공시일	2018-04-09
기준일	2018-04-06

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	2018-04-09
기준일	2018-04-06

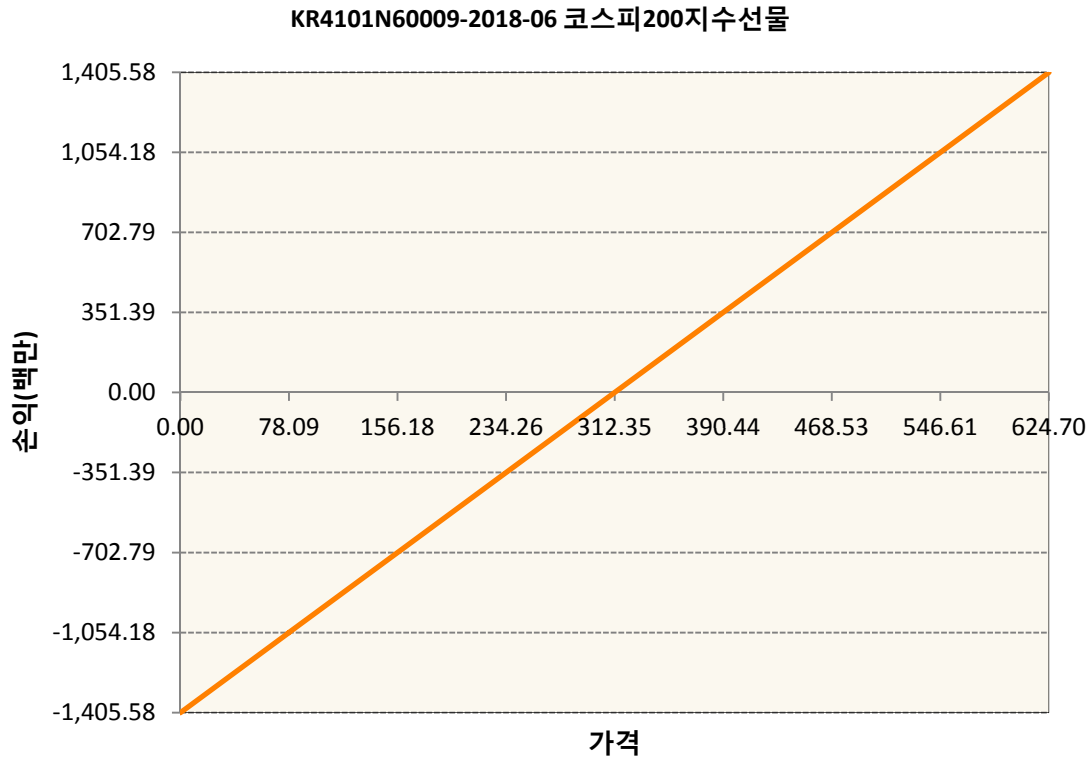
스마트인덱스모

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	1,406	0	1,406	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101N60(2018-06 코스피200지수선물							112
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-112	-112	-112	-112	-112	-112	-112
-5.33%	-75	-75	-75	-75	-75	-75	-75
-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%	75	75	75	75	75	75	75
8.00%	112	112	112	112	112	112	112

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

82

공시일	2018-04-09
기준일	2018-04-06

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	1,094

* 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	2018-04-09
기준일	2018-04-06

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	2018-04-09
기준일	2018-04-06

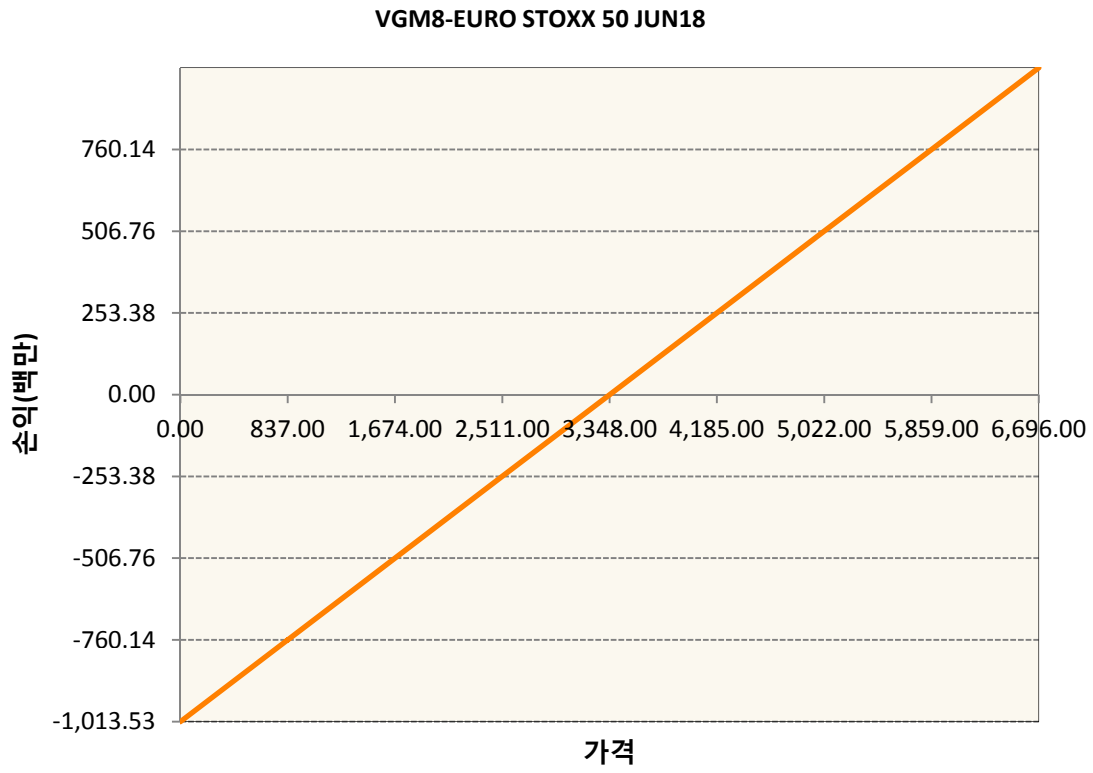
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,014	0	1,014	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGM8	EURO STOXX 50 JUN18	81

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

(단위:백만원)

50

공시일	2018-04-09
기준일	2018-04-06

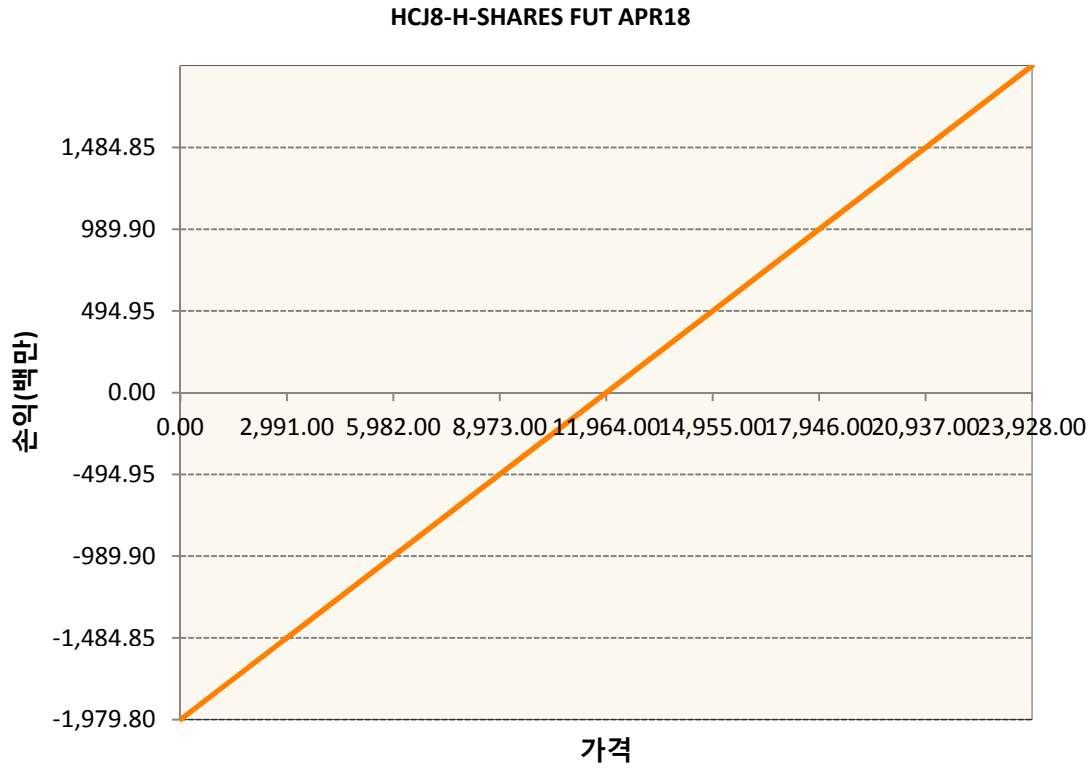
차이나인덱스모(주식-파생형)

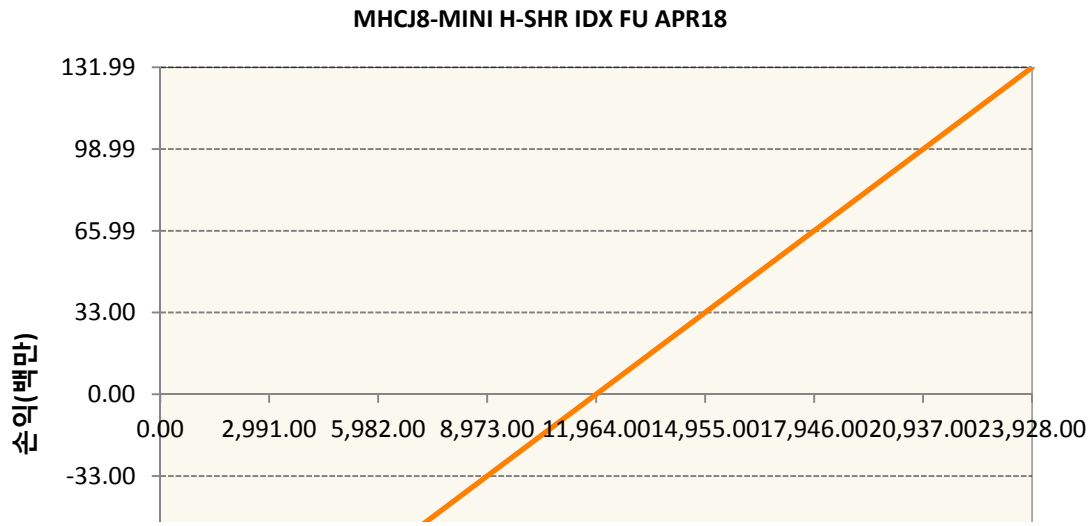
1. 계약금액

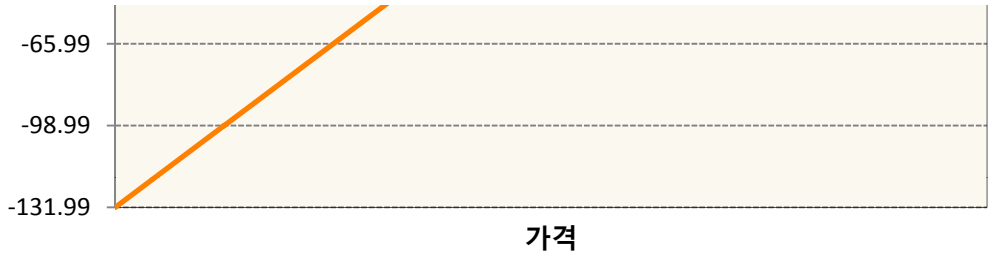
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,112	0	2,112	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCJ8	H-SHARES FUT APR18	158
MHCJ8	MINI H-SHR IDX FU APR18	11

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	148

공시일	2018-04-09
기준일	2018-04-06

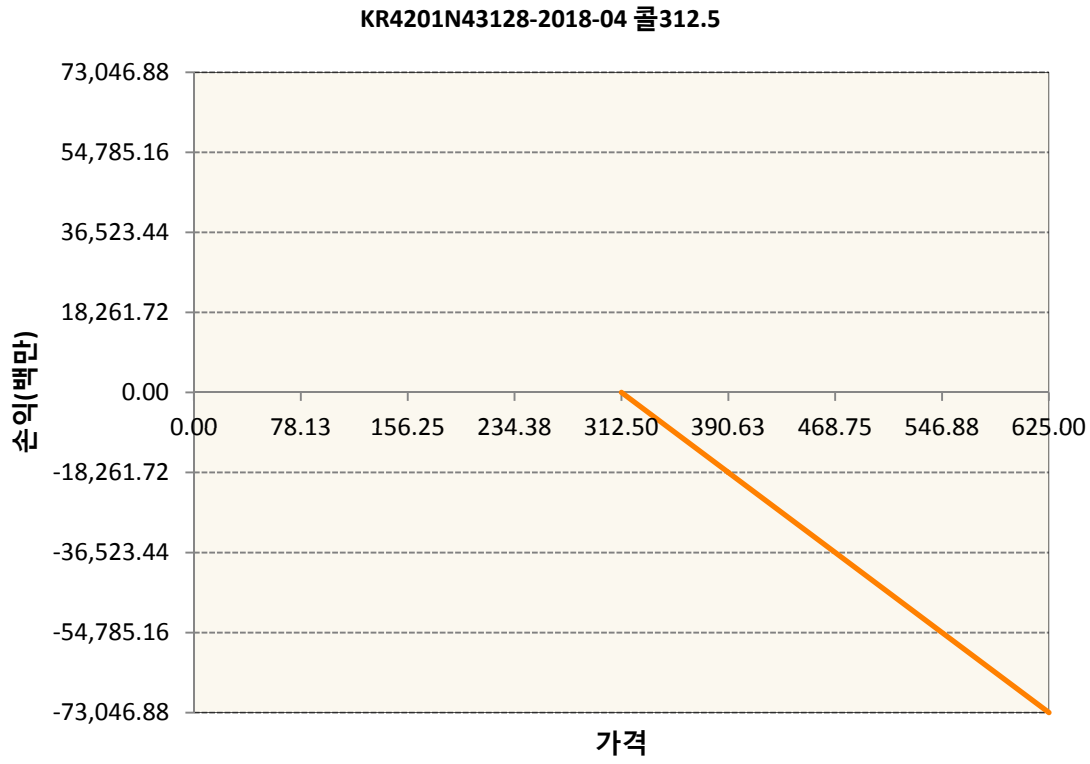
커버드콜모(주식혼합-파생형)

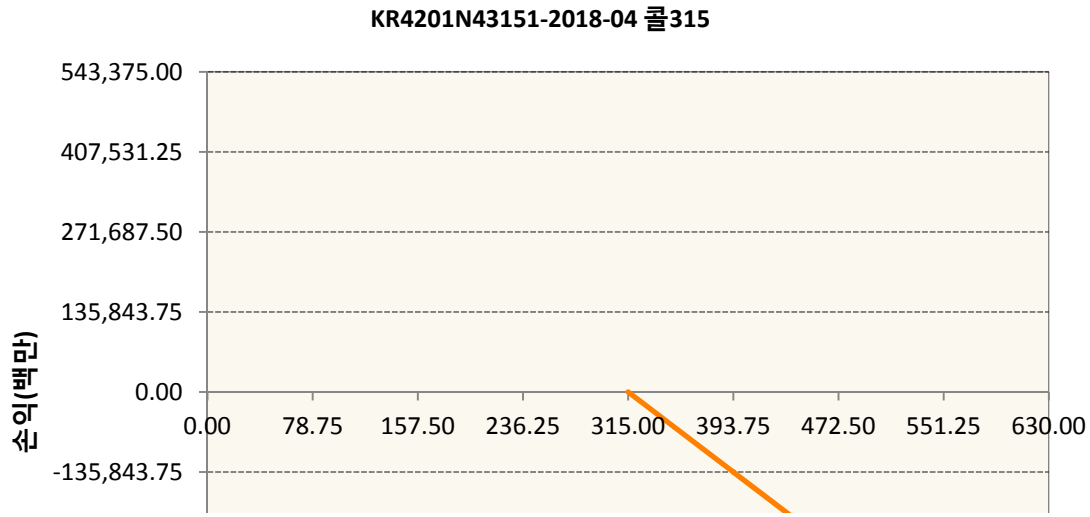
1. 계약금액

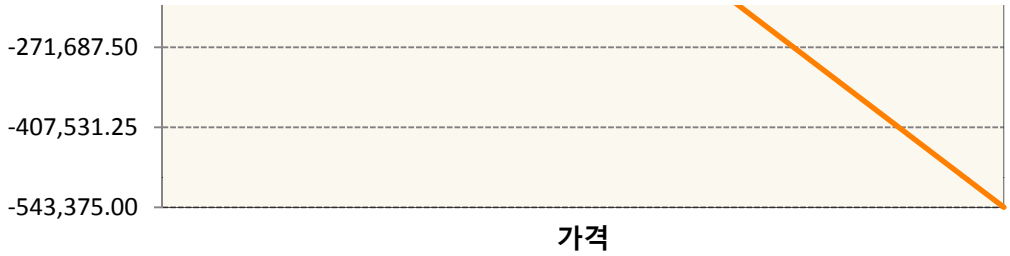
(단위:백만원)

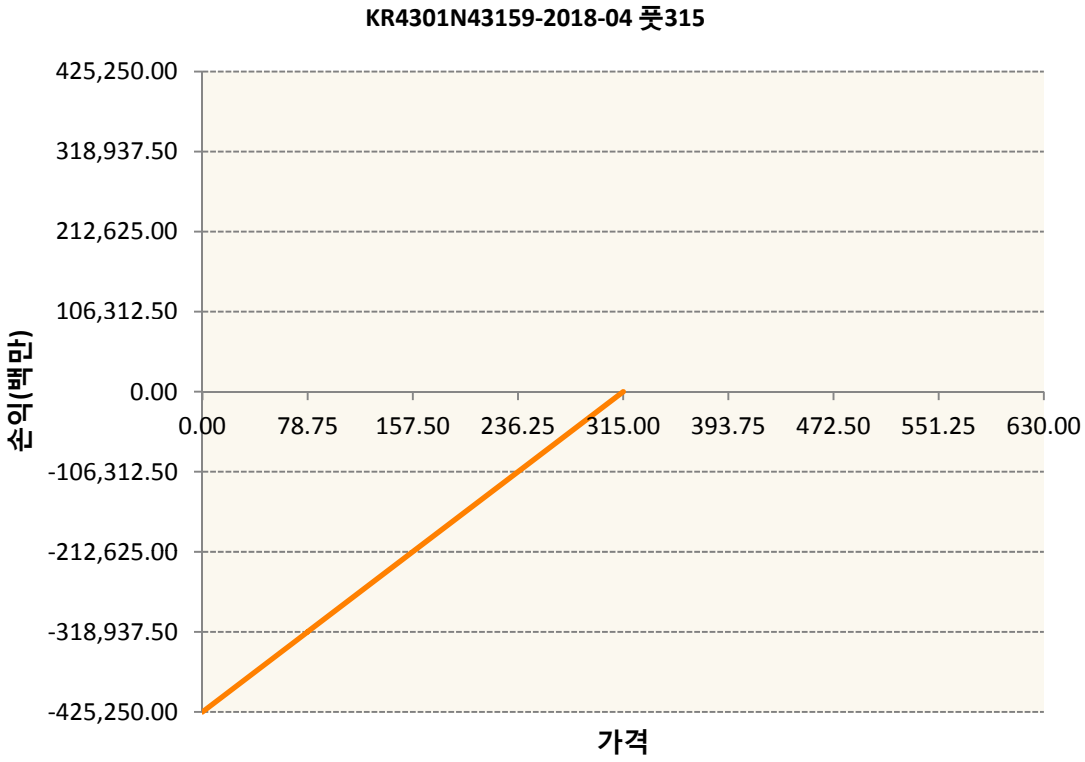
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	1,041,672	-1,041,672	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201N4312018-04 콜312.5							4,734
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	961	960	958	954	948	938	926
-5.33%	950	938	921	899	871	839	803
-2.67%	824	773	717	656	592	525	456
0%	264	176	88	0	-88	-176	-265
2.67%	-993	-1,058	-1,126	-1,197	-1,271	-1,348	-1,425
5.33%	-2,746	-2,767	-2,795	-2,829	-2,868	-2,912	-2,961
8.00%	-4,660	-4,664	-4,670	-4,680	-4,693	-4,711	-4,734
KR4201N4312018-04 콜315							32,708
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	5,291	5,288	5,279	5,263	5,233	5,188	5,123

-5.33%	5,253	5,204	5,126	5,017	4,873	4,695	4,484
-2.67%	4,735	4,461	4,141	3,781	3,387	2,964	2,516
0%	1,855	1,244	625	0	-629	-1,262	-1,898
2.67%	-5,873	-6,448	-7,037	-7,639	-8,250	-8,868	-9,492
5.33%	-17,980	-18,223	-18,516	-18,852	-19,226	-19,632	-20,067
8.00%	-31,909	-31,959	-32,038	-32,152	-32,302	-32,488	-32,708
KR4301N4312018-04 풋315							31,666

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-31,664	-31,664	-31,664	-31,664	-31,665	-31,665	-31,666
-5.33%	-20,450	-20,450	-20,451	-20,455	-20,462	-20,473	-20,492
-2.67%	-9,268	-9,303	-9,355	-9,425	-9,513	-9,619	-9,741
0%	826	559	283	0	-288	-581	-877
2.67%	5,821	5,598	5,359	5,108	4,847	4,577	4,301
5.33%	6,523	6,499	6,460	6,405	6,332	6,242	6,135
8.00%	6,542	6,542	6,540	6,537	6,530	6,518	6,500

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

80,210

공시일	2018-04-09
기준일	2018-04-06

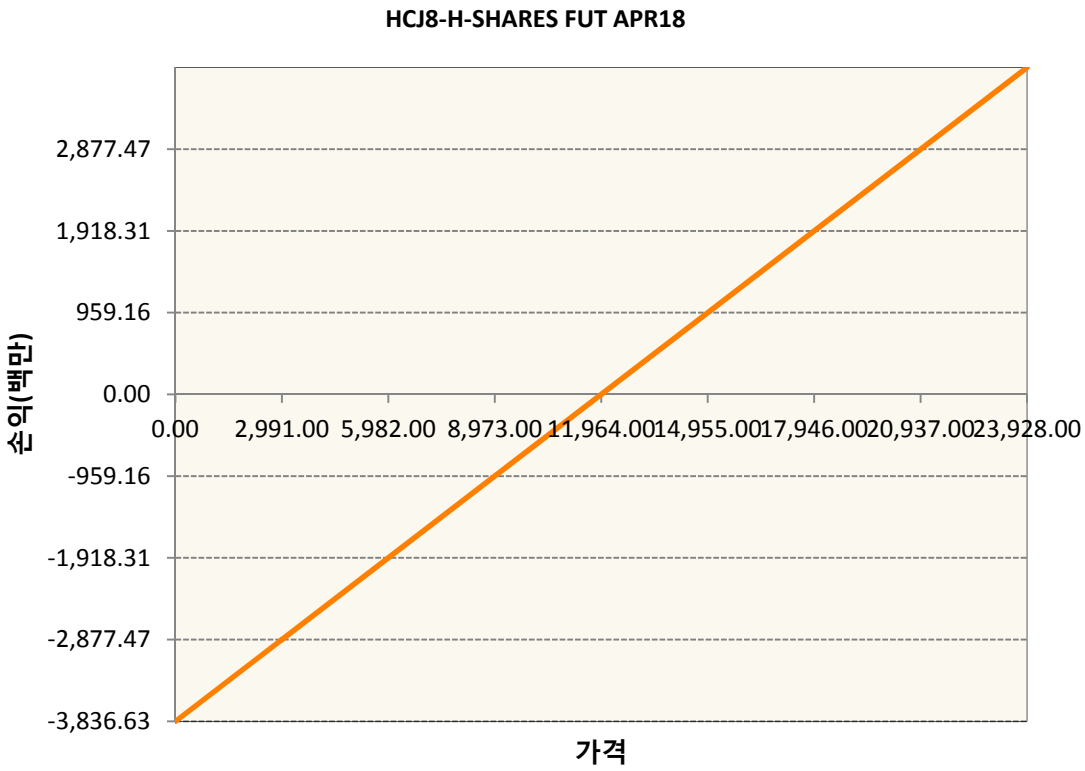
홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생

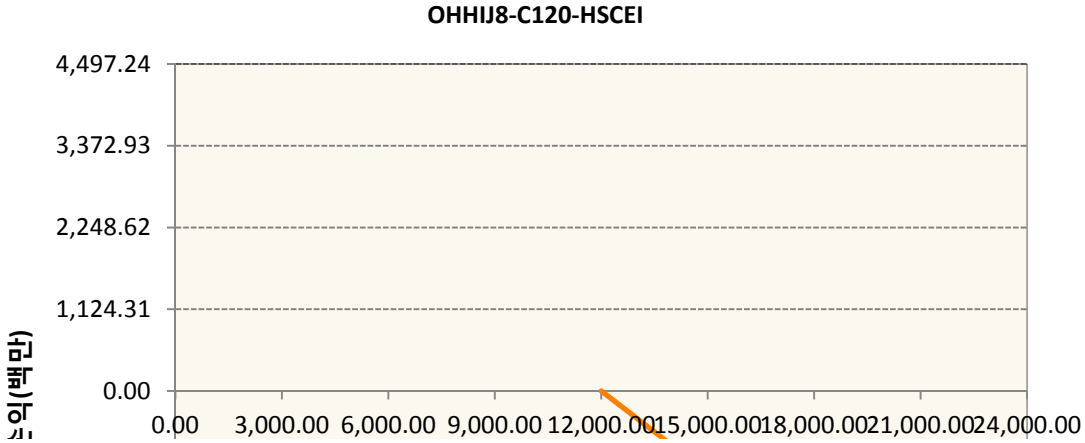
1. 계약금액

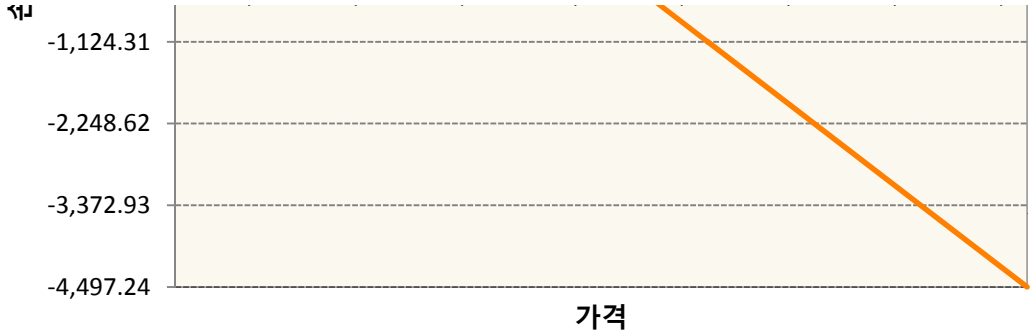
(단위:백만원)

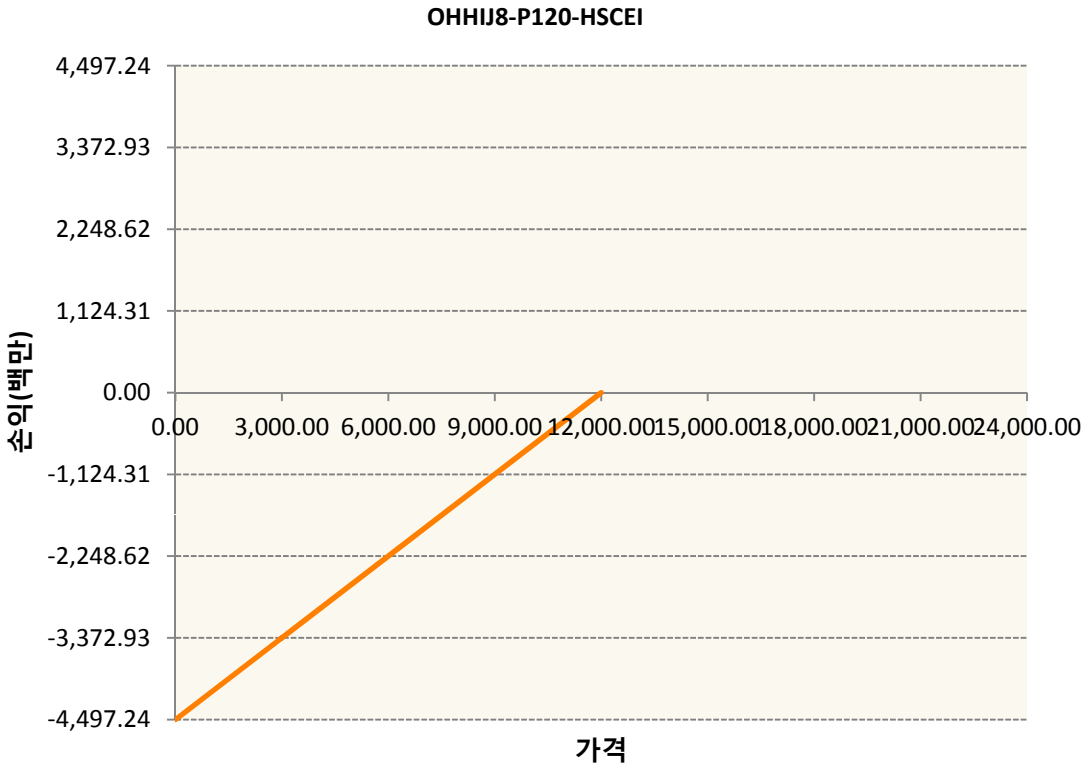
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	3,837	0	3,837	장내
누계	유가증권	옵션	0	8,994	-8,994	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCJ8	H-SHARES FUT APR18	307
OHHIJ8-C12	HSCEI	360
OHHIJ8-P12	HSCEI	360

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	899

공시일	2018-04-09
기준일	2018-04-06

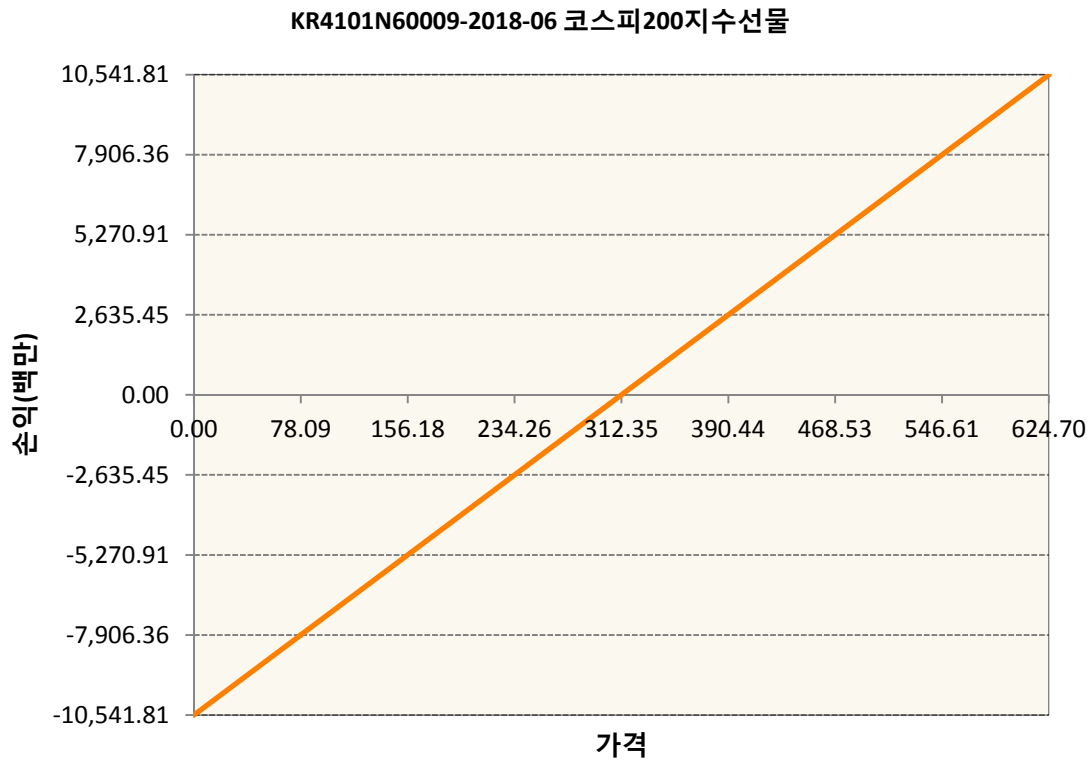
코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼

1. 계약금액

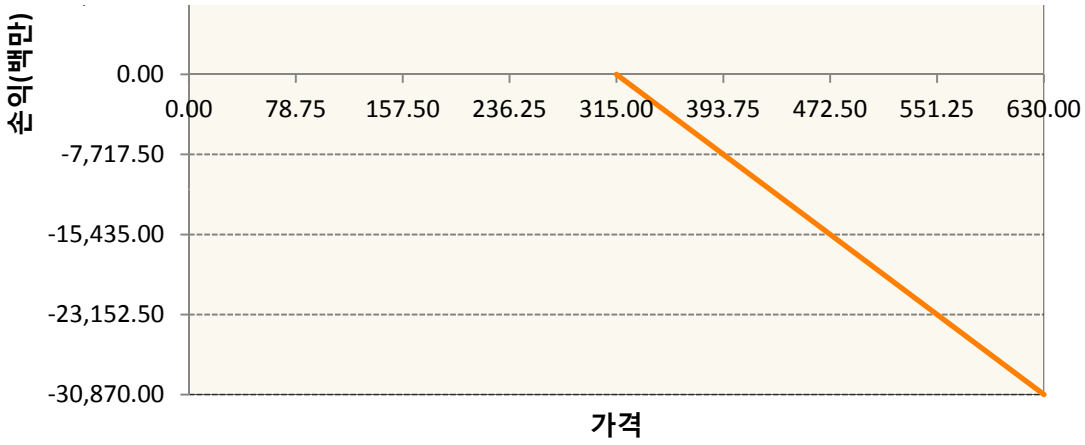
(단위:백만원)

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	10,542	0	10,542	장내
누계	유가증권	스왑	54,200	0	54,200	장외
누계	유가증권	옵션	0	55,718	-55,718	장내

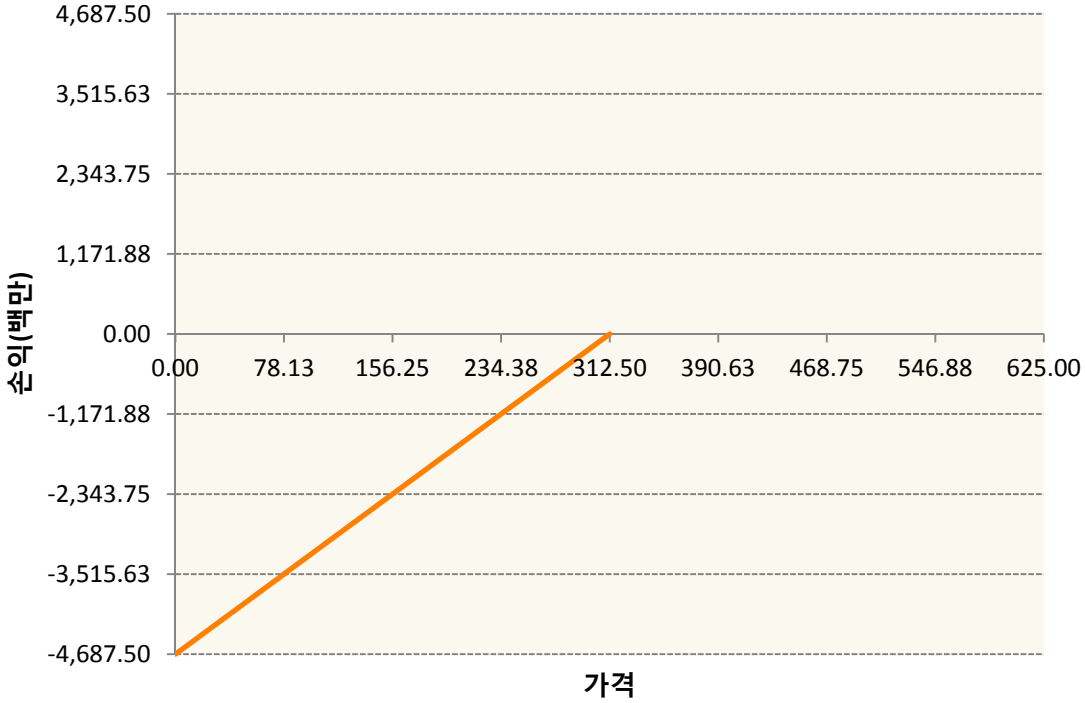
2. 만기시점의 손익구조



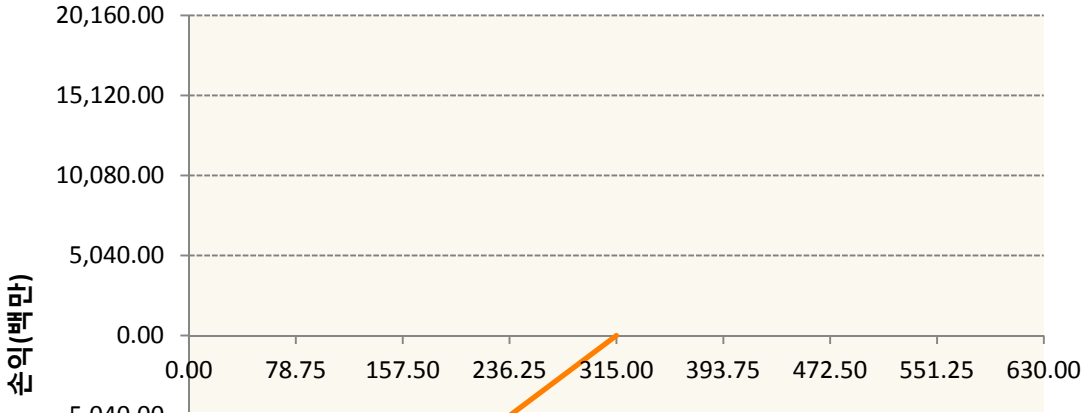




KR4301N43126-2018-04 풋312.5



KR4301N43159-2018-04 풋315





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_2							1,454
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,454	-1,454	-1,454	-1,454	-1,454	-1,454	-1,454
-5.33%	-969	-969	-969	-969	-969	-969	-969
-2.67%	-485	-485	-485	-485	-485	-485	-485
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	485	485	485	485	485	485	485
5.33%	969	969	969	969	969	969	969
8.00%	1,454	1,454	1,454	1,454	1,454	1,454	1,454
2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_3							275
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-275	-275	-275	-275	-275	-275	-275
-5.33%	-183	-183	-183	-183	-183	-183	-183
-2.67%	-92	-92	-92	-92	-92	-92	-92
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	92	92	92	92	92	92	92
5.33%	183	183	183	183	183	183	183
8.00%	275	275	275	275	275	275	275
2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_5							236
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-236	-236	-236	-236	-236	-236	-236
-5.33%	-157	-157	-157	-157	-157	-157	-157
-2.67%	-79	-79	-79	-79	-79	-79	-79
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	79	79	79	79	79	79	79
5.33%	157	157	157	157	157	157	157
8.00%	236	236	236	236	236	236	236
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%	-168	-168	-168	-168	-168	-168	-168
-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%	168	168	168	168	168	168	168
8.00%	251	251	251	251	251	251	251
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_8						465
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-465	-465	-465	-465	-465	-465	-465
-5.33%	-310	-310	-310	-310	-310	-310	-310
-2.67%	-155	-155	-155	-155	-155	-155	-155
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	155	155	155	155	155	155	155
5.33%	310	310	310	310	310	310	310
8.00%	465	465	465	465	465	465	465
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_10						275
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-275	-275	-275	-275	-275	-275	-275
-5.33%	-183	-183	-183	-183	-183	-183	-183
-2.67%	-92	-92	-92	-92	-92	-92	-92
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	92	92	92	92	92	92	92
5.33%	183	183	183	183	183	183	183
8.00%	275	275	275	275	275	275	275
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_11						629
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-629	-629	-629	-629	-629	-629	-629
-5.33%	-419	-419	-419	-419	-419	-419	-419
-2.67%	-210	-210	-210	-210	-210	-210	-210
0%	0	0	0	0	0	0	0

2.67%	210	210	210	210	210	210	210
5.33%	419	419	419	419	419	419	419
8.00%	629	629	629	629	629	629	629
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_12						471
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-471	-471	-471	-471	-471	-471	-471
-5.33%	-314	-314	-314	-314	-314	-314	-314
-2.67%	-157	-157	-157	-157	-157	-157	-157
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	157	157	157	157	157	157	157
5.33%	314	314	314	314	314	314	314
8.00%	471	471	471	471	471	471	471
	KR4101N60(	2018-06 코스피200지수선물					841
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-841	-841	-841	-841	-841	-841	-841
-5.33%	-561	-561	-561	-561	-561	-561	-561
-2.67%	-280	-280	-280	-280	-280	-280	-280
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	280	280	280	280	280	280	280
5.33%	561	561	561	561	561	561	561
8.00%	841	841	841	841	841	841	841
	KR4201N431	2018-04 콜315					1,858
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	301	300	300	299	297	295	291
-5.33%	298	296	291	285	277	267	255
-2.67%	269	253	235	215	192	168	143
0%	105	71	35	0	-36	-72	-108
2.67%	-334	-366	-400	-434	-469	-504	-539
5.33%	-1,021	-1,035	-1,052	-1,071	-1,092	-1,115	-1,140
8.00%	-1,813	-1,816	-1,820	-1,827	-1,835	-1,846	-1,858
	KR4301N431	2018-04 풋312.5					338
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-338	-338	-338	-338	-338	-338	-338
-5.33%	-213	-213	-213	-213	-213	-214	-214
-2.67%	-90	-91	-92	-93	-95	-96	-98
0%	11	7	4	0	-4	-7	-11
2.67%	46	45	43	41	39	36	34
5.33%	49	49	49	49	48	48	47
8.00%	49	49	49	49	49	49	49
	KR4301N431	2018-04 풋315					1,501

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,501	-1,501	-1,501	-1,501	-1,501	-1,501	-1,501
-5.33%	-969	-969	-970	-970	-970	-971	-971
-2.67%	-439	-441	-443	-447	-451	-456	-462
0%	39	26	13	0	-14	-28	-42
2.67%	276	265	254	242	230	217	204
5.33%	309	308	306	304	300	296	291
8.00%	310	310	310	310	310	309	308

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

9,178

공시일	2018-04-09
기준일	2018-04-06

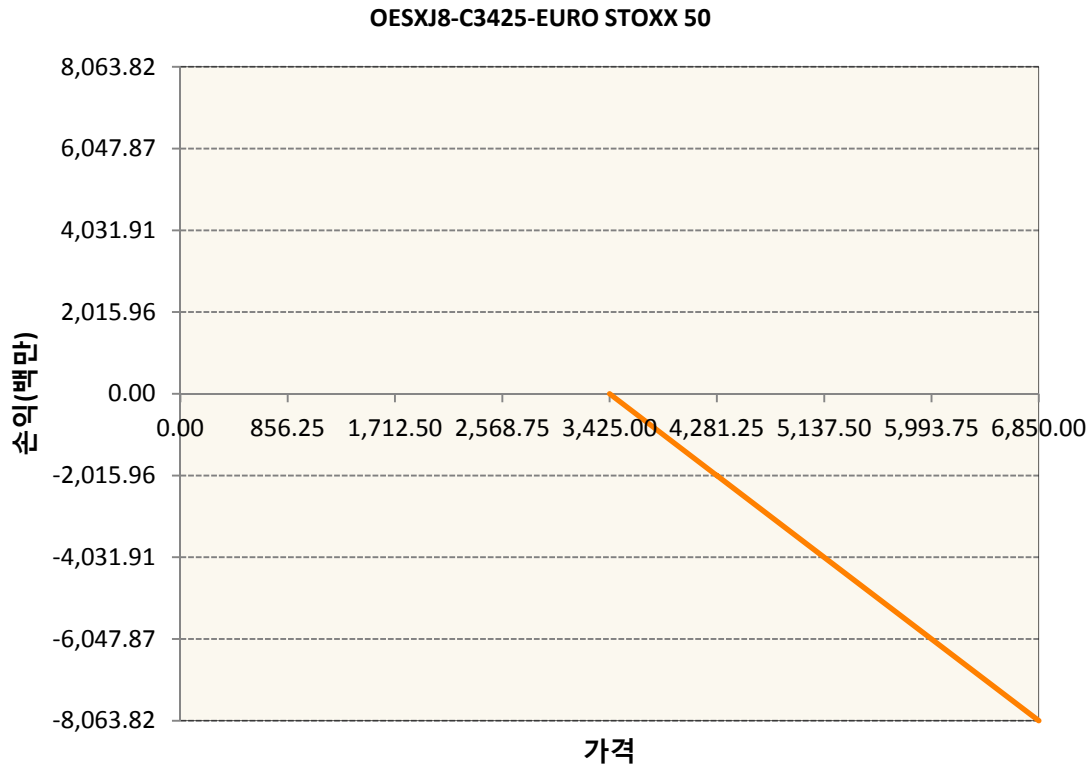
유로커버드콜모(주식혼합-파생형

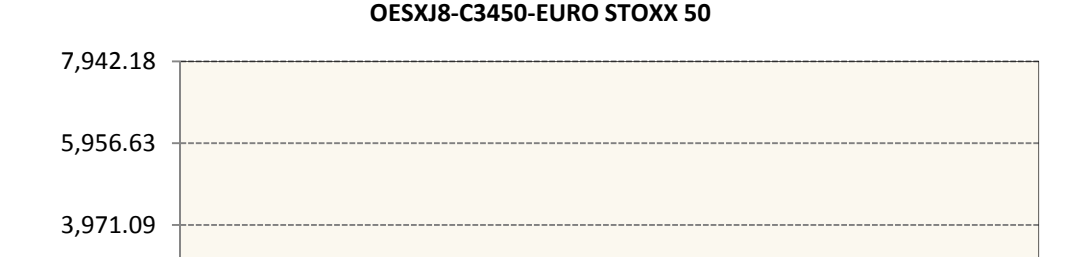
1. 계약금액

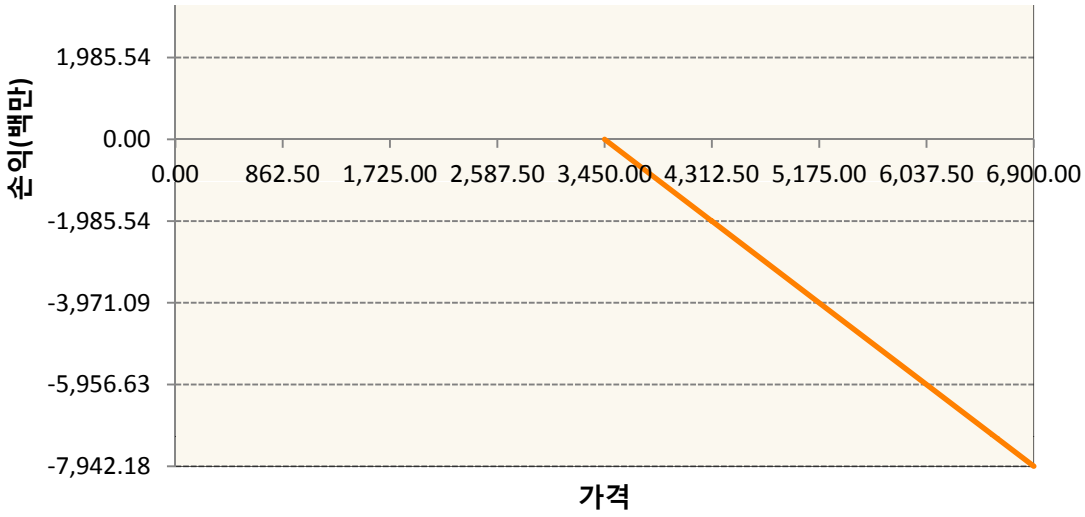
(단위:백만원)

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	7,550	0	7,550	
누계	유가증권	스왑	98,097	0	98,097	장외
누계	유가증권	옵션	0	32,012	-32,012	장내
누계	지수	스왑	52,319	0	52,319	장외

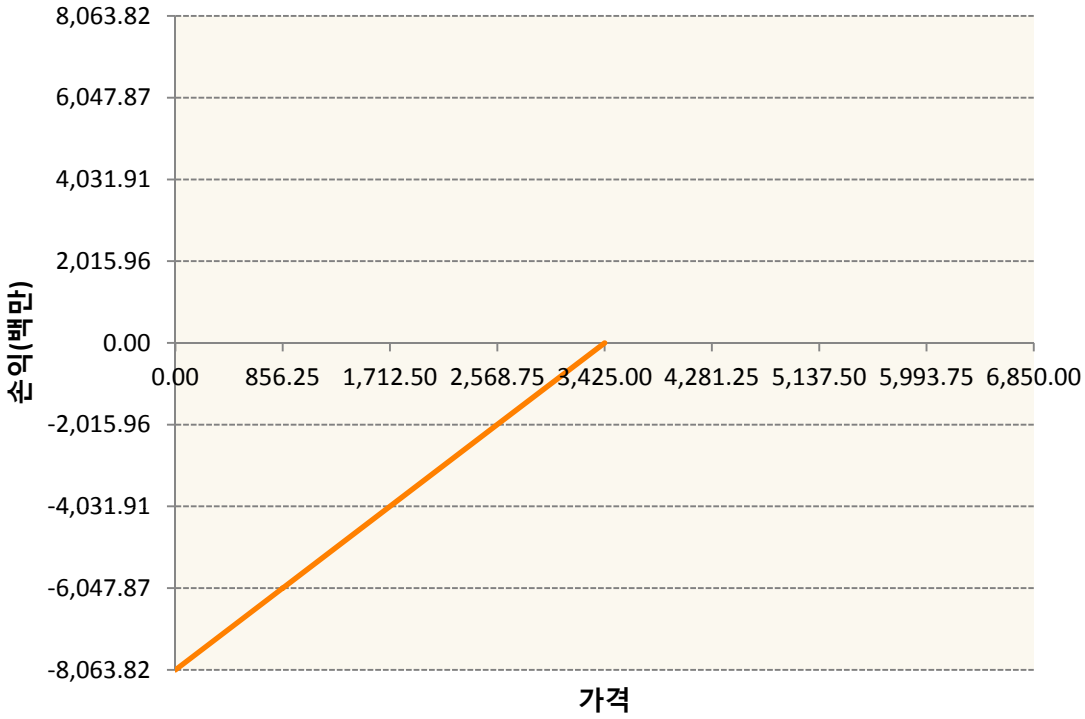
2. 만기시점의 손익구조



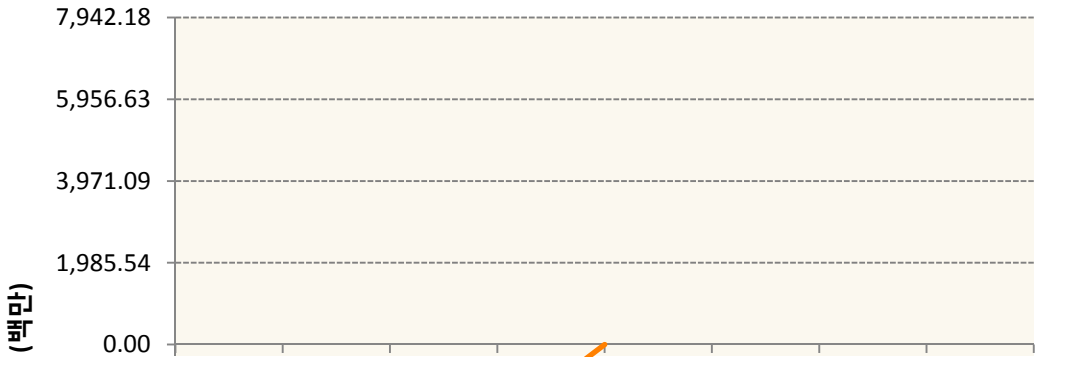


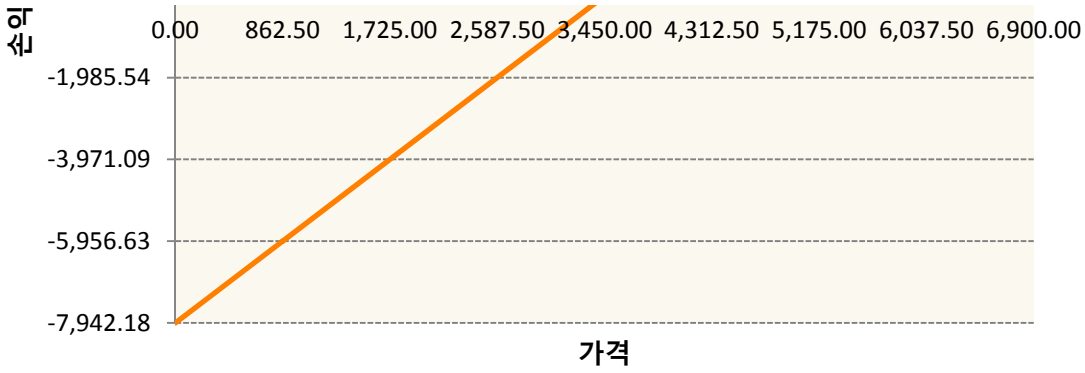


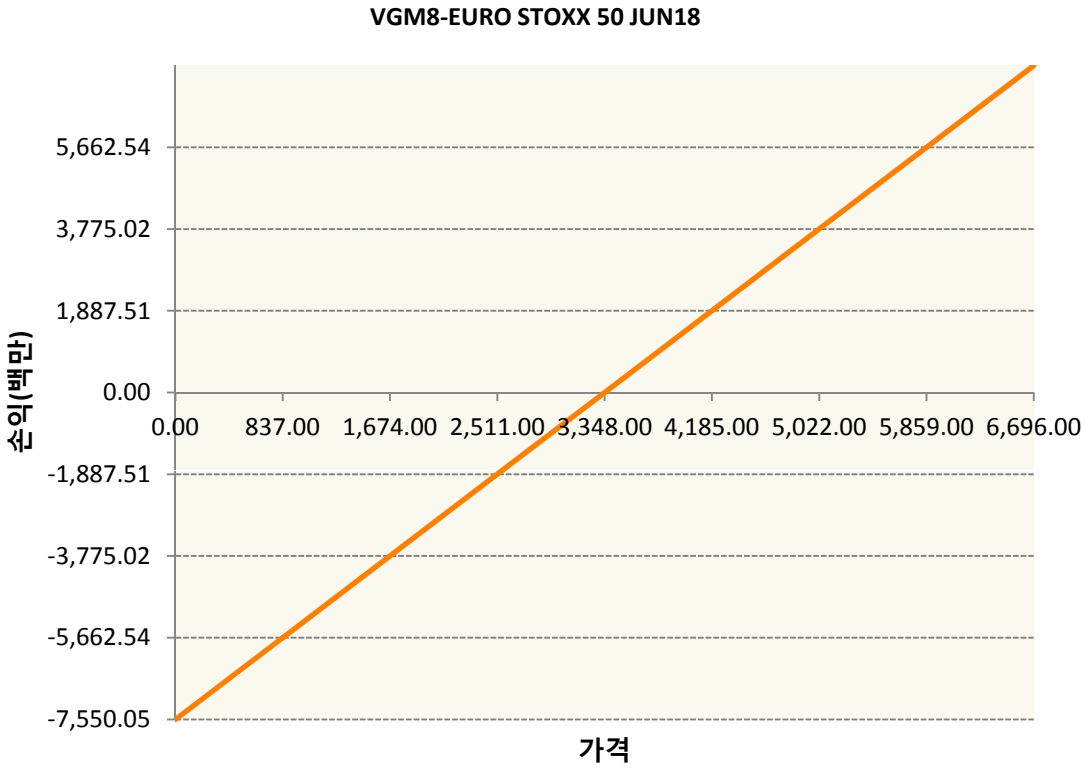
OESXJ8-P3425-EURO STOXX 50



OESXJ8-P3450-EURO STOXX 50







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
260105SGPX	SG EURO Covered CALL STRATEGY - 994.569	144
260105SQPX	SG EURO Covered CALL STRATEGY	269
OESXJ8-C34	EURO STOXX 50	645
OESXJ8-C34	EURO STOXX 50	635
OESXJ8-P34	EURO STOXX 50	645
OESXJ8-P34	EURO STOXX 50	635
VGM8	EURO STOXX 50 JUN18	604

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

2,253

공시일	2018-04-09
기준일	2018-04-06

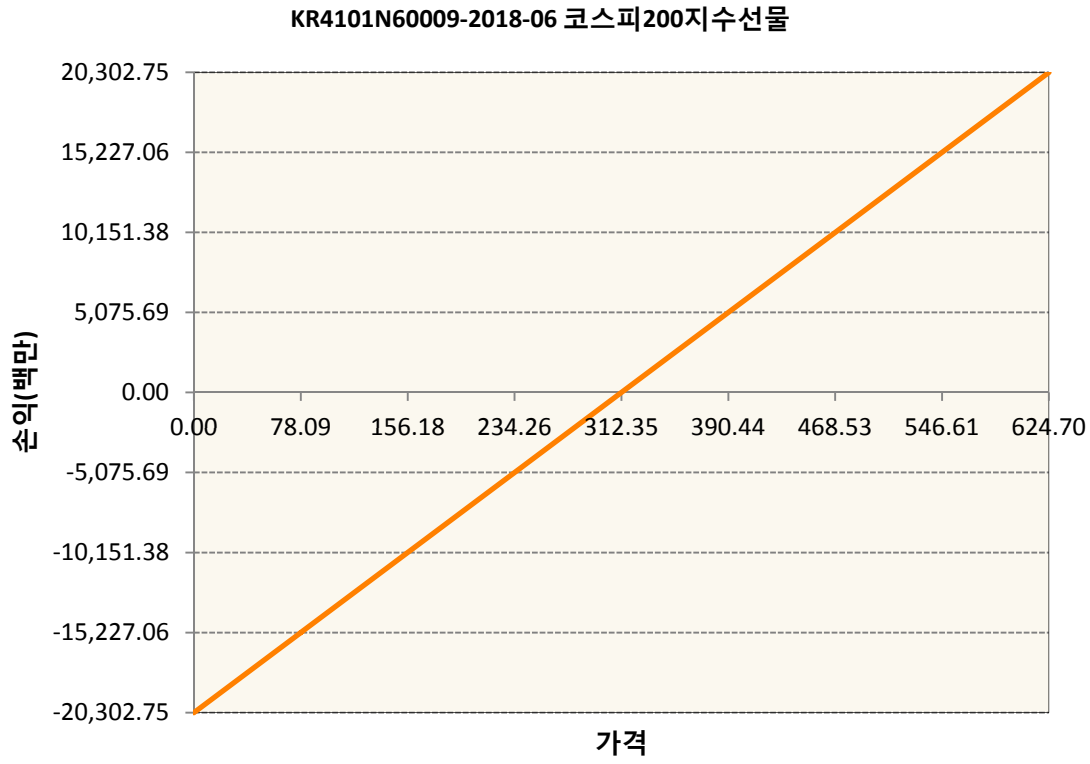
ETF스마트레버리지목표전환형8호

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	20,303	0	20,303	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101N60(2018-06 코스피200지수선물							1,620
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,620	-1,620	-1,620	-1,620	-1,620	-1,620	-1,620
-5.33%	-1,080	-1,080	-1,080	-1,080	-1,080	-1,080	-1,080
-2.67%	-540	-540	-540	-540	-540	-540	-540
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	540	540	540	540	540	540	540
5.33%	1,080	1,080	1,080	1,080	1,080	1,080	1,080
8.00%	1,620	1,620	1,620	1,620	1,620	1,620	1,620

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,183

공시일	2018-04-09
기준일	2018-04-06

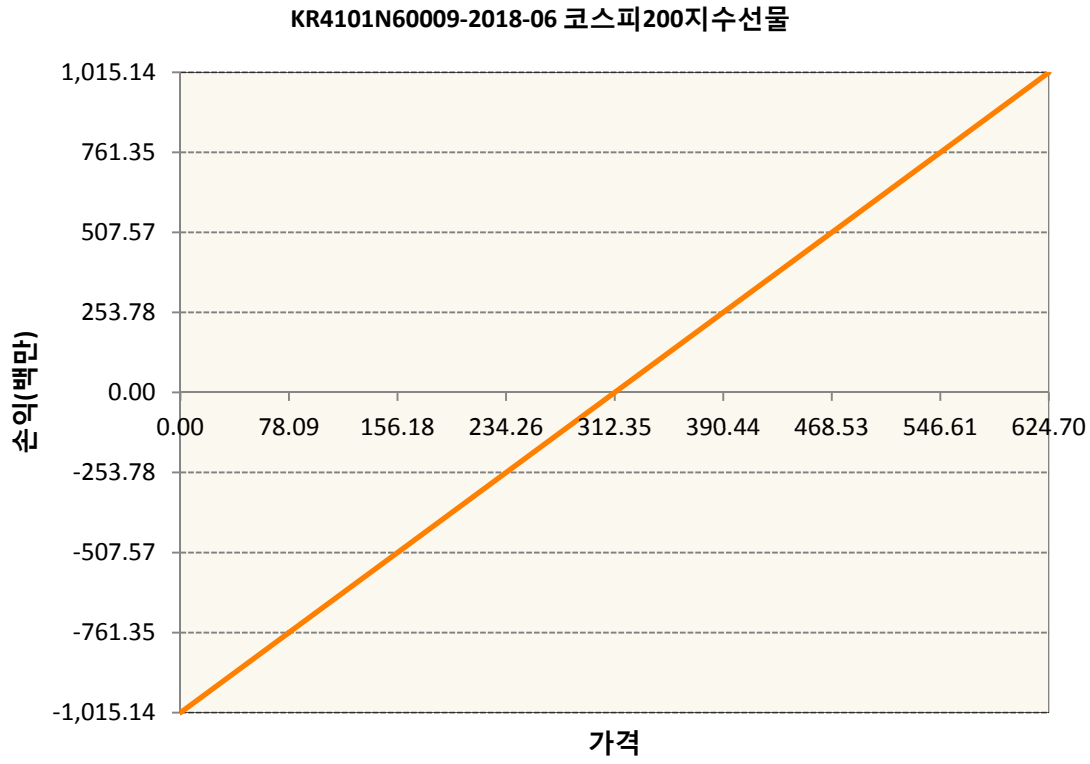
ETF스마트레버리지목표전환형9호

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	1,015	0	1,015	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	2018-04-09
기준일	2018-04-06

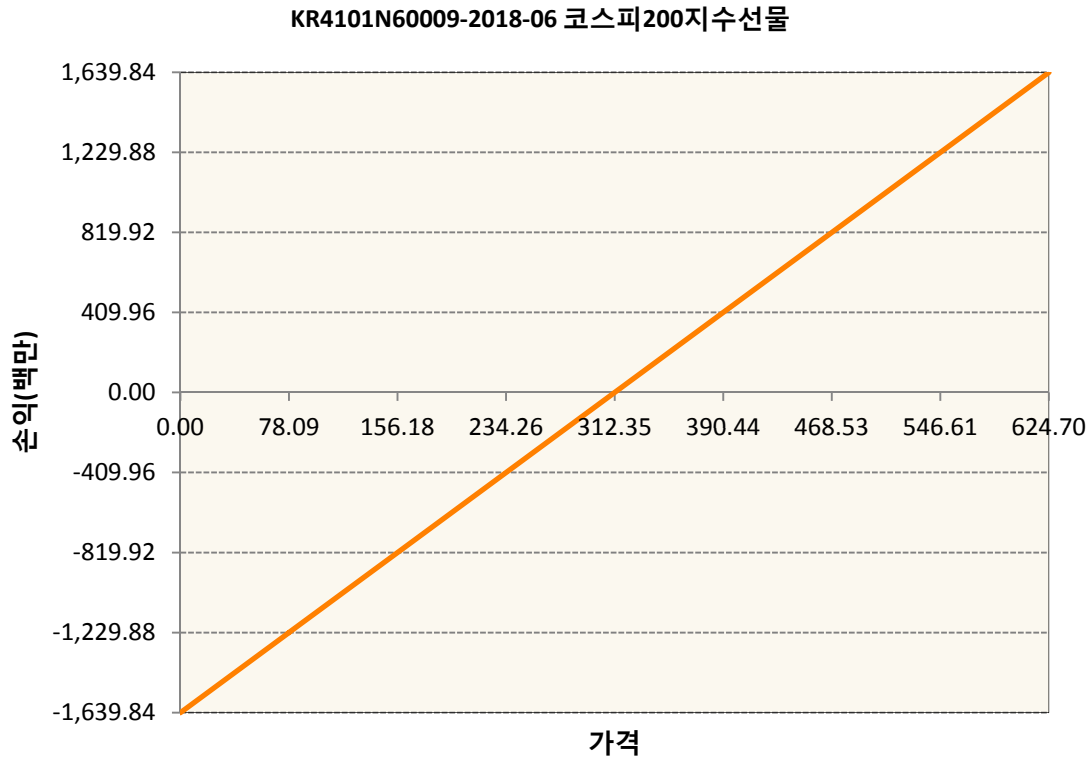
ETF스마트레버리지목표전환형10

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	1,640	0	1,640	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%	-87	-87	-87	-87	-87	-87	-87
-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%	87	87	87	87	87	87	87
8.00%	131	131	131	131	131	131	131

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

96

공시일	2018-04-09
기준일	2018-04-06

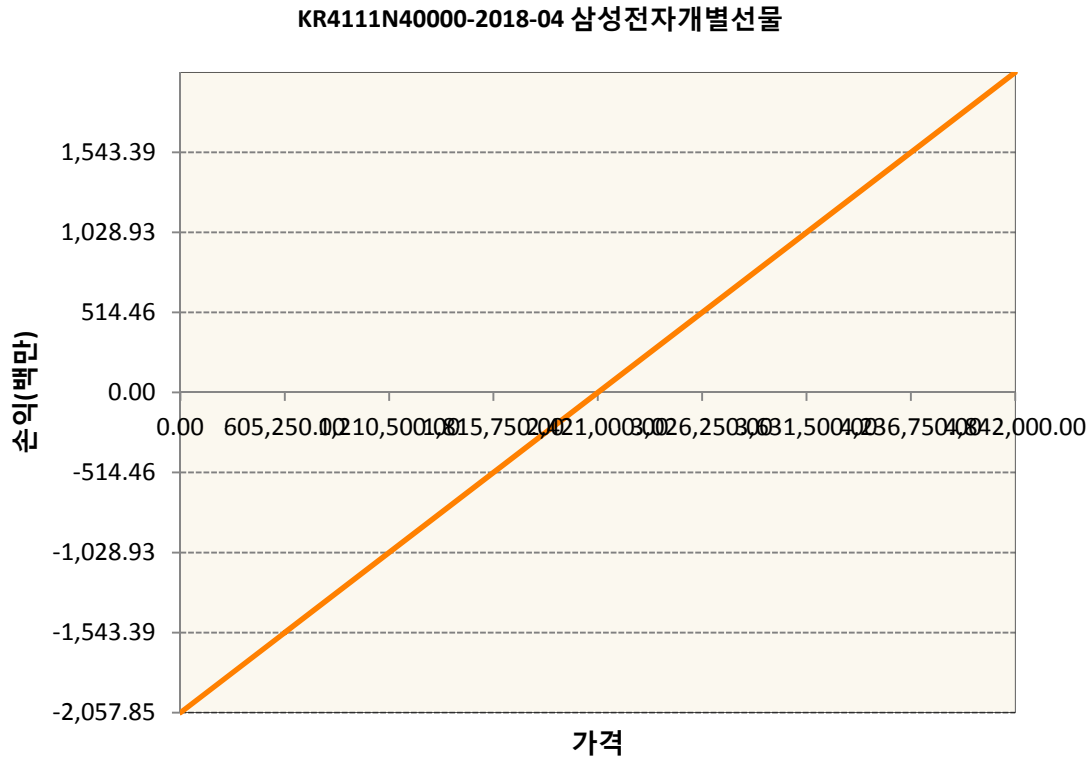
스마트KRX300인덱스1호(주식-파

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	2,058	0	2,058	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4111N40(2018-04 삼성전자개별선물							165
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-165	-165	-165	-165	-165	-165	-165
-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%	165	165	165	165	165	165	165

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

203

공시일	2018-04-09
기준일	2018-04-06

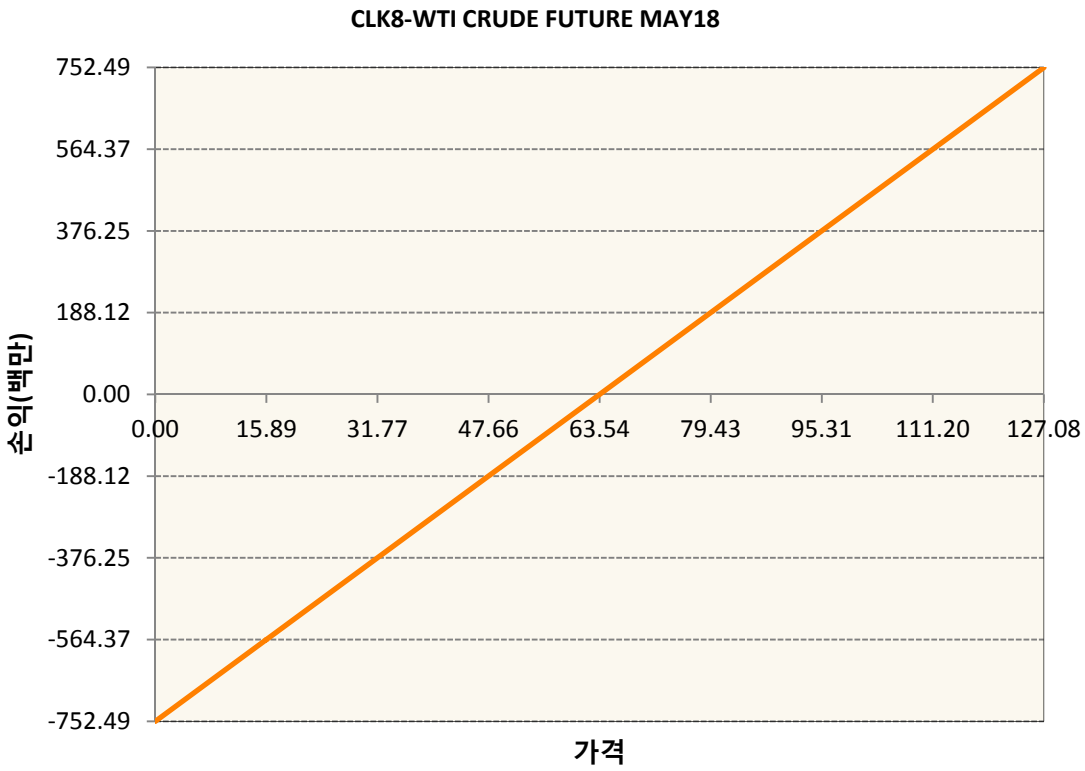
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

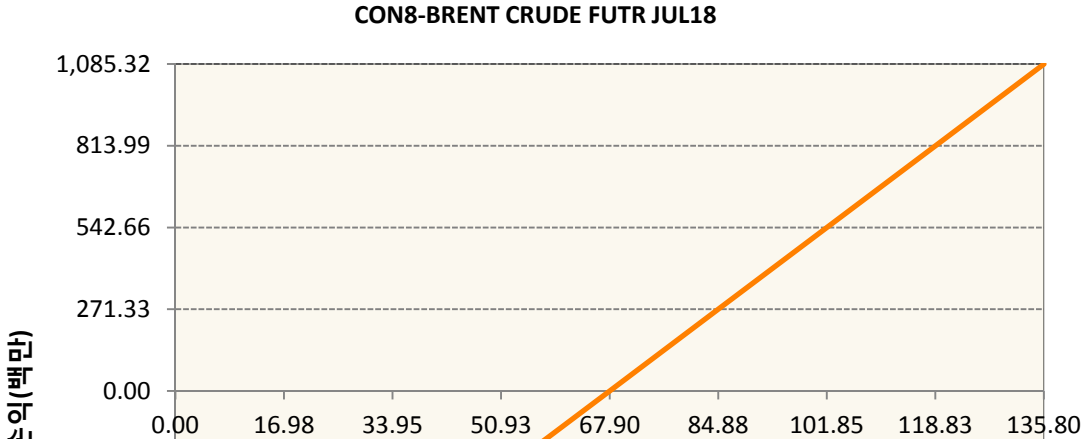
1. 계약금액

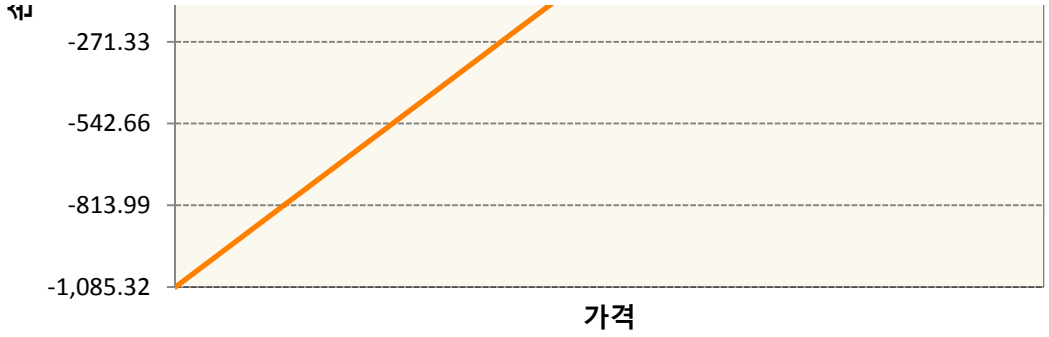
(단위:백만원)

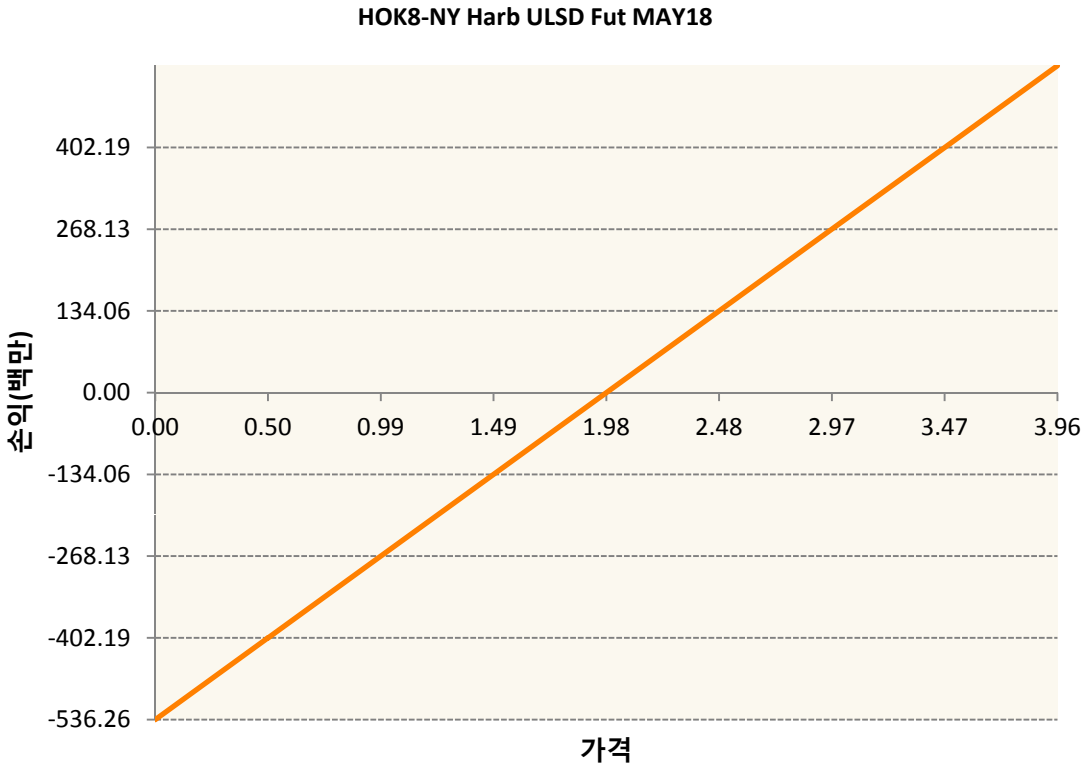
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	선물	유가증권	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	선물	유가증권	752	0	752	
누계	유가증권	선물	3,197	588	2,609	

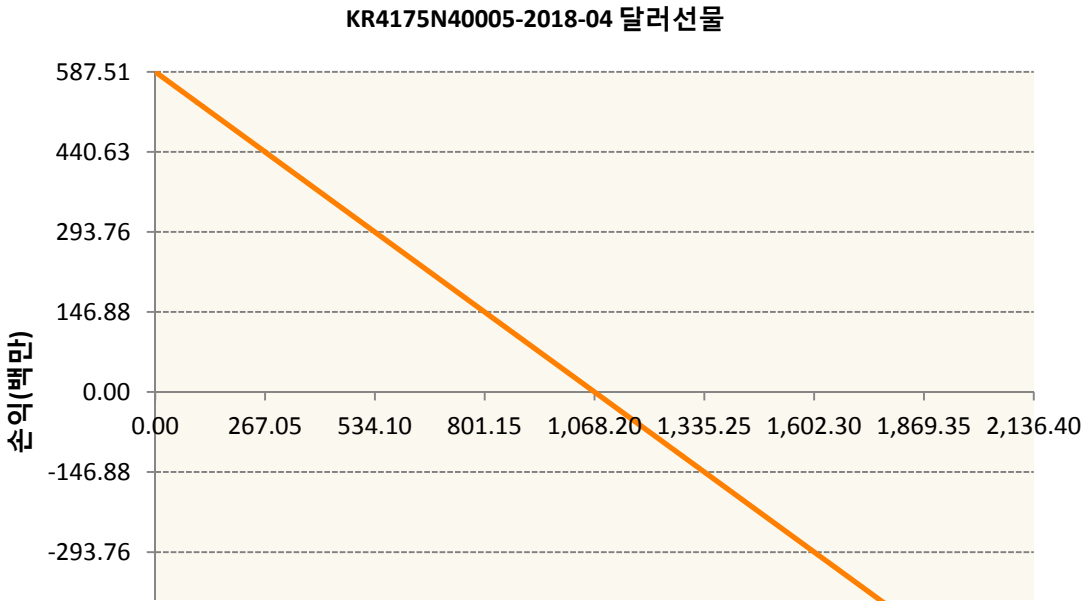
2. 만기시점의 손익구조

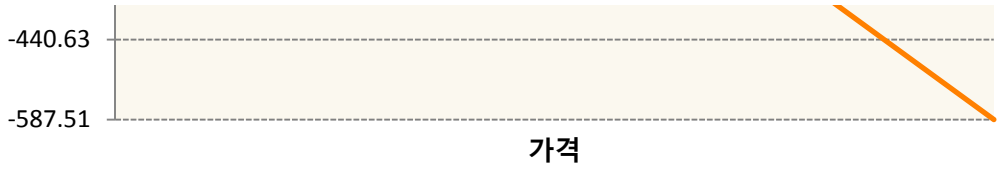


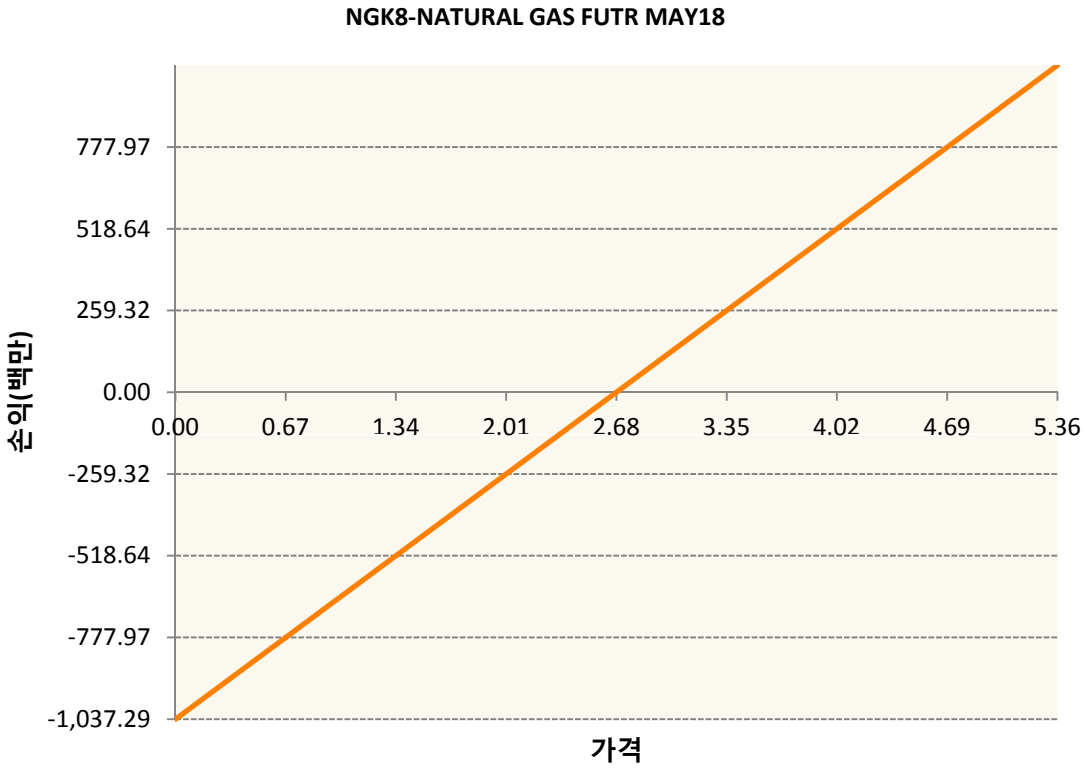


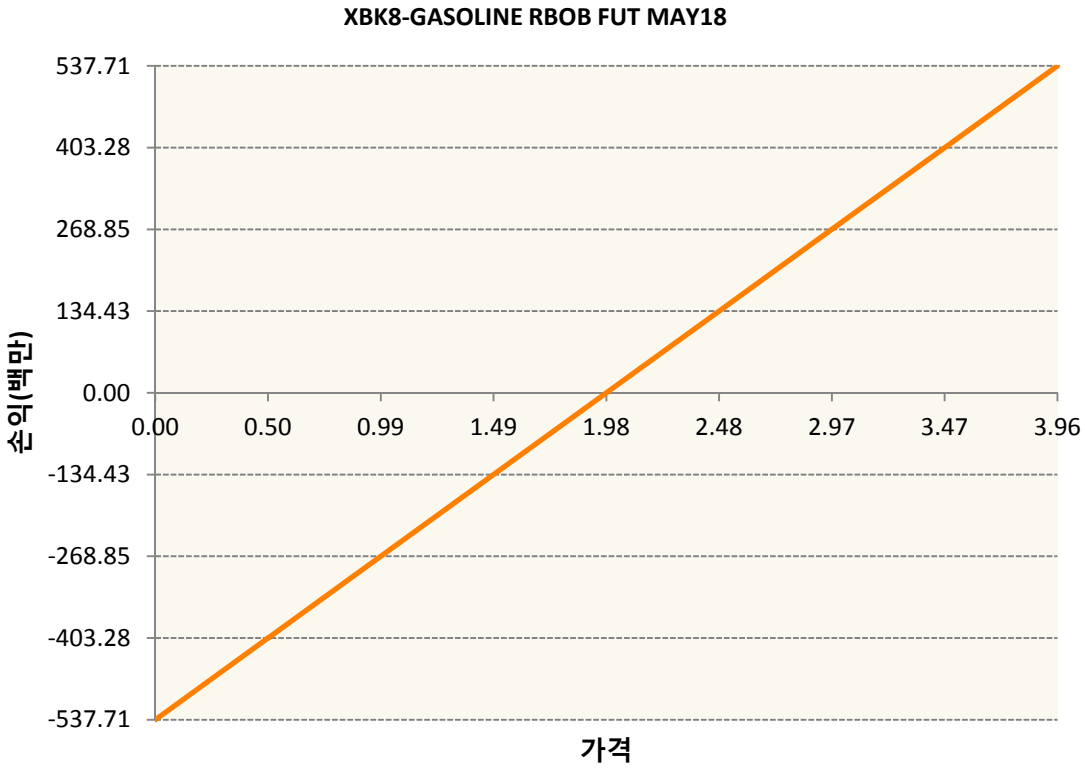

-271.33
-542.66
-813.99
-1,085.32
가격


HOK8-NY Harb ULSD Fut MAY18
402.19
268.13
134.06
0.00
-134.06
-268.13
-402.19
-536.26
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
587.51
440.63
293.76
146.88
0.00
-146.88
-293.76
0.00
267.05
534.10
801.15
1,068.20
1,335.25
1,602.30
1,869.35
2,136.40
손익(백만)


-440.63
-587.51
가격


NGK8-NATURAL GAS FUTR MAY18
777.97
518.64
259.32
0.00
-259.32
-518.64
-777.97
-1,037.29
0.00
0.67
1.34
2.01
2.68
3.35
4.02
4.69
5.36
손익(백만)
가격


XBK8-GASOLINE RBOB FUT MAY18
537.71
403.28
268.85
134.43
0.00
-134.43
-268.85
-403.28
-537.71
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	87
HOK8	NY Harb ULSD Fut MAY18	43
KR4175N40(	2018-04 달러선물	47
NGK8	NATURAL GAS FUTR MAY18	83
XBK8	GASOLINE RBOB FUT MAY18	43

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

506

공시일	2018-04-09
기준일	2018-04-06

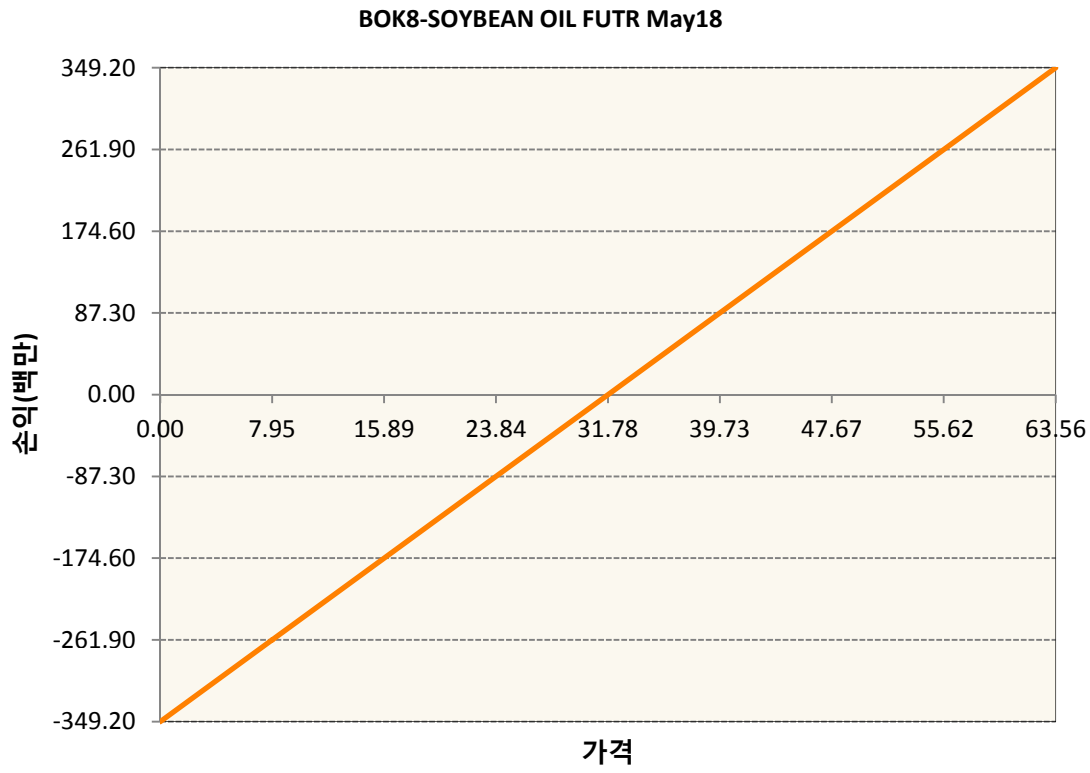
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

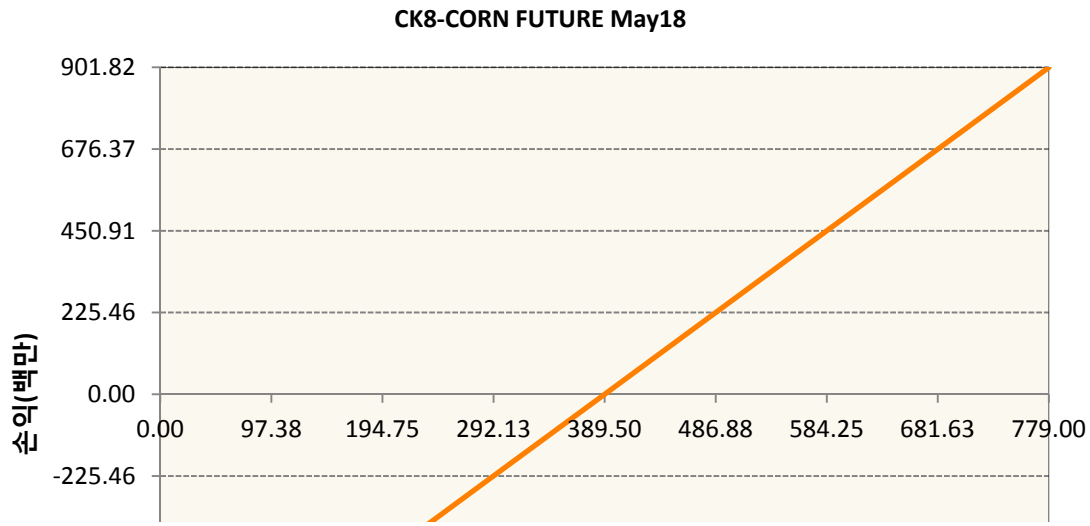
1. 계약금액

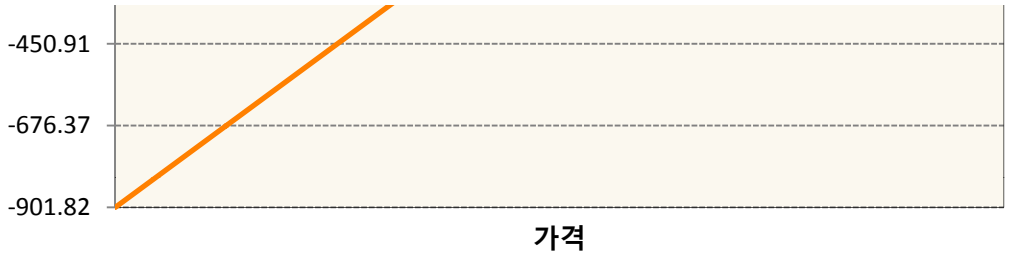
(단위:백만원)

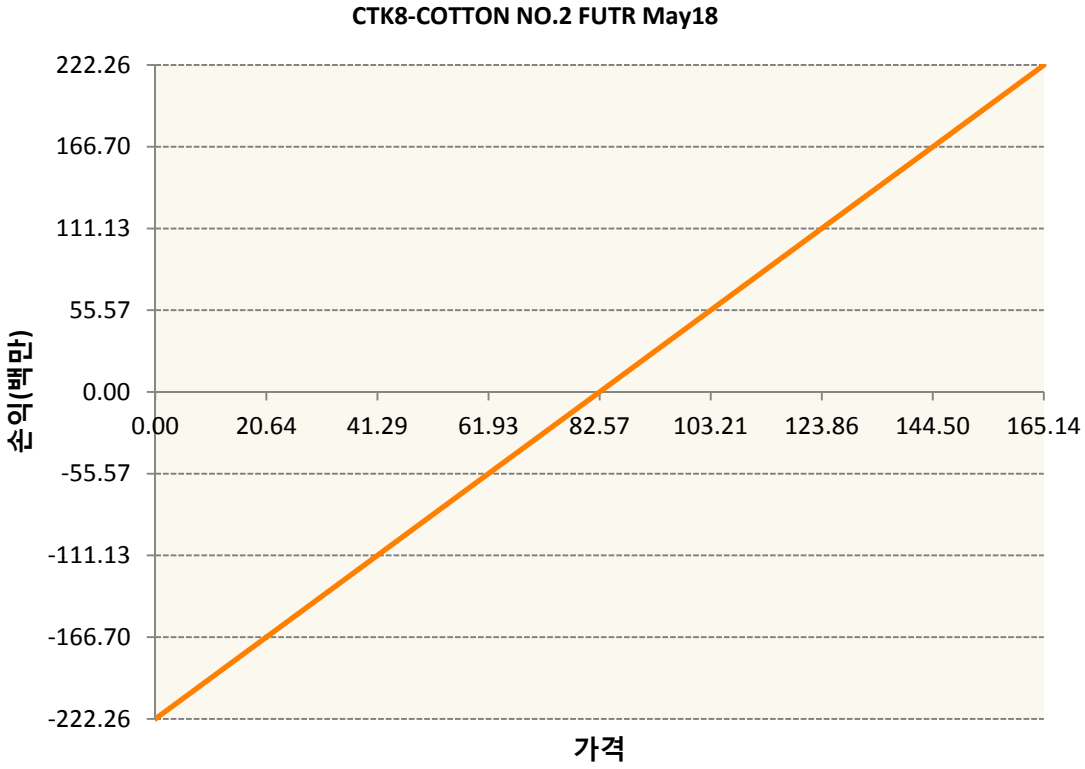
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	4,131	320	3,810	

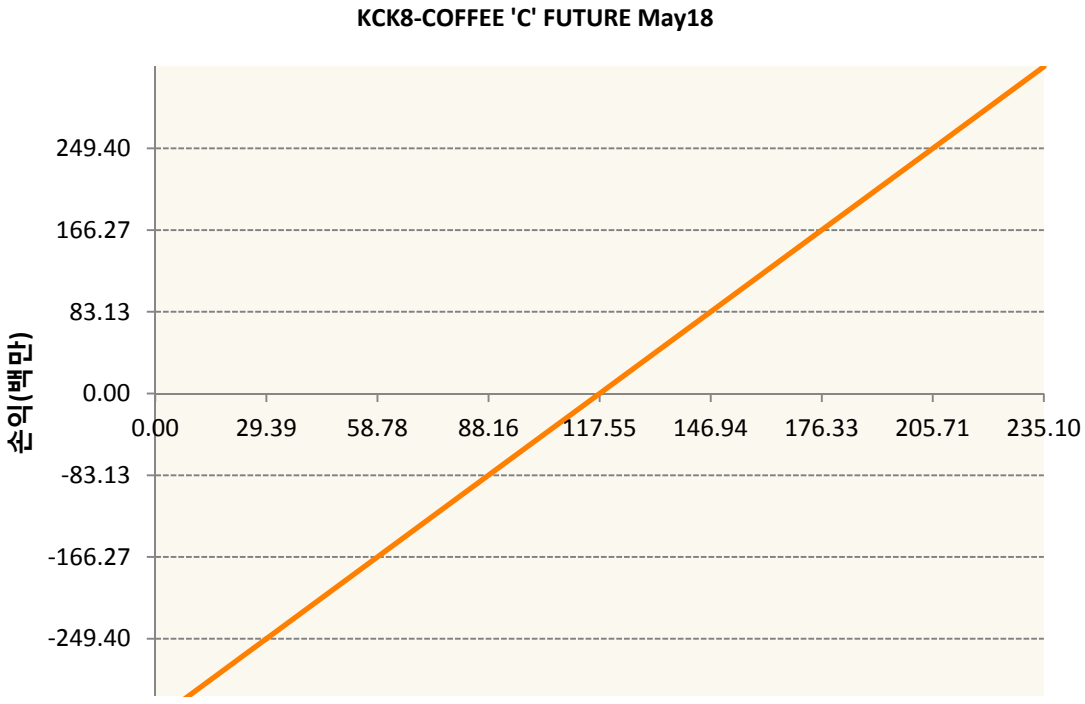
2. 만기시점의 손익구조

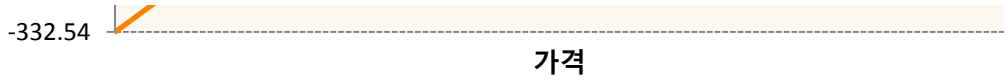


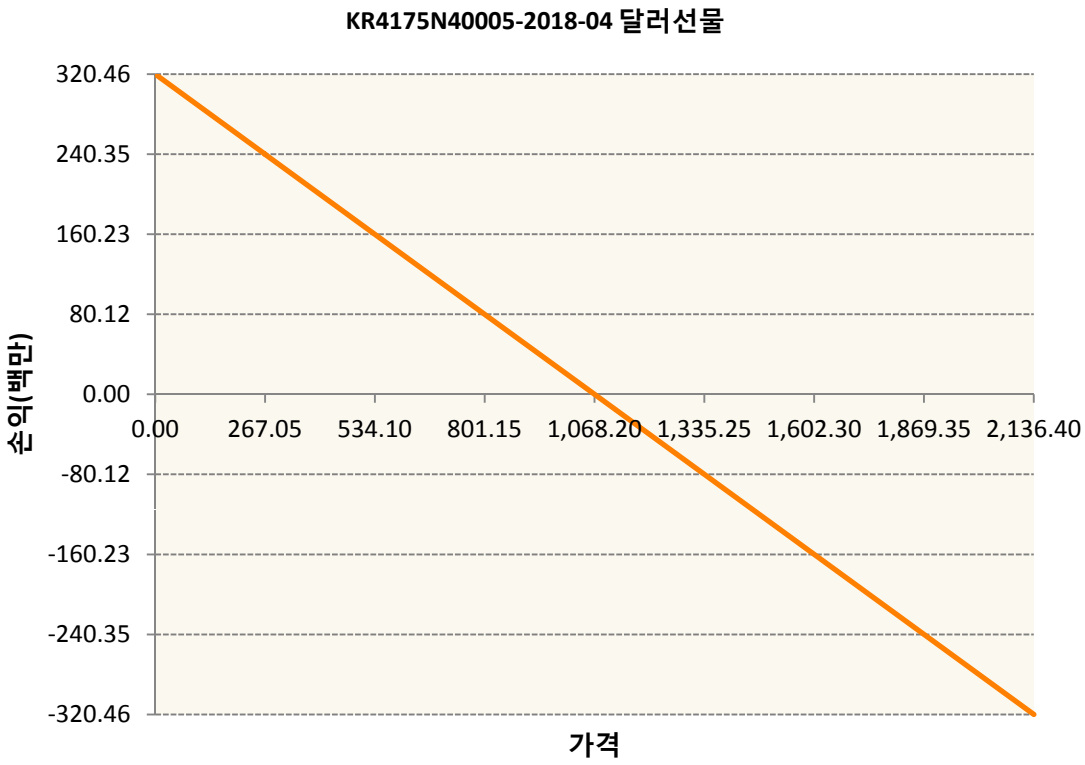


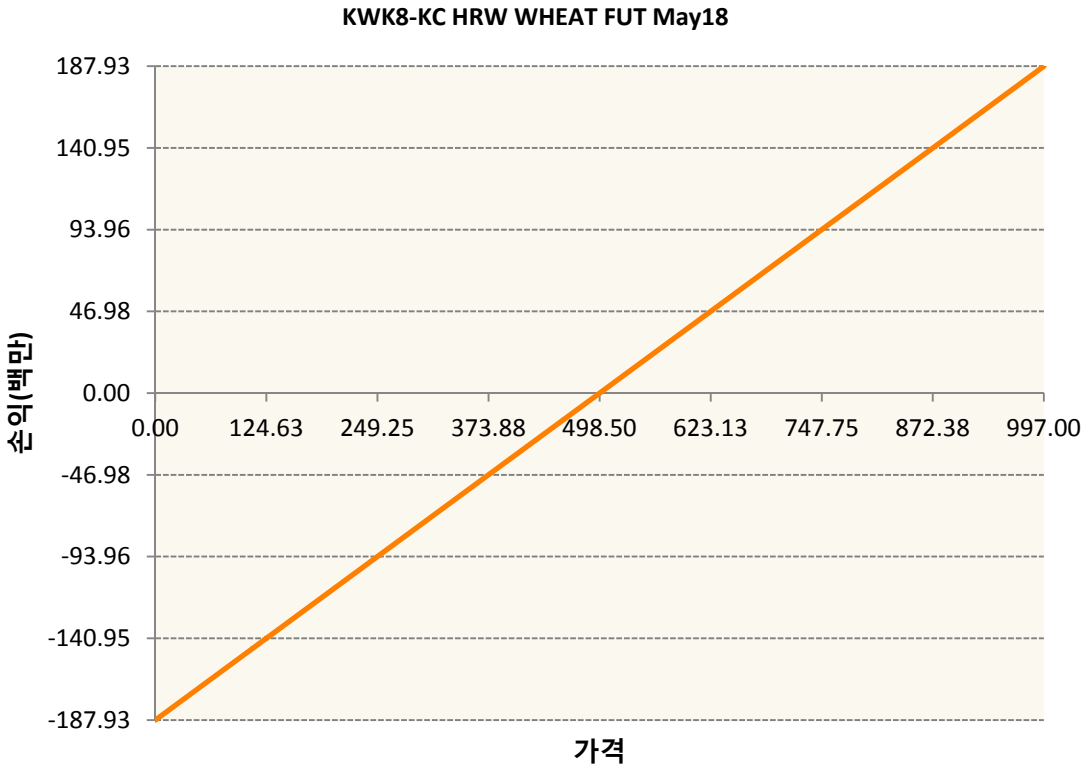

-450.91
-676.37
-901.82
가격


CTK8-COTTON NO.2 FUTR May18
222.26
166.70
111.13
55.57
0.00
-55.57
-111.13
-166.70
-222.26
0.00
20.64
41.29
61.93
82.57
103.21
123.86
144.50
165.14
손익(백만)
가격

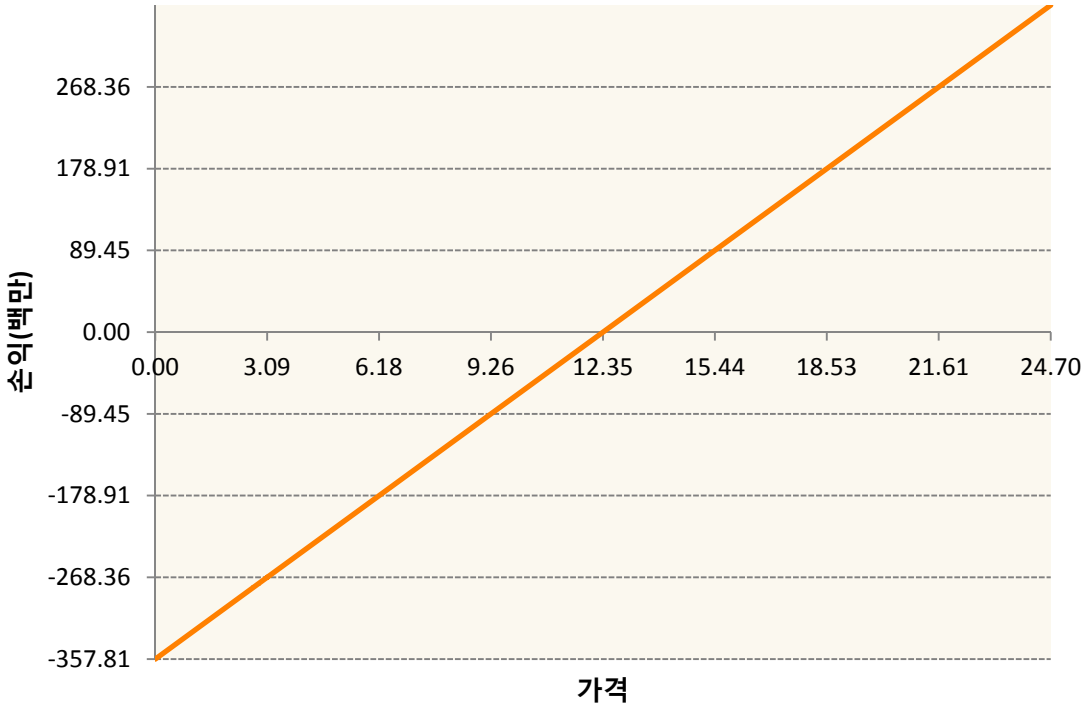

KCK8-COFFEE 'C' FUTURE May18
249.40
166.27
83.13
0.00
-83.13
-166.27
-249.40
0.00
29.39
58.78
88.16
117.55
146.94
176.33
205.71
235.10
손익(백만)


-332.54
가격

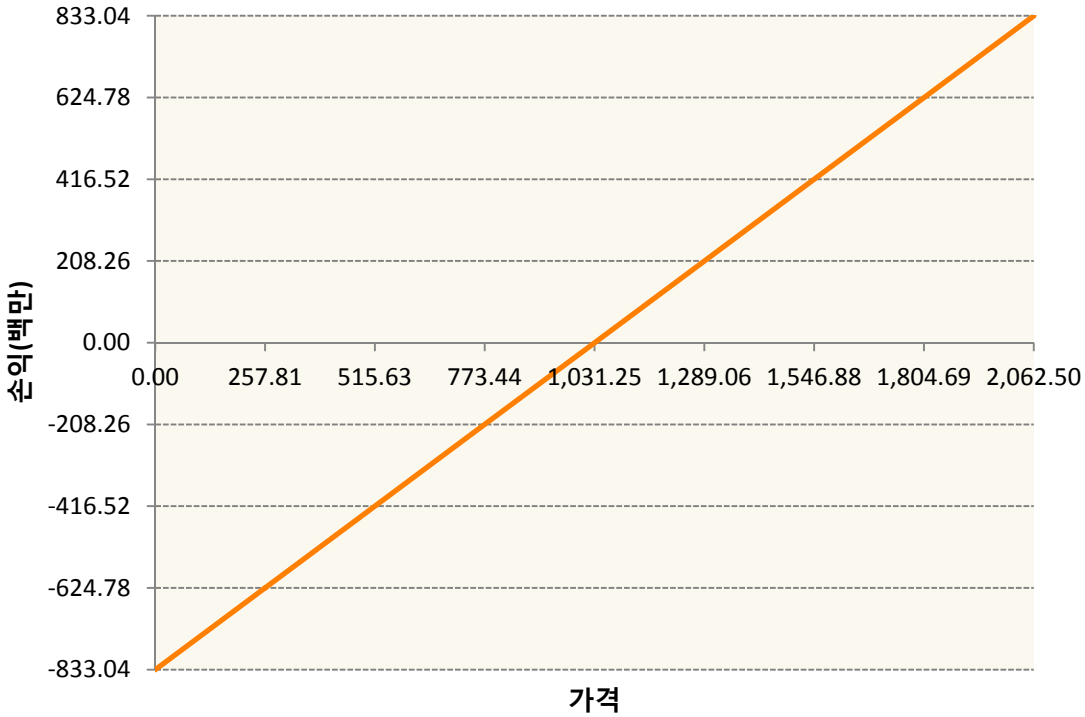

KR4175N40005-2018-04 달러선물
320.46
240.35
160.23
80.12
0.00
-80.12
-160.23
-240.35
-320.46
0.00
267.05
534.10
801.15
1,068.20
1,335.25
1,602.30
1,869.35
2,136.40
손익(백만)
가격


KWK8-KC HRW WHEAT FUT May18
187.93
140.95
93.96
46.98
0.00
-46.98
-93.96
-140.95
-187.93
0.00
124.63
249.25
373.88
498.50
623.13
747.75
872.38
997.00
손익(백만)
가격

SBK8-SUGAR #11 (WORLD) May18

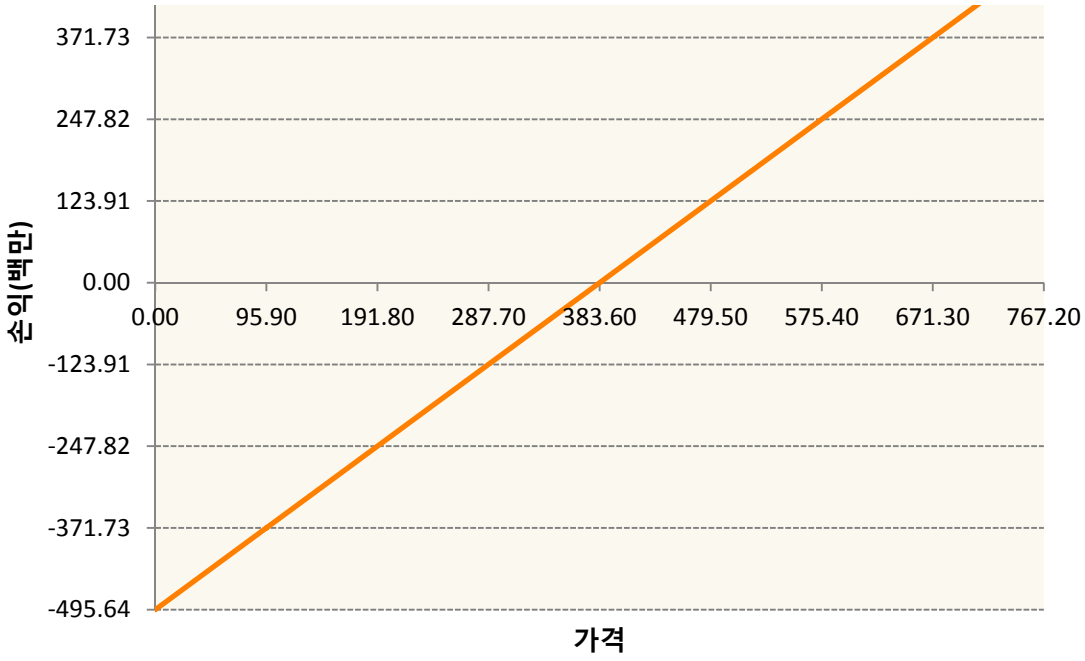


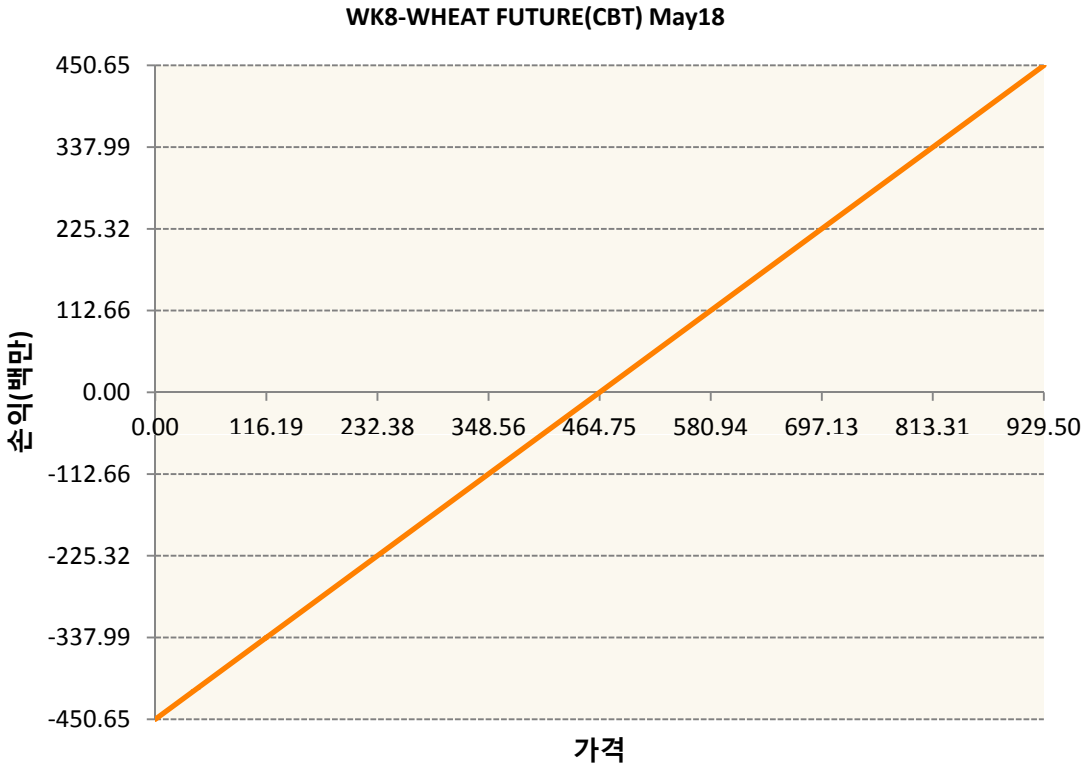
SK8-SOYBEAN FUTRUE May18



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	18
KCK8	COFFEE 'C' FUTURE May18	27
KR4175N40(	2018-04 달러선물	26

KWK8	KC HRW WHEAT FUT May18	15
SBK8	SUGAR #11 (WORLD) May18	29
SK8	SOYBEAN FUTRUE May18	67
SMK8	SOYBEAN MEAL FUTR May18	40
WK8	WHEAT FUTURE(CBT) May18	36

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

335