공시일	2018-03-27
기준일	2018-03-26

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	2018-03-27
기준일	2018-03-26

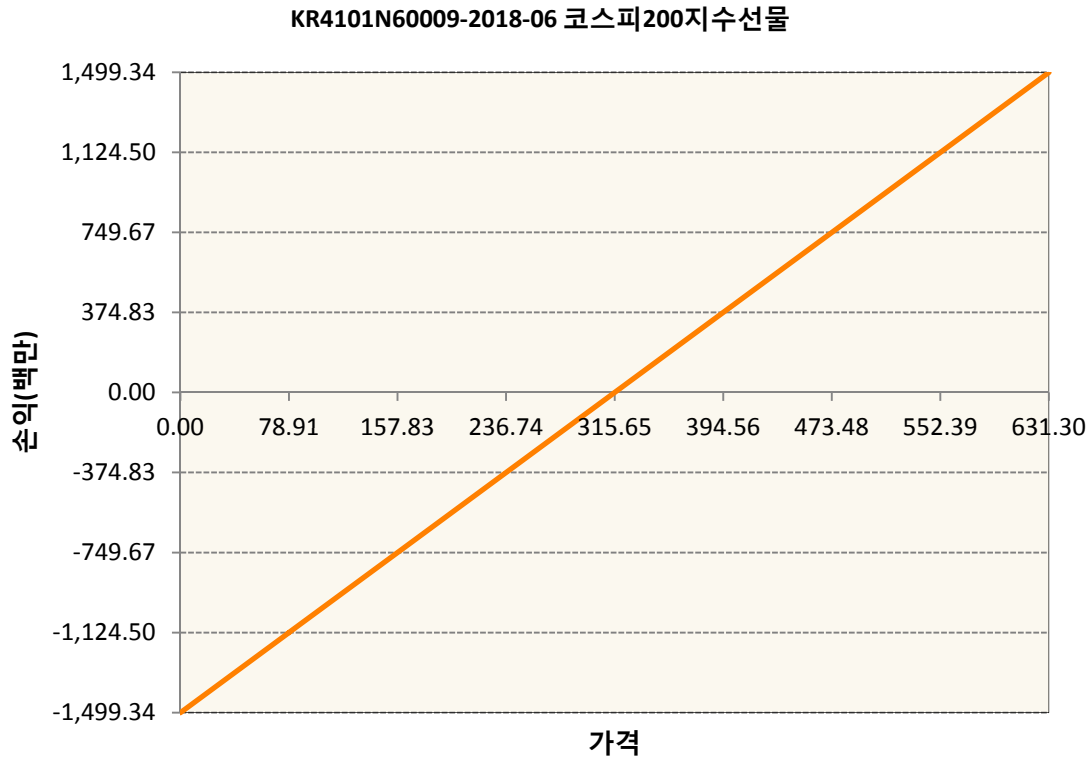
스마트인덱스모

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	1,499	0	1,499	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101N60(2018-06 코스피200지수선물							120
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-120	-120	-120	-120	-120	-120	-120
-5.33%	-80	-80	-80	-80	-80	-80	-80
-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%	80	80	80	80	80	80	80
8.00%	120	120	120	120	120	120	120

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

86

공시일	2018-03-27
기준일	2018-03-26

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	1,069

* 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	2018-03-27
기준일	2018-03-26

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	396

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

415

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2018-03-27
기준일	2018-03-26

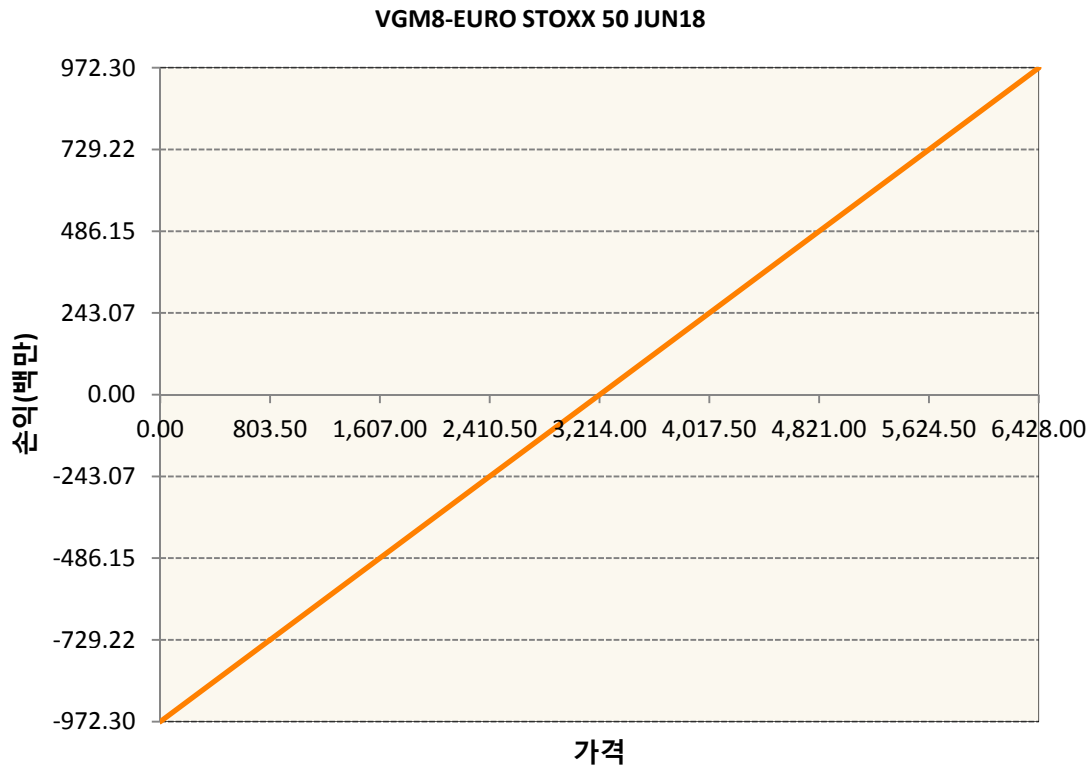
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	972	0	972	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGM8	EURO STOXX 50 JUN18	78

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

(단위:백만원)

47

공시일	2018-03-27
기준일	2018-03-26

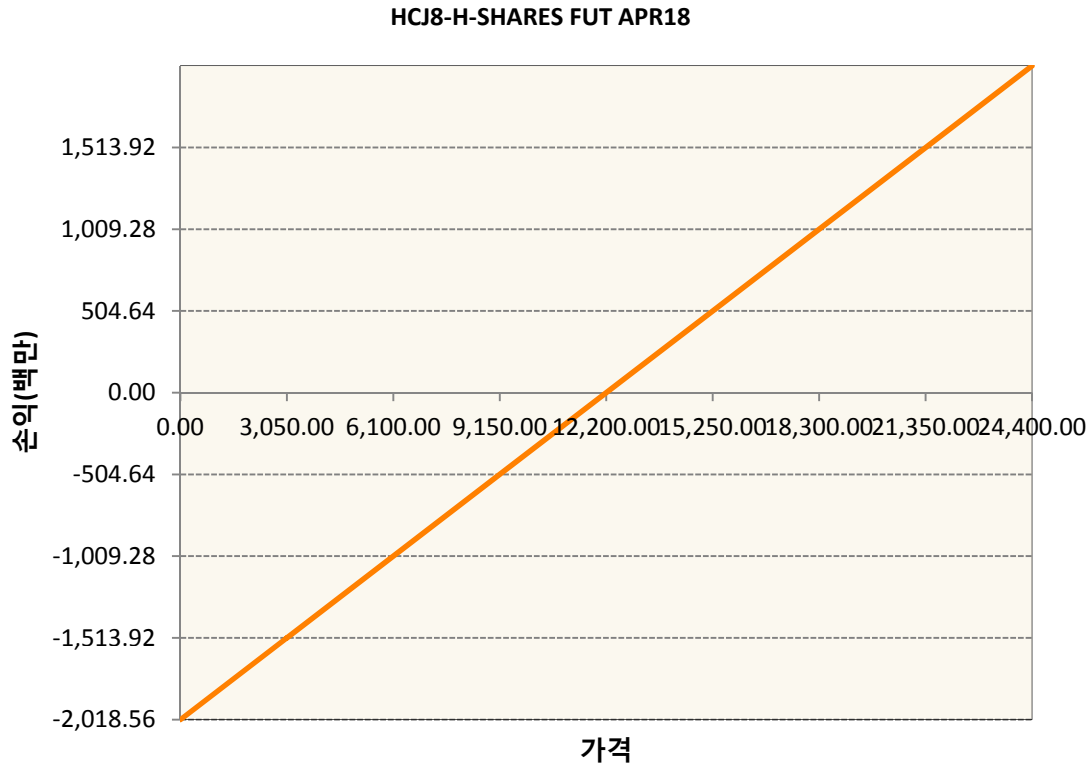
차이나인덱스모(주식-파생형)

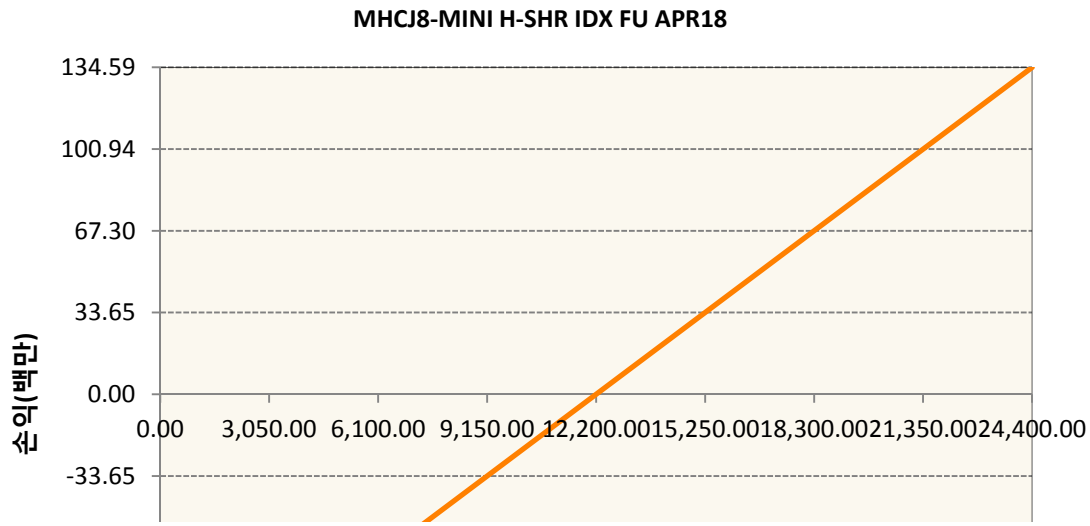
1. 계약금액

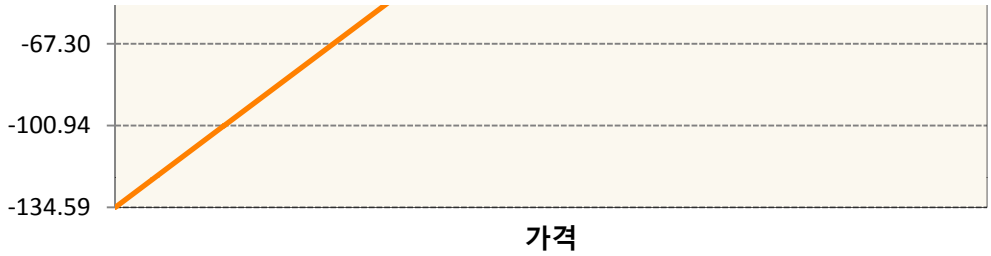
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,153	0	2,153	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCJ8	H-SHARES FUT APR18	161
MHCJ8	MINI H-SHR IDX FU APR18	11

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	151

공시일	2018-03-27
기준일	2018-03-26

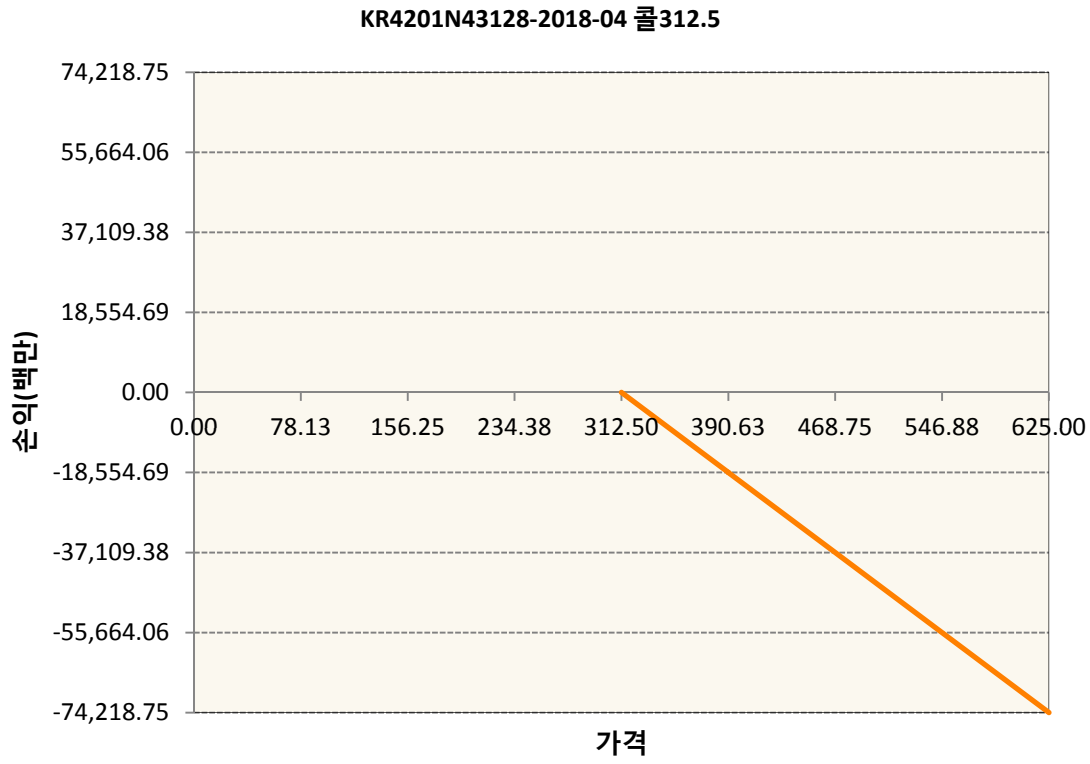
커버드콜모(주식혼합-파생형)

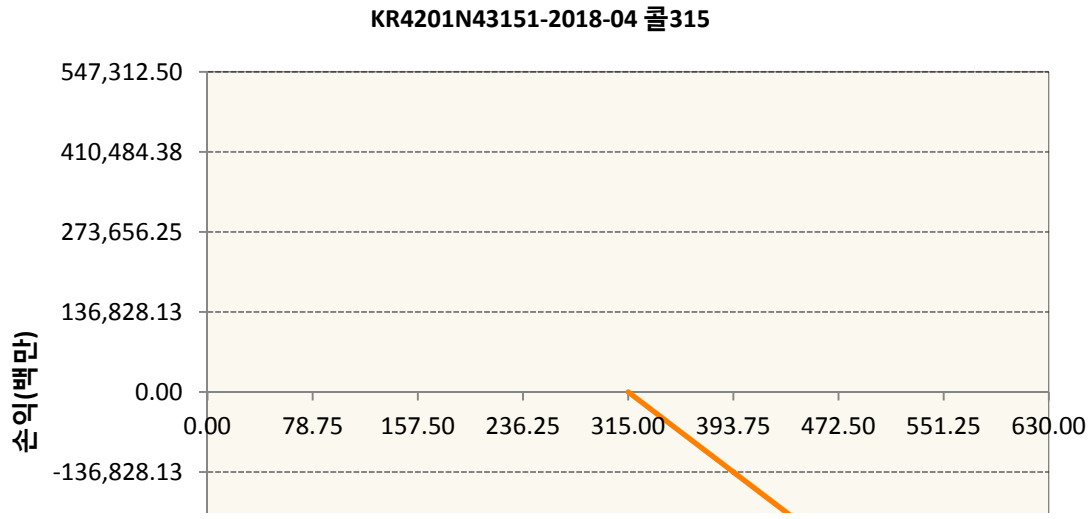
1. 계약금액

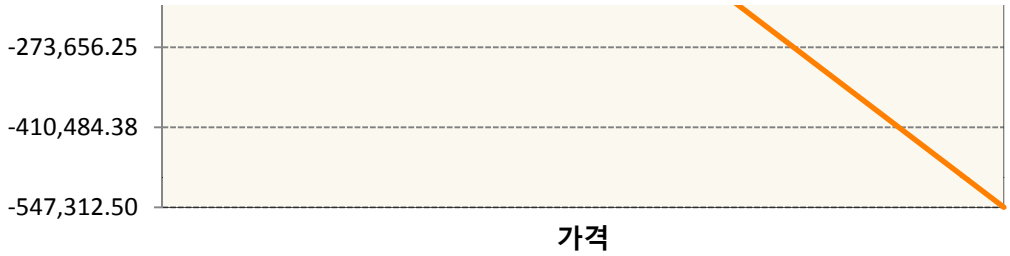
(단위:백만원)

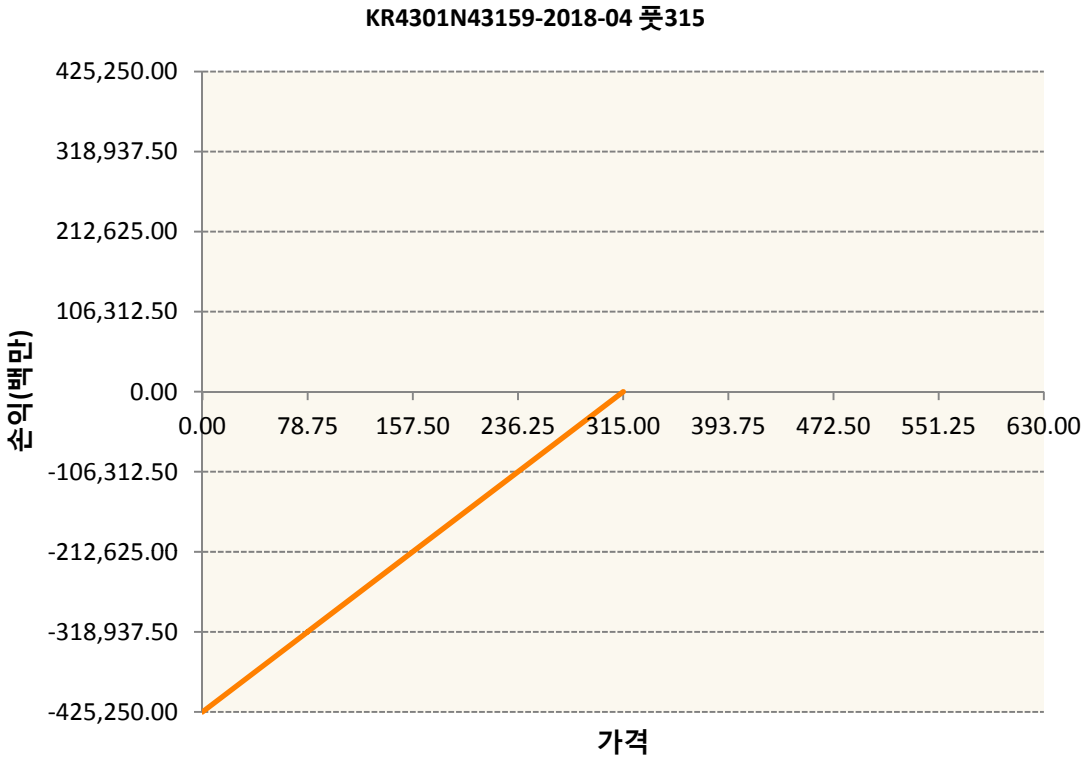
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	1,046,781	-1,046,781	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201N4312018-04 콜312.5							4,834
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	2,049	2,006	1,953	1,890	1,818	1,739	1,653
-5.33%	1,854	1,762	1,662	1,556	1,444	1,328	1,208
-2.67%	1,365	1,227	1,088	946	804	660	516
0%	449	300	150	0	-150	-300	-451
2.67%	-910	-1,029	-1,154	-1,284	-1,417	-1,552	-1,690
5.33%	-2,602	-2,674	-2,757	-2,850	-2,950	-3,056	-3,168
8.00%	-4,480	-4,514	-4,559	-4,614	-4,679	-4,753	-4,834
KR4201N4312018-04 콜315							33,920
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	12,936	12,696	12,383	11,999	11,550	11,042	10,481

-5.33%	11,894	11,329	10,693	9,999	9,256	8,472	7,655
-2.67%	9,056	8,122	7,160	6,177	5,178	4,166	3,142
0%	3,332	2,221	1,111	0	-1,111	-2,221	-3,331
2.67%	-5,682	-6,656	-7,655	-8,674	-9,709	-10,756	-11,814
5.33%	-17,422	-18,066	-18,780	-19,552	-20,372	-21,231	-22,122
8.00%	-30,838	-31,167	-31,579	-32,069	-32,627	-33,247	-33,920
KR4301N4312018-04 풋315							27,339
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-26,808	-26,836	-26,884	-26,956	-27,055	-27,183	-27,339
-5.33%	-15,695	-15,852	-16,051	-16,289	-16,562	-16,867	-17,200
-2.67%	-5,612	-6,042	-6,498	-6,975	-7,469	-7,976	-8,494
0%	1,812	1,208	604	0	-604	-1,208	-1,812
2.67%	5,681	5,226	4,746	4,246	3,730	3,202	2,663
5.33%	6,989	6,796	6,557	6,278	5,962	5,614	5,238
8.00%	7,266	7,217	7,140	7,031	6,889	6,712	6,504

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

67,394

공시일	2018-03-27
기준일	2018-03-26

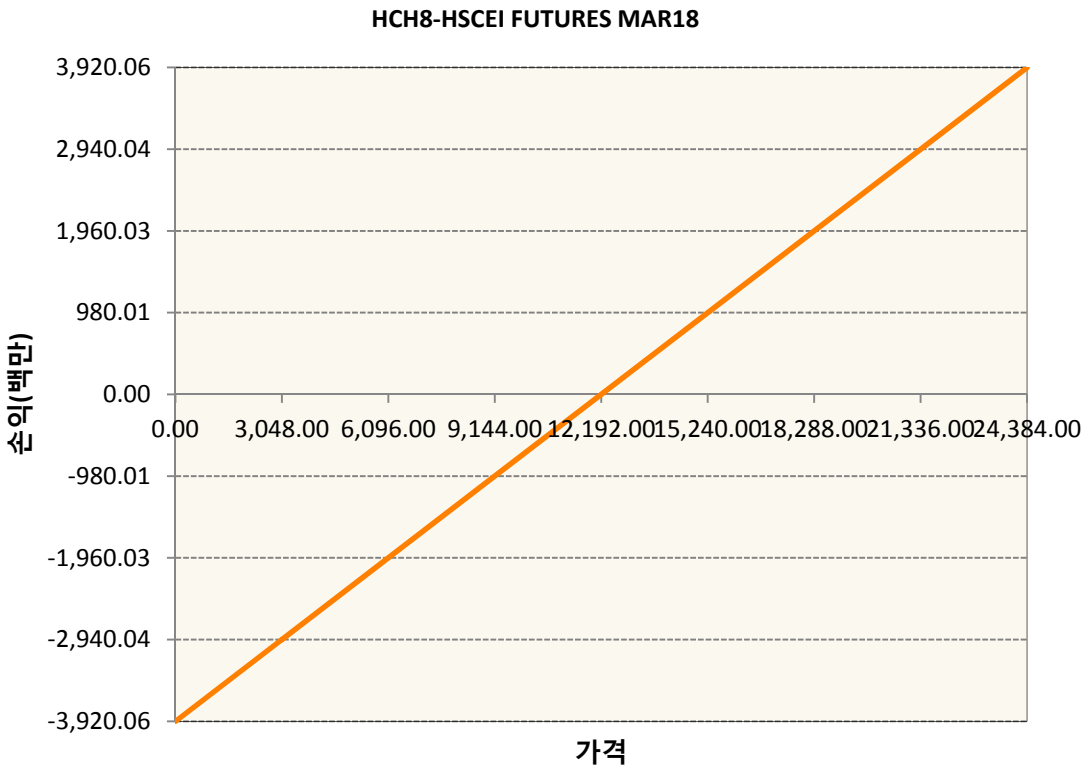
홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생

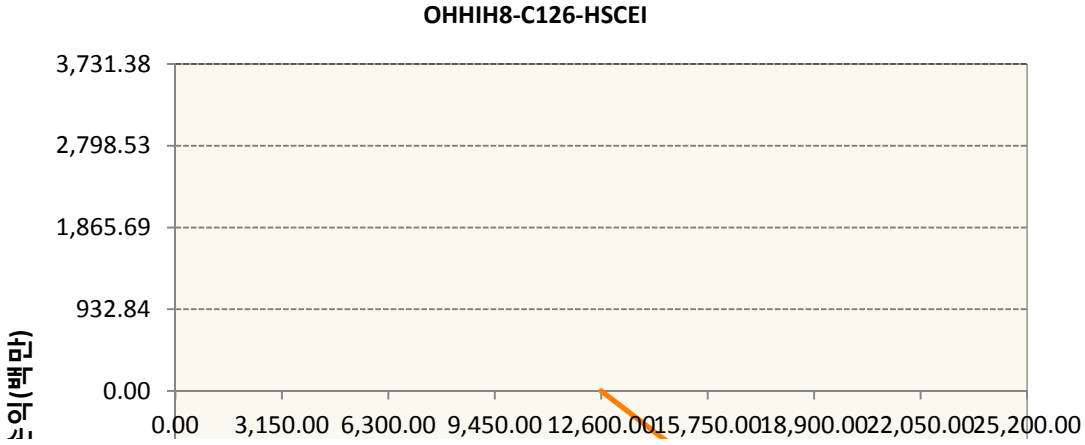
1. 계약금액

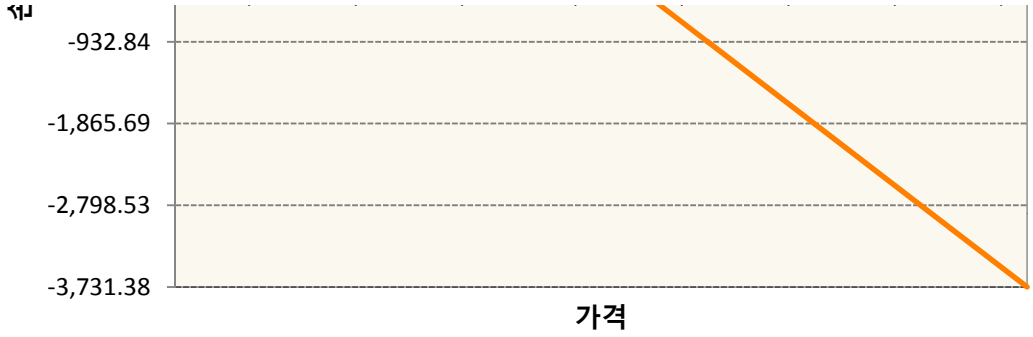
(단위:백만원)

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	3,920	0	3,920	장내
누계	유가증권	옵션	0	9,578	-9,578	장내

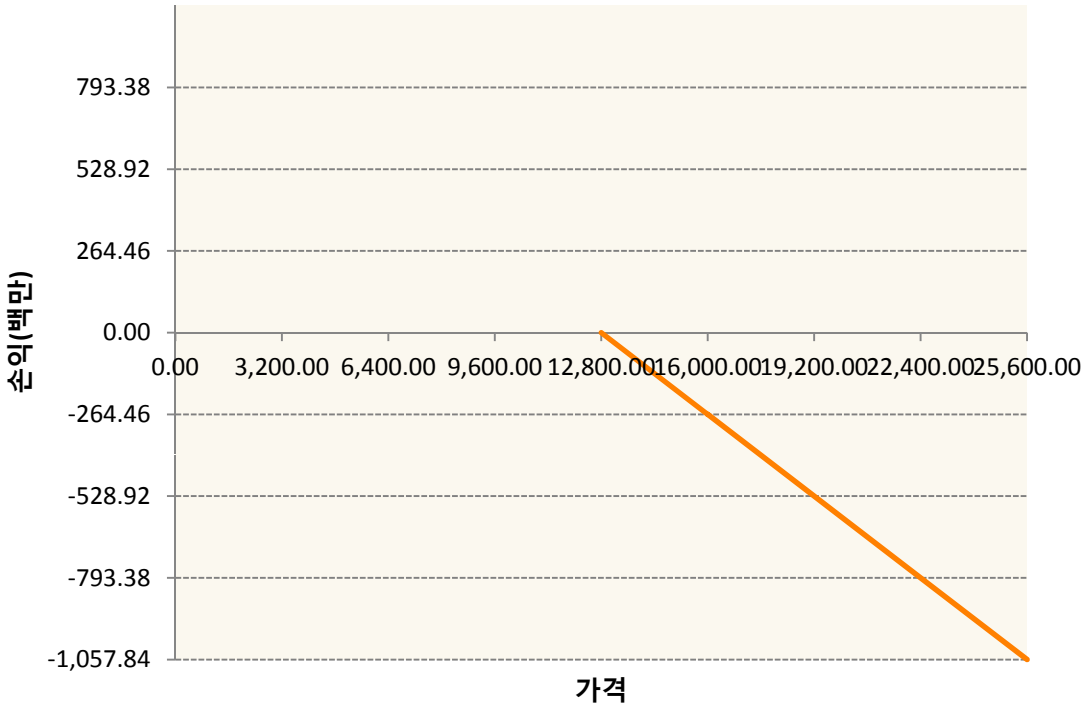
2. 만기시점의 손익구조



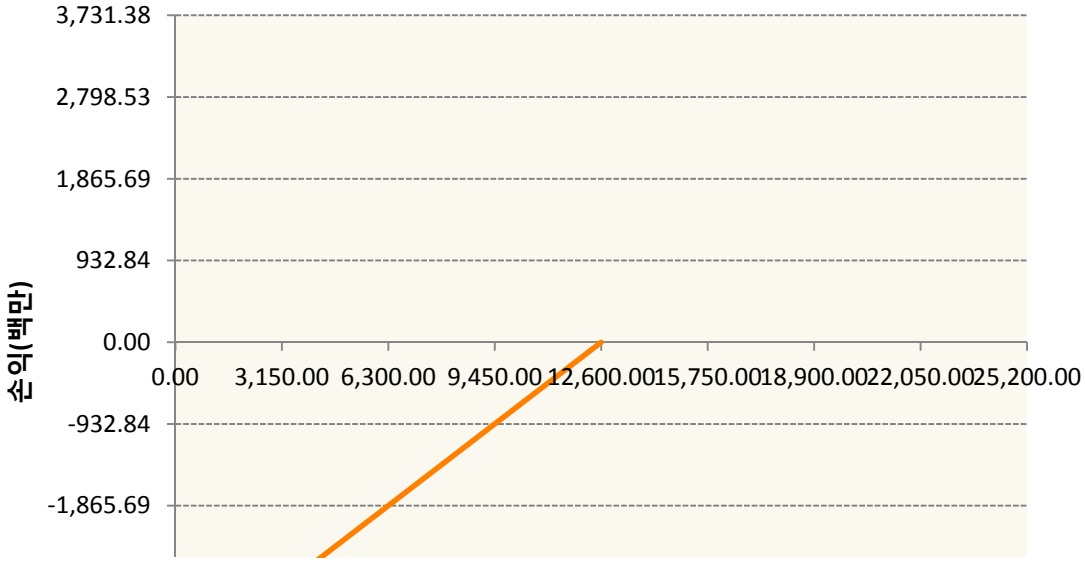


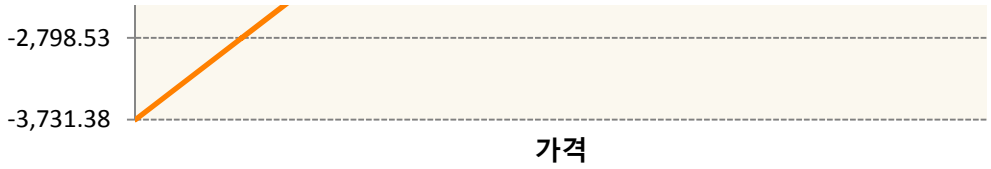


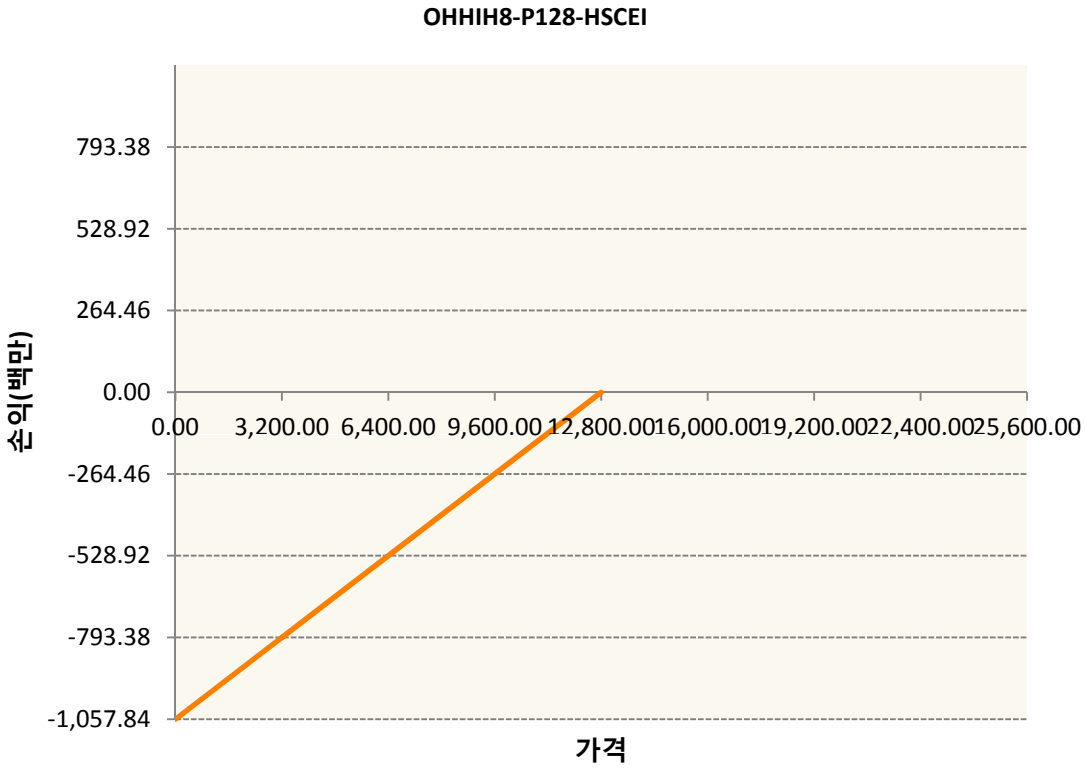
OHHIH8-C128-HSCEI



OHHIH8-P126-HSCEI







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

HCH8 HSCEI FUTURES MAR18	314
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)

947

공시일	2018-03-27
기준일	2018-03-26

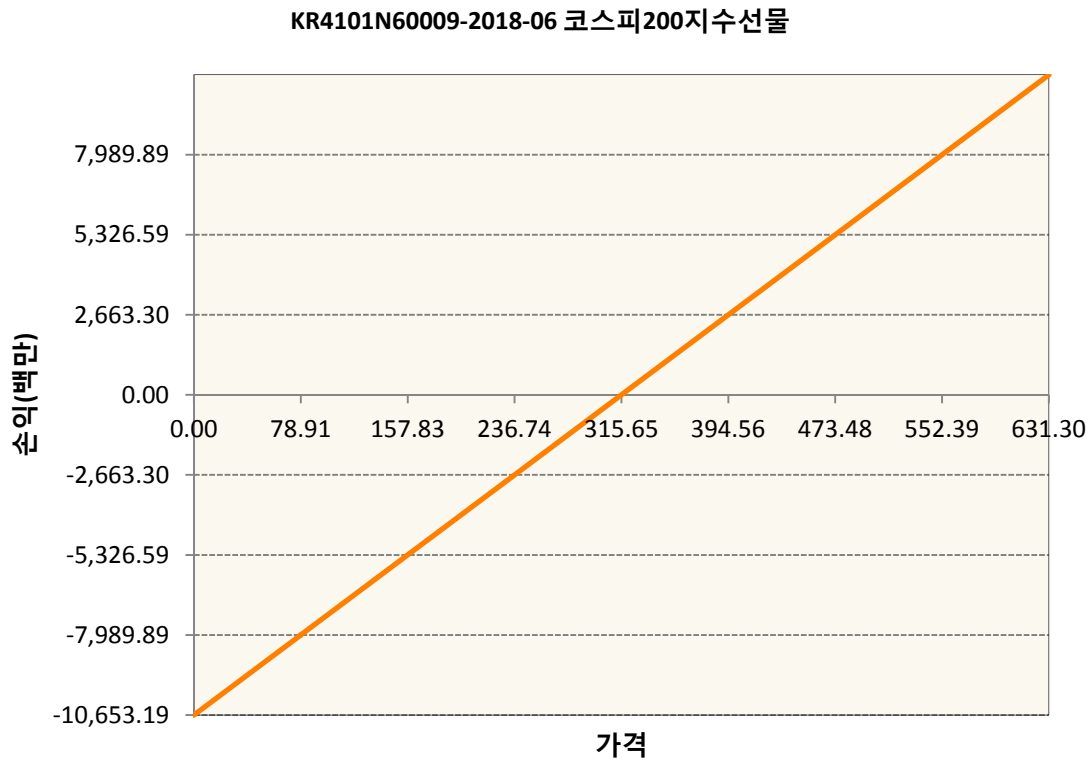
코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼

1. 계약금액

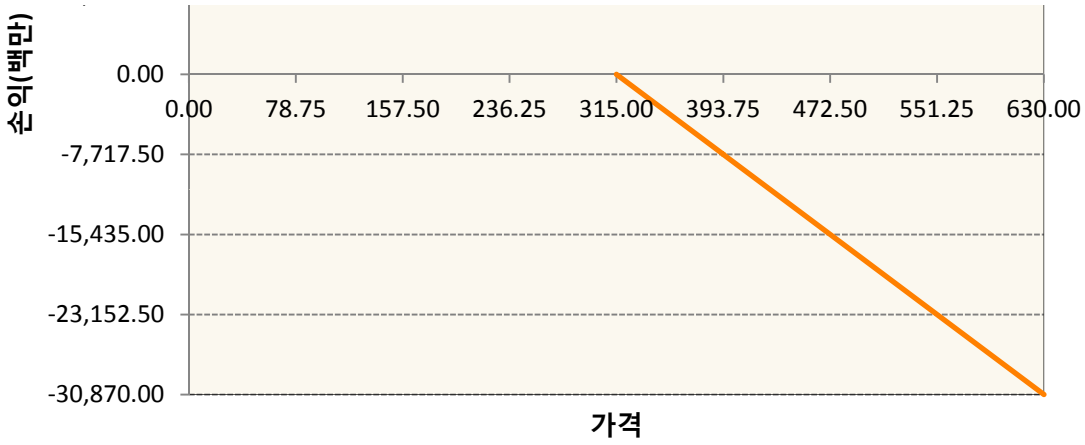
(단위:백만원)

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	10,653	0	10,653	장내
누계	유가증권	스왑	54,200	0	54,200	장외
누계	유가증권	옵션	0	55,718	-55,718	장내

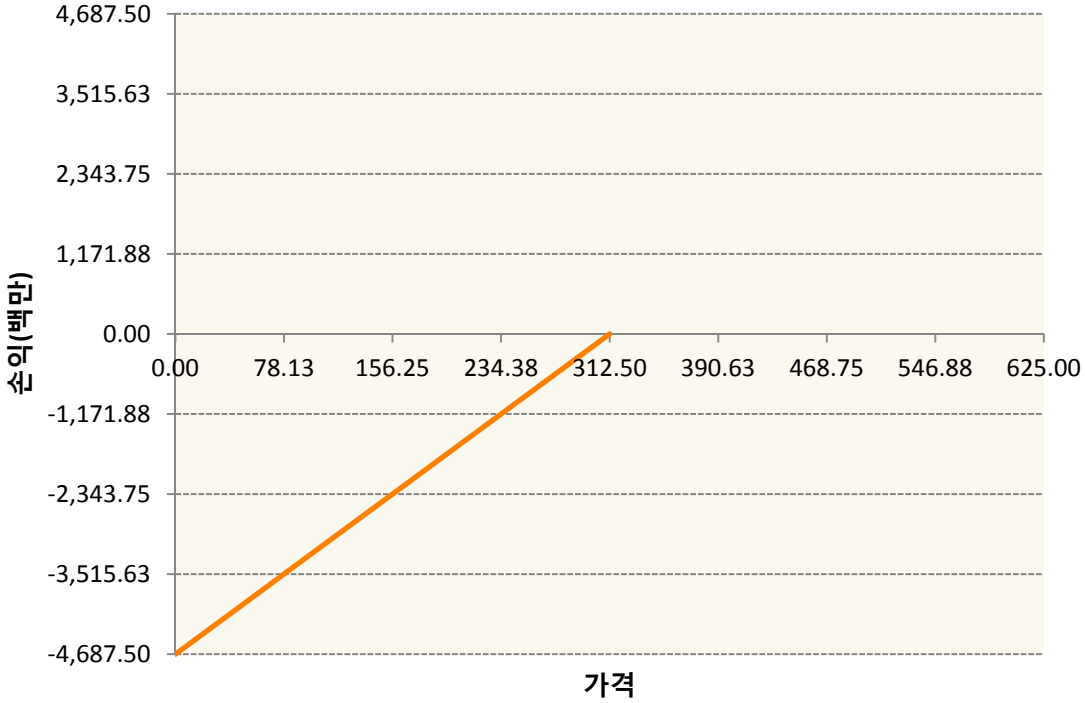
2. 만기시점의 손익구조



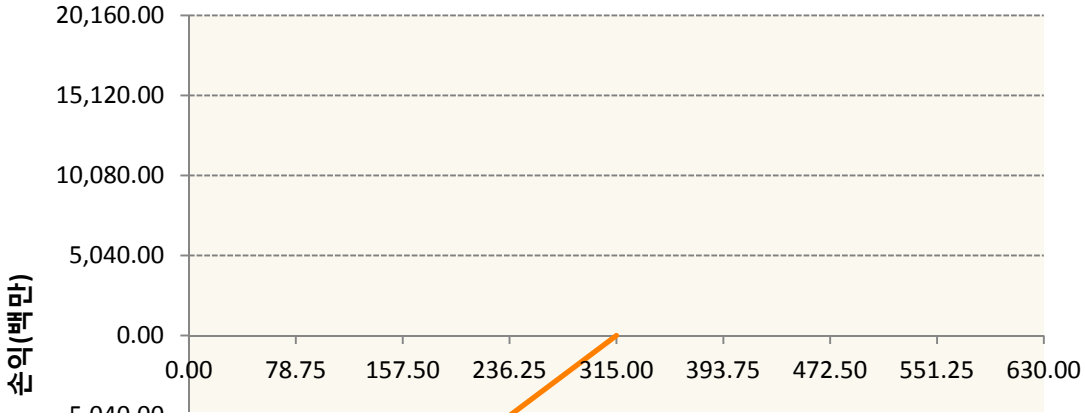




KR4301N43126-2018-04 풋312.5



KR4301N43159-2018-04 풋315





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_2							1,457
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,457	-1,457	-1,457	-1,457	-1,457	-1,457	-1,457
-5.33%	-971	-971	-971	-971	-971	-971	-971
-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%	971	971	971	971	971	971	971
8.00%	1,457	1,457	1,457	1,457	1,457	1,457	1,457
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						630
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-630	-630	-630	-630	-630	-630	-630
-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%	630	630	630	630	630	630	630
	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						850
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-850	-850	-850	-850	-850	-850	-850
-5.33%	-567	-567	-567	-567	-567	-567	-567
-2.67%	-283	-283	-283	-283	-283	-283	-283
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	283	283	283	283	283	283	283
5.33%	567	567	567	567	567	567	567
8.00%	850	850	850	850	850	850	850
	KR4201N431 2018-04 콜315						1,913
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	730	716	698	677	651	623	591
-5.33%	671	639	603	564	522	478	432
-2.67%	511	458	404	348	292	235	177
0%	188	125	63	0	-63	-125	-188
2.67%	-321	-375	-432	-489	-548	-607	-666
5.33%	-983	-1,019	-1,059	-1,103	-1,149	-1,197	-1,248
8.00%	-1,739	-1,758	-1,781	-1,809	-1,840	-1,875	-1,913
	KR4301N431 2018-04 풋312.5						286
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-278	-279	-280	-281	-282	-284	-286
-5.33%	-157	-159	-162	-165	-169	-173	-178
-2.67%	-51	-57	-63	-69	-75	-81	-87
0%	20	13	7	0	-7	-13	-20
2.67%	52	48	44	39	34	28	23
5.33%	62	60	58	56	53	50	46
8.00%	63	63	62	62	60	59	57
	KR4301N431 2018-04 풋315						1,296

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,271	-1,272	-1,274	-1,278	-1,283	-1,289	-1,296
-5.33%	-744	-751	-761	-772	-785	-800	-815
-2.67%	-266	-286	-308	-331	-354	-378	-403
0%	86	57	29	0	-29	-57	-86
2.67%	269	248	225	201	177	152	126
5.33%	331	322	311	298	283	266	248
8.00%	344	342	339	333	327	318	308

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

8,436

공시일	2018-03-27
기준일	2018-03-26

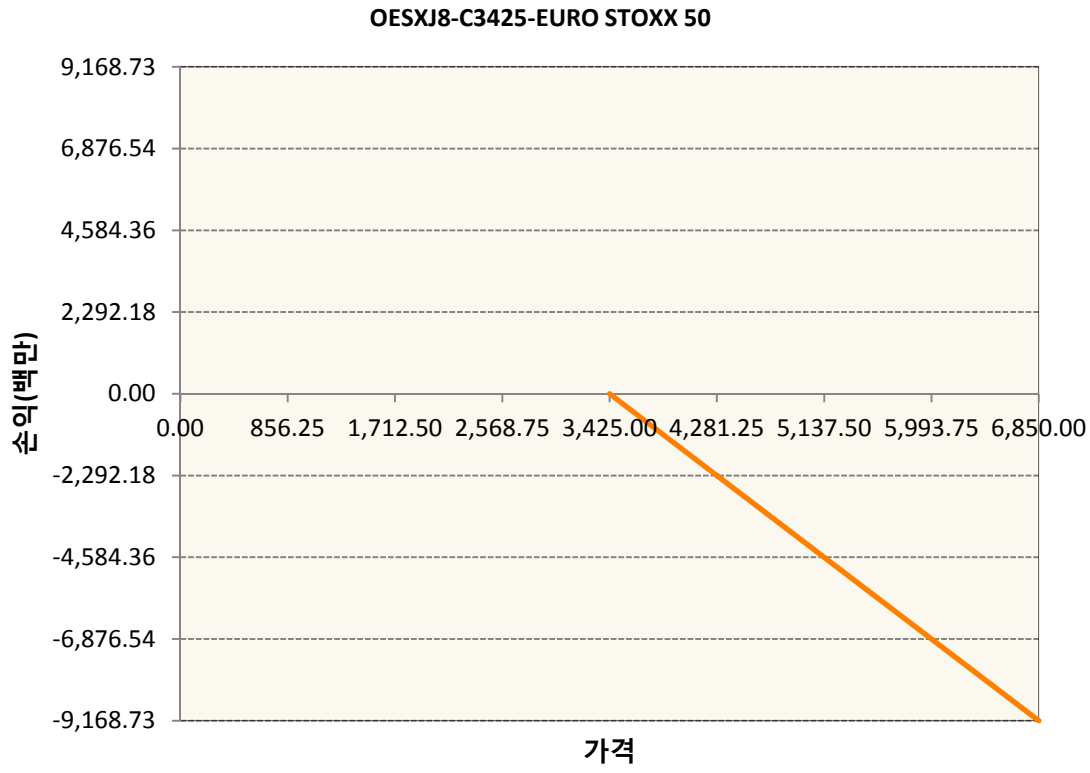
유로커버드콜모(주식혼합-파생형

1. 계약금액

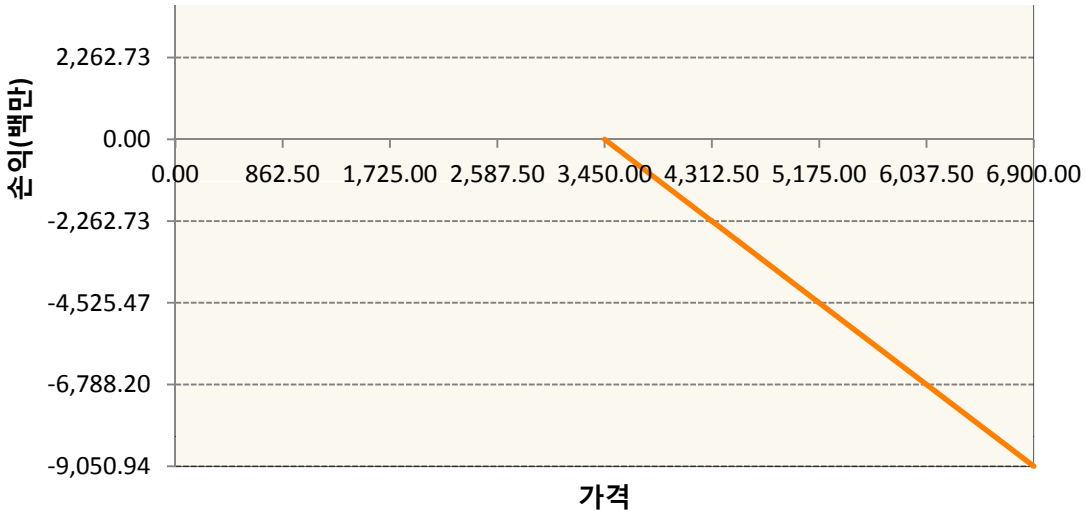
(단위:백만원)

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	8,953	0	8,953	
누계	유가증권	스왑	100,384	0	100,384	장외
누계	유가증권	옵션	0	36,439	-36,439	장내
누계	지수	스왑	53,539	0	53,539	장외

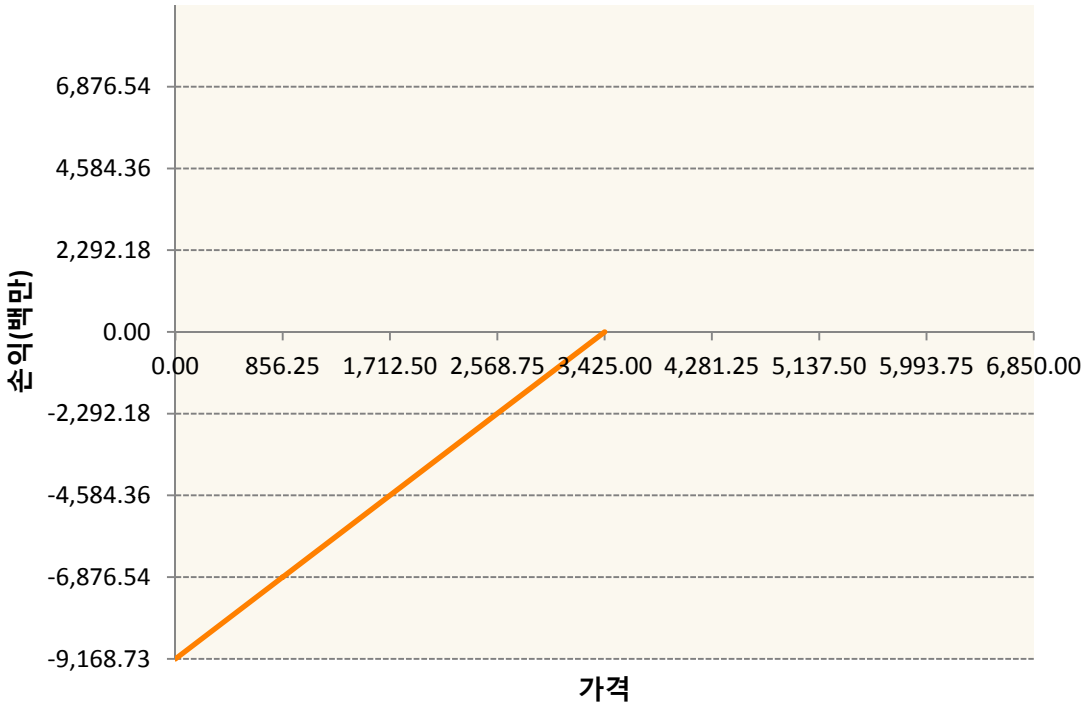
2. 만기시점의 손익구조



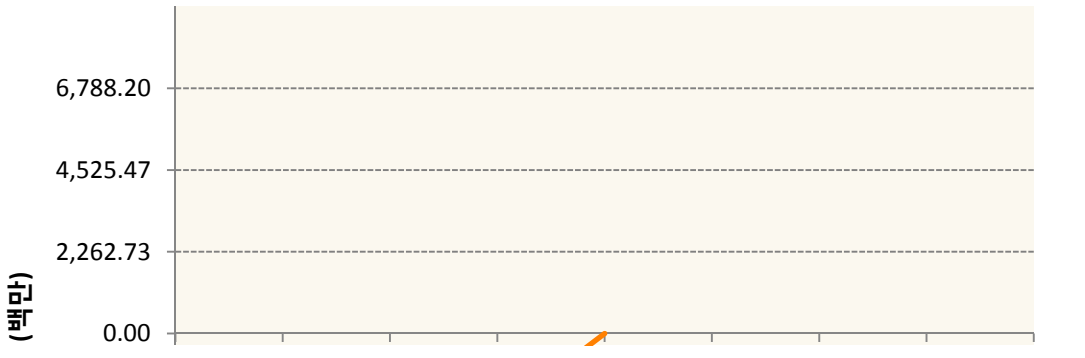


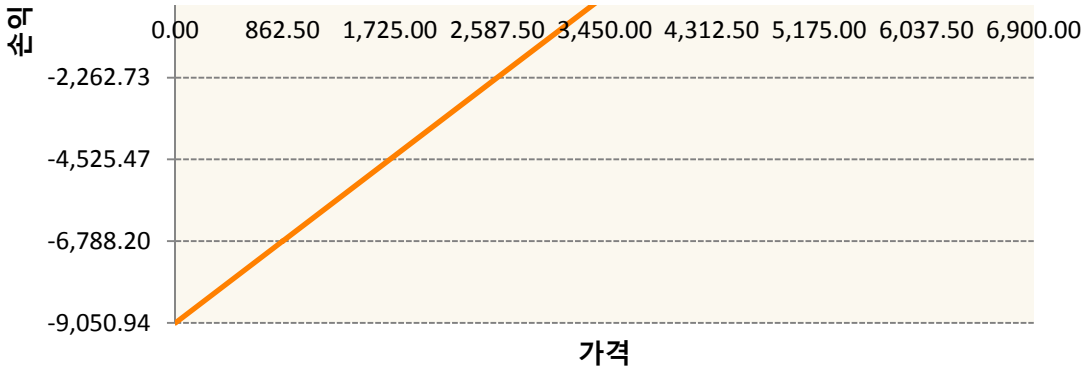


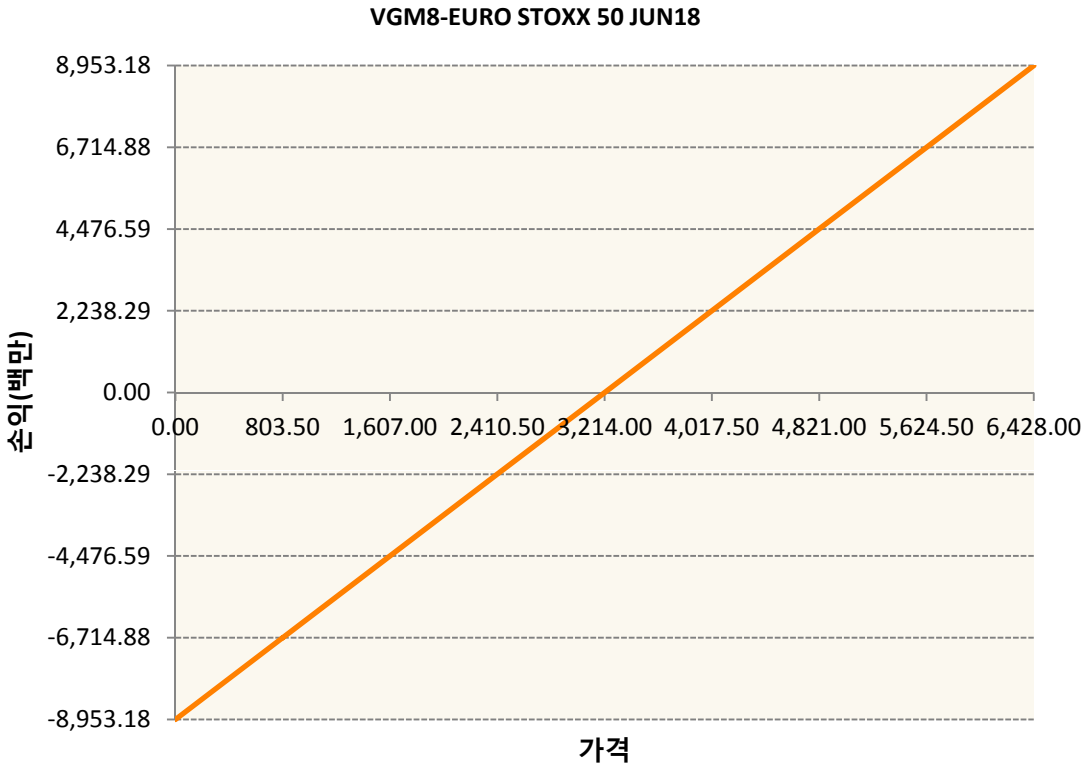
OESXJ8-P3425-EURO STOXX 50



OESXJ8-P3450-EURO STOXX 50







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
260105SGPX	SG EURO Covered CALL STRATEGY - 994.569	281
260105SQPX	SG EURO Covered CALL STRATEGY	528
OESXJ8-C34	EURO STOXX 50	733
OESXJ8-C34	EURO STOXX 50	724
OESXJ8-P34	EURO STOXX 50	733
OESXJ8-P34	EURO STOXX 50	724
VGM8	EURO STOXX 50 JUN18	716

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

2,787

공시일	2018-03-27
기준일	2018-03-26

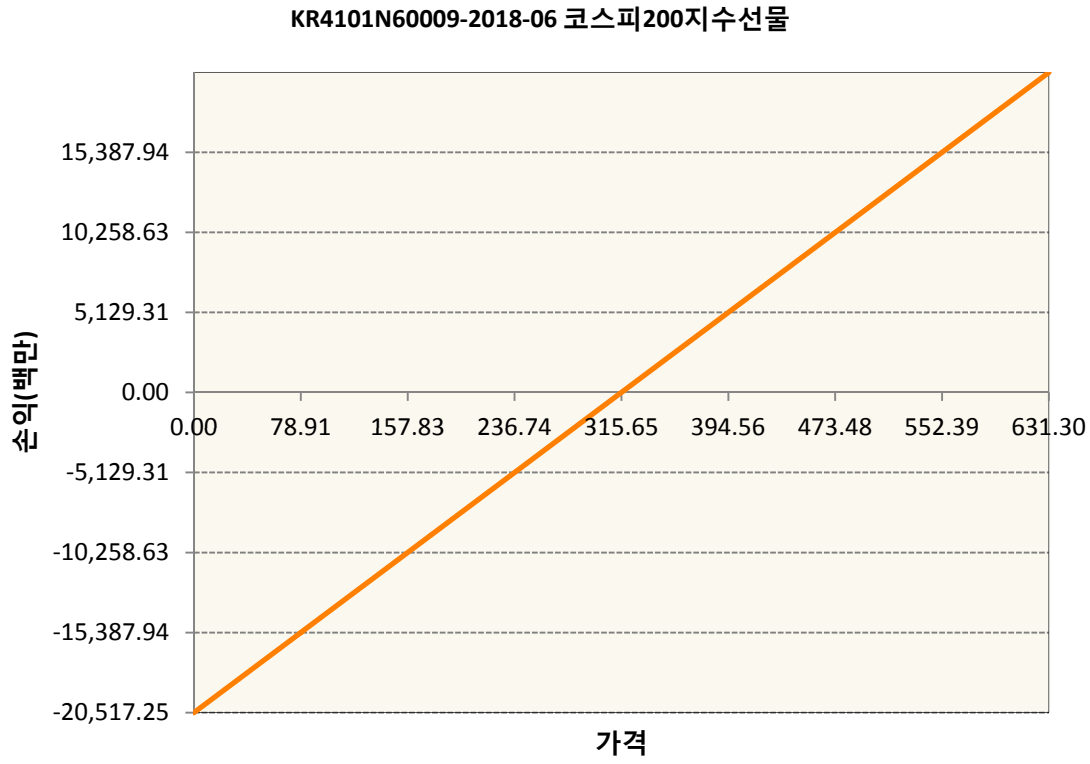
ETF스마트레버리지목표전환형8호

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	20,517	0	20,517	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101N60(2018-06 코스피200지수선물							1,637
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,637	-1,637	-1,637	-1,637	-1,637	-1,637	-1,637
-5.33%	-1,092	-1,092	-1,092	-1,092	-1,092	-1,092	-1,092
-2.67%	-546	-546	-546	-546	-546	-546	-546
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	546	546	546	546	546	546	546
5.33%	1,092	1,092	1,092	1,092	1,092	1,092	1,092
8.00%	1,637	1,637	1,637	1,637	1,637	1,637	1,637

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

1,176

공시일	2018-03-27
기준일	2018-03-26

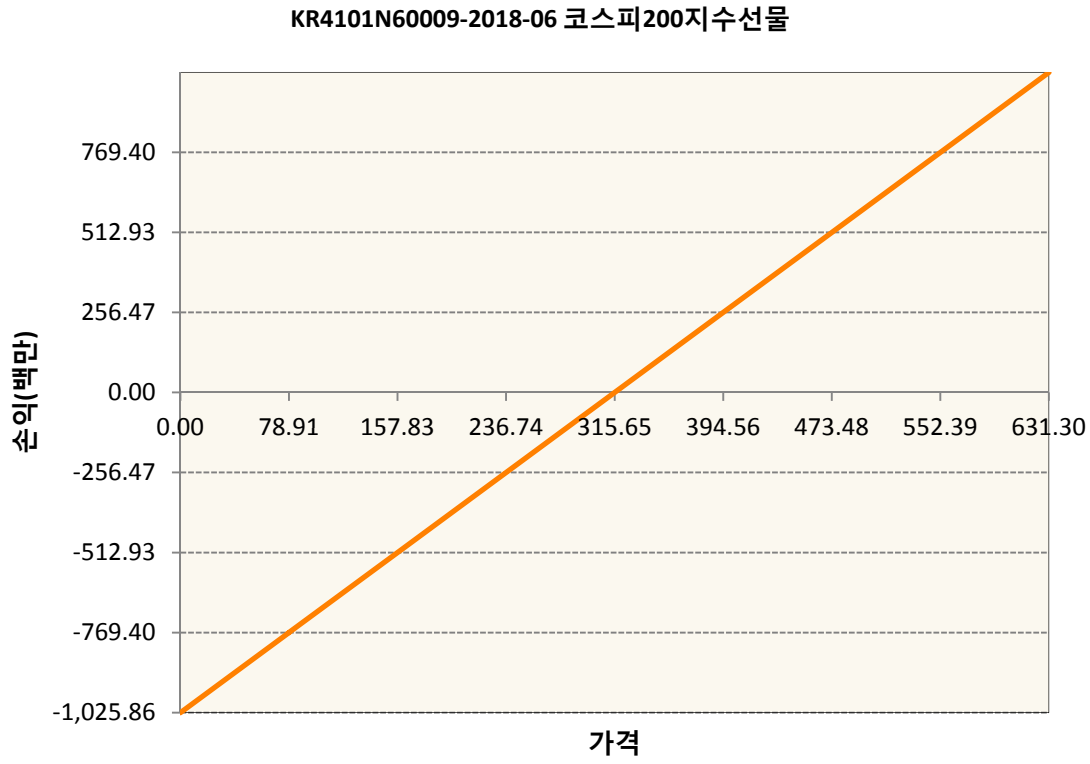
ETF스마트레버리지목표전환형9호

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	1,026	0	1,026	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101N60(2018-06 코스피200지수선물							82
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-82	-82	-82	-82	-82	-82	-82
-5.33%	-55	-55	-55	-55	-55	-55	-55
-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%	55	55	55	55	55	55	55
8.00%	82	82	82	82	82	82	82

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

59

공시일	2018-03-27
기준일	2018-03-26

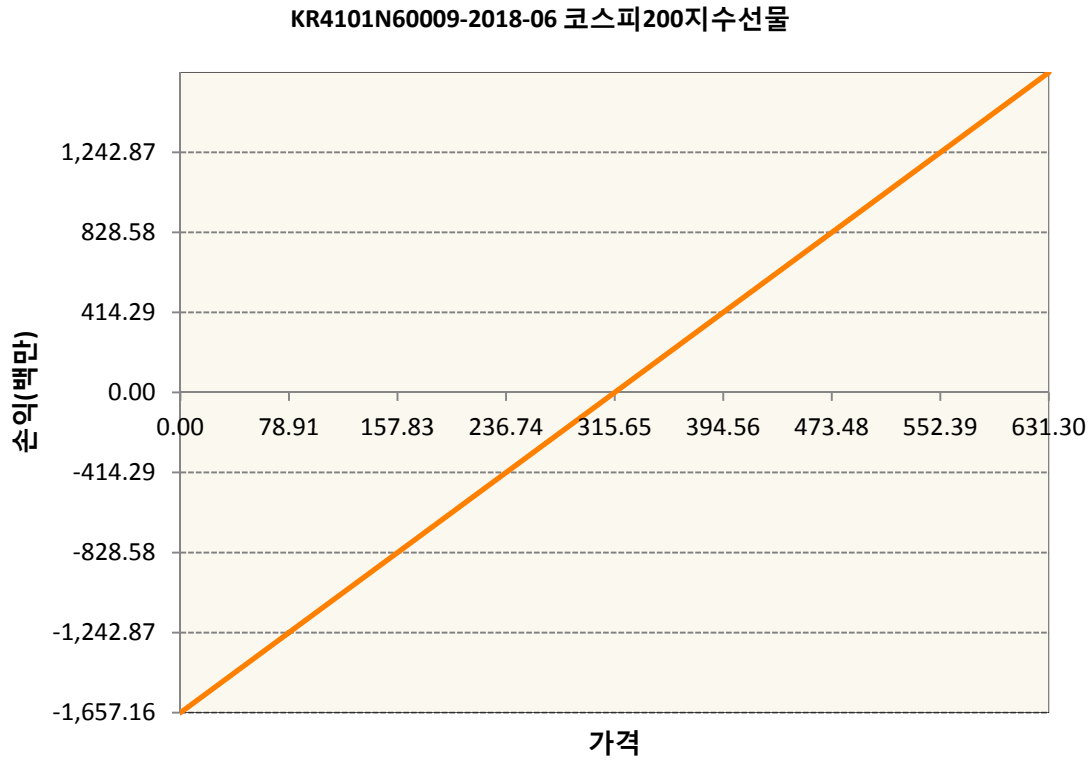
ETF스마트레버리지목표전환형10

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	1,657	0	1,657	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101N60(2018-06 코스피200지수선물							132
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-132	-132	-132	-132	-132	-132	-132
-5.33%	-88	-88	-88	-88	-88	-88	-88
-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%	88	88	88	88	88	88	88
8.00%	132	132	132	132	132	132	132

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

95

공시일	2018-03-27
기준일	2018-03-26

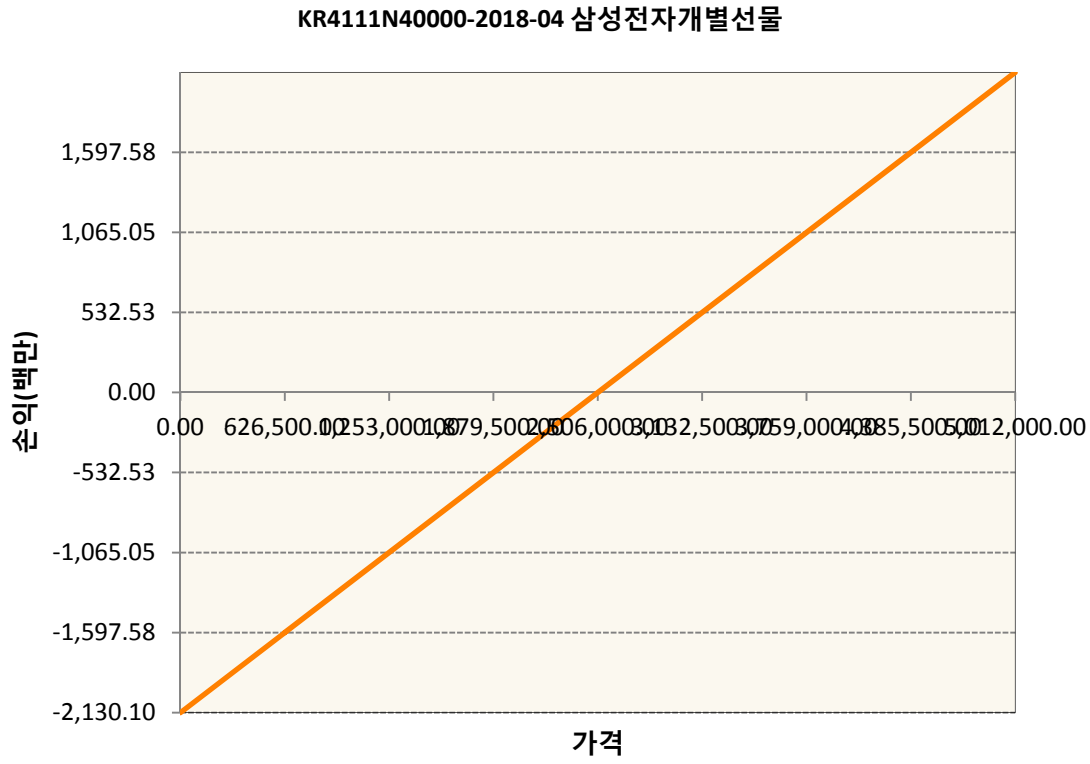
스마트KRX300인덱스1호(주식-파

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	2,130	0	2,130	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4111N40(2018-04 삼성전자개별선물							171
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-171	-171	-171	-171	-171	-171	-171
-5.33%	-114	-114	-114	-114	-114	-114	-114
-2.67%	-57	-57	-57	-57	-57	-57	-57
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	57	57	57	57	57	57	57
5.33%	114	114	114	114	114	114	114
8.00%	171	171	171	171	171	171	171

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

206

공시일	2018-03-27
기준일	2018-03-26

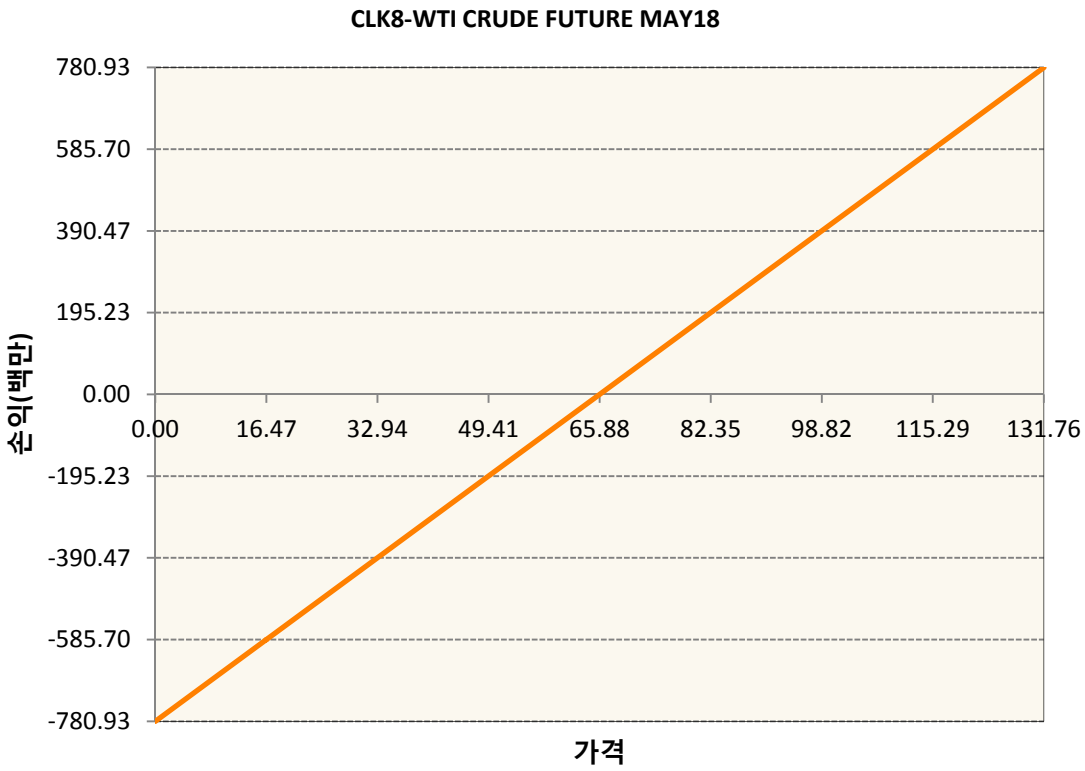
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

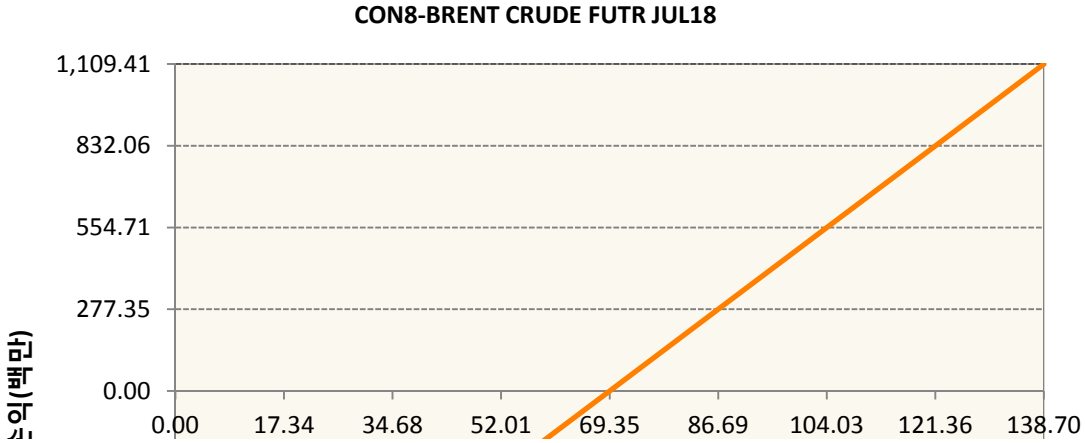
1. 계약금액

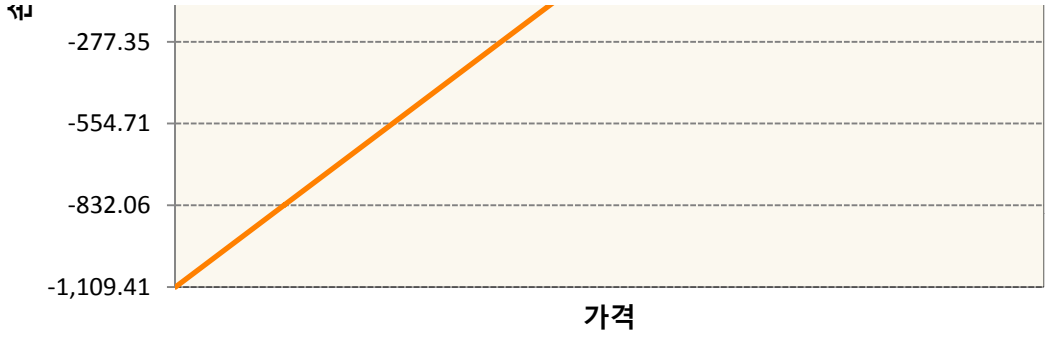
(단위:백만원)

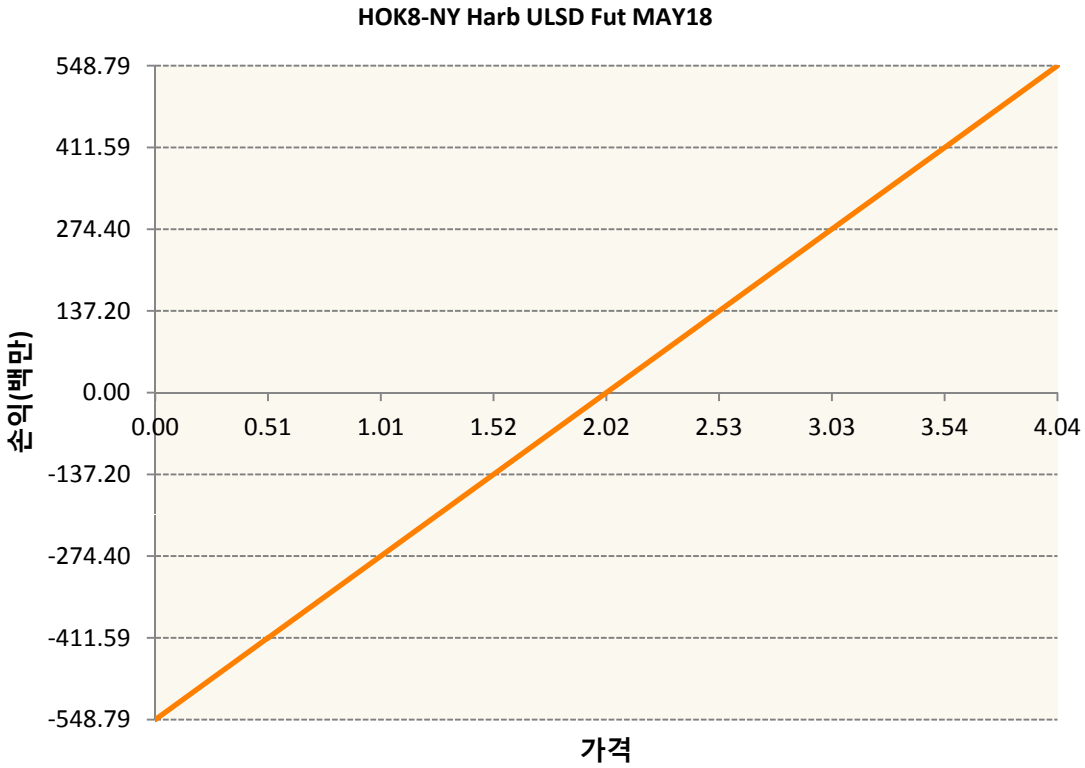
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	선물	유가증권	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	선물	유가증권	781	0	781	
누계	유가증권	선물	3,326	593	2,733	

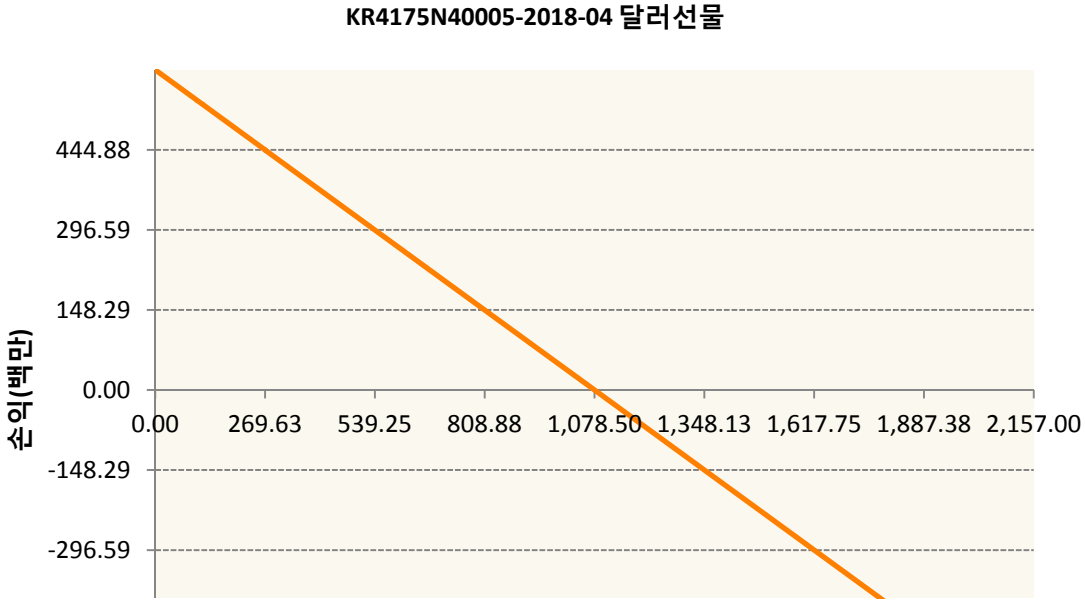
2. 만기시점의 손익구조

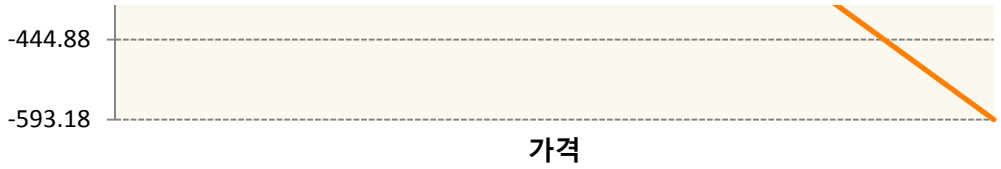


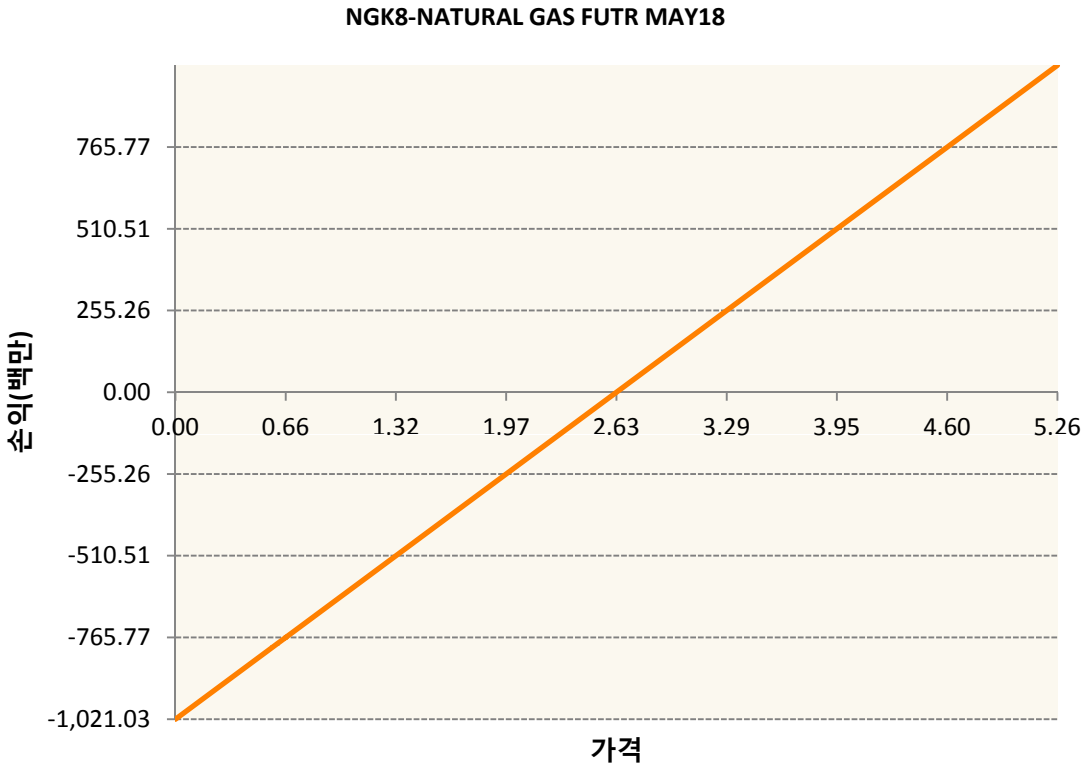


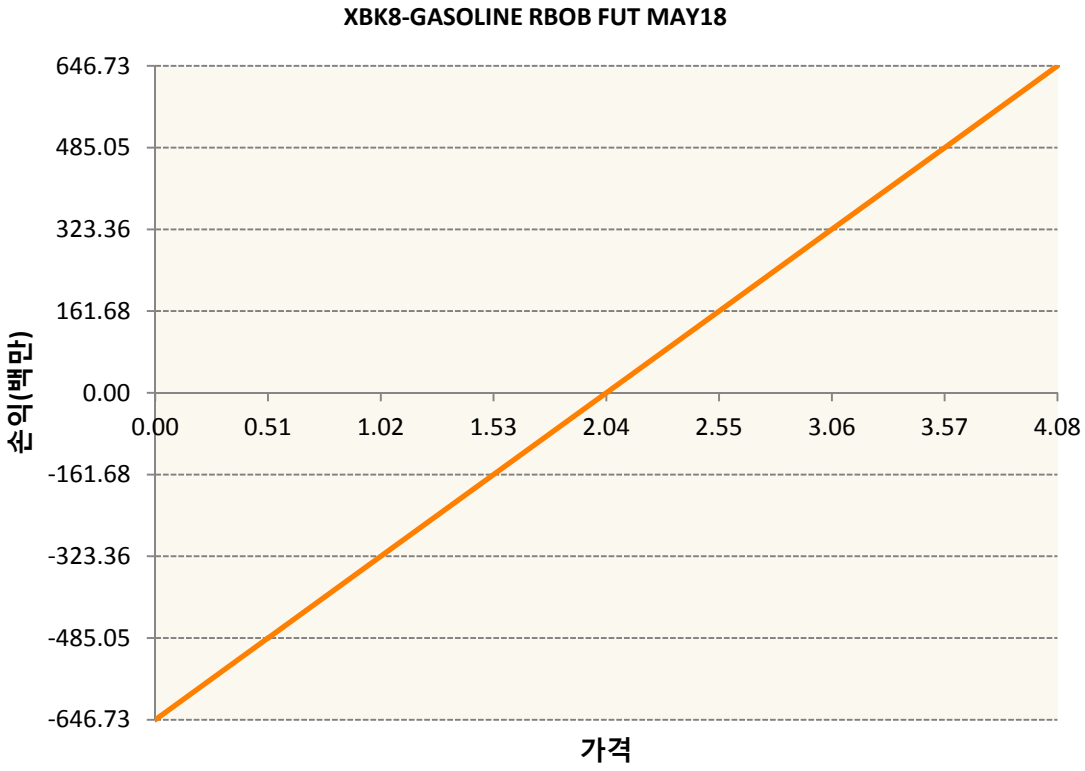

-277.35
-554.71
-832.06
-1,109.41
가격


HOK8-NY Harb ULSD Fut MAY18
548.79
411.59
274.40
137.20
0.00
-137.20
-274.40
-411.59
-548.79
0.00
0.51
1.01
1.52
2.02
2.53
3.03
3.54
4.04
손익(백만)
가격


KR4175N40005-2018-04 달러선물
444.88
296.59
148.29
0.00
-148.29
-296.59
0.00
269.63
539.25
808.88
1,078.50
1,348.13
1,617.75
1,887.38
2,157.00
손익(백만)


-444.88
-593.18
가격


NGK8-NATURAL GAS FUTR MAY18
765.77
510.51
255.26
0.00
-255.26
-510.51
-765.77
-1,021.03
0.00
0.66
1.32
1.97
2.63
3.29
3.95
4.60
5.26
손익(백만)
가격


XBK8-GASOLINE RBOB FUT MAY18
646.73
485.05
323.36
161.68
0.00
-161.68
-323.36
-485.05
-646.73
0.00
0.51
1.02
1.53
2.04
2.55
3.06
3.57
4.08
손익(백만)
가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLK8	WTI CRUDE FUTURE MAY18	62
CON8	BRENT CRUDE FUTR JUL18	89
HOK8	NY Harb ULSD Fut MAY18	44
KR4175N40(	2018-04 달러선물	47
NGK8	NATURAL GAS FUTR MAY18	82
XBK8	GASOLINE RBOB FUT MAY18	52

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

533

공시일	2018-03-27
기준일	2018-03-26

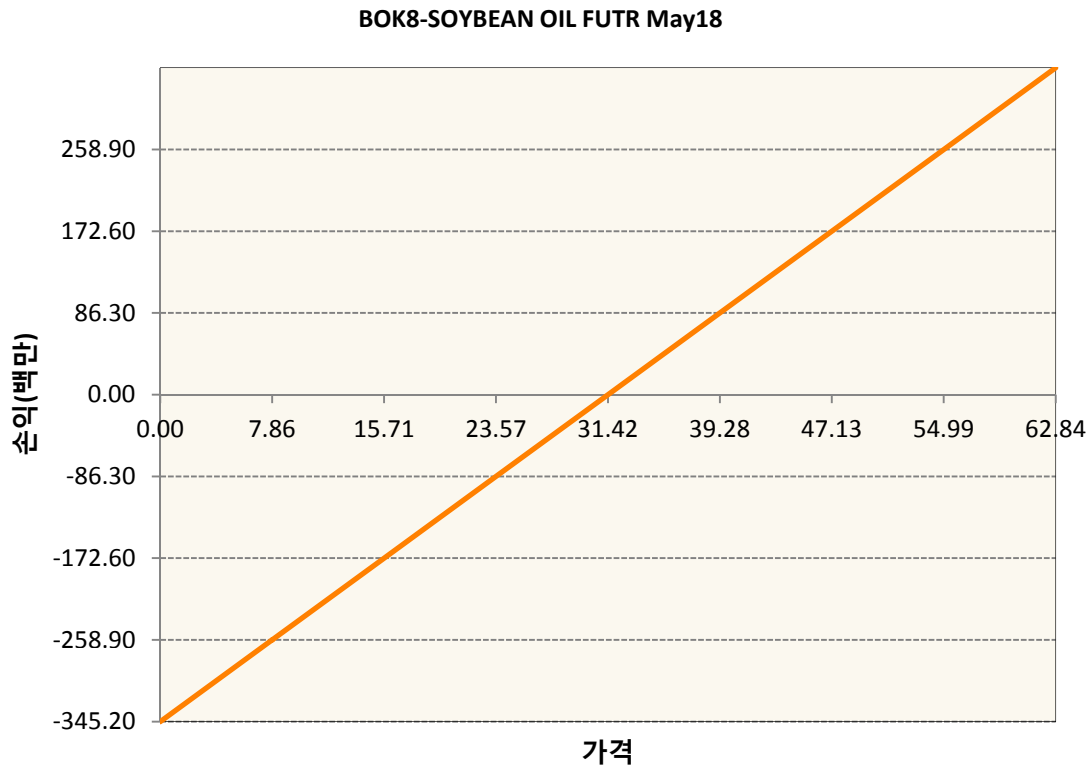
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

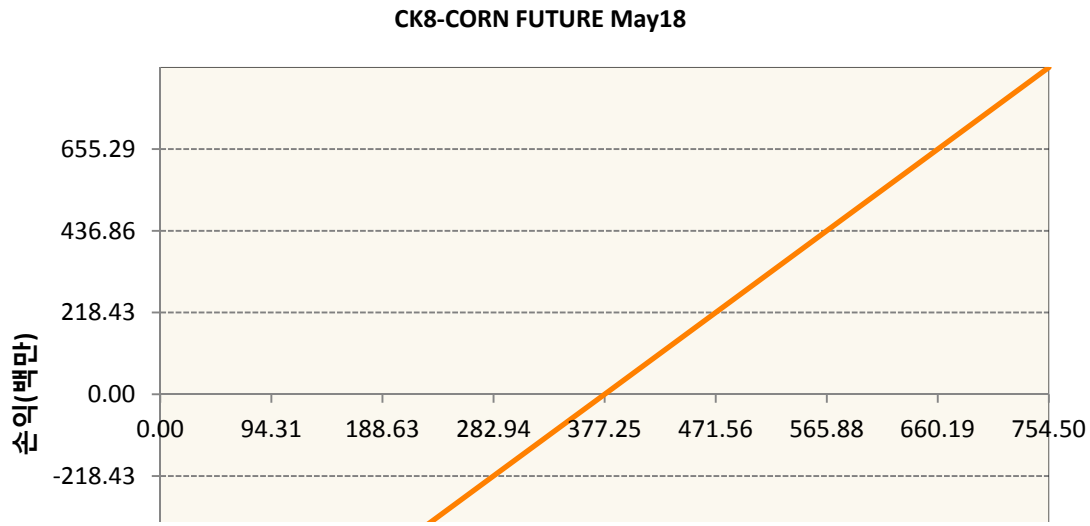
1. 계약금액

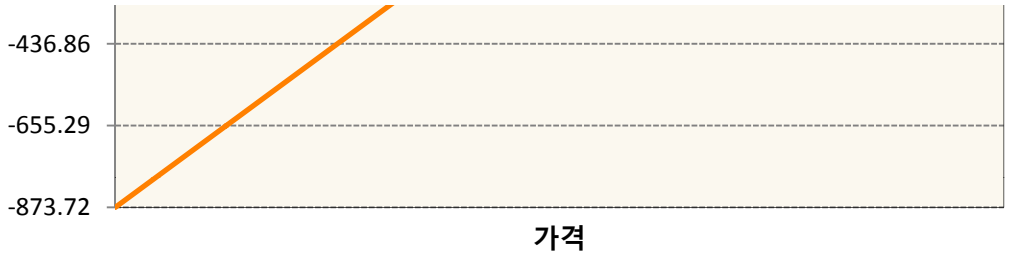
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	4,081	324	3,757	

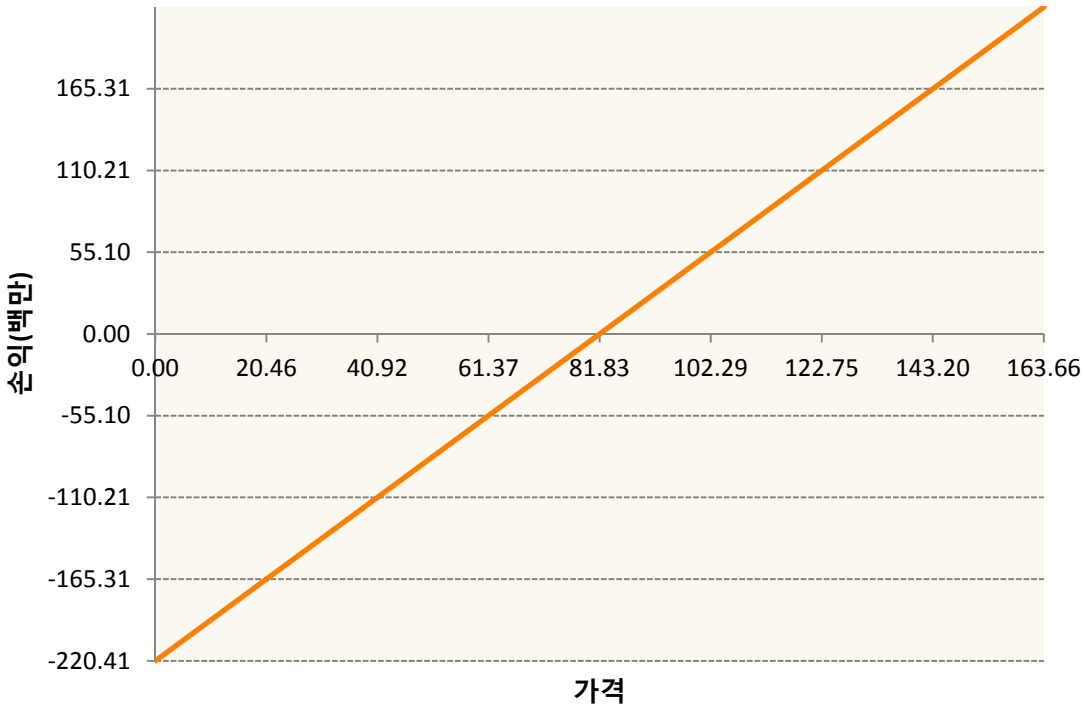
2. 만기시점의 손익구조



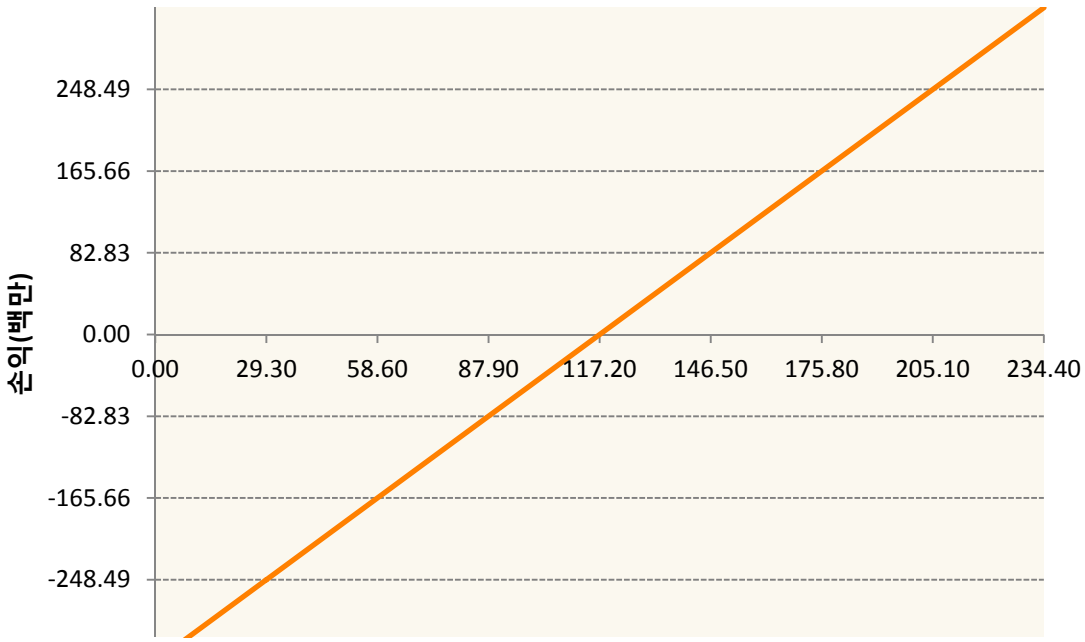


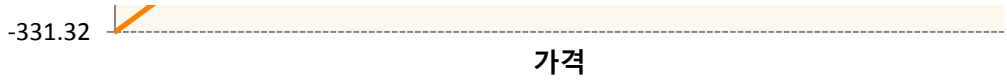


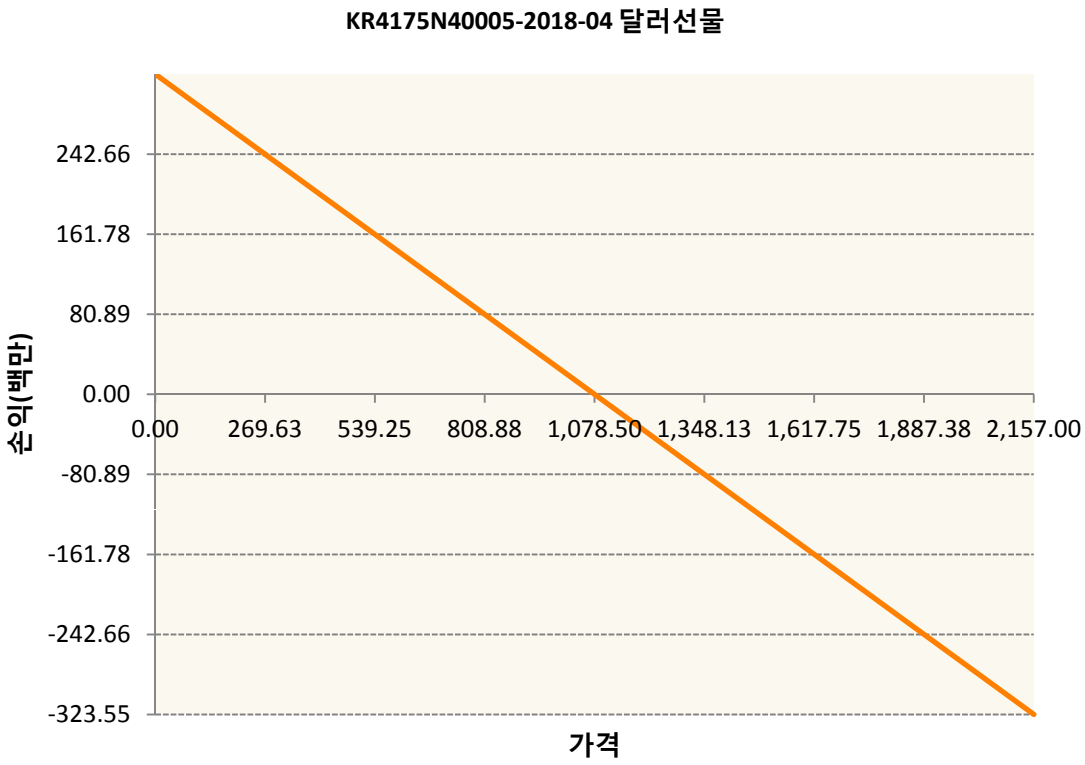
CTK8-COTTON NO.2 FUTR May18

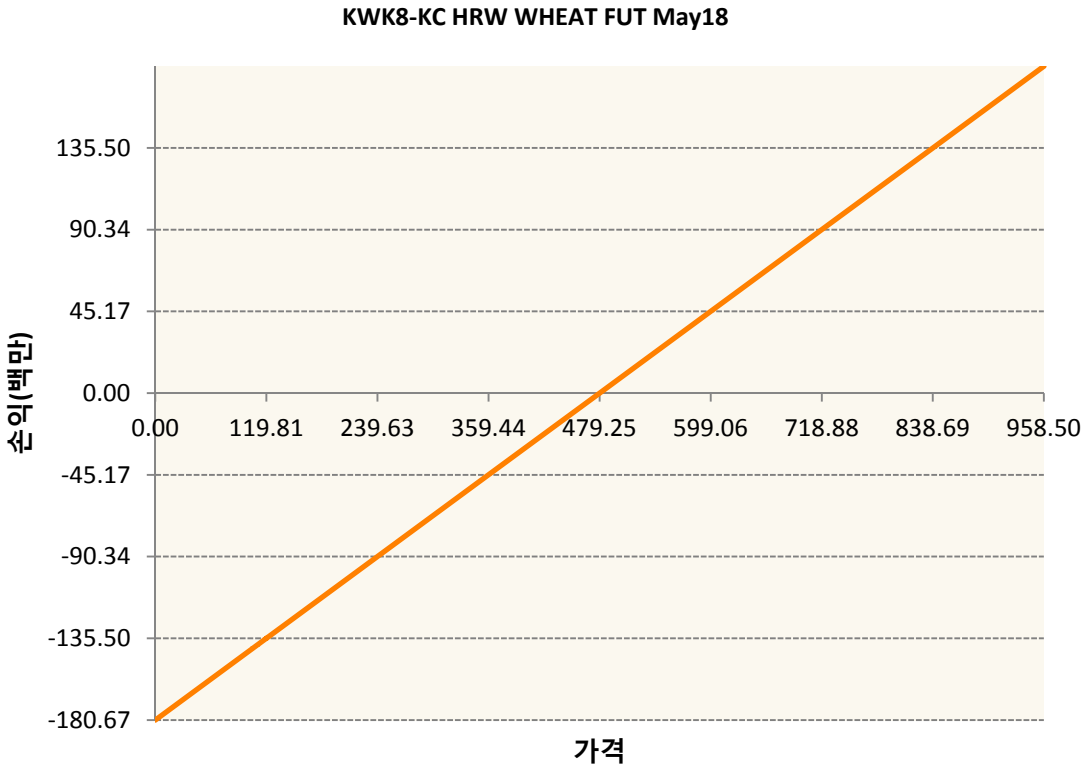


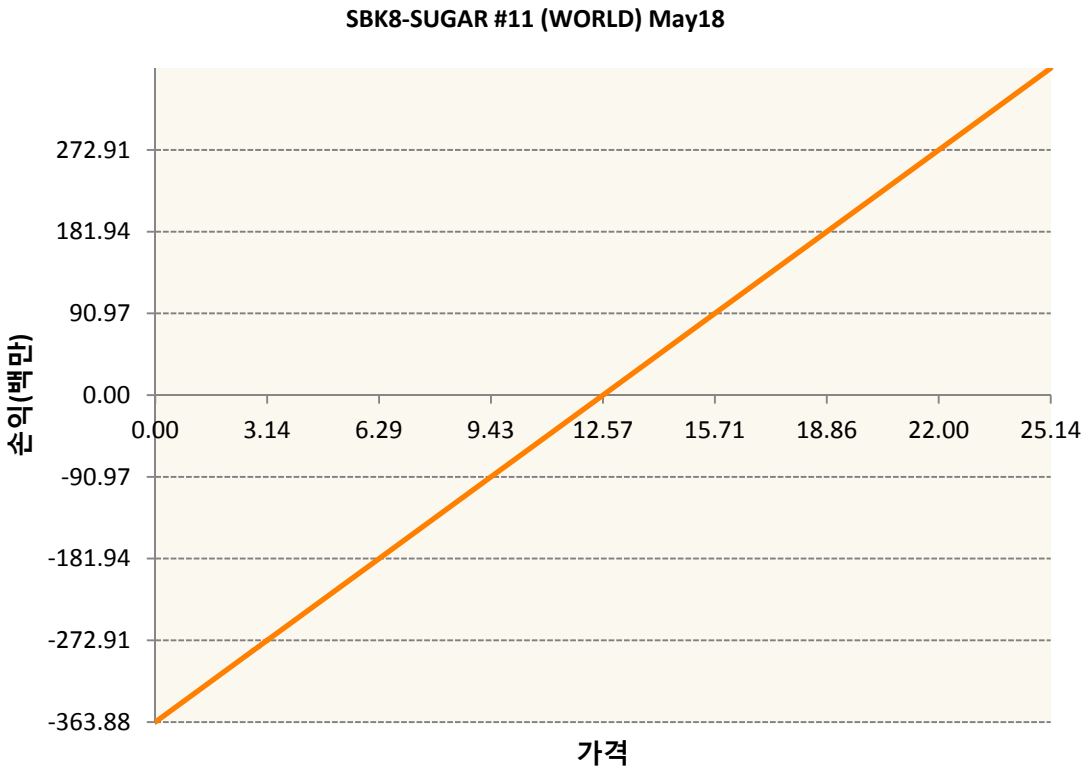
KCK8-COFFEE 'C' FUTURE May18

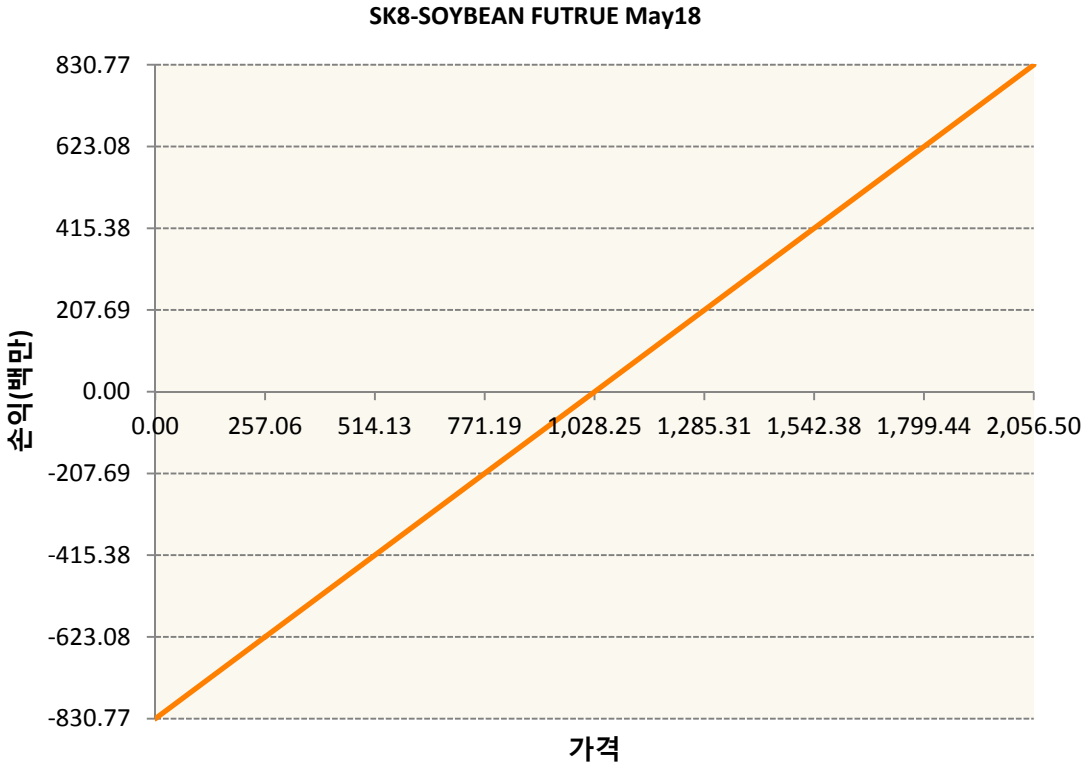



-331.32
가격

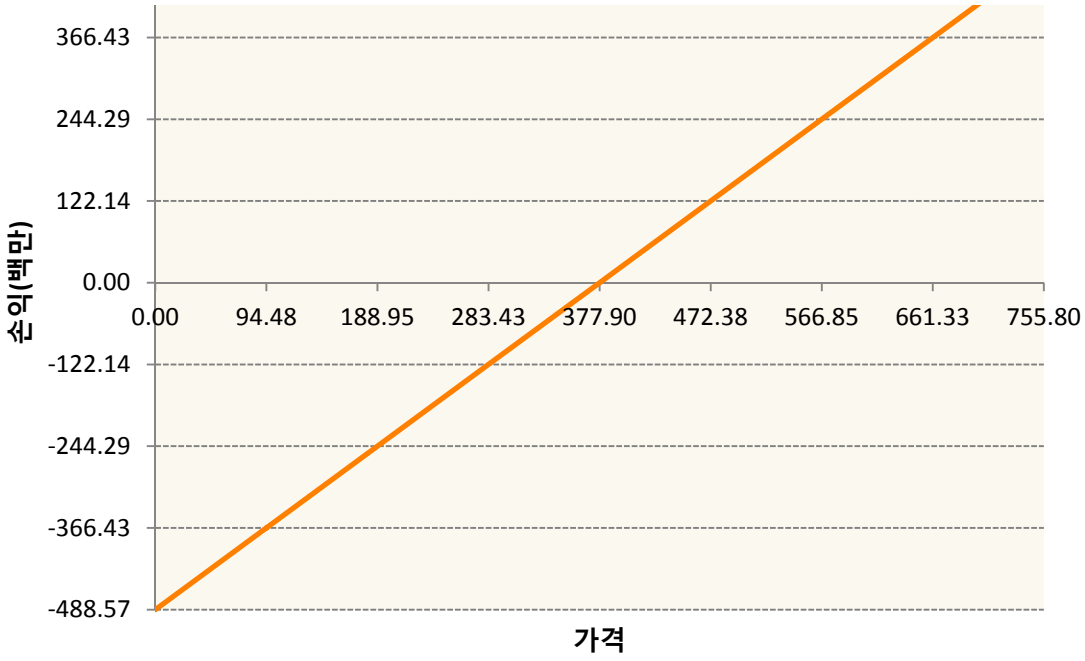

KR4175N40005-2018-04 달러선물
242.66
161.78
80.89
0.00
-80.89
-161.78
-242.66
-323.55
0.00
269.63
539.25
808.88
1,078.50
1,348.13
1,617.75
1,887.38
2,157.00
손익(백만)
가격

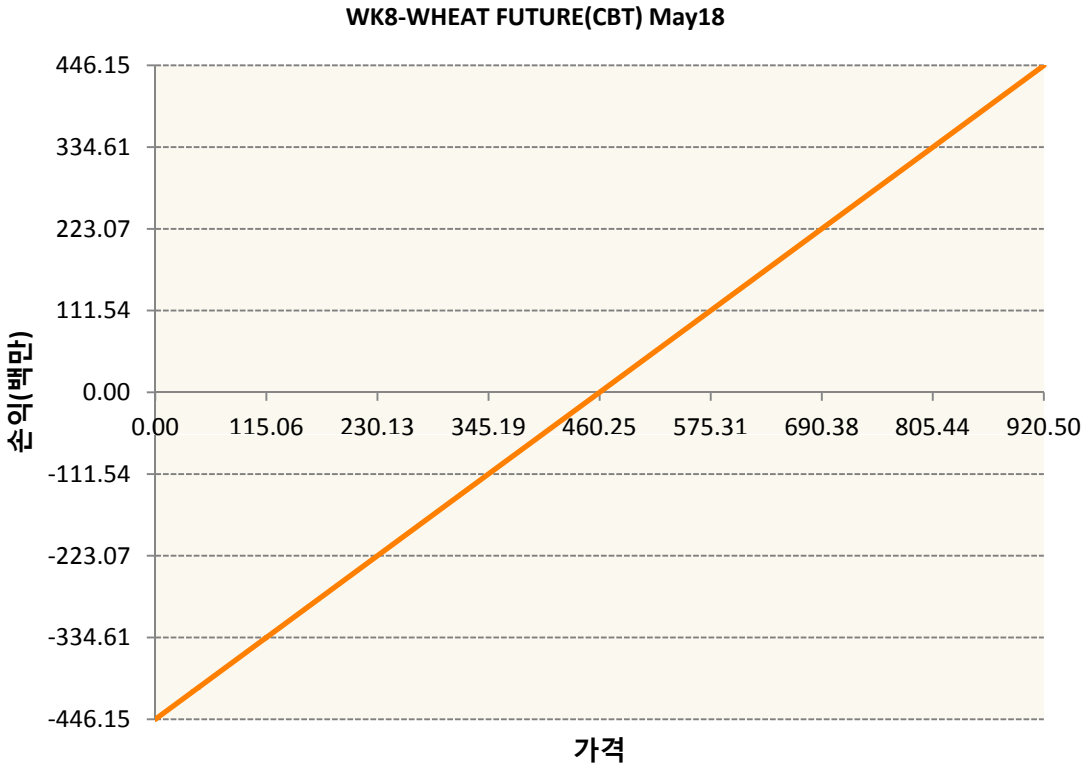

KWK8-KC HRW WHEAT FUT May18
135.50
90.34
45.17
0.00
-45.17
-90.34
-135.50
-180.67
0.00
119.81
239.63
359.44
479.25
599.06
718.88
838.69
958.50
손익(백만)
가격


SBK8-SUGAR #11 (WORLD) May18
272.91
181.94
90.97
0.00
-90.97
-181.94
-272.91
-363.88
0.00
3.14
6.29
9.43
12.57
15.71
18.86
22.00
25.14
손익(백만)
가격


SK8-SOYBEAN FUTRUE May18
830.77
623.08
415.38
207.69
0.00
-207.69
-415.38
-623.08
-830.77
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





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	29
SK8	SOYBEAN FUTRUE May18	66
SMK8	SOYBEAN MEAL FUTR May18	39
WK8	WHEAT FUTURE(CBT) May18	36

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

330