공시일	2018-03-23
기준일	2018-03-22

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	2018-03-23
기준일	2018-03-22

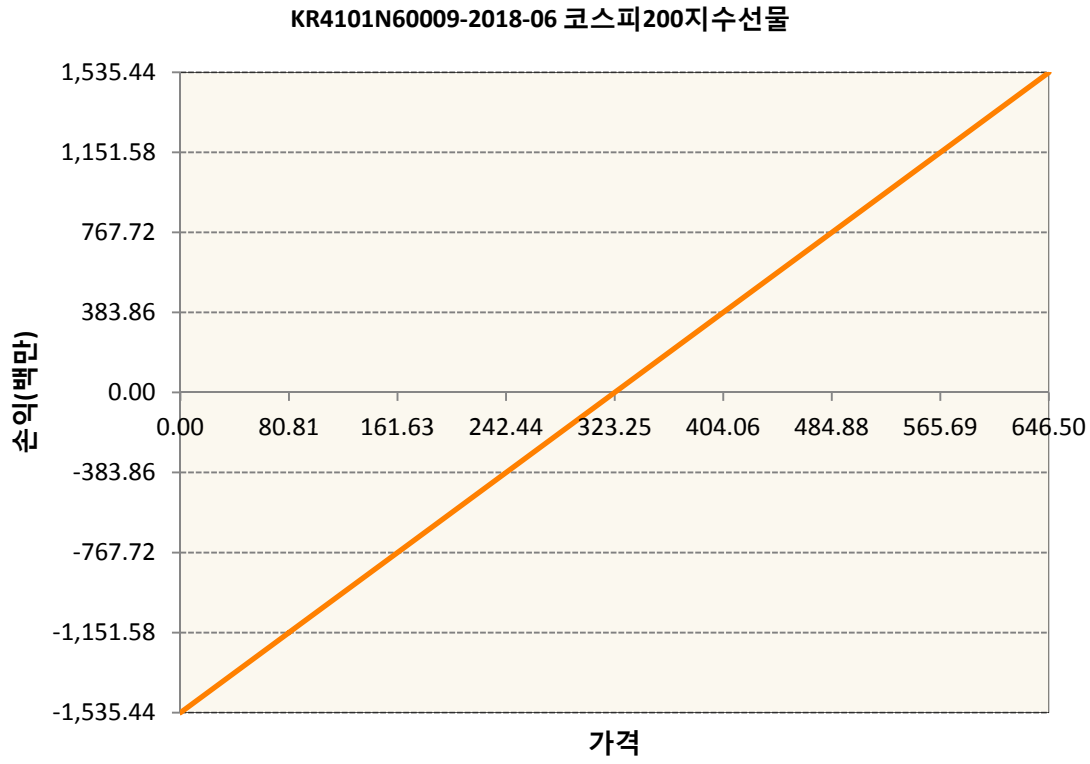
스마트인덱스모

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	1,535	0	1,535	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	2018-03-23
기준일	2018-03-22

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	1,107

* 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	2018-03-23
기준일	2018-03-22

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	407

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

408

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2018-03-23
기준일	2018-03-22

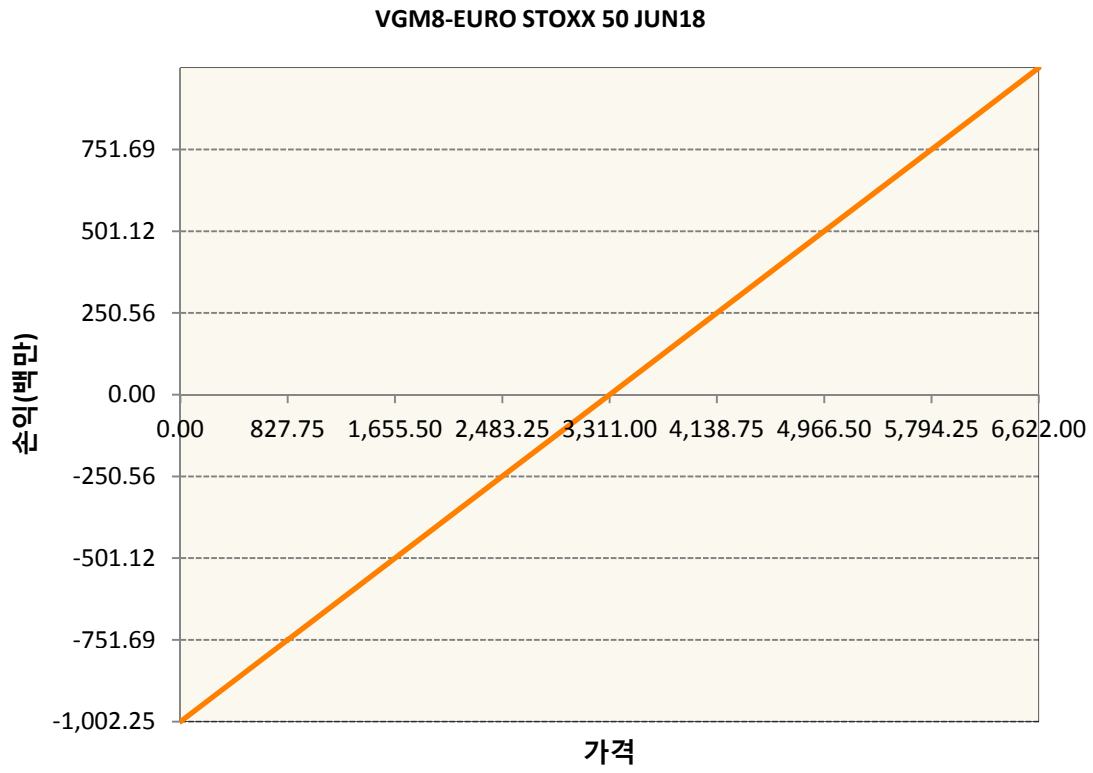
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,002	0	1,002	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGM8	EURO STOXX 50 JUN18	80

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

(단위:백만원)

48

공시일	2018-03-23
기준일	2018-03-22

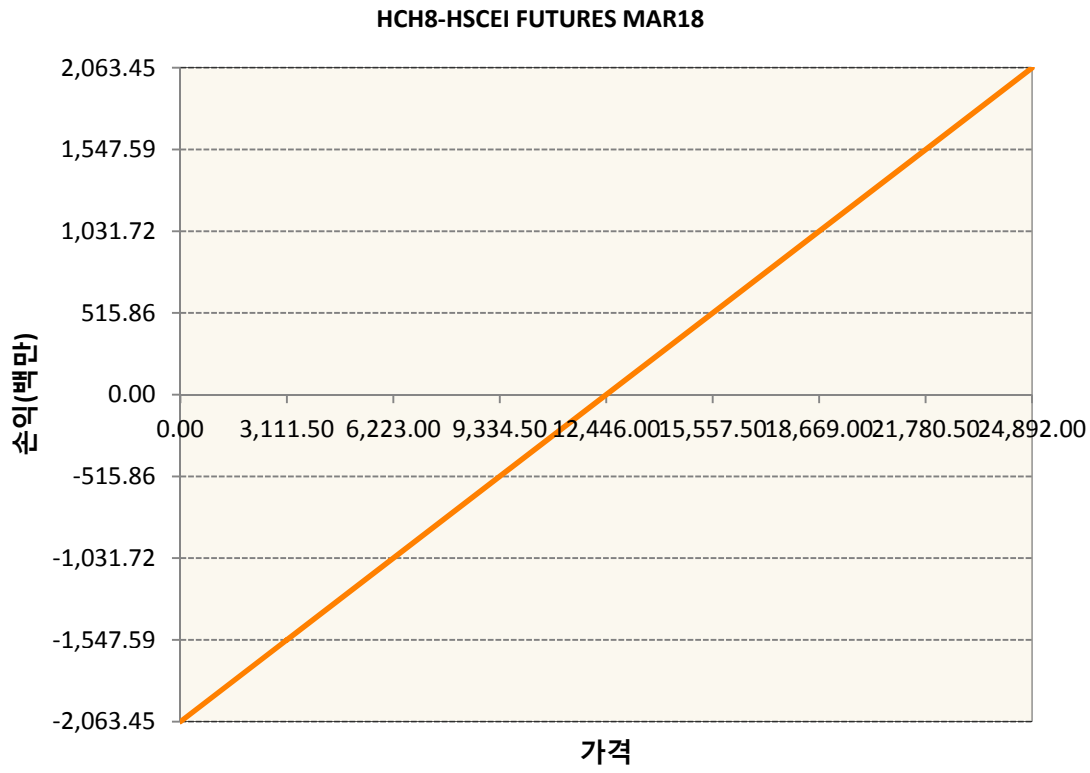
차이나인덱스모(주식-파생형)

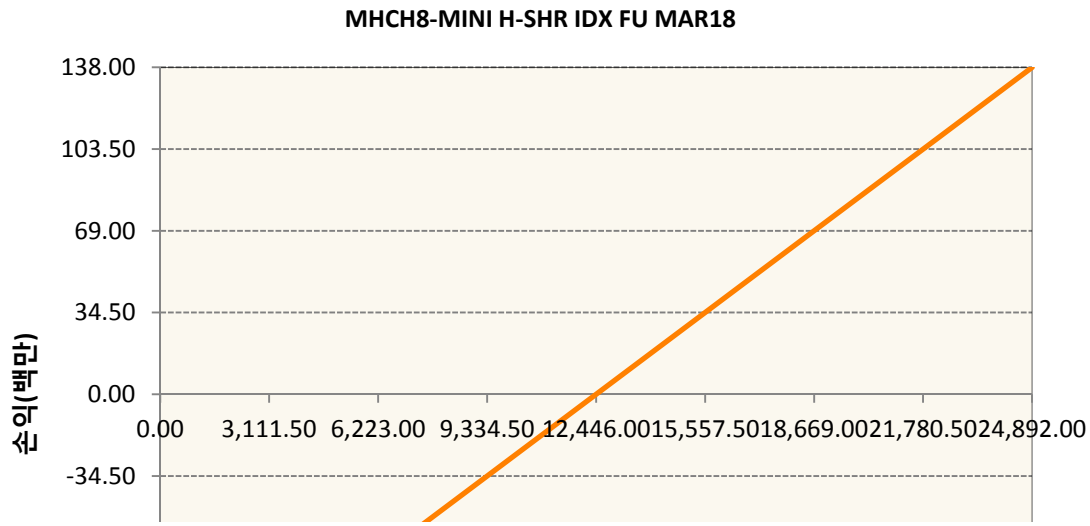
1. 계약금액

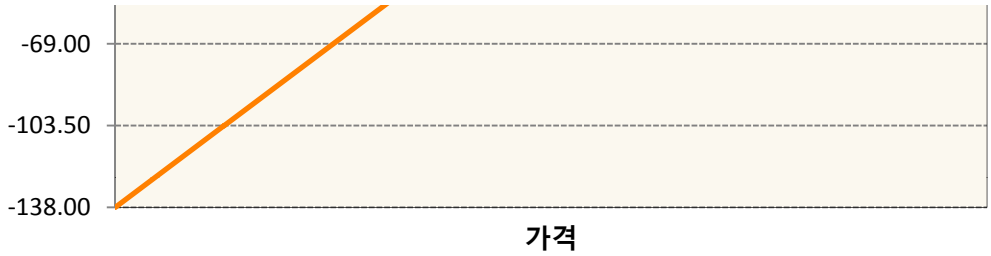
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,201	0	2,201	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCH8	HSCEI FUTURES MAR18	165
MHCH8	MINI H-SHR IDX FU MAR18	11

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	153

공시일	2018-03-23
기준일	2018-03-22

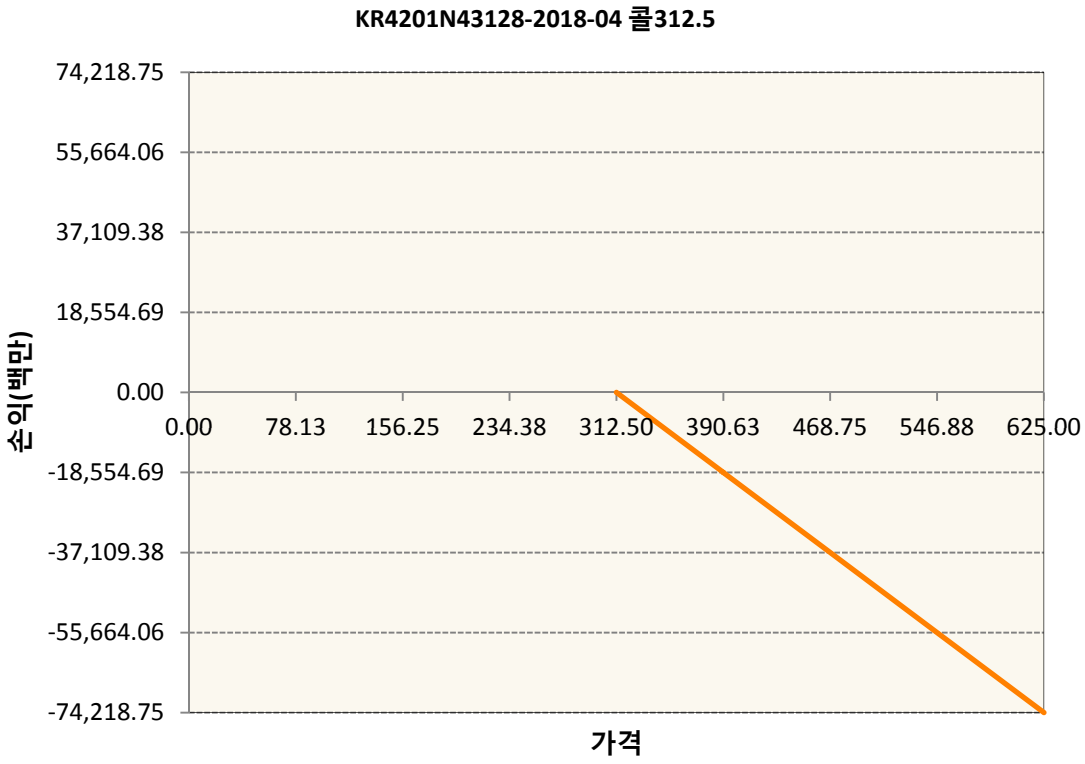
커버드콜모(주식혼합-파생형)

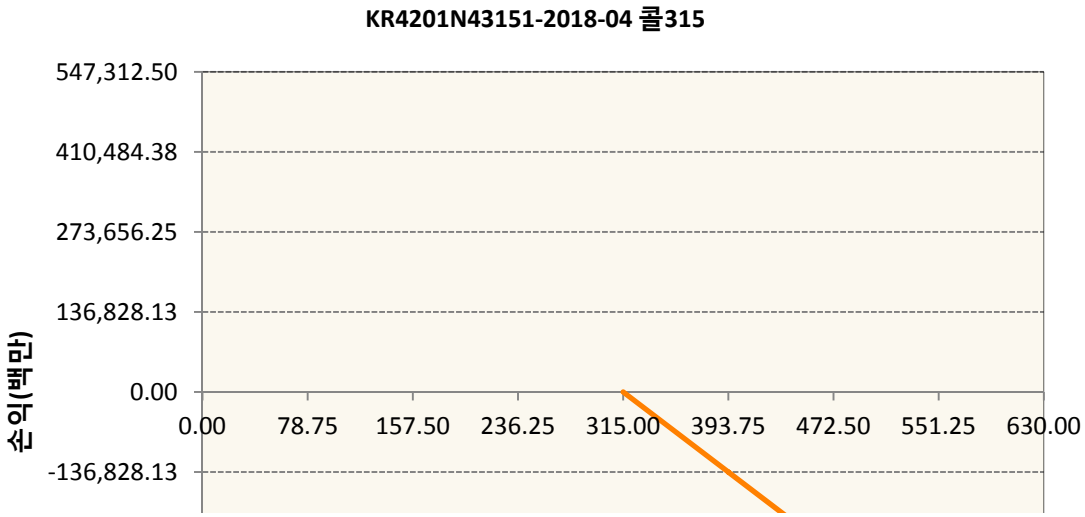
1. 계약금액

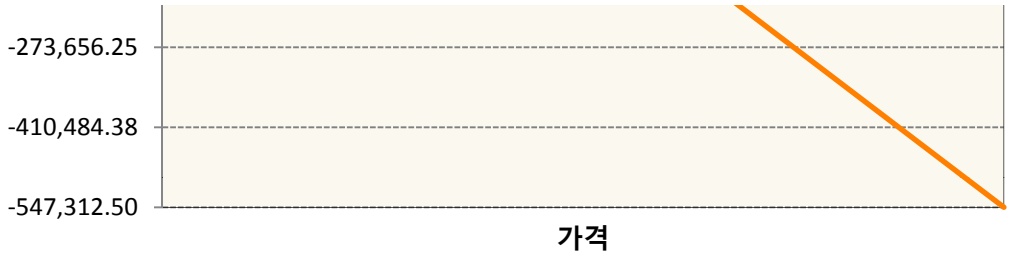
(단위:백만원)

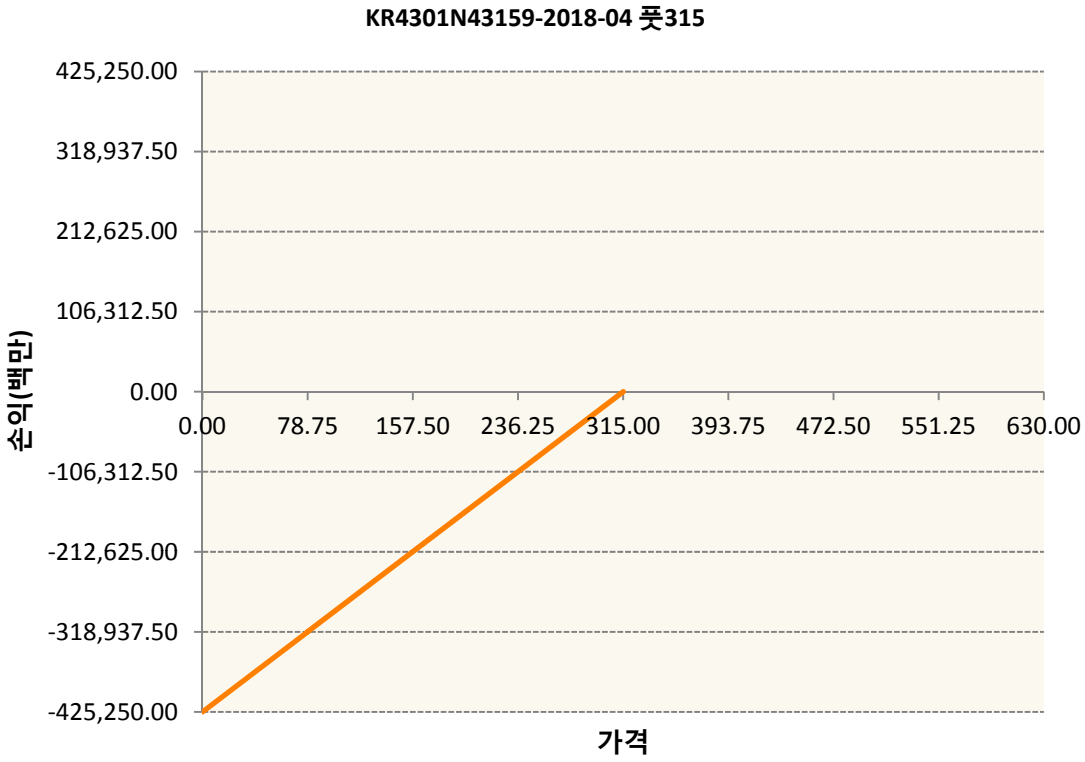
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	15,134	0	15,134	장내
누계	유가증권	옵션	0	1,046,781	-1,046,781	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201N4312018-04 콜312.5							5,458
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	3,217	3,119	3,012	2,898	2,779	2,655	2,527
-5.33%	2,711	2,565	2,417	2,268	2,117	1,965	1,813
-2.67%	1,779	1,621	1,462	1,302	1,143	983	824
0%	405	275	140	0	-143	-288	-436
2.67%	-1,309	-1,391	-1,485	-1,587	-1,697	-1,814	-1,936
5.33%	-3,222	-3,263	-3,316	-3,380	-3,453	-3,536	-3,627
8.00%	-5,225	-5,241	-5,266	-5,300	-5,344	-5,397	-5,458
KR4201N4312018-04 콜315							38,922
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	21,214	20,599	19,911	19,161	18,362	17,521	16,644

-5.33%	18,232	17,238	16,216	15,171	14,110	13,035	11,949
-2.67%	12,361	11,183	10,006	8,829	7,651	6,474	5,297
0%	3,212	2,164	1,092	0	-1,107	-2,225	-3,353
2.67%	-8,690	-9,406	-10,193	-11,039	-11,932	-12,865	-13,830
5.33%	-22,339	-22,723	-23,197	-23,752	-24,379	-25,068	-25,812
8.00%	-36,844	-37,009	-37,247	-37,559	-37,946	-38,401	-38,922
KR4301N4312018-04 풋315							22,298
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-21,247	-21,340	-21,468	-21,629	-21,823	-22,047	-22,298
-5.33%	-10,548	-10,896	-11,273	-11,672	-12,091	-12,525	-12,971
-2.67%	-2,621	-3,167	-3,713	-4,259	-4,805	-5,351	-5,897
0%	1,225	841	431	0	-448	-910	-1,382
2.67%	2,296	2,167	1,999	1,793	1,554	1,283	985
5.33%	2,458	2,436	2,397	2,335	2,248	2,135	1,995
8.00%	2,472	2,470	2,464	2,452	2,430	2,395	2,345

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

65,585

공시일	2018-03-23
기준일	2018-03-22

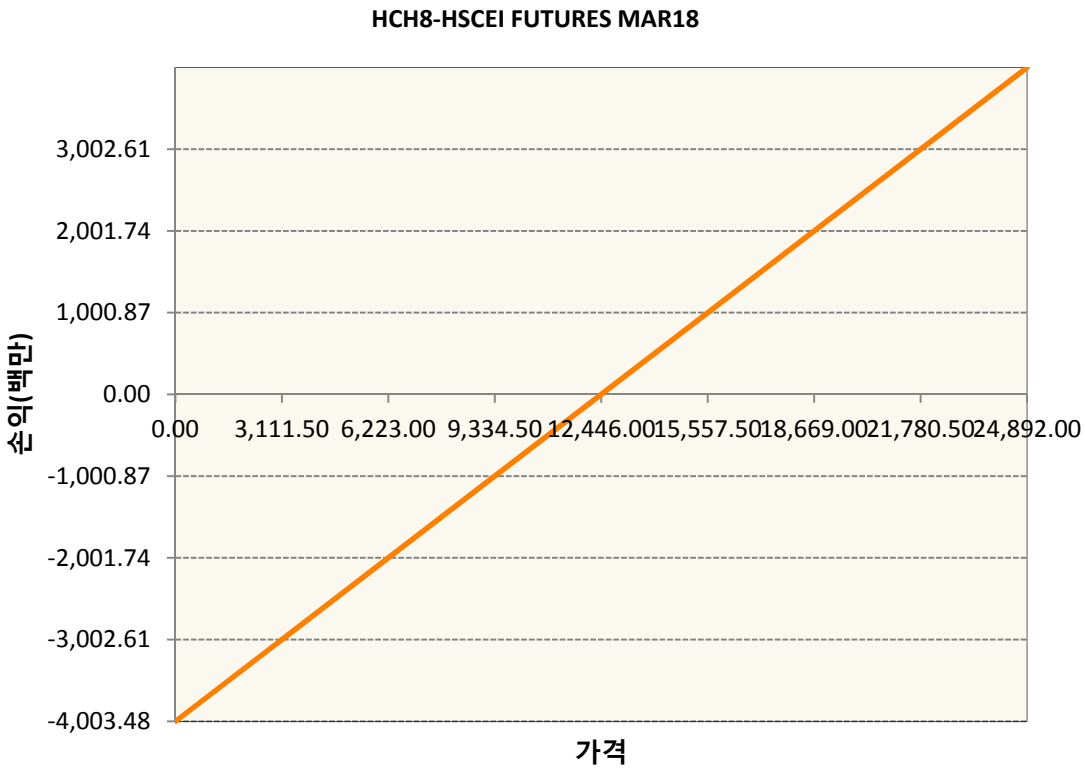
홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생

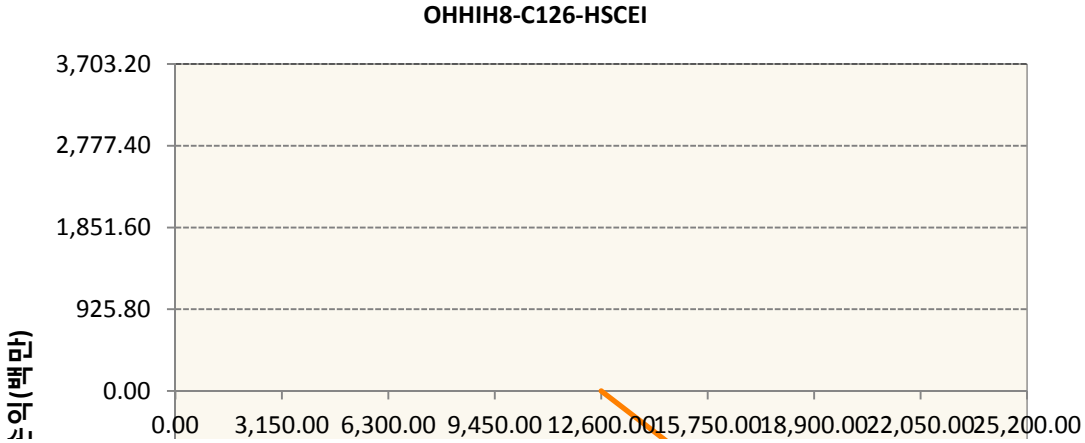
1. 계약금액

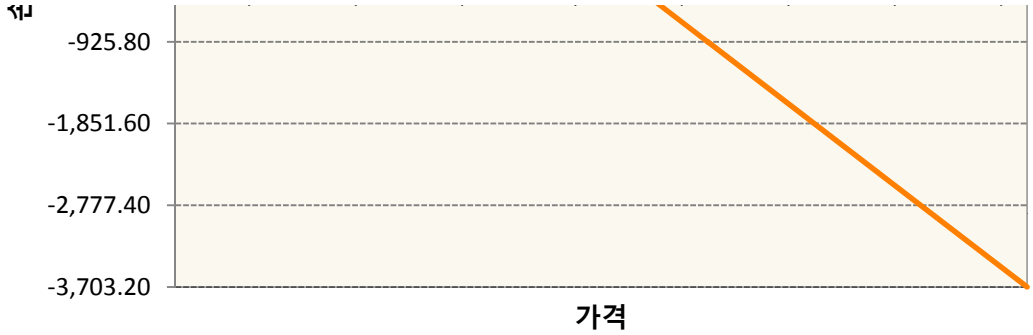
(단위:백만원)

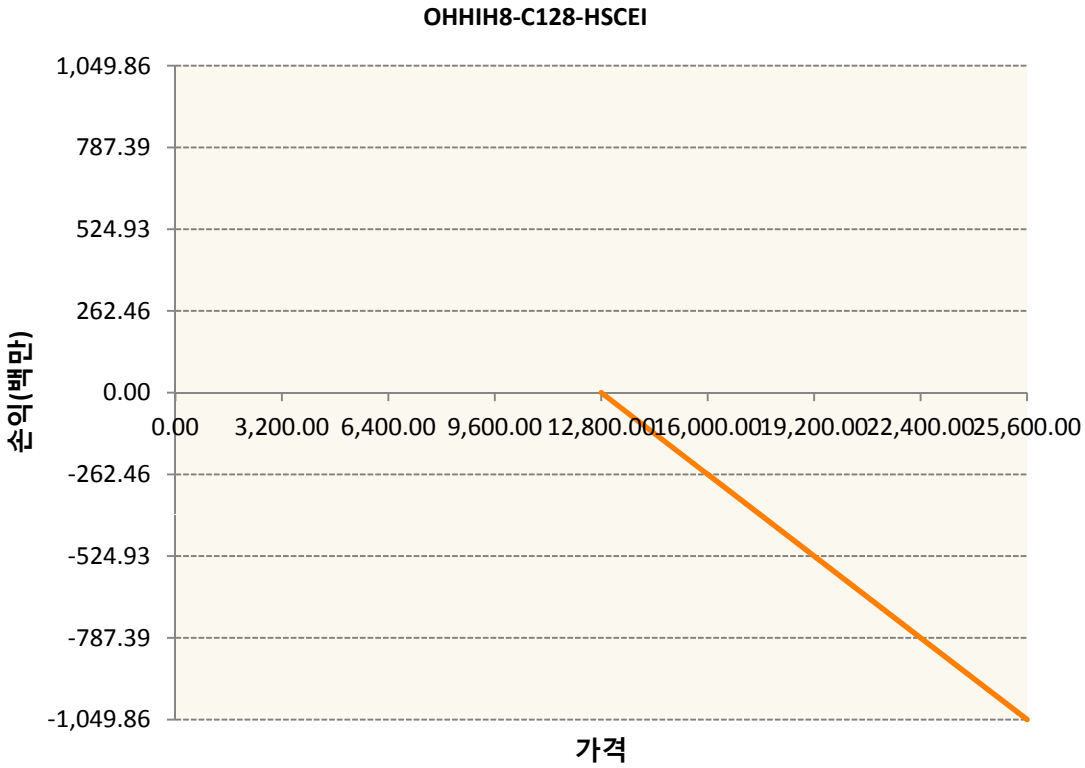
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	4,003	0	4,003	장내
누계	유가증권	옵션	0	9,506	-9,506	장내

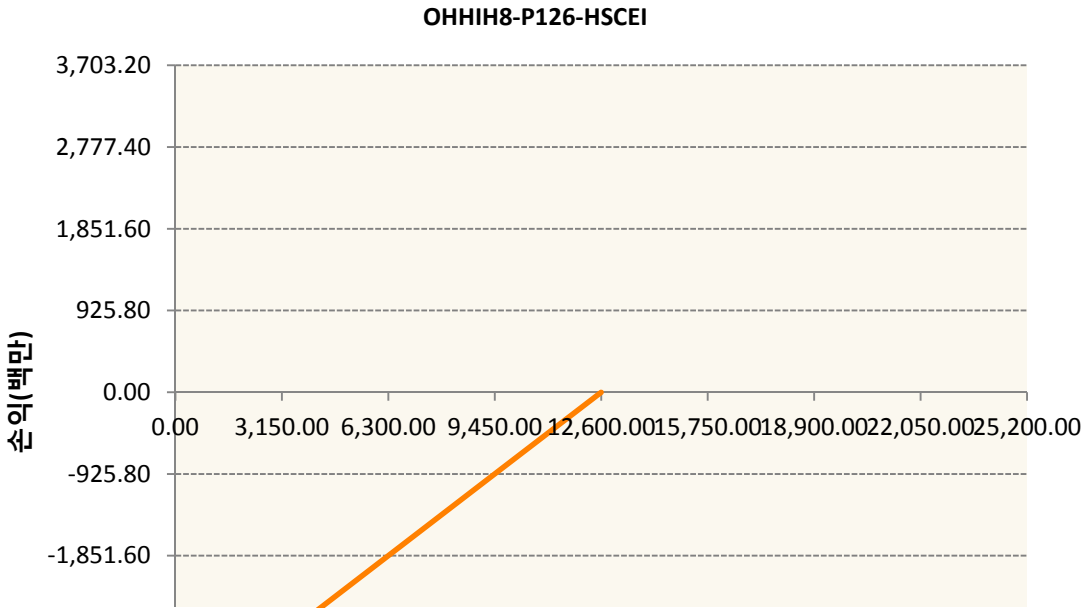
2. 만기시점의 손익구조

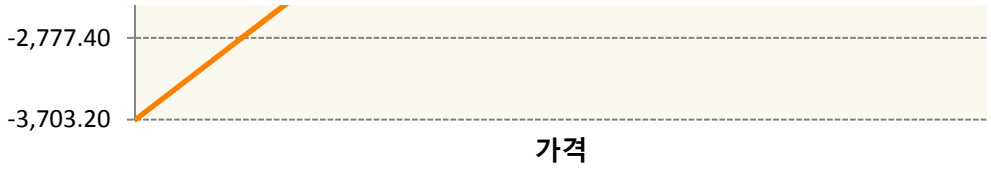


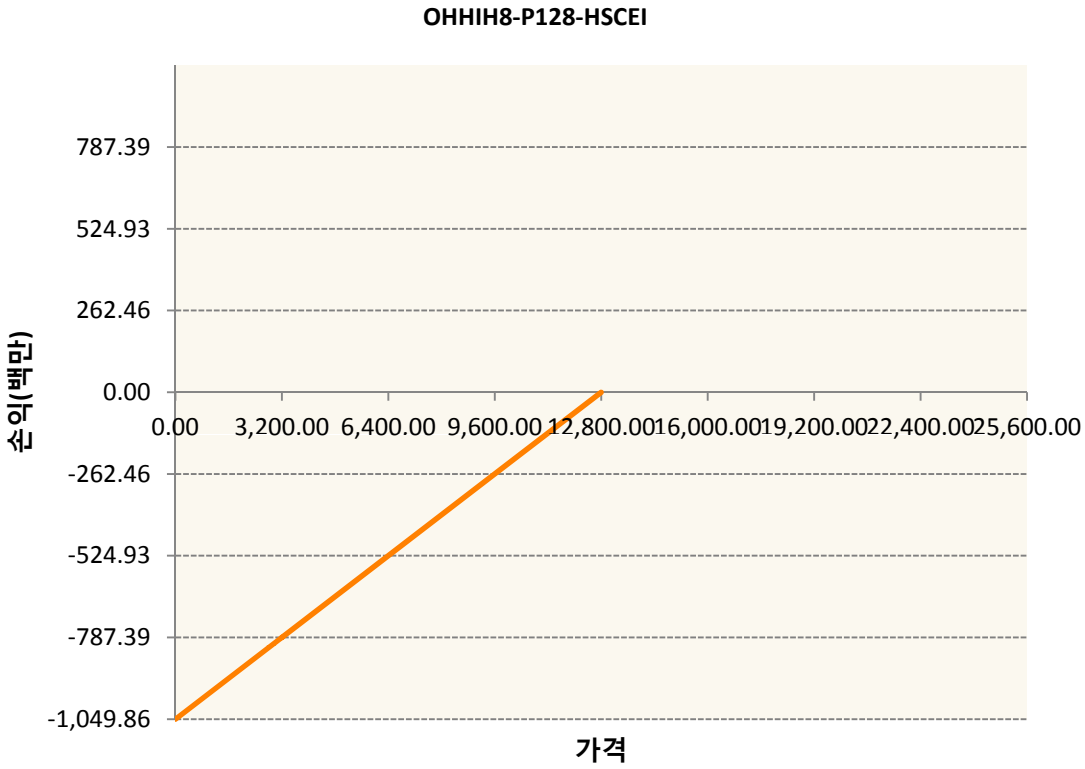



-925.80
-1,851.60
-2,777.40
-3,703.20
가격


OHHIH8-C128-HSCEI
1,049.86
787.39
524.93
262.46
0.00
-262.46
-524.93
-787.39
-1,049.86
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
3,703.20
2,777.40
1,851.60
925.80
0.00
-925.80
-1,851.60
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	320
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)

941

공시일	2018-03-23
기준일	2018-03-22

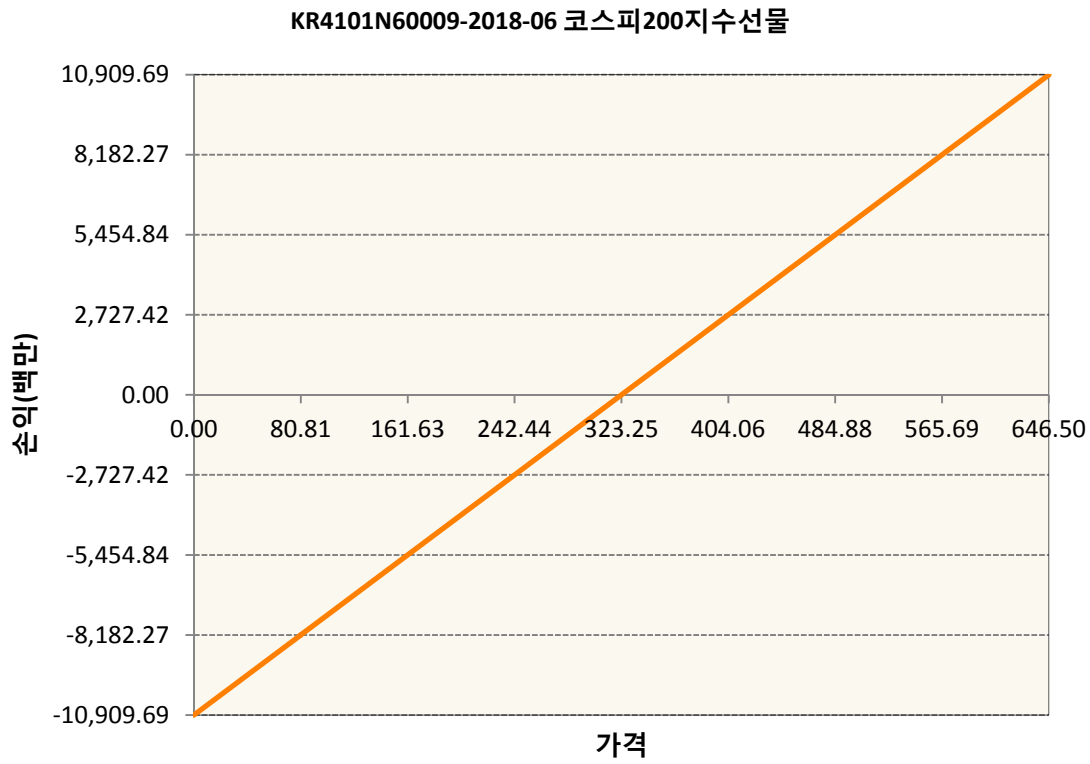
코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼

1. 계약금액

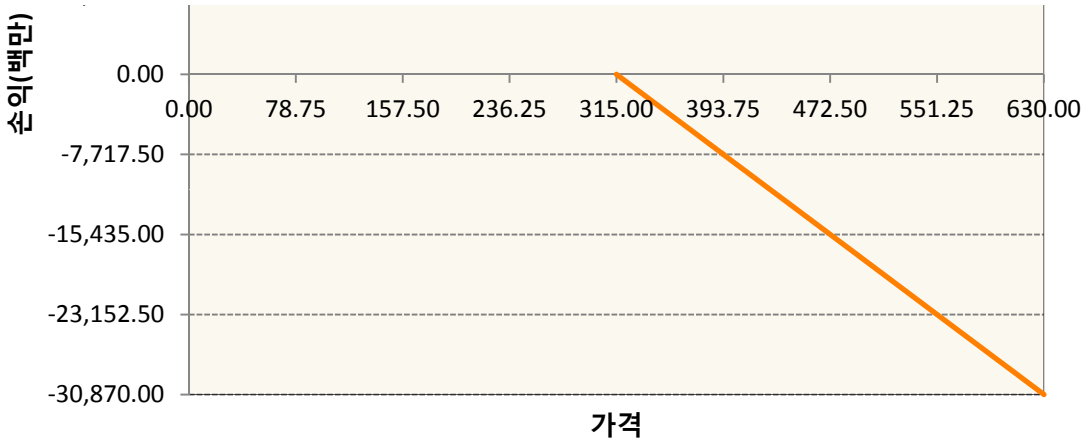
(단위:백만원)

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	10,910	0	10,910	장내
누계	유가증권	스왑	54,200	0	54,200	장외
누계	유가증권	옵션	0	55,718	-55,718	장내

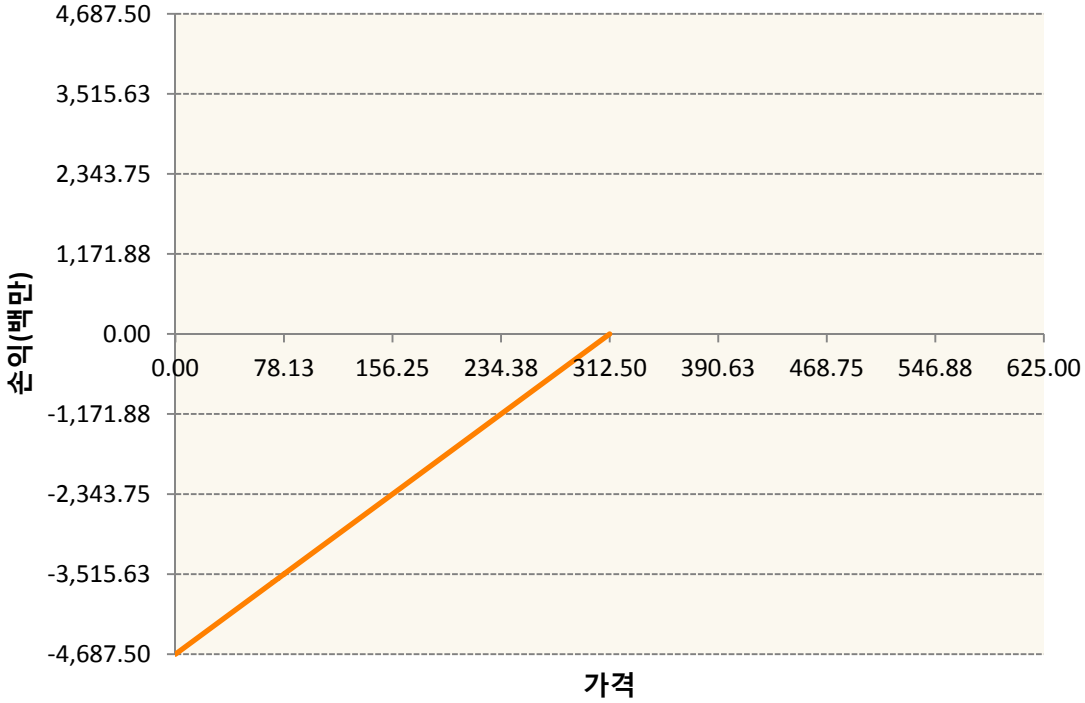
2. 만기시점의 손익구조



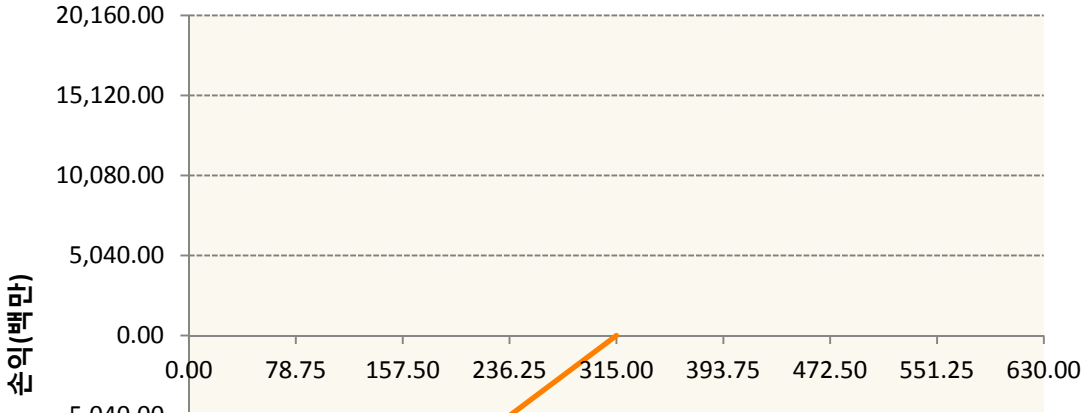




KR4301N43126-2018-04 풋312.5



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							274
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-274	-274	-274	-274	-274	-274	-274
-5.33%	-183	-183	-183	-183	-183	-183	-183
-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%	183	183	183	183	183	183	183
8.00%	274	274	274	274	274	274	274
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						274
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-274	-274	-274	-274	-274	-274	-274
-5.33%	-183	-183	-183	-183	-183	-183	-183
-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%	183	183	183	183	183	183	183
8.00%	274	274	274	274	274	274	274
	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						873
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-873	-873	-873	-873	-873	-873	-873
-5.33%	-582	-582	-582	-582	-582	-582	-582
-2.67%	-291	-291	-291	-291	-291	-291	-291
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	291	291	291	291	291	291	291
5.33%	582	582	582	582	582	582	582
8.00%	873	873	873	873	873	873	873
	KR4201N431 2018-04 콜315						2,195
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,197	1,162	1,123	1,081	1,036	988	939
-5.33%	1,028	972	915	856	796	735	674
-2.67%	697	631	564	498	432	365	299
0%	181	122	62	0	-62	-126	-189
2.67%	-490	-531	-575	-623	-673	-726	-780
5.33%	-1,260	-1,282	-1,308	-1,340	-1,375	-1,414	-1,456
8.00%	-2,078	-2,087	-2,101	-2,118	-2,140	-2,166	-2,195
	KR4301N431 2018-04 풋312.5						224
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-208	-210	-212	-214	-217	-220	-224
-5.33%	-95	-100	-105	-110	-115	-121	-126
-2.67%	-20	-26	-32	-38	-44	-50	-56
0%	11	8	4	0	-4	-9	-13
2.67%	18	17	16	14	12	10	7
5.33%	19	19	19	18	18	17	16
8.00%	19	19	19	19	19	19	18
	KR4301N431 2018-04 풋315						1,057

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,007	-1,012	-1,018	-1,025	-1,035	-1,045	-1,057
-5.33%	-500	-517	-534	-553	-573	-594	-615
-2.67%	-124	-150	-176	-202	-228	-254	-280
0%	58	40	20	0	-21	-43	-66
2.67%	109	103	95	85	74	61	47
5.33%	117	116	114	111	107	101	95
8.00%	117	117	117	116	115	114	111

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

8,234

공시일	2018-03-23
기준일	2018-03-22

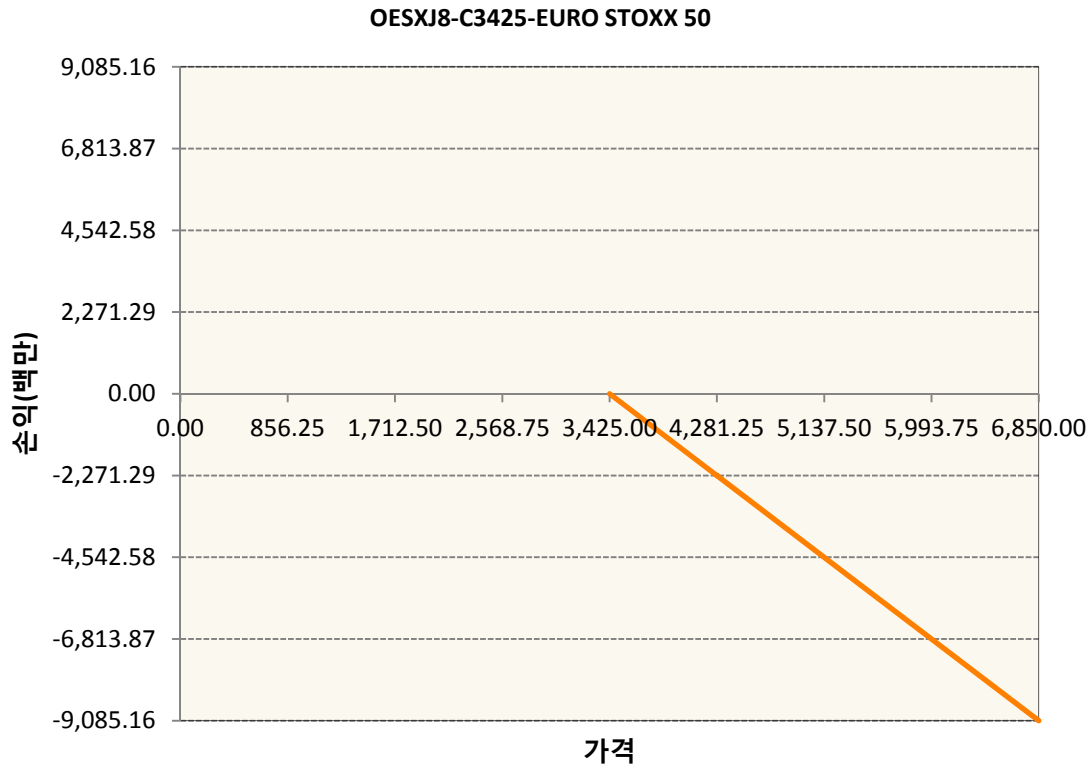
유로커버드콜모(주식혼합-파생형

1. 계약금액

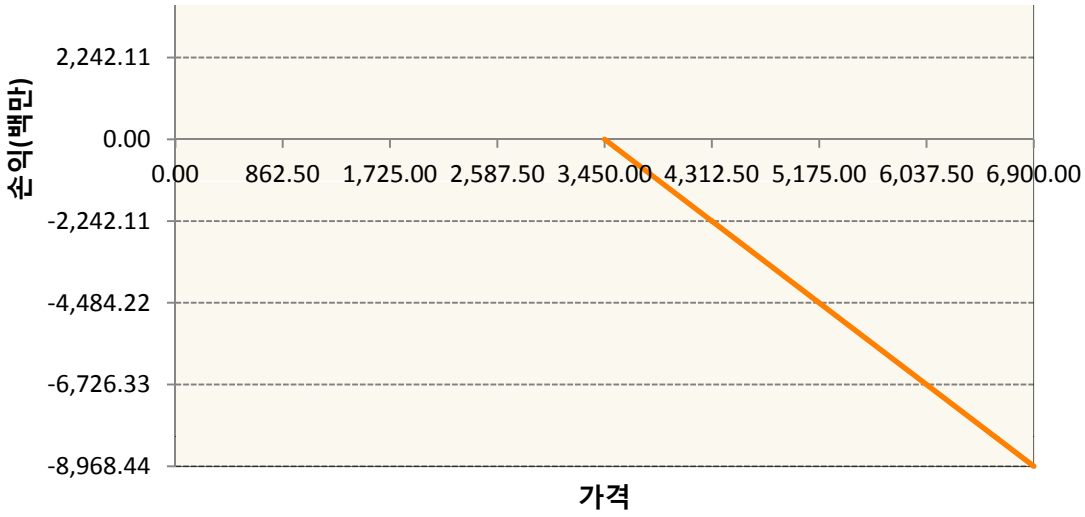
(단위:백만원)

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	9,229	0	9,229	
누계	유가증권	스왑	99,475	0	99,475	장외
누계	유가증권	옵션	0	36,107	-36,107	장내
누계	지수	스왑	53,054	0	53,054	장외

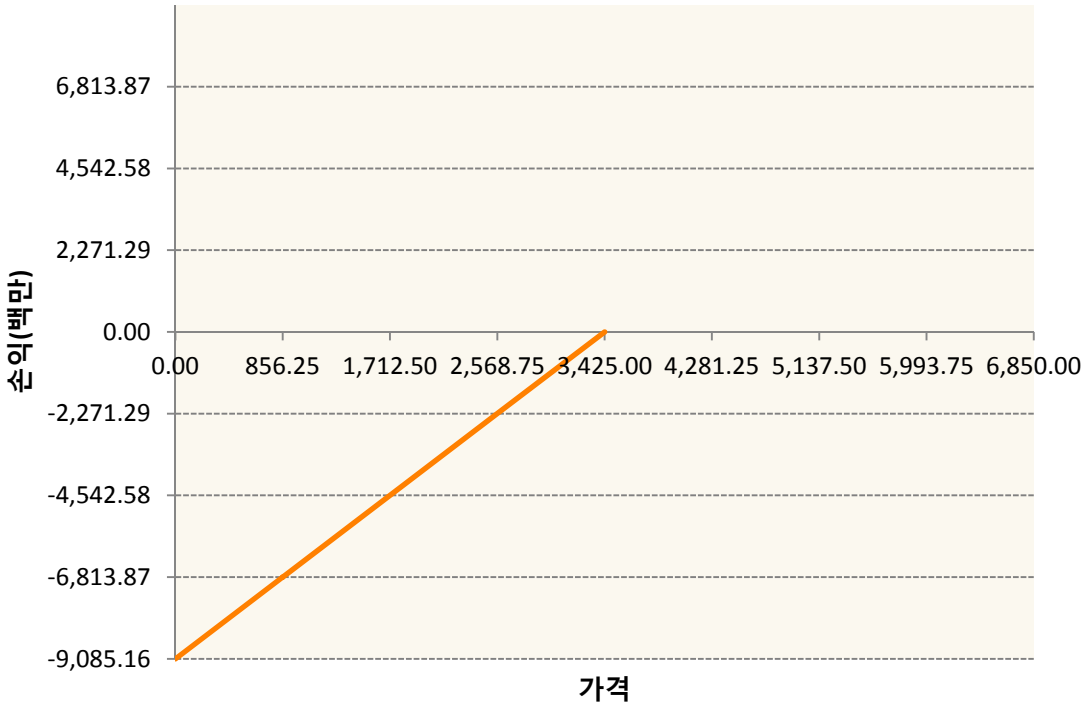
2. 만기시점의 손익구조



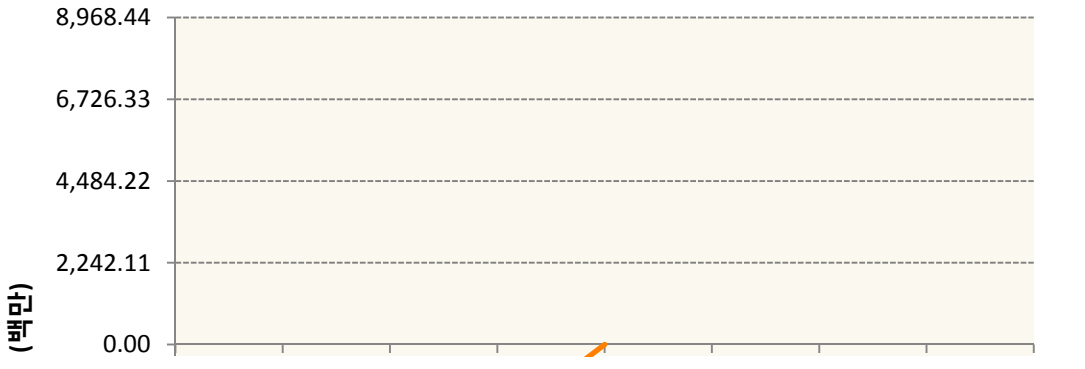


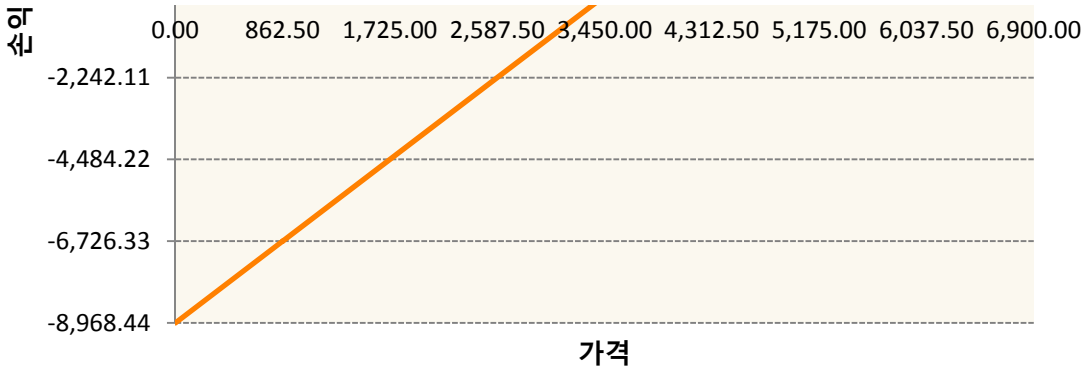


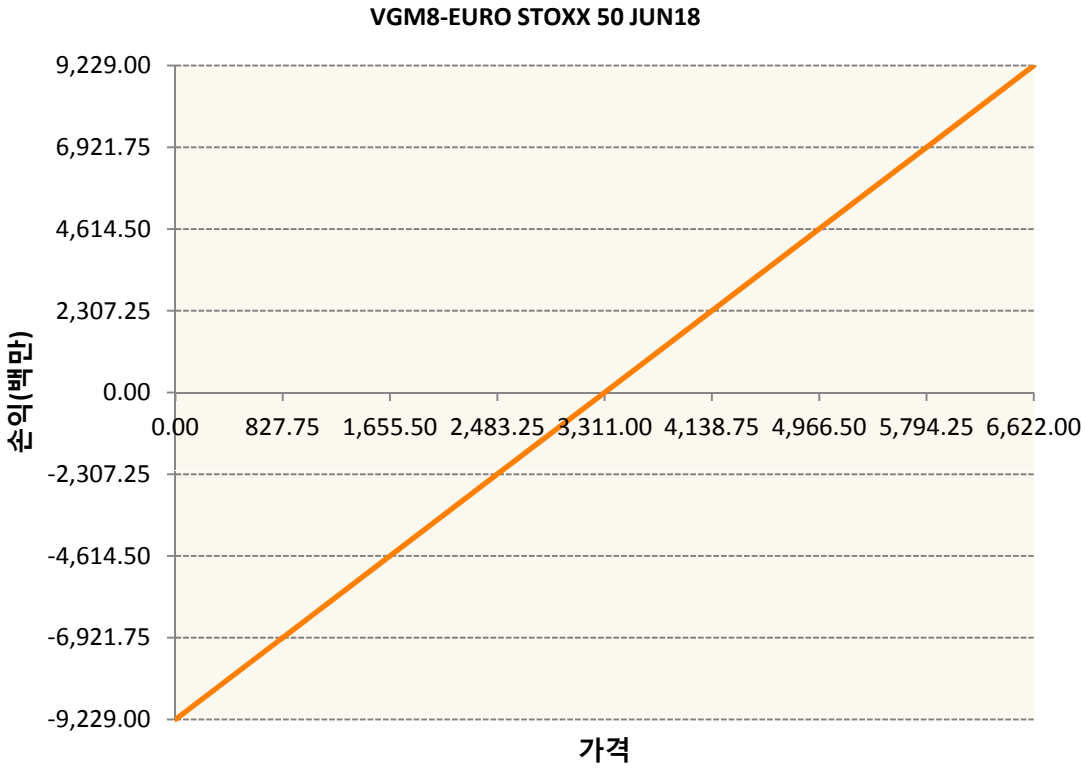
OESXJ8-P3425-EURO STOXX 50



OESXJ8-P3450-EURO STOXX 50







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)	(단위:백만원)
260105SGPX SG EURO Covered CALL STRATEGY - 994.569	176
260105SQPX SG EURO Covered CALL STRATEGY	330
OESXJ8-C34 EURO STOXX 50	727
OESXJ8-C34 EURO STOXX 50	717
OESXJ8-P34 EURO STOXX 50	727
OESXJ8-P34 EURO STOXX 50	717
VGM8 EURO STOXX 50 JUN18	738

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

2,516

공시일	2018-03-23
기준일	2018-03-22

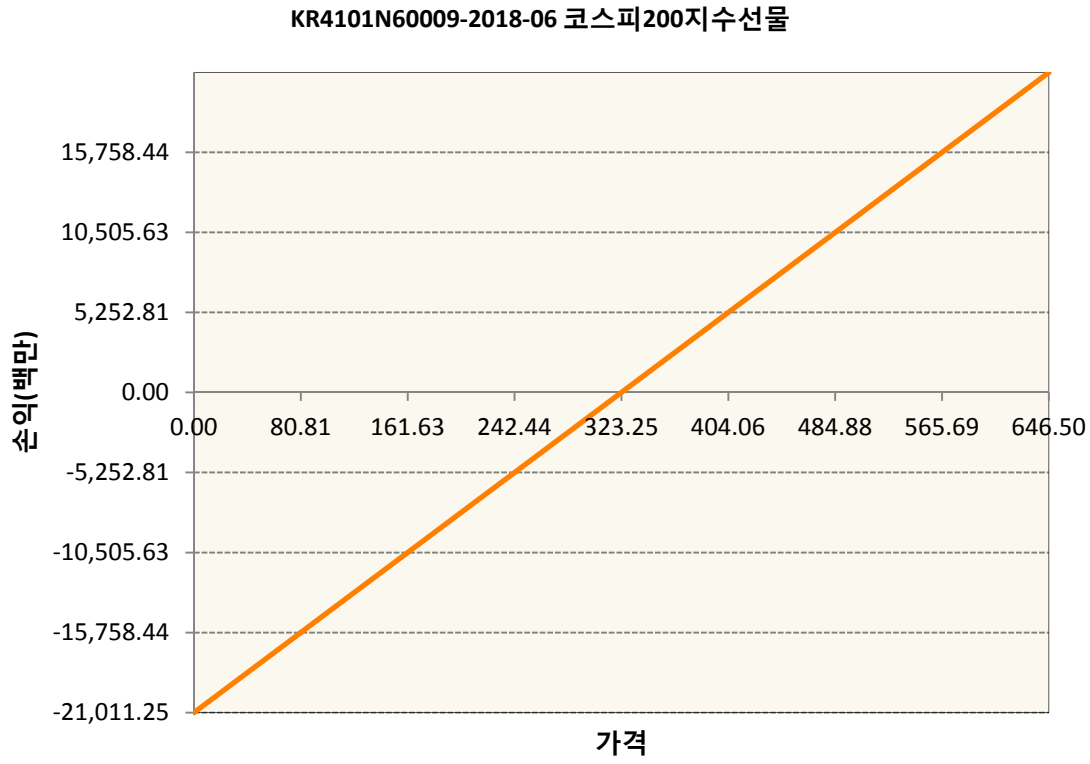
ETF스마트레버리지목표전환형8호

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	21,011	0	21,011	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101N60(2018-06 코스피200지수선물							1,681
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,681	-1,681	-1,681	-1,681	-1,681	-1,681	-1,681
-5.33%	-1,121	-1,121	-1,121	-1,121	-1,121	-1,121	-1,121
-2.67%	-560	-560	-560	-560	-560	-560	-560
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	560	560	560	560	560	560	560
5.33%	1,121	1,121	1,121	1,121	1,121	1,121	1,121
8.00%	1,681	1,681	1,681	1,681	1,681	1,681	1,681

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

1,158

공시일	2018-03-23
기준일	2018-03-22

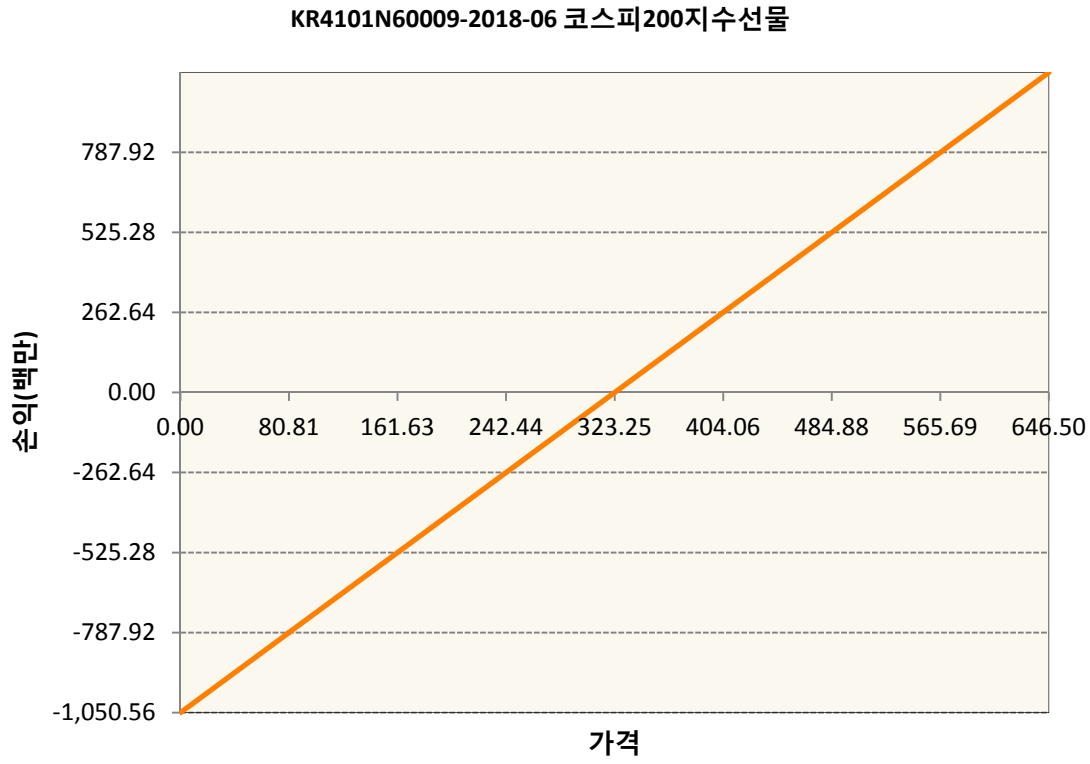
ETF스마트레버리지목표전환형9호

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	1,051	0	1,051	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	2018-03-23
기준일	2018-03-22

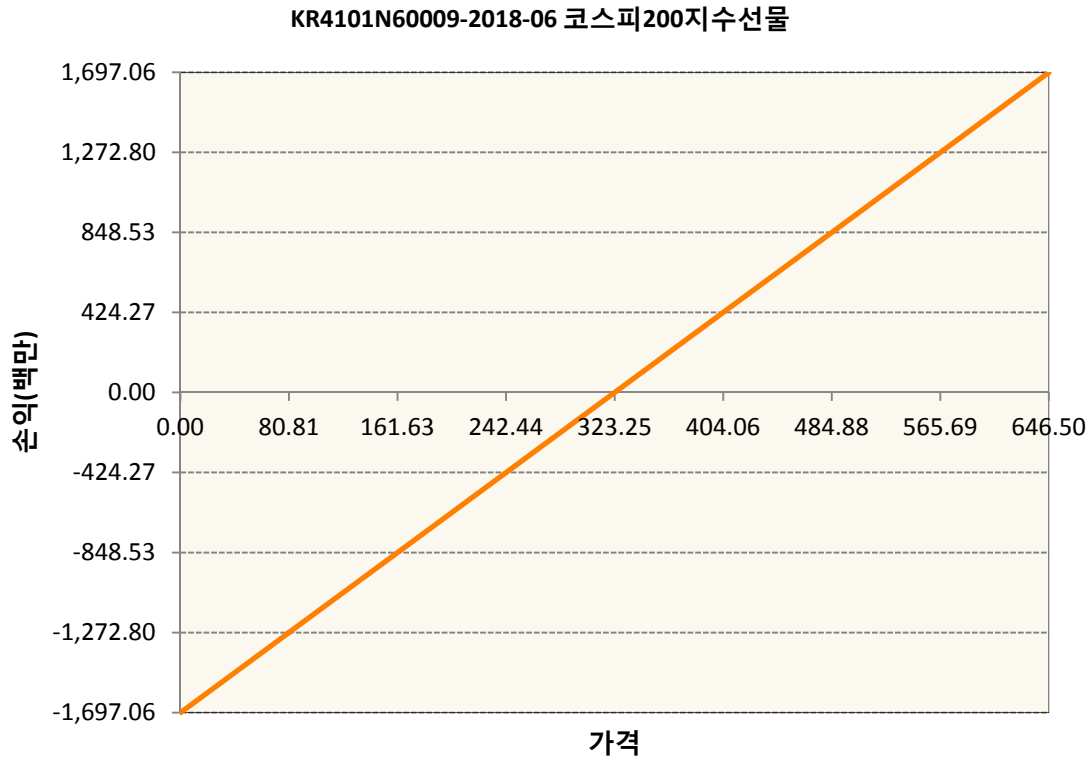
ETF스마트레버리지목표전환형10

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	1,697	0	1,697	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%	-91	-91	-91	-91	-91	-91	-91
-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%	91	91	91	91	91	91	91
8.00%	136	136	136	136	136	136	136

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

94

공시일	2018-03-23
기준일	2018-03-22

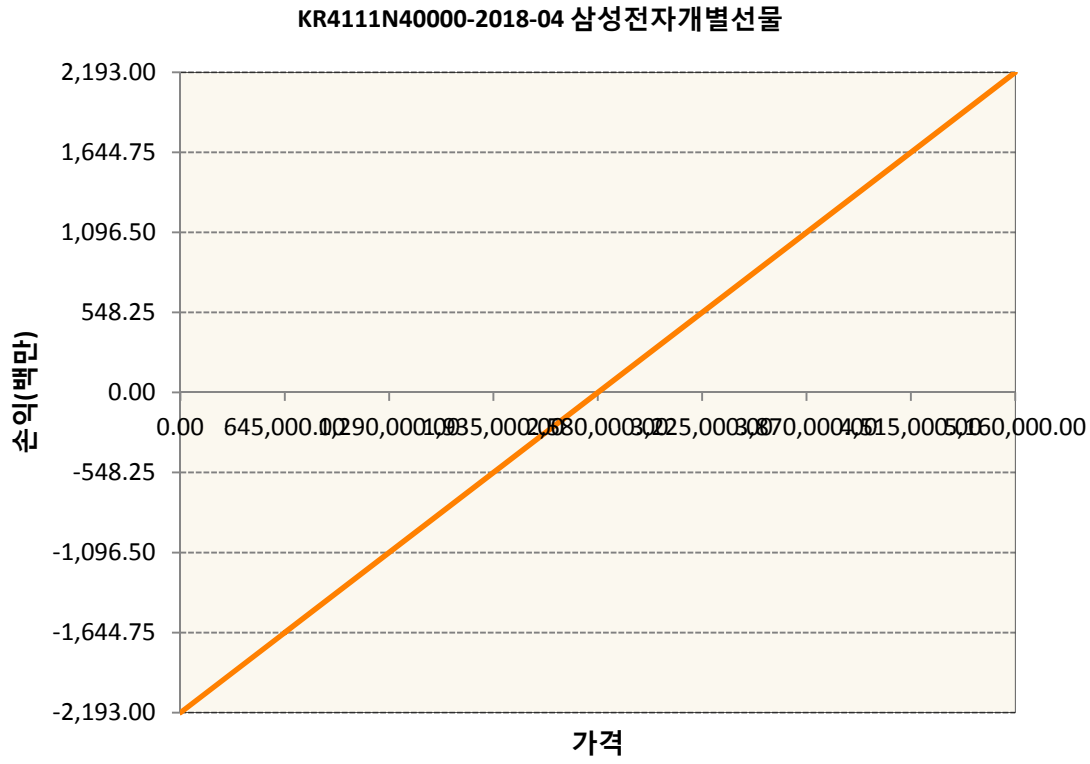
스마트KRX300인덱스1호(주식-파

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	2,193	0	2,193	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4111N40(2018-04 삼성전자개별선물							176
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-176	-176	-176	-176	-176	-176	-176
-5.33%	-117	-117	-117	-117	-117	-117	-117
-2.67%	-59	-59	-59	-59	-59	-59	-59
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	59	59	59	59	59	59	59
5.33%	117	117	117	117	117	117	117
8.00%	176	176	176	176	176	176	176

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

210

공시일	2018-03-23
기준일	2018-03-22

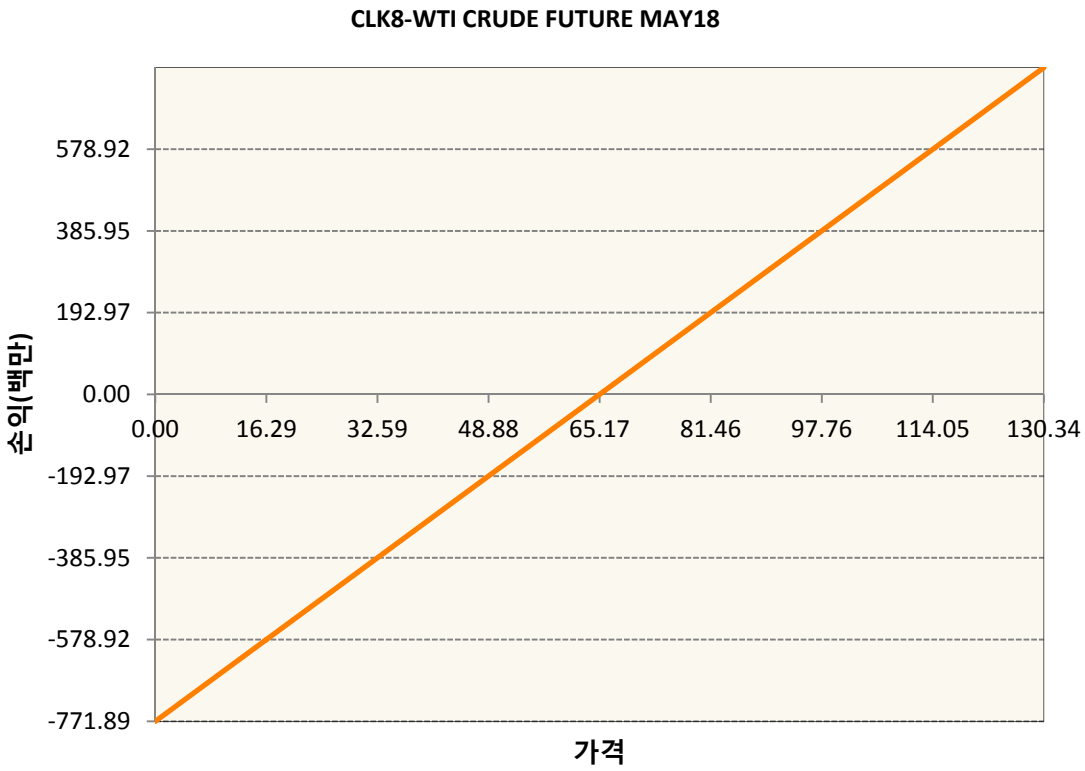
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

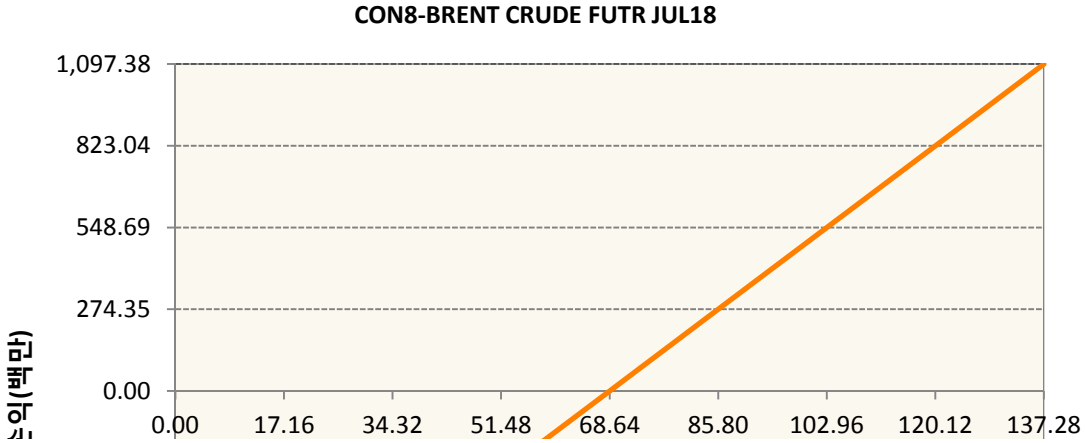
1. 계약금액

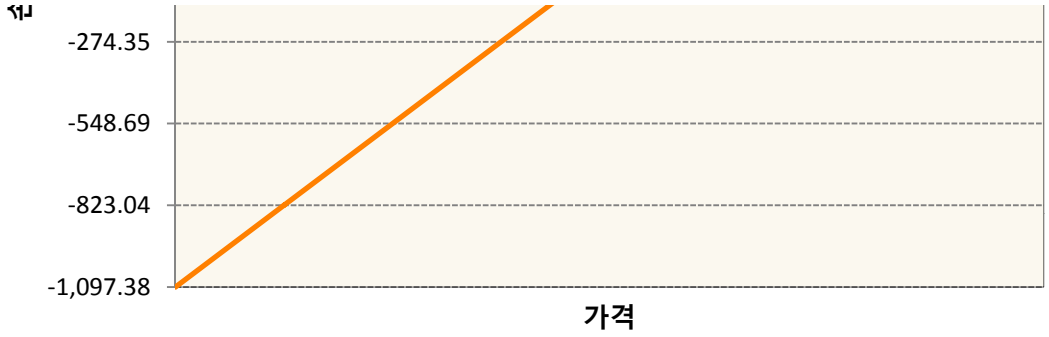
(단위:백만원)

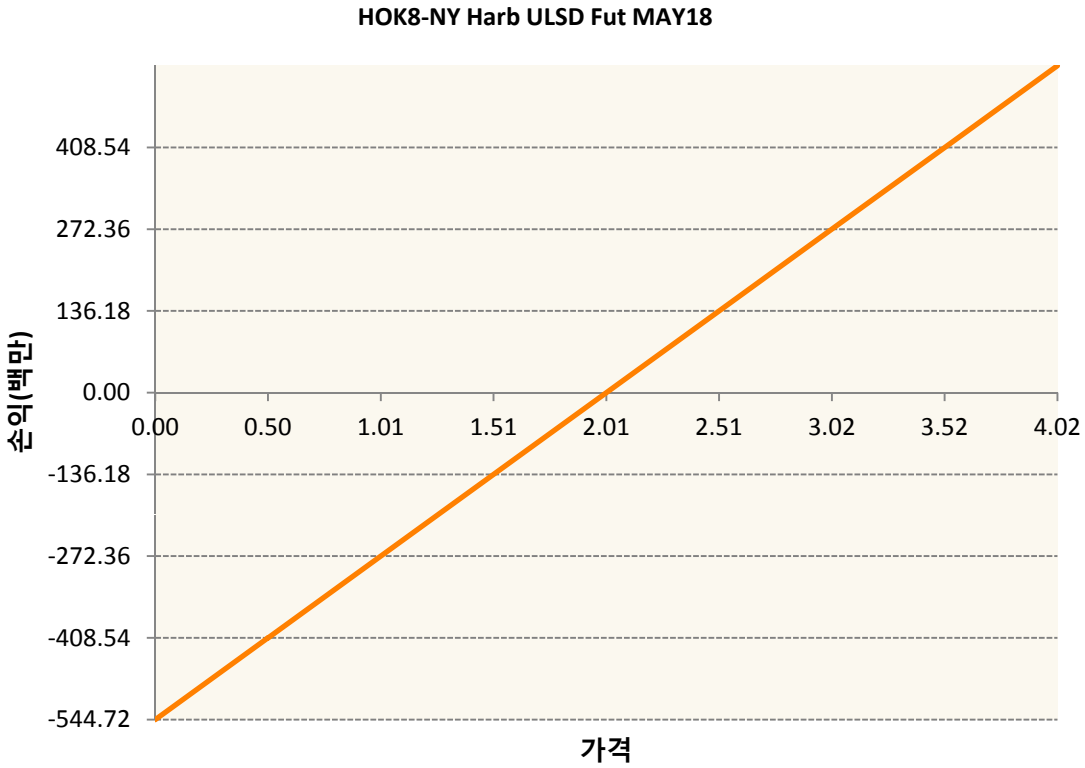
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	선물	유가증권	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	선물	유가증권	772	0	772	
누계	유가증권	선물	3,317	588	2,728	

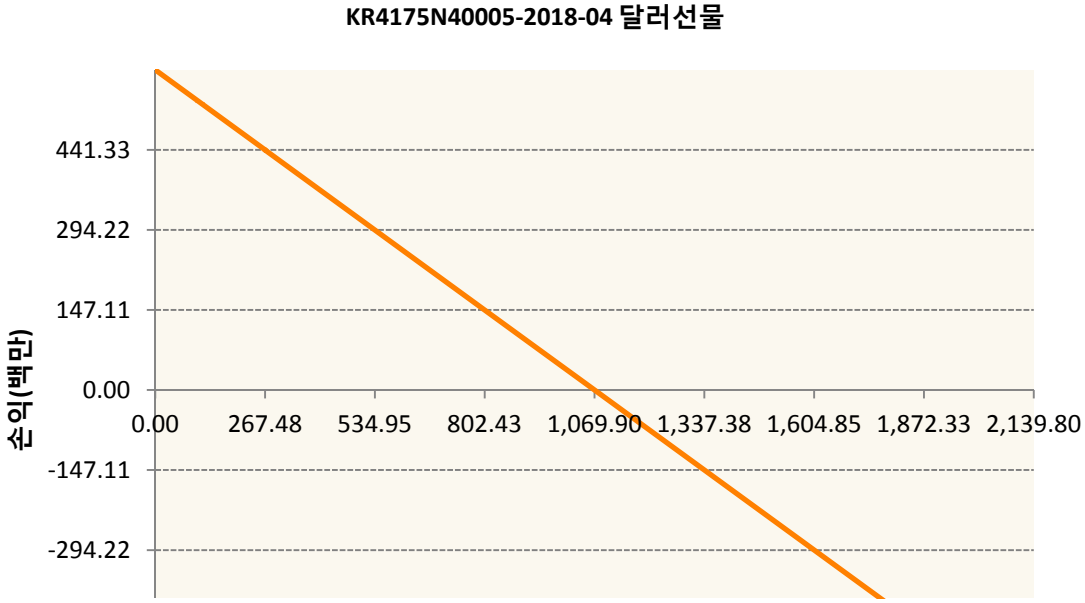
2. 만기시점의 손익구조

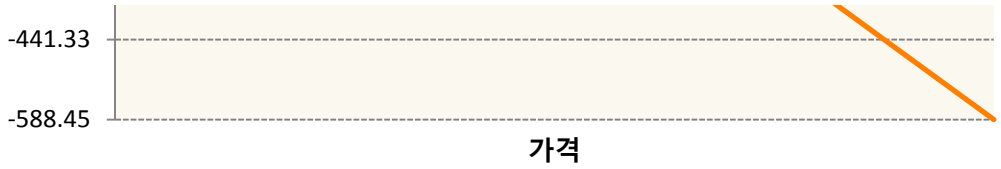


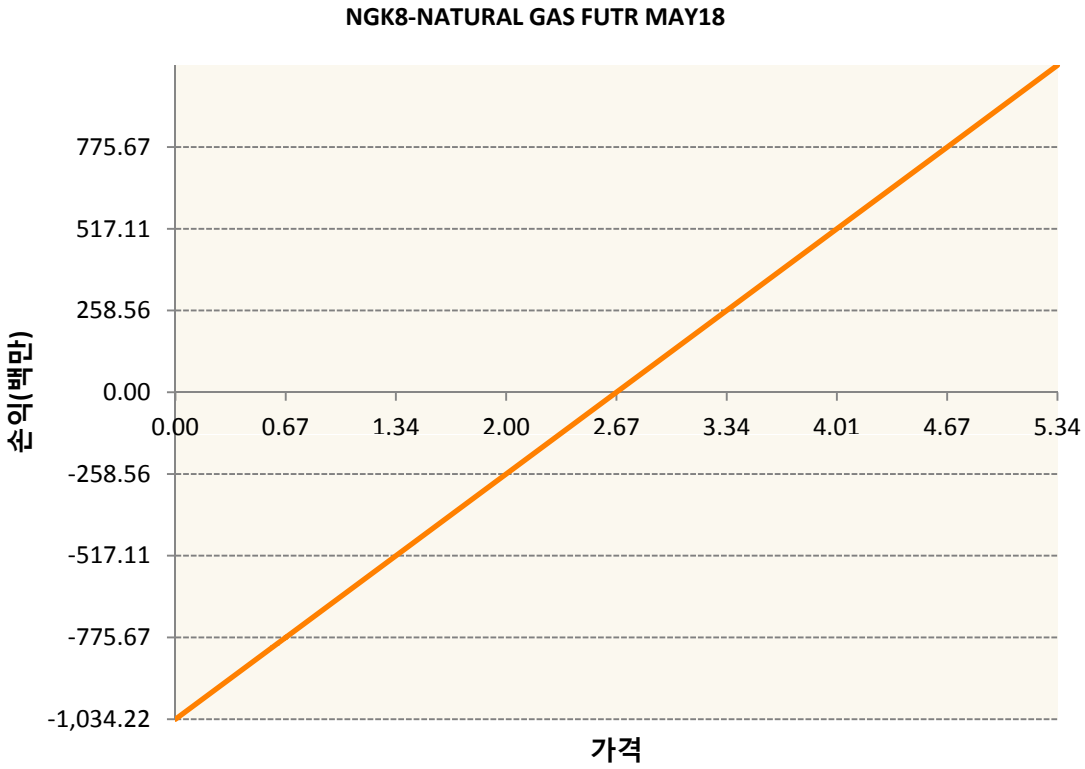


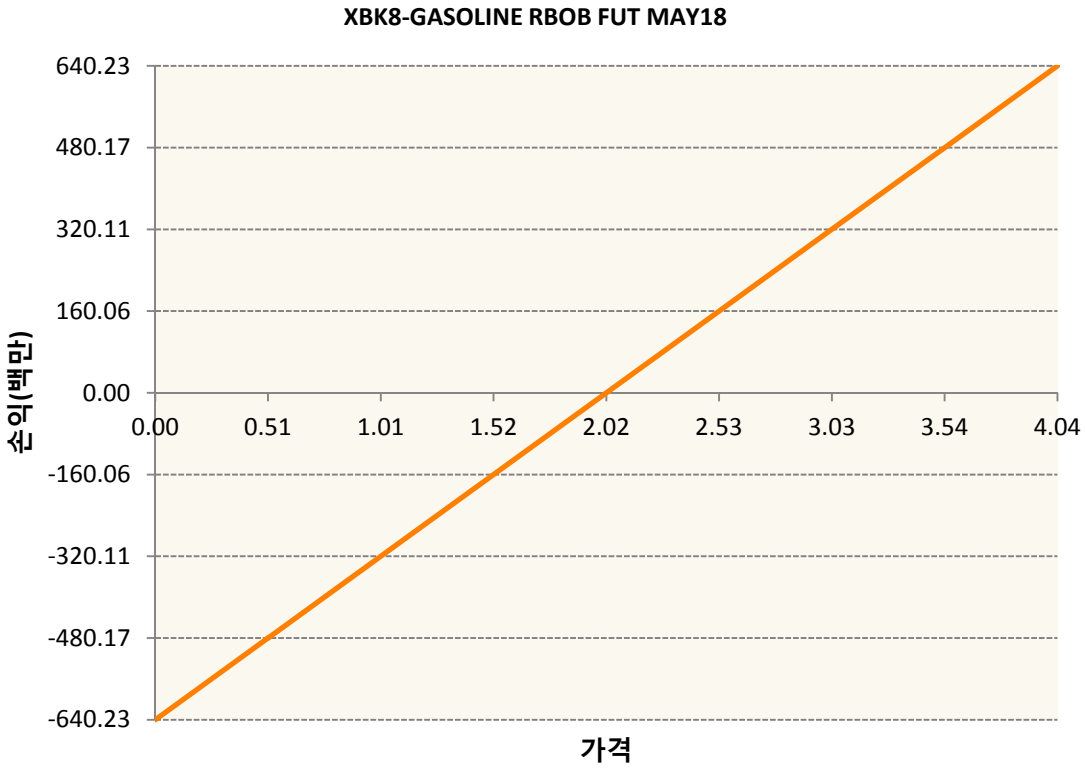

-274.35
-548.69
-823.04
-1,097.38
가격


HOK8-NY Harb ULSD Fut MAY18
408.54
272.36
136.18
0.00
-136.18
-272.36
-408.54
-544.72
0.00
0.50
1.01
1.51
2.01
2.51
3.02
3.52
4.02
손익(백만)
가격


KR4175N40005-2018-04 달러선물
441.33
294.22
147.11
0.00
-147.11
-294.22
0.00
267.48
534.95
802.43
1,069.90
1,337.38
1,604.85
1,872.33
2,139.80
손익(백만)


-441.33
-588.45
가격


NGK8-NATURAL GAS FUTR MAY18
775.67
517.11
258.56
0.00
-258.56
-517.11
-775.67
-1,034.22
0.00
0.67
1.34
2.00
2.67
3.34
4.01
4.67
5.34
손익(백만)
가격


XBK8-GASOLINE RBOB FUT MAY18
640.23
480.17
320.11
160.06
0.00
-160.06
-320.11
-480.17
-640.23
0.00
0.51
1.01
1.52
2.02
2.53
3.03
3.54
4.04
손익(백만)
가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLK8	WTI CRUDE FUTURE MAY18	62
CON8	BRENT CRUDE FUTR JUL18	88
HOK8	NY Harb ULSD Fut MAY18	44
KR4175N40(	2018-04 달러선물	47
NGK8	NATURAL GAS FUTR MAY18	83
XBK8	GASOLINE RBOB FUT MAY18	51

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

551

공시일	2018-03-23
기준일	2018-03-22

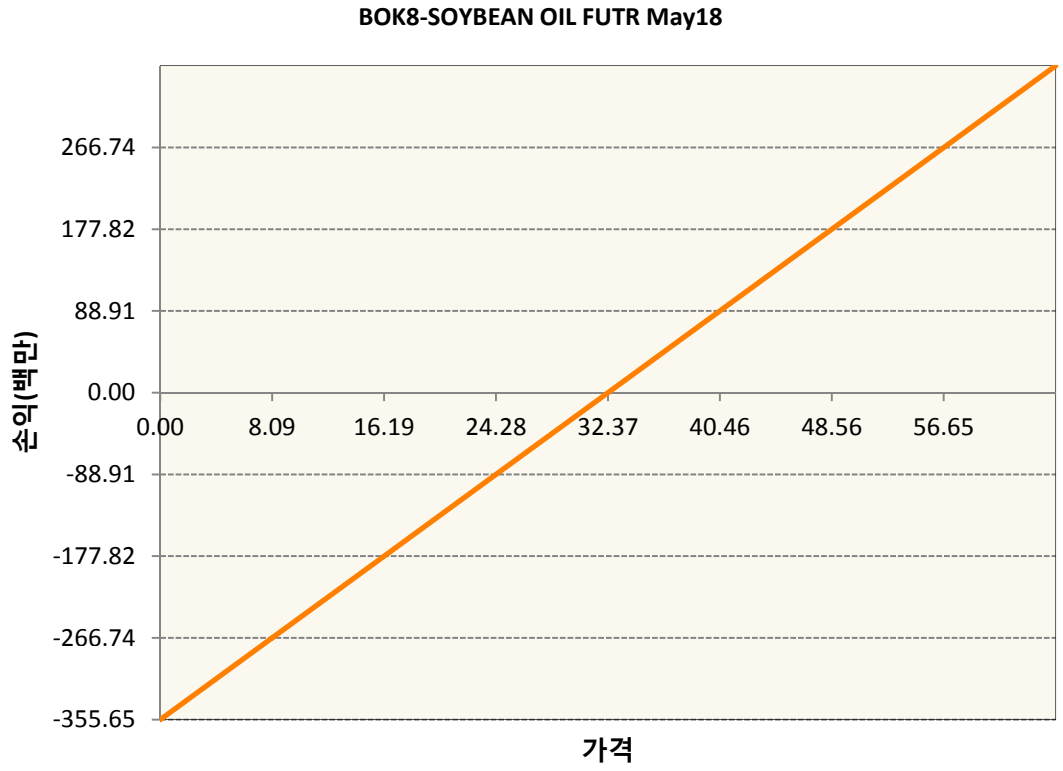
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

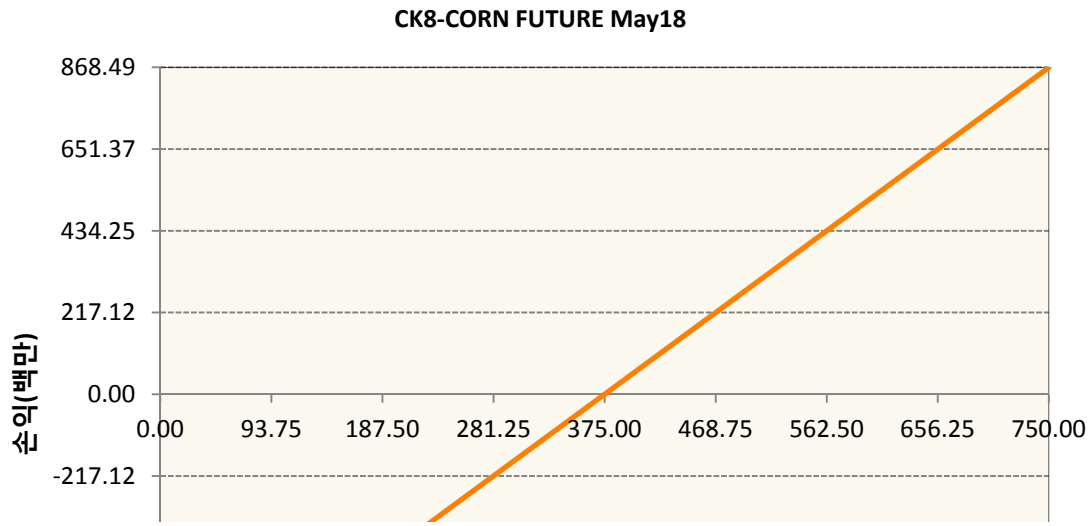
1. 계약금액

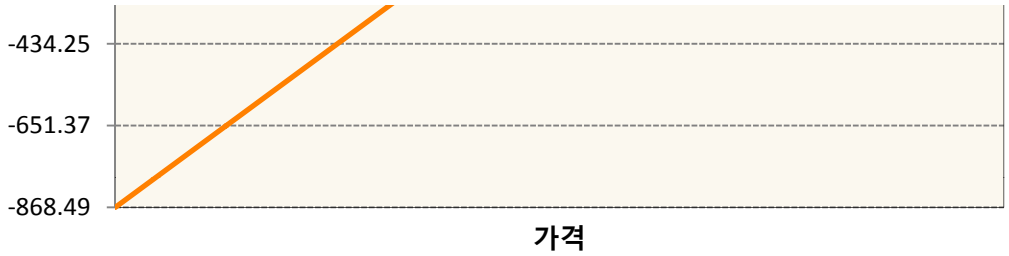
(단위:백만원)

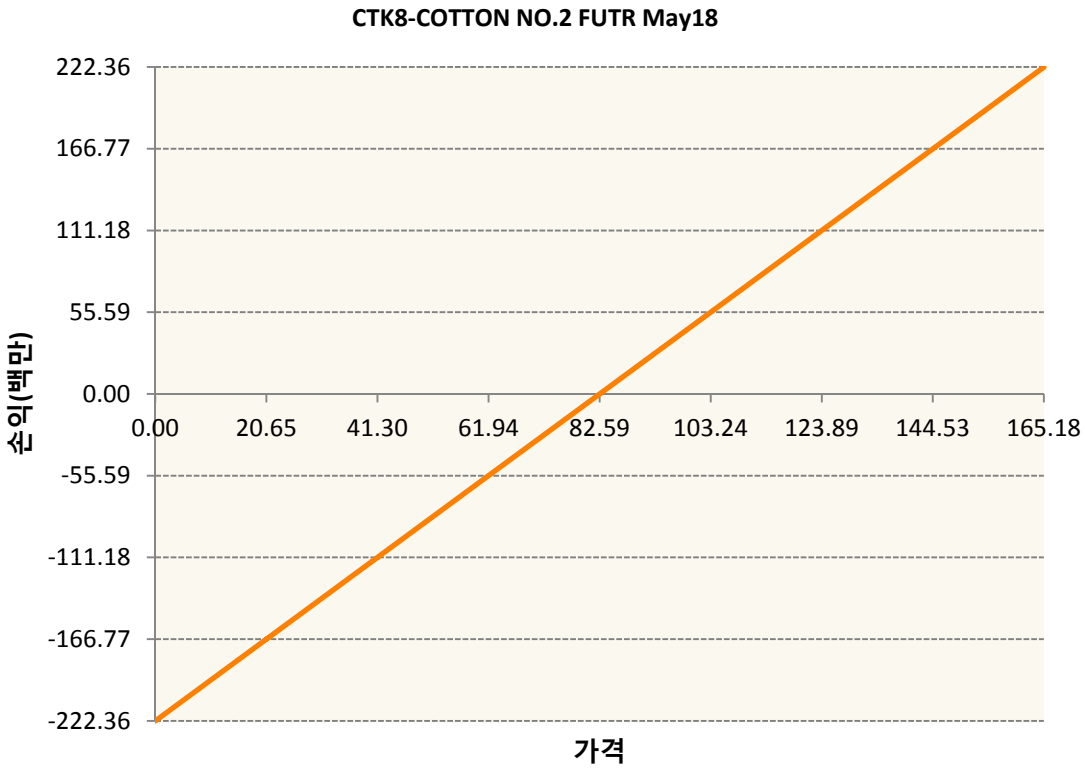
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	4,068	321	3,747	

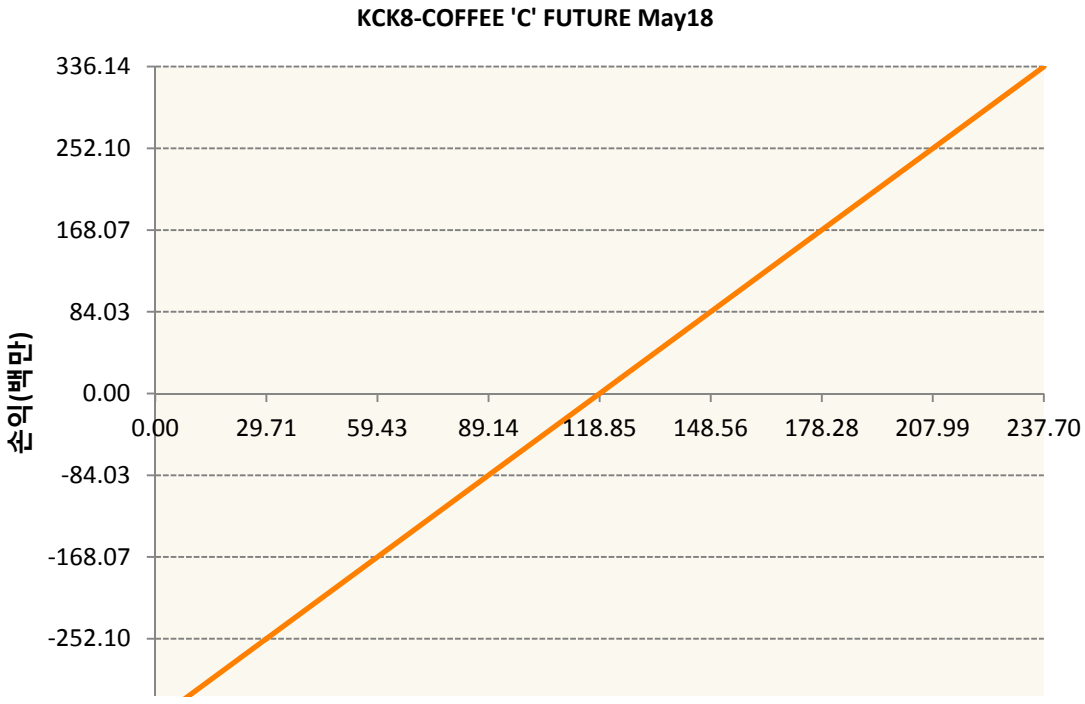
2. 만기시점의 손익구조

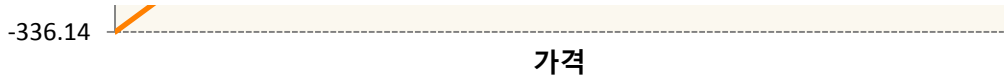


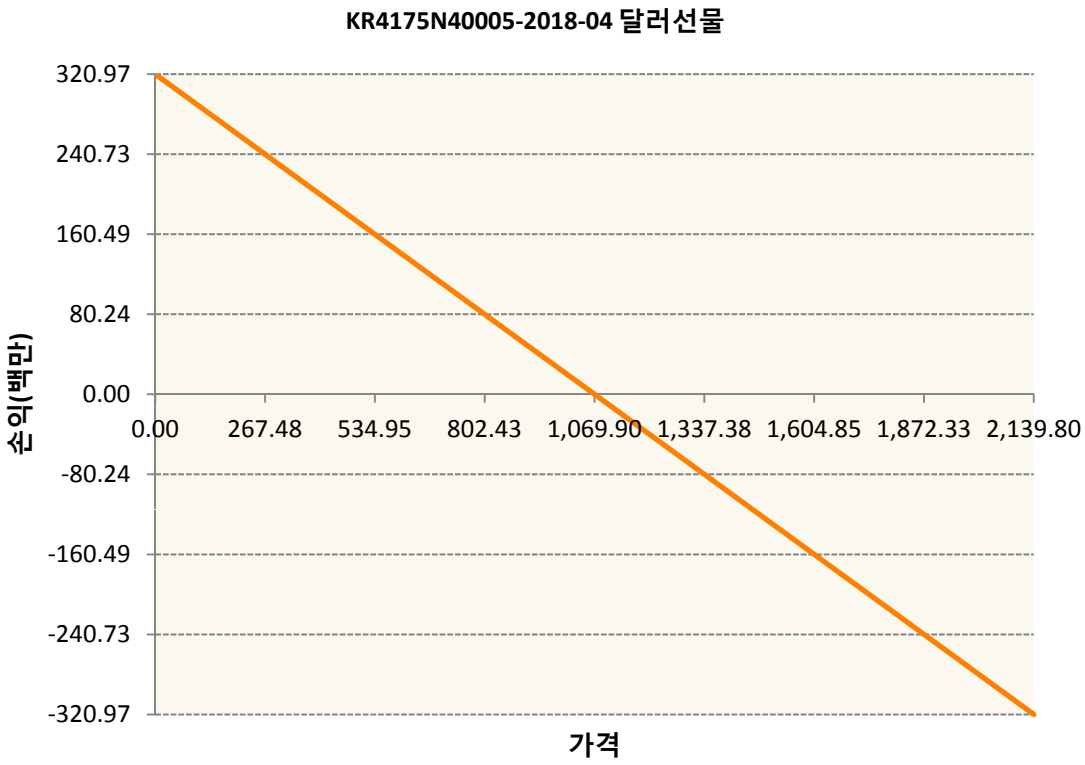


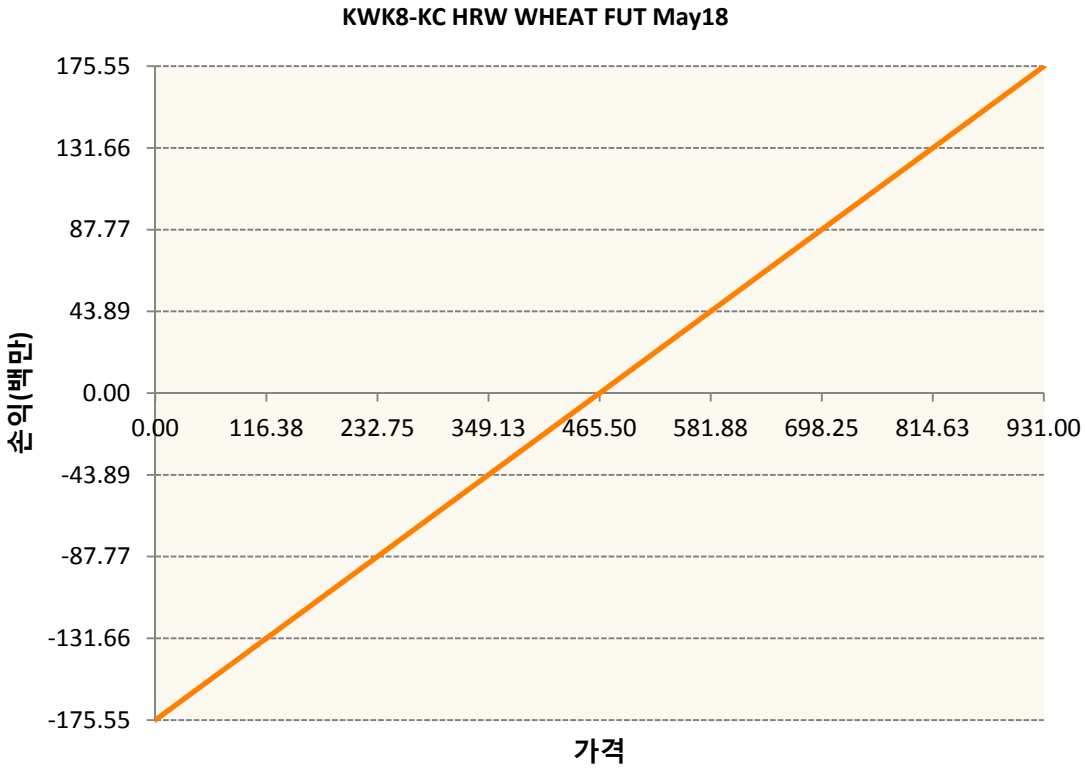

-434.25
-651.37
-868.49
가격

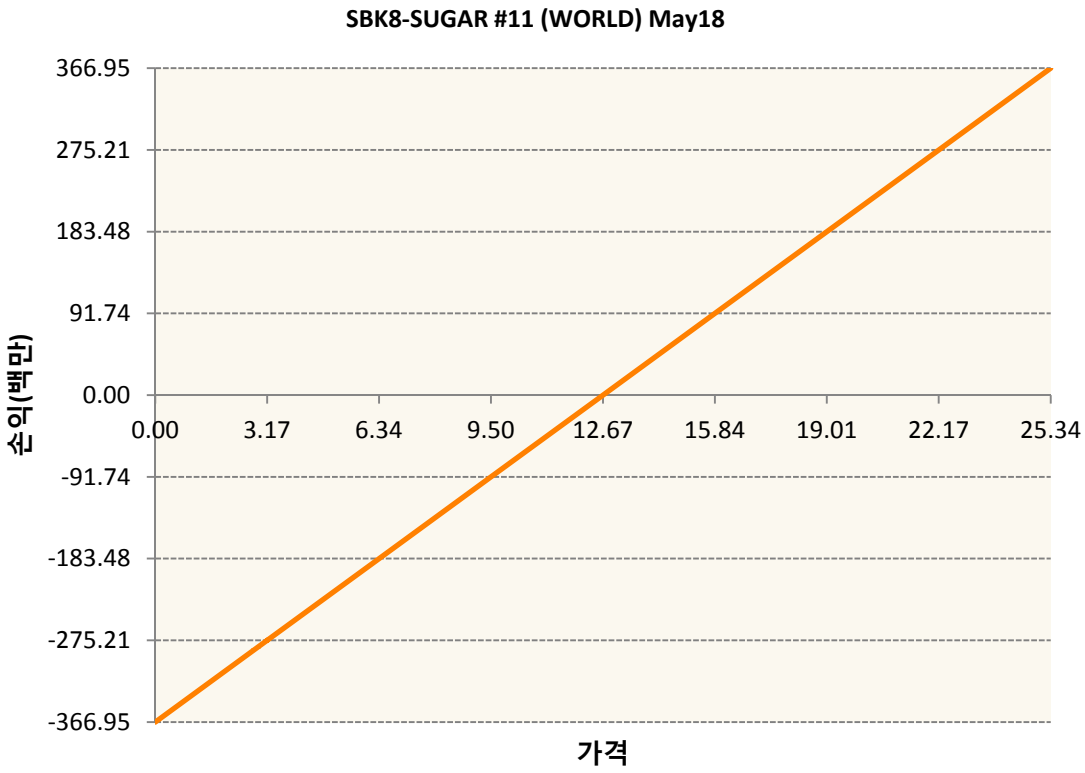

CTK8-COTTON NO.2 FUTR May18
222.36
166.77
111.18
55.59
0.00
-55.59
-111.18
-166.77
-222.36
0.00
20.65
41.30
61.94
82.59
103.24
123.89
144.53
165.18
손익(백만)
가격

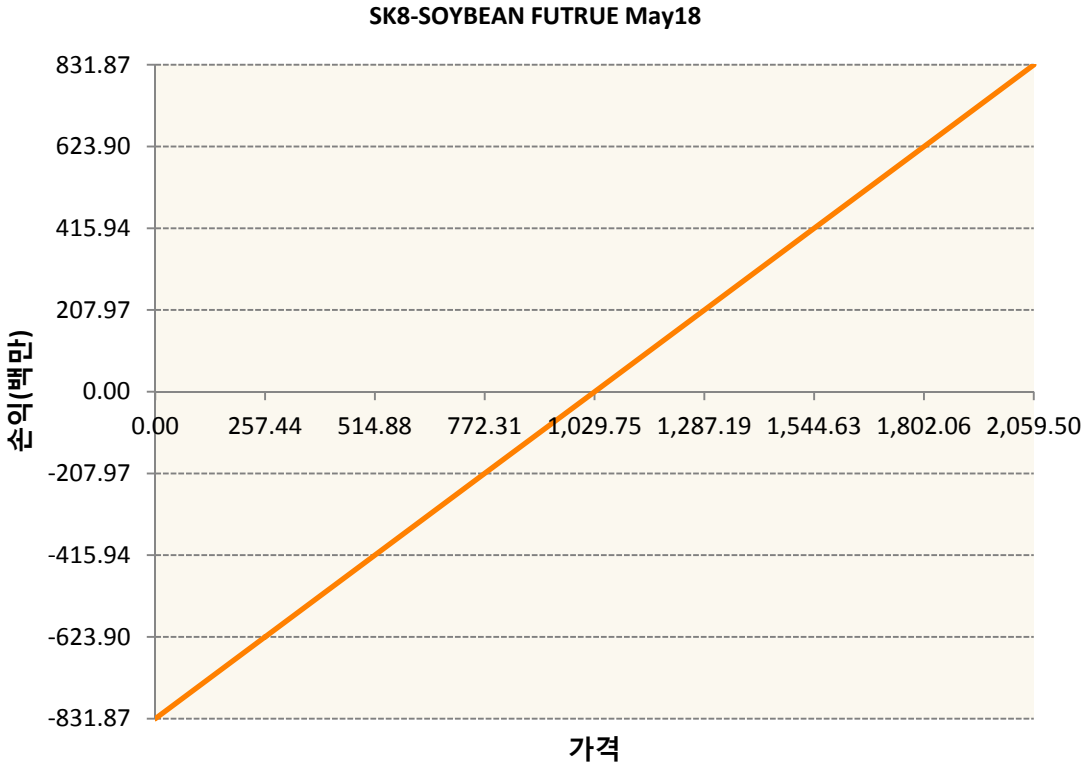

KCK8-COFFEE 'C' FUTURE May18
336.14
252.10
168.07
84.03
0.00
-84.03
-168.07
-252.10
0.00
29.71
59.43
89.14
118.85
148.56
178.28
207.99
237.70
손익(백만)


-336.14
가격

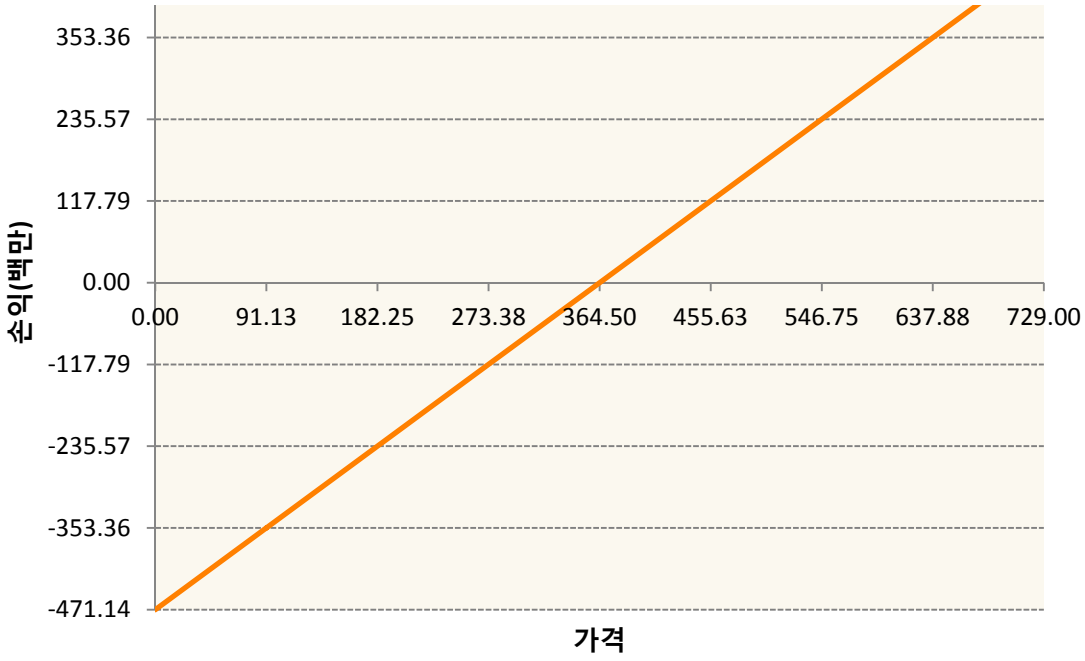

KR4175N40005-2018-04 달러선물
320.97
240.73
160.49
80.24
0.00
-80.24
-160.49
-240.73
-320.97
0.00
267.48
534.95
802.43
1,069.90
1,337.38
1,604.85
1,872.33
2,139.80
손익(백만)
가격


KWK8-KC HRW WHEAT FUT May18
175.55
131.66
87.77
43.89
0.00
-43.89
-87.77
-131.66
-175.55
0.00
116.38
232.75
349.13
465.50
581.88
698.25
814.63
931.00
손익(백만)
가격

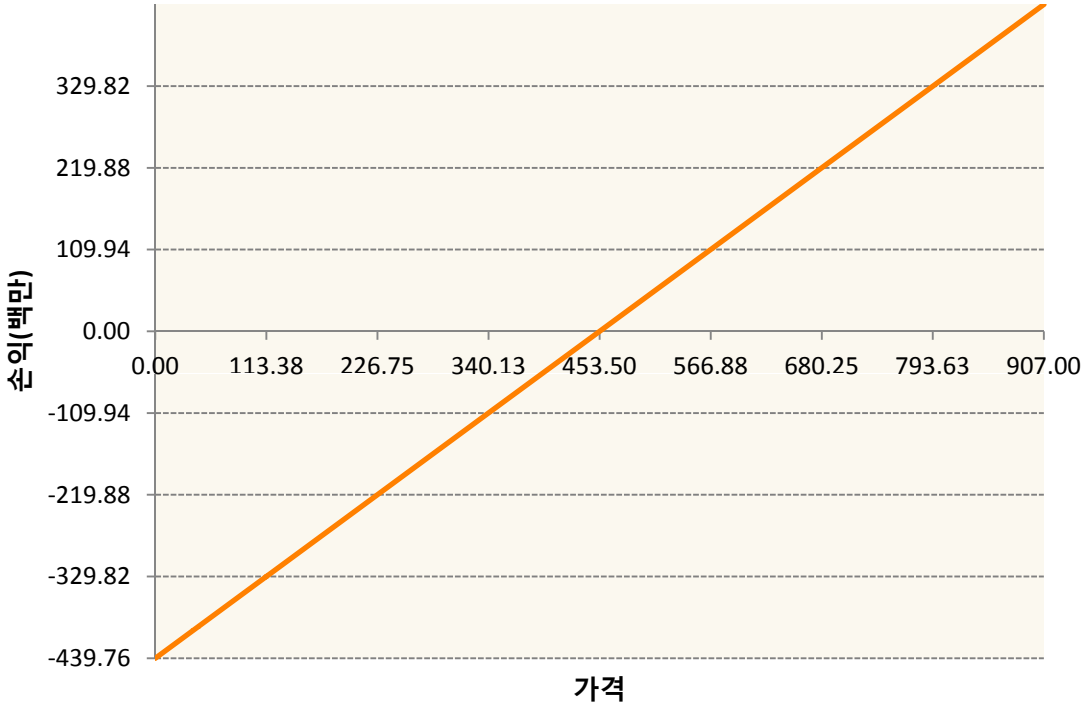

SBK8-SUGAR #11 (WORLD) May18
366.95
275.21
183.48
91.74
0.00
-91.74
-183.48
-275.21
-366.95
0.00
3.17
6.34
9.50
12.67
15.84
19.01
22.17
25.34
손익(백만)
가격


SK8-SOYBEAN FUTRUE May18
831.87
623.90
415.94
207.97
0.00
-207.97
-415.94
-623.90
-831.87
0.00
257.44
514.88
772.31
1,029.75
1,287.19
1,544.63
1,802.06
2,059.50
손익(백만)
가격


SMK8-SOYBEAN MEAL FUTR May18



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	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	67
SMK8	SOYBEAN MEAL FUTR May18	38
WK8	WHEAT FUTURE(CBT) May18	35

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

335