공시일	2018-04-18
기준일	2018-04-17

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	2018-04-18
기준일	2018-04-17

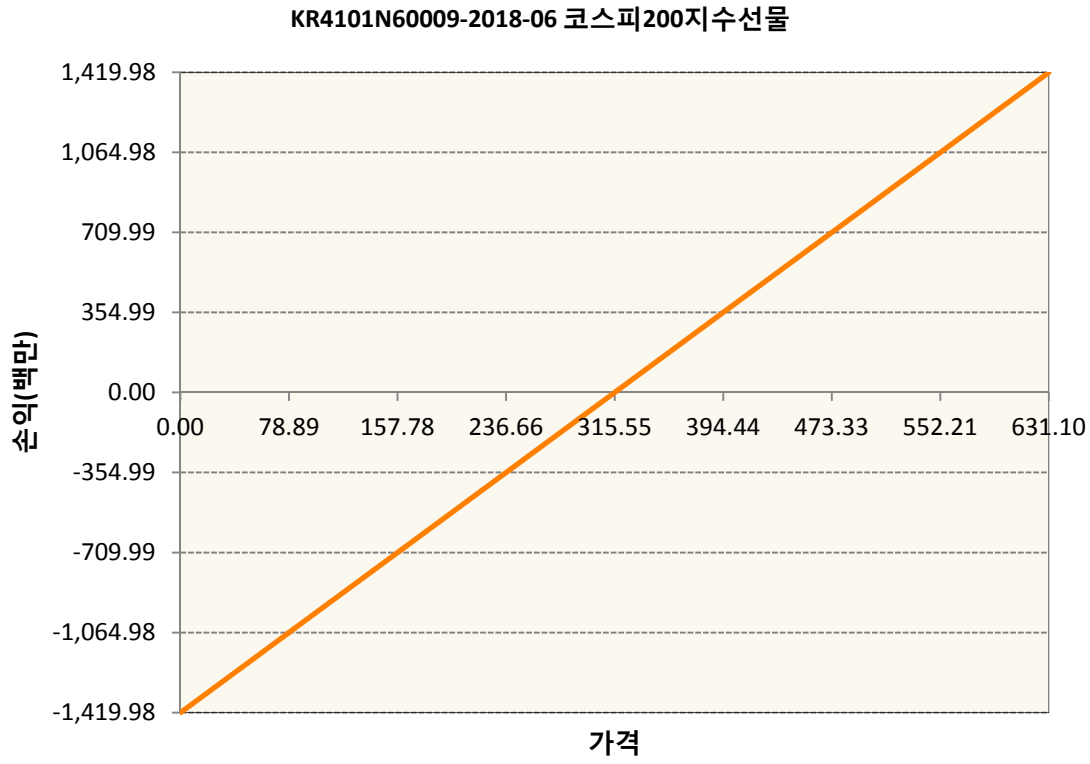
스마트인덱스모

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	2018-04-18
기준일	2018-04-17

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	1,105

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

449

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2018-04-18
기준일	2018-04-17

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	396

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

424

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2018-04-18
기준일	2018-04-17

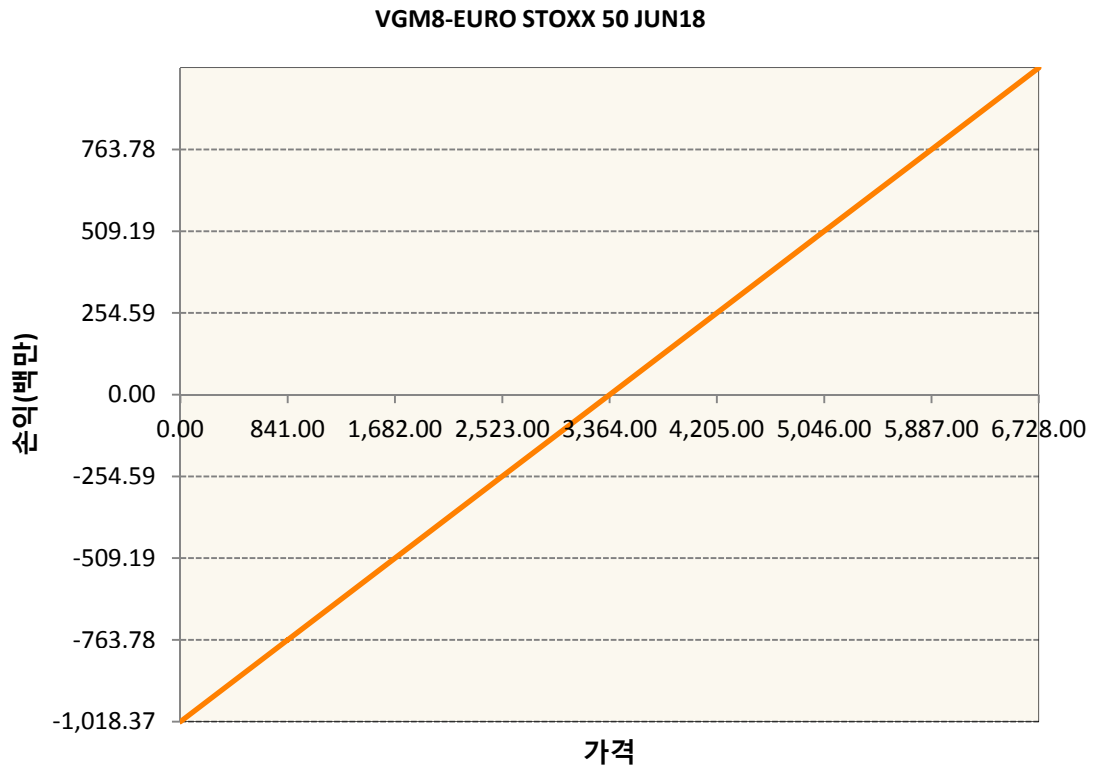
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,018	0	1,018	

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	2018-04-18
기준일	2018-04-17

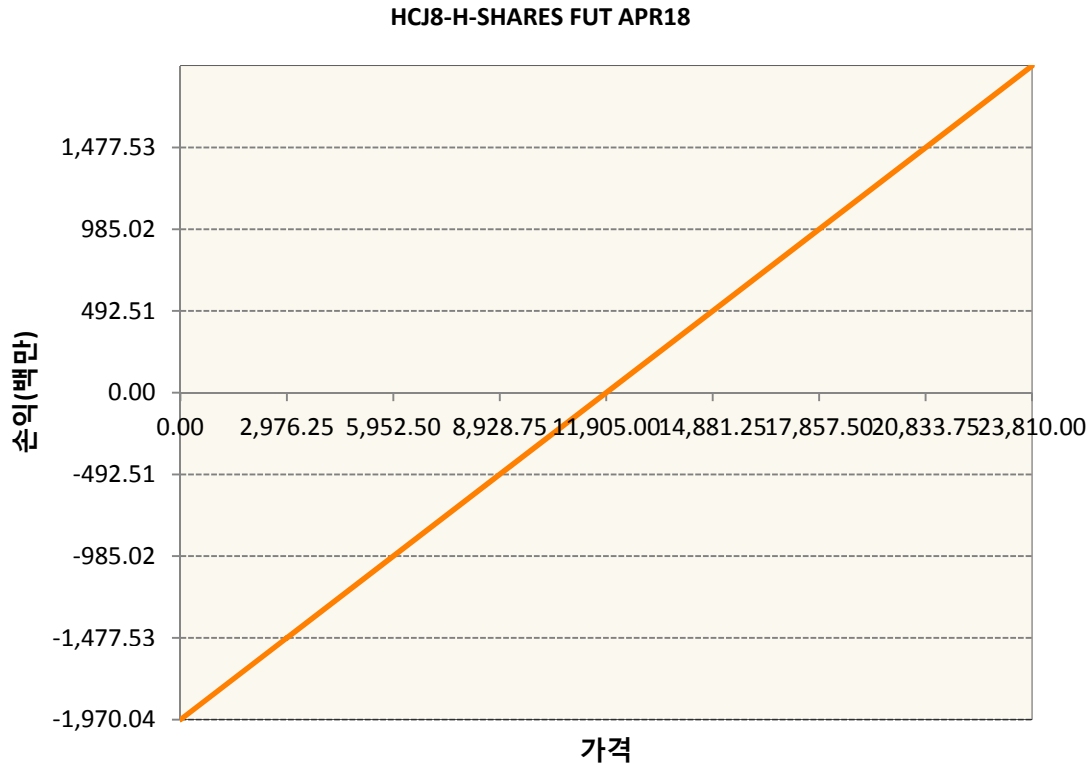
차이나인덱스모(주식-파생형)

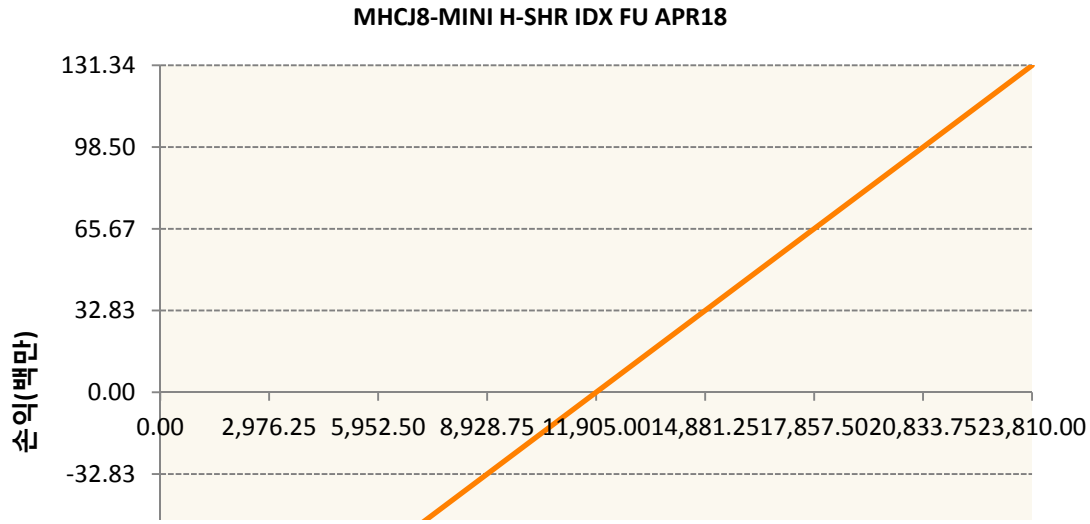
1. 계약금액

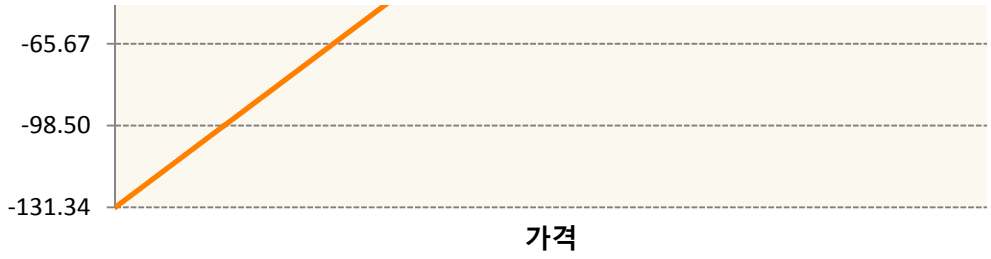
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,101	0	2,101	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)
	149

공시일	2018-04-18
기준일	2018-04-17

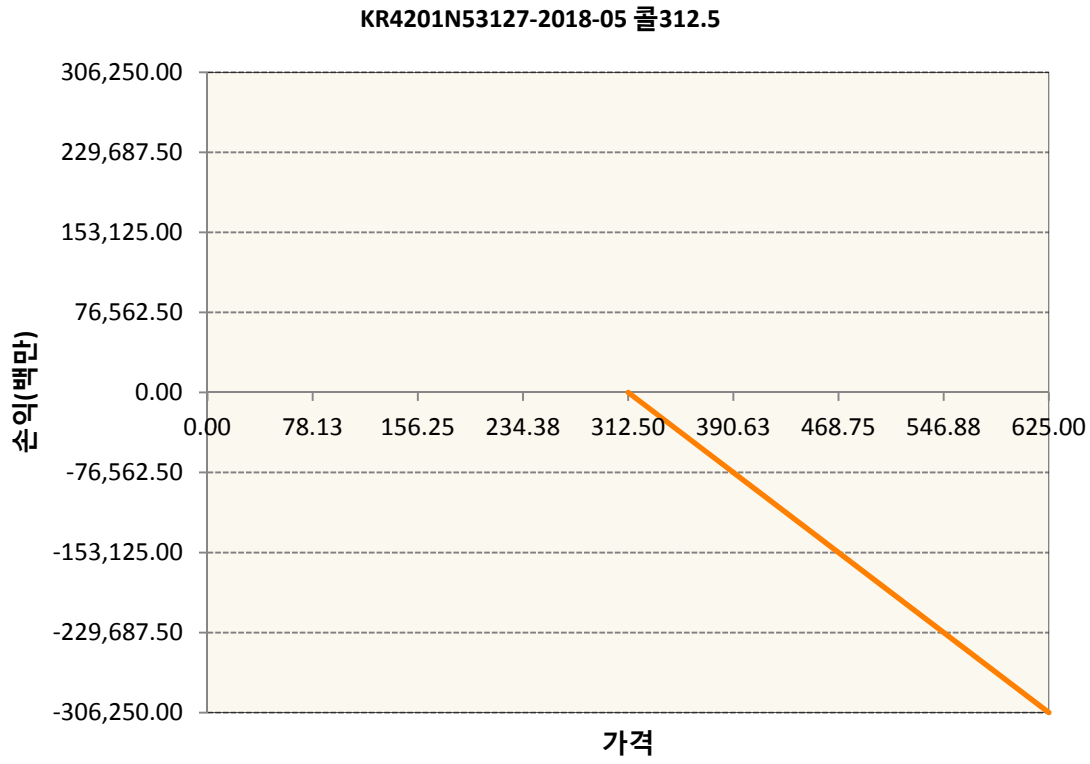
커버드콜모(주식혼합-파생형)

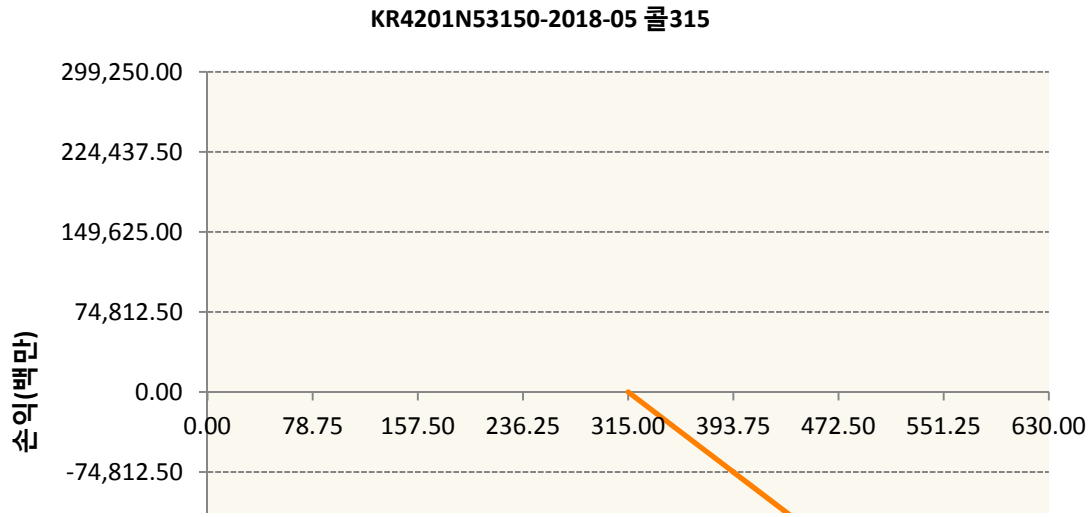
1. 계약금액

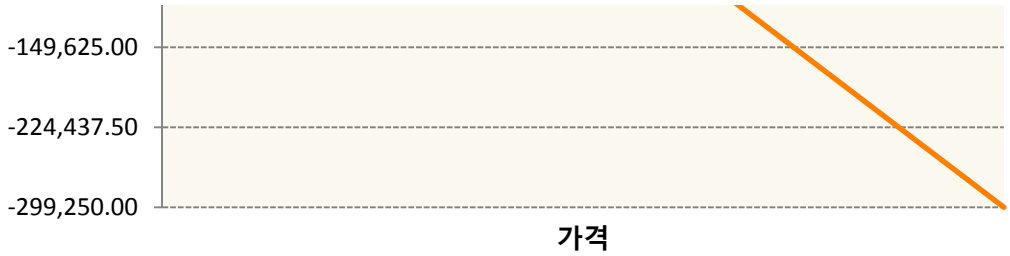
(단위:백만원)

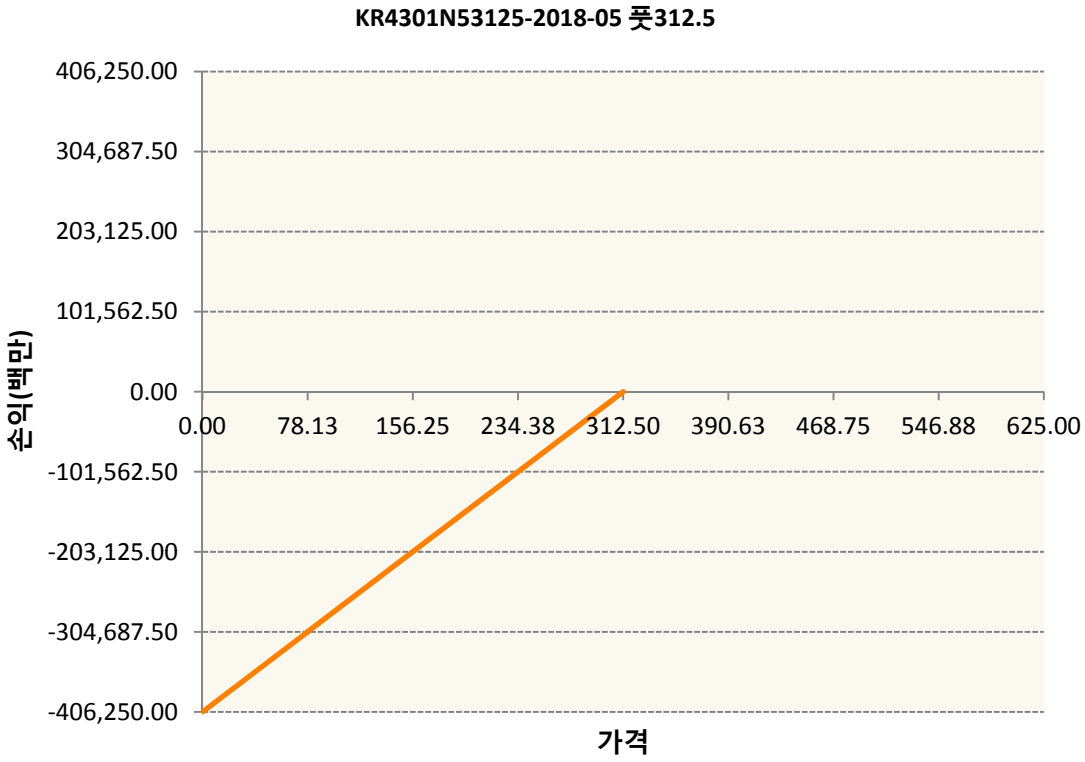
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	7,744	0	7,744	장내
누계	유가증권	옵션	0	1,011,750	-1,011,750	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201N5312018-05 콜312.5							19,619
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	9,135	8,876	8,567	8,216	7,826	7,405	6,956
-5.33%	8,108	7,636	7,130	6,597	6,043	5,471	4,885
-2.67%	5,901	5,247	4,584	3,916	3,243	2,567	1,887
0%	2,113	1,409	705	0	-706	-1,412	-2,118
2.67%	-3,297	-3,895	-4,514	-5,148	-5,794	-6,450	-7,114
5.33%	-10,005	-10,414	-10,869	-11,361	-11,883	-12,431	-12,999
8.00%	-17,535	-17,765	-18,050	-18,382	-18,759	-19,172	-19,619
KR4201N5312018-05 콜315							18,292
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	7,801	7,597	7,344	7,048	6,712	6,343	5,944

-5.33%	7,031	6,630	6,190	5,718	5,219	4,699	4,161
-2.67%	5,270	4,672	4,060	3,437	2,806	2,167	1,524
0%	2,070	1,380	690	0	-690	-1,380	-2,069
2.67%	-2,721	-3,349	-3,990	-4,641	-5,298	-5,962	-6,629
5.33%	-8,881	-9,342	-9,840	-10,368	-10,921	-11,493	-12,082
8.00%	-15,977	-16,253	-16,581	-16,955	-17,369	-17,816	-18,292
KR4301N5312018-05 풋312.5							25,887

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-25,657	-25,665	-25,681	-25,709	-25,751	-25,810	-25,887
-5.33%	-14,873	-14,964	-15,085	-15,236	-15,414	-15,616	-15,842
-2.67%	-5,110	-5,451	-5,811	-6,185	-6,569	-6,963	-7,364
0%	1,337	894	448	0	-450	-901	-1,352
2.67%	3,734	3,519	3,272	2,997	2,700	2,383	2,049
5.33%	4,165	4,122	4,057	3,966	3,850	3,707	3,540
8.00%	4,200	4,196	4,188	4,171	4,142	4,100	4,042

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

64,694

공시일	2018-04-18
기준일	2018-04-17

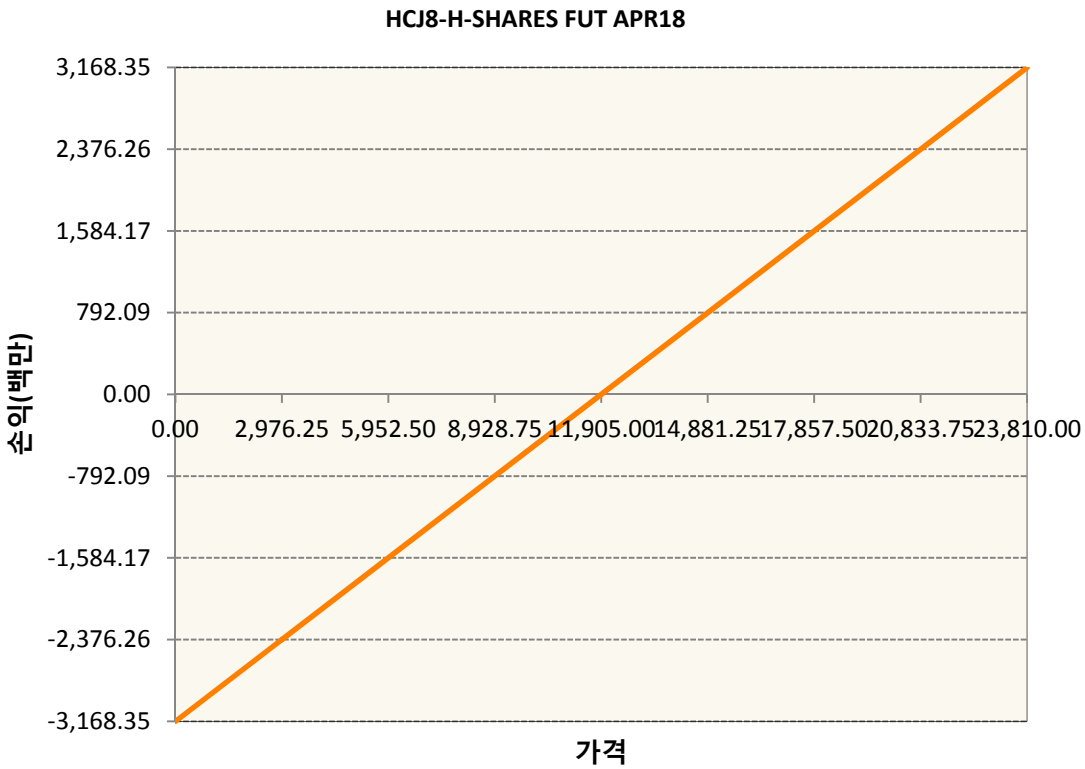
홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생

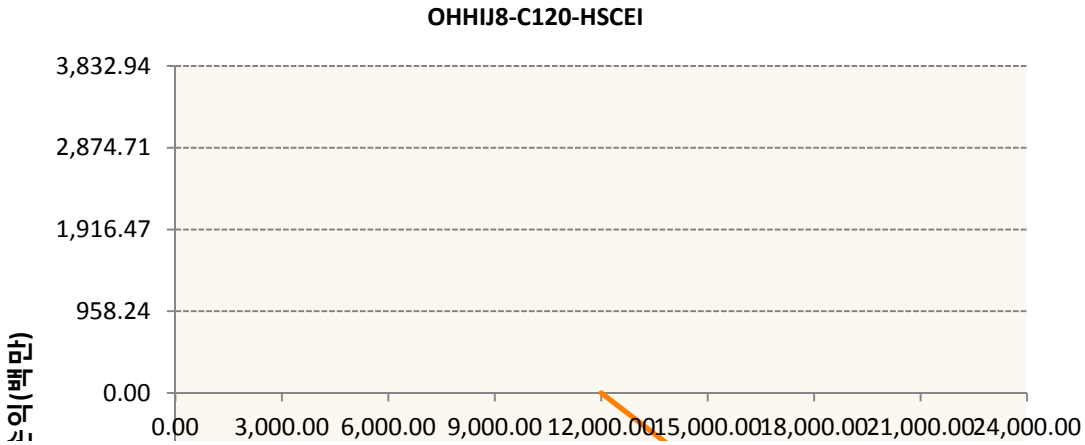
1. 계약금액

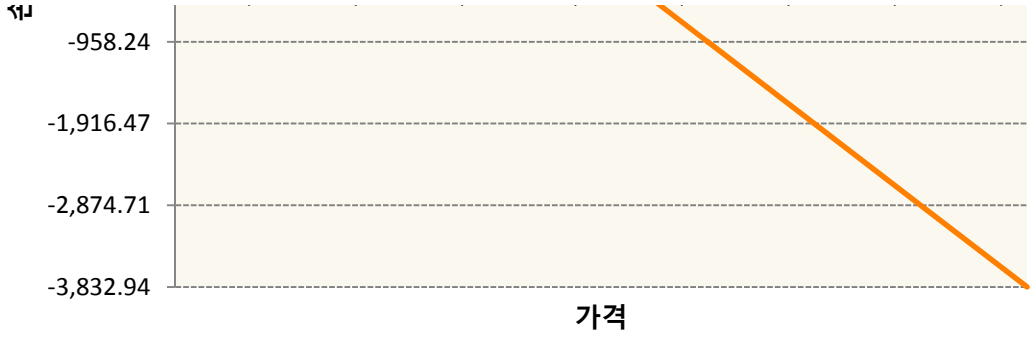
(단위:백만원)

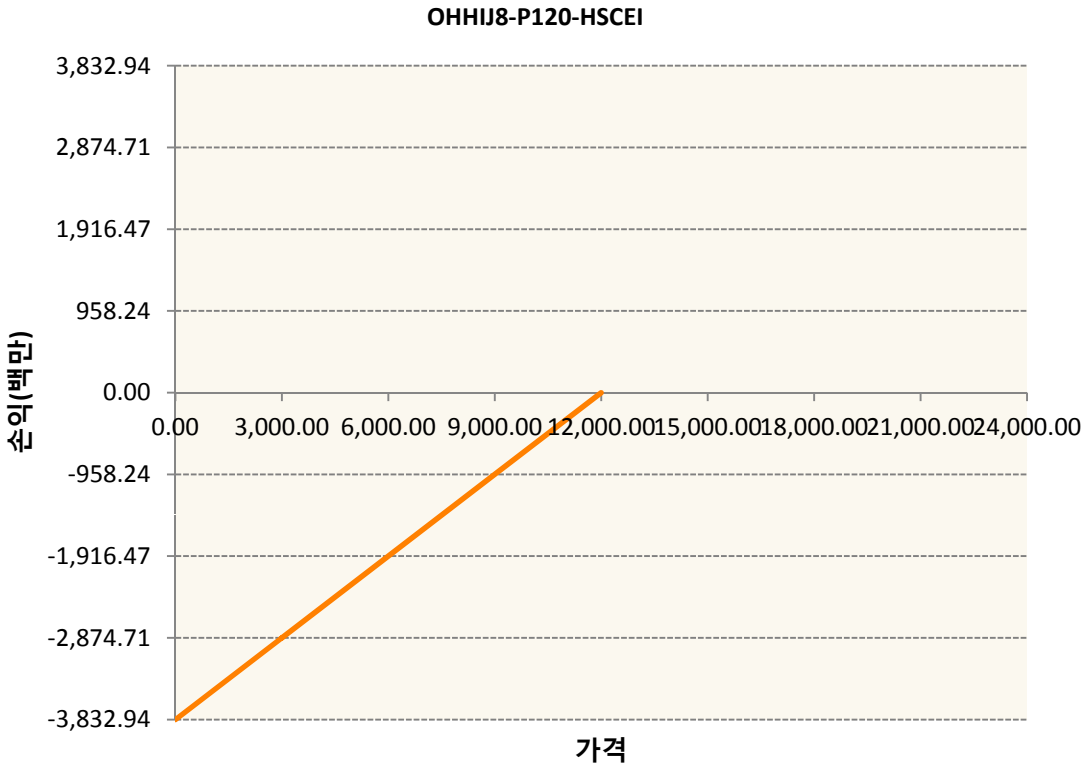
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	3,168	0	3,168	장내
누계	유가증권	옵션	0	7,666	-7,666	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCJ8	H-SHARES FUT APR18	253
OHHIJ8-C12	HSCEI	307
OHHIJ8-P12	HSCEI	307

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	766

공시일	2018-04-18
기준일	2018-04-17

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼

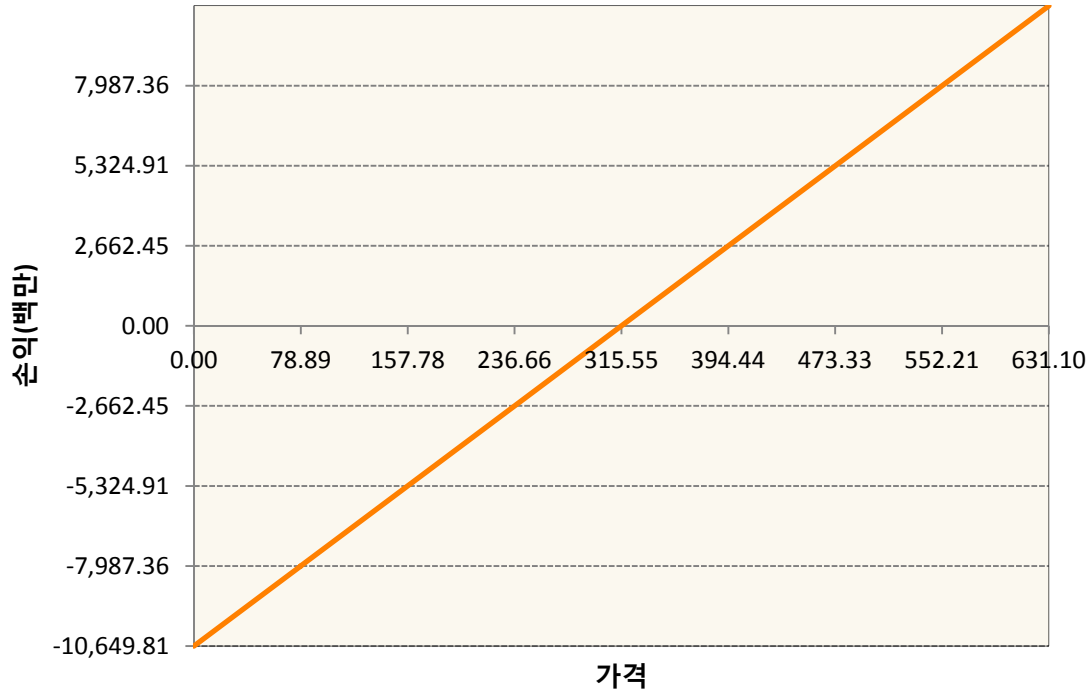
1. 계약금액

(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	10,650	0	10,650	장내
누계	유가증권	스왑	52,200	0	52,200	장외
누계	유가증권	옵션	0	55,754	-55,754	장내

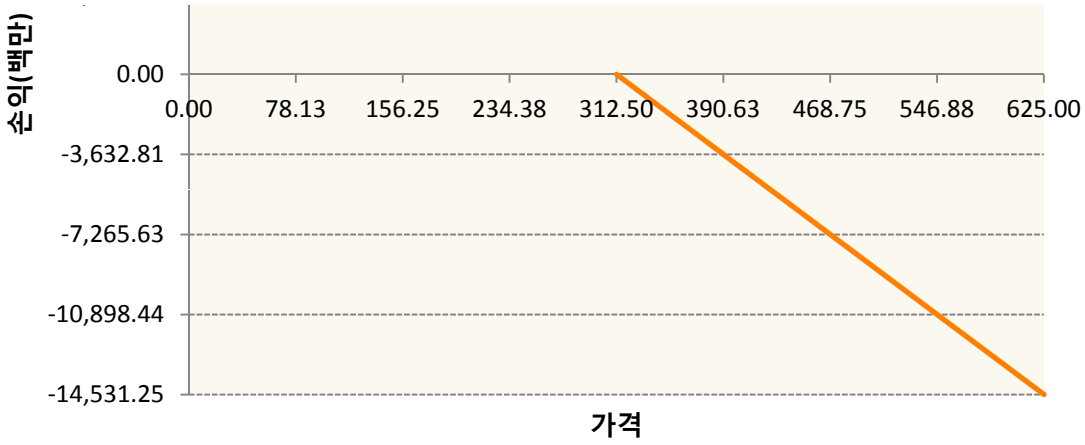
2. 만기시점의 손익구조

KR4101N60009-2018-06 코스피200지수선물

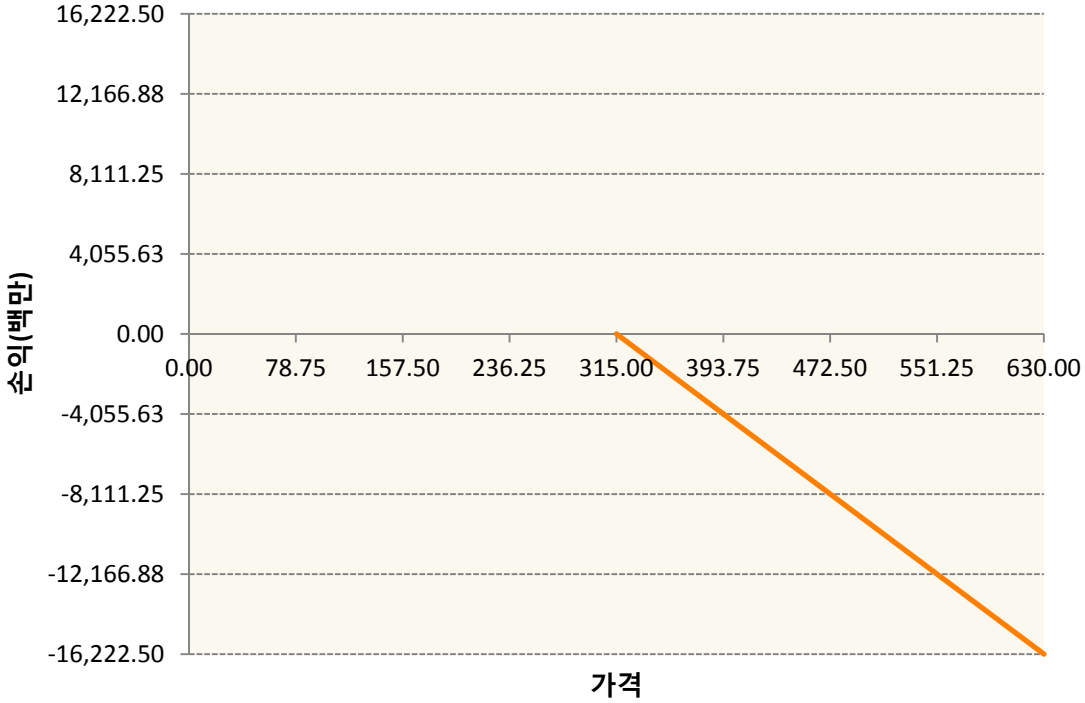


KR4201N53127-2018-05 콜312.5

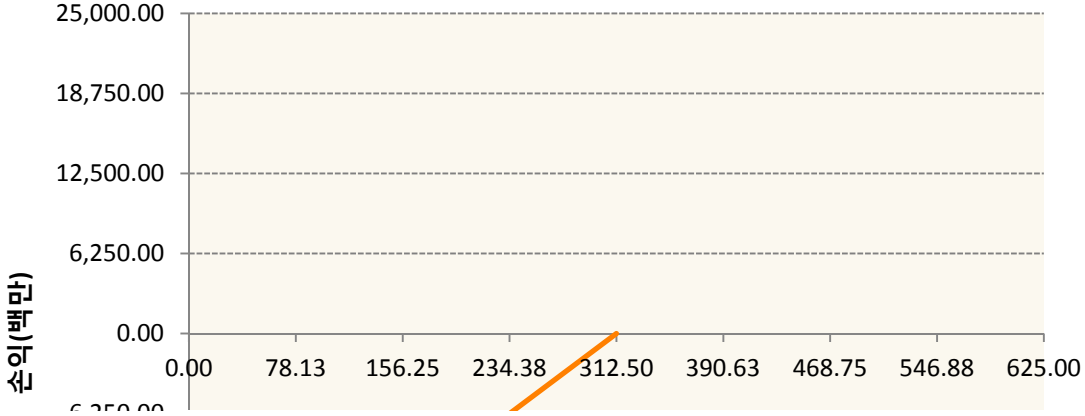




KR4201N53150-2018-05 콜315



KR4301N53125-2018-05 풋312.5





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_2							1,463
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,463	-1,463	-1,463	-1,463	-1,463	-1,463	-1,463
-5.33%	-975	-975	-975	-975	-975	-975	-975
-2.67%	-488	-488	-488	-488	-488	-488	-488
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	488	488	488	488	488	488	488
5.33%	975	975	975	975	975	975	975
8.00%	1,463	1,463	1,463	1,463	1,463	1,463	1,463
2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_3							277
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-277	-277	-277	-277	-277	-277	-277
-5.33%	-185	-185	-185	-185	-185	-185	-185
-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%	185	185	185	185	185	185	185
8.00%	277	277	277	277	277	277	277
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							198
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%

-8.00%	-198	-198	-198	-198	-198	-198	-198
-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%	198	198	198	198	198	198	198
	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%	-169	-169	-169	-169	-169	-169	-169
-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%	169	169	169	169	169	169	169
8.00%	253	253	253	253	253	253	253
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_8						468
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-468	-468	-468	-468	-468	-468	-468
-5.33%	-312	-312	-312	-312	-312	-312	-312
-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%	312	312	312	312	312	312	312
8.00%	468	468	468	468	468	468	468
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_10						119
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-119	-119	-119	-119	-119	-119	-119
-5.33%	-79	-79	-79	-79	-79	-79	-79
-2.67%	-40	-40	-40	-40	-40	-40	-40
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	40	40	40	40	40	40	40
5.33%	79	79	79	79	79	79	79
8.00%	119	119	119	119	119	119	119
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_11						633
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-633	-633	-633	-633	-633	-633	-633
-5.33%	-422	-422	-422	-422	-422	-422	-422
-2.67%	-211	-211	-211	-211	-211	-211	-211
0%	0	0	0	0	0	0	0

2.67%	211	211	211	211	211	211	211
5.33%	422	422	422	422	422	422	422
8.00%	633	633	633	633	633	633	633
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_12						475
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-475	-475	-475	-475	-475	-475	-475
-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%	475	475	475	475	475	475	475
	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%	-566	-566	-566	-566	-566	-566	-566
-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%	566	566	566	566	566	566	566
8.00%	850	850	850	850	850	850	850
	KR4201N531 2018-05 콜312.5						931
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	433	421	407	390	371	351	330
-5.33%	385	362	338	313	287	260	232
-2.67%	280	249	218	186	154	122	90
0%	100	67	33	0	-33	-67	-100
2.67%	-156	-185	-214	-244	-275	-306	-338
5.33%	-475	-494	-516	-539	-564	-590	-617
8.00%	-832	-843	-856	-872	-890	-910	-931
	KR4201N531 2018-05 콜315						992
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	423	412	398	382	364	344	322
-5.33%	381	359	336	310	283	255	226
-2.67%	286	253	220	186	152	117	83
0%	112	75	37	0	-37	-75	-112
2.67%	-147	-182	-216	-252	-287	-323	-359
5.33%	-481	-506	-533	-562	-592	-623	-655
8.00%	-866	-881	-899	-919	-942	-966	-992
	KR4301N531 2018-05 풋312.5						1,593

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,579	-1,579	-1,580	-1,582	-1,585	-1,588	-1,593
-5.33%	-915	-921	-928	-938	-949	-961	-975
-2.67%	-314	-335	-358	-381	-404	-428	-453
0%	82	55	28	0	-28	-55	-83
2.67%	230	217	201	184	166	147	126
5.33%	256	254	250	244	237	228	218
8.00%	258	258	258	257	255	252	249

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

8,327

공시일	2018-04-18
기준일	2018-04-17

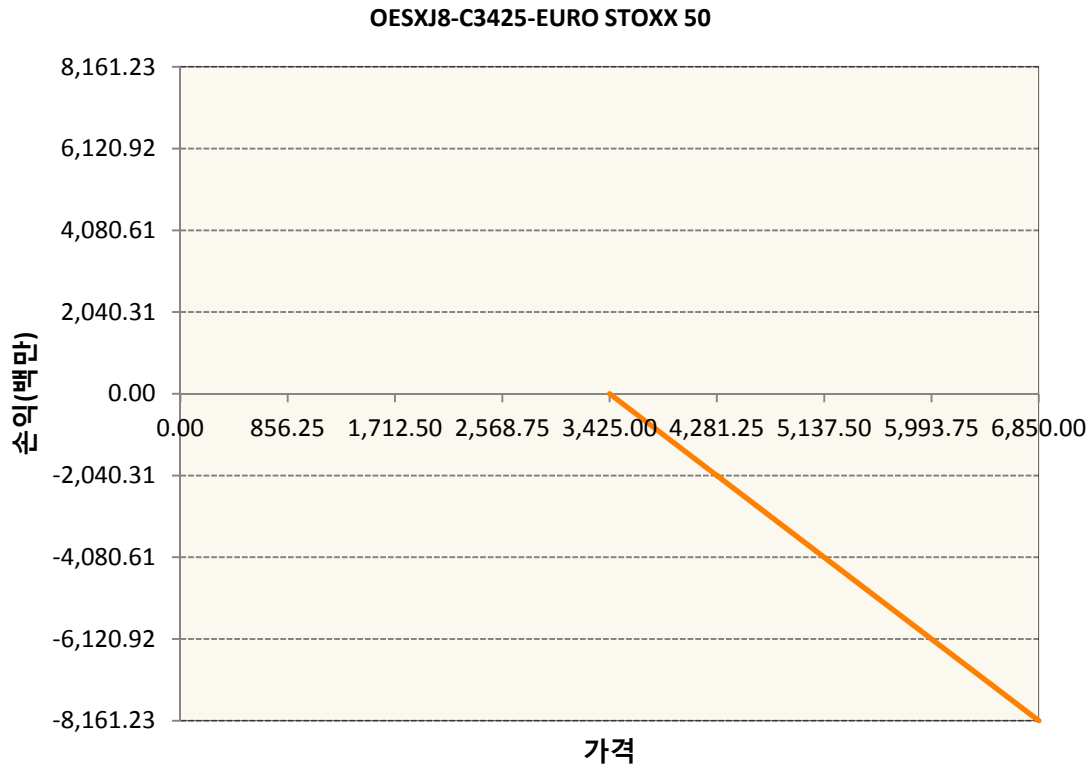
유로커버드콜모(주식혼합-파생형

1. 계약금액

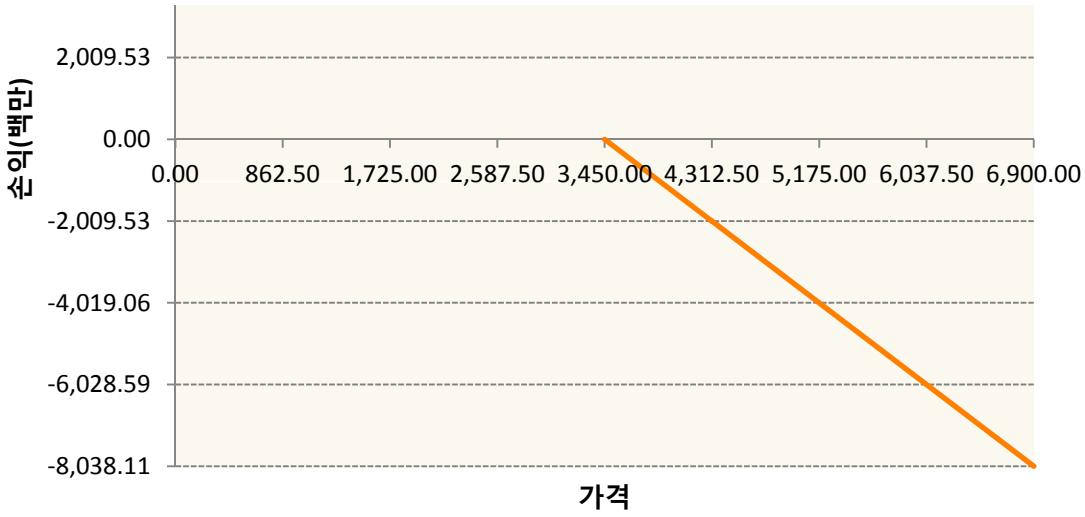
(단위:백만원)

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	7,587	0	7,587	
누계	유가증권	스왑	76,466	0	76,466	장외
누계	유가증권	옵션	0	32,399	-32,399	장내
누계	지수	스왑	52,954	0	52,954	장외

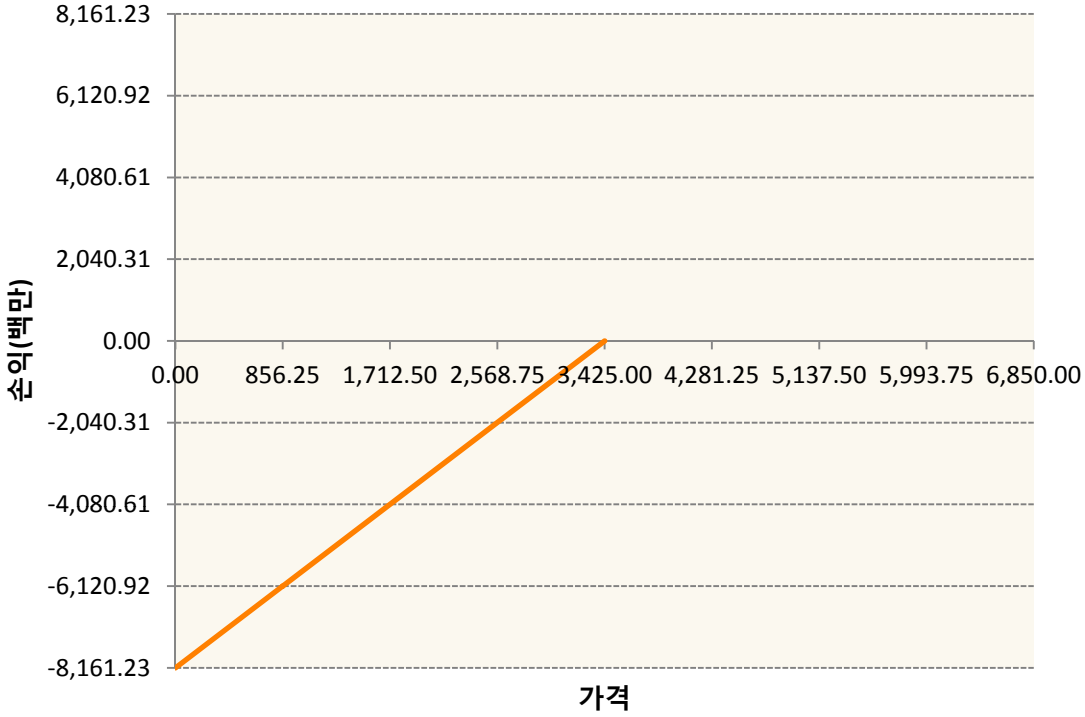
2. 만기시점의 손익구조



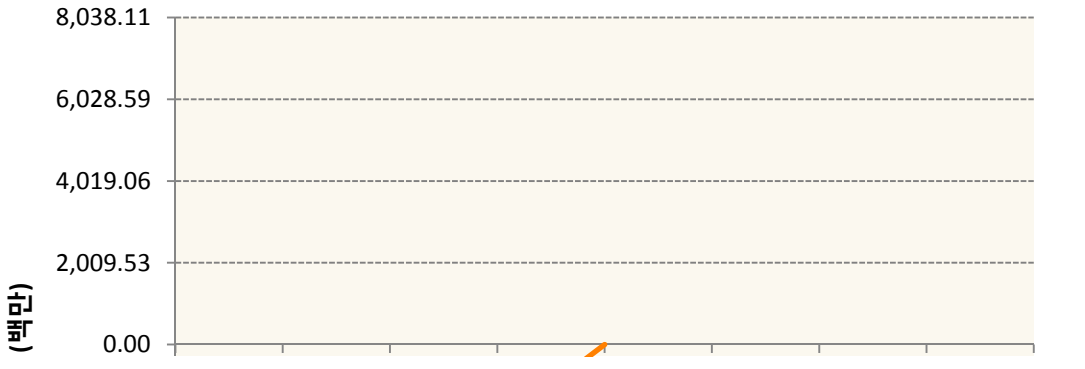


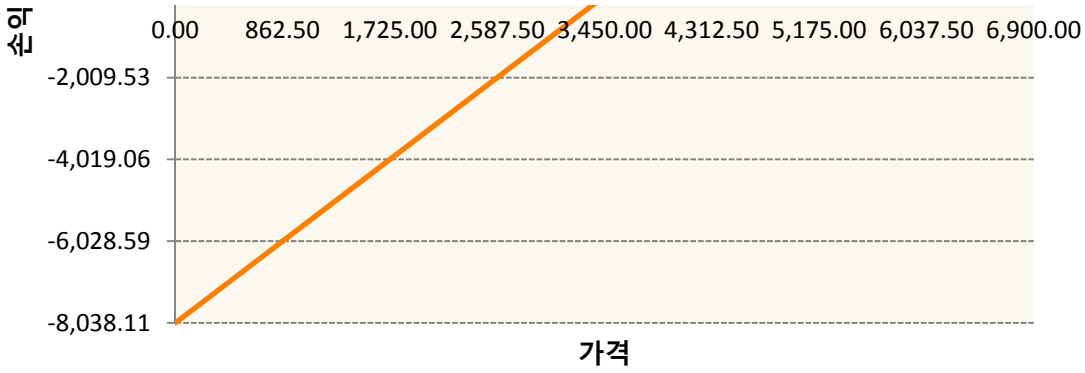


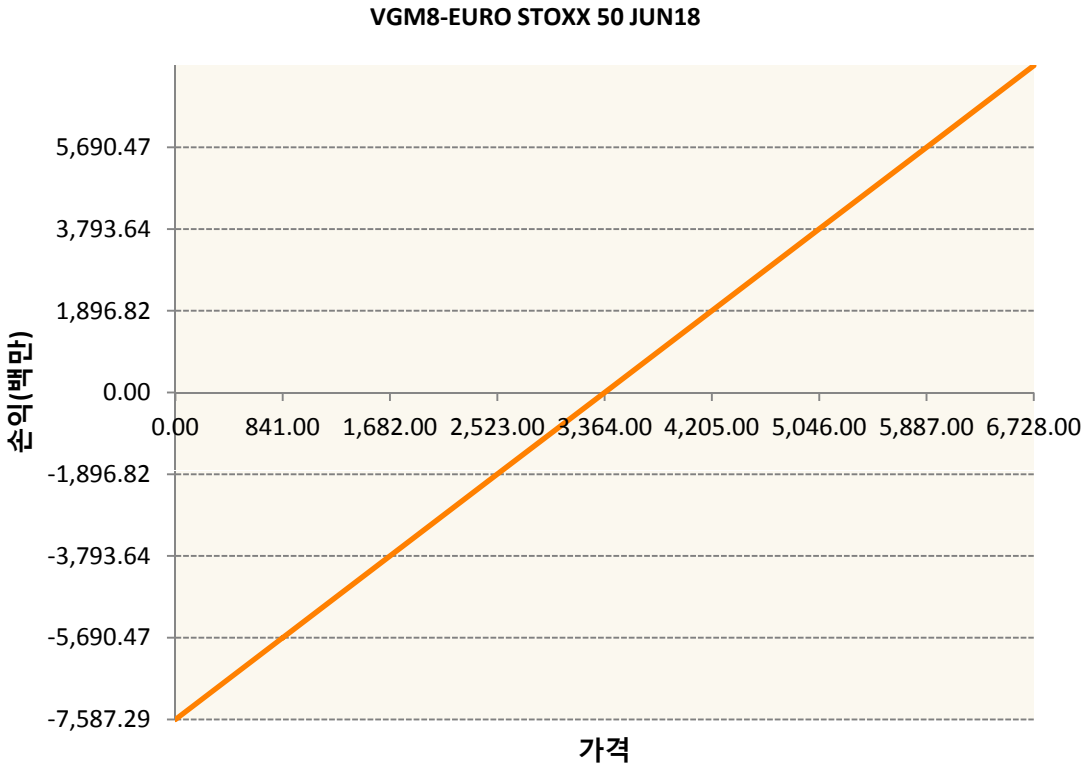
OESXJ8-P3425-EURO STOXX 50



OESXJ8-P3450-EURO STOXX 50







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)	(단위:백만원)
260105SGPX SG EURO Covered CALL STRATEGY - 994.569	110
260105SQPX SG EURO Covered CALL STRATEGY	159
OESXJ8-C34 EURO STOXX 50	653
OESXJ8-C34 EURO STOXX 50	643
OESXJ8-P34 EURO STOXX 50	653
OESXJ8-P34 EURO STOXX 50	643
VGM8 EURO STOXX 50 JUN18	607

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

2,159

공시일	2018-04-18
기준일	2018-04-17

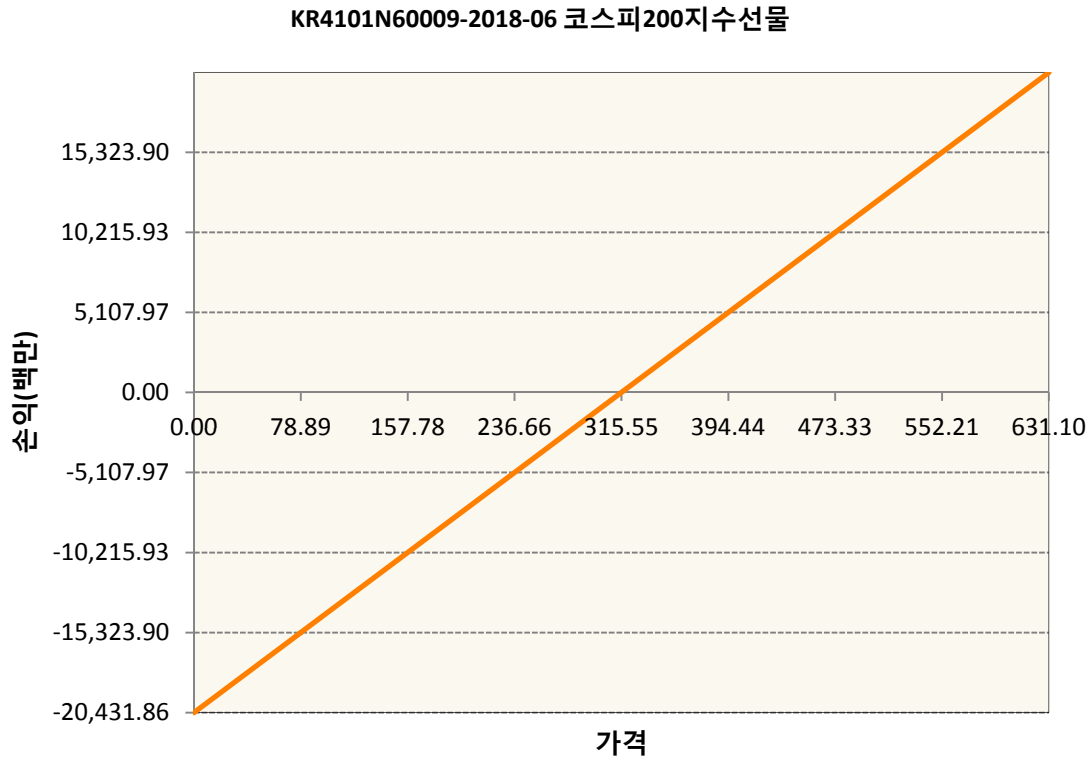
ETF스마트레버리지목표전환형8호

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	79	-79	장내
누계	유가증권	선물	20,432	0	20,432	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)

1,190

공시일	2018-04-18
기준일	2018-04-17

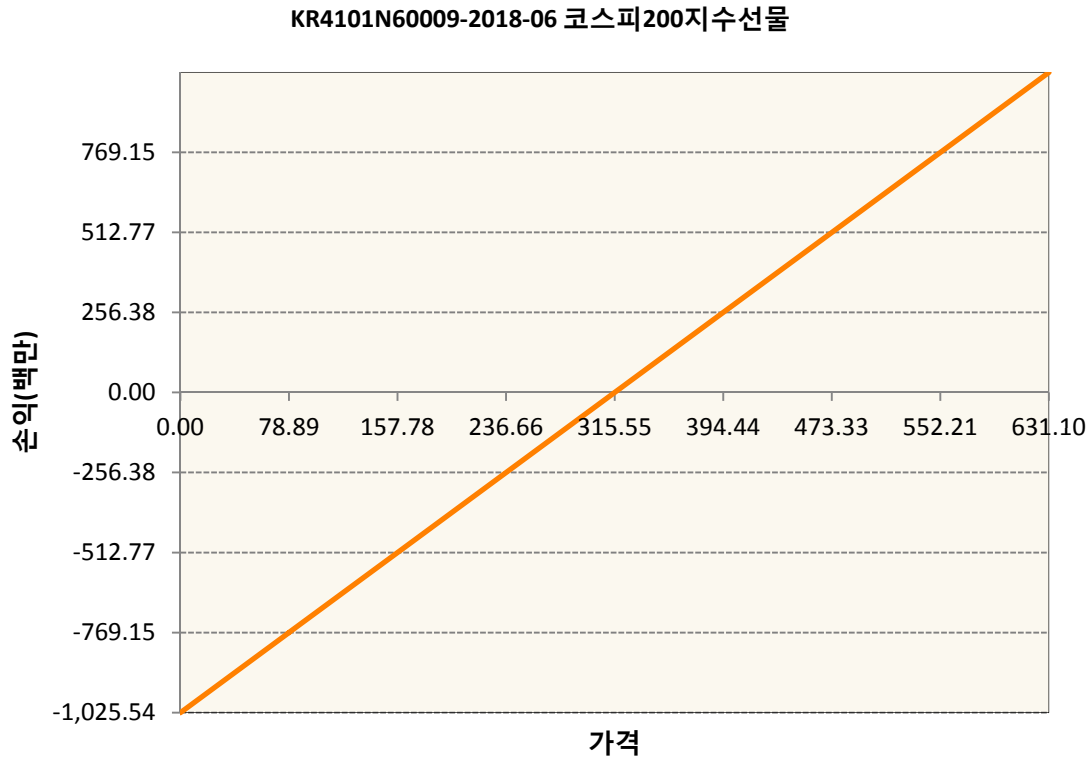
ETF스마트레버리지목표전환형9호

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	2018-04-18
기준일	2018-04-17

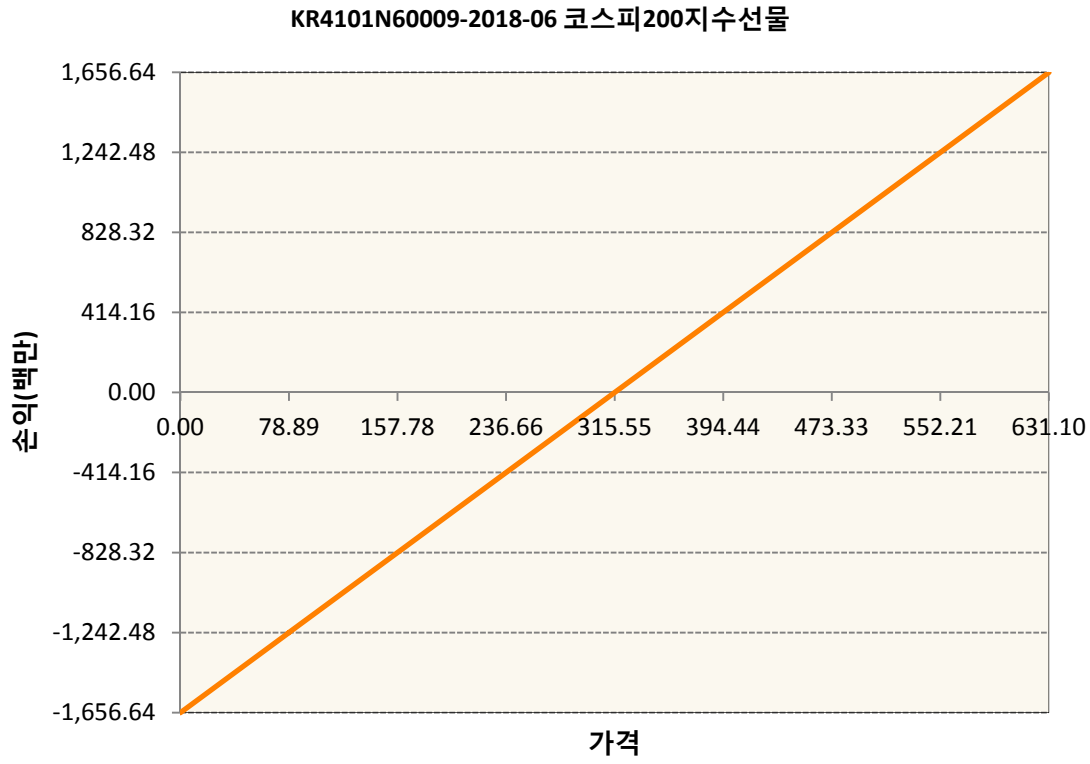
ETF스마트레버리지목표전환형10

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	2018-04-18
기준일	2018-04-17

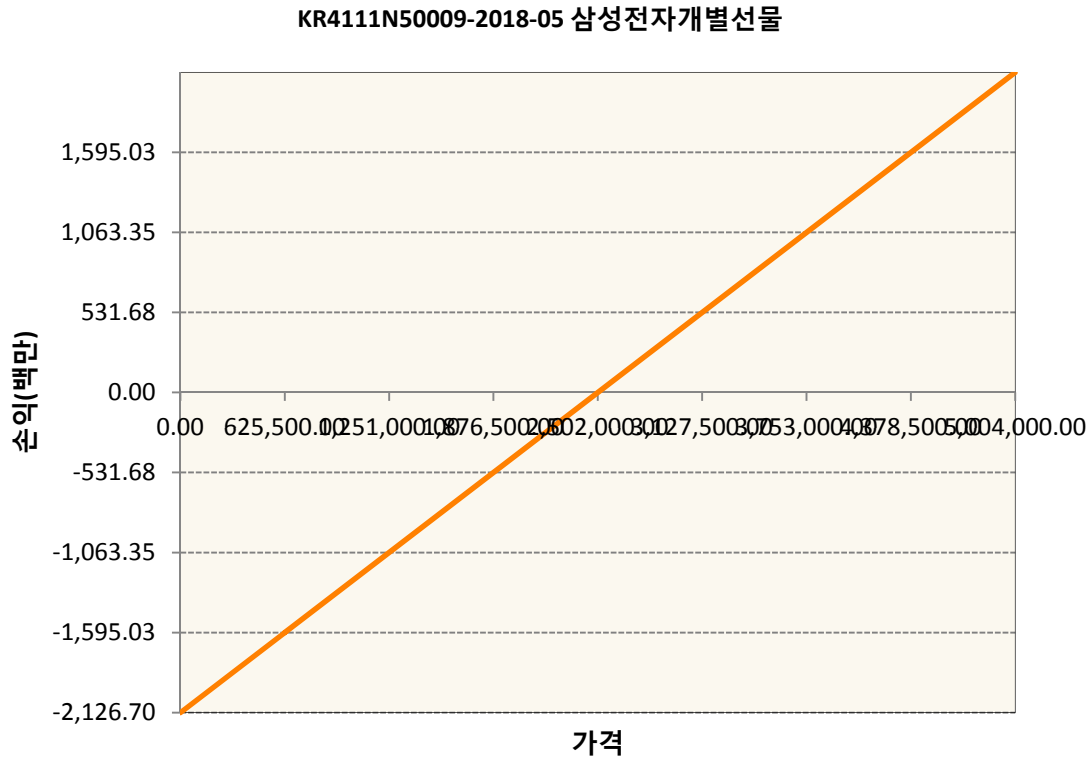
스마트KRX300인덱스1호(주식-파

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	2,127	0	2,127	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4111N50(2018-05 삼성전자개별선물 170

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-170	-170	-170	-170	-170	-170	-170
-5.33%	-113	-113	-113	-113	-113	-113	-113
-2.67%	-57	-57	-57	-57	-57	-57	-57
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	57	57	57	57	57	57	57
5.33%	113	113	113	113	113	113	113
8.00%	170	170	170	170	170	170	170

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

211

공시일	2018-04-18
기준일	2018-04-17

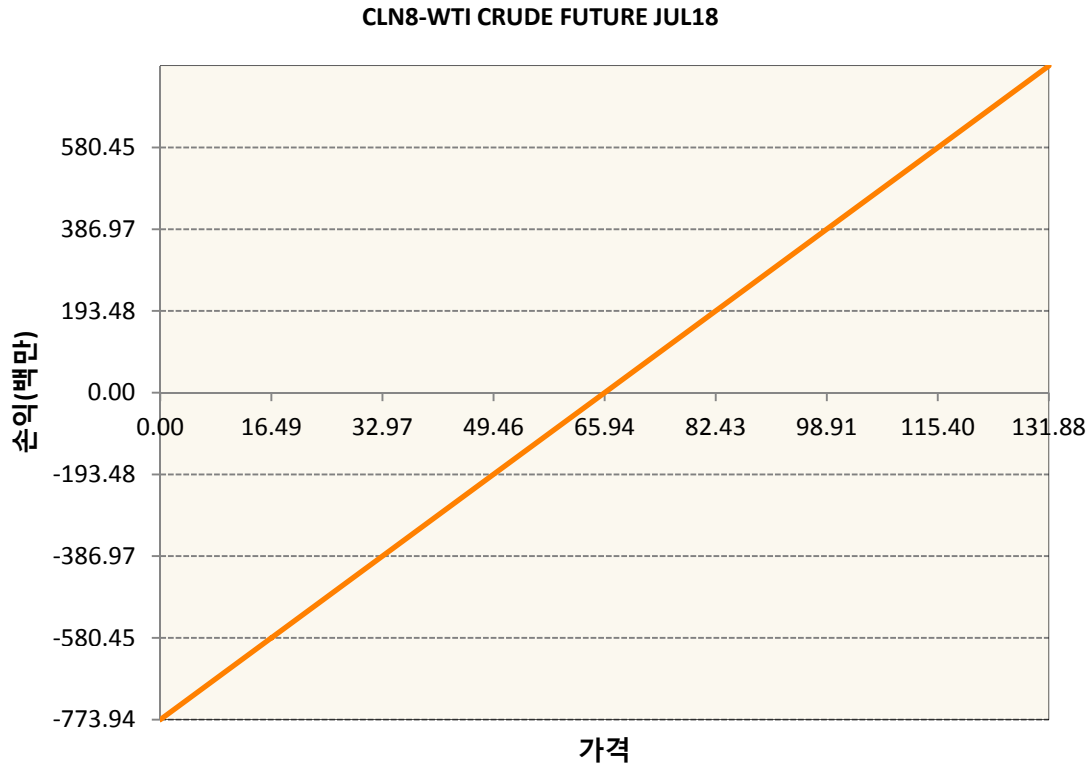
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

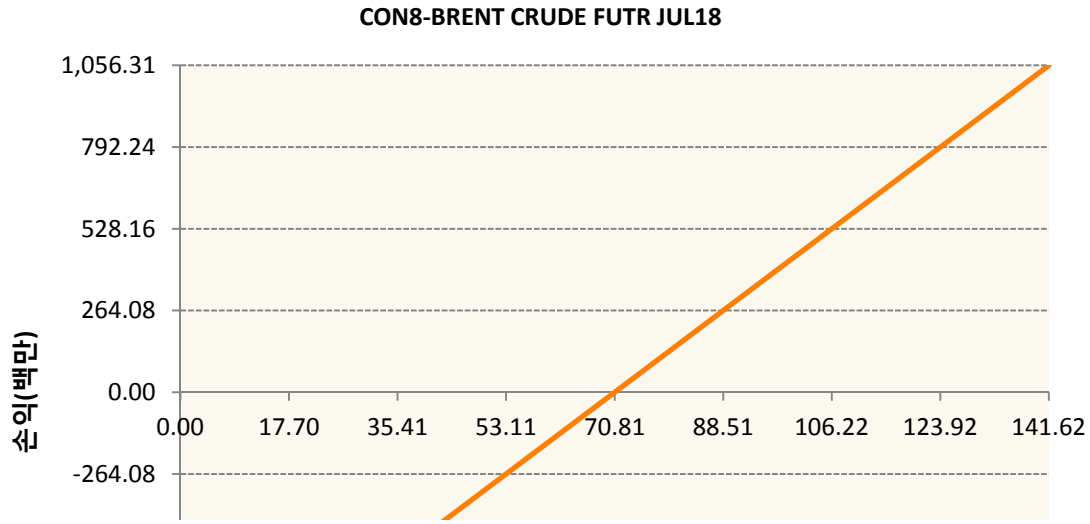
1. 계약금액

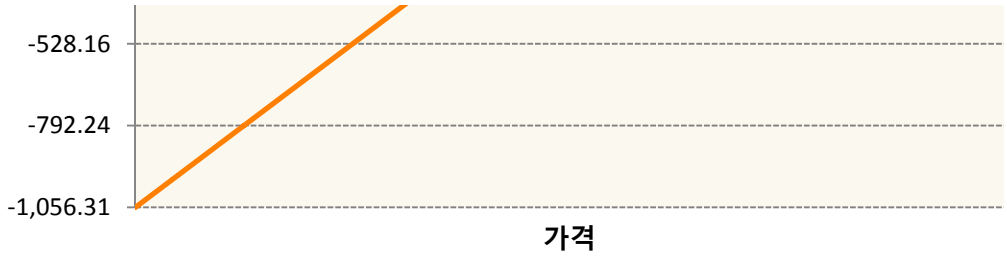
(단위:백만원)

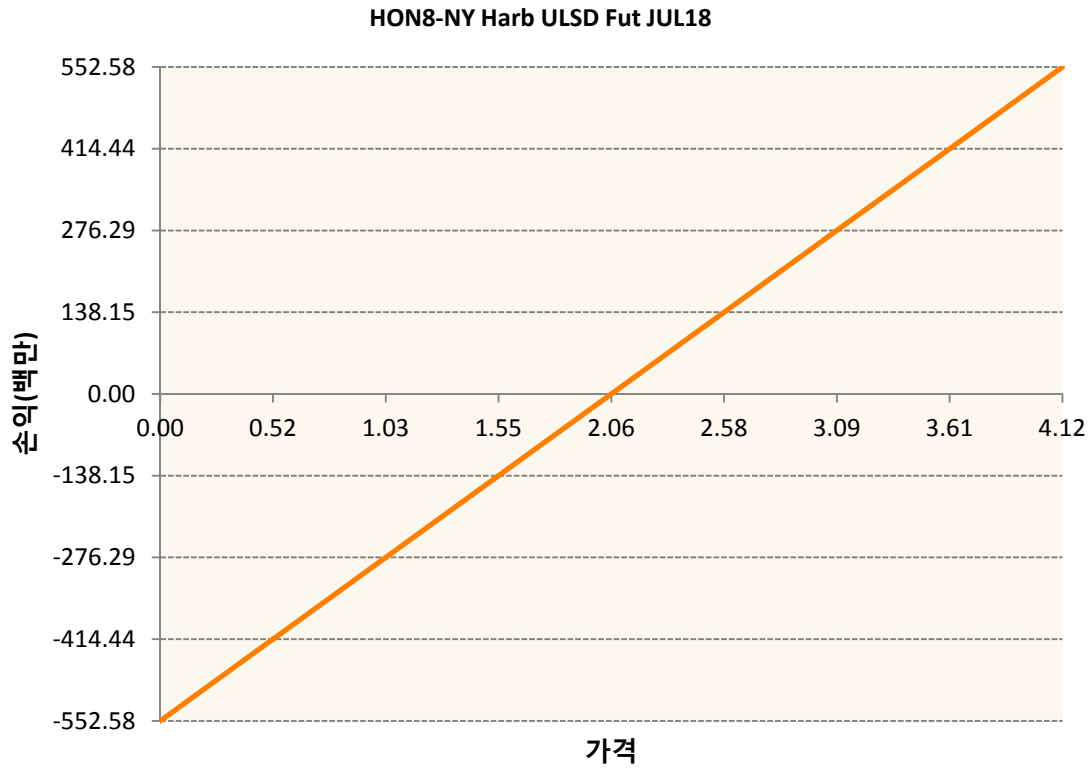
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	4,017	586	3,431	

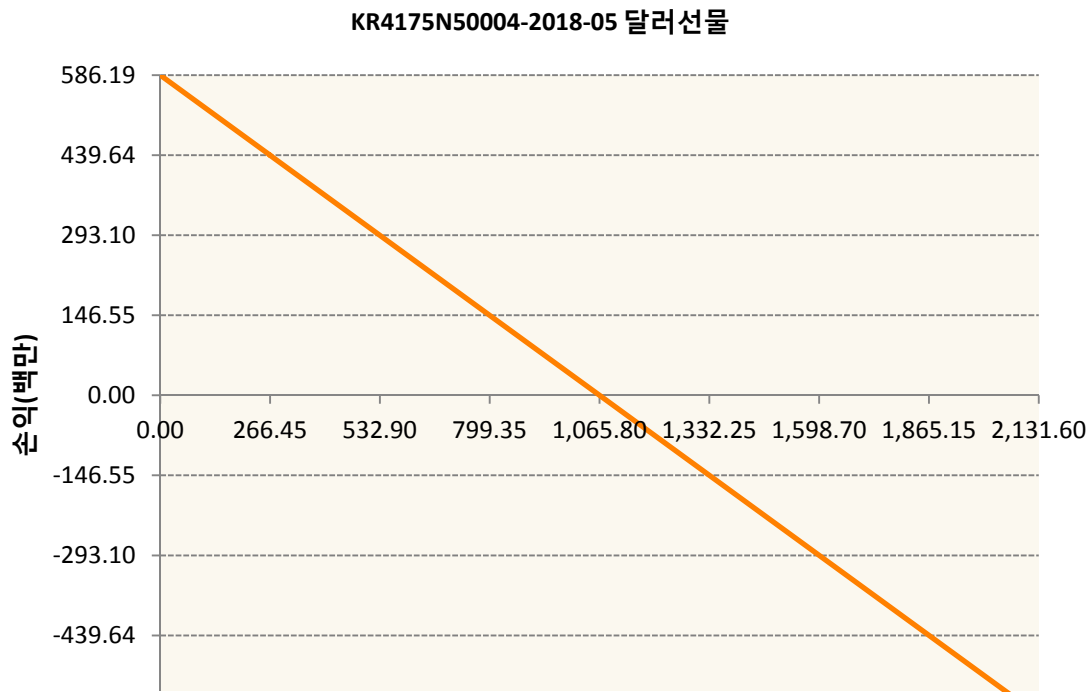
2. 만기시점의 손익구조

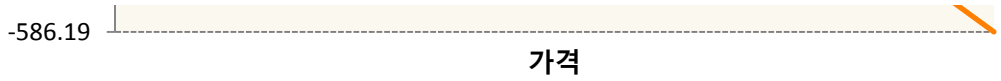


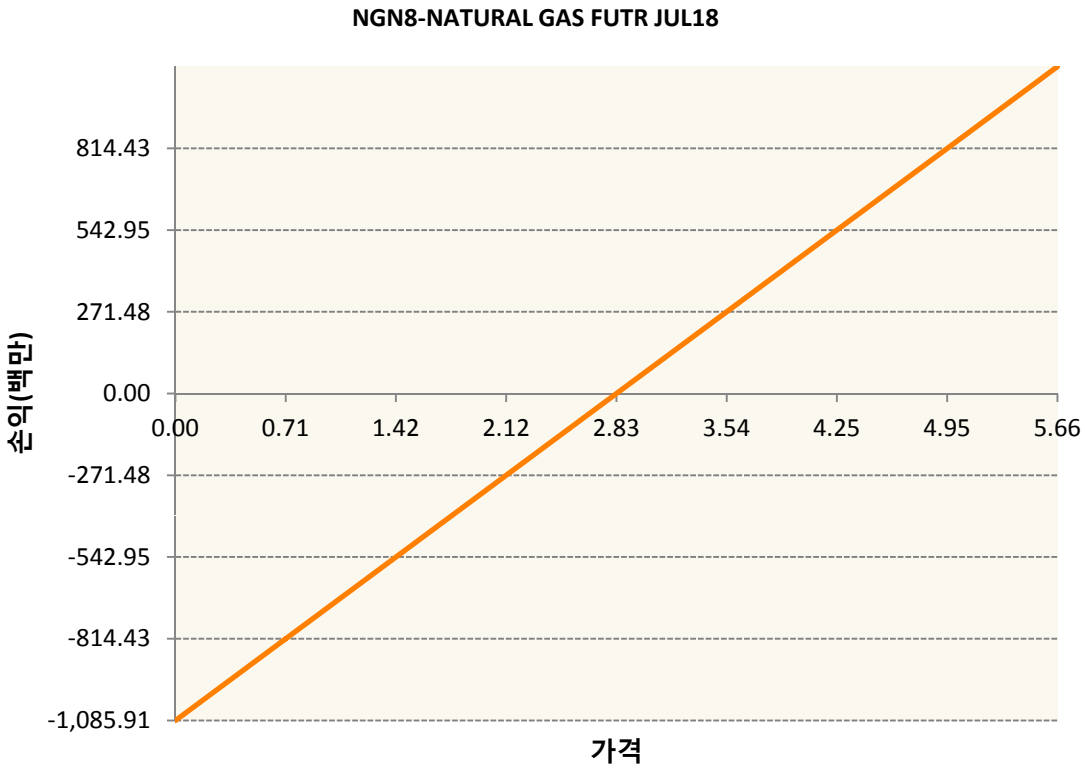


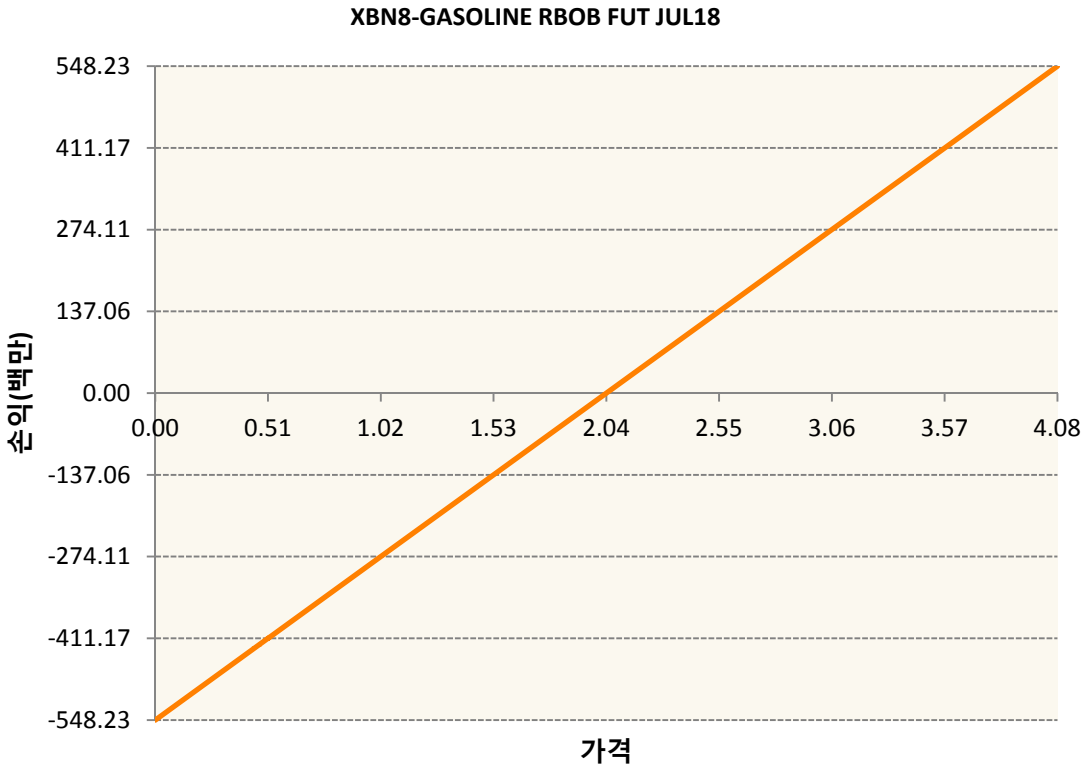

-528.16
-792.24
-1,056.31
가격


HON8-NY Harb ULSD Fut JUL18
552.58
414.44
276.29
138.15
0.00
-138.15
-276.29
-414.44
-552.58
0.00
0.52
1.03
1.55
2.06
2.58
3.09
3.61
4.12
손익(백만)
가격


KR4175N50004-2018-05 달러선물
586.19
439.64
293.10
146.55
0.00
-146.55
-293.10
-439.64
0.00
266.45
532.90
799.35
1,065.80
1,332.25
1,598.70
1,865.15
2,131.60
손익(백만)


-586.19
가격


NGN8-NATURAL GAS FUTR JUL18
814.43
542.95
271.48
0.00
-271.48
-542.95
-814.43
-1,085.91
0.00
0.71
1.42
2.12
2.83
3.54
4.25
4.95
5.66
손익(백만)
가격


XBN8-GASOLINE RBOB FUT JUL18
548.23
411.17
274.11
137.06
0.00
-137.06
-274.11
-411.17
-548.23
0.00
0.51
1.02
1.53
2.04
2.55
3.06
3.57
4.08
손익(백만)
가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLN8	WTI CRUDE FUTURE JUL18	62
CON8	BRENT CRUDE FUTR JUL18	85
HON8	NY Harb ULSD Fut JUL18	44
KR4175N50(	2018-05 달러선물	47
NGN8	NATURAL GAS FUTR JUL18	87
XBN8	GASOLINE RBOB FUT JUL18	44

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

511

공시일	2018-04-18
기준일	2018-04-17

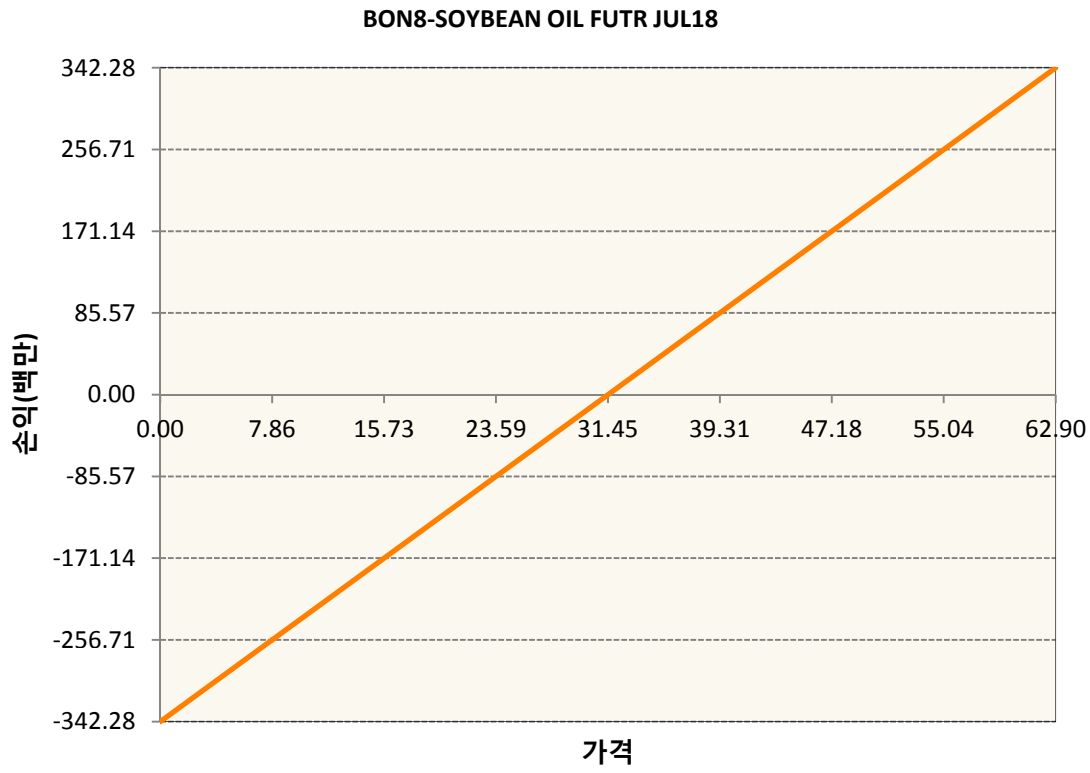
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

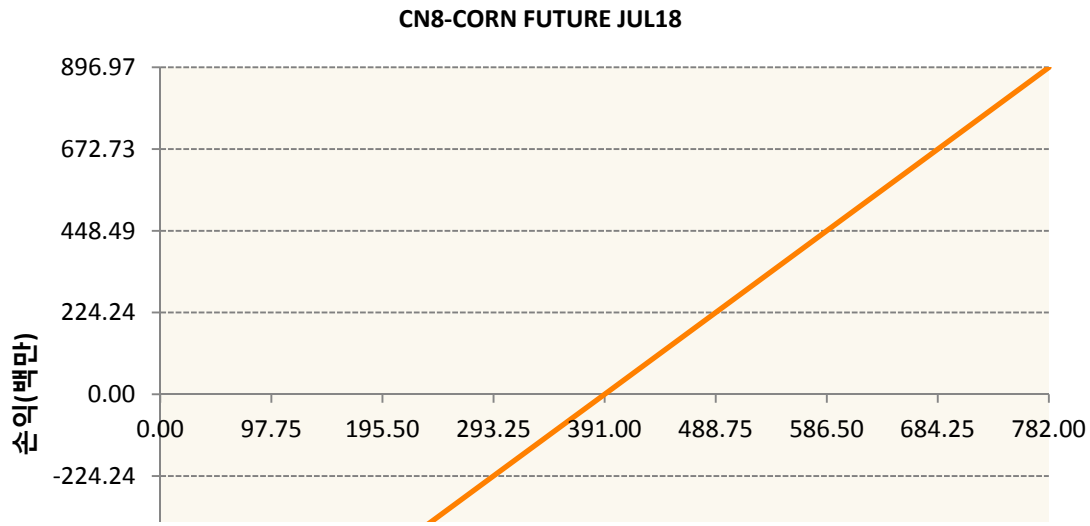
1. 계약금액

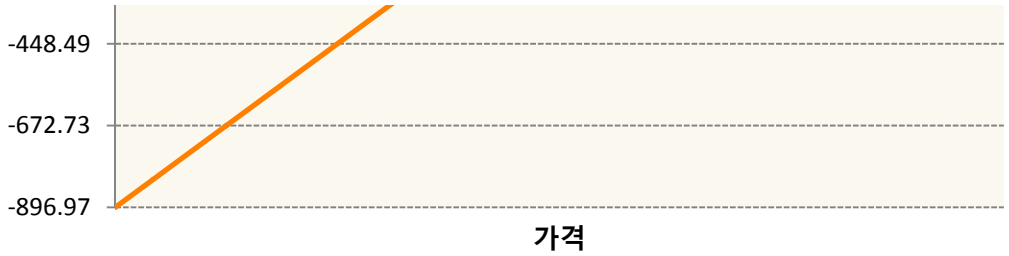
(단위:백만원)

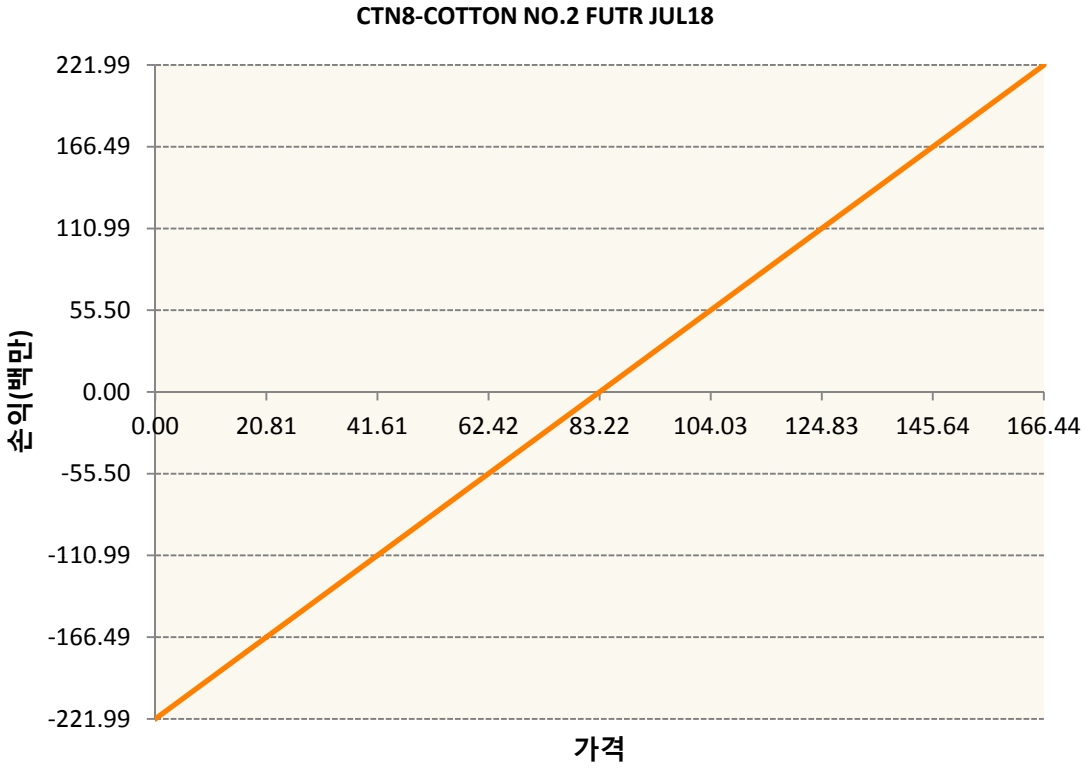
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	4,114	320	3,795	

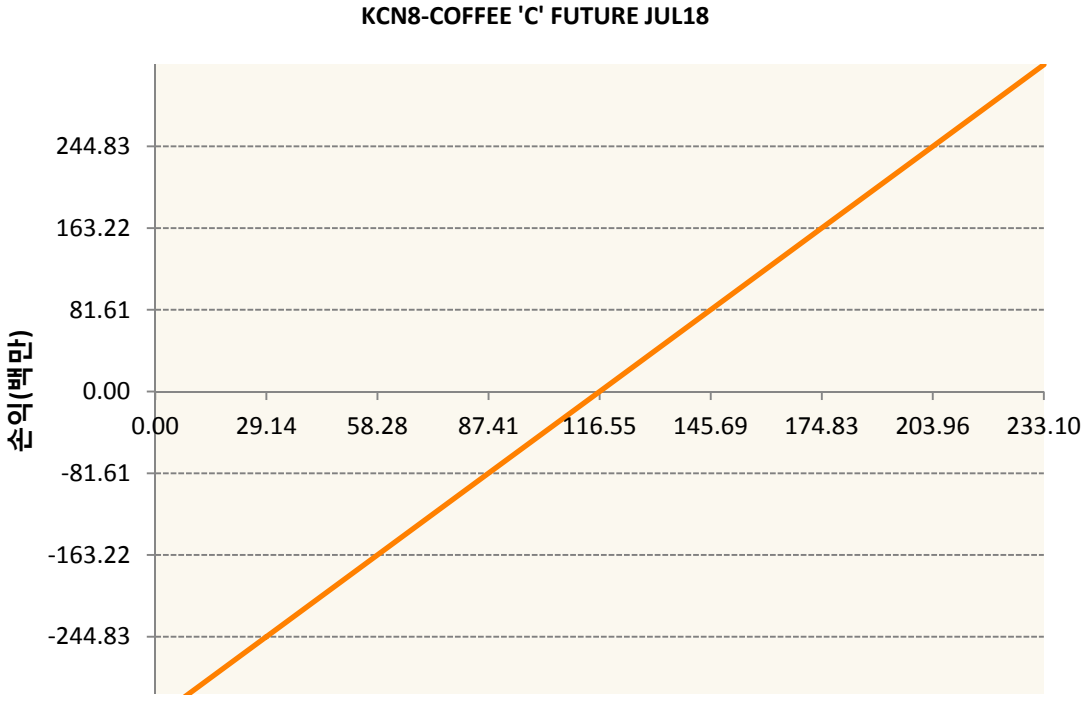
2. 만기시점의 손익구조

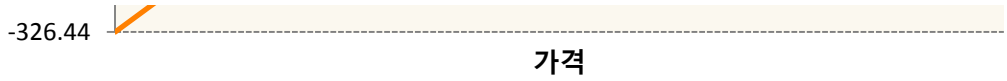


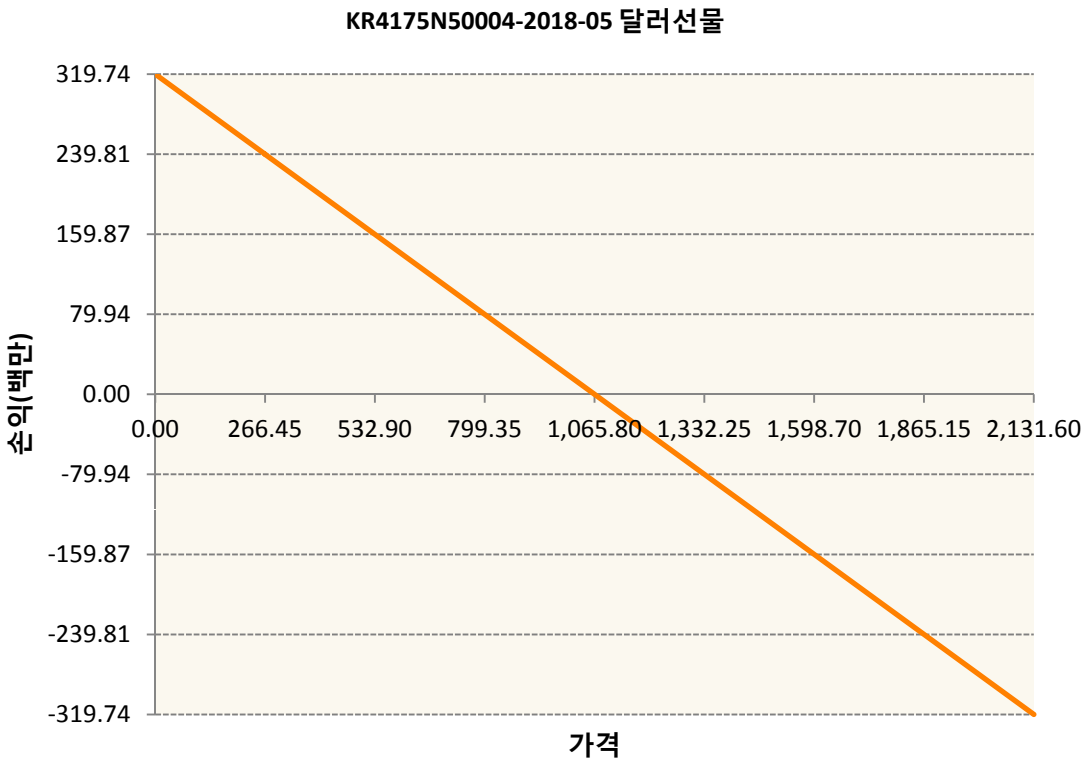


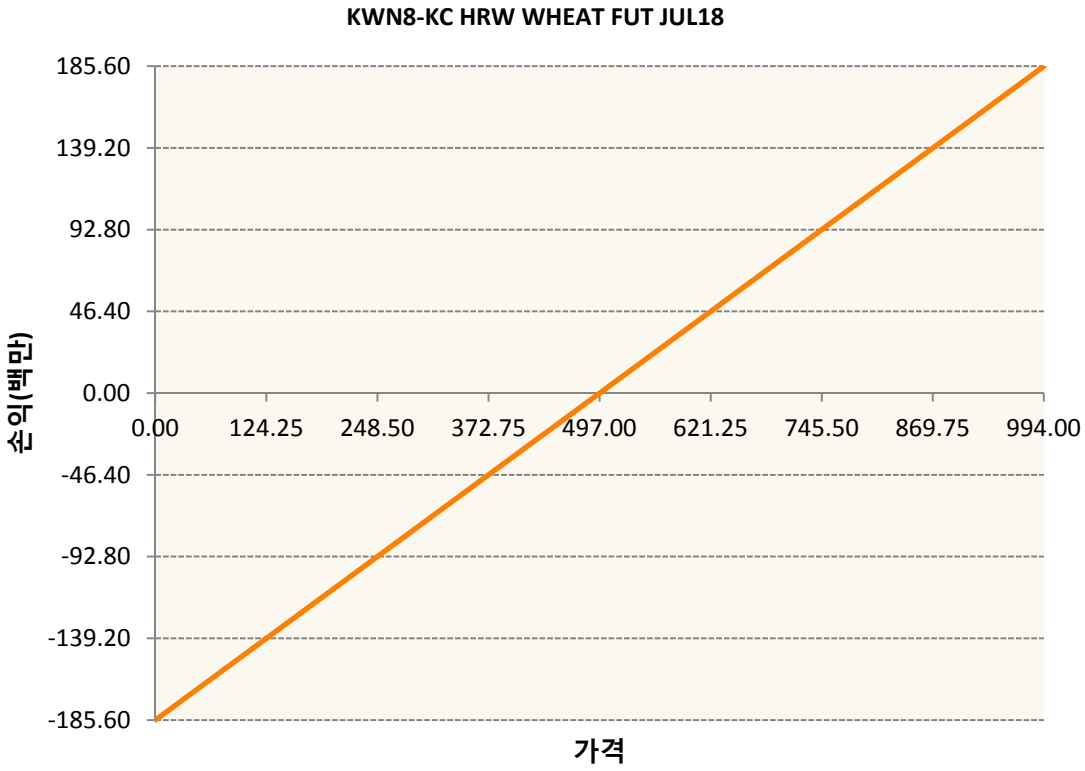

-448.49
-672.73
-896.97
가격


CTN8-COTTON NO.2 FUTR JUL18
221.99
166.49
110.99
55.50
0.00
-55.50
-110.99
-166.49
-221.99
0.00
20.81
41.61
62.42
83.22
104.03
124.83
145.64
166.44
손익(백만)
가격

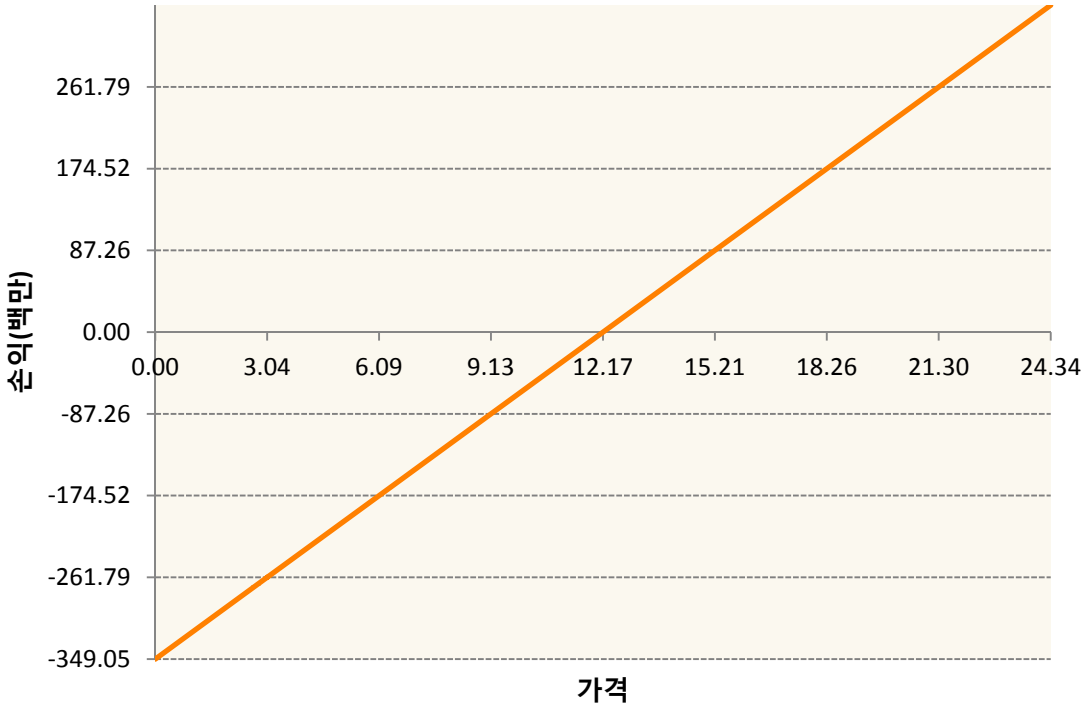

KCN8-COFFEE 'C' FUTURE JUL18
244.83
163.22
81.61
0.00
-81.61
-163.22
-244.83
0.00
29.14
58.28
87.41
116.55
145.69
174.83
203.96
233.10
손익(백만)


-326.44
가격

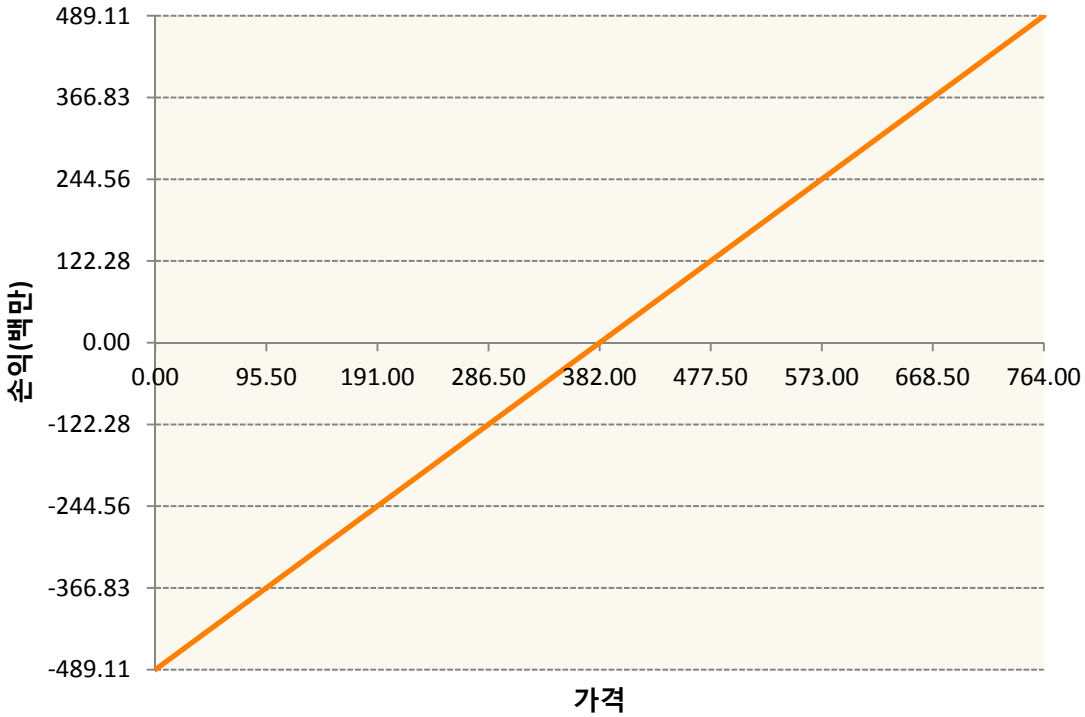

KR4175N50004-2018-05 달러선물
319.74
239.81
159.87
79.94
0.00
-79.94
-159.87
-239.81
-319.74
0.00
266.45
532.90
799.35
1,065.80
1,332.25
1,598.70
1,865.15
2,131.60
손익(백만)
가격


KWN8-KC HRW WHEAT FUT JUL18
185.60
139.20
92.80
46.40
0.00
-46.40
-92.80
-139.20
-185.60
0.00
124.25
248.50
372.75
497.00
621.25
745.50
869.75
994.00
손익(백만)
가격

SBN8-SUGAR #11 (WORLD) JUL18

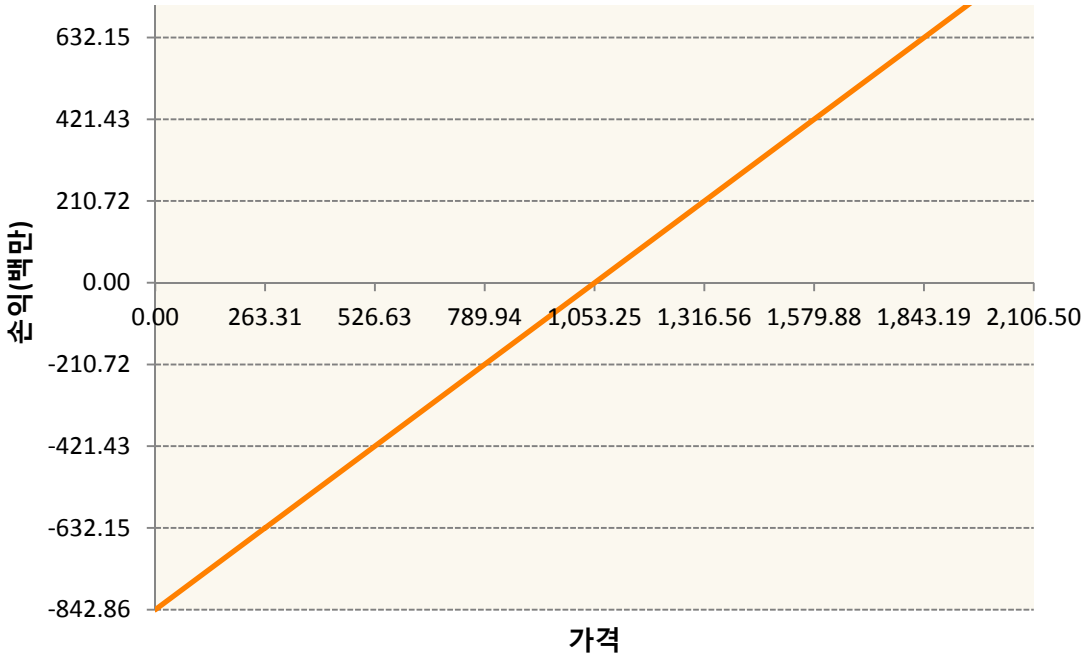


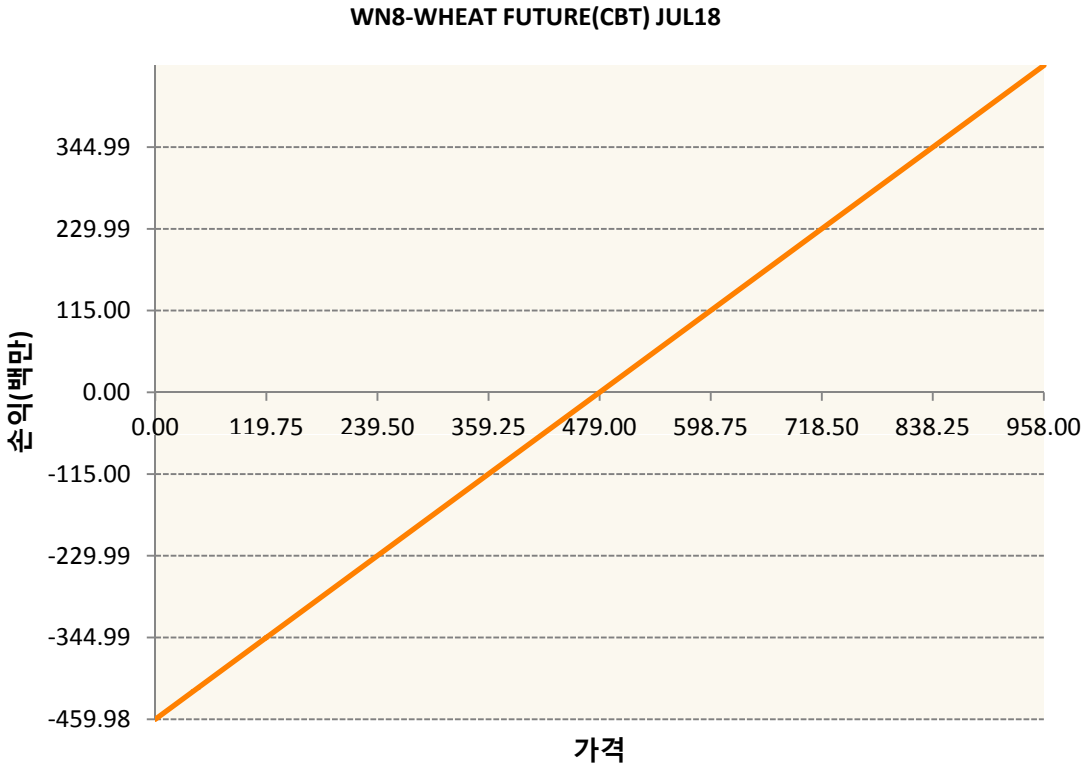
SMN8-SOYBEAN MEAL FUTR JUL18



SN8-SOYBEAN FUTURE JUL18







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

BON8	SOYBEAN OIL FUTR JUL18	27
CN8	CORN FUTURE JUL18	72
CTN8	COTTON NO.2 FUTR JUL18	18
KCN8	COFFEE 'C' FUTURE JUL18	26
KR4175N50(	2018-05 달러선물	26

KWN8	KC HRW WHEAT FUT JUL18	15
SBN8	SUGAR #11 (WORLD) JUL18	28
SMN8	SOYBEAN MEAL FUTR JUL18	39
SN8	SOYBEAN FUTURE JUL18	67
WN8	WHEAT FUTURE(CBT) JUL18	37

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

332