공시일	2017-12-28
기준일	2017-12-27

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	2017-12-28
기준일	2017-12-27

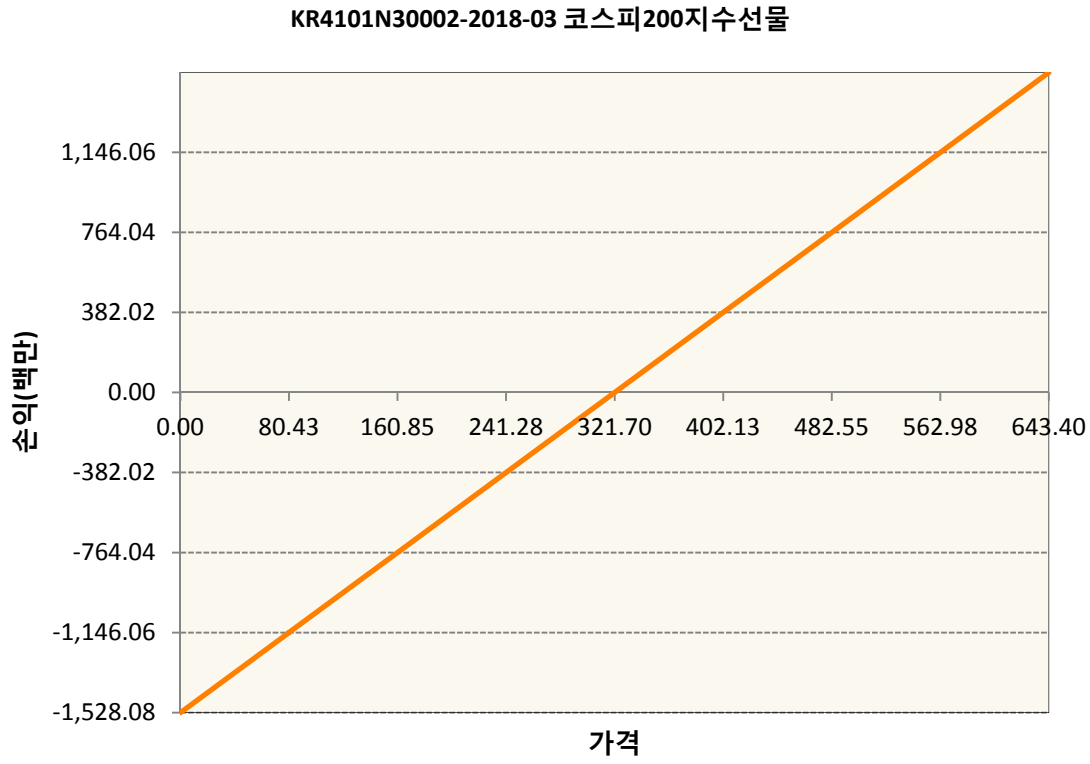
스마트인덱스모

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	1,528	0	1,528	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101N30(2018-03 코스피200지수선물							122
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-122	-122	-122	-122	-122	-122	-122
-5.33%	-81	-81	-81	-81	-81	-81	-81
-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%	81	81	81	81	81	81	81
8.00%	122	122	122	122	122	122	122

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

72

공시일	2017-12-28
기준일	2017-12-27

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	1,098

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

351

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-12-28
기준일	2017-12-27

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)

357

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-12-28
기준일	2017-12-27

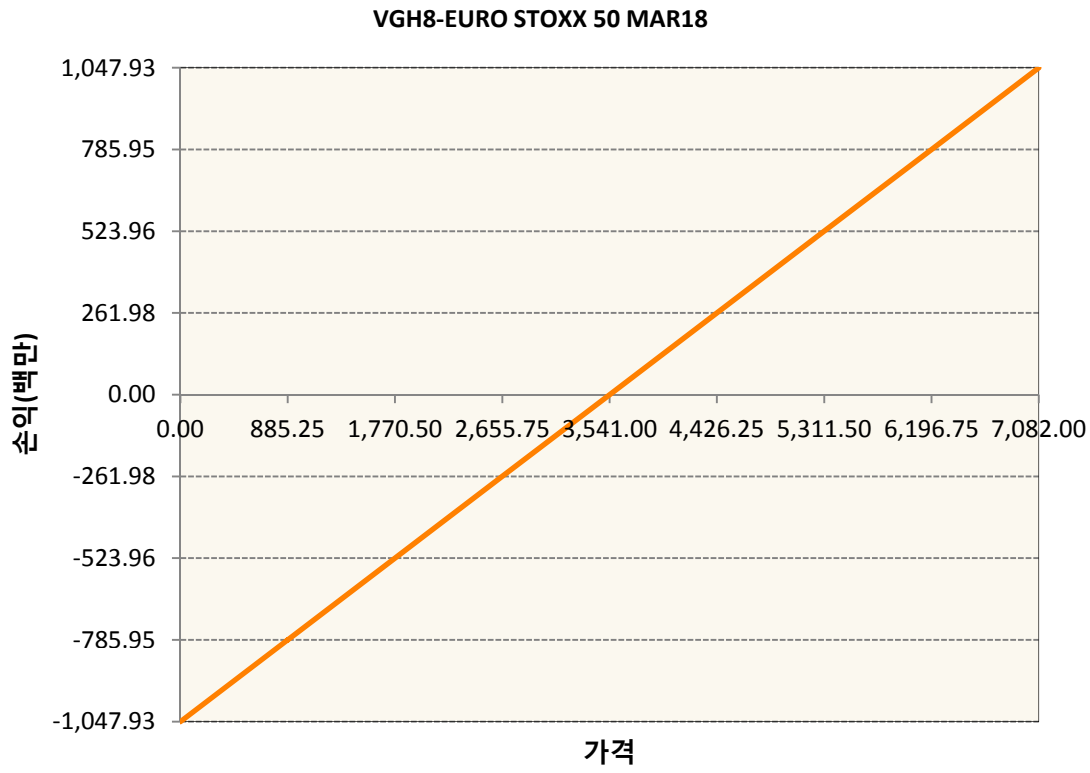
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,048	0	1,048	

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	2017-12-28
기준일	2017-12-27

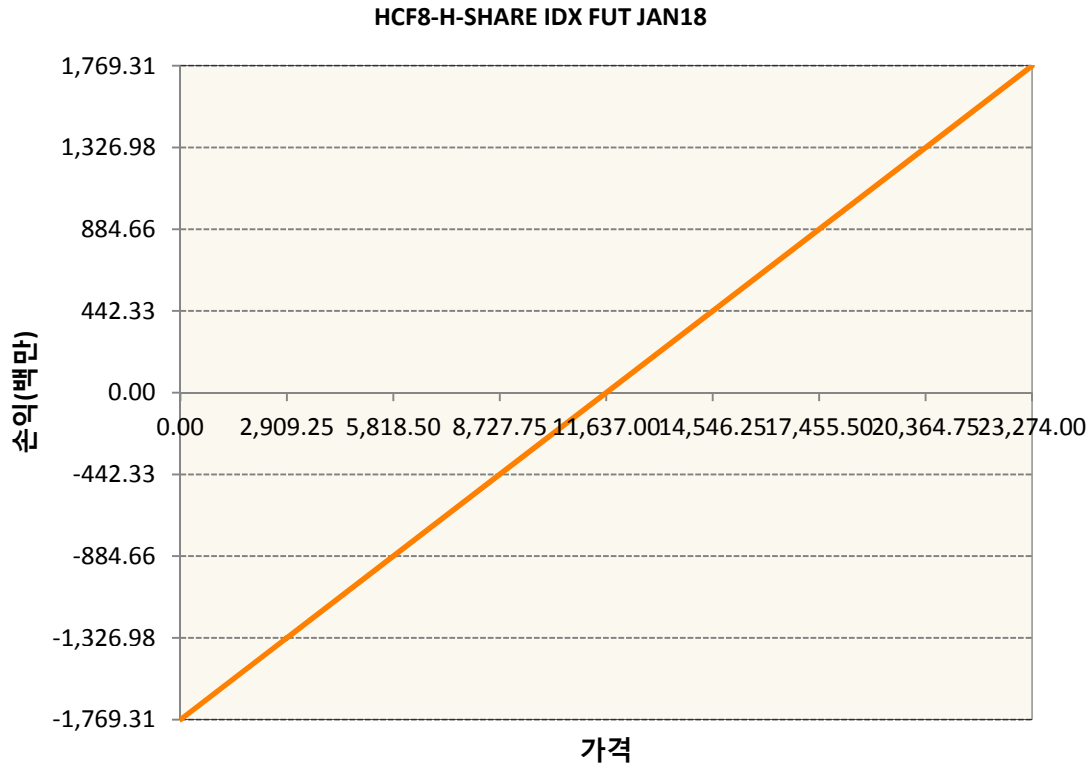
차이나인덱스모(주식-파생형)

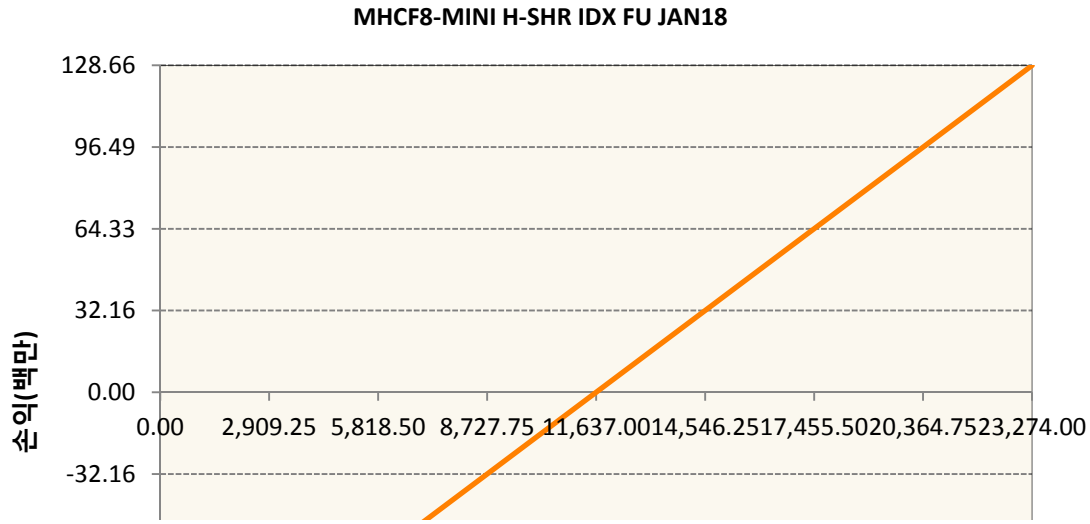
1. 계약금액

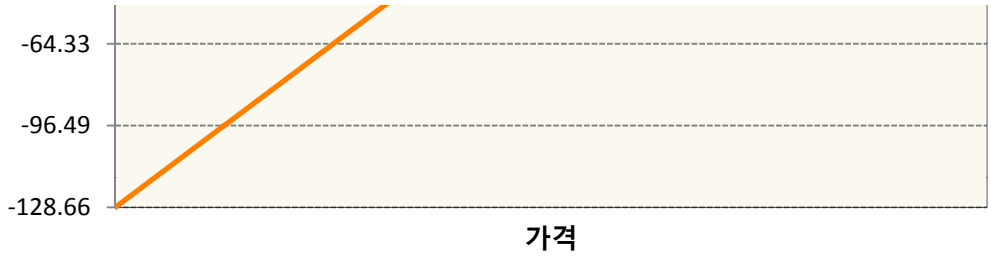
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,898	0	1,898	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCF8	H-SHARE IDX FUT JAN18	142
MHCF8	MINI H-SHR IDX FU JAN18	10

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	120

공시일	2017-12-28
기준일	2017-12-27

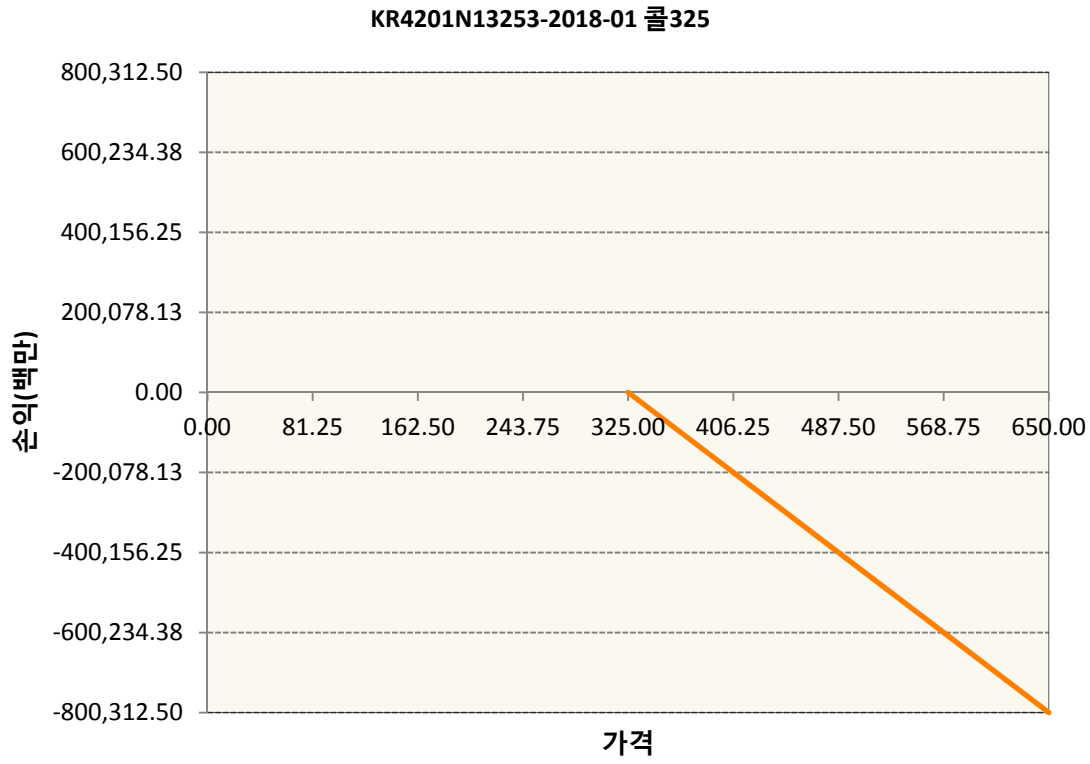
커버드콜모(주식혼합-파생형)

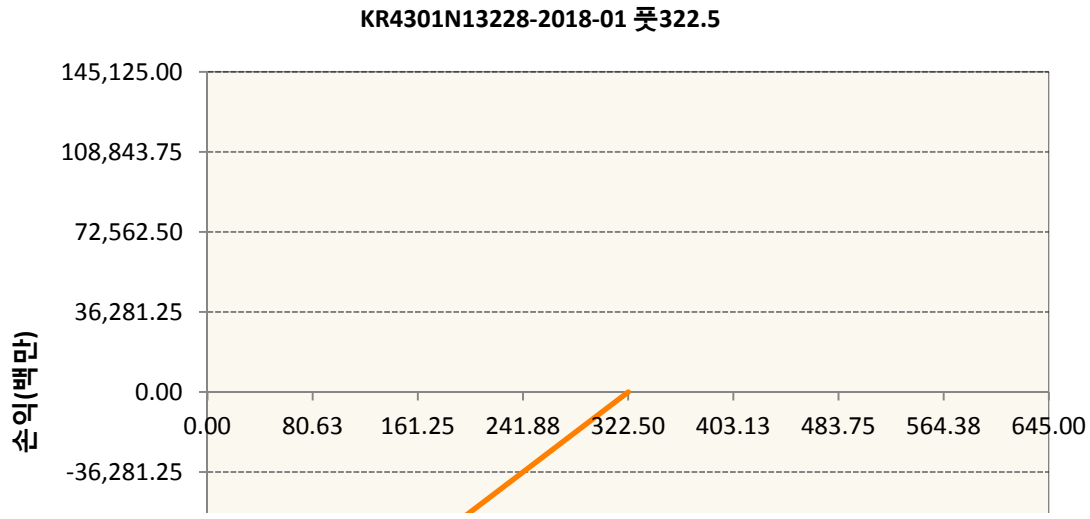
1. 계약금액

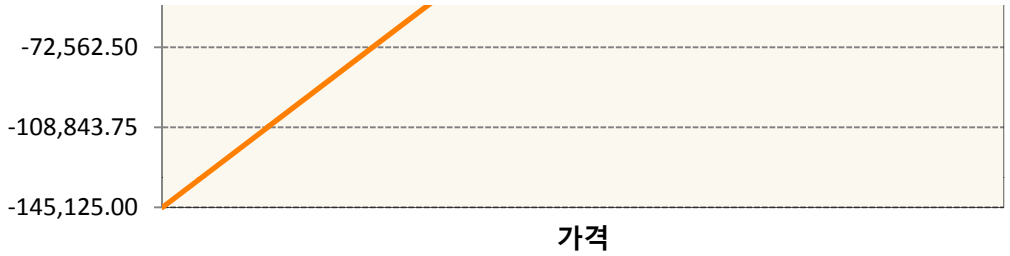
(단위:백만원)

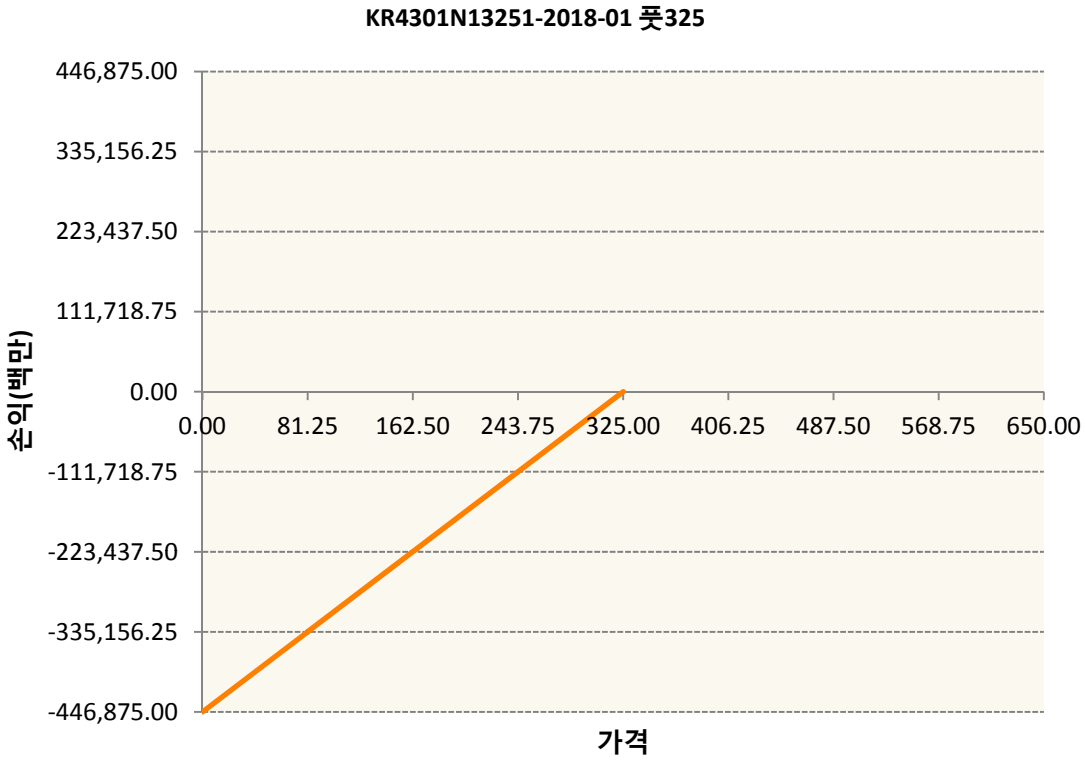
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	1,392,313	-1,392,313	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201N132 2018-01 콜325							45,059
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	10,863	10,798	10,687	10,520	10,292	10,001	9,646
-5.33%	10,518	10,228	9,848	9,381	8,835	8,217	7,535
-2.67%	8,851	8,083	7,236	6,325	5,361	4,352	3,308
0%	3,790	2,541	1,276	0	-1,285	-2,576	-3,874
2.67%	-6,590	-7,885	-9,190	-10,503	-11,822	-13,145	-14,473
5.33%	-22,233	-23,117	-24,074	-25,091	-26,155	-27,258	-28,393
8.00%	-41,261	-41,672	-42,185	-42,790	-43,477	-44,236	-45,059
KR4301N132 2018-01 풋322.5							10,453
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-10,448	-10,448	-10,449	-10,449	-10,449	-10,450	-10,453

-5.33%	-6,608	-6,610	-6,613	-6,620	-6,629	-6,643	-6,662
-2.67%	-2,816	-2,849	-2,892	-2,942	-3,000	-3,065	-3,135
0%	362	243	122	0	-122	-245	-369
2.67%	1,813	1,730	1,641	1,546	1,447	1,344	1,238
5.33%	2,047	2,034	2,016	1,990	1,956	1,916	1,869
8.00%	2,058	2,057	2,056	2,053	2,048	2,040	2,029
KR4301N132	2018-01 풋325						33,093

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-33,087	-33,087	-33,087	-33,087	-33,088	-33,089	-33,093
-5.33%	-21,352	-21,353	-21,357	-21,366	-21,381	-21,405	-21,440
-2.67%	-9,670	-9,722	-9,797	-9,895	-10,015	-10,158	-10,320
0%	948	645	328	0	-336	-680	-1,028
2.67%	7,063	6,729	6,385	6,033	5,676	5,313	4,947
5.33%	8,462	8,383	8,277	8,146	7,990	7,811	7,613
8.00%	8,559	8,555	8,545	8,526	8,496	8,453	8,394

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

97,701

공시일	2017-12-28
기준일	2017-12-27

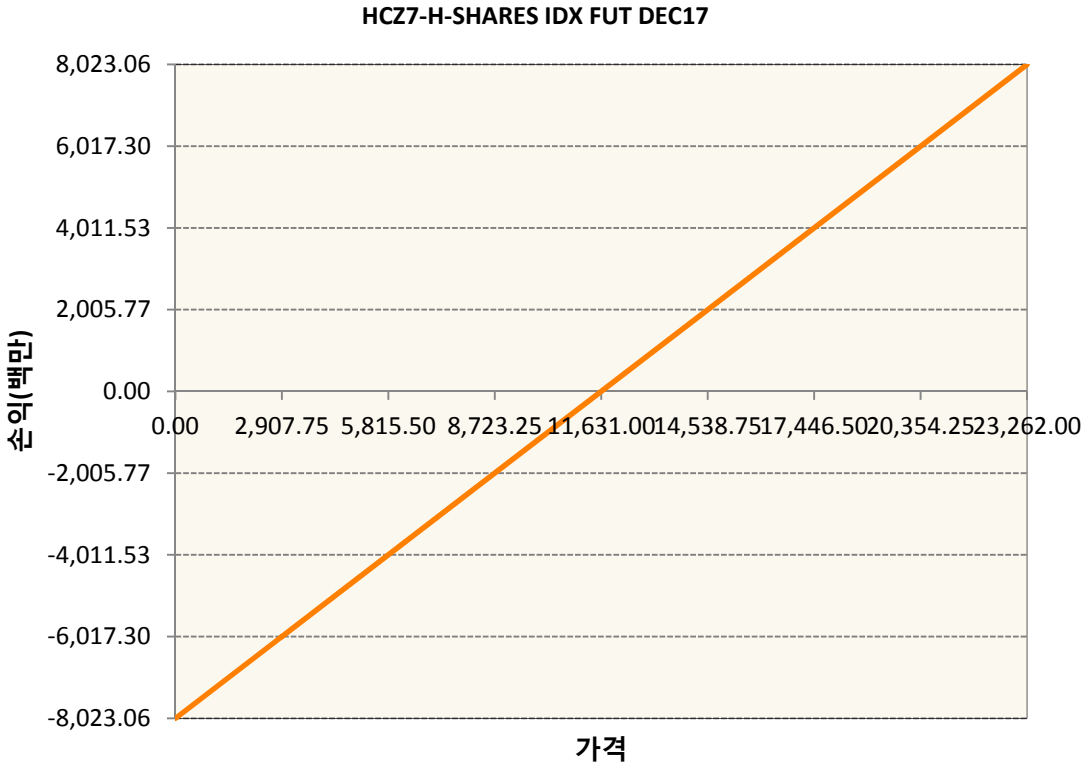
홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생

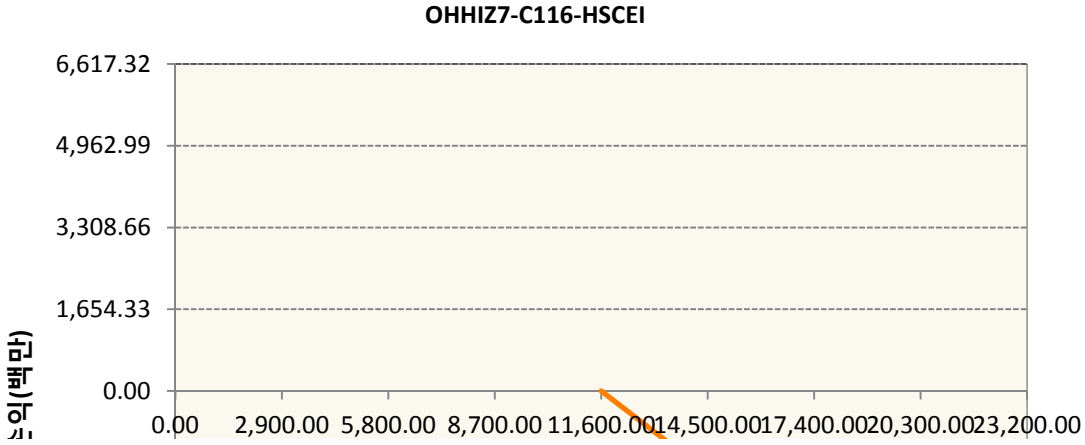
1. 계약금액

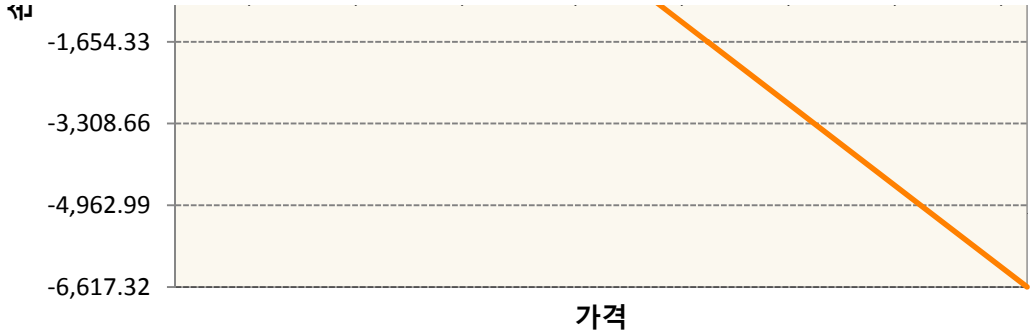
(단위:백만원)

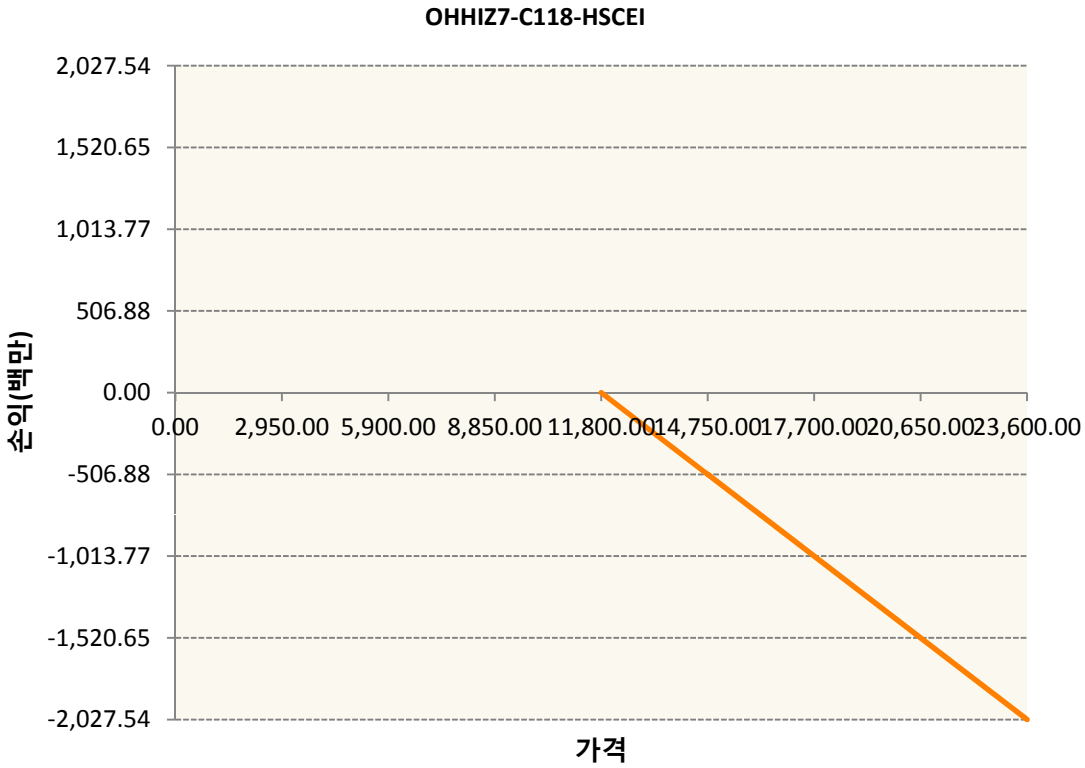
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	8,023	0	8,023	
누계	유가증권	옵션	0	17,290	-17,290	장내

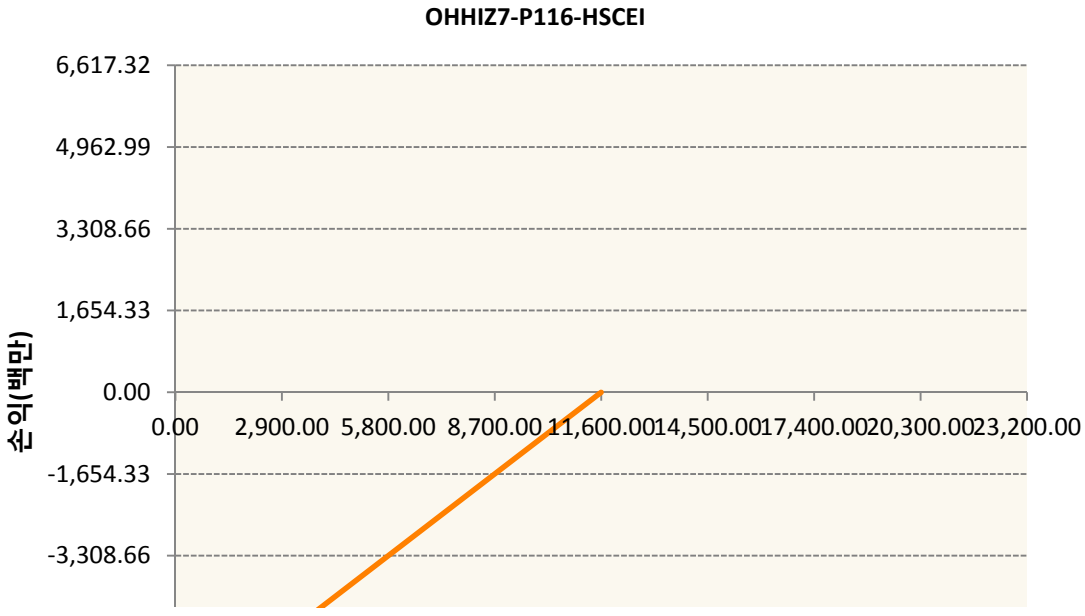
2. 만기시점의 손익구조

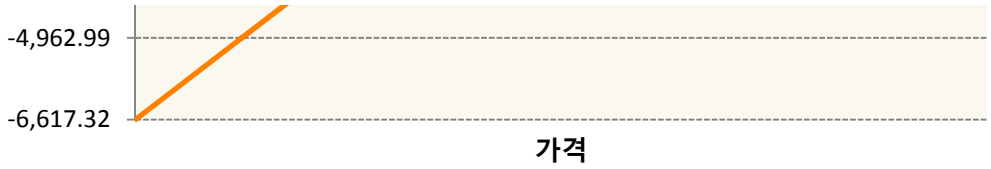


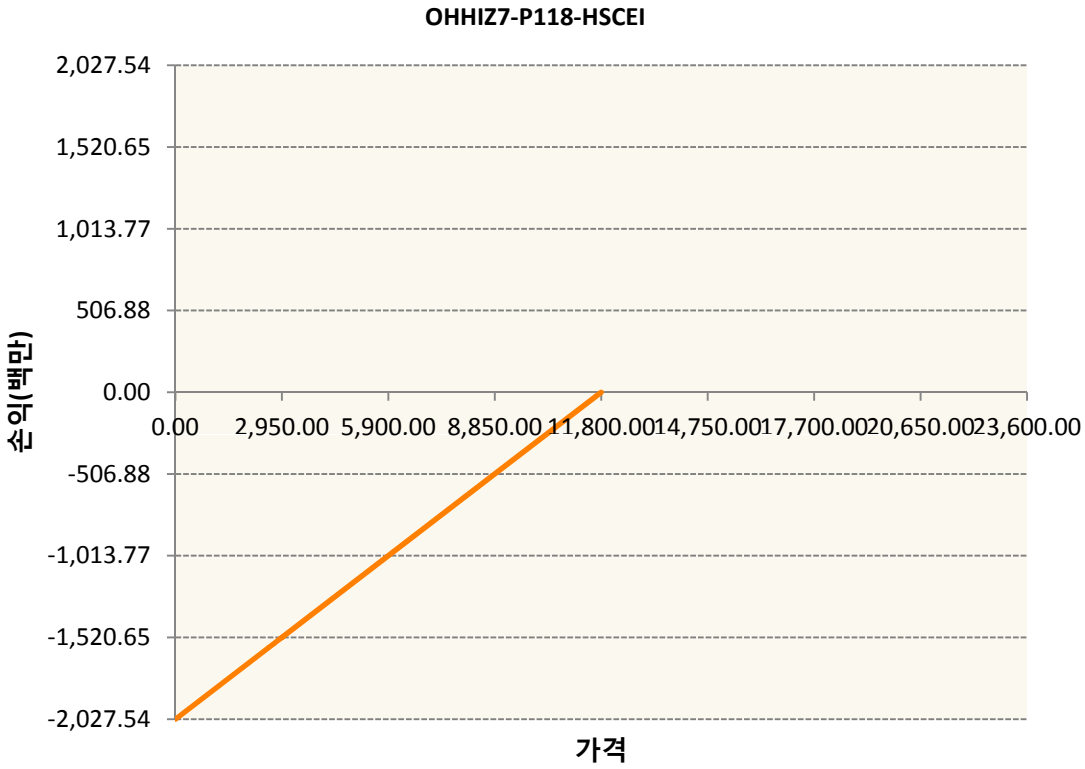



-1,654.33
-3,308.66
-4,962.99
-6,617.32
가격


OHHIZ7-C118-HSCEI
2,027.54
1,520.65
1,013.77
506.88
0.00
-506.88
-1,013.77
-1,520.65
-2,027.54
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
6,617.32
4,962.99
3,308.66
1,654.33
0.00
-1,654.33
-3,308.66
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	642
OHHIZ7-C11	HSCEI	529
OHHIZ7-C11	HSCEI	162
OHHIZ7-P11	HSCEI	529
OHHIZ7-P11	HSCEI	162

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

1,495

공시일	2017-12-28
기준일	2017-12-27

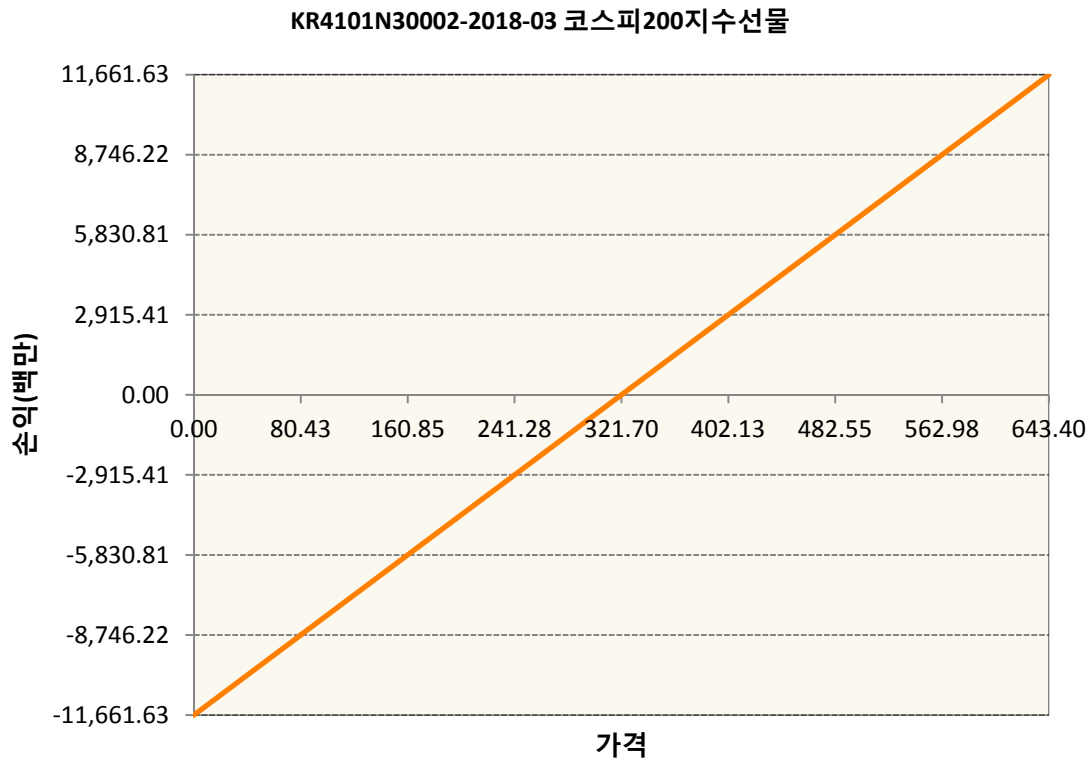
코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼

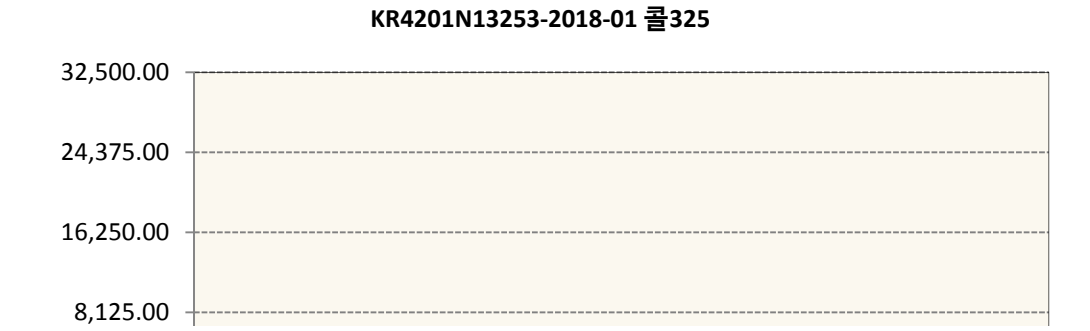
1. 계약금액

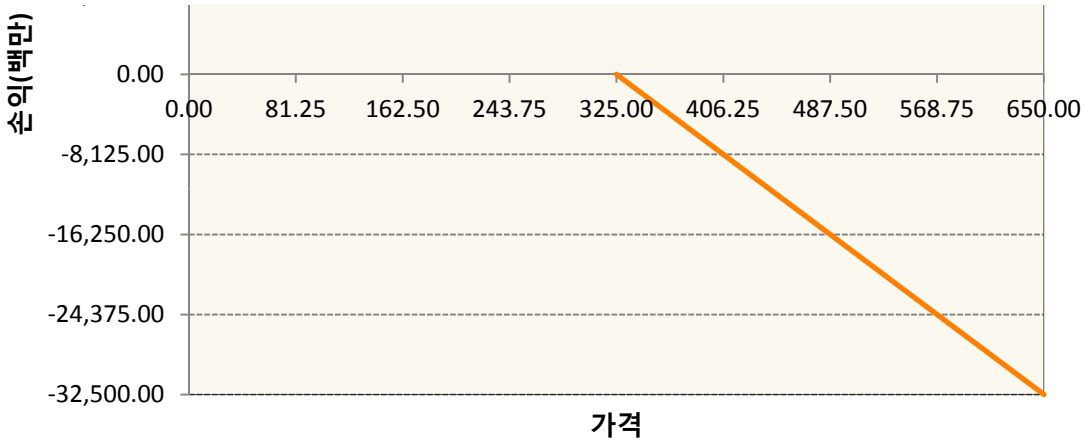
(단위:백만원)

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	11,662	0	11,662	장내
누계	유가증권	스왑	60,200	0	60,200	장외
누계	유가증권	옵션	0	60,875	-60,875	장내

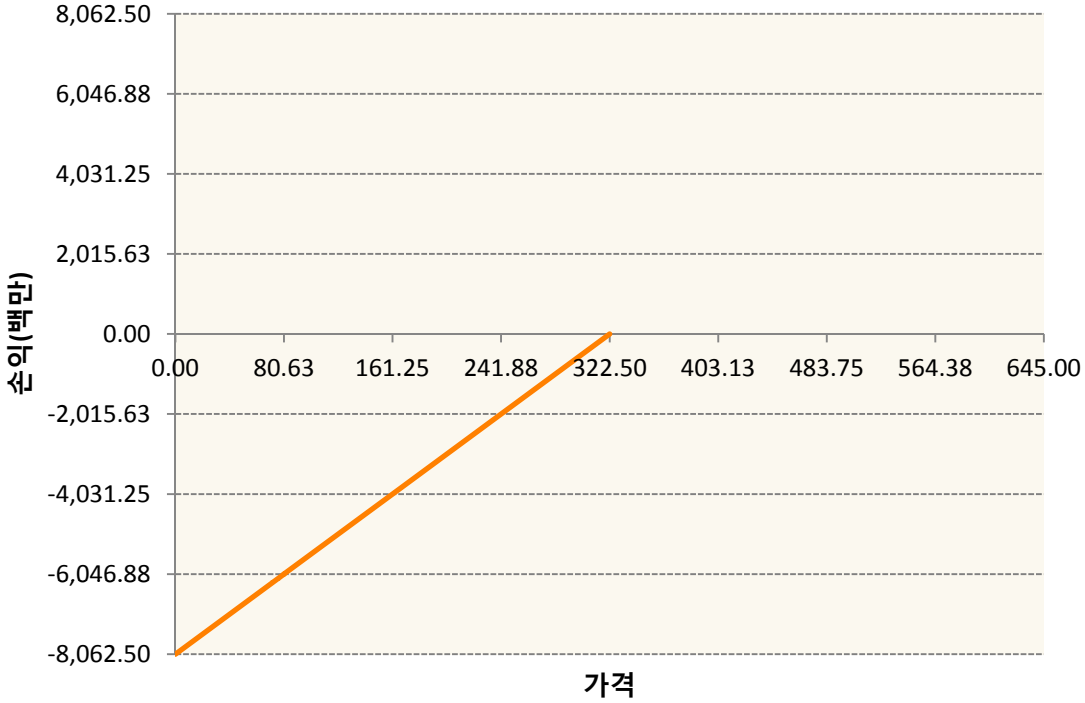
2. 만기시점의 손익구조



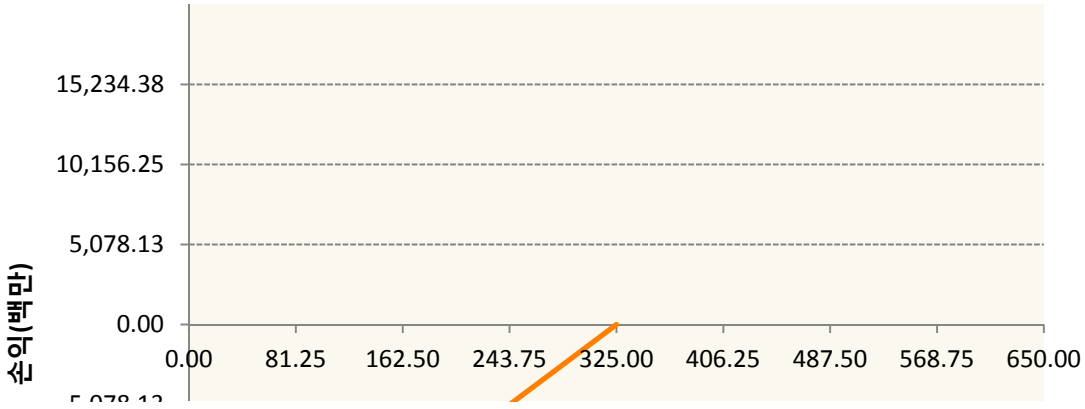




KR4301N13228-2018-01 풋322.5



KR4301N13251-2018-01 풋325





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_2							1,456
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,456	-1,456	-1,456	-1,456	-1,456	-1,456	-1,456
-5.33%	-971	-971	-971	-971	-971	-971	-971
-2.67%	-485	-485	-485	-485	-485	-485	-485
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	485	485	485	485	485	485	485
5.33%	971	971	971	971	971	971	971
8.00%	1,456	1,456	1,456	1,456	1,456	1,456	1,456
2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_3							275
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-275	-275	-275	-275	-275	-275	-275
-5.33%	-184	-184	-184	-184	-184	-184	-184
-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%	184	184	184	184	184	184	184
8.00%	275	275	275	275	275	275	275
2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_4							157
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-157	-157	-157	-157	-157	-157	-157
-5.33%	-105	-105	-105	-105	-105	-105	-105
-2.67%	-52	-52	-52	-52	-52	-52	-52
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	52	52	52	52	52	52	52
5.33%	105	105	105	105	105	105	105
8.00%	157	157	157	157	157	157	157
2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_5							236
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%

-8.00%	-236	-236	-236	-236	-236	-236	-236
-5.33%	-157	-157	-157	-157	-157	-157	-157
-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%	157	157	157	157	157	157	157
8.00%	236	236	236	236	236	236	236
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_6						197
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-197	-197	-197	-197	-197	-197	-197
-5.33%	-131	-131	-131	-131	-131	-131	-131
-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%	131	131	131	131	131	131	131
8.00%	197	197	197	197	197	197	197
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_7						252
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-252	-252	-252	-252	-252	-252	-252
-5.33%	-168	-168	-168	-168	-168	-168	-168
-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%	168	168	168	168	168	168	168
8.00%	252	252	252	252	252	252	252
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_8						466
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-466	-466	-466	-466	-466	-466	-466
-5.33%	-311	-311	-311	-311	-311	-311	-311
-2.67%	-155	-155	-155	-155	-155	-155	-155
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	155	155	155	155	155	155	155
5.33%	311	311	311	311	311	311	311
8.00%	466	466	466	466	466	466	466
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_9						311
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-311	-311	-311	-311	-311	-311	-311
-5.33%	-207	-207	-207	-207	-207	-207	-207
-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%	207	207	207	207	207	207	207
8.00%	311	311	311	311	311	311	311
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_10						275
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-275	-275	-275	-275	-275	-275	-275
-5.33%	-184	-184	-184	-184	-184	-184	-184
-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%	184	184	184	184	184	184	184
8.00%	275	275	275	275	275	275	275
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_11						630
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-630	-630	-630	-630	-630	-630	-630
-5.33%	-420	-420	-420	-420	-420	-420	-420
-2.67%	-210	-210	-210	-210	-210	-210	-210
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	210	210	210	210	210	210	210
5.33%	420	420	420	420	420	420	420
8.00%	630	630	630	630	630	630	630
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_12						472
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-472	-472	-472	-472	-472	-472	-472
-5.33%	-315	-315	-315	-315	-315	-315	-315
-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%	315	315	315	315	315	315	315
8.00%	472	472	472	472	472	472	472
	KR4101N30(2018-03 코스피200지수선물						929
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-929	-929	-929	-929	-929	-929	-929
-5.33%	-619	-619	-619	-619	-619	-619	-619
-2.67%	-310	-310	-310	-310	-310	-310	-310
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	310	310	310	310	310	310	310
5.33%	619	619	619	619	619	619	619
8.00%	929	929	929	929	929	929	929
	KR4201N13: 2018-01 콜325						1,830

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	441	439	434	427	418	406	392
-5.33%	427	415	400	381	359	334	306
-2.67%	359	328	294	257	218	177	134
0%	154	103	52	0	-52	-105	-157
2.67%	-268	-320	-373	-427	-480	-534	-588
5.33%	-903	-939	-978	-1,019	-1,062	-1,107	-1,153
8.00%	-1,676	-1,692	-1,713	-1,738	-1,766	-1,796	-1,830
	KR4301N132 2018-01 풋322.5						581

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-580	-580	-580	-580	-581	-581	-581
-5.33%	-367	-367	-367	-368	-368	-369	-370
-2.67%	-156	-158	-161	-163	-167	-170	-174
0%	20	13	7	0	-7	-14	-20
2.67%	101	96	91	86	80	75	69
5.33%	114	113	112	111	109	106	104
8.00%	114	114	114	114	114	113	113
	KR4301N132 2018-01 풋325						1,504

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,504	-1,504	-1,504	-1,504	-1,504	-1,504	-1,504
-5.33%	-971	-971	-971	-971	-972	-973	-975
-2.67%	-440	-442	-445	-450	-455	-462	-469
0%	43	29	15	0	-15	-31	-47
2.67%	321	306	290	274	258	242	225
5.33%	385	381	376	370	363	355	346
8.00%	389	389	388	388	386	384	382

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

9,635

공시일	2017-12-28
기준일	2017-12-27

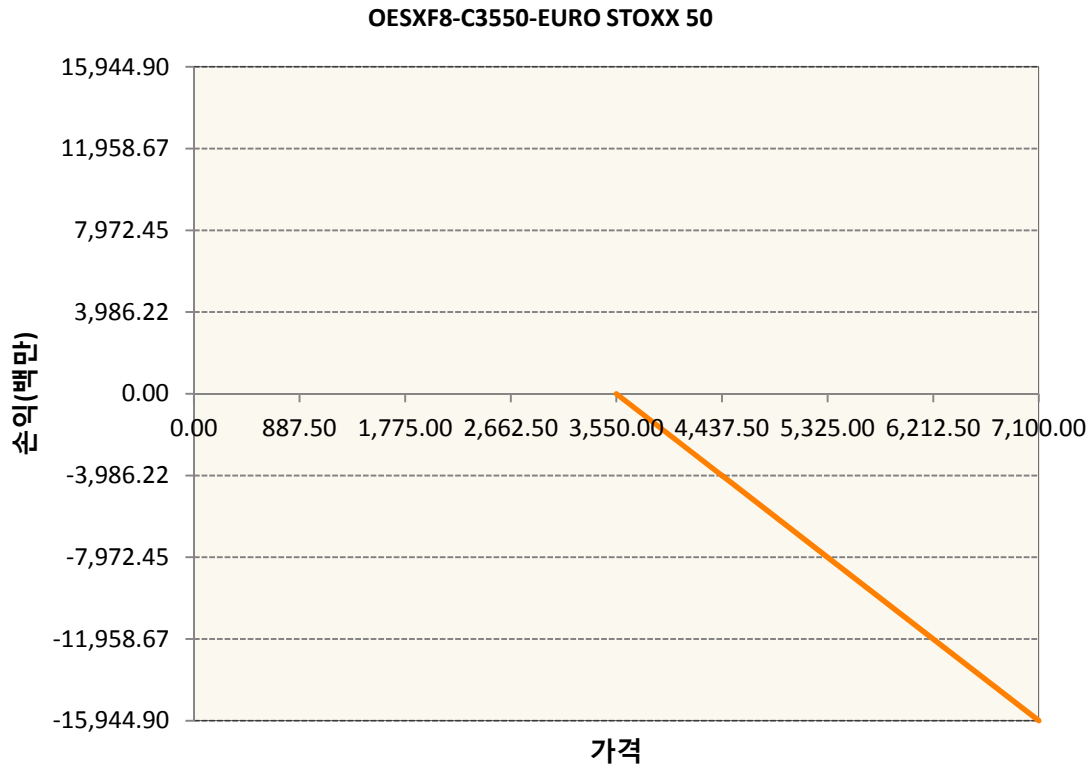
유로커버드콜모(주식혼합-파생형

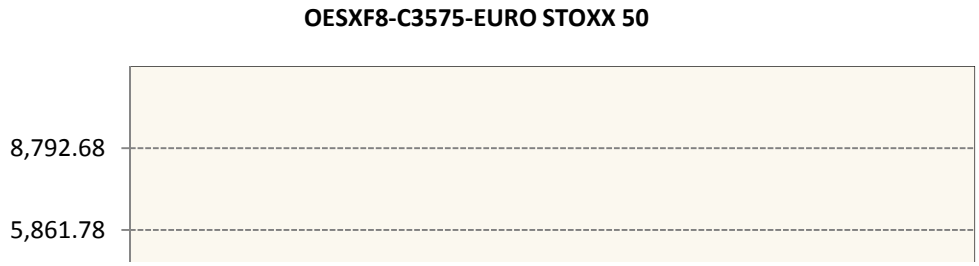
1. 계약금액

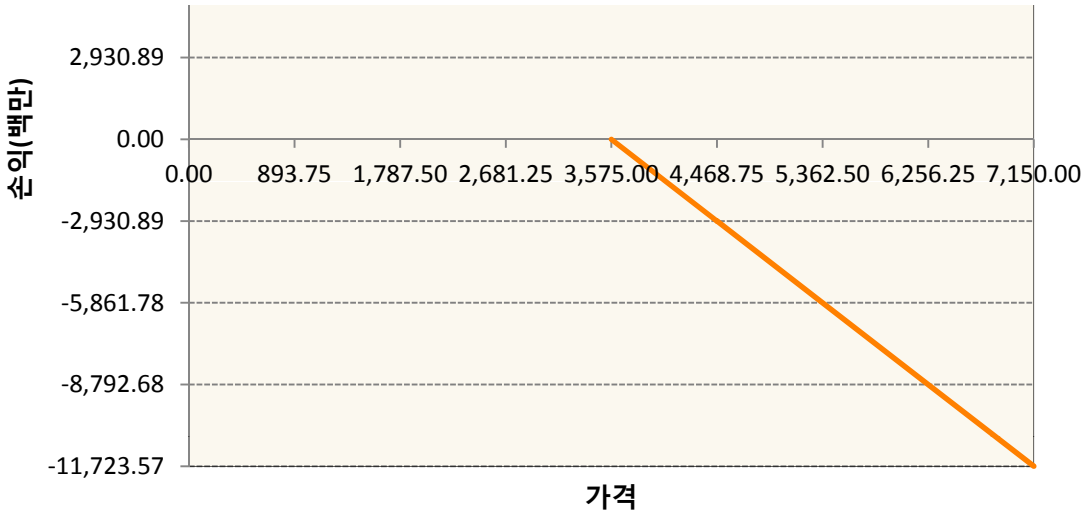
(단위:백만원)

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	19,413	0	19,413	
누계	유가증권	스왑	95,702	0	95,702	장외
누계	유가증권	옵션	0	55,337	-55,337	장내
누계	지수	스왑	51,042	0	51,042	장외

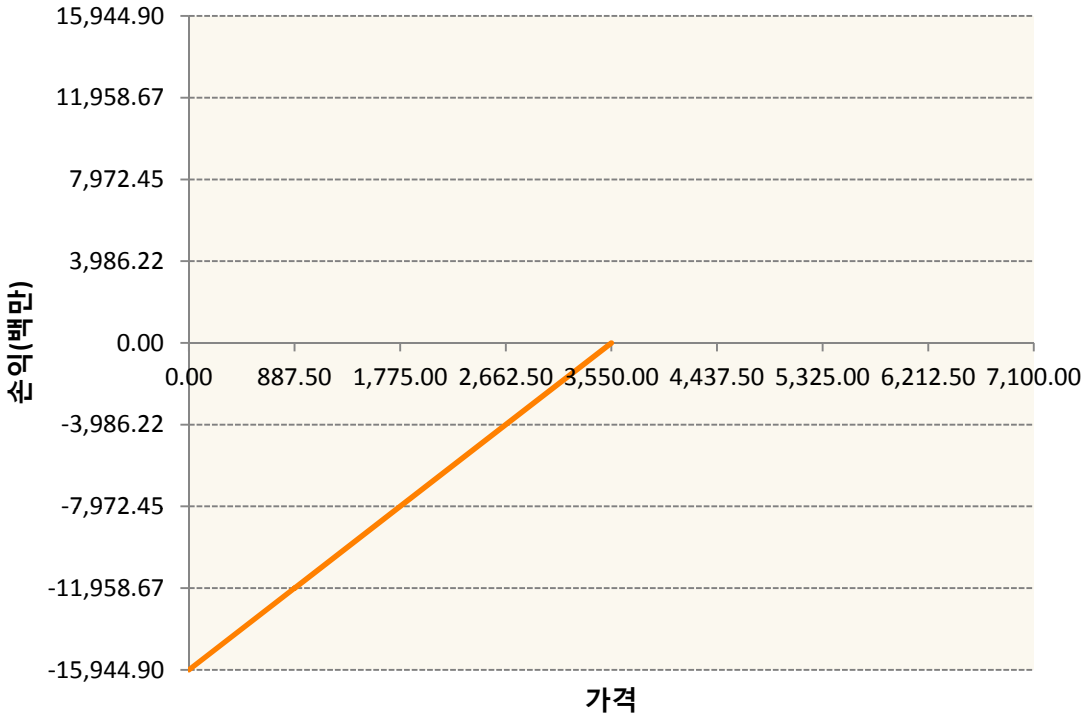
2. 만기시점의 손익구조



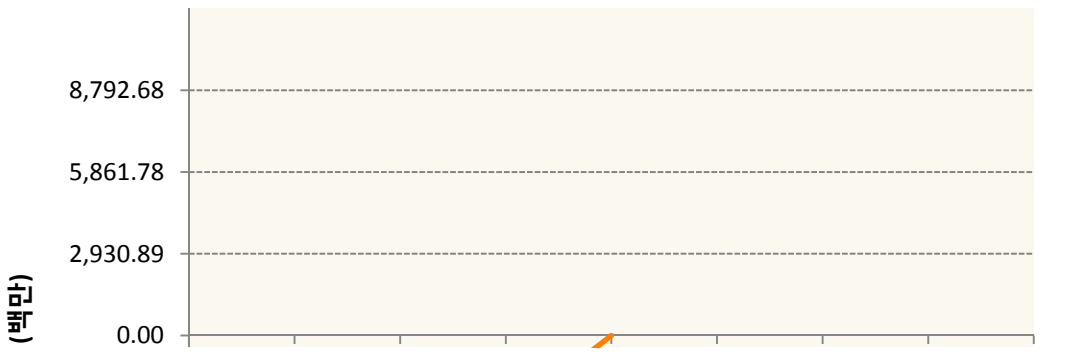


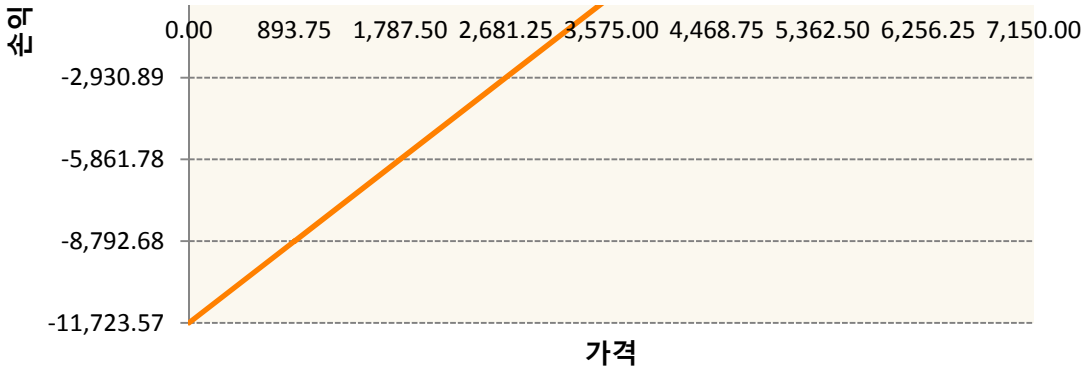


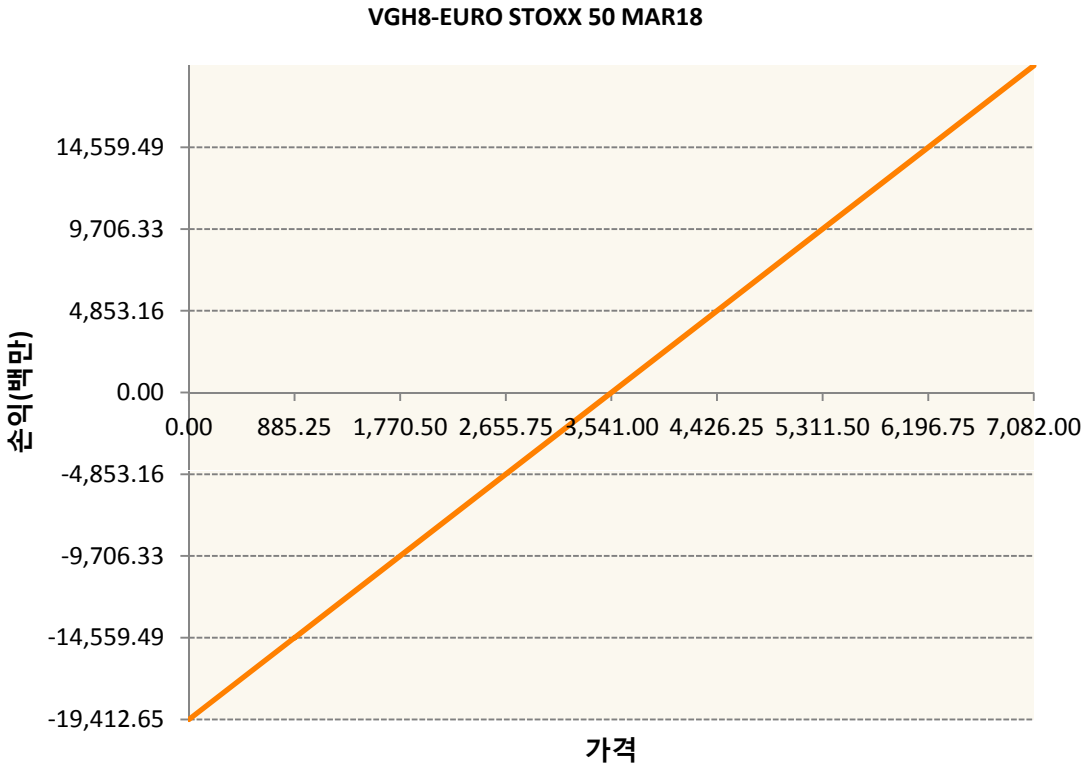
OESXF8-P3550-EURO STOXX 50



OESXF8-P3575-EURO STOXX 50







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)	(단위:백만원)
260105SGPX SG EURO Covered CALL STRATEGY - 994.569	61
260105SQPX SG EURO Covered CALL STRATEGY	71
OESXF8-C35 EURO STOXX 50	1,276
OESXF8-C35 EURO STOXX 50	938
OESXF8-P35 EURO STOXX 50	1,276
OESXF8-P35 EURO STOXX 50	938
VGH8 EURO STOXX 50 MAR18	1,553

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

3,483

공시일	2017-12-28
기준일	2017-12-27

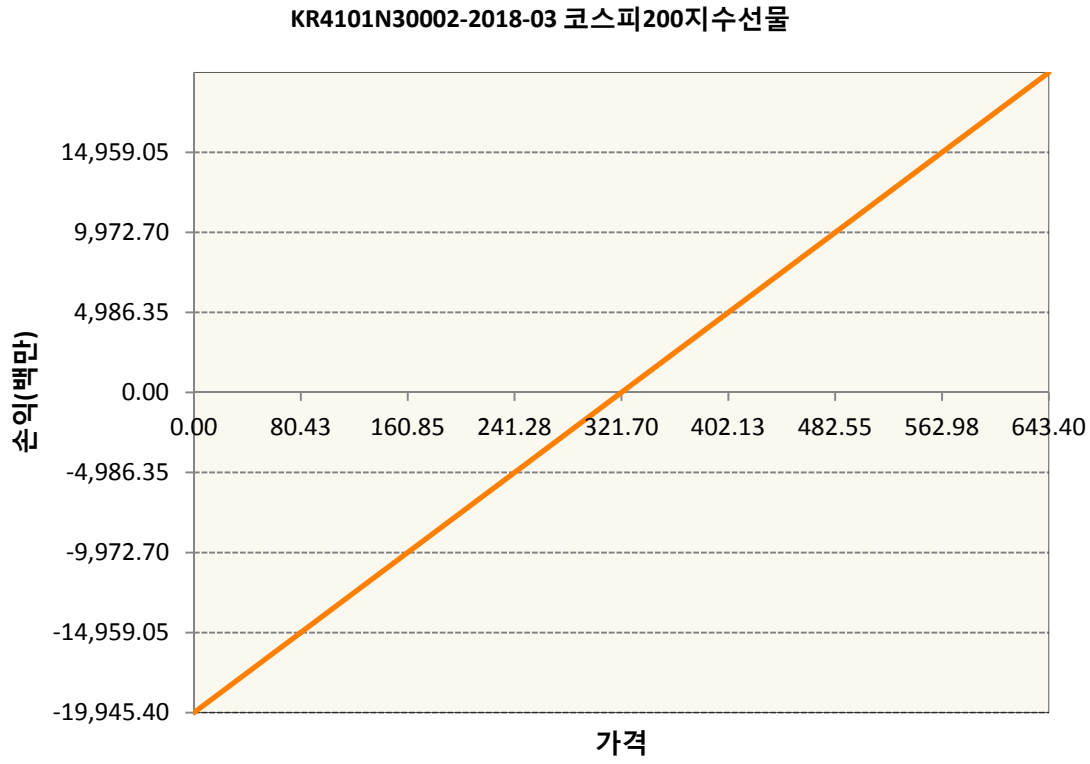
ETF스마트레버리지목표전환형8호

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	19,945	0	19,945	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101N30(2018-03 코스피200지수선물							1,588
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,588	-1,588	-1,588	-1,588	-1,588	-1,588	-1,588
-5.33%	-1,059	-1,059	-1,059	-1,059	-1,059	-1,059	-1,059
-2.67%	-529	-529	-529	-529	-529	-529	-529
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	529	529	529	529	529	529	529
5.33%	1,059	1,059	1,059	1,059	1,059	1,059	1,059
8.00%	1,588	1,588	1,588	1,588	1,588	1,588	1,588

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

936

공시일	2017-12-28
기준일	2017-12-27

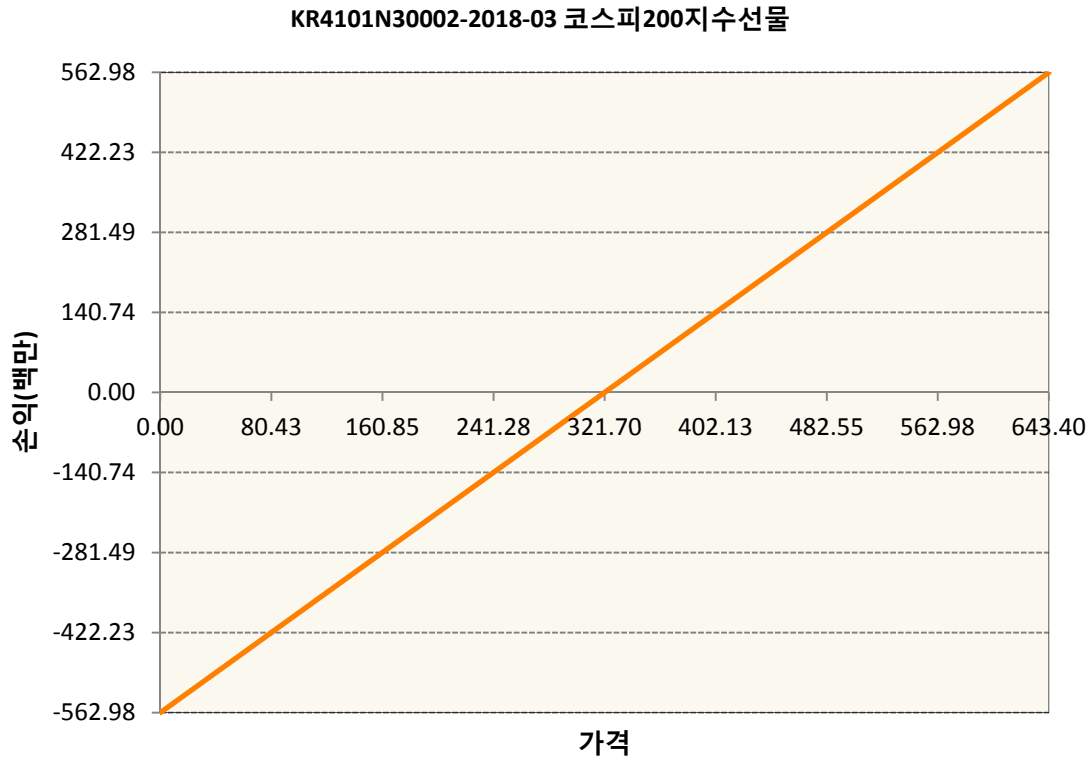
ETF스마트레버리지목표전환형9호

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	563	0	563	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101N30(2018-03 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)

26

공시일	2017-12-28
기준일	2017-12-27

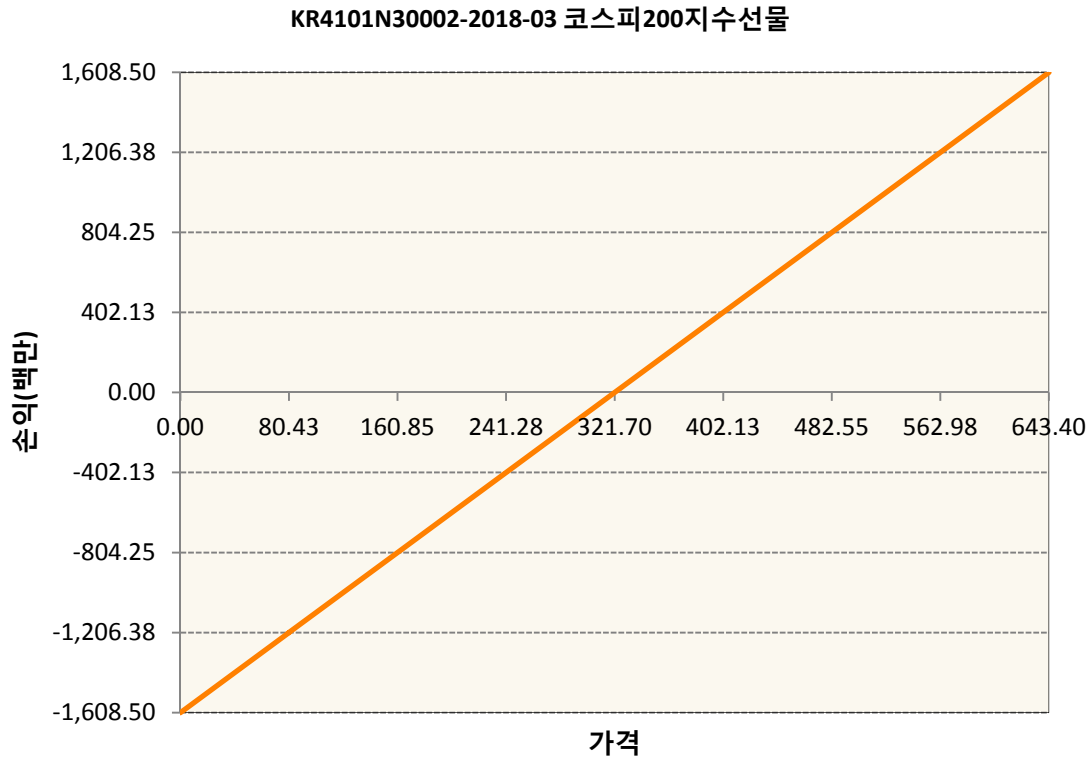
ETF스마트레버리지목표전환형10

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	1,609	0	1,609	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101N30(2018-03 코스피200지수선물							128
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-128	-128	-128	-128	-128	-128	-128
-5.33%	-85	-85	-85	-85	-85	-85	-85
-2.67%	-43	-43	-43	-43	-43	-43	-43
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	43	43	43	43	43	43	43
5.33%	85	85	85	85	85	85	85
8.00%	128	128	128	128	128	128	128

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

75

공시일	2017-12-28
기준일	2017-12-27

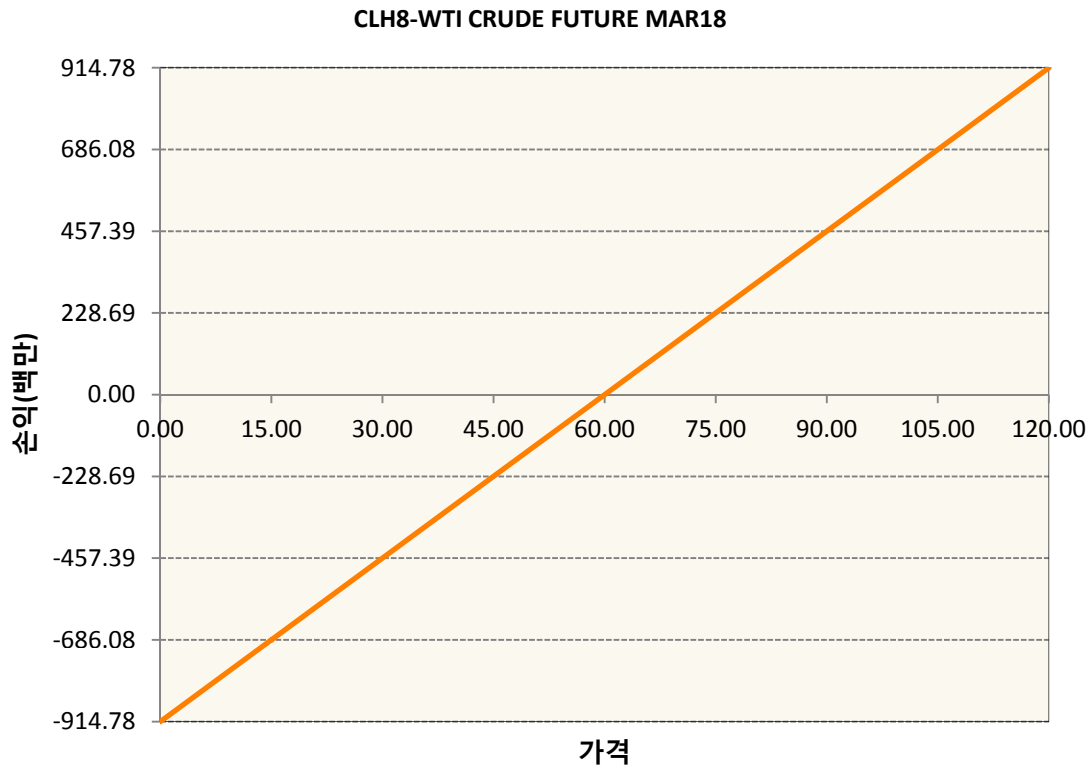
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

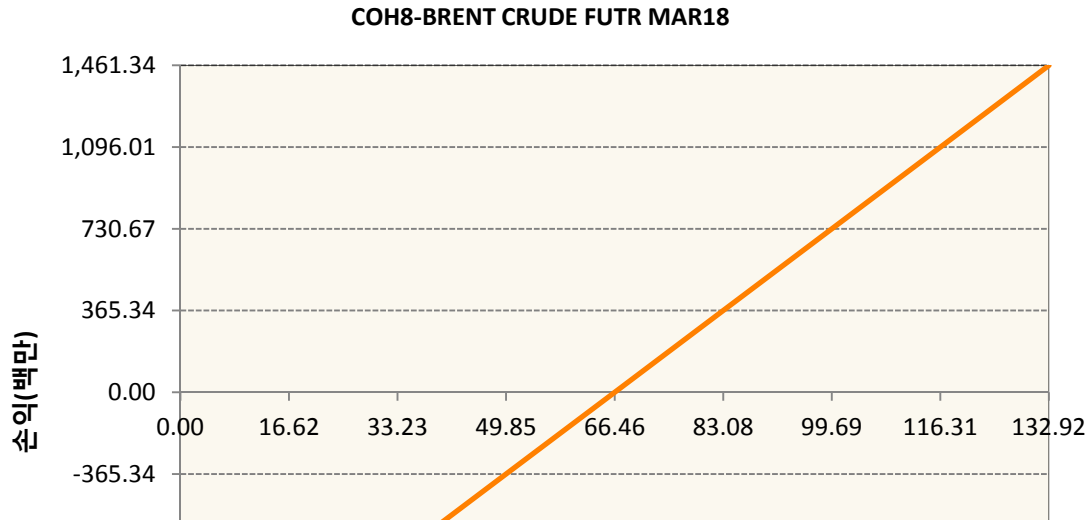
1. 계약금액

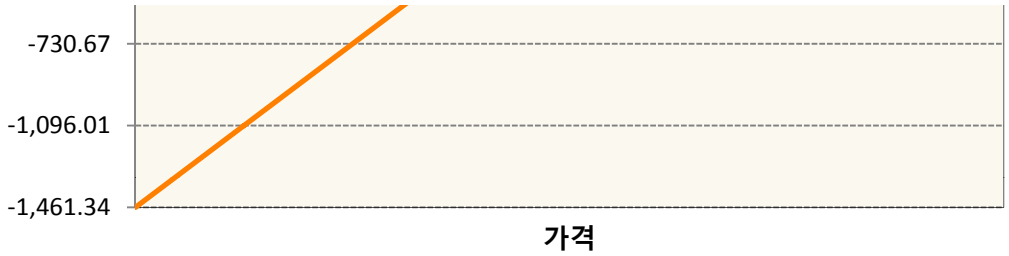
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	4,783	858	3,925	

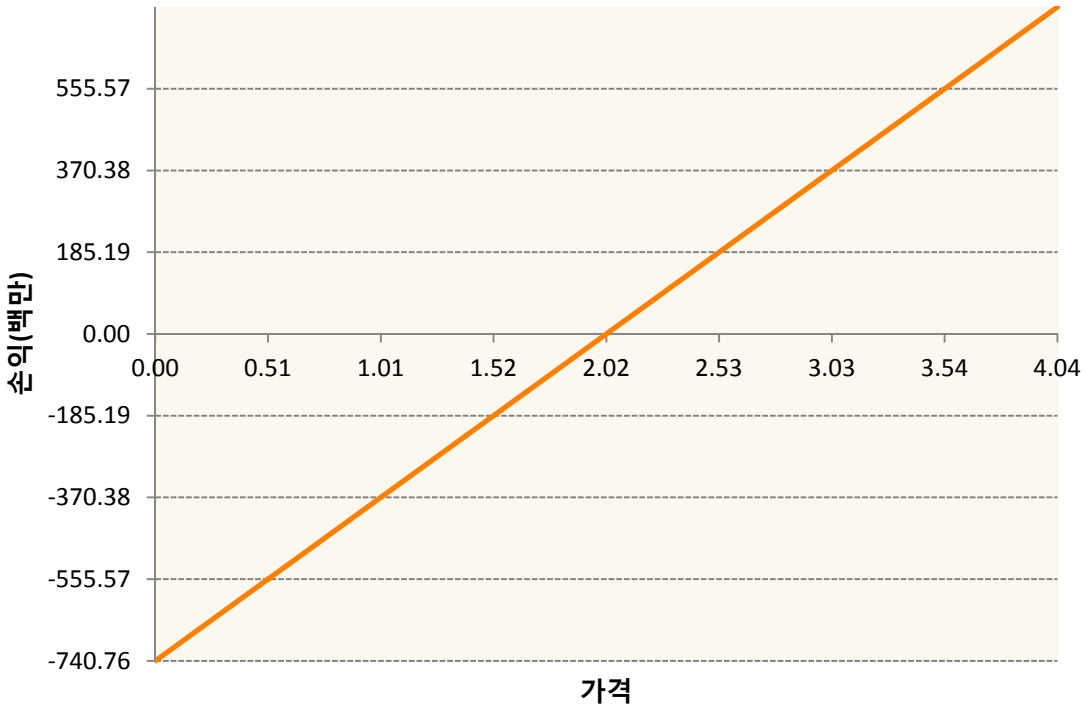
2. 만기시점의 손익구조



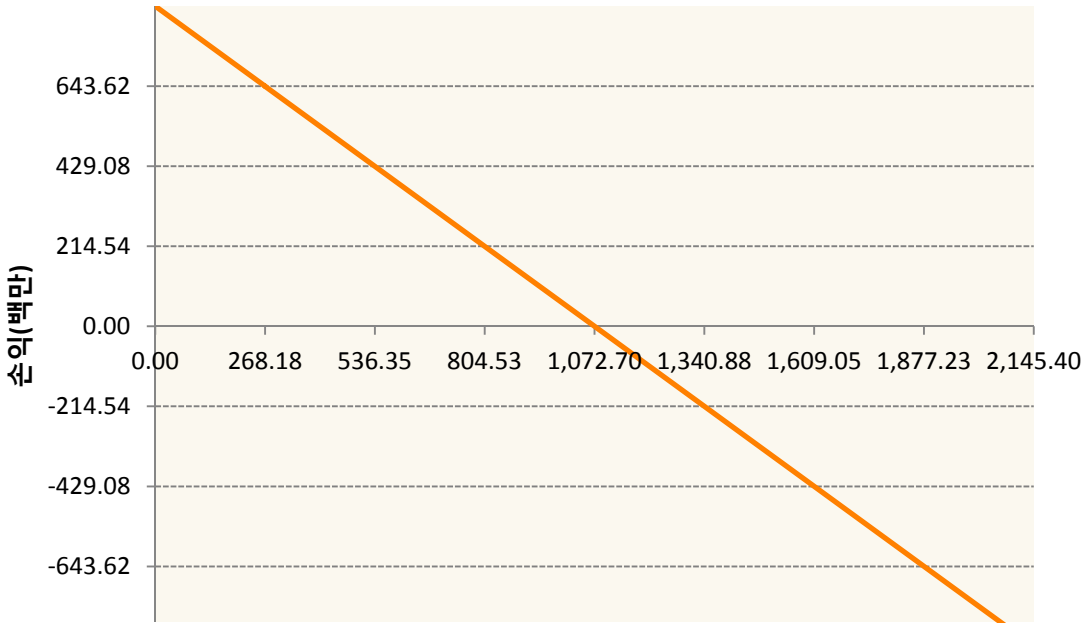


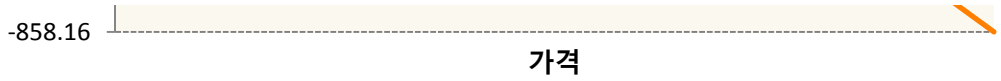


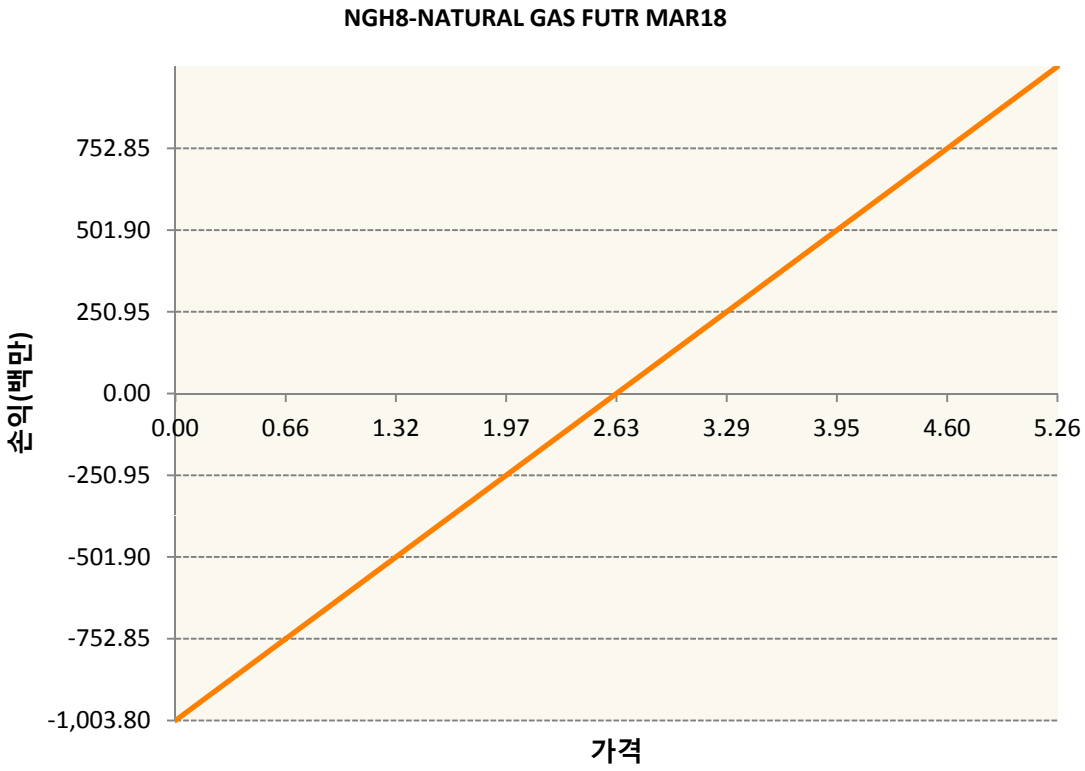
HOH8-NY Harb ULSD Fut MAR18

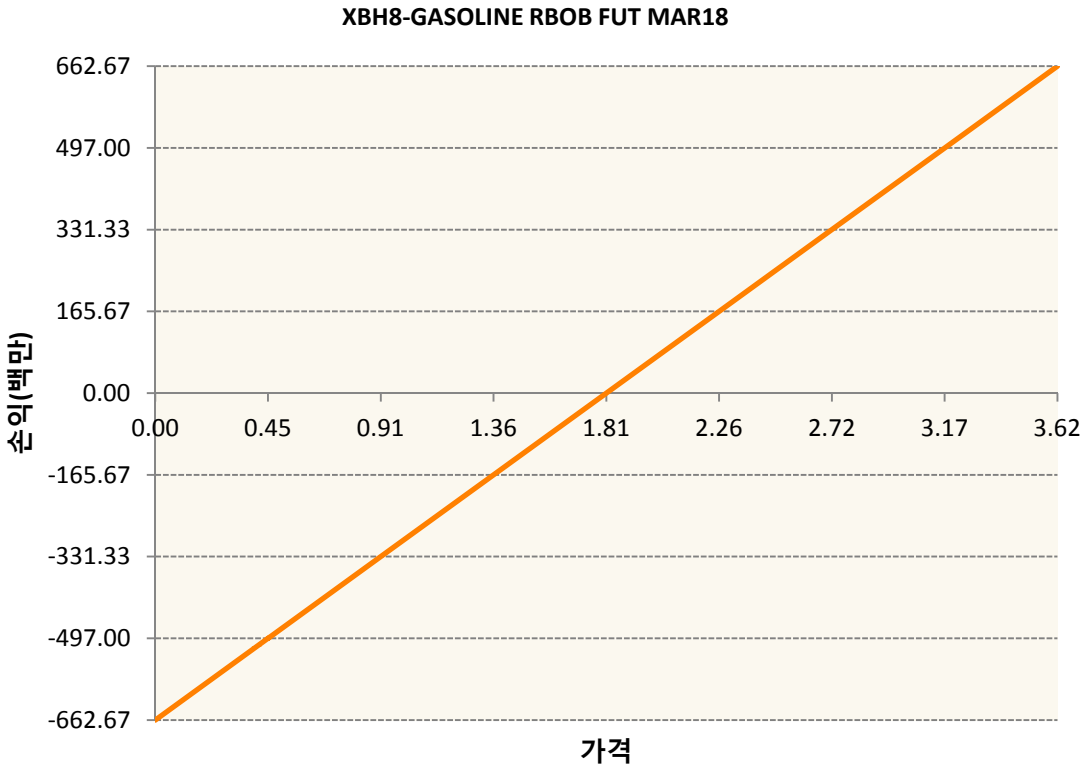


KR4175N10008-2018-01 달러선물




-858.16
가격


NGH8-NATURAL GAS FUTR MAR18
752.85
501.90
250.95
0.00
-250.95
-501.90
-752.85
-1,003.80
0.00
0.66
1.32
1.97
2.63
3.29
3.95
4.60
5.26
손익(백만)
가격


XBH8-GASOLINE RBOB FUT MAR18
662.67
497.00
331.33
165.67
0.00
-165.67
-331.33
-497.00
-662.67
0.00
0.45
0.91
1.36
1.81
2.26
2.72
3.17
3.62
손익(백만)
가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLH8	WTI CRUDE FUTURE MAR18	73
COH8	BRENT CRUDE FUTR MAR18	117
HOH8	NY Harb ULSD Fut MAR18	59
KR4175N10(	2018-01 달러선물	69
NGH8	NATURAL GAS FUTR MAR18	80
XBH8	GASOLINE RBOB FUT MAR18	53

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

638

공시일	2017-12-28
기준일	2017-12-27

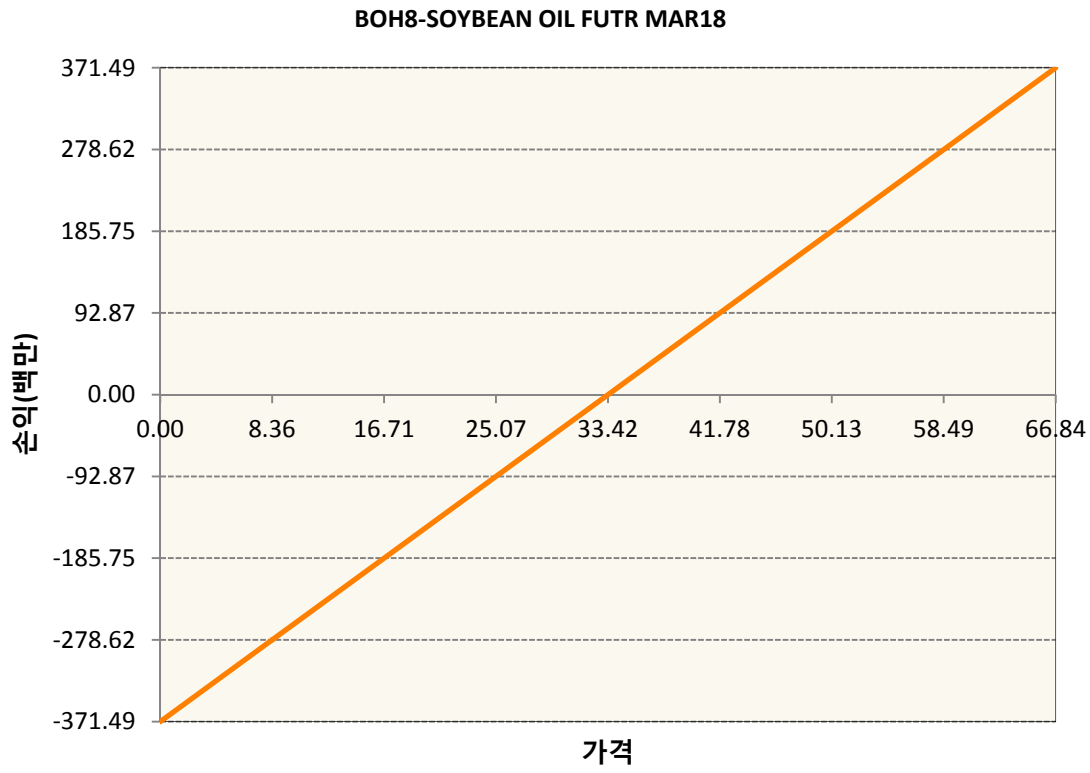
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

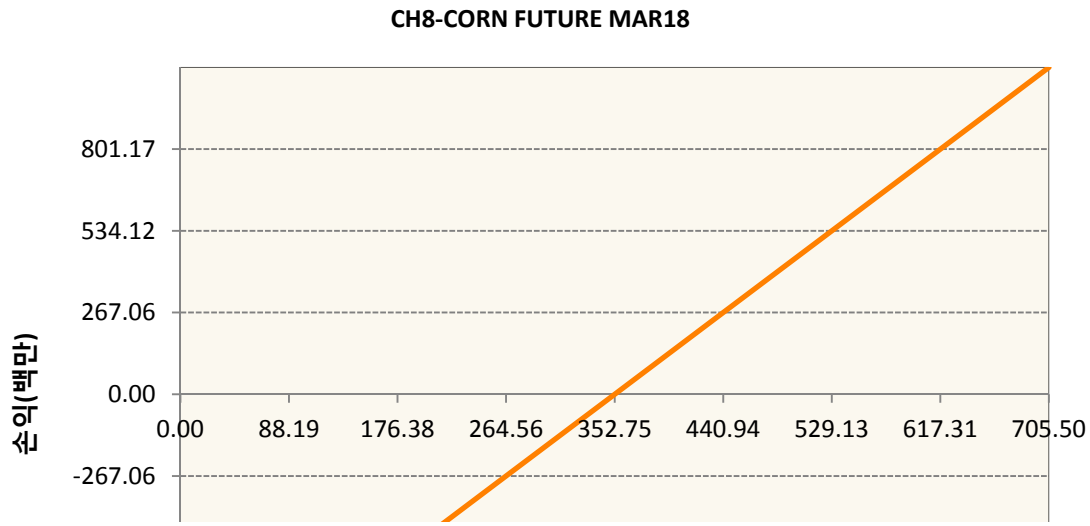
1. 계약금액

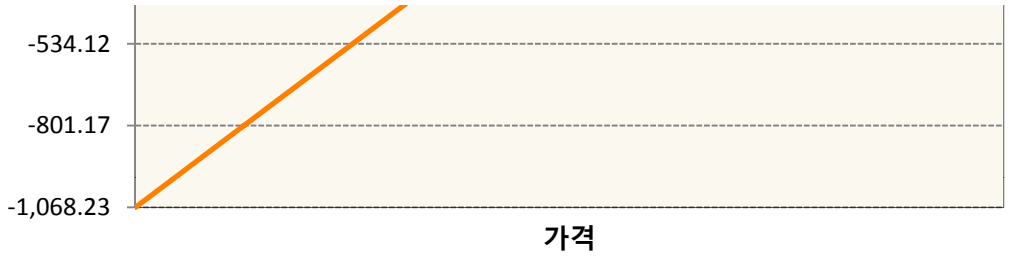
(단위:백만원)

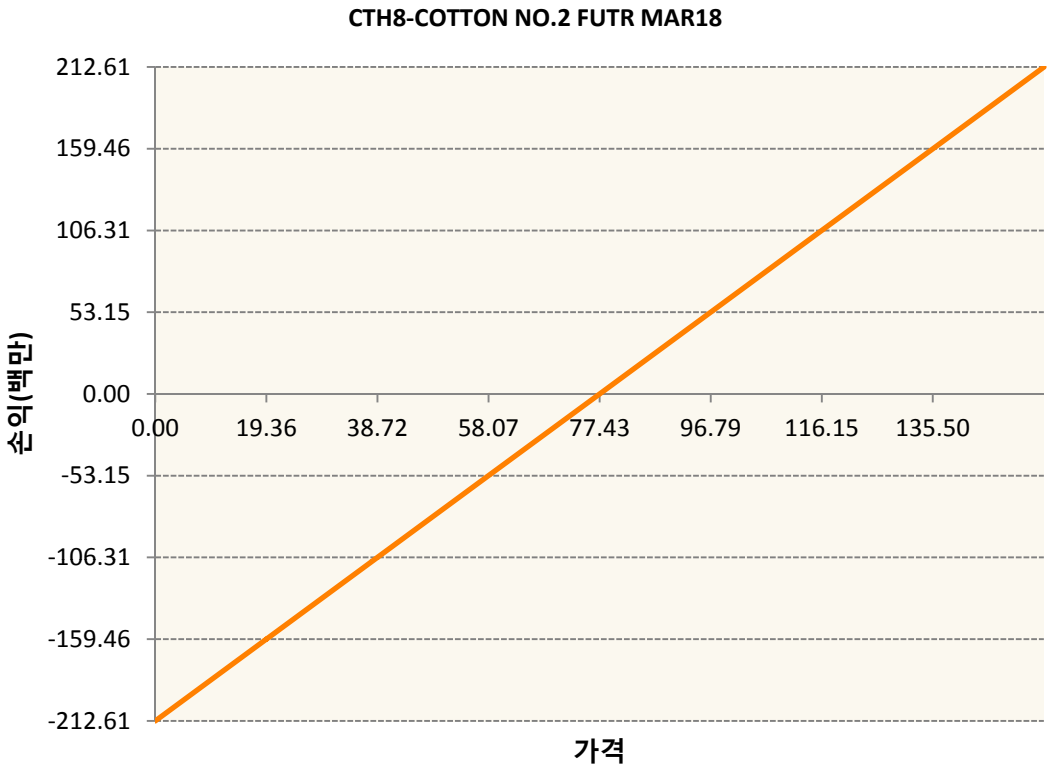
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	4,243	322	3,921	

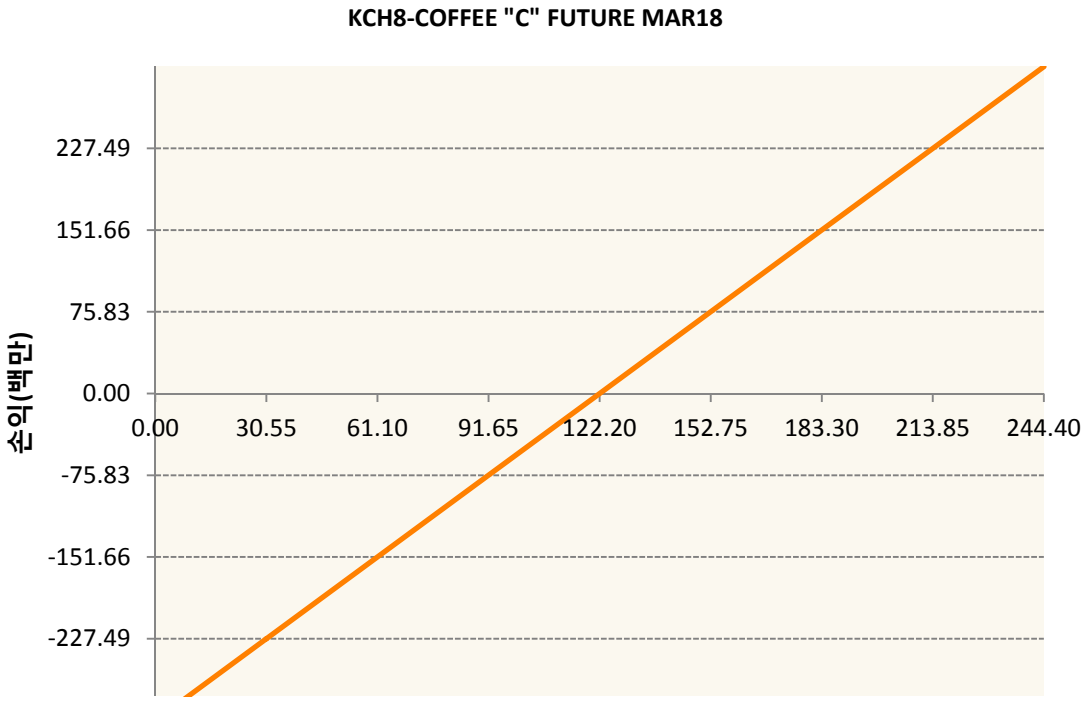
2. 만기시점의 손익구조

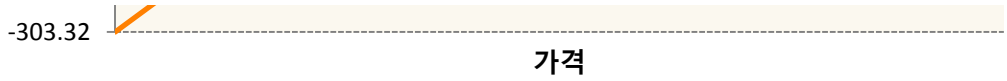


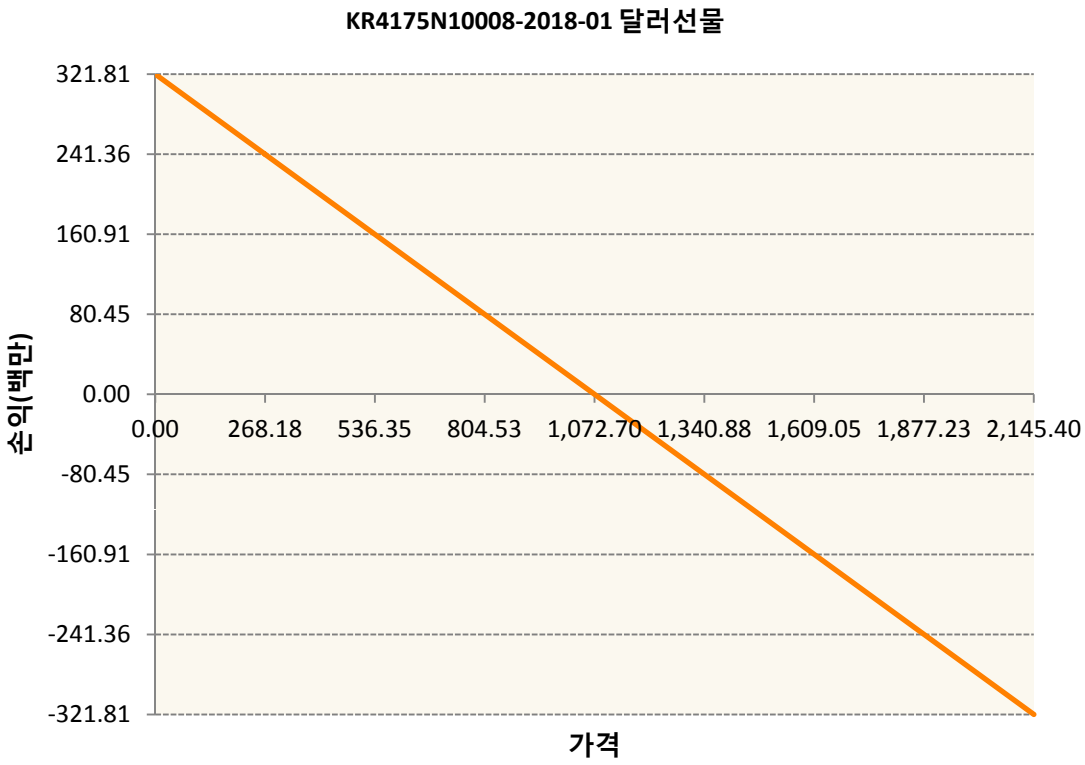


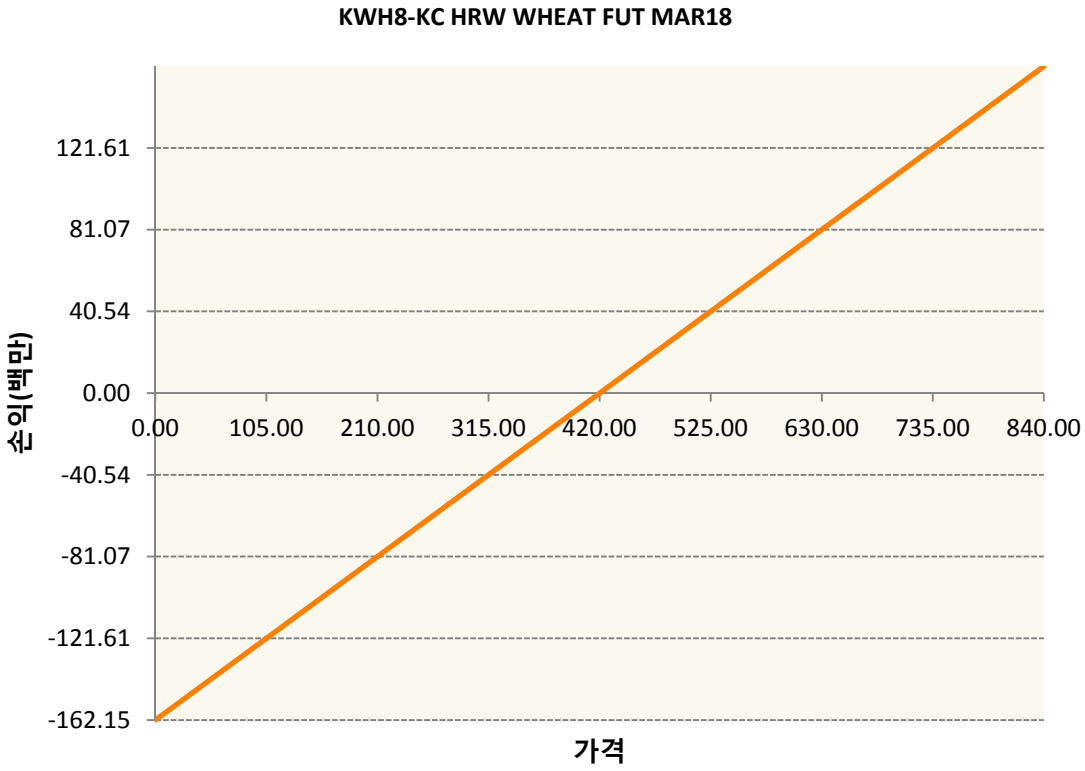

-534.12
-801.17
-1,068.23
가격

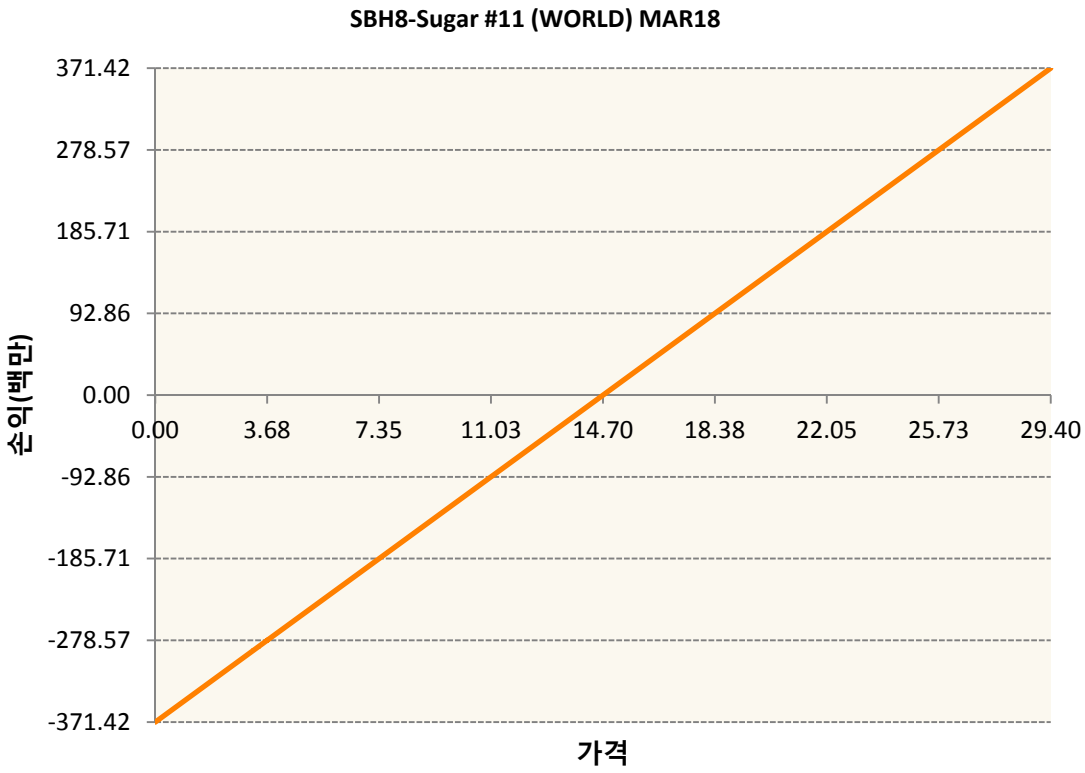

CTH8-COTTON NO.2 FUTR MAR18
212.61
159.46
106.31
53.15
0.00
-53.15
-106.31
-159.46
-212.61
0.00
19.36
38.72
58.07
77.43
96.79
116.15
135.50
손익(백만)
가격

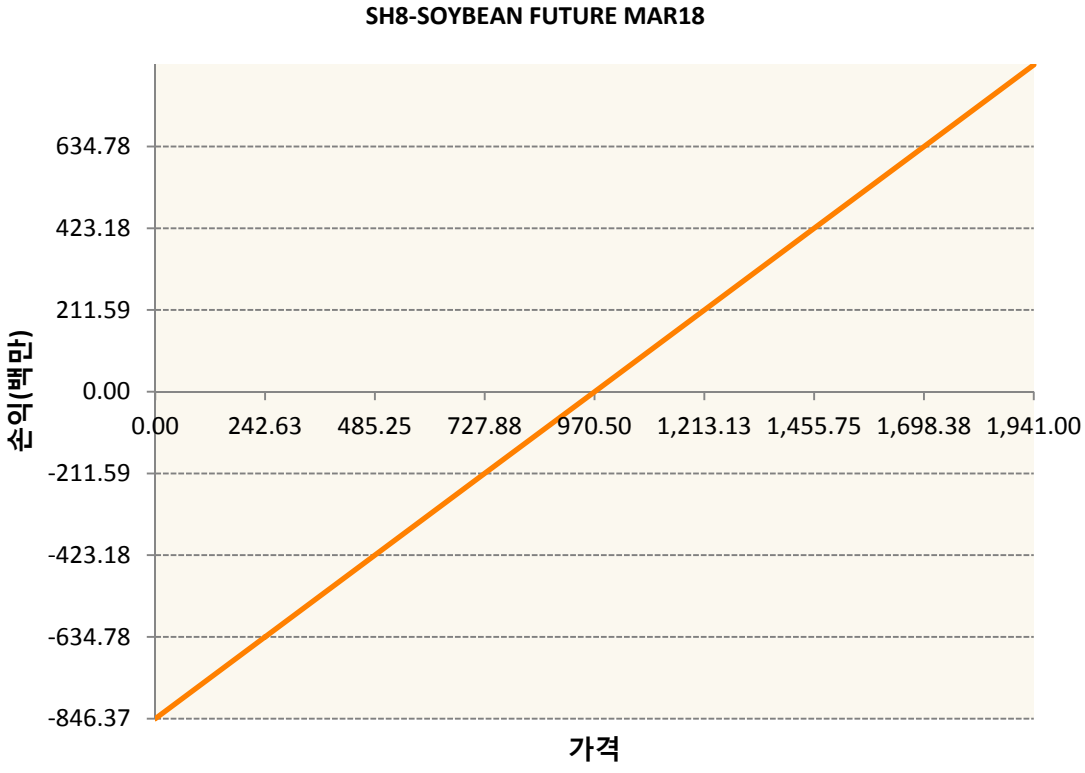

KCH8-COFFEE "C" FUTURE MAR18
227.49
151.66
75.83
0.00
-75.83
-151.66
-227.49
0.00
30.55
61.10
91.65
122.20
152.75
183.30
213.85
244.40
손익(백만)


-303.32
가격

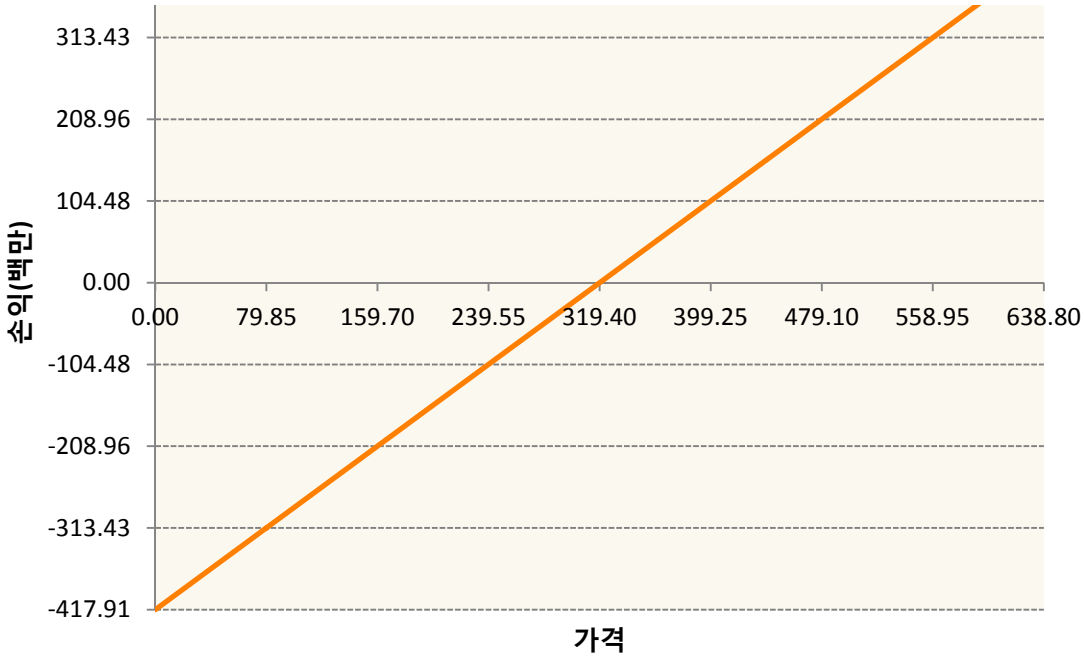

KR4175N10008-2018-01 달러선물
321.81
241.36
160.91
80.45
0.00
-80.45
-160.91
-241.36
-321.81
0.00
268.18
536.35
804.53
1,072.70
1,340.88
1,609.05
1,877.23
2,145.40
손익(백만)
가격

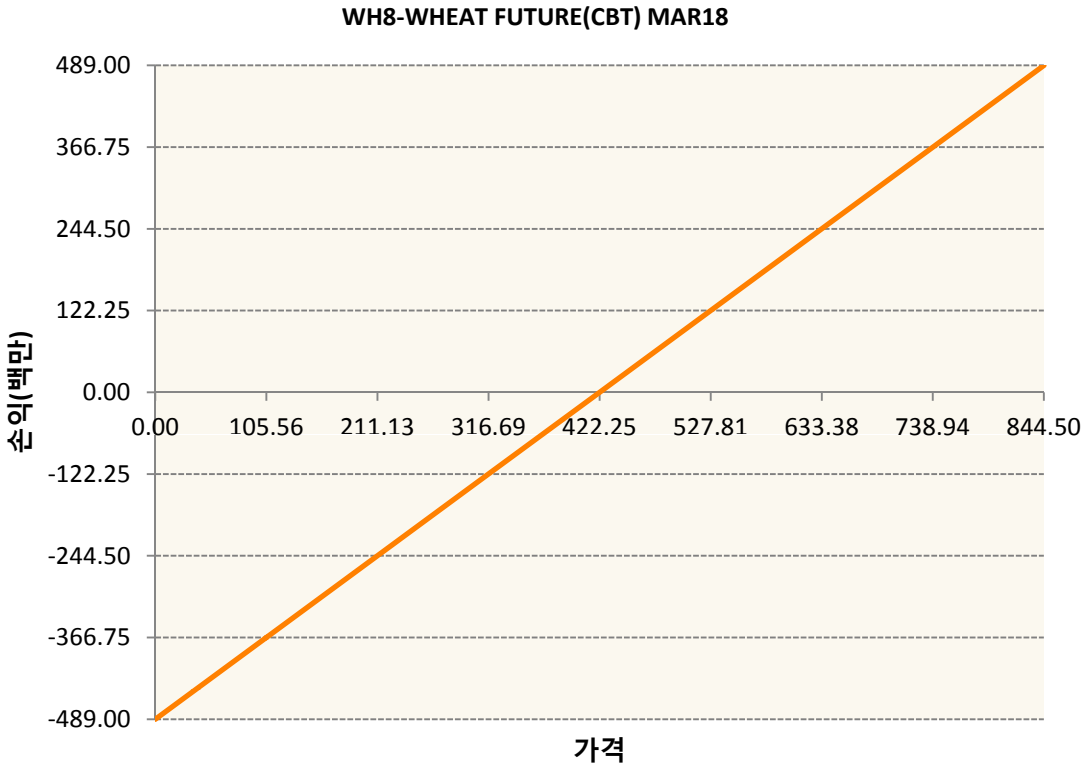

KWH8-KC HRW WHEAT FUT MAR18
121.61
81.07
40.54
0.00
-40.54
-81.07
-121.61
-162.15
0.00
105.00
210.00
315.00
420.00
525.00
630.00
735.00
840.00
손익(백만)
가격


SBH8-Sugar #11 (WORLD) MAR18
371.42
278.57
185.71
92.86
0.00
-92.86
-185.71
-278.57
-371.42
0.00
3.68
7.35
11.03
14.70
18.38
22.05
25.73
29.40
손익(백만)
가격


SH8-SOYBEAN FUTURE MAR18
634.78
423.18
211.59
0.00
-211.59
-423.18
-634.78
-846.37
0.00
242.63
485.25
727.88
970.50
1,213.13
1,455.75
1,698.38
1,941.00
손익(백만)
가격


SMH8-SOYBEAN MEAL FUTR MAR18
417.91





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
BOH8	SOYBEAN OIL FUTR MAR18	30
CH8	CORN FUTURE MAR18	85
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	30
SH8	SOYBEAN FUTURE MAR18	68
SMH8	SOYBEAN MEAL FUTR MAR18	33
WH8	WHEAT FUTURE(CBT) MAR18	39

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

358