공시일	2018-03-21
기준일	2018-03-20

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	2018-03-21
기준일	2018-03-20

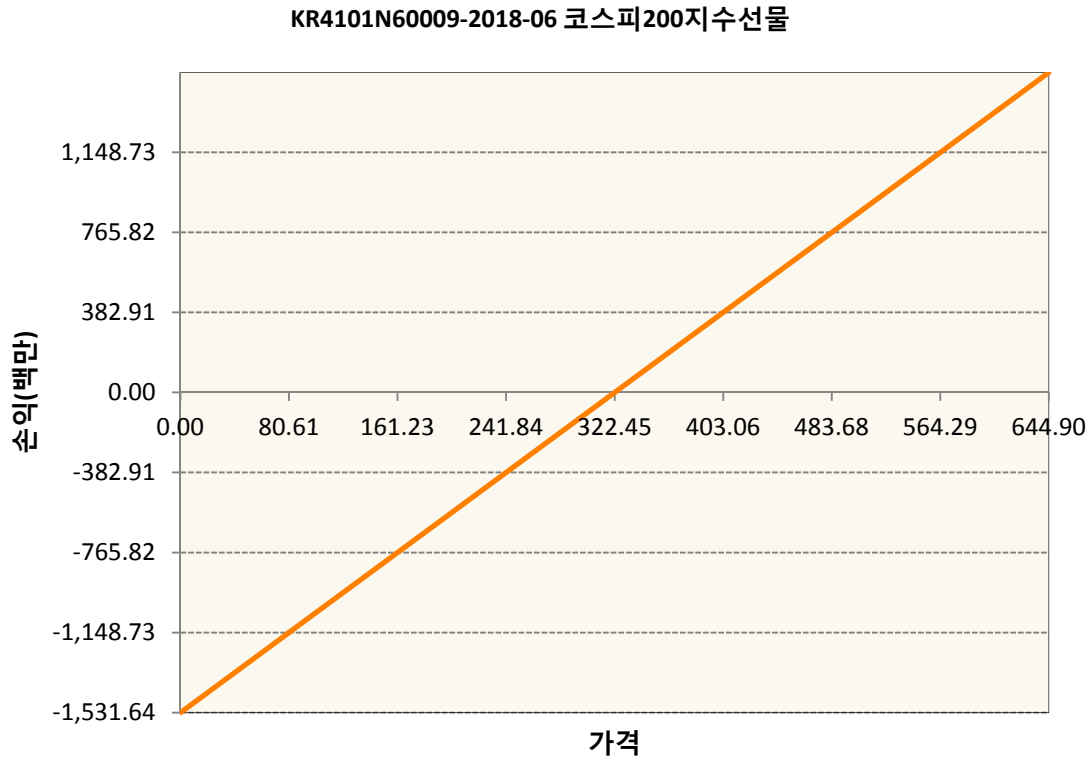
스마트인덱스모

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	1,532	0	1,532	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	2018-03-21
기준일	2018-03-20

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	1,108

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

420

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2018-03-21
기준일	2018-03-20

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	412

* 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	2018-03-21
기준일	2018-03-20

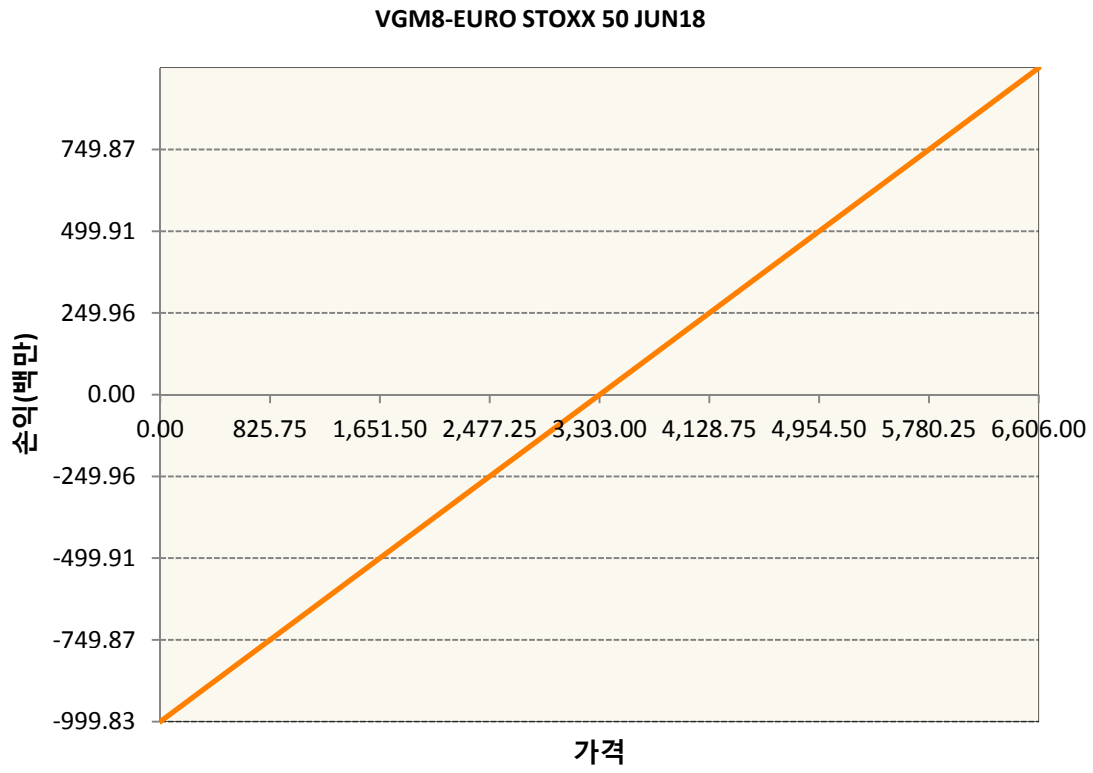
유로인덱스모(주식-파생형)

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)

47

공시일	2018-03-21
기준일	2018-03-20

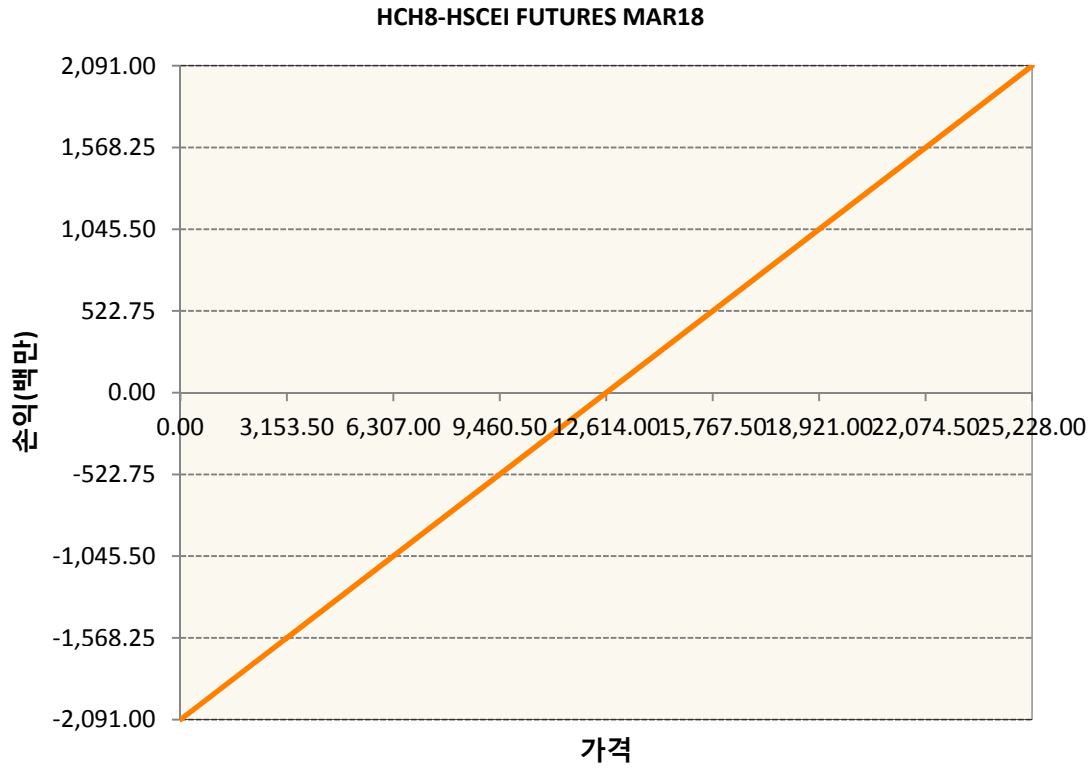
차이나인덱스모(주식-파생형)

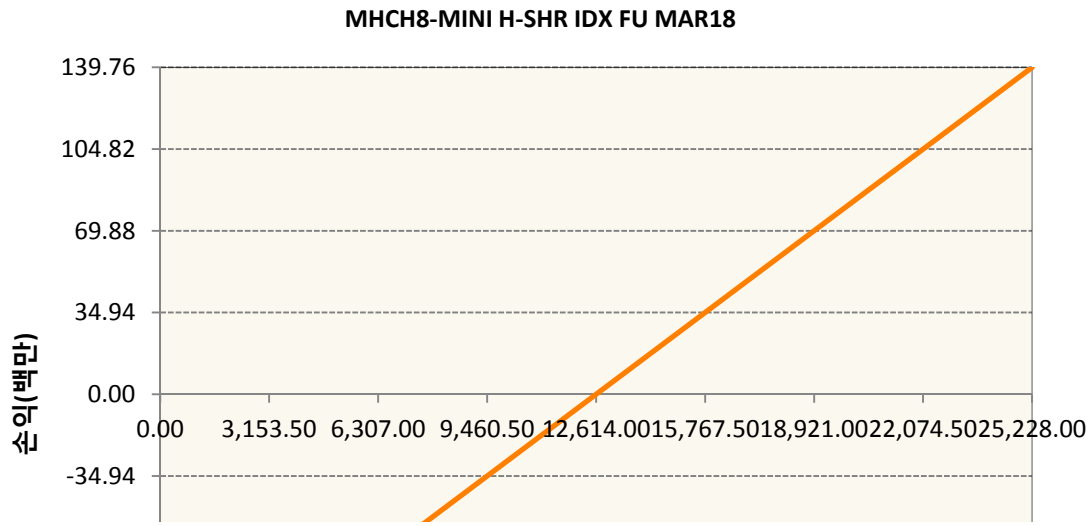
1. 계약금액

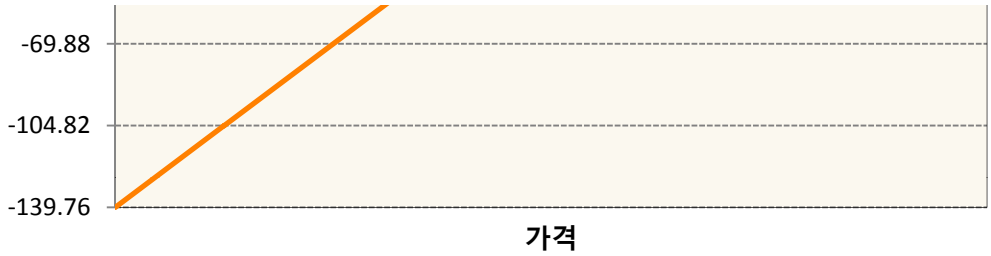
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,231	0	2,231	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	2018-03-21
기준일	2018-03-20

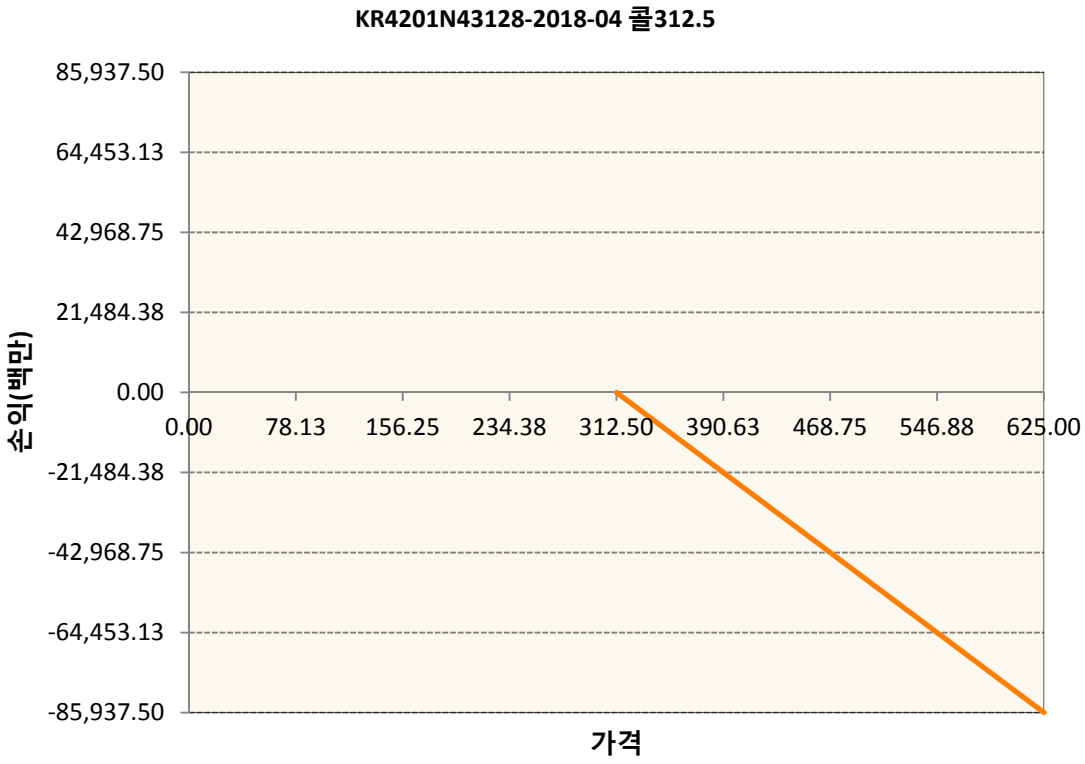
커버드콜모(주식혼합-파생형)

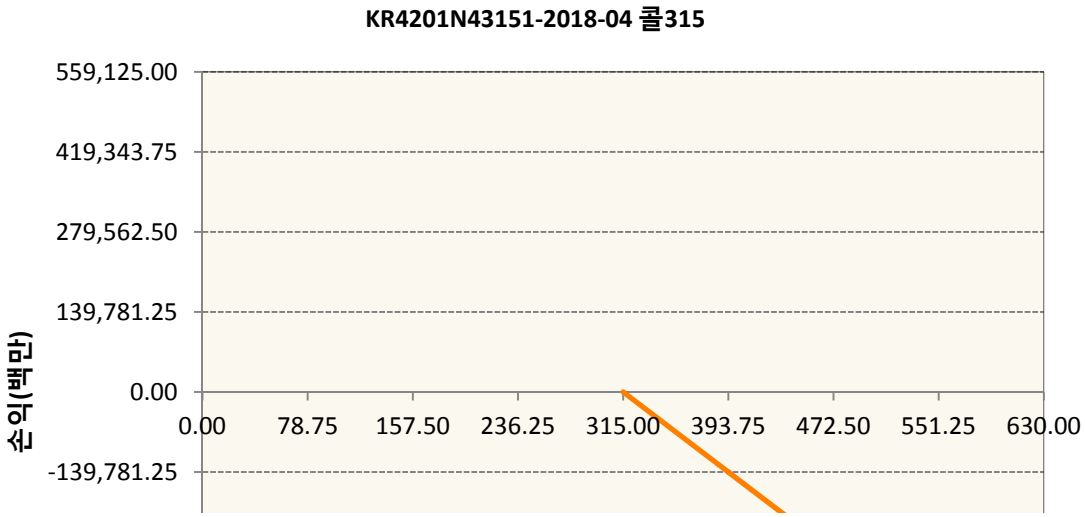
1. 계약금액

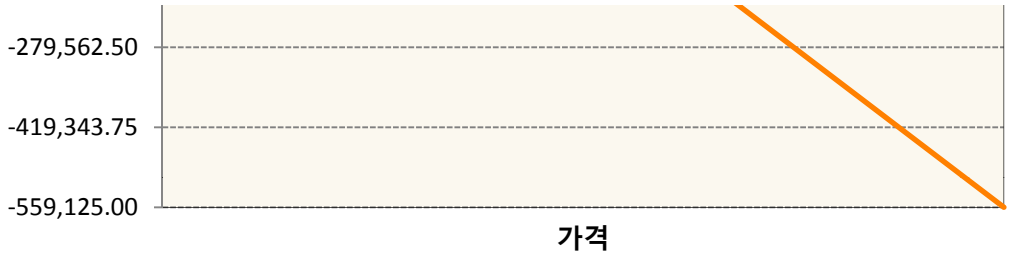
(단위:백만원)

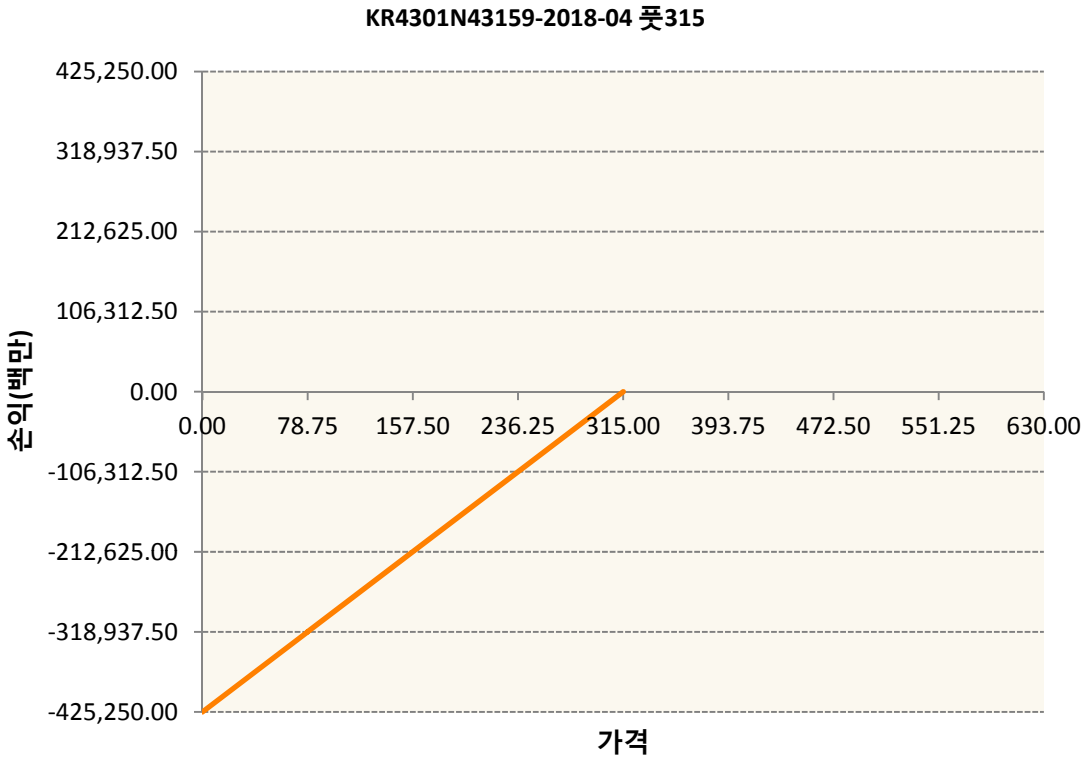
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	1,070,313	-1,070,313	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201N4312018-04 콜312.5							6,158
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	3,550	3,435	3,309	3,174	3,032	2,884	2,731
-5.33%	3,007	2,835	2,659	2,481	2,301	2,119	1,936
-2.67%	2,011	1,816	1,621	1,426	1,232	1,037	842
0%	524	353	178	0	-181	-365	-550
2.67%	-1,367	-1,485	-1,614	-1,753	-1,900	-2,054	-2,213
5.33%	-3,517	-3,582	-3,662	-3,755	-3,861	-3,976	-4,101
8.00%	-5,797	-5,827	-5,869	-5,923	-5,990	-6,069	-6,158
KR4201N4312018-04 콜315							38,667
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	20,658	20,022	19,305	18,521	17,681	16,794	15,868

-5.33%	17,824	16,795	15,729	14,636	13,520	12,387	11,239
-2.67%	12,291	11,035	9,777	8,519	7,260	6,000	4,740
0%	3,596	2,413	1,213	0	-1,223	-2,454	-3,691
2.67%	-7,917	-8,793	-9,735	-10,728	-11,762	-12,830	-13,927
5.33%	-21,376	-21,897	-22,514	-23,213	-23,983	-24,814	-25,698
8.00%	-35,896	-36,150	-36,492	-36,920	-37,430	-38,015	-38,667
KR4301N4312018-04 풋315							23,282
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-22,178	-22,274	-22,407	-22,577	-22,780	-23,016	-23,282
-5.33%	-11,439	-11,783	-12,162	-12,567	-12,995	-13,442	-13,904
-2.67%	-3,090	-3,666	-4,244	-4,823	-5,402	-5,983	-6,564
0%	1,488	1,009	512	0	-524	-1,057	-1,597
2.67%	3,065	2,857	2,604	2,313	1,987	1,631	1,250
5.33%	3,389	3,339	3,260	3,149	3,005	2,829	2,621
8.00%	3,429	3,422	3,406	3,377	3,330	3,263	3,174

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

67,068

공시일	2018-03-21
기준일	2018-03-20

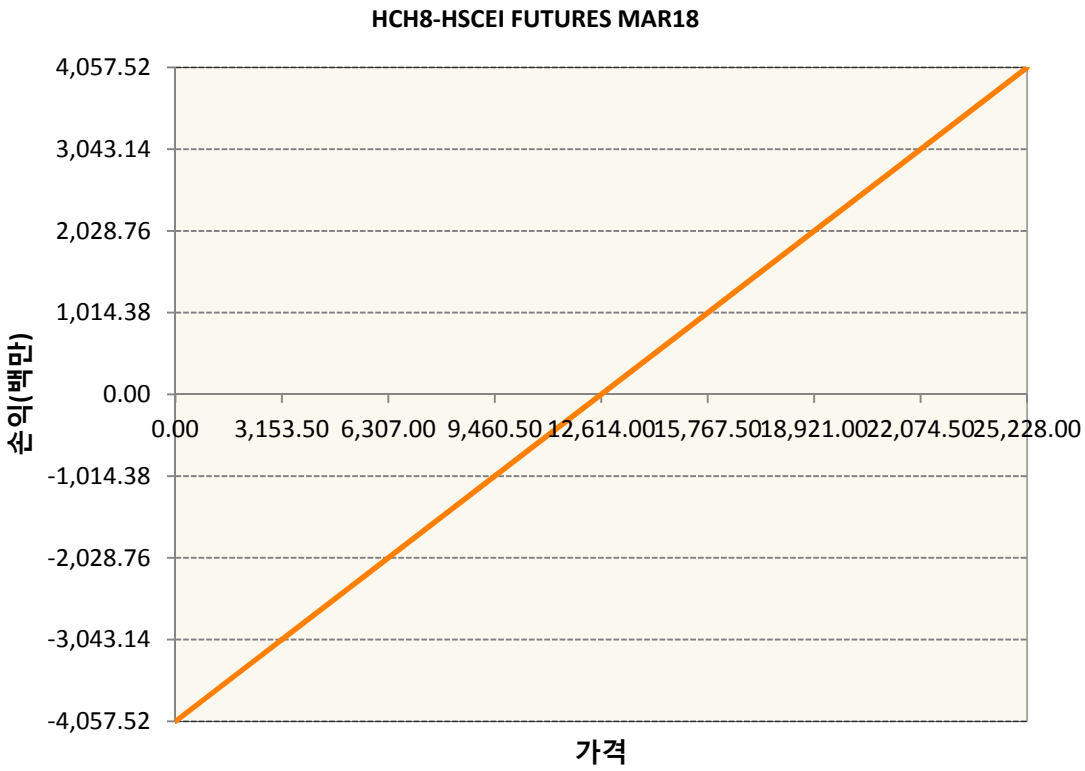
홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생

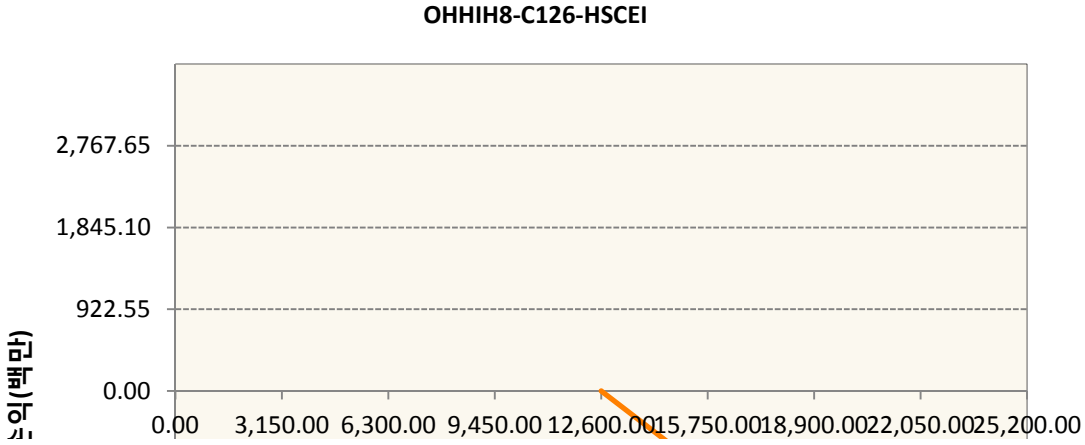
1. 계약금액

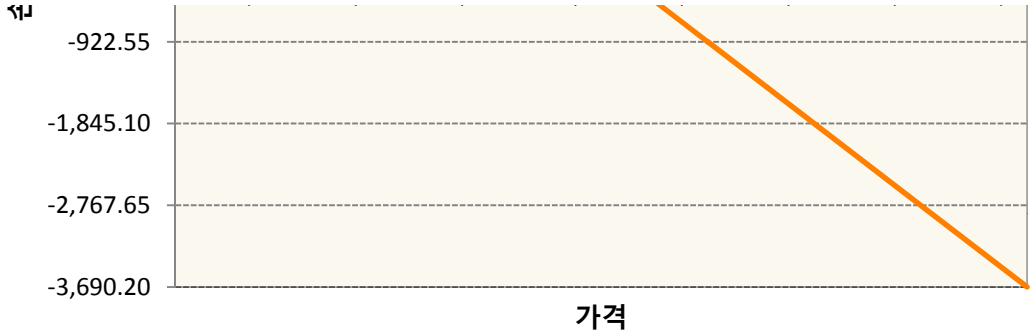
(단위:백만원)

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	4,058	0	4,058	장내
누계	유가증권	옵션	0	9,473	-9,473	장내

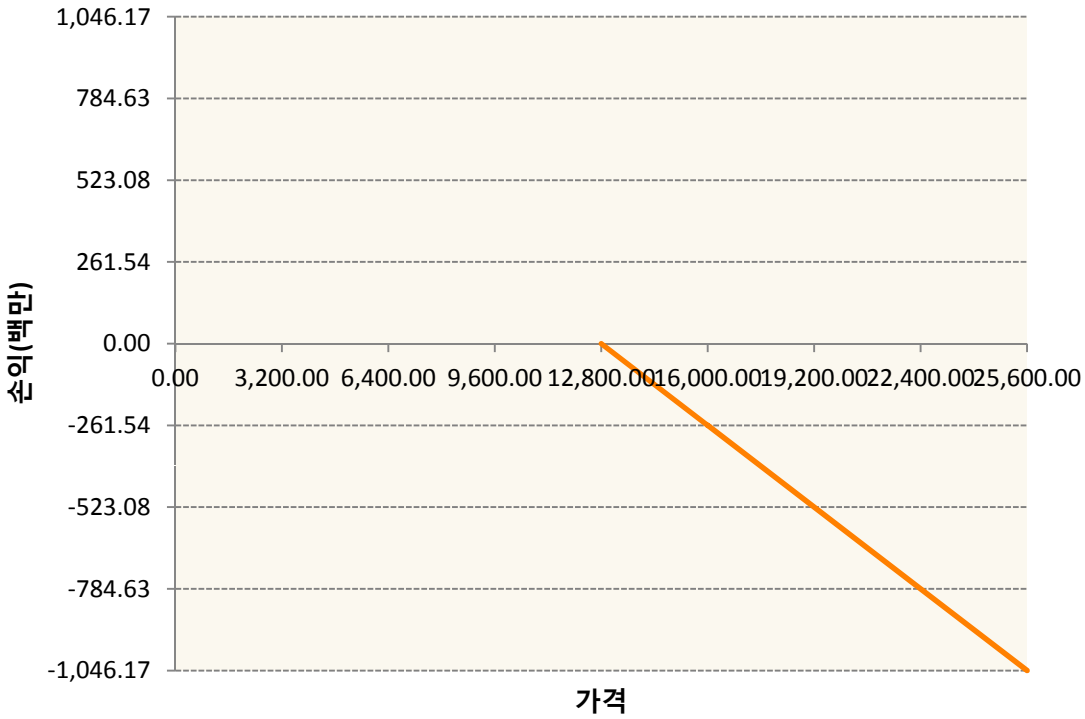
2. 만기시점의 손익구조



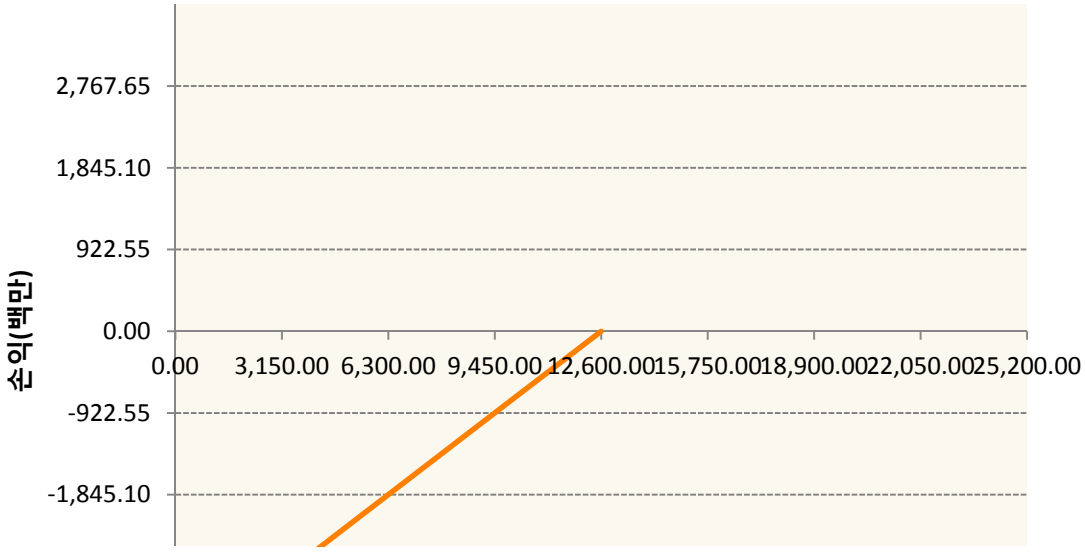


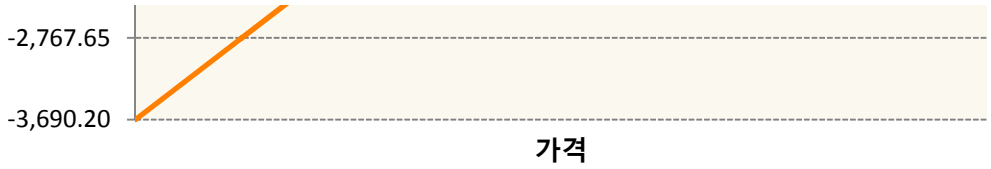


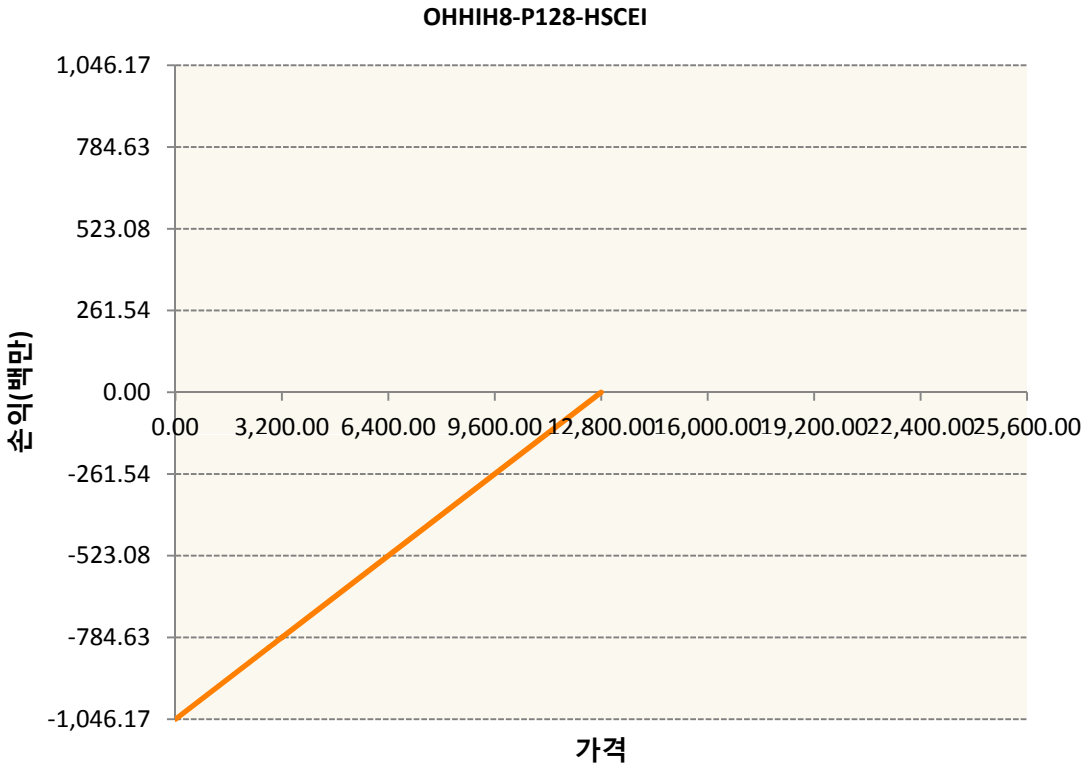
OHHIH8-C128-HSCEI



OHHIH8-P126-HSCEI







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCH8	HSCEI FUTURES MAR18	325
OHHIH8-C12	HSCEI	295
OHHIH8-C12	HSCEI	84
OHHIH8-P12	HSCEI	295
OHHIH8-P12	HSCEI	84

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	943

공시일	2018-03-21
기준일	2018-03-20

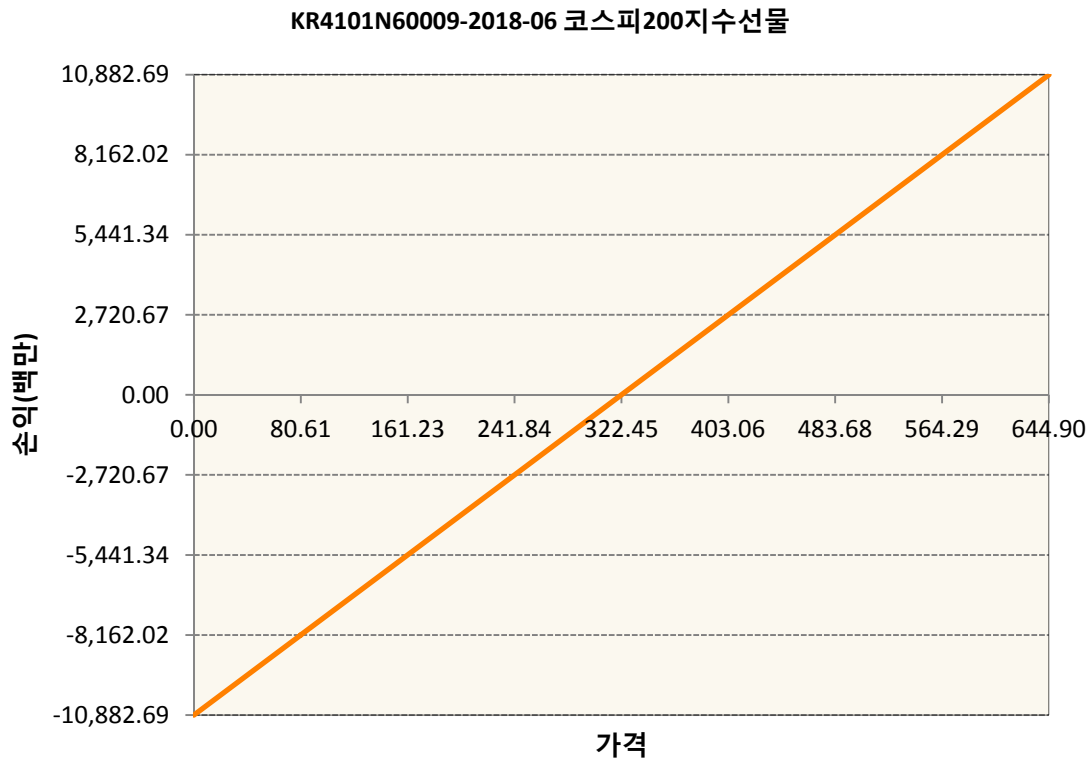
코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼

1. 계약금액

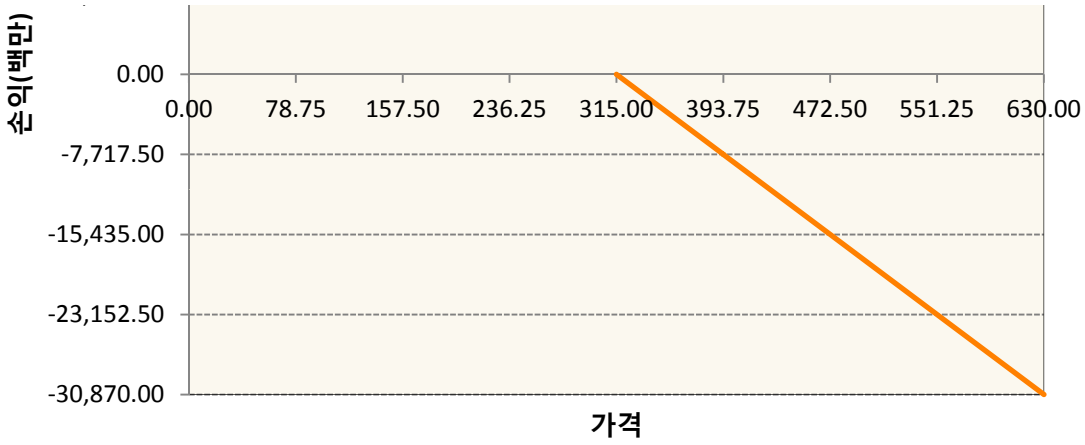
(단위:백만원)

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	10,883	0	10,883	장내
누계	유가증권	스왑	54,200	0	54,200	장외
누계	유가증권	옵션	0	55,718	-55,718	장내

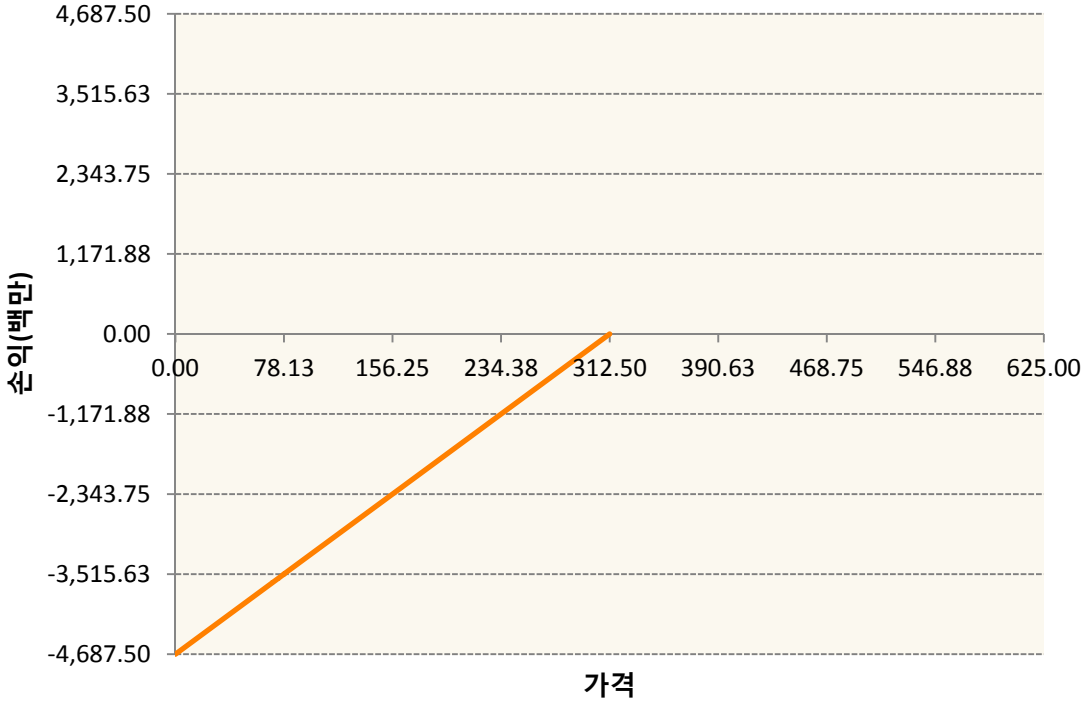
2. 만기시점의 손익구조



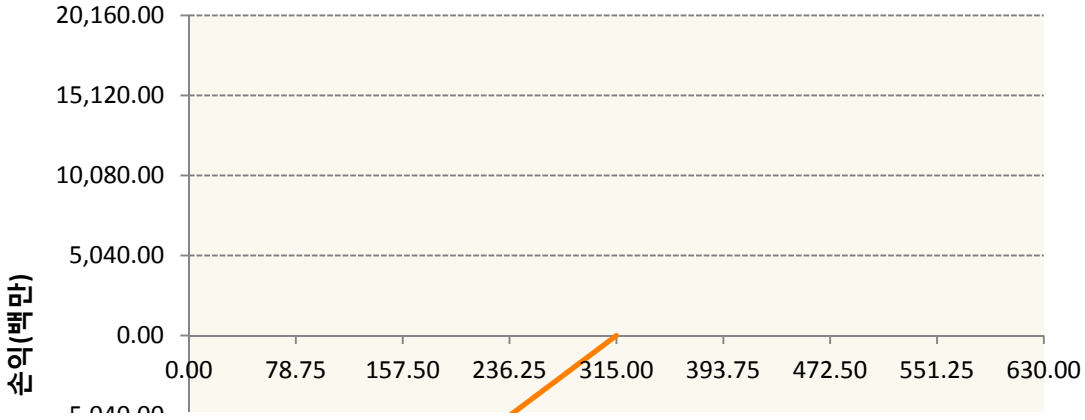




KR4301N43126-2018-04 풋312.5



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						628
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-628	-628	-628	-628	-628	-628	-628
-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%	628	628	628	628	628	628	628
	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						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%	-579	-579	-579	-579	-579	-579	-579
-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%	579	579	579	579	579	579	579
8.00%	869	869	869	869	869	869	869
	KR4201N431 2018-04 콜315						2,135
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,141	1,105	1,066	1,023	976	927	876
-5.33%	984	927	868	808	746	684	621
-2.67%	679	609	540	470	401	331	262
0%	199	133	67	0	-68	-135	-204
2.67%	-437	-485	-537	-592	-649	-708	-769
5.33%	-1,180	-1,209	-1,243	-1,282	-1,324	-1,370	-1,419
8.00%	-1,982	-1,996	-2,015	-2,038	-2,067	-2,099	-2,135
	KR4301N431 2018-04 풋312.5						236
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-220	-222	-224	-227	-230	-233	-236
-5.33%	-106	-111	-116	-121	-127	-132	-138
-2.67%	-25	-31	-38	-44	-51	-57	-64
0%	14	10	5	0	-5	-11	-16
2.67%	26	24	22	19	17	13	10
5.33%	28	27	27	26	25	23	21
8.00%	28	28	28	27	27	27	26
	KR4301N431 2018-04 풋315						1,104

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,051	-1,056	-1,062	-1,070	-1,080	-1,091	-1,104
-5.33%	-542	-559	-577	-596	-616	-637	-659
-2.67%	-146	-174	-201	-229	-256	-284	-311
0%	71	48	24	0	-25	-50	-76
2.67%	145	135	123	110	94	77	59
5.33%	161	158	155	149	142	134	124
8.00%	163	162	161	160	158	155	150

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

8,244

공시일	2018-03-21
기준일	2018-03-20

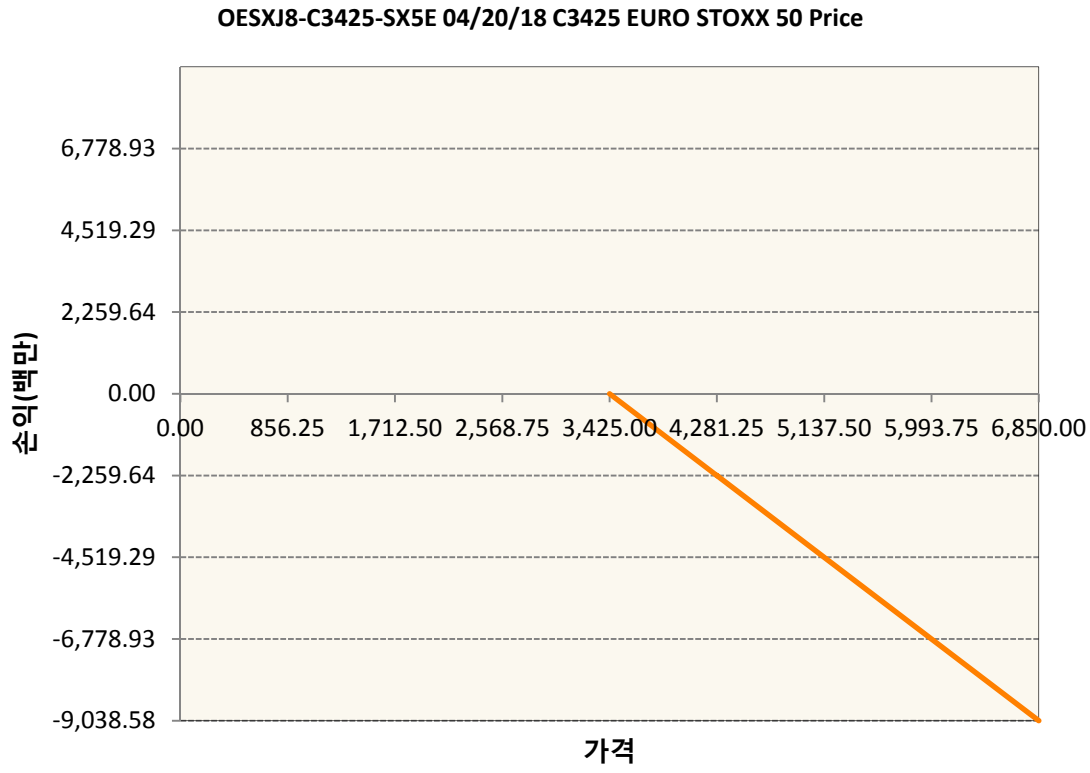
유로커버드콜모(주식혼합-파생형

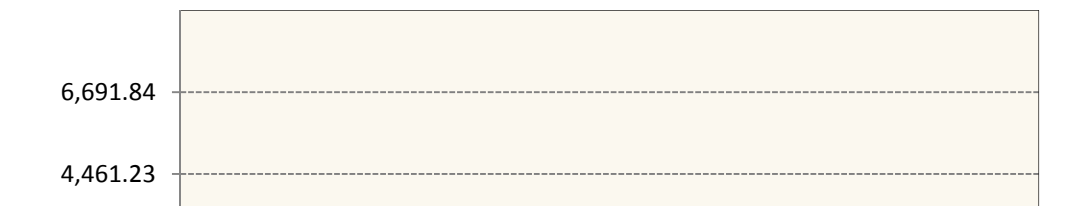
1. 계약금액

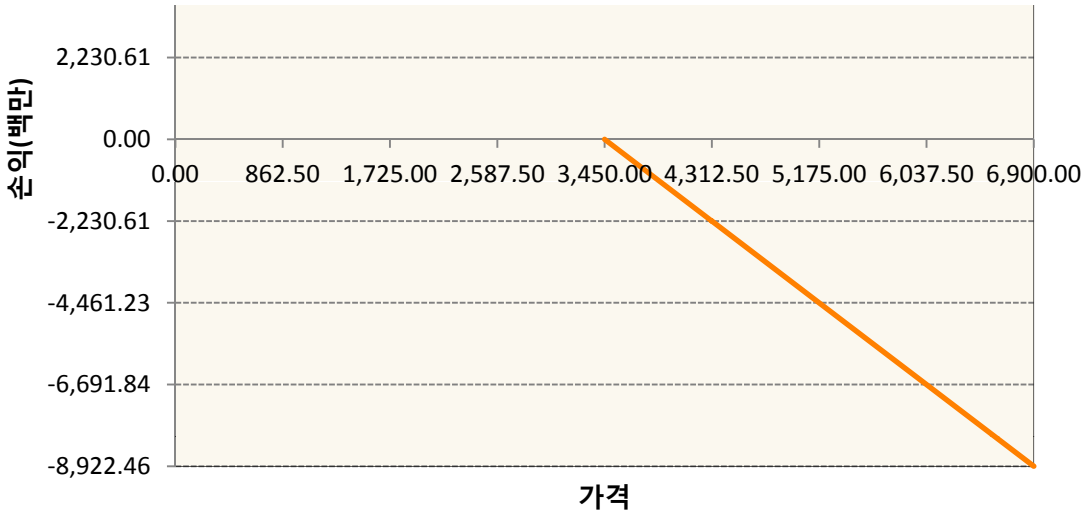
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	9,207	0	9,207	
누계	유가증권	스왑	98,963	0	98,963	장외
누계	유가증권	옵션	0	35,922	-35,922	장내
누계	지수	스왑	52,781	0	52,781	장외

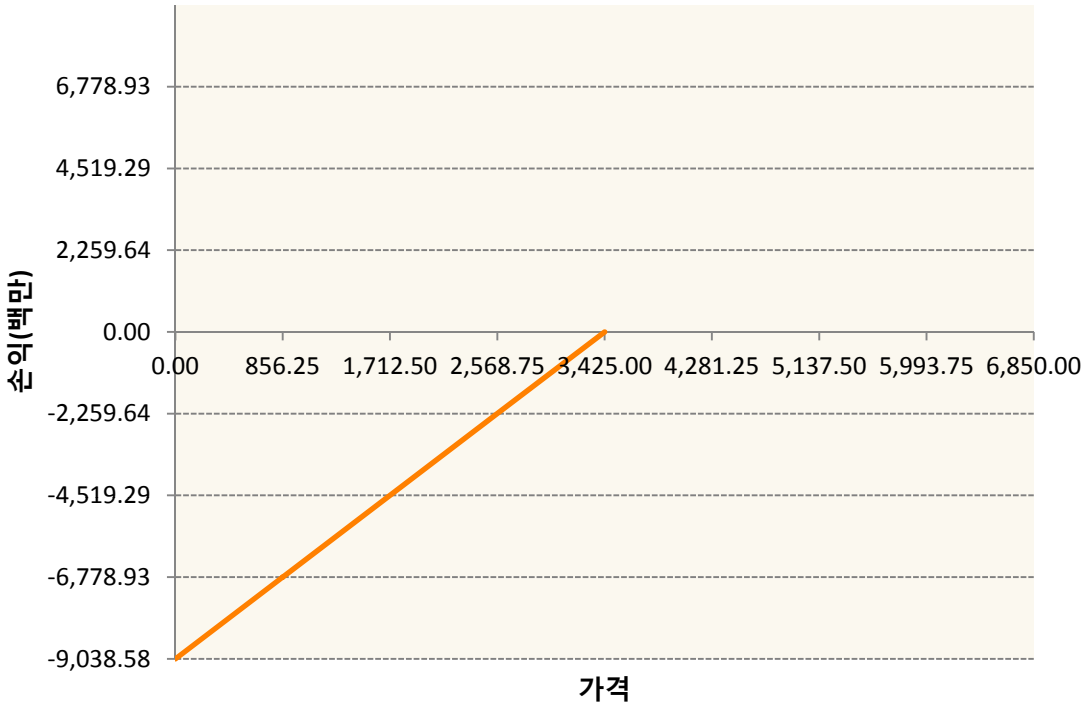
2. 만기시점의 손익구조



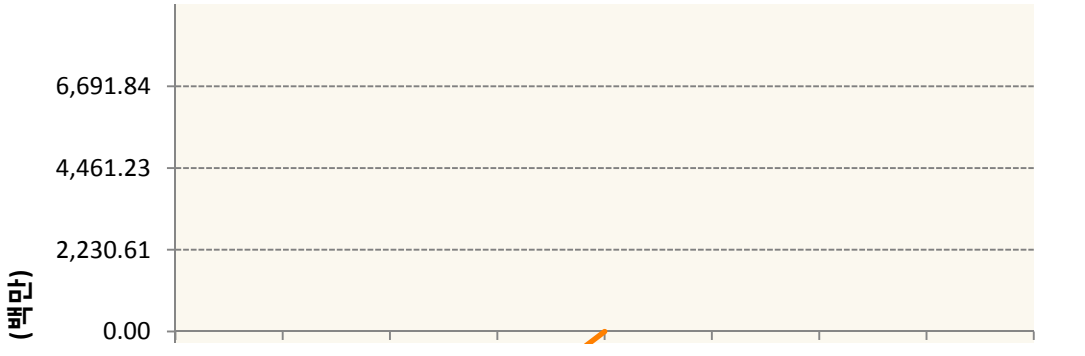


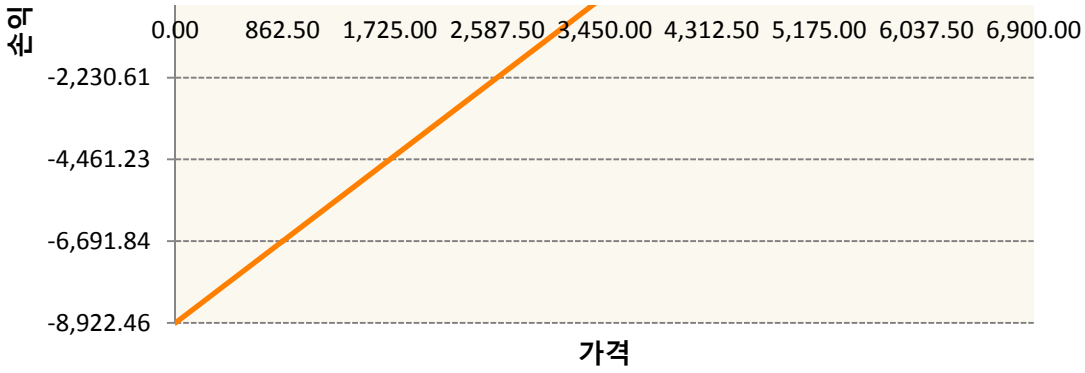


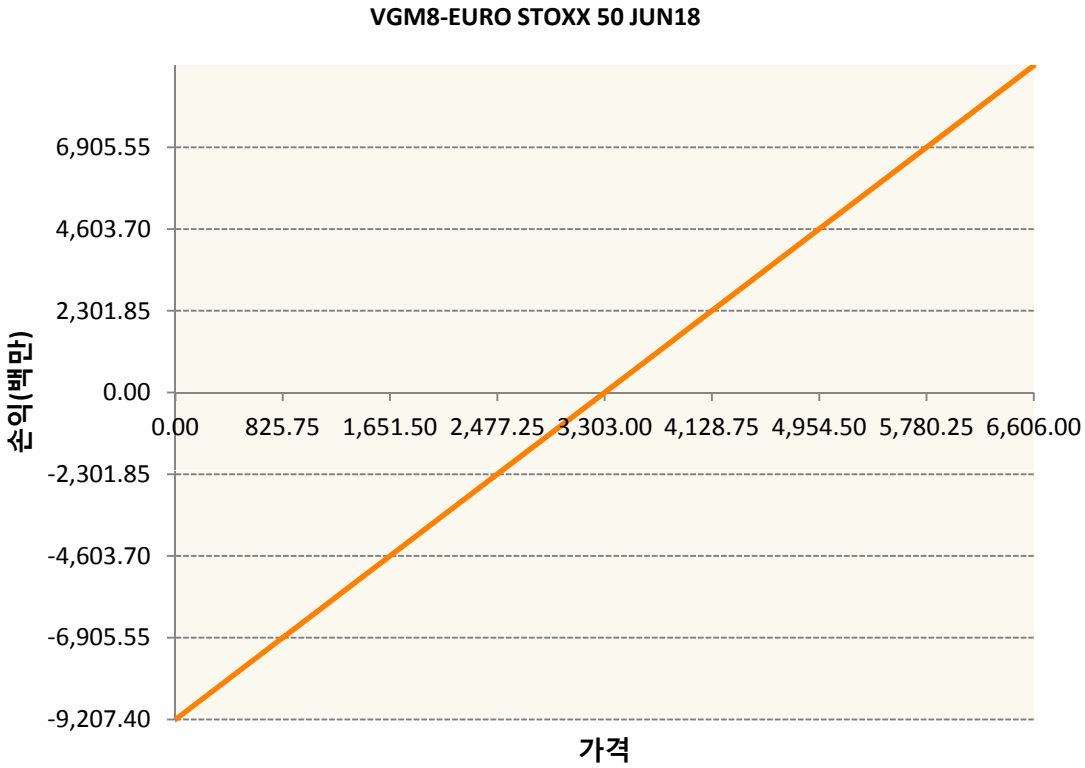
OESXJ8-P3425-SX5E 04/20/18 P3425 EURO STOXX 50 Price



OESXJ8-P3450-SX5E 04/20/18 P3450 EURO STOXX 50 Price







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)	(단위:백만원)
260105SGPX SG EURO Covered CALL STRATEGY - 994.569	186
260105SQPX SG EURO Covered CALL STRATEGY	348
OESXJ8-C34 SX5E 04/20/18 C3425 EURO STOXX 50 Price	723
OESXJ8-C34 SX5E 04/20/18 C3450 EURO STOXX 50 Price	714
OESXJ8-P34 SX5E 04/20/18 P3425 EURO STOXX 50 Price	723
OESXJ8-P34 SX5E 04/20/18 P3450 EURO STOXX 50 Price	714
VGM8 EURO STOXX 50 JUN18	737

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

2,472

공시일	2018-03-21
기준일	2018-03-20

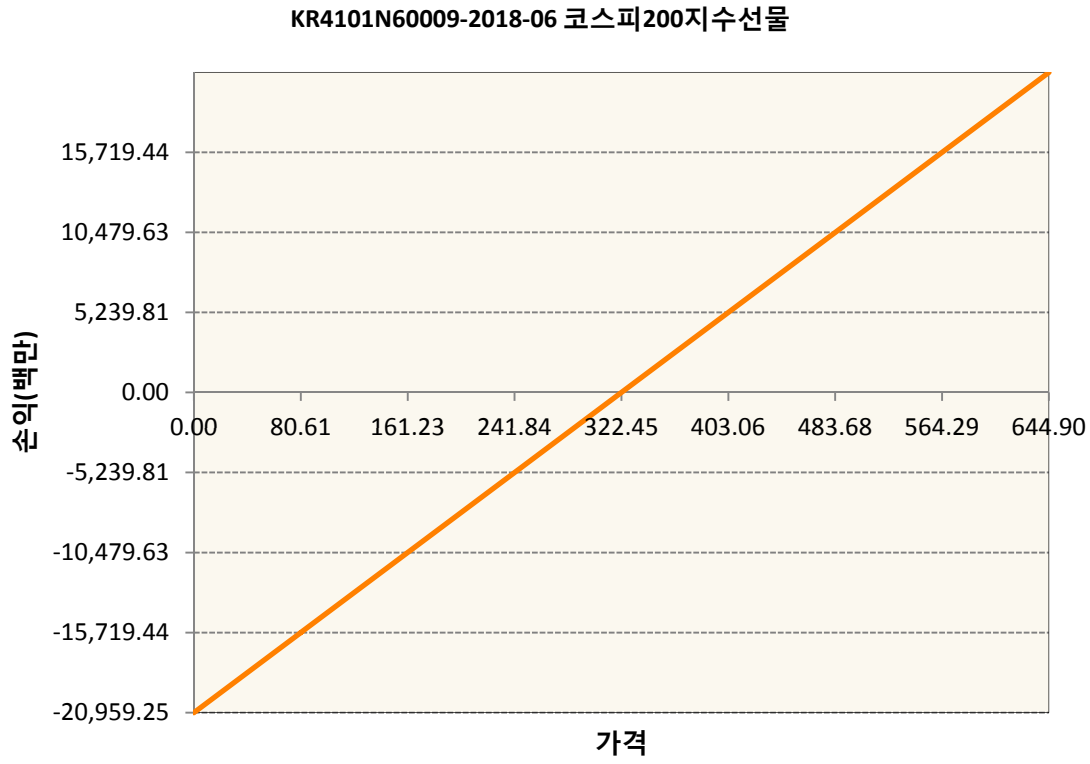
ETF스마트레버리지목표전환형8호

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	20,959	0	20,959	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101N60(2018-06 코스피200지수선물							1,673
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,673	-1,673	-1,673	-1,673	-1,673	-1,673	-1,673
-5.33%	-1,116	-1,116	-1,116	-1,116	-1,116	-1,116	-1,116
-2.67%	-558	-558	-558	-558	-558	-558	-558
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	558	558	558	558	558	558	558
5.33%	1,116	1,116	1,116	1,116	1,116	1,116	1,116
8.00%	1,673	1,673	1,673	1,673	1,673	1,673	1,673

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

1,159

공시일	2018-03-21
기준일	2018-03-20

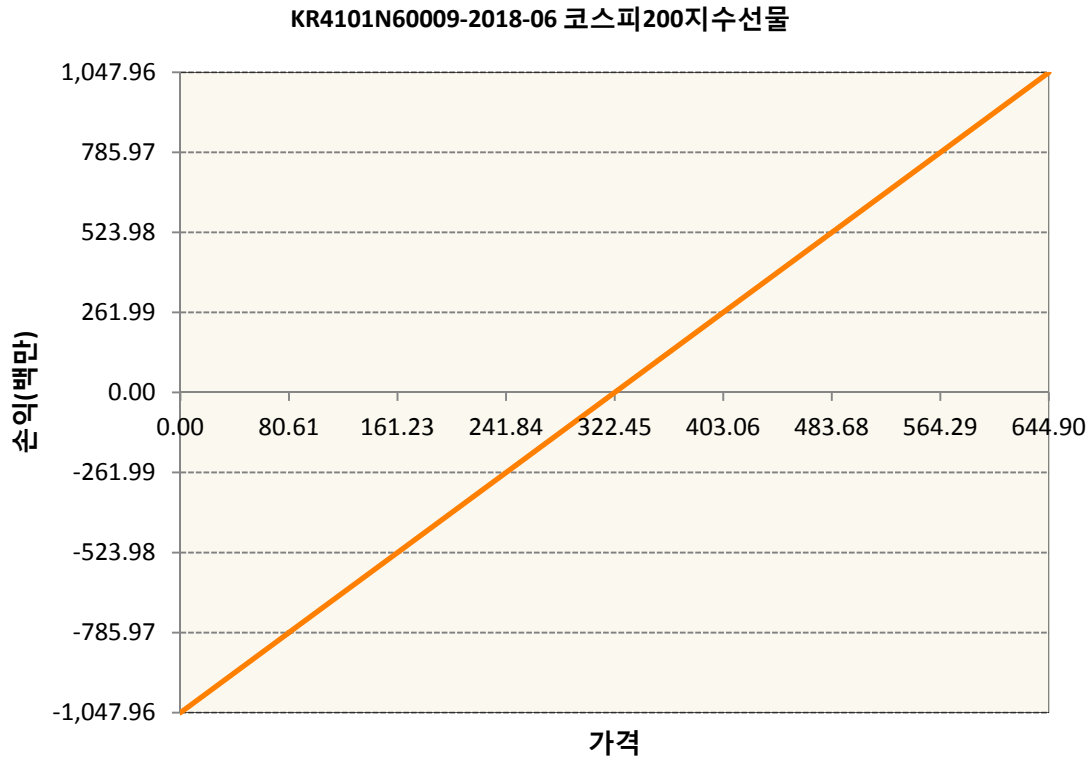
ETF스마트레버리지목표전환형9호

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	1,048	0	1,048	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	2018-03-21
기준일	2018-03-20

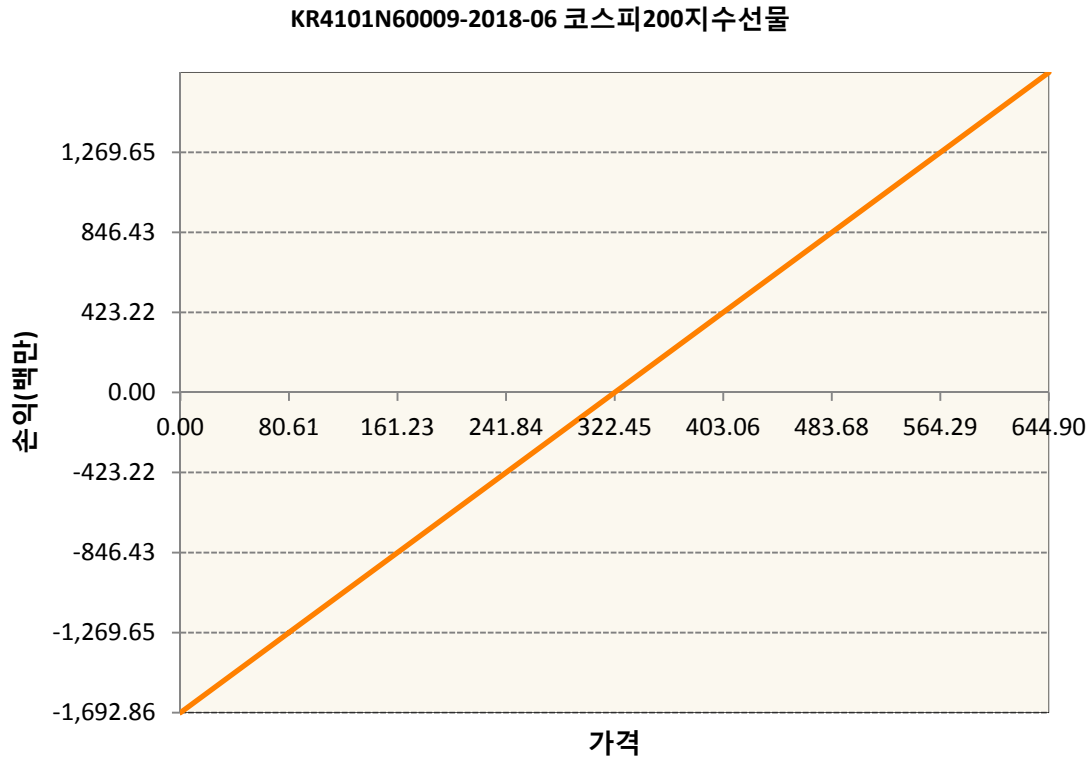
ETF스마트레버리지목표전환형10

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	1,693	0	1,693	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	2018-03-21
기준일	2018-03-20

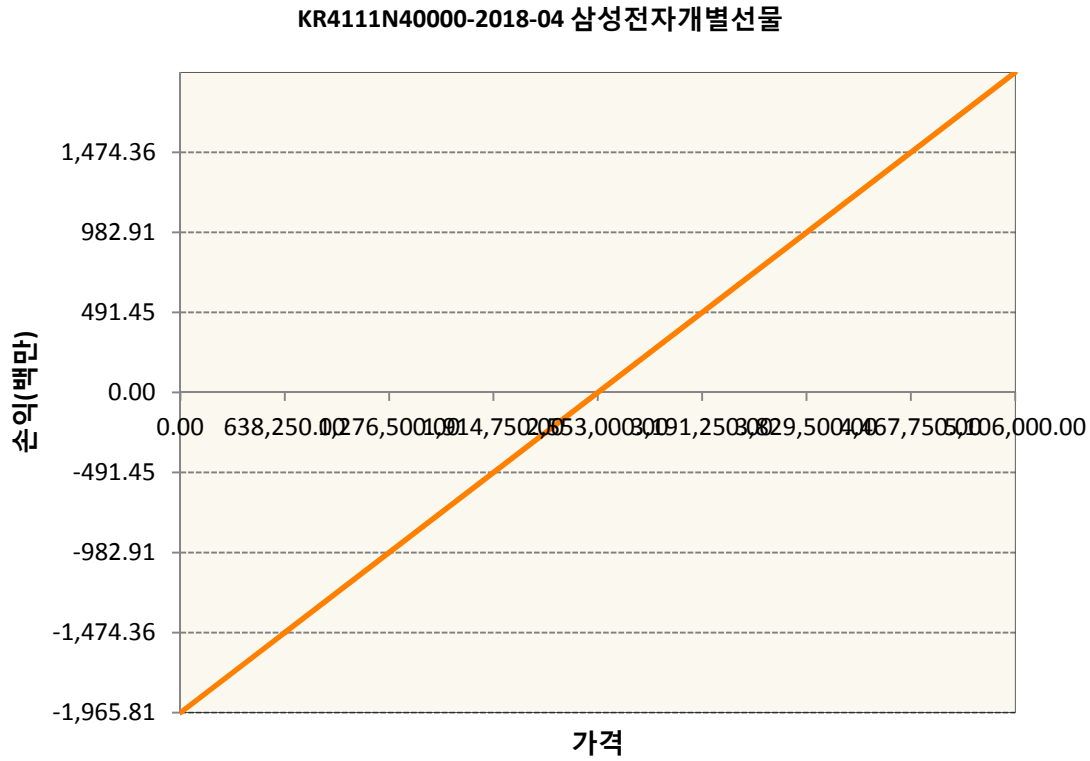
스마트KRX300인덱스1호(주식-파

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	1,966	0	1,966	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4111N40(2018-04 삼성전자개별선물							158
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-158	-158	-158	-158	-158	-158	-158
-5.33%	-105	-105	-105	-105	-105	-105	-105
-2.67%	-53	-53	-53	-53	-53	-53	-53
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	53	53	53	53	53	53	53
5.33%	105	105	105	105	105	105	105
8.00%	158	158	158	158	158	158	158

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

189

공시일	2018-03-21
기준일	2018-03-20

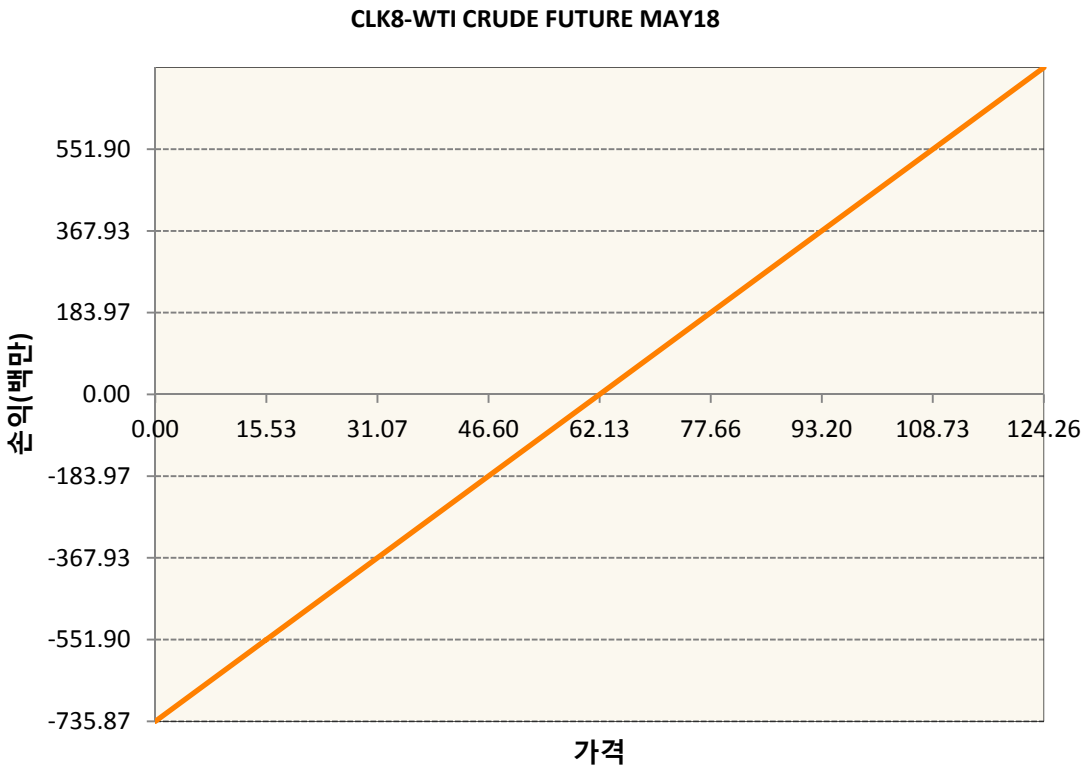
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

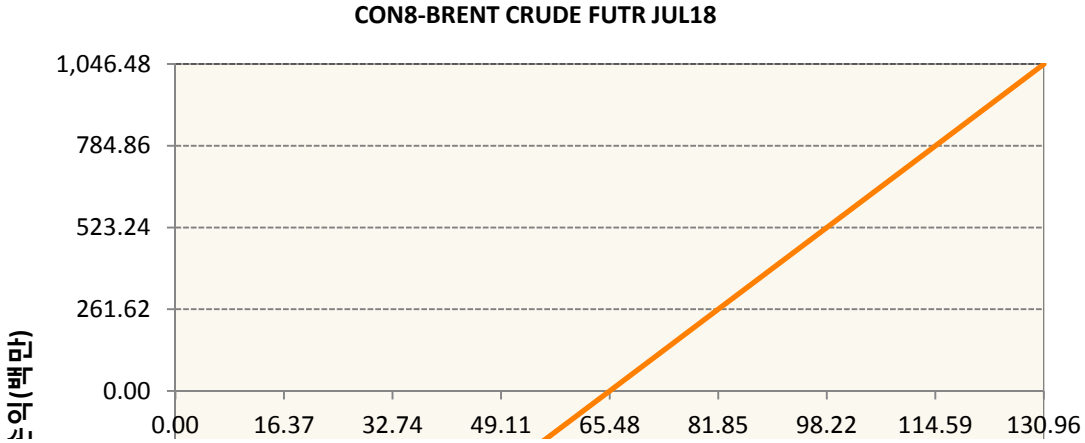
1. 계약금액

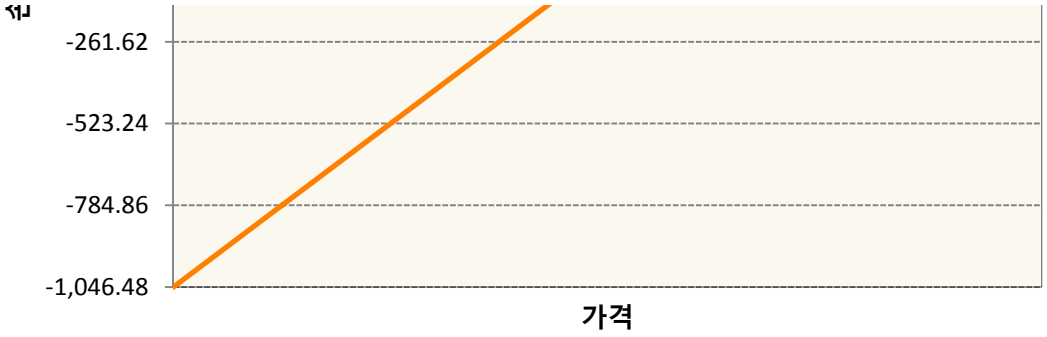
(단위:백만원)

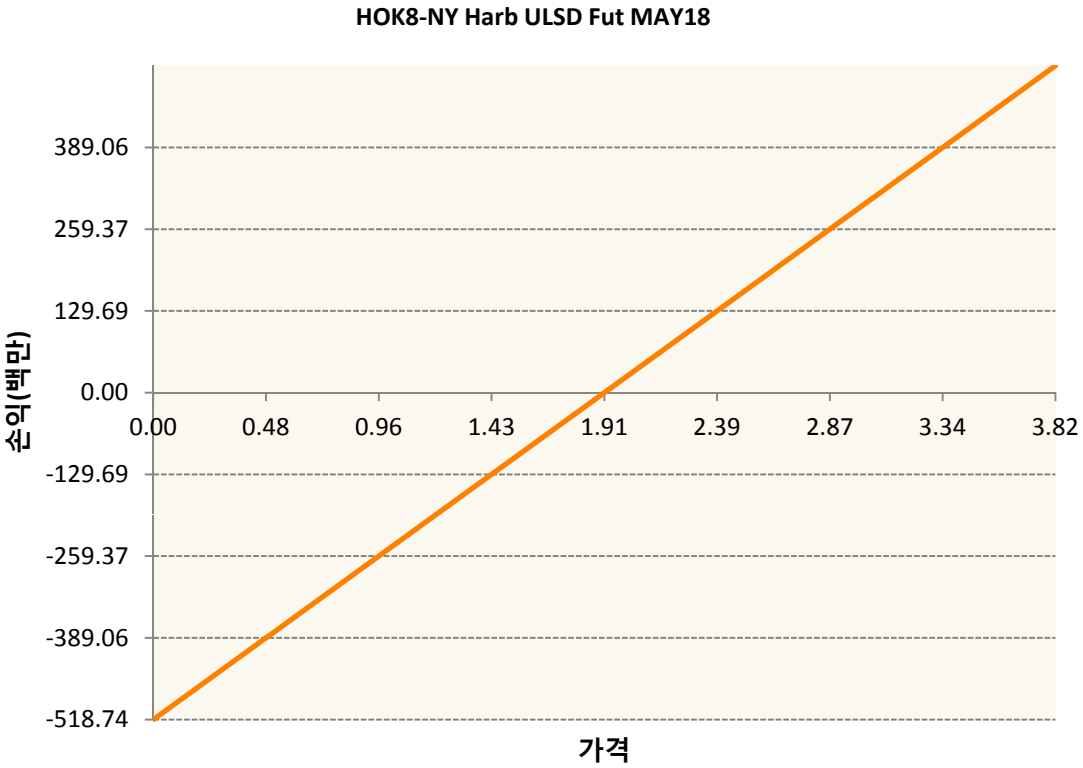
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	선물	유가증권	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	선물	유가증권	736	0	736	
누계	유가증권	선물	3,217	587	2,630	

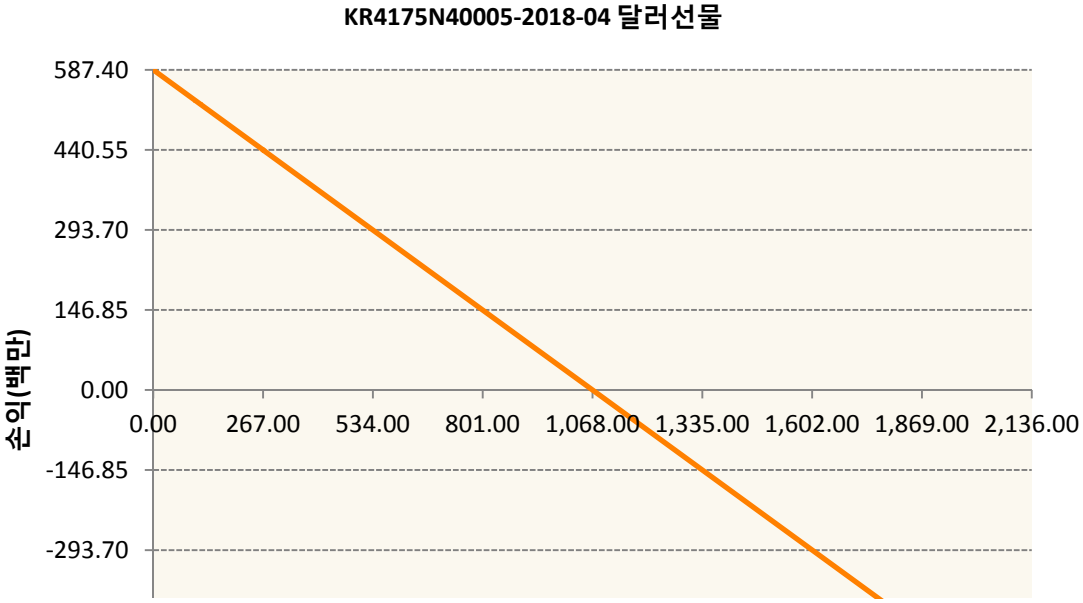
2. 만기시점의 손익구조

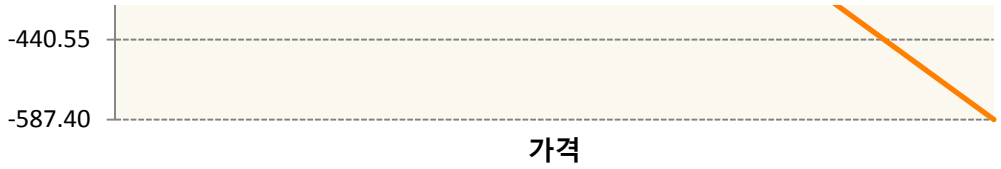


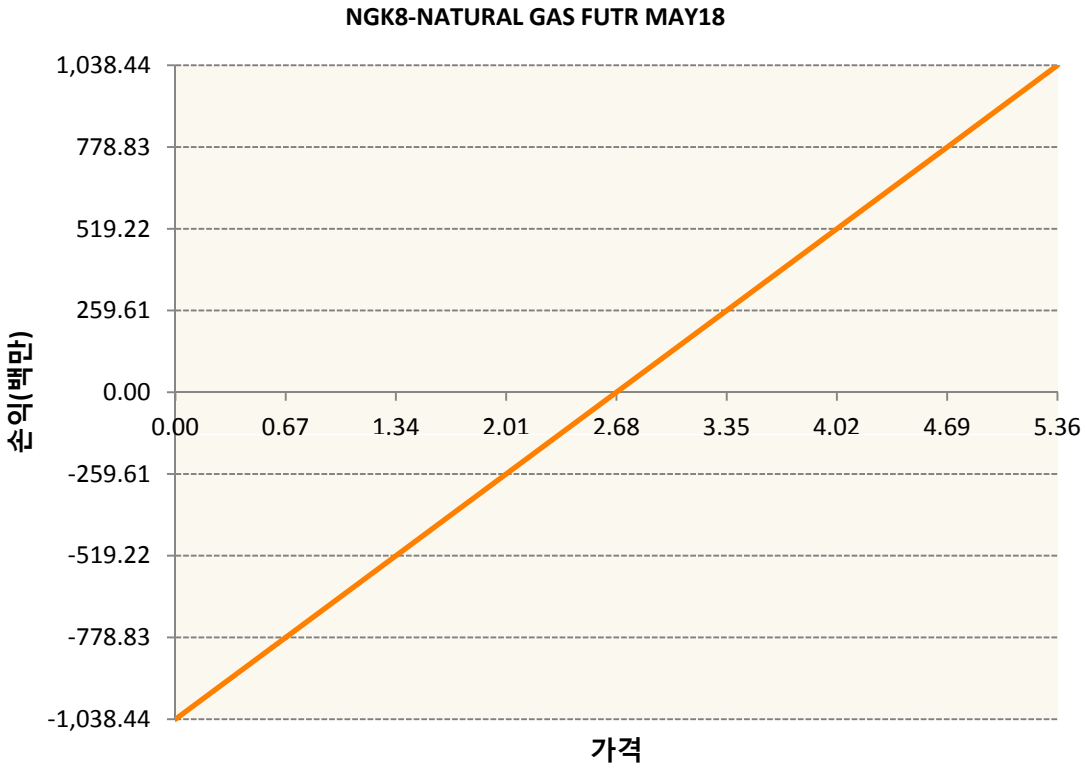


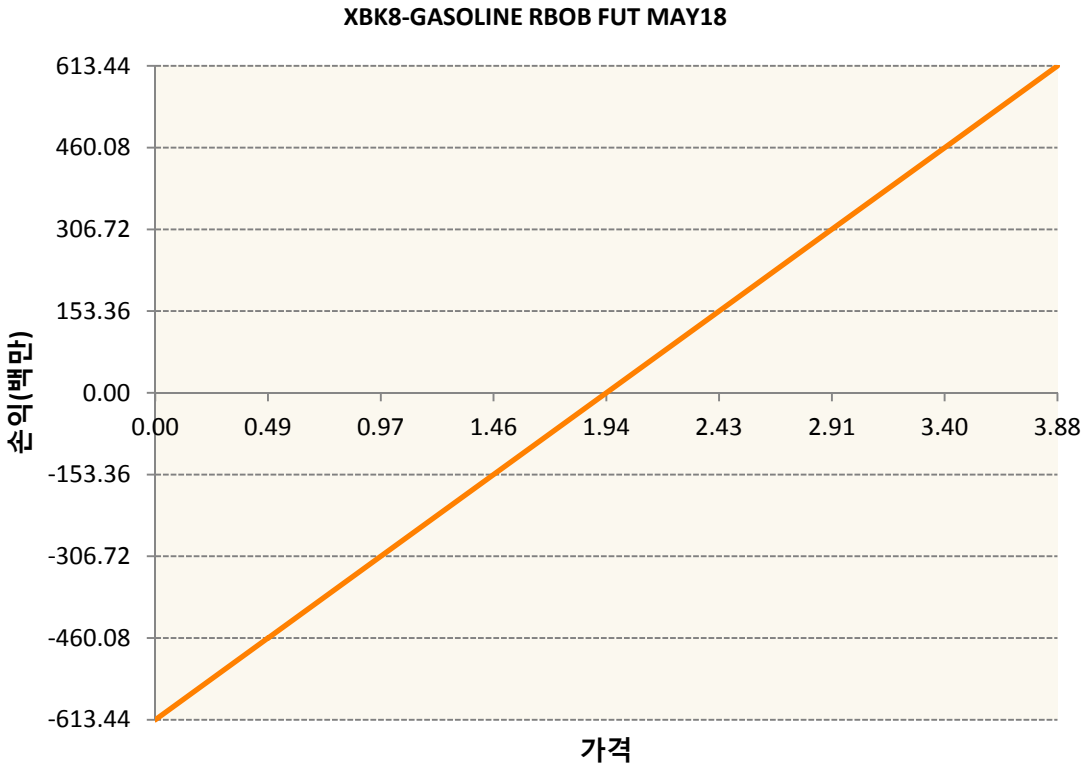

-261.62
-523.24
-784.86
-1,046.48
가격


HOK8-NY Harb ULSD Fut MAY18
389.06
259.37
129.69
0.00
-129.69
-259.37
-389.06
-518.74
0.00
0.48
0.96
1.43
1.91
2.39
2.87
3.34
3.82
손익(백만)
가격


KR4175N40005-2018-04 달러선물
587.40
440.55
293.70
146.85
0.00
-146.85
-293.70
0.00
267.00
534.00
801.00
1,068.00
1,335.00
1,602.00
1,869.00
2,136.00
손익(백만)


-440.55
-587.40
가격


NGK8-NATURAL GAS FUTR MAY18
1,038.44
778.83
519.22
259.61
0.00
-259.61
-519.22
-778.83
-1,038.44
0.00
0.67
1.34
2.01
2.68
3.35
4.02
4.69
5.36
손익(백만)
가격


XBK8-GASOLINE RBOB FUT MAY18
613.44
460.08
306.72
153.36
0.00
-153.36
-306.72
-460.08
-613.44
0.00
0.49
0.97
1.46
1.94
2.43
2.91
3.40
3.88
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	41
KR4175N40(	2018-04 달러선물	47
NGK8	NATURAL GAS FUTR MAY18	83
XBK8	GASOLINE RBOB FUT MAY18	49

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

516

공시일	2018-03-21
기준일	2018-03-20

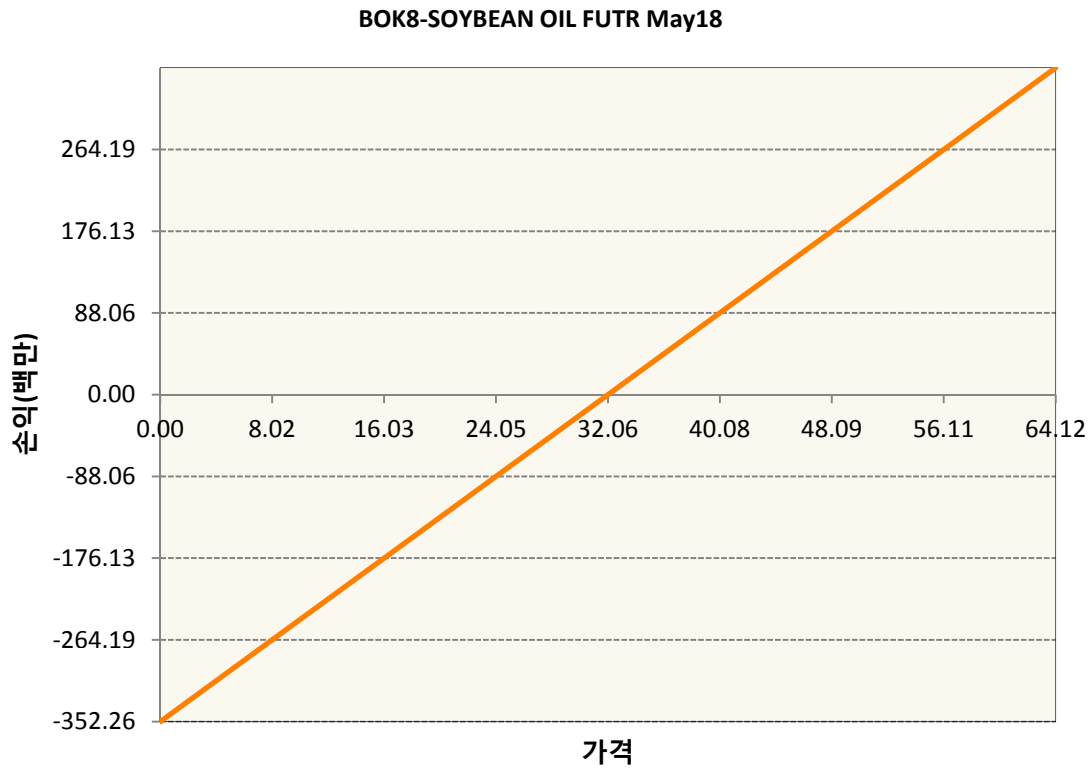
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

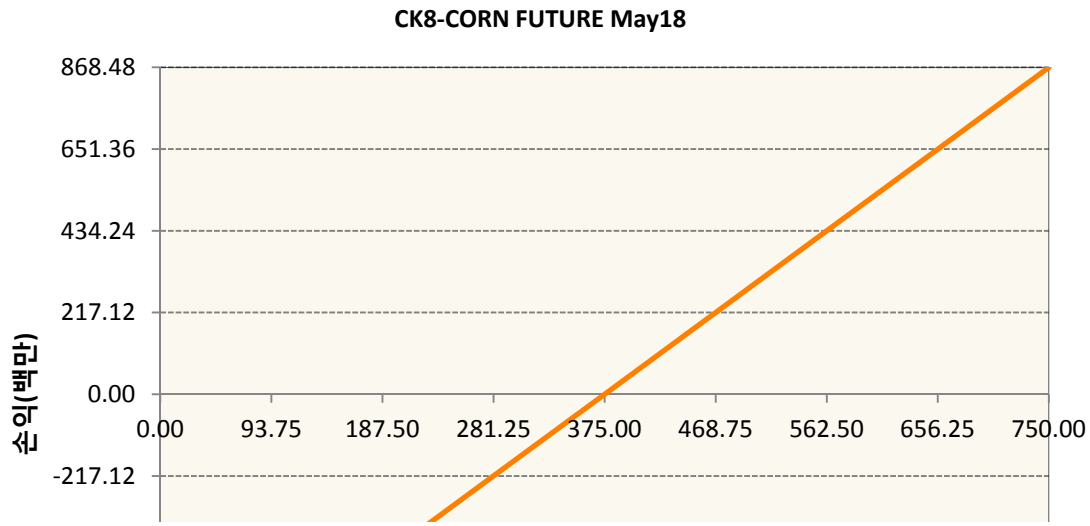
1. 계약금액

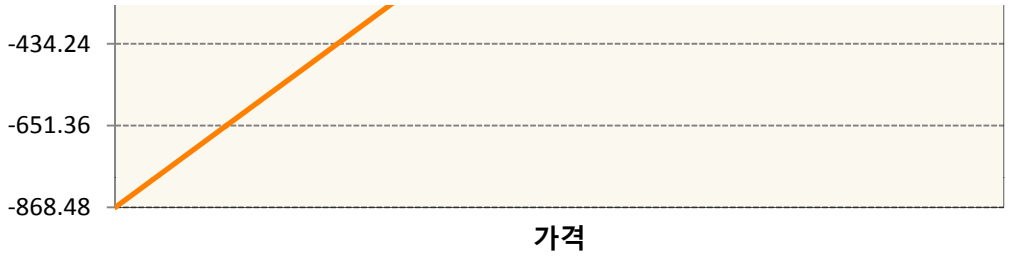
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	4,054	320	3,734	

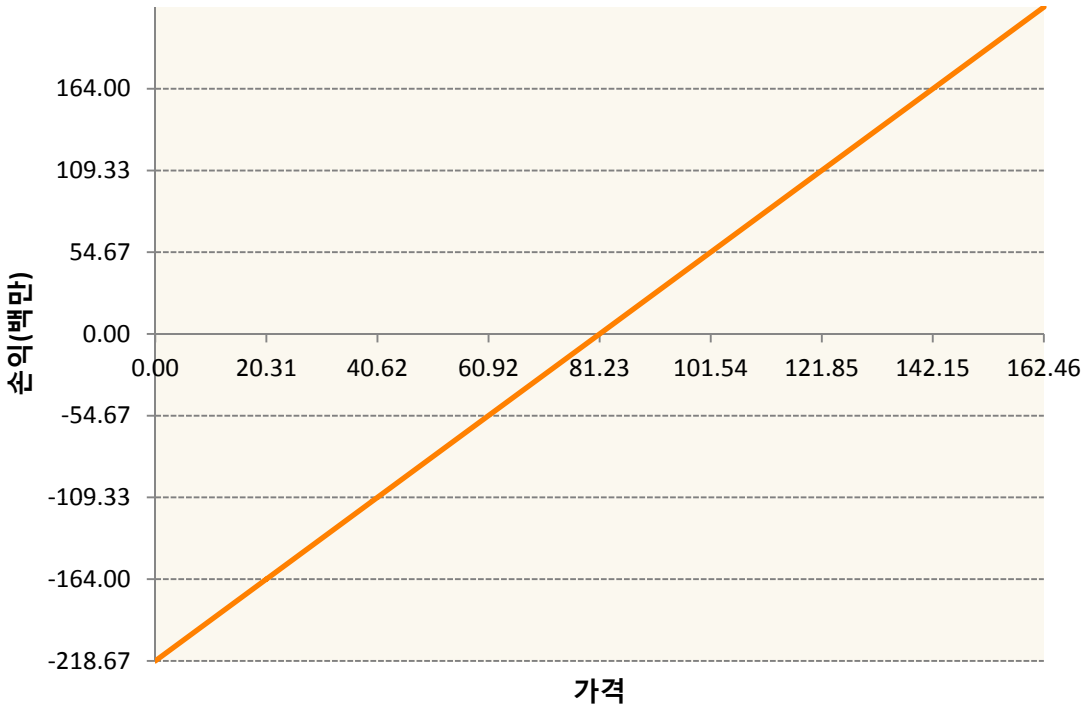
2. 만기시점의 손익구조



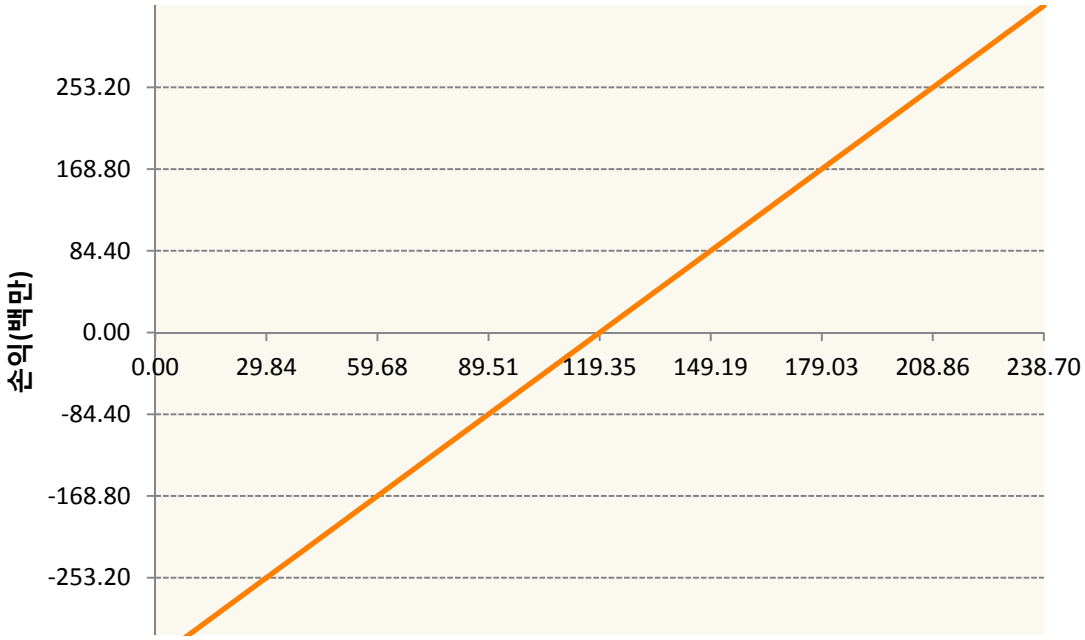


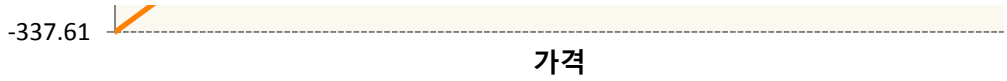


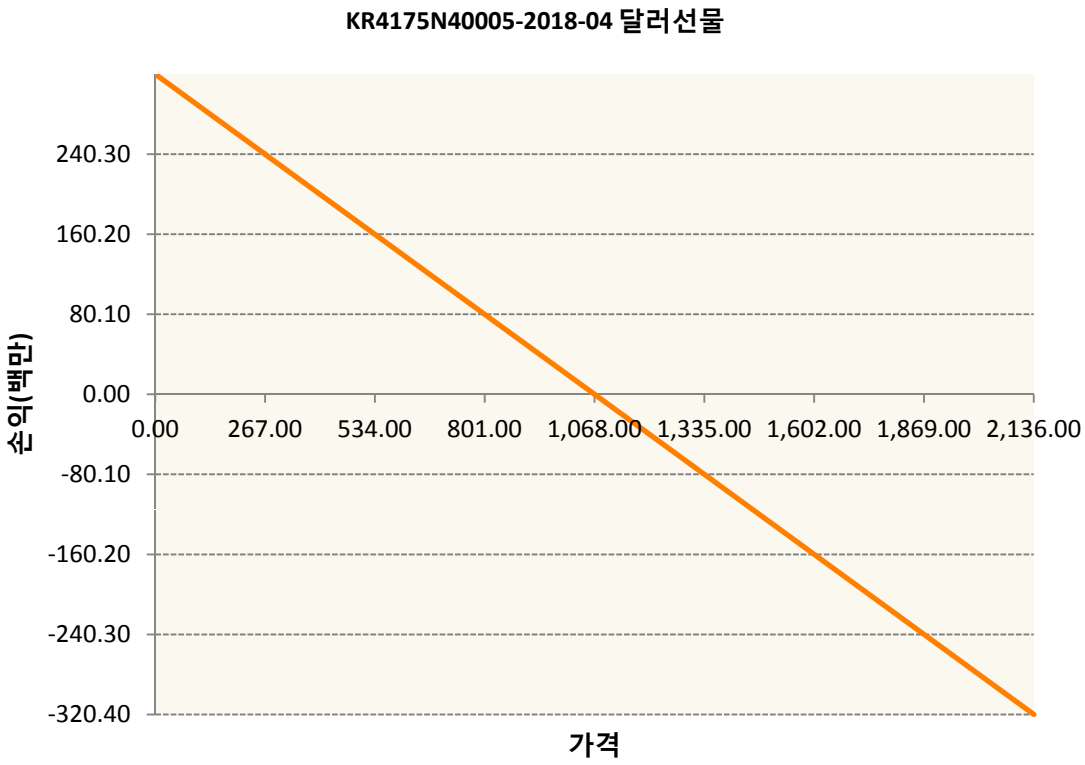
CTK8-COTTON NO.2 FUTR May18

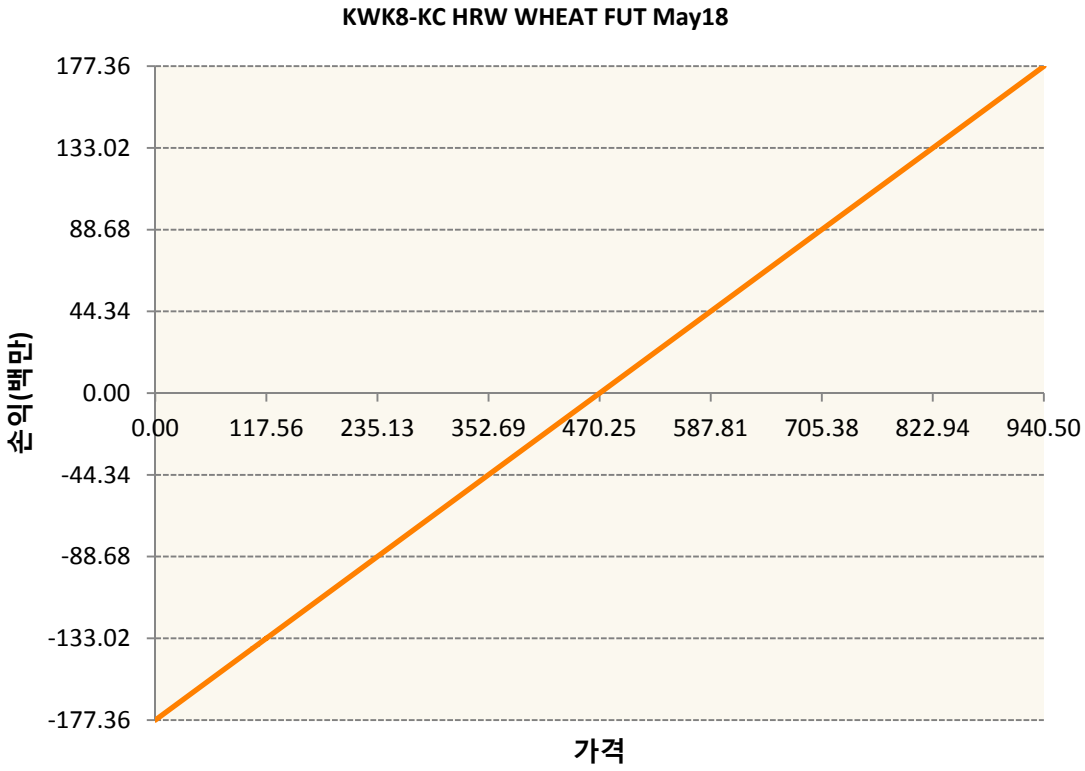


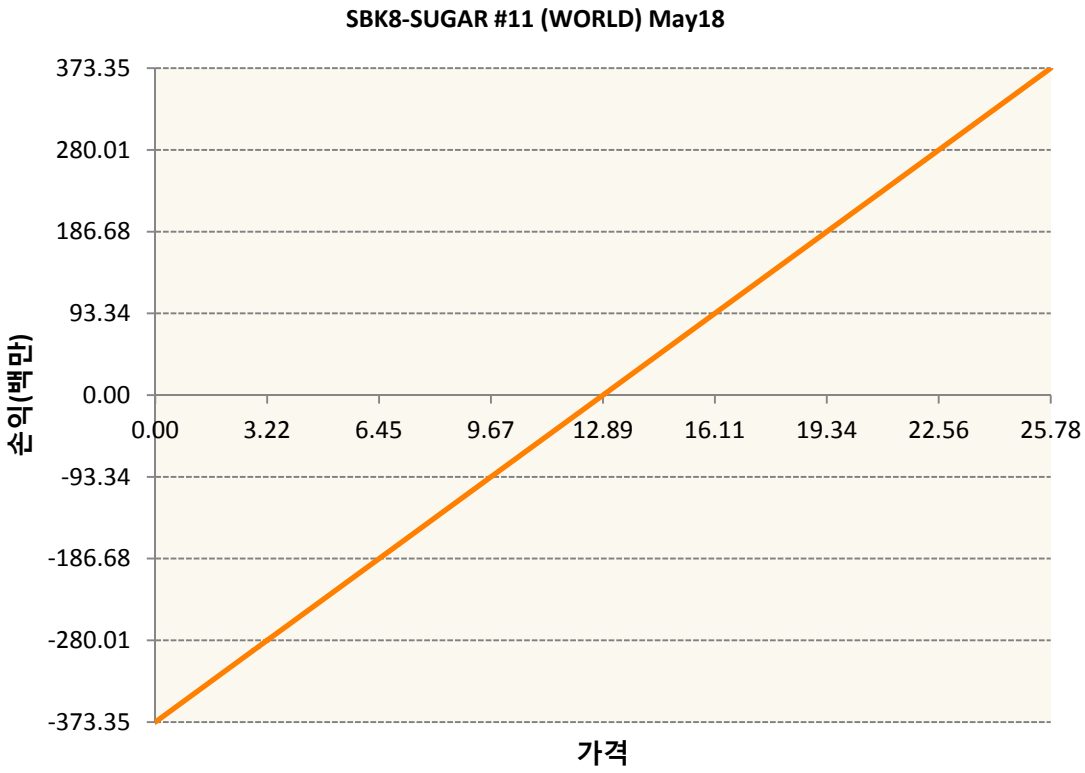
KCK8-COFFEE 'C' FUTURE May18

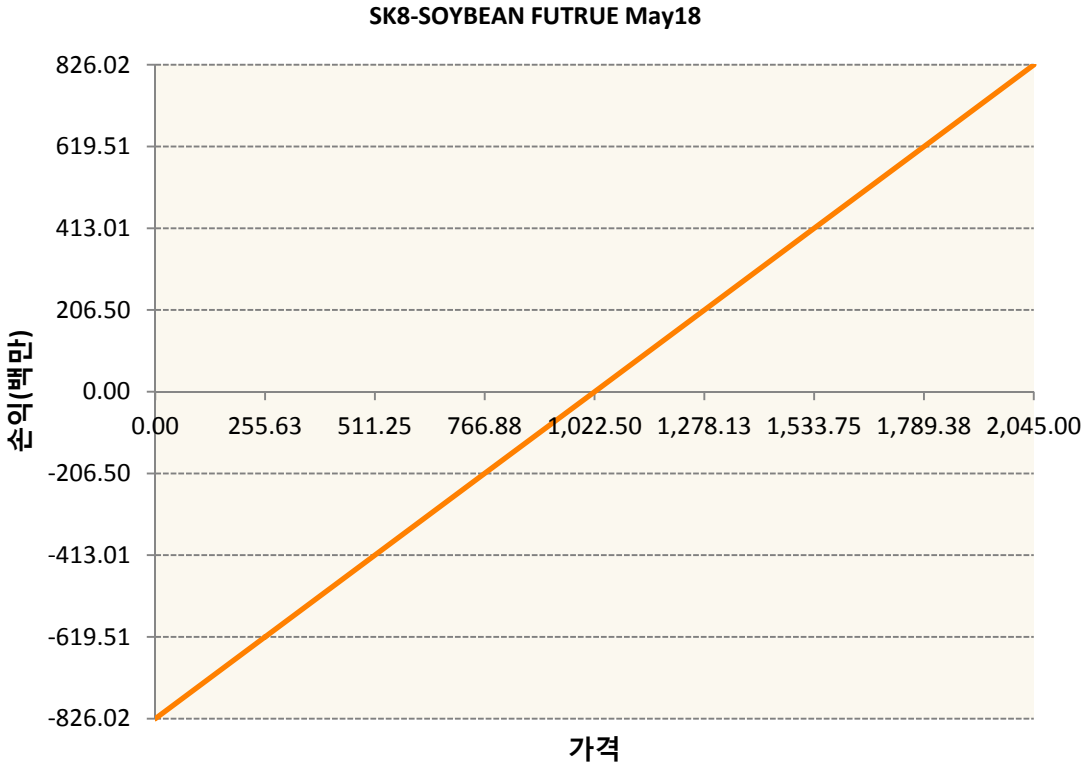



-337.61
가격

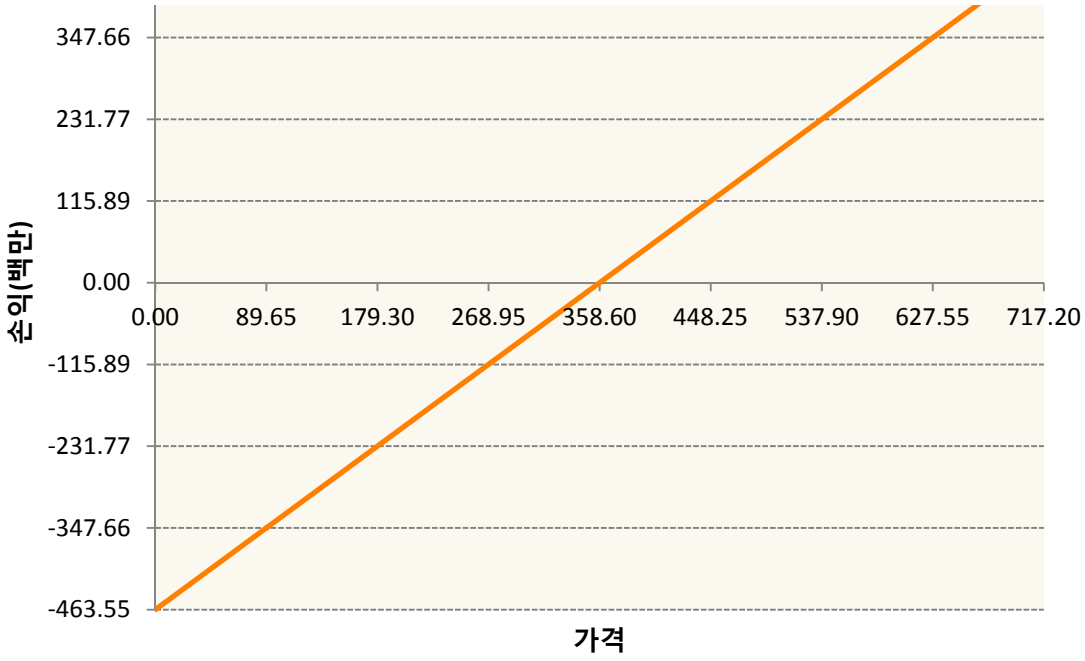

KR4175N40005-2018-04 달러선물
240.30
160.20
80.10
0.00
-80.10
-160.20
-240.30
-320.40
0.00
267.00
534.00
801.00
1,068.00
1,335.00
1,602.00
1,869.00
2,136.00
손익(백만)
가격


KWK8-KC HRW WHEAT FUT May18
177.36
133.02
88.68
44.34
0.00
-44.34
-88.68
-133.02
-177.36
0.00
117.56
235.13
352.69
470.25
587.81
705.38
822.94
940.50
손익(백만)
가격

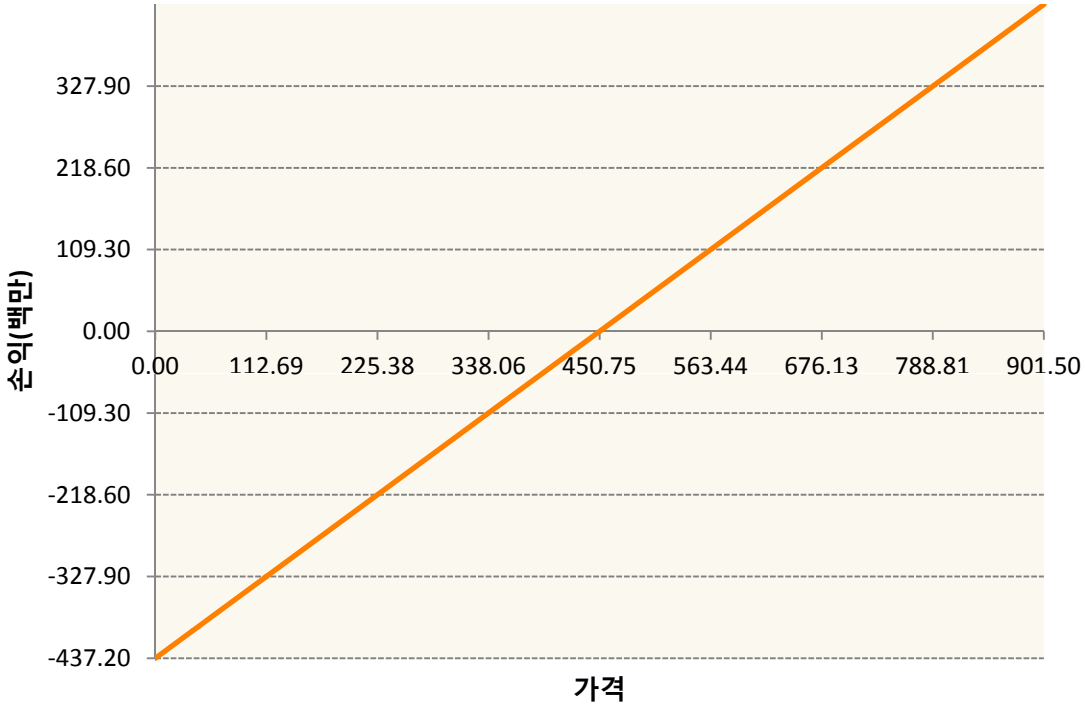

SBK8-SUGAR #11 (WORLD) May18
373.35
280.01
186.68
93.34
0.00
-93.34
-186.68
-280.01
-373.35
0.00
3.22
6.45
9.67
12.89
16.11
19.34
22.56
25.78
손익(백만)
가격


SK8-SOYBEAN FUTRUE May18
826.02
619.51
413.01
206.50
0.00
-206.50
-413.01
-619.51
-826.02
0.00
255.63
511.25
766.88
1,022.50
1,278.13
1,533.75
1,789.38
2,045.00
손익(백만)
가격


SMK8-SOYBEAN MEAL FUTR May18
463.55



WK8-WHEAT FUTURE(CBT) May18



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

BOK8	SOYBEAN OIL FUTR May18	28
CK8	CORN FUTURE May18	69
CTK8	COTTON NO.2 FUTR May18	17
KCK8	COFFEE 'C' FUTURE May18	27
KR4175N40(	2018-04 달러선물	26

KWK8	KC HRW WHEAT FUT May18	14
SBK8	SUGAR #11 (WORLD) May18	30
SK8	SOYBEAN FUTRUE May18	66
SMK8	SOYBEAN MEAL FUTR May18	37
WK8	WHEAT FUTURE(CBT) May18	35

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

327