공시일	2018-04-20
기준일	2018-04-19

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	2018-04-20
기준일	2018-04-19

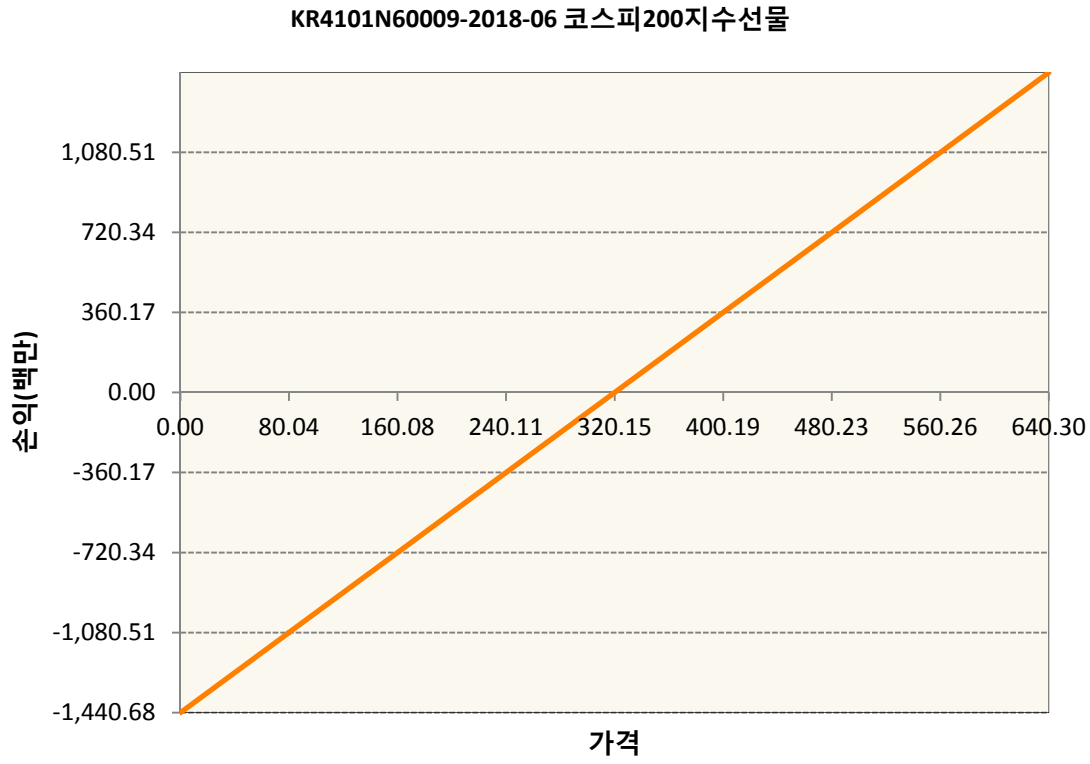
스마트인덱스모

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	1,441	0	1,441	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101N60(2018-06 코스피200지수선물							115
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-115	-115	-115	-115	-115	-115	-115
-5.33%	-77	-77	-77	-77	-77	-77	-77
-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%	77	77	77	77	77	77	77
8.00%	115	115	115	115	115	115	115

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

84

공시일	2018-04-20
기준일	2018-04-19

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	1,117

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

455

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2018-04-20
기준일	2018-04-19

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	403

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

434

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2018-04-20
기준일	2018-04-19

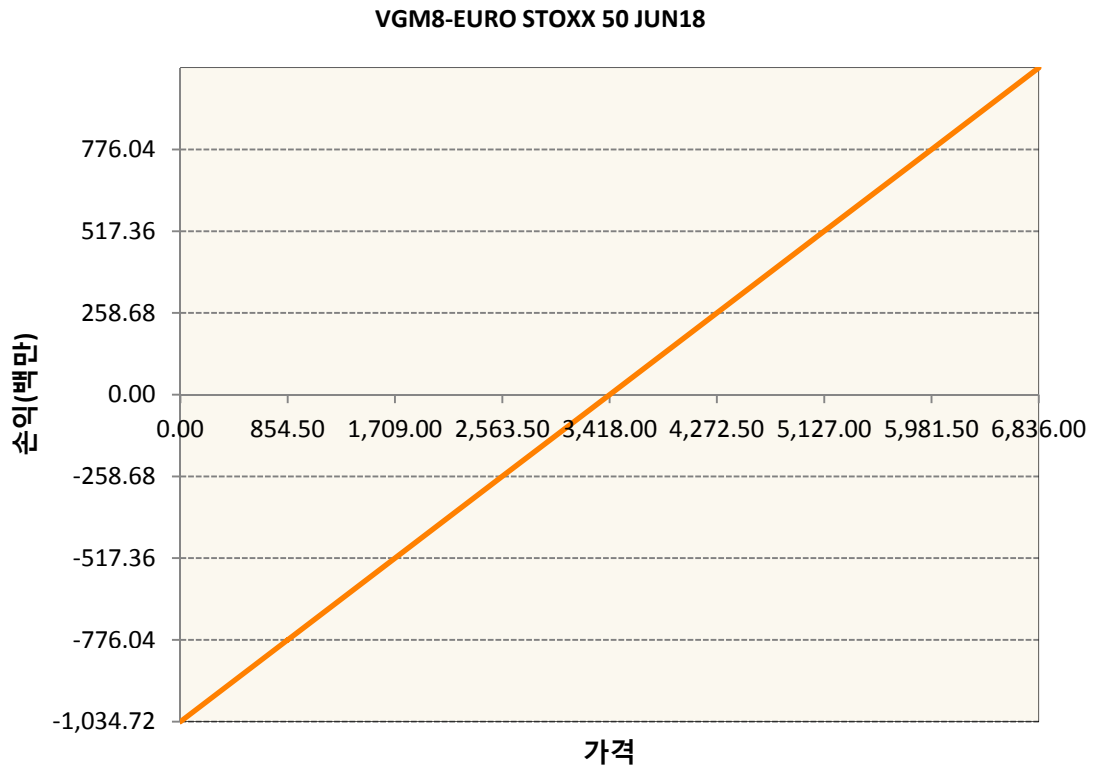
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,035	0	1,035	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGM8	EURO STOXX 50 JUN18	83

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

(단위:백만원)

51

공시일	2018-04-20
기준일	2018-04-19

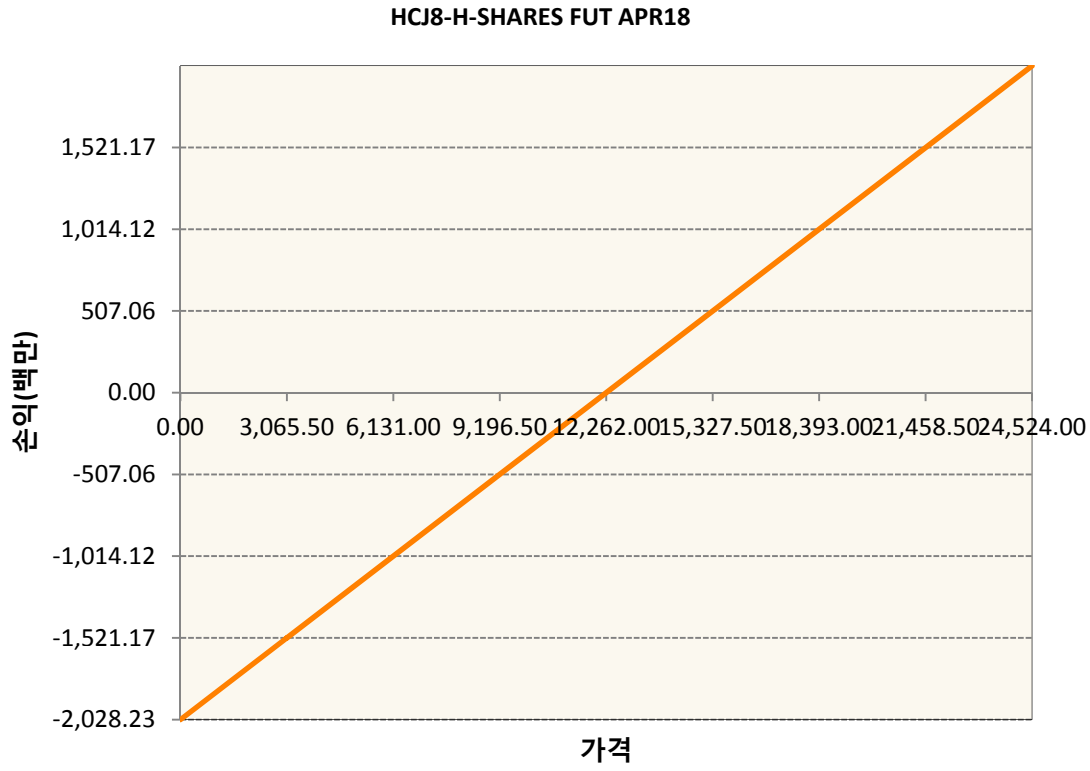
차이나인덱스모(주식-파생형)

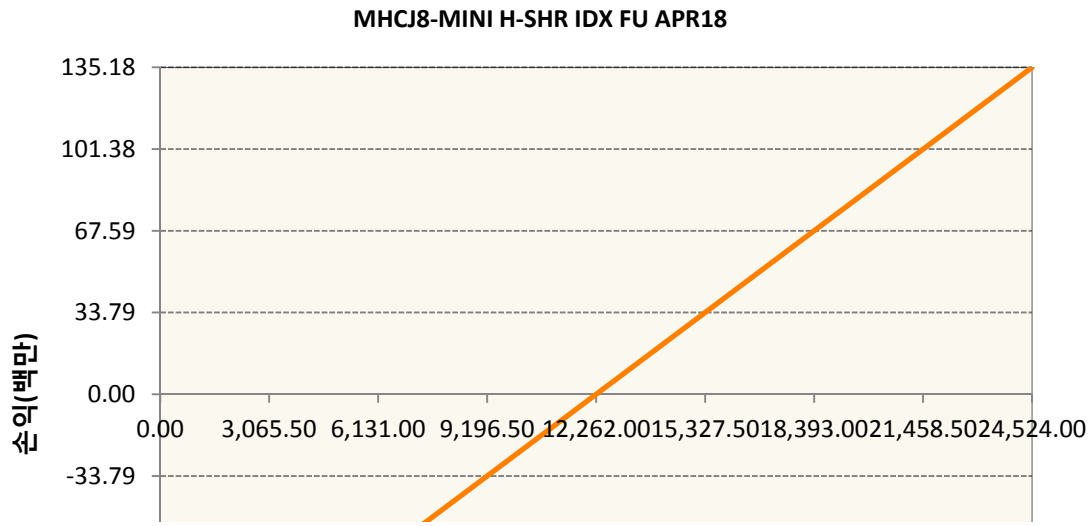
1. 계약금액

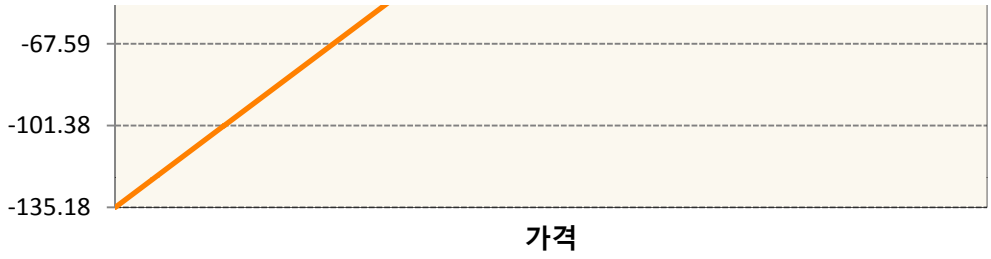
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,163	0	2,163	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCJ8	H-SHARES FUT APR18	162
MHCJ8	MINI H-SHR IDX FU APR18	11

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	152

공시일	2018-04-20
기준일	2018-04-19

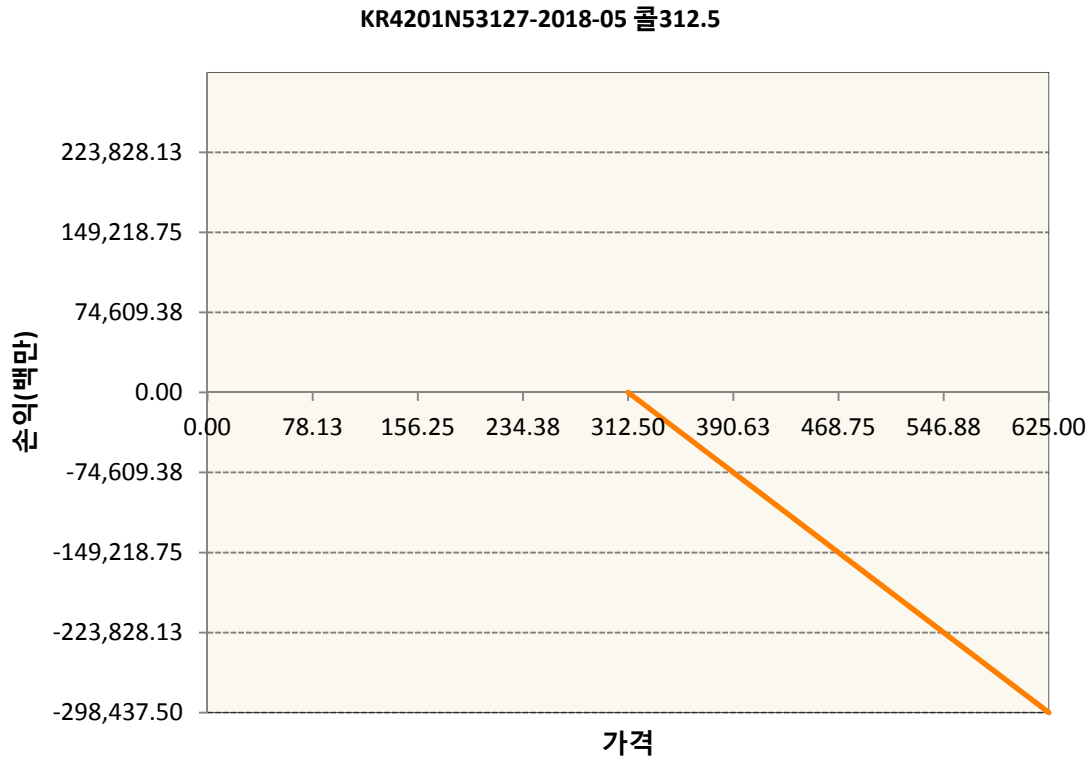
커버드콜모(주식혼합-파생형)

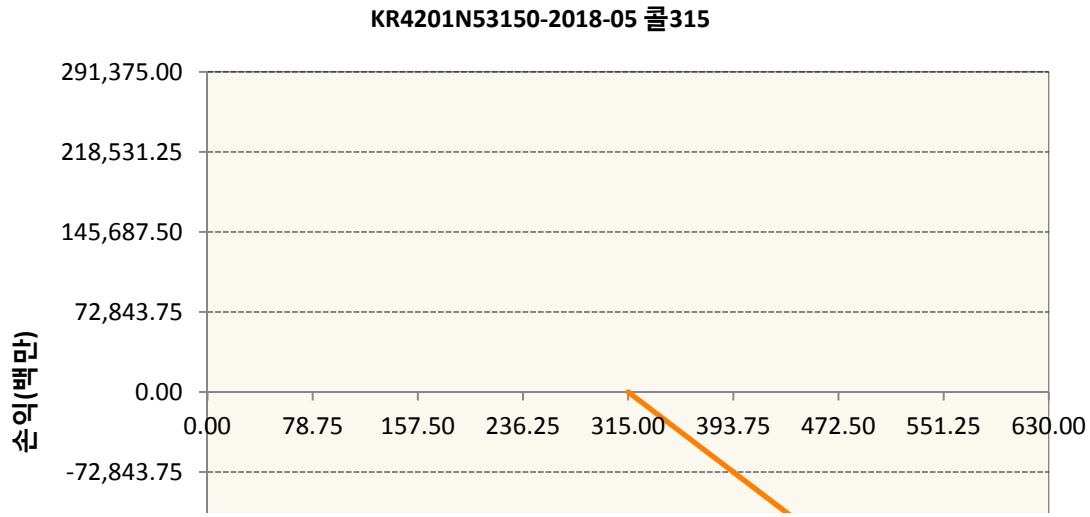
1. 계약금액

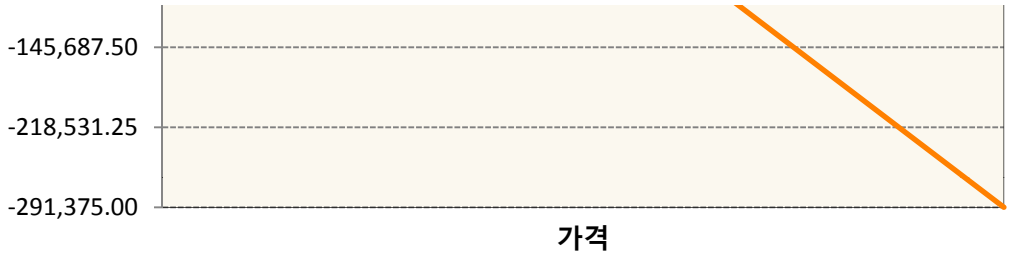
(단위:백만원)

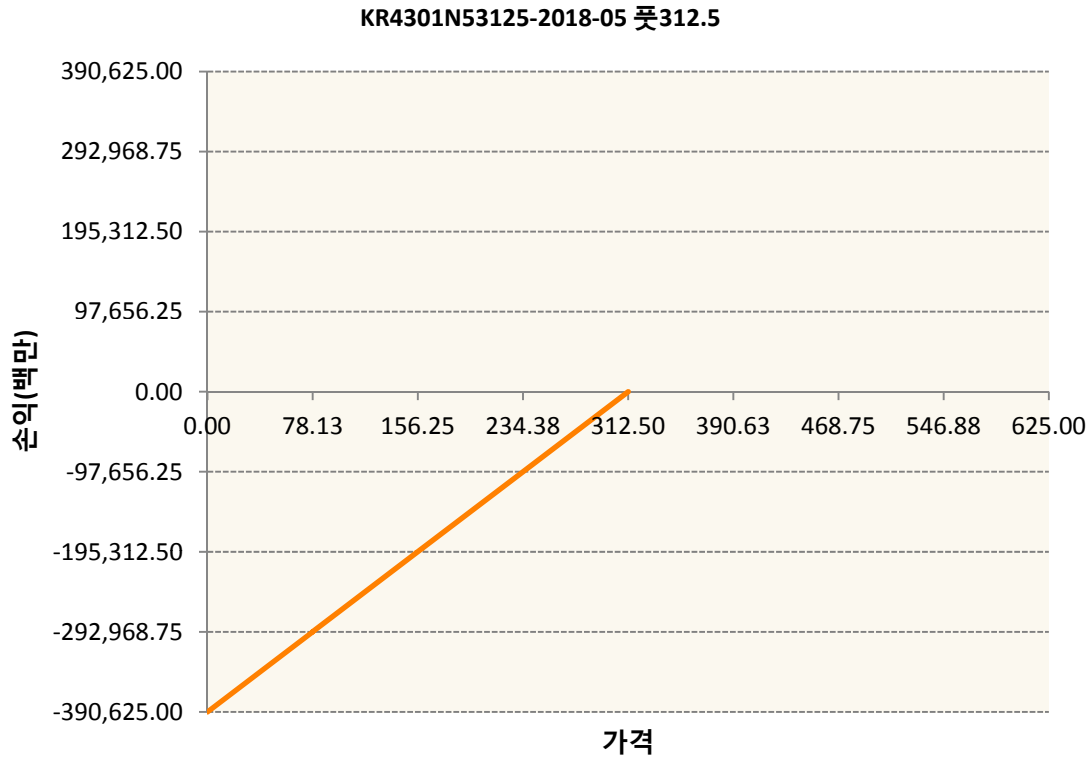
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	15,572	0	15,572	장내
누계	유가증권	옵션	0	980,438	-980,438	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201N5312018-05 콜312.5							21,012
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	11,279	10,952	10,582	10,179	9,747	9,292	8,816
-5.33%	9,727	9,190	8,637	8,070	7,493	6,907	6,315
-2.67%	6,645	5,999	5,352	4,705	4,058	3,411	2,765
0%	1,797	1,209	609	0	-616	-1,238	-1,864
2.67%	-4,570	-4,983	-5,433	-5,913	-6,418	-6,943	-7,485
5.33%	-11,929	-12,157	-12,435	-12,757	-13,117	-13,511	-13,935
8.00%	-19,789	-19,891	-20,034	-20,219	-20,446	-20,711	-21,012
KR4201N5312018-05 콜315							19,739
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	9,738	9,474	9,166	8,821	8,444	8,041	7,614

-5.33%	8,554	8,083	7,588	7,074	6,545	6,004	5,453
-2.67%	6,036	5,420	4,801	4,181	3,559	2,936	2,312
0%	1,838	1,230	617	0	-620	-1,243	-1,868
2.67%	-3,934	-4,395	-4,885	-5,399	-5,931	-6,478	-7,037
5.33%	-10,822	-11,097	-11,419	-11,781	-12,178	-12,604	-13,056
8.00%	-18,323	-18,454	-18,630	-18,850	-19,110	-19,408	-19,739
KR4301N5312018-05 풋312.5							21,364

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-21,036	-21,052	-21,081	-21,125	-21,187	-21,266	-21,364
-5.33%	-10,703	-10,868	-11,060	-11,275	-11,510	-11,761	-12,027
-2.67%	-2,664	-3,048	-3,432	-3,817	-4,202	-4,587	-4,972
0%	759	528	273	0	-289	-591	-903
2.67%	1,349	1,309	1,248	1,165	1,059	932	783
5.33%	1,386	1,383	1,377	1,366	1,346	1,315	1,272
8.00%	1,386	1,386	1,386	1,385	1,383	1,379	1,371

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

60,744

공시일	2018-04-20
기준일	2018-04-19

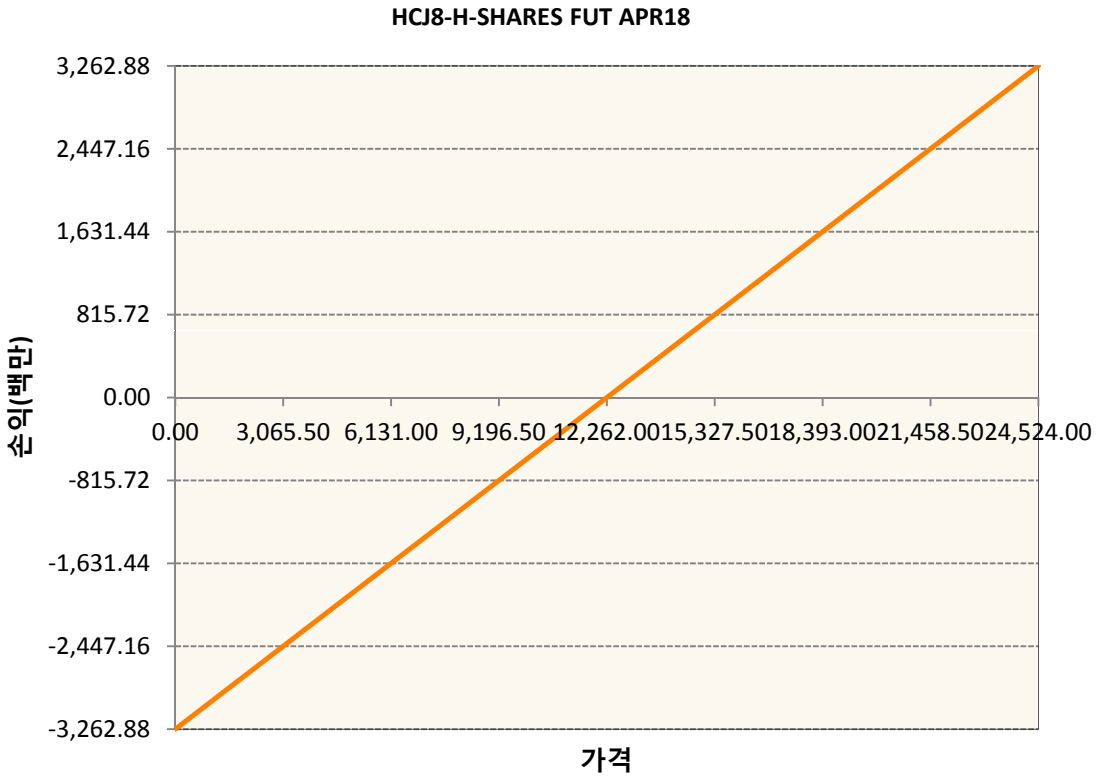
홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생

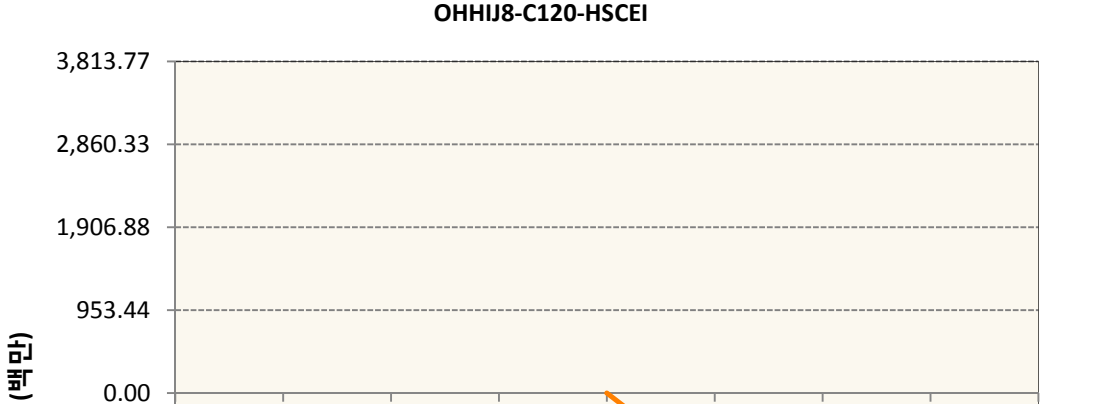
1. 계약금액

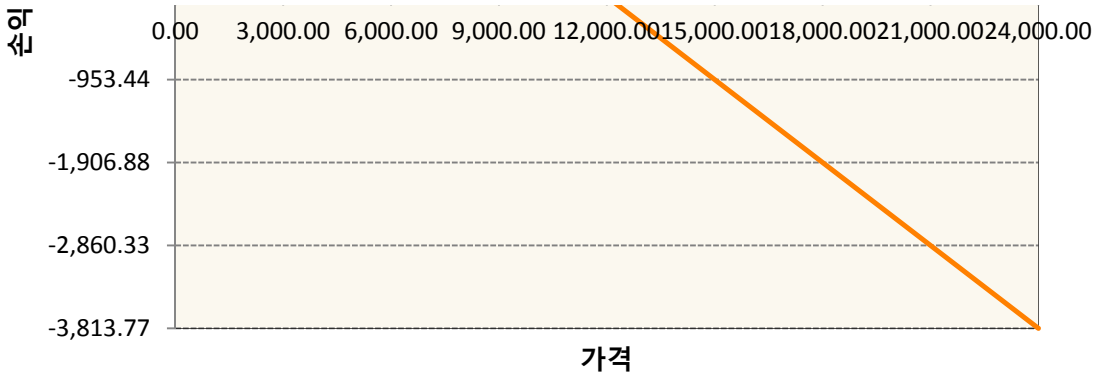
(단위:백만원)

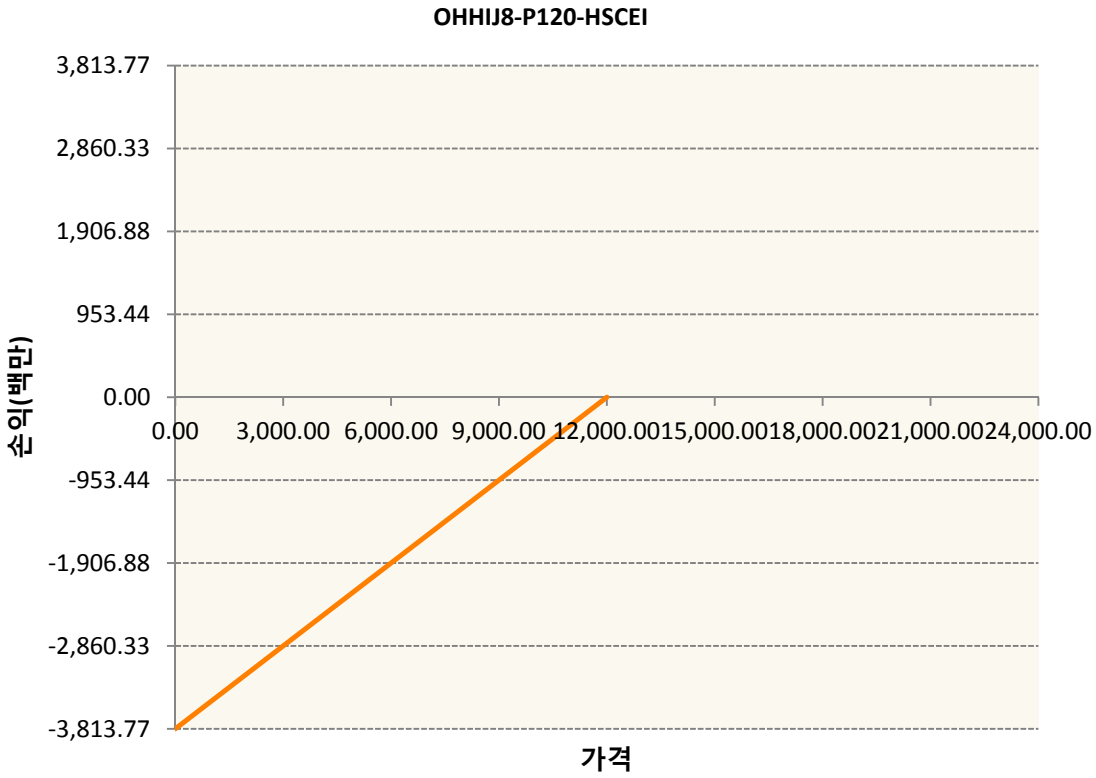
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	3,263	0	3,263	장내
누계	유가증권	옵션	0	7,628	-7,628	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)	(단위:백만원)
HCJ8 H-SHARES FUT APR18	261
OHHIJ8-C12(HSCEI	305
OHHIJ8-P12(HSCEI	305

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	764

공시일	2018-04-20
기준일	2018-04-19

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼

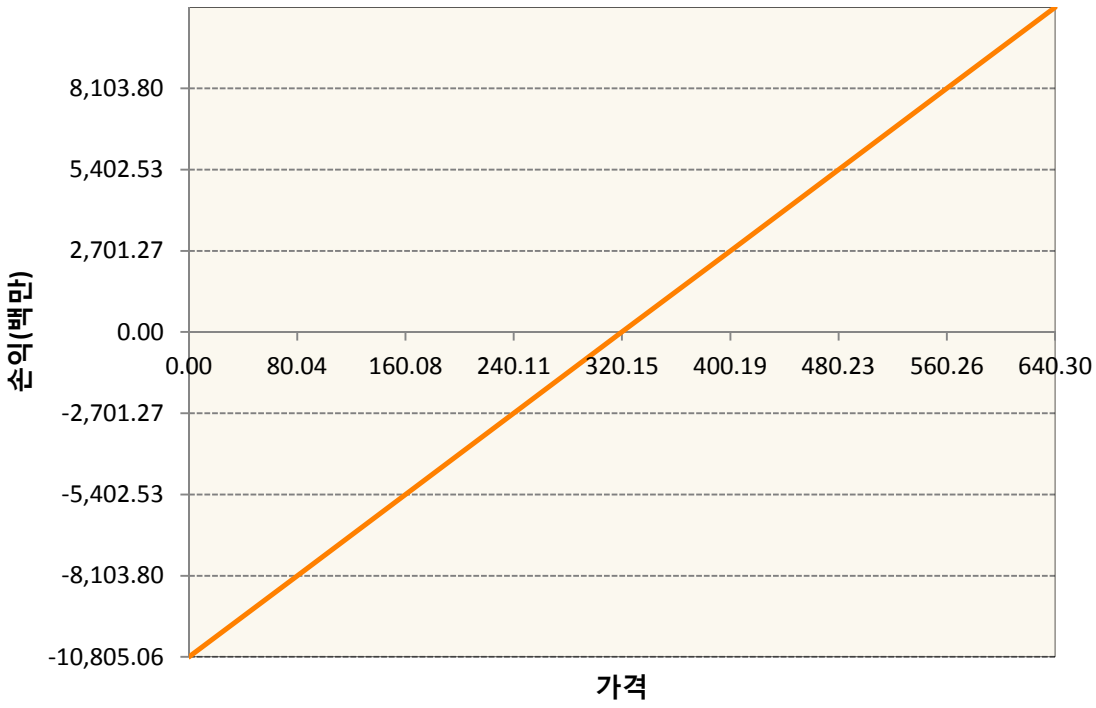
1. 계약금액

(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	10,805	0	10,805	장내
누계	유가증권	스왑	52,200	0	52,200	장외
누계	유가증권	옵션	0	55,754	-55,754	장내

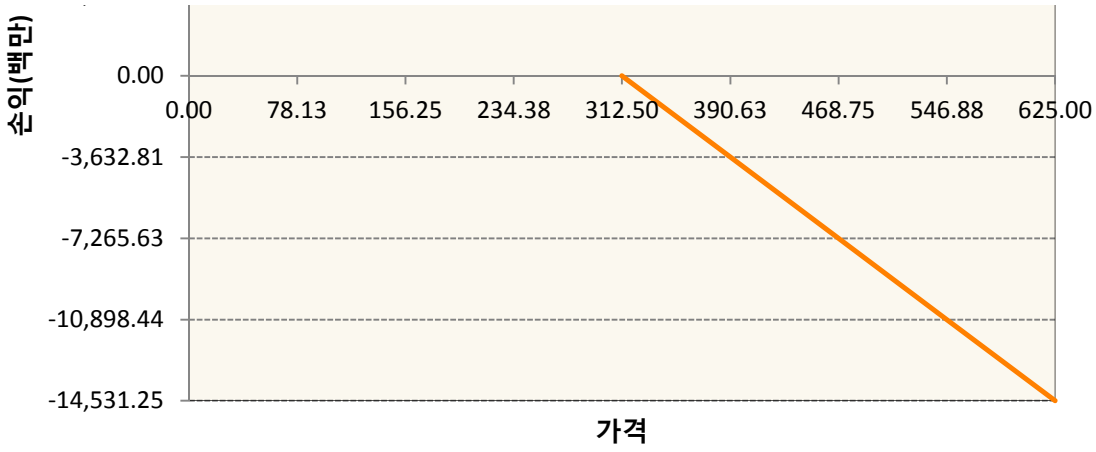
2. 만기시점의 손익구조

KR4101N60009-2018-06 코스피200지수선물

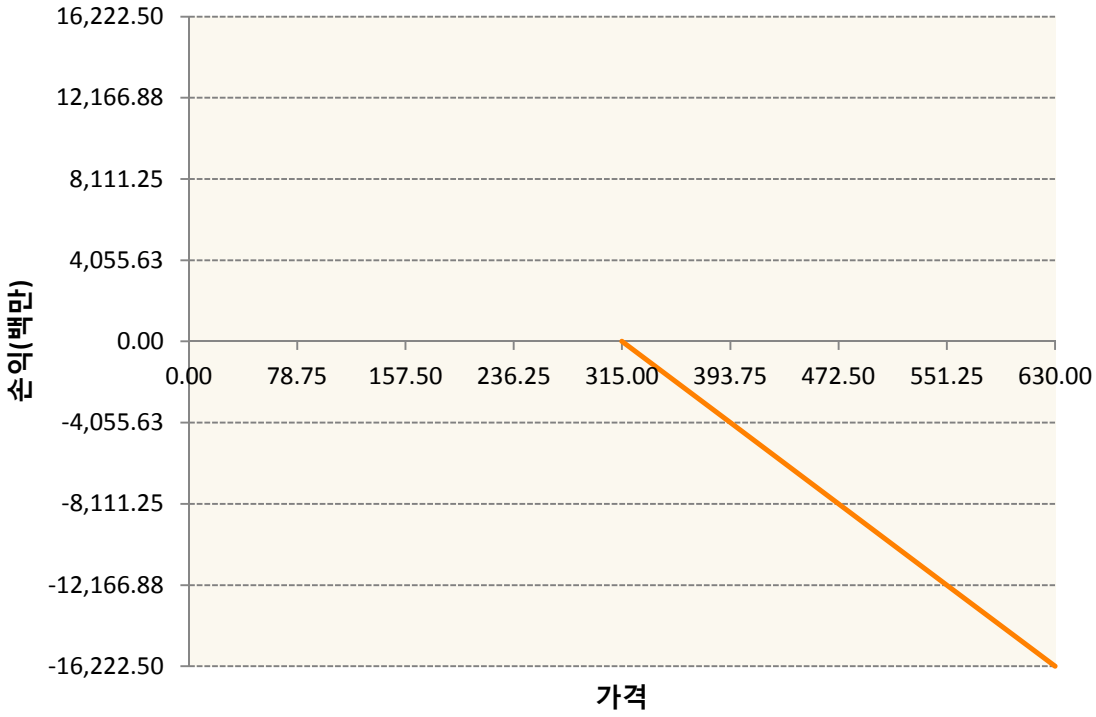


KR4201N53127-2018-05 콜312.5

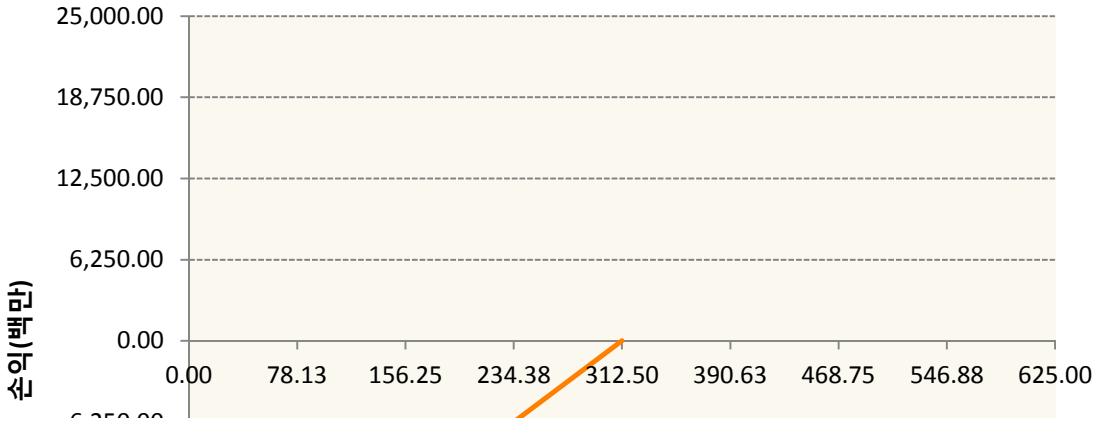




KR4201N53150-2018-05 콜315



KR4301N53125-2018-05 풋312.5





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

	2.5287E+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
	2.5287E+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
	2.5287E+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
	2.5287E+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
	2.5287E+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
	2.5287E+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
	2.5287E+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
	2.5287E+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
	2.5287E+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
	KR4101N600	2018-06	코스피200지수선물				864
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-864	-864	-864	-864	-864	-864	-864
-5.33%	-576	-576	-576	-576	-576	-576	-576
-2.67%	-288	-288	-288	-288	-288	-288	-288
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	288	288	288	288	288	288	288
5.33%	576	576	576	576	576	576	576
8.00%	864	864	864	864	864	864	864
	KR4201N531	2018-05	콜312.5				1,023
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	549	533	515	496	475	452	429
-5.33%	474	447	421	393	365	336	307
-2.67%	324	292	261	229	198	166	135
0%	88	59	30	0	-30	-60	-91
2.67%	-223	-243	-265	-288	-313	-338	-364
5.33%	-581	-592	-605	-621	-639	-658	-678
8.00%	-964	-968	-975	-985	-996	-1,008	-1,023
	KR4201N531	2018-05	콜315				1,099
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	542	527	510	491	470	448	424
-5.33%	476	450	422	394	364	334	304
-2.67%	336	302	267	233	198	163	129
0%	102	68	34	0	-35	-69	-104
2.67%	-219	-245	-272	-301	-330	-361	-392

5.33%	-603	-618	-636	-656	-678	-702	-727
8.00%	-1,020	-1,027	-1,037	-1,049	-1,064	-1,081	-1,099
KR4301N531	2018-05	풋312.5					1,367
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,346	-1,347	-1,349	-1,352	-1,356	-1,361	-1,367
-5.33%	-685	-696	-708	-722	-737	-753	-770
-2.67%	-171	-195	-220	-244	-269	-294	-318
0%	49	34	17	0	-18	-38	-58
2.67%	86	84	80	75	68	60	50
5.33%	89	89	88	87	86	84	81
8.00%	89	89	89	89	89	88	88

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

8,144

공시일	2018-04-20
기준일	2018-04-19

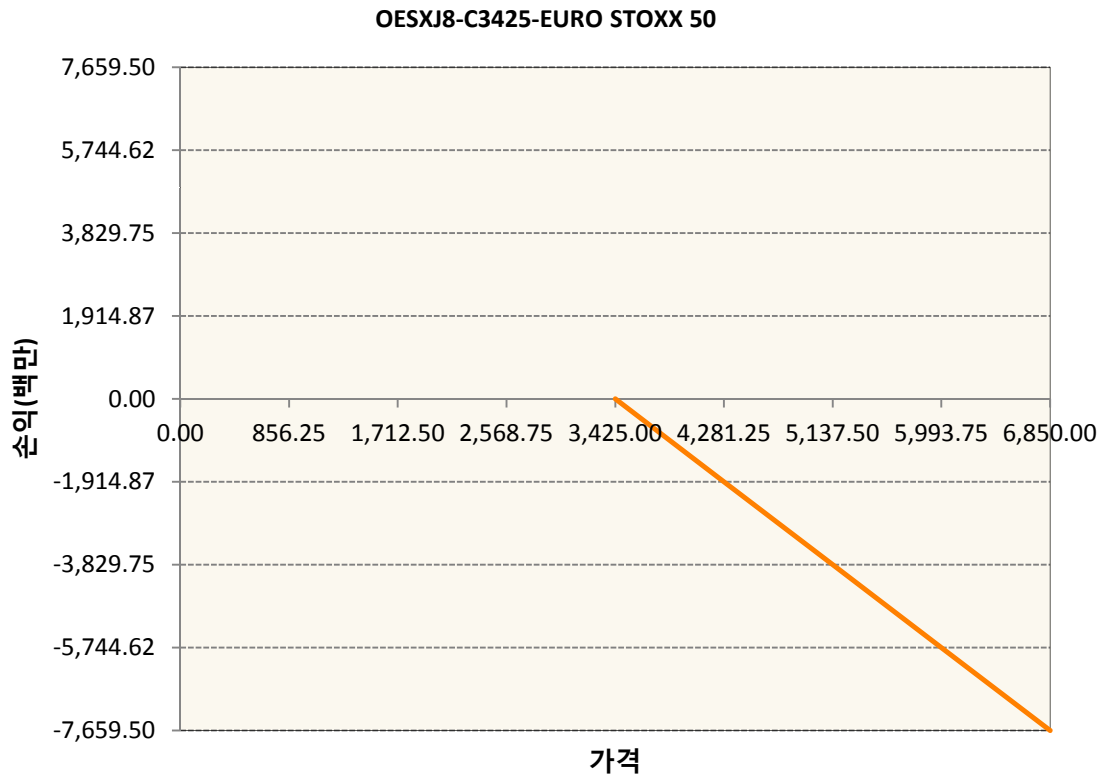
유로커버드콜모(주식혼합-파생형

1. 계약금액

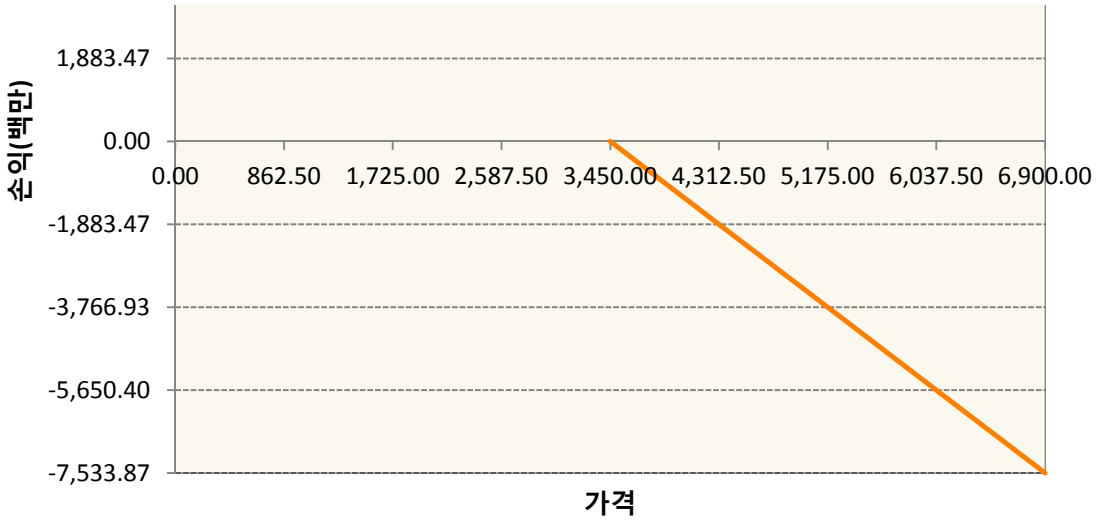
(단위:백만원)

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	6,810	0	6,810	
누계	유가증권	스왑	75,983	0	75,983	장외
누계	유가증권	옵션	0	30,387	-30,387	장내
누계	지수	스왑	52,619	0	52,619	장외

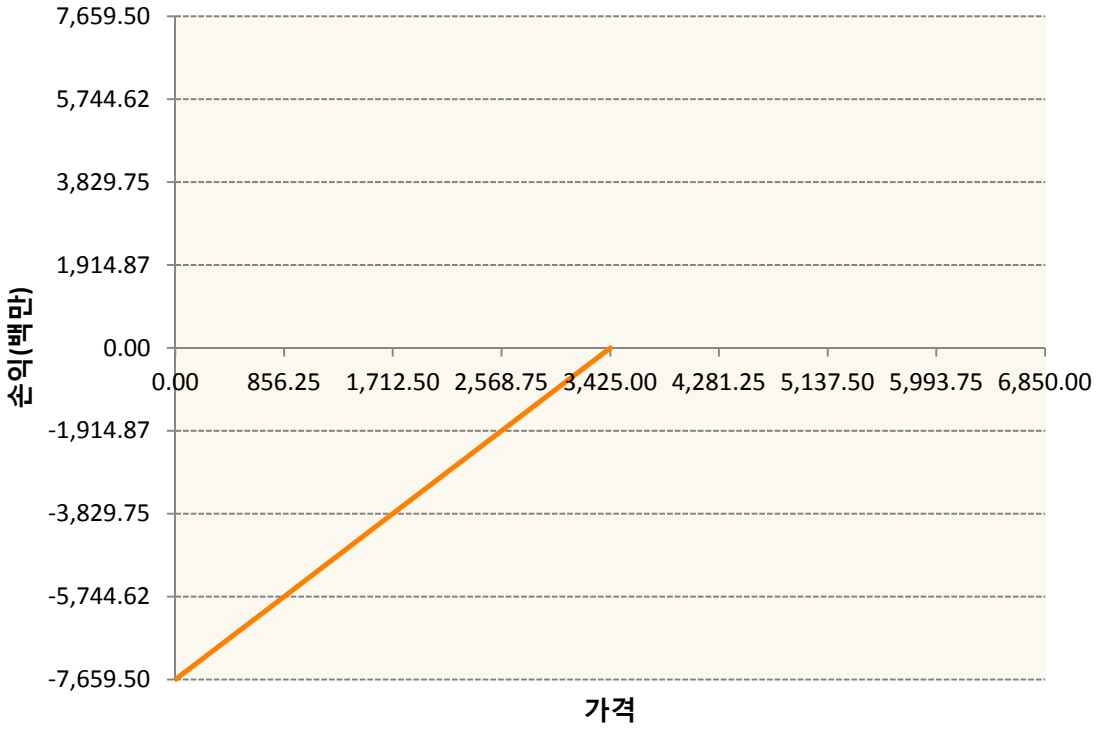
2. 만기시점의 손익구조



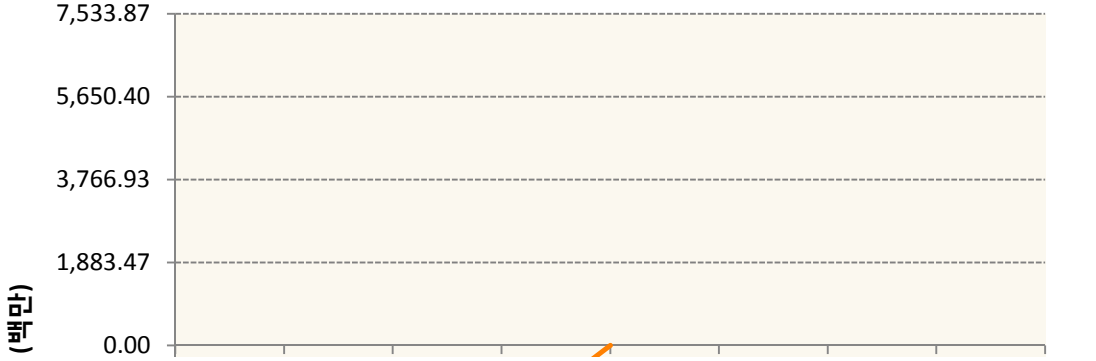


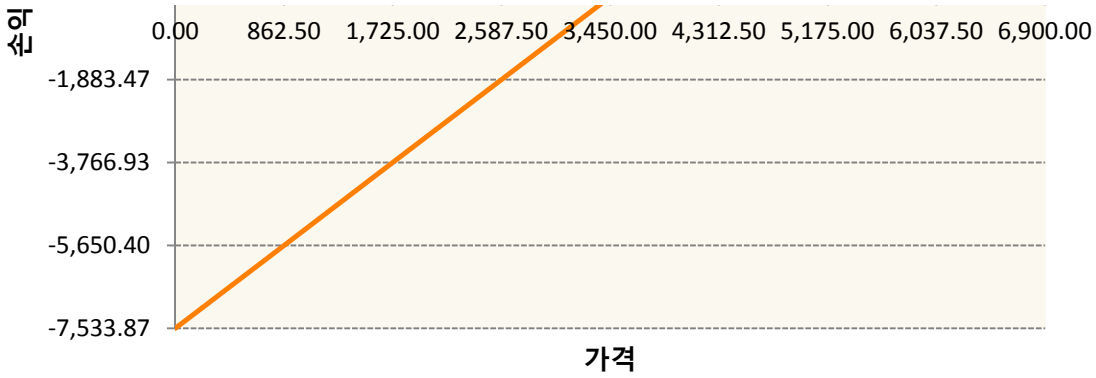


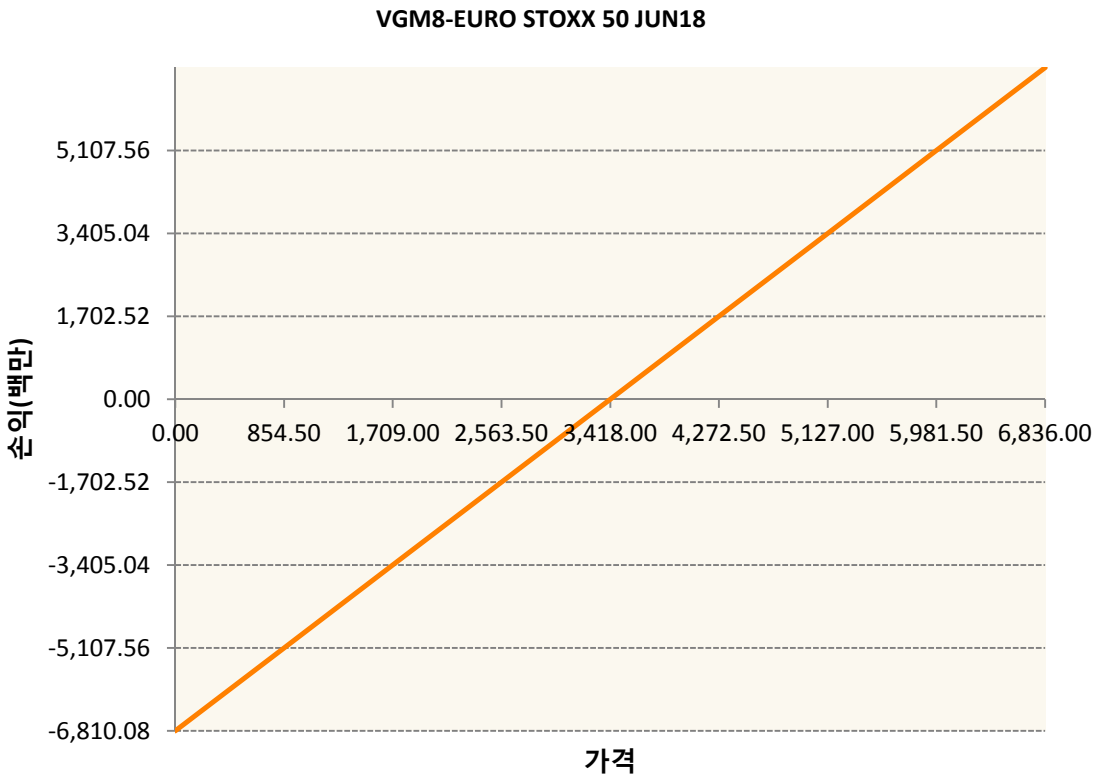
OESXJ8-P3425-EURO STOXX 50



OESXJ8-P3450-EURO STOXX 50







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)	(단위:백만원)
260105SGPX SG EURO Covered CALL STRATEGY - 994.569	93
260105SQPX SG EURO Covered CALL STRATEGY	135
OESXJ8-C34: EURO STOXX 50	613
OESXJ8-C34! EURO STOXX 50	603
OESXJ8-P34: EURO STOXX 50	613
OESXJ8-P34! EURO STOXX 50	603
VGM8 EURO STOXX 50 JUN18	545

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

	1,997

공시일	2018-04-20
기준일	2018-04-19

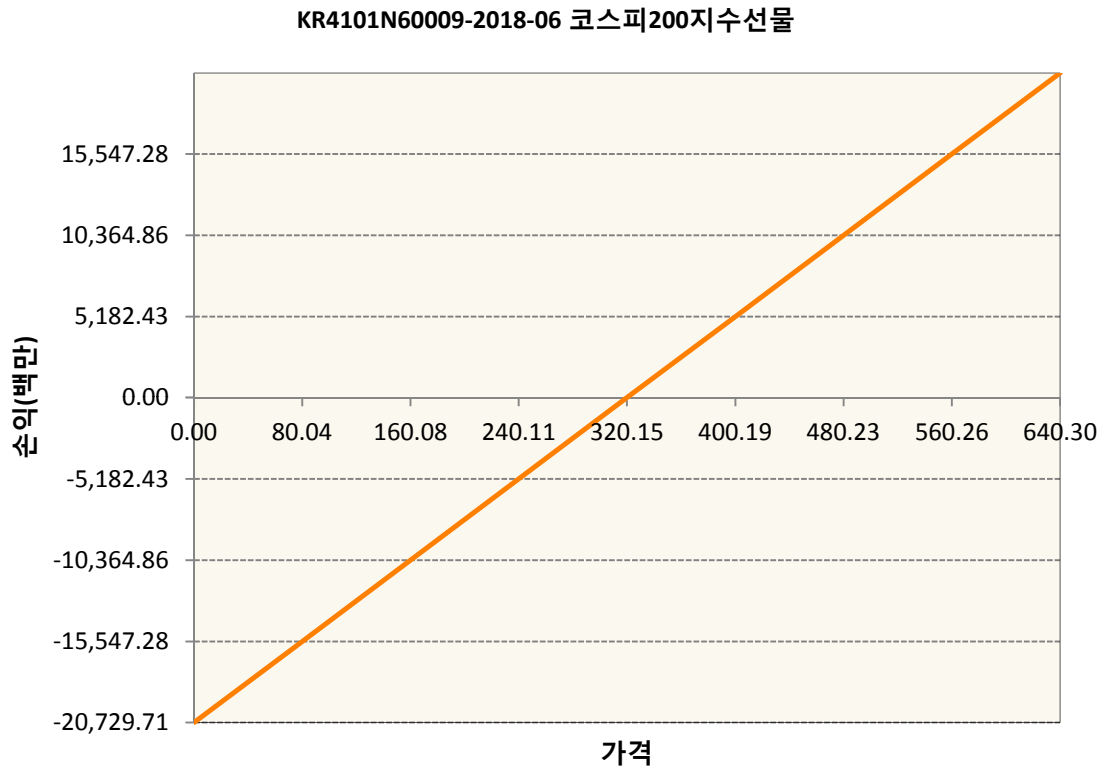
ETF스마트레버리지목표전환형8호

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	20,730	0	20,730	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101N600 2018-06 코스피200지수선물							1,658
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,658	-1,658	-1,658	-1,658	-1,658	-1,658	-1,658
-5.33%	-1,105	-1,105	-1,105	-1,105	-1,105	-1,105	-1,105
-2.67%	-553	-553	-553	-553	-553	-553	-553
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	553	553	553	553	553	553	553
5.33%	1,105	1,105	1,105	1,105	1,105	1,105	1,105

8.00%	1,658	1,658	1,658	1,658	1,658	1,658	1,658

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

1,214

공시일	2018-04-20
기준일	2018-04-19

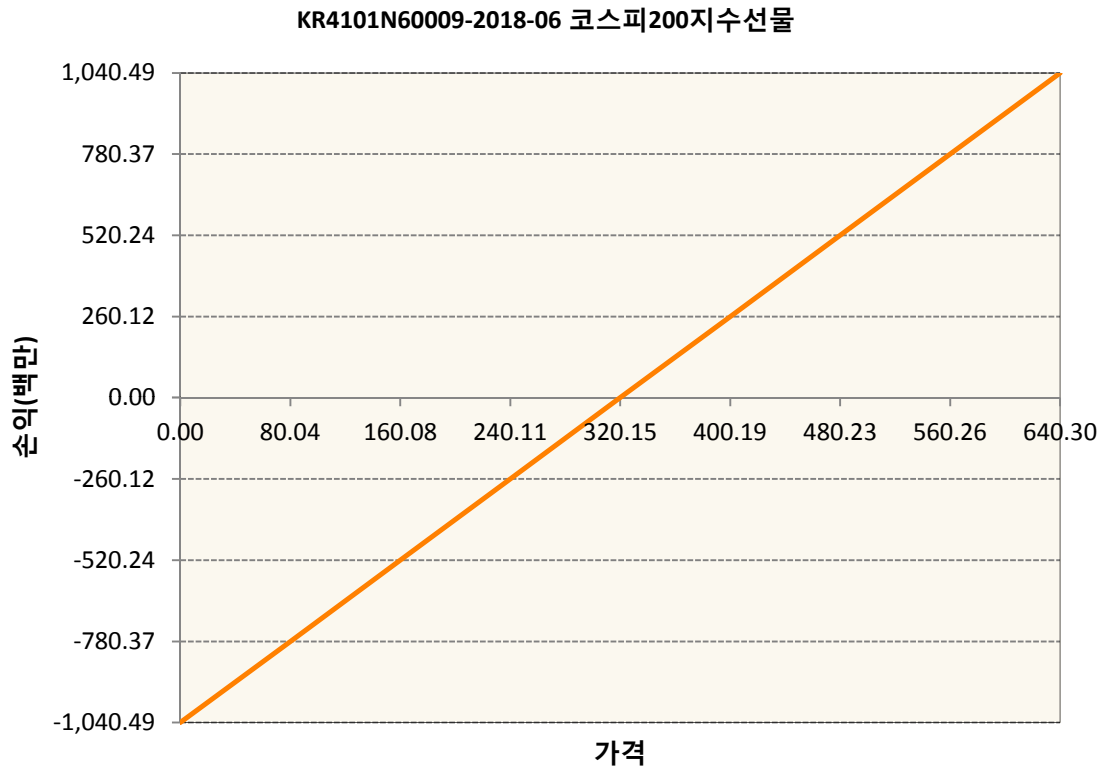
ETF스마트레버리지목표전환형9호

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	1,040	0	1,040	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101N600 2018-06 코스피200지수선물							83
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-83	-83	-83	-83	-83	-83	-83
-5.33%	-55	-55	-55	-55	-55	-55	-55
-2.67%	-28	-28	-28	-28	-28	-28	-28
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	28	28	28	28	28	28	28
5.33%	55	55	55	55	55	55	55

8.00%	83	83	83	83	83	83	83

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

61

공시일	2018-04-20
기준일	2018-04-19

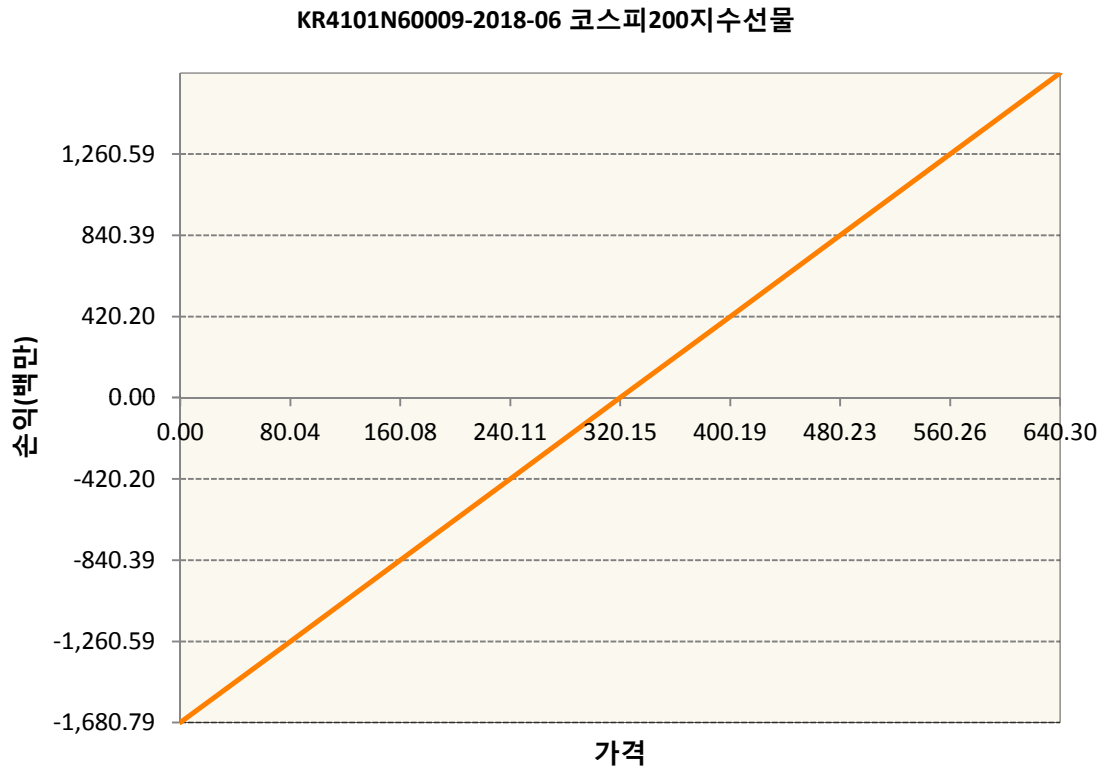
ETF스마트레버리지목표전환형10

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	1,681	0	1,681	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101N600 2018-06 코스피200지수선물							134
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-134	-134	-134	-134	-134	-134	-134
-5.33%	-90	-90	-90	-90	-90	-90	-90
-2.67%	-45	-45	-45	-45	-45	-45	-45
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	45	45	45	45	45	45	45
5.33%	90	90	90	90	90	90	90

8.00%	134	134	134	134	134	134	134

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

98

공시일	2018-04-20
기준일	2018-04-19

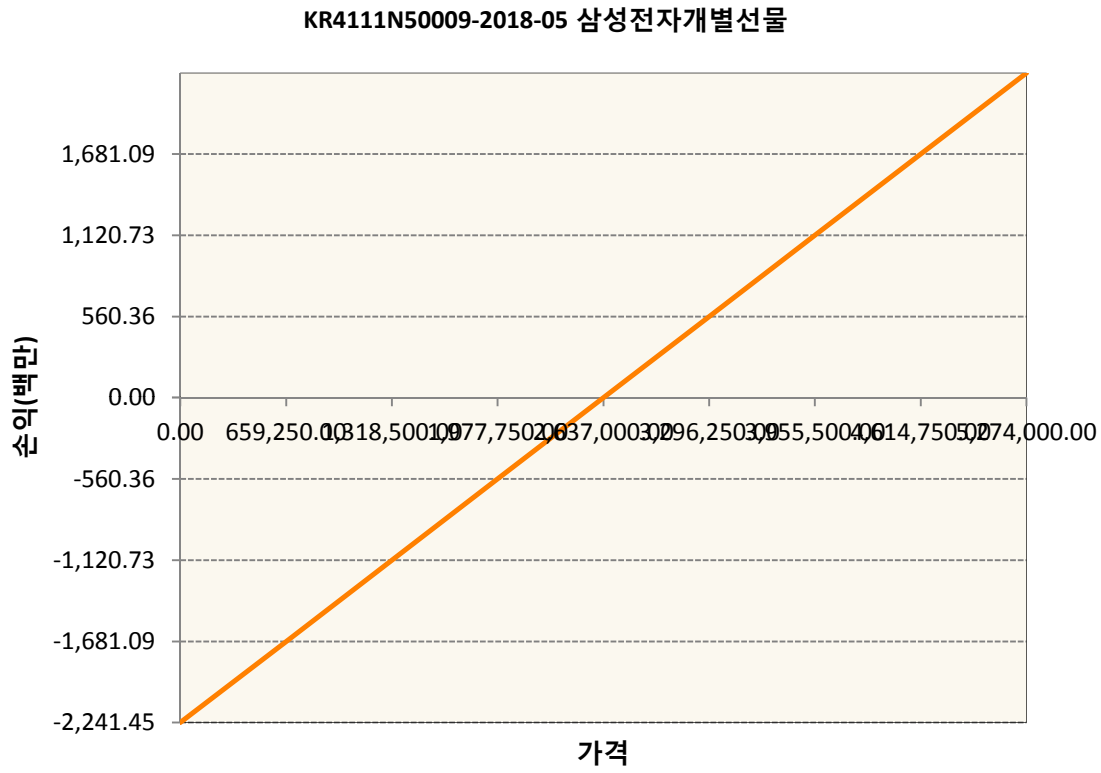
스마트KRX300인덱스1호(주식-파

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	2,241	0	2,241	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4111N500 2018-05 삼성전자개별선물							179
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-179	-179	-179	-179	-179	-179	-179
-5.33%	-120	-120	-120	-120	-120	-120	-120
-2.67%	-60	-60	-60	-60	-60	-60	-60
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	60	60	60	60	60	60	60
5.33%	120	120	120	120	120	120	120

8.00%	179	179	179	179	179	179	179

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

225

공시일	2018-04-20
기준일	2018-04-19

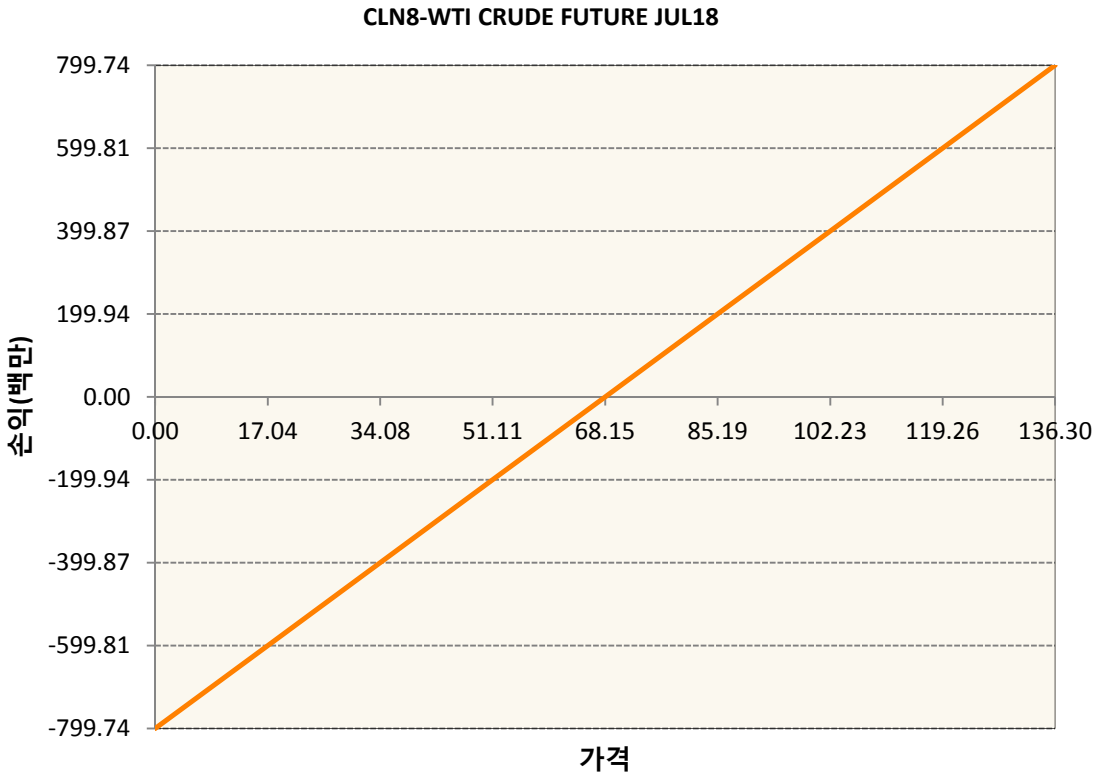
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

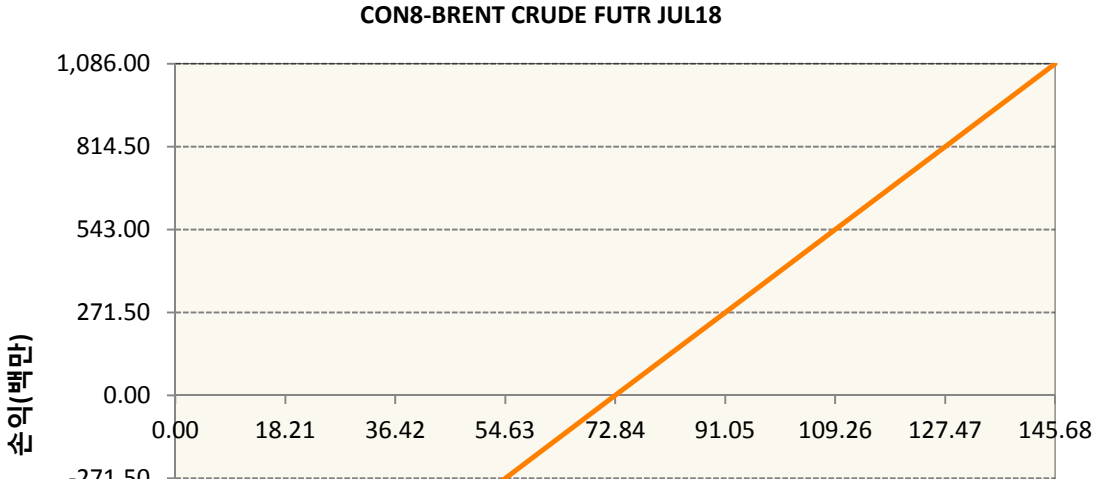
1. 계약금액

(단위:백만원)

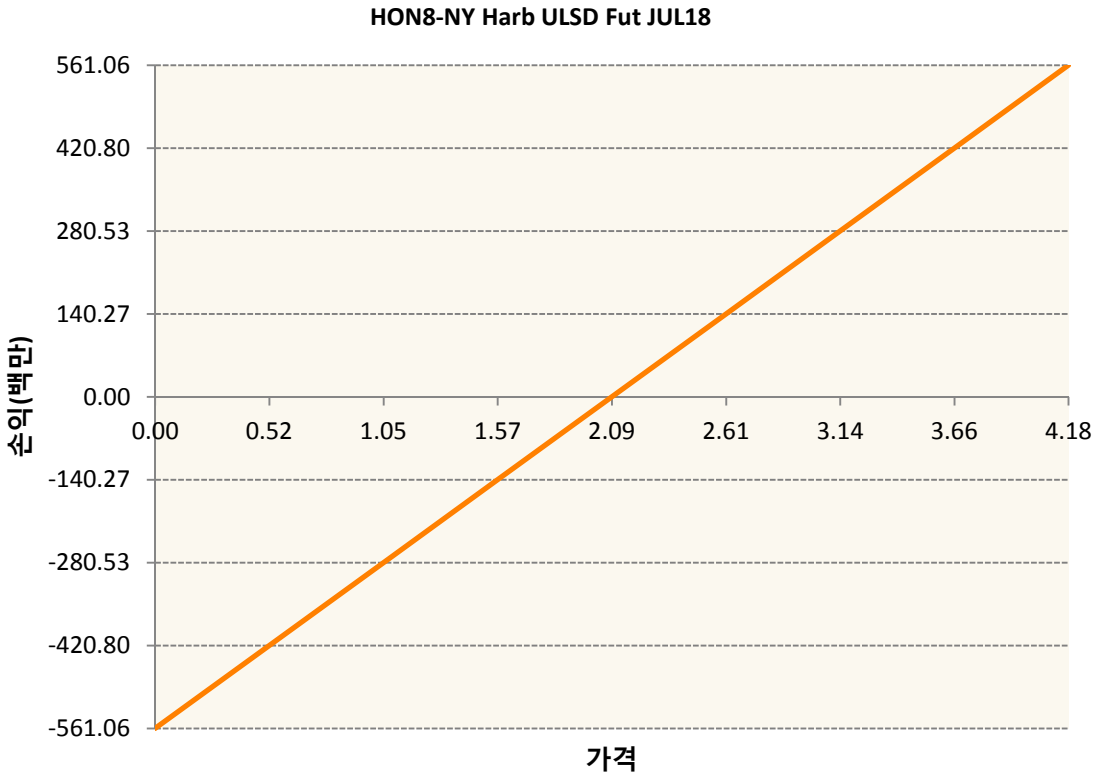
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	4,085	583	3,501	

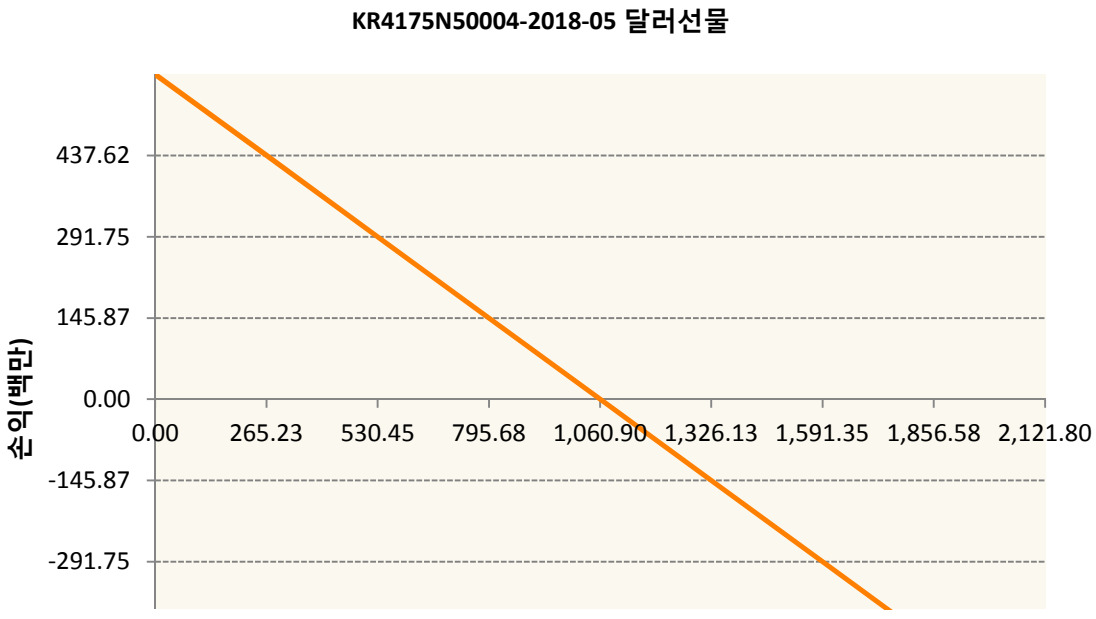
2. 만기시점의 손익구조

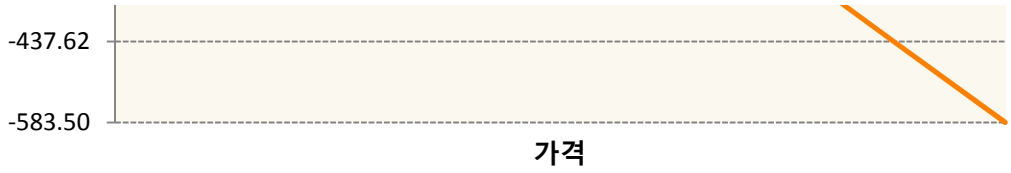


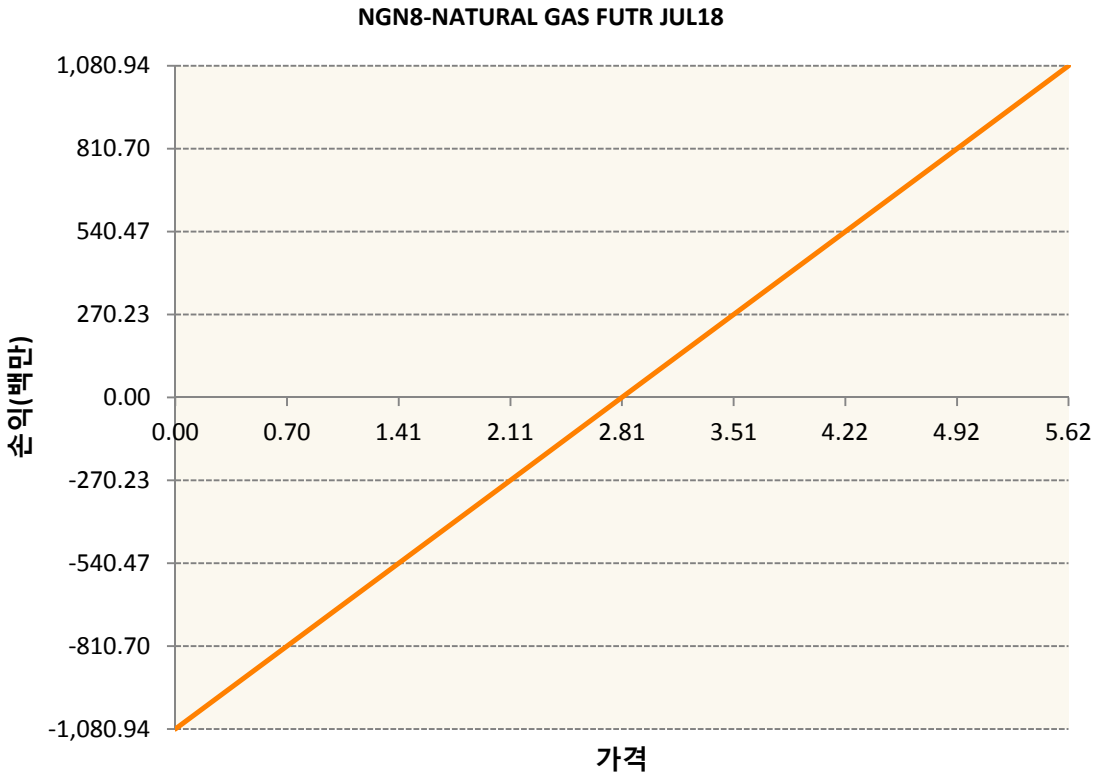


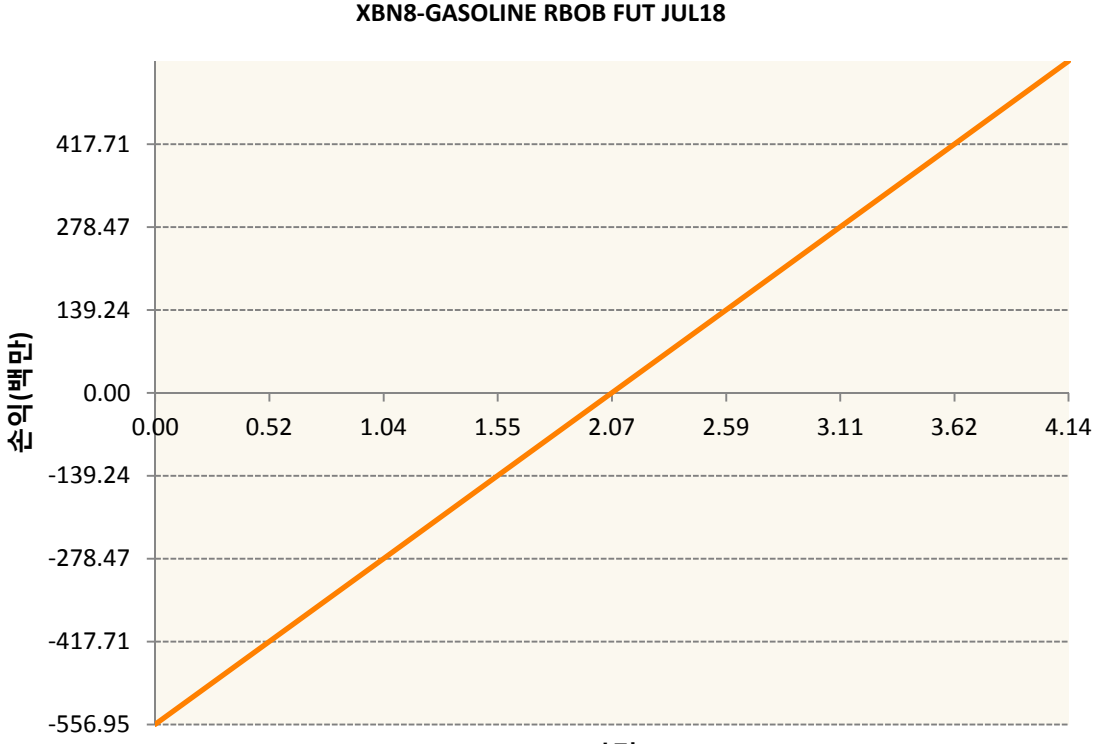

-543.00
-814.50
-1,086.00
가격


HON8-NY Harb ULSD Fut JUL18
561.06
420.80
280.53
140.27
0.00
-140.27
-280.53
-420.80
-561.06
0.00
0.52
1.05
1.57
2.09
2.61
3.14
3.66
4.18
손익(백만)
가격


KR4175N50004-2018-05 달러선물
437.62
291.75
145.87
0.00
-145.87
-291.75
0.00
265.23
530.45
795.68
1,060.90
1,326.13
1,591.35
1,856.58
2,121.80
손익(백만)


-437.62
-583.50
가격


NGN8-NATURAL GAS FUTR JUL18
1,080.94
810.70
540.47
270.23
0.00
-270.23
-540.47
-810.70
-1,080.94
0.00
0.70
1.41
2.11
2.81
3.51
4.22
4.92
5.62
손익(백만)
가격


XBN8-GASOLINE RBOB FUT JUL18
417.71
278.47
139.24
0.00
-139.24
-278.47
-417.71
-556.95
0.00
0.52
1.04
1.55
2.07
2.59
3.11
3.62
4.14
손익(백만)

가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
CLN8	WTI CRUDE FUTURE JUL18	64
CON8	BRENT CRUDE FUTR JUL18	87
HON8	NY Harb ULSD Fut JUL18	45
KR4175N500	2018-05 달러선물	47
NGN8	NATURAL GAS FUTR JUL18	86
XBN8	GASOLINE RBOB FUT JUL18	45

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	518

공시일	2018-04-20
기준일	2018-04-19

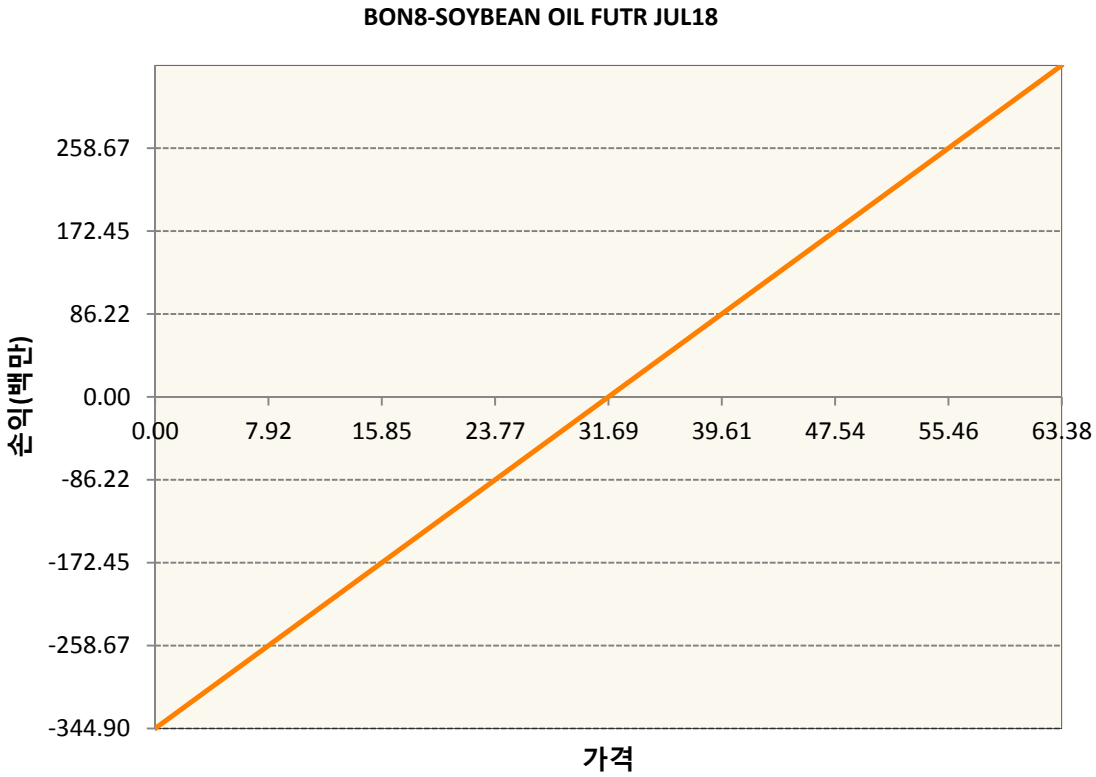
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

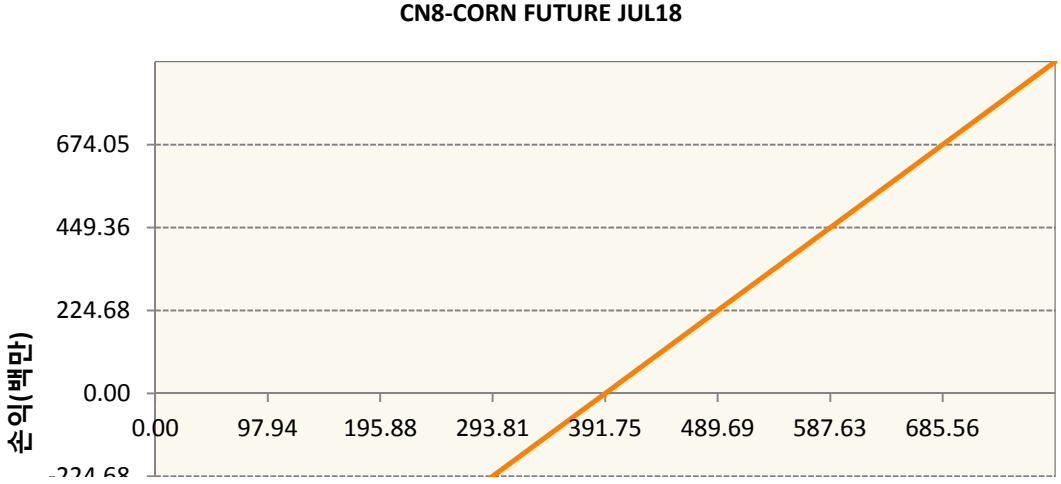
1. 계약금액

(단위:백만원)

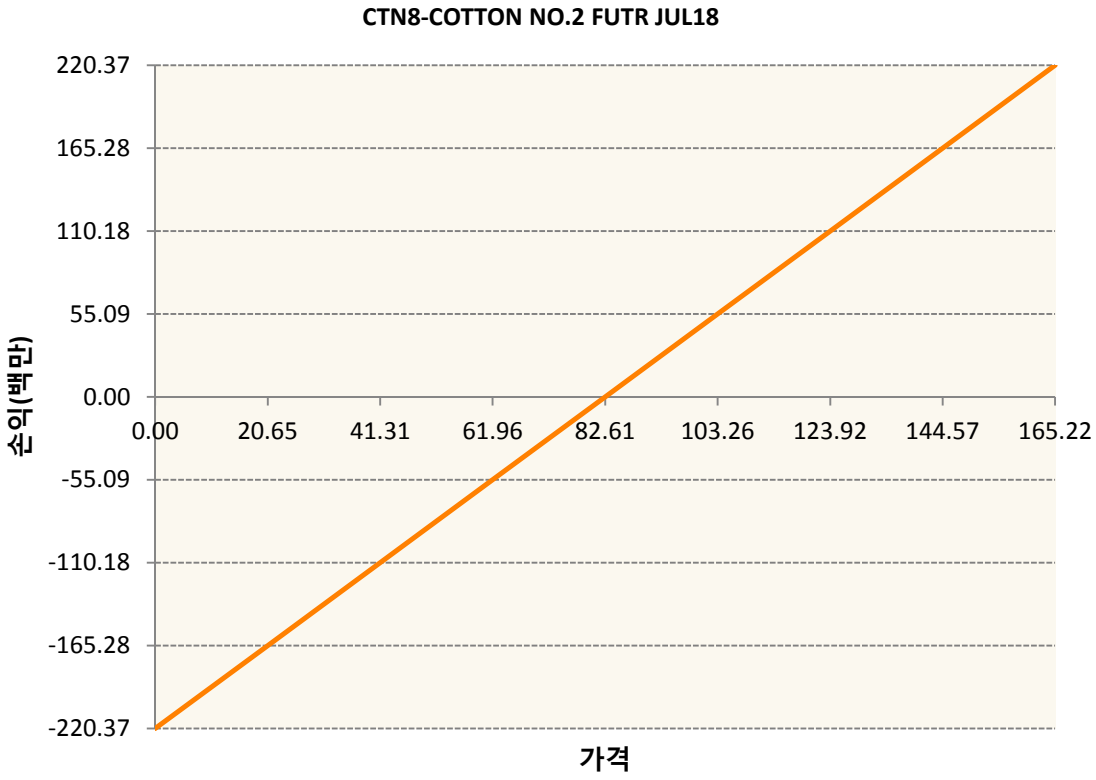
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	4,124	318	3,806	

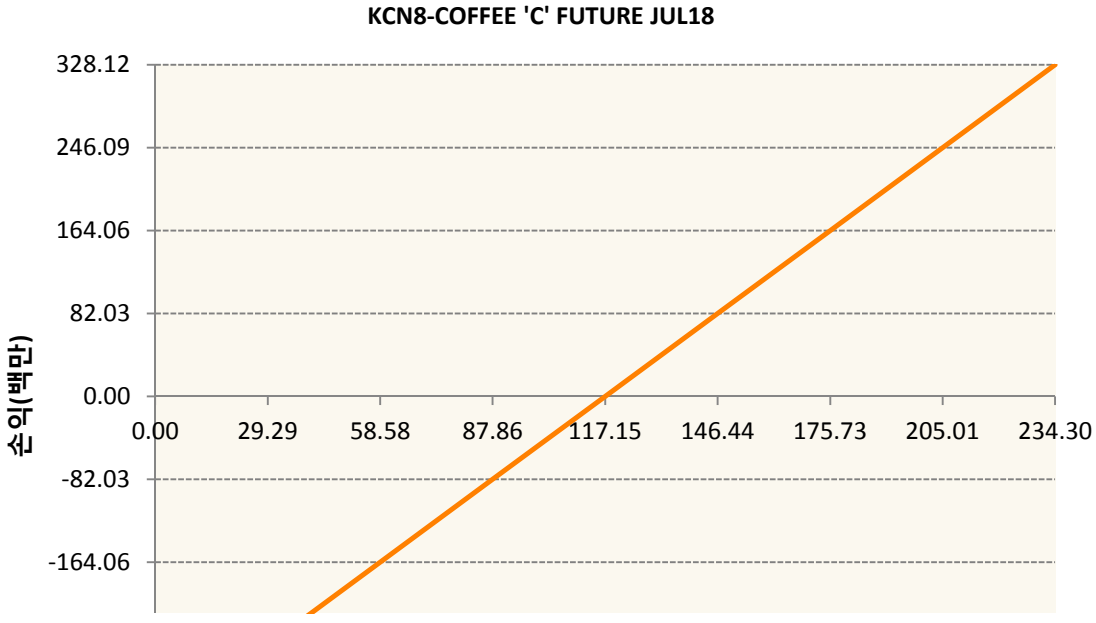
2. 만기시점의 손익구조

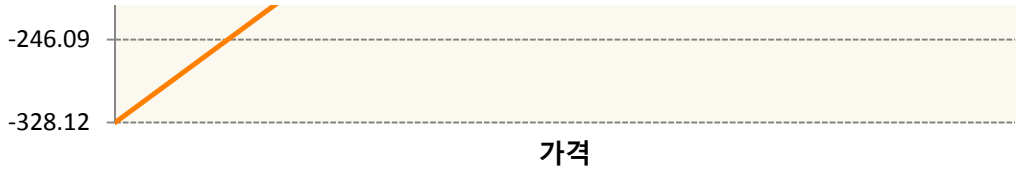


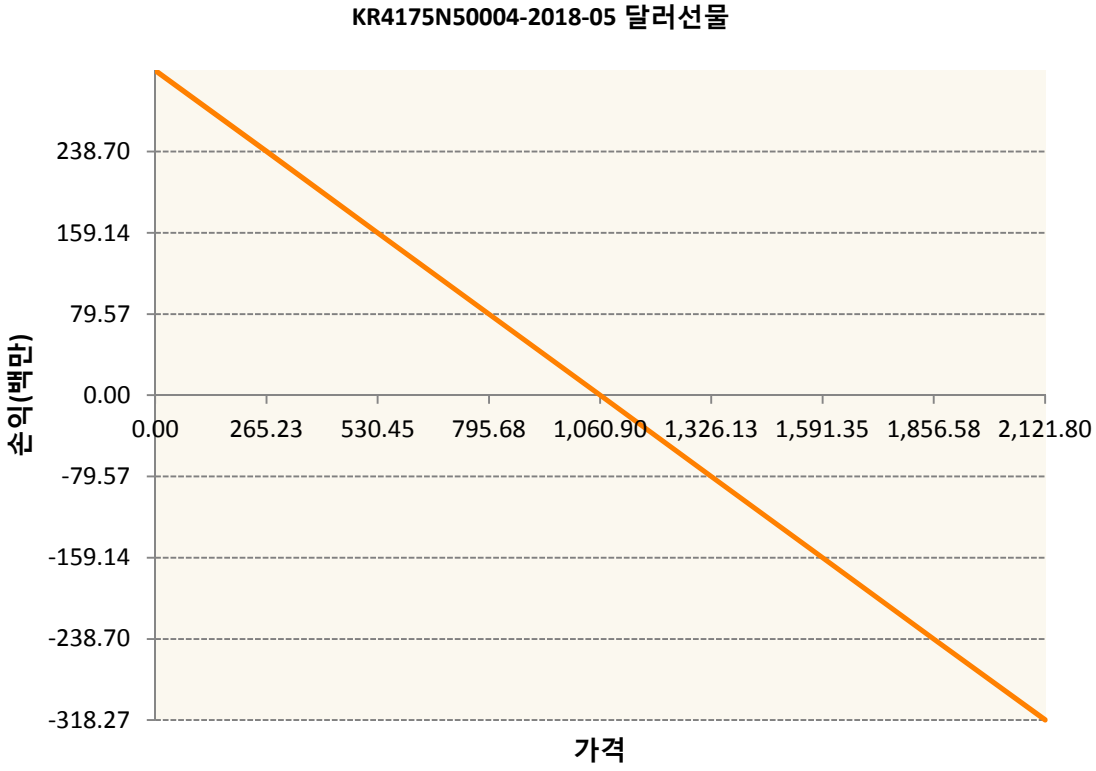


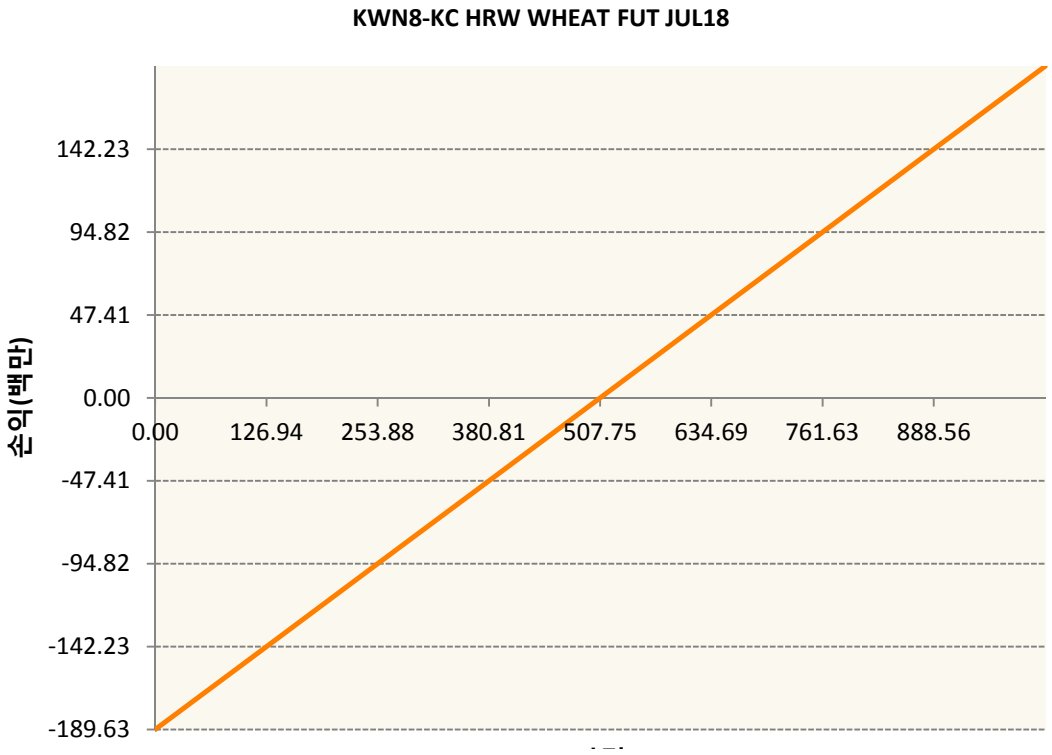

-224.68
-449.36
-674.05
-898.73
가격


CTN8-COTTON NO.2 FUTR JUL18
220.37
165.28
110.18
55.09
0.00
-55.09
-110.18
-165.28
-220.37
0.00
20.65
41.31
61.96
82.61
103.26
123.92
144.57
165.22
손익(백만)
가격

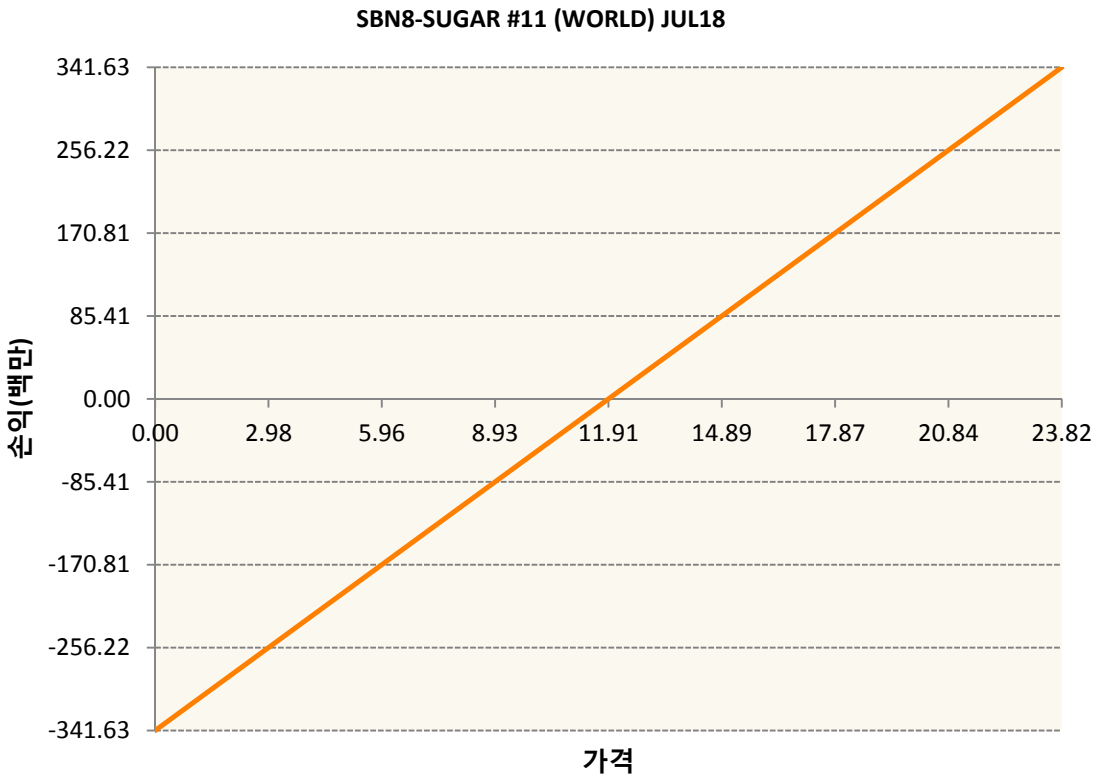

KCN8-COFFEE 'C' FUTURE JUL18
328.12
246.09
164.06
82.03
0.00
-82.03
-164.06
0.00
29.29
58.58
87.86
117.15
146.44
175.73
205.01
234.30
손익(백만)

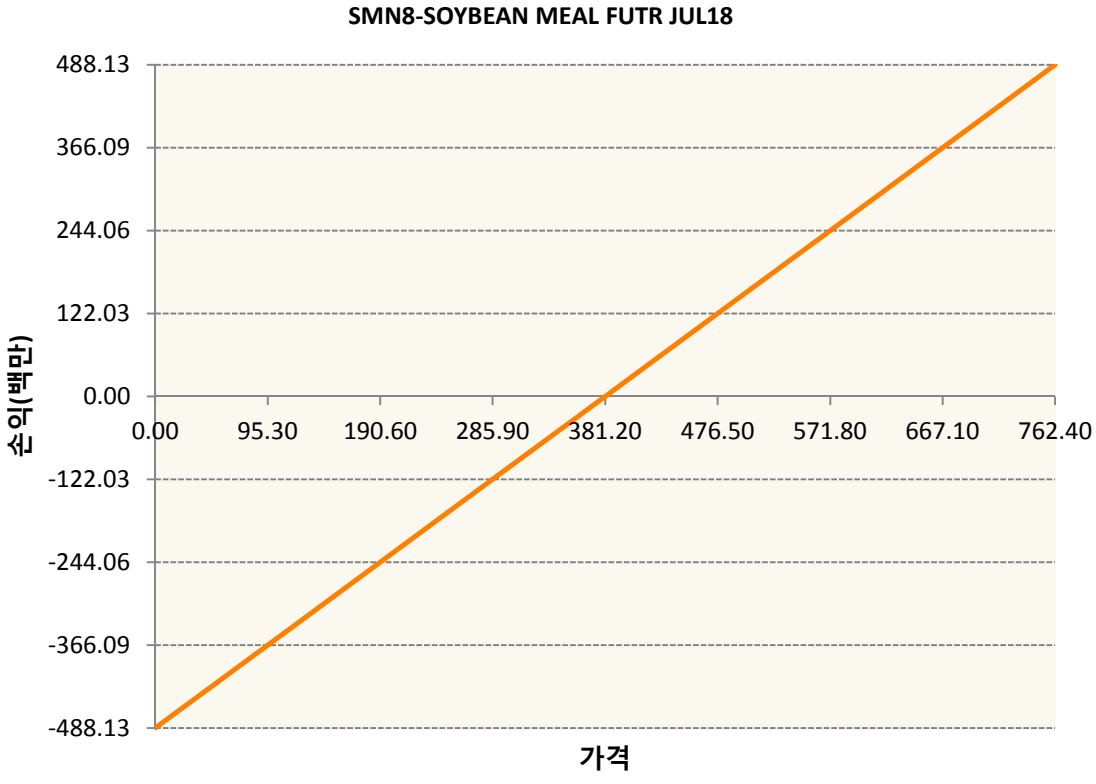

-246.09
-328.12
가격

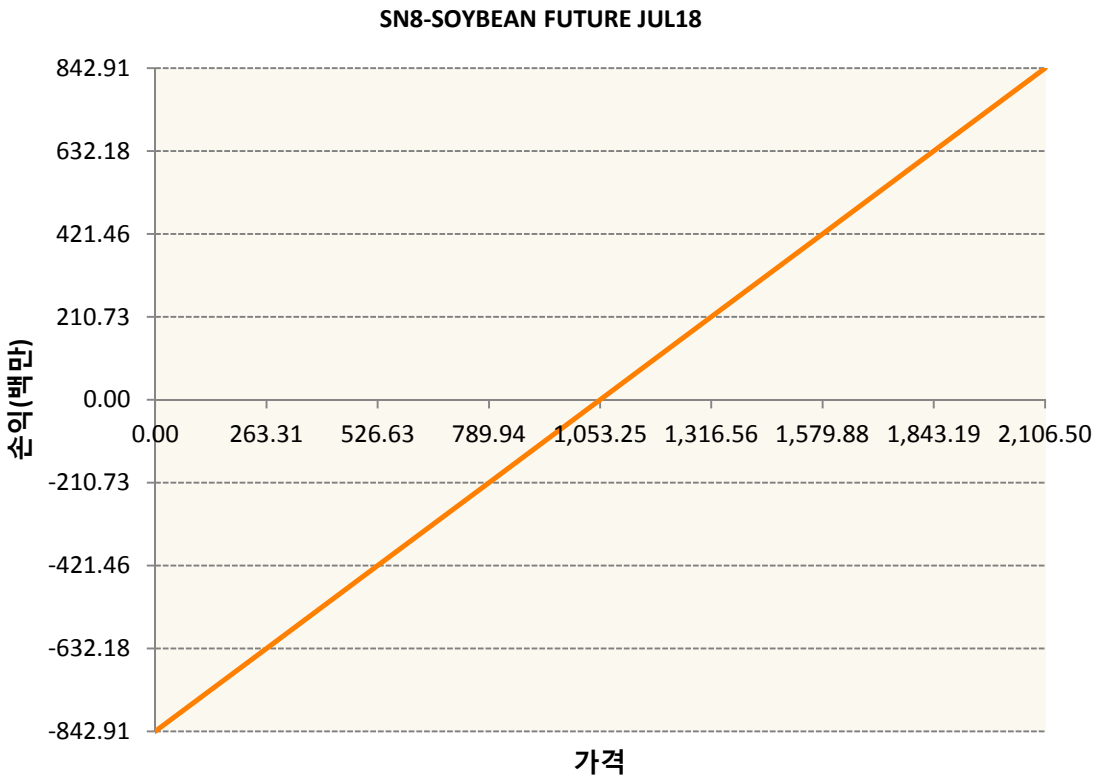

KR4175N50004-2018-05 달러선물
손익(백만)
238.70
159.14
79.57
0.00
-79.57
-159.14
-238.70
-318.27
0.00
265.23
530.45
795.68
1,060.90
1,326.13
1,591.35
1,856.58
2,121.80
가격

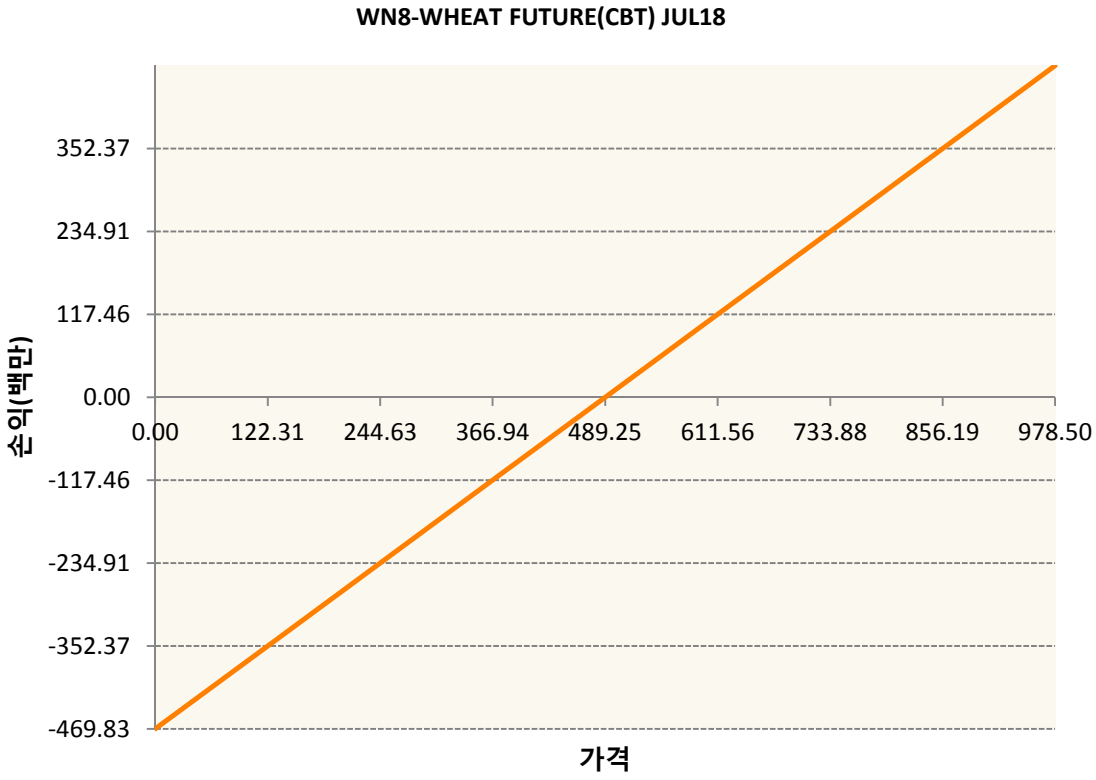

KWN8-KC HRW WHEAT FUT JUL18
손익(백만)
142.23
94.82
47.41
0.00
-47.41
-94.82
-142.23
-189.63
0.00
126.94
253.88
380.81
507.75
634.69
761.63
888.56

가격


SBN8-SUGAR #11 (WORLD) JUL18
341.63
256.22
170.81
85.41
0.00
-85.41
-170.81
-256.22
-341.63
0.00
2.98
5.96
8.93
11.91
14.89
17.87
20.84
23.82
손익(백만)
가격


SMN8-SOYBEAN MEAL FUTR JUL18
488.13
366.09
244.06
122.03
0.00
-122.03
-244.06
-366.09
-488.13
0.00
95.30
190.60
285.90
381.20
476.50
571.80
667.10
762.40
손익(백만)
가격





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

BON8	SOYBEAN OIL FUTR JUL18	28

CN8	CORN FUTURE JUL18	72
CTN8	COTTON NO.2 FUTR JUL18	18
KCN8	COFFEE 'C' FUTURE JUL18	26
KR4175N500	2018-05 달러선물	25
KWN8	KC HRW WHEAT FUT JUL18	15
SBN8	SUGAR #11 (WORLD) JUL18	27
SMN8	SOYBEAN MEAL FUTR JUL18	39
SN8	SOYBEAN FUTURE JUL18	67
WN8	WHEAT FUTURE(CBT) JUL18	38

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

331