공시일	2017-12-12
기준일	2017-12-11

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	2017-12-12
기준일	2017-12-11

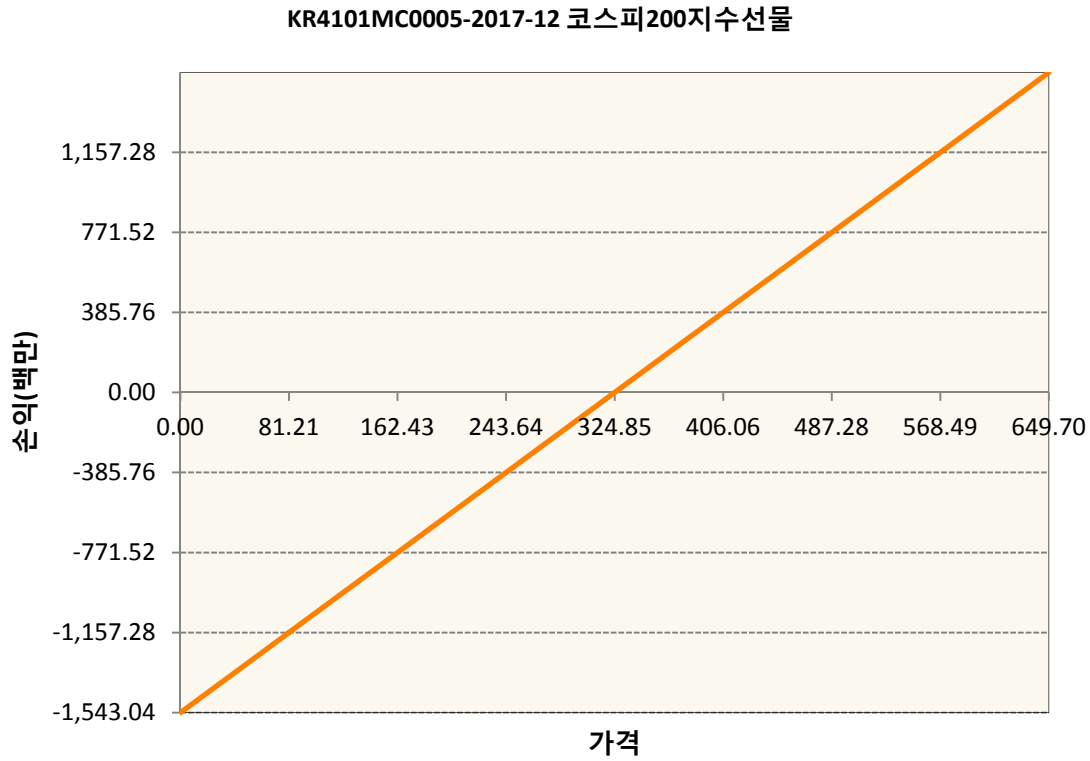
스마트인덱스모

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						124
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-124	-124	-124	-124	-124	-124	-124
-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%	124	124	124	124	124	124	124

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

73

공시일	2017-12-12
기준일	2017-12-11

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	1,084

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

347

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-12-12
기준일	2017-12-11

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	4,901	0	4,901	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI50000 신한CSI500미래S171208	402

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

373

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-12-12
기준일	2017-12-11

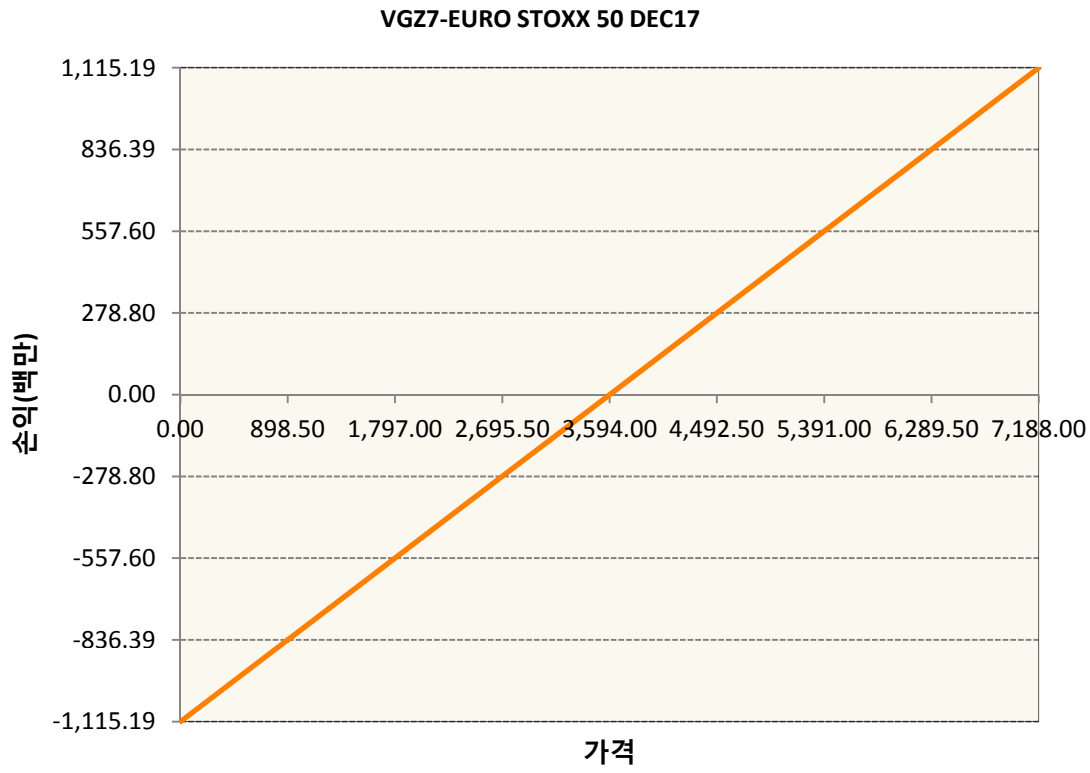
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,115	0	1,115	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGZ7	EURO STOXX 50 DEC17	89

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

(단위:백만원)

51

공시일	2017-12-12
기준일	2017-12-11

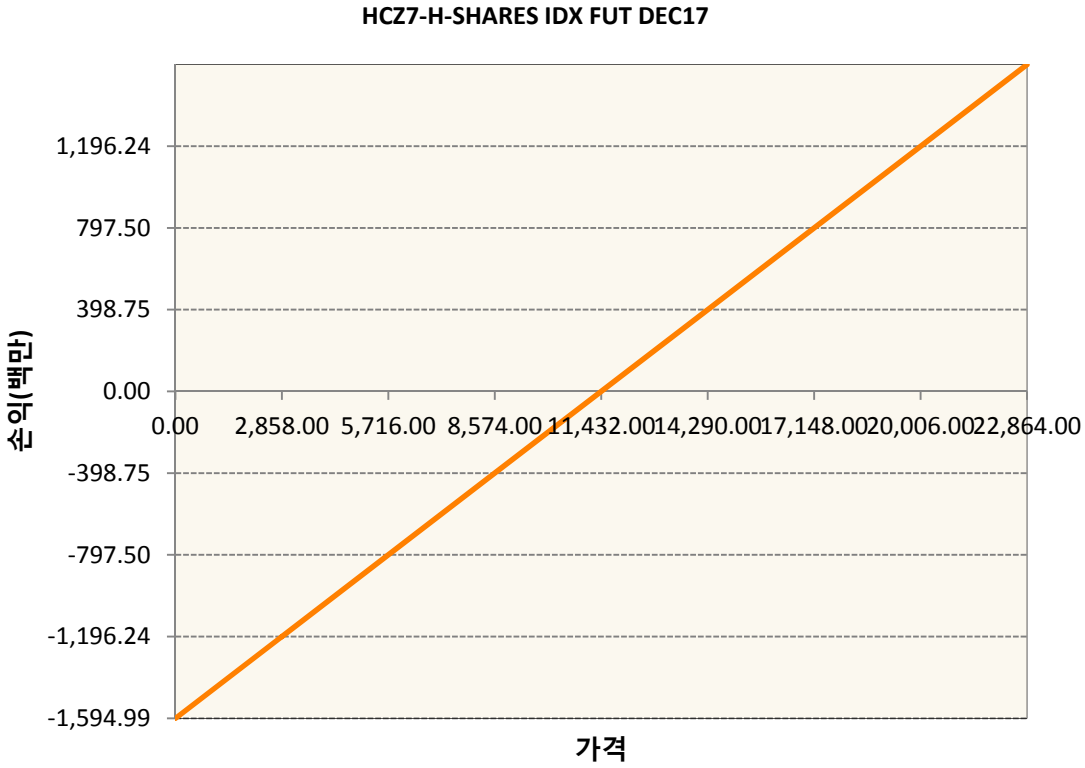
차이나인덱스모(주식-파생형)

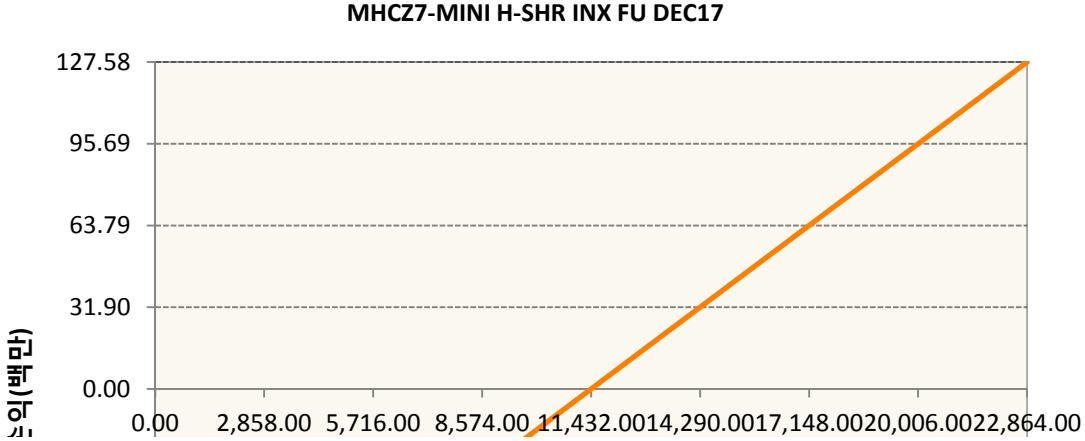
1. 계약금액

(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	1,595	0	1,595	
누계	유가증권	선물	128	0	128	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCZ7	H-SHARES IDX FUT DEC17	128
MHCZ7	MINI H-SHR INX FU DEC17	10

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	89

공시일	2017-12-12
기준일	2017-12-11

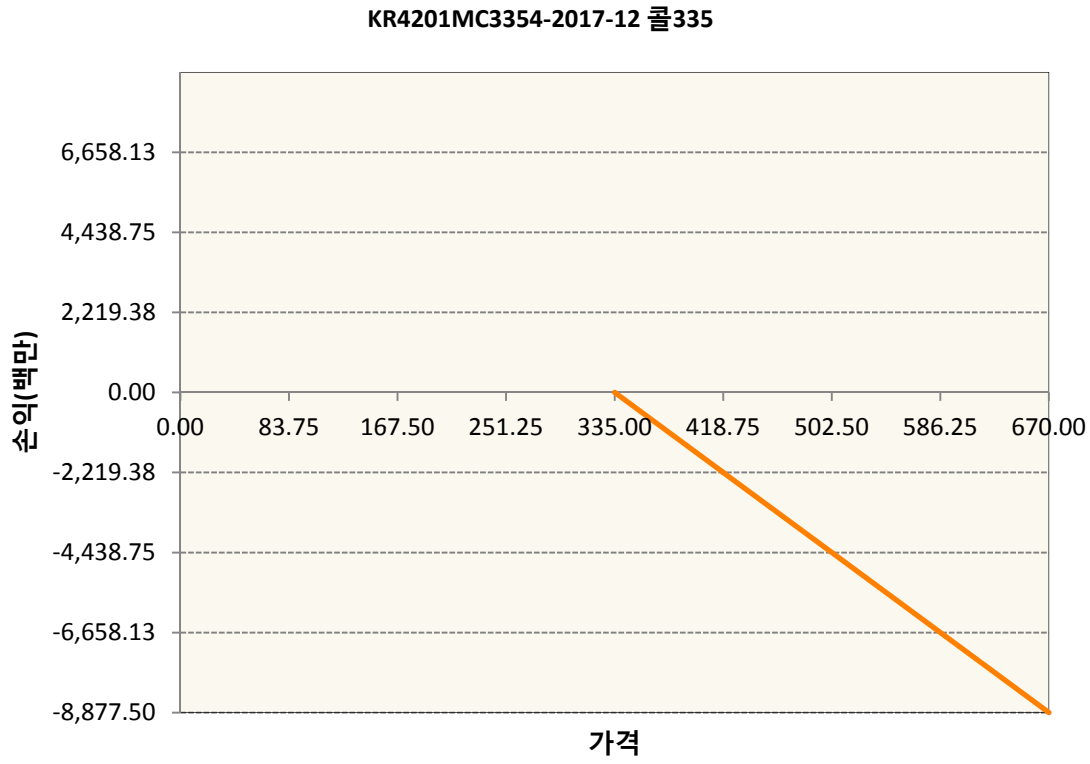
커버드콜모(주식혼합-파생형)

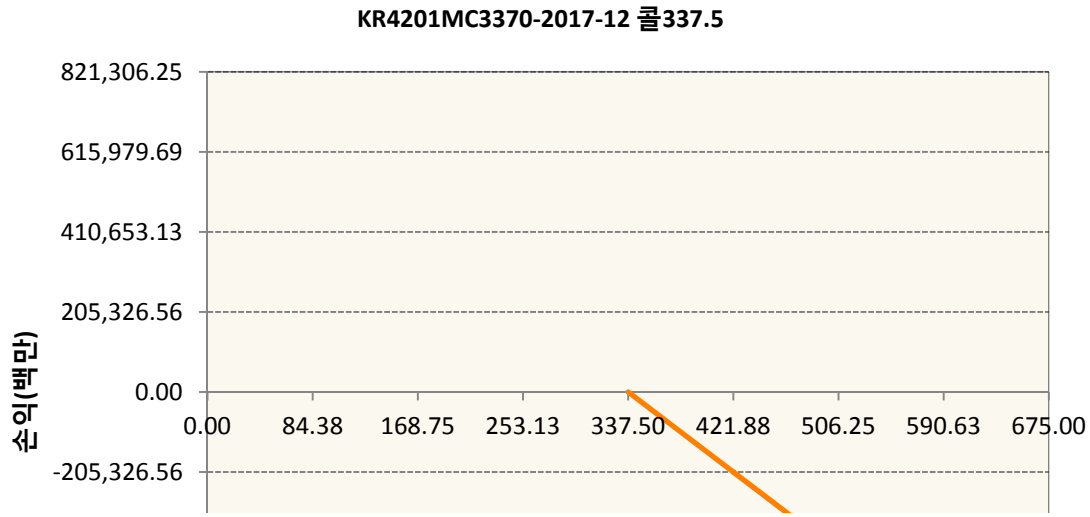
1. 계약금액

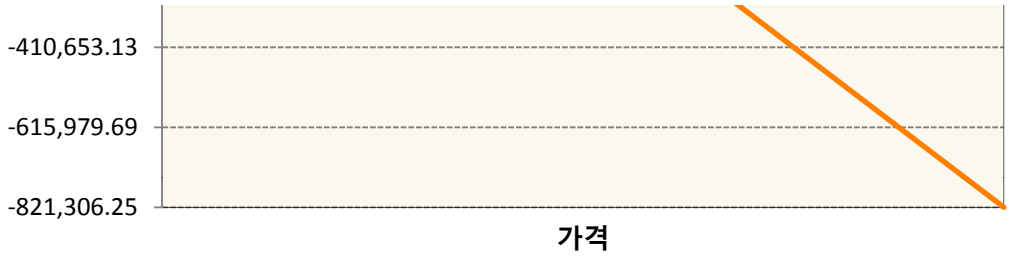
(단위:백만원)

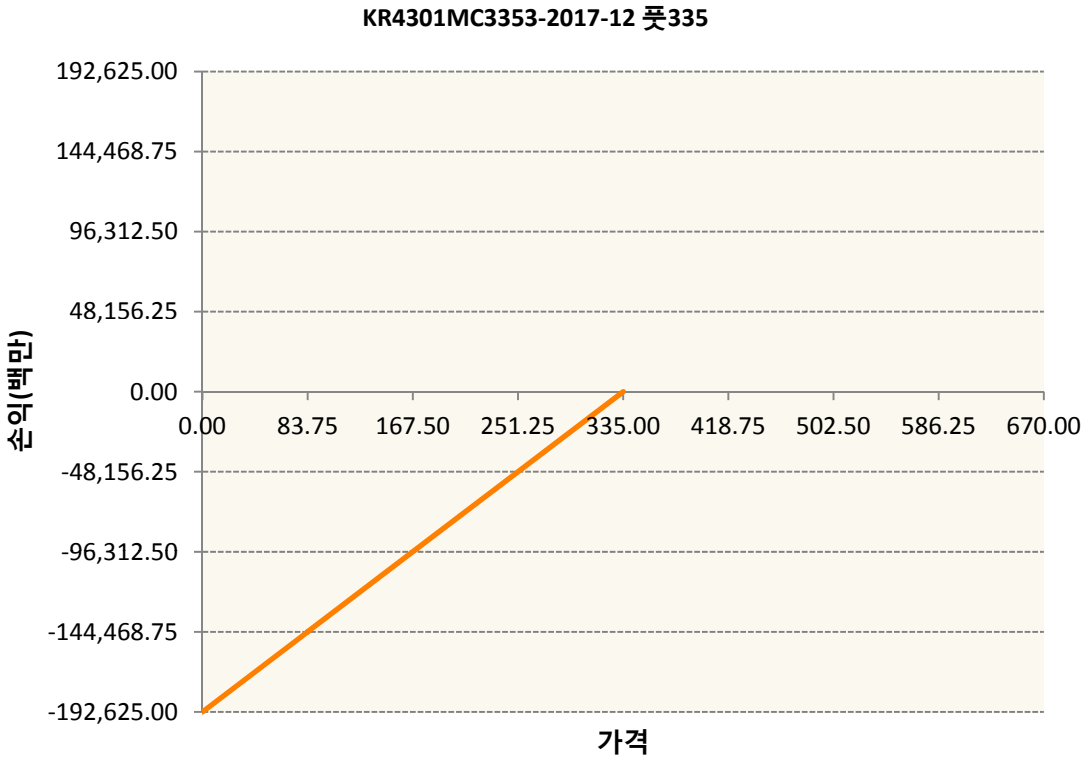
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	1,444,684	-1,444,684	장내

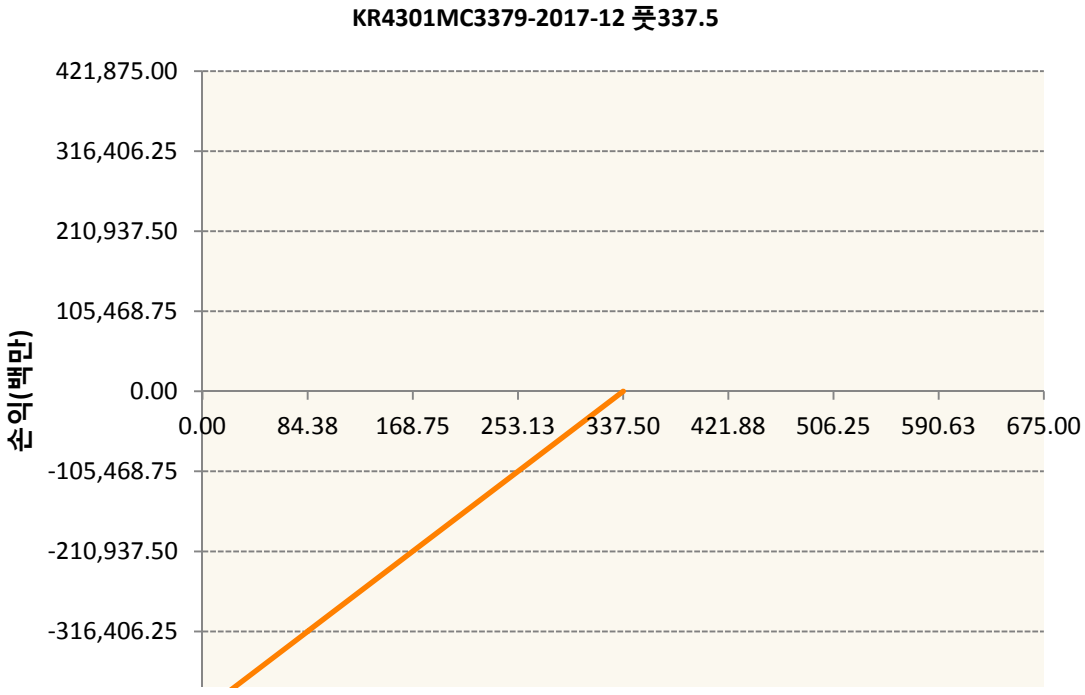
2. 만기시점의 손익구조






-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							423
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	9	9	9	9	9	9	9
-5.33%	9	9	9	9	9	9	9
-2.67%	9	9	8	8	8	7	7
0%	6	5	3	0	-3	-6	-10
2.67%	-37	-43	-50	-56	-63	-70	-76
5.33%	-196	-199	-202	-207	-211	-216	-221
8.00%	-418	-419	-419	-420	-421	-422	-423
KR4201MC3. 2017-12 콜337.5							33,618
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	378	378	378	378	378	378	378
-5.33%	378	378	378	378	378	377	375
-2.67%	378	377	374	366	352	327	289
0%	311	241	138	0	-174	-381	-621
2.67%	-1,772	-2,280	-2,807	-3,348	-3,899	-4,460	-5,027
5.33%	-13,179	-13,629	-14,106	-14,605	-15,122	-15,653	-16,195
8.00%	-32,783	-32,839	-32,926	-33,048	-33,204	-33,394	-33,618
KR4301MC3. 2017-12 풋335							14,949
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-14,949	-14,949	-14,949	-14,949	-14,949	-14,949	-14,949
-5.33%	-9,965	-9,965	-9,965	-9,965	-9,965	-9,965	-9,965
-2.67%	-4,981	-4,981	-4,981	-4,981	-4,981	-4,981	-4,981
0%	3	3	2	0	-3	-9	-16
2.67%	4,615	4,546	4,477	4,406	4,336	4,264	4,193
5.33%	5,691	5,687	5,680	5,669	5,655	5,636	5,614
8.00%	5,695	5,695	5,695	5,695	5,695	5,694	5,694
KR4301MC3. 2017-12 풋337.5							32,504
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-32,504	-32,504	-32,504	-32,504	-32,504	-32,504	-32,504
-5.33%	-21,669	-21,669	-21,669	-21,669	-21,669	-21,669	-21,669
-2.67%	-10,834	-10,834	-10,834	-10,834	-10,834	-10,834	-10,834
0%	1	1	1	0	-1	-4	-9
2.67%	10,661	10,583	10,494	10,396	10,290	10,177	10,059

5.33%	15,425	15,378	15,319	15,249	15,169	15,081	14,985
8.00%	15,498	15,498	15,497	15,497	15,496	15,495	15,491

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

71,205

공시일	2017-12-12
기준일	2017-12-11

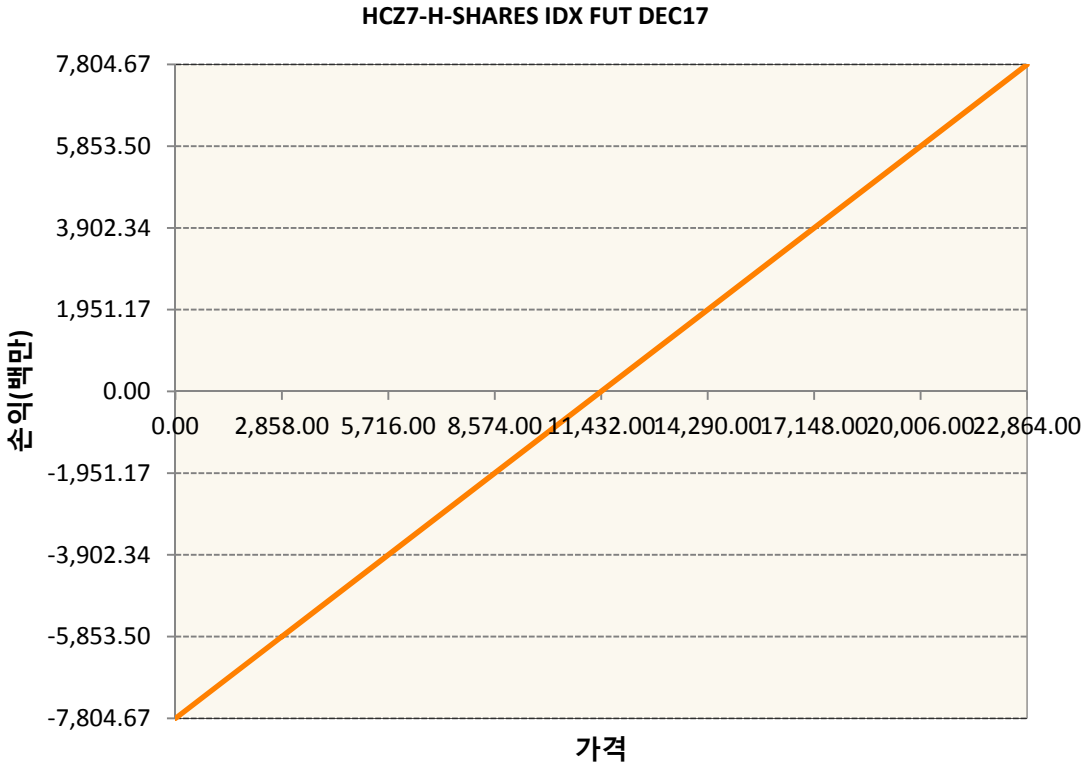
홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생

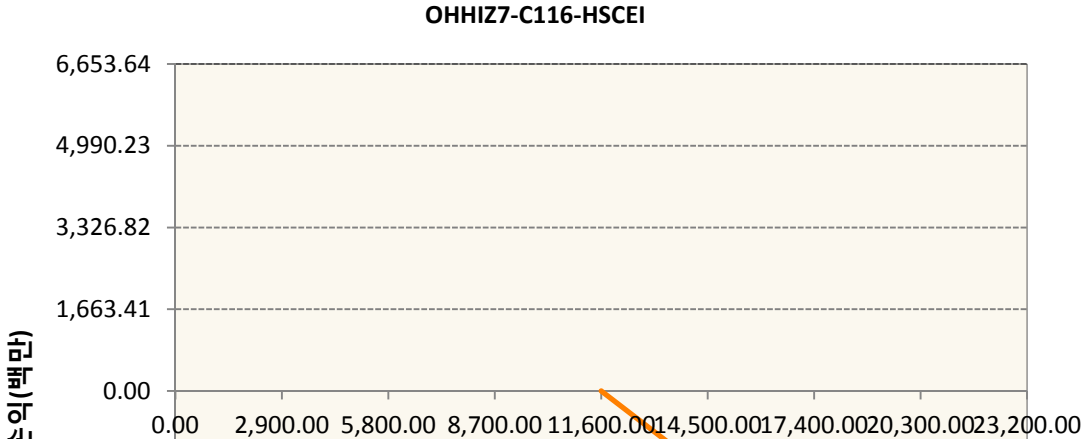
1. 계약금액

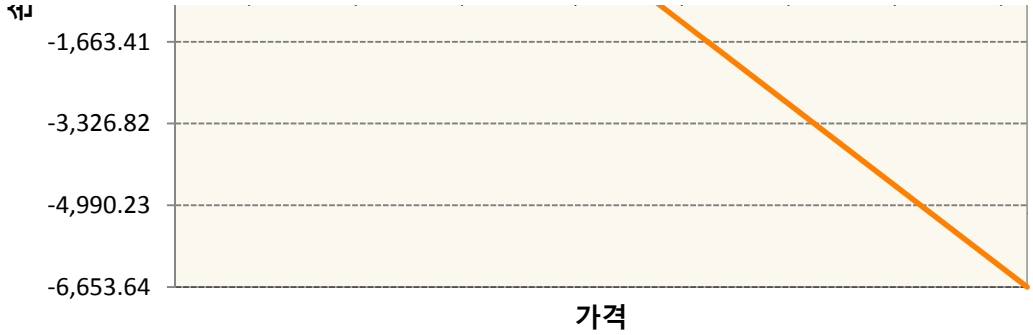
(단위:백만원)

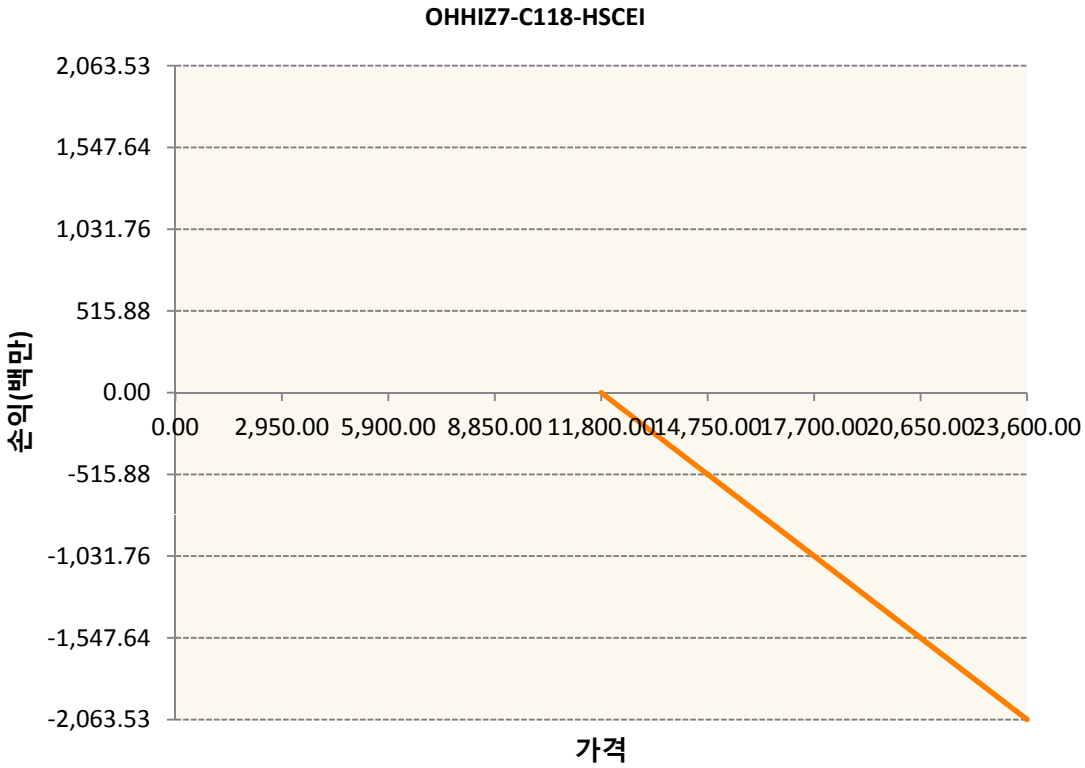
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	7,805	0	7,805	
누계	유가증권	옵션	0	17,434	-17,434	장내

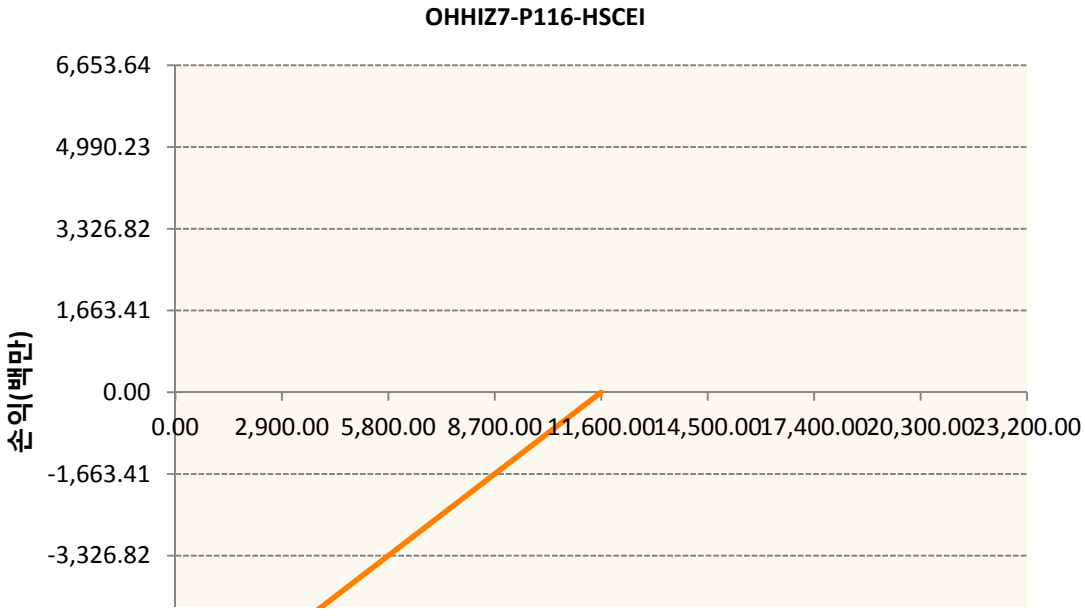
2. 만기시점의 손익구조

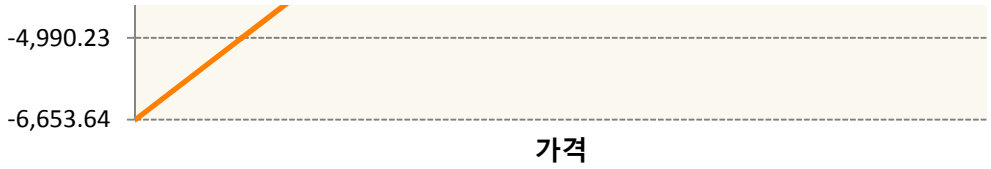


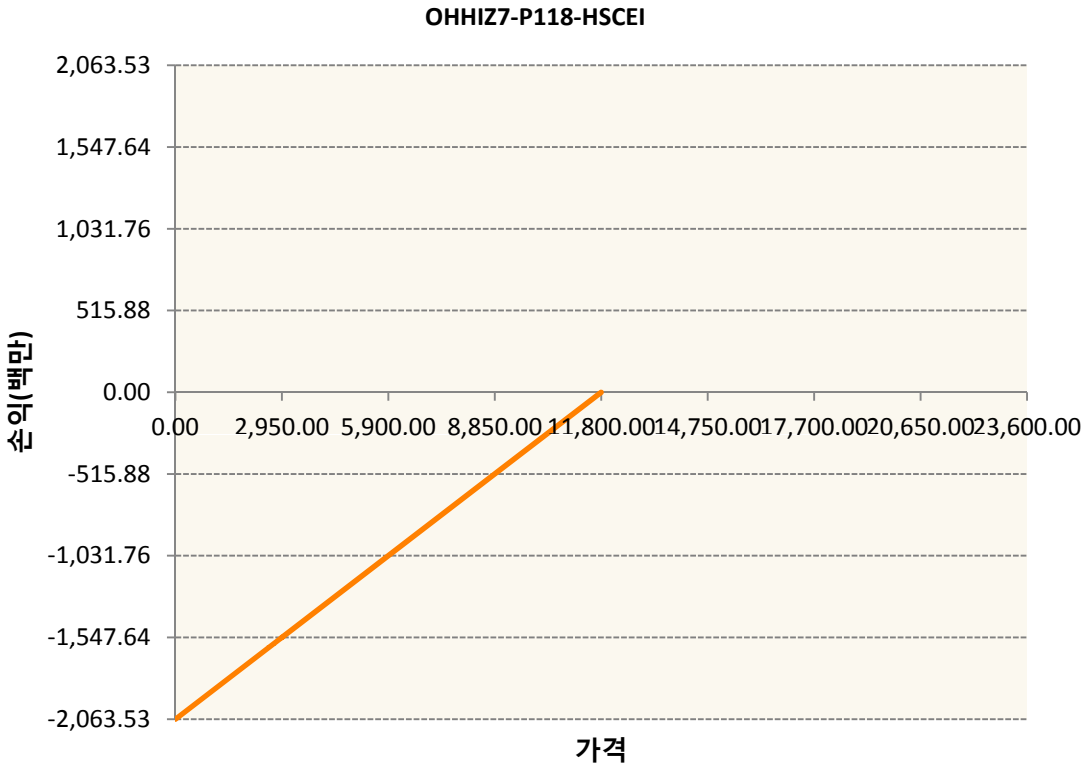



-1,663.41
-3,326.82
-4,990.23
-6,653.64
가격


OHHIZ7-C118-HSCEI
2,063.53
1,547.64
1,031.76
515.88
0.00
-515.88
-1,031.76
-1,547.64
-2,063.53
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
6,653.64
4,990.23
3,326.82
1,663.41
0.00
-1,663.41
-3,326.82
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	624
OHHIZ7-C11	HSCEI	532
OHHIZ7-C11	HSCEI	165
OHHIZ7-P11	HSCEI	532
OHHIZ7-P11	HSCEI	165

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

1,505

공시일	2017-12-12
기준일	2017-12-11

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼

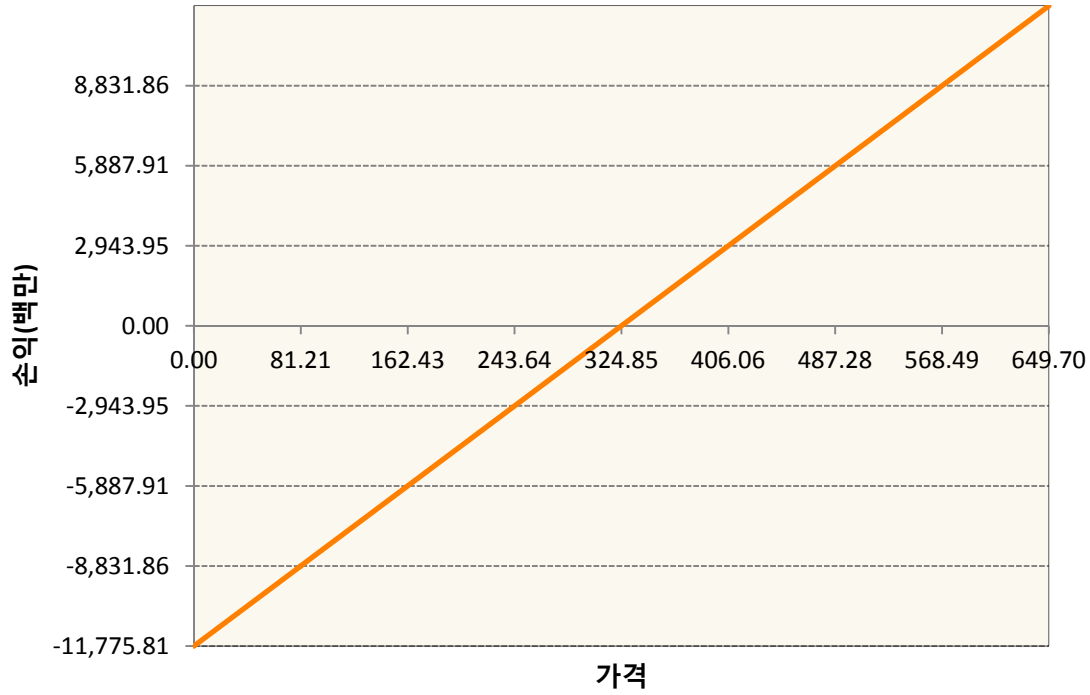
1. 계약금액

(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	11,776	0	11,776	장내
누계	유가증권	스왑	60,200	0	60,200	장외
누계	유가증권	옵션	0	59,409	-59,409	장내

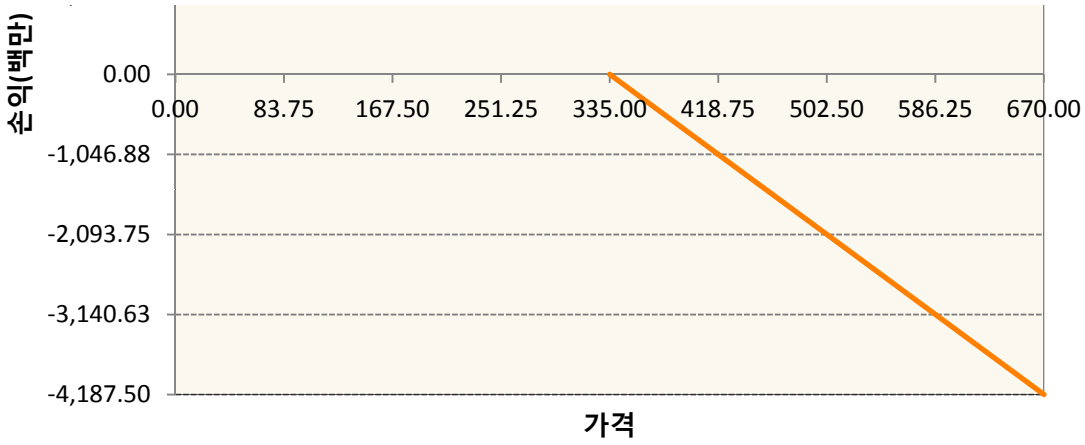
2. 만기시점의 손익구조

KR4101MC0005-2017-12 코스피200지수선물

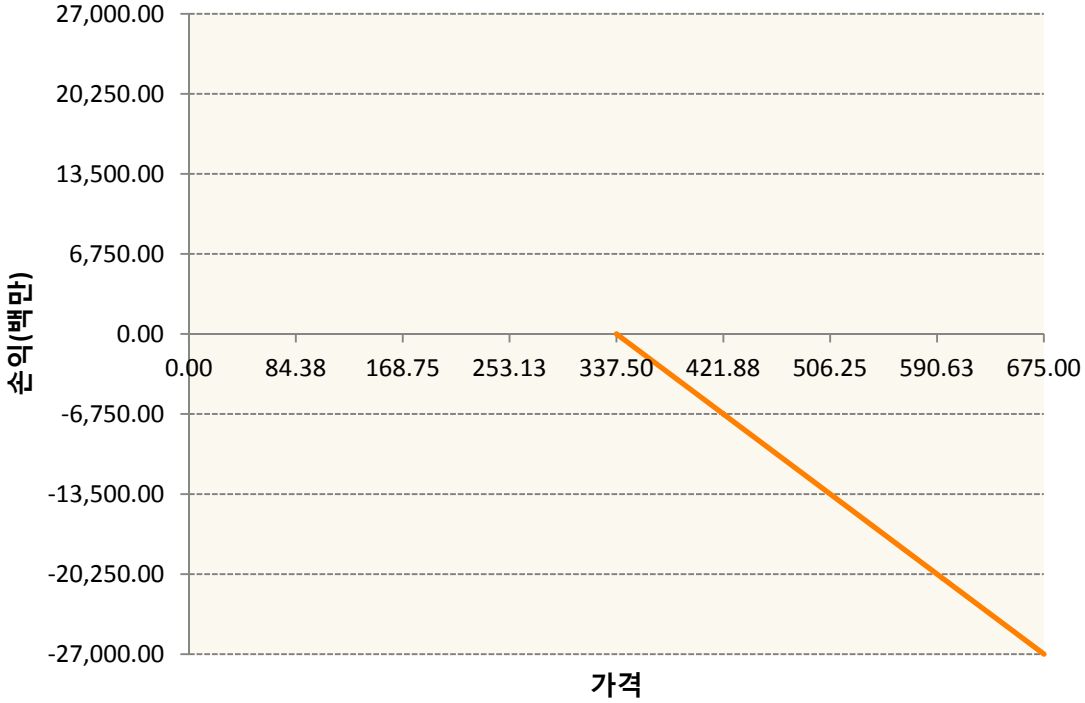


KR4201MC3354-2017-12 콜335

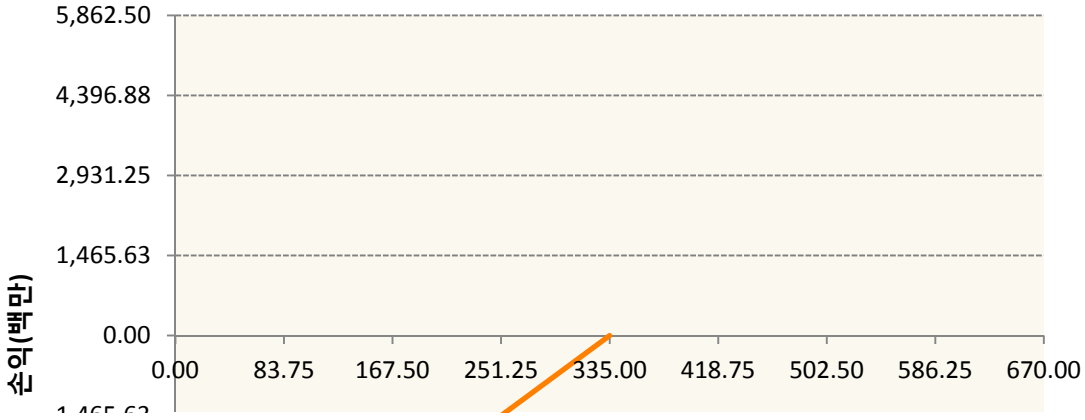




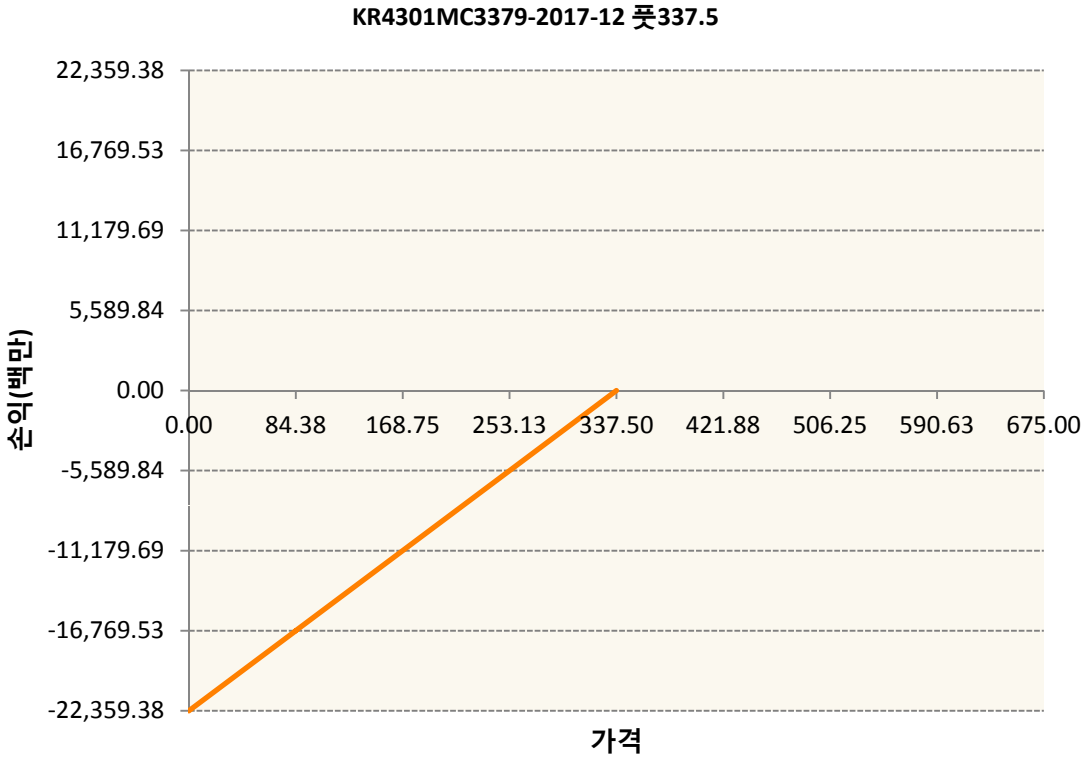
KR4201MC3370-2017-12 콜337.5



KR4301MC3353-2017-12 풋335







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_2							1,471
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,471	-1,471	-1,471	-1,471	-1,471	-1,471	-1,471
-5.33%	-981	-981	-981	-981	-981	-981	-981
-2.67%	-490	-490	-490	-490	-490	-490	-490
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	490	490	490	490	490	490	490
5.33%	981	981	981	981	981	981	981
8.00%	1,471	1,471	1,471	1,471	1,471	1,471	1,471
2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_3							278
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%

-8.00%	-278	-278	-278	-278	-278	-278	-278
-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%	278	278	278	278	278	278	278
	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						278
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-278	-278	-278	-278	-278	-278	-278
-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%	278	278	278	278	278	278	278
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_11						636
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-636	-636	-636	-636	-636	-636	-636
-5.33%	-424	-424	-424	-424	-424	-424	-424
-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%	424	424	424	424	424	424	424
8.00%	636	636	636	636	636	636	636
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_12						477

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-477	-477	-477	-477	-477	-477	-477
-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%	477	477	477	477	477	477	477
	KR4101MC0	2017-12 코스피200지수선물					943

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-943	-943	-943	-943	-943	-943	-943
-5.33%	-629	-629	-629	-629	-629	-629	-629
-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%	629	629	629	629	629	629	629
8.00%	943	943	943	943	943	943	943
	KR4201MC3	2017-12 콜335					200

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	4	4	4	4	4	4	4
-5.33%	4	4	4	4	4	4	4
-2.67%	4	4	4	4	4	3	3
0%	3	2	1	0	-1	-3	-5
2.67%	-17	-20	-23	-27	-30	-33	-36
5.33%	-92	-94	-96	-97	-99	-102	-104
8.00%	-197	-197	-198	-198	-198	-199	-200
	KR4201MC3	2017-12 콜337.5					1,105

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	12	12	12	12	12	12	12
-5.33%	12	12	12	12	12	12	12
-2.67%	12	12	12	12	12	11	9
0%	10	8	5	0	-6	-13	-20
2.67%	-58	-75	-92	-110	-128	-147	-165
5.33%	-433	-448	-464	-480	-497	-515	-532
8.00%	-1,078	-1,080	-1,082	-1,086	-1,092	-1,098	-1,105
	KR4301MC3	2017-12 풋335					455

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-455	-455	-455	-455	-455	-455	-455
-5.33%	-303	-303	-303	-303	-303	-303	-303

-2.67%	-152	-152	-152	-152	-152	-152	-152
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	140	138	136	134	132	130	128
5.33%	173	173	173	173	172	172	171
8.00%	173	173	173	173	173	173	173
	KR4301MC3. 2017-12 풋337.5						1,723
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,723	-1,723	-1,723	-1,723	-1,723	-1,723	-1,723
-5.33%	-1,148	-1,148	-1,148	-1,148	-1,148	-1,148	-1,148
-2.67%	-574	-574	-574	-574	-574	-574	-574
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	565	561	556	551	545	539	533
5.33%	818	815	812	808	804	799	794
8.00%	821	821	821	821	821	821	821

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

8,465

공시일	2017-12-12
기준일	2017-12-11

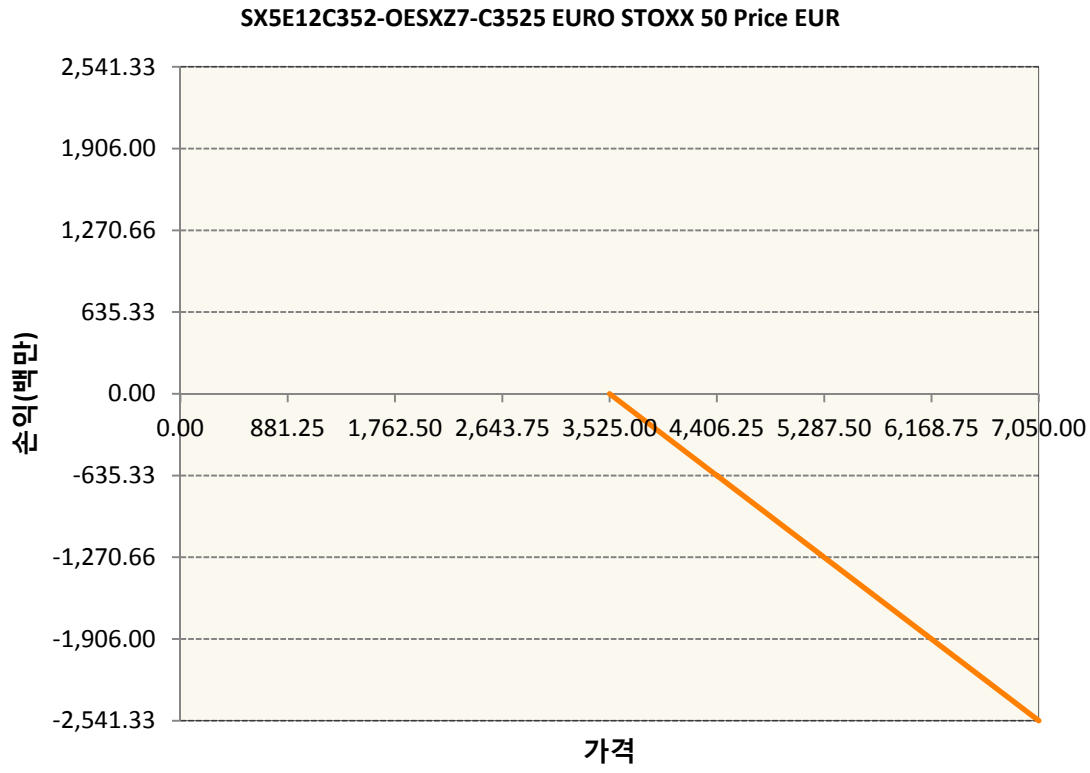
유로커버드콜모(주식혼합-파생형

1. 계약금액

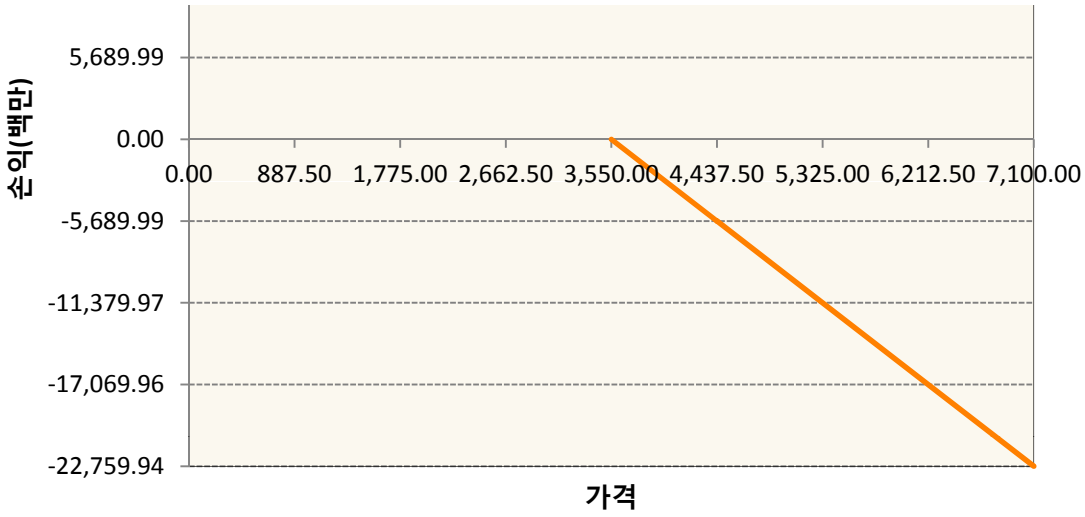
(단위:백만원)

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	17,433	0	17,433	
누계	유가증권	스왑	96,558	0	96,558	장외
누계	유가증권	옵션	0	50,603	-50,603	장내
누계	지수	스왑	51,498	0	51,498	장외

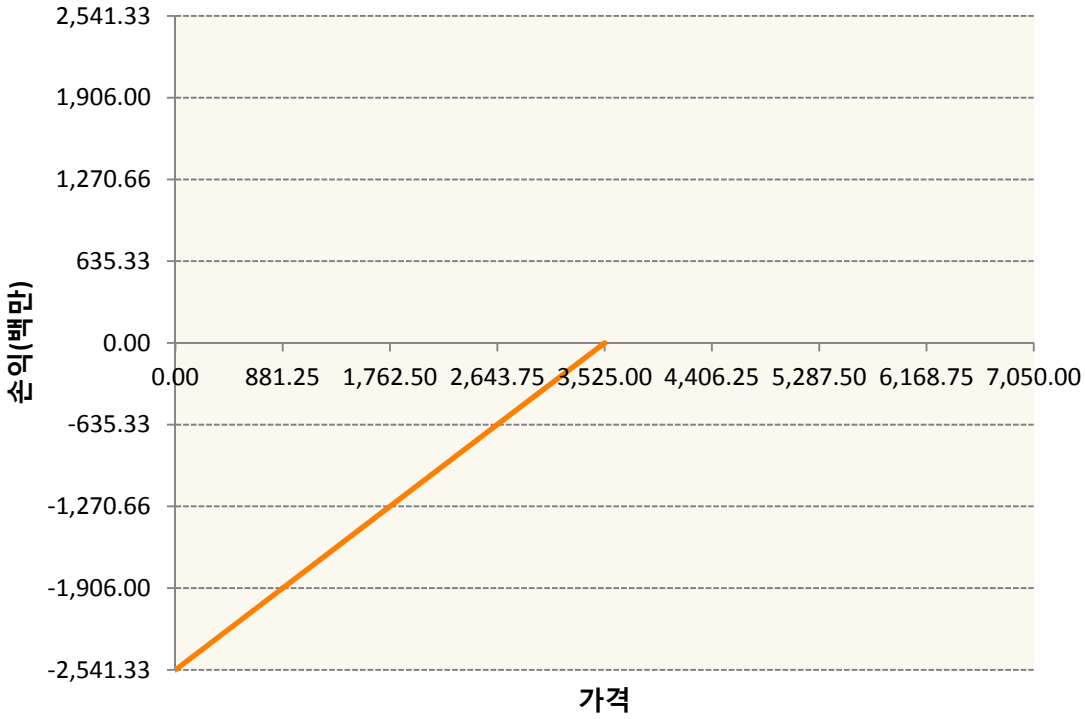
2. 만기시점의 손익구조



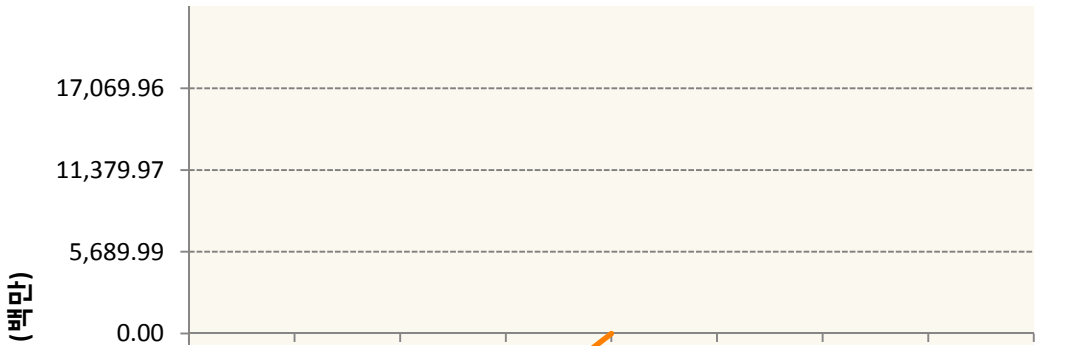


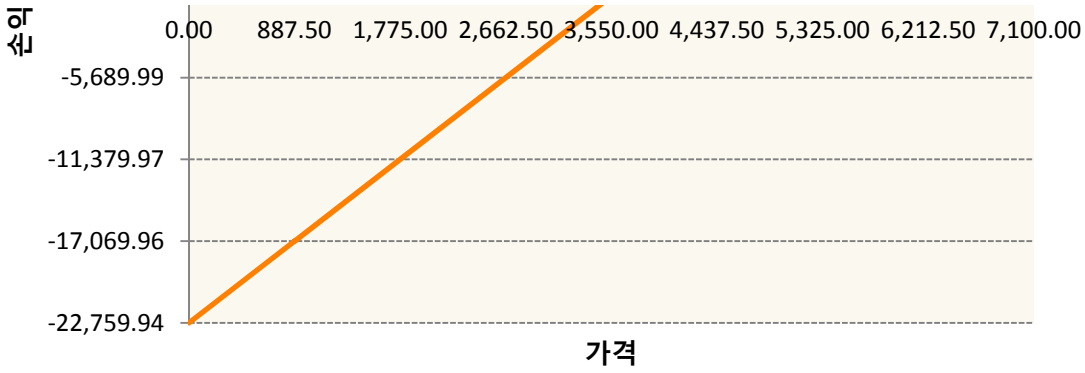


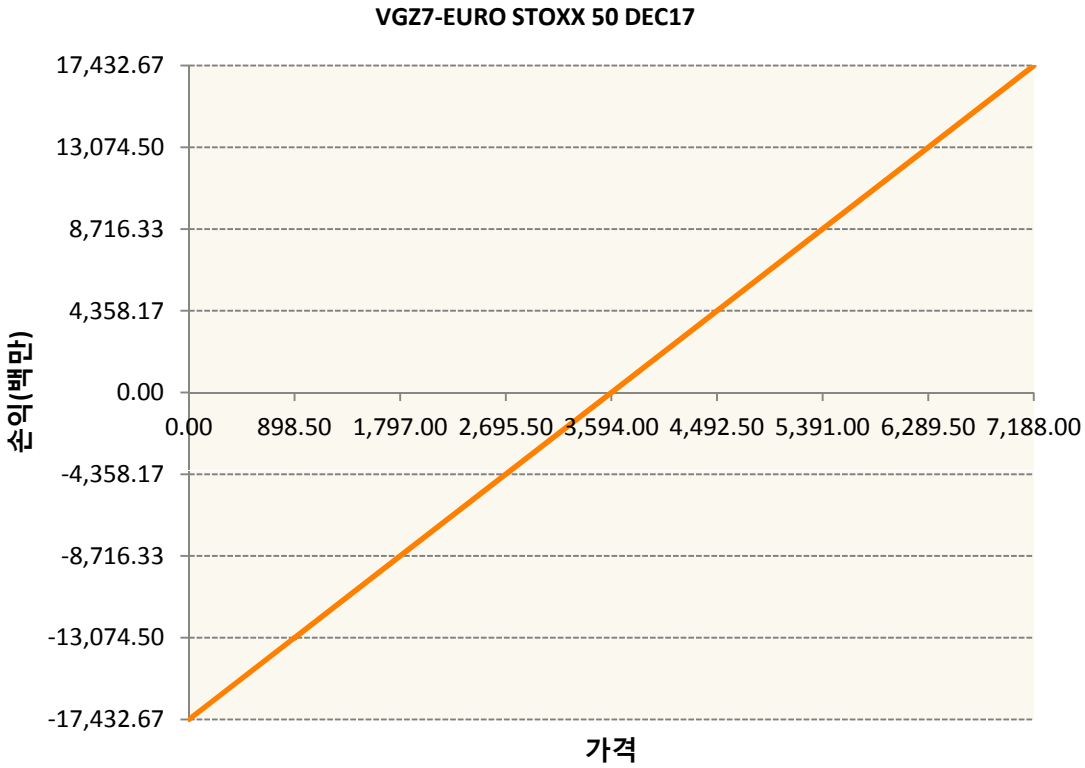
SX5E12P352-OESXZ7-P3525 EURO STOXX 50 Price EUR



SX5E12P355-OESXZ7-P3550 EURO STOXX 50 Price EUR







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
260105SGPX	SG EURO Covered CALL STRATEGY - 994.569	48
260105SQPX	SG EURO Covered CALL STRATEGY	46
SX5E12C352	OESXZ7-C3525 EURO STOXX 50 Price EUR	203
SX5E12C355	OESXZ7-C3550 EURO STOXX 50 Price EUR	1,821
SX5E12P352	OESXZ7-P3525 EURO STOXX 50 Price EUR	203
SX5E12P355	OESXZ7-P3550 EURO STOXX 50 Price EUR	1,821
VGZ7	EURO STOXX 50 DEC17	1,395

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

3,142

공시일	2017-12-12
기준일	2017-12-11

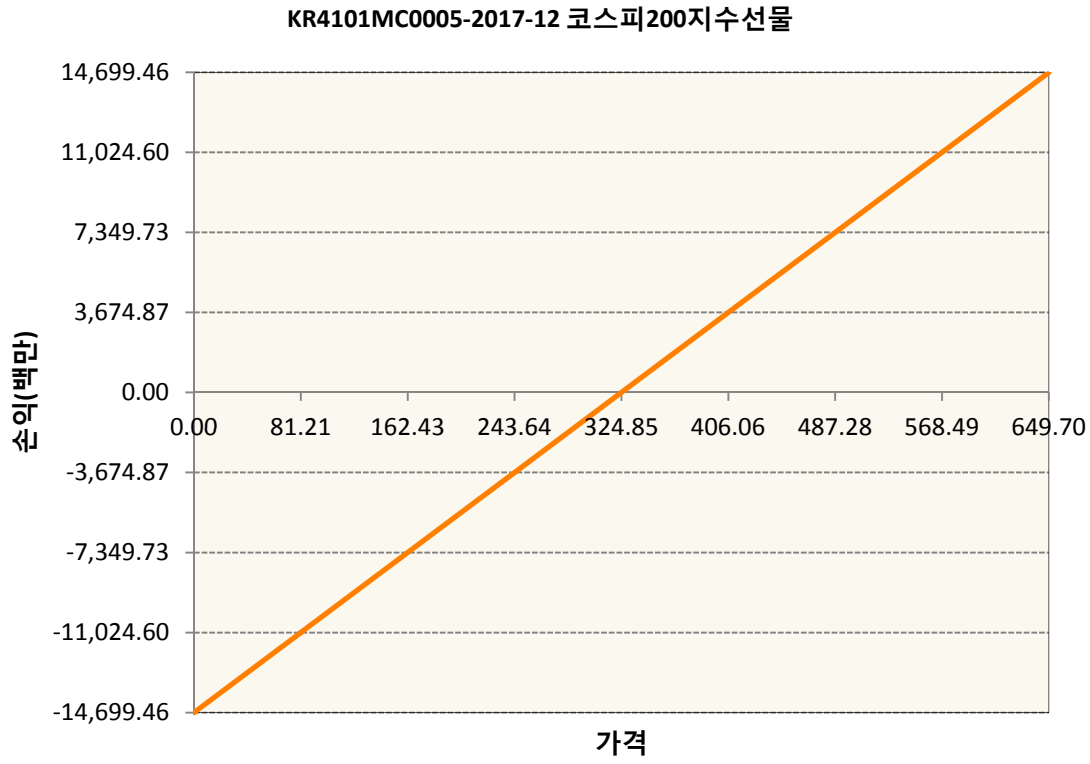
ETF스마트레버리지목표전환형8호

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	14,699	0	14,699	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101MC0	2017-12 코스피200지수선물						1,177
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,177	-1,177	-1,177	-1,177	-1,177	-1,177	-1,177
-5.33%	-785	-785	-785	-785	-785	-785	-785
-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%	785	785	785	785	785	785	785
8.00%	1,177	1,177	1,177	1,177	1,177	1,177	1,177

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

696

공시일	2017-12-12
기준일	2017-12-11

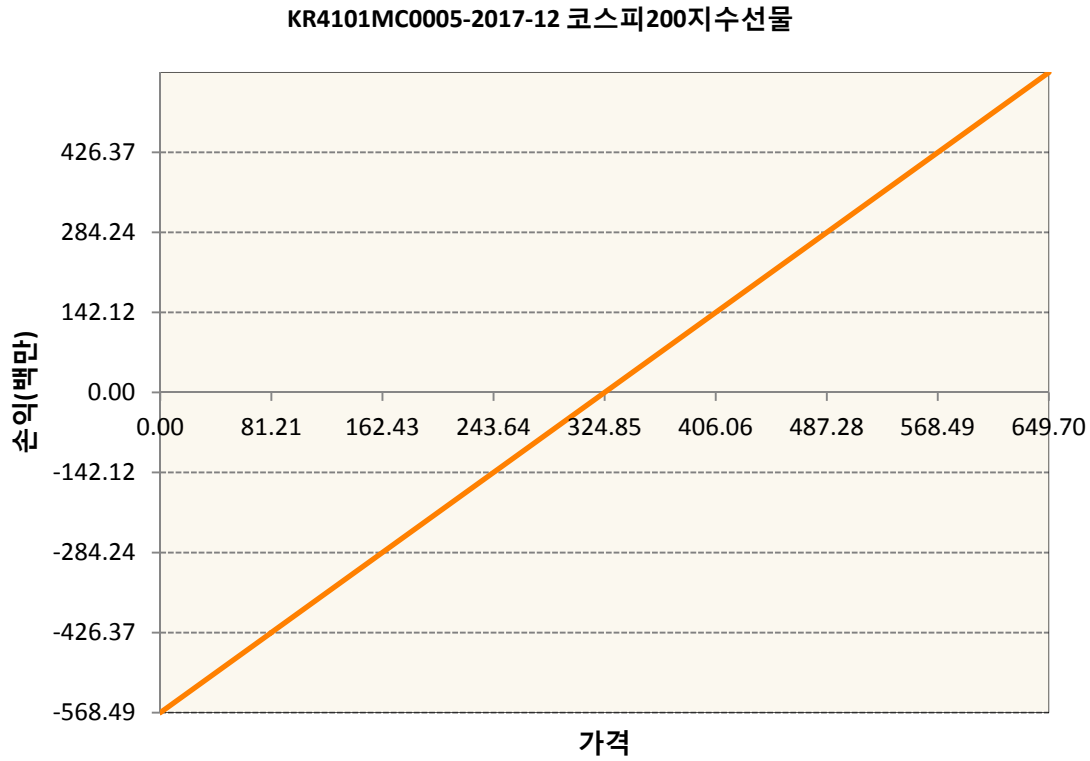
ETF스마트레버리지목표전환형9호

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	568	0	568	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101MC0 2017-12 코스피200지수선물							46
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-46	-46	-46	-46	-46	-46	-46
-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%	46	46	46	46	46	46	46

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

27

공시일	2017-12-12
기준일	2017-12-11

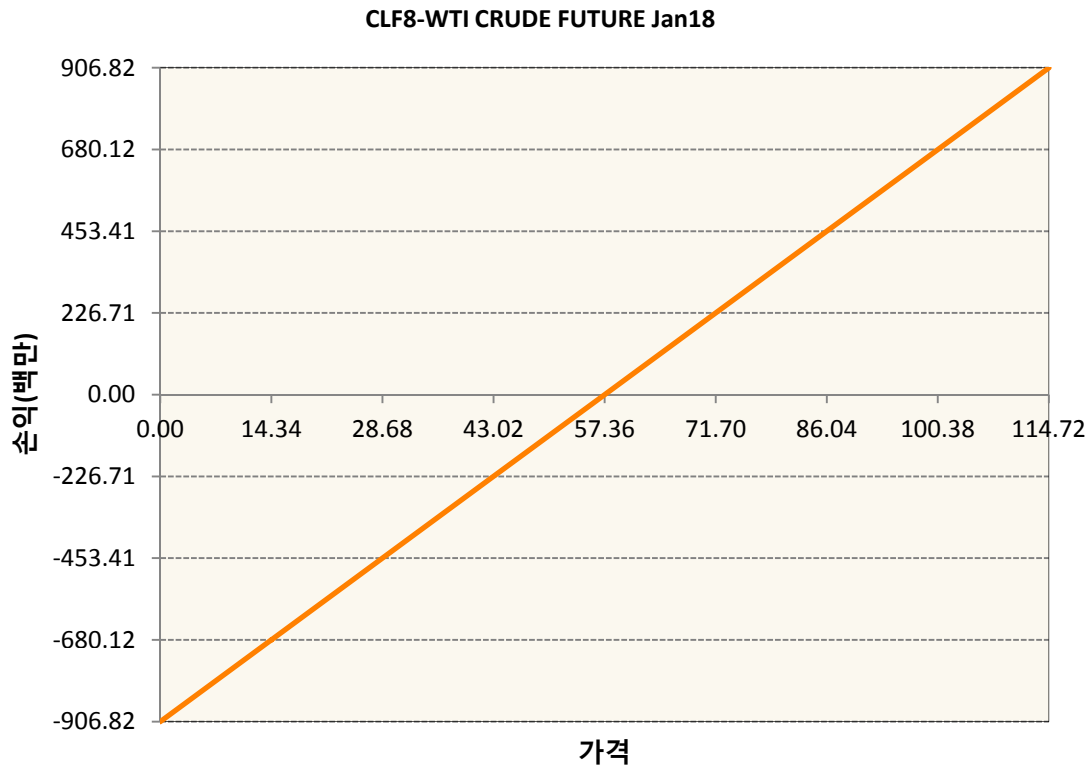
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

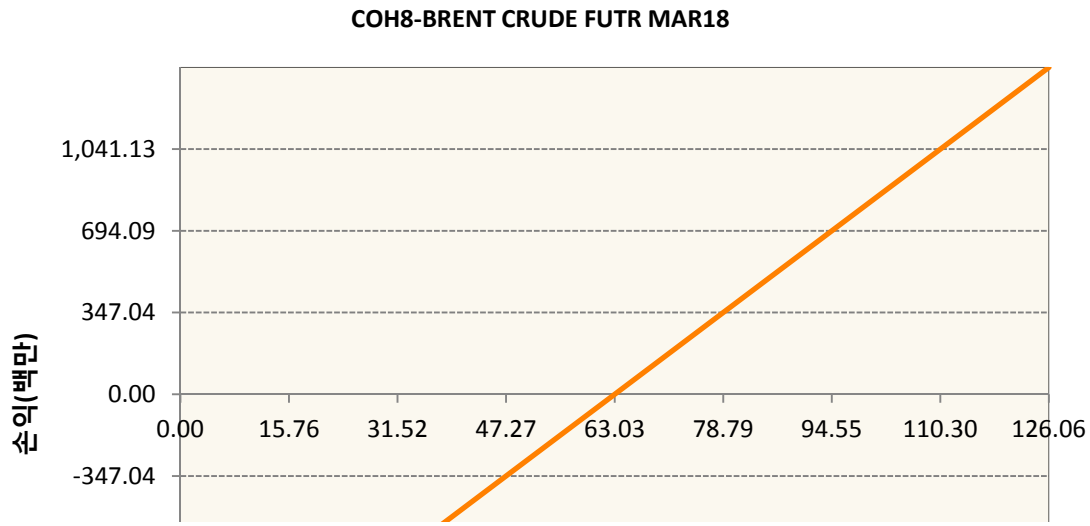
1. 계약금액

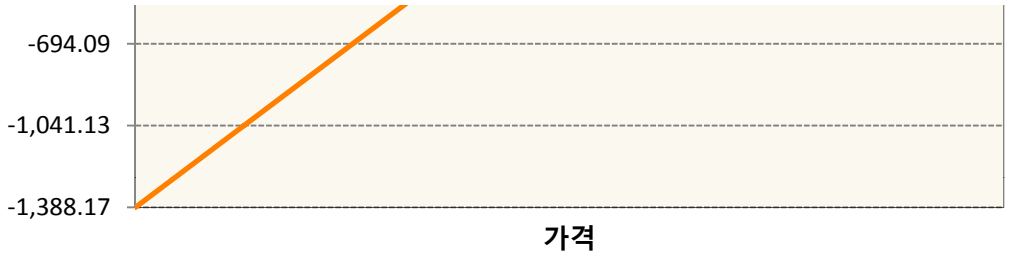
(단위:백만원)

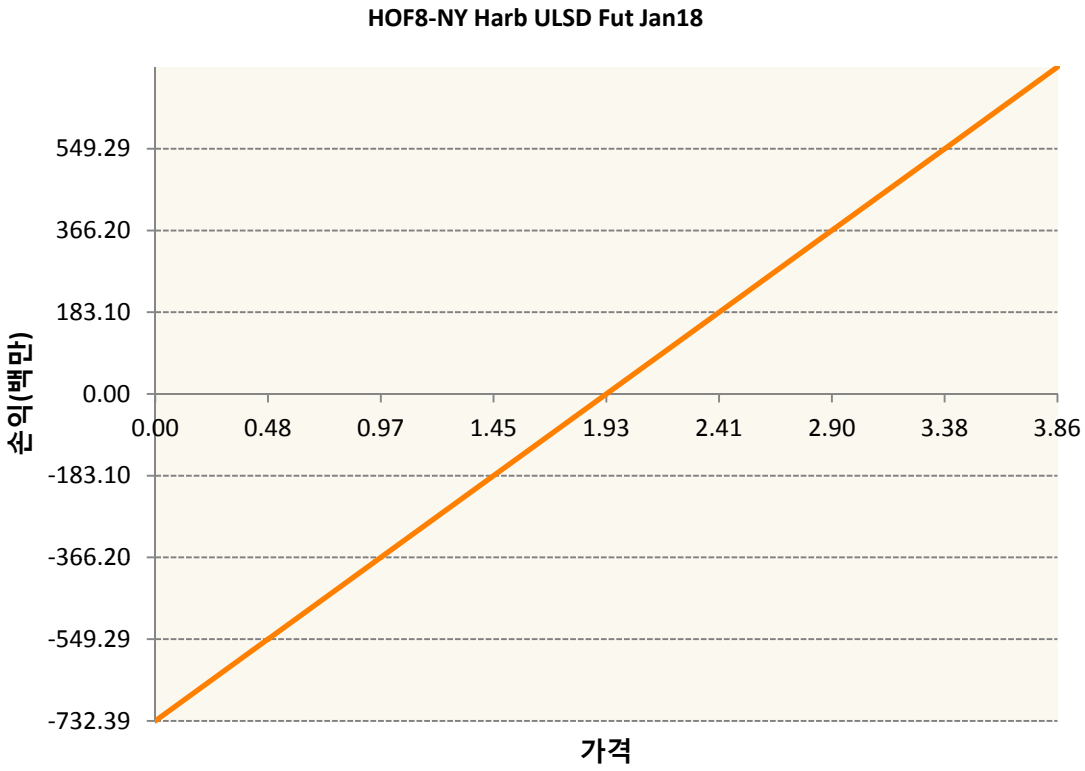
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	4,897	874	4,024	

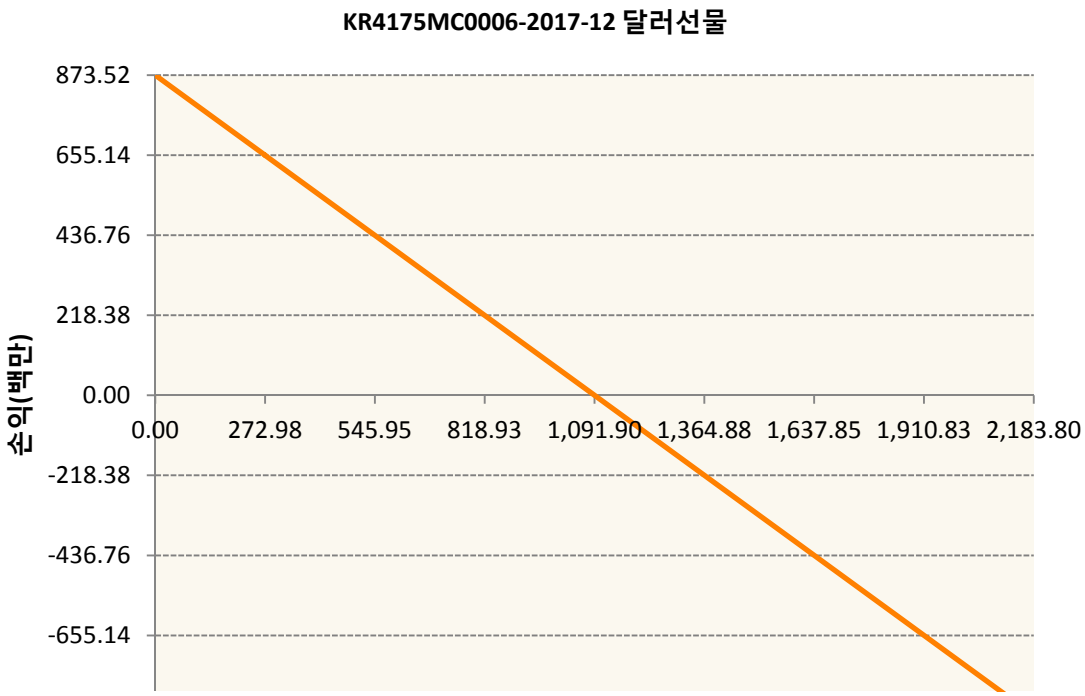
2. 만기시점의 손익구조

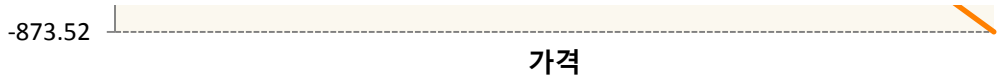


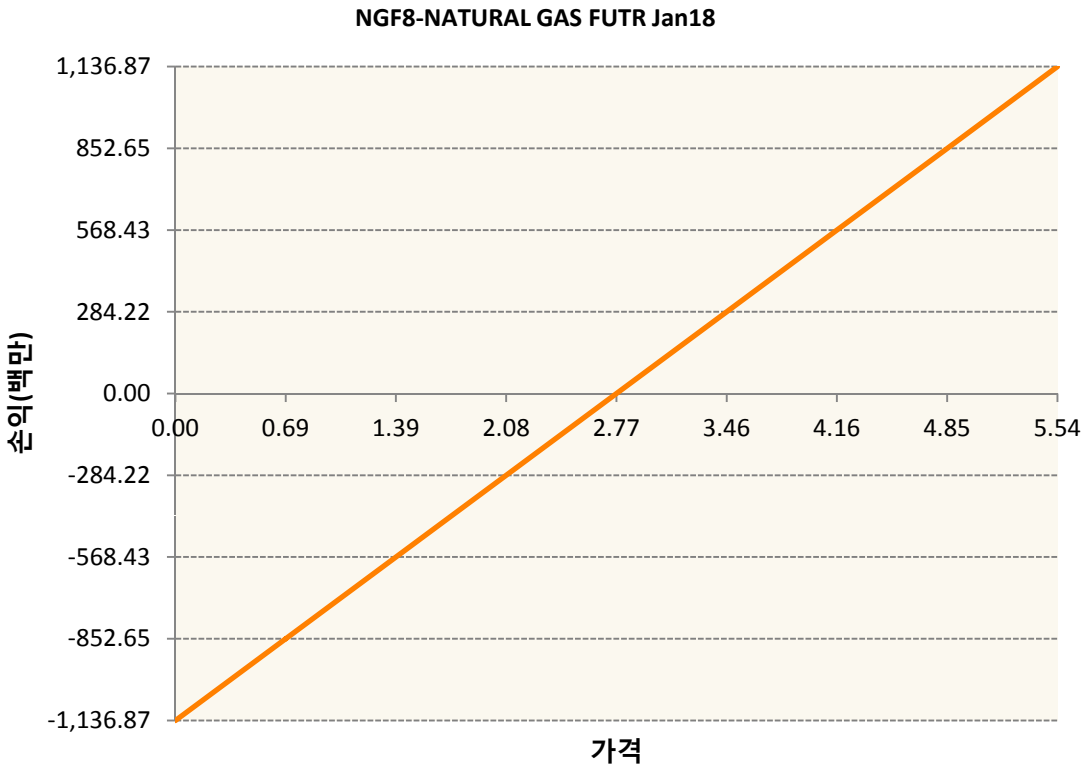


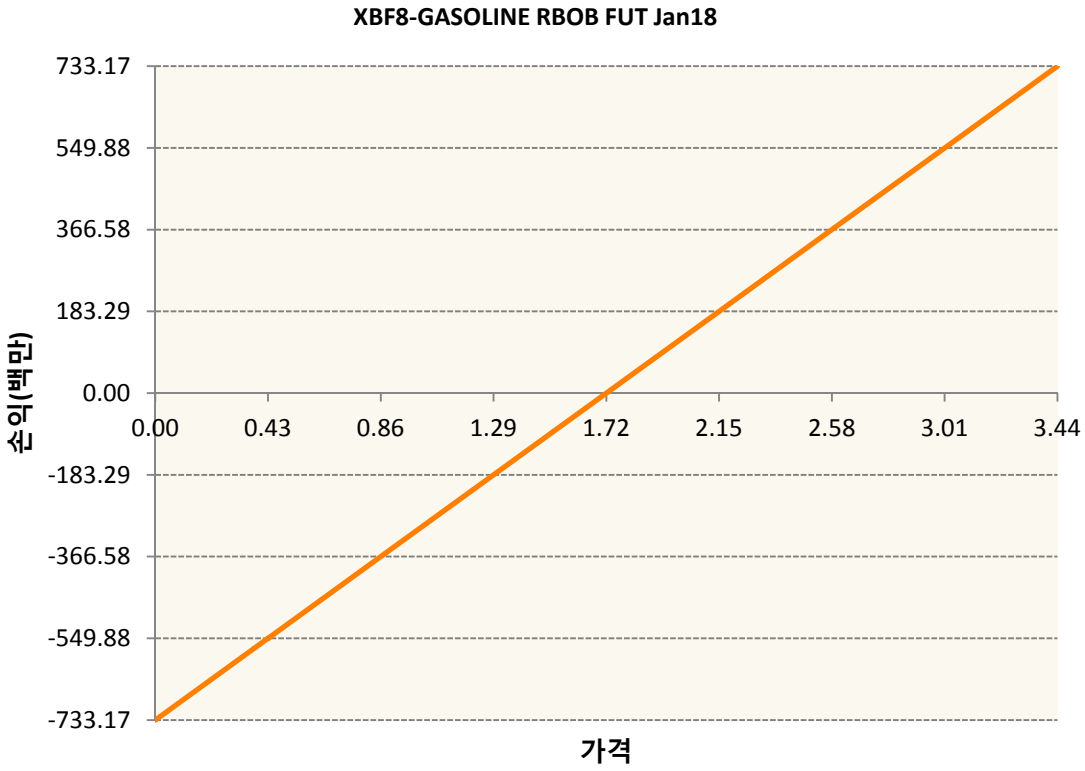

-694.09
-1,041.13
-1,388.17
가격


HOF8-NY Harb ULSD Fut Jan18
549.29
366.20
183.10
0.00
-183.10
-366.20
-549.29
-732.39
0.00
0.48
0.97
1.45
1.93
2.41
2.90
3.38
3.86
손익(백만)
가격


KR4175MC0006-2017-12 달러선물
873.52
655.14
436.76
218.38
0.00
-218.38
-436.76
-655.14
0.00
272.98
545.95
818.93
1,091.90
1,364.88
1,637.85
1,910.83
2,183.80
손익(백만)


-873.52
가격


NGF8-NATURAL GAS FUTR Jan18
1,136.87
852.65
568.43
284.22
0.00
-284.22
-568.43
-852.65
-1,136.87
0.00
0.69
1.39
2.08
2.77
3.46
4.16
4.85
5.54
손익(백만)
가격


XBF8-GASOLINE RBOB FUT Jan18
733.17
549.88
366.58
183.29
0.00
-183.29
-366.58
-549.88
-733.17
0.00
0.43
0.86
1.29
1.72
2.15
2.58
3.01
3.44
손익(백만)
가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLF8	WTI CRUDE FUTURE Jan18	73
COH8	BRENT CRUDE FUTR MAR18	111
HOF8	NY Harb ULSD Fut Jan18	59
KR4175MC0(	2017-12 달러선물	70
NGF8	NATURAL GAS FUTR Jan18	91
XBF8	GASOLINE RBOB FUT Jan18	59

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

665

공시일	2017-12-12
기준일	2017-12-11

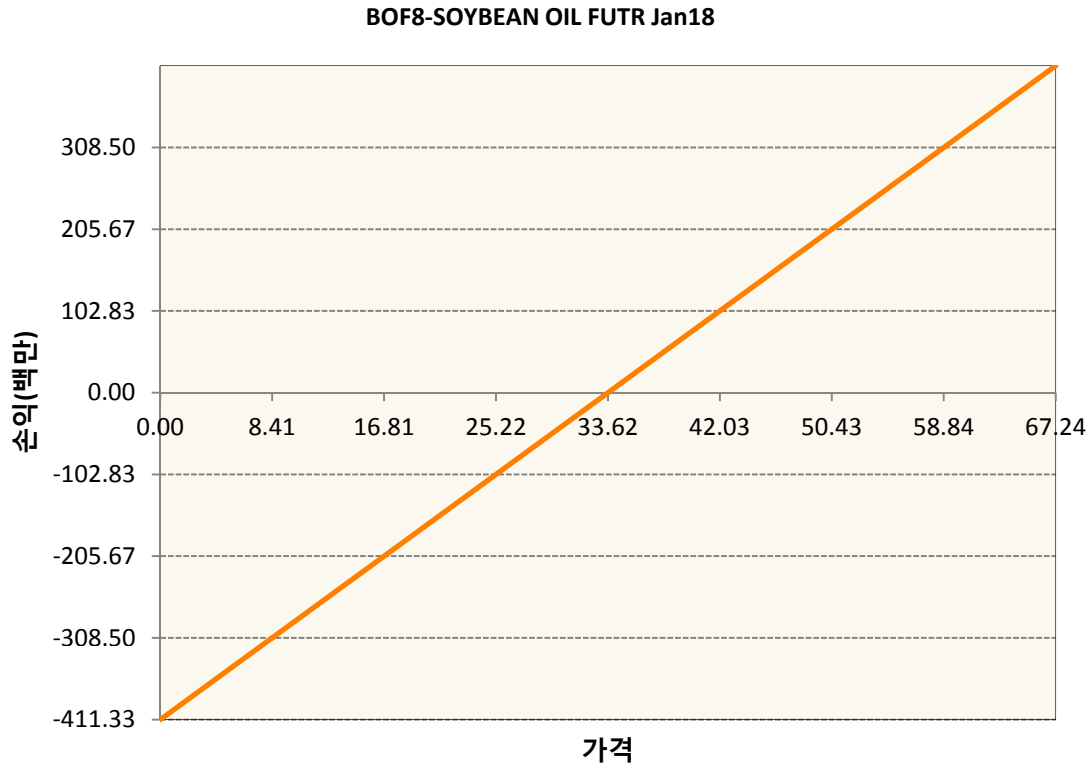
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

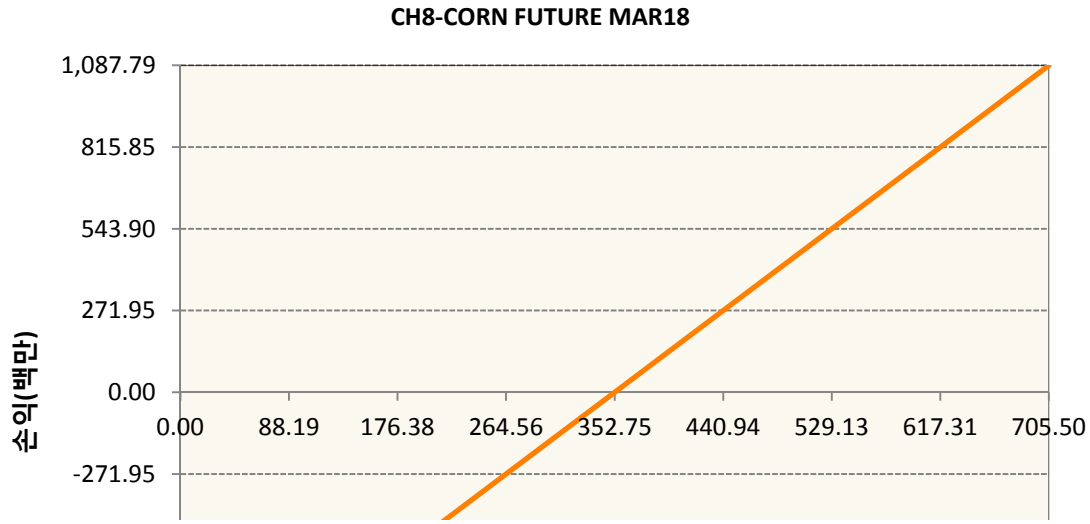
1. 계약금액

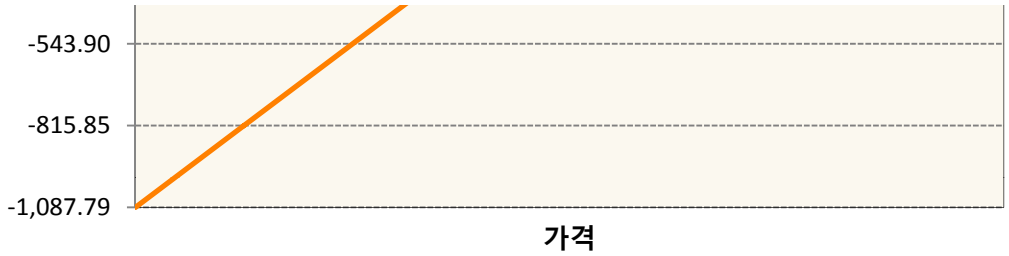
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	4,392	328	4,065	

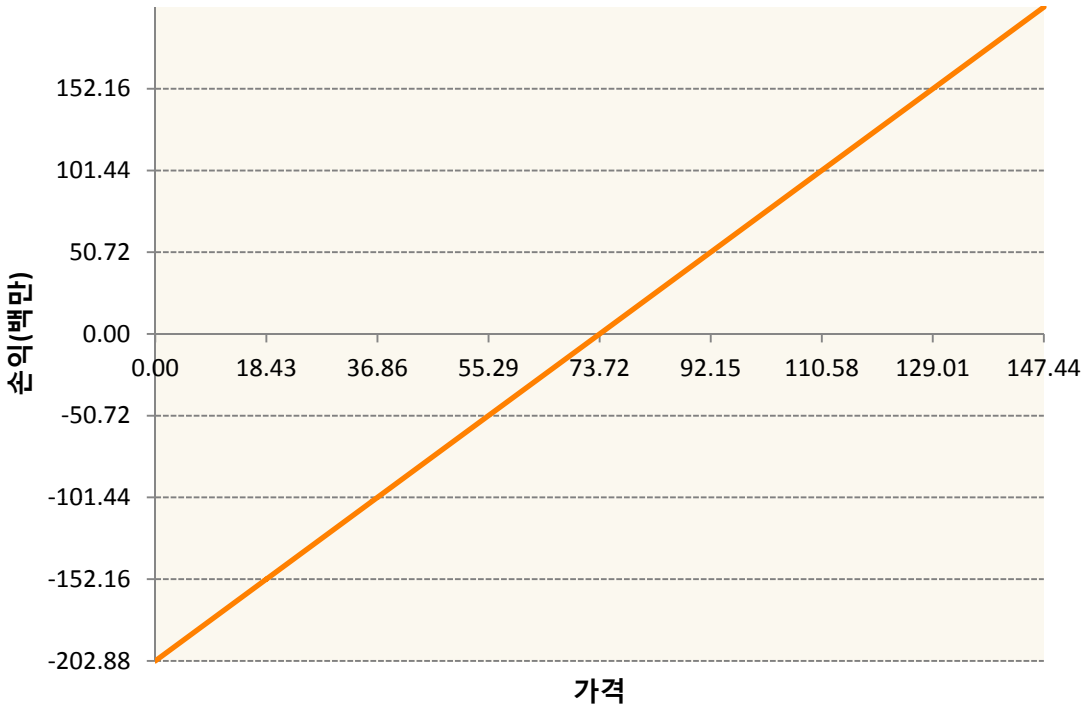
2. 만기시점의 손익구조



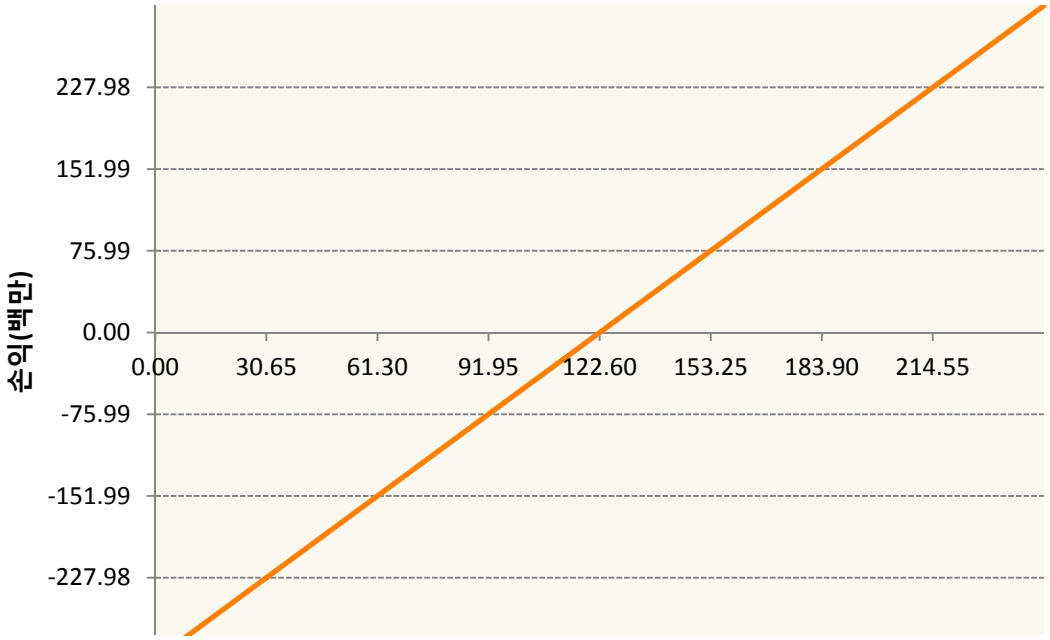


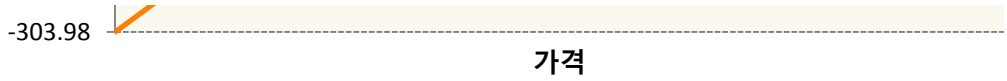


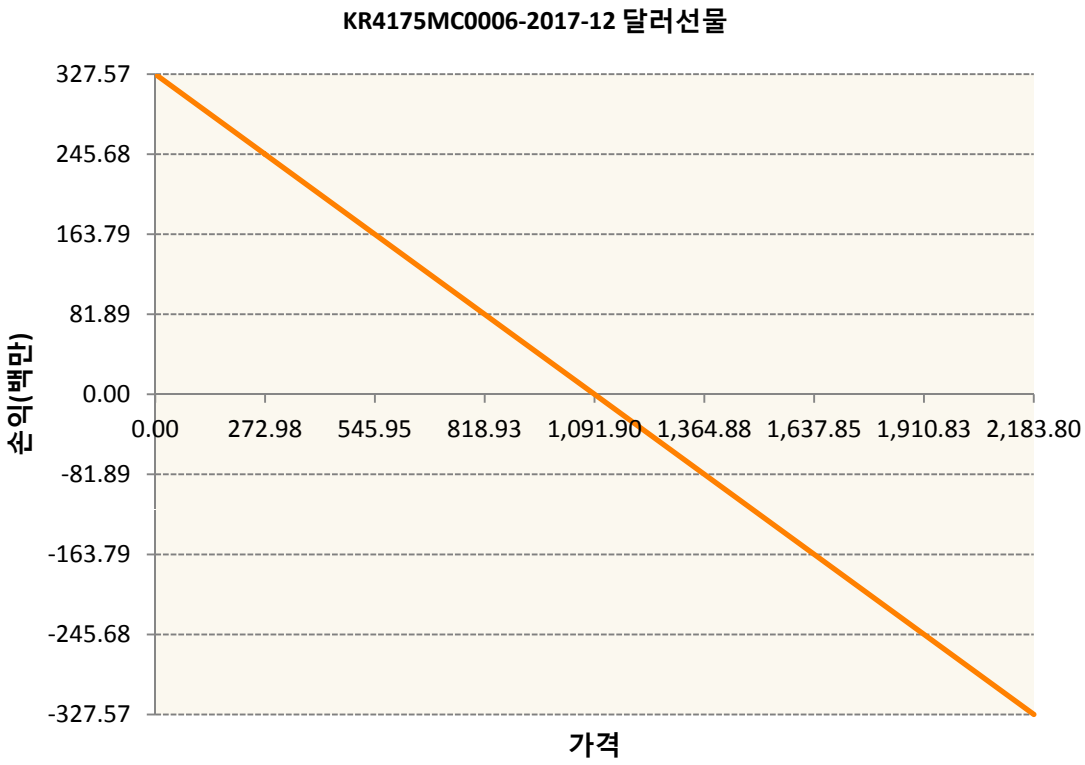
CTH8-COTTON NO.2 FUTR MAR18

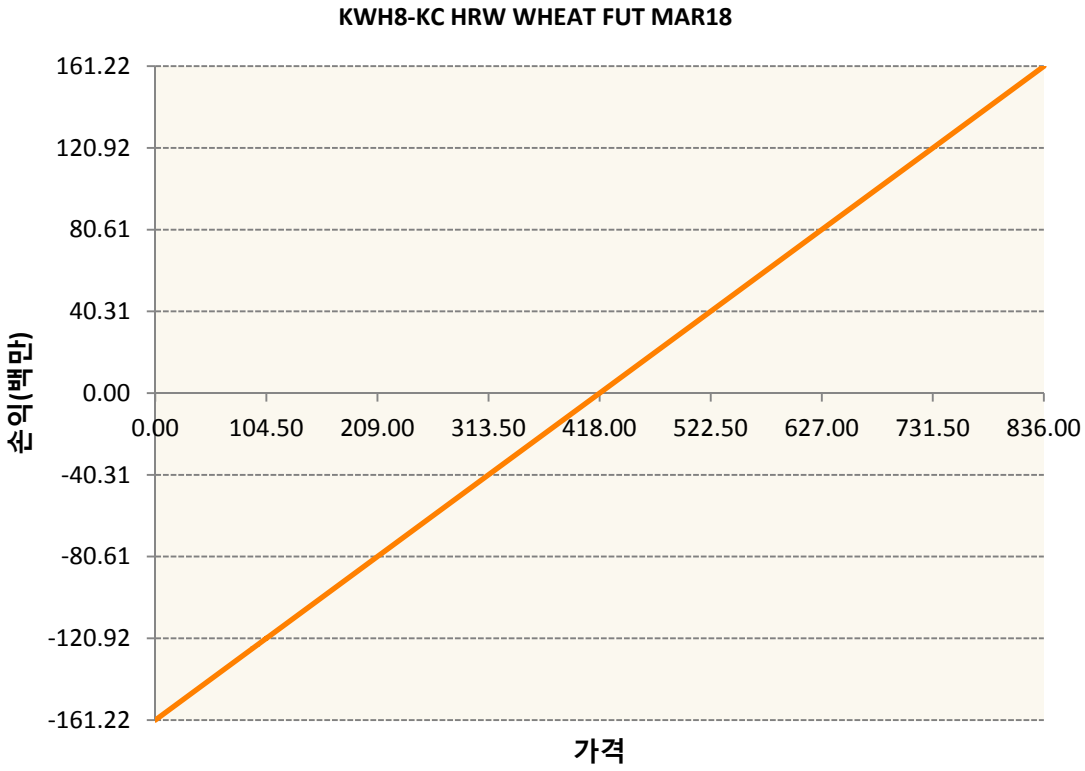


KCH8-COFFEE "C" FUTURE MAR18

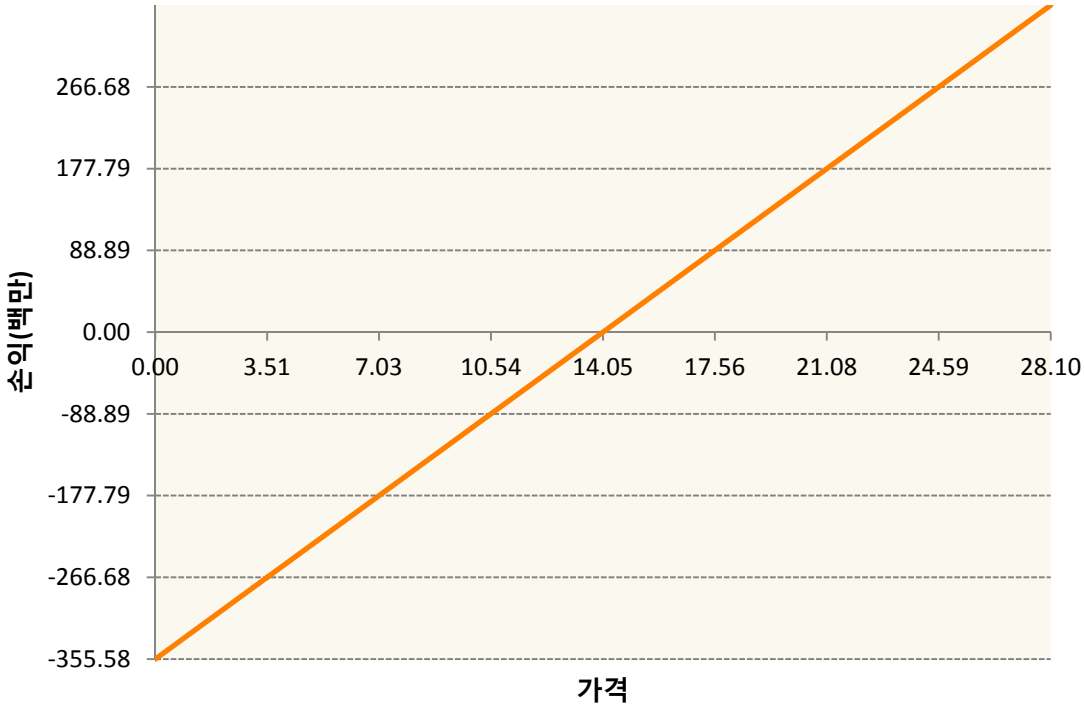



-303.98
가격

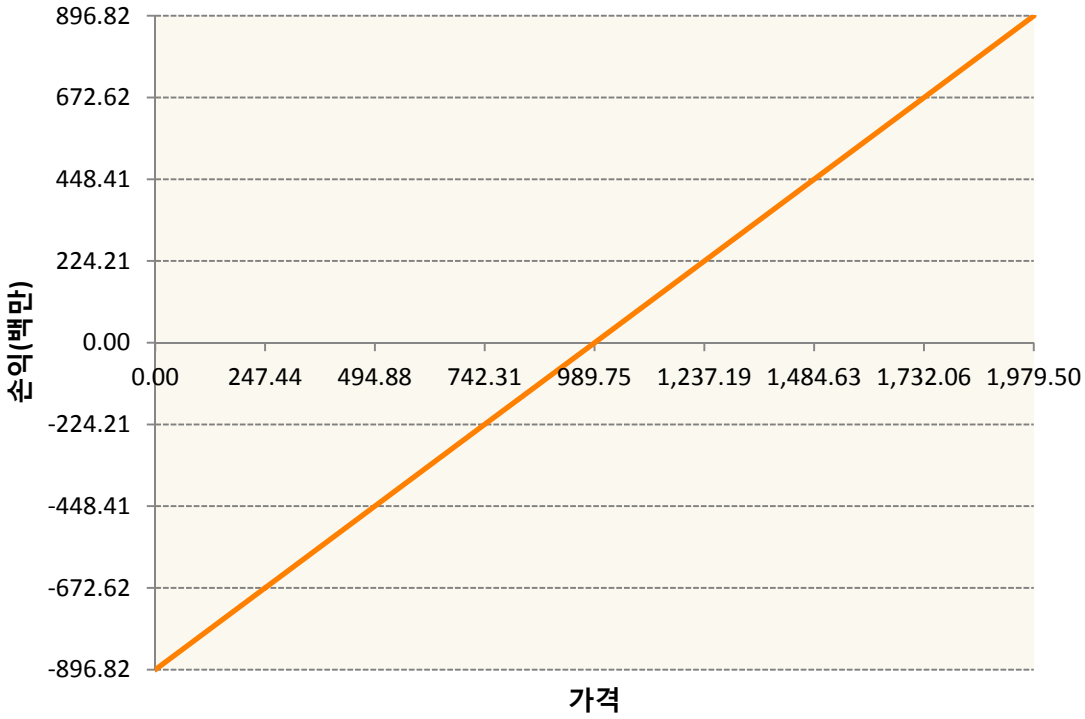

KR4175MC0006-2017-12 달러선물
327.57
245.68
163.79
81.89
0.00
-81.89
-163.79
-245.68
-327.57
0.00
272.98
545.95
818.93
1,091.90
1,364.88
1,637.85
1,910.83
2,183.80
손익(백만)
가격


KWH8-KC HRW WHEAT FUT MAR18
161.22
120.92
80.61
40.31
0.00
-40.31
-80.61
-120.92
-161.22
0.00
104.50
209.00
313.50
418.00
522.50
627.00
731.50
836.00
손익(백만)
가격

SBH8-Sugar #11 (WORLD) MAR18

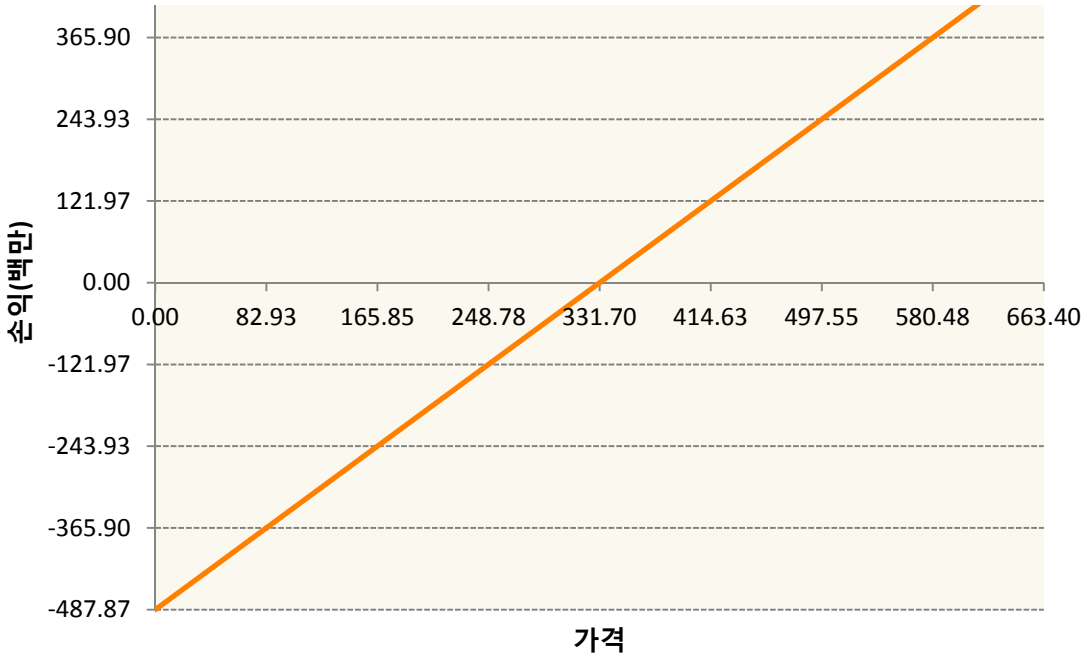


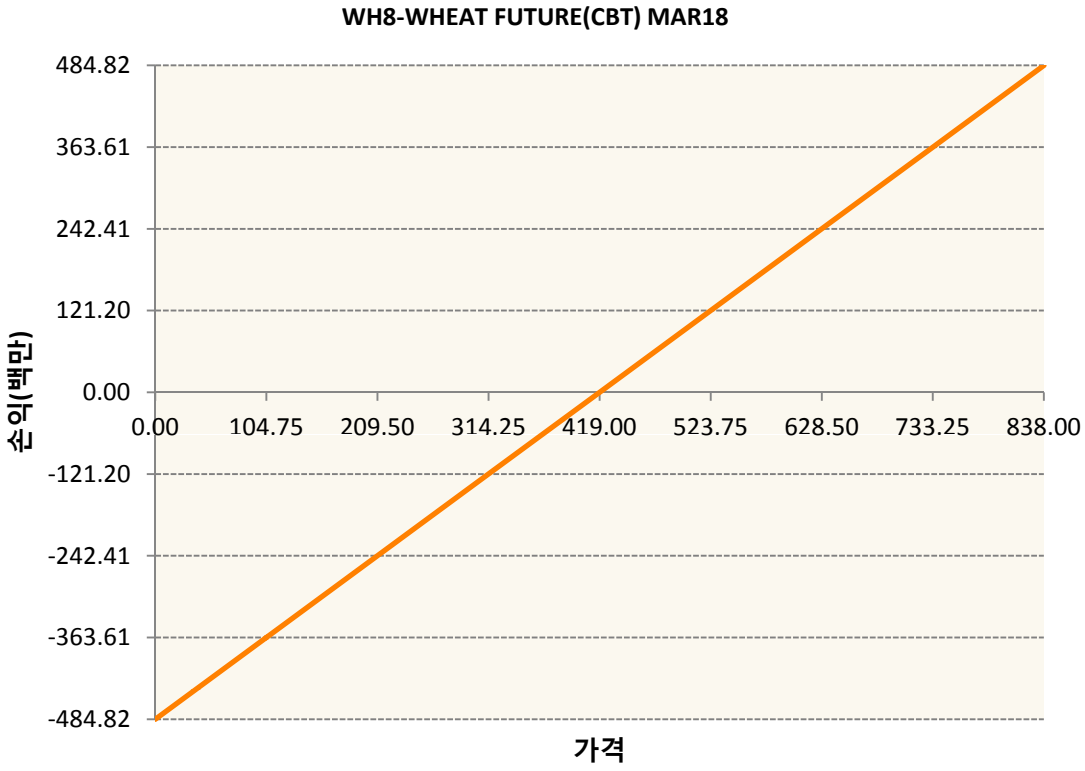
SF8-SOYBEAN FUTURE Jan18



SMF8-SOYBEAN MEAL FUTR Jan18







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	28
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)

373