공시일	2018-03-16
기준일	2018-03-15

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	2018-03-16
기준일	2018-03-15

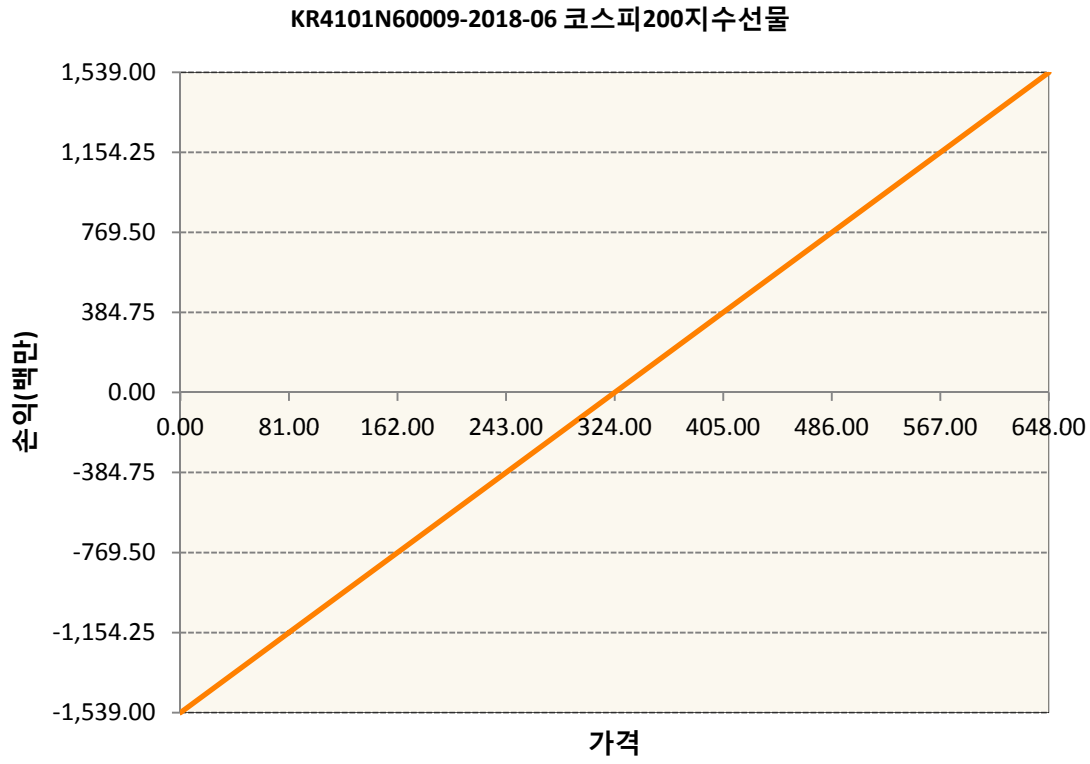
스마트인덱스모

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	1,539	0	1,539	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101N60(2018-06 코스피200지수선물							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)

85

공시일	2018-03-16
기준일	2018-03-15

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	1,120

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

422

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2018-03-16
기준일	2018-03-15

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	2018-03-16
기준일	2018-03-15

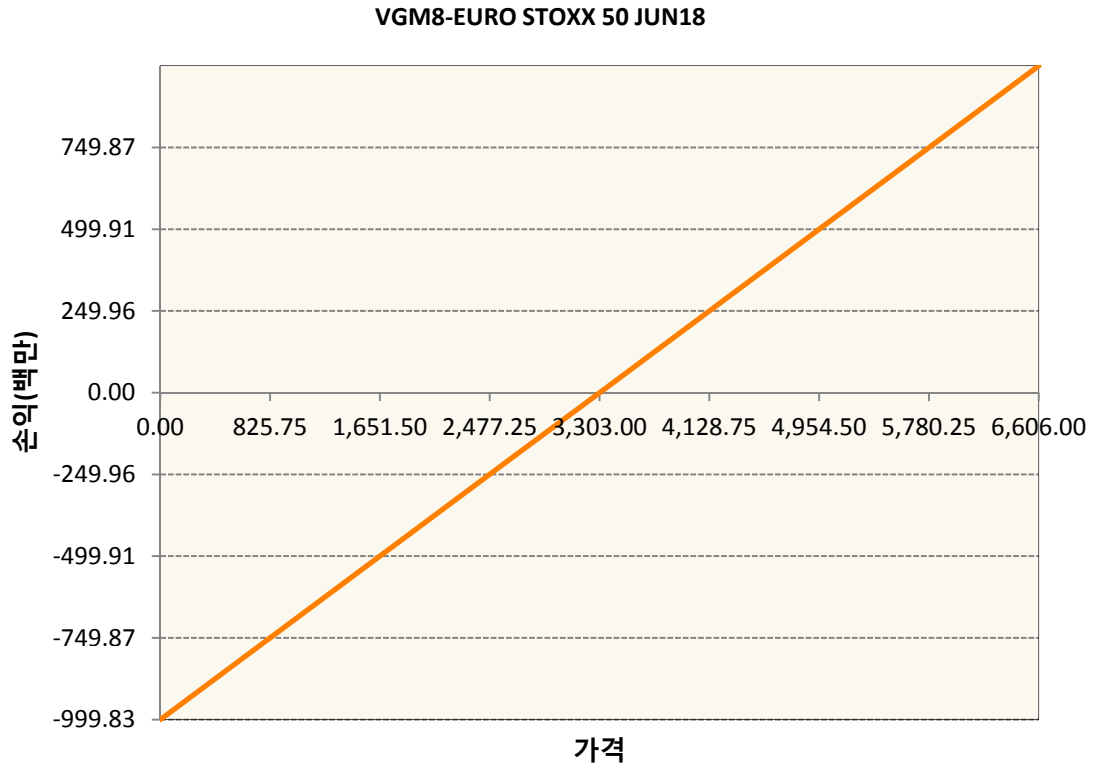
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,000	0	1,000	

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	2018-03-16
기준일	2018-03-15

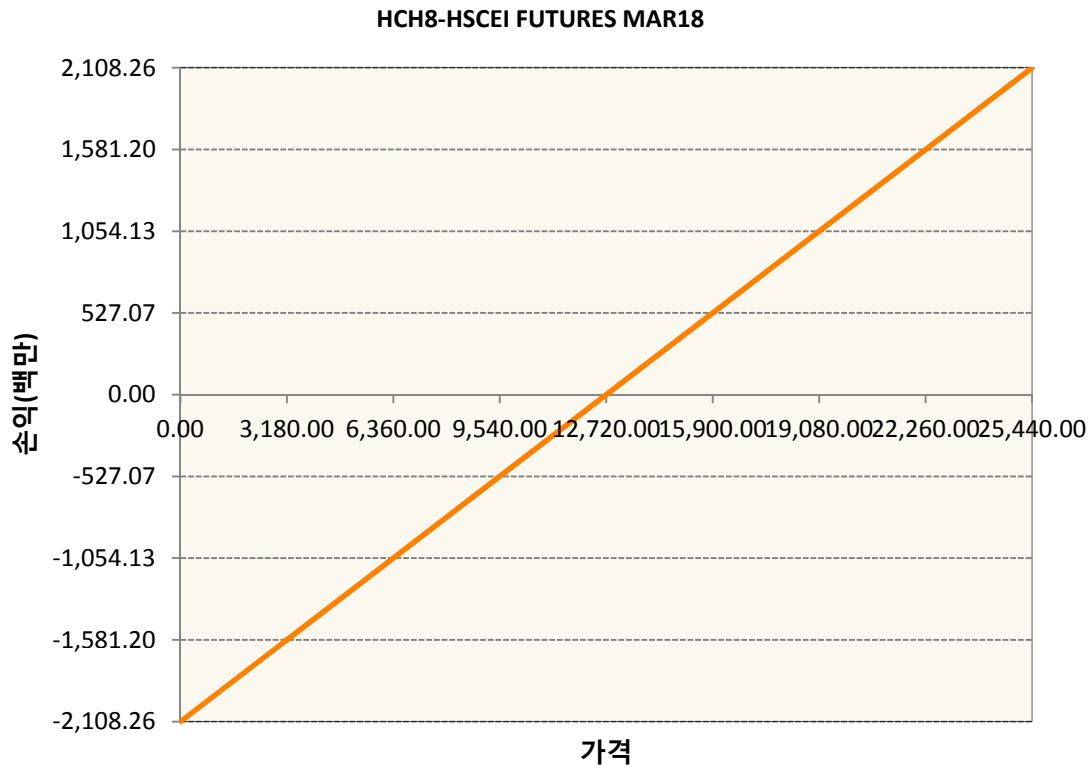
차이나인덱스모(주식-파생형)

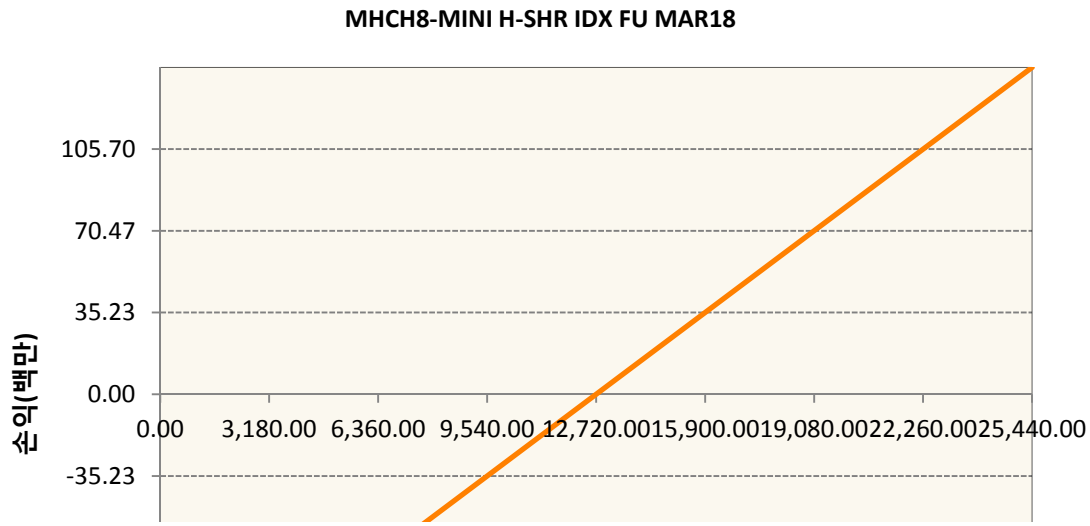
1. 계약금액

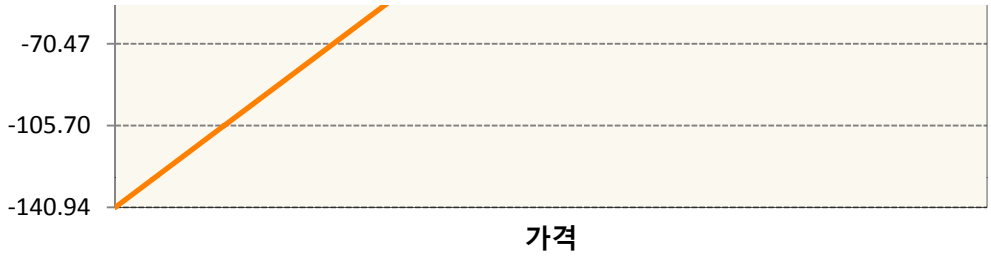
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,249	0	2,249	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCH8	HSCEI FUTURES MAR18	169
MHCH8	MINI H-SHR IDX FU MAR18	11

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

공시일	2018-03-16
기준일	2018-03-15

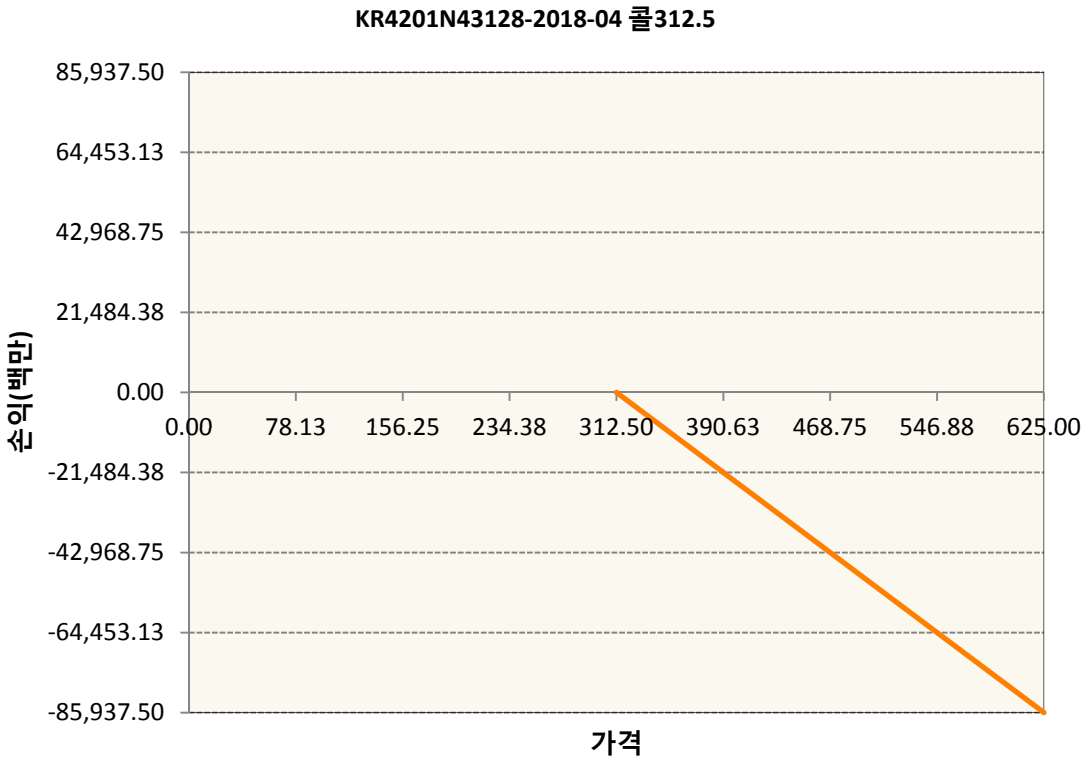
커버드콜모(주식혼합-파생형)

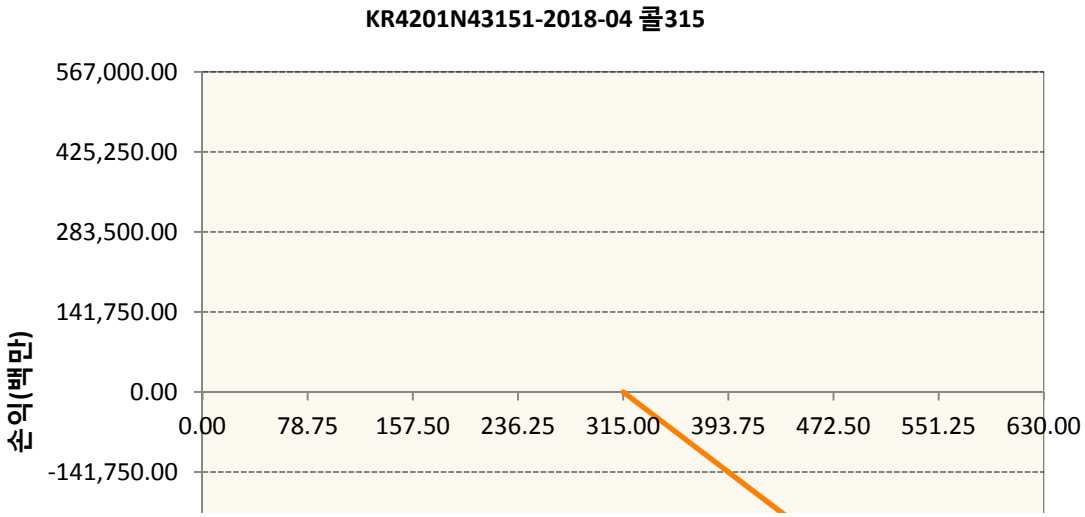
1. 계약금액

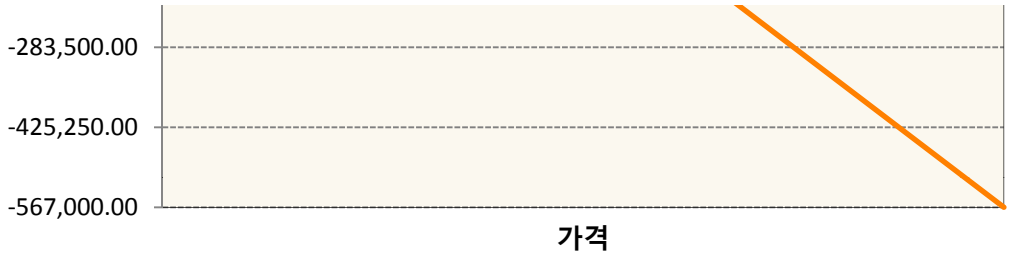
(단위:백만원)

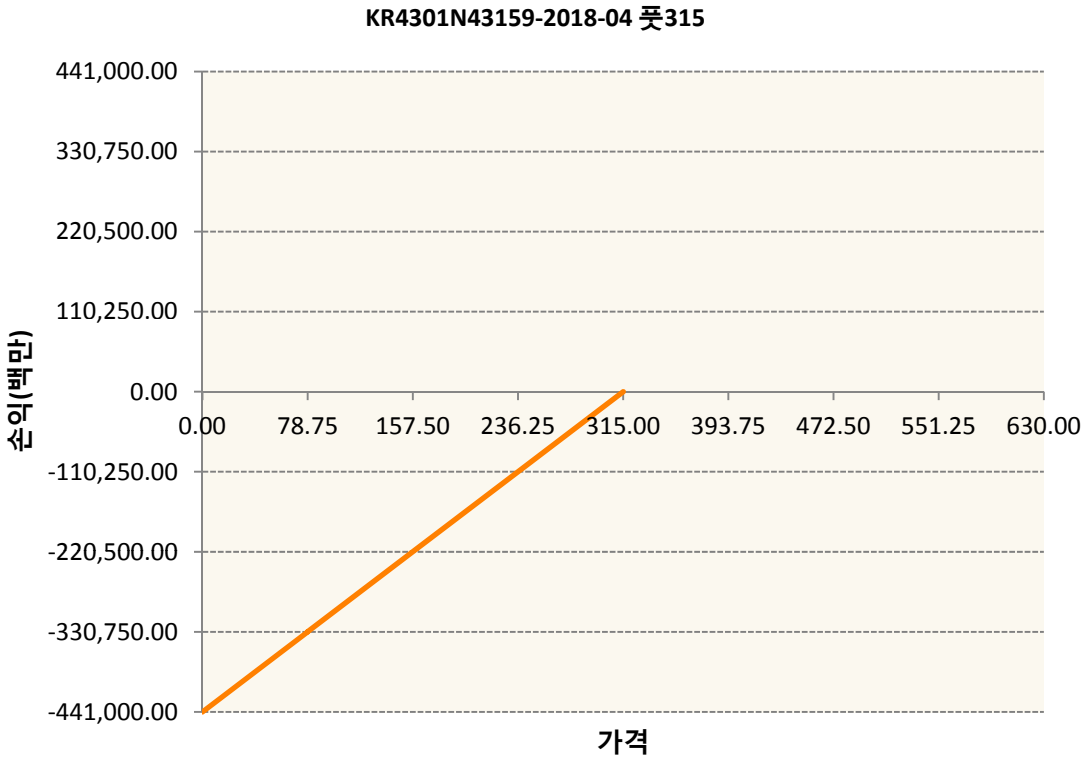
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	1,093,938	-1,093,938	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201N4312018-04 콜312.5							6,166
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	3,796	3,652	3,498	3,336	3,168	2,994	2,816
-5.33%	3,160	2,963	2,764	2,563	2,360	2,156	1,951
-2.67%	2,092	1,878	1,665	1,451	1,237	1,023	809
0%	575	388	196	0	-199	-401	-605
2.67%	-1,309	-1,444	-1,591	-1,749	-1,915	-2,087	-2,266
5.33%	-3,441	-3,522	-3,619	-3,731	-3,855	-3,990	-4,135
8.00%	-5,707	-5,748	-5,805	-5,876	-5,960	-6,057	-6,166
KR4201N4312018-04 콜315							39,347
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	22,709	21,872	20,958	19,980	18,950	17,877	16,769

-5.33%	19,230	18,011	16,763	15,493	14,205	12,903	11,590
-2.67%	13,085	11,677	10,270	8,862	7,454	6,047	4,639
0%	3,990	2,679	1,347	0	-1,359	-2,728	-4,104
2.67%	-7,699	-8,702	-9,773	-10,900	-12,070	-13,277	-14,512
5.33%	-21,237	-21,876	-22,619	-23,450	-24,358	-25,329	-26,355
8.00%	-35,856	-36,201	-36,650	-37,197	-37,835	-38,555	-39,347
KR4301N4312018-04 풋315							23,364

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-21,907	-22,051	-22,238	-22,467	-22,733	-23,034	-23,364
-5.33%	-11,026	-11,452	-11,909	-12,391	-12,893	-13,411	-13,942
-2.67%	-2,829	-3,464	-4,099	-4,734	-5,370	-6,006	-6,642
0%	1,570	1,068	543	0	-558	-1,127	-1,706
2.67%	3,101	2,880	2,612	2,300	1,951	1,569	1,158
5.33%	3,434	3,377	3,288	3,164	3,004	2,808	2,577
8.00%	3,478	3,469	3,450	3,415	3,359	3,281	3,176

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

66,514

공시일	2018-03-16
기준일	2018-03-15

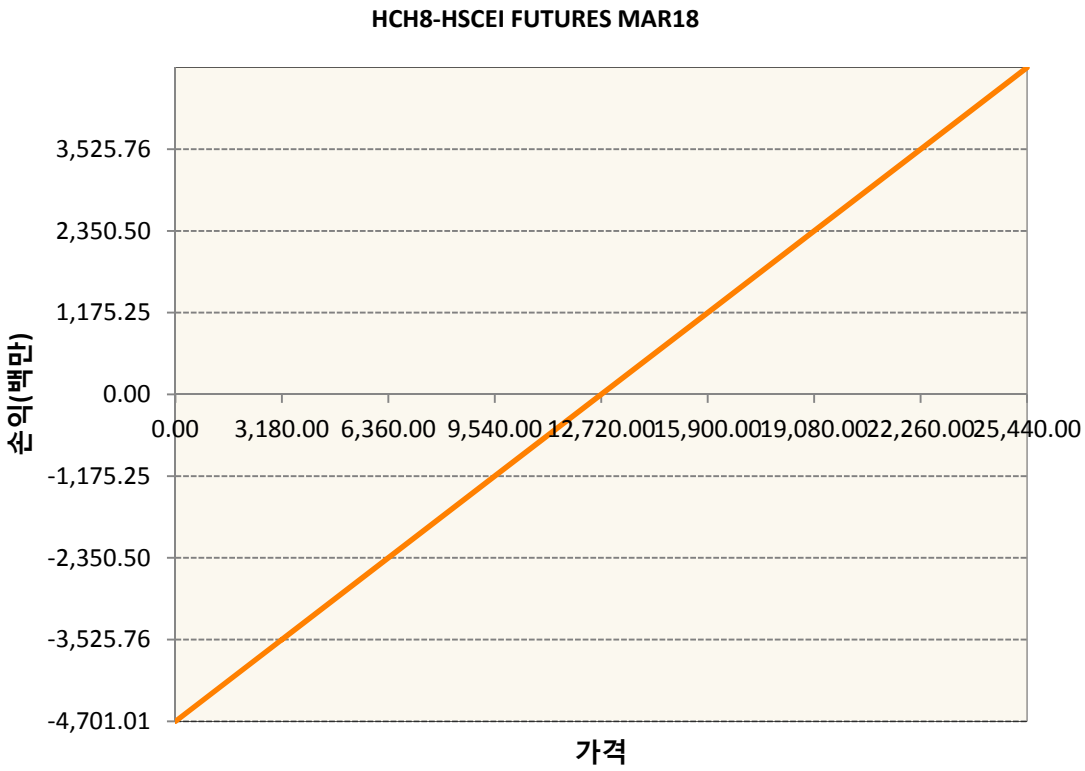
홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생

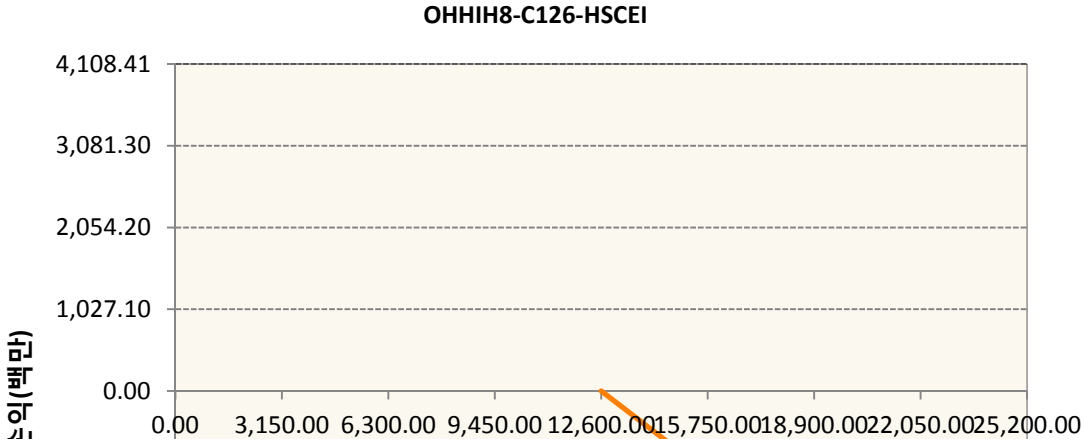
1. 계약금액

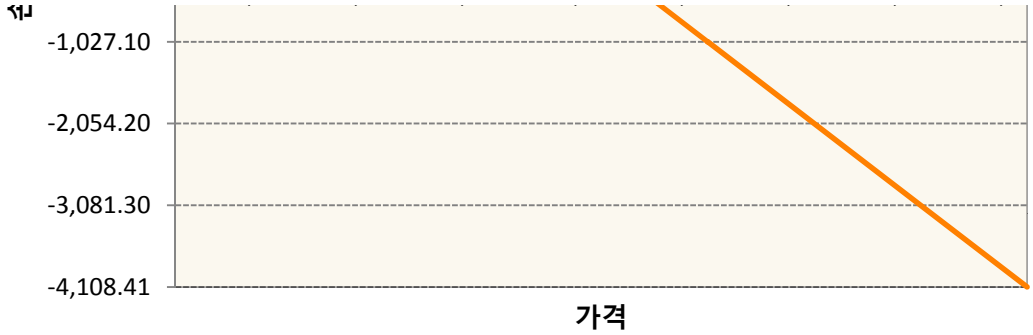
(단위:백만원)

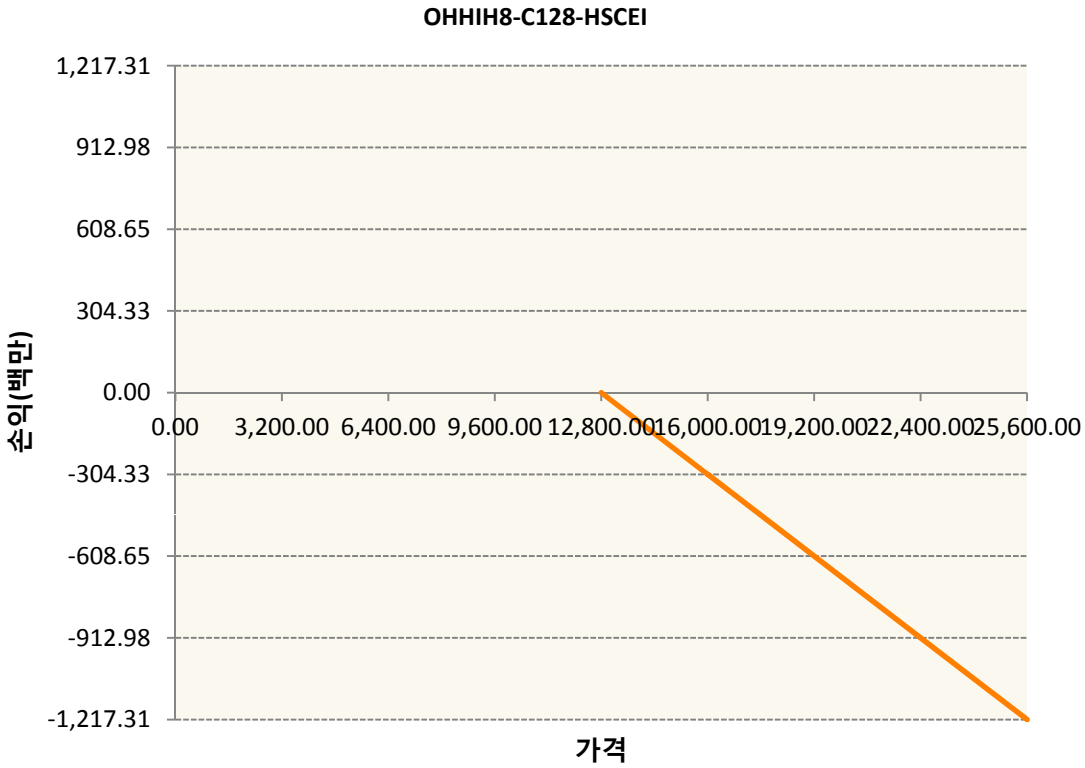
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	4,701	0	4,701	장내
누계	유가증권	옵션	0	10,651	-10,651	장내

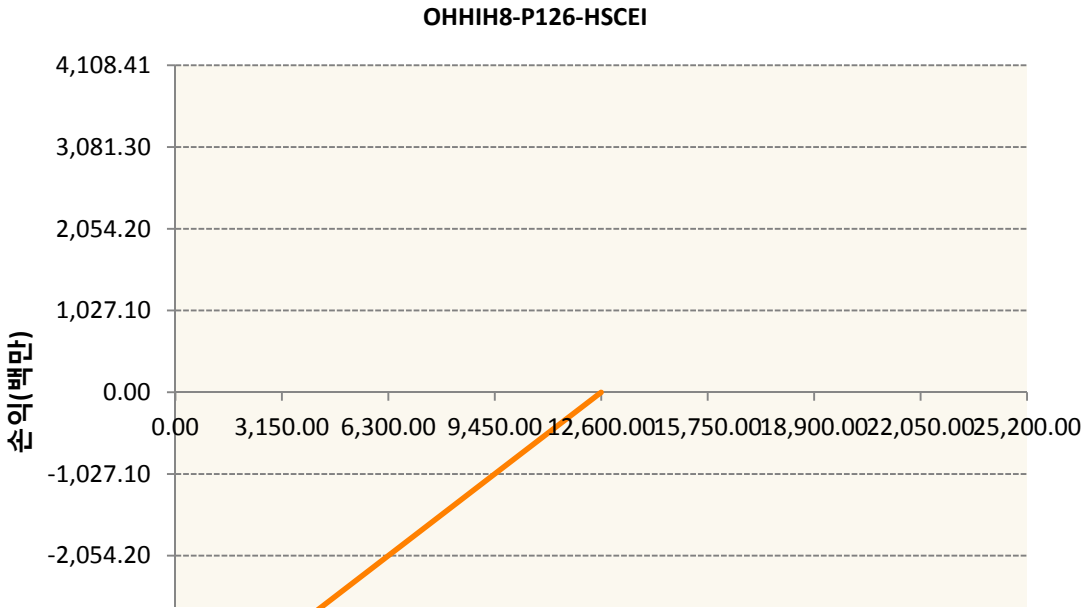
2. 만기시점의 손익구조

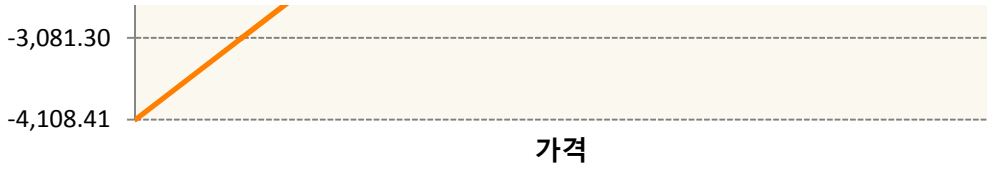


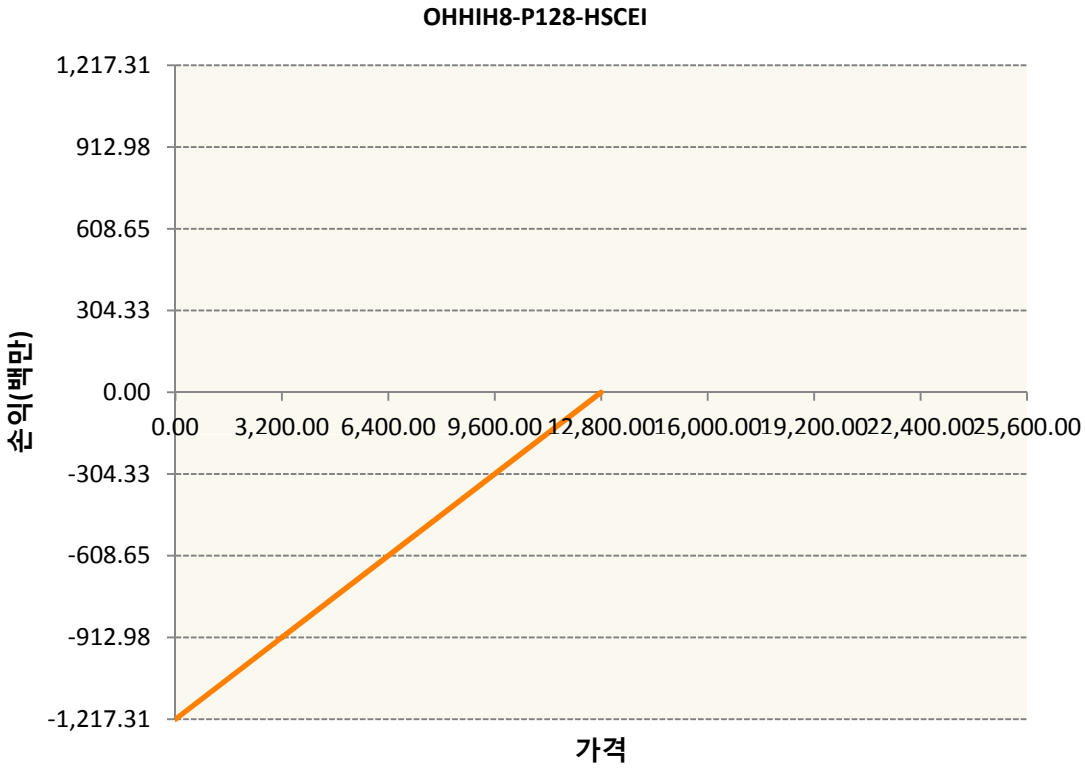



-1,027.10
-2,054.20
-3,081.30
-4,108.41
가격


OHHIH8-C128-HSCEI
1,217.31
912.98
608.65
304.33
0.00
-304.33
-608.65
-912.98
-1,217.31
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
4,108.41
3,081.30
2,054.20
1,027.10
0.00
-1,027.10
-2,054.20
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	376
OHHIH8-C12	HSCEI	329
OHHIH8-C12	HSCEI	97
OHHIH8-P12	HSCEI	329
OHHIH8-P12	HSCEI	97

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,071

공시일	2018-03-16
기준일	2018-03-15

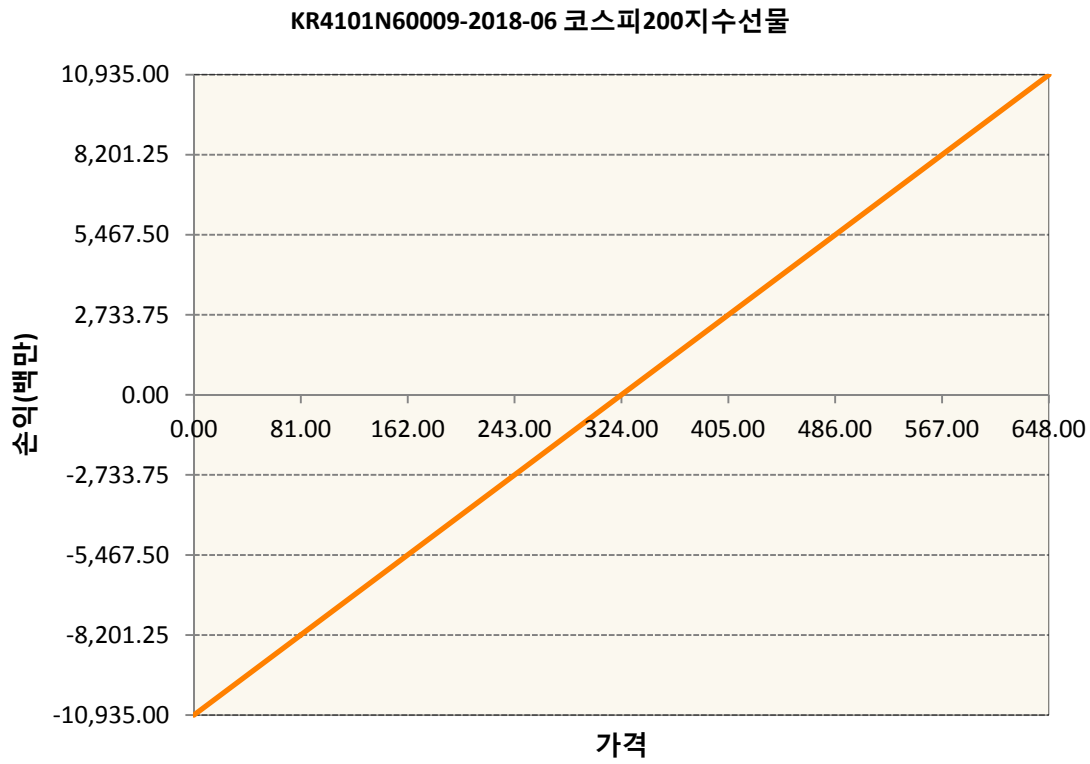
코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼

1. 계약금액

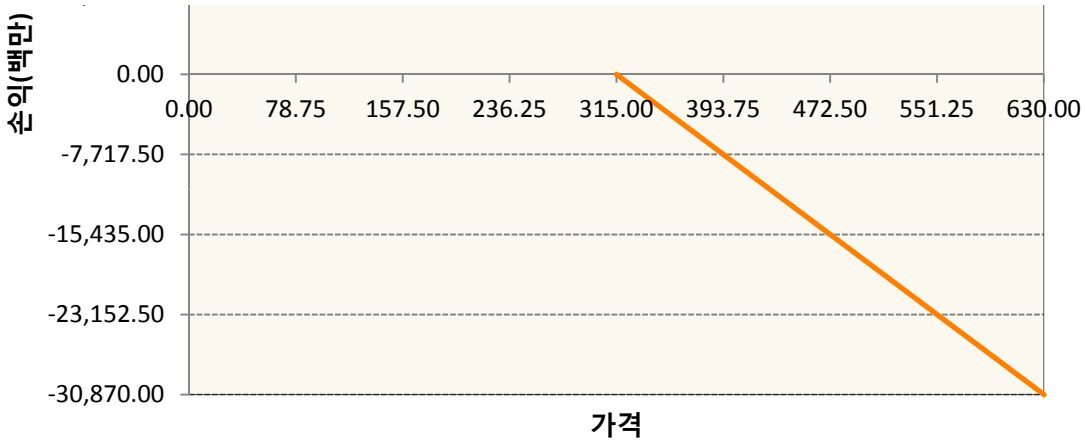
(단위:백만원)

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	10,935	0	10,935	장내
누계	유가증권	스왑	54,200	0	54,200	장외
누계	유가증권	옵션	0	56,033	-56,033	장내

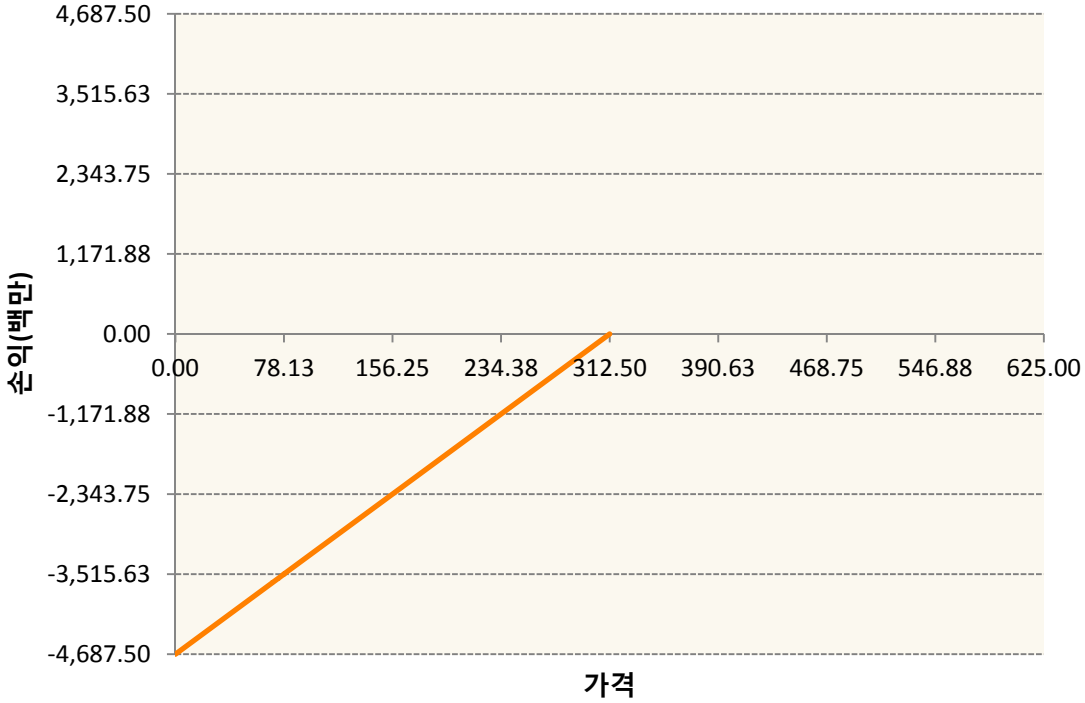
2. 만기시점의 손익구조



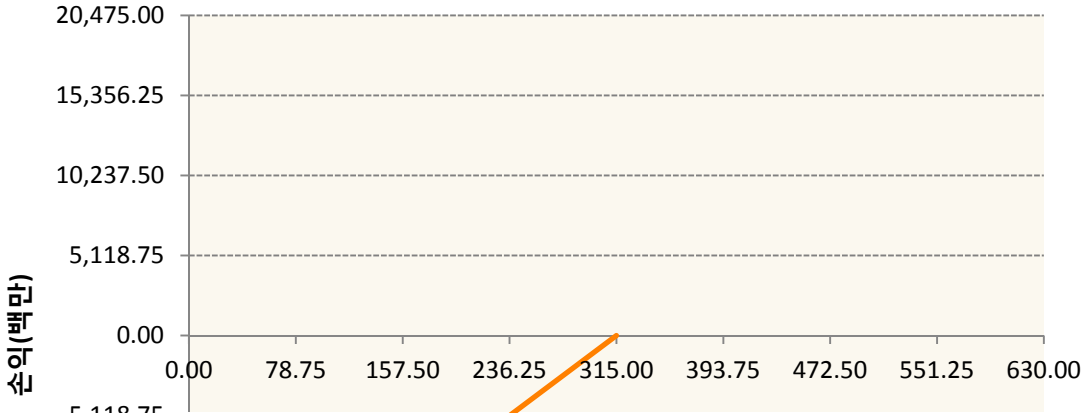




KR4301N43126-2018-04 풋312.5



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						871
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-871	-871	-871	-871	-871	-871	-871
-5.33%	-581	-581	-581	-581	-581	-581	-581
-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%	581	581	581	581	581	581	581
8.00%	871	871	871	871	871	871	871
	KR4201N431 2018-04 콜315						2,142
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,236	1,191	1,141	1,088	1,032	973	913
-5.33%	1,047	981	913	843	773	703	631
-2.67%	712	636	559	482	406	329	253
0%	217	146	73	0	-74	-149	-223
2.67%	-419	-474	-532	-593	-657	-723	-790
5.33%	-1,156	-1,191	-1,231	-1,277	-1,326	-1,379	-1,435
8.00%	-1,952	-1,971	-1,995	-2,025	-2,060	-2,099	-2,142
	KR4301N431 2018-04 풋312.5						228
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-209	-211	-214	-217	-220	-224	-228
-5.33%	-98	-104	-109	-115	-121	-127	-133
-2.67%	-22	-29	-35	-42	-49	-56	-62
0%	14	10	5	0	-5	-11	-17
2.67%	25	24	21	19	16	12	9
5.33%	27	27	26	25	24	22	20
8.00%	27	27	27	27	27	26	25
	KR4301N431 2018-04 풋315						1,085

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,017	-1,024	-1,033	-1,043	-1,055	-1,069	-1,085
-5.33%	-512	-532	-553	-575	-599	-623	-647
-2.67%	-131	-161	-190	-220	-249	-279	-308
0%	73	50	25	0	-26	-52	-79
2.67%	144	134	121	107	91	73	54
5.33%	159	157	153	147	139	130	120
8.00%	161	161	160	159	156	152	147

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

8,144

공시일	2018-03-16
기준일	2018-03-15

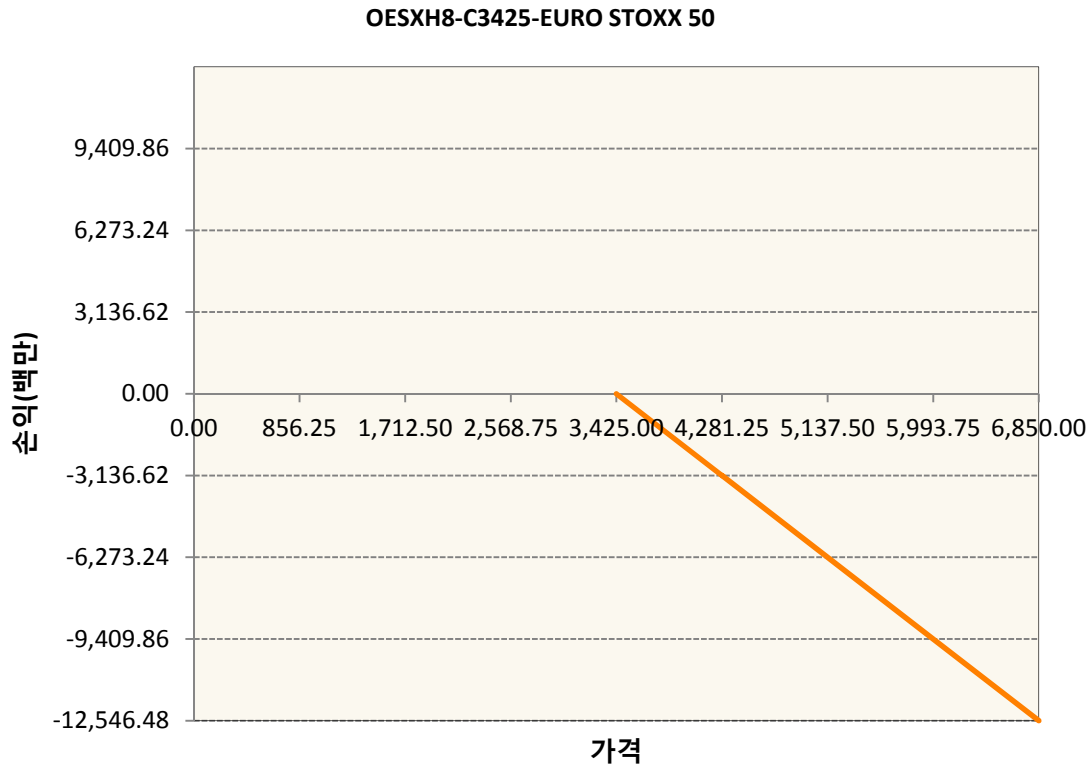
유로커버드콜모(주식혼합-파생형

1. 계약금액

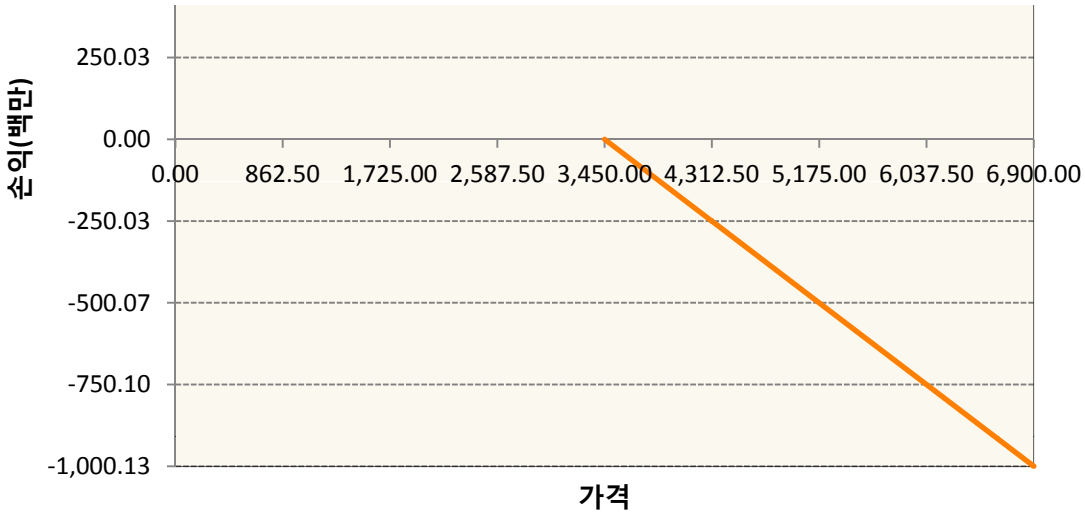
(단위:백만원)

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	5,528	0	5,528	
누계	유가증권	스왑	98,830	0	98,830	장외
누계	유가증권	옵션	0	27,093	-27,093	장내
누계	지수	스왑	52,710	0	52,710	장외

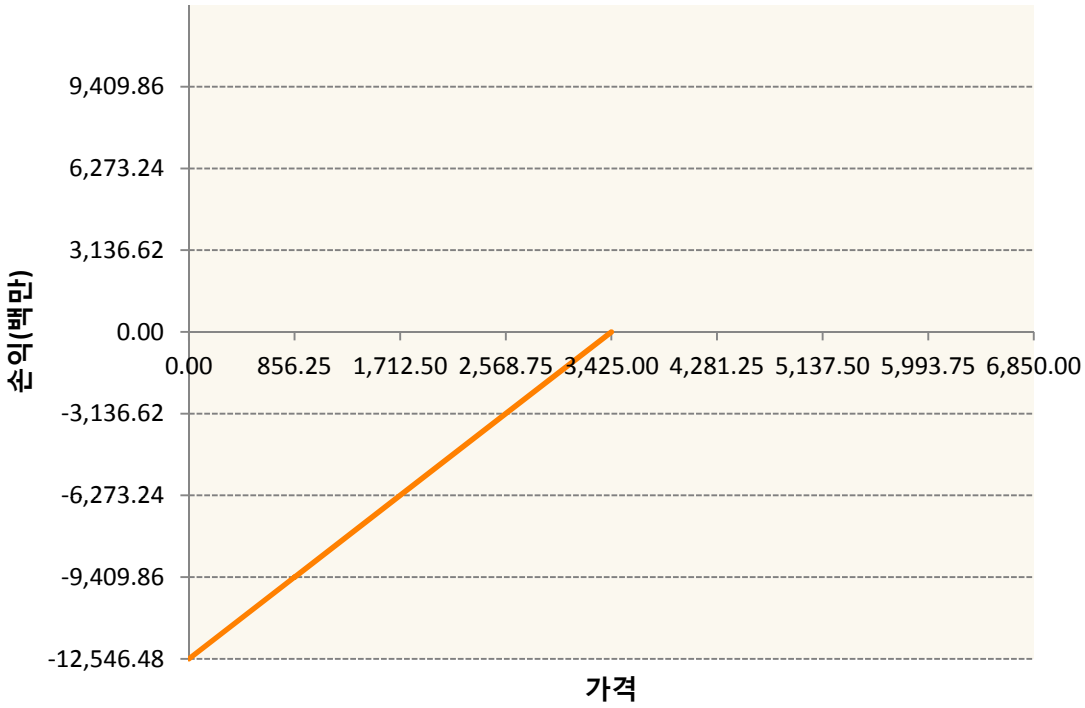
2. 만기시점의 손익구조



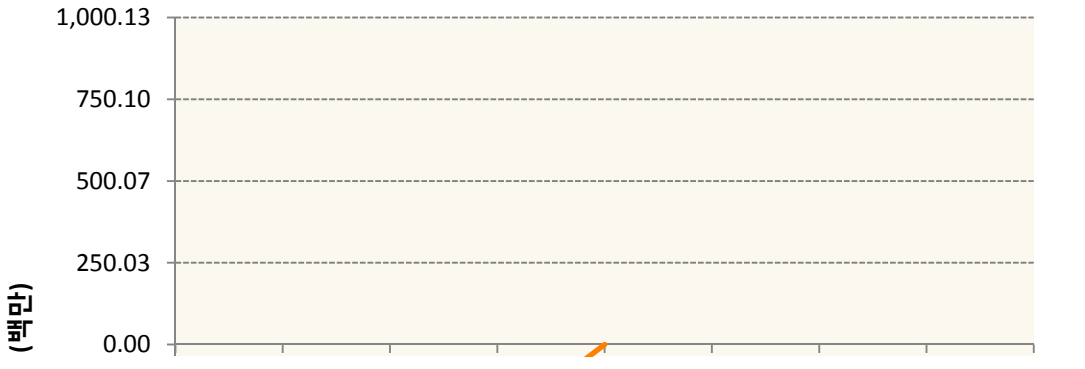


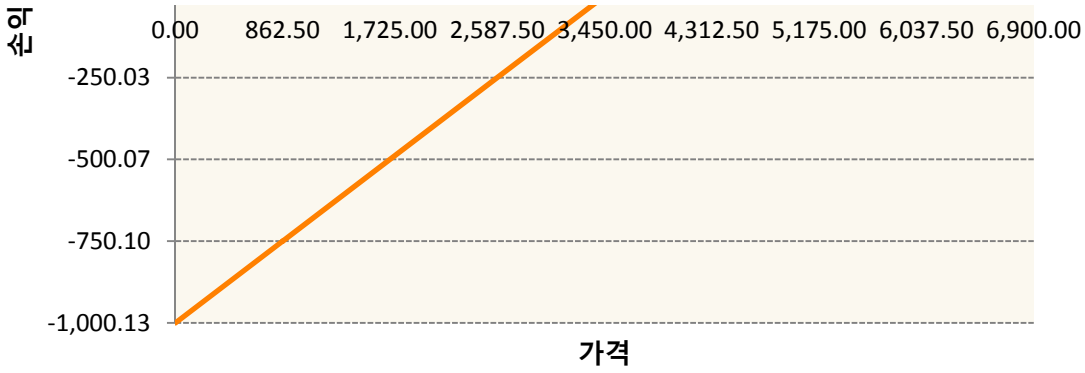


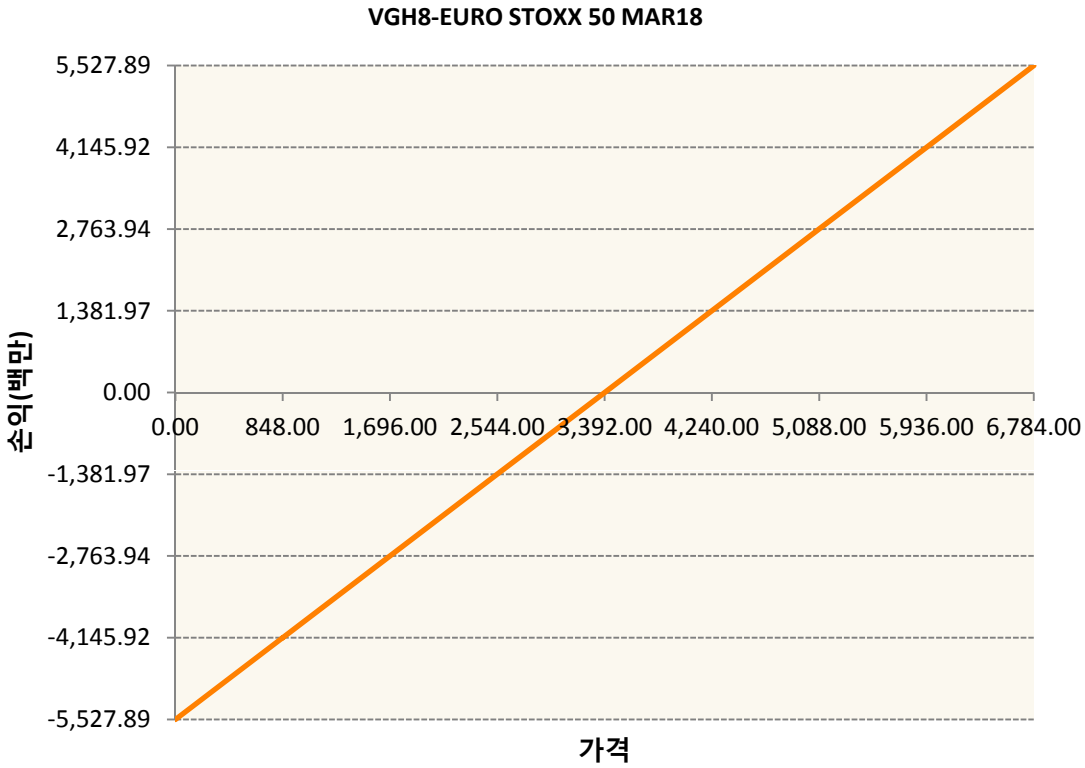
OESXH8-P3425-EURO STOXX 50



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	1,004
OESXH8-C34 EURO STOXX 50	80
OESXH8-P34 EURO STOXX 50	1,004
OESXH8-P34 EURO STOXX 50	80
VGH8 EURO STOXX 50 MAR18	442

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

1,877

공시일	2018-03-16
기준일	2018-03-15

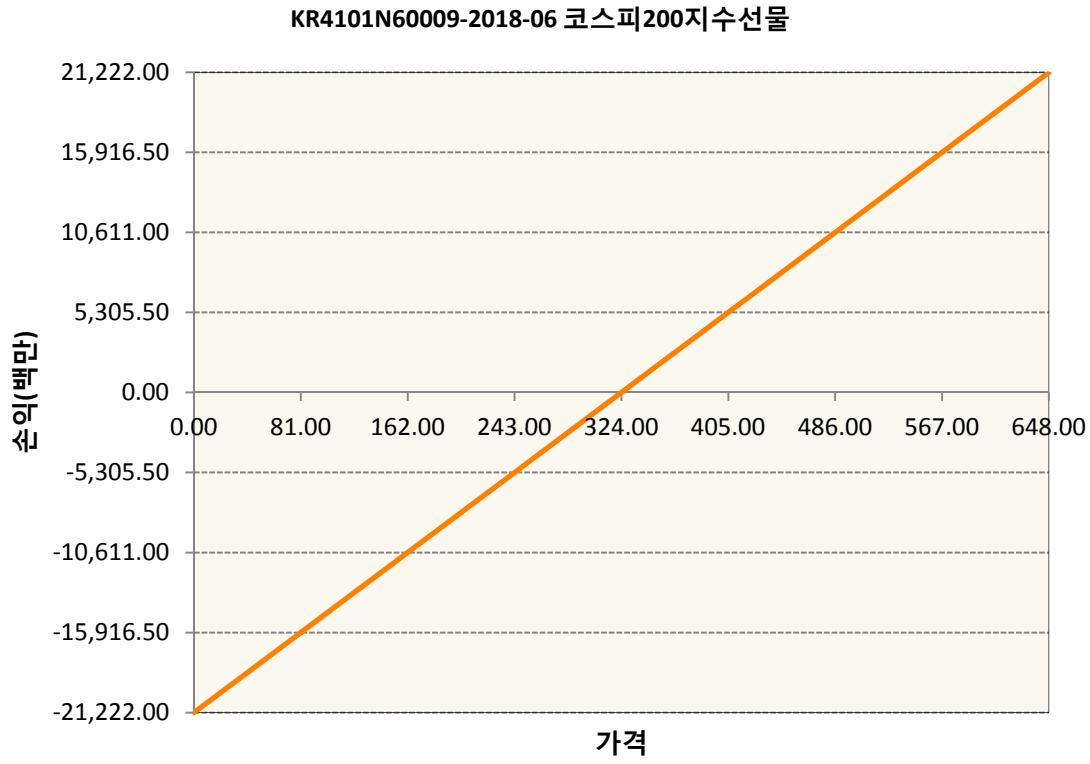
ETF스마트레버리지목표전환형8호

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	21,222	0	21,222	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101N60(2018-06 코스피200지수선물							1,691
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,691	-1,691	-1,691	-1,691	-1,691	-1,691	-1,691
-5.33%	-1,127	-1,127	-1,127	-1,127	-1,127	-1,127	-1,127
-2.67%	-564	-564	-564	-564	-564	-564	-564
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	564	564	564	564	564	564	564
5.33%	1,127	1,127	1,127	1,127	1,127	1,127	1,127
8.00%	1,691	1,691	1,691	1,691	1,691	1,691	1,691

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

1,169

공시일	2018-03-16
기준일	2018-03-15

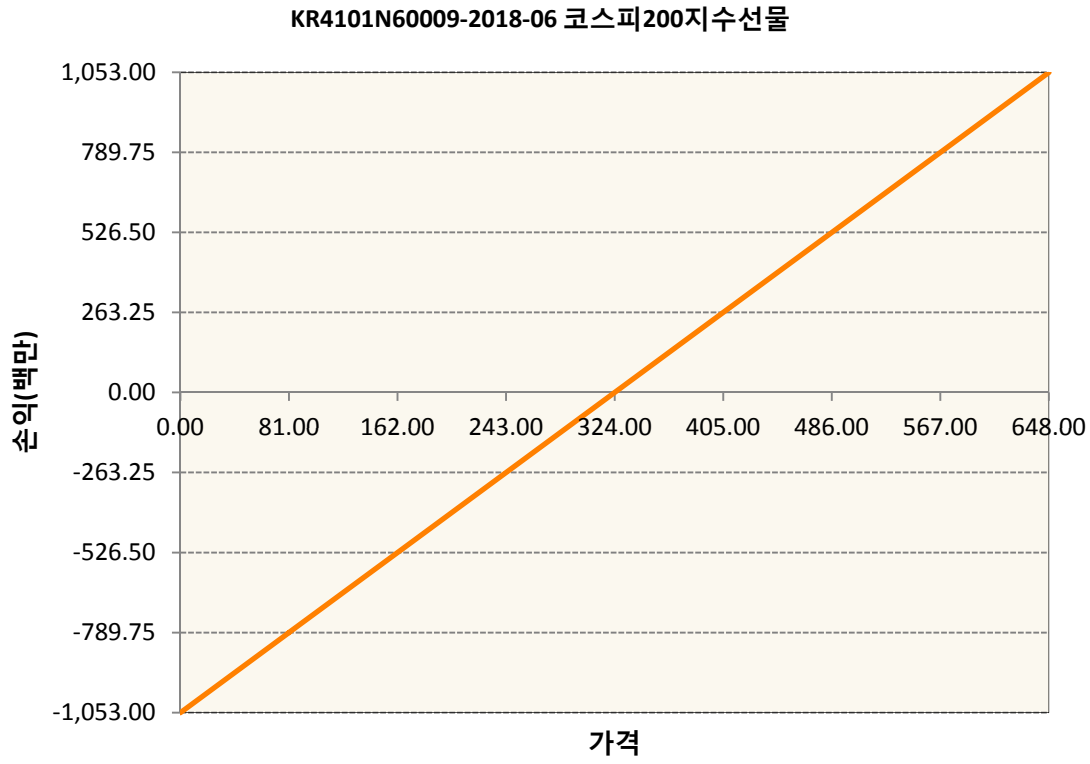
ETF스마트레버리지목표전환형9호

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	1,053	0	1,053	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	2018-03-16
기준일	2018-03-15

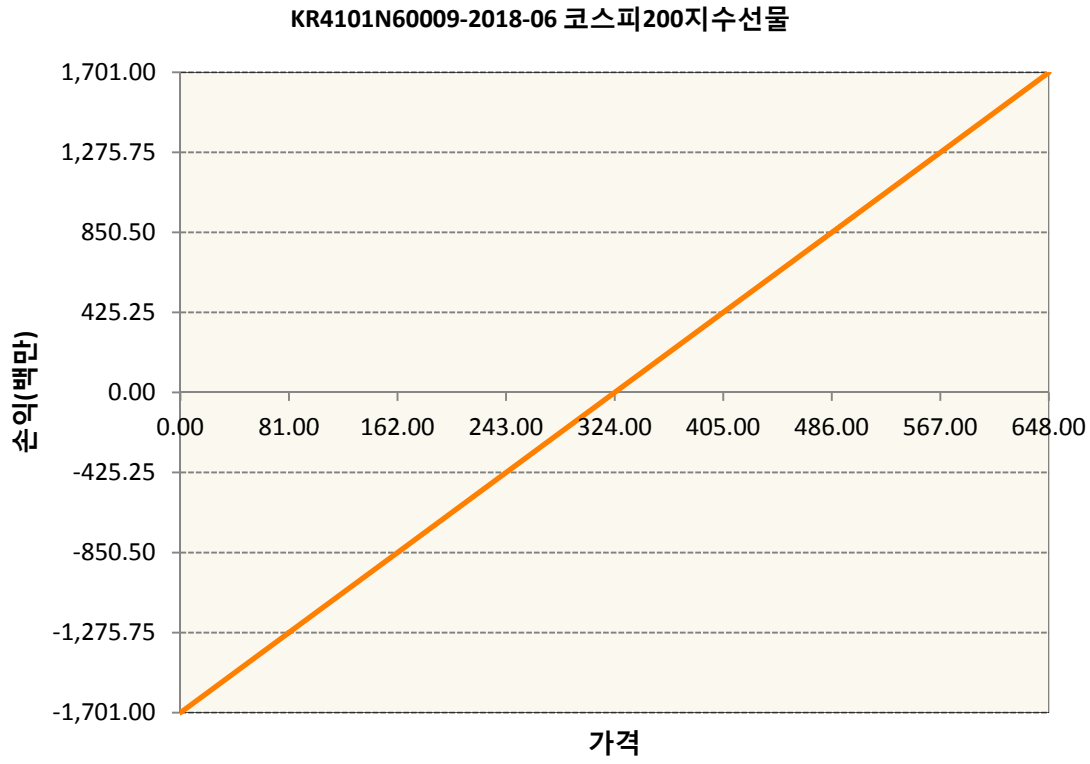
ETF스마트레버리지목표전환형10

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	1,701	0	1,701	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101N60(2018-06 코스피200지수선물							136
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-136	-136	-136	-136	-136	-136	-136
-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%	136	136	136	136	136	136	136

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

94

공시일	2018-03-16
기준일	2018-03-15

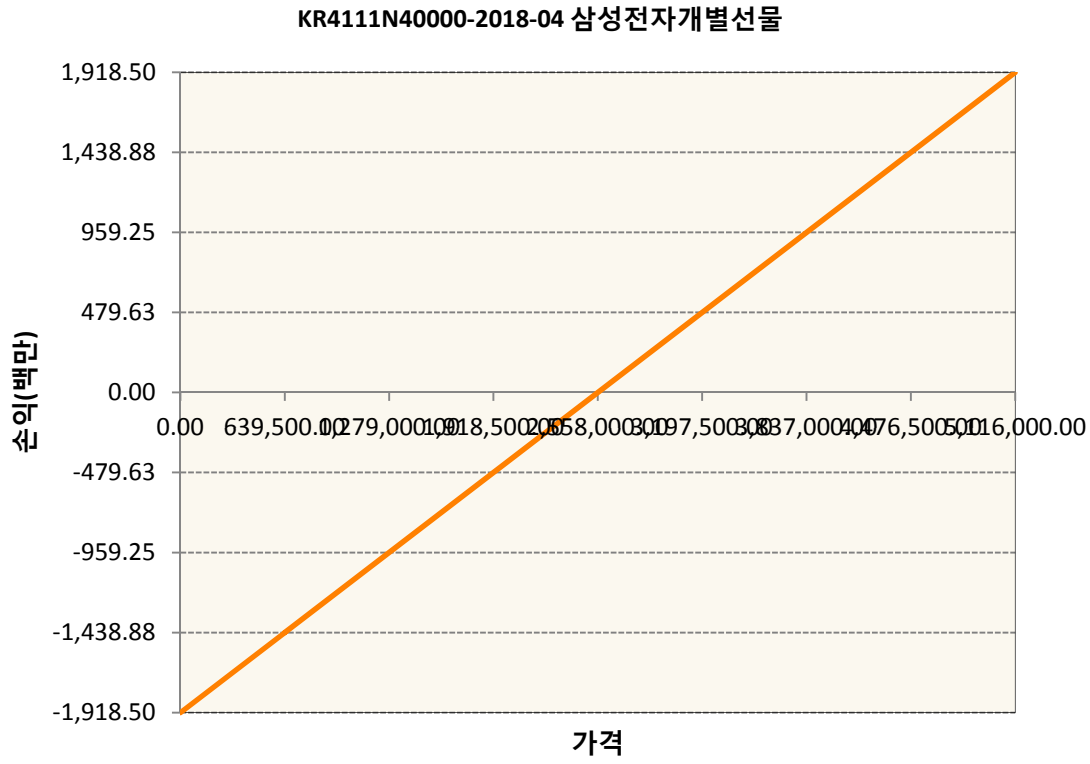
스마트KRX300인덱스1호(주식-파

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	1,919	0	1,919	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%	-103	-103	-103	-103	-103	-103	-103
-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%	103	103	103	103	103	103	103
8.00%	155	155	155	155	155	155	155

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

185

공시일	2018-03-16
기준일	2018-03-15

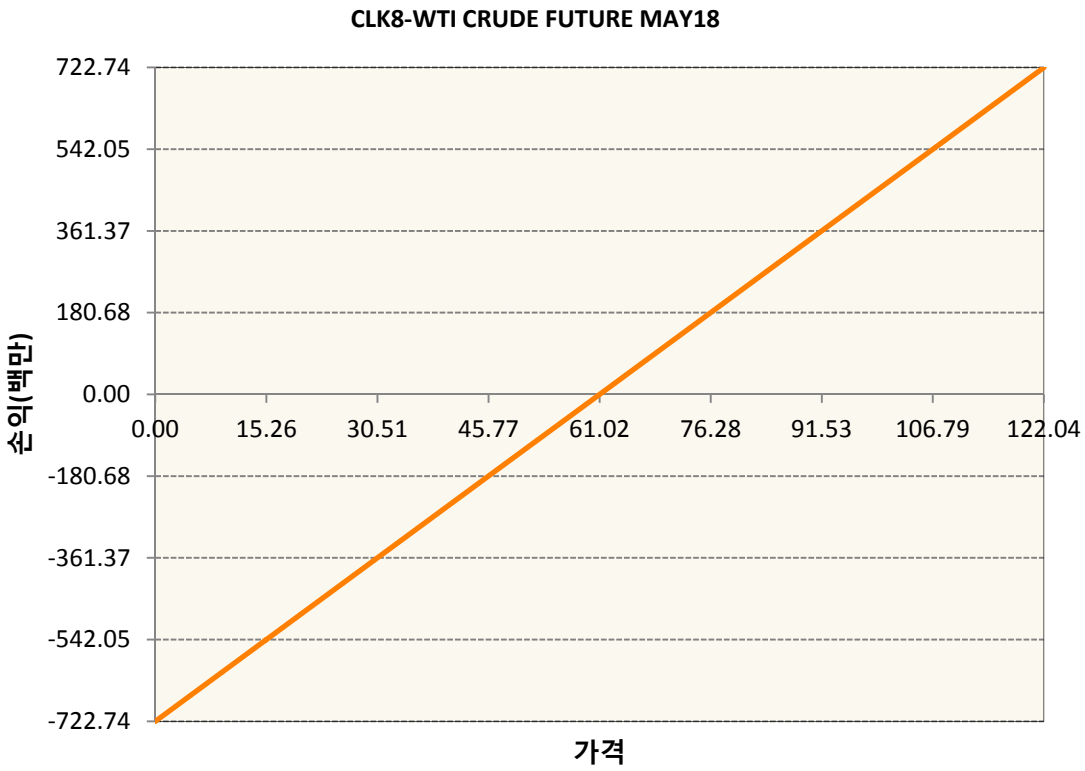
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

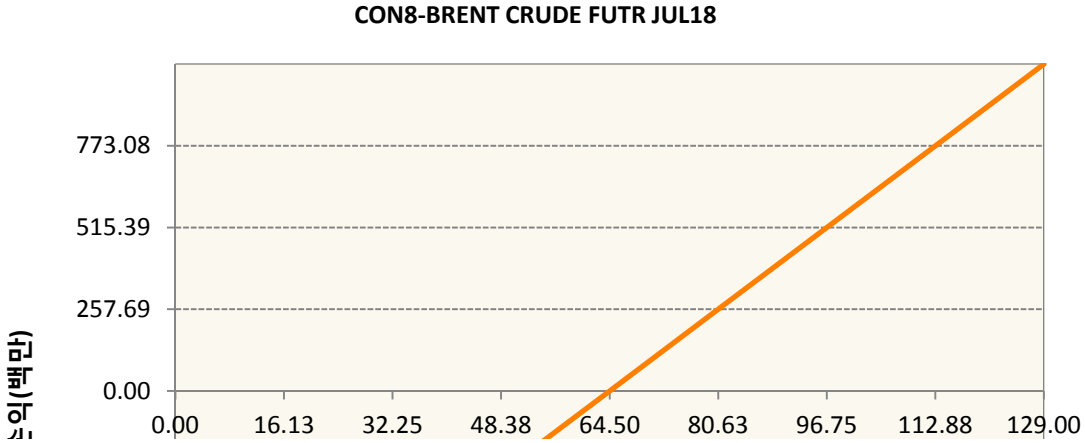
1. 계약금액

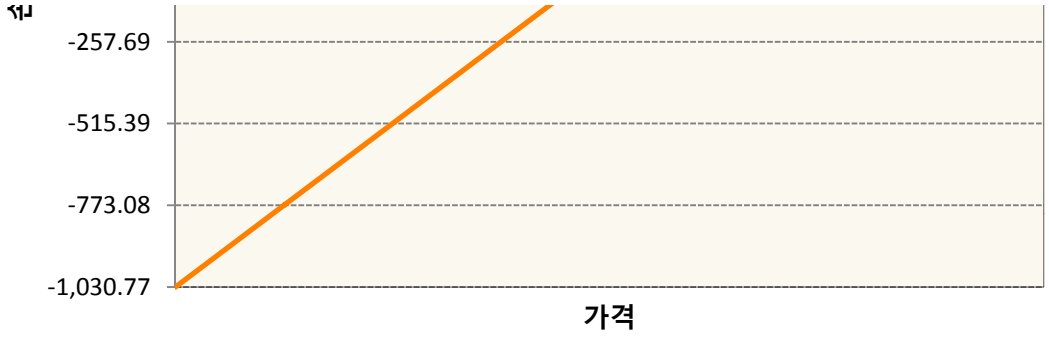
(단위:백만원)

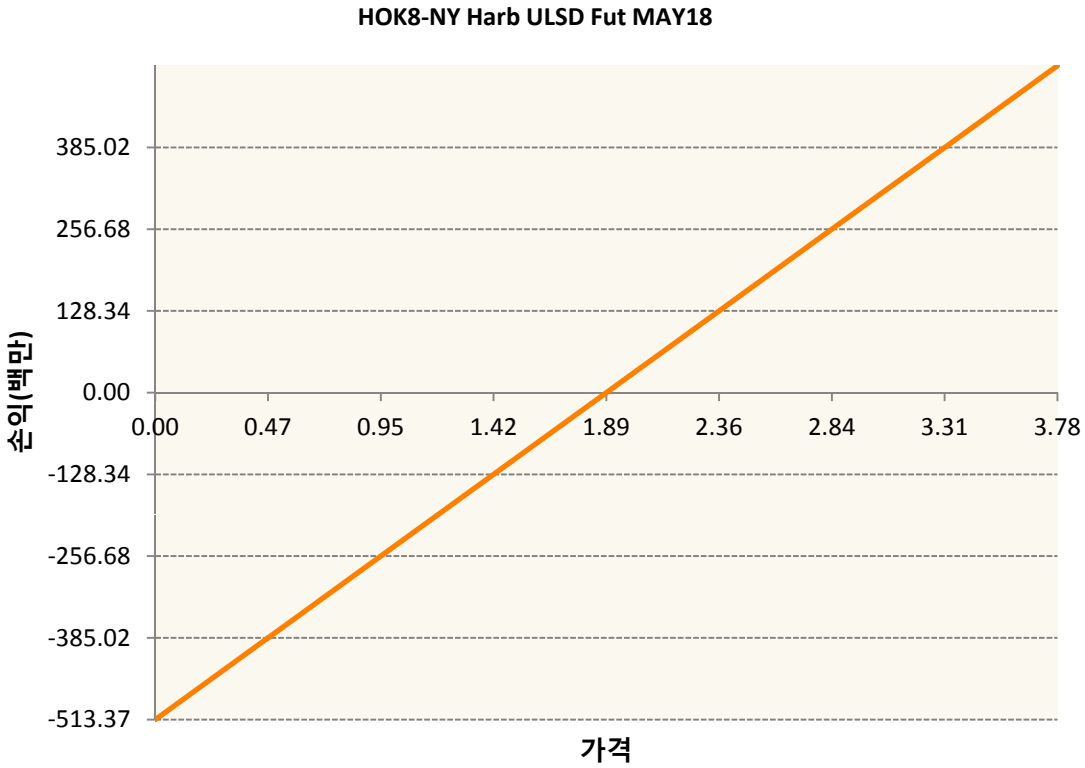
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	선물	유가증권	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	선물	유가증권	723	0	723	
누계	유가증권	선물	3,226	585	2,640	

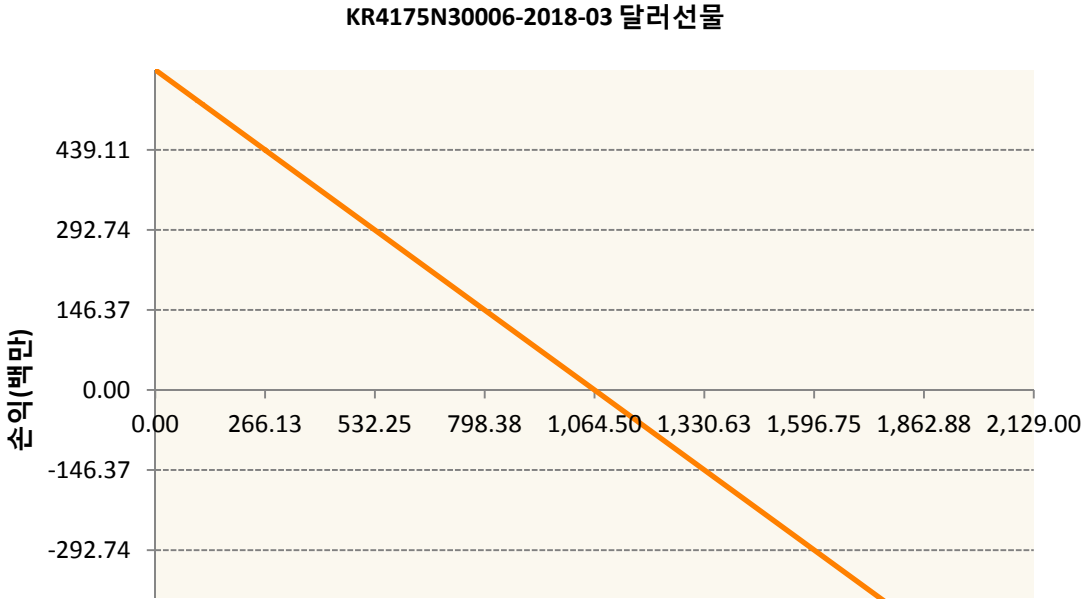
2. 만기시점의 손익구조

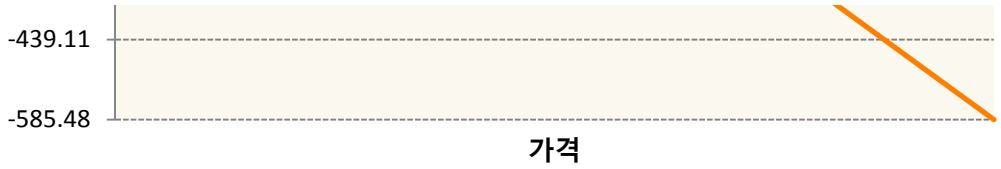


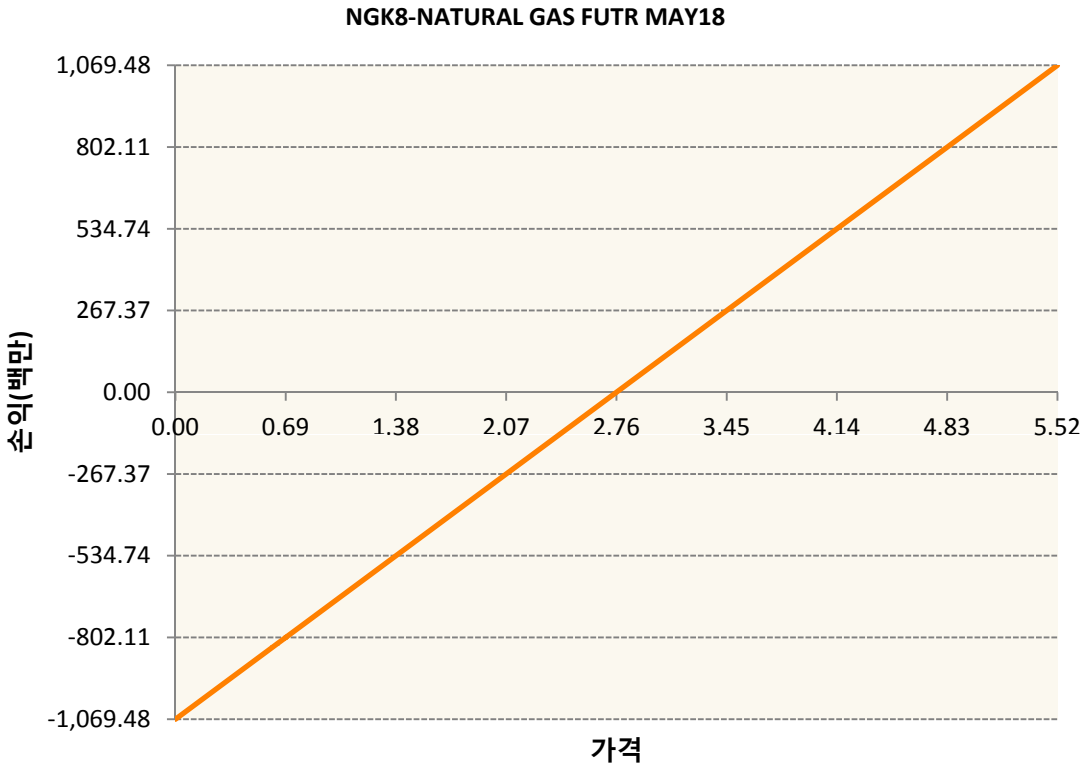


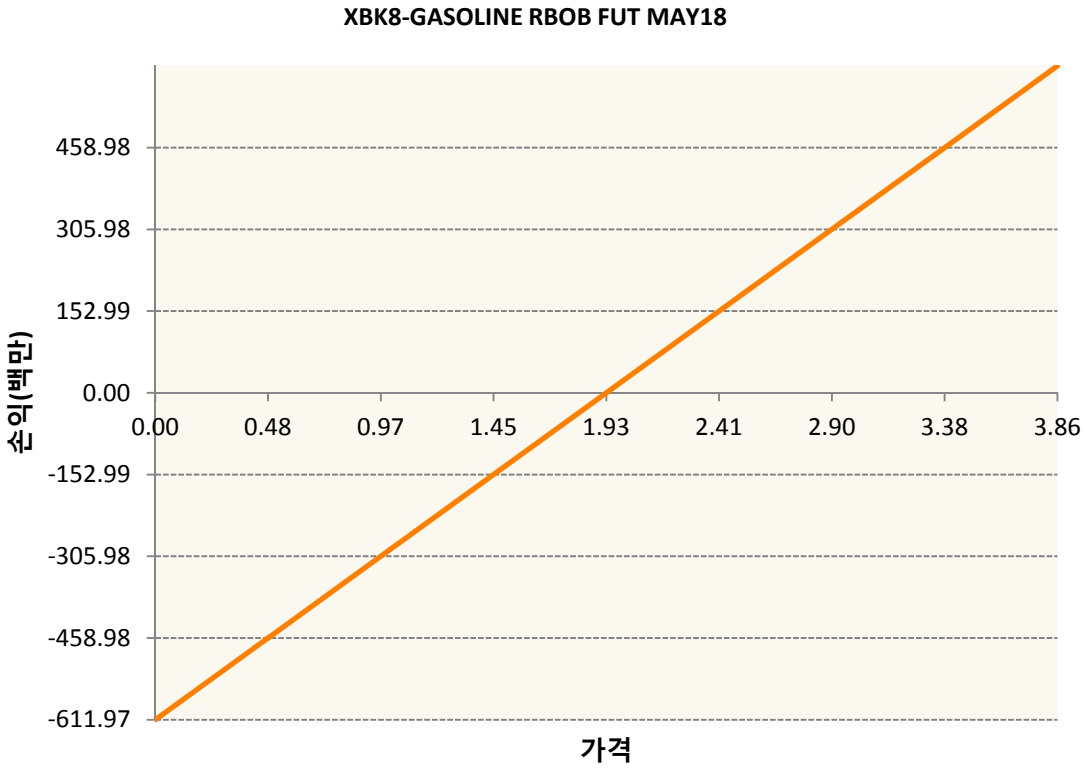

-257.69
-515.39
-773.08
-1,030.77
가격


HOK8-NY Harb ULSD Fut MAY18
385.02
256.68
128.34
0.00
-128.34
-256.68
-385.02
-513.37
0.00
0.47
0.95
1.42
1.89
2.36
2.84
3.31
3.78
손익(백만)
가격


KR4175N30006-2018-03 달러선물
439.11
292.74
146.37
0.00
-146.37
-292.74
0.00
266.13
532.25
798.38
1,064.50
1,330.63
1,596.75
1,862.88
2,129.00
손익(백만)


-439.11
-585.48
가격


NGK8-NATURAL GAS FUTR MAY18
1,069.48
802.11
534.74
267.37
0.00
-267.37
-534.74
-802.11
-1,069.48
0.00
0.69
1.38
2.07
2.76
3.45
4.14
4.83
5.52
손익(백만)
가격


XBK8-GASOLINE RBOB FUT MAY18
458.98
305.98
152.99
0.00
-152.99
-305.98
-458.98
-611.97
0.00
0.48
0.97
1.45
1.93
2.41
2.90
3.38
3.86
손익(백만)
가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLK8	WTI CRUDE FUTURE MAY18	58
CON8	BRENT CRUDE FUTR JUL18	82
HOK8	NY Harb ULSD Fut MAY18	41
KR4175N30(	2018-03 달러선물	47
NGK8	NATURAL GAS FUTR MAY18	86
XBK8	GASOLINE RBOB FUT MAY18	49

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

518

공시일	2018-03-16
기준일	2018-03-15

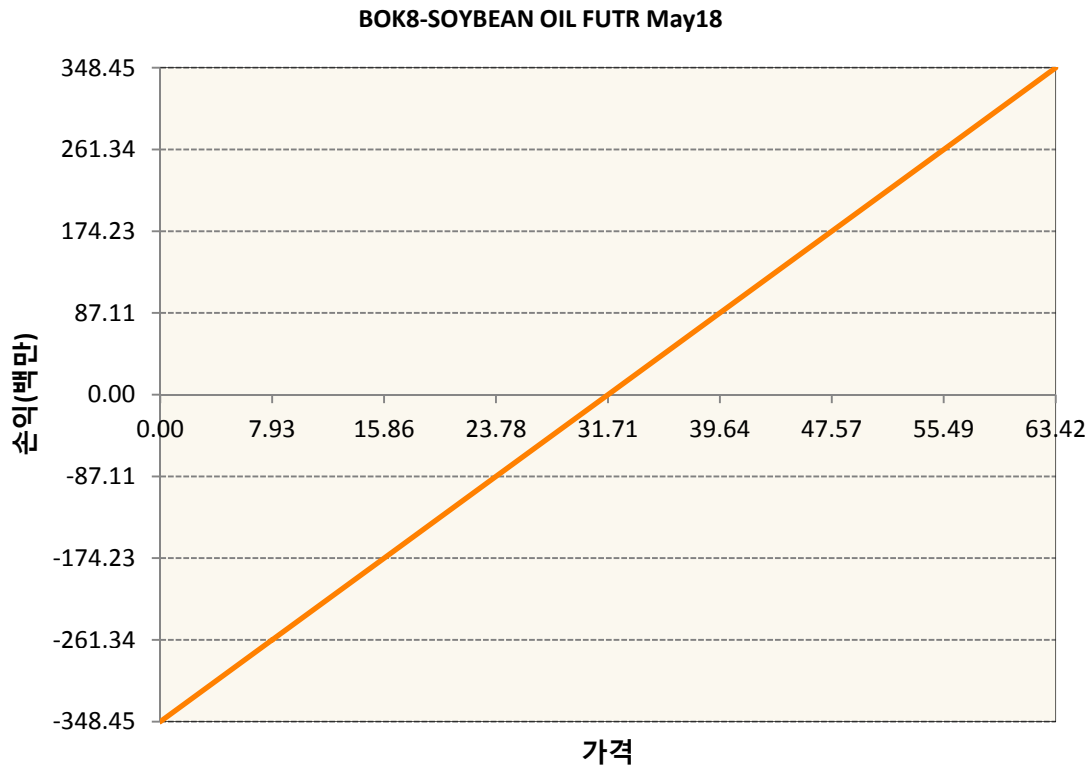
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

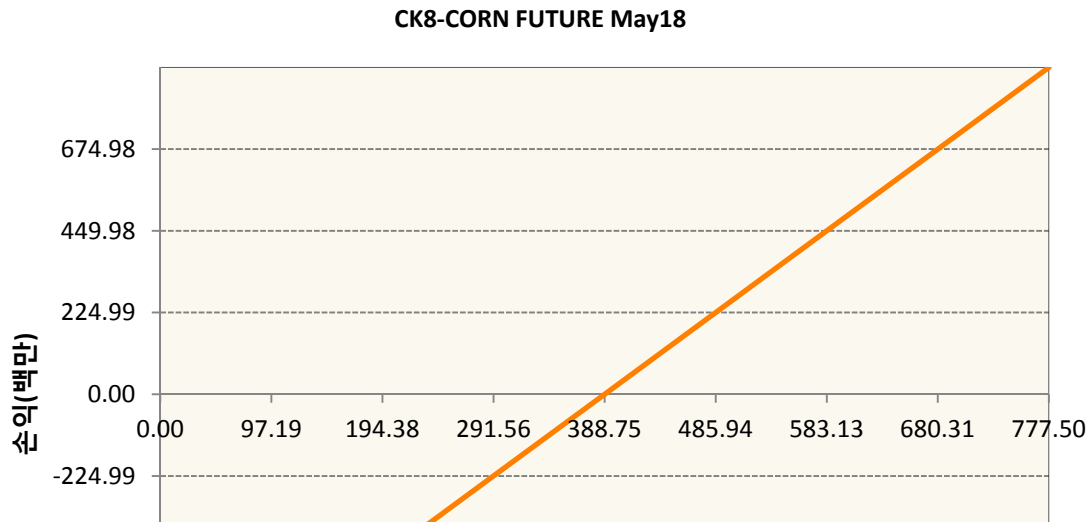
1. 계약금액

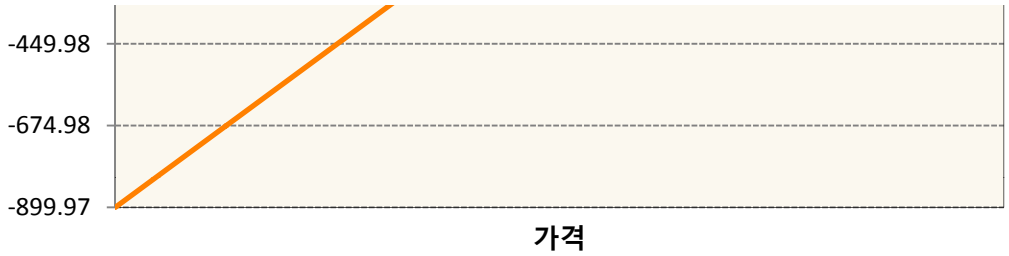
(단위:백만원)

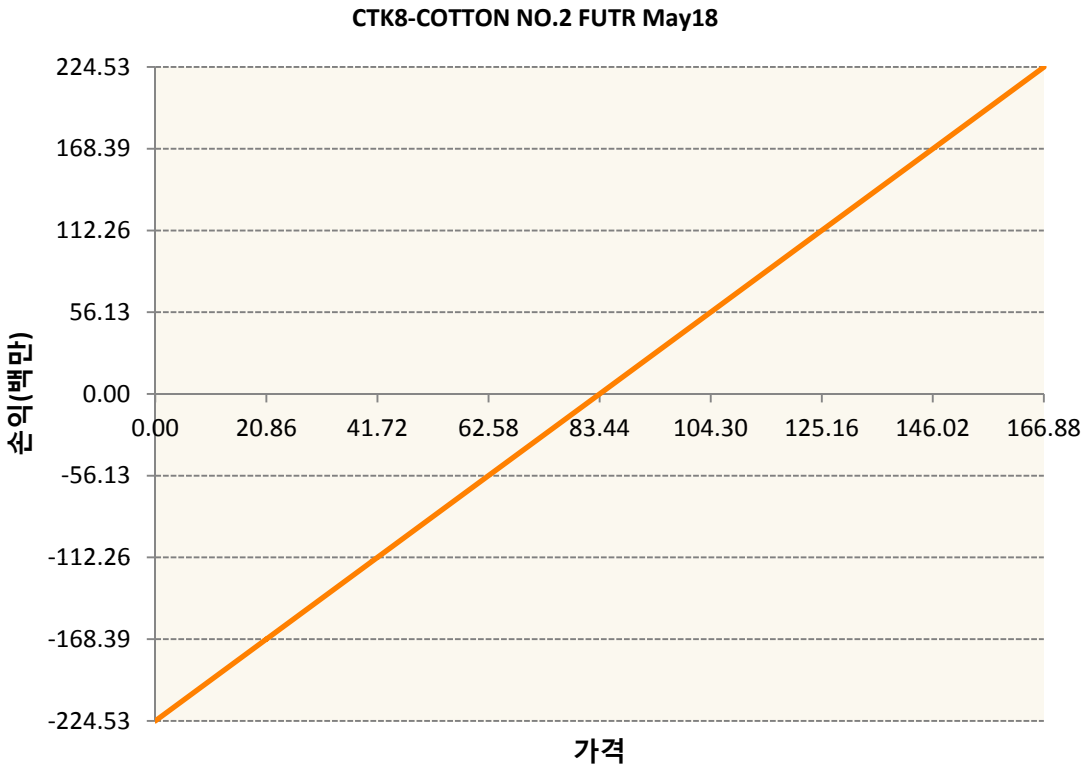
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	4,170	319	3,850	

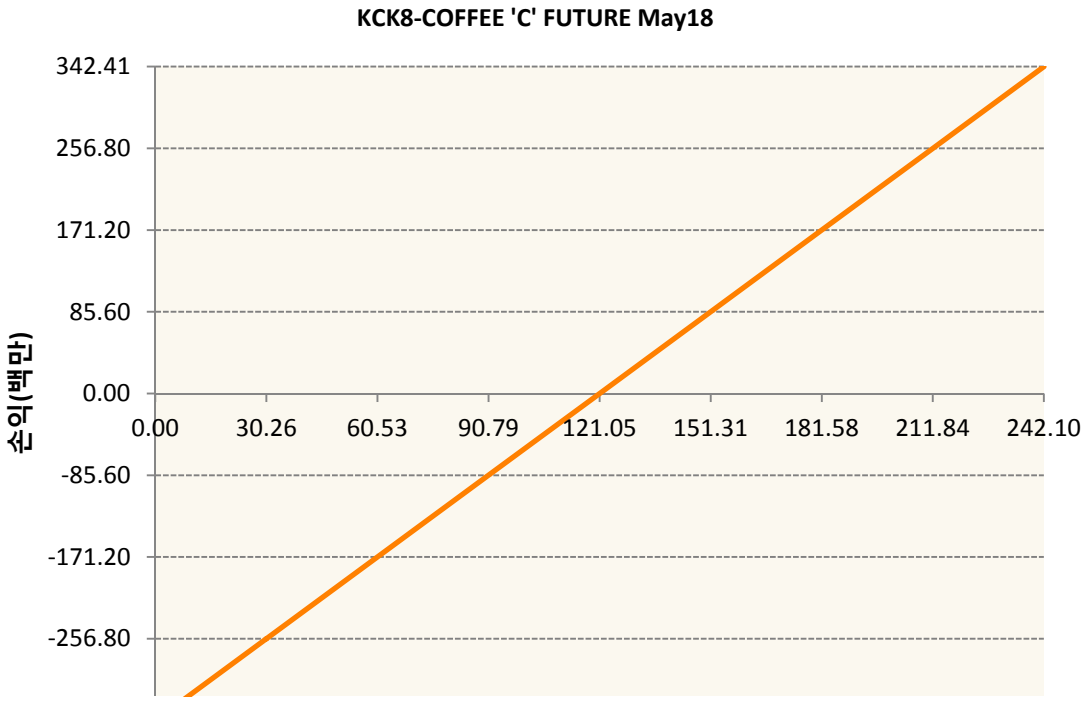
2. 만기시점의 손익구조

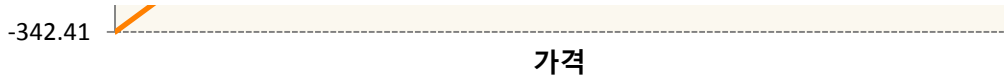


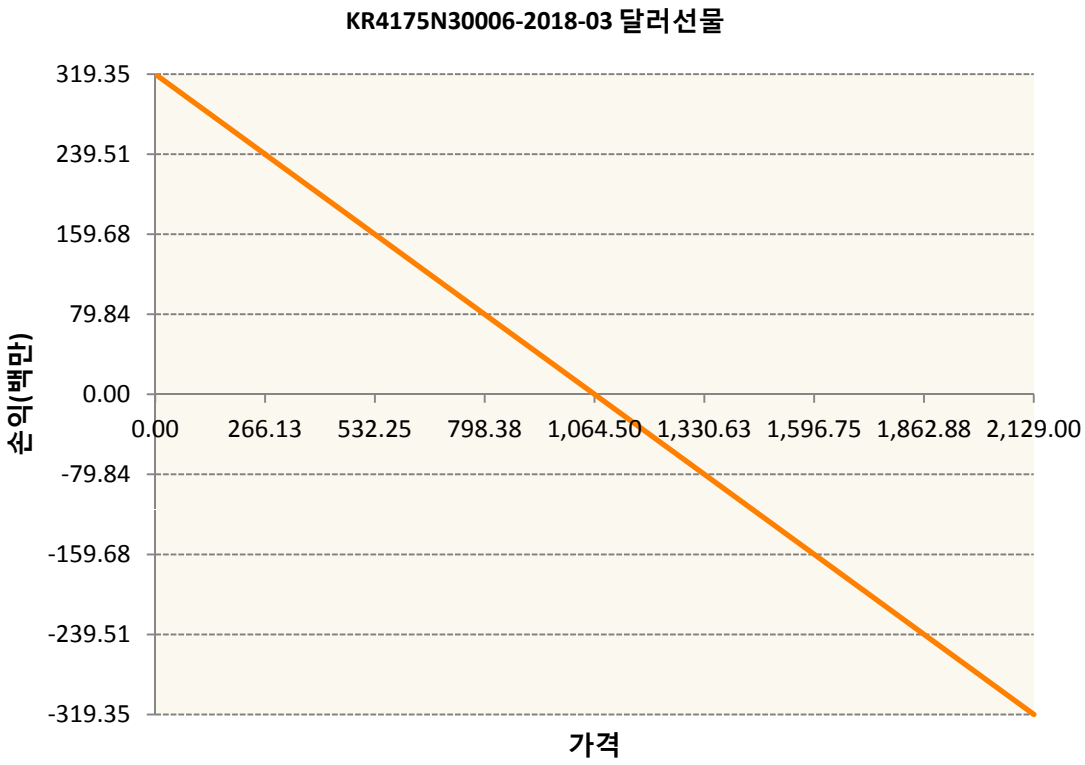


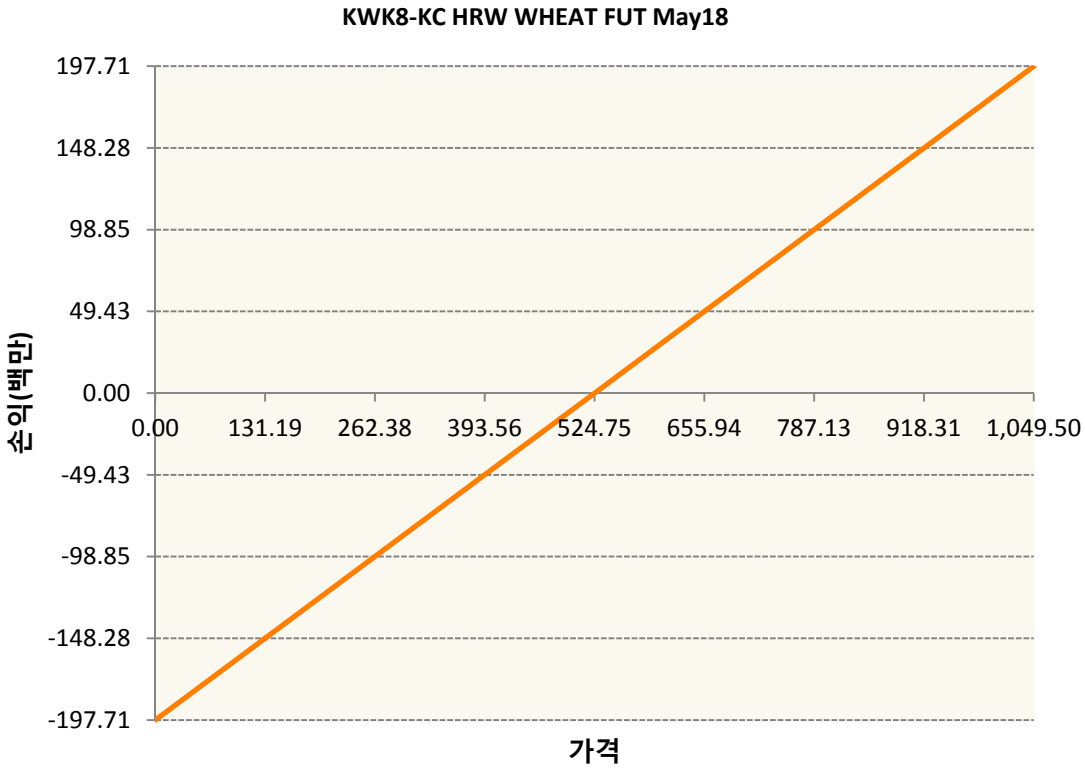

-449.98
-674.98
-899.97
가격

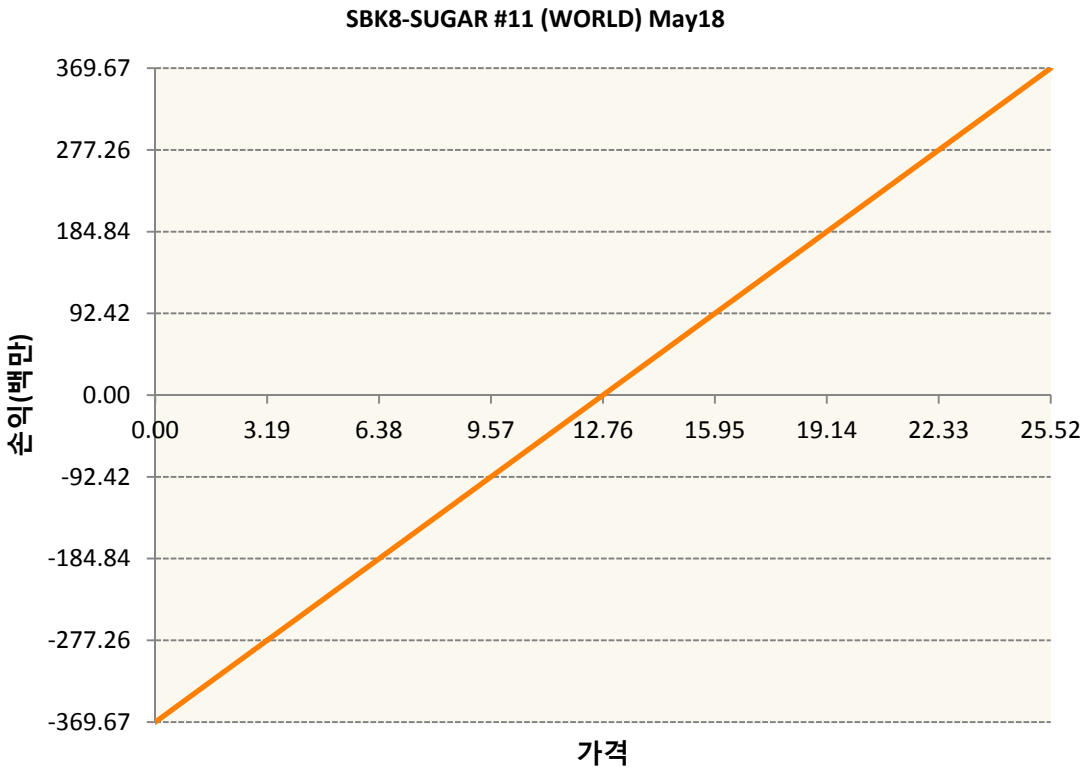

CTK8-COTTON NO.2 FUTR May18
224.53
168.39
112.26
56.13
0.00
-56.13
-112.26
-168.39
-224.53
0.00
20.86
41.72
62.58
83.44
104.30
125.16
146.02
166.88
손익(백만)
가격

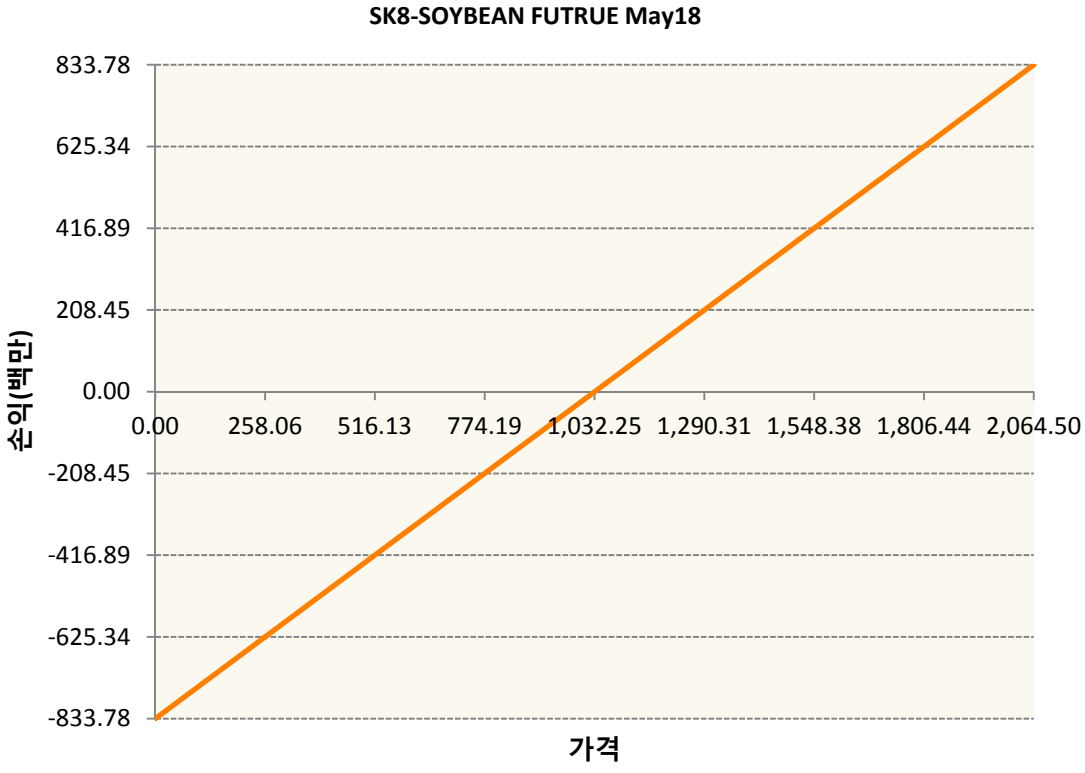

KCK8-COFFEE 'C' FUTURE May18
342.41
256.80
171.20
85.60
0.00
-85.60
-171.20
-256.80
0.00
30.26
60.53
90.79
121.05
151.31
181.58
211.84
242.10
손익(백만)


-342.41
가격

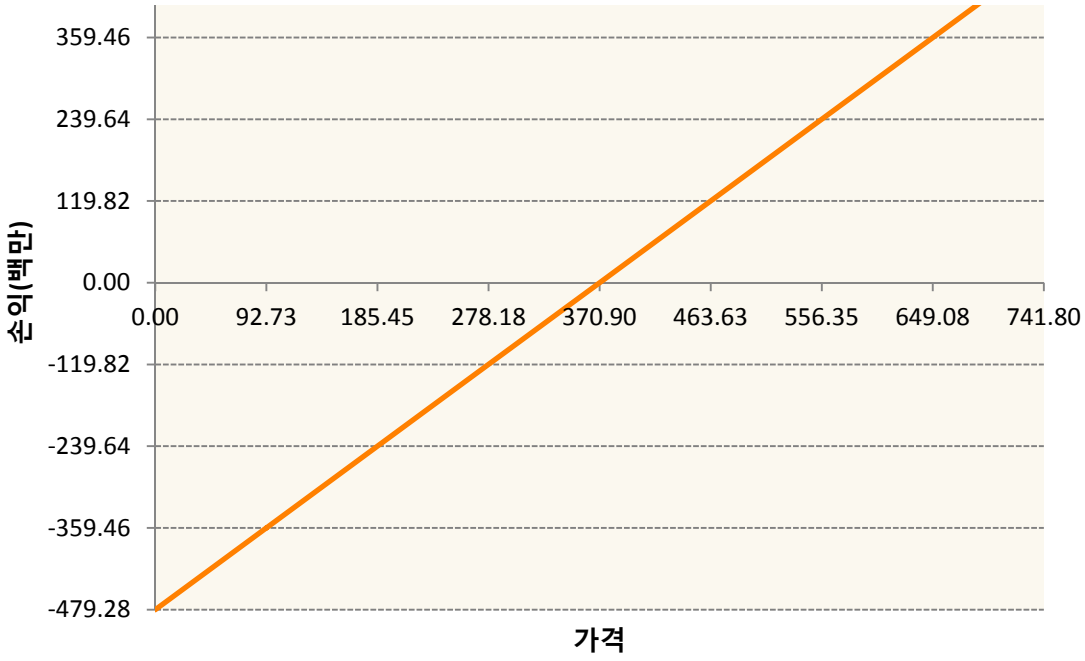

KR4175N30006-2018-03 달러선물
319.35
239.51
159.68
79.84
0.00
-79.84
-159.68
-239.51
-319.35
0.00
266.13
532.25
798.38
1,064.50
1,330.63
1,596.75
1,862.88
2,129.00
손익(백만)
가격

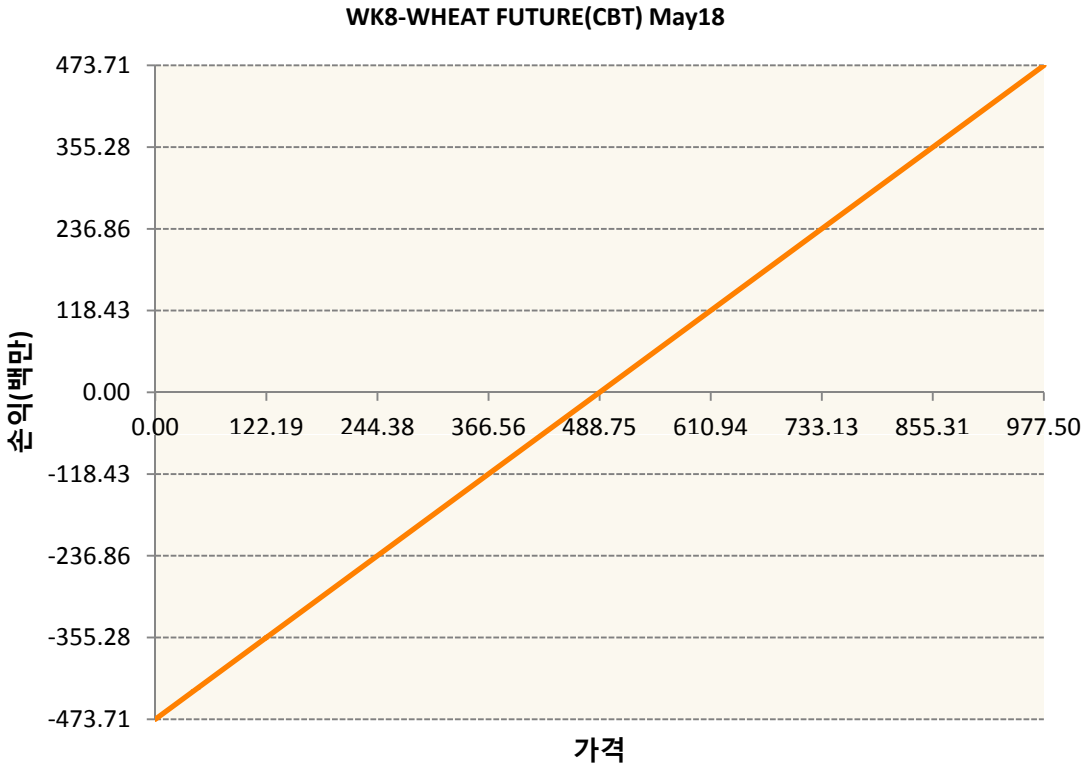

KWK8-KC HRW WHEAT FUT May18
197.71
148.28
98.85
49.43
0.00
-49.43
-98.85
-148.28
-197.71
0.00
131.19
262.38
393.56
524.75
655.94
787.13
918.31
1,049.50
손익(백만)
가격


SBK8-SUGAR #11 (WORLD) May18
369.67
277.26
184.84
92.42
0.00
-92.42
-184.84
-277.26
-369.67
0.00
3.19
6.38
9.57
12.76
15.95
19.14
22.33
25.52
손익(백만)
가격


SK8-SOYBEAN FUTRUE May18
833.78
625.34
416.89
208.45
0.00
-208.45
-416.89
-625.34
-833.78
0.00
258.06
516.13
774.19
1,032.25
1,290.31
1,548.38
1,806.44
2,064.50
손익(백만)
가격


SMK8-SOYBEAN MEAL FUTR May18
479.28





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

BOK8	SOYBEAN OIL FUTR May18	28
CK8	CORN FUTURE May18	72
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	67
SMK8	SOYBEAN MEAL FUTR May18	38
WK8	WHEAT FUTURE(CBT) May18	38

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

336