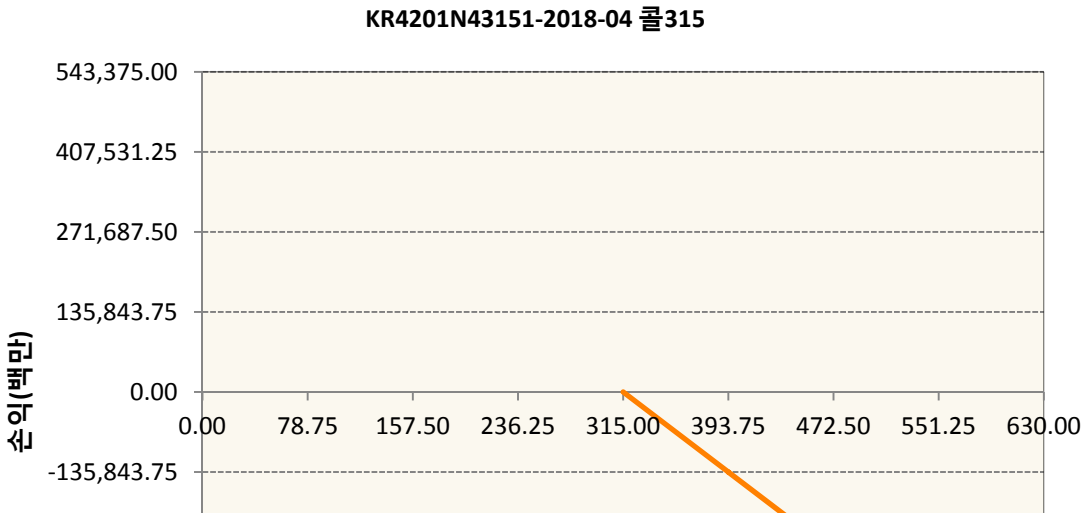
1. 계약금액

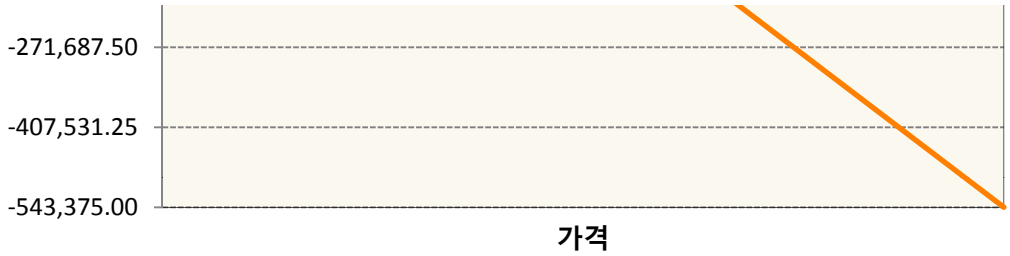
(단위:백만원)

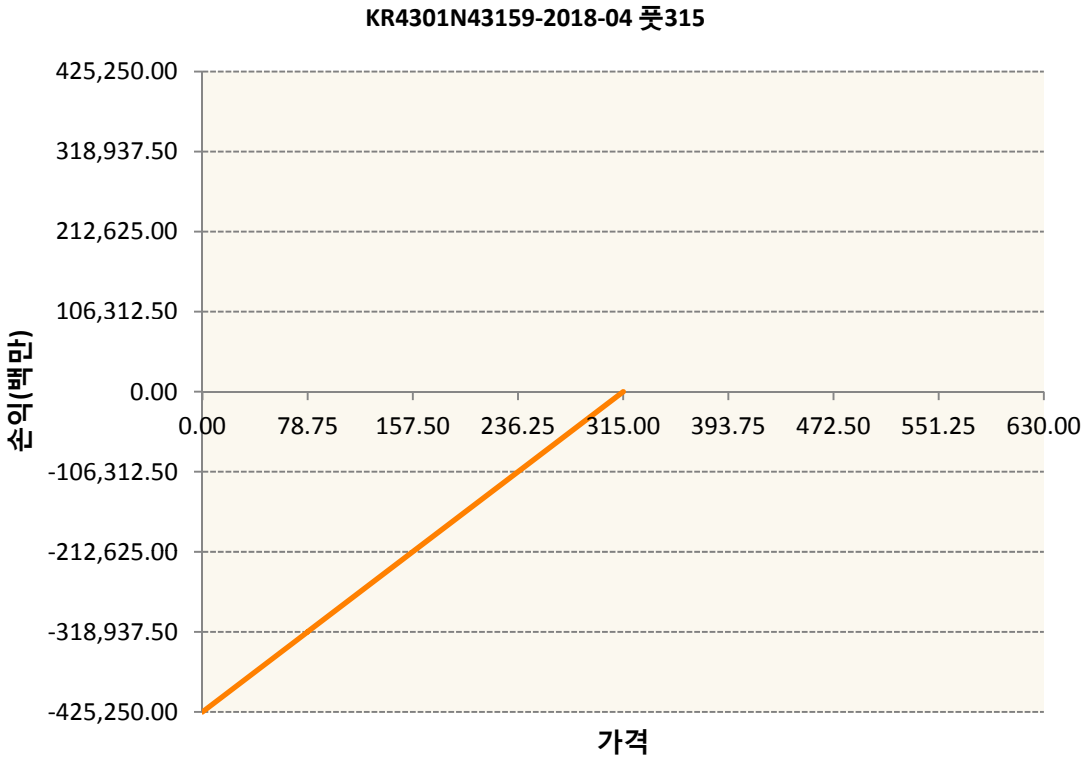
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	1,041,672	-1,041,672	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201N4312018-04 콜312.5							4,237
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	838	836	832	826	816	802	784
-5.33%	824	810	789	763	730	692	649
-2.67%	717	665	607	542	473	400	324
0%	294	197	99	0	-100	-200	-301
2.67%	-691	-788	-887	-986	-1,087	-1,188	-1,290
5.33%	-2,214	-2,269	-2,331	-2,399	-2,472	-2,548	-2,628
8.00%	-4,027	-4,046	-4,071	-4,103	-4,142	-4,186	-4,237
KR4201N4312018-04 콜315							29,020
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	4,717	4,710	4,694	4,663	4,613	4,539	4,439

-5.33%	4,665	4,600	4,499	4,359	4,177	3,955	3,694
-2.67%	4,192	3,907	3,567	3,178	2,747	2,280	1,782
0%	1,980	1,340	678	0	-692	-1,394	-2,105
2.67%	-3,939	-4,708	-5,479	-6,251	-7,024	-7,798	-8,573
5.33%	-14,113	-14,631	-15,190	-15,782	-16,401	-17,042	-17,701
8.00%	-27,022	-27,227	-27,489	-27,804	-28,167	-28,574	-29,020
KR4301N4312018-04 풋315							31,704

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-31,698	-31,698	-31,698	-31,698	-31,699	-31,701	-31,704
-5.33%	-20,595	-20,596	-20,600	-20,608	-20,623	-20,646	-20,679
-2.67%	-9,528	-9,569	-9,630	-9,713	-9,818	-9,945	-10,092
0%	832	574	296	0	-309	-629	-959
2.67%	7,780	7,392	7,001	6,609	6,215	5,821	5,426
5.33%	10,028	9,876	9,693	9,485	9,254	9,003	8,736
8.00%	10,301	10,284	10,253	10,205	10,139	10,053	9,947

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

70,377

공시일	2018-04-05
기준일	2018-04-04

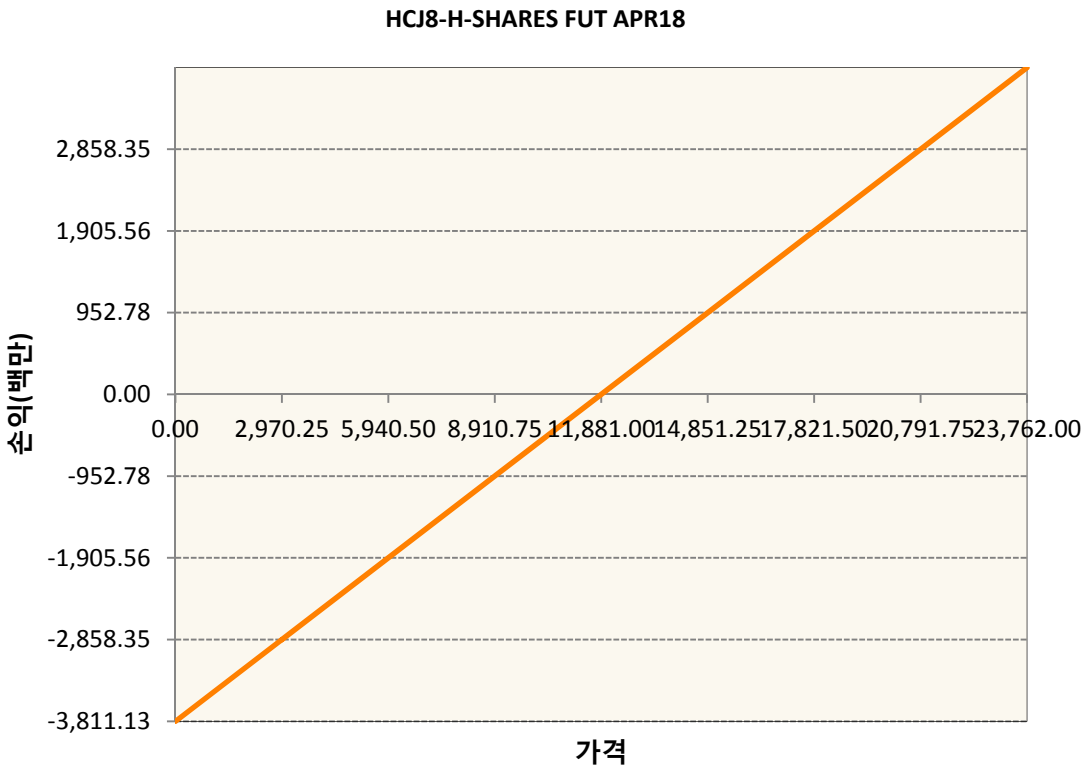
홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생

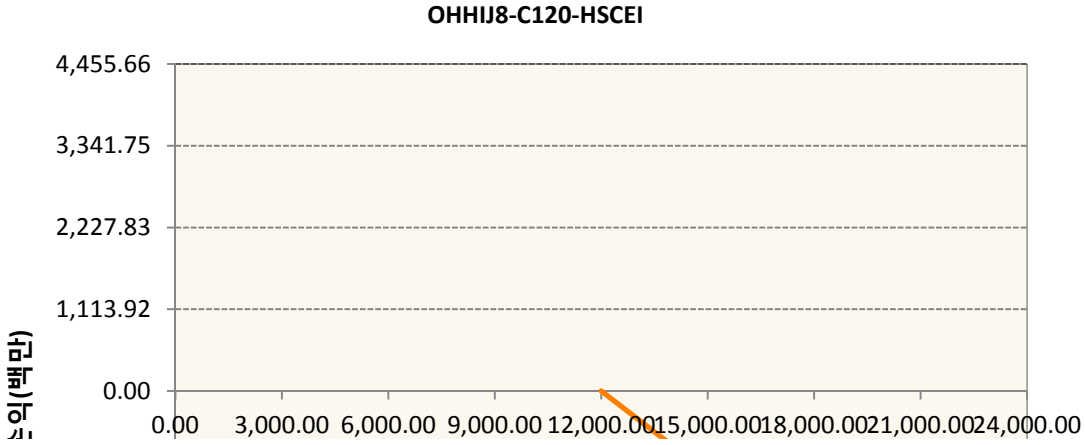
1. 계약금액

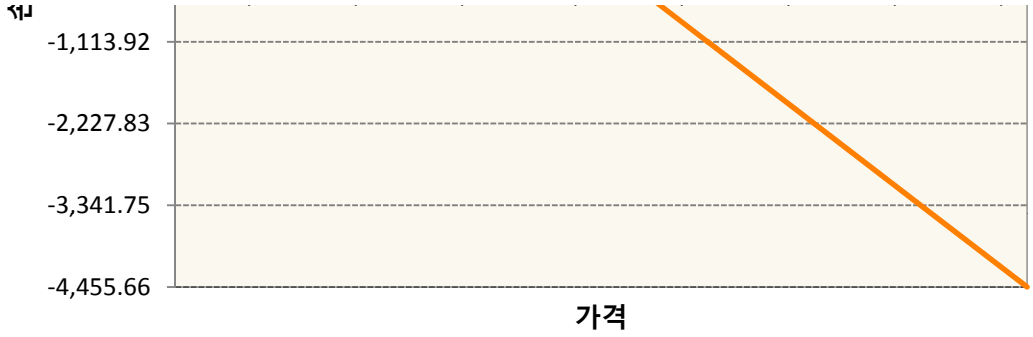
(단위:백만원)

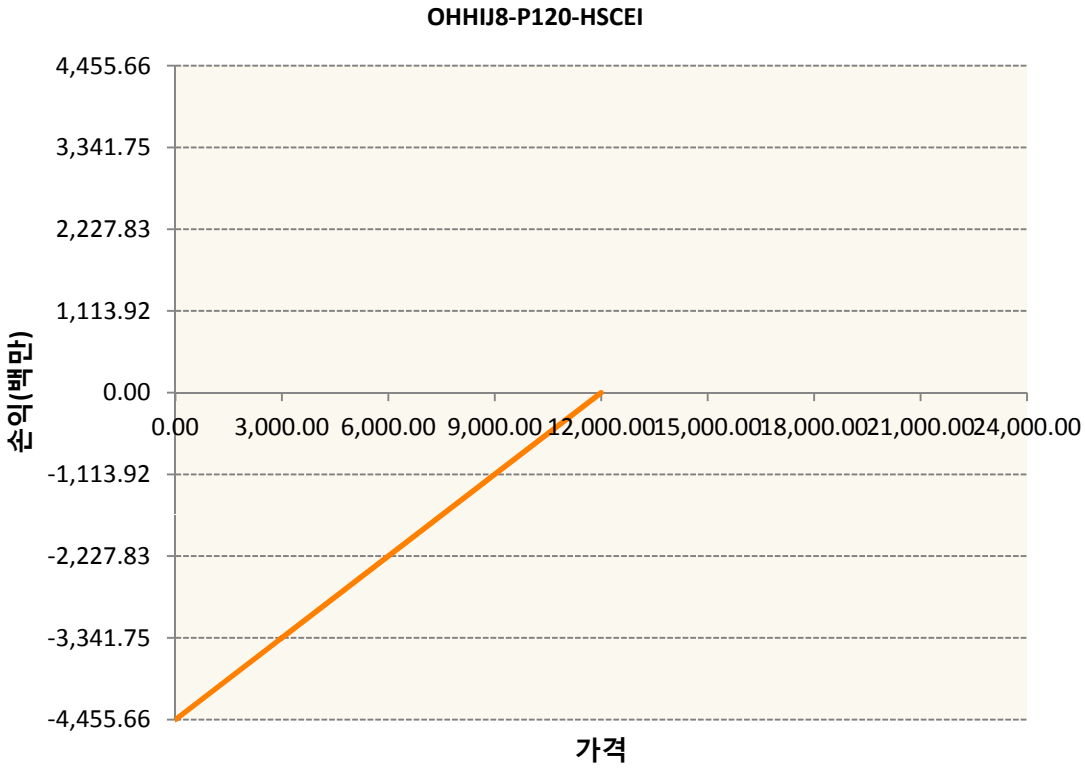
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	3,811	0	3,811	장내
누계	유가증권	옵션	0	8,911	-8,911	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCJ8	H-SHARES FUT APR18	305
OHHIJ8-C12	HSCEI	356
OHHIJ8-P12	HSCEI	356

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	887

공시일	2018-04-05
기준일	2018-04-04

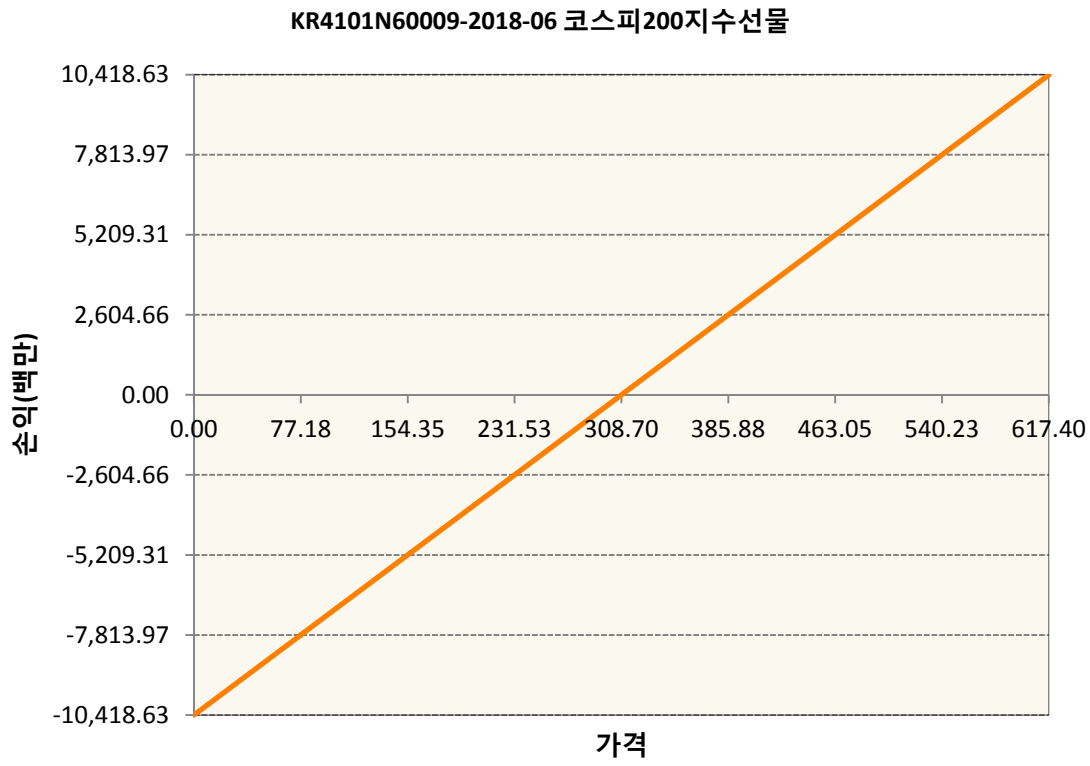
코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼

1. 계약금액

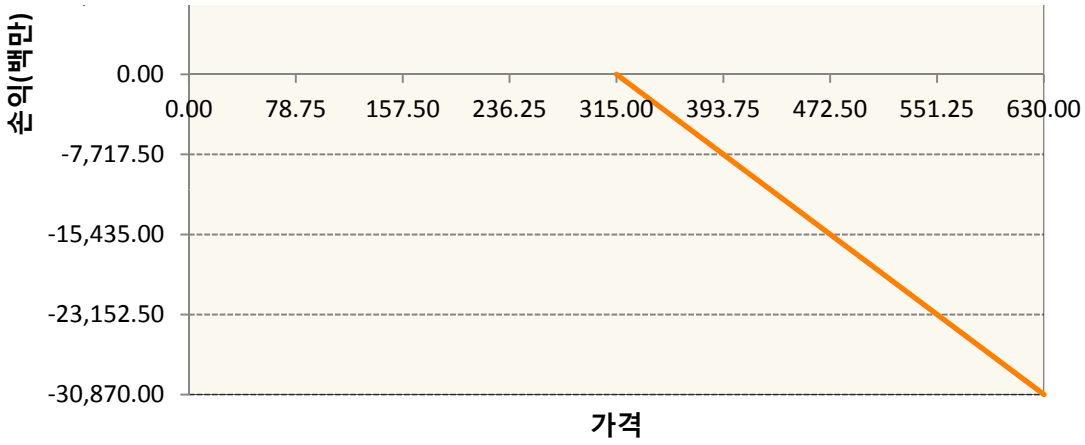
(단위:백만원)

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	10,419	0	10,419	장내
누계	유가증권	스왑	54,200	0	54,200	장외
누계	유가증권	옵션	0	55,718	-55,718	장내

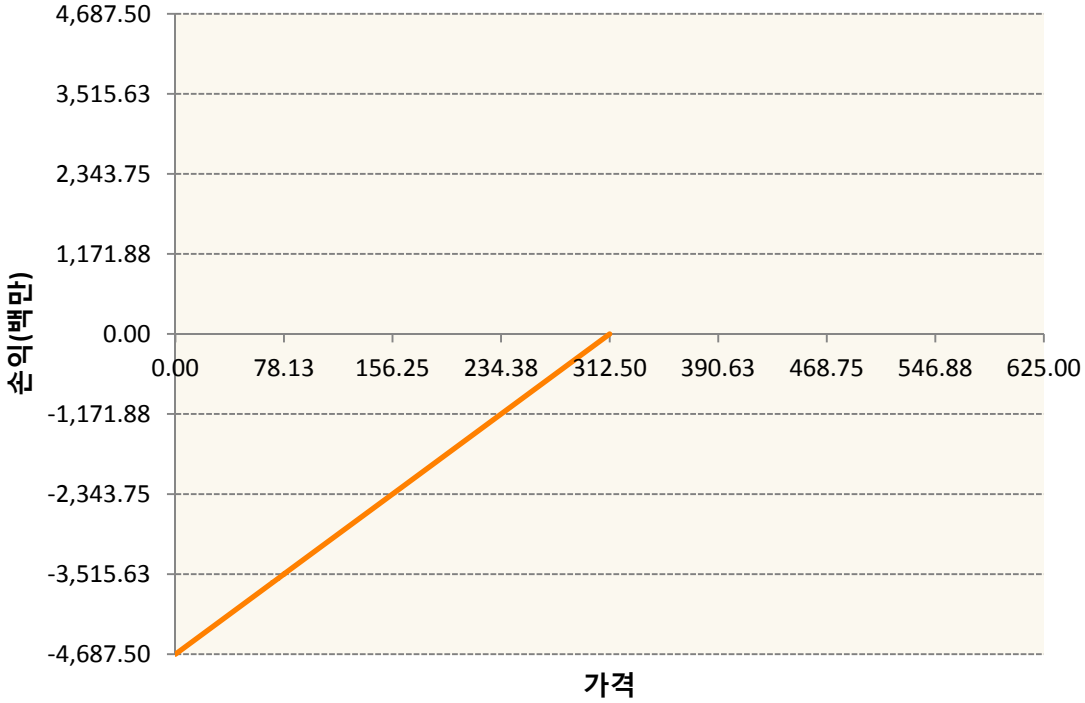
2. 만기시점의 손익구조



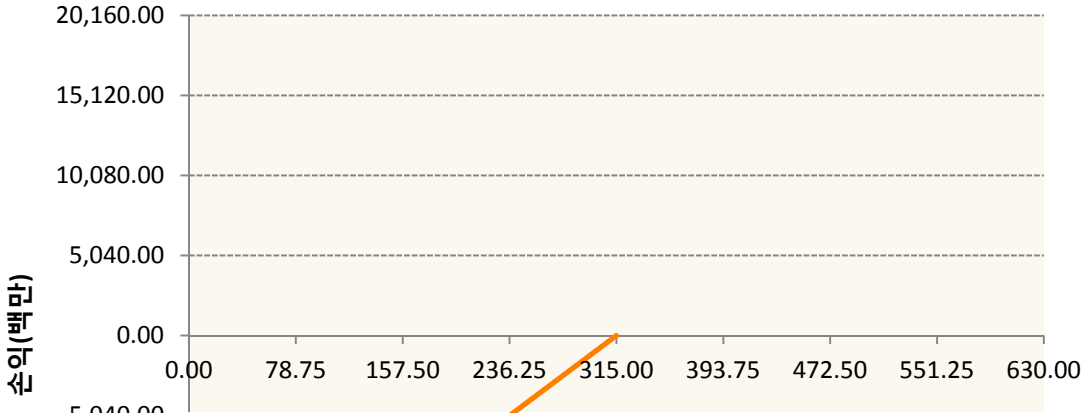




KR4301N43126-2018-04 풋312.5



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						833
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-833	-833	-833	-833	-833	-833	-833
-5.33%	-555	-555	-555	-555	-555	-555	-555
-2.67%	-278	-278	-278	-278	-278	-278	-278
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	278	278	278	278	278	278	278
5.33%	555	555	555	555	555	555	555
8.00%	833	833	833	833	833	833	833
	KR4201N431 2018-04 콜315						1,649
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	268	268	267	265	262	258	252
-5.33%	265	261	256	248	237	225	210
-2.67%	238	222	203	181	156	130	101
0%	112	76	39	0	-39	-79	-120
2.67%	-224	-267	-311	-355	-399	-443	-487
5.33%	-802	-831	-863	-897	-932	-968	-1,006
8.00%	-1,535	-1,547	-1,562	-1,580	-1,600	-1,623	-1,649
	KR4301N431 2018-04 풋312.5						342
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-342	-342	-342	-342	-342	-342	-342
-5.33%	-219	-219	-219	-219	-219	-220	-220
-2.67%	-96	-97	-98	-100	-102	-104	-106
0%	11	8	4	0	-4	-8	-12
2.67%	72	68	64	60	56	52	48
5.33%	86	85	84	82	80	78	76
8.00%	87	87	87	87	86	86	85
	KR4301N431 2018-04 풋315						1,503

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,503	-1,503	-1,503	-1,503	-1,503	-1,503	-1,503
-5.33%	-976	-976	-977	-977	-978	-979	-980
-2.67%	-452	-454	-457	-460	-465	-471	-478
0%	39	27	14	0	-15	-30	-45
2.67%	369	350	332	313	295	276	257
5.33%	475	468	460	450	439	427	414
8.00%	488	488	486	484	481	477	472

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

8,641

공시일	2018-04-05
기준일	2018-04-04

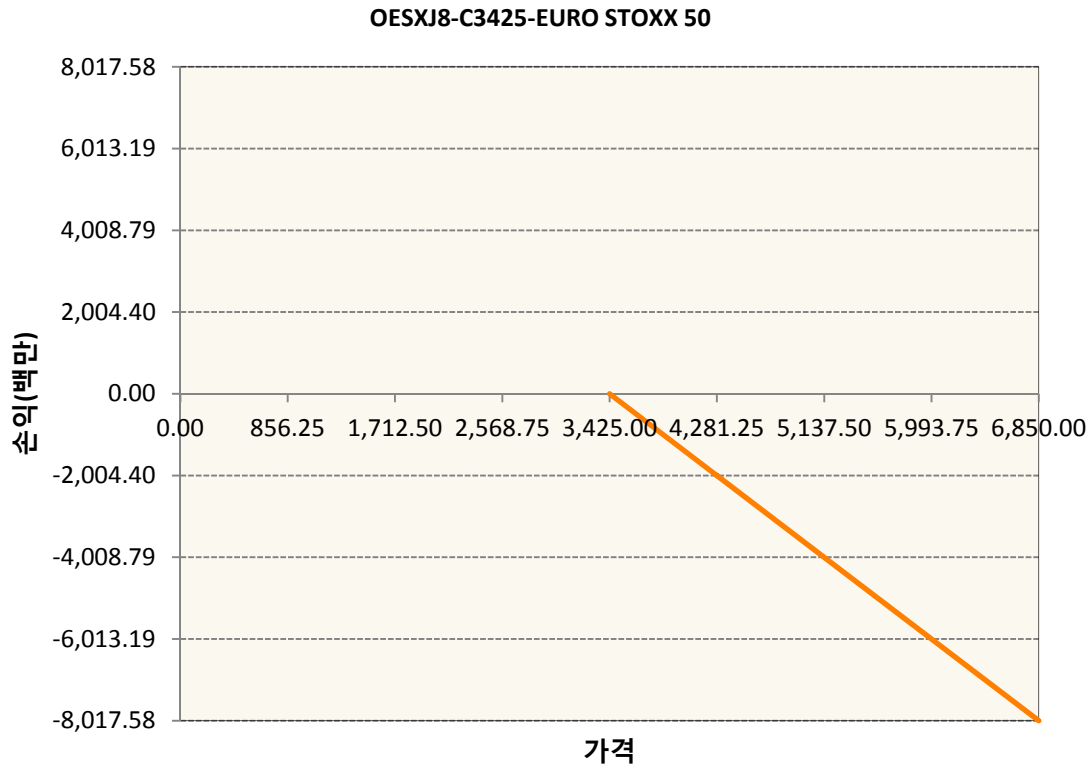
유로커버드콜모(주식혼합-파생형

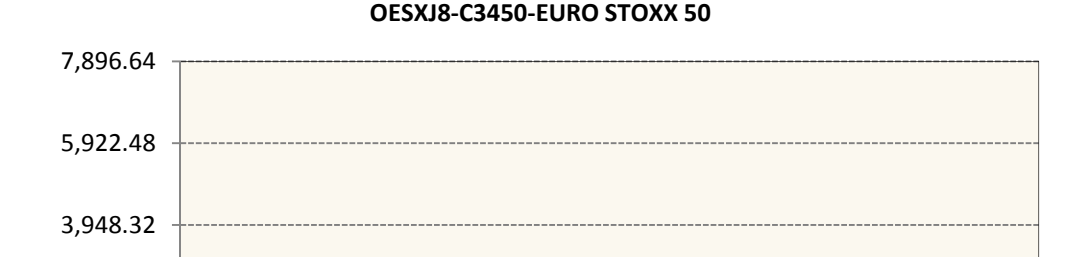
1. 계약금액

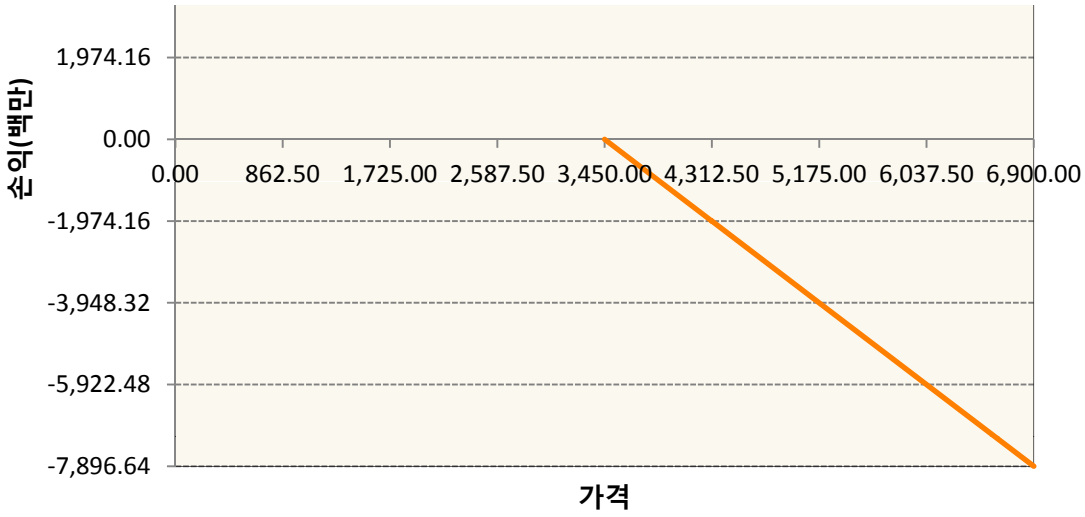
(단위:백만원)

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	7,362	0	7,362	
누계	유가증권	스왑	97,536	0	97,536	장외
누계	유가증권	옵션	0	31,828	-31,828	장내
누계	지수	스왑	52,020	0	52,020	장외

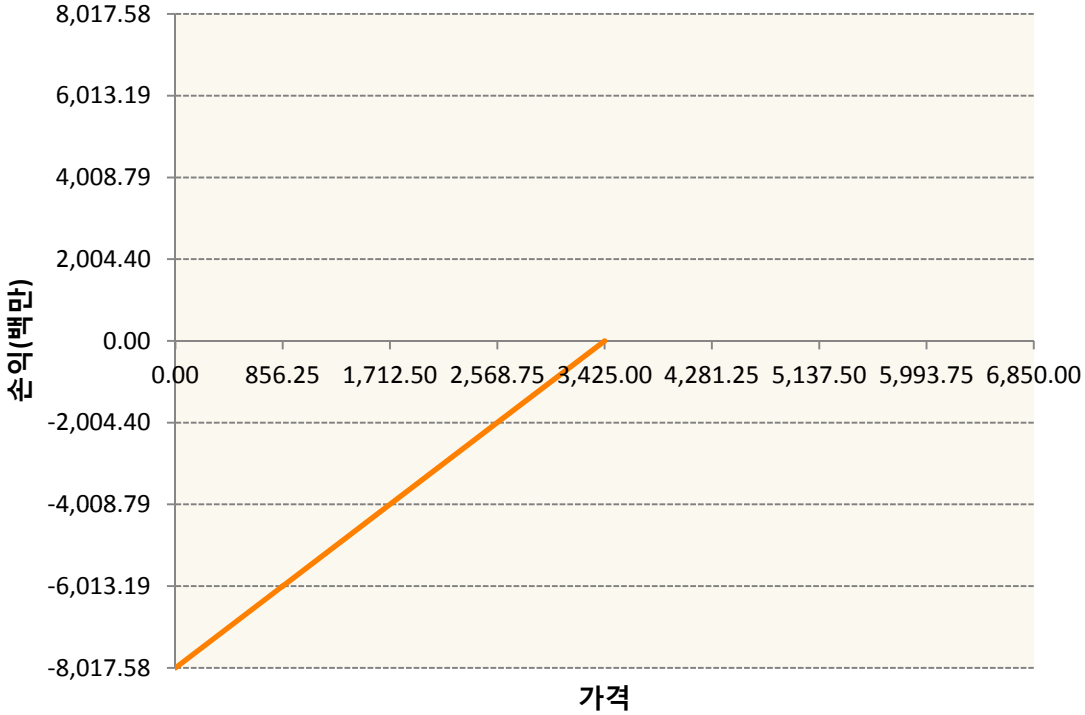
2. 만기시점의 손익구조



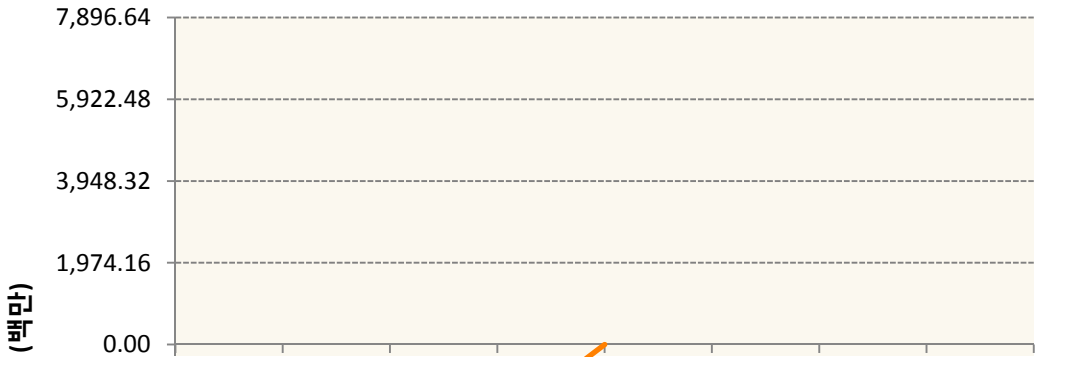


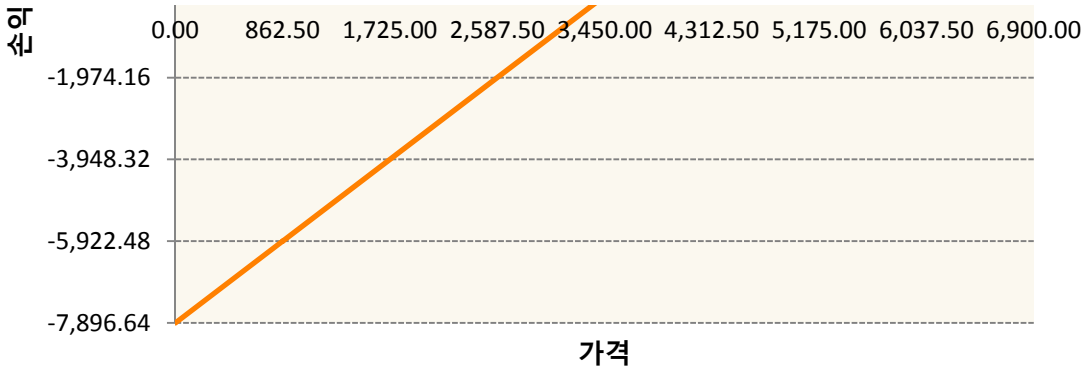


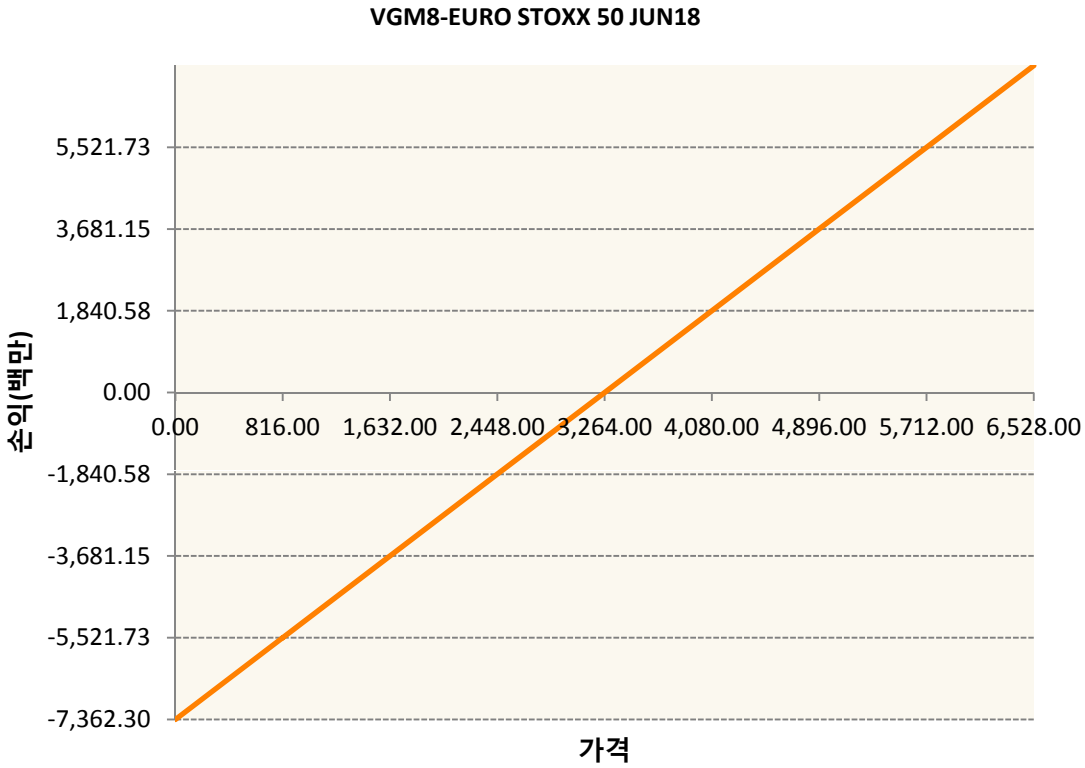
OESXJ8-P3425-EURO STOXX 50



OESXJ8-P3450-EURO STOXX 50







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
260105SGPX	SG EURO Covered CALL STRATEGY - 994.569	217
260105SQPX	SG EURO Covered CALL STRATEGY	406
OESXJ8-C34	EURO STOXX 50	641
OESXJ8-C34	EURO STOXX 50	632
OESXJ8-P34	EURO STOXX 50	641
OESXJ8-P34	EURO STOXX 50	632
VGM8	EURO STOXX 50 JUN18	589

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

2,357

공시일	2018-04-05
기준일	2018-04-04

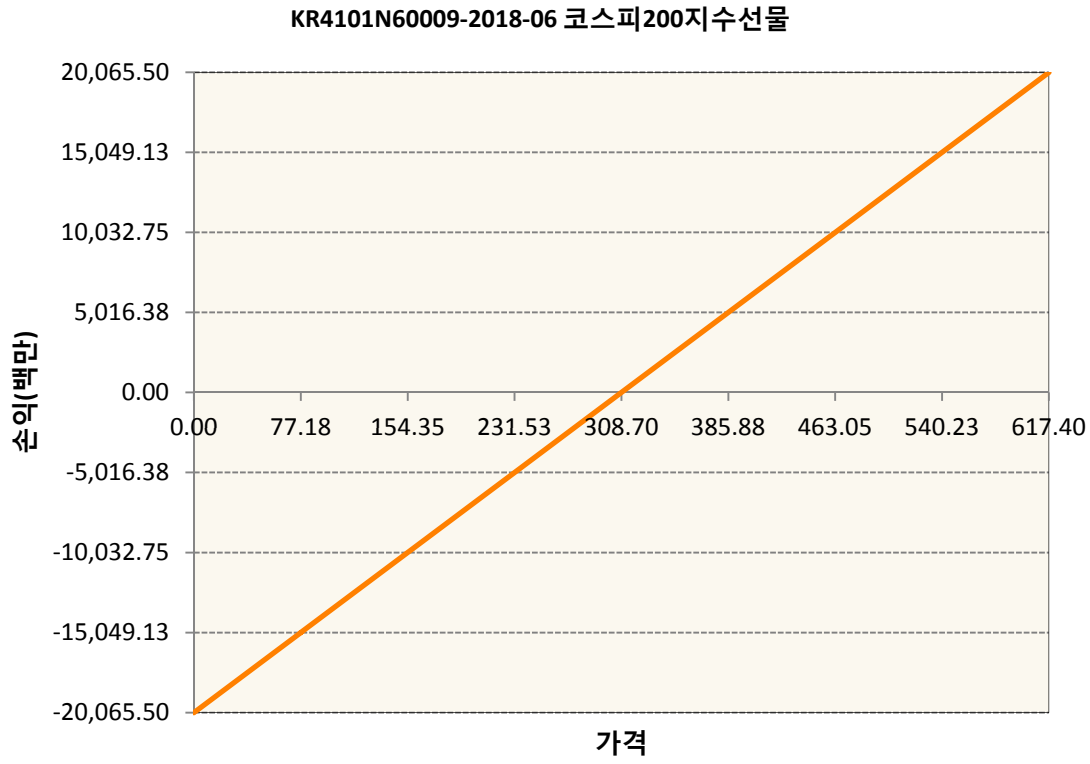
ETF스마트레버리지목표전환형8호

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	20,066	0	20,066	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101N60(2018-06 코스피200지수선물							1,604
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,604	-1,604	-1,604	-1,604	-1,604	-1,604	-1,604
-5.33%	-1,070	-1,070	-1,070	-1,070	-1,070	-1,070	-1,070
-2.67%	-535	-535	-535	-535	-535	-535	-535
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	535	535	535	535	535	535	535
5.33%	1,070	1,070	1,070	1,070	1,070	1,070	1,070
8.00%	1,604	1,604	1,604	1,604	1,604	1,604	1,604

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

1,163

공시일	2018-04-05
기준일	2018-04-04

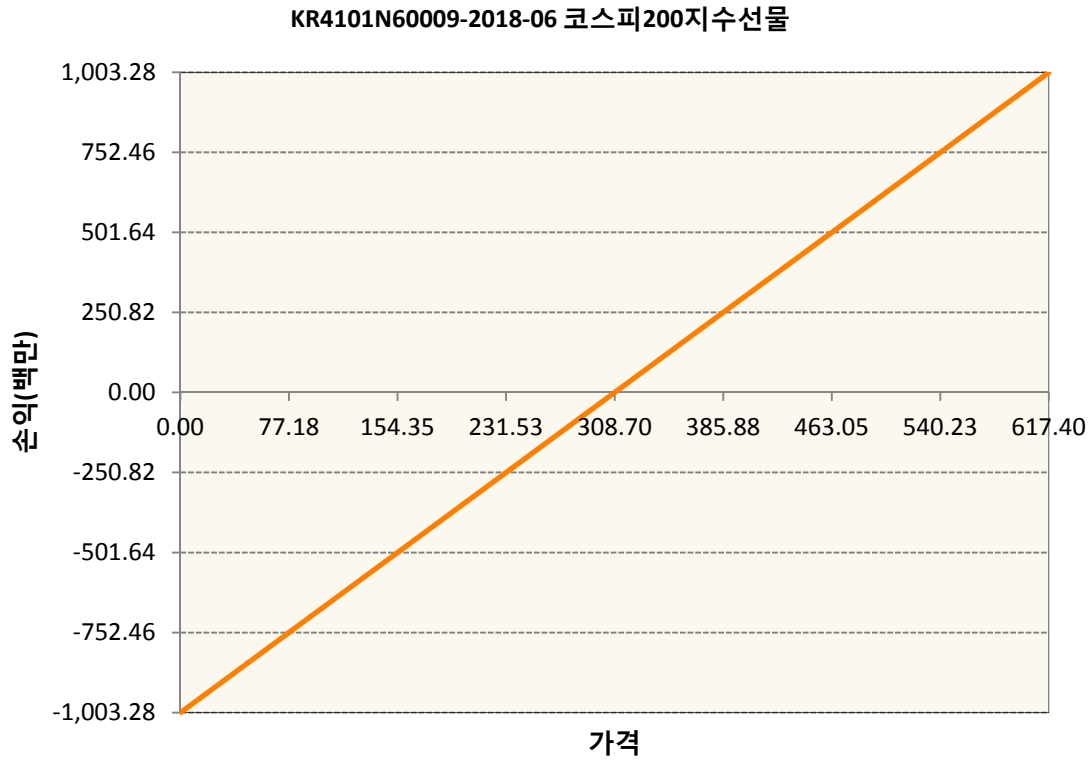
ETF스마트레버리지목표전환형9호

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	1,003	0	1,003	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101N60(2018-06 코스피200지수선물							80
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-80	-80	-80	-80	-80	-80	-80
-5.33%	-53	-53	-53	-53	-53	-53	-53
-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%	53	53	53	53	53	53	53
8.00%	80	80	80	80	80	80	80

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

58

공시일	2018-04-05
기준일	2018-04-04

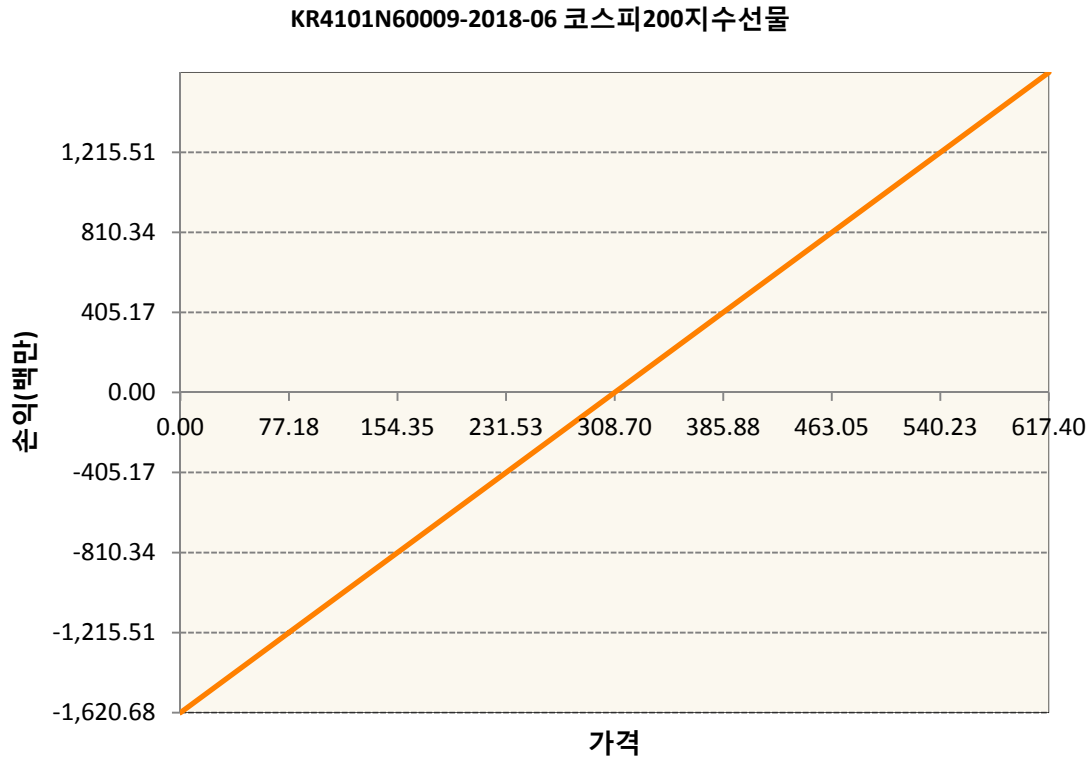
ETF스마트레버리지목표전환형10

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	1,621	0	1,621	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101N60(2018-06 코스피200지수선물							130
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-130	-130	-130	-130	-130	-130	-130
-5.33%	-86	-86	-86	-86	-86	-86	-86
-2.67%	-43	-43	-43	-43	-43	-43	-43
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	43	43	43	43	43	43	43
5.33%	86	86	86	86	86	86	86
8.00%	130	130	130	130	130	130	130

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

94

공시일	2018-04-05
기준일	2018-04-04

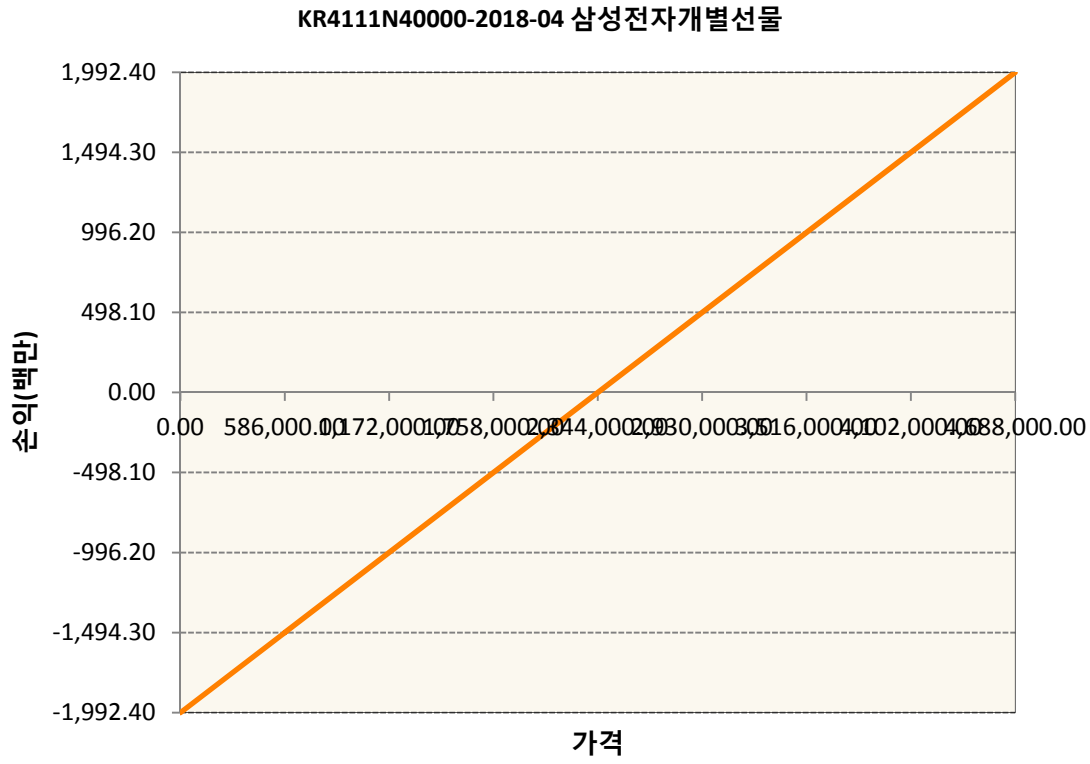
스마트KRX300인덱스1호(주식-파

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	1,992	0	1,992	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4111N40(2018-04 삼성전자개별선물							160
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-160	-160	-160	-160	-160	-160	-160
-5.33%	-106	-106	-106	-106	-106	-106	-106
-2.67%	-53	-53	-53	-53	-53	-53	-53
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	53	53	53	53	53	53	53
5.33%	106	106	106	106	106	106	106
8.00%	160	160	160	160	160	160	160

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

194

공시일	2018-04-05
기준일	2018-04-04

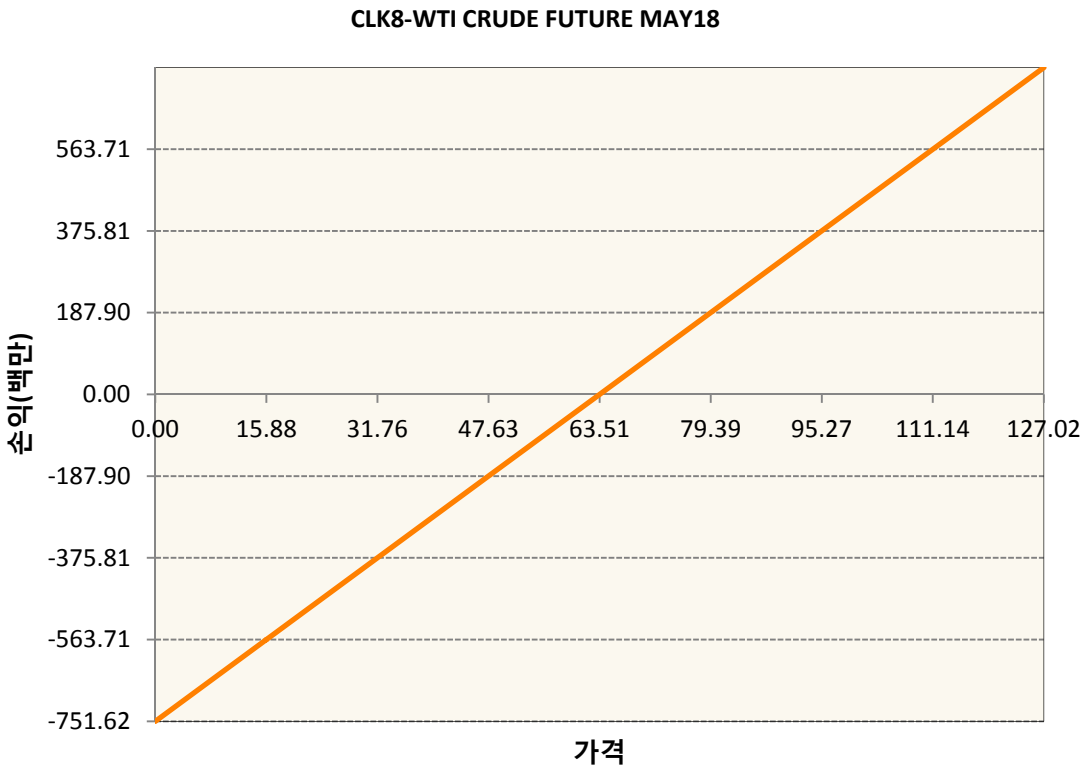
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

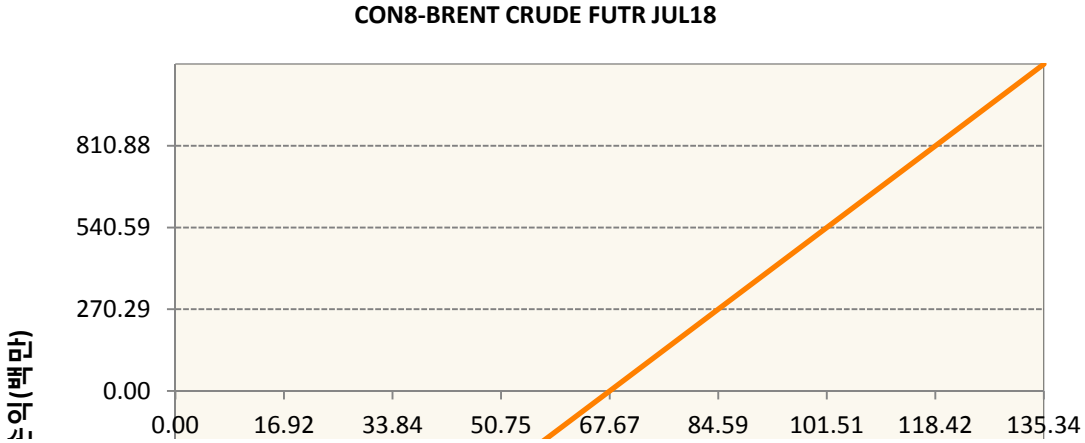
1. 계약금액

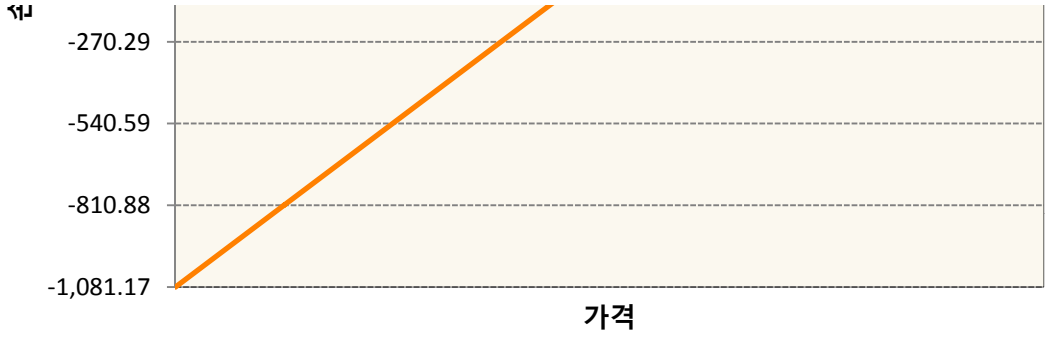
(단위:백만원)

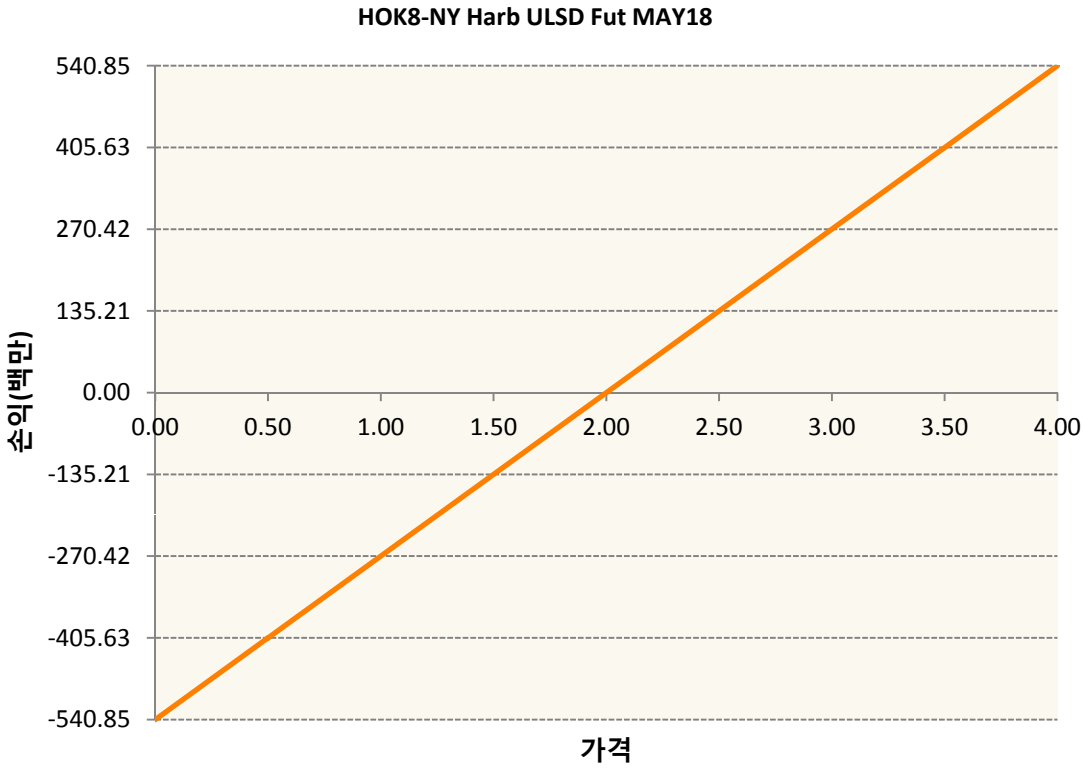
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	선물	유가증권	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	선물	유가증권	752	0	752	
누계	유가증권	선물	3,203	582	2,621	

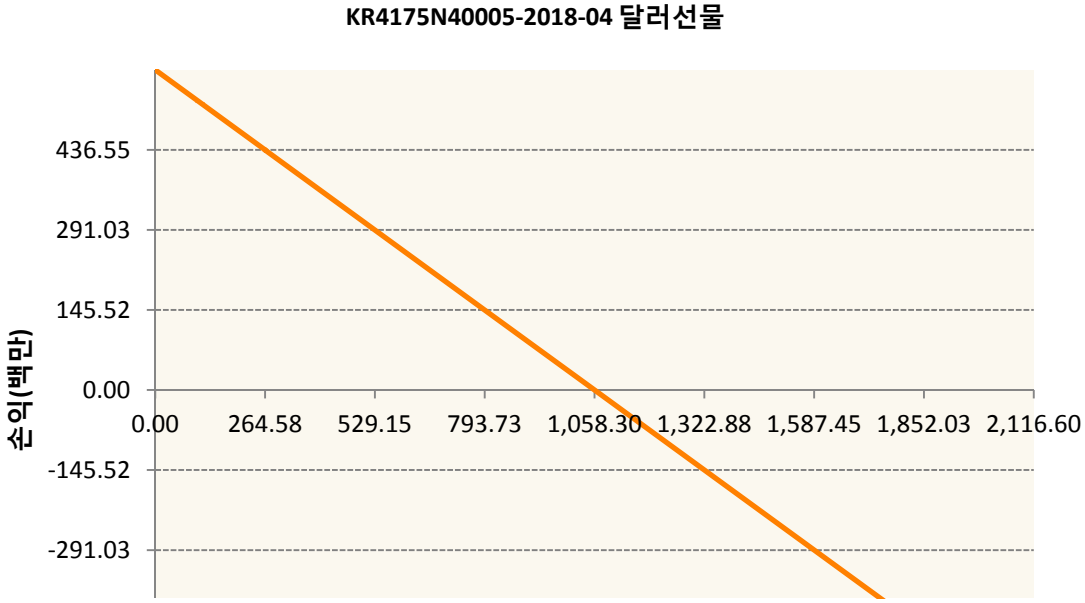
2. 만기시점의 손익구조

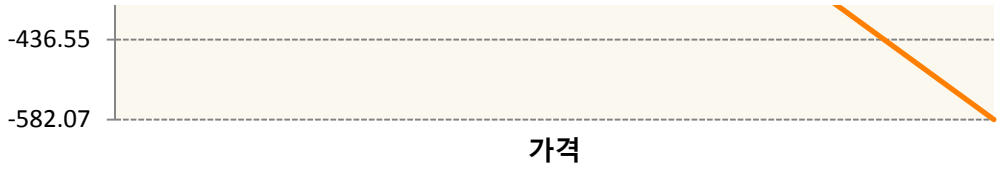


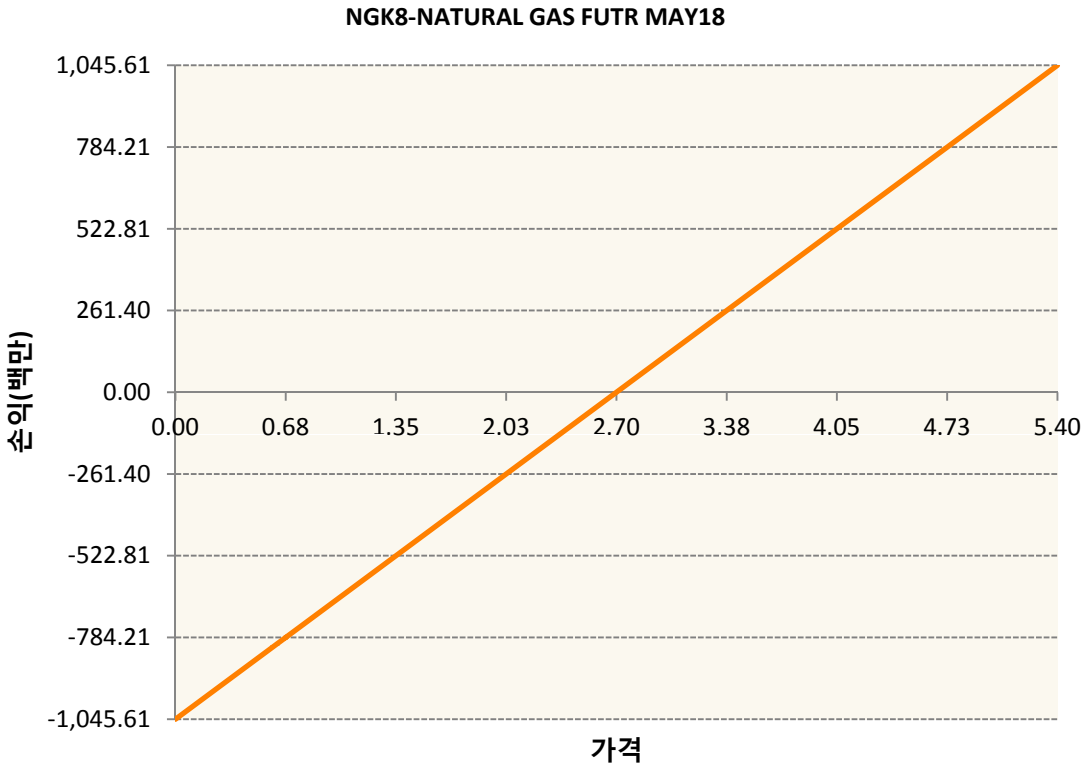


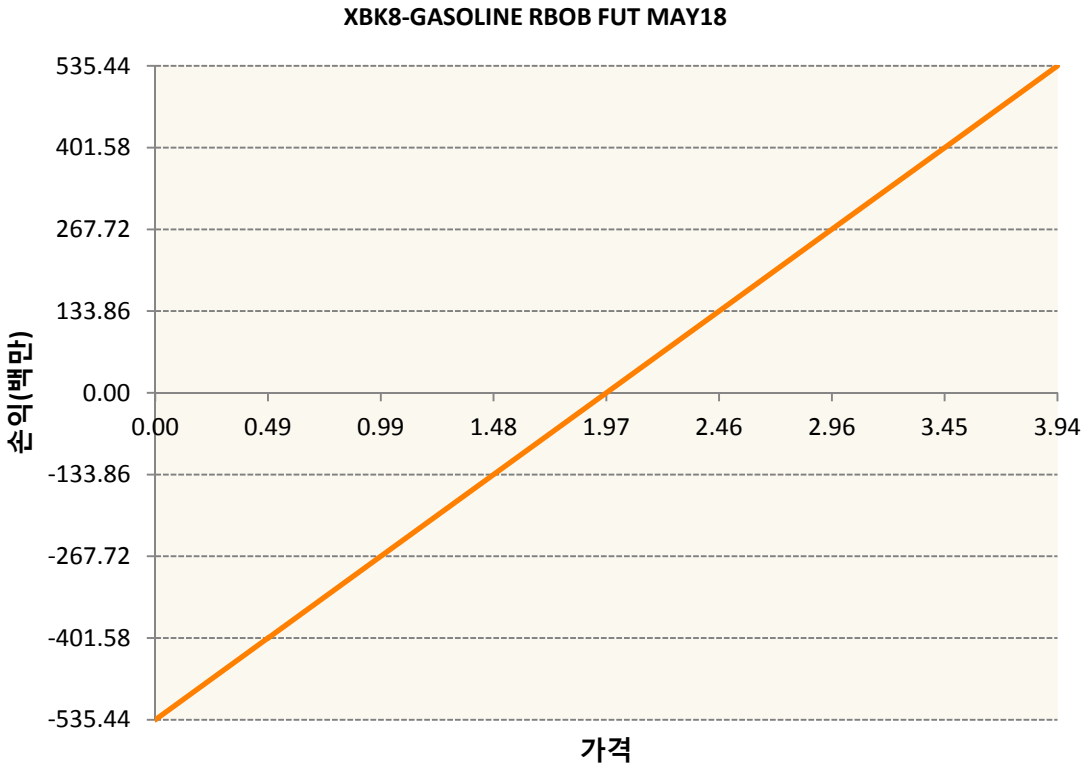

-270.29
-540.59
-810.88
-1,081.17
가격


HOK8-NY Harb ULSD Fut MAY18
540.85
405.63
270.42
135.21
0.00
-135.21
-270.42
-405.63
-540.85
0.00
0.50
1.00
1.50
2.00
2.50
3.00
3.50
4.00
손익(백만)
가격


KR4175N40005-2018-04 달러선물
436.55
291.03
145.52
0.00
-145.52
-291.03
0.00
264.58
529.15
793.73
1,058.30
1,322.88
1,587.45
1,852.03
2,116.60
손익(백만)


-436.55
-582.07
가격


NGK8-NATURAL GAS FUTR MAY18
1,045.61
784.21
522.81
261.40
0.00
-261.40
-522.81
-784.21
-1,045.61
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
535.44
401.58
267.72
133.86
0.00
-133.86
-267.72
-401.58
-535.44
0.00
0.49
0.99
1.48
1.97
2.46
2.96
3.45
3.94
손익(백만)
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	47
NGK8	NATURAL GAS FUTR MAY18	84
XBK8	GASOLINE RBOB FUT MAY18	43

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

512

공시일	2018-04-05
기준일	2018-04-04

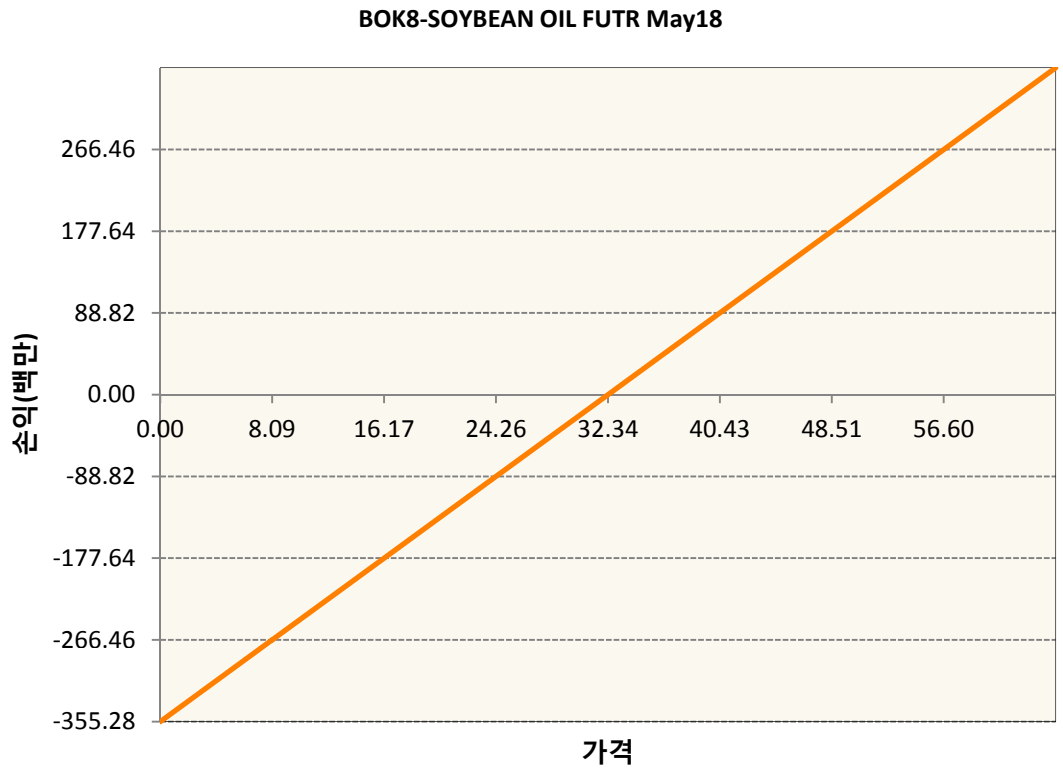
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

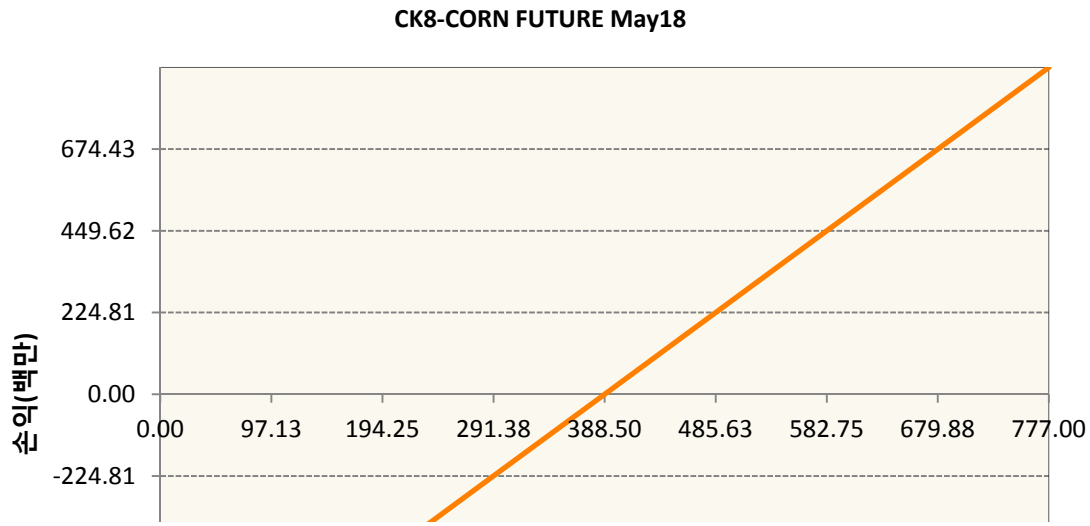
1. 계약금액

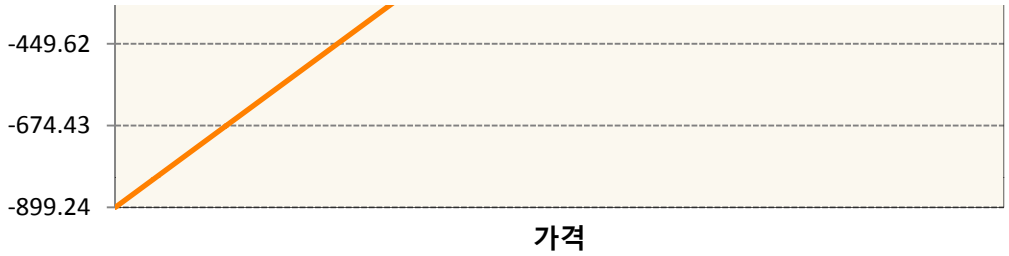
(단위:백만원)

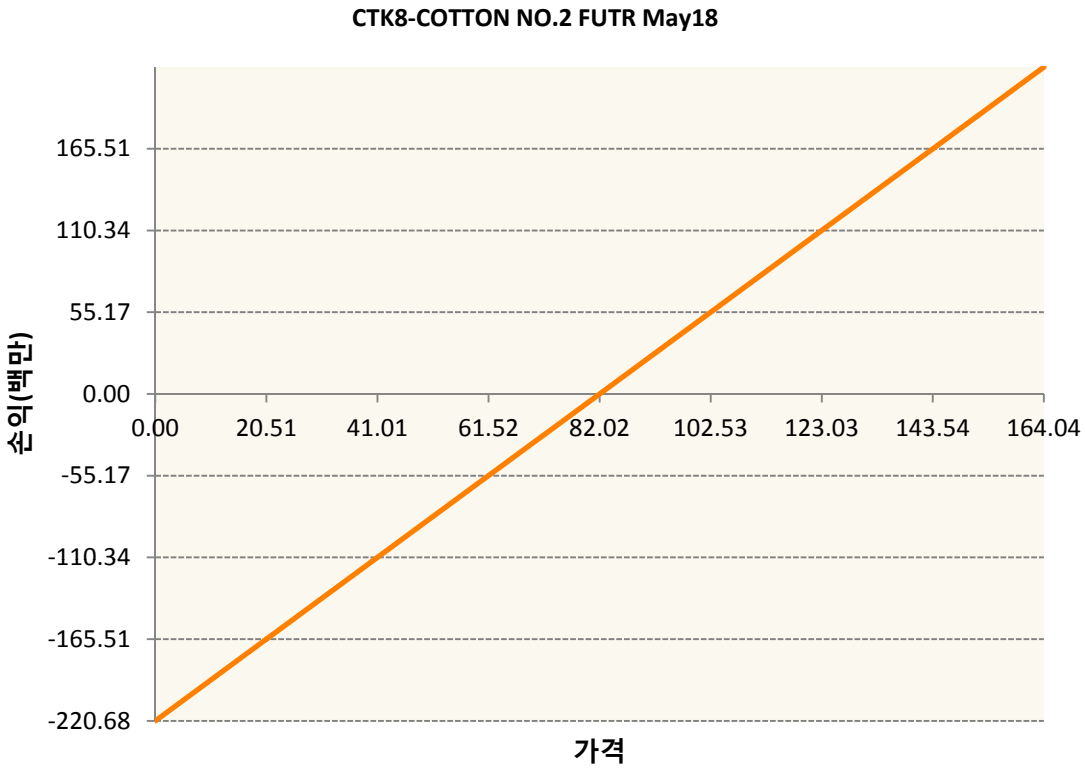
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	4,122	317	3,805	

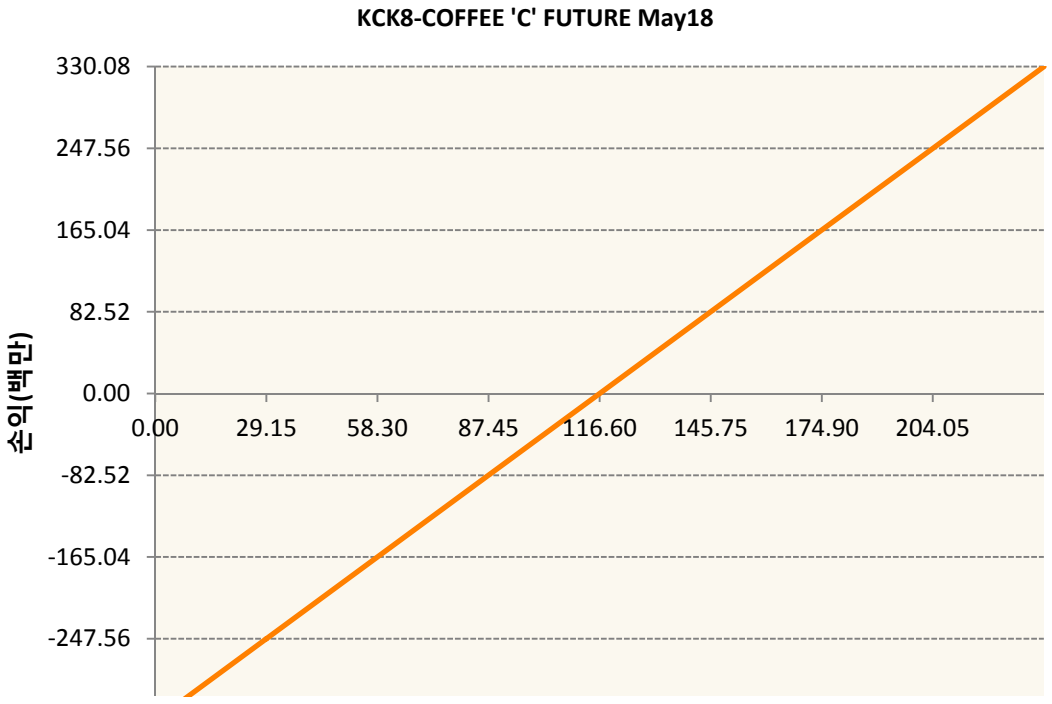
2. 만기시점의 손익구조

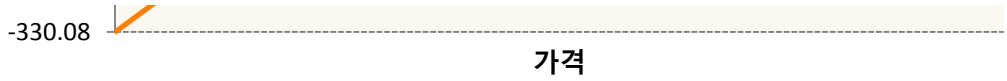


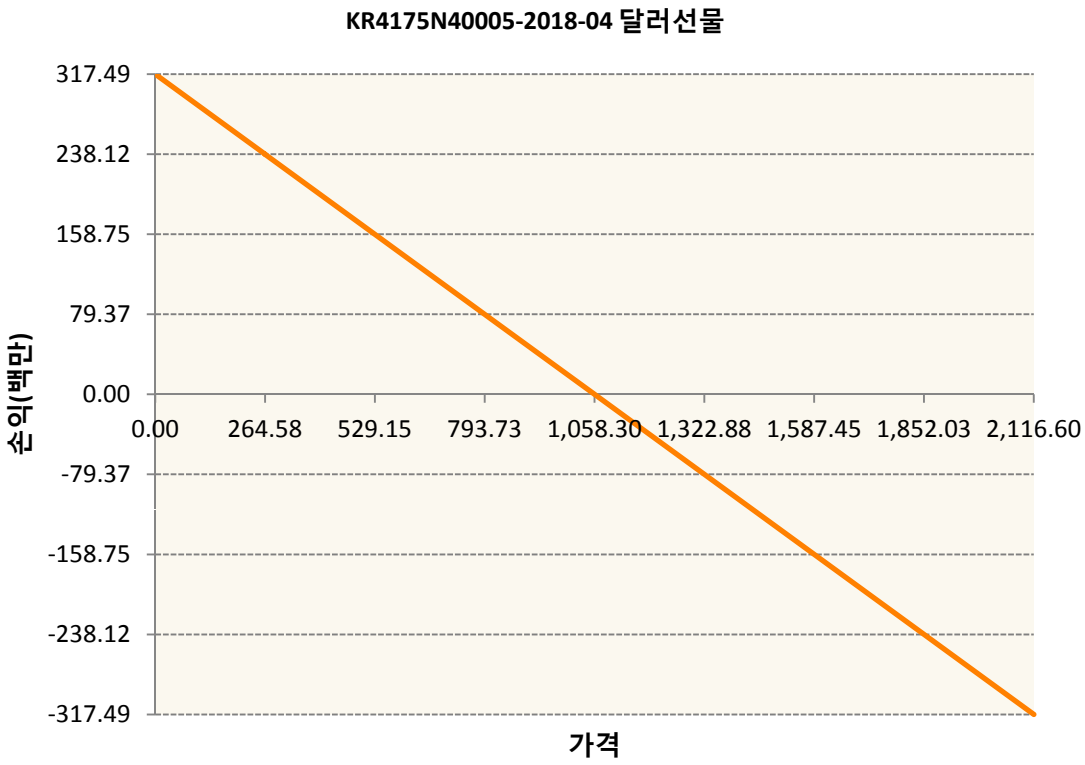


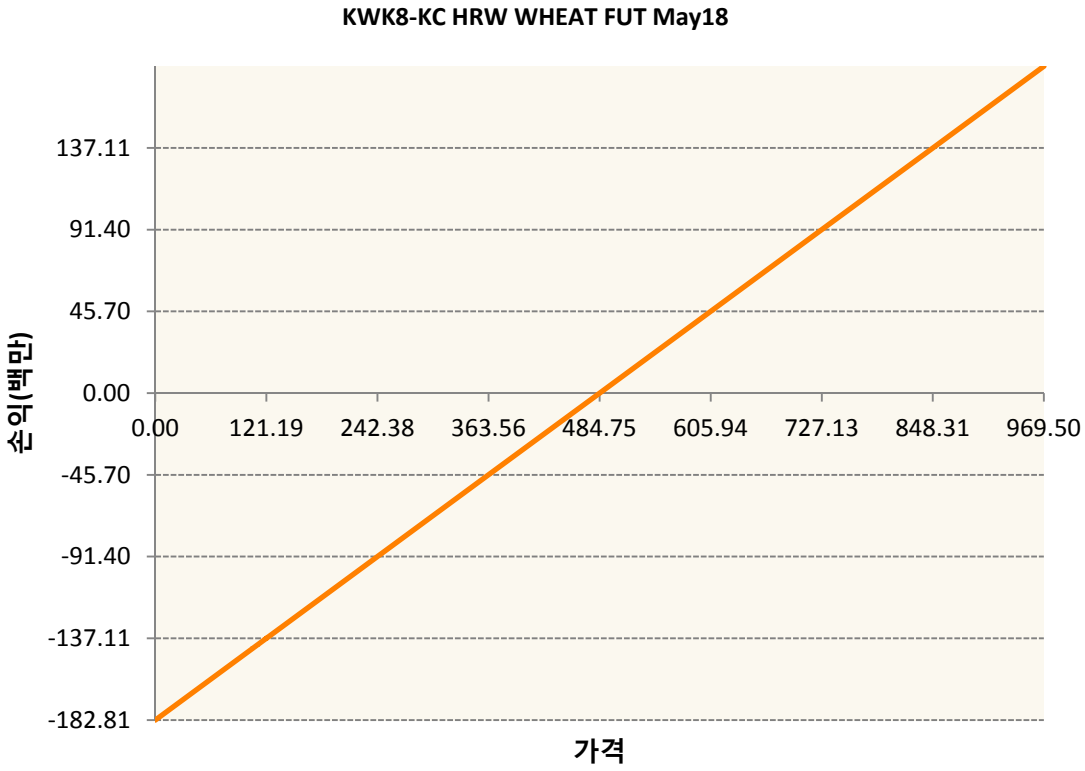

-449.62
-674.43
-899.24
가격

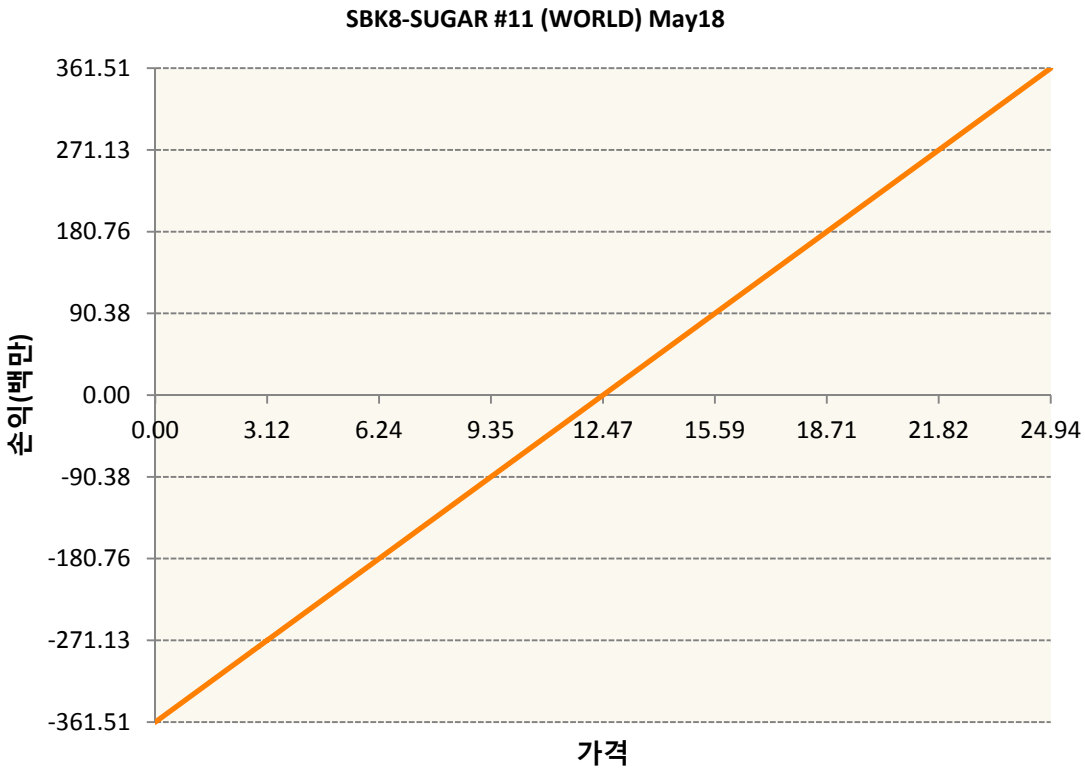

CTK8-COTTON NO.2 FUTR May18
165.51
110.34
55.17
0.00
-55.17
-110.34
-165.51
-220.68
0.00
20.51
41.01
61.52
82.02
102.53
123.03
143.54
164.04
손익(백만)
가격

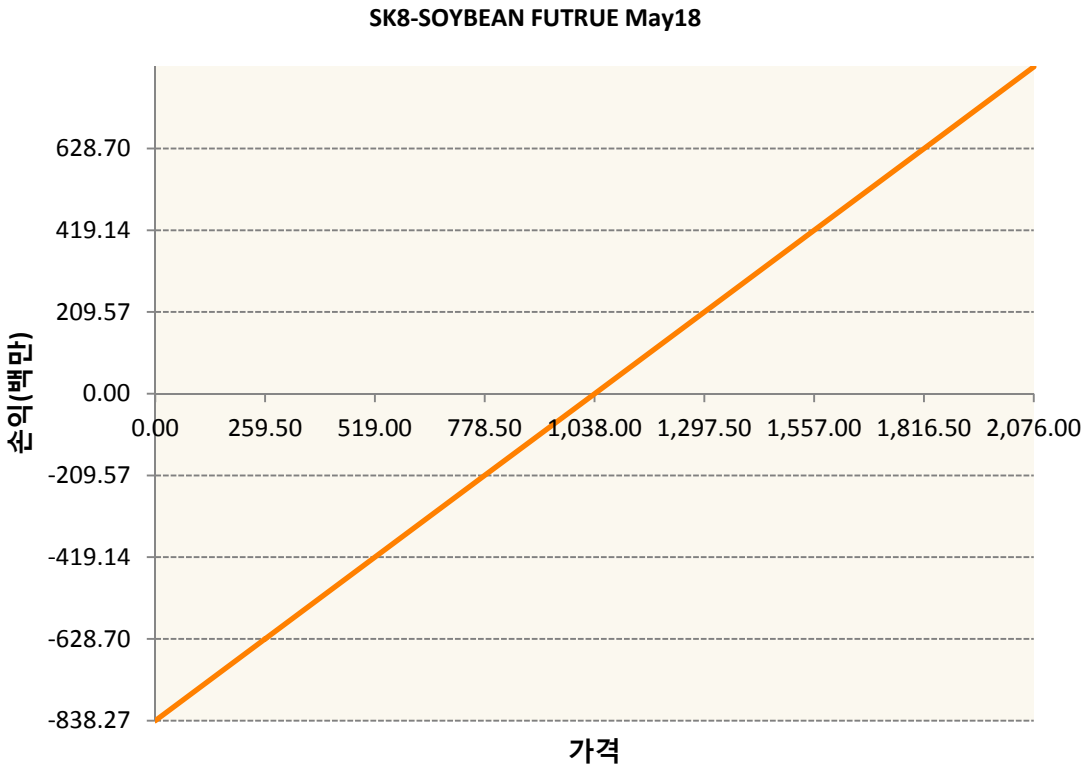

KCK8-COFFEE 'C' FUTURE May18
330.08
247.56
165.04
82.52
0.00
-82.52
-165.04
-247.56
0.00
29.15
58.30
87.45
116.60
145.75
174.90
204.05
손익(백만)


-330.08
가격

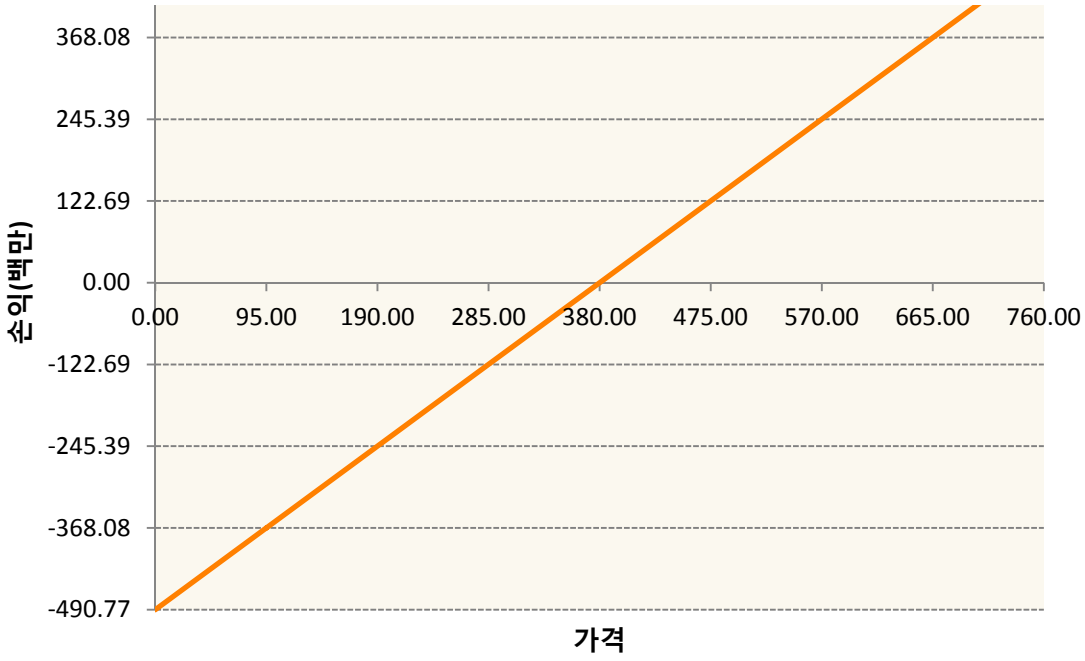

KR4175N40005-2018-04 달러선물
317.49
238.12
158.75
79.37
0.00
-79.37
-158.75
-238.12
-317.49
0.00
264.58
529.15
793.73
1,058.30
1,322.88
1,587.45
1,852.03
2,116.60
손익(백만)
가격


KWK8-KC HRW WHEAT FUT May18
137.11
91.40
45.70
0.00
-45.70
-91.40
-137.11
-182.81
0.00
121.19
242.38
363.56
484.75
605.94
727.13
848.31
969.50
손익(백만)
가격

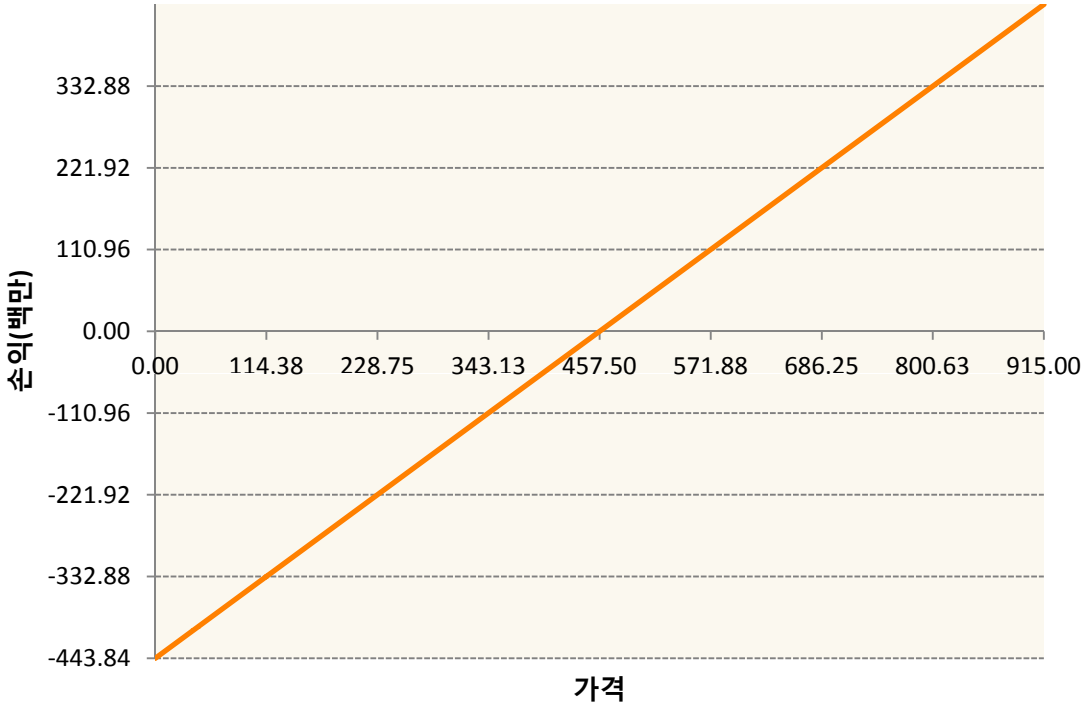

SBK8-SUGAR #11 (WORLD) May18
361.51
271.13
180.76
90.38
0.00
-90.38
-180.76
-271.13
-361.51
손익(백만)
0.00
3.12
6.24
9.35
12.47
15.59
18.71
21.82
24.94
가격


SK8-SOYBEAN FUTRUE May18
628.70
419.14
209.57
0.00
-209.57
-419.14
-628.70
-838.27
손익(백만)
0.00
259.50
519.00
778.50
1,038.00
1,297.50
1,557.00
1,816.50
2,076.00
가격


SMK8-SOYBEAN MEAL FUTR May18
490.77



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	26
KR4175N40(	2018-04 달러선물	25

KWK8	KC HRW WHEAT FUT May18	15
SBK8	SUGAR #11 (WORLD) May18	29
SK8	SOYBEAN FUTRUE May18	67
SMK8	SOYBEAN MEAL FUTR May18	39
WK8	WHEAT FUTURE(CBT) May18	36

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

333