공시일	2018-03-15
기준일	2018-03-14

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	2018-03-15
기준일	2018-03-14

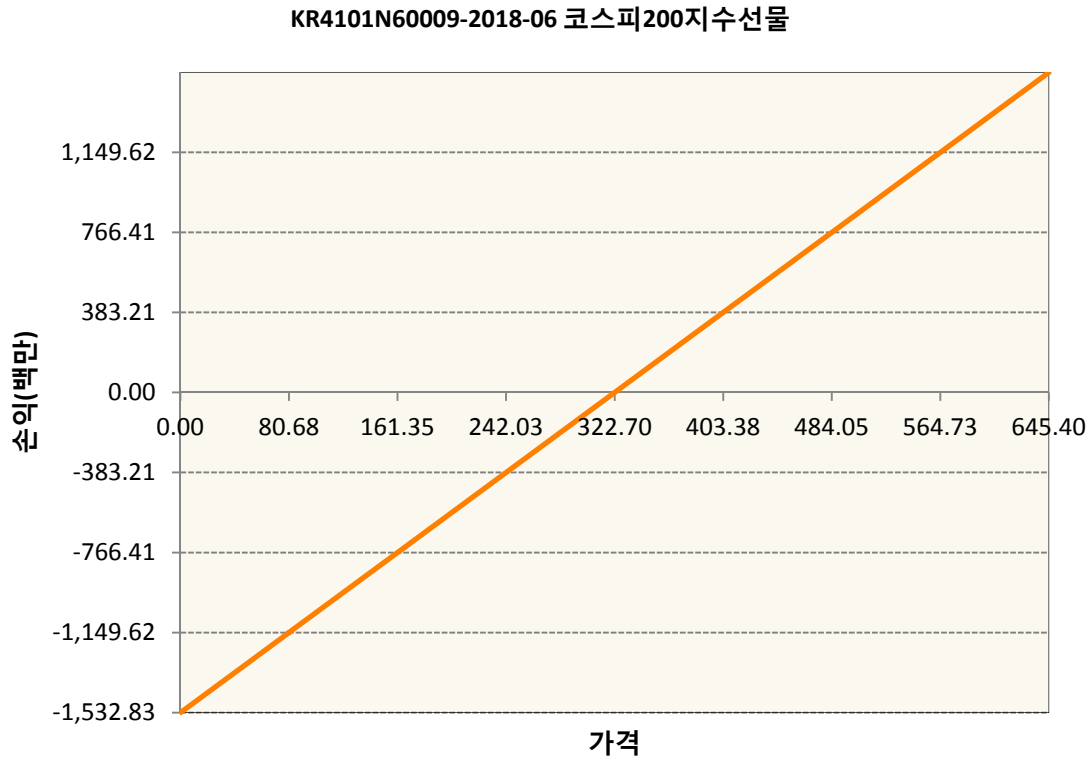
스마트인덱스모

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	1,533	0	1,533	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101N60(2018-06 코스피200지수선물							122
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-122	-122	-122	-122	-122	-122	-122
-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%	122	122	122	122	122	122	122

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

85

공시일	2018-03-15
기준일	2018-03-14

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	1,125

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

423

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2018-03-15
기준일	2018-03-14

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	413

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

415

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2018-03-15
기준일	2018-03-14

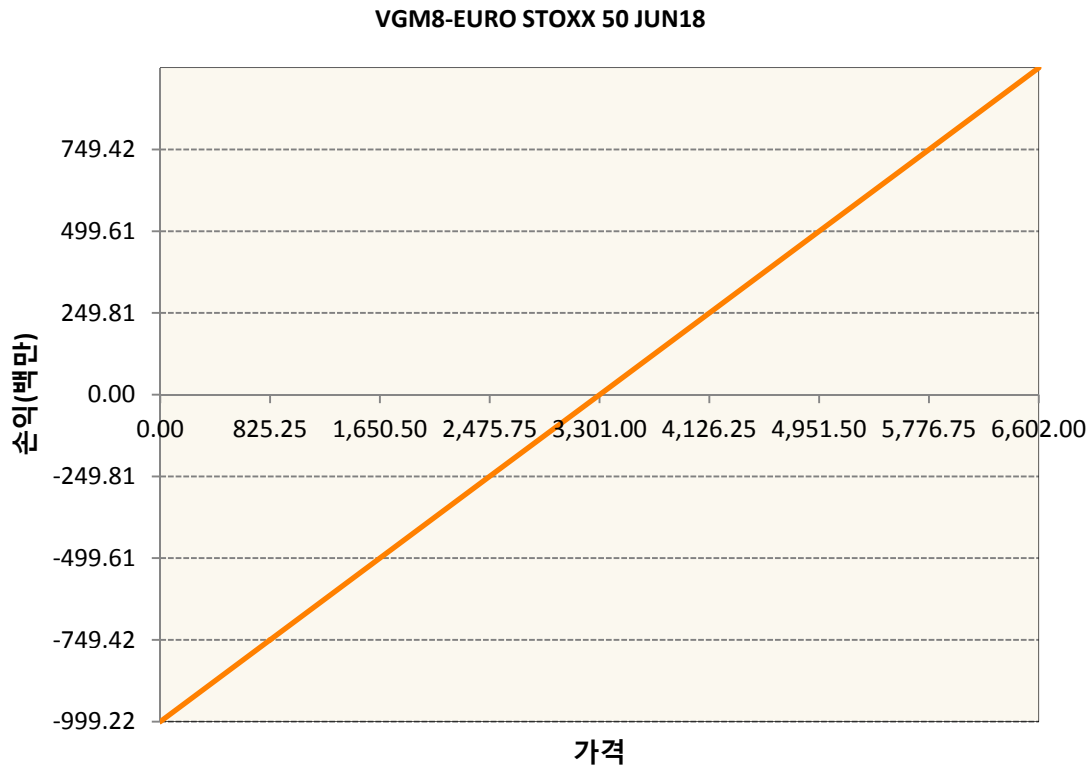
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	999	0	999	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGM8	EURO STOXX 50 JUN18	80

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

(단위:백만원)

46

공시일	2018-03-15
기준일	2018-03-14

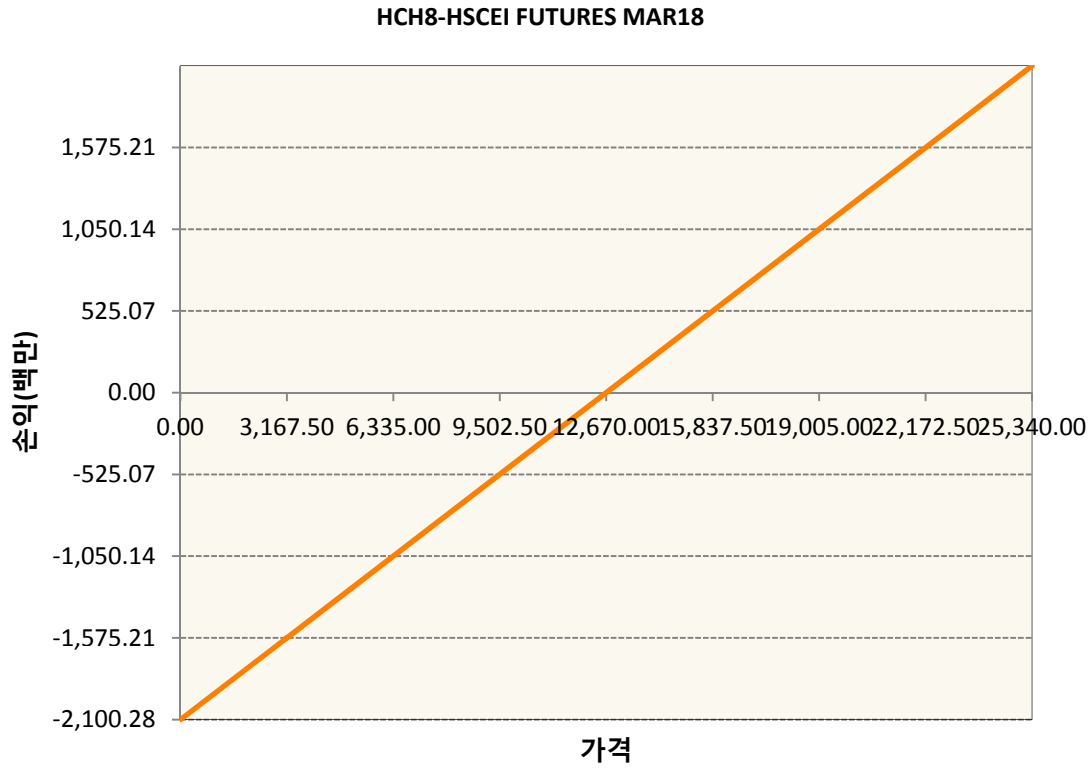
차이나인덱스모(주식-파생형)

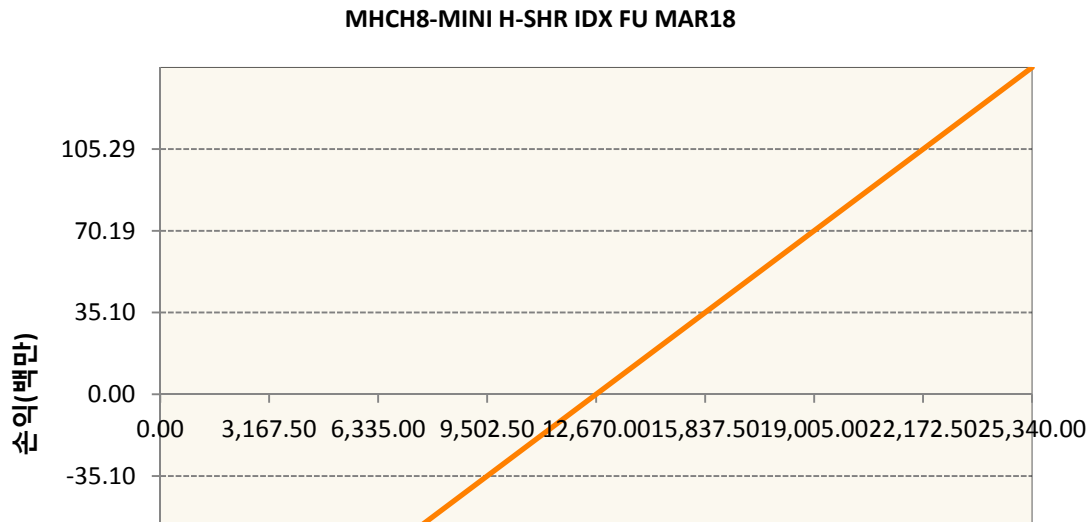
1. 계약금액

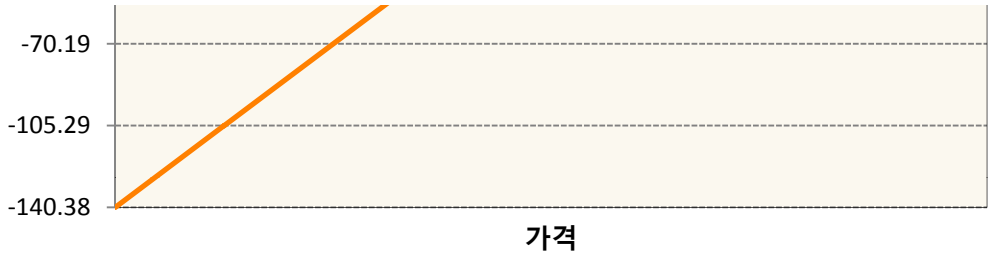
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,241	0	2,241	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCH8	HSCEI FUTURES MAR18	168
MHCH8	MINI H-SHR IDX FU MAR18	11

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	157

공시일	2018-03-15
기준일	2018-03-14

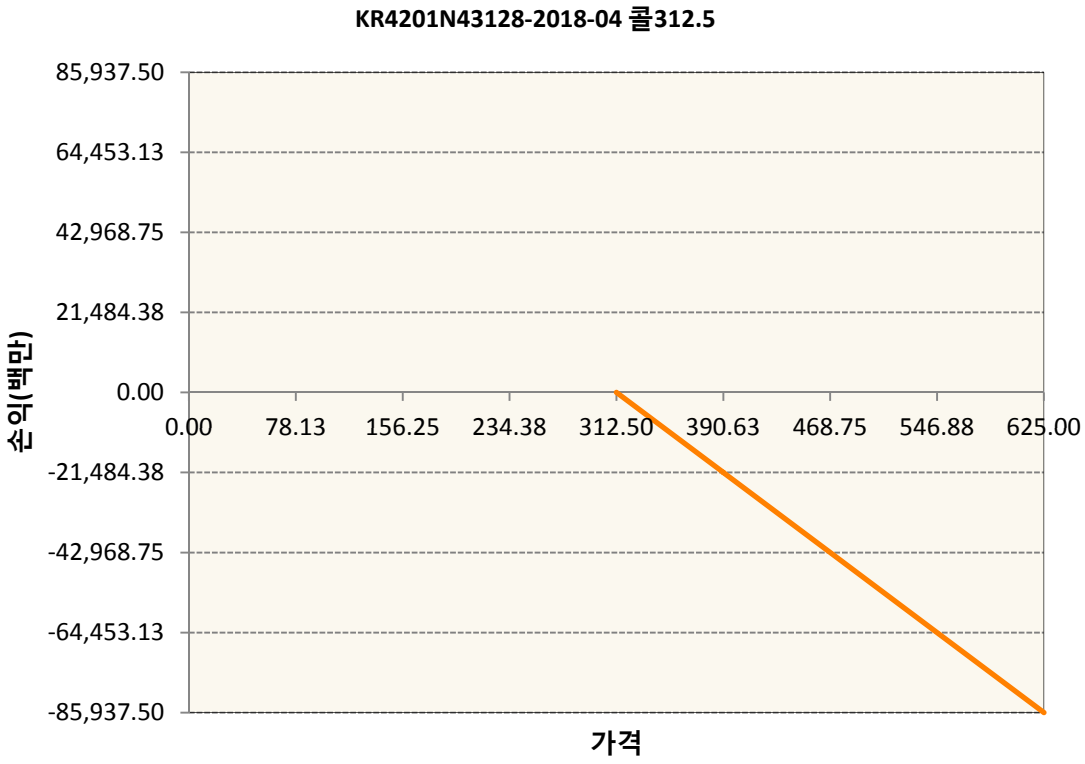
커버드콜모(주식혼합-파생형)

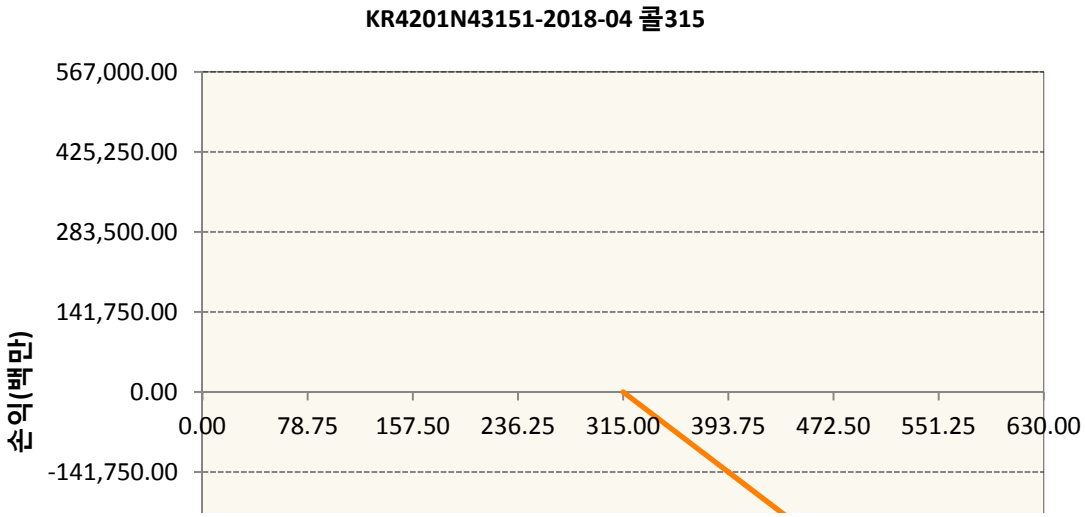
1. 계약금액

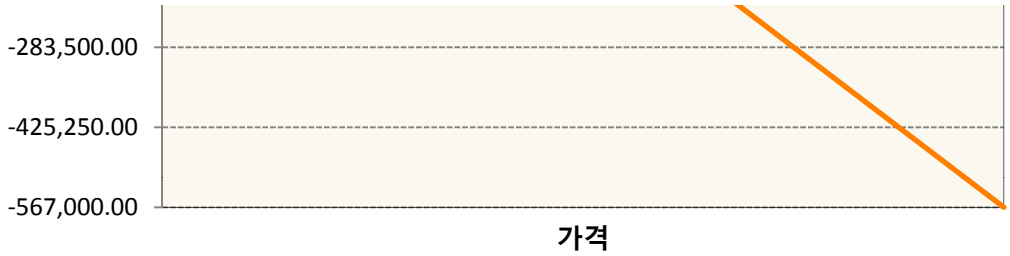
(단위:백만원)

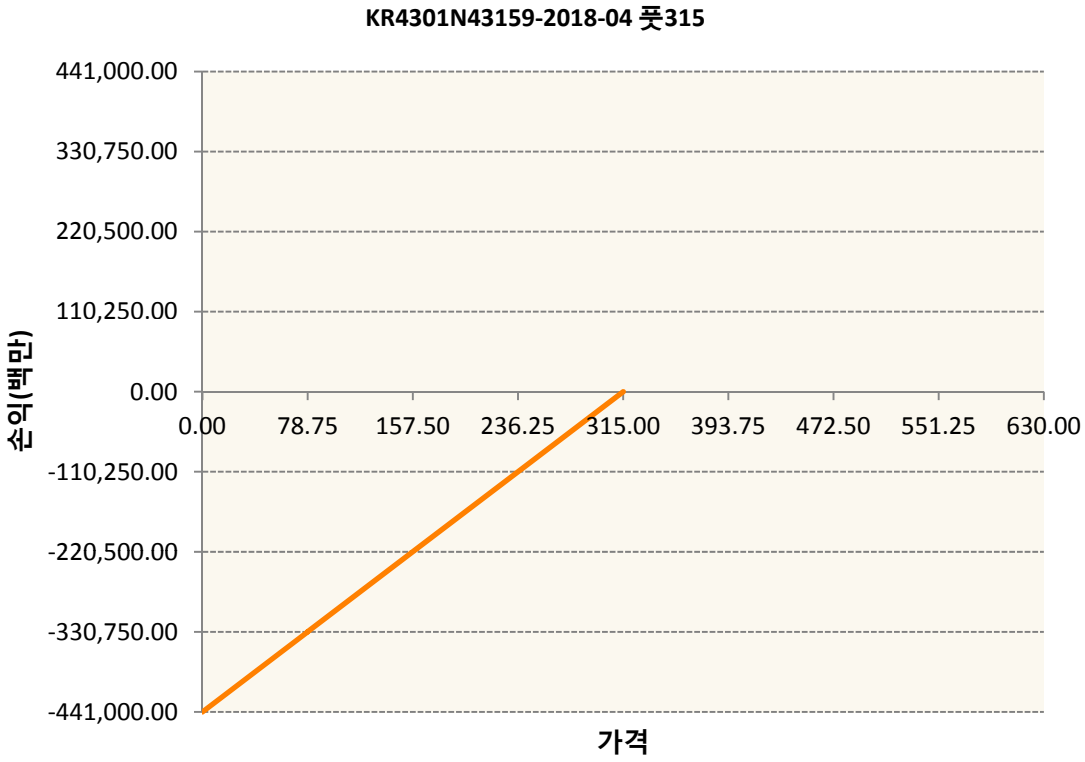
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	15,344	0	15,344	장내
누계	유가증권	옵션	0	1,093,938	-1,093,938	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201N4312018-04 콜312.5							6,099
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	3,709	3,567	3,413	3,252	3,084	2,910	2,731
-5.33%	3,099	2,902	2,702	2,500	2,296	2,091	1,884
-2.67%	2,068	1,851	1,634	1,417	1,200	983	766
0%	595	401	202	0	-205	-412	-620
2.67%	-1,251	-1,394	-1,550	-1,715	-1,888	-2,067	-2,252
5.33%	-3,353	-3,442	-3,547	-3,667	-3,799	-3,941	-4,093
8.00%	-5,600	-5,647	-5,710	-5,787	-5,879	-5,983	-6,099
KR4201N4312018-04 콜315							38,888
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	22,172	21,346	20,438	19,464	18,435	17,362	16,251

-5.33%	18,835	17,621	16,373	15,101	13,808	12,500	11,180
-2.67%	12,917	11,494	10,071	8,647	7,223	5,799	4,375
0%	4,101	2,749	1,381	0	-1,391	-2,789	-4,193
2.67%	-7,318	-8,378	-9,502	-10,676	-11,891	-13,139	-14,413
5.33%	-20,642	-21,337	-22,135	-23,020	-23,978	-24,997	-26,069
8.00%	-35,115	-35,503	-35,998	-36,594	-37,281	-38,049	-38,888
KR4301N4312018-04 풋315							23,930

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-22,663	-22,780	-22,936	-23,132	-23,365	-23,632	-23,930
-5.33%	-11,618	-12,002	-12,419	-12,864	-13,332	-13,818	-14,319
-2.67%	-3,100	-3,715	-4,332	-4,949	-5,567	-6,186	-6,805
0%	1,580	1,072	544	0	-556	-1,123	-1,697
2.67%	3,228	3,001	2,727	2,412	2,061	1,678	1,268
5.33%	3,584	3,526	3,436	3,312	3,152	2,956	2,727
8.00%	3,630	3,622	3,602	3,568	3,514	3,436	3,334

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

66,658

공시일	2018-03-15
기준일	2018-03-14

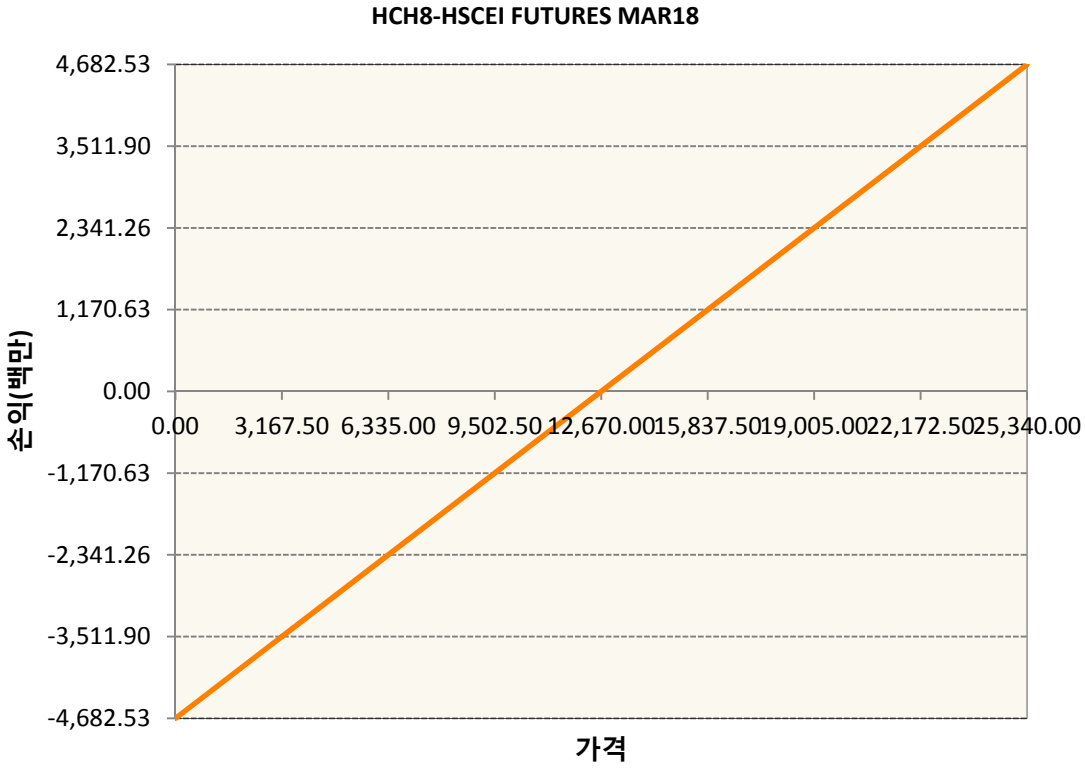
홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생

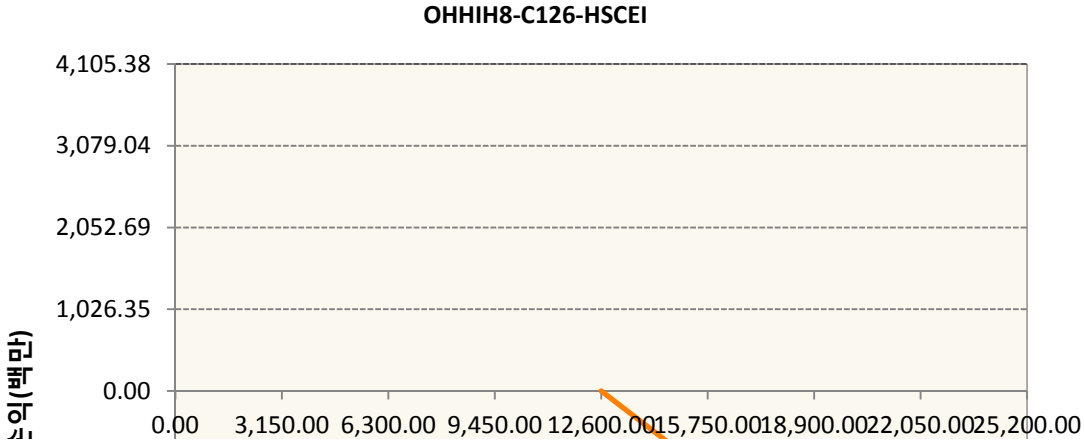
1. 계약금액

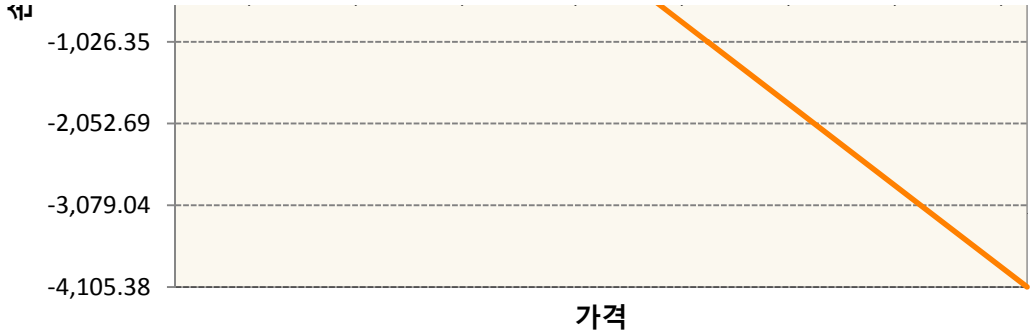
(단위:백만원)

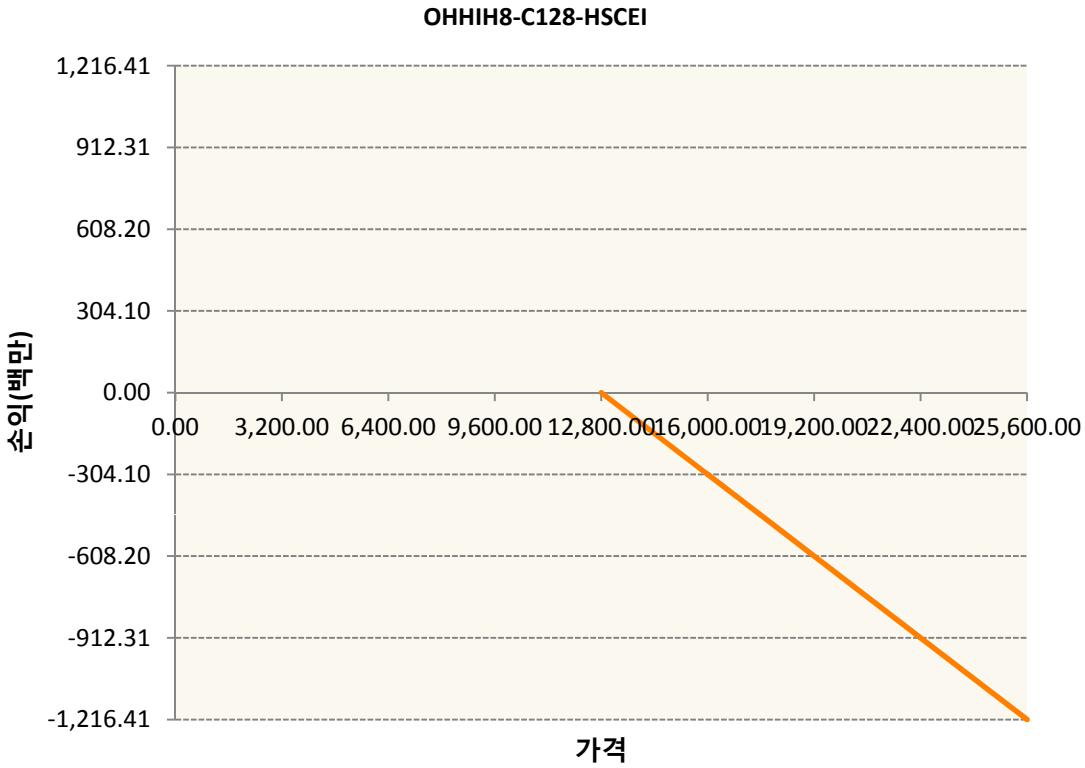
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	4,683	0	4,683	장내
누계	유가증권	옵션	0	10,644	-10,644	장내

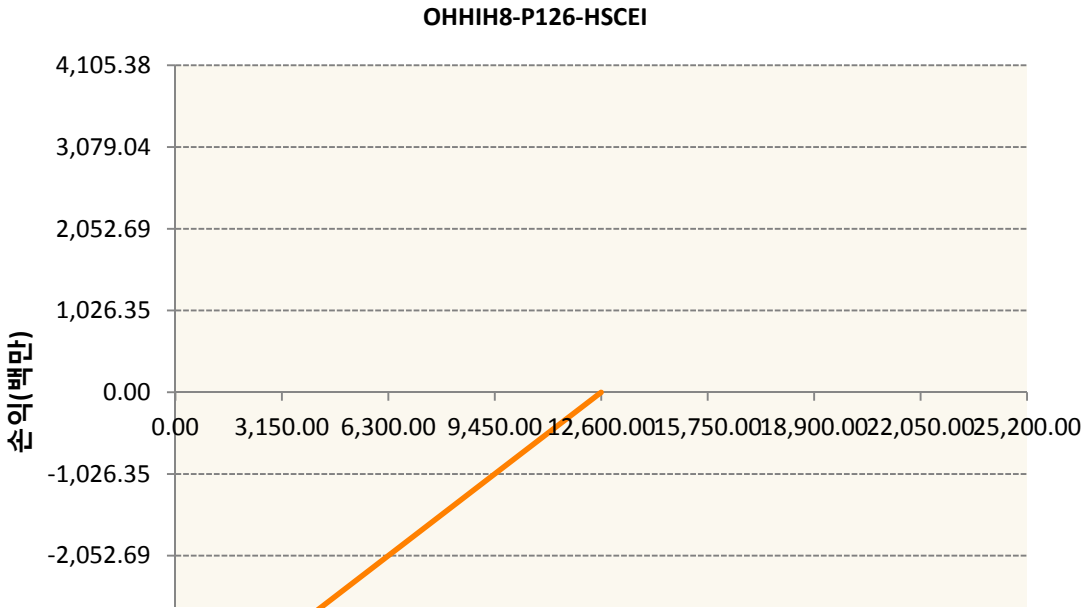
2. 만기시점의 손익구조

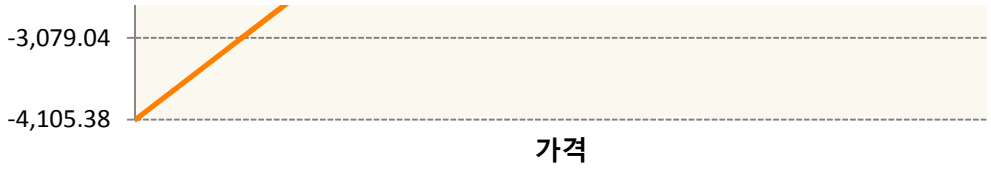


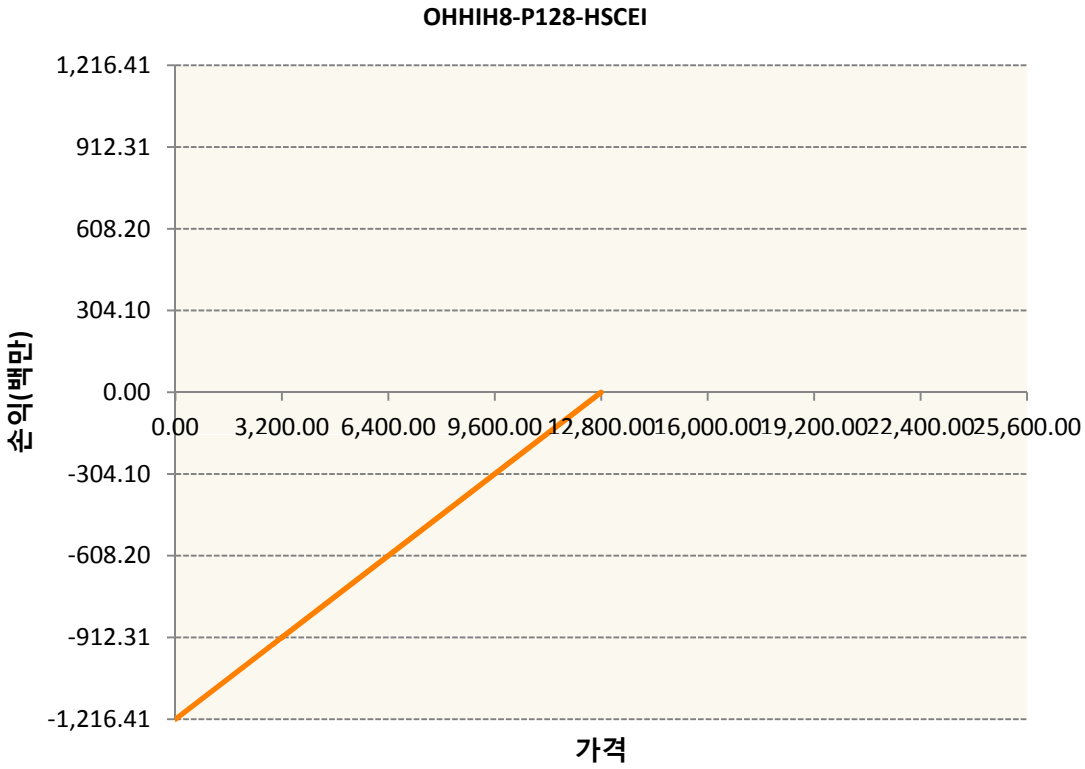



-1,026.35
-2,052.69
-3,079.04
-4,105.38
가격


OHHIH8-C128-HSCEI
1,216.41
912.31
608.20
304.10
0.00
-304.10
-608.20
-912.31
-1,216.41
0.00
3,200.00
6,400.00
9,600.00
12,800.00
16,000.00
19,200.00
22,400.00
25,600.00
손익(백만)
가격


OHHIH8-P126-HSCEI
4,105.38
3,079.04
2,052.69
1,026.35
0.00
-1,026.35
-2,052.69
0.00
3,150.00
6,300.00
9,450.00
12,600.00
15,750.00
18,900.00
22,050.00
25,200.00
손익(백만)





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

HCH8	HSCEI FUTURES MAR18	375
OHHIH8-C12	HSCEI	328
OHHIH8-C12	HSCEI	97
OHHIH8-P12	HSCEI	328
OHHIH8-P12	HSCEI	97

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

1,073

공시일	2018-03-15
기준일	2018-03-14

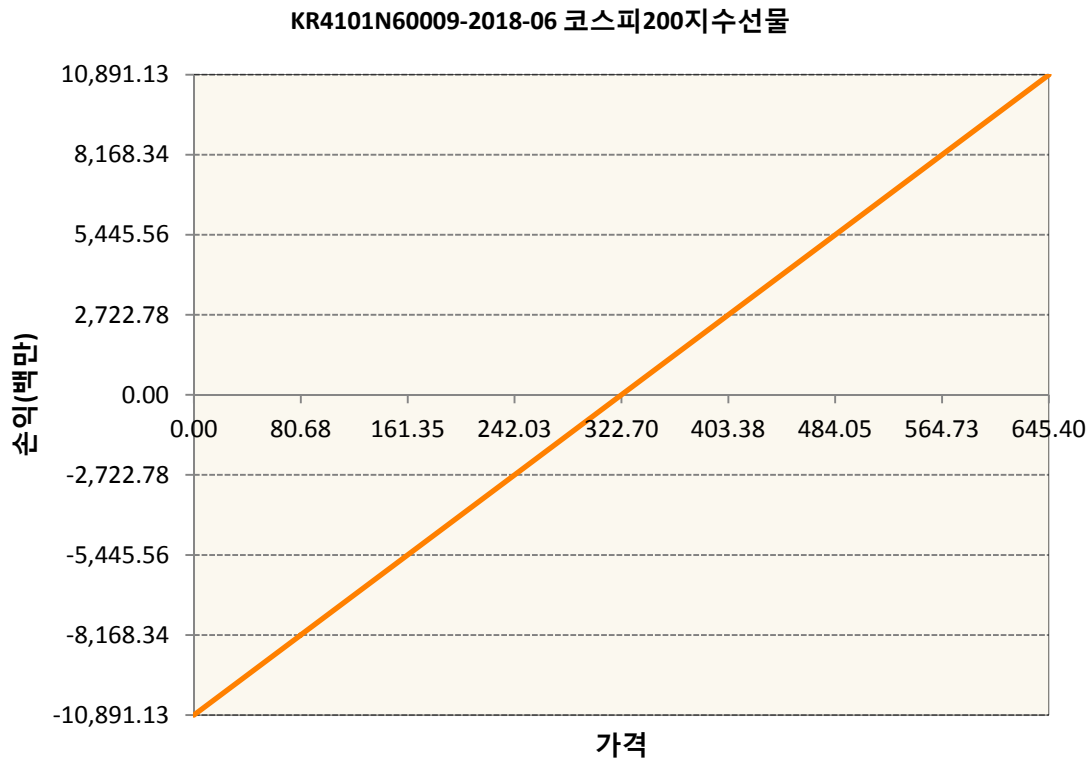
코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼

1. 계약금액

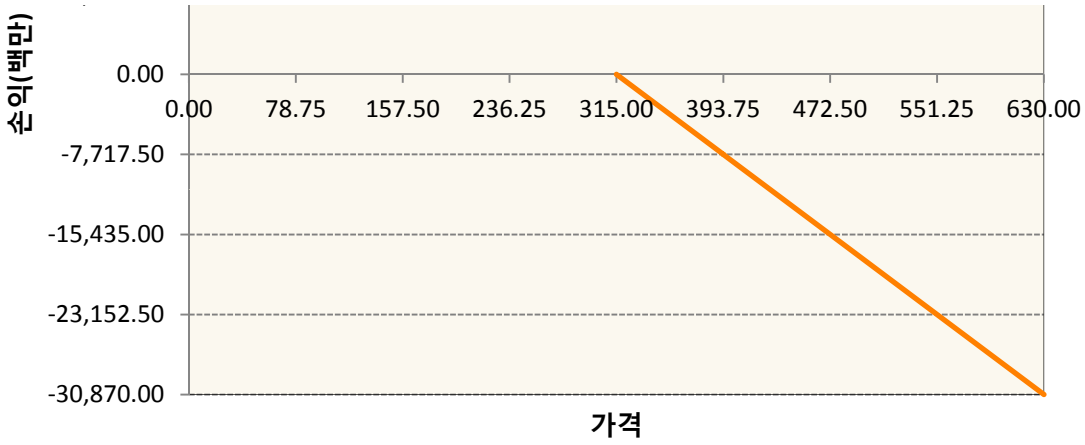
(단위:백만원)

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	10,891	0	10,891	장내
누계	유가증권	스왑	54,200	0	54,200	장외
누계	유가증권	옵션	0	56,033	-56,033	장내

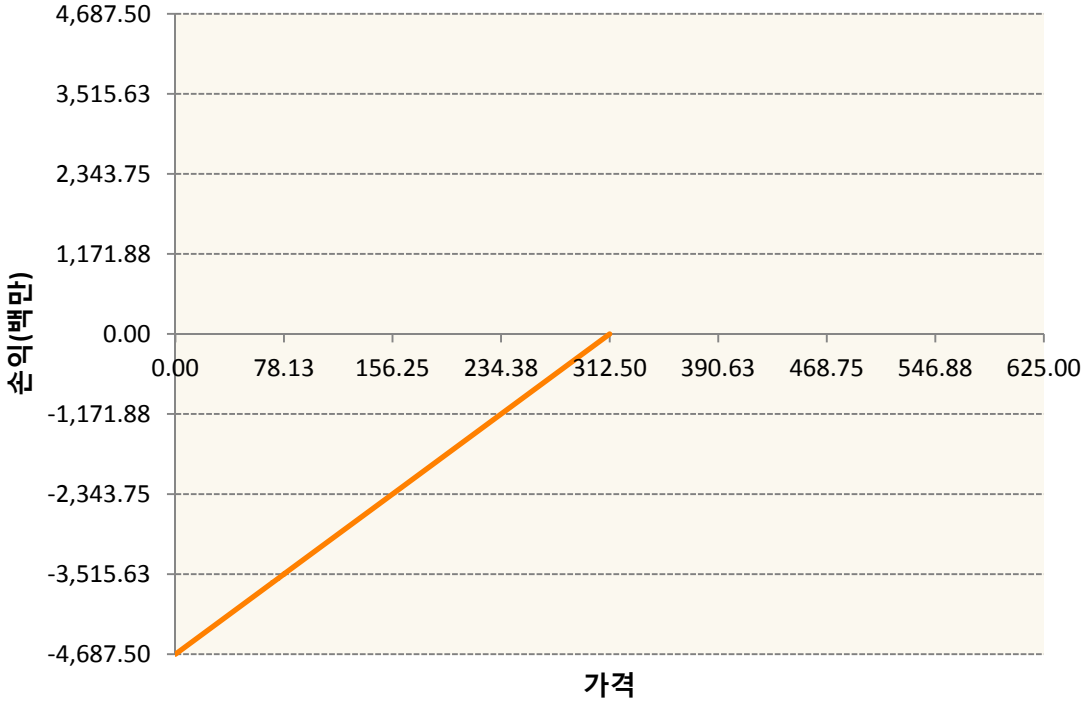
2. 만기시점의 손익구조



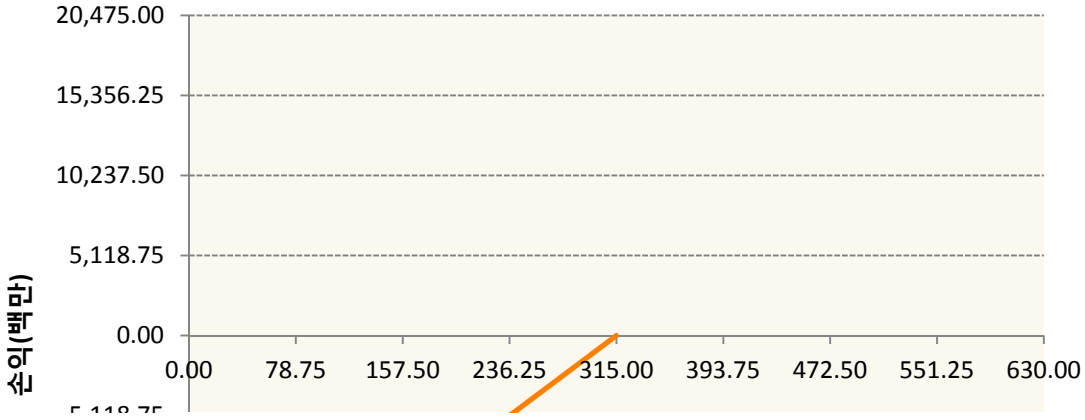




KR4301N43126-2018-04 풋312.5



KR4301N43159-2018-04 풋315





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_2							1,446
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,446	-1,446	-1,446	-1,446	-1,446	-1,446	-1,446
-5.33%	-964	-964	-964	-964	-964	-964	-964
-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%	964	964	964	964	964	964	964
8.00%	1,446	1,446	1,446	1,446	1,446	1,446	1,446
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_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%	-313	-313	-313	-313	-313	-313	-313
-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%	313	313	313	313	313	313	313
8.00%	469	469	469	469	469	469	469
	KR4101N60(2018-06 코스피200지수선물						869
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-869	-869	-869	-869	-869	-869	-869
-5.33%	-580	-580	-580	-580	-580	-580	-580
-2.67%	-290	-290	-290	-290	-290	-290	-290
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	290	290	290	290	290	290	290
5.33%	580	580	580	580	580	580	580
8.00%	869	869	869	869	869	869	869
	KR4201N431 2018-04 콜315						2,117
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,207	1,162	1,113	1,060	1,004	945	885
-5.33%	1,025	959	891	822	752	681	609
-2.67%	703	626	548	471	393	316	238
0%	223	150	75	0	-76	-152	-228
2.67%	-398	-456	-517	-581	-647	-715	-785
5.33%	-1,124	-1,162	-1,205	-1,253	-1,305	-1,361	-1,419
8.00%	-1,912	-1,933	-1,960	-1,992	-2,030	-2,072	-2,117
	KR4301N431 2018-04 풋312.5						234
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-217	-219	-221	-224	-227	-231	-234
-5.33%	-104	-109	-114	-120	-126	-131	-137
-2.67%	-24	-31	-37	-44	-51	-57	-64
0%	14	10	5	0	-5	-11	-17
2.67%	26	24	22	20	17	13	10
5.33%	28	28	27	26	25	24	22
8.00%	29	28	28	28	28	27	26
	KR4301N431 2018-04 풋315						1,111

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,052	-1,058	-1,065	-1,074	-1,085	-1,097	-1,111
-5.33%	-539	-557	-577	-597	-619	-642	-665
-2.67%	-144	-172	-201	-230	-258	-287	-316
0%	73	50	25	0	-26	-52	-79
2.67%	150	139	127	112	96	78	59
5.33%	166	164	160	154	146	137	127
8.00%	169	168	167	166	163	160	155

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

8,158

공시일	2018-03-15
기준일	2018-03-14

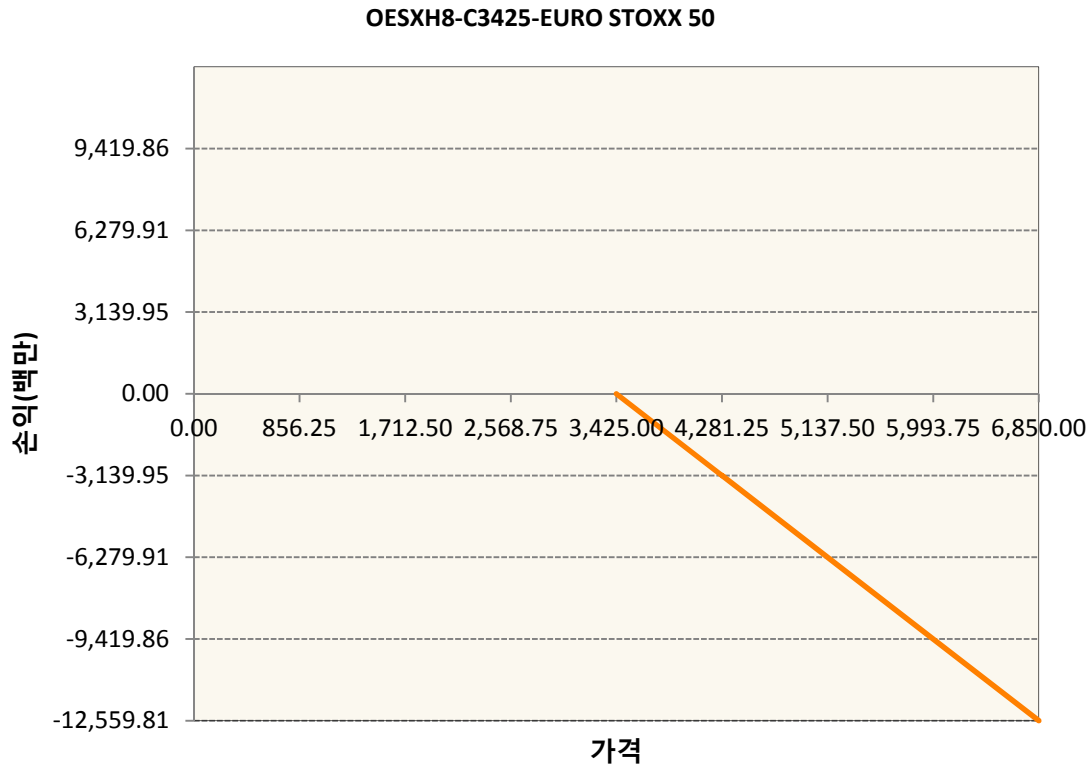
유로커버드콜모(주식혼합-파생형

1. 계약금액

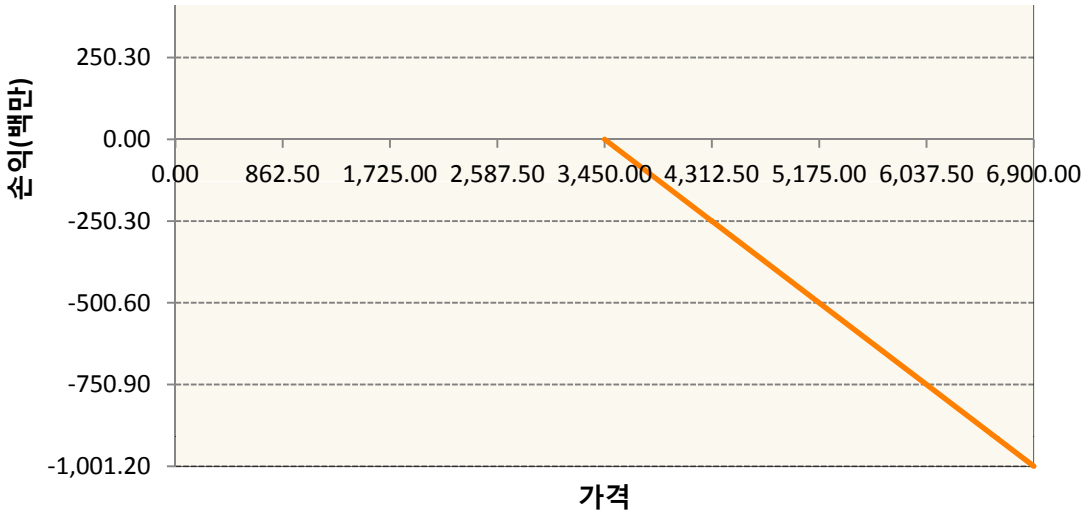
(단위:백만원)

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	5,525	0	5,525	
누계	유가증권	스왑	98,932	0	98,932	장외
누계	유가증권	옵션	0	27,122	-27,122	장내
누계	지수	스왑	52,764	0	52,764	장외

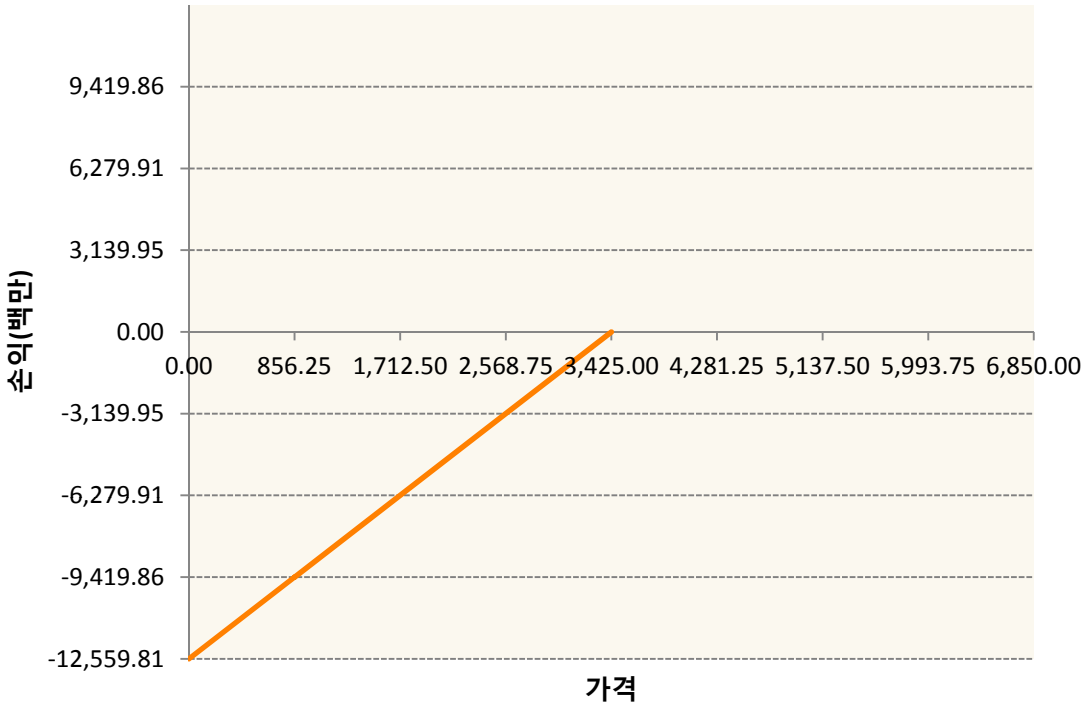
2. 만기시점의 손익구조



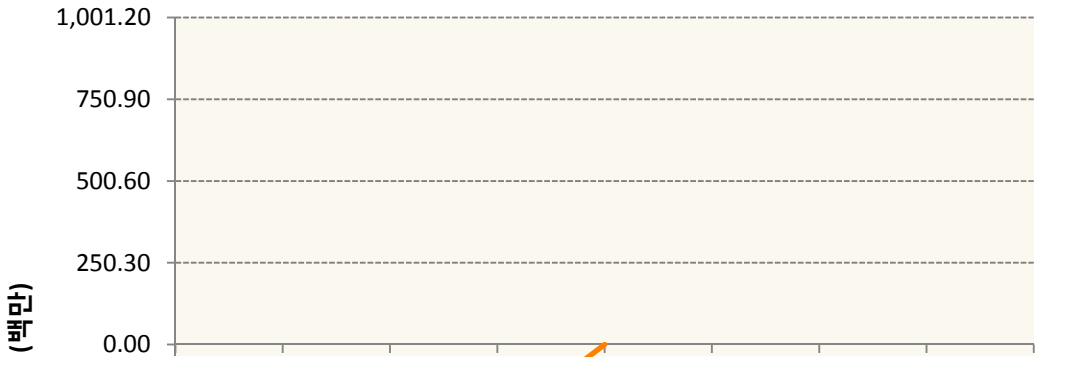


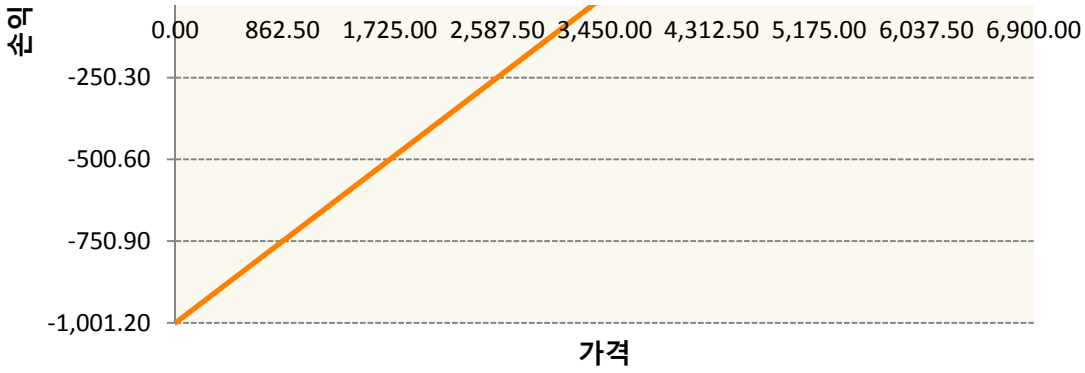


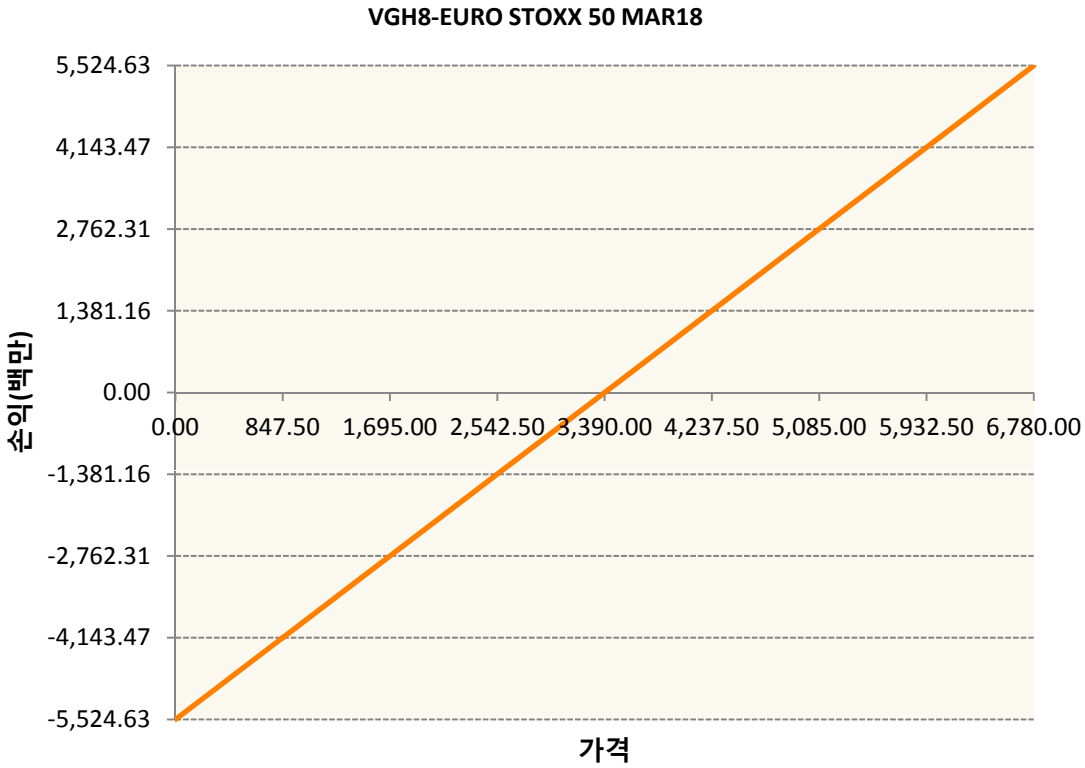
OESXH8-P3425-EURO STOXX 50



OESXH8-P3450-EURO STOXX 50







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

260105SGPX SG EURO Covered CALL STRATEGY - 994.569	194
260105SQPX SG EURO Covered CALL STRATEGY	364
OESXH8-C34 EURO STOXX 50	1,005
OESXH8-C34 EURO STOXX 50	80
OESXH8-P34 EURO STOXX 50	1,005
OESXH8-P34 EURO STOXX 50	80
VGH8 EURO STOXX 50 MAR18	442

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

1,884

공시일	2018-03-15
기준일	2018-03-14

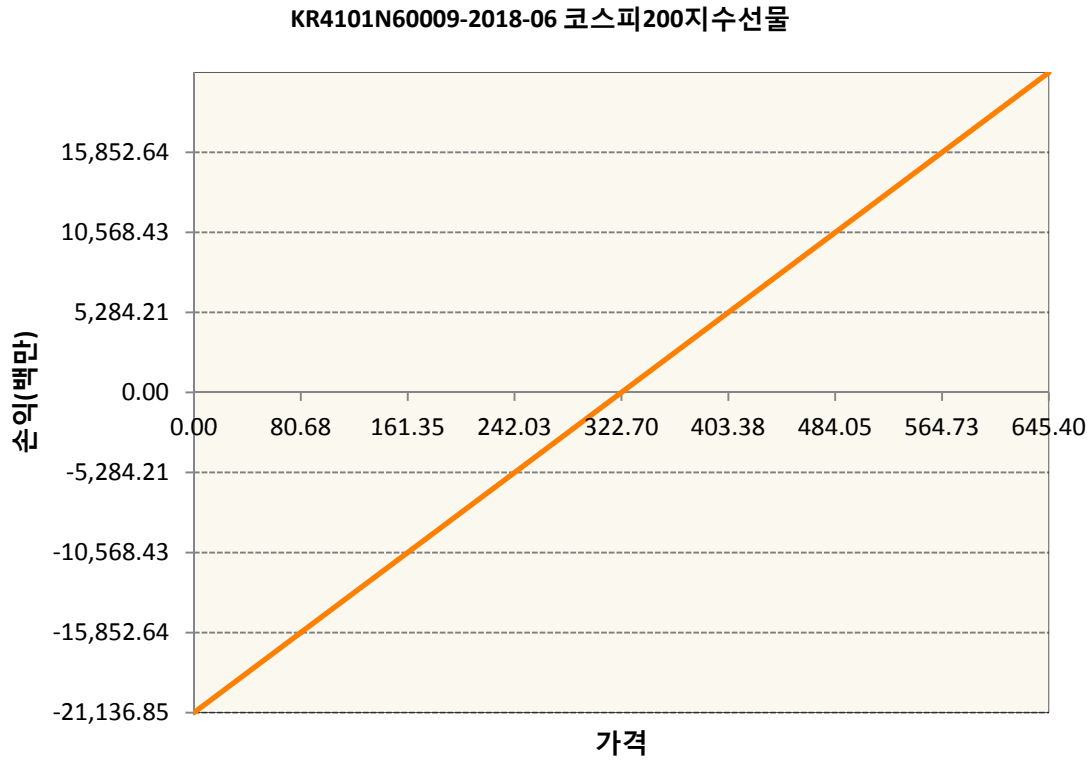
ETF스마트레버리지목표전환형8호

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	21,137	0	21,137	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101N60(2018-06 코스피200지수선물							1,687
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,687	-1,687	-1,687	-1,687	-1,687	-1,687	-1,687
-5.33%	-1,125	-1,125	-1,125	-1,125	-1,125	-1,125	-1,125
-2.67%	-562	-562	-562	-562	-562	-562	-562
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	562	562	562	562	562	562	562
5.33%	1,125	1,125	1,125	1,125	1,125	1,125	1,125
8.00%	1,687	1,687	1,687	1,687	1,687	1,687	1,687

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

1,167

공시일	2018-03-15
기준일	2018-03-14

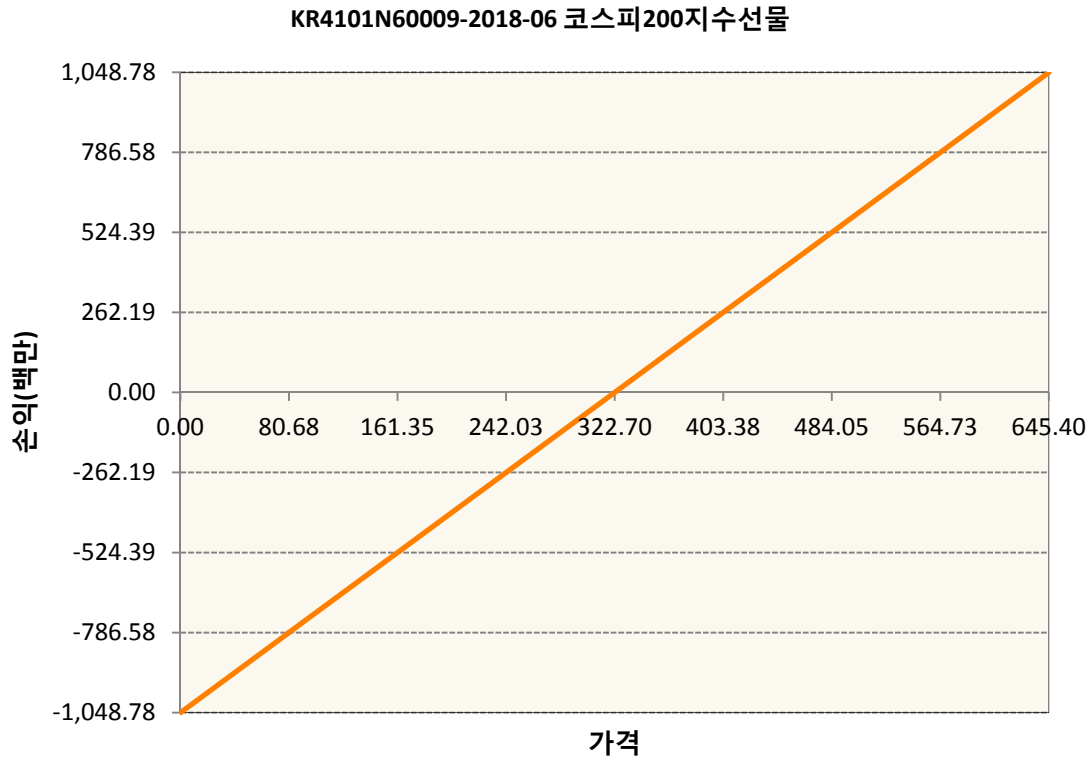
ETF스마트레버리지목표전환형9호

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	1,049	0	1,049	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101N60(2018-06 코스피200지수선물							84
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-84	-84	-84	-84	-84	-84	-84
-5.33%	-56	-56	-56	-56	-56	-56	-56
-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%	56	56	56	56	56	56	56
8.00%	84	84	84	84	84	84	84

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

58

공시일	2018-03-15
기준일	2018-03-14

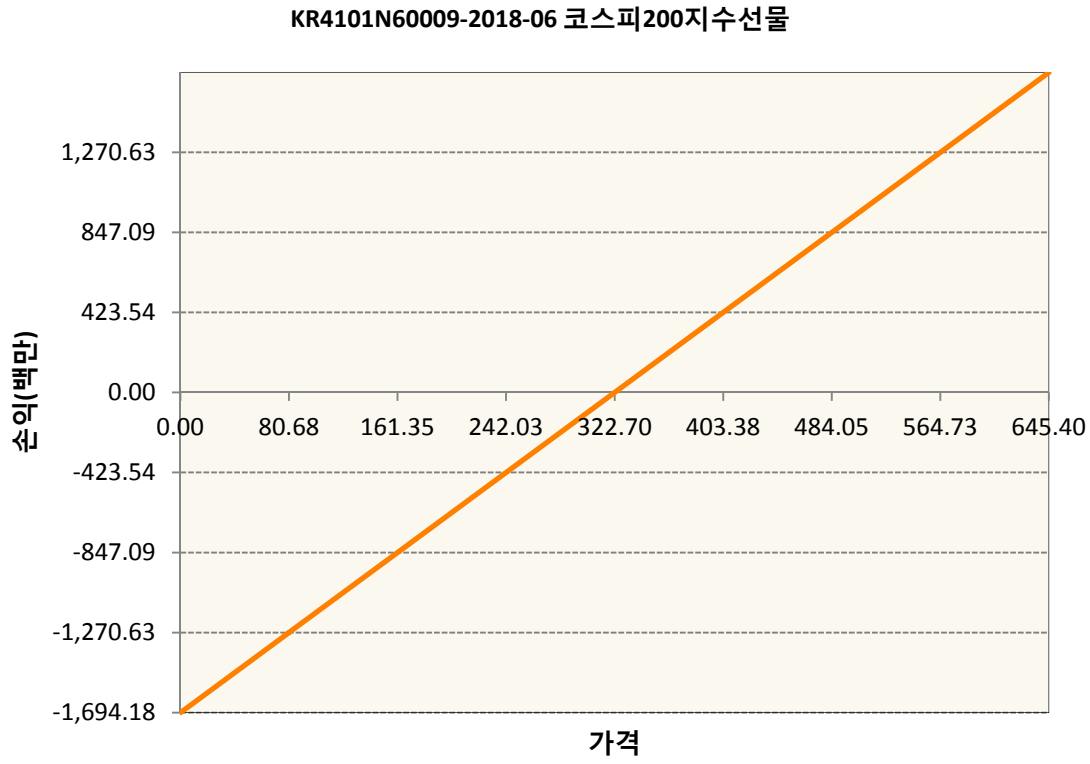
ETF스마트레버리지목표전환형10

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	1,694	0	1,694	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101N60(2018-06 코스피200지수선물							135
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-135	-135	-135	-135	-135	-135	-135
-5.33%	-90	-90	-90	-90	-90	-90	-90
-2.67%	-45	-45	-45	-45	-45	-45	-45
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	45	45	45	45	45	45	45
5.33%	90	90	90	90	90	90	90
8.00%	135	135	135	135	135	135	135

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

94

공시일	2018-03-15
기준일	2018-03-14

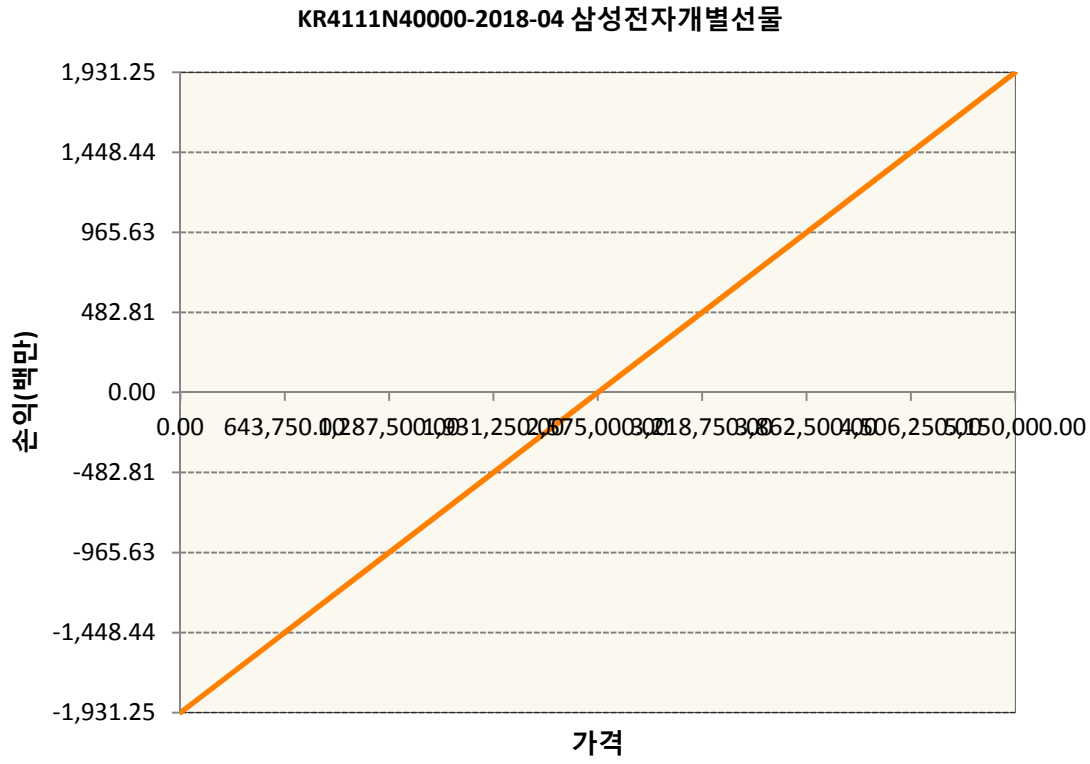
스마트KRX300인덱스1호(주식-파

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	1,931	0	1,931	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4111N40(2018-04 삼성전자개별선물							155
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-155	-155	-155	-155	-155	-155	-155
-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%	155	155	155	155	155	155	155

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

187

공시일	2018-03-15
기준일	2018-03-14

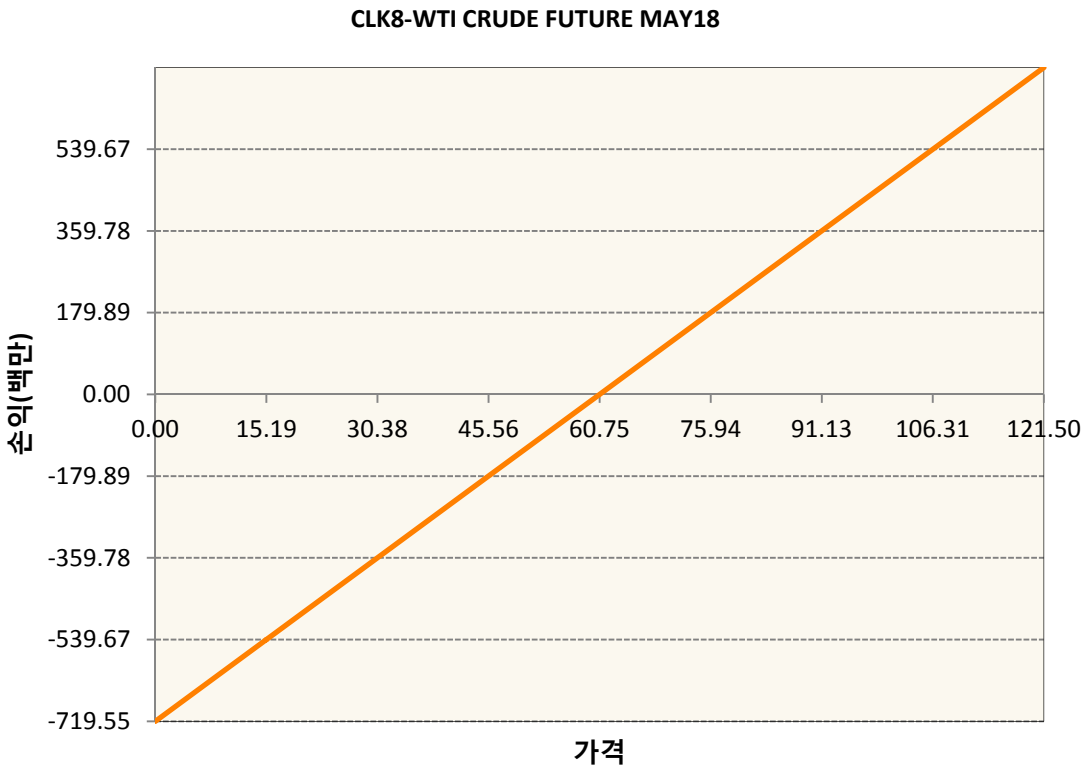
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

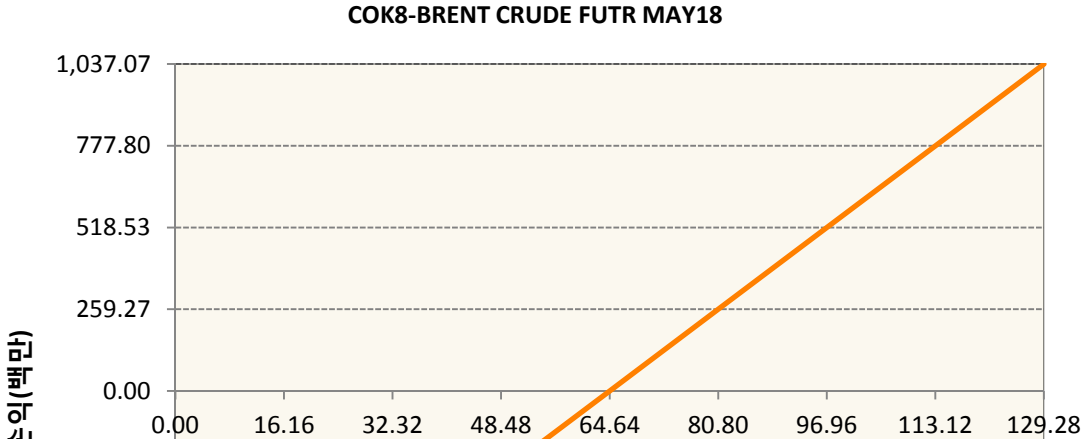
1. 계약금액

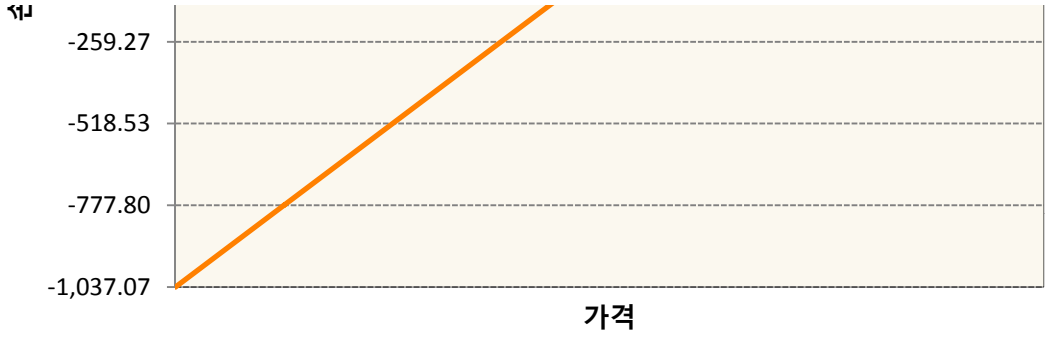
(단위:백만원)

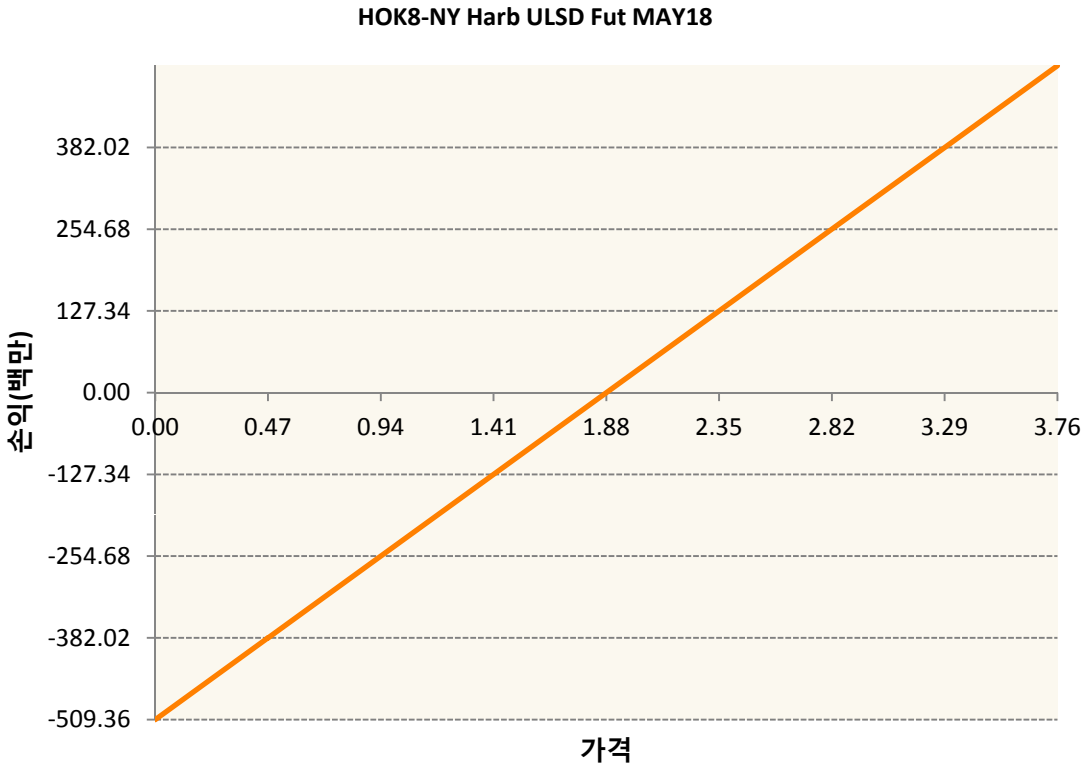
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	선물	유가증권	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	선물	유가증권	720	0	720	
누계	유가증권	선물	3,237	585	2,651	

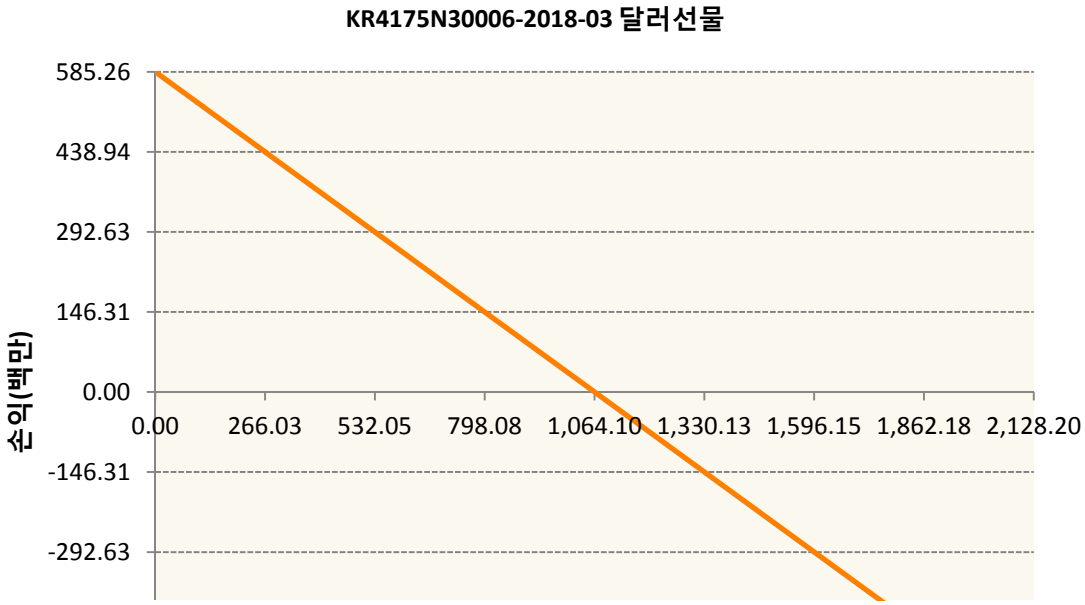
2. 만기시점의 손익구조

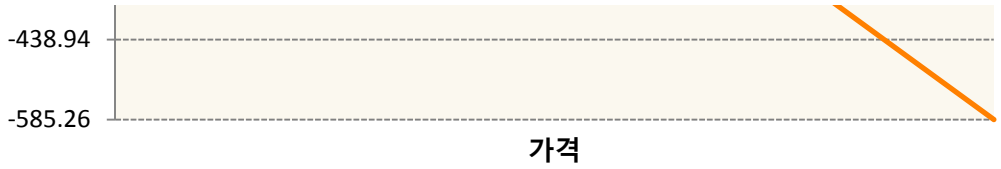


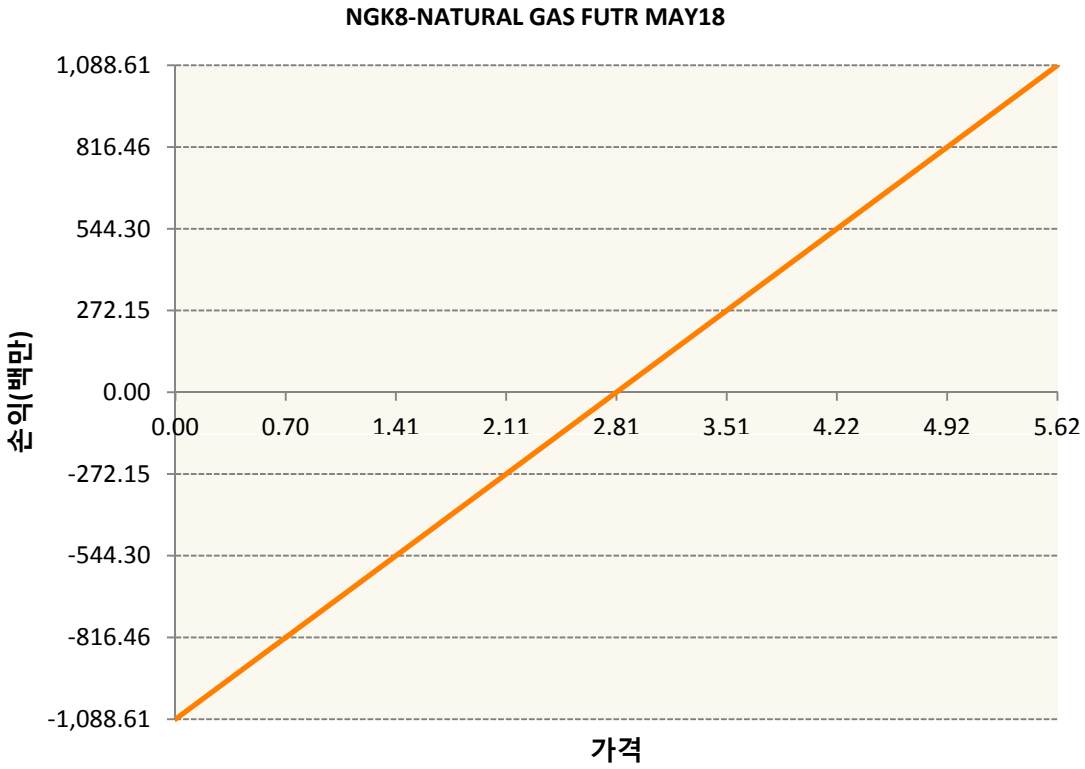


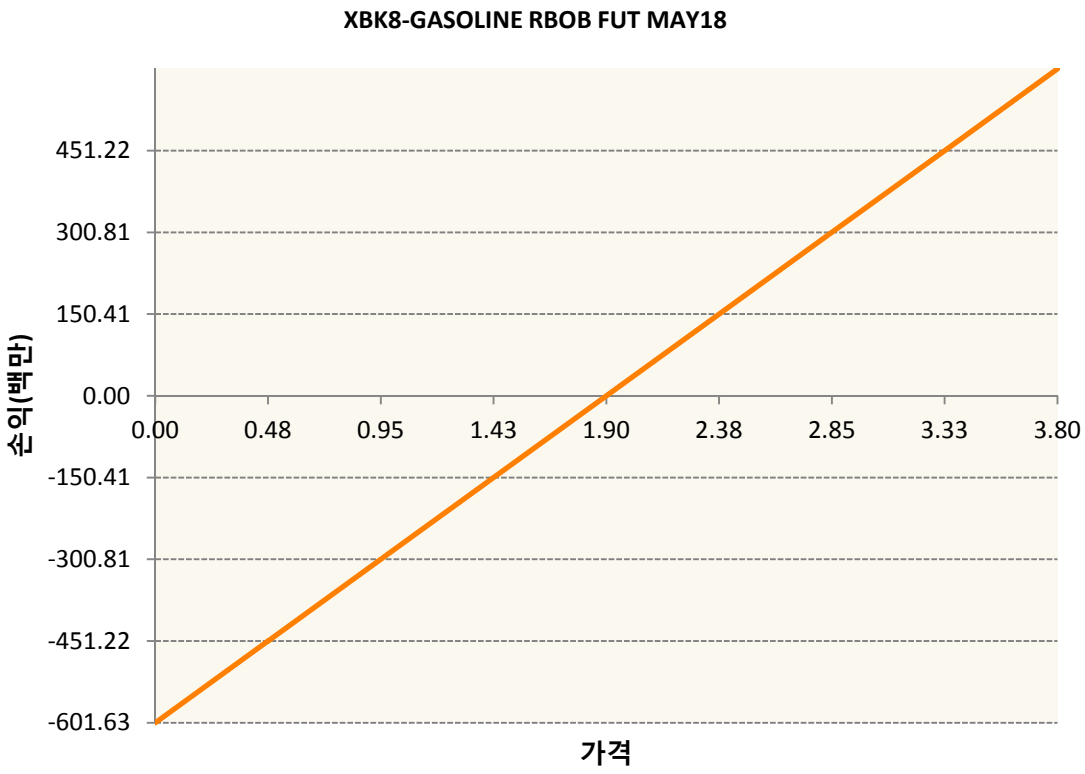

-259.27
-518.53
-777.80
-1,037.07
가격


HOK8-NY Harb ULSD Fut MAY18
382.02
254.68
127.34
0.00
-127.34
-254.68
-382.02
-509.36
0.00
0.47
0.94
1.41
1.88
2.35
2.82
3.29
3.76
손익(백만)
가격


KR4175N30006-2018-03 달러선물
585.26
438.94
292.63
146.31
0.00
-146.31
-292.63
0.00
266.03
532.05
798.08
1,064.10
1,330.13
1,596.15
1,862.18
2,128.20
손익(백만)


-438.94
-585.26
가격


NGK8-NATURAL GAS FUTR MAY18
1,088.61
816.46
544.30
272.15
0.00
-272.15
-544.30
-816.46
-1,088.61
0.00
0.70
1.41
2.11
2.81
3.51
4.22
4.92
5.62
손익(백만)
가격


XBK8-GASOLINE RBOB FUT MAY18
451.22
300.81
150.41
0.00
-150.41
-300.81
-451.22
-601.63
0.00
0.48
0.95
1.43
1.90
2.38
2.85
3.33
3.80
손익(백만)
가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLK8	WTI CRUDE FUTURE MAY18	58
COK8	BRENT CRUDE FUTR MAY18	83
HOK8	NY Harb ULSD Fut MAY18	41
KR4175N30(	2018-03 달러선물	47
NGK8	NATURAL GAS FUTR MAY18	87
XBK8	GASOLINE RBOB FUT MAY18	48

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

521

공시일	2018-03-15
기준일	2018-03-14

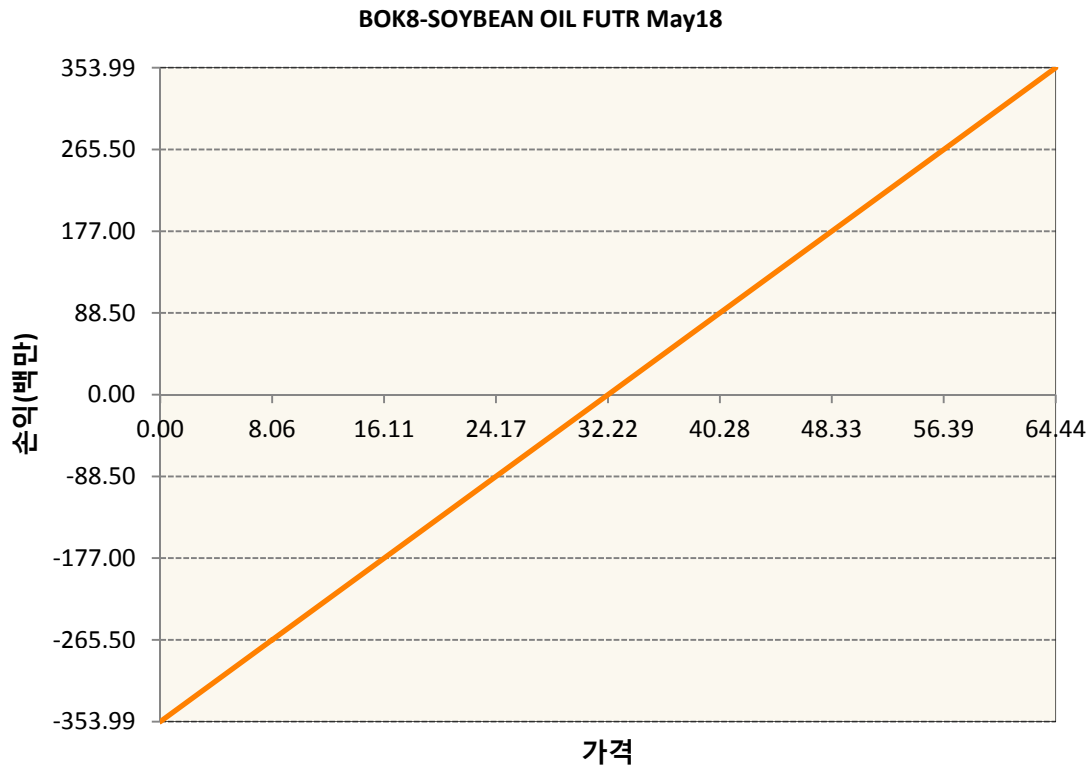
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

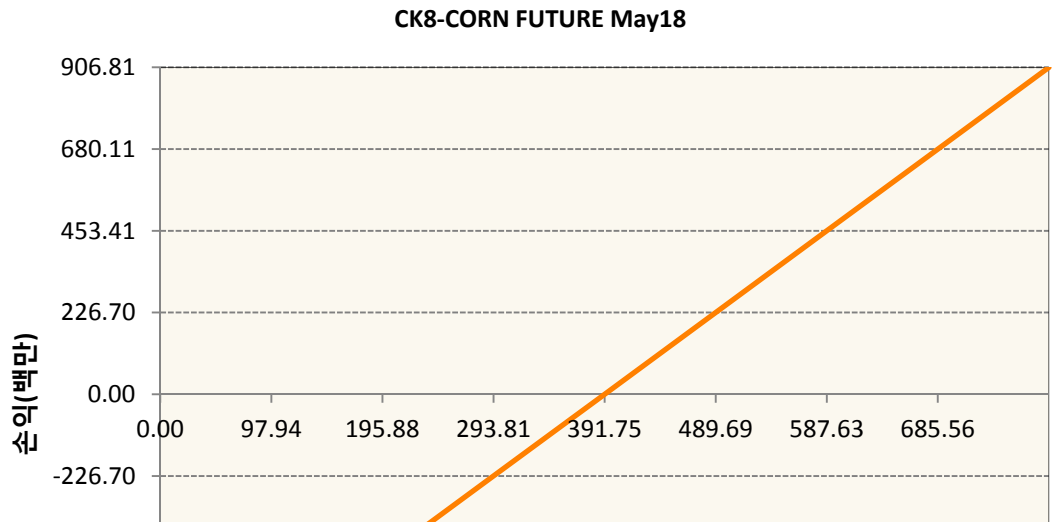
1. 계약금액

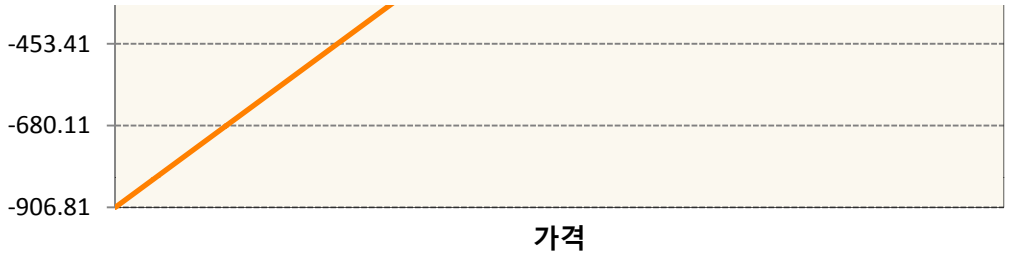
(단위:백만원)

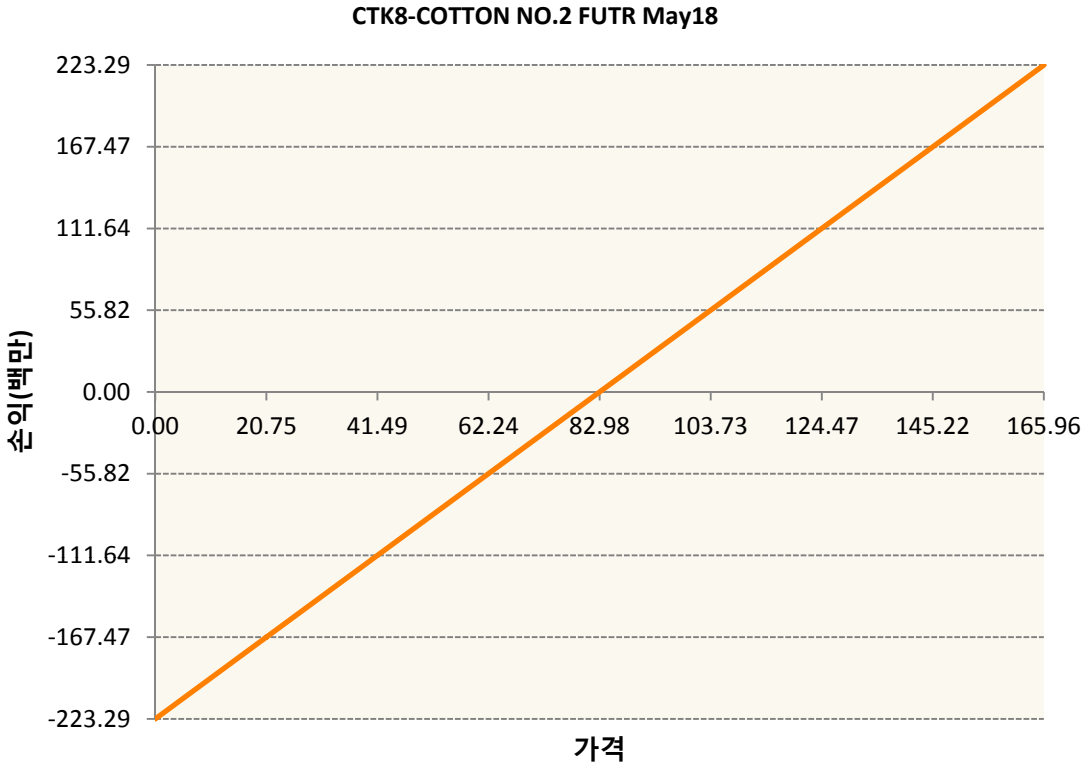
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	4,193	319	3,874	

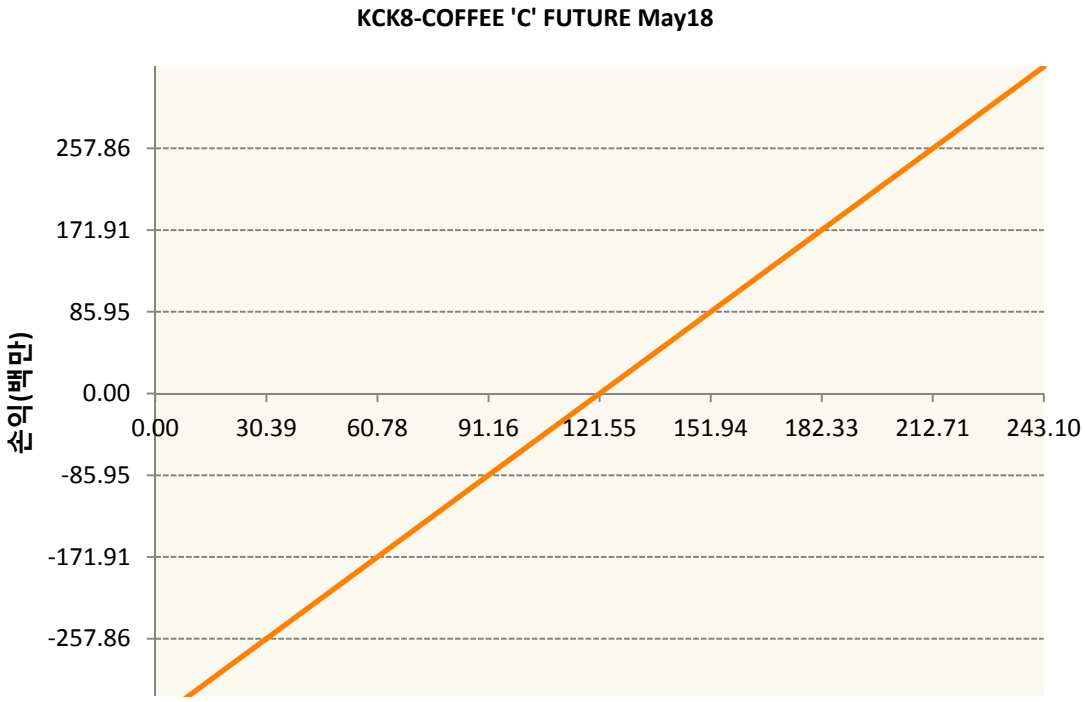
2. 만기시점의 손익구조

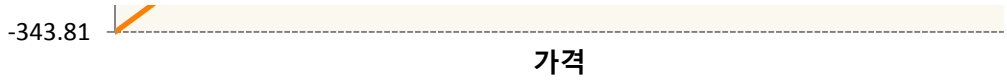


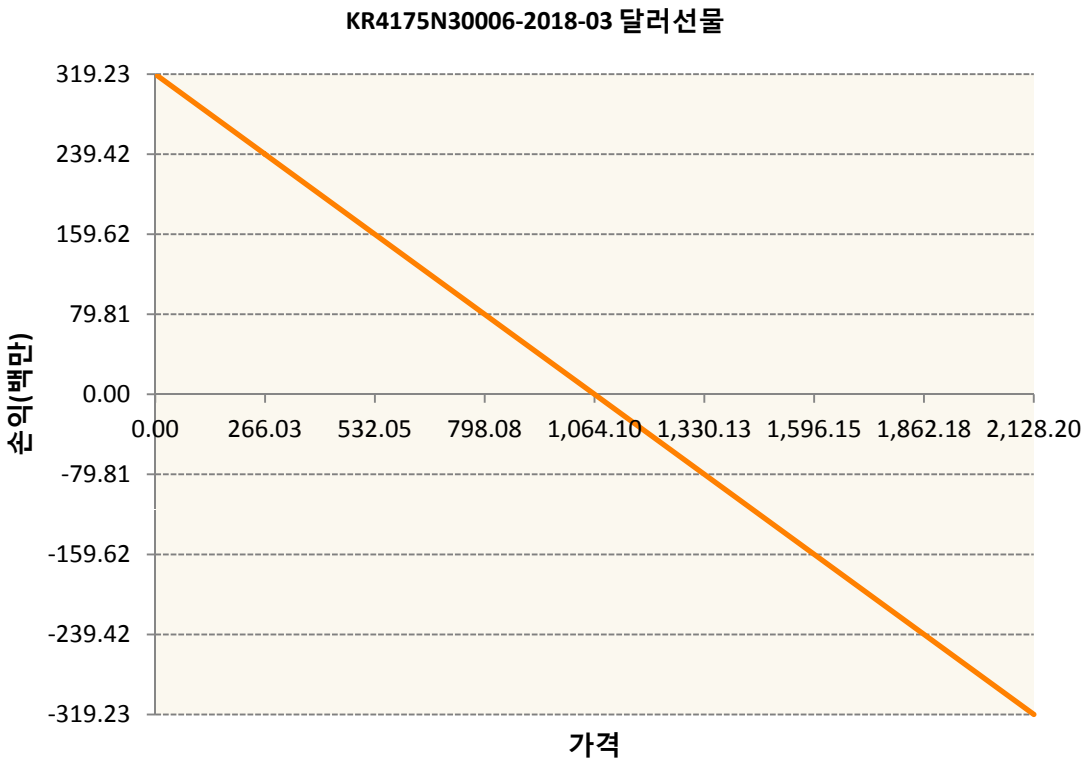


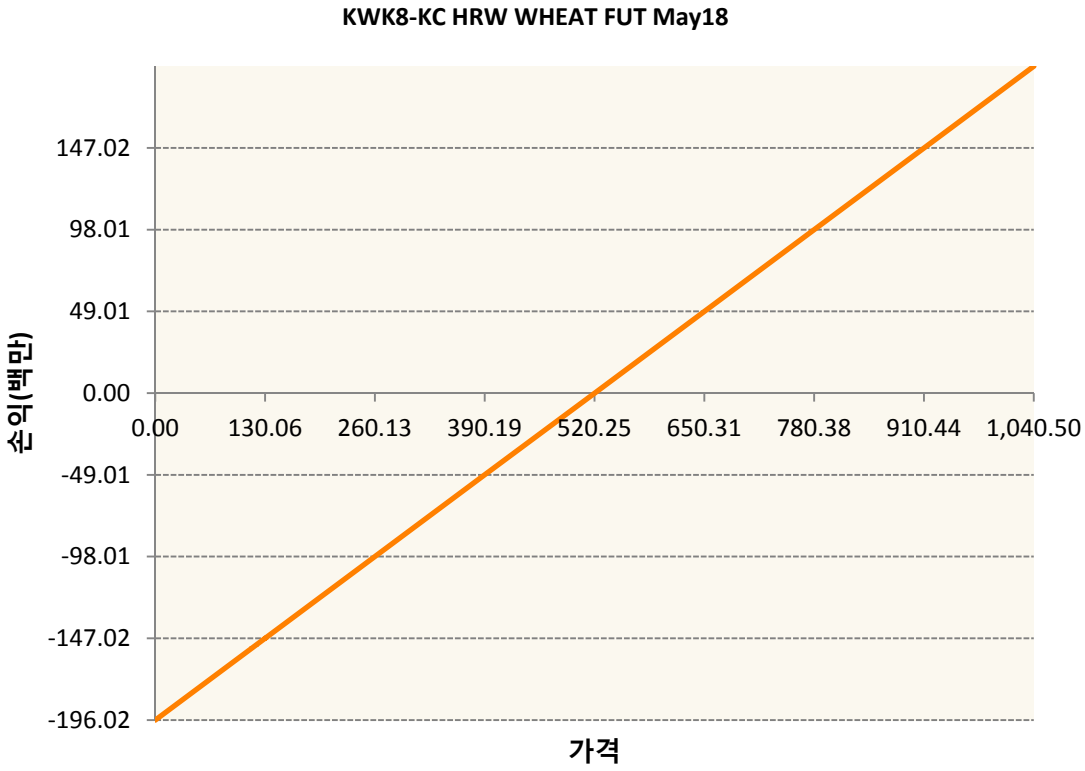

-453.41
-680.11
-906.81
가격


CTK8-COTTON NO.2 FUTR May18
223.29
167.47
111.64
55.82
0.00
-55.82
-111.64
-167.47
-223.29
손익(백만)
0.00
20.75
41.49
62.24
82.98
103.73
124.47
145.22
165.96
가격

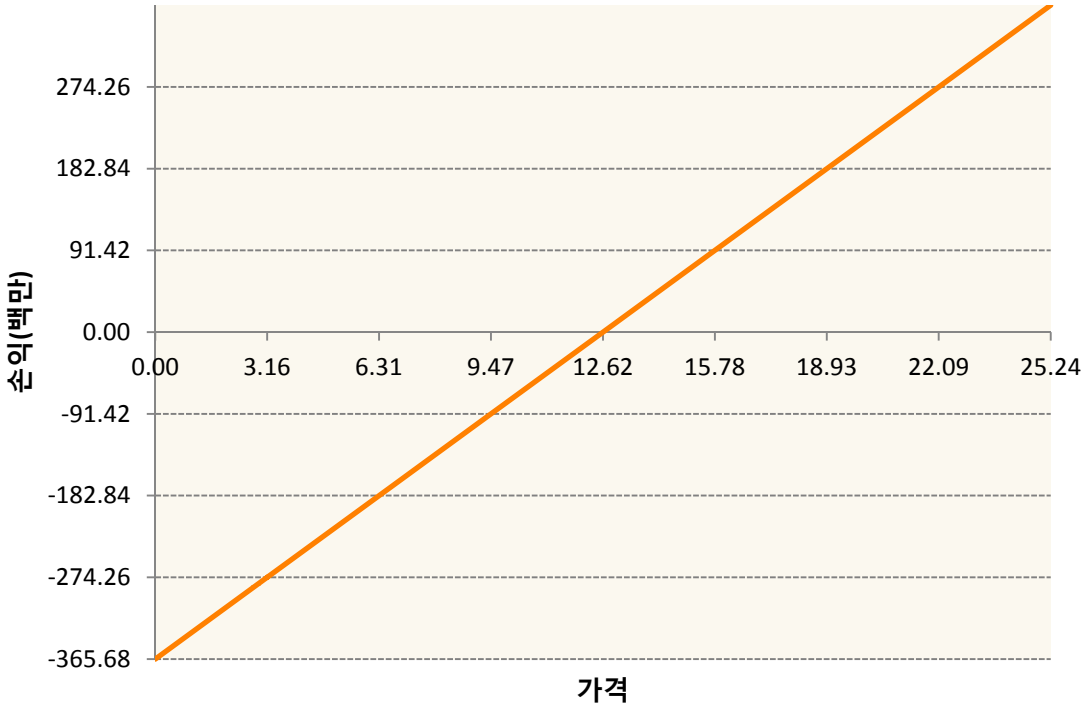

KCK8-COFFEE 'C' FUTURE May18
257.86
171.91
85.95
0.00
-85.95
-171.91
-257.86
손익(백만)
0.00
30.39
60.78
91.16
121.55
151.94
182.33
212.71
243.10


-343.81
가격

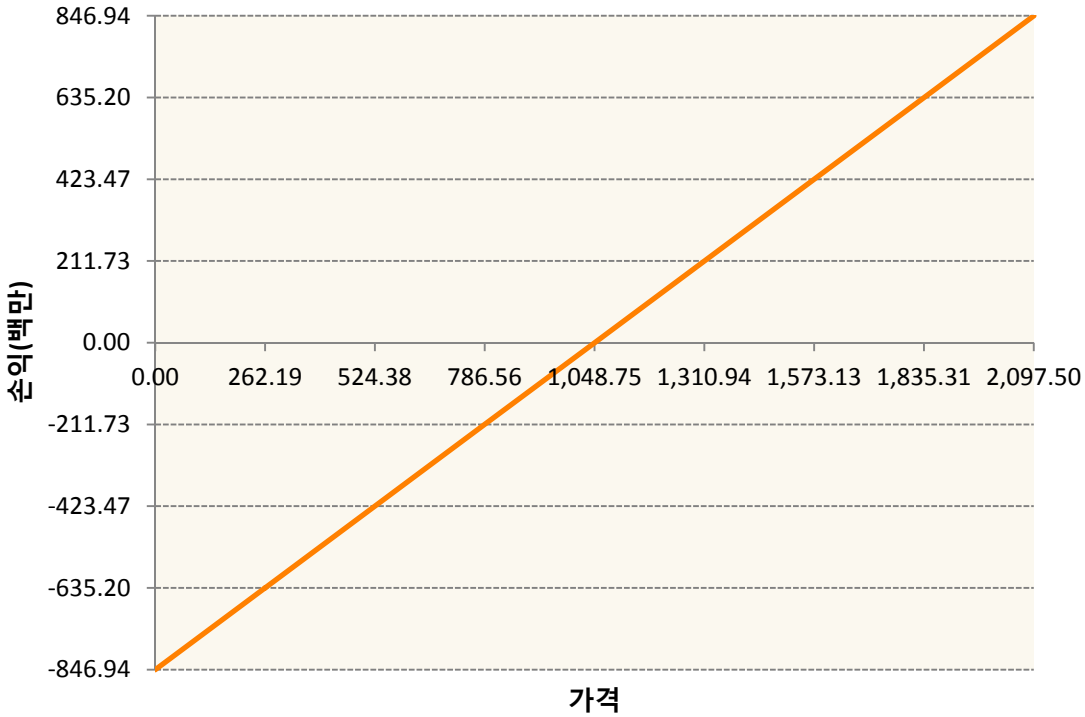

KR4175N30006-2018-03 달러선물
319.23
239.42
159.62
79.81
0.00
-79.81
-159.62
-239.42
-319.23
0.00
266.03
532.05
798.08
1,064.10
1,330.13
1,596.15
1,862.18
2,128.20
손익(백만)
가격


KWK8-KC HRW WHEAT FUT May18
147.02
98.01
49.01
0.00
-49.01
-98.01
-147.02
-196.02
0.00
130.06
260.13
390.19
520.25
650.31
780.38
910.44
1,040.50
손익(백만)
가격

SBK8-SUGAR #11 (WORLD) May18

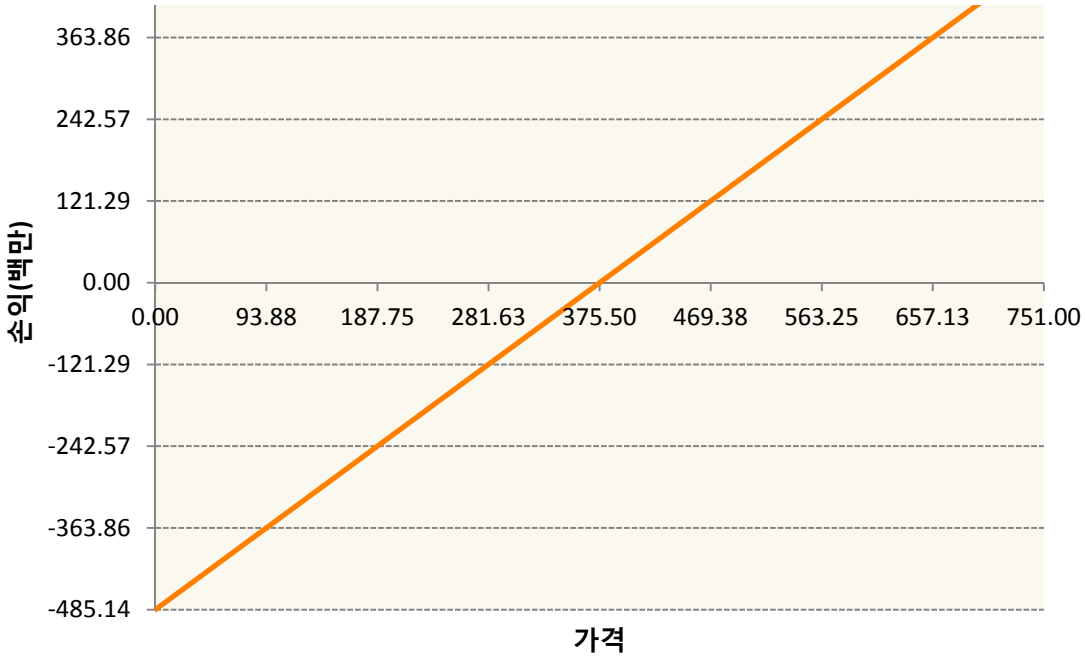


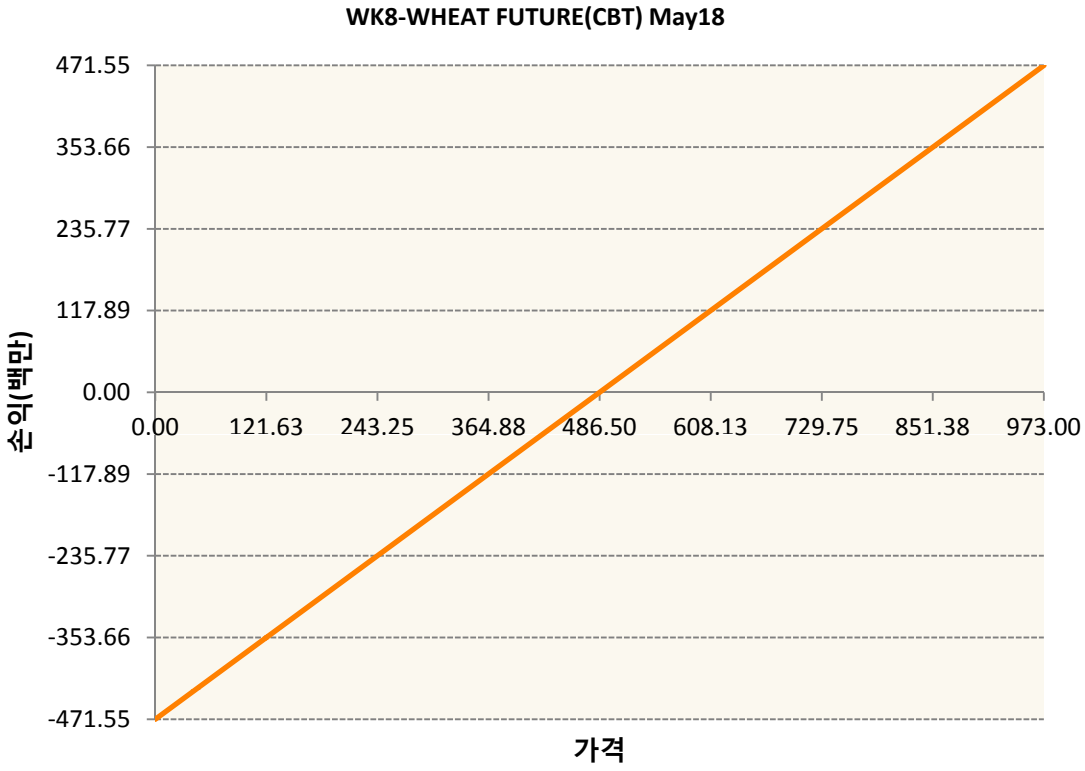
SK8-SOYBEAN FUTRUE May18



SMK8-SOYBEAN MEAL FUTR 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	28
KR4175N30(	2018-03 달러선물	26

KWK8	KC HRW WHEAT FUT May18	16
SBK8	SUGAR #11 (WORLD) May18	29
SK8	SOYBEAN FUTRUE May18	68
SMK8	SOYBEAN MEAL FUTR May18	39
WK8	WHEAT FUTURE(CBT) May18	38

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

336