공시일	2017-12-20
기준일	2017-12-19

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	2017-12-20
기준일	2017-12-19

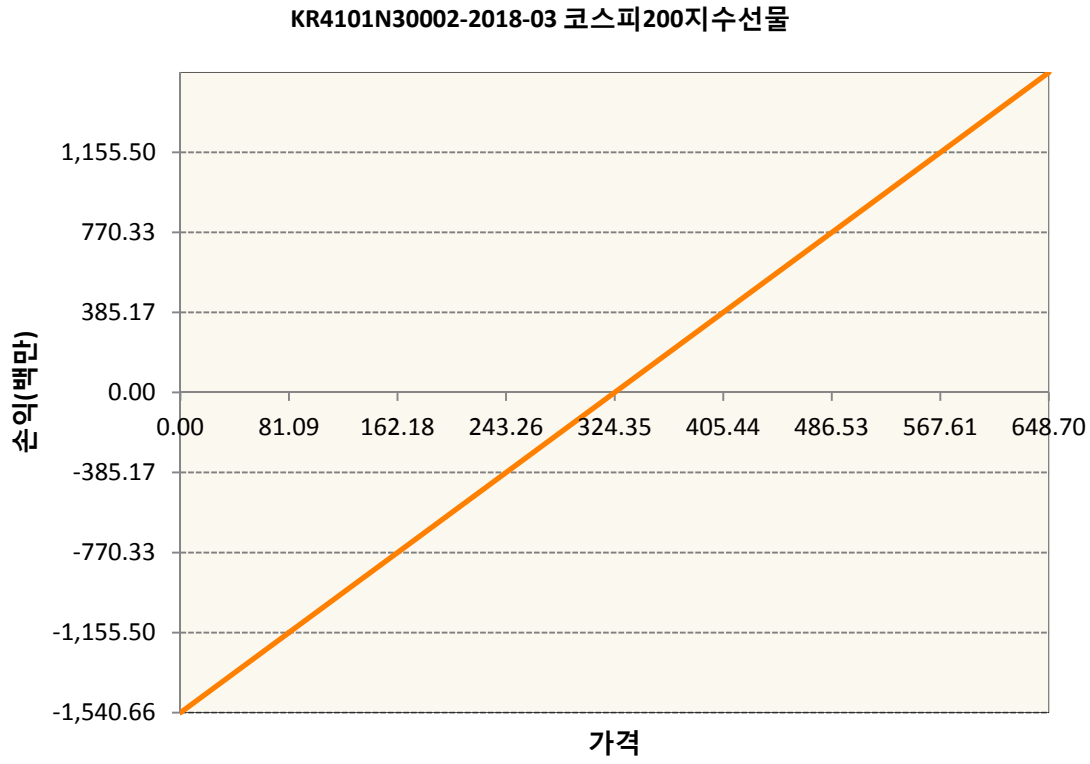
스마트인덱스모

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	1,541	0	1,541	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101N30(2018-03 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%	-83	-83	-83	-83	-83	-83	-83
-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%	83	83	83	83	83	83	83
8.00%	124	124	124	124	124	124	124

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

71

공시일	2017-12-20
기준일	2017-12-19

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	1,100

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

352

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-12-20
기준일	2017-12-19

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	400

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

359

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-12-20
기준일	2017-12-19

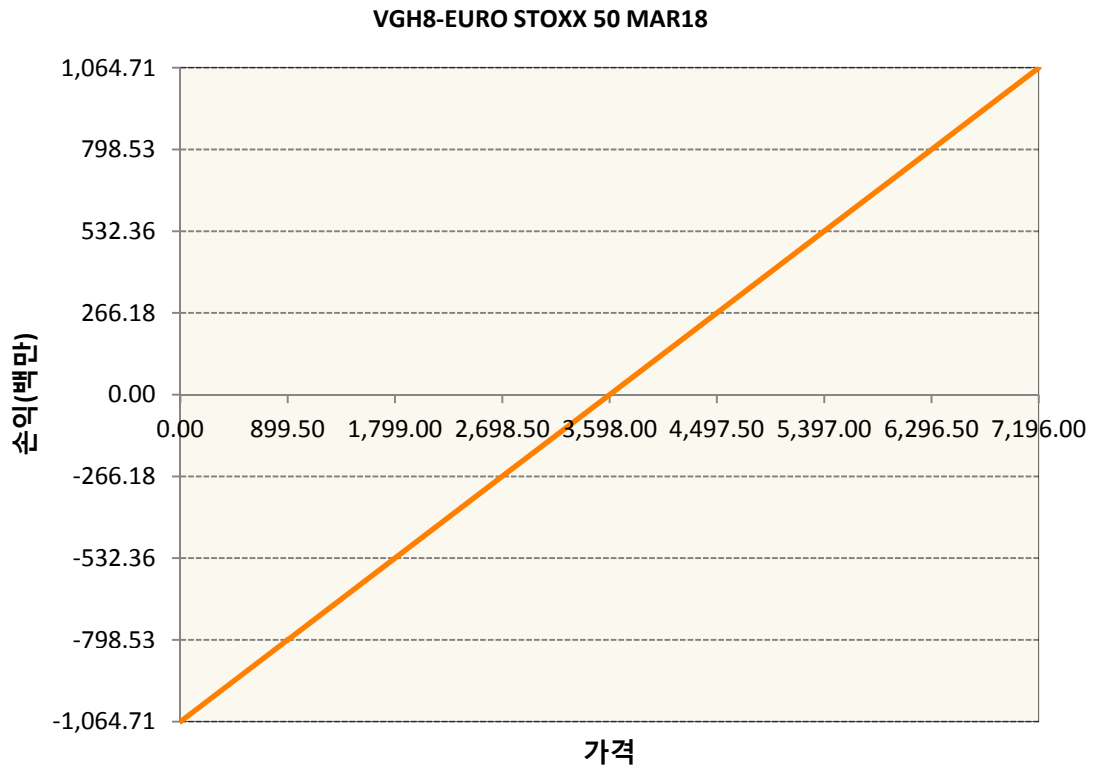
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

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

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGH8	EURO STOXX 50 MAR18	85

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

(단위:백만원)

49

공시일	2017-12-20
기준일	2017-12-19

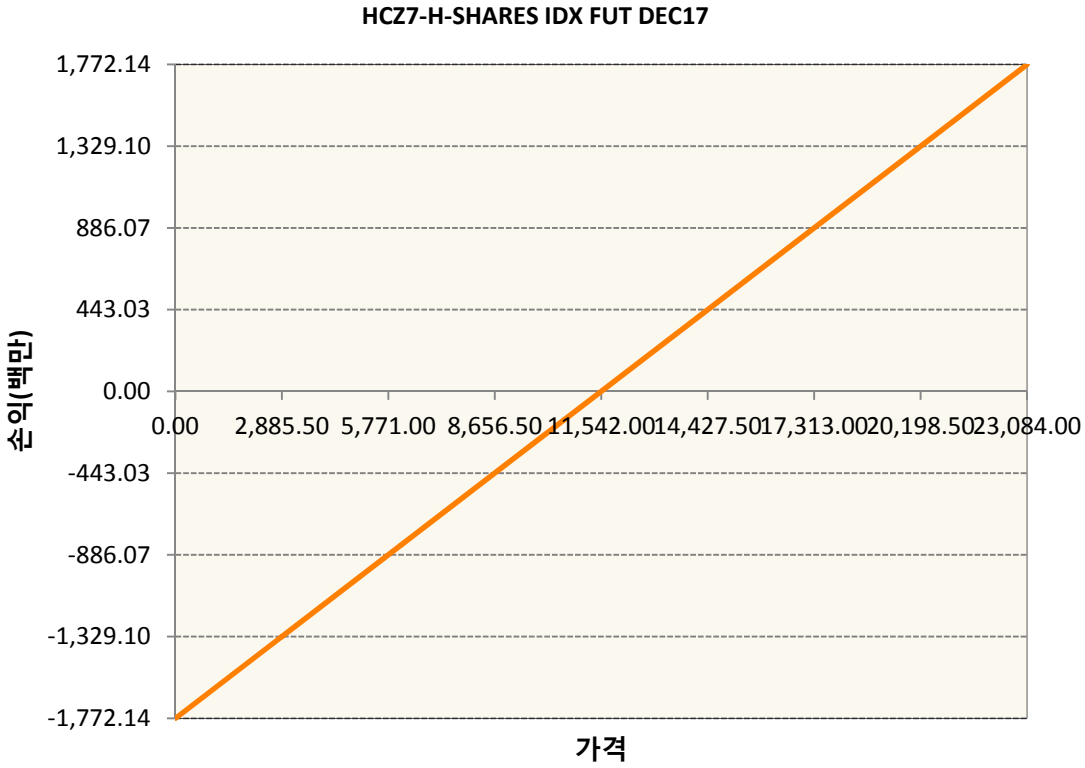
차이나인덱스모(주식-파생형)

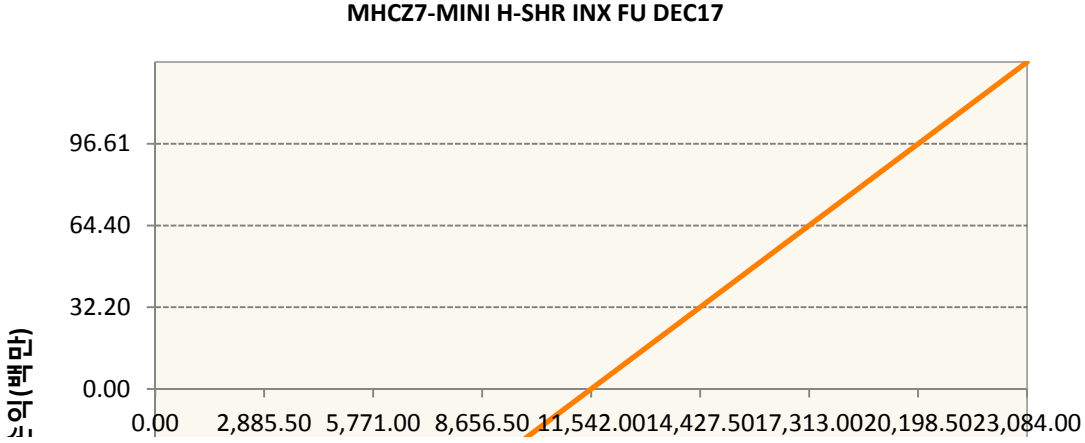
1. 계약금액

(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	1,772	0	1,772	
누계	유가증권	선물	129	0	129	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCZ7	H-SHARES IDX FUT DEC17	142
MHCZ7	MINI H-SHR INX FU DEC17	10

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	98

공시일	2017-12-20
기준일	2017-12-19

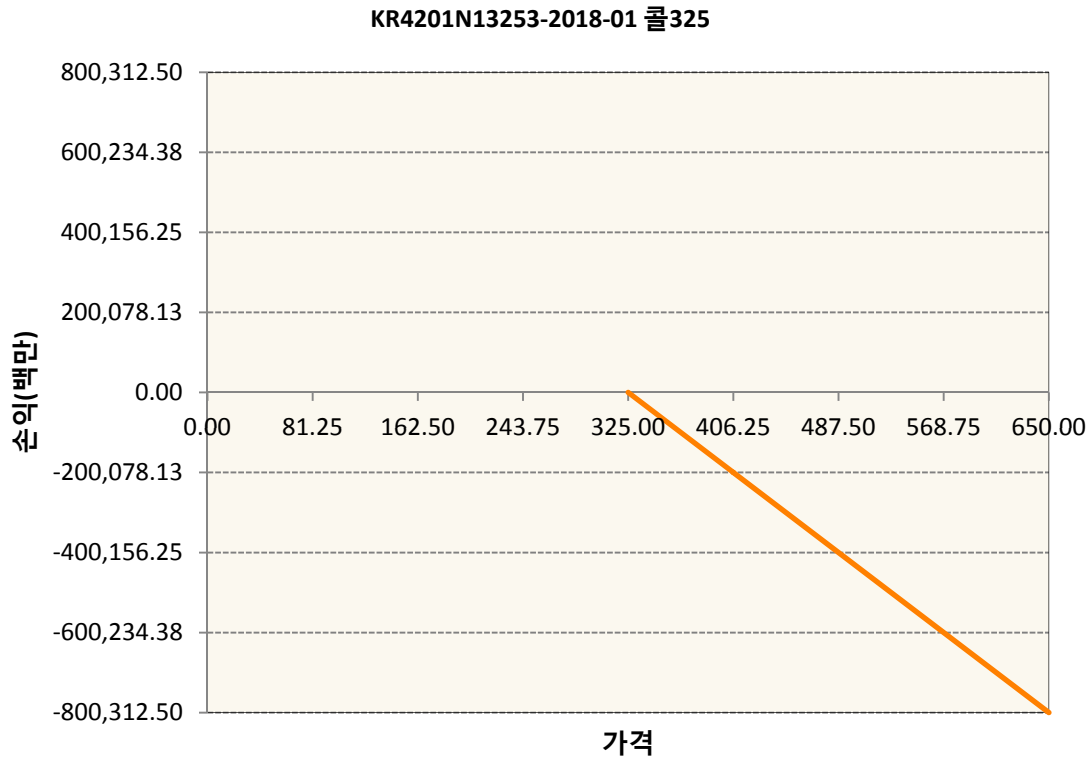
커버드콜모(주식혼합-파생형)

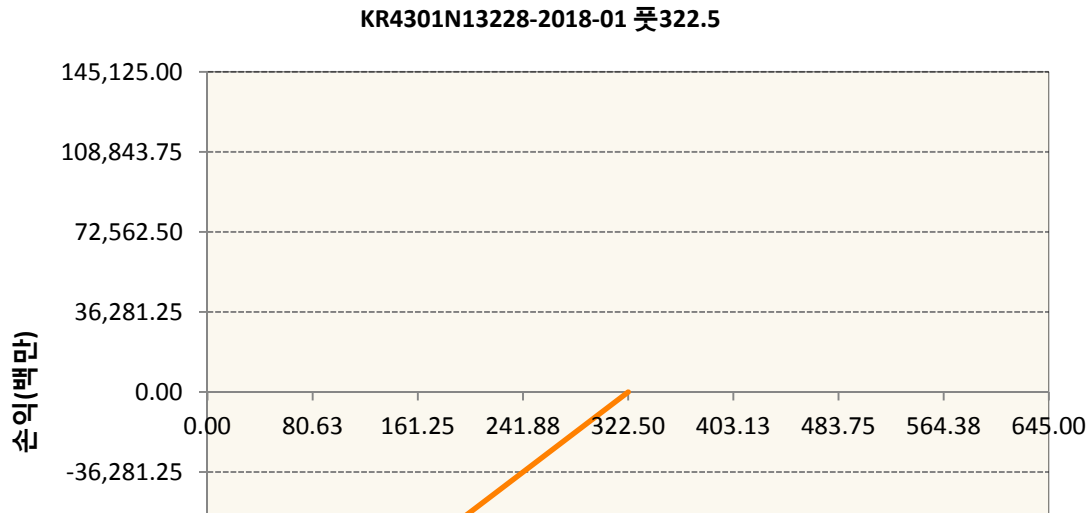
1. 계약금액

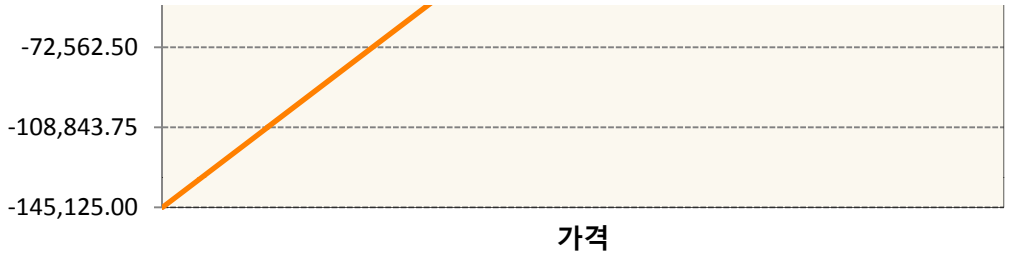
(단위:백만원)

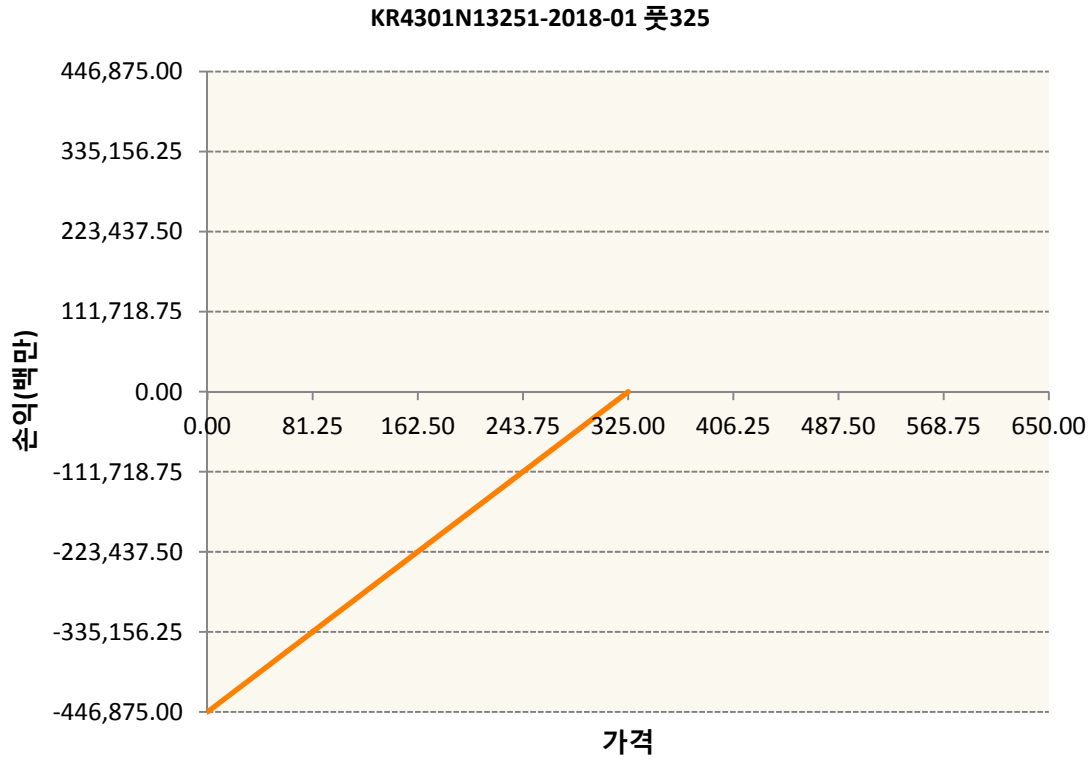
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	1,392,313	-1,392,313	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201N132 2018-01 콜325							51,432
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	21,448	21,000	20,436	19,767	19,004	18,158	17,238
-5.33%	19,451	18,482	17,421	16,285	15,087	13,838	12,547
-2.67%	14,423	12,945	11,441	9,918	8,380	6,830	5,270
0%	4,915	3,278	1,640	0	-1,641	-3,282	-4,925
2.67%	-9,335	-10,682	-12,083	-13,525	-15,000	-16,501	-18,024
5.33%	-27,259	-28,104	-29,061	-30,114	-31,246	-32,445	-33,700
8.00%	-47,316	-47,728	-48,261	-48,908	-49,659	-50,504	-51,432
KR4301N132 2018-01 풋322.5							8,964
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-8,914	-8,915	-8,918	-8,923	-8,933	-8,946	-8,964

-5.33%	-5,029	-5,055	-5,091	-5,136	-5,189	-5,249	-5,317
-2.67%	-1,581	-1,697	-1,816	-1,939	-2,064	-2,191	-2,319
0%	365	246	125	0	-127	-256	-386
2.67%	840	808	767	716	657	589	515
5.33%	881	878	873	864	851	831	806
8.00%	882	882	882	881	879	876	871
KR4301N132	2018-01 풋325						29,463

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-29,376	-29,378	-29,381	-29,390	-29,404	-29,428	-29,463
-5.33%	-17,443	-17,485	-17,549	-17,636	-17,747	-17,880	-18,036
-2.67%	-6,257	-6,531	-6,828	-7,144	-7,474	-7,816	-8,168
0%	1,257	840	421	0	-422	-846	-1,270
2.67%	3,683	3,520	3,324	3,101	2,853	2,585	2,299
5.33%	3,975	3,956	3,923	3,873	3,802	3,710	3,597
8.00%	3,987	3,986	3,984	3,979	3,968	3,951	3,923

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

94,204

공시일	2017-12-20
기준일	2017-12-19

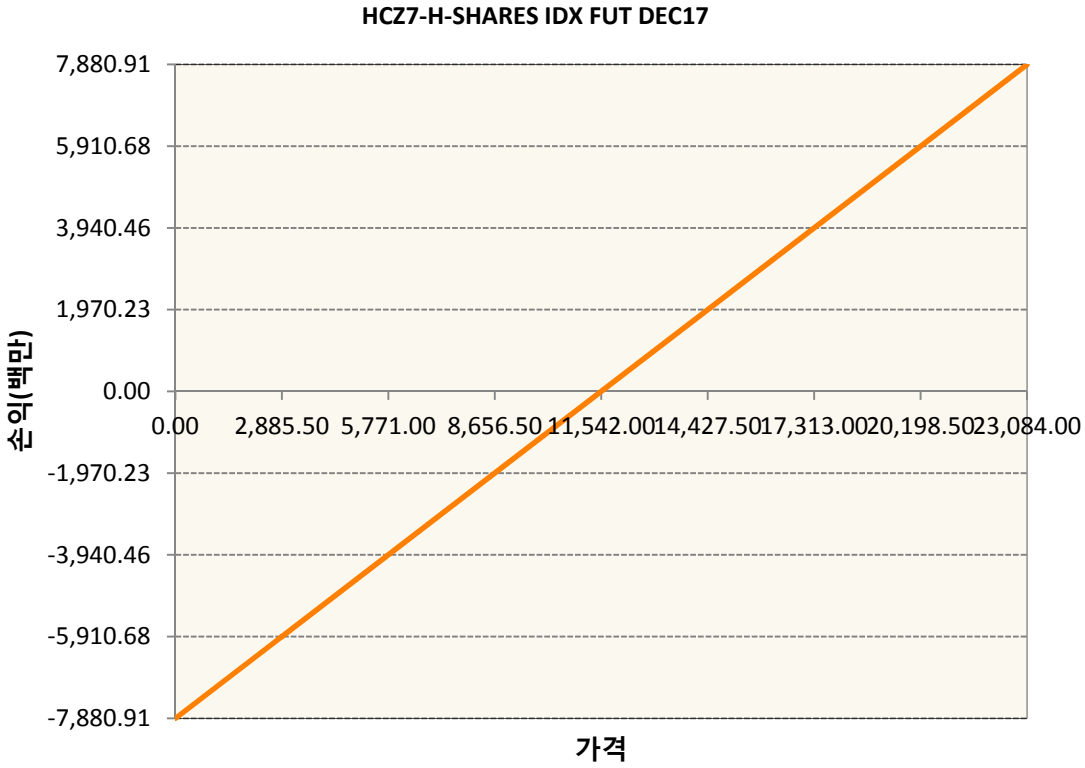
홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생

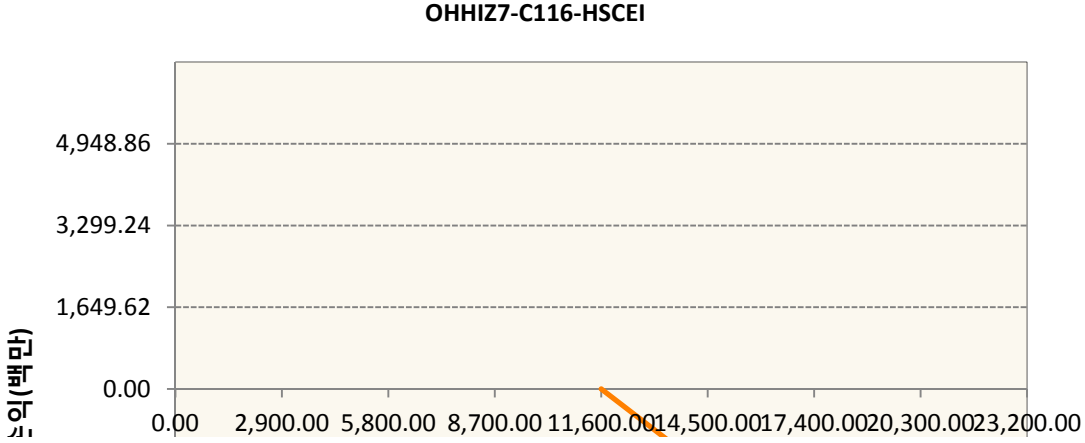
1. 계약금액

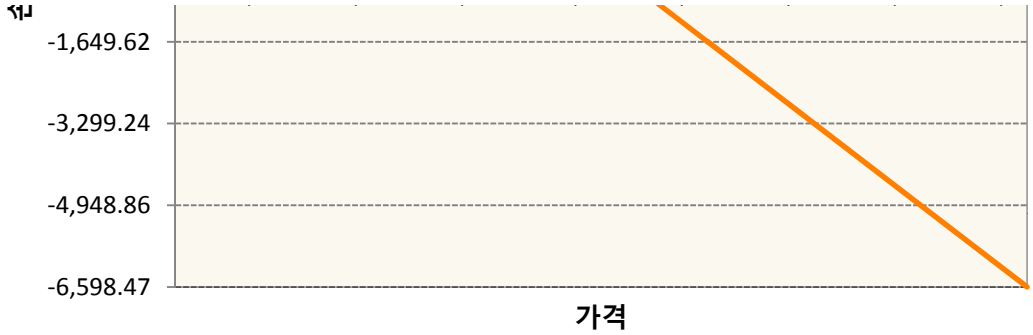
(단위:백만원)

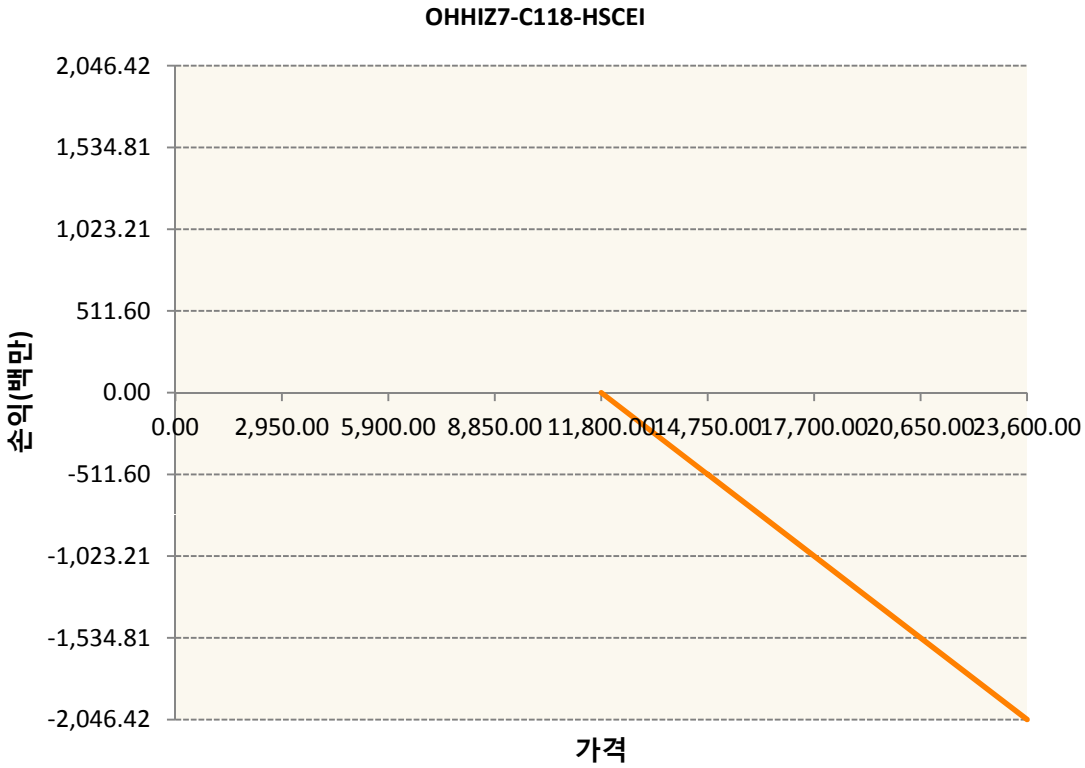
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	7,881	0	7,881	
누계	유가증권	옵션	0	17,290	-17,290	장내

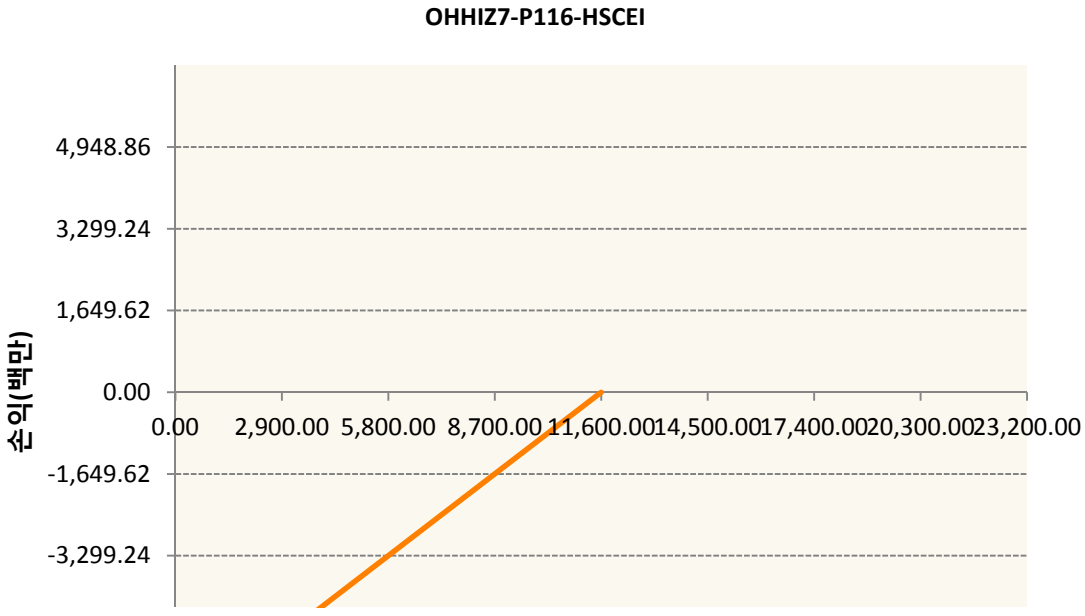
2. 만기시점의 손익구조

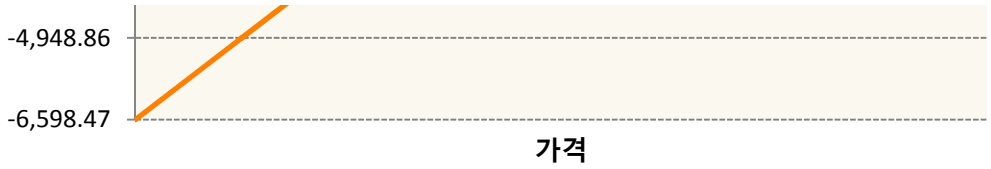


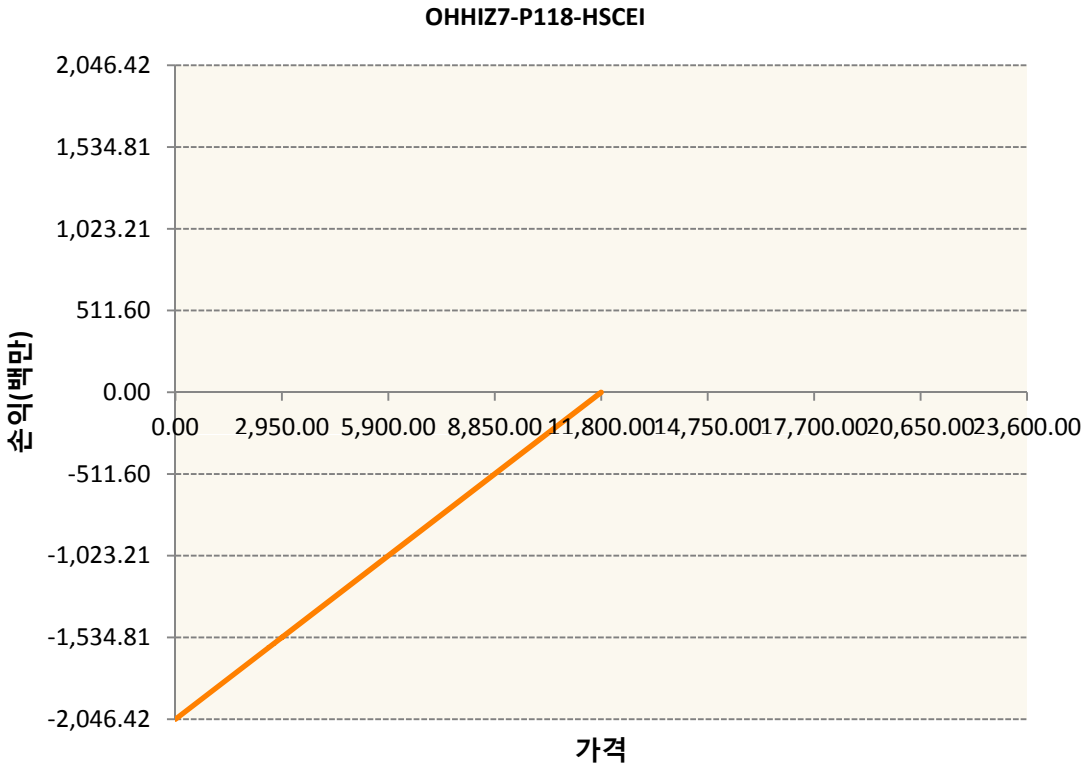



-1,649.62
-3,299.24
-4,948.86
-6,598.47
가격


OHHIZ7-C118-HSCEI
2,046.42
1,534.81
1,023.21
511.60
0.00
-511.60
-1,023.21
-1,534.81
-2,046.42
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
4,948.86
3,299.24
1,649.62
0.00
-1,649.62
-3,299.24
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	630
OHHIZ7-C11	HSCEI	528
OHHIZ7-C11	HSCEI	164
OHHIZ7-P11	HSCEI	528
OHHIZ7-P11	HSCEI	164

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,493

공시일	2017-12-20
기준일	2017-12-19

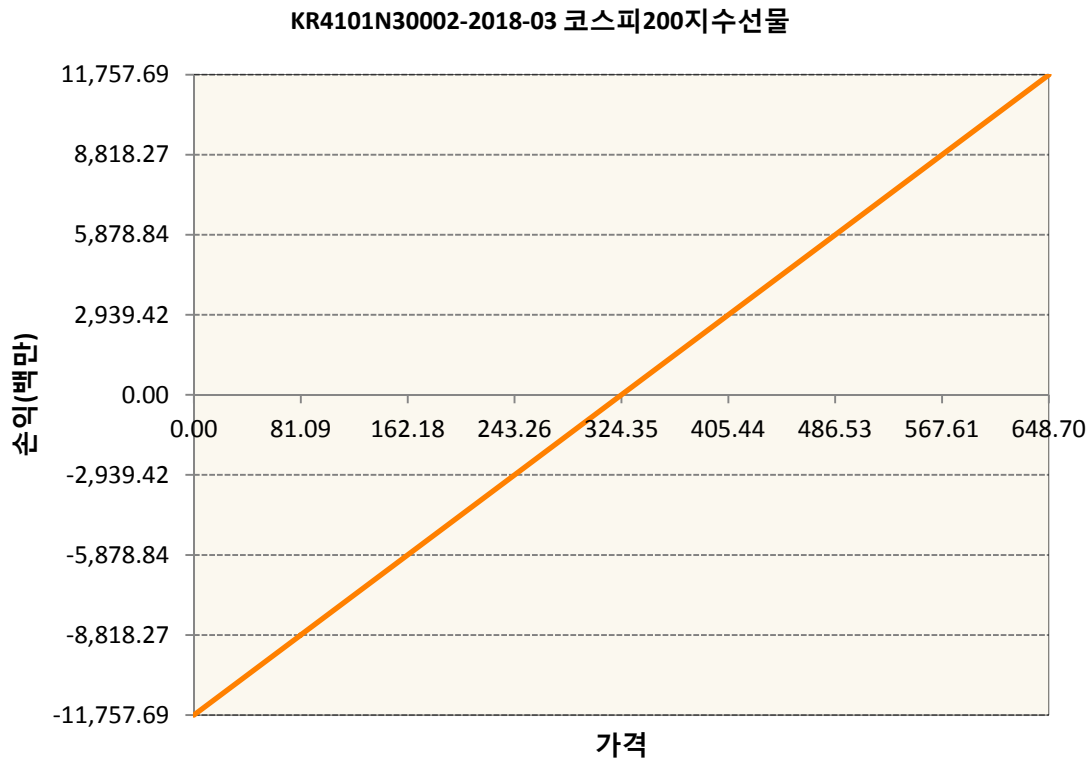
코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼

1. 계약금액

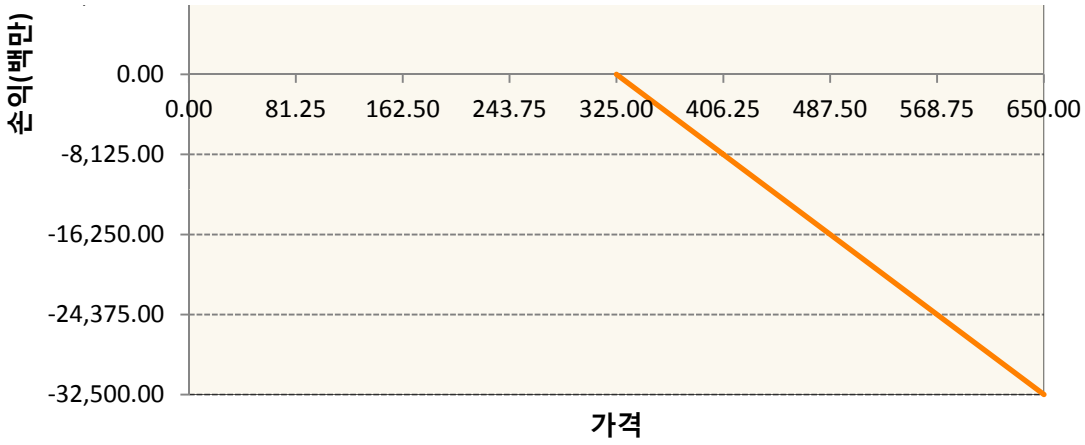
(단위:백만원)

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	11,758	0	11,758	장내
누계	유가증권	스왑	60,200	0	60,200	장외
누계	유가증권	옵션	0	60,875	-60,875	장내

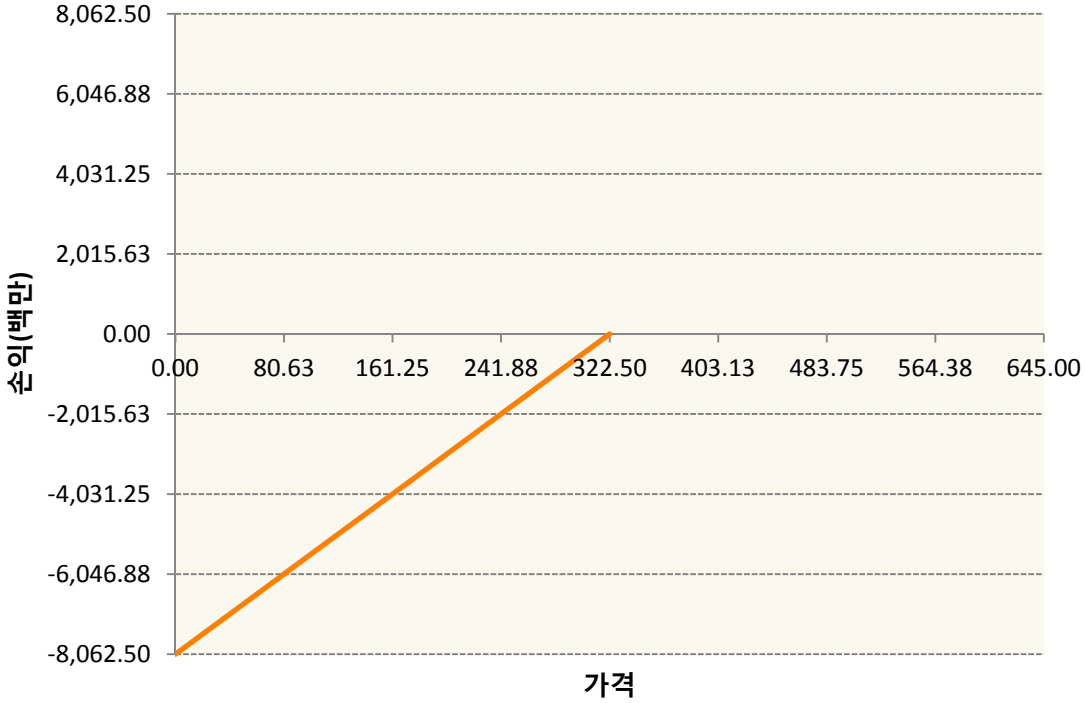
2. 만기시점의 손익구조



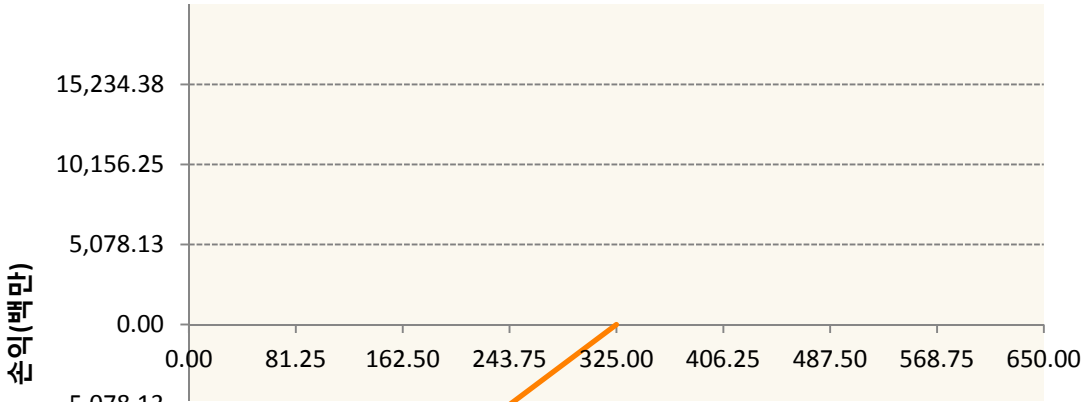




KR4301N13228-2018-01 풋322.5



KR4301N13251-2018-01 풋325





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_2							1,465
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,465	-1,465	-1,465	-1,465	-1,465	-1,465	-1,465
-5.33%	-977	-977	-977	-977	-977	-977	-977
-2.67%	-488	-488	-488	-488	-488	-488	-488
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	488	488	488	488	488	488	488
5.33%	977	977	977	977	977	977	977
8.00%	1,465	1,465	1,465	1,465	1,465	1,465	1,465
2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_3							277
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-277	-277	-277	-277	-277	-277	-277
-5.33%	-185	-185	-185	-185	-185	-185	-185
-2.67%	-92	-92	-92	-92	-92	-92	-92
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	92	92	92	92	92	92	92
5.33%	185	185	185	185	185	185	185
8.00%	277	277	277	277	277	277	277
2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_4							158
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-158	-158	-158	-158	-158	-158	-158
-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%	158	158	158	158	158	158	158
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%	-158	-158	-158	-158	-158	-158	-158
-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%	158	158	158	158	158	158	158
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						253
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-253	-253	-253	-253	-253	-253	-253
-5.33%	-169	-169	-169	-169	-169	-169	-169
-2.67%	-84	-84	-84	-84	-84	-84	-84
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	84	84	84	84	84	84	84
5.33%	169	169	169	169	169	169	169
8.00%	253	253	253	253	253	253	253
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_8						469
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-469	-469	-469	-469	-469	-469	-469
-5.33%	-312	-312	-312	-312	-312	-312	-312
-2.67%	-156	-156	-156	-156	-156	-156	-156
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	156	156	156	156	156	156	156
5.33%	312	312	312	312	312	312	312
8.00%	469	469	469	469	469	469	469
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_9						312
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-312	-312	-312	-312	-312	-312	-312
-5.33%	-208	-208	-208	-208	-208	-208	-208
-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%	208	208	208	208	208	208	208
8.00%	312	312	312	312	312	312	312
	2.529E+11	UBCSFXC1 INDEX_10					277
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-277	-277	-277	-277	-277	-277	-277
-5.33%	-185	-185	-185	-185	-185	-185	-185
-2.67%	-92	-92	-92	-92	-92	-92	-92
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	92	92	92	92	92	92	92
5.33%	185	185	185	185	185	185	185
8.00%	277	277	277	277	277	277	277
	2.529E+11	UBCSFXC1 INDEX_11					633
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-633	-633	-633	-633	-633	-633	-633
-5.33%	-422	-422	-422	-422	-422	-422	-422
-2.67%	-211	-211	-211	-211	-211	-211	-211
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	211	211	211	211	211	211	211
5.33%	422	422	422	422	422	422	422
8.00%	633	633	633	633	633	633	633
	2.529E+11	UBCSFXC1 INDEX_12					475
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-475	-475	-475	-475	-475	-475	-475
-5.33%	-317	-317	-317	-317	-317	-317	-317
-2.67%	-158	-158	-158	-158	-158	-158	-158
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	158	158	158	158	158	158	158
5.33%	317	317	317	317	317	317	317
8.00%	475	475	475	475	475	475	475
	KR4101N30(	2018-03	코스피200지수선물				948
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-948	-948	-948	-948	-948	-948	-948
-5.33%	-632	-632	-632	-632	-632	-632	-632
-2.67%	-316	-316	-316	-316	-316	-316	-316
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	316	316	316	316	316	316	316
5.33%	632	632	632	632	632	632	632
8.00%	948	948	948	948	948	948	948
	KR4201N13:	2018-01	콜325				2,089

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	871	853	830	803	772	737	700
-5.33%	790	751	707	661	613	562	510
-2.67%	586	526	465	403	340	277	214
0%	200	133	67	0	-67	-133	-200
2.67%	-379	-434	-491	-549	-609	-670	-732
5.33%	-1,107	-1,141	-1,180	-1,223	-1,269	-1,318	-1,369
8.00%	-1,921	-1,938	-1,960	-1,986	-2,017	-2,051	-2,089
	KR4301N132 2018-01 풋322.5						498

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-495	-495	-495	-496	-496	-497	-498
-5.33%	-279	-281	-283	-285	-288	-292	-295
-2.67%	-88	-94	-101	-108	-115	-122	-129
0%	20	14	7	0	-7	-14	-21
2.67%	47	45	43	40	36	33	29
5.33%	49	49	49	48	47	46	45
8.00%	49	49	49	49	49	49	48
	KR4301N132 2018-01 풋325						1,339

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,335	-1,335	-1,336	-1,336	-1,337	-1,338	-1,339
-5.33%	-793	-795	-798	-802	-807	-813	-820
-2.67%	-284	-297	-310	-325	-340	-355	-371
0%	57	38	19	0	-19	-38	-58
2.67%	167	160	151	141	130	117	104
5.33%	181	180	178	176	173	169	164
8.00%	181	181	181	181	180	180	178

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

9,433

공시일	2017-12-20
기준일	2017-12-19

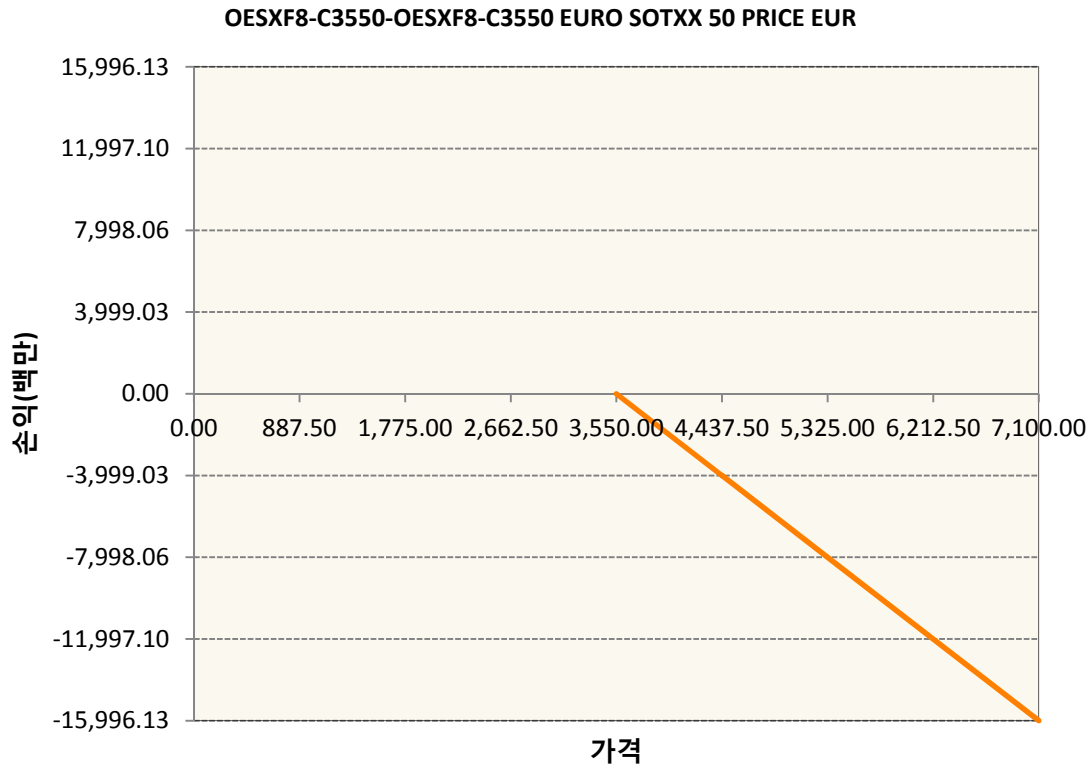
유로커버드콜모(주식혼합-파생형

1. 계약금액

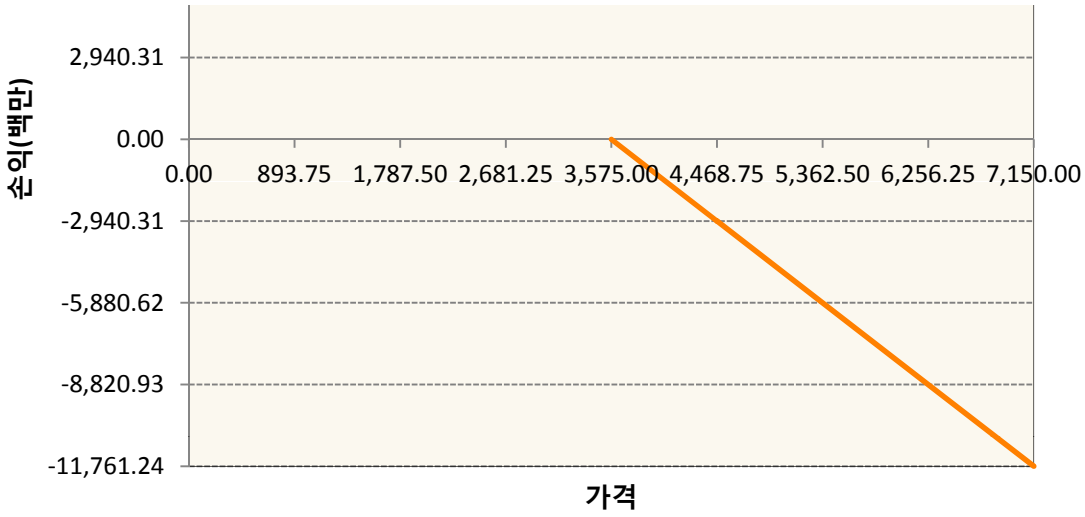
(단위:백만원)

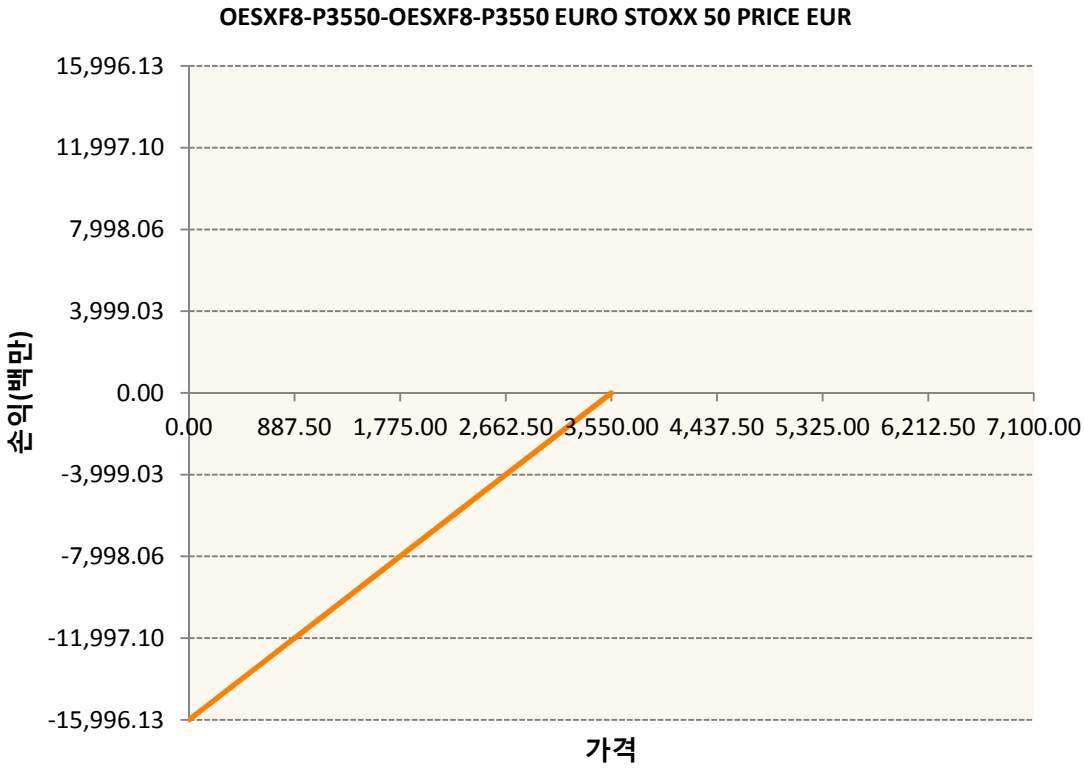
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	19,725	0	19,725	
누계	유가증권	스왑	96,006	0	96,006	장외
누계	유가증권	옵션	0	55,515	-55,515	장내
누계	지수	스왑	51,204	0	51,204	장외

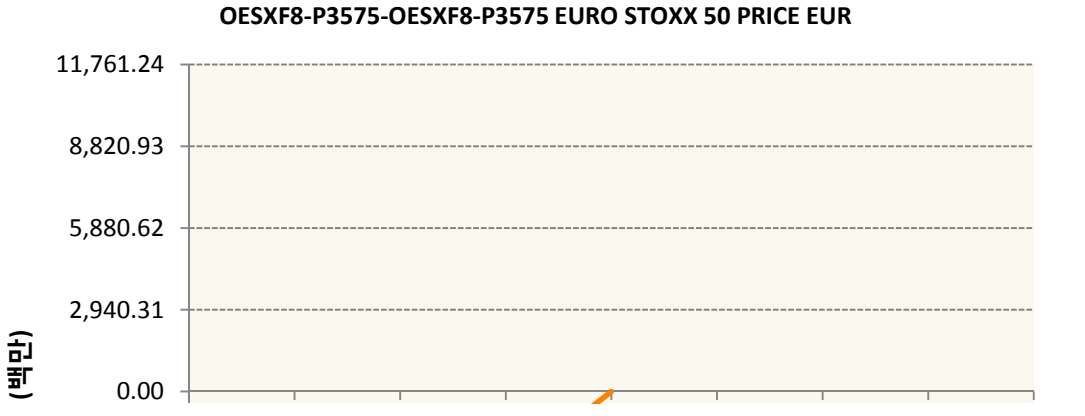
2. 만기시점의 손익구조

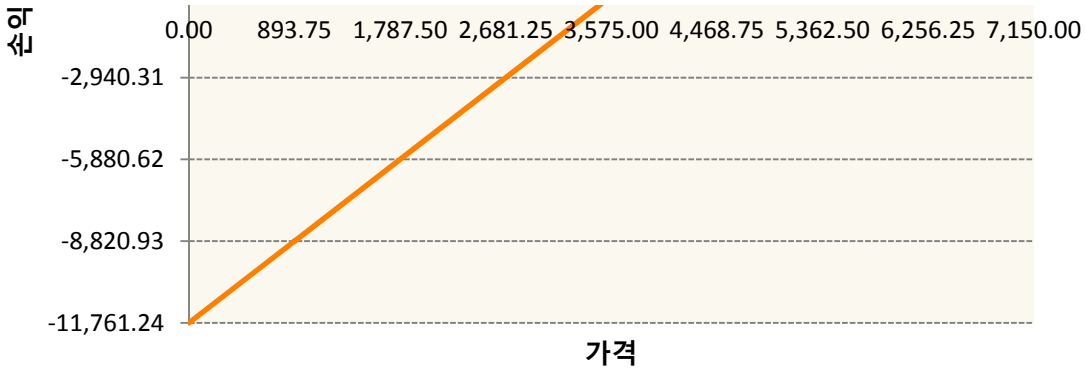


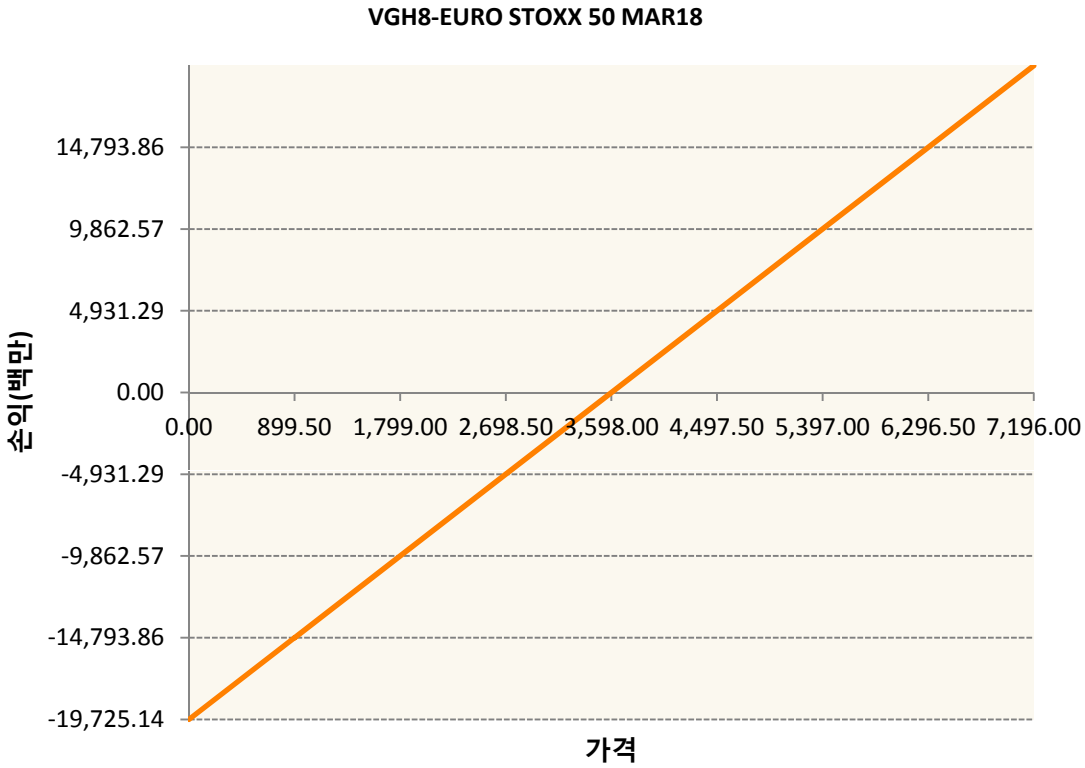



2,940.31
0.00
-2,940.31
-5,880.62
-8,820.93
-11,761.24
0.00
893.75
1,787.50
2,681.25
3,575.00
4,468.75
5,362.50
6,256.25
7,150.00
손익(백만)
가격


OESXF8-P3550-OESXF8-P3550 EURO STOXX 50 PRICE EUR
15,996.13
11,997.10
7,998.06
3,999.03
0.00
-3,999.03
-7,998.06
-11,997.10
-15,996.13
0.00
887.50
1,775.00
2,662.50
3,550.00
4,437.50
5,325.00
6,212.50
7,100.00
손익(백만)
가격


OESXF8-P3575-OESXF8-P3575 EURO STOXX 50 PRICE EUR
11,761.24
8,820.93
5,880.62
2,940.31
0.00
(백만)





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)	(단위:백만원)
260105SGPX SG EURO Covered CALL STRATEGY - 994.569	82
260105SQPX SG EURO Covered CALL STRATEGY	111
OESXF8-C35 OESXF8-C3550 EURO SOTXX 50 PRICE EUR	1,280
OESXF8-C35 OESXF8-C3575 EURO STOXX 50 PRICE EUR	941
OESXF8-P35 OESXF8-P3550 EURO STOXX 50 PRICE EUR	1,280
OESXF8-P35 OESXF8-P3575 EURO STOXX 50 PRICE EUR	941
VGH8 EURO STOXX 50 MAR18	1,578

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

3,534

공시일	2017-12-20
기준일	2017-12-19

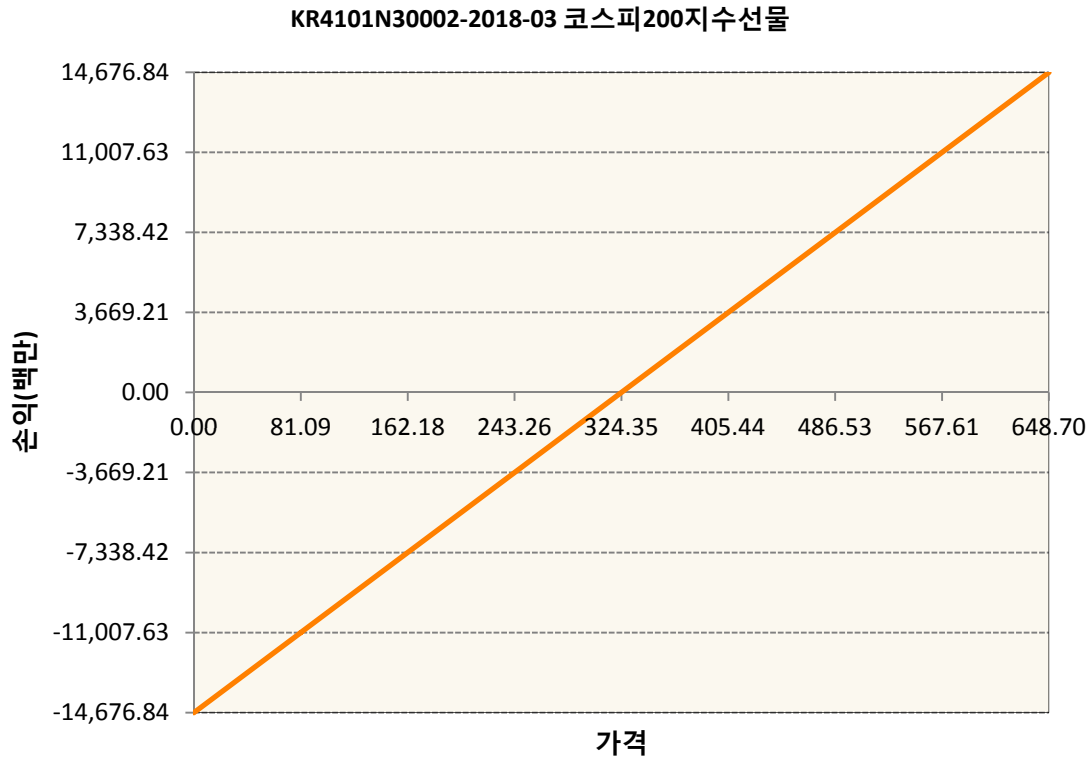
ETF스마트레버리지목표전환형8호

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	14,677	0	14,677	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101N30(2018-03 코스피200지수선물							1,183
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,183	-1,183	-1,183	-1,183	-1,183	-1,183	-1,183
-5.33%	-789	-789	-789	-789	-789	-789	-789
-2.67%	-394	-394	-394	-394	-394	-394	-394
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	394	394	394	394	394	394	394
5.33%	789	789	789	789	789	789	789
8.00%	1,183	1,183	1,183	1,183	1,183	1,183	1,183

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

681

공시일	2017-12-20
기준일	2017-12-19

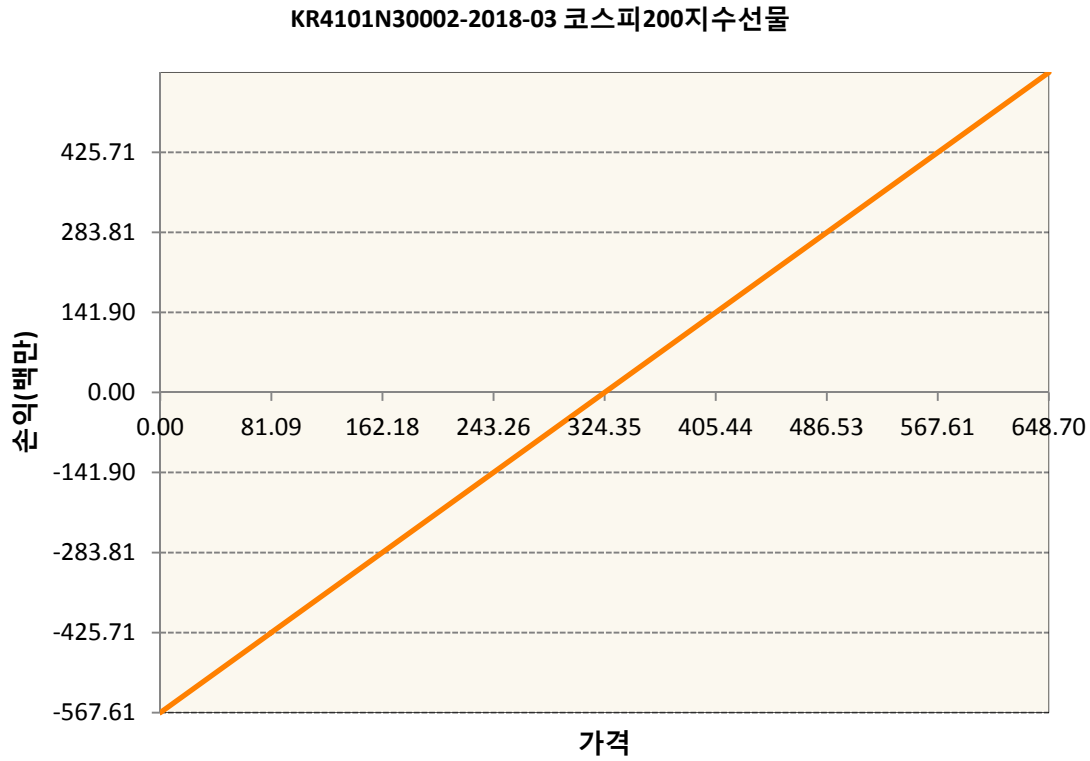
ETF스마트레버리지목표전환형9호

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)

KR4101N30(2018-03 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)

26

공시일	2017-12-20
기준일	2017-12-19

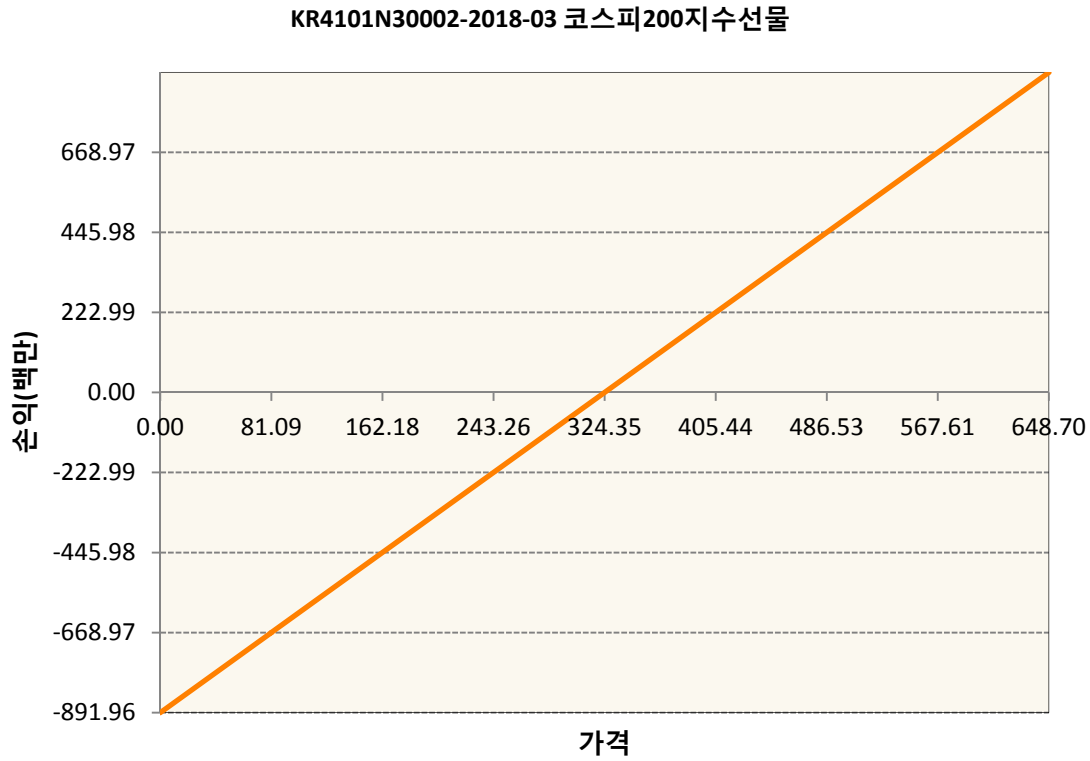
ETF스마트레버리지목표전환형10

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	892	0	892	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101N30(2018-03 코스피200지수선물							72
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-72	-72	-72	-72	-72	-72	-72
-5.33%	-48	-48	-48	-48	-48	-48	-48
-2.67%	-24	-24	-24	-24	-24	-24	-24
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	24	24	24	24	24	24	24
5.33%	48	48	48	48	48	48	48
8.00%	72	72	72	72	72	72	72

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

41

공시일	2017-12-20
기준일	2017-12-19

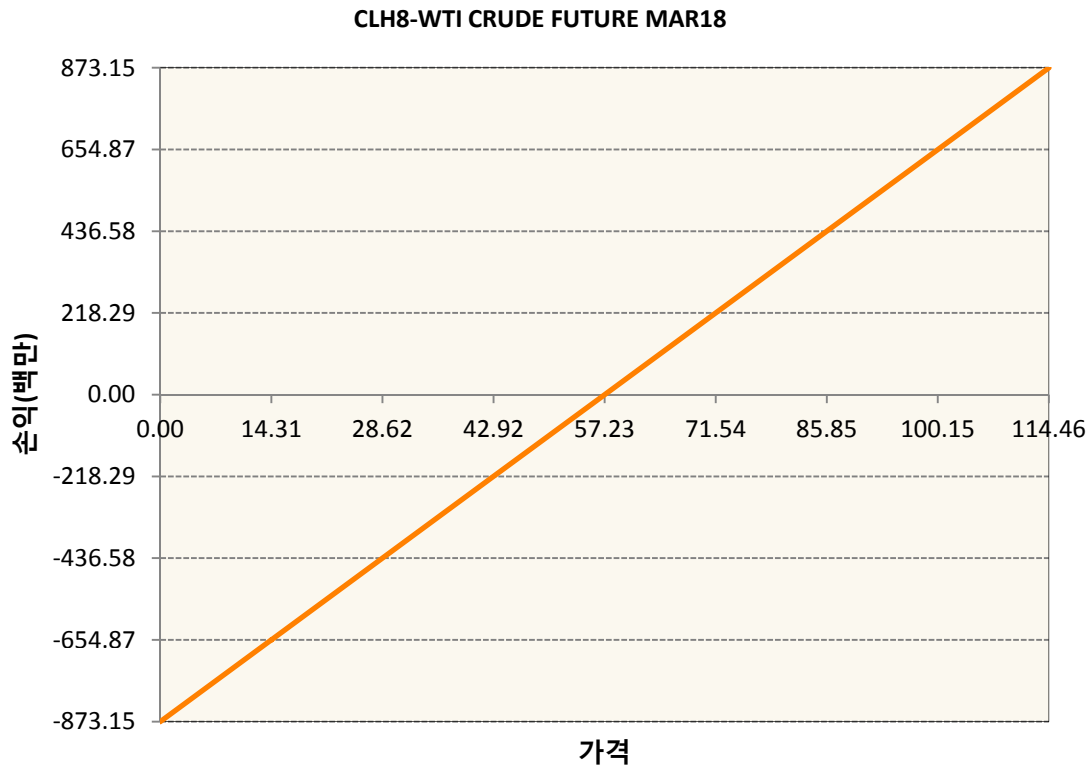
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

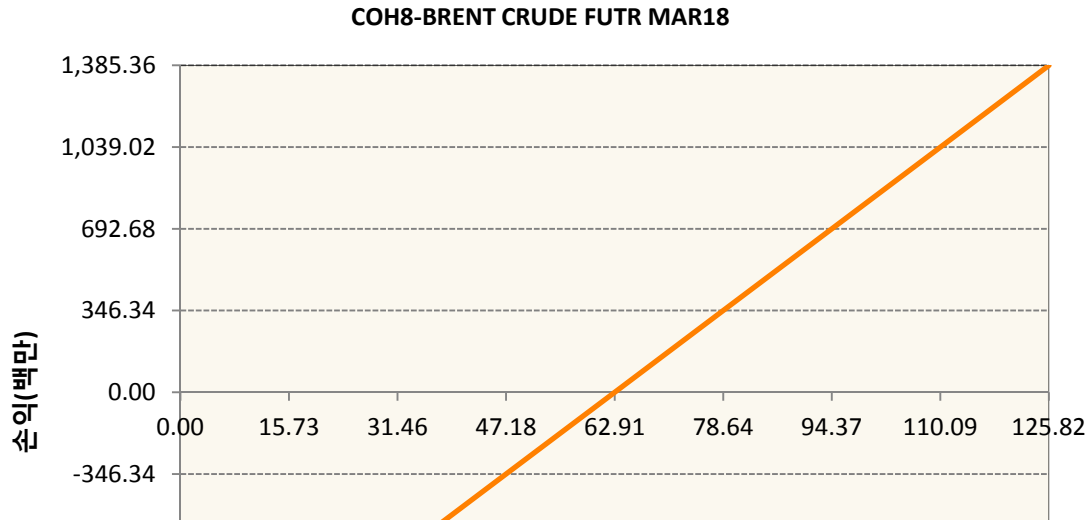
1. 계약금액

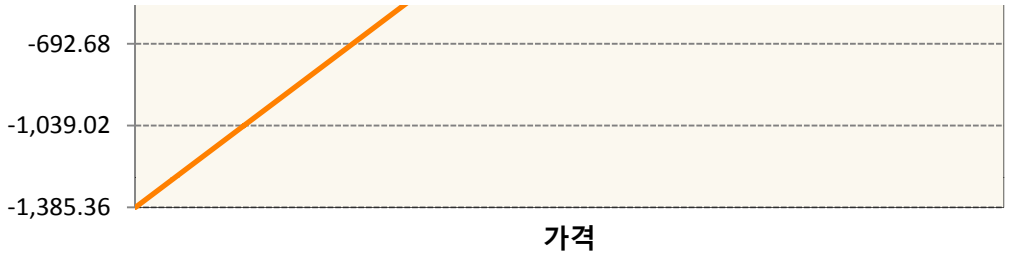
(단위:백만원)

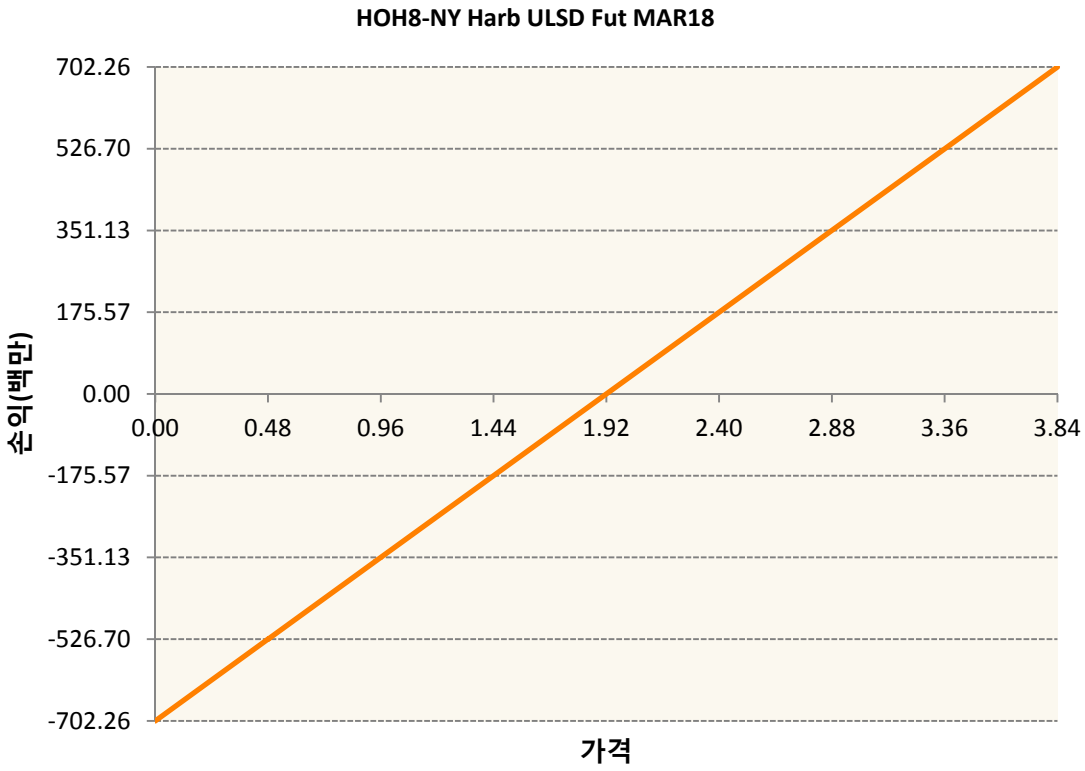
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	4,624	867	3,757	

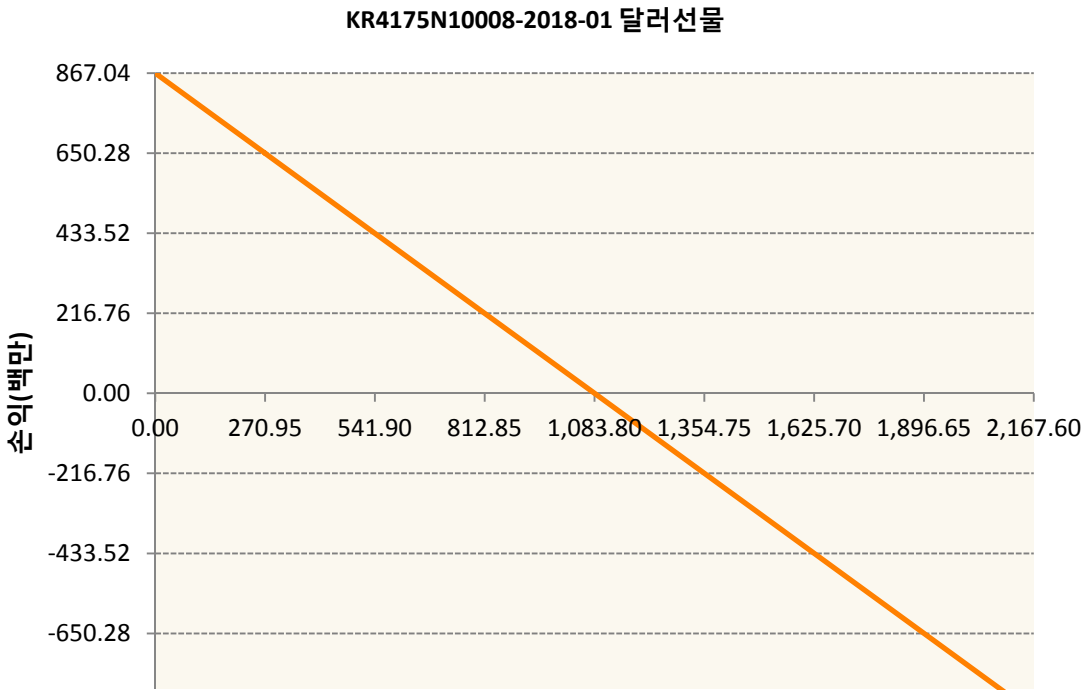
2. 만기시점의 손익구조

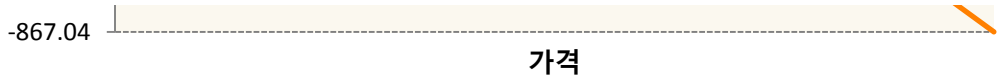


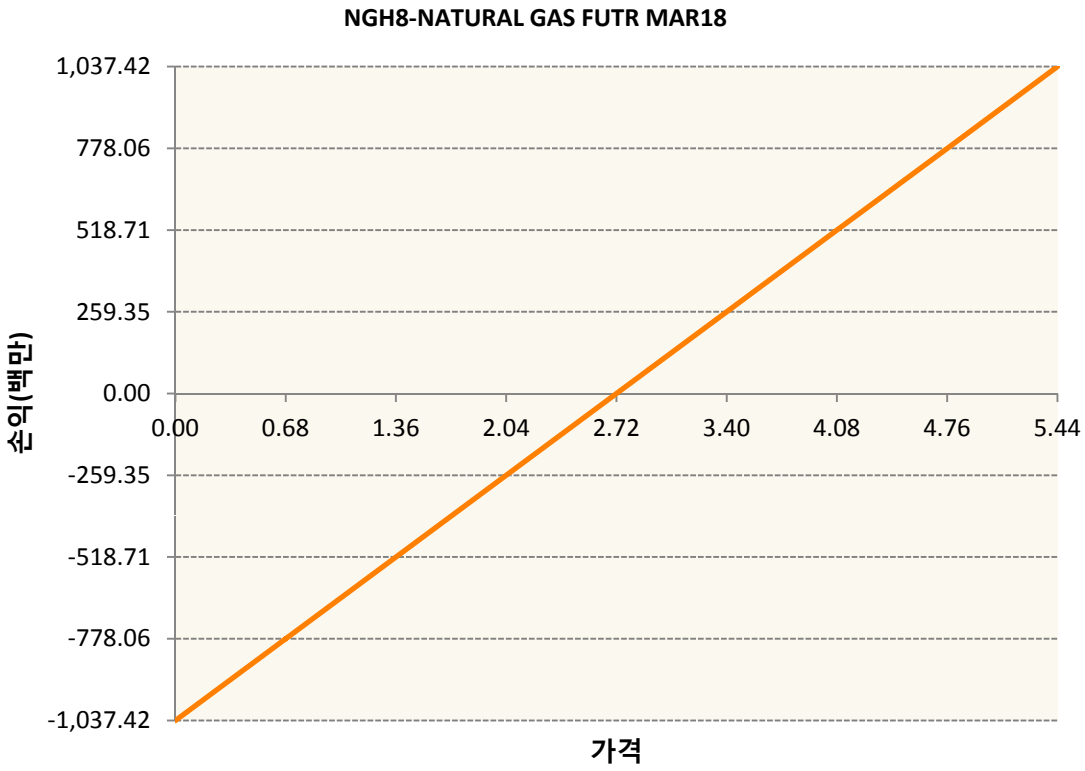


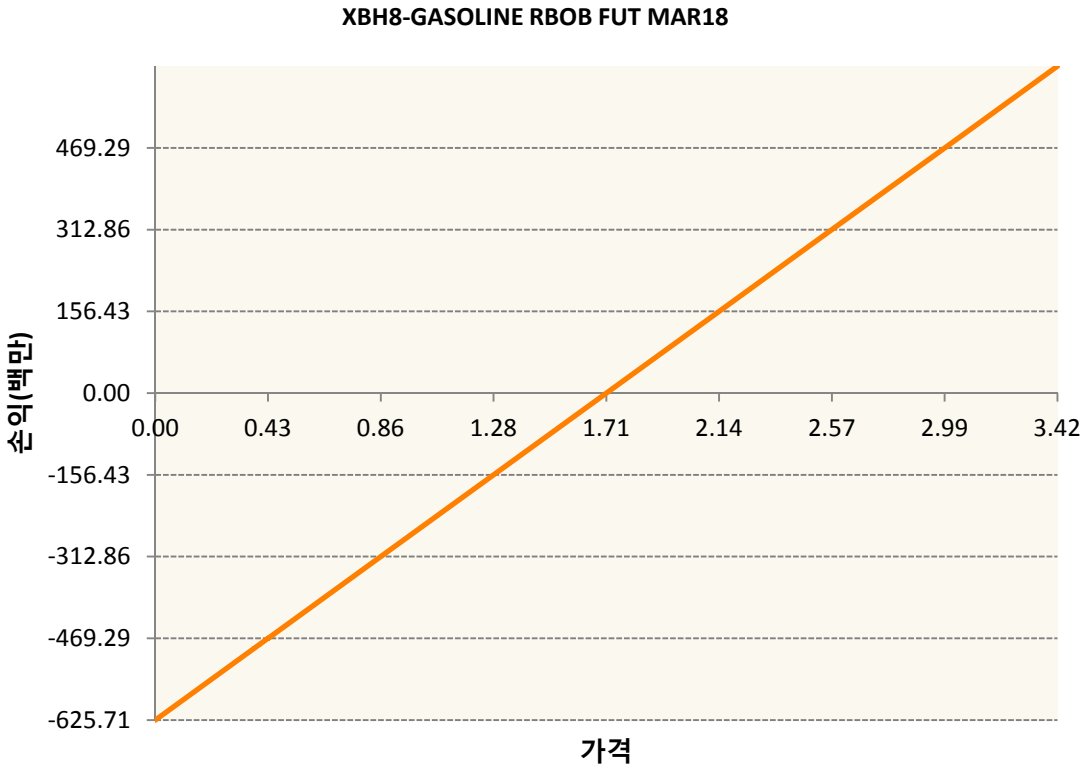

-692.68
-1,039.02
-1,385.36
가격


HOH8-NY Harb ULSD Fut MAR18
702.26
526.70
351.13
175.57
0.00
-175.57
-351.13
-526.70
-702.26
0.00
0.48
0.96
1.44
1.92
2.40
2.88
3.36
3.84
손익(백만)
가격


KR4175N10008-2018-01 달러선물
867.04
650.28
433.52
216.76
0.00
-216.76
-433.52
-650.28
0.00
270.95
541.90
812.85
1,083.80
1,354.75
1,625.70
1,896.65
2,167.60
손익(백만)


-867.04
가격


NGH8-NATURAL GAS FUTR MAR18
1,037.42
778.06
518.71
259.35
0.00
-259.35
-518.71
-778.06
-1,037.42
0.00
0.68
1.36
2.04
2.72
3.40
4.08
4.76
5.44
손익(백만)
가격


XBH8-GASOLINE RBOB FUT MAR18
469.29
312.86
156.43
0.00
-156.43
-312.86
-469.29
-625.71
0.00
0.43
0.86
1.28
1.71
2.14
2.57
2.99
3.42
손익(백만)
가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLH8	WTI CRUDE FUTURE MAR18	70
COH8	BRENT CRUDE FUTR MAR18	111
HOH8	NY Harb ULSD Fut MAR18	56
KR4175N10(	2018-01 달러선물	69
NGH8	NATURAL GAS FUTR MAR18	83
XBH8	GASOLINE RBOB FUT MAR18	50

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

623

공시일	2017-12-20
기준일	2017-12-19

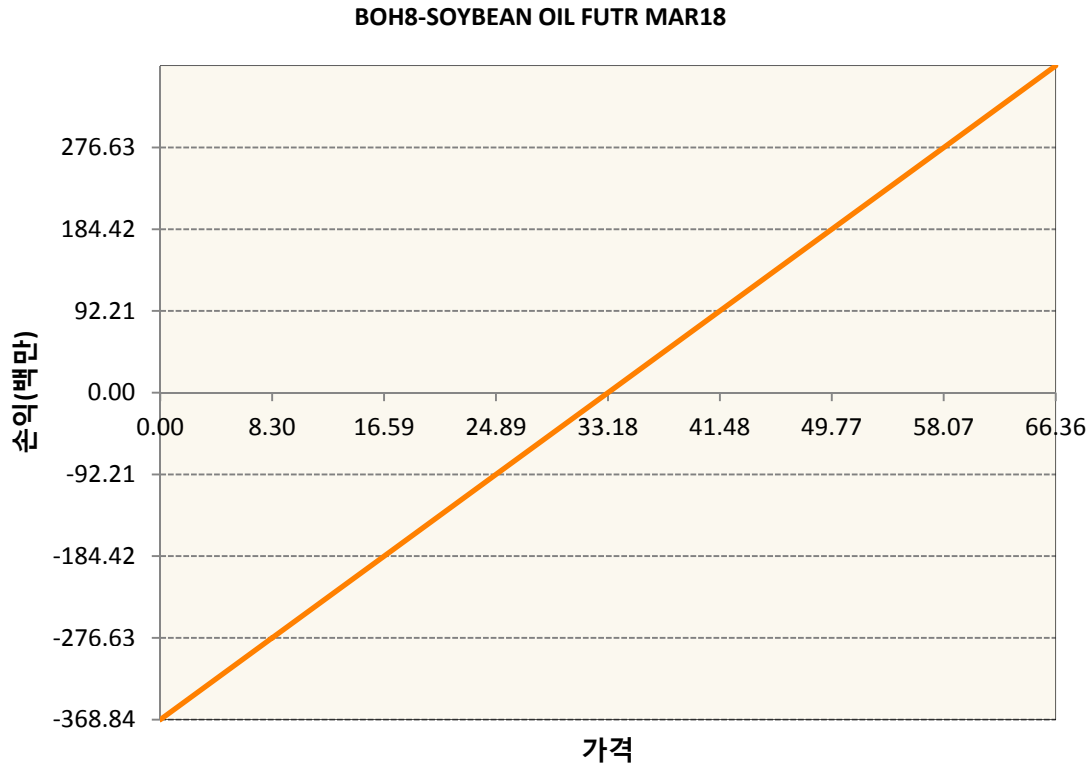
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

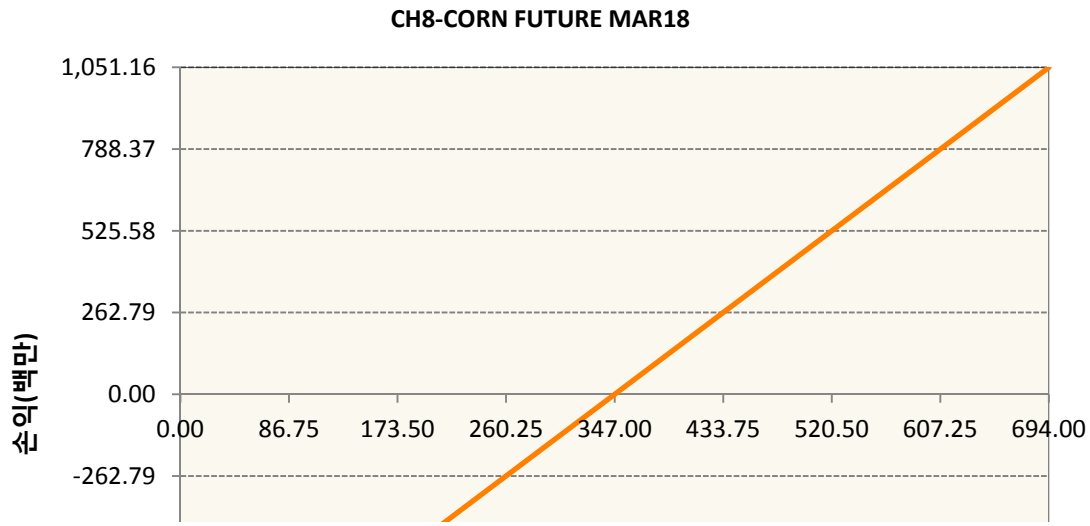
1. 계약금액

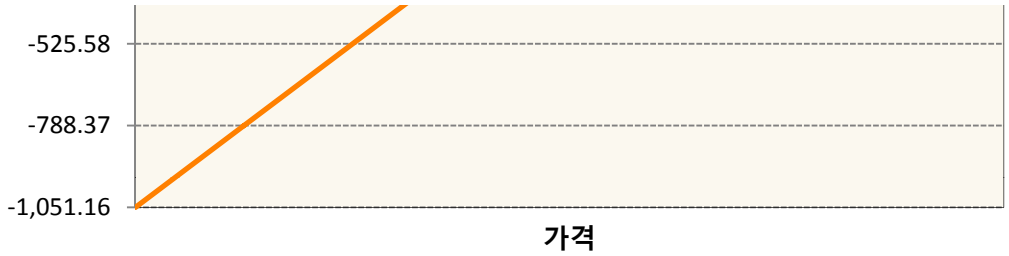
(단위:백만원)

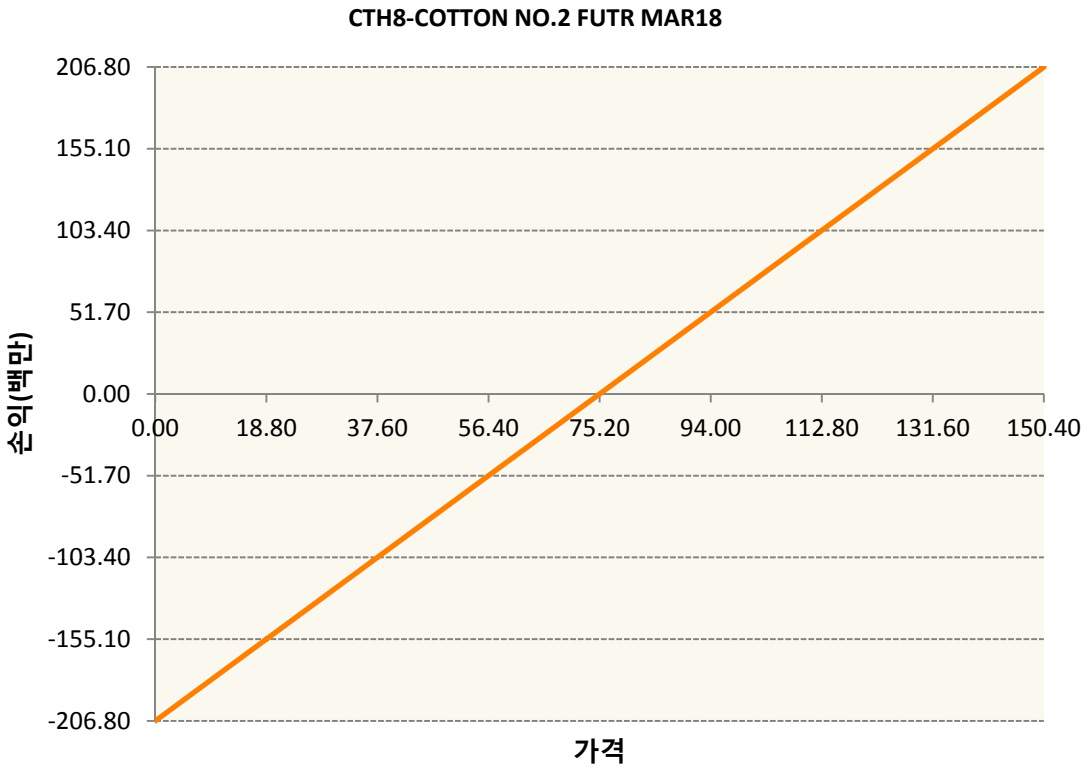
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	4,196	325	3,871	

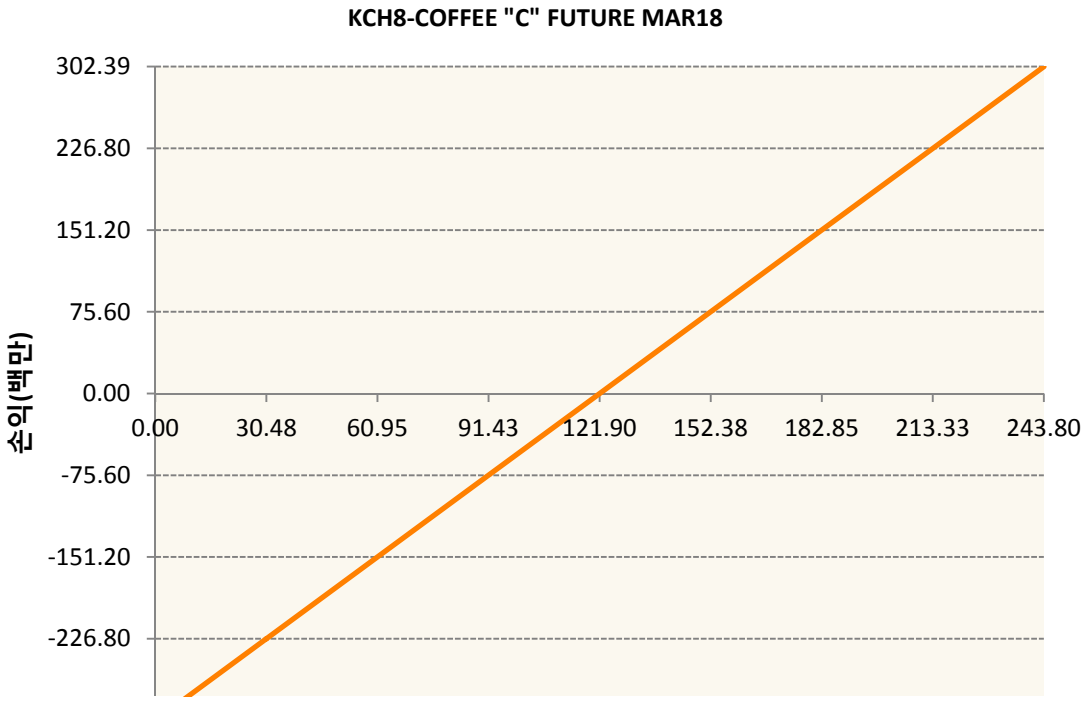
2. 만기시점의 손익구조

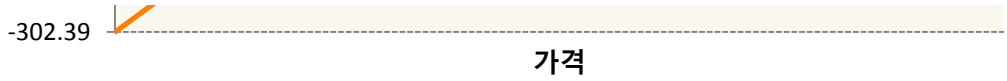


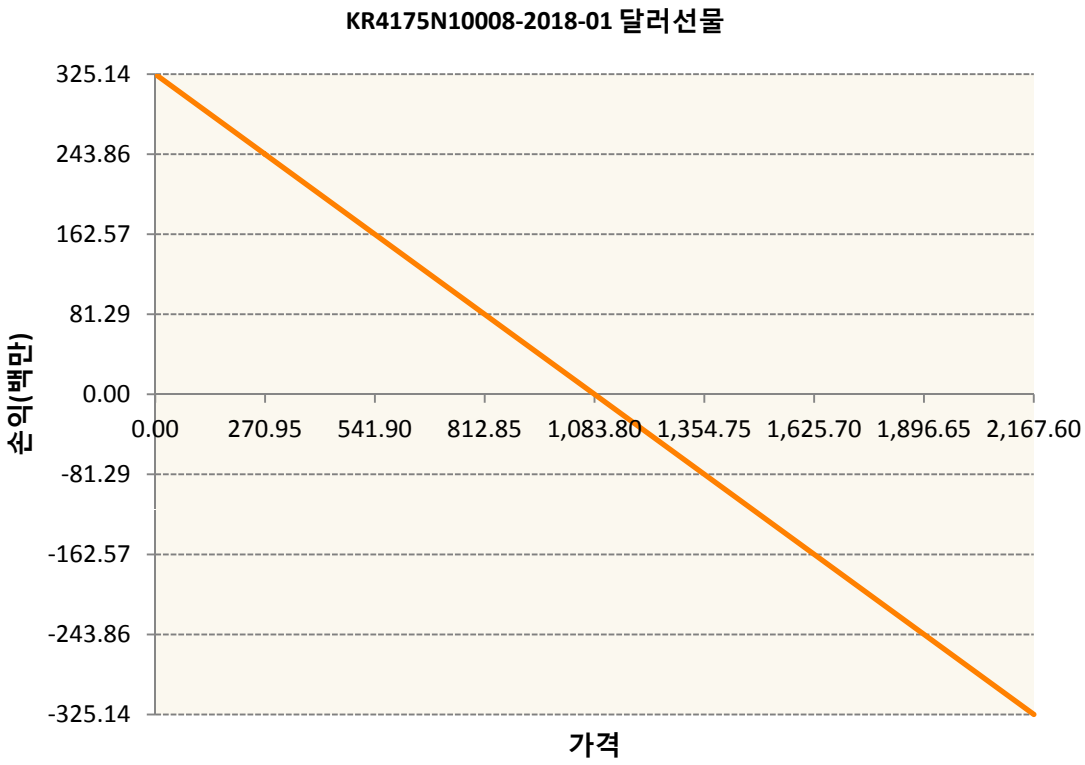


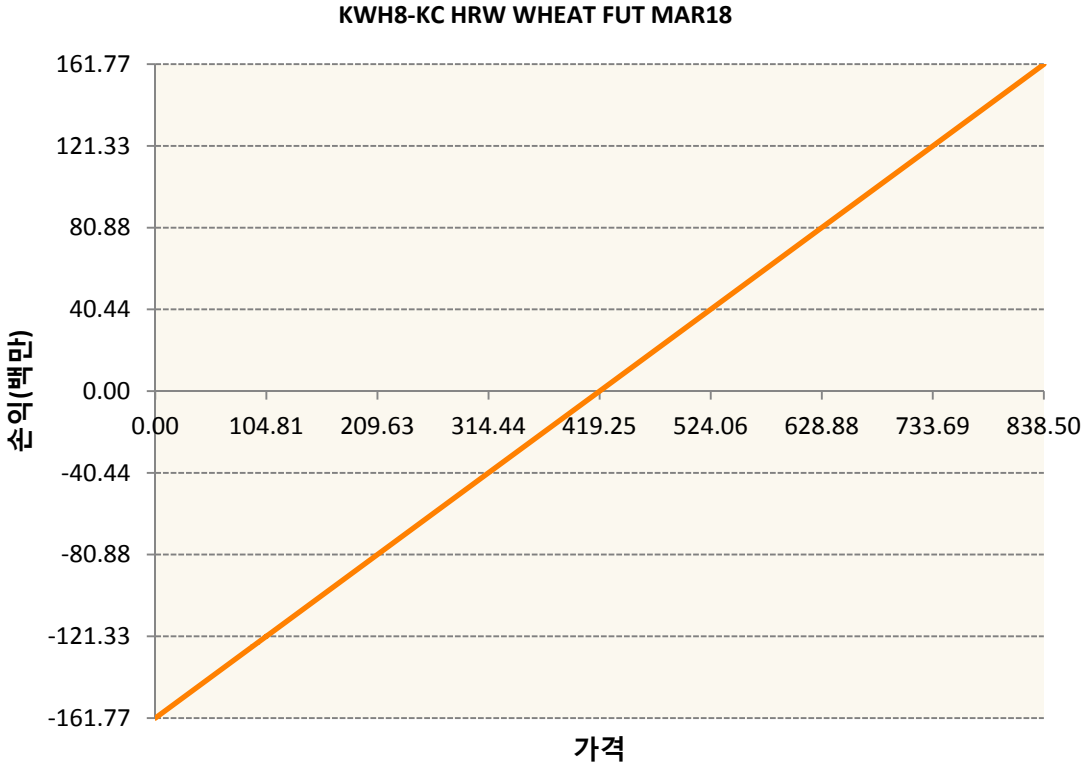

-525.58
-788.37
-1,051.16
가격


CTH8-COTTON NO.2 FUTR MAR18
206.80
155.10
103.40
51.70
0.00
-51.70
-103.40
-155.10
-206.80
0.00
18.80
37.60
56.40
75.20
94.00
112.80
131.60
150.40
손익(백만)
가격

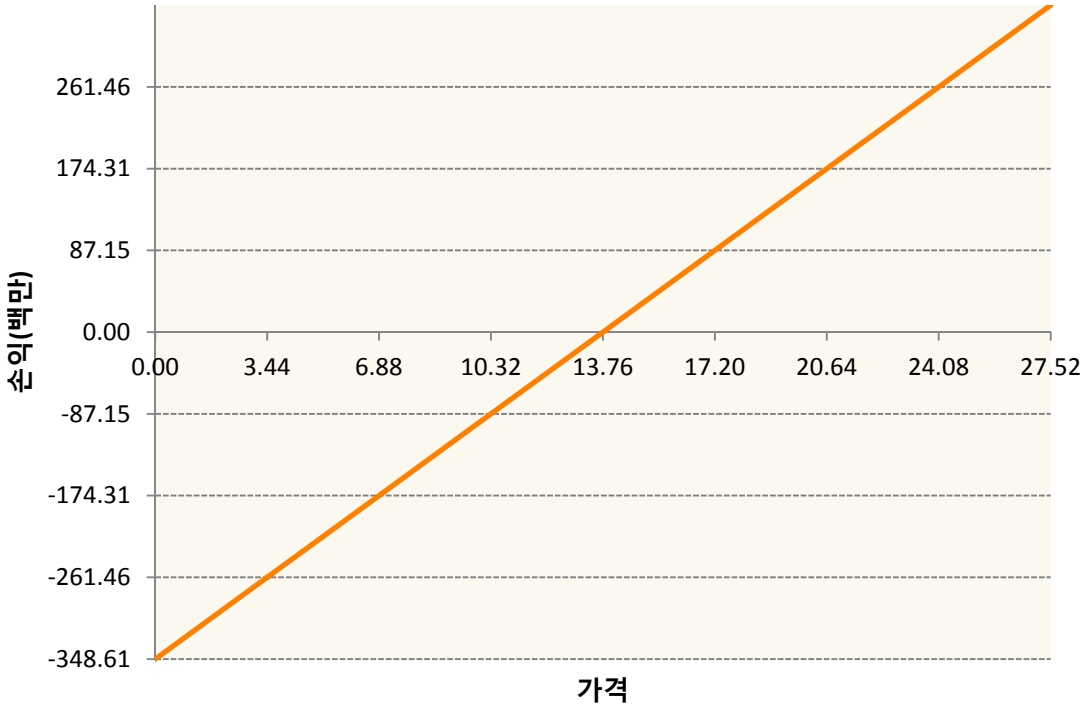

KCH8-COFFEE "C" FUTURE MAR18
302.39
226.80
151.20
75.60
0.00
-75.60
-151.20
-226.80
0.00
30.48
60.95
91.43
121.90
152.38
182.85
213.33
243.80
손익(백만)


-302.39
가격

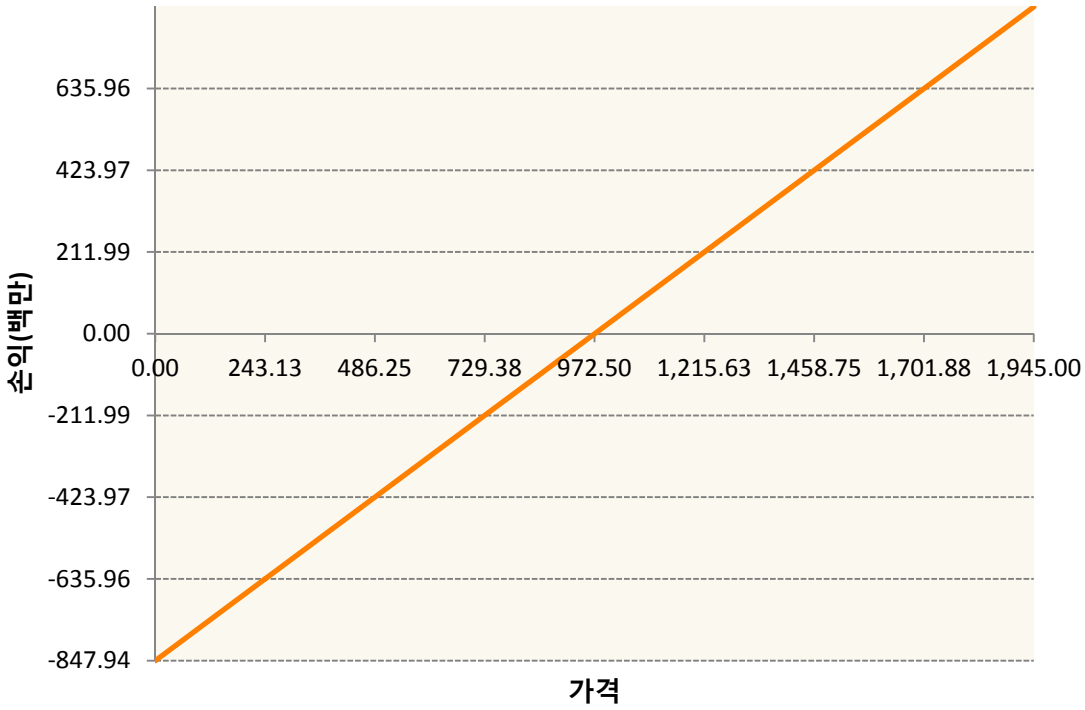

KR4175N10008-2018-01 달러선물
325.14
243.86
162.57
81.29
0.00
-81.29
-162.57
-243.86
-325.14
0.00
270.95
541.90
812.85
1,083.80
1,354.75
1,625.70
1,896.65
2,167.60
손익(백만)
가격


KWH8-KC HRW WHEAT FUT MAR18
161.77
121.33
80.88
40.44
0.00
-40.44
-80.88
-121.33
-161.77
0.00
104.81
209.63
314.44
419.25
524.06
628.88
733.69
838.50
손익(백만)
가격

SBH8-Sugar #11 (WORLD) MAR18

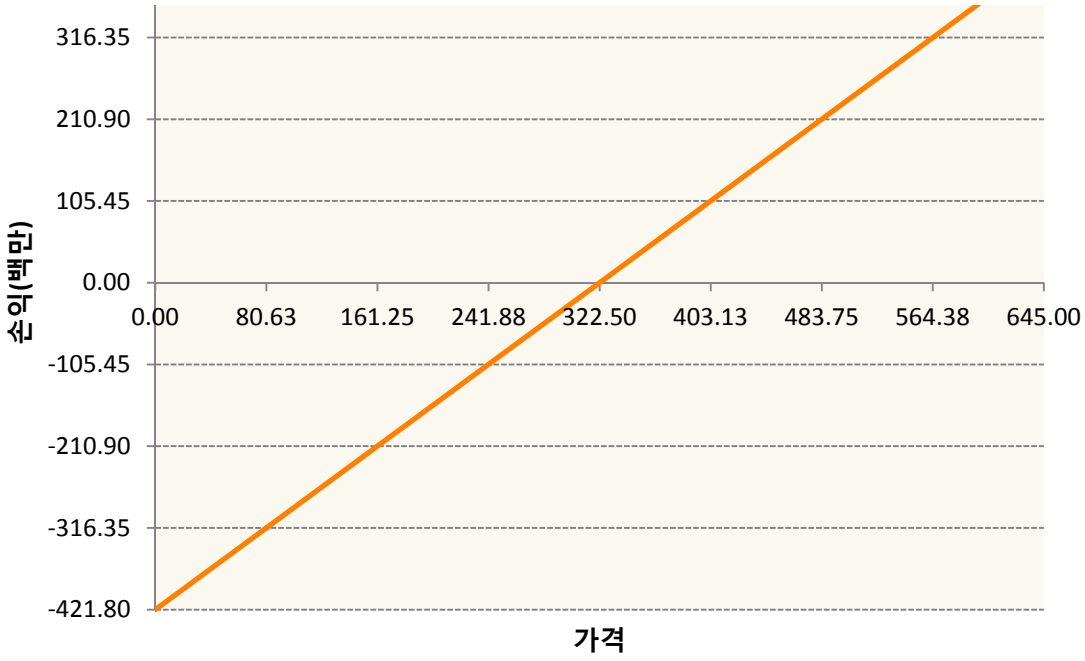


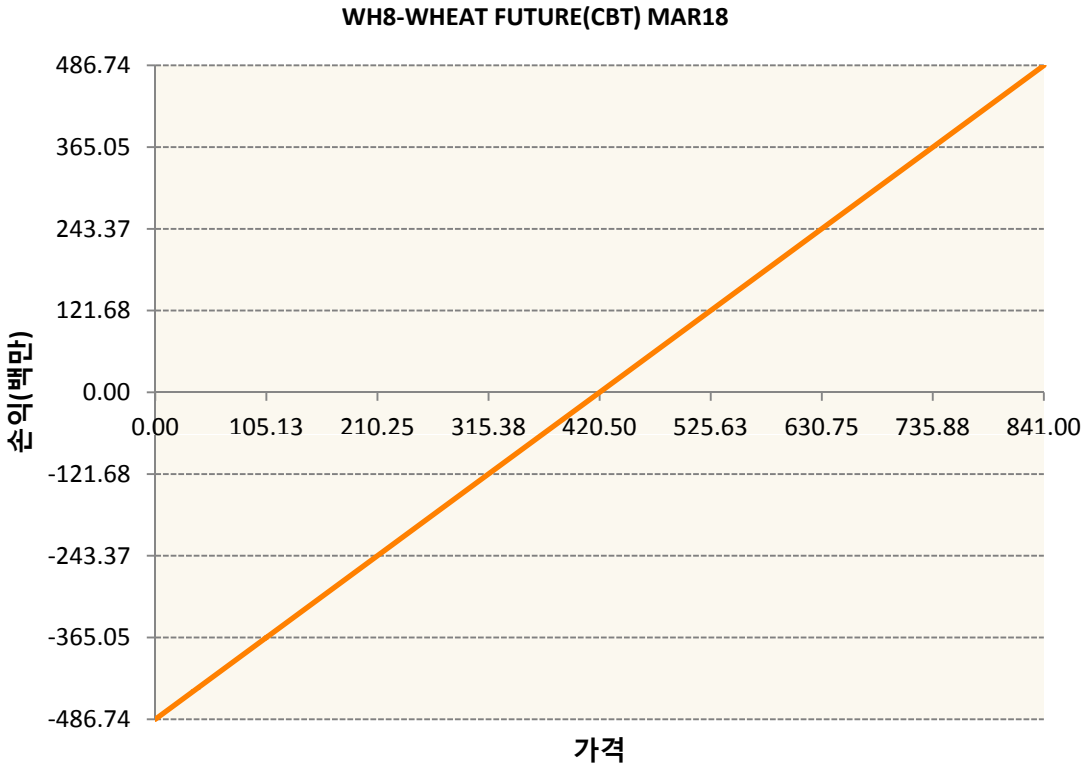
SH8-SOYBEAN FUTURE MAR18



SMH8-SOYBEAN MEAL FUTR MAR18







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
BOH8	SOYBEAN OIL FUTR MAR18	30
CH8	CORN FUTURE MAR18	84
CTH8	COTTON NO.2 FUTR MAR18	17
KCH8	COFFEE "C" FUTURE MAR18	24
KR4175N10(	2018-01 달러선물	26

KWH8	KC HRW WHEAT FUT MAR18	13
SBH8	Sugar #11 (WORLD) MAR18	28
SH8	SOYBEAN FUTURE MAR18	68
SMH8	SOYBEAN MEAL FUTR MAR18	34
WH8	WHEAT FUTURE(CBT) MAR18	39

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

357