공시일	2018-03-26
기준일	2018-03-23

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	2018-03-26
기준일	2018-03-23

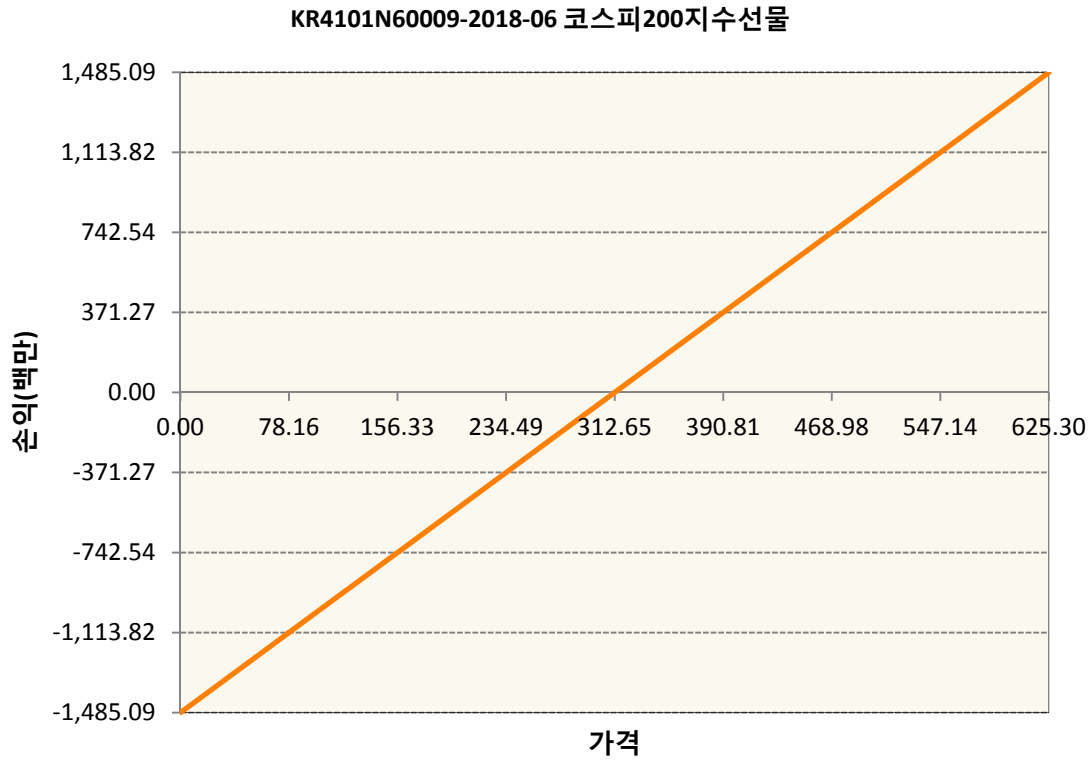
스마트인덱스모

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	1,485	0	1,485	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101N60(2018-06 코스피200지수선물							119
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-119	-119	-119	-119	-119	-119	-119
-5.33%	-79	-79	-79	-79	-79	-79	-79
-2.67%	-40	-40	-40	-40	-40	-40	-40
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	40	40	40	40	40	40	40
5.33%	79	79	79	79	79	79	79
8.00%	119	119	119	119	119	119	119

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

85

공시일	2018-03-26
기준일	2018-03-23

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	1,088

* 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	2018-03-26
기준일	2018-03-23

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	387

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

388

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2018-03-26
기준일	2018-03-23

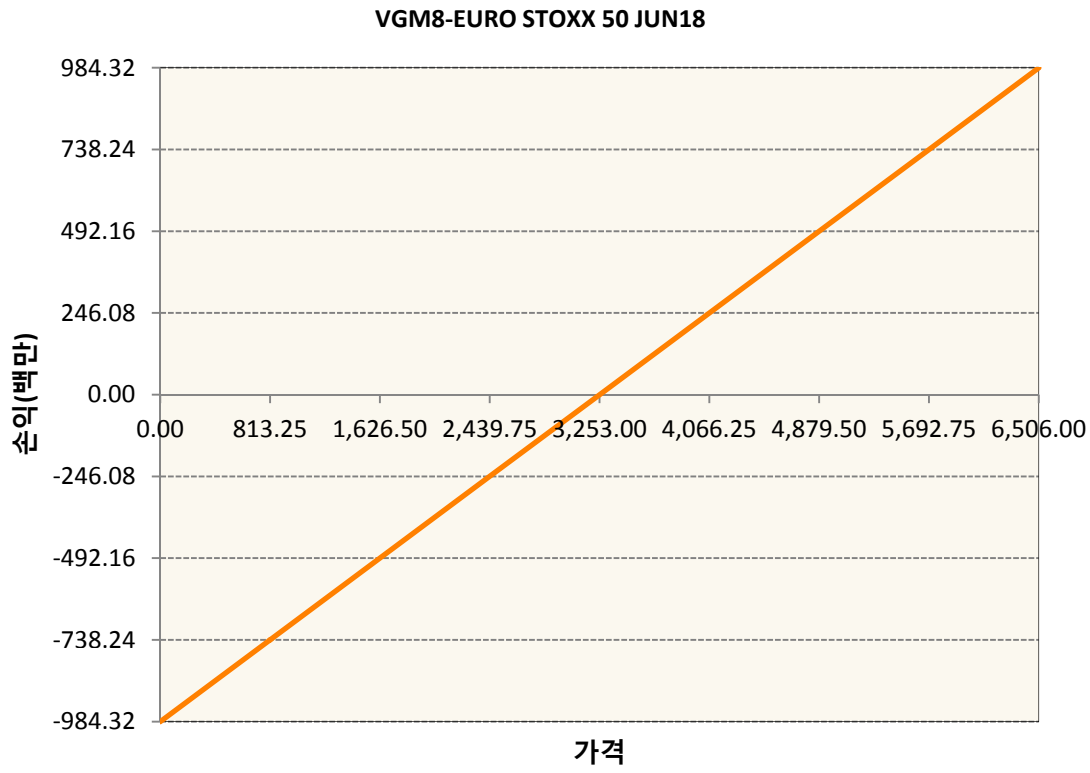
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	984	0	984	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGM8	EURO STOXX 50 JUN18	79

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

(단위:백만원)

47

공시일	2018-03-26
기준일	2018-03-23

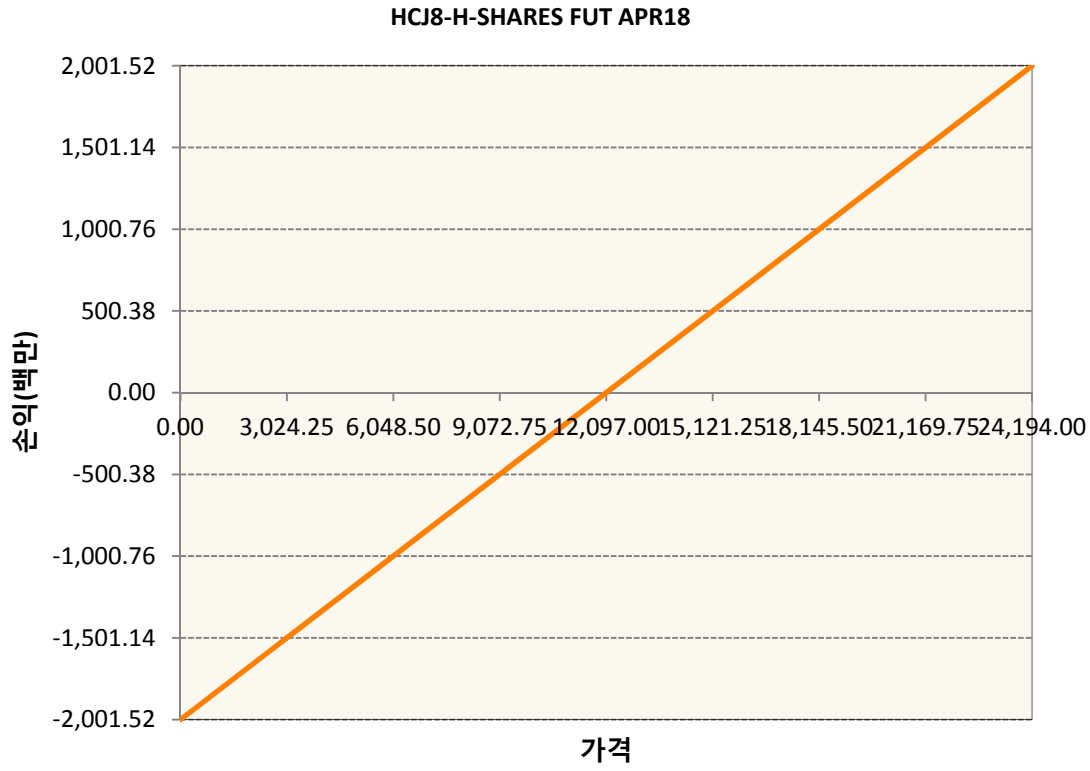
차이나인덱스모(주식-파생형)

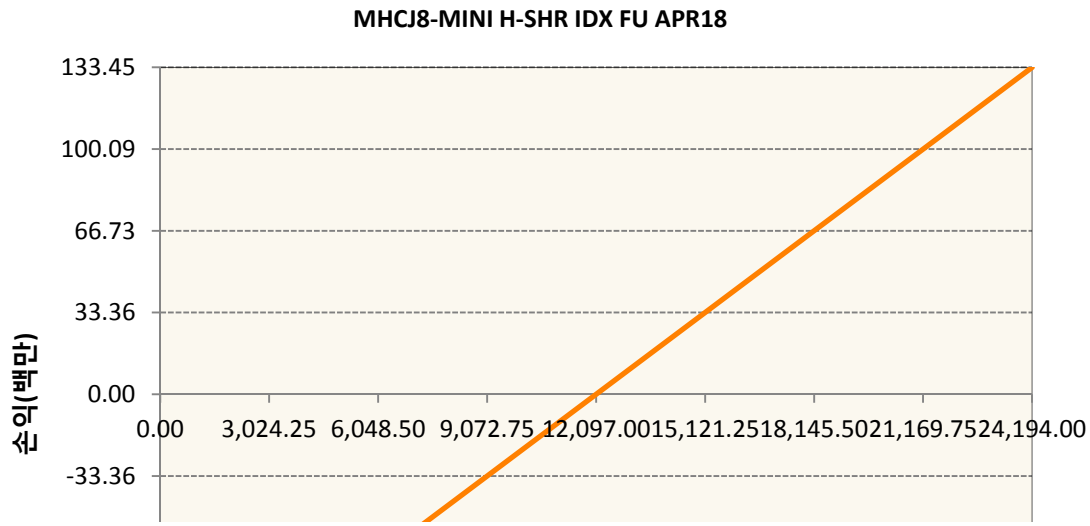
1. 계약금액

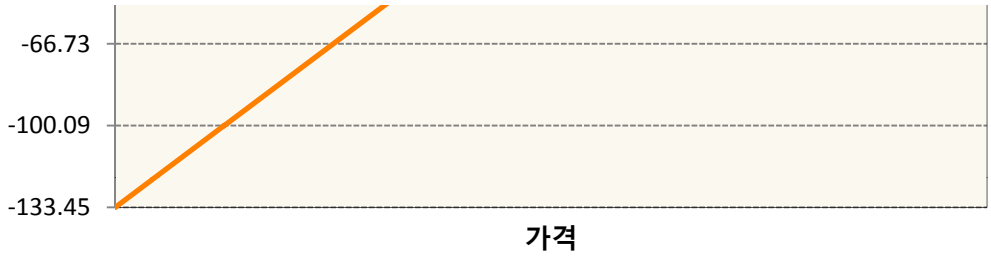
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,135	0	2,135	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCJ8	H-SHARES FUT APR18	160
MHCJ8	MINI H-SHR IDX FU APR18	11

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	148

공시일	2018-03-26
기준일	2018-03-23

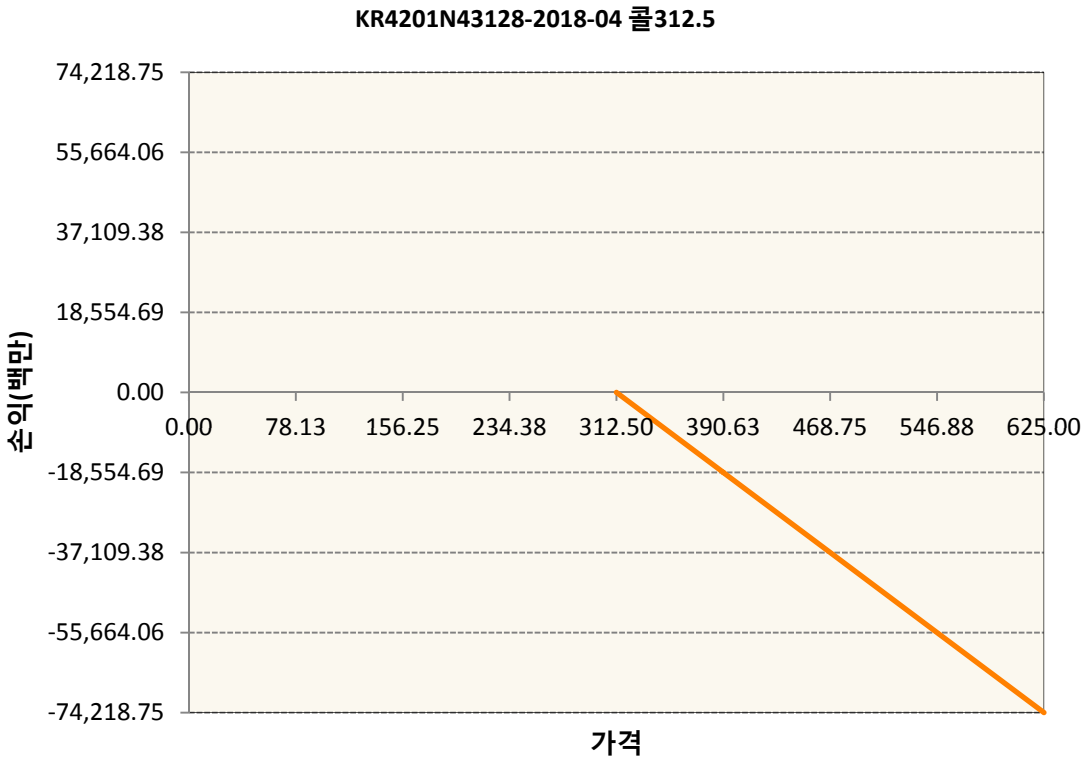
커버드콜모(주식혼합-파생형)

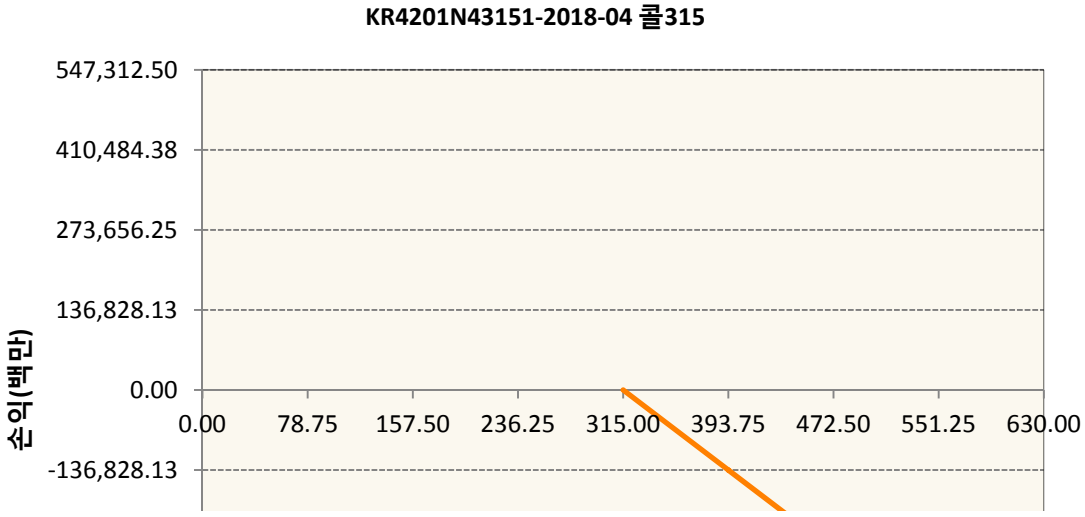
1. 계약금액

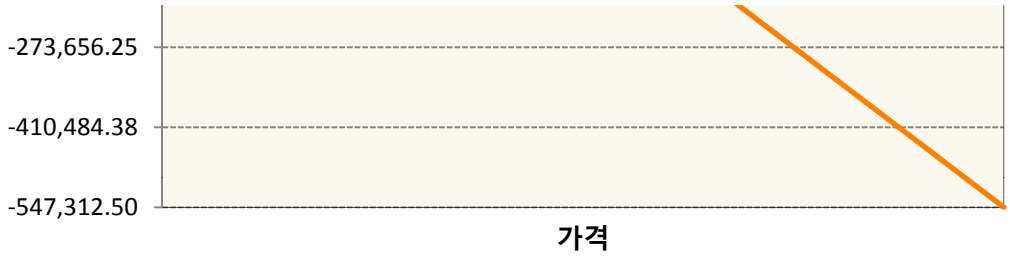
(단위:백만원)

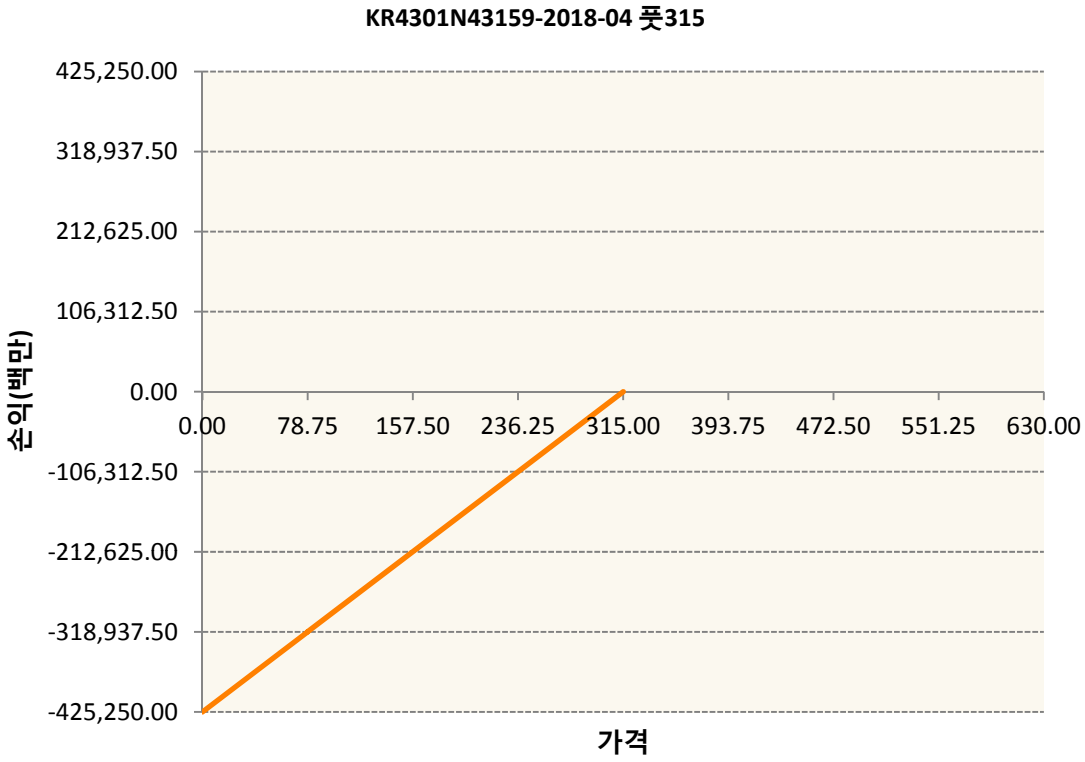
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	1,046,781	-1,046,781	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201N4312018-04 콜312.5							4,570
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,906	1,860	1,802	1,734	1,657	1,571	1,478
-5.33%	1,725	1,631	1,527	1,416	1,298	1,175	1,047
-2.67%	1,295	1,152	1,005	856	705	552	398
0%	496	331	165	0	-165	-331	-496
2.67%	-711	-860	-1,011	-1,165	-1,322	-1,479	-1,638
5.33%	-2,265	-2,370	-2,485	-2,608	-2,736	-2,870	-3,009
8.00%	-4,047	-4,107	-4,180	-4,264	-4,358	-4,461	-4,570
KR4201N4312018-04 콜315							31,987
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	12,108	11,843	11,498	11,075	10,581	10,023	9,408

-5.33%	11,119	10,534	9,870	9,138	8,351	7,517	6,644
-2.67%	8,595	7,633	6,633	5,601	4,546	3,472	2,382
0%	3,607	2,407	1,204	0	-1,206	-2,413	-3,620
2.67%	-4,341	-5,501	-6,674	-7,856	-9,045	-10,240	-11,439
5.33%	-15,005	-15,891	-16,834	-17,821	-18,845	-19,897	-20,973
8.00%	-27,608	-28,153	-28,787	-29,499	-30,275	-31,107	-31,987
KR4301N4312018-04 풋315							28,024
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-27,451	-27,481	-27,532	-27,610	-27,718	-27,856	-28,024
-5.33%	-16,402	-16,552	-16,747	-16,984	-17,260	-17,572	-17,914
-2.67%	-6,166	-6,578	-7,025	-7,500	-7,999	-8,517	-9,050
0%	1,930	1,289	646	0	-647	-1,296	-1,946
2.67%	6,840	6,251	5,648	5,036	4,415	3,789	3,157
5.33%	8,955	8,621	8,242	7,825	7,377	6,901	6,403
8.00%	9,578	9,458	9,292	9,083	8,833	8,544	8,220

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

64,578

공시일	2018-03-26
기준일	2018-03-23

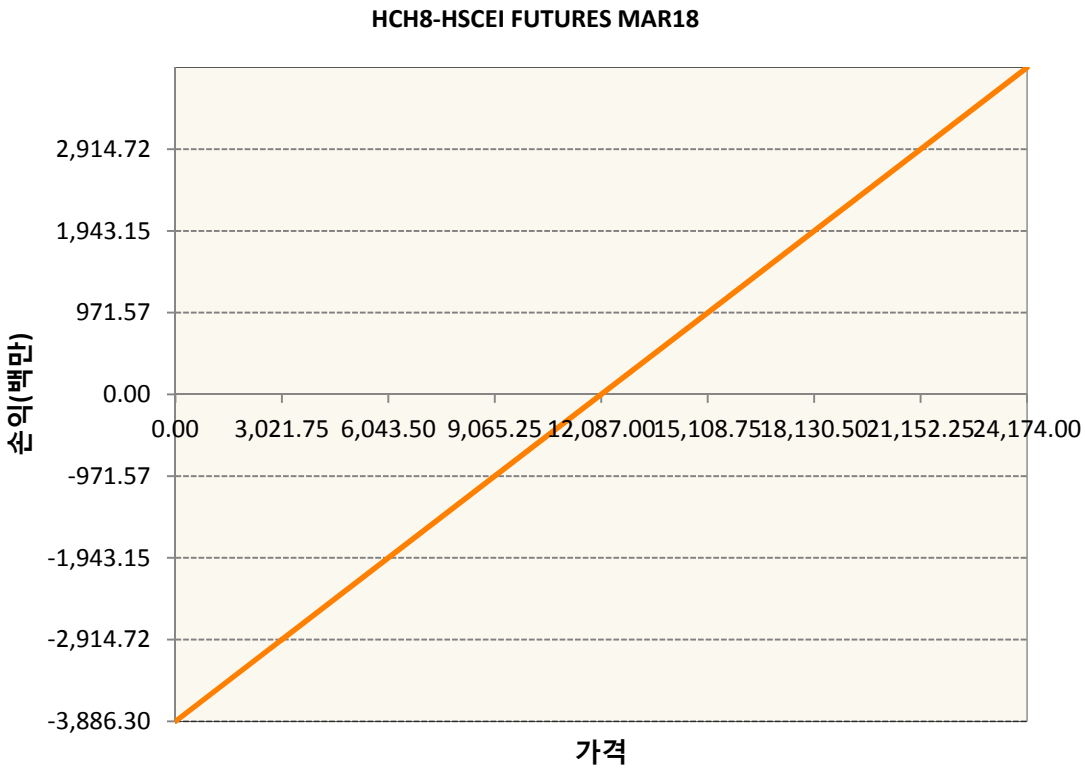
홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생

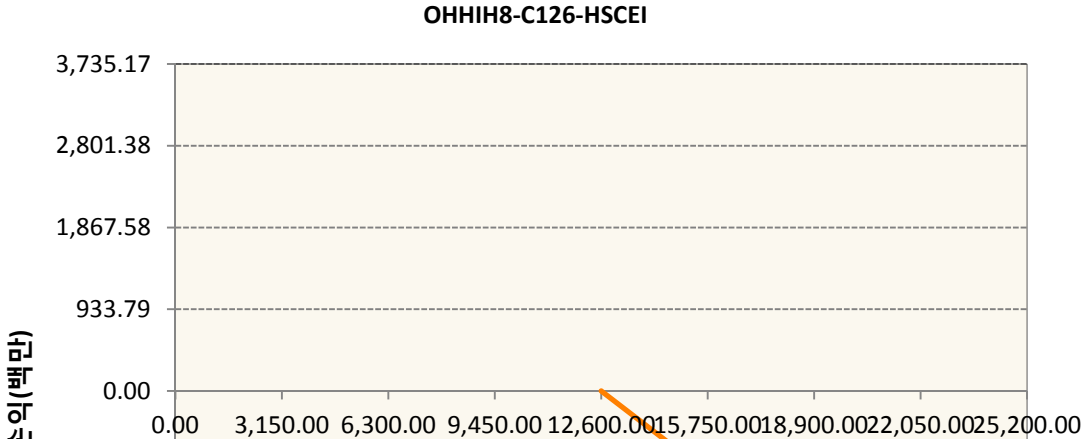
1. 계약금액

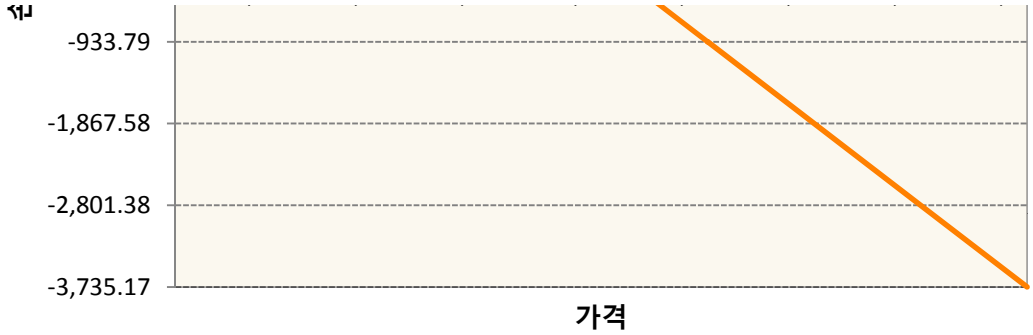
(단위:백만원)

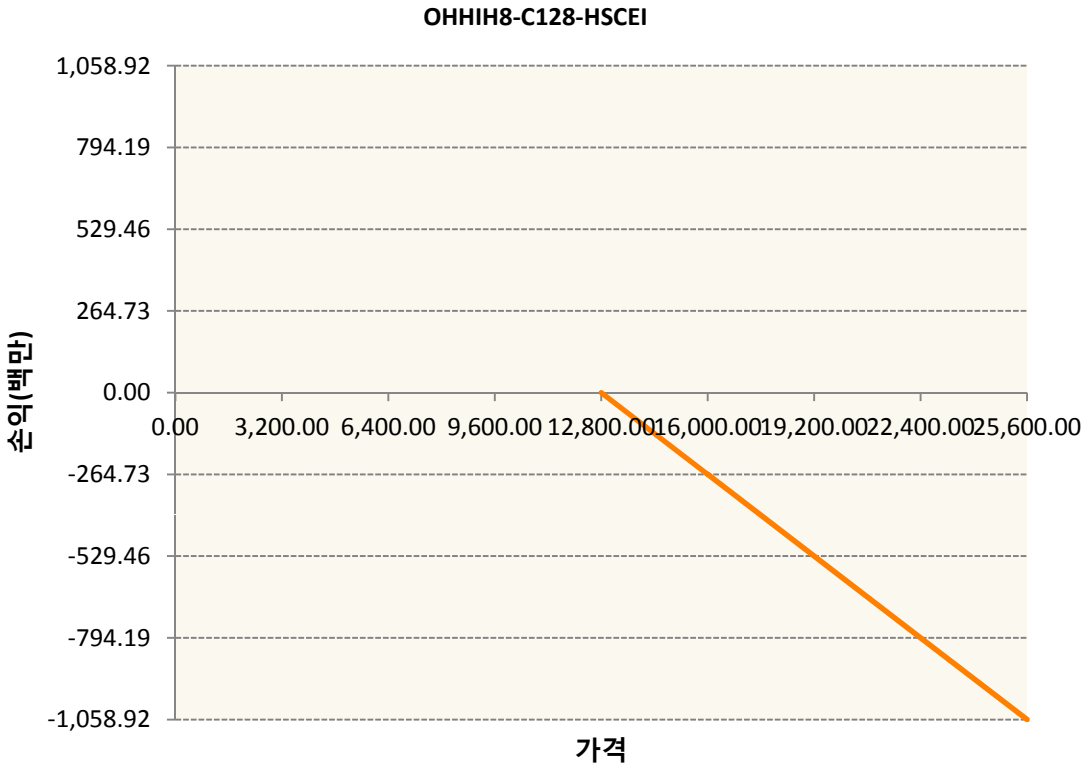
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	3,886	0	3,886	장내
누계	유가증권	옵션	0	9,588	-9,588	장내

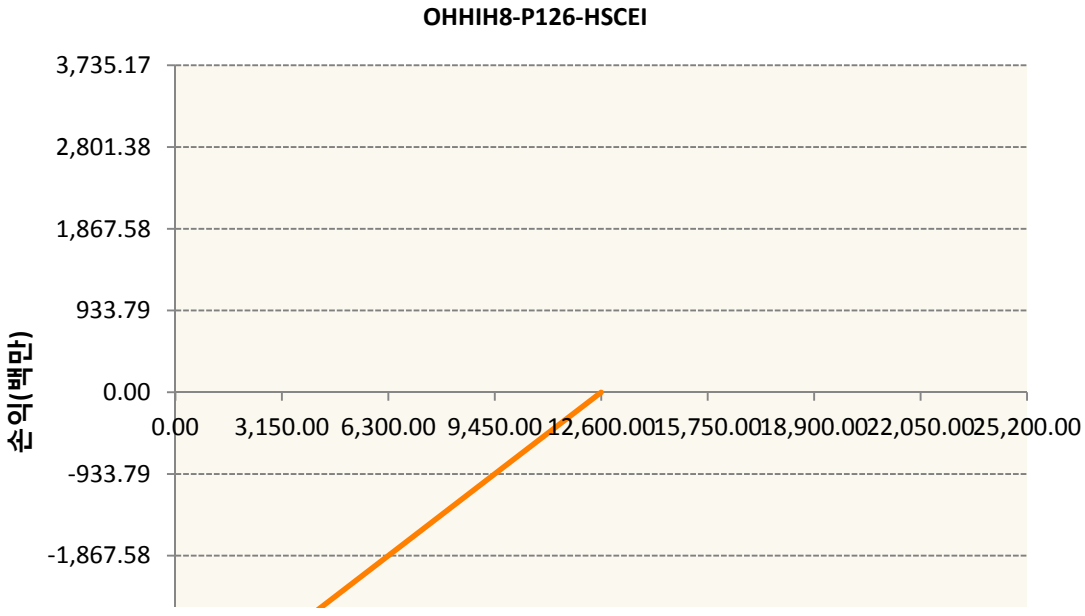
2. 만기시점의 손익구조

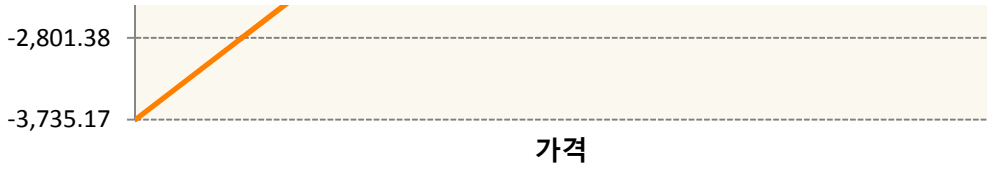


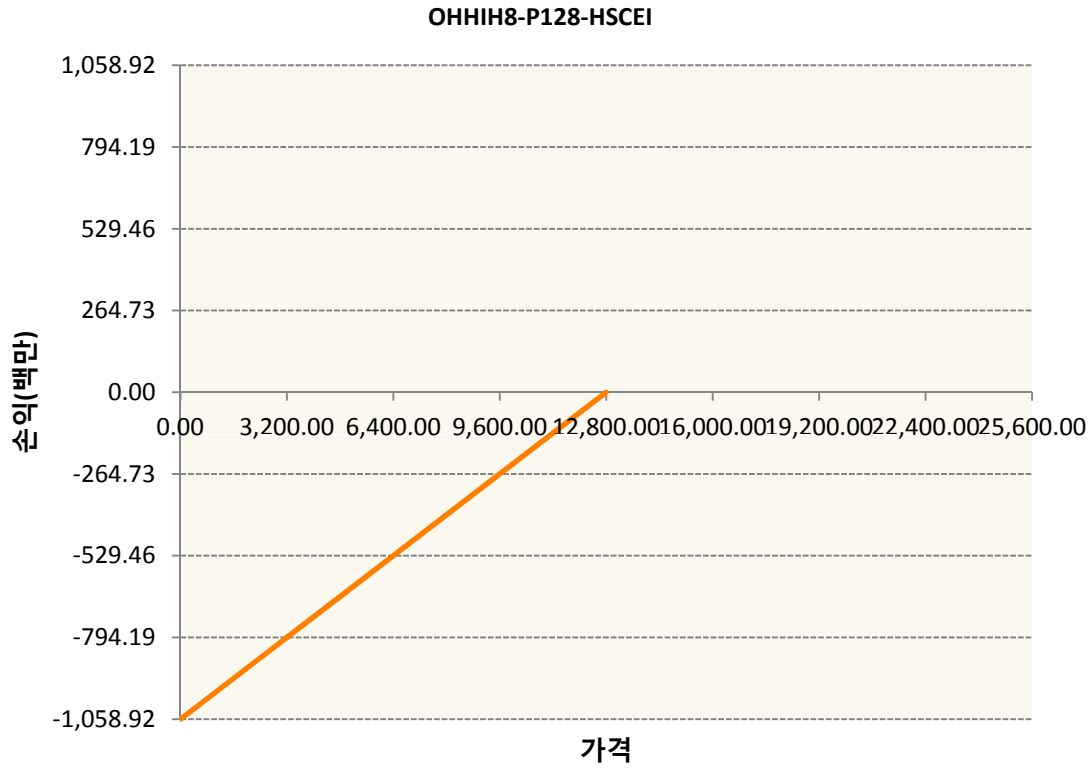



-933.79
-1,867.58
-2,801.38
-3,735.17
가격


OHHIH8-C128-HSCEI
1,058.92
794.19
529.46
264.73
0.00
-264.73
-529.46
-794.19
-1,058.92
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
3,735.17
2,801.38
1,867.58
933.79
0.00
-933.79
-1,867.58
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	311
OHHIH8-C12	HSCEI	299
OHHIH8-C12	HSCEI	85
OHHIH8-P12	HSCEI	299
OHHIH8-P12	HSCEI	85

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	937

공시일	2018-03-26
기준일	2018-03-23

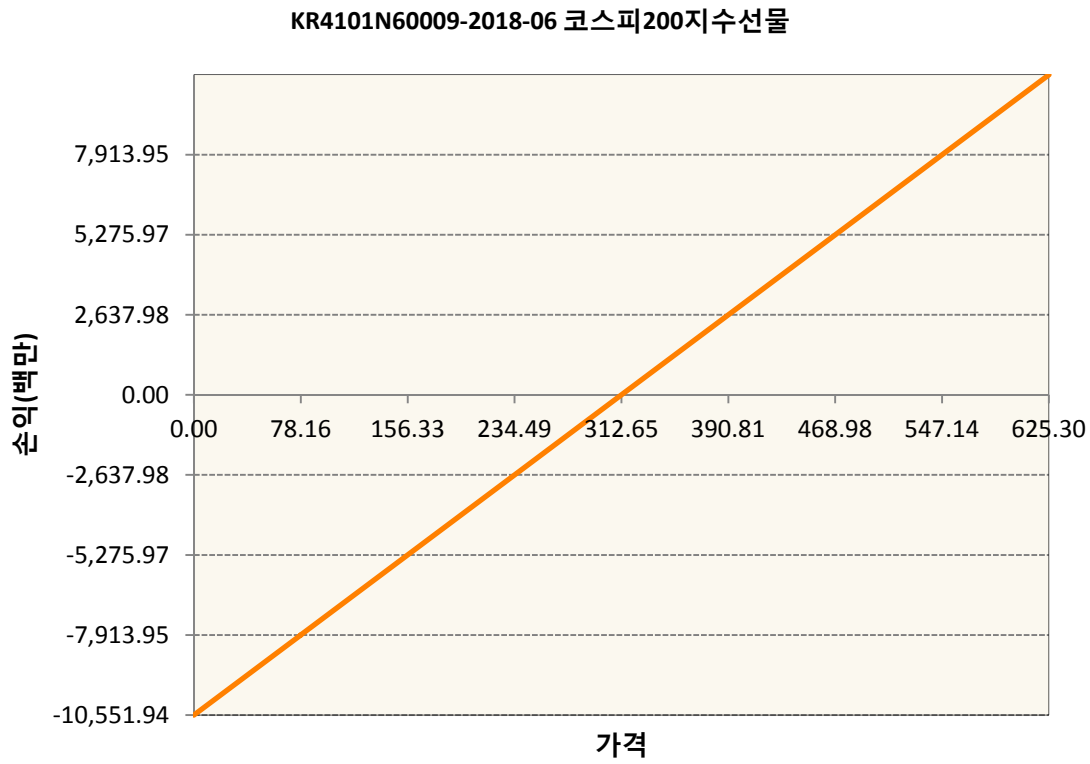
코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼

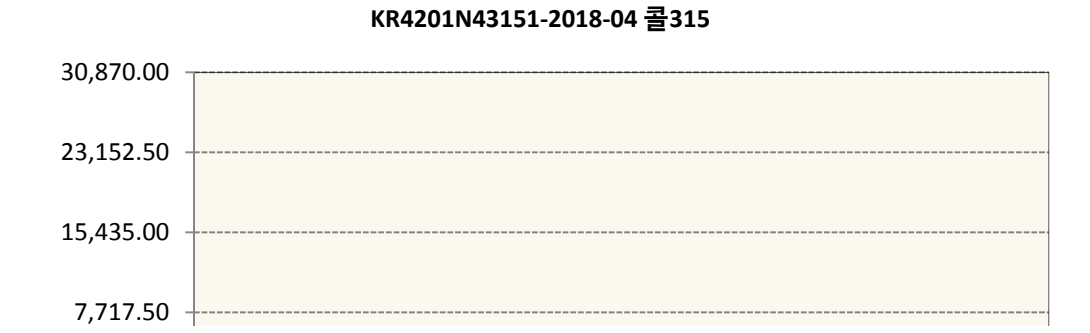
1. 계약금액

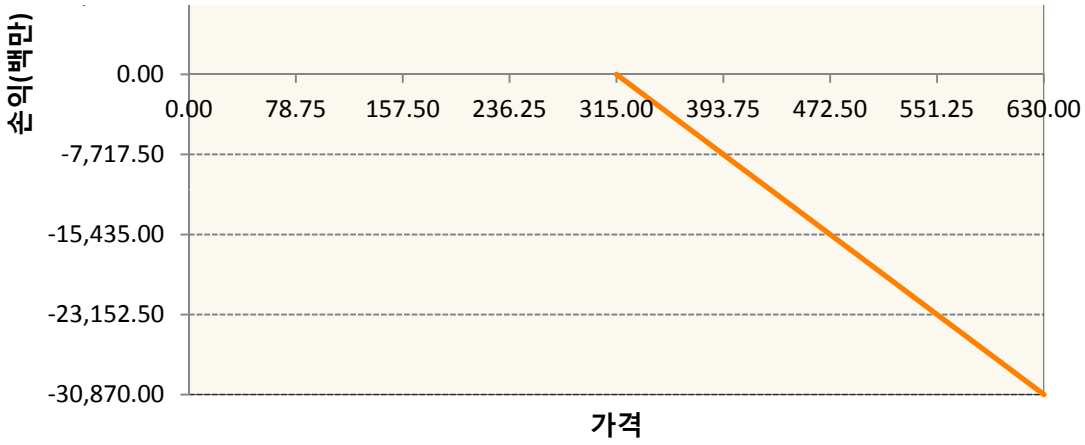
(단위:백만원)

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	10,552	0	10,552	장내
누계	유가증권	스왑	54,200	0	54,200	장외
누계	유가증권	옵션	0	55,718	-55,718	장내

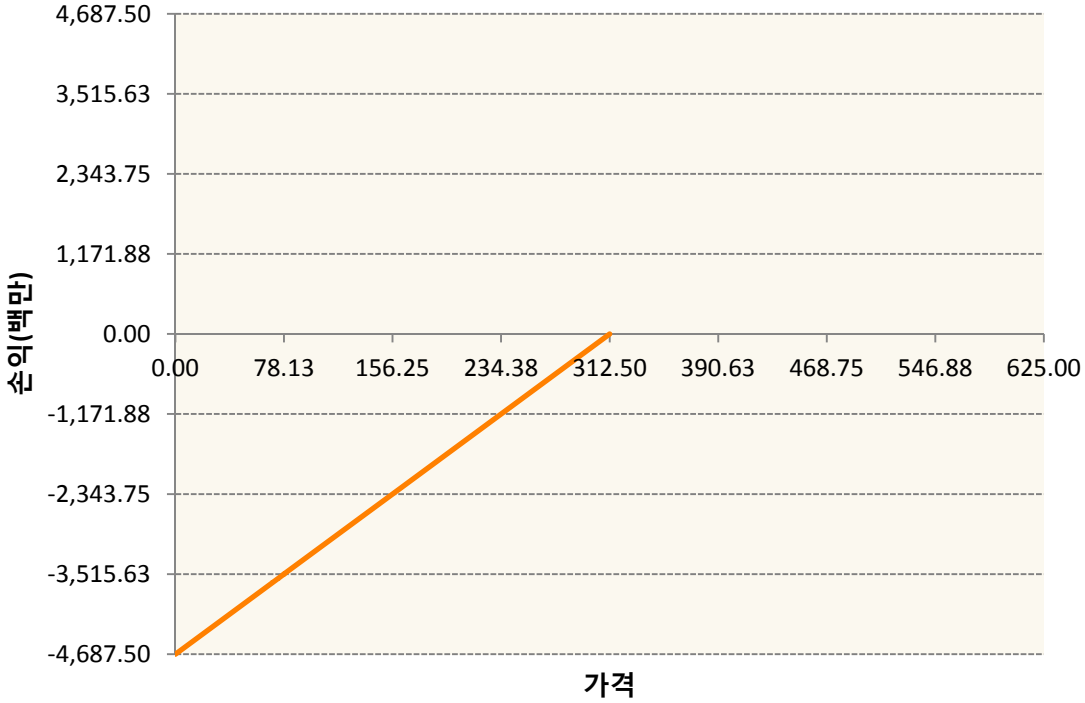
2. 만기시점의 손익구조



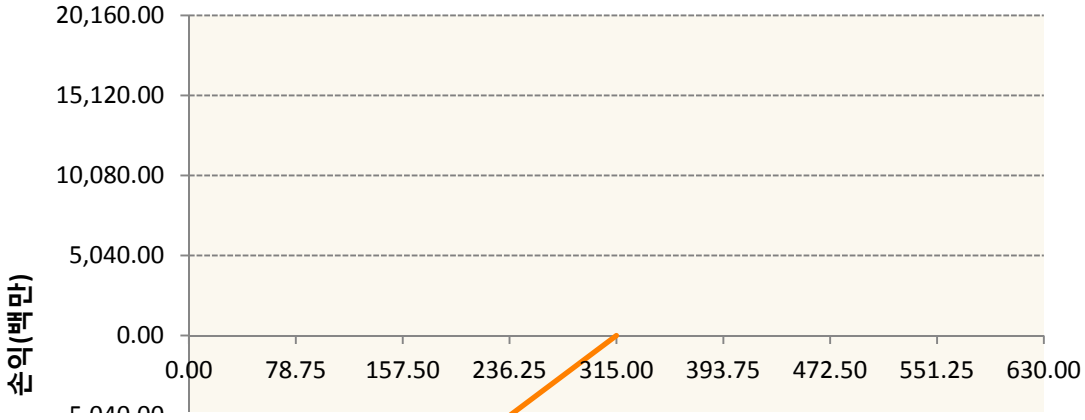




KR4301N43126-2018-04 풋312.5



KR4301N43159-2018-04 풋315





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_2							1,458
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,458	-1,458	-1,458	-1,458	-1,458	-1,458	-1,458
-5.33%	-972	-972	-972	-972	-972	-972	-972
-2.67%	-486	-486	-486	-486	-486	-486	-486
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	486	486	486	486	486	486	486
5.33%	972	972	972	972	972	972	972
8.00%	1,458	1,458	1,458	1,458	1,458	1,458	1,458
2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_3							276
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-276	-276	-276	-276	-276	-276	-276
-5.33%	-184	-184	-184	-184	-184	-184	-184
-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%	184	184	184	184	184	184	184
8.00%	276	276	276	276	276	276	276
2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_5							236
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-236	-236	-236	-236	-236	-236	-236
-5.33%	-158	-158	-158	-158	-158	-158	-158
-2.67%	-79	-79	-79	-79	-79	-79	-79
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	79	79	79	79	79	79	79
5.33%	158	158	158	158	158	158	158
8.00%	236	236	236	236	236	236	236
2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_6							197
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%

-8.00%	-197	-197	-197	-197	-197	-197	-197
-5.33%	-131	-131	-131	-131	-131	-131	-131
-2.67%	-66	-66	-66	-66	-66	-66	-66
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	66	66	66	66	66	66	66
5.33%	131	131	131	131	131	131	131
8.00%	197	197	197	197	197	197	197
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_7						252
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-252	-252	-252	-252	-252	-252	-252
-5.33%	-168	-168	-168	-168	-168	-168	-168
-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%	168	168	168	168	168	168	168
8.00%	252	252	252	252	252	252	252
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_8						466
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-466	-466	-466	-466	-466	-466	-466
-5.33%	-311	-311	-311	-311	-311	-311	-311
-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%	311	311	311	311	311	311	311
8.00%	466	466	466	466	466	466	466
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_10						276
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-276	-276	-276	-276	-276	-276	-276
-5.33%	-184	-184	-184	-184	-184	-184	-184
-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%	184	184	184	184	184	184	184
8.00%	276	276	276	276	276	276	276
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_11						631
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-631	-631	-631	-631	-631	-631	-631
-5.33%	-420	-420	-420	-420	-420	-420	-420
-2.67%	-210	-210	-210	-210	-210	-210	-210
0%	0	0	0	0	0	0	0

2.67%	210	210	210	210	210	210	210
5.33%	420	420	420	420	420	420	420
8.00%	631	631	631	631	631	631	631
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_12						473
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-473	-473	-473	-473	-473	-473	-473
-5.33%	-315	-315	-315	-315	-315	-315	-315
-2.67%	-158	-158	-158	-158	-158	-158	-158
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	158	158	158	158	158	158	158
5.33%	315	315	315	315	315	315	315
8.00%	473	473	473	473	473	473	473
	KR4101N60(2018-06 코스피200지수선물						844
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-844	-844	-844	-844	-844	-844	-844
-5.33%	-562	-562	-562	-562	-562	-562	-562
-2.67%	-281	-281	-281	-281	-281	-281	-281
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	281	281	281	281	281	281	281
5.33%	562	562	562	562	562	562	562
8.00%	844	844	844	844	844	844	844
	KR4201N431 2018-04 콜315						1,804
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	683	668	649	625	597	565	531
-5.33%	627	594	557	515	471	424	375
-2.67%	485	431	374	316	256	196	134
0%	203	136	68	0	-68	-136	-204
2.67%	-245	-310	-376	-443	-510	-578	-645
5.33%	-846	-896	-949	-1,005	-1,063	-1,122	-1,183
8.00%	-1,557	-1,588	-1,624	-1,664	-1,708	-1,755	-1,804
	KR4301N431 2018-04 풋312.5						297
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-288	-289	-290	-291	-292	-294	-297
-5.33%	-167	-169	-172	-175	-179	-183	-188
-2.67%	-58	-64	-70	-75	-82	-88	-94
0%	22	15	7	0	-7	-15	-22
2.67%	66	60	54	48	41	35	28
5.33%	82	80	76	72	68	64	59
8.00%	87	86	85	83	81	78	75
	KR4301N431 2018-04 풋315						1,329

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,301	-1,303	-1,305	-1,309	-1,314	-1,321	-1,329
-5.33%	-778	-785	-794	-805	-818	-833	-849
-2.67%	-292	-312	-333	-356	-379	-404	-429
0%	92	61	31	0	-31	-61	-92
2.67%	324	296	268	239	209	180	150
5.33%	425	409	391	371	350	327	304
8.00%	454	448	441	431	419	405	390

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

8,307

공시일	2018-03-26
기준일	2018-03-23

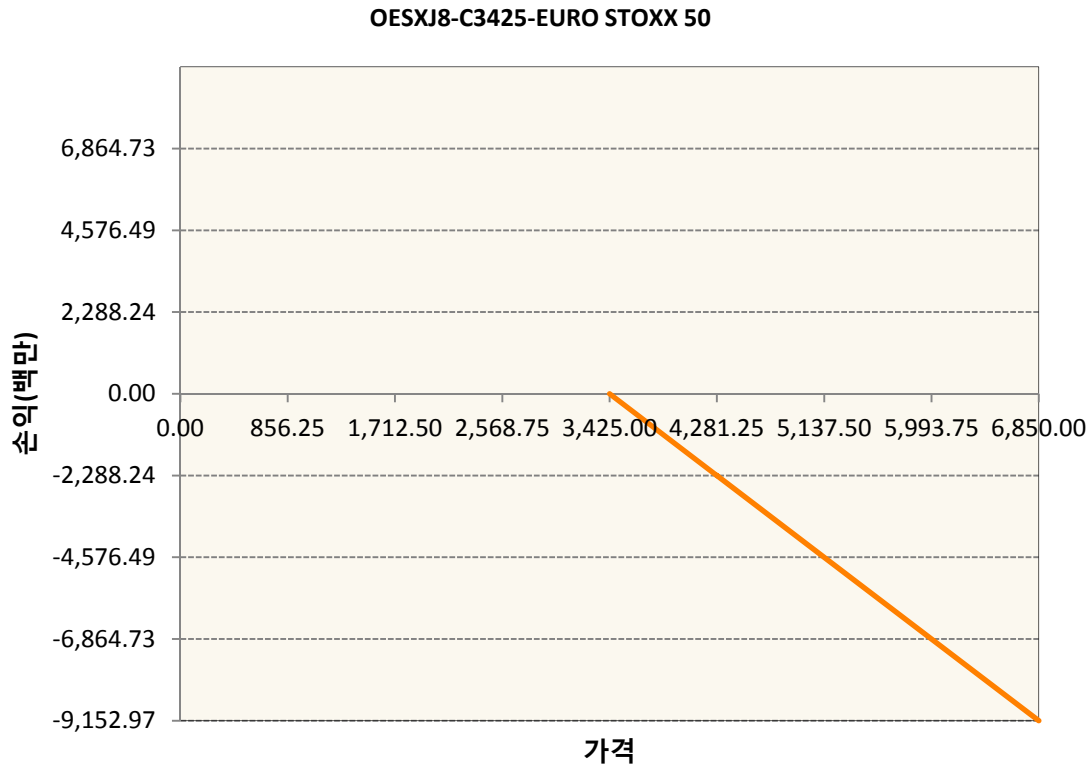
유로커버드콜모(주식혼합-파생형

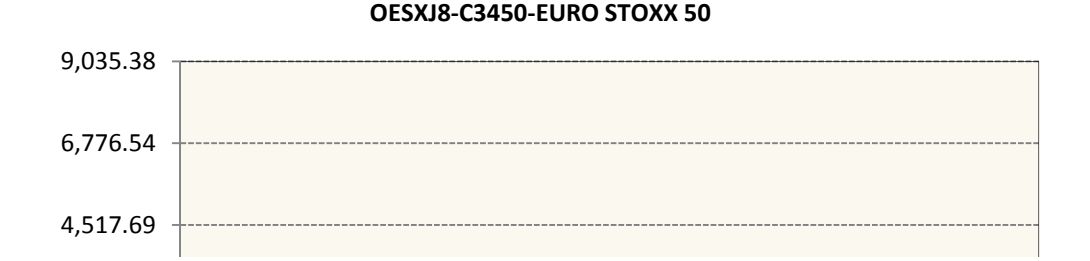
1. 계약금액

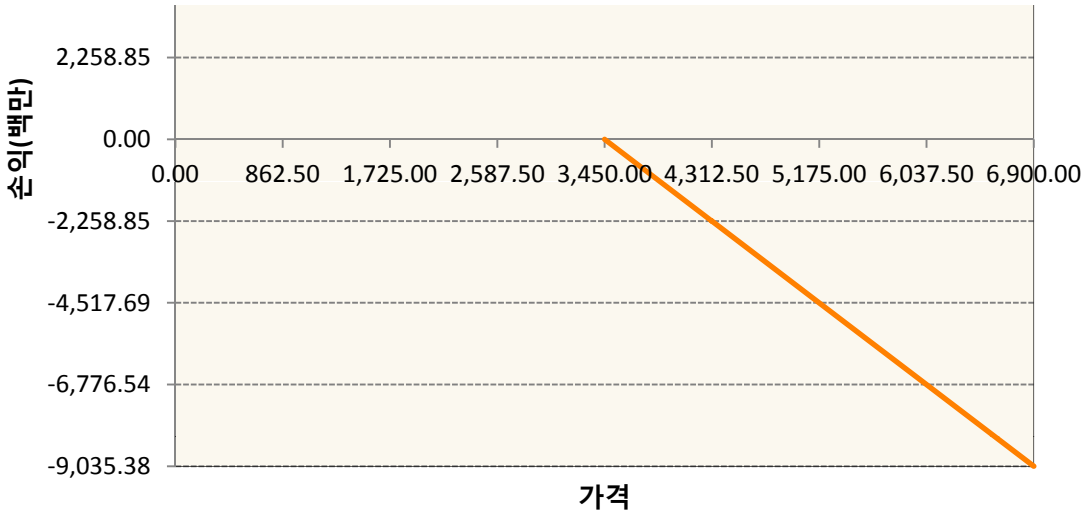
(단위:백만원)

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	9,064	0	9,064	
누계	유가증권	스왑	100,214	0	100,214	장외
누계	유가증권	옵션	0	36,377	-36,377	장내
누계	지수	스왑	53,448	0	53,448	장외

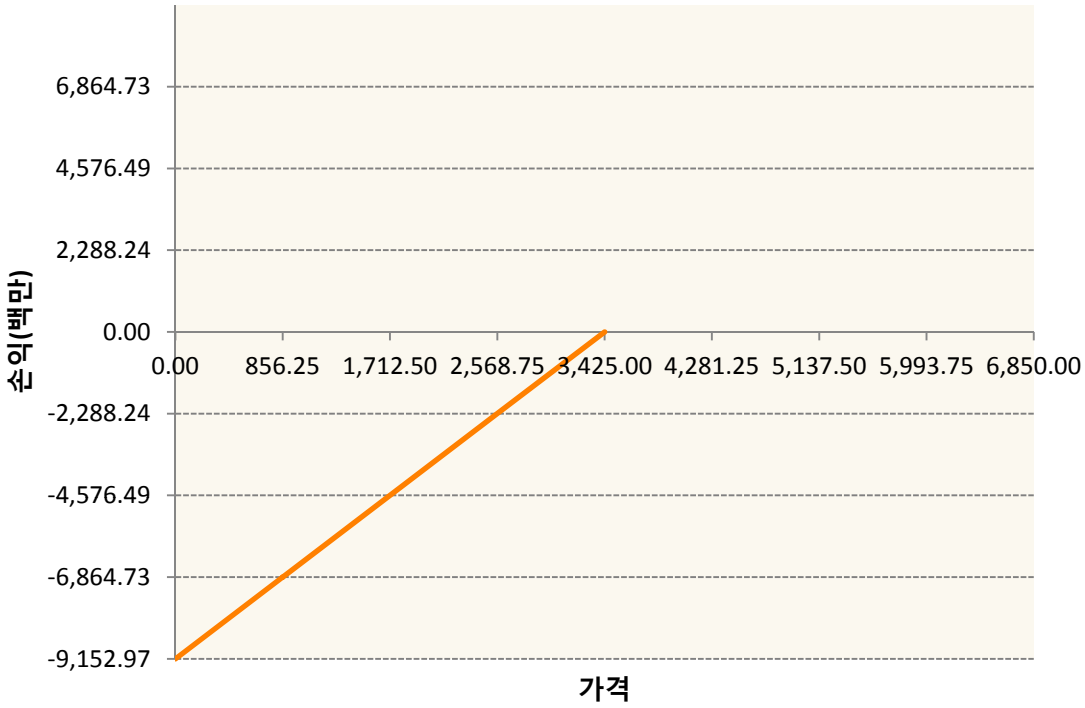
2. 만기시점의 손익구조



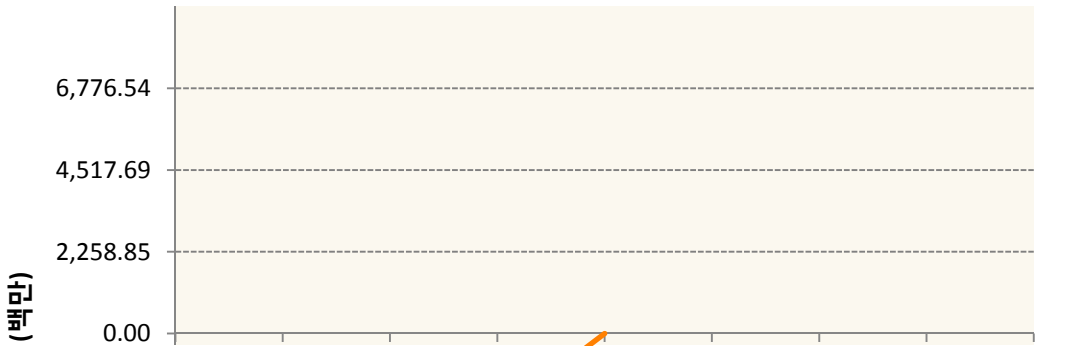


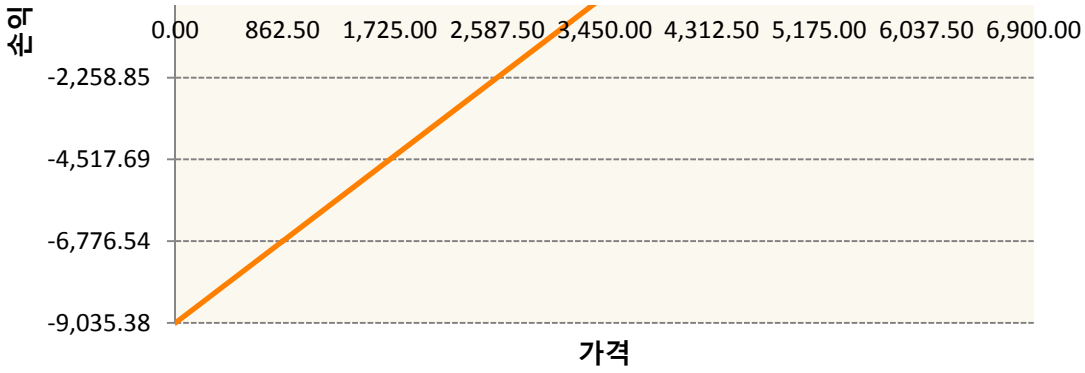


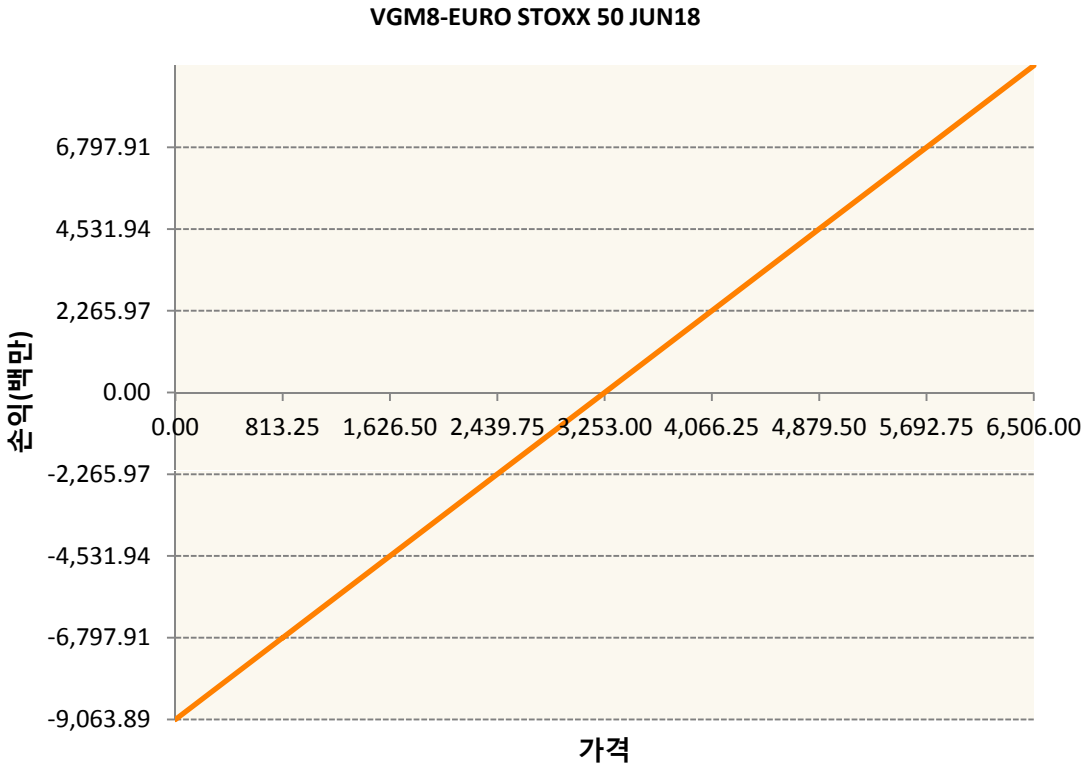
OESXJ8-P3425-EURO STOXX 50



OESXJ8-P3450-EURO STOXX 50







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
260105SGPX	SG EURO Covered CALL STRATEGY - 994.569	178
260105SQPX	SG EURO Covered CALL STRATEGY	333
OESXJ8-C34	EURO STOXX 50	732
OESXJ8-C34	EURO STOXX 50	723
OESXJ8-P34	EURO STOXX 50	732
OESXJ8-P34	EURO STOXX 50	723
VGM8	EURO STOXX 50 JUN18	725

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

2,542

공시일	2018-03-26
기준일	2018-03-23

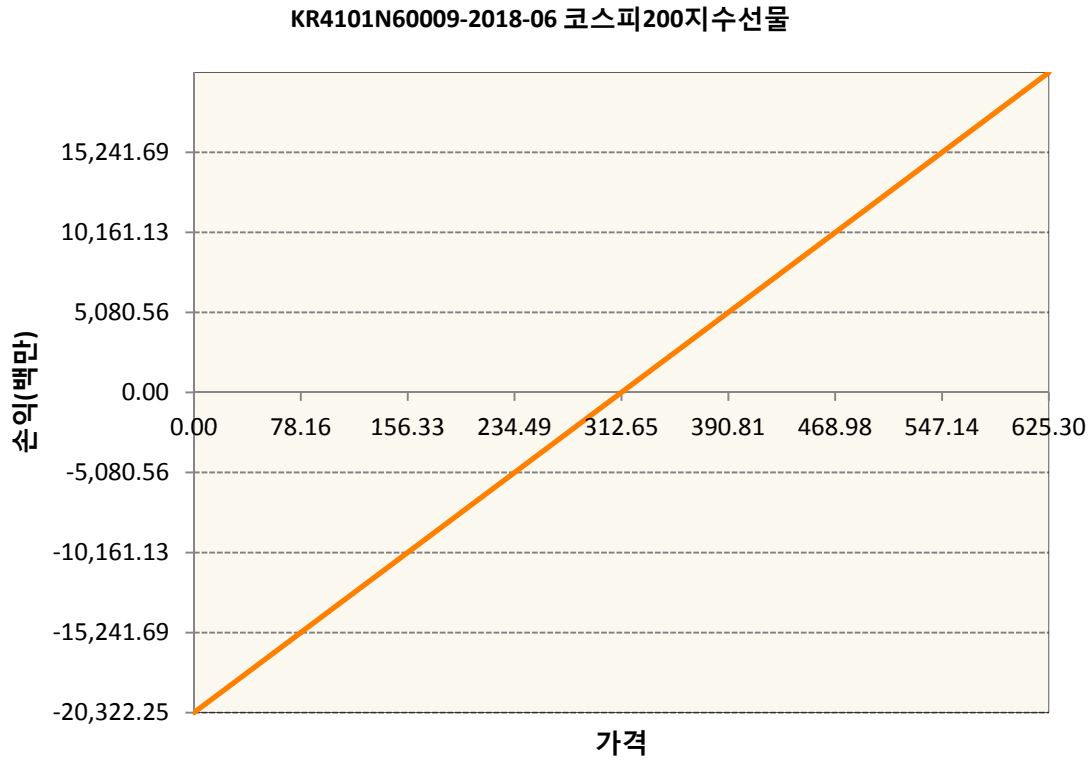
ETF스마트레버리지목표전환형8호

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	20,322	0	20,322	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101N60(2018-06 코스피200지수선물							1,625
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,625	-1,625	-1,625	-1,625	-1,625	-1,625	-1,625
-5.33%	-1,083	-1,083	-1,083	-1,083	-1,083	-1,083	-1,083
-2.67%	-542	-542	-542	-542	-542	-542	-542
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	542	542	542	542	542	542	542
5.33%	1,083	1,083	1,083	1,083	1,083	1,083	1,083
8.00%	1,625	1,625	1,625	1,625	1,625	1,625	1,625

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

1,167

공시일	2018-03-26
기준일	2018-03-23

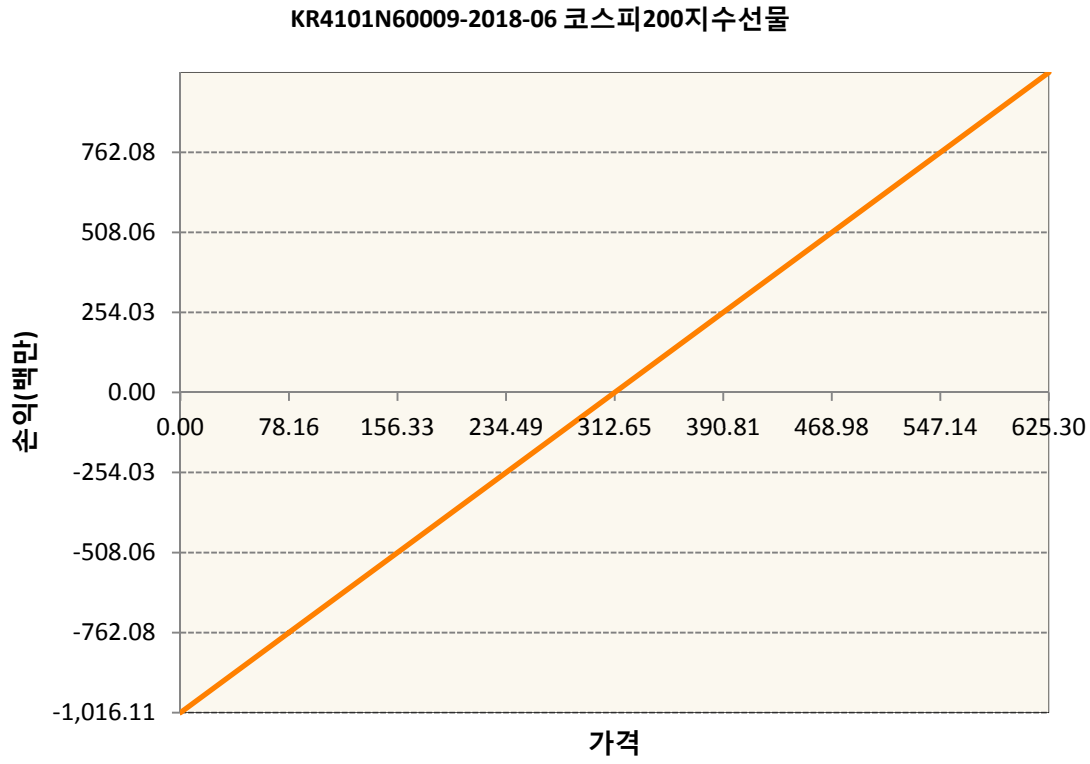
ETF스마트레버리지목표전환형9호

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	1,016	0	1,016	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101N60(2018-06 코스피200지수선물							81
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-81	-81	-81	-81	-81	-81	-81
-5.33%	-54	-54	-54	-54	-54	-54	-54
-2.67%	-27	-27	-27	-27	-27	-27	-27
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	27	27	27	27	27	27	27
5.33%	54	54	54	54	54	54	54
8.00%	81	81	81	81	81	81	81

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

58

공시일	2018-03-26
기준일	2018-03-23

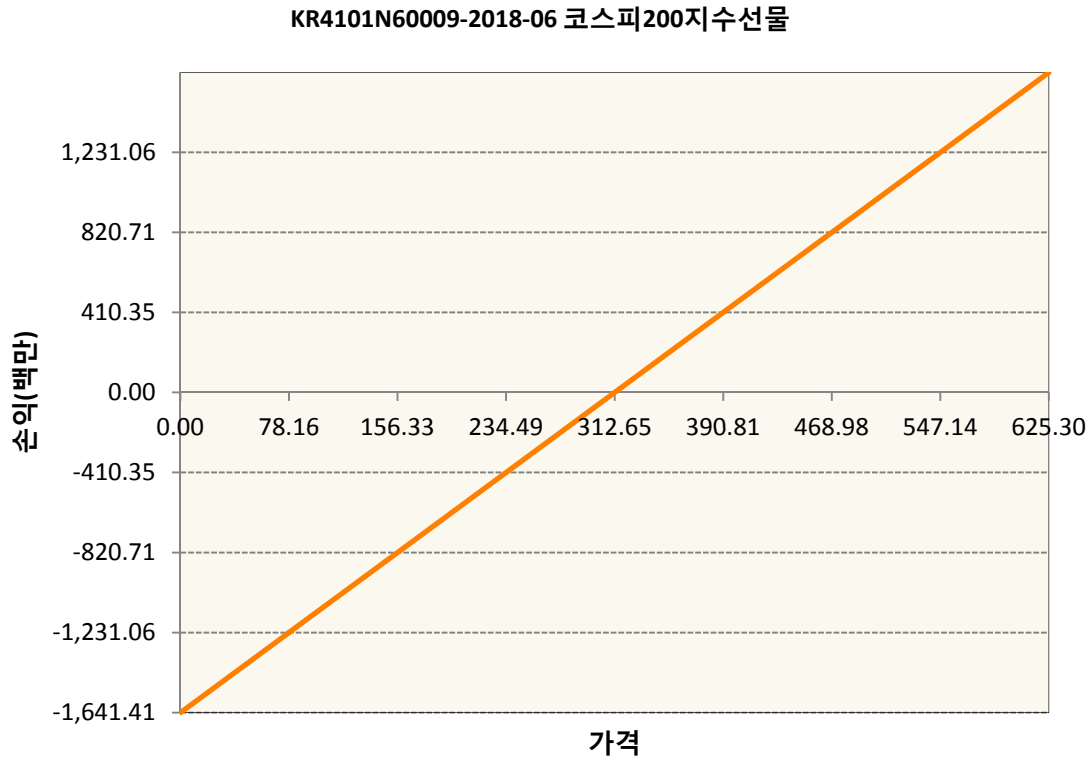
ETF스마트레버리지목표전환형10

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	1,641	0	1,641	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101N60(2018-06 코스피200지수선물							131
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-131	-131	-131	-131	-131	-131	-131
-5.33%	-87	-87	-87	-87	-87	-87	-87
-2.67%	-44	-44	-44	-44	-44	-44	-44
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	44	44	44	44	44	44	44
5.33%	87	87	87	87	87	87	87
8.00%	131	131	131	131	131	131	131

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

94

공시일	2018-03-26
기준일	2018-03-23

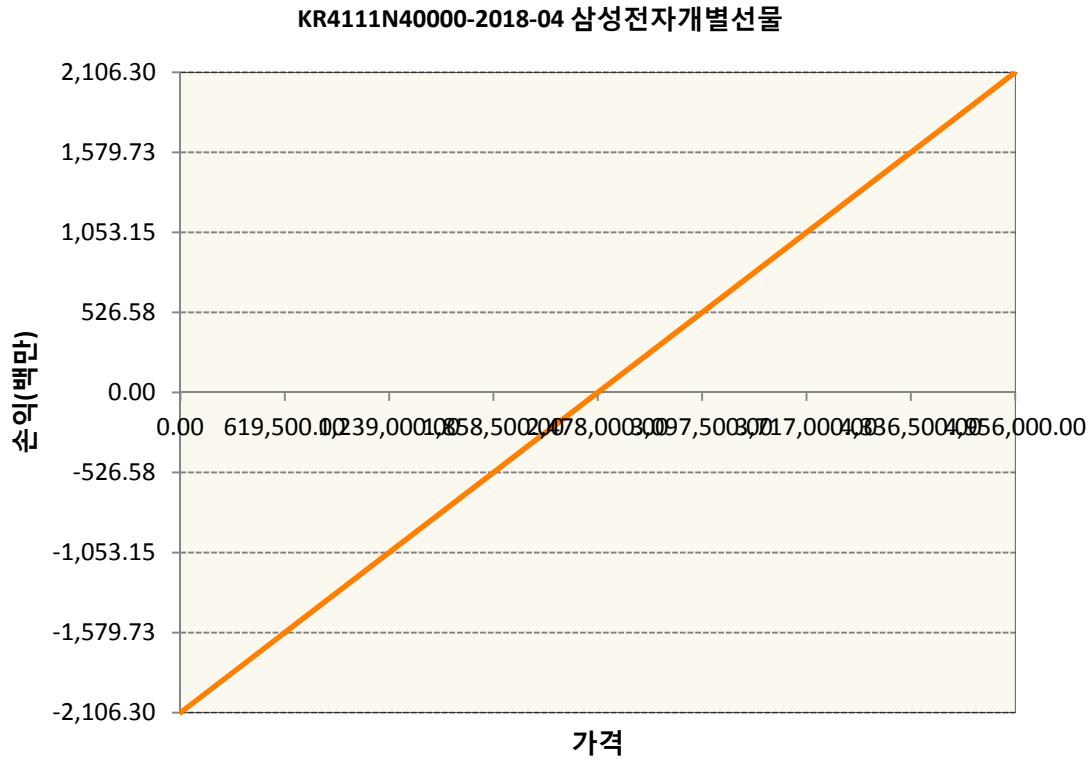
스마트KRX300인덱스1호(주식-파

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	2,106	0	2,106	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4111N40(2018-04 삼성전자개별선물							169
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-169	-169	-169	-169	-169	-169	-169
-5.33%	-113	-113	-113	-113	-113	-113	-113
-2.67%	-56	-56	-56	-56	-56	-56	-56
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	56	56	56	56	56	56	56
5.33%	113	113	113	113	113	113	113
8.00%	169	169	169	169	169	169	169

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

204

공시일	2018-03-26
기준일	2018-03-23

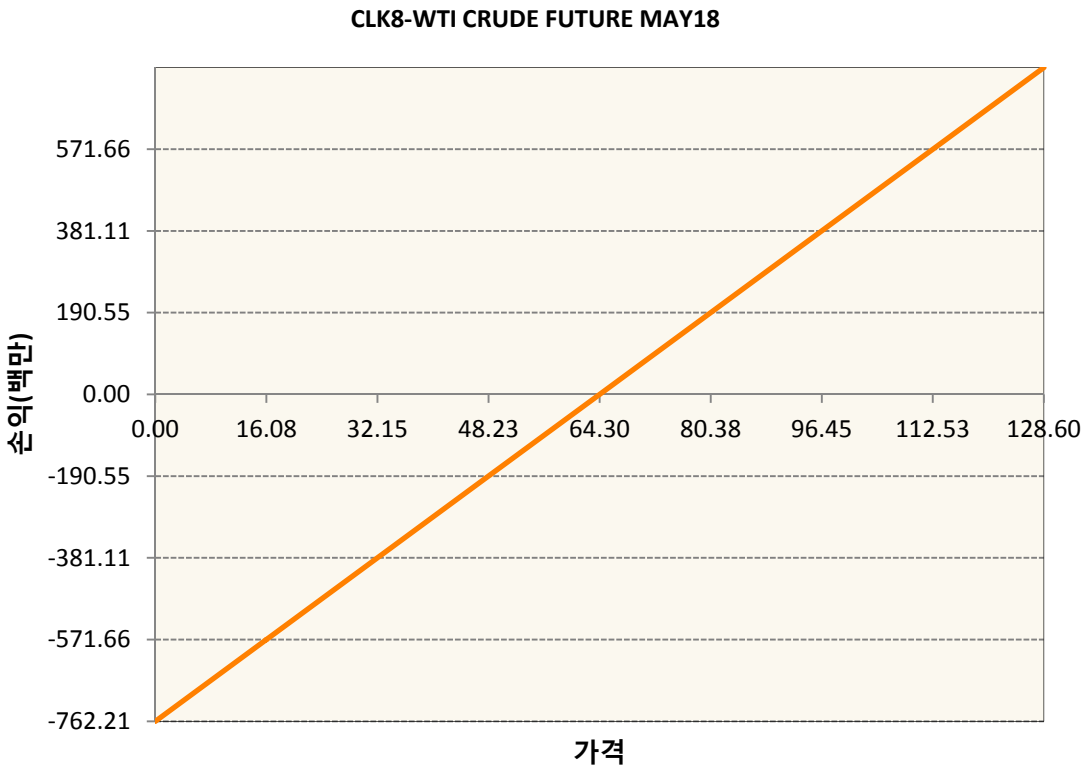
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

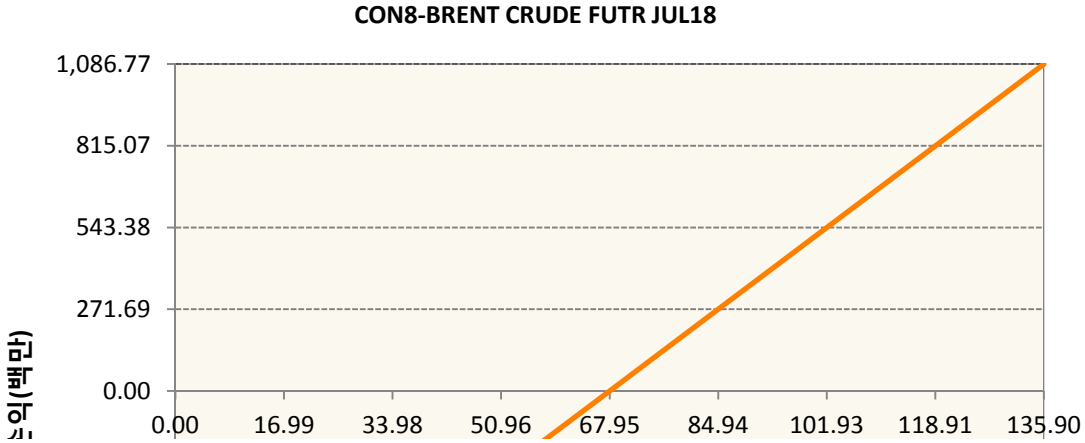
1. 계약금액

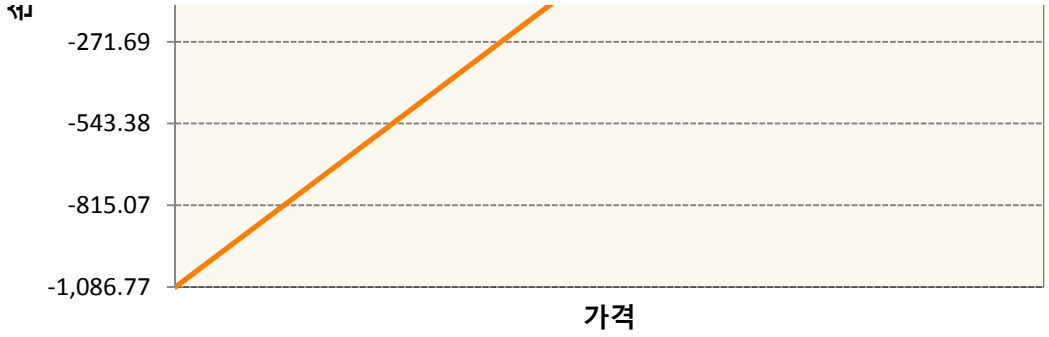
(단위:백만원)

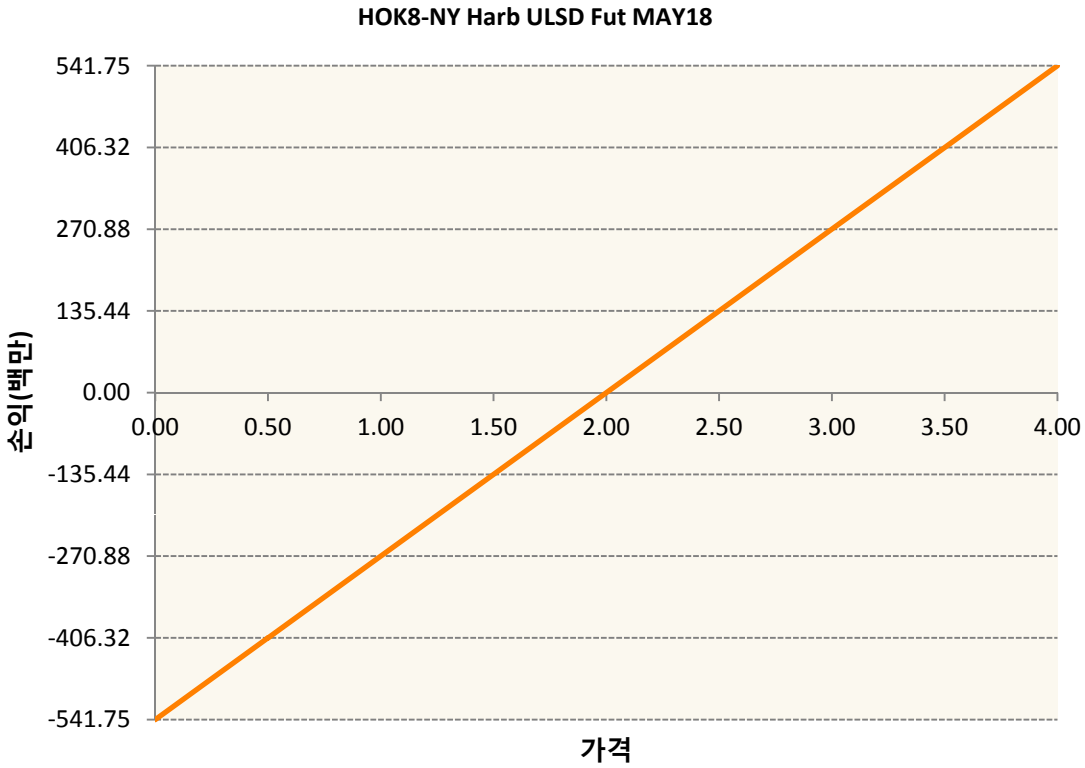
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	선물	유가증권	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	선물	유가증권	762	0	762	
누계	유가증권	선물	3,298	594	2,704	

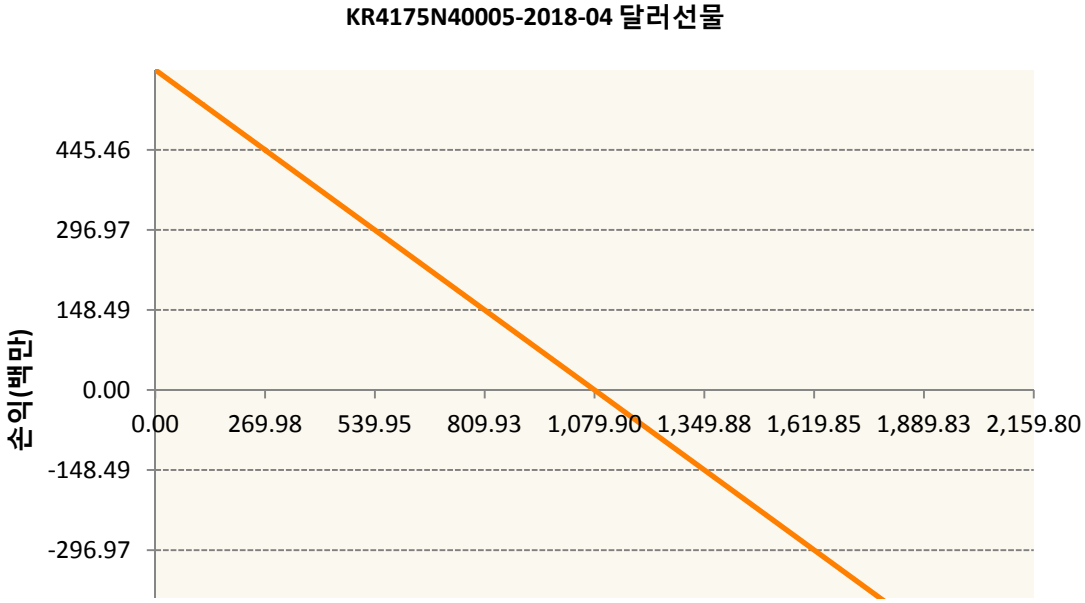
2. 만기시점의 손익구조

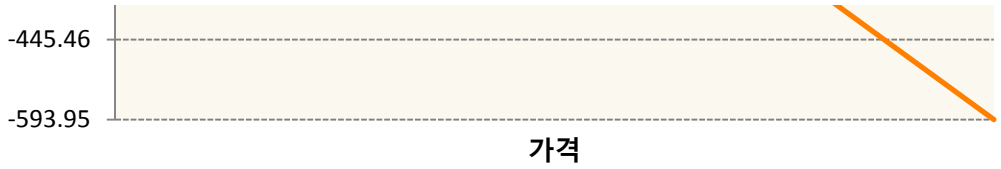


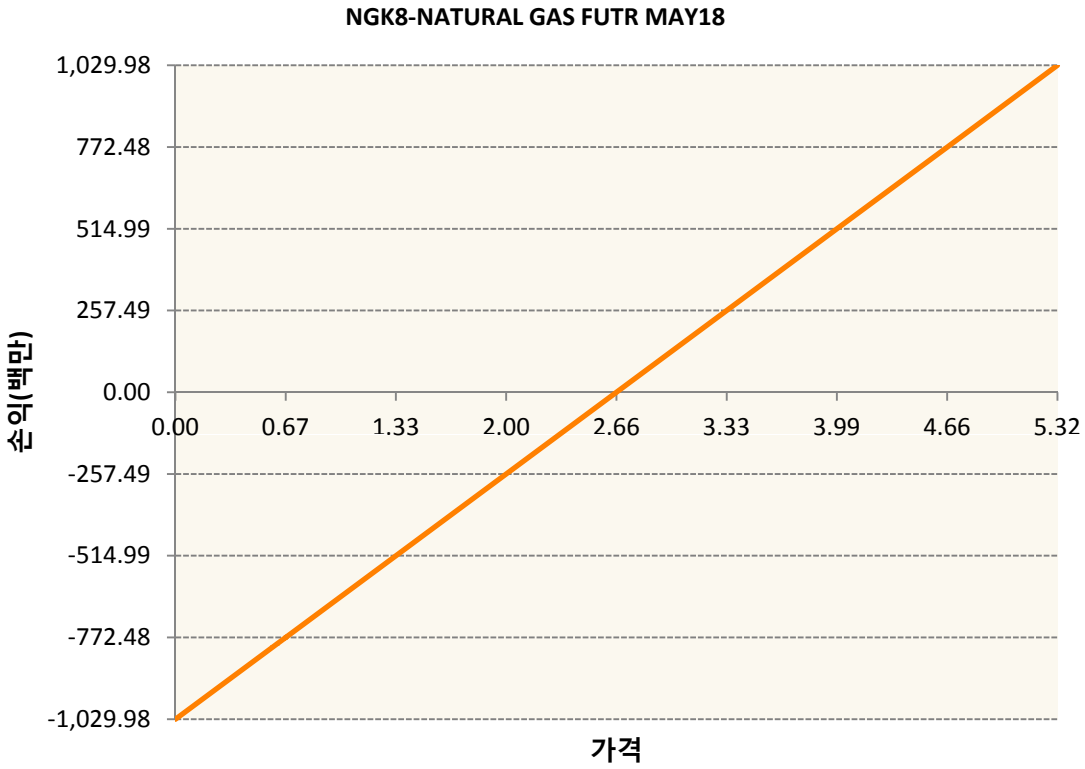


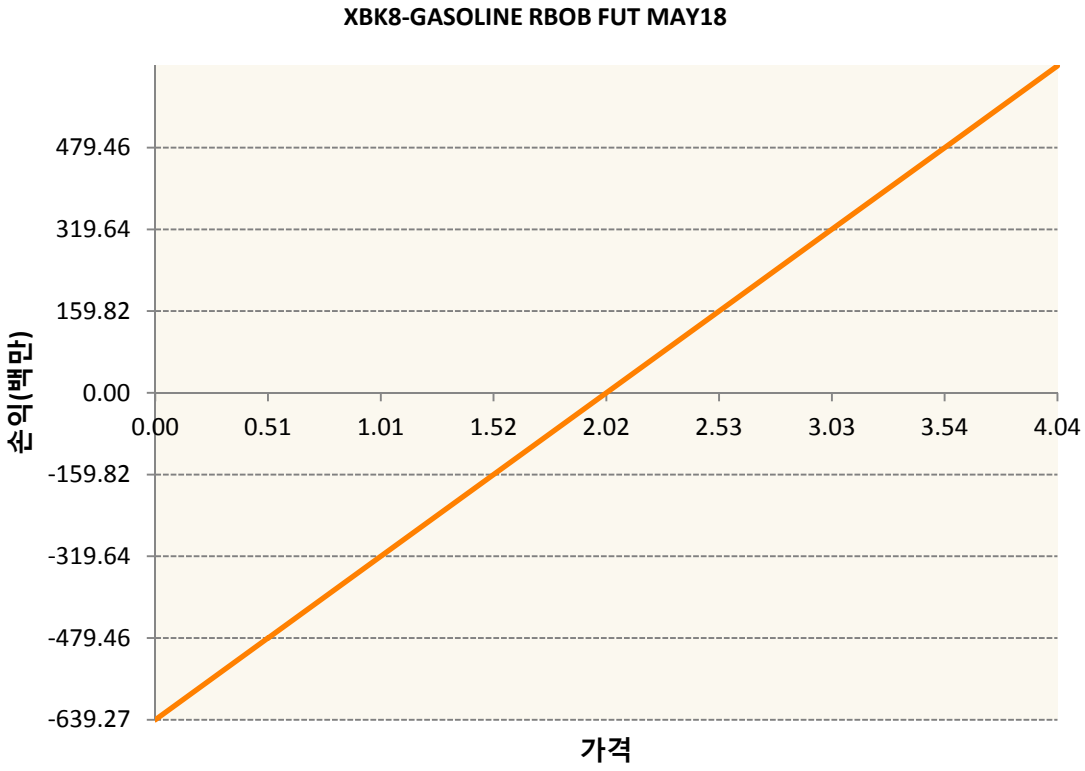

-271.69
-543.38
-815.07
-1,086.77
가격


HOK8-NY Harb ULSD Fut MAY18
541.75
406.32
270.88
135.44
0.00
-135.44
-270.88
-406.32
-541.75
0.00
0.50
1.00
1.50
2.00
2.50
3.00
3.50
4.00
손익(백만)
가격


KR4175N40005-2018-04 달러선물
445.46
296.97
148.49
0.00
-148.49
-296.97
0.00
269.98
539.95
809.93
1,079.90
1,349.88
1,619.85
1,889.83
2,159.80
손익(백만)


-445.46
-593.95
가격


NGK8-NATURAL GAS FUTR MAY18
1,029.98
772.48
514.99
257.49
0.00
-257.49
-514.99
-772.48
-1,029.98
0.00
0.67
1.33
2.00
2.66
3.33
3.99
4.66
5.32
손익(백만)
가격


XBK8-GASOLINE RBOB FUT MAY18
479.46
319.64
159.82
0.00
-159.82
-319.64
-479.46
-639.27
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	61
CON8	BRENT CRUDE FUTR JUL18	87
HOK8	NY Harb ULSD Fut MAY18	43
KR4175N40(	2018-04 달러선물	48
NGK8	NATURAL GAS FUTR MAY18	82
XBK8	GASOLINE RBOB FUT MAY18	51

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

528

공시일	2018-03-26
기준일	2018-03-23

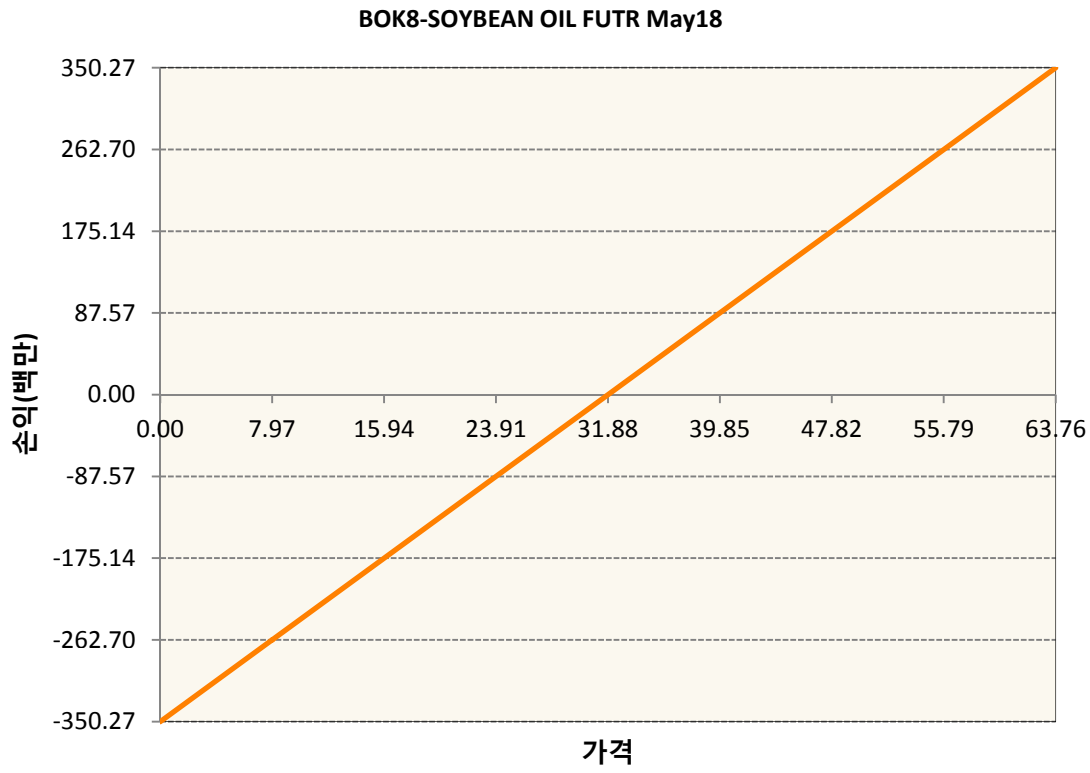
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

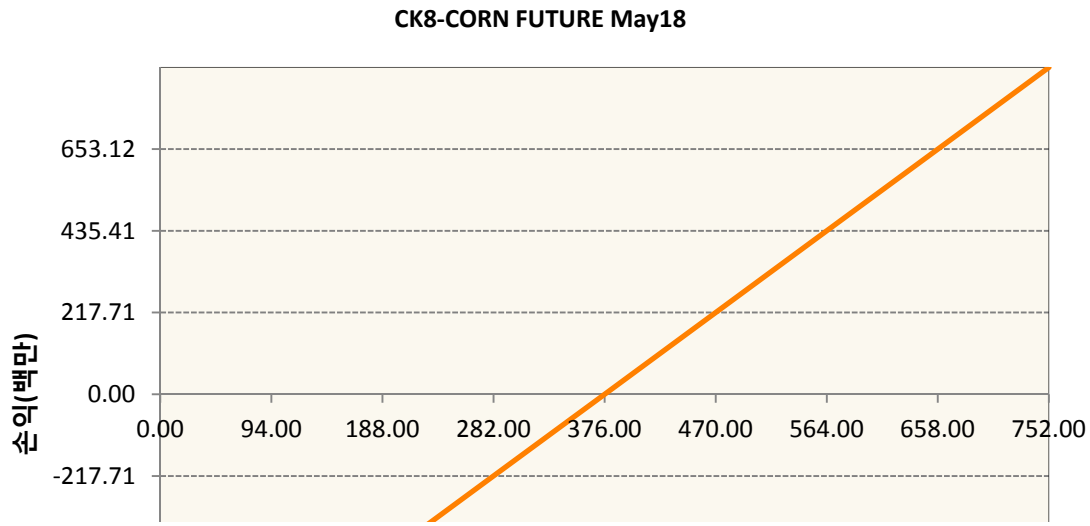
1. 계약금액

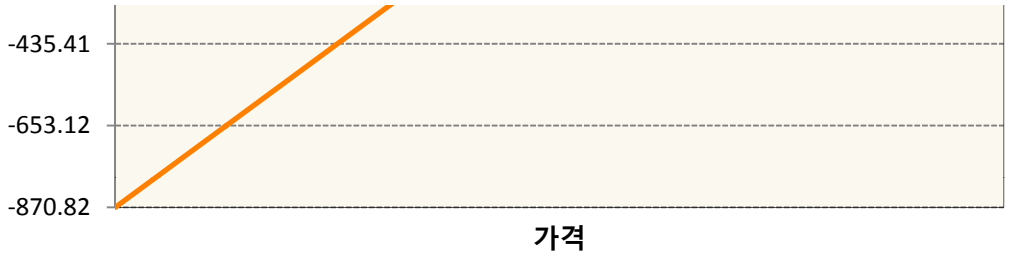
(단위:백만원)

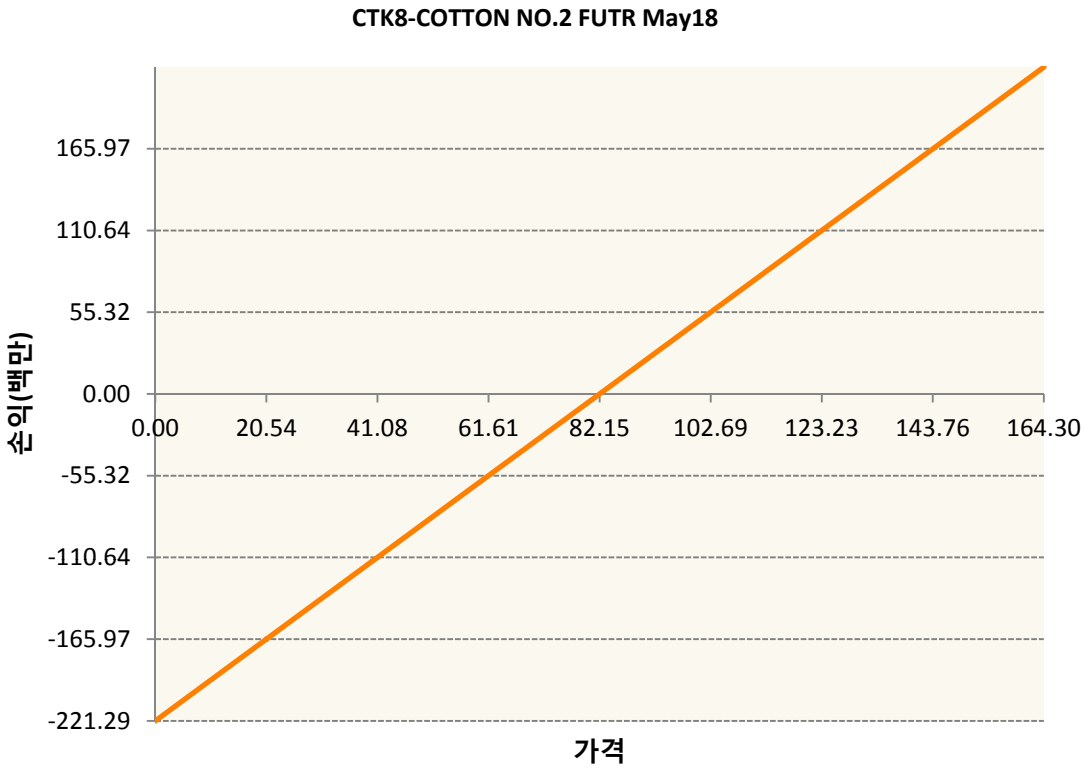
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	4,075	324	3,752	

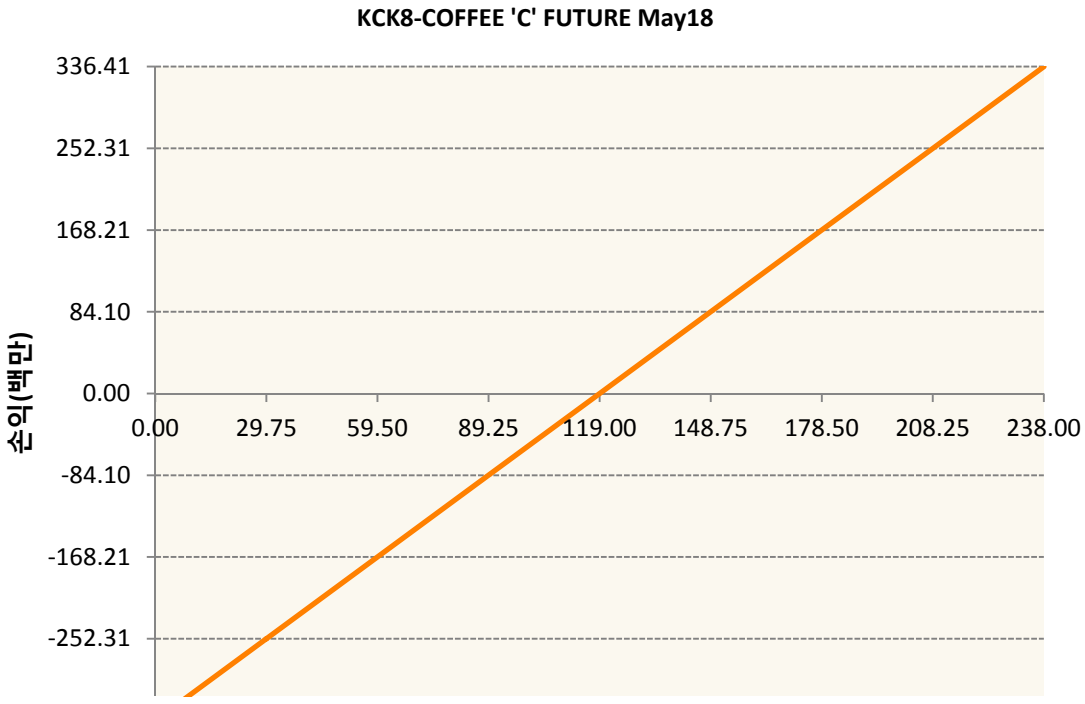
2. 만기시점의 손익구조

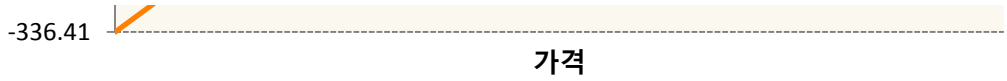


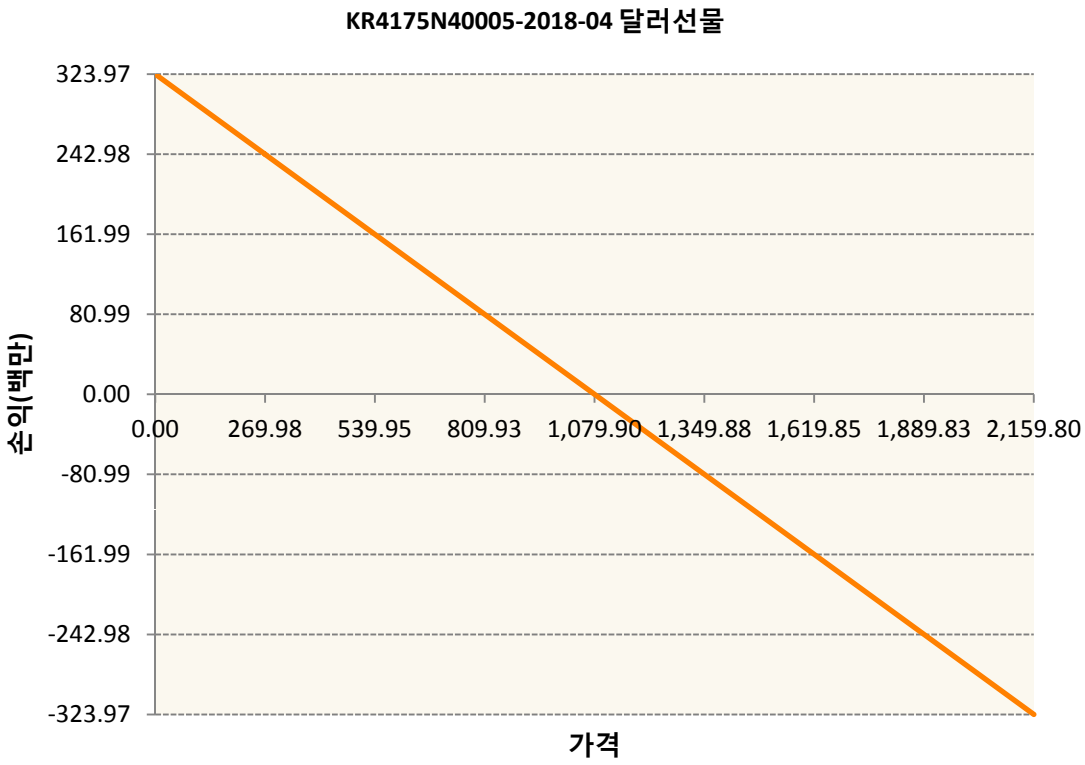


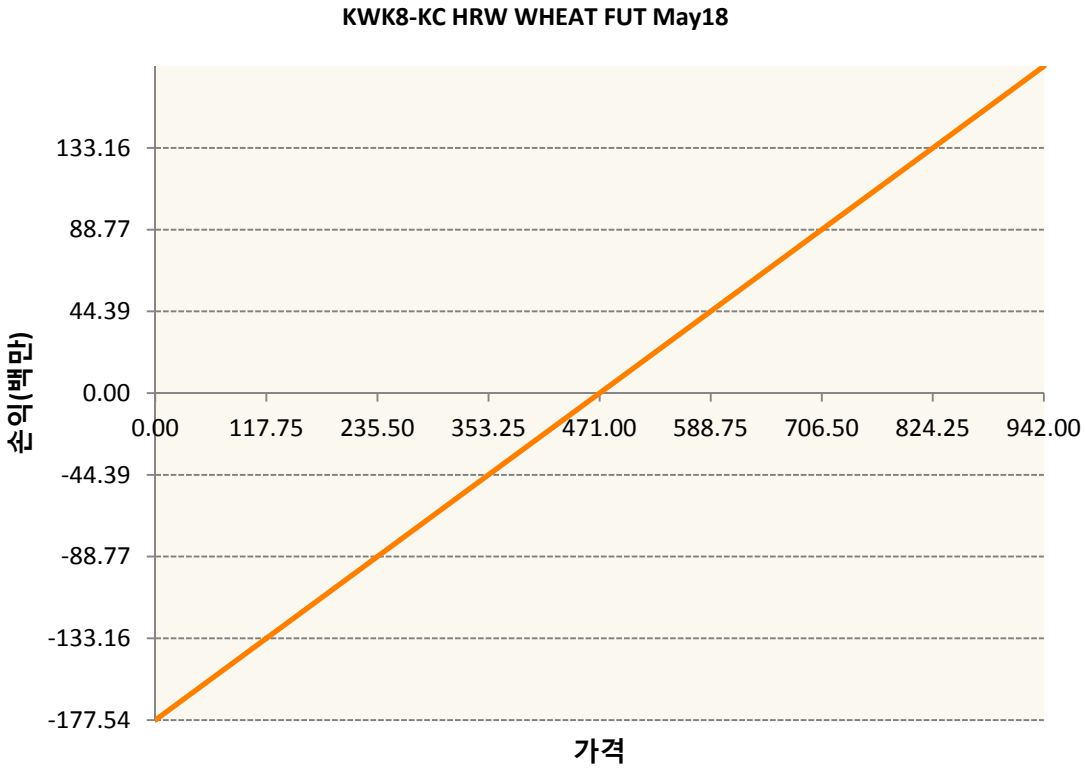

-435.41
-653.12
-870.82
가격


CTK8-COTTON NO.2 FUTR May18
165.97
110.64
55.32
0.00
-55.32
-110.64
-165.97
-221.29
0.00
20.54
41.08
61.61
82.15
102.69
123.23
143.76
164.30
손익(백만)
가격

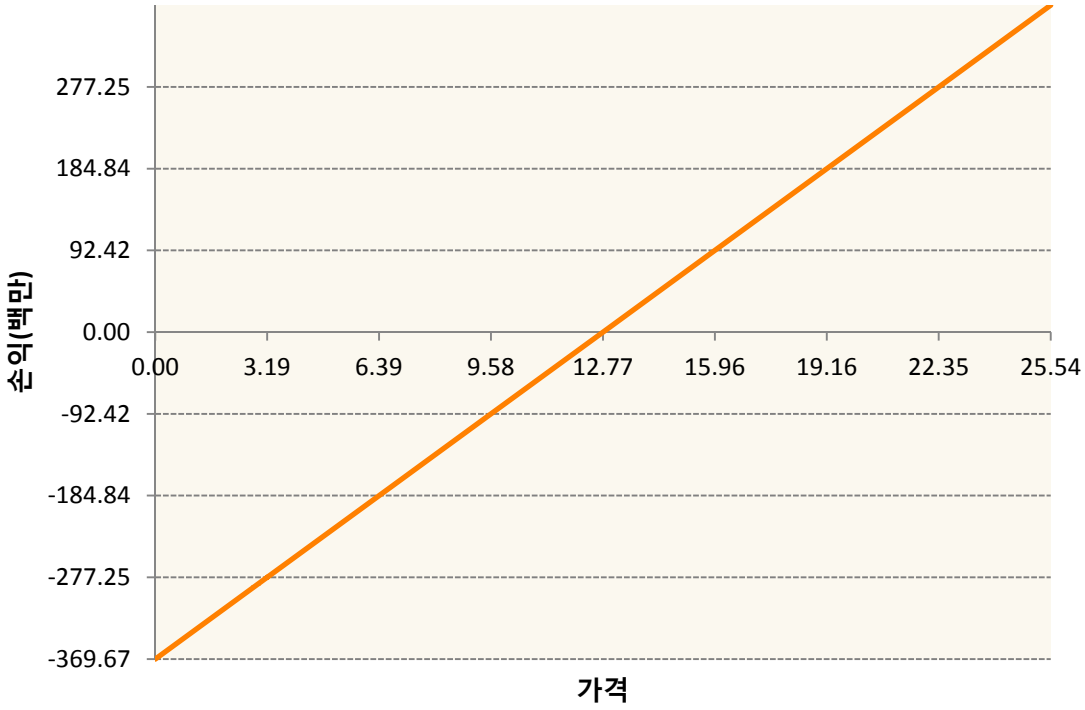

KCK8-COFFEE 'C' FUTURE May18
336.41
252.31
168.21
84.10
0.00
-84.10
-168.21
-252.31
0.00
29.75
59.50
89.25
119.00
148.75
178.50
208.25
238.00
손익(백만)


-336.41
가격

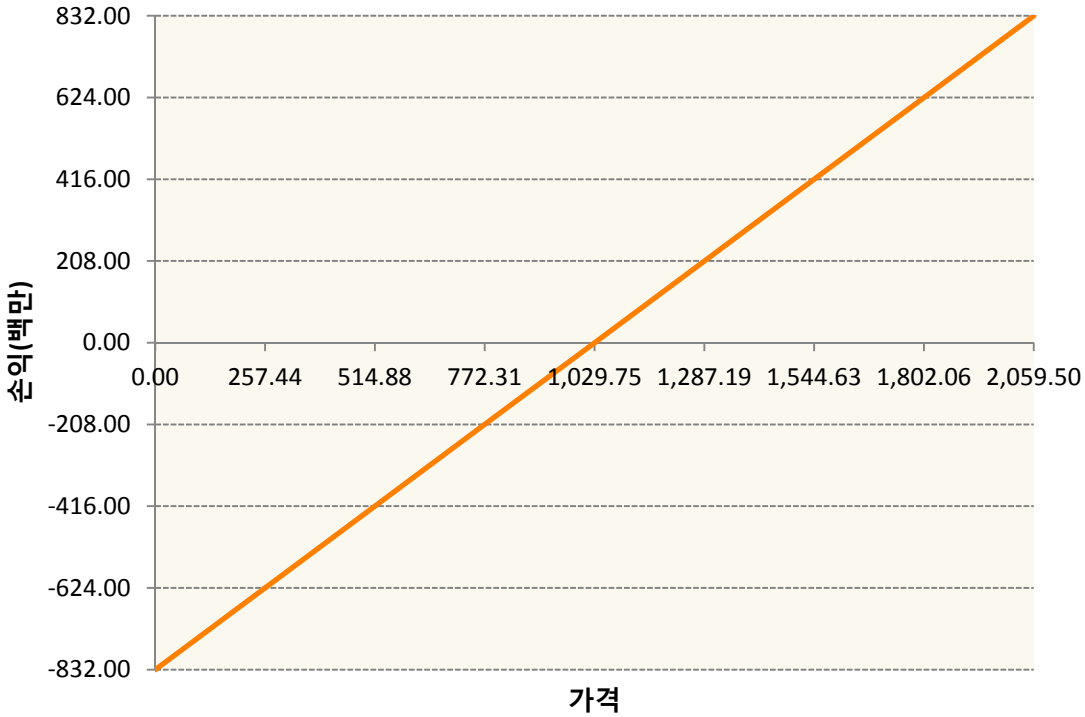

KR4175N40005-2018-04 달러선물
323.97
242.98
161.99
80.99
0.00
-80.99
-161.99
-242.98
-323.97
0.00
269.98
539.95
809.93
1,079.90
1,349.88
1,619.85
1,889.83
2,159.80
손익(백만)
가격


KWK8-KC HRW WHEAT FUT May18
133.16
88.77
44.39
0.00
-44.39
-88.77
-133.16
-177.54
0.00
117.75
235.50
353.25
471.00
588.75
706.50
824.25
942.00
손익(백만)
가격

SBK8-SUGAR #11 (WORLD) May18

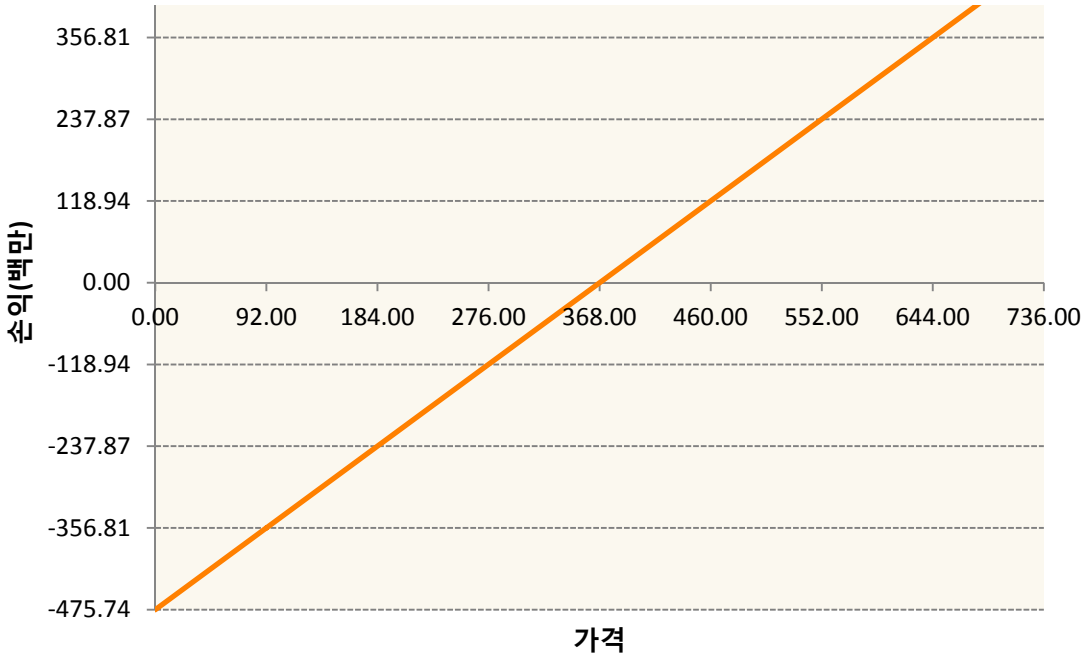


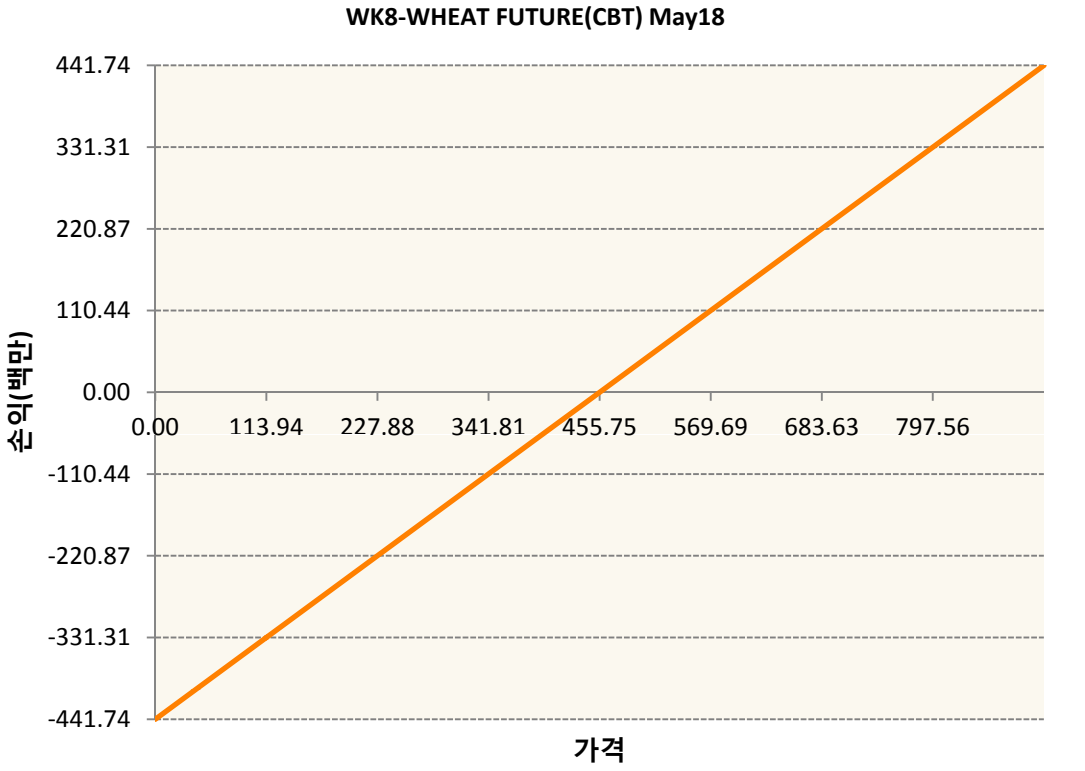
SK8-SOYBEAN FUTRUE May18



SMK8-SOYBEAN MEAL FUTR May18







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

BOK8	SOYBEAN OIL FUTR May18	28
CK8	CORN FUTURE May18	70
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	30
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)

330