공시일	2018-04-24
기준일	2018-04-23

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	2018-04-24
기준일	2018-04-23

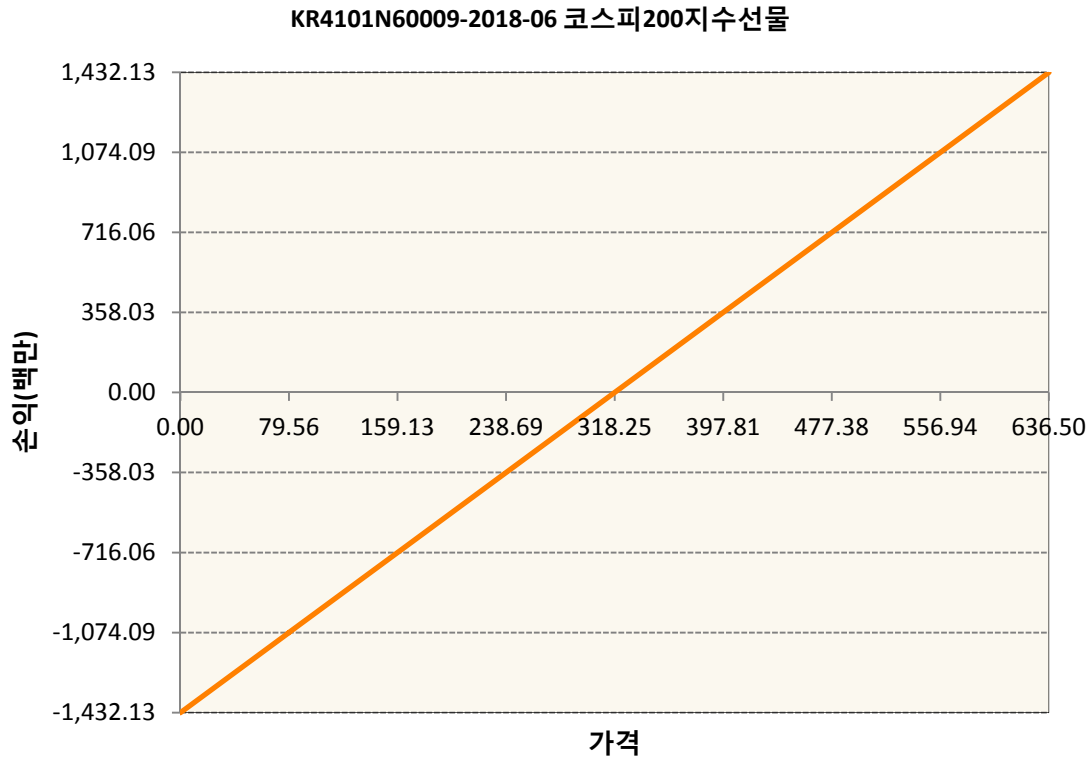
스마트인덱스모

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	1,432	0	1,432	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	2018-04-24
기준일	2018-04-23

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)

452

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2018-04-24
기준일	2018-04-23

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	391

* 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	2018-04-24
기준일	2018-04-23

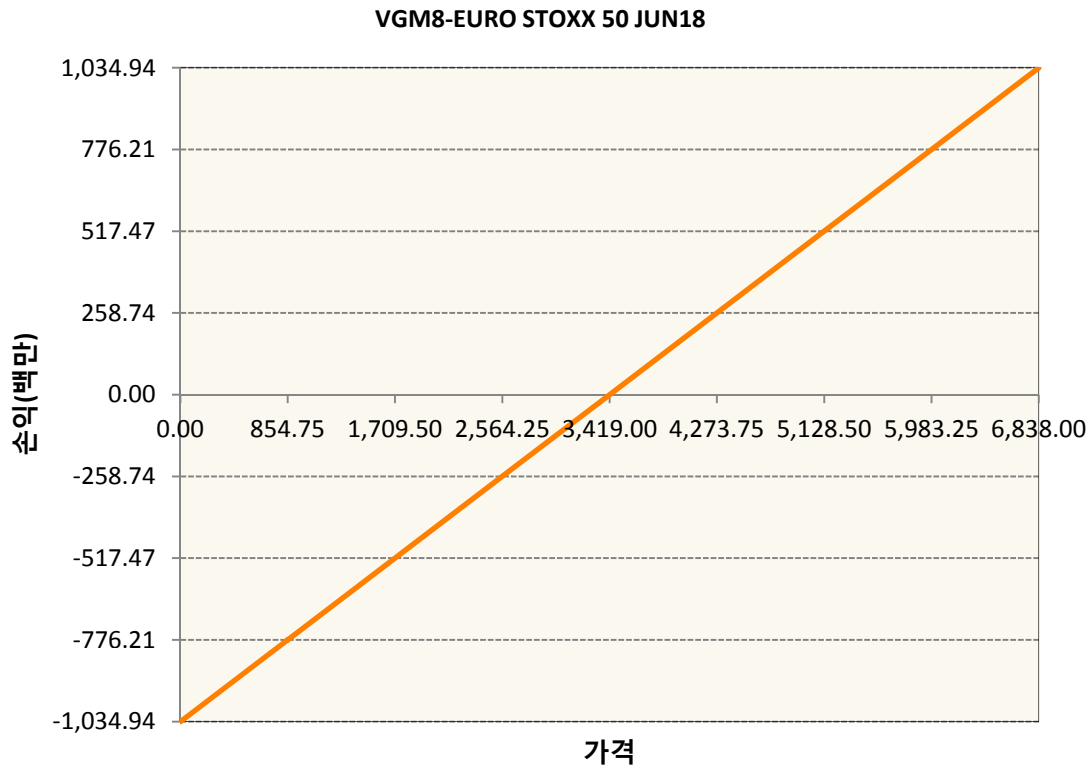
유로인덱스모(주식-파생형)

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	2018-04-24
기준일	2018-04-23

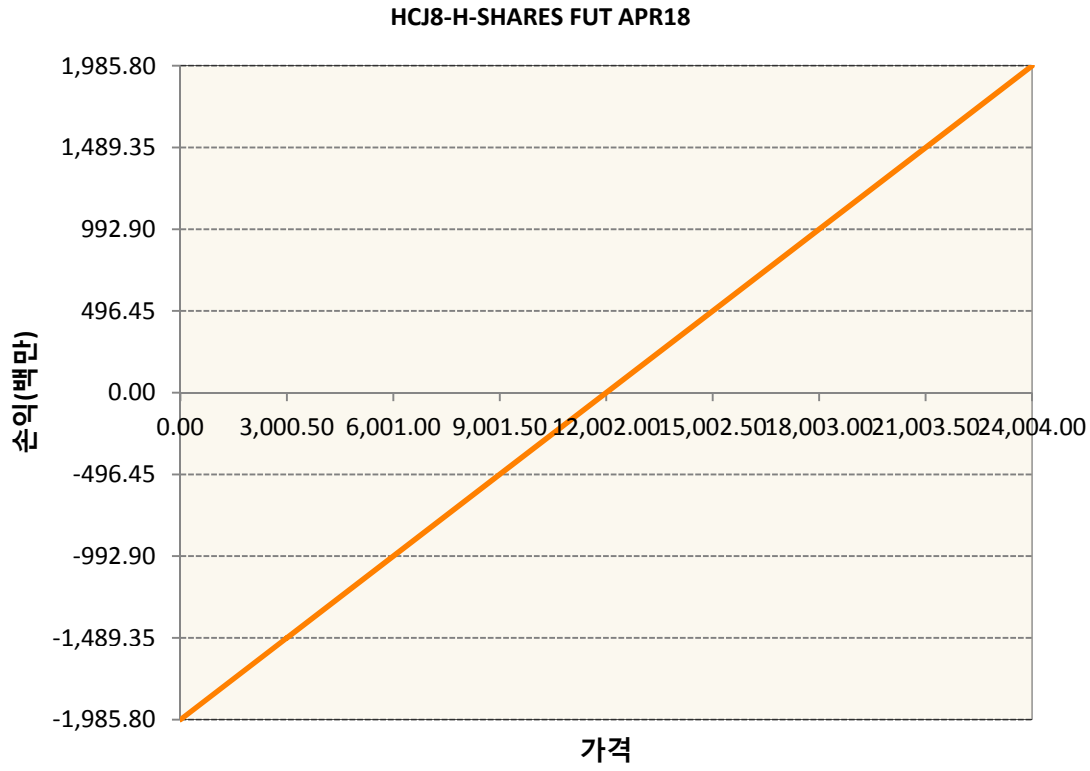
차이나인덱스모(주식-파생형)

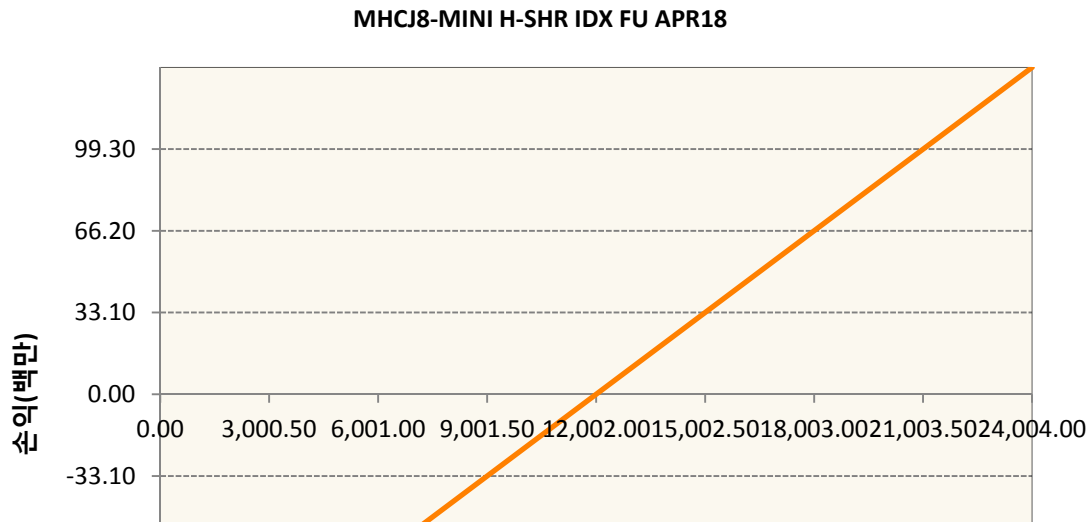
1. 계약금액

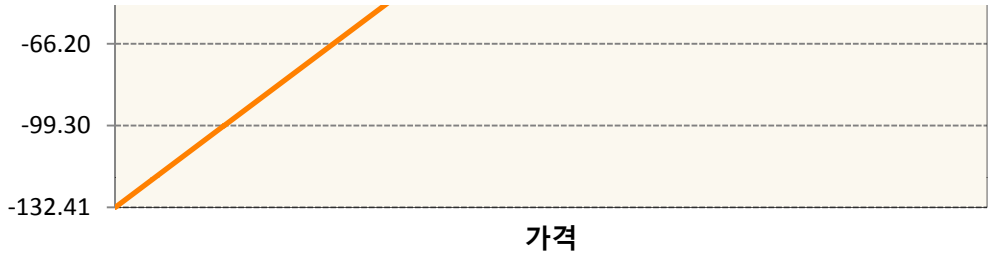
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,118	0	2,118	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	2018-04-24
기준일	2018-04-23

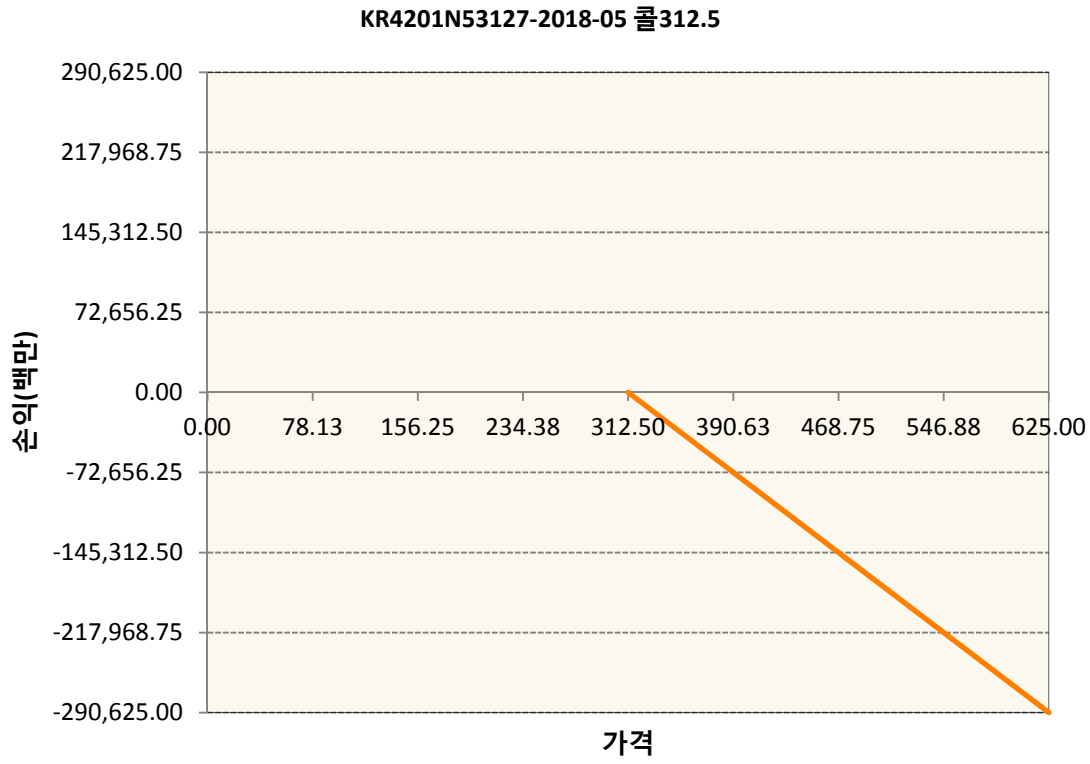
커버드콜모(주식혼합-파생형)

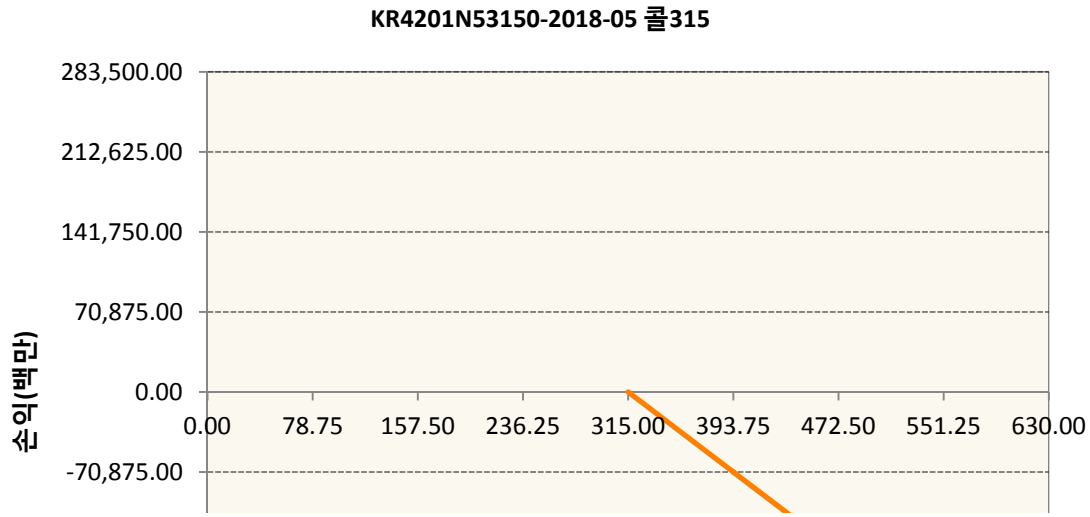
1. 계약금액

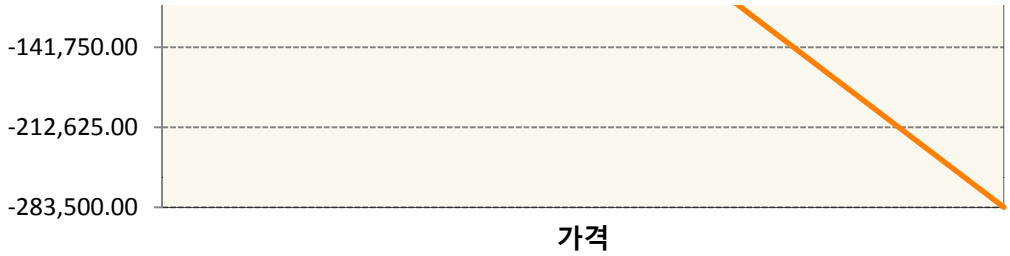
(단위:백만원)

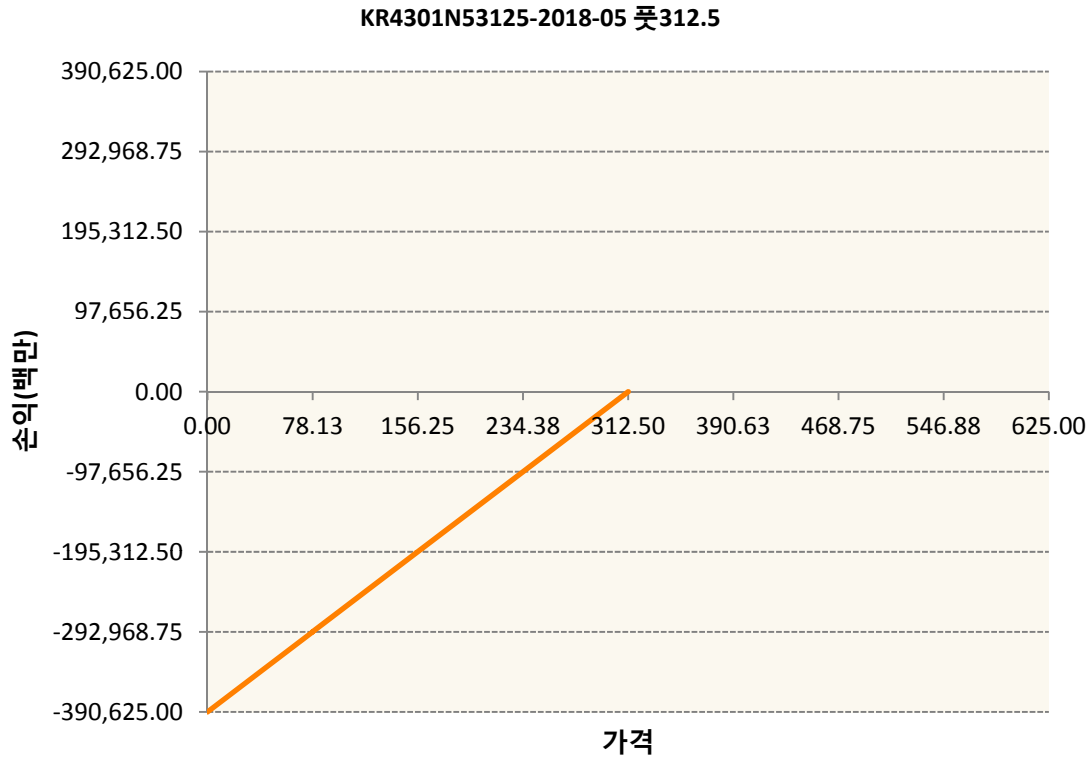
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	964,750	-964,750	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201N5312018-05 콜312.5							20,000
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	9,420	9,208	8,955	8,667	8,347	8,001	7,632
-5.33%	8,369	7,954	7,515	7,056	6,583	6,096	5,600
-2.67%	5,925	5,361	4,795	4,228	3,659	3,089	2,518
0%	1,658	1,111	558	0	-562	-1,127	-1,694
2.67%	-4,287	-4,675	-5,094	-5,538	-6,002	-6,482	-6,976
5.33%	-11,346	-11,553	-11,804	-12,095	-12,419	-12,773	-13,153
8.00%	-18,951	-19,036	-19,157	-19,315	-19,510	-19,739	-20,000
KR4201N5312018-05 콜315							18,675
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	7,950	7,790	7,589	7,352	7,084	6,786	6,464

-5.33%	7,192	6,844	6,466	6,063	5,640	5,201	4,748
-2.67%	5,274	4,753	4,224	3,691	3,154	2,613	2,070
0%	1,675	1,118	560	0	-561	-1,123	-1,685
2.67%	-3,636	-4,069	-4,526	-5,000	-5,489	-5,989	-6,498
5.33%	-10,199	-10,453	-10,747	-11,077	-11,437	-11,823	-12,230
8.00%	-17,439	-17,552	-17,705	-17,896	-18,124	-18,384	-18,675
KR4301N5312018-05 풋312.5							23,244

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-23,070	-23,076	-23,088	-23,108	-23,140	-23,185	-23,244
-5.33%	-12,617	-12,711	-12,831	-12,976	-13,143	-13,330	-13,535
-2.67%	-3,672	-4,011	-4,356	-4,705	-5,057	-5,412	-5,770
0%	892	608	310	0	-320	-647	-980
2.67%	1,849	1,787	1,701	1,591	1,458	1,303	1,129
5.33%	1,917	1,913	1,904	1,888	1,860	1,821	1,767
8.00%	1,919	1,919	1,919	1,917	1,914	1,909	1,899

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

62,935

공시일	2018-04-24
기준일	2018-04-23

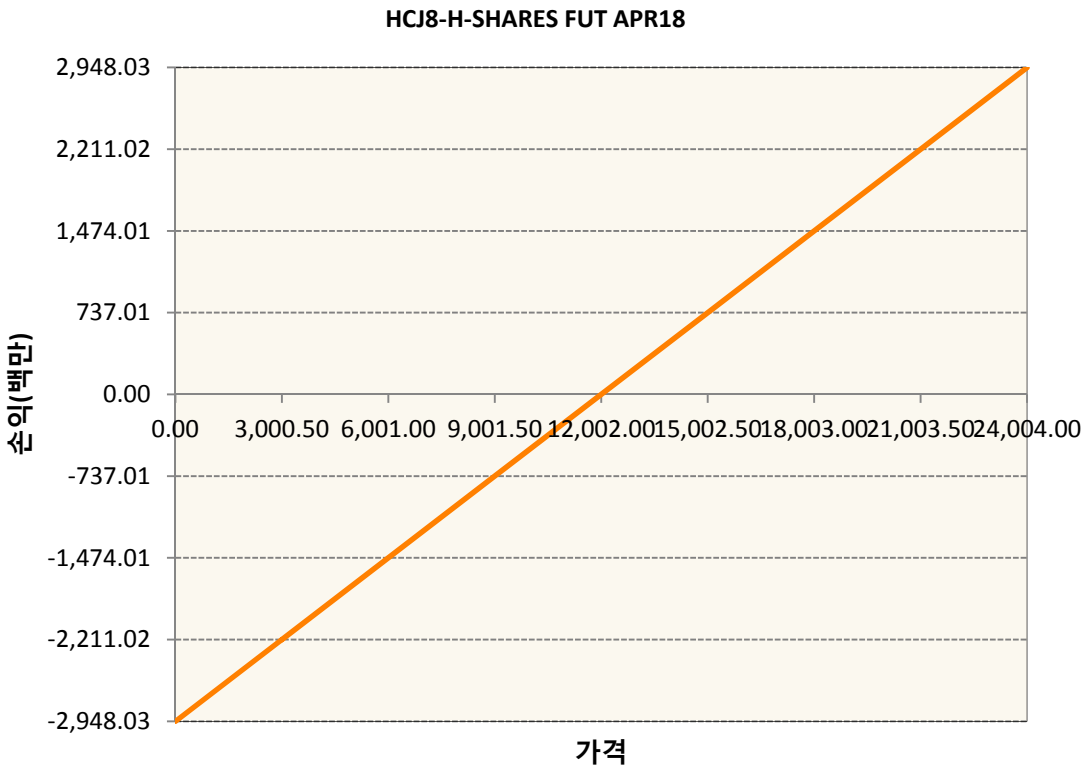
홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생

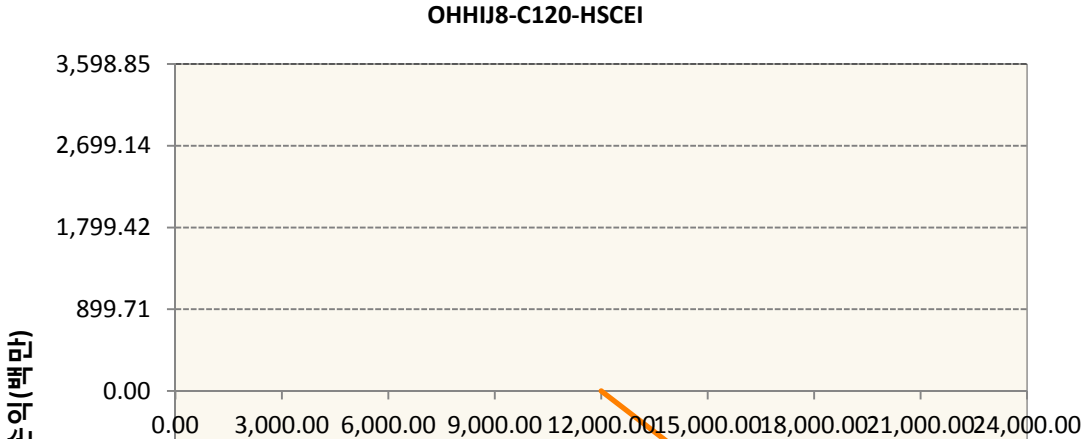
1. 계약금액

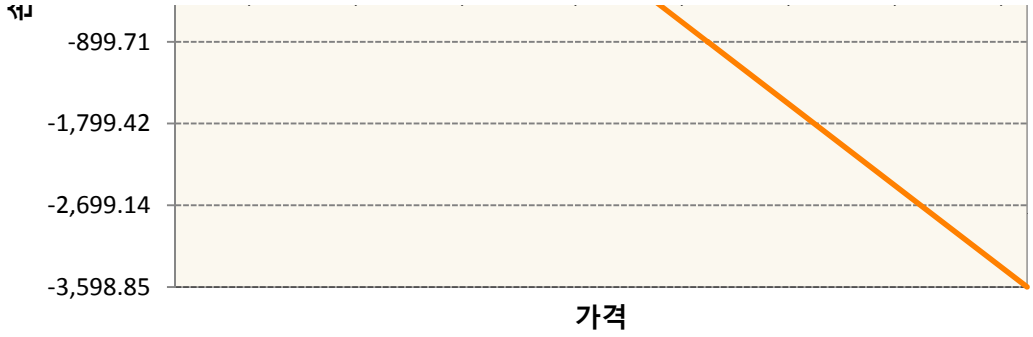
(단위:백만원)

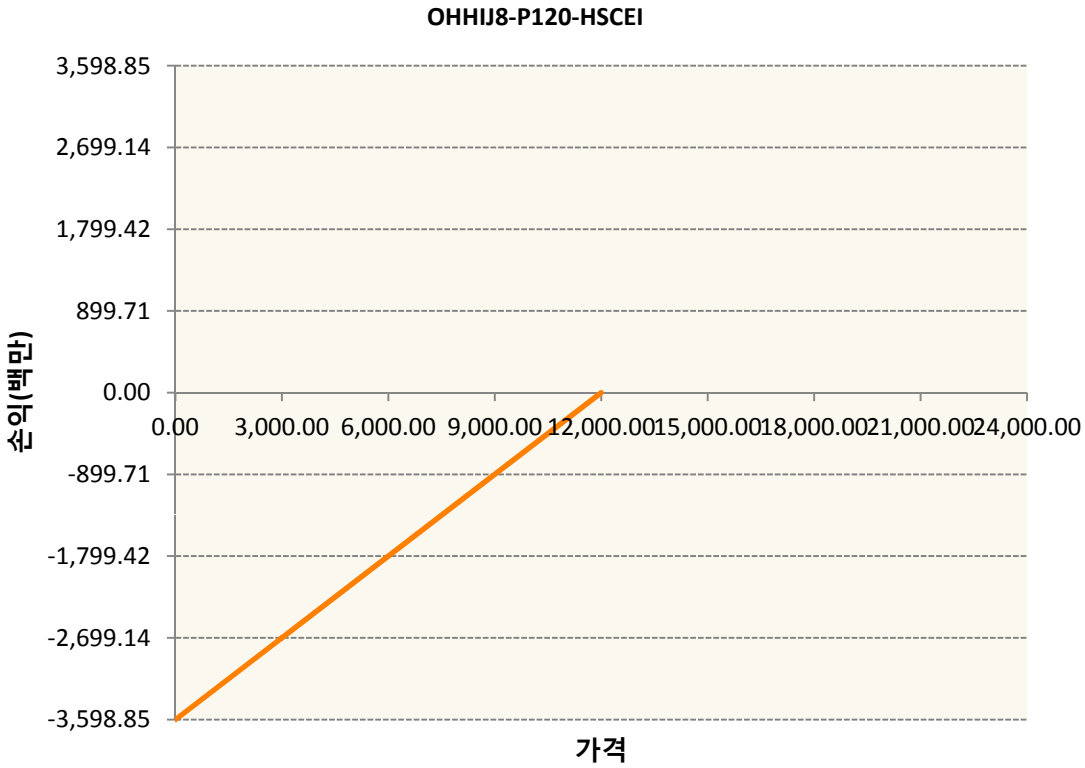
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,948	0	2,948	장내
누계	유가증권	옵션	0	7,198	-7,198	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCJ8	H-SHARES FUT APR18	236
OHHIJ8-C12	HSCEI	288
OHHIJ8-P12	HSCEI	288

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	718

공시일	2018-04-24
기준일	2018-04-23

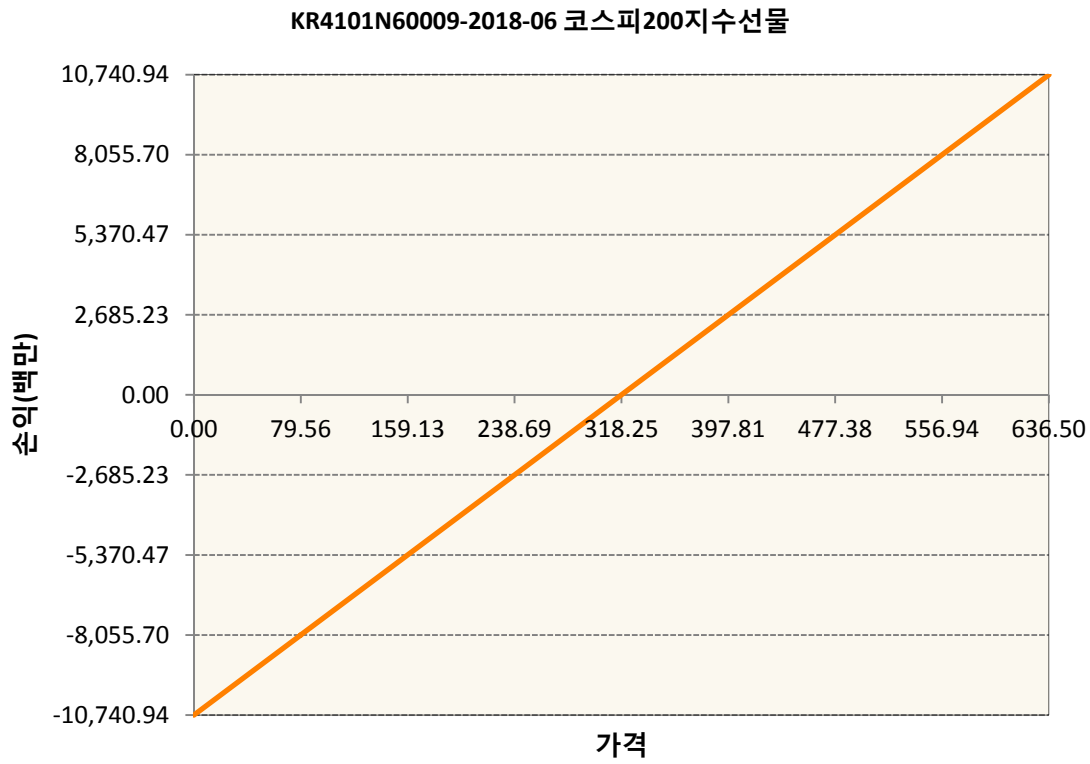
코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼

1. 계약금액

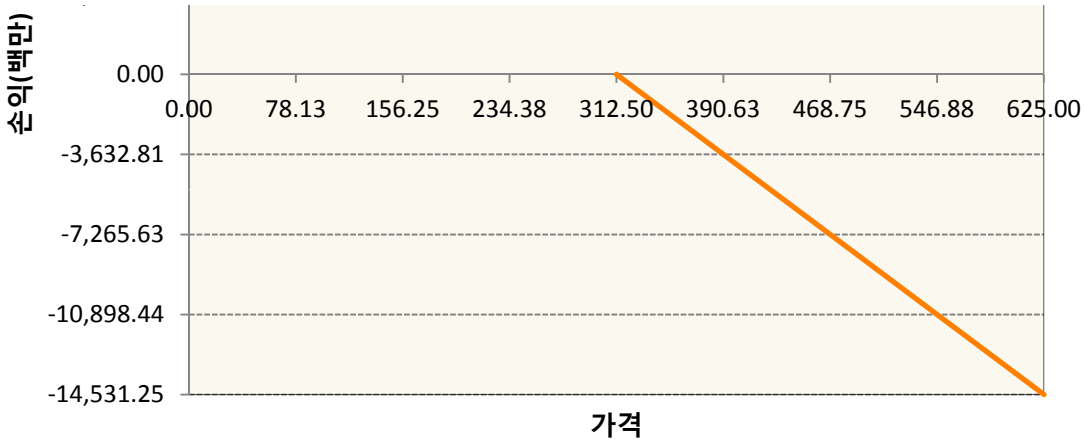
(단위:백만원)

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	10,741	0	10,741	장내
누계	유가증권	스왑	52,200	0	52,200	장외
누계	유가증권	옵션	0	55,754	-55,754	장내

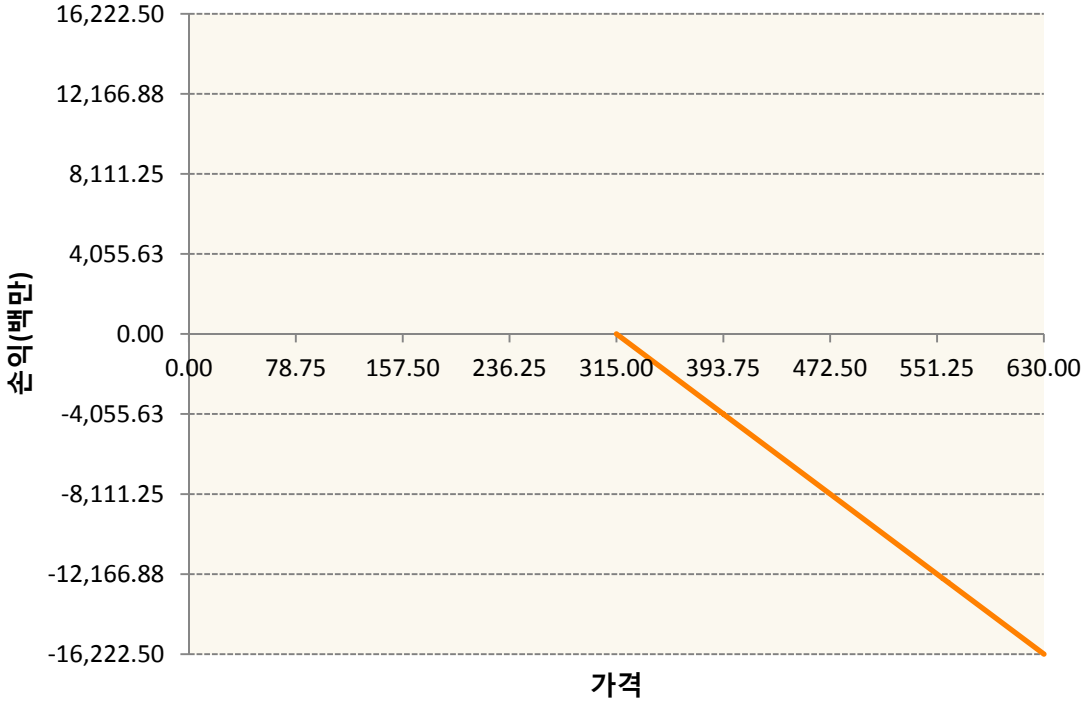
2. 만기시점의 손익구조



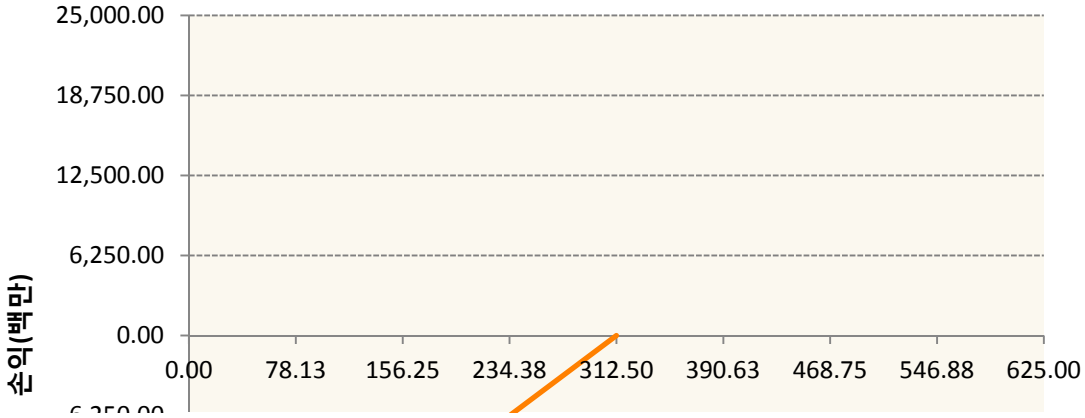




KR4201N53150-2018-05 콜315



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						1,000
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	471	460	448	433	417	400	382
-5.33%	418	398	376	353	329	305	280
-2.67%	296	268	240	211	183	154	126
0%	83	56	28	0	-28	-56	-85
2.67%	-214	-234	-255	-277	-300	-324	-349
5.33%	-567	-578	-590	-605	-621	-639	-658
8.00%	-948	-952	-958	-966	-976	-987	-1,000
	KR4201N531 2018-05 콜315						1,069
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	455	446	434	421	405	388	370
-5.33%	412	392	370	347	323	298	272
-2.67%	302	272	242	211	180	150	118
0%	96	64	32	0	-32	-64	-96
2.67%	-208	-233	-259	-286	-314	-343	-372
5.33%	-584	-598	-615	-634	-654	-677	-700
8.00%	-998	-1,004	-1,013	-1,024	-1,037	-1,052	-1,069
	KR4301N531 2018-05 풋312.5						1,488

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,477	-1,477	-1,478	-1,479	-1,481	-1,484	-1,488
-5.33%	-807	-813	-821	-830	-841	-853	-866
-2.67%	-235	-257	-279	-301	-324	-346	-369
0%	57	39	20	0	-20	-41	-63
2.67%	118	114	109	102	93	83	72
5.33%	123	122	122	121	119	117	113
8.00%	123	123	123	123	123	122	122

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

8,367

공시일	2018-04-24
기준일	2018-04-23

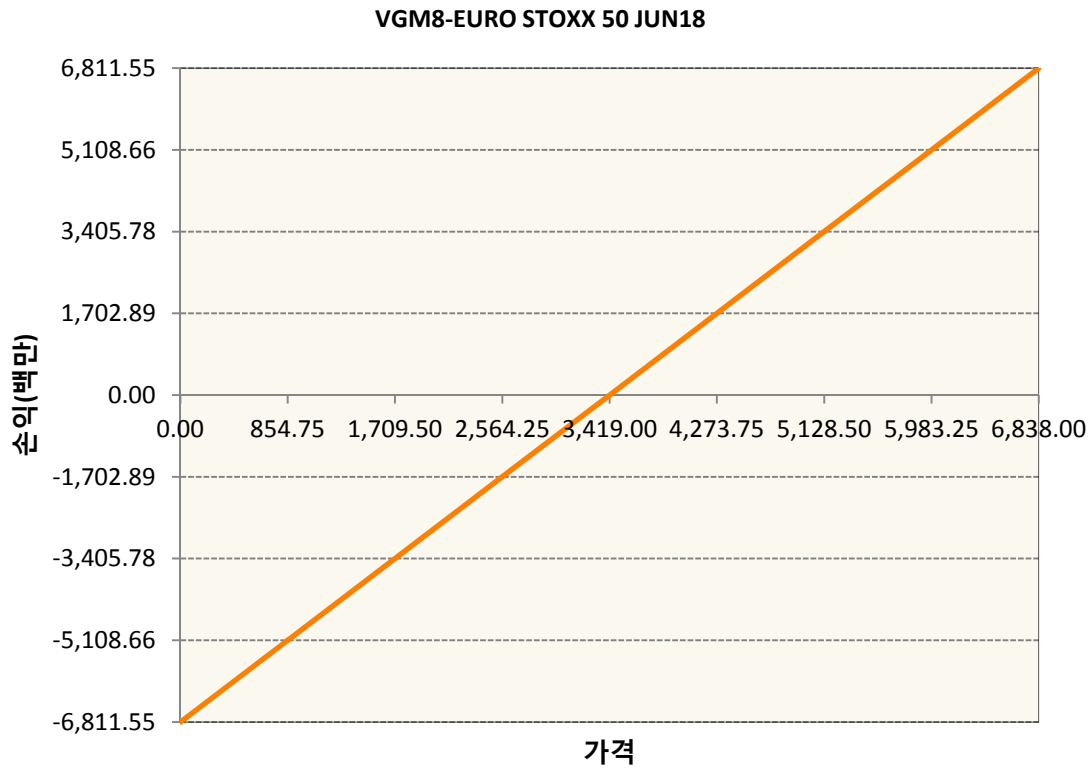
유로커버드콜모(주식혼합-파생형

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	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	6,812	0	6,812	
누계	유가증권	스왑	75,846	0	75,846	장외
누계	지수	스왑	52,525	0	52,525	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

260105SGPX	SG EURO Covered CALL STRATEGY - 994.569	0
260105SQPX	SG EURO Covered CALL STRATEGY	0
VGM8	EURO STOXX 50 JUN18	545

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

334

공시일	2018-04-24
기준일	2018-04-23

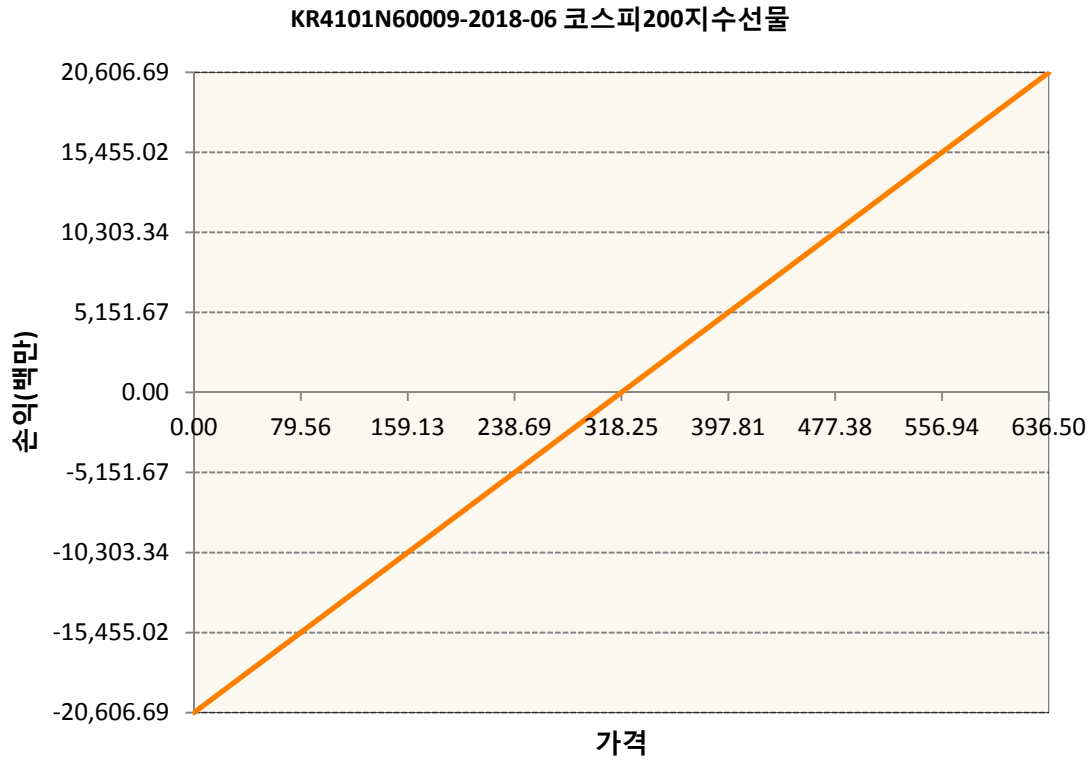
ETF스마트레버리지목표전환형8호

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	20,607	0	20,607	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)

1,203

공시일	2018-04-24
기준일	2018-04-23

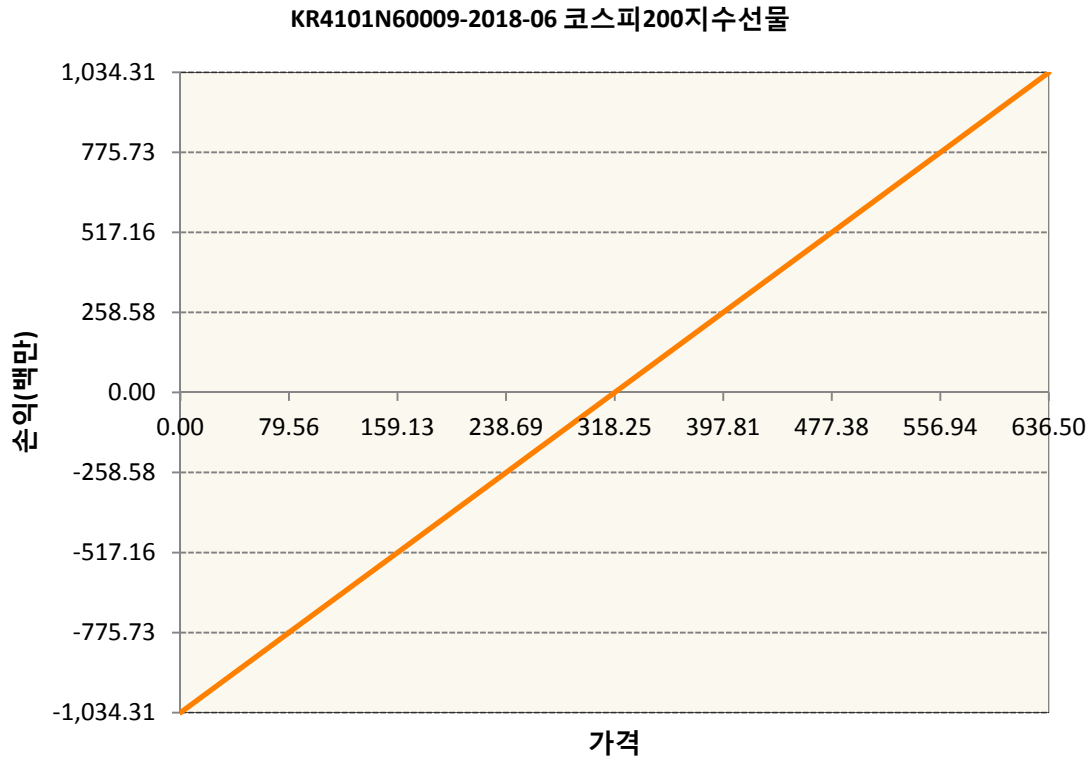
ETF스마트레버리지목표전환형9호

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)

60

공시일	2018-04-24
기준일	2018-04-23

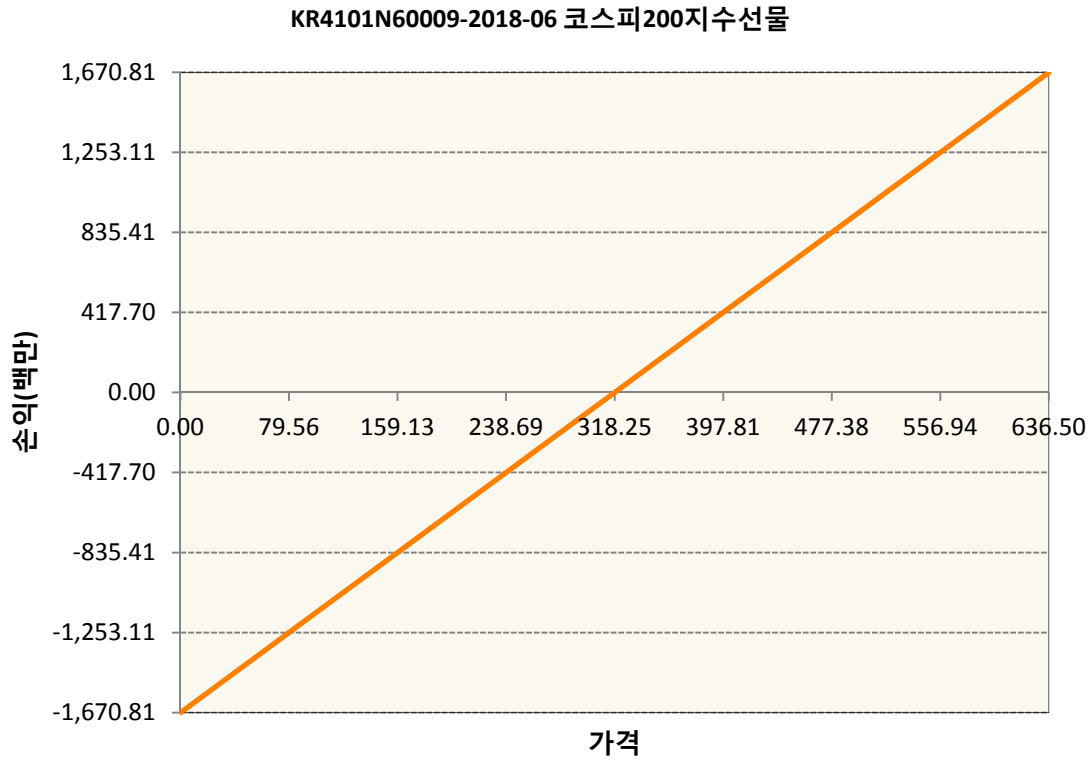
ETF스마트레버리지목표전환형10

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	1,671	0	1,671	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	2018-04-24
기준일	2018-04-23

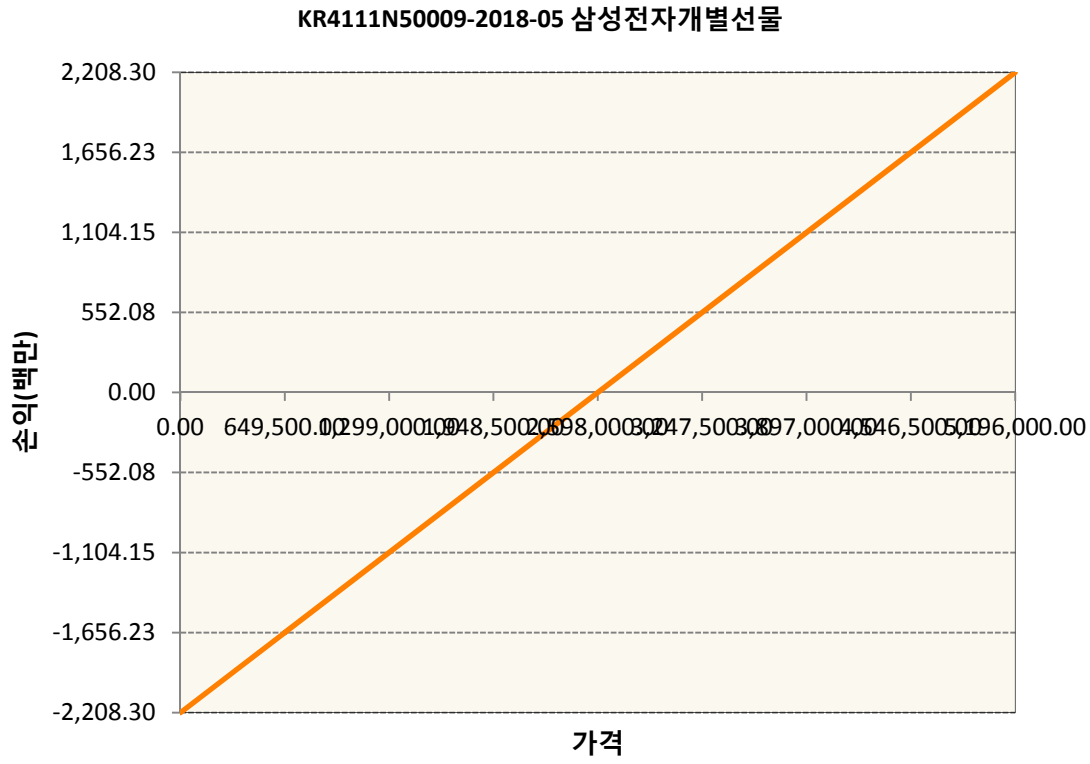
스마트KRX300인덱스1호(주식-파

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	2,208	0	2,208	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%	-118	-118	-118	-118	-118	-118	-118
-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%	118	118	118	118	118	118	118
8.00%	176	176	176	176	176	176	176

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

222

공시일	2018-04-24
기준일	2018-04-23

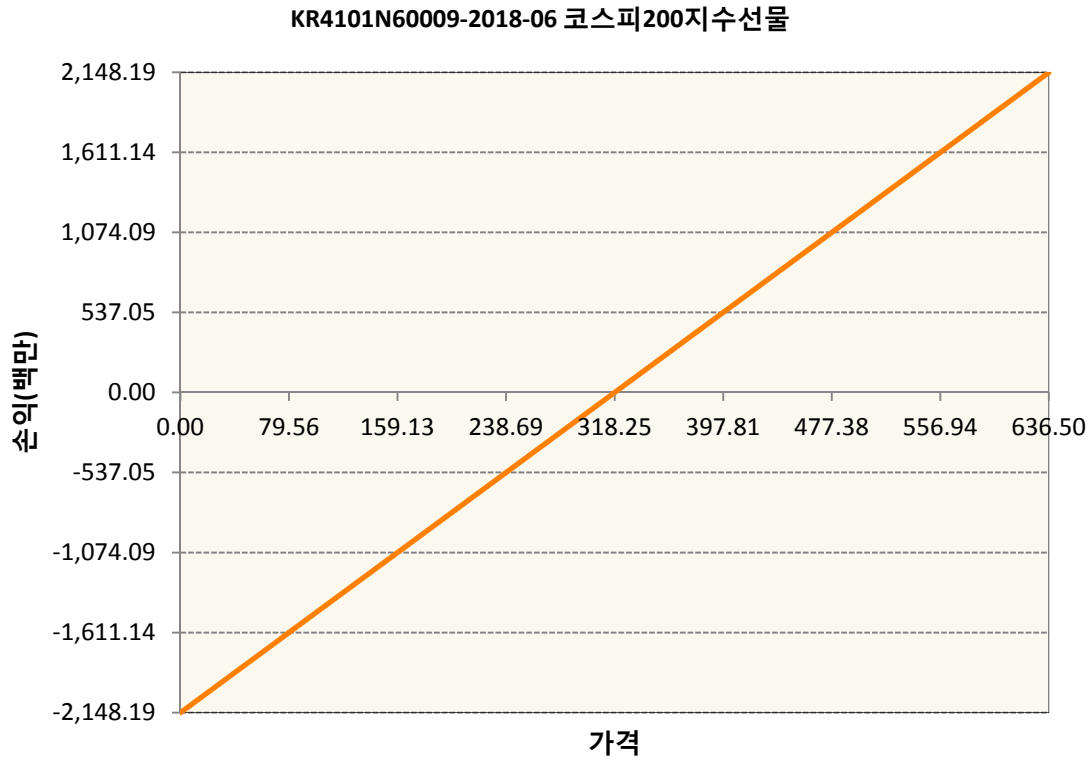
스마트KRX300인덱스목표전환형1

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	2,148	0	2,148	장내
누계	유가증권	선물	2,148	0	2,148	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101N60(2018-06 코스피200지수선물							172
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-172	-172	-172	-172	-172	-172	-172
-5.33%	-114	-114	-114	-114	-114	-114	-114
-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%	114	114	114	114	114	114	114
8.00%	172	172	172	172	172	172	172

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

125

공시일	2018-04-24
기준일	2018-04-23

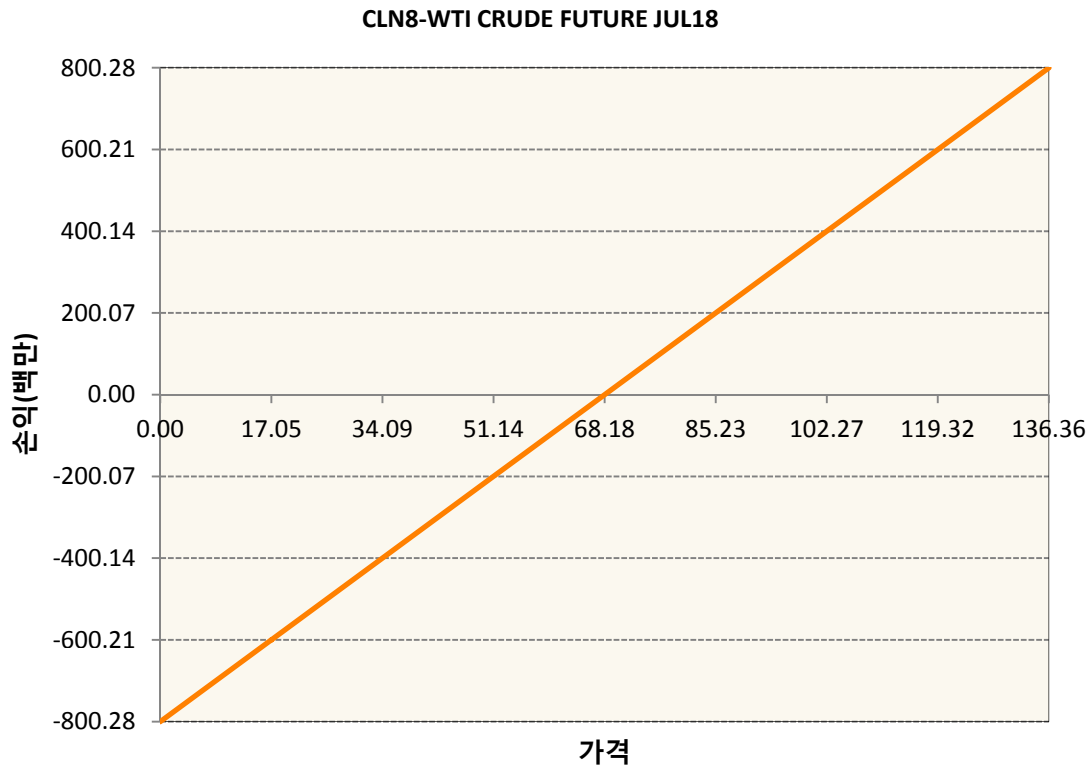
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

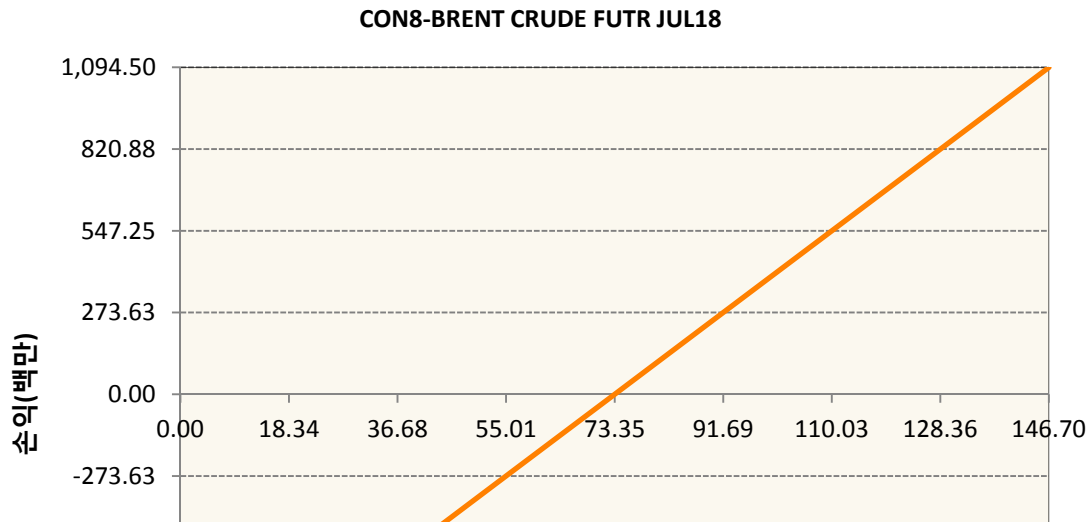
1. 계약금액

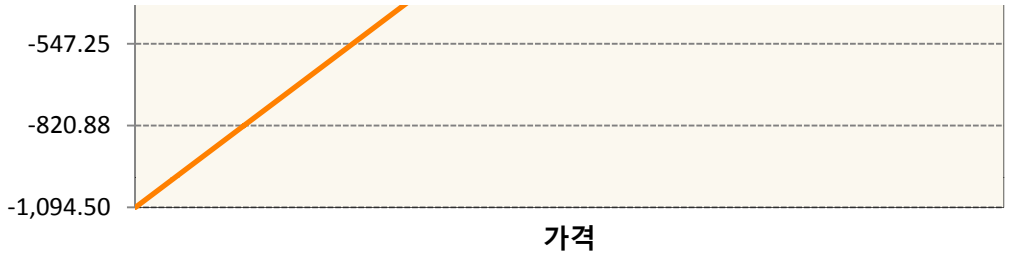
(단위:백만원)

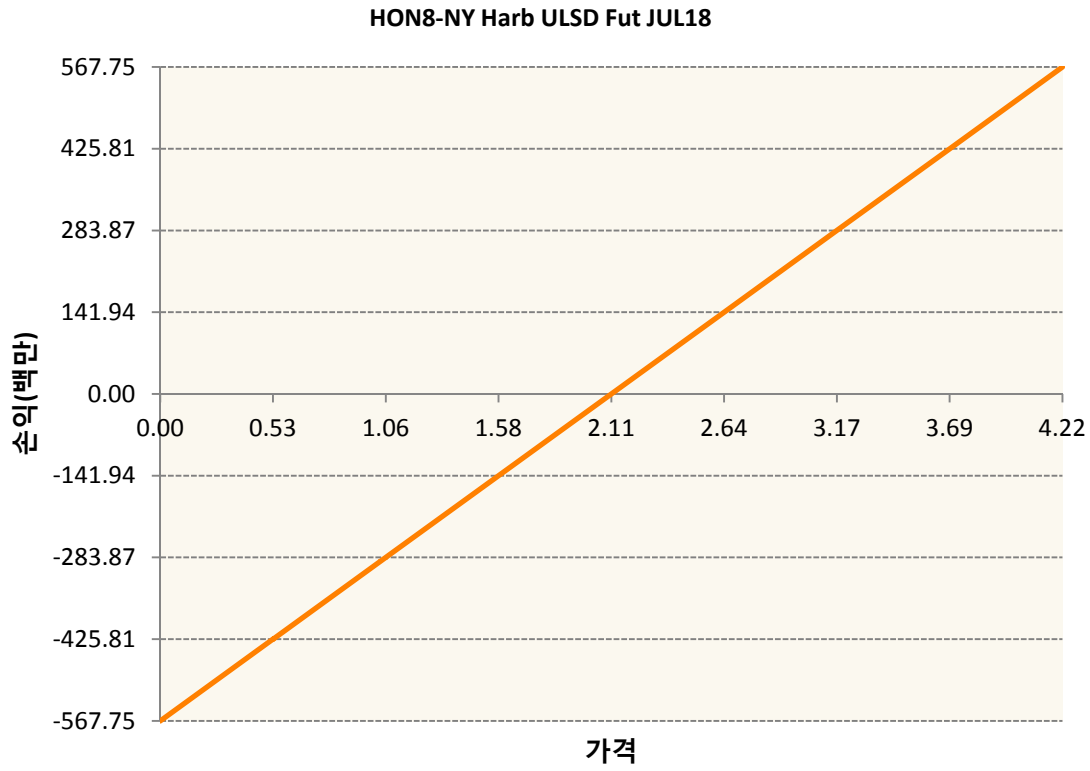
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	4,105	587	3,518	

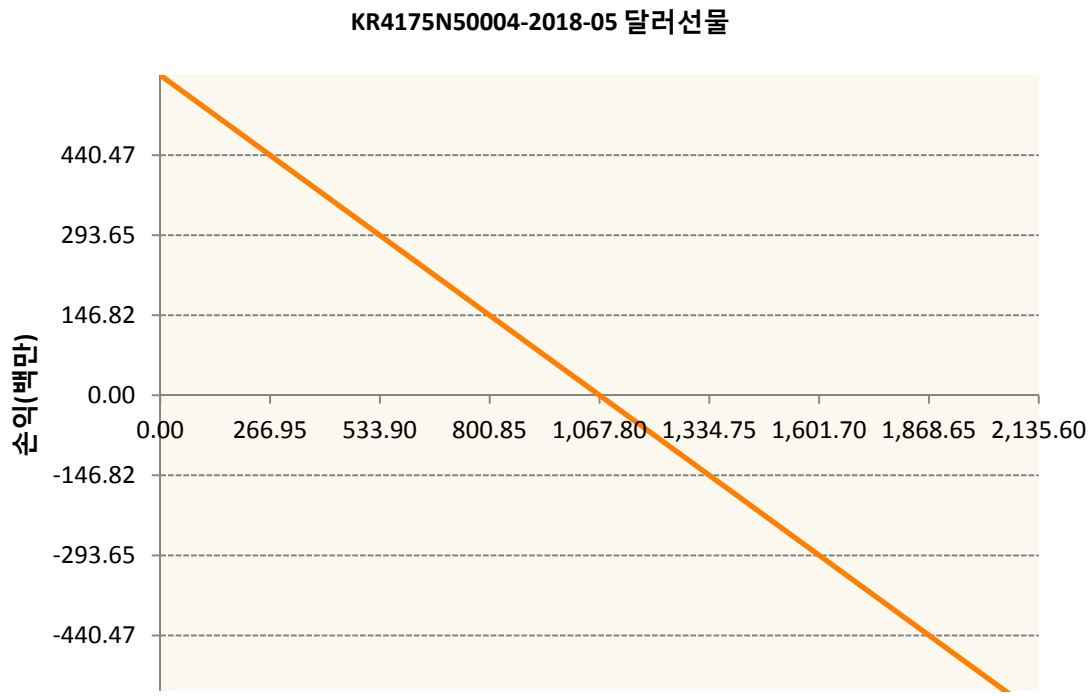
2. 만기시점의 손익구조

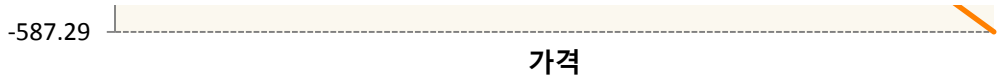


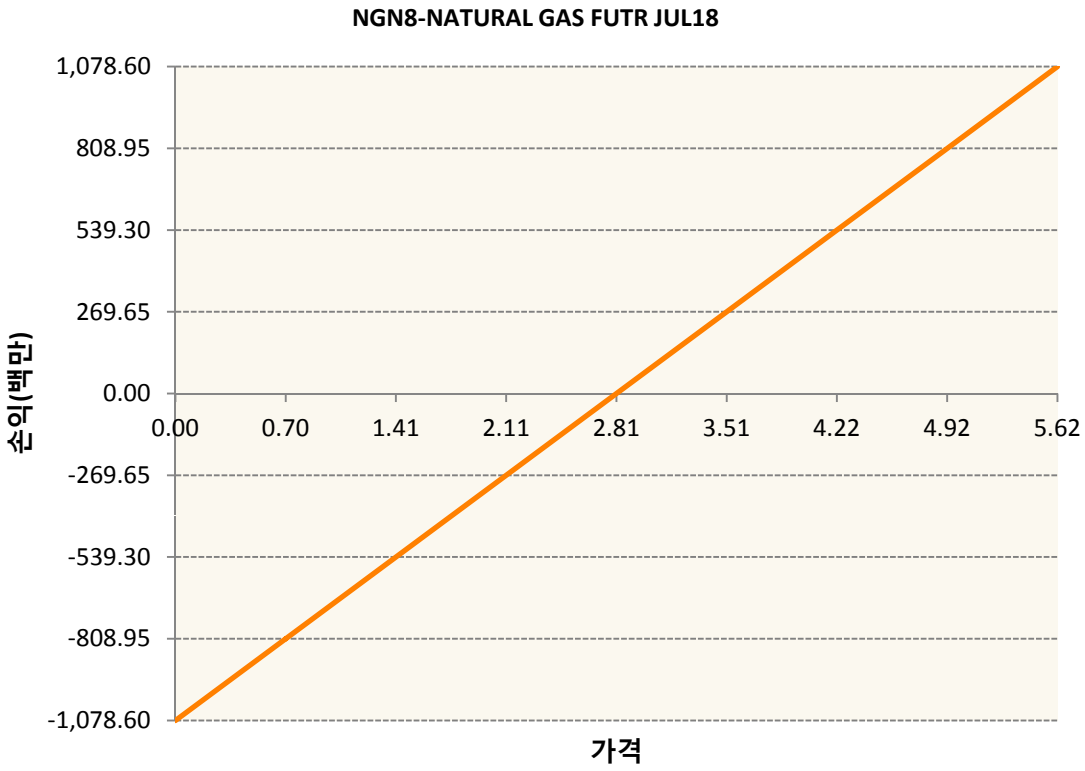


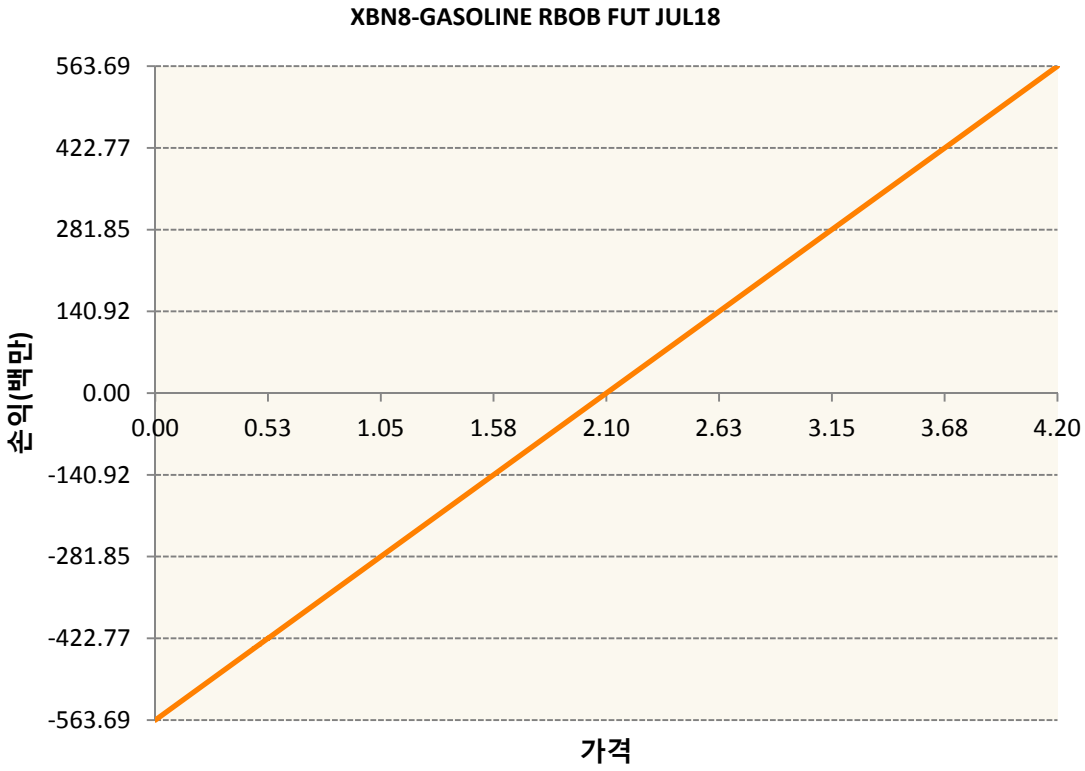

-547.25
-820.88
-1,094.50
가격


HON8-NY Harb ULSD Fut JUL18
567.75
425.81
283.87
141.94
0.00
-141.94
-283.87
-425.81
-567.75
0.00
0.53
1.06
1.58
2.11
2.64
3.17
3.69
4.22
손익(백만)
가격


KR4175N50004-2018-05 달러선물
440.47
293.65
146.82
0.00
-146.82
-293.65
-440.47
0.00
266.95
533.90
800.85
1,067.80
1,334.75
1,601.70
1,868.65
2,135.60
손익(백만)


-587.29
가격


NGN8-NATURAL GAS FUTR JUL18
1,078.60
808.95
539.30
269.65
0.00
-269.65
-539.30
-808.95
-1,078.60
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
563.69
422.77
281.85
140.92
0.00
-140.92
-281.85
-422.77
-563.69
0.00
0.53
1.05
1.58
2.10
2.63
3.15
3.68
4.20
손익(백만)
가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLN8	WTI CRUDE FUTURE JUL18	64
CON8	BRENT CRUDE FUTR JUL18	88
HON8	NY Harb ULSD Fut JUL18	45
KR4175N50(	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	2018-04-24
기준일	2018-04-23

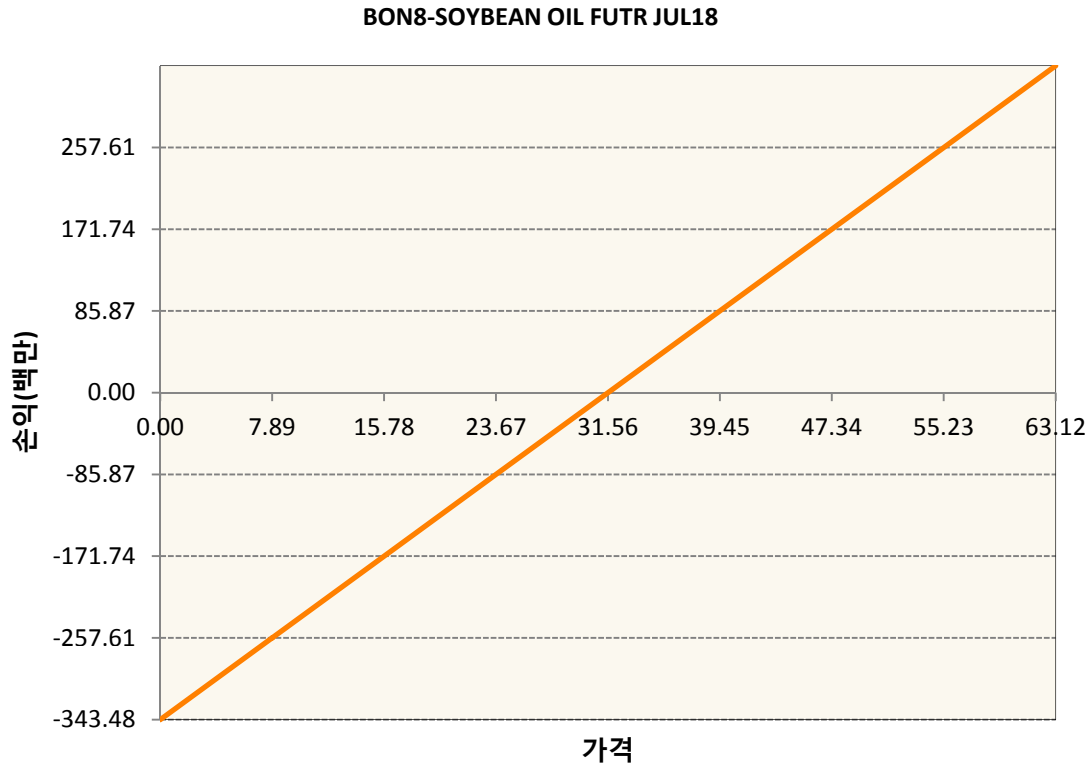
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

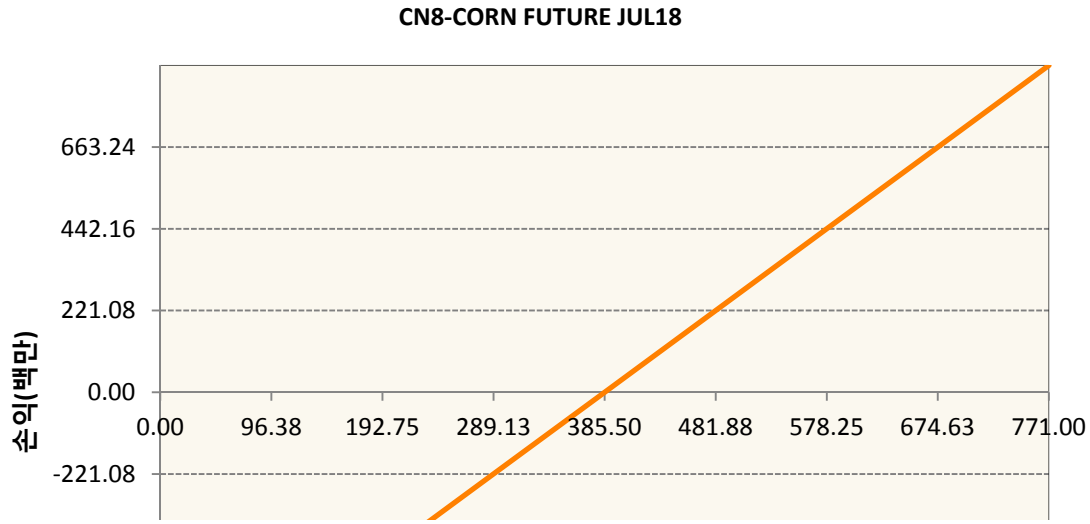
1. 계약금액

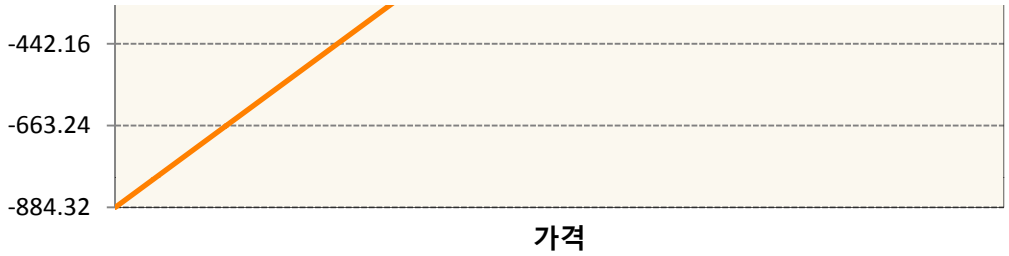
(단위:백만원)

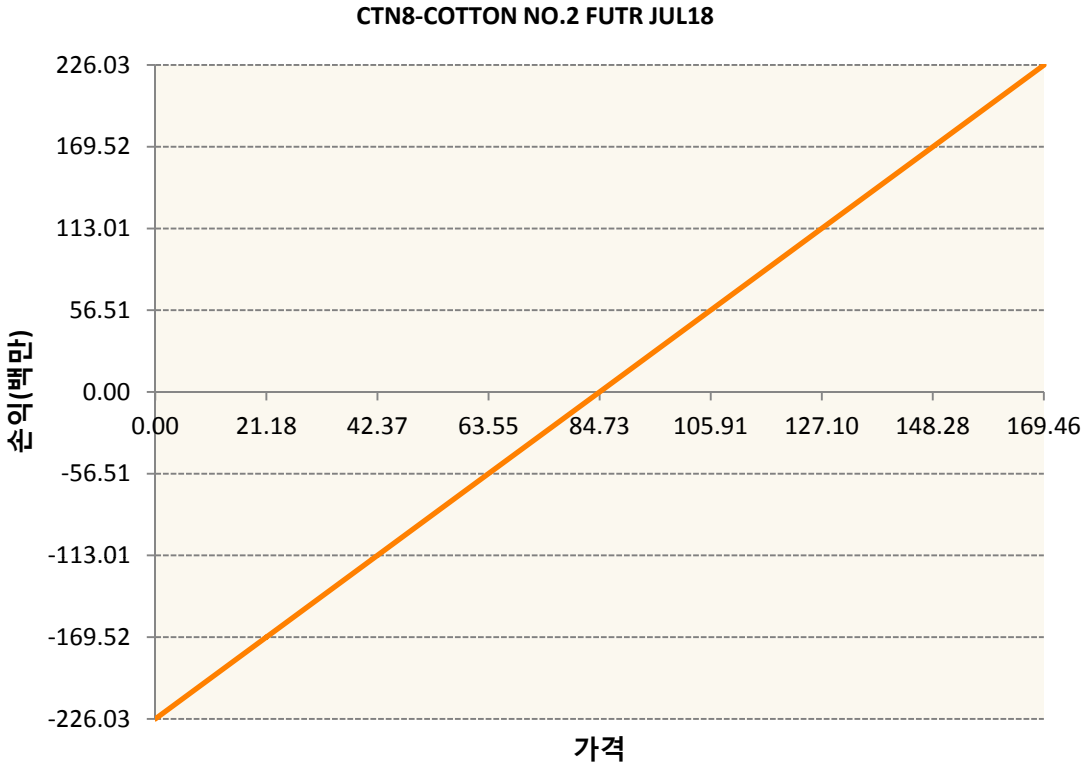
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	4,087	320	3,766	

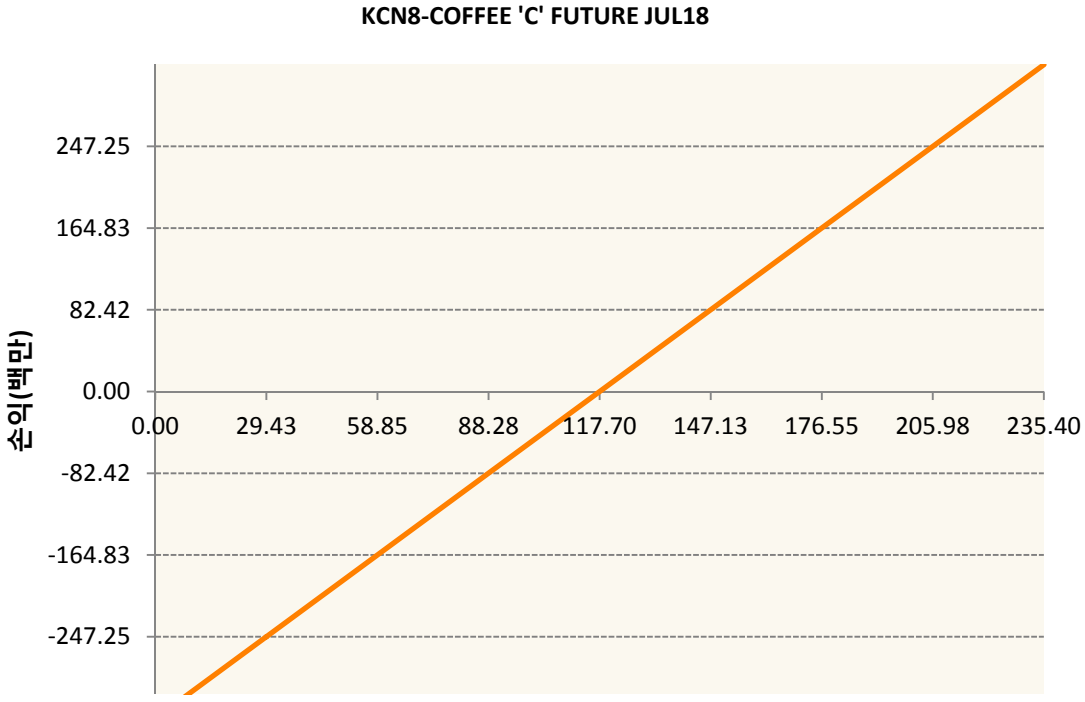
2. 만기시점의 손익구조

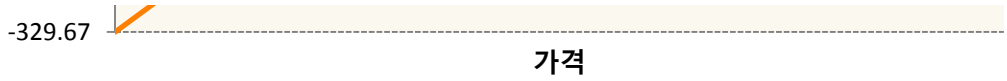


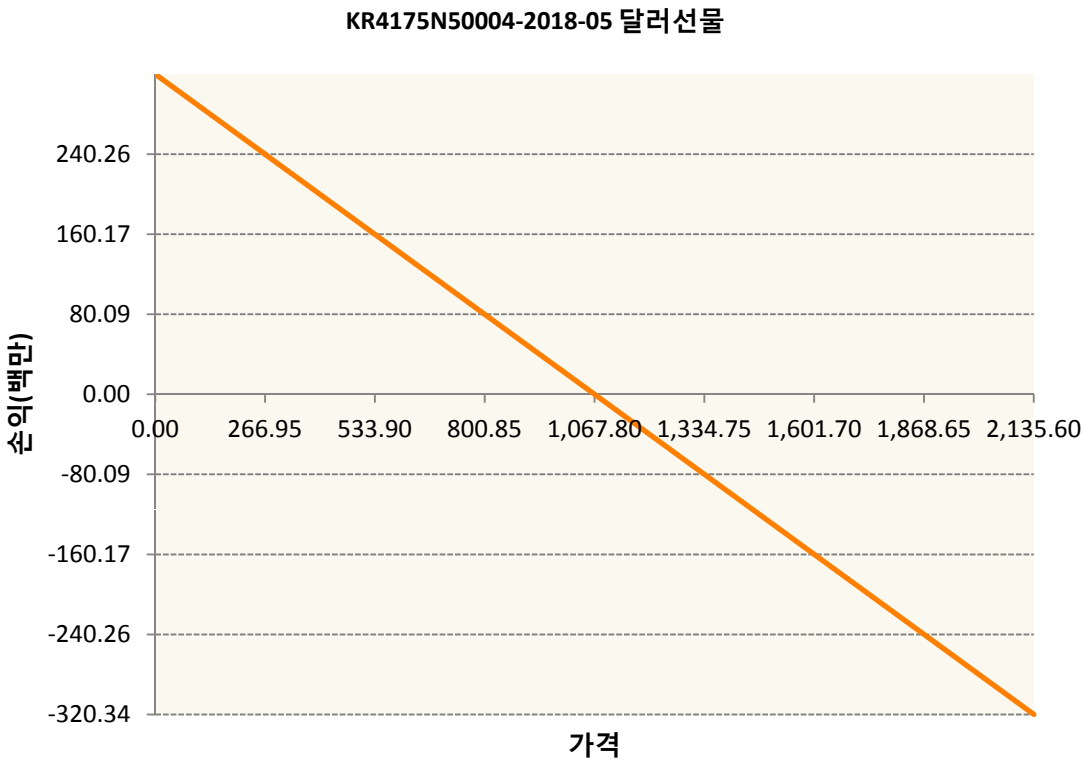


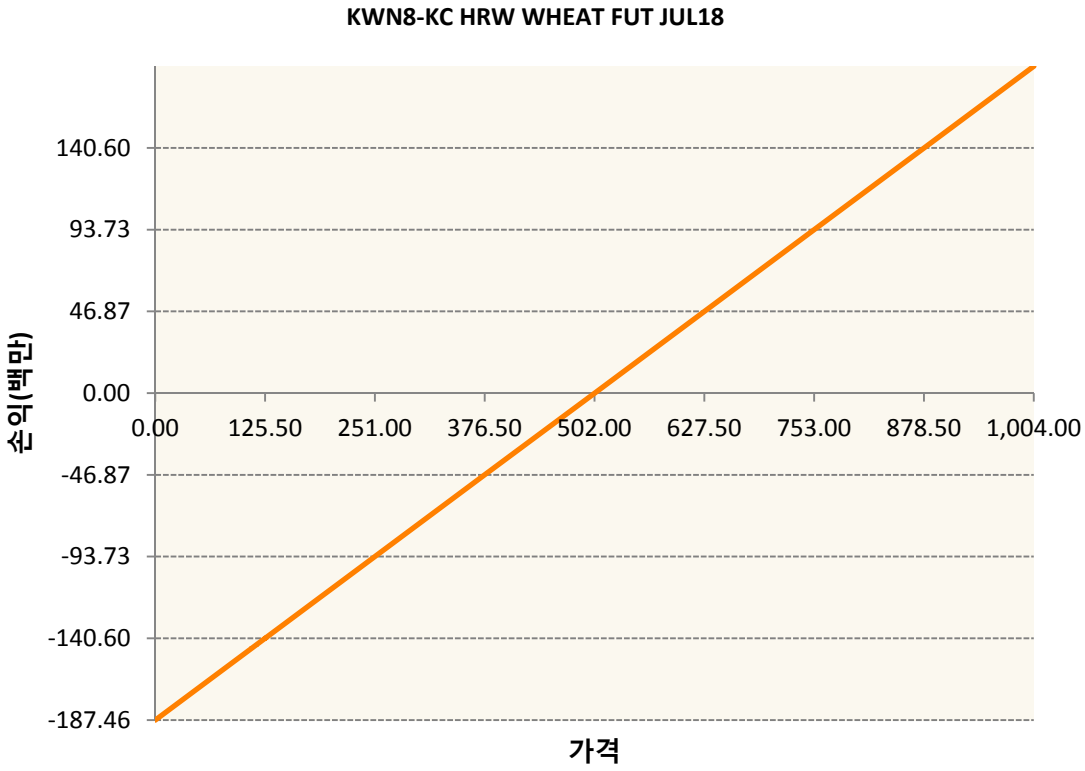

-442.16
-663.24
-884.32
가격

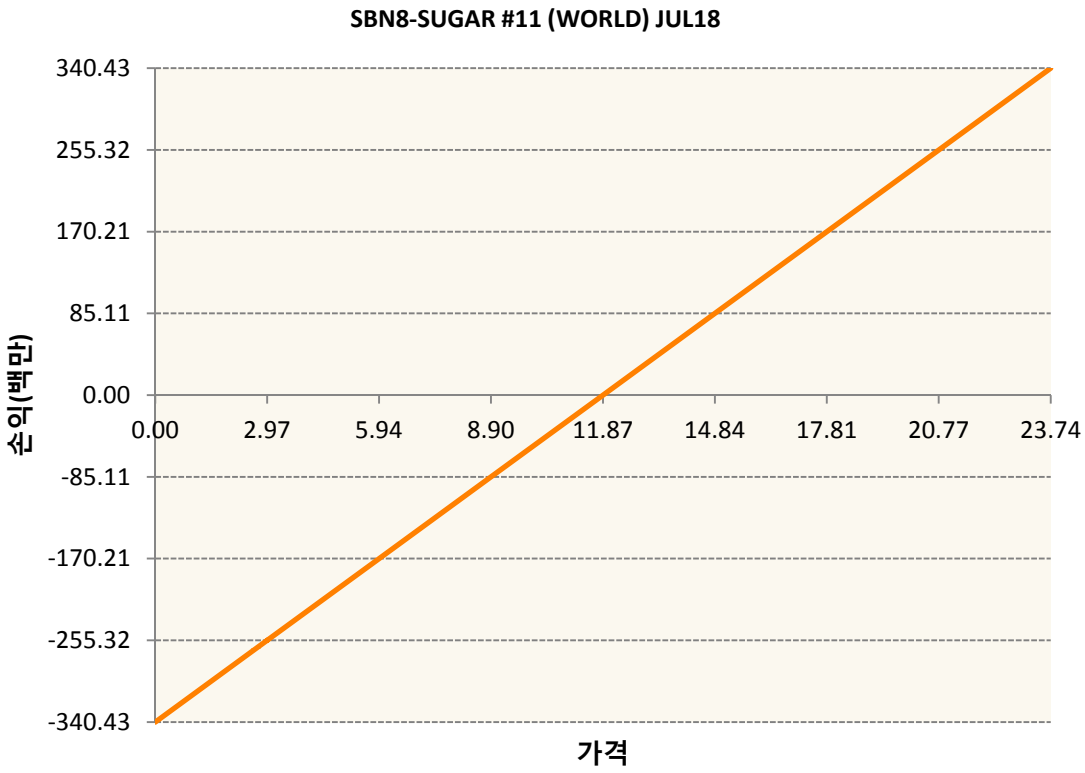

CTN8-COTTON NO.2 FUTR JUL18
226.03
169.52
113.01
56.51
0.00
-56.51
-113.01
-169.52
-226.03
0.00
21.18
42.37
63.55
84.73
105.91
127.10
148.28
169.46
손익(백만)
가격

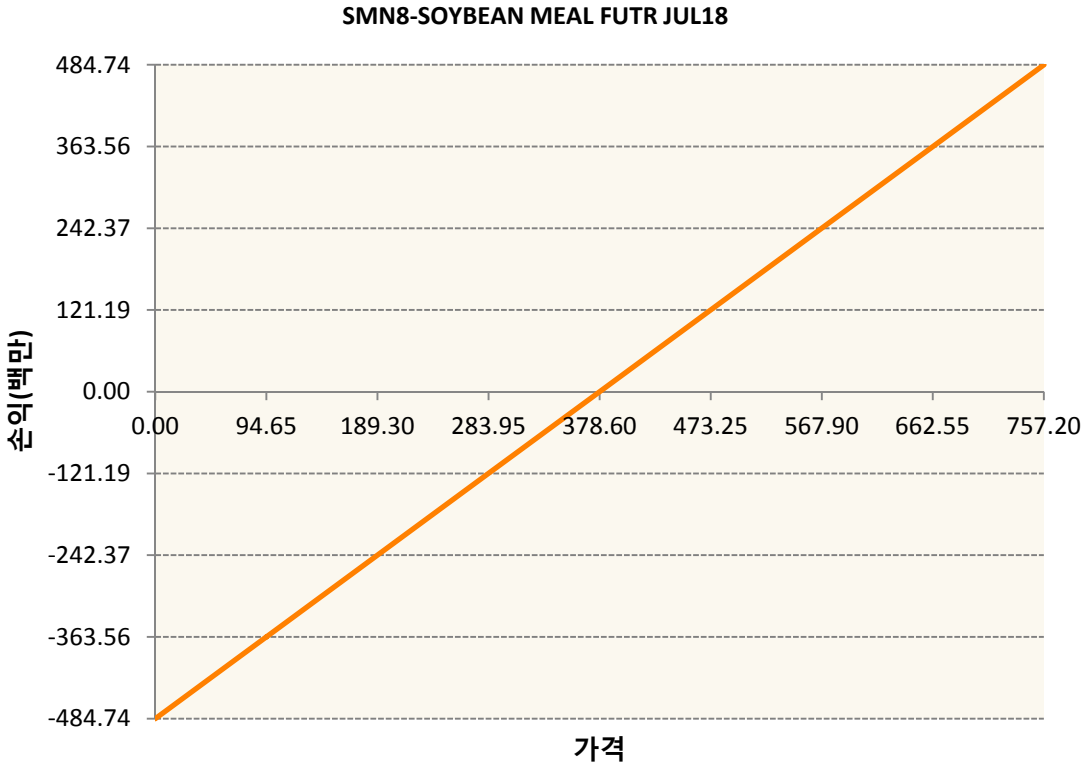

KCN8-COFFEE 'C' FUTURE JUL18
247.25
164.83
82.42
0.00
-82.42
-164.83
-247.25
0.00
29.43
58.85
88.28
117.70
147.13
176.55
205.98
235.40
손익(백만)

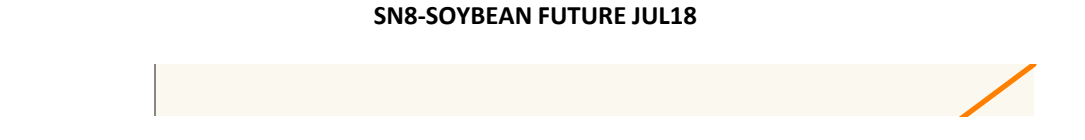

-329.67
가격

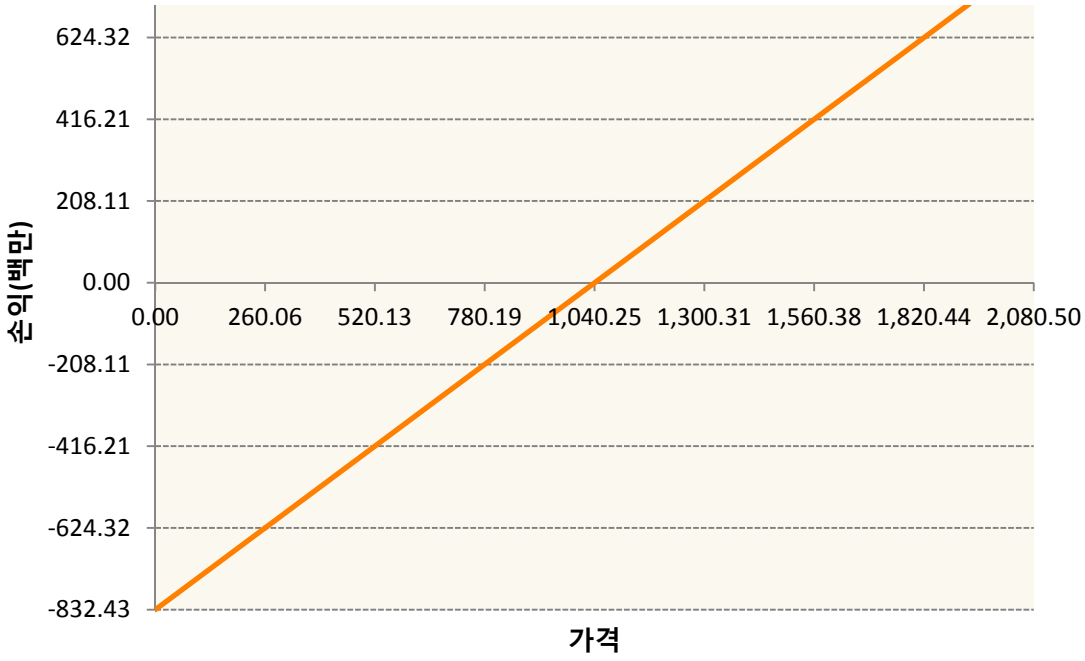

KR4175N50004-2018-05 달러선물
240.26
160.17
80.09
0.00
-80.09
-160.17
-240.26
-320.34
0.00
266.95
533.90
800.85
1,067.80
1,334.75
1,601.70
1,868.65
2,135.60
손익(백만)
가격

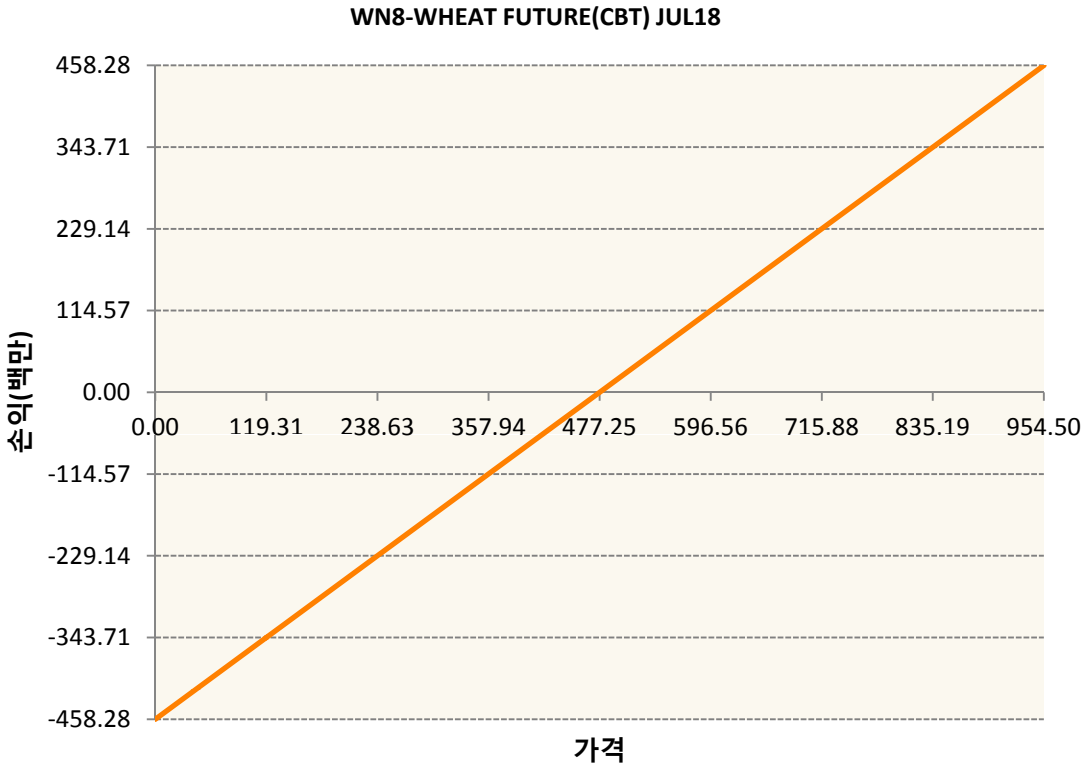

KWN8-KC HRW WHEAT FUT JUL18
140.60
93.73
46.87
0.00
-46.87
-93.73
-140.60
-187.46
0.00
125.50
251.00
376.50
502.00
627.50
753.00
878.50
1,004.00
손익(백만)
가격


SBN8-SUGAR #11 (WORLD) JUL18
340.43
255.32
170.21
85.11
0.00
-85.11
-170.21
-255.32
-340.43
0.00
2.97
5.94
8.90
11.87
14.84
17.81
20.77
23.74
손익(백만)
가격


SMN8-SOYBEAN MEAL FUTR JUL18
484.74
363.56
242.37
121.19
0.00
-121.19
-242.37
-363.56
-484.74
0.00
94.65
189.30
283.95
378.60
473.25
567.90
662.55
757.20
손익(백만)
가격


SN8-SOYBEAN FUTURE JUL18





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
BON8	SOYBEAN OIL FUTR JUL18	27
CN8	CORN FUTURE JUL18	71
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	37

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

328