공시일	2018-03-29
기준일	2018-03-28

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	2018-03-29
기준일	2018-03-28

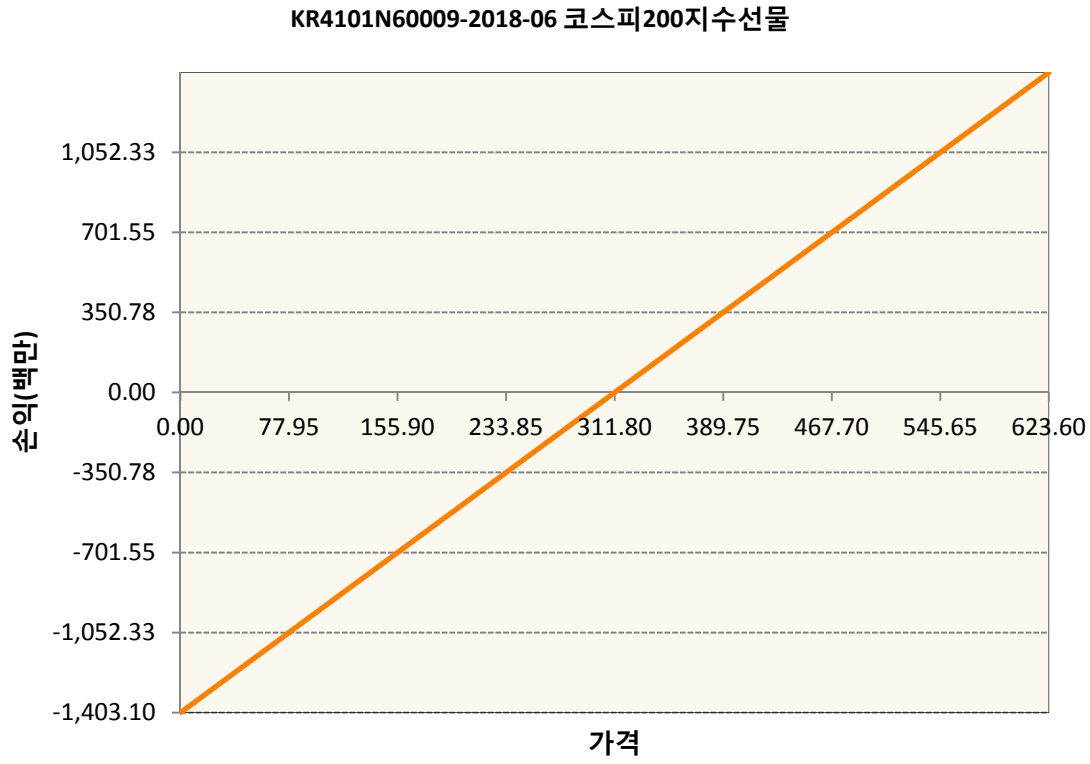
스마트인덱스모

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	78	-78	장내
누계	유가증권	선물	1,403	0	1,403	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101N60(2018-06 코스피200지수선물							112
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-112	-112	-112	-112	-112	-112	-112
-5.33%	-75	-75	-75	-75	-75	-75	-75
-2.67%	-37	-37	-37	-37	-37	-37	-37
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	37	37	37	37	37	37	37
5.33%	75	75	75	75	75	75	75
8.00%	112	112	112	112	112	112	112

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

81

공시일	2018-03-29
기준일	2018-03-28

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	1,080

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

424

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2018-03-29
기준일	2018-03-28

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	403

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

432

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2018-03-29
기준일	2018-03-28

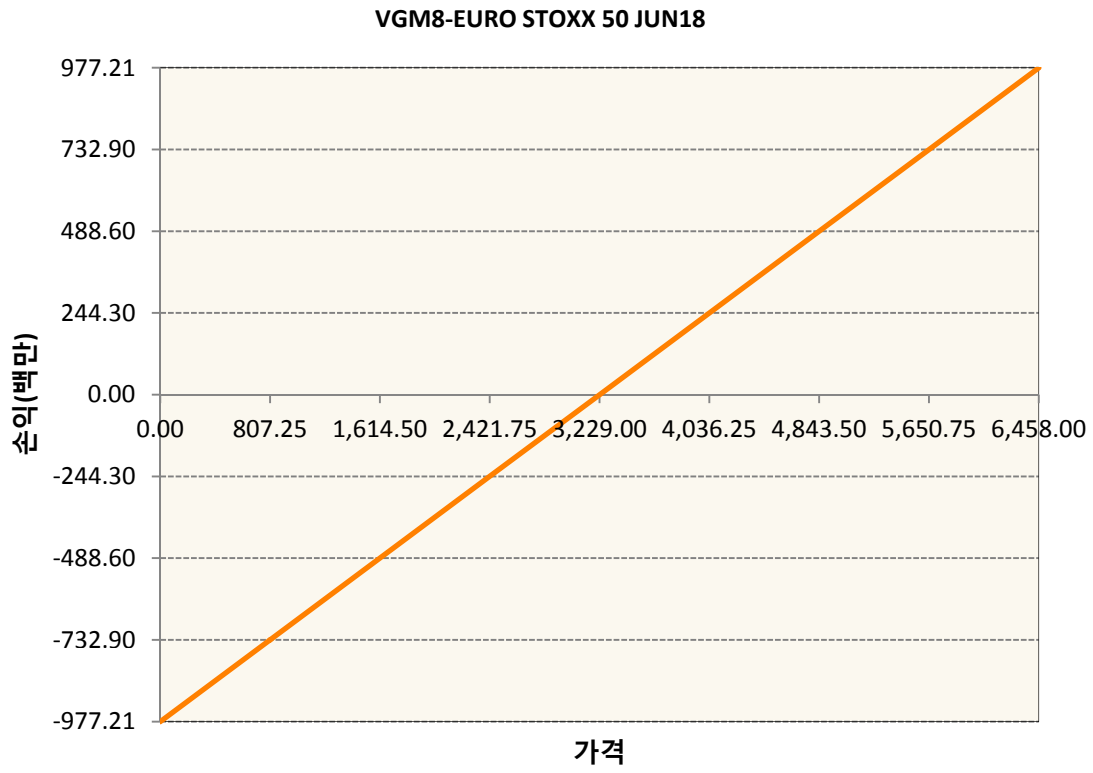
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	977	0	977	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGM8	EURO STOXX 50 JUN18	78

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

(단위:백만원)

48

공시일	2018-03-29
기준일	2018-03-28

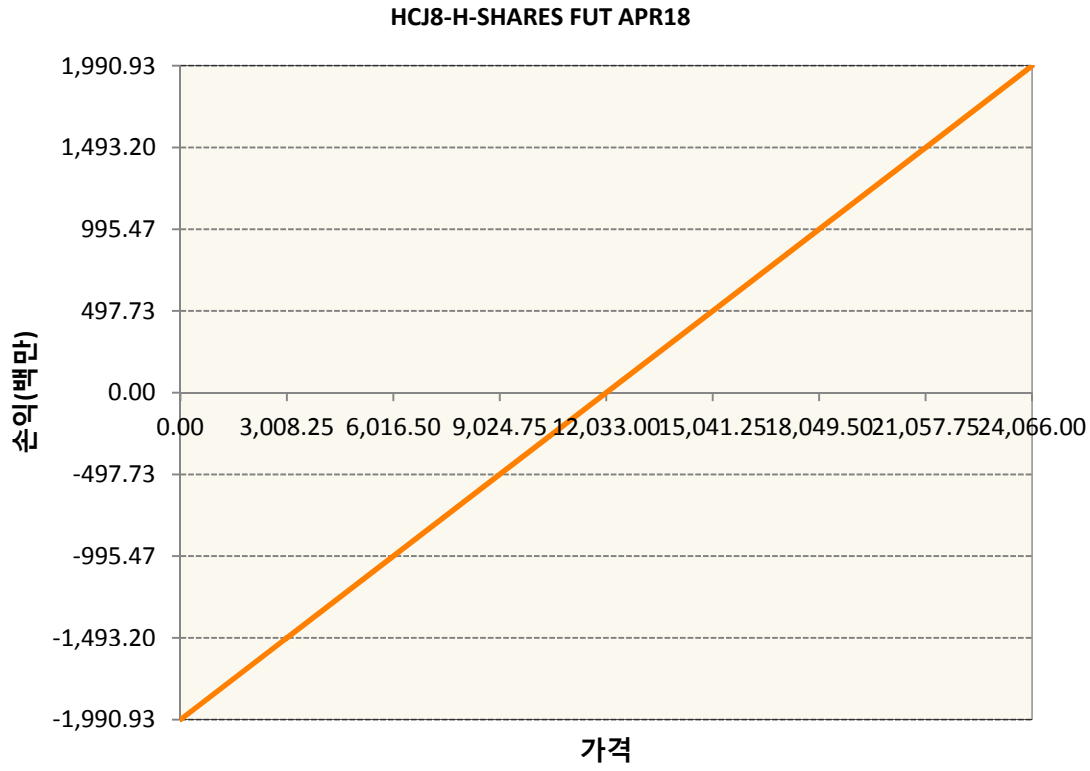
차이나인덱스모(주식-파생형)

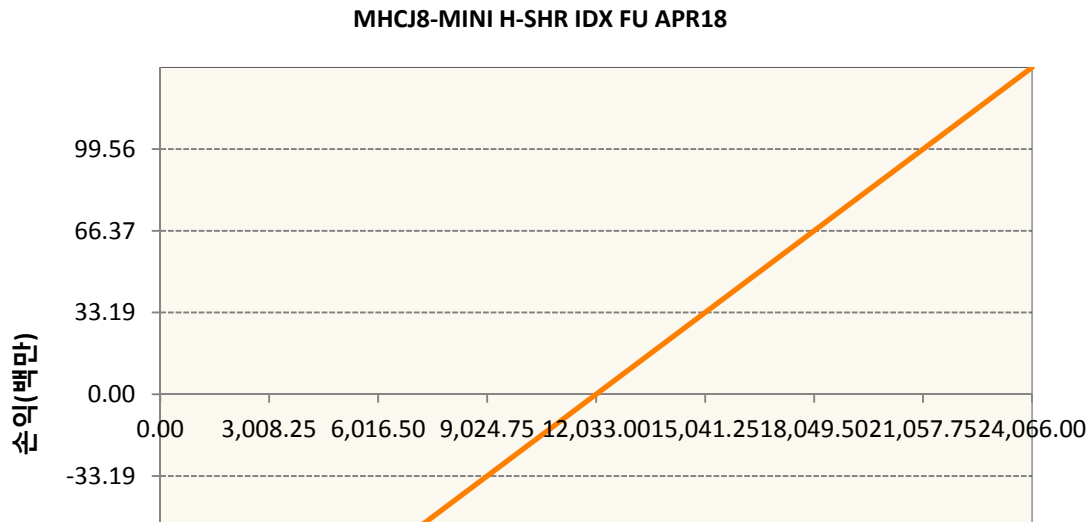
1. 계약금액

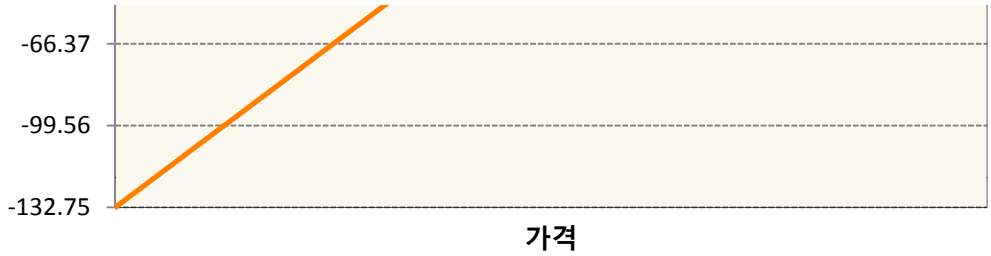
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,124	0	2,124	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCJ8	H-SHARES FUT APR18	159
MHCJ8	MINI H-SHR IDX FU APR18	11

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

공시일	2018-03-29
기준일	2018-03-28

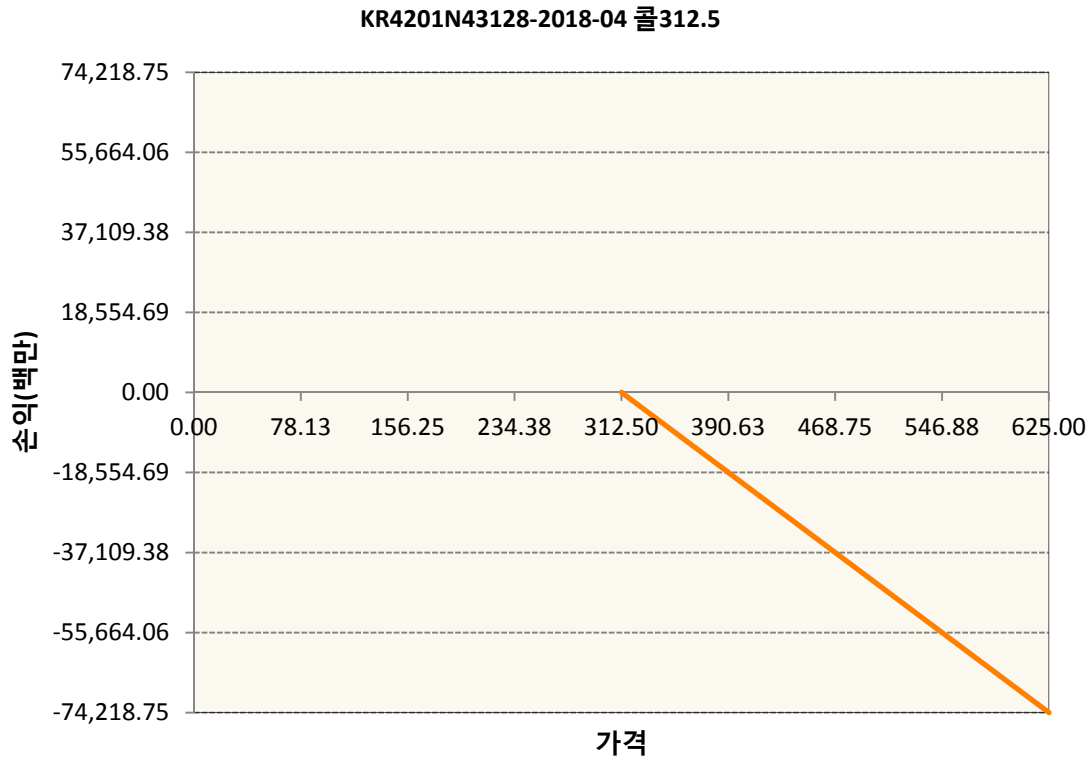
커버드콜모(주식혼합-파생형)

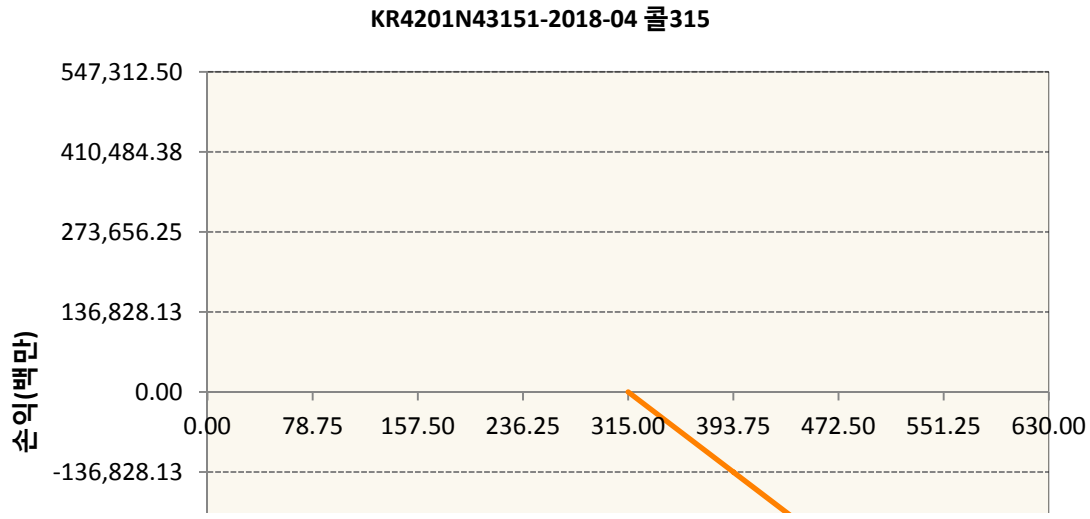
1. 계약금액

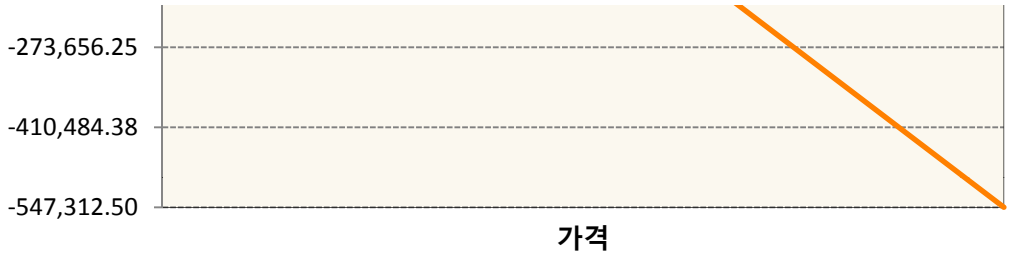
(단위:백만원)

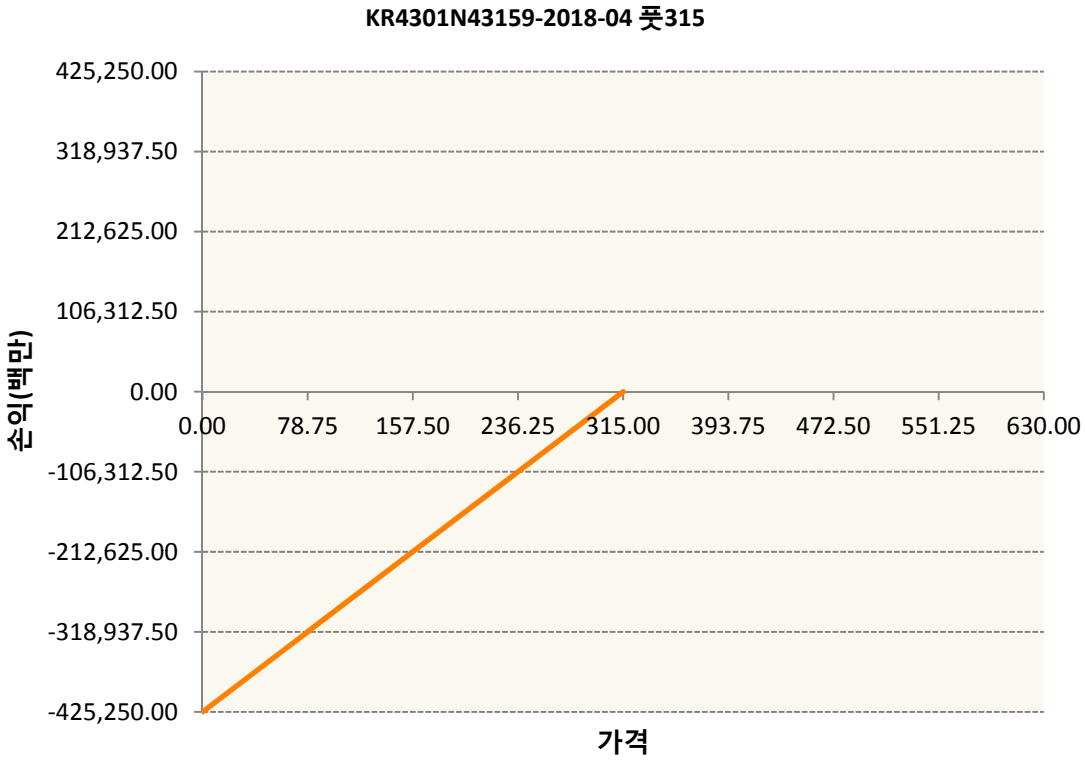
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	1,046,781	-1,046,781	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201N4312018-04 콜312.5							4,556
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,635	1,609	1,573	1,529	1,476	1,415	1,347
-5.33%	1,517	1,450	1,373	1,288	1,195	1,098	995
-2.67%	1,171	1,053	931	805	677	547	415
0%	436	291	145	0	-145	-291	-436
2.67%	-759	-888	-1,020	-1,155	-1,291	-1,429	-1,568
5.33%	-2,341	-2,425	-2,519	-2,620	-2,728	-2,840	-2,957
8.00%	-4,158	-4,200	-4,253	-4,316	-4,388	-4,468	-4,556
KR4201N4312018-04 콜315							31,701
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	10,109	9,970	9,770	9,509	9,186	8,806	8,372

-5.33%	9,511	9,115	8,644	8,106	7,511	6,867	6,180
-2.67%	7,585	6,817	6,004	5,155	4,277	3,376	2,456
0%	3,142	2,099	1,051	0	-1,053	-2,109	-3,166
2.67%	-4,599	-5,618	-6,648	-7,687	-8,732	-9,782	-10,836
5.33%	-15,402	-16,136	-16,926	-17,759	-18,629	-19,527	-20,450
8.00%	-28,271	-28,670	-29,151	-29,703	-30,317	-30,986	-31,701
KR4301N4312018-04 풋315							28,905
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-28,618	-28,628	-28,648	-28,682	-28,735	-28,809	-28,905
-5.33%	-17,480	-17,559	-17,672	-17,819	-18,000	-18,213	-18,455
-2.67%	-6,907	-7,207	-7,544	-7,913	-8,308	-8,724	-9,158
0%	1,674	1,120	562	0	-565	-1,132	-1,700
2.67%	6,781	6,261	5,729	5,188	4,640	4,086	3,528
5.33%	8,765	8,502	8,197	7,857	7,486	7,088	6,669
8.00%	9,239	9,164	9,055	8,910	8,729	8,515	8,269

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

66,947

공시일	2018-03-29
기준일	2018-03-28

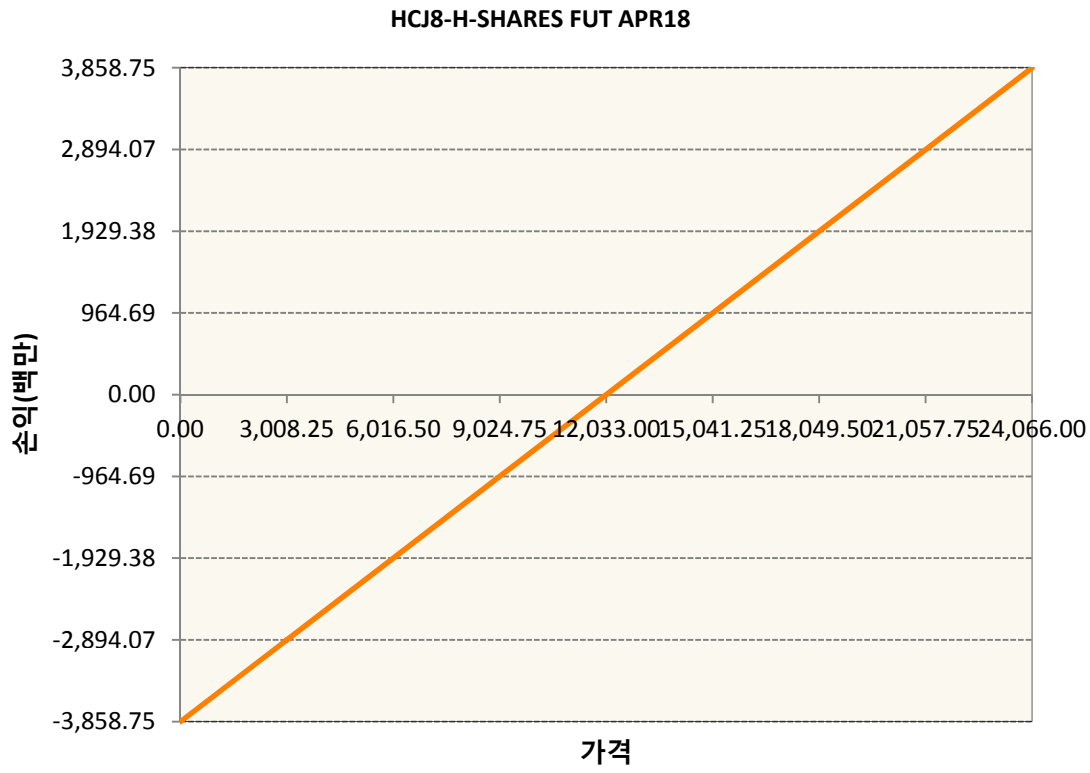
홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	1	0	1	장내
누계	유가증권	선물	3,859	0	3,859	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCJ8	H-SHARES FUT APR18	309

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

(단위:백만원)

269

공시일	2018-03-29
기준일	2018-03-28

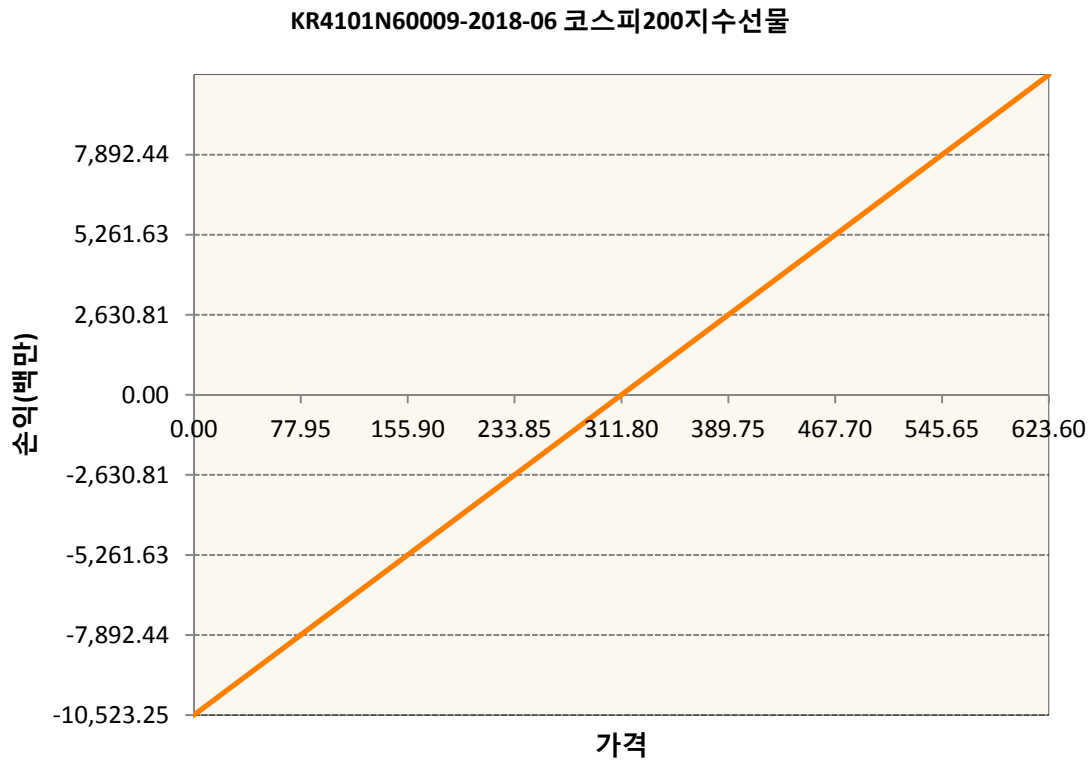
코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼

1. 계약금액

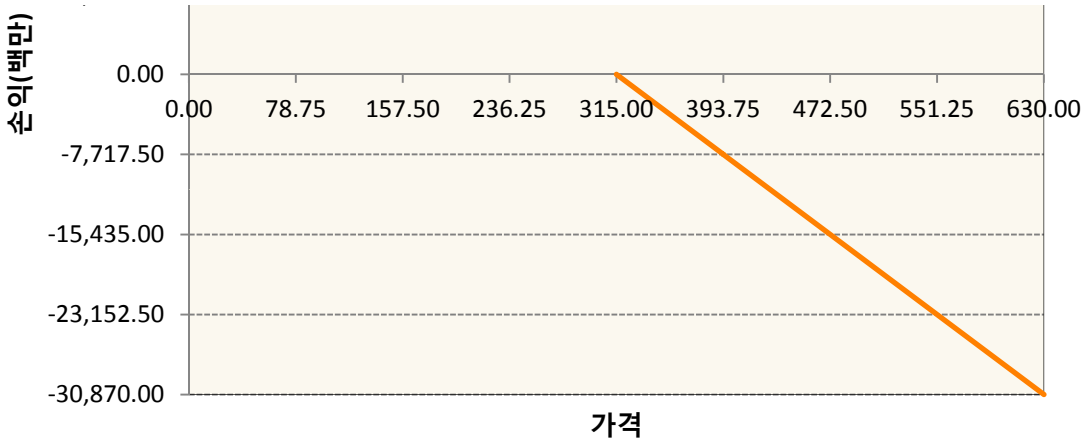
(단위:백만원)

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	10,523	0	10,523	장내
누계	유가증권	스왑	54,200	0	54,200	장외
누계	유가증권	옵션	0	55,718	-55,718	장내

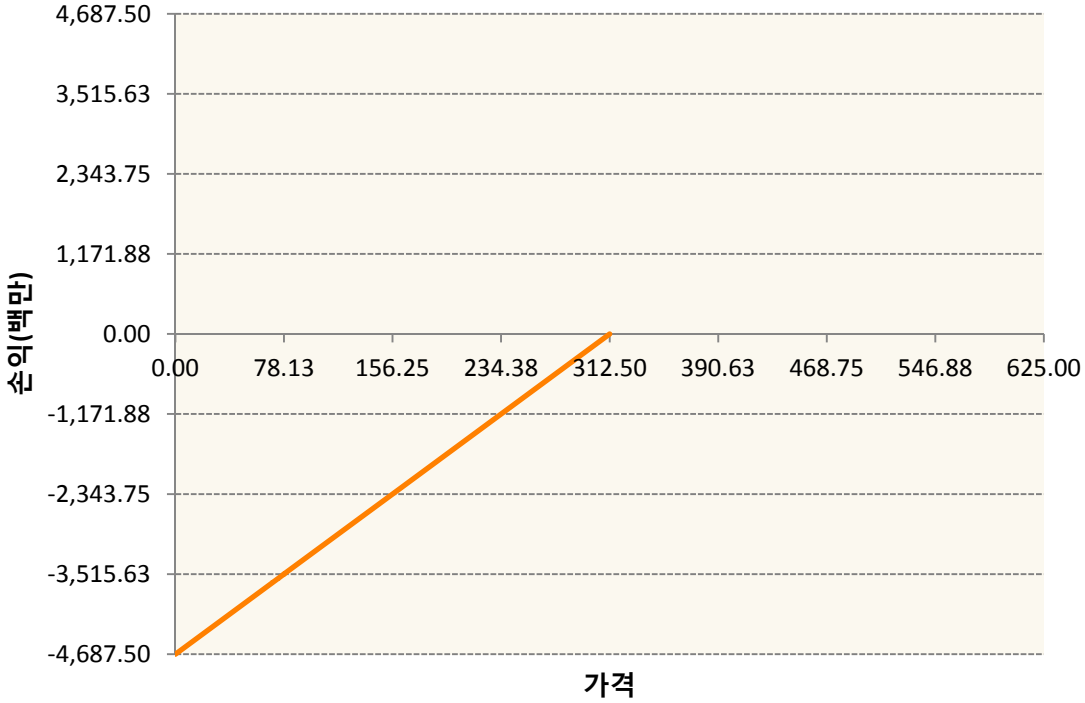
2. 만기시점의 손익구조



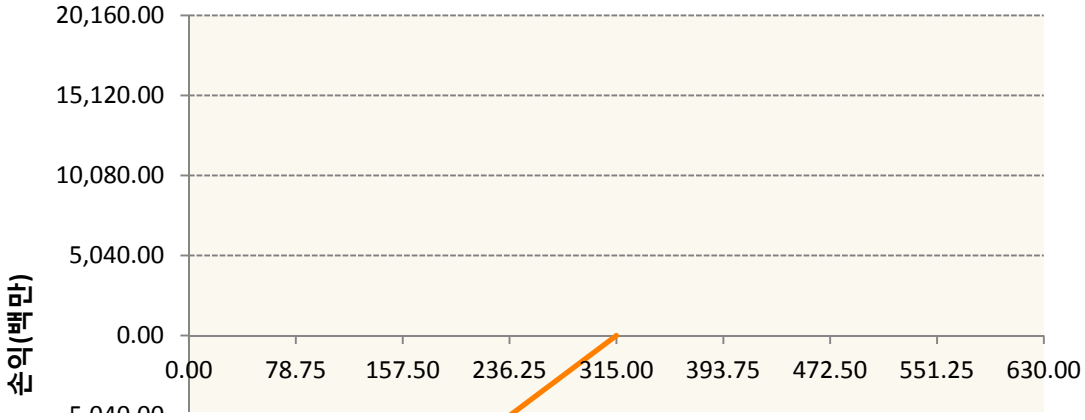




KR4301N43126-2018-04 풋312.5



KR4301N43159-2018-04 풋315





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_2							1,452
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,452	-1,452	-1,452	-1,452	-1,452	-1,452	-1,452
-5.33%	-968	-968	-968	-968	-968	-968	-968
-2.67%	-484	-484	-484	-484	-484	-484	-484
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	484	484	484	484	484	484	484
5.33%	968	968	968	968	968	968	968
8.00%	1,452	1,452	1,452	1,452	1,452	1,452	1,452
2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_3							275
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-275	-275	-275	-275	-275	-275	-275
-5.33%	-183	-183	-183	-183	-183	-183	-183
-2.67%	-92	-92	-92	-92	-92	-92	-92
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	92	92	92	92	92	92	92
5.33%	183	183	183	183	183	183	183
8.00%	275	275	275	275	275	275	275
2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_5							235
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-235	-235	-235	-235	-235	-235	-235
-5.33%	-157	-157	-157	-157	-157	-157	-157
-2.67%	-78	-78	-78	-78	-78	-78	-78
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	78	78	78	78	78	78	78
5.33%	157	157	157	157	157	157	157
8.00%	235	235	235	235	235	235	235
2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_6							196
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%

-8.00%	-196	-196	-196	-196	-196	-196	-196
-5.33%	-131	-131	-131	-131	-131	-131	-131
-2.67%	-65	-65	-65	-65	-65	-65	-65
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	65	65	65	65	65	65	65
5.33%	131	131	131	131	131	131	131
8.00%	196	196	196	196	196	196	196
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_7						251
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-251	-251	-251	-251	-251	-251	-251
-5.33%	-167	-167	-167	-167	-167	-167	-167
-2.67%	-84	-84	-84	-84	-84	-84	-84
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	84	84	84	84	84	84	84
5.33%	167	167	167	167	167	167	167
8.00%	251	251	251	251	251	251	251
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_8						464
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-464	-464	-464	-464	-464	-464	-464
-5.33%	-310	-310	-310	-310	-310	-310	-310
-2.67%	-155	-155	-155	-155	-155	-155	-155
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	155	155	155	155	155	155	155
5.33%	310	310	310	310	310	310	310
8.00%	464	464	464	464	464	464	464
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_10						275
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-275	-275	-275	-275	-275	-275	-275
-5.33%	-183	-183	-183	-183	-183	-183	-183
-2.67%	-92	-92	-92	-92	-92	-92	-92
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	92	92	92	92	92	92	92
5.33%	183	183	183	183	183	183	183
8.00%	275	275	275	275	275	275	275
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_11						628
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-628	-628	-628	-628	-628	-628	-628
-5.33%	-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						842
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-842	-842	-842	-842	-842	-842	-842
-5.33%	-561	-561	-561	-561	-561	-561	-561
-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%	561	561	561	561	561	561	561
8.00%	842	842	842	842	842	842	842
	KR4201N431 2018-04 콜315						1,788
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	570	562	551	536	518	497	472
-5.33%	536	514	488	457	424	387	349
-2.67%	428	385	339	291	241	190	139
0%	177	118	59	0	-59	-119	-179
2.67%	-259	-317	-375	-434	-492	-552	-611
5.33%	-869	-910	-955	-1,002	-1,051	-1,101	-1,153
8.00%	-1,595	-1,617	-1,644	-1,675	-1,710	-1,748	-1,788
	KR4301N431 2018-04 풋312.5						306
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-302	-302	-302	-303	-304	-305	-306
-5.33%	-179	-180	-182	-184	-187	-190	-193
-2.67%	-66	-70	-75	-79	-84	-90	-95
0%	19	13	6	0	-6	-13	-19
2.67%	64	59	54	48	43	37	31
5.33%	79	77	74	71	68	64	60
8.00%	82	81	81	79	78	76	74
	KR4301N431 2018-04 풋315						1,370

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,357	-1,357	-1,358	-1,360	-1,362	-1,366	-1,370
-5.33%	-829	-832	-838	-845	-853	-863	-875
-2.67%	-327	-342	-358	-375	-394	-414	-434
0%	79	53	27	0	-27	-54	-81
2.67%	321	297	272	246	220	194	167
5.33%	416	403	389	372	355	336	316
8.00%	438	434	429	422	414	404	392

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

8,423

공시일	2018-03-29
기준일	2018-03-28

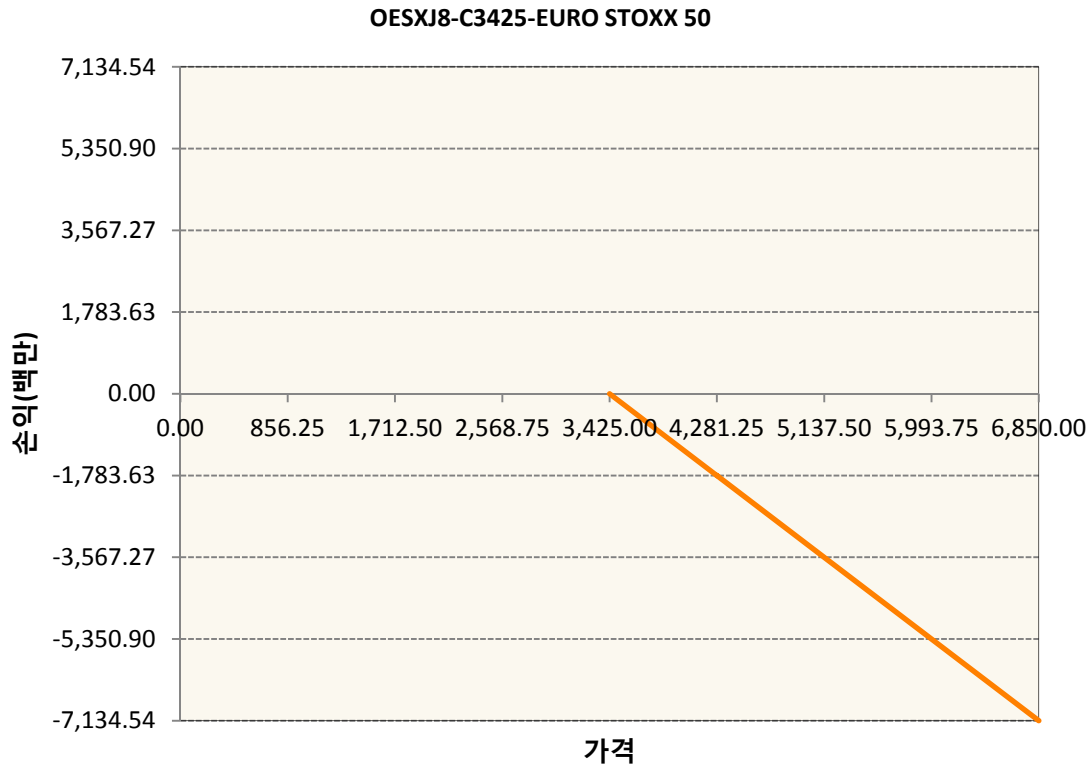
유로커버드콜모(주식혼합-파생형

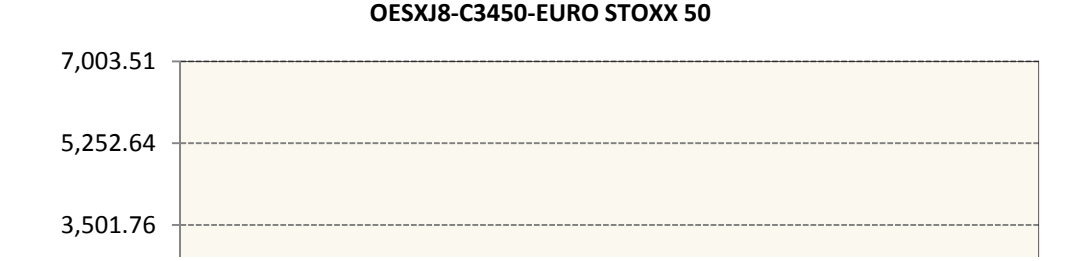
1. 계약금액

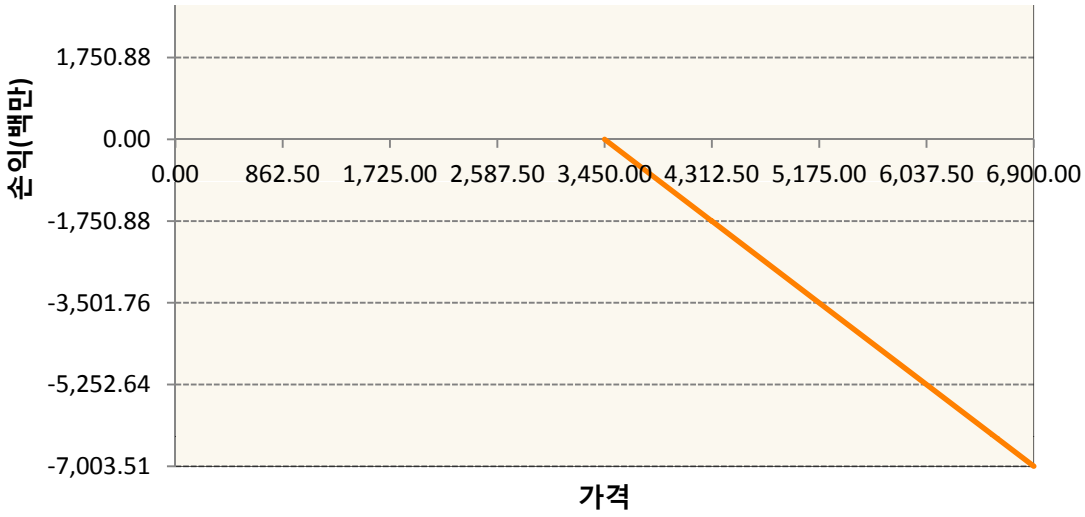
(단위:백만원)

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	5,348	0	5,348	
누계	유가증권	스왑	99,508	0	99,508	장외
누계	유가증권	옵션	0	28,276	-28,276	장내
누계	지수	스왑	53,072	0	53,072	장외

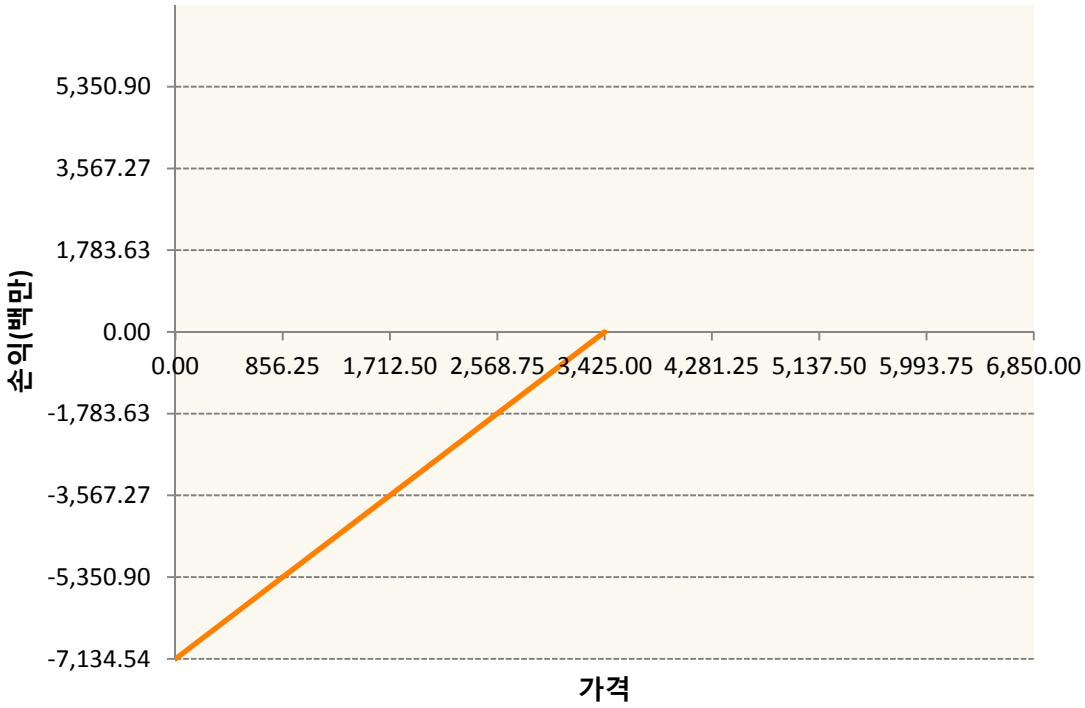
2. 만기시점의 손익구조



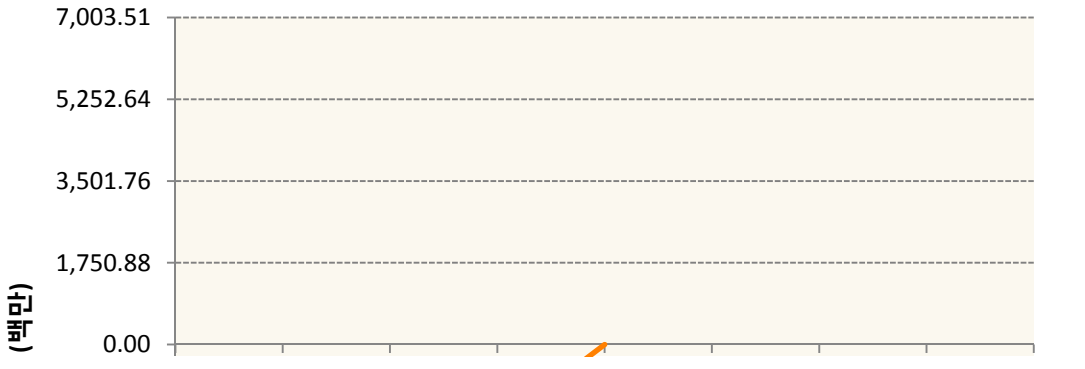


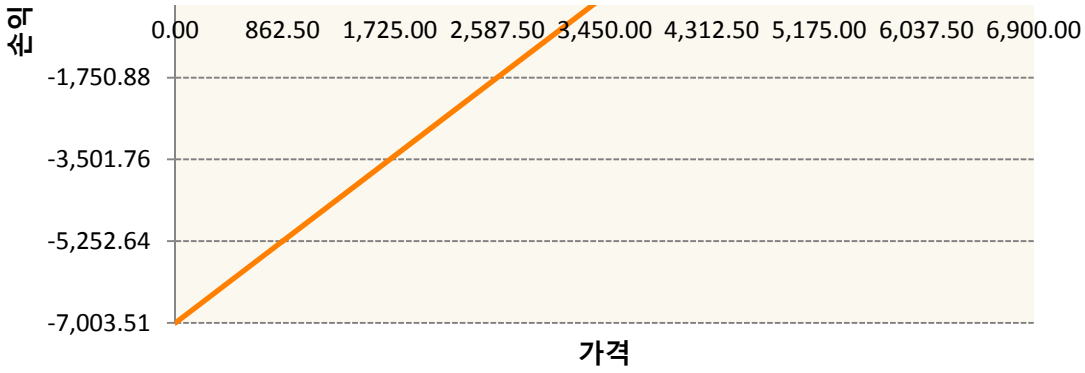


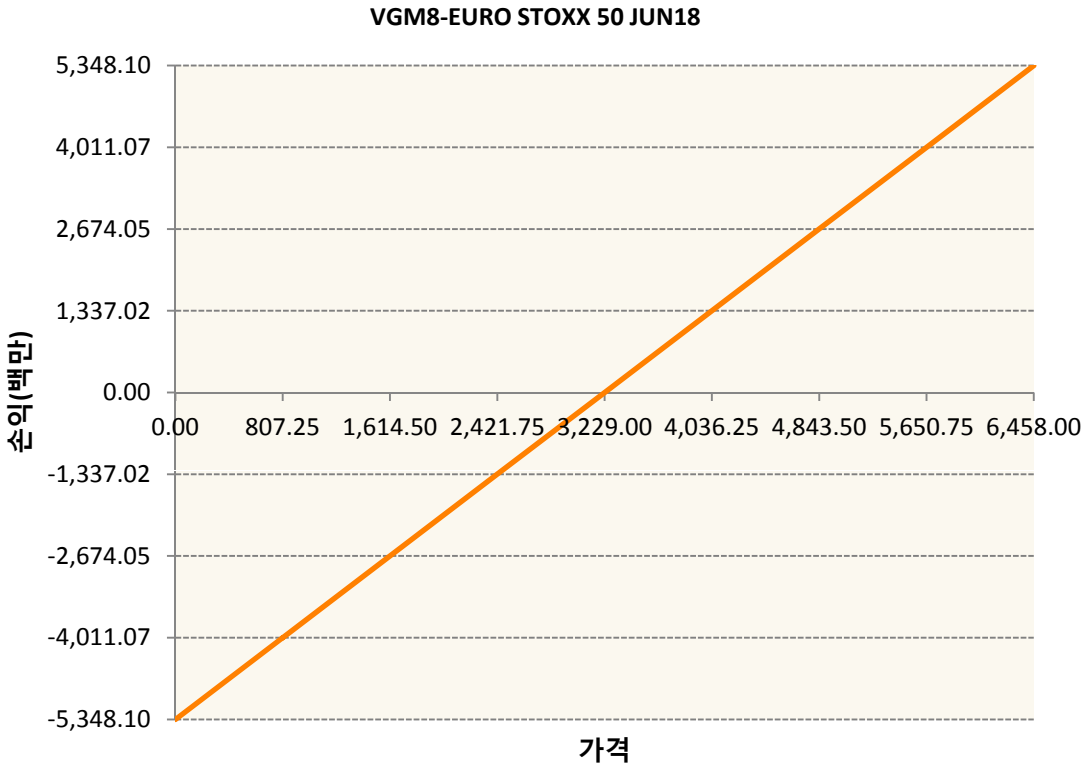
OESXJ8-P3425-EURO STOXX 50



OESXJ8-P3450-EURO STOXX 50







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
260105SGPX	SG EURO Covered CALL STRATEGY - 994.569	300
260105SQPX	SG EURO Covered CALL STRATEGY	562
OESXJ8-C34	EURO STOXX 50	571
OESXJ8-C34	EURO STOXX 50	560
OESXJ8-P34	EURO STOXX 50	571
OESXJ8-P34	EURO STOXX 50	560
VGM8	EURO STOXX 50 JUN18	428

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

2,267

공시일	2018-03-29
기준일	2018-03-28

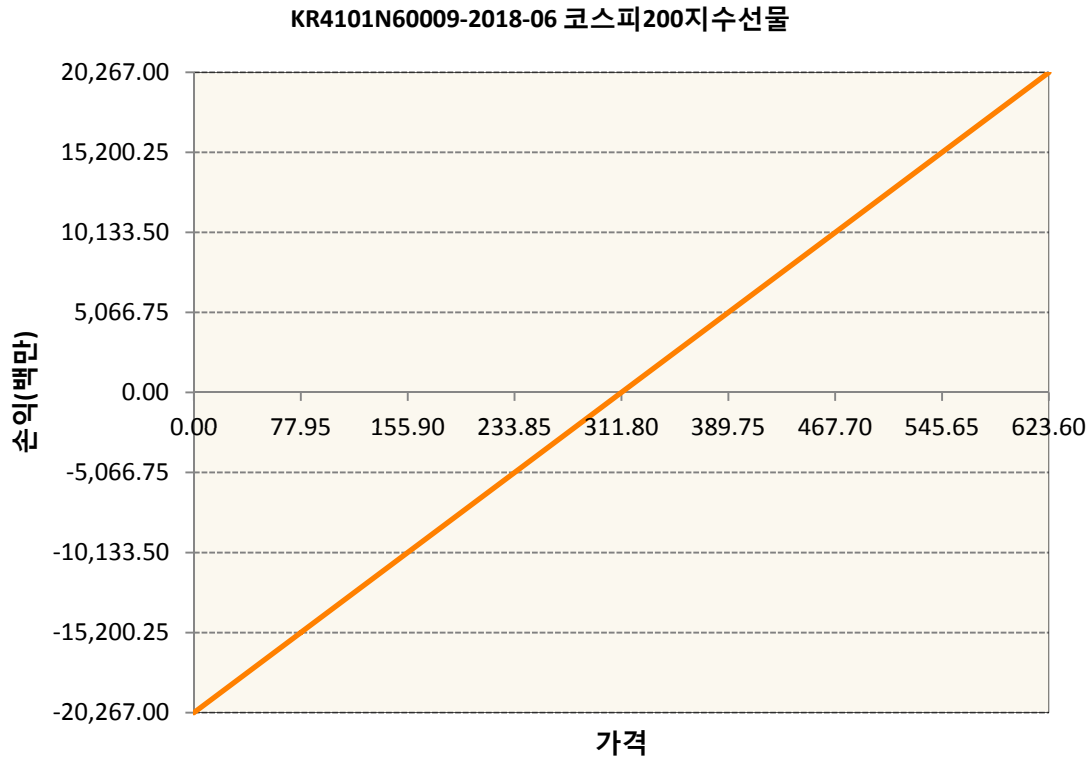
ETF스마트레버리지목표전환형8호

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	20,267	0	20,267	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101N60(2018-06 코스피200지수선물							1,621
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,621	-1,621	-1,621	-1,621	-1,621	-1,621	-1,621
-5.33%	-1,081	-1,081	-1,081	-1,081	-1,081	-1,081	-1,081
-2.67%	-540	-540	-540	-540	-540	-540	-540
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	540	540	540	540	540	540	540
5.33%	1,081	1,081	1,081	1,081	1,081	1,081	1,081
8.00%	1,621	1,621	1,621	1,621	1,621	1,621	1,621

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

1,171

공시일	2018-03-29
기준일	2018-03-28

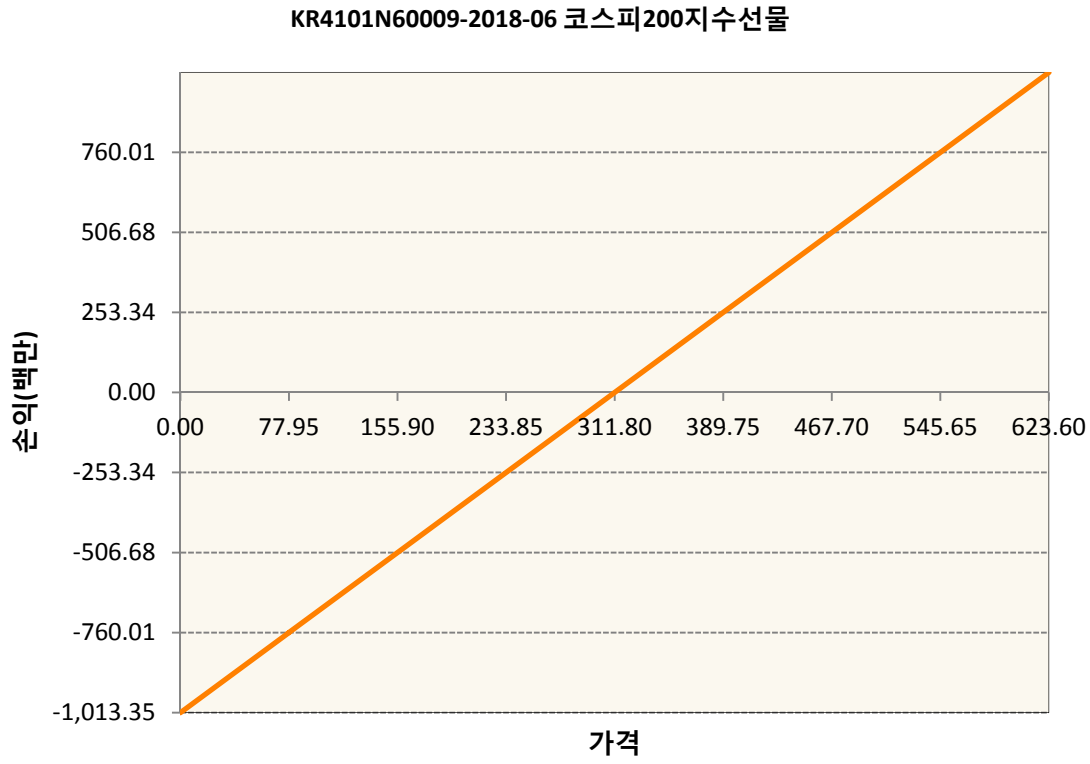
ETF스마트레버리지목표전환형9호

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	1,013	0	1,013	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)

59

공시일	2018-03-29
기준일	2018-03-28

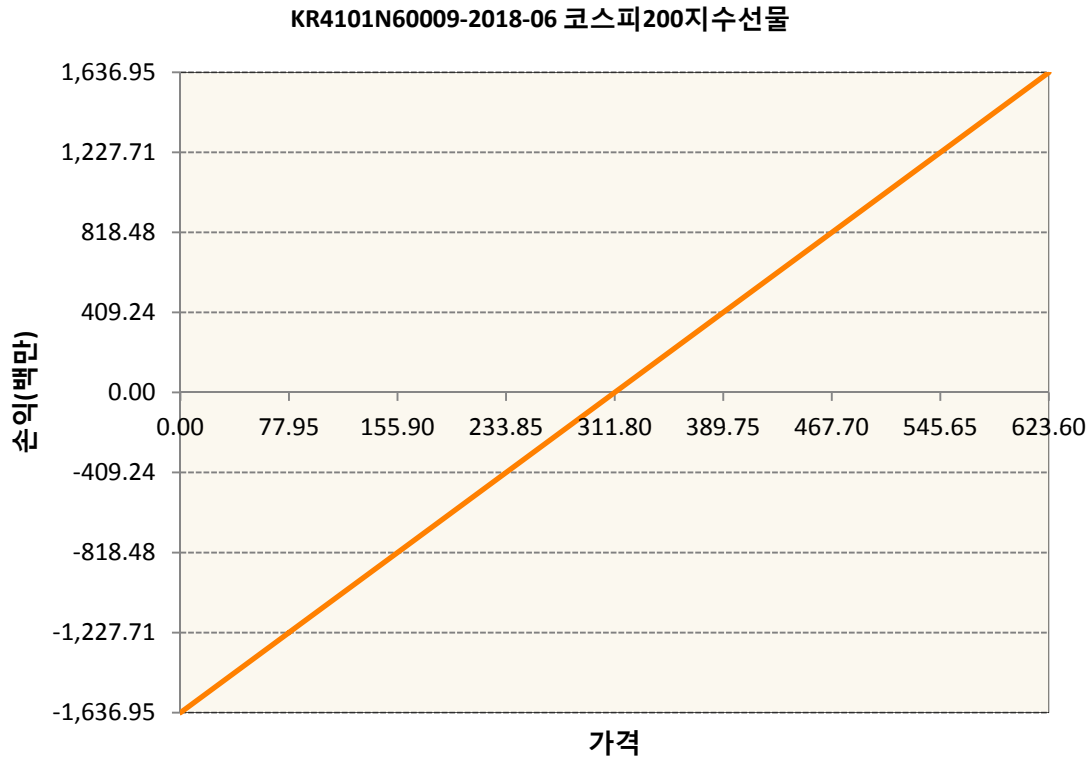
ETF스마트레버리지목표전환형10

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	1,637	0	1,637	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)

95

공시일	2018-03-29
기준일	2018-03-28

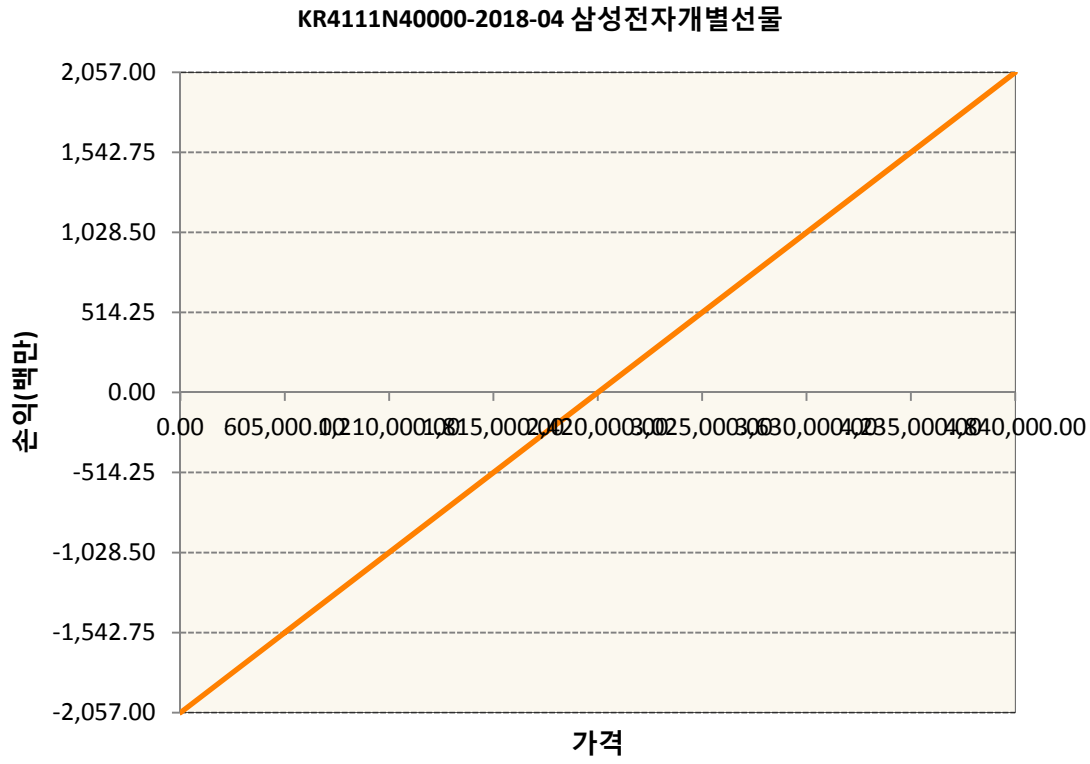
스마트KRX300인덱스1호(주식-파

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	2,057	0	2,057	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4111N40(2018-04 삼성전자개별선물							166
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-166	-166	-166	-166	-166	-166	-166
-5.33%	-110	-110	-110	-110	-110	-110	-110
-2.67%	-55	-55	-55	-55	-55	-55	-55
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	55	55	55	55	55	55	55
5.33%	110	110	110	110	110	110	110
8.00%	166	166	166	166	166	166	166

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

201

공시일	2018-03-29
기준일	2018-03-28

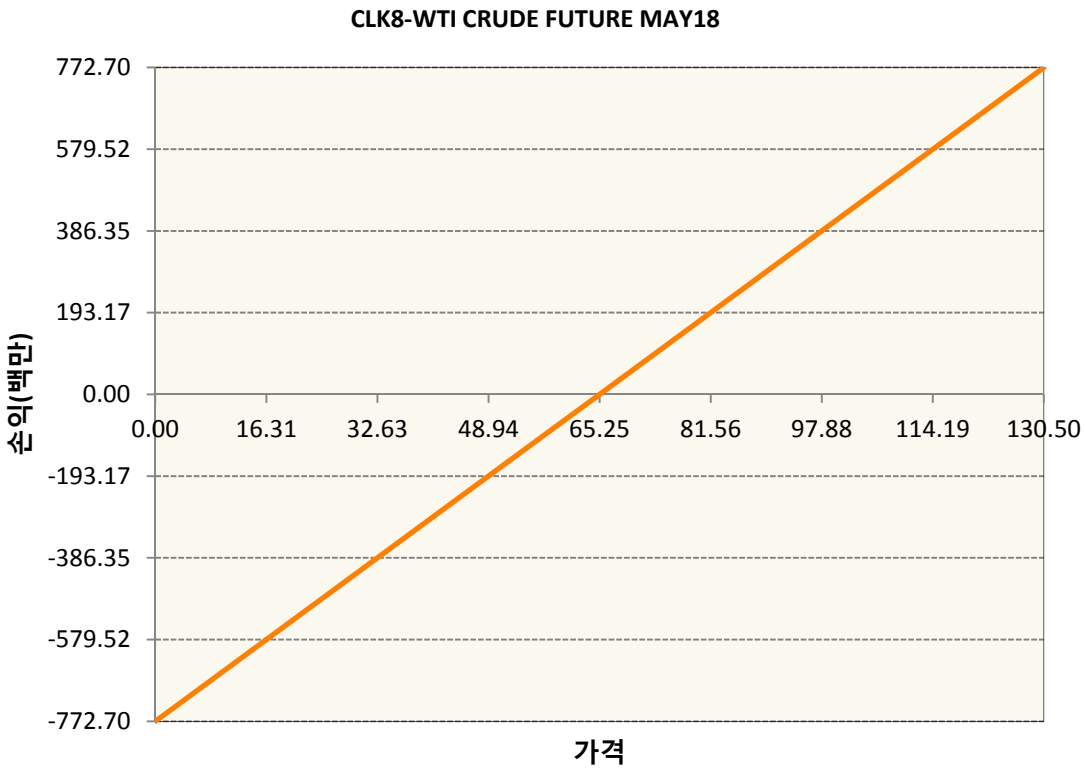
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

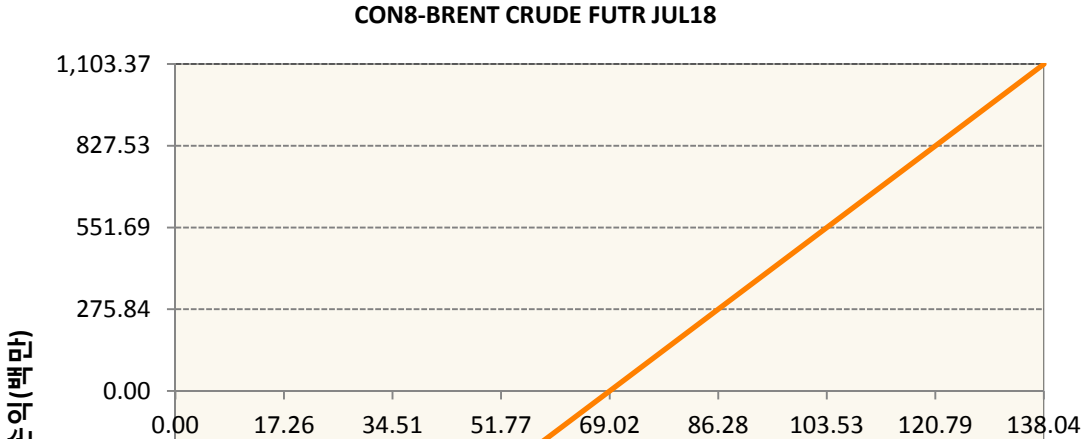
1. 계약금액

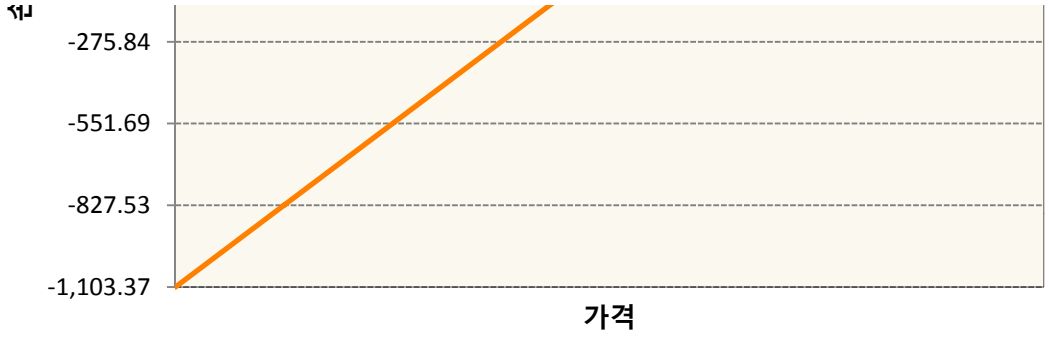
(단위:백만원)

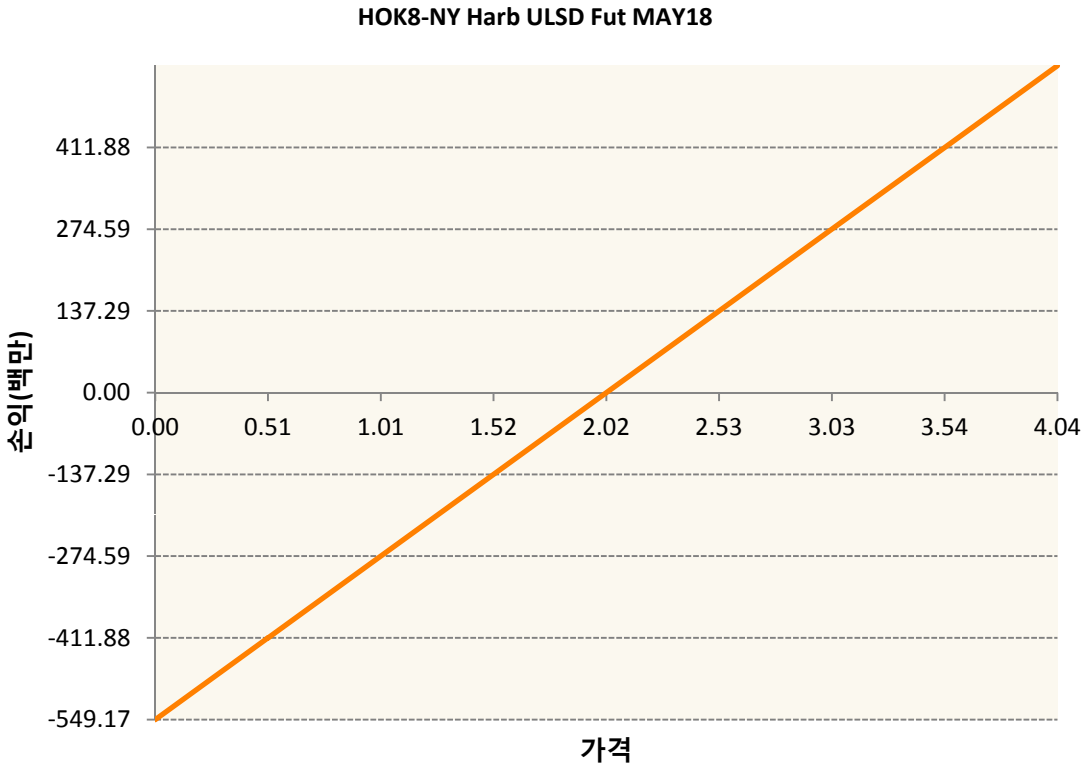
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	선물	유가증권	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	선물	유가증권	773	0	773	
누계	유가증권	선물	3,345	589	2,756	

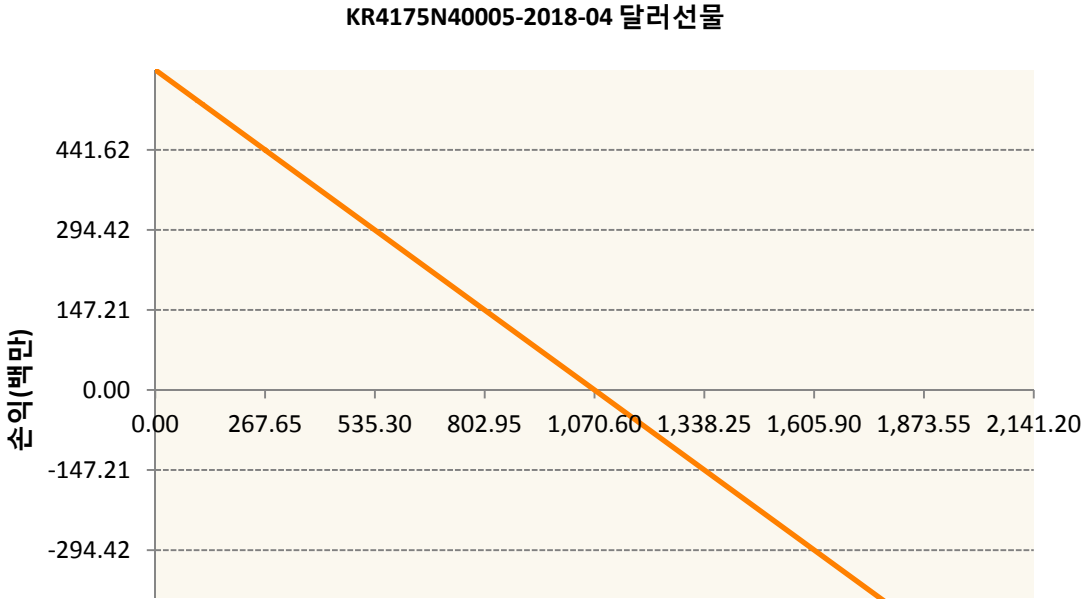
2. 만기시점의 손익구조

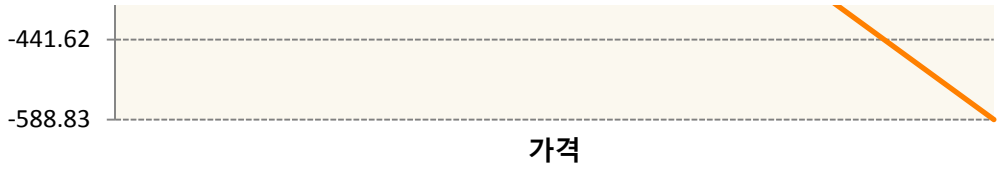




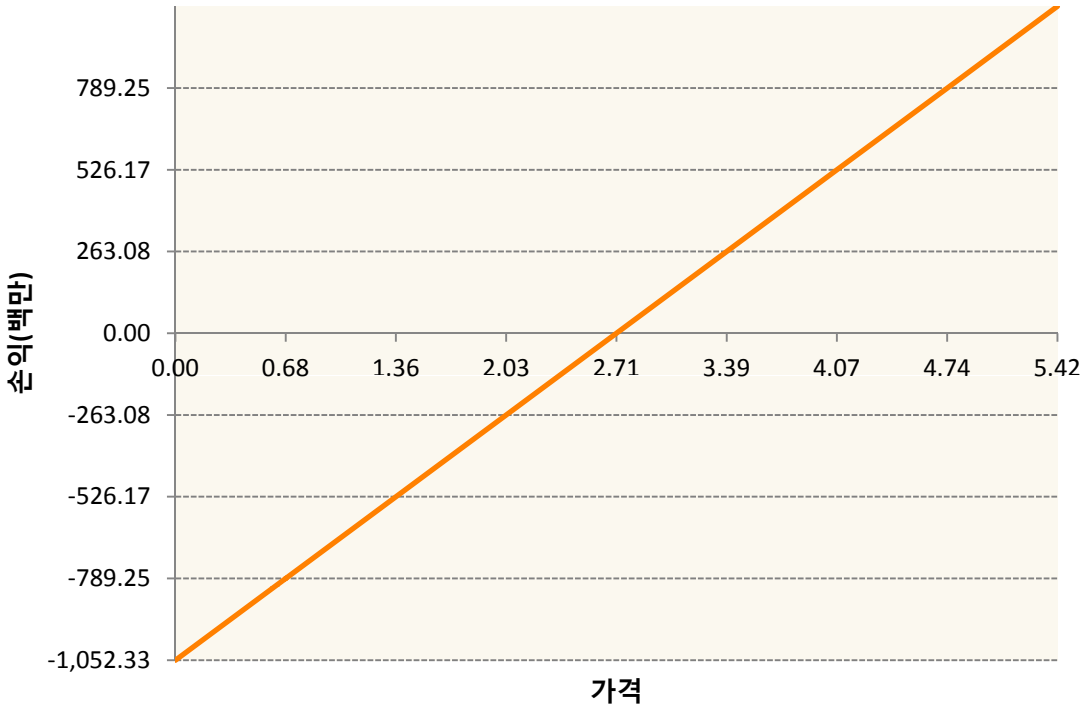

-275.84
-551.69
-827.53
-1,103.37
가격


HOK8-NY Harb ULSD Fut MAY18
411.88
274.59
137.29
0.00
-137.29
-274.59
-411.88
-549.17
0.00
0.51
1.01
1.52
2.02
2.53
3.03
3.54
4.04
손익(백만)
가격

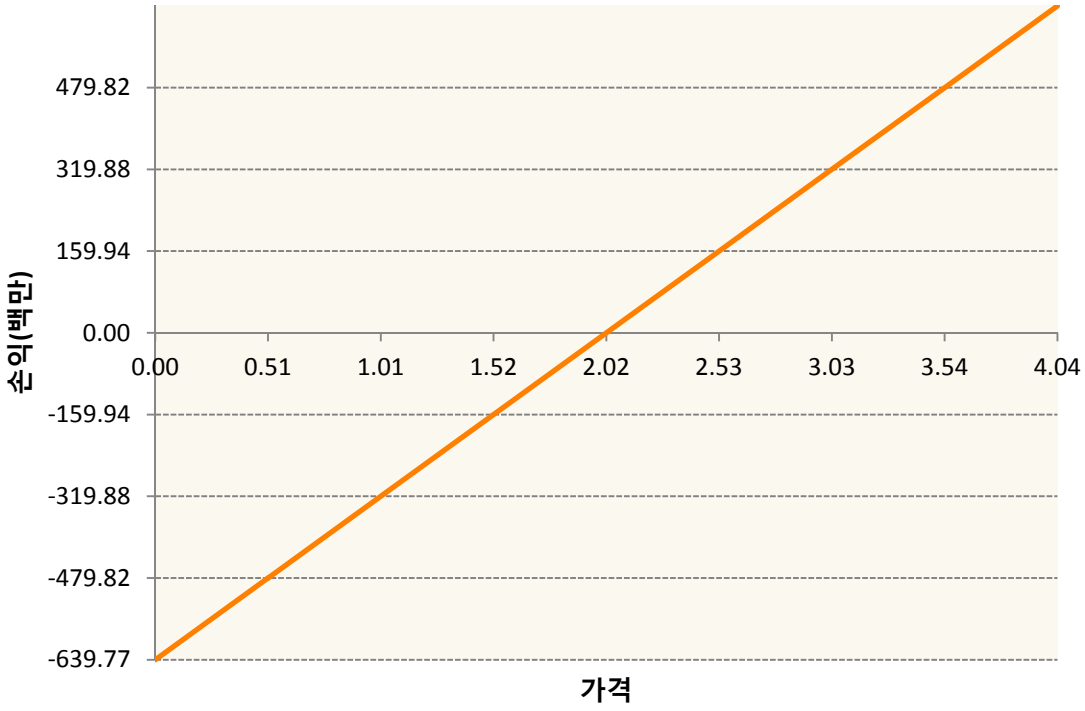

KR4175N40005-2018-04 달러선물
441.62
294.42
147.21
0.00
-147.21
-294.42
0.00
267.65
535.30
802.95
1,070.60
1,338.25
1,605.90
1,873.55
2,141.20
손익(백만)



NGK8-NATURAL GAS FUTR MAY18



XBK8-GASOLINE RBOB FUT MAY18



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	84
XBK8	GASOLINE RBOB FUT MAY18	51

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

534

공시일	2018-03-29
기준일	2018-03-28

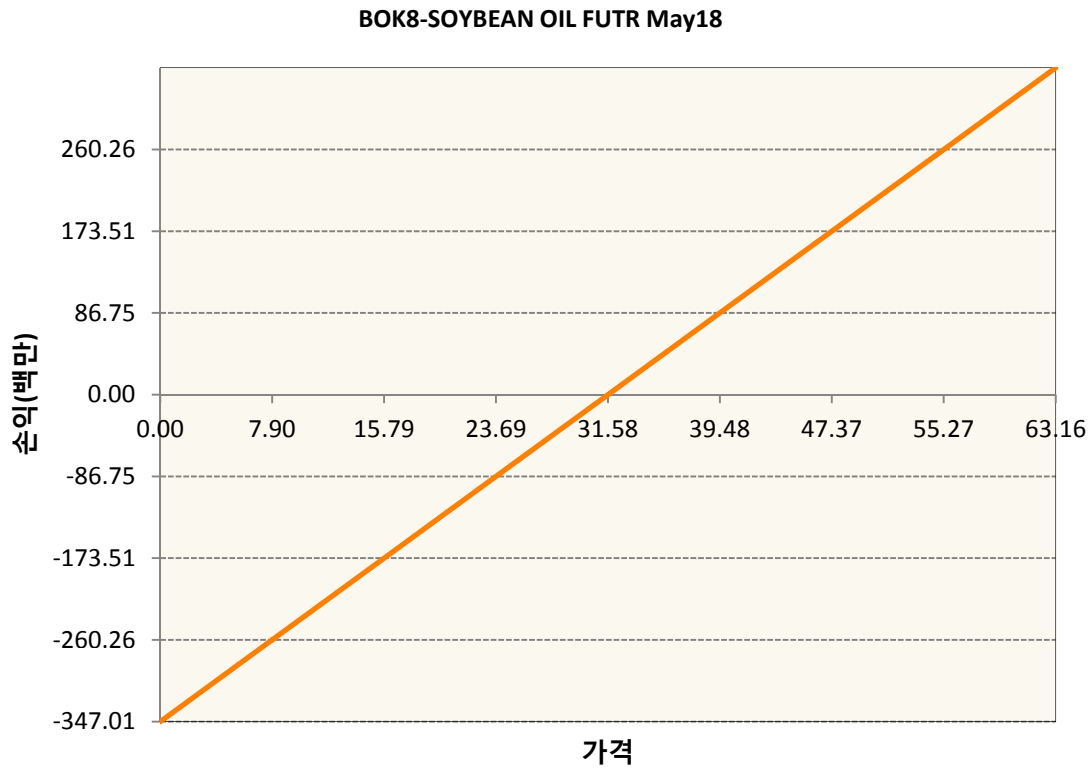
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

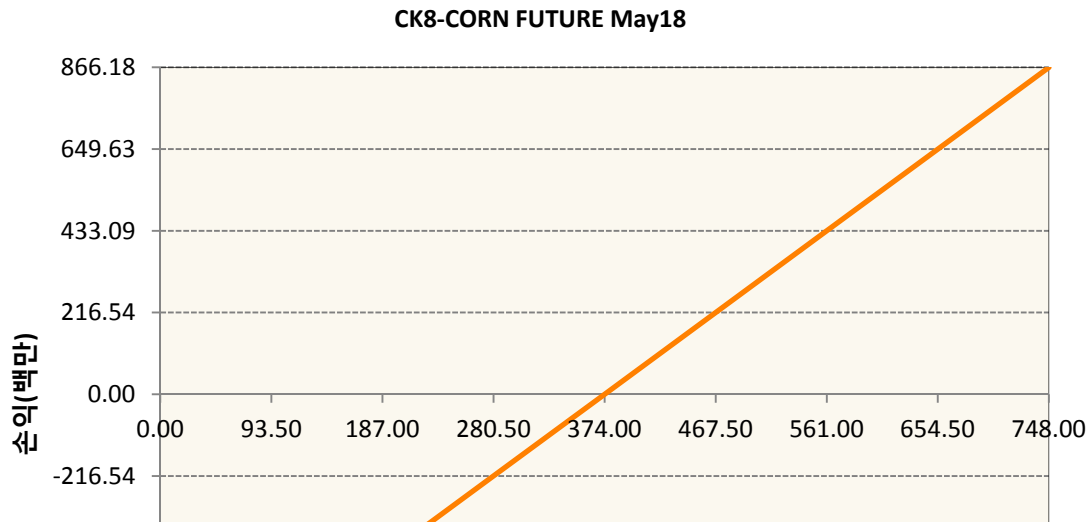
1. 계약금액

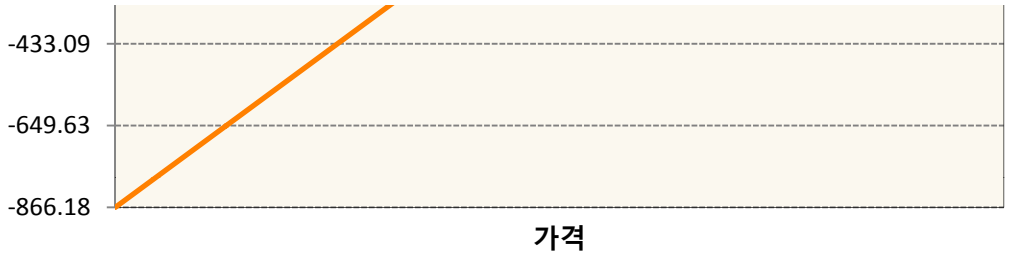
(단위:백만원)

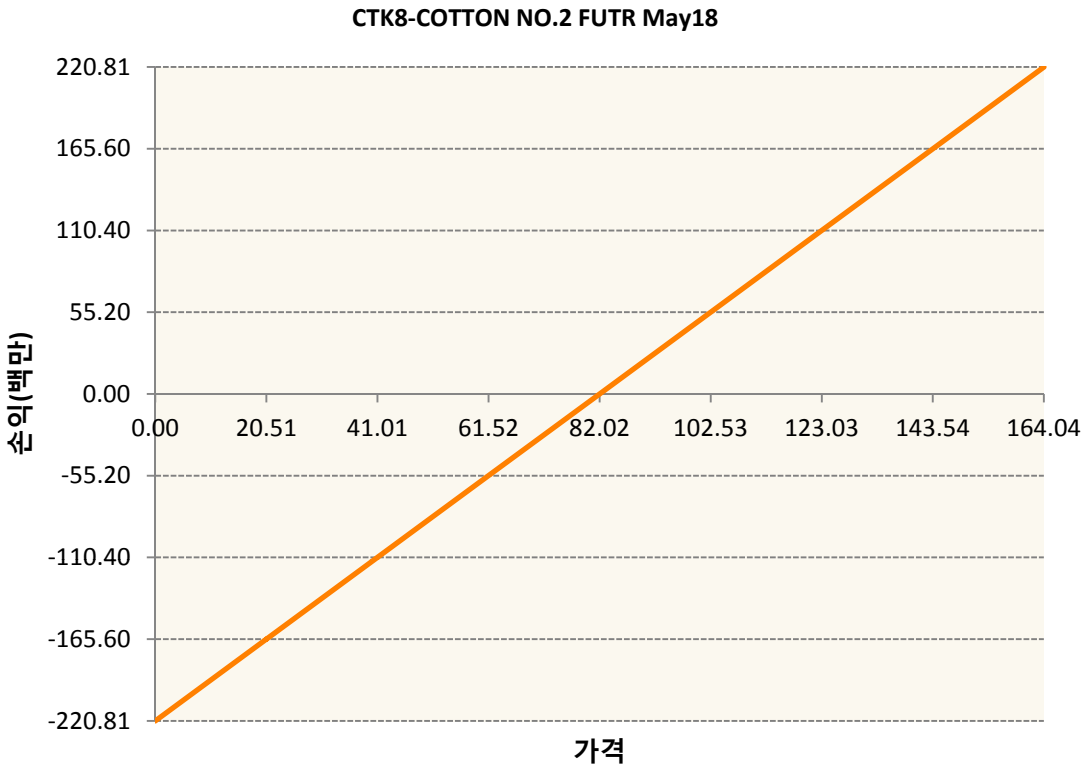
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	4,049	321	3,728	

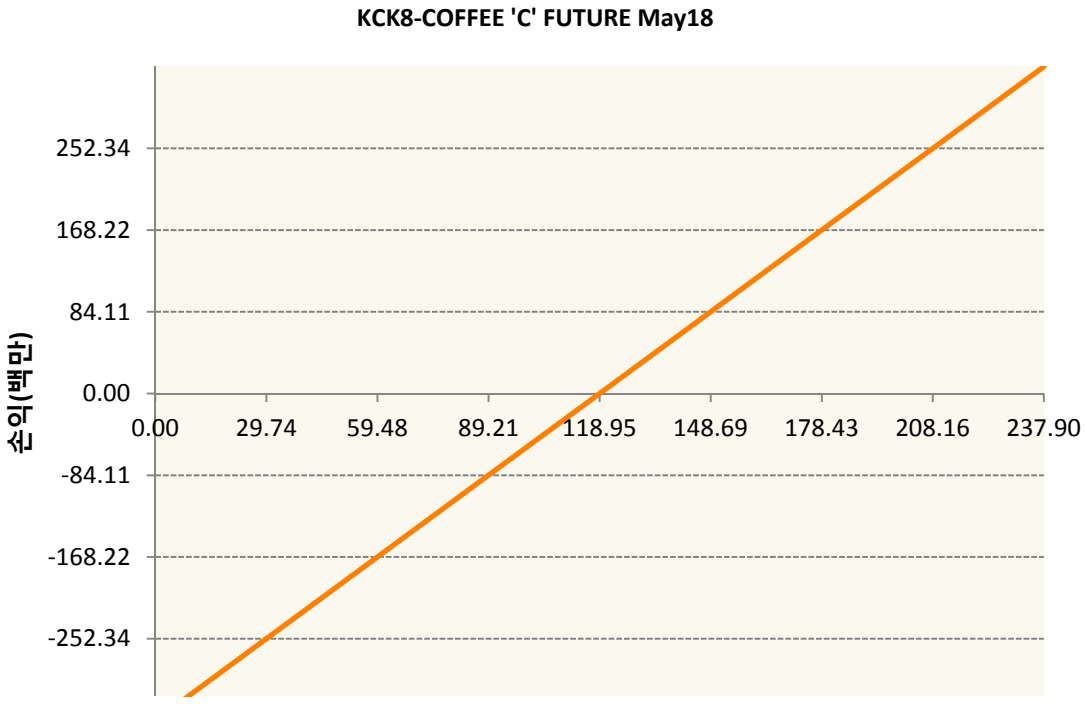
2. 만기시점의 손익구조

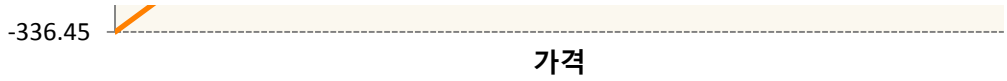


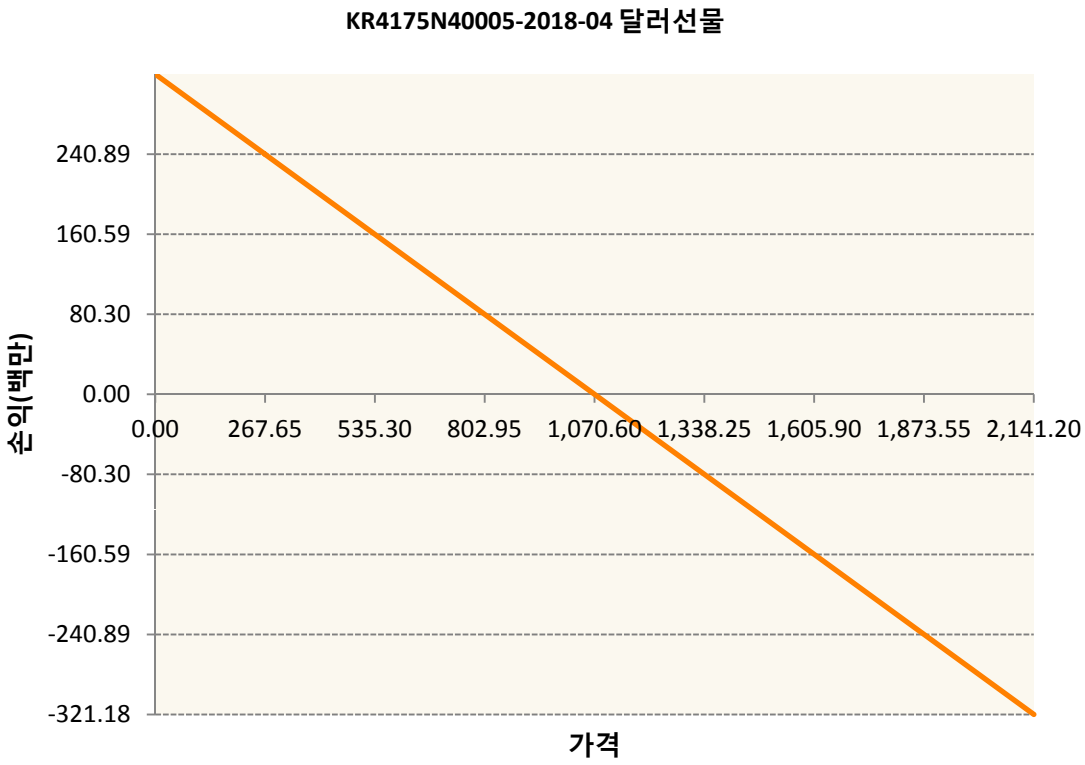


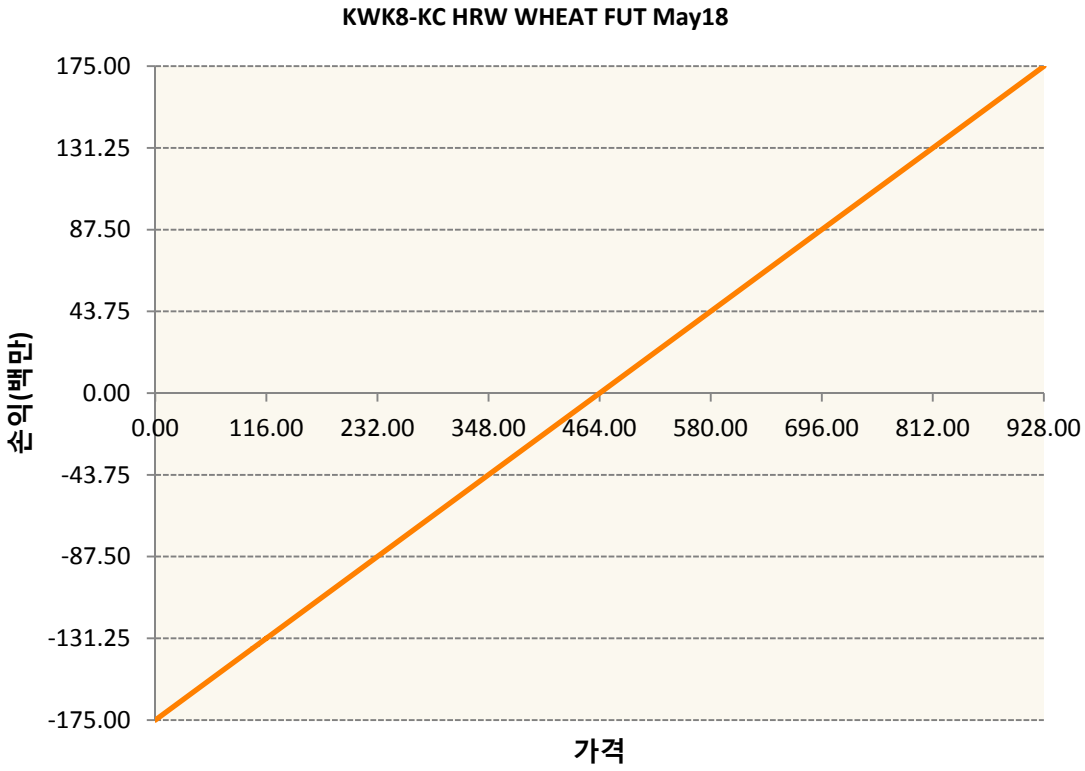

-433.09
-649.63
-866.18
가격

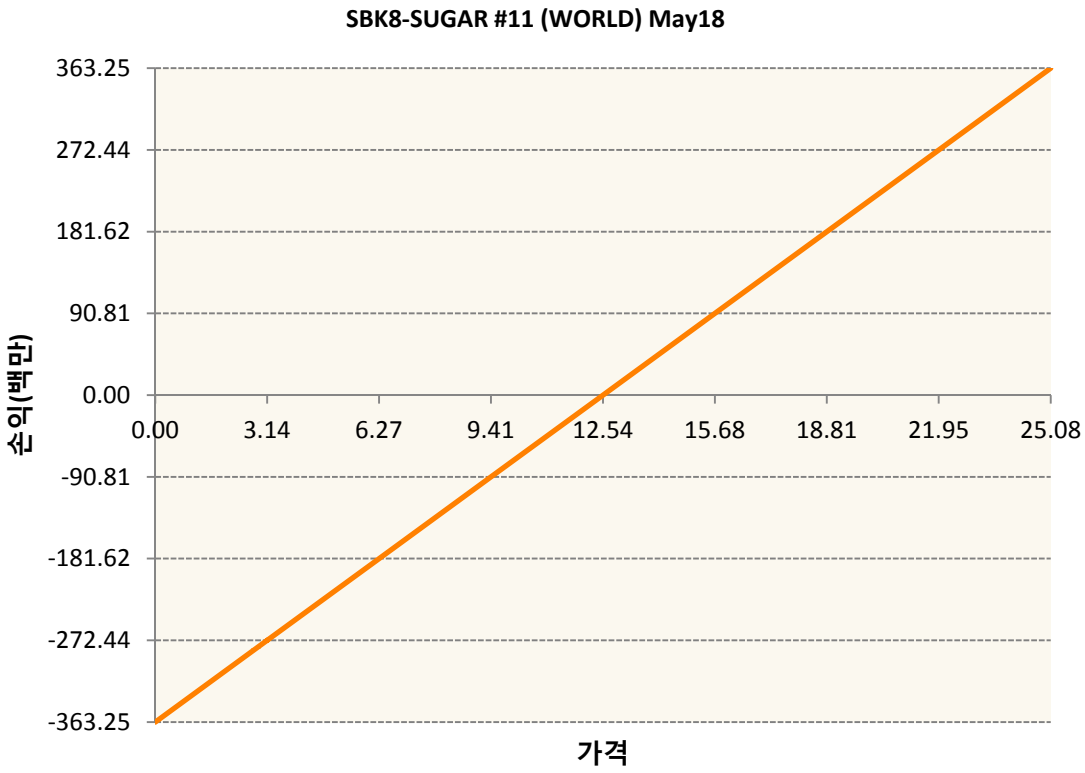

CTK8-COTTON NO.2 FUTR May18
220.81
165.60
110.40
55.20
0.00
-55.20
-110.40
-165.60
-220.81
0.00
20.51
41.01
61.52
82.02
102.53
123.03
143.54
164.04
손익(백만)
가격

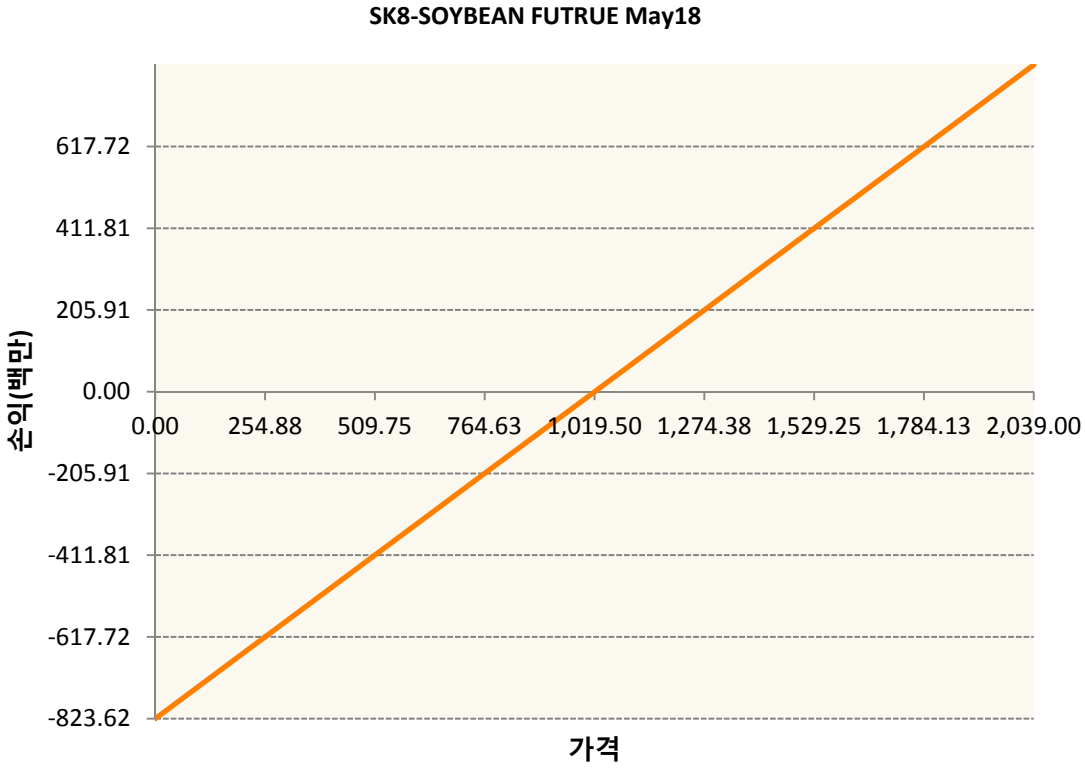

KCK8-COFFEE 'C' FUTURE May18
252.34
168.22
84.11
0.00
-84.11
-168.22
-252.34
0.00
29.74
59.48
89.21
118.95
148.69
178.43
208.16
237.90
손익(백만)


-336.45
가격

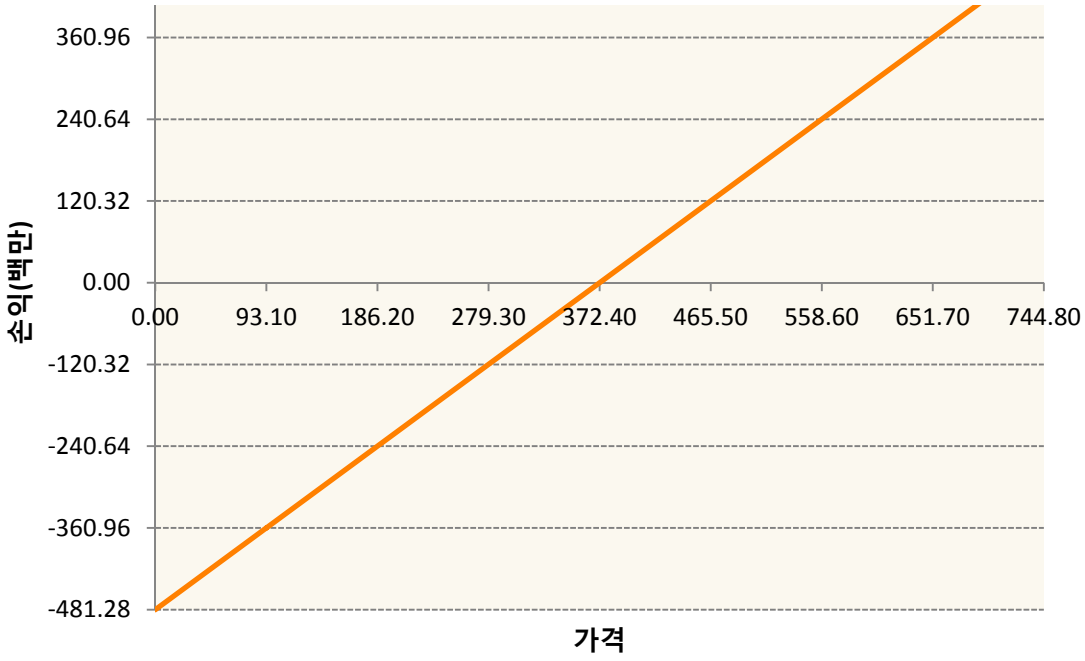

KR4175N40005-2018-04 달러선물
240.89
160.59
80.30
0.00
-80.30
-160.59
-240.89
-321.18
0.00
267.65
535.30
802.95
1,070.60
1,338.25
1,605.90
1,873.55
2,141.20
손익(백만)
가격

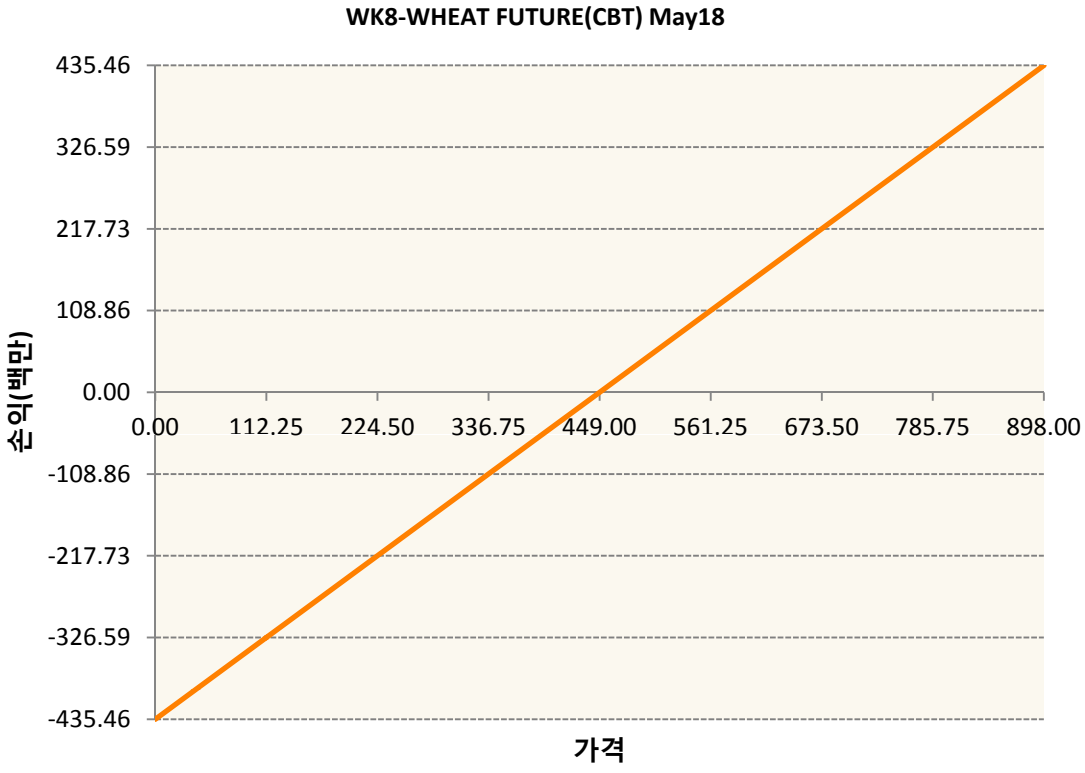

KWK8-KC HRW WHEAT FUT May18
175.00
131.25
87.50
43.75
0.00
-43.75
-87.50
-131.25
-175.00
0.00
116.00
232.00
348.00
464.00
580.00
696.00
812.00
928.00
손익(백만)
가격


SBK8-SUGAR #11 (WORLD) May18
363.25
272.44
181.62
90.81
0.00
-90.81
-181.62
-272.44
-363.25
0.00
3.14
6.27
9.41
12.54
15.68
18.81
21.95
25.08
손익(백만)
가격


SK8-SOYBEAN FUTRUE May18
617.72
411.81
205.91
0.00
-205.91
-411.81
-617.72
-823.62
0.00
254.88
509.75
764.63
1,019.50
1,274.38
1,529.25
1,784.13
2,039.00
손익(백만)
가격


SMK8-SOYBEAN MEAL FUTR 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