공시일	2018-01-11
기준일	2018-01-10

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	2018-01-11
기준일	2018-01-10

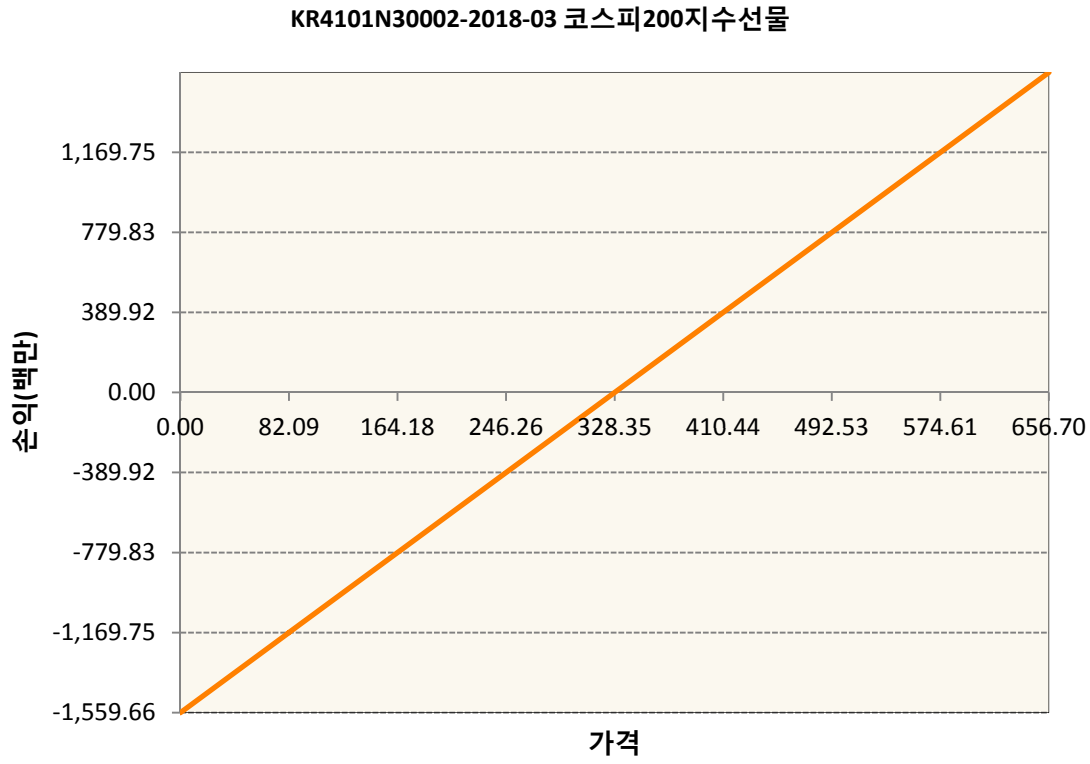
스마트인덱스모

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	1,560	0	1,560	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)

75

공시일	2018-01-11
기준일	2018-01-10

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	1,130

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

362

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2018-01-11
기준일	2018-01-10

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	417

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

377

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2018-01-11
기준일	2018-01-10

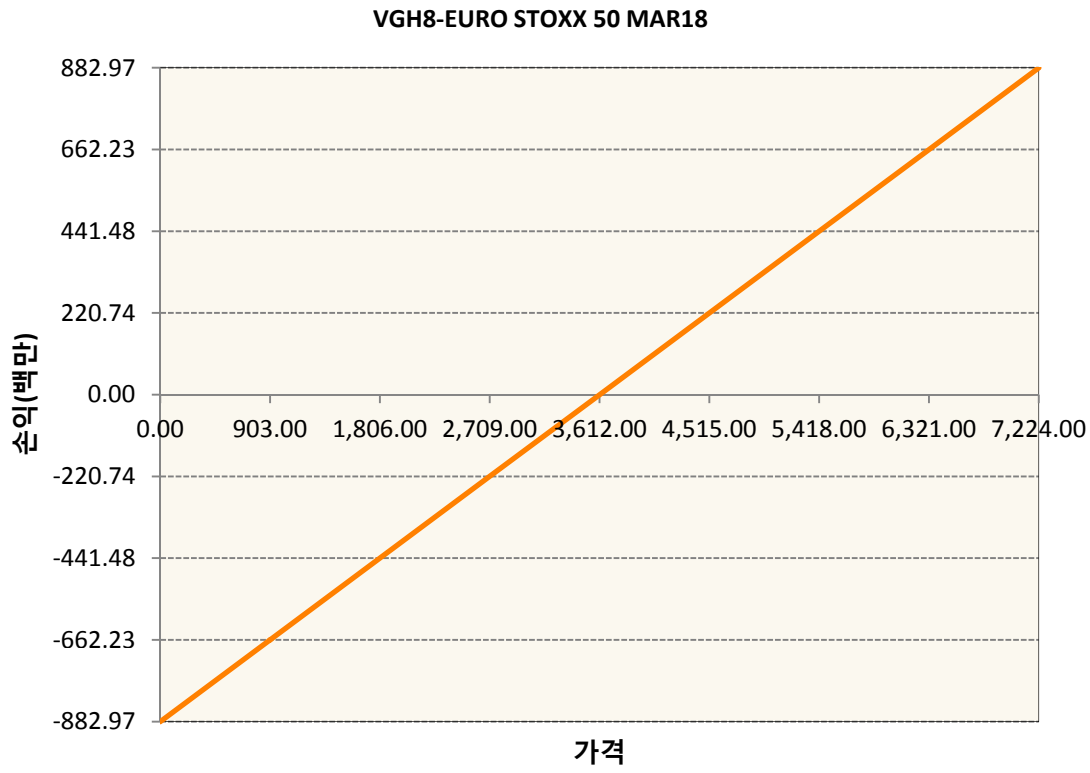
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	883	0	883	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGH8	EURO STOXX 50 MAR18	71

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

(단위:백만원)

40

공시일	2018-01-11
기준일	2018-01-10

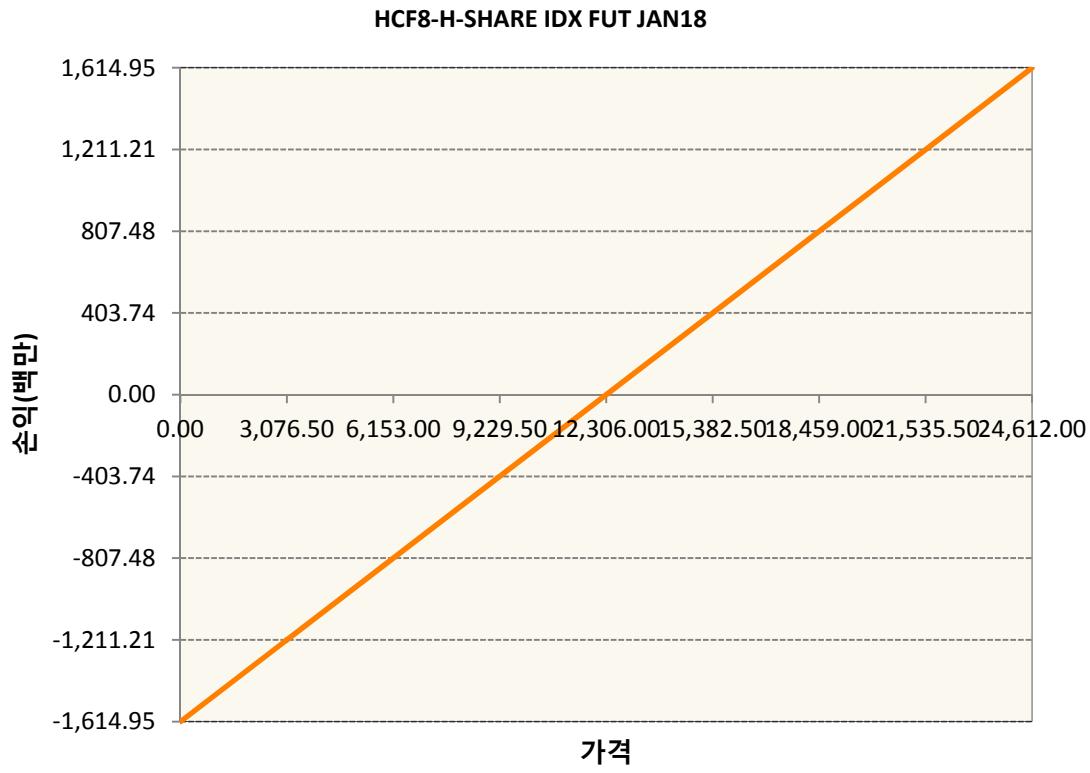
차이나인덱스모(주식-파생형)

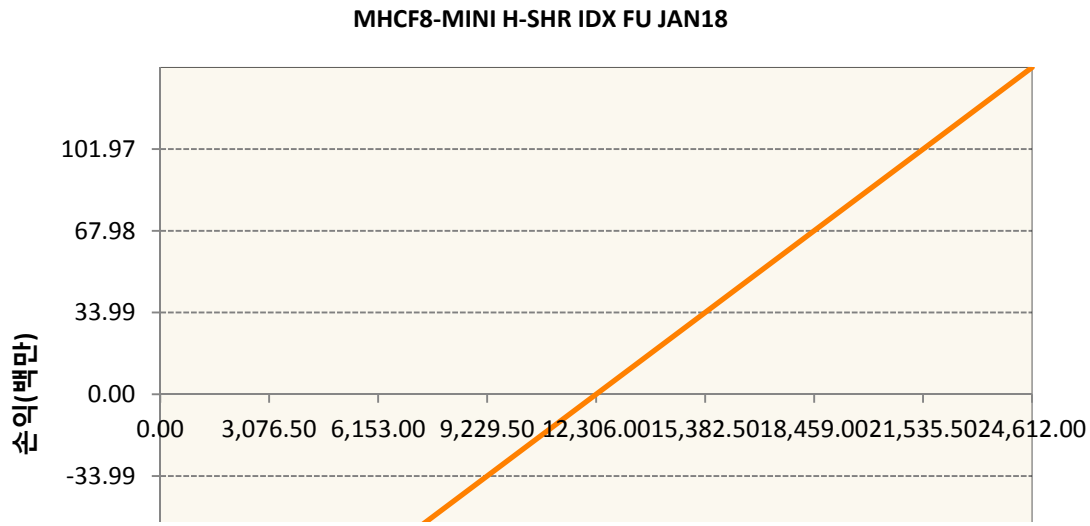
1. 계약금액

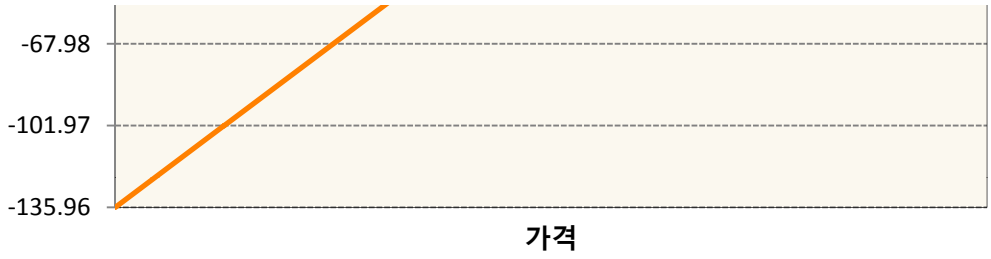
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,751	0	1,751	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCF8	H-SHARE IDX FUT JAN18	129
MHCF8	MINI H-SHR IDX FU JAN18	11

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	112

공시일	2018-01-11
기준일	2018-01-10

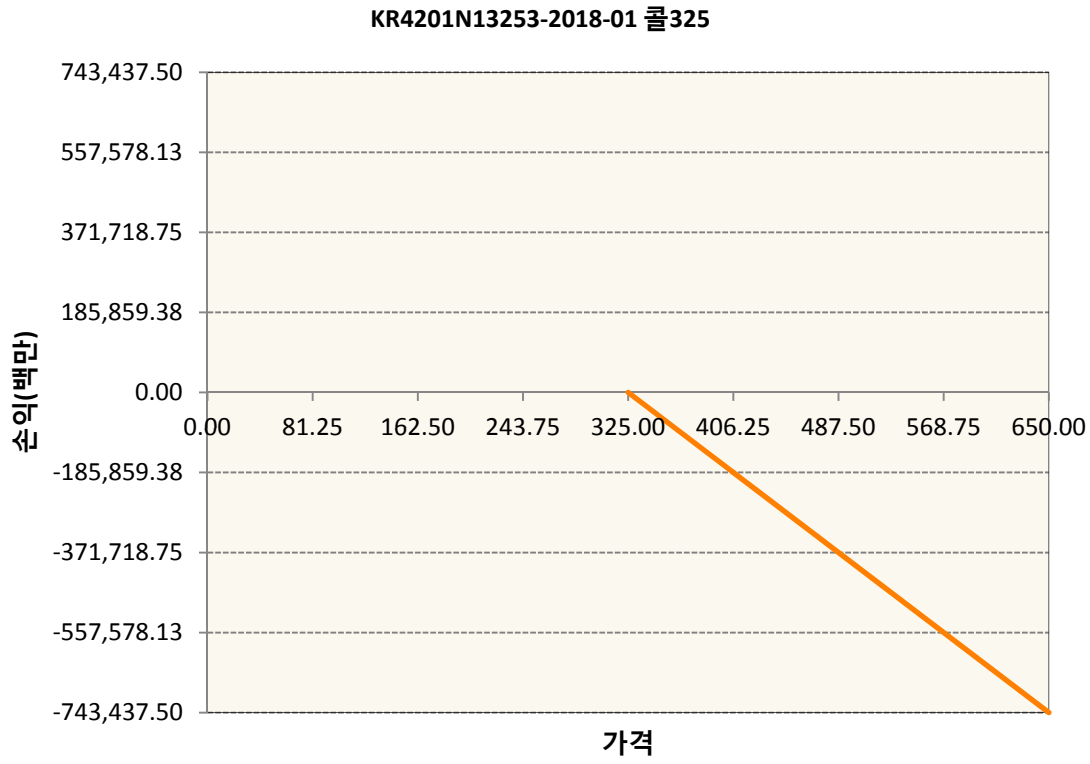
커버드콜모(주식혼합-파생형)

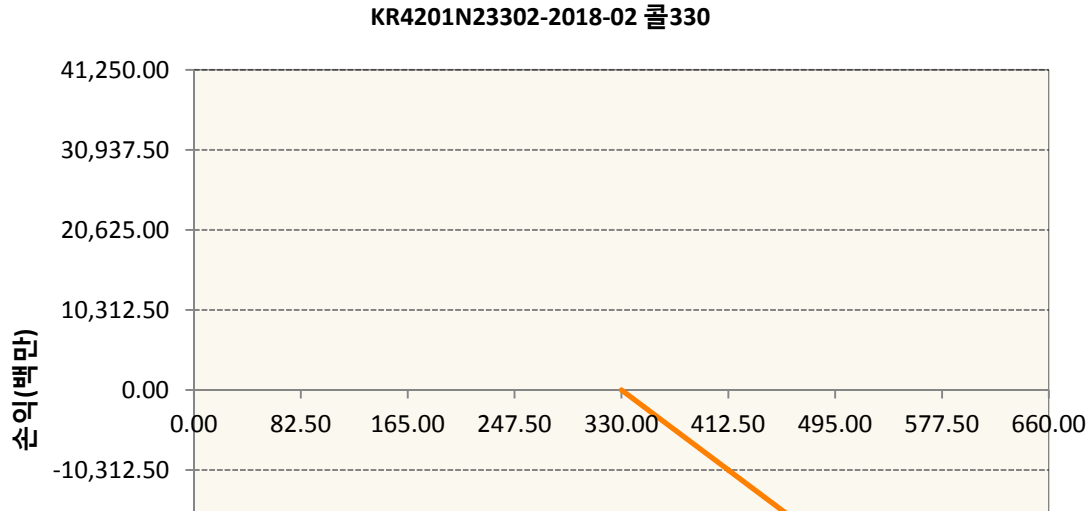
1. 계약금액

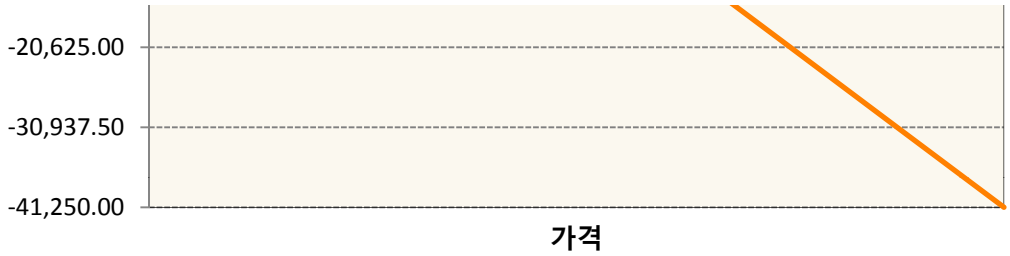
(단위:백만원)

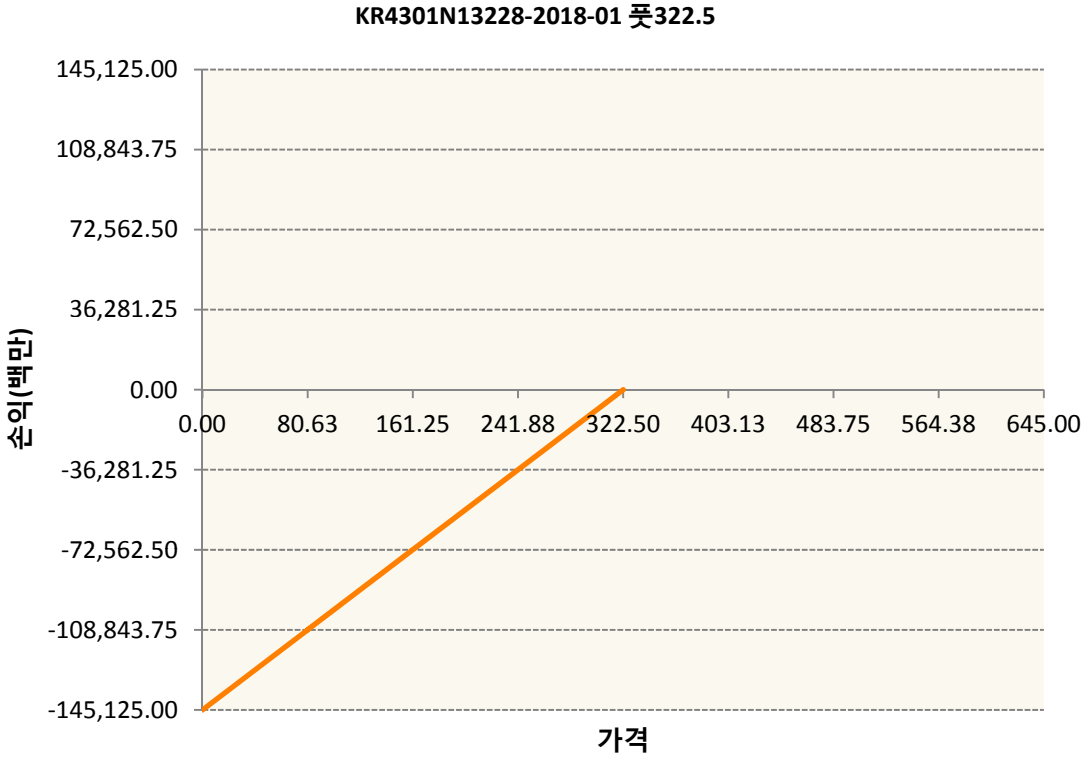
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	40,162	41,704	-1,542	장내
누계	유가증권	옵션	0	1,376,688	-1,376,688	장내

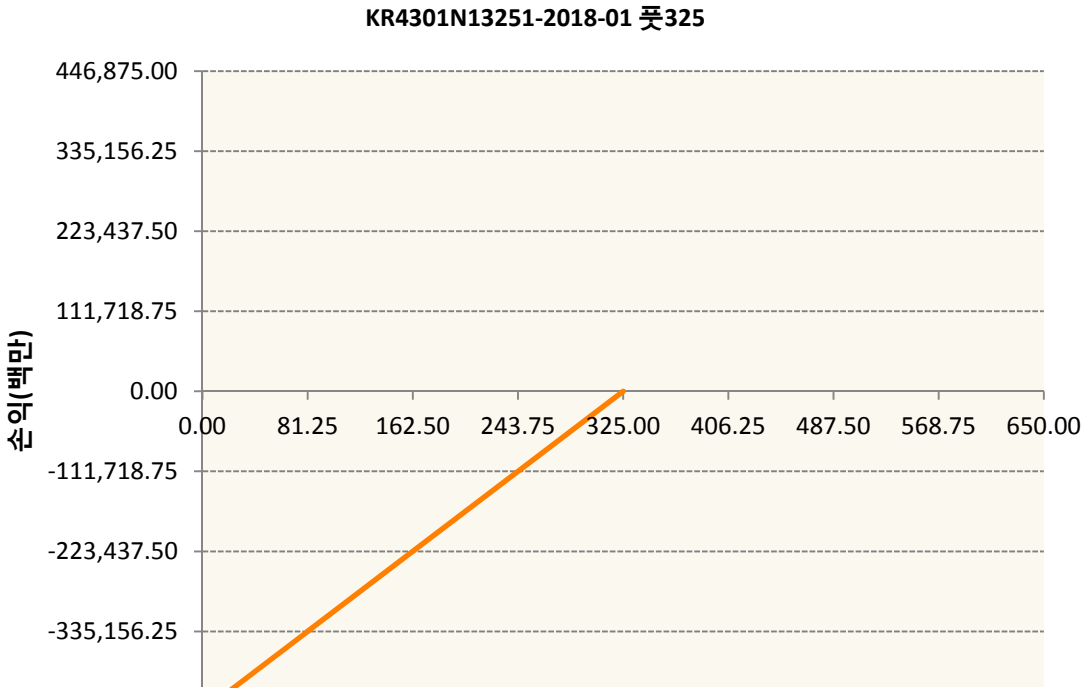
2. 만기시점의 손익구조






-20,625.00
-30,937.50
-41,250.00
가격


KR4301N13228-2018-01 풋322.5
145,125.00
108,843.75
72,562.50
36,281.25
0.00
-36,281.25
-72,562.50
-108,843.75
-145,125.00
0.00
80.63
161.25
241.88
322.50
403.13
483.75
564.38
645.00
손익(백만)
가격


KR4301N13251-2018-01 풋325
446,875.00
335,156.25
223,437.50
111,718.75
0.00
-111,718.75
-223,437.50
-335,156.25
0.00
81.25
162.50
243.75
325.00
406.25
487.50
568.75
650.00
손익(백만)



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4201N132 2018-01 콜325							58,374
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	7,567	7,567	7,567	7,567	7,567	7,567	7,567
-5.33%	7,567	7,567	7,567	7,567	7,566	7,564	7,560
-2.67%	7,499	7,442	7,365	7,267	7,149	7,014	6,863
0%	746	510	260	0	-269	-545	-826
2.67%	-18,407	-18,408	-18,412	-18,419	-18,431	-18,452	-18,481
5.33%	-38,390	-38,390	-38,390	-38,390	-38,390	-38,390	-38,391
8.00%	-58,374	-58,374	-58,374	-58,374	-58,374	-58,374	-58,374
KR4201N233 2018-02 콜330							2,434
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	977	953	922	885	843	796	744
-5.33%	889	839	783	723	658	590	519
-2.67%	679	601	521	438	354	268	181
0%	284	189	95	0	-95	-189	-284
2.67%	-328	-419	-510	-602	-695	-788	-882
5.33%	-1,136	-1,206	-1,280	-1,357	-1,437	-1,520	-1,604
8.00%	-2,086	-2,129	-2,180	-2,236	-2,298	-2,364	-2,434
KR4301N132 2018-01 풋322.5							9,488
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-9,488	-9,488	-9,488	-9,488	-9,488	-9,488	-9,488
-5.33%	-5,557	-5,557	-5,557	-5,557	-5,557	-5,557	-5,557
-2.67%	-1,628	-1,631	-1,635	-1,641	-1,648	-1,657	-1,668
0%	2	2	1	0	-2	-5	-9
2.67%	2	2	2	2	2	2	2
5.33%	2	2	2	2	2	2	2
8.00%	2	2	2	2	2	2	2
KR4301N132 2018-01 풋325							32,290
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-32,290	-32,290	-32,290	-32,290	-32,290	-32,290	-32,290
-5.33%	-20,278	-20,278	-20,278	-20,278	-20,278	-20,278	-20,278
-2.67%	-8,266	-8,266	-8,266	-8,267	-8,269	-8,272	-8,277
0%	103	75	41	0	-47	-98	-154
2.67%	146	146	146	146	146	146	146

5.33%	146	146	146	146	146	146	146
8.00%	146	146	146	146	146	146	146

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

145,867

공시일	2018-01-11
기준일	2018-01-10

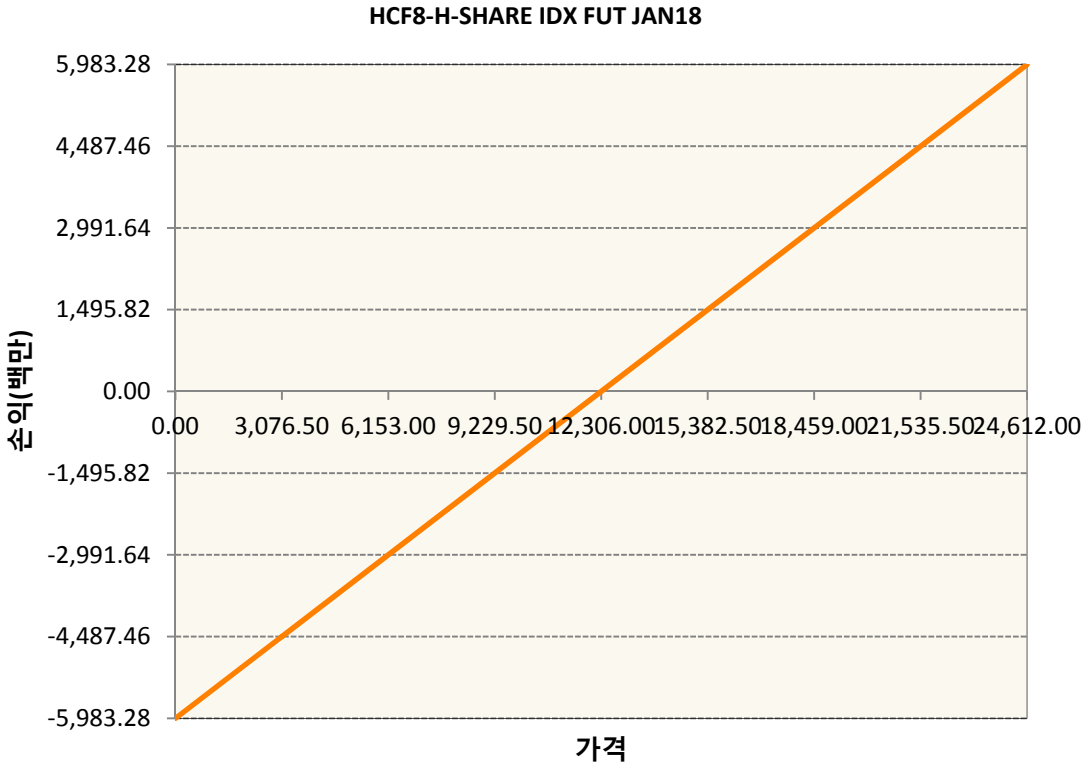
홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생

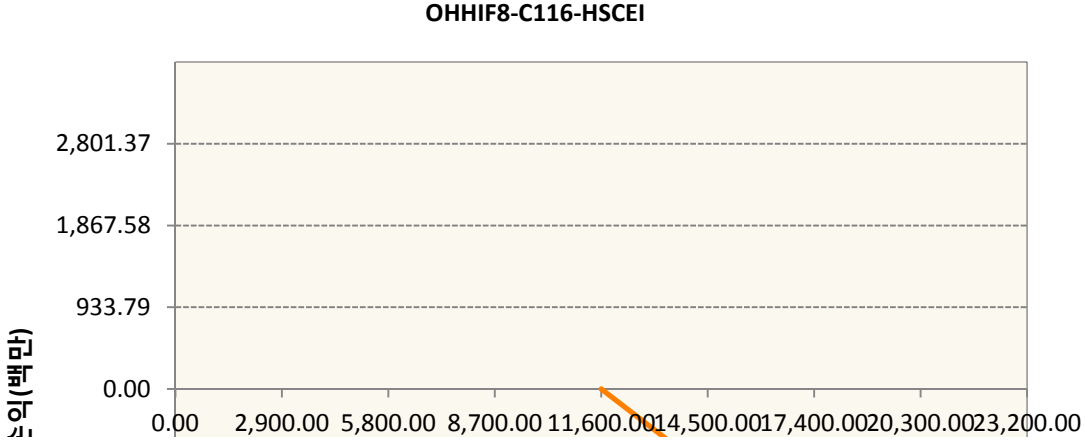
1. 계약금액

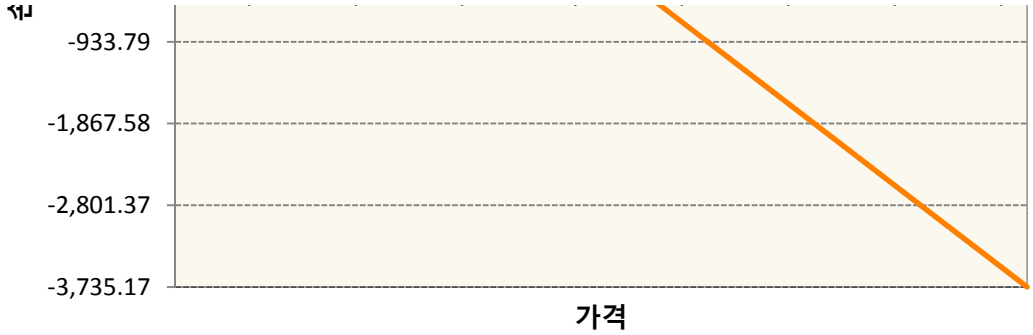
(단위:백만원)

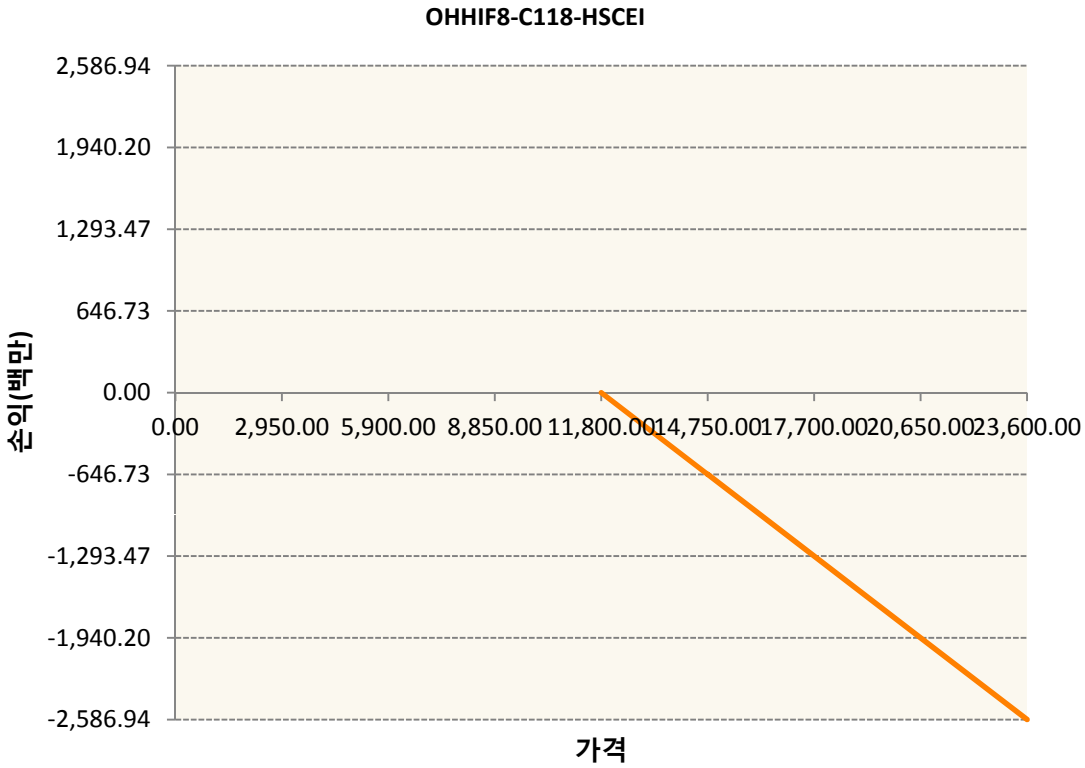
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	5,983	0	5,983	장내
누계	유가증권	옵션	0	12,644	-12,644	장내

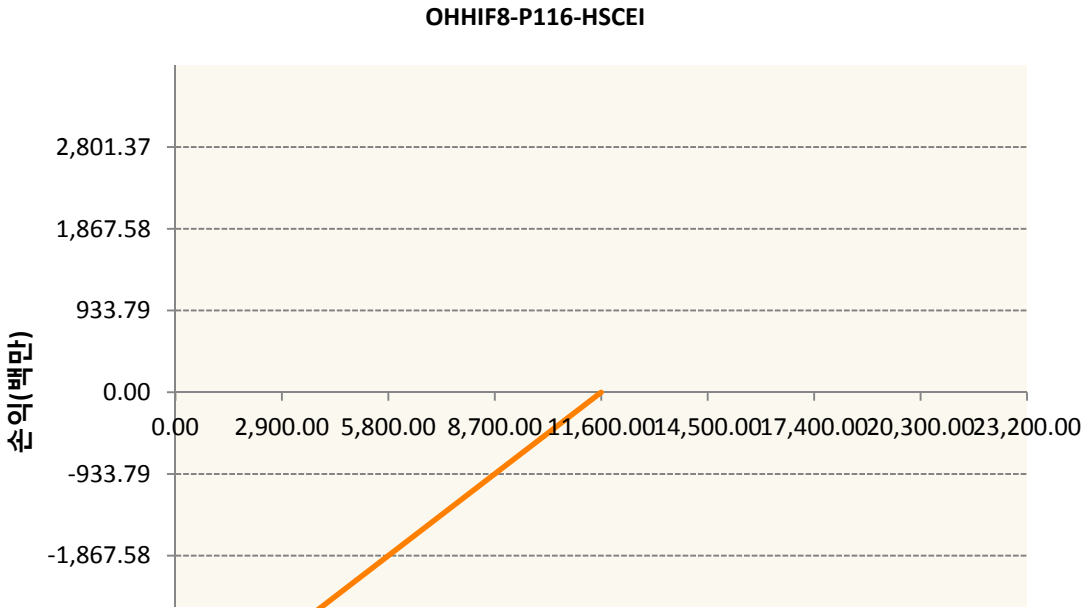
2. 만기시점의 손익구조

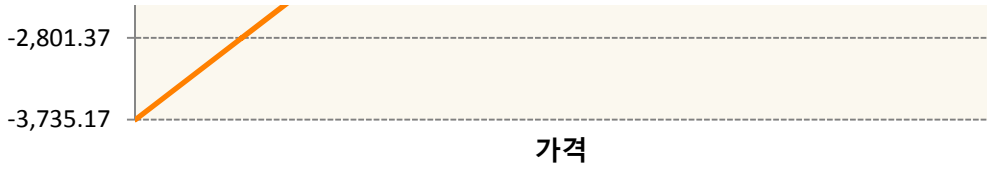


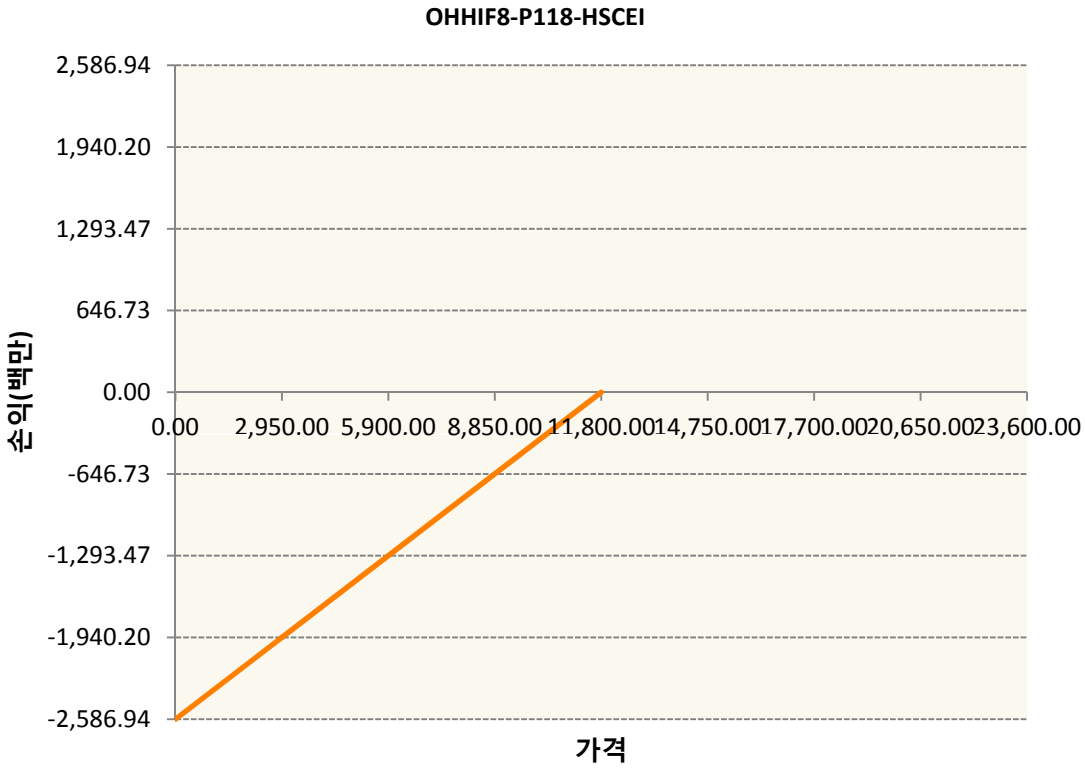



-933.79
-1,867.58
-2,801.37
-3,735.17
가격


OHHIF8-C118-HSCEI
2,586.94
1,940.20
1,293.47
646.73
0.00
-646.73
-1,293.47
-1,940.20
-2,586.94
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
2,801.37
1,867.58
933.79
0.00
-933.79
-1,867.58
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	479
OHHIF8-C11	HSCEI	299
OHHIF8-C11	HSCEI	207
OHHIF8-P11	HSCEI	299
OHHIF8-P11	HSCEI	207

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,189

공시일	2018-01-11
기준일	2018-01-10

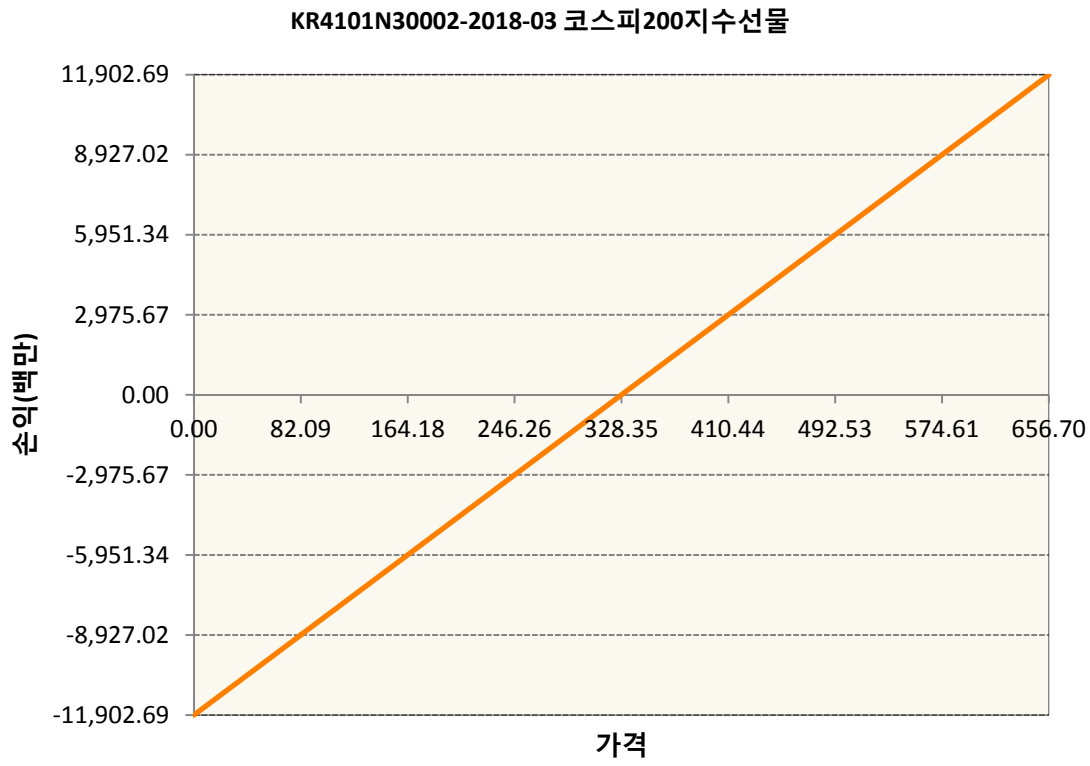
코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼

1. 계약금액

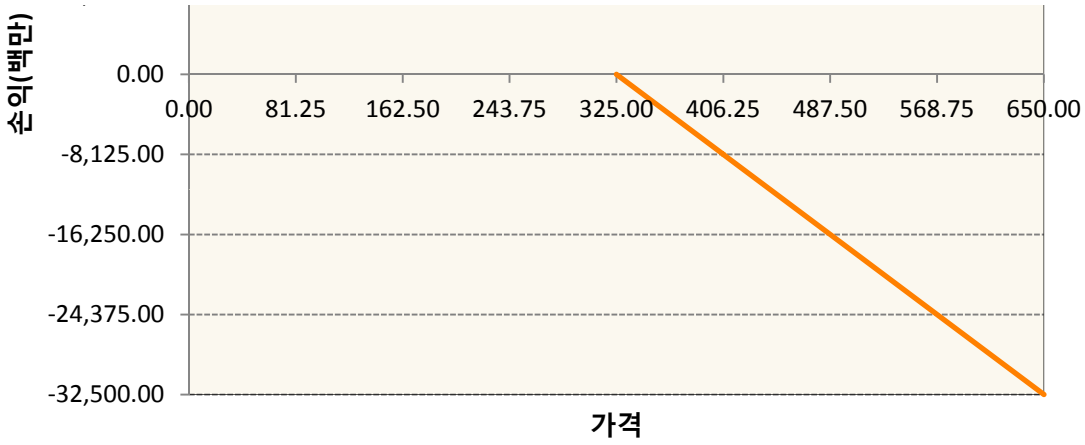
(단위:백만원)

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	11,903	0	11,903	장내
누계	유가증권	스왑	60,200	0	60,200	장외
누계	유가증권	옵션	0	59,263	-59,263	장내

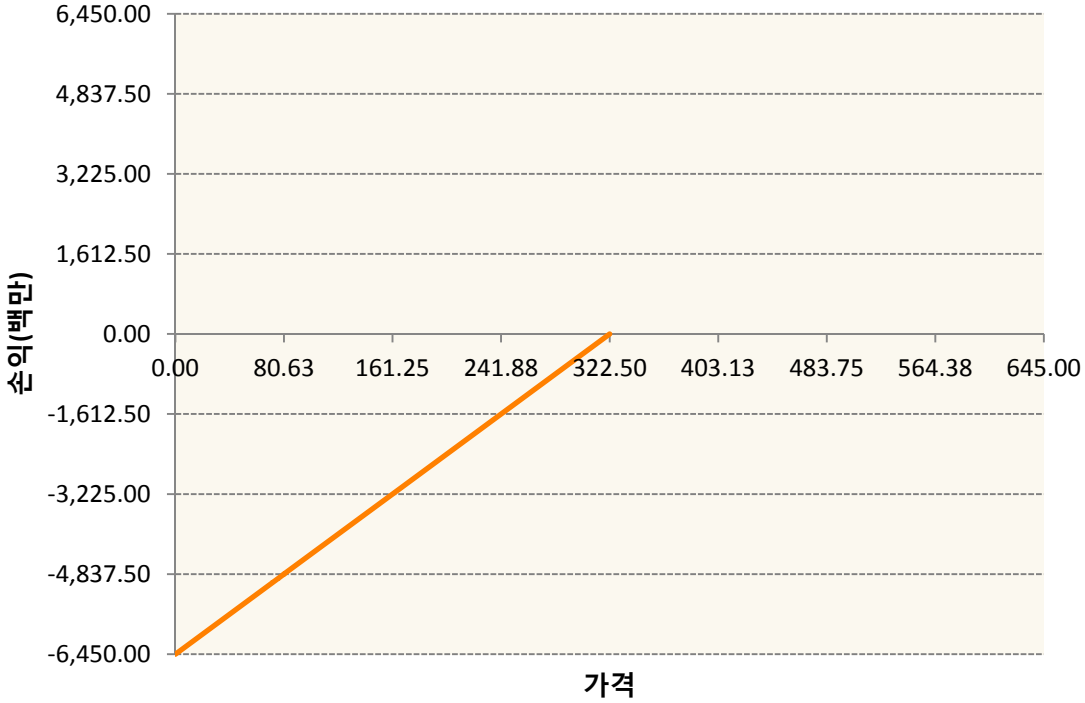
2. 만기시점의 손익구조



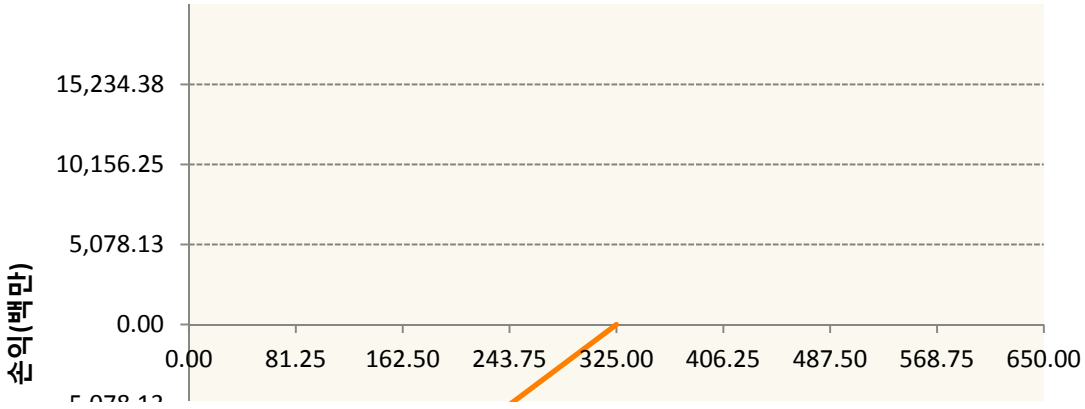




KR4301N13228-2018-01 풋322.5



KR4301N13251-2018-01 풋325





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_2							1,454
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,454	-1,454	-1,454	-1,454	-1,454	-1,454	-1,454
-5.33%	-969	-969	-969	-969	-969	-969	-969
-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%	969	969	969	969	969	969	969
8.00%	1,454	1,454	1,454	1,454	1,454	1,454	1,454
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							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						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%	-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%	251	251	251	251	251	251	251
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_8						465
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-465	-465	-465	-465	-465	-465	-465
-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%	465	465	465	465	465	465	465
	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%	-207	-207	-207	-207	-207	-207	-207
-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%	207	207	207	207	207	207	207
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						629
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-629	-629	-629	-629	-629	-629	-629
-5.33%	-419	-419	-419	-419	-419	-419	-419
-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%	419	419	419	419	419	419	419
8.00%	629	629	629	629	629	629	629
	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						950
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-950	-950	-950	-950	-950	-950	-950
-5.33%	-633	-633	-633	-633	-633	-633	-633
-2.67%	-317	-317	-317	-317	-317	-317	-317
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	317	317	317	317	317	317	317
5.33%	633	633	633	633	633	633	633
8.00%	950	950	950	950	950	950	950
	KR4201N13: 2018-01 콜325						2,552

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	331	331	331	331	331	331	331
-5.33%	331	331	331	331	331	331	331
-2.67%	328	325	322	318	313	307	300
0%	33	22	11	0	-12	-24	-36
2.67%	-805	-805	-805	-805	-806	-807	-808
5.33%	-1,678	-1,678	-1,678	-1,678	-1,678	-1,678	-1,678
8.00%	-2,552	-2,552	-2,552	-2,552	-2,552	-2,552	-2,552
	KR4301N132 2018-01 풋322.5						422

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-422	-422	-422	-422	-422	-422	-422
-5.33%	-247	-247	-247	-247	-247	-247	-247
-2.67%	-72	-72	-73	-73	-73	-74	-74
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	0	0	0	0	0	0	0
5.33%	0	0	0	0	0	0	0
8.00%	0	0	0	0	0	0	0
	KR4301N132 2018-01 풋325						1,468

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,468	-1,468	-1,468	-1,468	-1,468	-1,468	-1,468
-5.33%	-922	-922	-922	-922	-922	-922	-922
-2.67%	-376	-376	-376	-376	-376	-376	-376
0%	5	3	2	0	-2	-4	-7
2.67%	7	7	7	7	7	7	7
5.33%	7	7	7	7	7	7	7
8.00%	7	7	7	7	7	7	7

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

11,658

공시일	2018-01-11
기준일	2018-01-10

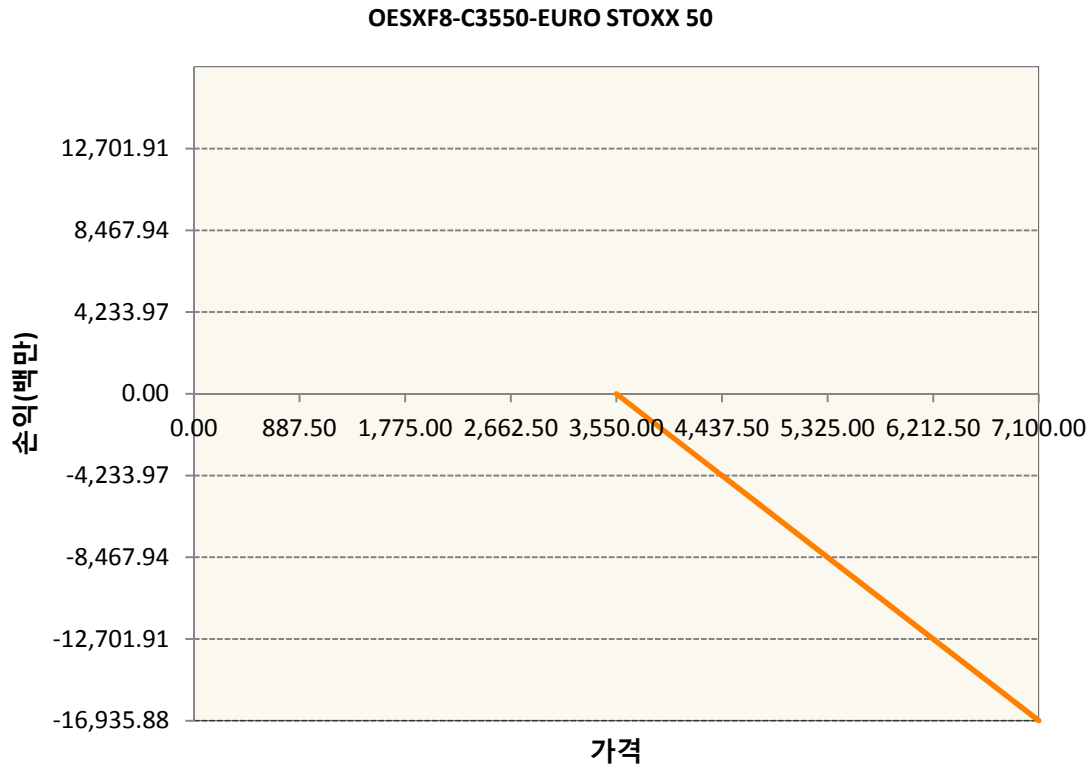
유로커버드콜모(주식혼합-파생형

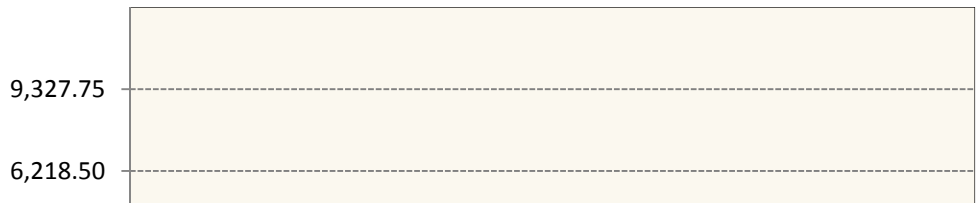
1. 계약금액

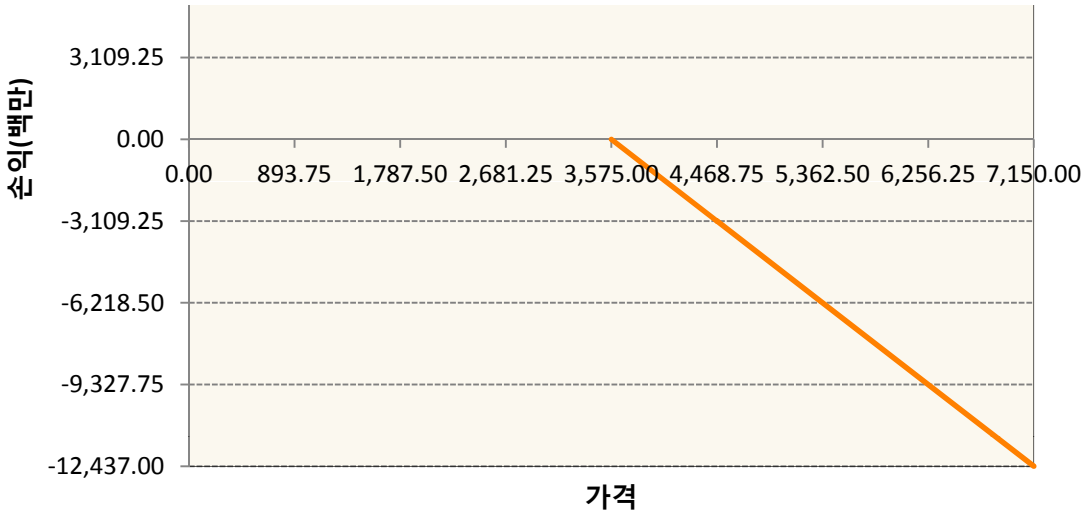
(단위:백만원)

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	21,466	0	21,466	
누계	유가증권	스왑	95,928	0	95,928	장외
누계	유가증권	옵션	0	58,746	-58,746	장내
누계	지수	스왑	51,163	0	51,163	장외

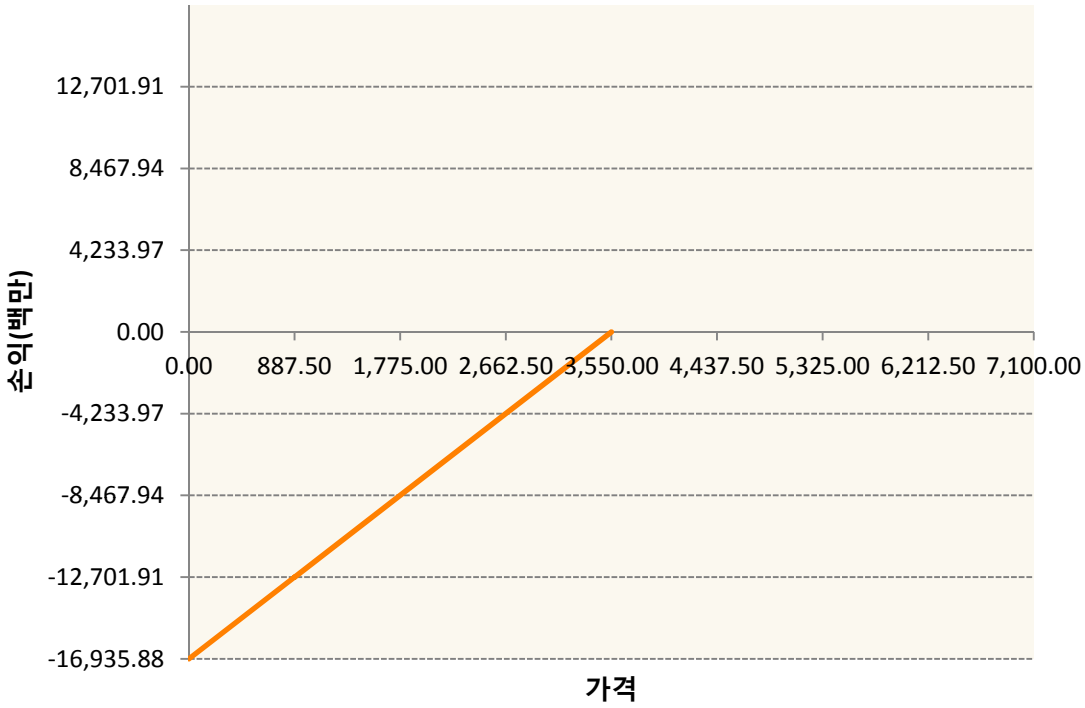
2. 만기시점의 손익구조



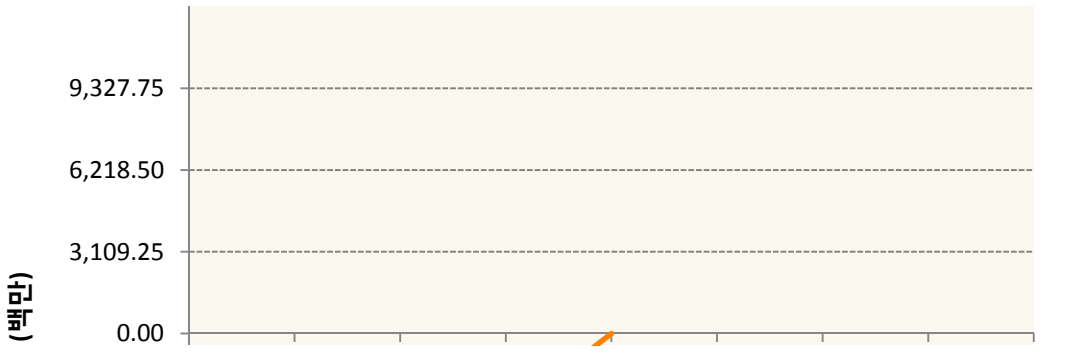


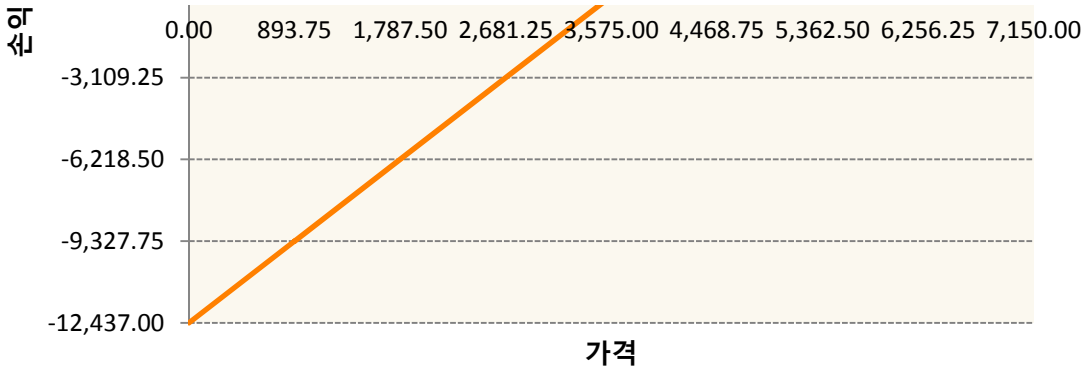


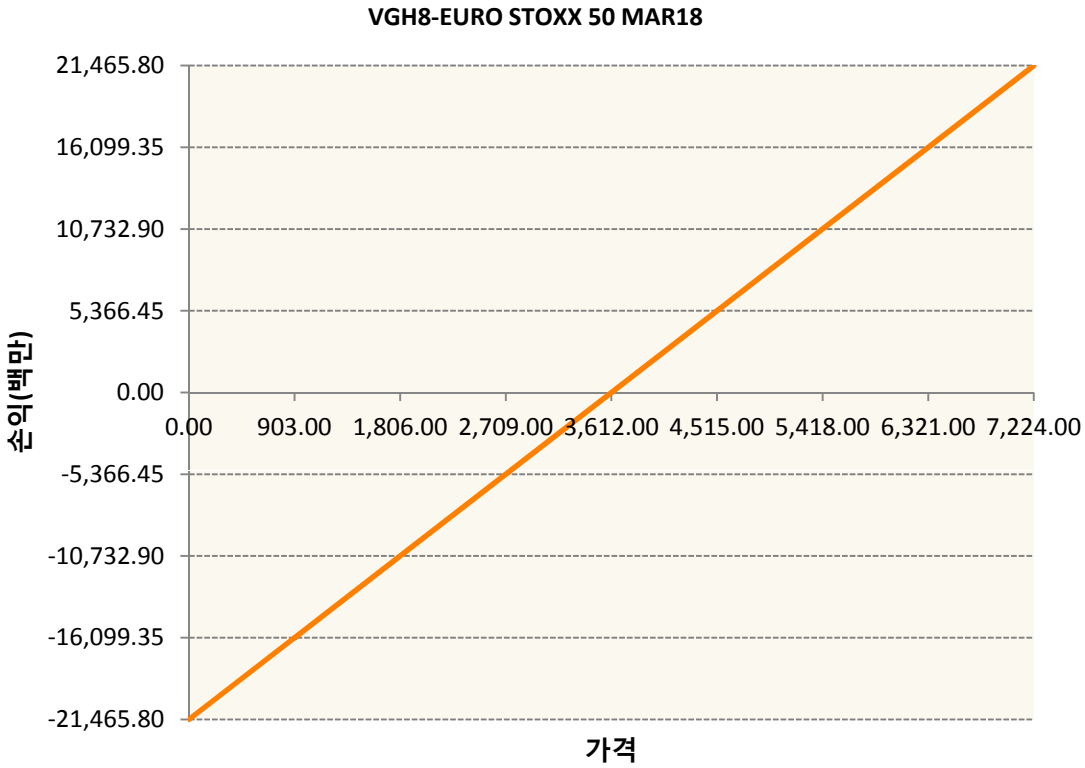
OESXF8-P3550-EURO STOXX 50



OESXF8-P3575-EURO STOXX 50







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)	(단위:백만원)
260105SGPX SG EURO Covered CALL STRATEGY - 994.569	103
260105SQPX SG EURO Covered CALL STRATEGY	150
OESXF8-C35 EURO STOXX 50	1,355
OESXF8-C35 EURO STOXX 50	995
OESXF8-P35 EURO STOXX 50	1,355
OESXF8-P35 EURO STOXX 50	995
VGH8 EURO STOXX 50 MAR18	1,717

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

3,764

공시일	2018-01-11
기준일	2018-01-10

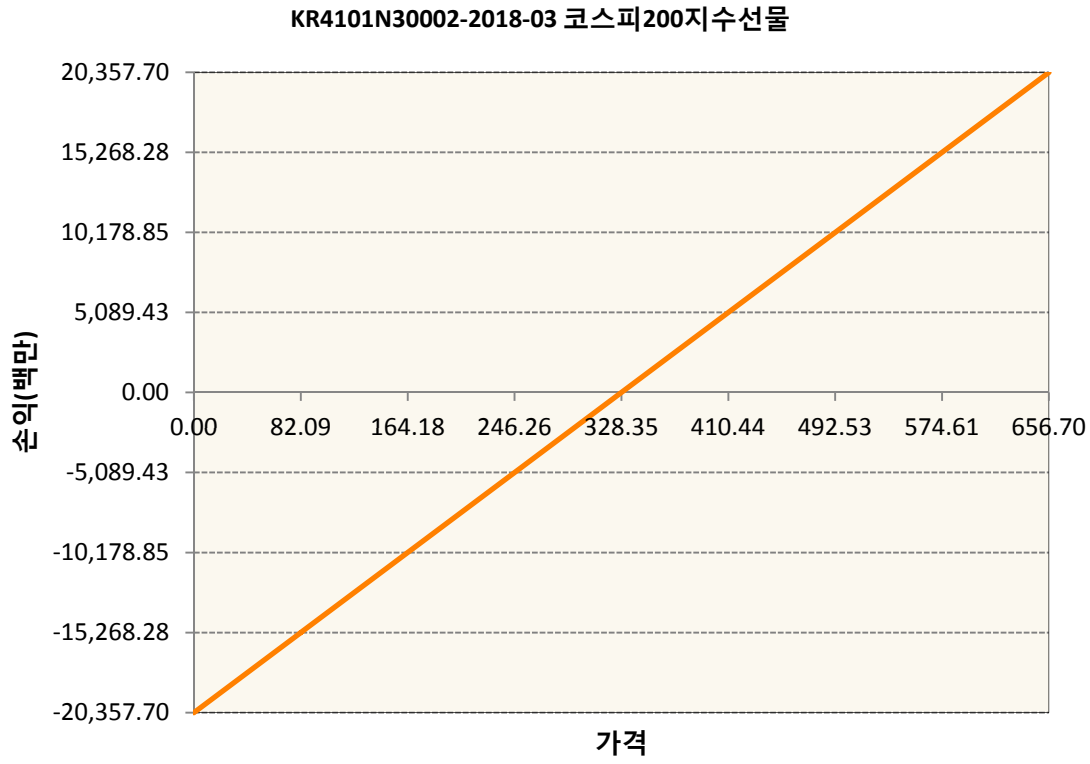
ETF스마트레버리지목표전환형8호

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	20,358	0	20,358	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101N30(2018-03 코스피200지수선물							1,625
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,625	-1,625	-1,625	-1,625	-1,625	-1,625	-1,625
-5.33%	-1,083	-1,083	-1,083	-1,083	-1,083	-1,083	-1,083
-2.67%	-542	-542	-542	-542	-542	-542	-542
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	542	542	542	542	542	542	542
5.33%	1,083	1,083	1,083	1,083	1,083	1,083	1,083
8.00%	1,625	1,625	1,625	1,625	1,625	1,625	1,625

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

976

공시일	2018-01-11
기준일	2018-01-10

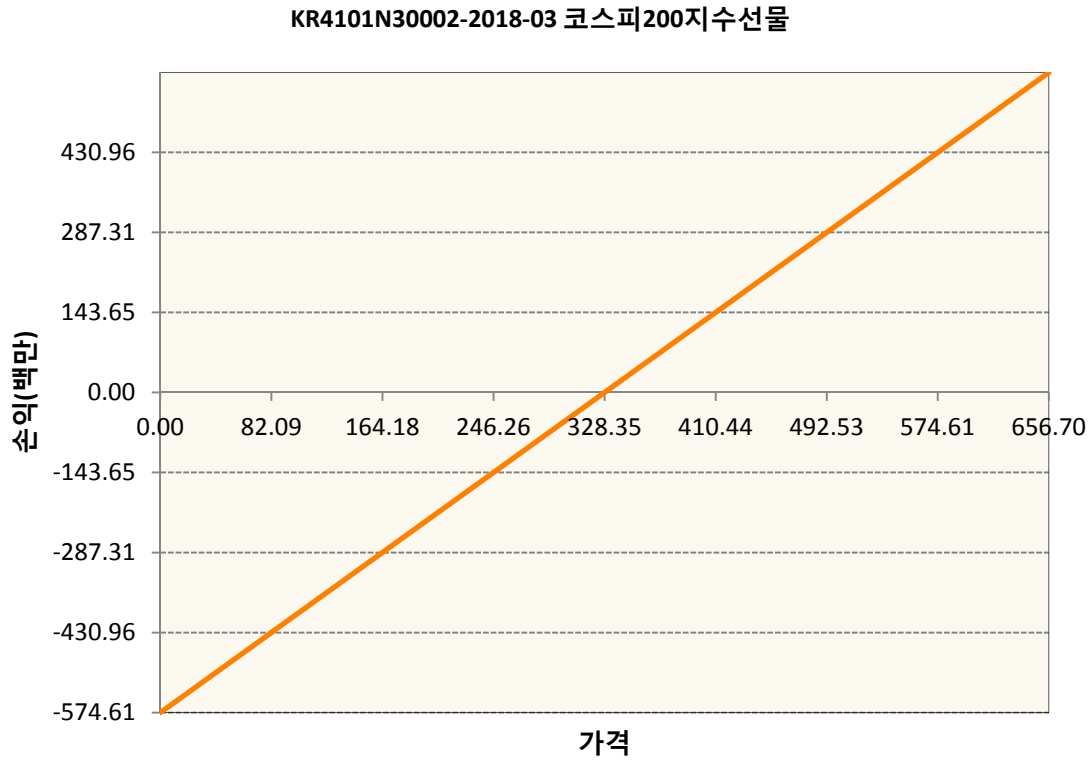
ETF스마트레버리지목표전환형9호

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	575	0	575	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%	-31	-31	-31	-31	-31	-31	-31
-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%	31	31	31	31	31	31	31
8.00%	46	46	46	46	46	46	46

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

28

공시일	2018-01-11
기준일	2018-01-10

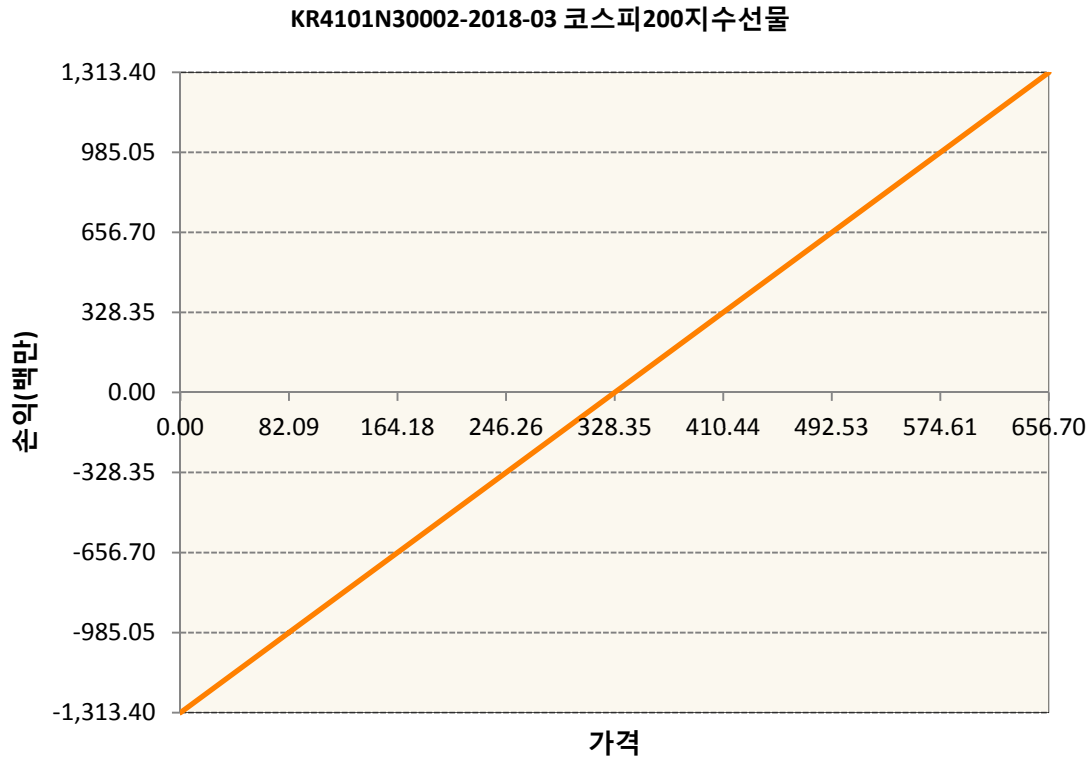
ETF스마트레버리지목표전환형10

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	330	-330	장내
누계	유가증권	선물	1,313	0	1,313	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101N30(2018-03 코스피200지수선물							105
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-105	-105	-105	-105	-105	-105	-105
-5.33%	-70	-70	-70	-70	-70	-70	-70
-2.67%	-35	-35	-35	-35	-35	-35	-35
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	35	35	35	35	35	35	35
5.33%	70	70	70	70	70	70	70
8.00%	105	105	105	105	105	105	105

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

63

공시일	2018-01-11
기준일	2018-01-10

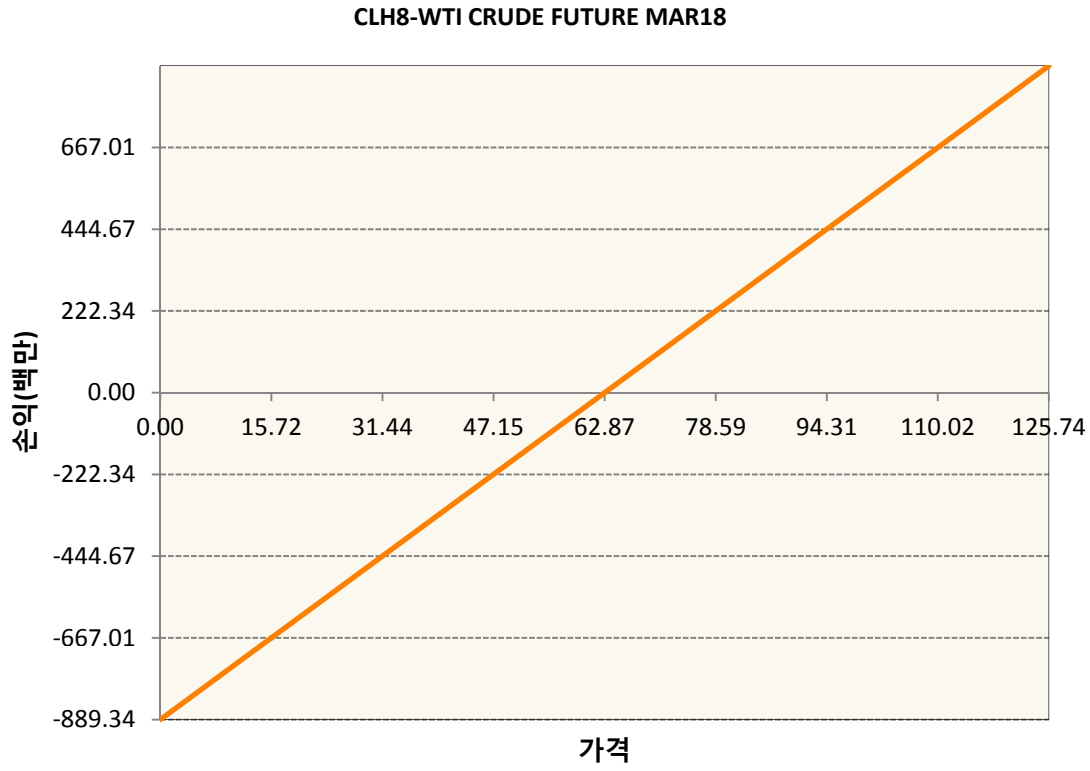
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

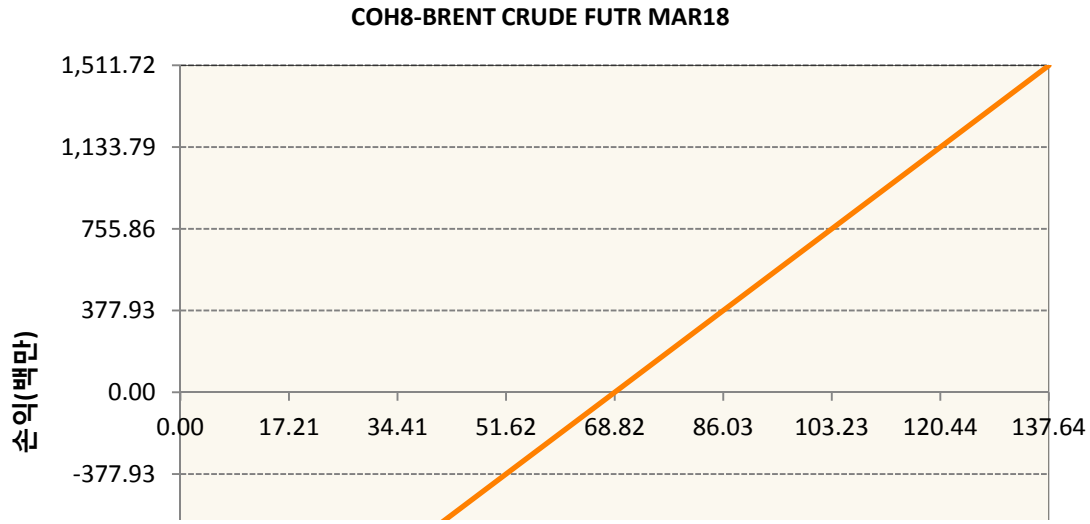
1. 계약금액

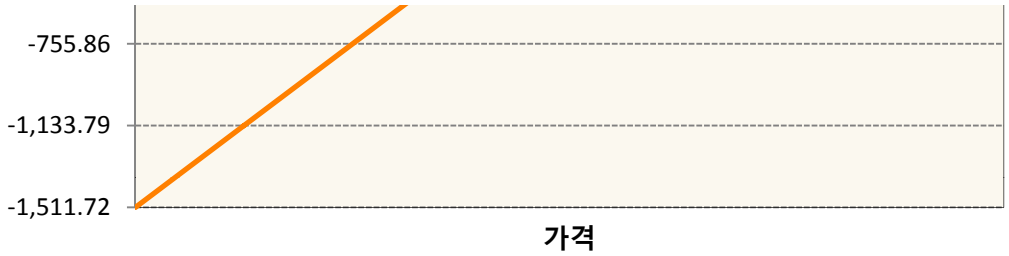
(단위:백만원)

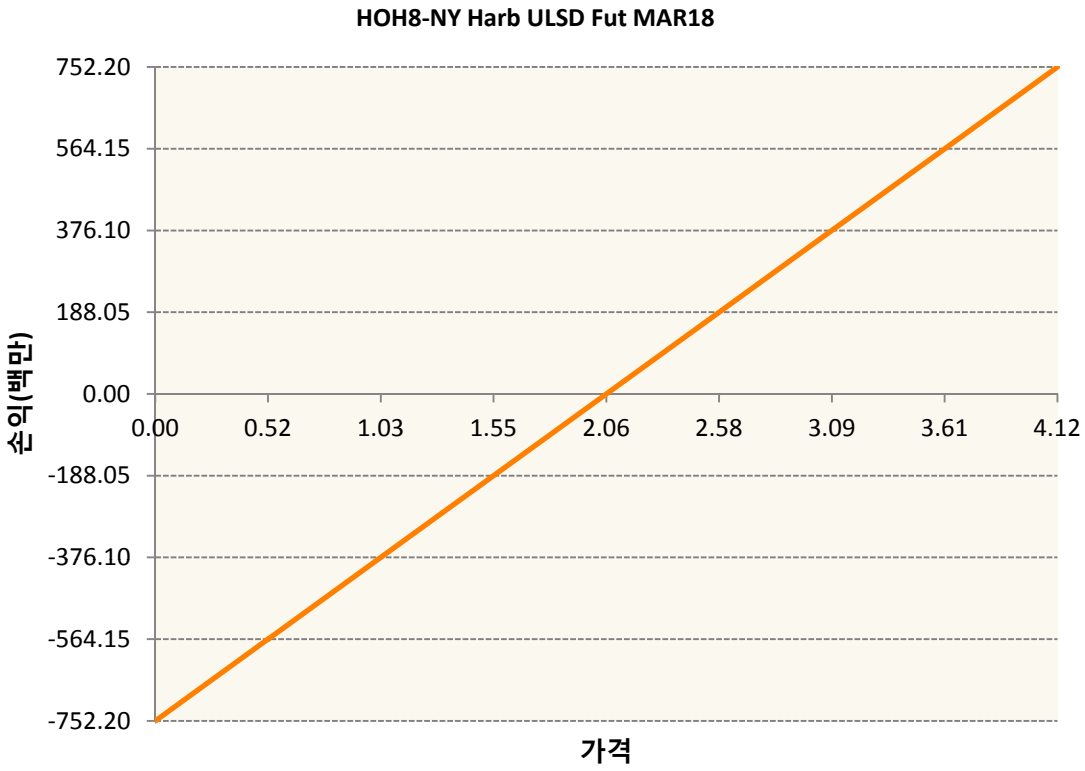
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	4,793	858	3,936	

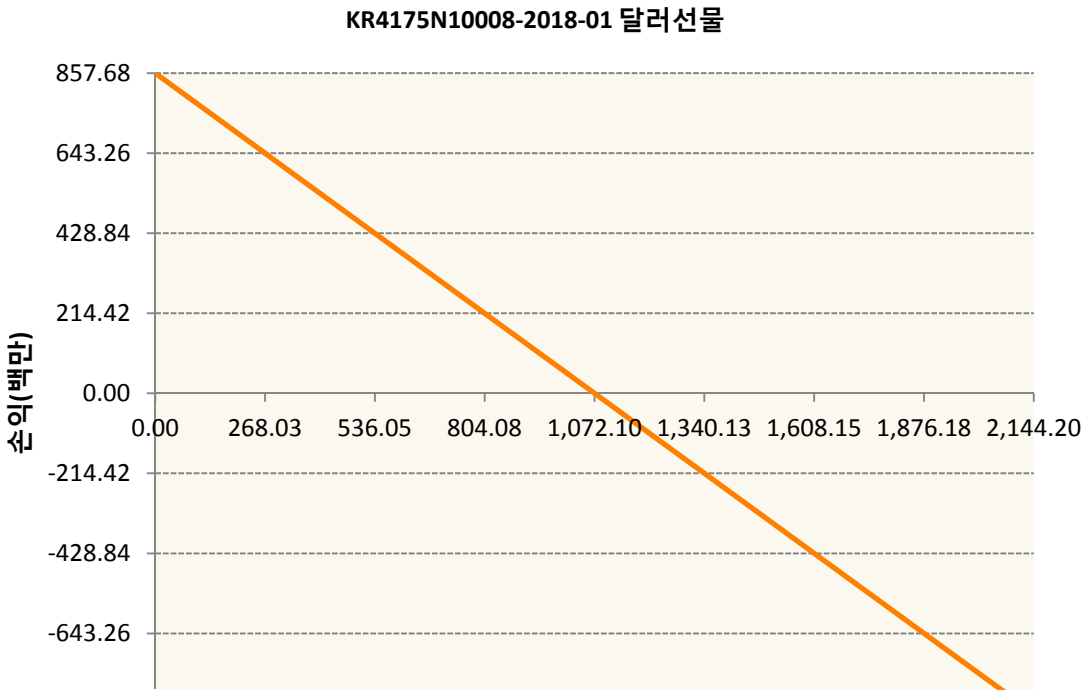
2. 만기시점의 손익구조

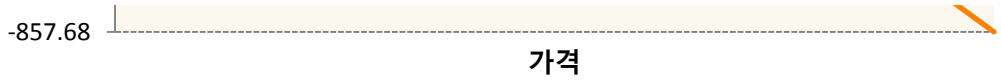


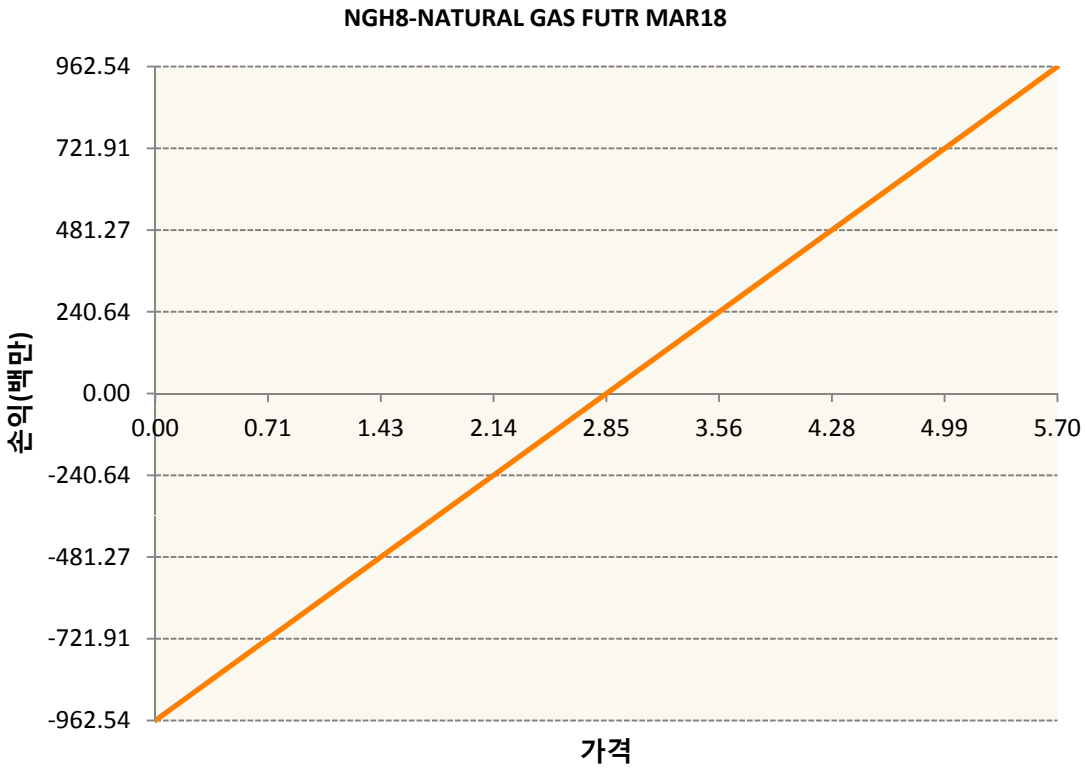


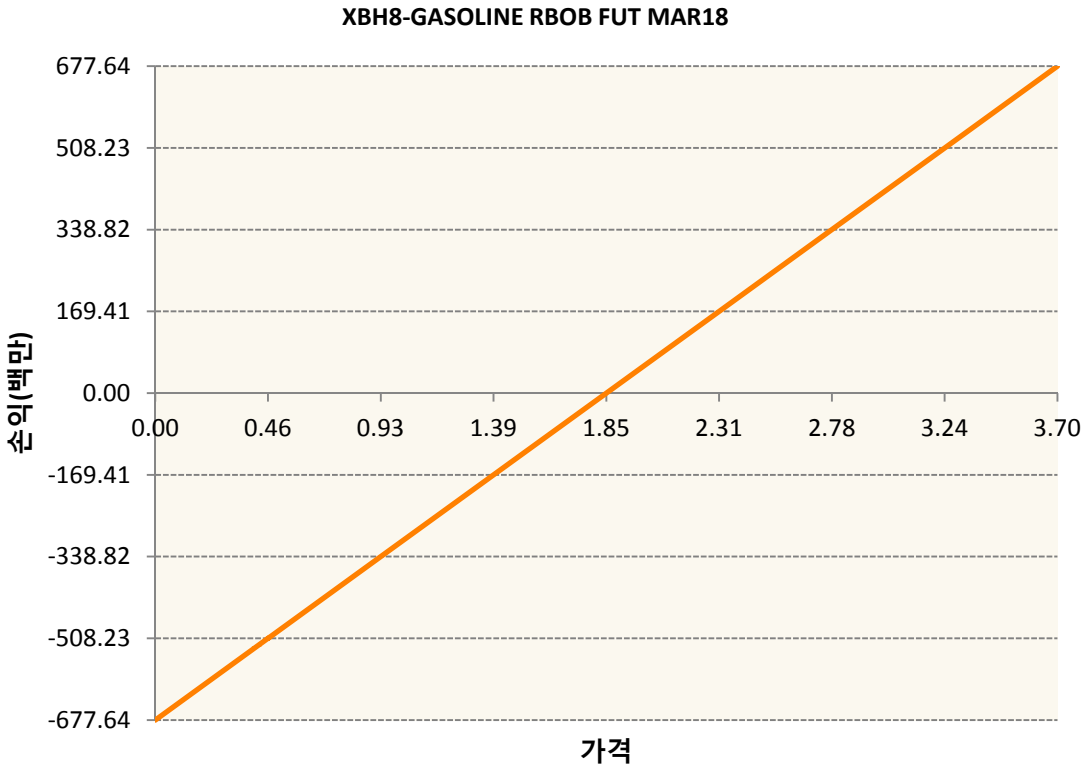

-755.86
-1,133.79
-1,511.72
가격


HOH8-NY Harb ULSD Fut MAR18
752.20
564.15
376.10
188.05
0.00
-188.05
-376.10
-564.15
-752.20
0.00
0.52
1.03
1.55
2.06
2.58
3.09
3.61
4.12
손익(백만)
가격


KR4175N10008-2018-01 달러선물
857.68
643.26
428.84
214.42
0.00
-214.42
-428.84
-643.26
0.00
268.03
536.05
804.08
1,072.10
1,340.13
1,608.15
1,876.18
2,144.20
손익(백만)


-857.68
가격


NGH8-NATURAL GAS FUTR MAR18
962.54
721.91
481.27
240.64
0.00
-240.64
-481.27
-721.91
-962.54
손익(백만)
0.00
0.71
1.43
2.14
2.85
3.56
4.28
4.99
5.70
가격


XBH8-GASOLINE RBOB FUT MAR18
677.64
508.23
338.82
169.41
0.00
-169.41
-338.82
-508.23
-677.64
손익(백만)
0.00
0.46
0.93
1.39
1.85
2.31
2.78
3.24
3.70
가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLH8	WTI CRUDE FUTURE MAR18	71
COH8	BRENT CRUDE FUTR MAR18	121
HOH8	NY Harb ULSD Fut MAR18	60
KR4175N10(	2018-01 달러선물	69
NGH8	NATURAL GAS FUTR MAR18	77
XBH8	GASOLINE RBOB FUT MAR18	54

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

632

공시일	2018-01-11
기준일	2018-01-10

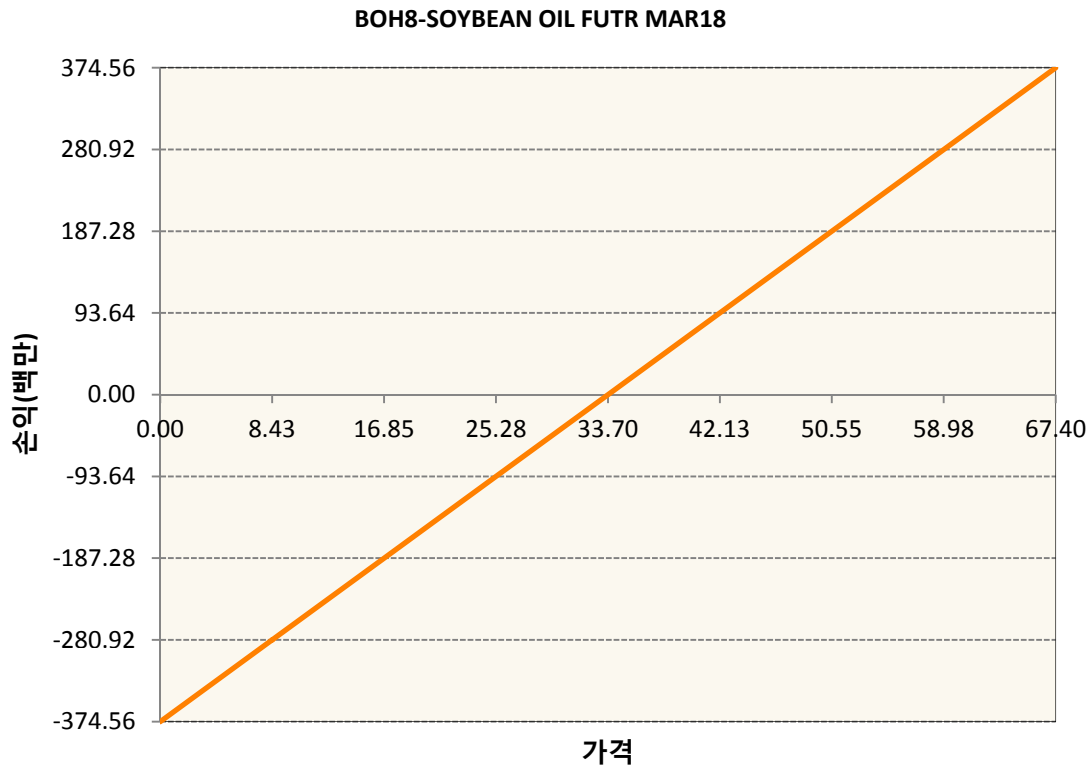
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

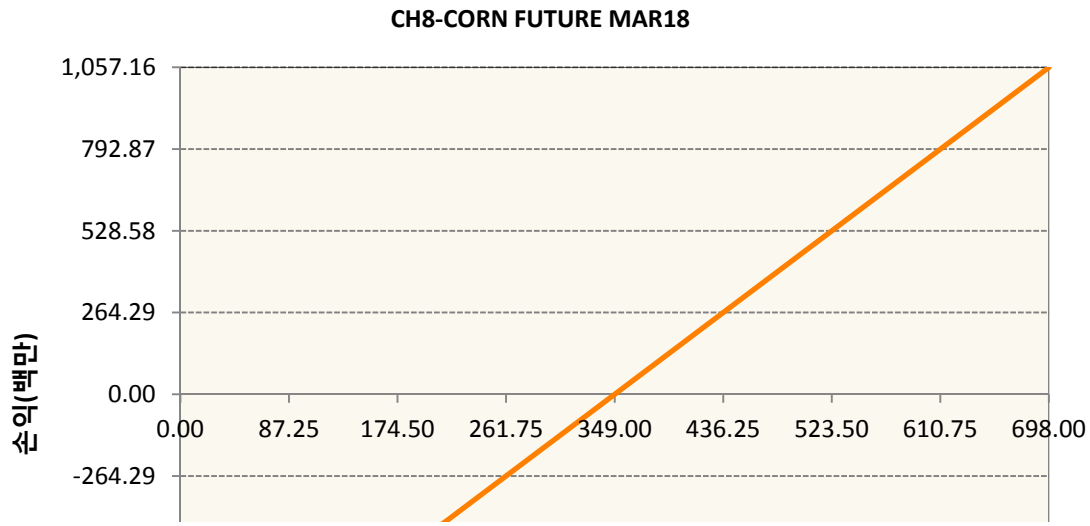
1. 계약금액

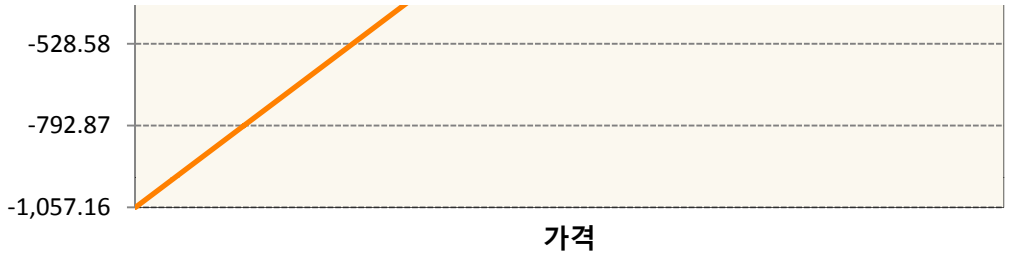
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	4,256	322	3,934	

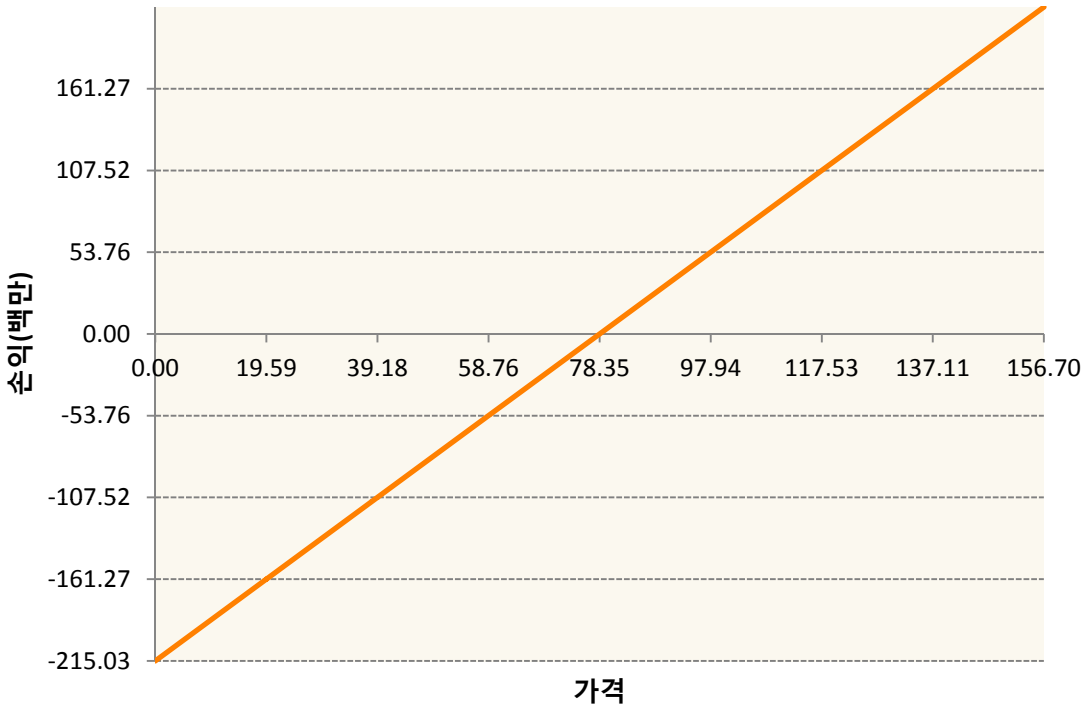
2. 만기시점의 손익구조



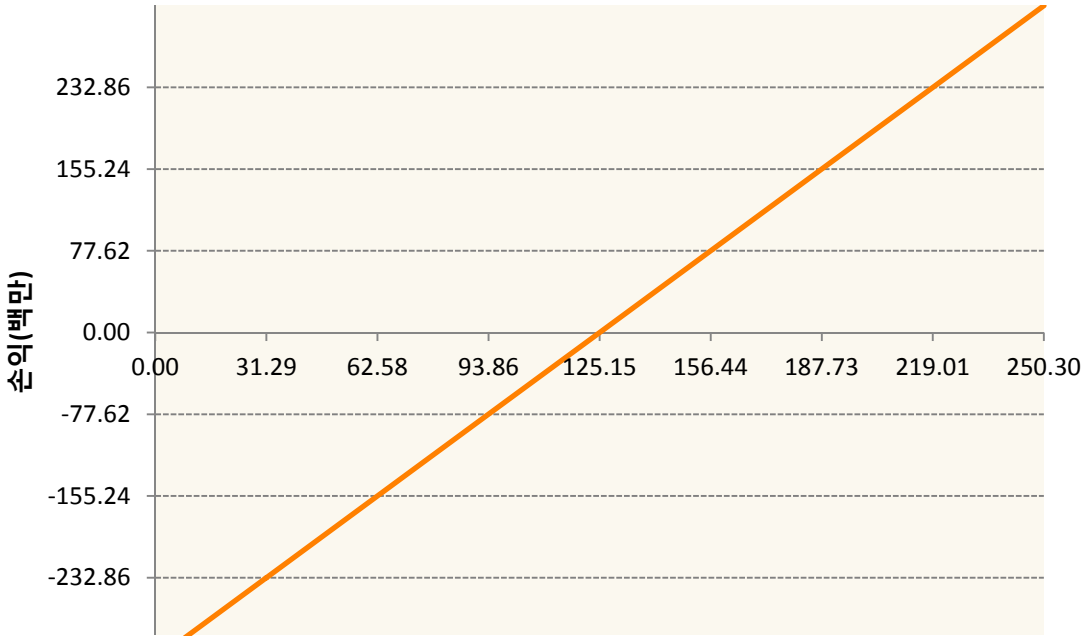


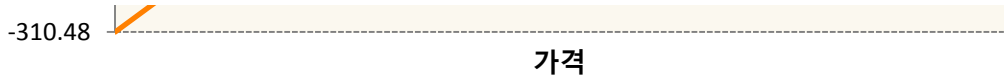


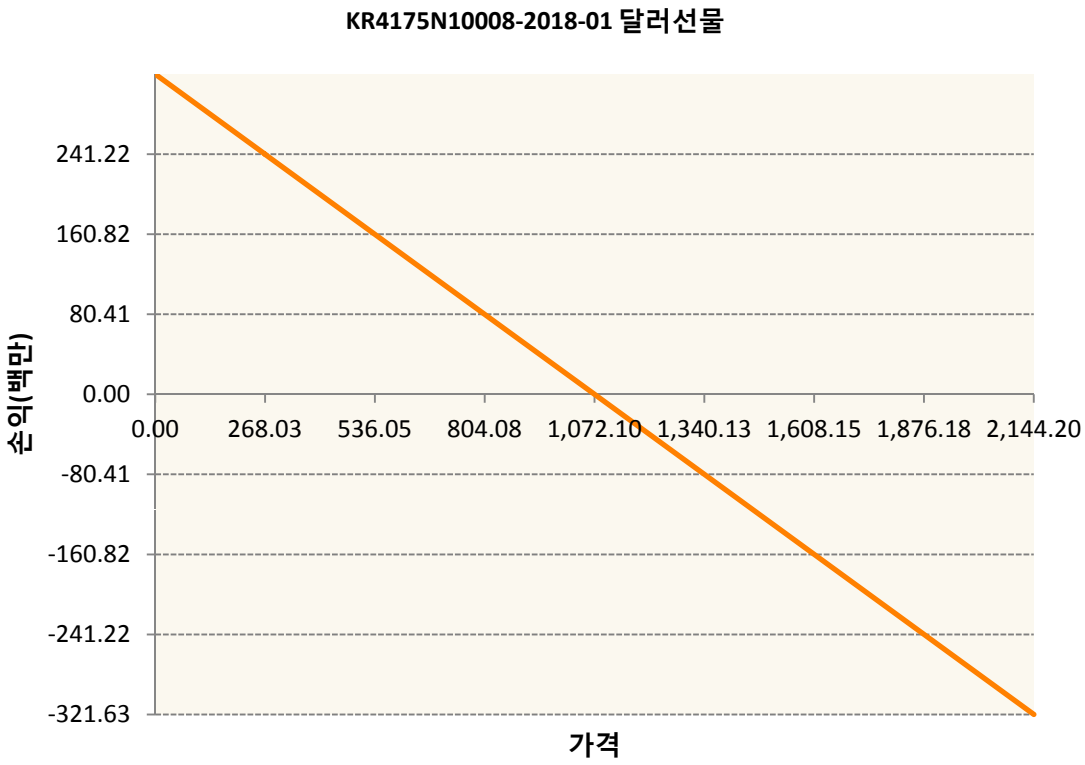
CTH8-COTTON NO.2 FUTR MAR18

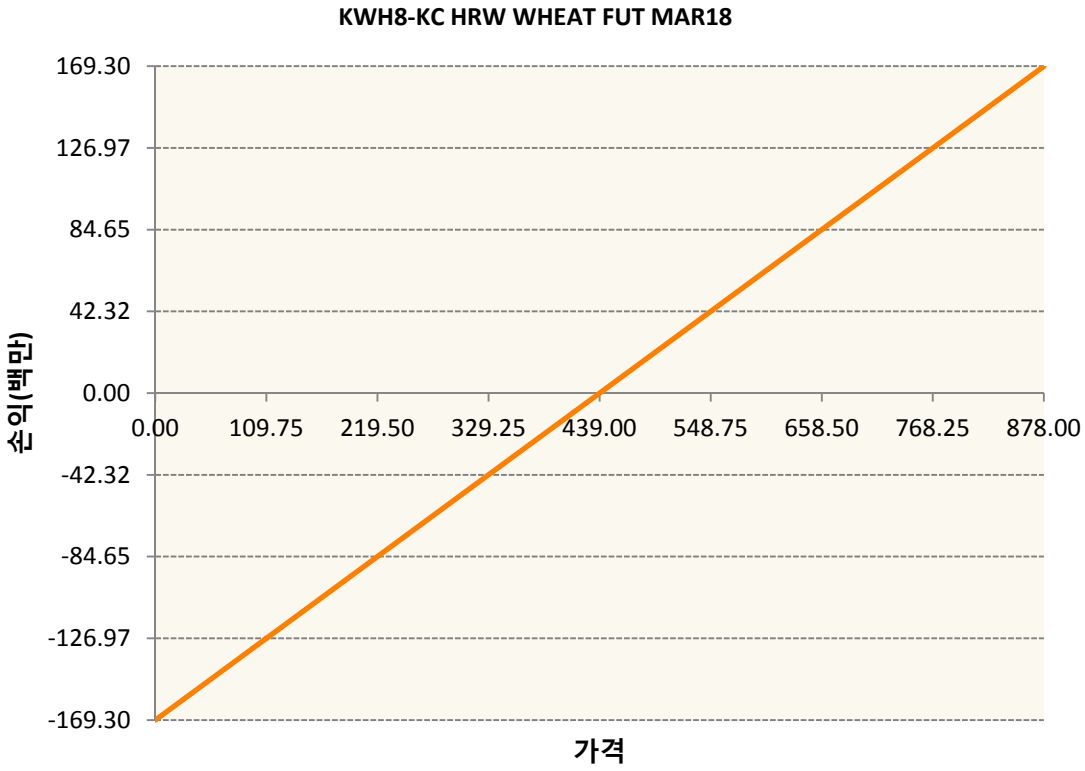


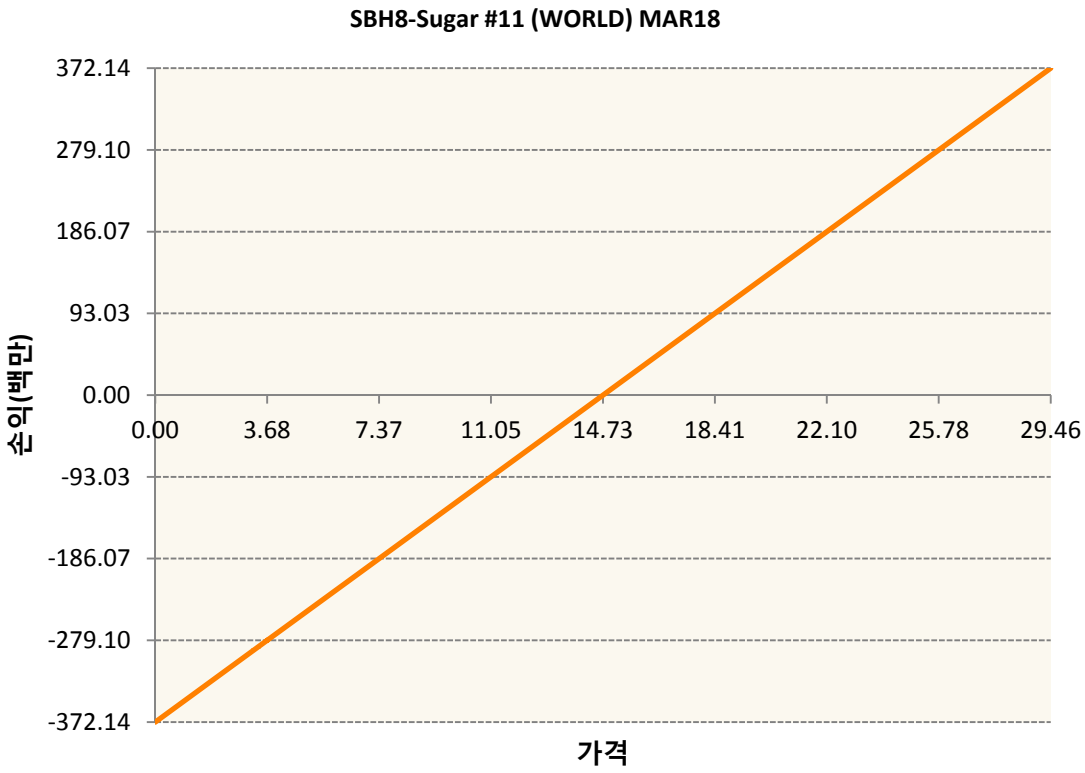
KCH8-COFFEE "C" FUTURE MAR18

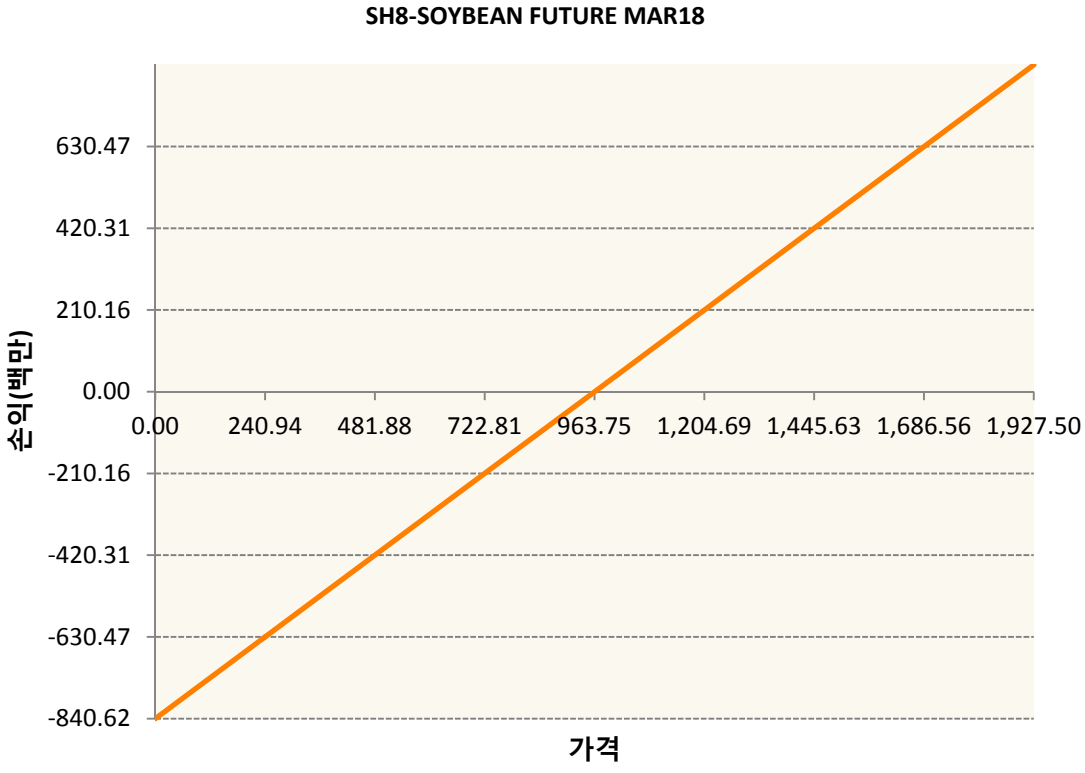



-310.48
가격

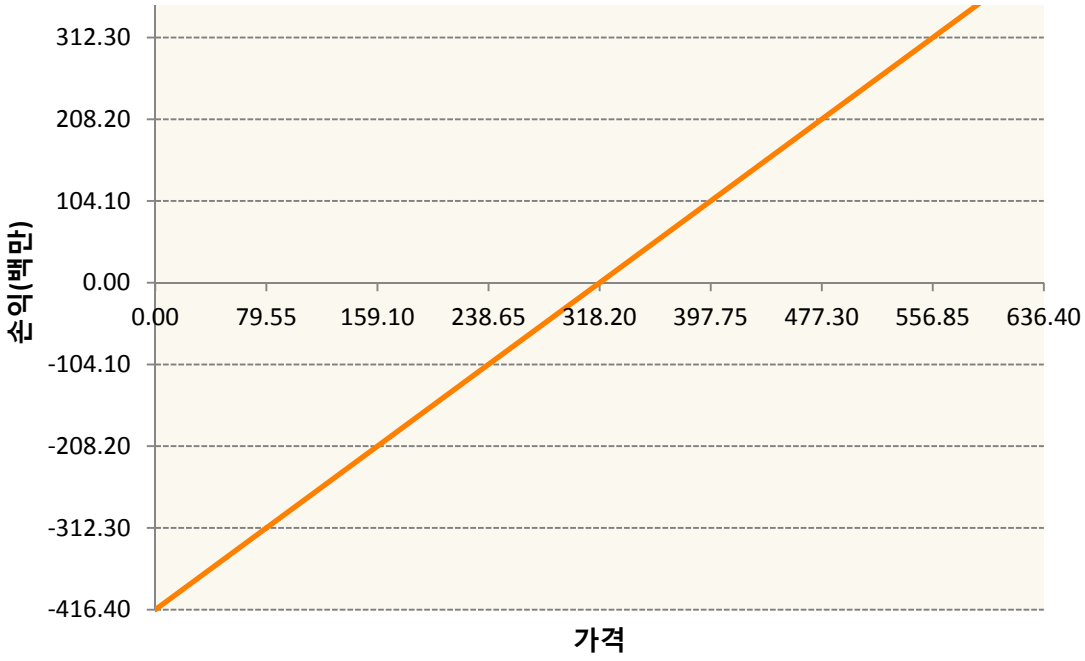

KR4175N10008-2018-01 달러선물
241.22
160.82
80.41
0.00
-80.41
-160.82
-241.22
-321.63
0.00
268.03
536.05
804.08
1,072.10
1,340.13
1,608.15
1,876.18
2,144.20
손익(백만)
가격

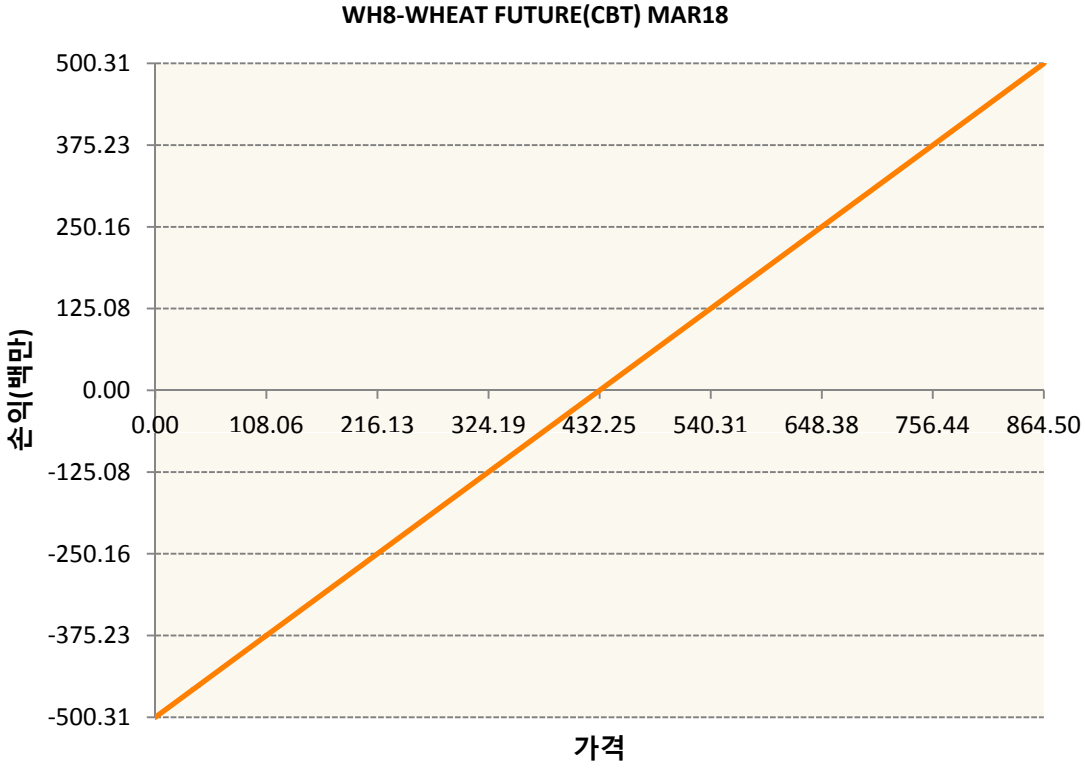

KWH8-KC HRW WHEAT FUT MAR18
169.30
126.97
84.65
42.32
0.00
-42.32
-84.65
-126.97
-169.30
0.00
109.75
219.50
329.25
439.00
548.75
658.50
768.25
878.00
손익(백만)
가격


SBH8-Sugar #11 (WORLD) MAR18
372.14
279.10
186.07
93.03
0.00
-93.03
-186.07
-279.10
-372.14
0.00
3.68
7.37
11.05
14.73
18.41
22.10
25.78
29.46
손익(백만)
가격


SH8-SOYBEAN FUTURE MAR18
630.47
420.31
210.16
0.00
-210.16
-420.31
-630.47
-840.62
0.00
240.94
481.88
722.81
963.75
1,204.69
1,445.63
1,686.56
1,927.50
손익(백만)
가격


SMH8-SOYBEAN MEAL FUTR MAR18





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	25
KR4175N10(	2018-01 달러선물	26

KWH8	KC HRW WHEAT FUT MAR18	14
SBH8	Sugar #11 (WORLD) MAR18	30
SH8	SOYBEAN FUTURE MAR18	67
SMH8	SOYBEAN MEAL FUTR MAR18	33
WH8	WHEAT FUTURE(CBT) MAR18	40

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

355