공시일	2017-12-29
기준일	2017-12-28

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	2017-12-29
기준일	2017-12-28

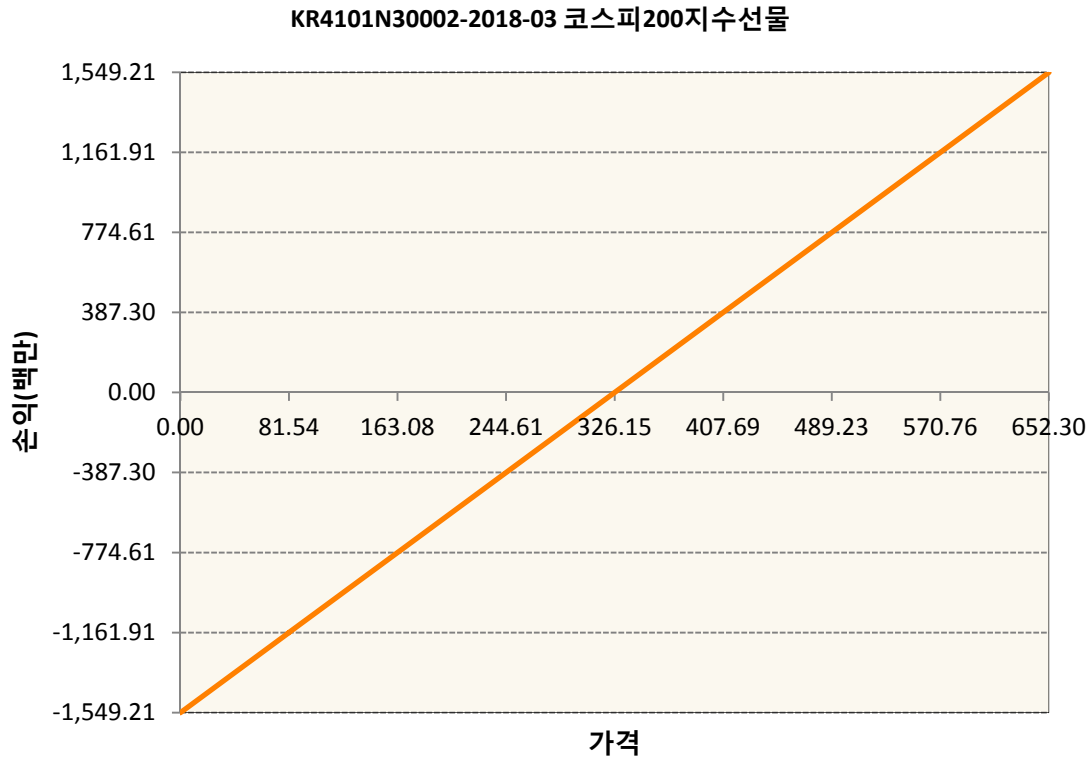
스마트인덱스모

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	1,549	0	1,549	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101N30(2018-03 코스피200지수선물							123
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-123	-123	-123	-123	-123	-123	-123
-5.33%	-82	-82	-82	-82	-82	-82	-82
-2.67%	-41	-41	-41	-41	-41	-41	-41
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	41	41	41	41	41	41	41
5.33%	82	82	82	82	82	82	82
8.00%	123	123	123	123	123	123	123

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

73

공시일	2017-12-29
기준일	2017-12-28

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)

351

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-12-29
기준일	2017-12-28

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	401

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

360

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-12-29
기준일	2017-12-28

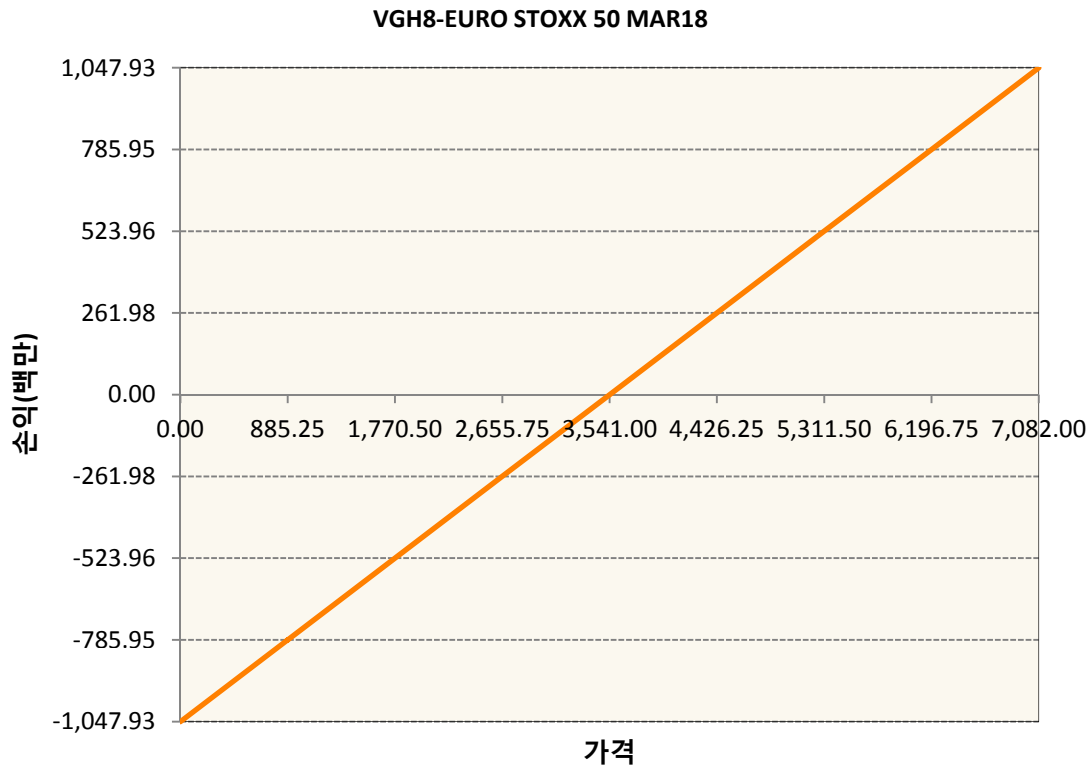
유로인덱스모(주식-파생형)

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)

47

공시일	2017-12-29
기준일	2017-12-28

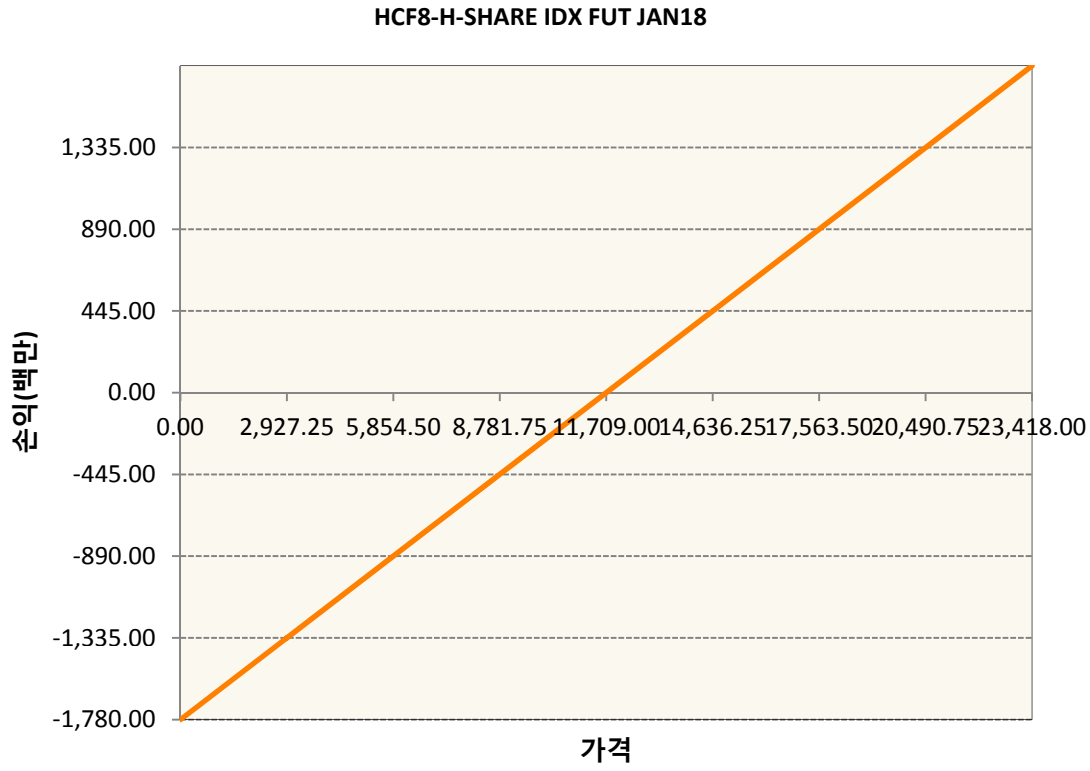
차이나인덱스모(주식-파생형)

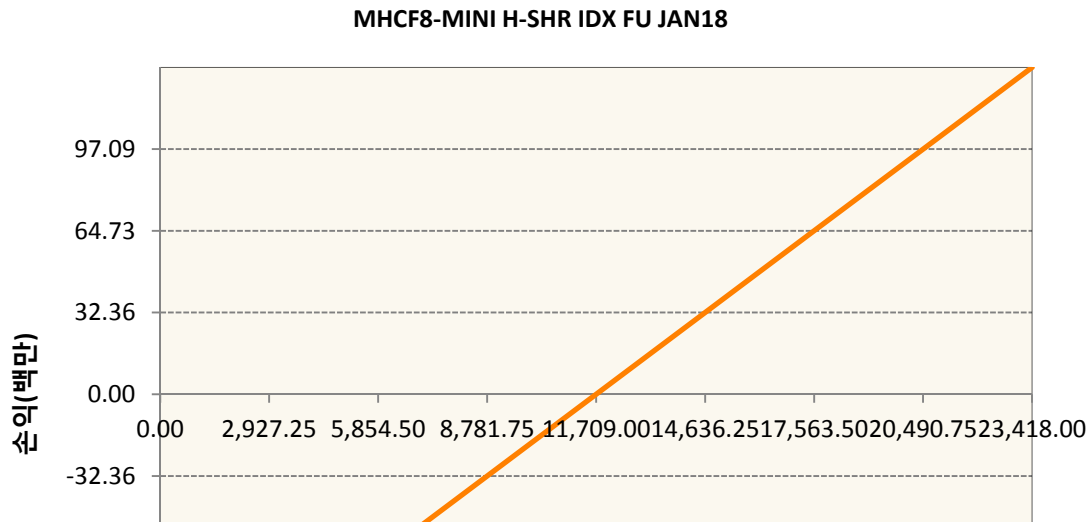
1. 계약금액

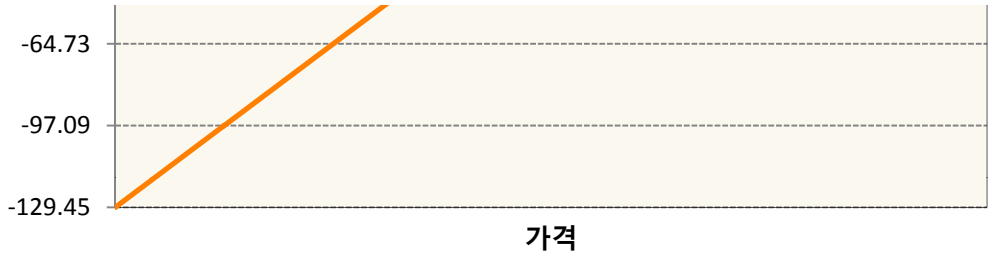
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,909	0	1,909	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)
	121

공시일	2017-12-29
기준일	2017-12-28

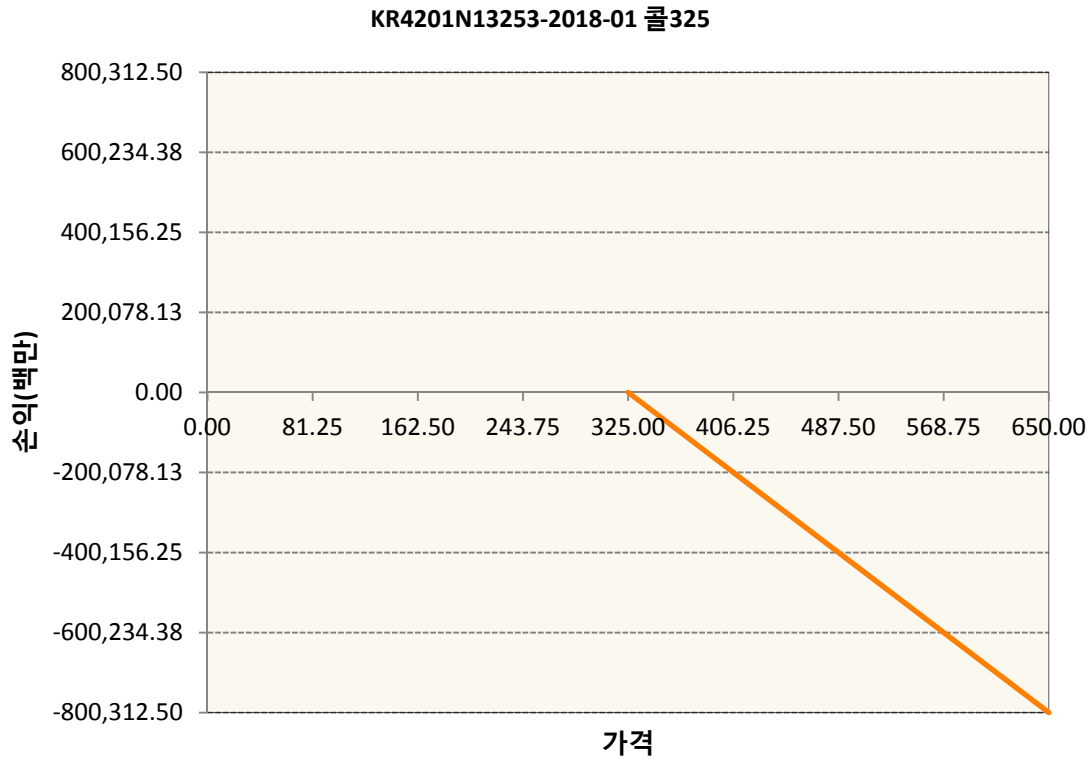
커버드콜모(주식혼합-파생형)

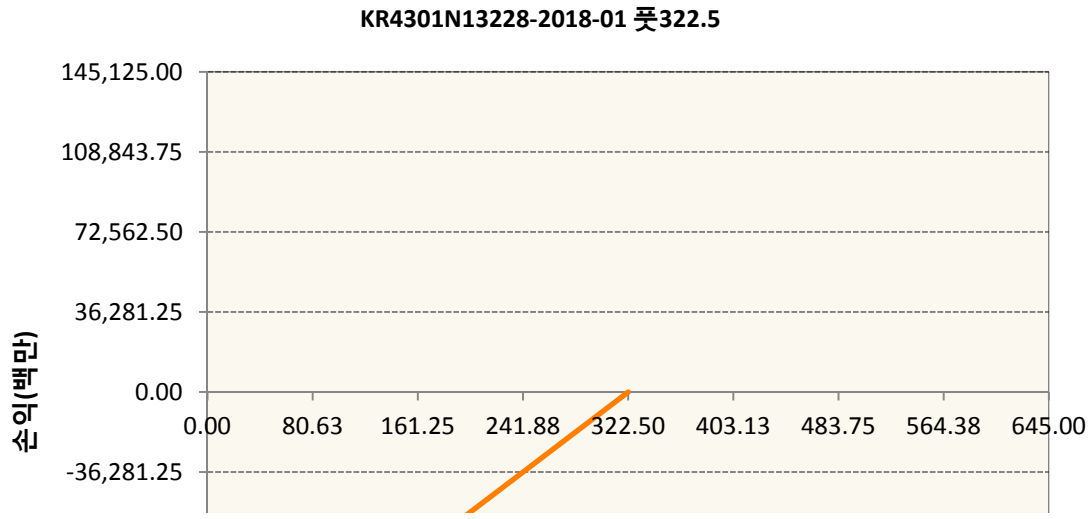
1. 계약금액

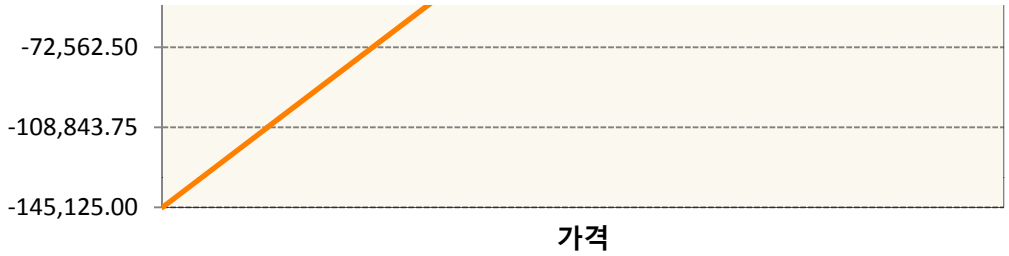
(단위:백만원)

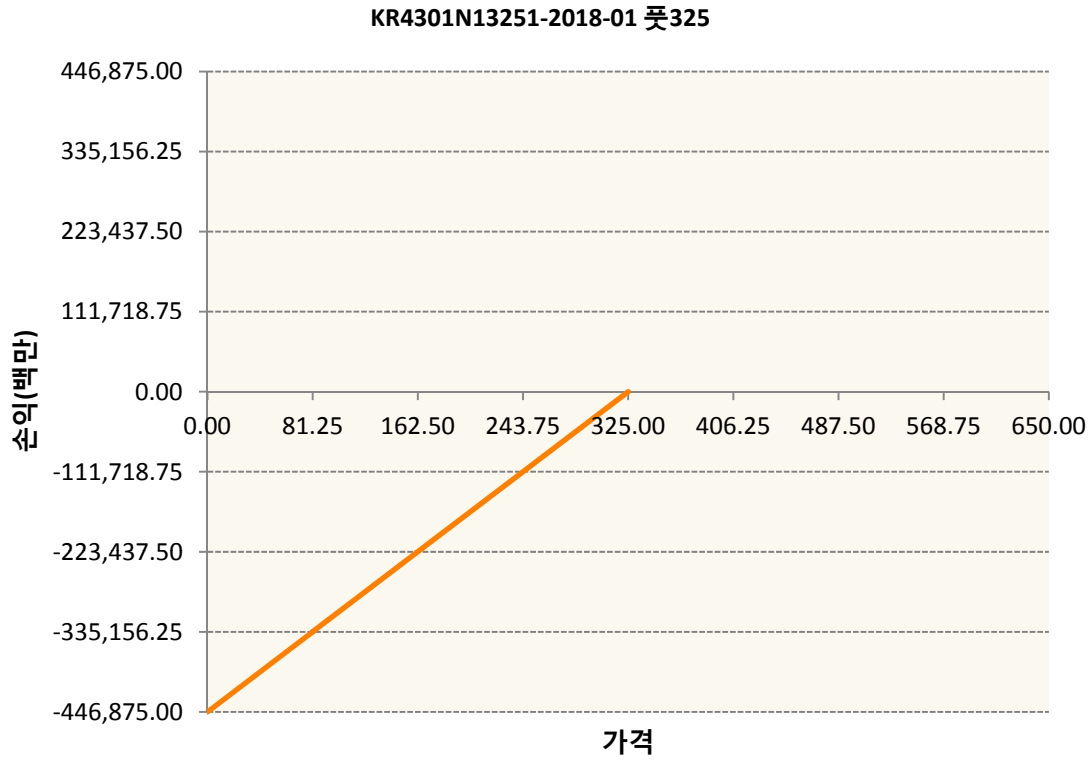
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	1,392,313	-1,392,313	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201N132 2018-01 콜325							50,779
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	15,099	14,987	14,815	14,577	14,271	13,897	13,459
-5.33%	14,420	13,982	13,452	12,841	12,159	11,416	10,619
-2.67%	11,516	10,540	9,516	8,455	7,366	6,252	5,119
0%	3,851	2,567	1,284	0	-1,284	-2,567	-3,851
2.67%	-9,805	-10,840	-11,920	-13,034	-14,174	-15,336	-16,516
5.33%	-28,052	-28,585	-29,214	-29,924	-30,705	-31,547	-32,440
8.00%	-48,513	-48,694	-48,954	-49,296	-49,717	-50,213	-50,779
KR4301N132 2018-01 풋322.5							9,740
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-9,734	-9,734	-9,734	-9,734	-9,735	-9,737	-9,740

-5.33%	-5,841	-5,846	-5,853	-5,865	-5,882	-5,904	-5,931
-2.67%	-2,109	-2,172	-2,243	-2,319	-2,400	-2,484	-2,572
0%	321	215	108	0	-109	-219	-329
2.67%	876	854	823	785	740	688	631
5.33%	905	904	902	898	892	883	869
8.00%	905	905	905	905	905	904	902
KR4301N132 2018-01 풋325							31,644

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-31,636	-31,636	-31,636	-31,637	-31,638	-31,640	-31,644
-5.33%	-19,736	-19,741	-19,750	-19,766	-19,793	-19,831	-19,882
-2.67%	-8,030	-8,144	-8,285	-8,447	-8,630	-8,830	-9,045
0%	1,046	698	349	0	-349	-698	-1,046
2.67%	4,053	3,917	3,756	3,573	3,370	3,150	2,916
5.33%	4,303	4,295	4,279	4,253	4,213	4,159	4,089
8.00%	4,307	4,307	4,307	4,305	4,303	4,297	4,287

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

103,649

공시일	2017-12-29
기준일	2017-12-28

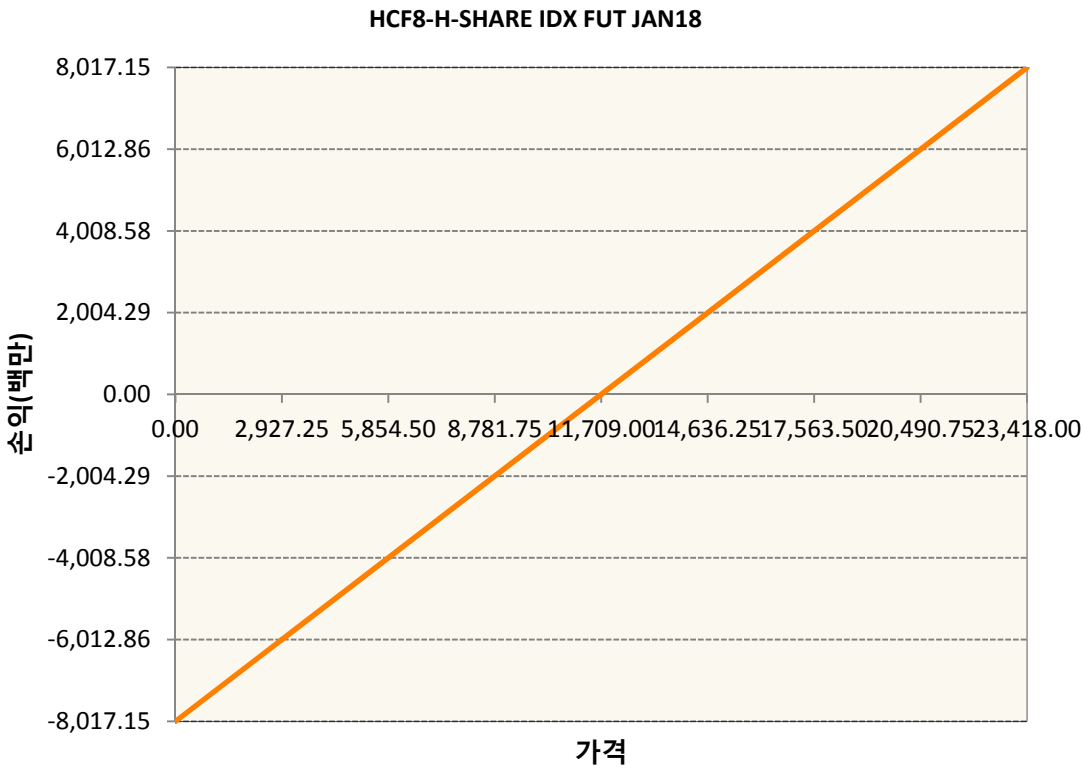
홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생

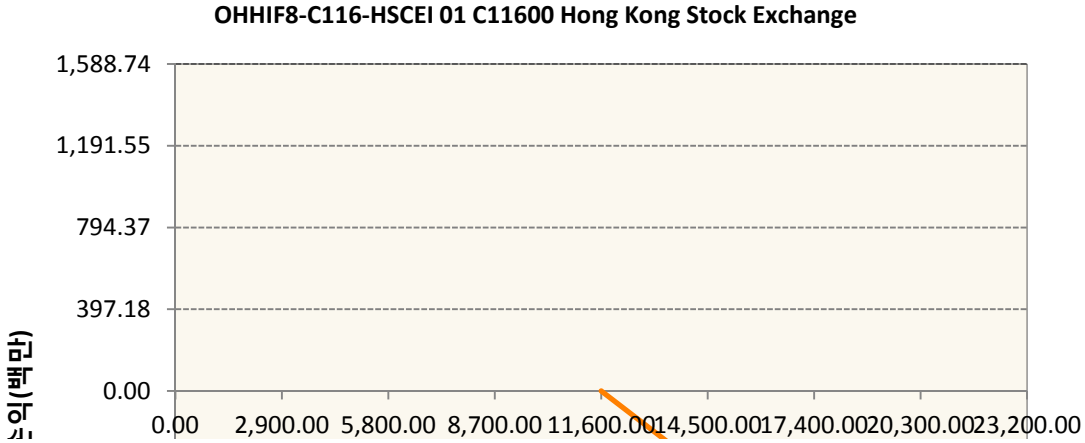
1. 계약금액

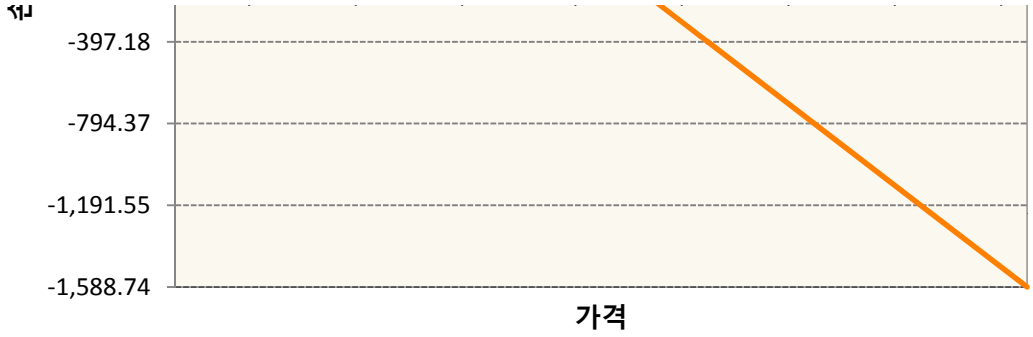
(단위:백만원)

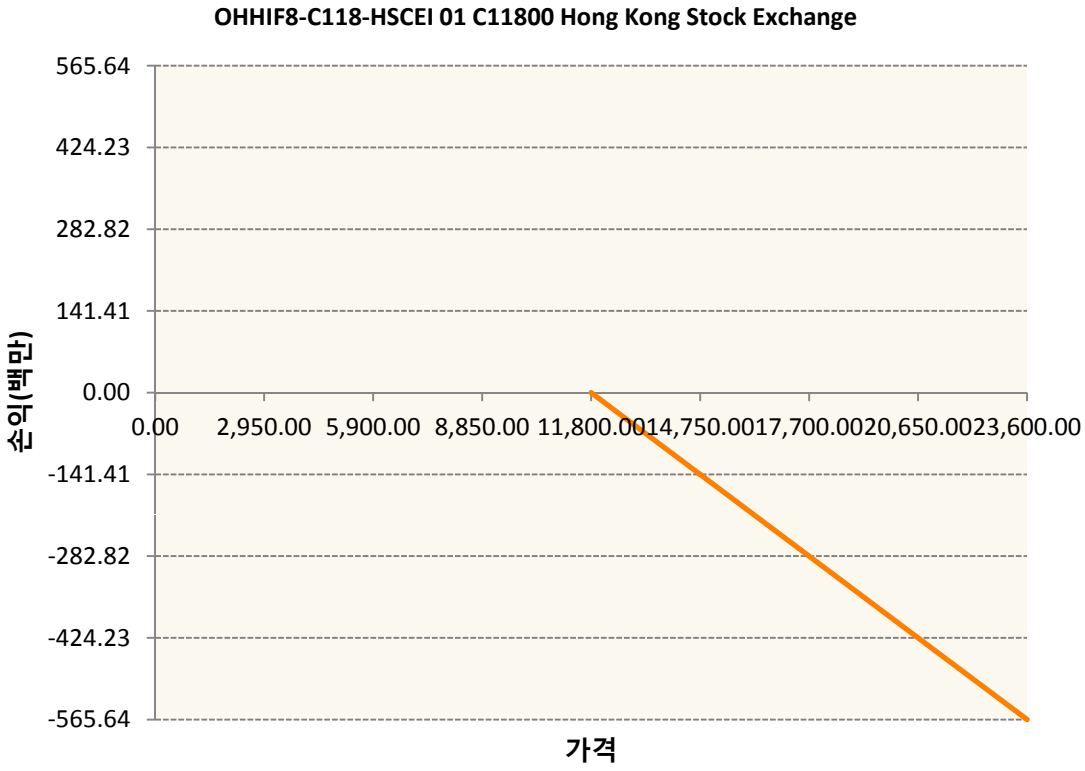
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	1	0	1	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	8,017	0	8,017	장내
누계	유가증권	옵션	0	4,309	-4,309	장내

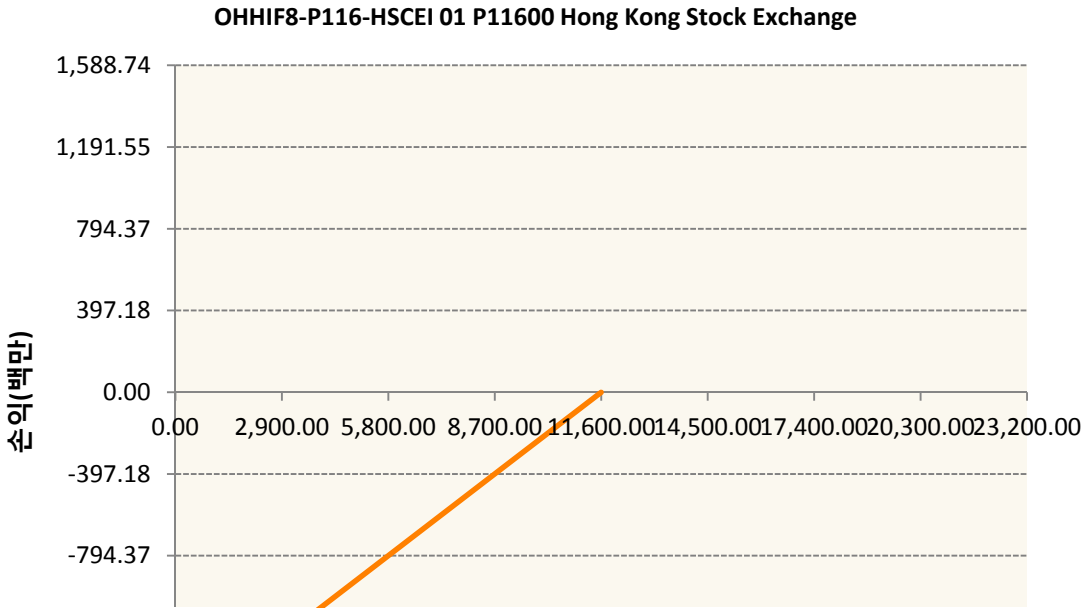
2. 만기시점의 손익구조

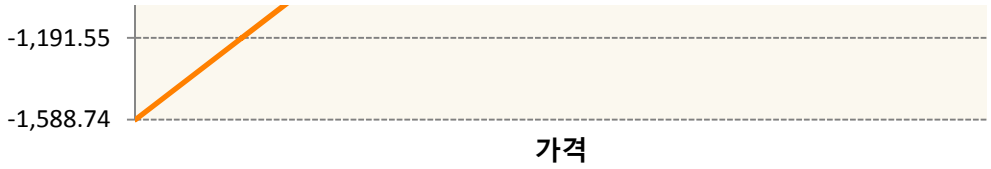


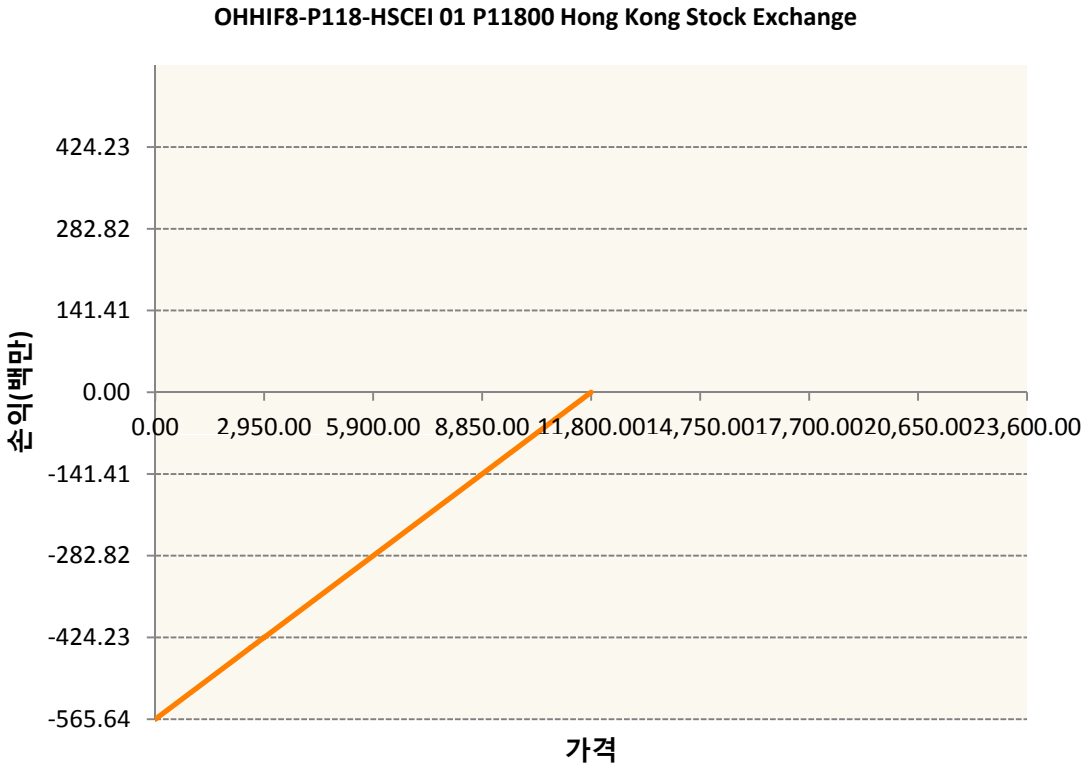



-397.18
-794.37
-1,191.55
-1,588.74
가격


OHHIF8-C118-HSCEI 01 C11800 Hong Kong Stock Exchange
565.64
424.23
282.82
141.41
0.00
-141.41
-282.82
-424.23
-565.64
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


OHHIF8-P116-HSCEI 01 P11600 Hong Kong Stock Exchange
1,588.74
1,191.55
794.37
397.18
0.00
-397.18
-794.37
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)
HCF8 H-SHARE IDX FUT JAN18	641
OHHIF8-C11 HSCEI 01 C11600 Hong Kong Stock Exchange	127
OHHIF8-C11 HSCEI 01 C11800 Hong Kong Stock Exchange	45
OHHIF8-P11 HSCEI 01 P11600 Hong Kong Stock Exchange	127
OHHIF8-P11 HSCEI 01 P11800 Hong Kong Stock Exchange	45

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	779

공시일	2017-12-29
기준일	2017-12-28

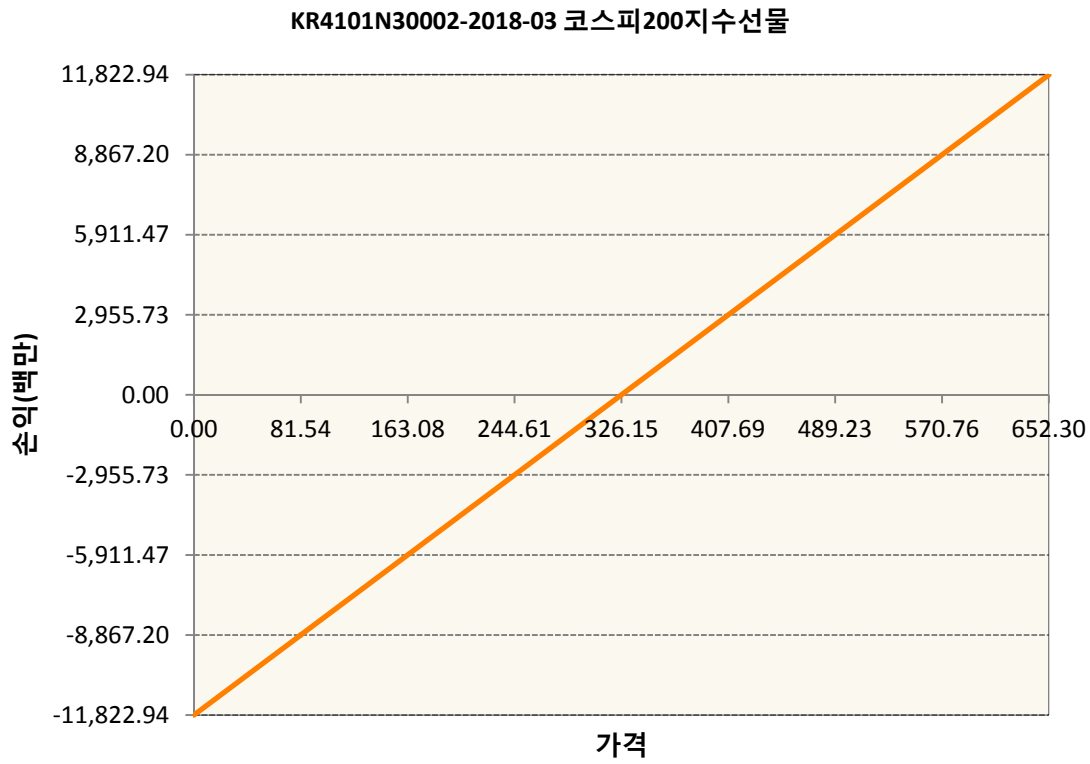
코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼

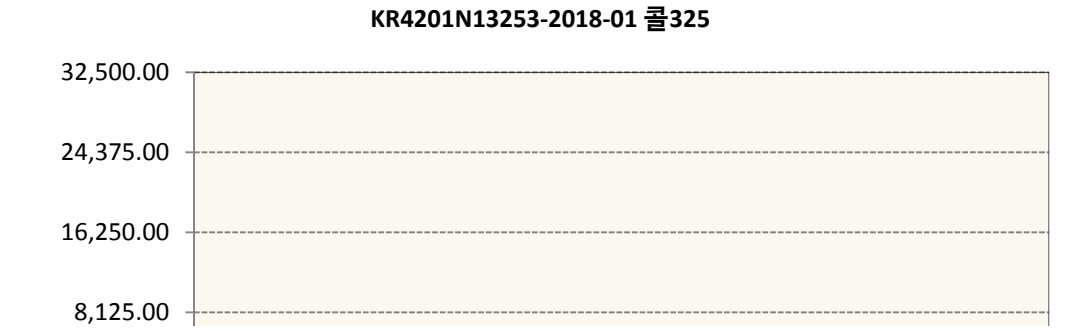
1. 계약금액

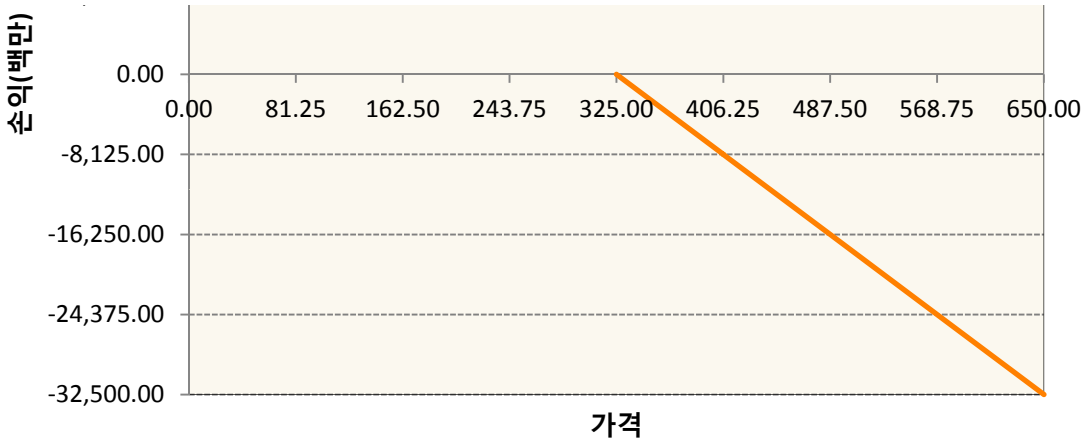
(단위:백만원)

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	11,823	0	11,823	장내
누계	유가증권	스왑	60,200	0	60,200	장외
누계	유가증권	옵션	0	60,875	-60,875	장내

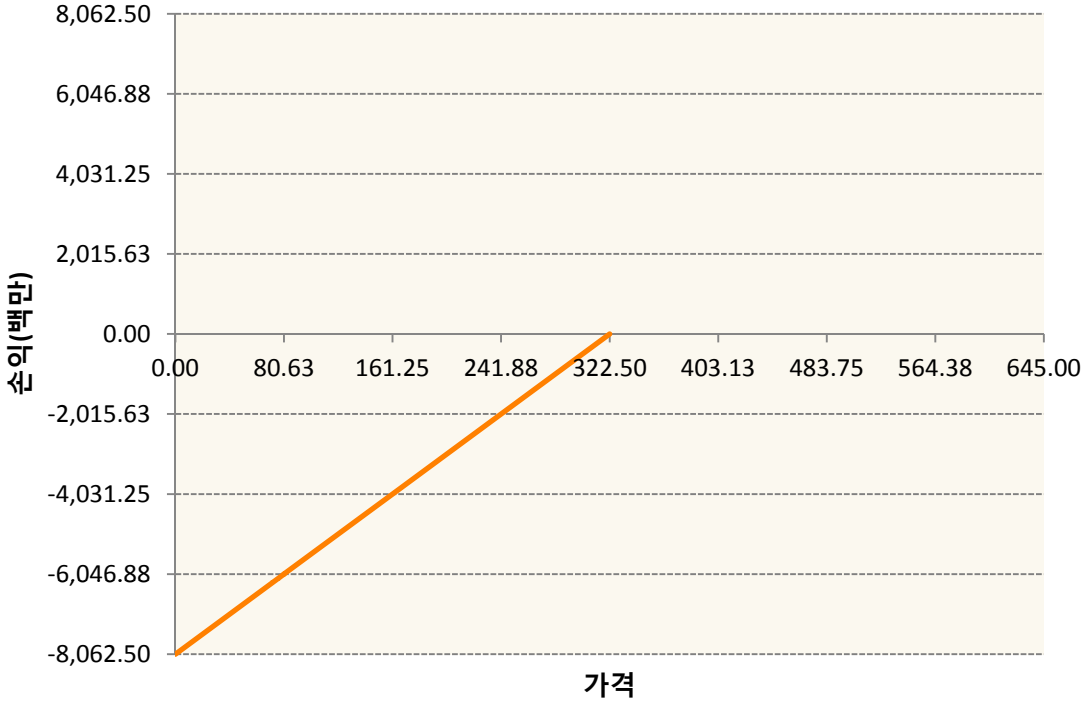
2. 만기시점의 손익구조



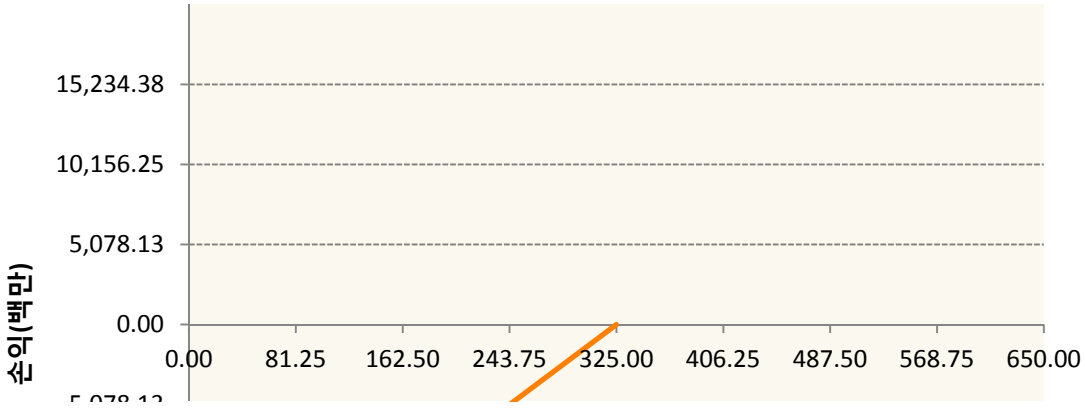




KR4301N13228-2018-01 풋322.5



KR4301N13251-2018-01 풋325





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_2							1,452
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,452	-1,452	-1,452	-1,452	-1,452	-1,452	-1,452
-5.33%	-968	-968	-968	-968	-968	-968	-968
-2.67%	-484	-484	-484	-484	-484	-484	-484
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	484	484	484	484	484	484	484
5.33%	968	968	968	968	968	968	968
8.00%	1,452	1,452	1,452	1,452	1,452	1,452	1,452
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%	-183	-183	-183	-183	-183	-183	-183
-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%	183	183	183	183	183	183	183
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							235
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%

-8.00%	-235	-235	-235	-235	-235	-235	-235
-5.33%	-157	-157	-157	-157	-157	-157	-157
-2.67%	-78	-78	-78	-78	-78	-78	-78
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	78	78	78	78	78	78	78
5.33%	157	157	157	157	157	157	157
8.00%	235	235	235	235	235	235	235
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_6						196
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-196	-196	-196	-196	-196	-196	-196
-5.33%	-131	-131	-131	-131	-131	-131	-131
-2.67%	-65	-65	-65	-65	-65	-65	-65
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	65	65	65	65	65	65	65
5.33%	131	131	131	131	131	131	131
8.00%	196	196	196	196	196	196	196
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_7						251
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-251	-251	-251	-251	-251	-251	-251
-5.33%	-167	-167	-167	-167	-167	-167	-167
-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%	167	167	167	167	167	167	167
8.00%	251	251	251	251	251	251	251
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_8						464
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-464	-464	-464	-464	-464	-464	-464
-5.33%	-310	-310	-310	-310	-310	-310	-310
-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%	310	310	310	310	310	310	310
8.00%	464	464	464	464	464	464	464
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_9						310
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-310	-310	-310	-310	-310	-310	-310
-5.33%	-206	-206	-206	-206	-206	-206	-206
-2.67%	-103	-103	-103	-103	-103	-103	-103
0%	0	0	0	0	0	0	0

2.67%	103	103	103	103	103	103	103
5.33%	206	206	206	206	206	206	206
8.00%	310	310	310	310	310	310	310
	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%	-183	-183	-183	-183	-183	-183	-183
-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%	183	183	183	183	183	183	183
8.00%	275	275	275	275	275	275	275
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_11						628
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-628	-628	-628	-628	-628	-628	-628
-5.33%	-419	-419	-419	-419	-419	-419	-419
-2.67%	-209	-209	-209	-209	-209	-209	-209
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	209	209	209	209	209	209	209
5.33%	419	419	419	419	419	419	419
8.00%	628	628	628	628	628	628	628
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_12						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
	KR4101N30(2018-03 코스피200지수선물						942
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-942	-942	-942	-942	-942	-942	-942
-5.33%	-628	-628	-628	-628	-628	-628	-628
-2.67%	-314	-314	-314	-314	-314	-314	-314
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	314	314	314	314	314	314	314
5.33%	628	628	628	628	628	628	628
8.00%	942	942	942	942	942	942	942
	KR4201N13: 2018-01 콜325						2,062

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	613	609	602	592	580	564	547
-5.33%	586	568	546	521	494	464	431
-2.67%	468	428	386	343	299	254	208
0%	156	104	52	0	-52	-104	-156
2.67%	-398	-440	-484	-529	-576	-623	-671
5.33%	-1,139	-1,161	-1,186	-1,215	-1,247	-1,281	-1,317
8.00%	-1,970	-1,977	-1,988	-2,002	-2,019	-2,039	-2,062
	KR4301N132 2018-01 풋322.5						541

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-541	-541	-541	-541	-541	-541	-541
-5.33%	-325	-325	-325	-326	-327	-328	-329
-2.67%	-117	-121	-125	-129	-133	-138	-143
0%	18	12	6	0	-6	-12	-18
2.67%	49	47	46	44	41	38	35
5.33%	50	50	50	50	50	49	48
8.00%	50	50	50	50	50	50	50
	KR4301N132 2018-01 풋325						1,438

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,438	-1,438	-1,438	-1,438	-1,438	-1,438	-1,438
-5.33%	-897	-897	-898	-898	-900	-901	-904
-2.67%	-365	-370	-377	-384	-392	-401	-411
0%	48	32	16	0	-16	-32	-48
2.67%	184	178	171	162	153	143	133
5.33%	196	195	195	193	191	189	186
8.00%	196	196	196	196	196	195	195

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

9,847

공시일	2017-12-29
기준일	2017-12-28

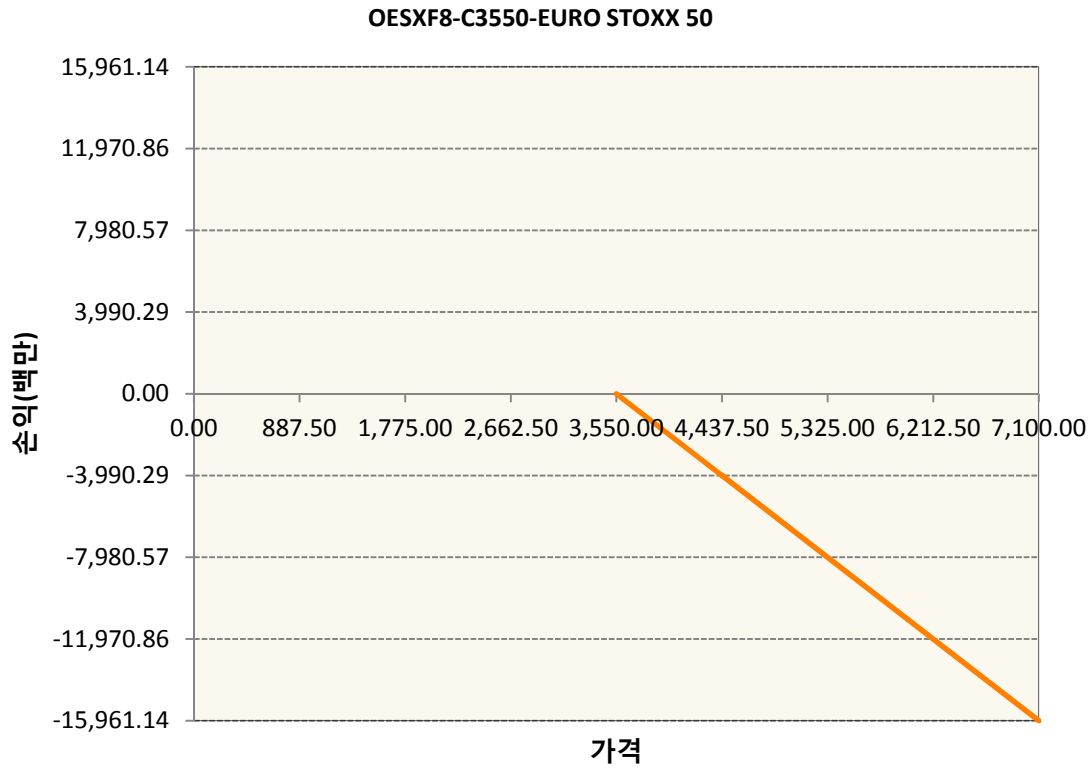
유로커버드콜모(주식혼합-파생형

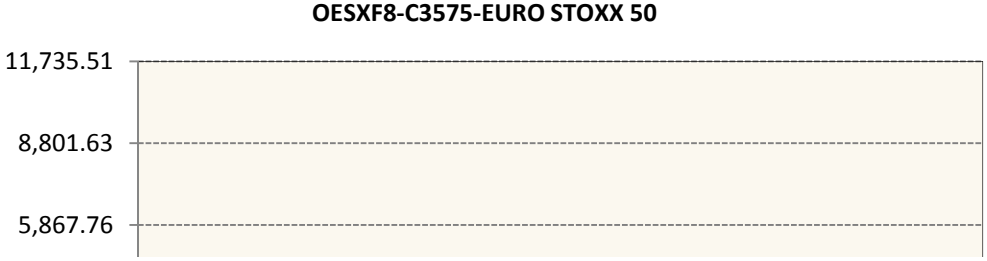
1. 계약금액

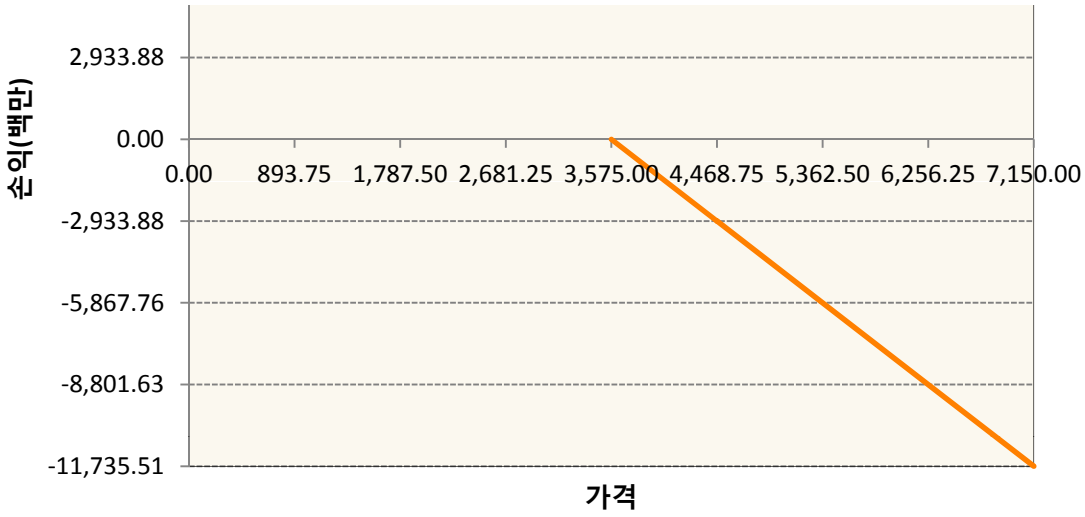
(단위:백만원)

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	95,799	0	95,799	장외
누계	유가증권	옵션	0	55,393	-55,393	장내
누계	지수	스왑	51,094	0	51,094	장외

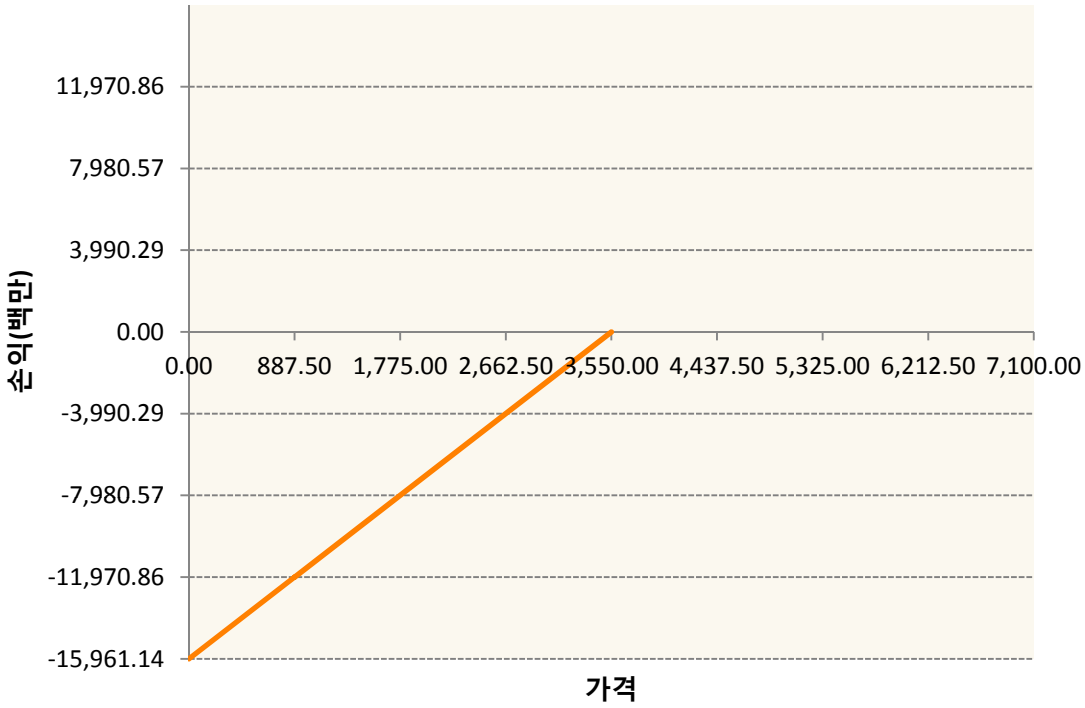
2. 만기시점의 손익구조



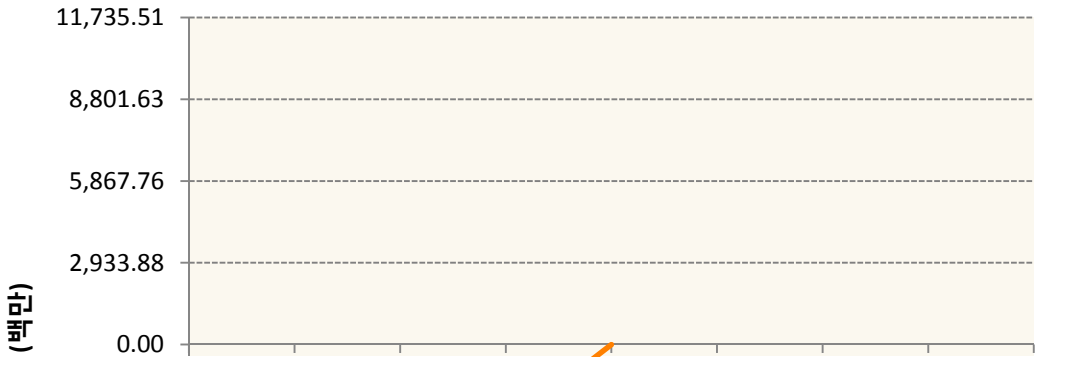


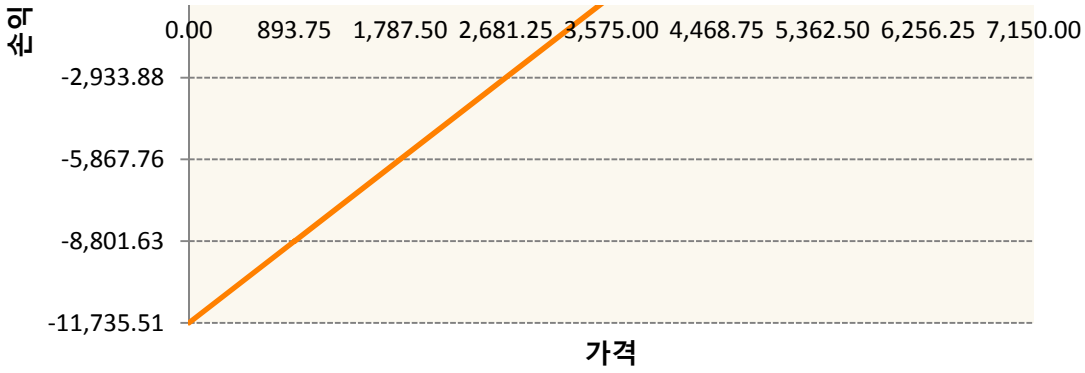


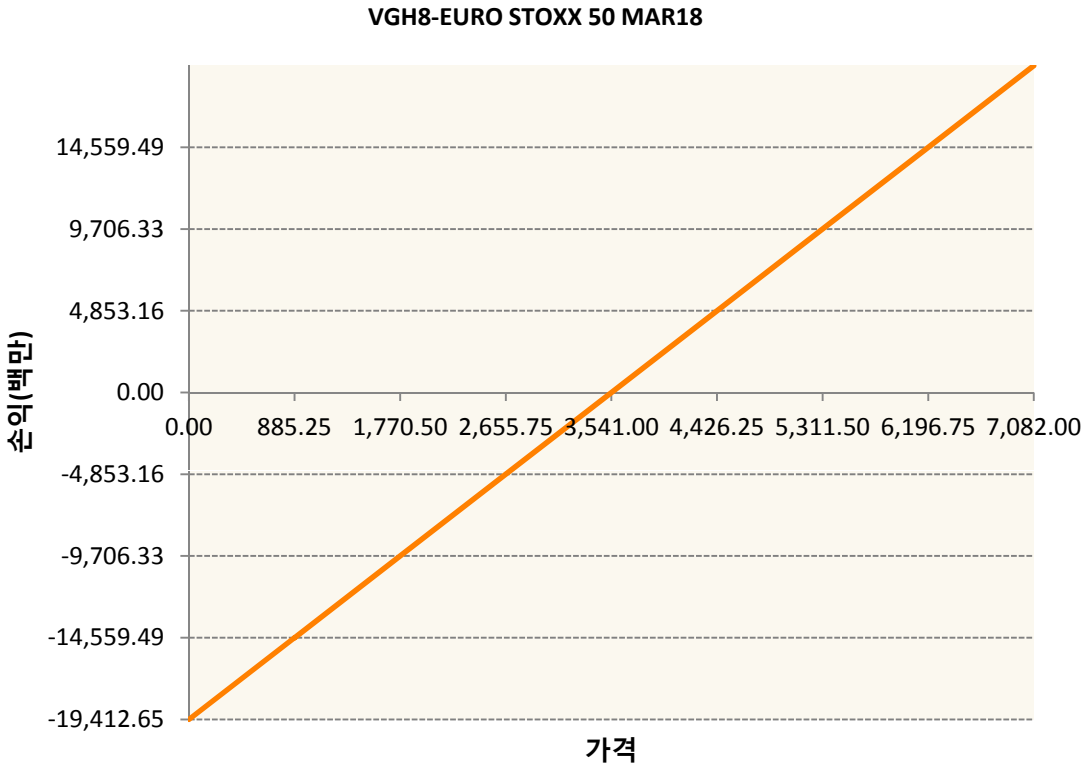
OESXF8-P3550-EURO STOXX 50



OESXF8-P3575-EURO STOXX 50







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)	(단위:백만원)
260105SGPX SG EURO Covered CALL STRATEGY - 994.569	60
260105SQPX SG EURO Covered CALL STRATEGY	70
OESXF8-C35 EURO STOXX 50	1,277
OESXF8-C35 EURO STOXX 50	939
OESXF8-P35 EURO STOXX 50	1,277
OESXF8-P35 EURO STOXX 50	939
VGH8 EURO STOXX 50 MAR18	1,553

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

3,446

공시일	2017-12-29
기준일	2017-12-28

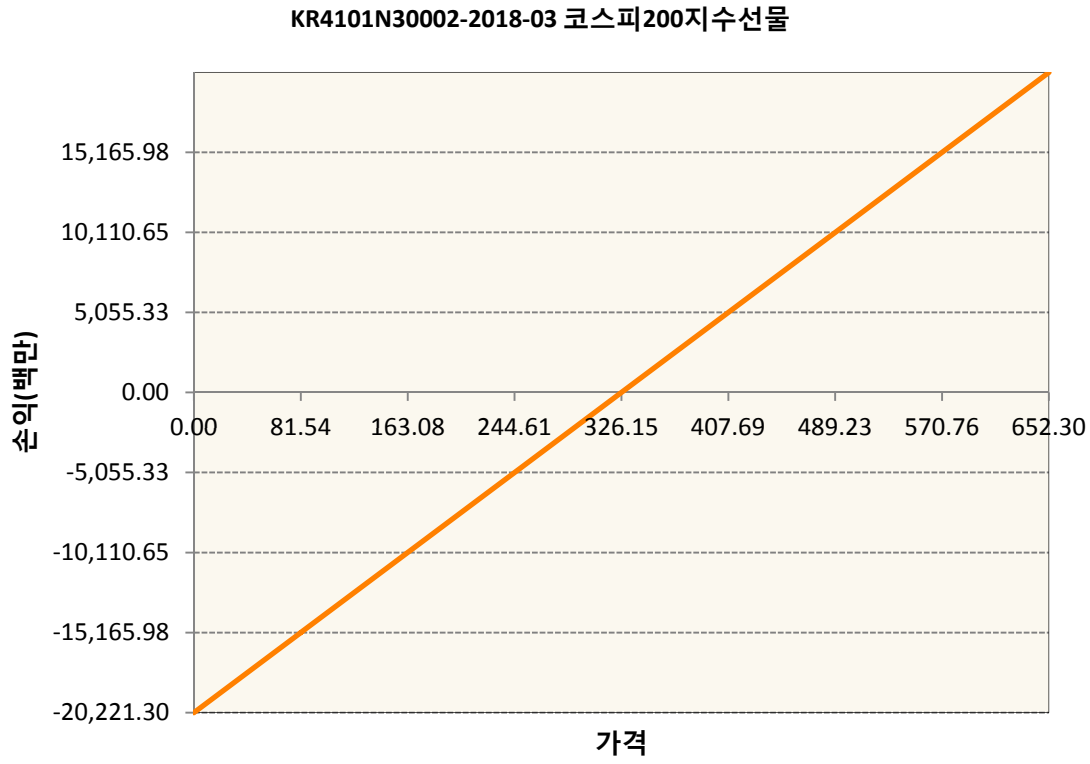
ETF스마트레버리지목표전환형8호

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	20,221	0	20,221	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101N30(2018-03 코스피200지수선물							1,611
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,611	-1,611	-1,611	-1,611	-1,611	-1,611	-1,611
-5.33%	-1,074	-1,074	-1,074	-1,074	-1,074	-1,074	-1,074
-2.67%	-537	-537	-537	-537	-537	-537	-537
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	537	537	537	537	537	537	537
5.33%	1,074	1,074	1,074	1,074	1,074	1,074	1,074
8.00%	1,611	1,611	1,611	1,611	1,611	1,611	1,611

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

956

공시일	2017-12-29
기준일	2017-12-28

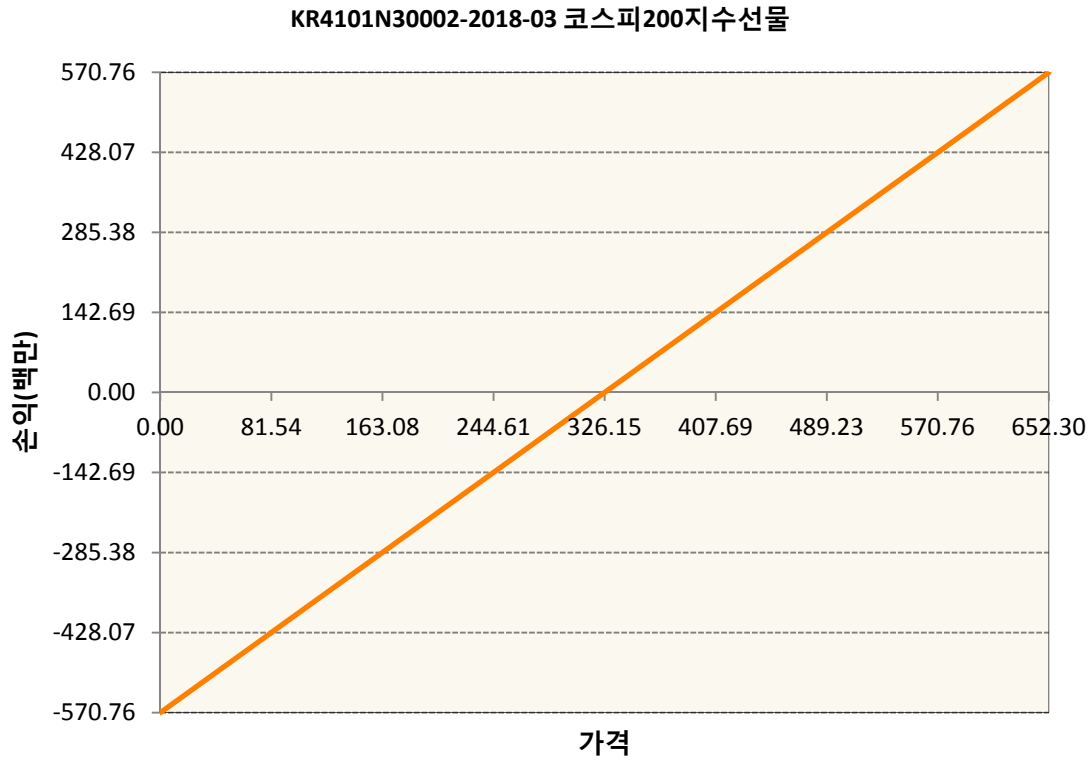
ETF스마트레버리지목표전환형9호

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	571	0	571	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)

27

공시일	2017-12-29
기준일	2017-12-28

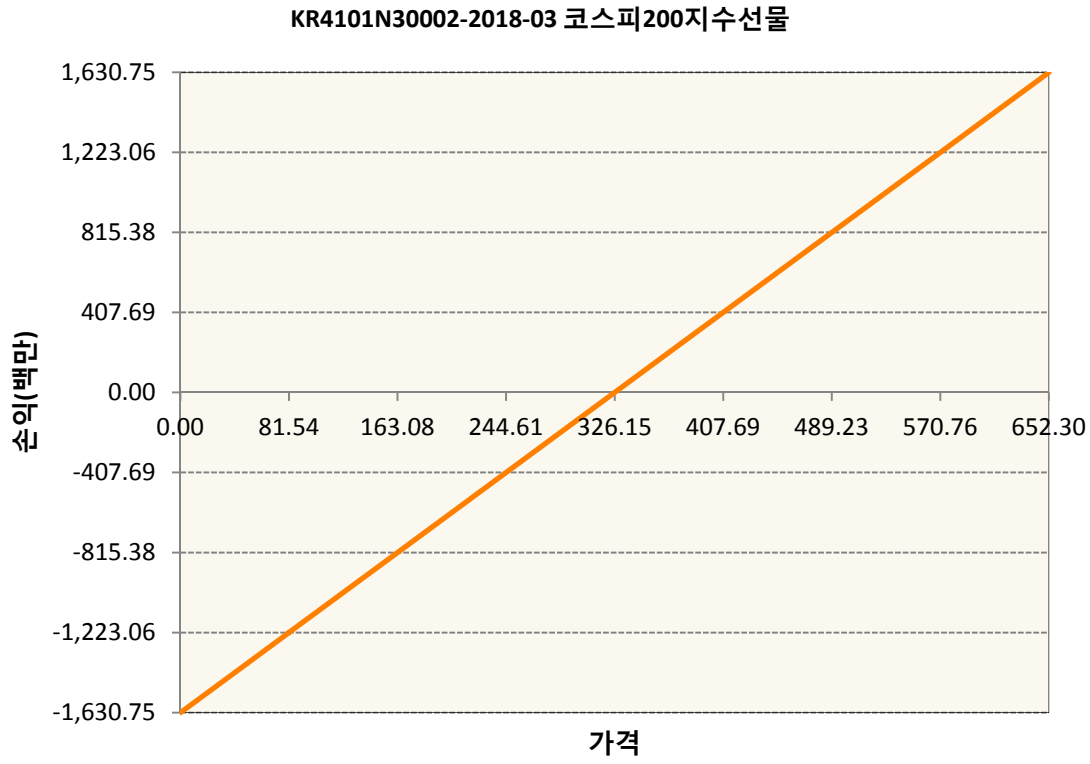
ETF스마트레버리지목표전환형10

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	1,631	0	1,631	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101N30(2018-03 코스피200지수선물							130
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-130	-130	-130	-130	-130	-130	-130
-5.33%	-87	-87	-87	-87	-87	-87	-87
-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%	87	87	87	87	87	87	87
8.00%	130	130	130	130	130	130	130

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

77

공시일	2017-12-29
기준일	2017-12-28

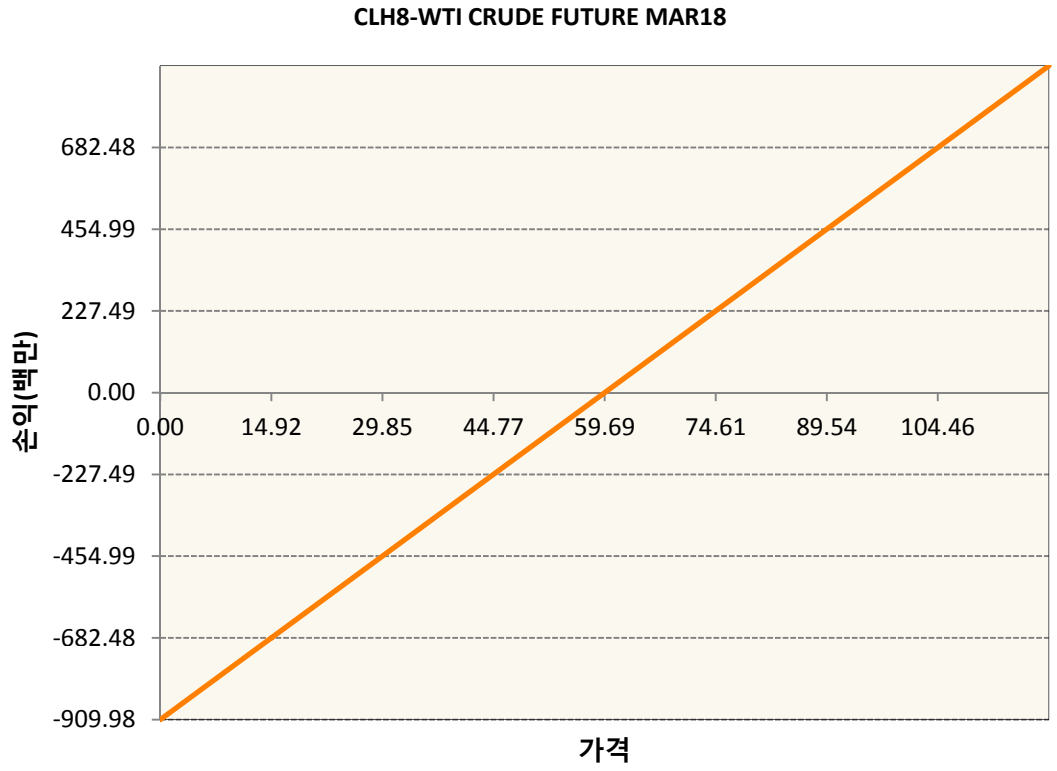
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

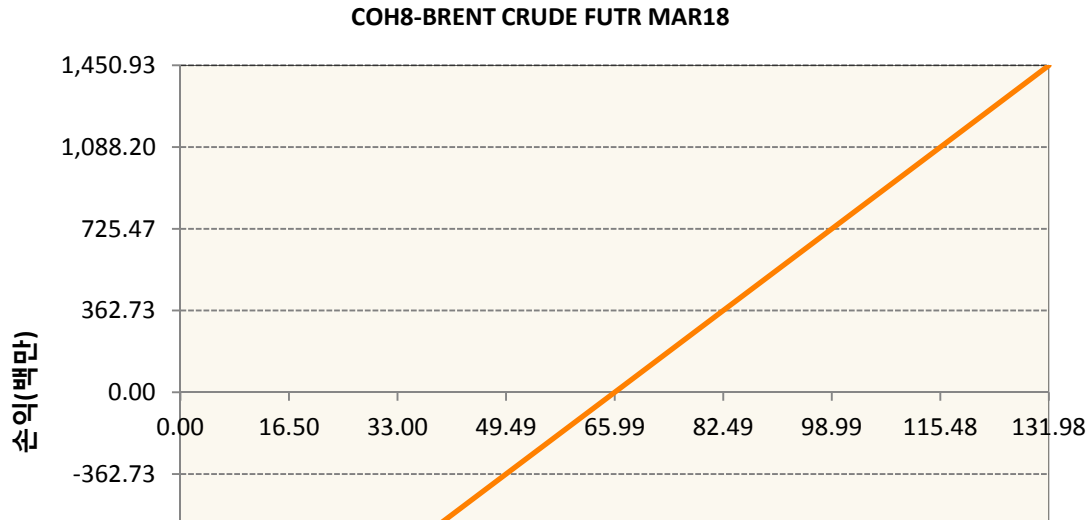
1. 계약금액

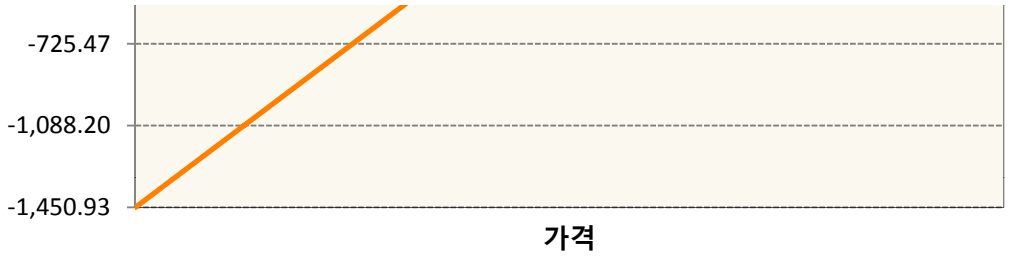
(단위:백만원)

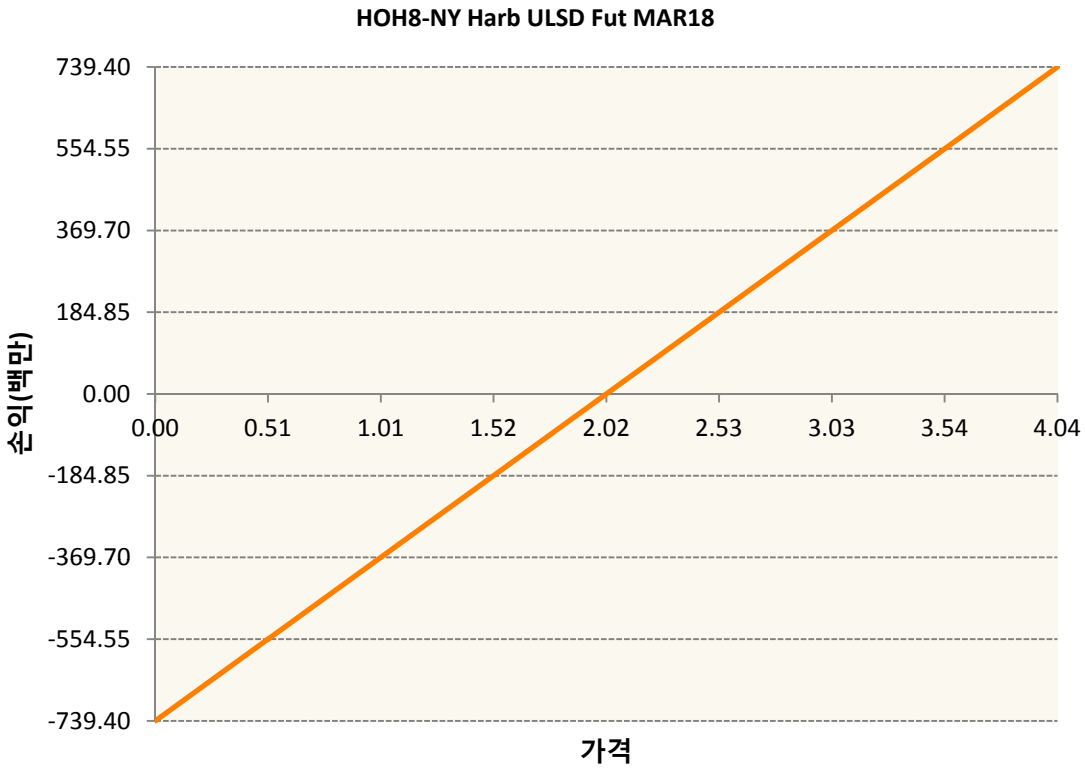
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	4,792	855	3,937	

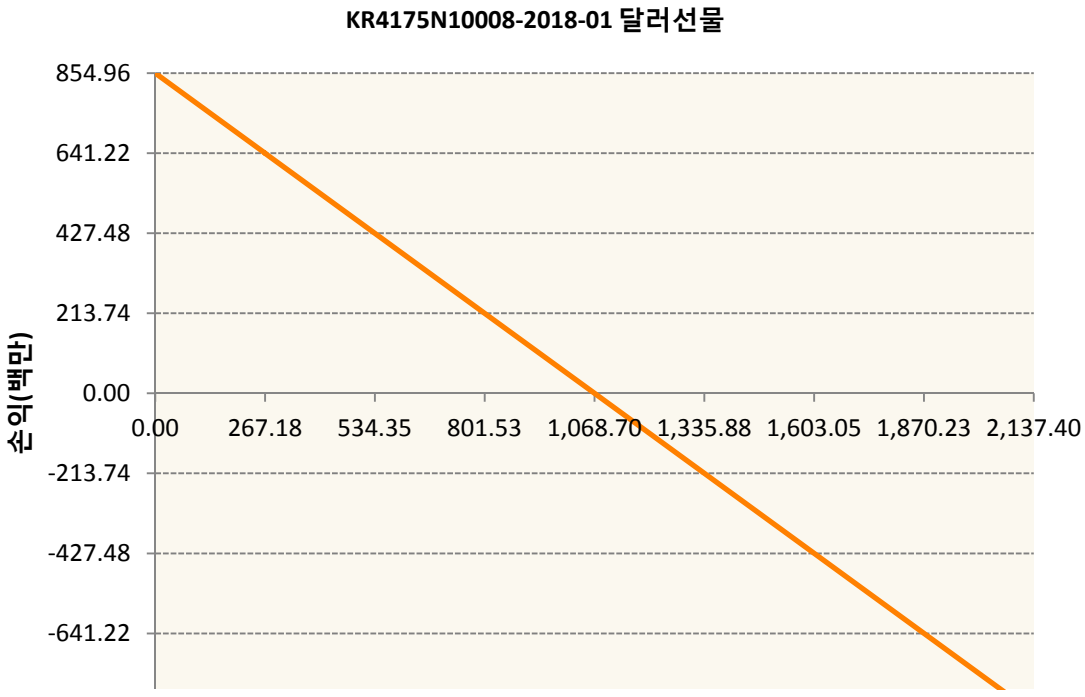
2. 만기시점의 손익구조

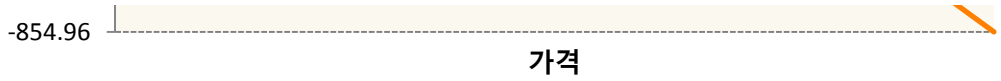


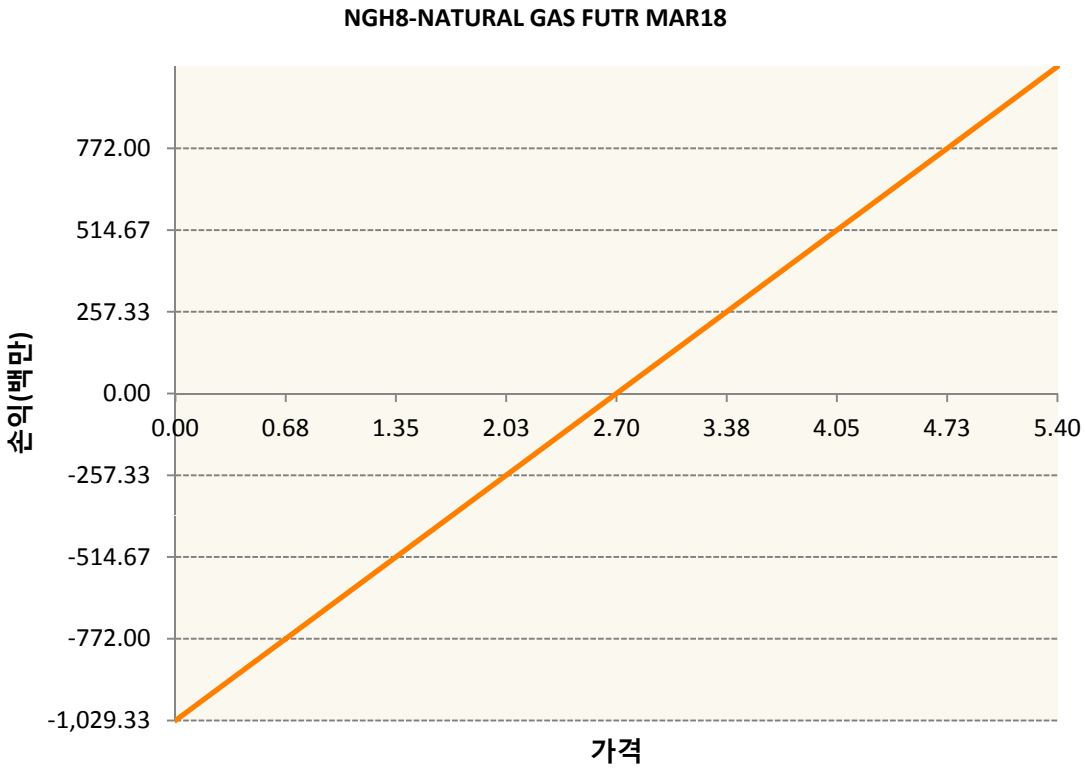


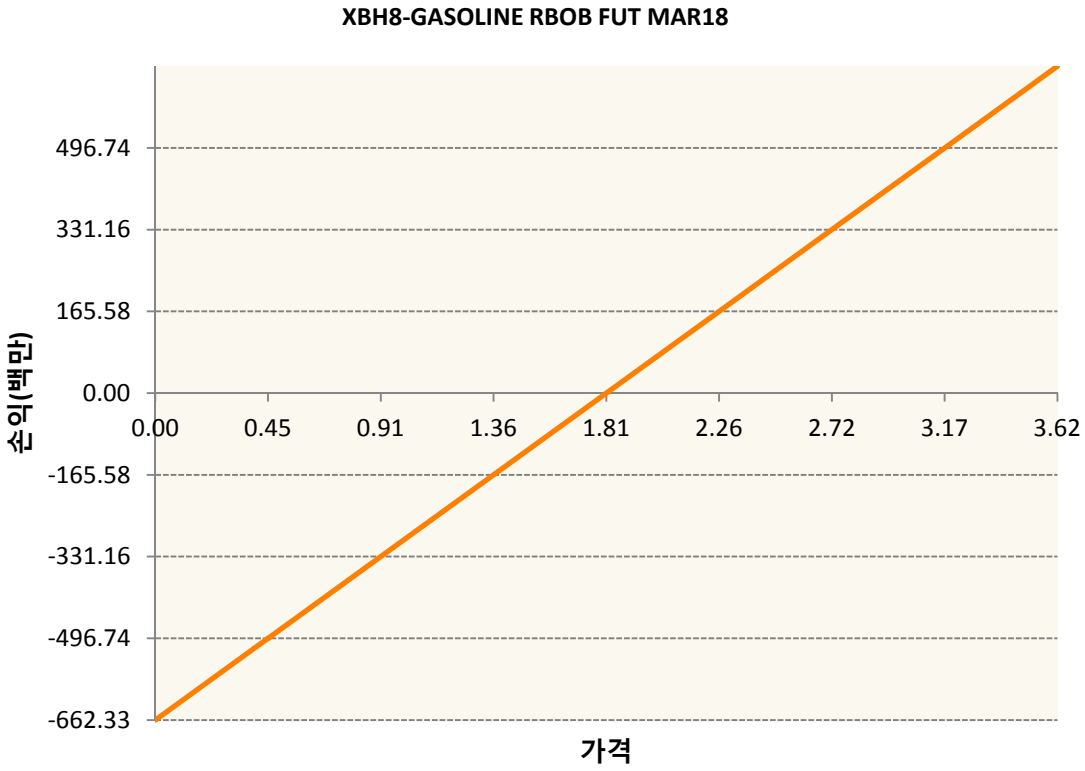

-725.47
-1,088.20
-1,450.93
가격


HOH8-NY Harb ULSD Fut MAR18
739.40
554.55
369.70
184.85
0.00
-184.85
-369.70
-554.55
-739.40
0.00
0.51
1.01
1.52
2.02
2.53
3.03
3.54
4.04
손익(백만)
가격


KR4175N10008-2018-01 달러선물
854.96
641.22
427.48
213.74
0.00
-213.74
-427.48
-641.22
0.00
267.18
534.35
801.53
1,068.70
1,335.88
1,603.05
1,870.23
2,137.40
손익(백만)


-854.96
가격


NGH8-NATURAL GAS FUTR MAR18
772.00
514.67
257.33
0.00
-257.33
-514.67
-772.00
-1,029.33
0.00
0.68
1.35
2.03
2.70
3.38
4.05
4.73
5.40
손익(백만)
가격


XBH8-GASOLINE RBOB FUT MAR18
496.74
331.16
165.58
0.00
-165.58
-331.16
-496.74
-662.33
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	116
HOH8	NY Harb ULSD Fut MAR18	59
KR4175N10(	2018-01 달러선물	68
NGH8	NATURAL GAS FUTR MAR18	82
XBH8	GASOLINE RBOB FUT MAR18	53

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

640

공시일	2017-12-29
기준일	2017-12-28

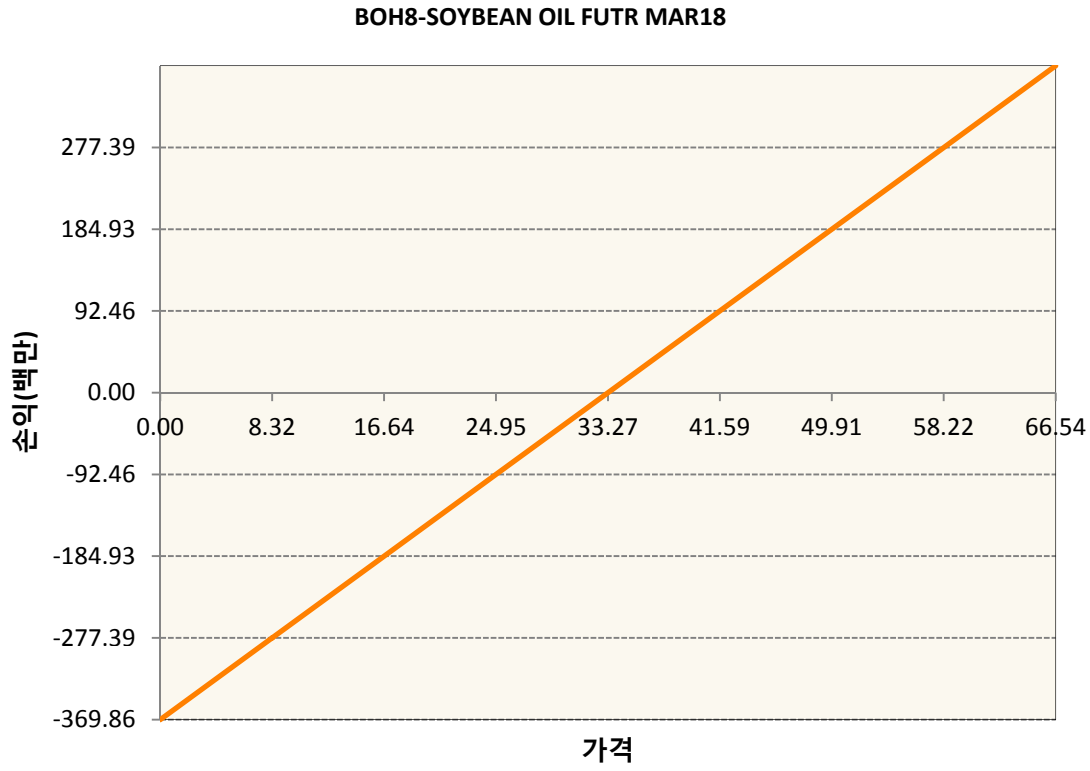
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

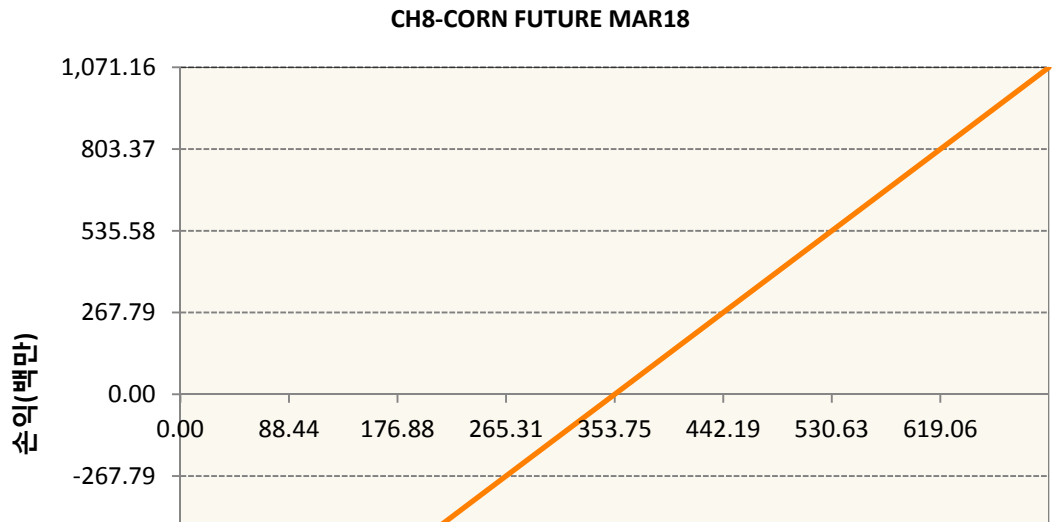
1. 계약금액

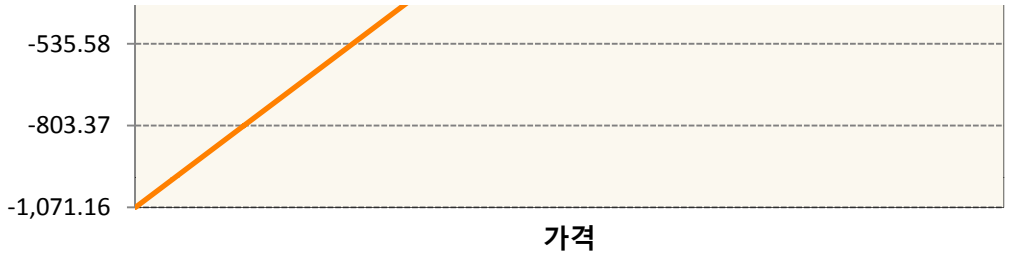
(단위:백만원)

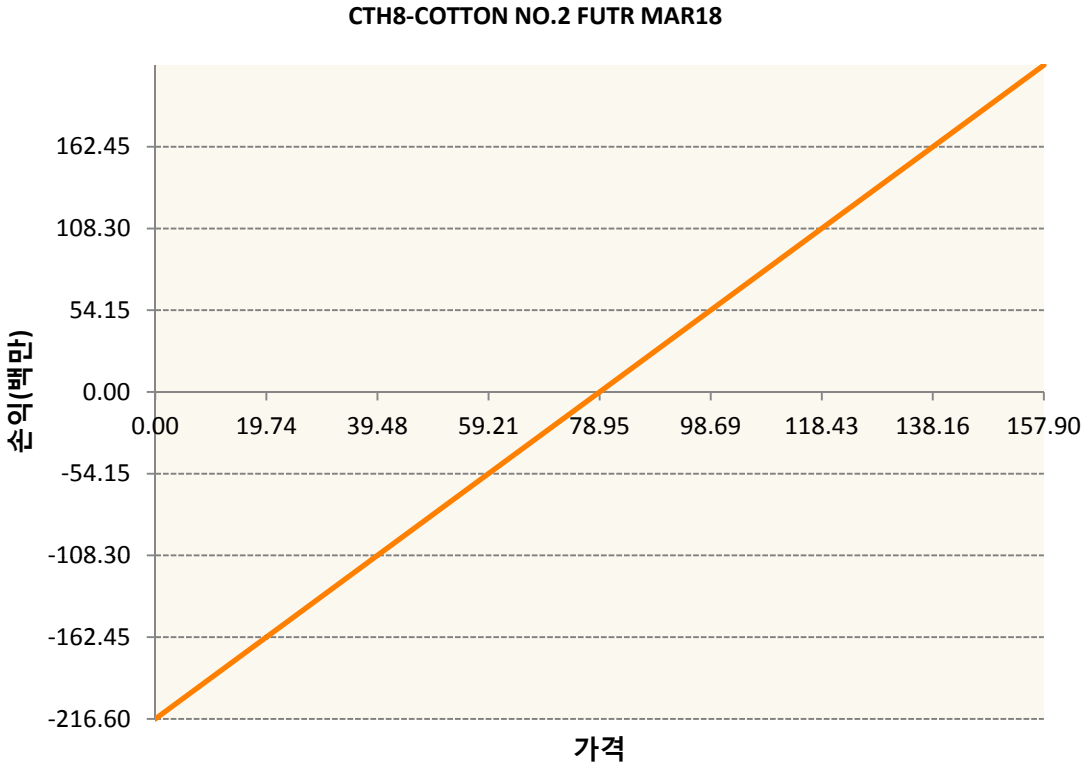
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	4,264	321	3,943	

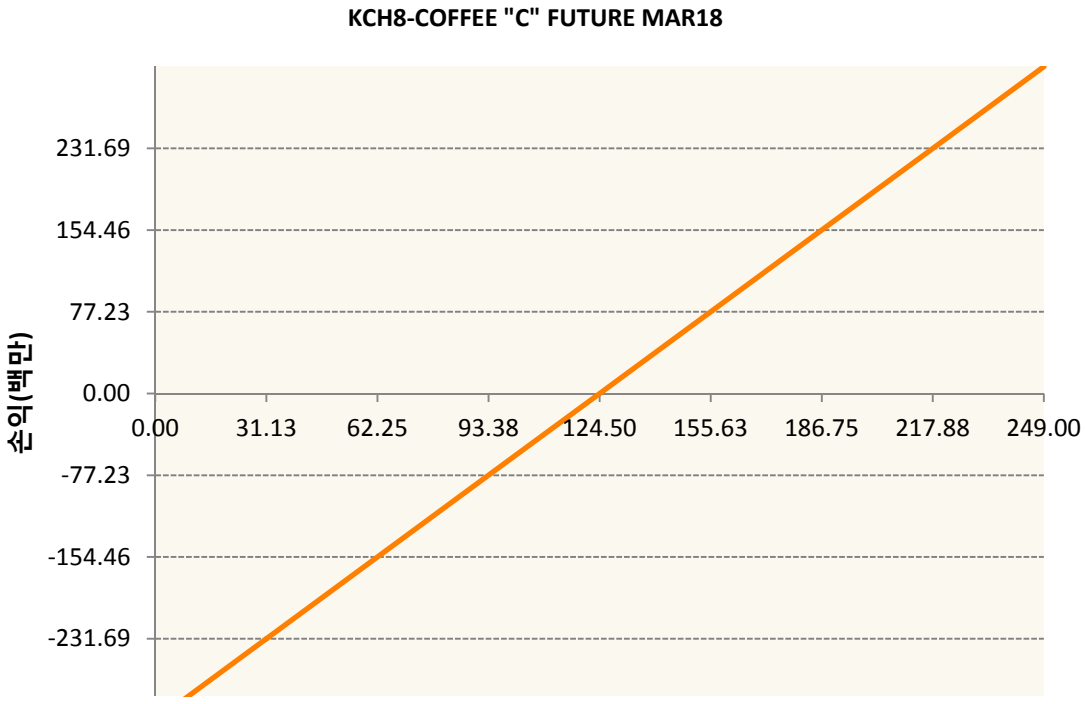
2. 만기시점의 손익구조

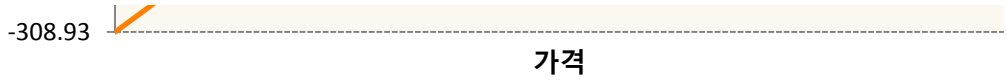


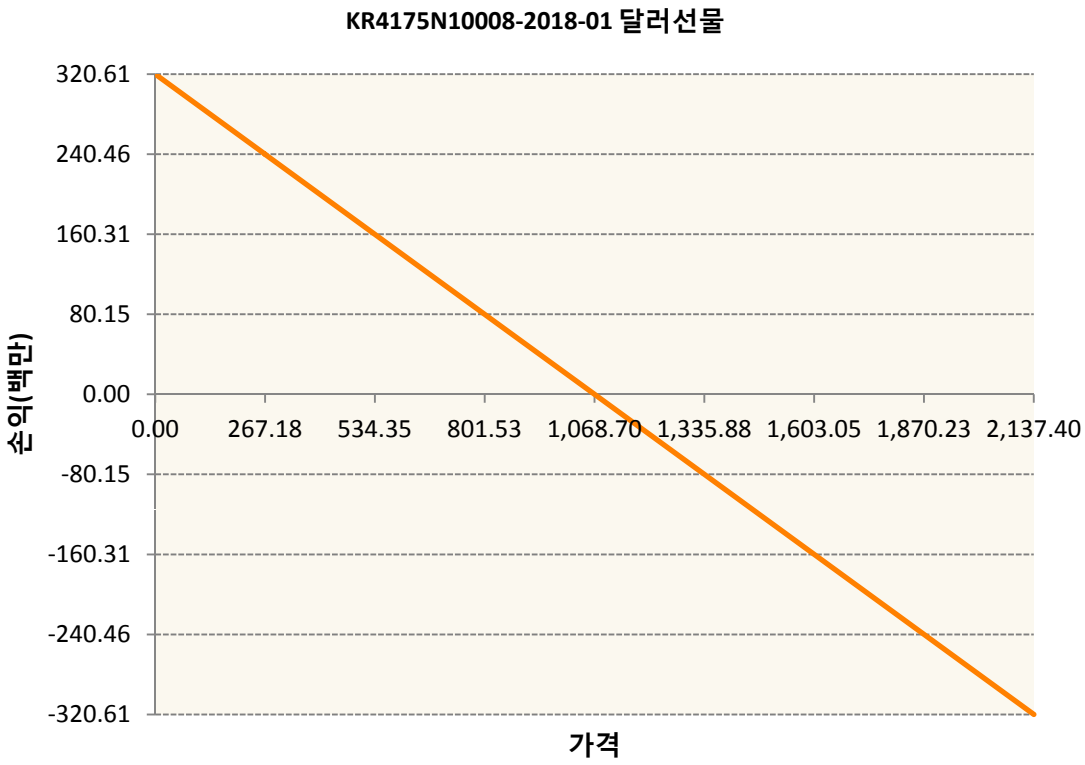


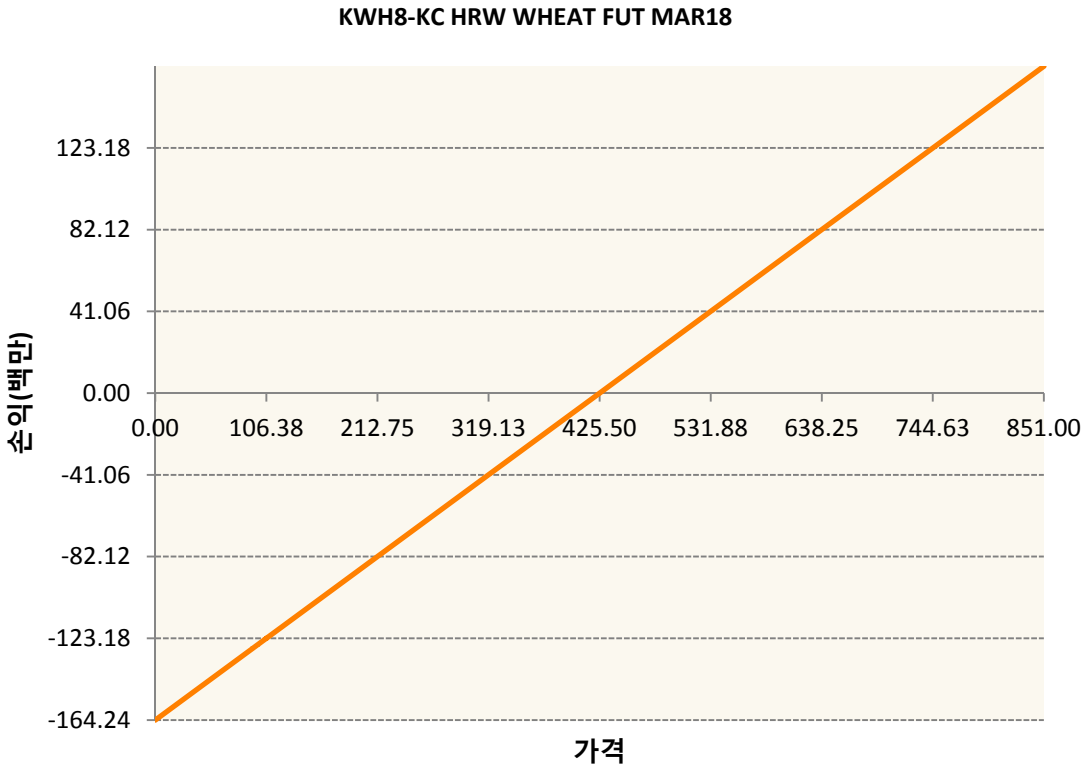

-535.58
-803.37
-1,071.16
가격


CTH8-COTTON NO.2 FUTR MAR18
162.45
108.30
54.15
0.00
-54.15
-108.30
-162.45
-216.60
0.00
19.74
39.48
59.21
78.95
98.69
118.43
138.16
157.90
손익(백만)
가격

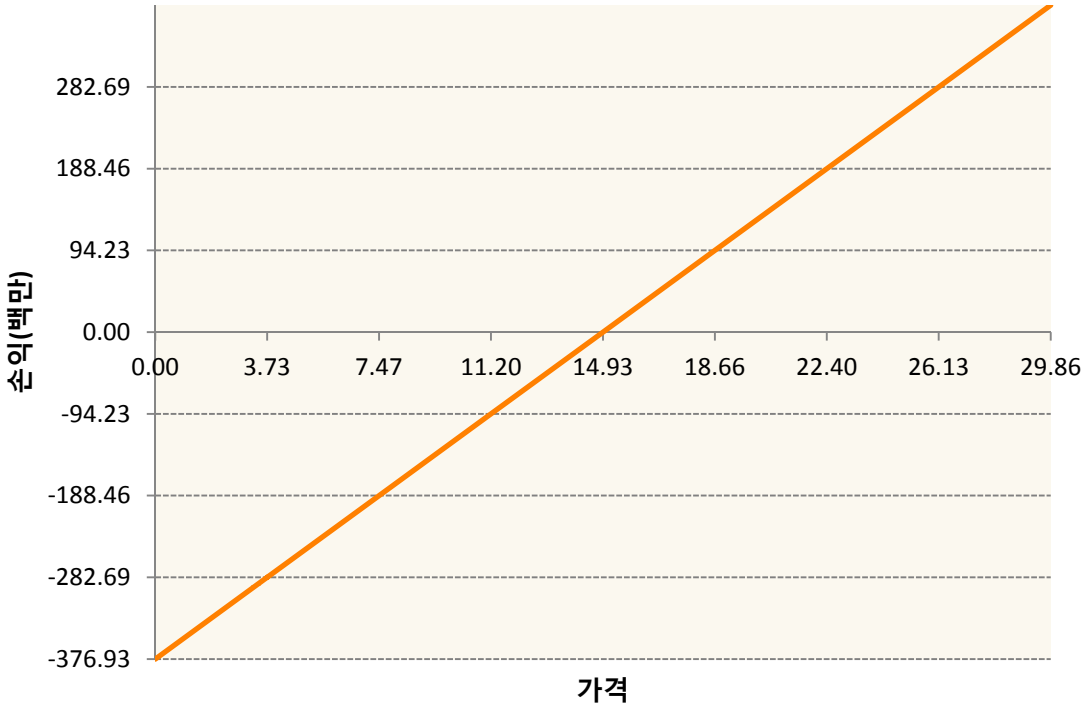

KCH8-COFFEE "C" FUTURE MAR18
231.69
154.46
77.23
0.00
-77.23
-154.46
-231.69
0.00
31.13
62.25
93.38
124.50
155.63
186.75
217.88
249.00
손익(백만)


-308.93
가격

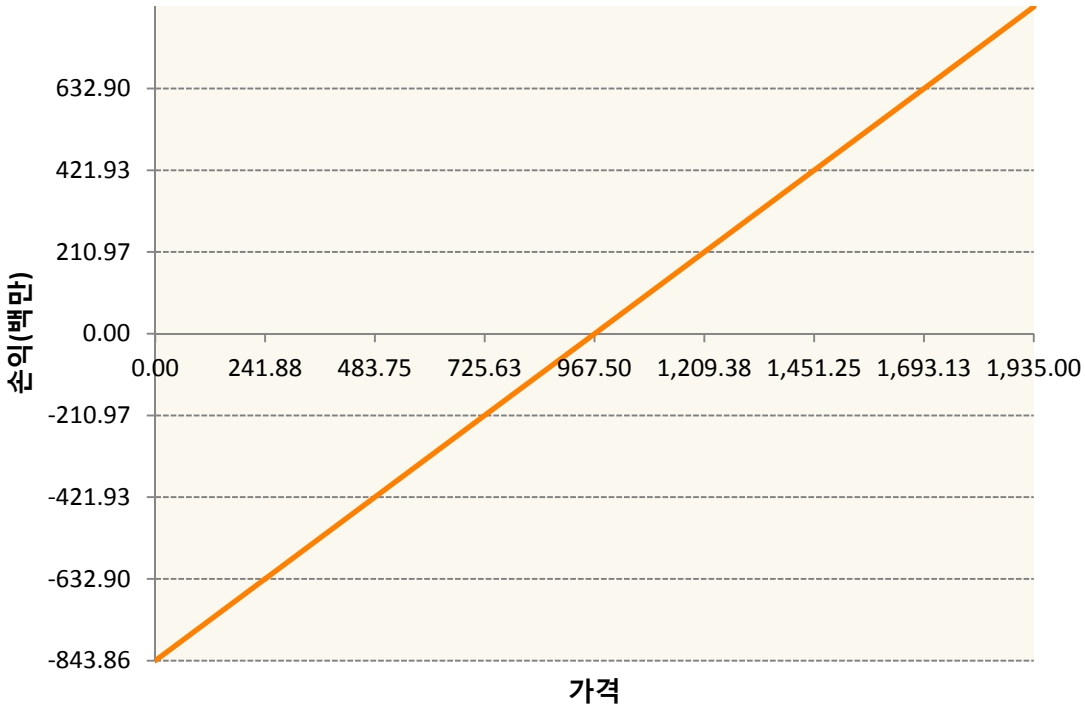

KR4175N10008-2018-01 달러선물
320.61
240.46
160.31
80.15
0.00
-80.15
-160.31
-240.46
-320.61
0.00
267.18
534.35
801.53
1,068.70
1,335.88
1,603.05
1,870.23
2,137.40
손익(백만)
가격


KWH8-KC HRW WHEAT FUT MAR18
123.18
82.12
41.06
0.00
-41.06
-82.12
-123.18
-164.24
0.00
106.38
212.75
319.13
425.50
531.88
638.25
744.63
851.00
손익(백만)
가격

SBH8-Sugar #11 (WORLD) MAR18

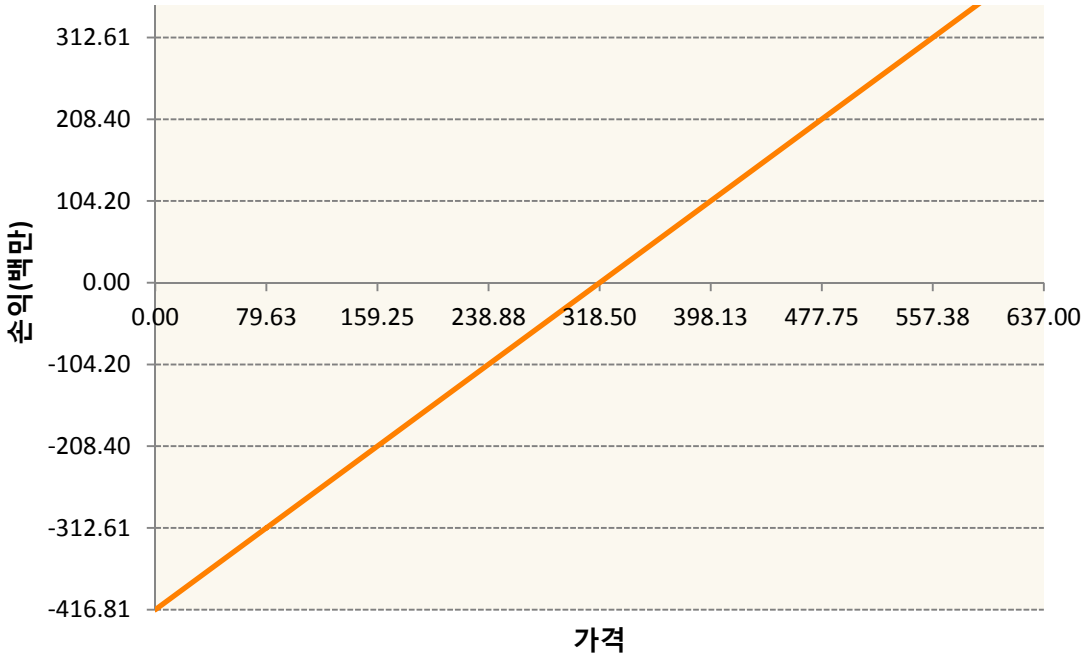


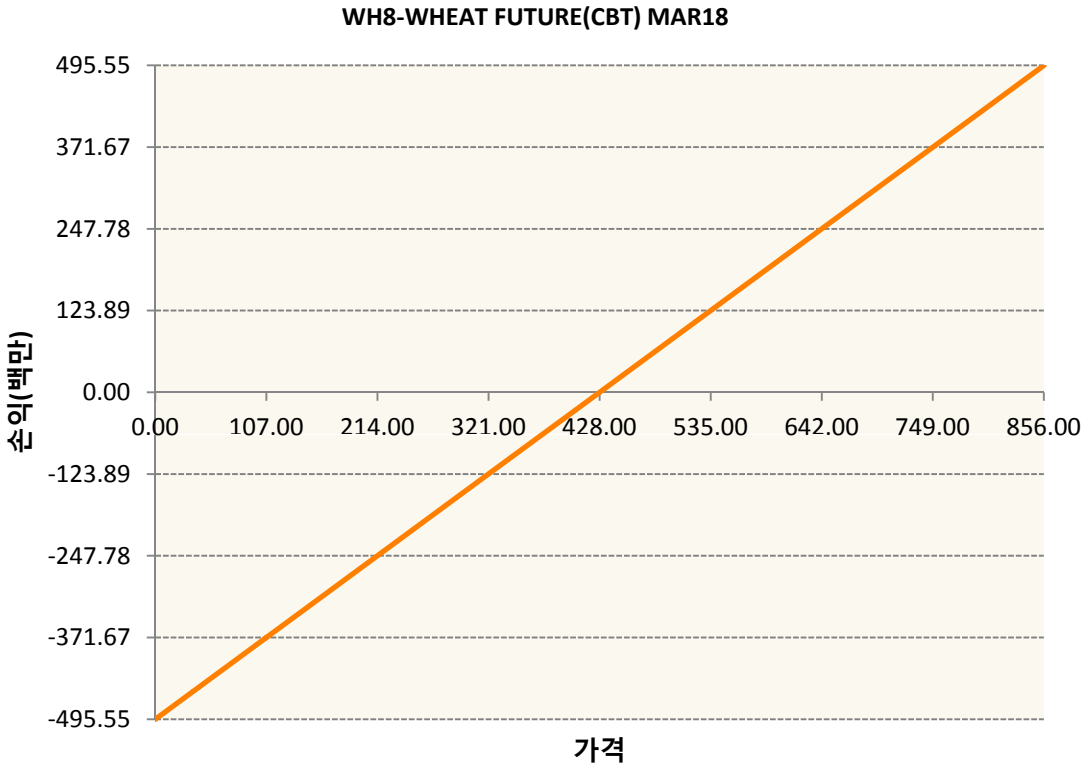
SH8-SOYBEAN FUTURE MAR18



SMH8-SOYBEAN MEAL FUTR MAR18







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

BOH8	SOYBEAN OIL FUTR MAR18	30
CH8	CORN FUTURE MAR18	86
CTH8	COTTON NO.2 FUTR MAR18	17
KCH8	COFFEE "C" FUTURE MAR18	25
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	40

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

360