공시일	2018-03-12
기준일	2018-03-09

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	2018-03-12
기준일	2018-03-09

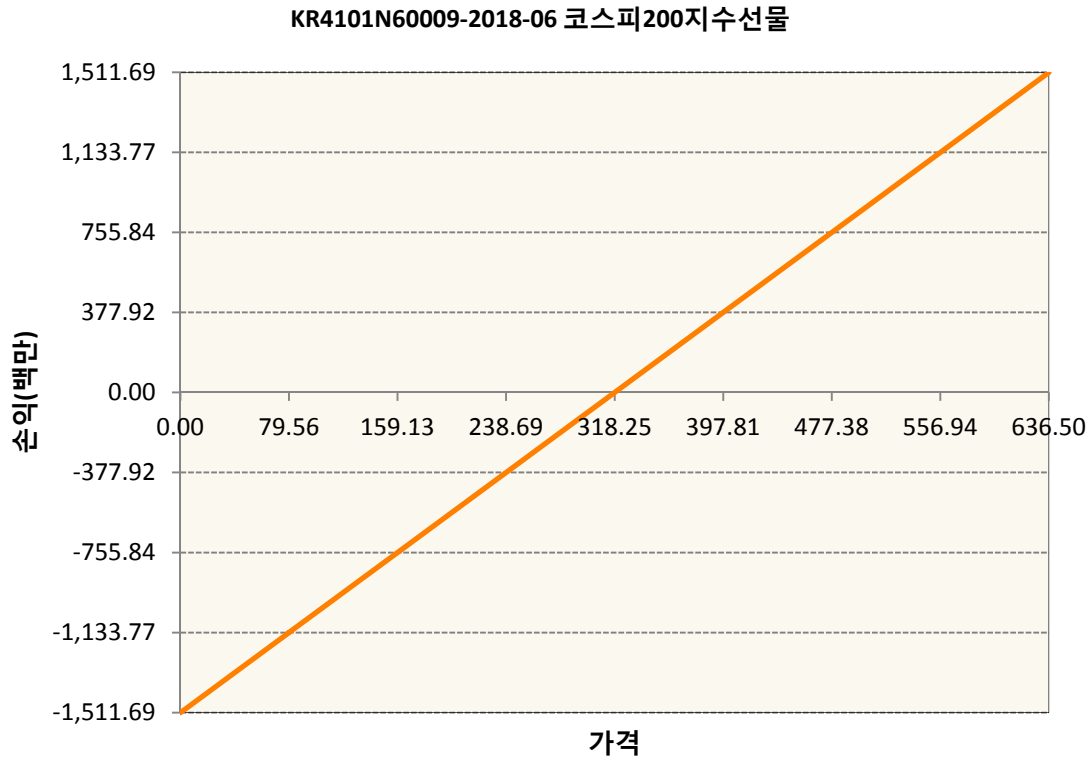
스마트인덱스모

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	1,512	0	1,512	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101N60(2018-06 코스피200지수선물							121
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-121	-121	-121	-121	-121	-121	-121
-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%	121	121	121	121	121	121	121

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

84

공시일	2018-03-12
기준일	2018-03-09

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	1,115

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

416

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2018-03-12
기준일	2018-03-09

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	415

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

414

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2018-03-12
기준일	2018-03-09

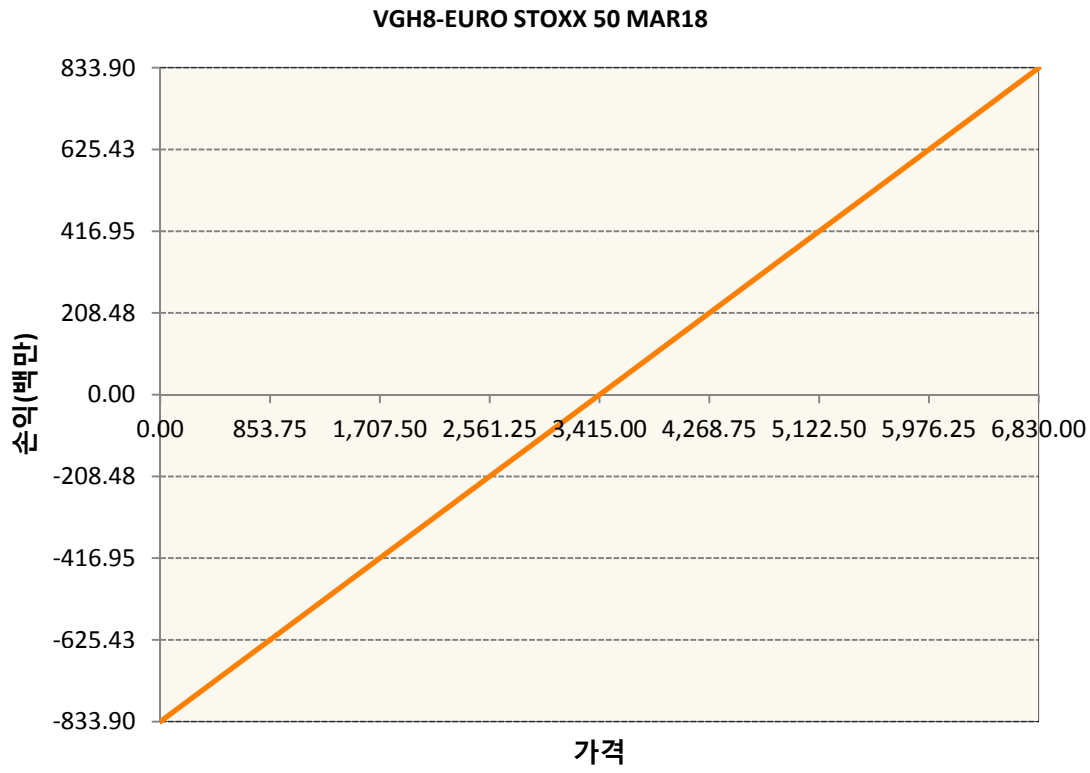
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	834	0	834	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGH8	EURO STOXX 50 MAR18	67

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

(단위:백만원)

39

공시일	2018-03-12
기준일	2018-03-09

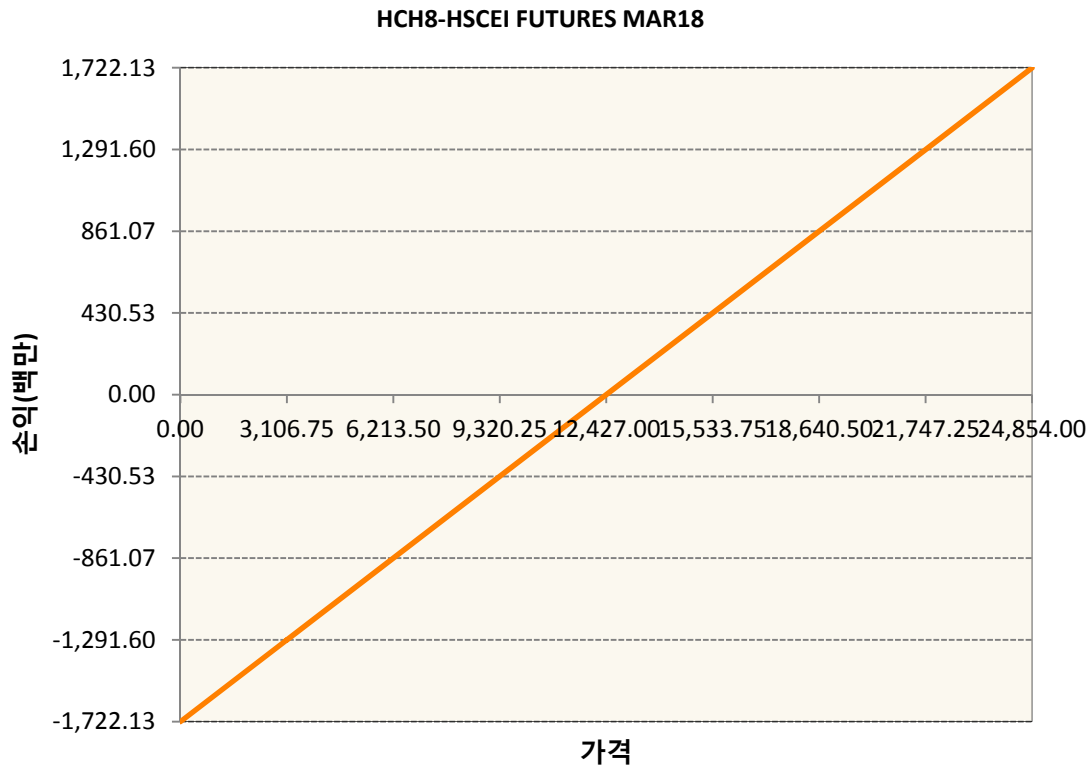
차이나인덱스모(주식-파생형)

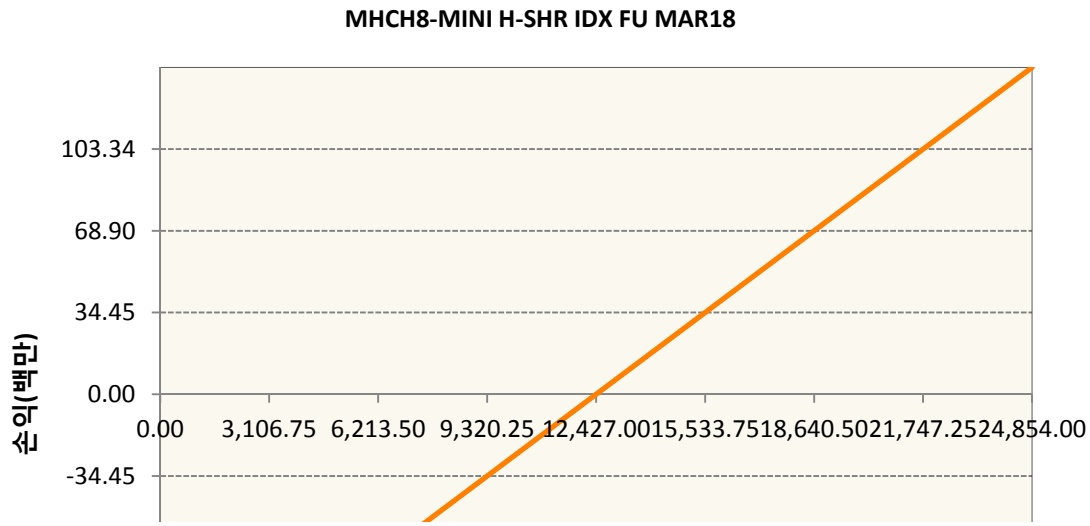
1. 계약금액

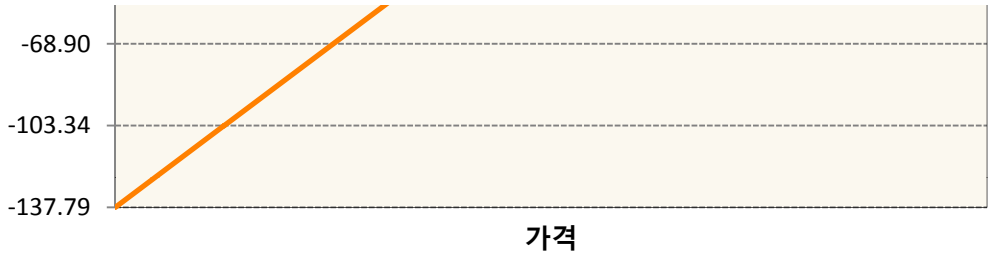
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,860	0	1,860	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCH8	HSCEI FUTURES MAR18	138
MHCH8	MINI H-SHR IDX FU MAR18	11

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

공시일	2018-03-12
기준일	2018-03-09

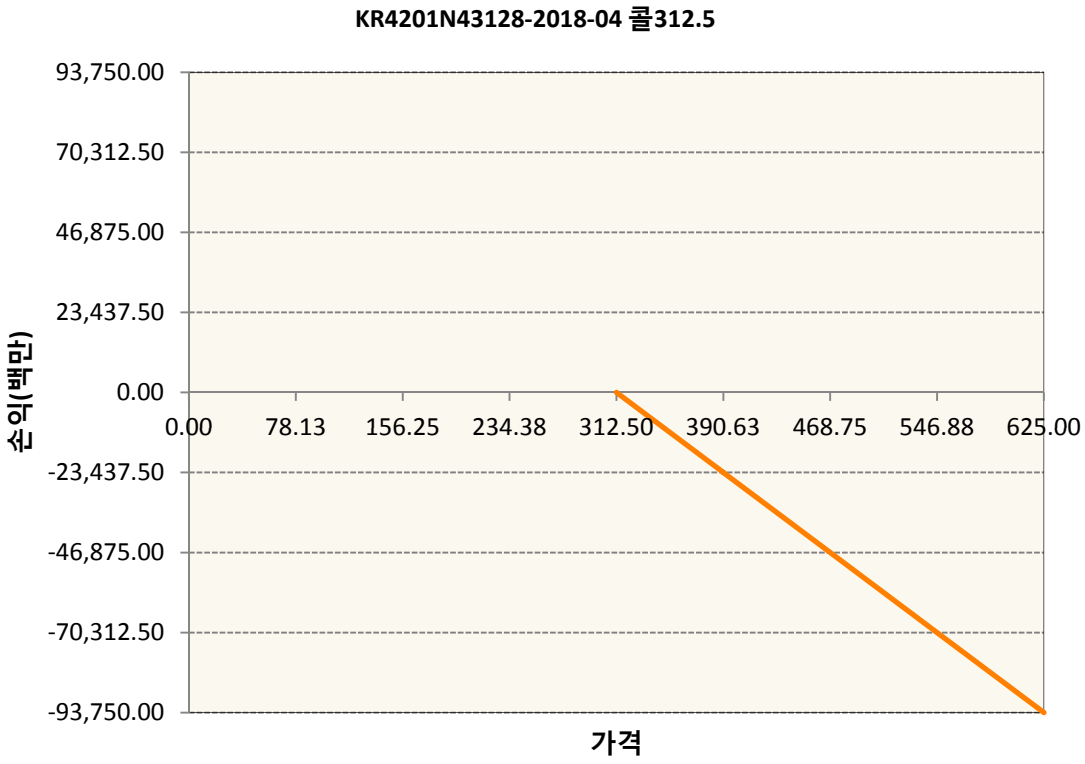
커버드콜모(주식혼합-파생형)

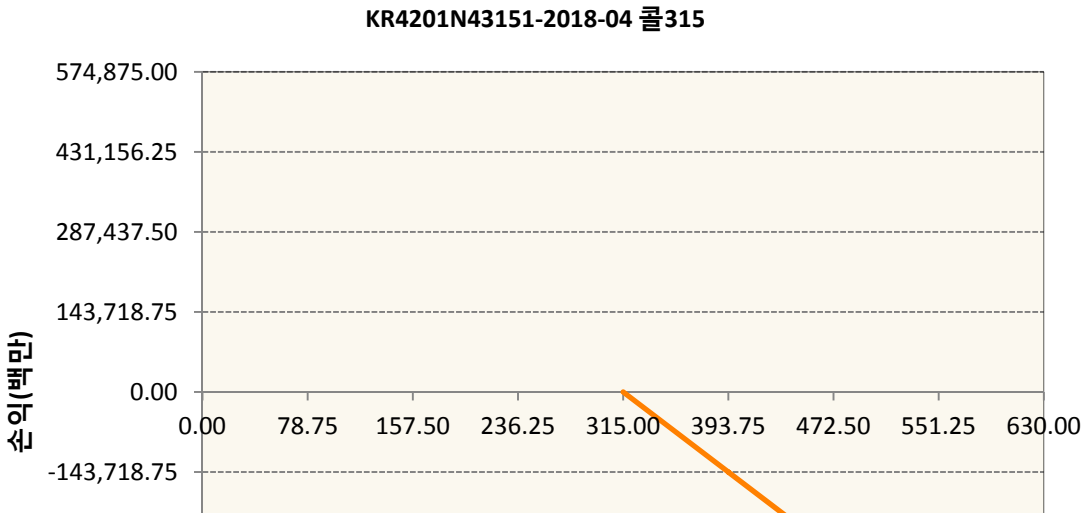
1. 계약금액

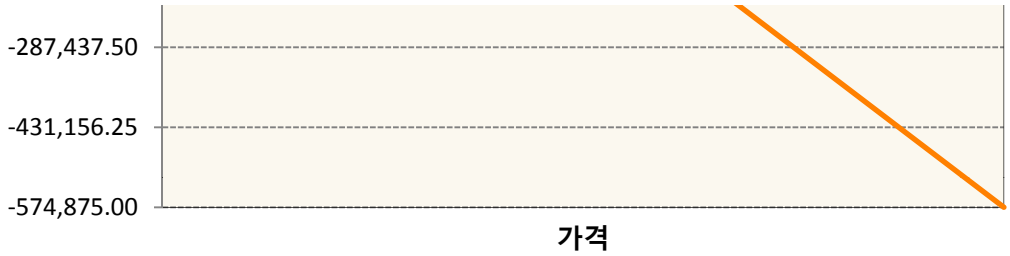
(단위:백만원)

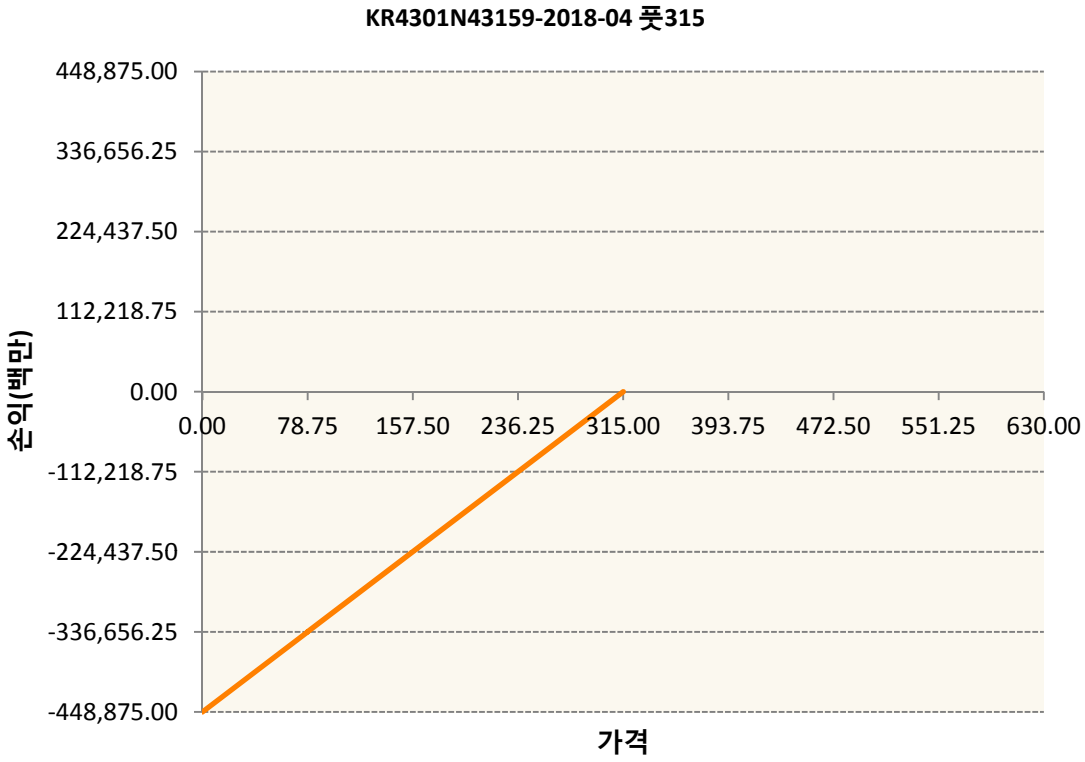
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	60,667	1,010,537	-949,870	장내
누계	유가증권	옵션	0	1,117,500	-1,117,500	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201N4312018-04 콜312.5							6,237
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	3,507	3,368	3,213	3,046	2,870	2,685	2,494
-5.33%	2,992	2,786	2,574	2,357	2,135	1,911	1,683
-2.67%	2,088	1,842	1,595	1,348	1,101	853	606
0%	737	493	247	0	-248	-496	-745
2.67%	-1,034	-1,239	-1,451	-1,671	-1,895	-2,124	-2,356
5.33%	-3,135	-3,281	-3,442	-3,617	-3,803	-3,997	-4,200
8.00%	-5,453	-5,542	-5,651	-5,777	-5,918	-6,072	-6,237
KR4201N4312018-04 콜315							36,792
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	19,373	18,630	17,787	16,861	15,867	14,814	13,713

-5.33%	16,774	15,620	14,409	13,154	11,865	10,547	9,206
-2.67%	12,006	10,546	9,075	7,596	6,110	4,620	3,125
0%	4,594	3,065	1,533	0	-1,535	-3,070	-4,606
2.67%	-5,455	-6,801	-8,184	-9,595	-11,028	-12,479	-13,944
5.33%	-17,687	-18,695	-19,790	-20,953	-22,173	-23,440	-24,744
8.00%	-31,438	-32,090	-32,857	-33,724	-34,677	-35,703	-36,792
KR4301N4312018-04 풋315							26,938

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-25,881	-25,963	-26,081	-26,239	-26,436	-26,670	-26,938
-5.33%	-14,386	-14,687	-15,035	-15,423	-15,845	-16,296	-16,771
-2.67%	-4,580	-5,178	-5,791	-6,415	-7,047	-7,685	-8,329
0%	2,021	1,351	677	0	-678	-1,359	-2,040
2.67%	5,195	4,753	4,273	3,762	3,226	2,669	2,095
5.33%	6,226	6,047	5,818	5,542	5,223	4,865	4,473
8.00%	6,448	6,402	6,326	6,216	6,070	5,886	5,666

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

67,958

공시일	2018-03-12
기준일	2018-03-09

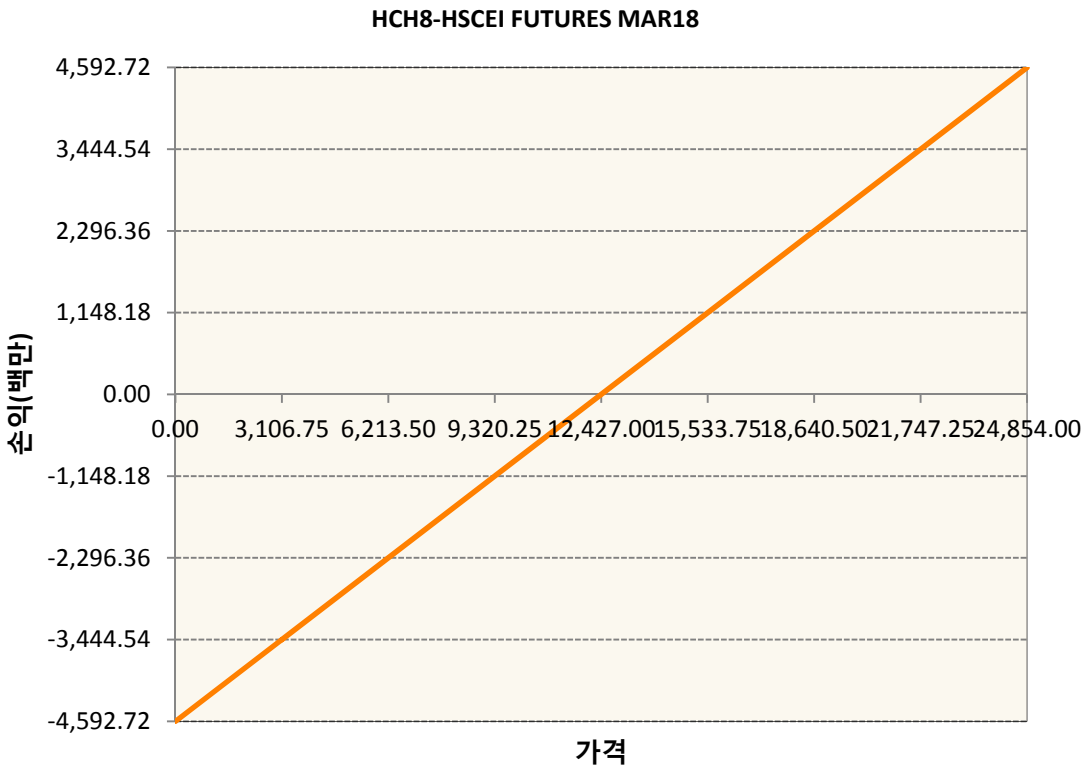
홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생

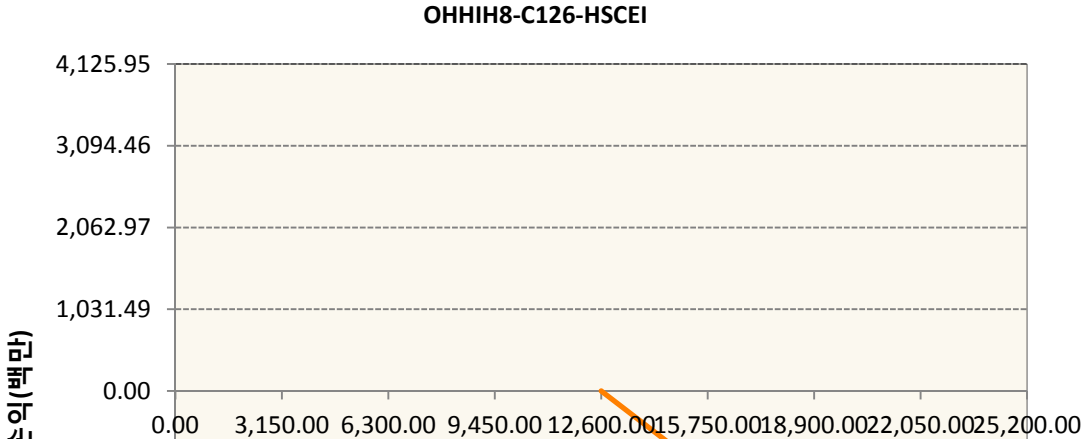
1. 계약금액

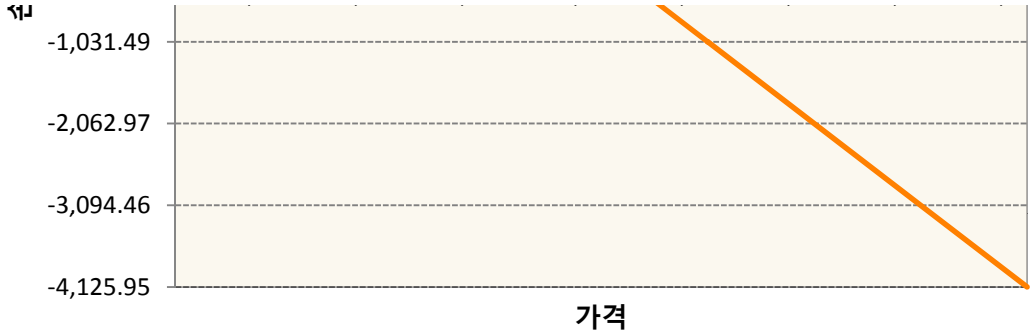
(단위:백만원)

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	4,593	0	4,593	장내
누계	유가증권	옵션	0	10,697	-10,697	장내

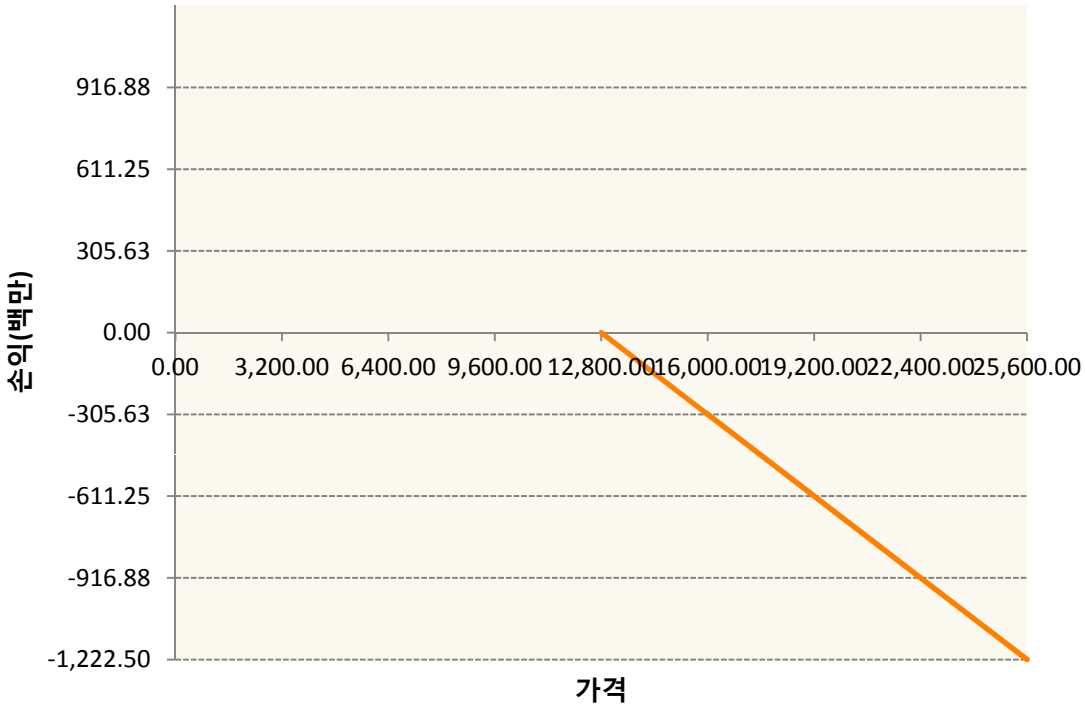
2. 만기시점의 손익구조



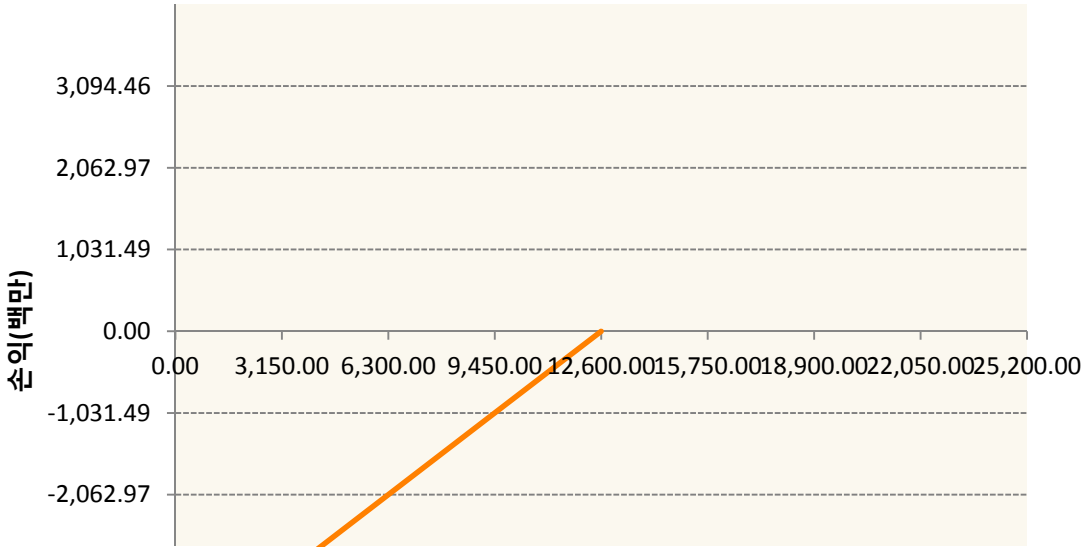


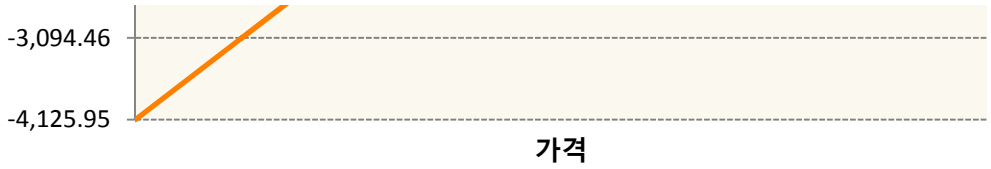


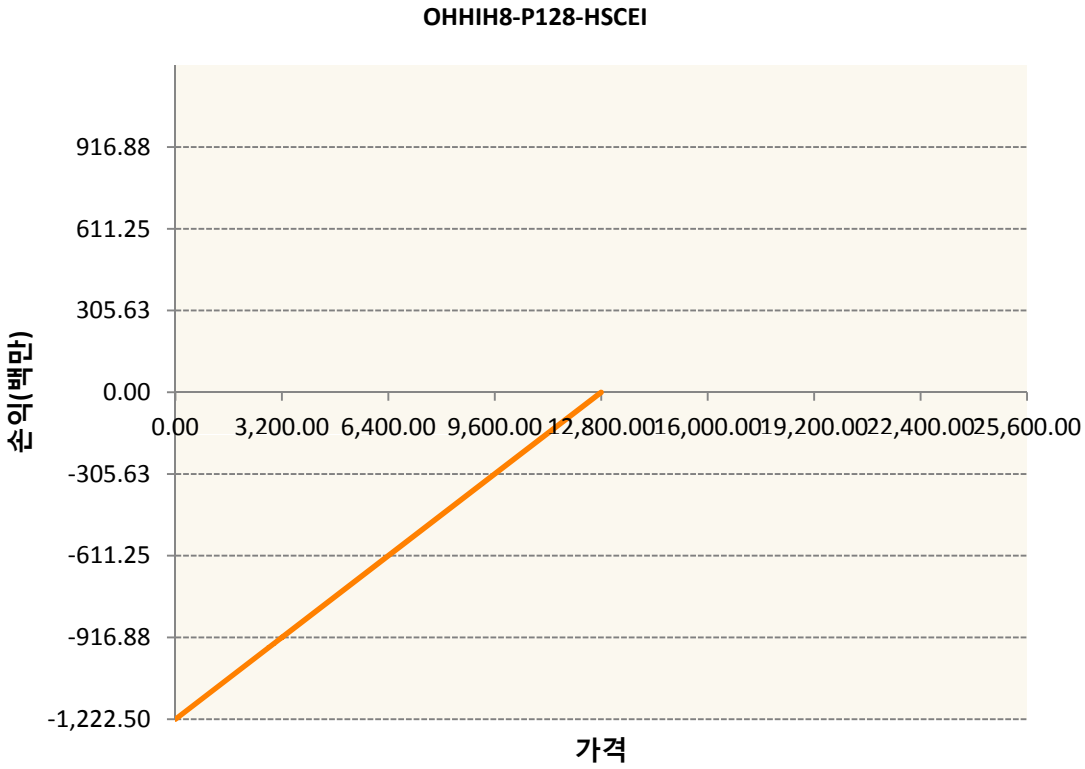
OHHIH8-C128-HSCEI



OHHIH8-P126-HSCEI







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCH8	HSCEI FUTURES MAR18	367
OHHIH8-C12	HSCEI	330
OHHIH8-C12	HSCEI	98
OHHIH8-P12	HSCEI	330
OHHIH8-P12	HSCEI	98

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,068

공시일	2018-03-12
기준일	2018-03-09

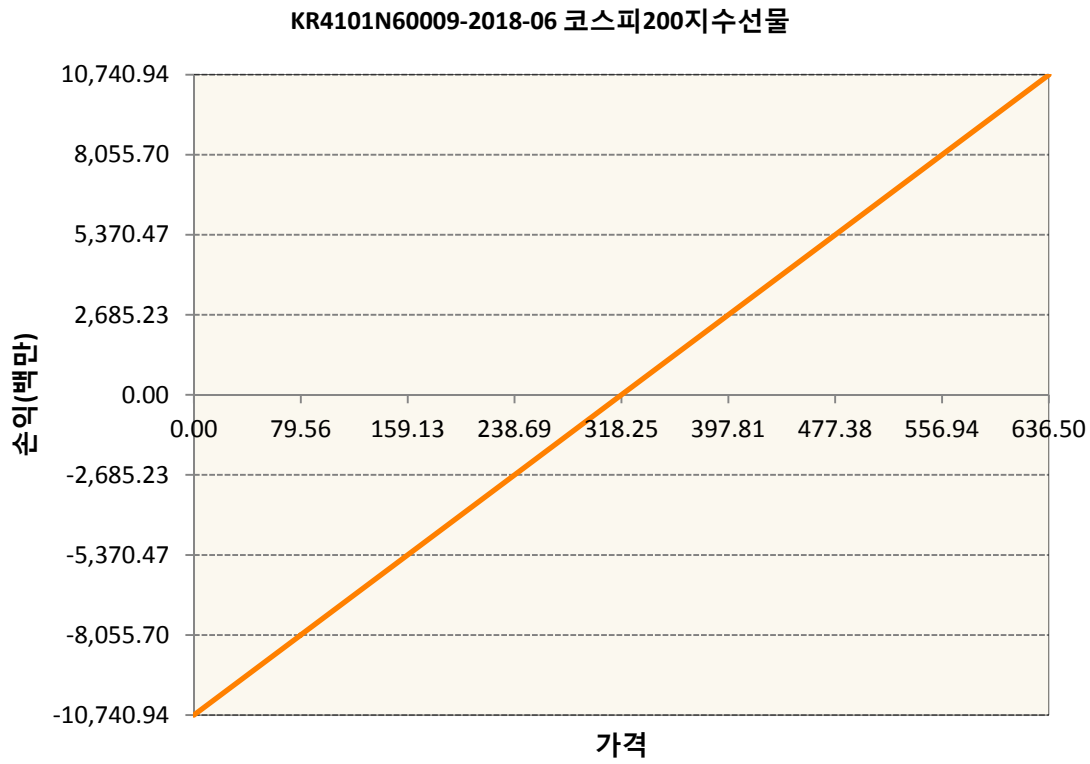
코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼

1. 계약금액

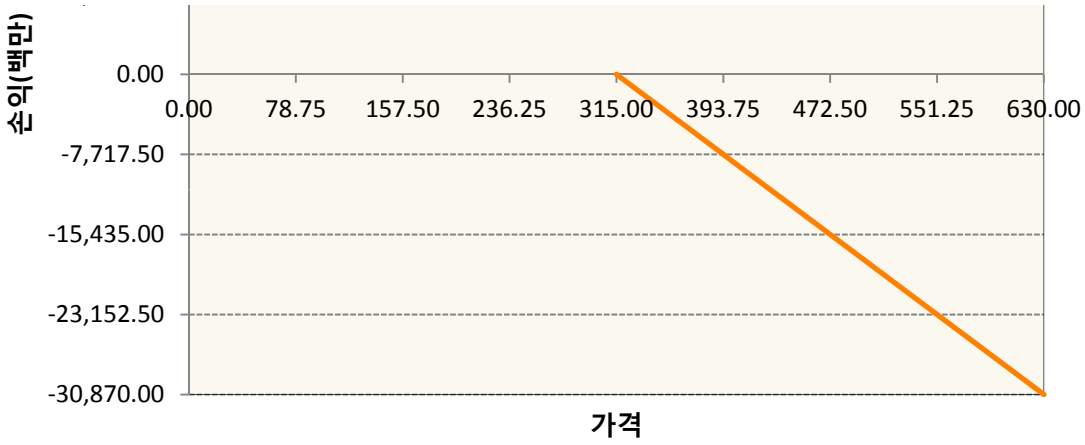
(단위:백만원)

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	57,059	-57,059	장내
누계	유가증권	선물	10,741	0	10,741	장내
누계	유가증권	스왑	56,200	0	56,200	장외
누계	유가증권	옵션	0	56,033	-56,033	장내

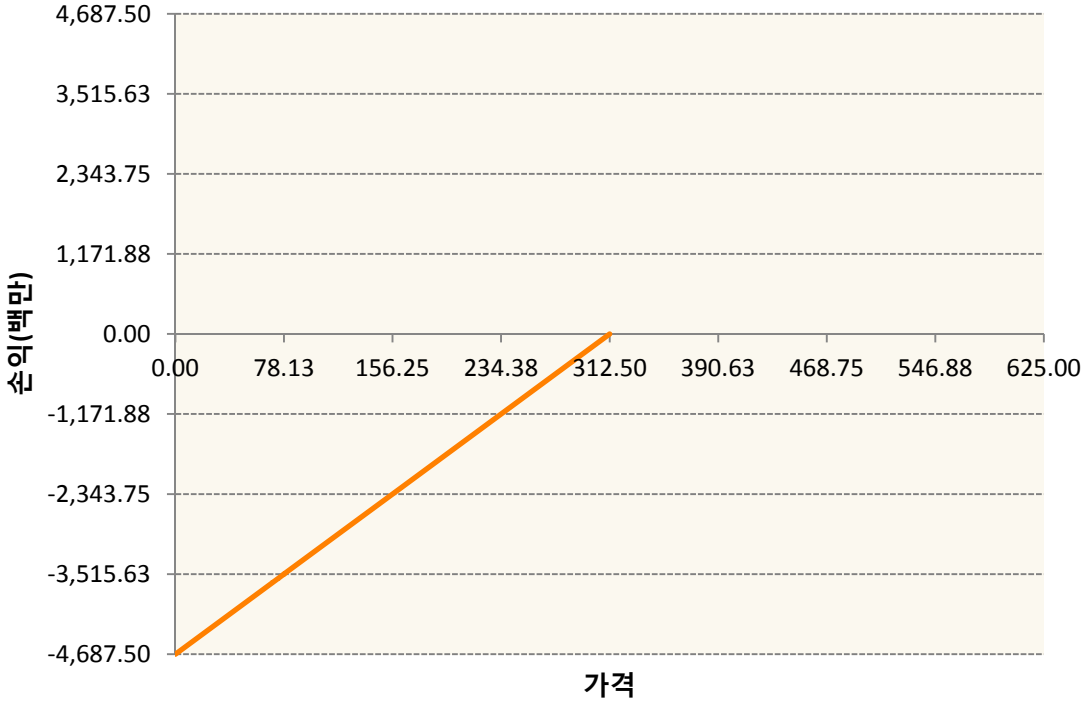
2. 만기시점의 손익구조



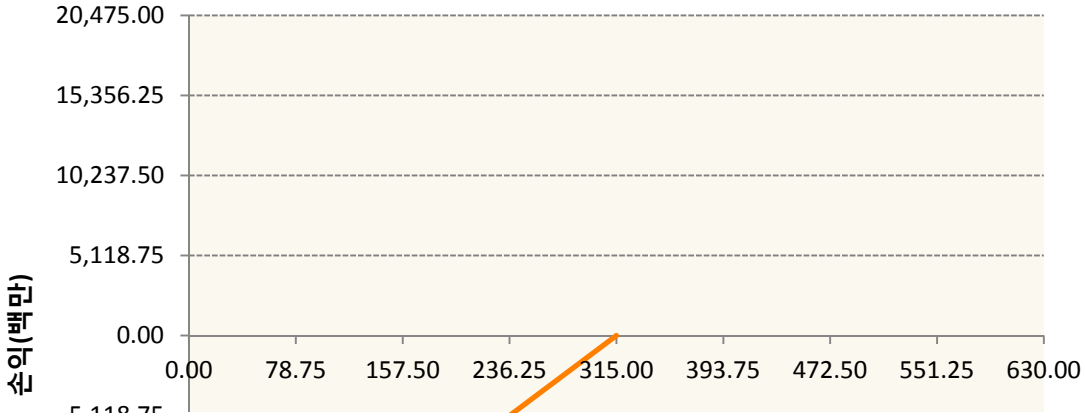




KR4301N43126-2018-04 풋312.5



KR4301N43159-2018-04 풋315





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_2							1,445
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,445	-1,445	-1,445	-1,445	-1,445	-1,445	-1,445
-5.33%	-963	-963	-963	-963	-963	-963	-963
-2.67%	-482	-482	-482	-482	-482	-482	-482
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	482	482	482	482	482	482	482
5.33%	963	963	963	963	963	963	963
8.00%	1,445	1,445	1,445	1,445	1,445	1,445	1,445
2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_3							273
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-273	-273	-273	-273	-273	-273	-273
-5.33%	-182	-182	-182	-182	-182	-182	-182
-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%	182	182	182	182	182	182	182
8.00%	273	273	273	273	273	273	273
2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_4							156
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-156	-156	-156	-156	-156	-156	-156
-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%	156	156	156	156	156	156	156
2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_5							234
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%

-8.00%	-234	-234	-234	-234	-234	-234	-234
-5.33%	-156	-156	-156	-156	-156	-156	-156
-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%	156	156	156	156	156	156	156
8.00%	234	234	234	234	234	234	234
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_6						195
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-195	-195	-195	-195	-195	-195	-195
-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%	195	195	195	195	195	195	195
	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						462
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-462	-462	-462	-462	-462	-462	-462
-5.33%	-308	-308	-308	-308	-308	-308	-308
-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%	308	308	308	308	308	308	308
8.00%	462	462	462	462	462	462	462
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_10						273
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-273	-273	-273	-273	-273	-273	-273
-5.33%	-182	-182	-182	-182	-182	-182	-182
-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%	182	182	182	182	182	182	182
8.00%	273	273	273	273	273	273	273
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_11						625
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-625	-625	-625	-625	-625	-625	-625
-5.33%	-417	-417	-417	-417	-417	-417	-417
-2.67%	-208	-208	-208	-208	-208	-208	-208
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	208	208	208	208	208	208	208
5.33%	417	417	417	417	417	417	417
8.00%	625	625	625	625	625	625	625
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_12						469
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-469	-469	-469	-469	-469	-469	-469
-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%	469	469	469	469	469	469	469
	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
	KR4201N431	2018-04 콜315					1,976
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,040	1,000	955	905	852	796	736
-5.33%	901	839	774	706	637	566	494
-2.67%	645	566	487	408	328	248	168
0%	247	165	82	0	-82	-165	-247
2.67%	-293	-365	-439	-515	-592	-670	-749
5.33%	-950	-1,004	-1,063	-1,125	-1,191	-1,259	-1,329
8.00%	-1,688	-1,723	-1,764	-1,811	-1,862	-1,917	-1,976
	KR4301N431	2018-04 풋312.5					265

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-251	-252	-254	-256	-259	-262	-265
-5.33%	-133	-137	-142	-146	-152	-157	-162
-2.67%	-38	-45	-52	-59	-66	-73	-80
0%	20	13	7	0	-7	-14	-21
2.67%	45	41	37	32	27	22	17
5.33%	52	50	49	46	44	41	37
8.00%	53	53	52	51	50	49	47
	KR4301N4312018-04 풋315						1,229

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,181	-1,184	-1,190	-1,197	-1,206	-1,217	-1,229
-5.33%	-656	-670	-686	-703	-723	-743	-765
-2.67%	-209	-236	-264	-293	-321	-351	-380
0%	92	62	31	0	-31	-62	-93
2.67%	237	217	195	172	147	122	96
5.33%	284	276	265	253	238	222	204
8.00%	294	292	289	284	277	268	258

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

8,344

공시일	2018-03-12
기준일	2018-03-09

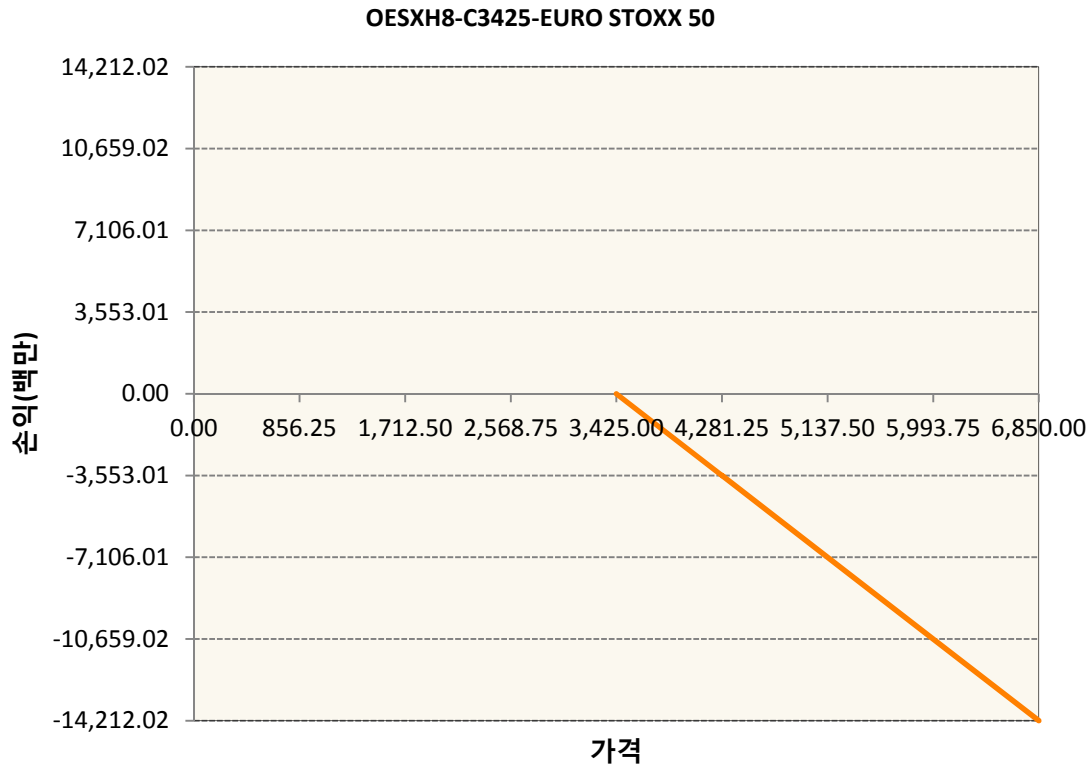
유로커버드콜모(주식혼합-파생형

1. 계약금액

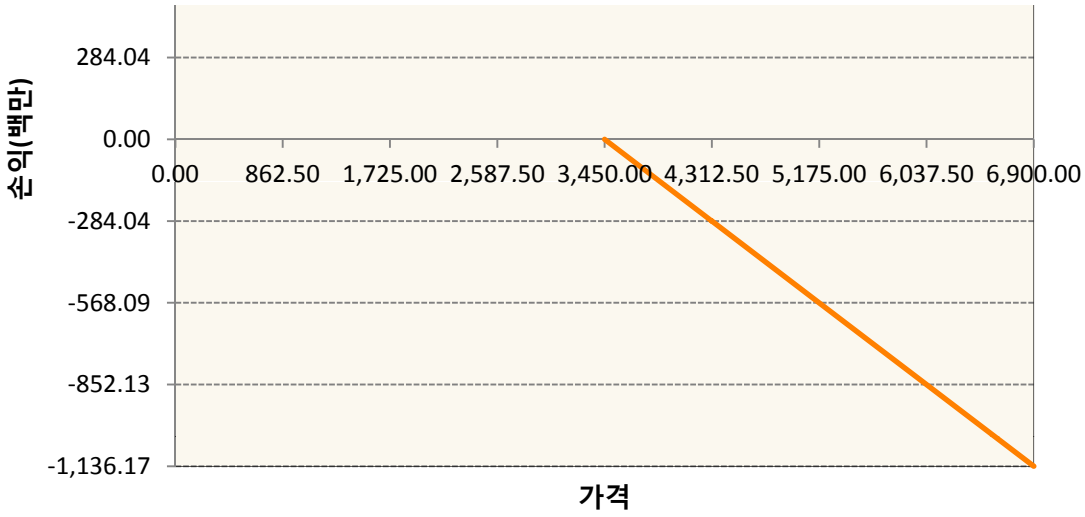
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	7,314	0	7,314	
누계	유가증권	스왑	98,797	0	98,797	장외
누계	유가증권	옵션	0	30,696	-30,696	장내
누계	지수	스왑	52,693	0	52,693	장외

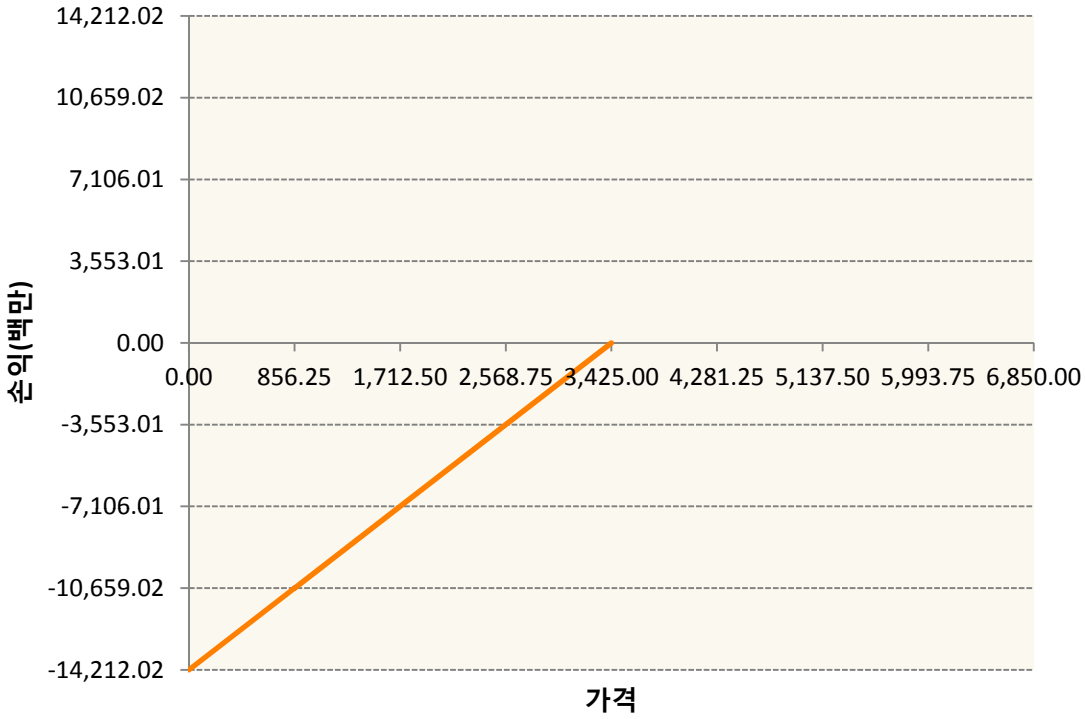
2. 만기시점의 손익구조



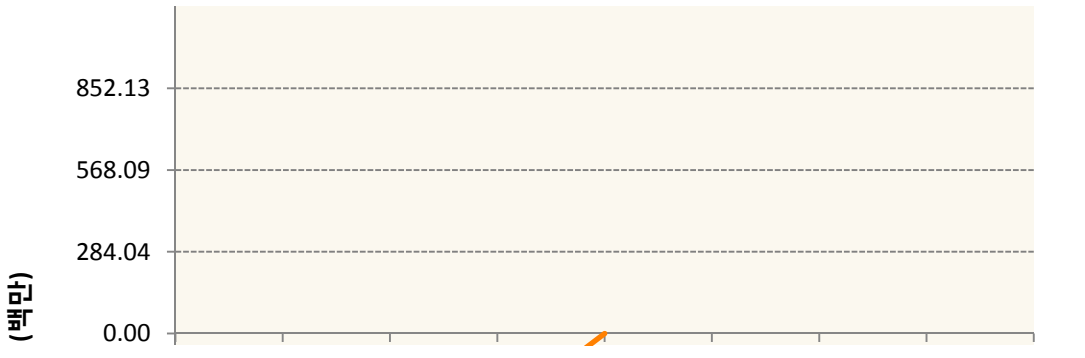


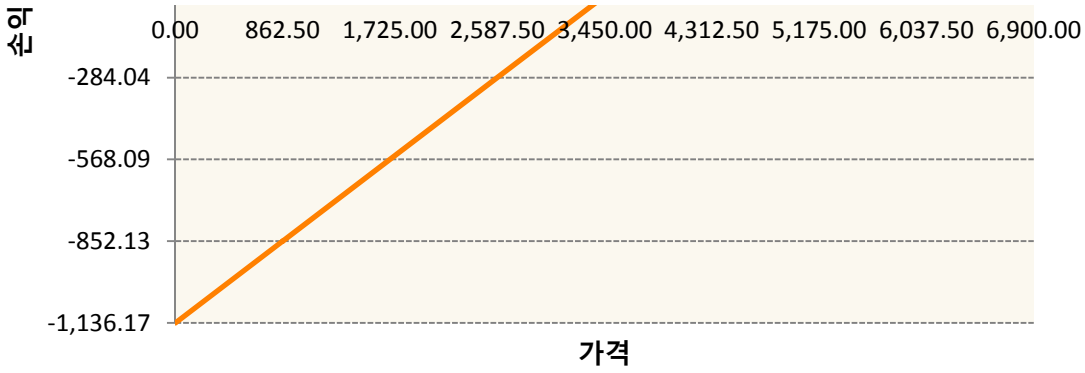


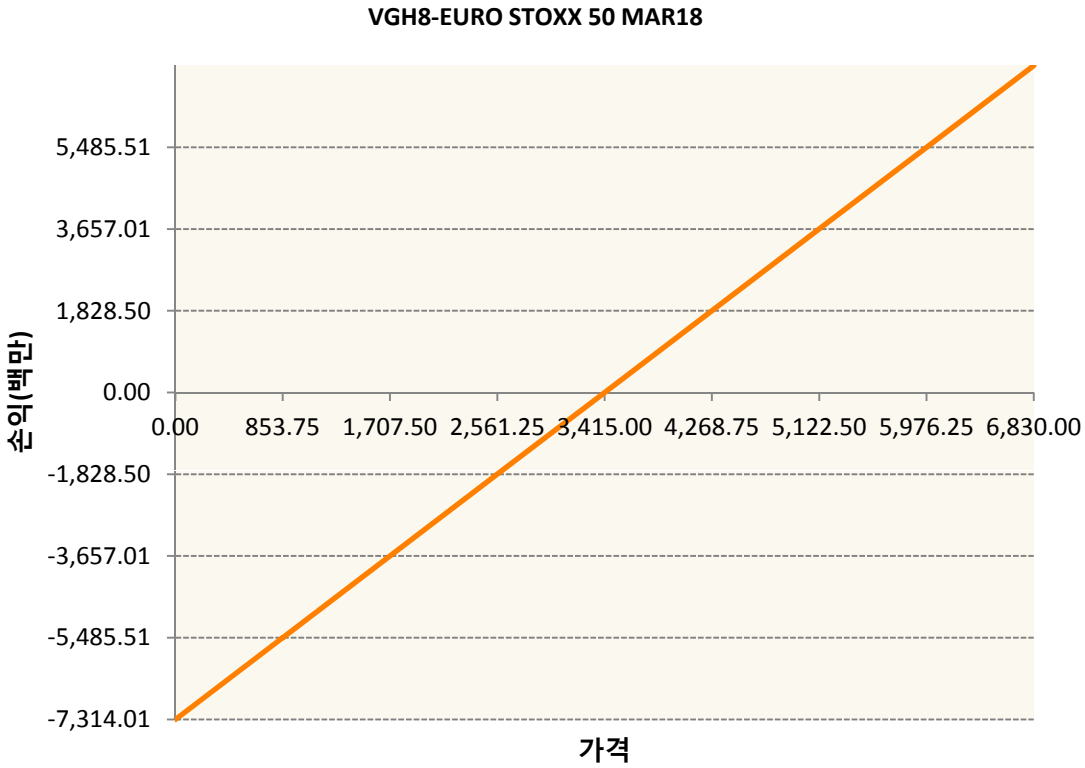
OESXH8-P3425-EURO STOXX 50



OESXH8-P3450-EURO STOXX 50







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)	(단위:백만원)
260105SGPX SG EURO Covered CALL STRATEGY - 994.569	191
260105SQPX SG EURO Covered CALL STRATEGY	358
OESXH8-C34 EURO STOXX 50	1,137
OESXH8-C34 EURO STOXX 50	91
OESXH8-P34 EURO STOXX 50	1,137
OESXH8-P34 EURO STOXX 50	91
VGH8 EURO STOXX 50 MAR18	585

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

2,140

공시일	2018-03-12
기준일	2018-03-09

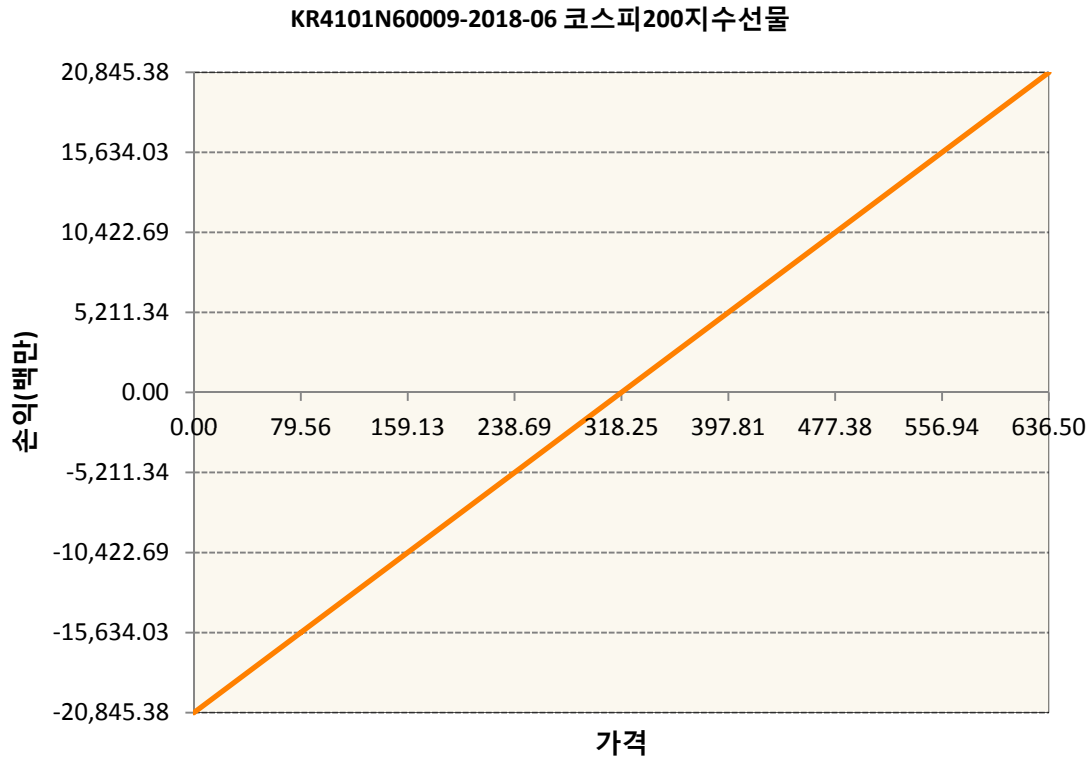
ETF스마트레버리지목표전환형8호

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	20,845	0	20,845	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101N60(2018-06 코스피200지수선물							1,665
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,665	-1,665	-1,665	-1,665	-1,665	-1,665	-1,665
-5.33%	-1,110	-1,110	-1,110	-1,110	-1,110	-1,110	-1,110
-2.67%	-555	-555	-555	-555	-555	-555	-555
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	555	555	555	555	555	555	555
5.33%	1,110	1,110	1,110	1,110	1,110	1,110	1,110
8.00%	1,665	1,665	1,665	1,665	1,665	1,665	1,665

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

1,154

공시일	2018-03-12
기준일	2018-03-09

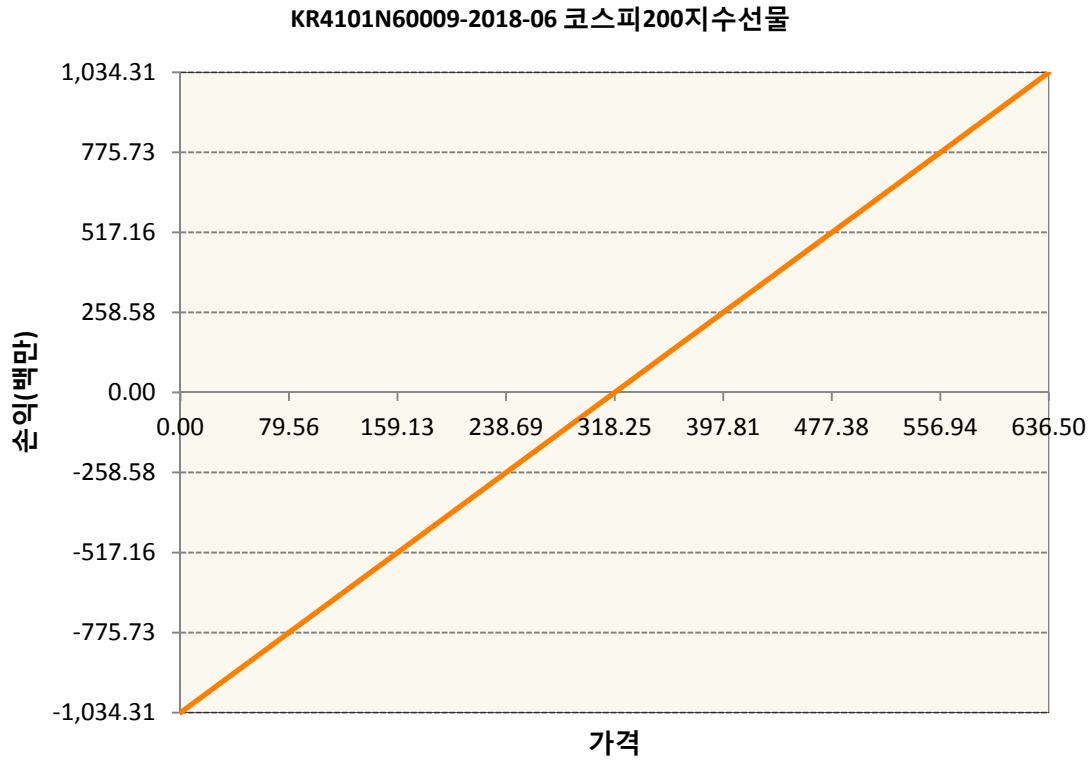
ETF스마트레버리지목표전환형9호

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)

57

공시일	2018-03-12
기준일	2018-03-09

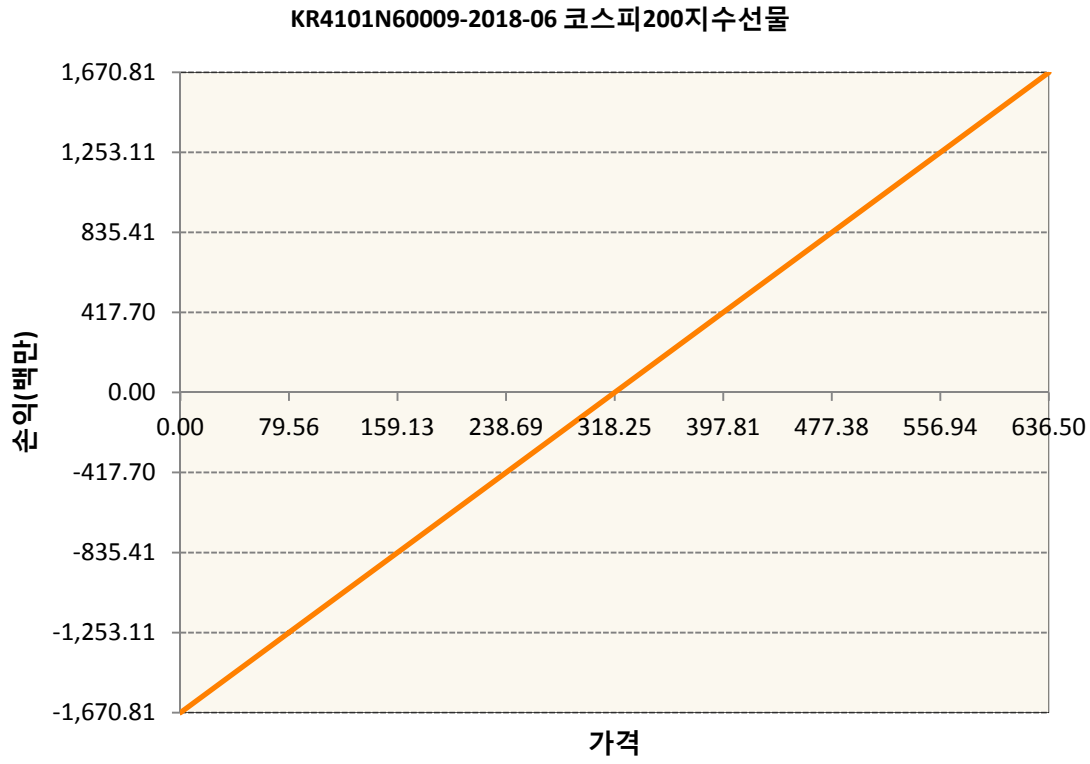
ETF스마트레버리지목표전환형10

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							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)

93

공시일	2018-03-12
기준일	2018-03-09

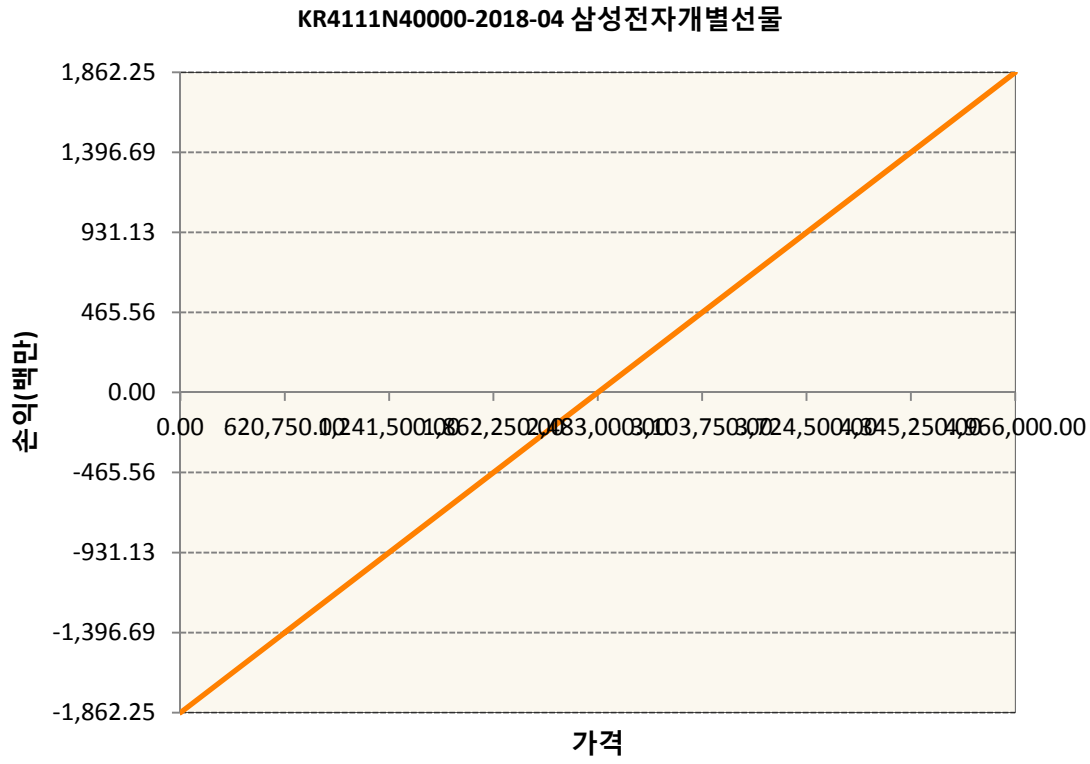
스마트KRX300인덱스1호(주식-파

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	1,862	0	1,862	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4111N40(2018-04 삼성전자개별선물							149
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-149	-149	-149	-149	-149	-149	-149
-5.33%	-99	-99	-99	-99	-99	-99	-99
-2.67%	-50	-50	-50	-50	-50	-50	-50
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	50	50	50	50	50	50	50
5.33%	99	99	99	99	99	99	99
8.00%	149	149	149	149	149	149	149

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

180

공시일	2018-03-12
기준일	2018-03-09

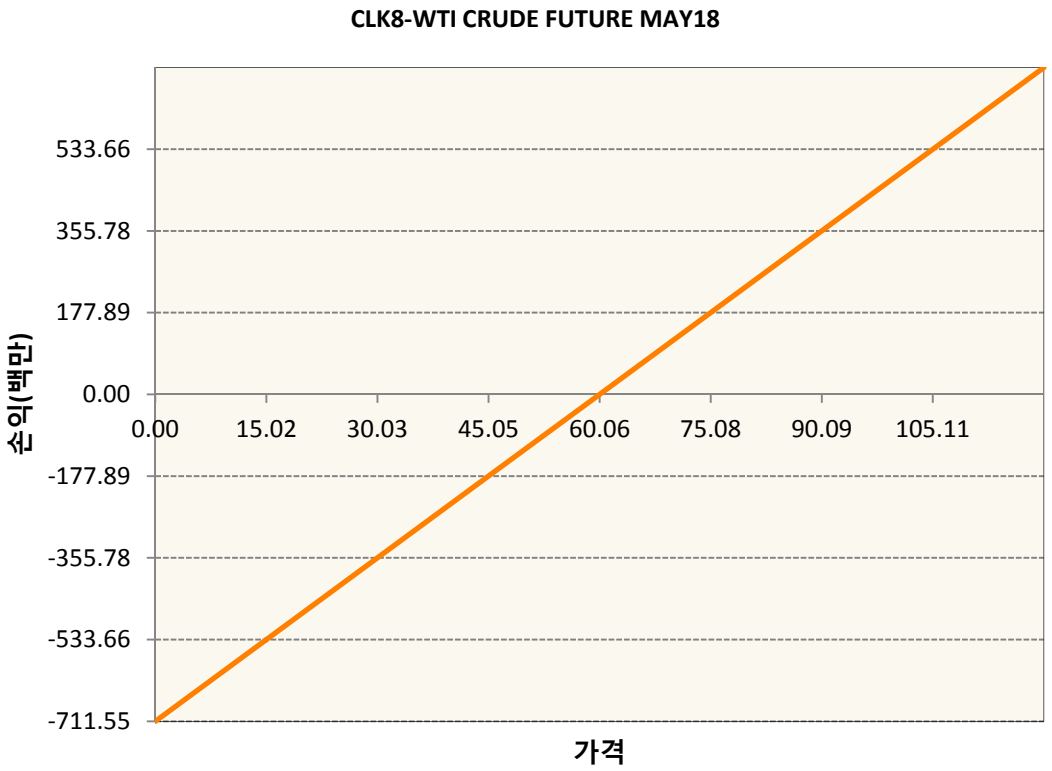
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

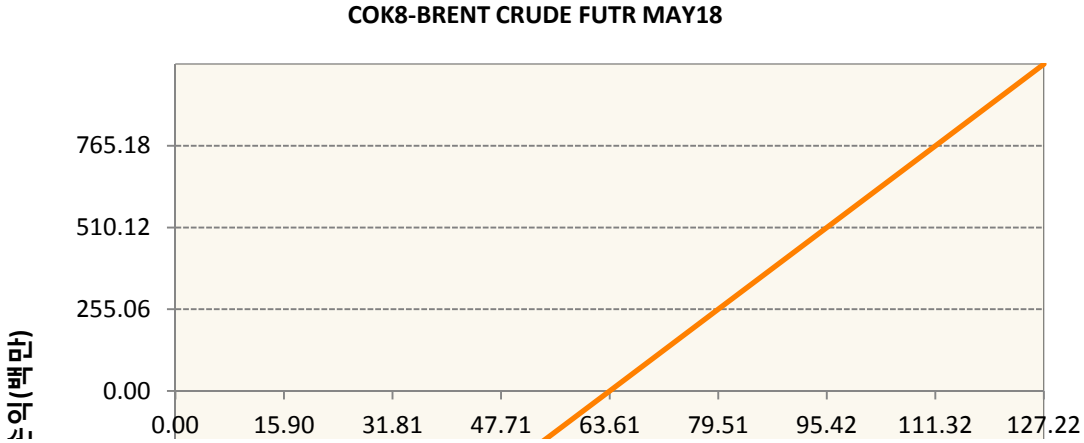
1. 계약금액

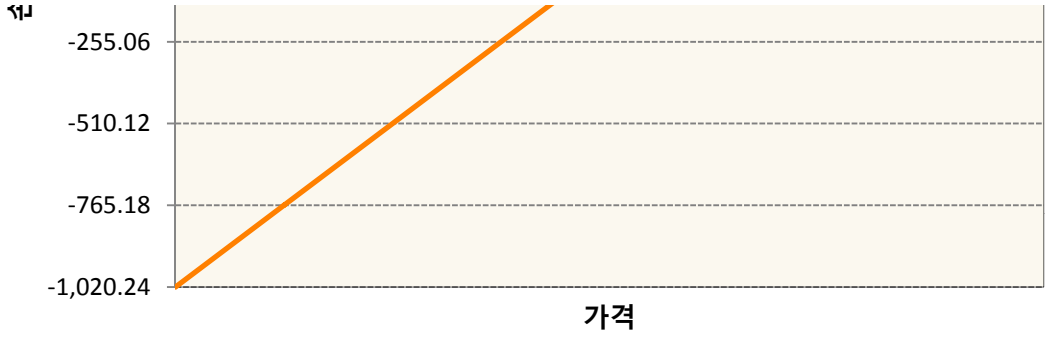
(단위:백만원)

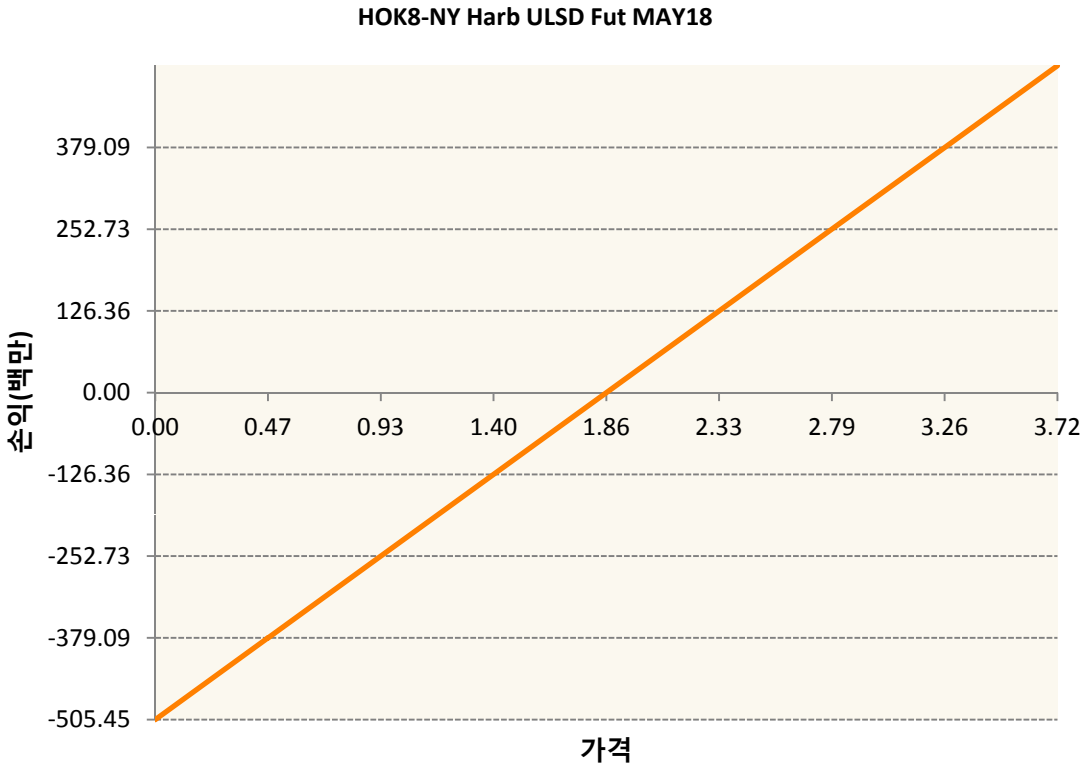
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	선물	유가증권	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	선물	유가증권	712	0	712	
누계	유가증권	선물	3,202	588	2,614	

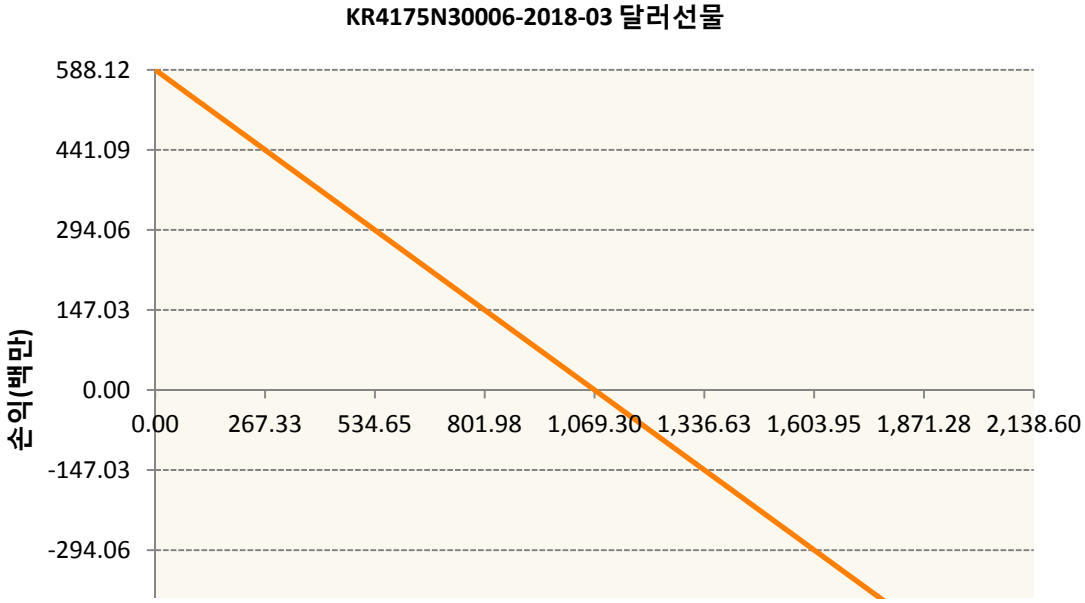
2. 만기시점의 손익구조

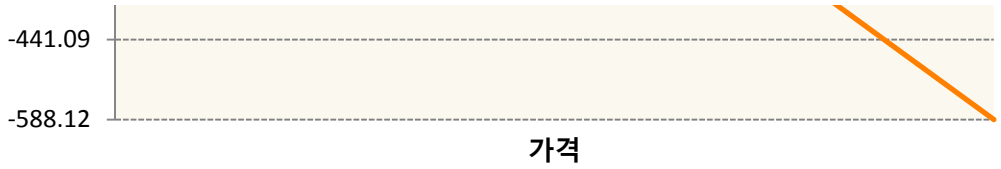


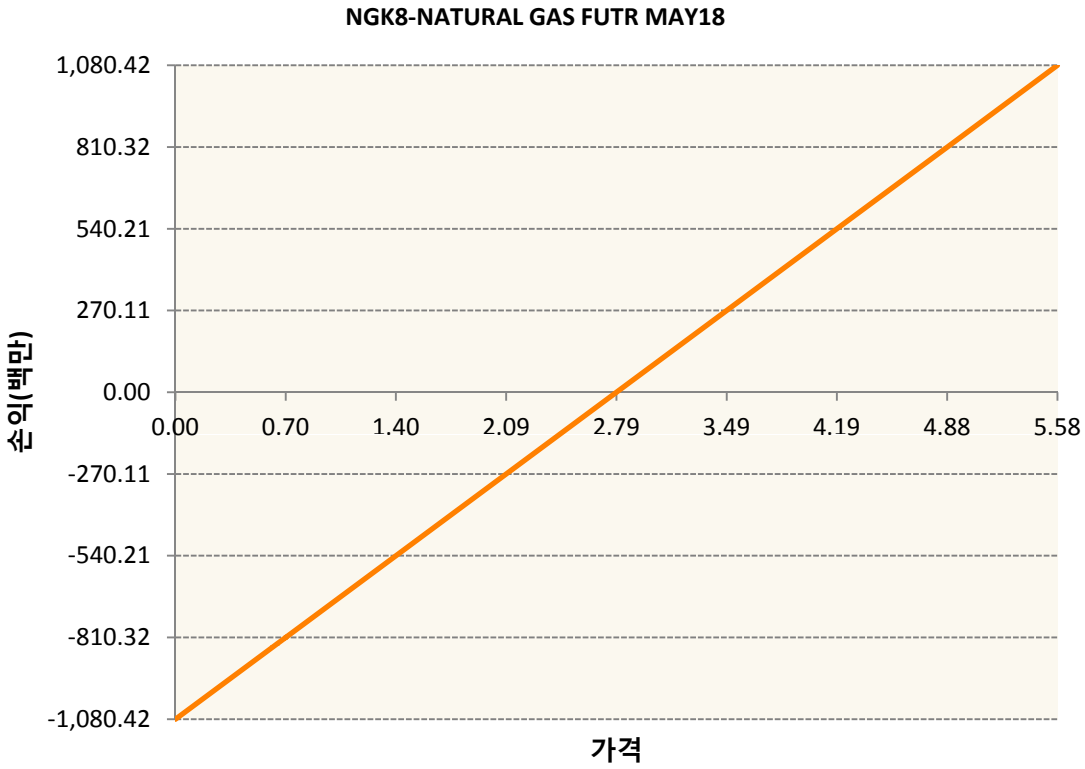


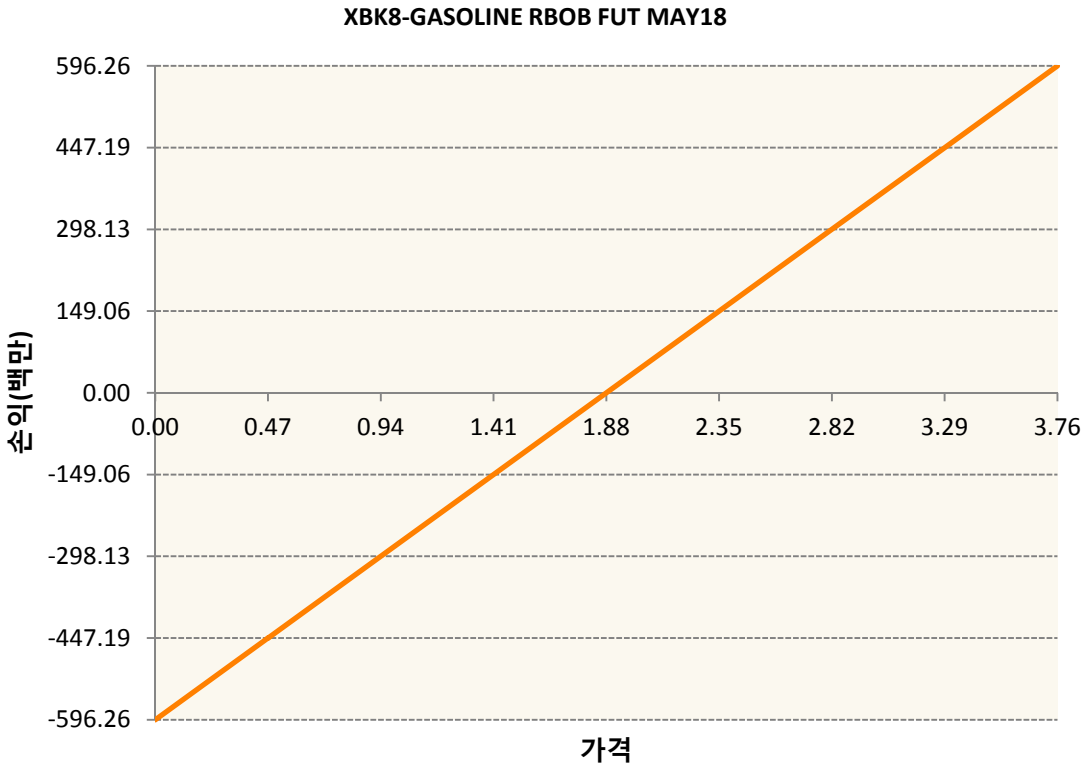

-255.06
-510.12
-765.18
-1,020.24
가격


HOK8-NY Harb ULSD Fut MAY18
379.09
252.73
126.36
0.00
-126.36
-252.73
-379.09
-505.45
0.00
0.47
0.93
1.40
1.86
2.33
2.79
3.26
3.72
손익(백만)
가격


KR4175N30006-2018-03 달러선물
588.12
441.09
294.06
147.03
0.00
-147.03
-294.06
0.00
267.33
534.65
801.98
1,069.30
1,336.63
1,603.95
1,871.28
2,138.60
손익(백만)


-441.09
-588.12
가격


NGK8-NATURAL GAS FUTR MAY18
1,080.42
810.32
540.21
270.11
0.00
-270.11
-540.21
-810.32
-1,080.42
0.00
0.70
1.40
2.09
2.79
3.49
4.19
4.88
5.58
손익(백만)
가격


XBK8-GASOLINE RBOB FUT MAY18
596.26
447.19
298.13
149.06
0.00
-149.06
-298.13
-447.19
-596.26
0.00
0.47
0.94
1.41
1.88
2.35
2.82
3.29
3.76
손익(백만)
가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLK8	WTI CRUDE FUTURE MAY18	57
COK8	BRENT CRUDE FUTR MAY18	82
HOK8	NY Harb ULSD Fut MAY18	40
KR4175N30(	2018-03 달러선물	47
NGK8	NATURAL GAS FUTR MAY18	86
XBK8	GASOLINE RBOB FUT MAY18	48

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

516

공시일	2018-03-12
기준일	2018-03-09

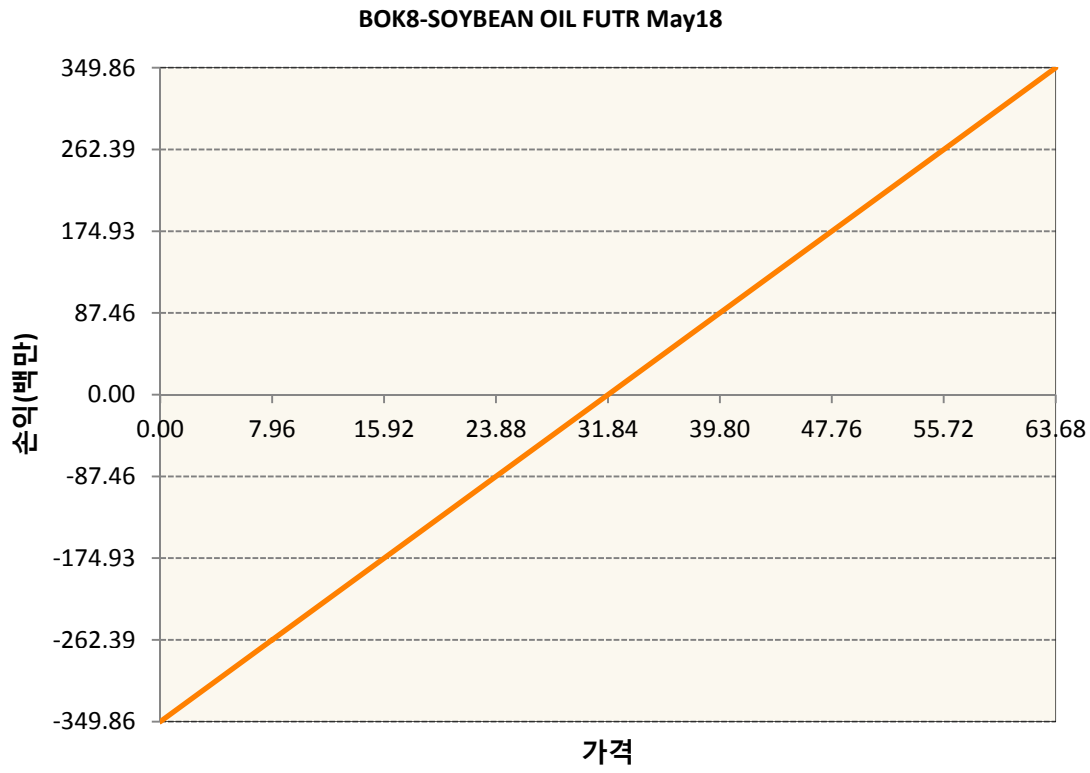
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

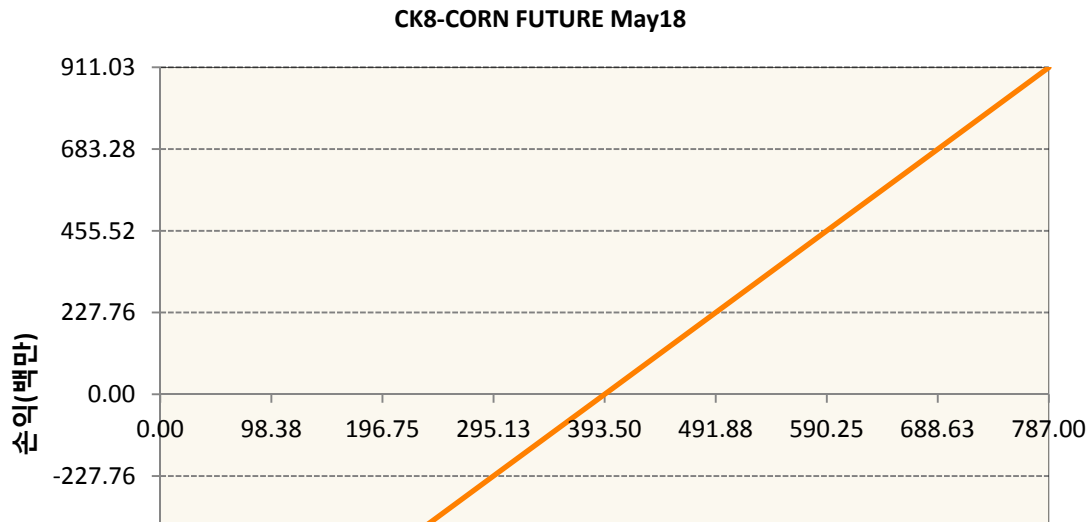
1. 계약금액

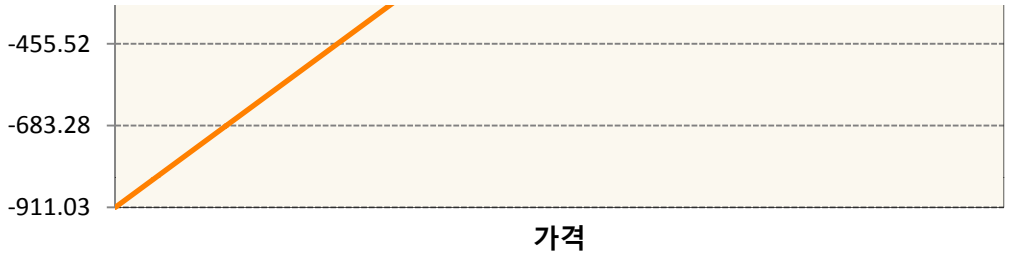
(단위:백만원)

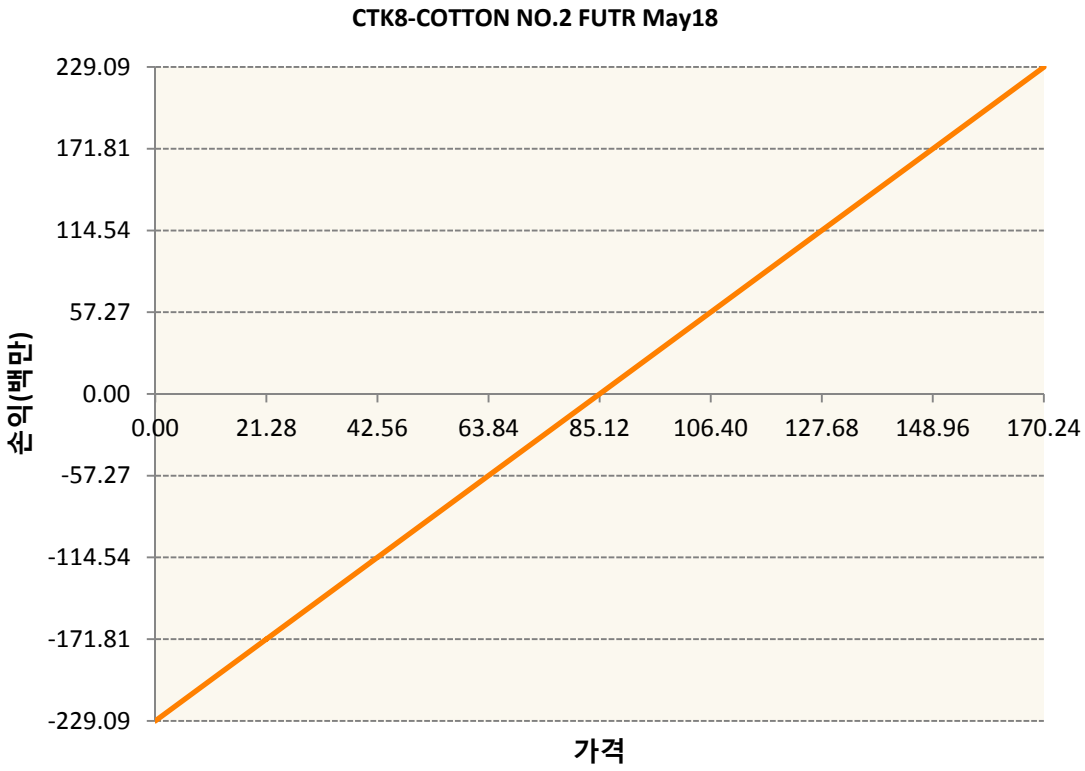
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	4,243	321	3,922	

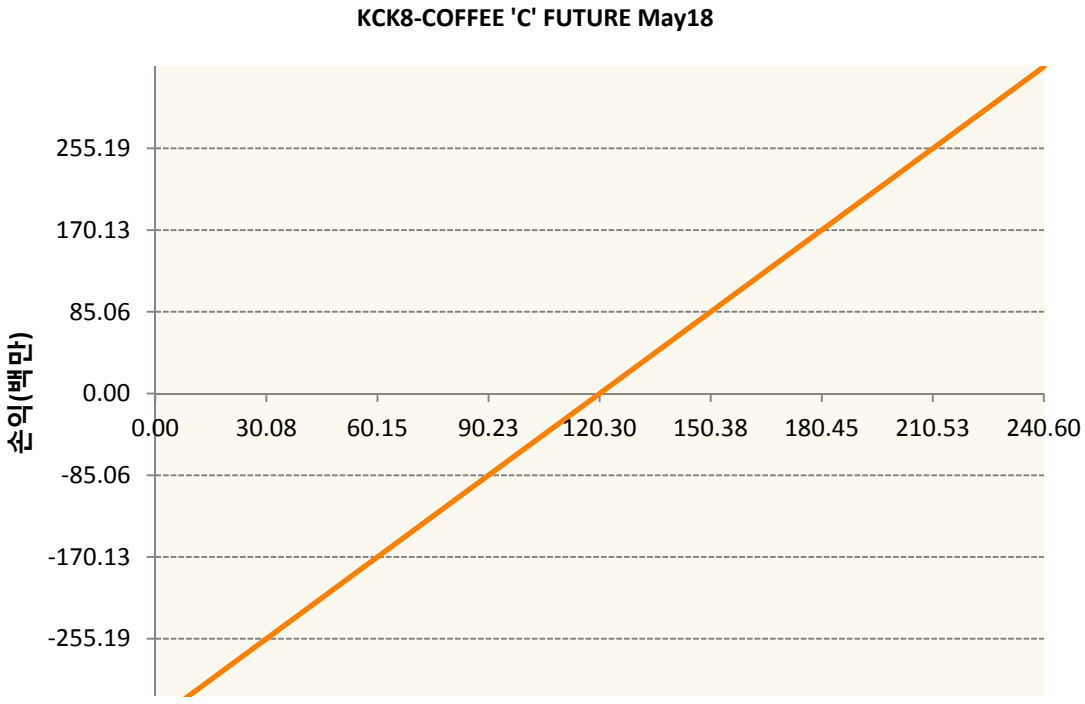
2. 만기시점의 손익구조

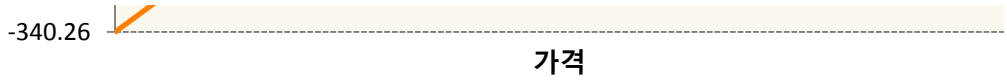


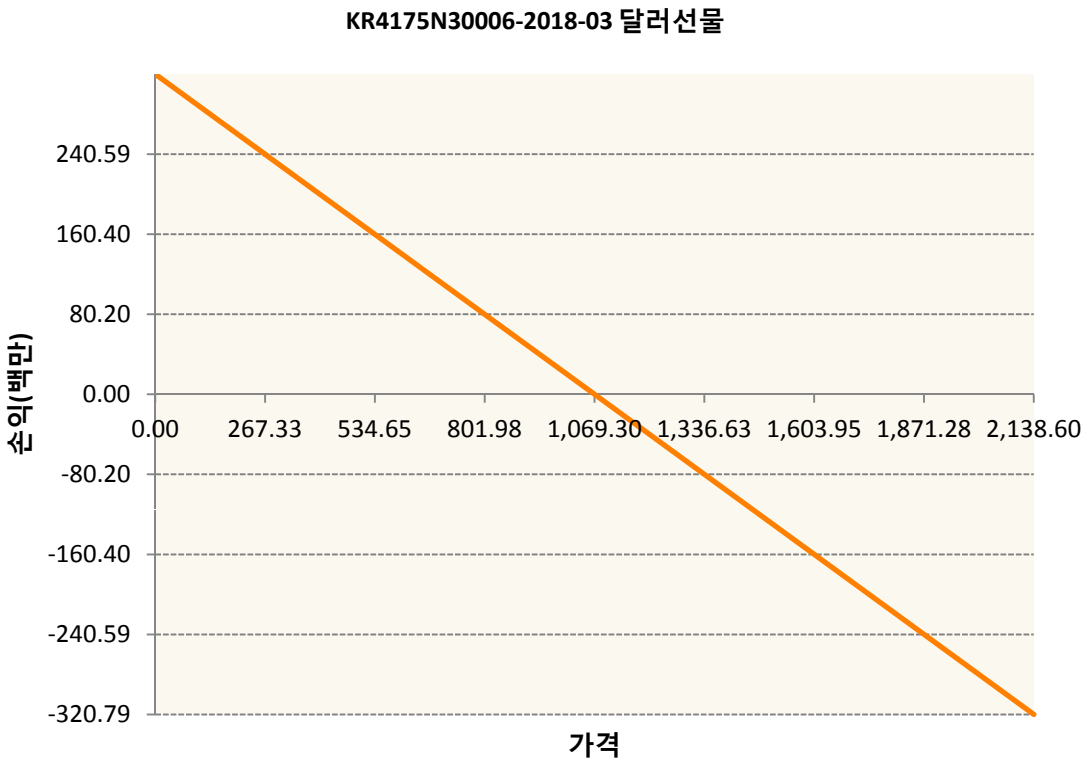


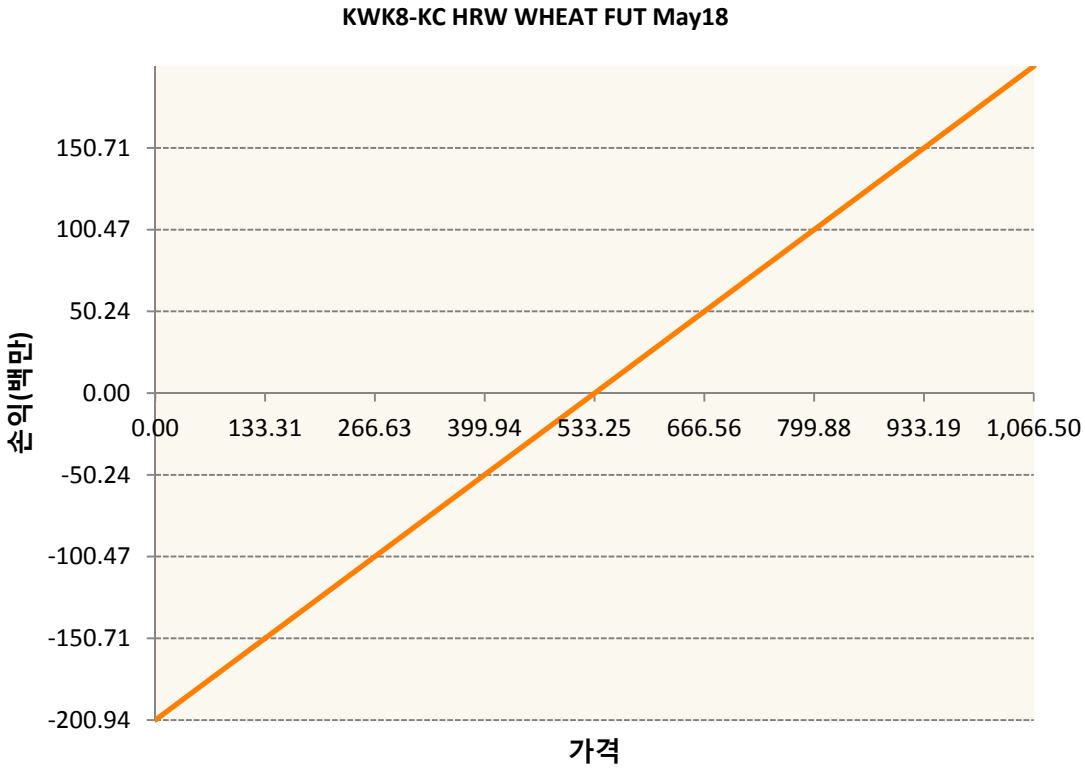

-455.52
-683.28
-911.03
가격

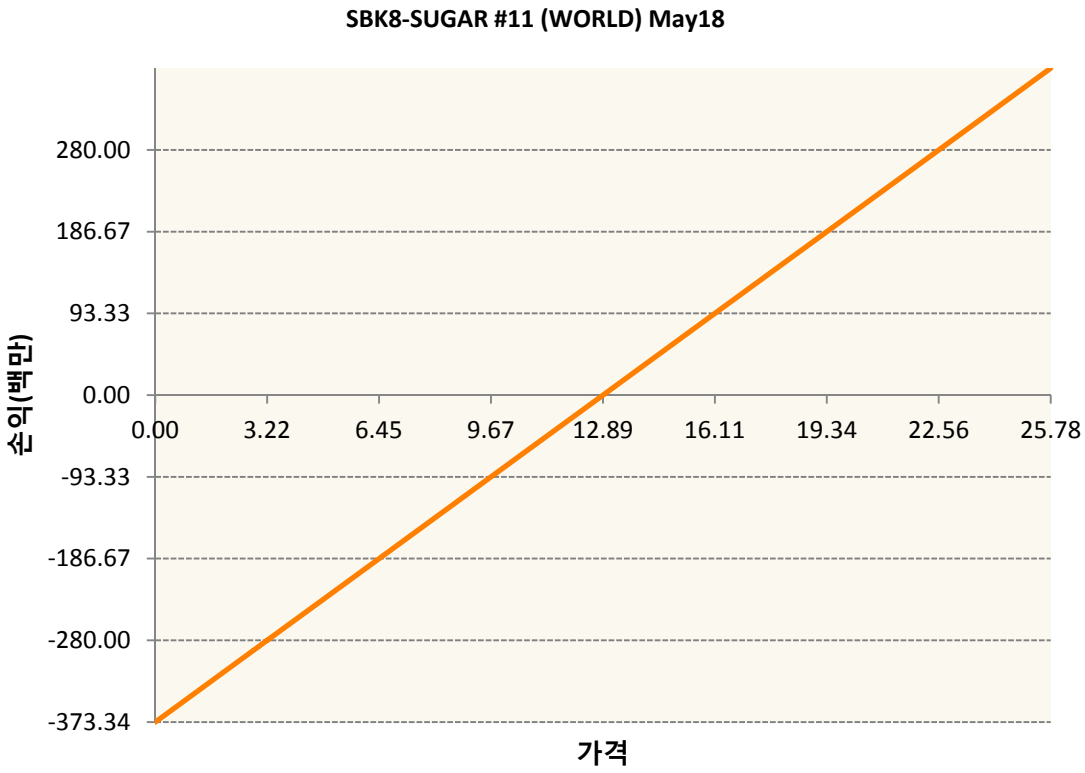

CTK8-COTTON NO.2 FUTR May18
229.09
171.81
114.54
57.27
0.00
-57.27
-114.54
-171.81
-229.09
손익(백만)
0.00
21.28
42.56
63.84
85.12
106.40
127.68
148.96
170.24
가격

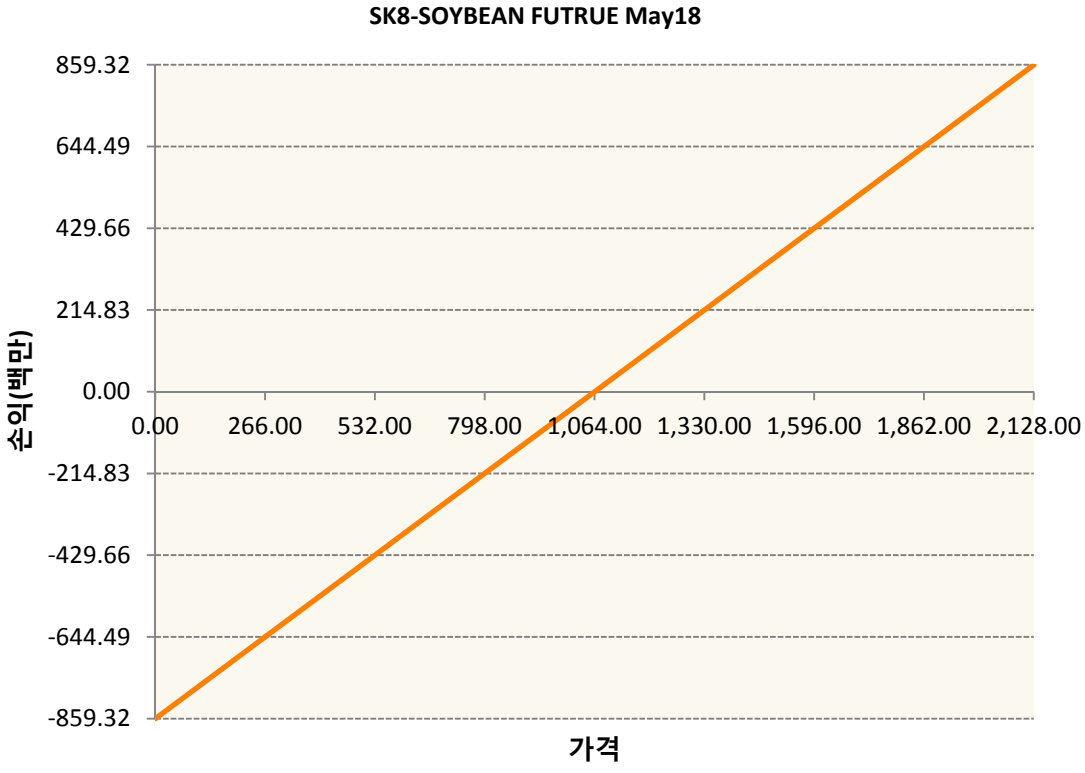

KCK8-COFFEE 'C' FUTURE May18
255.19
170.13
85.06
0.00
-85.06
-170.13
-255.19
손익(백만)
0.00
30.08
60.15
90.23
120.30
150.38
180.45
210.53
240.60


-340.26
가격

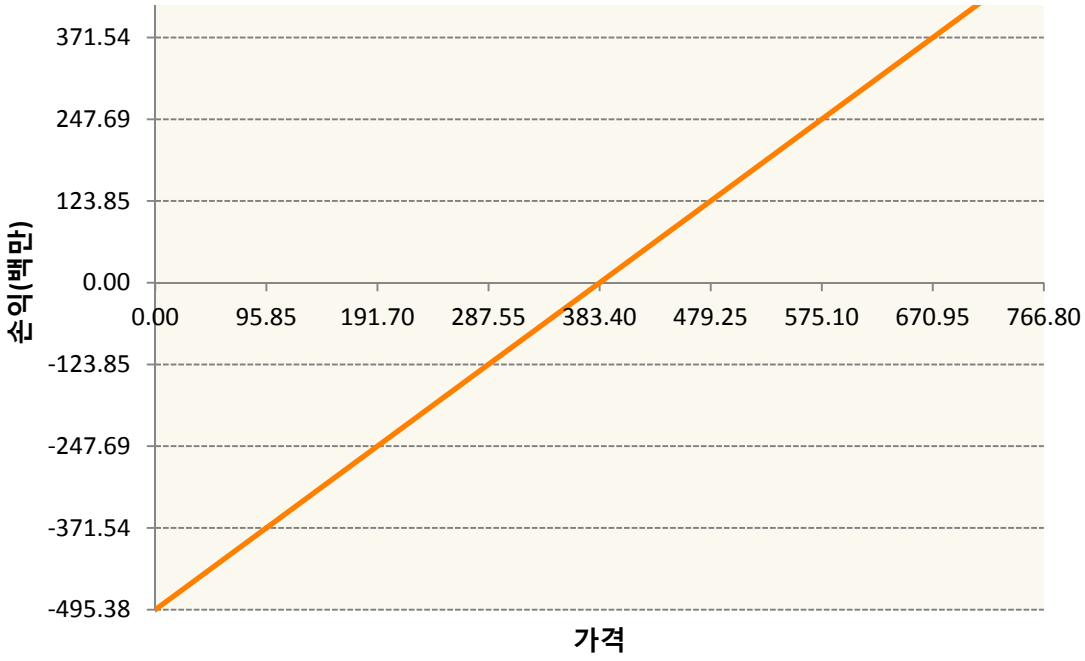

KR4175N30006-2018-03 달러선물
240.59
160.40
80.20
0.00
-80.20
-160.40
-240.59
-320.79
0.00
267.33
534.65
801.98
1,069.30
1,336.63
1,603.95
1,871.28
2,138.60
손익(백만)
가격


KWK8-KC HRW WHEAT FUT May18
150.71
100.47
50.24
0.00
-50.24
-100.47
-150.71
-200.94
0.00
133.31
266.63
399.94
533.25
666.56
799.88
933.19
1,066.50
손익(백만)
가격

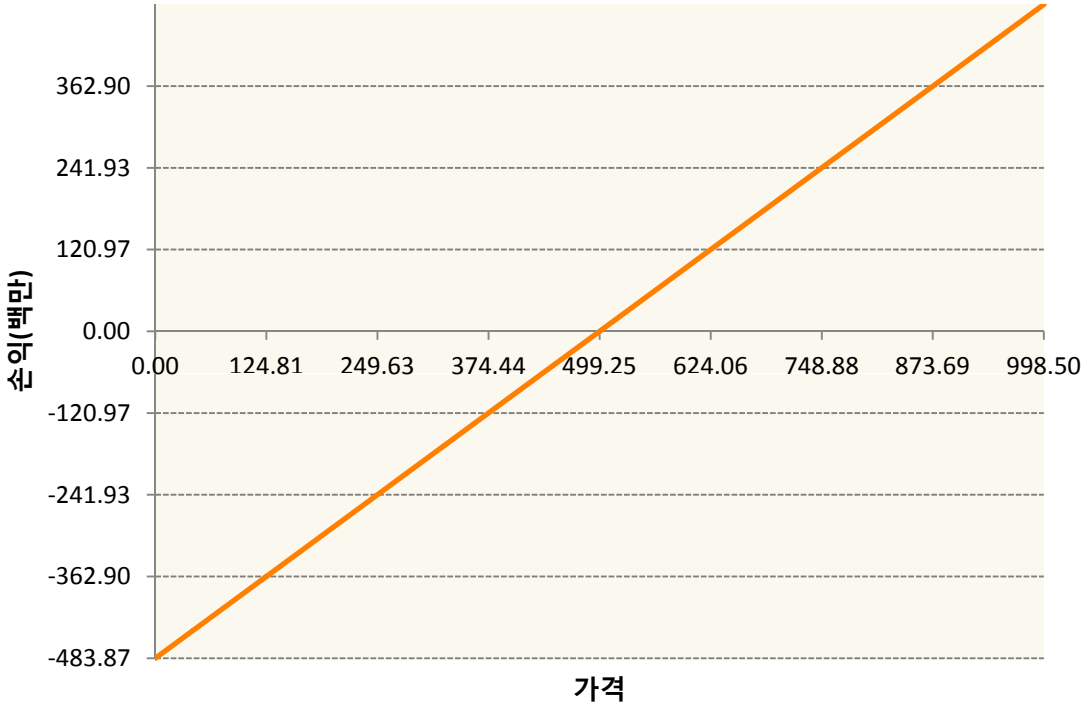

SBK8-SUGAR #11 (WORLD) May18
280.00
186.67
93.33
0.00
-93.33
-186.67
-280.00
-373.34
0.00
3.22
6.45
9.67
12.89
16.11
19.34
22.56
25.78
손익(백만)
가격


SK8-SOYBEAN FUTRUE May18
859.32
644.49
429.66
214.83
0.00
-214.83
-429.66
-644.49
-859.32
0.00
266.00
532.00
798.00
1,064.00
1,330.00
1,596.00
1,862.00
2,128.00
손익(백만)
가격


SMK8-SOYBEAN MEAL FUTR May18
495.38



WK8-WHEAT FUTURE(CBT) May18



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

BOK8	SOYBEAN OIL FUTR May18	28
CK8	CORN FUTURE May18	73
CTK8	COTTON NO.2 FUTR May18	18
KCK8	COFFEE 'C' FUTURE May18	27
KR4175N30(	2018-03 달러선물	26

KWK8	KC HRW WHEAT FUT May18	16
SBK8	SUGAR #11 (WORLD) May18	30
SK8	SOYBEAN FUTRUE May18	69
SMK8	SOYBEAN MEAL FUTR May18	40
WK8	WHEAT FUTURE(CBT) May18	39

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

341