공시일	2018-03-28
기준일	2018-03-27

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	2018-03-28
기준일	2018-03-27

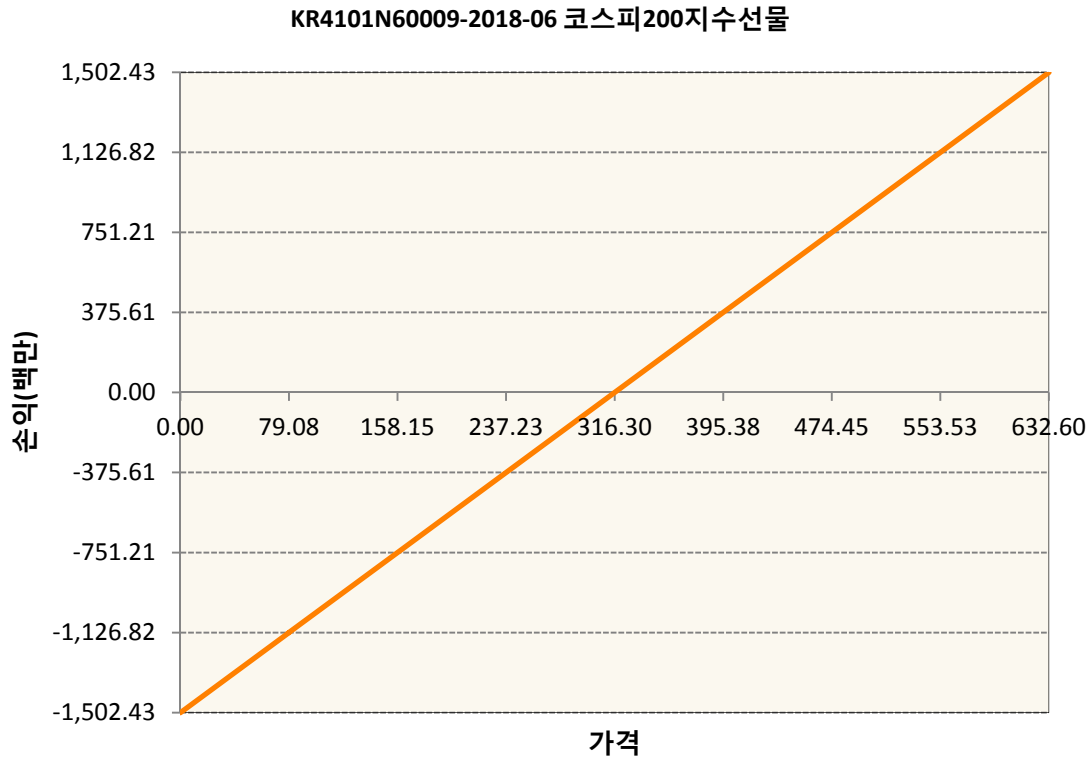
스마트인덱스모

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	1,502	0	1,502	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	2018-03-28
기준일	2018-03-27

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	1,087

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

426

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2018-03-28
기준일	2018-03-27

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	404

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

426

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2018-03-28
기준일	2018-03-27

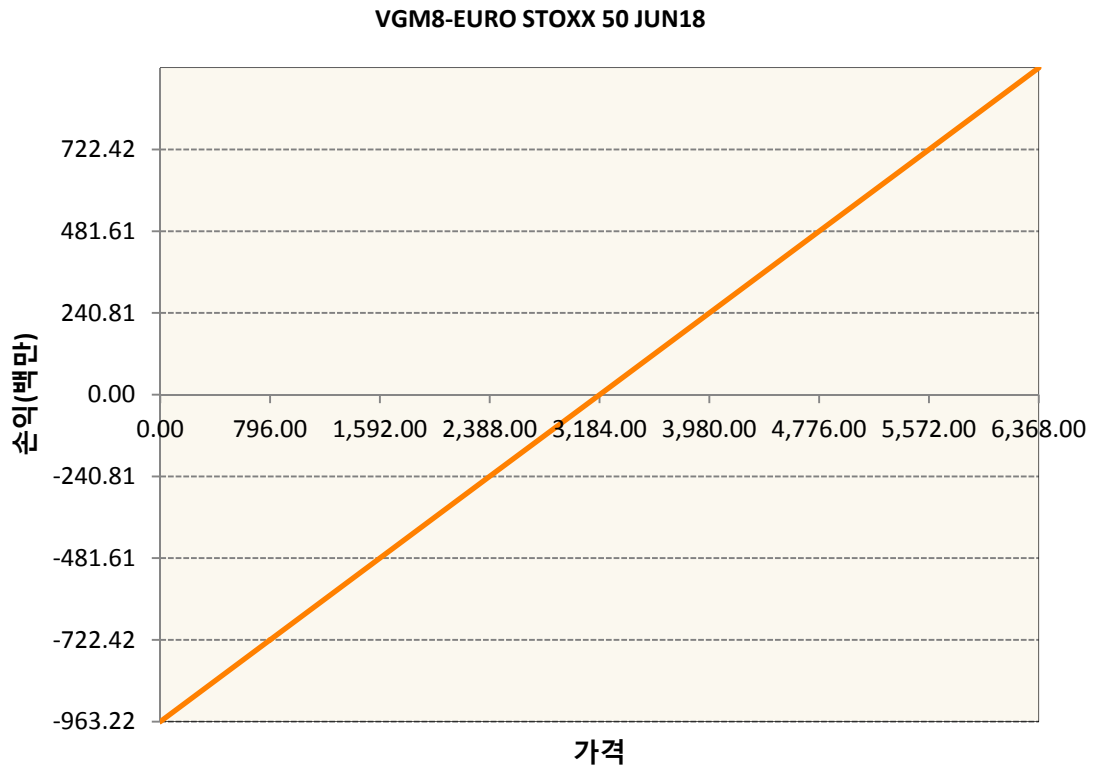
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	963	0	963	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGM8	EURO STOXX 50 JUN18	77

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

(단위:백만원)

47

공시일	2018-03-28
기준일	2018-03-27

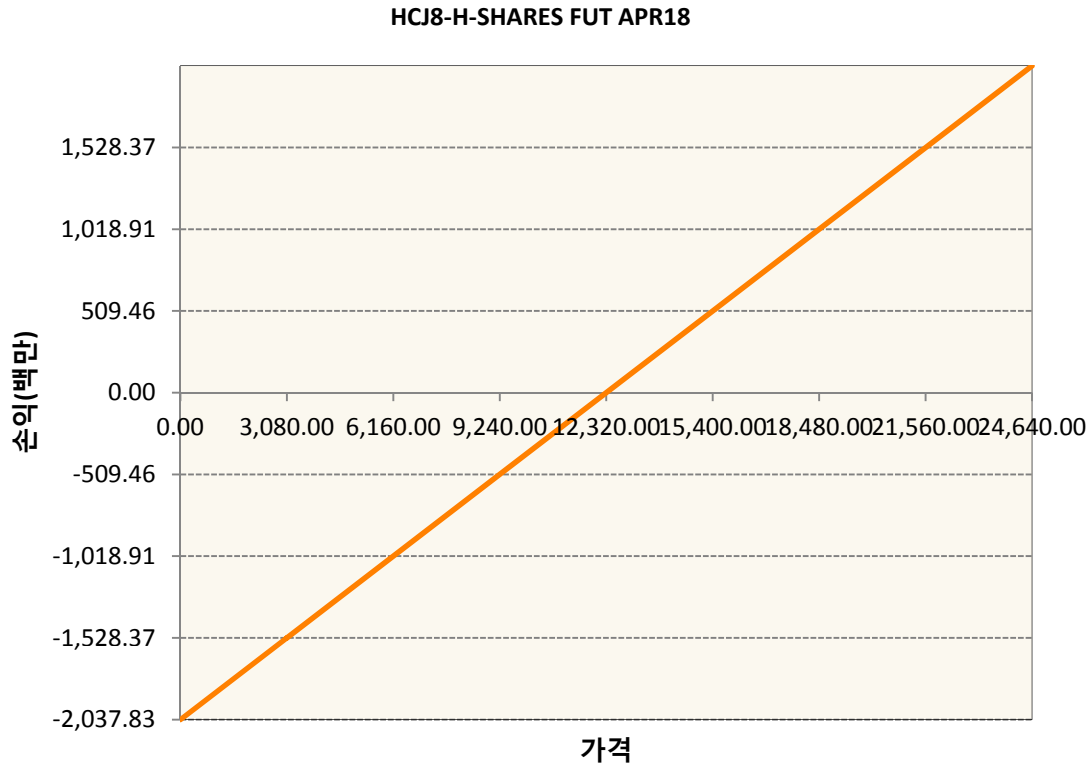
차이나인덱스모(주식-파생형)

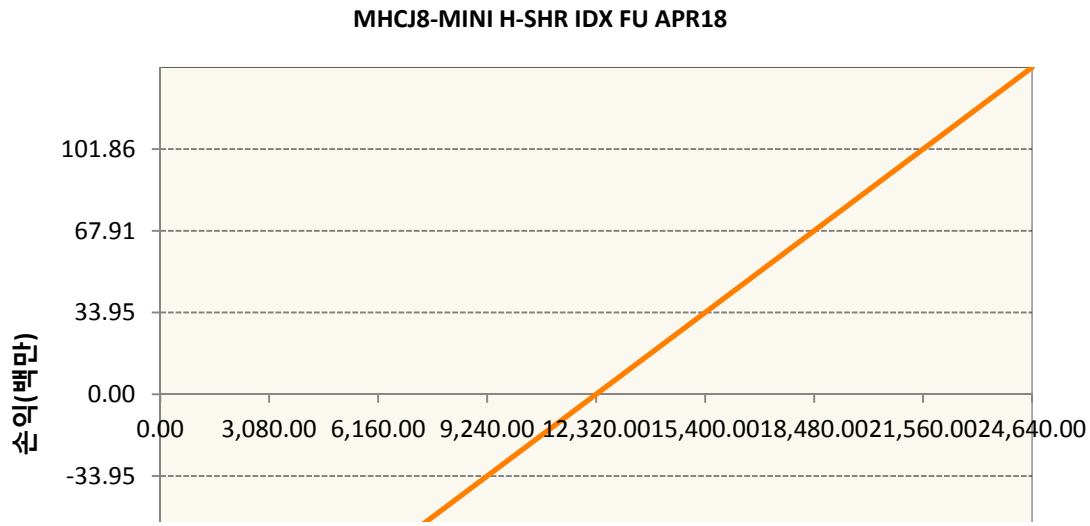
1. 계약금액

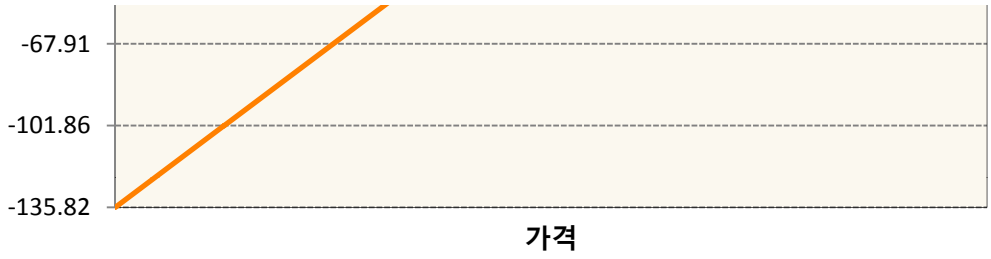
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,174	0	2,174	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCJ8	H-SHARES FUT APR18	163
MHCJ8	MINI H-SHR IDX FU APR18	11

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	152

공시일	2018-03-28
기준일	2018-03-27

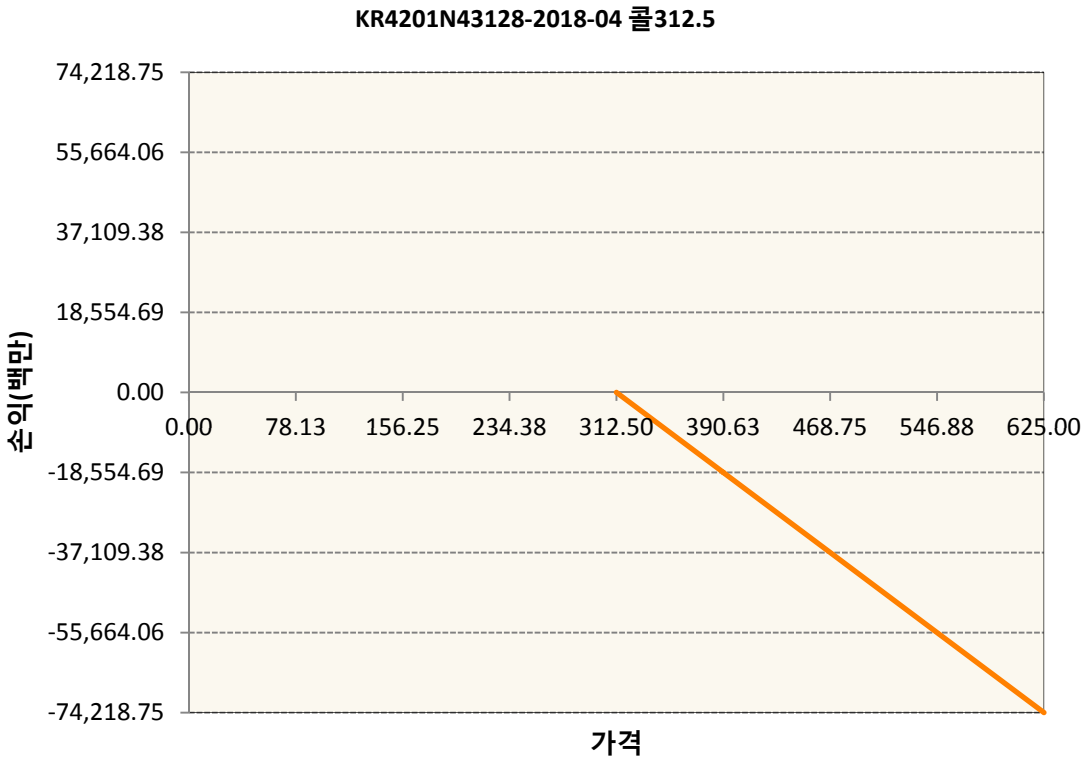
커버드콜모(주식혼합-파생형)

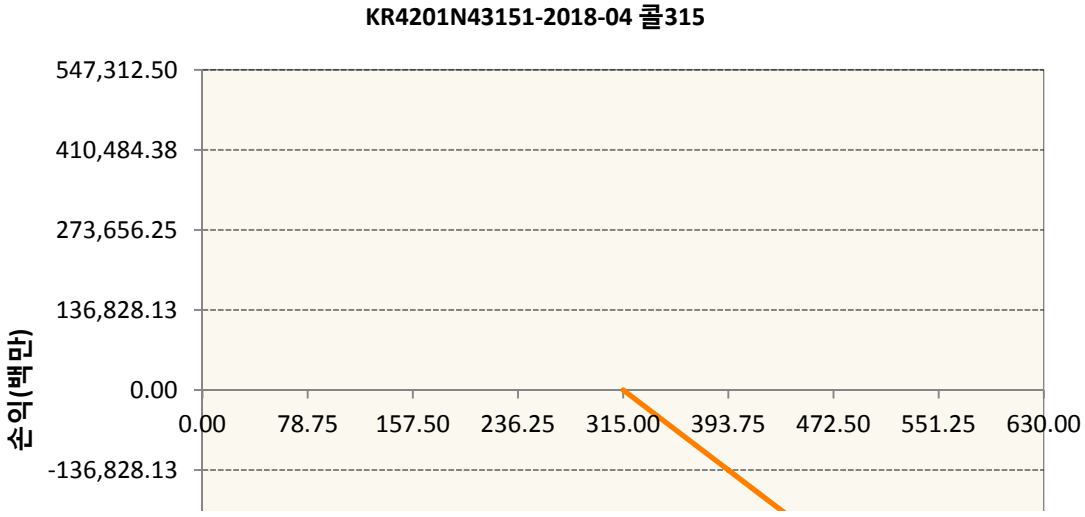
1. 계약금액

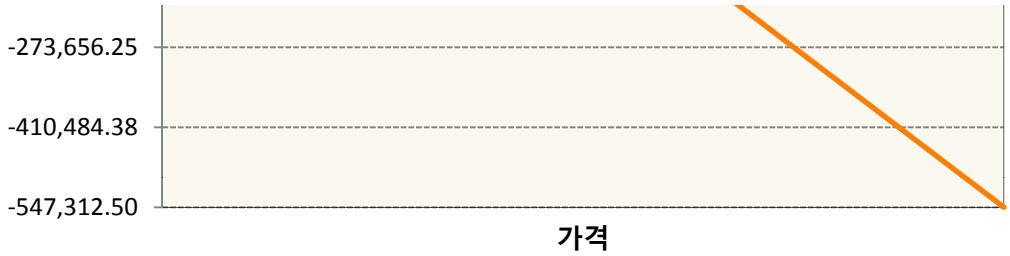
(단위:백만원)

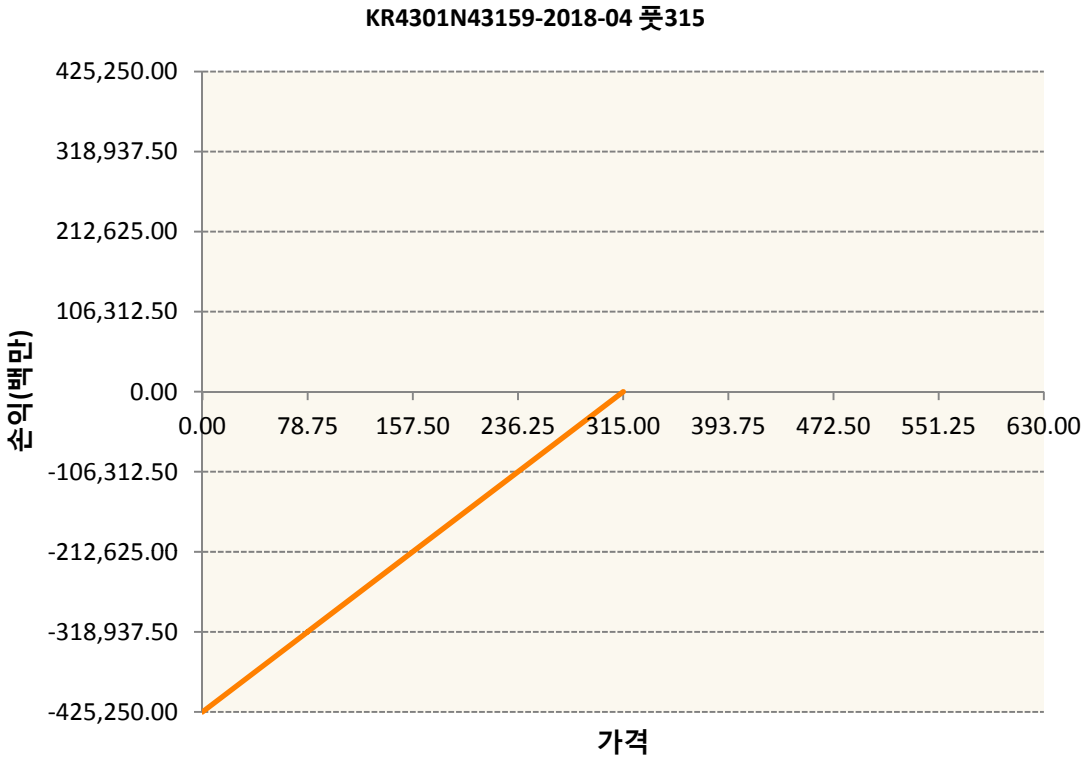
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	1,046,781	-1,046,781	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201N4312018-04 콜312.5							4,992
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	2,165	2,122	2,070	2,008	1,938	1,861	1,777
-5.33%	1,954	1,862	1,763	1,657	1,547	1,433	1,316
-2.67%	1,419	1,283	1,146	1,008	870	731	591
0%	421	282	141	0	-142	-284	-426
2.67%	-1,029	-1,132	-1,242	-1,358	-1,477	-1,601	-1,727
5.33%	-2,793	-2,850	-2,917	-2,993	-3,078	-3,170	-3,268
8.00%	-4,716	-4,739	-4,772	-4,814	-4,865	-4,924	-4,992
KR4201N4312018-04 콜315							35,102
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	13,650	13,415	13,108	12,733	12,296	11,803	11,260

-5.33%	12,535	11,967	11,334	10,646	9,915	9,146	8,346
-2.67%	9,431	8,502	7,553	6,588	5,610	4,623	3,628
0%	3,176	2,118	1,059	0	-1,060	-2,120	-3,180
2.67%	-6,512	-7,376	-8,274	-9,201	-10,148	-11,113	-12,093
5.33%	-18,842	-19,360	-19,954	-20,610	-21,320	-22,074	-22,867
8.00%	-32,642	-32,877	-33,187	-33,571	-34,022	-34,534	-35,102
KR4301N4312018-04 풋315							26,999
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-26,574	-26,594	-26,630	-26,687	-26,766	-26,870	-26,999
-5.33%	-15,389	-15,529	-15,708	-15,923	-16,170	-16,446	-16,747
-2.67%	-5,338	-5,752	-6,188	-6,639	-7,104	-7,580	-8,064
0%	1,640	1,094	548	0	-548	-1,097	-1,645
2.67%	4,780	4,440	4,067	3,668	3,249	2,811	2,360
5.33%	5,604	5,497	5,353	5,171	4,955	4,707	4,431
8.00%	5,725	5,707	5,674	5,620	5,543	5,441	5,312

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

69,270

공시일	2018-03-28
기준일	2018-03-27

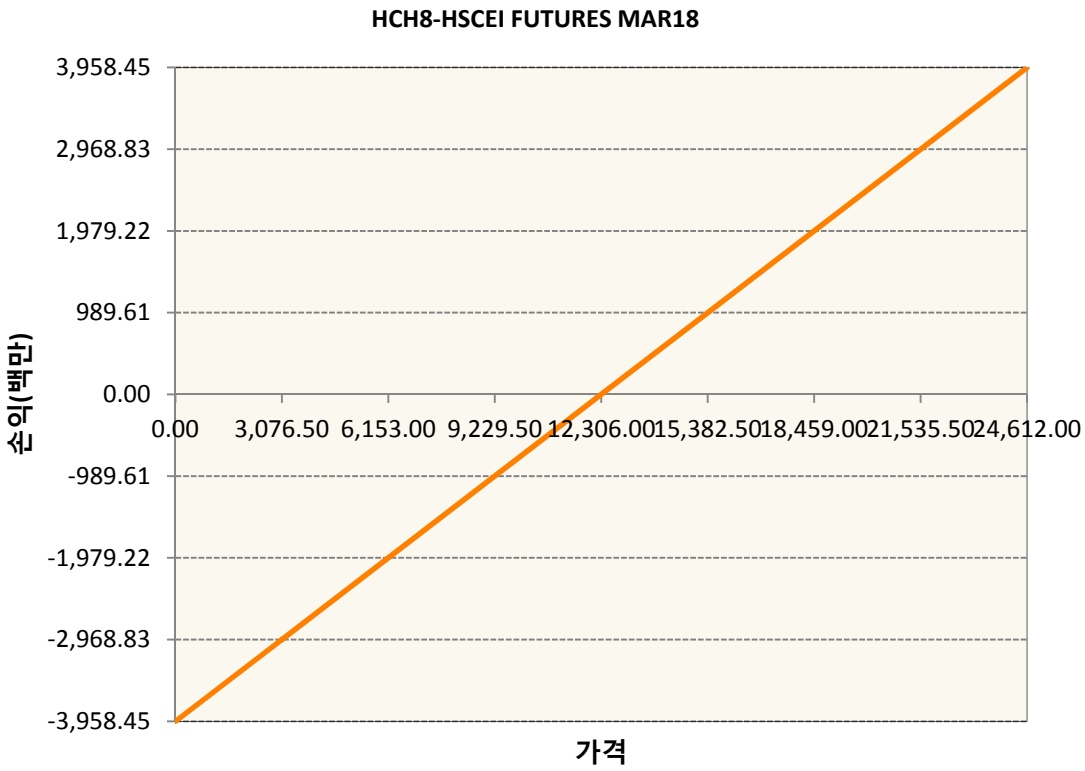
홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생

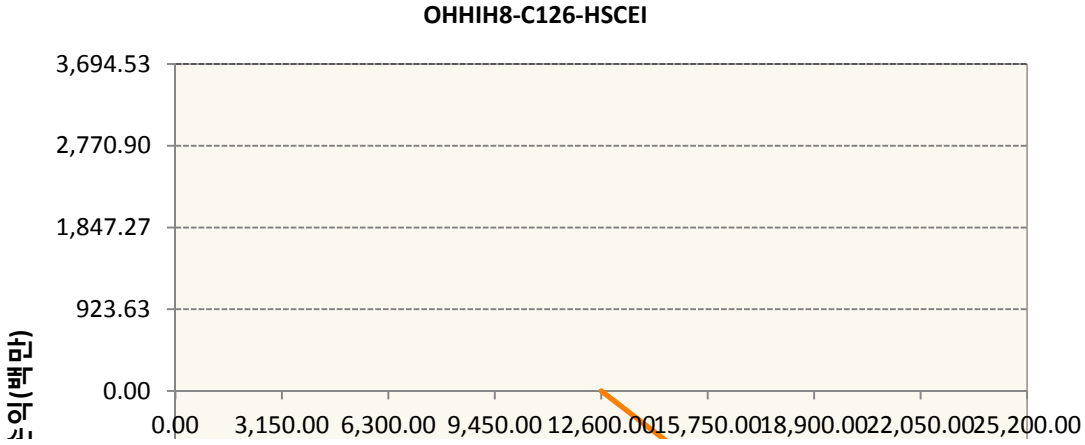
1. 계약금액

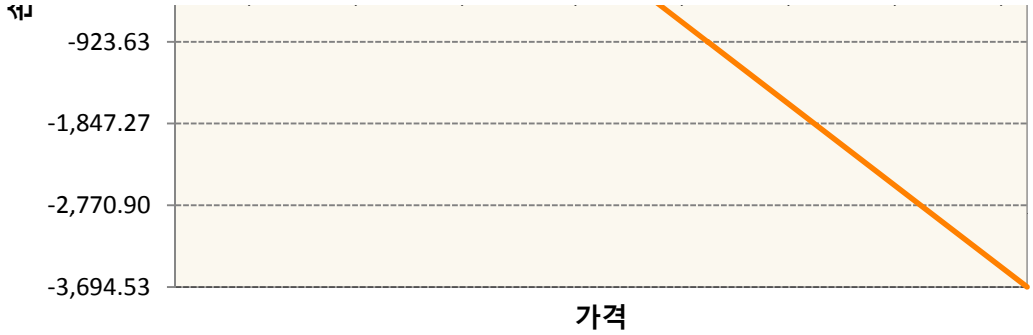
(단위:백만원)

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	3,958	0	3,958	장내
누계	유가증권	옵션	0	9,484	-9,484	장내

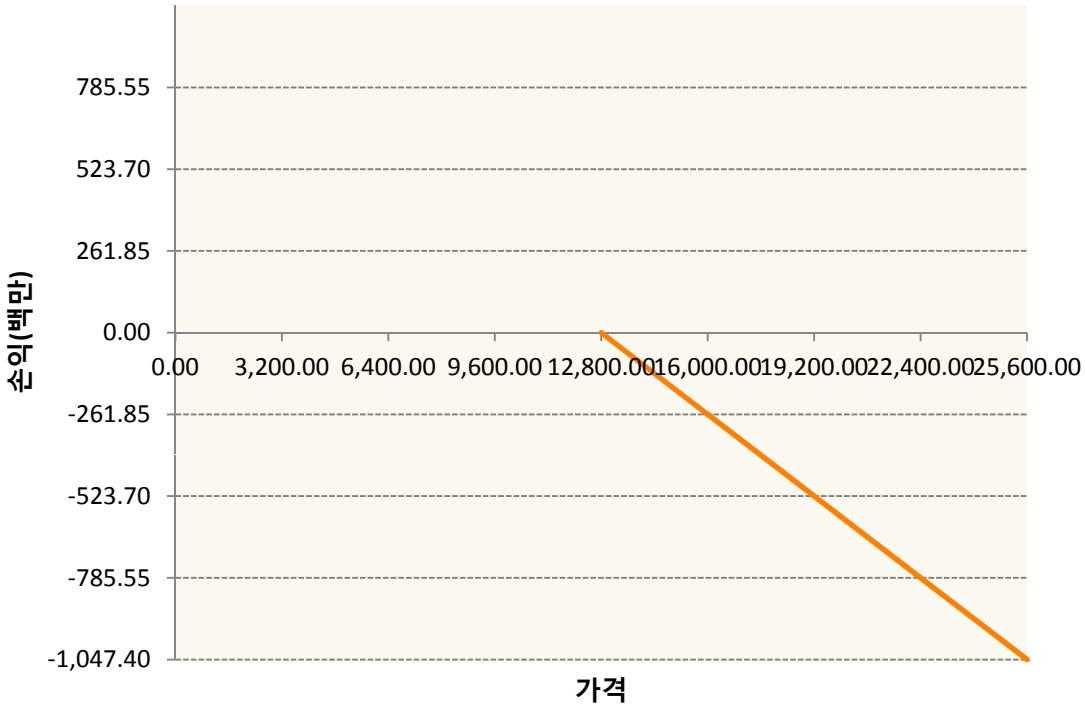
2. 만기시점의 손익구조



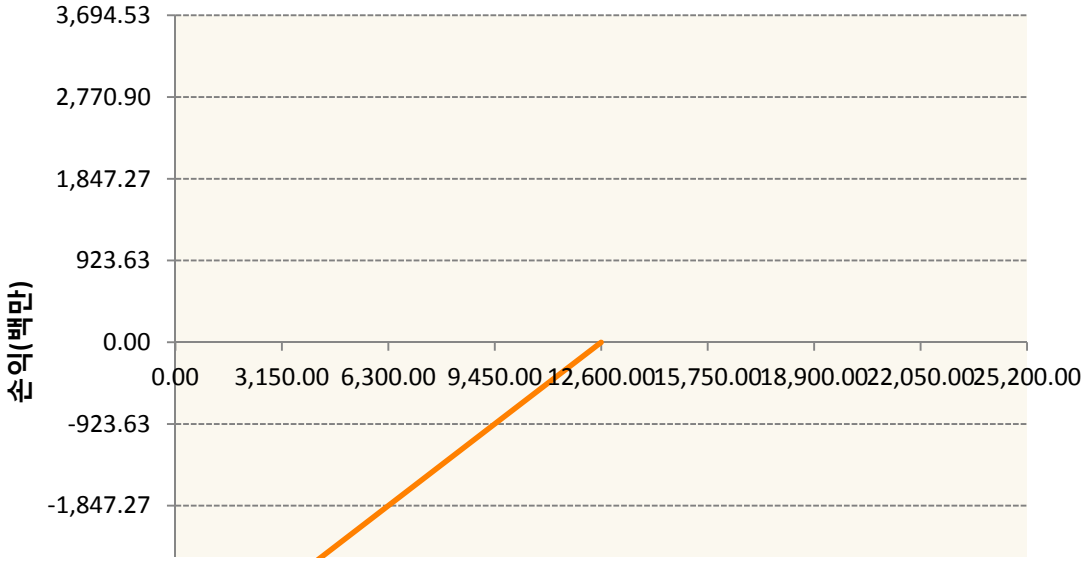


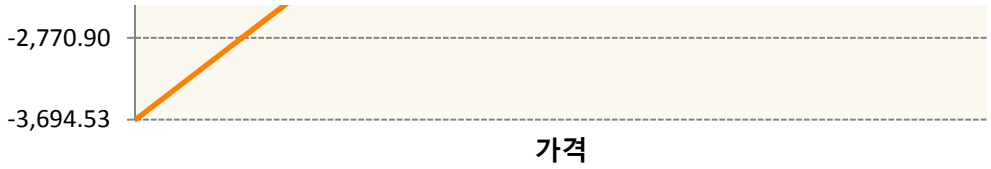


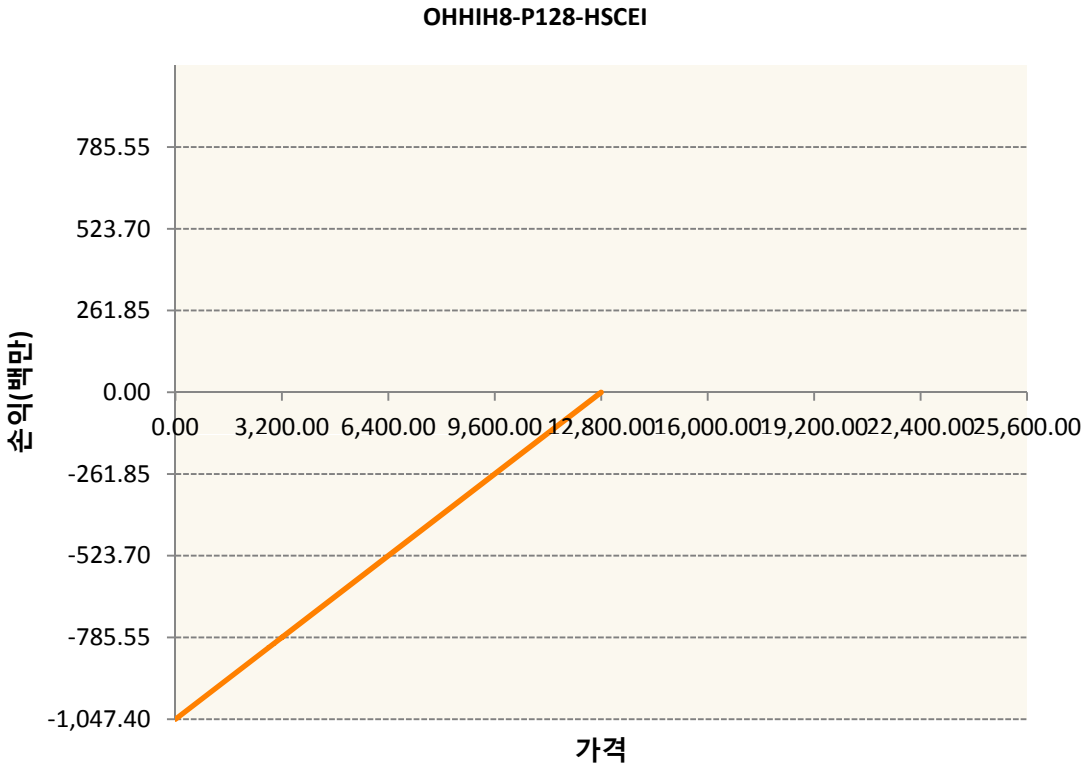
OHHIH8-C128-HSCEI



OHHIH8-P126-HSCEI







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCH8	HSCEI FUTURES MAR18	317
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)
	939

공시일	2018-03-28
기준일	2018-03-27

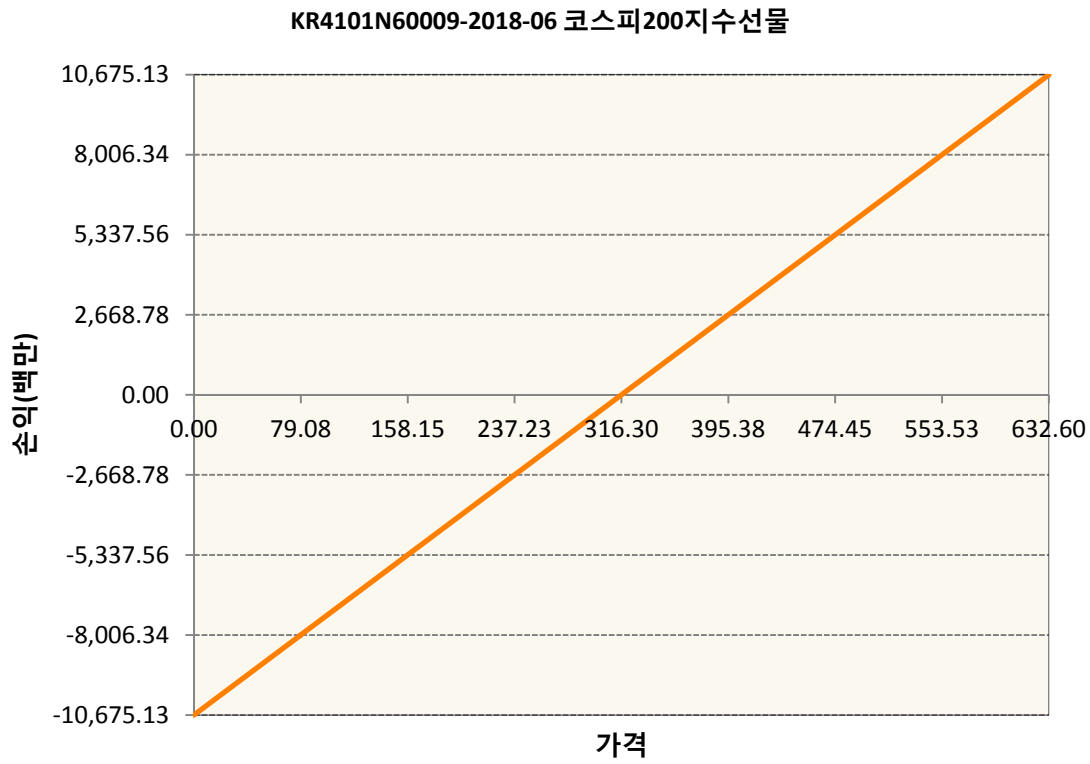
코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼

1. 계약금액

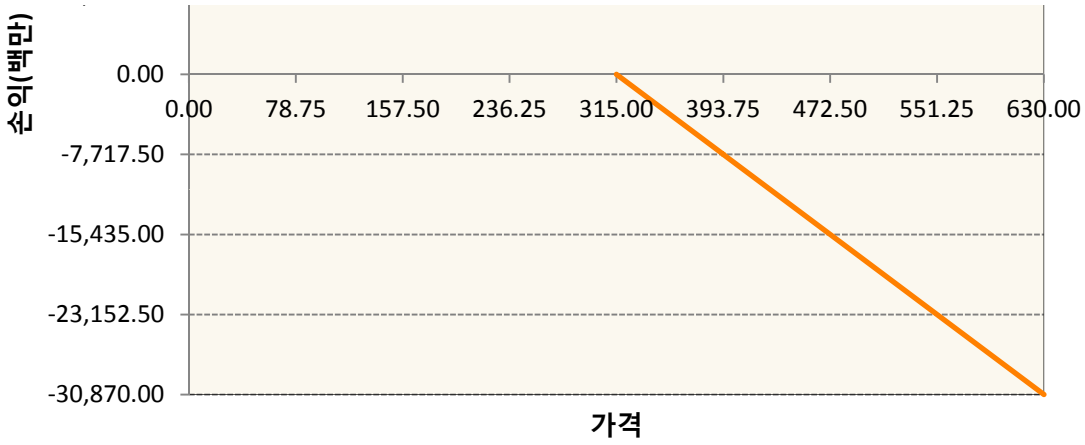
(단위:백만원)

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	10,675	0	10,675	장내
누계	유가증권	스왑	54,200	0	54,200	장외
누계	유가증권	옵션	0	55,718	-55,718	장내

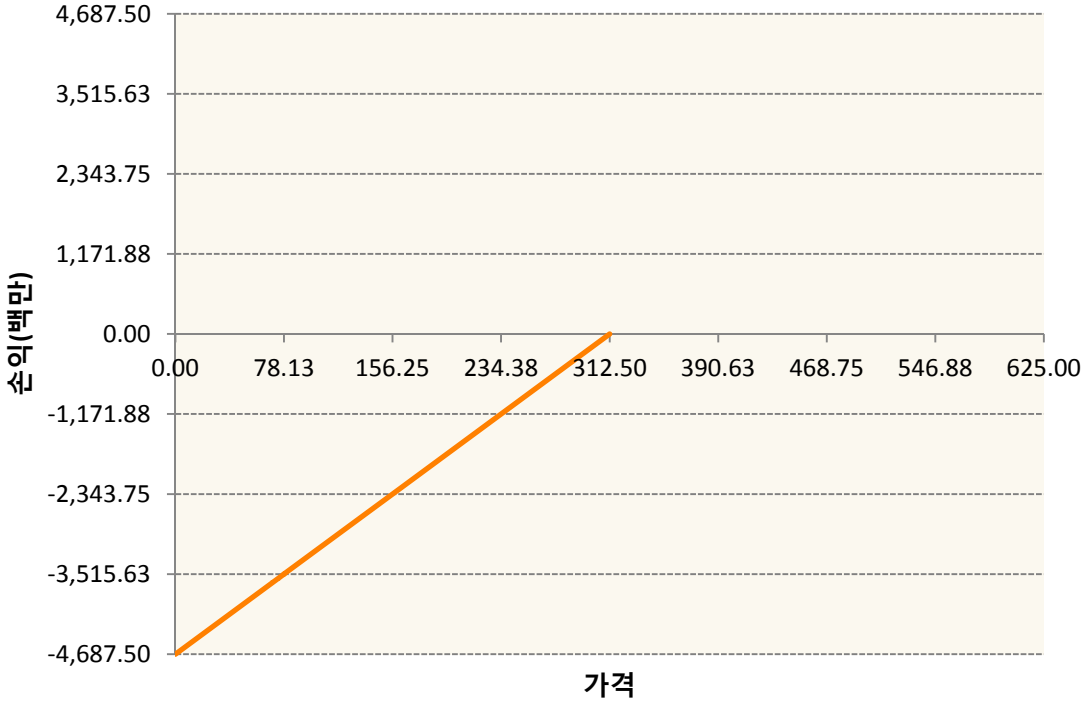
2. 만기시점의 손익구조



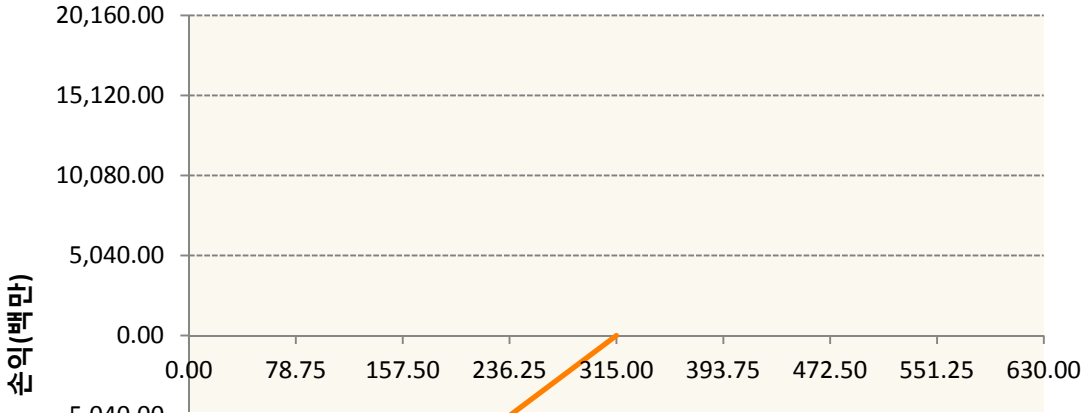




KR4301N43126-2018-04 풋312.5



KR4301N43159-2018-04 풋315





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_2							1,453
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,453	-1,453	-1,453	-1,453	-1,453	-1,453	-1,453
-5.33%	-969	-969	-969	-969	-969	-969	-969
-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%	969	969	969	969	969	969	969
8.00%	1,453	1,453	1,453	1,453	1,453	1,453	1,453
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							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%	-157	-157	-157	-157	-157	-157	-157
-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%	157	157	157	157	157	157	157
8.00%	236	236	236	236	236	236	236
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%	-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%	251	251	251	251	251	251	251
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_8						465
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-465	-465	-465	-465	-465	-465	-465
-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%	465	465	465	465	465	465	465
	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%	-419	-419	-419	-419	-419	-419	-419
-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%	419	419	419	419	419	419	419
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						854
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-854	-854	-854	-854	-854	-854	-854
-5.33%	-569	-569	-569	-569	-569	-569	-569
-2.67%	-285	-285	-285	-285	-285	-285	-285
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	285	285	285	285	285	285	285
5.33%	569	569	569	569	569	569	569
8.00%	854	854	854	854	854	854	854
	KR4201N431 2018-04 콜315						1,980
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	770	757	739	718	694	666	635
-5.33%	707	675	639	600	559	516	471
-2.67%	532	480	426	372	316	261	205
0%	179	119	60	0	-60	-120	-179
2.67%	-367	-416	-467	-519	-572	-627	-682
5.33%	-1,063	-1,092	-1,125	-1,162	-1,203	-1,245	-1,290
8.00%	-1,841	-1,854	-1,872	-1,893	-1,919	-1,948	-1,980
	KR4301N431 2018-04 풋312.5						281
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-274	-274	-275	-276	-277	-279	-281
-5.33%	-151	-154	-156	-160	-163	-167	-171
-2.67%	-47	-53	-58	-64	-69	-75	-81
0%	17	11	6	0	-6	-12	-18
2.67%	42	39	36	32	28	24	20
5.33%	47	46	45	44	42	40	38
8.00%	48	48	48	47	47	46	45
	KR4301N431 2018-04 풋315						1,280

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,260	-1,261	-1,262	-1,265	-1,269	-1,274	-1,280
-5.33%	-730	-736	-745	-755	-767	-780	-794
-2.67%	-253	-273	-293	-315	-337	-359	-382
0%	78	52	26	0	-26	-52	-78
2.67%	227	210	193	174	154	133	112
5.33%	266	261	254	245	235	223	210
8.00%	271	271	269	266	263	258	252

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

8,511

공시일	2018-03-28
기준일	2018-03-27

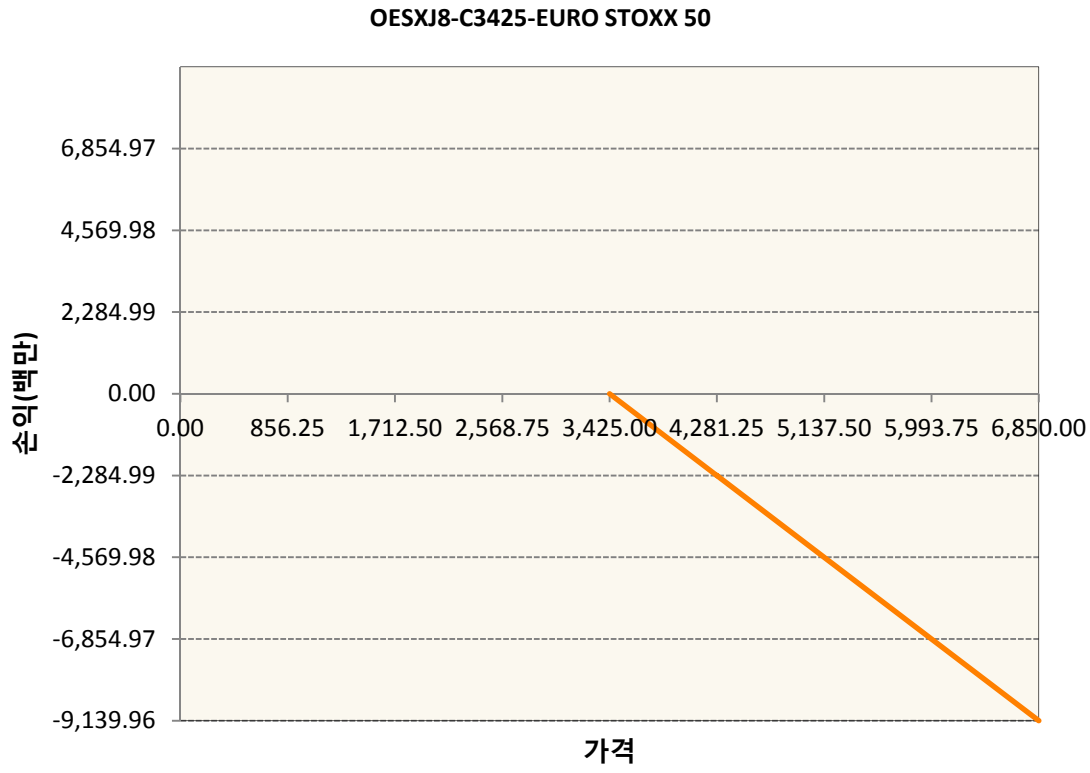
유로커버드콜모(주식혼합-파생형

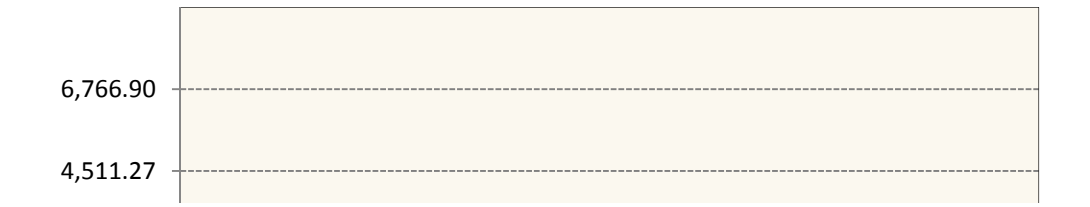
1. 계약금액

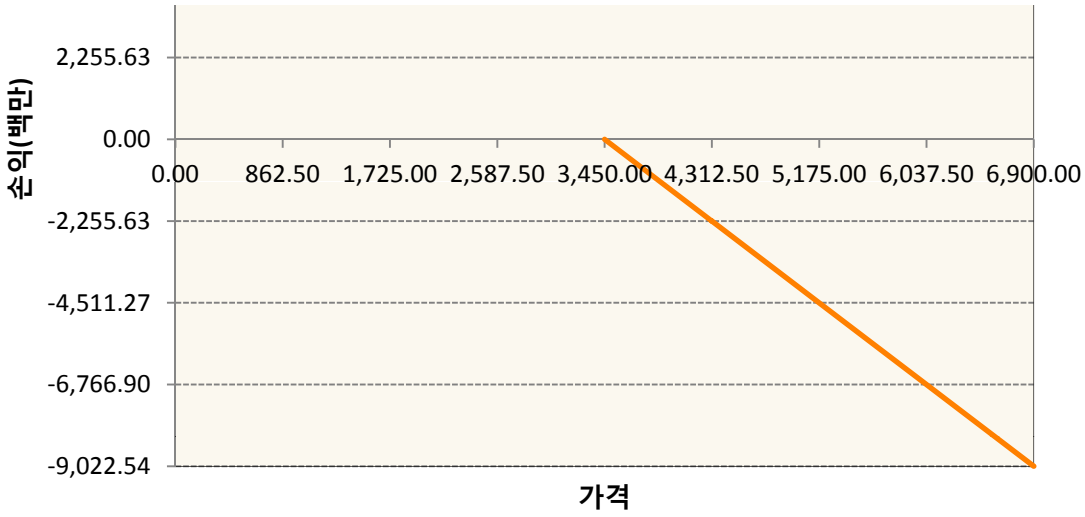
(단위:백만원)

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	8,870	0	8,870	
누계	유가증권	스왑	100,072	0	100,072	장외
누계	유가증권	옵션	0	36,325	-36,325	장내
누계	지수	스왑	53,372	0	53,372	장외

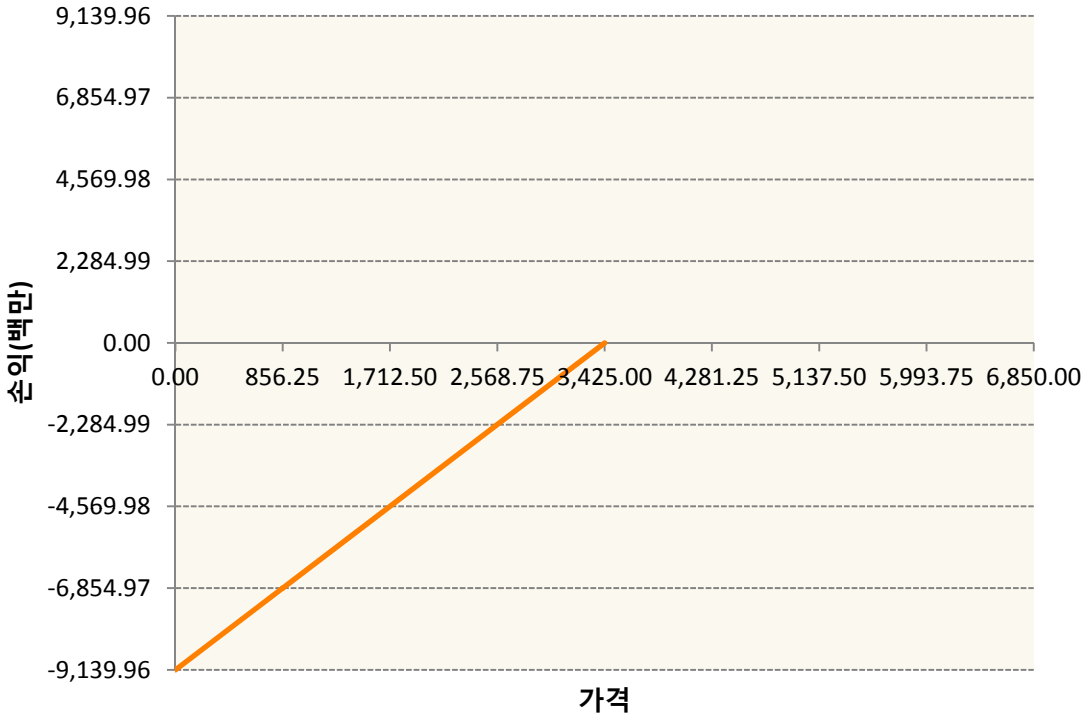
2. 만기시점의 손익구조



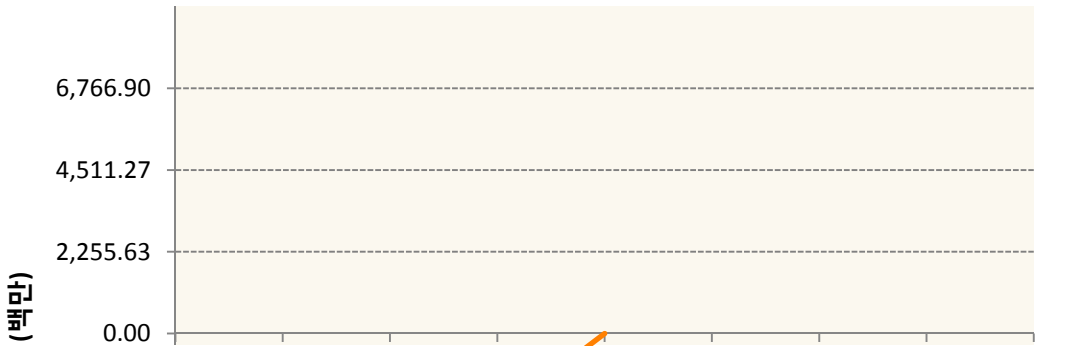


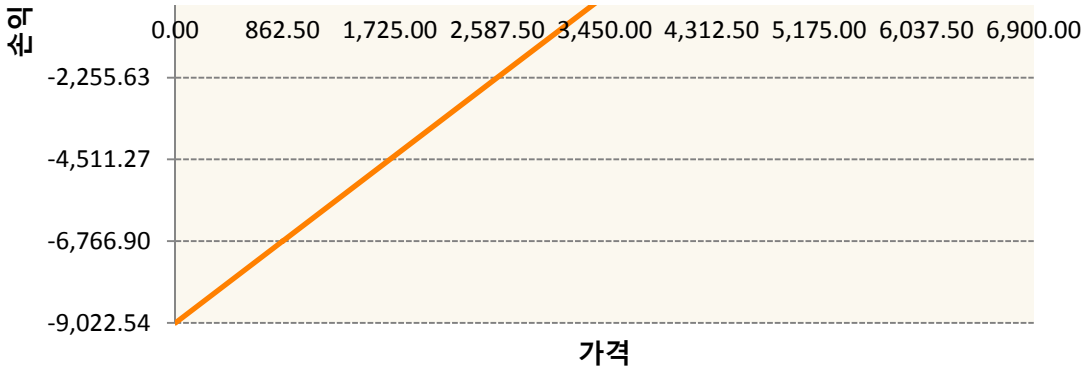


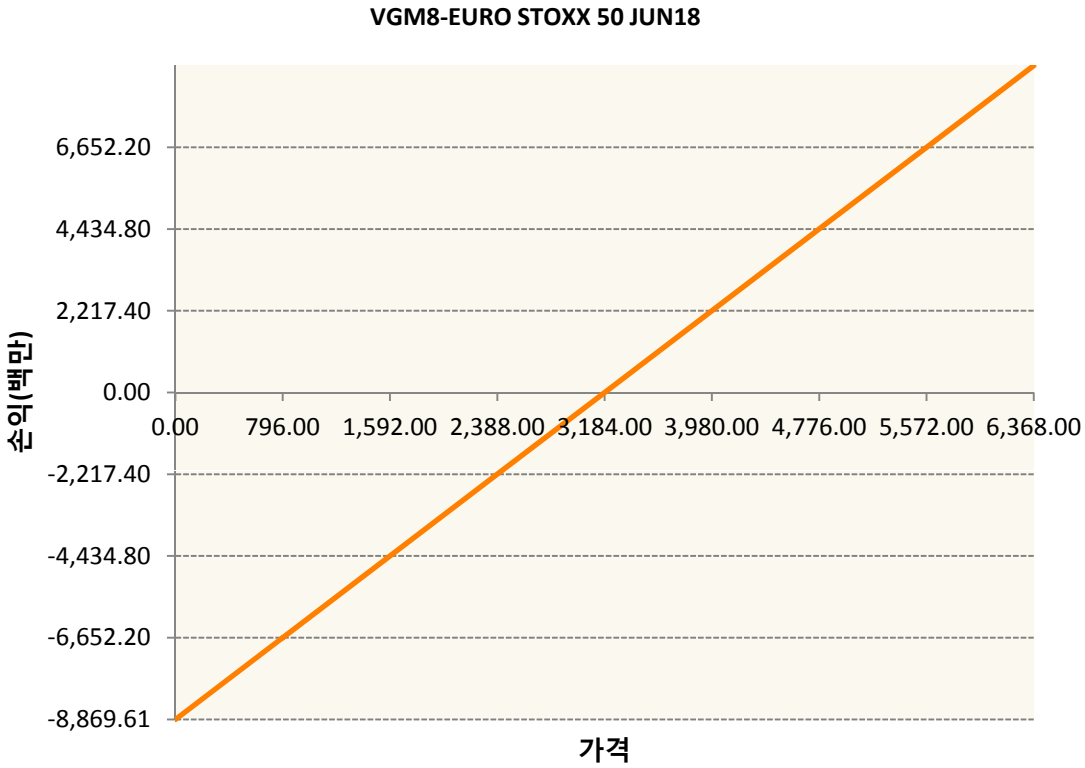
OESXJ8-P3425-EURO STOXX 50



OESXJ8-P3450-EURO STOXX 50







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)	(단위:백만원)
260105SGPX SG EURO Covered CALL STRATEGY - 994.569	301
260105SQPX SG EURO Covered CALL STRATEGY	565
OESXJ8-C34 EURO STOXX 50	731
OESXJ8-C34 EURO STOXX 50	722
OESXJ8-P34 EURO STOXX 50	731
OESXJ8-P34 EURO STOXX 50	722
VGM8 EURO STOXX 50 JUN18	710

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

2,824

공시일	2018-03-28
기준일	2018-03-27

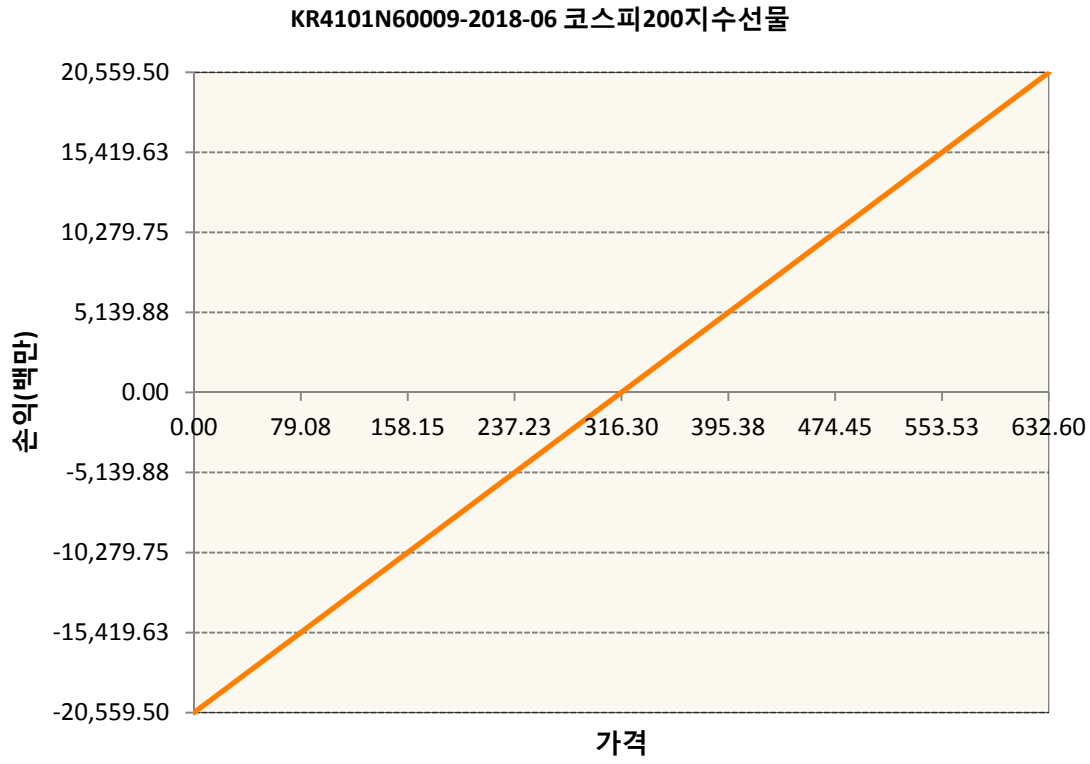
ETF스마트레버리지목표전환형8호

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	20,560	0	20,560	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101N60(2018-06 코스피200지수선물							1,645
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,645	-1,645	-1,645	-1,645	-1,645	-1,645	-1,645
-5.33%	-1,097	-1,097	-1,097	-1,097	-1,097	-1,097	-1,097
-2.67%	-548	-548	-548	-548	-548	-548	-548
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	548	548	548	548	548	548	548
5.33%	1,097	1,097	1,097	1,097	1,097	1,097	1,097
8.00%	1,645	1,645	1,645	1,645	1,645	1,645	1,645

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

1,181

공시일	2018-03-28
기준일	2018-03-27

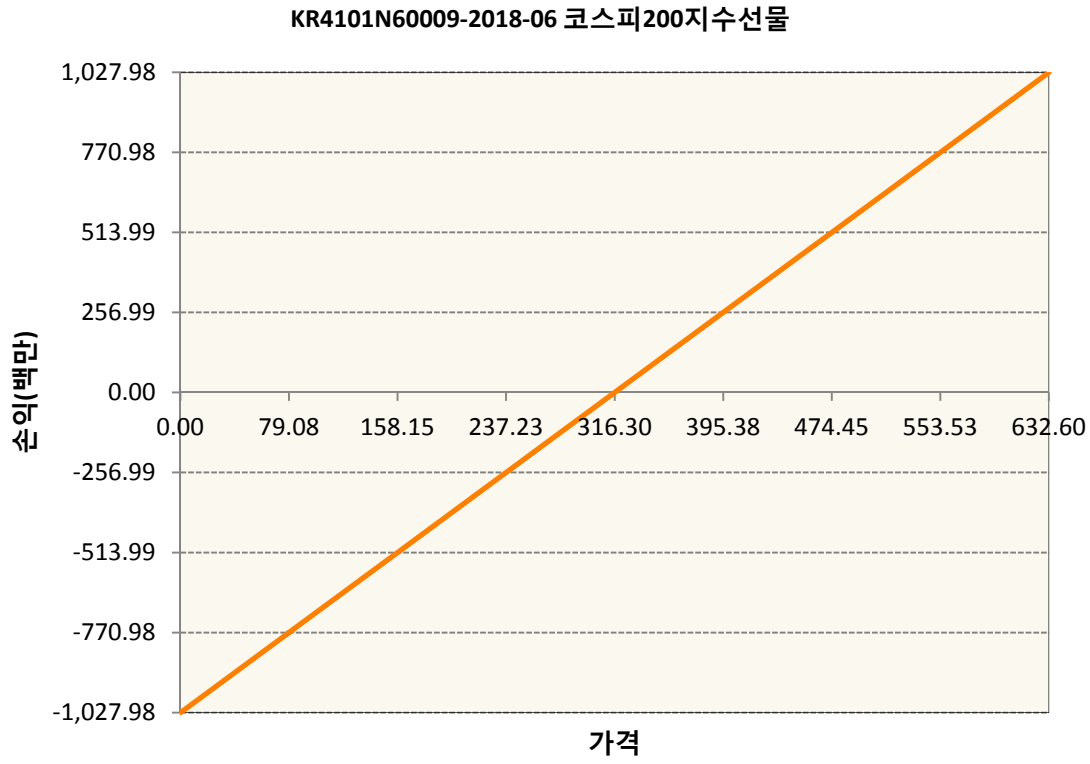
ETF스마트레버리지목표전환형9호

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	1,028	0	1,028	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	2018-03-28
기준일	2018-03-27

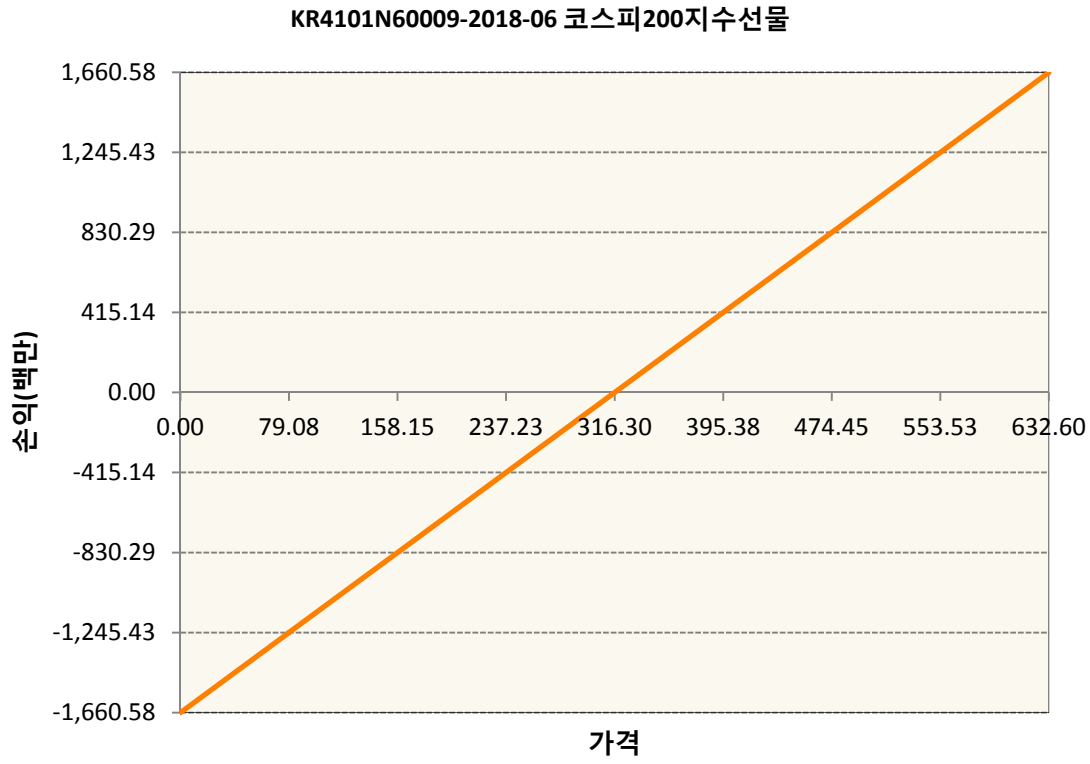
ETF스마트레버리지목표전환형10

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	1,661	0	1,661	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101N60(2018-06 코스피200지수선물							133
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-133	-133	-133	-133	-133	-133	-133
-5.33%	-89	-89	-89	-89	-89	-89	-89
-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%	89	89	89	89	89	89	89
8.00%	133	133	133	133	133	133	133

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

95

공시일	2018-03-28
기준일	2018-03-27

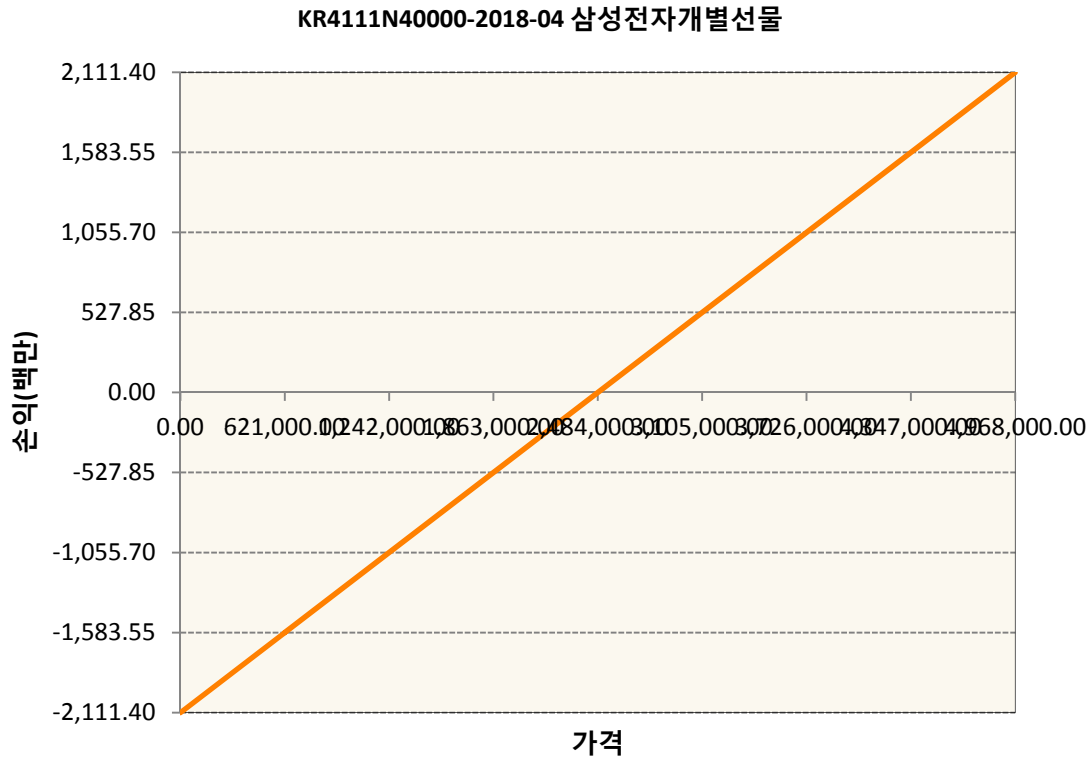
스마트KRX300인덱스1호(주식-파

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	2,111	0	2,111	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4111N40(2018-04 삼성전자개별선물							170
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-170	-170	-170	-170	-170	-170	-170
-5.33%	-113	-113	-113	-113	-113	-113	-113
-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%	113	113	113	113	113	113	113
8.00%	170	170	170	170	170	170	170

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

204

공시일	2018-03-28
기준일	2018-03-27

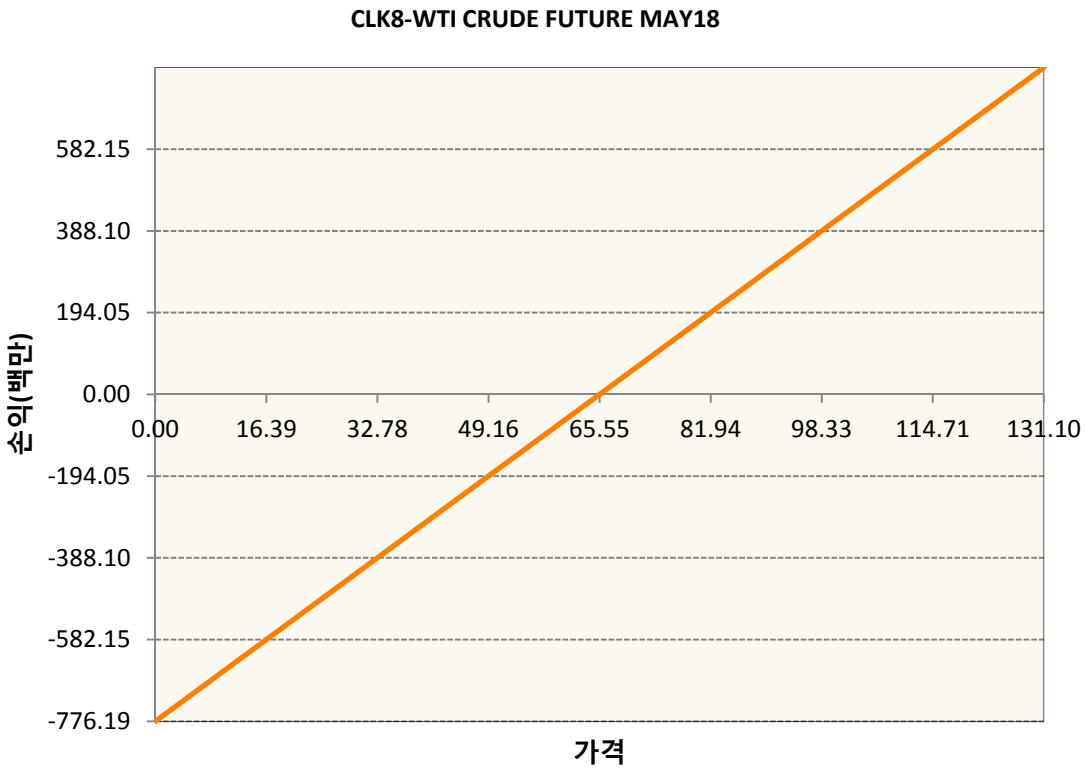
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

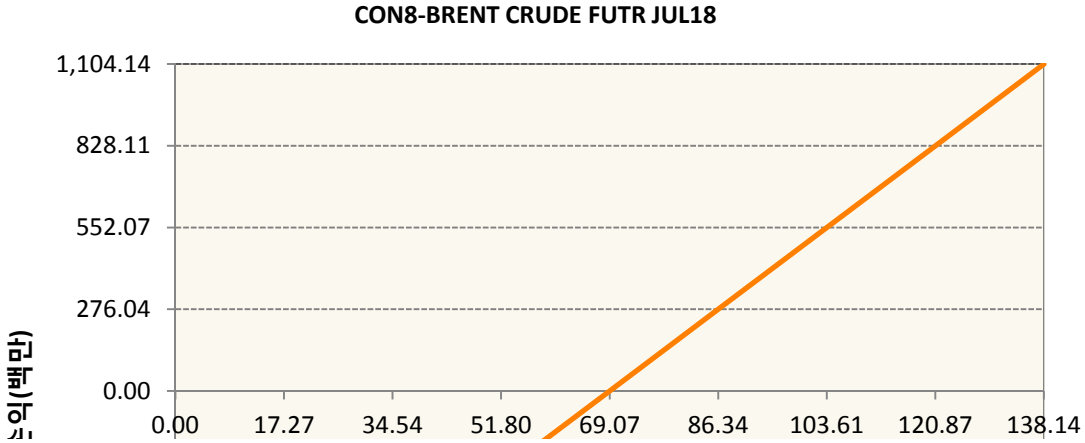
1. 계약금액

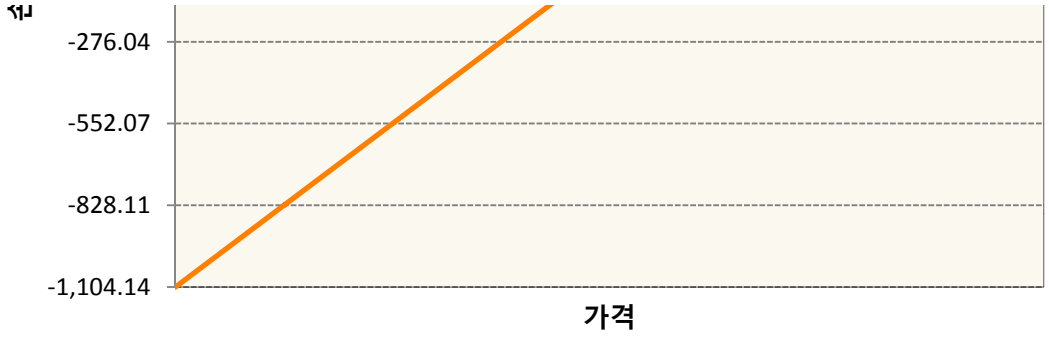
(단위:백만원)

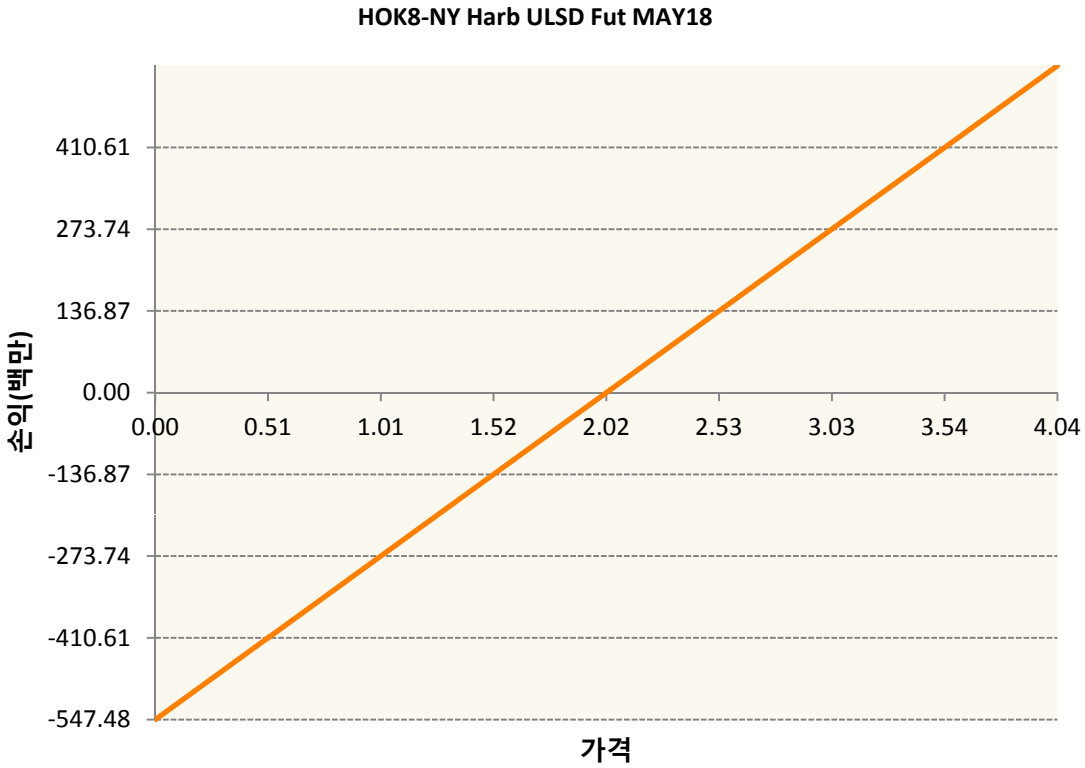
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	선물	유가증권	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	선물	유가증권	776	0	776	
누계	유가증권	선물	3,321	588	2,734	

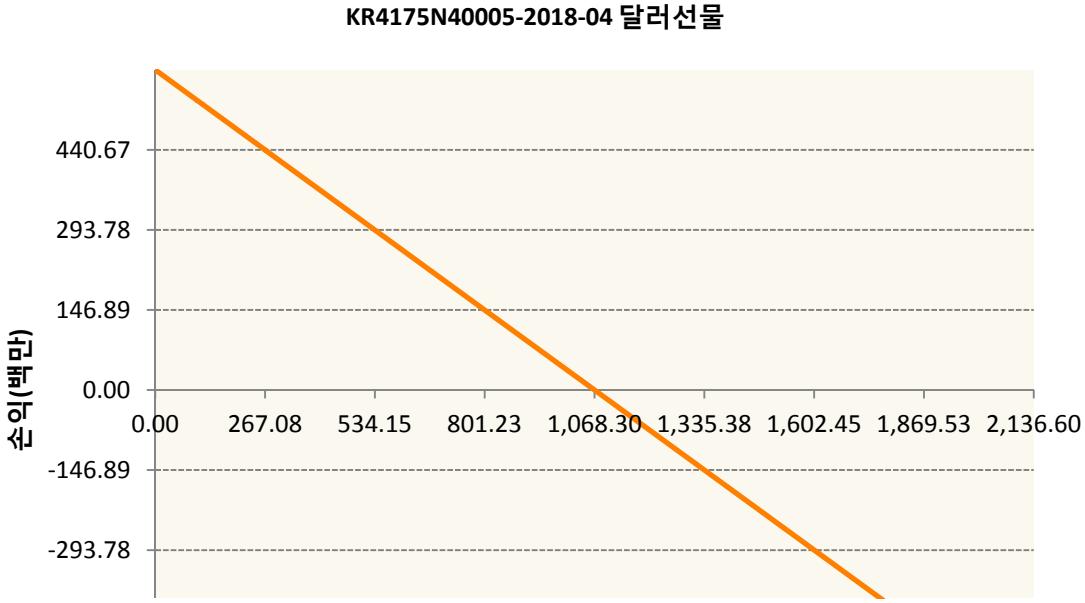
2. 만기시점의 손익구조

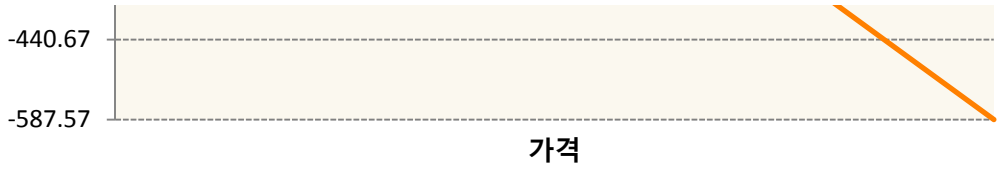


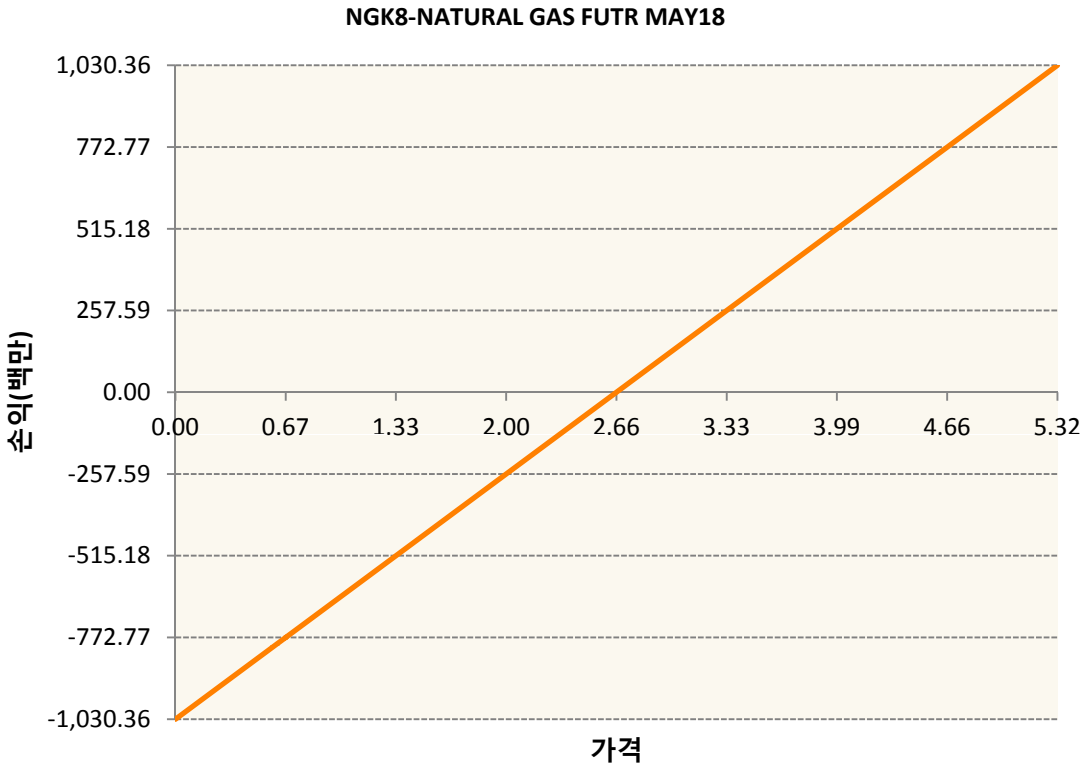


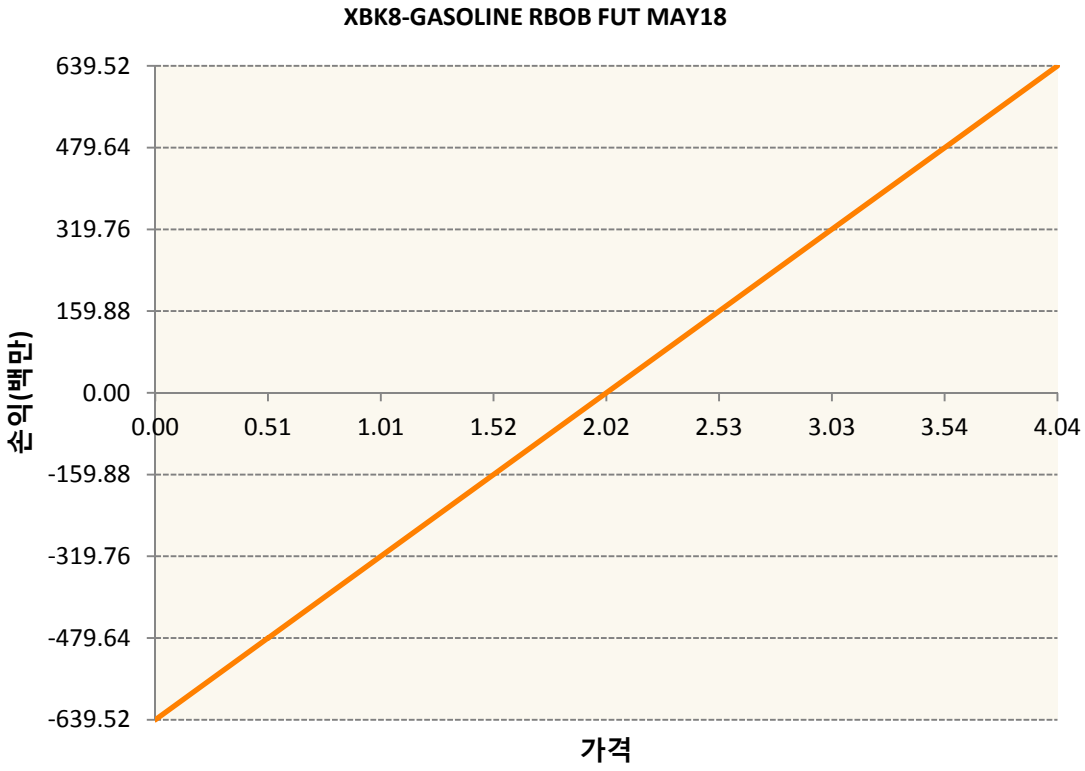

-276.04
-552.07
-828.11
-1,104.14
가격


HOK8-NY Harb ULSD Fut MAY18
410.61
273.74
136.87
0.00
-136.87
-273.74
-410.61
-547.48
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
440.67
293.78
146.89
0.00
-146.89
-293.78
0.00
267.08
534.15
801.23
1,068.30
1,335.38
1,602.45
1,869.53
2,136.60
손익(백만)


-440.67
-587.57
가격


NGK8-NATURAL GAS FUTR MAY18
1,030.36
772.77
515.18
257.59
0.00
-257.59
-515.18
-772.77
-1,030.36
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
639.52
479.64
319.76
159.88
0.00
-159.88
-319.76
-479.64
-639.52
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	82
XBK8	GASOLINE RBOB FUT MAY18	51

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

531

공시일	2018-03-28
기준일	2018-03-27

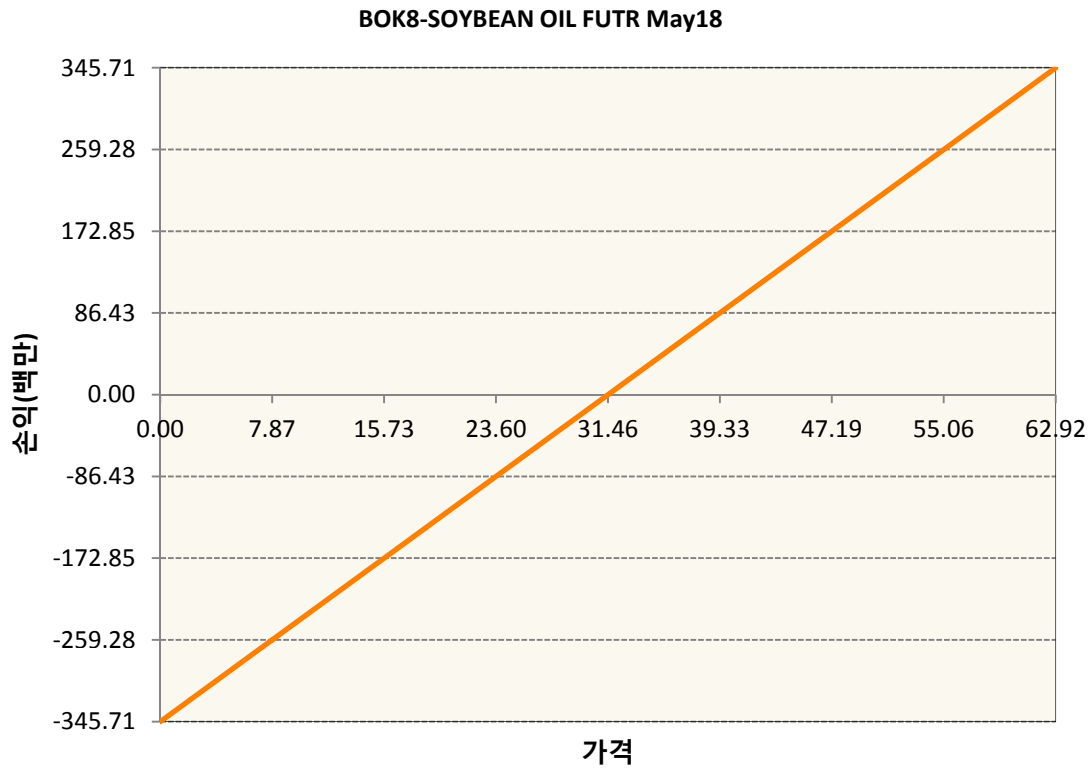
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

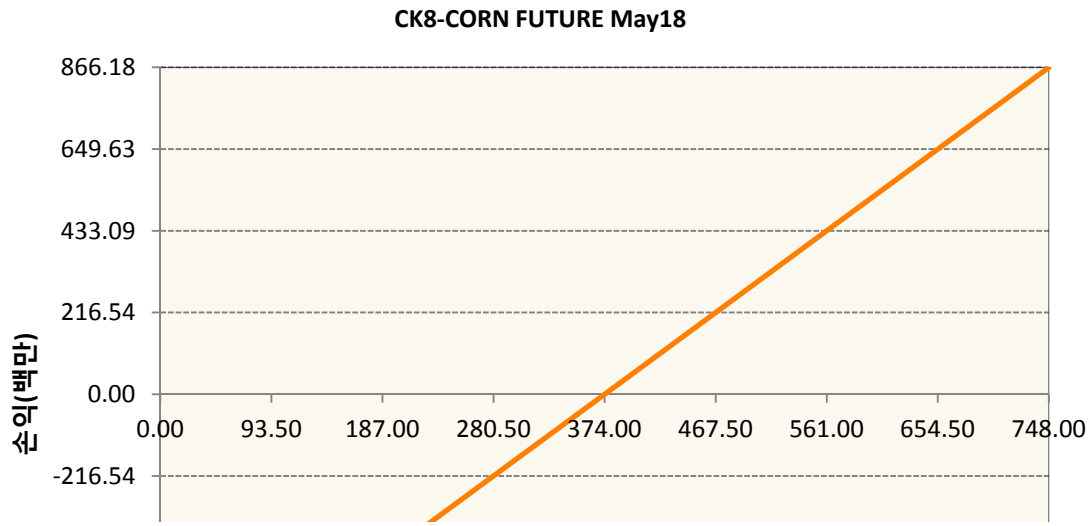
1. 계약금액

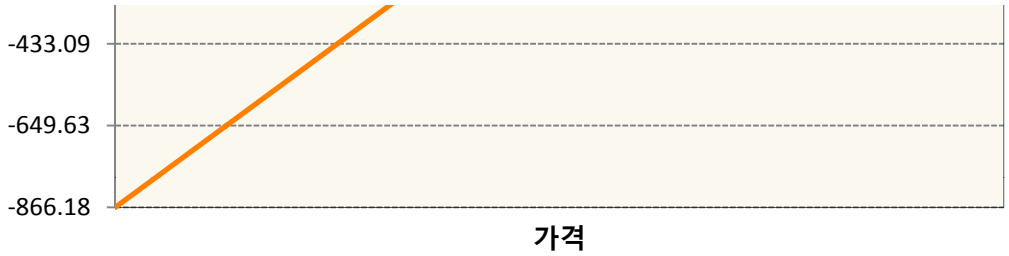
(단위:백만원)

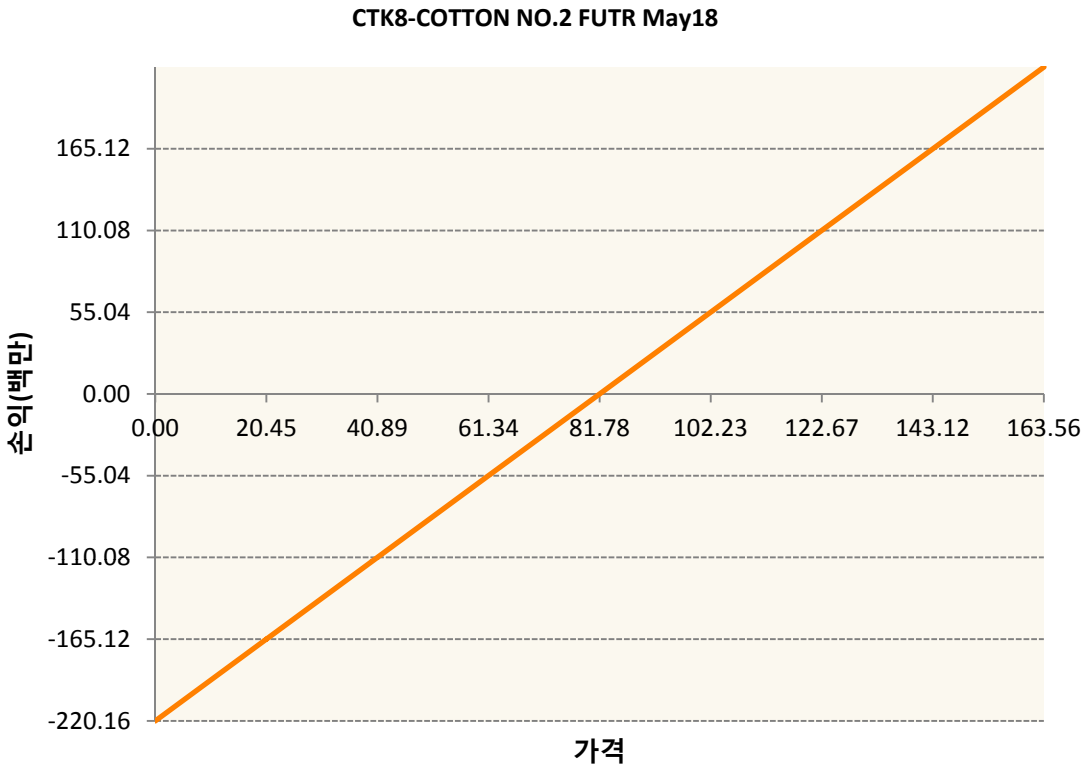
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	4,056	320	3,736	

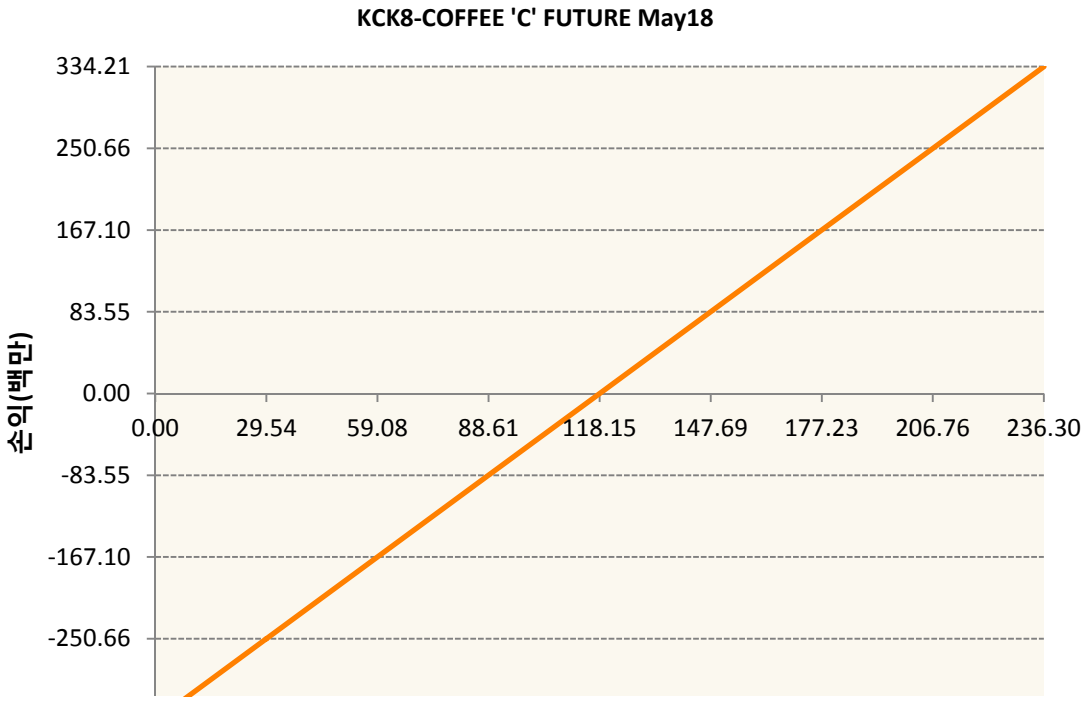
2. 만기시점의 손익구조

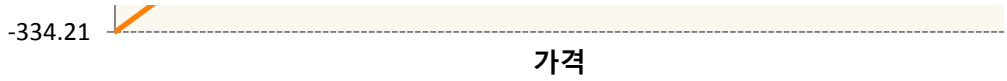


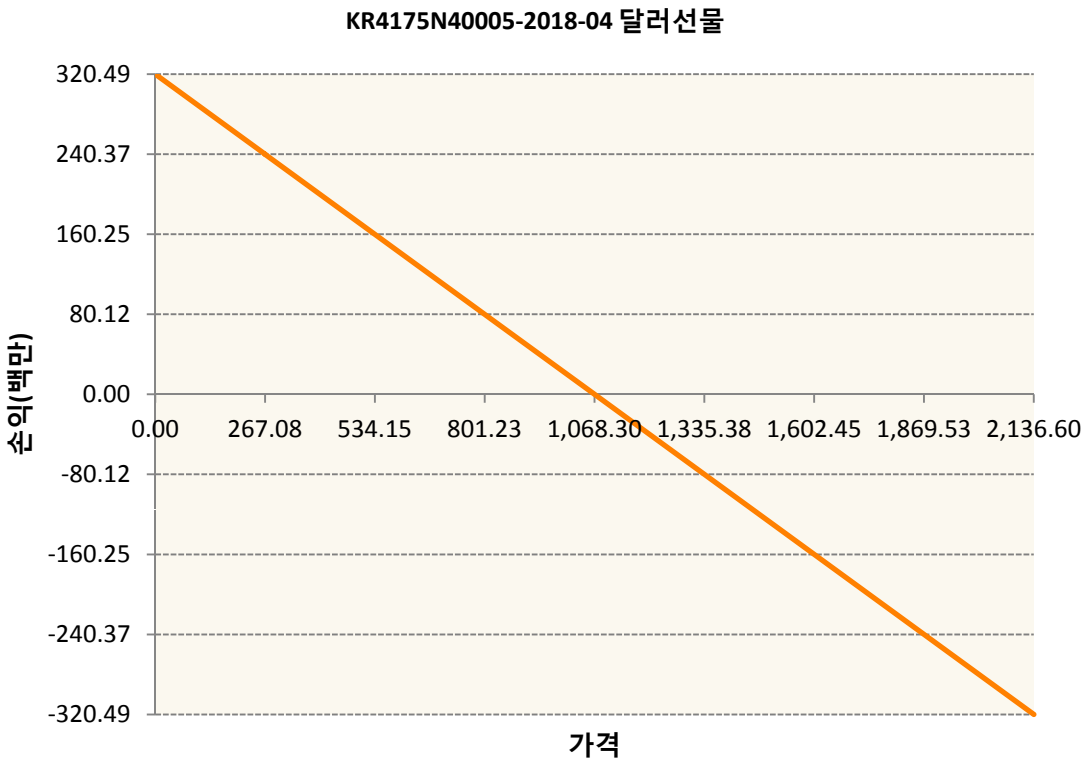


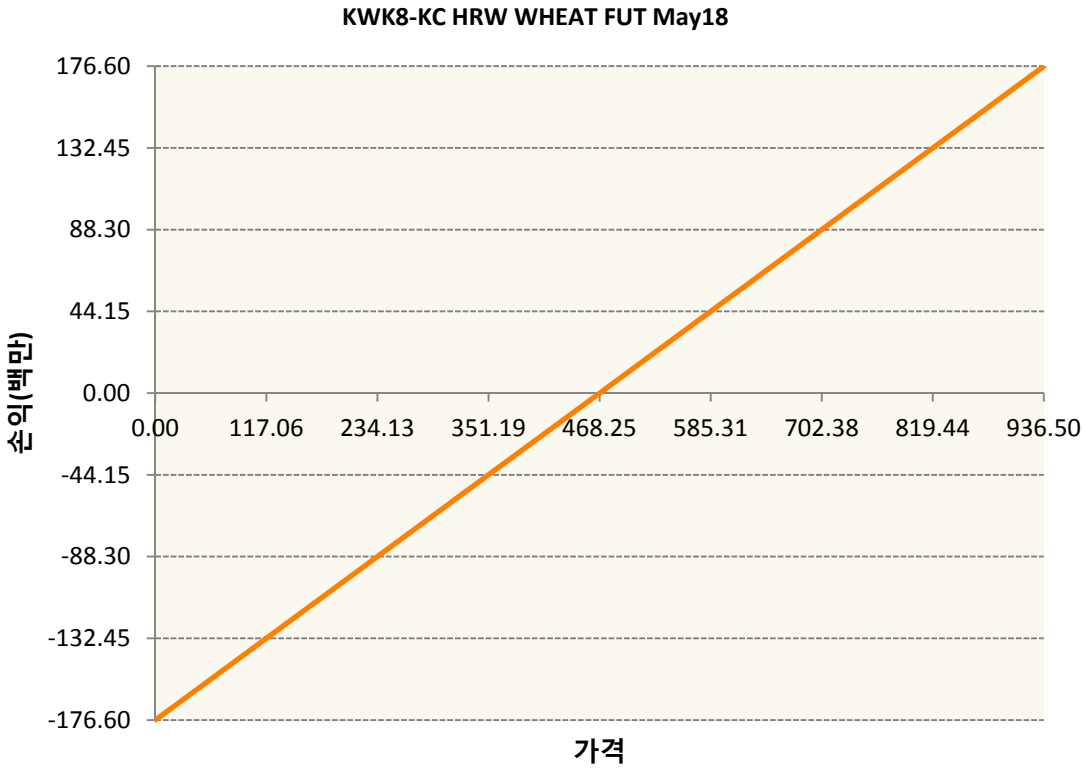

-433.09
-649.63
-866.18
가격

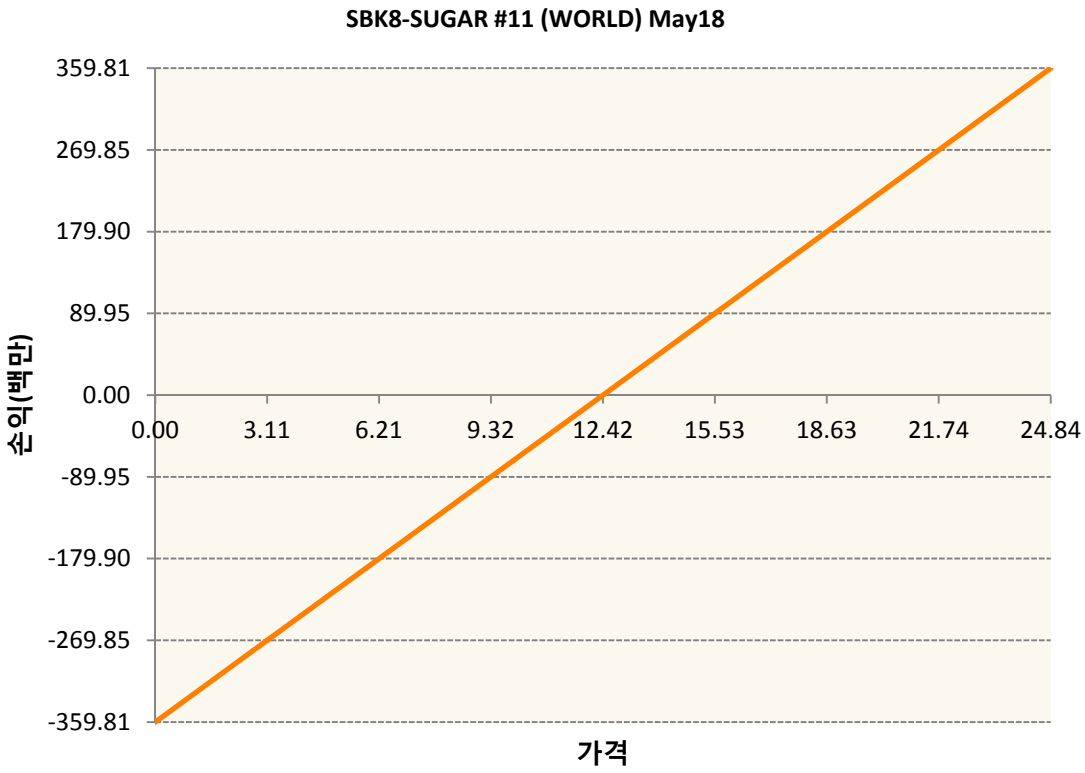

CTK8-COTTON NO.2 FUTR May18
165.12
110.08
55.04
0.00
-55.04
-110.08
-165.12
-220.16
0.00
20.45
40.89
61.34
81.78
102.23
122.67
143.12
163.56
손익(백만)
가격

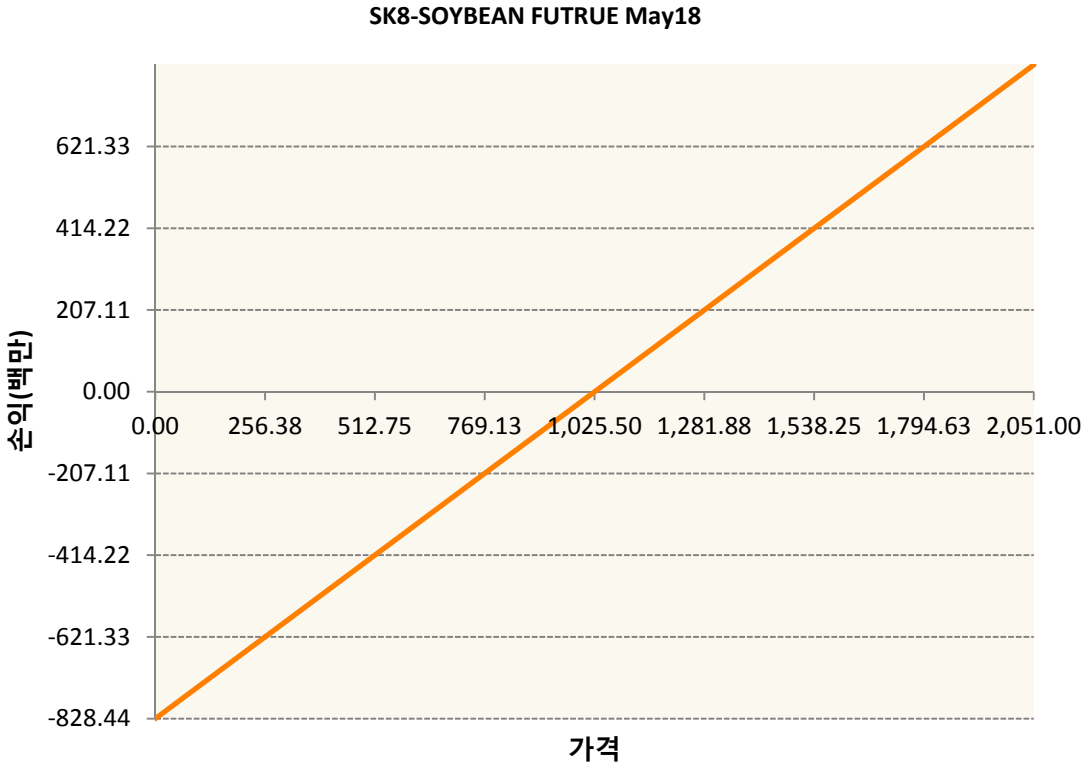

KCK8-COFFEE 'C' FUTURE May18
334.21
250.66
167.10
83.55
0.00
-83.55
-167.10
-250.66
0.00
29.54
59.08
88.61
118.15
147.69
177.23
206.76
236.30
손익(백만)


-334.21
가격

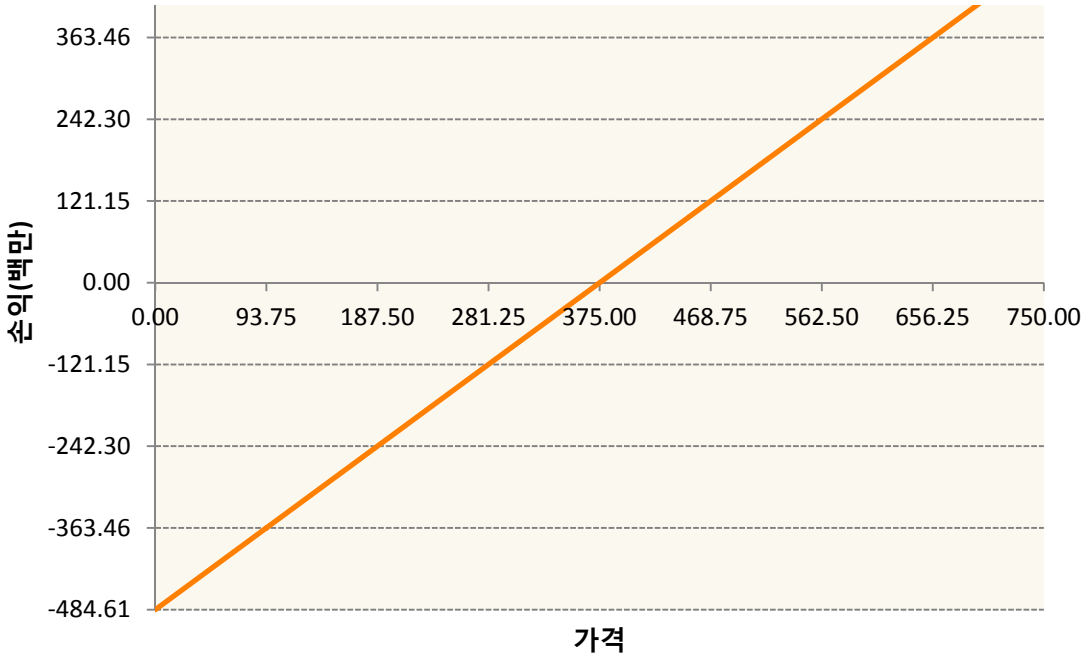

KR4175N40005-2018-04 달러선물
320.49
240.37
160.25
80.12
0.00
-80.12
-160.25
-240.37
-320.49
0.00
267.08
534.15
801.23
1,068.30
1,335.38
1,602.45
1,869.53
2,136.60
손익(백만)
가격


KWK8-KC HRW WHEAT FUT May18
176.60
132.45
88.30
44.15
0.00
-44.15
-88.30
-132.45
-176.60
0.00
117.06
234.13
351.19
468.25
585.31
702.38
819.44
936.50
손익(백만)
가격

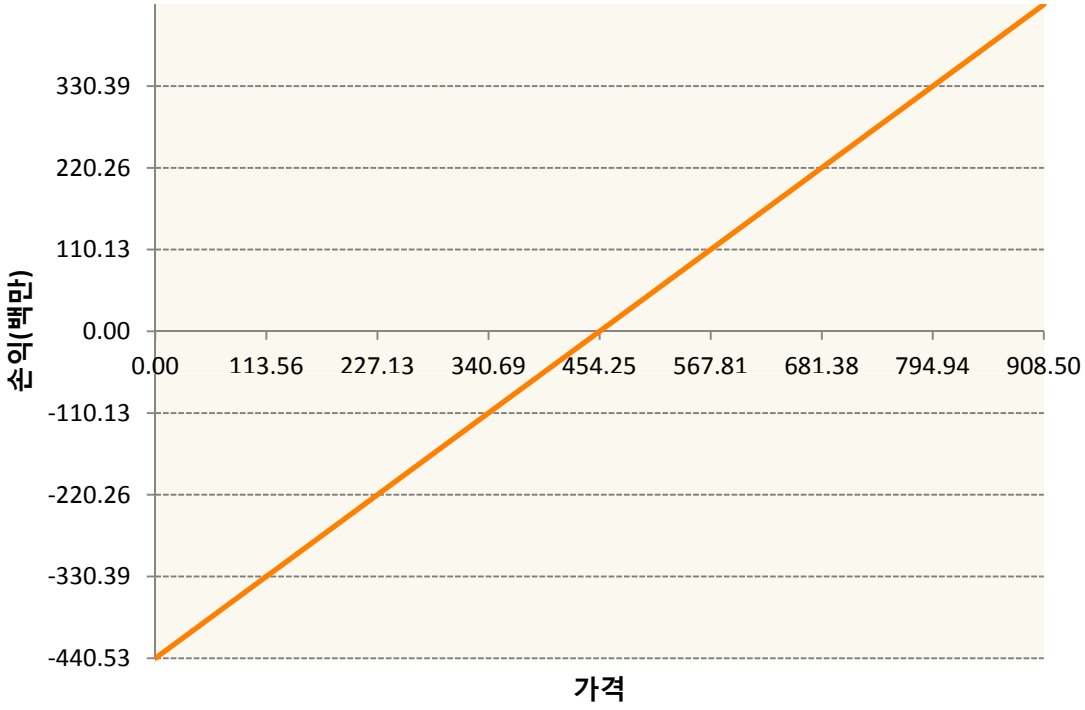

SBK8-SUGAR #11 (WORLD) May18
359.81
269.85
179.90
89.95
0.00
-89.95
-179.90
-269.85
-359.81
0.00
3.11
6.21
9.32
12.42
15.53
18.63
21.74
24.84
손익(백만)
가격


SK8-SOYBEAN FUTRUE May18
621.33
414.22
207.11
0.00
-207.11
-414.22
-621.33
-828.44
0.00
256.38
512.75
769.13
1,025.50
1,281.88
1,538.25
1,794.63
2,051.00
손익(백만)
가격


SMK8-SOYBEAN MEAL FUTR May18
484.61



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	66
SMK8	SOYBEAN MEAL FUTR May18	39
WK8	WHEAT FUTURE(CBT) May18	35

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

327