공시일	2018-04-10
기준일	2018-04-09

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	2018-04-10
기준일	2018-04-09

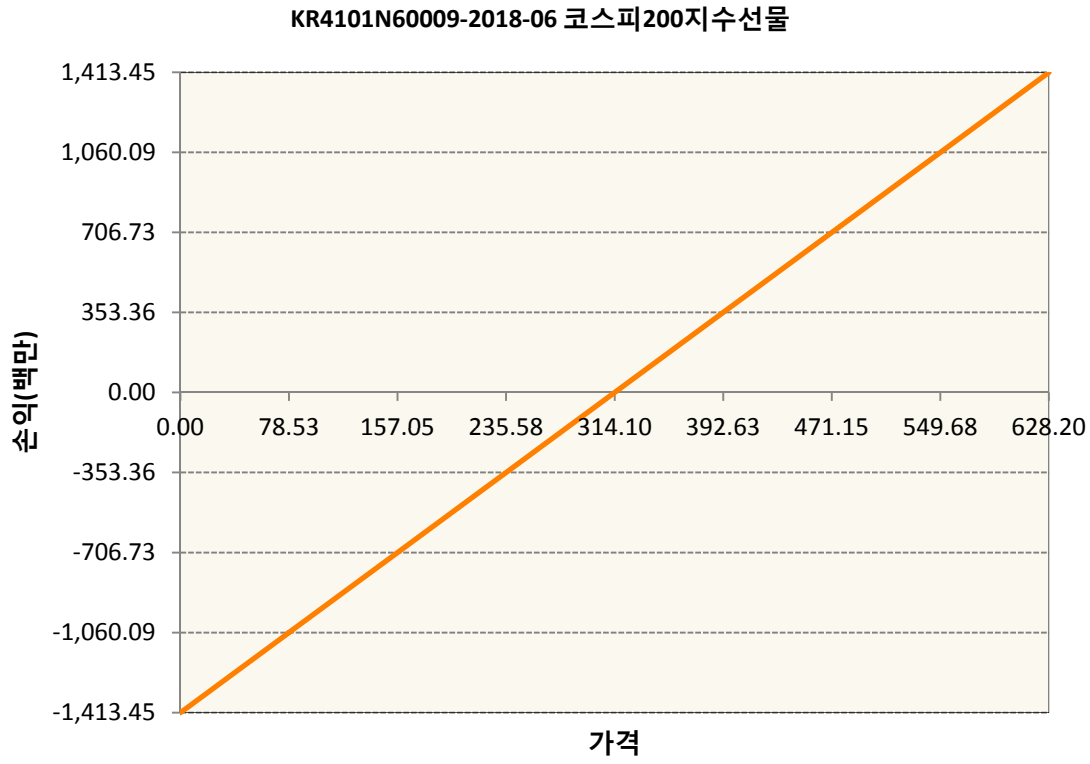
스마트인덱스모

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	2018-04-10
기준일	2018-04-09

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	1,080

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

435

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2018-04-10
기준일	2018-04-09

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)

435

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2018-04-10
기준일	2018-04-09

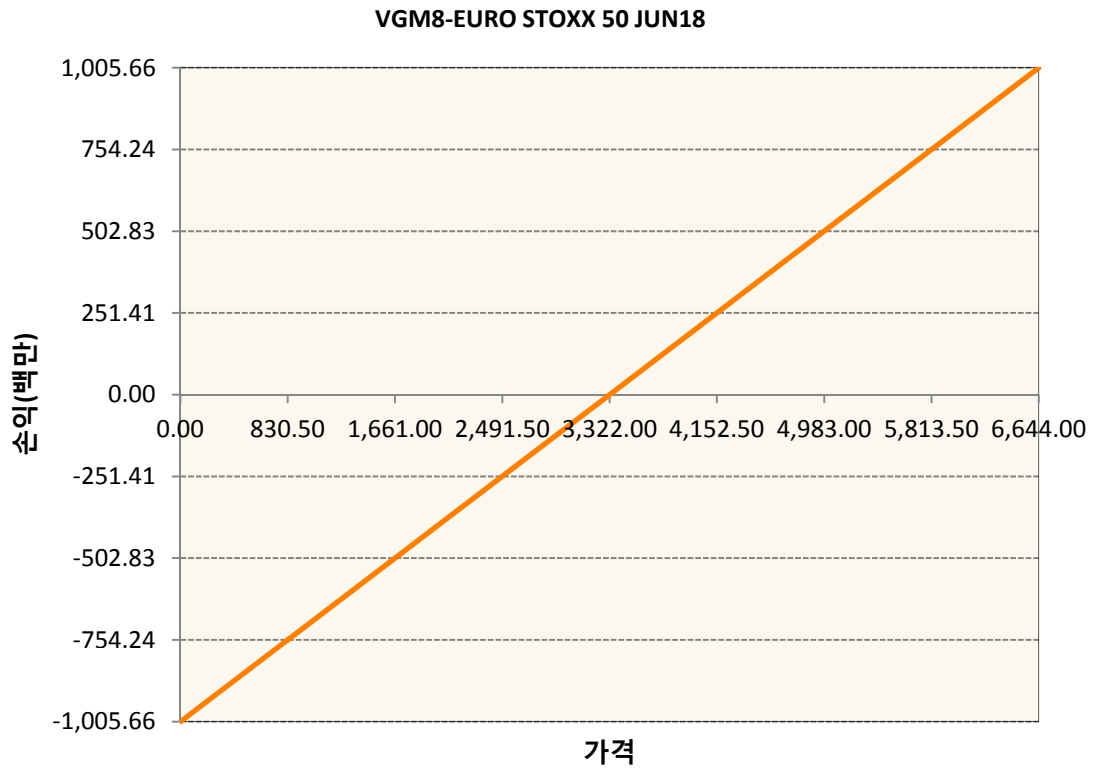
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,006	0	1,006	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGM8	EURO STOXX 50 JUN18	80

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

(단위:백만원)

49

공시일	2018-04-10
기준일	2018-04-09

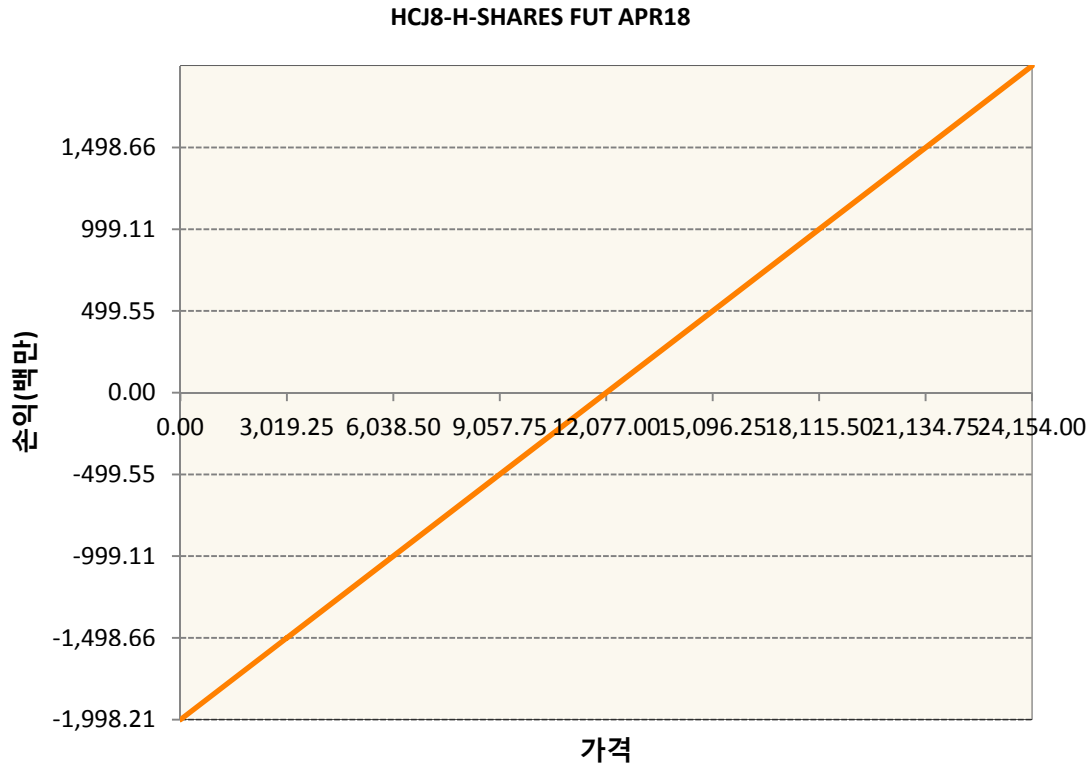
차이나인덱스모(주식-파생형)

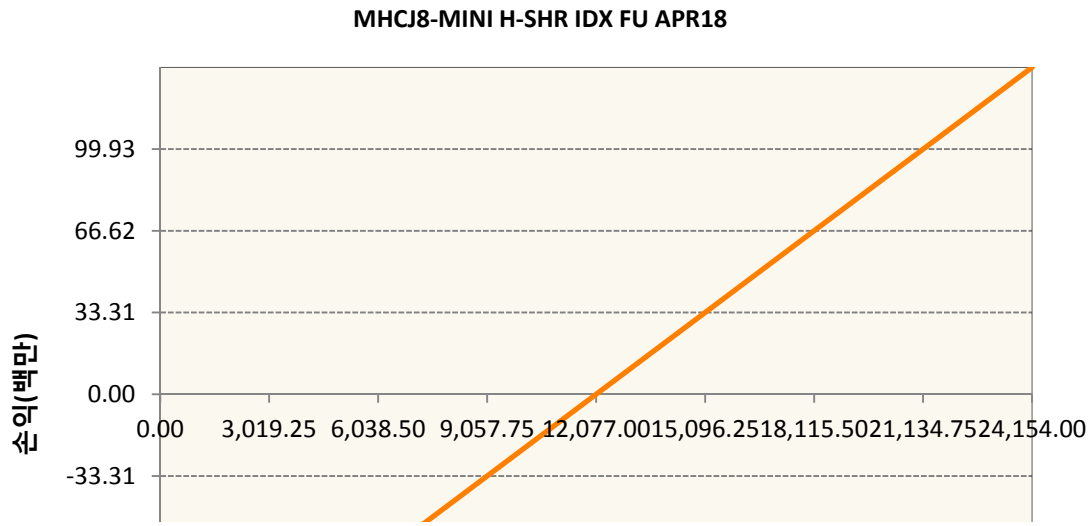
1. 계약금액

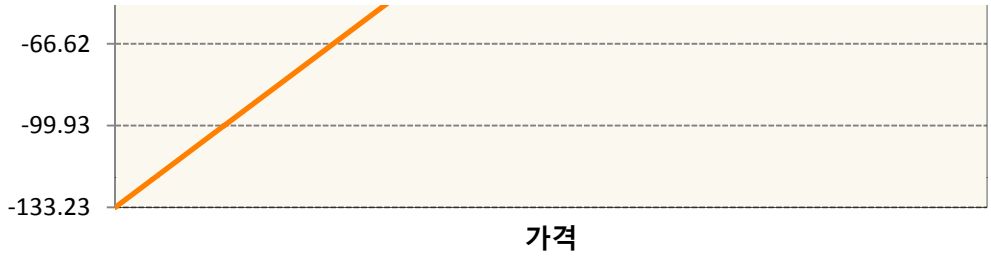
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,131	0	2,131	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCJ8	H-SHARES FUT APR18	160
MHCJ8	MINI H-SHR IDX FU APR18	11

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

공시일	2018-04-10
기준일	2018-04-09

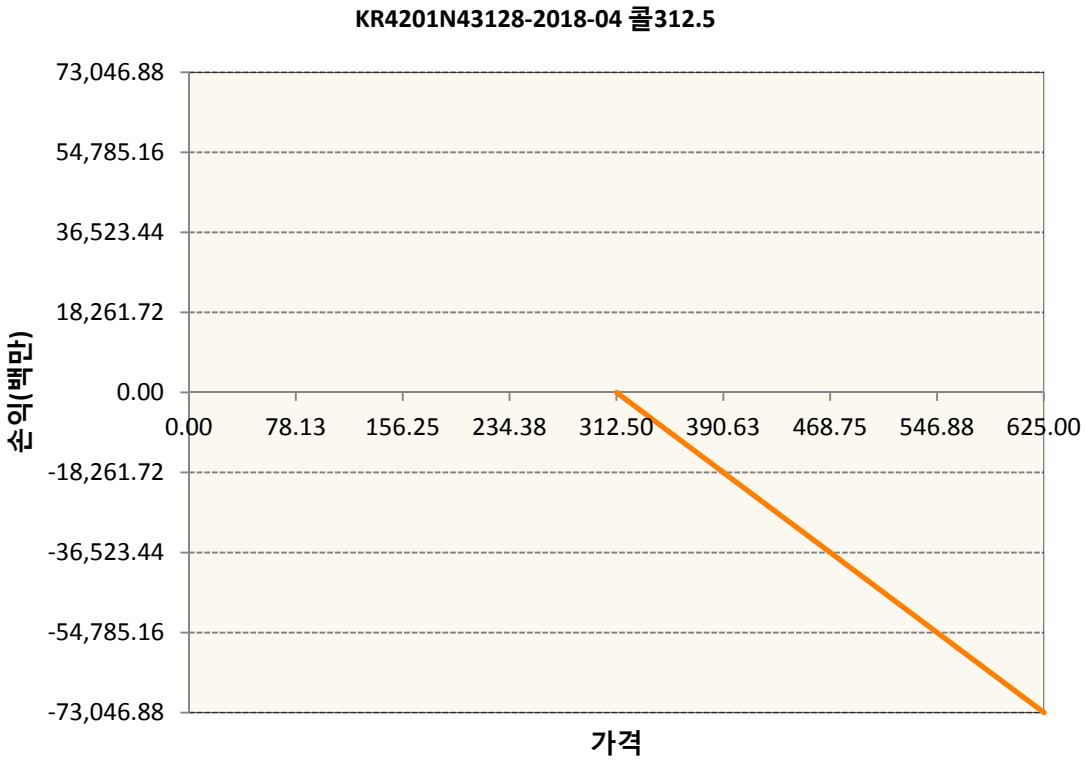
커버드콜모(주식혼합-파생형)

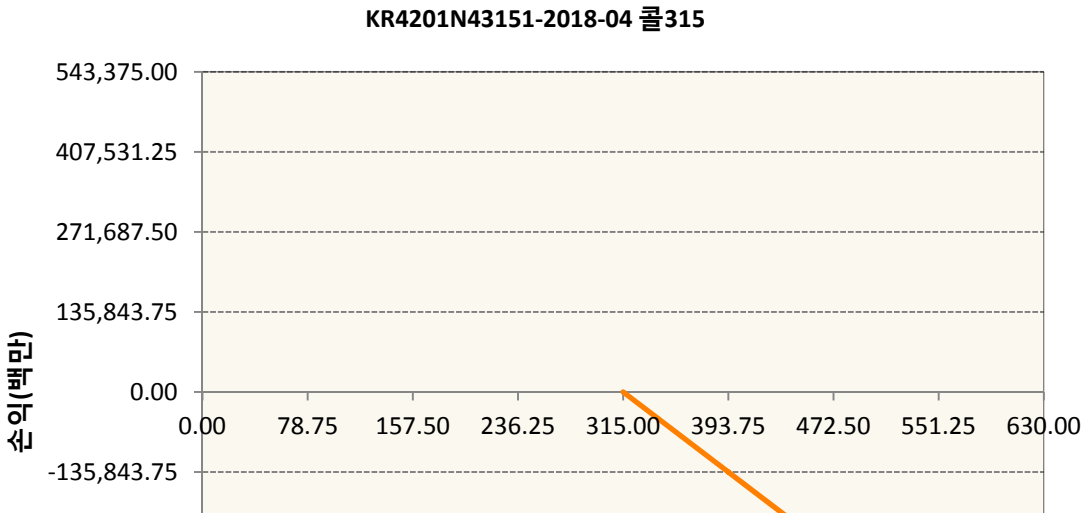
1. 계약금액

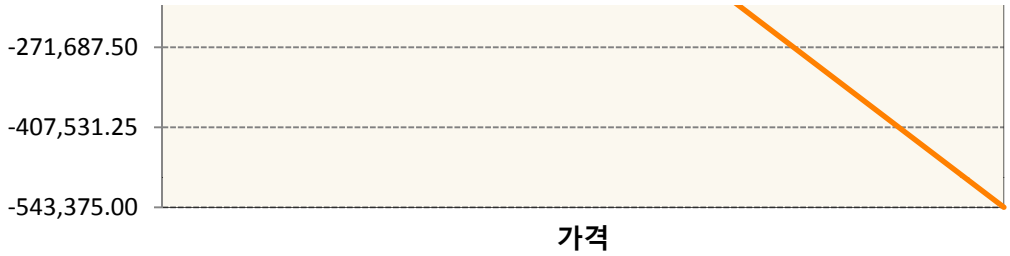
(단위:백만원)

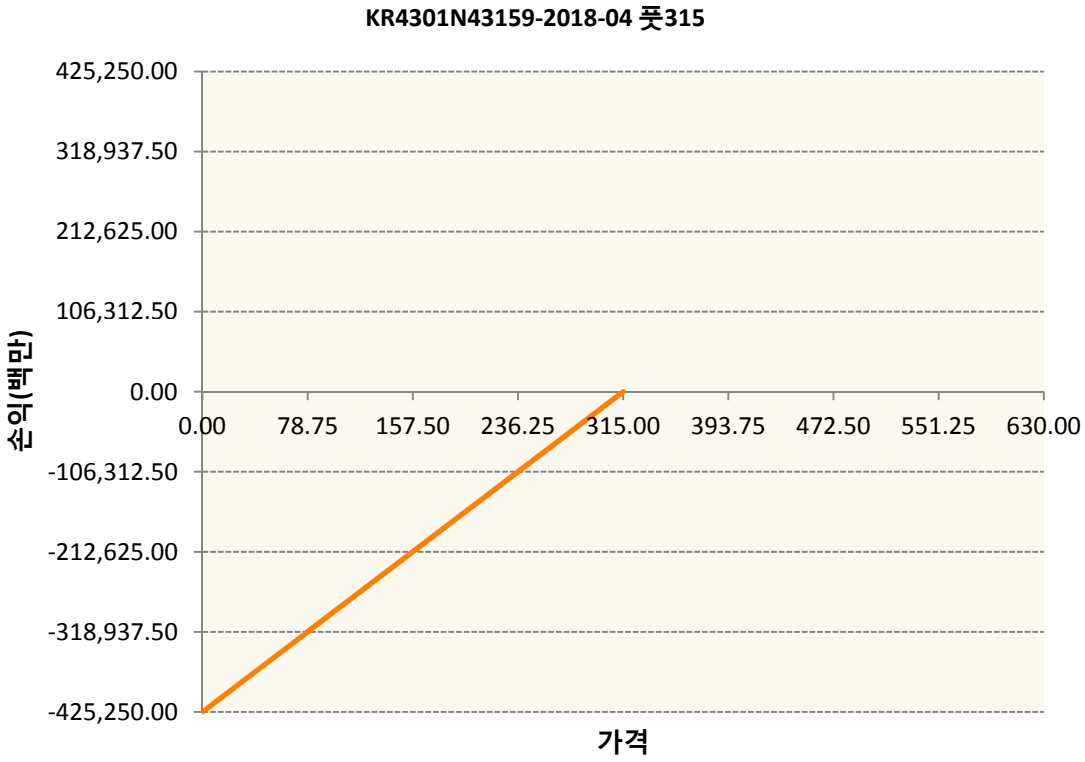
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	1,041,672	-1,041,672	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201N4312018-04 콜312.5							5,227
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	861	861	861	861	860	859	857
-5.33%	860	858	853	847	838	826	811
-2.67%	792	762	727	690	649	606	561
0%	184	123	62	0	-62	-123	-185
2.67%	-1,354	-1,376	-1,402	-1,433	-1,467	-1,504	-1,544
5.33%	-3,270	-3,272	-3,275	-3,280	-3,287	-3,297	-3,310
8.00%	-5,223	-5,223	-5,223	-5,223	-5,224	-5,225	-5,227
KR4201N4312018-04 콜315							36,375
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	4,285	4,285	4,285	4,284	4,282	4,278	4,271

-5.33%	4,282	4,277	4,264	4,241	4,206	4,154	4,086
-2.67%	4,084	3,954	3,791	3,598	3,378	3,135	2,870
0%	1,345	899	450	0	-452	-905	-1,358
2.67%	-8,162	-8,428	-8,722	-9,039	-9,375	-9,728	-10,093
5.33%	-21,909	-21,940	-21,991	-22,066	-22,164	-22,287	-22,434
8.00%	-36,302	-36,302	-36,305	-36,311	-36,324	-36,344	-36,375
KR4301N4312018-04 풋315							32,161

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-32,161	-32,161	-32,161	-32,161	-32,161	-32,161	-32,161
-5.33%	-20,879	-20,879	-20,879	-20,879	-20,879	-20,879	-20,881
-2.67%	-9,600	-9,607	-9,619	-9,640	-9,669	-9,707	-9,756
0%	606	407	205	0	-206	-414	-623
2.67%	3,711	3,664	3,603	3,527	3,437	3,336	3,223
5.33%	3,772	3,771	3,771	3,770	3,767	3,761	3,752
8.00%	3,772	3,772	3,772	3,772	3,772	3,772	3,771

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

95,378

공시일	2018-04-10
기준일	2018-04-09

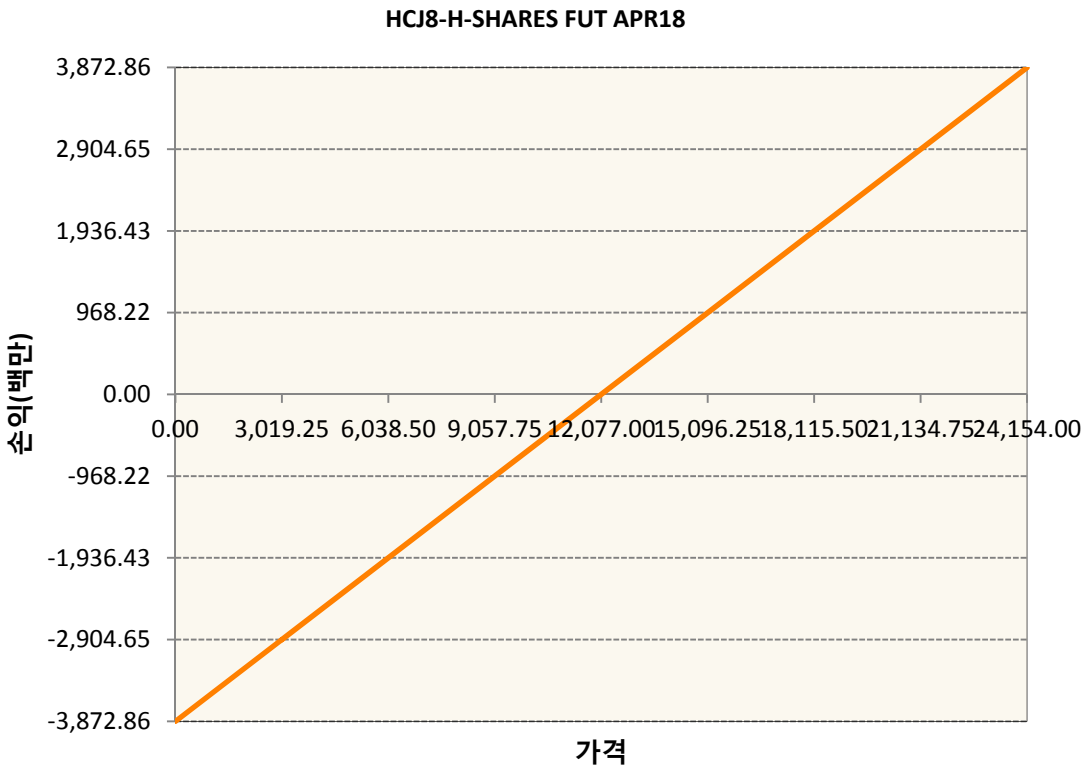
홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생

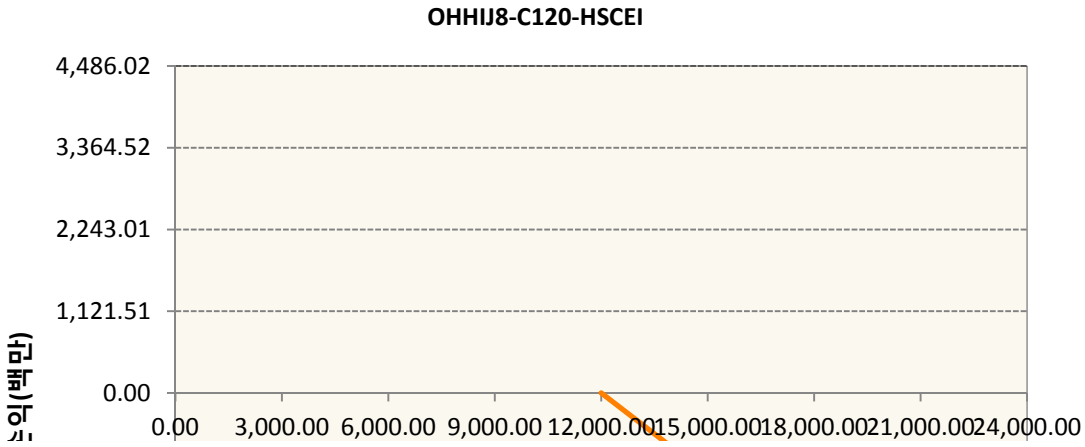
1. 계약금액

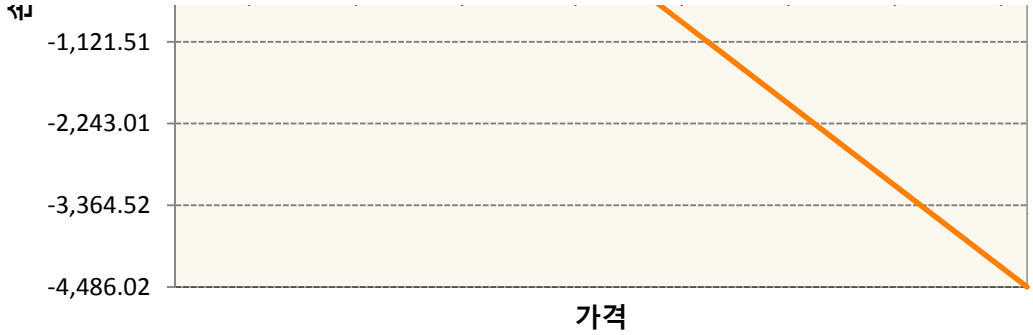
(단위:백만원)

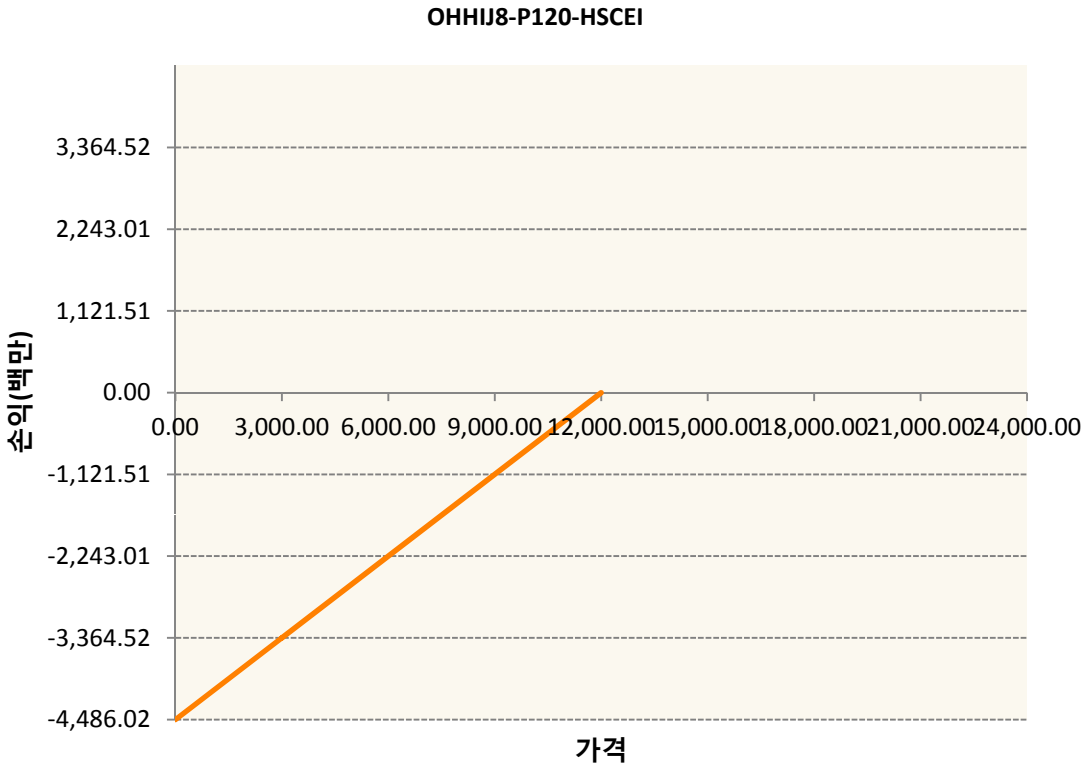
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	3,873	0	3,873	장내
누계	유가증권	옵션	0	8,972	-8,972	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCJ8	H-SHARES FUT APR18	310
OHHIJ8-C12	HSCEI	359
OHHIJ8-P12	HSCEI	359

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	901

공시일	2018-04-10
기준일	2018-04-09

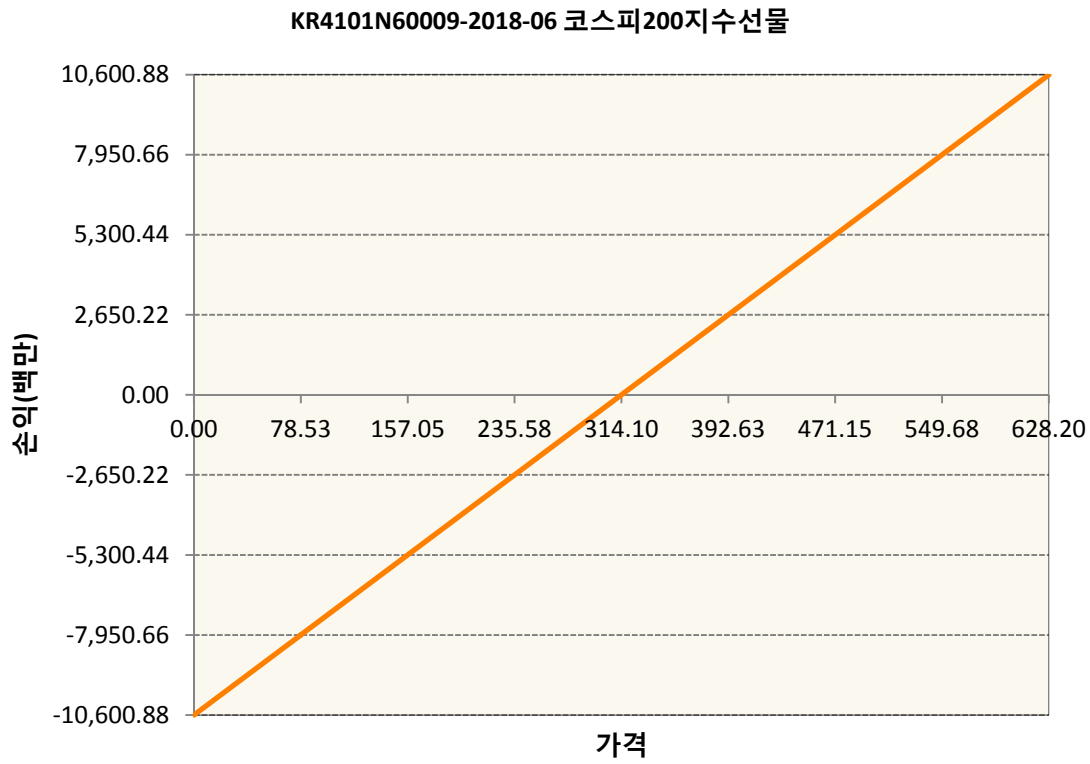
코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼

1. 계약금액

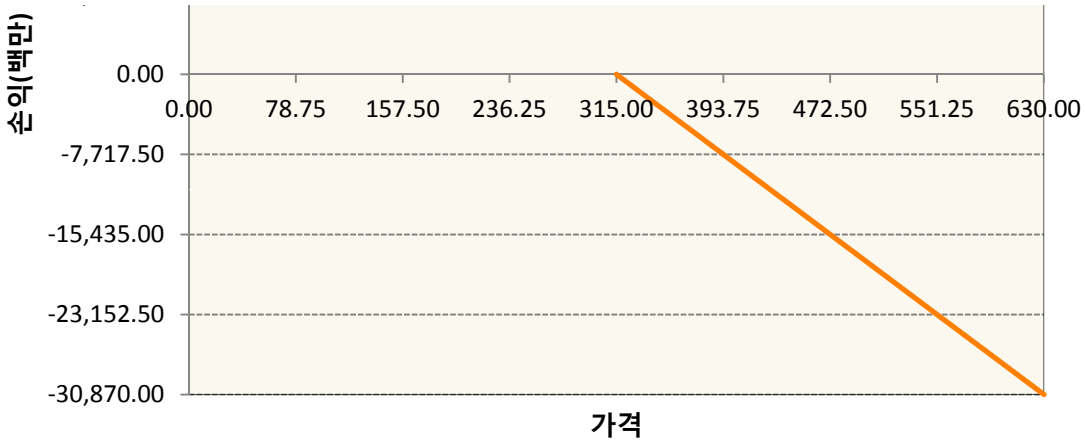
(단위:백만원)

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

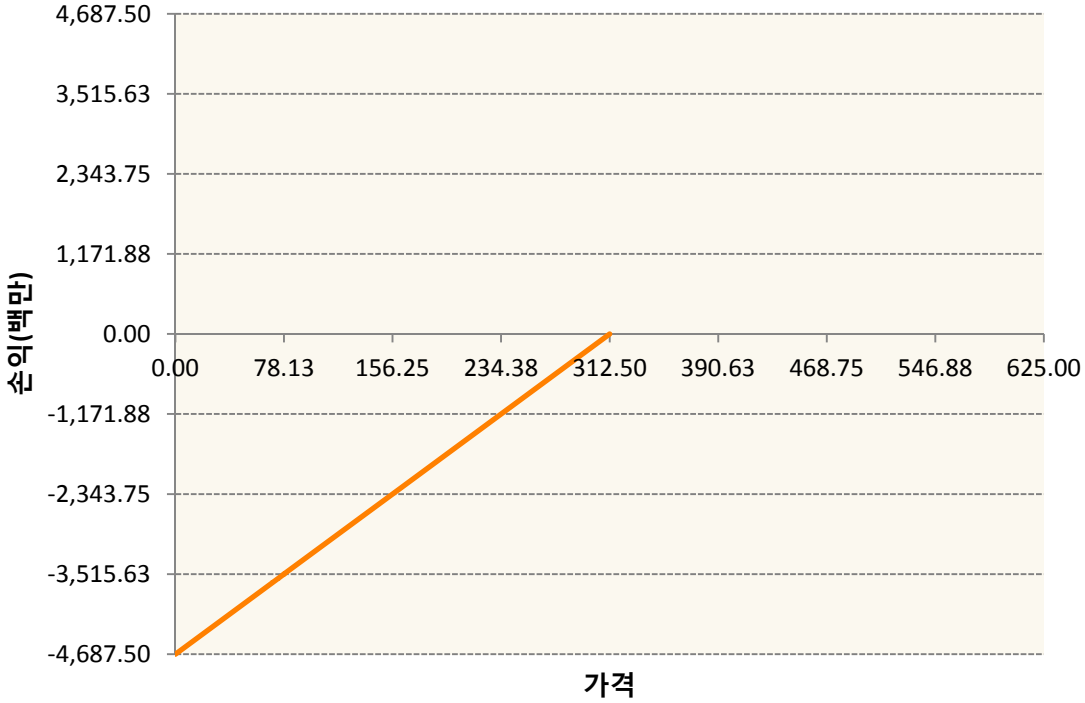
2. 만기시점의 손익구조



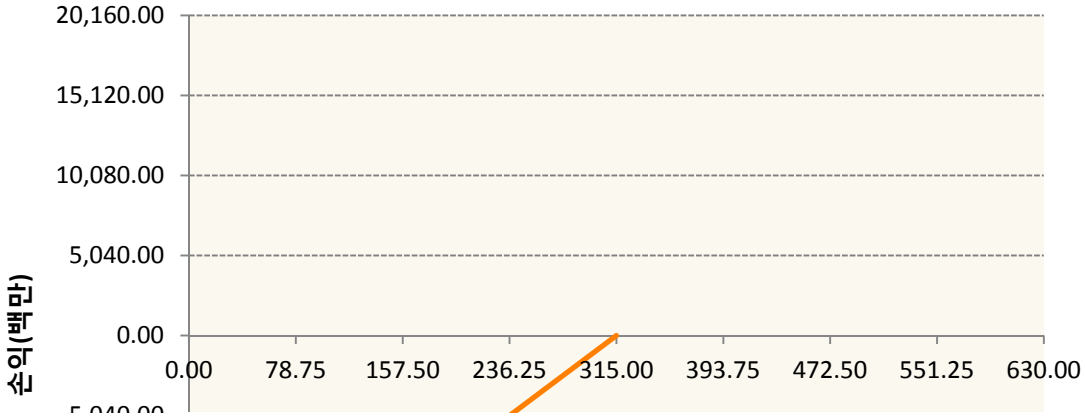




KR4301N43126-2018-04 풋312.5



KR4301N43159-2018-04 풋315





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_2							1,455
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,455	-1,455	-1,455	-1,455	-1,455	-1,455	-1,455
-5.33%	-970	-970	-970	-970	-970	-970	-970
-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%	970	970	970	970	970	970	970
8.00%	1,455	1,455	1,455	1,455	1,455	1,455	1,455
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							197
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%

-8.00%	-197	-197	-197	-197	-197	-197	-197
-5.33%	-131	-131	-131	-131	-131	-131	-131
-2.67%	-66	-66	-66	-66	-66	-66	-66
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	66	66	66	66	66	66	66
5.33%	131	131	131	131	131	131	131
8.00%	197	197	197	197	197	197	197
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_7						252
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-252	-252	-252	-252	-252	-252	-252
-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%	252	252	252	252	252	252	252
	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						472
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-472	-472	-472	-472	-472	-472	-472
-5.33%	-315	-315	-315	-315	-315	-315	-315
-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%	315	315	315	315	315	315	315
8.00%	472	472	472	472	472	472	472
	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						2,067
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	243	243	243	243	243	243	243
-5.33%	243	243	242	241	239	236	232
-2.67%	232	225	215	204	192	178	163
0%	76	51	26	0	-26	-51	-77
2.67%	-464	-479	-495	-514	-533	-553	-573
5.33%	-1,245	-1,246	-1,249	-1,254	-1,259	-1,266	-1,275
8.00%	-2,062	-2,062	-2,063	-2,063	-2,064	-2,065	-2,067
	KR4301N431 2018-04 풋312.5						340
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-340	-340	-340	-340	-340	-340	-340
-5.33%	-214	-214	-214	-214	-214	-214	-214
-2.67%	-89	-90	-90	-91	-91	-92	-93
0%	7	5	2	0	-2	-5	-7
2.67%	22	22	22	21	21	20	20
5.33%	22	22	22	22	22	22	22
8.00%	22	22	22	22	22	22	22
	KR4301N431 2018-04 풋315						1,525

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,525	-1,525	-1,525	-1,525	-1,525	-1,525	-1,525
-5.33%	-990	-990	-990	-990	-990	-990	-990
-2.67%	-455	-455	-456	-457	-458	-460	-462
0%	29	19	10	0	-10	-20	-30
2.67%	176	174	171	167	163	158	153
5.33%	179	179	179	179	179	178	178
8.00%	179	179	179	179	179	179	179

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

9,965

공시일	2018-04-10
기준일	2018-04-09

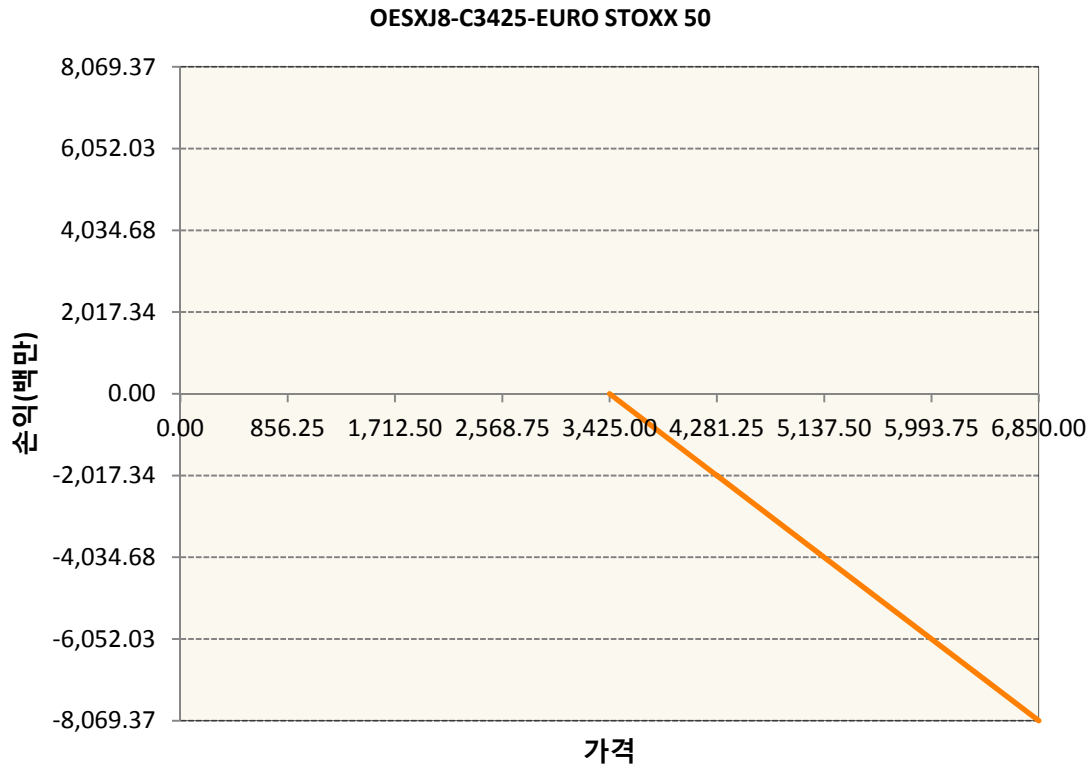
유로커버드콜모(주식혼합-파생형

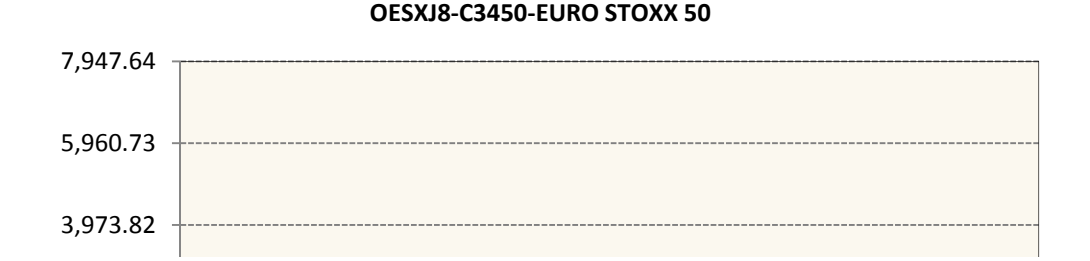
1. 계약금액

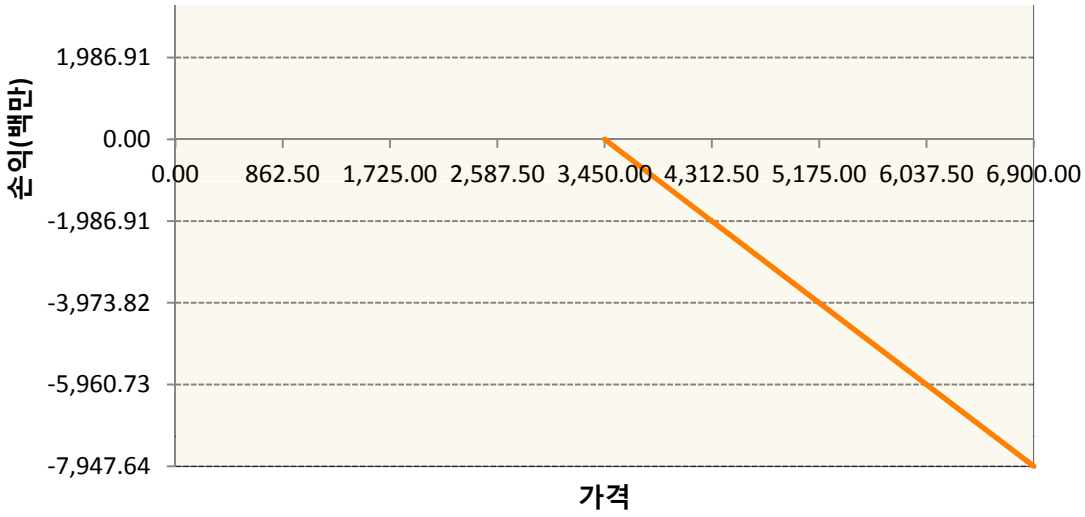
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	17	-17	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	7,492	0	7,492	
누계	유가증권	스왑	75,604	0	75,604	장외
누계	유가증권	옵션	0	32,034	-32,034	장내
누계	지수	스왑	52,357	0	52,357	장외

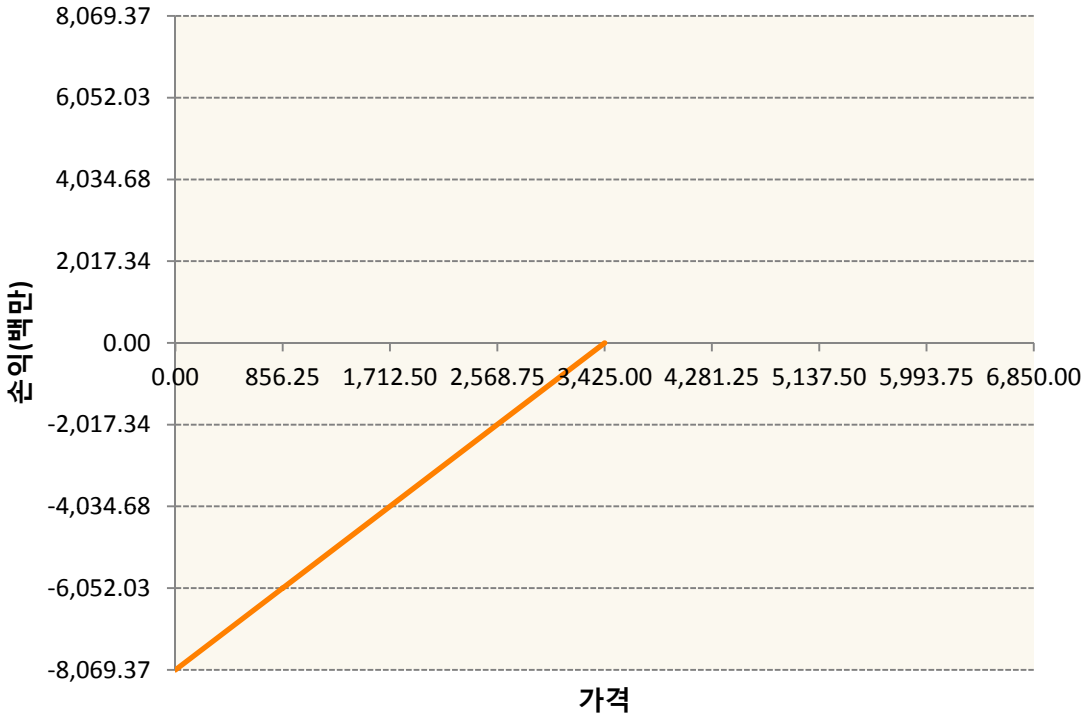
2. 만기시점의 손익구조



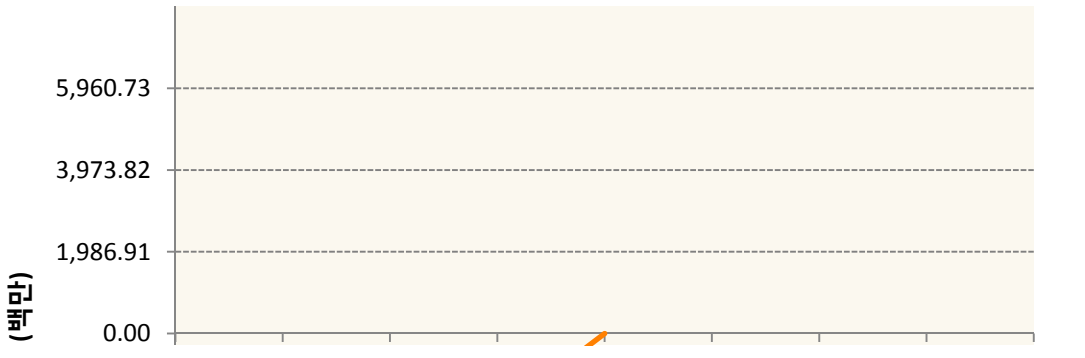


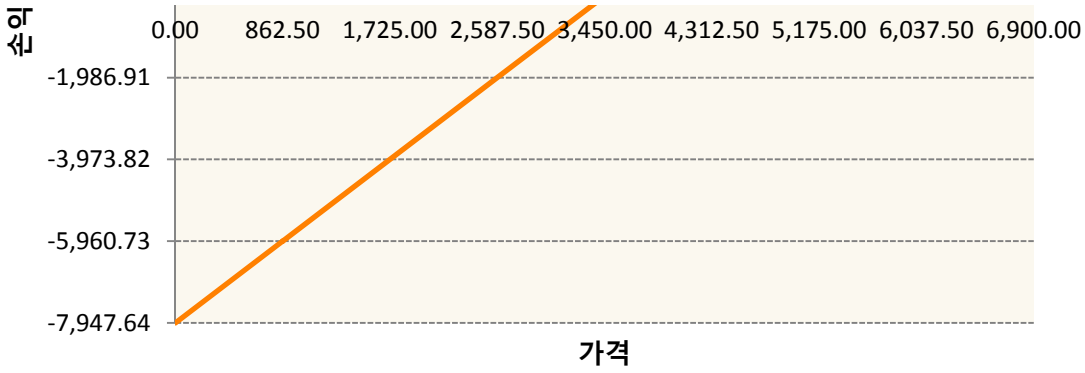


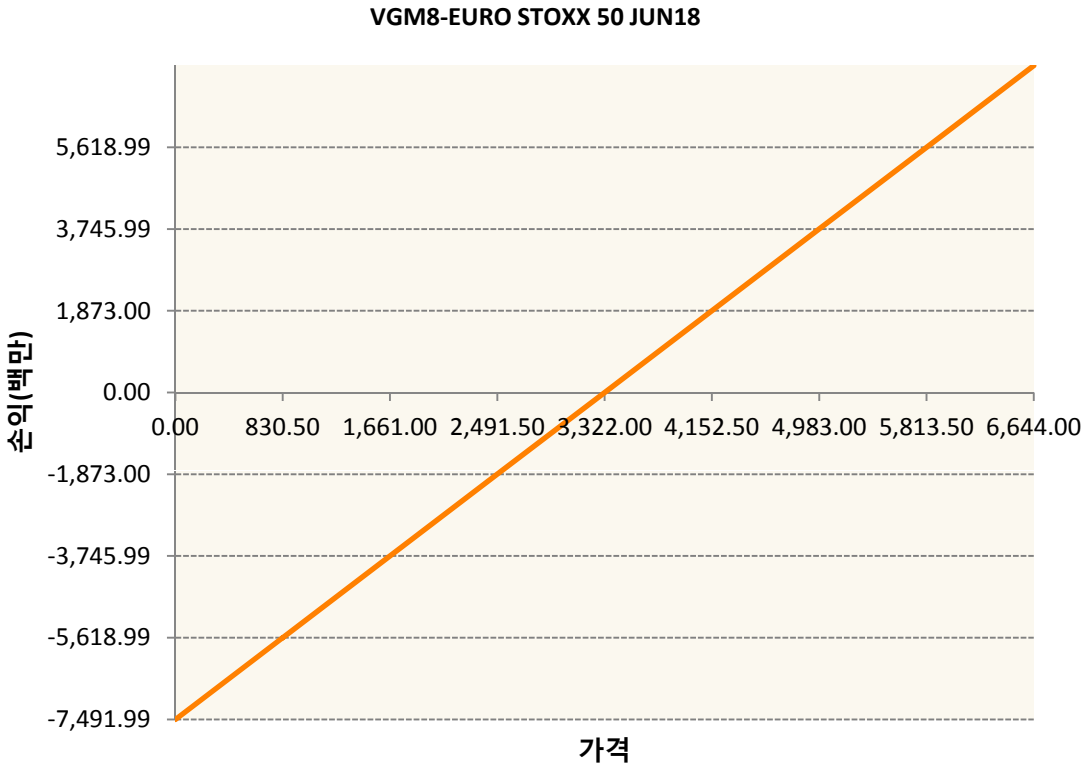
OESXJ8-P3425-EURO STOXX 50



OESXJ8-P3450-EURO STOXX 50







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)	(단위:백만원)
260105SGPX SG EURO Covered CALL STRATEGY - 994.569	158
260105SQPX SG EURO Covered CALL STRATEGY	228
OESXJ8-C34 EURO STOXX 50	646
OESXJ8-C34 EURO STOXX 50	636
OESXJ8-P34 EURO STOXX 50	646
OESXJ8-P34 EURO STOXX 50	636
VGM8 EURO STOXX 50 JUN18	599

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

2,228

공시일	2018-04-10
기준일	2018-04-09

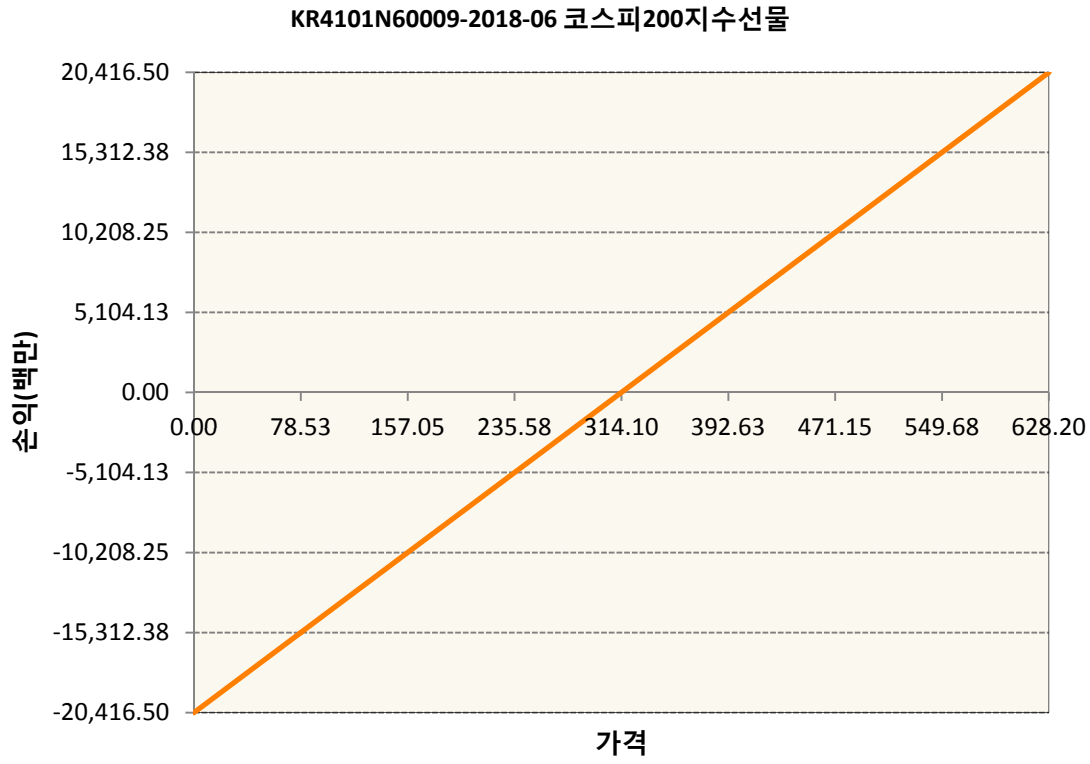
ETF스마트레버리지목표전환형8호

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							1,630
	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%	-1,087	-1,087	-1,087	-1,087	-1,087	-1,087	-1,087
-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%	1,087	1,087	1,087	1,087	1,087	1,087	1,087
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)

1,191

공시일	2018-04-10
기준일	2018-04-09

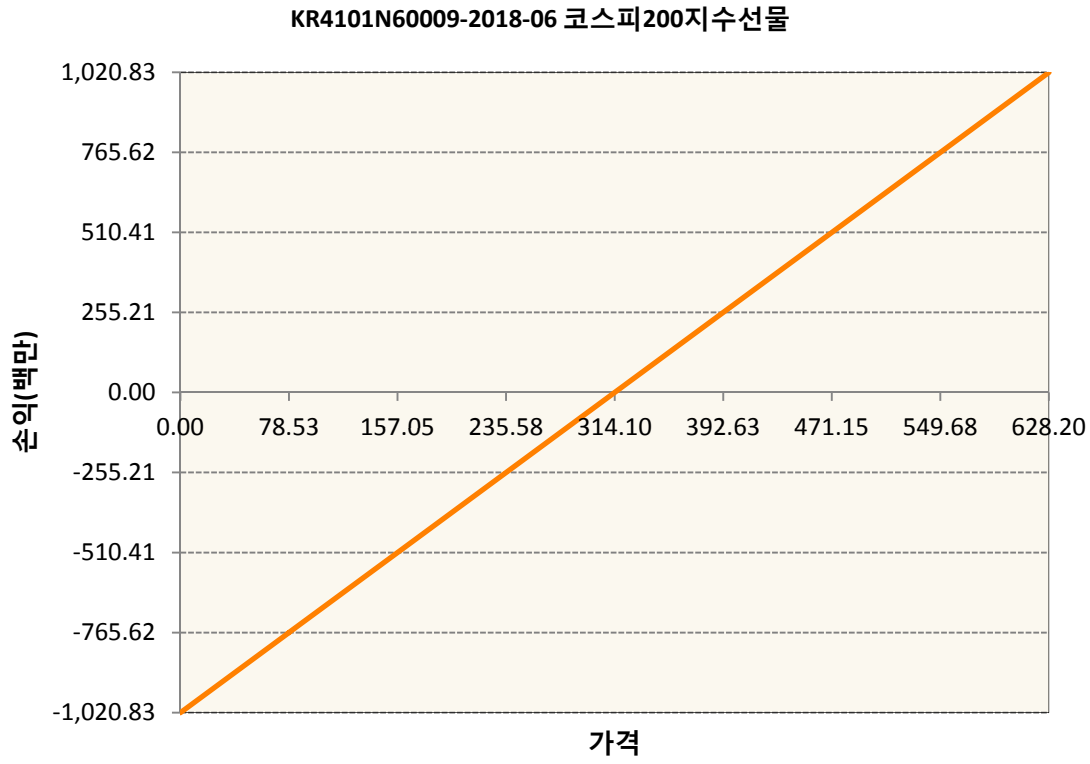
ETF스마트레버리지목표전환형9호

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)

60

공시일	2018-04-10
기준일	2018-04-09

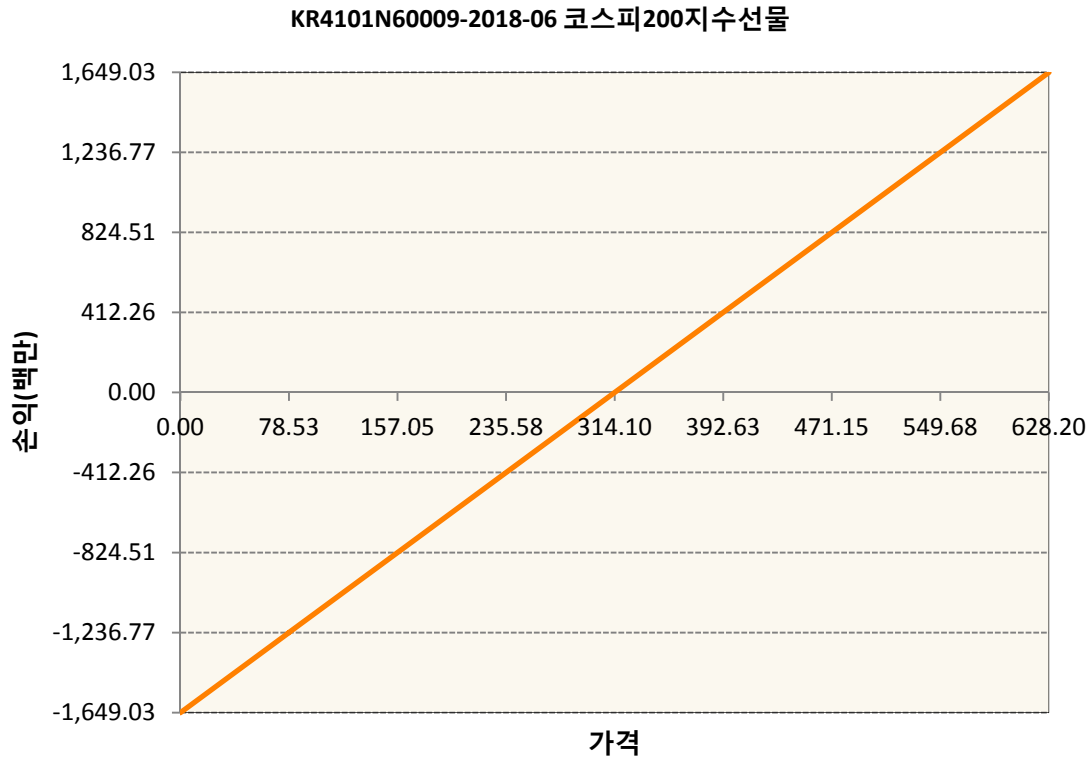
ETF스마트레버리지목표전환형10

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							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)

96

공시일	2018-04-10
기준일	2018-04-09

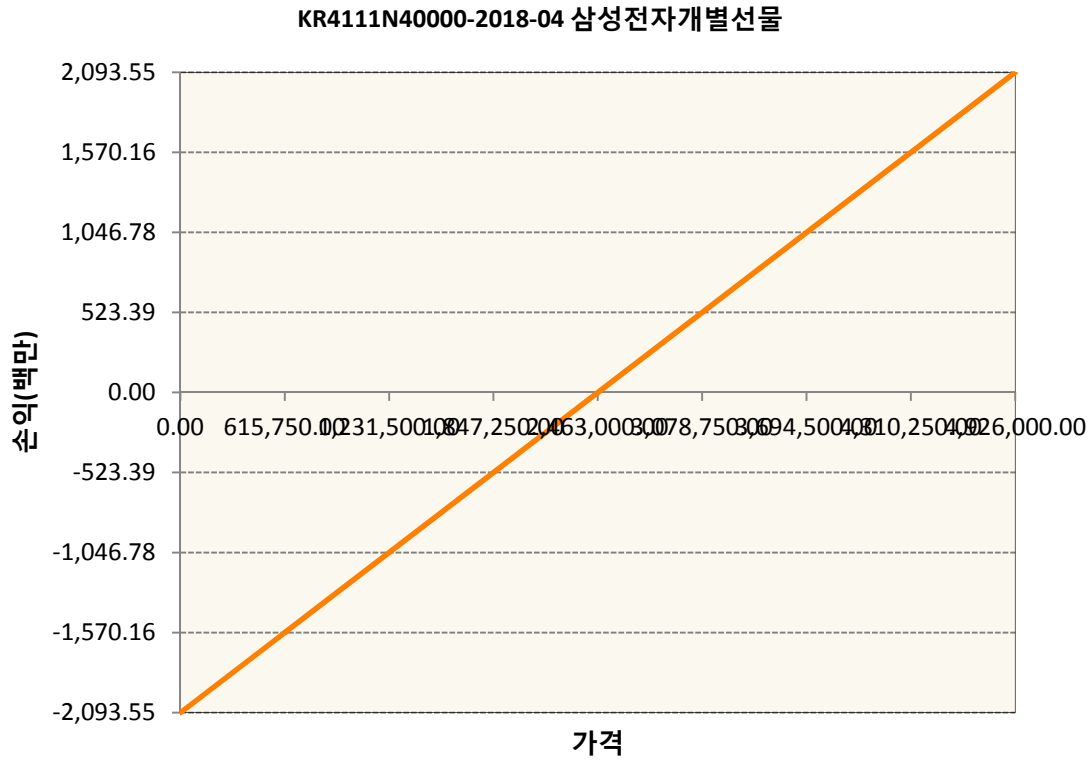
스마트KRX300인덱스1호(주식-파

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	2,094	0	2,094	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4111N40(2018-04 삼성전자개별선물							167
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-167	-167	-167	-167	-167	-167	-167
-5.33%	-112	-112	-112	-112	-112	-112	-112
-2.67%	-56	-56	-56	-56	-56	-56	-56
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	56	56	56	56	56	56	56
5.33%	112	112	112	112	112	112	112
8.00%	167	167	167	167	167	167	167

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

207

공시일	2018-04-10
기준일	2018-04-09

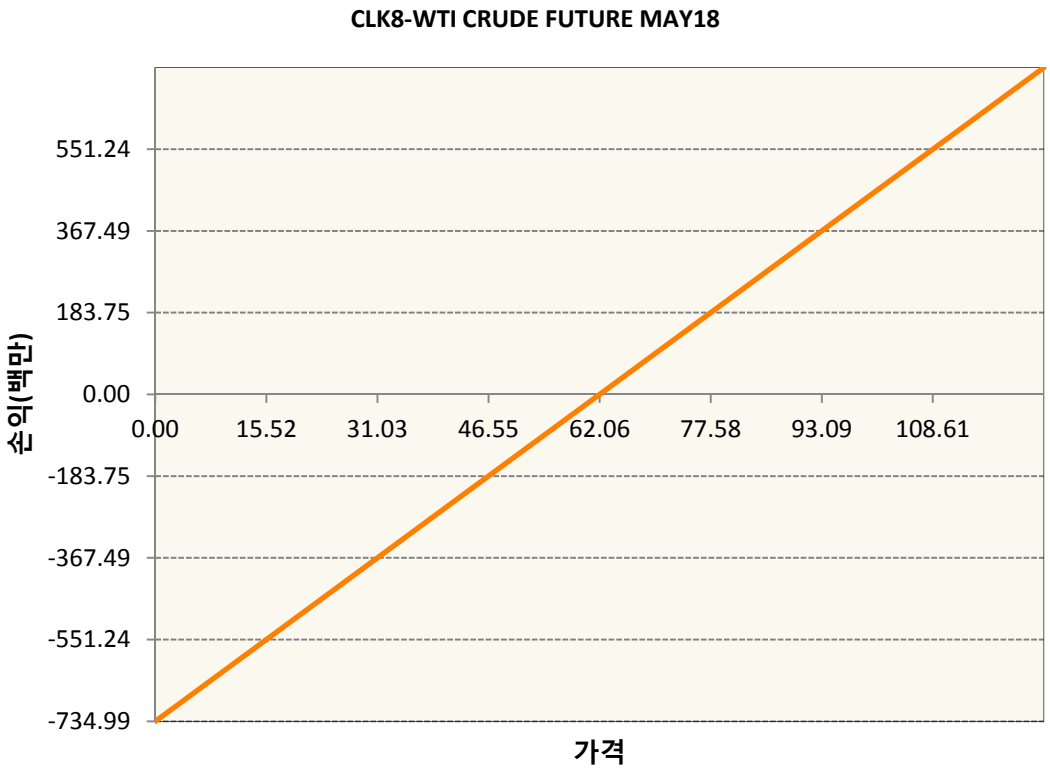
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

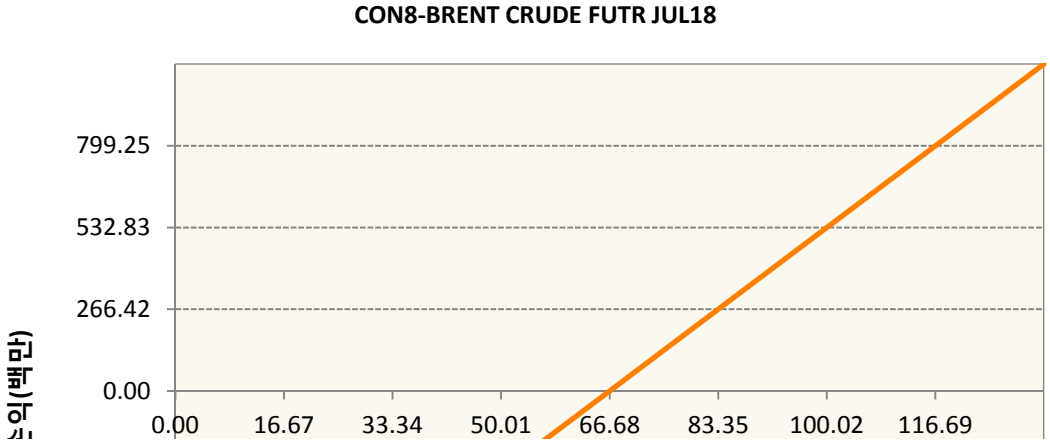
1. 계약금액

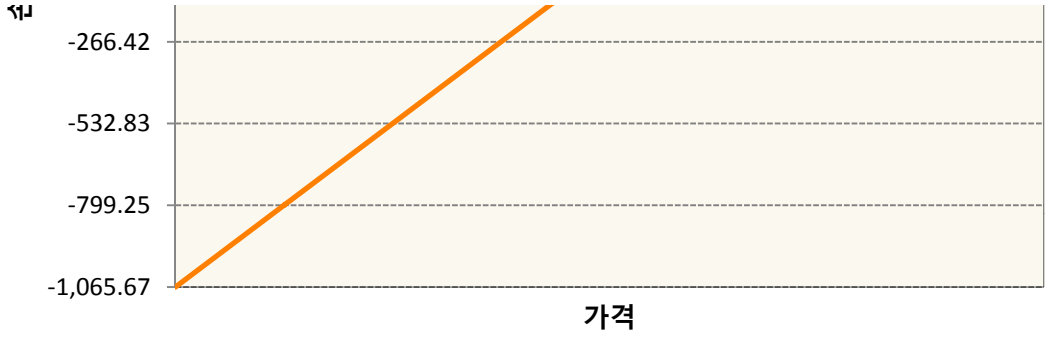
(단위:백만원)

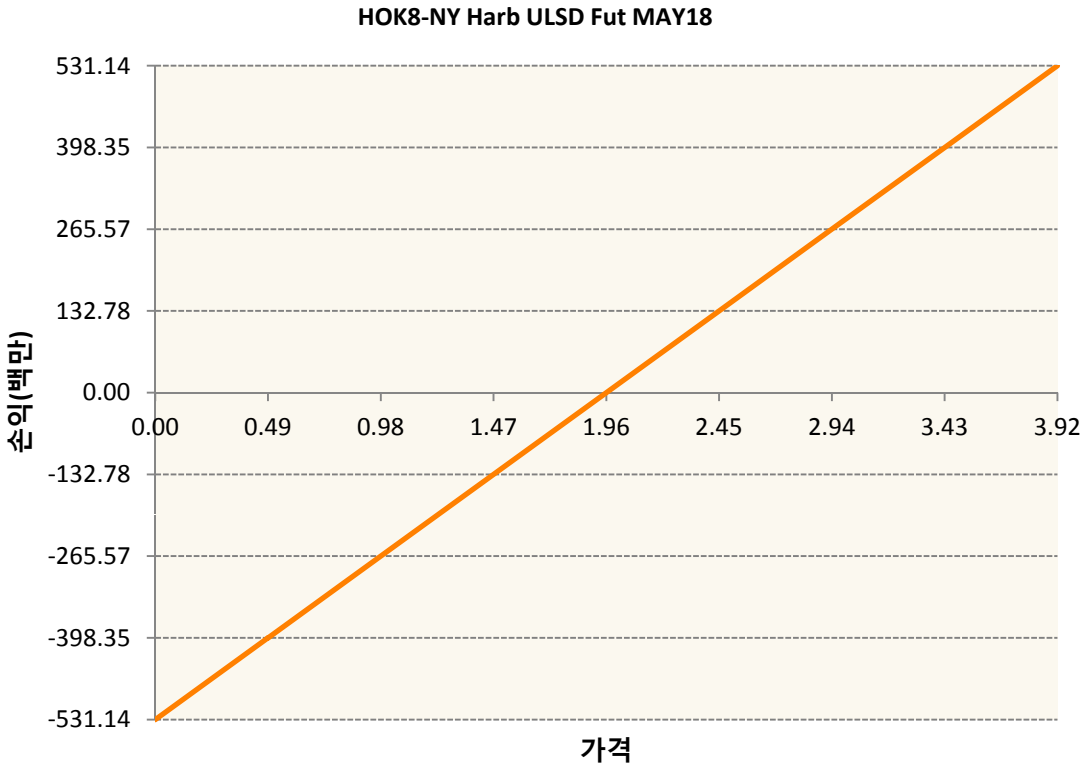
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	선물	유가증권	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	선물	유가증권	735	0	735	
누계	유가증권	선물	3,174	586	2,588	

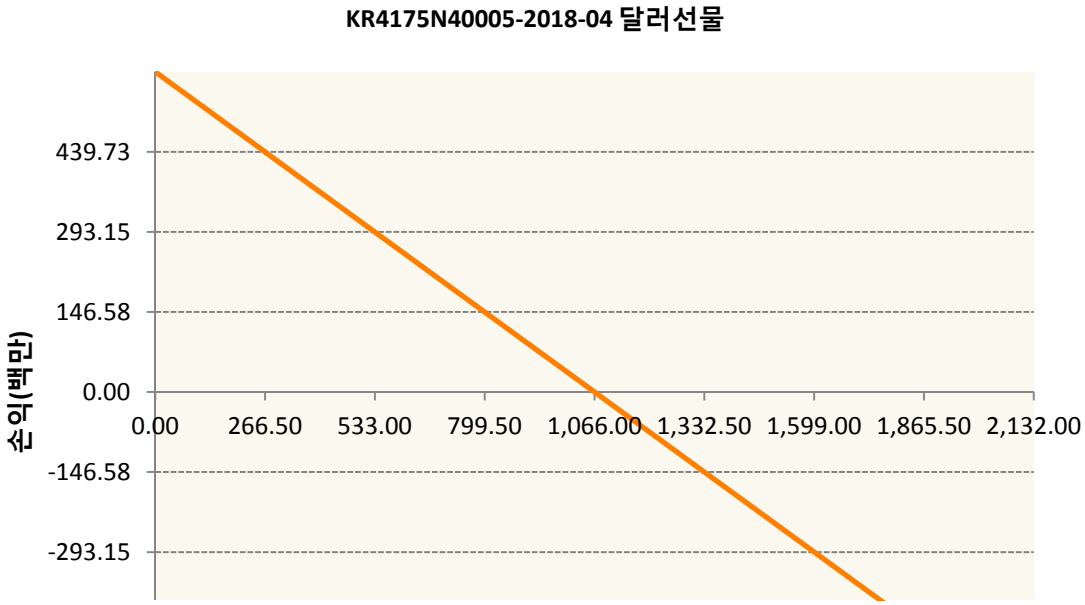
2. 만기시점의 손익구조

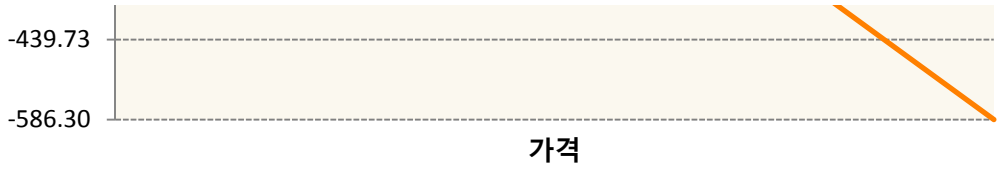




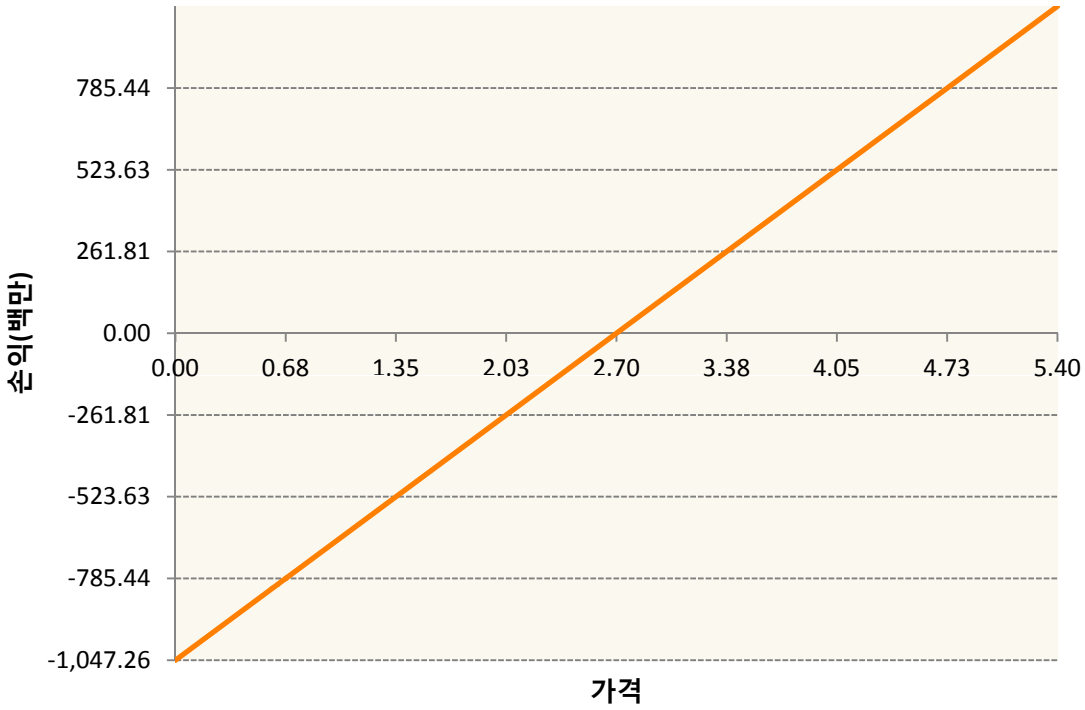

-266.42
-532.83
-799.25
-1,065.67
가격


HOK8-NY Harb ULSD Fut MAY18
531.14
398.35
265.57
132.78
0.00
-132.78
-265.57
-398.35
-531.14
손익(백만)
0.00
0.49
0.98
1.47
1.96
2.45
2.94
3.43
3.92
가격

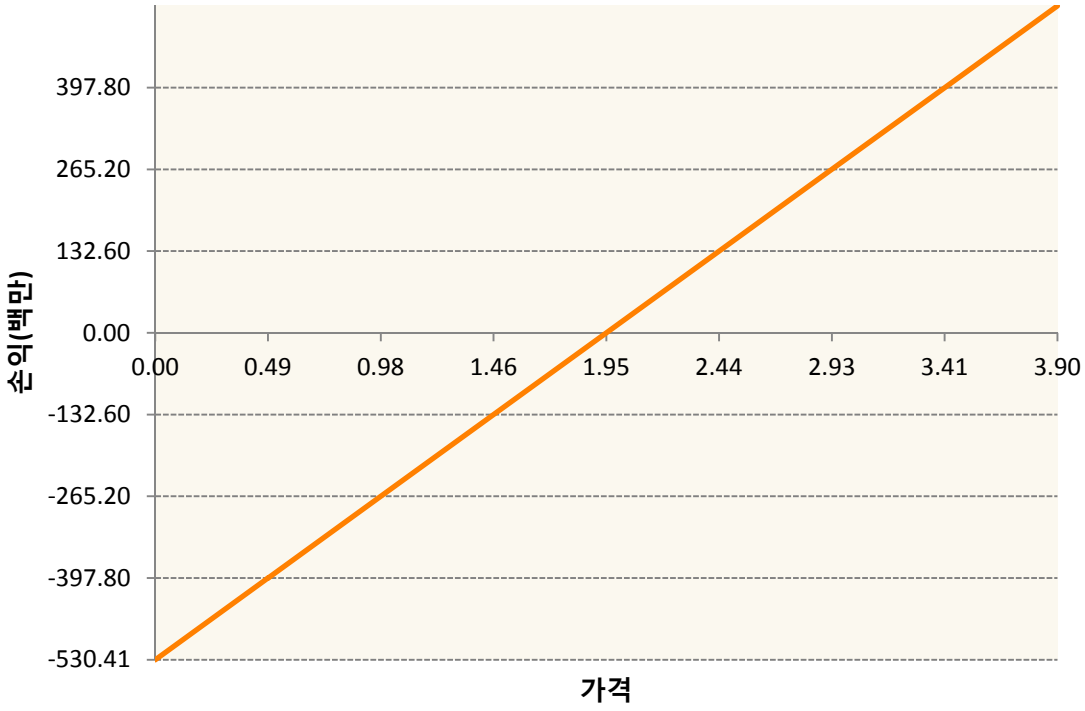

KR4175N40005-2018-04 달러선물
439.73
293.15
146.58
0.00
-146.58
-293.15
손익(백만)
0.00
266.50
533.00
799.50
1,066.00
1,332.50
1,599.00
1,865.50
2,132.00



NGK8-NATURAL GAS FUTR MAY18



XBK8-GASOLINE RBOB FUT MAY18



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLK8	WTI CRUDE FUTURE MAY18	59
CON8	BRENT CRUDE FUTR JUL18	85
HOK8	NY Harb ULSD Fut MAY18	42
KR4175N40(	2018-04 달러선물	47
NGK8	NATURAL GAS FUTR MAY18	84
XBK8	GASOLINE RBOB FUT MAY18	42

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

502

공시일	2018-04-10
기준일	2018-04-09

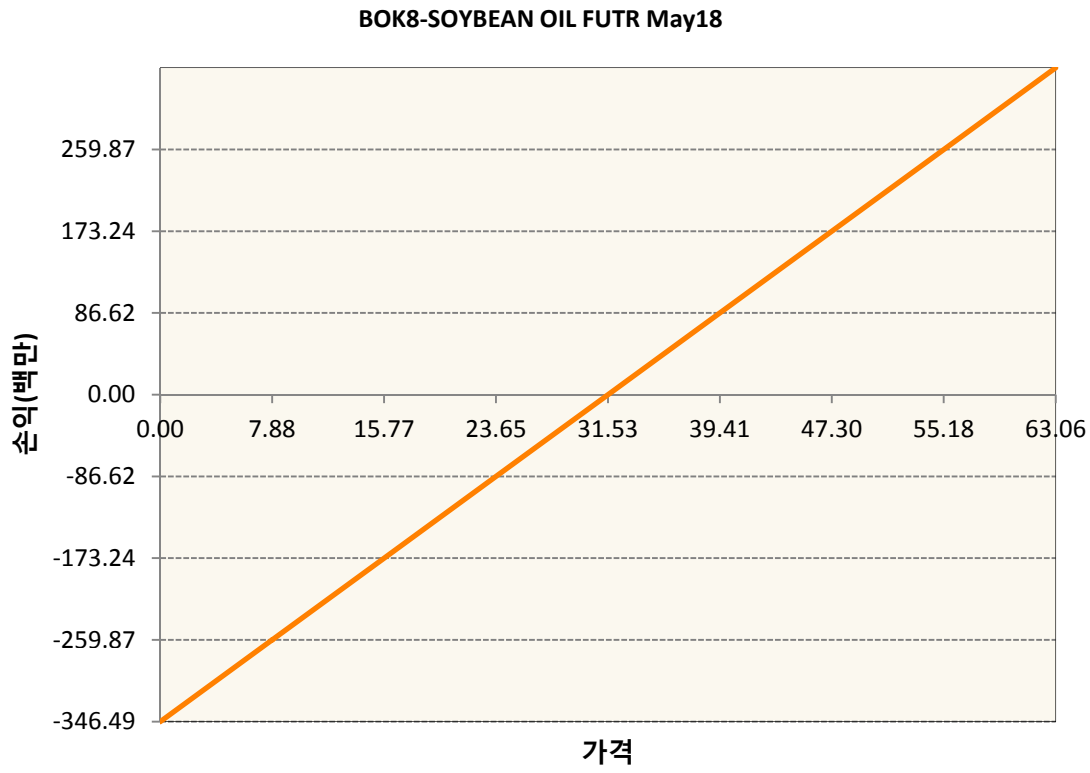
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

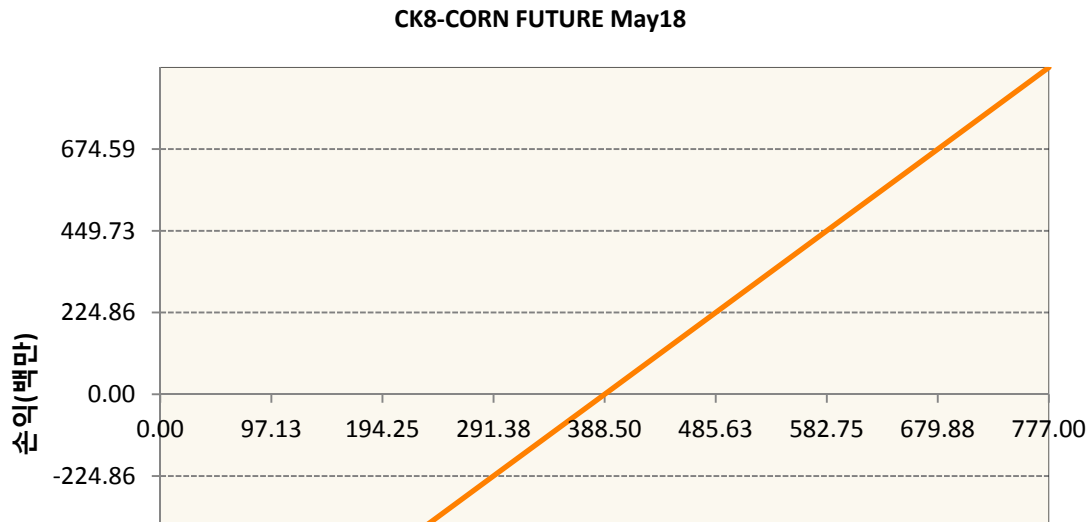
1. 계약금액

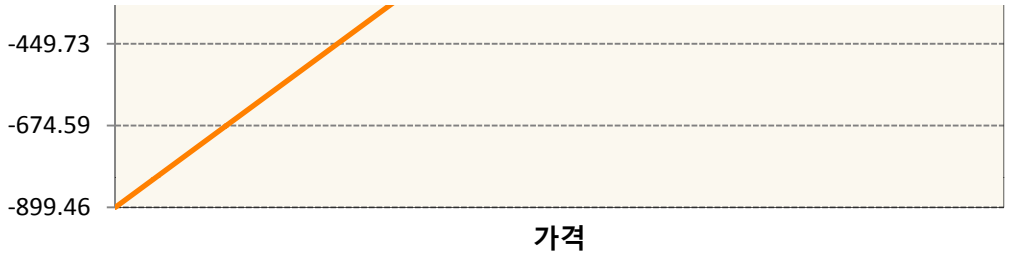
(단위:백만원)

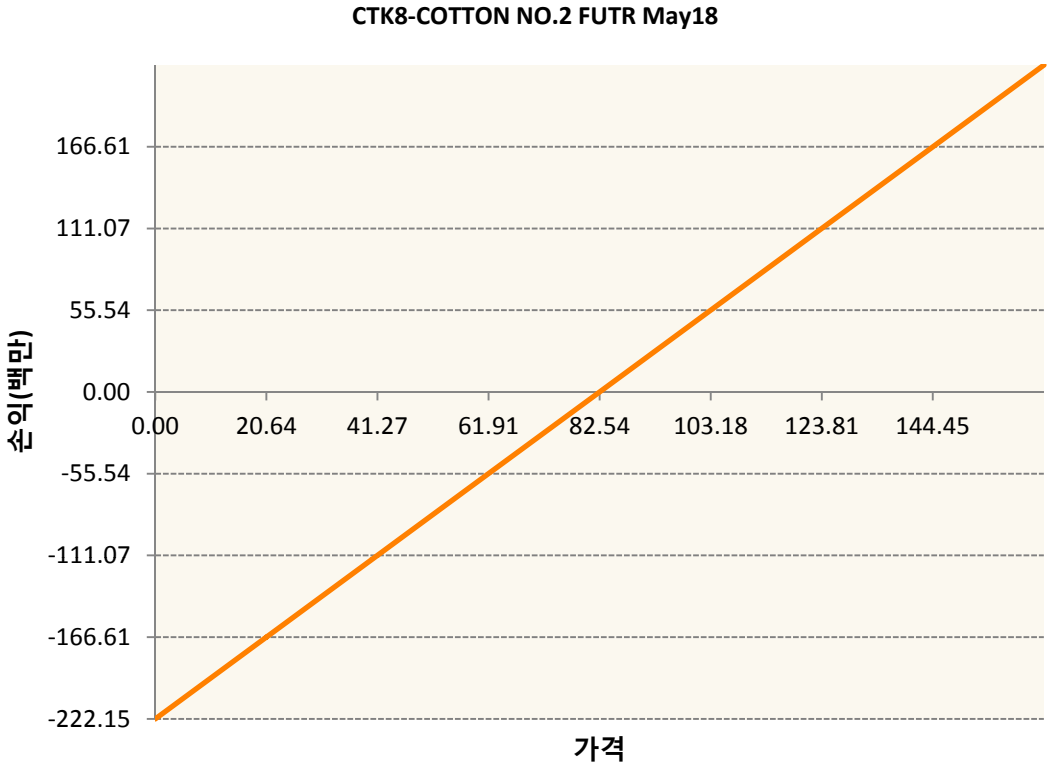
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	4,141	320	3,821	

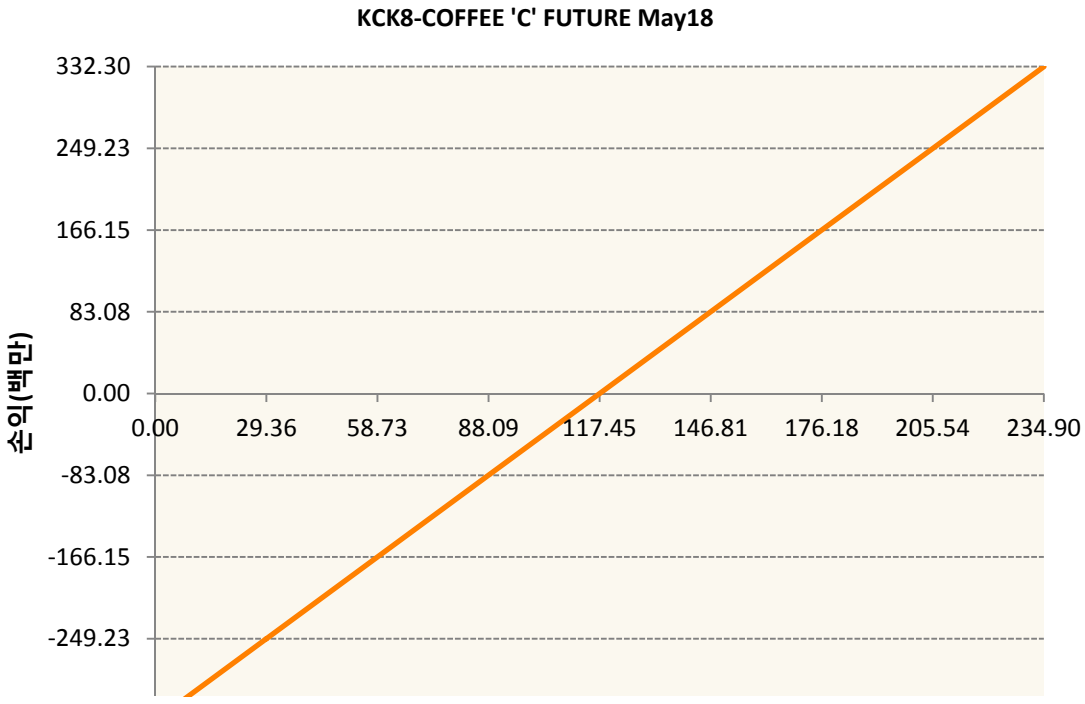
2. 만기시점의 손익구조

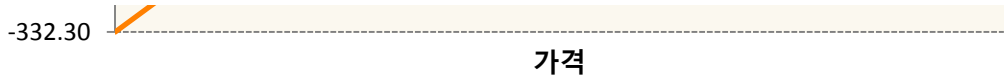


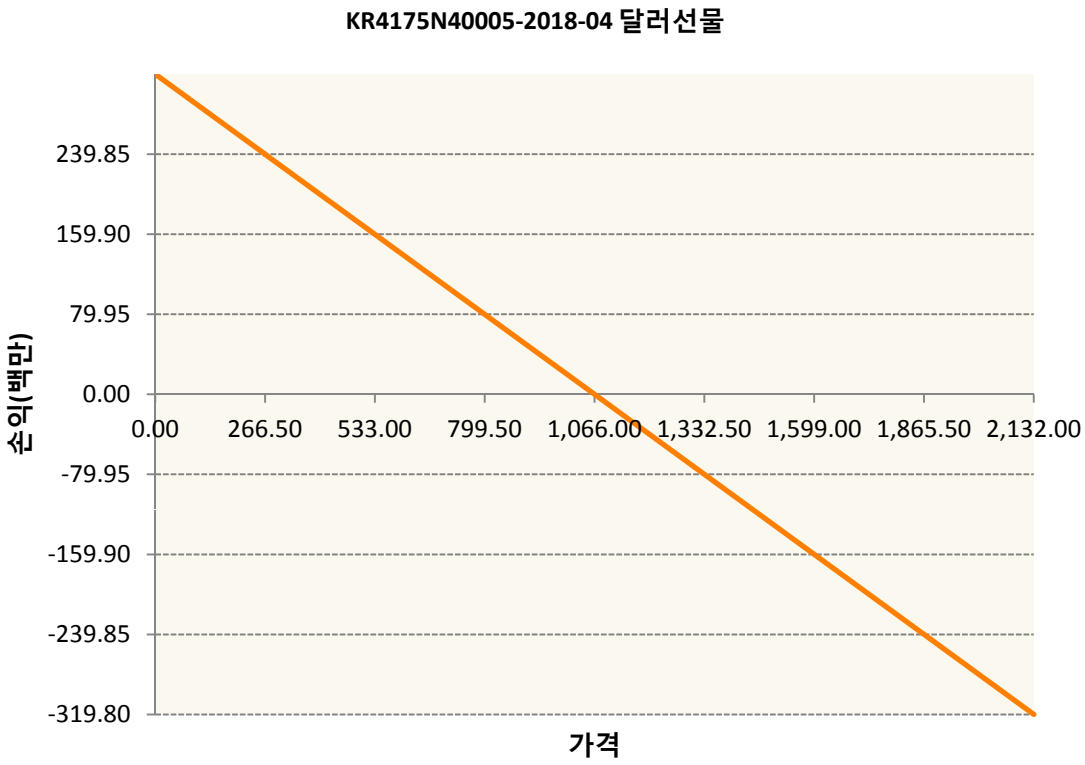


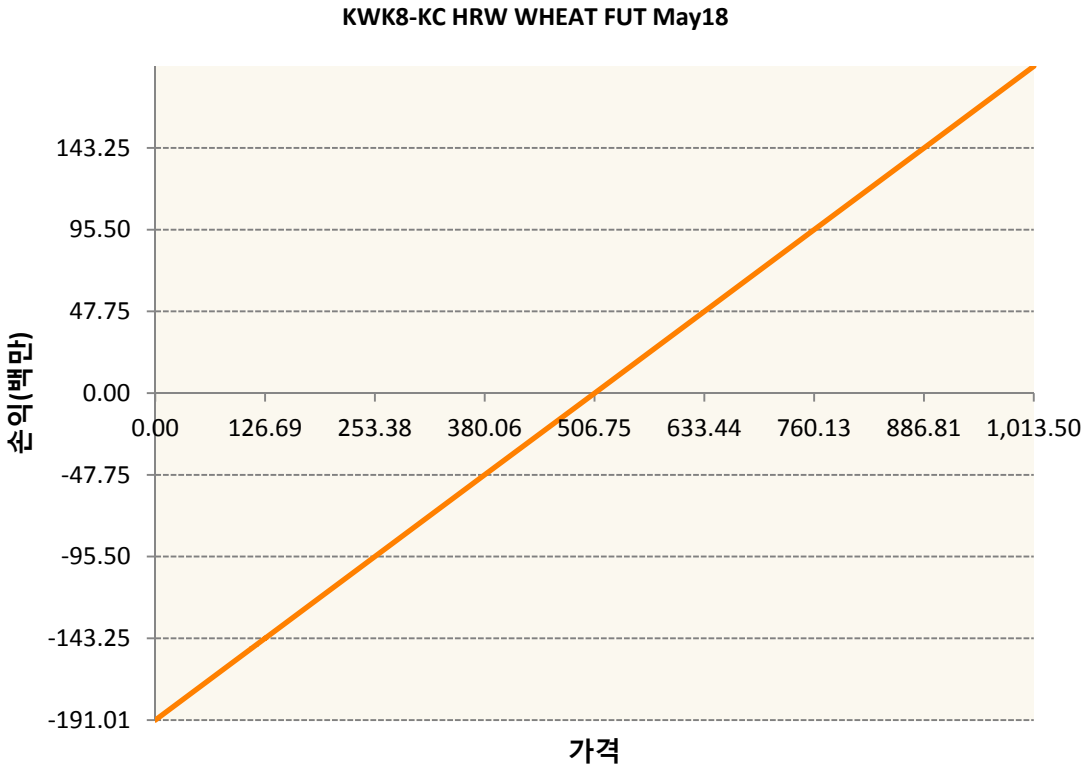

-449.73
-674.59
-899.46
가격


CTK8-COTTON NO.2 FUTR May18
166.61
111.07
55.54
0.00
-55.54
-111.07
-166.61
-222.15
0.00
20.64
41.27
61.91
82.54
103.18
123.81
144.45
손익(백만)
가격

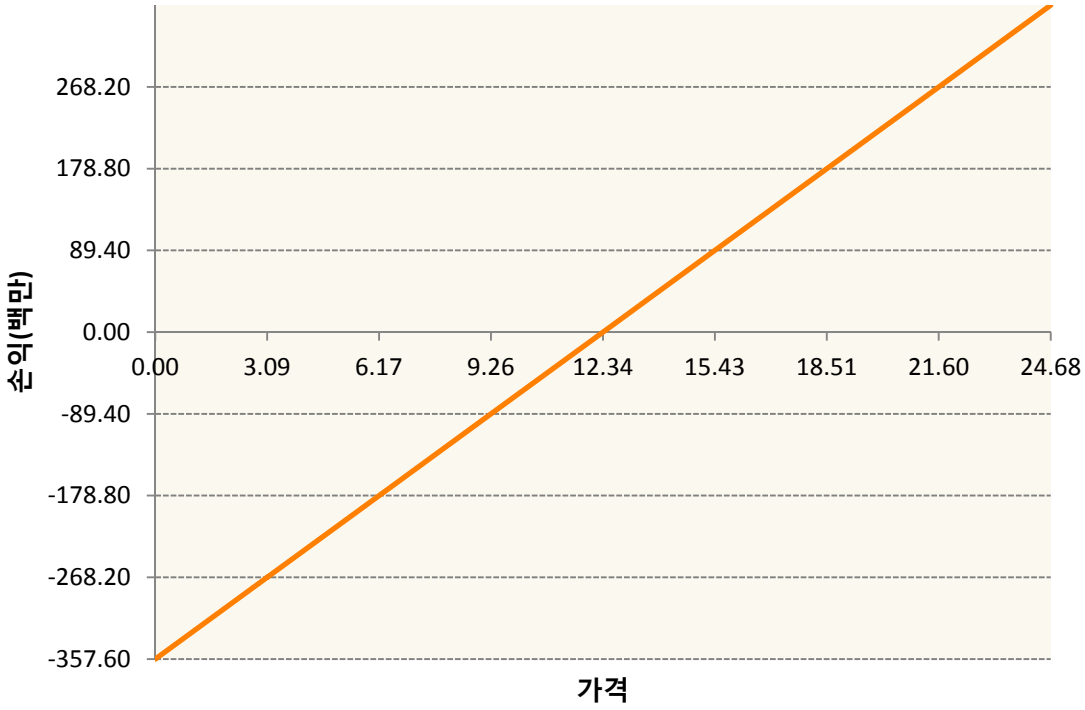

KCK8-COFFEE 'C' FUTURE May18
332.30
249.23
166.15
83.08
0.00
-83.08
-166.15
-249.23
0.00
29.36
58.73
88.09
117.45
146.81
176.18
205.54
234.90
손익(백만)


-332.30
가격

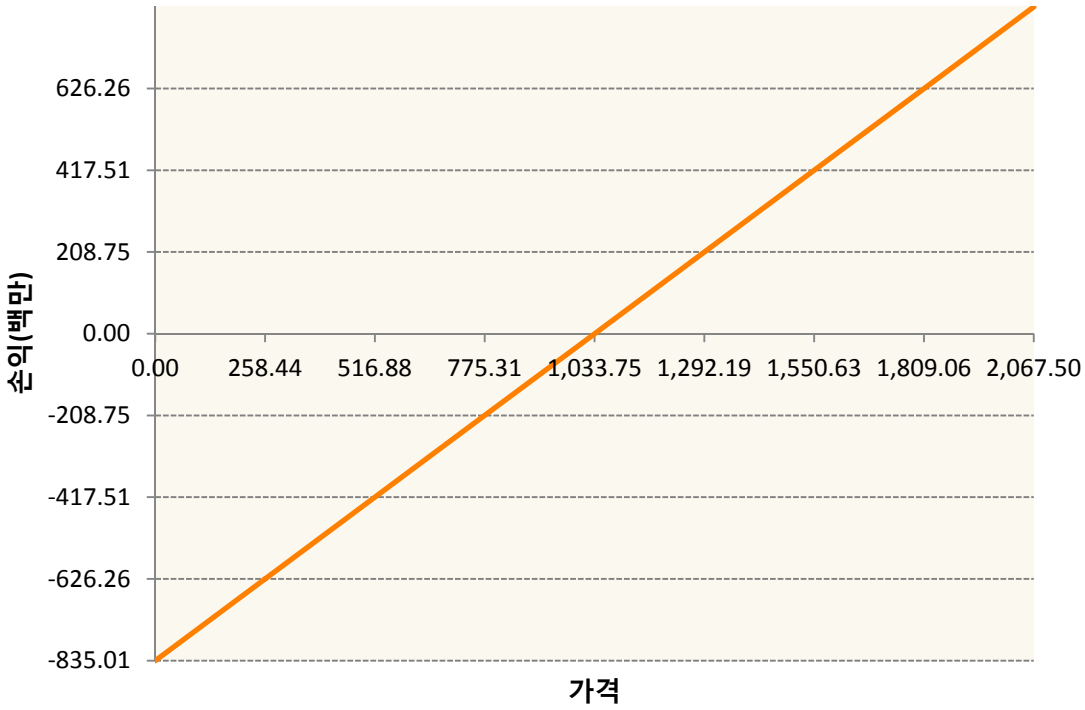

KR4175N40005-2018-04 달러선물
239.85
159.90
79.95
0.00
-79.95
-159.90
-239.85
-319.80
0.00
266.50
533.00
799.50
1,066.00
1,332.50
1,599.00
1,865.50
2,132.00
손익(백만)
가격


KWK8-KC HRW WHEAT FUT May18
143.25
95.50
47.75
0.00
-47.75
-95.50
-143.25
-191.01
0.00
126.69
253.38
380.06
506.75
633.44
760.13
886.81
1,013.50
손익(백만)
가격

SBK8-SUGAR #11 (WORLD) May18

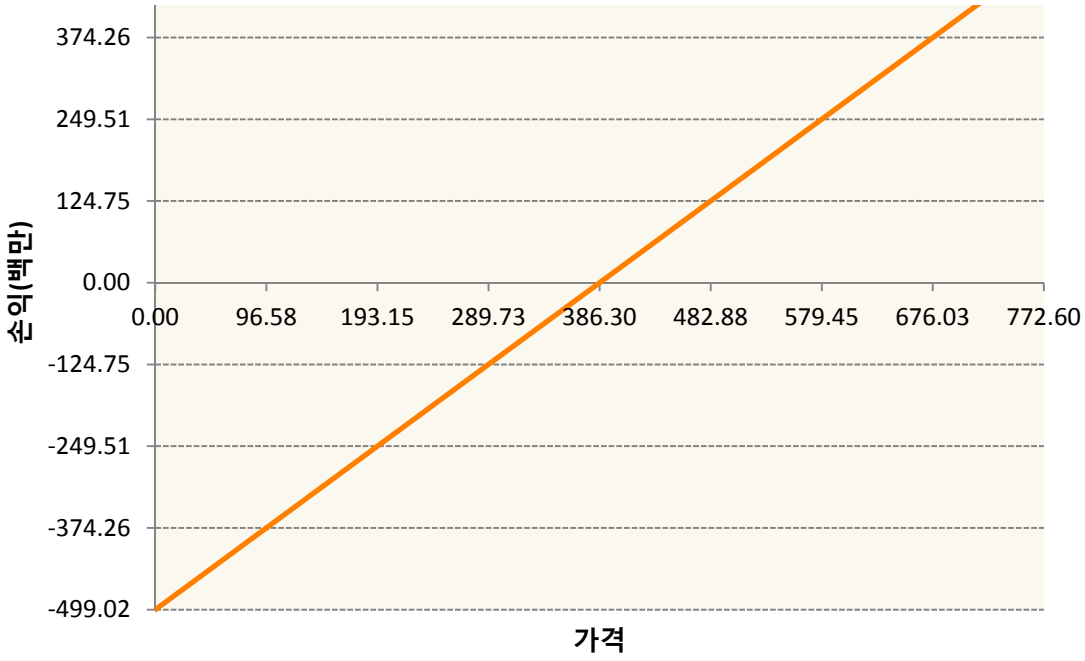


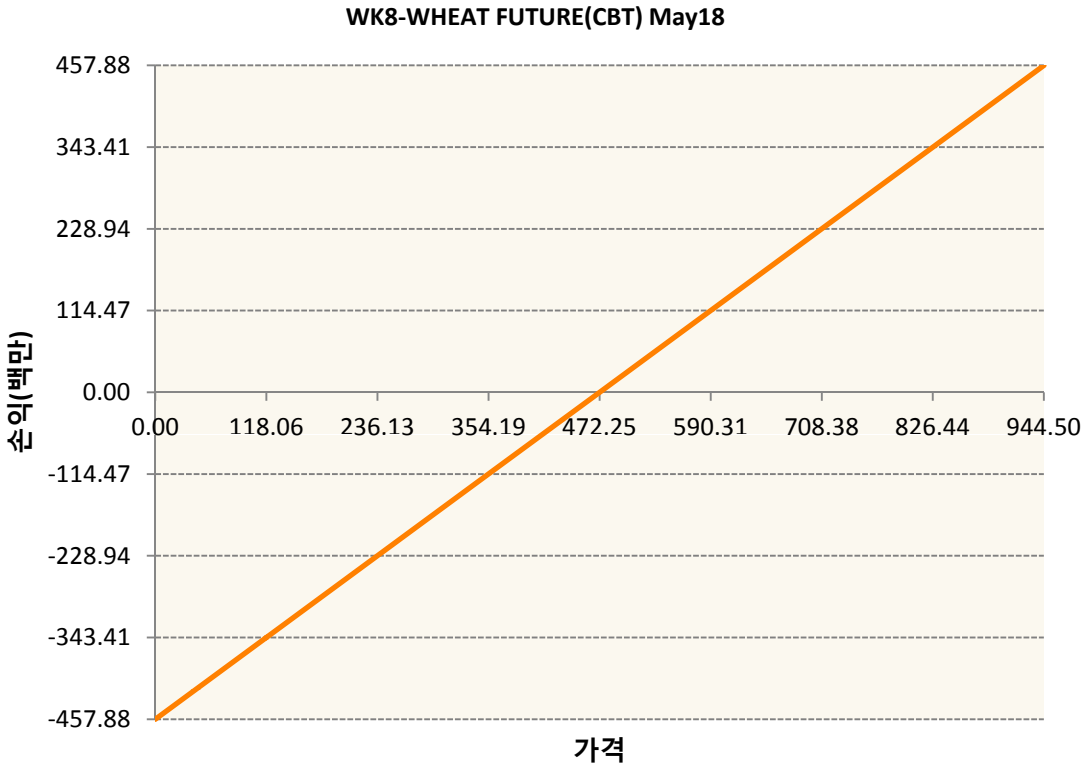
SK8-SOYBEAN FUTRUE May18



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	37

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

335