공시일	2018-03-20
기준일	2018-03-19

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	2018-03-20
기준일	2018-03-19

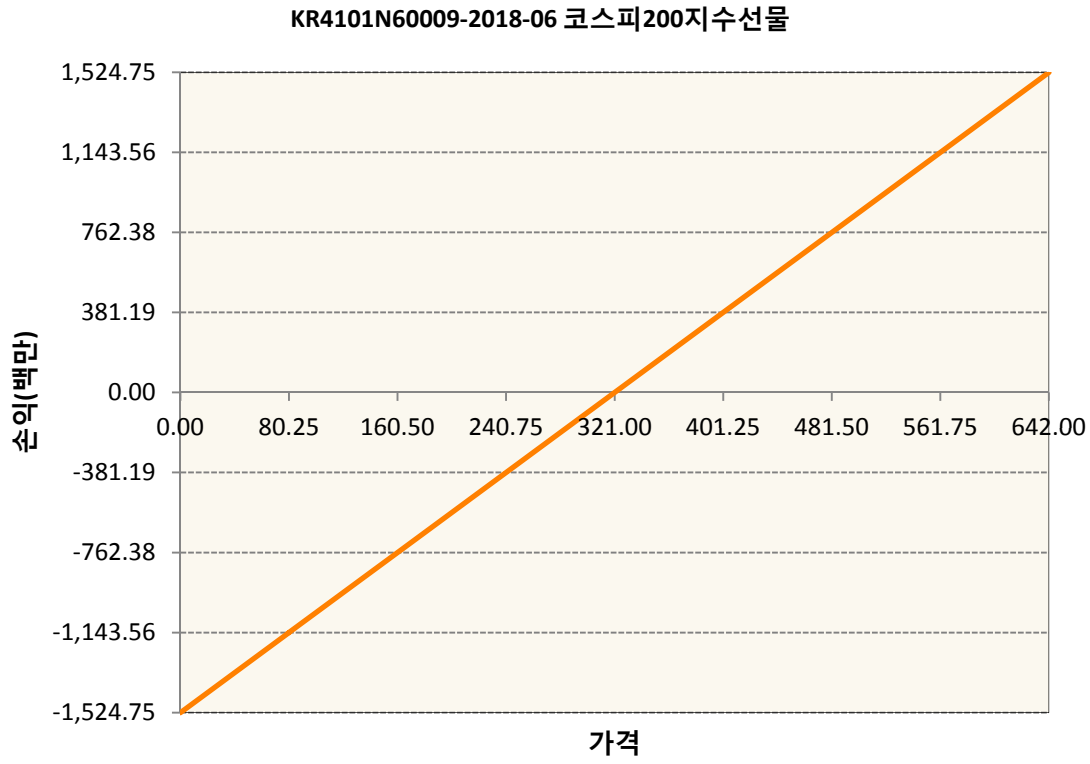
스마트인덱스모

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	1,525	0	1,525	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%	-81	-81	-81	-81	-81	-81	-81
-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%	81	81	81	81	81	81	81
8.00%	122	122	122	122	122	122	122

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

84

공시일	2018-03-20
기준일	2018-03-19

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)

421

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2018-03-20
기준일	2018-03-19

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	411

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

413

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2018-03-20
기준일	2018-03-19

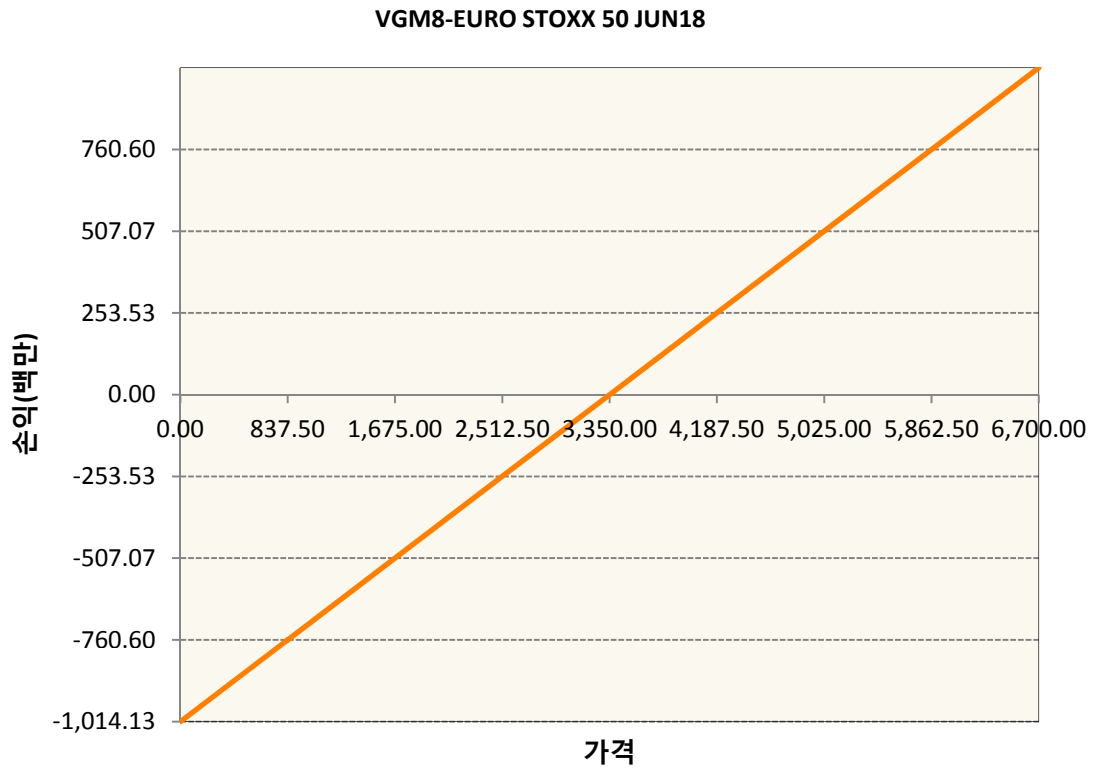
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,014	0	1,014	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGM8	EURO STOXX 50 JUN18	81

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

(단위:백만원)

47

공시일	2018-03-20
기준일	2018-03-19

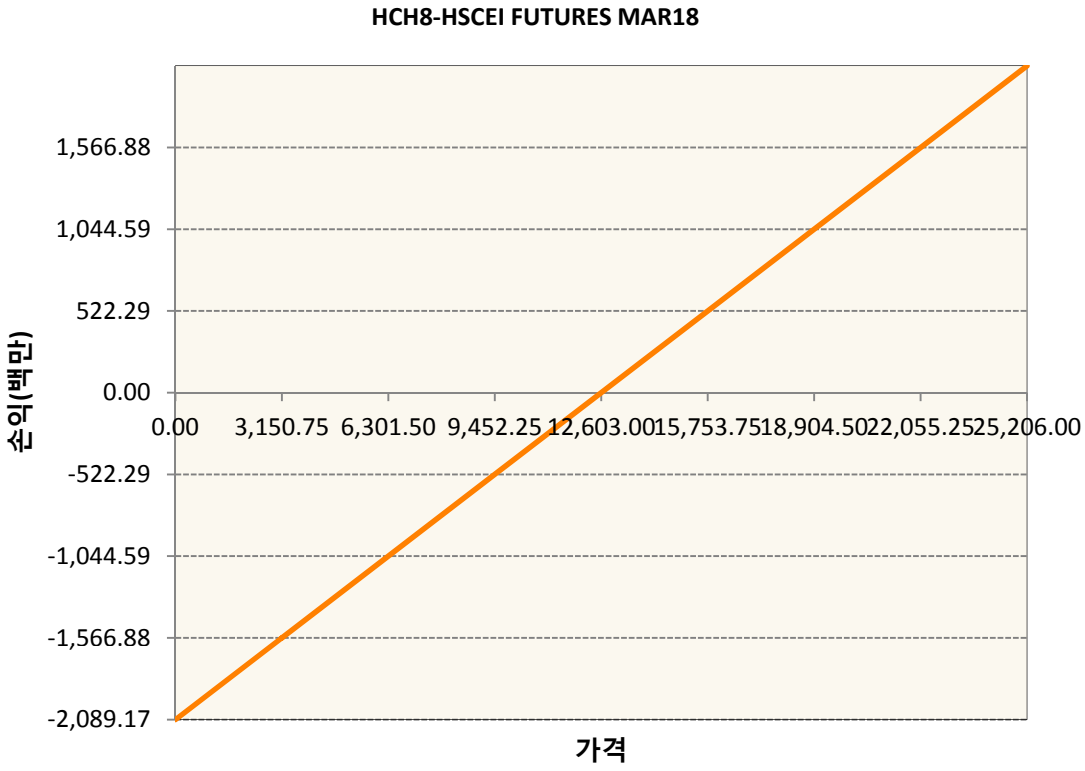
차이나인덱스모(주식-파생형)

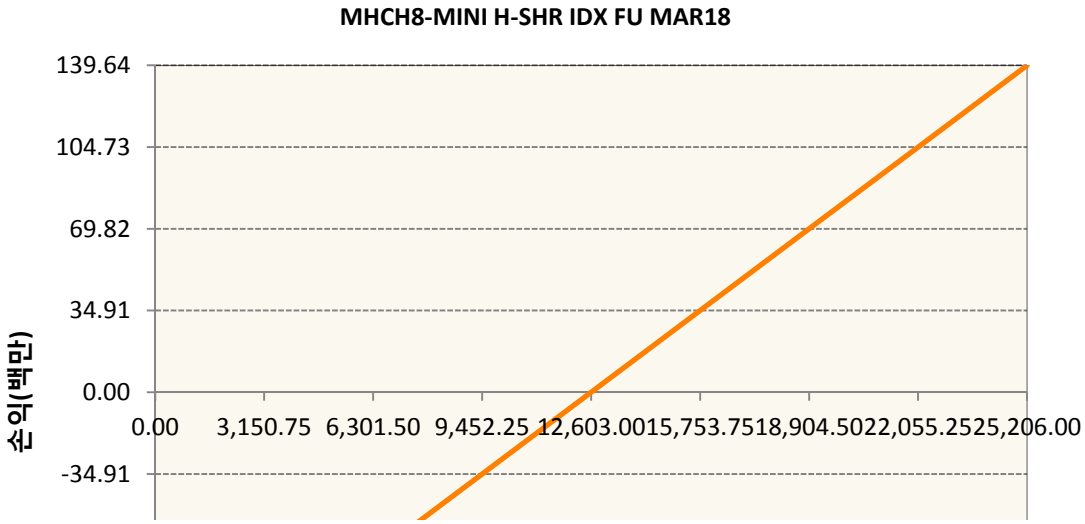
1. 계약금액

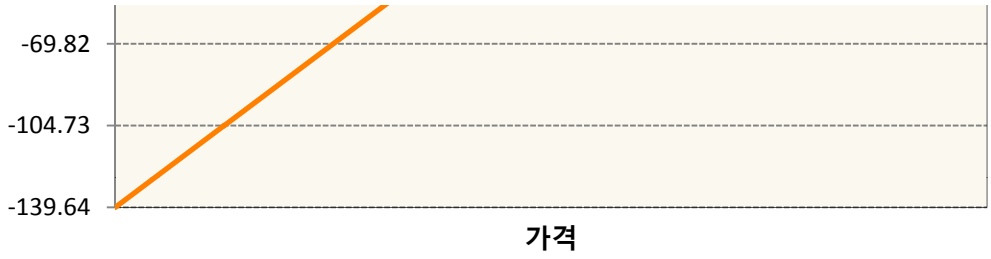
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,229	0	2,229	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCH8	HSCEI FUTURES MAR18	167
MHCH8	MINI H-SHR IDX FU MAR18	11

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	155

공시일	2018-03-20
기준일	2018-03-19

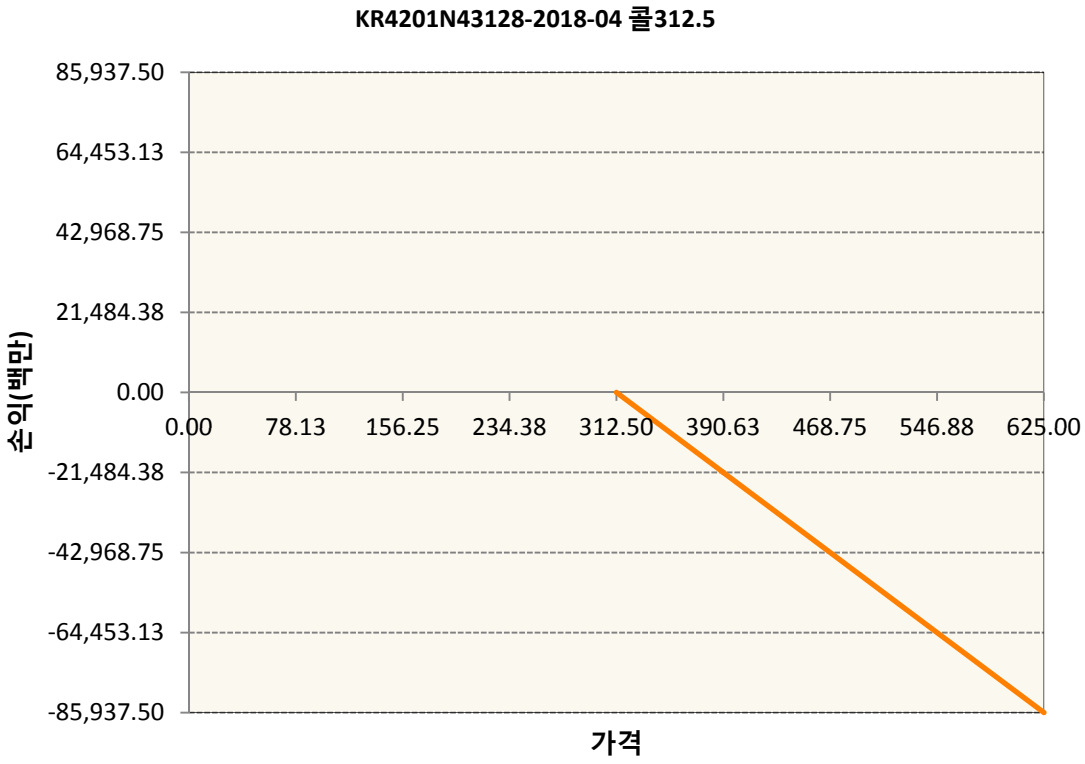
커버드콜모(주식혼합-파생형)

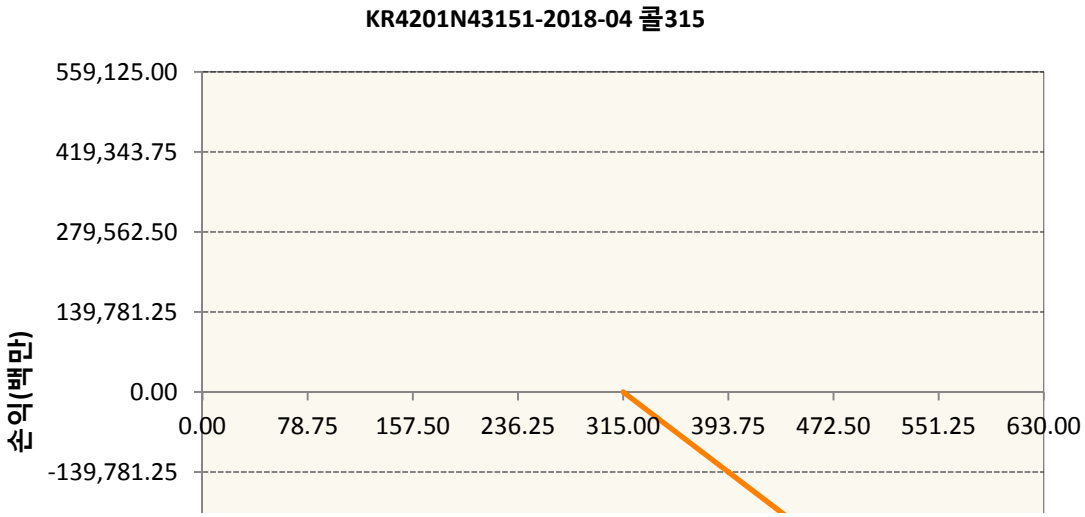
1. 계약금액

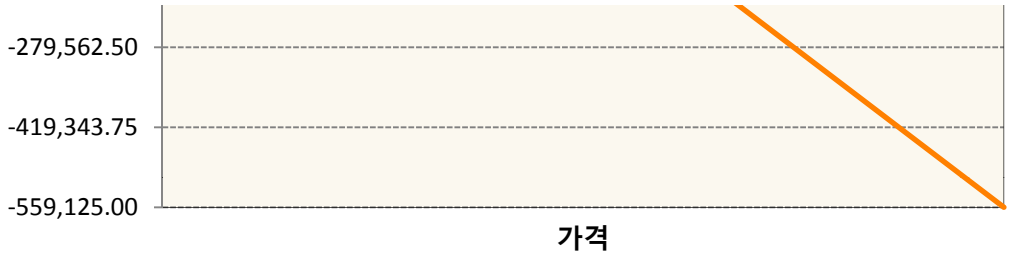
(단위:백만원)

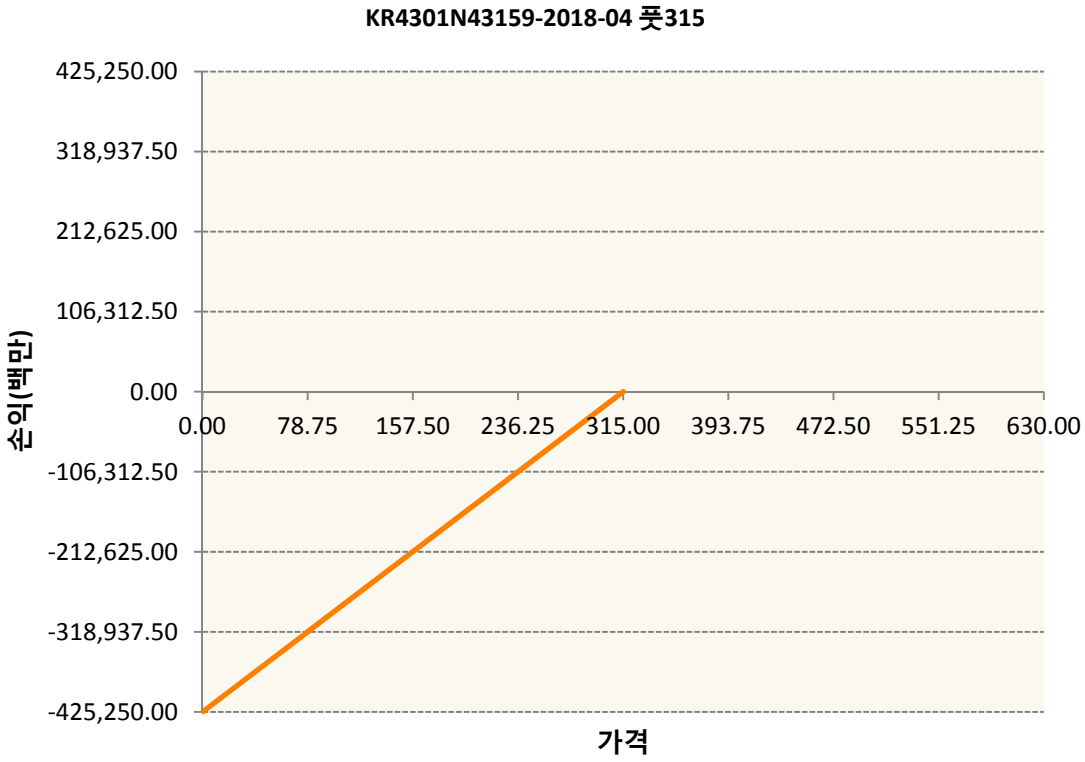
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	7,805	0	7,805	장내
누계	유가증권	옵션	0	1,070,313	-1,070,313	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201N4312018-04 콜312.5							6,022
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	3,369	3,258	3,136	3,003	2,863	2,716	2,564
-5.33%	2,875	2,705	2,531	2,353	2,173	1,990	1,805
-2.67%	1,955	1,756	1,557	1,358	1,159	960	761
0%	556	374	188	0	-190	-382	-575
2.67%	-1,256	-1,389	-1,533	-1,685	-1,845	-2,010	-2,180
5.33%	-3,349	-3,428	-3,522	-3,629	-3,748	-3,876	-4,013
8.00%	-5,595	-5,633	-5,686	-5,752	-5,830	-5,921	-6,022
KR4201N4312018-04 콜315							37,741
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	19,564	18,954	18,258	17,491	16,664	15,786	14,865

-5.33%	16,991	15,984	14,933	13,848	12,736	11,603	10,452
-2.67%	11,905	10,636	9,362	8,086	6,808	5,528	4,247
0%	3,773	2,525	1,267	0	-1,273	-2,550	-3,832
2.67%	-7,200	-8,175	-9,206	-10,281	-11,391	-12,530	-13,691
5.33%	-20,248	-20,865	-21,576	-22,366	-23,223	-24,136	-25,098
8.00%	-34,506	-34,827	-35,245	-35,753	-36,344	-37,009	-37,741
KR4301N4312018-04 풋315							24,213

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-23,226	-23,306	-23,420	-23,569	-23,752	-23,968	-24,213
-5.33%	-12,367	-12,674	-13,018	-13,395	-13,797	-14,222	-14,664
-2.67%	-3,576	-4,142	-4,712	-5,286	-5,863	-6,442	-7,022
0%	1,615	1,088	549	0	-557	-1,119	-1,686
2.67%	3,602	3,341	3,036	2,694	2,321	1,921	1,497
5.33%	4,068	3,995	3,888	3,744	3,565	3,351	3,105
8.00%	4,133	4,121	4,097	4,055	3,992	3,904	3,791

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

67,103

공시일	2018-03-20
기준일	2018-03-19

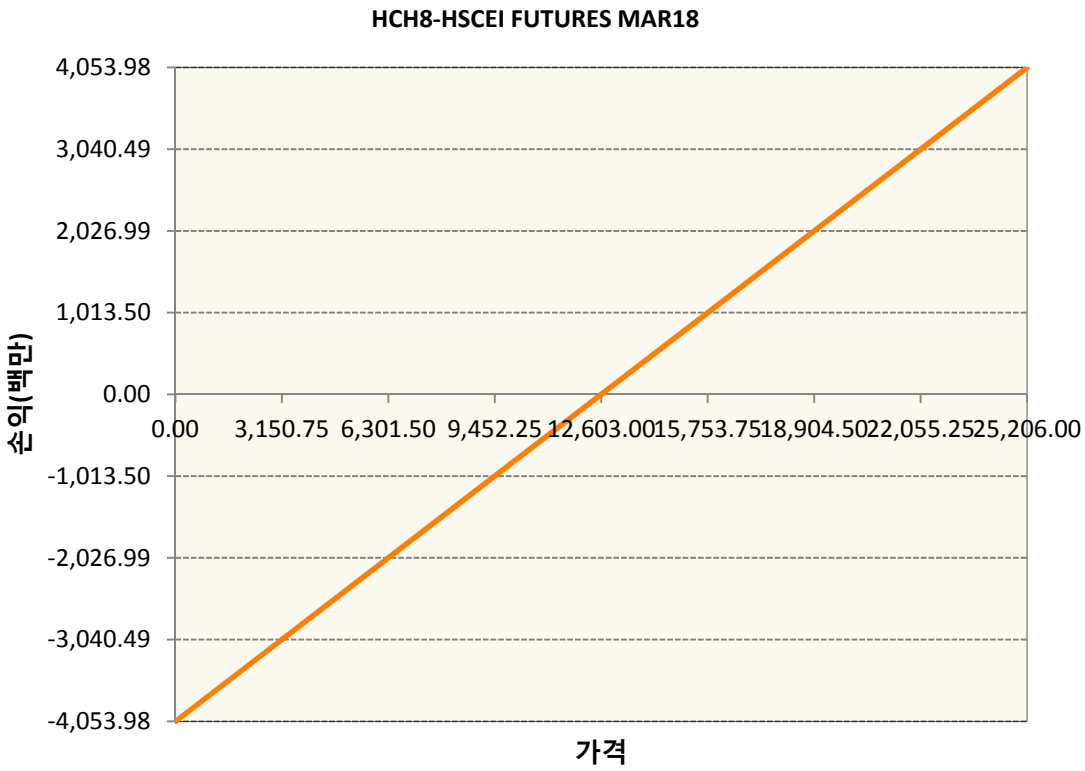
홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생

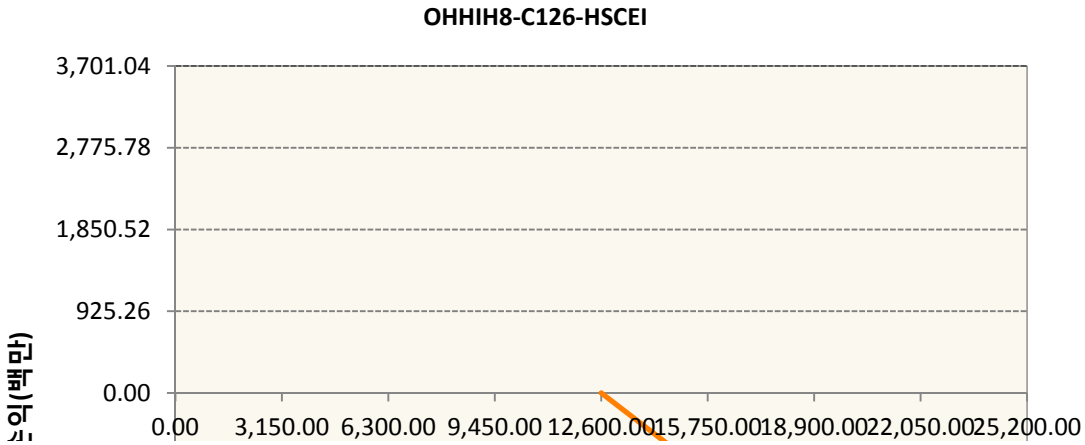
1. 계약금액

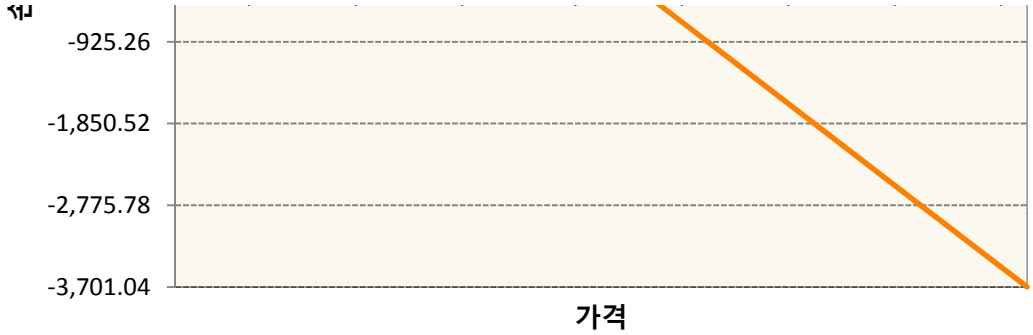
(단위:백만원)

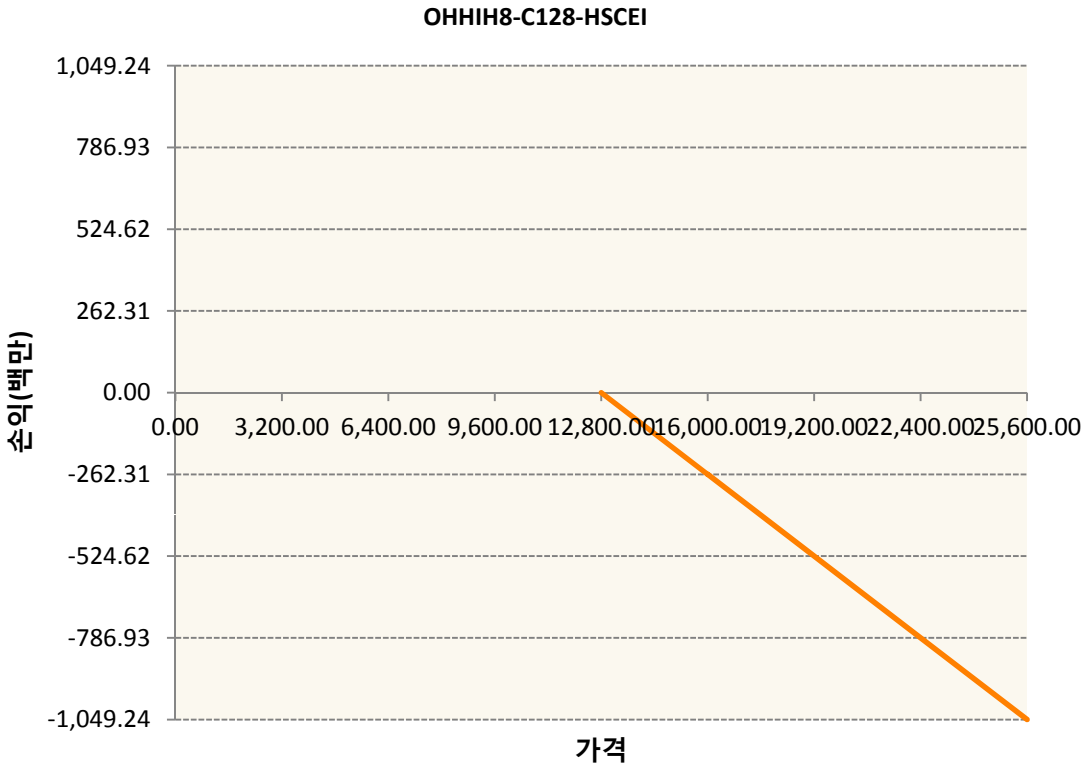
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	4,054	0	4,054	장내
누계	유가증권	옵션	0	9,501	-9,501	장내

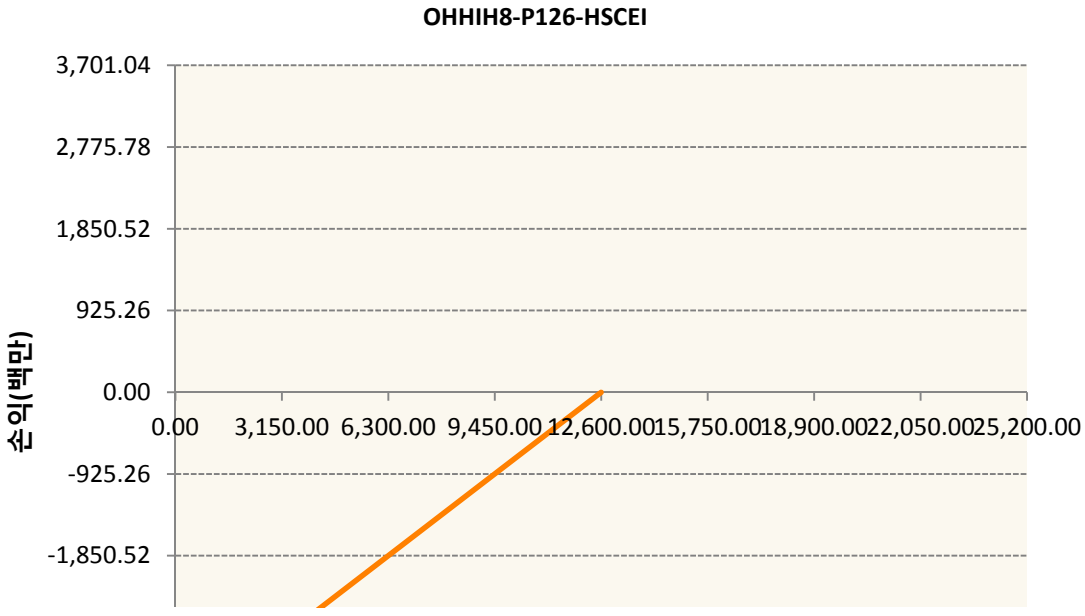
2. 만기시점의 손익구조

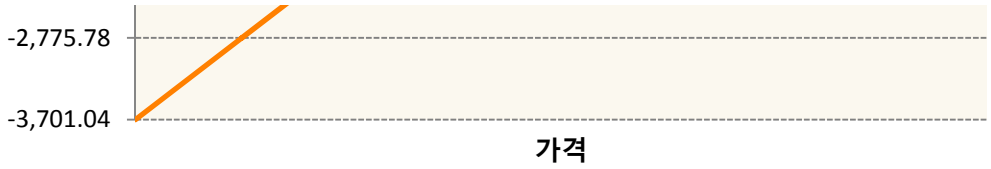


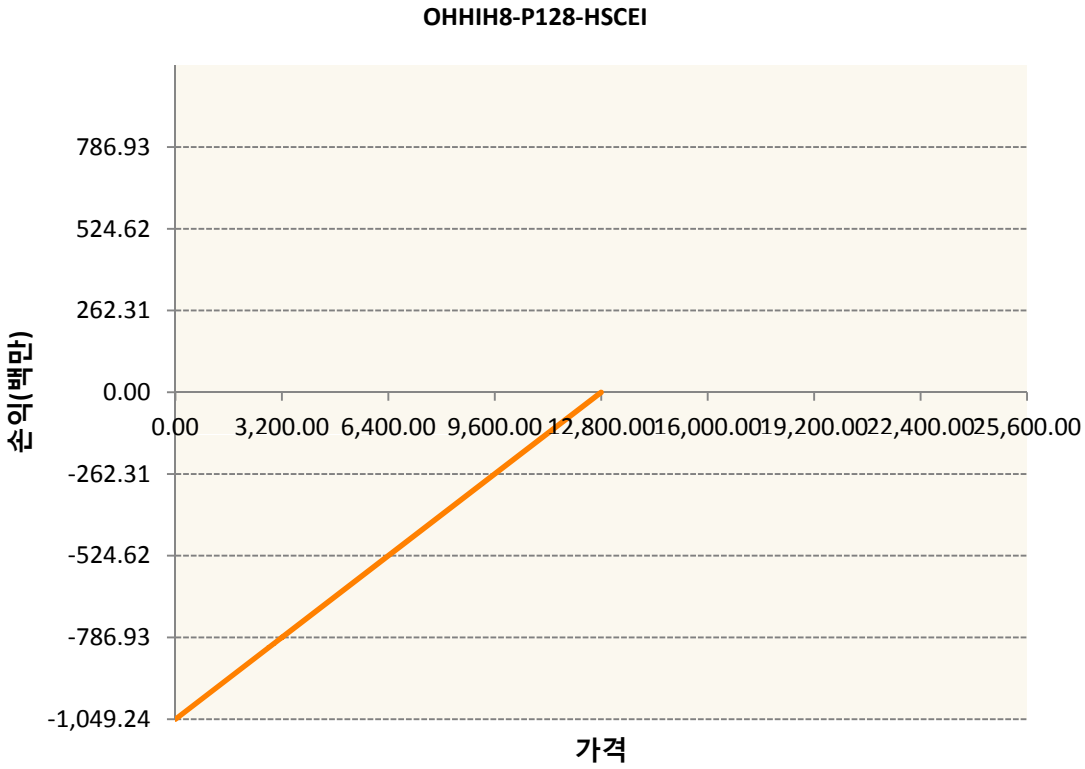



-925.26
-1,850.52
-2,775.78
-3,701.04
가격


OHHIH8-C128-HSCEI
1,049.24
786.93
524.62
262.31
0.00
-262.31
-524.62
-786.93
-1,049.24
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
3,701.04
2,775.78
1,850.52
925.26
0.00
-925.26
-1,850.52
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	324
OHHIH8-C12 HSCEI	296
OHHIH8-C12 HSCEI	84
OHHIH8-P12 HSCEI	296
OHHIH8-P12 HSCEI	84

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

945

공시일	2018-03-20
기준일	2018-03-19

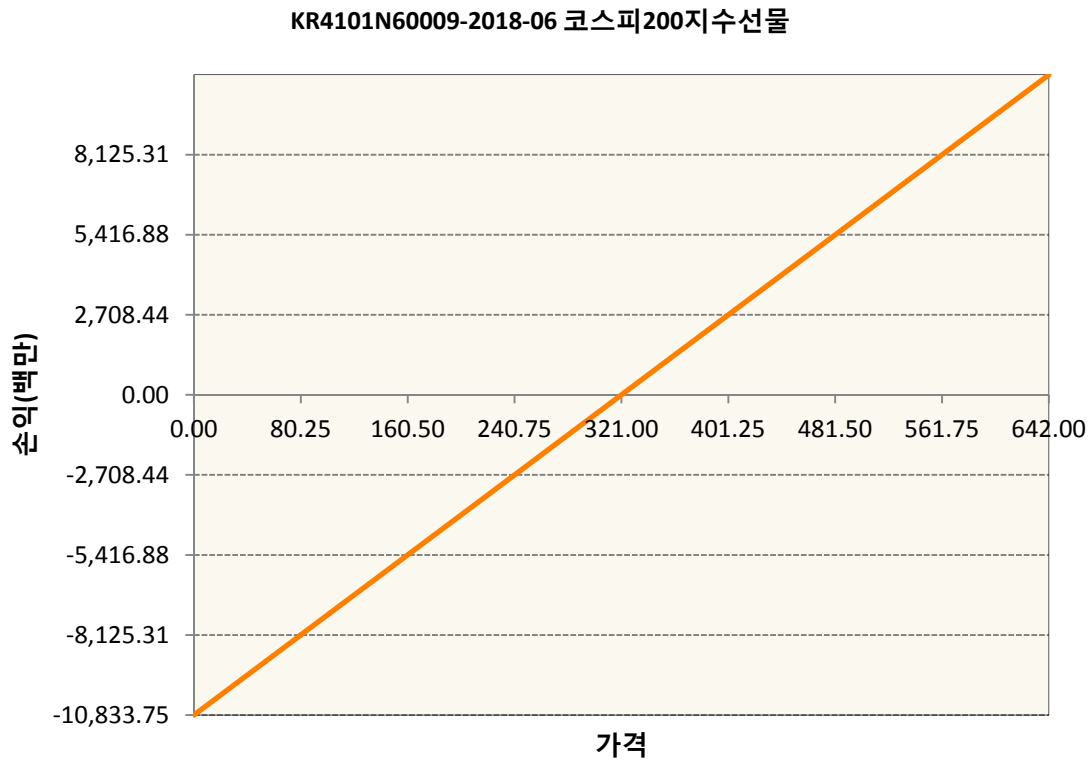
코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼

1. 계약금액

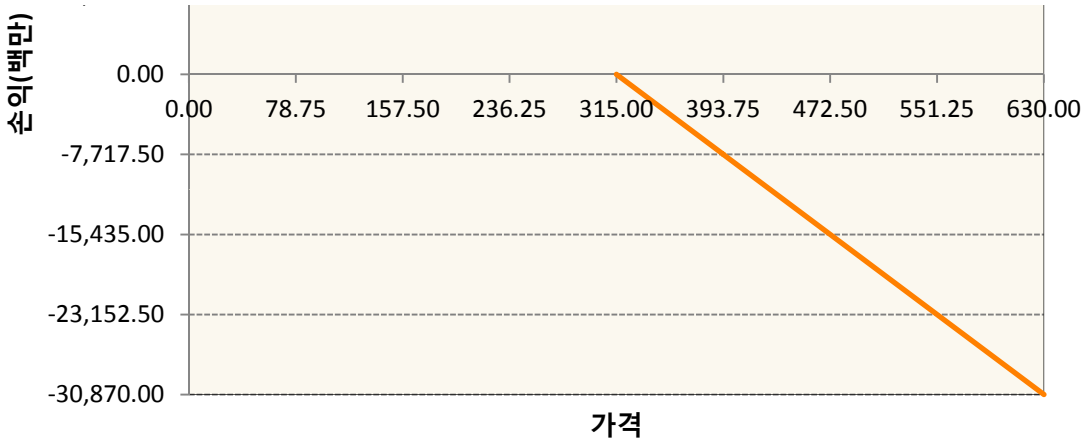
(단위:백만원)

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	312	0	312	장내
누계	유가증권	선물	10,834	0	10,834	장내
누계	유가증권	스왑	54,200	0	54,200	장외
누계	유가증권	옵션	0	55,718	-55,718	장내

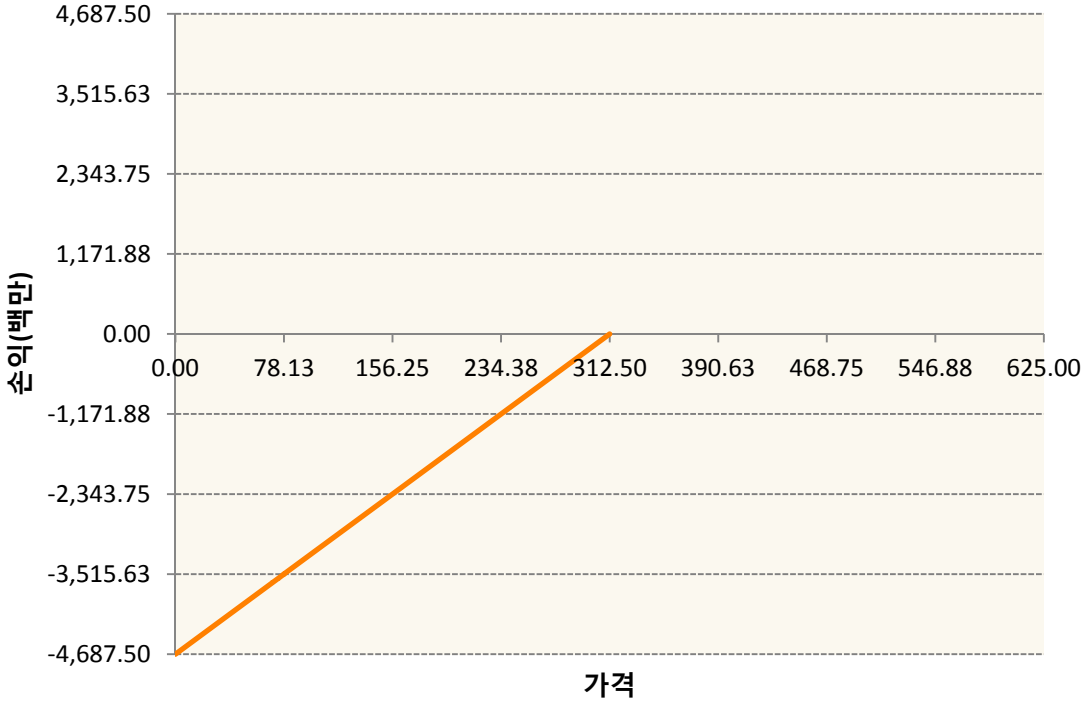
2. 만기시점의 손익구조



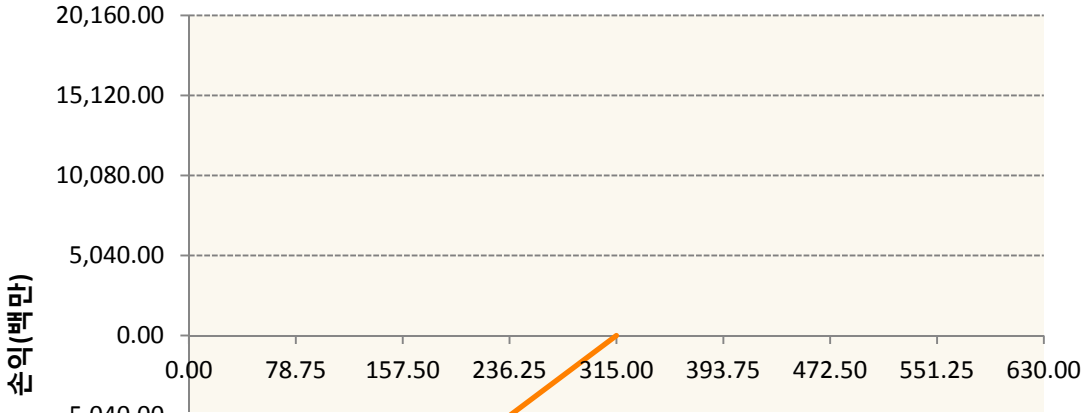




KR4301N43126-2018-04 풋312.5



KR4301N43159-2018-04 풋315





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_2							1,451
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,451	-1,451	-1,451	-1,451	-1,451	-1,451	-1,451
-5.33%	-967	-967	-967	-967	-967	-967	-967
-2.67%	-484	-484	-484	-484	-484	-484	-484
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	484	484	484	484	484	484	484
5.33%	967	967	967	967	967	967	967
8.00%	1,451	1,451	1,451	1,451	1,451	1,451	1,451
2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_3							275
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-275	-275	-275	-275	-275	-275	-275
-5.33%	-183	-183	-183	-183	-183	-183	-183
-2.67%	-92	-92	-92	-92	-92	-92	-92
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	92	92	92	92	92	92	92
5.33%	183	183	183	183	183	183	183
8.00%	275	275	275	275	275	275	275
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%	-131	-131	-131	-131	-131	-131	-131
-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%	131	131	131	131	131	131	131
8.00%	196	196	196	196	196	196	196
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_7						251
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-251	-251	-251	-251	-251	-251	-251
-5.33%	-167	-167	-167	-167	-167	-167	-167
-2.67%	-84	-84	-84	-84	-84	-84	-84
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	84	84	84	84	84	84	84
5.33%	167	167	167	167	167	167	167
8.00%	251	251	251	251	251	251	251
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_8						464
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-464	-464	-464	-464	-464	-464	-464
-5.33%	-309	-309	-309	-309	-309	-309	-309
-2.67%	-155	-155	-155	-155	-155	-155	-155
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	155	155	155	155	155	155	155
5.33%	309	309	309	309	309	309	309
8.00%	464	464	464	464	464	464	464
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_10						275
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-275	-275	-275	-275	-275	-275	-275
-5.33%	-183	-183	-183	-183	-183	-183	-183
-2.67%	-92	-92	-92	-92	-92	-92	-92
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	92	92	92	92	92	92	92
5.33%	183	183	183	183	183	183	183
8.00%	275	275	275	275	275	275	275
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_11						627
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-627	-627	-627	-627	-627	-627	-627
-5.33%	-418	-418	-418	-418	-418	-418	-418
-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%	418	418	418	418	418	418	418
8.00%	627	627	627	627	627	627	627
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_12						471
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-471	-471	-471	-471	-471	-471	-471
-5.33%	-314	-314	-314	-314	-314	-314	-314
-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%	314	314	314	314	314	314	314
8.00%	471	471	471	471	471	471	471
	KR4101N60(2018-06 코스피200지수선물						865
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-865	-865	-865	-865	-865	-865	-865
-5.33%	-577	-577	-577	-577	-577	-577	-577
-2.67%	-288	-288	-288	-288	-288	-288	-288
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	288	288	288	288	288	288	288
5.33%	577	577	577	577	577	577	577
8.00%	865	865	865	865	865	865	865
	KR4201N431 2018-04 콜315						2,084
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,080	1,046	1,008	966	920	872	821
-5.33%	938	882	824	765	703	641	577
-2.67%	657	587	517	446	376	305	235
0%	208	139	70	0	-70	-141	-212
2.67%	-398	-451	-508	-568	-629	-692	-756
5.33%	-1,118	-1,152	-1,191	-1,235	-1,282	-1,333	-1,386
8.00%	-1,905	-1,923	-1,946	-1,974	-2,007	-2,043	-2,084
	KR4301N431 2018-04 풋312.5						248
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-233	-235	-237	-239	-241	-244	-248
-5.33%	-117	-121	-126	-131	-136	-141	-147
-2.67%	-30	-36	-43	-49	-56	-63	-69
0%	16	11	5	0	-6	-11	-17
2.67%	31	29	26	23	20	16	12
5.33%	34	33	32	31	30	28	26
8.00%	34	34	34	34	33	32	31
	KR4301N431 2018-04 풋315						1,148

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,101	-1,105	-1,110	-1,117	-1,126	-1,136	-1,148
-5.33%	-586	-601	-617	-635	-654	-674	-695
-2.67%	-170	-196	-223	-251	-278	-305	-333
0%	77	52	26	0	-26	-53	-80
2.67%	171	158	144	128	110	91	71
5.33%	193	189	184	178	169	159	147
8.00%	196	195	194	192	189	185	180

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

8,260

공시일	2018-03-20
기준일	2018-03-19

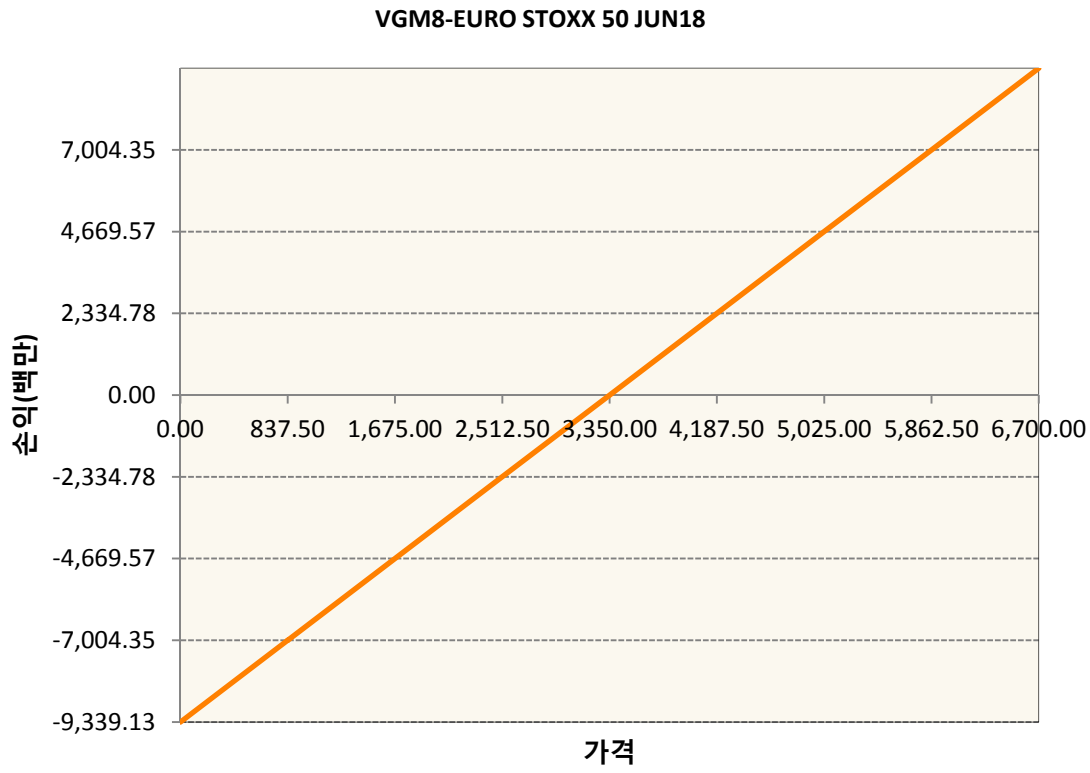
유로커버드콜모(주식혼합-파생형

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	1	0	1	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	9,339	0	9,339	
누계	유가증권	스왑	98,622	0	98,622	장외
누계	지수	스왑	52,599	0	52,599	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

260105SGPX	SG EURO Covered CALL STRATEGY - 994.569	151
260105SQPX	SG EURO Covered CALL STRATEGY	284
VGM8	EURO STOXX 50 JUN18	747

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

730

공시일	2018-03-20
기준일	2018-03-19

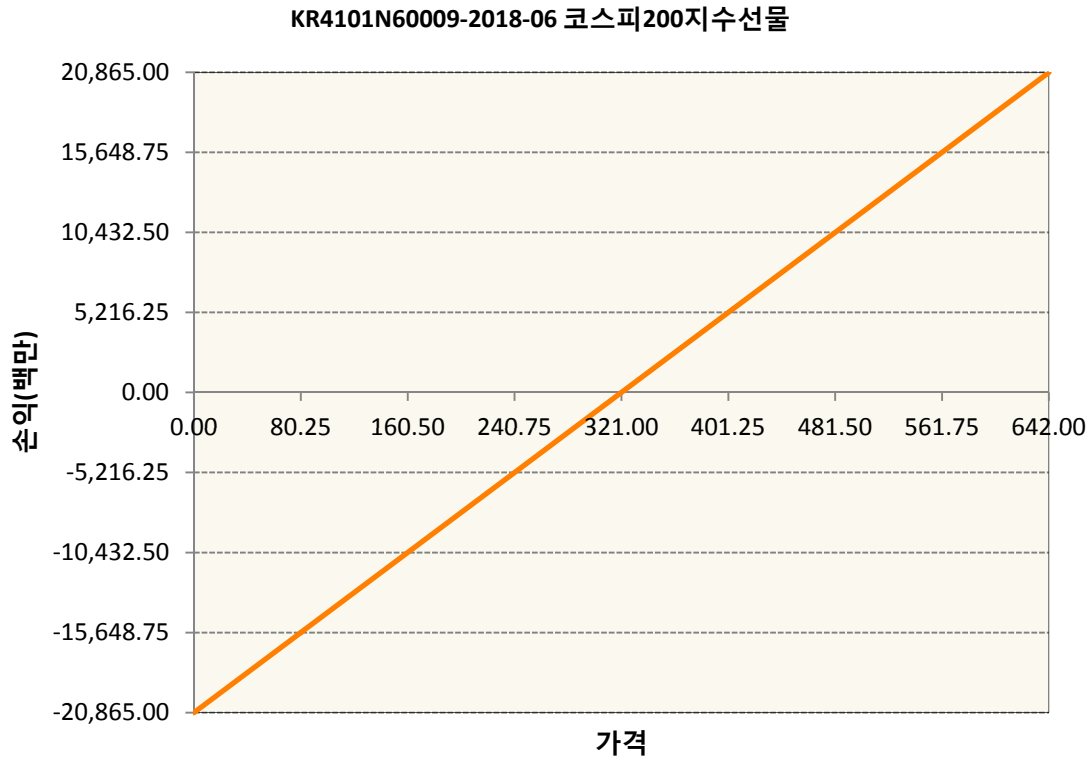
ETF스마트레버리지목표전환형8호

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	161	-161	장내
누계	유가증권	선물	20,865	0	20,865	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101N60(2018-06 코스피200지수선물							1,666
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,666	-1,666	-1,666	-1,666	-1,666	-1,666	-1,666
-5.33%	-1,111	-1,111	-1,111	-1,111	-1,111	-1,111	-1,111
-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%	1,111	1,111	1,111	1,111	1,111	1,111	1,111
8.00%	1,666	1,666	1,666	1,666	1,666	1,666	1,666

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

1,154

공시일	2018-03-20
기준일	2018-03-19

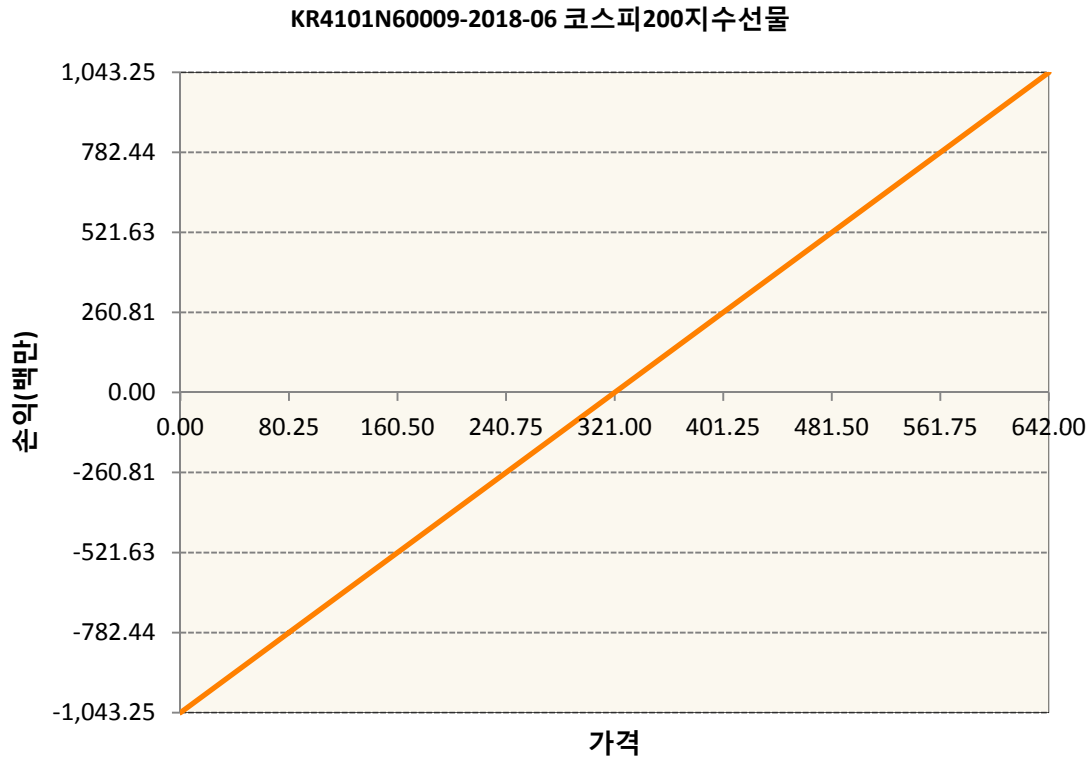
ETF스마트레버리지목표전환형9호

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	1,043	0	1,043	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%	-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%	83	83	83	83	83	83	83

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

58

공시일	2018-03-20
기준일	2018-03-19

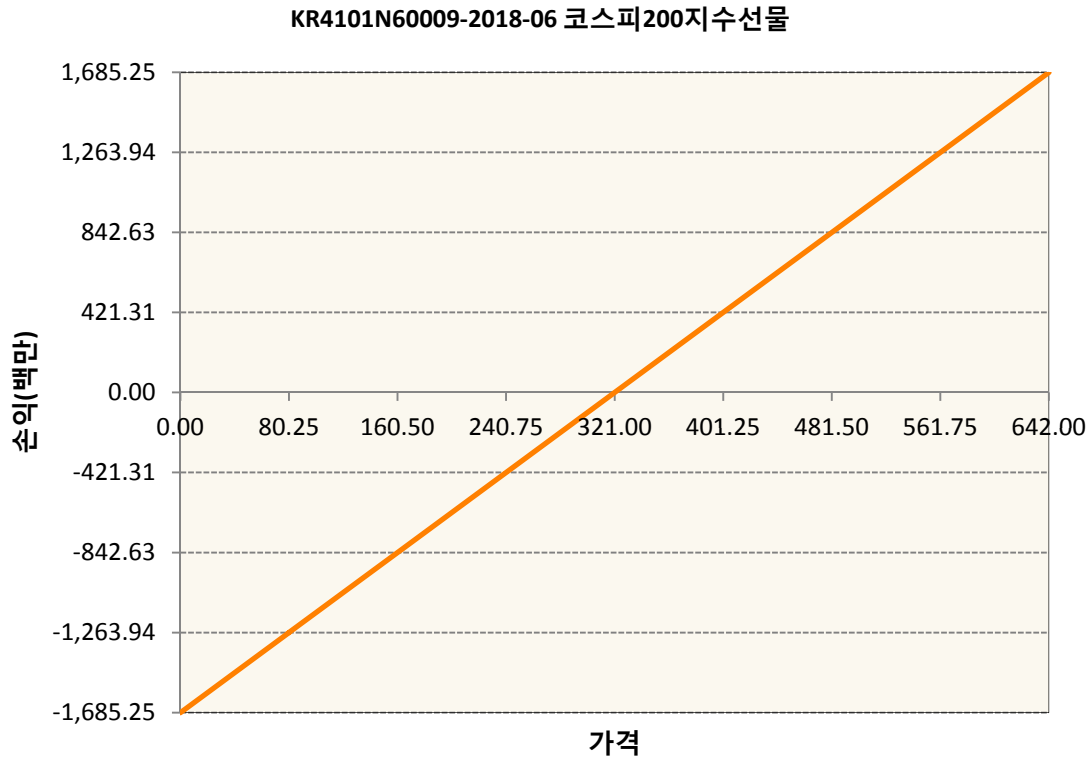
ETF스마트레버리지목표전환형10

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	1,685	0	1,685	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)

93

공시일	2018-03-20
기준일	2018-03-19

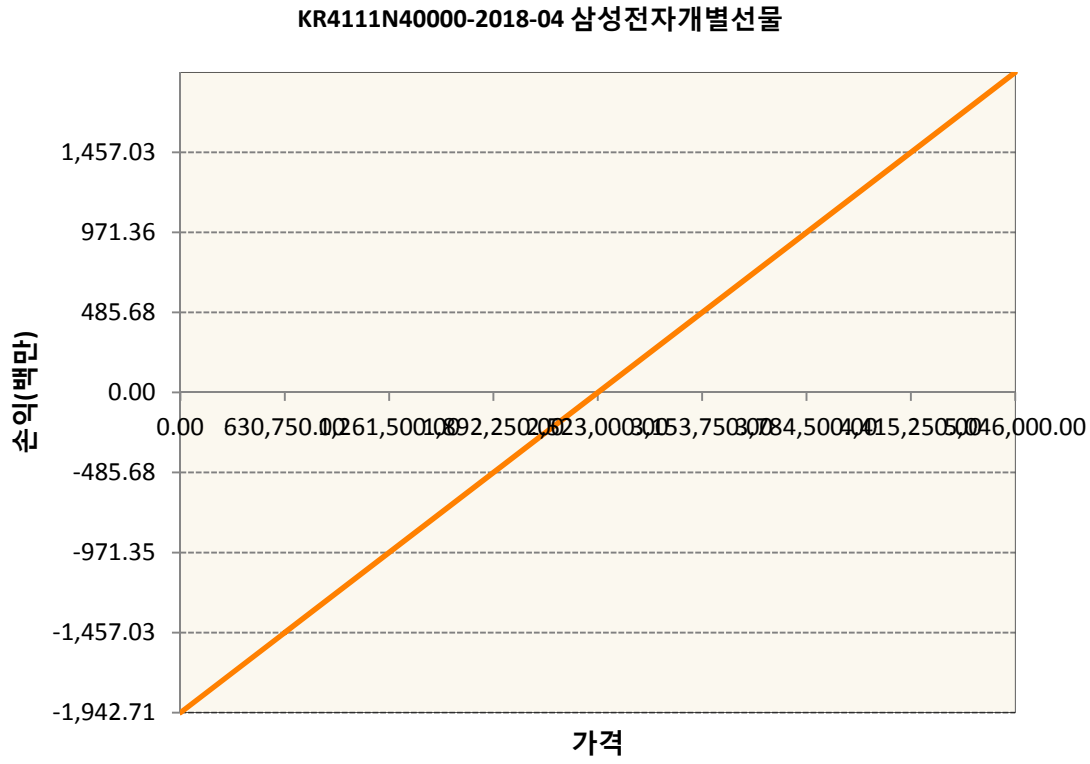
스마트KRX300인덱스1호(주식-파

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	51	0	51	장내
누계	유가증권	선물	1,943	0	1,943	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4111N40(2018-04 삼성전자개별선물							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

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

187

공시일	2018-03-20
기준일	2018-03-19

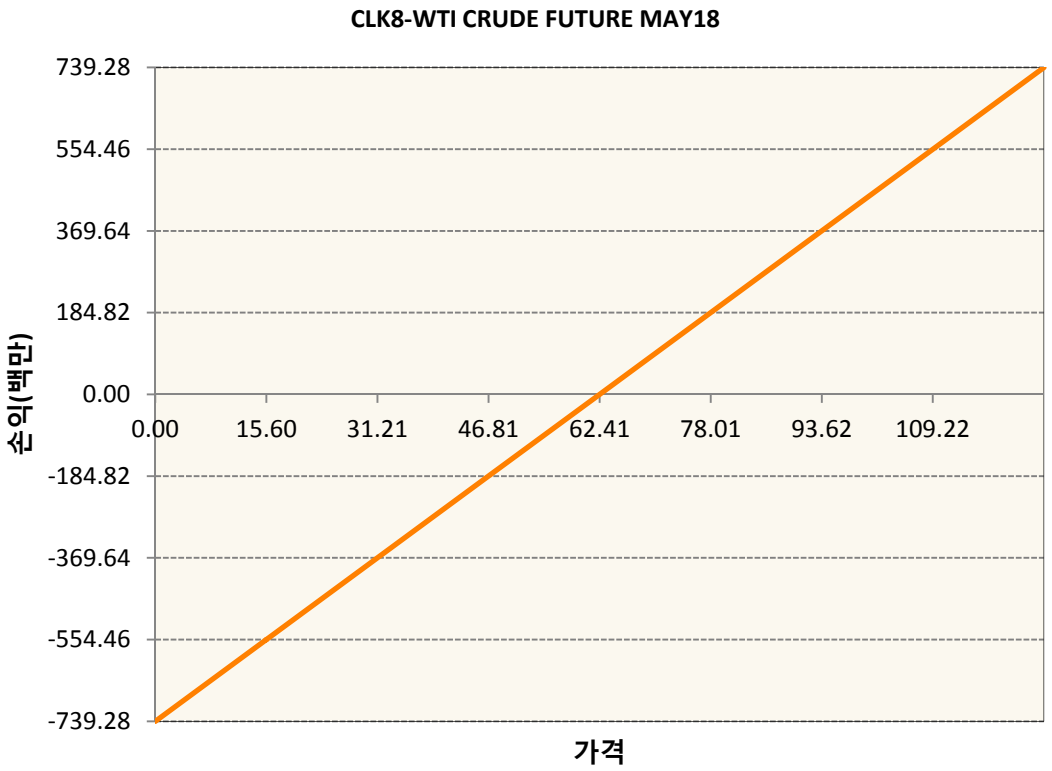
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

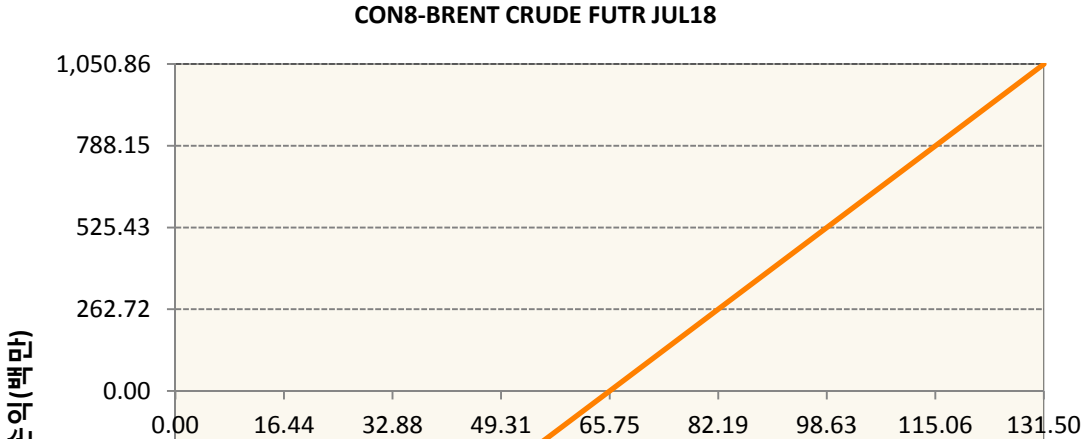
1. 계약금액

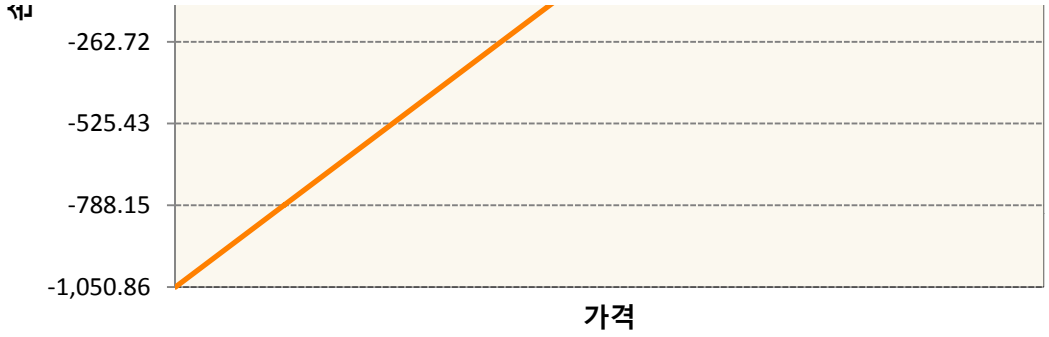
(단위:백만원)

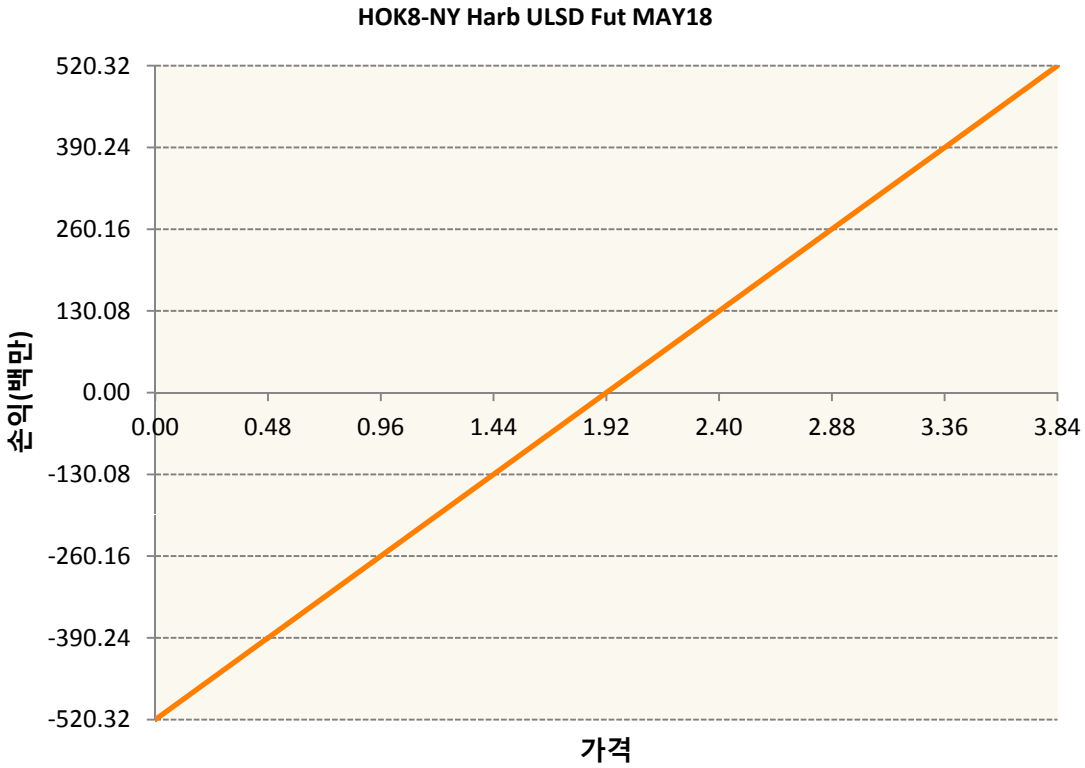
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	선물	유가증권	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	선물	유가증권	739	0	739	
누계	유가증권	선물	3,244	589	2,655	

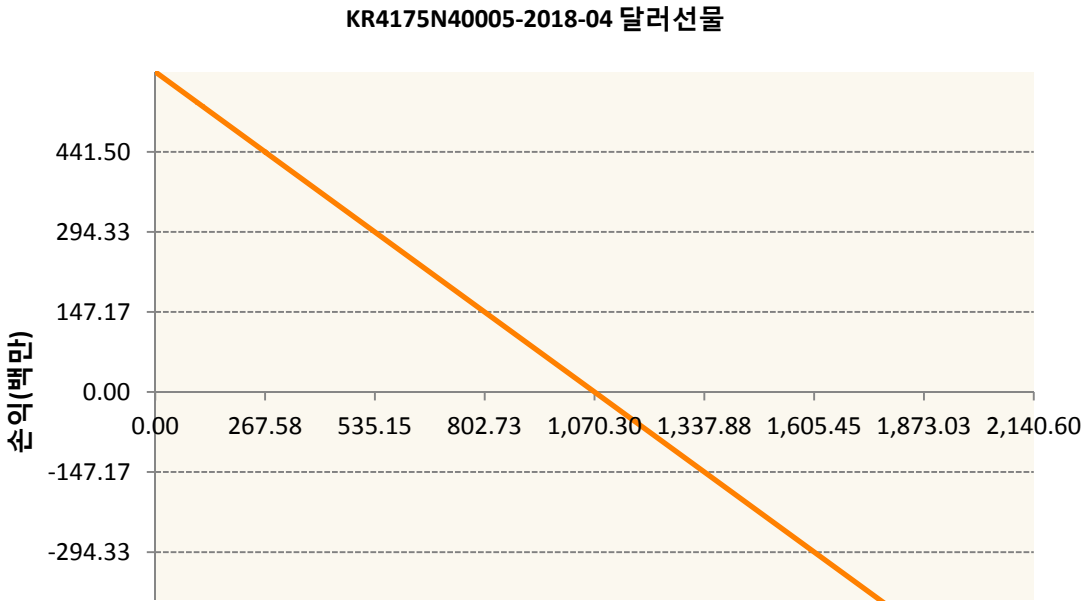
2. 만기시점의 손익구조

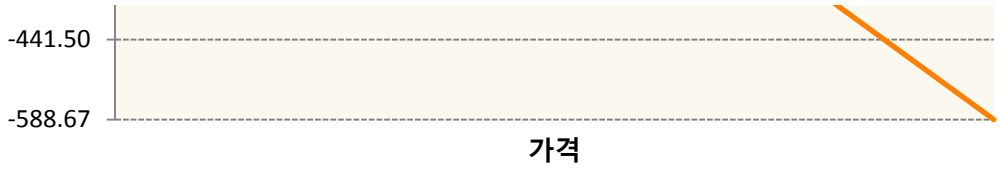


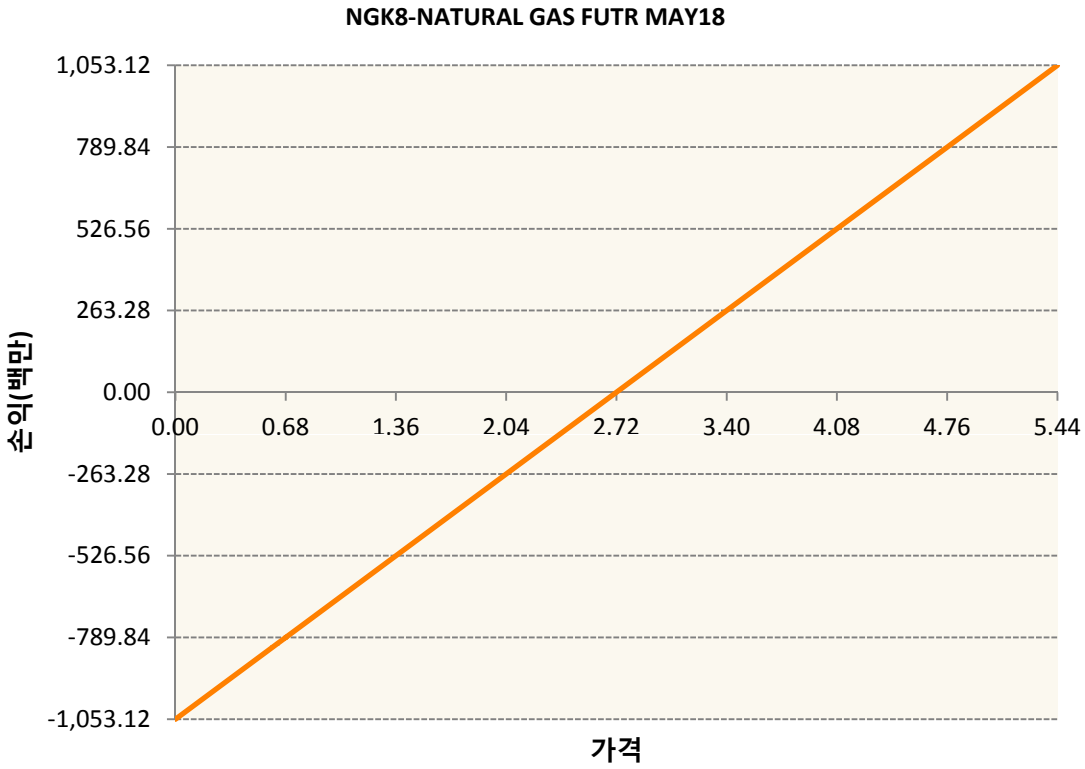


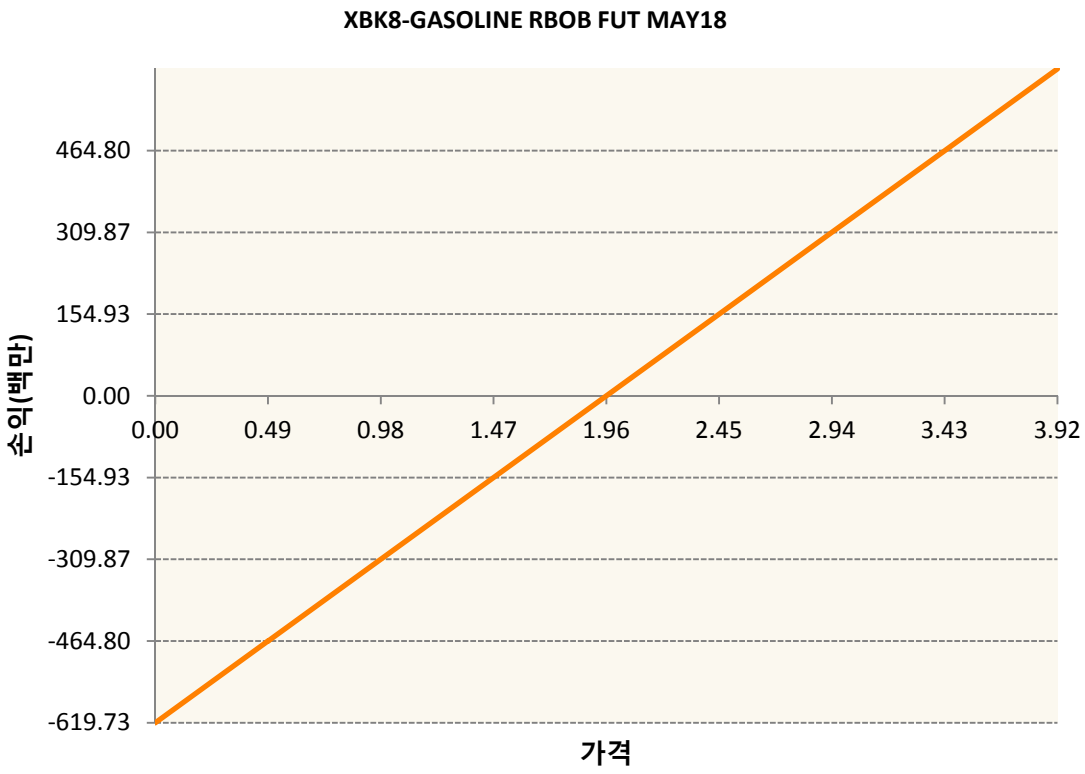

-262.72
-525.43
-788.15
-1,050.86
가격


HOK8-NY Harb ULSD Fut MAY18
520.32
390.24
260.16
130.08
0.00
-130.08
-260.16
-390.24
-520.32
손익(백만)
0.00
0.48
0.96
1.44
1.92
2.40
2.88
3.36
3.84
가격


KR4175N40005-2018-04 달러선물
441.50
294.33
147.17
0.00
-147.17
-294.33
손익(백만)
0.00
267.58
535.15
802.73
1,070.30
1,337.88
1,605.45
1,873.03
2,140.60


-441.50
-588.67
가격


NGK8-NATURAL GAS FUTR MAY18
1,053.12
789.84
526.56
263.28
0.00
-263.28
-526.56
-789.84
-1,053.12
0.00
0.68
1.36
2.04
2.72
3.40
4.08
4.76
5.44
손익(백만)
가격


XBK8-GASOLINE RBOB FUT MAY18
464.80
309.87
154.93
0.00
-154.93
-309.87
-464.80
-619.73
0.00
0.49
0.98
1.47
1.96
2.45
2.94
3.43
3.92
손익(백만)
가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLK8	WTI CRUDE FUTURE MAY18	59
CON8	BRENT CRUDE FUTR JUL18	84
HOK8	NY Harb ULSD Fut MAY18	42
KR4175N40(	2018-04 달러선물	47
NGK8	NATURAL GAS FUTR MAY18	84
XBK8	GASOLINE RBOB FUT MAY18	50

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

520

공시일	2018-03-20
기준일	2018-03-19

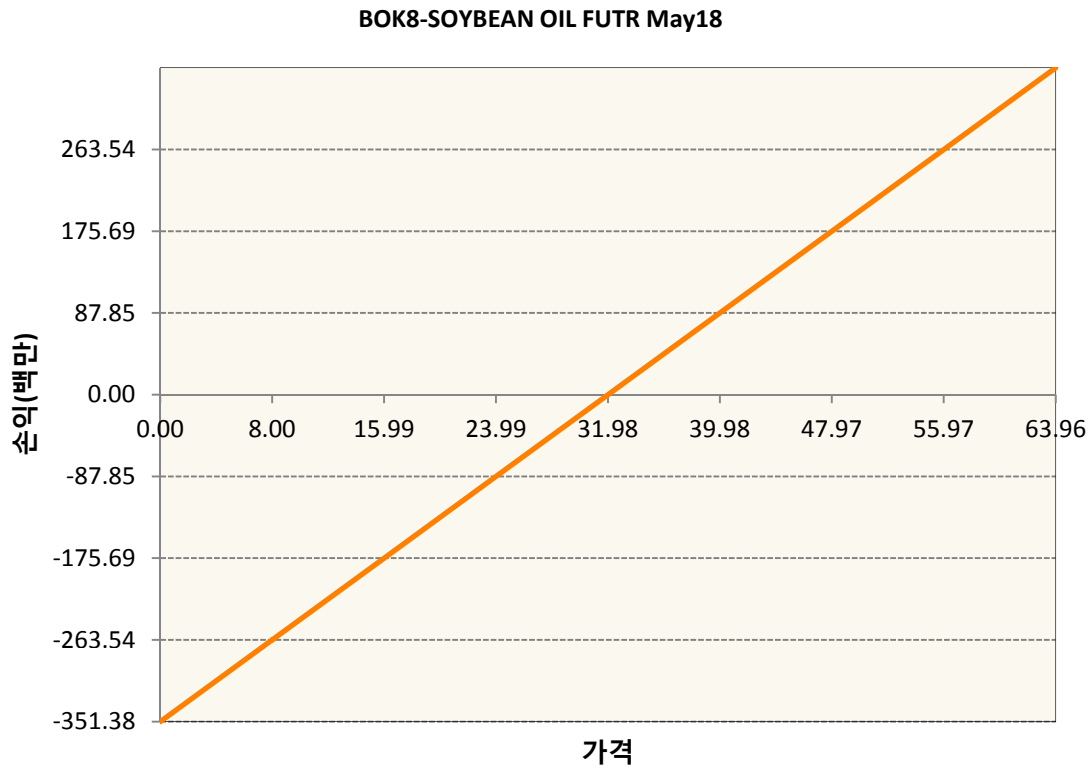
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

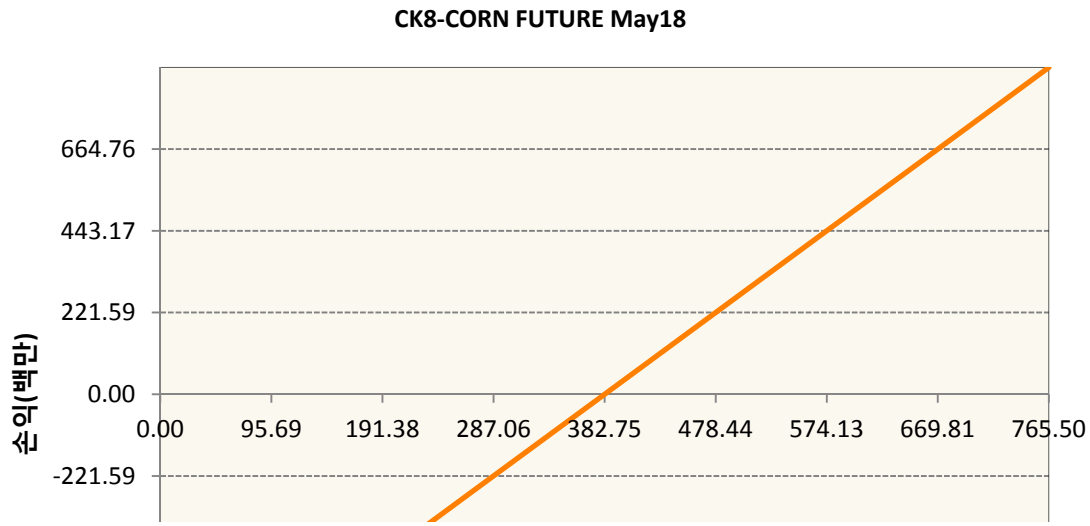
1. 계약금액

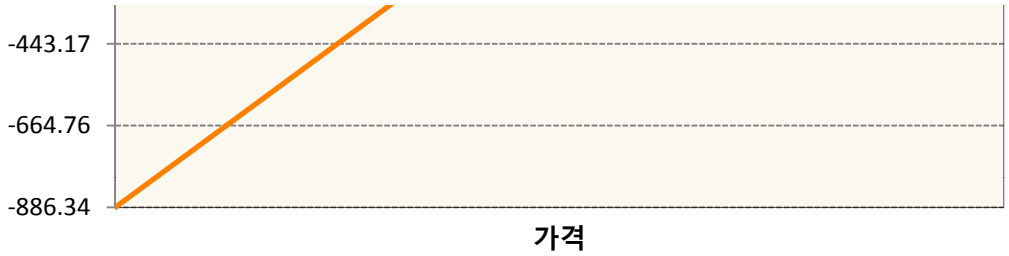
(단위:백만원)

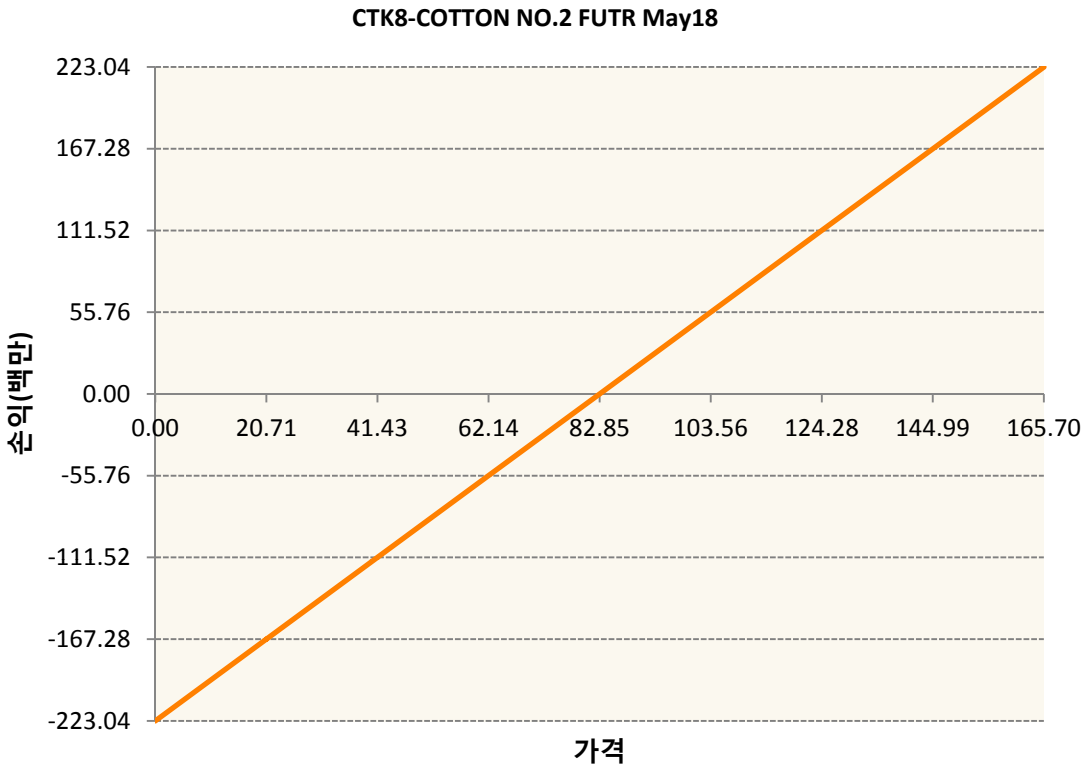
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	4,133	321	3,811	

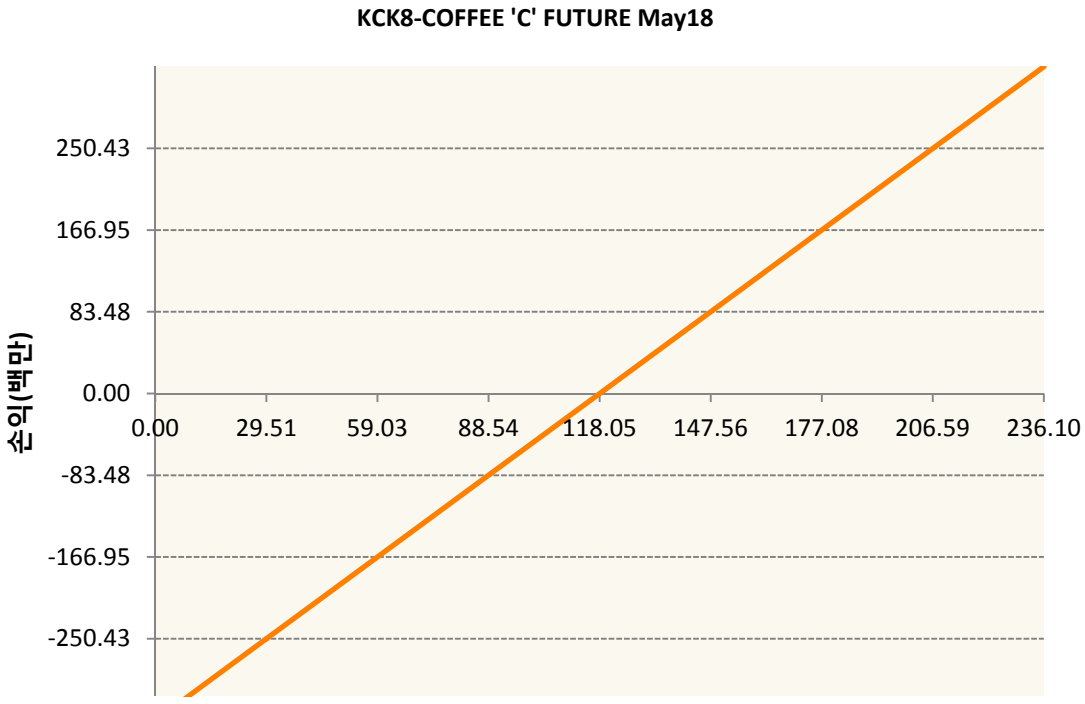
2. 만기시점의 손익구조

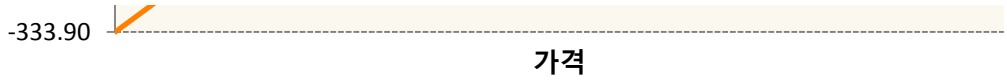


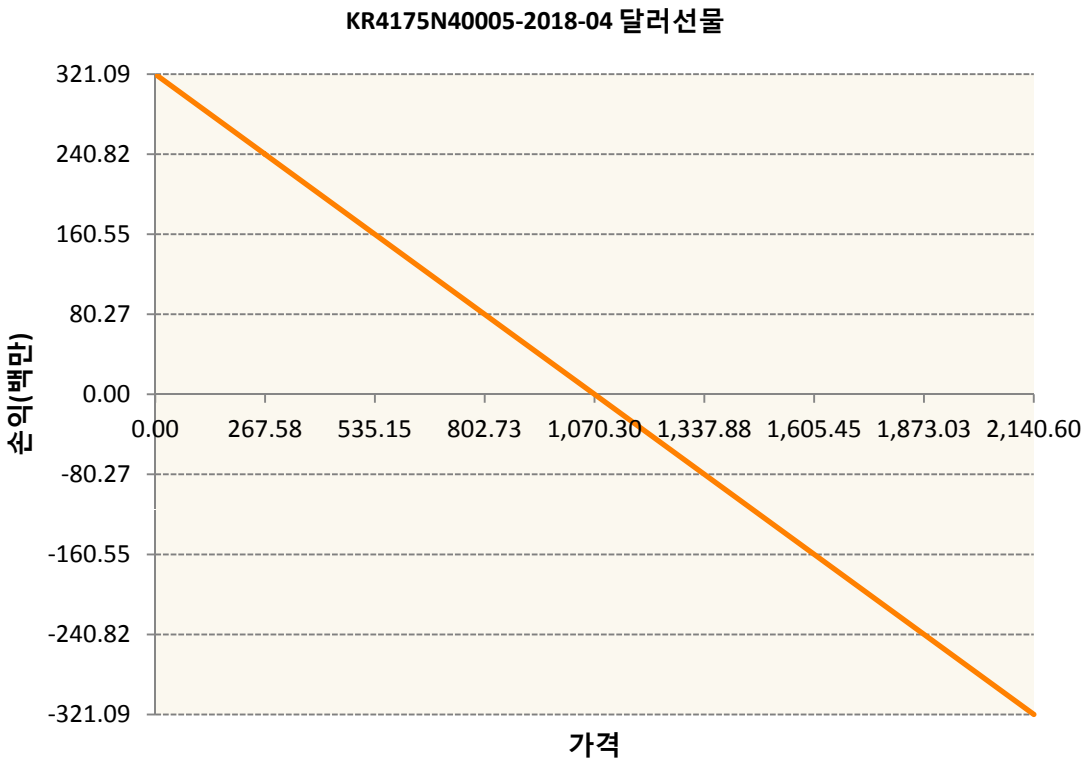


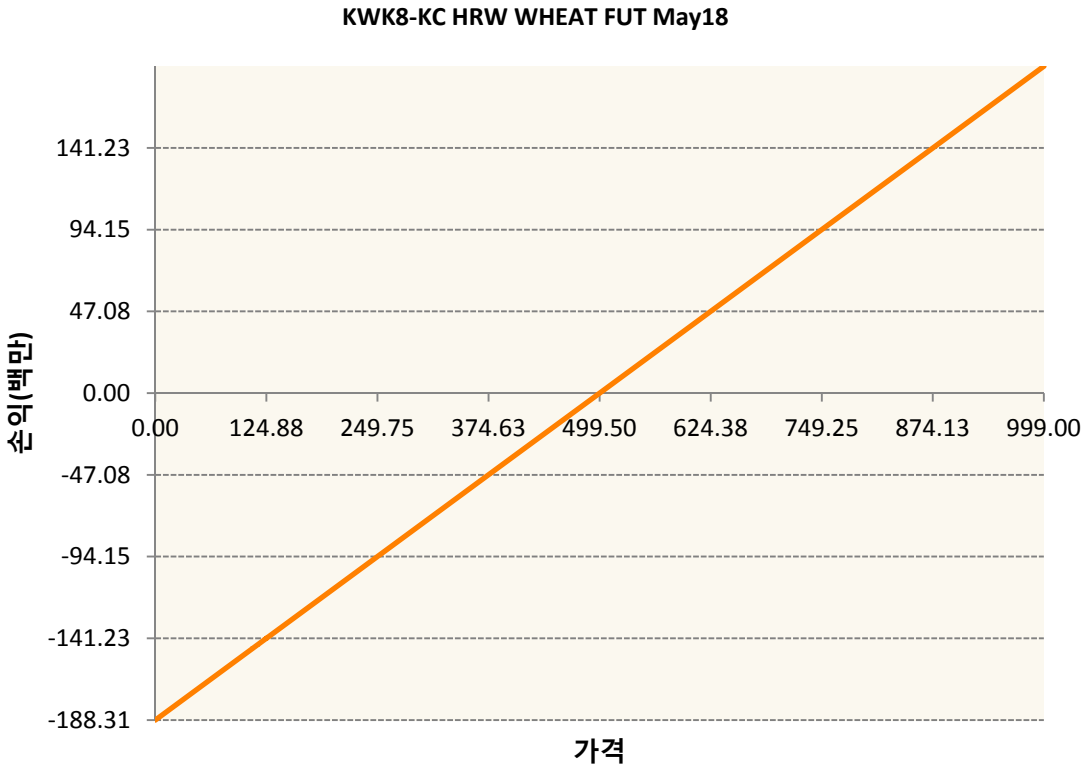

-443.17
-664.76
-886.34
가격

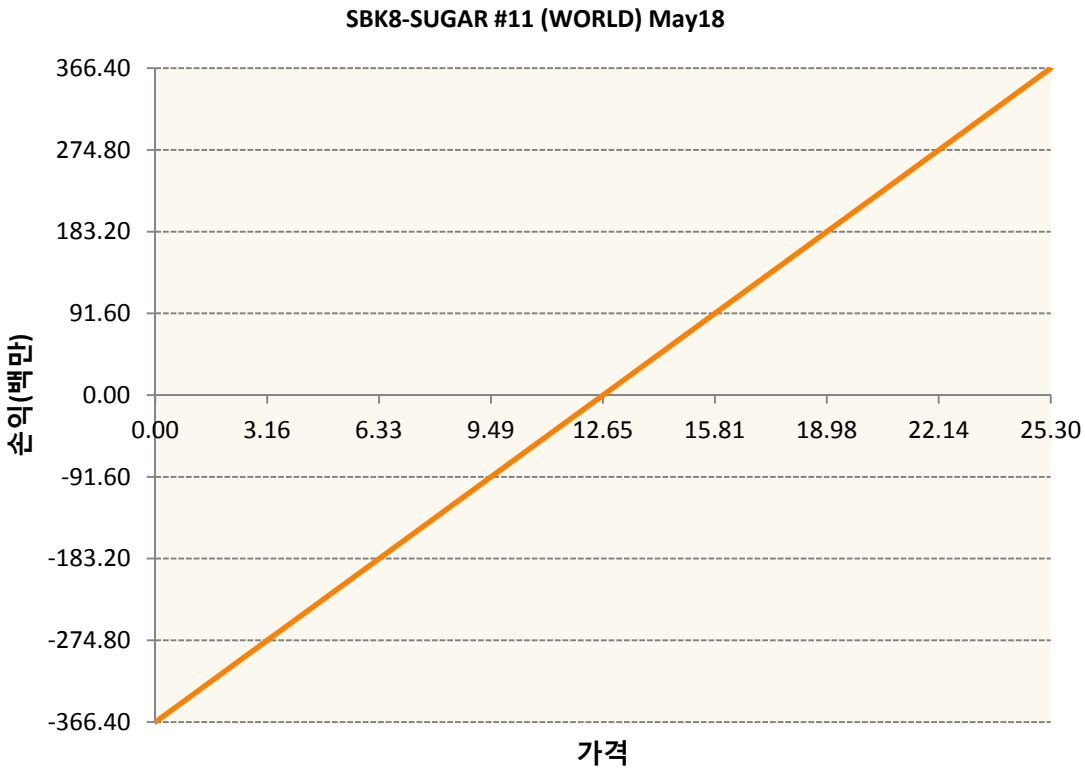

CTK8-COTTON NO.2 FUTR May18
223.04
167.28
111.52
55.76
0.00
-55.76
-111.52
-167.28
-223.04
손익(백만)
0.00
20.71
41.43
62.14
82.85
103.56
124.28
144.99
165.70
가격

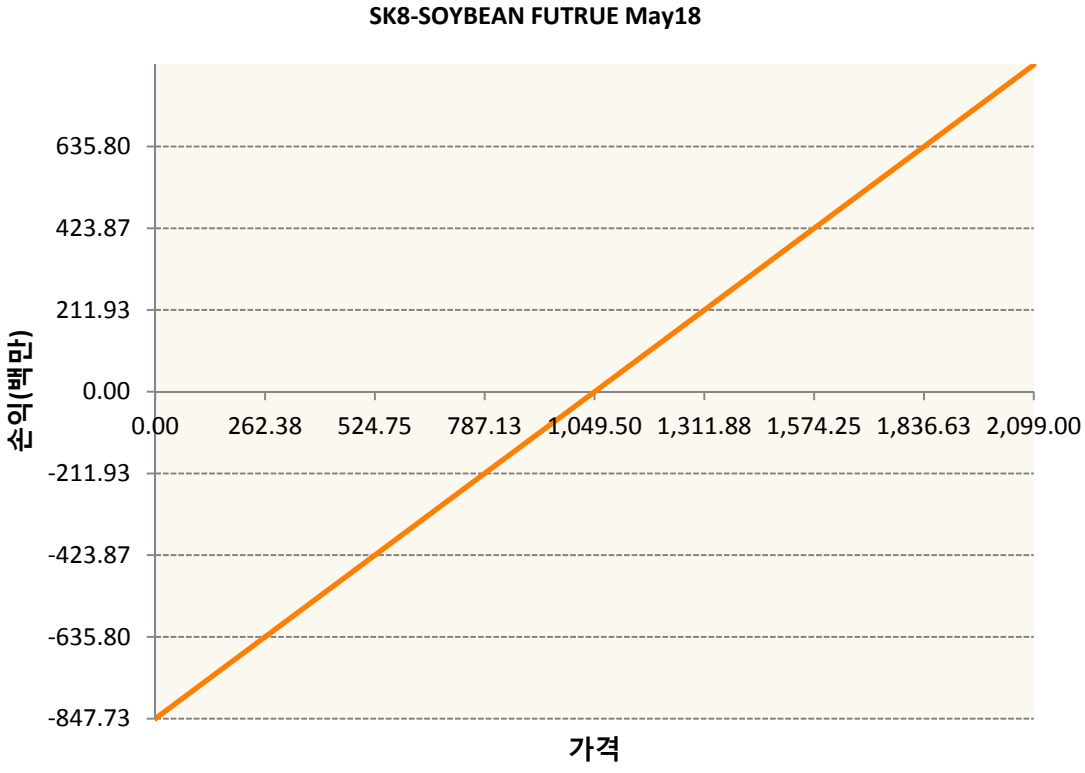

KCK8-COFFEE 'C' FUTURE May18
250.43
166.95
83.48
0.00
-83.48
-166.95
-250.43
손익(백만)
0.00
29.51
59.03
88.54
118.05
147.56
177.08
206.59
236.10


-333.90
가격

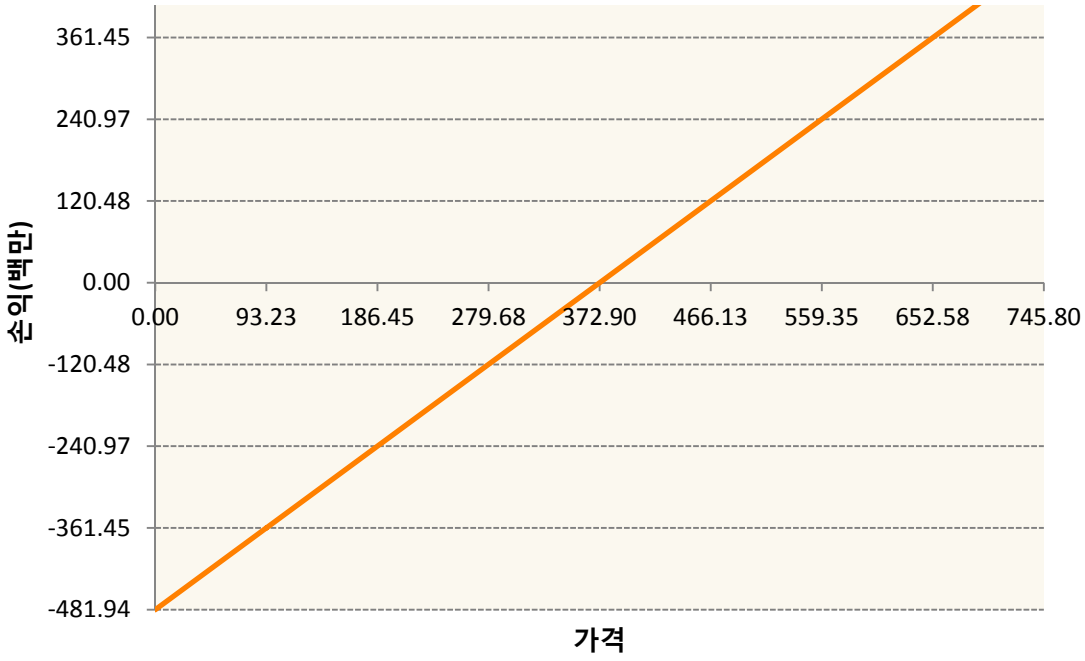

KR4175N40005-2018-04 달러선물
321.09
240.82
160.55
80.27
0.00
-80.27
-160.55
-240.82
-321.09
0.00
267.58
535.15
802.73
1,070.30
1,337.88
1,605.45
1,873.03
2,140.60
손익(백만)
가격


KWK8-KC HRW WHEAT FUT May18
141.23
94.15
47.08
0.00
-47.08
-94.15
-141.23
-188.31
0.00
124.88
249.75
374.63
499.50
624.38
749.25
874.13
999.00
손익(백만)
가격

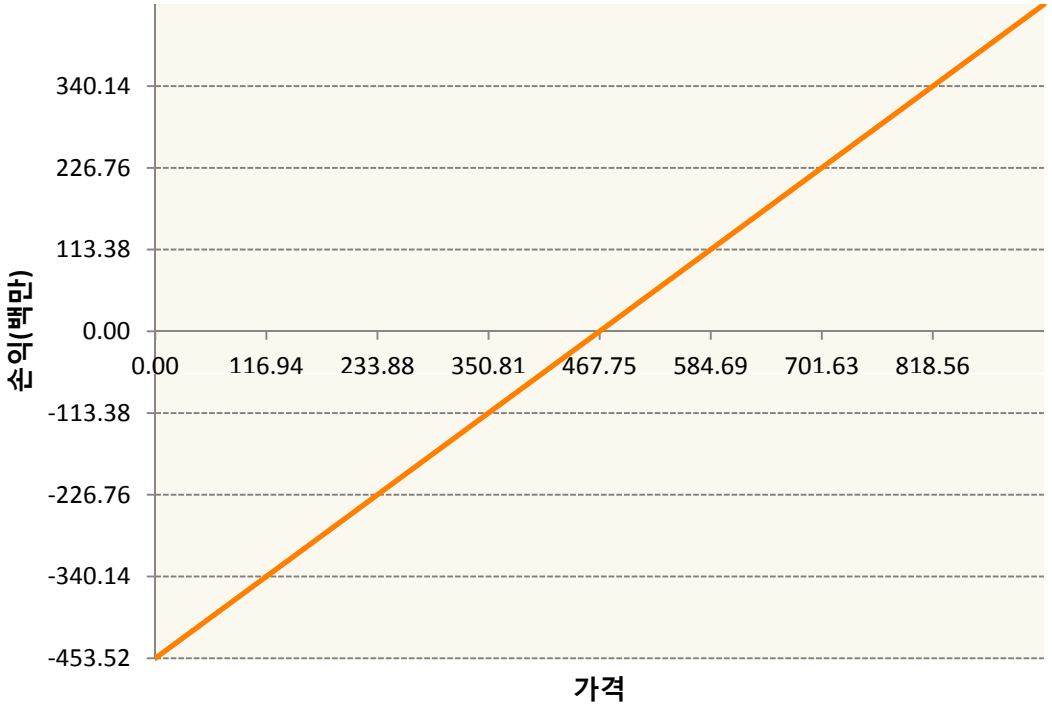

SBK8-SUGAR #11 (WORLD) May18
366.40
274.80
183.20
91.60
0.00
-91.60
-183.20
-274.80
-366.40
0.00
3.16
6.33
9.49
12.65
15.81
18.98
22.14
25.30
손익(백만)
가격


SK8-SOYBEAN FUTRUE May18
635.80
423.87
211.93
0.00
-211.93
-423.87
-635.80
-847.73
0.00
262.38
524.75
787.13
1,049.50
1,311.88
1,574.25
1,836.63
2,099.00
손익(백만)
가격


SMK8-SOYBEAN MEAL FUTR May18
481.94



WK8-WHEAT FUTURE(CBT) May18



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

BOK8	SOYBEAN OIL FUTR May18	28
CK8	CORN FUTURE May18	71
CTK8	COTTON NO.2 FUTR May18	18
KCK8	COFFEE 'C' FUTURE May18	27
KR4175N40(	2018-04 달러선물	26

KWK8	KC HRW WHEAT FUT May18	15
SBK8	SUGAR #11 (WORLD) May18	29
SK8	SOYBEAN FUTRUE May18	68
SMK8	SOYBEAN MEAL FUTR May18	39
WK8	WHEAT FUTURE(CBT) May18	36

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

332