공시일	2018-02-28
기준일	2018-02-27

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	2018-02-28
기준일	2018-02-27

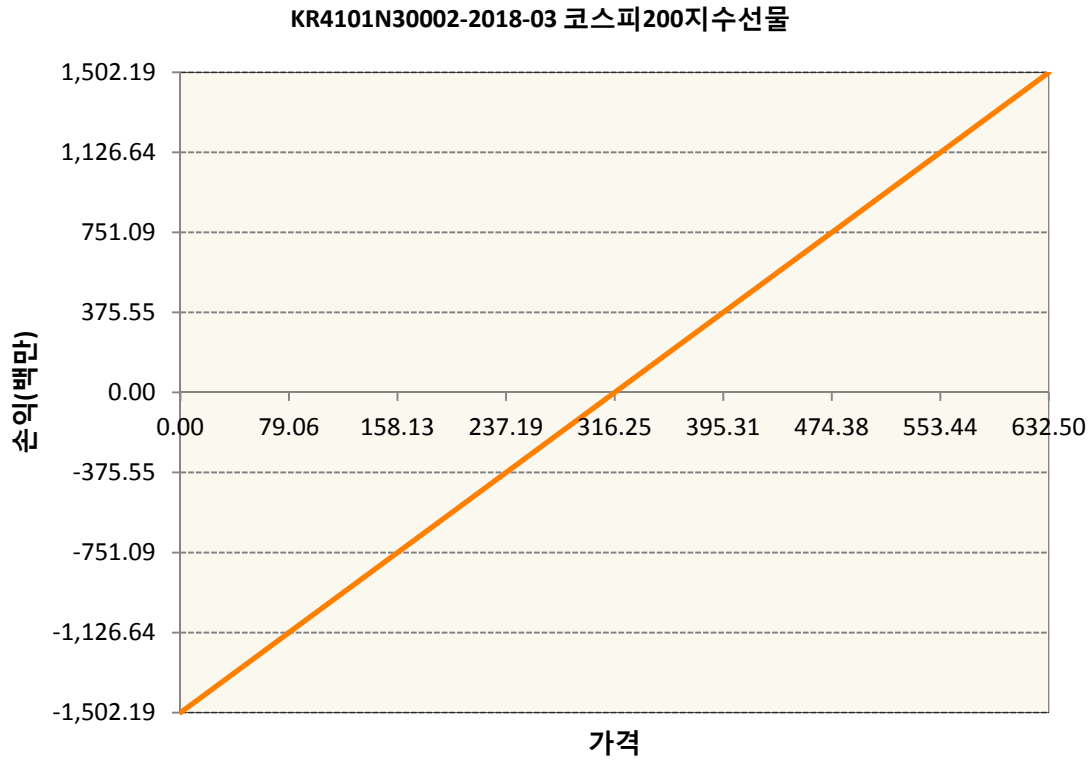
스마트인덱스모

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	1,502	0	1,502	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101N30(2018-03 코스피200지수선물							120
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-120	-120	-120	-120	-120	-120	-120
-5.33%	-80	-80	-80	-80	-80	-80	-80
-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%	80	80	80	80	80	80	80
8.00%	120	120	120	120	120	120	120

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

81

공시일	2018-02-28
기준일	2018-02-27

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	1,131

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

412

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2018-02-28
기준일	2018-02-27

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	4,901	0	4,901	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI50000 신한CSI500미래S171208	403

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

403

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2018-02-28
기준일	2018-02-27

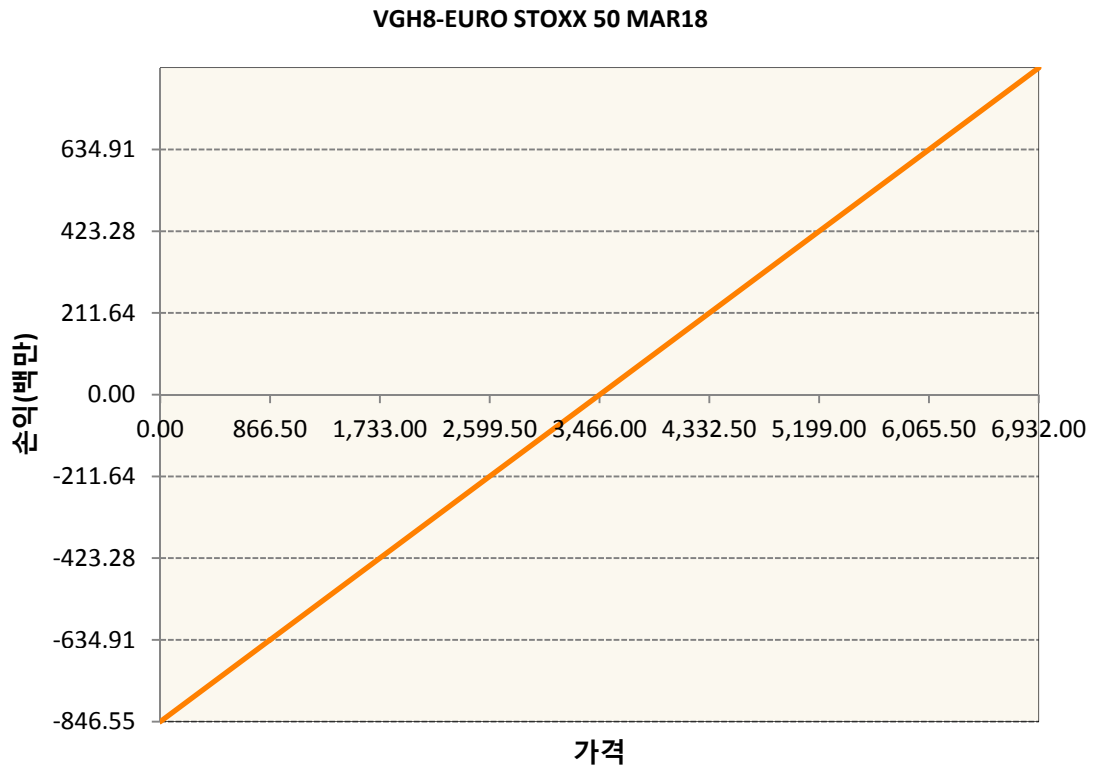
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	847	0	847	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGH8	EURO STOXX 50 MAR18	68

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

(단위:백만원)

39

공시일	2018-02-28
기준일	2018-02-27

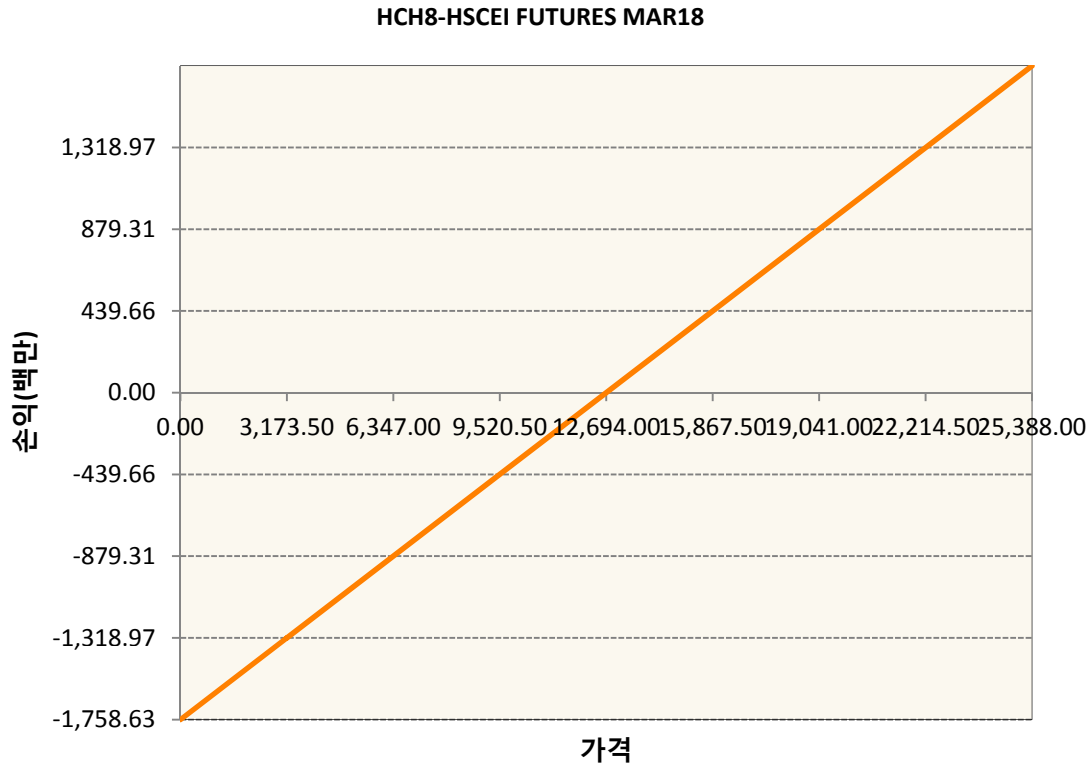
차이나인덱스모(주식-파생형)

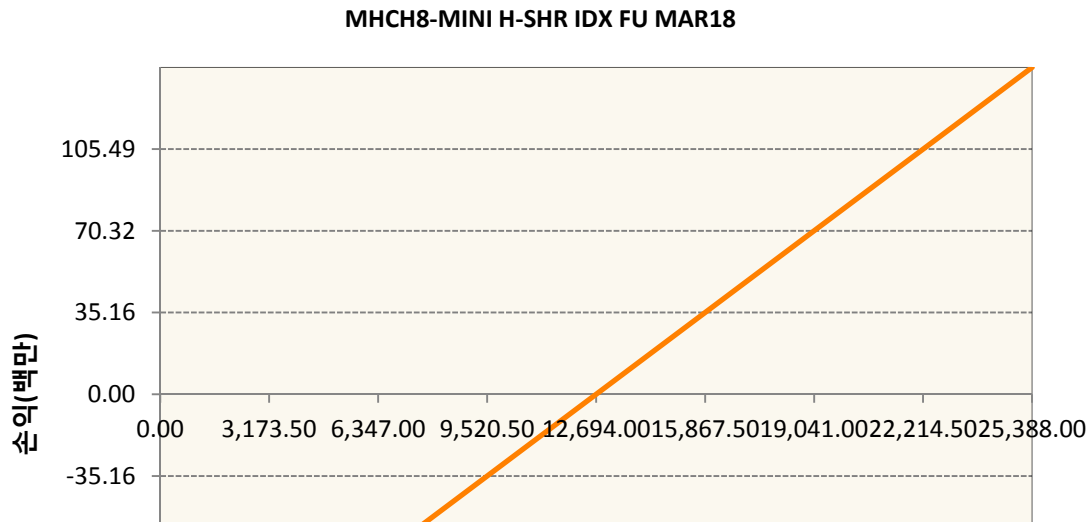
1. 계약금액

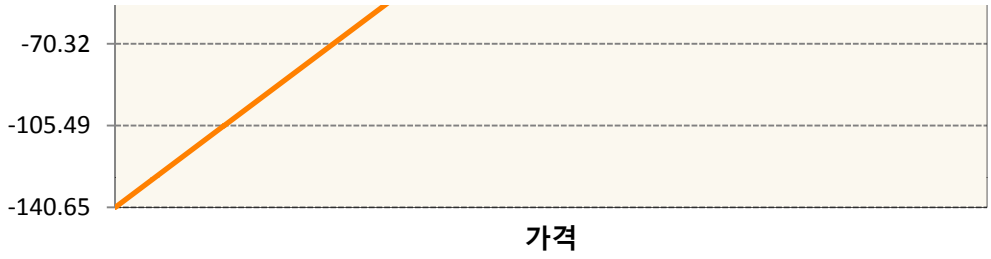
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,899	0	1,899	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCH8	HSCEI FUTURES MAR18	141
MHCH8	MINI H-SHR IDX FU MAR18	11

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	130

공시일	2018-02-28
기준일	2018-02-27

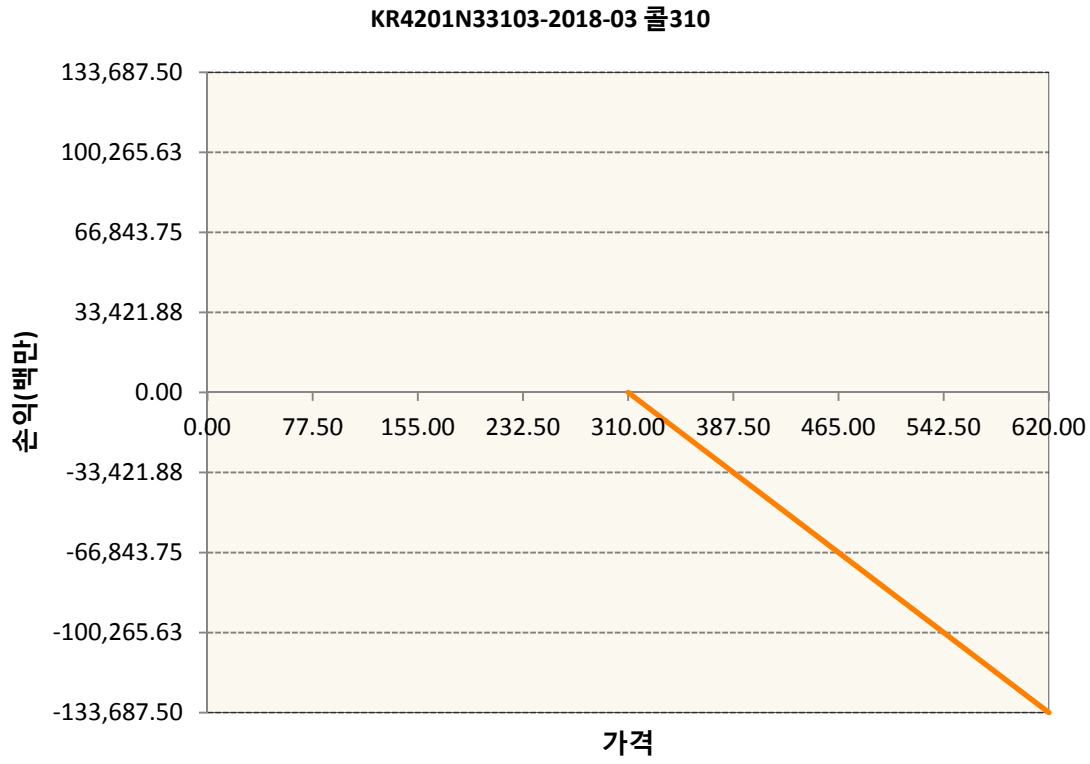
커버드콜모(주식혼합-파생형)

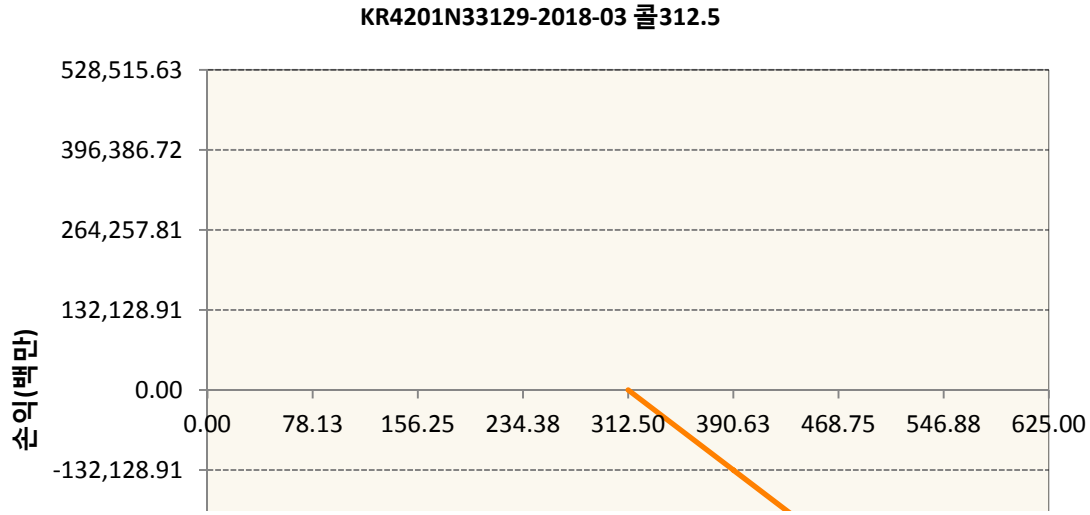
1. 계약금액

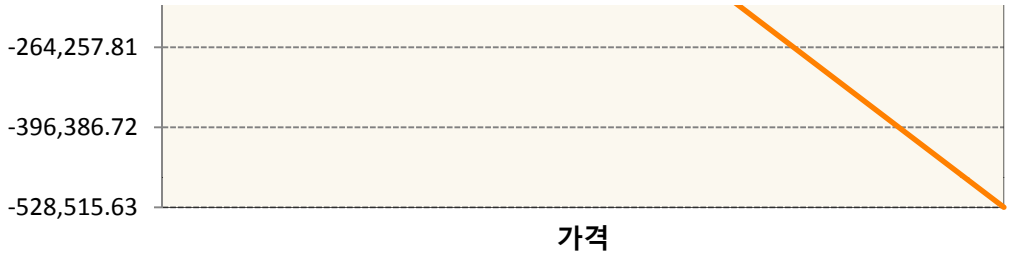
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	1,121,059	-1,121,059	장내

2. 만기시점의 손익구조



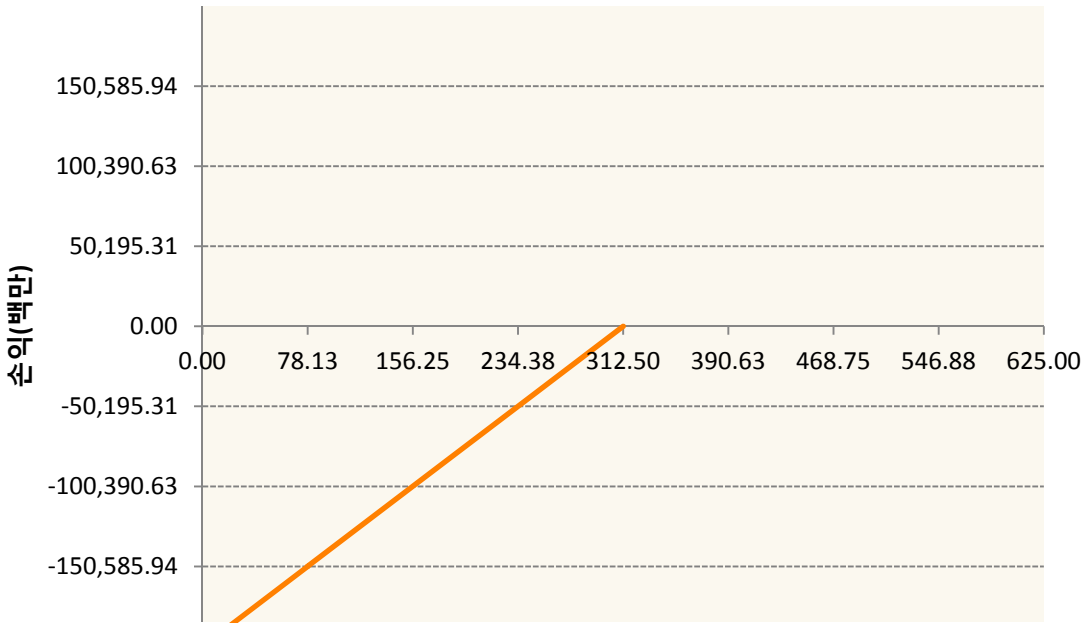




KR4301N33101-2018-03 풋310



KR4301N33127-2018-03 풋312.5





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201N3312018-03 콜310							9,953
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	3,966	3,936	3,895	3,842	3,779	3,705	3,623
-5.33%	3,703	3,596	3,477	3,350	3,216	3,077	2,932
-2.67%	2,680	2,500	2,320	2,139	1,958	1,776	1,595
0%	460	312	159	0	-162	-328	-496
2.67%	-2,701	-2,764	-2,841	-2,930	-3,029	-3,138	-3,256
5.33%	-6,247	-6,262	-6,285	-6,318	-6,362	-6,415	-6,478
8.00%	-9,878	-9,880	-9,885	-9,893	-9,907	-9,926	-9,953
KR4201N3312018-03 콜312.5							37,743
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	12,836	12,764	12,655	12,507	12,320	12,094	11,831
-5.33%	12,215	11,894	11,523	11,110	10,661	10,183	9,678
-2.67%	9,319	8,657	7,986	7,306	6,621	5,932	5,238
0%	2,027	1,361	685	0	-691	-1,388	-2,088
2.67%	-9,490	-9,836	-10,232	-10,672	-11,148	-11,655	-12,188
5.33%	-23,115	-23,213	-23,354	-23,541	-23,771	-24,044	-24,356
8.00%	-37,306	-37,322	-37,354	-37,408	-37,489	-37,600	-37,743
KR4301N3312018-03 풋310							14,905
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-14,868	-14,868	-14,870	-14,873	-14,880	-14,890	-14,905
-5.33%	-7,880	-7,915	-7,963	-8,024	-8,096	-8,178	-8,271
-2.67%	-1,964	-2,150	-2,337	-2,526	-2,715	-2,905	-3,095
0%	319	225	118	0	-128	-264	-407
2.67%	524	518	508	491	466	432	390
5.33%	527	527	526	526	524	521	516
8.00%	527	527	527	527	527	526	526
KR4301N3312018-03 풋312.5							12,739
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-12,727	-12,727	-12,727	-12,728	-12,730	-12,733	-12,739
-5.33%	-7,309	-7,320	-7,338	-7,362	-7,395	-7,436	-7,484
-2.67%	-2,298	-2,412	-2,532	-2,657	-2,785	-2,917	-3,050
0%	357	244	124	0	-128	-260	-394
2.67%	749	737	717	689	652	608	555

5.33%	760	760	759	757	754	749	740
8.00%	760	760	760	760	760	760	759

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

80,781

공시일	2018-02-28
기준일	2018-02-27

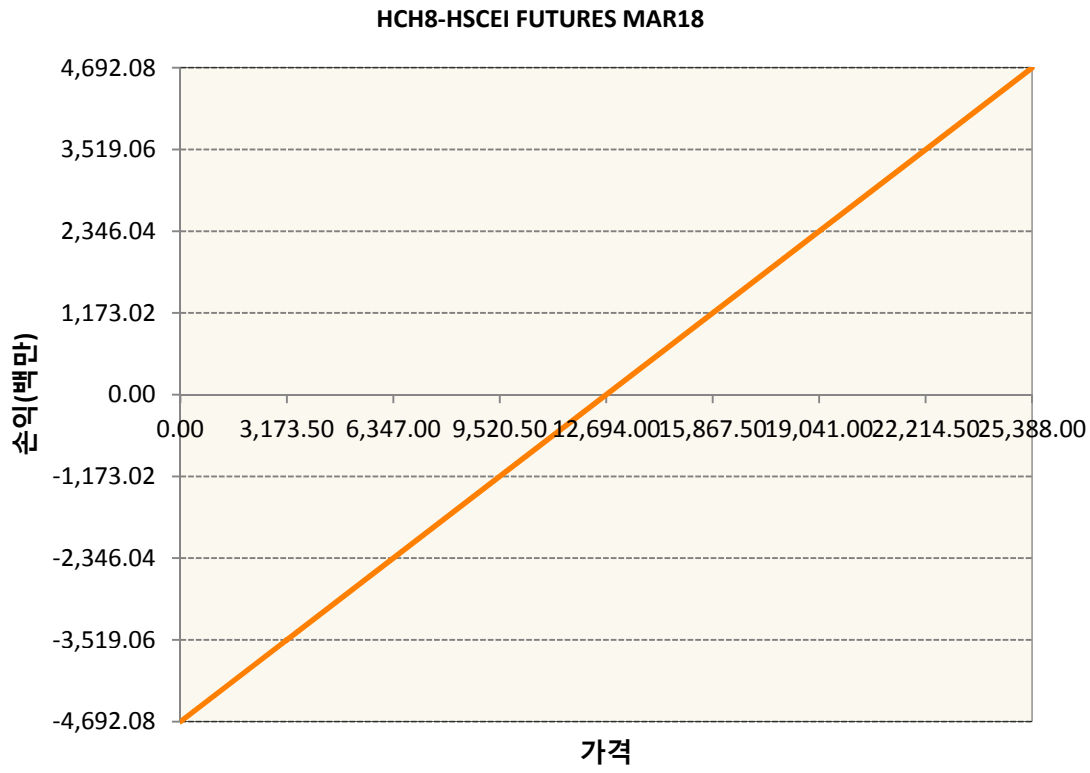
홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	1	0	1	장내
누계	유가증권	선물	4,692	0	4,692	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCH8	HSCEI FUTURES MAR18	375

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

(단위:백만원)

322

공시일	2018-02-28
기준일	2018-02-27

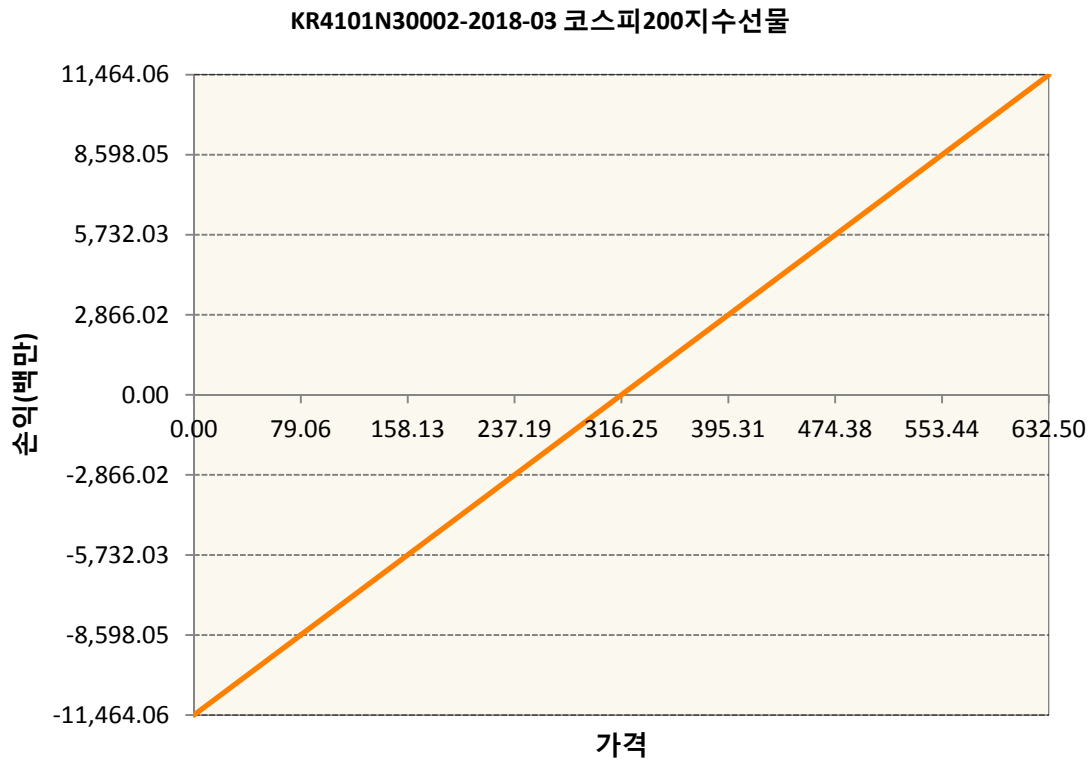
코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼

1. 계약금액

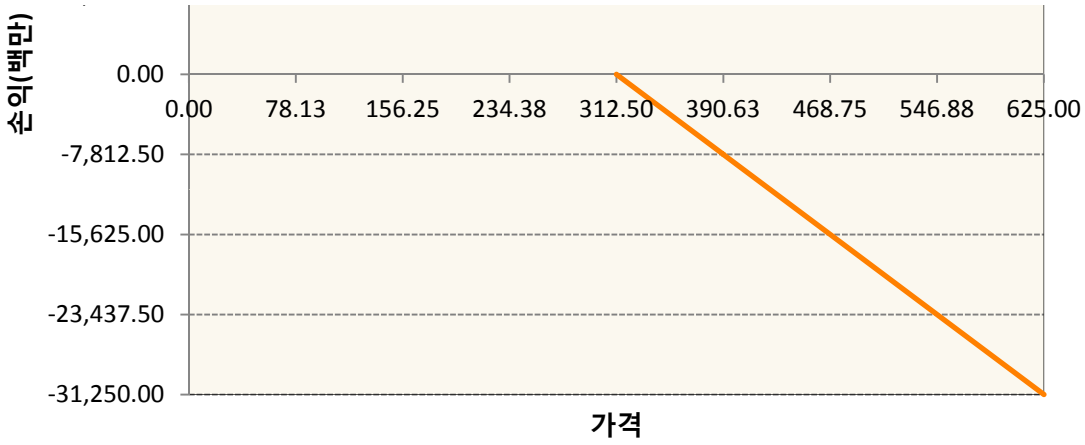
(단위:백만원)

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	11,464	0	11,464	장내
누계	유가증권	스왑	56,200	0	56,200	장외
누계	유가증권	옵션	0	56,094	-56,094	장내

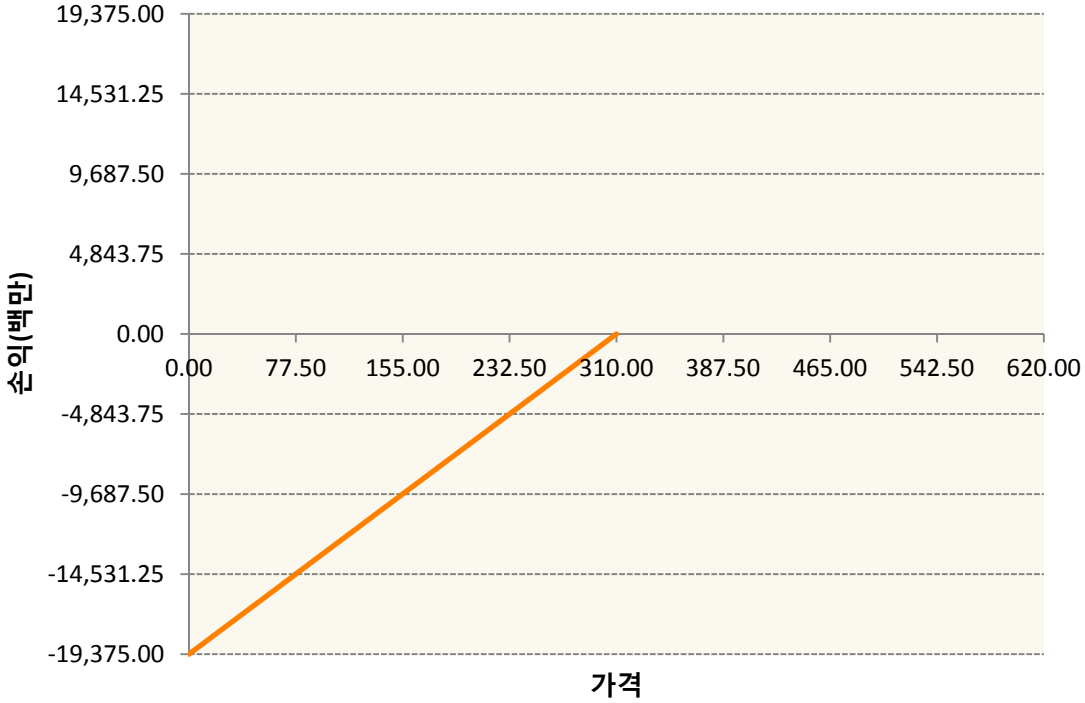
2. 만기시점의 손익구조



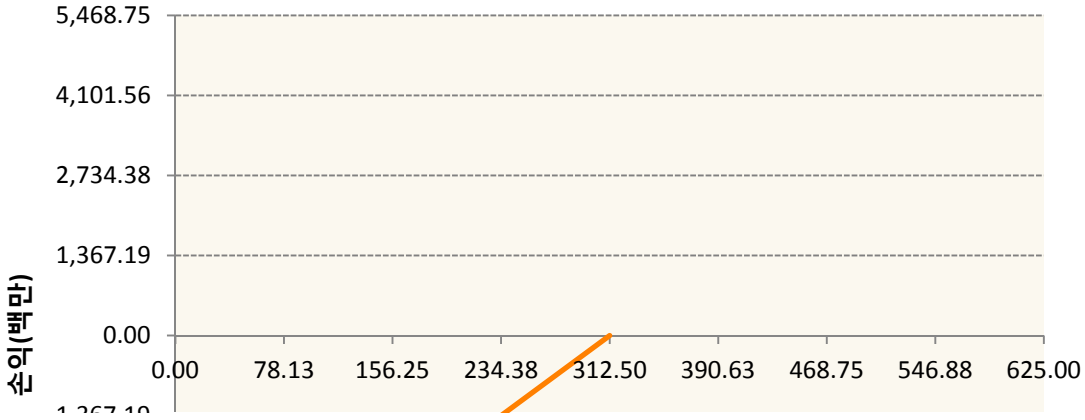




KR4301N33101-2018-03 풋310



KR4301N33127-2018-03 풋312.5





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_2							1,448
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,448	-1,448	-1,448	-1,448	-1,448	-1,448	-1,448
-5.33%	-965	-965	-965	-965	-965	-965	-965
-2.67%	-483	-483	-483	-483	-483	-483	-483
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	483	483	483	483	483	483	483
5.33%	965	965	965	965	965	965	965
8.00%	1,448	1,448	1,448	1,448	1,448	1,448	1,448
2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_3							274
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-274	-274	-274	-274	-274	-274	-274
-5.33%	-183	-183	-183	-183	-183	-183	-183
-2.67%	-91	-91	-91	-91	-91	-91	-91
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	91	91	91	91	91	91	91
5.33%	183	183	183	183	183	183	183
8.00%	274	274	274	274	274	274	274
2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_4							157
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-157	-157	-157	-157	-157	-157	-157
-5.33%	-104	-104	-104	-104	-104	-104	-104
-2.67%	-52	-52	-52	-52	-52	-52	-52
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	52	52	52	52	52	52	52
5.33%	104	104	104	104	104	104	104
8.00%	157	157	157	157	157	157	157
2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_5							235
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%

-8.00%	-235	-235	-235	-235	-235	-235	-235
-5.33%	-157	-157	-157	-157	-157	-157	-157
-2.67%	-78	-78	-78	-78	-78	-78	-78
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	78	78	78	78	78	78	78
5.33%	157	157	157	157	157	157	157
8.00%	235	235	235	235	235	235	235
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_6						196
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-196	-196	-196	-196	-196	-196	-196
-5.33%	-130	-130	-130	-130	-130	-130	-130
-2.67%	-65	-65	-65	-65	-65	-65	-65
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	65	65	65	65	65	65	65
5.33%	130	130	130	130	130	130	130
8.00%	196	196	196	196	196	196	196
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_7						250
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-250	-250	-250	-250	-250	-250	-250
-5.33%	-167	-167	-167	-167	-167	-167	-167
-2.67%	-83	-83	-83	-83	-83	-83	-83
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	83	83	83	83	83	83	83
5.33%	167	167	167	167	167	167	167
8.00%	250	250	250	250	250	250	250
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_8						463
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-463	-463	-463	-463	-463	-463	-463
-5.33%	-309	-309	-309	-309	-309	-309	-309
-2.67%	-154	-154	-154	-154	-154	-154	-154
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	154	154	154	154	154	154	154
5.33%	309	309	309	309	309	309	309
8.00%	463	463	463	463	463	463	463
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_10						274
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-274	-274	-274	-274	-274	-274	-274
-5.33%	-183	-183	-183	-183	-183	-183	-183
-2.67%	-91	-91	-91	-91	-91	-91	-91
0%	0	0	0	0	0	0	0

2.67%	91	91	91	91	91	91	91
5.33%	183	183	183	183	183	183	183
8.00%	274	274	274	274	274	274	274
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_11						626
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-626	-626	-626	-626	-626	-626	-626
-5.33%	-417	-417	-417	-417	-417	-417	-417
-2.67%	-209	-209	-209	-209	-209	-209	-209
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	209	209	209	209	209	209	209
5.33%	417	417	417	417	417	417	417
8.00%	626	626	626	626	626	626	626
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_12						470
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-470	-470	-470	-470	-470	-470	-470
-5.33%	-313	-313	-313	-313	-313	-313	-313
-2.67%	-157	-157	-157	-157	-157	-157	-157
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	157	157	157	157	157	157	157
5.33%	313	313	313	313	313	313	313
8.00%	470	470	470	470	470	470	470
	KR4101N30(2018-03 코스피200지수선물						919
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-919	-919	-919	-919	-919	-919	-919
-5.33%	-613	-613	-613	-613	-613	-613	-613
-2.67%	-306	-306	-306	-306	-306	-306	-306
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	306	306	306	306	306	306	306
5.33%	613	613	613	613	613	613	613
8.00%	919	919	919	919	919	919	919
	KR4201N331 2018-03 콜312.5						2,232
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	759	755	748	740	728	715	700
-5.33%	722	703	681	657	630	602	572
-2.67%	551	512	472	432	392	351	310
0%	120	80	40	0	-41	-82	-123
2.67%	-561	-582	-605	-631	-659	-689	-721
5.33%	-1,367	-1,373	-1,381	-1,392	-1,406	-1,422	-1,440
8.00%	-2,206	-2,207	-2,209	-2,212	-2,217	-2,223	-2,232
	KR4301N331 2018-03 풋310						1,119

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,116	-1,116	-1,116	-1,117	-1,117	-1,118	-1,119
-5.33%	-592	-594	-598	-602	-608	-614	-621
-2.67%	-147	-161	-175	-190	-204	-218	-232
0%	24	17	9	0	-10	-20	-31
2.67%	39	39	38	37	35	32	29
5.33%	40	40	40	39	39	39	39
8.00%	40	40	40	40	40	40	39
	KR4301N3312018-03 풋312.5						347

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-347	-347	-347	-347	-347	-347	-347
-5.33%	-199	-199	-200	-201	-201	-203	-204
-2.67%	-63	-66	-69	-72	-76	-79	-83
0%	10	7	3	0	-3	-7	-11
2.67%	20	20	20	19	18	17	15
5.33%	21	21	21	21	21	20	20
8.00%	21	21	21	21	21	21	21

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

8,909

공시일	2018-02-28
기준일	2018-02-27

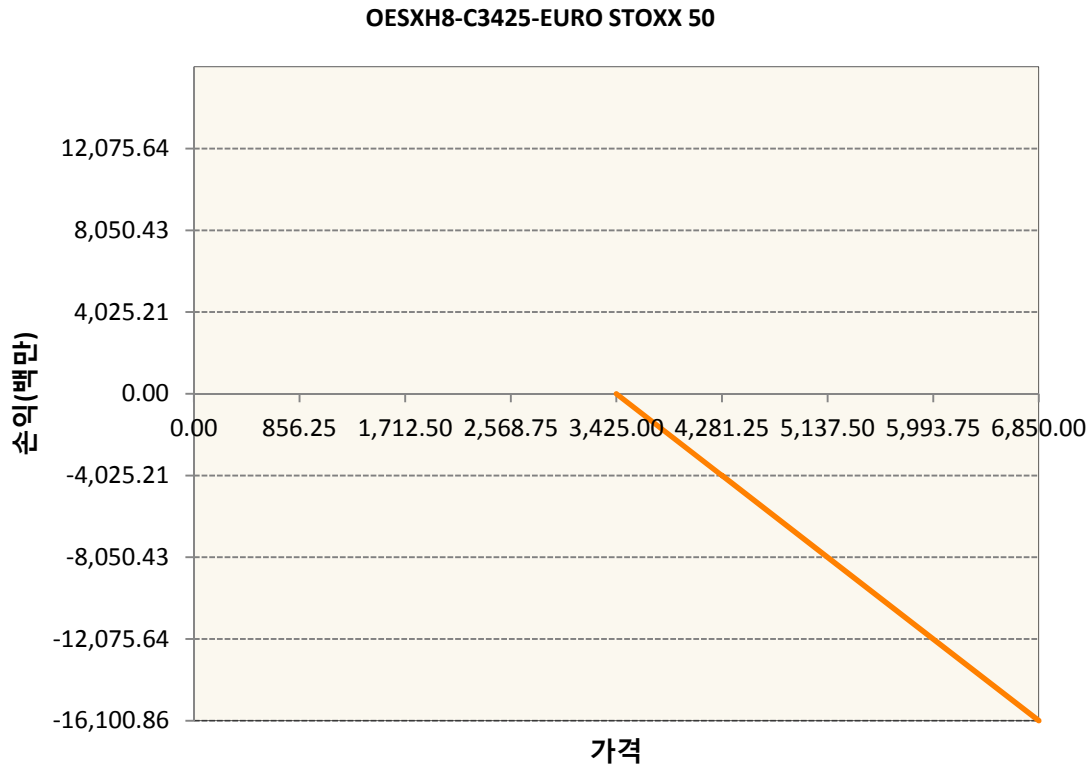
유로커버드콜모(주식혼합-파생형

1. 계약금액

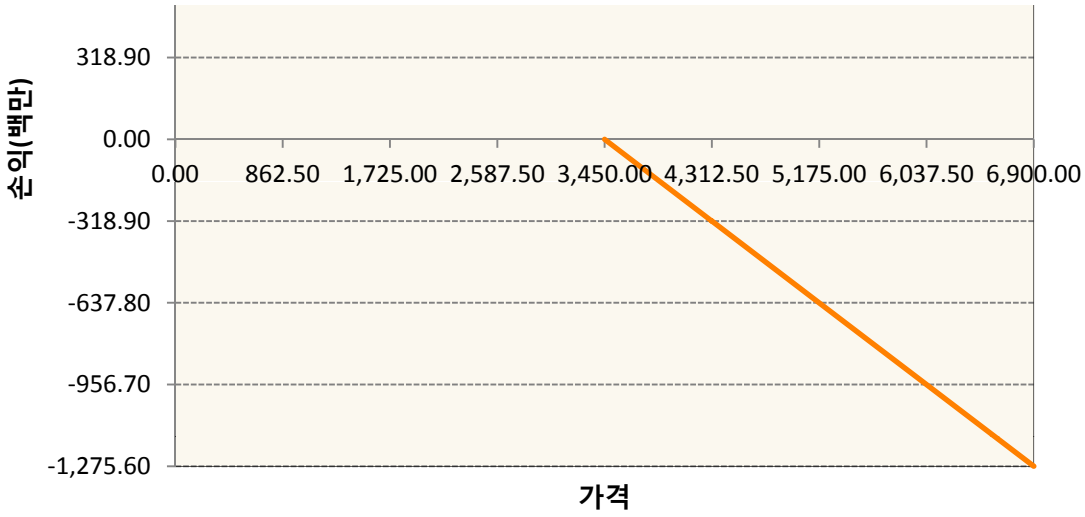
(단위:백만원)

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	9,377	0	9,377	
누계	유가증권	스왑	99,036	0	99,036	장외
누계	유가증권	옵션	0	34,753	-34,753	장내
누계	지수	스왑	52,820	0	52,820	장외

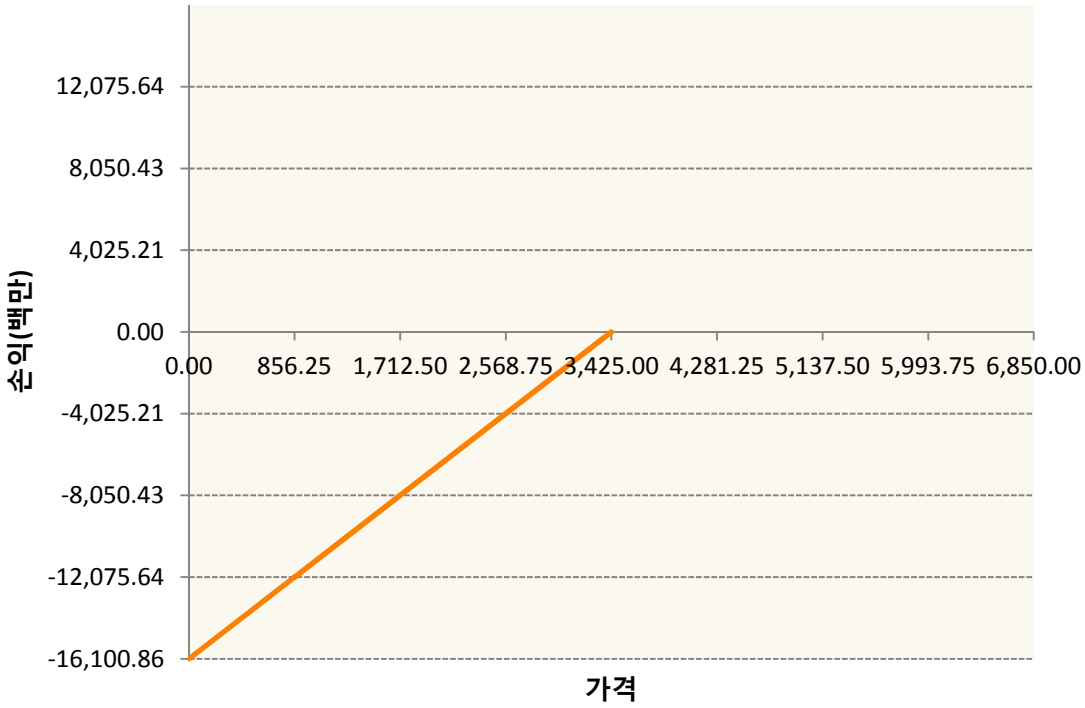
2. 만기시점의 손익구조



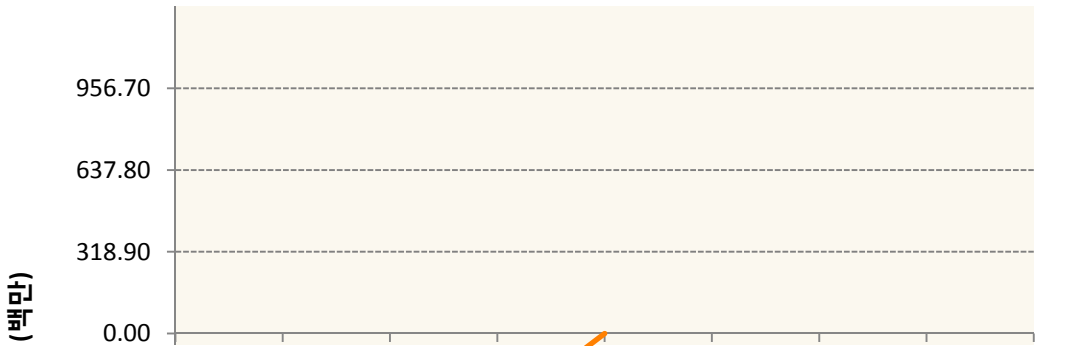


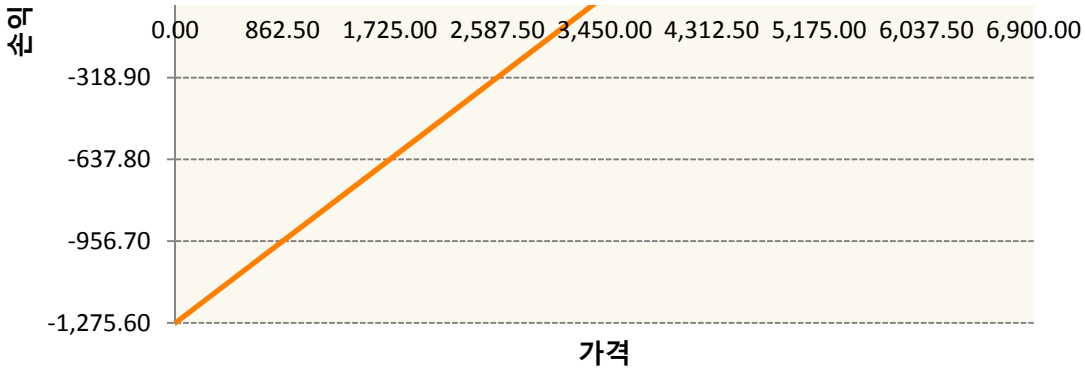


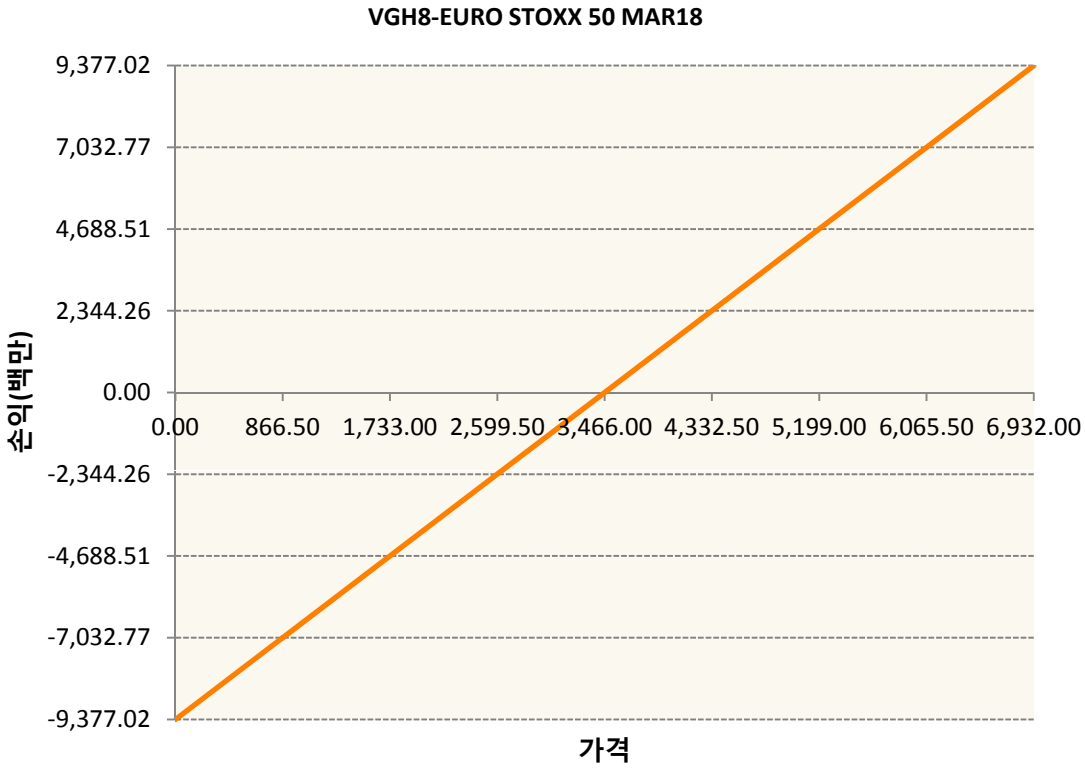
OESXH8-P3425-EURO STOXX 50



OESXH8-P3450-EURO STOXX 50







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)	(단위:백만원)
260105SGPX SG EURO Covered CALL STRATEGY - 994.569	187
260105SQPX SG EURO Covered CALL STRATEGY	351
OESXH8-C34 EURO STOXX 50	1,288
OESXH8-C34 EURO STOXX 50	102
OESXH8-P34 EURO STOXX 50	1,288
OESXH8-P34 EURO STOXX 50	102
VGH8 EURO STOXX 50 MAR18	750

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

2,390

공시일	2018-02-28
기준일	2018-02-27

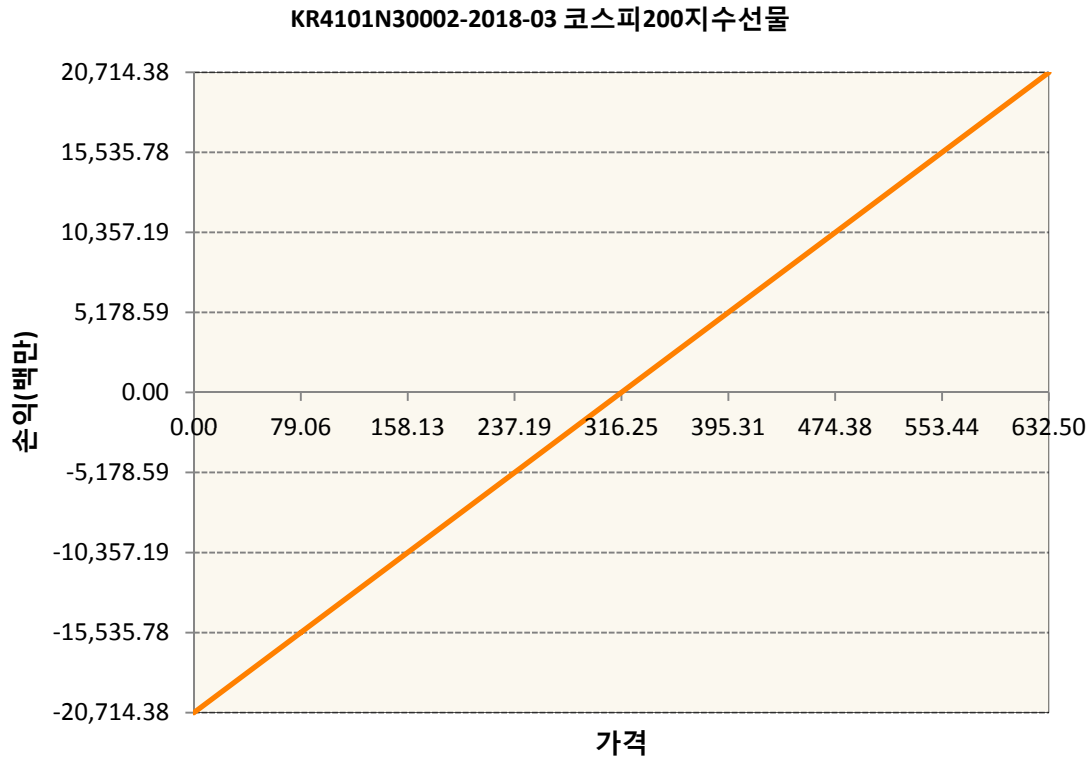
ETF스마트레버리지목표전환형8호

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	20,714	0	20,714	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101N30(2018-03 코스피200지수선물							1,660
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,660	-1,660	-1,660	-1,660	-1,660	-1,660	-1,660
-5.33%	-1,107	-1,107	-1,107	-1,107	-1,107	-1,107	-1,107
-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%	1,107	1,107	1,107	1,107	1,107	1,107	1,107
8.00%	1,660	1,660	1,660	1,660	1,660	1,660	1,660

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

1,114

공시일	2018-02-28
기준일	2018-02-27

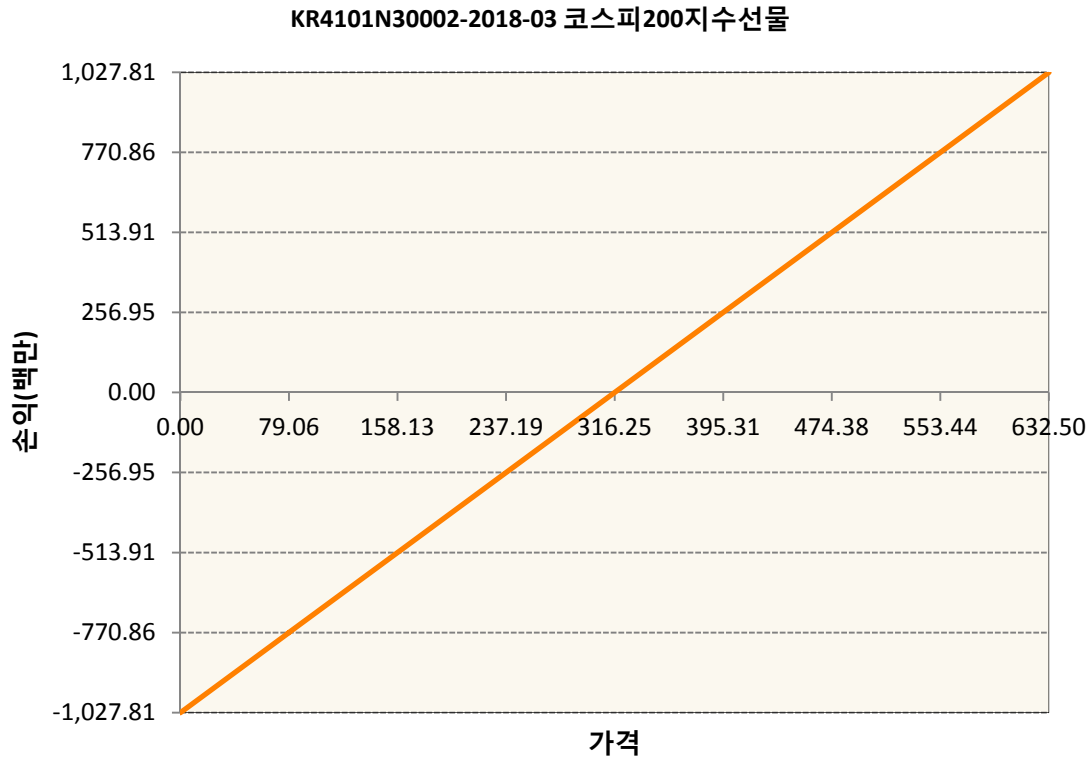
ETF스마트레버리지목표전환형9호

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	1,028	0	1,028	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101N30(2018-03 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)

55

공시일	2018-02-28
기준일	2018-02-27

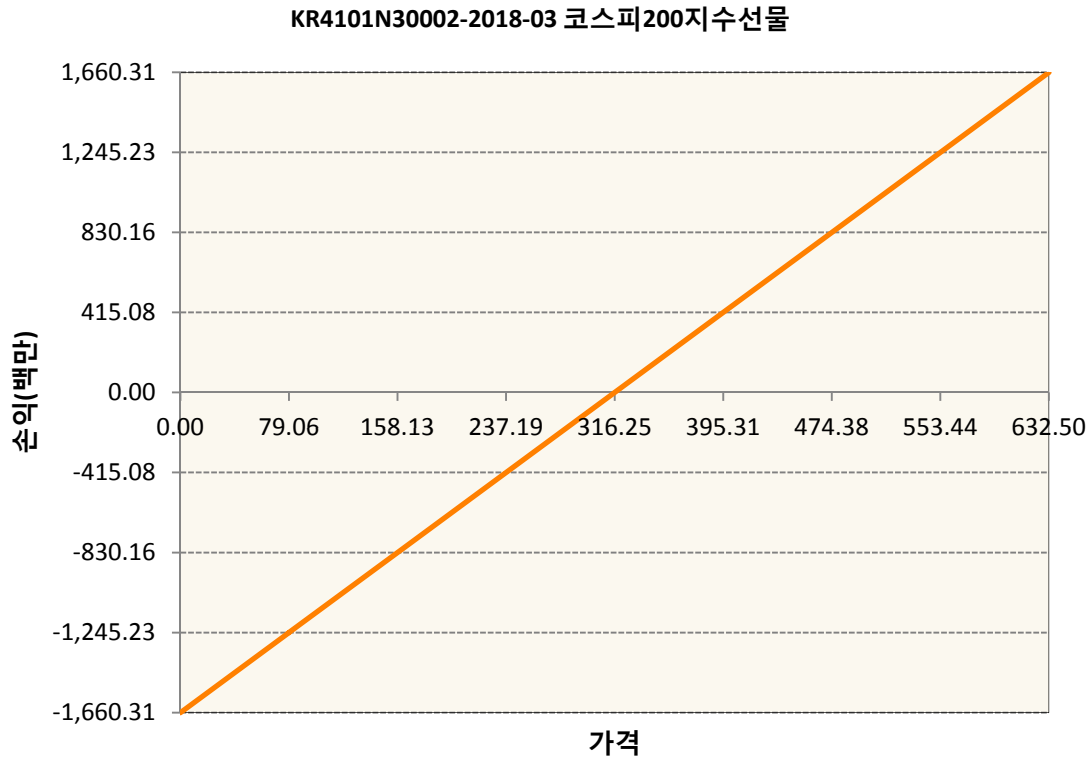
ETF스마트레버리지목표전환형10

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	1,660	0	1,660	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101N30(2018-03 코스피200지수선물							133
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-133	-133	-133	-133	-133	-133	-133
-5.33%	-89	-89	-89	-89	-89	-89	-89
-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%	89	89	89	89	89	89	89
8.00%	133	133	133	133	133	133	133

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

89

공시일	2018-02-28
기준일	2018-02-27

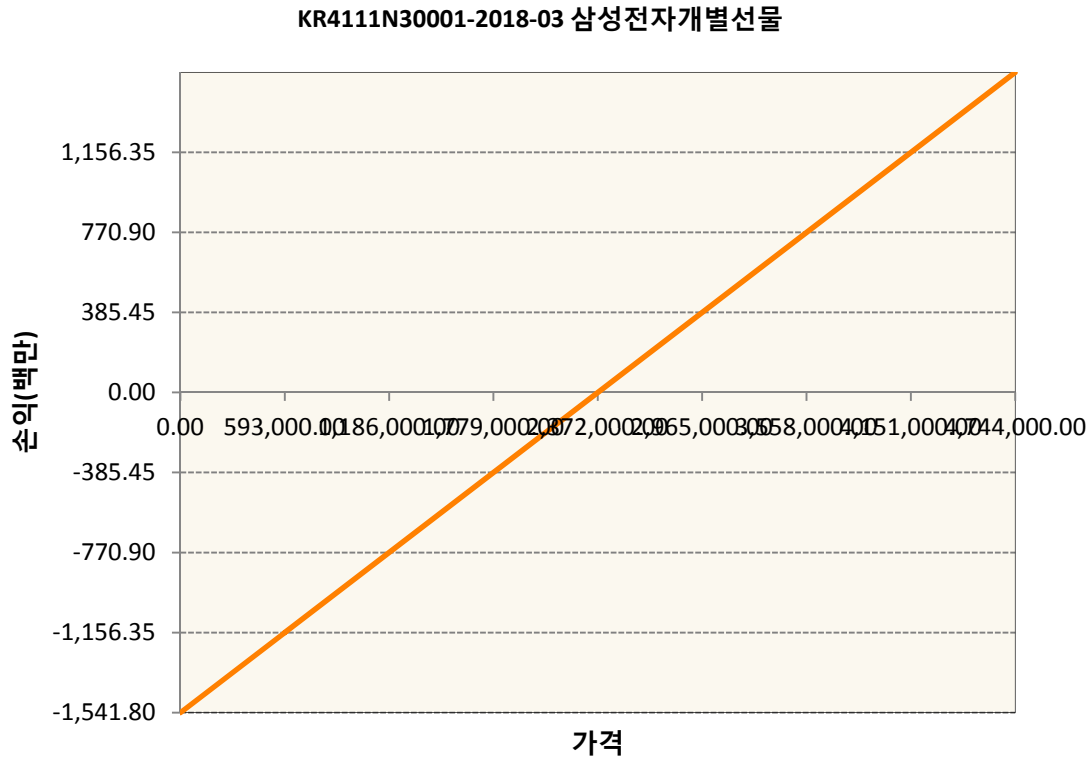
스마트KRX300인덱스1호(주식-파

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	1,542	0	1,542	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4111N30(2018-03 삼성전자개별선물							123
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-123	-123	-123	-123	-123	-123	-123
-5.33%	-82	-82	-82	-82	-82	-82	-82
-2.67%	-41	-41	-41	-41	-41	-41	-41
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	41	41	41	41	41	41	41
5.33%	82	82	82	82	82	82	82
8.00%	123	123	123	123	123	123	123

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

146

공시일	2018-02-28
기준일	2018-02-27

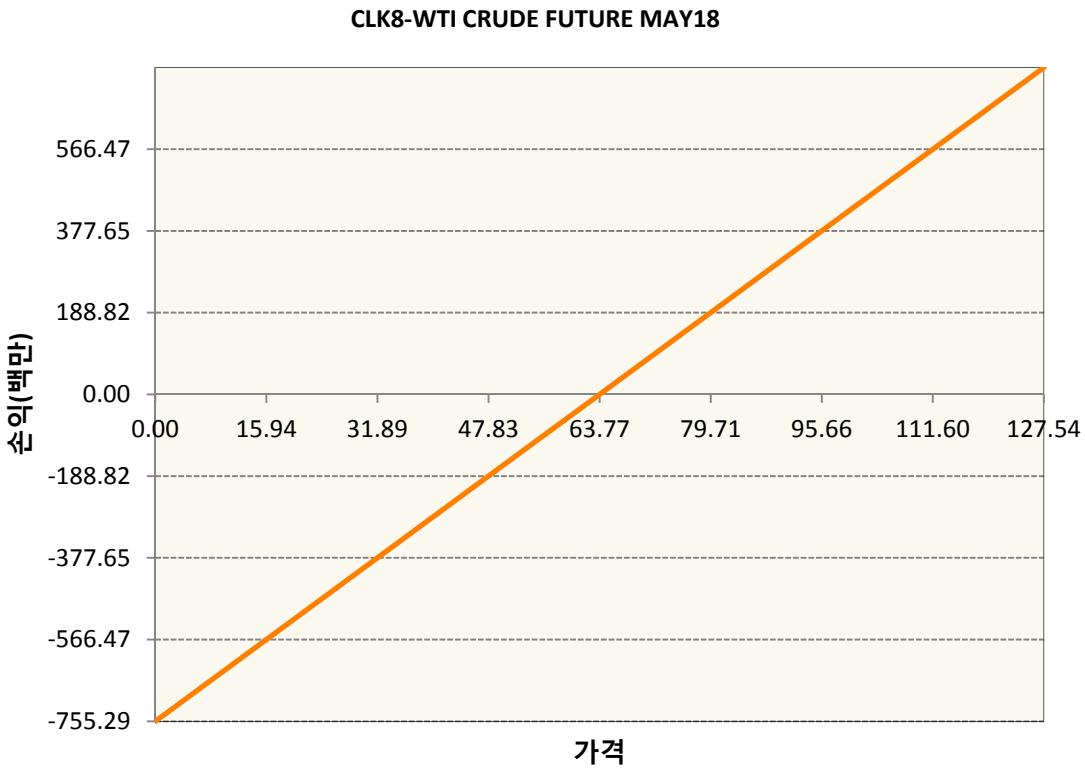
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

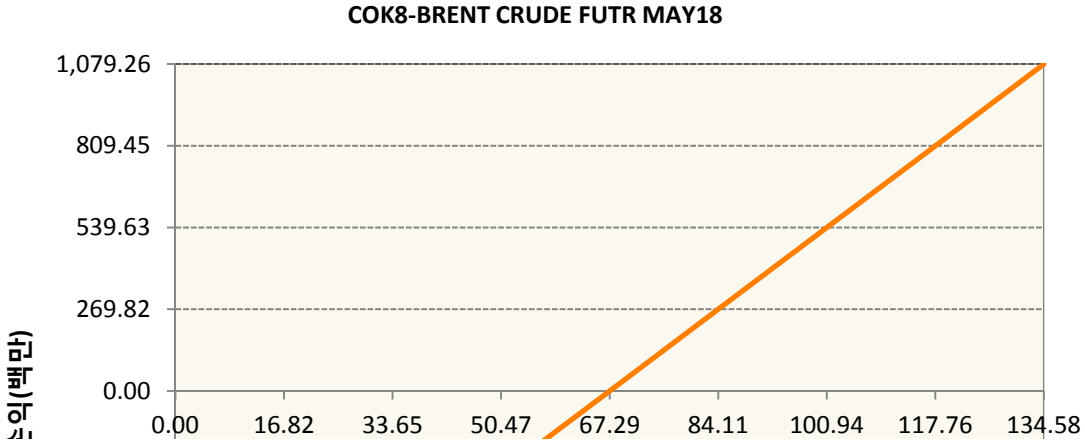
1. 계약금액

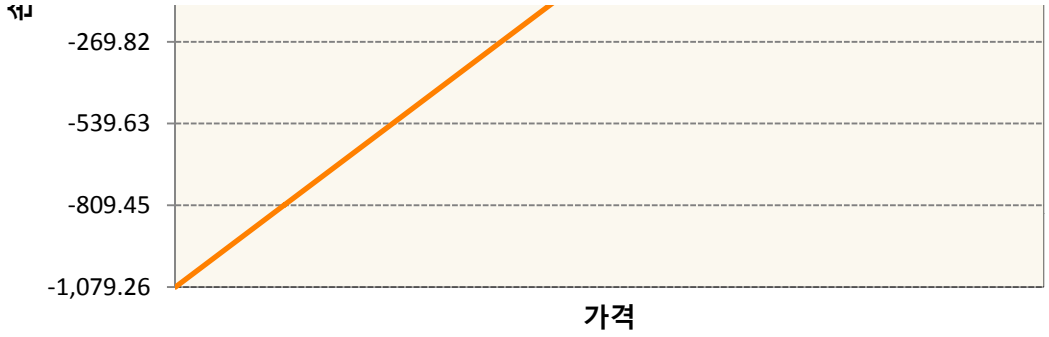
(단위:백만원)

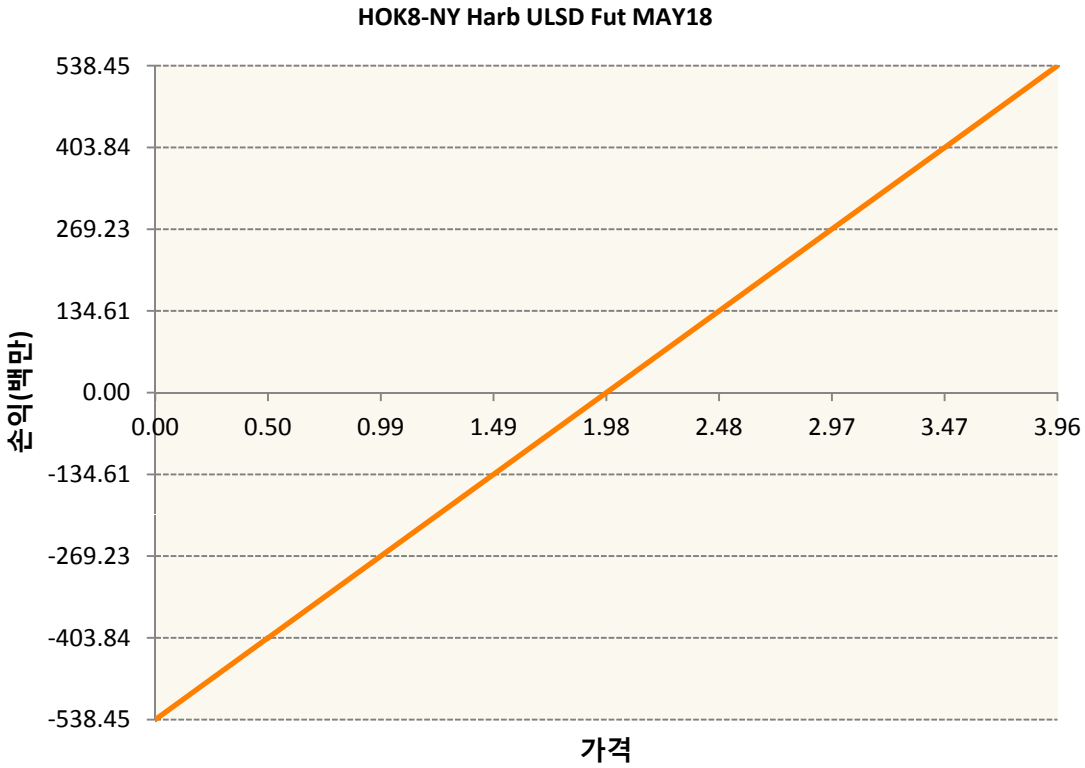
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	선물	유가증권	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	선물	유가증권	755	0	755	
누계	유가증권	선물	3,307	589	2,718	

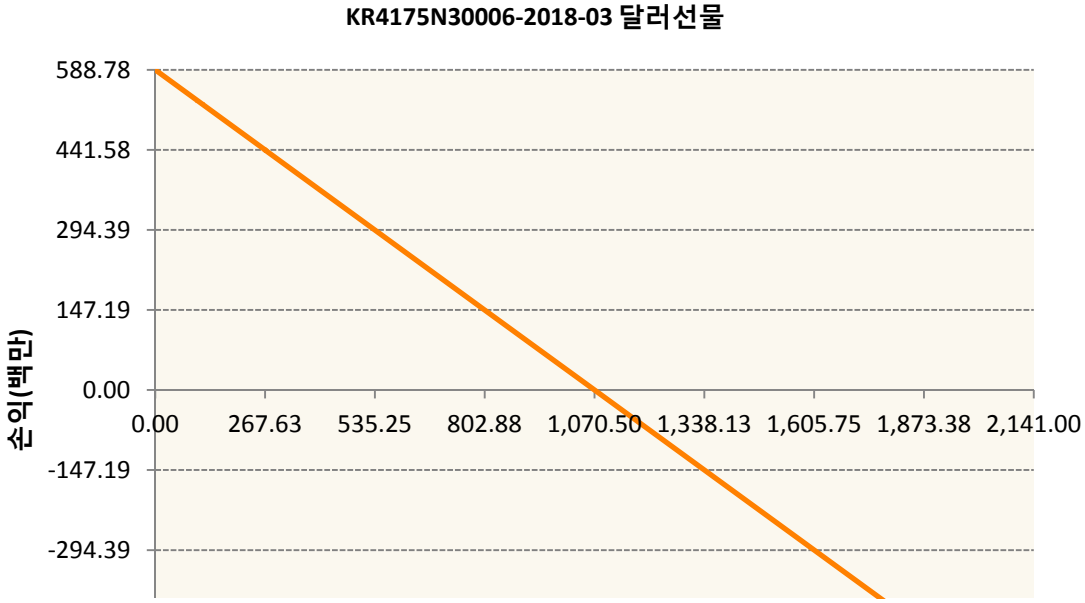
2. 만기시점의 손익구조

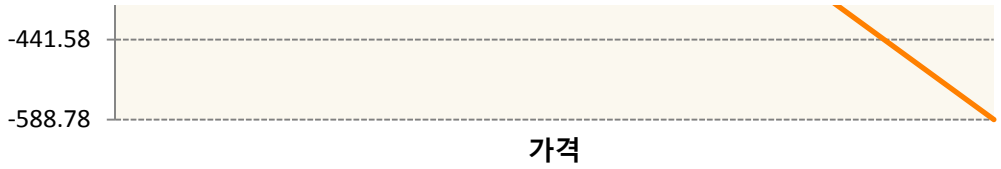


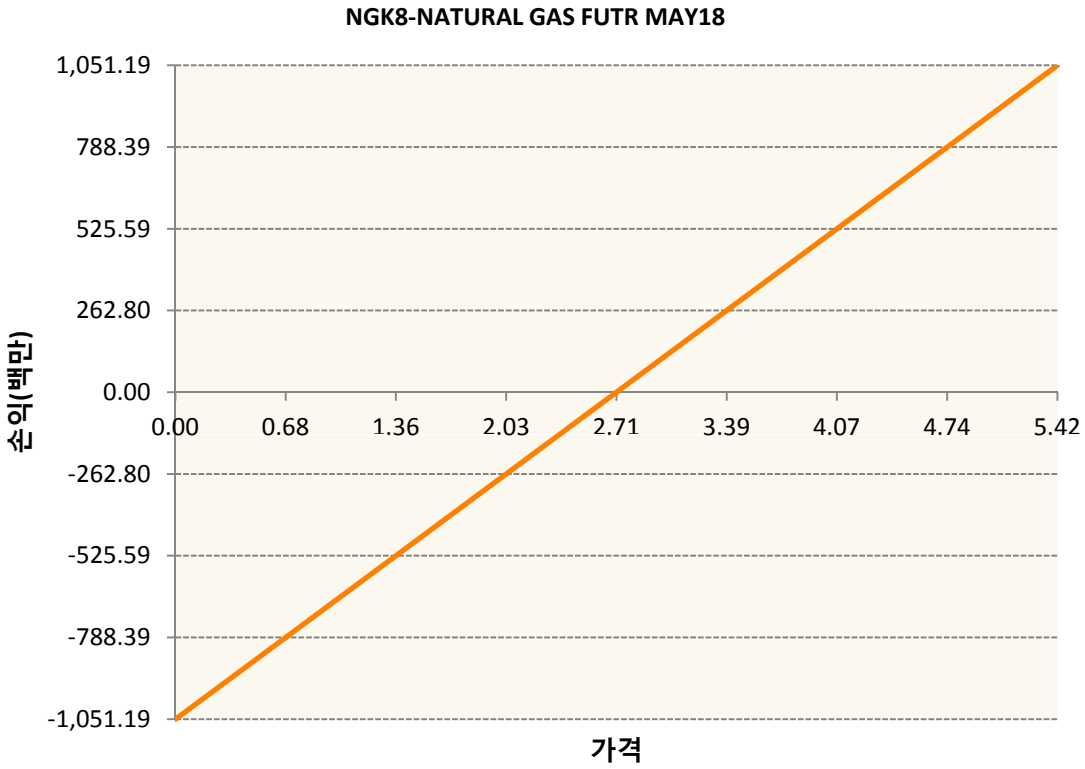


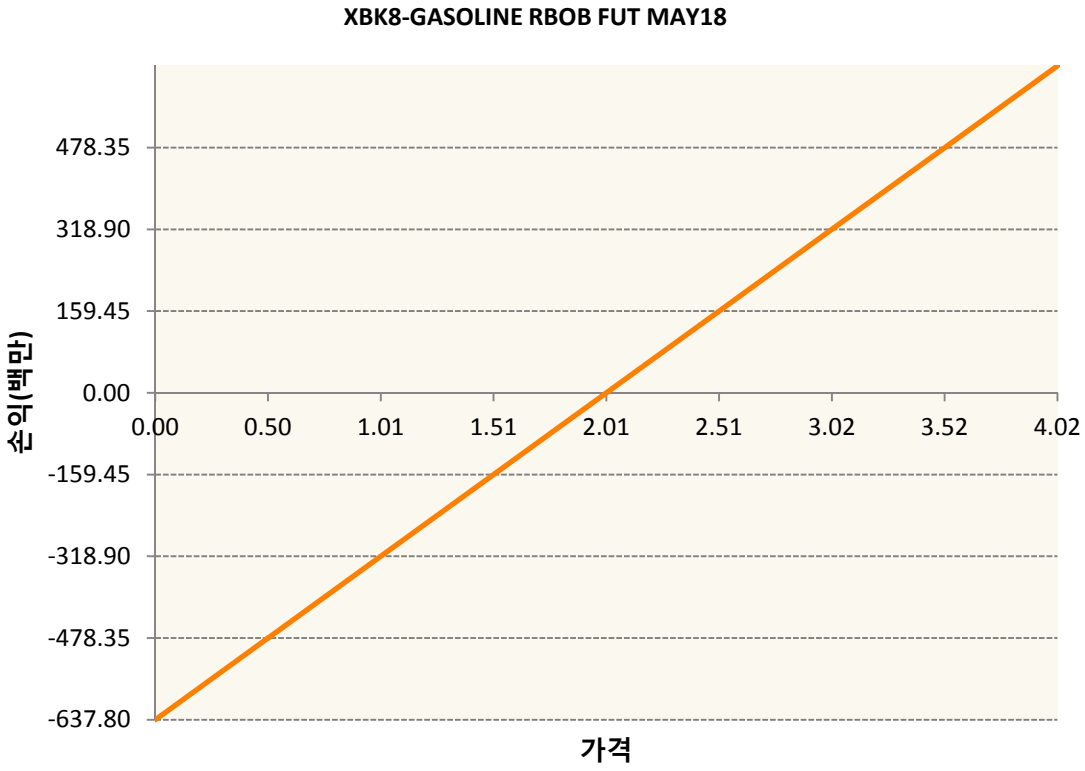

-269.82
-539.63
-809.45
-1,079.26
가격


HOK8-NY Harb ULSD Fut MAY18
538.45
403.84
269.23
134.61
0.00
-134.61
-269.23
-403.84
-538.45
손익(백만)
0.00
0.50
0.99
1.49
1.98
2.48
2.97
3.47
3.96
가격


KR4175N30006-2018-03 달러선물
588.78
441.58
294.39
147.19
0.00
-147.19
-294.39
손익(백만)
0.00
267.63
535.25
802.88
1,070.50
1,338.13
1,605.75
1,873.38
2,141.00


-441.58
-588.78
가격


NGK8-NATURAL GAS FUTR MAY18
1,051.19
788.39
525.59
262.80
0.00
-262.80
-525.59
-788.39
-1,051.19
0.00
0.68
1.36
2.03
2.71
3.39
4.07
4.74
5.42
손익(백만)
가격


XBK8-GASOLINE RBOB FUT MAY18
478.35
318.90
159.45
0.00
-159.45
-318.90
-478.35
-637.80
0.00
0.50
1.01
1.51
2.01
2.51
3.02
3.52
4.02
손익(백만)
가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLK8	WTI CRUDE FUTURE MAY18	60
COK8	BRENT CRUDE FUTR MAY18	86
HOK8	NY Harb ULSD Fut MAY18	43
KR4175N30(	2018-03 달러선물	47
NGK8	NATURAL GAS FUTR MAY18	84
XBK8	GASOLINE RBOB FUT MAY18	51

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

532

공시일	2018-02-28
기준일	2018-02-27

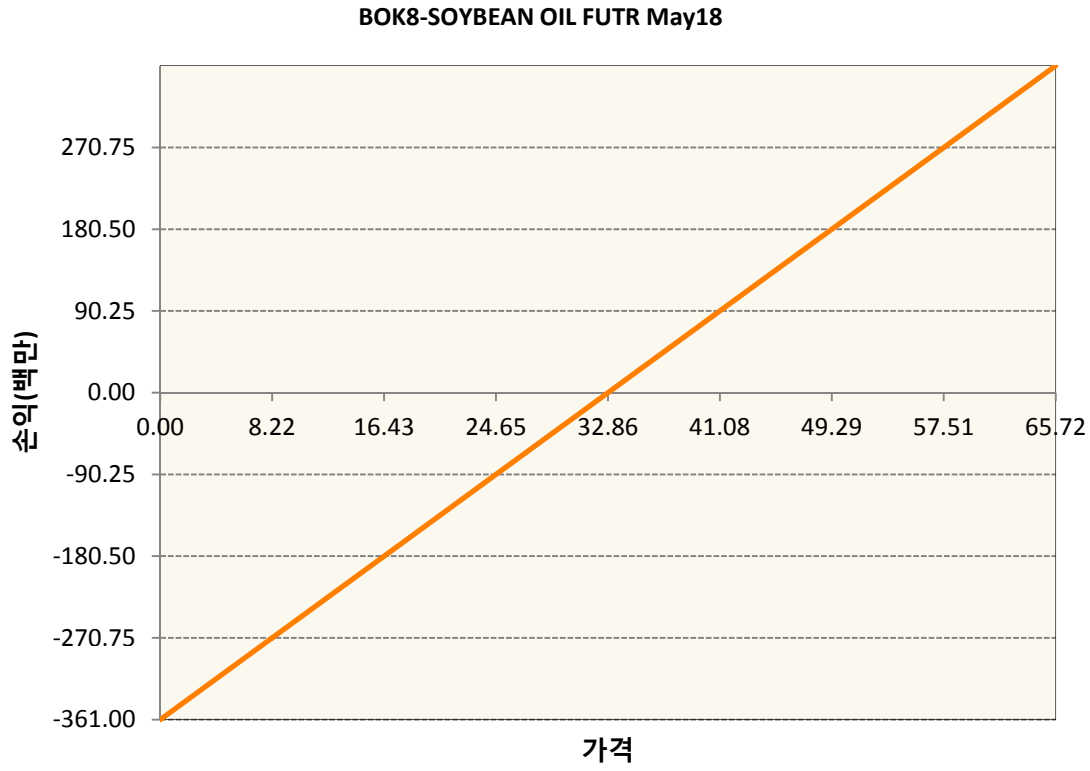
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

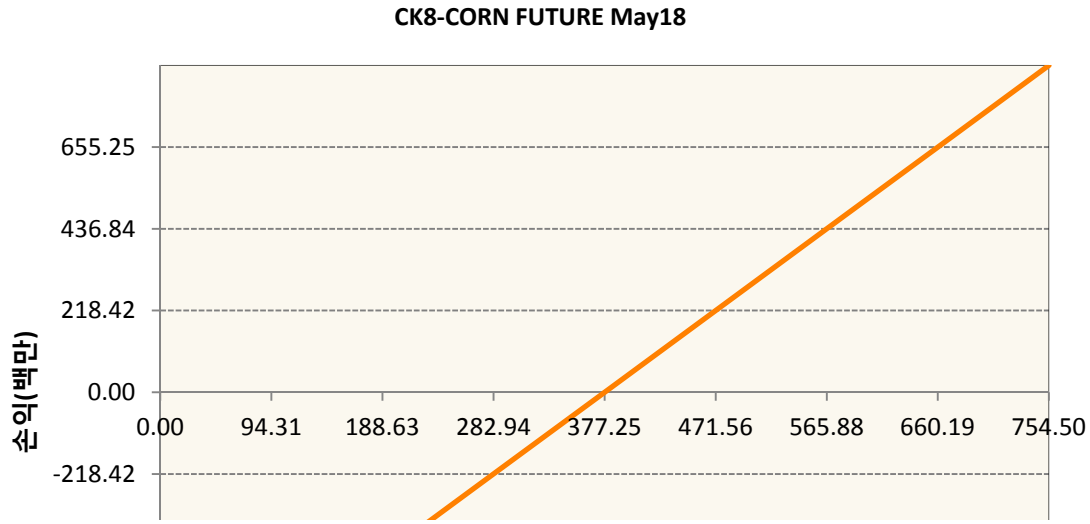
1. 계약금액

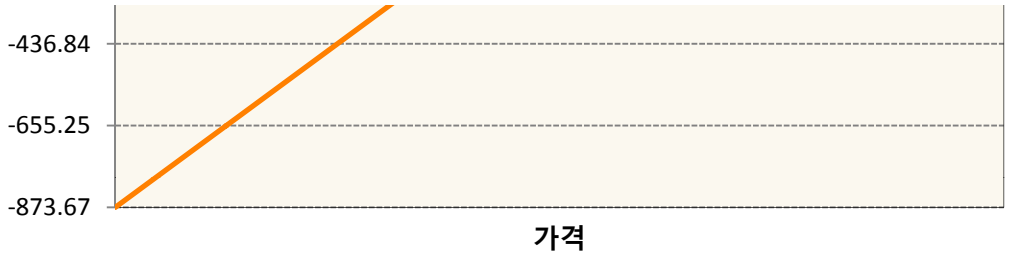
(단위:백만원)

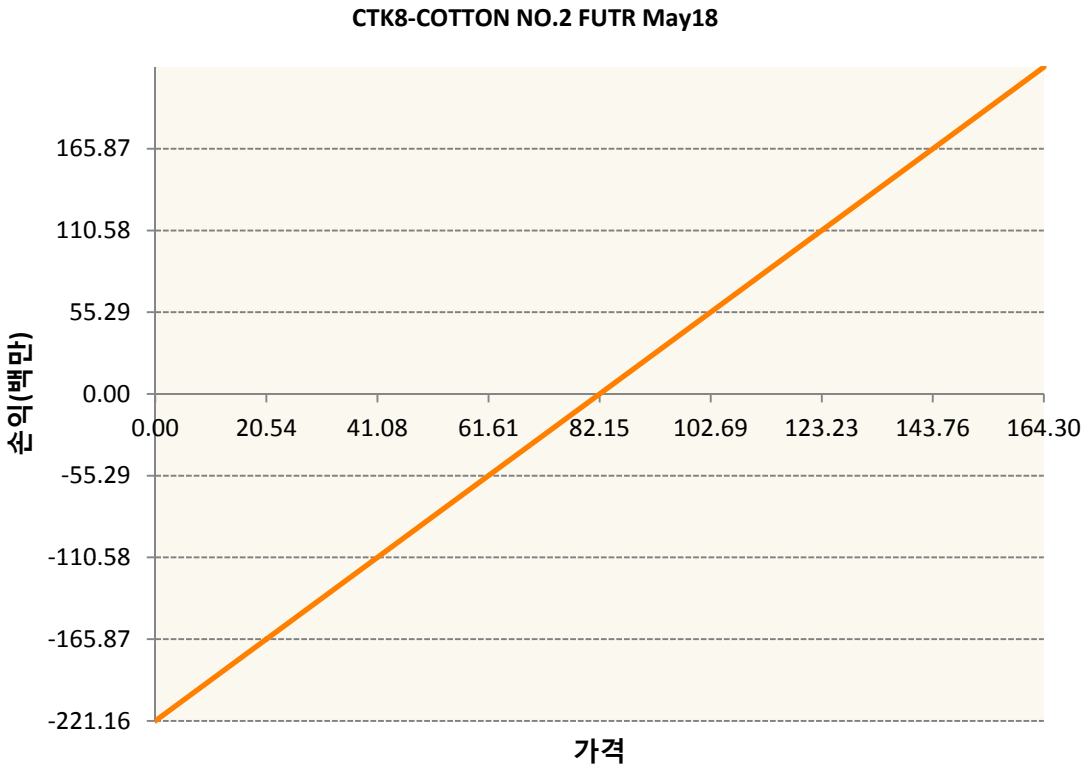
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	4,170	321	3,849	

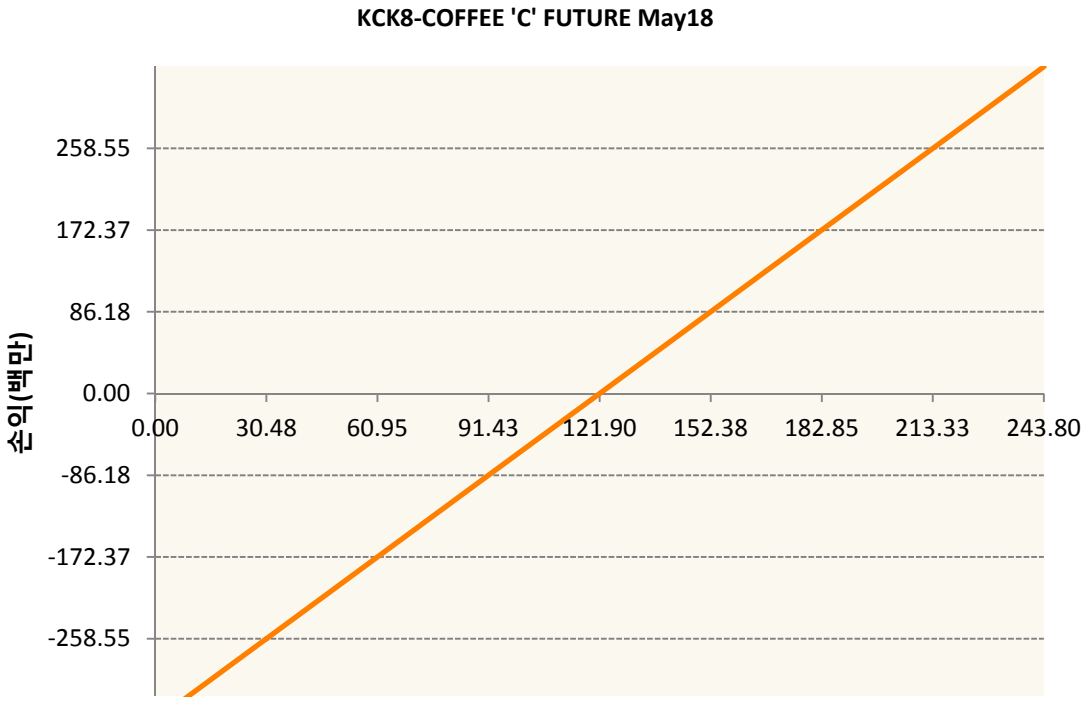
2. 만기시점의 손익구조

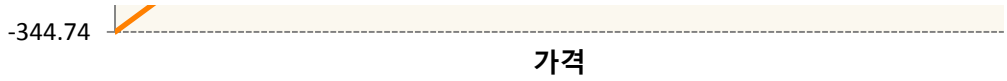


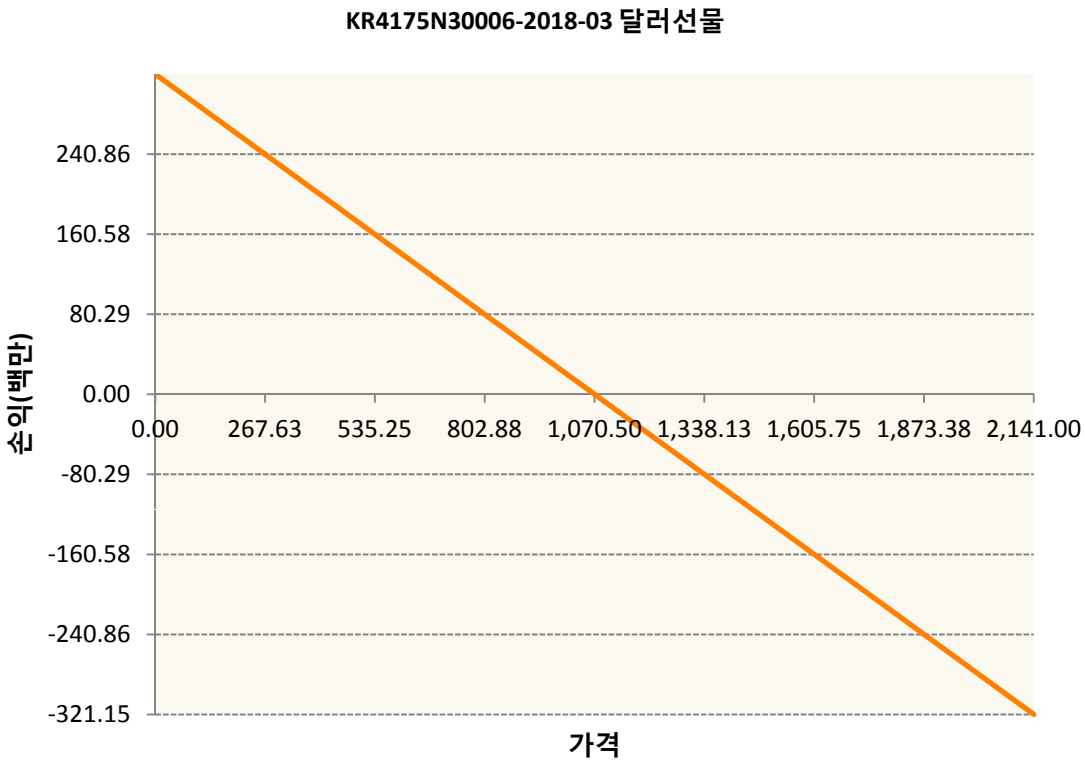


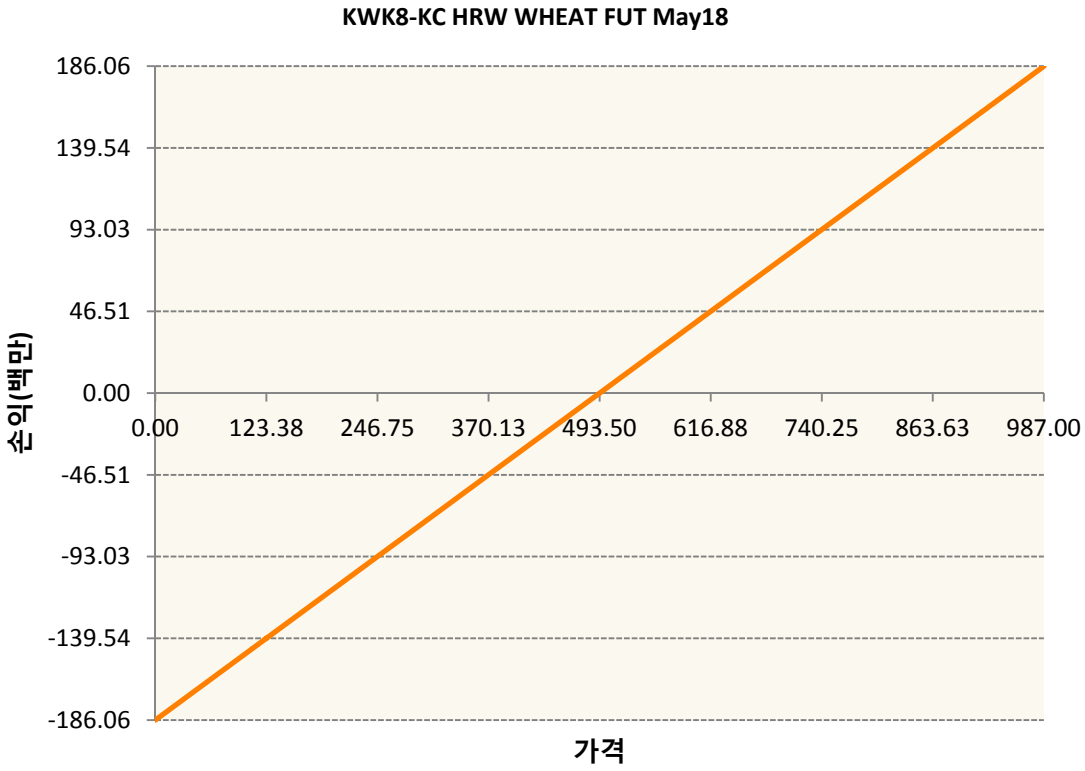

-436.84
-655.25
-873.67
가격

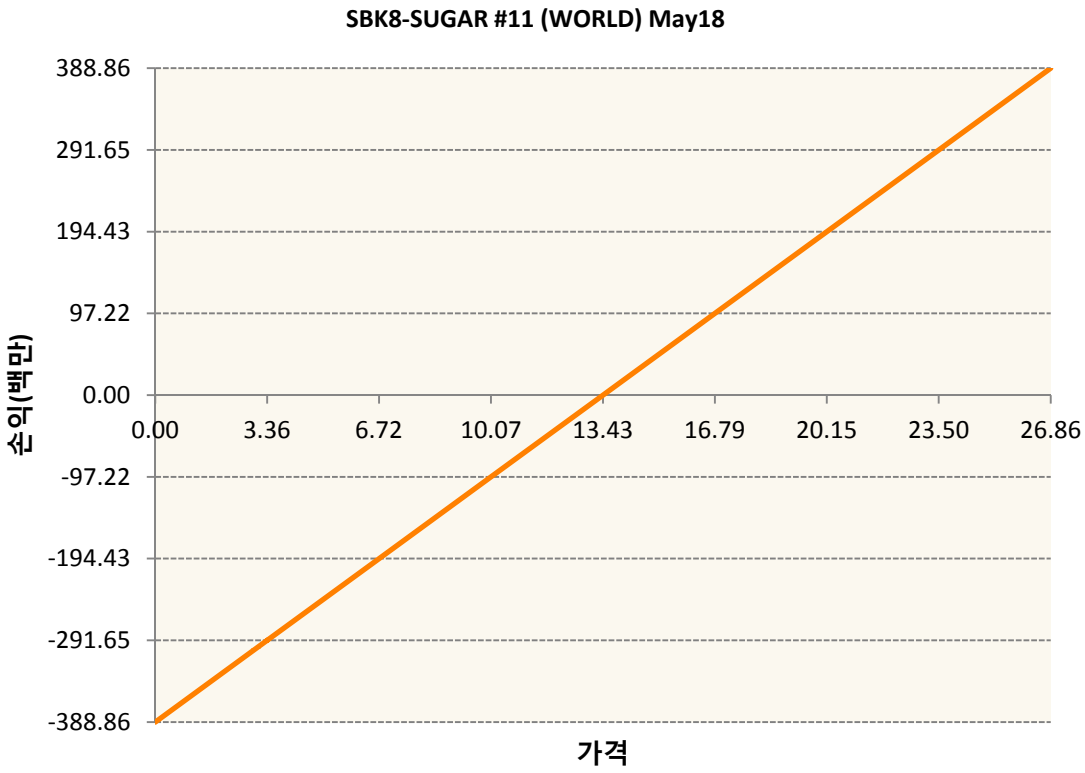

CTK8-COTTON NO.2 FUTR May18
165.87
110.58
55.29
0.00
-55.29
-110.58
-165.87
-221.16
0.00
20.54
41.08
61.61
82.15
102.69
123.23
143.76
164.30
손익(백만)
가격

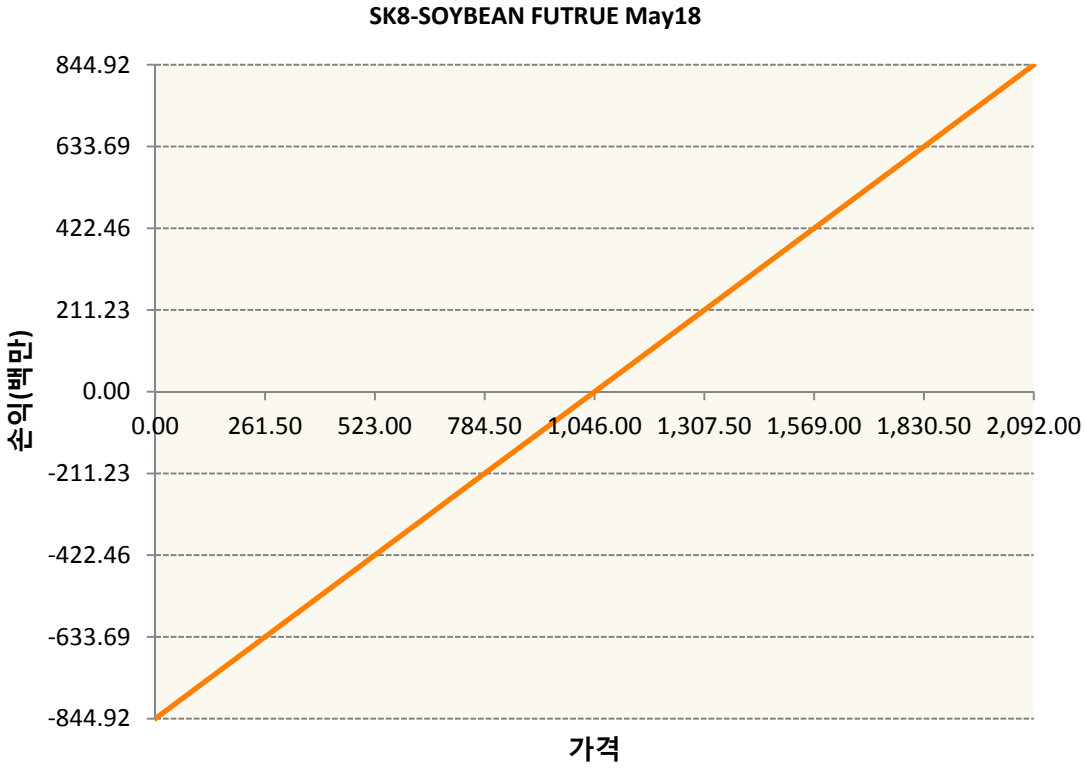

KCK8-COFFEE 'C' FUTURE May18
258.55
172.37
86.18
0.00
-86.18
-172.37
-258.55
0.00
30.48
60.95
91.43
121.90
152.38
182.85
213.33
243.80
손익(백만)


-344.74
가격

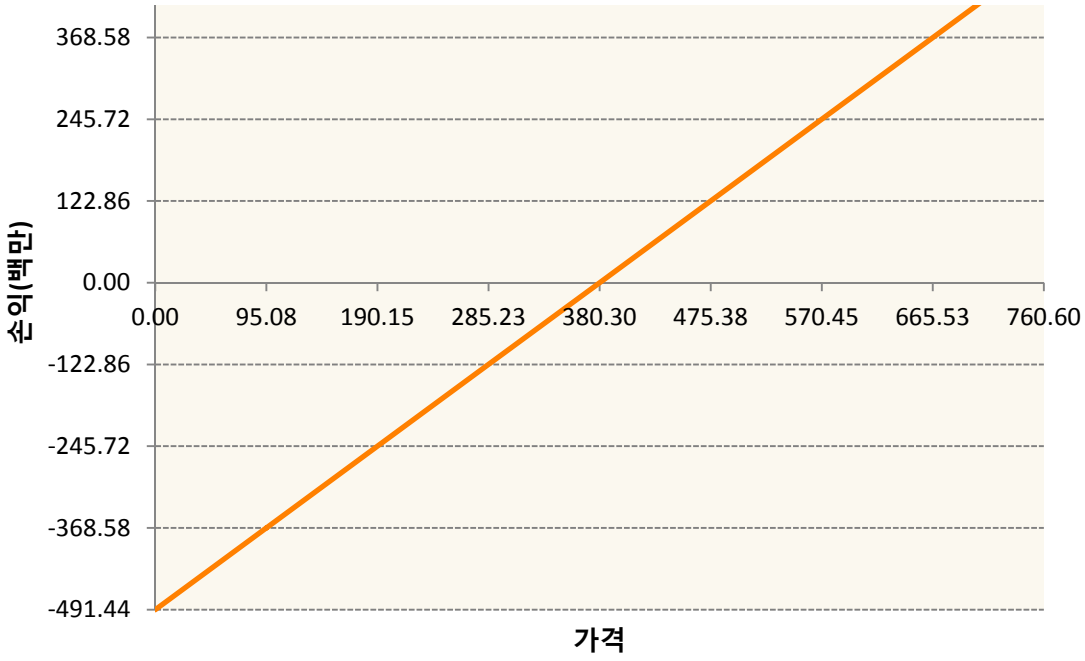

KR4175N30006-2018-03 달러선물
240.86
160.58
80.29
0.00
-80.29
-160.58
-240.86
-321.15
0.00
267.63
535.25
802.88
1,070.50
1,338.13
1,605.75
1,873.38
2,141.00
손익(백만)
가격

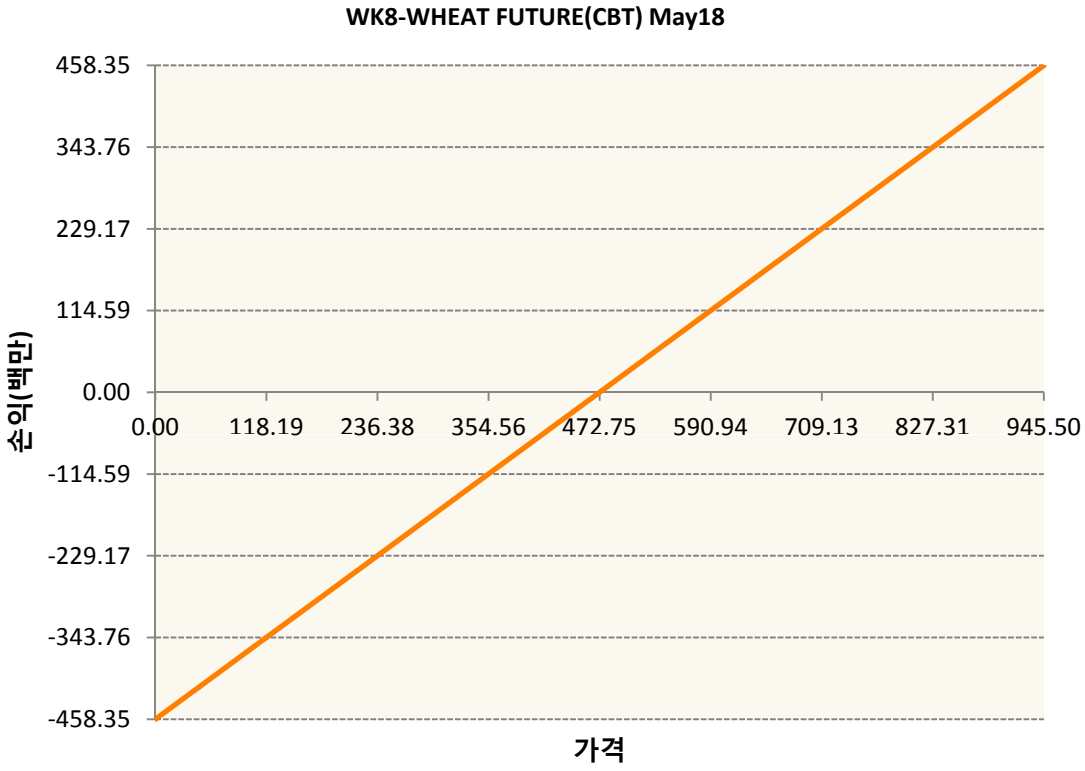

KWK8-KC HRW WHEAT FUT May18
186.06
139.54
93.03
46.51
0.00
-46.51
-93.03
-139.54
-186.06
0.00
123.38
246.75
370.13
493.50
616.88
740.25
863.63
987.00
손익(백만)
가격


SBK8-SUGAR #11 (WORLD) May18
388.86
291.65
194.43
97.22
0.00
-97.22
-194.43
-291.65
-388.86
0.00
3.36
6.72
10.07
13.43
16.79
20.15
23.50
26.86
손익(백만)
가격


SK8-SOYBEAN FUTRUE May18
844.92
633.69
422.46
211.23
0.00
-211.23
-422.46
-633.69
-844.92
0.00
261.50
523.00
784.50
1,046.00
1,307.50
1,569.00
1,830.50
2,092.00
손익(백만)
가격


SMK8-SOYBEAN MEAL FUTR May18
491.44





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

BOK8	SOYBEAN OIL FUTR May18	29
CK8	CORN FUTURE May18	70
CTK8	COTTON NO.2 FUTR May18	18
KCK8	COFFEE 'C' FUTURE May18	28
KR4175N30(	2018-03 달러선물	26

KWK8	KC HRW WHEAT FUT May18	15
SBK8	SUGAR #11 (WORLD) May18	31
SK8	SOYBEAN FUTRUE May18	68
SMK8	SOYBEAN MEAL FUTR May18	39
WK8	WHEAT FUTURE(CBT) May18	37

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

334