공시일	2017-12-13
기준일	2017-12-12

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	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	2017-12-13
기준일	2017-12-12

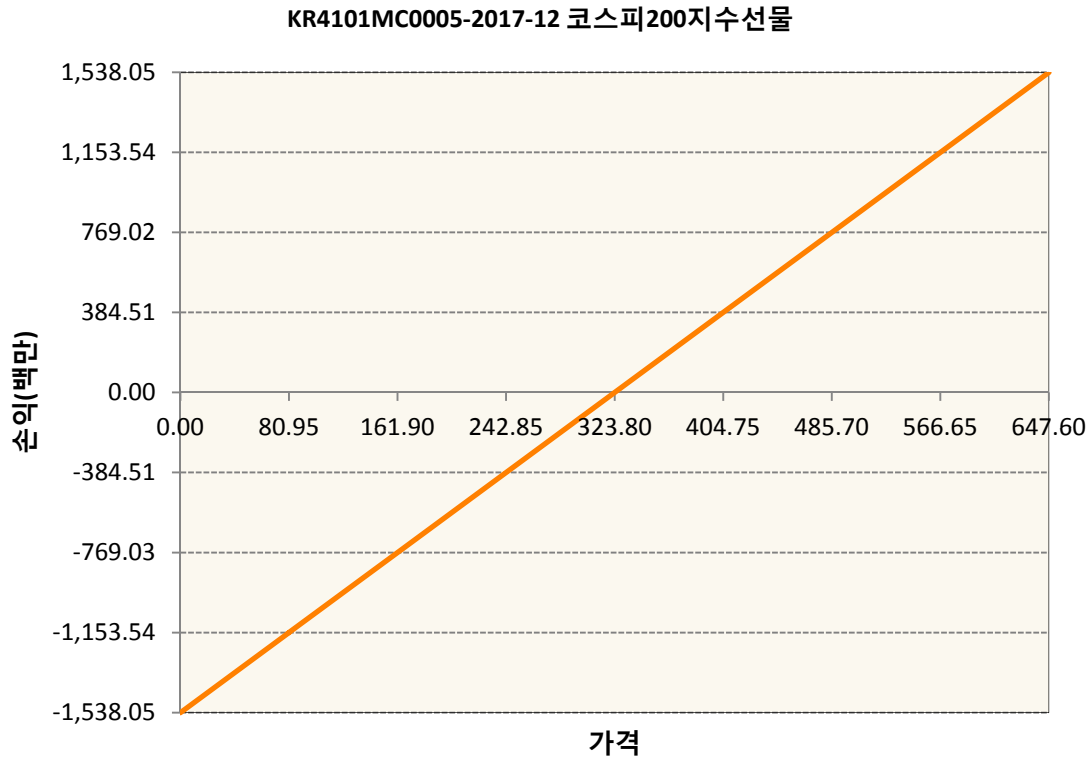
스마트인덱스모

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	1,538	0	1,538	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)

72

공시일	2017-12-13
기준일	2017-12-12

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	13,365	0	13,365	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWMXWO0(신한MXWO 미래S171122	1,088

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

349

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-12-13
기준일	2017-12-12

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	4,901	0	4,901	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI50000 신한CSI500미래S171208	398

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

371

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-12-13
기준일	2017-12-12

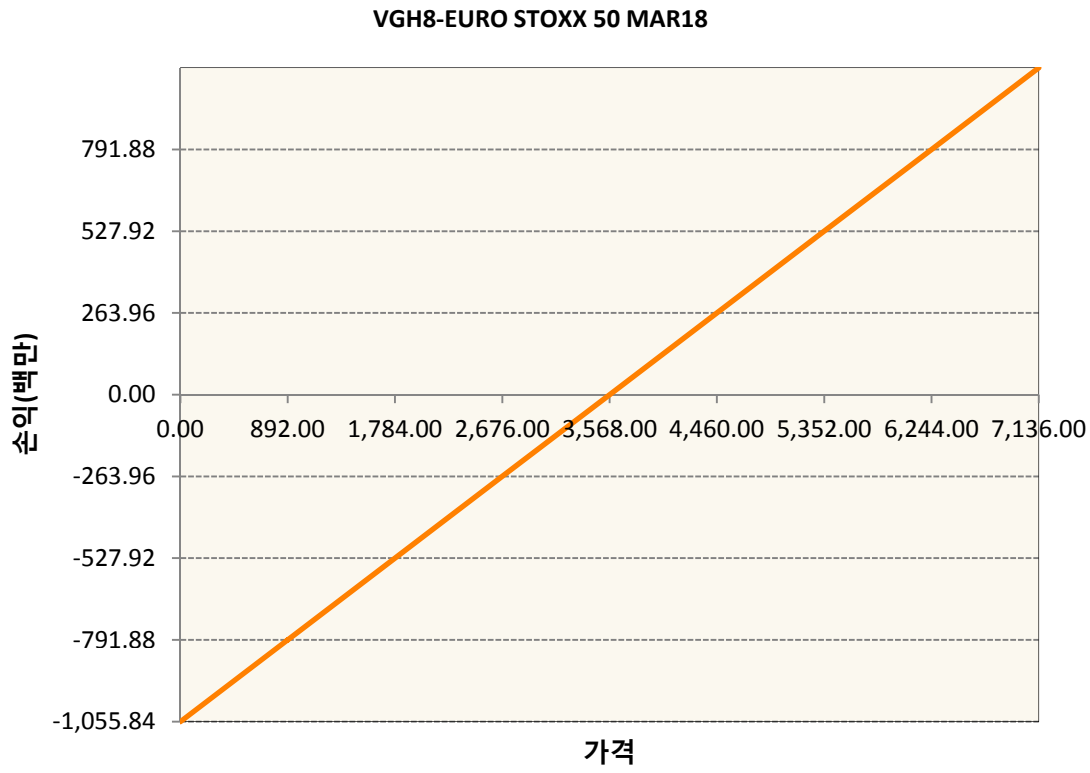
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

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

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGH8	EURO STOXX 50 MAR18	84

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

(단위:백만원)

48

공시일	2017-12-13
기준일	2017-12-12

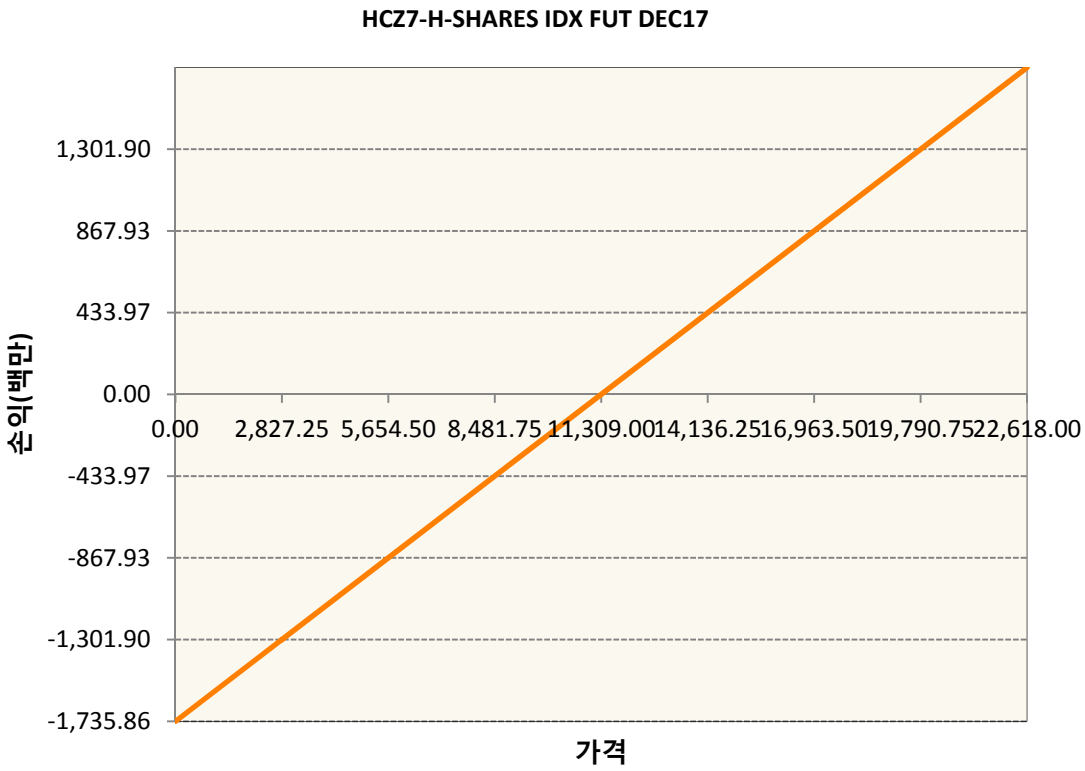
차이나인덱스모(주식-파생형)

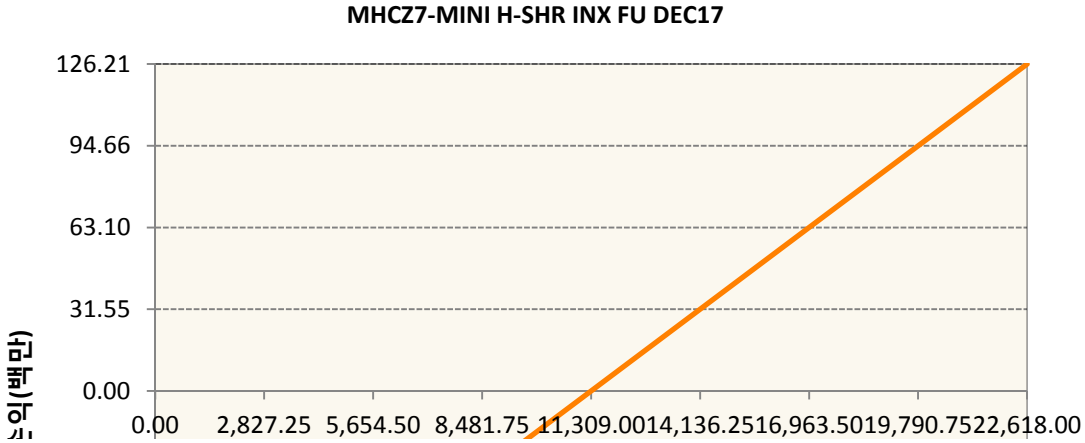
1. 계약금액

(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	1,736	0	1,736	
누계	유가증권	선물	126	0	126	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCZ7	H-SHARES IDX FUT DEC17	139
MHCZ7	MINI H-SHR INX FU DEC17	10

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	96

공시일	2017-12-13
기준일	2017-12-12

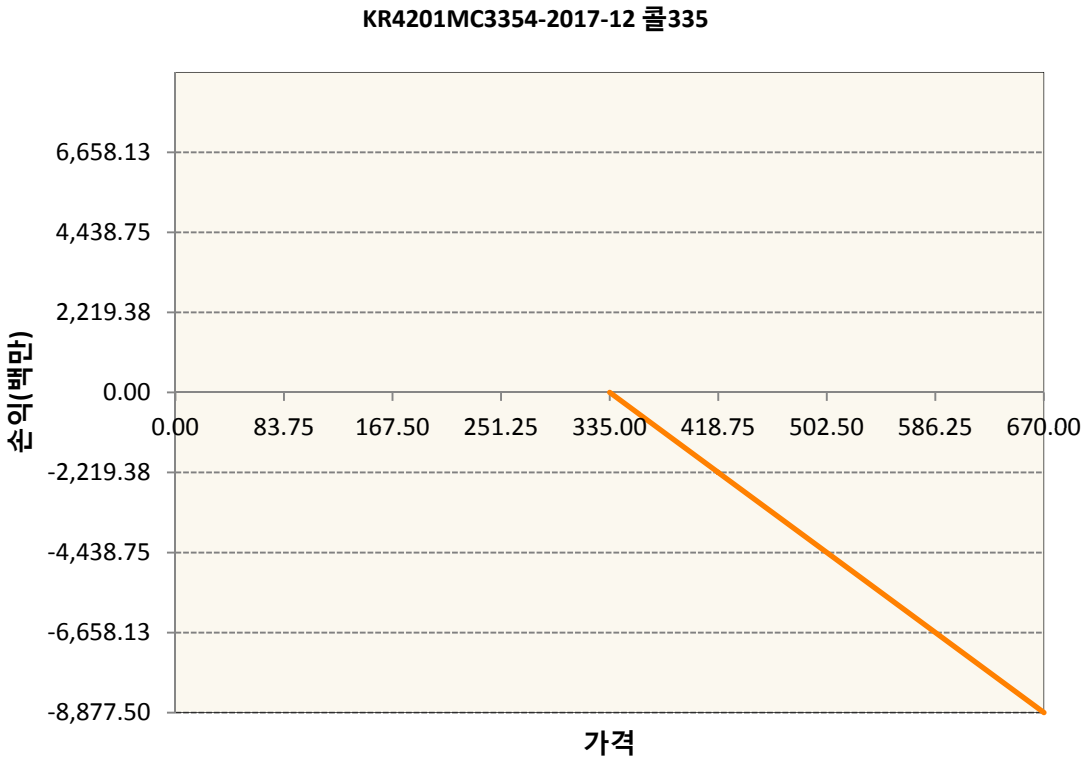
커버드콜모(주식혼합-파생형)

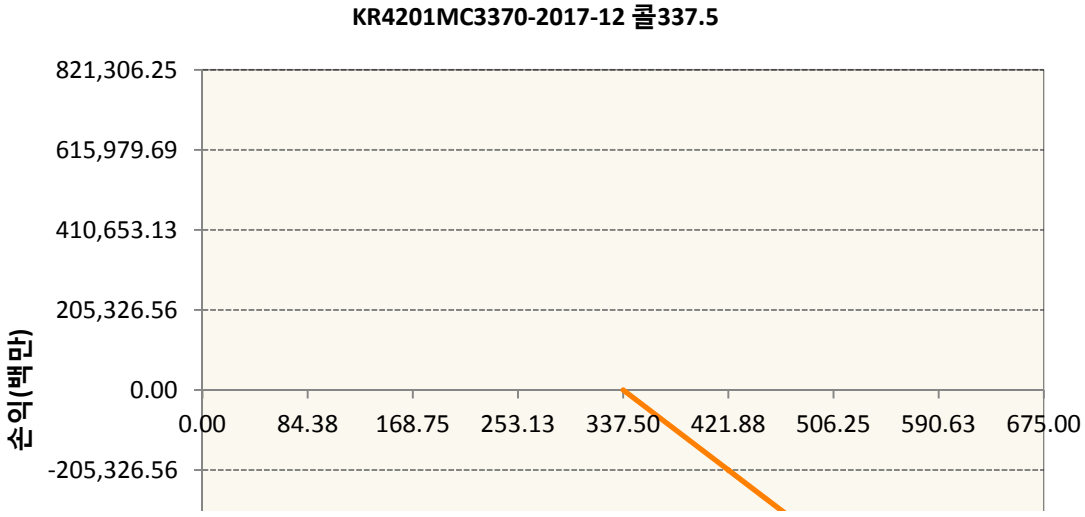
1. 계약금액

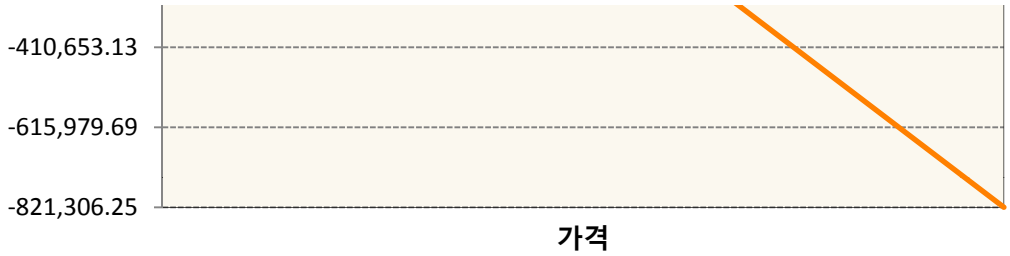
(단위:백만원)

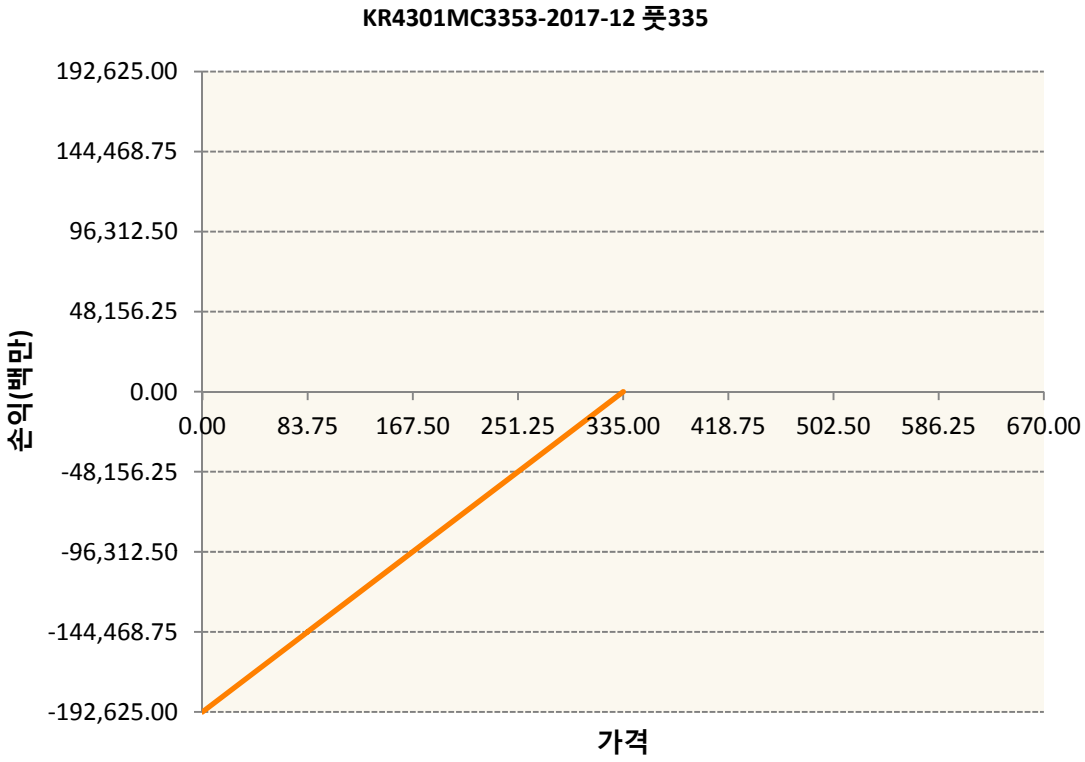
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	1,444,684	-1,444,684	장내

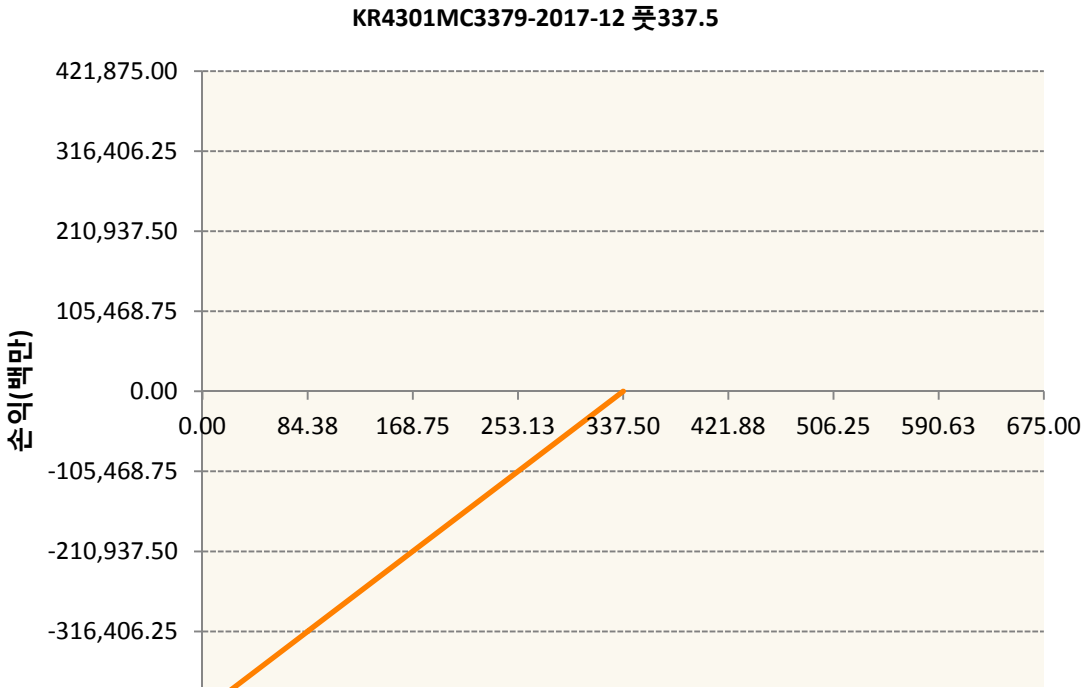
2. 만기시점의 손익구조






-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							398
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	2	2	2	2	2	2	2
-5.33%	2	2	2	2	2	2	2
-2.67%	2	2	2	2	2	2	2
0%	2	2	1	0	-1	-3	-4
2.67%	-22	-27	-32	-37	-42	-47	-52
5.33%	-171	-174	-176	-179	-183	-186	-190
8.00%	-395	-395	-395	-396	-396	-397	-398
KR4201MC3. 2017-12 콜337.5							30,819
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	71	71	71	71	71	71	71
-5.33%	71	71	71	71	71	71	71
-2.67%	71	71	71	71	70	68	63
0%	66	56	35	0	-52	-125	-218
2.67%	-808	-1,117	-1,453	-1,813	-2,191	-2,584	-2,990
5.33%	-10,637	-11,009	-11,403	-11,813	-12,237	-12,671	-13,114
8.00%	-30,367	-30,390	-30,430	-30,491	-30,575	-30,685	-30,819
KR4301MC3. 2017-12 풋335							14,906
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-14,906	-14,906	-14,906	-14,906	-14,906	-14,906	-14,906
-5.33%	-9,937	-9,937	-9,937	-9,937	-9,937	-9,937	-9,937
-2.67%	-4,969	-4,969	-4,969	-4,969	-4,969	-4,969	-4,969
0%	0	0	0	0	0	-1	-1
2.67%	4,850	4,811	4,769	4,724	4,678	4,629	4,579
5.33%	6,279	6,276	6,272	6,265	6,256	6,243	6,228
8.00%	6,280	6,280	6,280	6,280	6,280	6,280	6,280
KR4301MC3. 2017-12 풋337.5							32,404
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-32,404	-32,404	-32,404	-32,404	-32,404	-32,404	-32,404
-5.33%	-21,603	-21,603	-21,603	-21,603	-21,603	-21,603	-21,603
-2.67%	-10,801	-10,801	-10,801	-10,801	-10,801	-10,801	-10,801
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	10,778	10,758	10,729	10,692	10,648	10,595	10,536

5.33%	16,711	16,670	16,620	16,561	16,494	16,420	16,340
8.00%	16,777	16,777	16,777	16,777	16,777	16,777	16,776

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

60,908

공시일	2017-12-13
기준일	2017-12-12

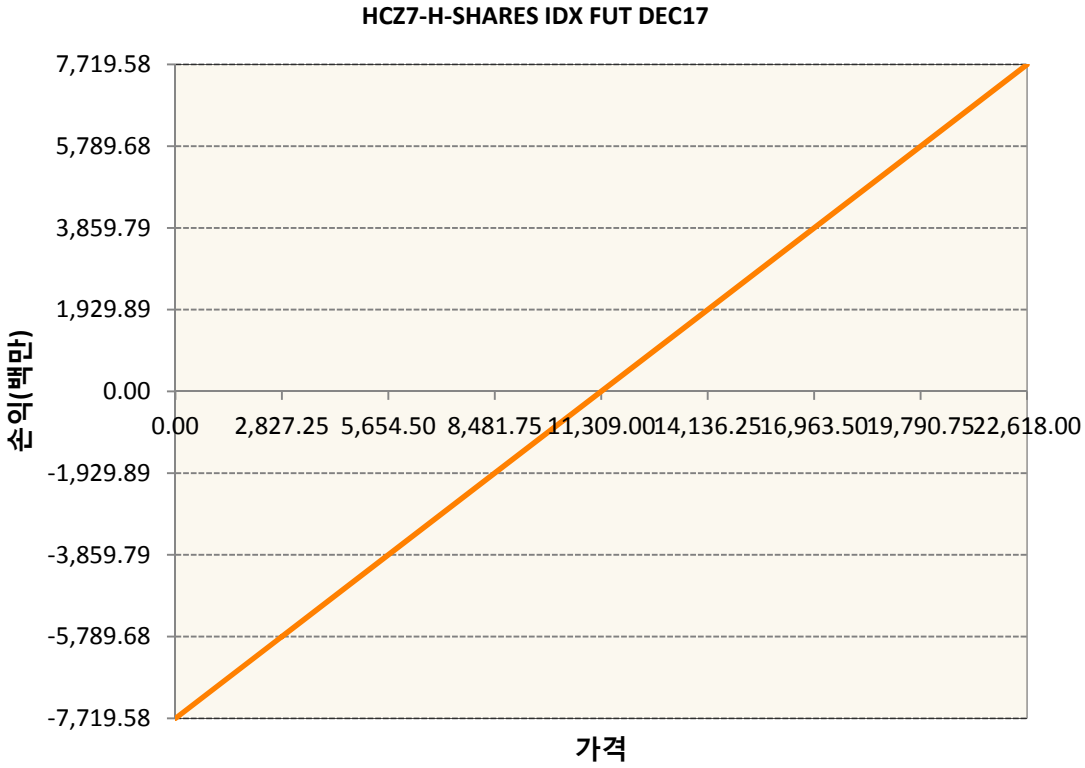
홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생

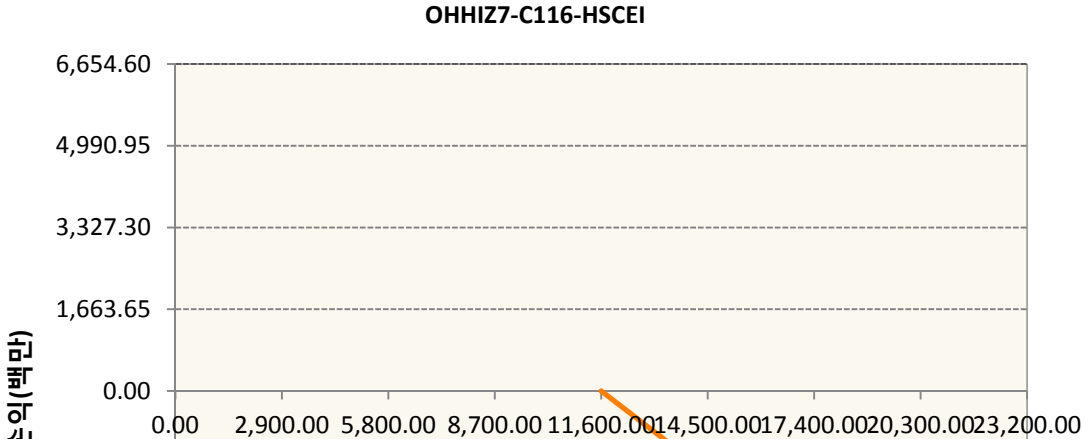
1. 계약금액

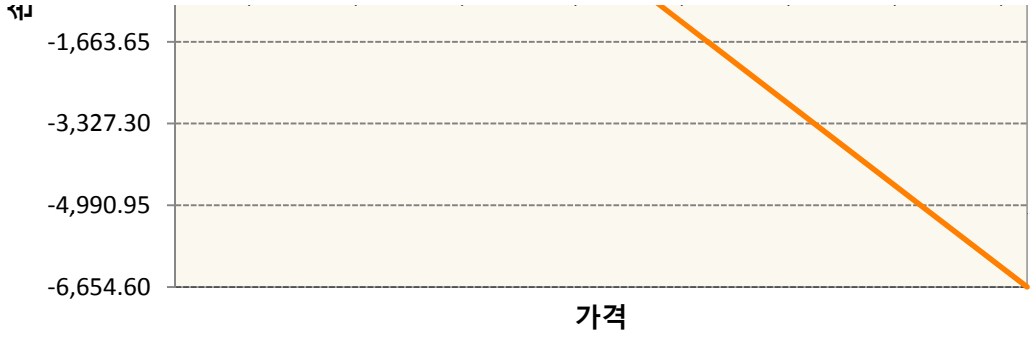
(단위:백만원)

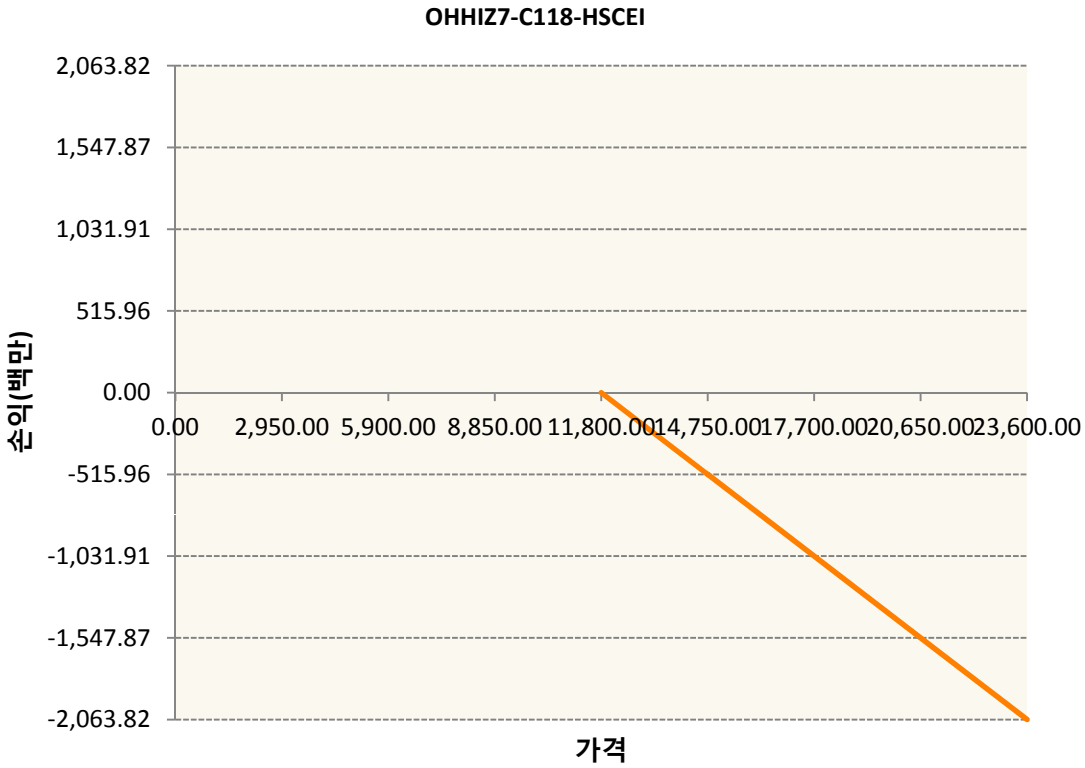
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	7,720	0	7,720	
누계	유가증권	옵션	0	17,437	-17,437	장내

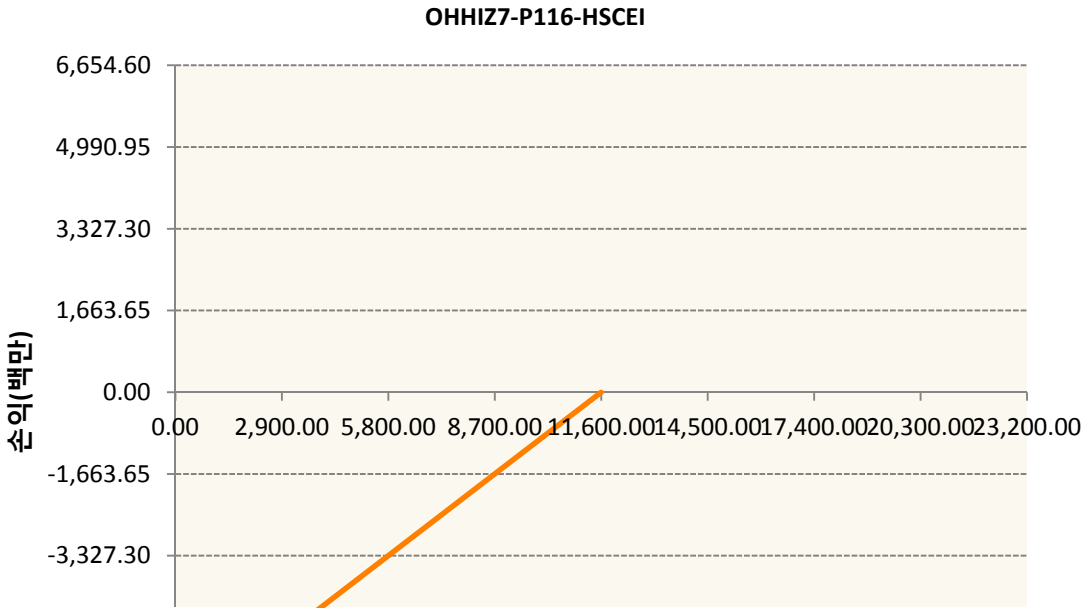
2. 만기시점의 손익구조

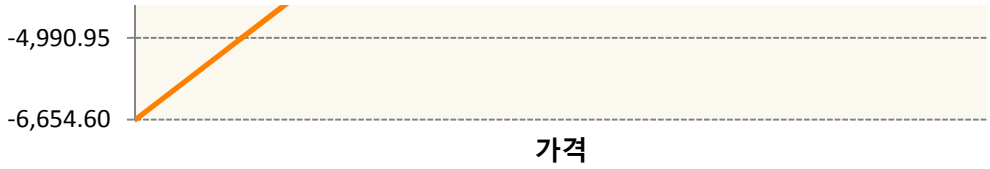


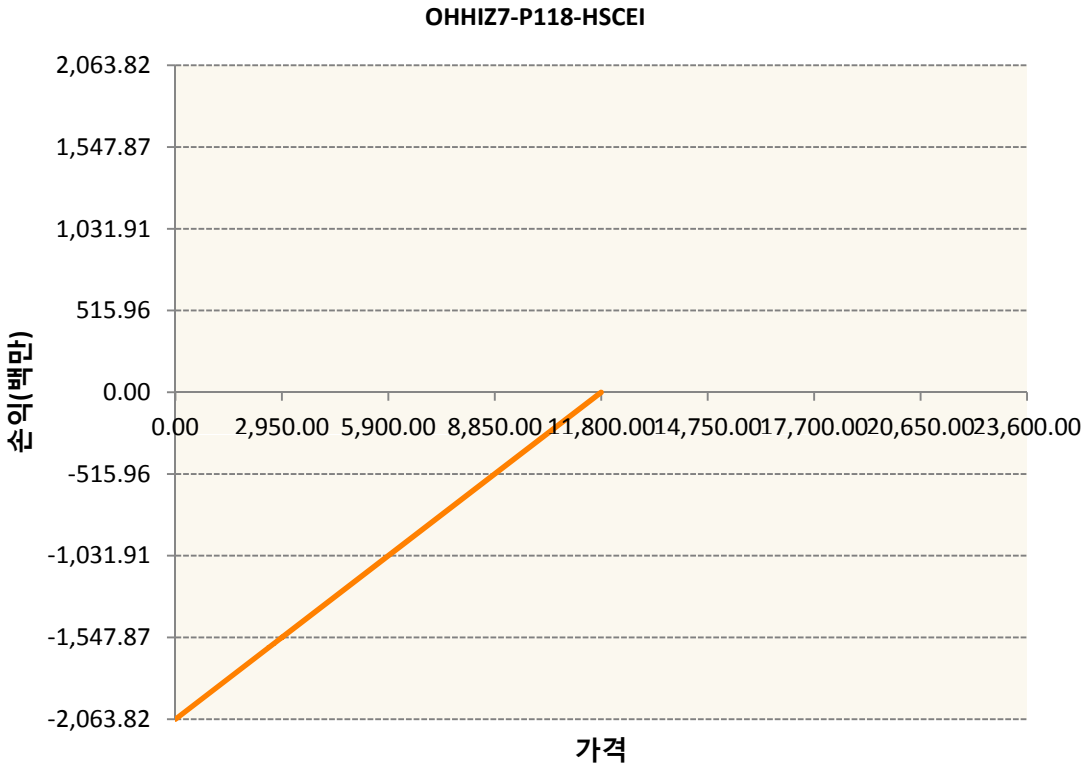



-1,663.65
-3,327.30
-4,990.95
-6,654.60
가격


OHHIZ7-C118-HSCEI
2,063.82
1,547.87
1,031.91
515.96
0.00
-515.96
-1,031.91
-1,547.87
-2,063.82
손익(백만)
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
가격


OHHIZ7-P116-HSCEI
6,654.60
4,990.95
3,327.30
1,663.65
0.00
-1,663.65
-3,327.30
손익(백만)
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





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

HCZ7	H-SHARES IDX FUT DEC17	618
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)

1,497

공시일	2017-12-13
기준일	2017-12-12

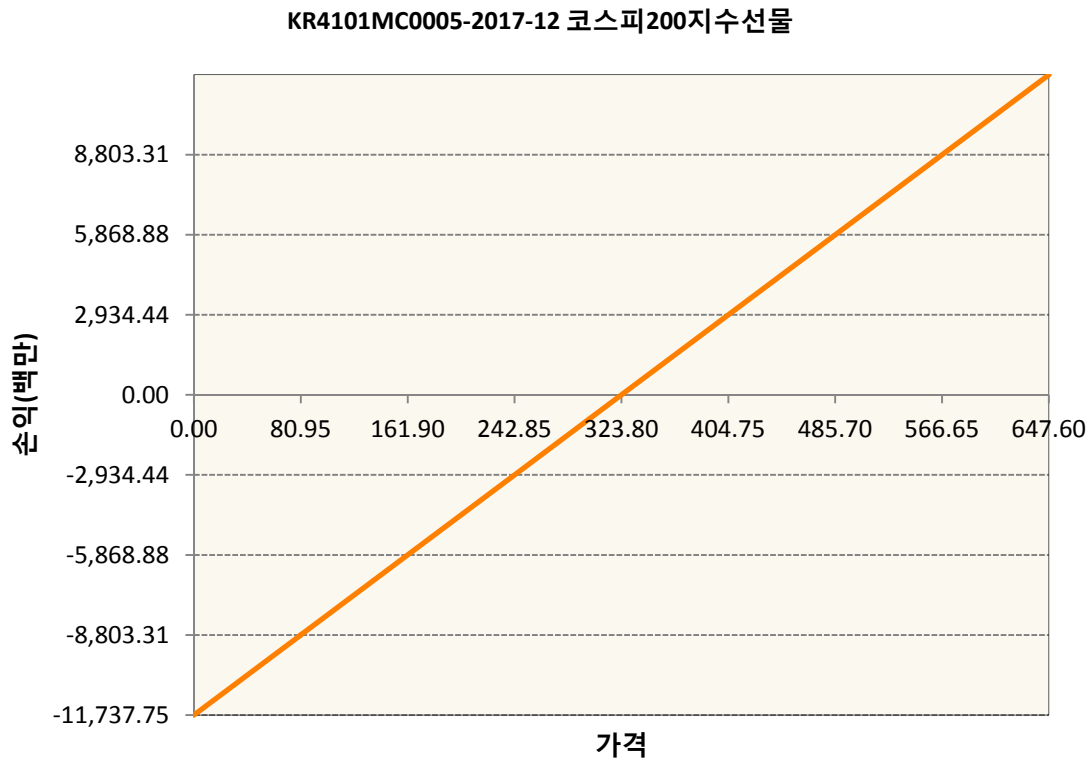
코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼

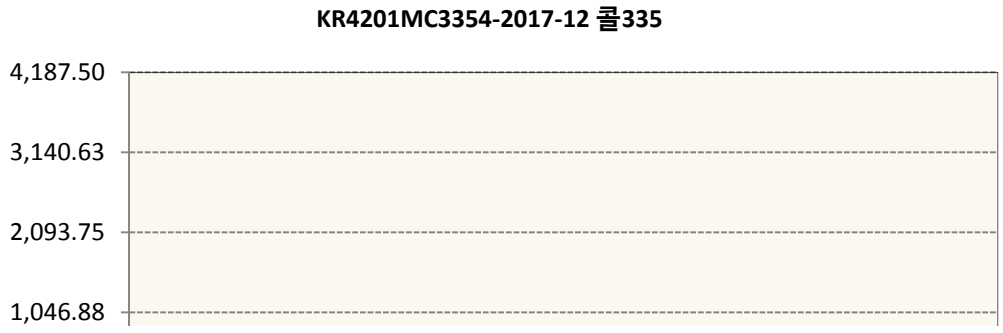
1. 계약금액

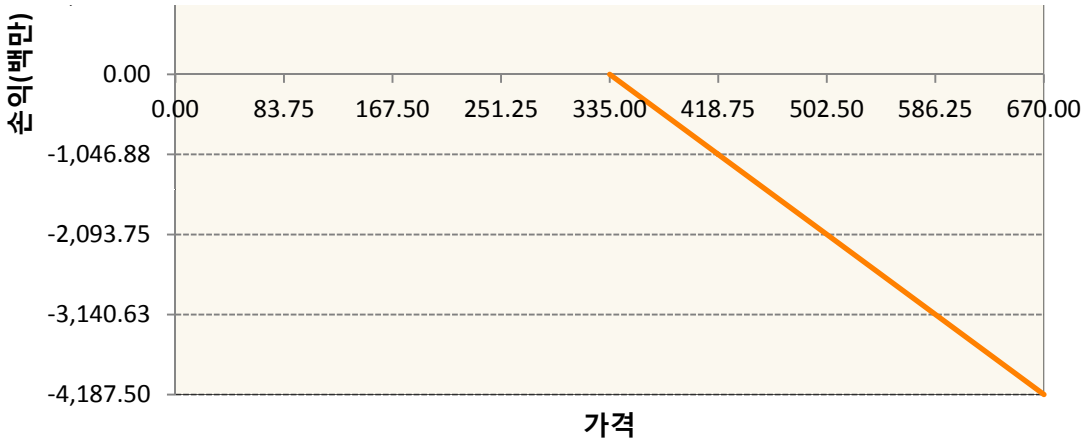
(단위:백만원)

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	11,738	0	11,738	장내
누계	유가증권	스왑	60,200	0	60,200	장외
누계	유가증권	옵션	0	59,409	-59,409	장내

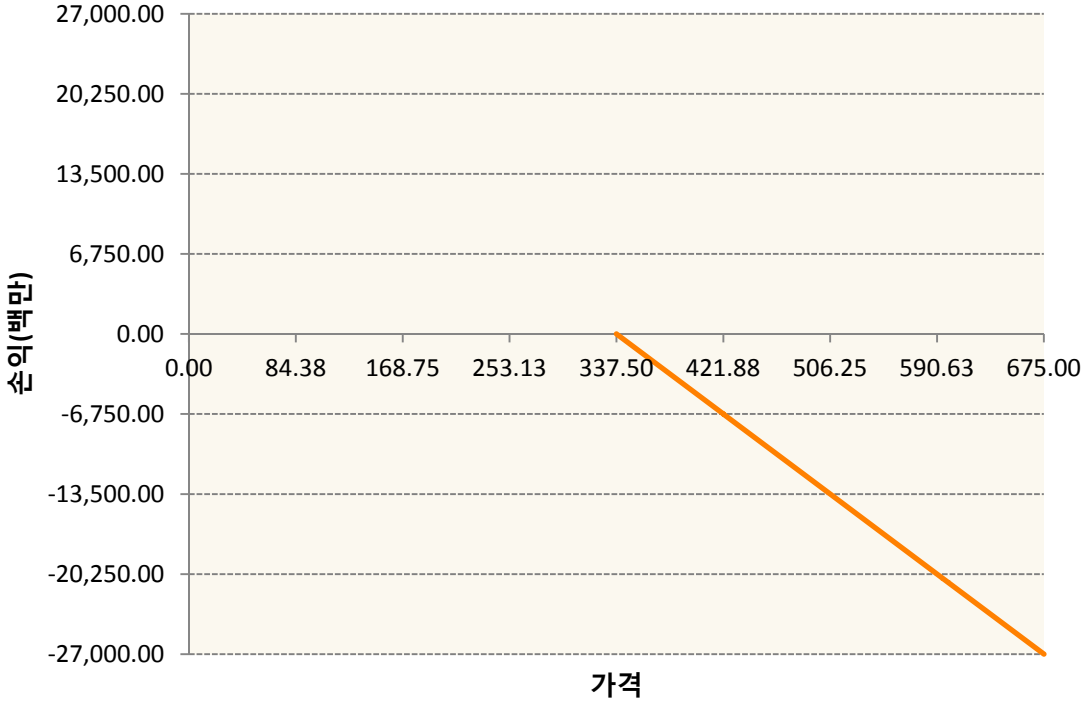
2. 만기시점의 손익구조



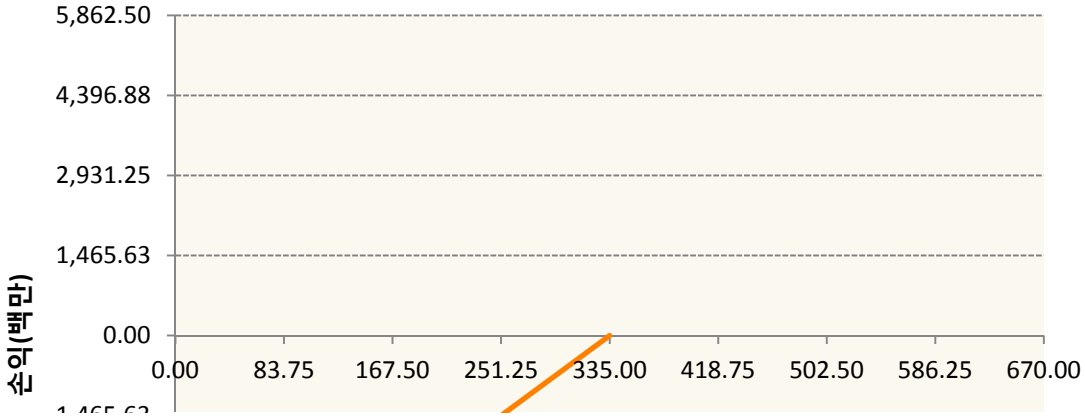




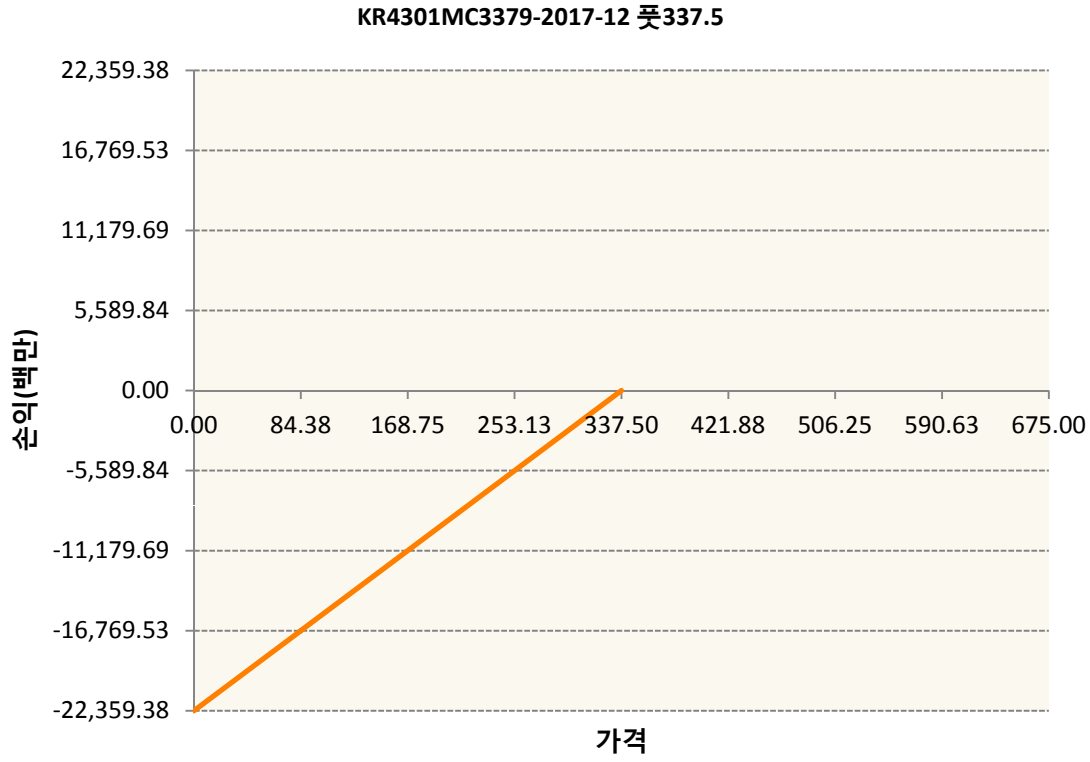
KR4201MC3370-2017-12 콜337.5



KR4301MC3353-2017-12 풋335







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_2							1,469
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,469	-1,469	-1,469	-1,469	-1,469	-1,469	-1,469
-5.33%	-979	-979	-979	-979	-979	-979	-979
-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%	979	979	979	979	979	979	979
8.00%	1,469	1,469	1,469	1,469	1,469	1,469	1,469
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%	-185	-185	-185	-185	-185	-185	-185
-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%	185	185	185	185	185	185	185
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						238
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-238	-238	-238	-238	-238	-238	-238
-5.33%	-159	-159	-159	-159	-159	-159	-159
-2.67%	-79	-79	-79	-79	-79	-79	-79
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	79	79	79	79	79	79	79
5.33%	159	159	159	159	159	159	159
8.00%	238	238	238	238	238	238	238
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_6						198
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-198	-198	-198	-198	-198	-198	-198
-5.33%	-132	-132	-132	-132	-132	-132	-132
-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%	132	132	132	132	132	132	132
8.00%	198	198	198	198	198	198	198
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_7						254
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-254	-254	-254	-254	-254	-254	-254
-5.33%	-169	-169	-169	-169	-169	-169	-169
-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%	169	169	169	169	169	169	169
8.00%	254	254	254	254	254	254	254
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_8						470
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-470	-470	-470	-470	-470	-470	-470
-5.33%	-313	-313	-313	-313	-313	-313	-313
-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%	313	313	313	313	313	313	313
8.00%	470	470	470	470	470	470	470
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_9						313
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-313	-313	-313	-313	-313	-313	-313
-5.33%	-209	-209	-209	-209	-209	-209	-209
-2.67%	-104	-104	-104	-104	-104	-104	-104
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	104	104	104	104	104	104	104
5.33%	209	209	209	209	209	209	209
8.00%	313	313	313	313	313	313	313
	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%	-185	-185	-185	-185	-185	-185	-185
-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%	185	185	185	185	185	185	185
8.00%	278	278	278	278	278	278	278
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_11						635
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-635	-635	-635	-635	-635	-635	-635
-5.33%	-423	-423	-423	-423	-423	-423	-423
-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%	423	423	423	423	423	423	423
8.00%	635	635	635	635	635	635	635
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_12						476

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-476	-476	-476	-476	-476	-476	-476
-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%	476	476	476	476	476	476	476
	KR4101MC0	2017-12 코스피200지수선물					940

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-940	-940	-940	-940	-940	-940	-940
-5.33%	-627	-627	-627	-627	-627	-627	-627
-2.67%	-313	-313	-313	-313	-313	-313	-313
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	313	313	313	313	313	313	313
5.33%	627	627	627	627	627	627	627
8.00%	940	940	940	940	940	940	940
	KR4201MC3	2017-12 콜335					188

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1	1	1	1	1	1	1
-5.33%	1	1	1	1	1	1	1
-2.67%	1	1	1	1	1	1	1
0%	1	1	0	0	-1	-1	-2
2.67%	-10	-13	-15	-17	-20	-22	-25
5.33%	-81	-82	-83	-85	-86	-88	-90
8.00%	-186	-186	-187	-187	-187	-187	-188
	KR4201MC3	2017-12 콜337.5					1,013

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	2	2	2	2	2	2	2
-5.33%	2	2	2	2	2	2	2
-2.67%	2	2	2	2	2	2	2
0%	2	2	1	0	-2	-4	-7
2.67%	-27	-37	-48	-60	-72	-85	-98
5.33%	-350	-362	-375	-388	-402	-417	-431
8.00%	-998	-999	-1,000	-1,002	-1,005	-1,009	-1,013
	KR4301MC3	2017-12 풋335					454

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-454	-454	-454	-454	-454	-454	-454
-5.33%	-302	-302	-302	-302	-302	-302	-302

-2.67%	-151	-151	-151	-151	-151	-151	-151
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	148	146	145	144	142	141	139
5.33%	191	191	191	191	190	190	190
8.00%	191	191	191	191	191	191	191
KR4301MC3. 2017-12 풋337.5							1,717
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,717	-1,717	-1,717	-1,717	-1,717	-1,717	-1,717
-5.33%	-1,145	-1,145	-1,145	-1,145	-1,145	-1,145	-1,145
-2.67%	-572	-572	-572	-572	-572	-572	-572
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	571	570	569	567	564	562	558
5.33%	886	884	881	878	874	870	866
8.00%	889	889	889	889	889	889	889

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

8,050

공시일	2017-12-13
기준일	2017-12-12

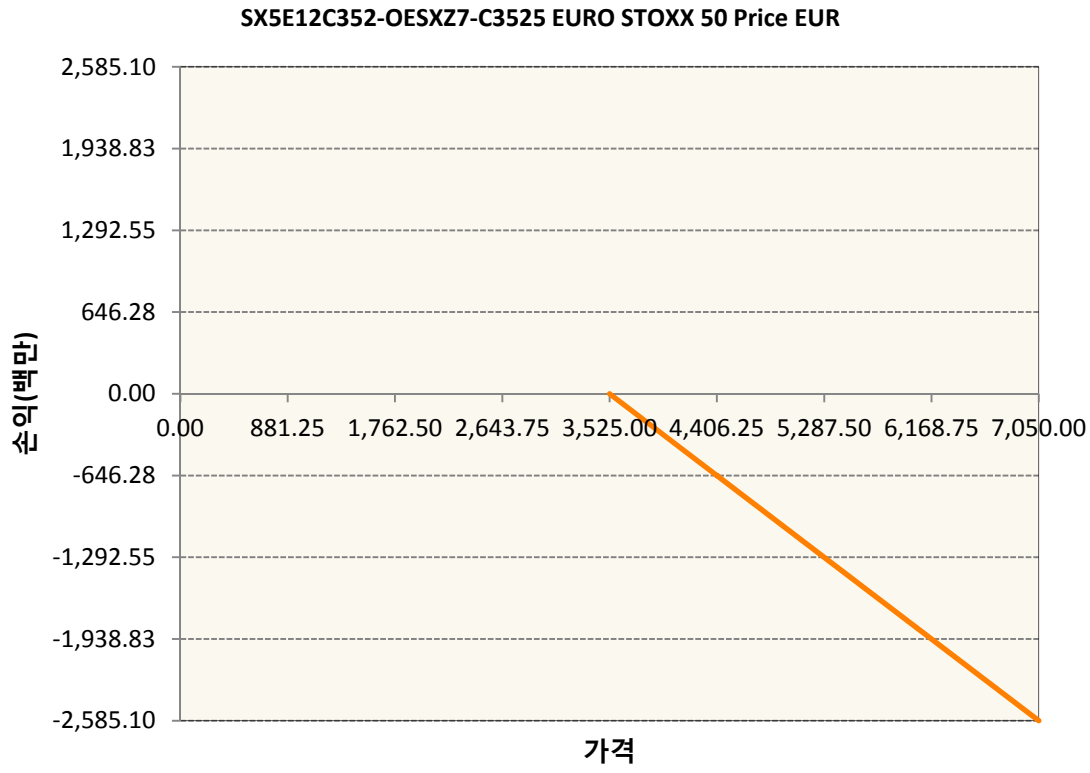
유로커버드콜모(주식혼합-파생형

1. 계약금액

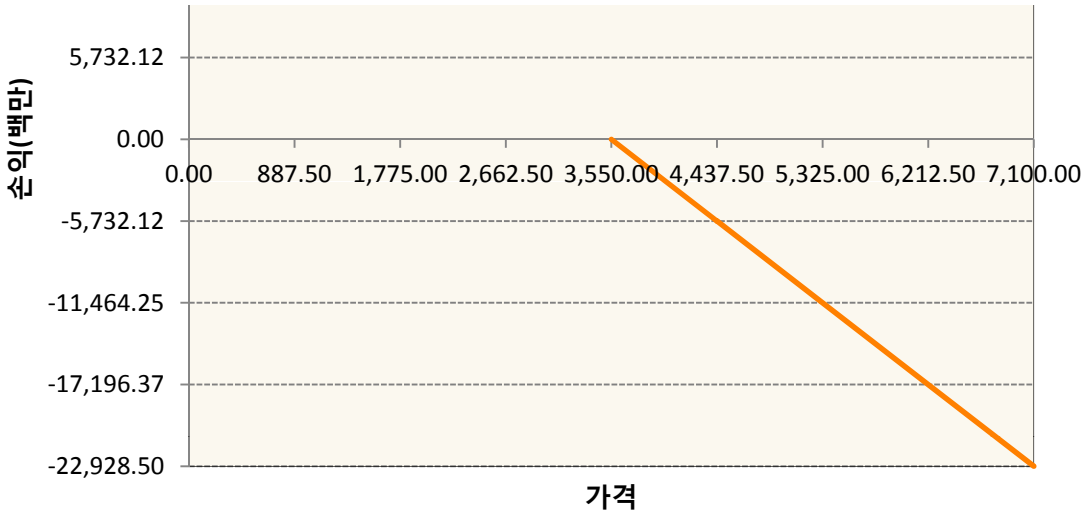
(단위:백만원)

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	17,601	0	17,601	
누계	유가증권	스왑	96,497	0	96,497	장외
누계	유가증권	옵션	0	51,027	-51,027	장내
누계	지수	스왑	51,466	0	51,466	장외

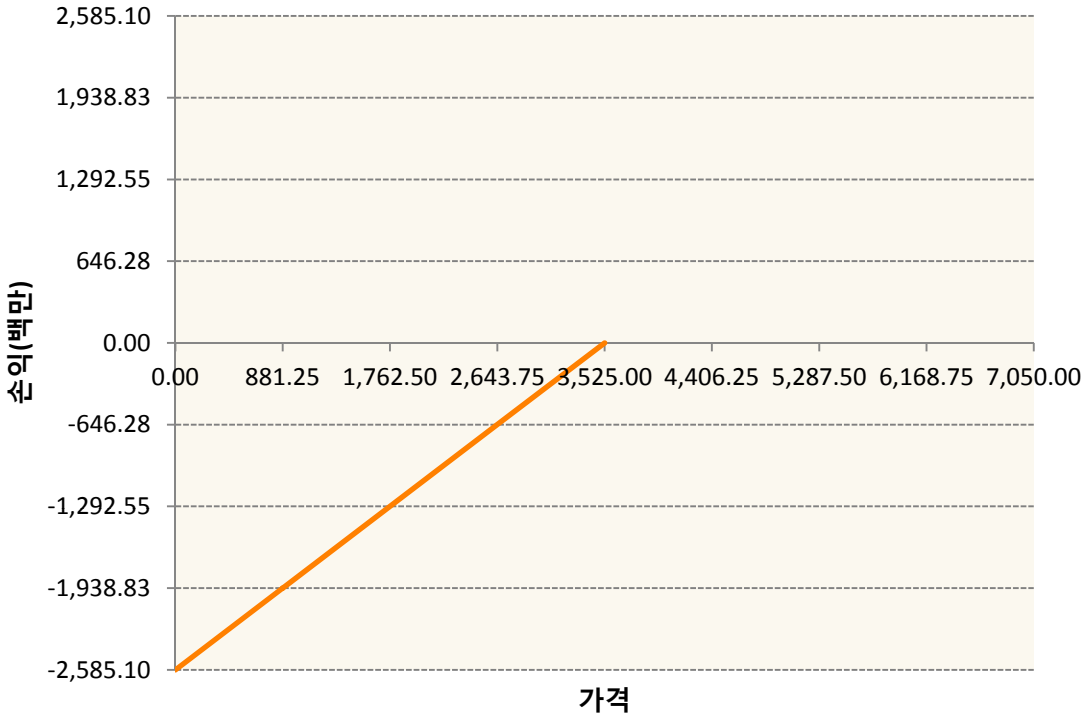
2. 만기시점의 손익구조



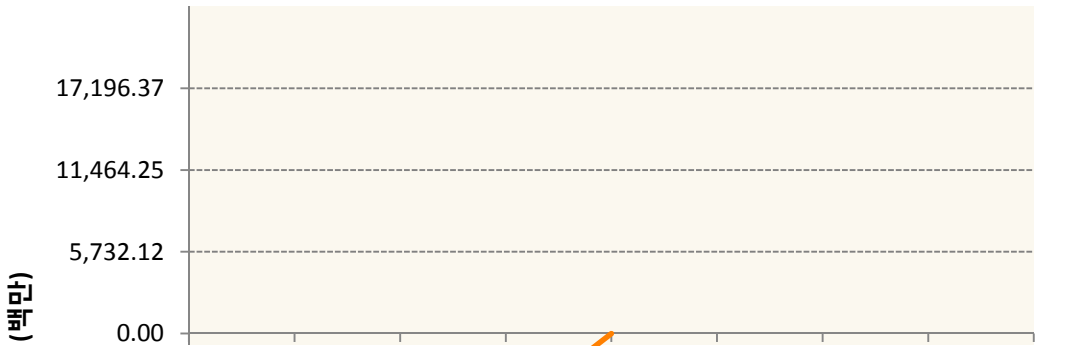


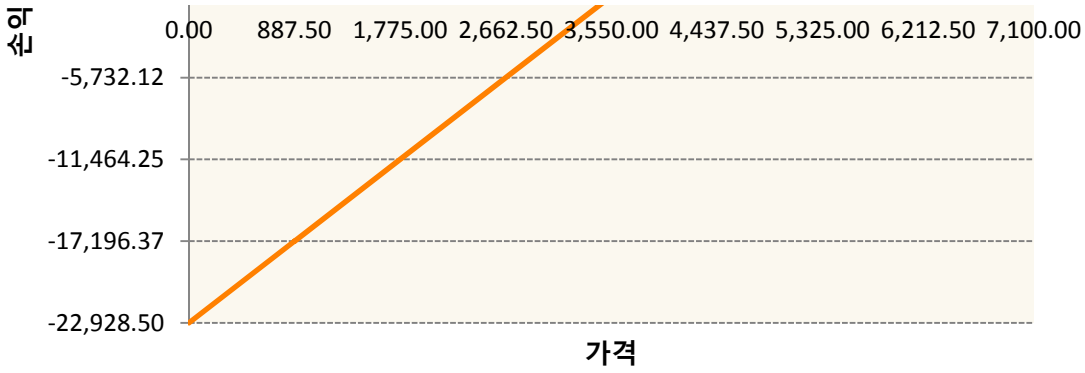


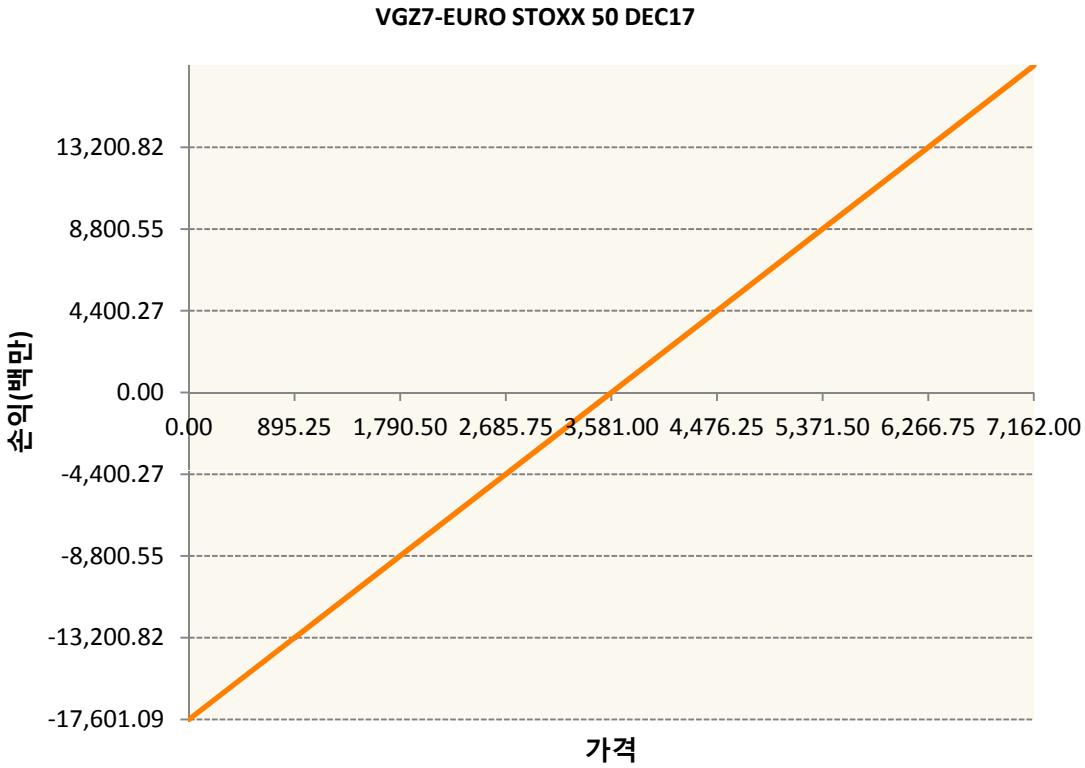
SX5E12P352-OESXZ7-P3525 EURO STOXX 50 Price EUR



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	48
SX5E12C352 OESXZ7-C3525 EURO STOXX 50 Price EUR	207
SX5E12C355 OESXZ7-C3550 EURO STOXX 50 Price EUR	1,834
SX5E12P352 OESXZ7-P3525 EURO STOXX 50 Price EUR	207
SX5E12P355 OESXZ7-P3550 EURO STOXX 50 Price EUR	1,834
VGZ7 EURO STOXX 50 DEC17	1,408

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

3,159

공시일	2017-12-13
기준일	2017-12-12

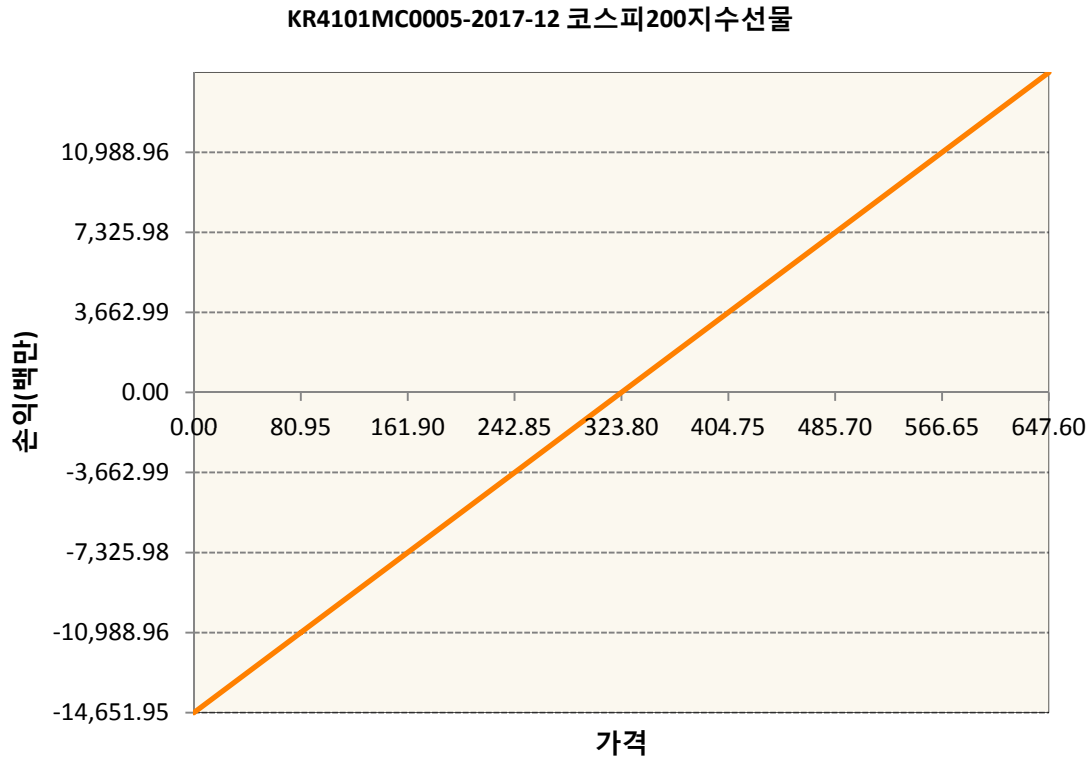
ETF스마트레버리지목표전환형8호

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	14,652	0	14,652	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101MC0	2017-12 코스피200지수선물						1,173
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,173	-1,173	-1,173	-1,173	-1,173	-1,173	-1,173
-5.33%	-782	-782	-782	-782	-782	-782	-782
-2.67%	-391	-391	-391	-391	-391	-391	-391
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	391	391	391	391	391	391	391
5.33%	782	782	782	782	782	782	782
8.00%	1,173	1,173	1,173	1,173	1,173	1,173	1,173

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

689

공시일	2017-12-13
기준일	2017-12-12

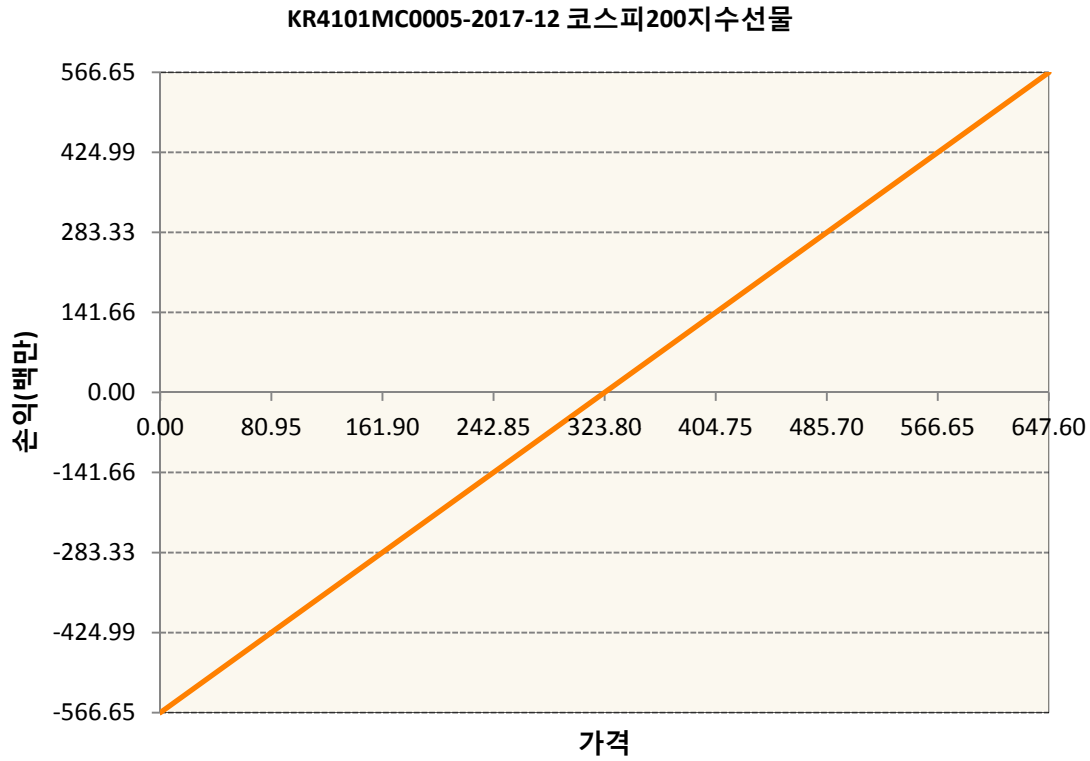
ETF스마트레버리지목표전환형9호

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	567	0	567	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	2017-12-13
기준일	2017-12-12

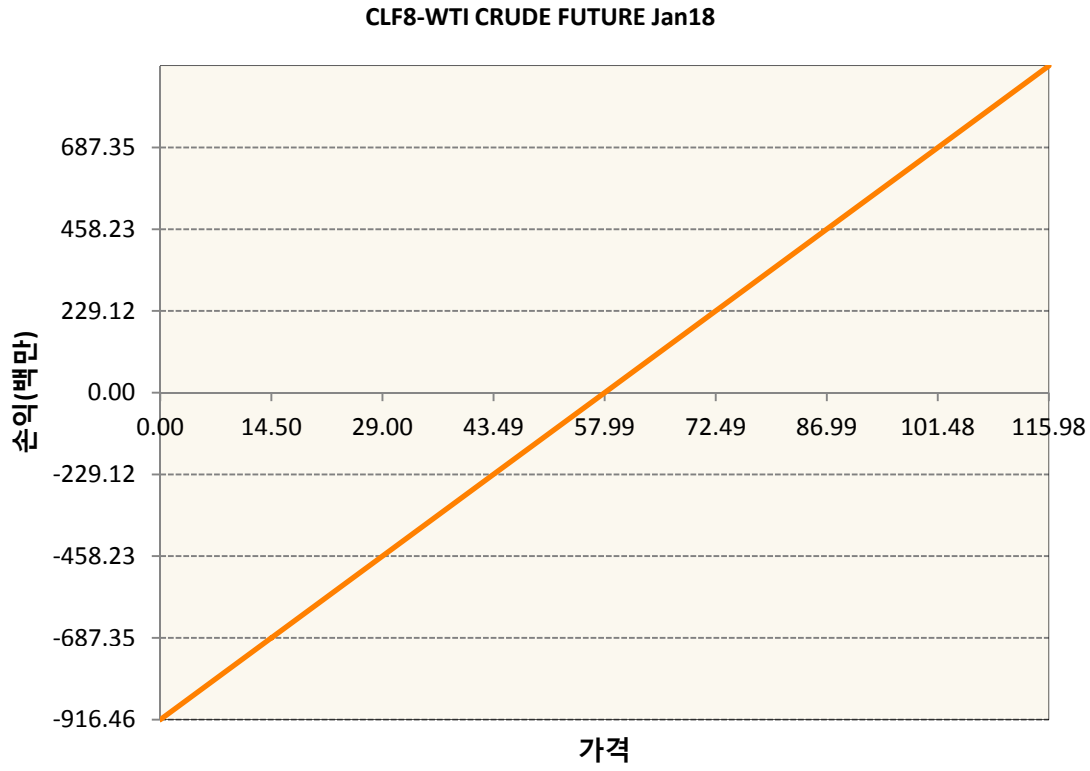
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

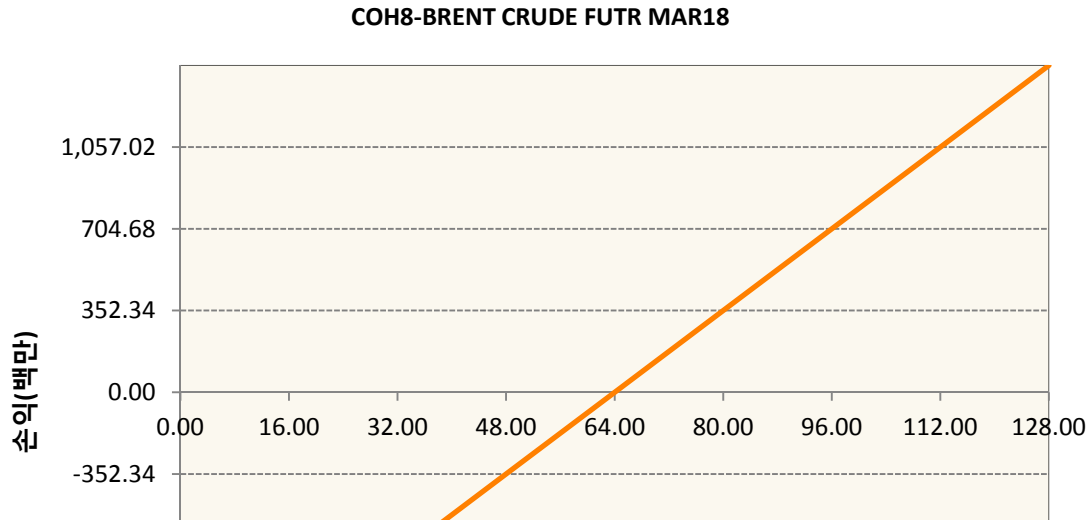
1. 계약금액

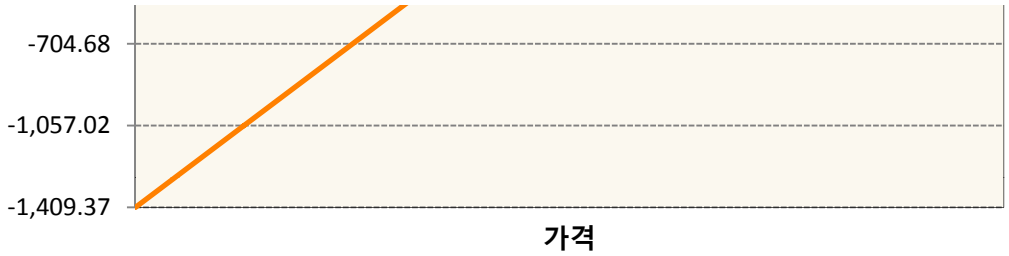
(단위:백만원)

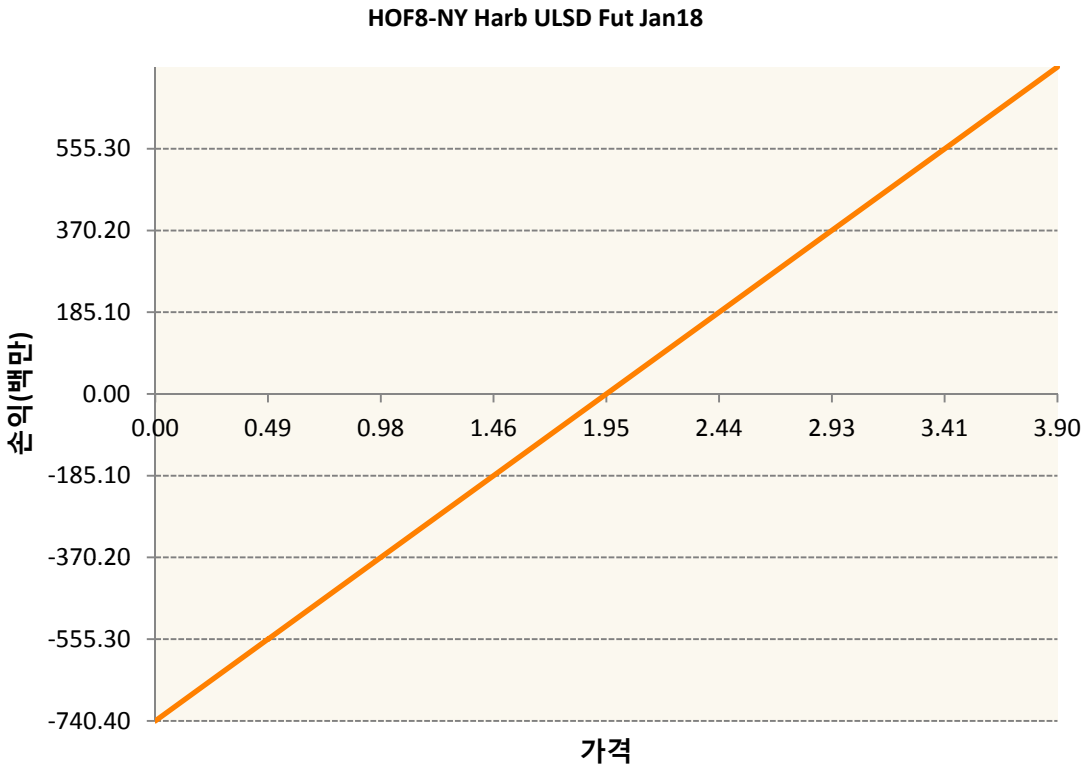
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	4,962	873	4,089	

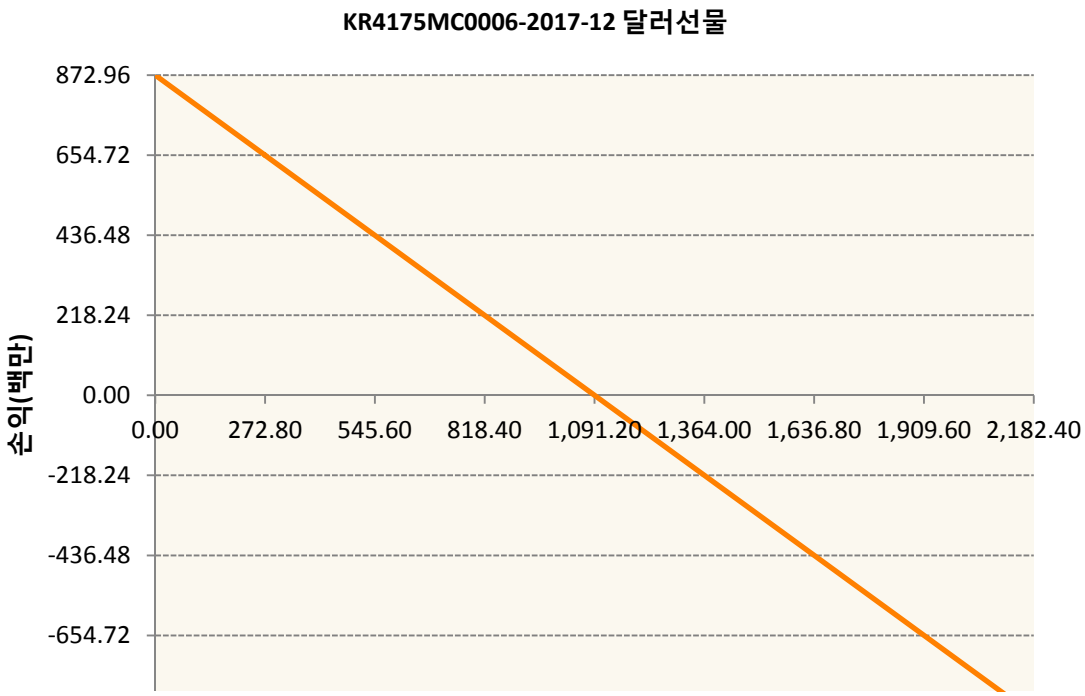
2. 만기시점의 손익구조

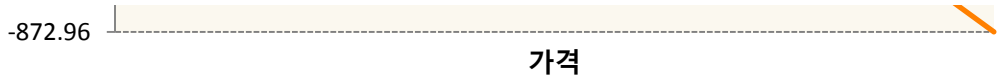


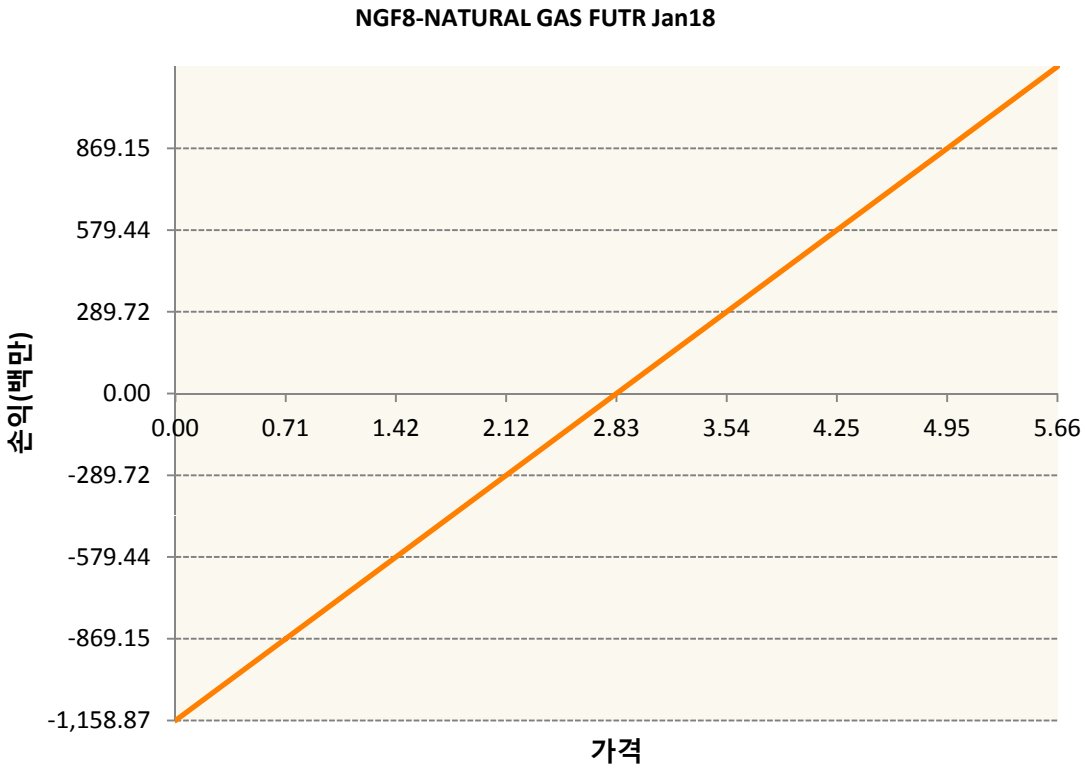


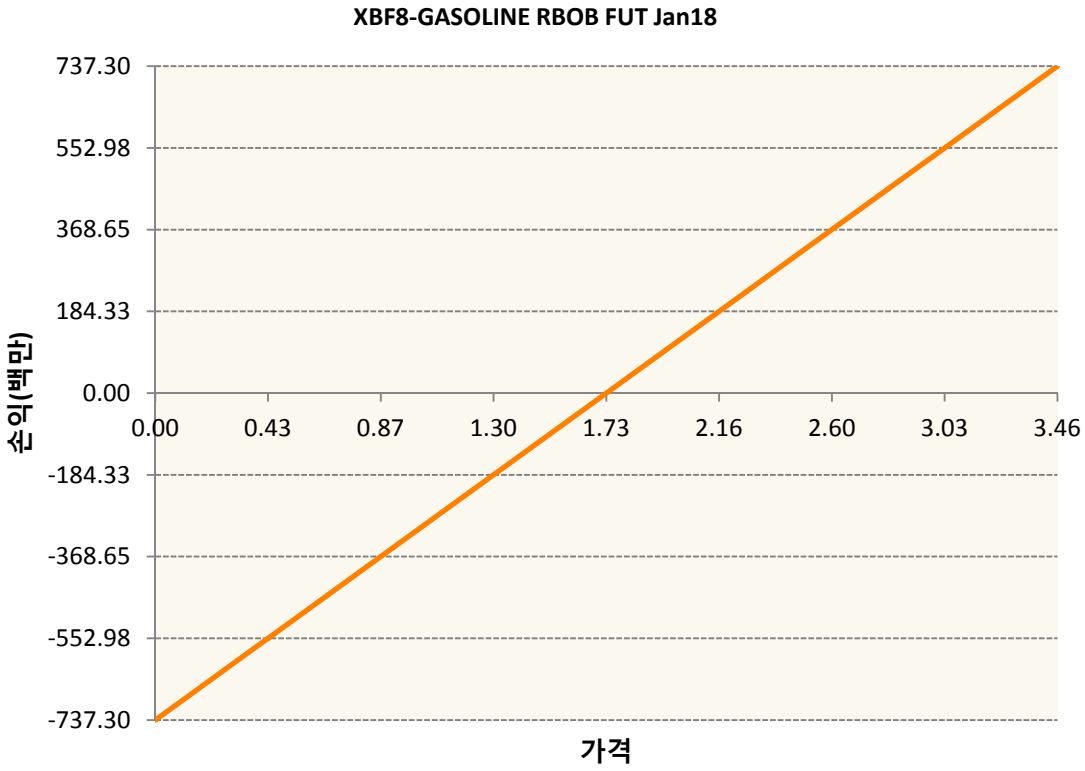

-704.68
-1,057.02
-1,409.37
가격


HOF8-NY Harb ULSD Fut Jan18
555.30
370.20
185.10
0.00
-185.10
-370.20
-555.30
-740.40
0.00
0.49
0.98
1.46
1.95
2.44
2.93
3.41
3.90
손익(만)
가격


KR4175MC0006-2017-12 달러선물
872.96
654.72
436.48
218.24
0.00
-218.24
-436.48
-654.72
0.00
272.80
545.60
818.40
1,091.20
1,364.00
1,636.80
1,909.60
2,182.40
손익(만)


-872.96
가격


NGF8-NATURAL GAS FUTR Jan18
869.15
579.44
289.72
0.00
-289.72
-579.44
-869.15
-1,158.87
0.00
0.71
1.42
2.12
2.83
3.54
4.25
4.95
5.66
손익(백만)
가격


XBF8-GASOLINE RBOB FUT Jan18
737.30
552.98
368.65
184.33
0.00
-184.33
-368.65
-552.98
-737.30
0.00
0.43
0.87
1.30
1.73
2.16
2.60
3.03
3.46
손익(백만)
가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLF8	WTI CRUDE FUTURE Jan18	73
COH8	BRENT CRUDE FUTR MAR18	113
HOF8	NY Harb ULSD Fut Jan18	59
KR4175MC0(	2017-12 달러선물	70
NGF8	NATURAL GAS FUTR Jan18	93
XBF8	GASOLINE RBOB FUT Jan18	59

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

674

공시일	2017-12-13
기준일	2017-12-12

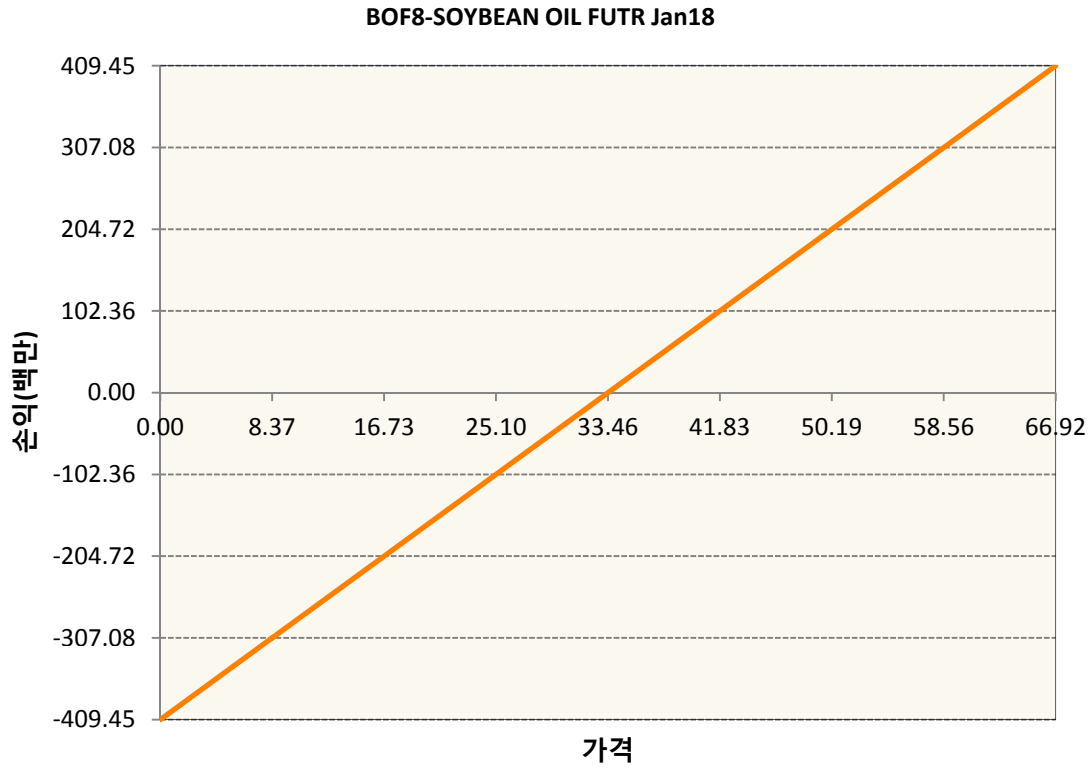
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

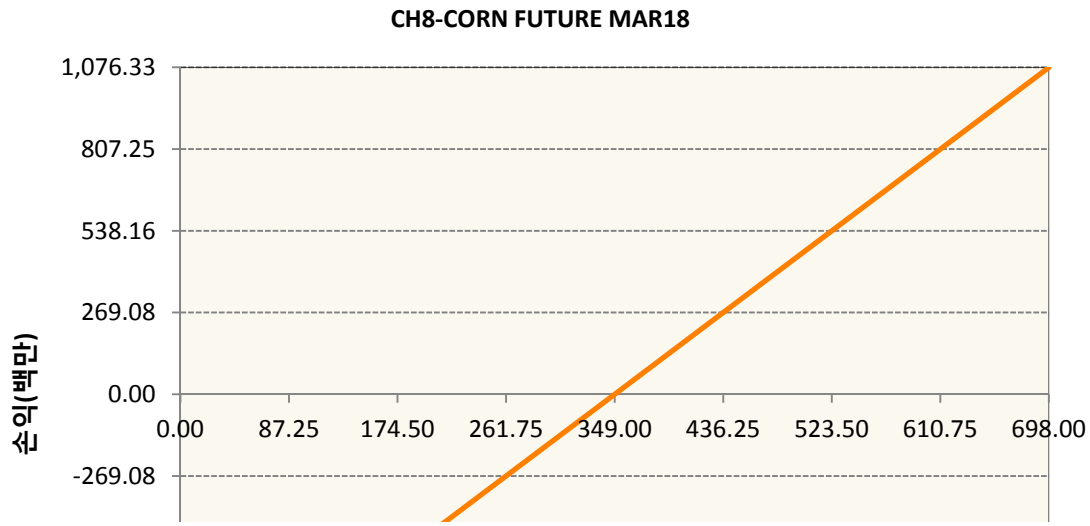
1. 계약금액

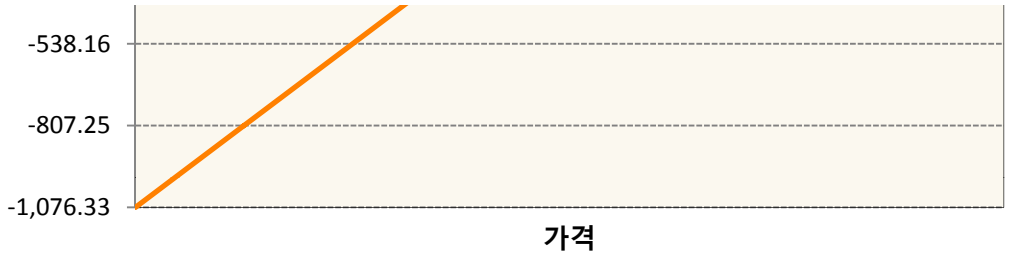
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	4,348	327	4,020	

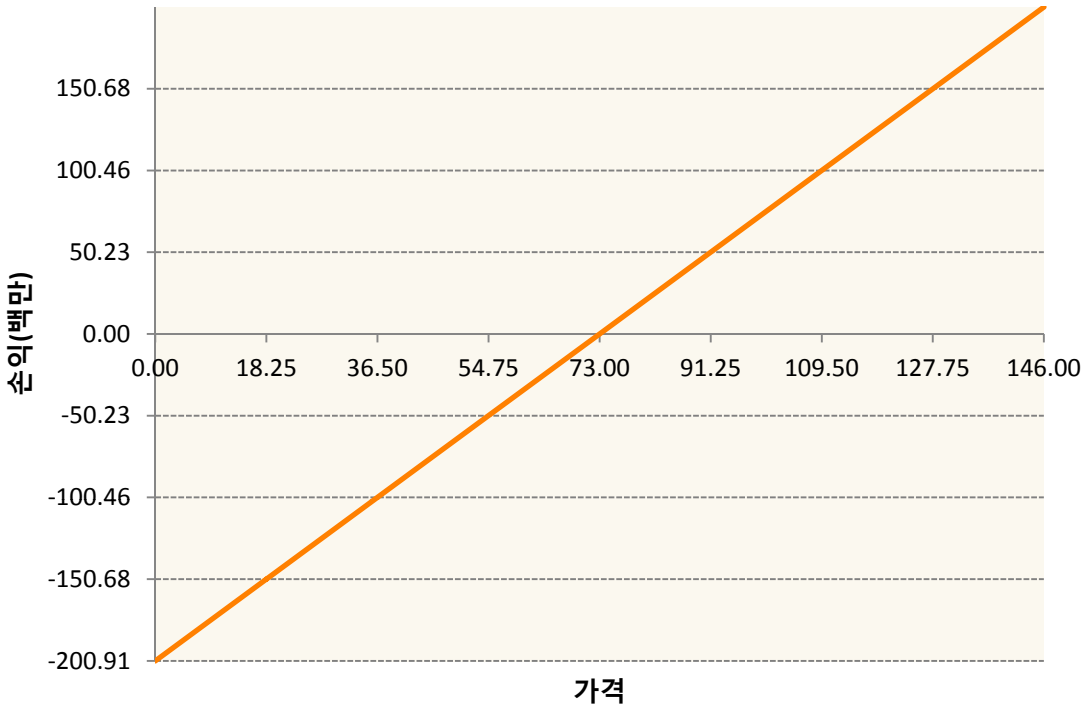
2. 만기시점의 손익구조



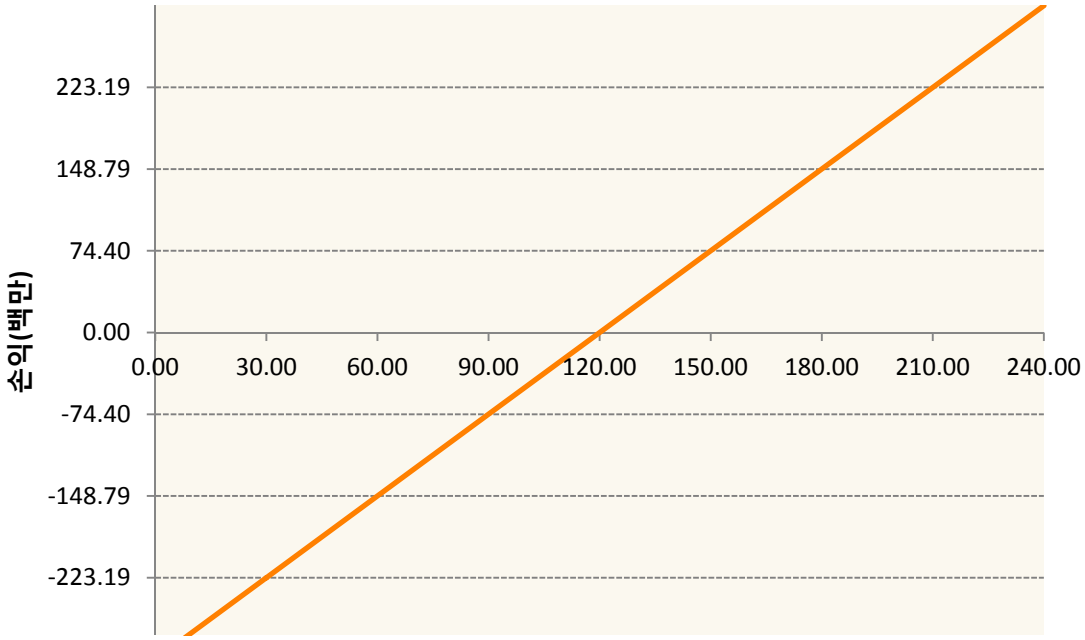


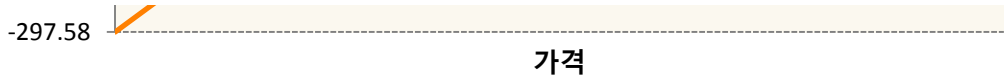


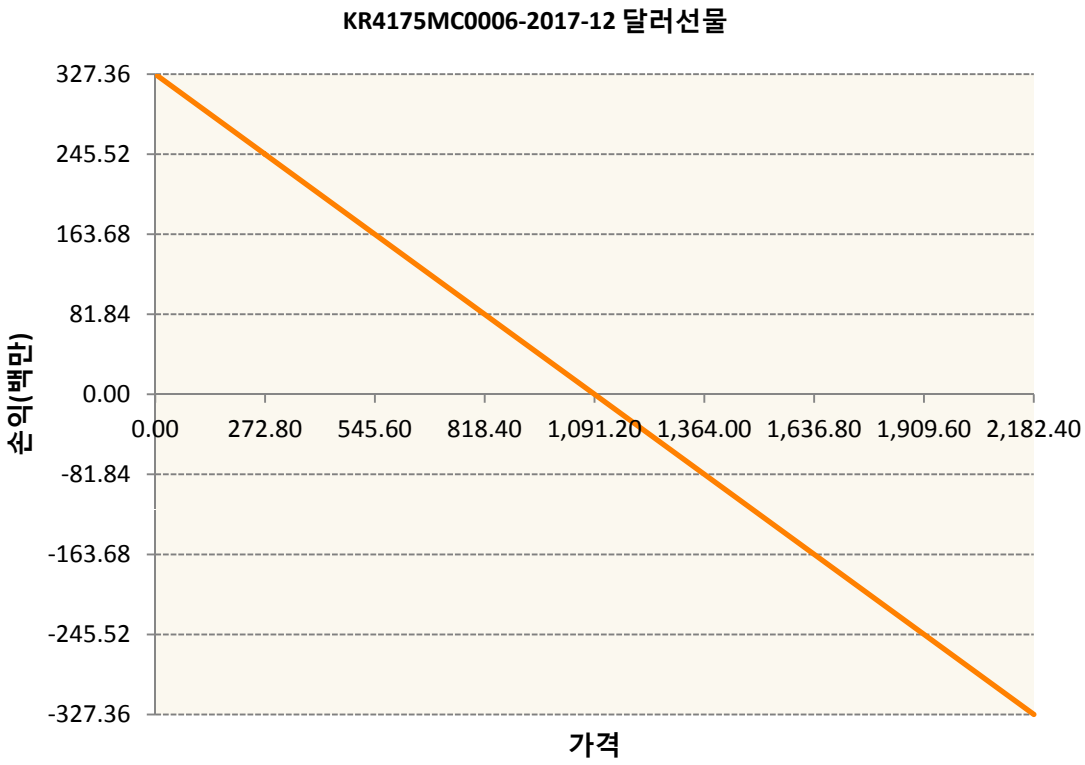
CTH8-COTTON NO.2 FUTR MAR18

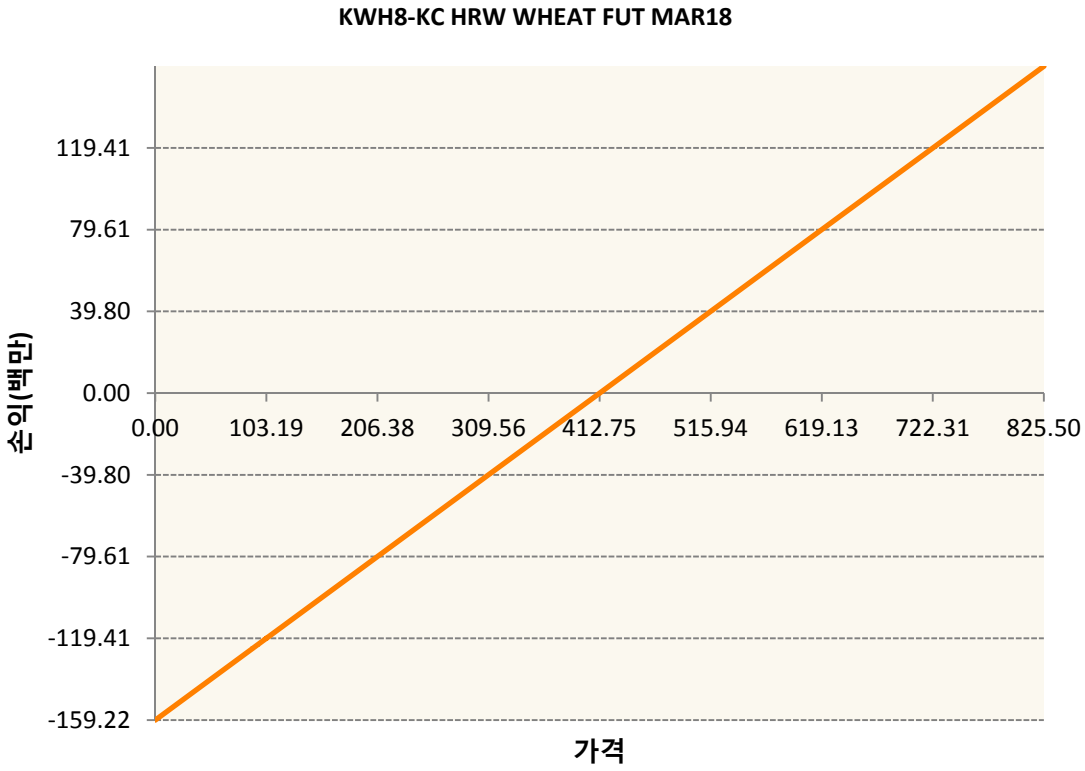


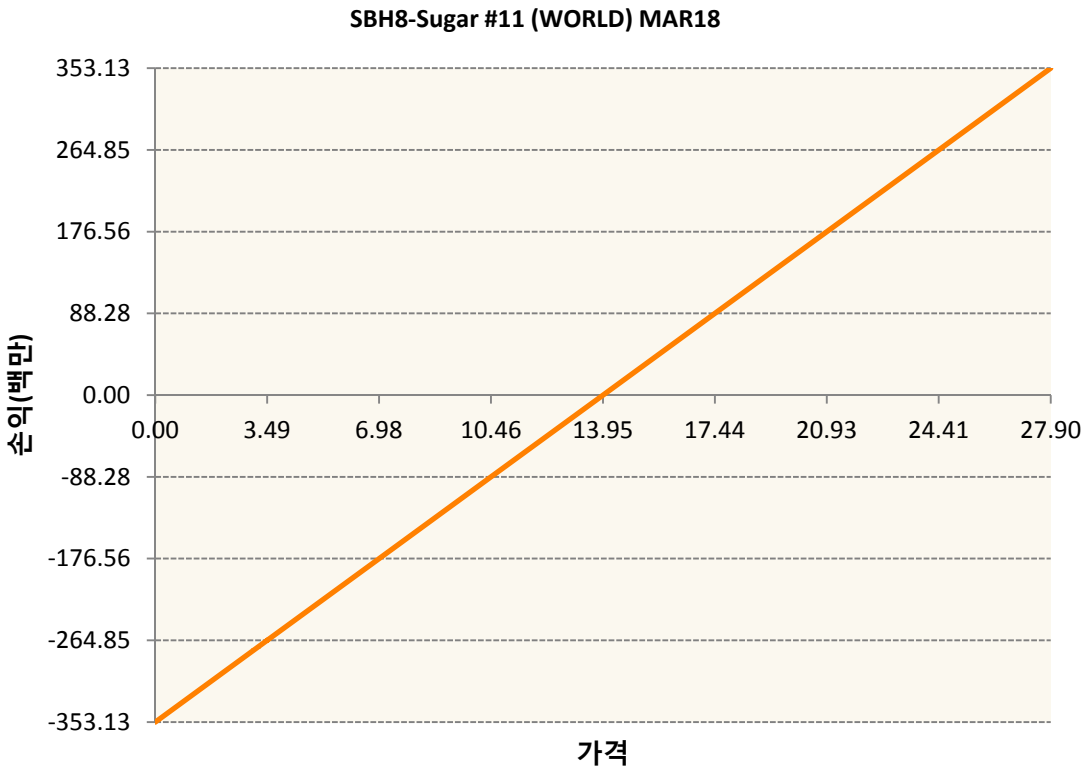
KCH8-COFFEE "C" FUTURE MAR18

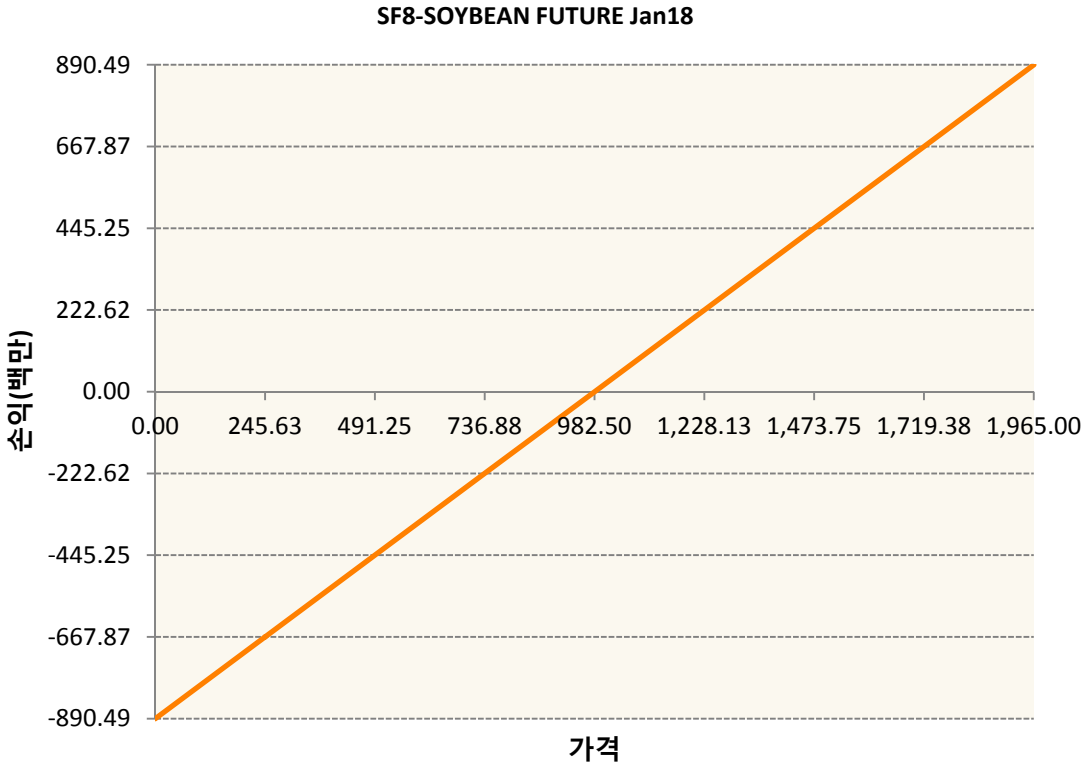



-297.58
가격

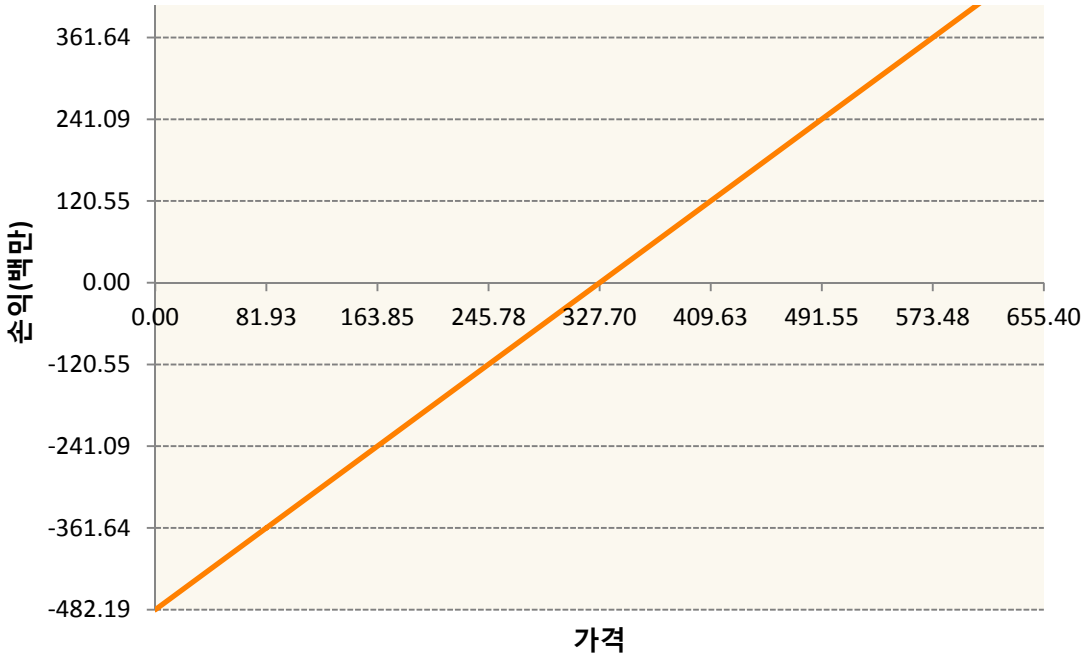

KR4175MC0006-2017-12 달러선물
327.36
245.52
163.68
81.84
0.00
-81.84
-163.68
-245.52
-327.36
0.00
272.80
545.60
818.40
1,091.20
1,364.00
1,636.80
1,909.60
2,182.40
손익(백만)
가격

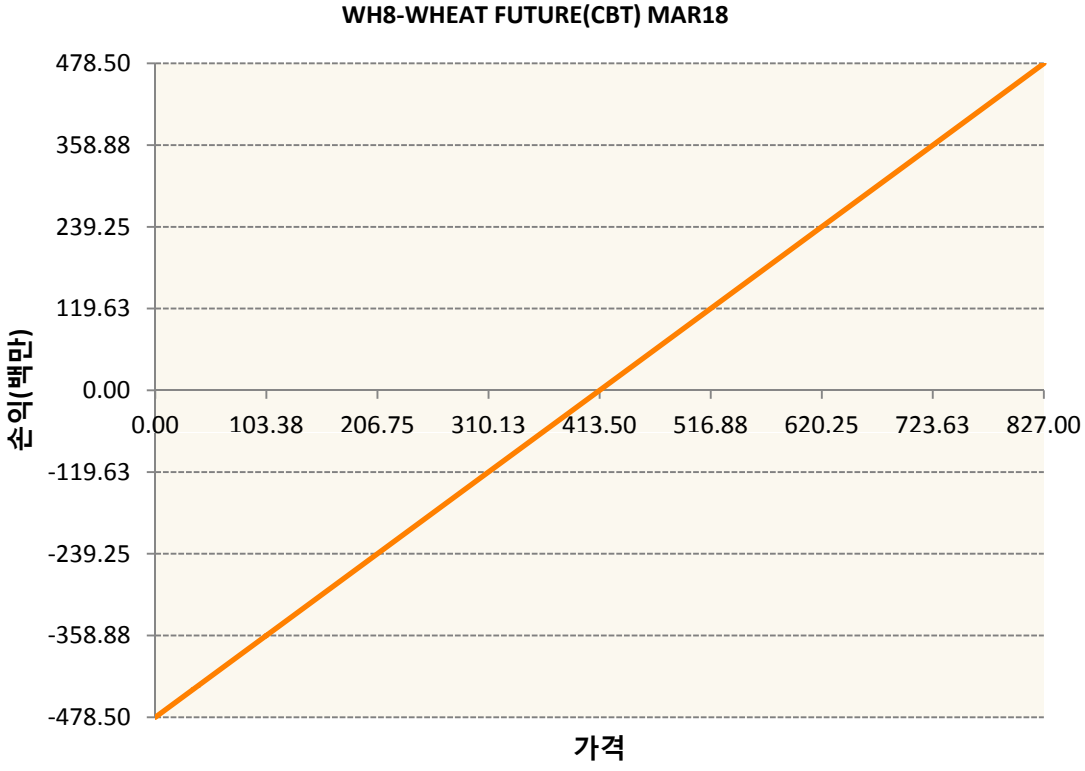

KWH8-KC HRW WHEAT FUT MAR18
119.41
79.61
39.80
0.00
-39.80
-79.61
-119.41
-159.22
0.00
103.19
206.38
309.56
412.75
515.94
619.13
722.31
825.50
손익(백만)
가격


SBH8-Sugar #11 (WORLD) MAR18
353.13
264.85
176.56
88.28
0.00
-88.28
-176.56
-264.85
-353.13
0.00
3.49
6.98
10.46
13.95
17.44
20.93
24.41
27.90
손익(백만)
가격


SF8-SOYBEAN FUTURE Jan18
890.49
667.87
445.25
222.62
0.00
-222.62
-445.25
-667.87
-890.49
0.00
245.63
491.25
736.88
982.50
1,228.13
1,473.75
1,719.38
1,965.00
손익(백만)
가격


SMF8-SOYBEAN MEAL FUTR Jan18
482.19





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

BOF8	SOYBEAN OIL FUTR Jan18	33
CH8	CORN FUTURE MAR18	86
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	71
SMF8	SOYBEAN MEAL FUTR Jan18	39
WH8	WHEAT FUTURE(CBT) MAR18	38

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

369