공시일	2018-04-06
기준일	2018-04-05

포커스농산물모(채권-파생평)

1. 계약금액

(단위:USD 백만)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	8	0	8	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

공시일	2018-04-06
기준일	2018-04-05

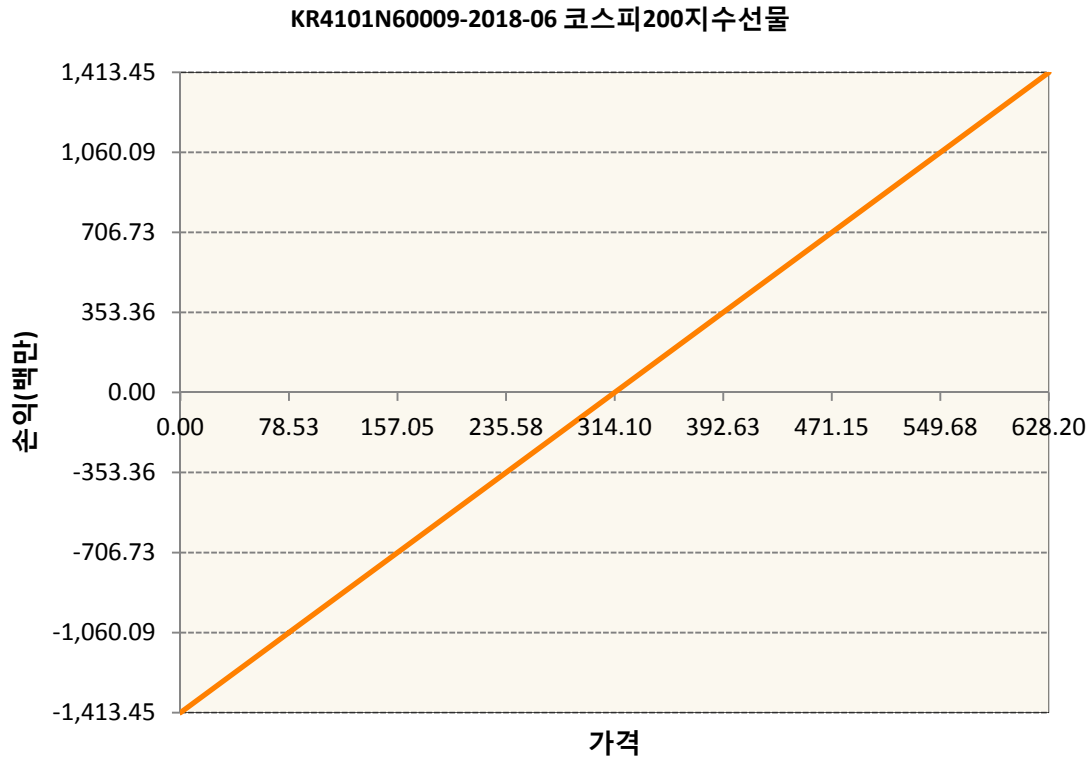
스마트인덱스모

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)

82

공시일	2018-04-06
기준일	2018-04-05

SMART합성-MSCI선진국증권상장지

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	13,869	0	13,869	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWMXWO0(신한MXWO 미래S180222	1,084

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

432

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2018-04-06
기준일	2018-04-05

SMART중국본토중소형CSI500상장

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	5,081	0	5,081	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI50000 신한CSI500미래S180308	404

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

437

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2018-04-06
기준일	2018-04-05

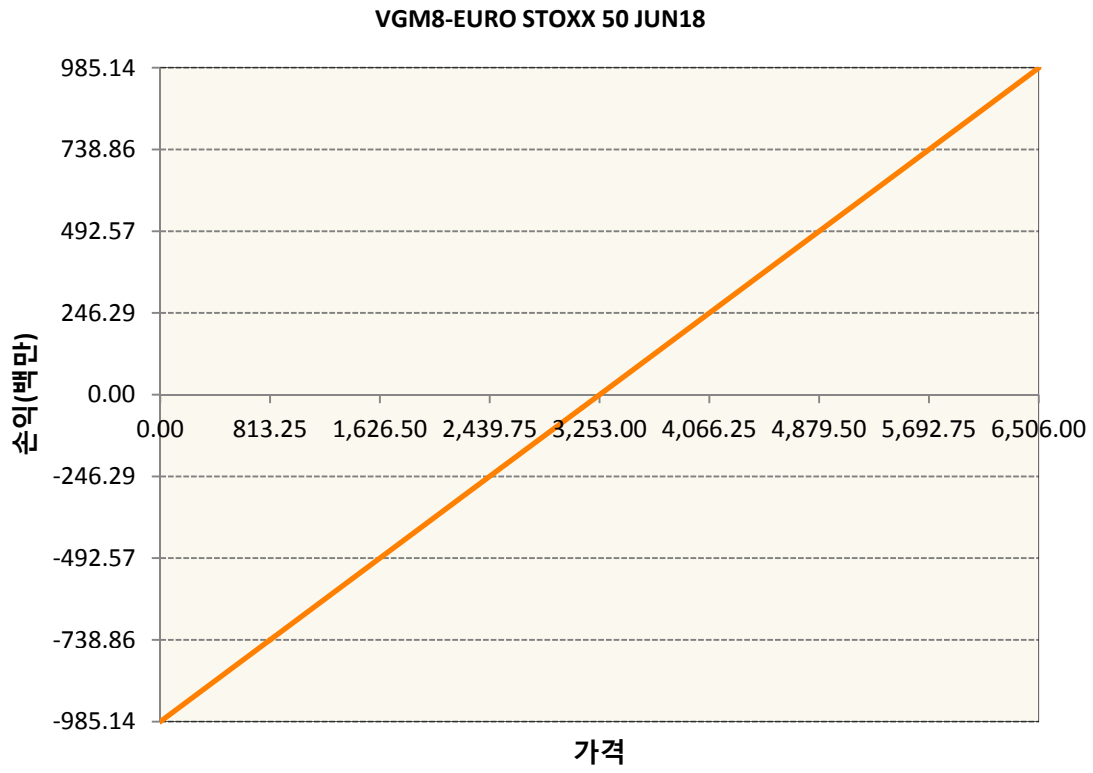
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	985	0	985	

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	2018-04-06
기준일	2018-04-05

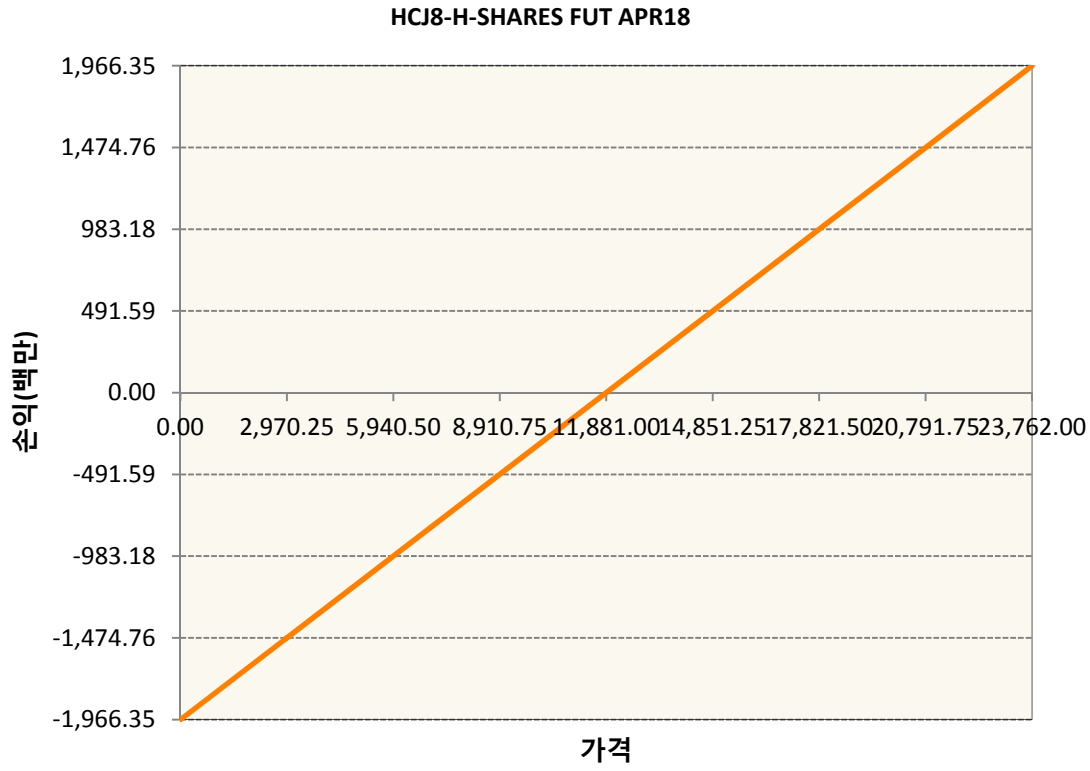
차이나인덱스모(주식-파생형)

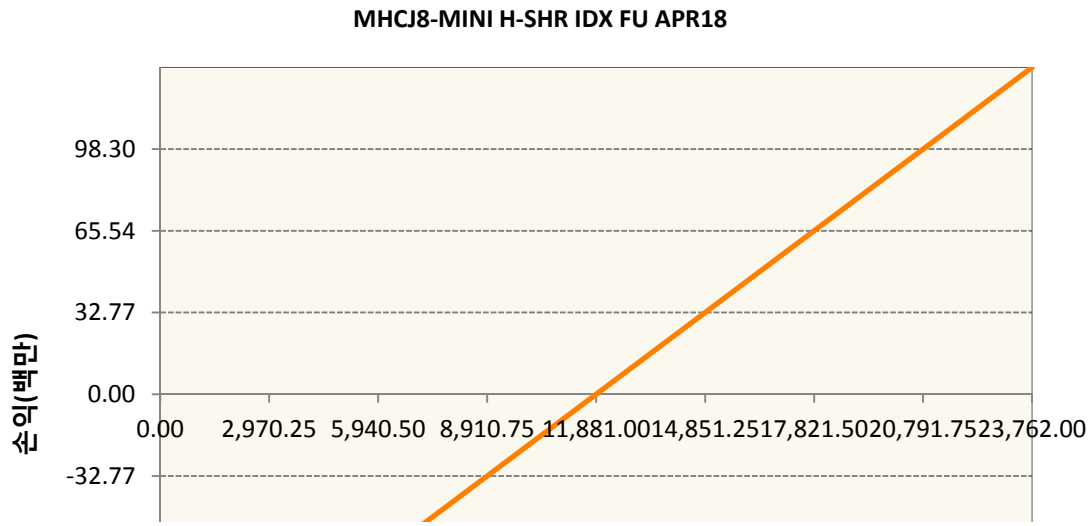
1. 계약금액

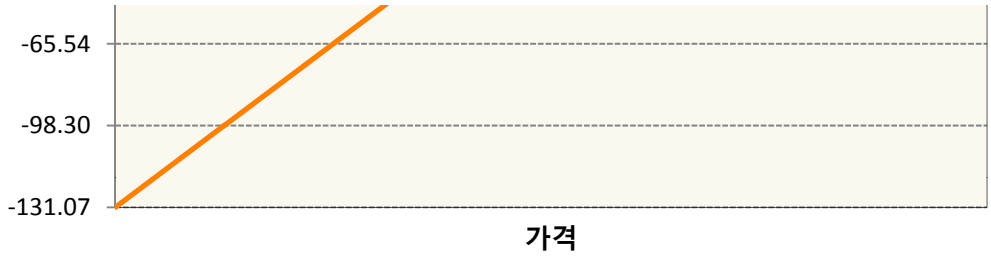
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,097	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)
	147

공시일	2018-04-06
기준일	2018-04-05

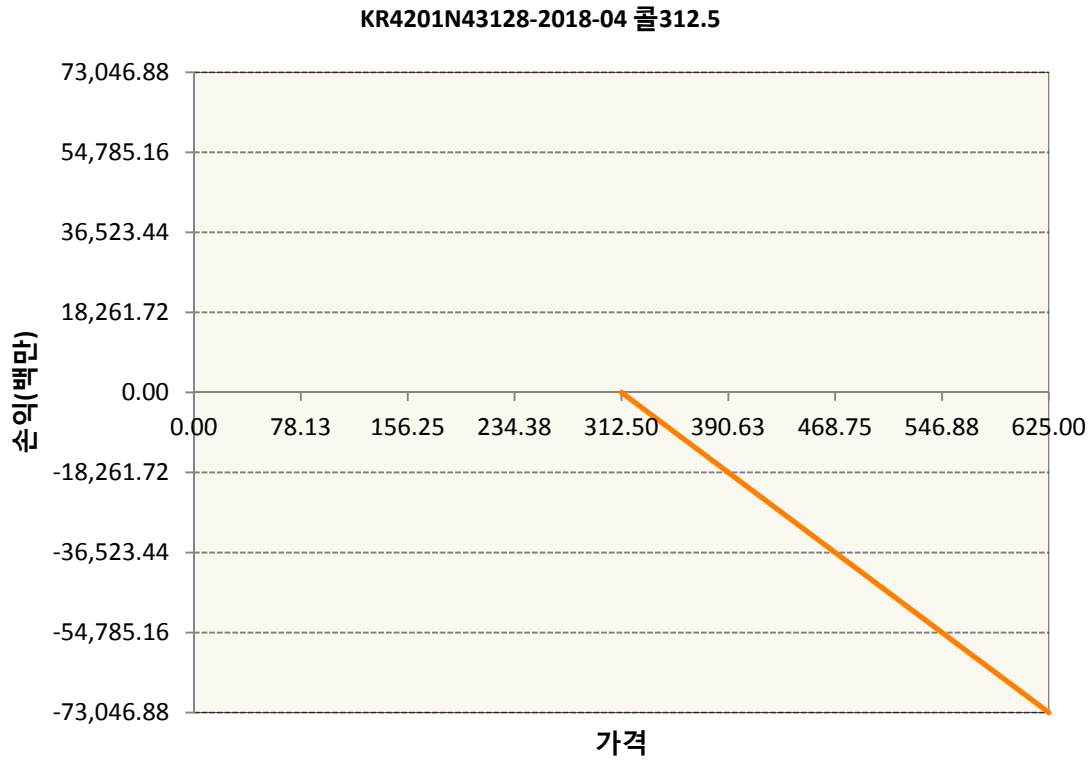
커버드콜모(주식혼합-파생형)

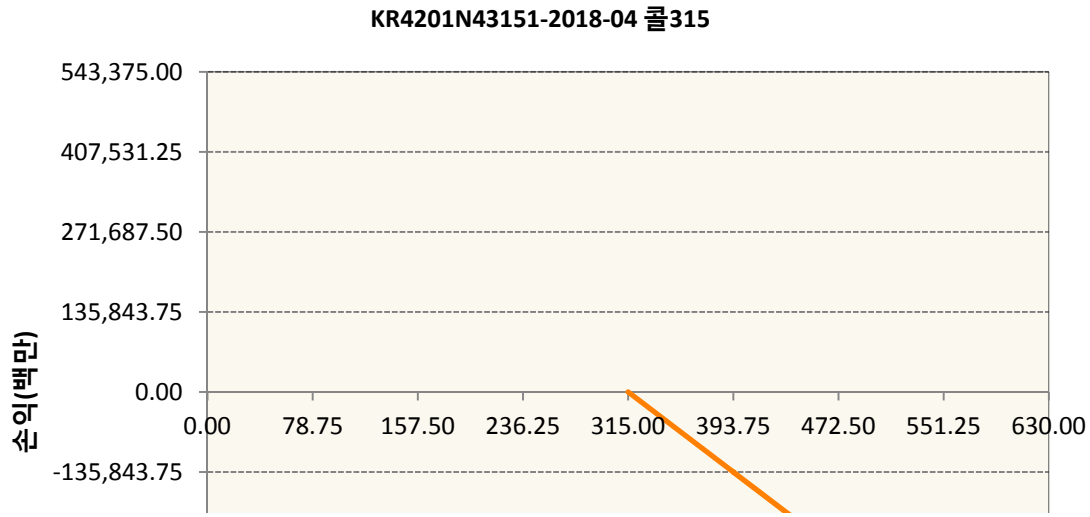
1. 계약금액

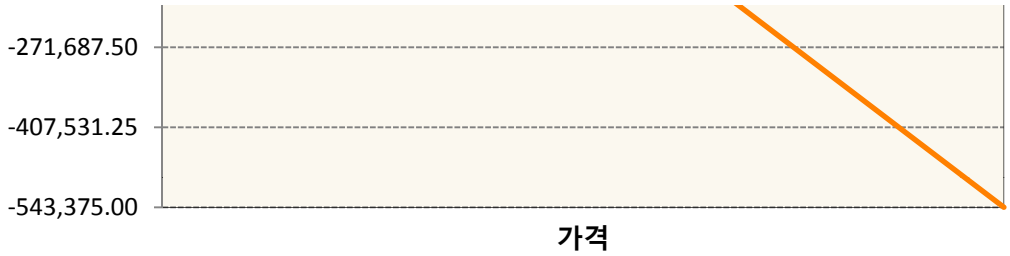
(단위:백만원)

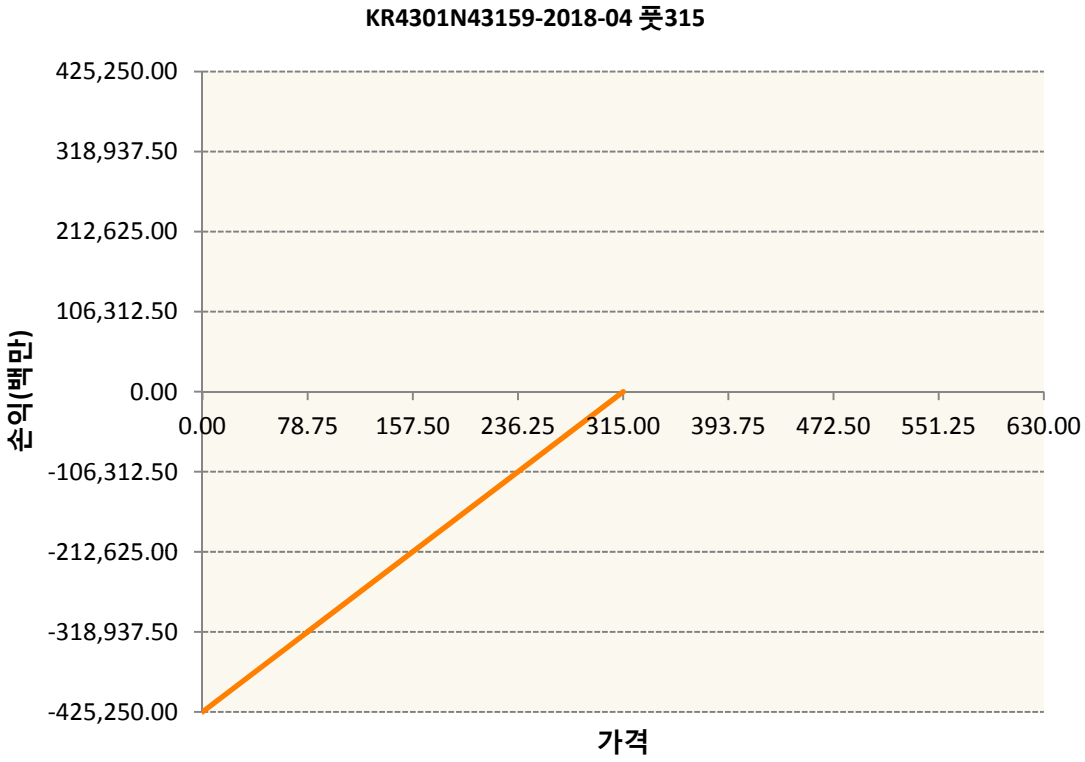
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	1,041,672	-1,041,672	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201N4312018-04 콜312.5							4,856
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,209	1,206	1,201	1,192	1,179	1,163	1,142
-5.33%	1,181	1,159	1,131	1,097	1,057	1,012	962
-2.67%	980	913	841	766	688	608	526
0%	286	191	95	0	-95	-191	-286
2.67%	-1,067	-1,132	-1,201	-1,274	-1,350	-1,429	-1,510
5.33%	-2,849	-2,871	-2,900	-2,935	-2,977	-3,023	-3,075
8.00%	-4,773	-4,777	-4,784	-4,795	-4,811	-4,831	-4,856
KR4201N4312018-04 콜315							33,840
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	6,907	6,896	6,873	6,833	6,771	6,684	6,570

-5.33%	6,803	6,702	6,560	6,375	6,149	5,884	5,583
-2.67%	5,890	5,496	5,060	4,587	4,086	3,560	3,015
0%	2,086	1,393	697	0	-699	-1,399	-2,100
2.67%	-6,503	-7,084	-7,687	-8,308	-8,943	-9,589	-10,243
5.33%	-18,945	-19,191	-19,489	-19,836	-20,224	-20,648	-21,104
8.00%	-32,960	-33,016	-33,104	-33,230	-33,395	-33,599	-33,840
KR4301N4312018-04 풋315							30,951
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-30,946	-30,946	-30,946	-30,947	-30,947	-30,948	-30,951
-5.33%	-19,681	-19,683	-19,688	-19,697	-19,713	-19,738	-19,772
-2.67%	-8,507	-8,577	-8,670	-8,785	-8,920	-9,074	-9,244
0%	963	645	324	0	-325	-652	-980
2.67%	4,979	4,786	4,572	4,342	4,097	3,840	3,573
5.33%	5,467	5,448	5,417	5,371	5,308	5,227	5,130
8.00%	5,480	5,479	5,478	5,475	5,469	5,458	5,441

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

80,436

공시일	2018-04-06
기준일	2018-04-05

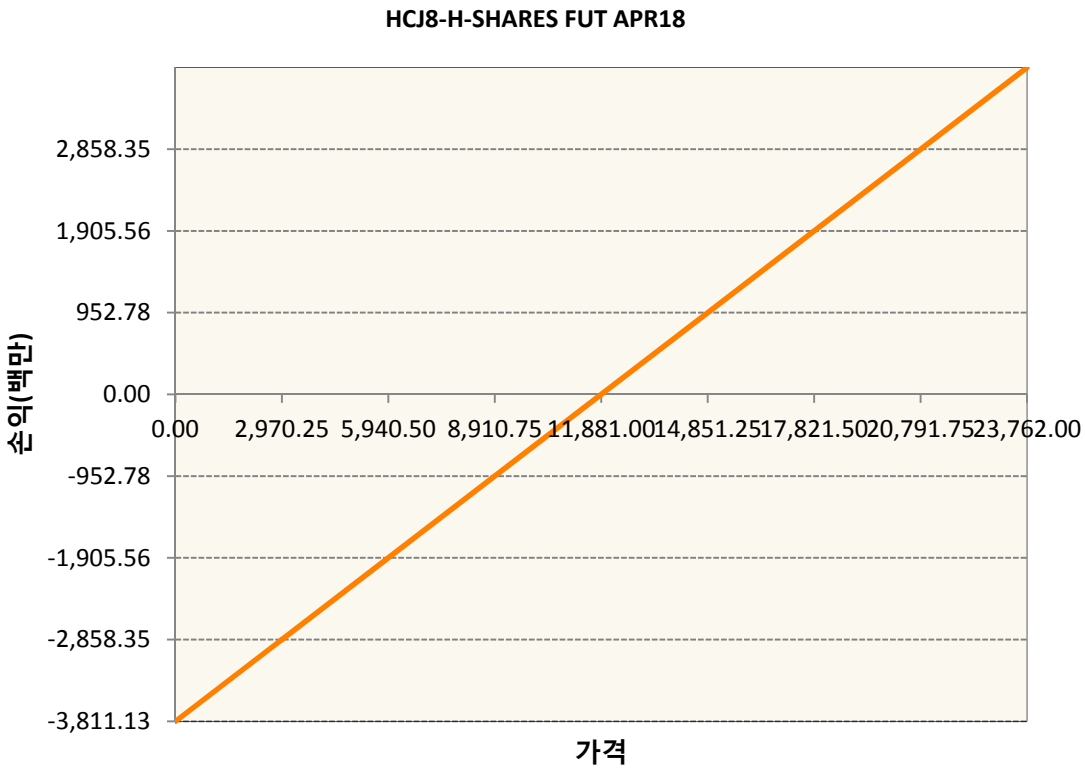
홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생

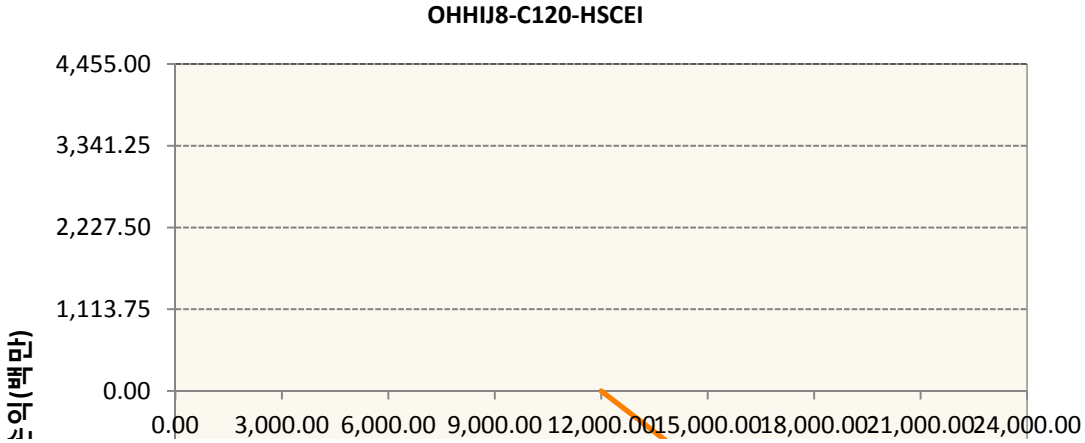
1. 계약금액

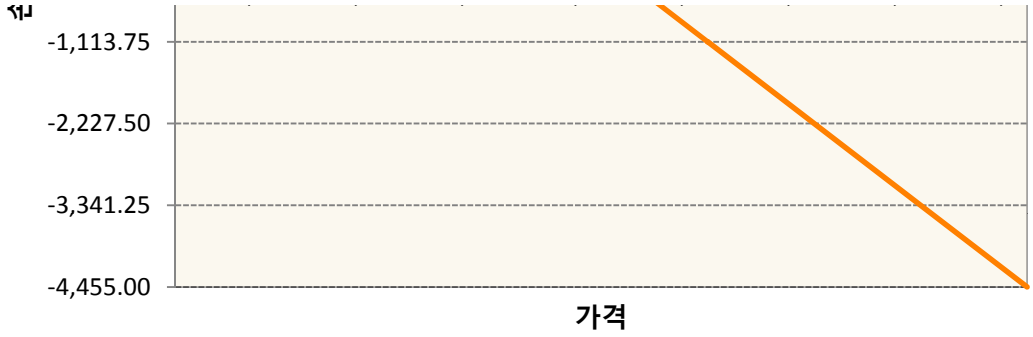
(단위:백만원)

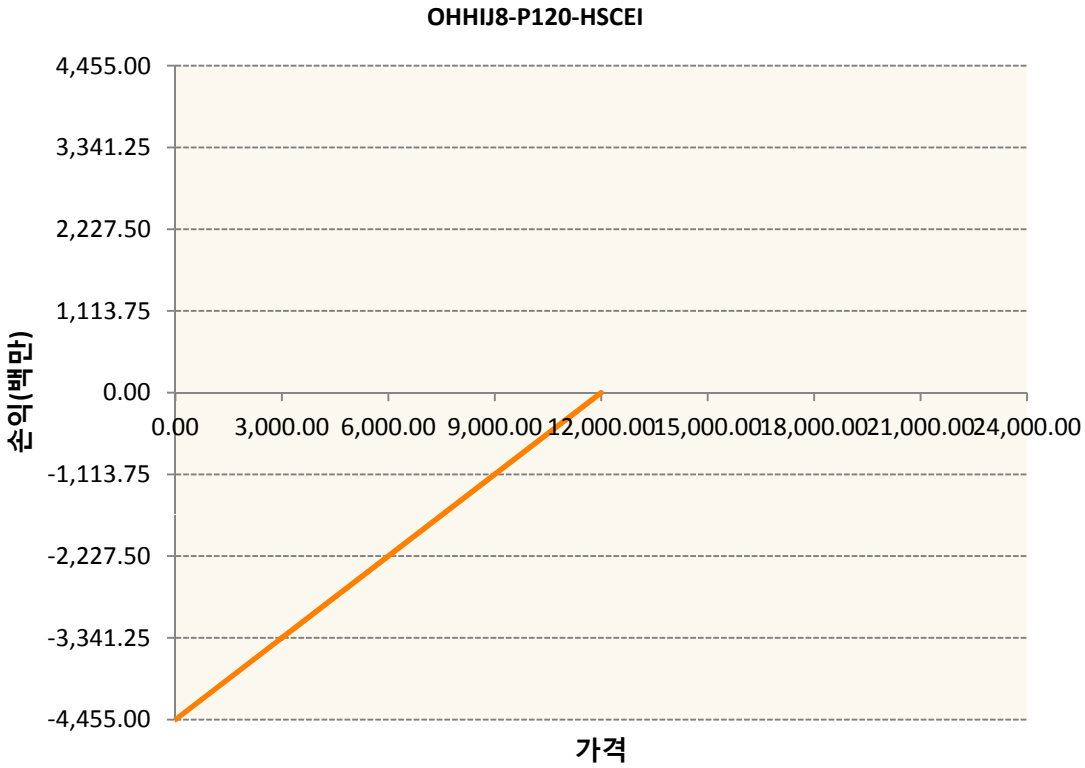
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	3,811	0	3,811	장내
누계	유가증권	옵션	0	8,910	-8,910	장내

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)
	892

공시일	2018-04-06
기준일	2018-04-05

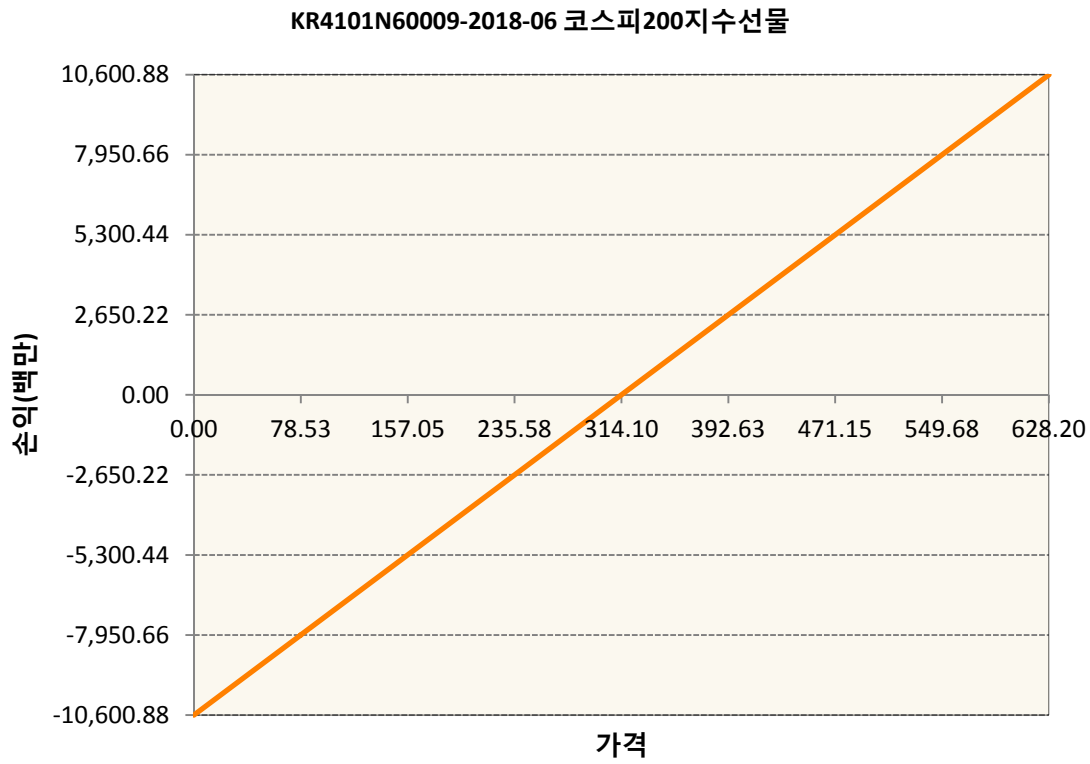
코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼

1. 계약금액

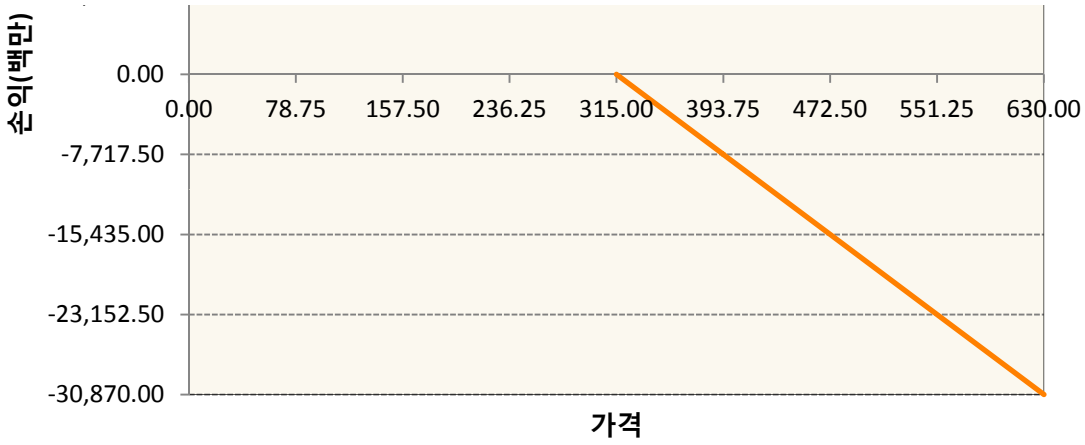
(단위:백만원)

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	10,601	0	10,601	장내
누계	유가증권	스왑	54,200	0	54,200	장외
누계	유가증권	옵션	0	55,718	-55,718	장내

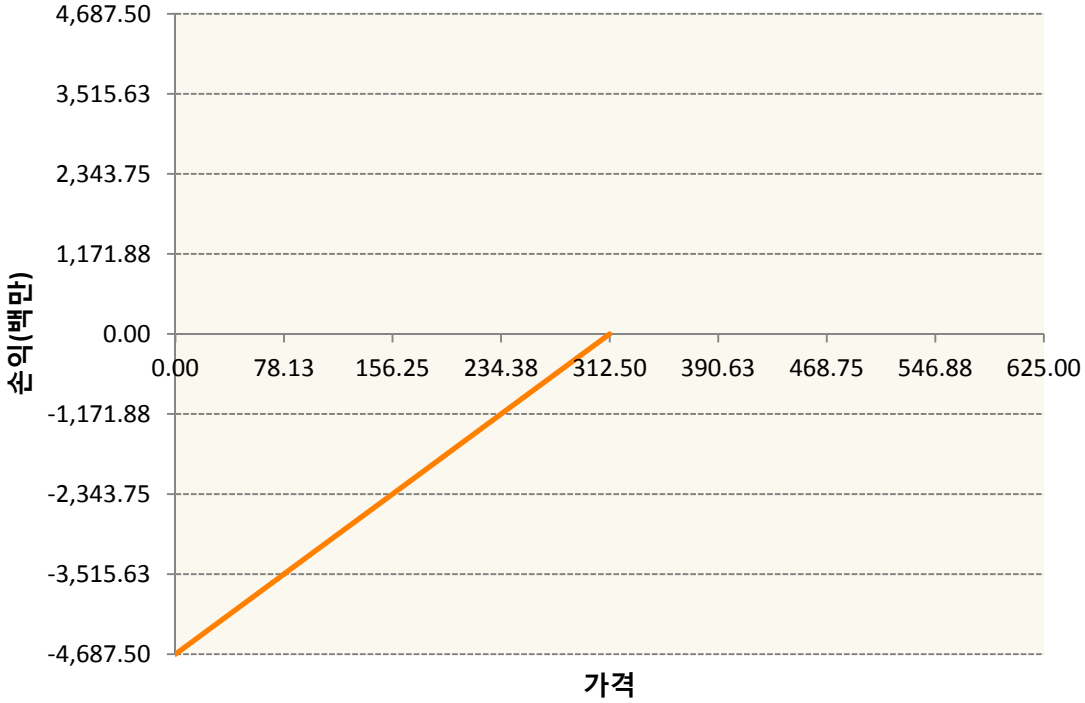
2. 만기시점의 손익구조



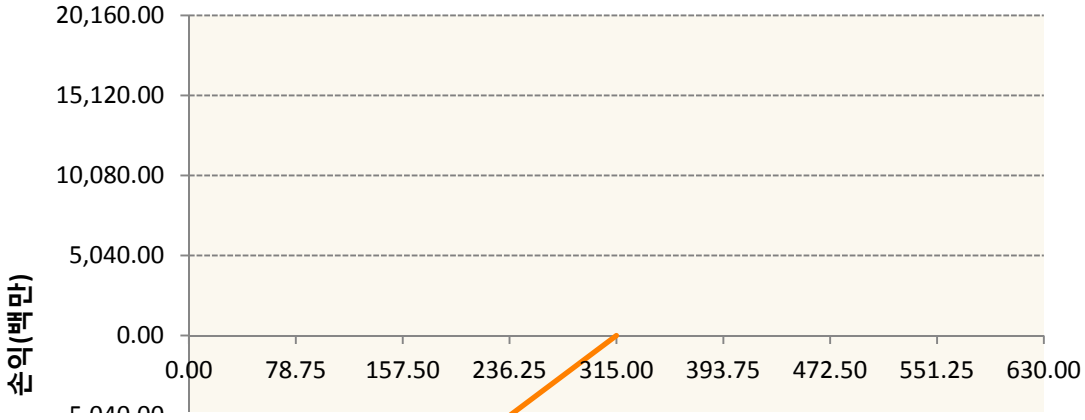




KR4301N43126-2018-04 풋312.5



KR4301N43159-2018-04 풋315





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_2							1,446
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,446	-1,446	-1,446	-1,446	-1,446	-1,446	-1,446
-5.33%	-964	-964	-964	-964	-964	-964	-964
-2.67%	-482	-482	-482	-482	-482	-482	-482
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	482	482	482	482	482	482	482
5.33%	964	964	964	964	964	964	964
8.00%	1,446	1,446	1,446	1,446	1,446	1,446	1,446
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%	-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%	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%	-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%	235	235	235	235	235	235	235
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						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%	-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%	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%	-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%	274	274	274	274	274	274	274
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_11						625
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-625	-625	-625	-625	-625	-625	-625
-5.33%	-417	-417	-417	-417	-417	-417	-417
-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%	417	417	417	417	417	417	417
8.00%	625	625	625	625	625	625	625
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_12						469
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-469	-469	-469	-469	-469	-469	-469
-5.33%	-313	-313	-313	-313	-313	-313	-313
-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%	313	313	313	313	313	313	313
8.00%	469	469	469	469	469	469	469
	KR4101N60(2018-06 코스피200지수선물						845
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-845	-845	-845	-845	-845	-845	-845
-5.33%	-563	-563	-563	-563	-563	-563	-563
-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%	563	563	563	563	563	563	563
8.00%	845	845	845	845	845	845	845
	KR4201N431 2018-04 콜315						1,923
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	392	392	390	388	385	380	373
-5.33%	386	381	373	362	349	334	317
-2.67%	335	312	287	261	232	202	171
0%	119	79	40	0	-40	-79	-119
2.67%	-369	-402	-437	-472	-508	-545	-582
5.33%	-1,076	-1,090	-1,107	-1,127	-1,149	-1,173	-1,199
8.00%	-1,873	-1,876	-1,881	-1,888	-1,897	-1,909	-1,923
	KR4301N431 2018-04 풋312.5						327
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-327	-327	-327	-327	-327	-327	-327
-5.33%	-202	-202	-202	-202	-202	-203	-204
-2.67%	-79	-81	-83	-85	-87	-89	-92
0%	11	7	4	0	-4	-7	-11
2.67%	38	37	36	34	32	30	27
5.33%	41	40	40	40	40	39	39
8.00%	41	41	41	41	41	40	40
	KR4301N431 2018-04 풋315						1,467

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,467	-1,467	-1,467	-1,467	-1,467	-1,467	-1,467
-5.33%	-933	-933	-933	-934	-935	-936	-937
-2.67%	-403	-407	-411	-416	-423	-430	-438
0%	46	31	15	0	-15	-31	-46
2.67%	236	227	217	206	194	182	169
5.33%	259	258	257	255	252	248	243
8.00%	260	260	260	260	259	259	258

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

9,149

공시일	2018-04-06
기준일	2018-04-05

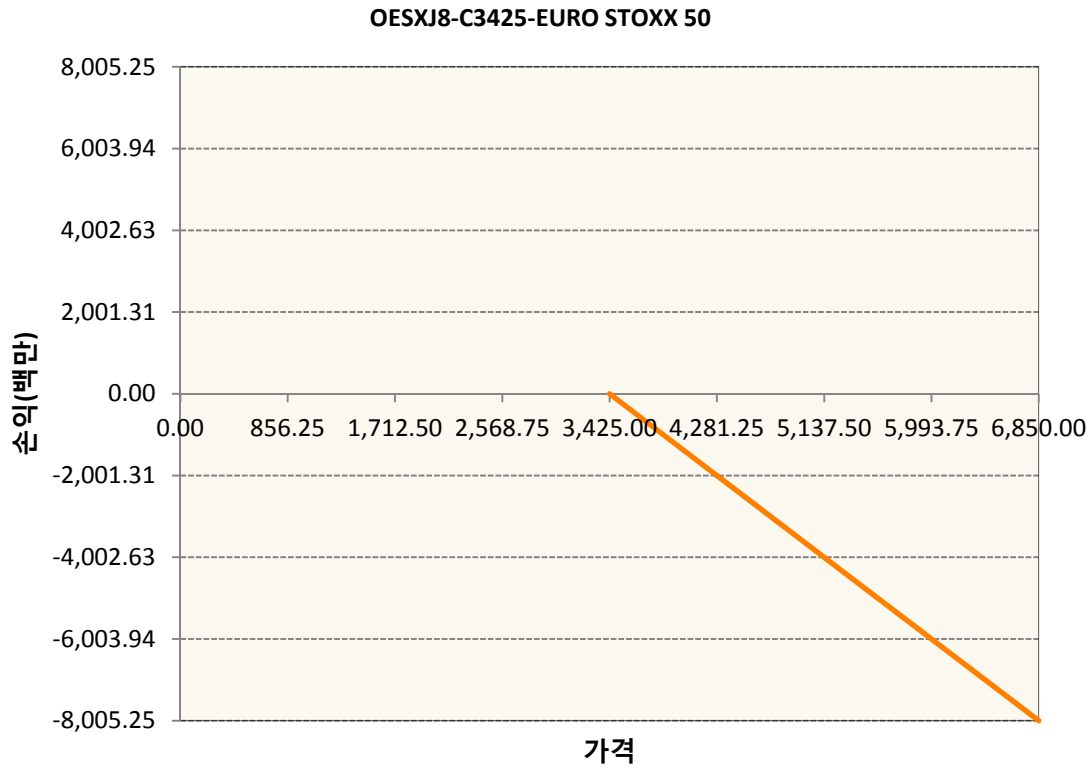
유로커버드콜모(주식혼합-파생형

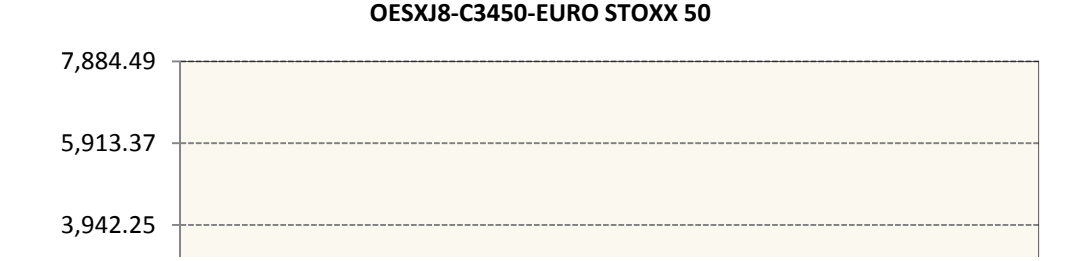
1. 계약금액

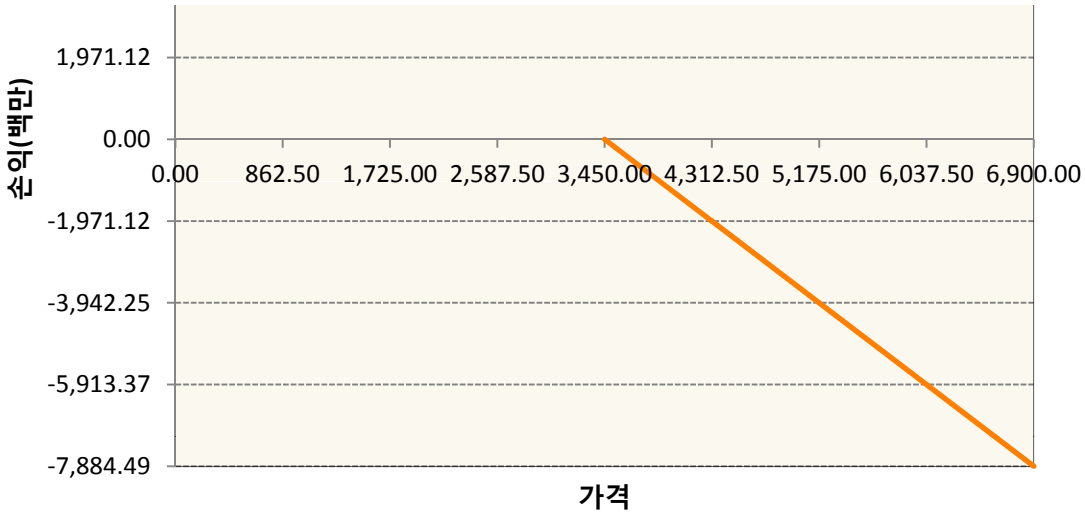
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	7,337	0	7,337	
누계	유가증권	스왑	97,384	0	97,384	장외
누계	유가증권	옵션	0	31,779	-31,779	장내
누계	지수	스왑	51,939	0	51,939	장외

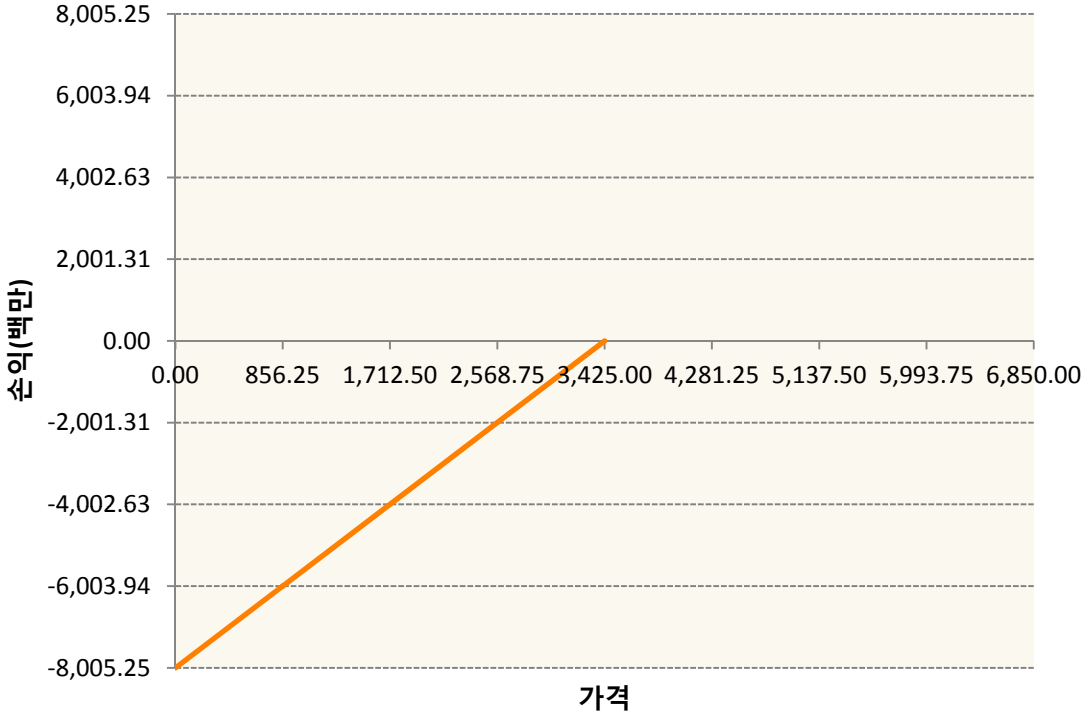
2. 만기시점의 손익구조



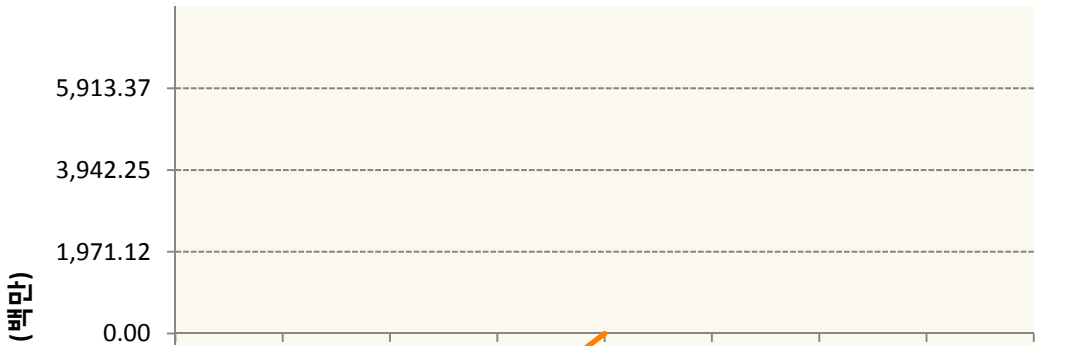


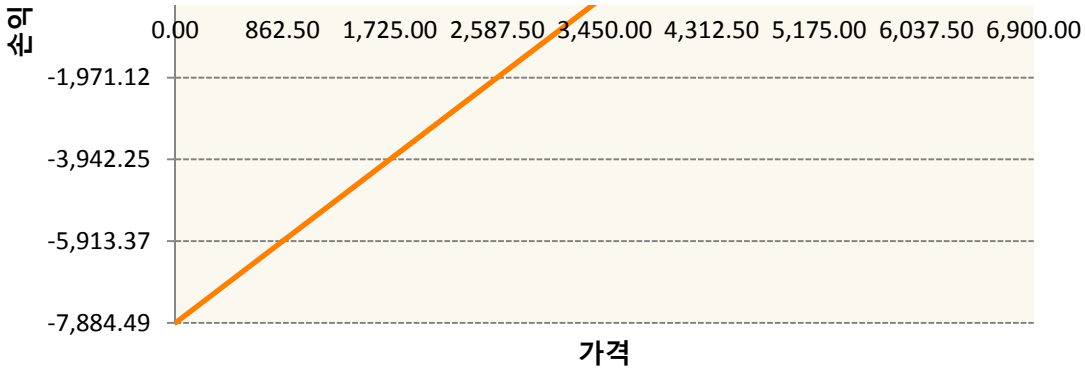


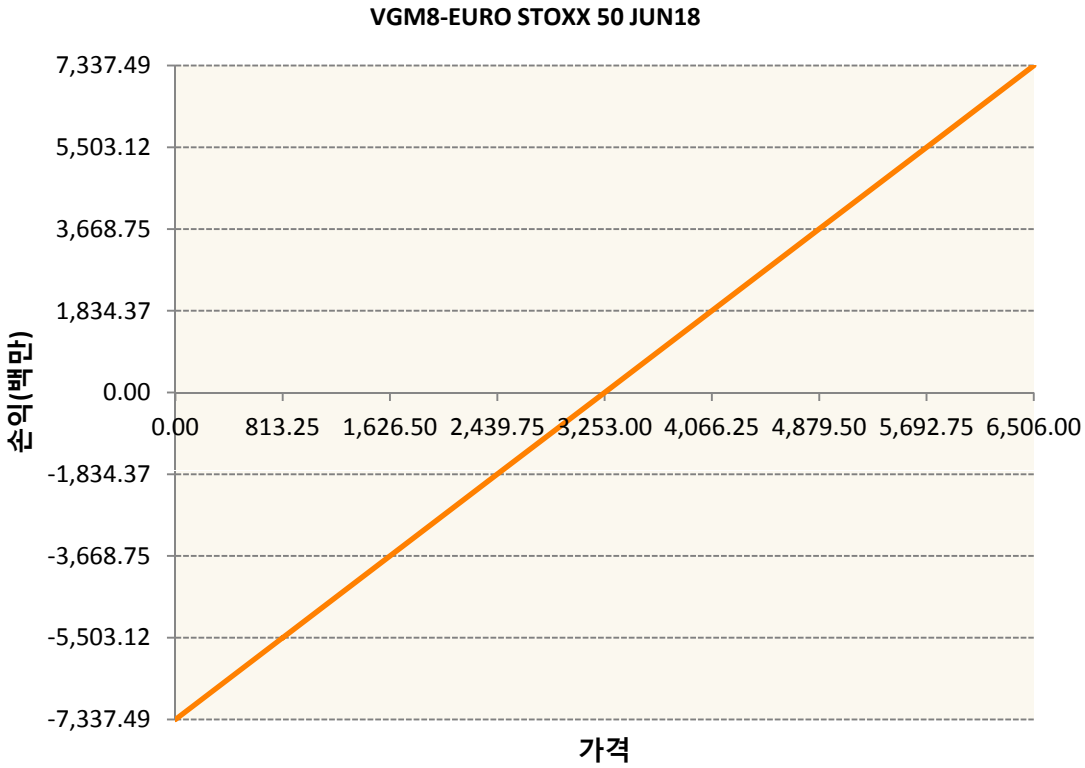
OESXJ8-P3425-EURO STOXX 50



OESXJ8-P3450-EURO STOXX 50







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)	(단위:백만원)
260105SGPX SG EURO Covered CALL STRATEGY - 994.569	216
260105SQPX SG EURO Covered CALL STRATEGY	406
OESXJ8-C34 EURO STOXX 50	640
OESXJ8-C34 EURO STOXX 50	631
OESXJ8-P34 EURO STOXX 50	640
OESXJ8-P34 EURO STOXX 50	631
VGM8 EURO STOXX 50 JUN18	587

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

2,350

공시일	2018-04-06
기준일	2018-04-05

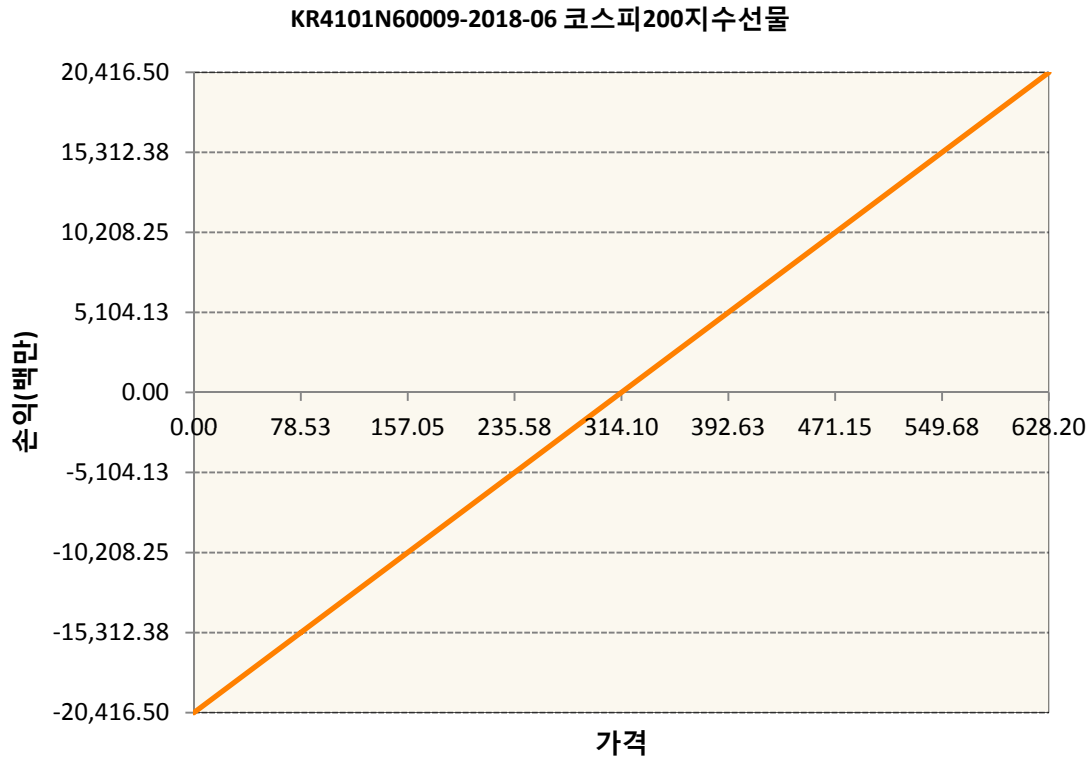
ETF스마트레버리지목표전환형8호

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	20,417	0	20,417	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101N60(2018-06 코스피200지수선물							1,628
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,628	-1,628	-1,628	-1,628	-1,628	-1,628	-1,628
-5.33%	-1,085	-1,085	-1,085	-1,085	-1,085	-1,085	-1,085
-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%	1,085	1,085	1,085	1,085	1,085	1,085	1,085
8.00%	1,628	1,628	1,628	1,628	1,628	1,628	1,628

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,188

공시일	2018-04-06
기준일	2018-04-05

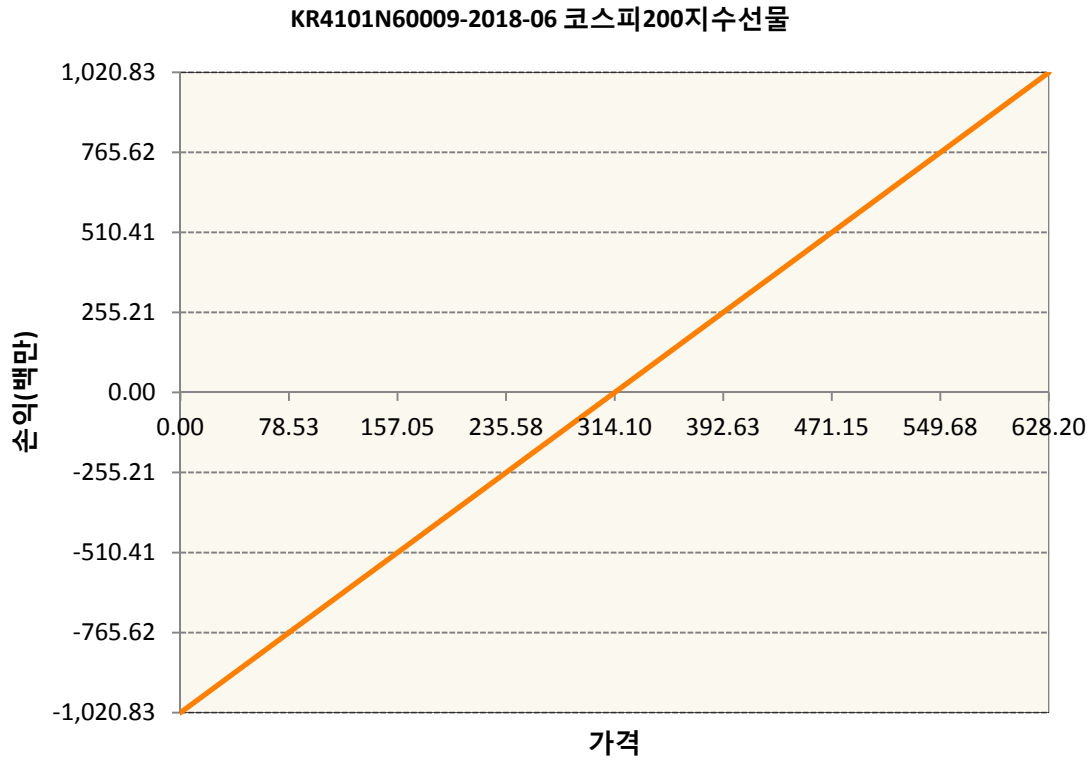
ETF스마트레버리지목표전환형9호

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	1,021	0	1,021	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	2018-04-06
기준일	2018-04-05

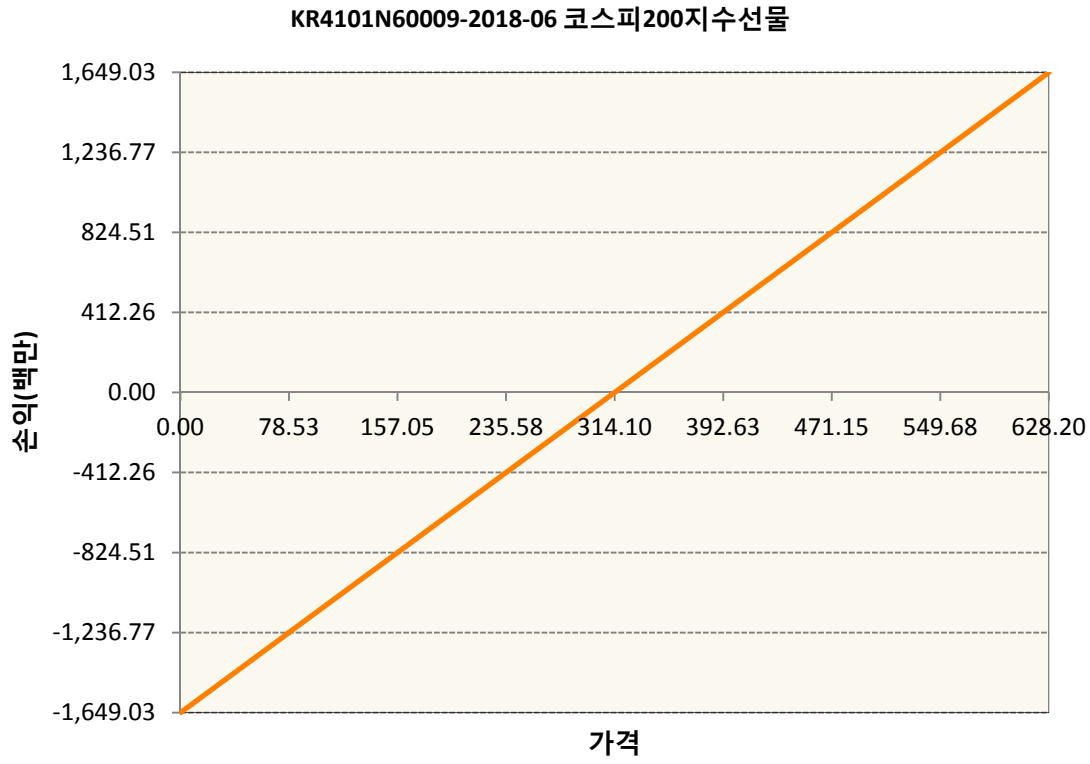
ETF스마트레버리지목표전환형10

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	1,649	0	1,649	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101N60(2018-06 코스피200지수선물							131
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-131	-131	-131	-131	-131	-131	-131
-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%	131	131	131	131	131	131	131

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

96

공시일	2018-04-06
기준일	2018-04-05

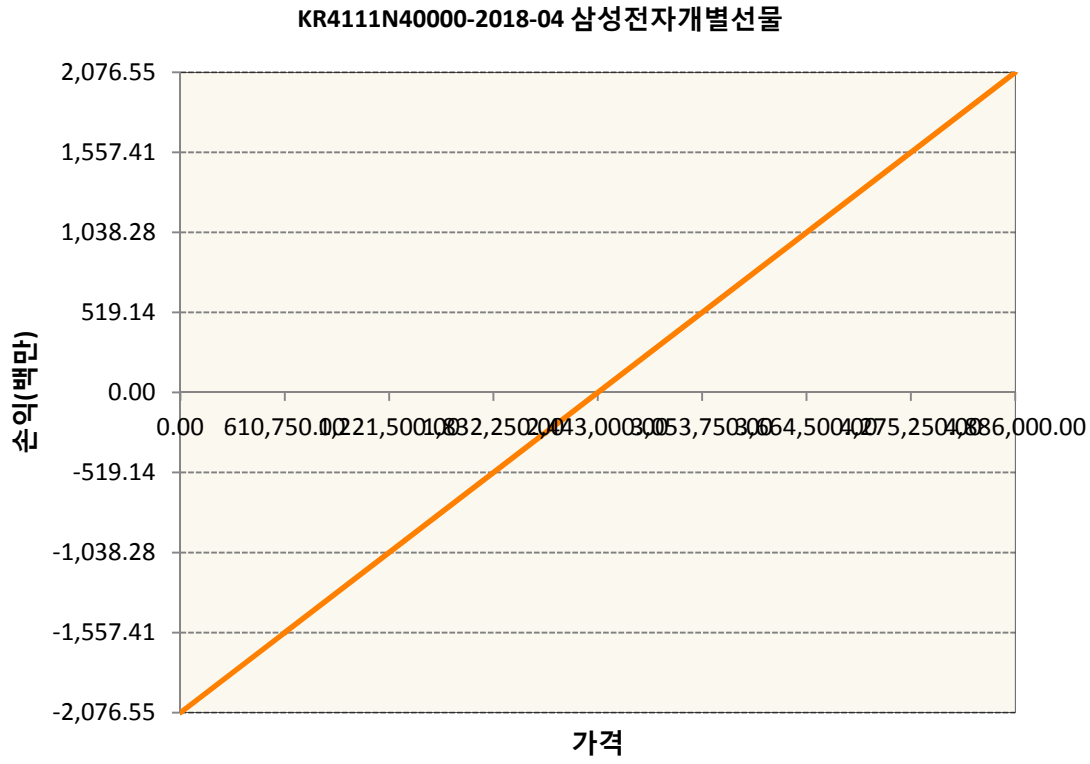
스마트KRX300인덱스1호(주식-파

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	2,077	0	2,077	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4111N40(2018-04 삼성전자개별선물							166
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-166	-166	-166	-166	-166	-166	-166
-5.33%	-110	-110	-110	-110	-110	-110	-110
-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%	110	110	110	110	110	110	110
8.00%	166	166	166	166	166	166	166

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

205

공시일	2018-04-06
기준일	2018-04-05

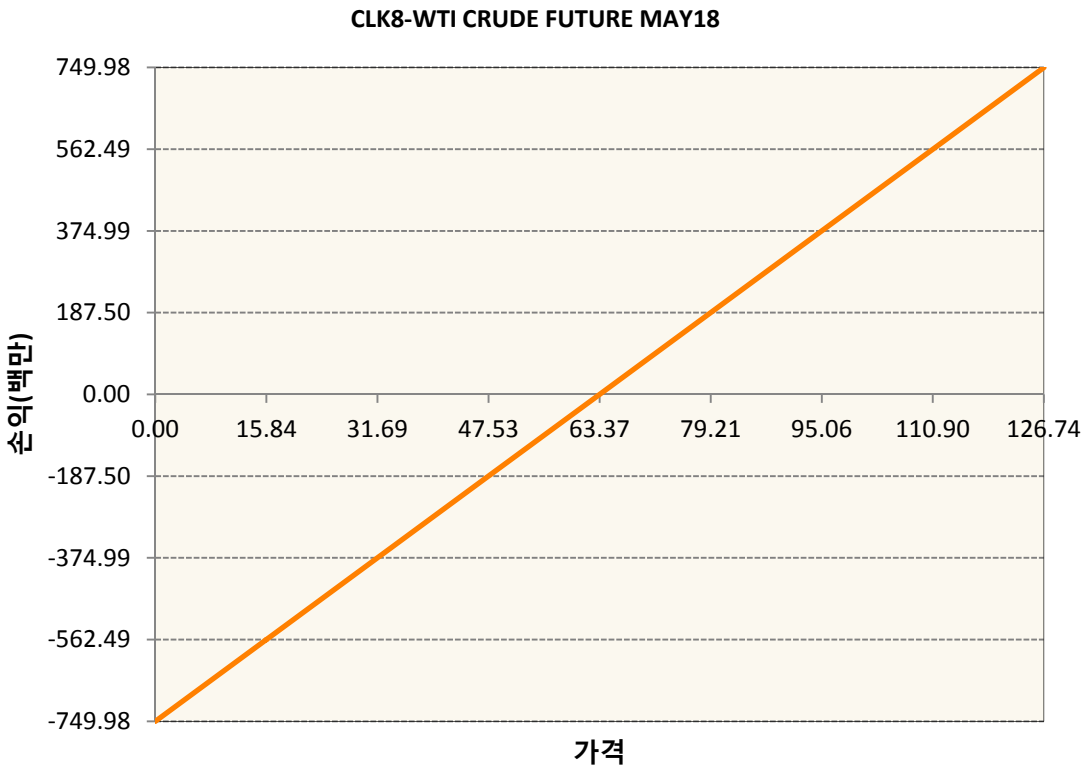
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

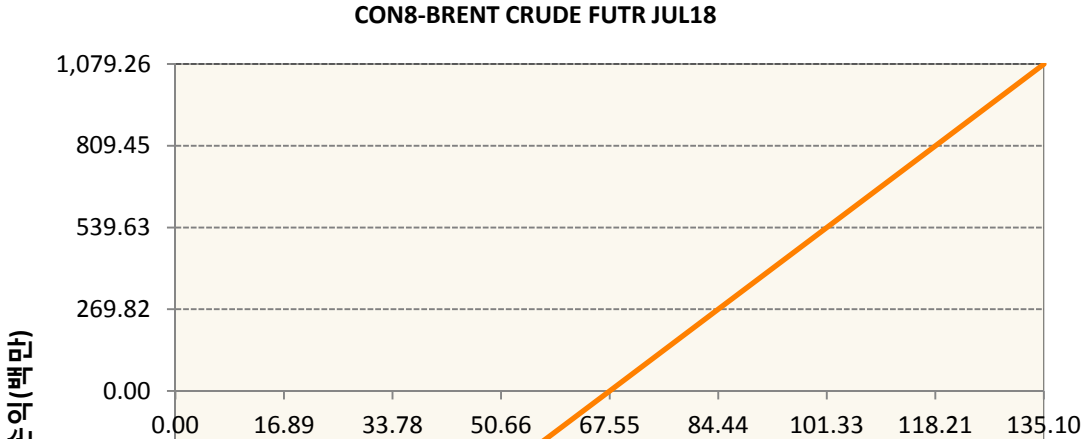
1. 계약금액

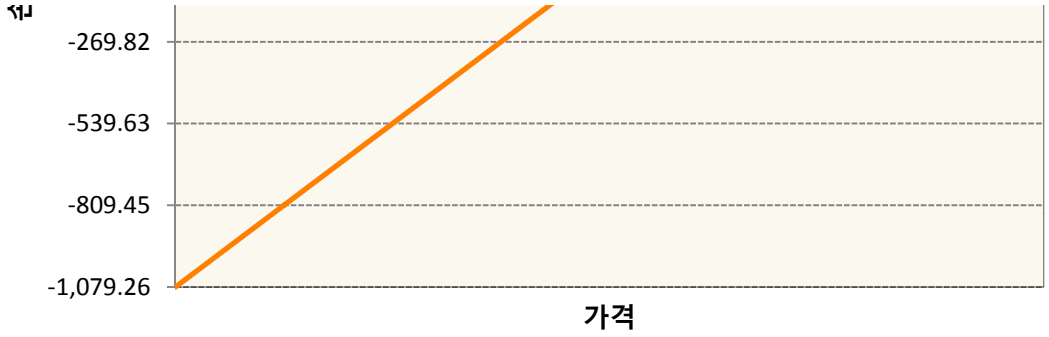
(단위:백만원)

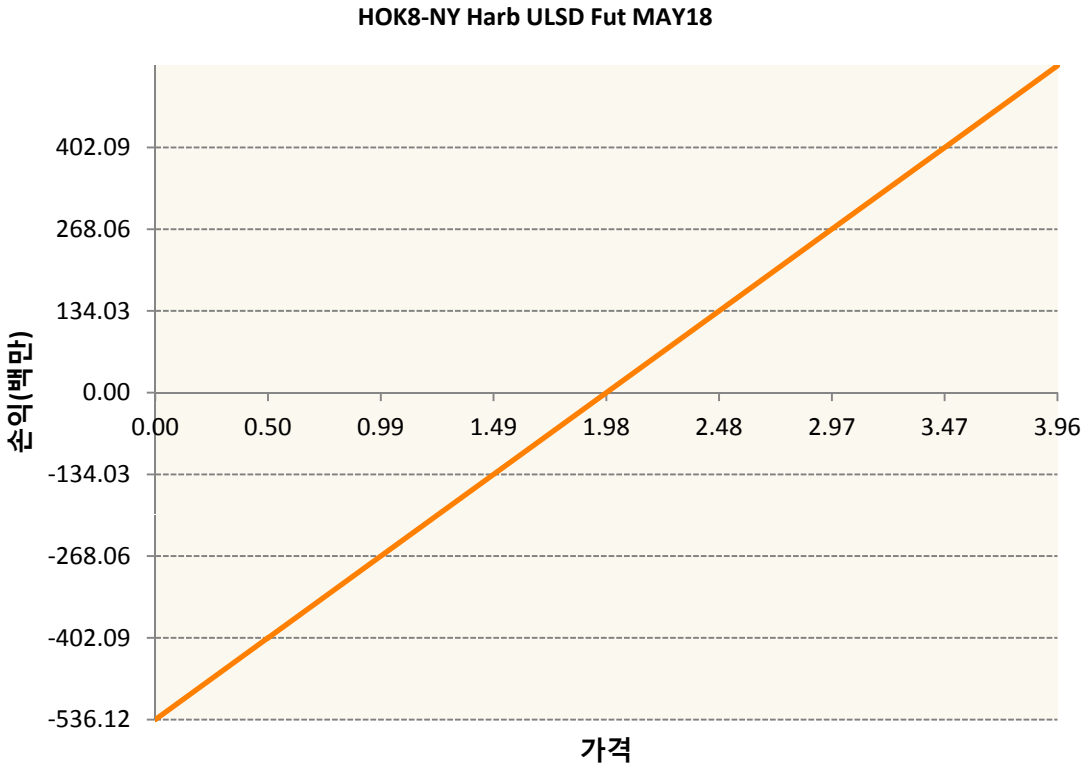
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	선물	유가증권	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	선물	유가증권	750	0	750	
누계	유가증권	선물	3,205	583	2,622	

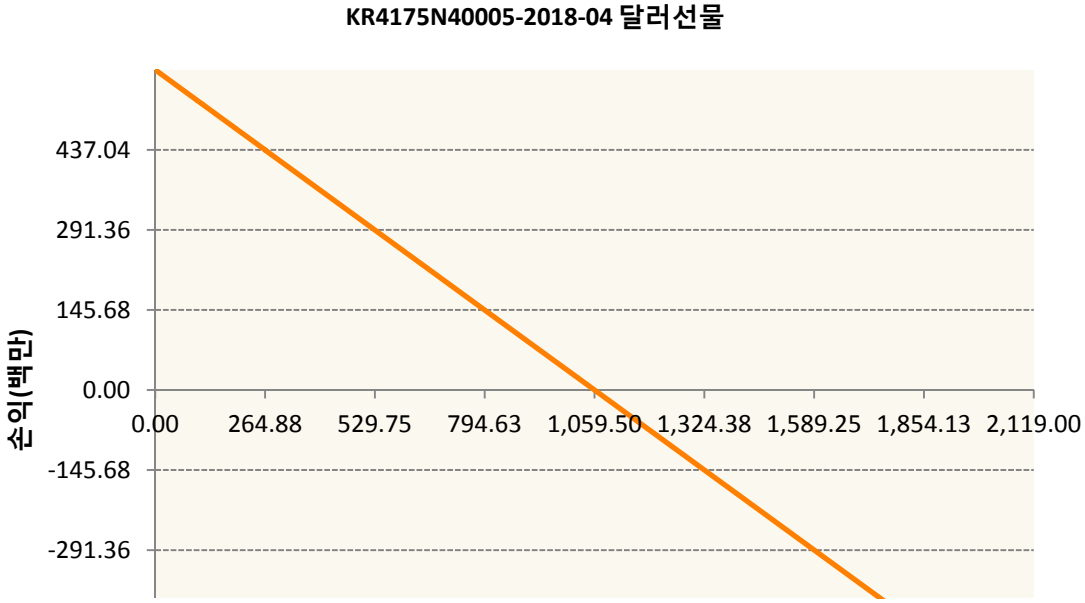
2. 만기시점의 손익구조

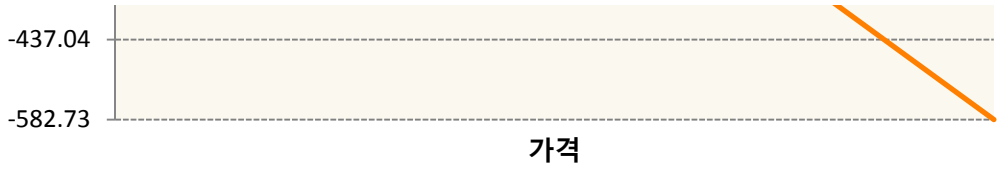


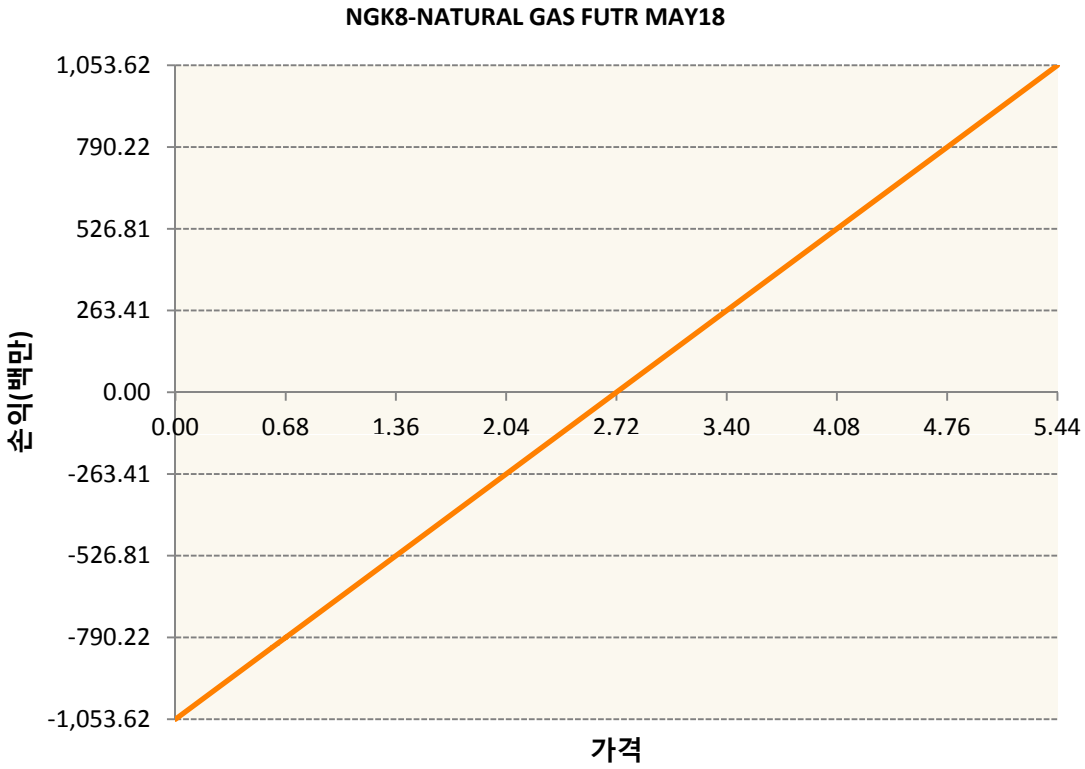


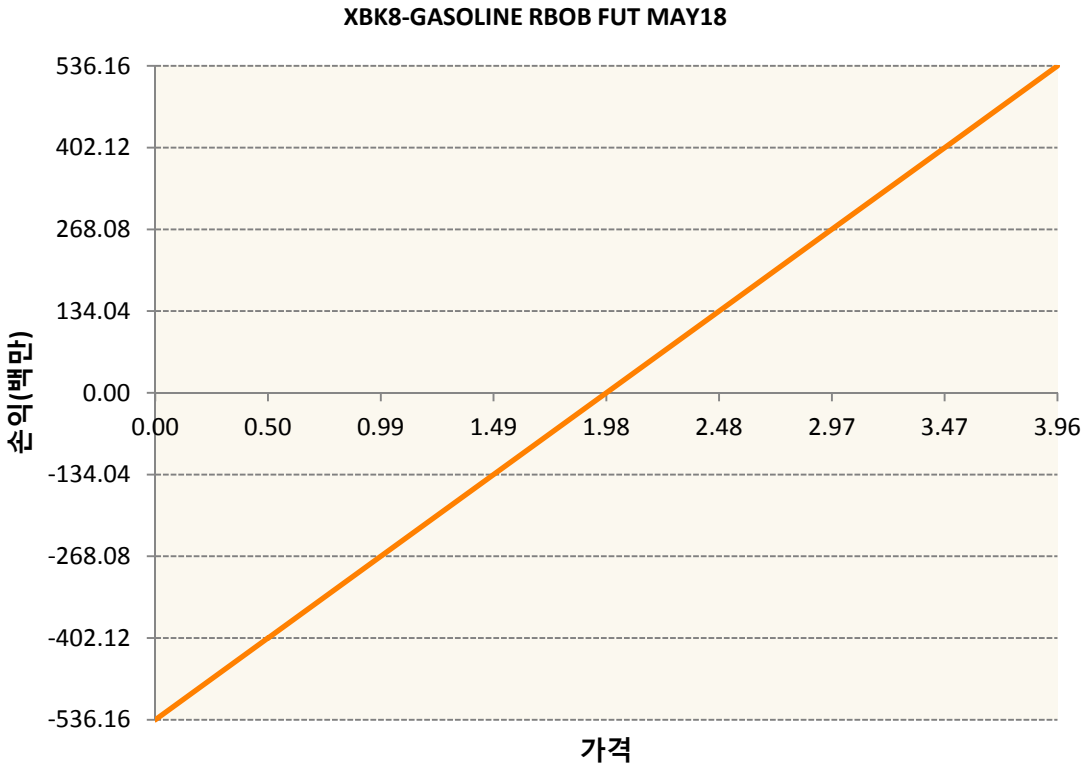

-269.82
-539.63
-809.45
-1,079.26
가격


HOK8-NY Harb ULSD Fut MAY18
402.09
268.06
134.03
0.00
-134.03
-268.06
-402.09
-536.12
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
437.04
291.36
145.68
0.00
-145.68
-291.36
0.00
264.88
529.75
794.63
1,059.50
1,324.38
1,589.25
1,854.13
2,119.00
손익(백만)


-437.04
-582.73
가격


NGK8-NATURAL GAS FUTR MAY18
1,053.62
790.22
526.81
263.41
0.00
-263.41
-526.81
-790.22
-1,053.62
0.00
0.68
1.36
2.04
2.72
3.40
4.08
4.76
5.44
손익(백만)
가격


XBK8-GASOLINE RBOB FUT MAY18
536.16
402.12
268.08
134.04
0.00
-134.04
-268.08
-402.12
-536.16
0.00
0.50
0.99
1.49
1.98
2.48
2.97
3.47
3.96
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)

513

공시일	2018-04-06
기준일	2018-04-05

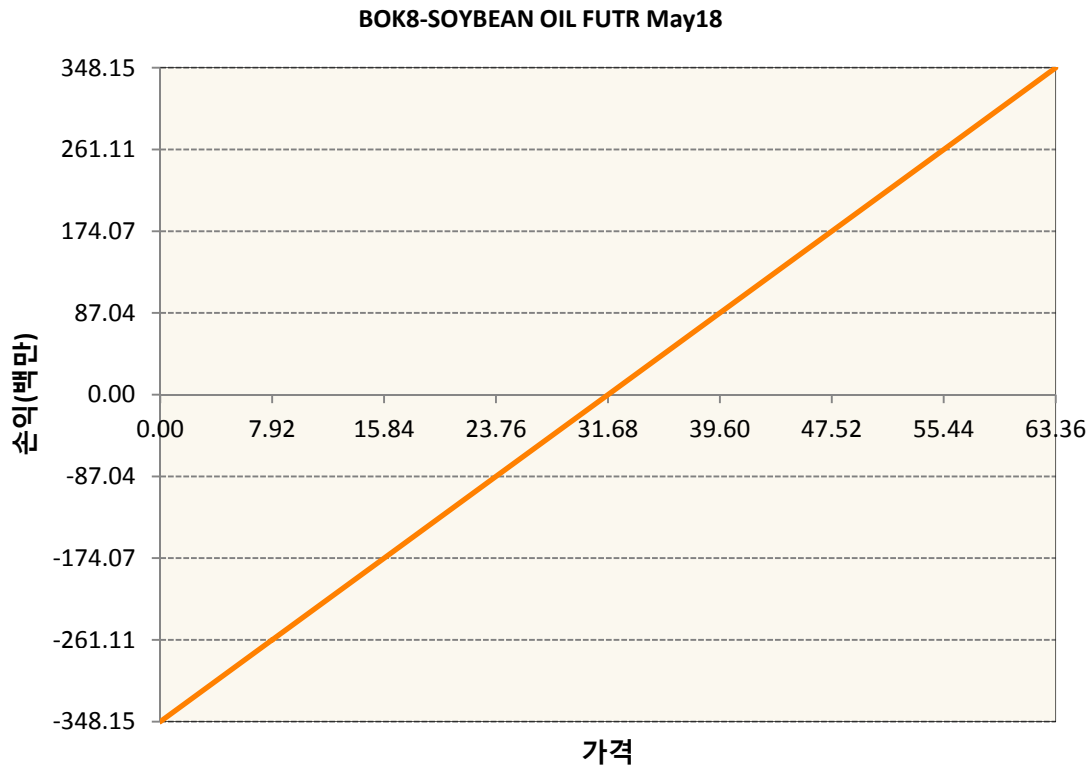
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

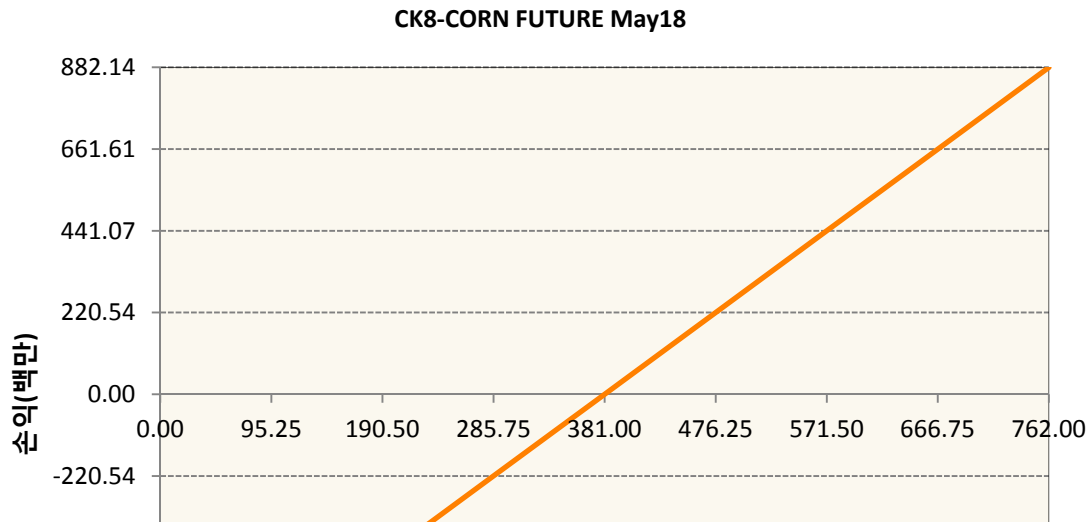
1. 계약금액

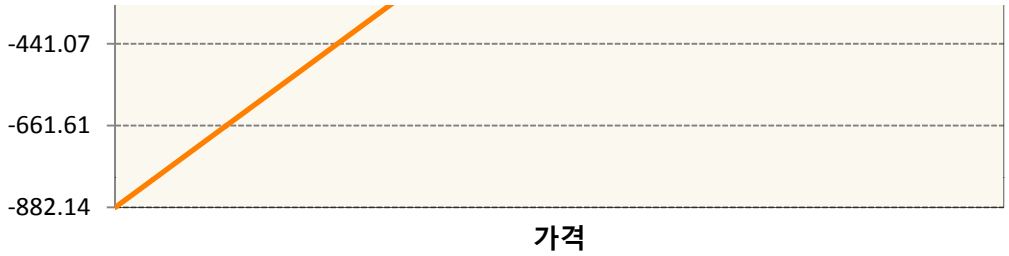
(단위:백만원)

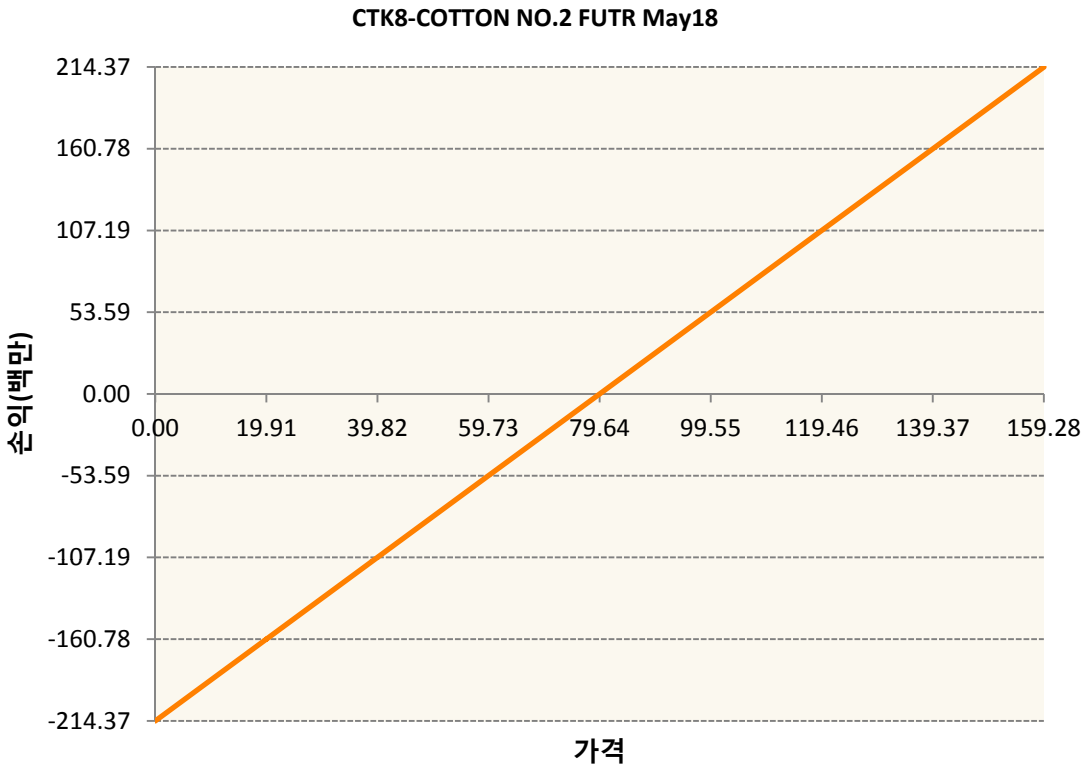
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	4,070	318	3,752	

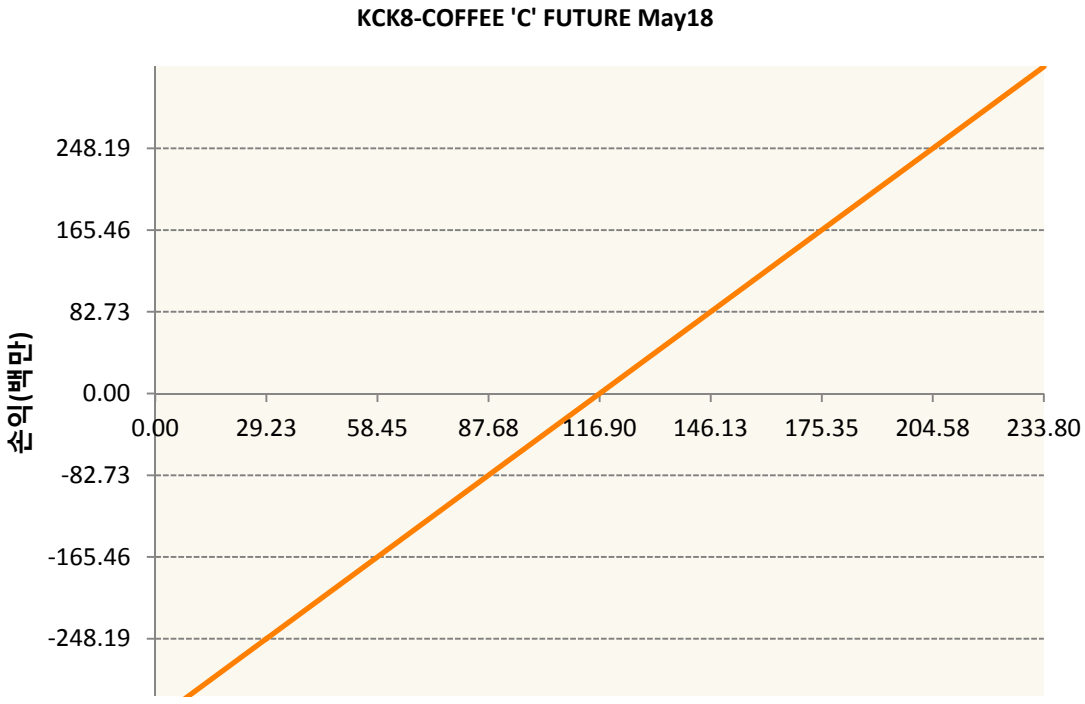
2. 만기시점의 손익구조

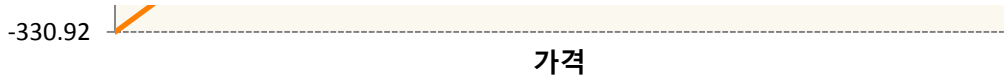


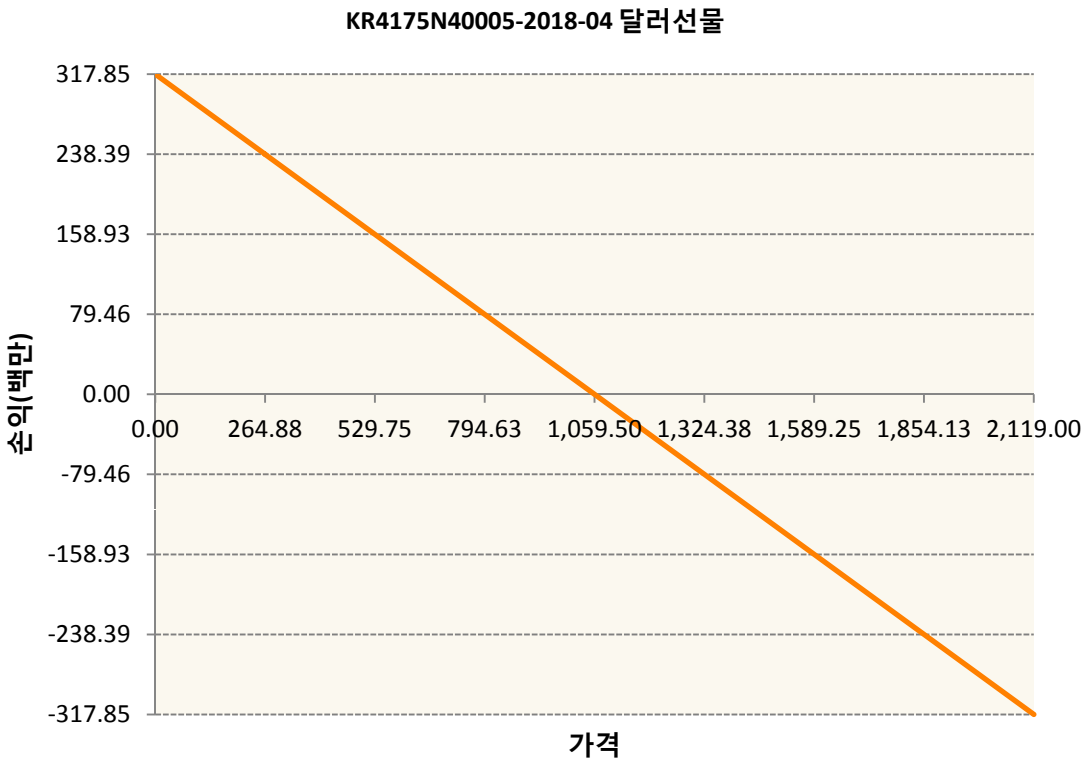


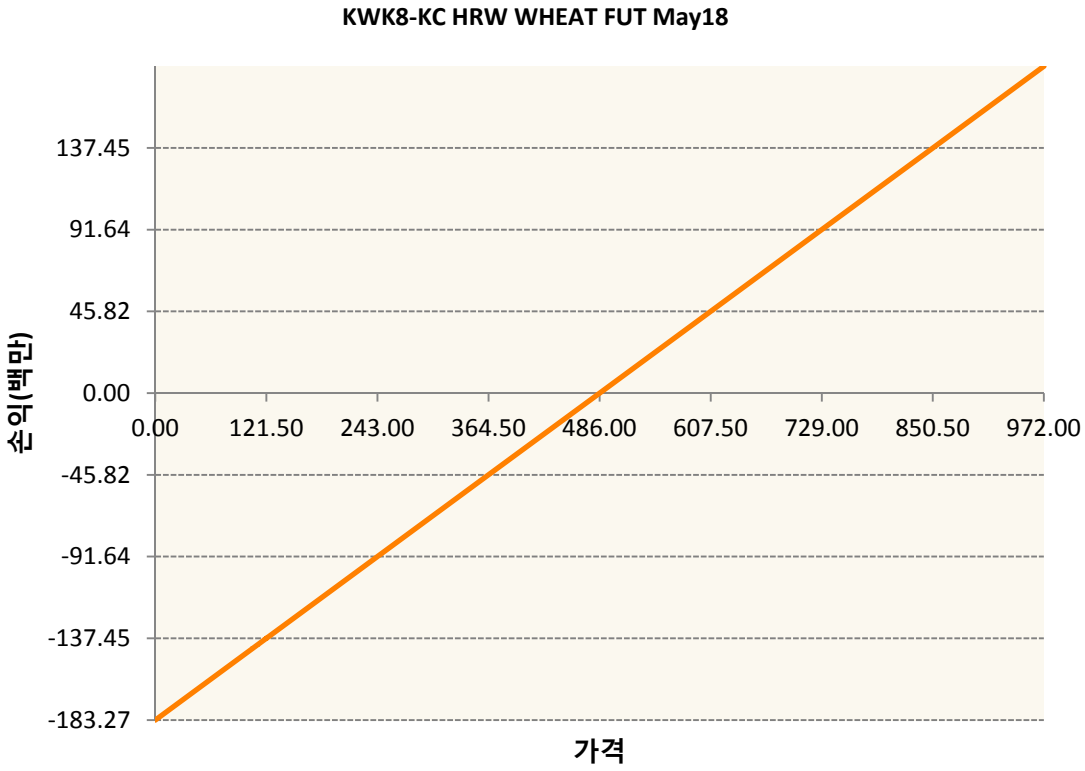

-441.07
-661.61
-882.14
가격


CTK8-COTTON NO.2 FUTR May18
214.37
160.78
107.19
53.59
0.00
-53.59
-107.19
-160.78
-214.37
0.00
19.91
39.82
59.73
79.64
99.55
119.46
139.37
159.28
손익(백만)
가격

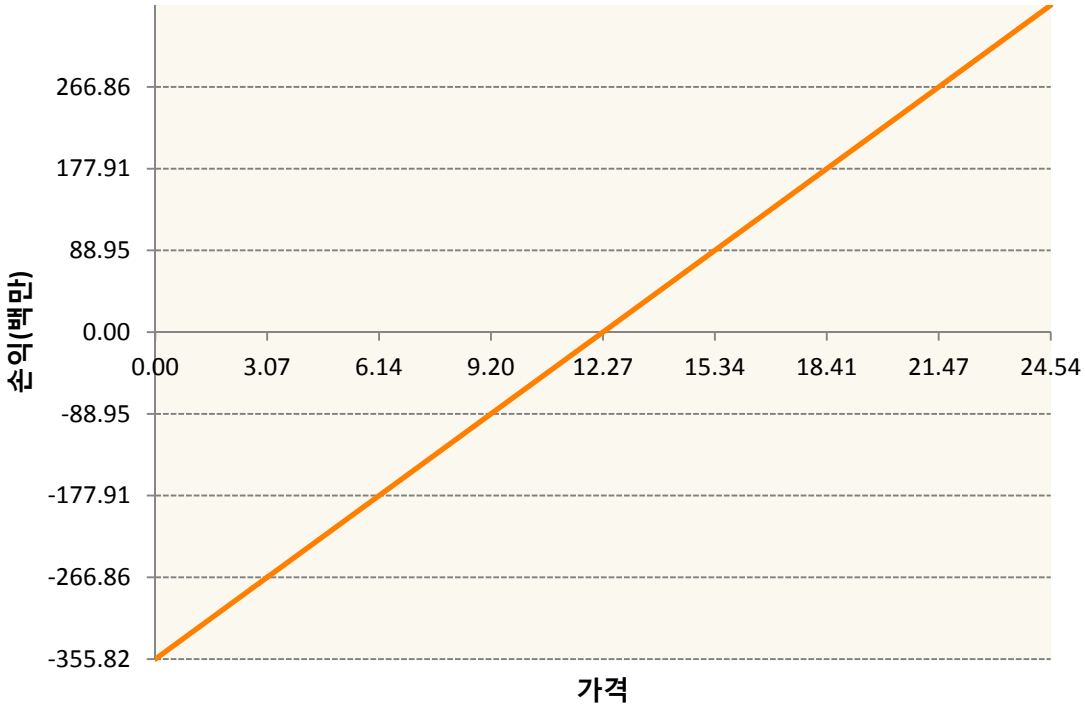

KCK8-COFFEE 'C' FUTURE May18
248.19
165.46
82.73
0.00
-82.73
-165.46
-248.19
0.00
29.23
58.45
87.68
116.90
146.13
175.35
204.58
233.80
손익(백만)


-330.92
가격

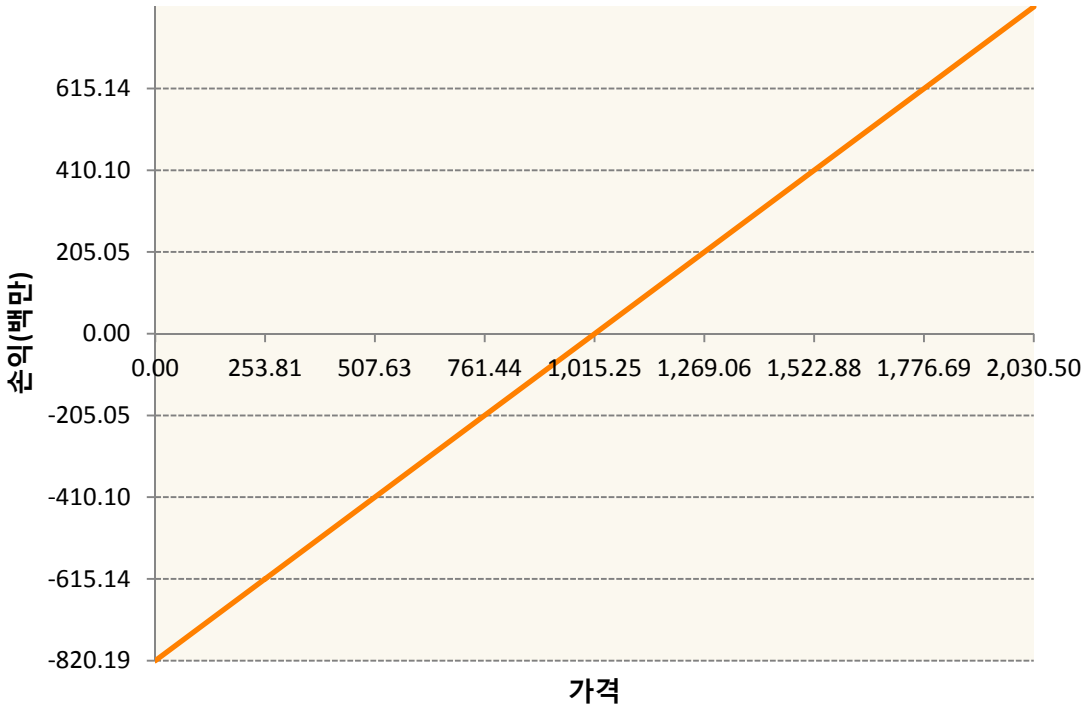

KR4175N40005-2018-04 달러선물
317.85
238.39
158.93
79.46
0.00
-79.46
-158.93
-238.39
-317.85
0.00
264.88
529.75
794.63
1,059.50
1,324.38
1,589.25
1,854.13
2,119.00
손익(백만)
가격


KWK8-KC HRW WHEAT FUT May18
137.45
91.64
45.82
0.00
-45.82
-91.64
-137.45
-183.27
0.00
121.50
243.00
364.50
486.00
607.50
729.00
850.50
972.00
손익(백만)
가격

SBK8-SUGAR #11 (WORLD) May18

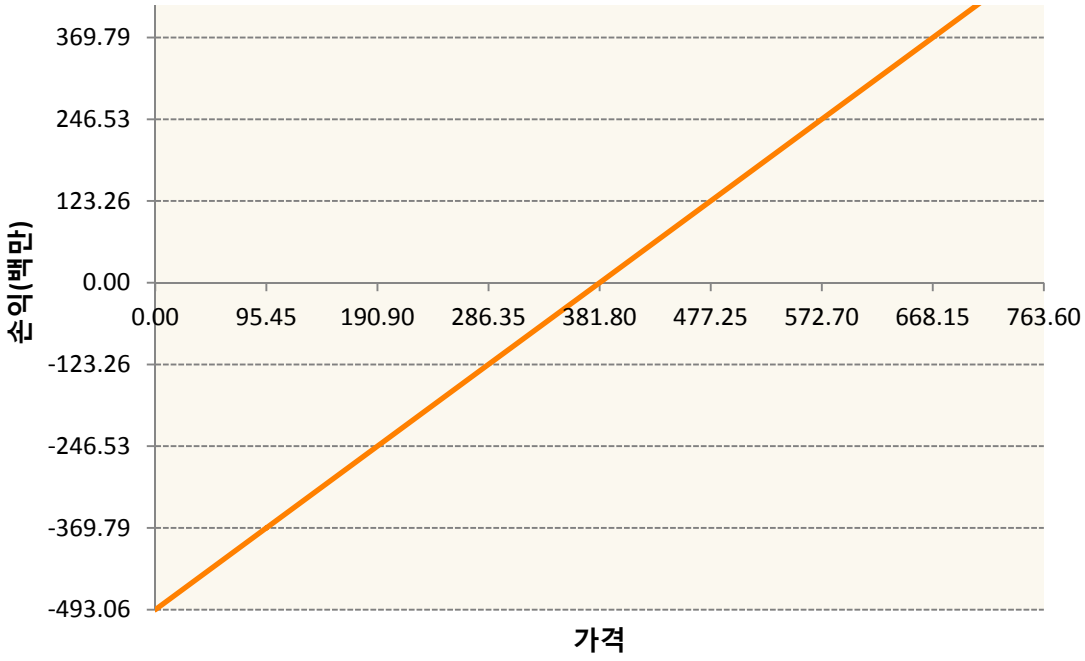


SK8-SOYBEAN FUTRUE May18

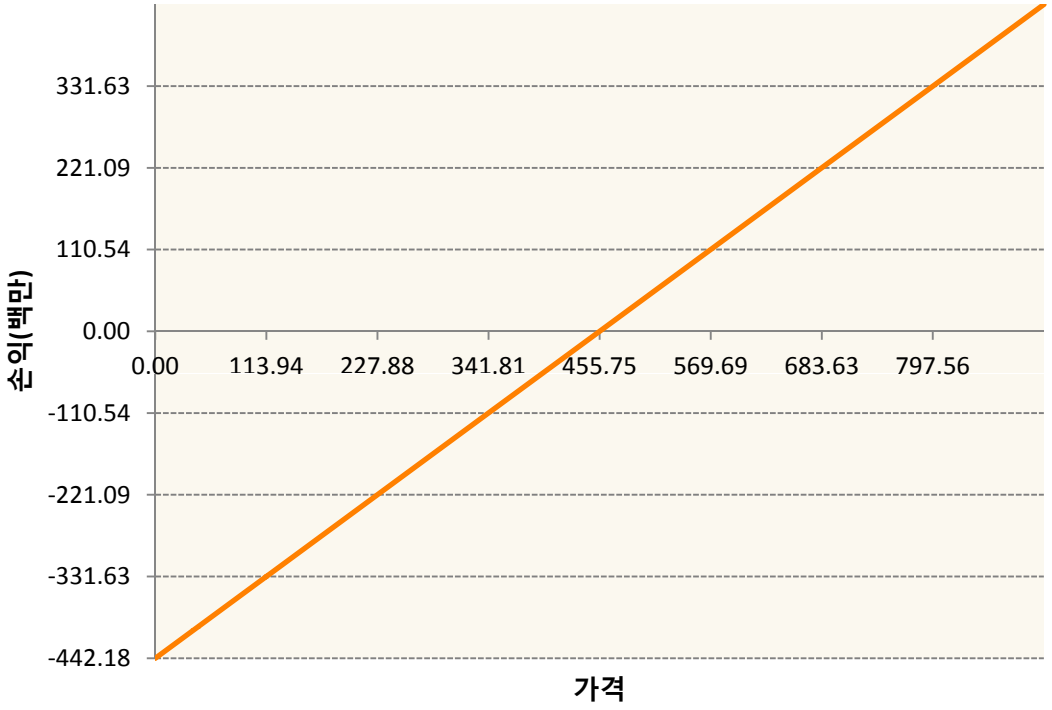


SMK8-SOYBEAN MEAL FUTR May18





WK8-WHEAT FUTURE(CBT) May18



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

BOK8	SOYBEAN OIL FUTR May18	28
CK8	CORN FUTURE May18	71
CTK8	COTTON NO.2 FUTR May18	17
KCK8	COFFEE 'C' FUTURE May18	26
KR4175N40(	2018-04 달러선물	25

KWK8	KC HRW WHEAT FUT May18	15
SBK8	SUGAR #11 (WORLD) May18	28
SK8	SOYBEAN FUTRUE May18	66
SMK8	SOYBEAN MEAL FUTR May18	39
WK8	WHEAT FUTURE(CBT) May18	35

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

329