

공시일	2018-09-13
기준일	2018-09-12

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	6	0	6	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	2018-09-13
기준일	2018-09-12

스마트인덱스모

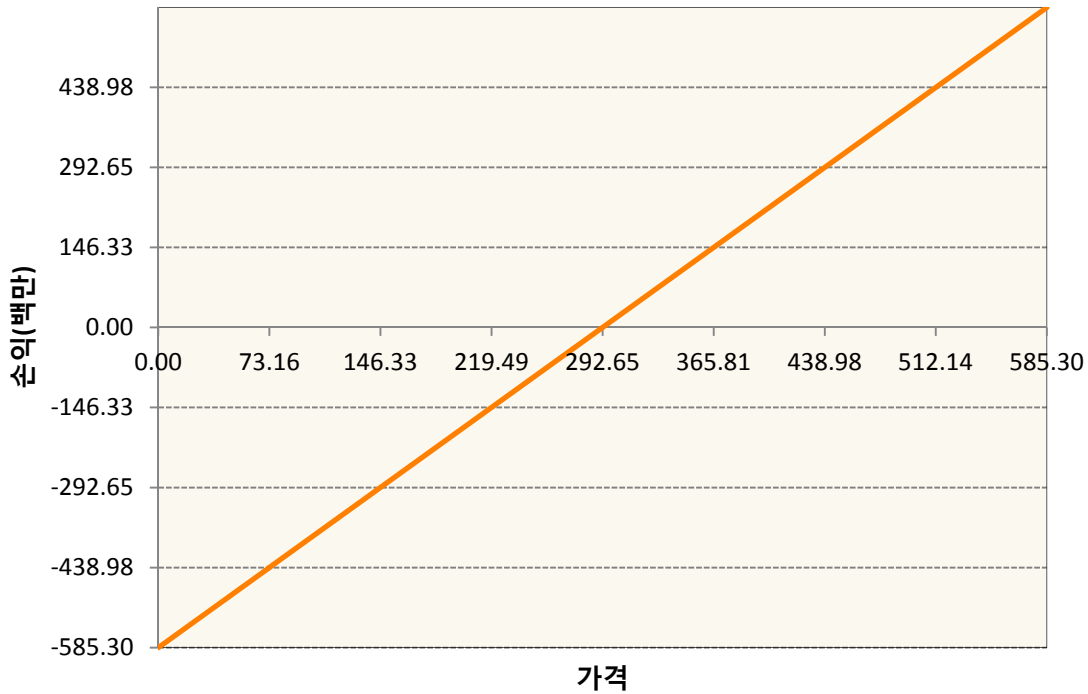
1. 계약금액

(단위:백만원)

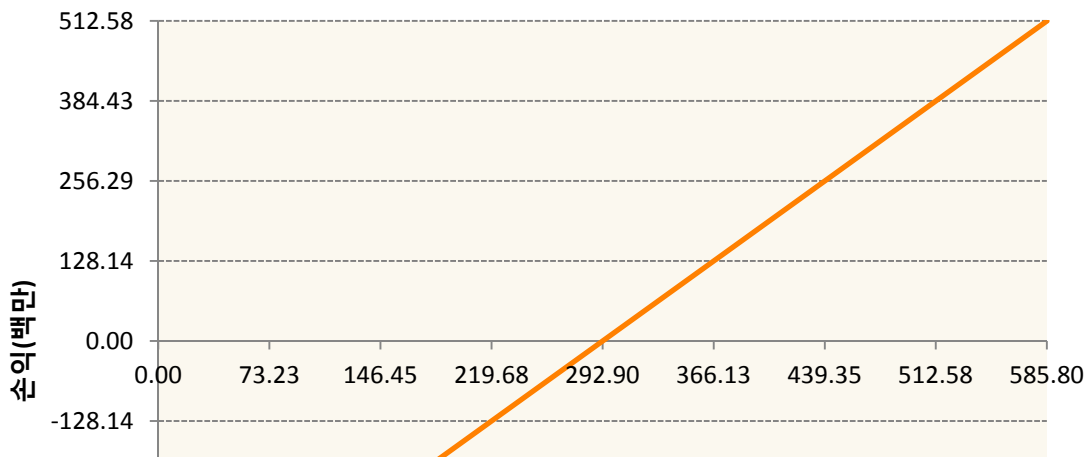
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	512	511	1	장내
누계	유가증권	선물	1,098	0	1,098	장내

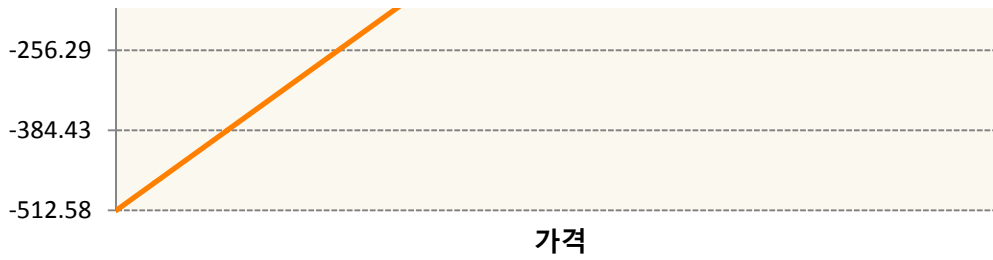
2. 만기시점의 손익구조

KR4101N90006-2018-09 코스피200지수선물



KR4101NC0004-2018-12 코스피200지수선물





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101N90(2018-09 코스피200지수선물) 47

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-47	-47	-47	-47	-47	-47	-47
-5.33%	-31	-31	-31	-31	-31	-31	-31
-2.67%	-16	-16	-16	-16	-16	-16	-16
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	16	16	16	16	16	16	16
5.33%	31	31	31	31	31	31	31
8.00%	47	47	47	47	47	47	47

KR4101NC0(2018-12 코스피200지수선물) 41

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-41	-41	-41	-41	-41	-41	-41
-5.33%	-27	-27	-27	-27	-27	-27	-27
-2.67%	-14	-14	-14	-14	-14	-14	-14
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	14	14	14	14	14	14	14
5.33%	27	27	27	27	27	27	27
8.00%	41	41	41	41	41	41	41

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

66

공시일	2018-09-13
기준일	2018-09-12

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	14,259	0	14,259	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWMXWO0(신한MXWO 미래S180822

1,140

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

482

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2018-09-13
기준일	2018-09-12

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	3,685	0	3,685	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI500000 신한CSI500미래S180910

288

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

364

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2018-09-13
기준일	2018-09-12

유로인덱스모(주식-파생형)

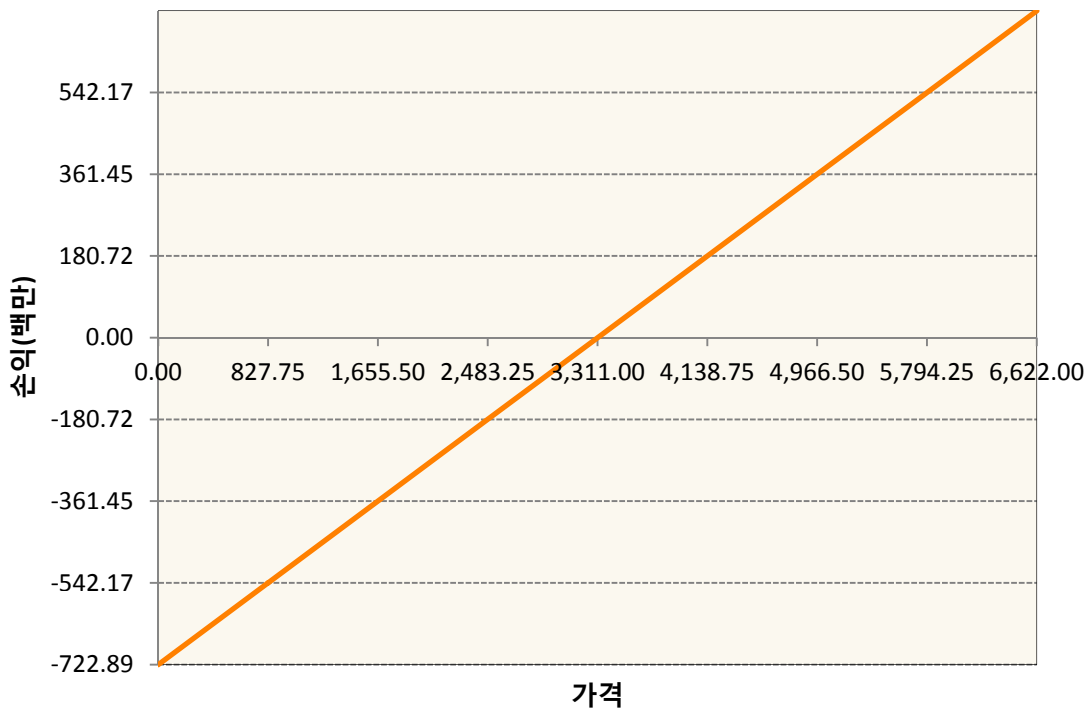
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	723	0	723	

2. 만기시점의 손익구조

VGU8-EURO STOXXX 50 SEP18



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGU8	EURO STOXXX 50 SEP18	58
------	----------------------	----

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

(단위:백만원)

36

공시일	2018-09-13
기준일	2018-09-12

차이나인덱스모(주식-파생형)

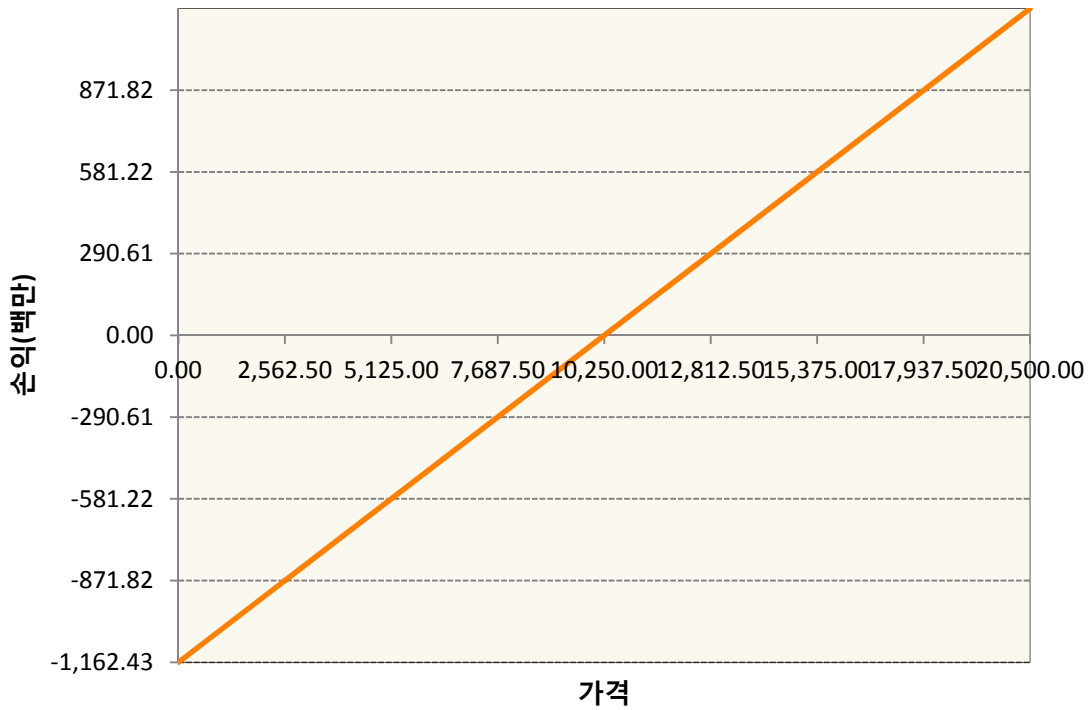
1. 계약금액

(단위:백만원)

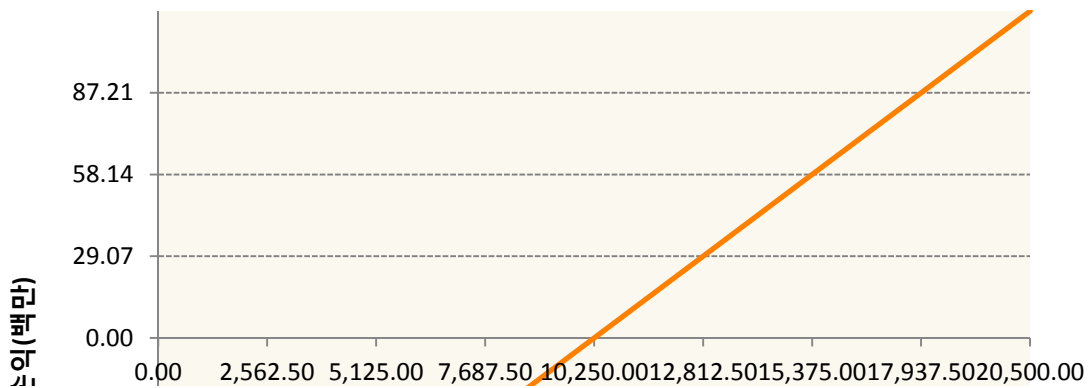
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	116	0	116	
누계	유가증권	선물	1,162	0	1,162	장내

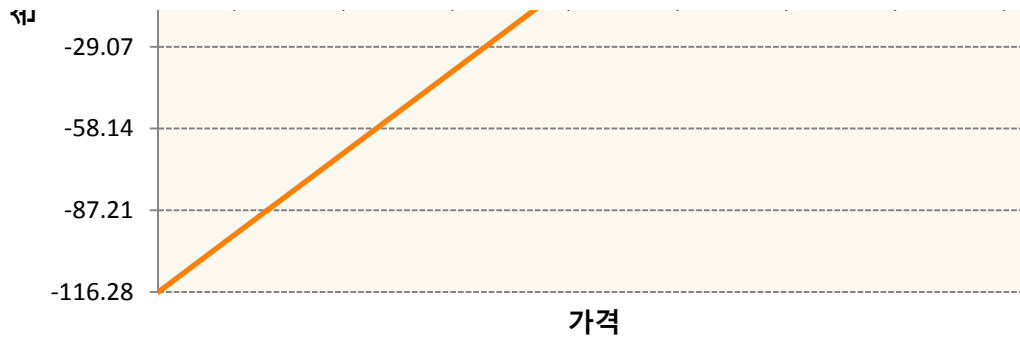
2. 만기시점의 손익구조

HCU8-H-SHARES IDX FUT Sep18



MHCU8-MINI H-SHR IDX Fut Sep18





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

HCU8	H-SHARES IDX FUT Sep18	93
MHCU8	MINI H-SHR IDX Fut Sep18	9

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

94

공시일	2018-09-13
기준일	2018-09-12

커버드콜모(주식혼합-파생형)

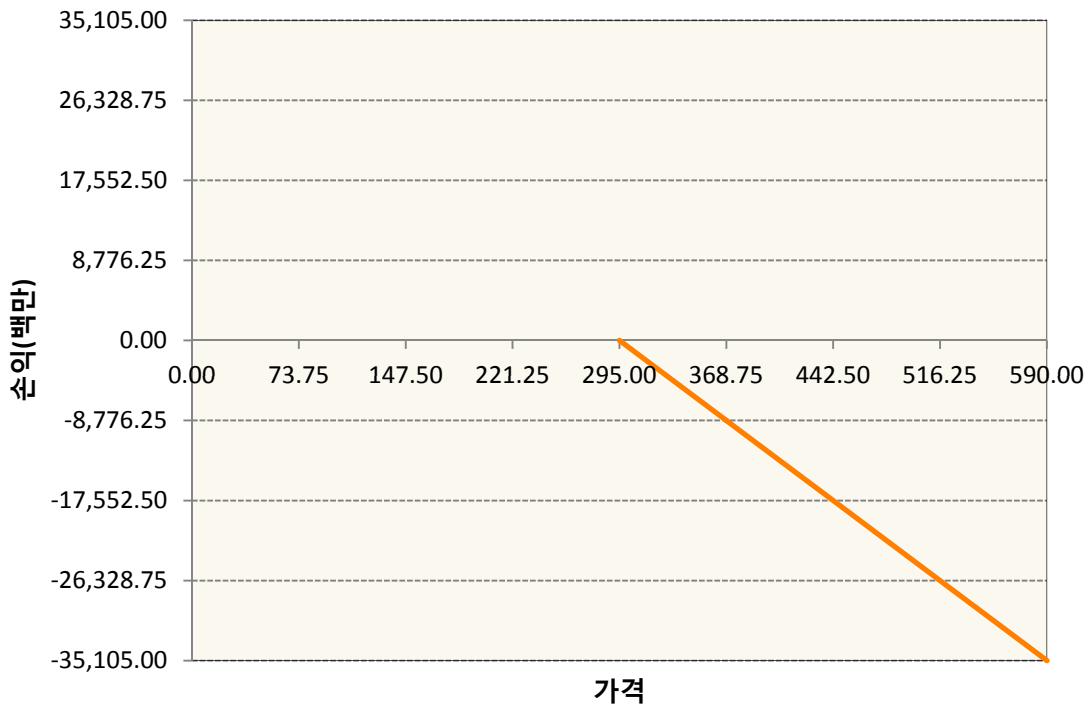
1. 계약금액

(단위:백만원)

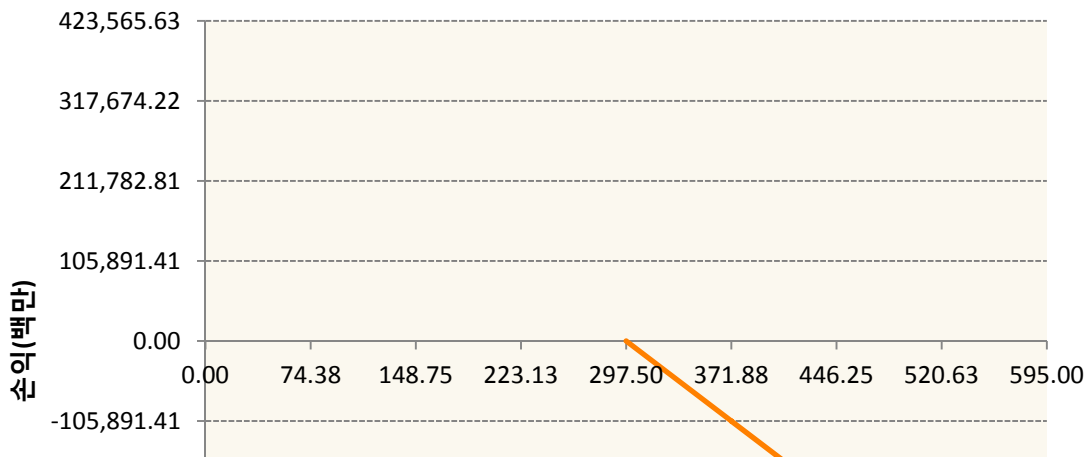
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	756,171	-756,171	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4201N92950-2018-09 콜295



KR4201N92976-2018-09 콜297.5



-5.33%	304	304	304	304	304	304	303
-2.67%	303	303	303	302	300	297	290
0%	214	156	85	0	-96	-203	-319
2.67%	-3,963	-4,108	-4,261	-4,422	-4,587	-4,758	-4,931
5.33%	-14,559	-14,560	-14,564	-14,572	-14,585	-14,603	-14,629
8.00%	-25,657	-25,657	-25,657	-25,657	-25,657	-25,657	-25,658

KR4301N929 2018-09 풋 297.5

23,385

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-23,385	-23,385	-23,385	-23,385	-23,385	-23,385	-23,385
-5.33%	-15,589	-15,589	-15,589	-15,589	-15,589	-15,589	-15,589
-2.67%	-7,794	-7,794	-7,794	-7,794	-7,794	-7,794	-7,794
0%	2	1	1	0	-2	-5	-10
2.67%	5,137	5,124	5,106	5,084	5,059	5,030	4,997
5.33%	5,155	5,155	5,155	5,155	5,155	5,155	5,155
8.00%	5,155	5,155	5,155	5,155	5,155	5,155	5,155

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

(단위:백만원)

60,738

공시일	2018-09-13
기준일	2018-09-12

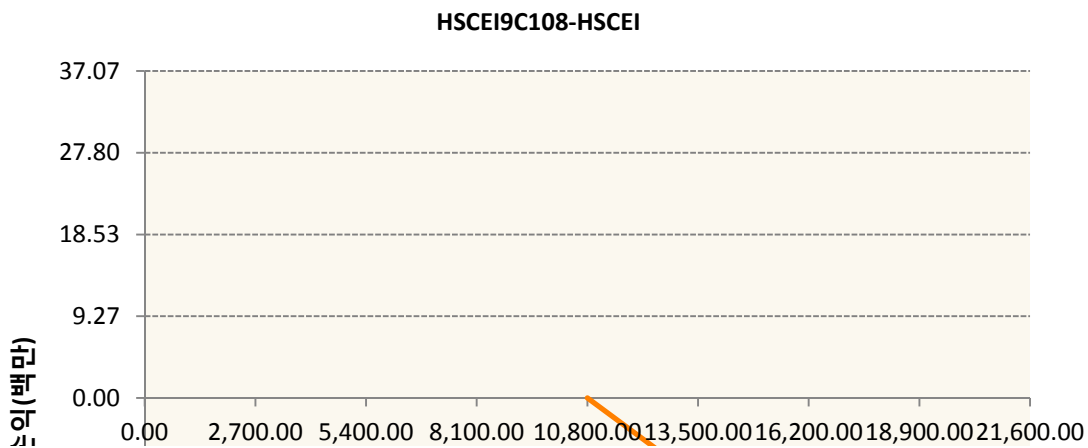
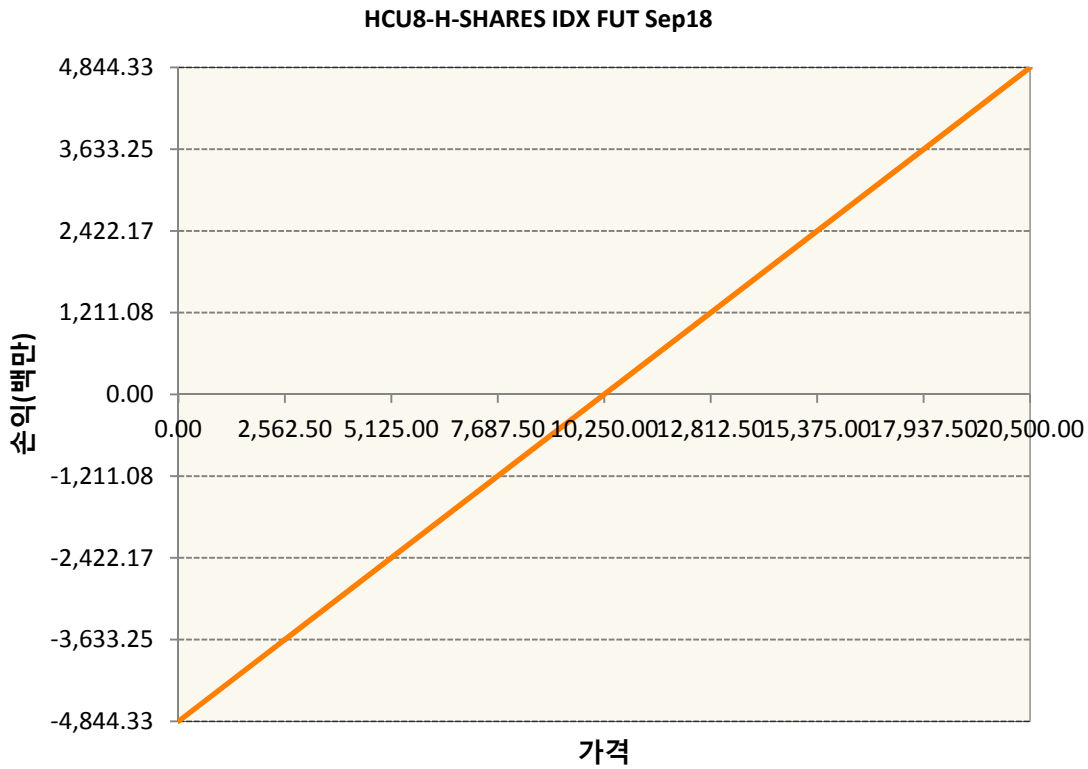
홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생)

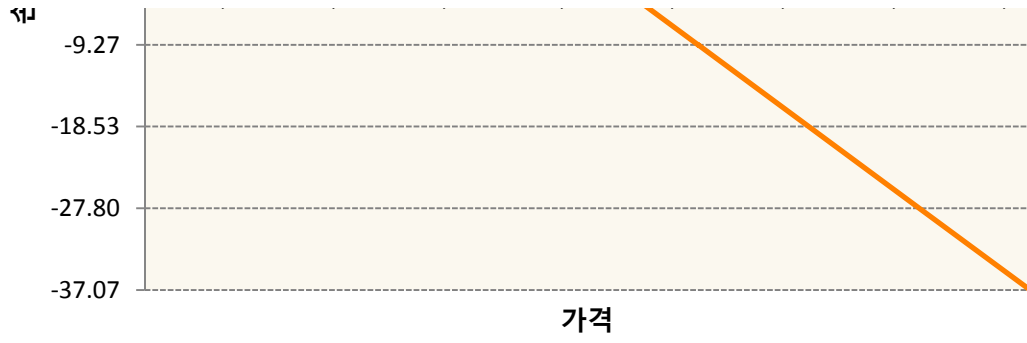
1. 계약금액

(단위:백만원)

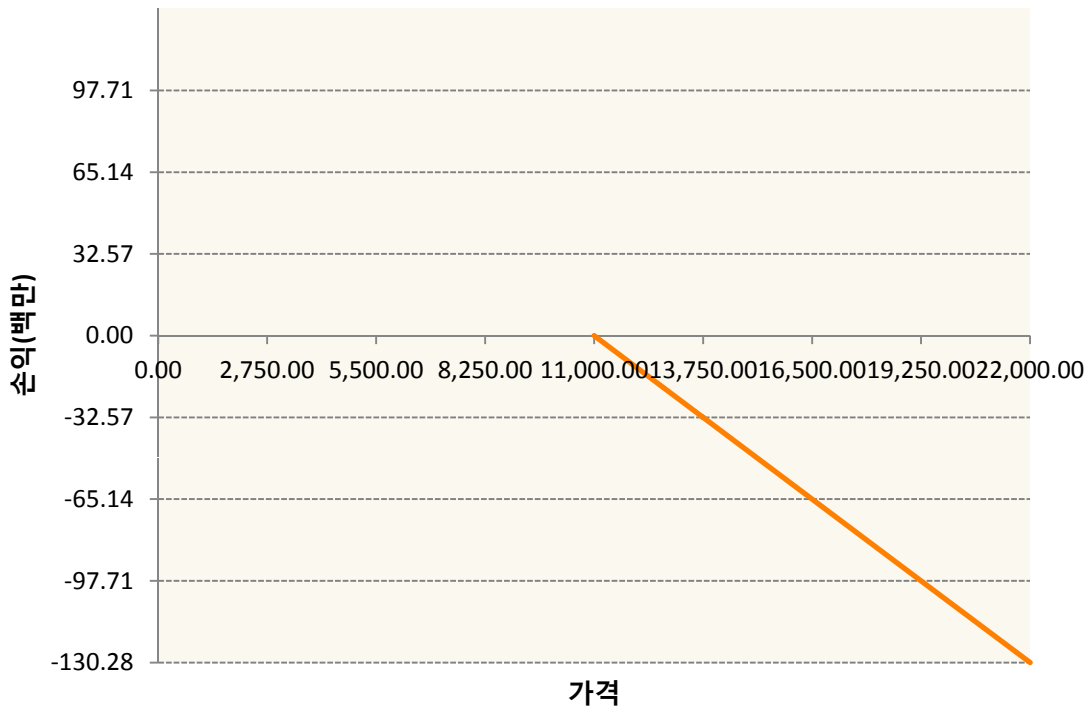
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	4,844	0	4,844	장내
누계	유가증권	옵션	0	102	-102	장내

2. 만기시점의 손익구조

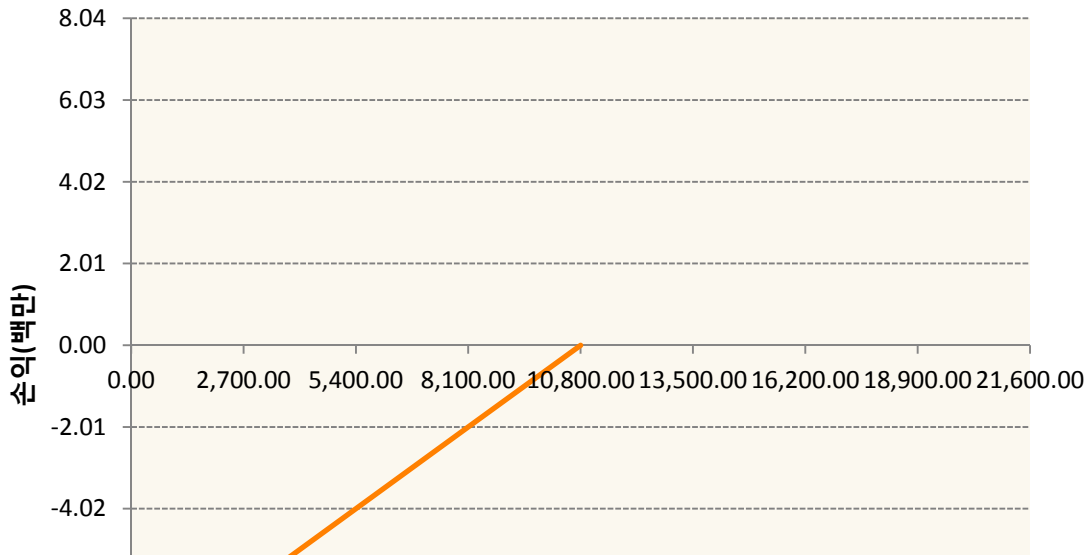


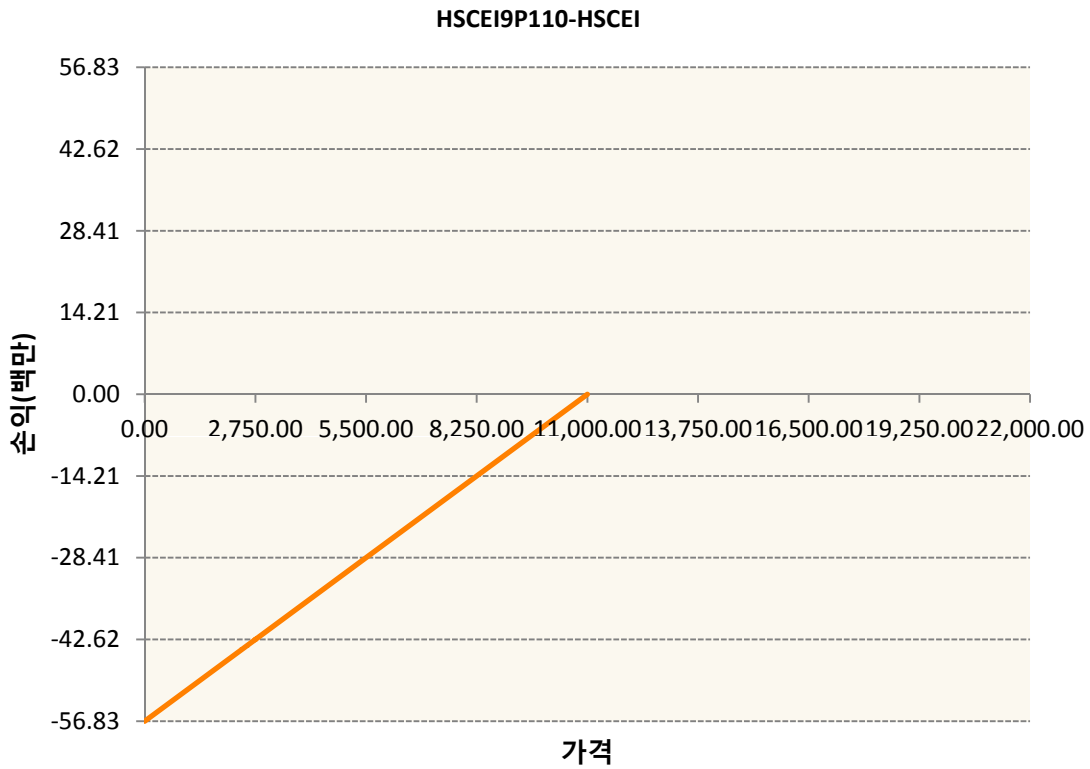
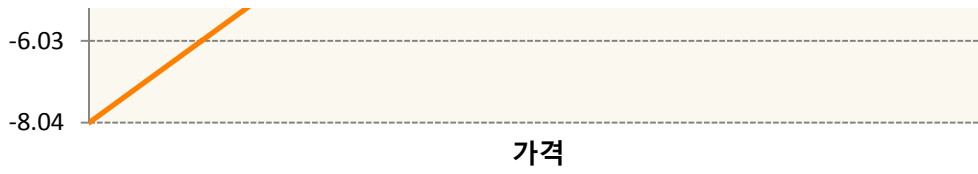


HSCEI9C110-HSCEI



HSCEI9P108-HSCEI





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCU8	H-SHARES IDX FUT Sep18	388
HSCEI9C108	HSCEI	3
HSCEI9C110	HSCEI	10
HSCEI9P108	HSCEI	1
HSCEI9P110	HSCEI	5

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	373

공시일	2018-09-13
기준일	2018-09-12

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	스왑	48,836	0	48,836	장외
누계	유가증권	옵션	0	49,668	-49,668	장내

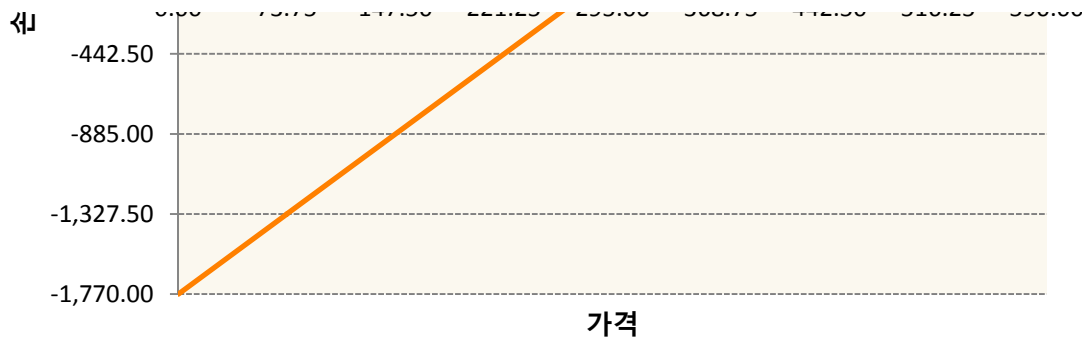
2. 만기시점의 손익구조

KR4201N92976-2018-09 콜297.5

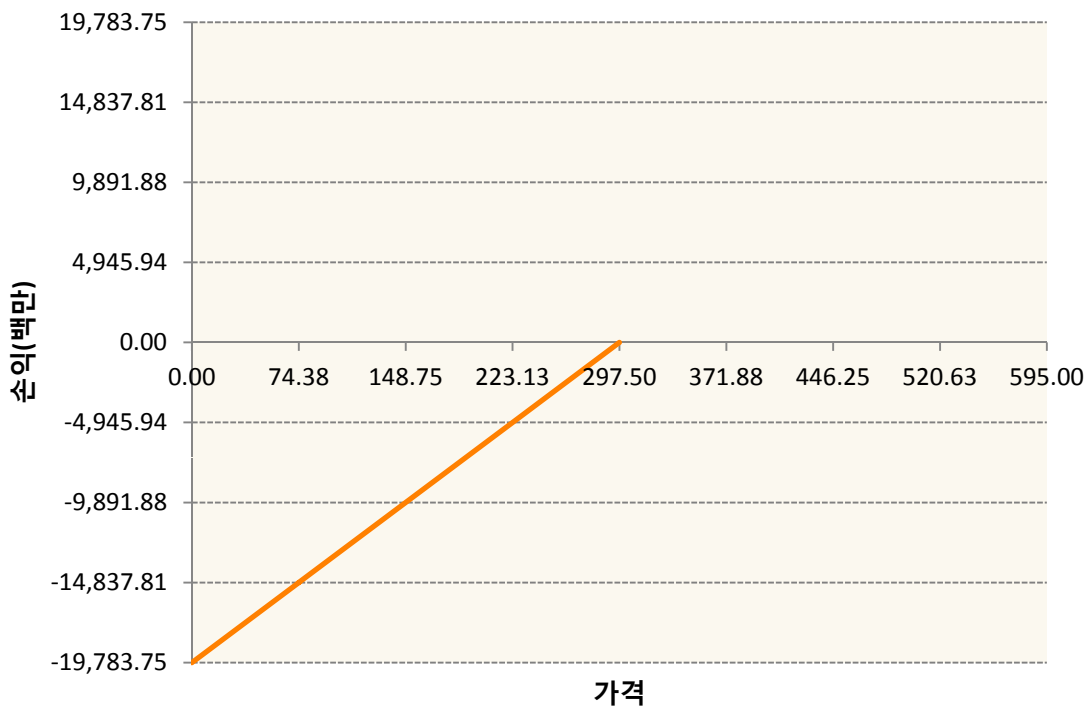


KR4301N92958-2018-09 풋295





KR4301N92974-2018-09 풋297.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_14							3,991	
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-3,991	-3,991	-3,991	-3,991	-3,991	-3,991	-3,991	
-5.33%	-2,660	-2,660	-2,660	-2,660	-2,660	-2,660	-2,660	
-2.67%	-1,330	-1,330	-1,330	-1,330	-1,330	-1,330	-1,330	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	1,330	1,330	1,330	1,330	1,330	1,330	1,330	
5.33%	2,660	2,660	2,660	2,660	2,660	2,660	2,660	
8.00%	3,991	3,991	3,991	3,991	3,991	3,991	3,991	
KR4201N92974-2018-09 풋297.5							1,703	
	기초자산의 변동성							

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	20	20	20	20	20	20	20
-5.33%	20	20	20	20	20	20	20
-2.67%	20	20	20	20	20	20	19
0%	14	10	6	0	-6	-13	-21
2.67%	-263	-273	-283	-293	-304	-316	-327
5.33%	-966	-966	-967	-967	-968	-969	-971
8.00%	-1,703	-1,703	-1,703	-1,703	-1,703	-1,703	-1,703

KR4301N929 2018-09 풋295

140

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-140	-140	-140	-140	-140	-140	-140
-5.33%	-93	-93	-93	-93	-93	-93	-93
-2.67%	-46	-46	-46	-46	-46	-46	-46
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	16	16	16	16	16	16	16
5.33%	16	16	16	16	16	16	16
8.00%	16	16	16	16	16	16	16

KR4301N929 2018-09 풋297.5

1,555

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,555	-1,555	-1,555	-1,555	-1,555	-1,555	-1,555
-5.33%	-1,037	-1,037	-1,037	-1,037	-1,037	-1,037	-1,037
-2.67%	-518	-518	-518	-518	-518	-518	-518
0%	0	0	0	0	0	0	-1
2.67%	342	341	340	338	336	334	332
5.33%	343	343	343	343	343	343	343
8.00%	343	343	343	343	343	343	343

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

(단위:백만원)

8,042

공시일	2018-09-13
기준일	2018-09-12

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

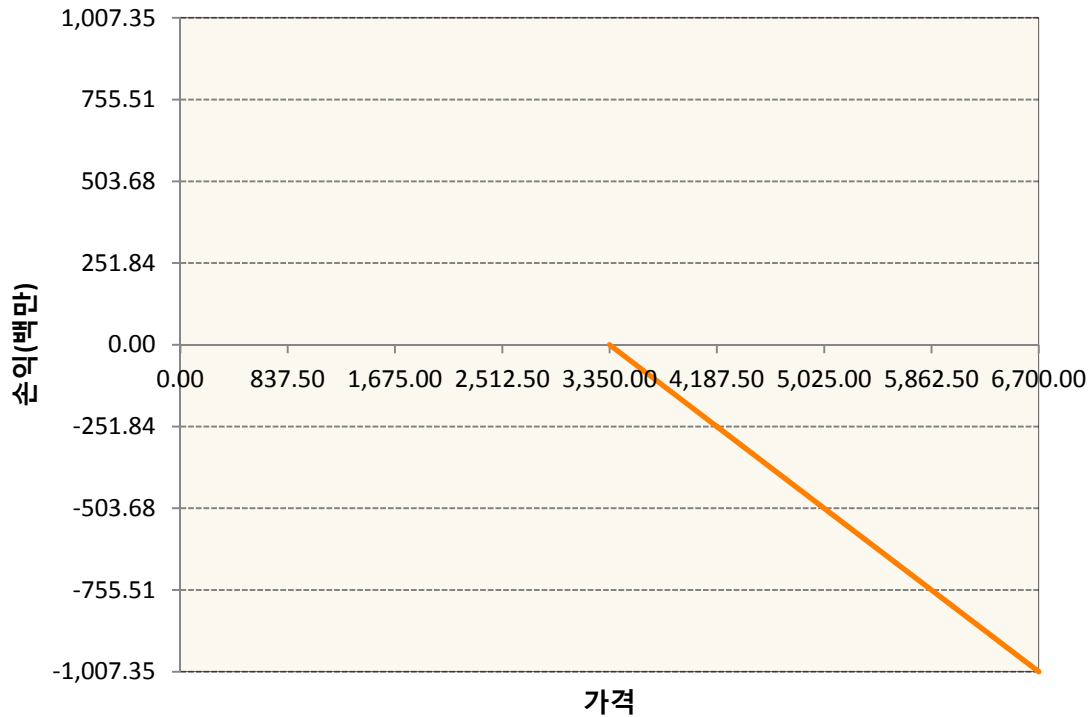
1. 계약금액

(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	5,421	0	5,421	
누계	유가증권	스왑	34,524	0	34,524	장외
누계	유가증권	옵션	0	25,224	-25,224	장내
누계	지수	스왑	53,076	0	53,076	장외

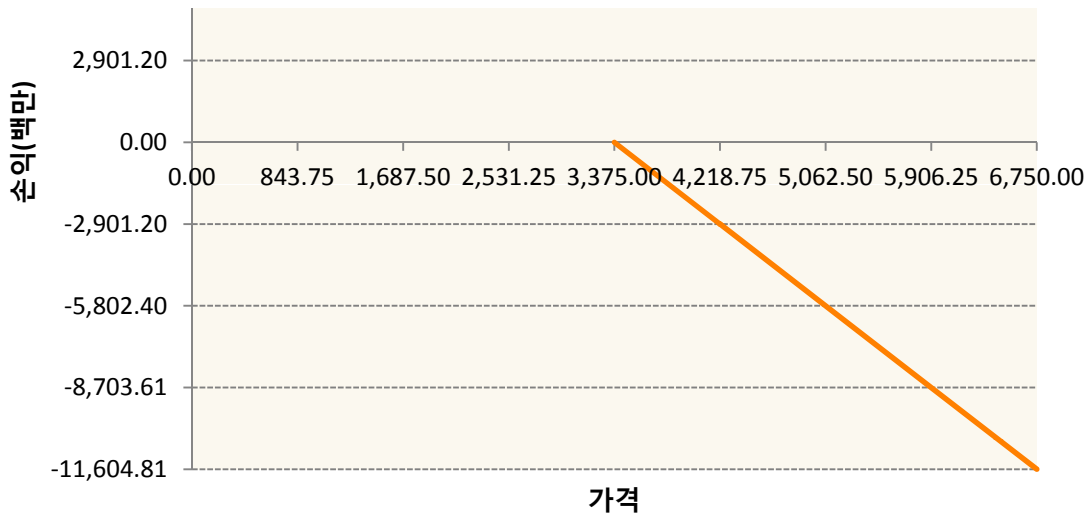
2. 만기시점의 손익구조

OESXU8-C3350-EURO STOXX 50

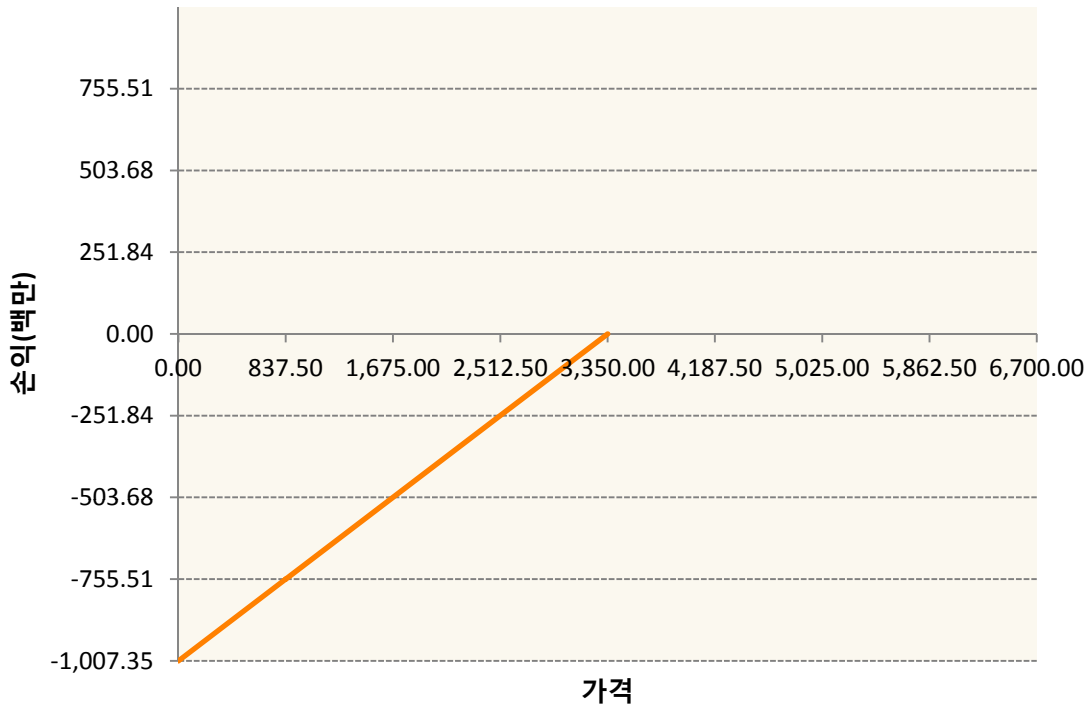


OESXU8-C3375-EURO STOXX 50



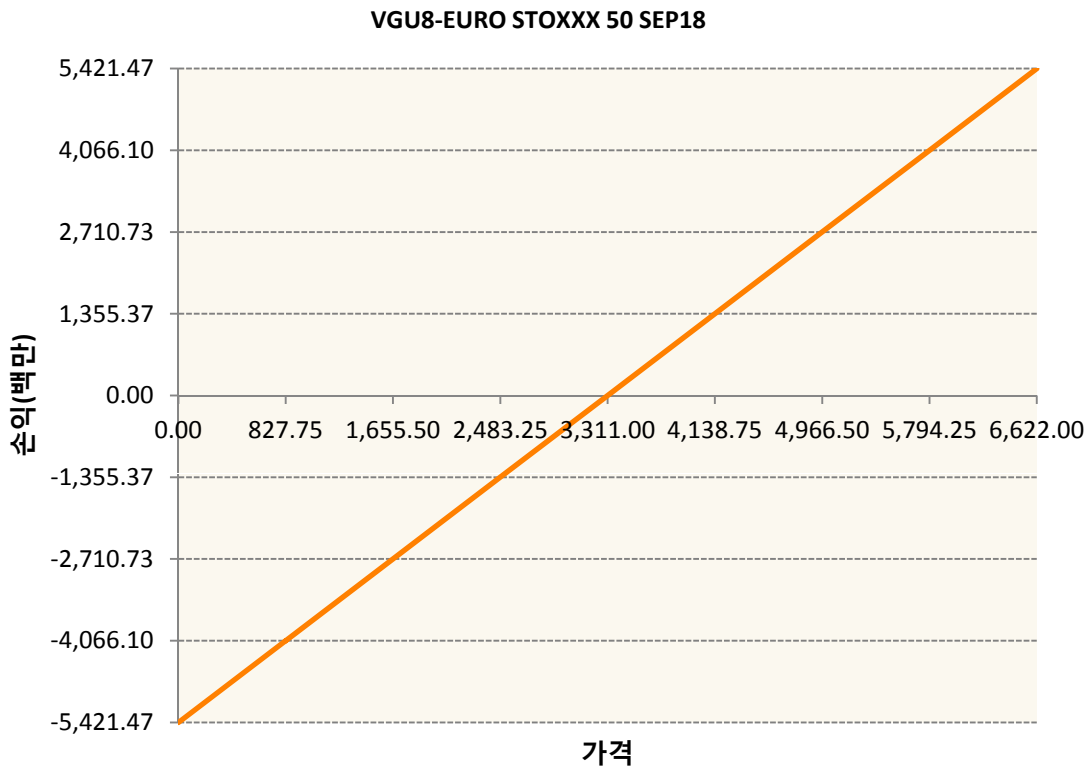
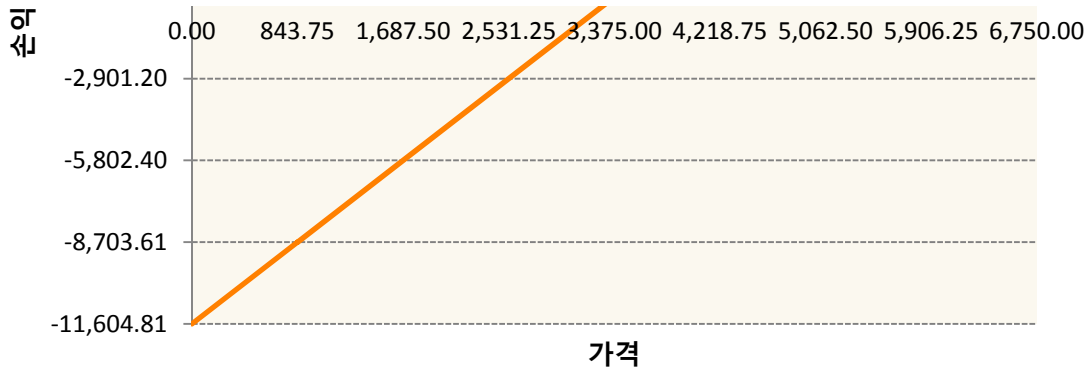


OESXU8-P3350-EURO STOXX 50



OESXU8-P3375-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
260105SGPXSG EURO Covered CALL STRATEGY - 994.569		72
260105SQPXSG EURO Covered CALL STRATEGY		47
OESXU8-C3E EURO STOXX 50		81
OESXU8-C3E EURO STOXX 50		928
OESXU8-P3E EURO STOXX 50		81
OESXU8-P3E EURO STOXX 50		928
VGU8 EURO STOXXX 50 SEP18		434

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

공시일	2018-09-13
기준일	2018-09-12

ETF스마트레버리지목표전환형8호

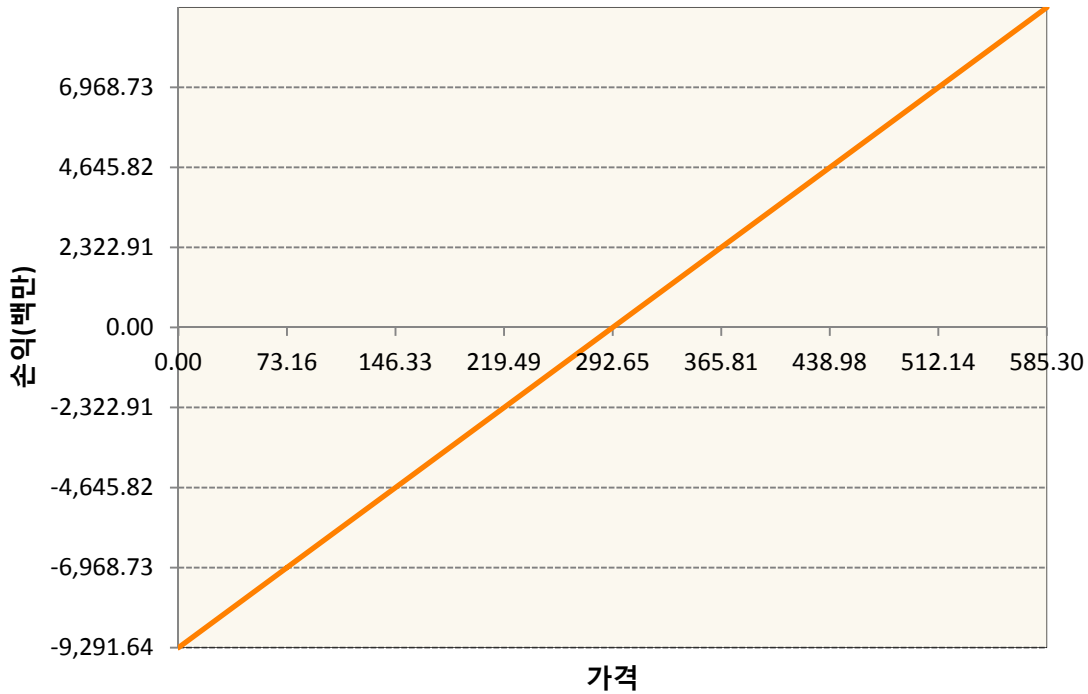
1. 계약금액

(단위:백만원)

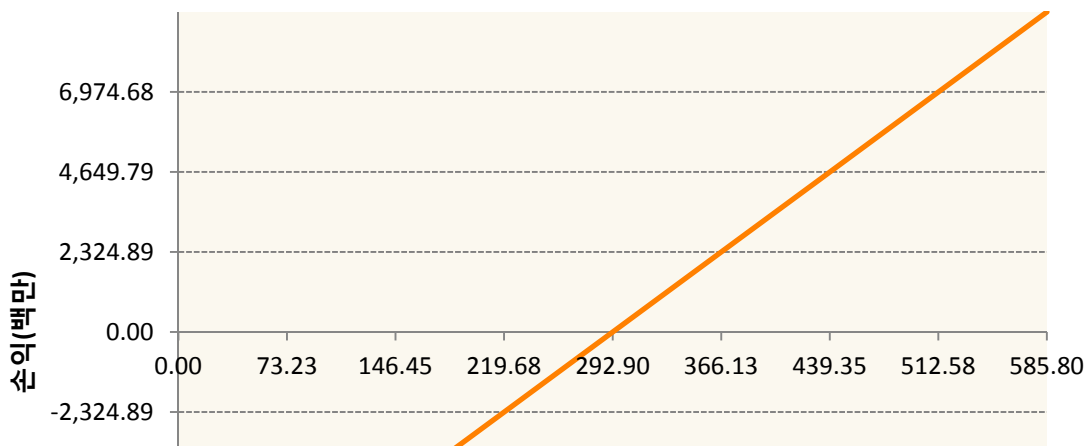
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	9,284	9,276	8	장내
누계	유가증권	선물	18,591	0	18,591	장내

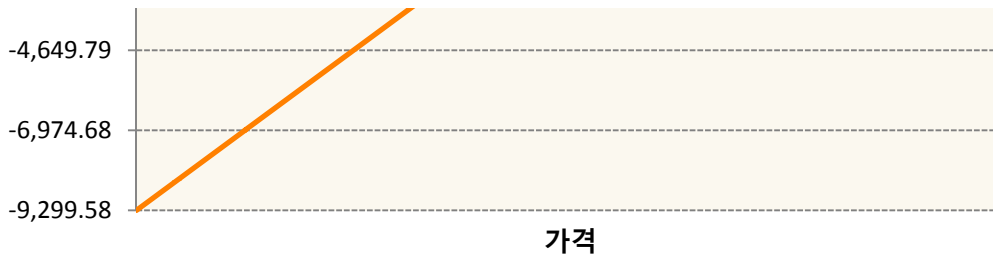
2. 만기시점의 손익구조

KR4101N90006-2018-09 코스피200지수선물



KR4101NC0004-2018-12 코스피200지수선물





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101N90(2018-09 코스피200지수선물) 743

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-743	-743	-743	-743	-743	-743	-743
-5.33%	-495	-495	-495	-495	-495	-495	-495
-2.67%	-248	-248	-248	-248	-248	-248	-248
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	248	248	248	248	248	248	248
5.33%	495	495	495	495	495	495	495
8.00%	743	743	743	743	743	743	743

KR4101NC0(2018-12 코스피200지수선물) 743

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-743	-743	-743	-743	-743	-743	-743
-5.33%	-495	-495	-495	-495	-495	-495	-495
-2.67%	-248	-248	-248	-248	-248	-248	-248
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	248	248	248	248	248	248	248
5.33%	495	495	495	495	495	495	495
8.00%	743	743	743	743	743	743	743

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

1,118

공시일	2018-09-13
기준일	2018-09-12

ETF스마트레버리지목표전환형9호

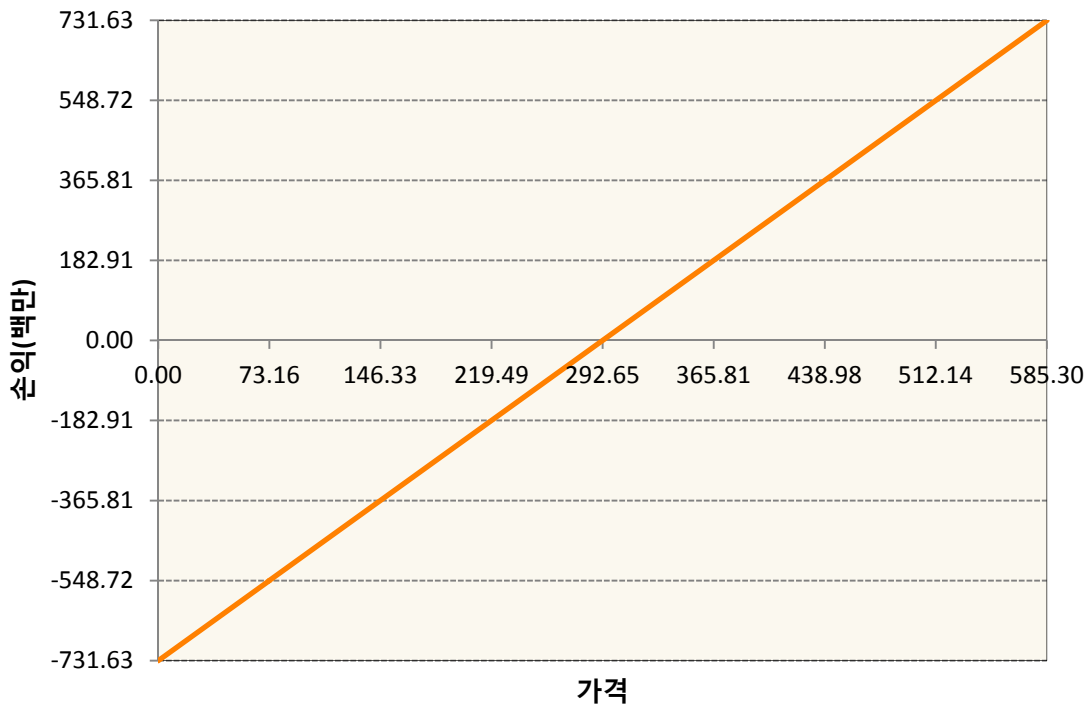
1. 계약금액

(단위:백만원)

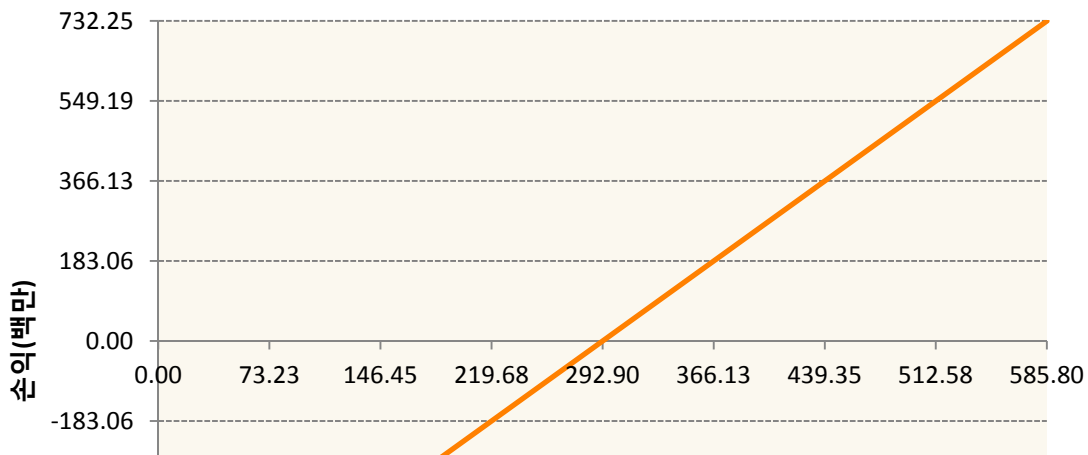
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	731	730	1	장내
누계	유가증권	선물	1,464	0	1,464	장내

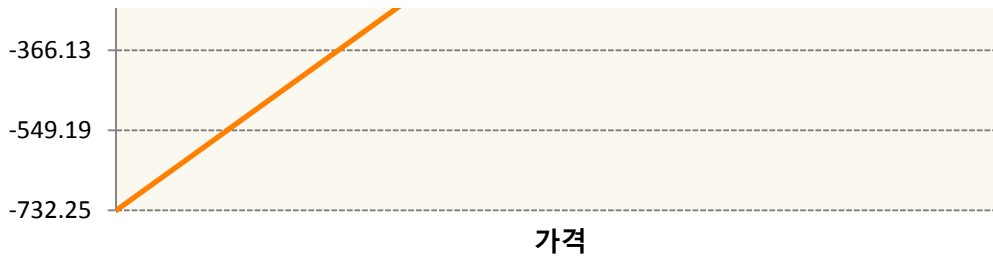
2. 만기시점의 손익구조

KR4101N90006-2018-09 코스피200지수선물



KR4101NC0004-2018-12 코스피200지수선물





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101N90(2018-09 코스피200지수선물) 58

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-58	-58	-58	-58	-58	-58	-58
-5.33%	-39	-39	-39	-39	-39	-39	-39
-2.67%	-19	-19	-19	-19	-19	-19	-19
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	19	19	19	19	19	19	19
5.33%	39	39	39	39	39	39	39
8.00%	58	58	58	58	58	58	58

KR4101NC0(2018-12 코스피200지수선물) 58

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-58	-58	-58	-58	-58	-58	-58
-5.33%	-39	-39	-39	-39	-39	-39	-39
-2.67%	-19	-19	-19	-19	-19	-19	-19
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	19	19	19	19	19	19	19
5.33%	39	39	39	39	39	39	39
8.00%	58	58	58	58	58	58	58

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

88

공시일	2018-09-13
기준일	2018-09-12

ETF스마트레버리지목표전환형10

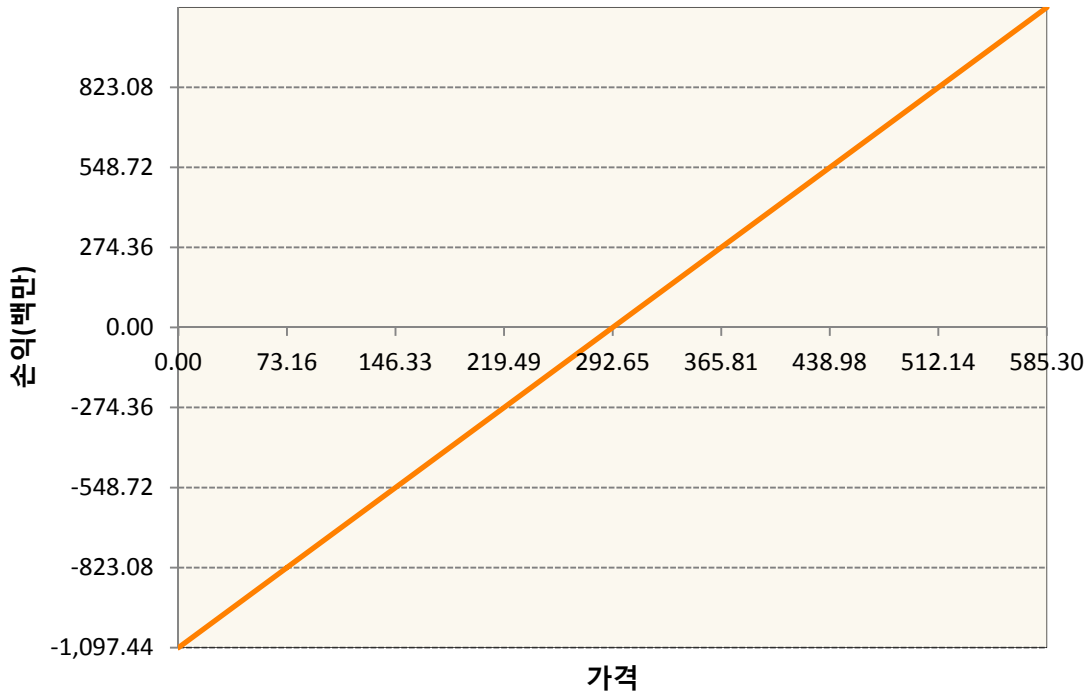
1. 계약금액

(단위:백만원)

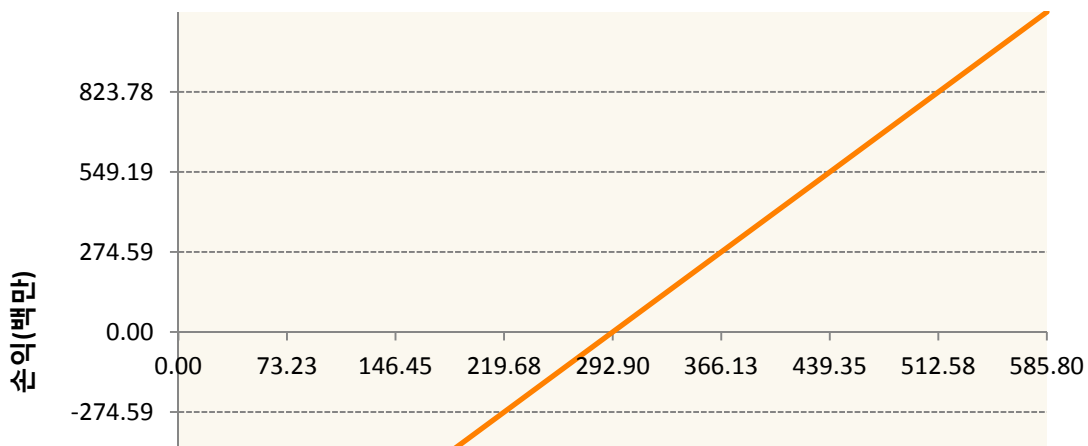
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	1,096	1,095	1	장내
누계	유가증권	선물	2,196	0	2,196	장내

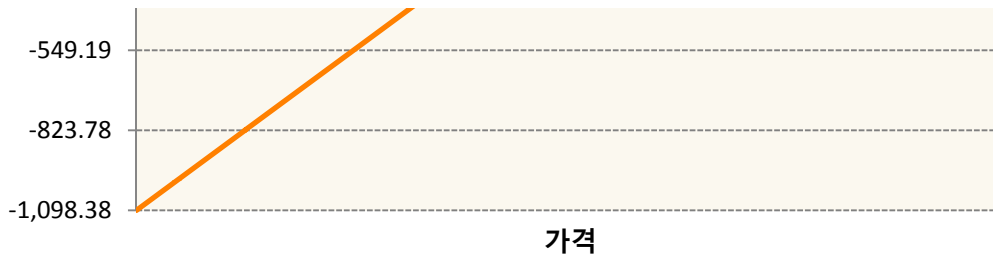
2. 만기시점의 손익구조

KR4101N90006-2018-09 코스피200지수선물



KR4101NC0004-2018-12 코스피200지수선물





3. 시나리오 별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101N90(2018-09 코스피200지수선물) 88

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-88	-88	-88	-88	-88	-88	-88
-5.33%	-58	-58	-58	-58	-58	-58	-58
-2.67%	-29	-29	-29	-29	-29	-29	-29
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	29	29	29	29	29	29	29
5.33%	58	58	58	58	58	58	58
8.00%	88	88	88	88	88	88	88

KR4101NC0(2018-12 코스피200지수선물) 88

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-88	-88	-88	-88	-88	-88	-88
-5.33%	-58	-58	-58	-58	-58	-58	-58
-2.67%	-29	-29	-29	-29	-29	-29	-29
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	29	29	29	29	29	29	29
5.33%	58	58	58	58	58	58	58
8.00%	88	88	88	88	88	88	88

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

132

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

(단위:백만원)

160

공시일	2018-09-13
기준일	2018-09-12

스마트KRX300인덱스목표전환형1

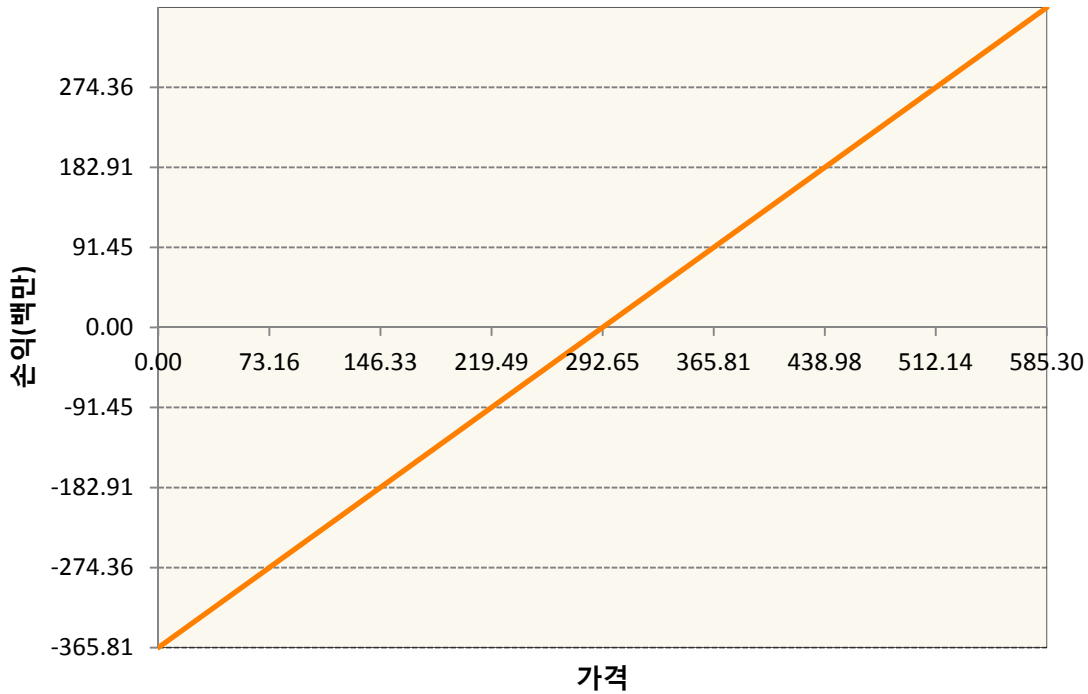
1. 계약금액

(단위:백만원)

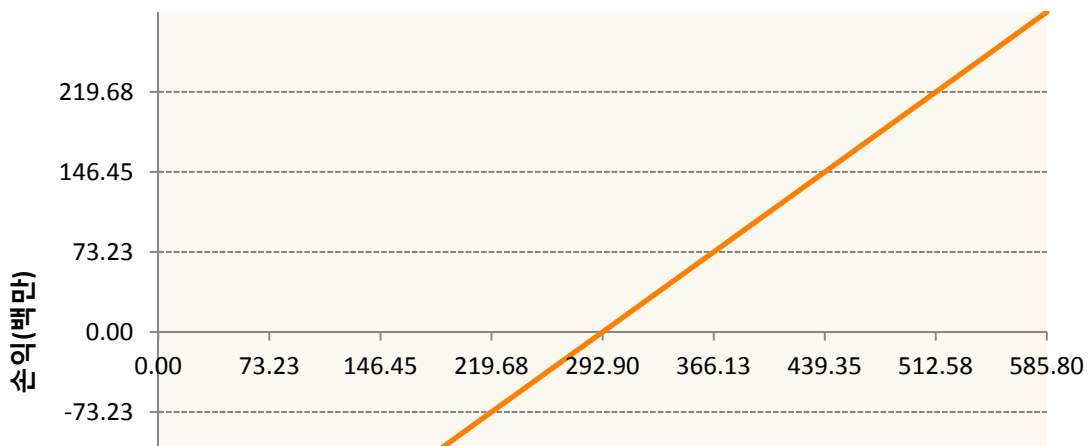
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	293	292	0	장내
누계	유가증권	선물	659	0	659	장내

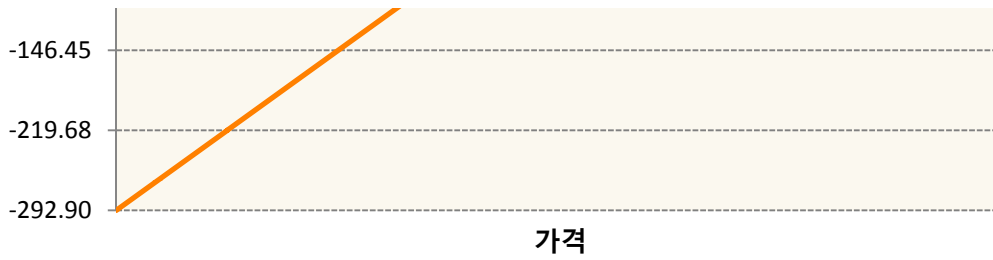
2. 만기시점의 손익구조

KR4101N90006-2018-09 코스피200지수선물



KR4101NC0004-2018-12 코스피200지수선물





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101N90(2018-09 코스피200지수선물) 29

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-29	-29	-29	-29	-29	-29	-29
-5.33%	-19	-19	-19	-19	-19	-19	-19
-2.67%	-10	-10	-10	-10	-10	-10	-10
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	10	10	10	10	10	10	10
5.33%	19	19	19	19	19	19	19
8.00%	29	29	29	29	29	29	29

KR4101NC0(2018-12 코스피200지수선물) 23

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-23	-23	-23	-23	-23	-23	-23
-5.33%	-16	-16	-16	-16	-16	-16	-16
-2.67%	-8	-8	-8	-8	-8	-8	-8
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	8	8	8	8	8	8	8
5.33%	16	16	16	16	16	16	16
8.00%	23	23	23	23	23	23	23

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

40

공시일	2018-09-13
기준일	2018-09-12

리디파인K200(주식혼합-파생재간

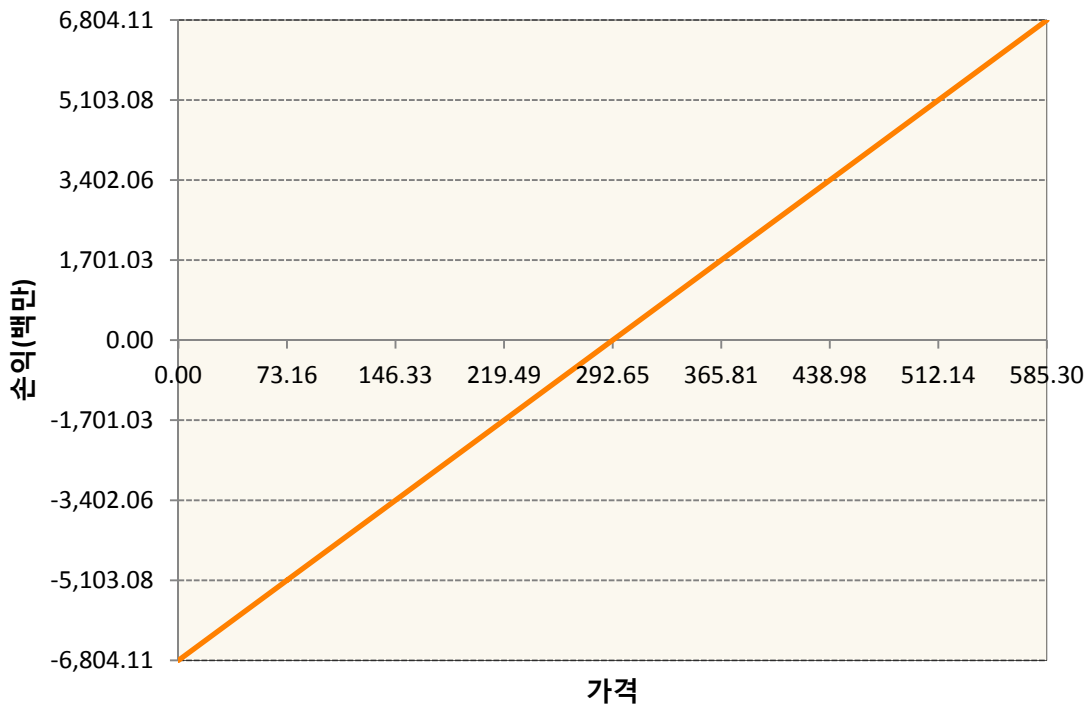
1. 계약금액

(단위:백만원)

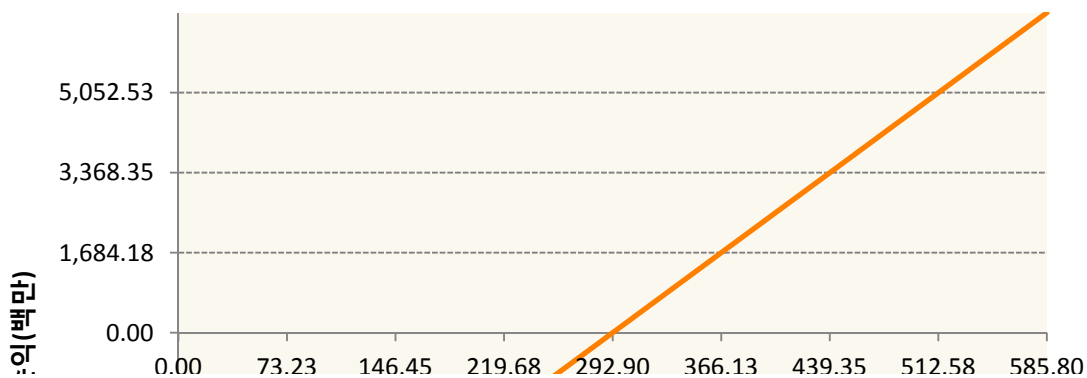
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	6,724	6,718	6	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	13,541	0	13,541	장내
누계	유가증권	옵션	1,339	24,671	-23,332	장내

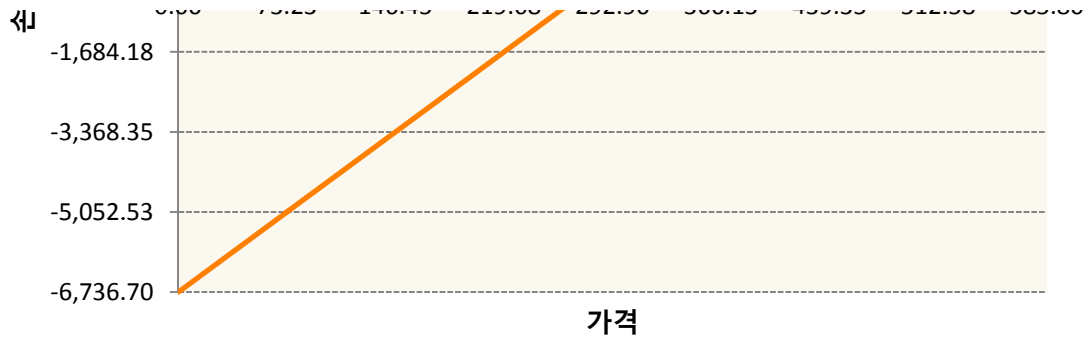
2. 만기시점의 손익구조

KR4101N90006-2018-09 코스피200지수선물

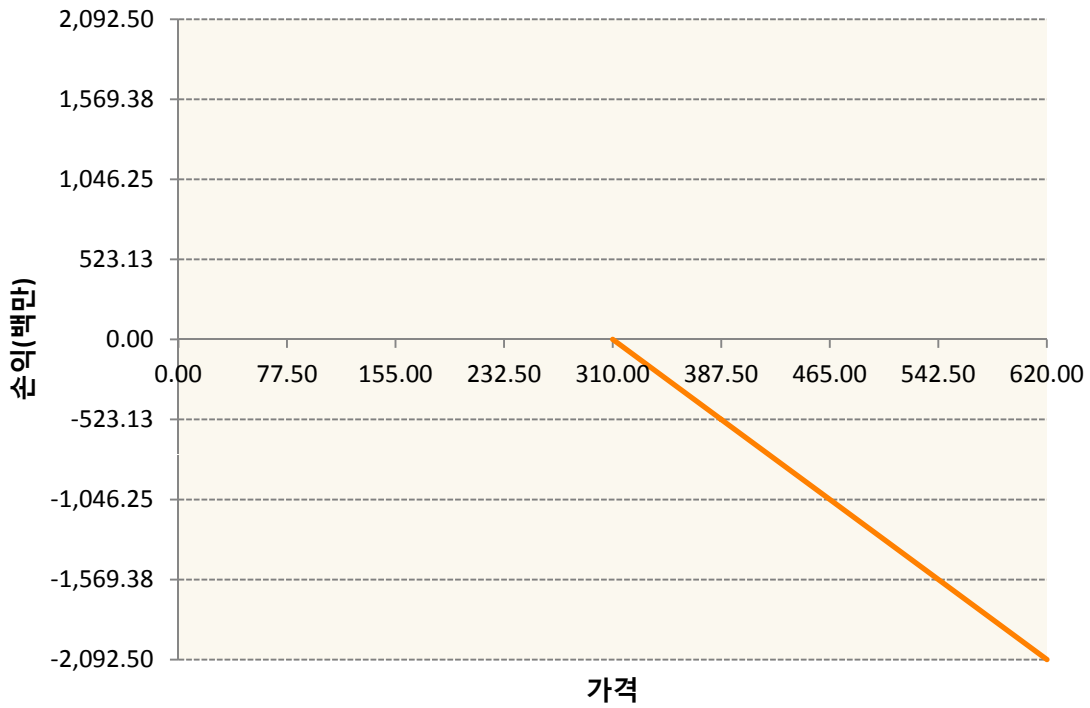


KR4101NC0004-2018-12 코스피200지수선물

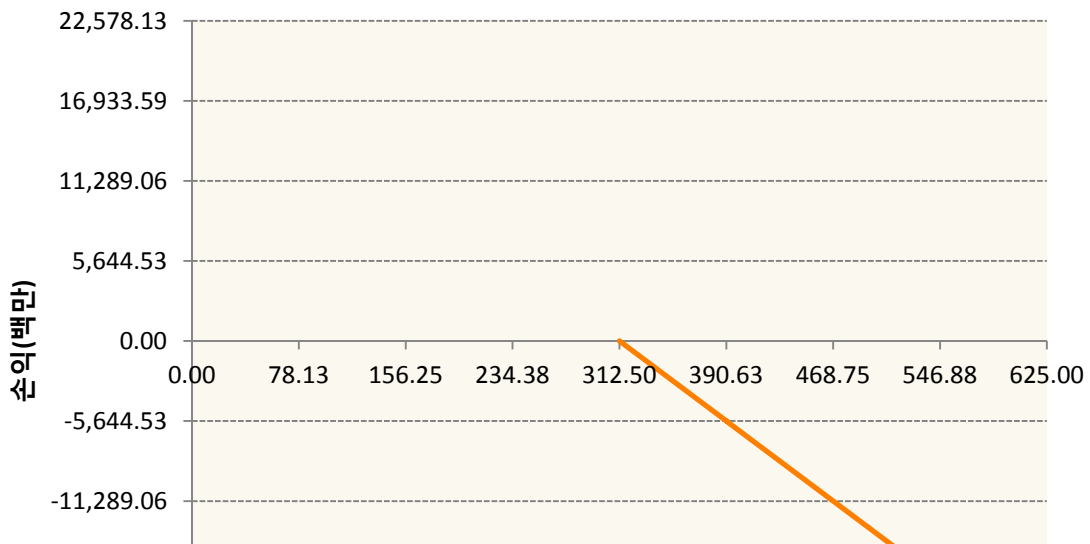




KR4201N93107-2018-09 콜310



KR4201N93123-2018-09 콜312.5



0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	179	179	179	179	179	179	179
5.33%	359	359	359	359	359	359	359
8.00%	538	538	538	538	538	538	538

KR4201N9312018-09 콜310

42

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	0	0	0	0	0	0	0
-5.33%	0	0	0	0	0	0	0
-2.67%	0	0	0	0	0	0	0
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	0	0	0	0	0	0	0
5.33%	-4	-4	-5	-6	-7	-8	-9
8.00%	-39	-39	-40	-40	-41	-41	-42

KR4201N9312018-09 콜312.5

303

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	0	0	0	0	0	0	0
-5.33%	0	0	0	0	0	0	0
-2.67%	0	0	0	0	0	0	0
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	0	0	0	0	0	-1	-1
5.33%	-9	-13	-18	-24	-30	-37	-44
8.00%	-255	-261	-269	-277	-285	-294	-303

KR4301N929 2018-09 풋297.5

105

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	105	105	105	105	105	105	105
-5.33%	70	70	70	70	70	70	70
-2.67%	35	35	35	35	35	35	35
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-23	-23	-23	-23	-23	-23	-22
5.33%	-23	-23	-23	-23	-23	-23	-23
8.00%	-23	-23	-23	-23	-23	-23	-23

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

(단위:백만원)

901

공시일	2018-09-13
기준일	2018-09-12

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

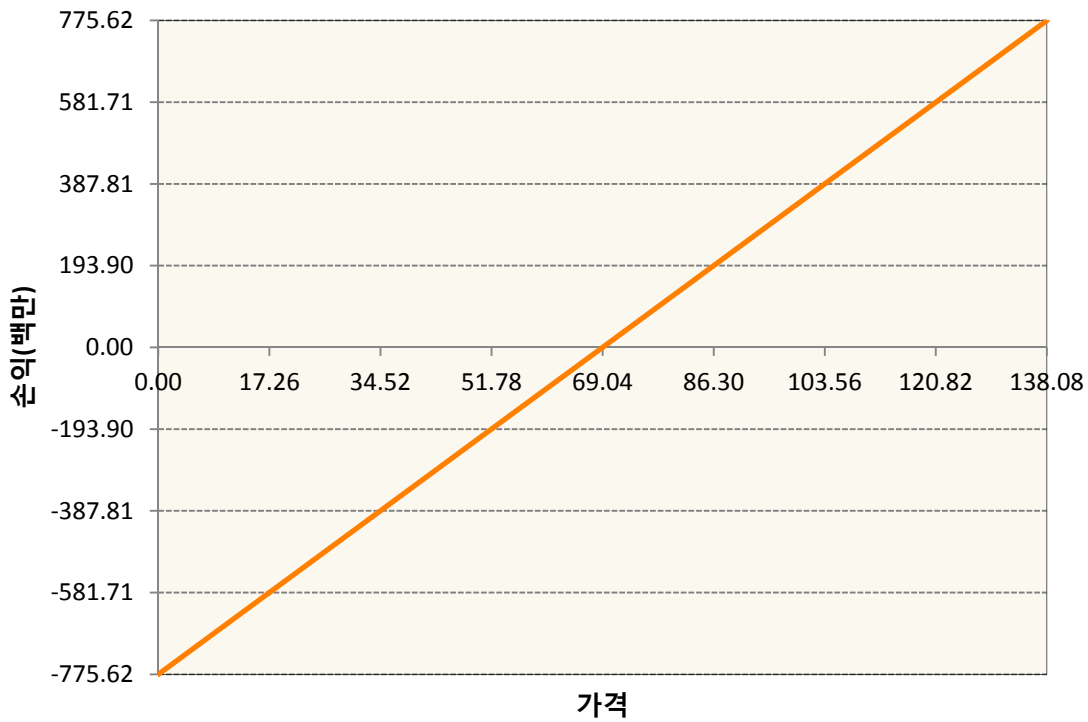
1. 계약금액

(단위:백만원)

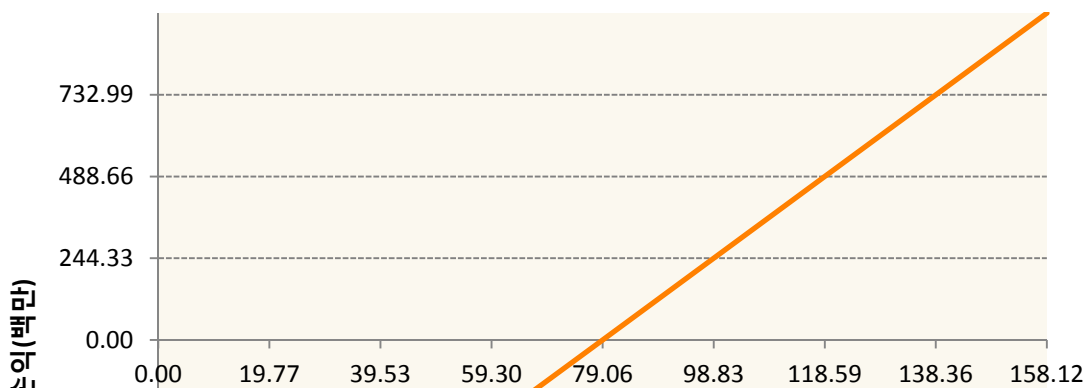
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	3,176	621	2,555	
누계	유가증권	선물	532	0	532	장내

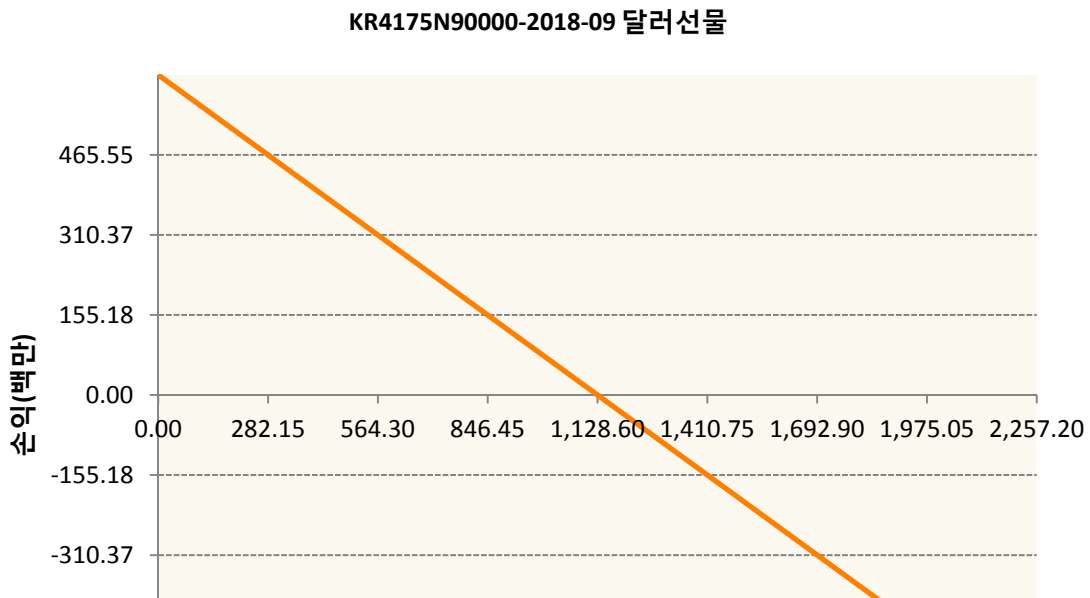
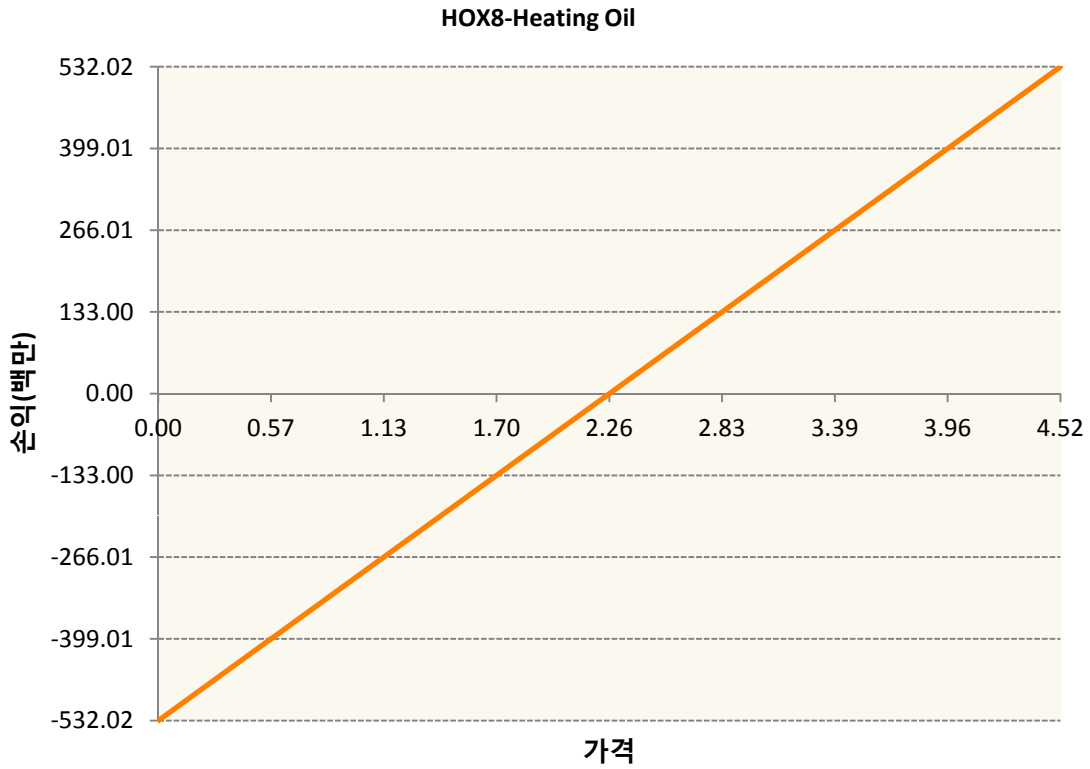
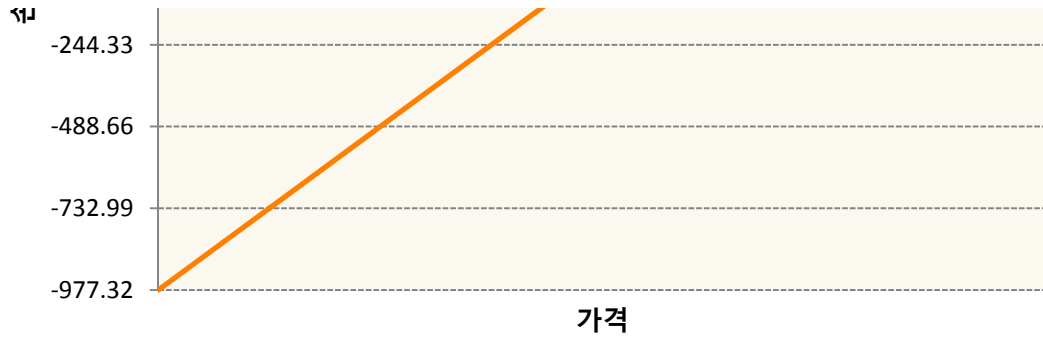
2. 만기시점의 손익구조

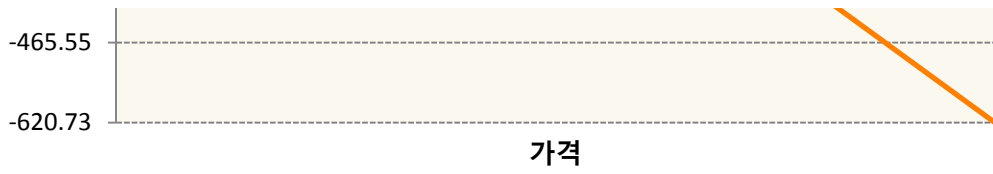
CLX8-WTI CRUDE FUTURE Nov18



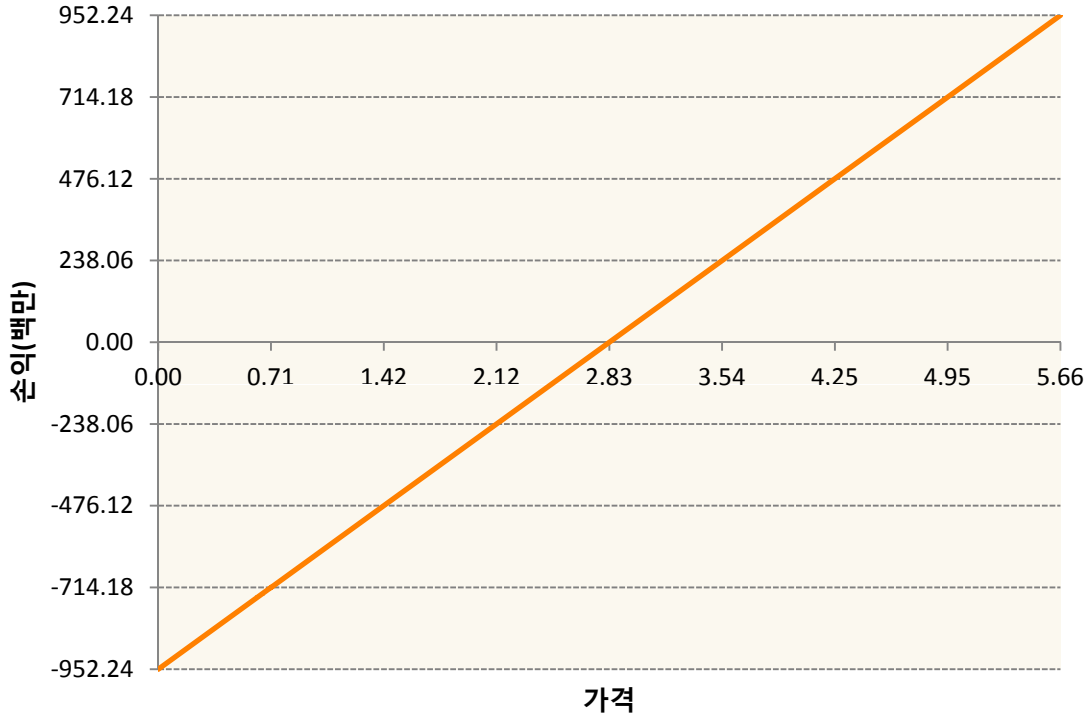
COX8-BRENT CRUDE FUTR Nov18



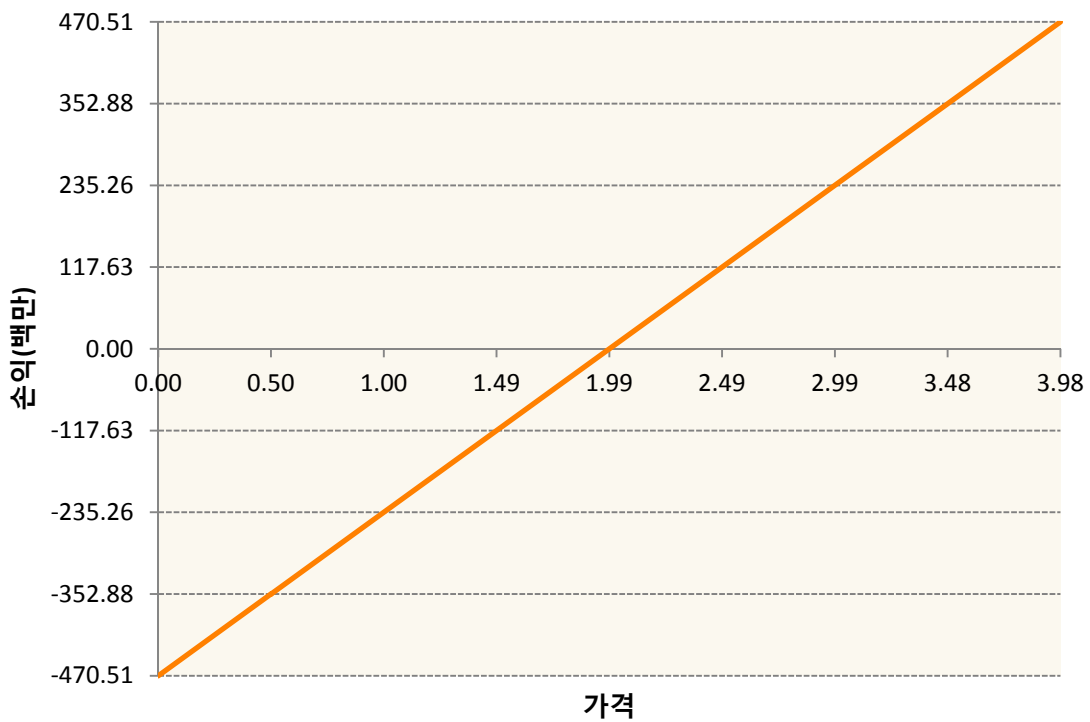




NGX18-NATURAL GAS FUTR Nov18



XBX8-GASOLINE RBOB FUT Nov18



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
CLX8	WTI CRUDE FUTURE Nov18	62
COX8	BRENT CRUDE FUTR Nov18	78
HOX8	Heating Oil	43
	KR4175N90C 2018-09 달러선물	50
NGX18	NATURAL GAS FUTR Nov18	76
XBX8	GASOLINE RBOB FUT Nov18	38

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	442

공시일	2018-09-13
기준일	2018-09-12

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

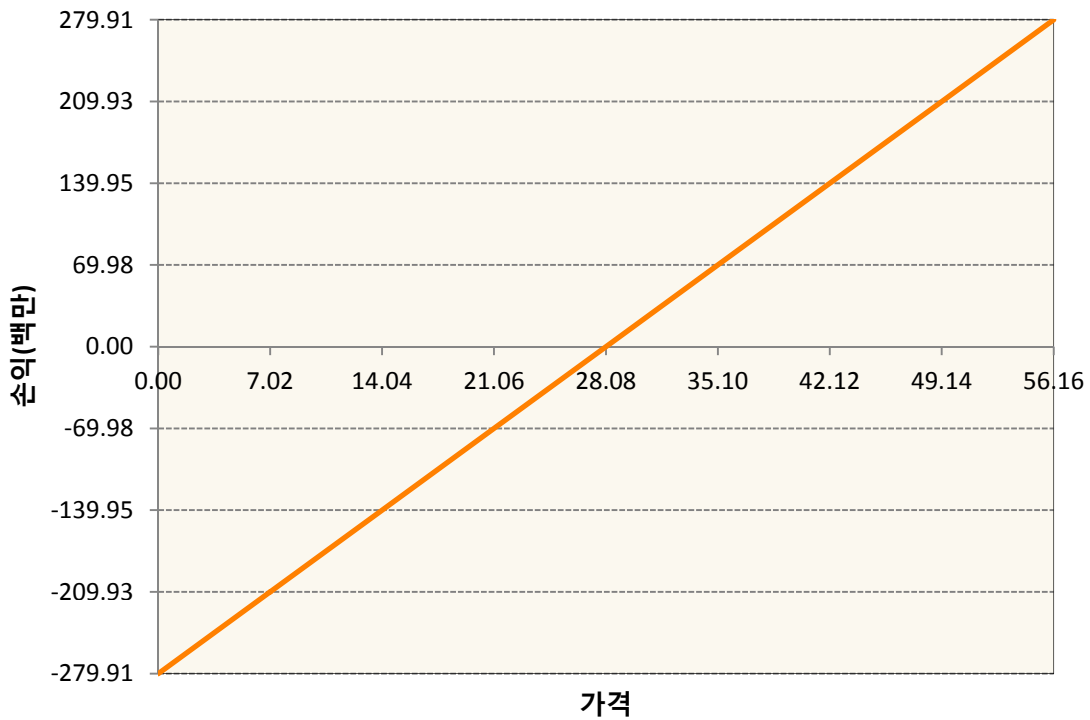
1. 계약금액

(단위:백만원)

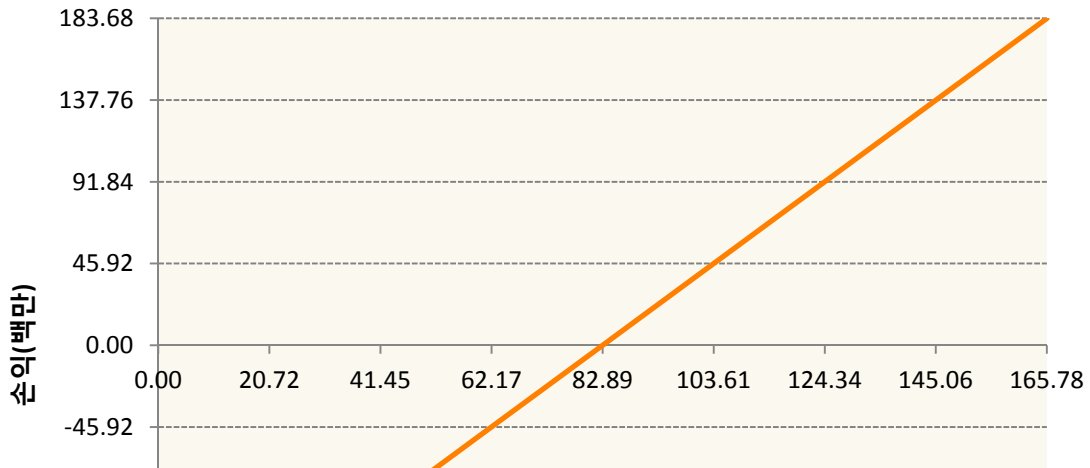
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,598	79	3,519	

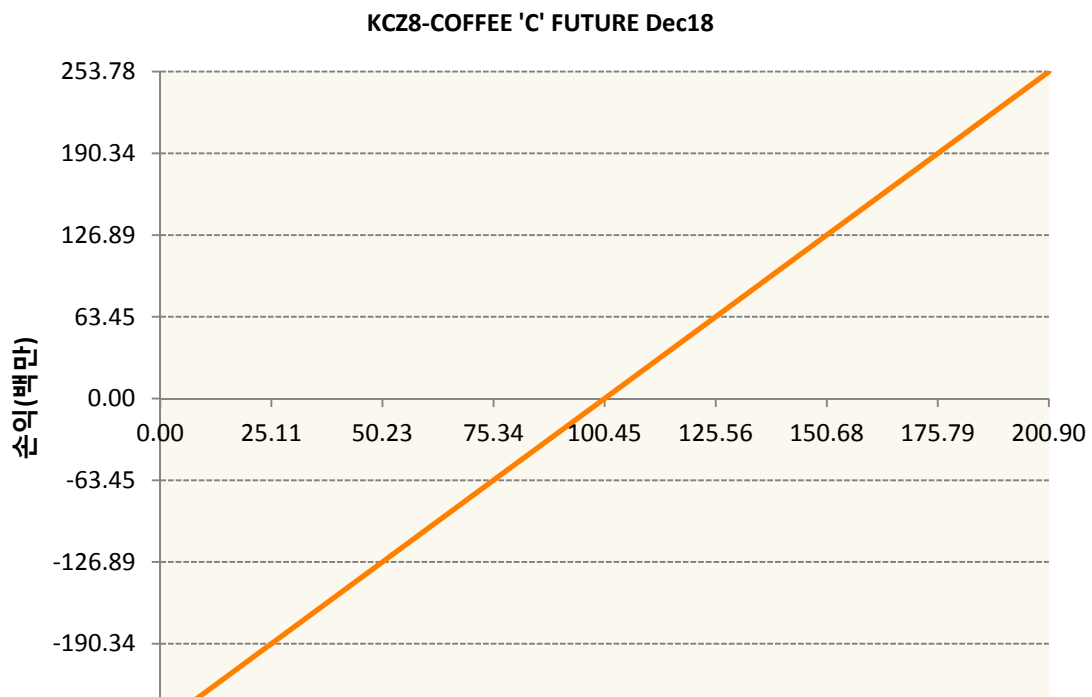
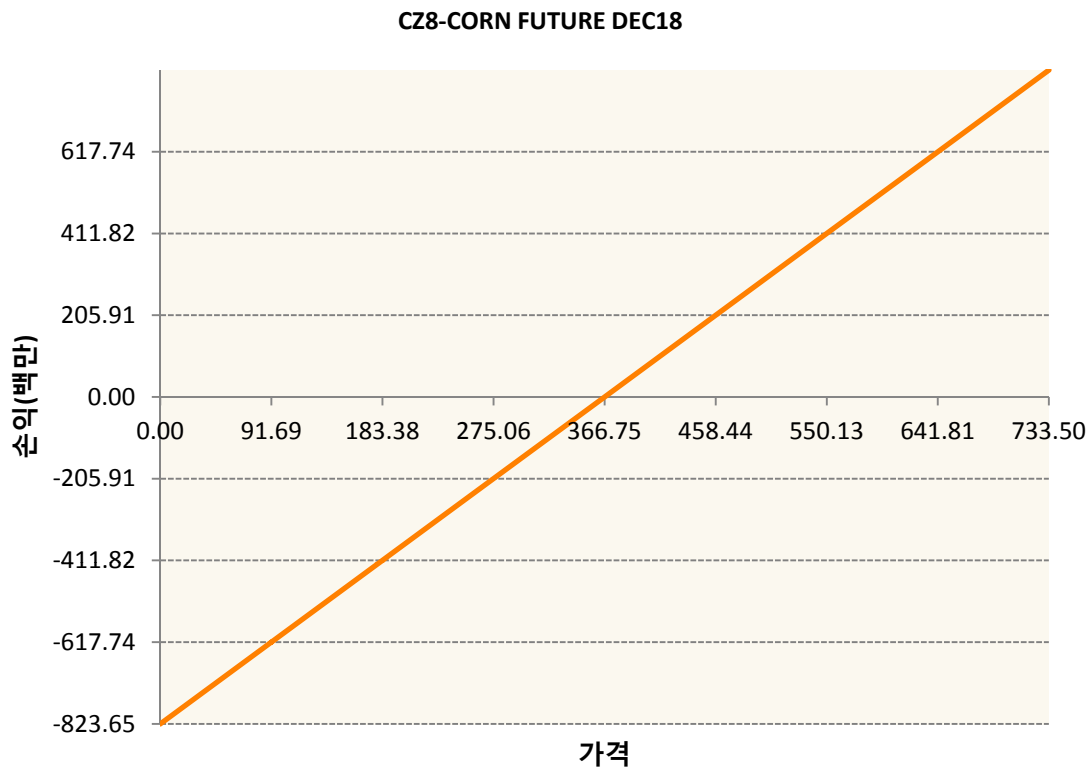
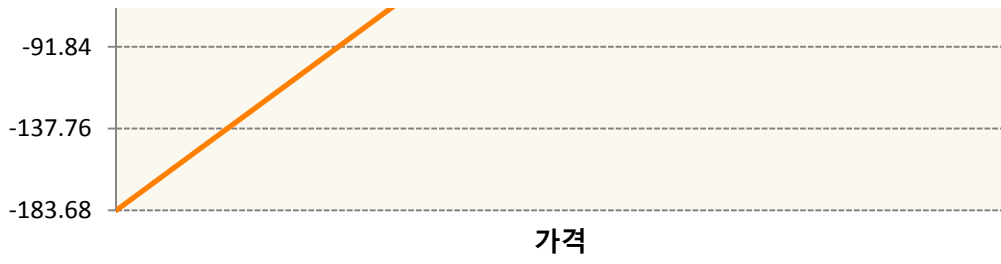
2. 만기시점의 손익구조

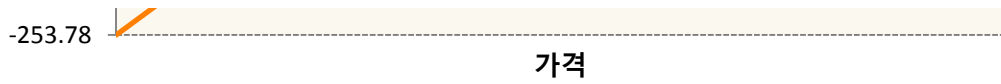
BOZ8-SOYBEAN OIL FUTR DEC18



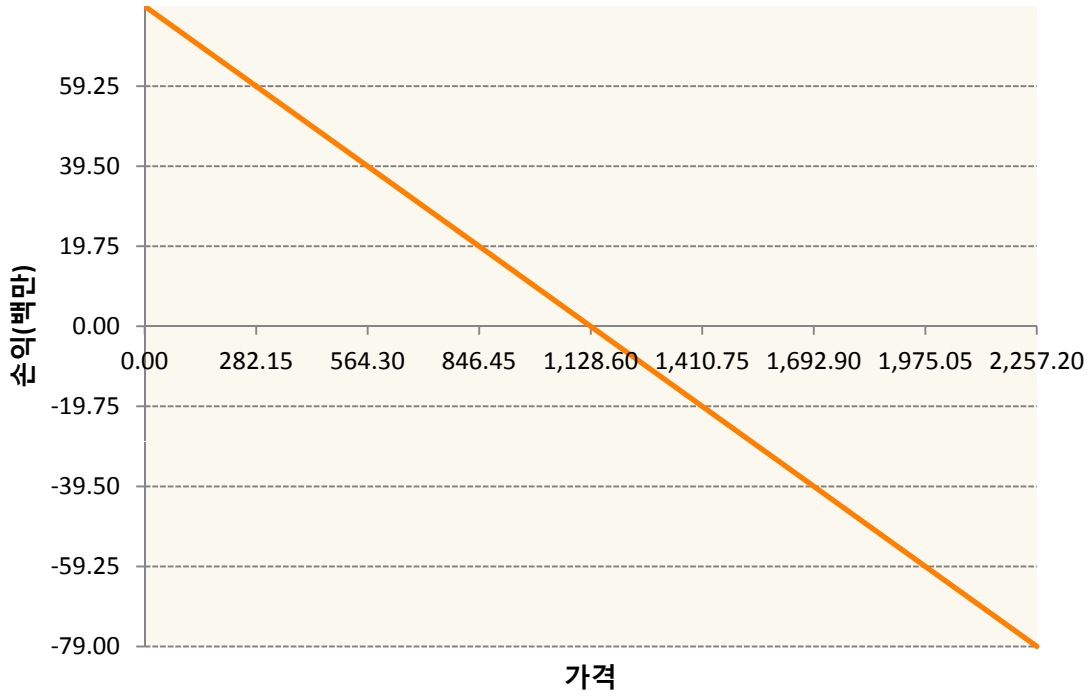
CTZ8-COTTON NO.2 FUTR DEC18



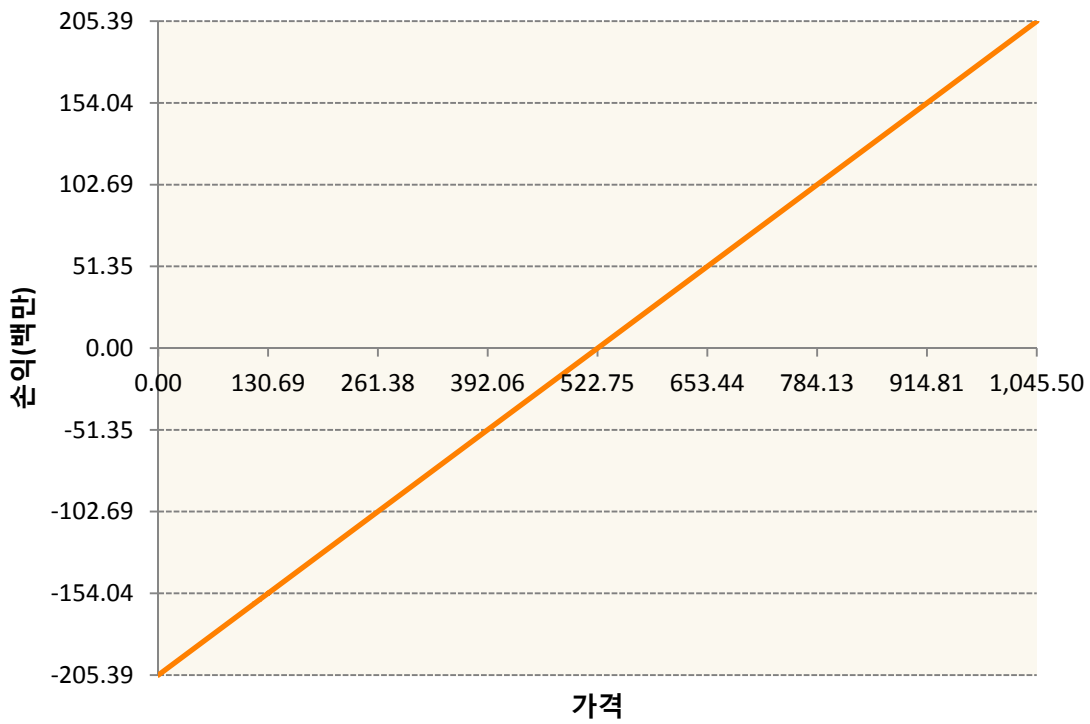




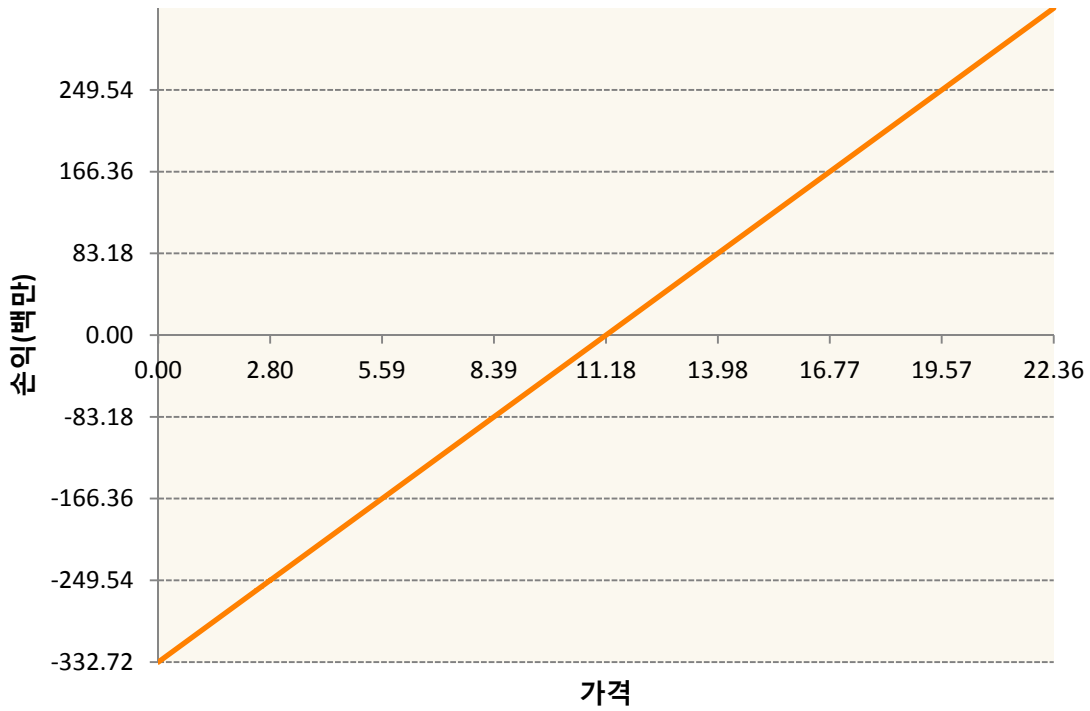
KR4175N90000-2018-09 달러선물



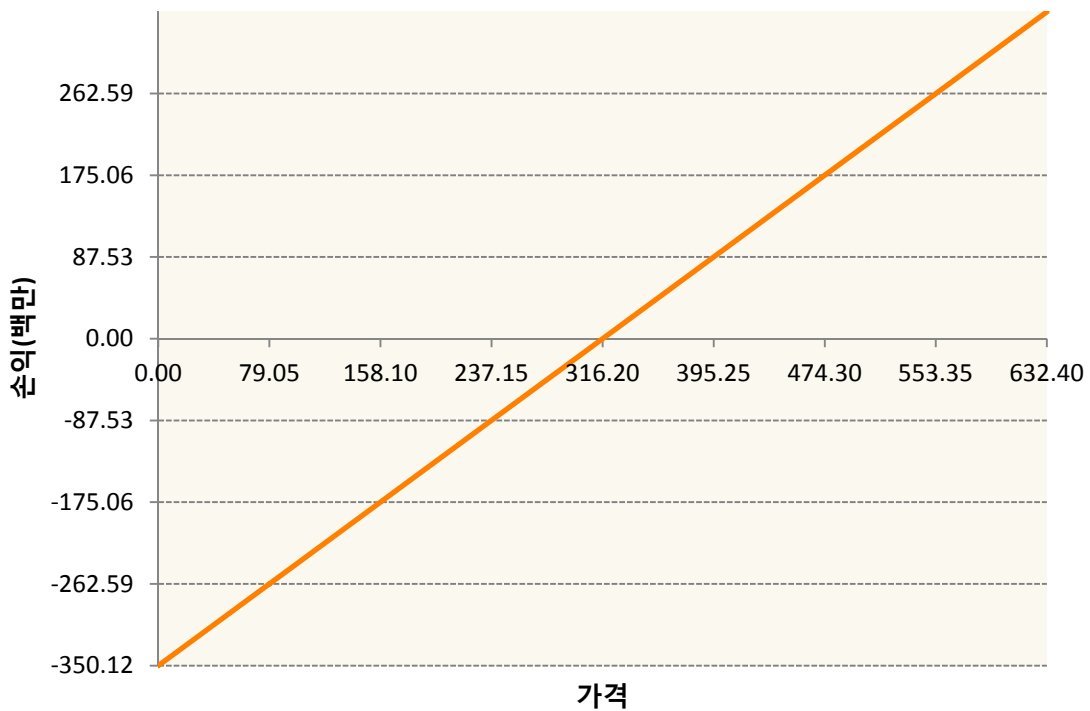
KWZ8-KC HRW WHEAT FUT DEC18



SBV8-SUGAR #11 (WORLD) OCT18

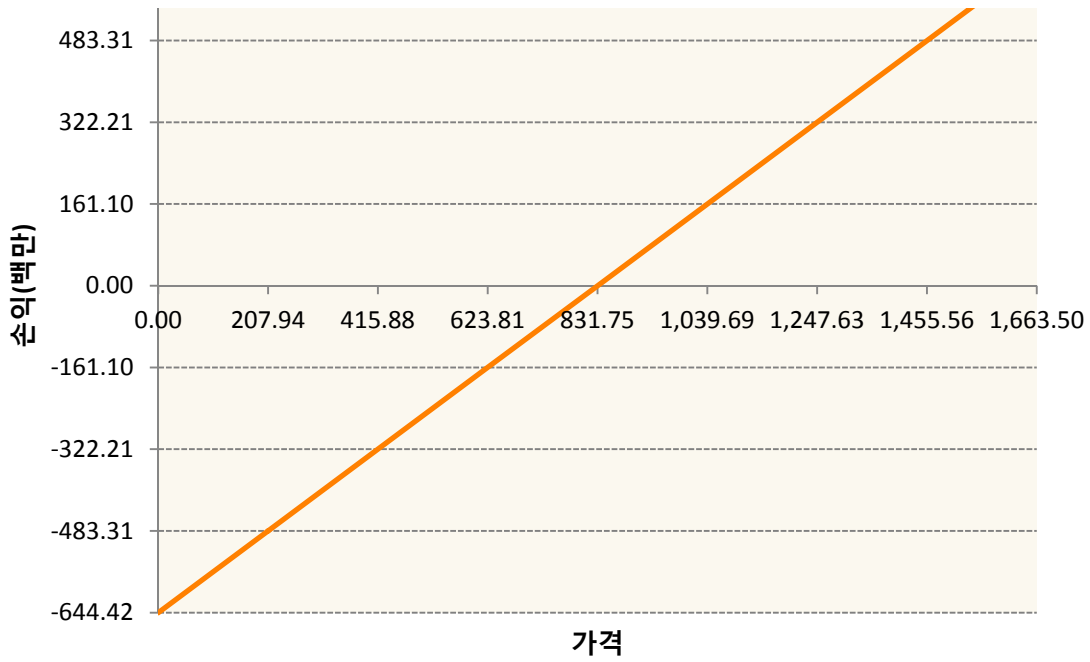


SMZ8-SOYBEAN MEAL FUTR DEC18

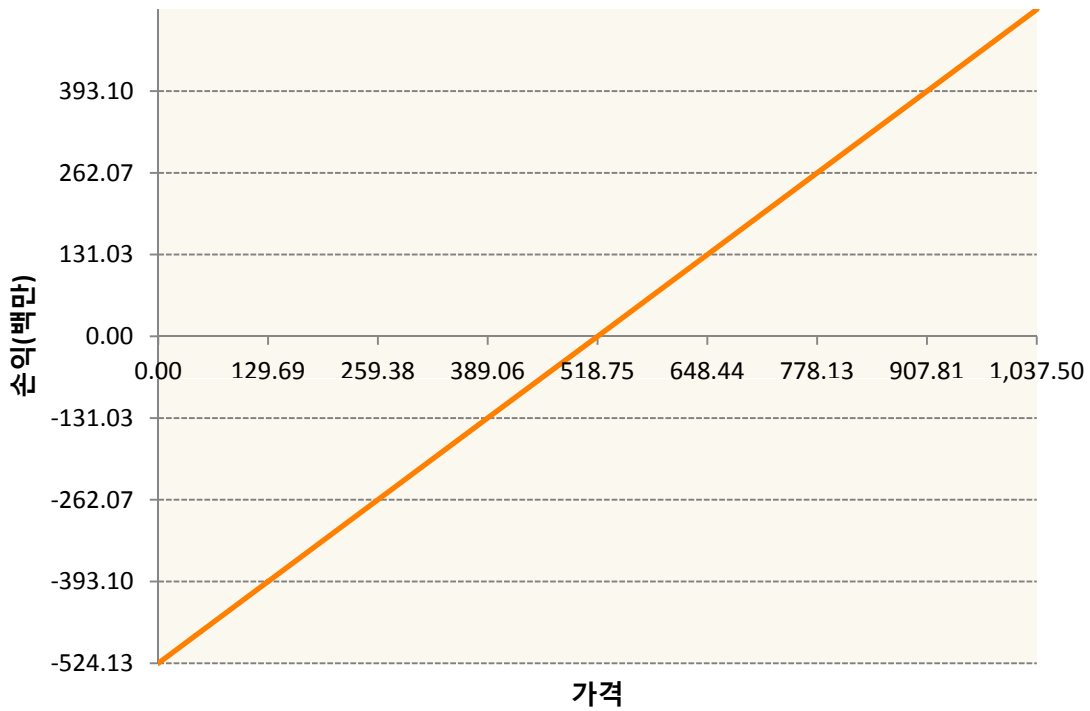


SX8-SOYBEAN FUTURE NOV18





WZ8-WHEAT FUTURE(CBT) DEC18



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

BOZ8	SOYBEAN OIL FUTR DEC18	22
CTZ8	COTTON NO.2 FUTR DEC18	15
CZ8	CORN FUTURE DEC18	66
KCZ8	COFFEE 'C' FUTURE Dec18	20
KR4175N90C	2018-09 달러선물	6

KWZ8	KC HRW WHEAT FUT DEC18	16
SBV8	SUGAR #11 (WORLD) OCT18	27
SMZ8	SOYBEAN MEAL FUTR DEC18	28
SX8	SOYBEAN FUTURE NOV18	52
WZ8	WHEAT FUTURE(CBT) DEC18	42

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

(단위:백만원)

310