공시일	2018-04-23
기준일	2018-04-20

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	2018-04-23
기준일	2018-04-20

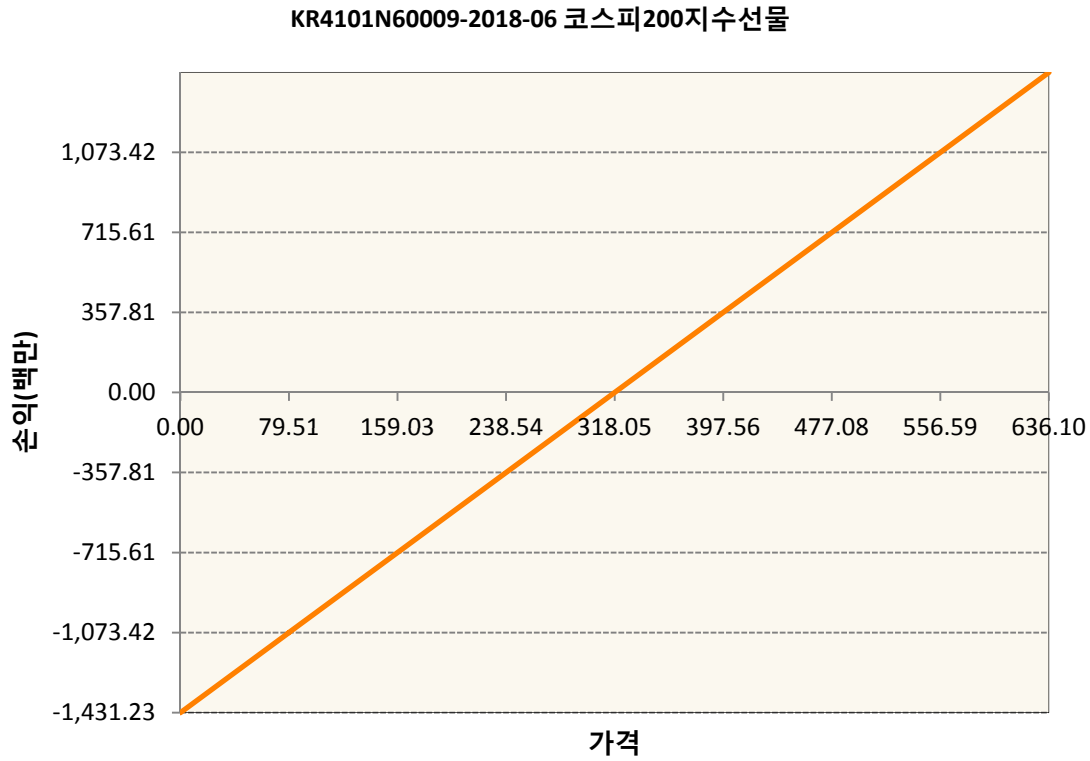
스마트인덱스모

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	1,431	0	1,431	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101N60(2018-06 코스피200지수선물							114
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-114	-114	-114	-114	-114	-114	-114
-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%	114	114	114	114	114	114	114

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

84

공시일	2018-04-23
기준일	2018-04-20

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	1,114

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

454

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2018-04-23
기준일	2018-04-20

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	395

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

426

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2018-04-23
기준일	2018-04-20

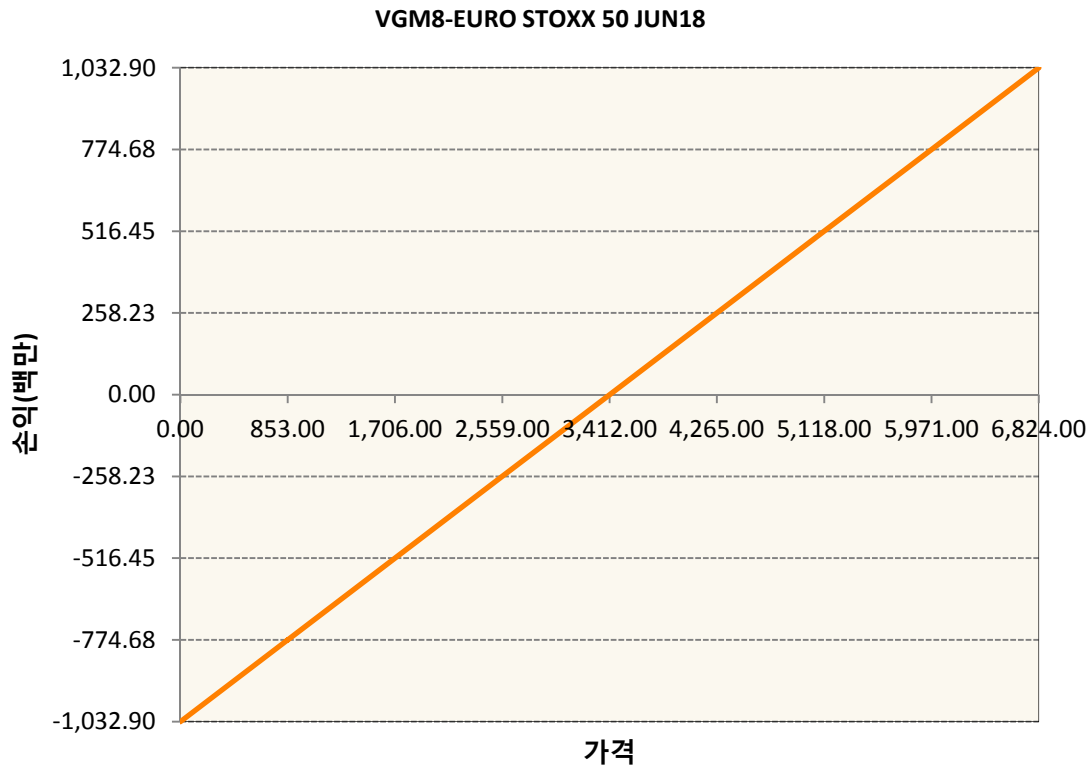
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,033	0	1,033	

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	2018-04-23
기준일	2018-04-20

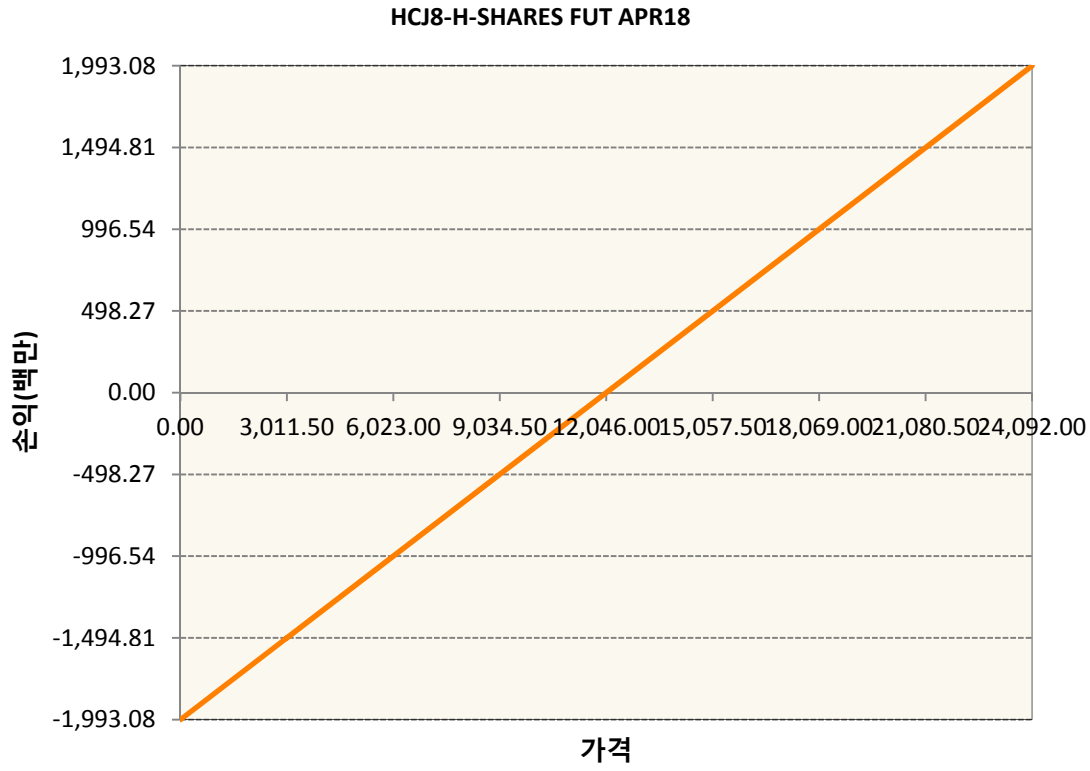
차이나인덱스모(주식-파생형)

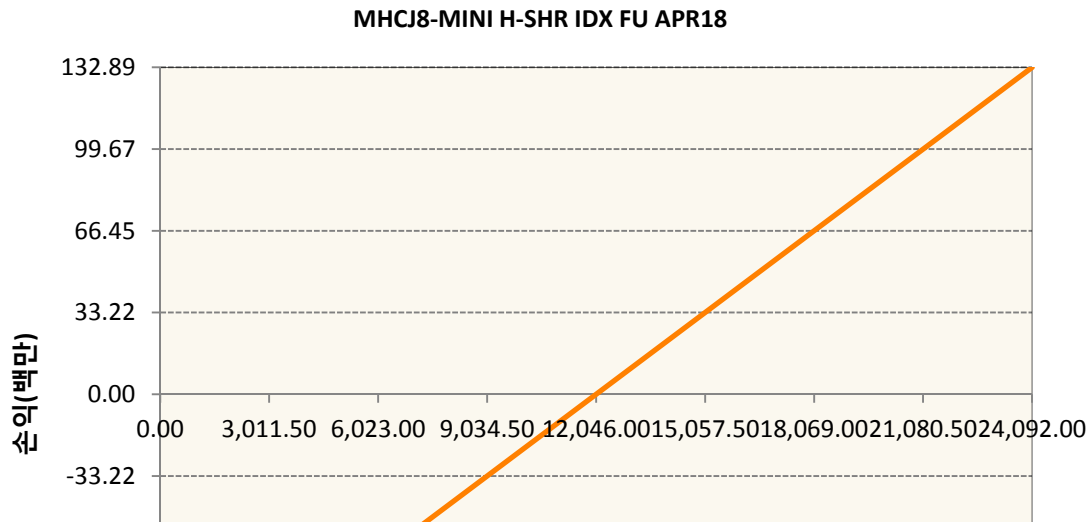
1. 계약금액

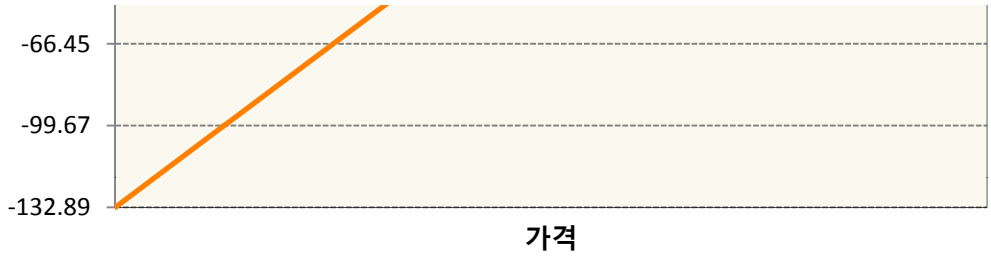
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,126	0	2,126	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCJ8	H-SHARES FUT APR18	159
MHCJ8	MINI H-SHR IDX FU APR18	11

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	150

공시일	2018-04-23
기준일	2018-04-20

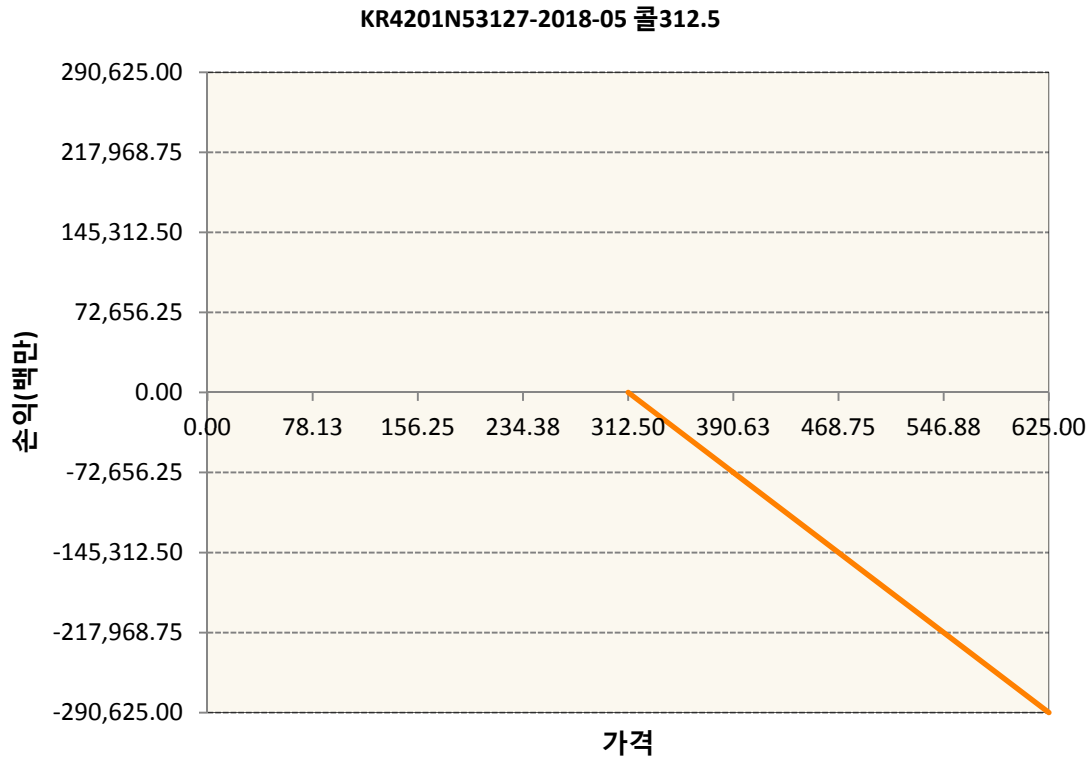
커버드콜모(주식혼합-파생형)

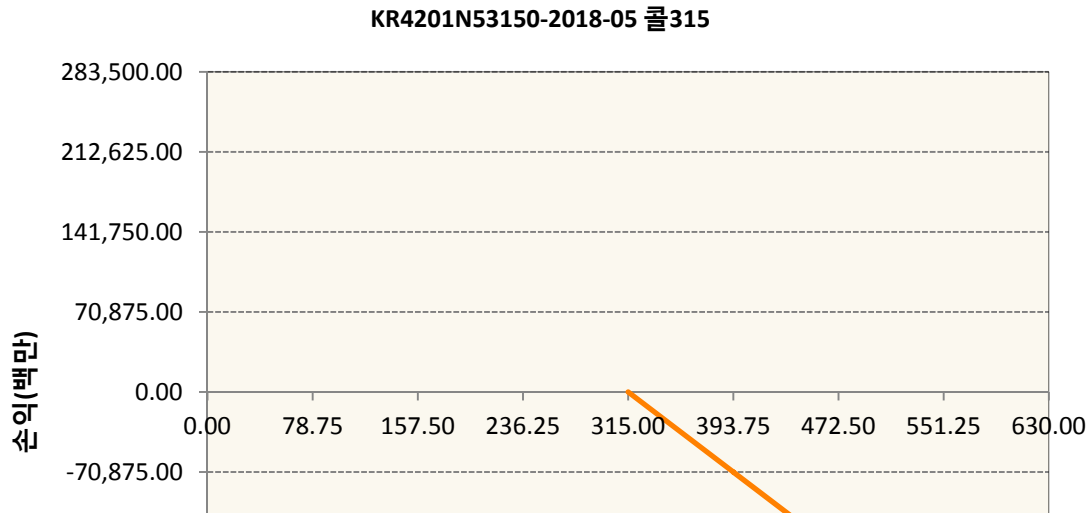
1. 계약금액

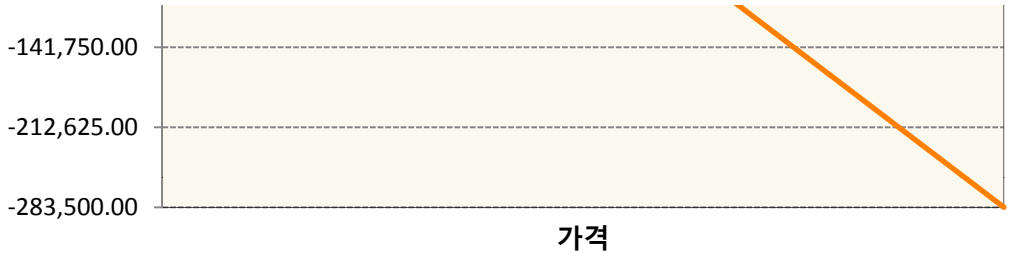
(단위:백만원)

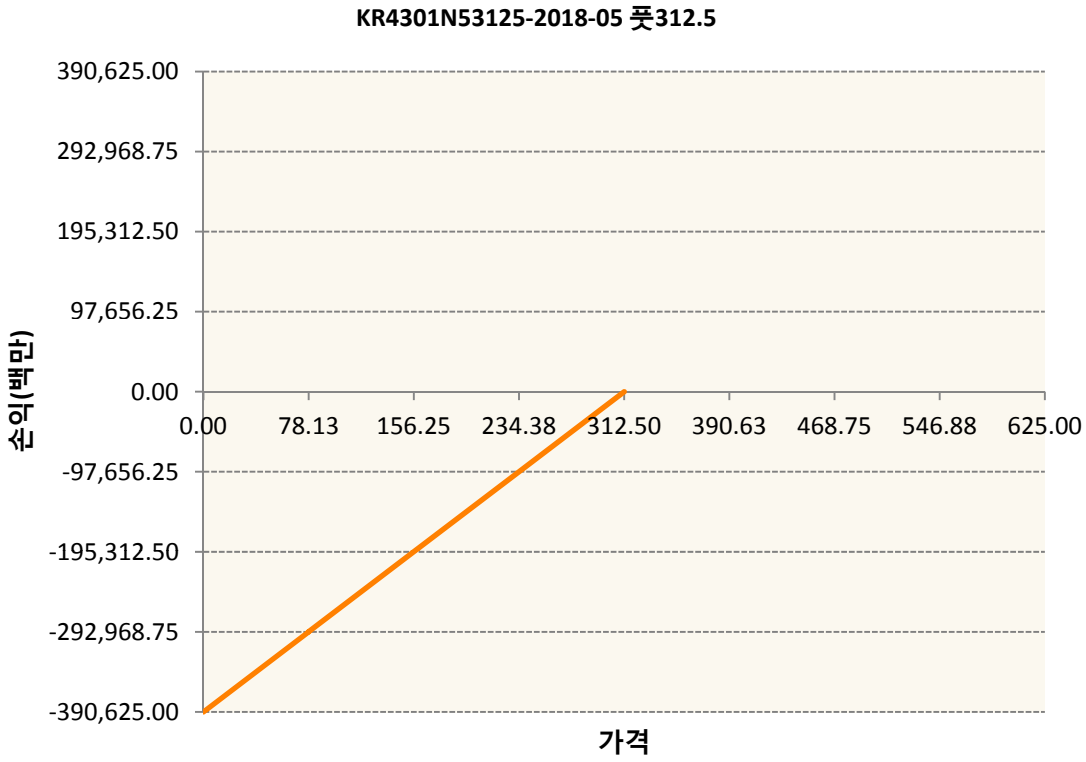
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	15,366	0	15,366	장내
누계	유가증권	옵션	0	964,750	-964,750	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201N5312018-05 콜312.5							19,845
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	9,734	9,482	9,187	8,855	8,493	8,103	7,691
-5.33%	8,565	8,107	7,625	7,125	6,610	6,084	5,548
-2.67%	6,031	5,430	4,827	4,222	3,616	3,009	2,402
0%	1,775	1,189	597	0	-600	-1,203	-1,809
2.67%	-4,076	-4,510	-4,974	-5,462	-5,969	-6,492	-7,028
5.33%	-11,029	-11,278	-11,574	-11,909	-12,280	-12,680	-13,106
8.00%	-18,564	-18,677	-18,833	-19,030	-19,266	-19,539	-19,845
KR4201N5312018-05 콜315							18,547
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	8,294	8,097	7,857	7,580	7,269	6,930	6,565

-5.33%	7,427	7,036	6,616	6,171	5,707	5,227	4,734
-2.67%	5,405	4,846	4,280	3,709	3,135	2,558	1,979
0%	1,785	1,191	596	0	-597	-1,196	-1,794
2.67%	-3,452	-3,929	-4,428	-4,944	-5,473	-6,014	-6,563
5.33%	-9,910	-10,206	-10,546	-10,920	-11,325	-11,756	-12,207
8.00%	-17,069	-17,215	-17,405	-17,637	-17,907	-18,211	-18,547
KR4301N5312018-05 풋312.5							23,178

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-22,982	-22,989	-23,003	-23,026	-23,063	-23,113	-23,178
-5.33%	-12,546	-12,648	-12,777	-12,931	-13,107	-13,304	-13,518
-2.67%	-3,653	-4,001	-4,354	-4,711	-5,072	-5,435	-5,801
0%	919	627	319	0	-329	-665	-1,007
2.67%	1,919	1,851	1,757	1,639	1,497	1,333	1,149
5.33%	1,997	1,992	1,981	1,961	1,931	1,886	1,827
8.00%	1,999	1,999	1,998	1,997	1,993	1,986	1,974

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

62,003

공시일	2018-04-23
기준일	2018-04-20

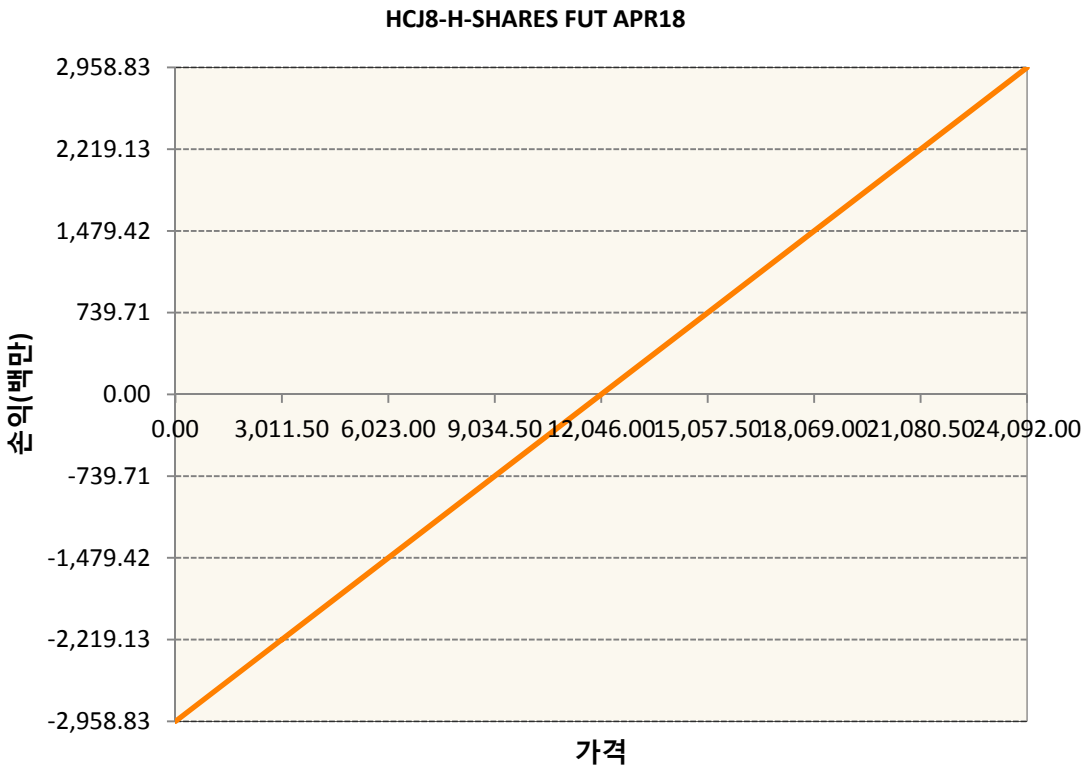
홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생

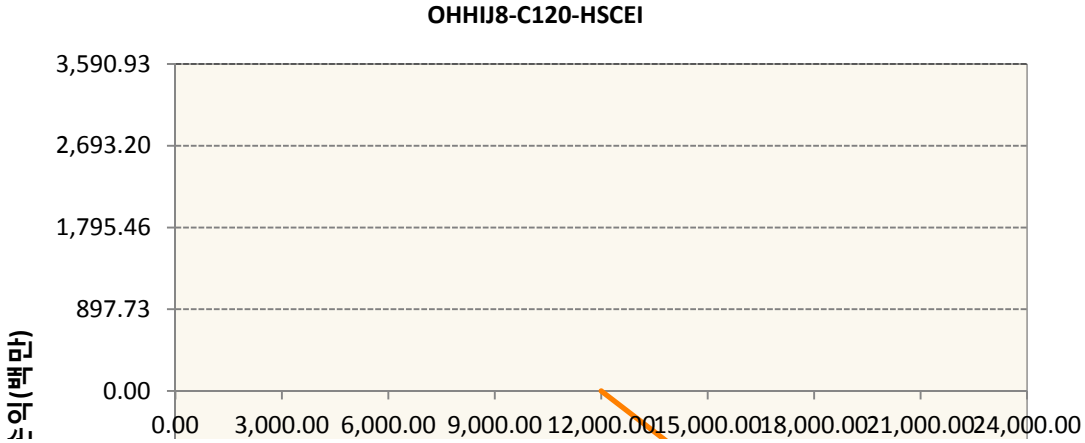
1. 계약금액

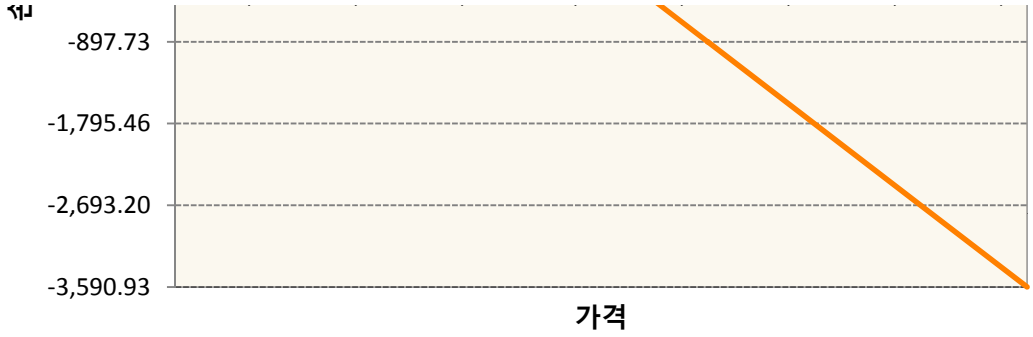
(단위:백만원)

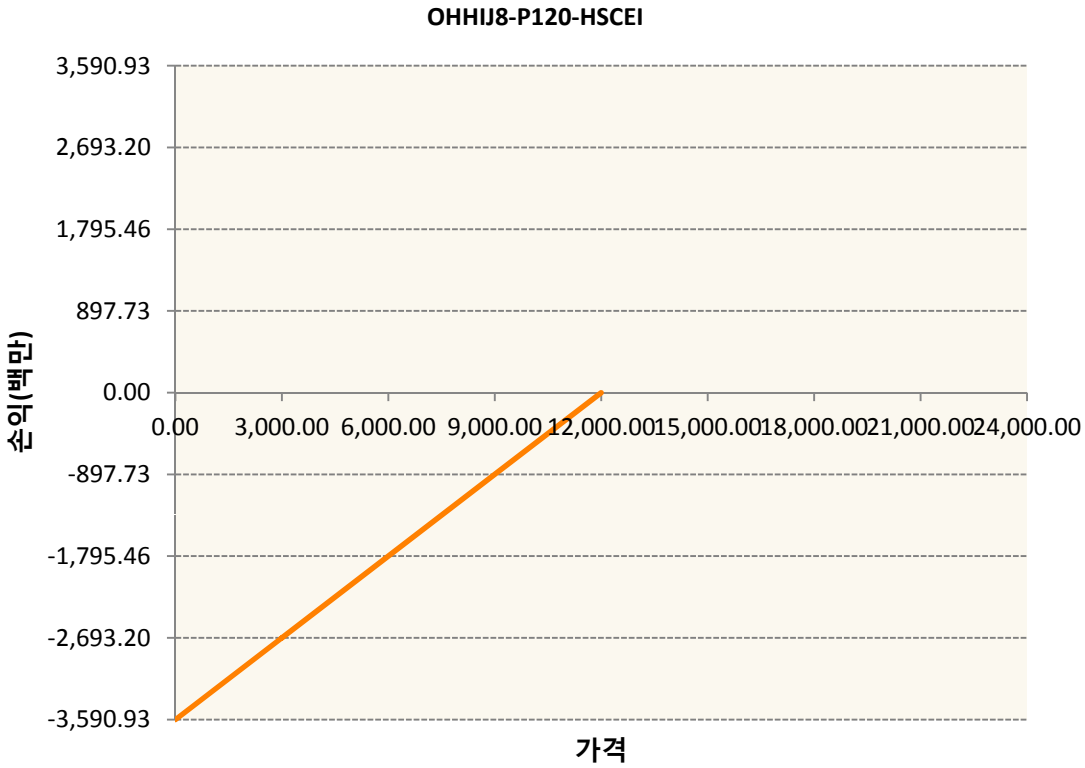
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,959	0	2,959	장내
누계	유가증권	옵션	0	7,182	-7,182	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCJ8	H-SHARES FUT APR18	237
OHHIJ8-C12	HSCEI	287
OHHIJ8-P12	HSCEI	287

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	715

공시일	2018-04-23
기준일	2018-04-20

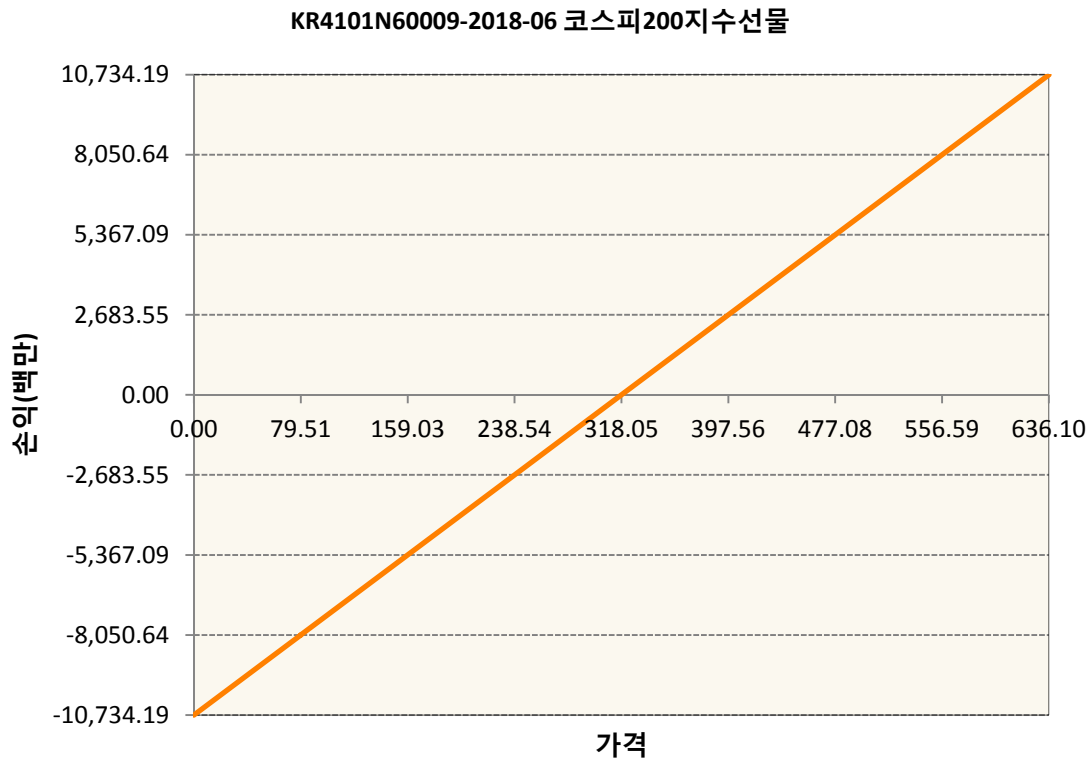
코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼

1. 계약금액

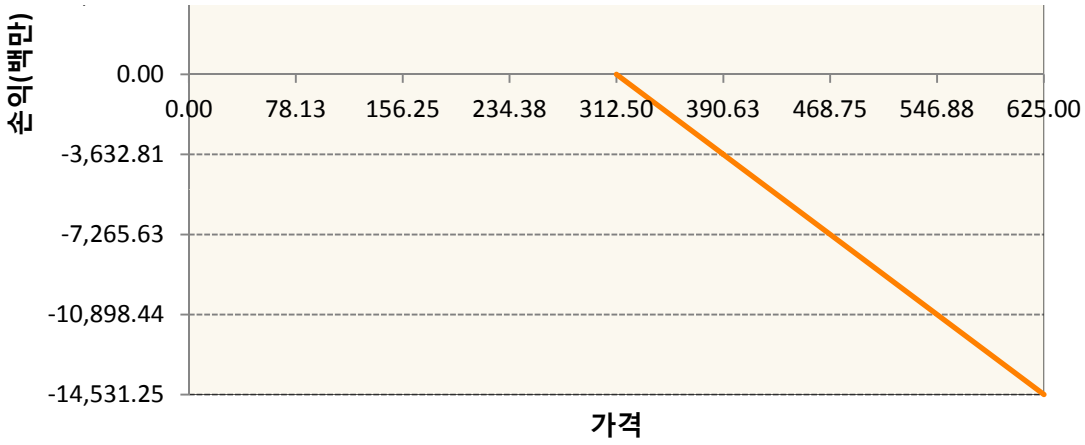
(단위:백만원)

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	10,734	0	10,734	장내
누계	유가증권	스왑	52,200	0	52,200	장외
누계	유가증권	옵션	0	55,754	-55,754	장내

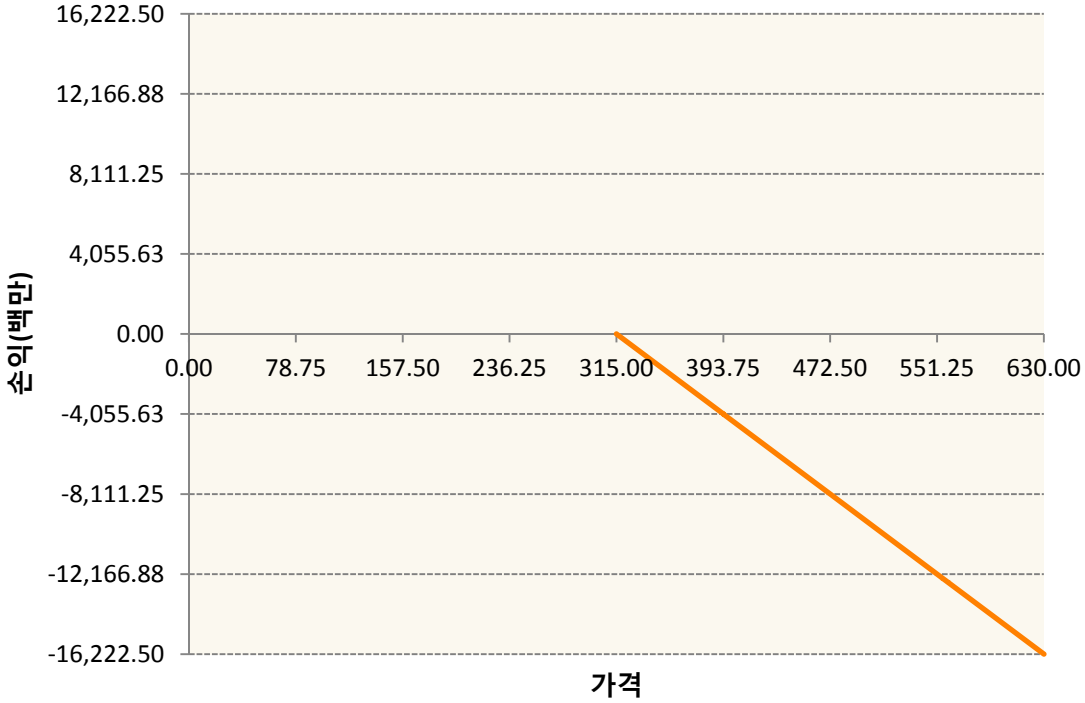
2. 만기시점의 손익구조



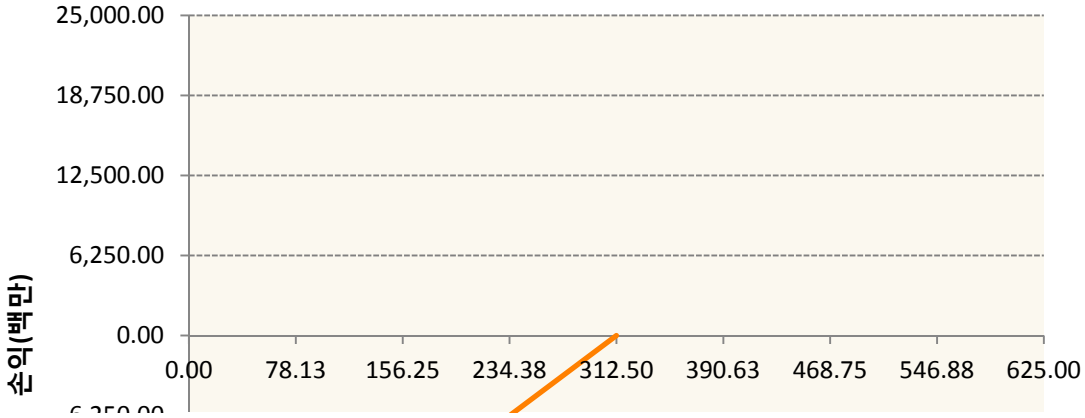




KR4201N53150-2018-05 콜315



KR4301N53125-2018-05 풋312.5





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_2							1,464
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,464	-1,464	-1,464	-1,464	-1,464	-1,464	-1,464
-5.33%	-976	-976	-976	-976	-976	-976	-976
-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%	976	976	976	976	976	976	976
8.00%	1,464	1,464	1,464	1,464	1,464	1,464	1,464
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%	-317	-317	-317	-317	-317	-317	-317
-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%	317	317	317	317	317	317	317
8.00%	475	475	475	475	475	475	475
	KR4101N60(2018-06 코스피200지수선물						858
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-858	-858	-858	-858	-858	-858	-858
-5.33%	-572	-572	-572	-572	-572	-572	-572
-2.67%	-286	-286	-286	-286	-286	-286	-286
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	286	286	286	286	286	286	286
5.33%	572	572	572	572	572	572	572
8.00%	858	858	858	858	858	858	858
	KR4201N531 2018-05 콜312.5						992
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	487	474	459	443	425	405	385
-5.33%	428	405	381	356	331	304	277
-2.67%	302	272	241	211	181	150	120
0%	89	59	30	0	-30	-60	-90
2.67%	-204	-225	-249	-273	-298	-325	-351
5.33%	-551	-564	-579	-595	-614	-634	-655
8.00%	-928	-934	-942	-951	-963	-977	-992
	KR4201N531 2018-05 콜315						1,061
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	475	463	450	434	416	397	376
-5.33%	425	403	379	353	327	299	271
-2.67%	309	277	245	212	179	146	113
0%	102	68	34	0	-34	-68	-103
2.67%	-198	-225	-253	-283	-313	-344	-376
5.33%	-567	-584	-603	-625	-648	-673	-699
8.00%	-977	-985	-996	-1,009	-1,025	-1,042	-1,061
	KR4301N531 2018-05 풋312.5						1,483

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,471	-1,471	-1,472	-1,474	-1,476	-1,479	-1,483
-5.33%	-803	-809	-818	-828	-839	-851	-865
-2.67%	-234	-256	-279	-302	-325	-348	-371
0%	59	40	20	0	-21	-43	-64
2.67%	123	118	112	105	96	85	74
5.33%	128	127	127	126	124	121	117
8.00%	128	128	128	128	128	127	126

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

8,317

공시일	2018-04-23
기준일	2018-04-20

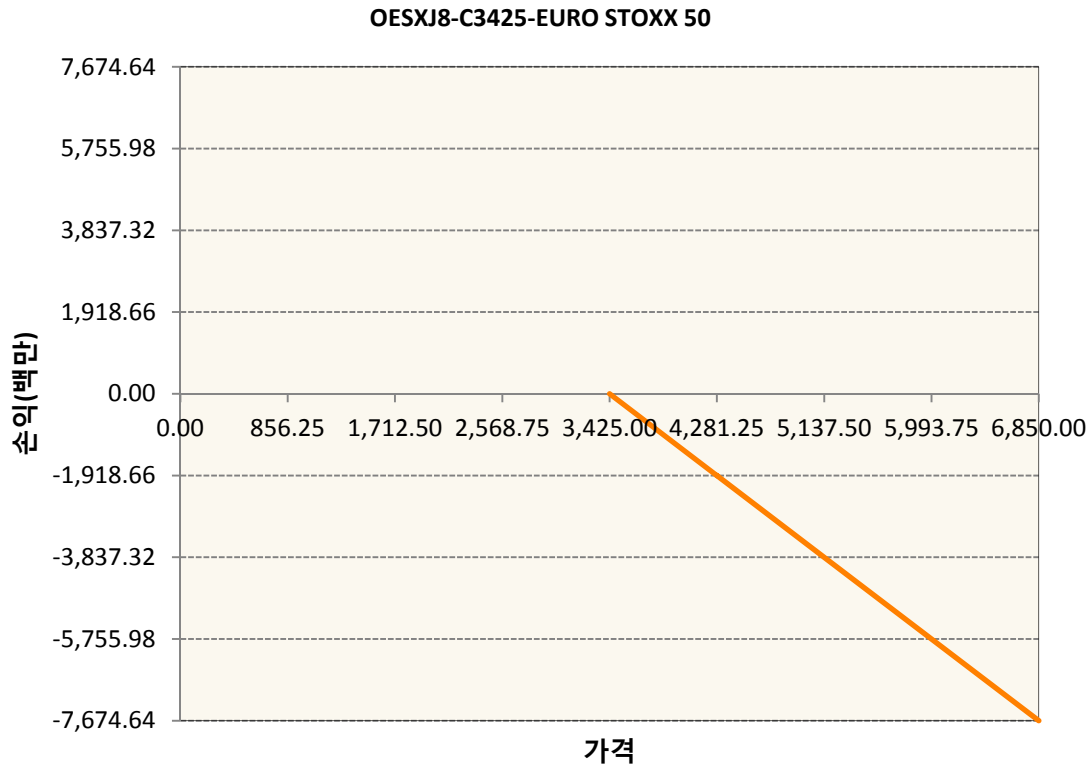
유로커버드콜모(주식혼합-파생형

1. 계약금액

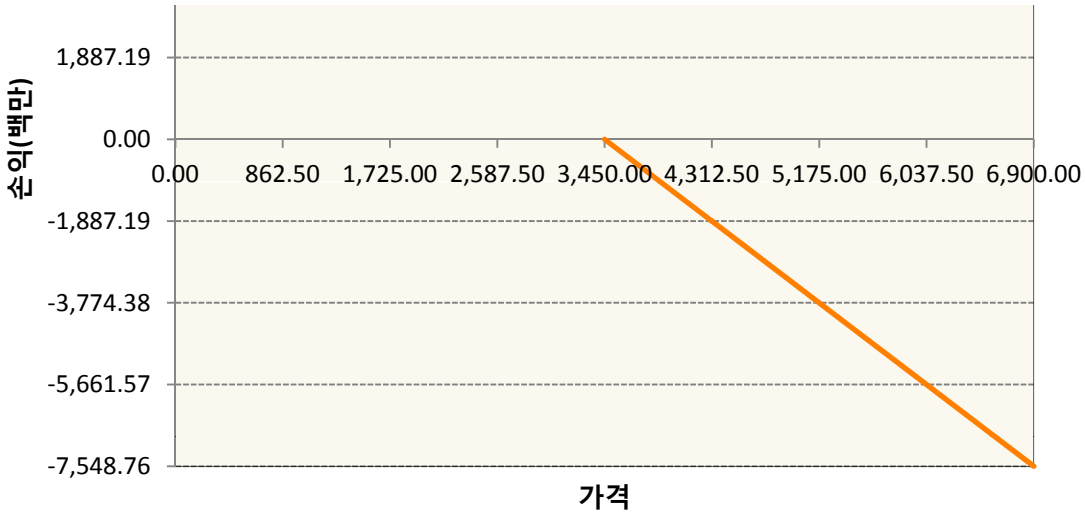
(단위:백만원)

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	6,799	0	6,799	
누계	유가증권	스왑	76,136	0	76,136	장외
누계	유가증권	옵션	0	30,447	-30,447	장내
누계	지수	스왑	52,725	0	52,725	장외

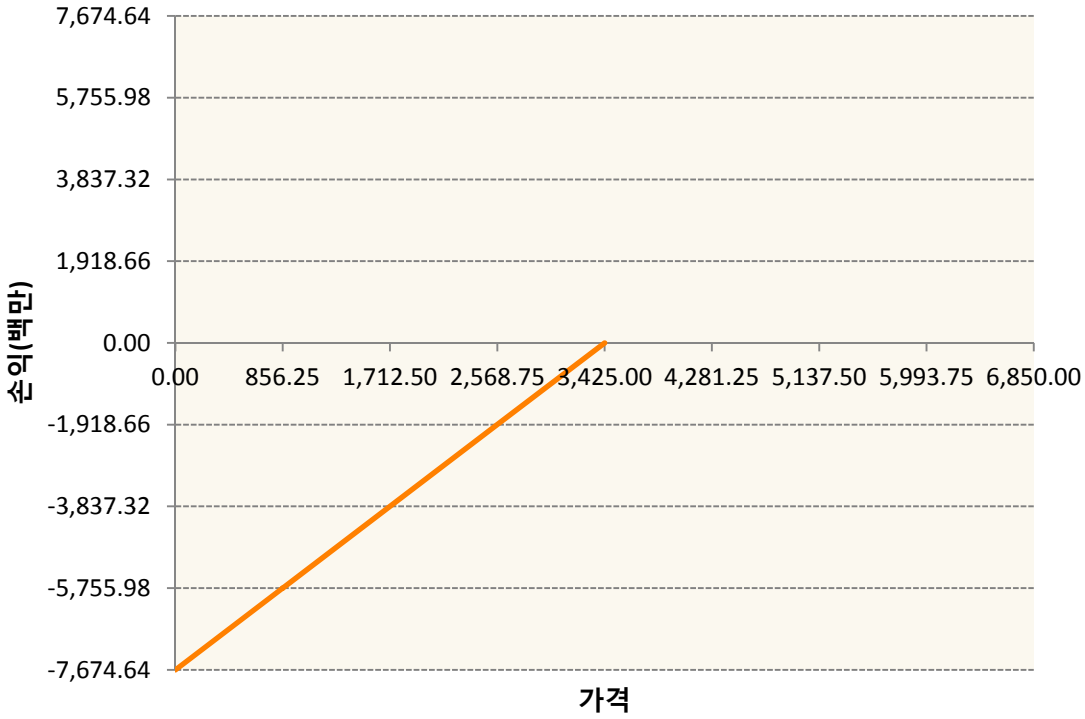
2. 만기시점의 손익구조



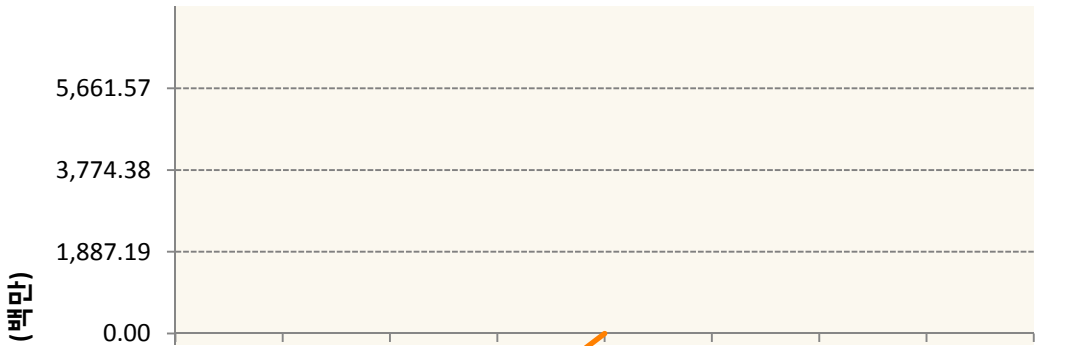


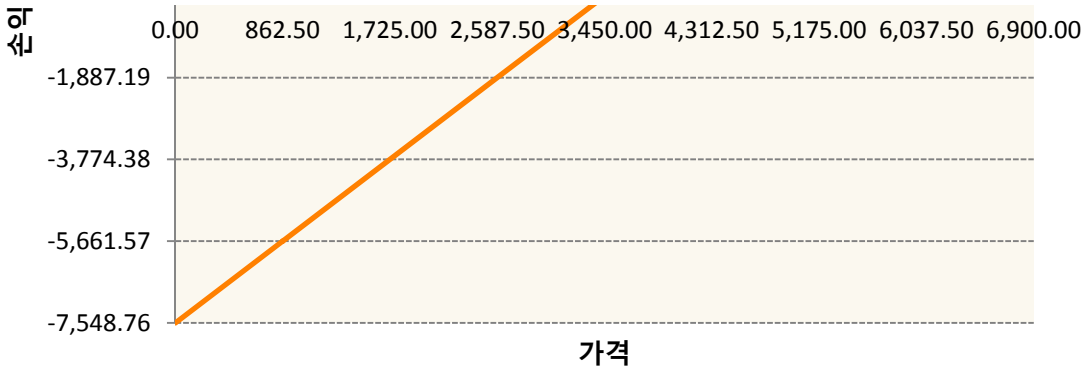


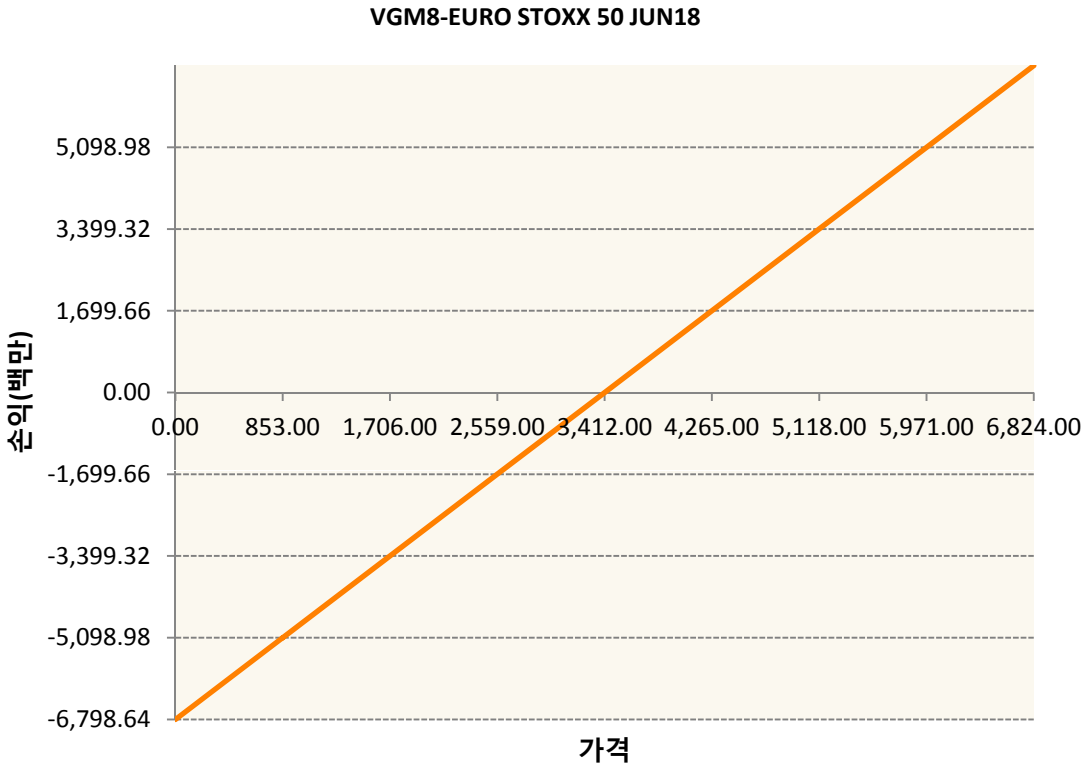
OESXJ8-P3425-EURO STOXX 50



OESXJ8-P3450-EURO STOXX 50







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
260105SGPX	SG EURO Covered CALL STRATEGY - 994.569	92
260105SQPX	SG EURO Covered CALL STRATEGY	133
OESXJ8-C34	EURO STOXX 50	614
OESXJ8-C34	EURO STOXX 50	604
OESXJ8-P34	EURO STOXX 50	614
OESXJ8-P34	EURO STOXX 50	604
VGM8	EURO STOXX 50 JUN18	544

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

1,998

공시일	2018-04-23
기준일	2018-04-20

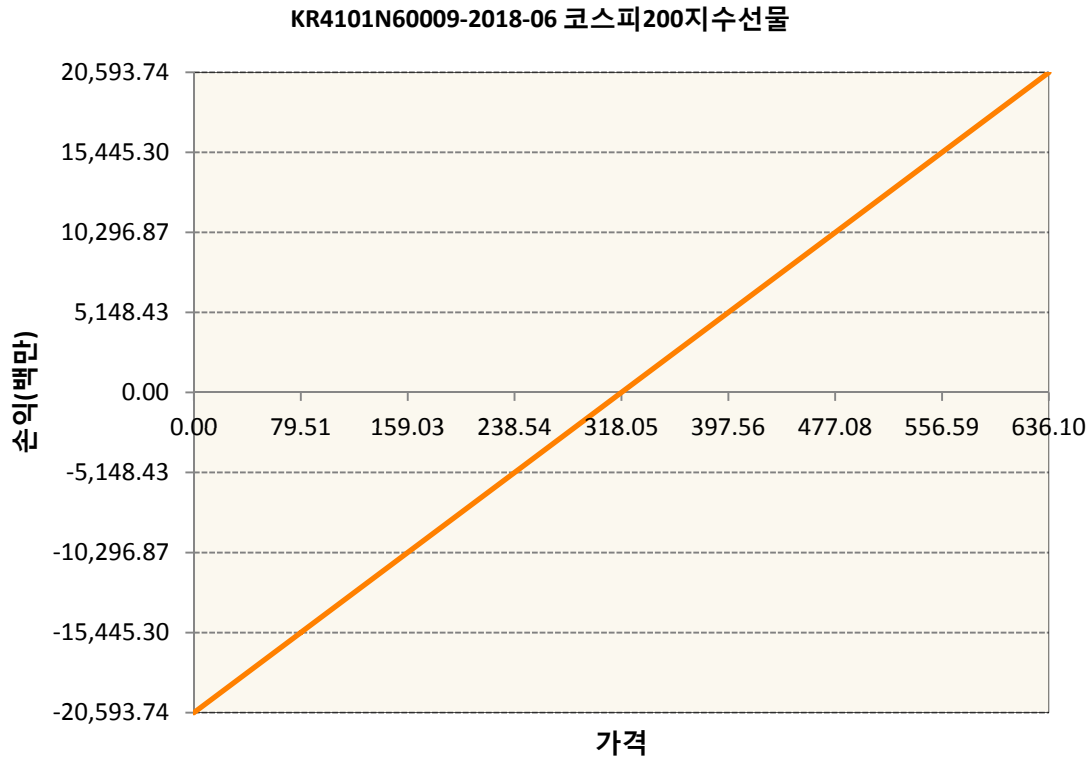
ETF스마트레버리지목표전환형8호

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	20,594	0	20,594	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101N60(2018-06 코스피200지수선물							1,647
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,647	-1,647	-1,647	-1,647	-1,647	-1,647	-1,647
-5.33%	-1,098	-1,098	-1,098	-1,098	-1,098	-1,098	-1,098
-2.67%	-549	-549	-549	-549	-549	-549	-549
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	549	549	549	549	549	549	549
5.33%	1,098	1,098	1,098	1,098	1,098	1,098	1,098
8.00%	1,647	1,647	1,647	1,647	1,647	1,647	1,647

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

1,207

공시일	2018-04-23
기준일	2018-04-20

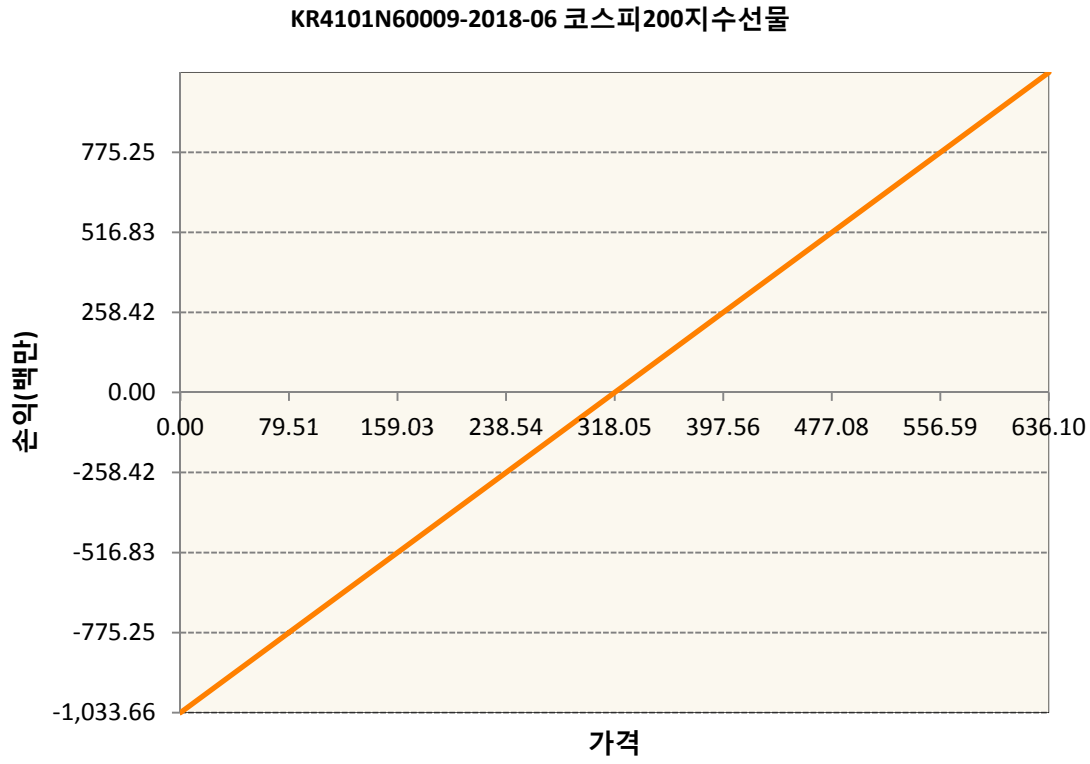
ETF스마트레버리지목표전환형9호

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	1,034	0	1,034	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101N60(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	2018-04-23
기준일	2018-04-20

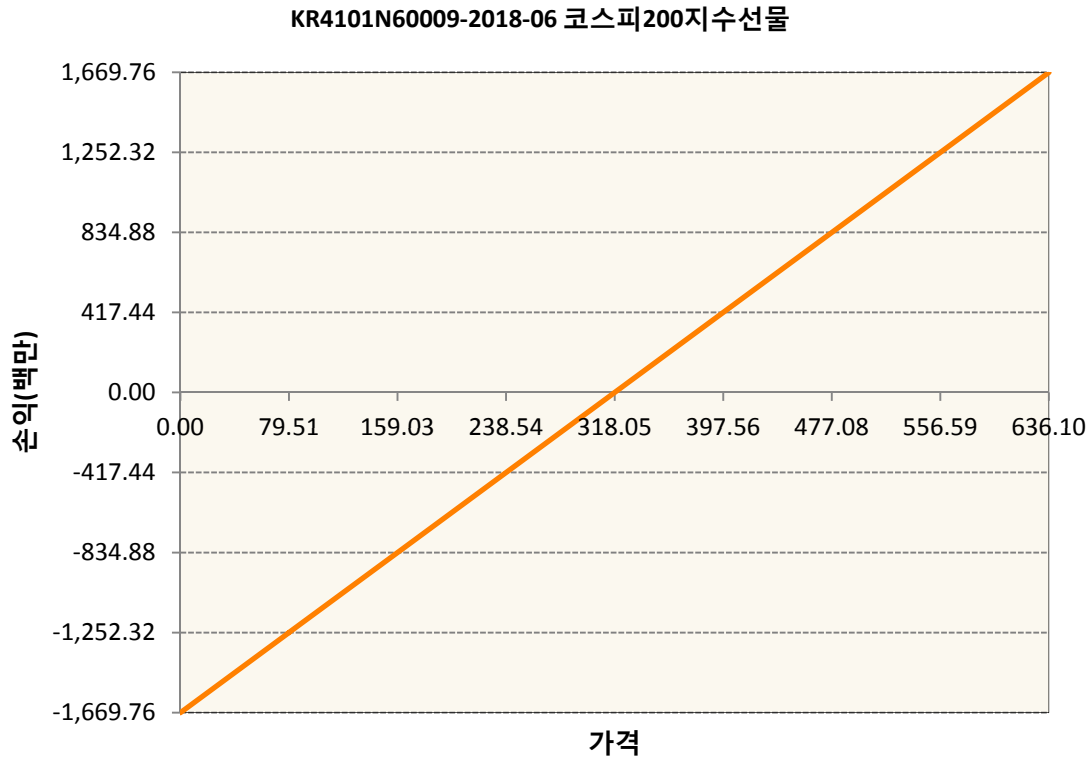
ETF스마트레버리지목표전환형10

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	1,670	0	1,670	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101N60(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%	-89	-89	-89	-89	-89	-89	-89
-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%	89	89	89	89	89	89	89
8.00%	134	134	134	134	134	134	134

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

98

공시일	2018-04-23
기준일	2018-04-20

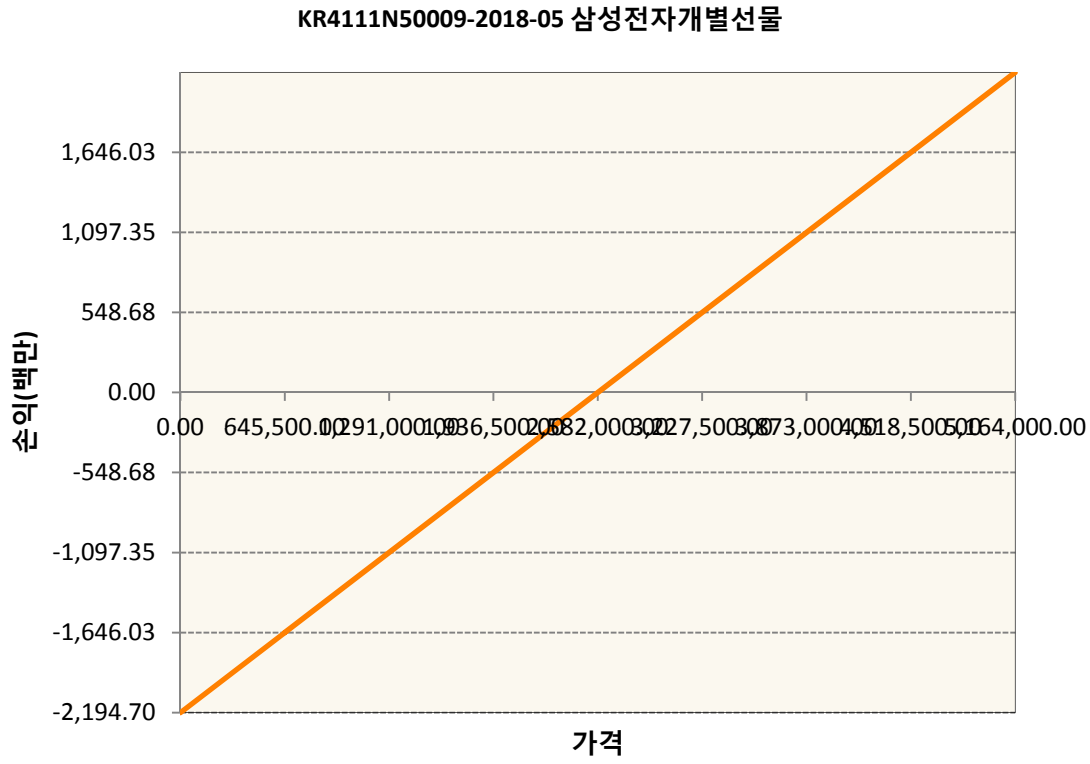
스마트KRX300인덱스1호(주식-파

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	2,195	0	2,195	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4111N50(2018-05 삼성전자개별선물							176
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-176	-176	-176	-176	-176	-176	-176
-5.33%	-117	-117	-117	-117	-117	-117	-117
-2.67%	-59	-59	-59	-59	-59	-59	-59
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	59	59	59	59	59	59	59
5.33%	117	117	117	117	117	117	117
8.00%	176	176	176	176	176	176	176

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

221

공시일	2018-04-23
기준일	2018-04-20

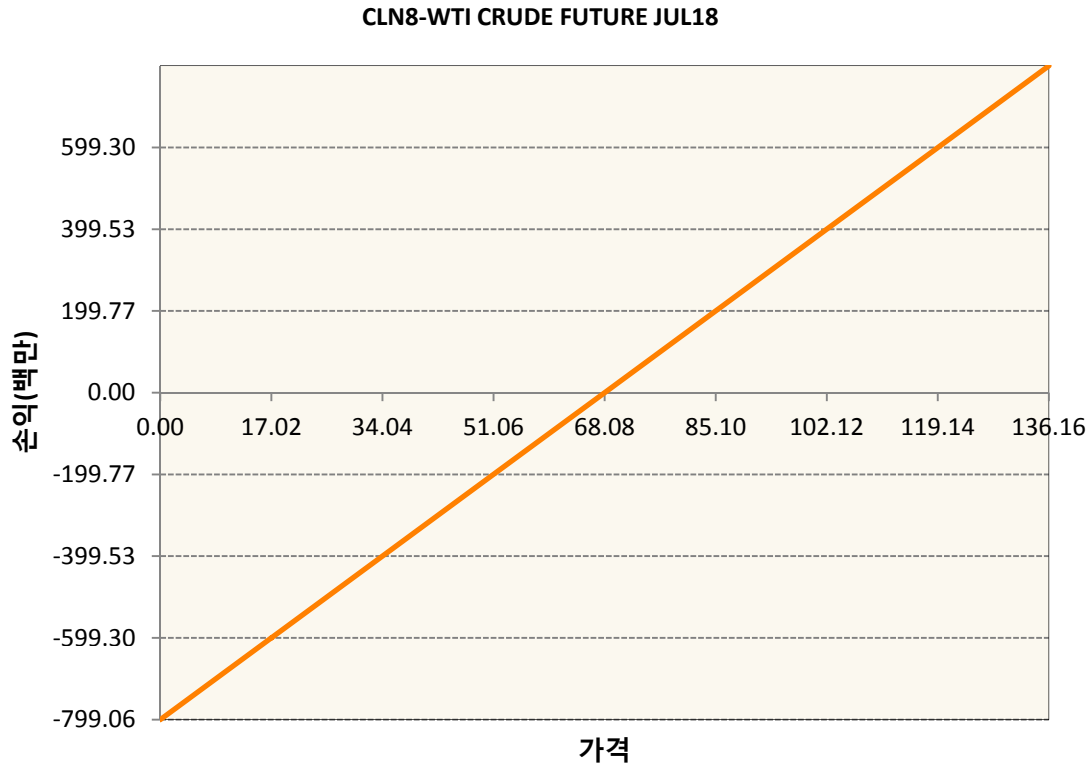
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

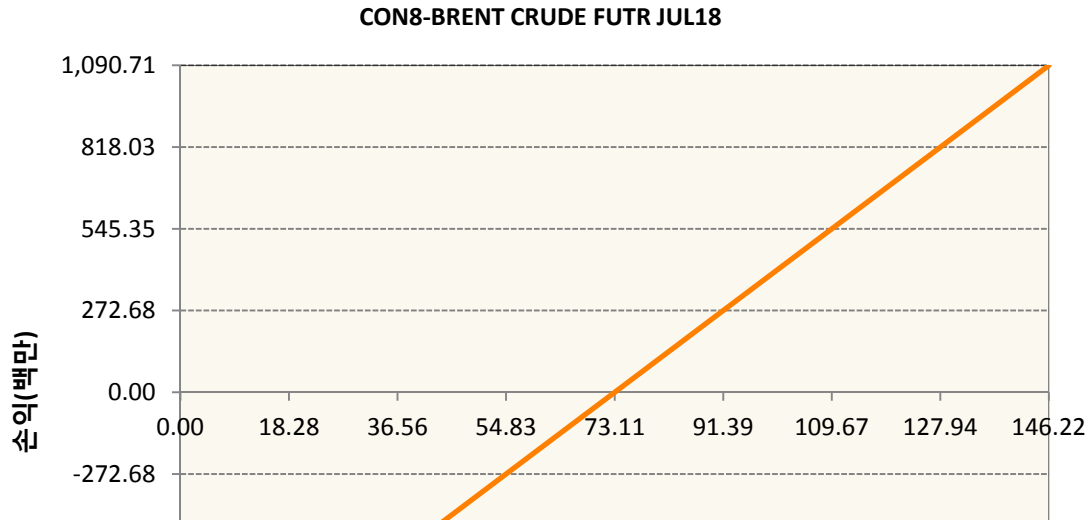
1. 계약금액

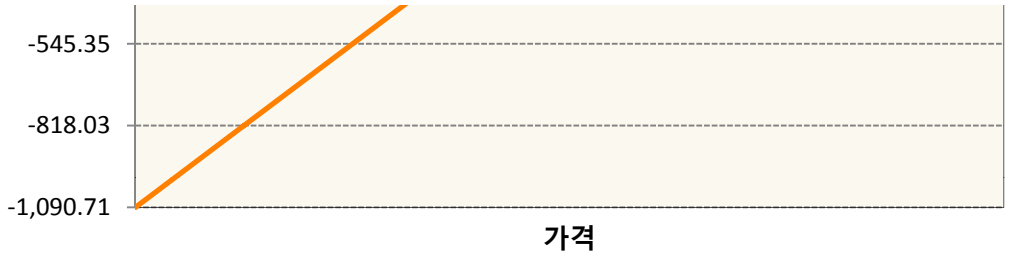
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	4,068	587	3,481	

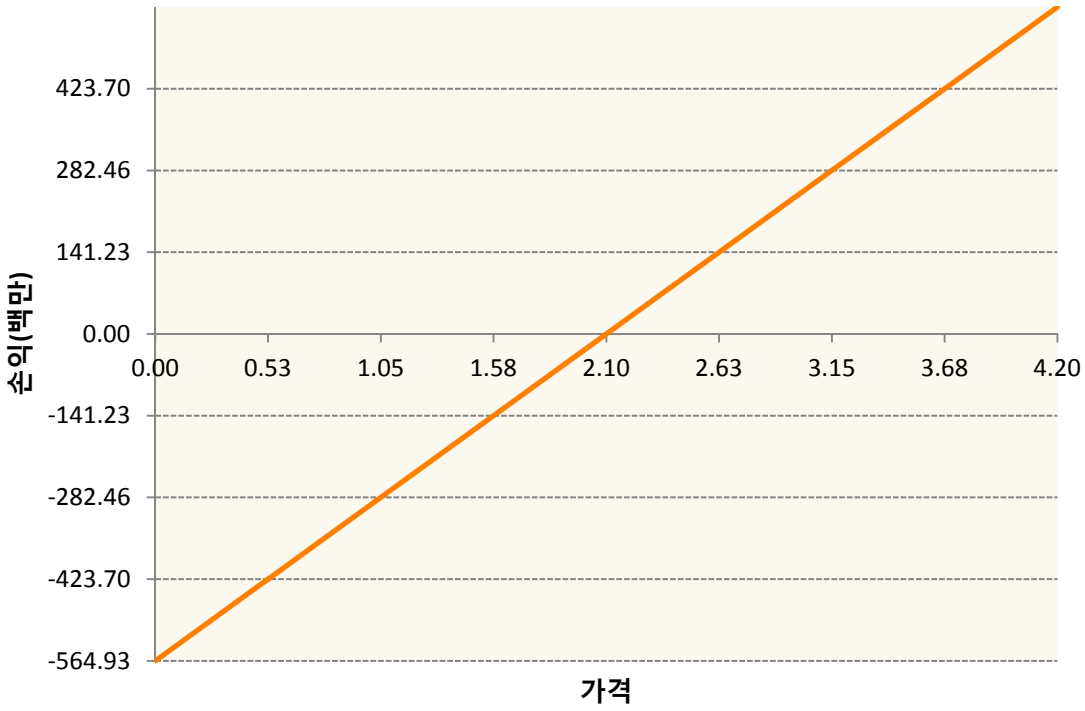
2. 만기시점의 손익구조



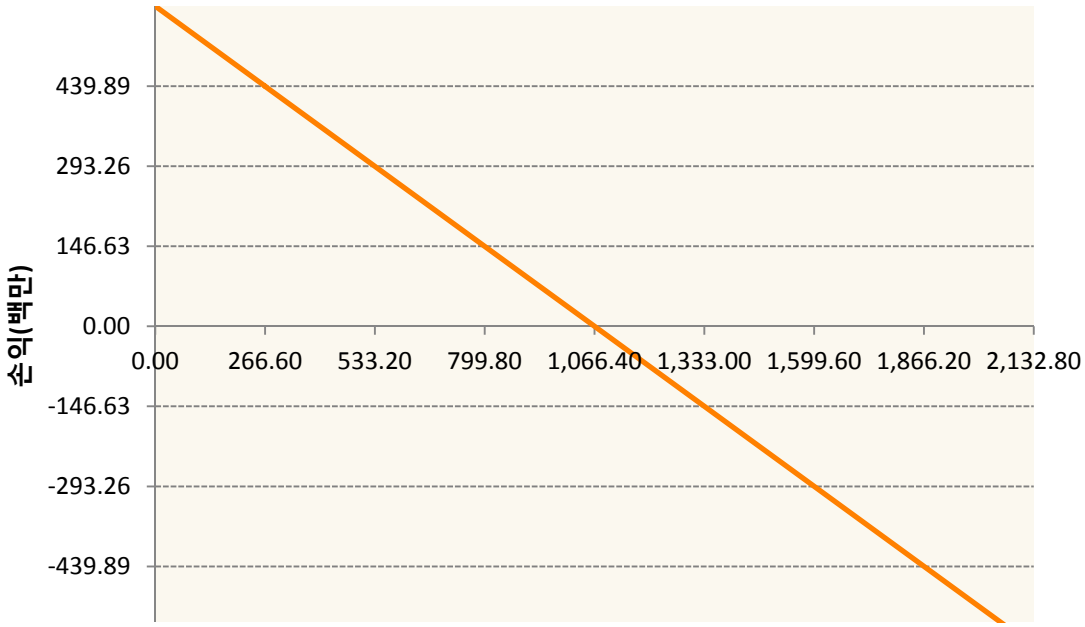


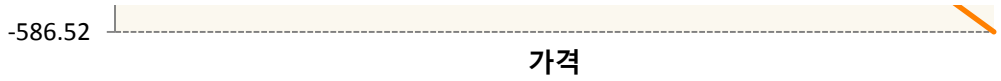


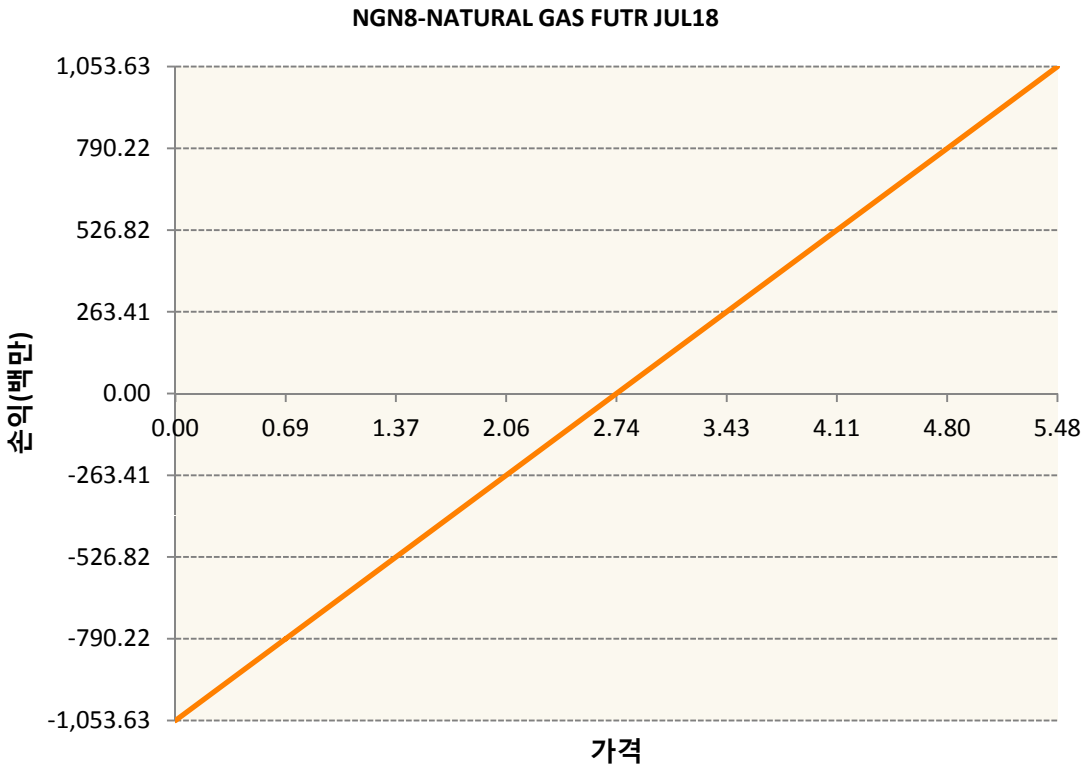
HON8-NY Harb ULSD Fut JUL18

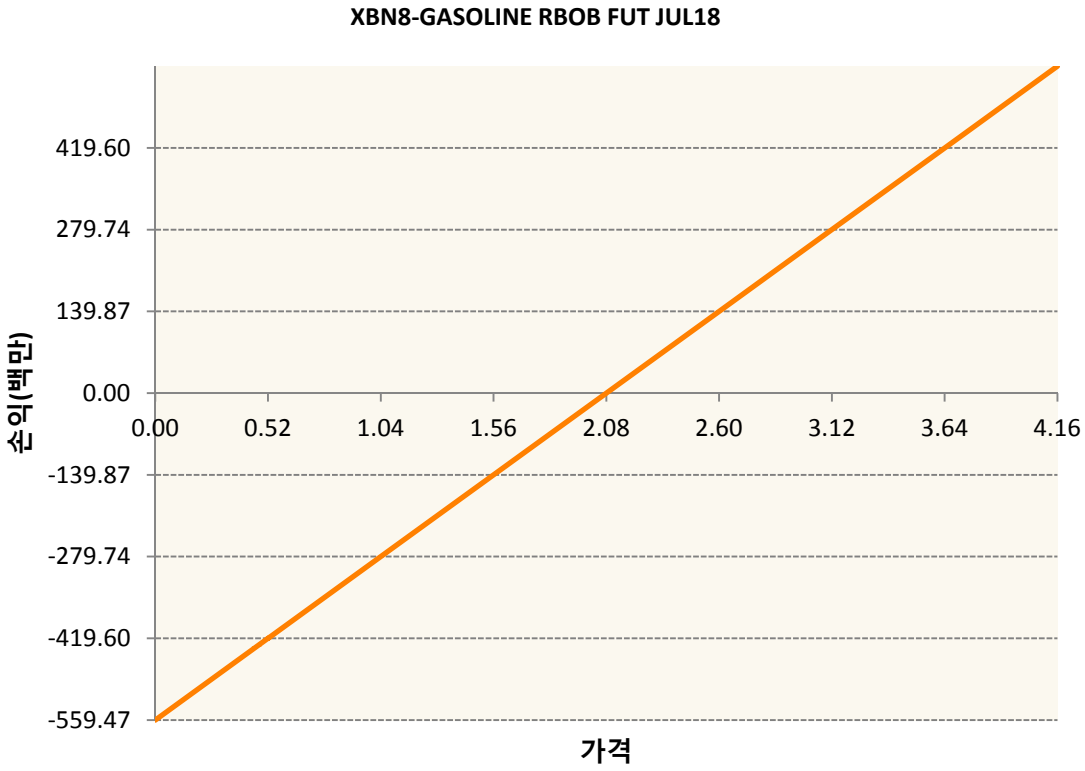


KR4175N50004-2018-05 달러선물




-586.52
가격


NGN8-NATURAL GAS FUTR JUL18
1,053.63
790.22
526.82
263.41
0.00
-263.41
-526.82
-790.22
-1,053.63
0.00
0.69
1.37
2.06
2.74
3.43
4.11
4.80
5.48
손익(백만)
가격


XBN8-GASOLINE RBOB FUT JUL18
419.60
279.74
139.87
0.00
-139.87
-279.74
-419.60
-559.47
0.00
0.52
1.04
1.56
2.08
2.60
3.12
3.64
4.16
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
KR4175N50(	2018-05 달러선물	47
NGN8	NATURAL GAS FUTR JUL18	84
XBN8	GASOLINE RBOB FUT JUL18	45

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

514

공시일	2018-04-23
기준일	2018-04-20

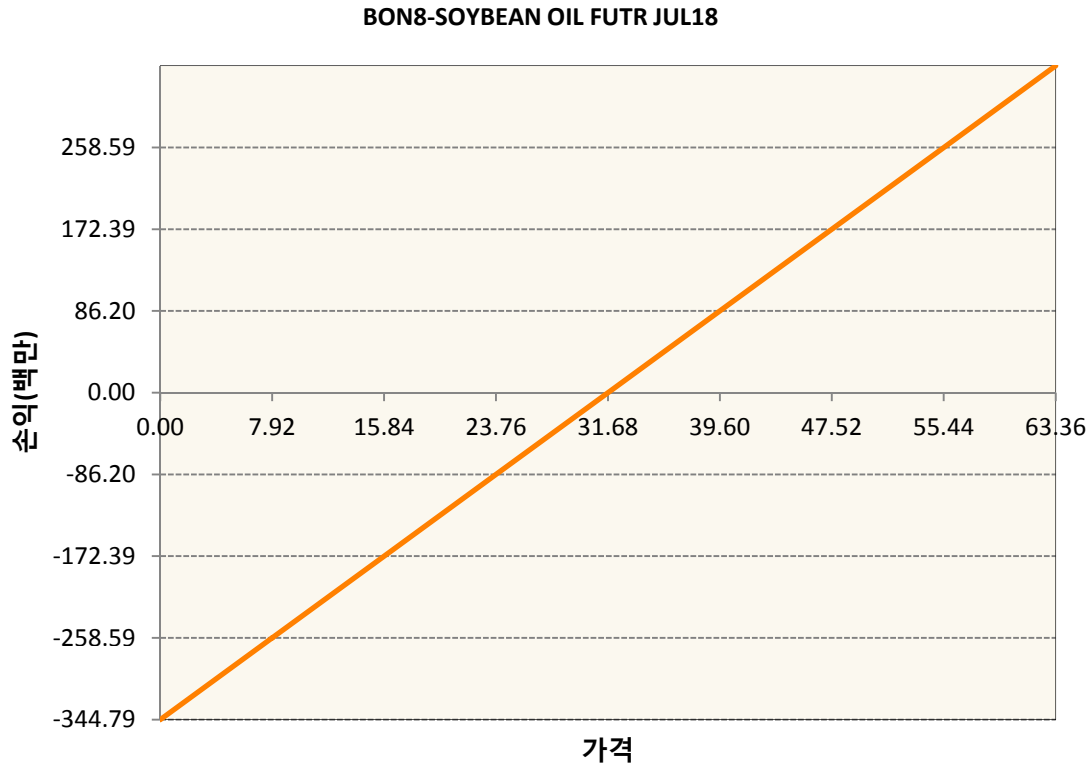
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

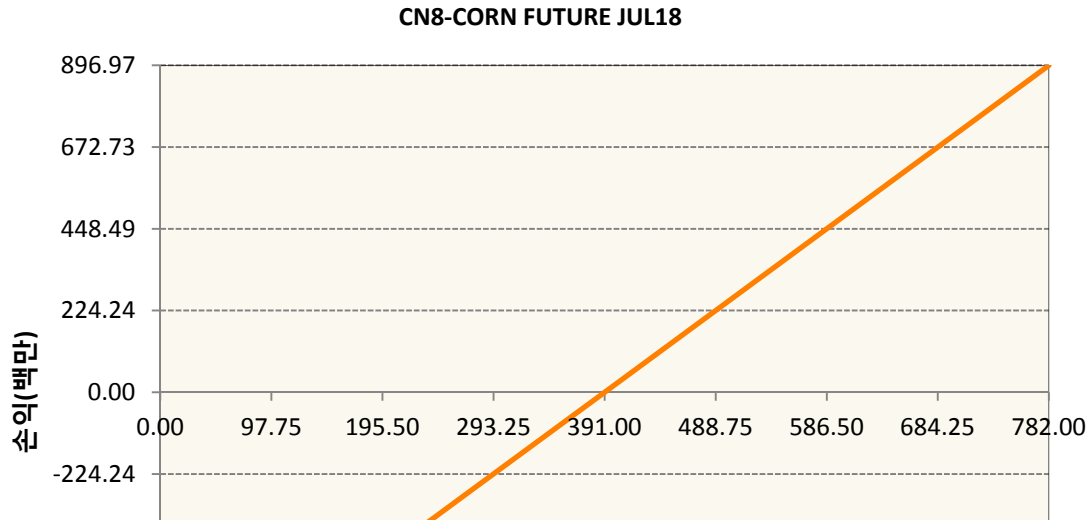
1. 계약금액

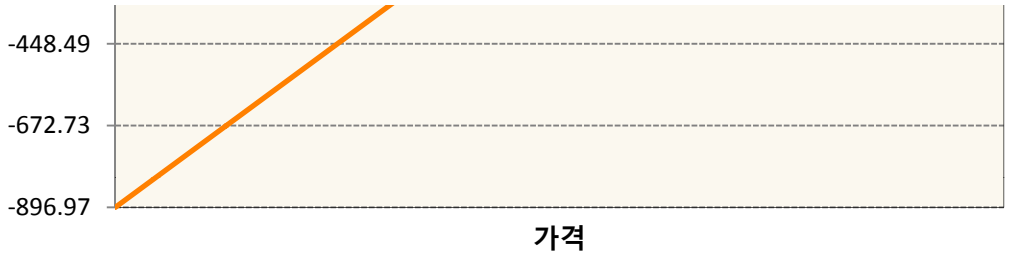
(단위:백만원)

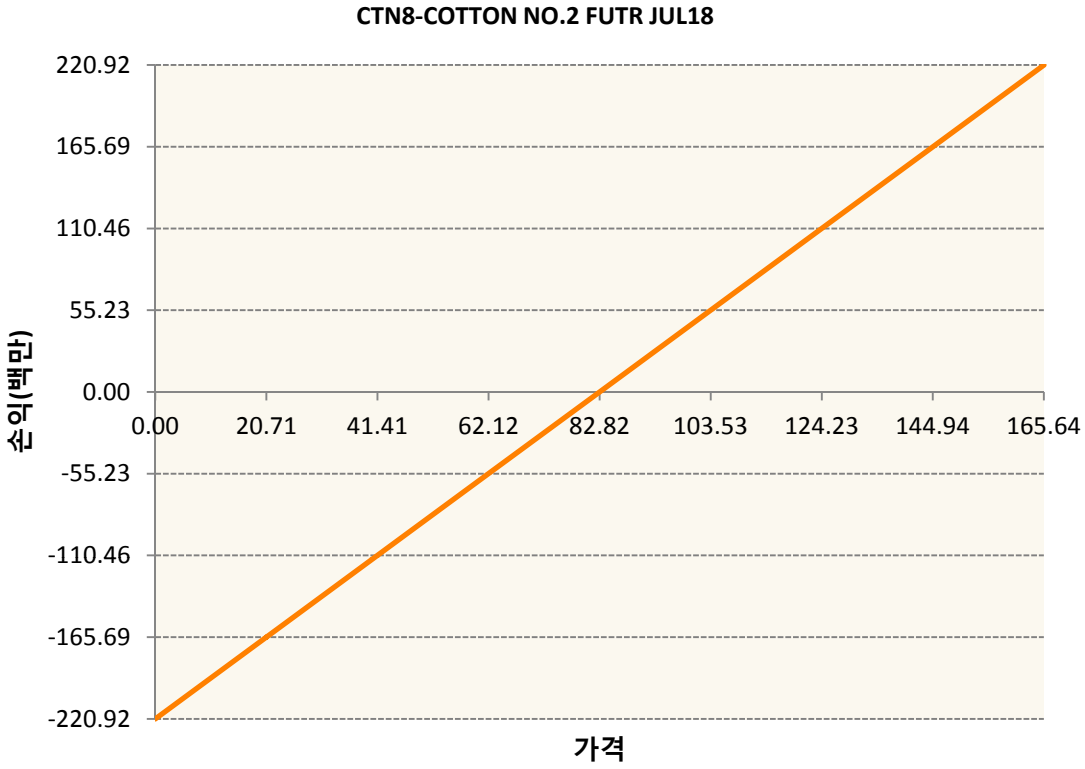
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	4,118	320	3,798	

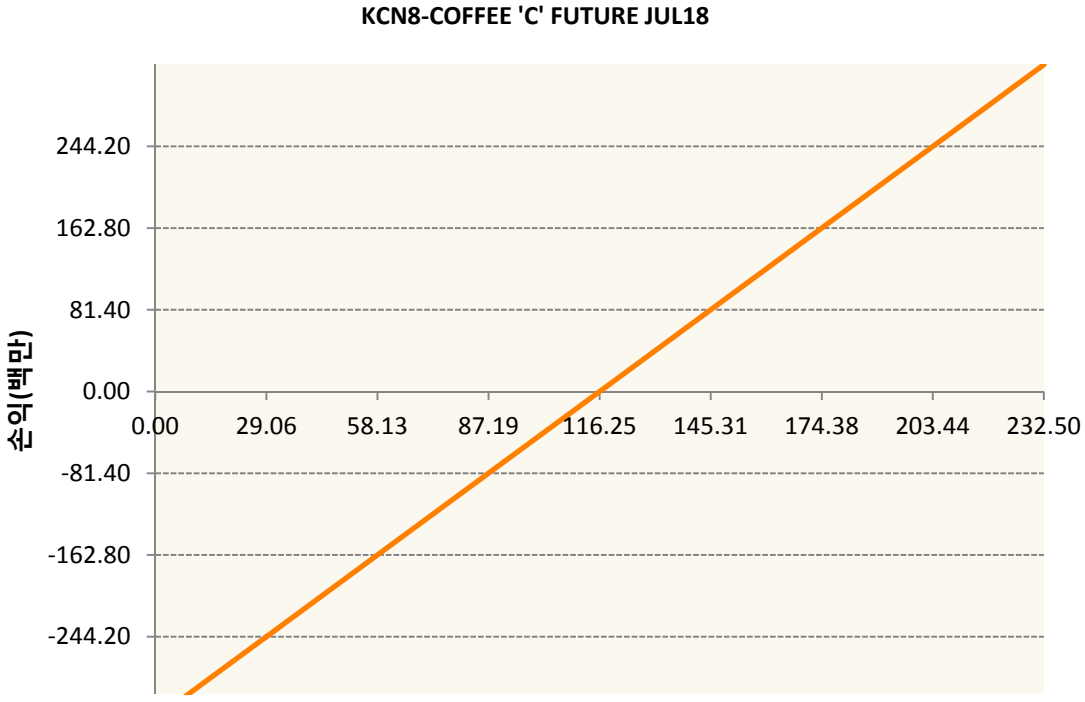
2. 만기시점의 손익구조

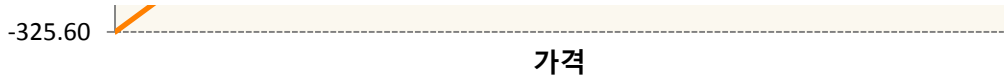


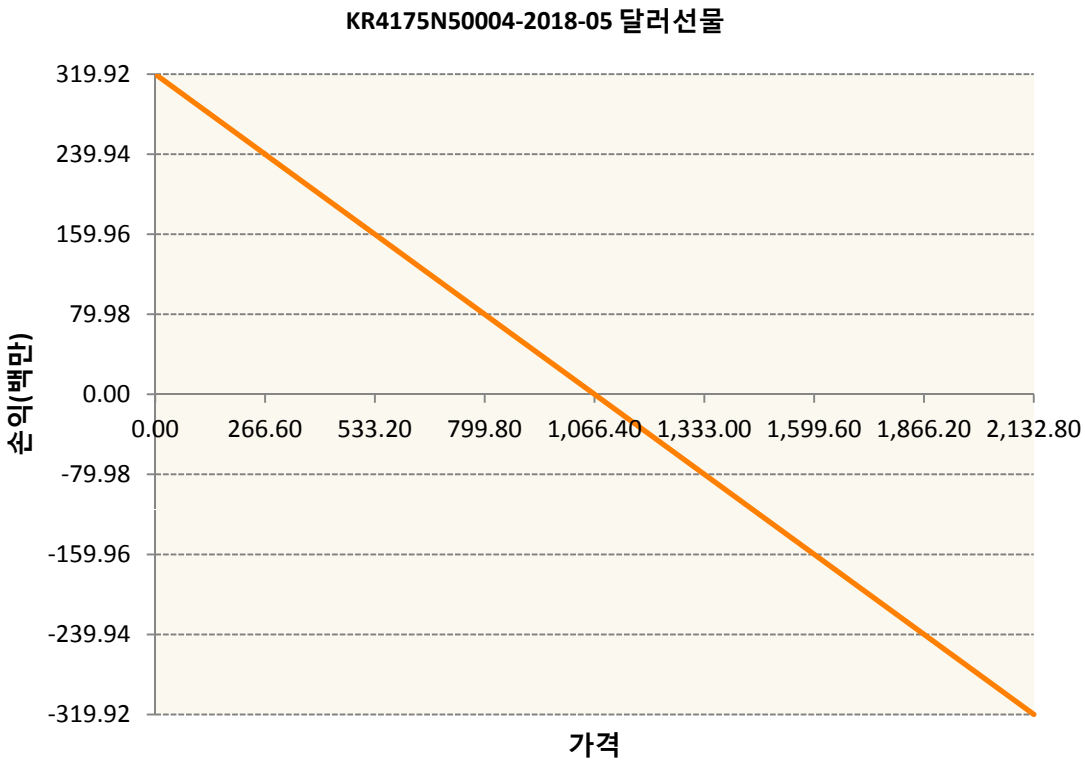


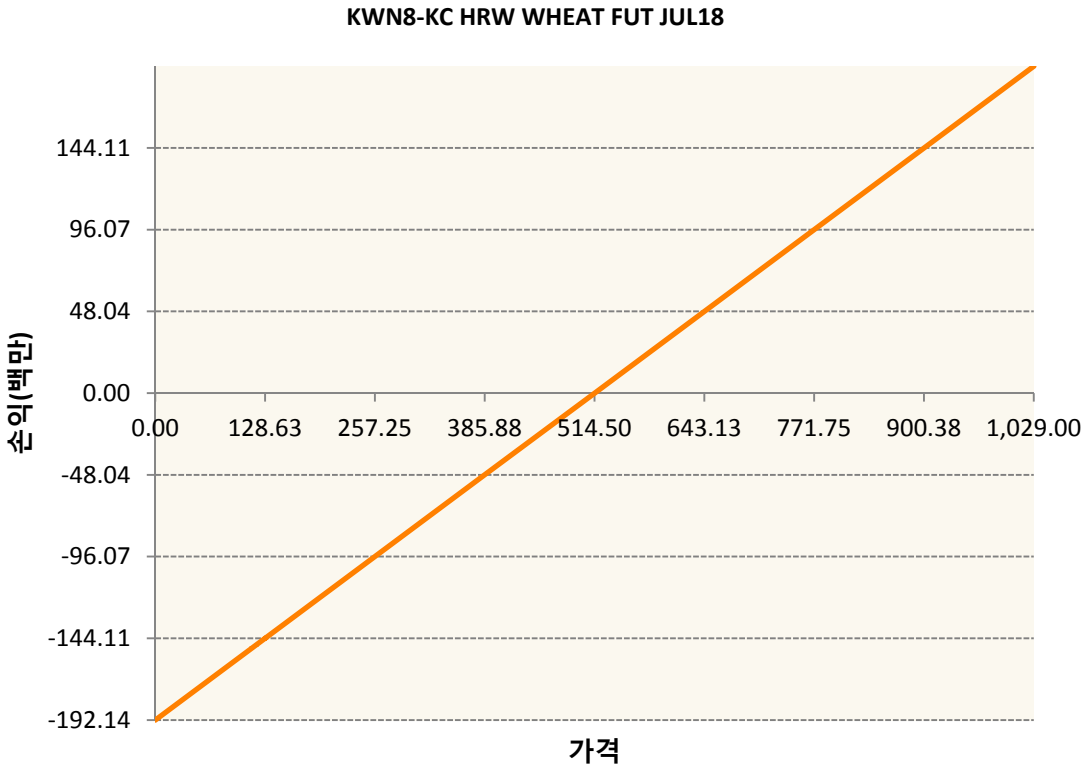

-448.49
-672.73
-896.97
가격


CTN8-COTTON NO.2 FUTR JUL18
220.92
165.69
110.46
55.23
0.00
-55.23
-110.46
-165.69
-220.92
0.00
20.71
41.41
62.12
82.82
103.53
124.23
144.94
165.64
손익(백만)
가격

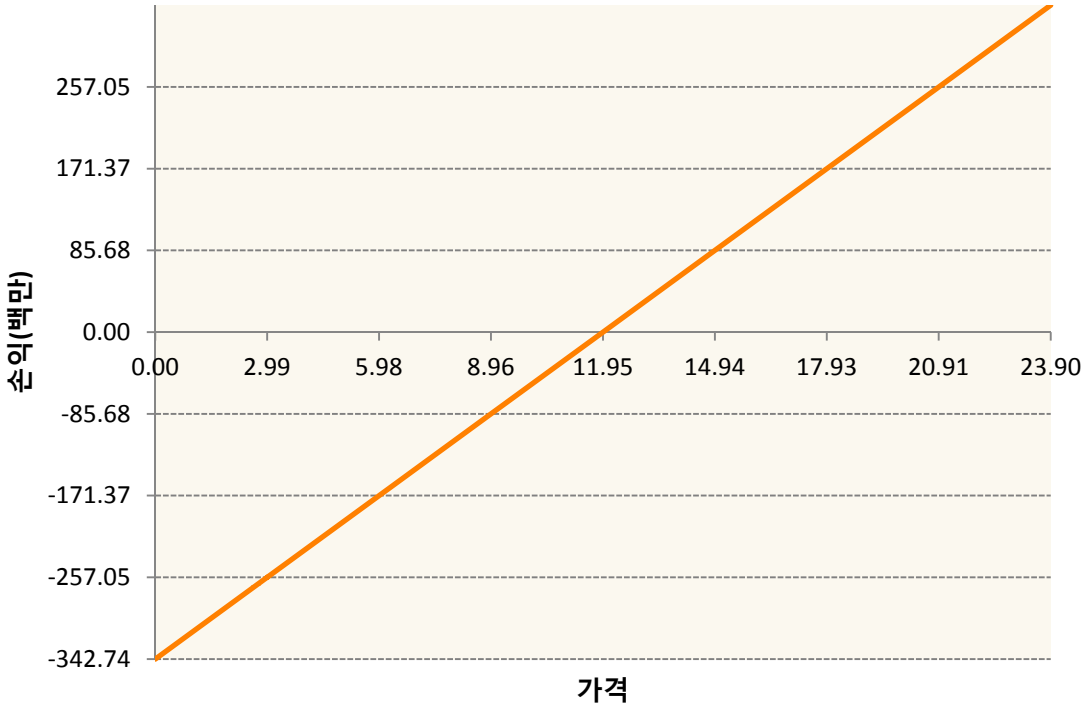

KCN8-COFFEE 'C' FUTURE JUL18
244.20
162.80
81.40
0.00
-81.40
-162.80
-244.20
0.00
29.06
58.13
87.19
116.25
145.31
174.38
203.44
232.50
손익(백만)


-325.60
가격

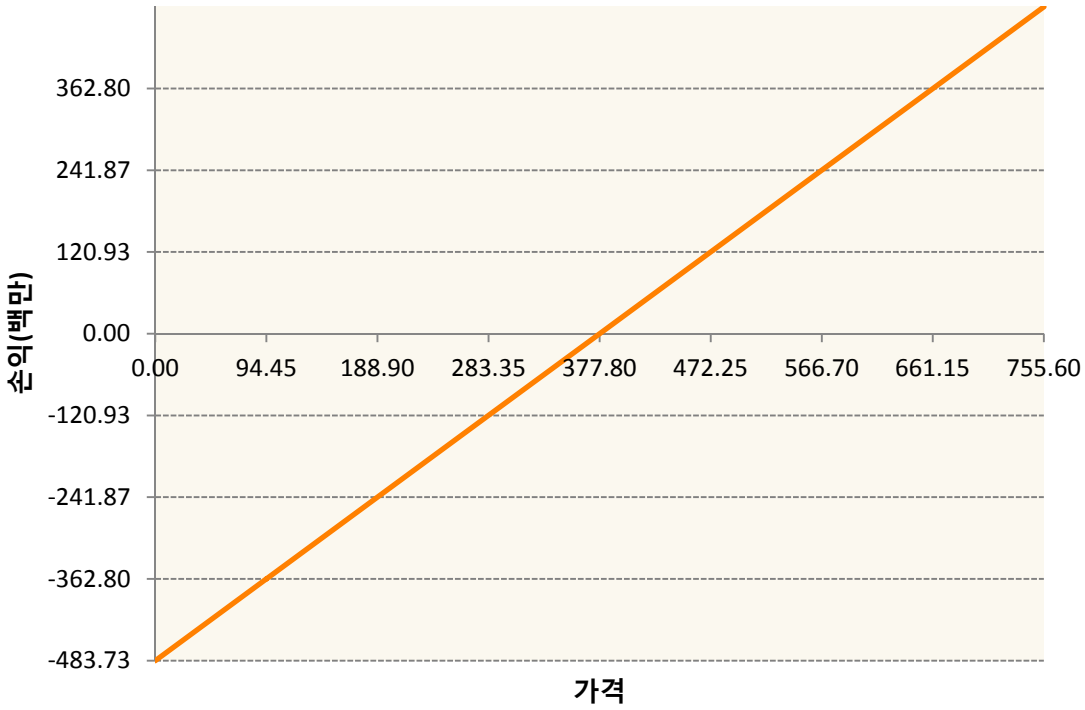

KR4175N50004-2018-05 달러선물
319.92
239.94
159.96
79.98
0.00
-79.98
-159.96
-239.94
-319.92
0.00
266.60
533.20
799.80
1,066.40
1,333.00
1,599.60
1,866.20
2,132.80
손익(백만)
가격


KWN8-KC HRW WHEAT FUT JUL18
144.11
96.07
48.04
0.00
-48.04
-96.07
-144.11
-192.14
0.00
128.63
257.25
385.88
514.50
643.13
771.75
900.38
1,029.00
손익(백만)
가격

SBN8-SUGAR #11 (WORLD) JUL18

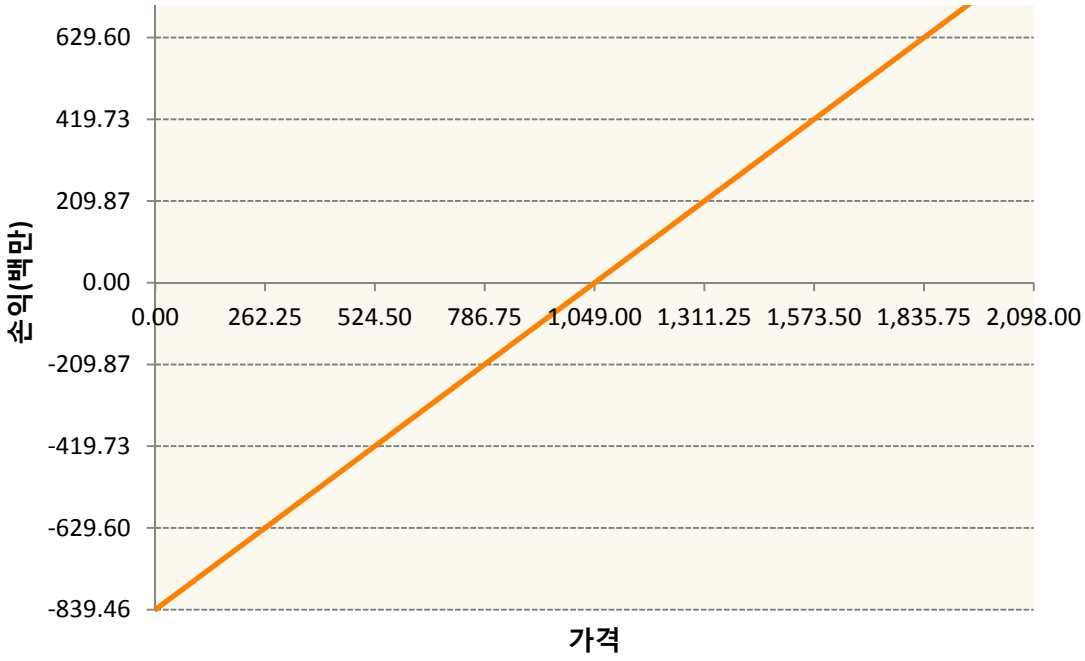


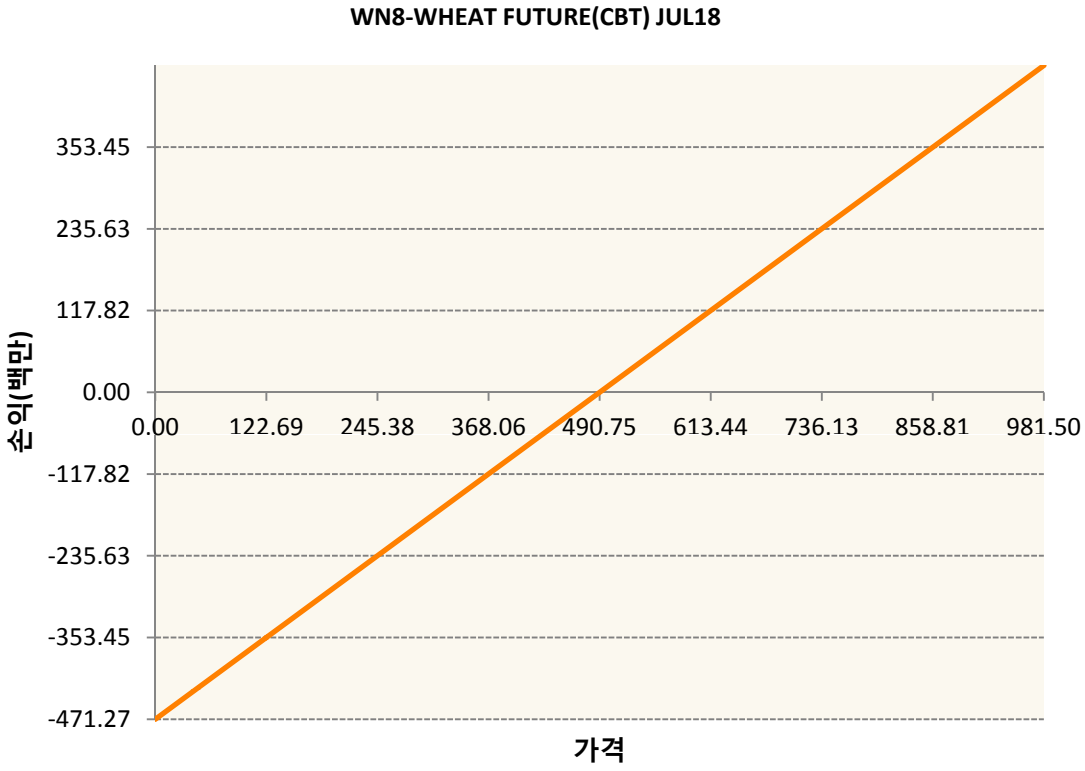
SMN8-SOYBEAN MEAL FUTR JUL18



SN8-SOYBEAN FUTURE JUL18







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

BON8	SOYBEAN OIL FUTR JUL18	28
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	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