공시일	2017-12-11
기준일	2017-12-08

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	2017-12-11
기준일	2017-12-08

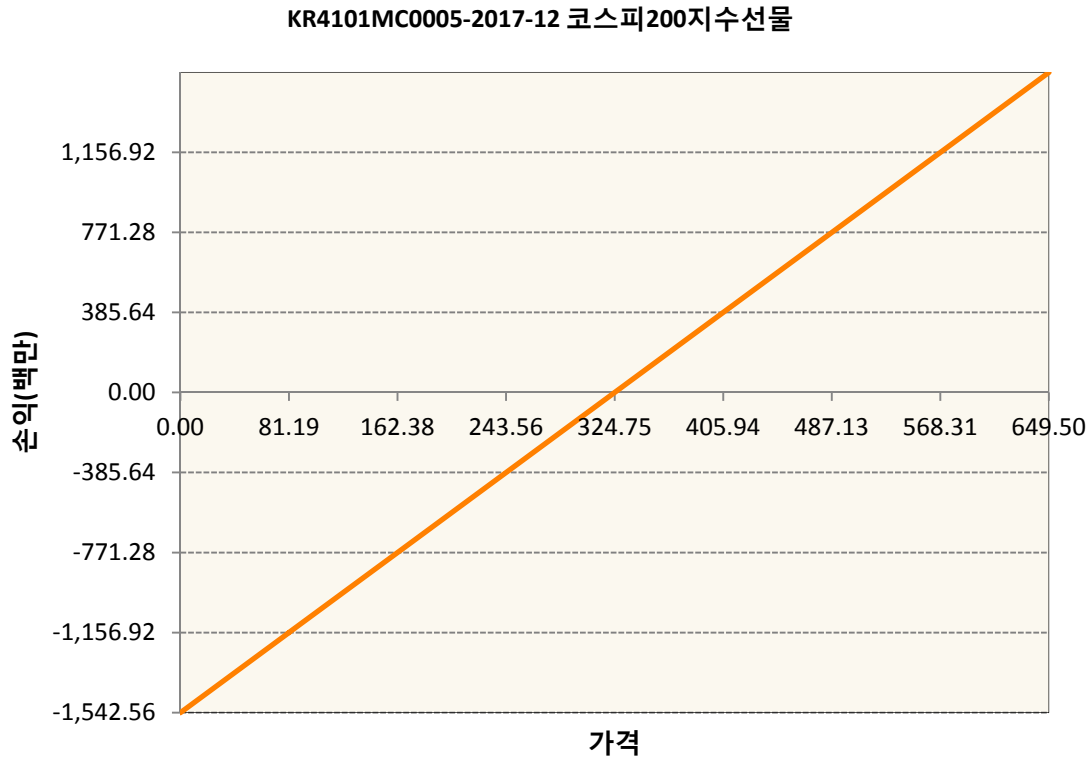
스마트인덱스모

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	1,543	0	1,543	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101MC0	2017-12 코스피200지수선물						123
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-123	-123	-123	-123	-123	-123	-123
-5.33%	-82	-82	-82	-82	-82	-82	-82
-2.67%	-41	-41	-41	-41	-41	-41	-41
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	41	41	41	41	41	41	41
5.33%	82	82	82	82	82	82	82
8.00%	123	123	123	123	123	123	123

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

73

공시일	2017-12-11
기준일	2017-12-08

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	13,365	0	13,365	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWMXWO0(신한MXWO 미래S171122	1,079

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

346

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-12-11
기준일	2017-12-08

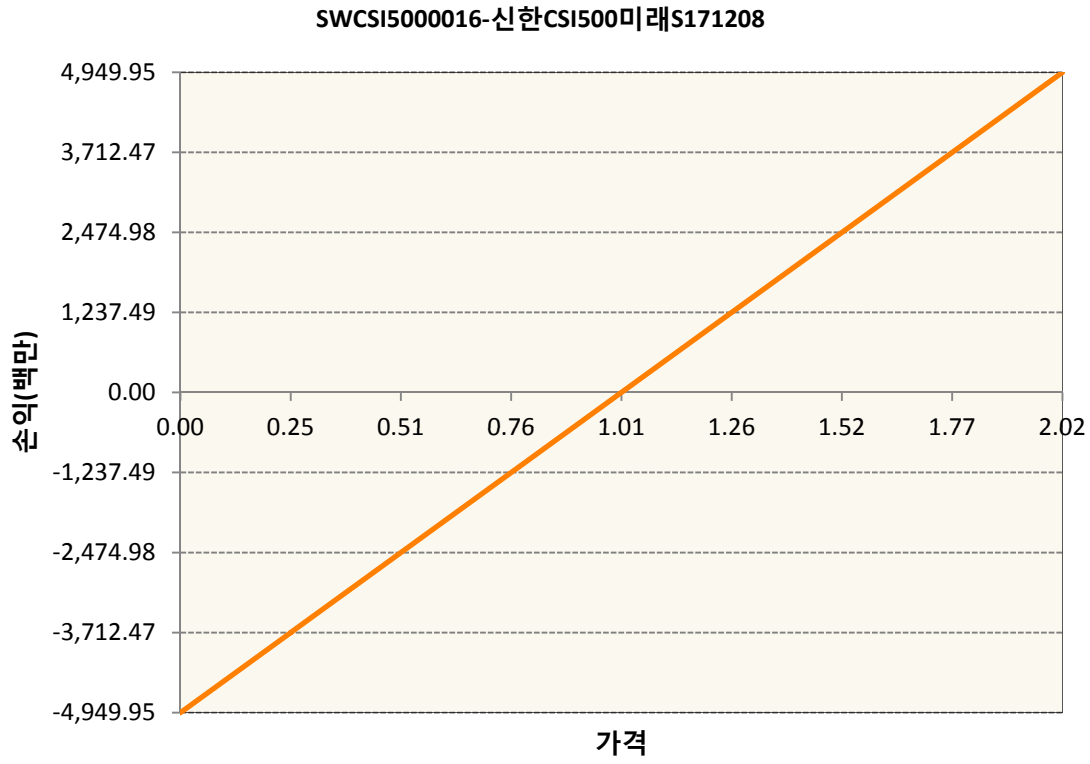
SMART중국본토중소형CSI500상장

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	4,950	0	4,950	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI50000 신한CSI500미래S171208	396

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

367

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-12-11
기준일	2017-12-08

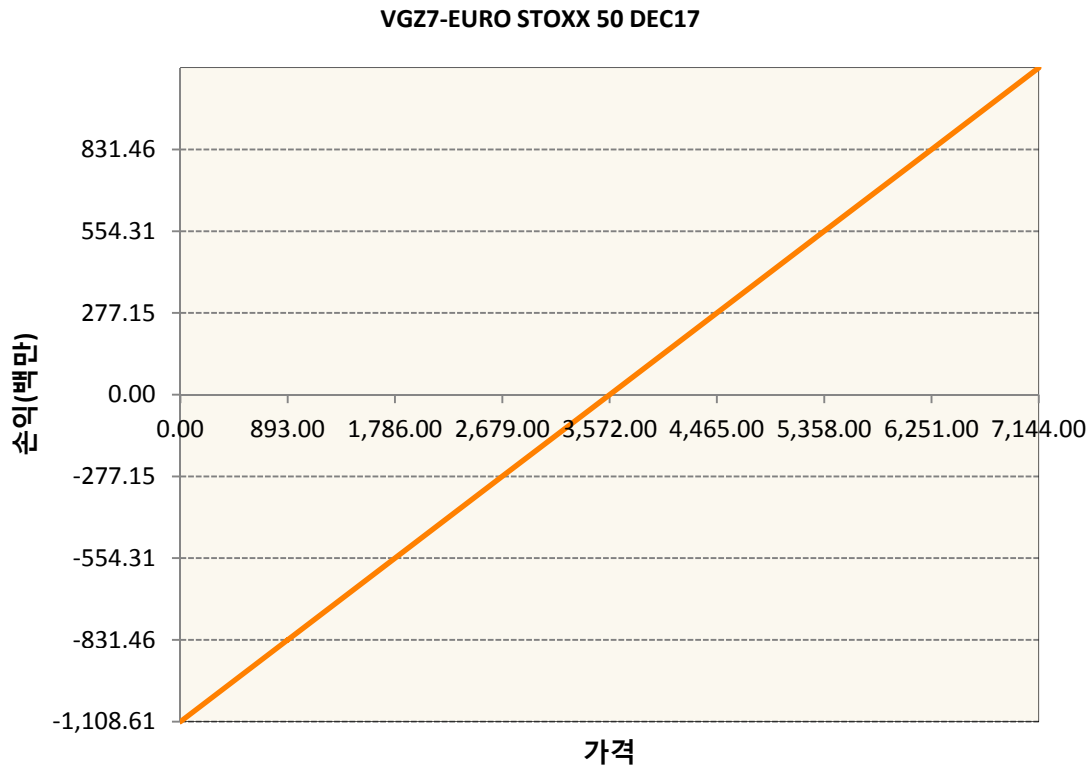
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,109	0	1,109	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGZ7	EURO STOXX 50 DEC17	89

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

(단위:백만원)

50

공시일	2017-12-11
기준일	2017-12-08

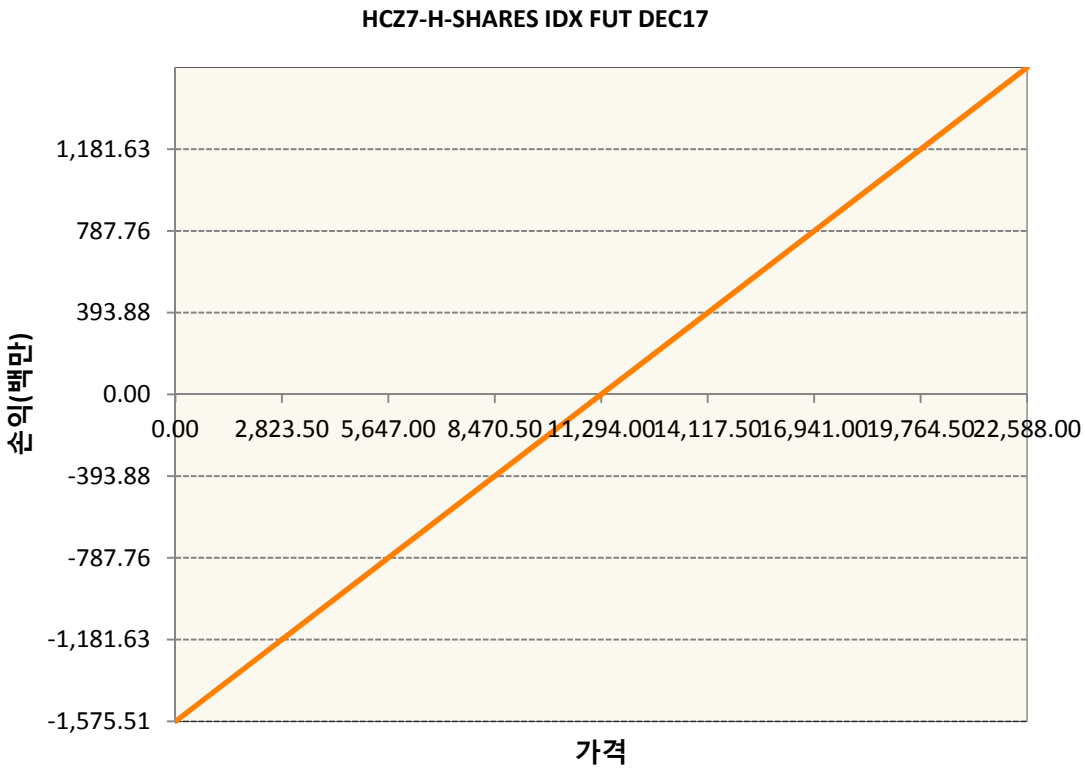
차이나인덱스모(주식-파생형)

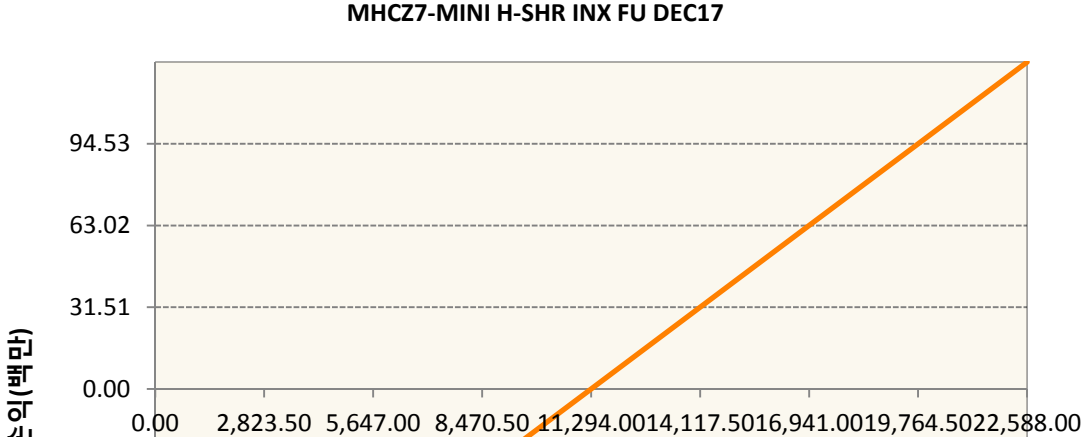
1. 계약금액

(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	1,576	0	1,576	
누계	유가증권	선물	126	0	126	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCZ7	H-SHARES IDX FUT DEC17	126
MHCZ7	MINI H-SHR INX FU DEC17	10

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	88

공시일	2017-12-11
기준일	2017-12-08

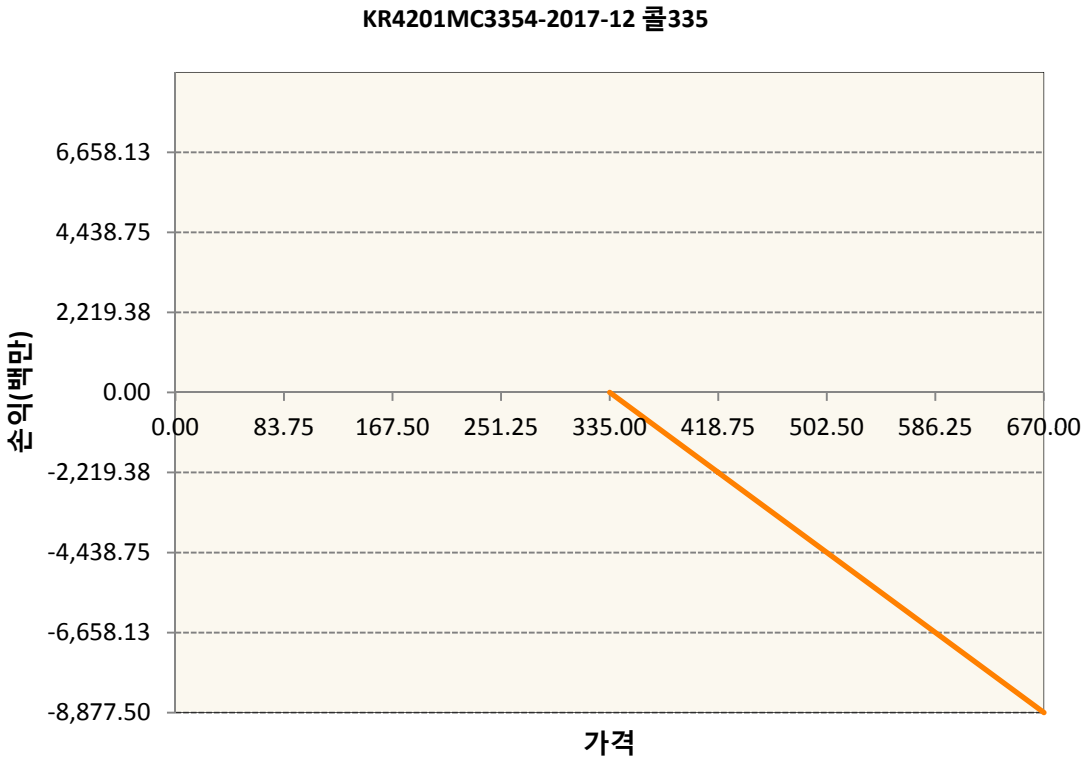
커버드콜모(주식혼합-파생형)

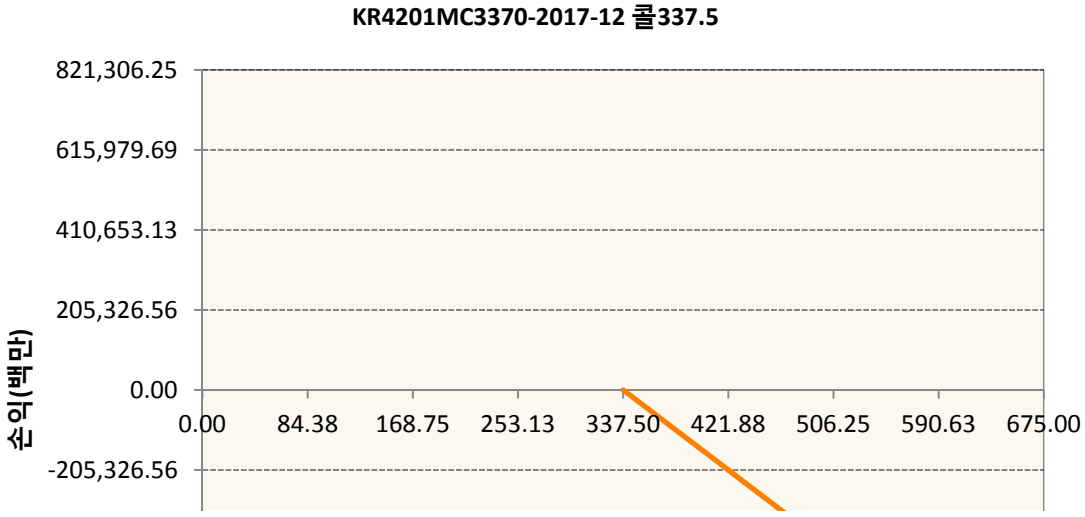
1. 계약금액

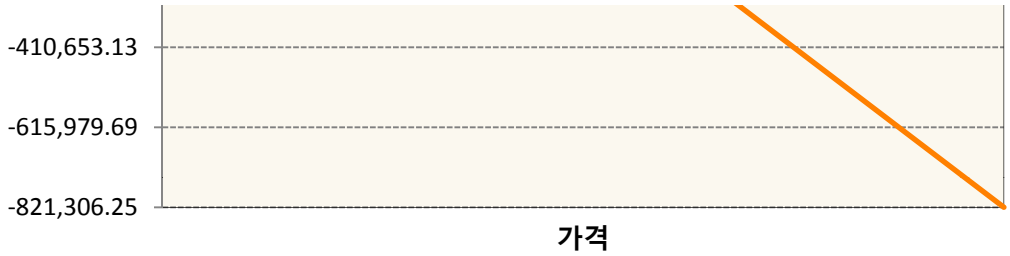
(단위:백만원)

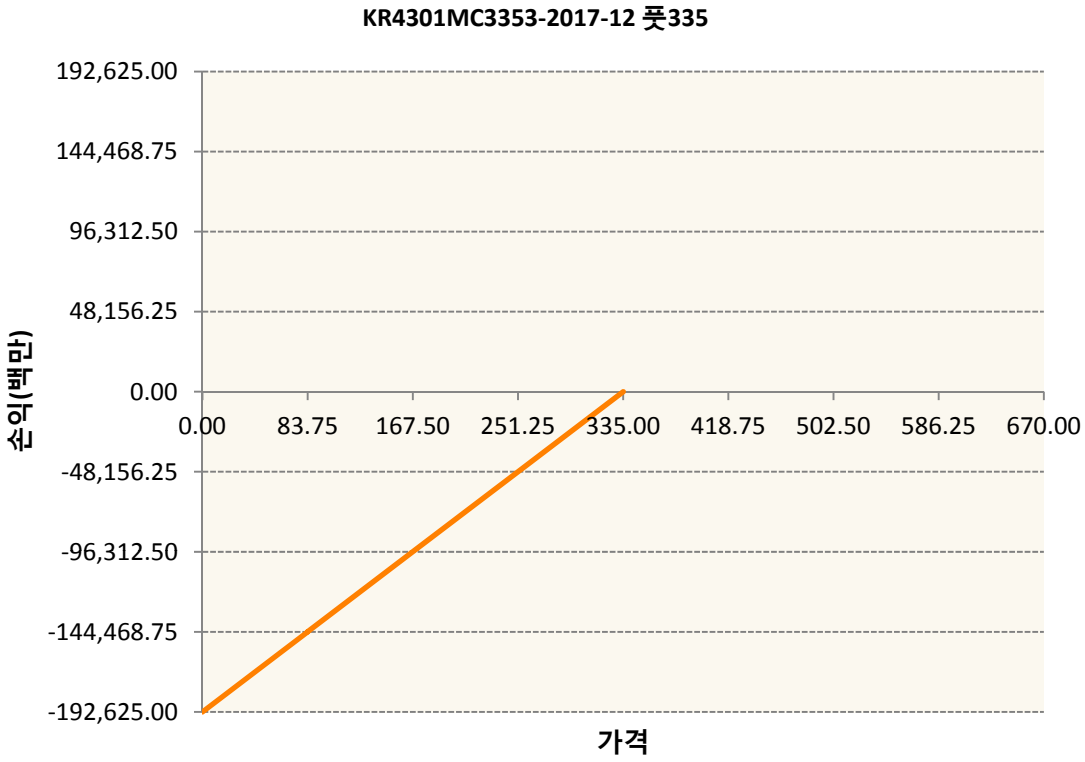
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	4,218	0	4,218	장내
누계	유가증권	옵션	0	1,444,684	-1,444,684	장내

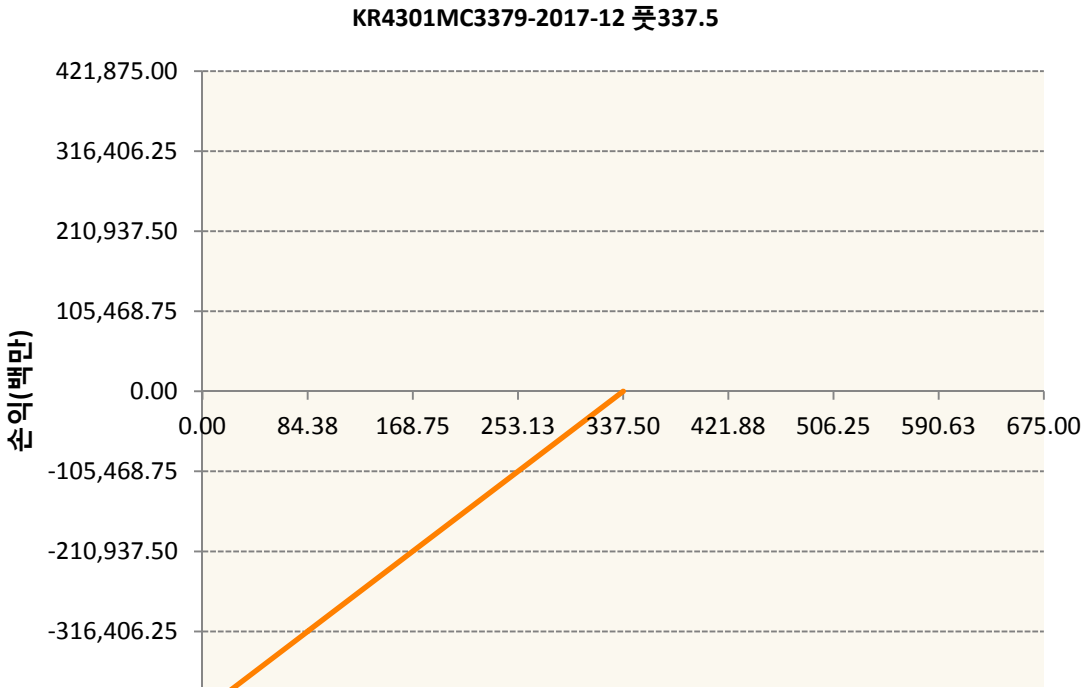
2. 만기시점의 손익구조






-410,653.13
-615,979.69
-821,306.25
가격


KR4301MC3353-2017-12 풋335
192,625.00
144,468.75
96,312.50
48,156.25
0.00
-48,156.25
-96,312.50
-144,468.75
-192,625.00
0.00
83.75
167.50
251.25
335.00
418.75
502.50
586.25
670.00
손익(백만)
가격


KR4301MC3379-2017-12 풋337.5
421,875.00
316,406.25
210,937.50
105,468.75
0.00
-105,468.75
-210,937.50
-316,406.25
0.00
84.38
168.75
253.13
337.50
421.88
506.25
590.63
675.00
손익(백만)



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201MC3 2017-12 콜335							414
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	25	25	25	25	25	24	24
-5.33%	25	25	24	24	24	23	23
-2.67%	24	23	22	21	19	16	13
0%	15	11	6	0	-6	-12	-19
2.67%	-40	-50	-59	-68	-78	-87	-96
5.33%	-185	-191	-199	-206	-214	-222	-231
8.00%	-393	-395	-398	-401	-405	-409	-414
KR4201MC3 2017-12 콜337.5							33,667
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,433	1,433	1,433	1,433	1,431	1,429	1,423
-5.33%	1,433	1,432	1,428	1,420	1,403	1,374	1,328
-2.67%	1,415	1,384	1,329	1,243	1,120	959	757
0%	990	721	389	0	-439	-923	-1,444
2.67%	-2,371	-3,144	-3,933	-4,736	-5,548	-6,368	-7,195
5.33%	-13,179	-13,947	-14,734	-15,536	-16,350	-17,173	-18,004
8.00%	-31,103	-31,389	-31,740	-32,150	-32,612	-33,120	-33,667
KR4301MC3 2017-12 풋335							14,893
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-14,893	-14,893	-14,893	-14,893	-14,893	-14,893	-14,893
-5.33%	-9,916	-9,916	-9,916	-9,916	-9,916	-9,916	-9,916
-2.67%	-4,938	-4,938	-4,939	-4,939	-4,939	-4,940	-4,942
0%	34	27	16	0	-21	-48	-81
2.67%	4,451	4,351	4,250	4,147	4,044	3,941	3,837
5.33%	5,908	5,876	5,836	5,788	5,735	5,676	5,611
8.00%	5,958	5,958	5,957	5,955	5,951	5,946	5,937
KR4301MC3 2017-12 풋337.5							32,435
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-32,435	-32,435	-32,435	-32,435	-32,435	-32,435	-32,435
-5.33%	-21,615	-21,615	-21,615	-21,615	-21,615	-21,615	-21,615
-2.67%	-10,795	-10,795	-10,795	-10,795	-10,795	-10,796	-10,797
0%	24	20	13	0	-20	-48	-86
2.67%	10,390	10,238	10,074	9,900	9,718	9,530	9,335

5.33%	15,619	15,476	15,319	15,151	14,974	14,790	14,599
8.00%	16,016	16,012	16,004	15,990	15,968	15,938	15,897

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

77,829

공시일	2017-12-11
기준일	2017-12-08

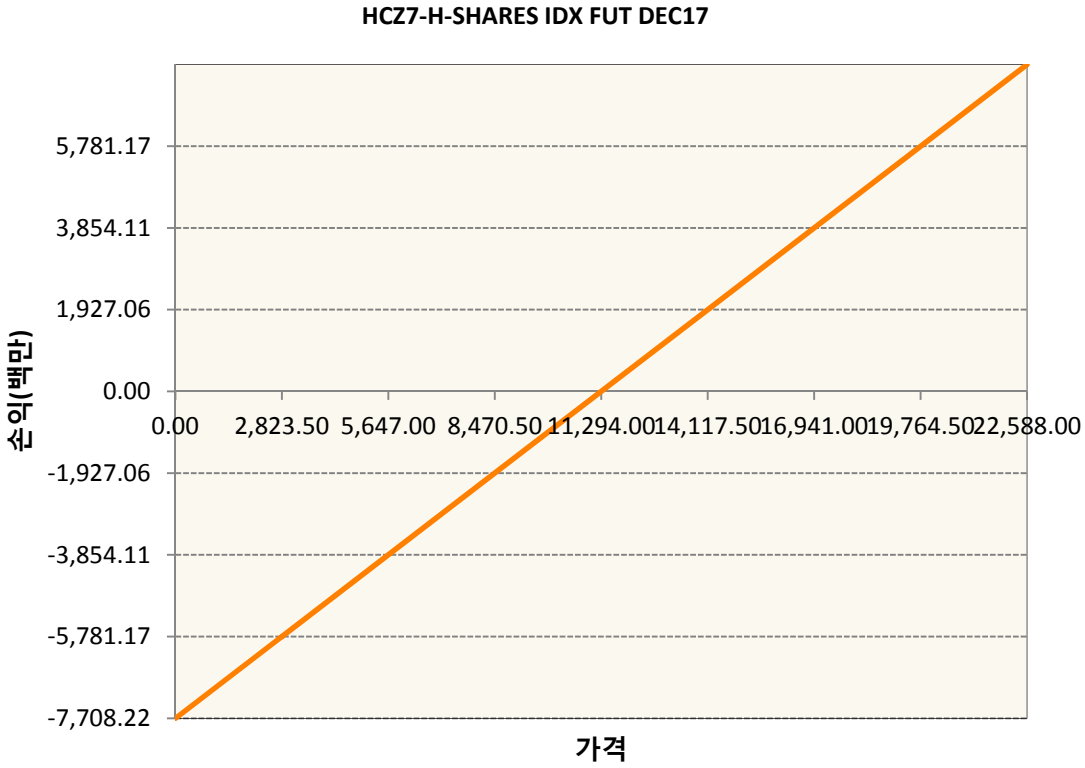
홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생

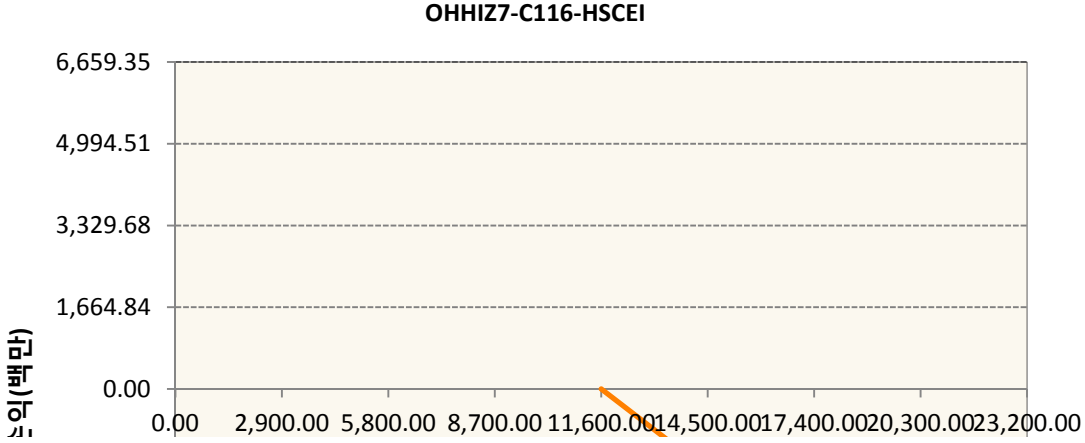
1. 계약금액

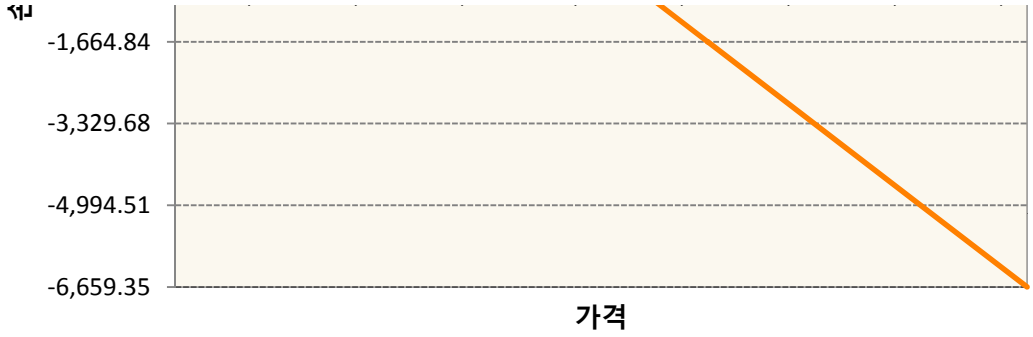
(단위:백만원)

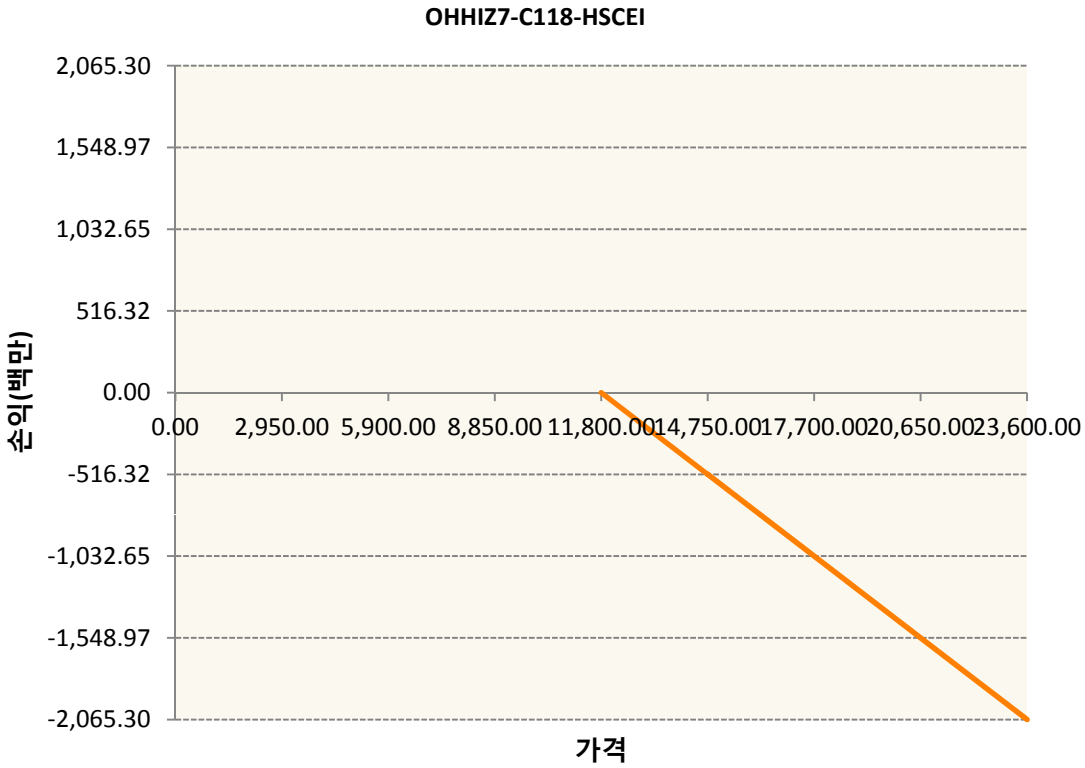
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	7,708	0	7,708	
누계	유가증권	옵션	0	17,449	-17,449	장내

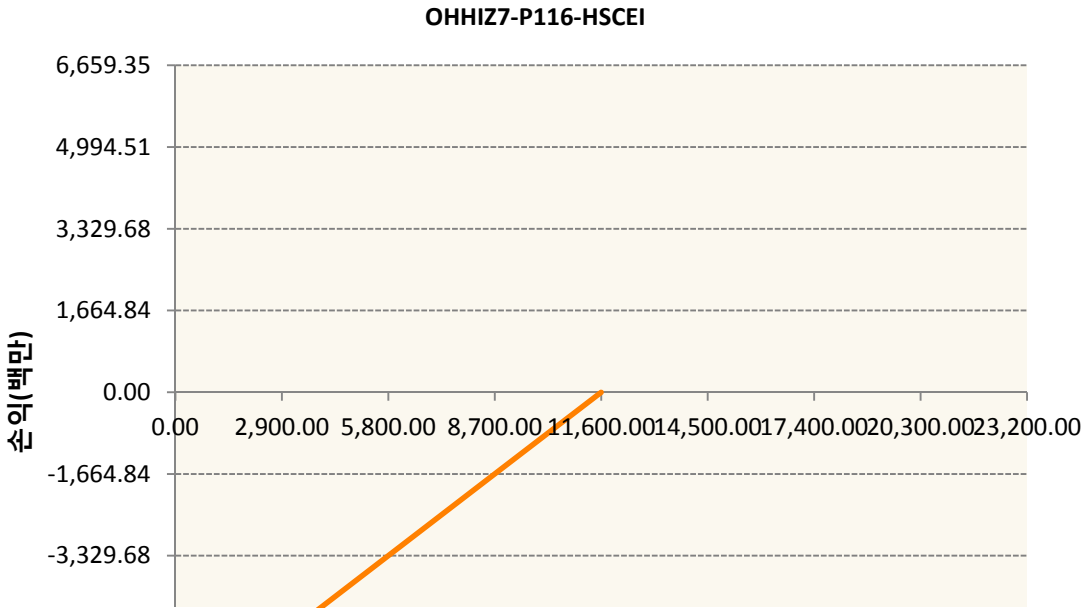
2. 만기시점의 손익구조

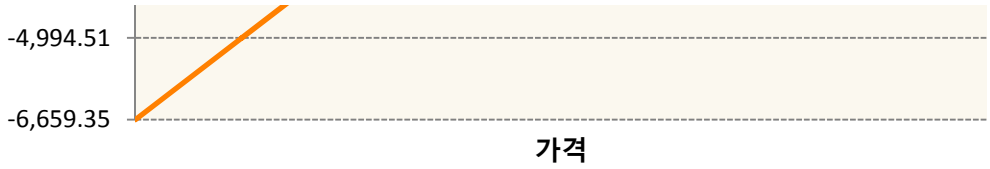


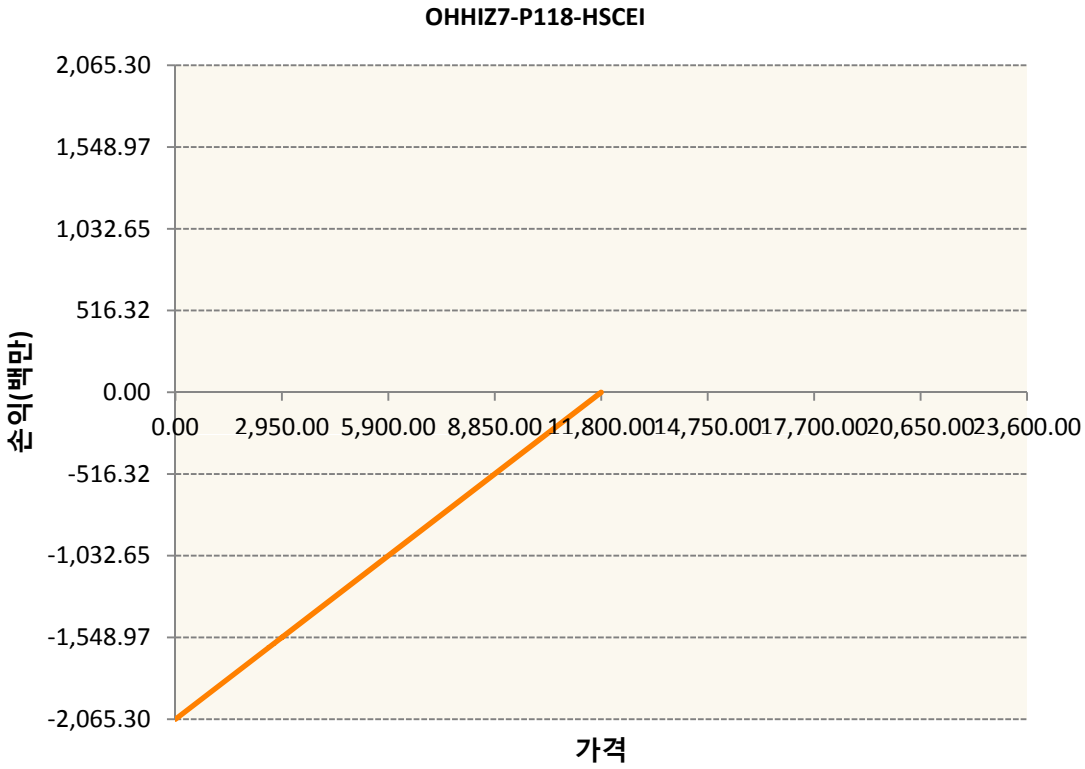



-1,664.84
-3,329.68
-4,994.51
-6,659.35
가격


OHHIZ7-C118-HSCEI
2,065.30
1,548.97
1,032.65
516.32
0.00
-516.32
-1,032.65
-1,548.97
-2,065.30
0.00
2,950.00
5,900.00
8,850.00
11,800.00
14,750.00
17,700.00
20,650.00
23,600.00
손익(백만)
가격


OHHIZ7-P116-HSCEI
6,659.35
4,994.51
3,329.68
1,664.84
0.00
-1,664.84
-3,329.68
0.00
2,900.00
5,800.00
8,700.00
11,600.00
14,500.00
17,400.00
20,300.00
23,200.00
손익(백만)





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCZ7	H-SHARES IDX FUT DEC17	617
OHHIZ7-C11	HSCEI	533
OHHIZ7-C11	HSCEI	165
OHHIZ7-P11	HSCEI	533
OHHIZ7-P11	HSCEI	165

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,499

공시일	2017-12-11
기준일	2017-12-08

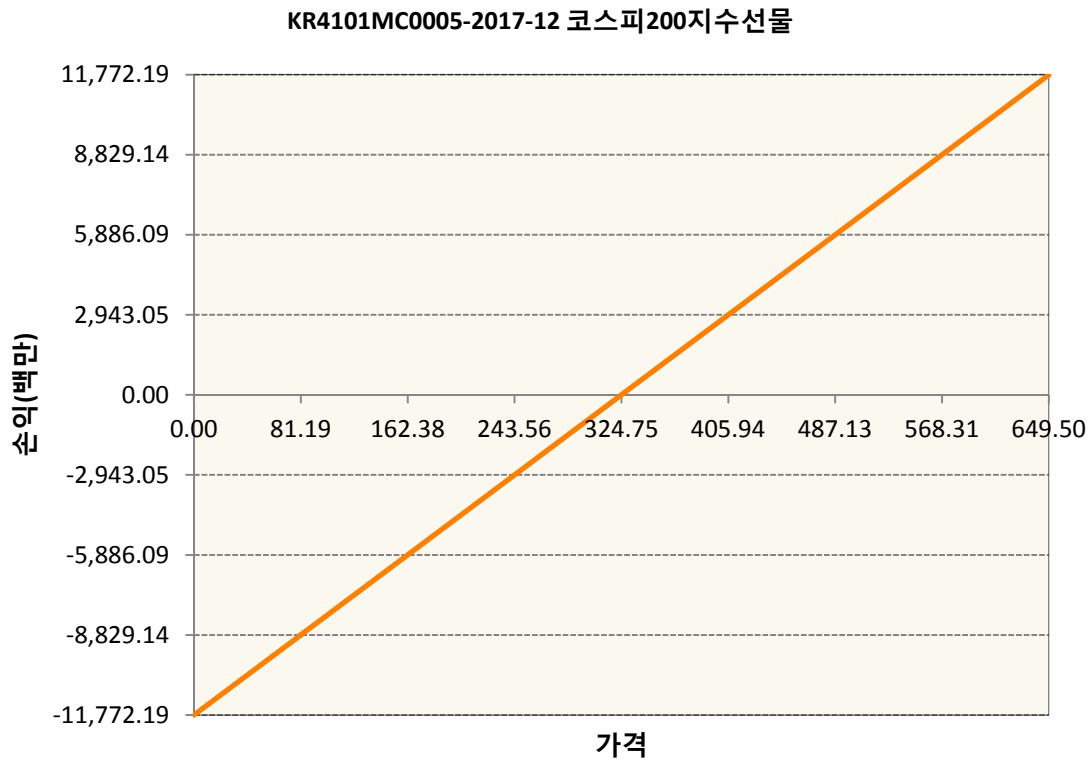
코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼

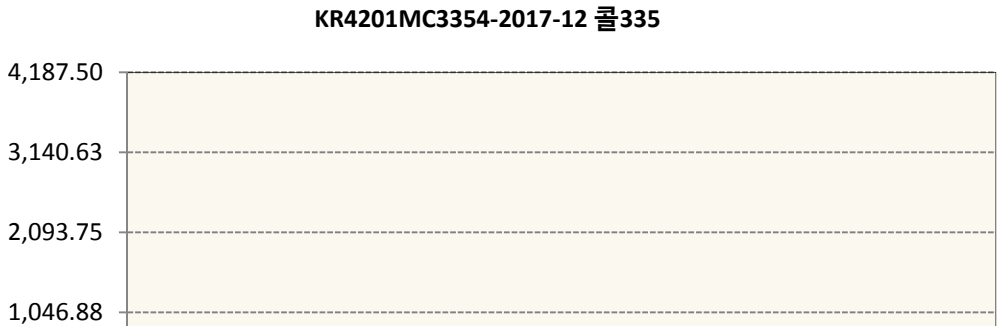
1. 계약금액

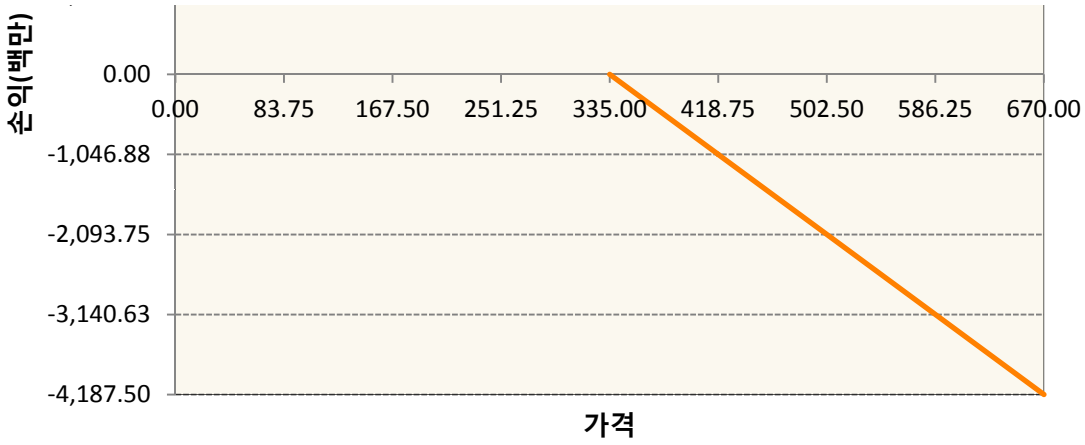
(단위:백만원)

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	11,772	0	11,772	장내
누계	유가증권	스왑	60,200	0	60,200	장외
누계	유가증권	옵션	0	59,409	-59,409	장내

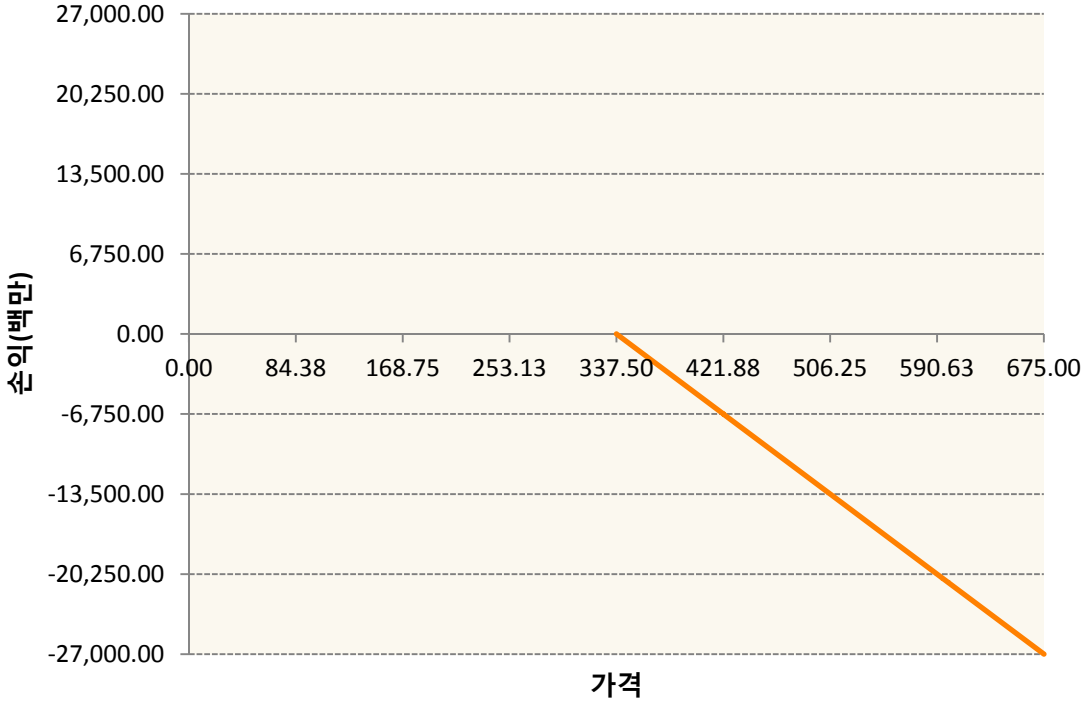
2. 만기시점의 손익구조



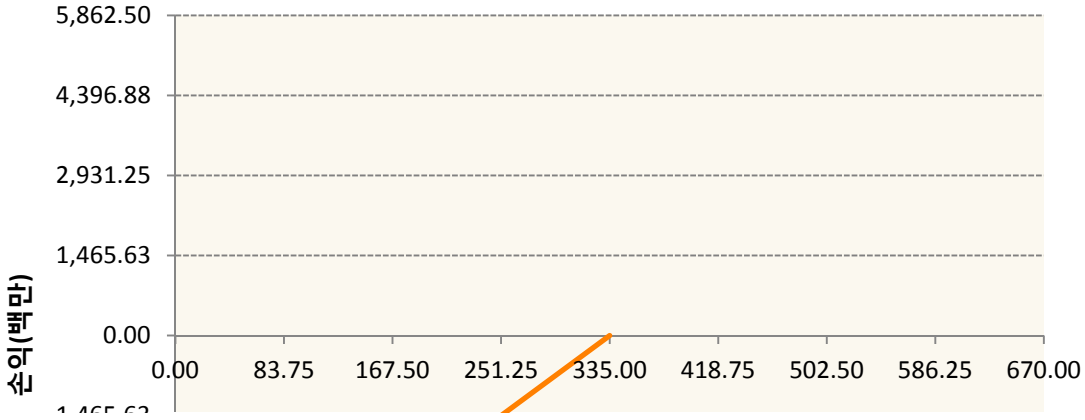




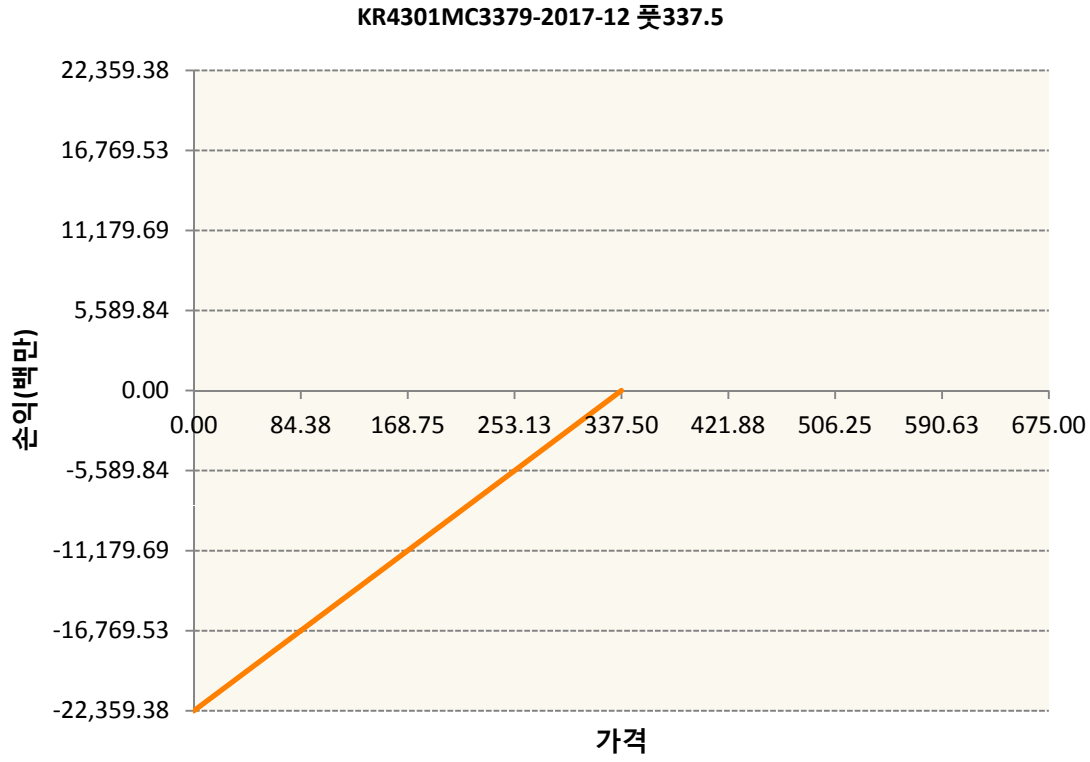
KR4201MC3370-2017-12 콜337.5



KR4301MC3353-2017-12 풋335







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_2							1,473
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,473	-1,473	-1,473	-1,473	-1,473	-1,473	-1,473
-5.33%	-982	-982	-982	-982	-982	-982	-982
-2.67%	-491	-491	-491	-491	-491	-491	-491
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	491	491	491	491	491	491	491
5.33%	982	982	982	982	982	982	982
8.00%	1,473	1,473	1,473	1,473	1,473	1,473	1,473
2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_3							279
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%

-8.00%	-279	-279	-279	-279	-279	-279	-279
-5.33%	-186	-186	-186	-186	-186	-186	-186
-2.67%	-93	-93	-93	-93	-93	-93	-93
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	93	93	93	93	93	93	93
5.33%	186	186	186	186	186	186	186
8.00%	279	279	279	279	279	279	279
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_4						159
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-159	-159	-159	-159	-159	-159	-159
-5.33%	-106	-106	-106	-106	-106	-106	-106
-2.67%	-53	-53	-53	-53	-53	-53	-53
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	53	53	53	53	53	53	53
5.33%	106	106	106	106	106	106	106
8.00%	159	159	159	159	159	159	159
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_5						239
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-239	-239	-239	-239	-239	-239	-239
-5.33%	-159	-159	-159	-159	-159	-159	-159
-2.67%	-80	-80	-80	-80	-80	-80	-80
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	80	80	80	80	80	80	80
5.33%	159	159	159	159	159	159	159
8.00%	239	239	239	239	239	239	239
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_6						199
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-199	-199	-199	-199	-199	-199	-199
-5.33%	-133	-133	-133	-133	-133	-133	-133
-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%	133	133	133	133	133	133	133
8.00%	199	199	199	199	199	199	199
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_7						255
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-255	-255	-255	-255	-255	-255	-255
-5.33%	-170	-170	-170	-170	-170	-170	-170
-2.67%	-85	-85	-85	-85	-85	-85	-85
0%	0	0	0	0	0	0	0

2.67%	85	85	85	85	85	85	85
5.33%	170	170	170	170	170	170	170
8.00%	255	255	255	255	255	255	255
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_8						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
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_9						314
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-314	-314	-314	-314	-314	-314	-314
-5.33%	-209	-209	-209	-209	-209	-209	-209
-2.67%	-105	-105	-105	-105	-105	-105	-105
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	105	105	105	105	105	105	105
5.33%	209	209	209	209	209	209	209
8.00%	314	314	314	314	314	314	314
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_10						279
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-279	-279	-279	-279	-279	-279	-279
-5.33%	-186	-186	-186	-186	-186	-186	-186
-2.67%	-93	-93	-93	-93	-93	-93	-93
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	93	93	93	93	93	93	93
5.33%	186	186	186	186	186	186	186
8.00%	279	279	279	279	279	279	279
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_11						637
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-637	-637	-637	-637	-637	-637	-637
-5.33%	-425	-425	-425	-425	-425	-425	-425
-2.67%	-212	-212	-212	-212	-212	-212	-212
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	212	212	212	212	212	212	212
5.33%	425	425	425	425	425	425	425
8.00%	637	637	637	637	637	637	637
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_12						478

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-478	-478	-478	-478	-478	-478	-478
-5.33%	-318	-318	-318	-318	-318	-318	-318
-2.67%	-159	-159	-159	-159	-159	-159	-159
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	159	159	159	159	159	159	159
5.33%	318	318	318	318	318	318	318
8.00%	478	478	478	478	478	478	478
	KR4101MC0	2017-12 코스피200지수선물					942

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-942	-942	-942	-942	-942	-942	-942
-5.33%	-628	-628	-628	-628	-628	-628	-628
-2.67%	-314	-314	-314	-314	-314	-314	-314
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	314	314	314	314	314	314	314
5.33%	628	628	628	628	628	628	628
8.00%	942	942	942	942	942	942	942
	KR4201MC3	2017-12 콜335					195

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	12	12	12	12	12	12	11
-5.33%	12	12	12	11	11	11	11
-2.67%	11	11	11	10	9	8	6
0%	7	5	3	0	-3	-6	-9
2.67%	-19	-23	-28	-32	-37	-41	-45
5.33%	-87	-90	-94	-97	-101	-105	-109
8.00%	-185	-186	-188	-189	-191	-193	-195
	KR4201MC3	2017-12 콜337.5					1,107

	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%	47	47	47	47	46	45	44
-2.67%	47	46	44	41	37	32	25
0%	33	24	13	0	-14	-30	-47
2.67%	-78	-103	-129	-156	-182	-209	-237
5.33%	-433	-458	-484	-511	-537	-565	-592
8.00%	-1,022	-1,032	-1,043	-1,057	-1,072	-1,089	-1,107
	KR4301MC3	2017-12 풋335					453

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-453	-453	-453	-453	-453	-453	-453
-5.33%	-302	-302	-302	-302	-302	-302	-302

-2.67%	-150	-150	-150	-150	-150	-150	-150
0%	1	1	0	0	-1	-1	-2
2.67%	135	132	129	126	123	120	117
5.33%	180	179	178	176	175	173	171
8.00%	181	181	181	181	181	181	181
	KR4301MC3. 2017-12 풋337.5						1,719
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,719	-1,719	-1,719	-1,719	-1,719	-1,719	-1,719
-5.33%	-1,146	-1,146	-1,146	-1,146	-1,146	-1,146	-1,146
-2.67%	-572	-572	-572	-572	-572	-572	-572
0%	1	1	1	0	-1	-3	-5
2.67%	551	543	534	525	515	505	495
5.33%	828	820	812	803	794	784	774
8.00%	849	849	848	847	846	845	843

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

8,720

공시일	2017-12-11
기준일	2017-12-08

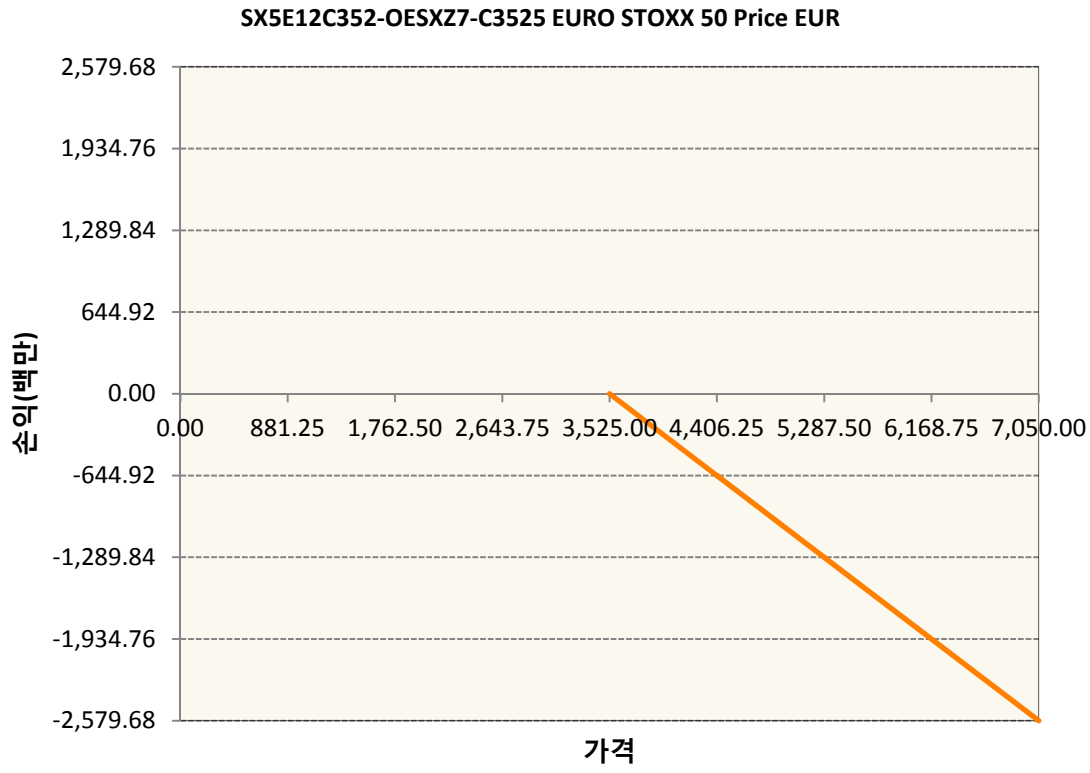
유로커버드콜모(주식혼합-파생형

1. 계약금액

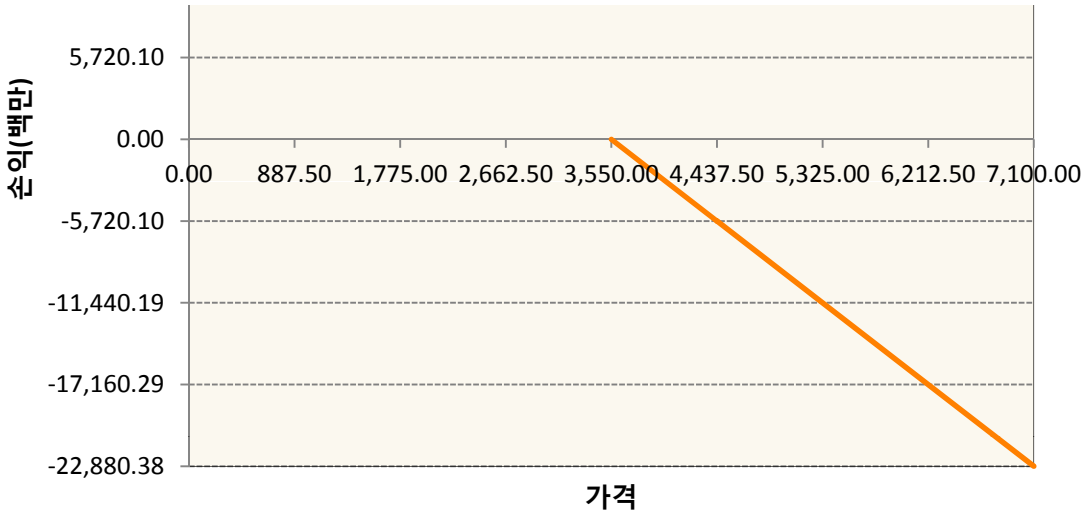
(단위:백만원)

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	17,561	0	17,561	
누계	유가증권	스왑	96,290	0	96,290	장외
누계	유가증권	옵션	0	50,920	-50,920	장내
누계	지수	스왑	51,355	0	51,355	장외

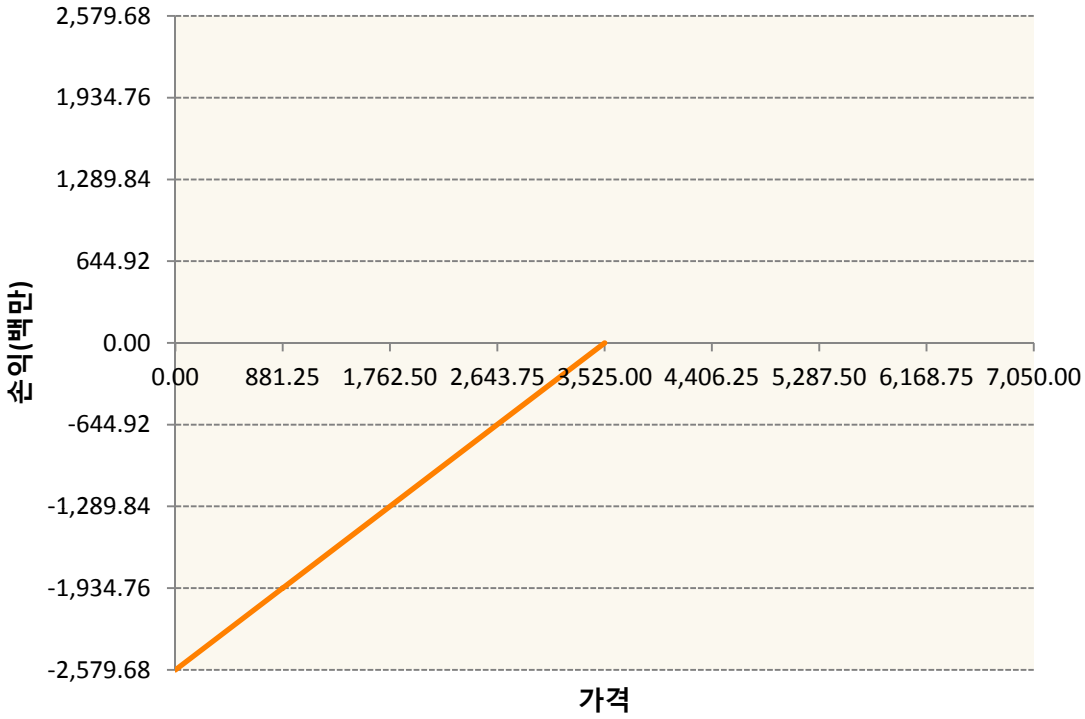
2. 만기시점의 손익구조



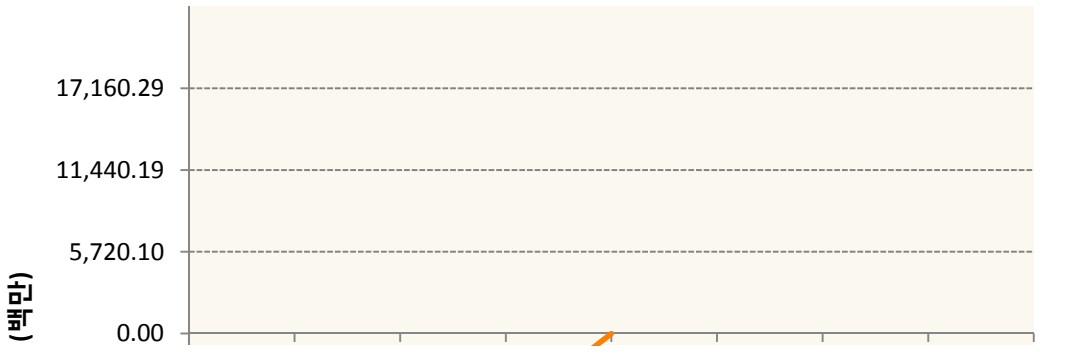


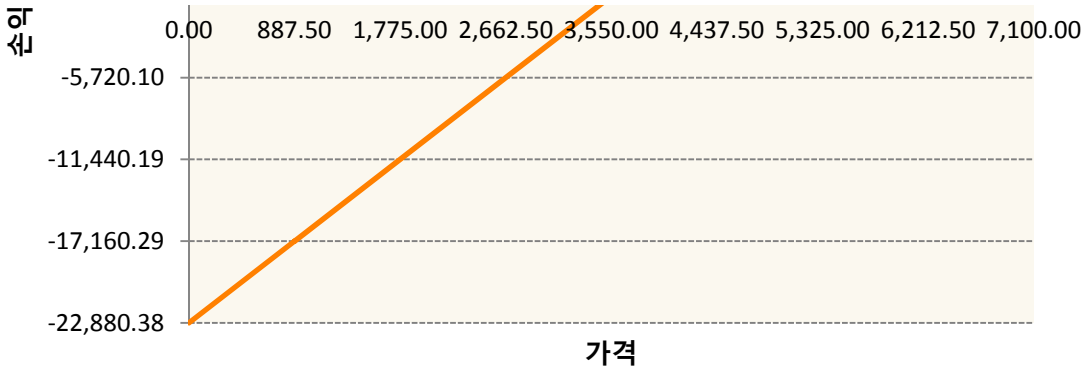


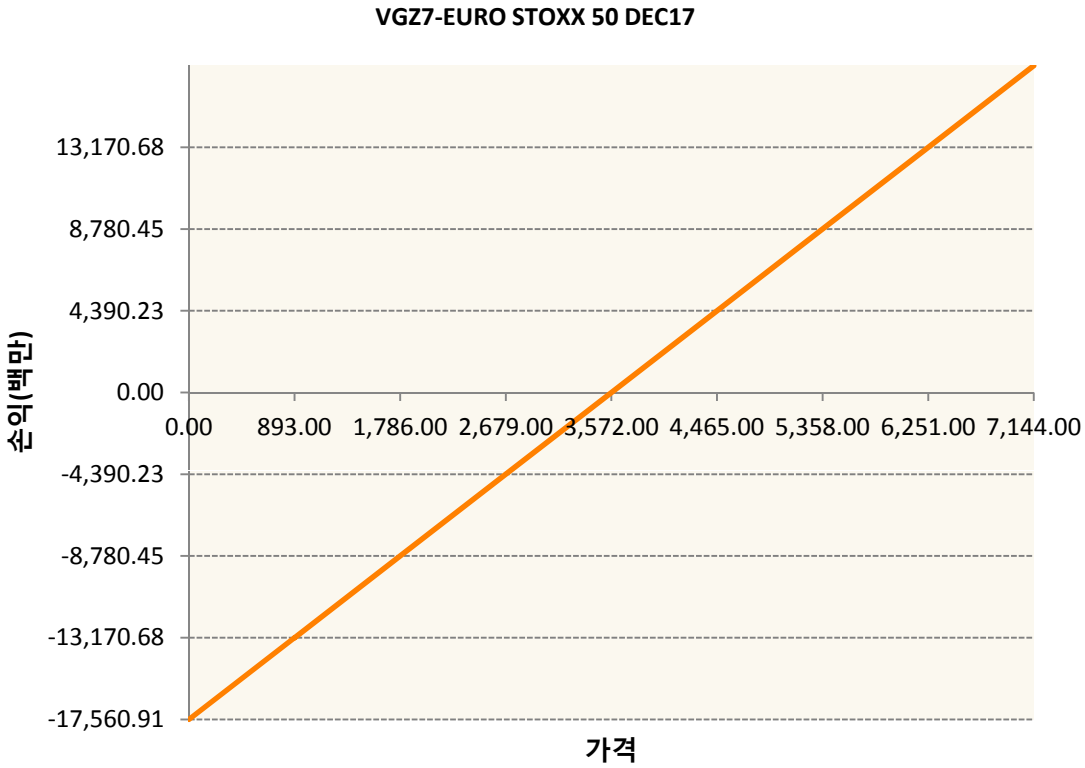
SX5E12P352-OESXZ7-P3525 EURO STOXX 50 Price EUR



SX5E12P355-OESXZ7-P3550 EURO STOXX 50 Price EUR







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
260105SGPX	SG EURO Covered CALL STRATEGY - 994.569	37
260105SQPX	SG EURO Covered CALL STRATEGY	27
SX5E12C352	OESXZ7-C3525 EURO STOXX 50 Price EUR	206
SX5E12C355	OESXZ7-C3550 EURO STOXX 50 Price EUR	1,830
SX5E12P352	OESXZ7-P3525 EURO STOXX 50 Price EUR	206
SX5E12P355	OESXZ7-P3550 EURO STOXX 50 Price EUR	1,830
VGZ7	EURO STOXX 50 DEC17	1,405

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

3,148

공시일	2017-12-11
기준일	2017-12-08

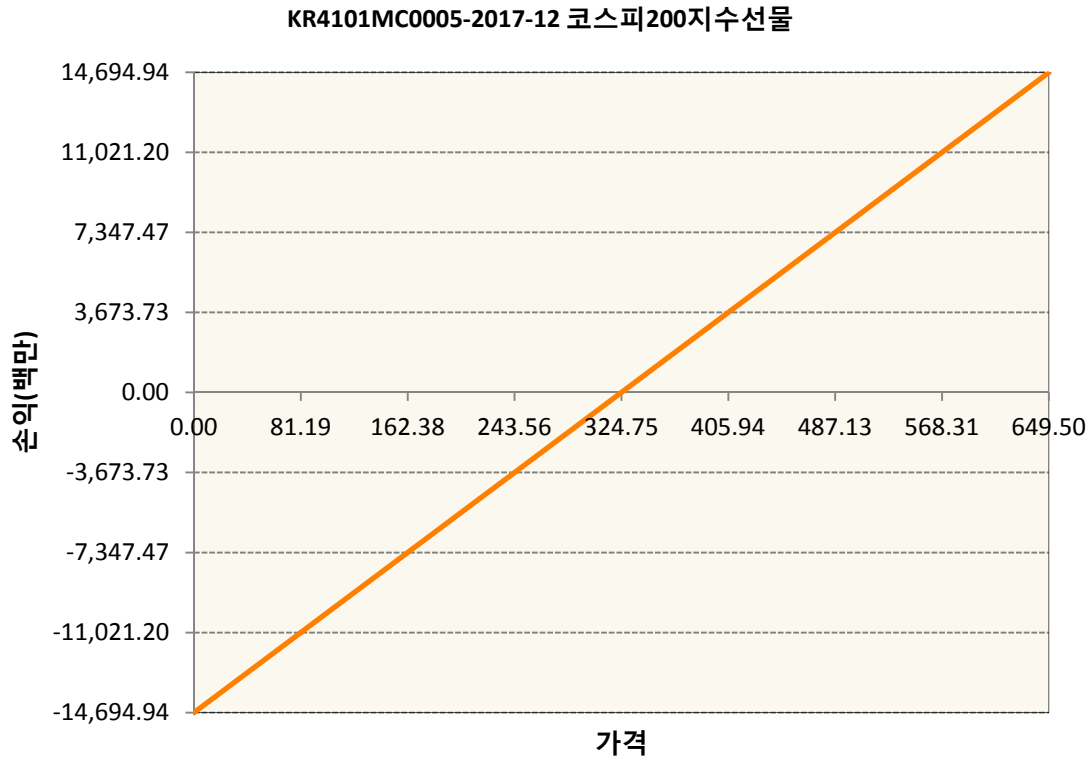
ETF스마트레버리지목표전환형8호

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	14,695	0	14,695	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101MC0	2017-12 코스피200지수선물						1,175
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,175	-1,175	-1,175	-1,175	-1,175	-1,175	-1,175
-5.33%	-784	-784	-784	-784	-784	-784	-784
-2.67%	-392	-392	-392	-392	-392	-392	-392
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	392	392	392	392	392	392	392
5.33%	784	784	784	784	784	784	784
8.00%	1,175	1,175	1,175	1,175	1,175	1,175	1,175

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

696

공시일	2017-12-11
기준일	2017-12-08

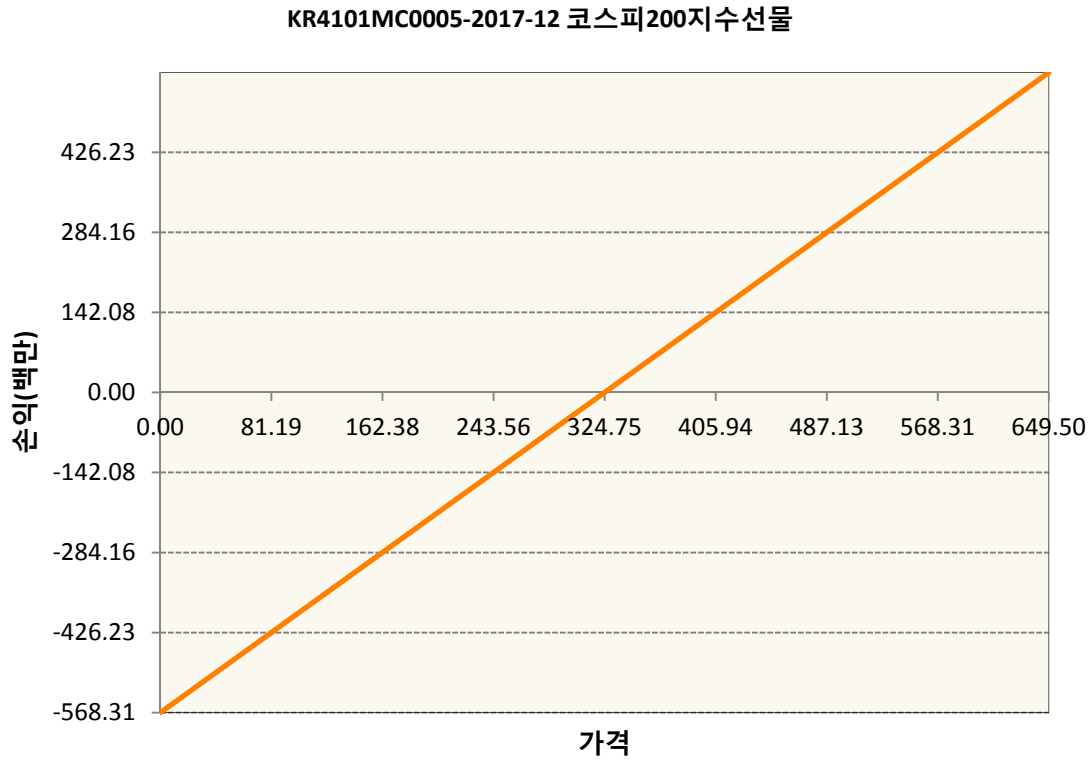
ETF스마트레버리지목표전환형9호

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	569	0	569	장내
누계	유가증권	선물	568	0	568	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101MC0	2017-12 코스피200지수선물						45
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-45	-45	-45	-45	-45	-45	-45
-5.33%	-30	-30	-30	-30	-30	-30	-30
-2.67%	-15	-15	-15	-15	-15	-15	-15
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	15	15	15	15	15	15	15
5.33%	30	30	30	30	30	30	30
8.00%	45	45	45	45	45	45	45

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

27

공시일	2017-12-11
기준일	2017-12-08

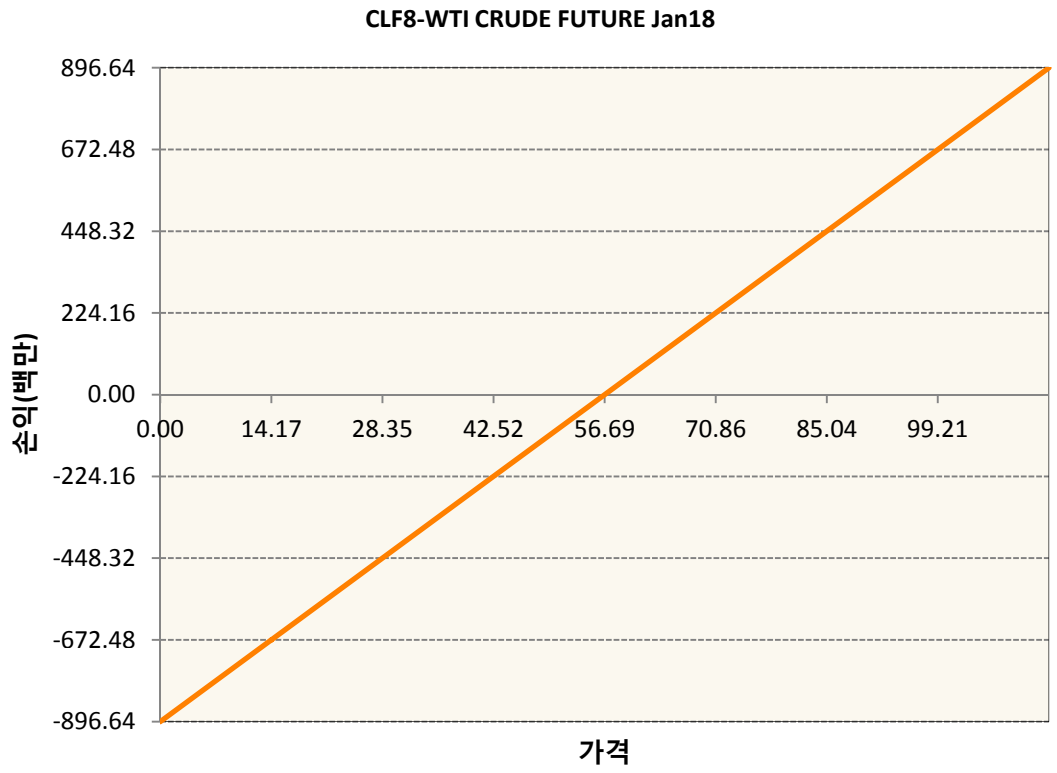
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

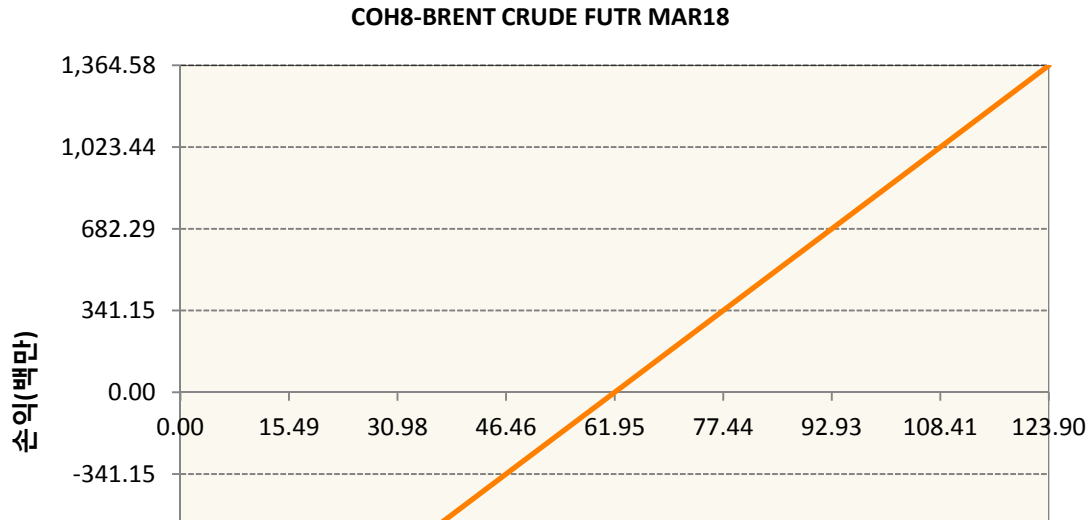
1. 계약금액

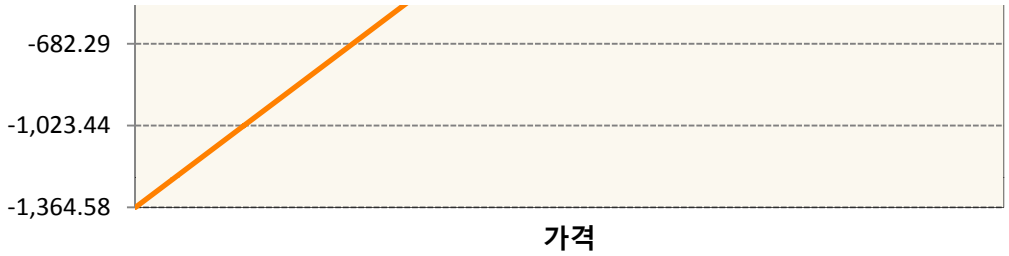
(단위:백만원)

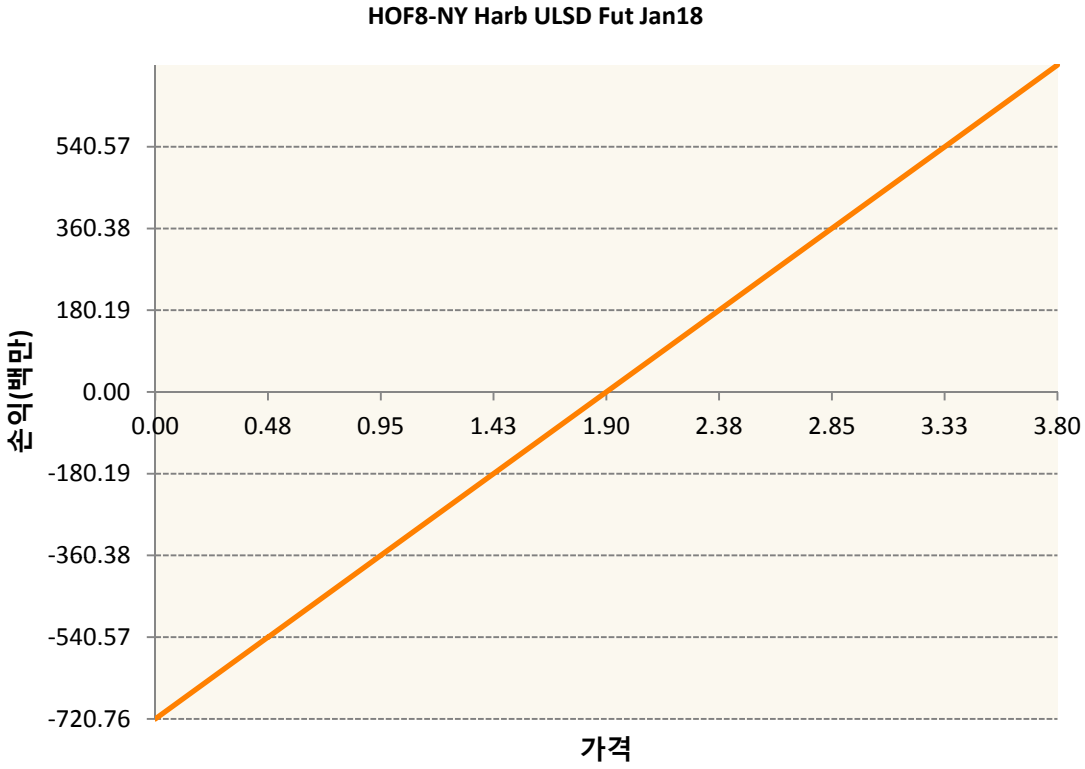
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	4,842	874	3,967	

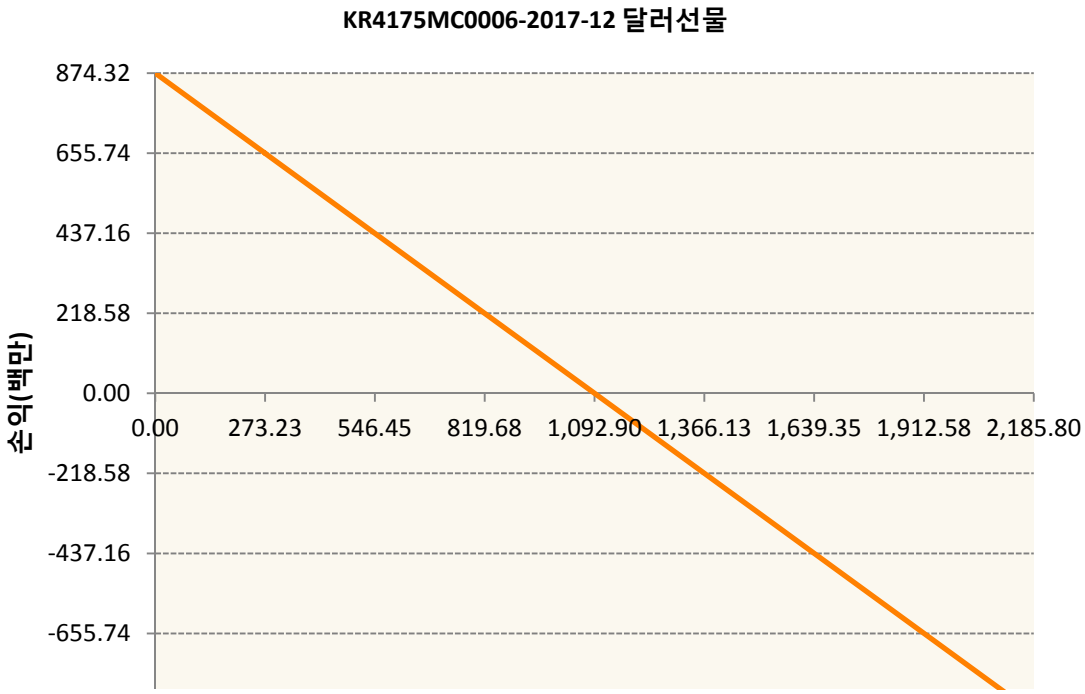
2. 만기시점의 손익구조

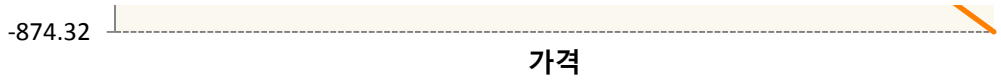


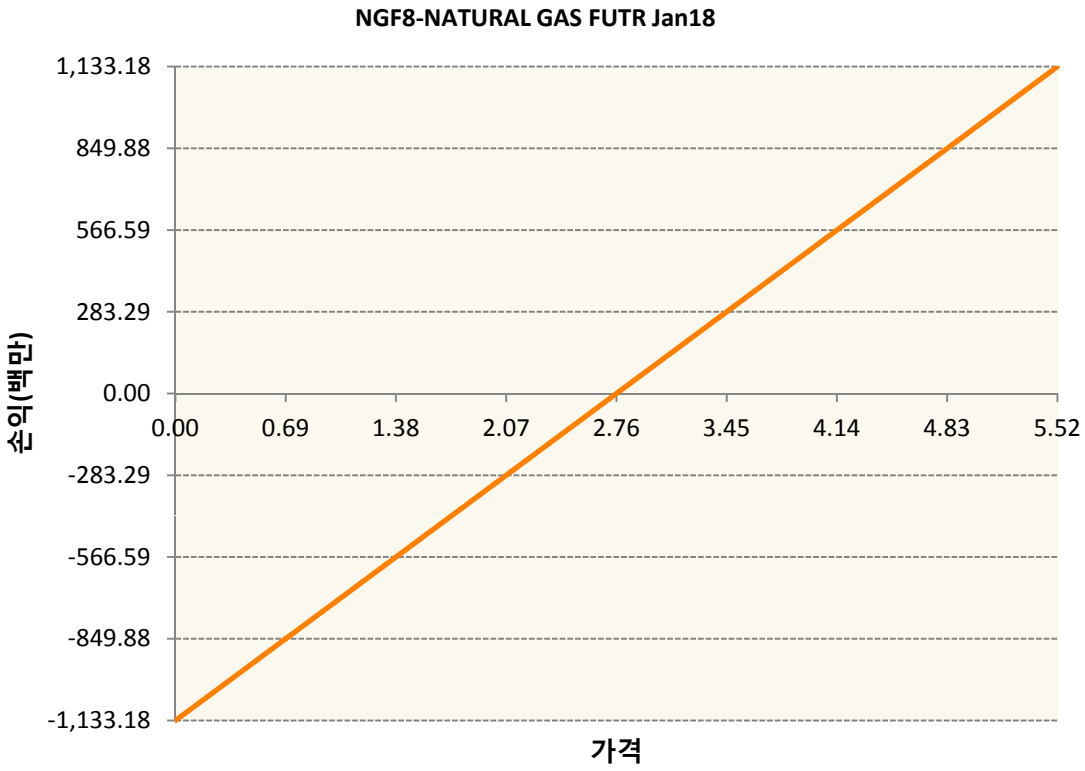


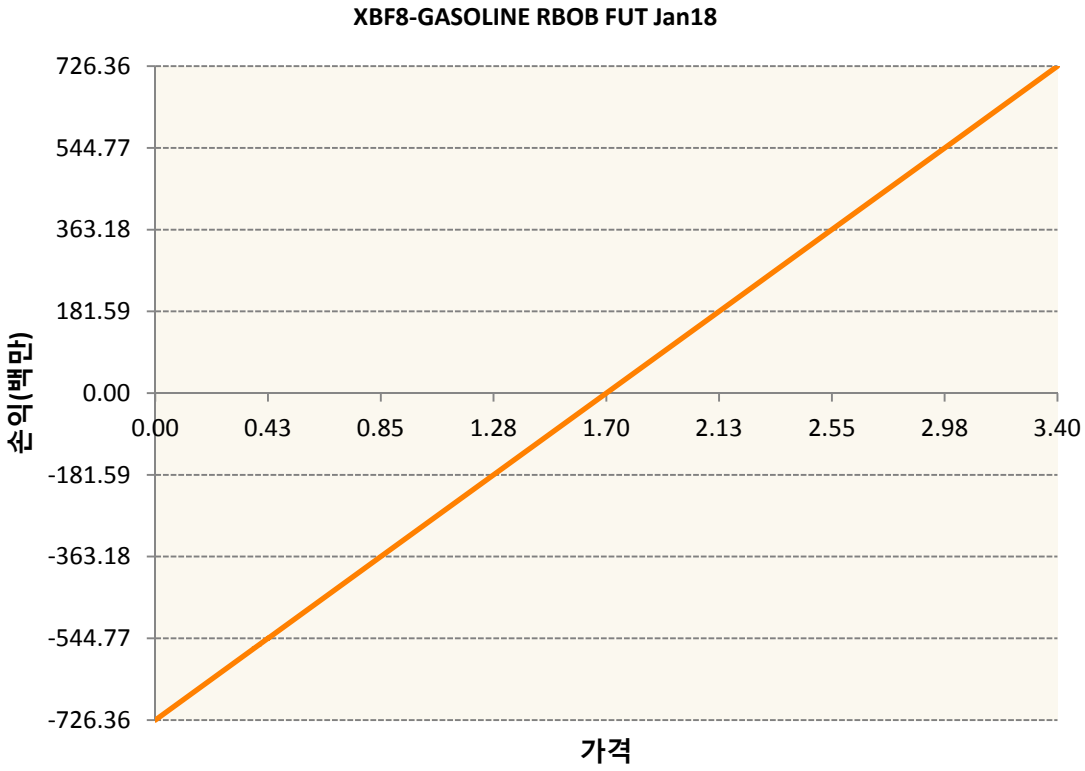

-682.29
-1,023.44
-1,364.58
가격


HOF8-NY Harb ULSD Fut Jan18
540.57
360.38
180.19
0.00
-180.19
-360.38
-540.57
-720.76
0.00
0.48
0.95
1.43
1.90
2.38
2.85
3.33
3.80
손익(백만)
가격


KR4175MC0006-2017-12 달러선물
874.32
655.74
437.16
218.58
0.00
-218.58
-437.16
-655.74
0.00
273.23
546.45
819.68
1,092.90
1,366.13
1,639.35
1,912.58
2,185.80
손익(백만)


-874.32
가격


NGF8-NATURAL GAS FUTR Jan18
1,133.18
849.88
566.59
283.29
0.00
-283.29
-566.59
-849.88
-1,133.18
0.00
0.69
1.38
2.07
2.76
3.45
4.14
4.83
5.52
손익(백만)
가격


XBF8-GASOLINE RBOB FUT Jan18
726.36
544.77
363.18
181.59
0.00
-181.59
-363.18
-544.77
-726.36
0.00
0.43
0.85
1.28
1.70
2.13
2.55
2.98
3.40
손익(백만)
가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLF8	WTI CRUDE FUTURE Jan18	72
COH8	BRENT CRUDE FUTR MAR18	109
HOF8	NY Harb ULSD Fut Jan18	58
KR4175MC0(	2017-12 달러선물	70
NGF8	NATURAL GAS FUTR Jan18	91
XBF8	GASOLINE RBOB FUT Jan18	58

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

659

공시일	2017-12-11
기준일	2017-12-08

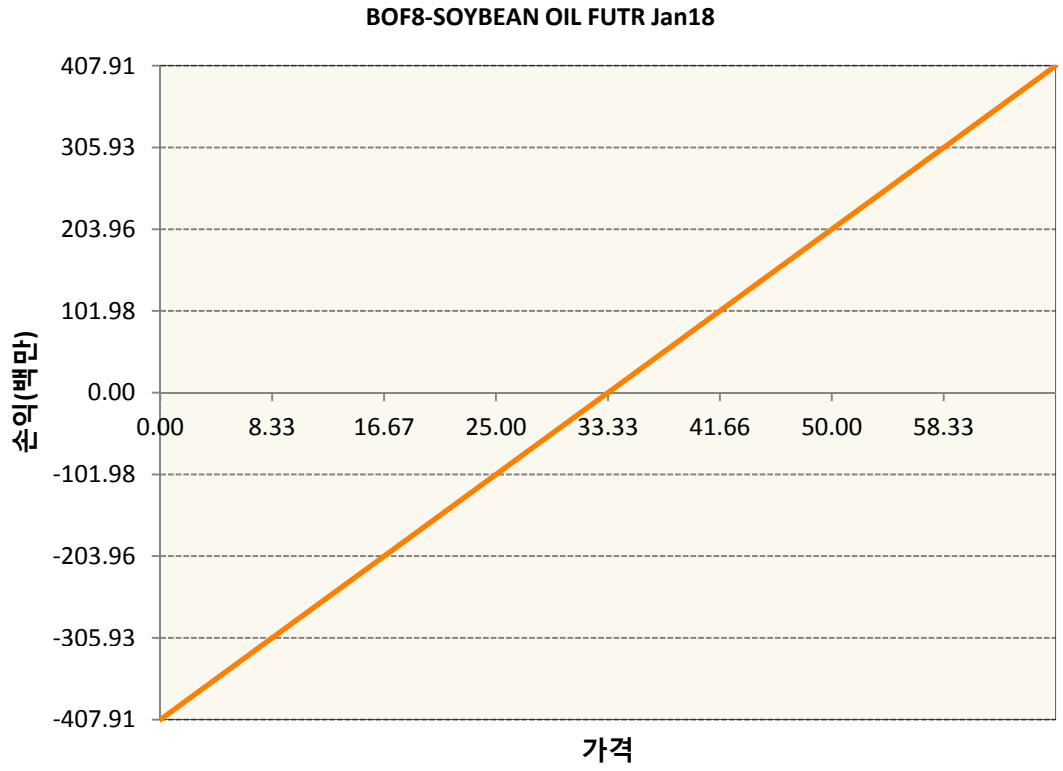
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

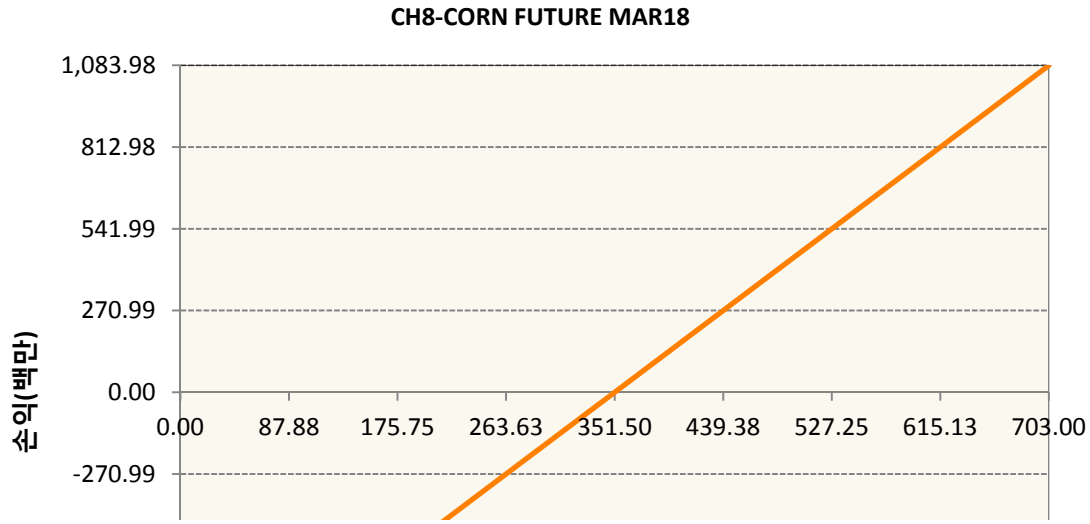
1. 계약금액

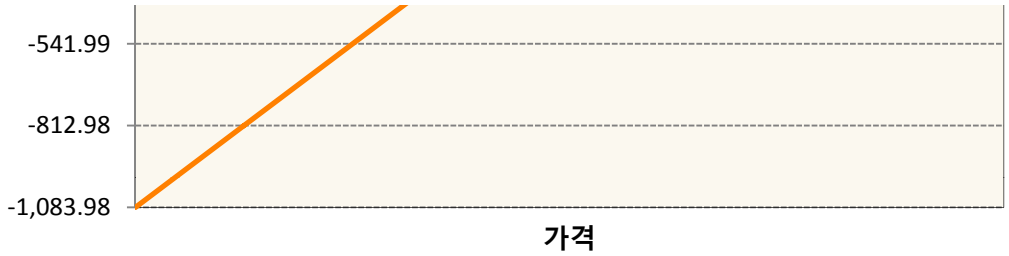
(단위:백만원)

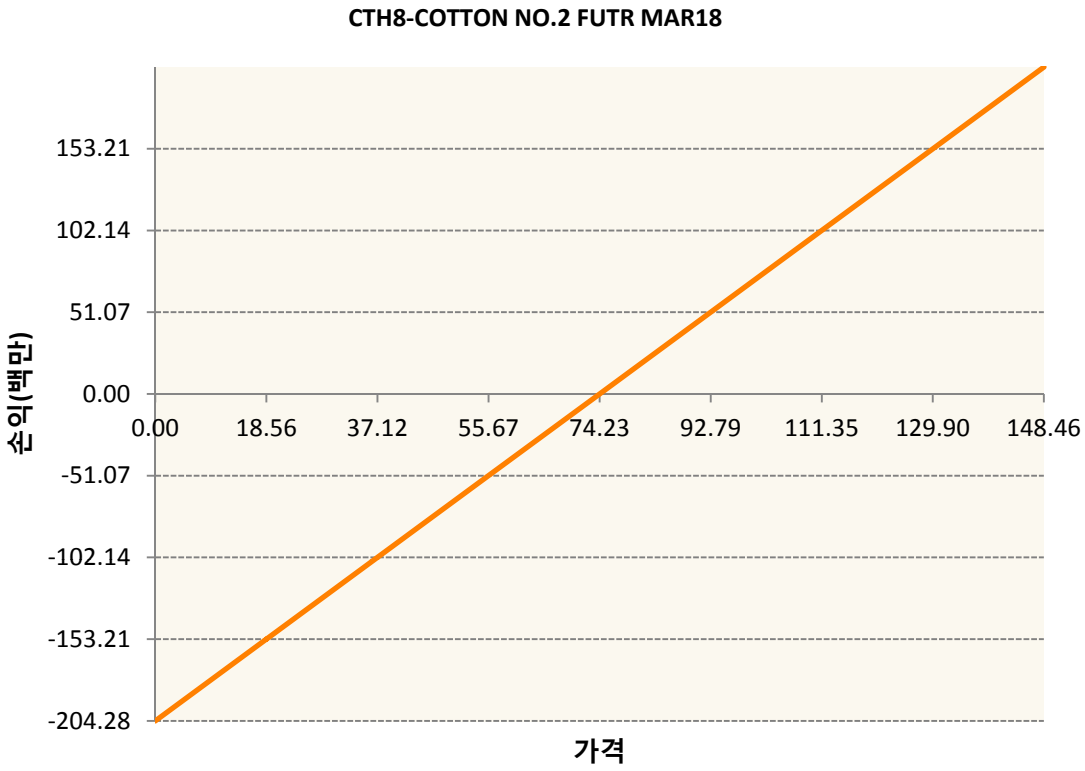
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	4,404	328	4,077	

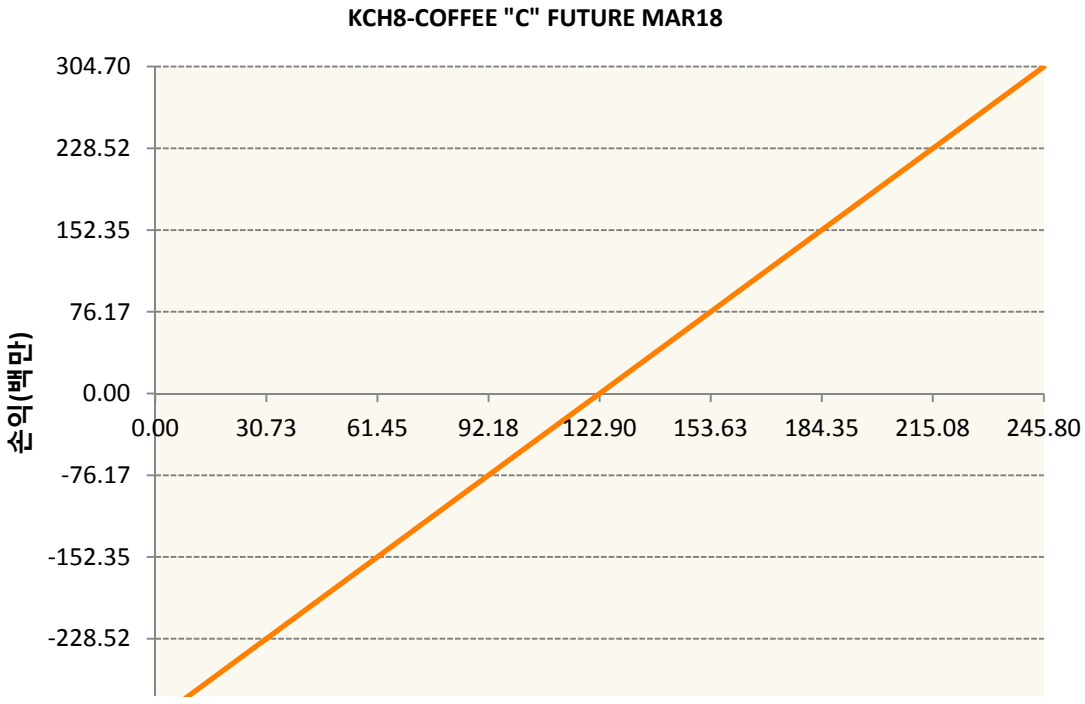
2. 만기시점의 손익구조

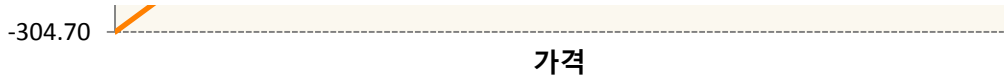


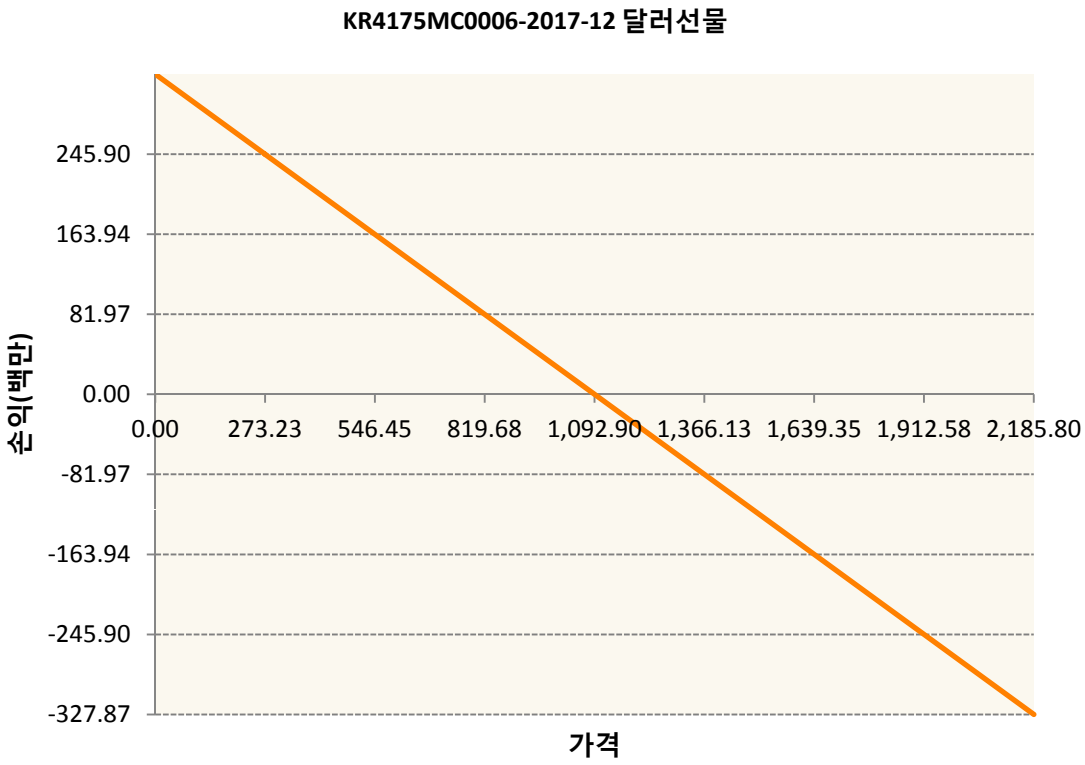


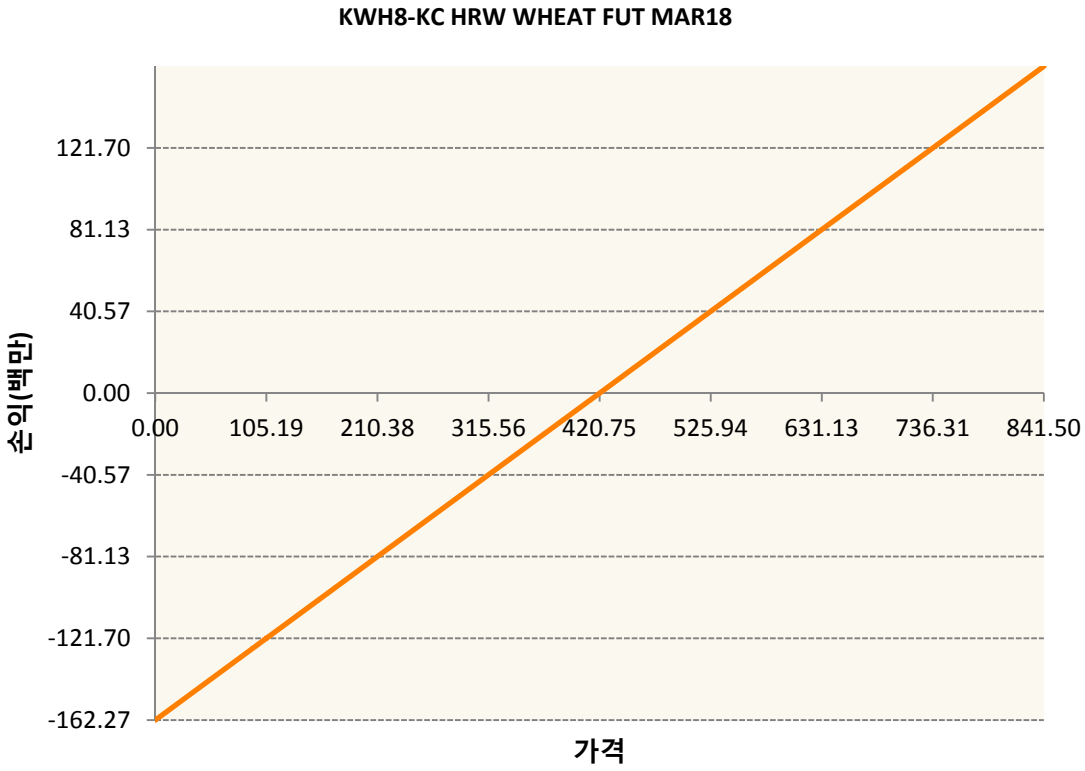

-541.99
-812.98
-1,083.98
가격


CTH8-COTTON NO.2 FUTR MAR18
153.21
102.14
51.07
0.00
-51.07
-102.14
-153.21
-204.28
0.00
18.56
37.12
55.67
74.23
92.79
111.35
129.90
148.46
손익(백만)
가격

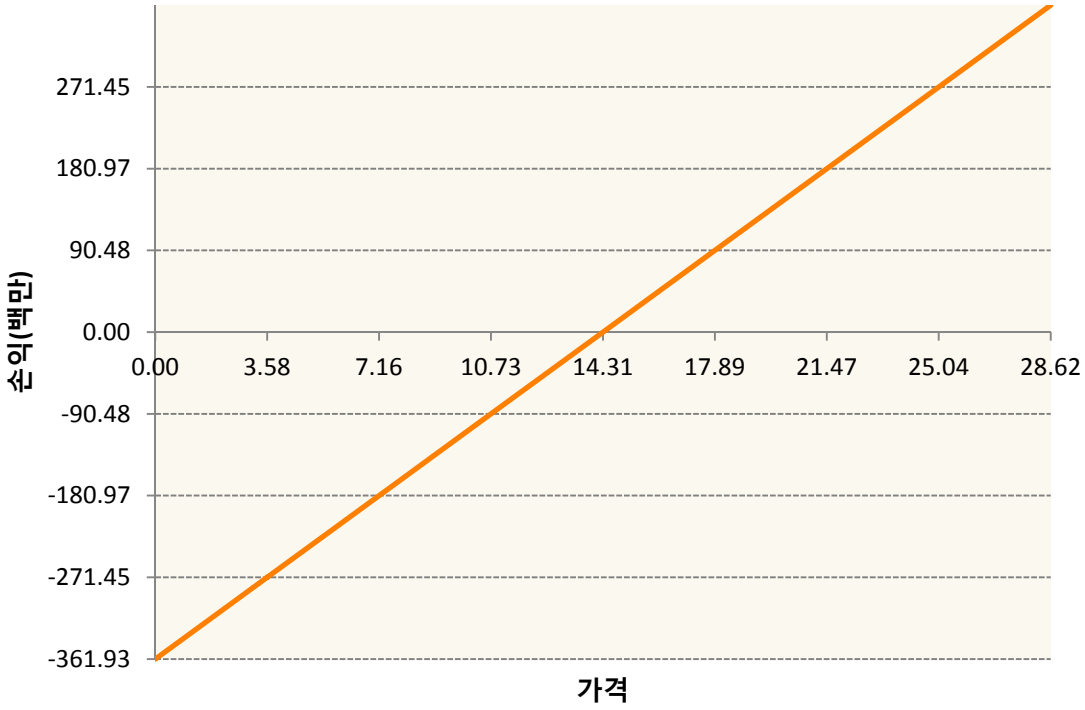

KCH8-COFFEE "C" FUTURE MAR18
304.70
228.52
152.35
76.17
0.00
-76.17
-152.35
-228.52
0.00
30.73
61.45
92.18
122.90
153.63
184.35
215.08
245.80
손익(백만)


-304.70
가격

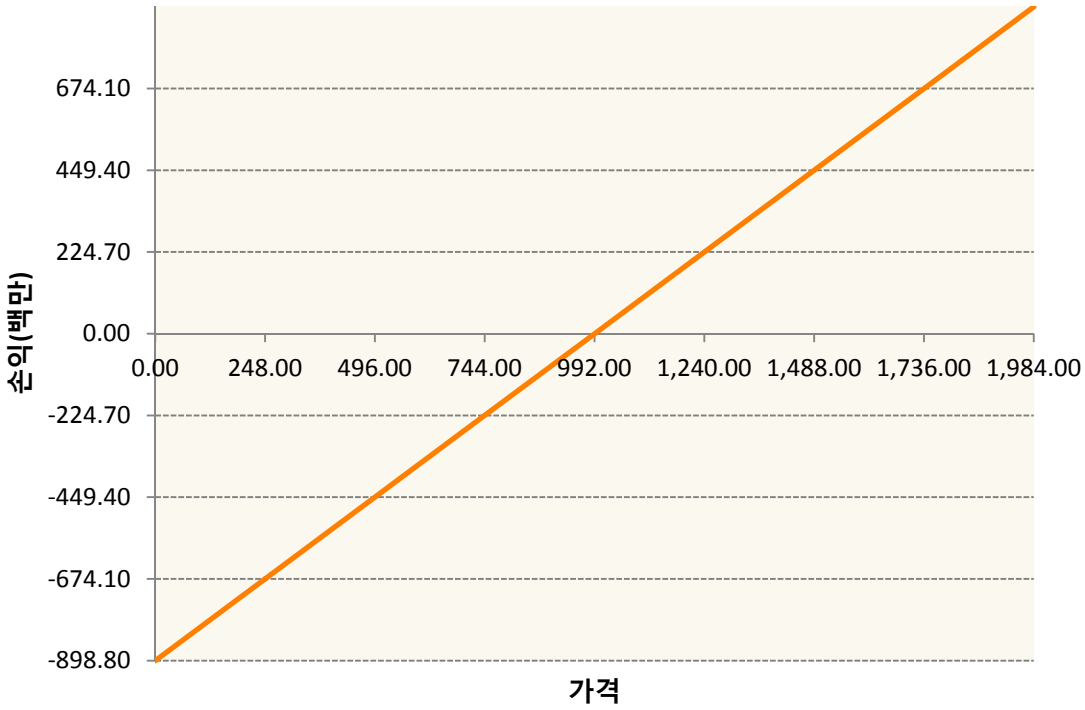

KR4175MC0006-2017-12 달러선물
245.90
163.94
81.97
0.00
-81.97
-163.94
-245.90
-327.87
0.00
273.23
546.45
819.68
1,092.90
1,366.13
1,639.35
1,912.58
2,185.80
손익(백만)
가격


KWH8-KC HRW WHEAT FUT MAR18
121.70
81.13
40.57
0.00
-40.57
-81.13
-121.70
-162.27
0.00
105.19
210.38
315.56
420.75
525.94
631.13
736.31
841.50
손익(백만)
가격

SBH8-Sugar #11 (WORLD) MAR18

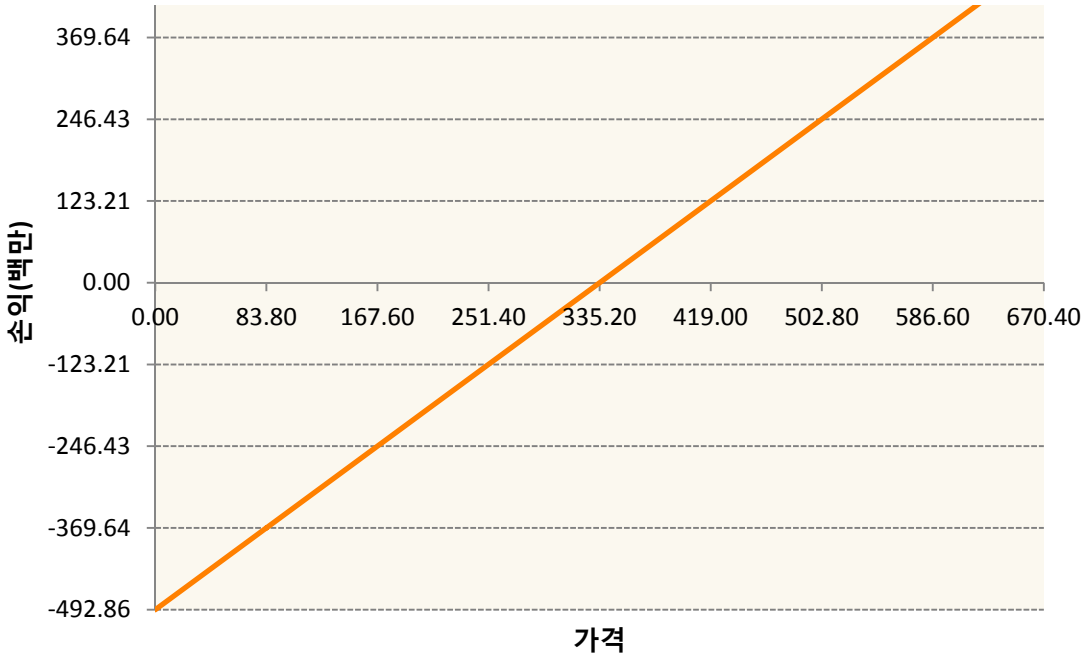


SF8-SOYBEAN FUTURE Jan18

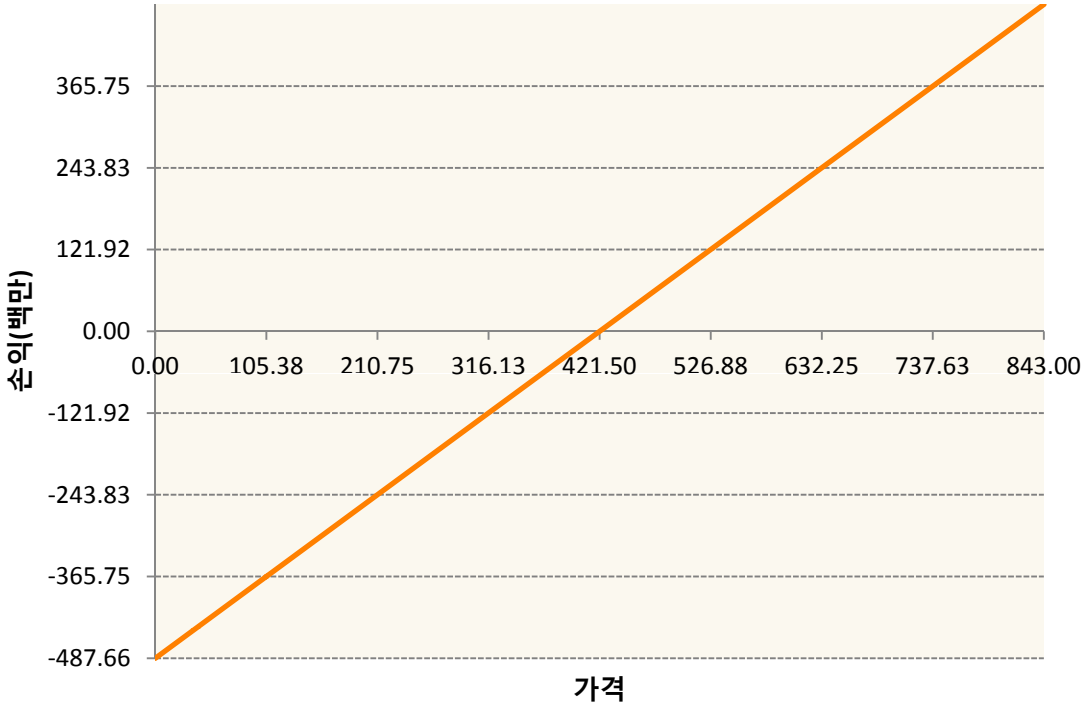


SMF8-SOYBEAN MEAL FUTR Jan18





WH8-WHEAT FUTURE(CBT) MAR18



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

BOF8	SOYBEAN OIL FUTR Jan18	33
CH8	CORN FUTURE MAR18	87
CTH8	COTTON NO.2 FUTR MAR18	16
KCH8	COFFEE "C" FUTURE MAR18	24
KR4175MC0(	2017-12 달러선물	26

KWH8	KC HRW WHEAT FUT MAR18	13
SBH8	Sugar #11 (WORLD) MAR18	29
SF8	SOYBEAN FUTURE Jan18	72
SMF8	SOYBEAN MEAL FUTR Jan18	39
WH8	WHEAT FUTURE(CBT) MAR18	39

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

377