공시일	2018-04-11
기준일	2018-04-10

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	2018-04-11
기준일	2018-04-10

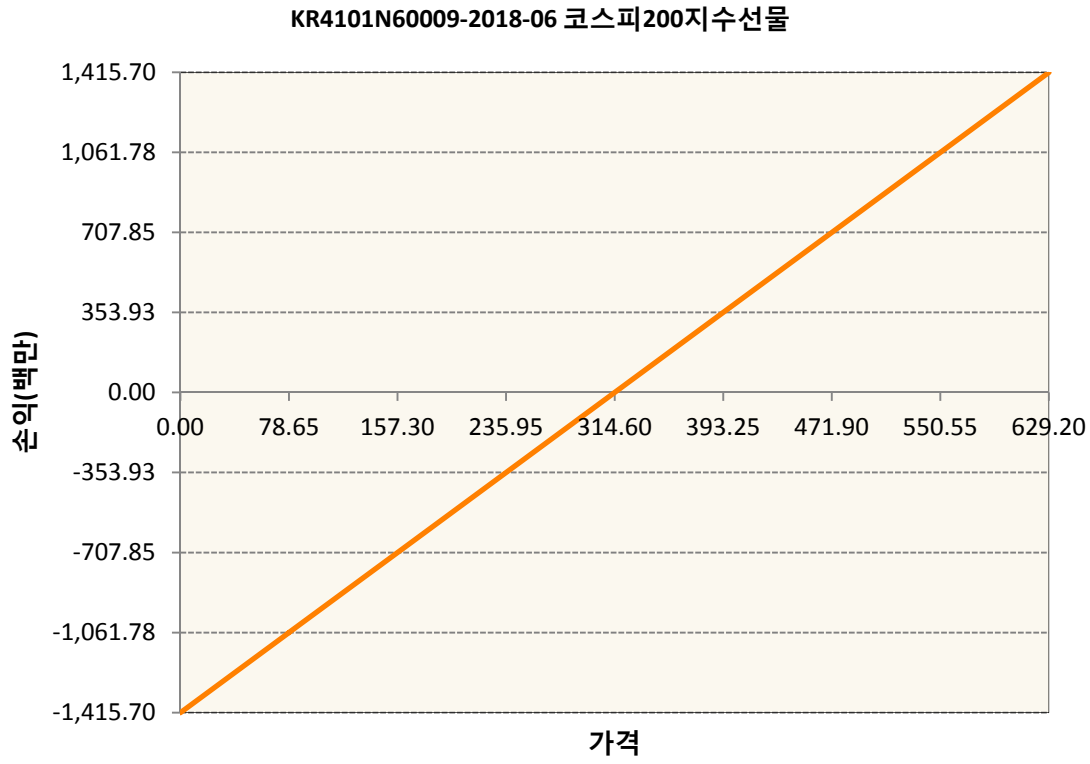
스마트인덱스모

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	1,416	0	1,416	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)

83

공시일	2018-04-11
기준일	2018-04-10

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)

436

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2018-04-11
기준일	2018-04-10

SMART중국본토중소형CSI500상장

1. 계약금액

(단위:백만원)

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

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI50000 신한CSI500미래S180308	407

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

438

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2018-04-11
기준일	2018-04-10

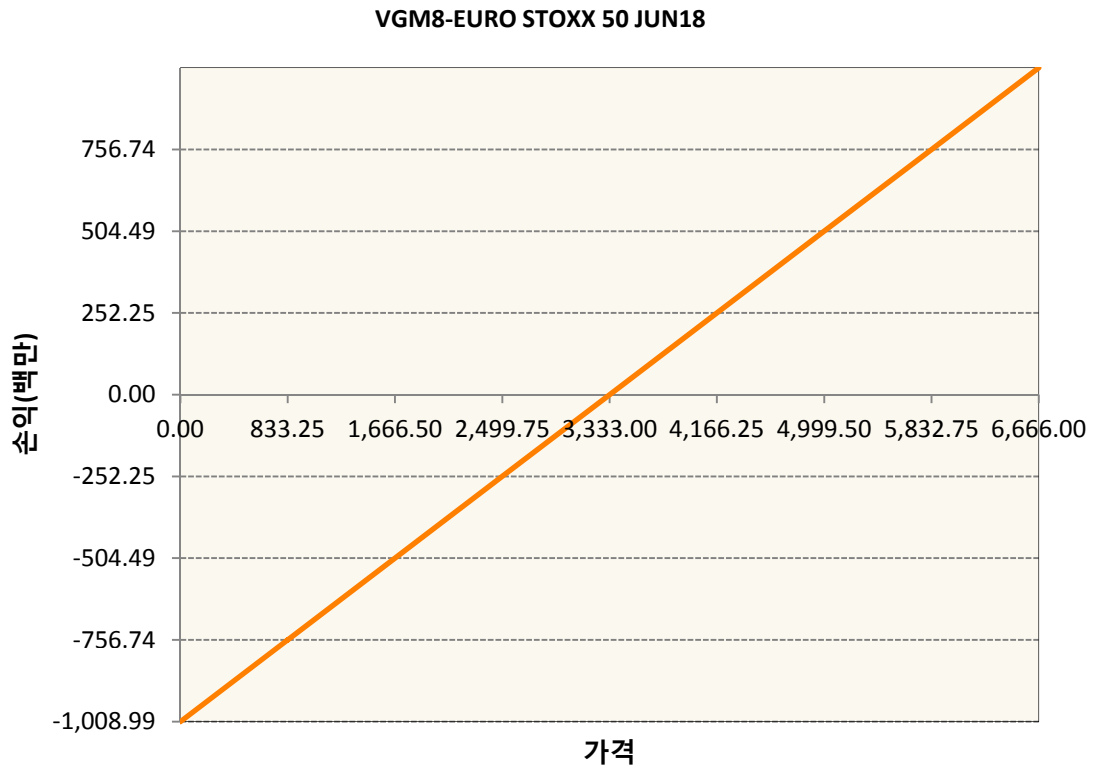
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,009	0	1,009	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGM8	EURO STOXX 50 JUN18	81

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

(단위:백만원)

49

공시일	2018-04-11
기준일	2018-04-10

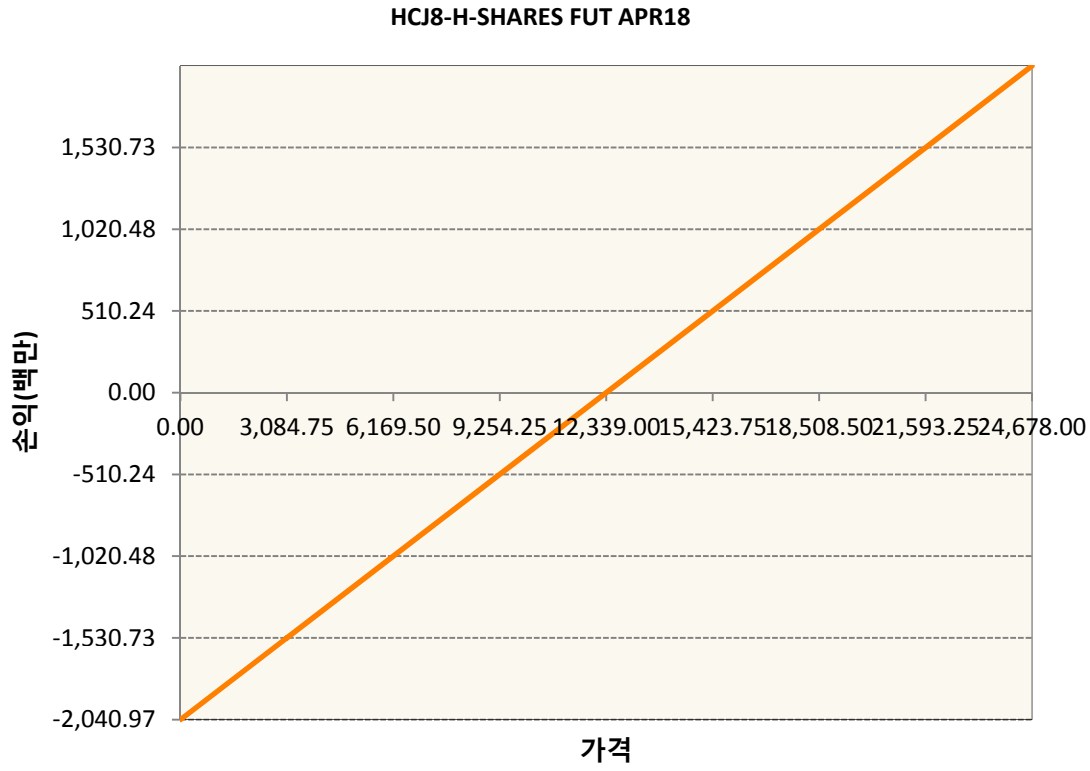
차이나인덱스모(주식-파생형)

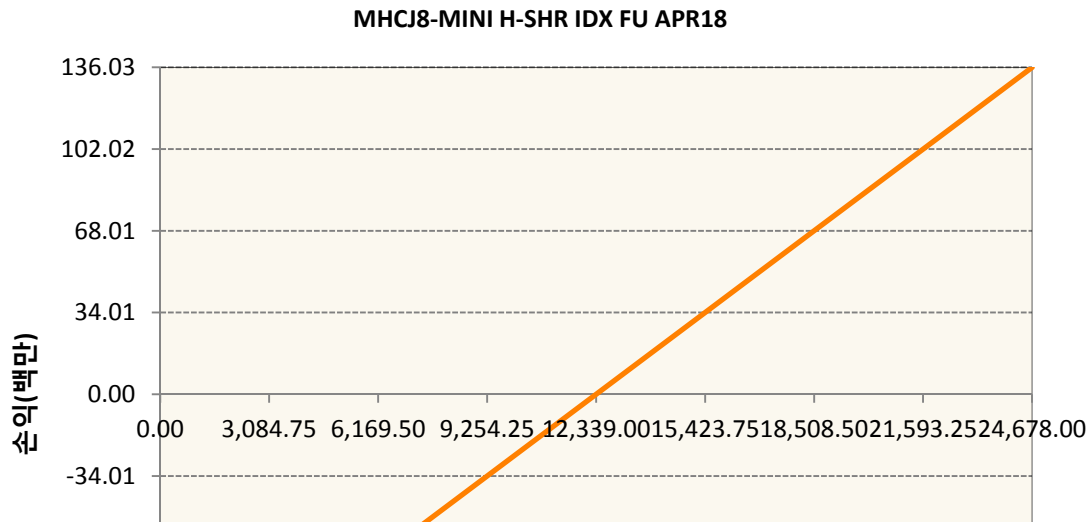
1. 계약금액

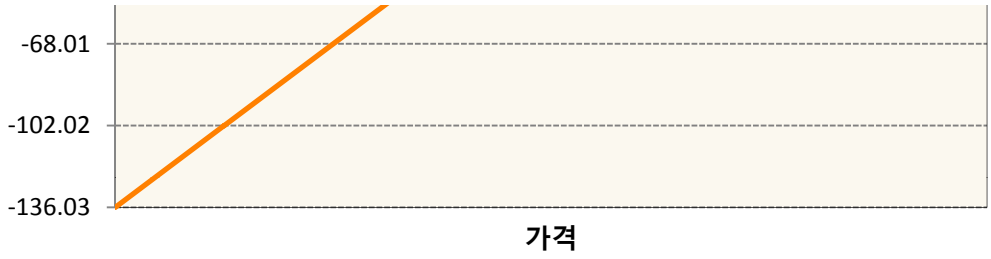
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,177	0	2,177	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCJ8	H-SHARES FUT APR18	163
MHCJ8	MINI H-SHR IDX FU APR18	11

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	153

공시일	2018-04-11
기준일	2018-04-10

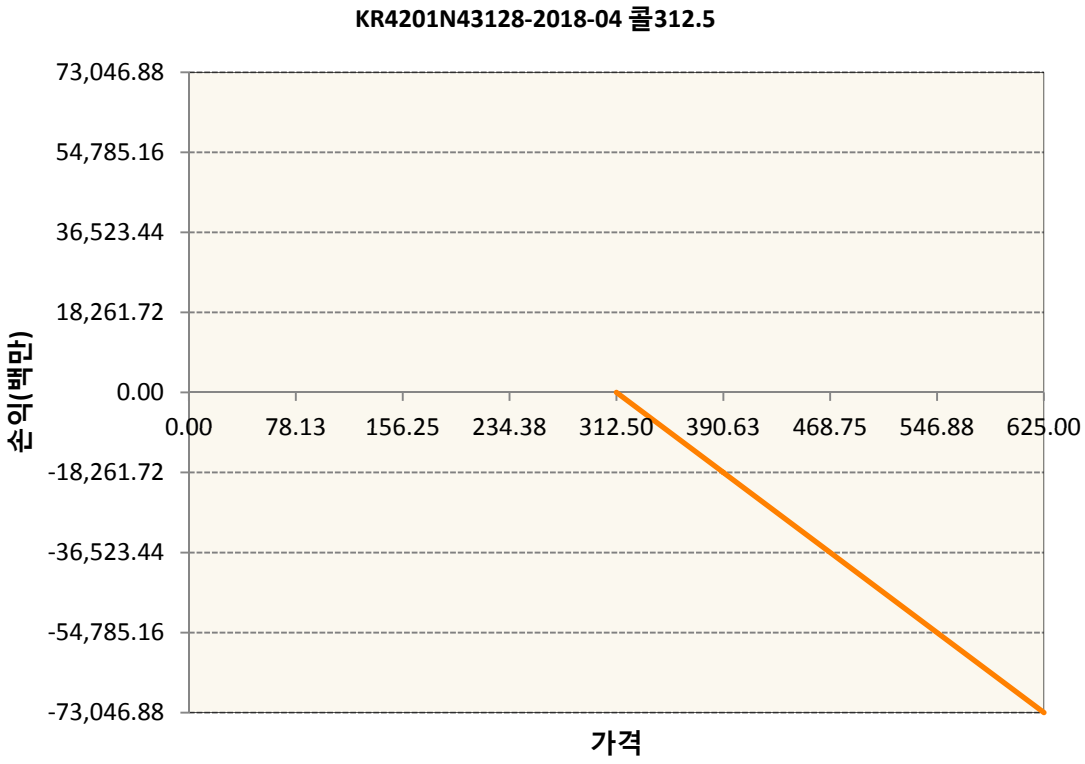
커버드콜모(주식혼합-파생형)

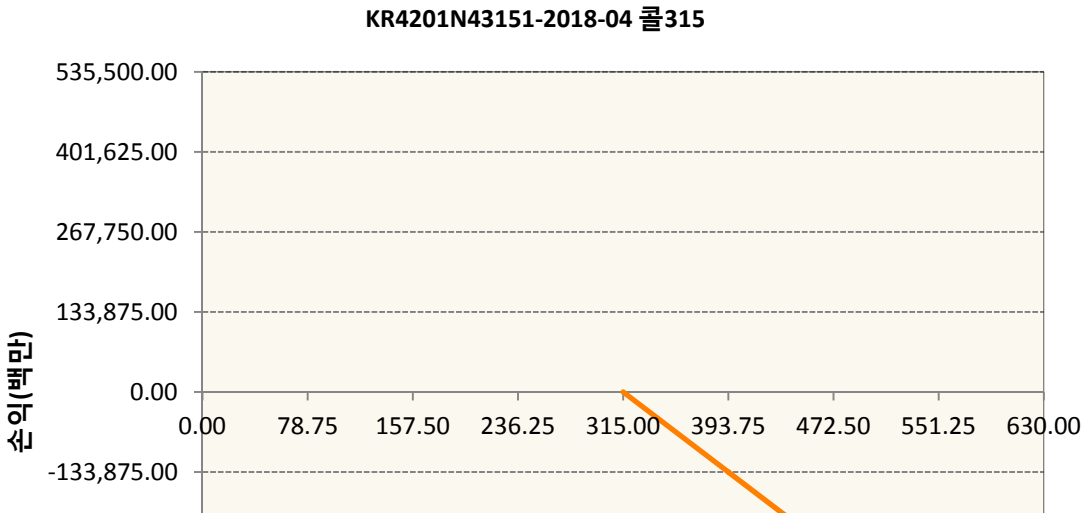
1. 계약금액

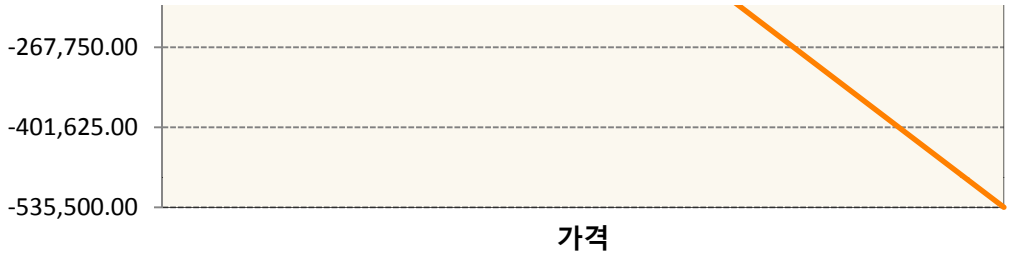
(단위:백만원)

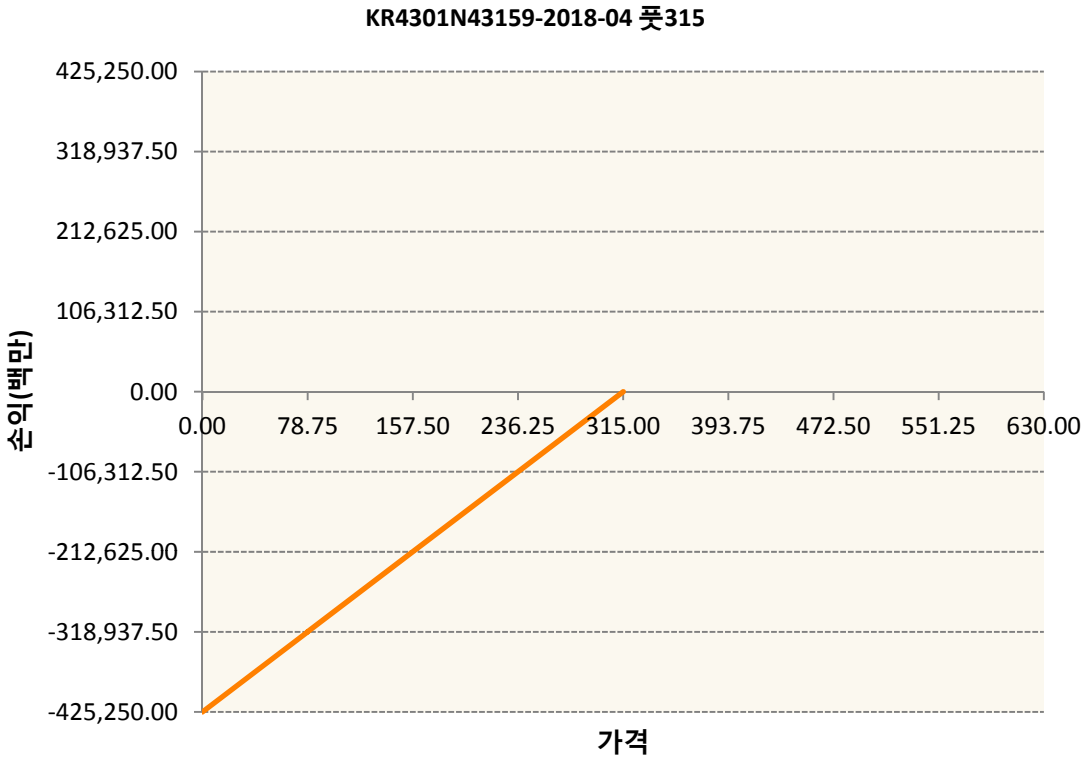
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	7,842	0	7,842	장내
누계	유가증권	옵션	0	1,033,797	-1,033,797	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201N4312018-04 콜312.5							5,416
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	792	792	792	792	792	792	792
-5.33%	792	792	790	788	785	780	773
-2.67%	754	734	711	684	655	623	589
0%	147	99	49	0	-50	-99	-149
2.67%	-1,512	-1,521	-1,533	-1,549	-1,568	-1,589	-1,613
5.33%	-3,459	-3,459	-3,459	-3,460	-3,462	-3,465	-3,469
8.00%	-5,415	-5,415	-5,415	-5,415	-5,415	-5,416	-5,416
KR4201N4312018-04 콜315							37,302
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	3,604	3,604	3,604	3,604	3,604	3,604	3,603

-5.33%	3,604	3,603	3,601	3,596	3,586	3,569	3,544
-2.67%	3,523	3,456	3,365	3,250	3,113	2,955	2,779
0%	1,092	729	365	0	-366	-733	-1,100
2.67%	-9,097	-9,239	-9,409	-9,603	-9,817	-10,050	-10,297
5.33%	-23,064	-23,069	-23,080	-23,100	-23,131	-23,175	-23,234
8.00%	-37,292	-37,292	-37,292	-37,293	-37,294	-37,297	-37,302
KR4301N4312018-04 풋315							32,486

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-32,486	-32,486	-32,486	-32,486	-32,486	-32,486	-32,486
-5.33%	-21,186	-21,186	-21,186	-21,186	-21,186	-21,186	-21,186
-2.67%	-9,885	-9,886	-9,889	-9,895	-9,904	-9,918	-9,938
0%	487	326	164	0	-165	-331	-497
2.67%	2,835	2,825	2,808	2,784	2,751	2,709	2,658
5.33%	2,842	2,842	2,842	2,842	2,842	2,841	2,841
8.00%	2,842	2,842	2,842	2,842	2,842	2,842	2,842

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

103,278

공시일	2018-04-11
기준일	2018-04-10

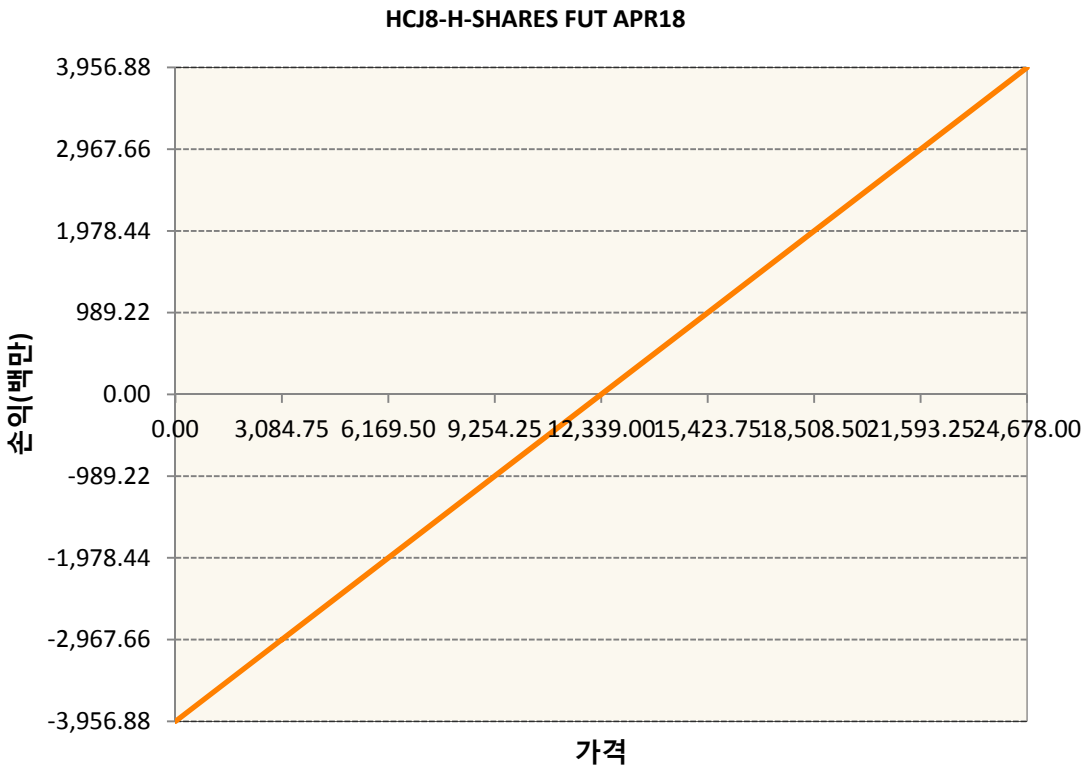
홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생

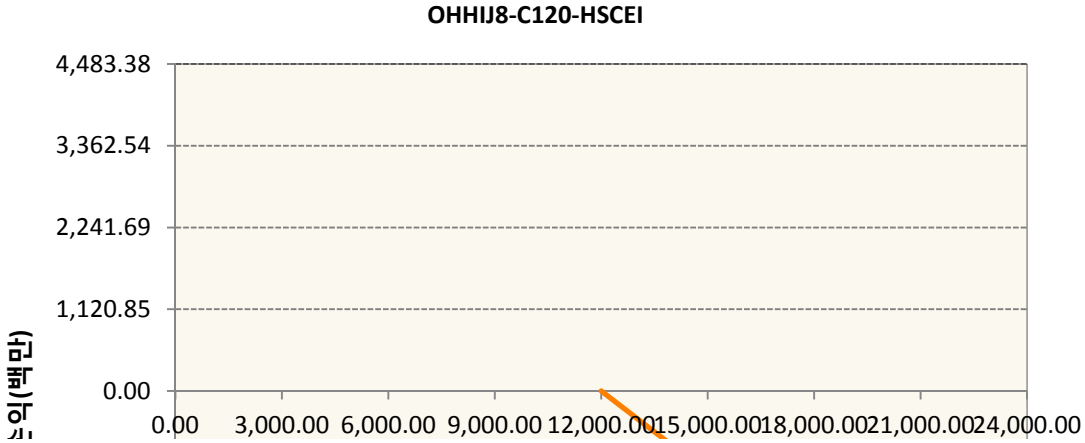
1. 계약금액

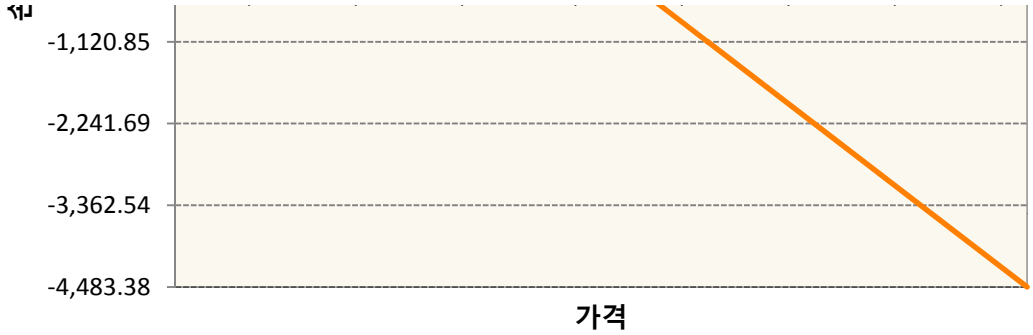
(단위:백만원)

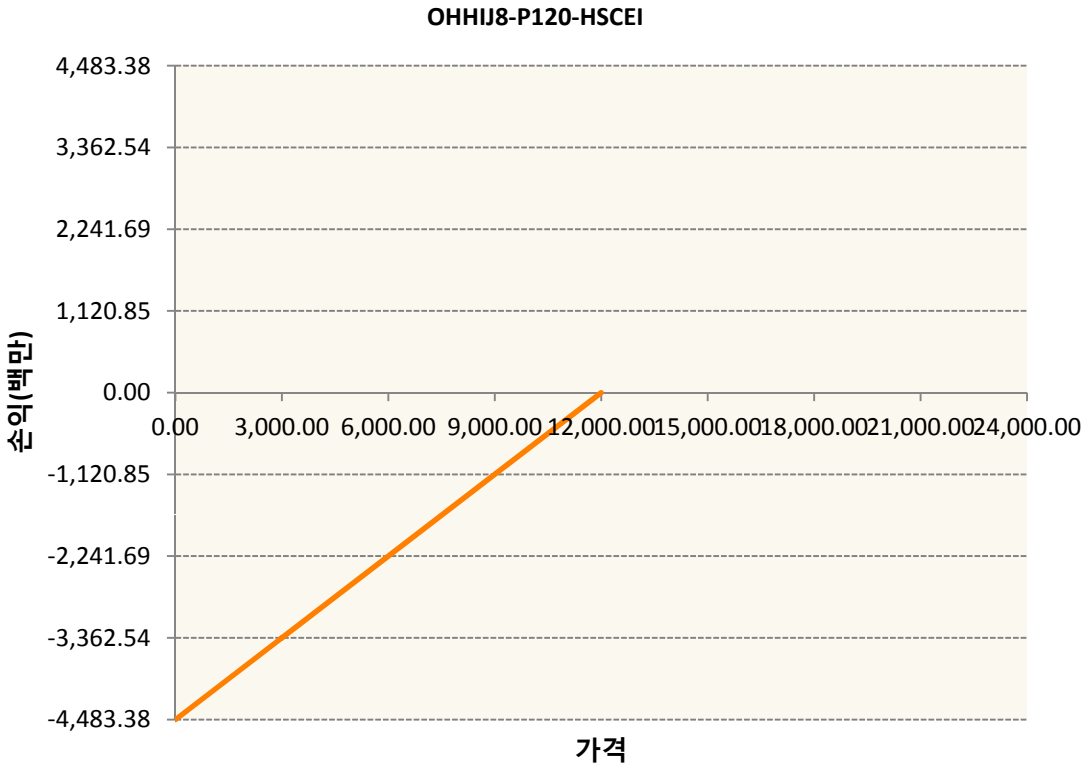
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	3,957	0	3,957	장내
누계	유가증권	옵션	0	8,967	-8,967	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCJ8	H-SHARES FUT APR18	317
OHHIJ8-C12	HSCEI	359
OHHIJ8-P12	HSCEI	359

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	905

공시일	2018-04-11
기준일	2018-04-10

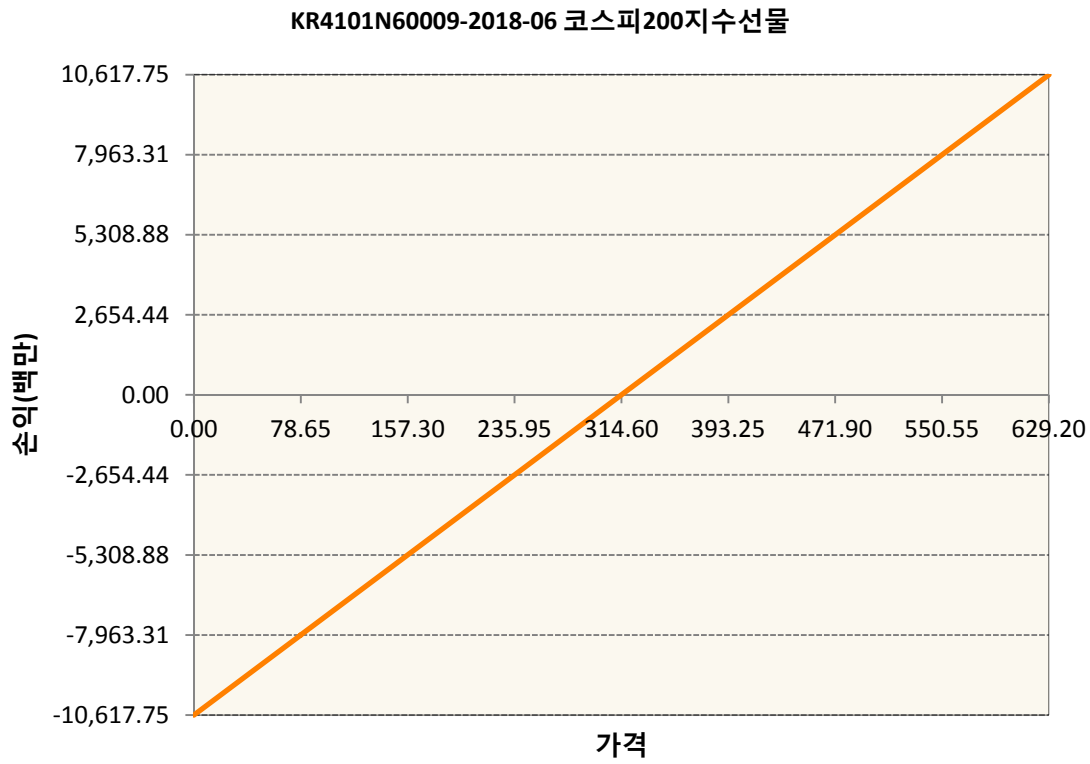
코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼

1. 계약금액

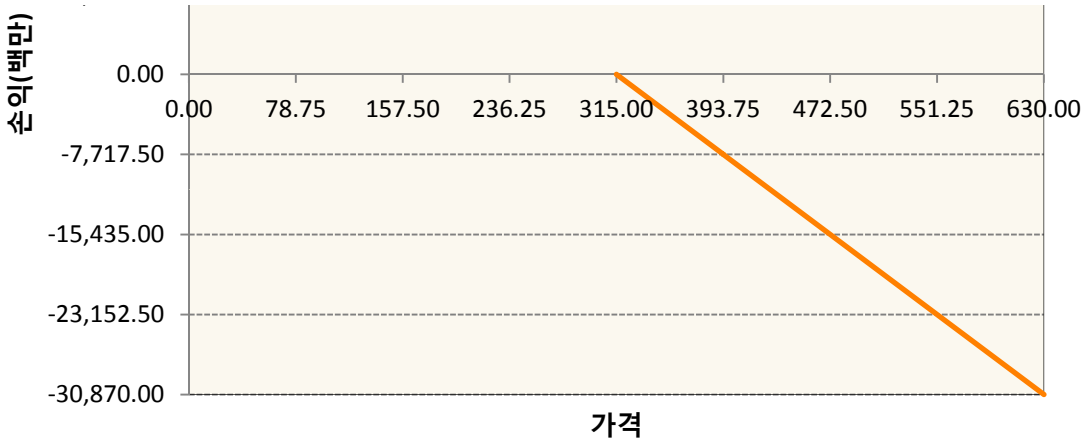
(단위:백만원)

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	10,618	0	10,618	장내
누계	유가증권	스왑	54,200	0	54,200	장외
누계	유가증권	옵션	0	55,718	-55,718	장내

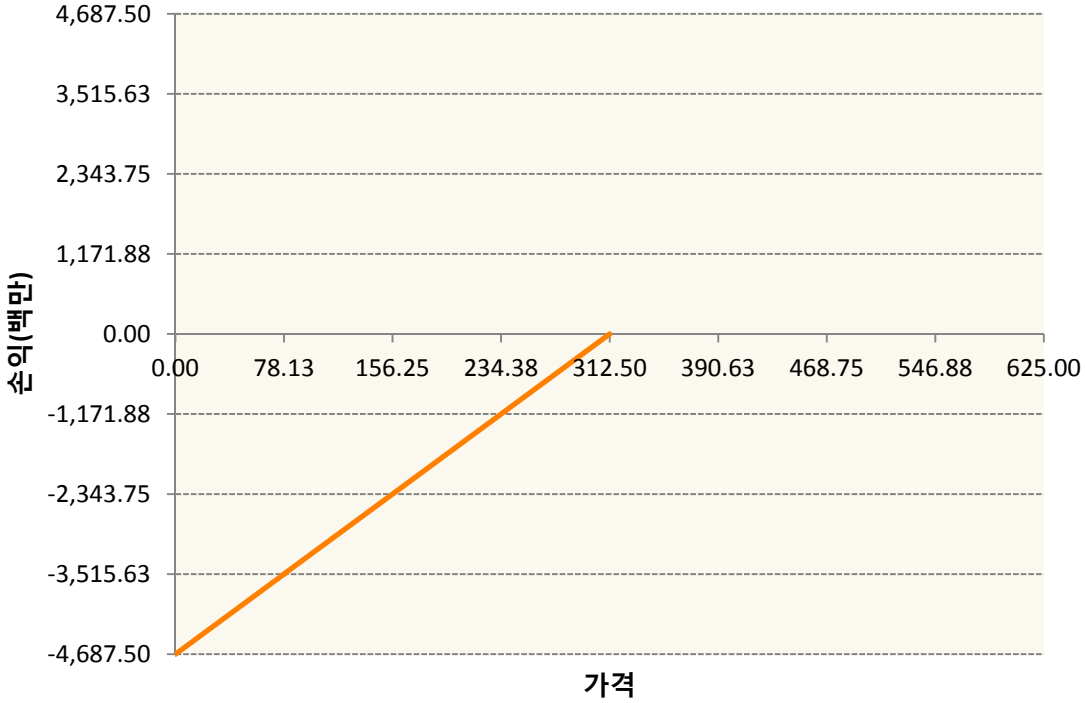
2. 만기시점의 손익구조



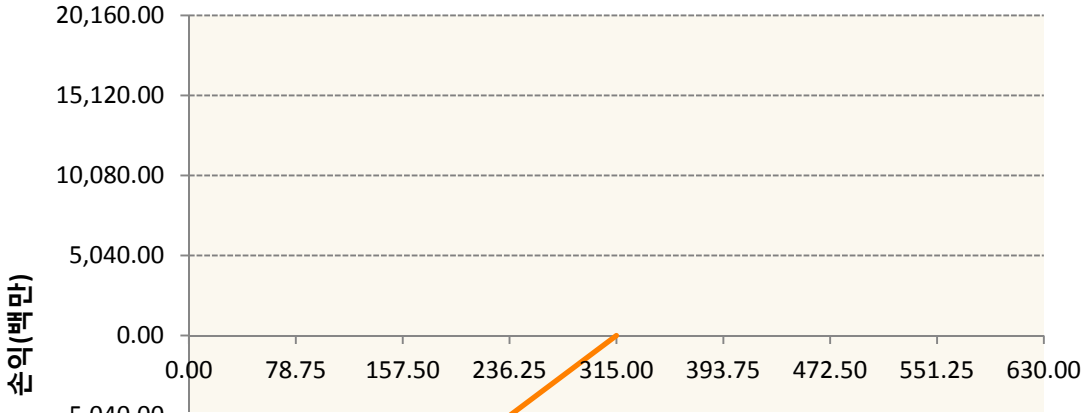




KR4301N43126-2018-04 풋312.5



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						848
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-848	-848	-848	-848	-848	-848	-848
-5.33%	-565	-565	-565	-565	-565	-565	-565
-2.67%	-283	-283	-283	-283	-283	-283	-283
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	283	283	283	283	283	283	283
5.33%	565	565	565	565	565	565	565
8.00%	848	848	848	848	848	848	848
	KR4201N431 2018-04 콜315						2,150
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	208	208	208	208	208	208	208
-5.33%	208	208	208	207	207	206	204
-2.67%	203	199	194	187	179	170	160
0%	63	42	21	0	-21	-42	-63
2.67%	-524	-533	-542	-554	-566	-579	-594
5.33%	-1,330	-1,330	-1,330	-1,332	-1,333	-1,336	-1,339
8.00%	-2,150	-2,150	-2,150	-2,150	-2,150	-2,150	-2,150
	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%	-216	-216	-216	-216	-216	-216	-216
-2.67%	-91	-91	-91	-91	-92	-92	-93
0%	5	3	2	0	-2	-4	-5
2.67%	13	13	13	13	13	13	13
5.33%	13	13	13	13	13	13	13
8.00%	13	13	13	13	13	13	13
	KR4301N431 2018-04 풋315						1,540

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,540	-1,540	-1,540	-1,540	-1,540	-1,540	-1,540
-5.33%	-1,004	-1,004	-1,004	-1,004	-1,004	-1,004	-1,004
-2.67%	-469	-469	-469	-469	-470	-470	-471
0%	23	15	8	0	-8	-16	-24
2.67%	134	134	133	132	130	128	126
5.33%	135	135	135	135	135	135	135
8.00%	135	135	135	135	135	135	135

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

10,409

공시일	2018-04-11
기준일	2018-04-10

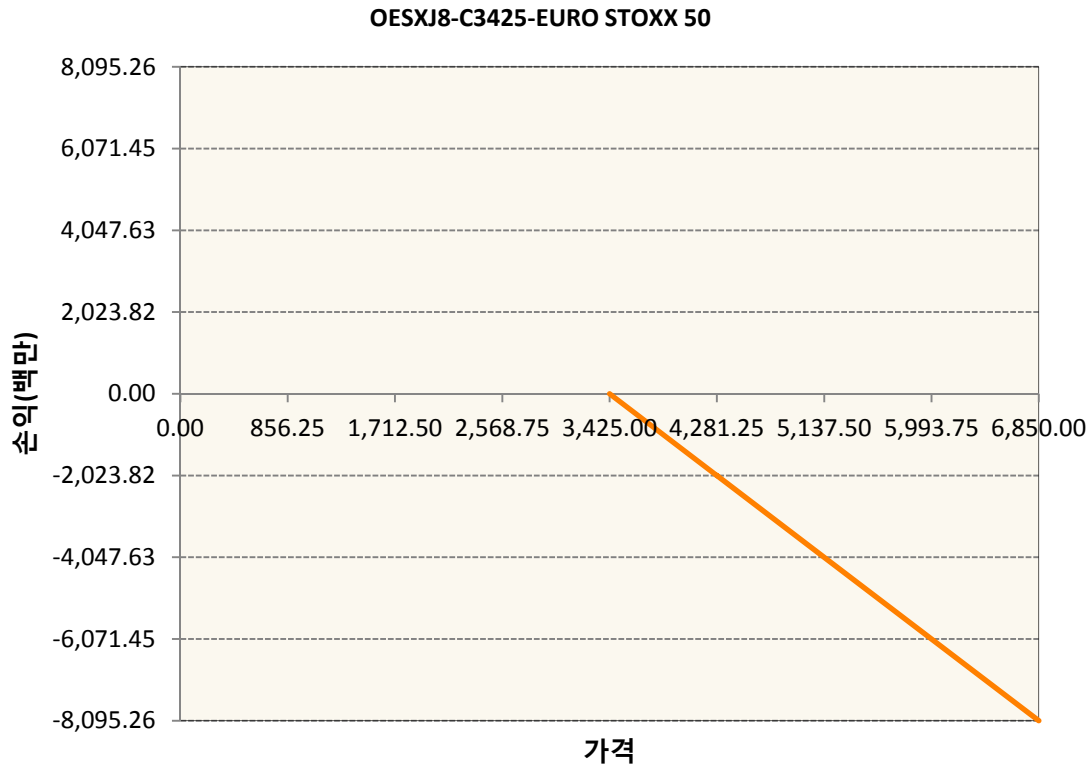
유로커버드콜모(주식혼합-파생형

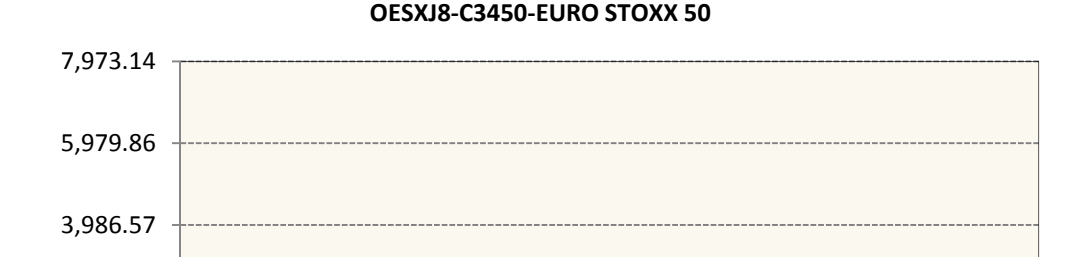
1. 계약금액

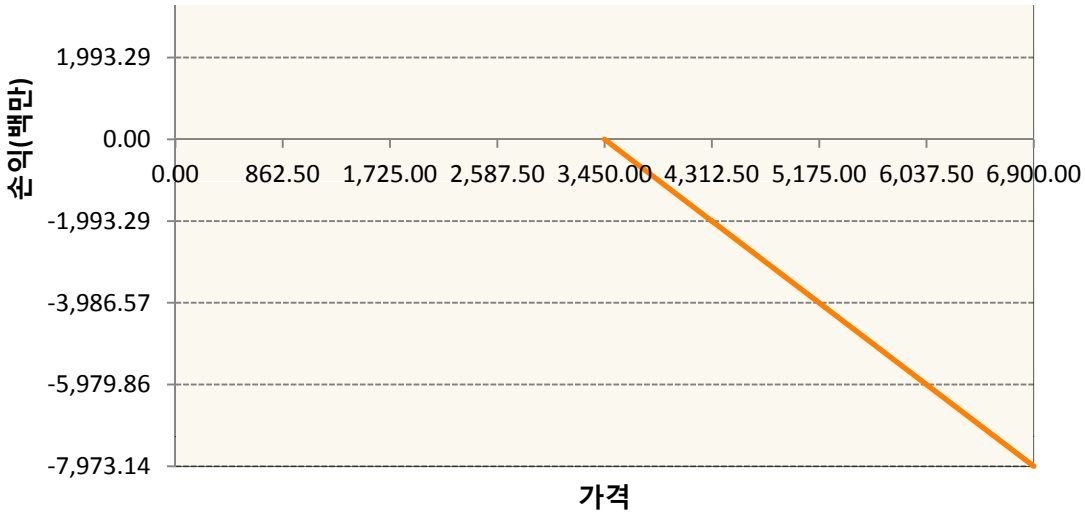
(단위:백만원)

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	7,517	0	7,517	
누계	유가증권	스왑	75,844	0	75,844	장외
누계	유가증권	옵션	0	32,137	-32,137	장내
누계	지수	스왑	52,523	0	52,523	장외

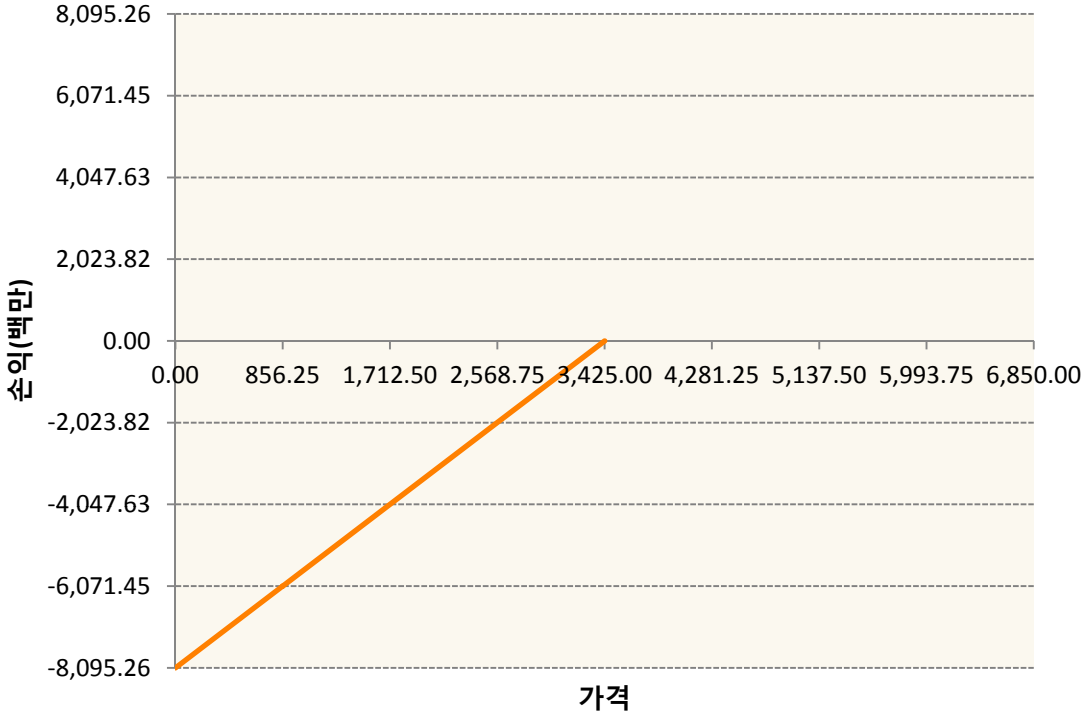
2. 만기시점의 손익구조



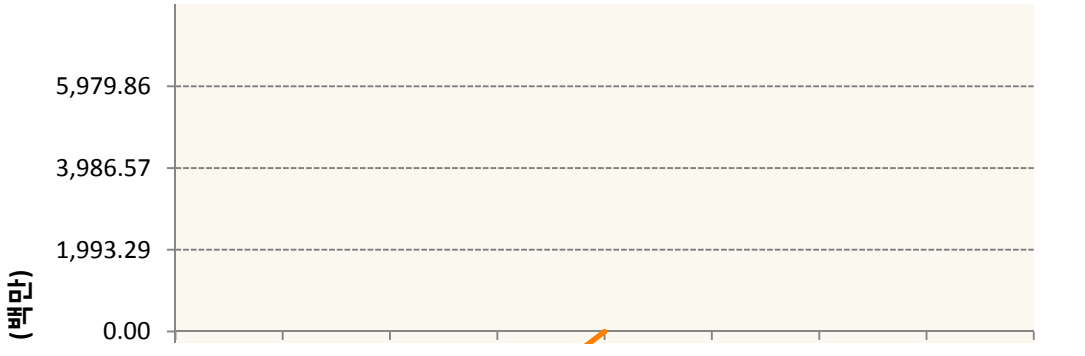


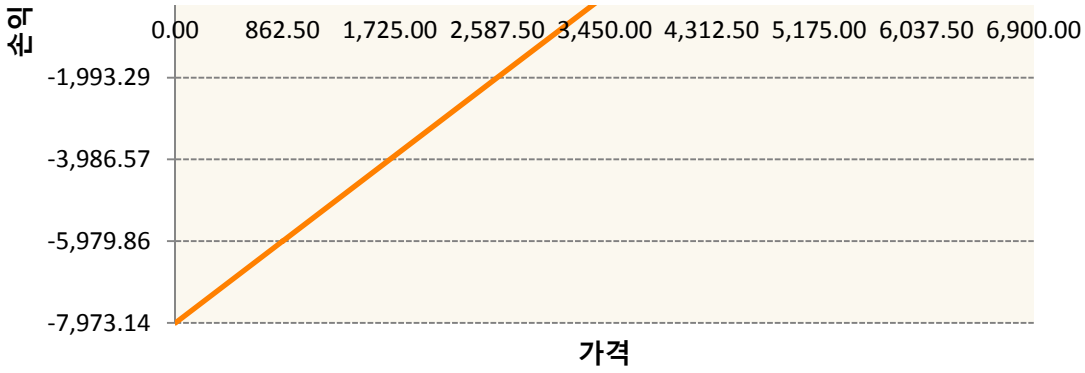


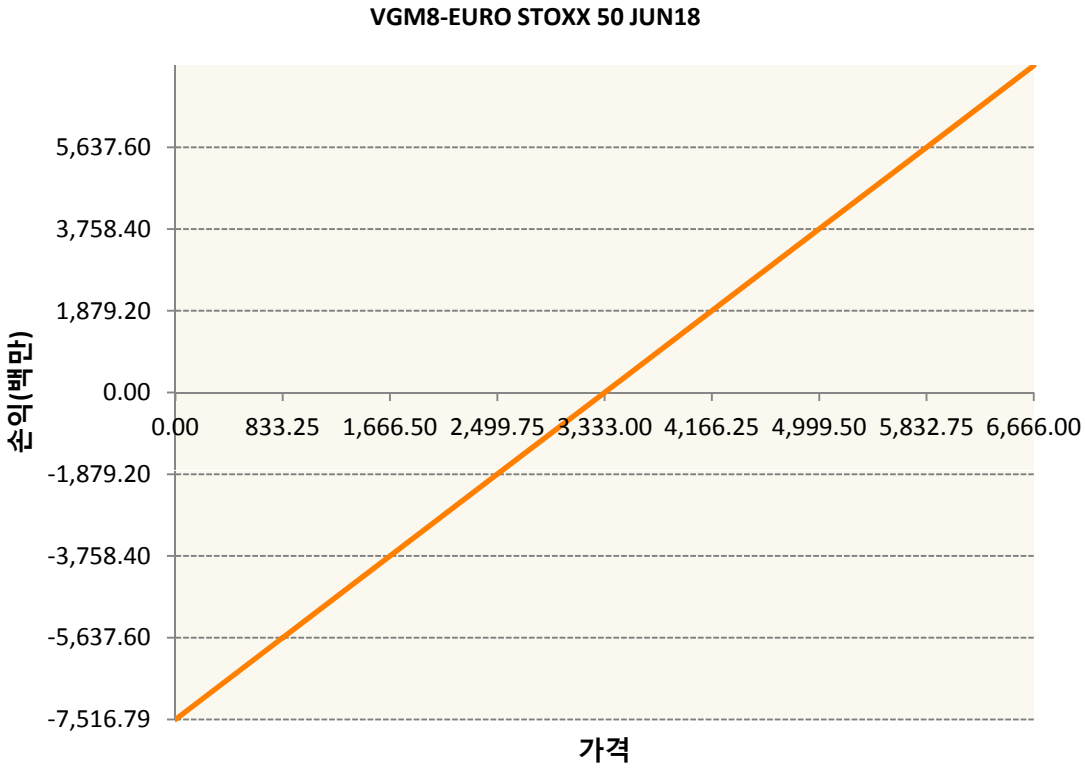
OESXJ8-P3425-EURO STOXX 50



OESXJ8-P3450-EURO STOXX 50







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
260105SGPX	SG EURO Covered CALL STRATEGY - 994.569	151
260105SQPX	SG EURO Covered CALL STRATEGY	218
OESXJ8-C34	EURO STOXX 50	648
OESXJ8-C34	EURO STOXX 50	638
OESXJ8-P34	EURO STOXX 50	648
OESXJ8-P34	EURO STOXX 50	638
VGM8	EURO STOXX 50 JUN18	601

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

2,216

공시일	2018-04-11
기준일	2018-04-10

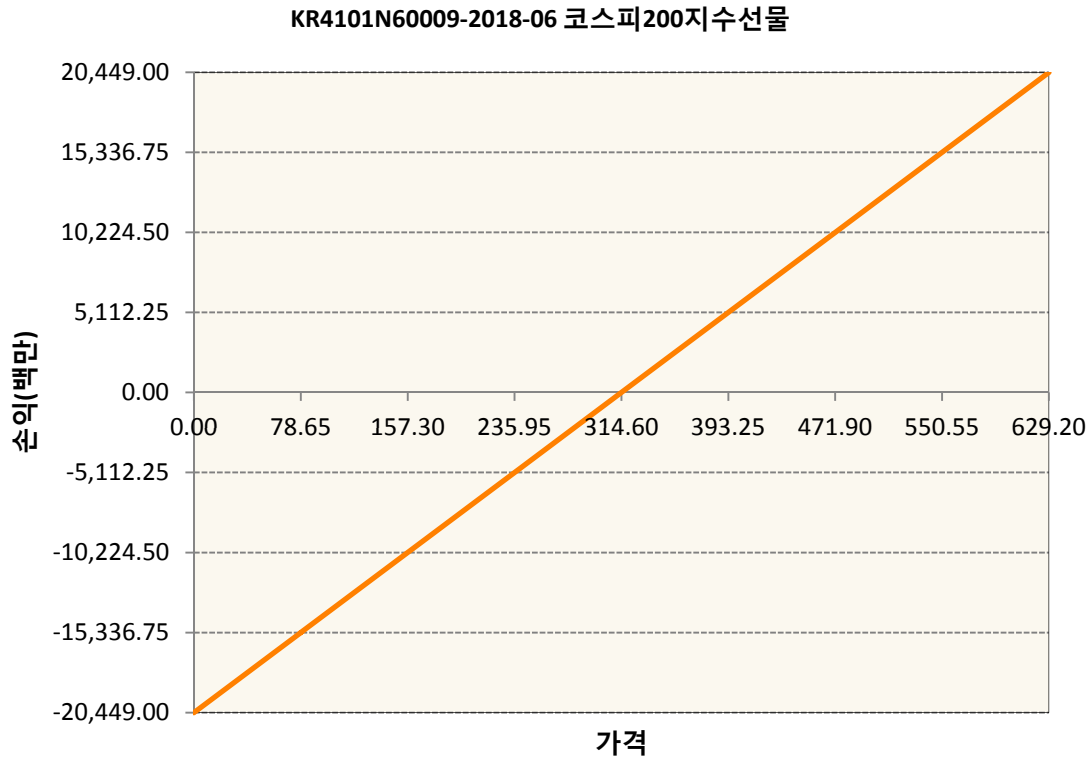
ETF스마트레버리지목표전환형8호

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	20,449	0	20,449	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101N60(2018-06 코스피200지수선물							1,632
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,632	-1,632	-1,632	-1,632	-1,632	-1,632	-1,632
-5.33%	-1,088	-1,088	-1,088	-1,088	-1,088	-1,088	-1,088
-2.67%	-544	-544	-544	-544	-544	-544	-544
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	544	544	544	544	544	544	544
5.33%	1,088	1,088	1,088	1,088	1,088	1,088	1,088
8.00%	1,632	1,632	1,632	1,632	1,632	1,632	1,632

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

1,192

공시일	2018-04-11
기준일	2018-04-10

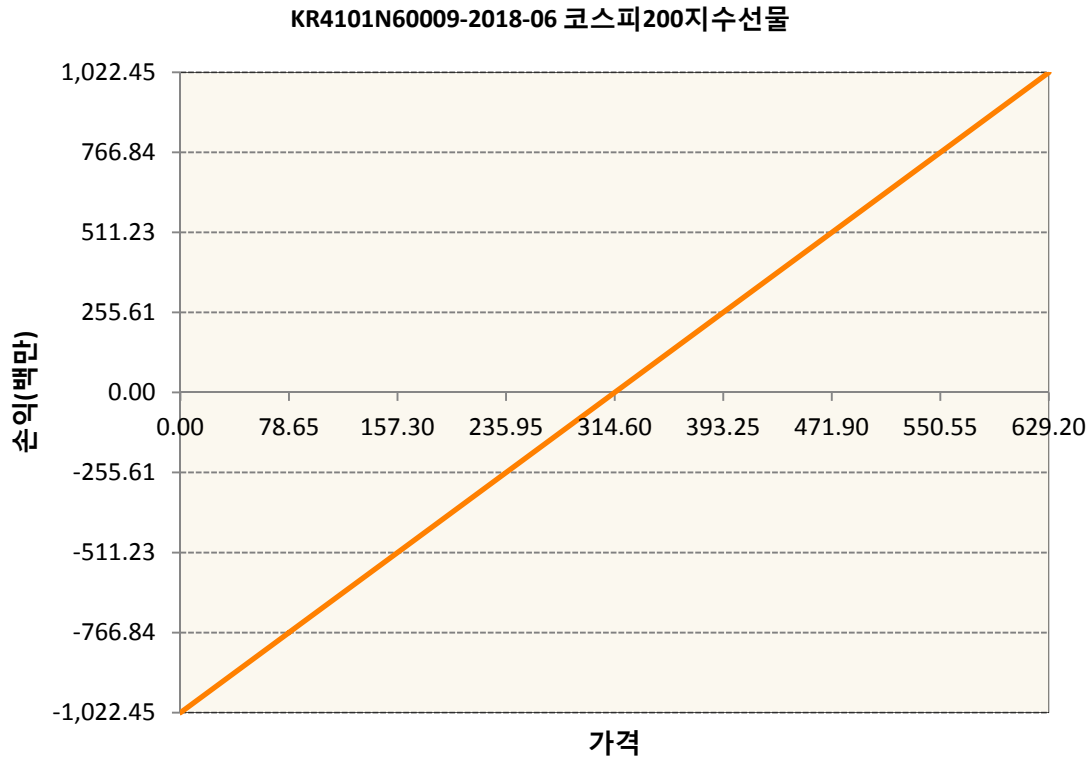
ETF스마트레버리지목표전환형9호

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	1,022	0	1,022	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101N60(2018-06 코스피200지수선물							82
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-82	-82	-82	-82	-82	-82	-82
-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%	82	82	82	82	82	82	82

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

60

공시일	2018-04-11
기준일	2018-04-10

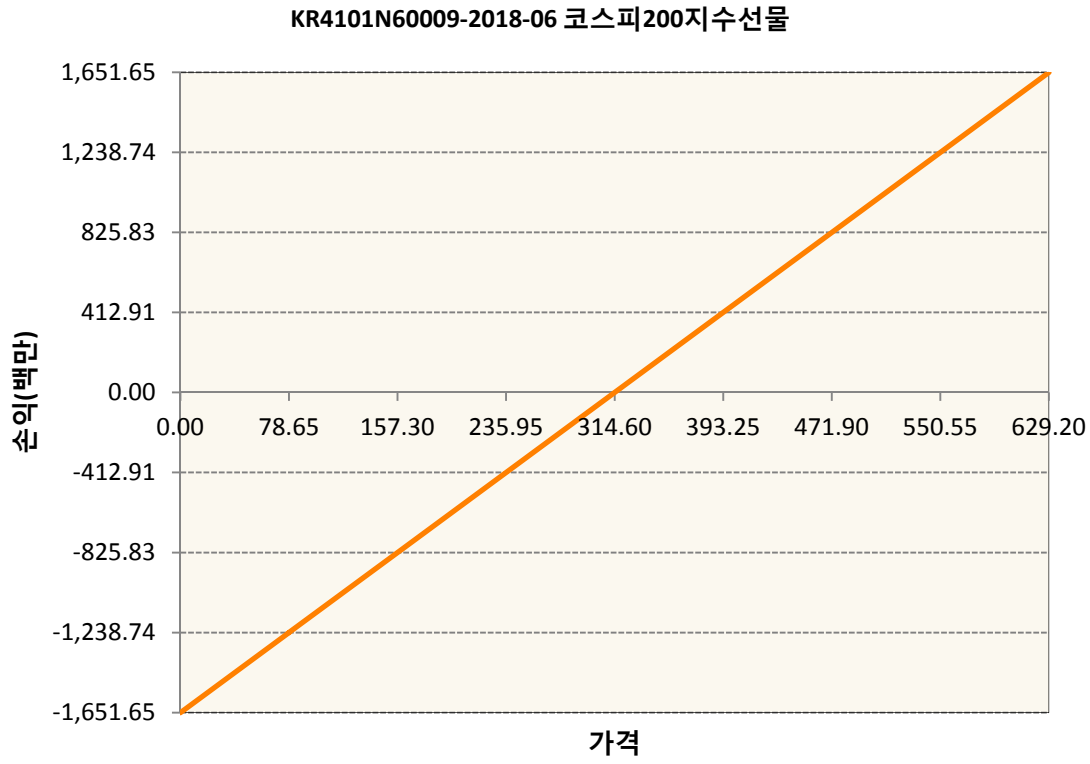
ETF스마트레버리지목표전환형10

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	1,652	0	1,652	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	2018-04-11
기준일	2018-04-10

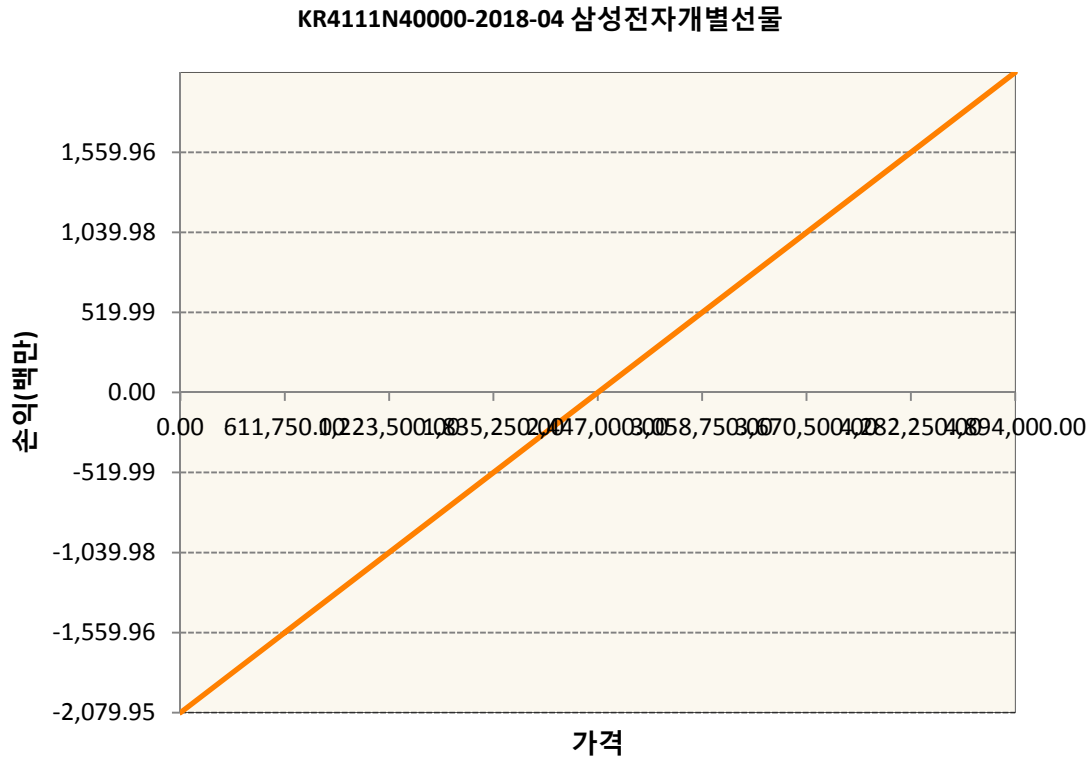
스마트KRX300인덱스1호(주식-파

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	2,080	0	2,080	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%	-111	-111	-111	-111	-111	-111	-111
-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%	111	111	111	111	111	111	111
8.00%	166	166	166	166	166	166	166

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

206

공시일	2018-04-11
기준일	2018-04-10

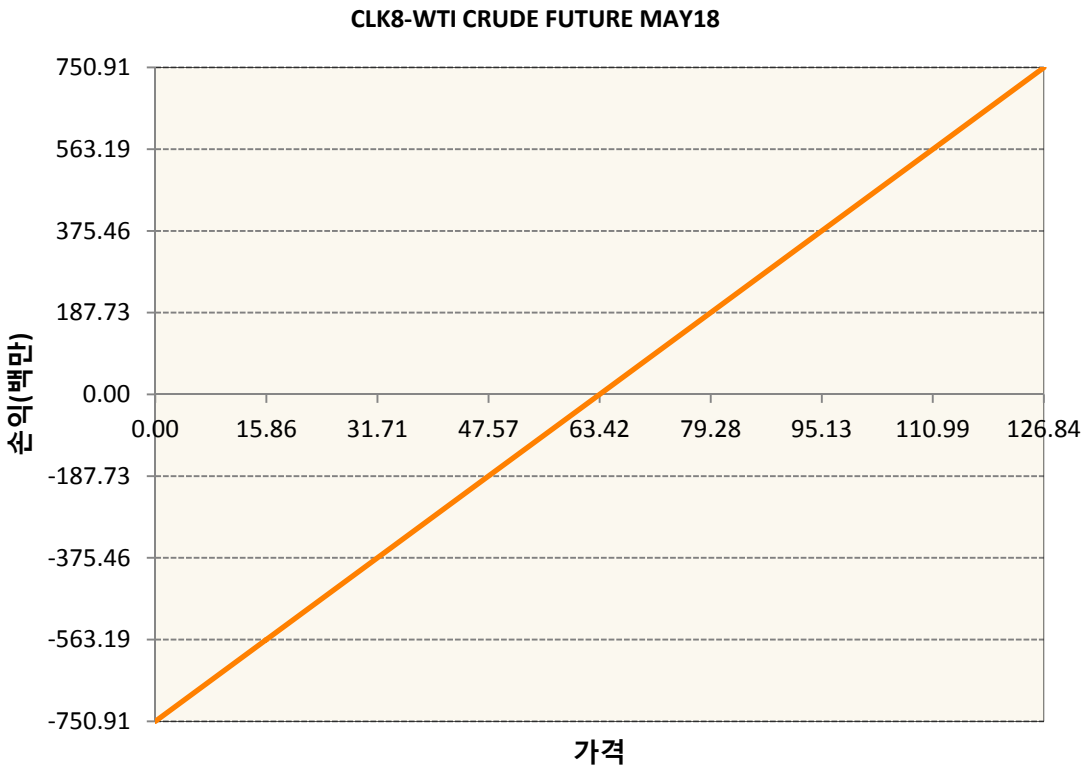
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

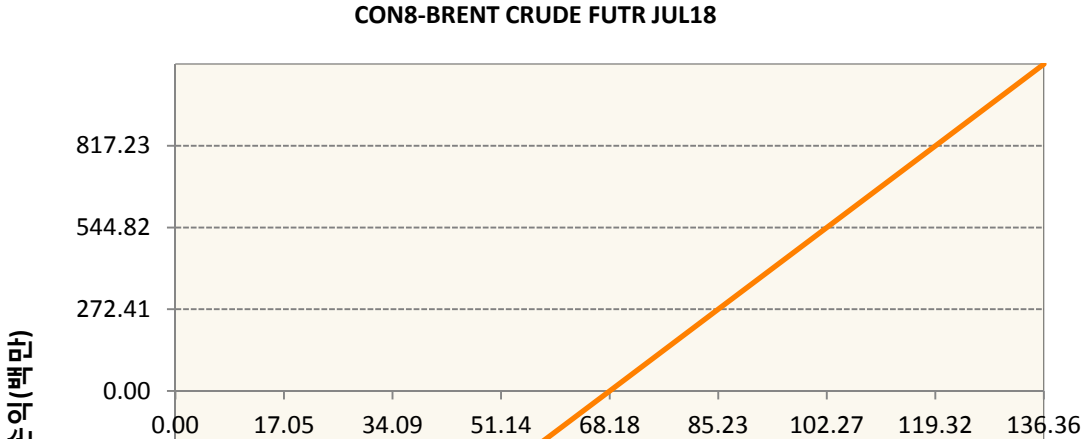
1. 계약금액

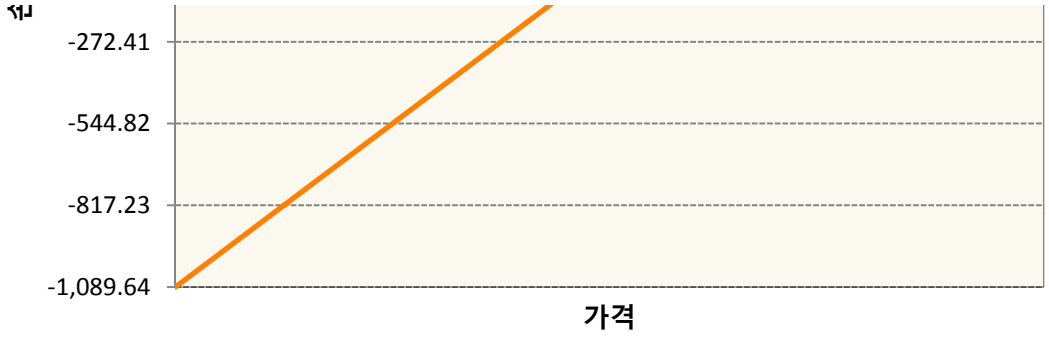
(단위:백만원)

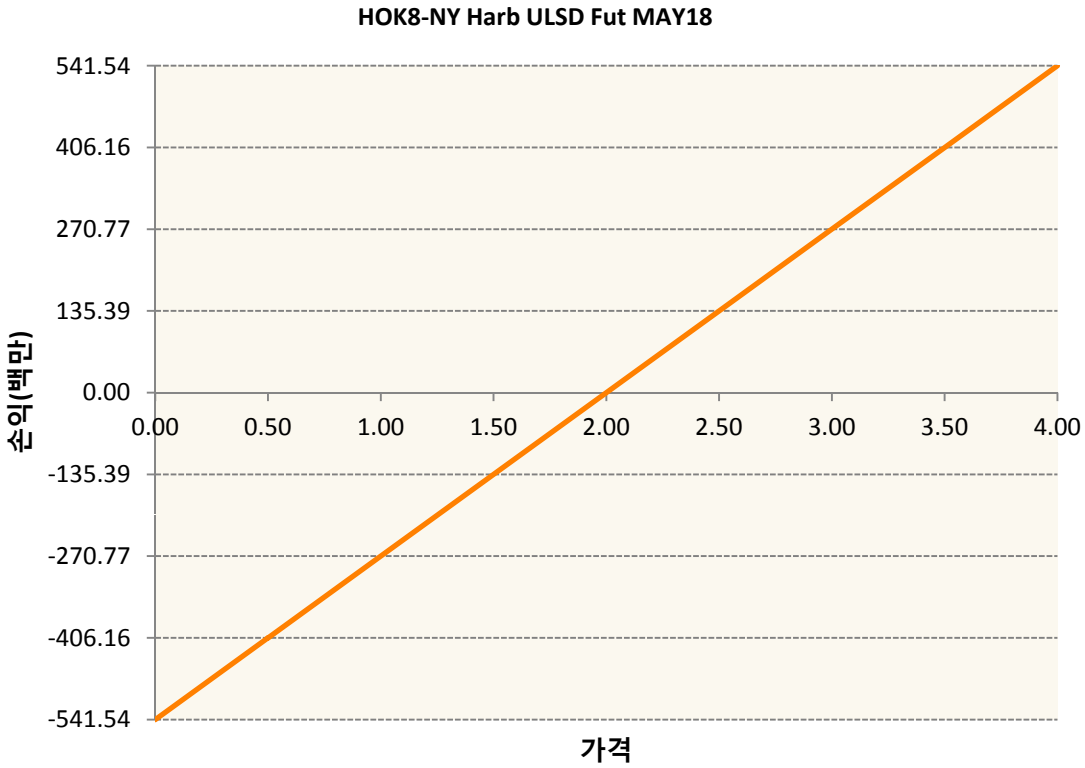
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	선물	유가증권	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	선물	유가증권	751	0	751	
누계	유가증권	선물	3,214	586	2,628	

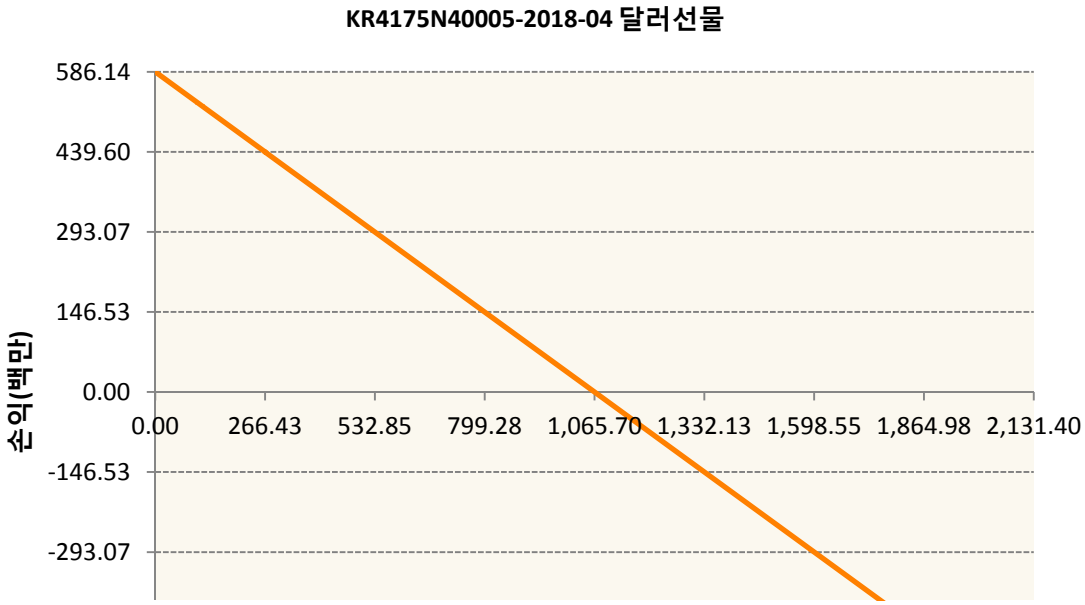
2. 만기시점의 손익구조

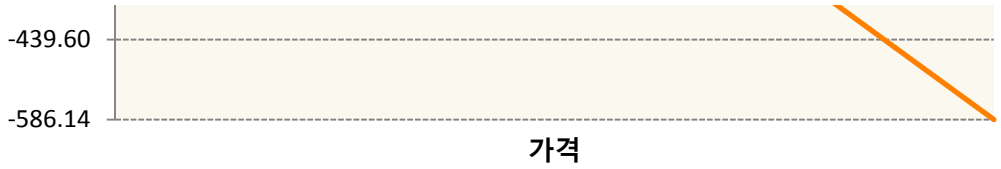


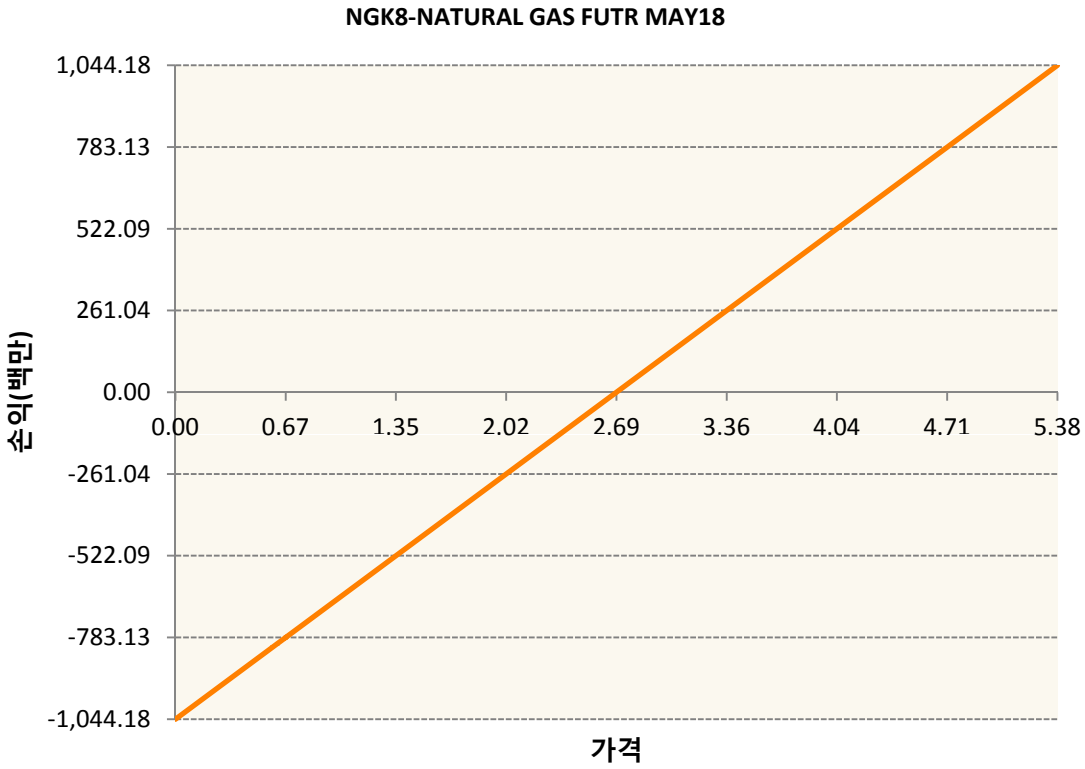


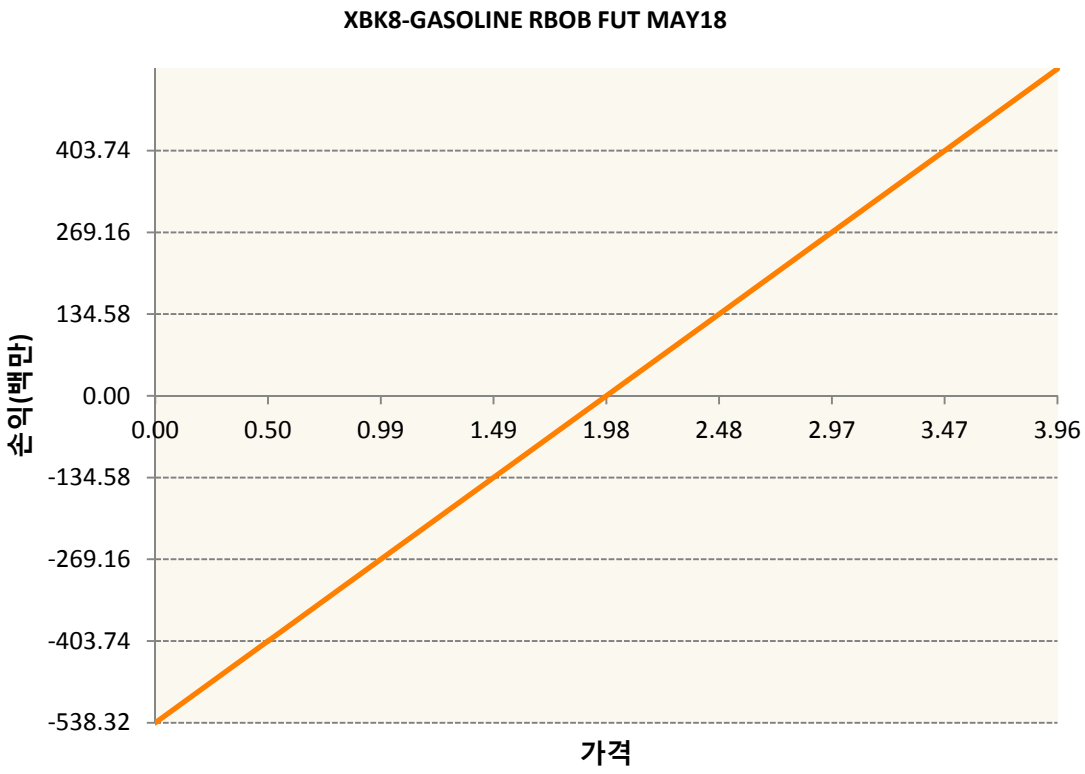

-272.41
-544.82
-817.23
-1,089.64
가격


HOK8-NY Harb ULSD Fut MAY18
541.54
406.16
270.77
135.39
0.00
-135.39
-270.77
-406.16
-541.54
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
586.14
439.60
293.07
146.53
0.00
-146.53
-293.07
0.00
266.43
532.85
799.28
1,065.70
1,332.13
1,598.55
1,864.98
2,131.40
손익(백만)


-439.60
-586.14
가격


NGK8-NATURAL GAS FUTR MAY18
1,044.18
783.13
522.09
261.04
0.00
-261.04
-522.09
-783.13
-1,044.18
0.00
0.67
1.35
2.02
2.69
3.36
4.04
4.71
5.38
손익(백만)
가격


XBK8-GASOLINE RBOB FUT MAY18
403.74
269.16
134.58
0.00
-134.58
-269.16
-403.74
-538.32
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	84
XBK8	GASOLINE RBOB FUT MAY18	43

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

505

공시일	2018-04-11
기준일	2018-04-10

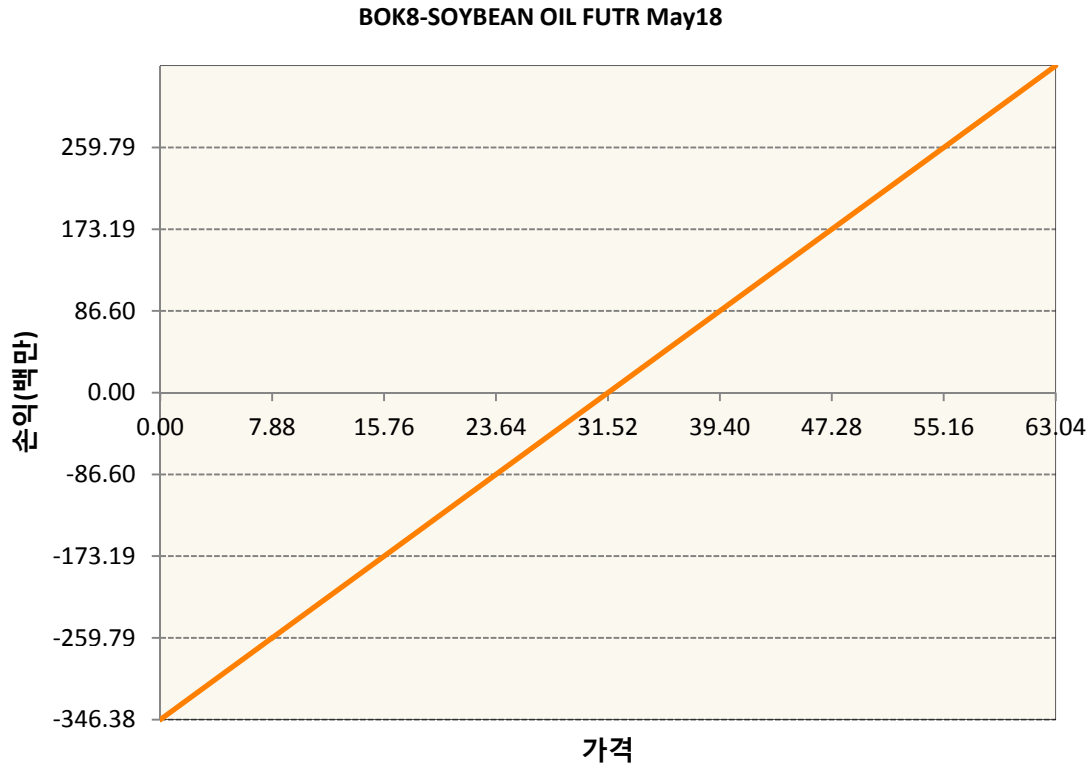
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

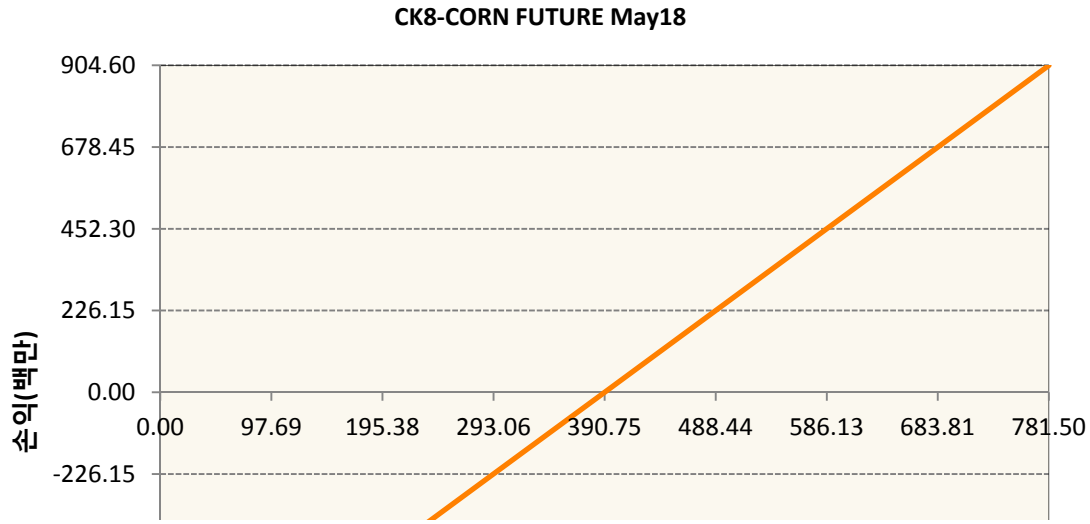
1. 계약금액

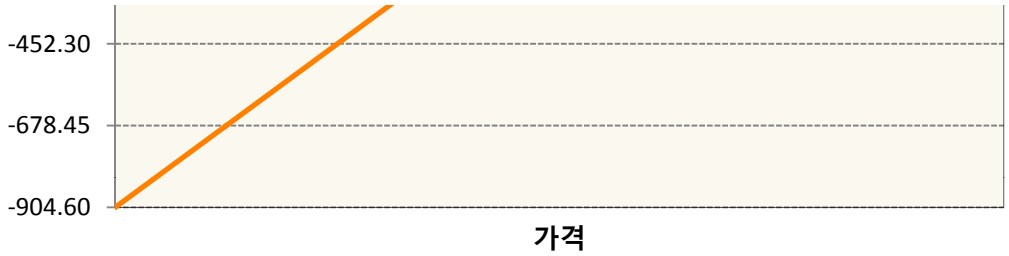
(단위:백만원)

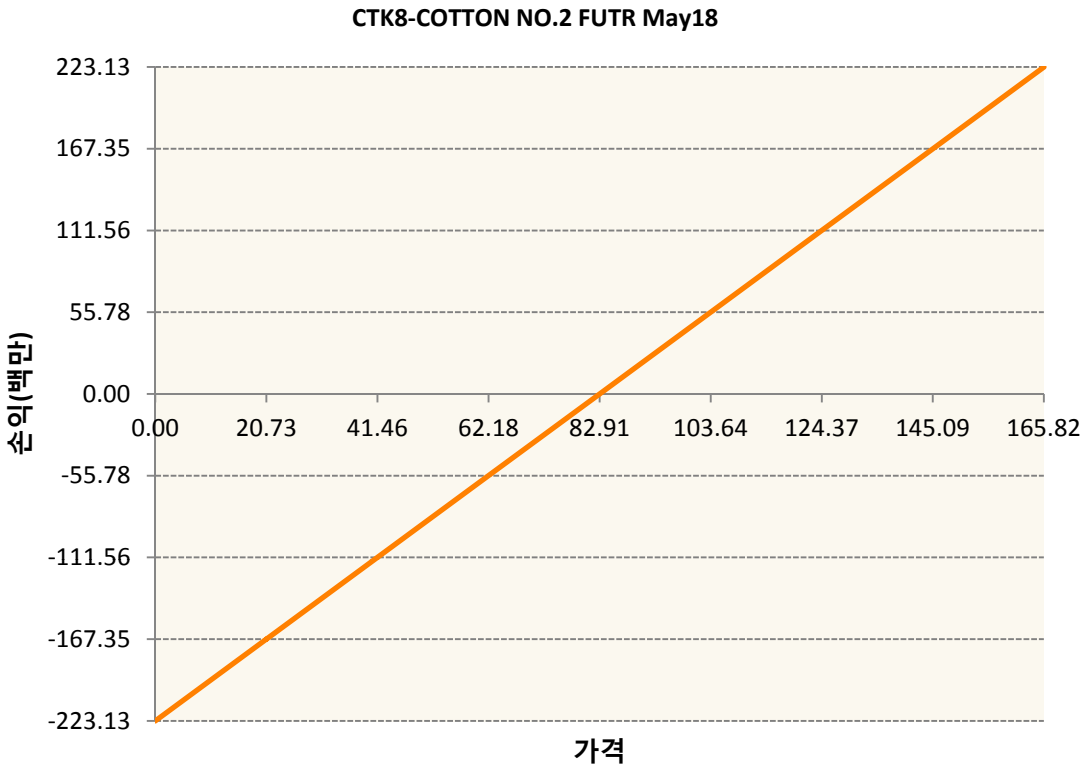
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	4,189	320	3,870	

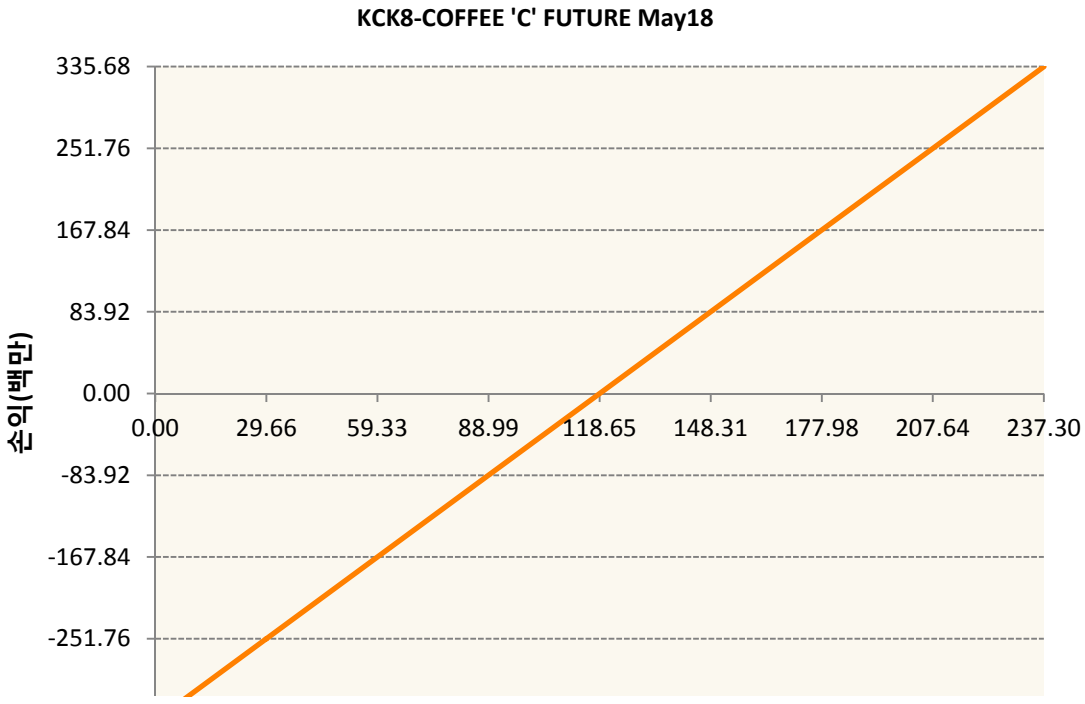
2. 만기시점의 손익구조

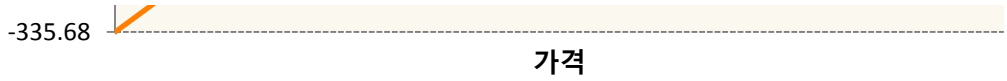


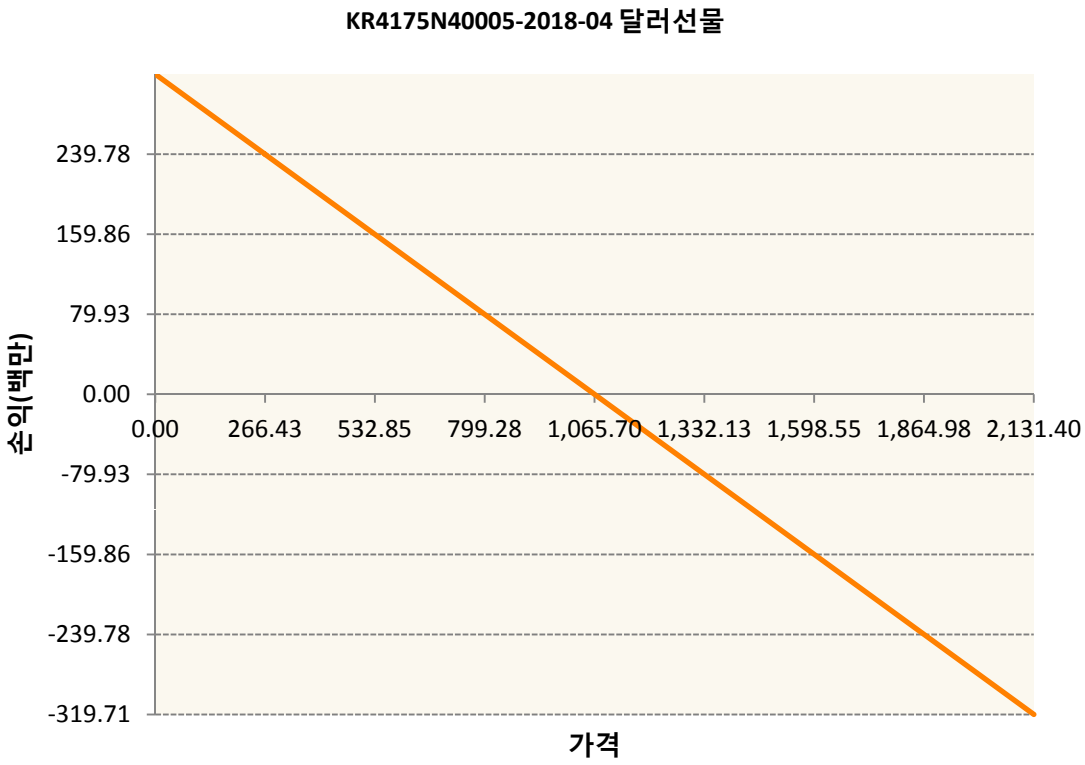


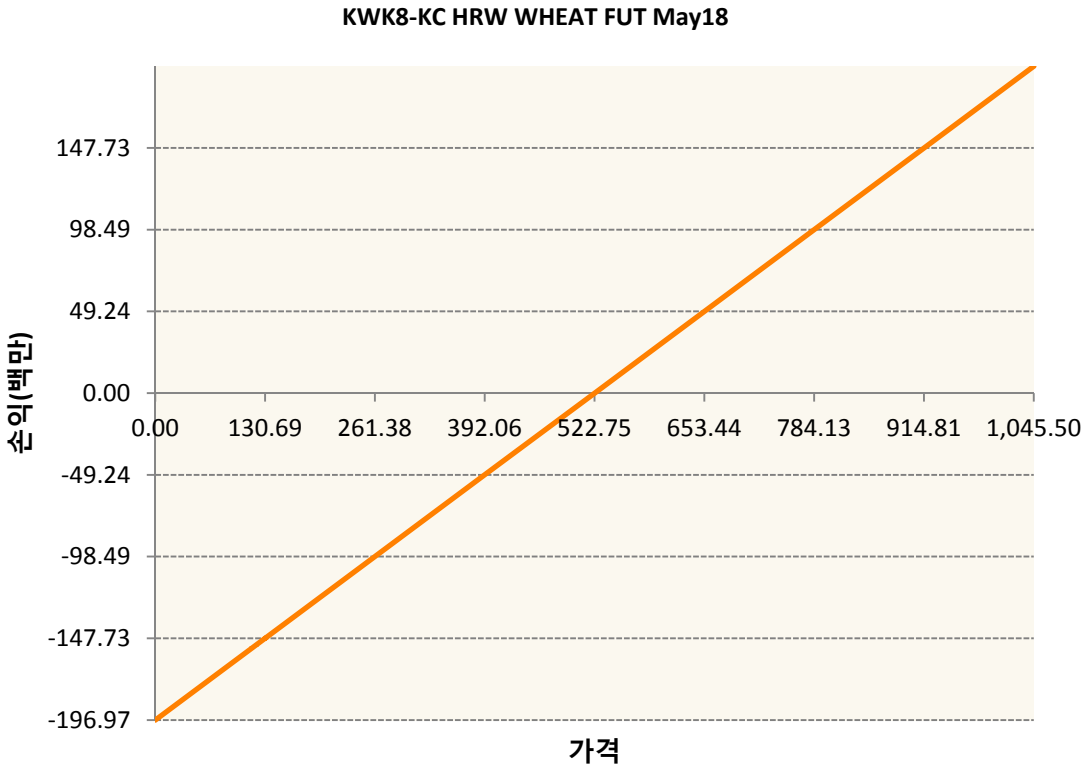

-452.30
-678.45
-904.60
가격

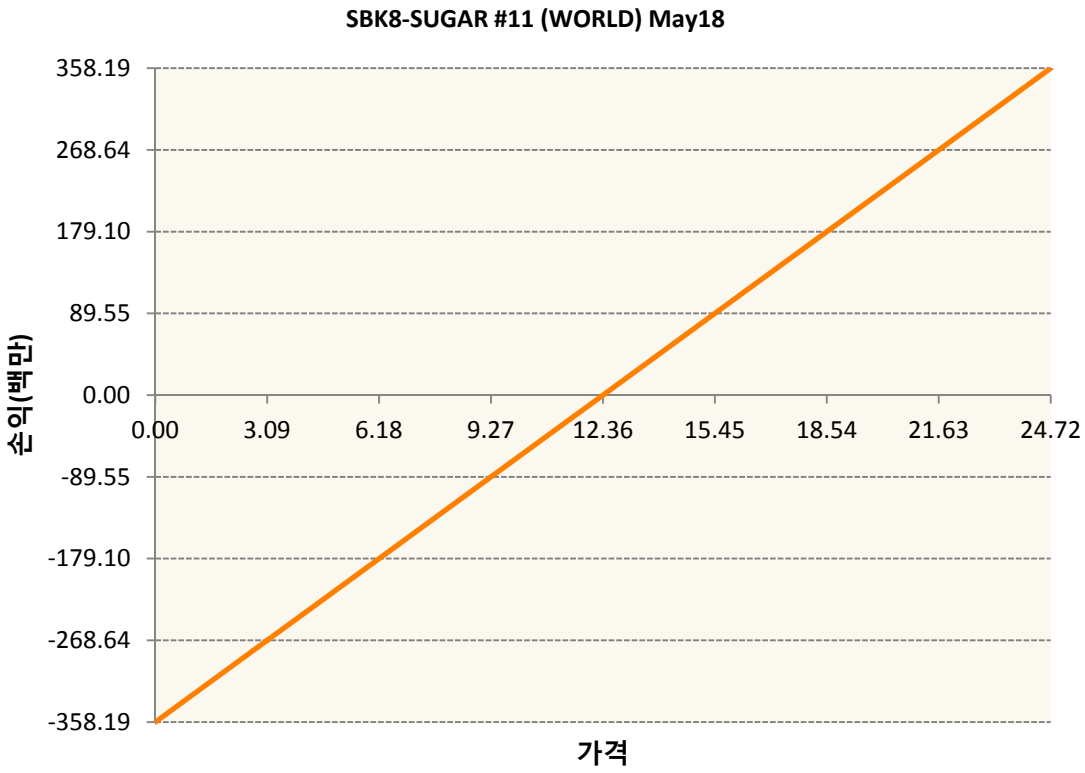

CTK8-COTTON NO.2 FUTR May18
223.13
167.35
111.56
55.78
0.00
-55.78
-111.56
-167.35
-223.13
손익(백만)
0.00
20.73
41.46
62.18
82.91
103.64
124.37
145.09
165.82
가격

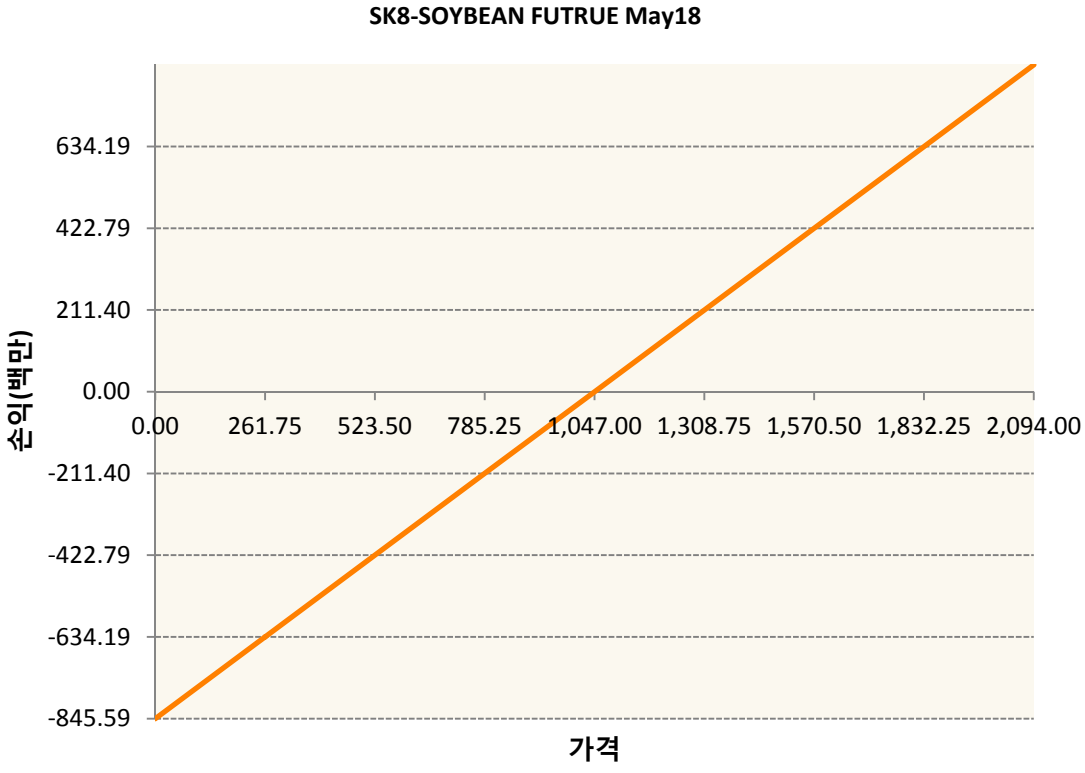

KCK8-COFFEE 'C' FUTURE May18
335.68
251.76
167.84
83.92
0.00
-83.92
-167.84
-251.76
손익(백만)
0.00
29.66
59.33
88.99
118.65
148.31
177.98
207.64
237.30


-335.68
가격

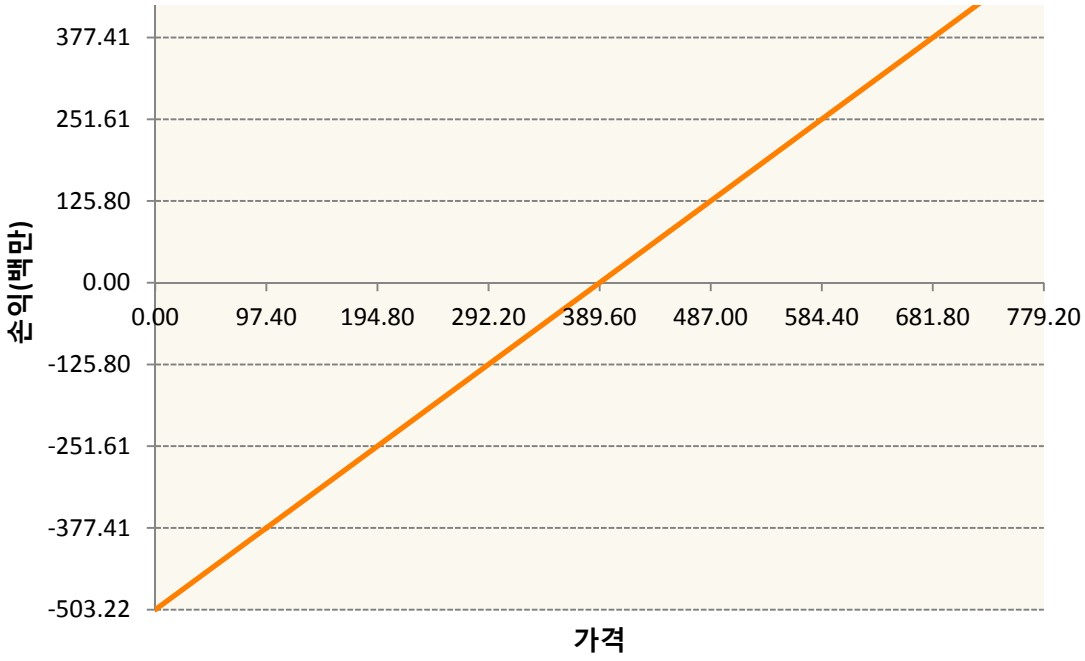

KR4175N40005-2018-04 달러선물
239.78
159.86
79.93
0.00
-79.93
-159.86
-239.78
-319.71
0.00
266.43
532.85
799.28
1,065.70
1,332.13
1,598.55
1,864.98
2,131.40
손익(백만)
가격

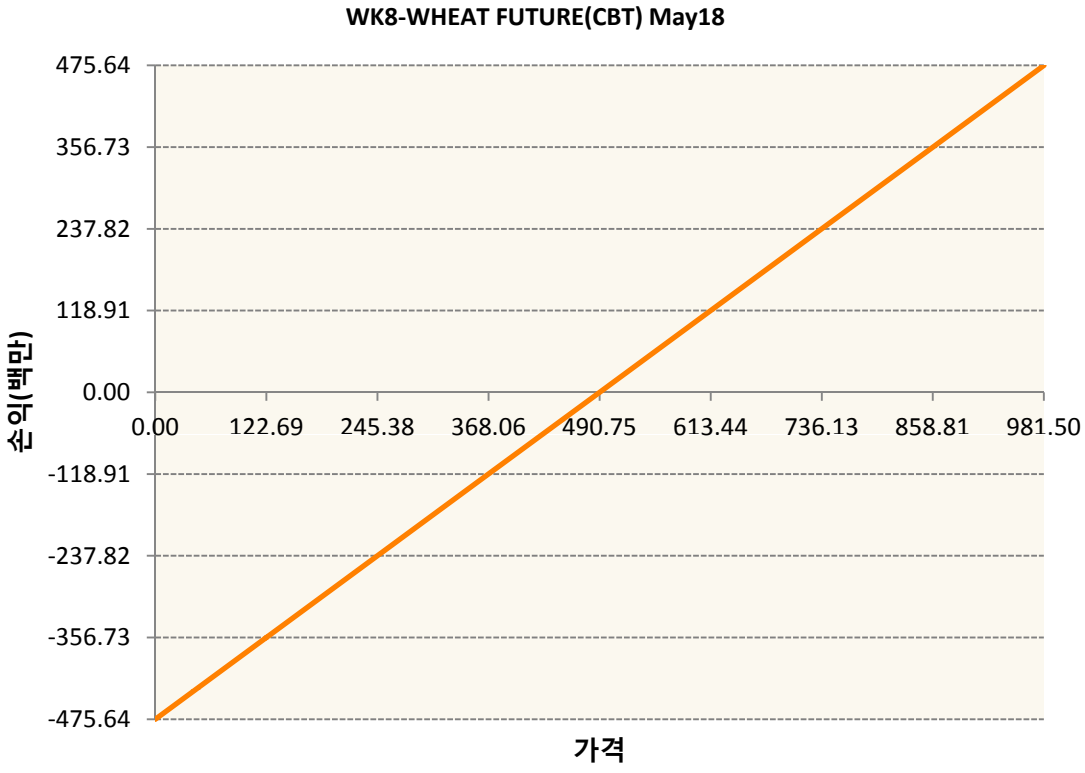

KWK8-KC HRW WHEAT FUT May18
147.73
98.49
49.24
0.00
-49.24
-98.49
-147.73
-196.97
0.00
130.69
261.38
392.06
522.75
653.44
784.13
914.81
1,045.50
손익(백만)
가격


SBK8-SUGAR #11 (WORLD) May18
358.19
268.64
179.10
89.55
0.00
-89.55
-179.10
-268.64
-358.19
0.00
3.09
6.18
9.27
12.36
15.45
18.54
21.63
24.72
손익(백만)
가격


SK8-SOYBEAN FUTRUE May18
634.19
422.79
211.40
0.00
-211.40
-422.79
-634.19
-845.59
0.00
261.75
523.50
785.25
1,047.00
1,308.75
1,570.50
1,832.25
2,094.00
손익(백만)
가격


SMK8-SOYBEAN MEAL FUTR May18
503.22





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	16
SBK8	SUGAR #11 (WORLD) May18	29
SK8	SOYBEAN FUTRUE May18	68
SMK8	SOYBEAN MEAL FUTR May18	40
WK8	WHEAT FUTURE(CBT) May18	38

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

339