공시일	2018-04-16
기준일	2018-04-13

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	2018-04-16
기준일	2018-04-13

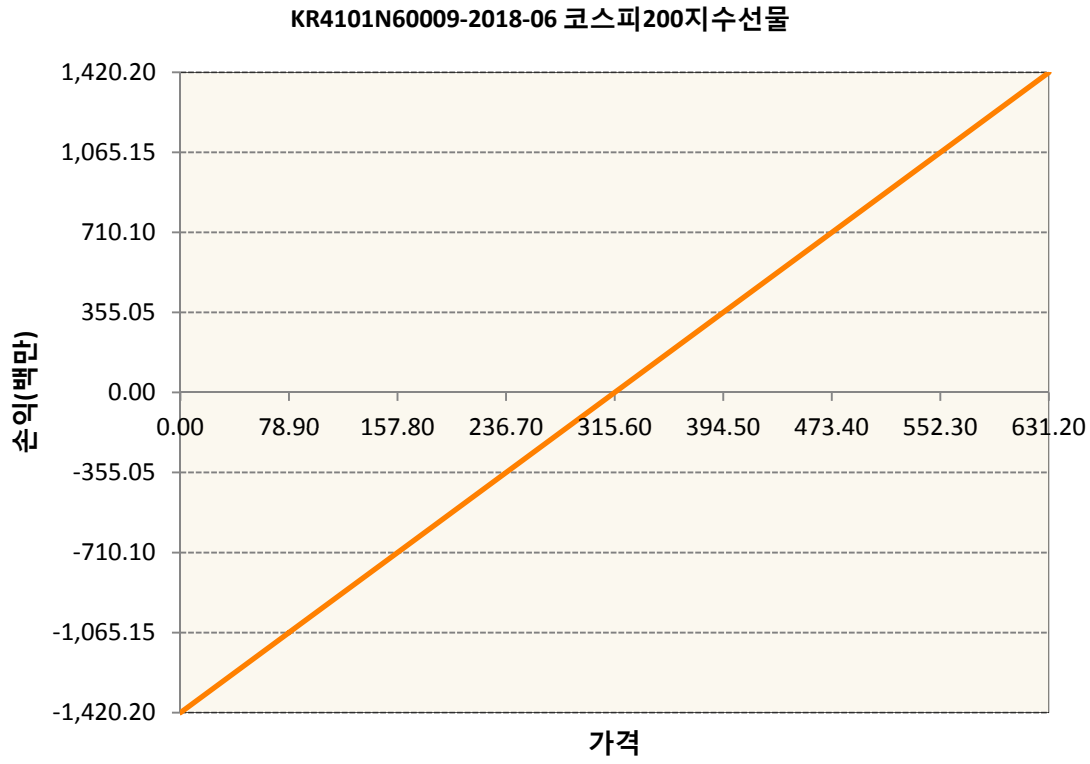
스마트인덱스모

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	1,420	0	1,420	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%	-76	-76	-76	-76	-76	-76	-76
-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%	76	76	76	76	76	76	76
8.00%	113	113	113	113	113	113	113

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

83

공시일	2018-04-16
기준일	2018-04-13

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	1,100

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

447

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2018-04-16
기준일	2018-04-13

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	406

* 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	2018-04-16
기준일	2018-04-13

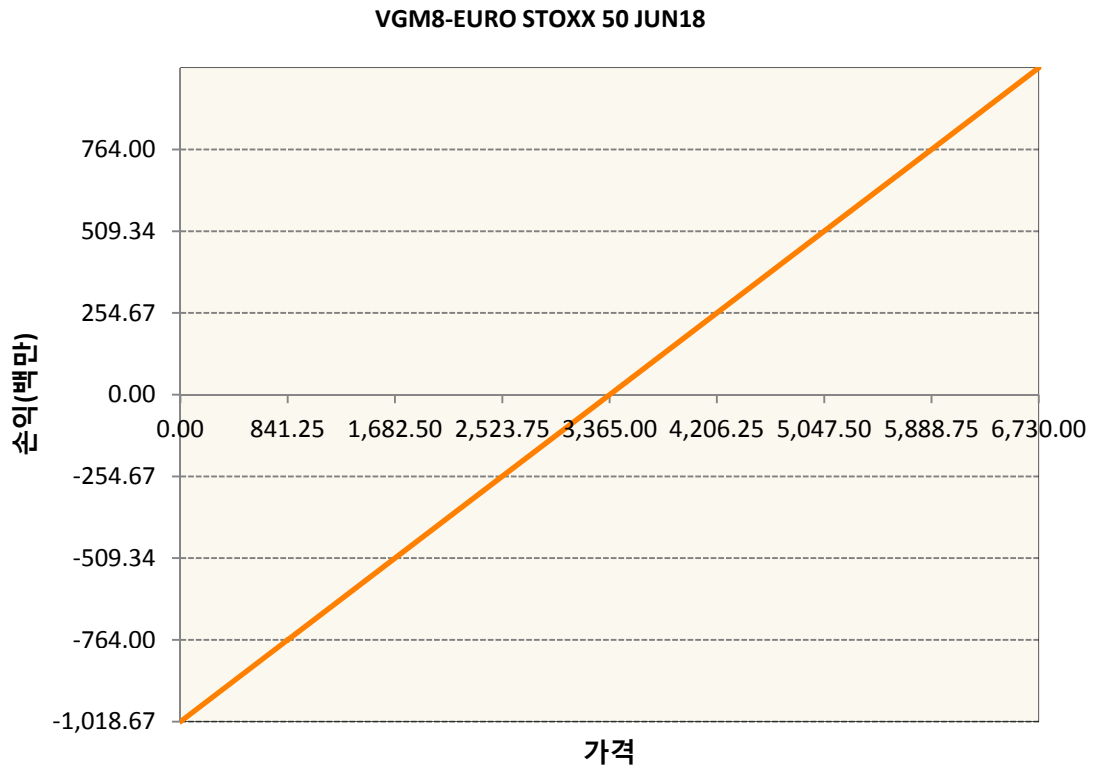
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,019	0	1,019	

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	2018-04-16
기준일	2018-04-13

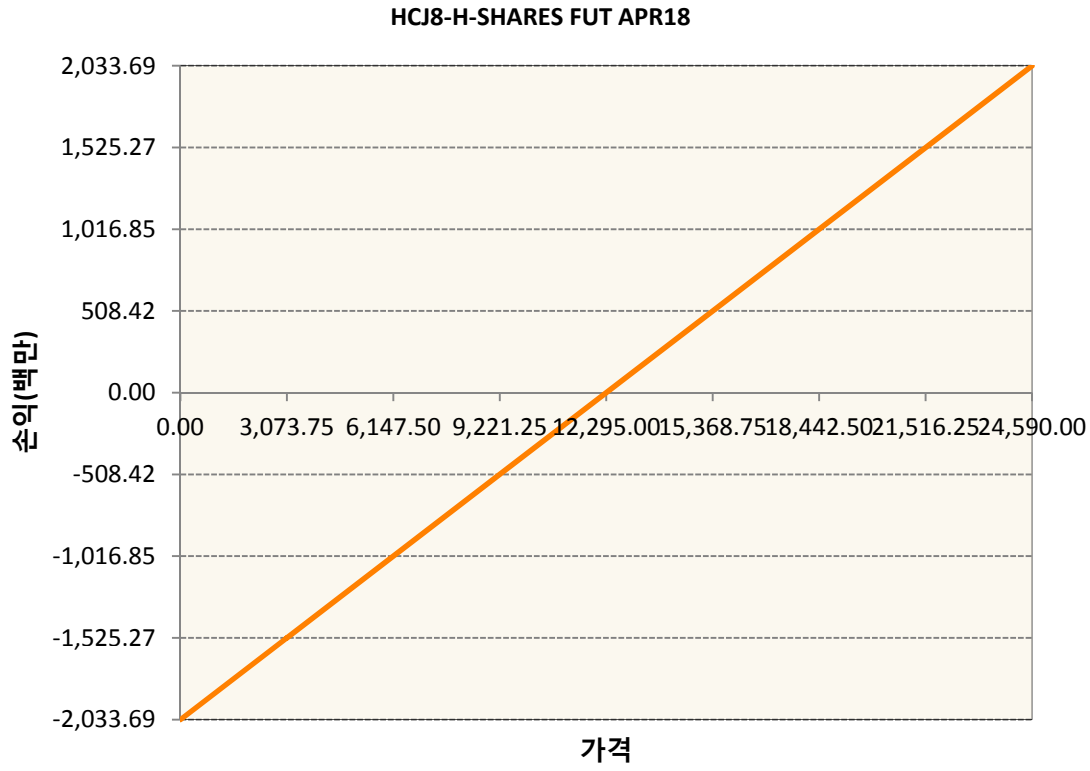
차이나인덱스모(주식-파생형)

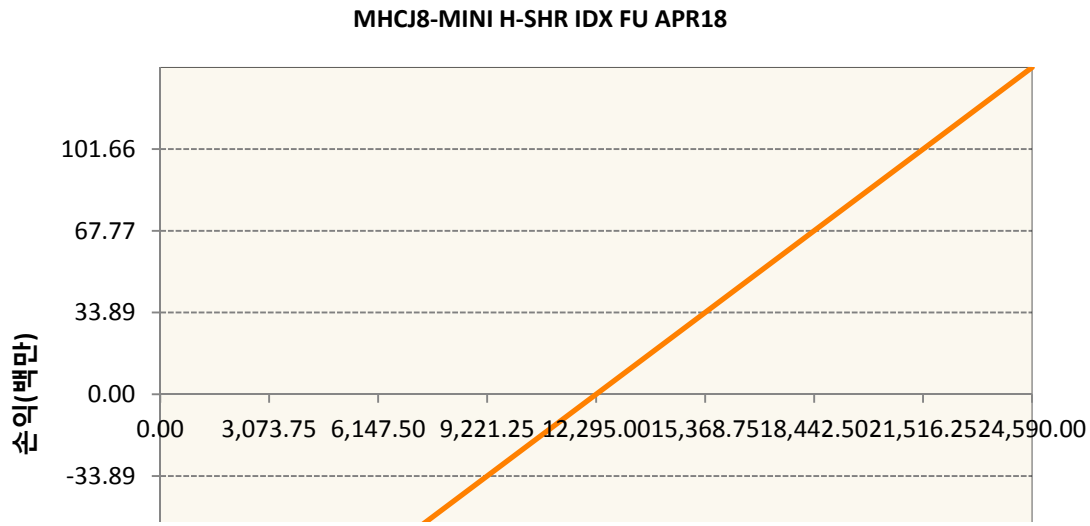
1. 계약금액

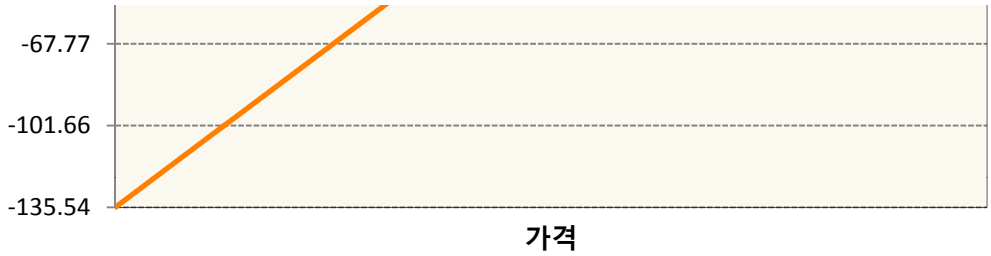
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,169	0	2,169	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)
	152

공시일	2018-04-16
기준일	2018-04-13

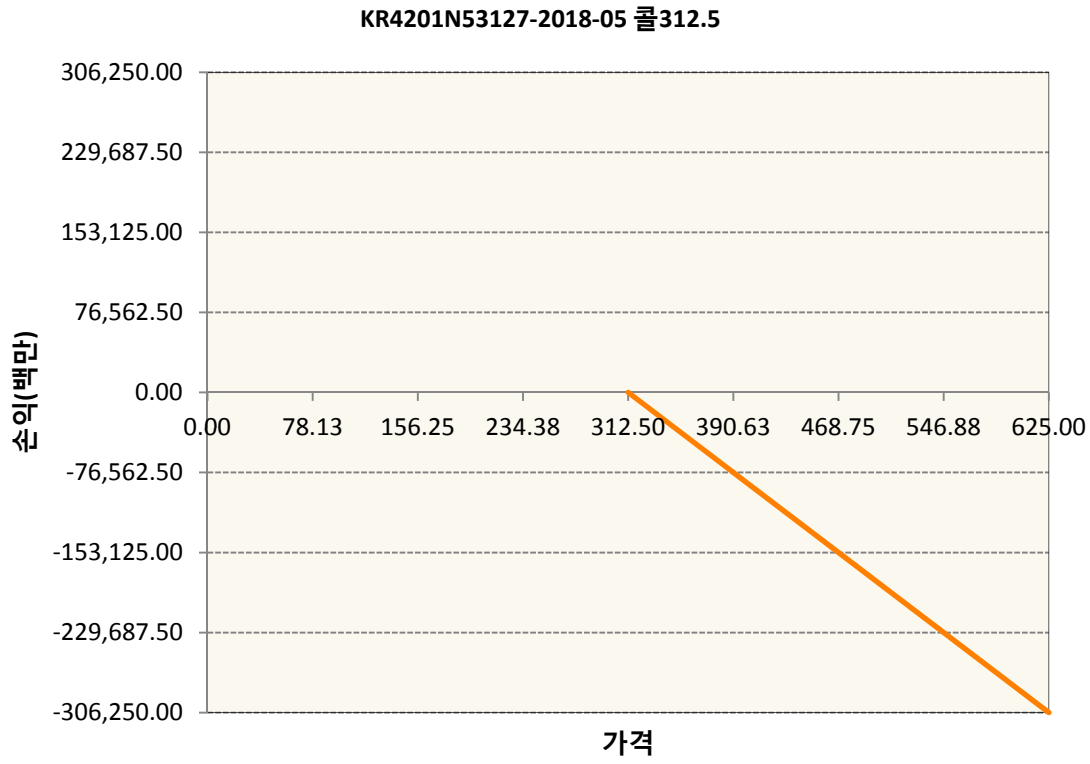
커버드콜모(주식혼합-파생형)

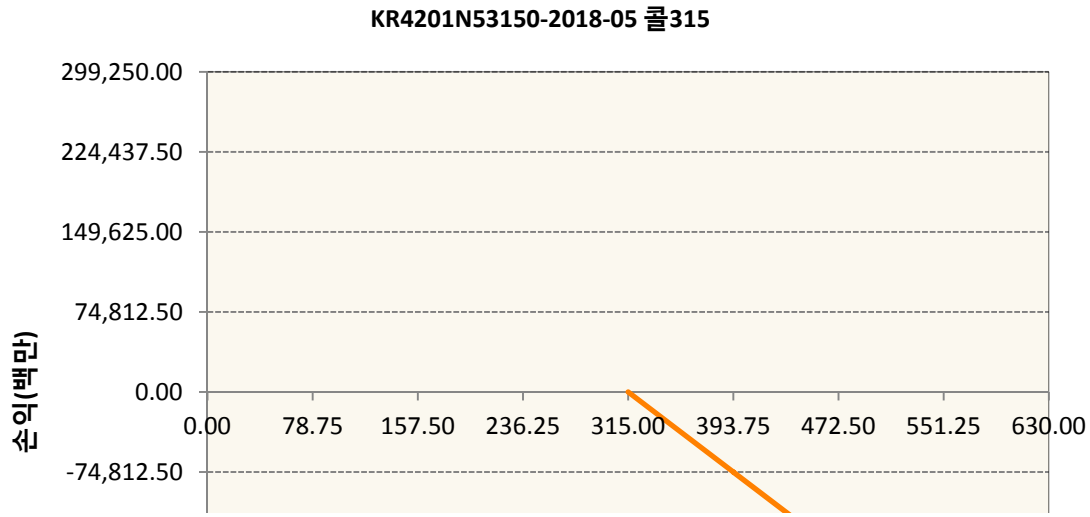
1. 계약금액

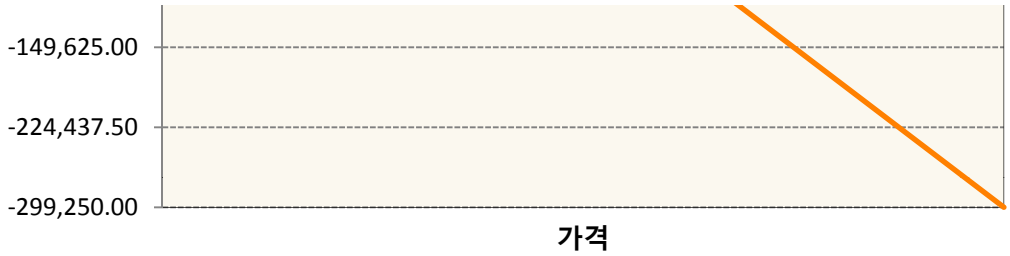
(단위:백만원)

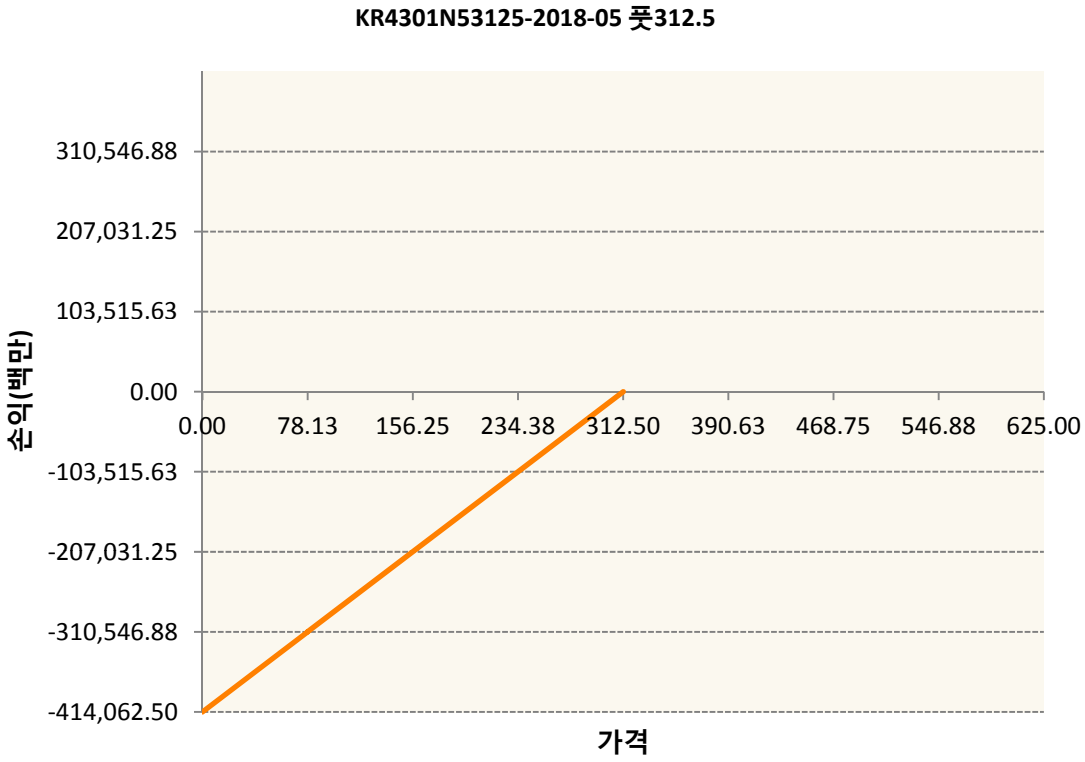
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	864,611	-864,611	장내
누계	유가증권	옵션	0	1,019,563	-1,019,563	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201N5312018-05 콜312.5							19,576
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	9,796	9,462	9,075	8,645	8,177	7,677	7,150
-5.33%	8,570	8,017	7,433	6,824	6,194	5,549	4,890
-2.67%	6,176	5,452	4,721	3,984	3,244	2,501	1,755
0%	2,304	1,537	769	0	-769	-1,539	-2,310
2.67%	-3,060	-3,727	-4,414	-5,116	-5,830	-6,553	-7,284
5.33%	-9,644	-10,128	-10,657	-11,223	-11,820	-12,441	-13,082
8.00%	-17,049	-17,346	-17,702	-18,109	-18,561	-19,052	-19,576
KR4201N5312018-05 콜315							18,301
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	8,482	8,209	7,883	7,512	7,100	6,655	6,179

-5.33%	7,531	7,051	6,533	5,984	5,410	4,816	4,206
-2.67%	5,575	4,905	4,223	3,532	2,832	2,127	1,418
0%	2,258	1,505	753	0	-752	-1,505	-2,257
2.67%	-2,523	-3,217	-3,923	-4,638	-5,360	-6,087	-6,819
5.33%	-8,579	-9,111	-9,681	-10,281	-10,904	-11,547	-12,205
8.00%	-15,547	-15,892	-16,293	-16,741	-17,229	-17,750	-18,301
KR4301N5312018-05 풋312.5							25,739

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-25,293	-25,316	-25,355	-25,415	-25,499	-25,606	-25,739
-5.33%	-14,410	-14,563	-14,754	-14,979	-15,234	-15,516	-15,821
-2.67%	-4,808	-5,233	-5,673	-6,126	-6,589	-7,060	-7,537
0%	1,542	1,031	516	0	-518	-1,038	-1,558
2.67%	4,170	3,886	3,567	3,219	2,847	2,456	2,048
5.33%	4,785	4,707	4,596	4,452	4,275	4,068	3,832
8.00%	4,863	4,852	4,829	4,791	4,733	4,654	4,551

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

63,032

공시일	2018-04-16
기준일	2018-04-13

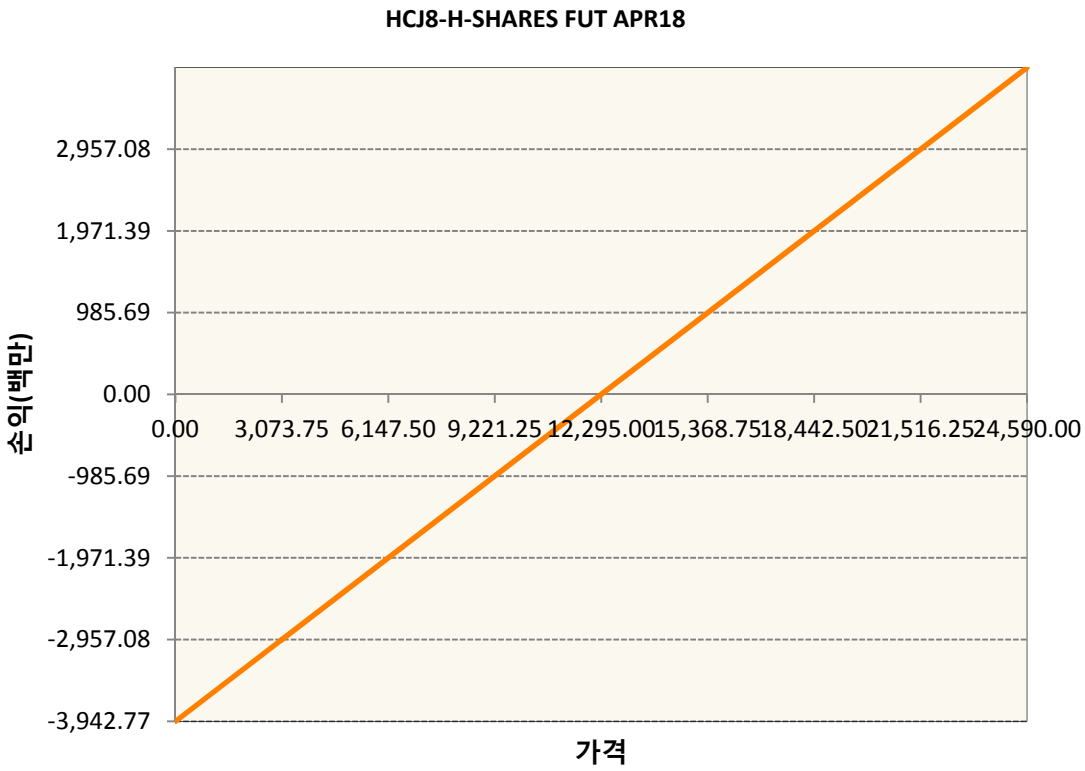
홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생

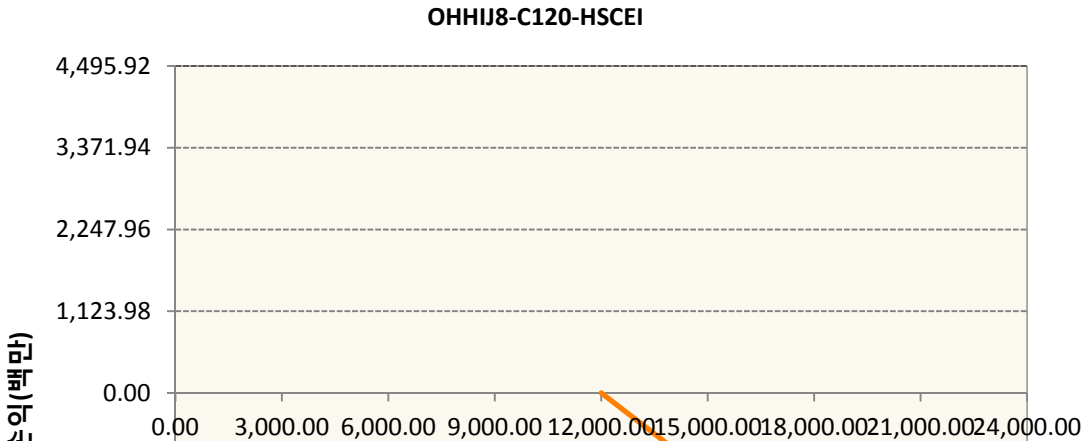
1. 계약금액

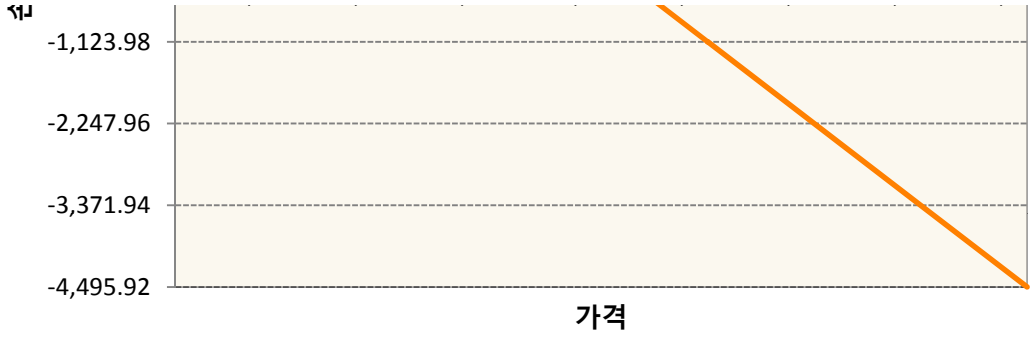
(단위:백만원)

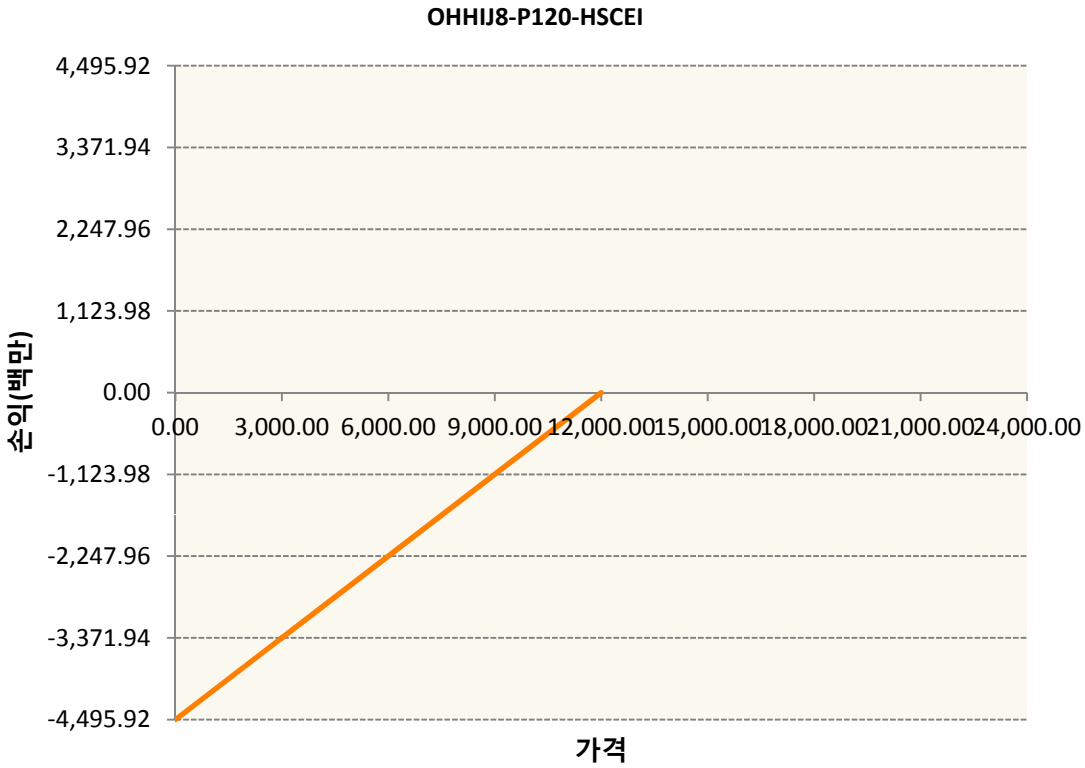
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	3,943	0	3,943	장내
누계	유가증권	옵션	0	8,992	-8,992	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCJ8	H-SHARES FUT APR18	315
OHHIJ8-C12	HSCEI	360
OHHIJ8-P12	HSCEI	360

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	907

공시일	2018-04-16
기준일	2018-04-13

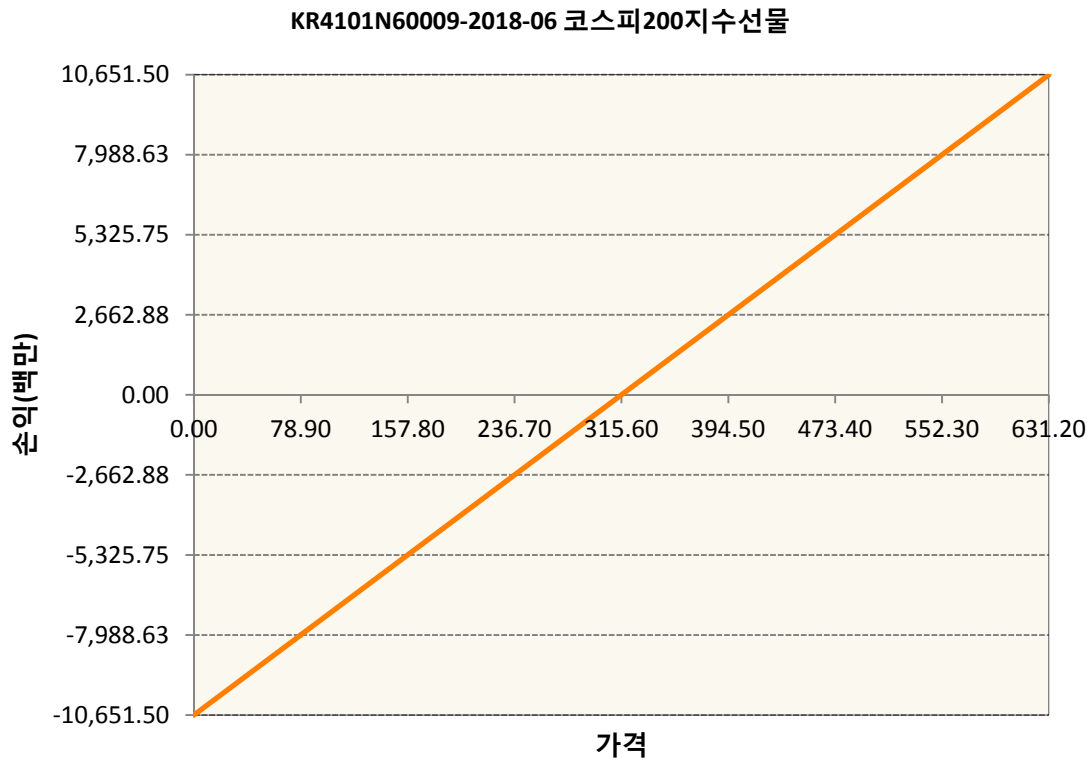
코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼

1. 계약금액

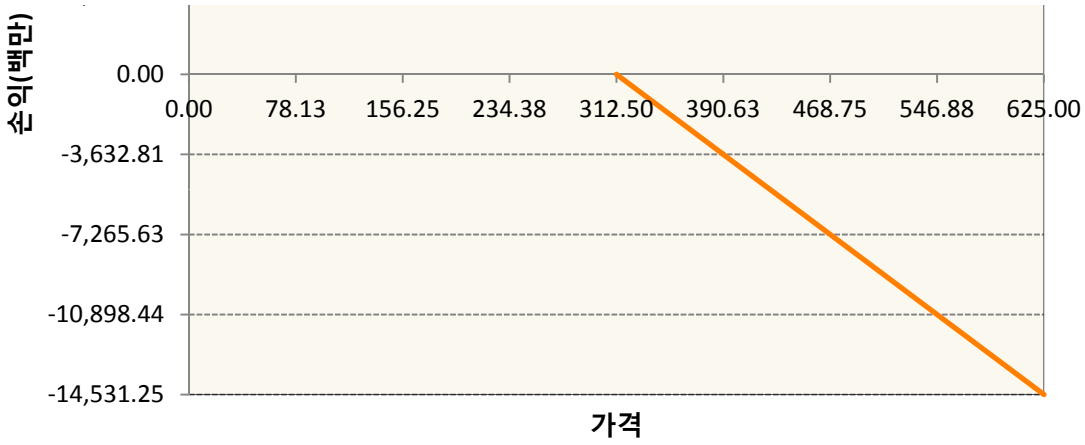
(단위:백만원)

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	56,507	-56,507	장내
누계	유가증권	선물	10,652	0	10,652	장내
누계	유가증권	스왑	52,200	0	52,200	장외
누계	유가증권	옵션	0	55,754	-55,754	장내

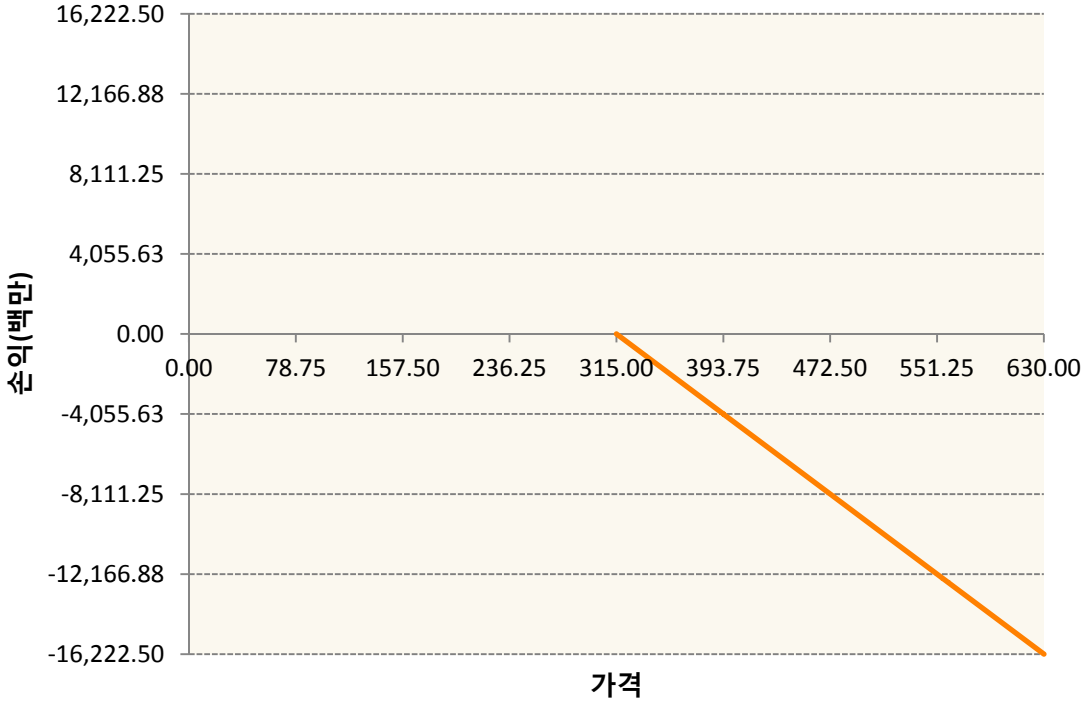
2. 만기시점의 손익구조



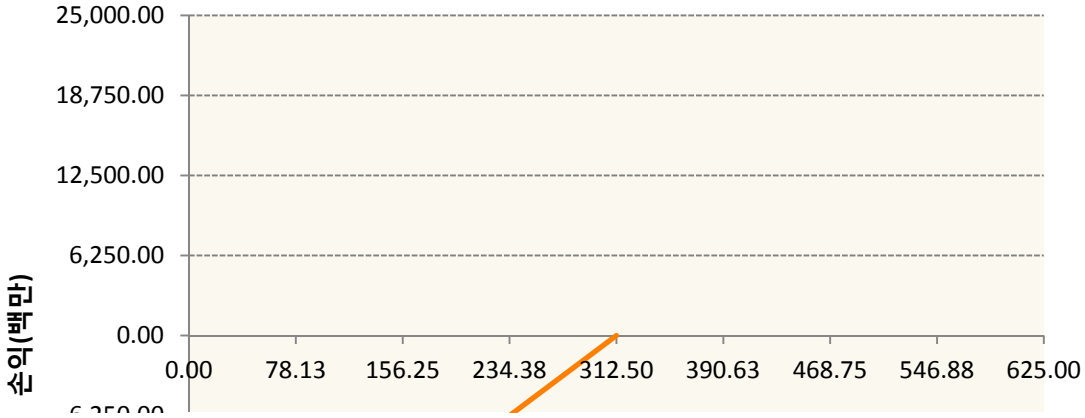




KR4201N53150-2018-05 콜315



KR4301N53125-2018-05 풋312.5





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_2							1,460
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,460	-1,460	-1,460	-1,460	-1,460	-1,460	-1,460
-5.33%	-974	-974	-974	-974	-974	-974	-974
-2.67%	-487	-487	-487	-487	-487	-487	-487
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	487	487	487	487	487	487	487
5.33%	974	974	974	974	974	974	974
8.00%	1,460	1,460	1,460	1,460	1,460	1,460	1,460
2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_3							276
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-276	-276	-276	-276	-276	-276	-276
-5.33%	-184	-184	-184	-184	-184	-184	-184
-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%	184	184	184	184	184	184	184
8.00%	276	276	276	276	276	276	276
2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_5							237
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-237	-237	-237	-237	-237	-237	-237
-5.33%	-158	-158	-158	-158	-158	-158	-158
-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%	158	158	158	158	158	158	158
8.00%	237	237	237	237	237	237	237
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%	-132	-132	-132	-132	-132	-132	-132
-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%	132	132	132	132	132	132	132
8.00%	197	197	197	197	197	197	197
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_7						253
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-253	-253	-253	-253	-253	-253	-253
-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%	253	253	253	253	253	253	253
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_8						467
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-467	-467	-467	-467	-467	-467	-467
-5.33%	-311	-311	-311	-311	-311	-311	-311
-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%	311	311	311	311	311	311	311
8.00%	467	467	467	467	467	467	467
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_10						118
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-118	-118	-118	-118	-118	-118	-118
-5.33%	-79	-79	-79	-79	-79	-79	-79
-2.67%	-39	-39	-39	-39	-39	-39	-39
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	39	39	39	39	39	39	39
5.33%	79	79	79	79	79	79	79
8.00%	118	118	118	118	118	118	118
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_11						631
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-631	-631	-631	-631	-631	-631	-631
-5.33%	-421	-421	-421	-421	-421	-421	-421
-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%	421	421	421	421	421	421	421
8.00%	631	631	631	631	631	631	631
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_12						474
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-474	-474	-474	-474	-474	-474	-474
-5.33%	-316	-316	-316	-316	-316	-316	-316
-2.67%	-158	-158	-158	-158	-158	-158	-158
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	158	158	158	158	158	158	158
5.33%	316	316	316	316	316	316	316
8.00%	474	474	474	474	474	474	474
	KR4101N60(2018-06 코스피200지수선물						850
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-850	-850	-850	-850	-850	-850	-850
-5.33%	-567	-567	-567	-567	-567	-567	-567
-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%	567	567	567	567	567	567	567
8.00%	850	850	850	850	850	850	850
	KR4201N531 2018-05 콜312.5						929
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	465	449	431	410	388	364	339
-5.33%	407	380	353	324	294	263	232
-2.67%	293	259	224	189	154	119	83
0%	109	73	36	0	-37	-73	-110
2.67%	-145	-177	-209	-243	-277	-311	-346
5.33%	-458	-481	-506	-533	-561	-590	-621
8.00%	-809	-823	-840	-859	-881	-904	-929
	KR4201N531 2018-05 콜315						992
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	460	445	427	407	385	361	335
-5.33%	408	382	354	324	293	261	228
-2.67%	302	266	229	191	154	115	77
0%	122	82	41	0	-41	-82	-122
2.67%	-137	-174	-213	-251	-291	-330	-370
5.33%	-465	-494	-525	-557	-591	-626	-662
8.00%	-843	-862	-883	-908	-934	-962	-992
	KR4301N531 2018-05 풋312.5						1,554

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,527	-1,528	-1,531	-1,535	-1,540	-1,546	-1,554
-5.33%	-870	-879	-891	-904	-920	-937	-955
-2.67%	-290	-316	-343	-370	-398	-426	-455
0%	93	62	31	0	-31	-63	-94
2.67%	252	235	215	194	172	148	124
5.33%	289	284	277	269	258	246	231
8.00%	294	293	292	289	286	281	275

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

8,194

공시일	2018-04-16
기준일	2018-04-13

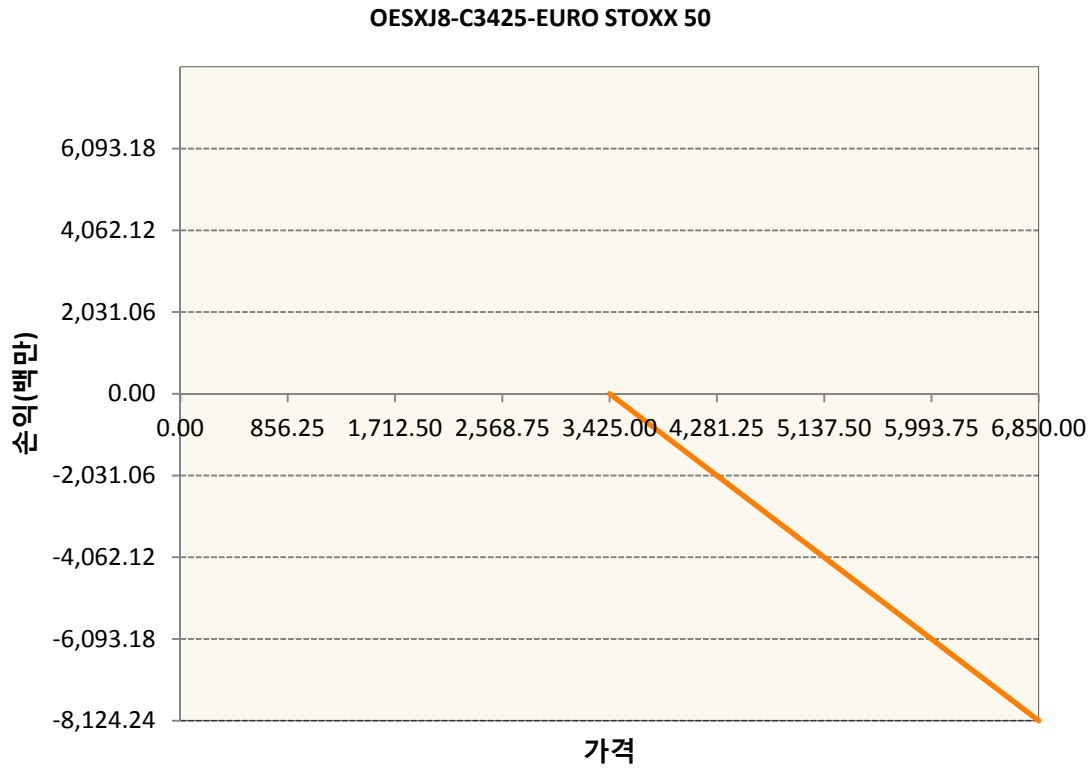
유로커버드콜모(주식혼합-파생형

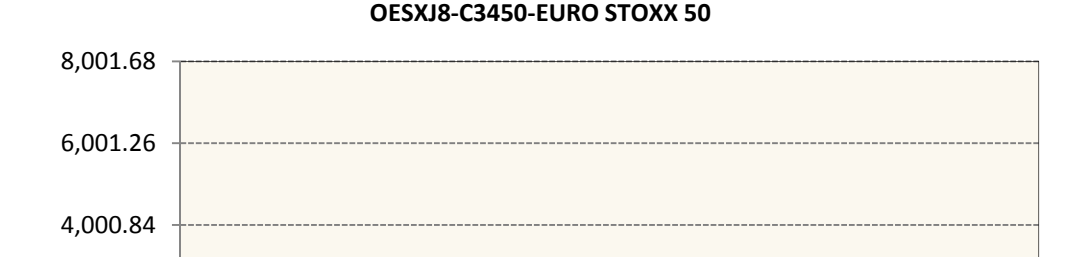
1. 계약금액

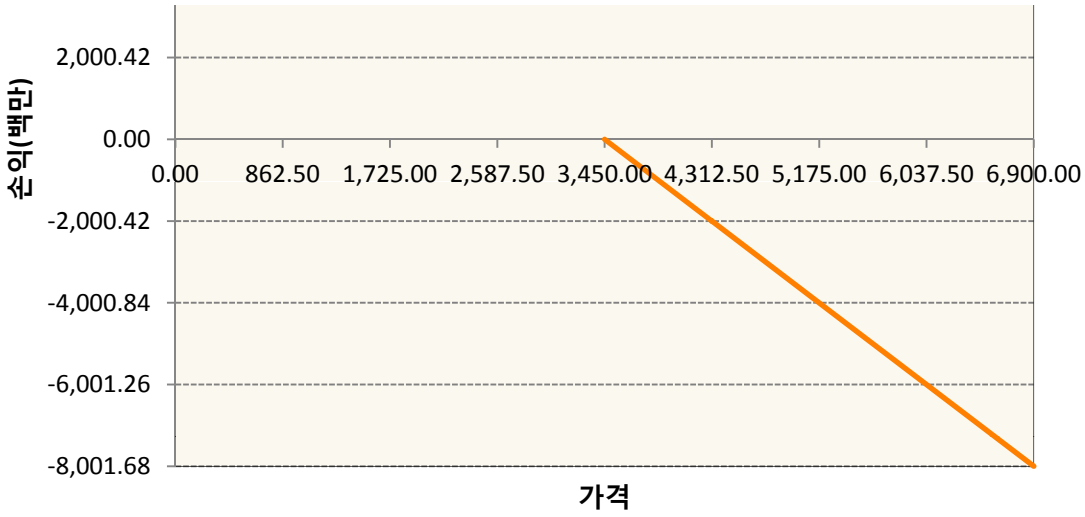
(단위:백만원)

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	7,589	0	7,589	
누계	유가증권	스왑	76,120	0	76,120	장외
누계	유가증권	옵션	0	32,252	-32,252	장내
누계	지수	스왑	52,714	0	52,714	장외

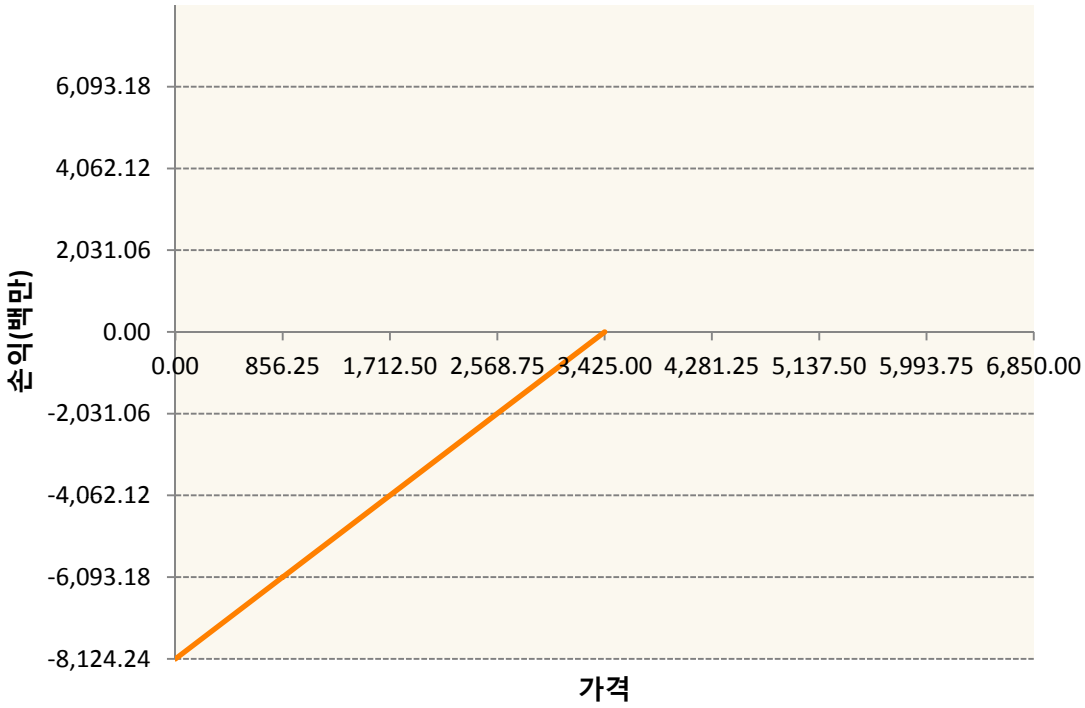
2. 만기시점의 손익구조



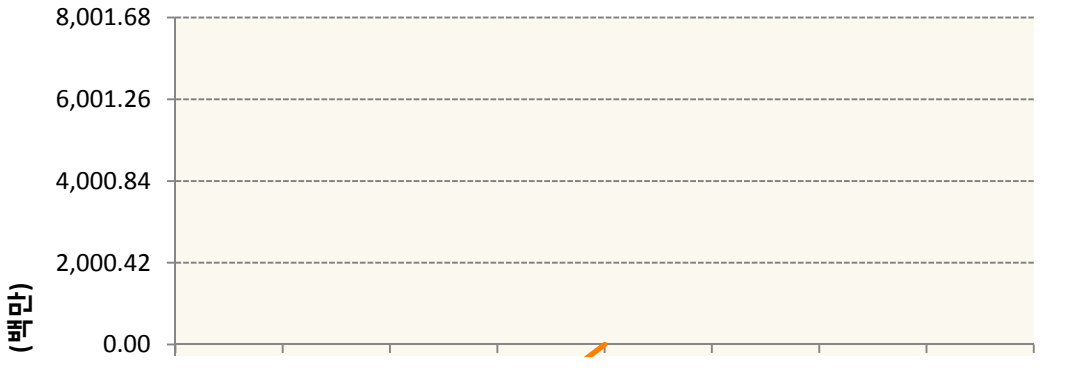


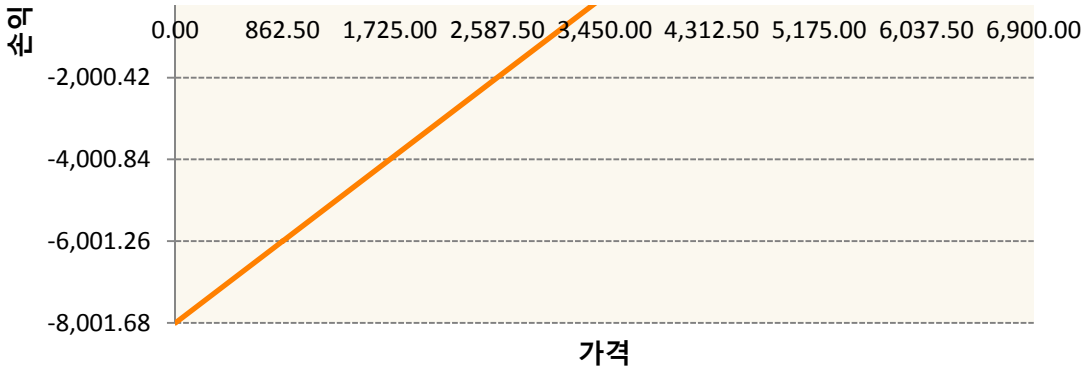


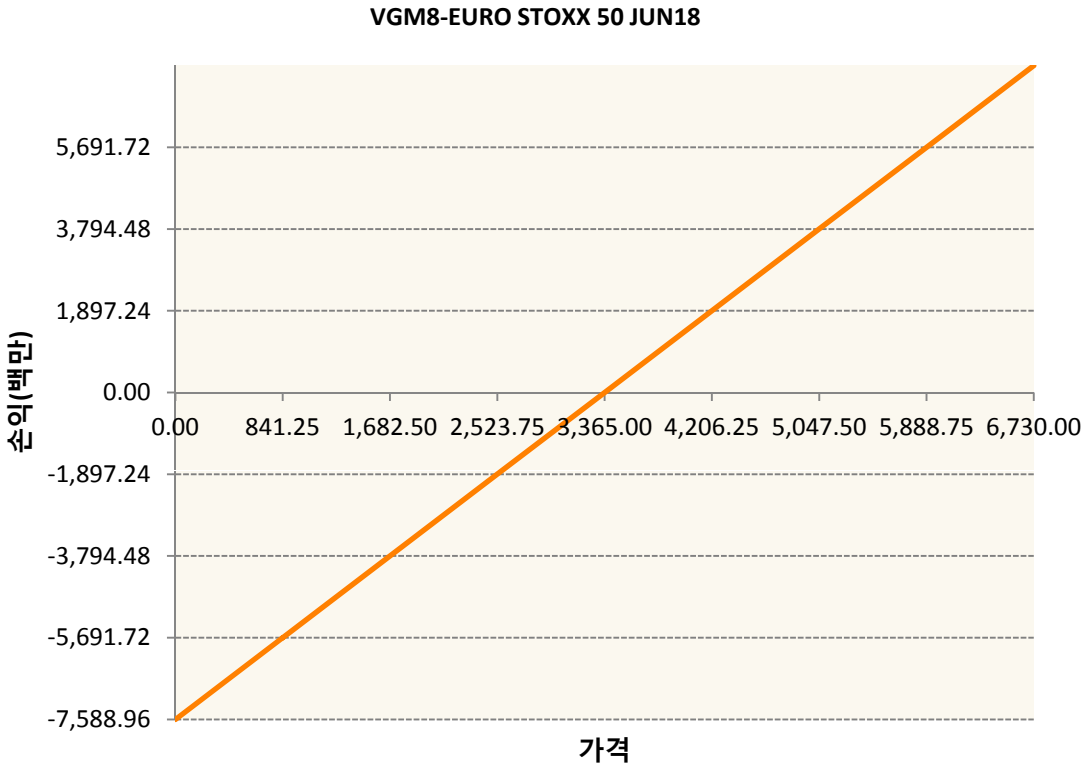
OESXJ8-P3425-EURO STOXX 50



OESXJ8-P3450-EURO STOXX 50







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)	(단위:백만원)
260105SGPX SG EURO Covered CALL STRATEGY - 994.569	139
260105SQPX SG EURO Covered CALL STRATEGY	201
OESXJ8-C34 EURO STOXX 50	650
OESXJ8-C34 EURO STOXX 50	640
OESXJ8-P34 EURO STOXX 50	650
OESXJ8-P34 EURO STOXX 50	640
VGM8 EURO STOXX 50 JUN18	607

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

2,207

공시일	2018-04-16
기준일	2018-04-13

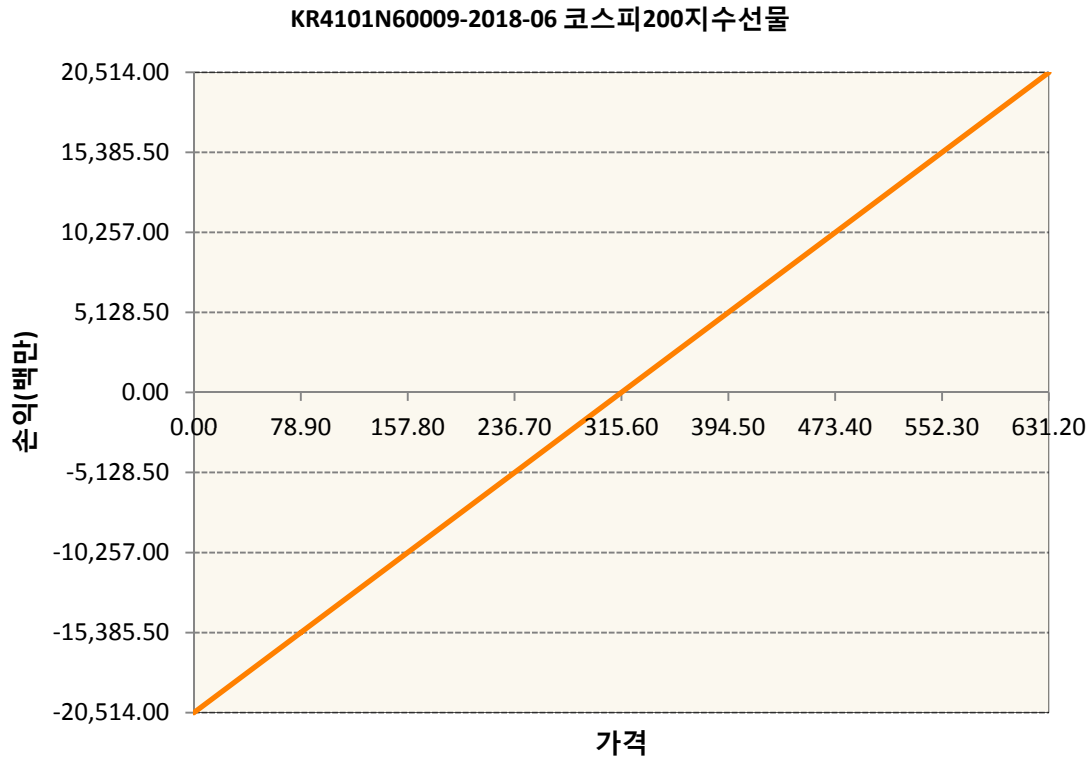
ETF스마트레버리지목표전환형8호

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	20,514	0	20,514	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101N60(2018-06 코스피200지수선물							1,637
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,637	-1,637	-1,637	-1,637	-1,637	-1,637	-1,637
-5.33%	-1,092	-1,092	-1,092	-1,092	-1,092	-1,092	-1,092
-2.67%	-546	-546	-546	-546	-546	-546	-546
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	546	546	546	546	546	546	546
5.33%	1,092	1,092	1,092	1,092	1,092	1,092	1,092
8.00%	1,637	1,637	1,637	1,637	1,637	1,637	1,637

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

1,197

공시일	2018-04-16
기준일	2018-04-13

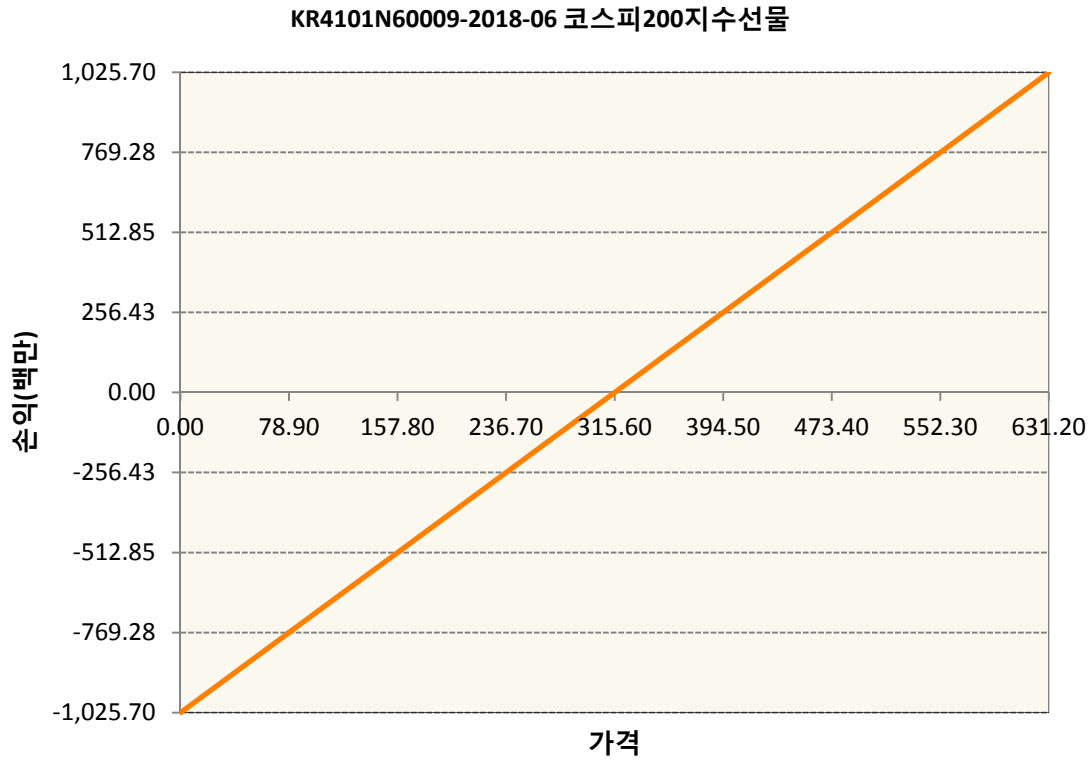
ETF스마트레버리지목표전환형9호

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	1,026	0	1,026	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%	-55	-55	-55	-55	-55	-55	-55
-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%	55	55	55	55	55	55	55
8.00%	82	82	82	82	82	82	82

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

60

공시일	2018-04-16
기준일	2018-04-13

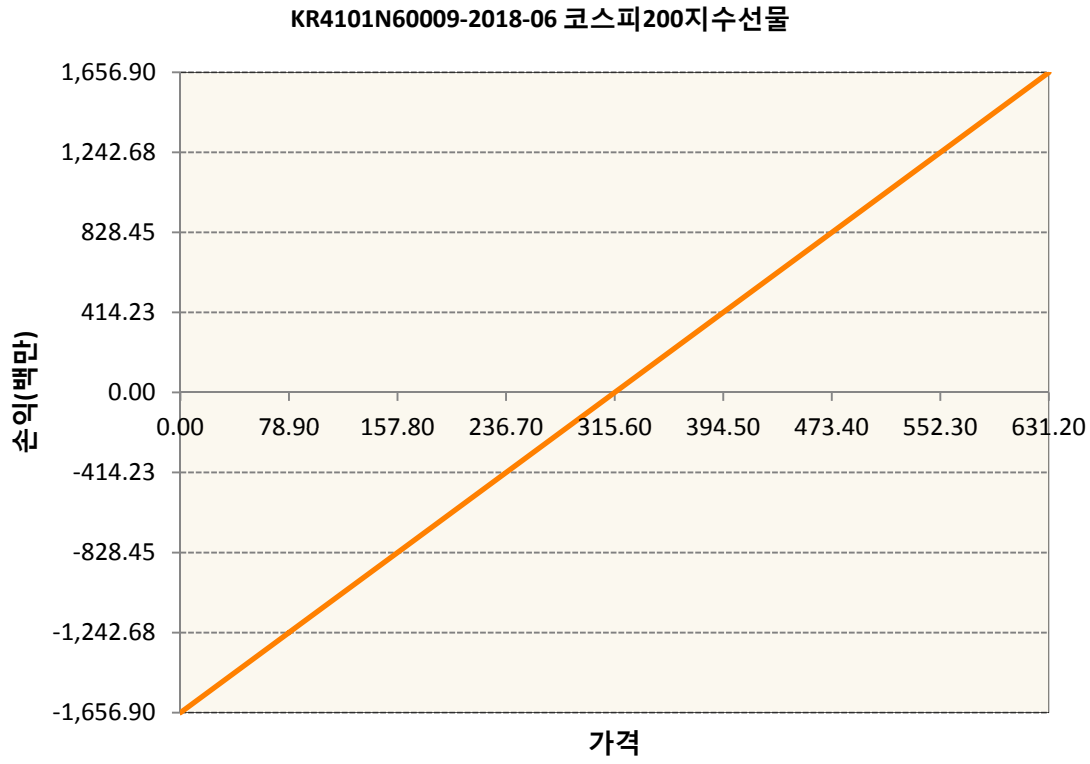
ETF스마트레버리지목표전환형10

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	1,657	0	1,657	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)

97

공시일	2018-04-16
기준일	2018-04-13

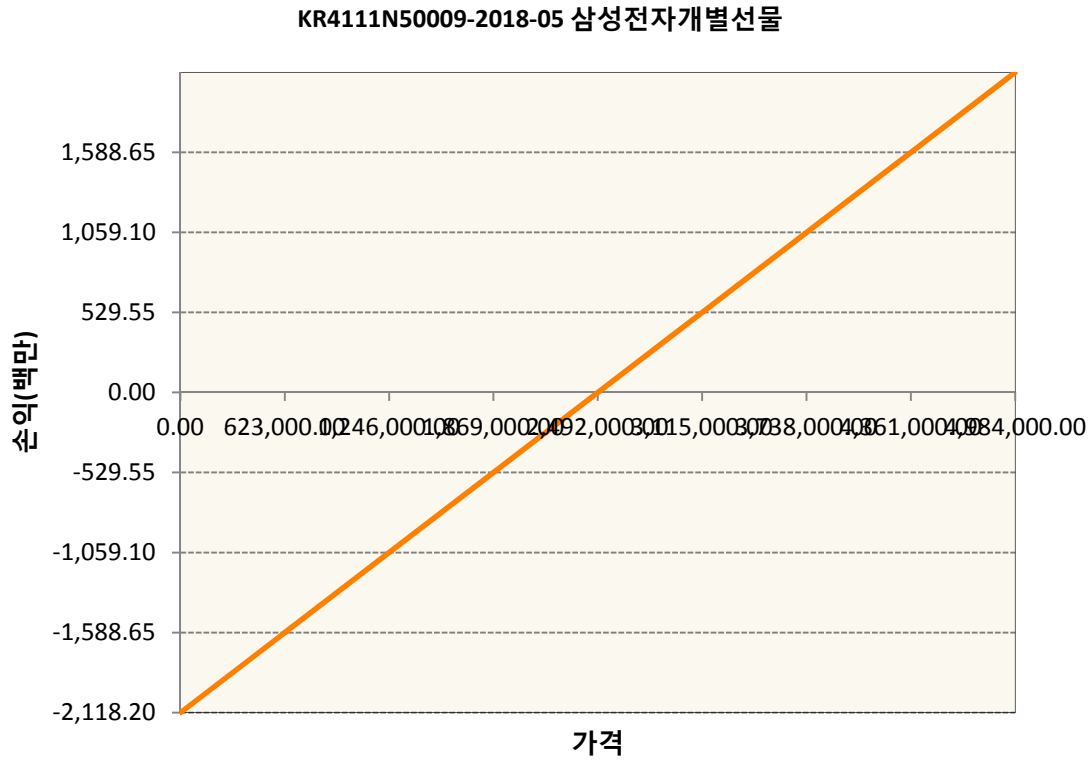
스마트KRX300인덱스1호(주식-파

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	2,118	0	2,118	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4111N50(2018-05 삼성전자개별선물							169
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-169	-169	-169	-169	-169	-169	-169
-5.33%	-113	-113	-113	-113	-113	-113	-113
-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%	113	113	113	113	113	113	113
8.00%	169	169	169	169	169	169	169

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

210

공시일	2018-04-16
기준일	2018-04-13

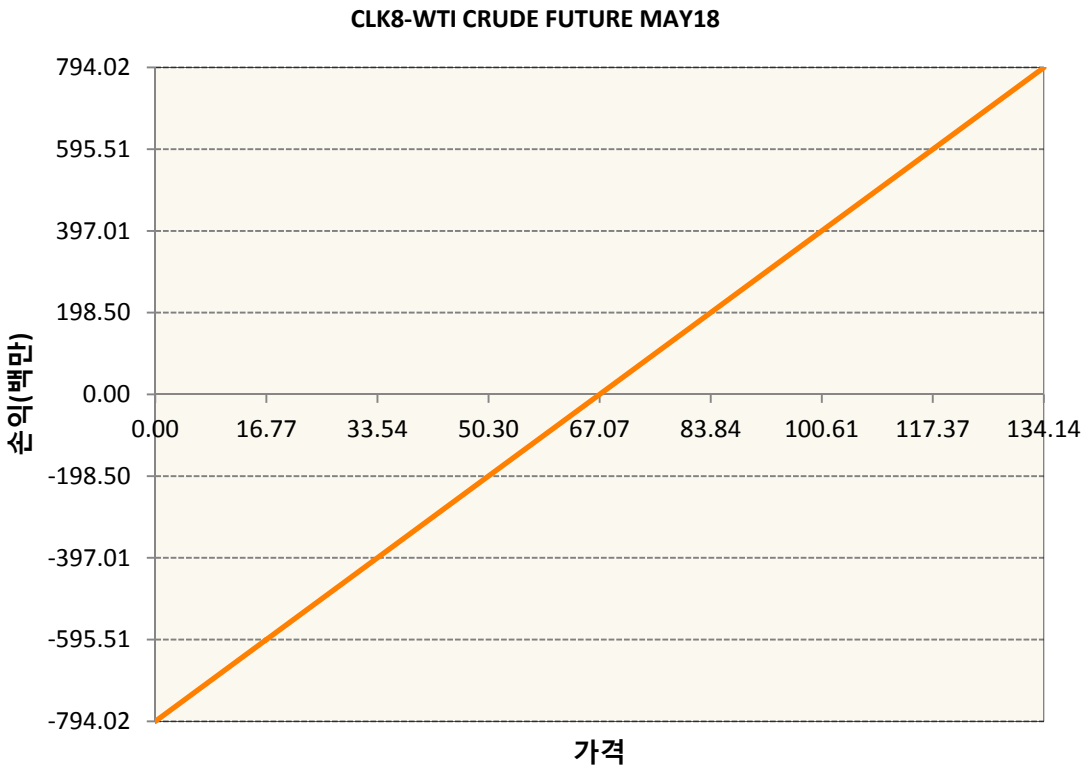
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

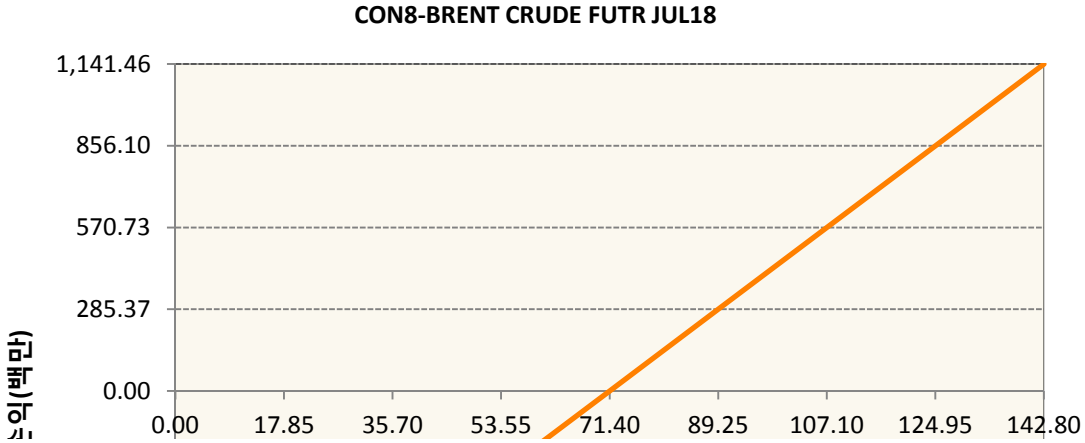
1. 계약금액

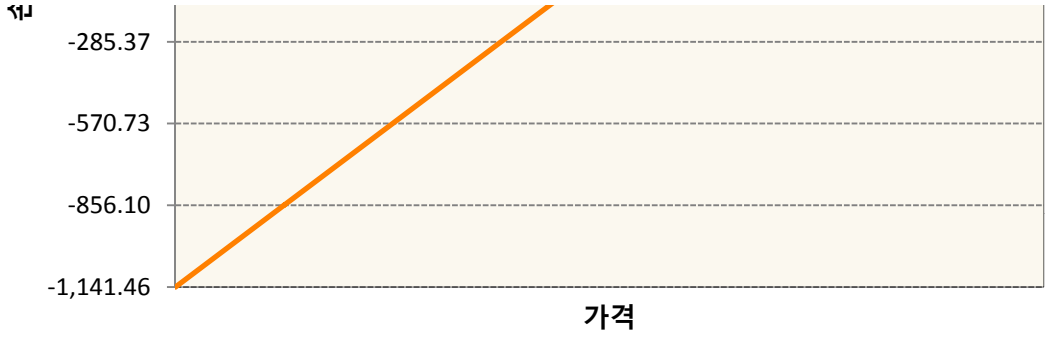
(단위:백만원)

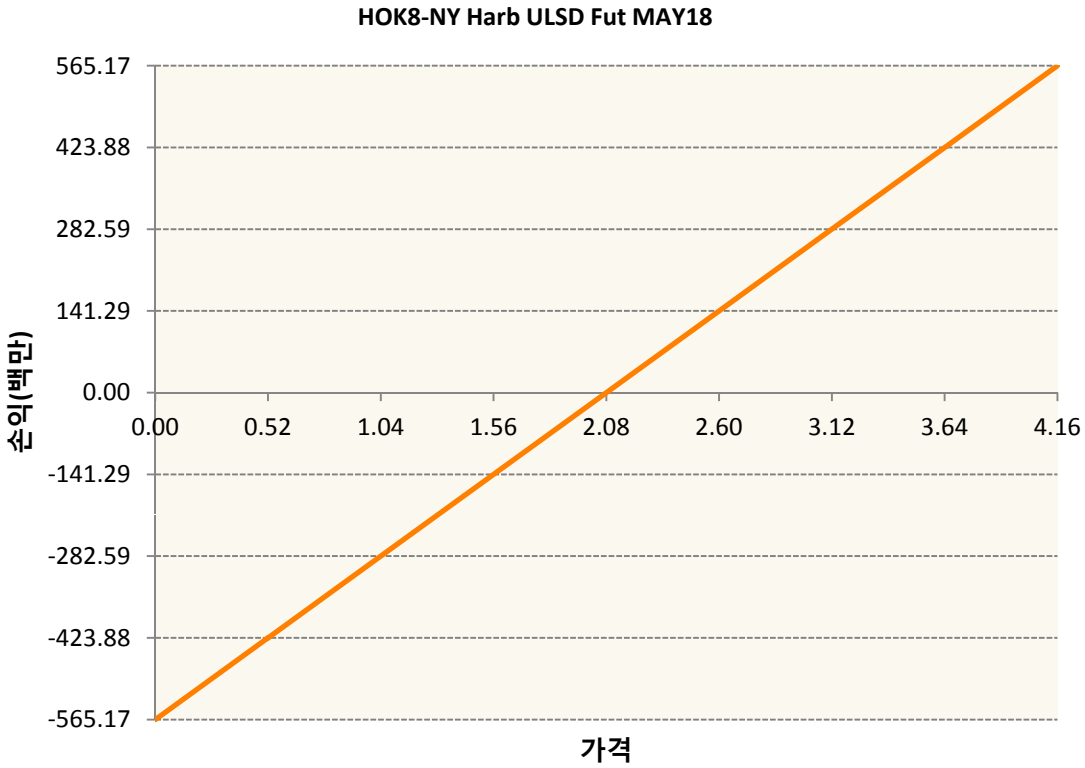
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	선물	유가증권	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	선물	유가증권	794	0	794	
누계	유가증권	선물	3,306	588	2,718	

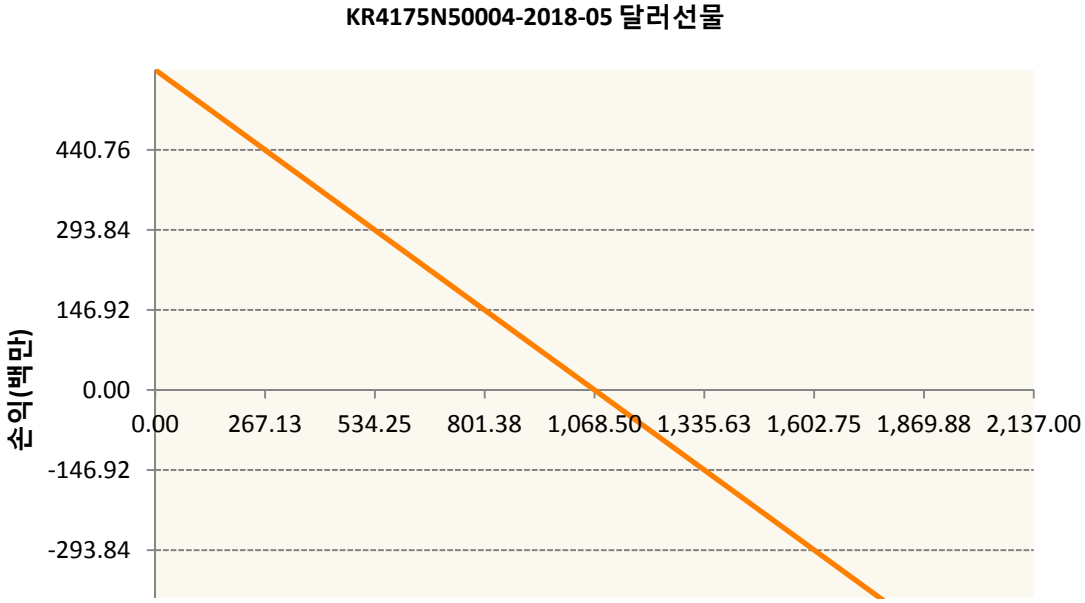
2. 만기시점의 손익구조

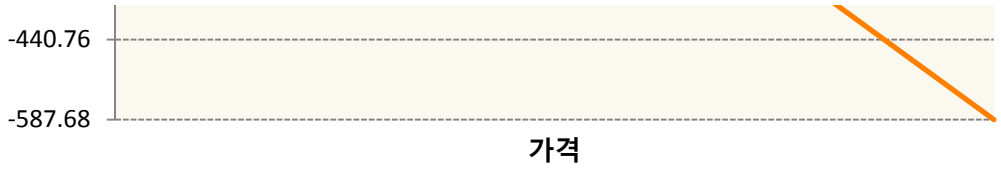


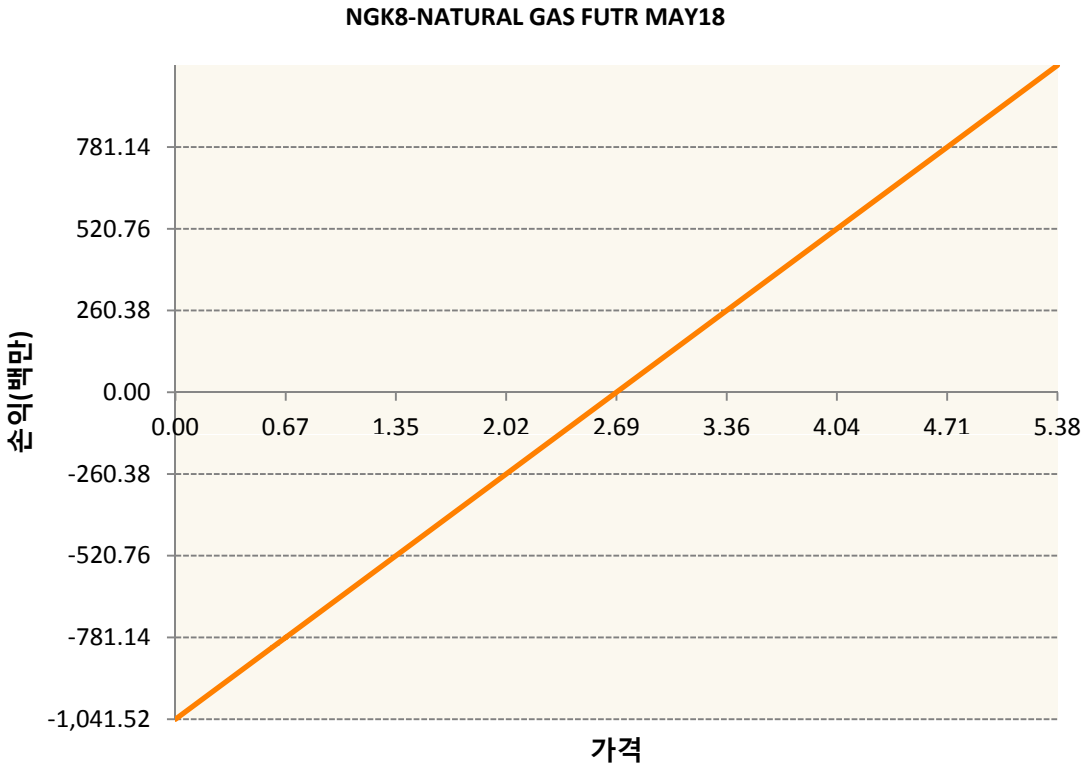


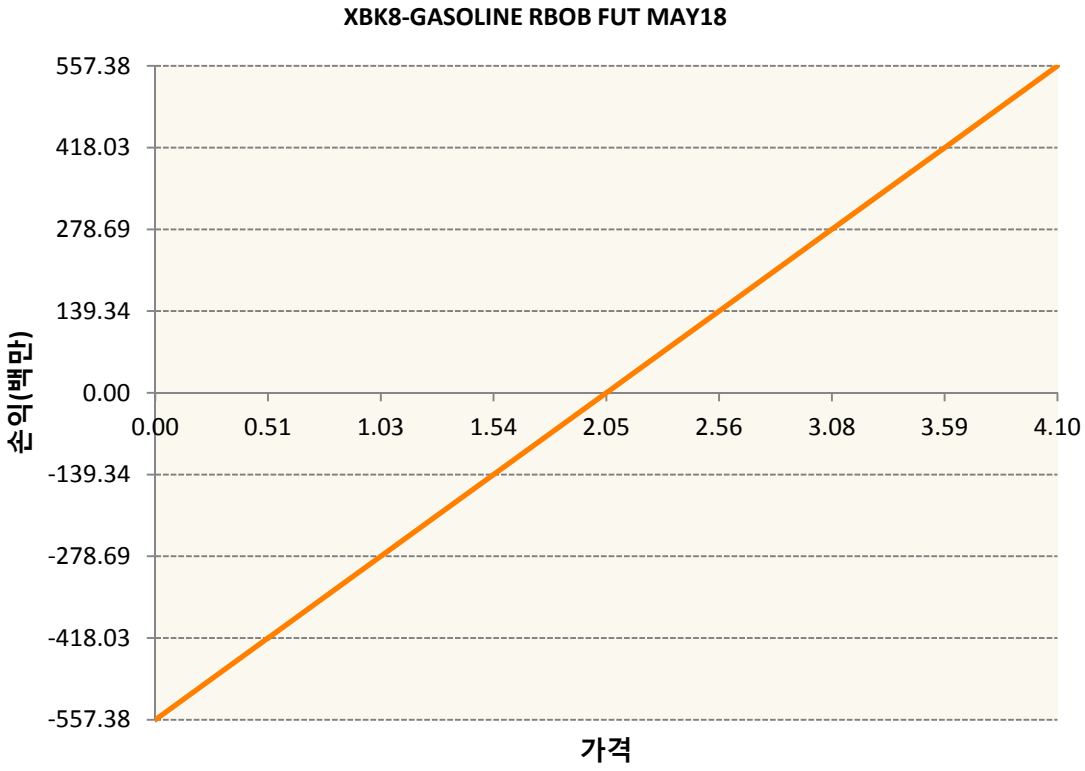

-285.37
-570.73
-856.10
-1,141.46
가격


HOK8-NY Harb ULSD Fut MAY18
565.17
423.88
282.59
141.29
0.00
-141.29
-282.59
-423.88
-565.17
손익(백만)
0.00
0.52
1.04
1.56
2.08
2.60
3.12
3.64
4.16
가격


KR4175N50004-2018-05 달러선물
440.76
293.84
146.92
0.00
-146.92
-293.84
손익(백만)
0.00
267.13
534.25
801.38
1,068.50
1,335.63
1,602.75
1,869.88
2,137.00


-440.76
-587.68
가격


NGK8-NATURAL GAS FUTR MAY18
781.14
520.76
260.38
0.00
-260.38
-520.76
-781.14
-1,041.52
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
557.38
418.03
278.69
139.34
0.00
-139.34
-278.69
-418.03
-557.38
0.00
0.51
1.03
1.54
2.05
2.56
3.08
3.59
4.10
손익(백만)
가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLK8	WTI CRUDE FUTURE MAY18	64
CON8	BRENT CRUDE FUTR JUL18	91
HOK8	NY Harb ULSD Fut MAY18	45
KR4175N50(	2018-05 달러선물	47
NGK8	NATURAL GAS FUTR MAY18	83
XBK8	GASOLINE RBOB FUT MAY18	45

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

520

공시일	2018-04-16
기준일	2018-04-13

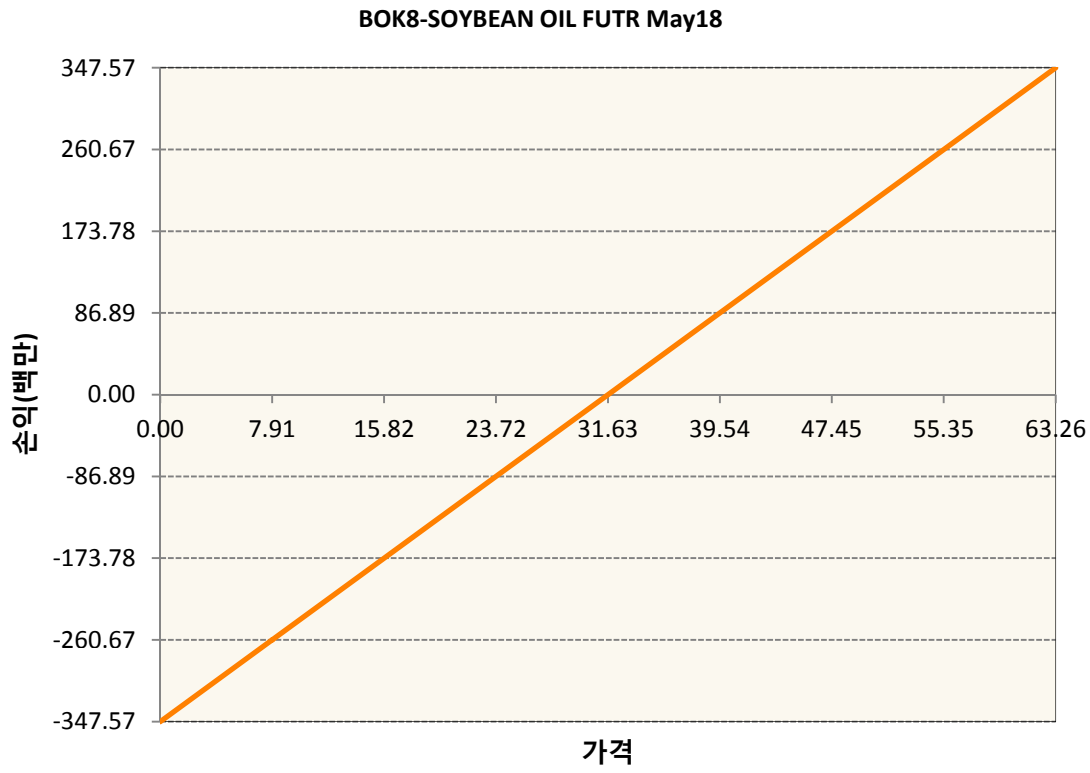
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

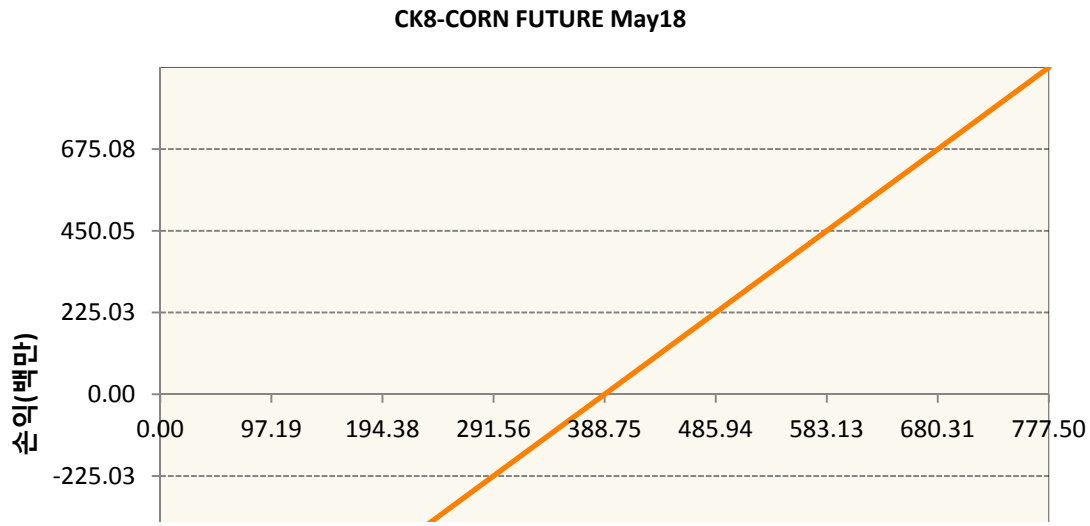
1. 계약금액

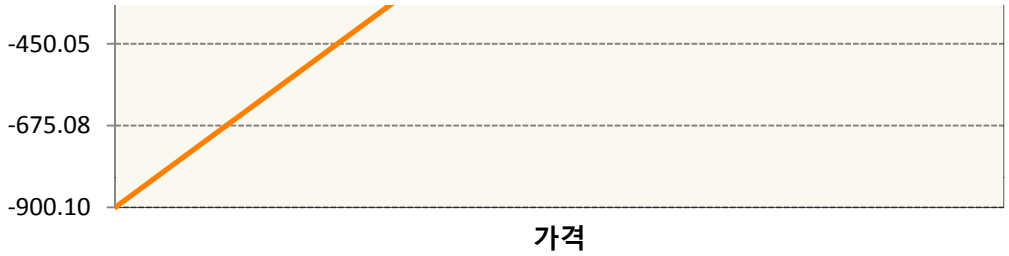
(단위:백만원)

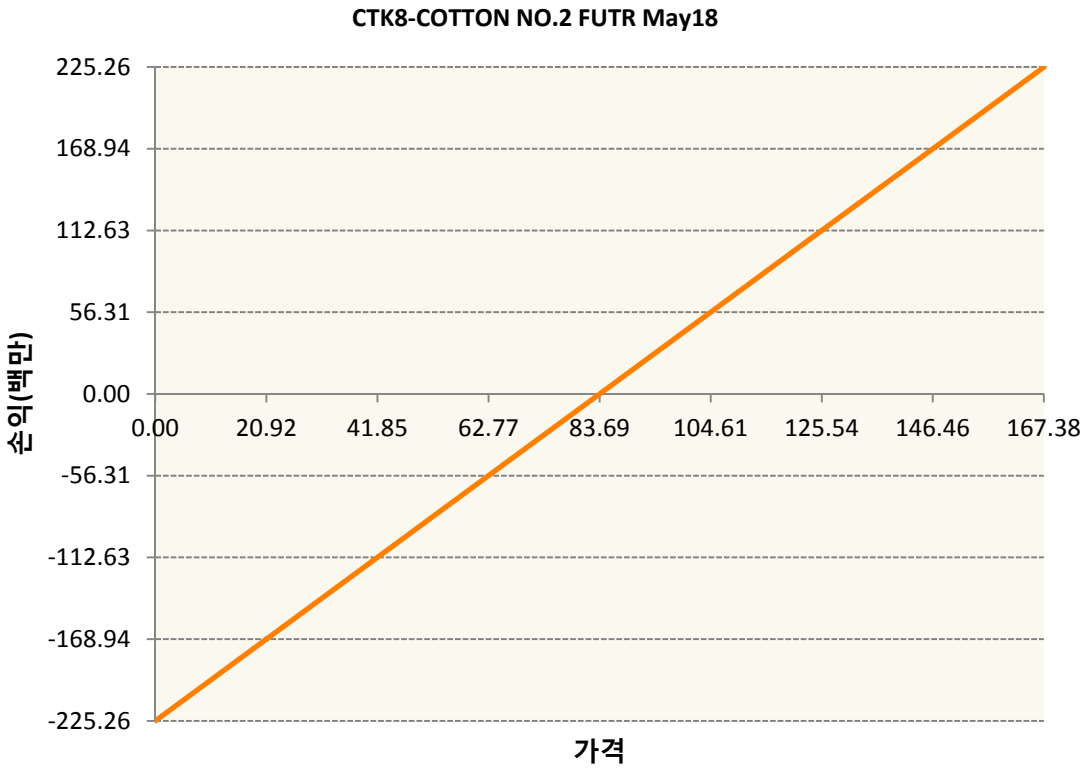
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	4,165	321	3,845	

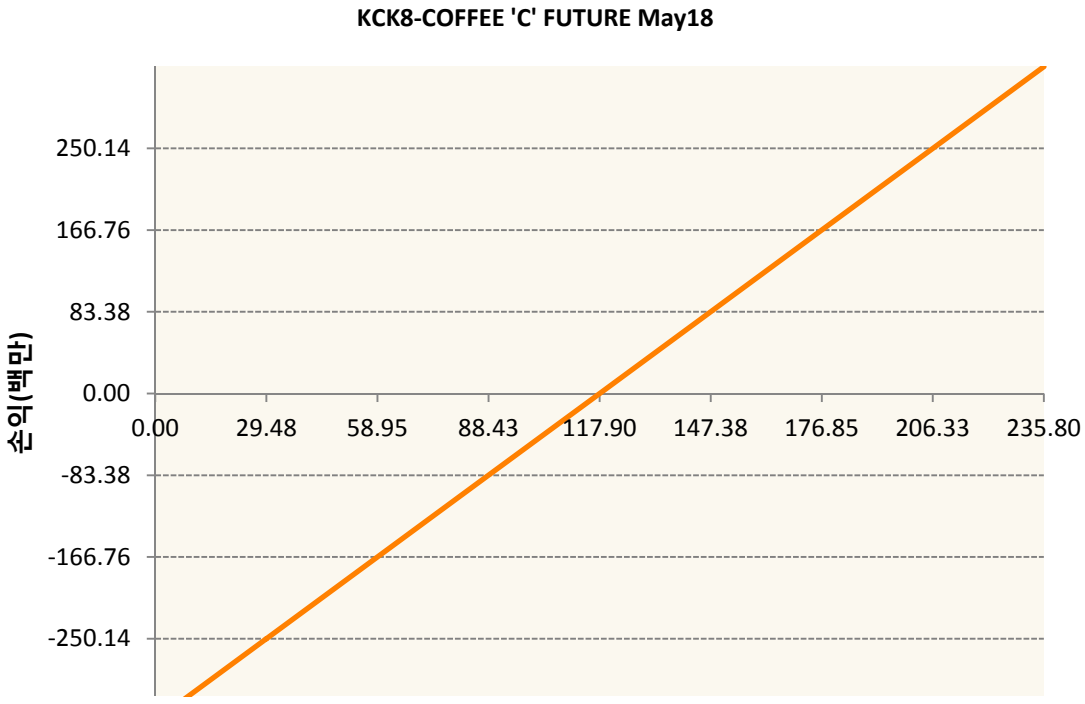
2. 만기시점의 손익구조

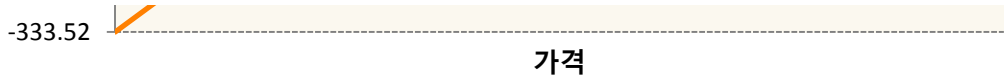


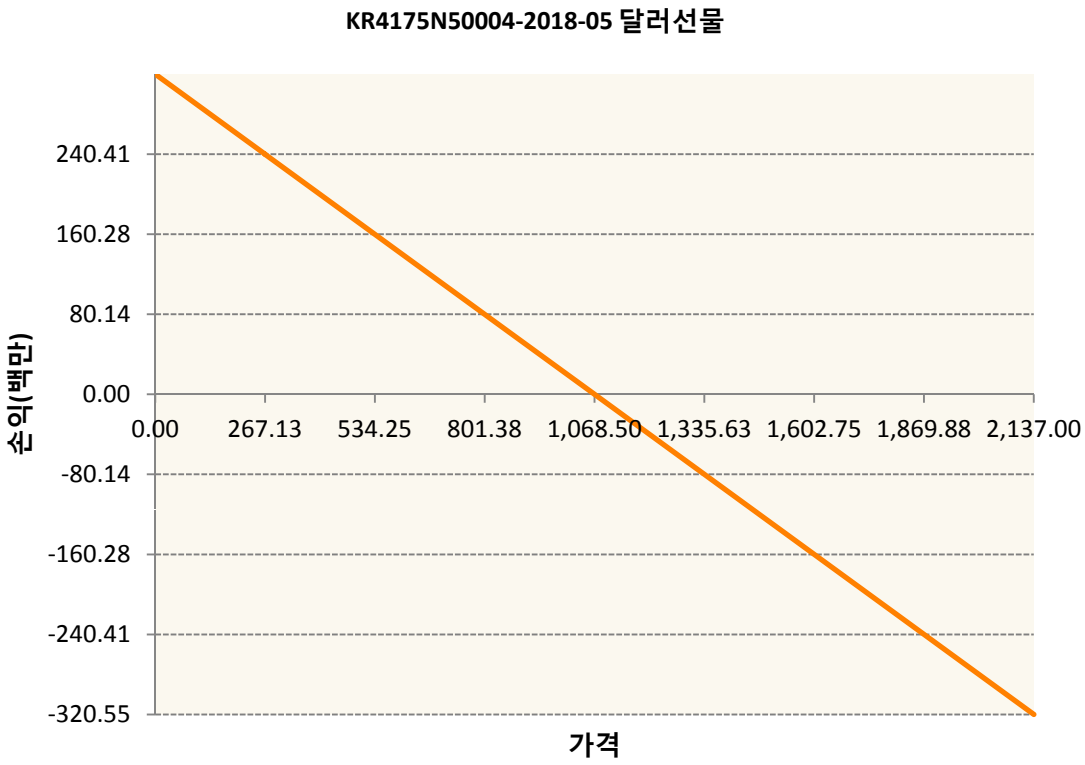


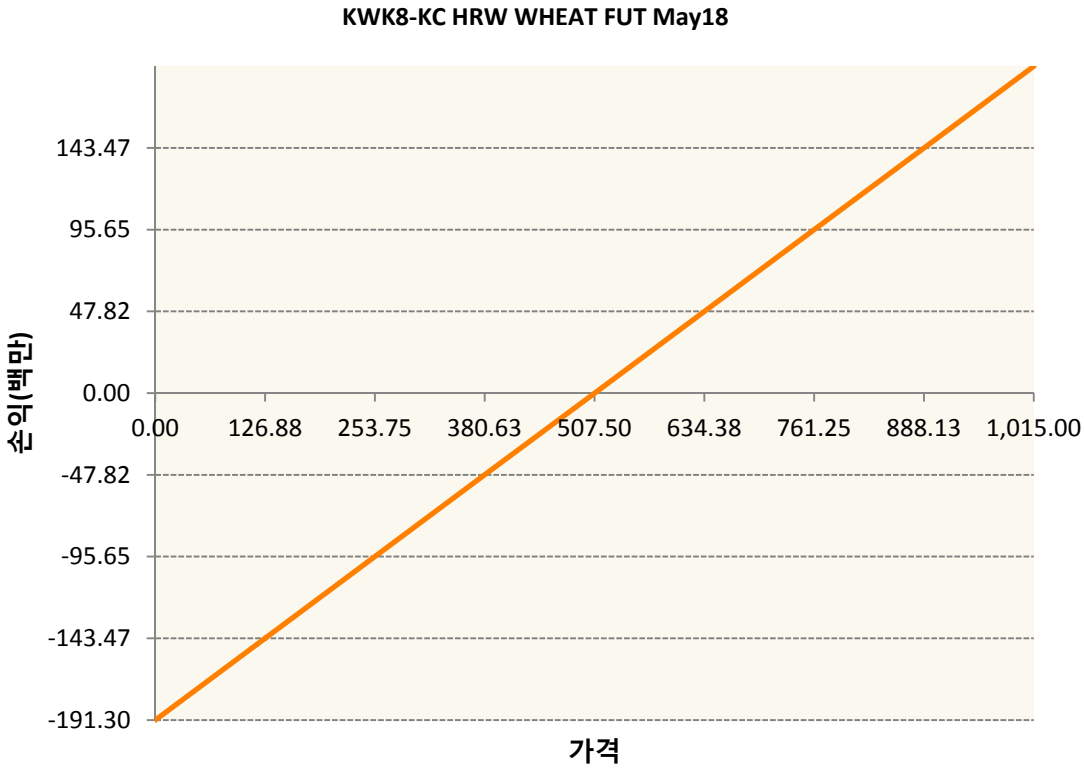

-450.05
-675.08
-900.10
가격

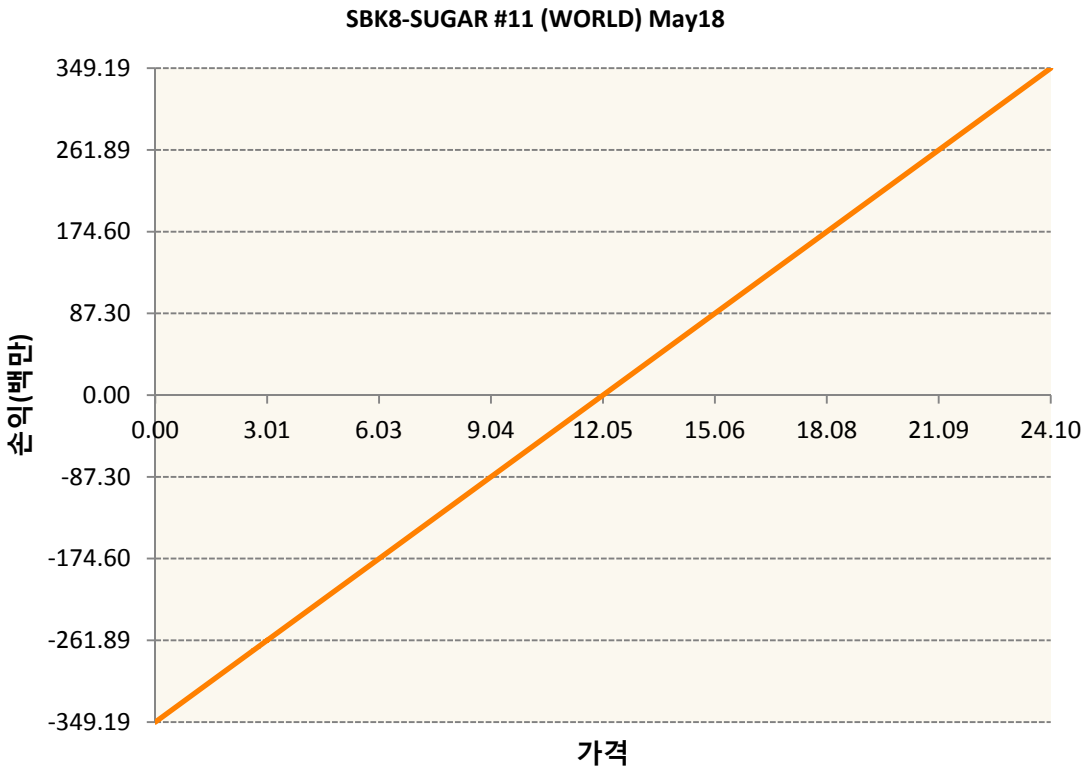

CTK8-COTTON NO.2 FUTR May18
225.26
168.94
112.63
56.31
0.00
-56.31
-112.63
-168.94
-225.26
0.00
20.92
41.85
62.77
83.69
104.61
125.54
146.46
167.38
손익(백만)
가격

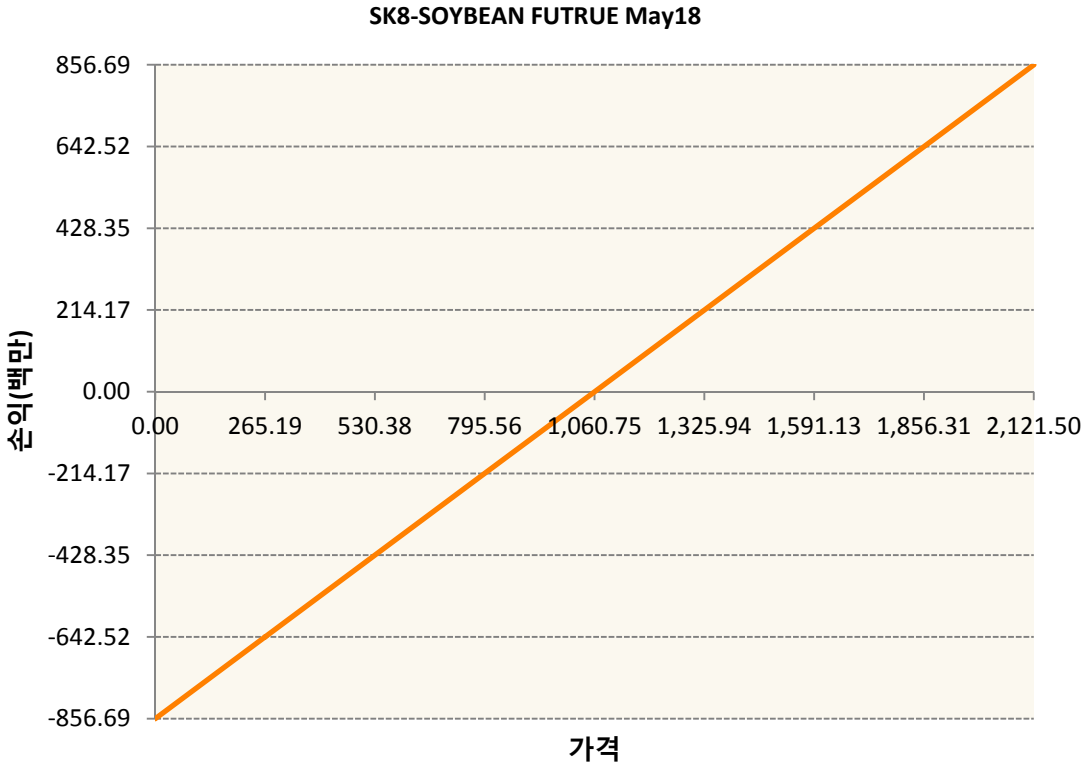

KCK8-COFFEE 'C' FUTURE May18
250.14
166.76
83.38
0.00
-83.38
-166.76
-250.14
0.00
29.48
58.95
88.43
117.90
147.38
176.85
206.33
235.80
손익(백만)


-333.52
가격

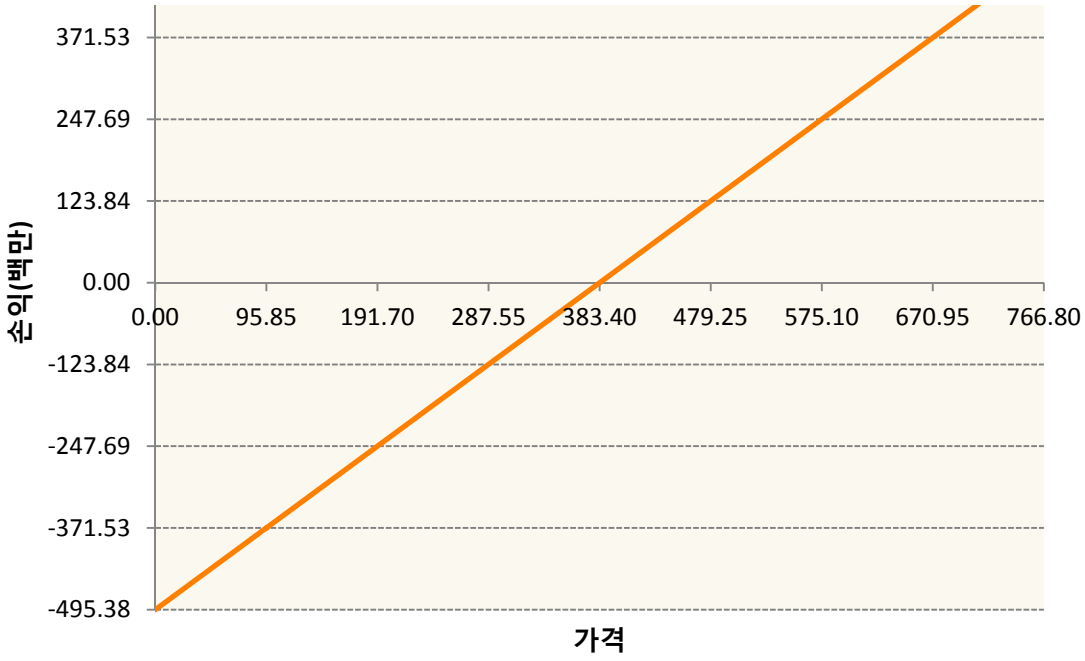

KR4175N50004-2018-05 달러선물
240.41
160.28
80.14
0.00
-80.14
-160.28
-240.41
-320.55
0.00
267.13
534.25
801.38
1,068.50
1,335.63
1,602.75
1,869.88
2,137.00
손익(백만)
가격

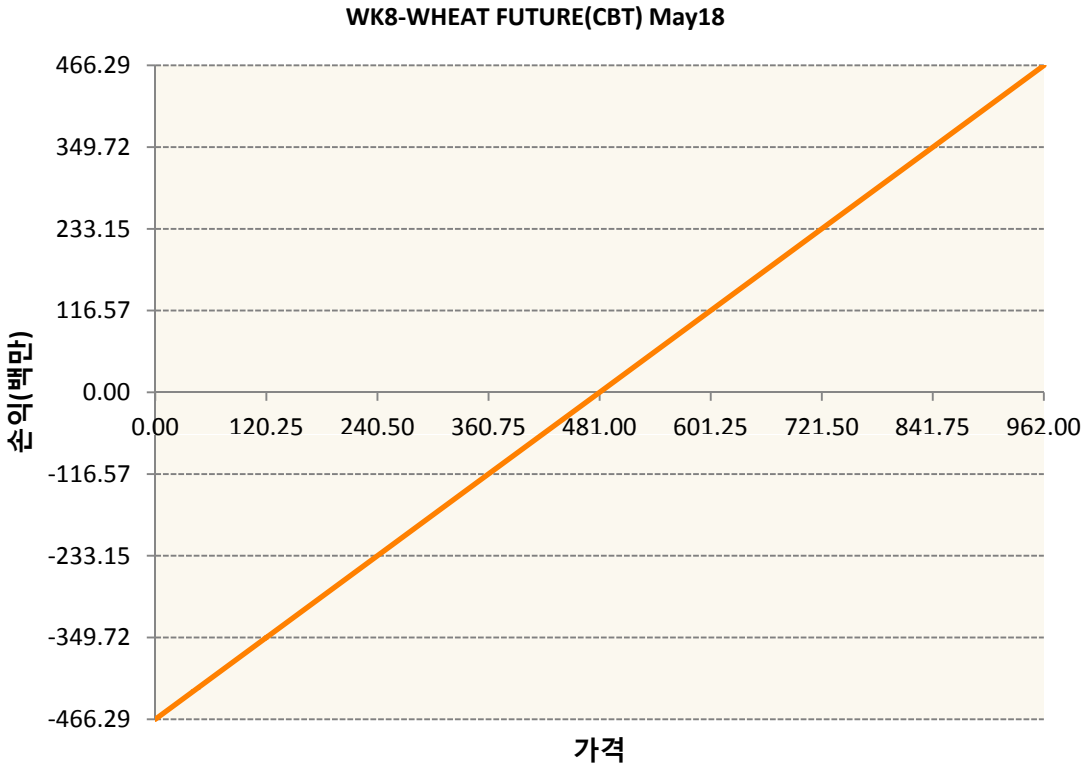

KWK8-KC HRW WHEAT FUT May18
143.47
95.65
47.82
0.00
-47.82
-95.65
-143.47
-191.30
0.00
126.88
253.75
380.63
507.50
634.38
761.25
888.13
1,015.00
손익(백만)
가격


SBK8-SUGAR #11 (WORLD) May18
349.19
261.89
174.60
87.30
0.00
-87.30
-174.60
-261.89
-349.19
0.00
3.01
6.03
9.04
12.05
15.06
18.08
21.09
24.10
손익(백만)
가격


SK8-SOYBEAN FUTRUE May18
856.69
642.52
428.35
214.17
0.00
-214.17
-428.35
-642.52
-856.69
0.00
265.19
530.38
795.56
1,060.75
1,325.94
1,591.13
1,856.31
2,121.50
손익(백만)
가격


SMK8-SOYBEAN MEAL FUTR May18
495.38





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
KR4175N50(	2018-05 달러선물	26

KWK8	KC HRW WHEAT FUT May18	15
SBK8	SUGAR #11 (WORLD) May18	28
SK8	SOYBEAN FUTRUE May18	69
SMK8	SOYBEAN MEAL FUTR May18	40
WK8	WHEAT FUTURE(CBT) May18	37

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

337