공시일	2018-03-22
기준일	2018-03-21

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	2018-03-22
기준일	2018-03-21

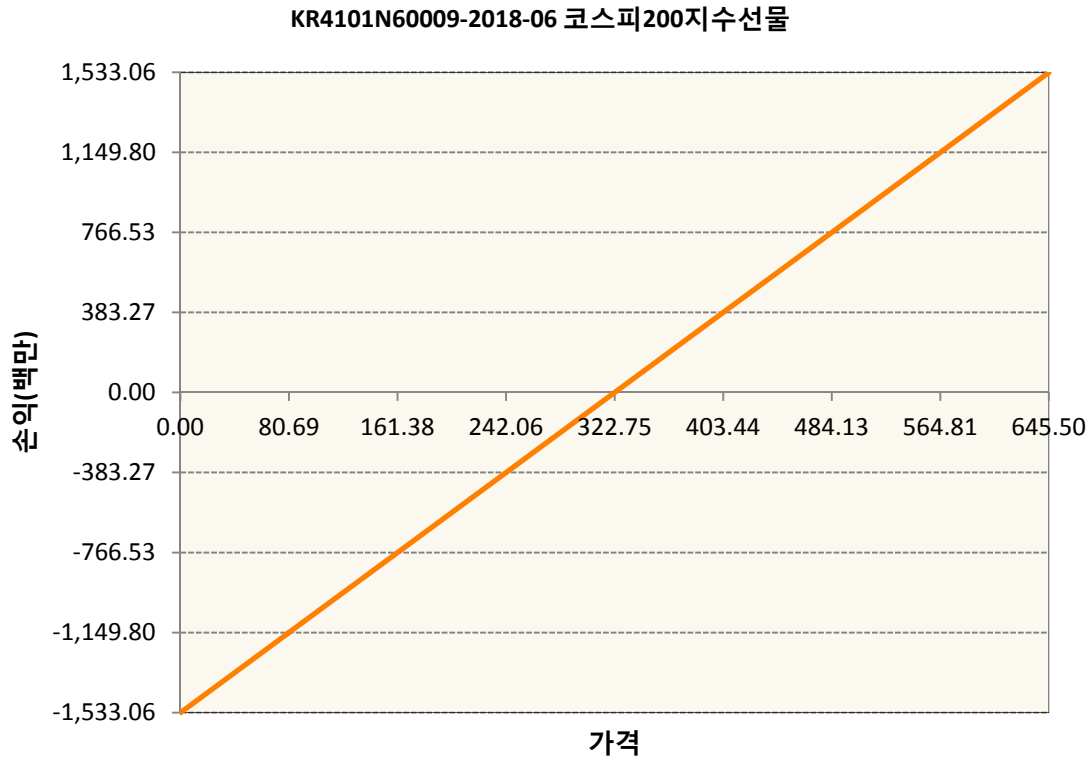
스마트인덱스모

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%	-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	2018-03-22
기준일	2018-03-21

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)

418

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2018-03-22
기준일	2018-03-21

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	409

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

410

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2018-03-22
기준일	2018-03-21

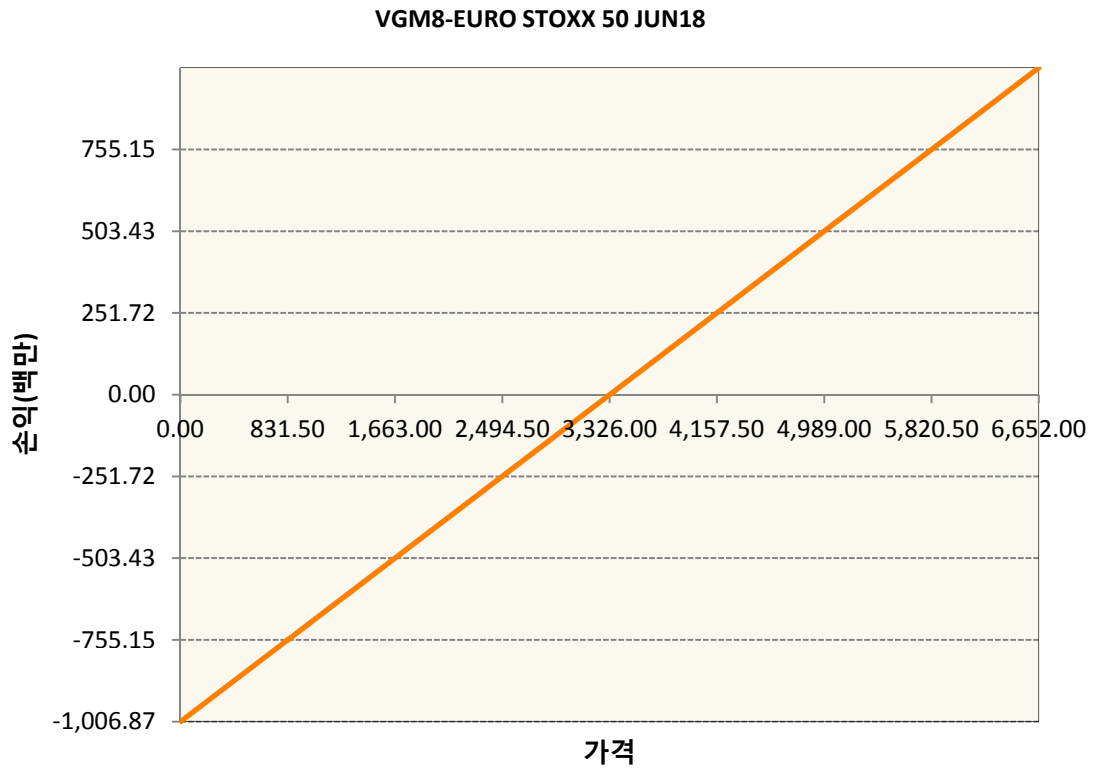
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,007	0	1,007	

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	2018-03-22
기준일	2018-03-21

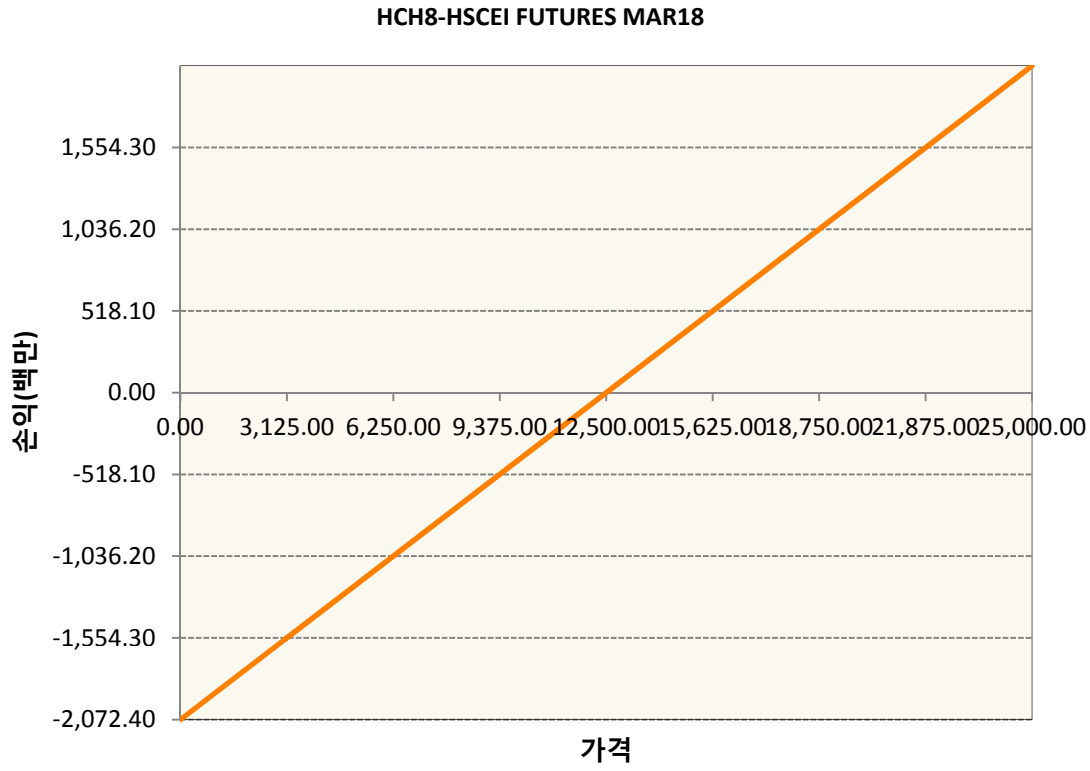
차이나인덱스모(주식-파생형)

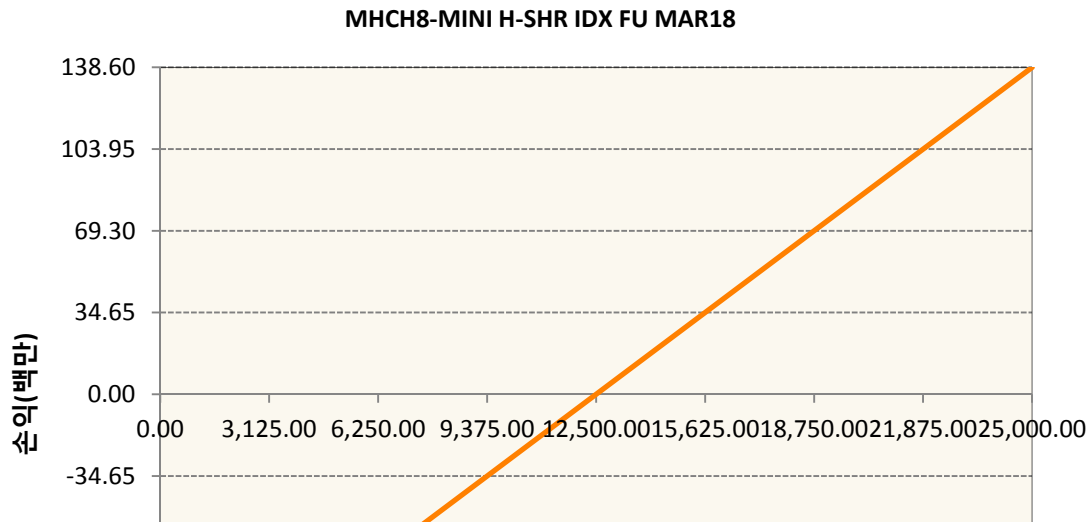
1. 계약금액

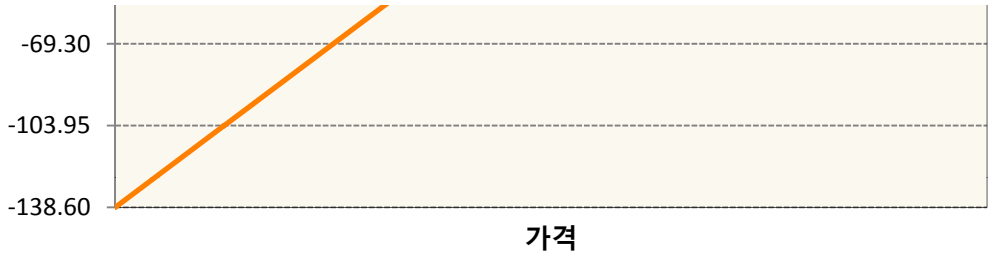
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,211	0	2,211	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCH8	HSCEI FUTURES MAR18	166
MHCH8	MINI H-SHR IDX FU MAR18	11

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	154

공시일	2018-03-22
기준일	2018-03-21

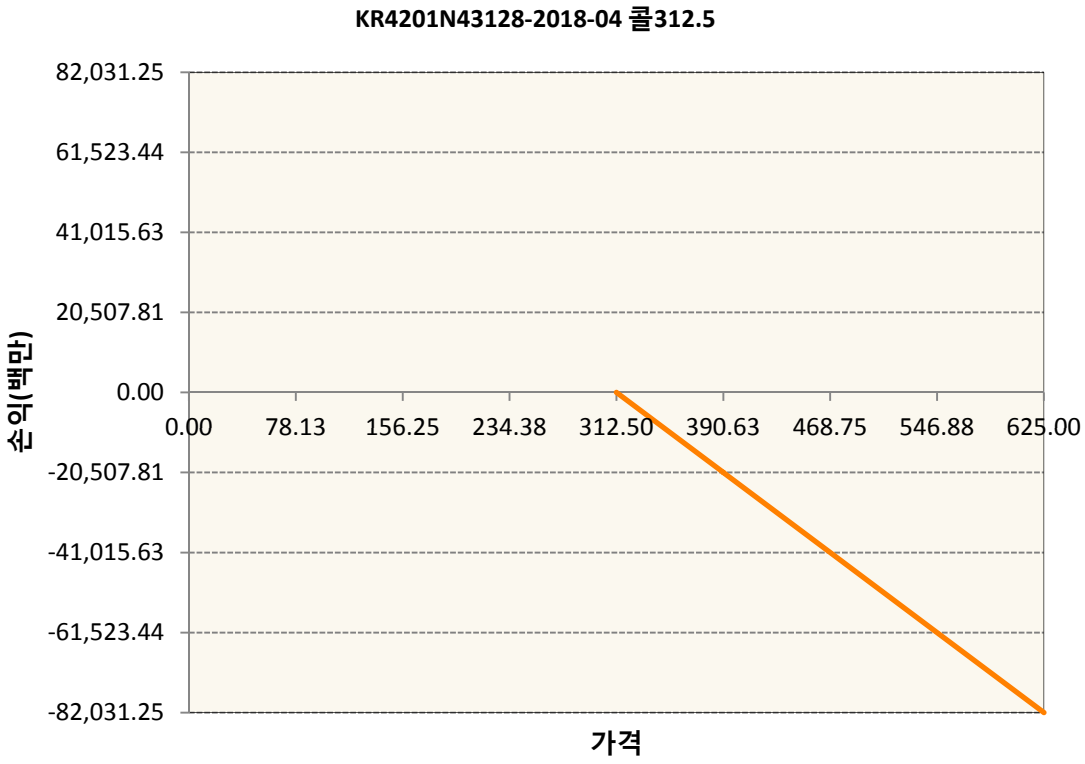
커버드콜모(주식혼합-파생형)

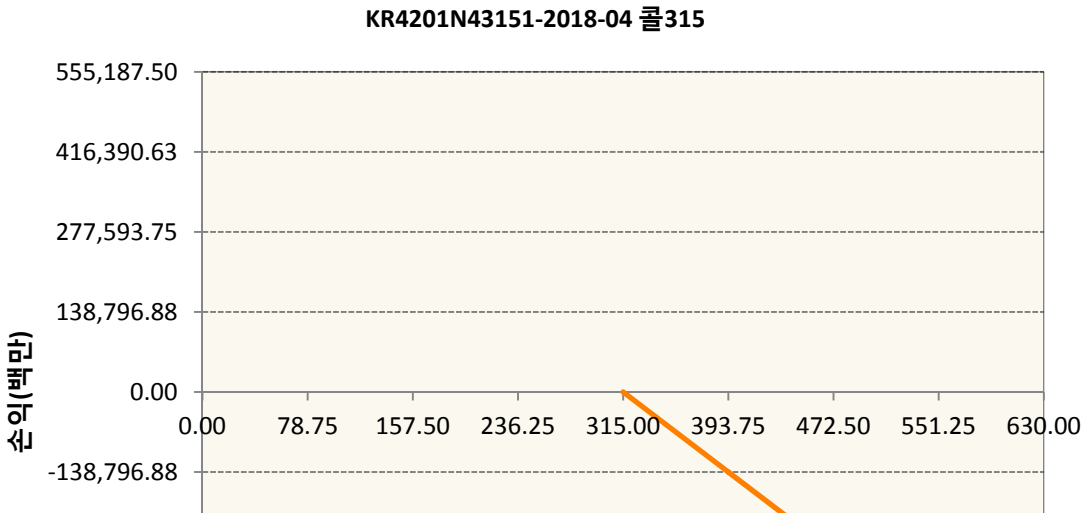
1. 계약금액

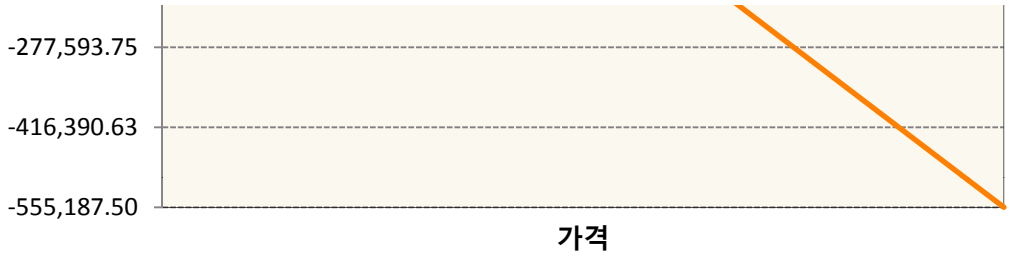
(단위:백만원)

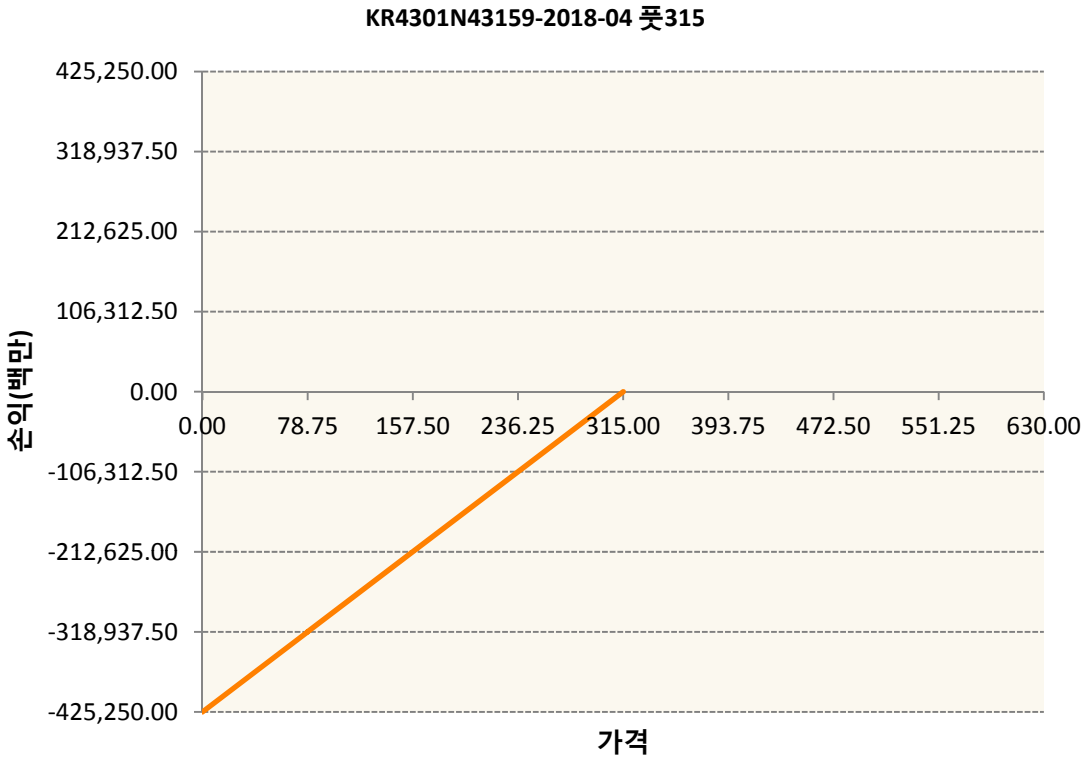
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	7,584	0	7,584	장내
누계	유가증권	옵션	0	1,062,469	-1,062,469	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201N4312018-04 콜312.5							5,878
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	3,338	3,234	3,119	2,996	2,866	2,730	2,589
-5.33%	2,839	2,680	2,517	2,351	2,184	2,015	1,844
-2.67%	1,903	1,721	1,539	1,357	1,175	992	810
0%	490	330	167	0	-169	-341	-514
2.67%	-1,317	-1,426	-1,546	-1,675	-1,812	-1,955	-2,103
5.33%	-3,373	-3,432	-3,505	-3,591	-3,688	-3,794	-3,909
8.00%	-5,553	-5,579	-5,616	-5,665	-5,726	-5,797	-5,878
KR4201N4312018-04 콜315							38,379
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	20,143	19,549	18,875	18,133	17,336	16,491	15,606

-5.33%	17,454	16,468	15,445	14,392	13,317	12,223	11,114
-2.67%	12,075	10,855	9,634	8,411	7,188	5,964	4,740
0%	3,500	2,348	1,180	0	-1,190	-2,388	-3,591
2.67%	-7,932	-8,779	-9,689	-10,651	-11,653	-12,689	-13,752
5.33%	-21,323	-21,818	-22,406	-23,075	-23,814	-24,613	-25,464
8.00%	-35,764	-35,999	-36,318	-36,721	-37,203	-37,758	-38,379
KR4301N4312018-04 풋315							23,437
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-22,390	-22,479	-22,603	-22,763	-22,957	-23,182	-23,437
-5.33%	-11,606	-11,937	-12,303	-12,696	-13,113	-13,549	-14,001
-2.67%	-3,167	-3,735	-4,306	-4,877	-5,450	-6,023	-6,597
0%	1,482	1,005	509	0	-521	-1,050	-1,587
2.67%	3,081	2,873	2,622	2,332	2,009	1,656	1,278
5.33%	3,405	3,356	3,278	3,169	3,028	2,854	2,649
8.00%	3,444	3,437	3,422	3,394	3,349	3,284	3,196

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

66,929

공시일	2018-03-22
기준일	2018-03-21

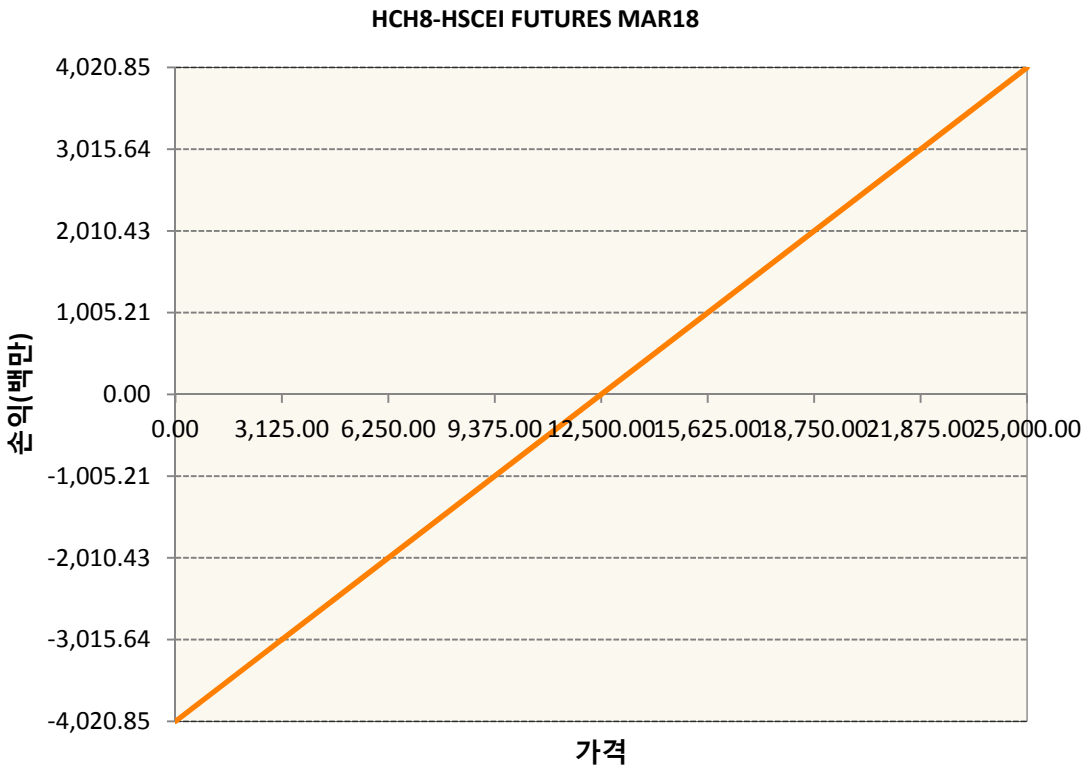
홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생

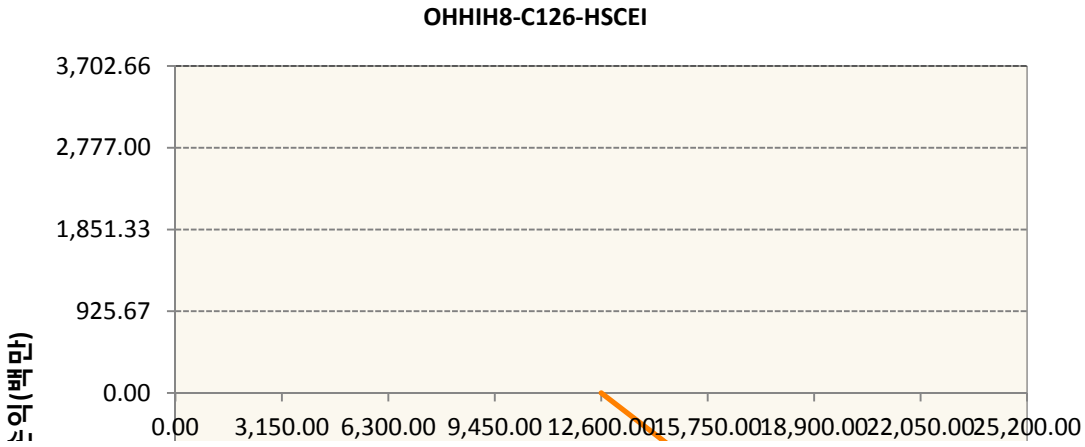
1. 계약금액

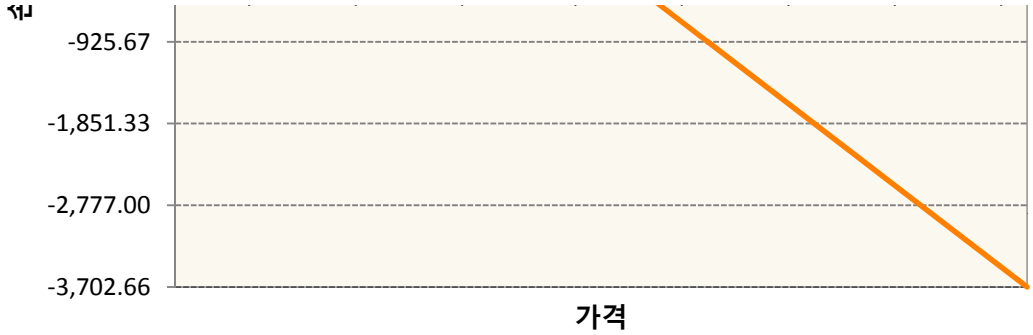
(단위:백만원)

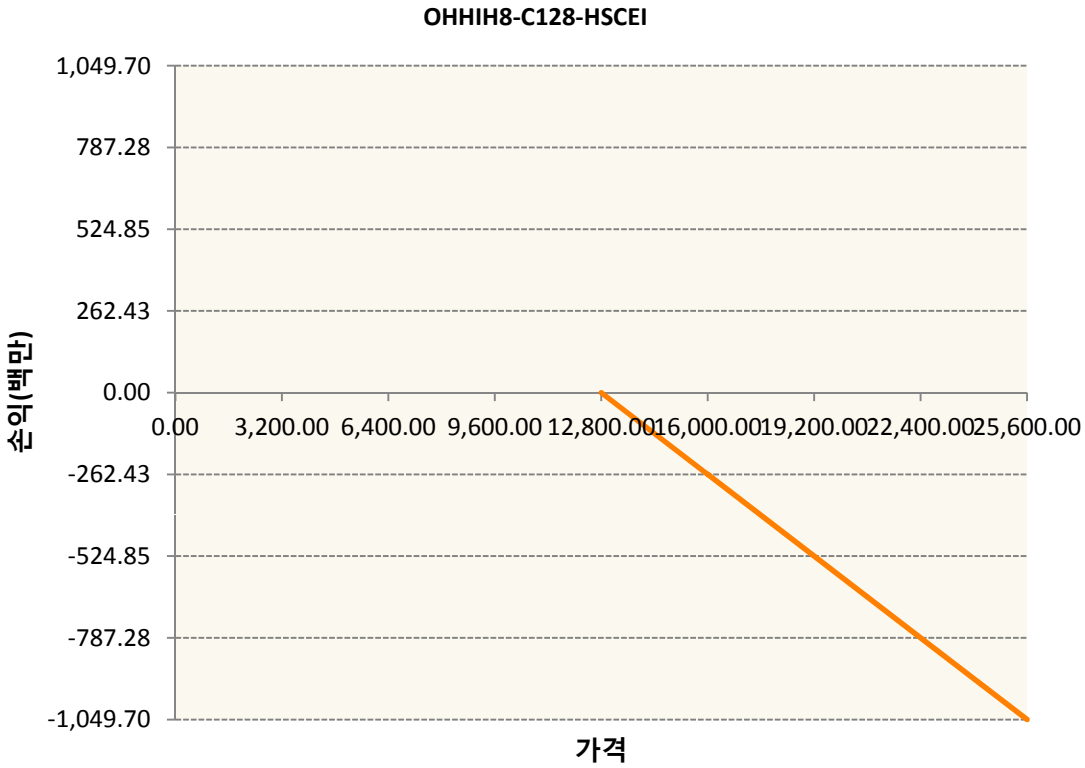
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	4,021	0	4,021	장내
누계	유가증권	옵션	0	9,505	-9,505	장내

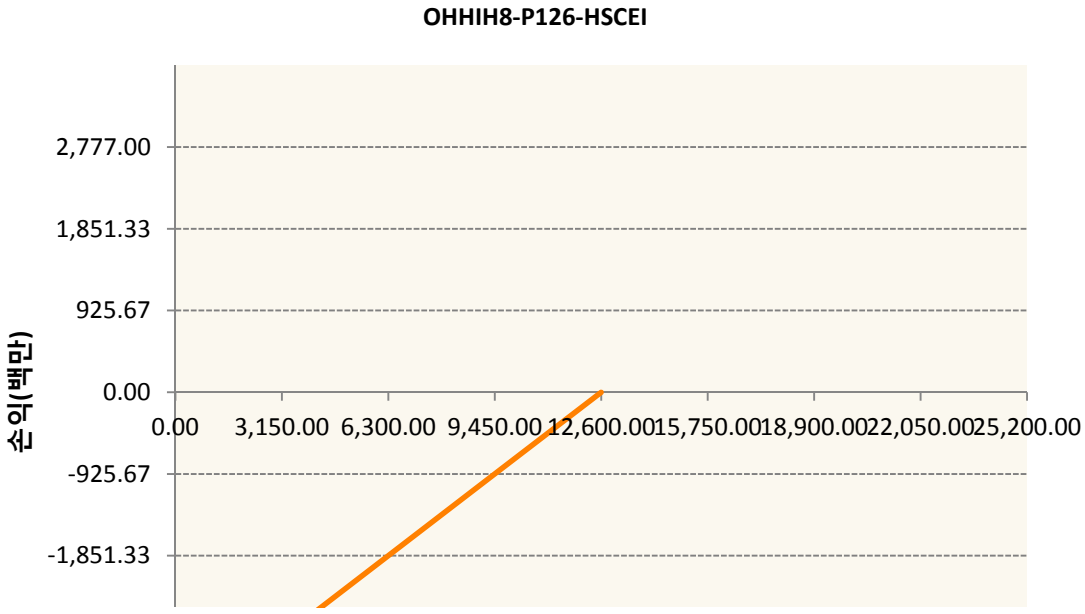
2. 만기시점의 손익구조

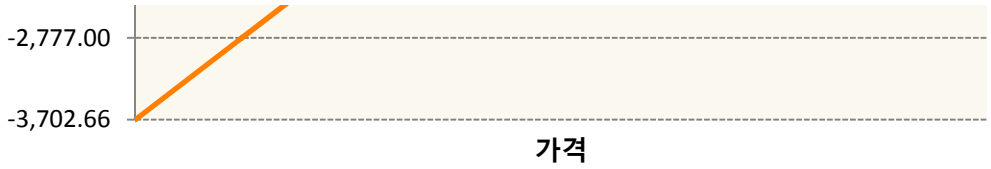


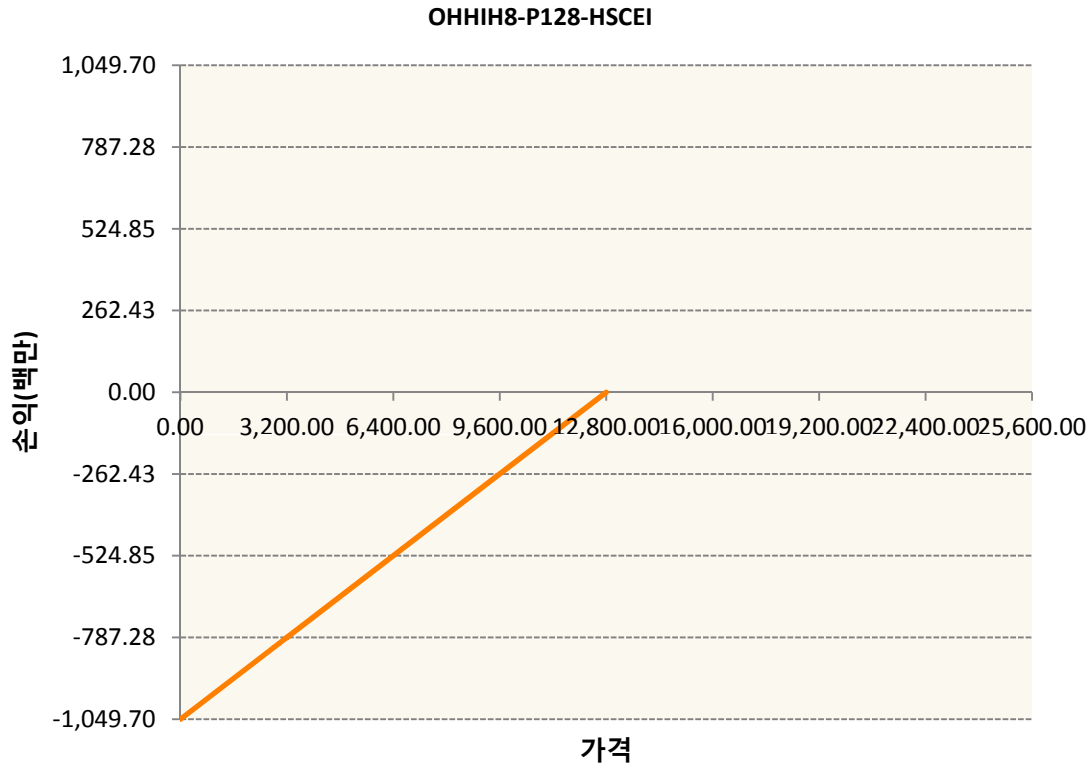



-925.67
-1,851.33
-2,777.00
-3,702.66
가격


OHHIH8-C128-HSCEI
1,049.70
787.28
524.85
262.43
0.00
-262.43
-524.85
-787.28
-1,049.70
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
2,777.00
1,851.33
925.67
0.00
-925.67
-1,851.33
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	322
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)
	940

공시일	2018-03-22
기준일	2018-03-21

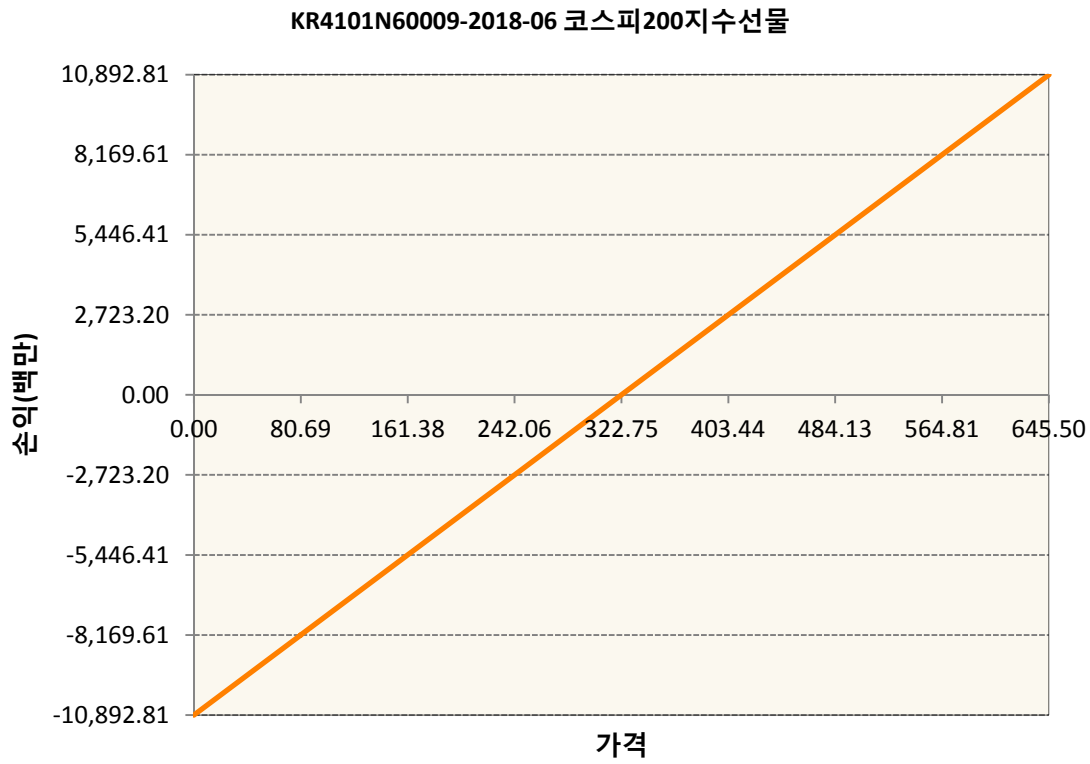
코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼

1. 계약금액

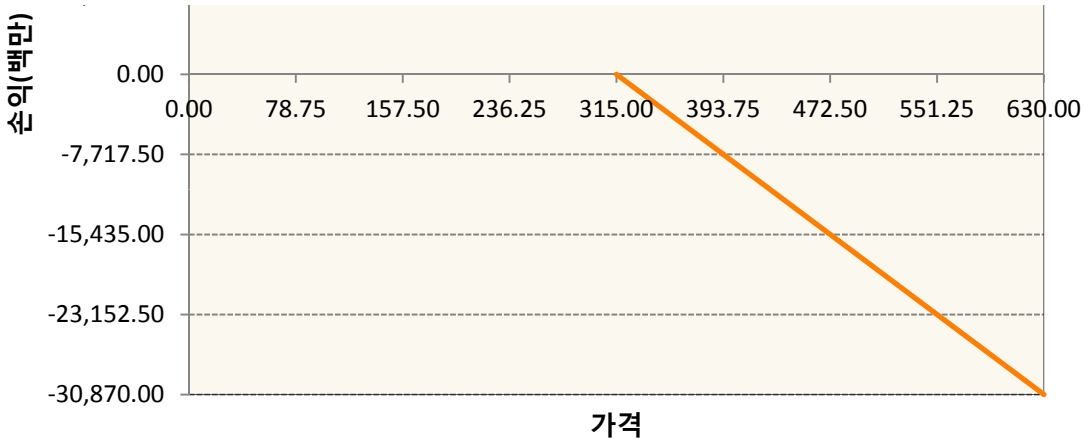
(단위:백만원)

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	10,893	0	10,893	장내
누계	유가증권	스왑	54,200	0	54,200	장외
누계	유가증권	옵션	0	55,718	-55,718	장내

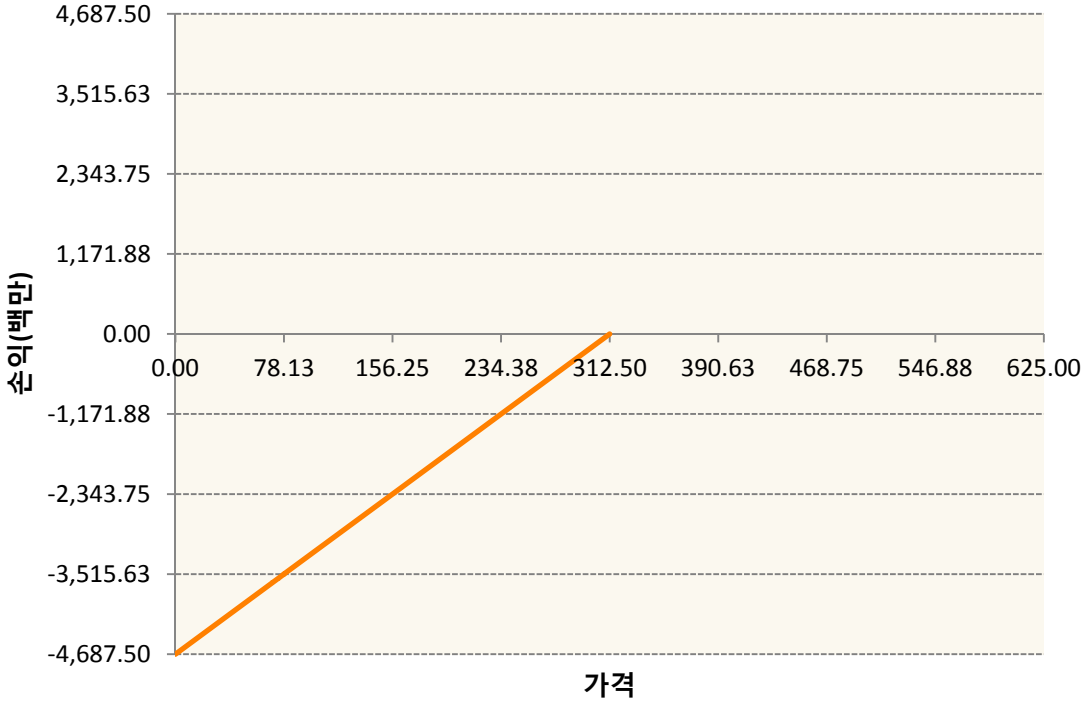
2. 만기시점의 손익구조



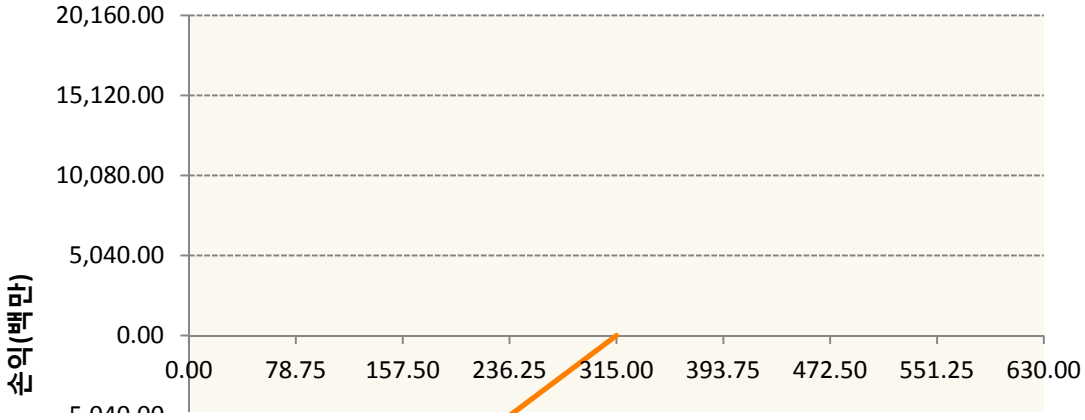




KR4301N43126-2018-04 풋312.5



KR4301N43159-2018-04 풋315





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_2							1,452
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,452	-1,452	-1,452	-1,452	-1,452	-1,452	-1,452
-5.33%	-968	-968	-968	-968	-968	-968	-968
-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%	968	968	968	968	968	968	968
8.00%	1,452	1,452	1,452	1,452	1,452	1,452	1,452
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%	-310	-310	-310	-310	-310	-310	-310
-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%	310	310	310	310	310	310	310
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						868
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-868	-868	-868	-868	-868	-868	-868
-5.33%	-579	-579	-579	-579	-579	-579	-579
-2.67%	-289	-289	-289	-289	-289	-289	-289
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	289	289	289	289	289	289	289
5.33%	579	579	579	579	579	579	579
8.00%	868	868	868	868	868	868	868
	KR4201N431 2018-04 콜315						2,134
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,120	1,087	1,049	1,008	964	917	868
-5.33%	970	916	859	800	740	680	618
-2.67%	671	604	536	468	400	332	264
0%	195	131	66	0	-66	-133	-200
2.67%	-441	-488	-539	-592	-648	-706	-765
5.33%	-1,186	-1,213	-1,246	-1,283	-1,324	-1,369	-1,416
8.00%	-1,989	-2,002	-2,019	-2,042	-2,069	-2,099	-2,134
	KR4301N431 2018-04 풋312.5						238
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-223	-224	-226	-229	-232	-235	-238
-5.33%	-108	-113	-118	-123	-128	-133	-139
-2.67%	-26	-32	-38	-45	-51	-58	-64
0%	14	10	5	0	-5	-11	-16
2.67%	26	24	22	20	17	13	10
5.33%	28	27	27	26	25	23	22
8.00%	28	28	28	27	27	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%	-1,061	-1,066	-1,072	-1,079	-1,088	-1,099	-1,111
-5.33%	-550	-566	-583	-602	-622	-642	-664
-2.67%	-150	-177	-204	-231	-258	-286	-313
0%	70	48	24	0	-25	-50	-75
2.67%	146	136	124	111	95	79	61
5.33%	161	159	155	150	144	135	126
8.00%	163	163	162	161	159	156	152

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

8,265

공시일	2018-03-22
기준일	2018-03-21

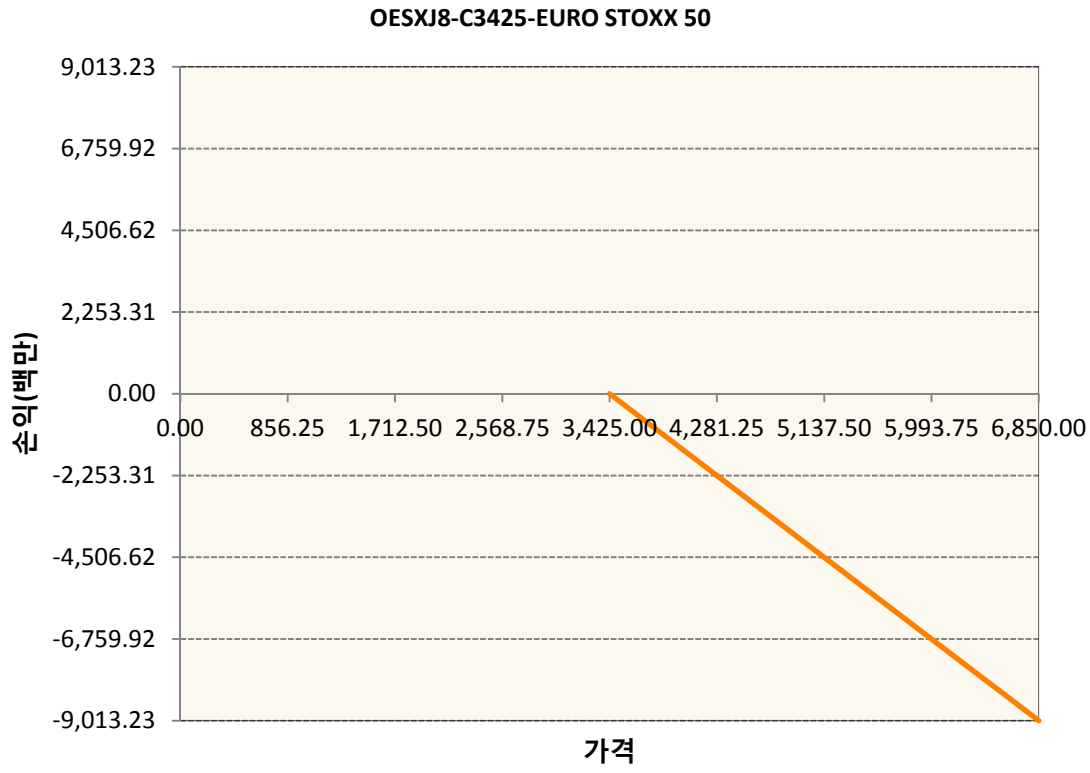
유로커버드콜모(주식혼합-파생형

1. 계약금액

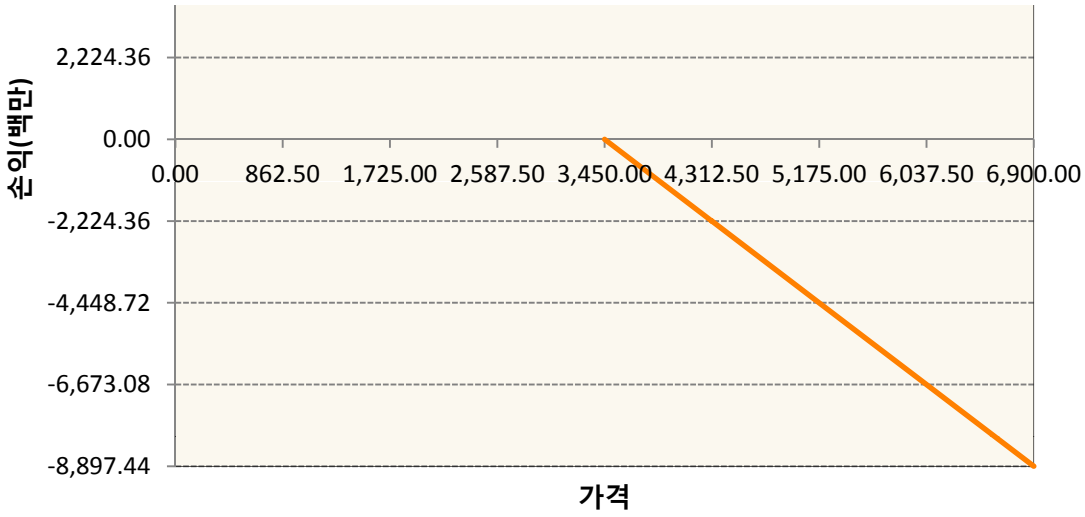
(단위:백만원)

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	9,272	0	9,272	
누계	유가증권	스왑	98,682	0	98,682	장외
누계	유가증권	옵션	0	35,821	-35,821	장내
누계	지수	스왑	52,631	0	52,631	장외

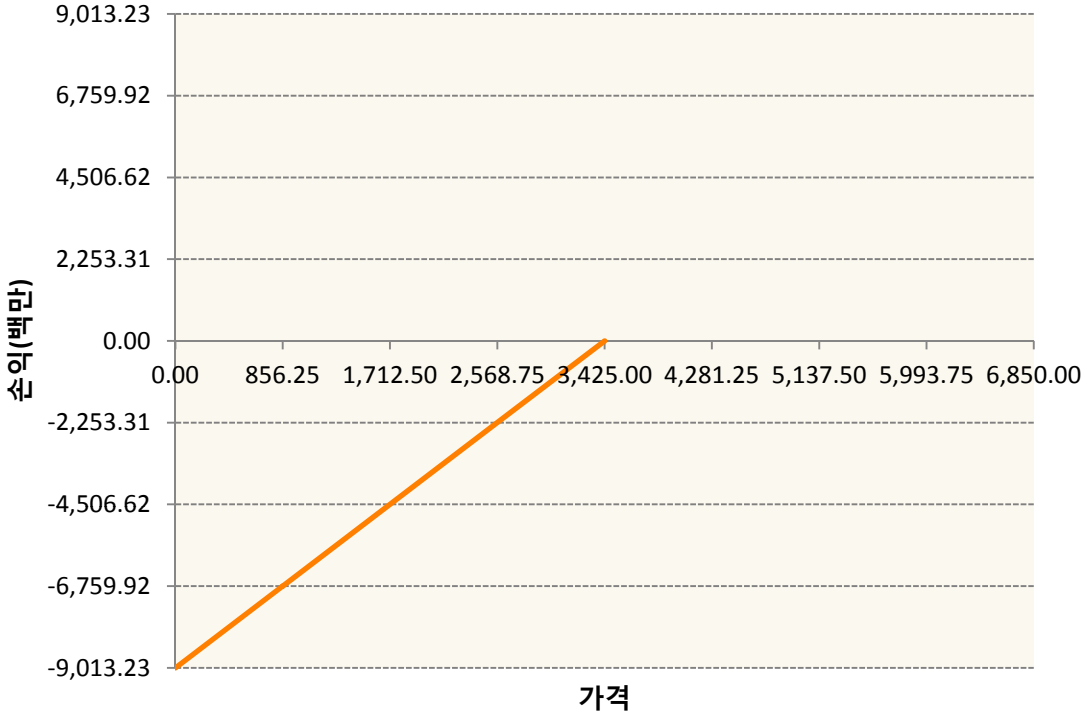
2. 만기시점의 손익구조



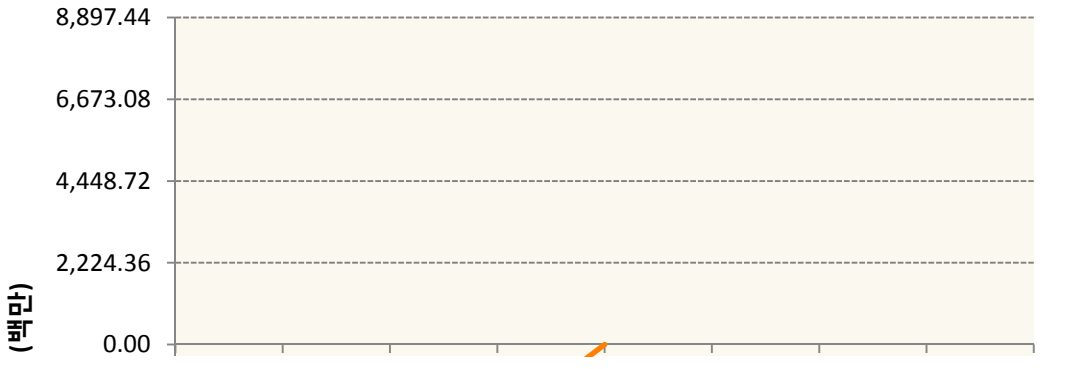


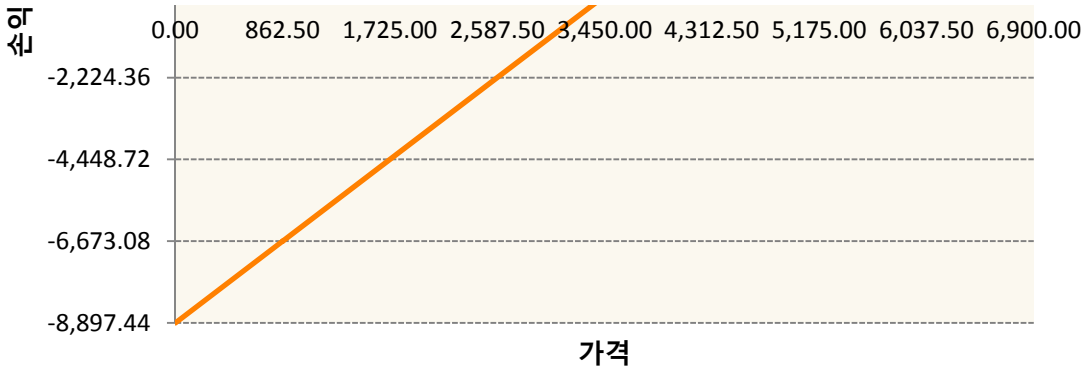


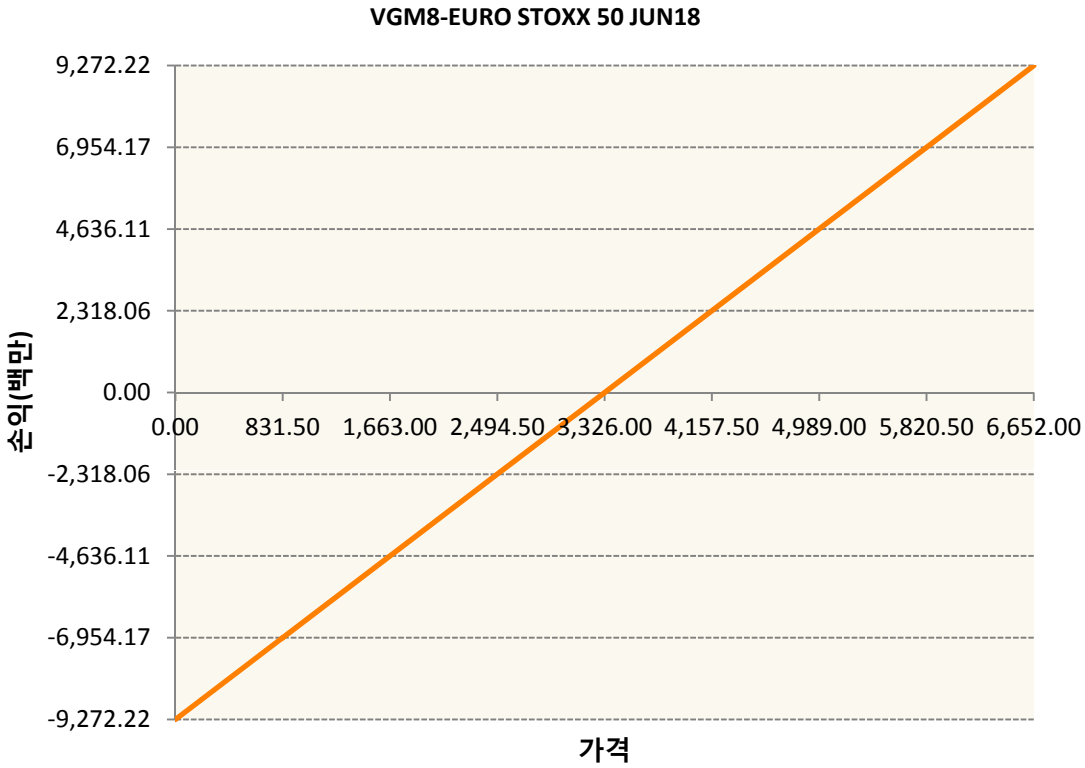
OESXJ8-P3425-EURO STOXX 50



OESXJ8-P3450-EURO STOXX 50







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
260105SGPX	SG EURO Covered CALL STRATEGY - 994.569	169
260105SQPX	SG EURO Covered CALL STRATEGY	317
OESXJ8-C34	EURO STOXX 50	721
OESXJ8-C34	EURO STOXX 50	712
OESXJ8-P34	EURO STOXX 50	721
OESXJ8-P34	EURO STOXX 50	712
VGM8	EURO STOXX 50 JUN18	742

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

2,439

공시일	2018-03-22
기준일	2018-03-21

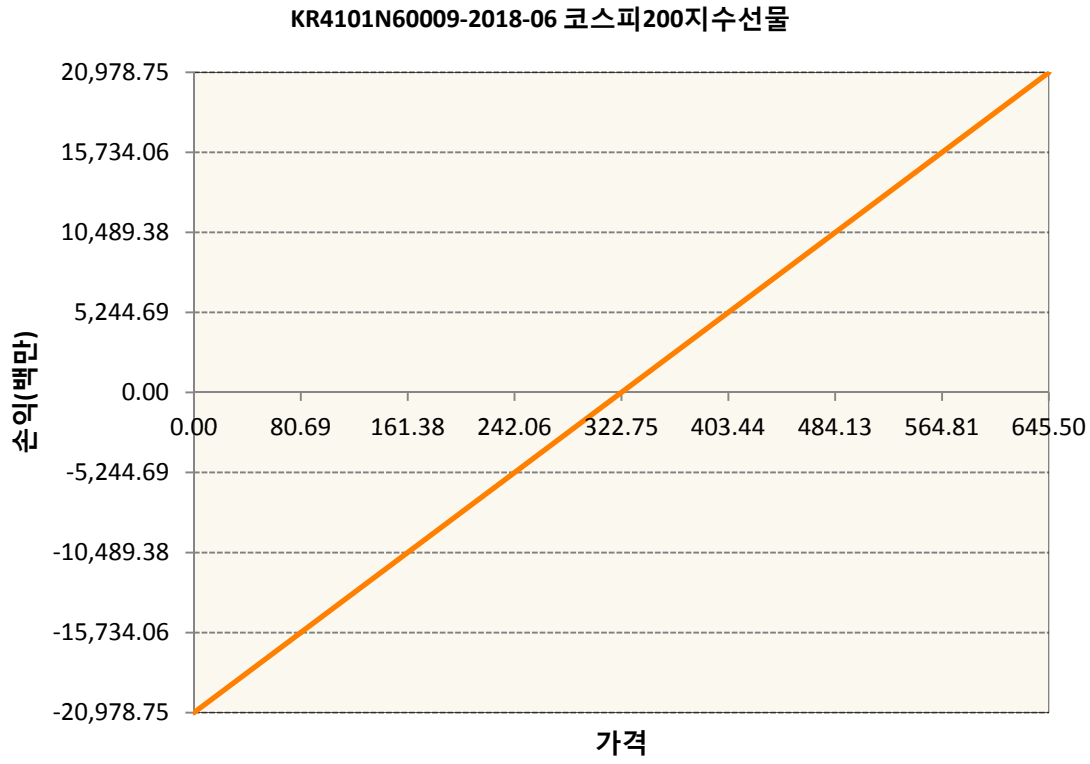
ETF스마트레버리지목표전환형8호

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	20,979	0	20,979	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101N60(2018-06 코스피200지수선물							1,672
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,672	-1,672	-1,672	-1,672	-1,672	-1,672	-1,672
-5.33%	-1,115	-1,115	-1,115	-1,115	-1,115	-1,115	-1,115
-2.67%	-557	-557	-557	-557	-557	-557	-557
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	557	557	557	557	557	557	557
5.33%	1,115	1,115	1,115	1,115	1,115	1,115	1,115
8.00%	1,672	1,672	1,672	1,672	1,672	1,672	1,672

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

1,154

공시일	2018-03-22
기준일	2018-03-21

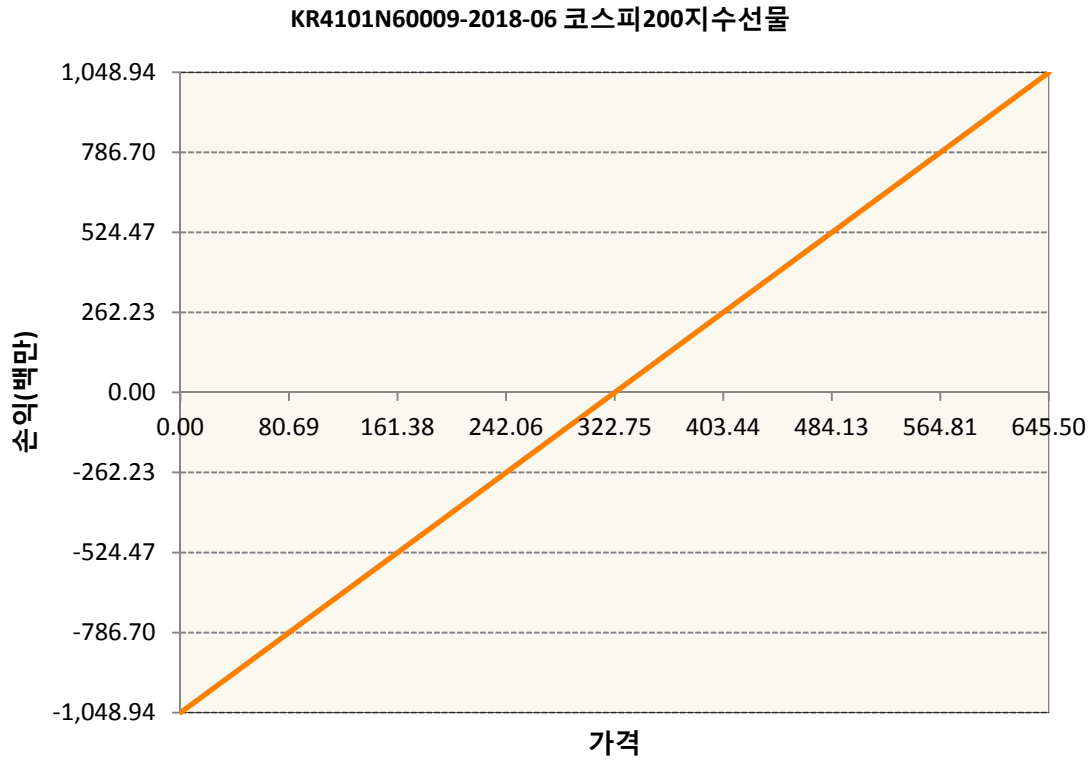
ETF스마트레버리지목표전환형9호

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	2018-03-22
기준일	2018-03-21

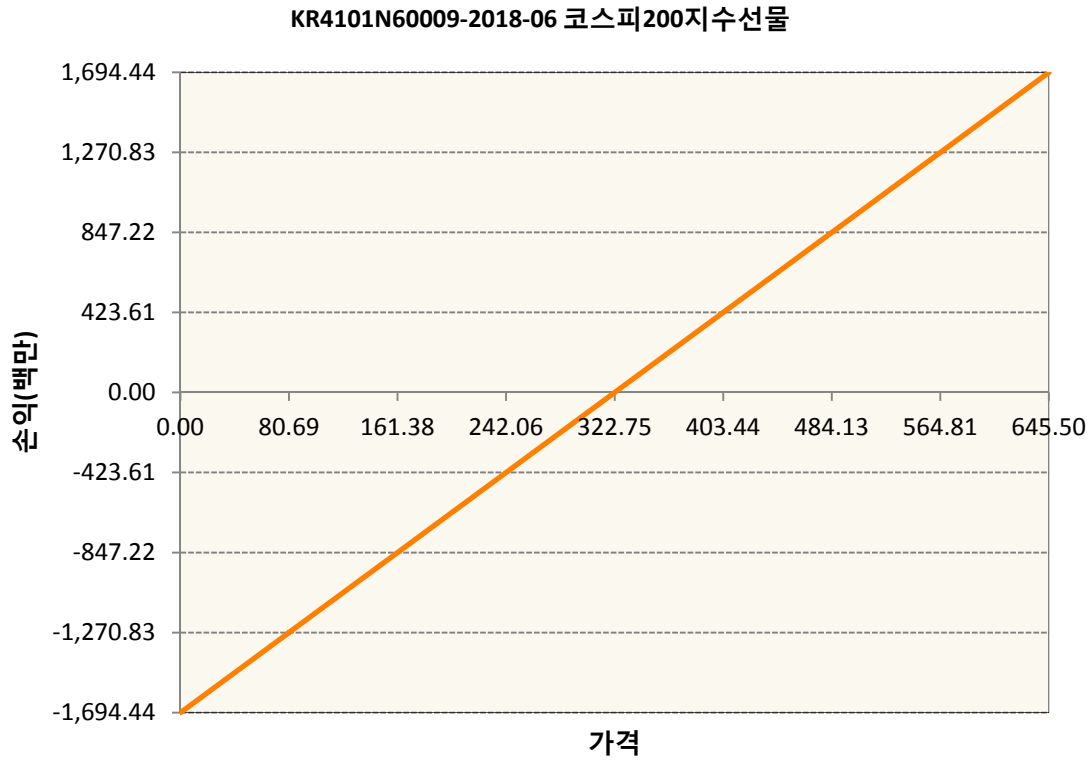
ETF스마트레버리지목표전환형10

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)

93

공시일	2018-03-22
기준일	2018-03-21

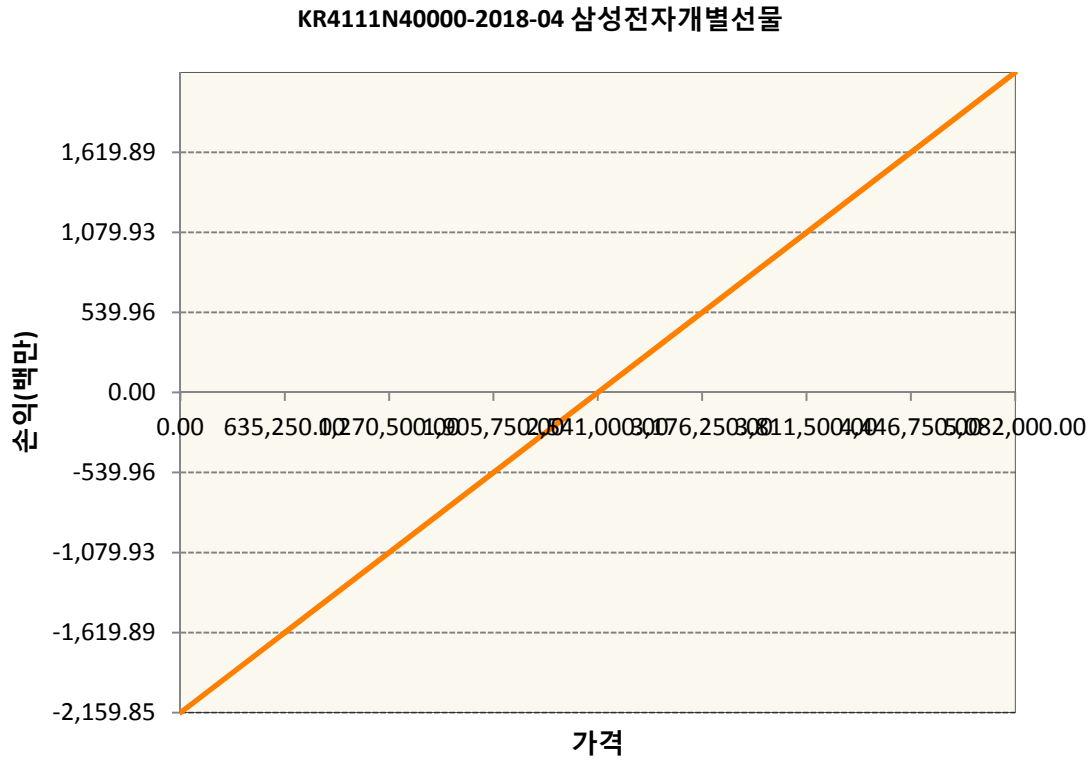
스마트KRX300인덱스1호(주식-파

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	204	0	204	장내
누계	유가증권	선물	2,160	0	2,160	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4111N40(2018-04 삼성전자개별선물							174
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-174	-174	-174	-174	-174	-174	-174
-5.33%	-116	-116	-116	-116	-116	-116	-116
-2.67%	-58	-58	-58	-58	-58	-58	-58
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	58	58	58	58	58	58	58
5.33%	116	116	116	116	116	116	116
8.00%	174	174	174	174	174	174	174

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

207

공시일	2018-03-22
기준일	2018-03-21

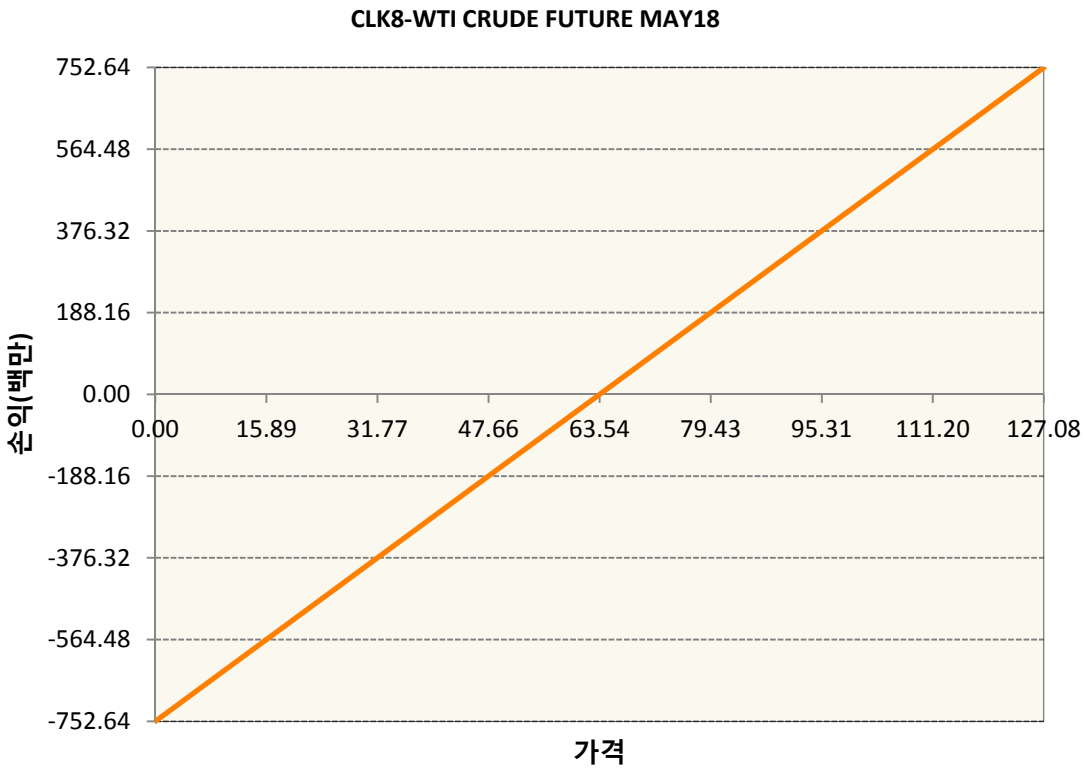
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

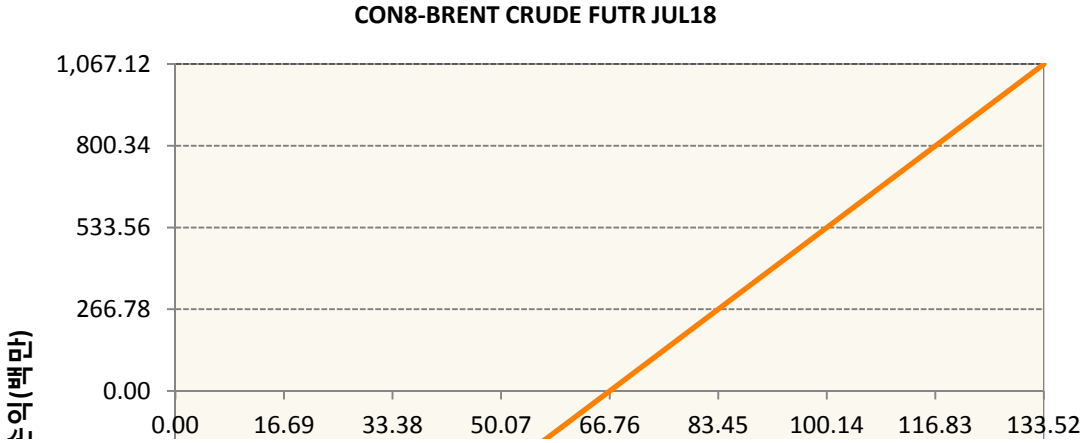
1. 계약금액

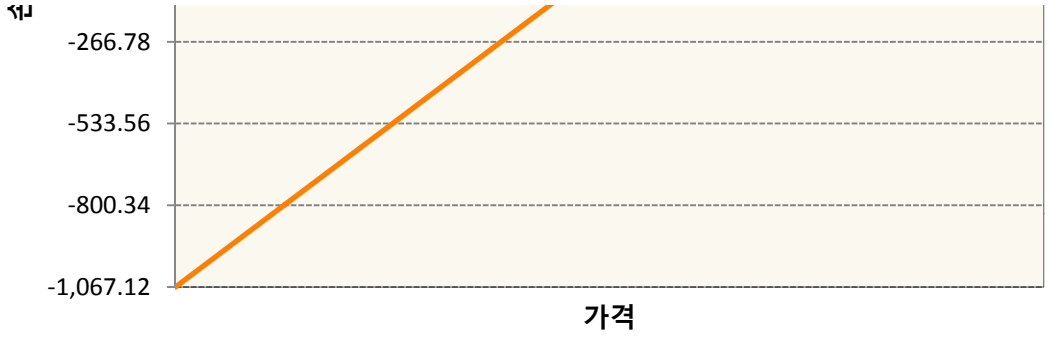
(단위:백만원)

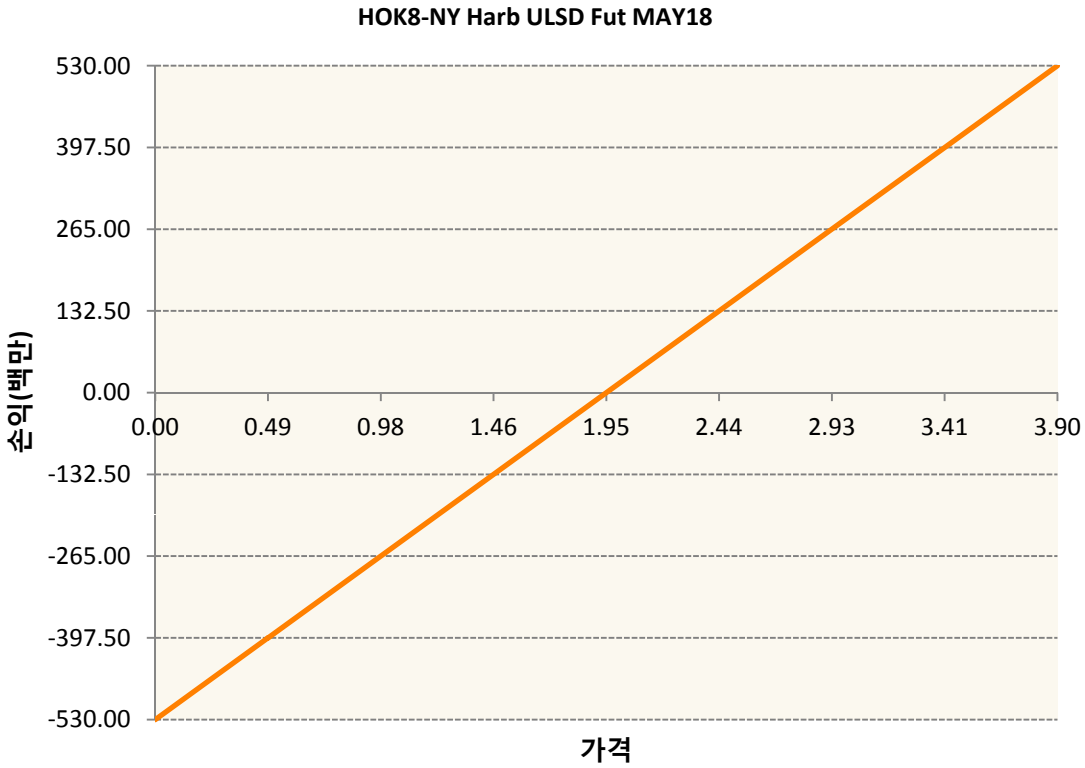
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	선물	유가증권	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	선물	유가증권	753	0	753	
누계	유가증권	선물	3,271	589	2,682	

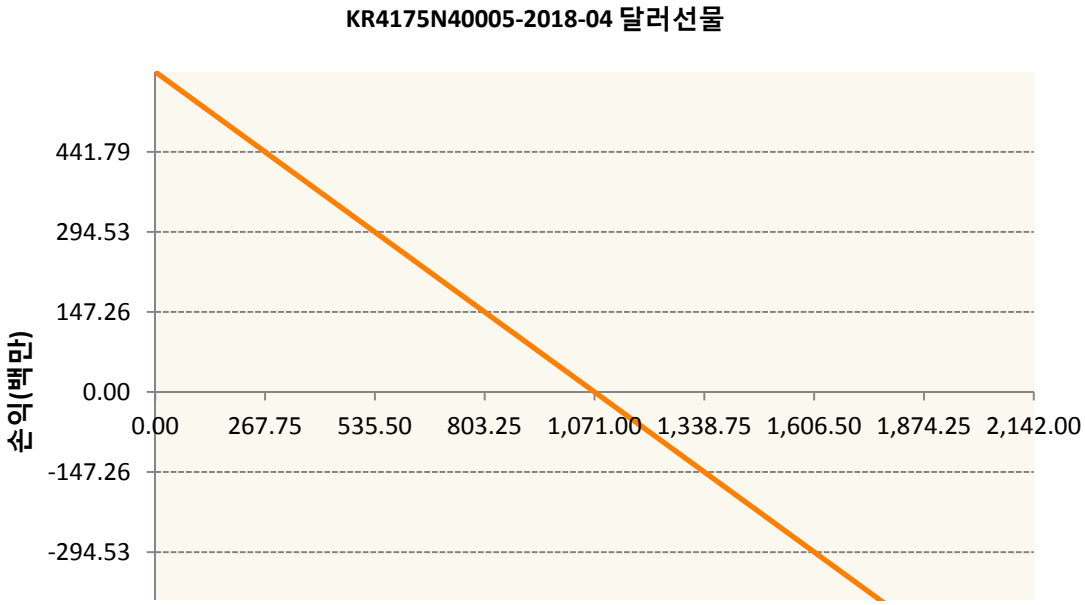
2. 만기시점의 손익구조

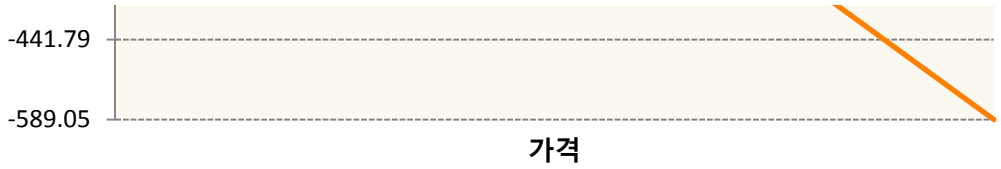


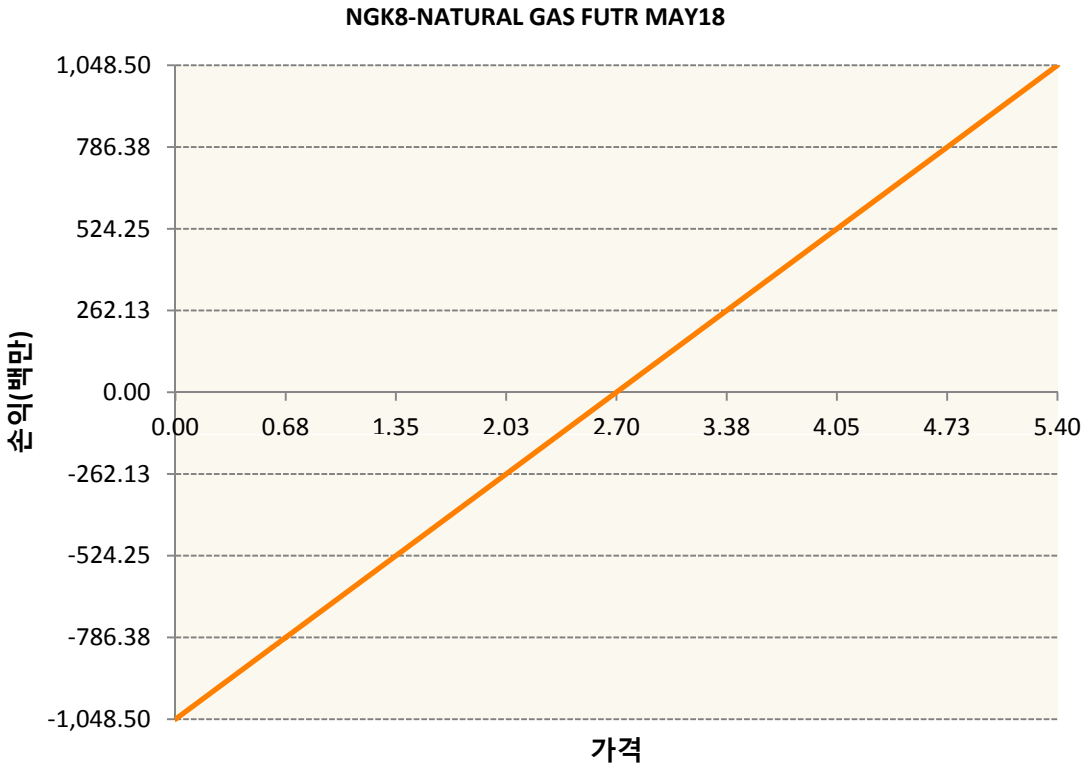


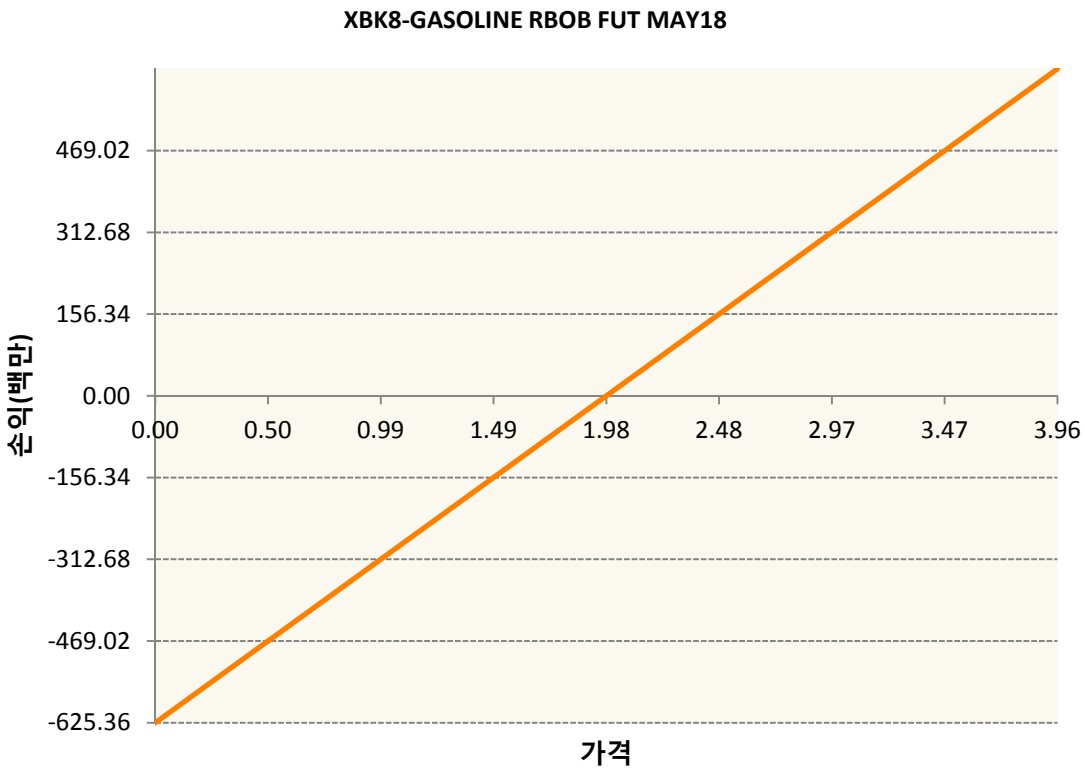

-266.78
-533.56
-800.34
-1,067.12
가격


HOK8-NY Harb ULSD Fut MAY18
530.00
397.50
265.00
132.50
0.00
-132.50
-265.00
-397.50
-530.00
손익(백만)
0.00
0.49
0.98
1.46
1.95
2.44
2.93
3.41
3.90
가격


KR4175N40005-2018-04 달러선물
441.79
294.53
147.26
0.00
-147.26
-294.53
손익(백만)
0.00
267.75
535.50
803.25
1,071.00
1,338.75
1,606.50
1,874.25
2,142.00


-441.79
-589.05
가격


NGK8-NATURAL GAS FUTR MAY18
1,048.50
786.38
524.25
262.13
0.00
-262.13
-524.25
-786.38
-1,048.50
0.00
0.68
1.35
2.03
2.70
3.38
4.05
4.73
5.40
손익(백만)
가격


XBK8-GASOLINE RBOB FUT MAY18
469.02
312.68
156.34
0.00
-156.34
-312.68
-469.02
-625.36
0.00
0.50
0.99
1.49
1.98
2.48
2.97
3.47
3.96
손익(백만)
가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLK8	WTI CRUDE FUTURE MAY18	60
CON8	BRENT CRUDE FUTR JUL18	85
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)

524

공시일	2018-03-22
기준일	2018-03-21

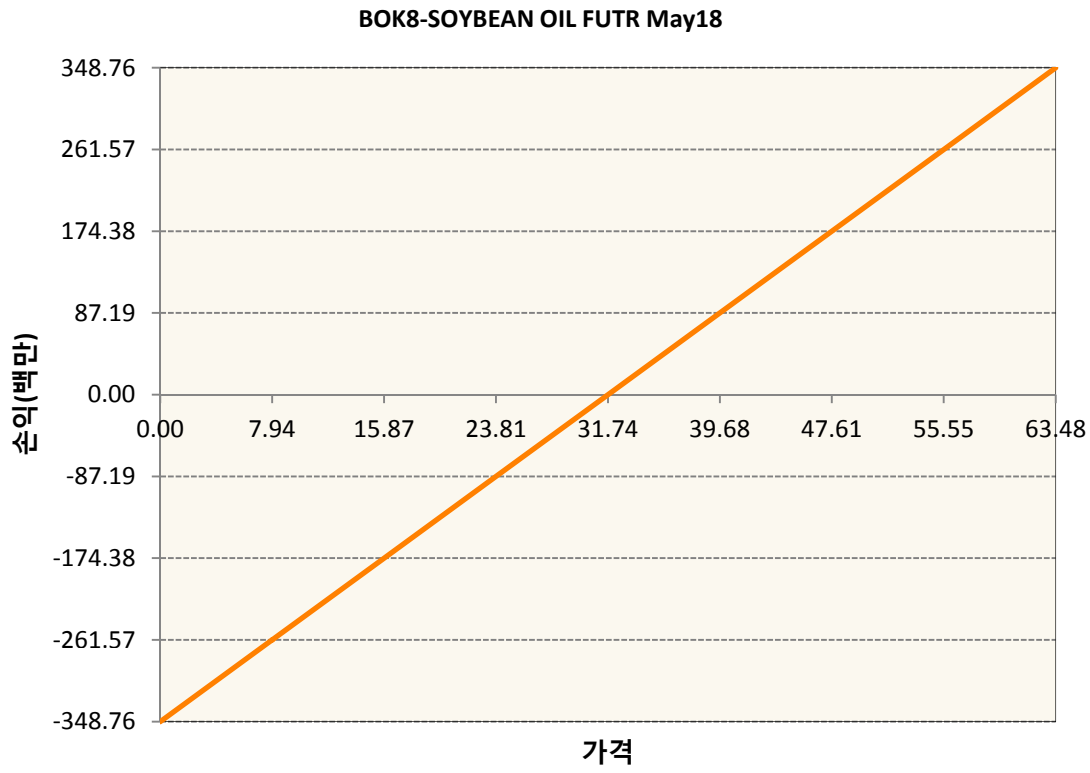
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

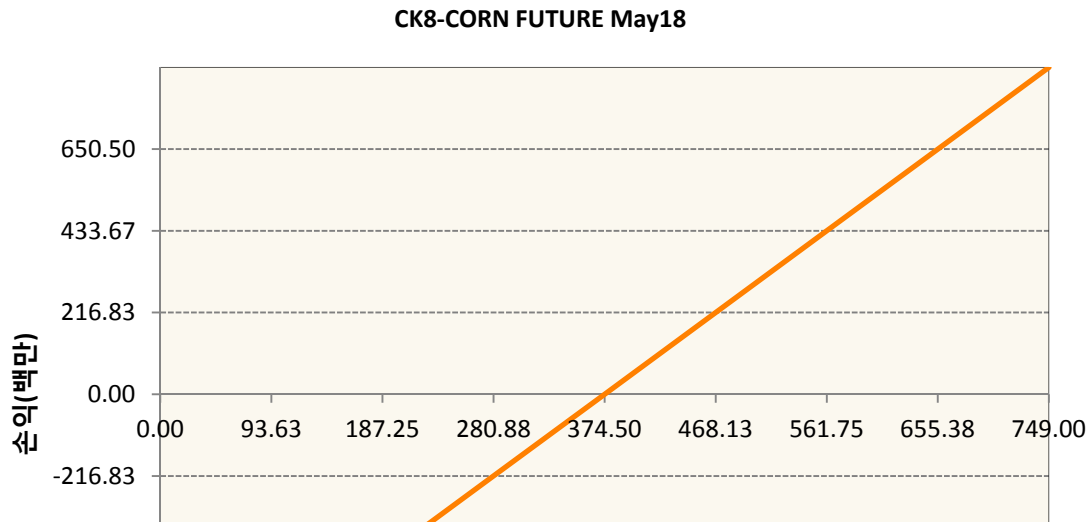
1. 계약금액

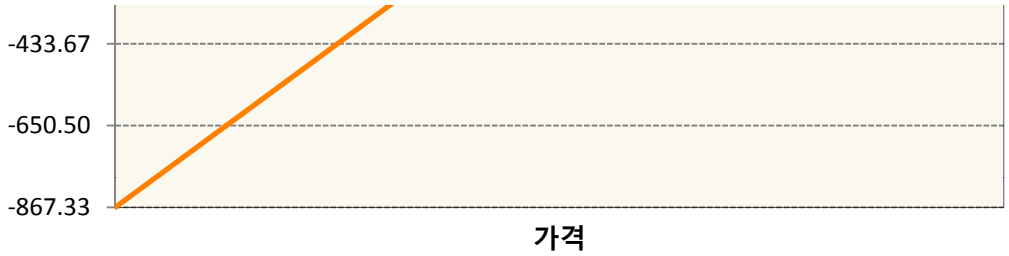
(단위:백만원)

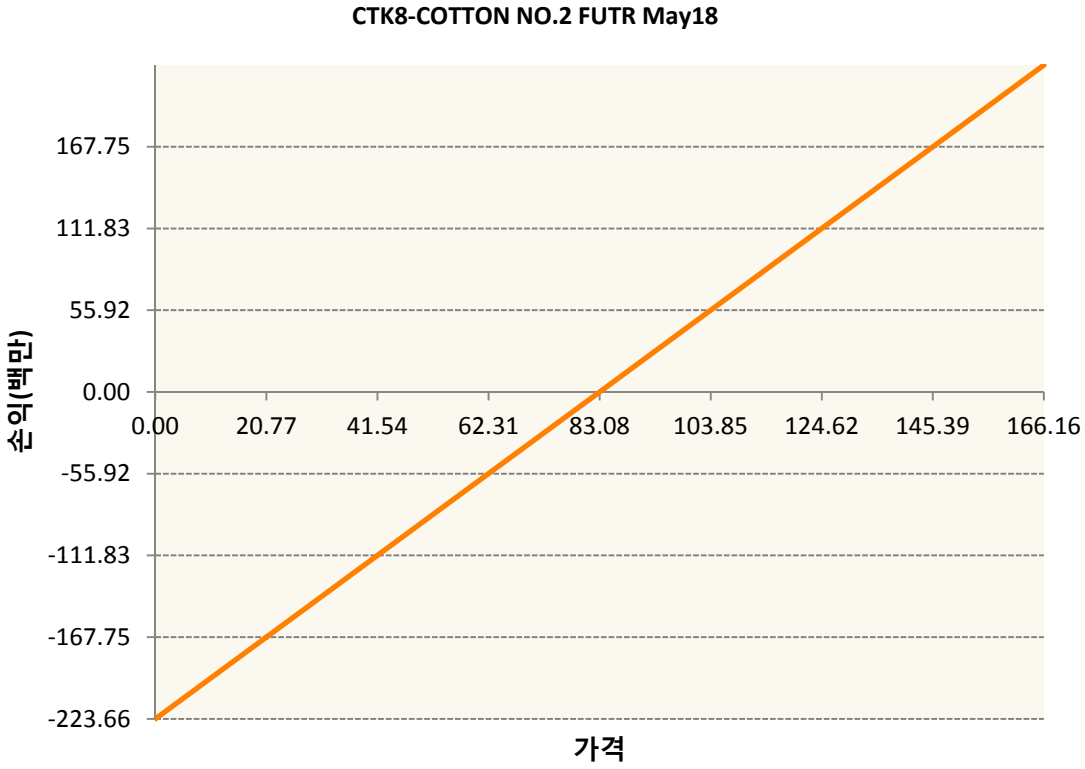
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	4,055	321	3,733	

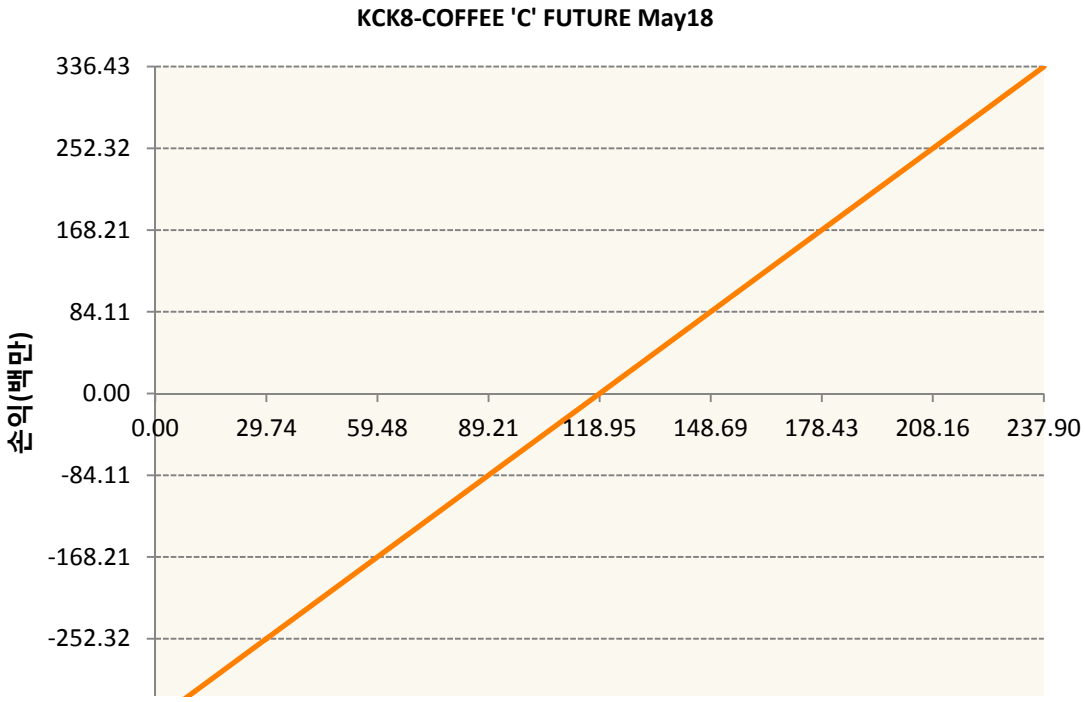
2. 만기시점의 손익구조

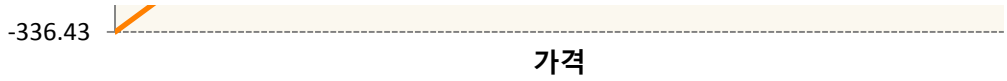


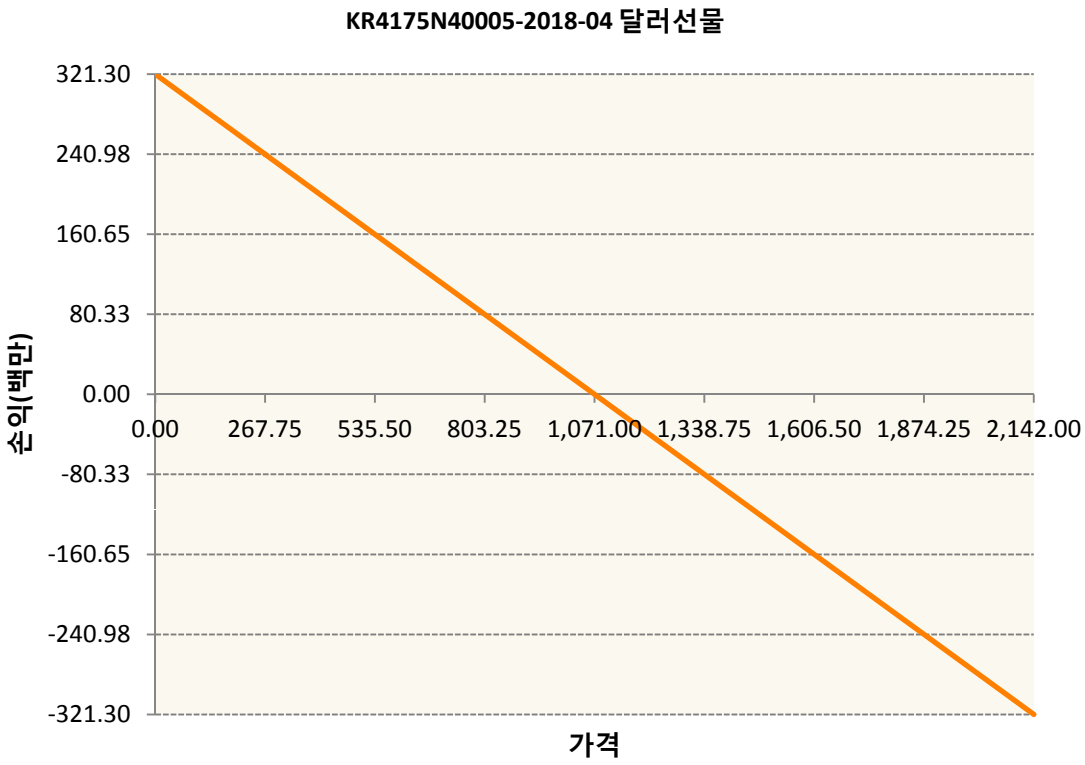


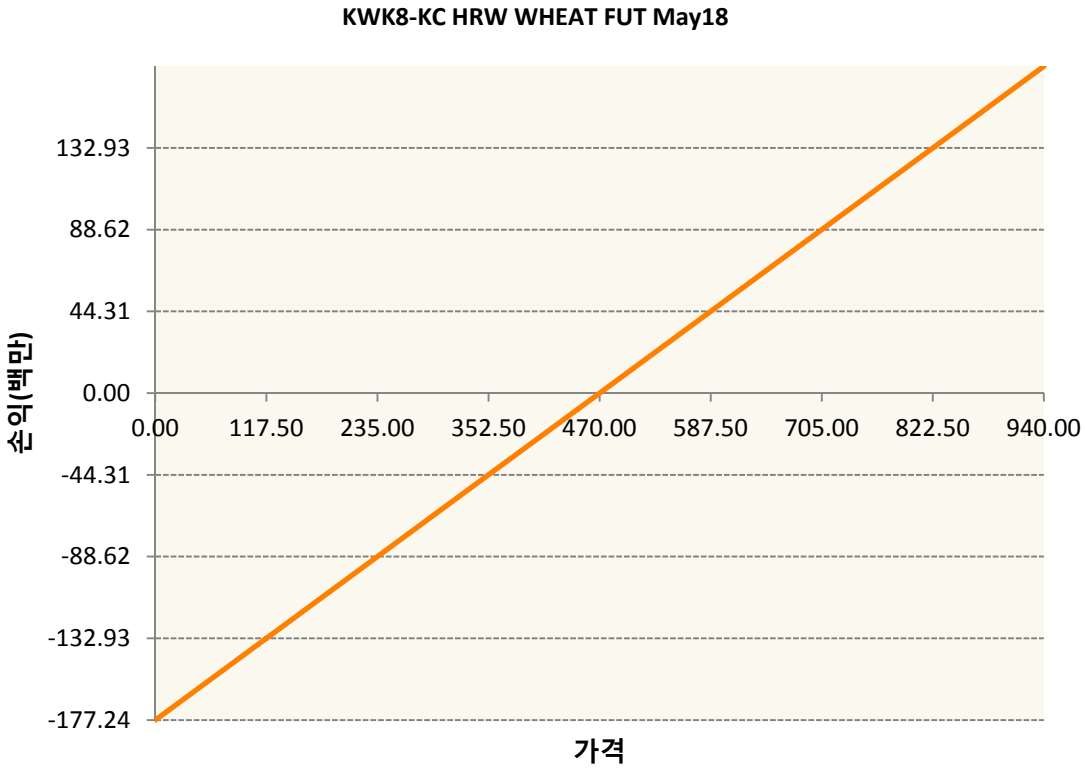

-433.67
-650.50
-867.33
가격

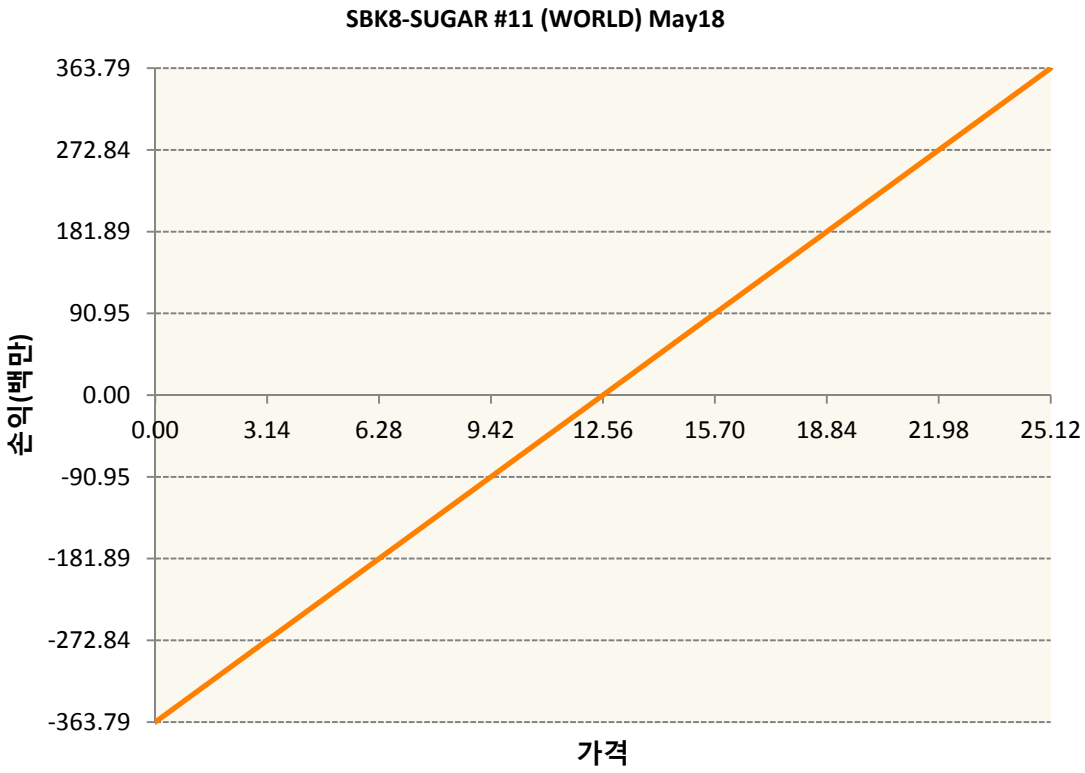

CTK8-COTTON NO.2 FUTR May18
167.75
111.83
55.92
0.00
-55.92
-111.83
-167.75
-223.66
0.00
20.77
41.54
62.31
83.08
103.85
124.62
145.39
166.16
손익(백만)
가격

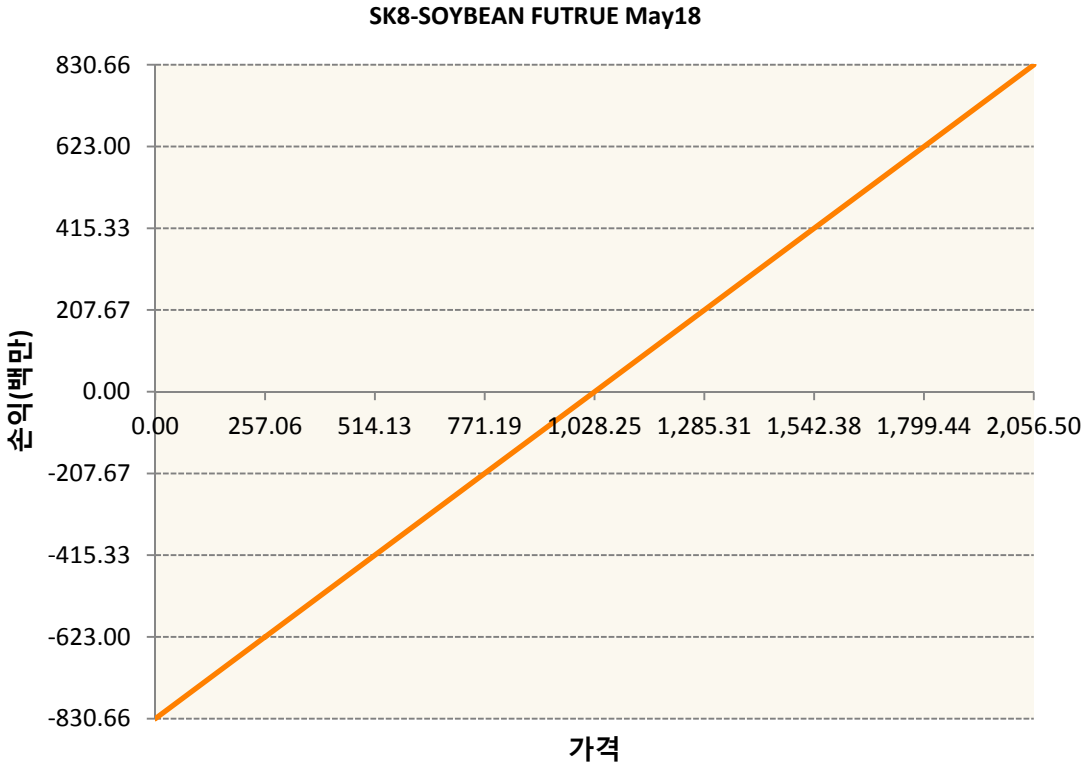

KCK8-COFFEE 'C' FUTURE May18
336.43
252.32
168.21
84.11
0.00
-84.11
-168.21
-252.32
0.00
29.74
59.48
89.21
118.95
148.69
178.43
208.16
237.90
손익(백만)


-336.43
가격

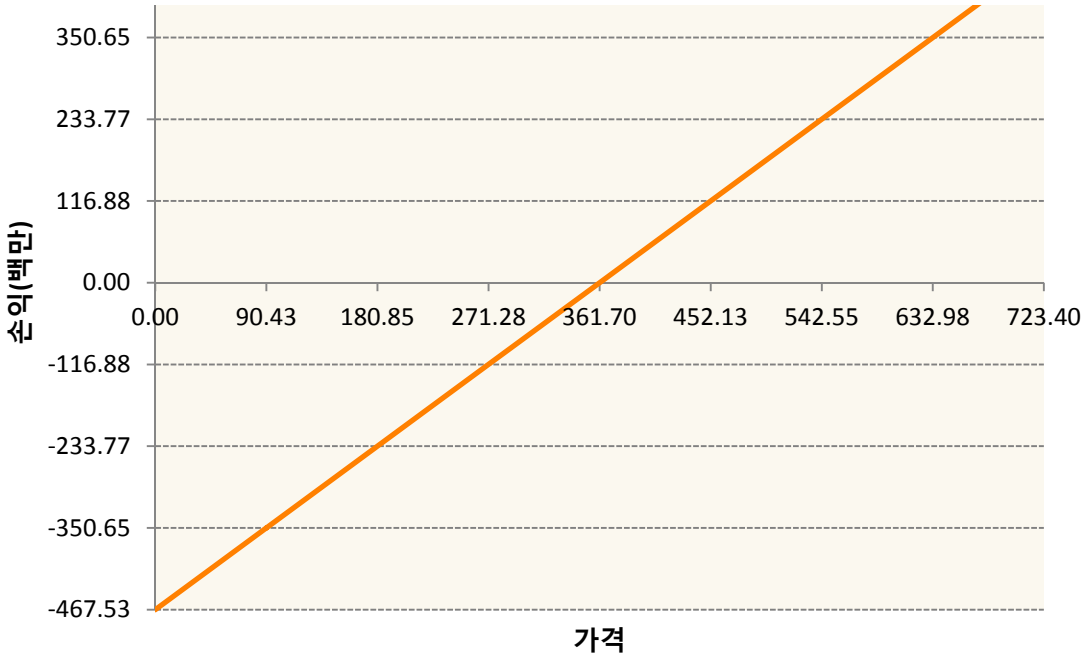

KR4175N40005-2018-04 달러선물
321.30
240.98
160.65
80.33
0.00
-80.33
-160.65
-240.98
-321.30
0.00
267.75
535.50
803.25
1,071.00
1,338.75
1,606.50
1,874.25
2,142.00
손익(백만)
가격

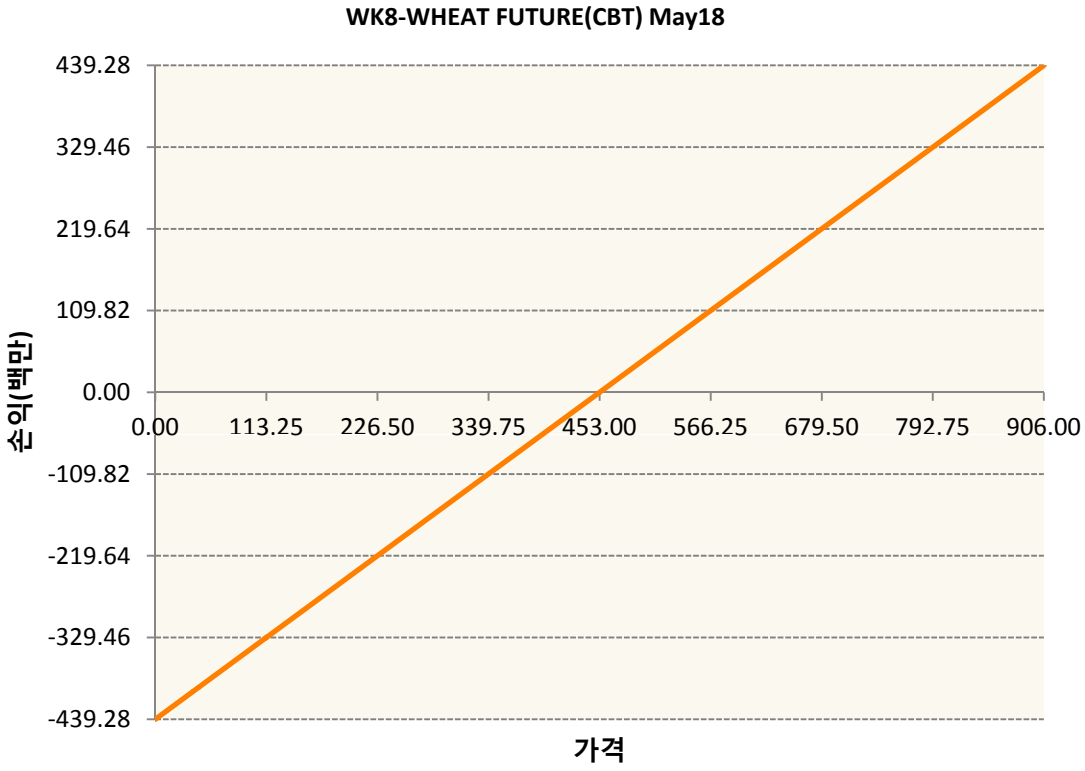

KWK8-KC HRW WHEAT FUT May18
132.93
88.62
44.31
0.00
-44.31
-88.62
-132.93
-177.24
0.00
117.50
235.00
352.50
470.00
587.50
705.00
822.50
940.00
손익(백만)
가격


SBK8-SUGAR #11 (WORLD) May18
363.79
272.84
181.89
90.95
0.00
-90.95
-181.89
-272.84
-363.79
0.00
3.14
6.28
9.42
12.56
15.70
18.84
21.98
25.12
손익(백만)
가격


SK8-SOYBEAN FUTRUE May18
830.66
623.00
415.33
207.67
0.00
-207.67
-415.33
-623.00
-830.66
0.00
257.06
514.13
771.19
1,028.25
1,285.31
1,542.38
1,799.44
2,056.50
손익(백만)
가격


SMK8-SOYBEAN MEAL FUTR May18
467.53





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

BOK8	SOYBEAN OIL FUTR May18	28
CK8	CORN FUTURE May18	69
CTK8	COTTON NO.2 FUTR May18	18
KCK8	COFFEE 'C' FUTURE May18	27
KR4175N40(	2018-04 달러선물	26

KWK8	KC HRW WHEAT FUT May18	14
SBK8	SUGAR #11 (WORLD) May18	29
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)

325