공시일	2018-01-15
기준일	2018-01-12

포커스농산물모(채권-파생평)

1. 계약금액

(단위:USD 백만)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	8	0	8	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

공시일	2018-01-15
기준일	2018-01-12

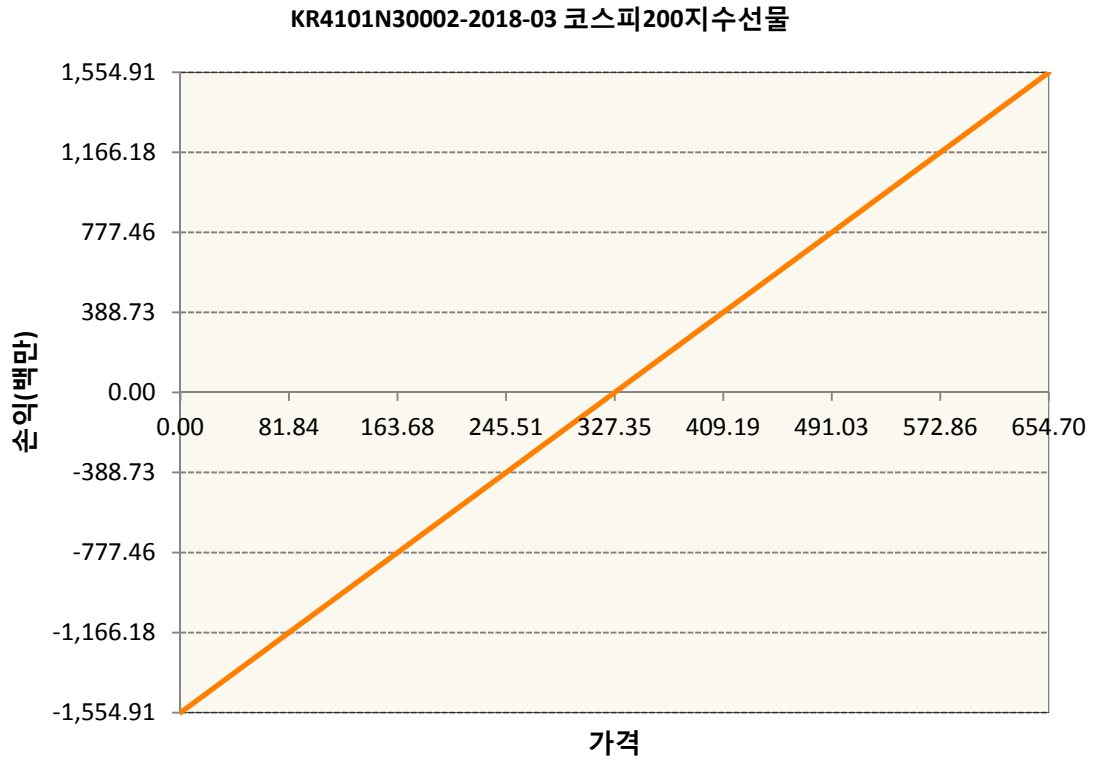
스마트인덱스모

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,555	0	1,555	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)

74

공시일	2018-01-15
기준일	2018-01-12

SMART합성-MSCI선진국증권상장지

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	13,365	0	13,365	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWMXWO0(신한MXWO 미래S171122	1,135

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

364

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2018-01-15
기준일	2018-01-12

SMART중국본토중소형CSI500상장

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	4,901	0	4,901	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI50000 신한CSI500미래S171208	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	2018-01-15
기준일	2018-01-12

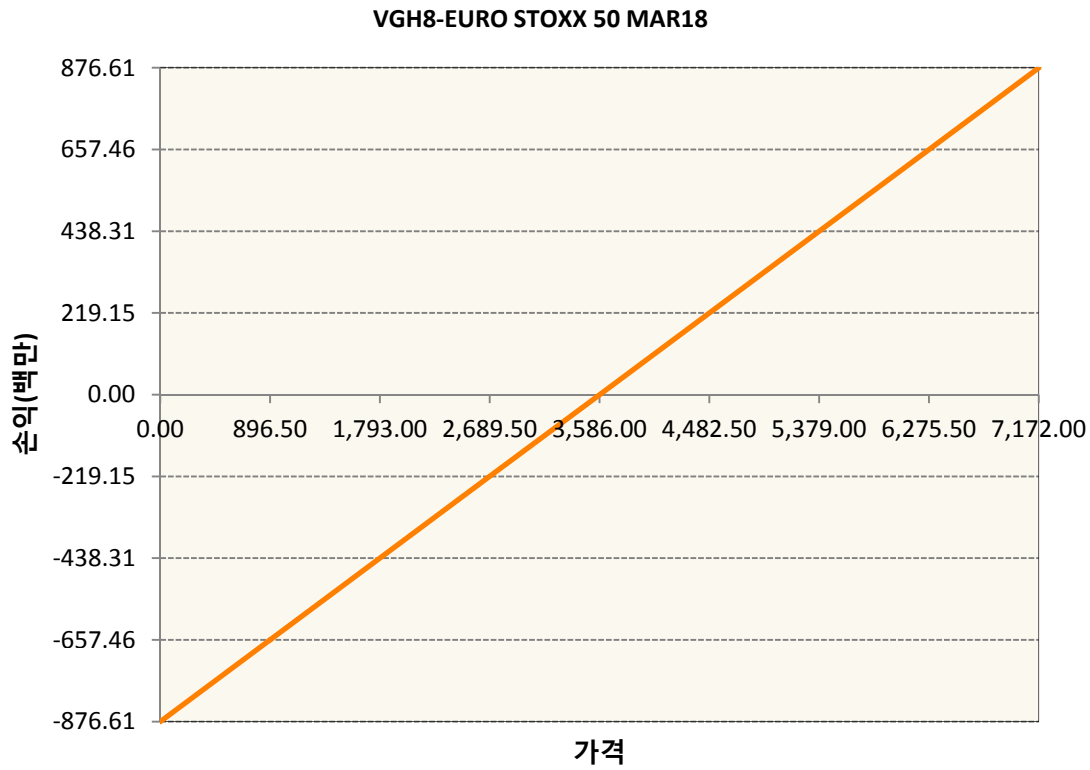
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	877	0	877	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGH8	EURO STOXX 50 MAR18	70

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

(단위:백만원)

39

공시일	2018-01-15
기준일	2018-01-12

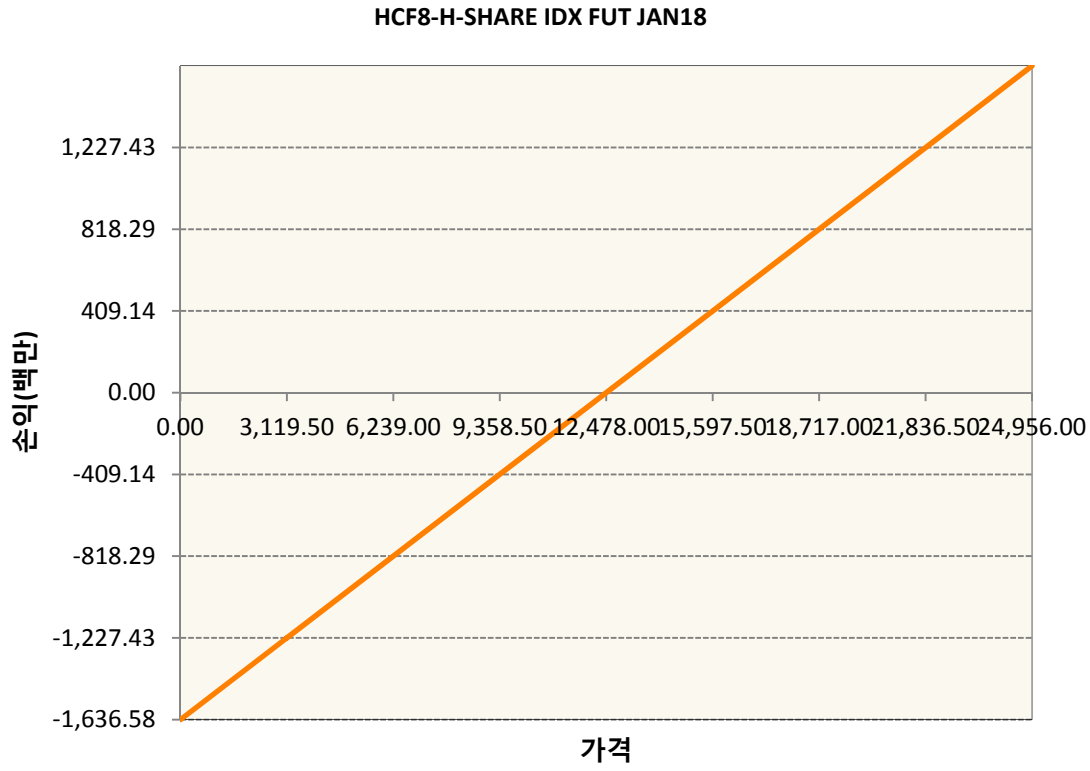
차이나인덱스모(주식-파생형)

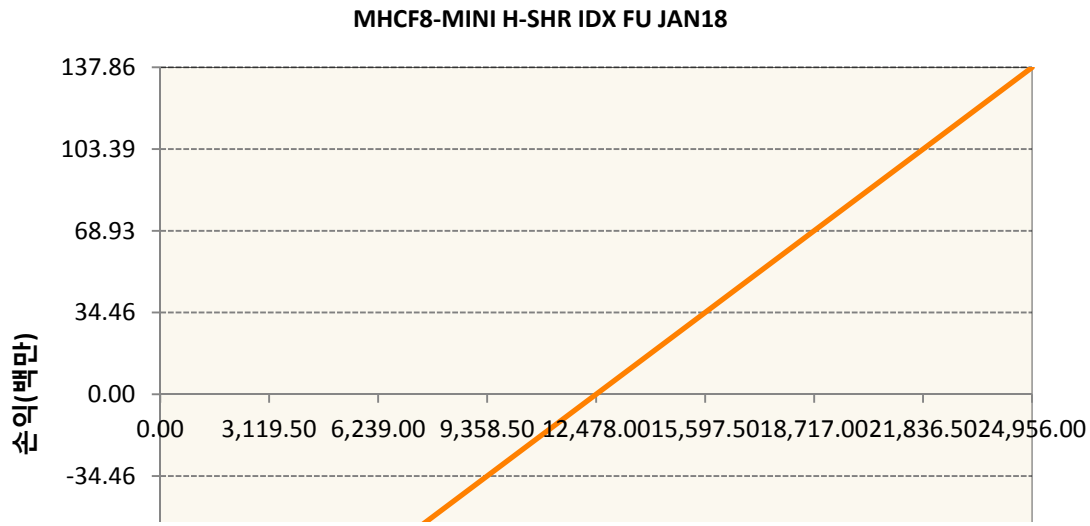
1. 계약금액

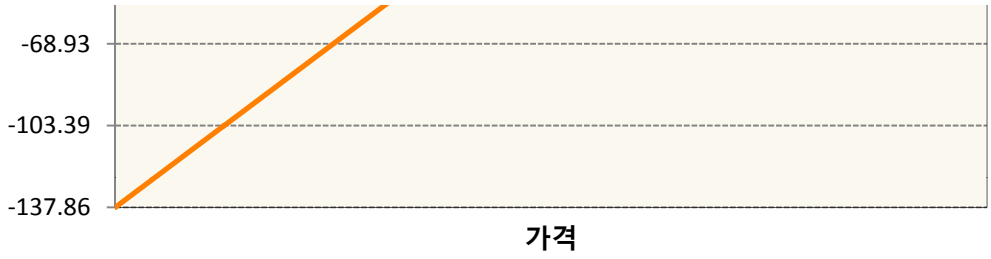
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,774	0	1,774	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCF8	H-SHARE IDX FUT JAN18	131
MHCF8	MINI H-SHR IDX FU JAN18	11

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	113

공시일	2018-01-15
기준일	2018-01-12

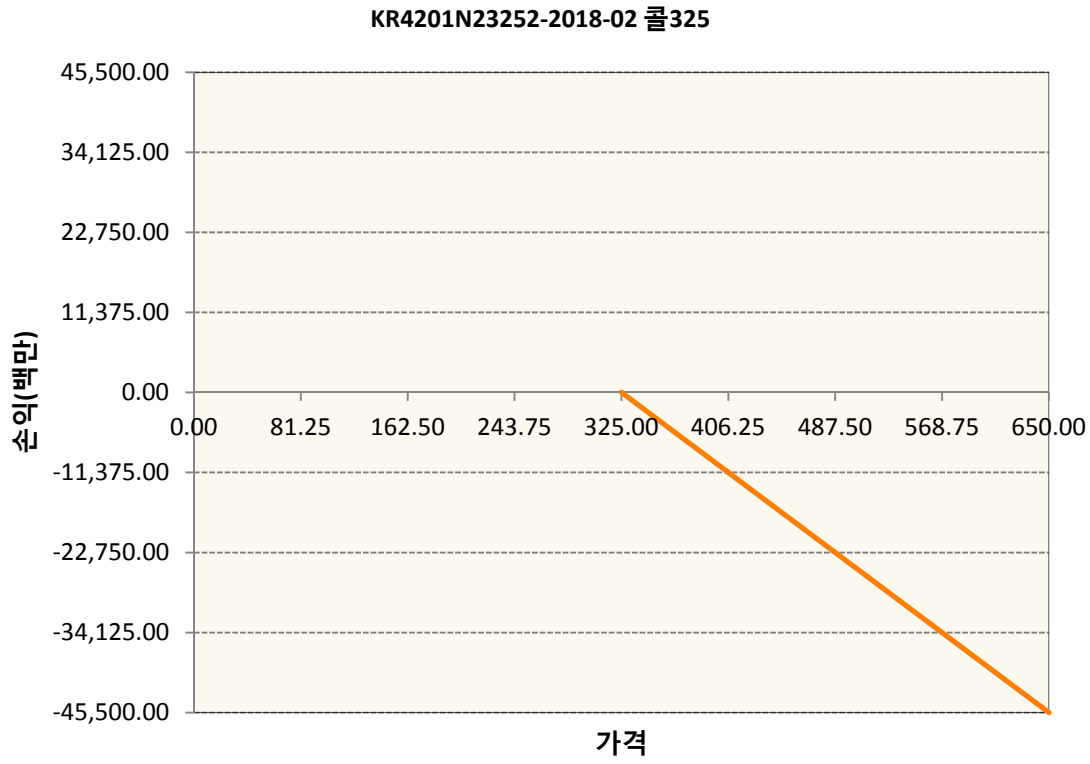
커버드콜모(주식혼합-파생형)

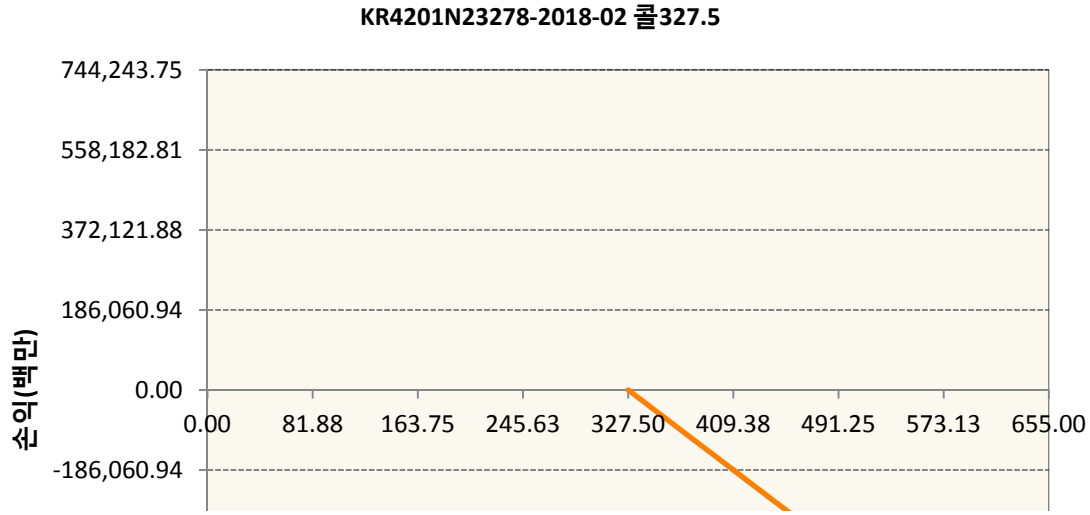
1. 계약금액

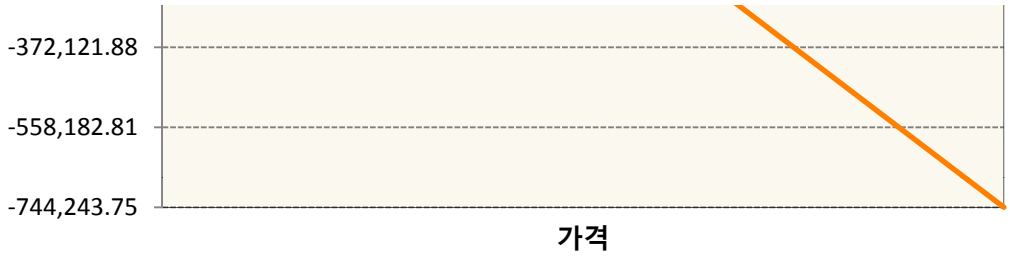
(단위:백만원)

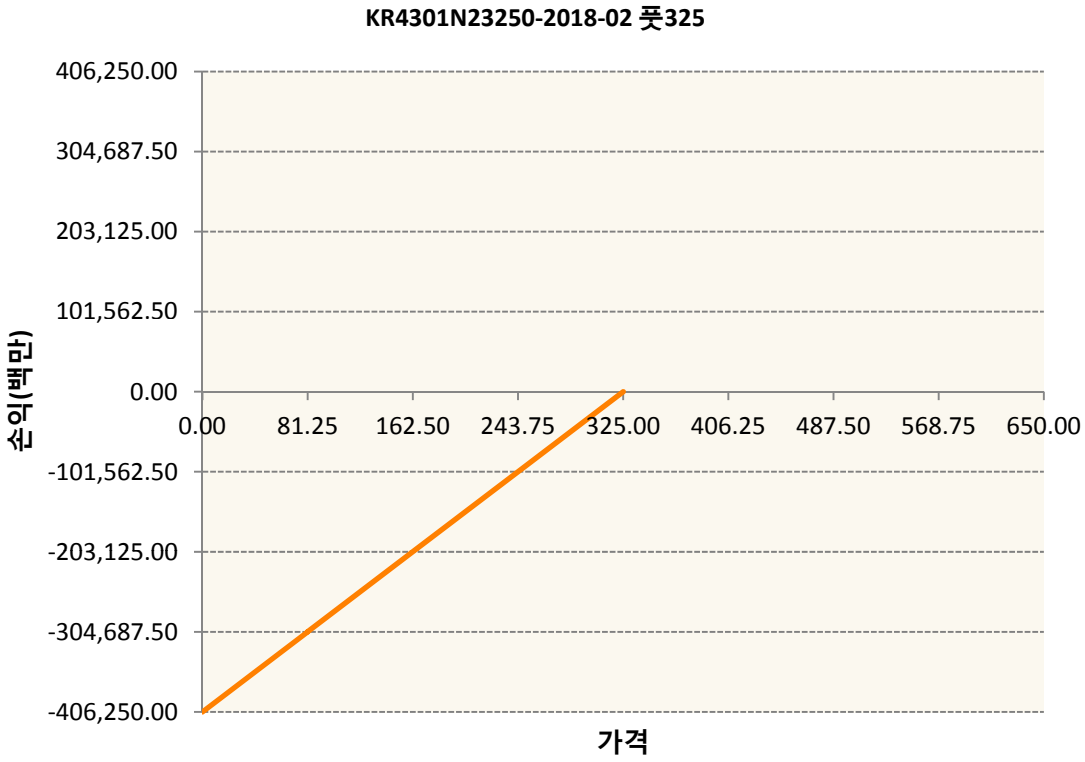
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	1,274,055	-1,274,055	장내
누계	유가증권	옵션	0	1,384,306	-1,384,306	장내

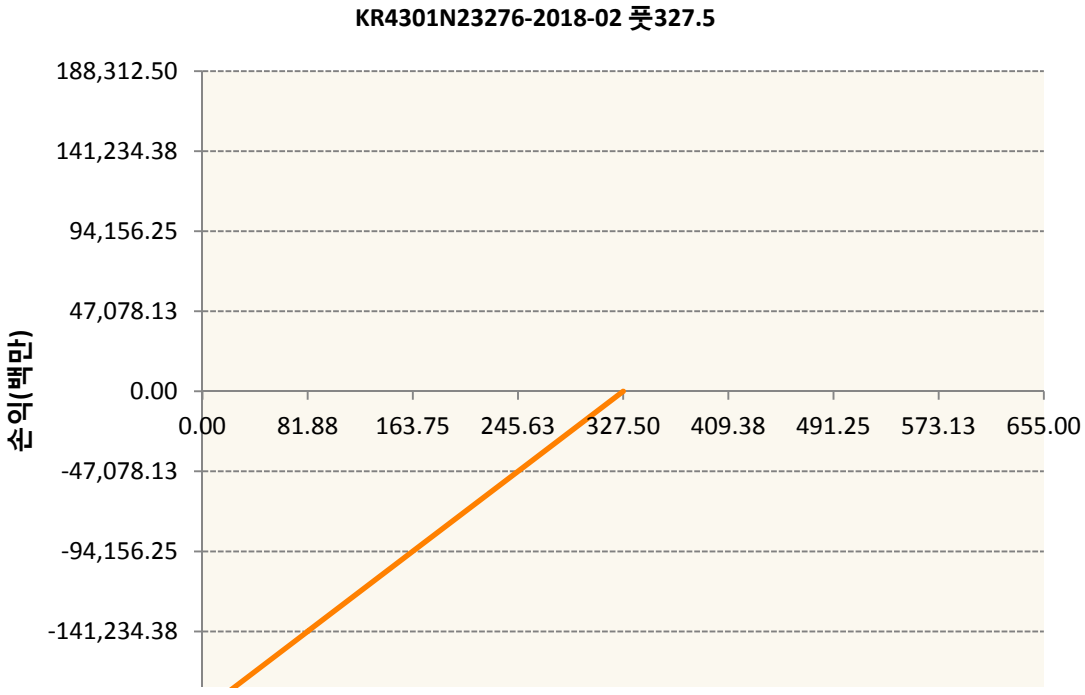
2. 만기시점의 손익구조






-372,121.88
-558,182.81
-744,243.75
가격


KR4301N23250-2018-02 풋325
406,250.00
304,687.50
203,125.00
101,562.50
0.00
-101,562.50
-203,125.00
-304,687.50
-406,250.00
0.00
81.25
162.50
243.75
325.00
406.25
487.50
568.75
650.00
손익(백만)
가격


KR4301N23276-2018-02 풋327.5
188,312.50
141,234.38
94,156.25
47,078.13
0.00
-47,078.13
-94,156.25
-141,234.38
0.00
81.88
163.75
245.63
327.50
409.38
491.25
573.13
655.00
손익(백만)



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201N232 2018-02 콜325							2,908
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,295	1,262	1,222	1,176	1,124	1,067	1,006
-5.33%	1,160	1,096	1,027	953	877	797	716
-2.67%	851	759	666	571	476	381	285
0%	301	201	100	0	-101	-201	-302
2.67%	-500	-585	-672	-762	-854	-947	-1,041
5.33%	-1,501	-1,557	-1,620	-1,689	-1,762	-1,839	-1,919
8.00%	-2,625	-2,655	-2,693	-2,738	-2,790	-2,847	-2,908
KR4201N232 2018-02 콜327.5							45,399
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	18,472	18,042	17,499	16,850	16,106	15,278	14,376
-5.33%	16,787	15,886	14,887	13,805	12,657	11,454	10,204
-2.67%	12,684	11,286	9,849	8,383	6,895	5,388	3,866
0%	4,931	3,287	1,644	0	-1,644	-3,287	-4,930
2.67%	-6,938	-8,431	-9,955	-11,501	-13,065	-14,643	-16,232
5.33%	-22,342	-23,413	-24,576	-25,813	-27,110	-28,457	-29,845
8.00%	-40,107	-40,723	-41,465	-42,317	-43,265	-44,296	-45,399
KR4301N232 2018-02 풋325							26,497
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-26,380	-26,382	-26,388	-26,400	-26,421	-26,453	-26,497
-5.33%	-15,549	-15,602	-15,678	-15,778	-15,902	-16,048	-16,216
-2.67%	-5,505	-5,784	-6,083	-6,397	-6,725	-7,063	-7,409
0%	1,208	808	405	0	-406	-813	-1,221
2.67%	3,497	3,326	3,124	2,897	2,647	2,378	2,092
5.33%	3,819	3,795	3,754	3,694	3,613	3,511	3,387
8.00%	3,836	3,835	3,831	3,823	3,809	3,786	3,751
KR4301N232 2018-02 풋327.5							12,915
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-12,884	-12,884	-12,885	-12,888	-12,893	-12,902	-12,915
-5.33%	-7,886	-7,899	-7,919	-7,947	-7,986	-8,034	-8,092
-2.67%	-3,084	-3,177	-3,283	-3,399	-3,524	-3,657	-3,796
0%	571	381	191	0	-191	-381	-572
2.67%	2,137	2,022	1,896	1,760	1,617	1,467	1,313

5.33%	2,429	2,407	2,373	2,328	2,272	2,205	2,128
8.00%	2,451	2,449	2,445	2,438	2,426	2,408	2,383

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

91,270

공시일	2018-01-15
기준일	2018-01-12

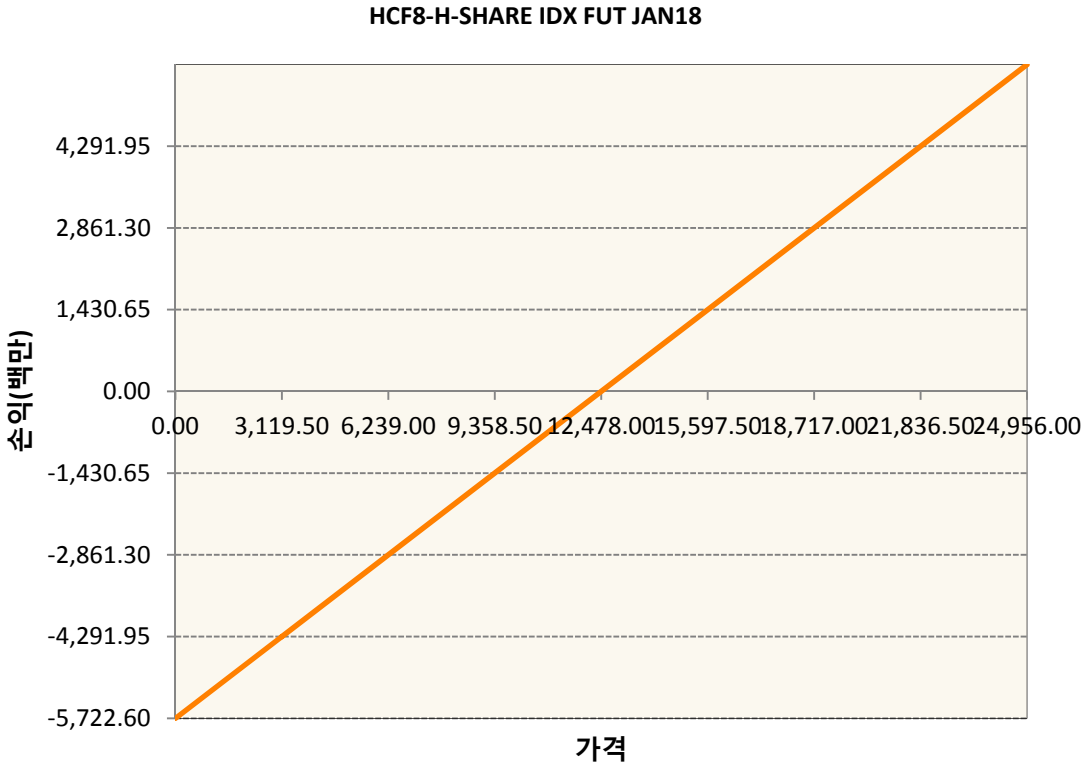
홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생

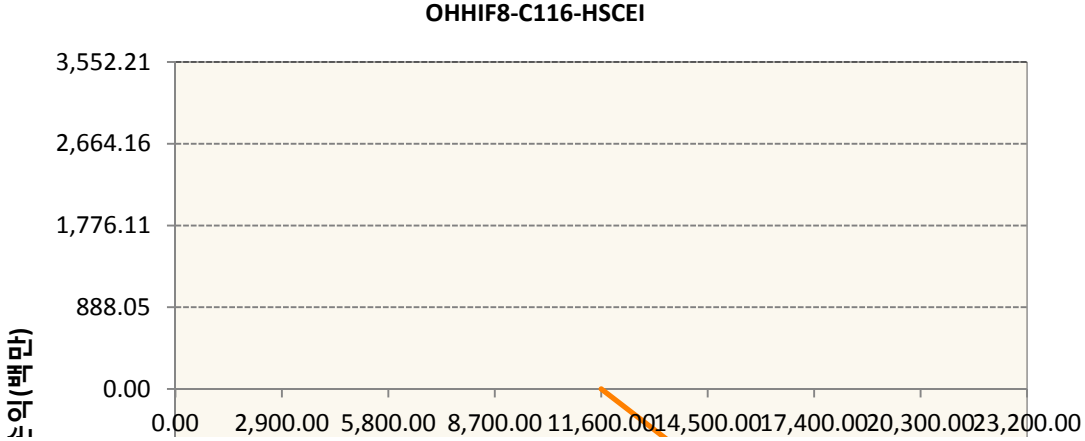
1. 계약금액

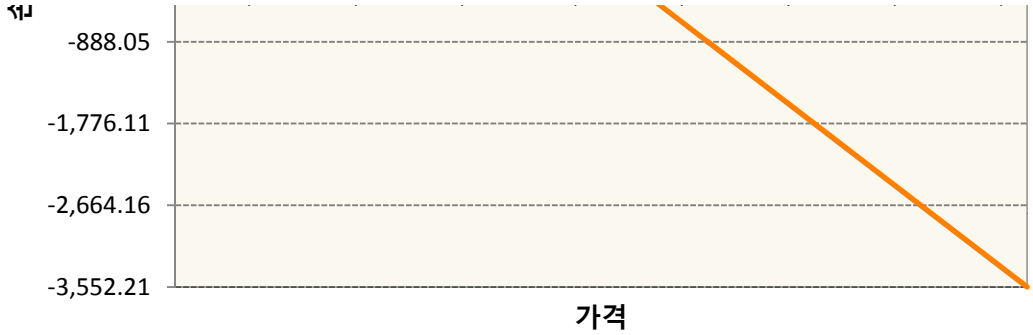
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	5,723	0	5,723	장내
누계	유가증권	옵션	0	11,922	-11,922	장내

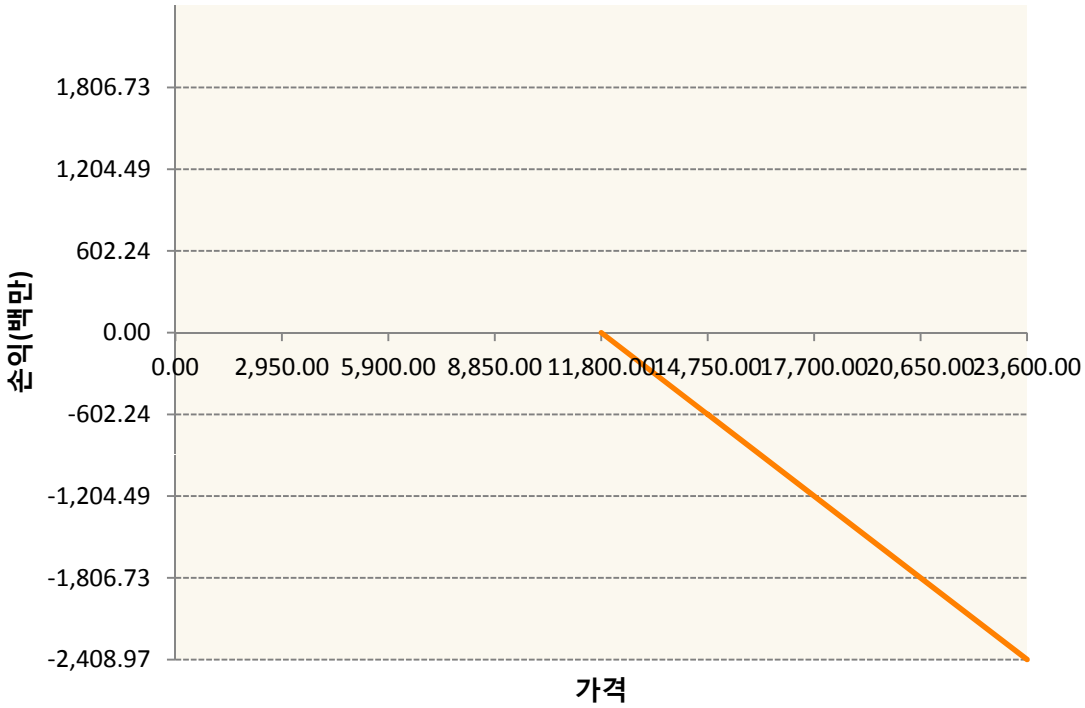
2. 만기시점의 손익구조



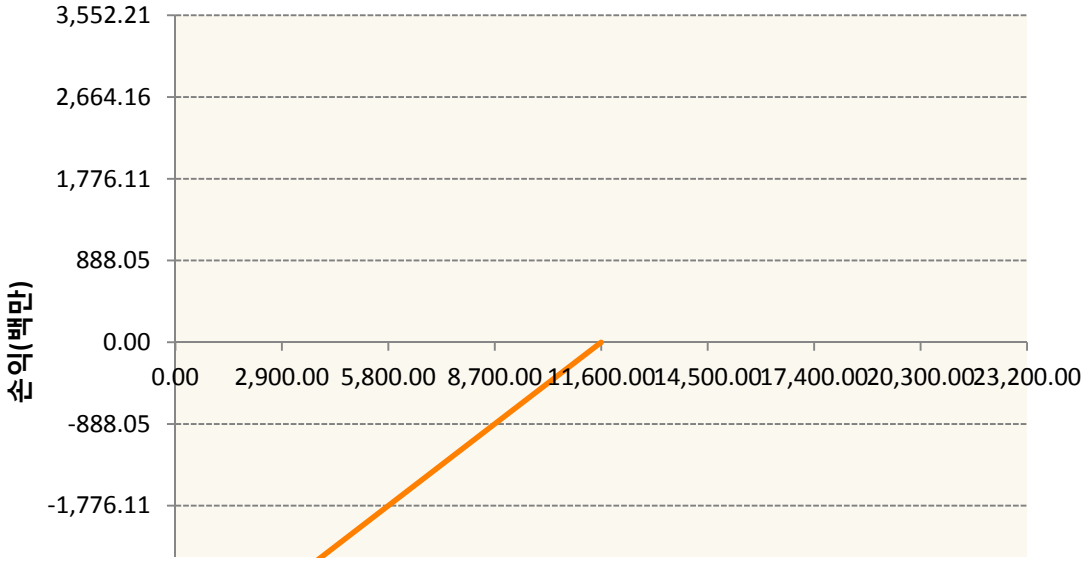


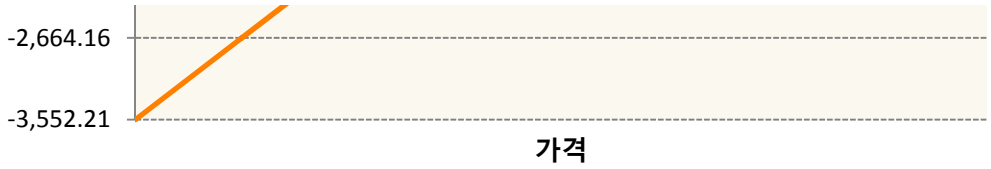


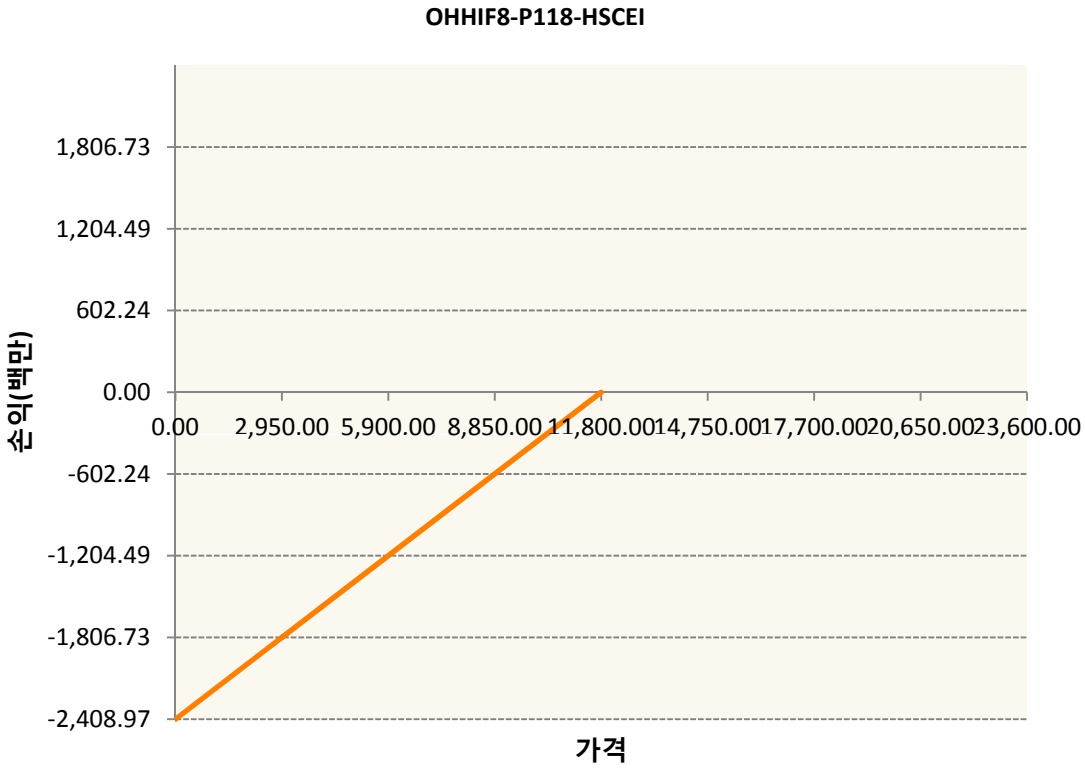
OHHIF8-C118-HSCEI



OHHIF8-P116-HSCEI







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

HCF8	H-SHARE IDX FUT JAN18	458
OHHIF8-C11	HSCEI	284
OHHIF8-C11	HSCEI	193
OHHIF8-P11	HSCEI	284
OHHIF8-P11	HSCEI	193

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

1,121

공시일	2018-01-15
기준일	2018-01-12

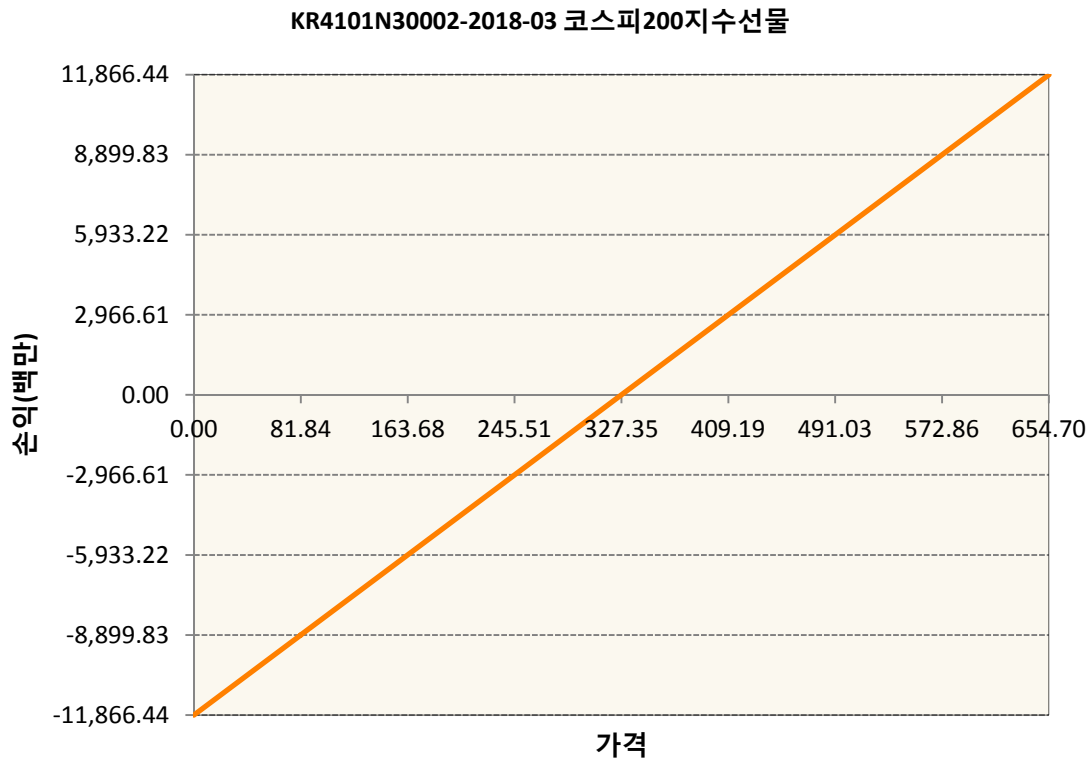
코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼

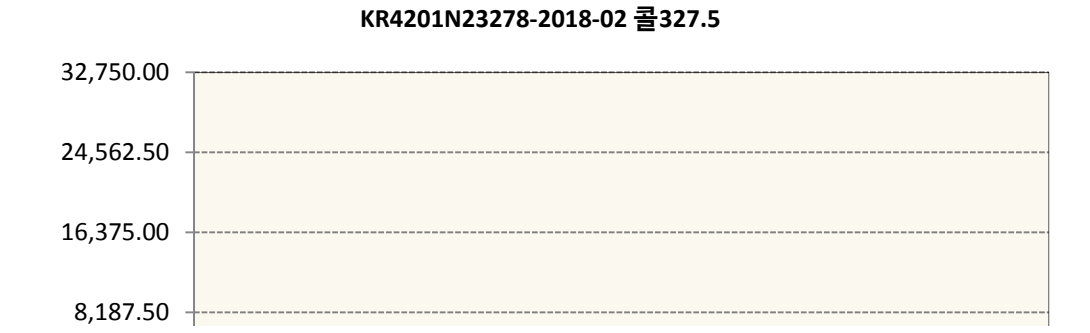
1. 계약금액

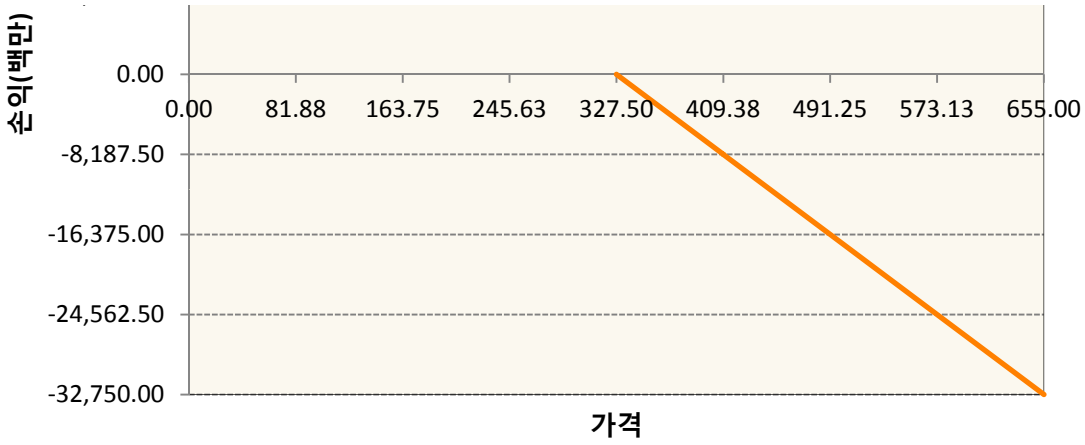
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	61,008	-61,008	장내
누계	유가증권	선물	11,866	0	11,866	장내
누계	유가증권	스왑	60,200	0	60,200	장외
누계	유가증권	옵션	0	60,431	-60,431	장내

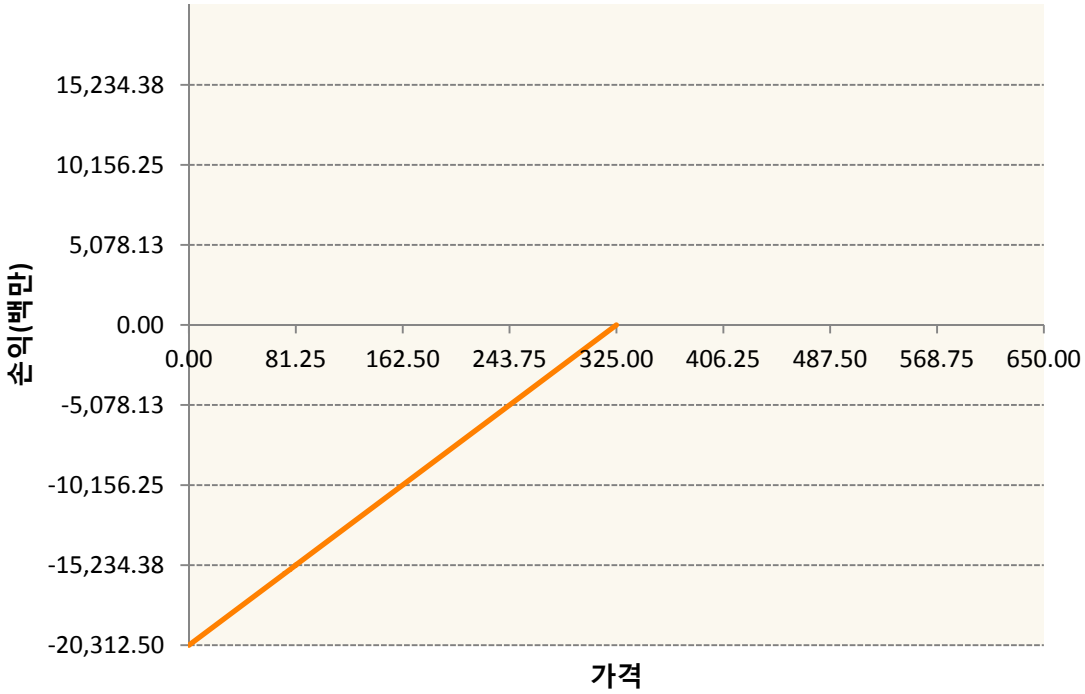
2. 만기시점의 손익구조



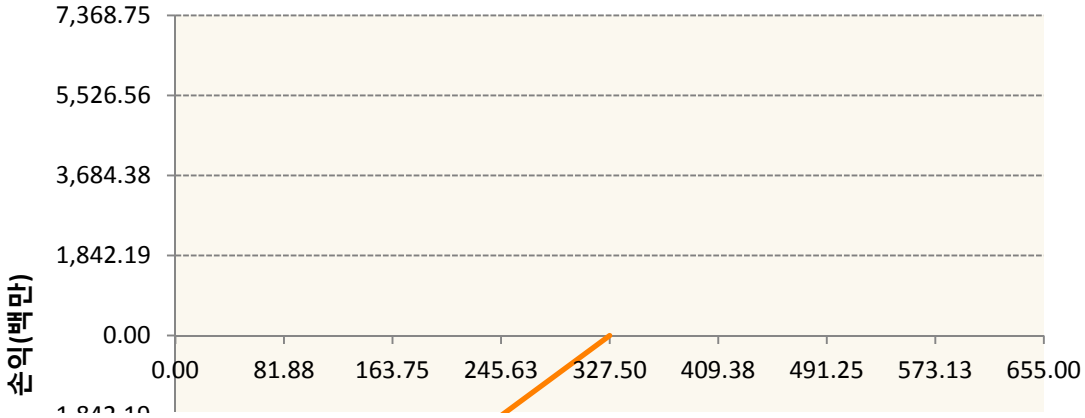




KR4301N23250-2018-02 풋325



KR4301N23276-2018-02 풋327.5





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_2							1,446
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,446	-1,446	-1,446	-1,446	-1,446	-1,446	-1,446
-5.33%	-964	-964	-964	-964	-964	-964	-964
-2.67%	-482	-482	-482	-482	-482	-482	-482
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	482	482	482	482	482	482	482
5.33%	964	964	964	964	964	964	964
8.00%	1,446	1,446	1,446	1,446	1,446	1,446	1,446
2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_3							274
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-274	-274	-274	-274	-274	-274	-274
-5.33%	-182	-182	-182	-182	-182	-182	-182
-2.67%	-91	-91	-91	-91	-91	-91	-91
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	91	91	91	91	91	91	91
5.33%	182	182	182	182	182	182	182
8.00%	274	274	274	274	274	274	274
2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_4							156
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-156	-156	-156	-156	-156	-156	-156
-5.33%	-104	-104	-104	-104	-104	-104	-104
-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%	104	104	104	104	104	104	104
8.00%	156	156	156	156	156	156	156
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%	-156	-156	-156	-156	-156	-156	-156
-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%	156	156	156	156	156	156	156
8.00%	235	235	235	235	235	235	235
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_6						195
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-195	-195	-195	-195	-195	-195	-195
-5.33%	-130	-130	-130	-130	-130	-130	-130
-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%	130	130	130	130	130	130	130
8.00%	195	195	195	195	195	195	195
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_7						250
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-250	-250	-250	-250	-250	-250	-250
-5.33%	-167	-167	-167	-167	-167	-167	-167
-2.67%	-83	-83	-83	-83	-83	-83	-83
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	83	83	83	83	83	83	83
5.33%	167	167	167	167	167	167	167
8.00%	250	250	250	250	250	250	250
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_8						463
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-463	-463	-463	-463	-463	-463	-463
-5.33%	-308	-308	-308	-308	-308	-308	-308
-2.67%	-154	-154	-154	-154	-154	-154	-154
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	154	154	154	154	154	154	154
5.33%	308	308	308	308	308	308	308
8.00%	463	463	463	463	463	463	463
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_9						308
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-308	-308	-308	-308	-308	-308	-308
-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%	308	308	308	308	308	308	308
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_10						274
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-274	-274	-274	-274	-274	-274	-274
-5.33%	-182	-182	-182	-182	-182	-182	-182
-2.67%	-91	-91	-91	-91	-91	-91	-91
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	91	91	91	91	91	91	91
5.33%	182	182	182	182	182	182	182
8.00%	274	274	274	274	274	274	274
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_11						625
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-625	-625	-625	-625	-625	-625	-625
-5.33%	-417	-417	-417	-417	-417	-417	-417
-2.67%	-208	-208	-208	-208	-208	-208	-208
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	208	208	208	208	208	208	208
5.33%	417	417	417	417	417	417	417
8.00%	625	625	625	625	625	625	625
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_12						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%	-313	-313	-313	-313	-313	-313	-313
-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%	313	313	313	313	313	313	313
8.00%	469	469	469	469	469	469	469
	KR4101N30(2018-03 코스피200지수선물						947
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-947	-947	-947	-947	-947	-947	-947
-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%	947	947	947	947	947	947	947
	KR4201N23: 2018-02 콜327.5						1,998

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	813	794	770	741	709	672	633
-5.33%	739	699	655	608	557	504	449
-2.67%	558	497	433	369	303	237	170
0%	217	145	72	0	-72	-145	-217
2.67%	-305	-371	-438	-506	-575	-644	-714
5.33%	-983	-1,030	-1,081	-1,136	-1,193	-1,252	-1,313
8.00%	-1,765	-1,792	-1,825	-1,862	-1,904	-1,949	-1,998
	KR4301N232 2018-02 풋325						1,325

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,319	-1,319	-1,319	-1,320	-1,321	-1,323	-1,325
-5.33%	-777	-780	-784	-789	-795	-802	-811
-2.67%	-275	-289	-304	-320	-336	-353	-370
0%	60	40	20	0	-20	-41	-61
2.67%	175	166	156	145	132	119	105
5.33%	191	190	188	185	181	176	169
8.00%	192	192	192	191	190	189	188
	KR4301N232 2018-02 풋327.5						505

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-504	-504	-504	-504	-505	-505	-505
-5.33%	-309	-309	-310	-311	-312	-314	-317
-2.67%	-121	-124	-128	-133	-138	-143	-149
0%	22	15	7	0	-7	-15	-22
2.67%	84	79	74	69	63	57	51
5.33%	95	94	93	91	89	86	83
8.00%	96	96	96	95	95	94	93

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

9,260

공시일	2018-01-15
기준일	2018-01-12

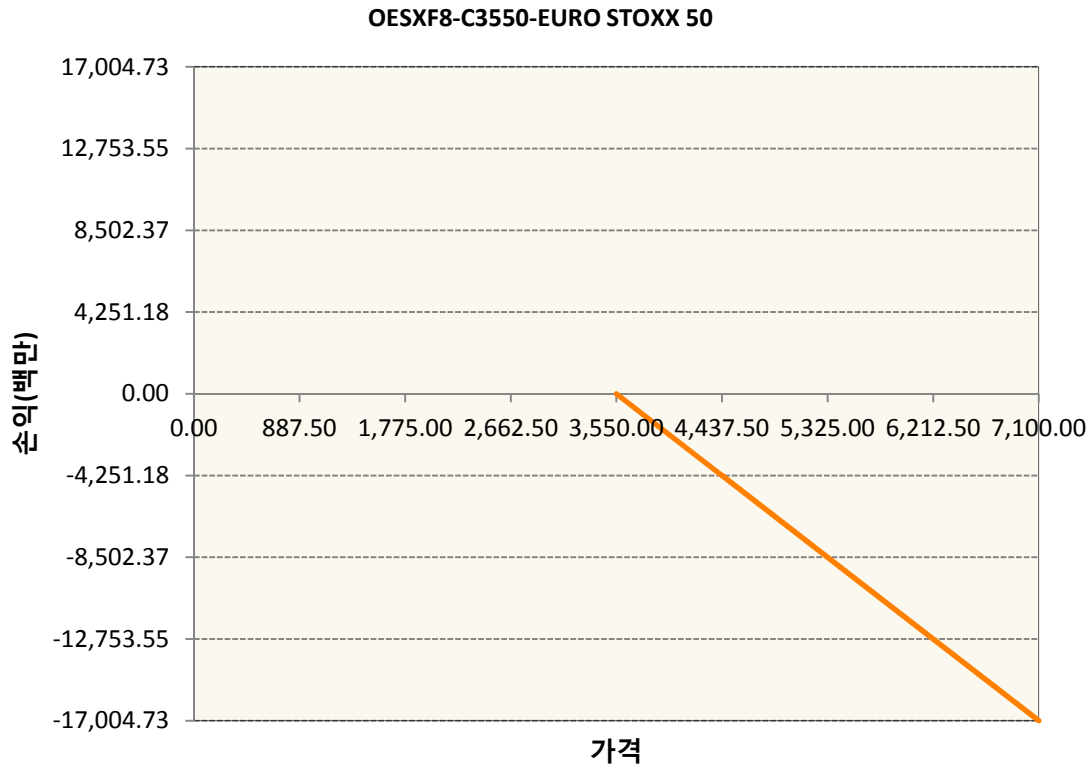
유로커버드콜모(주식혼합-파생형

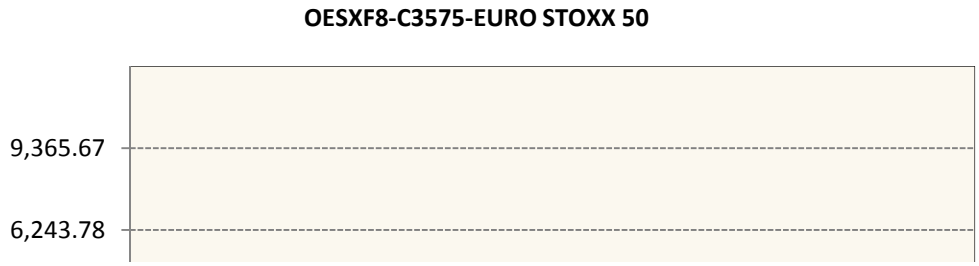
1. 계약금액

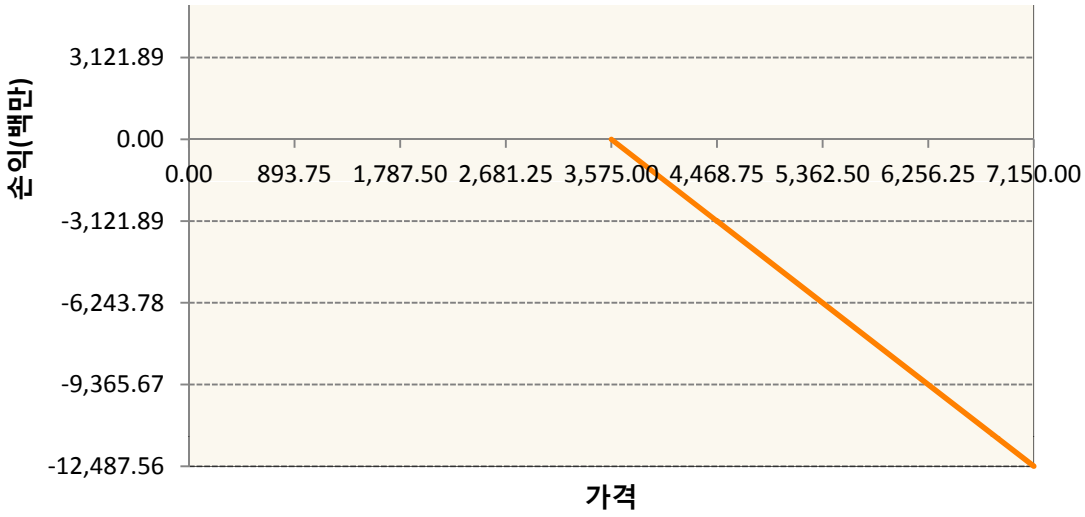
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	21,311	0	21,311	
누계	유가증권	스왑	96,315	0	96,315	장외
누계	유가증권	옵션	0	58,985	-58,985	장내
누계	지수	스왑	51,369	0	51,369	장외

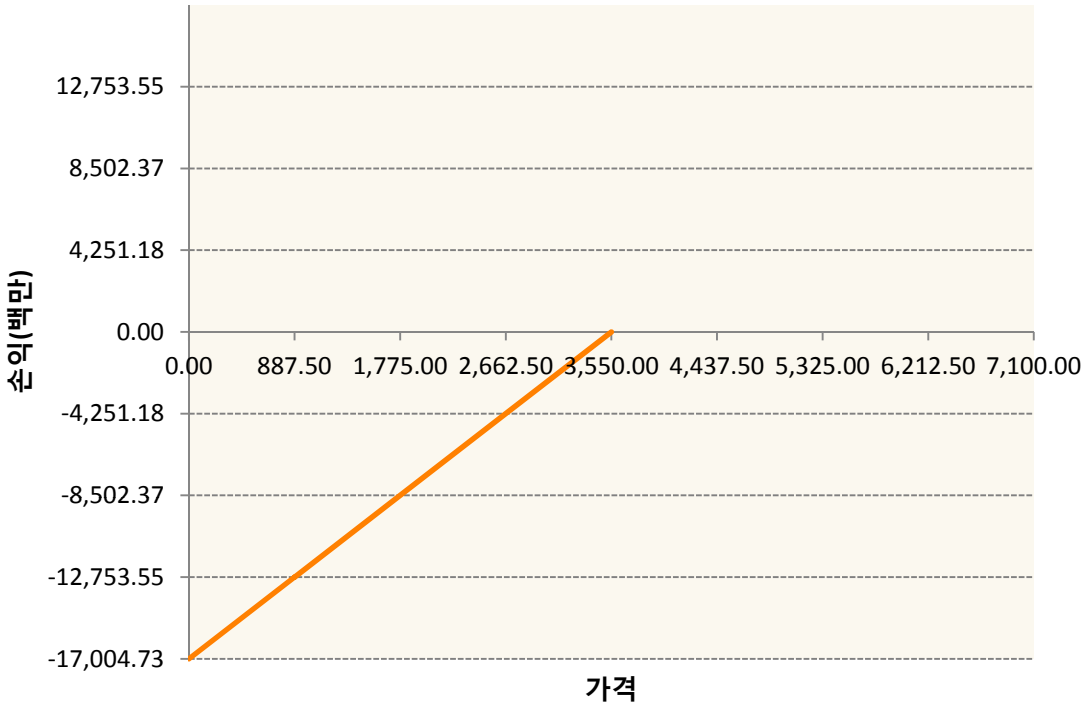
2. 만기시점의 손익구조



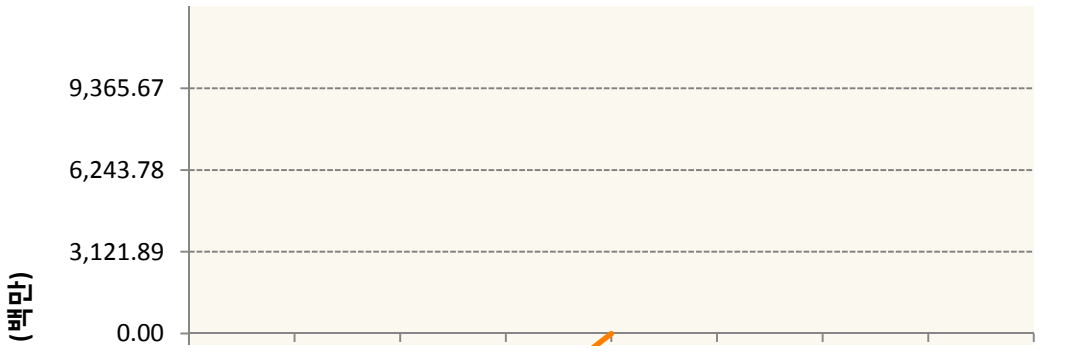


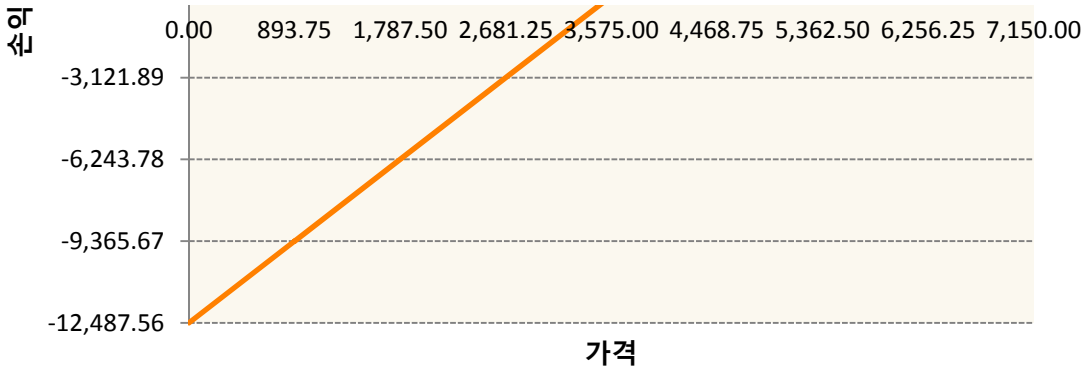


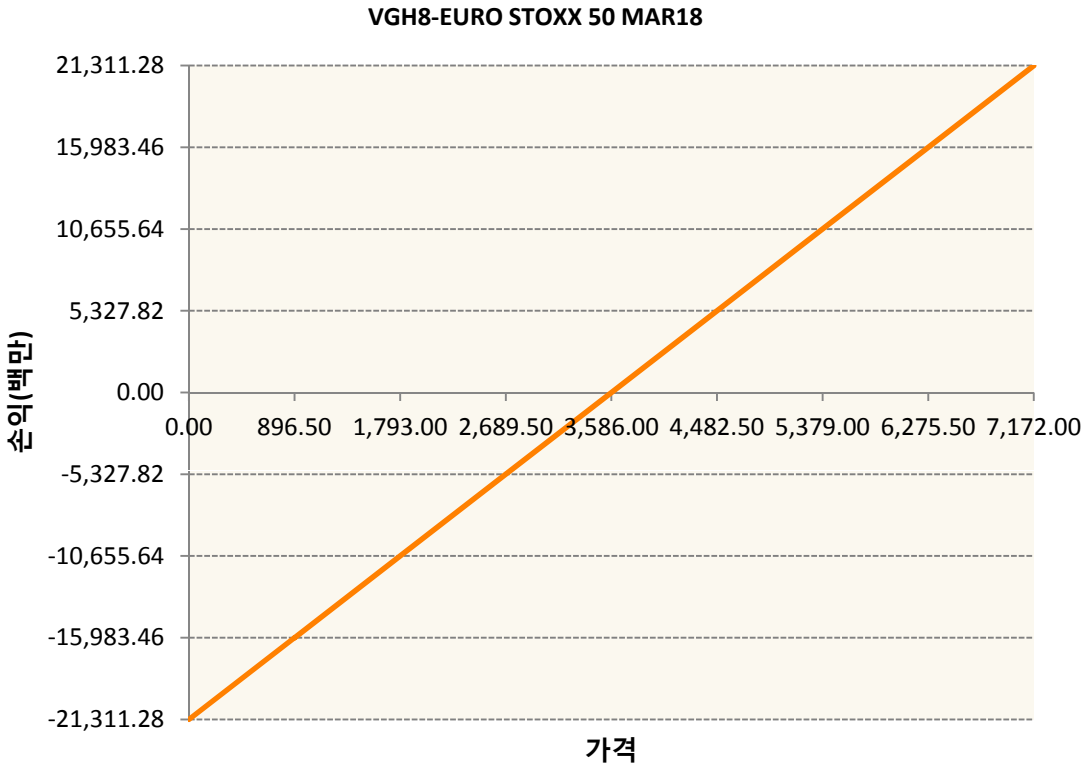
OESXF8-P3550-EURO STOXX 50



OESXF8-P3575-EURO STOXX 50







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

260105SGPX SG EURO Covered CALL STRATEGY - 994.569	100
260105SQPX SG EURO Covered CALL STRATEGY	144
OESXF8-C35 EURO STOXX 50	1,360
OESXF8-C35 EURO STOXX 50	999
OESXF8-P35 EURO STOXX 50	1,360
OESXF8-P35 EURO STOXX 50	999
VGH8 EURO STOXX 50 MAR18	1,705

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

3,740

공시일	2018-01-15
기준일	2018-01-12

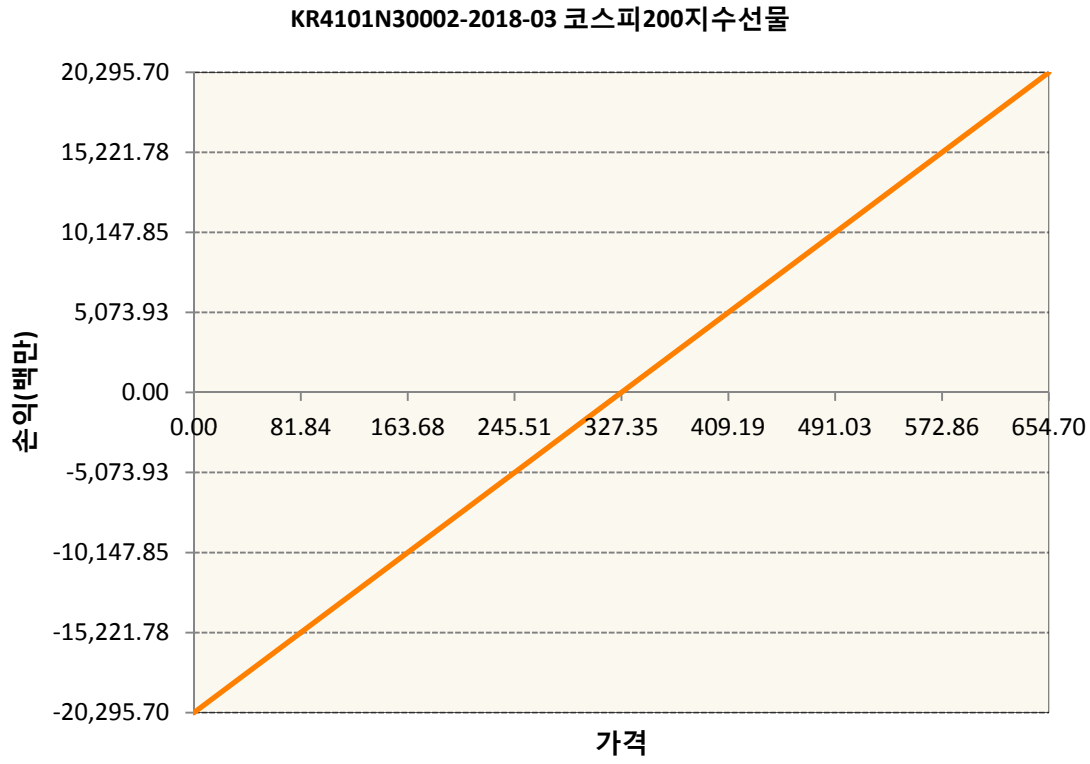
ETF스마트레버리지목표전환형8호

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	20,296	0	20,296	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101N30(2018-03 코스피200지수선물							1,621
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,621	-1,621	-1,621	-1,621	-1,621	-1,621	-1,621
-5.33%	-1,080	-1,080	-1,080	-1,080	-1,080	-1,080	-1,080
-2.67%	-540	-540	-540	-540	-540	-540	-540
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	540	540	540	540	540	540	540
5.33%	1,080	1,080	1,080	1,080	1,080	1,080	1,080
8.00%	1,621	1,621	1,621	1,621	1,621	1,621	1,621

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

972

공시일	2018-01-15
기준일	2018-01-12

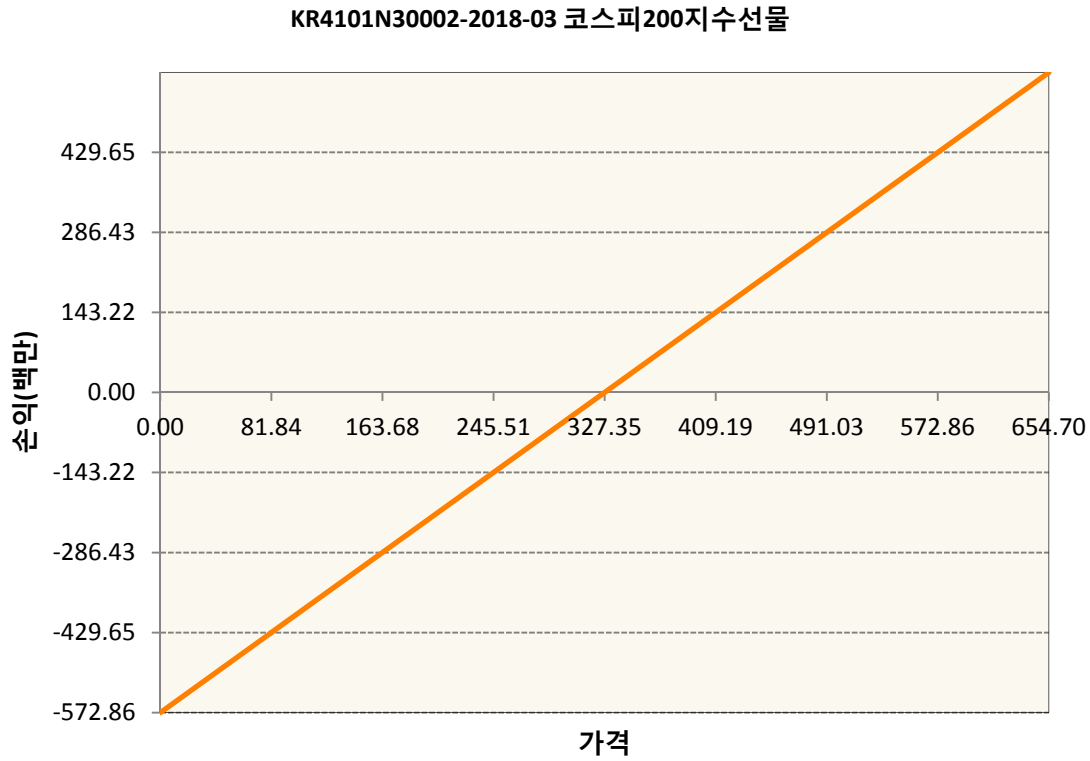
ETF스마트레버리지목표전환형9호

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	573	0	573	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)

27

공시일	2018-01-15
기준일	2018-01-12

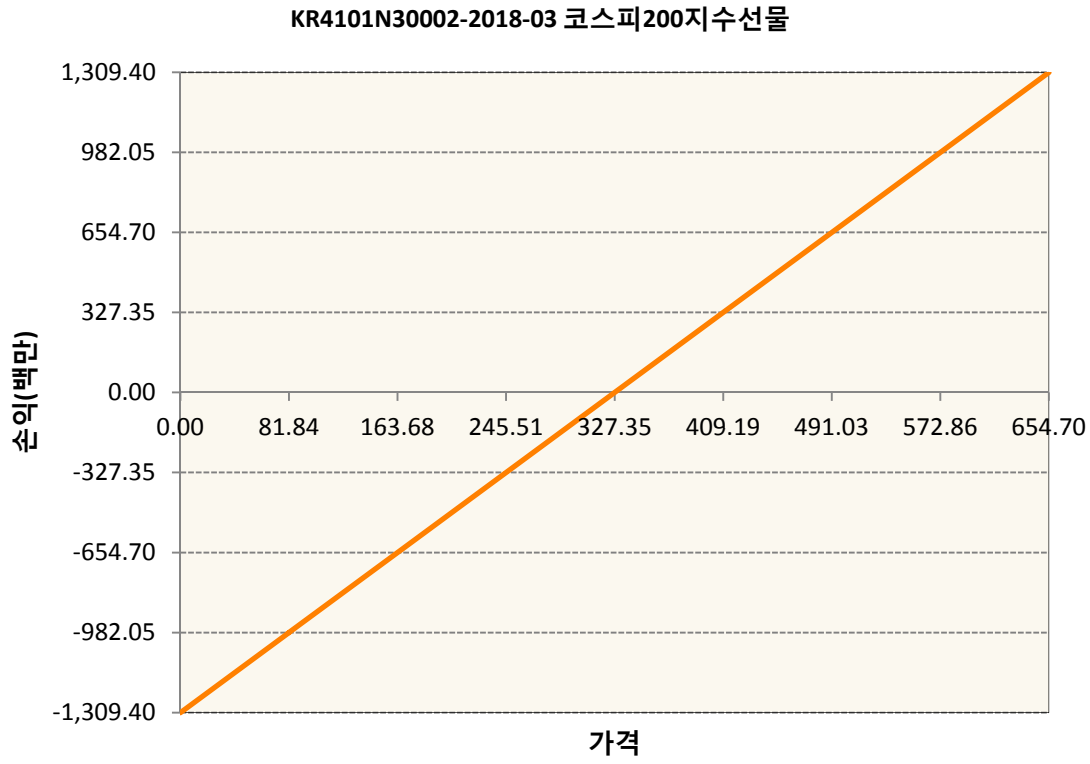
ETF스마트레버리지목표전환형10

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	1,309	0	1,309	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	2018-01-15
기준일	2018-01-12

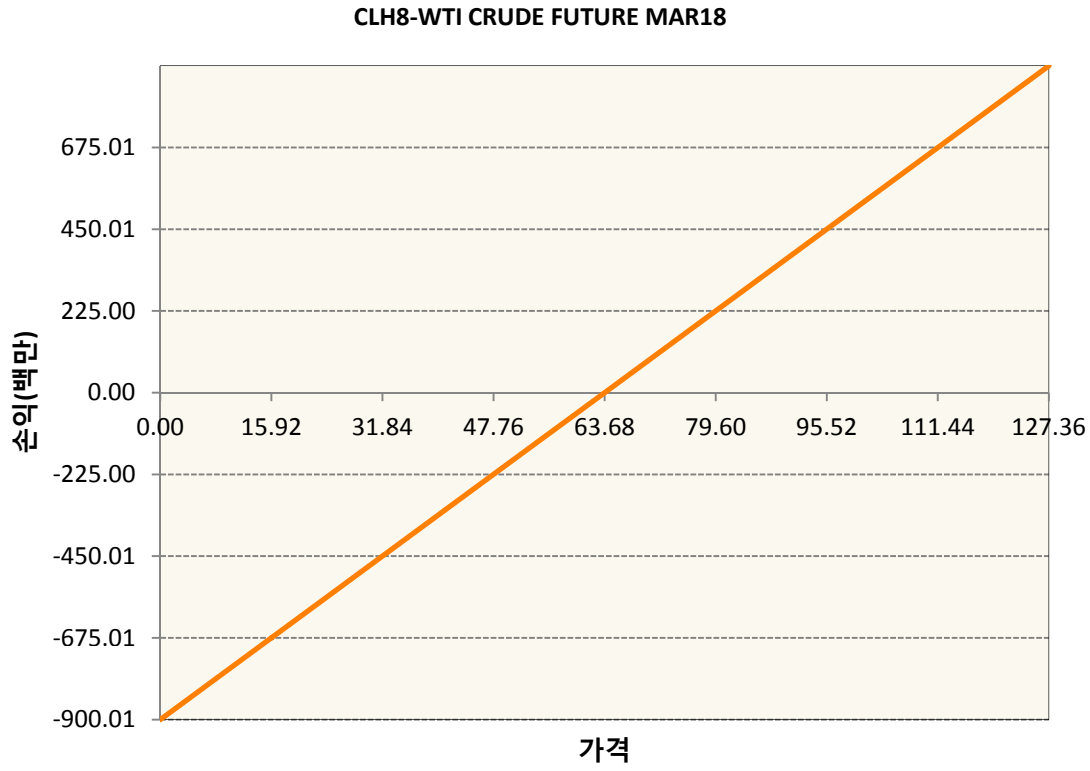
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

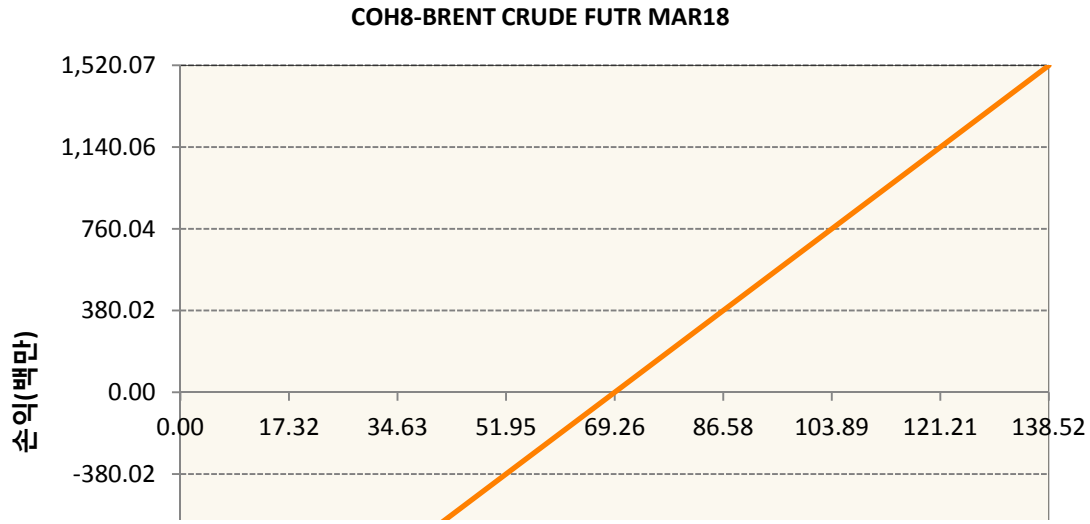
1. 계약금액

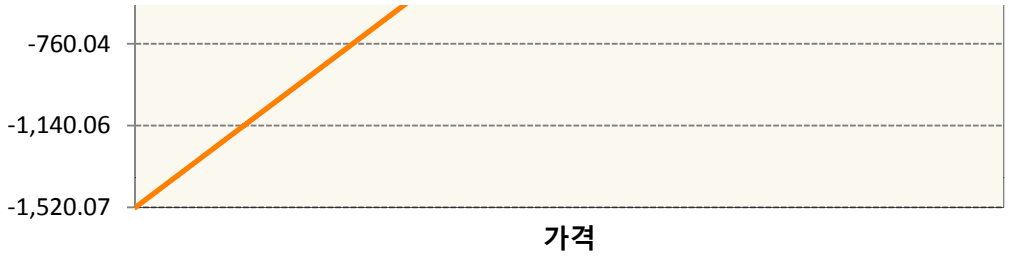
(단위:백만원)

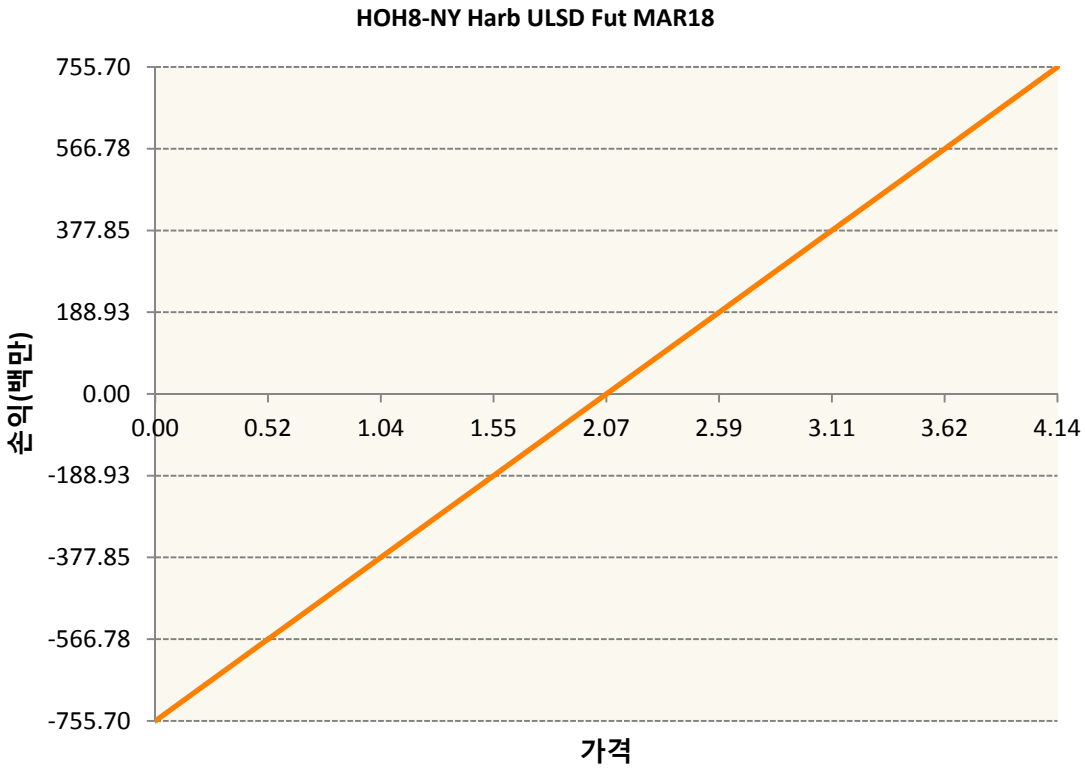
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	4,840	850	3,990	

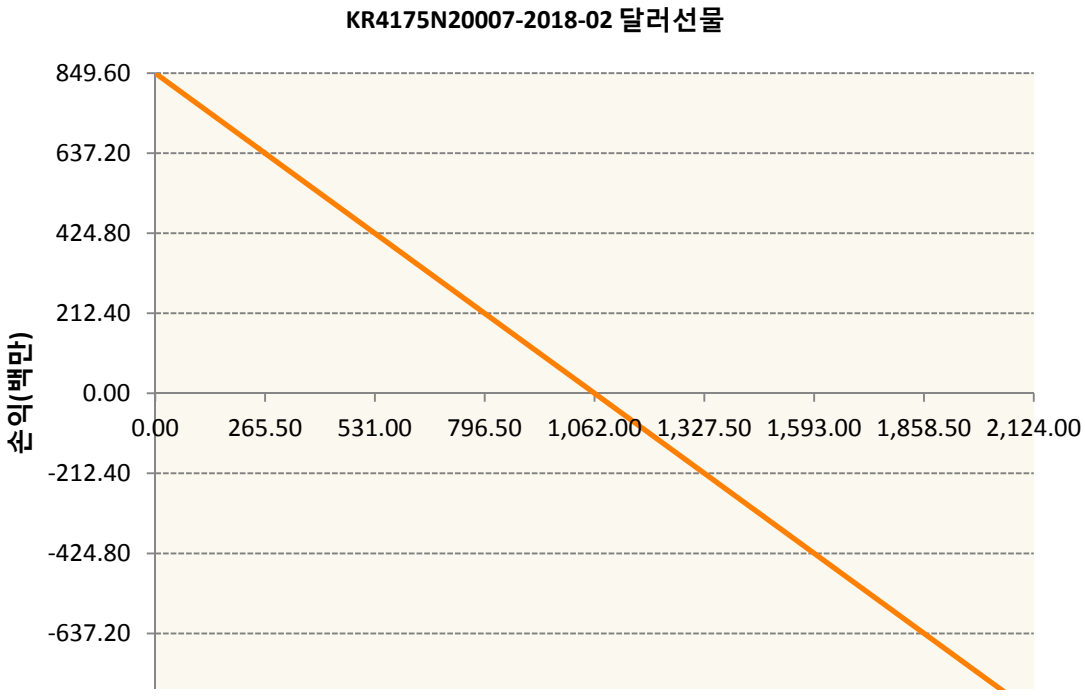
2. 만기시점의 손익구조

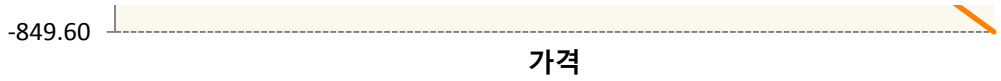


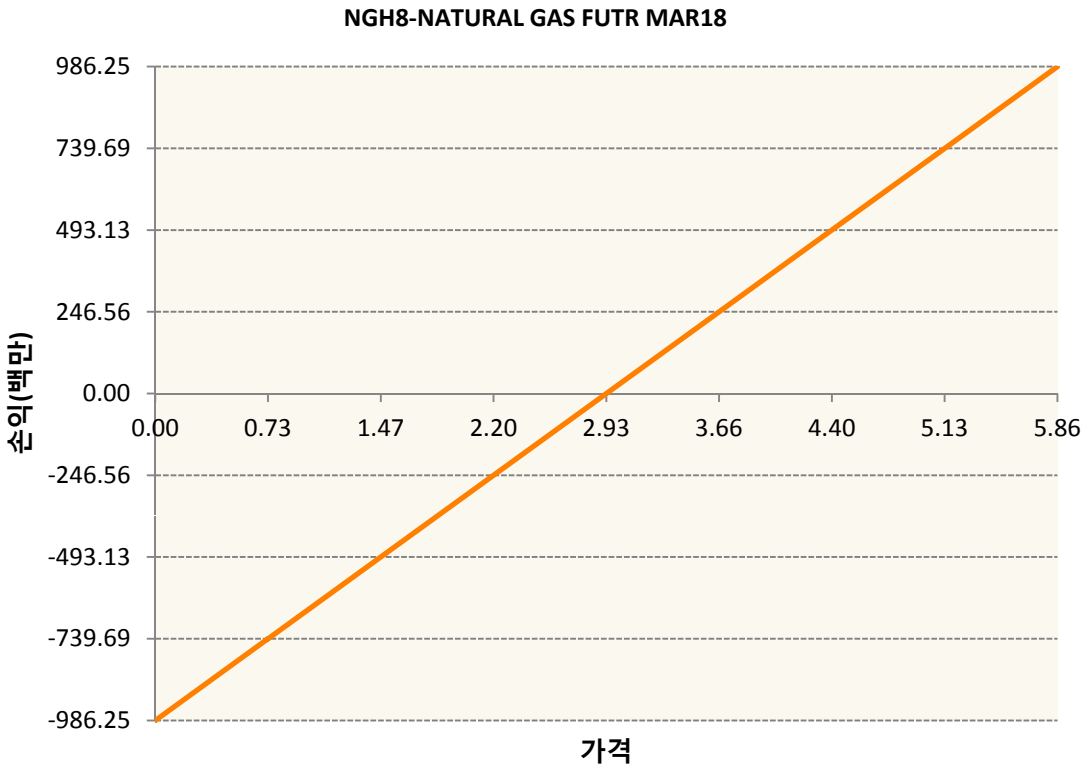


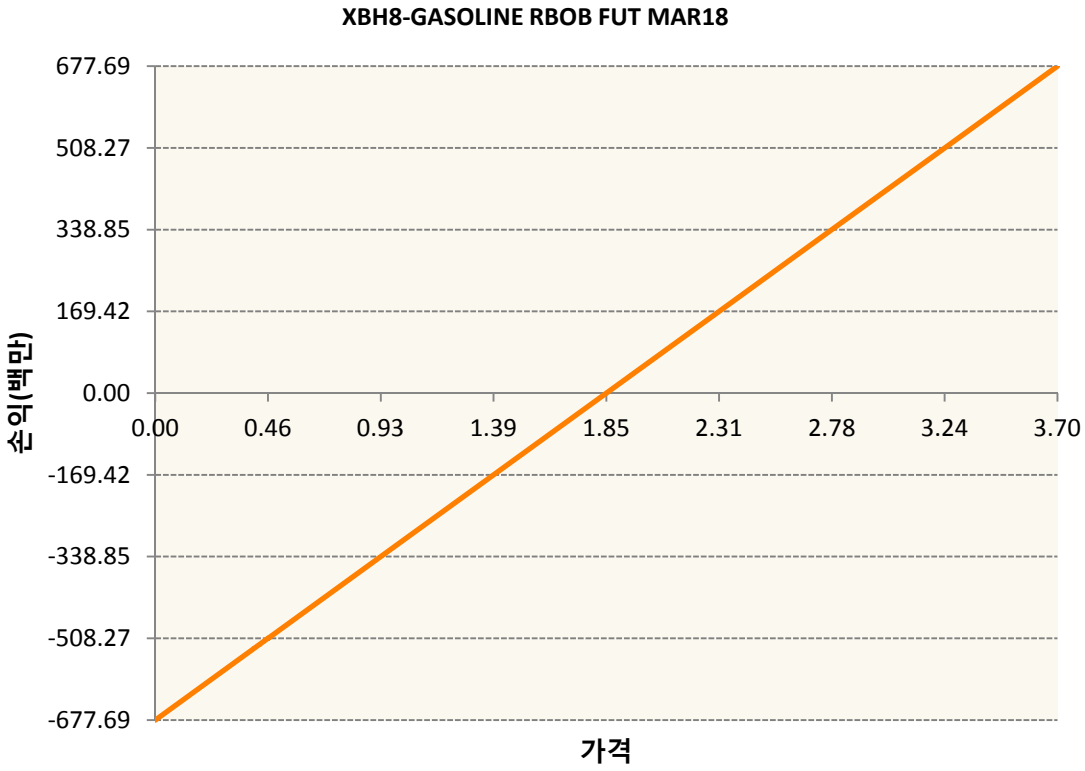

-760.04
-1,140.06
-1,520.07
가격


HOH8-NY Harb ULSD Fut MAR18
755.70
566.78
377.85
188.93
0.00
-188.93
-377.85
-566.78
-755.70
0.00
0.52
1.04
1.55
2.07
2.59
3.11
3.62
4.14
손익(백만)
가격


KR4175N20007-2018-02 달러선물
849.60
637.20
424.80
212.40
0.00
-212.40
-424.80
-637.20
0.00
265.50
531.00
796.50
1,062.00
1,327.50
1,593.00
1,858.50
2,124.00
손익(백만)


-849.60
가격


NGH8-NATURAL GAS FUTR MAR18
986.25
739.69
493.13
246.56
0.00
-246.56
-493.13
-739.69
-986.25
손익(백만)
0.00
0.73
1.47
2.20
2.93
3.66
4.40
5.13
5.86
가격


XBH8-GASOLINE RBOB FUT MAR18
677.69
508.27
338.85
169.42
0.00
-169.42
-338.85
-508.27
-677.69
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	72
COH8	BRENT CRUDE FUTR MAR18	122
HOH8	NY Harb ULSD Fut MAR18	60
KR4175N20(	2018-02 달러선물	68
NGH8	NATURAL GAS FUTR MAR18	79
XBH8	GASOLINE RBOB FUT MAR18	54

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

638

공시일	2018-01-15
기준일	2018-01-12

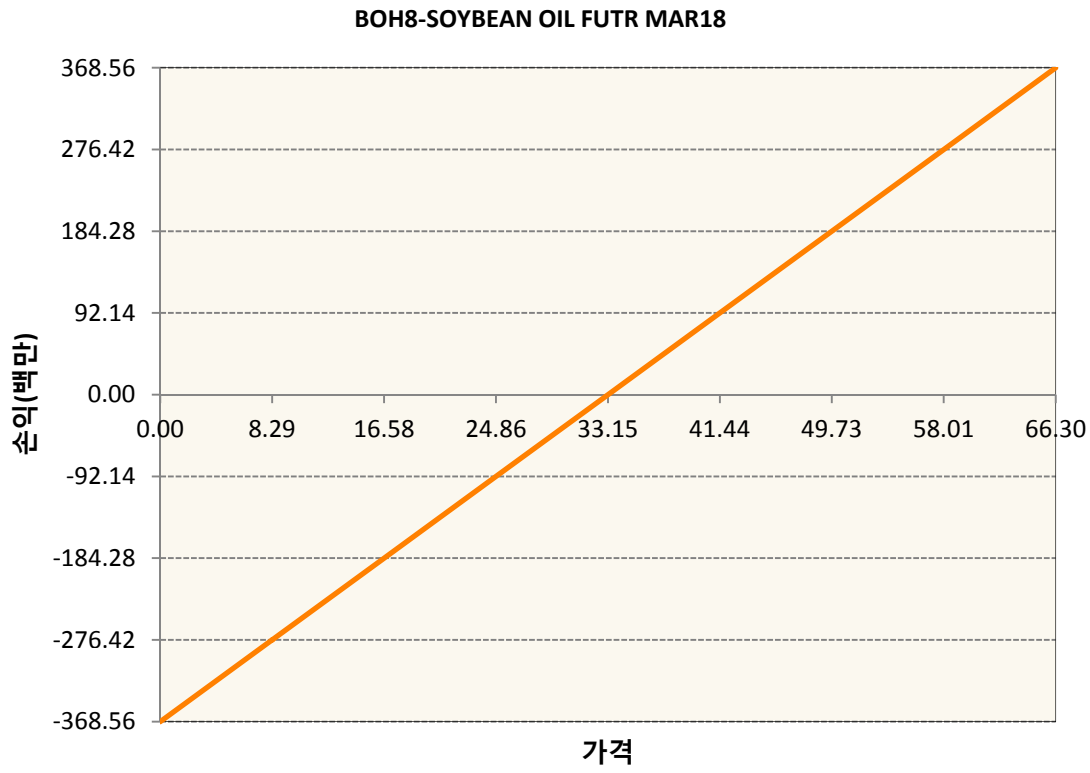
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

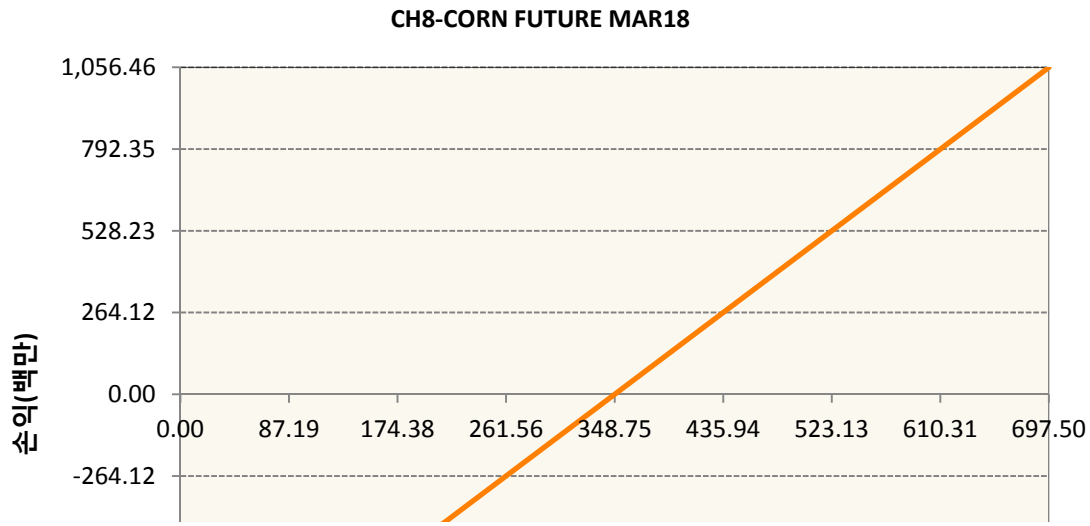
1. 계약금액

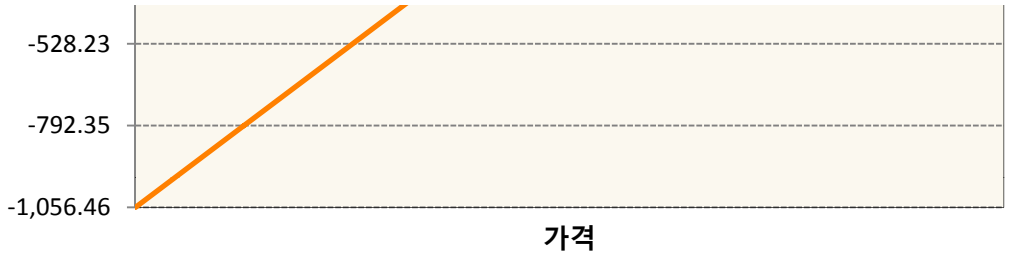
(단위:백만원)

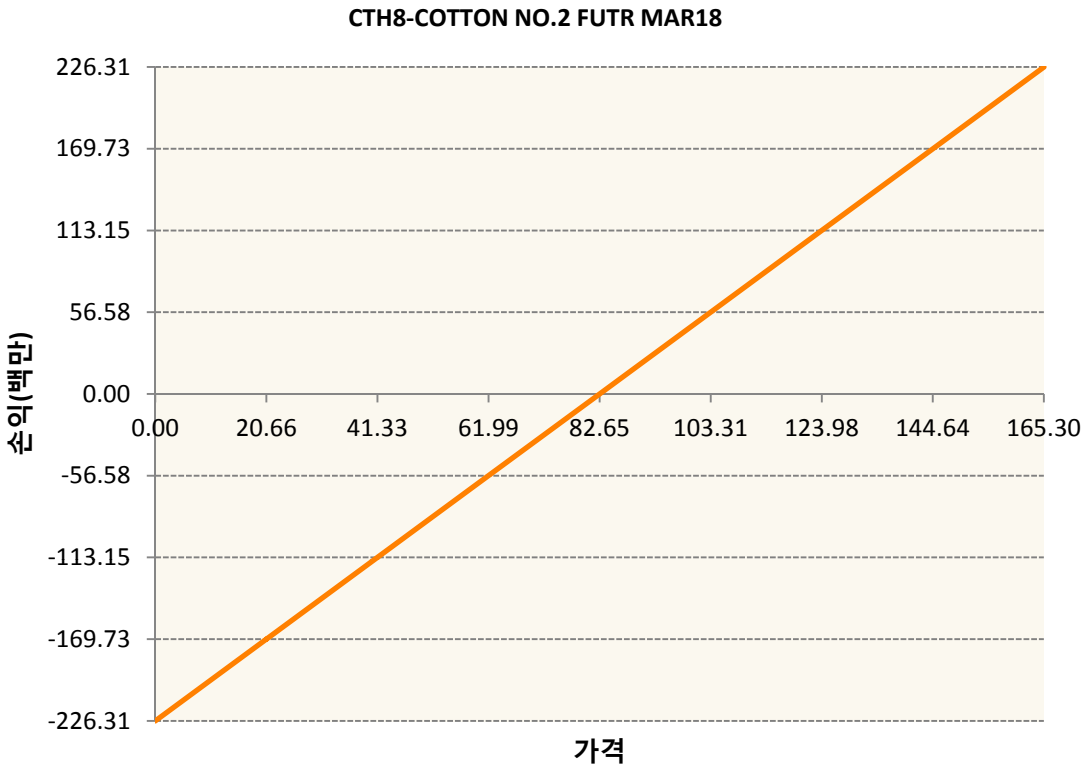
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	4,226	319	3,907	

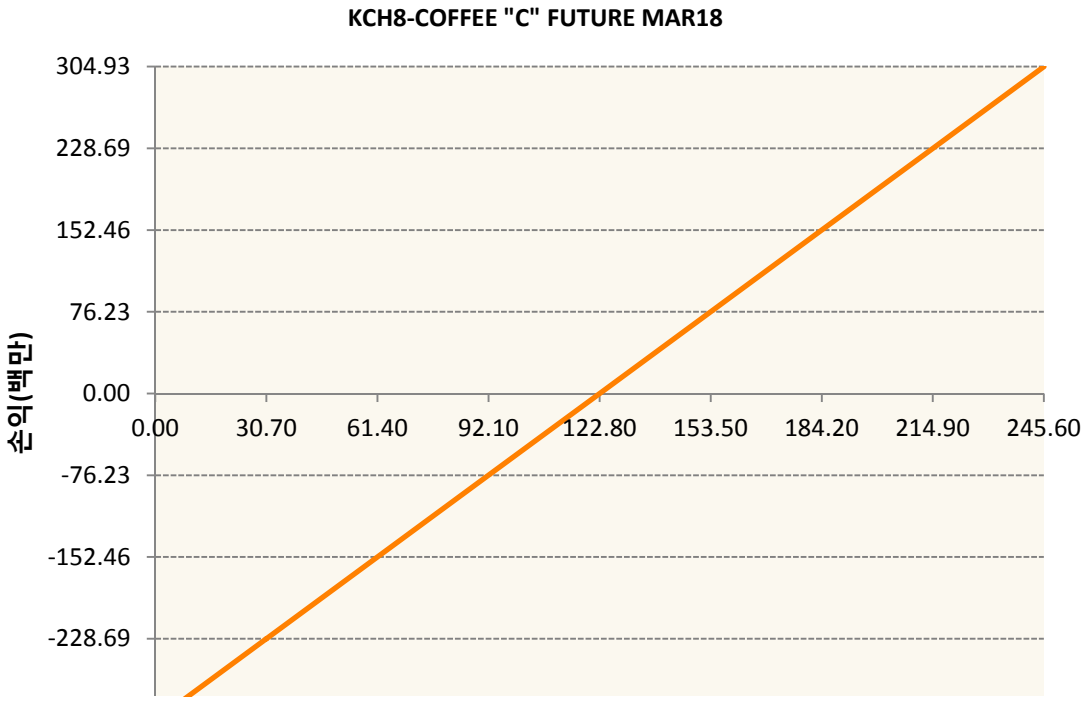
2. 만기시점의 손익구조

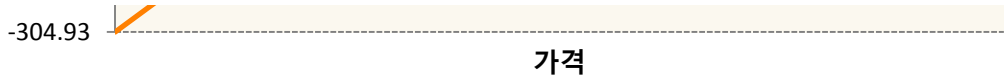


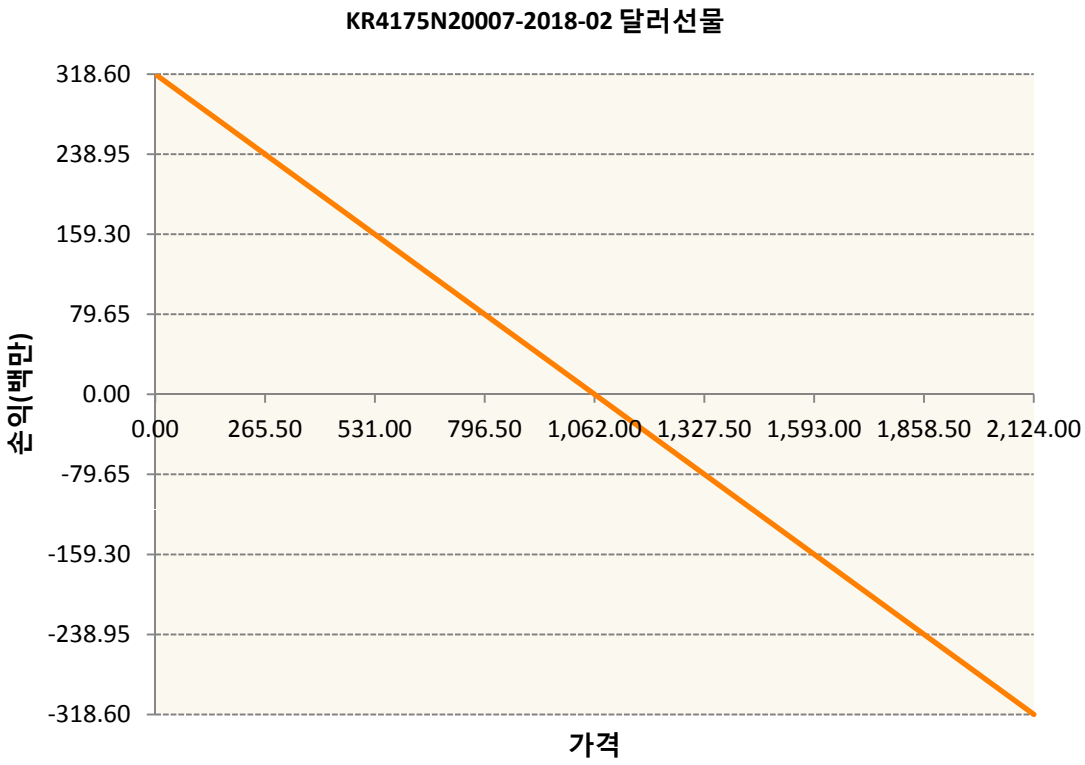


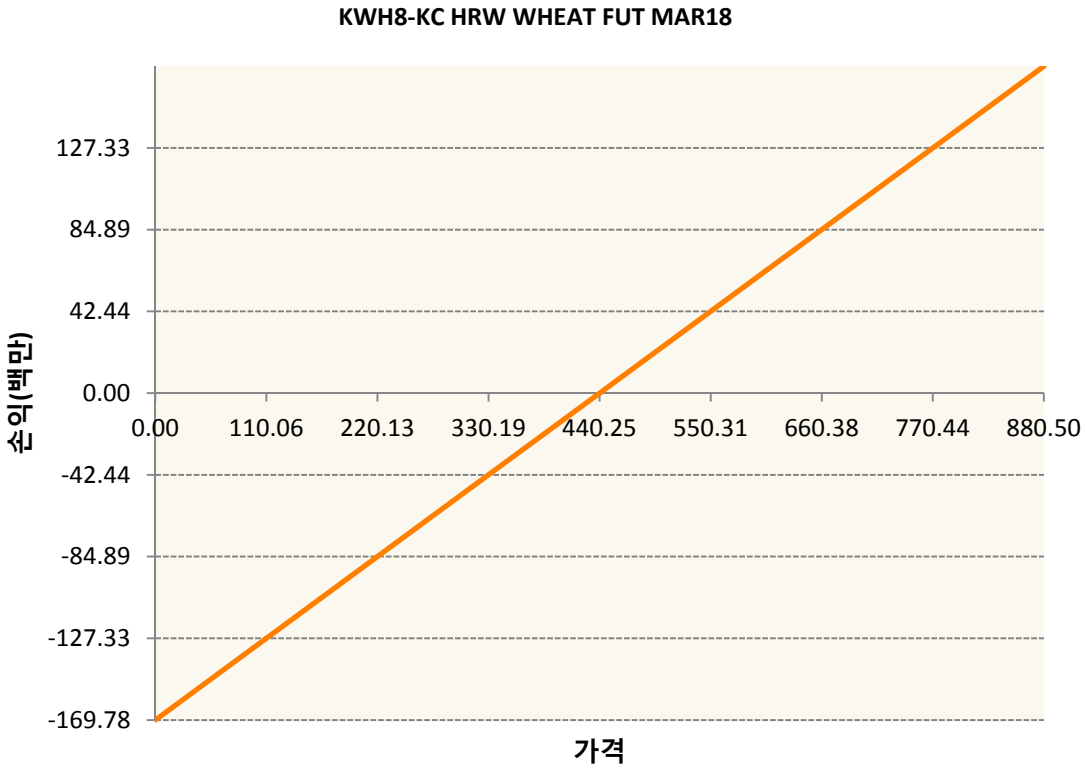

-528.23
-792.35
-1,056.46
가격


CTH8-COTTON NO.2 FUTR MAR18
226.31
169.73
113.15
56.58
0.00
-56.58
-113.15
-169.73
-226.31
0.00
20.66
41.33
61.99
82.65
103.31
123.98
144.64
165.30
손익(백만)
가격

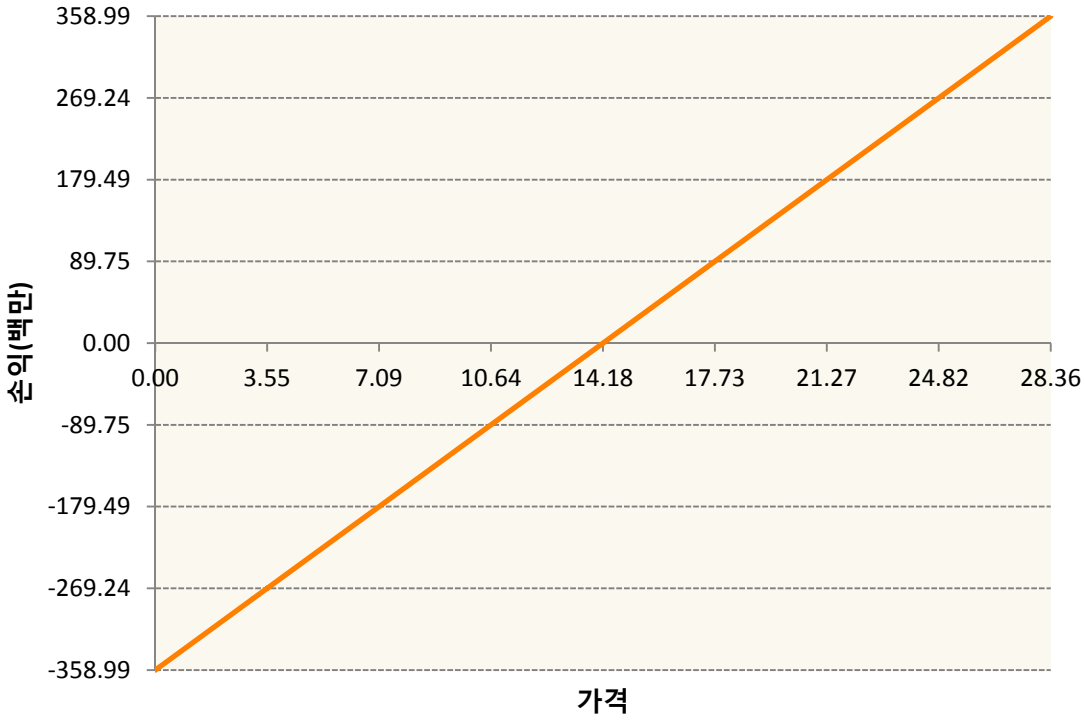

KCH8-COFFEE "C" FUTURE MAR18
304.93
228.69
152.46
76.23
0.00
-76.23
-152.46
-228.69
0.00
30.70
61.40
92.10
122.80
153.50
184.20
214.90
245.60
손익(백만)


-304.93
가격

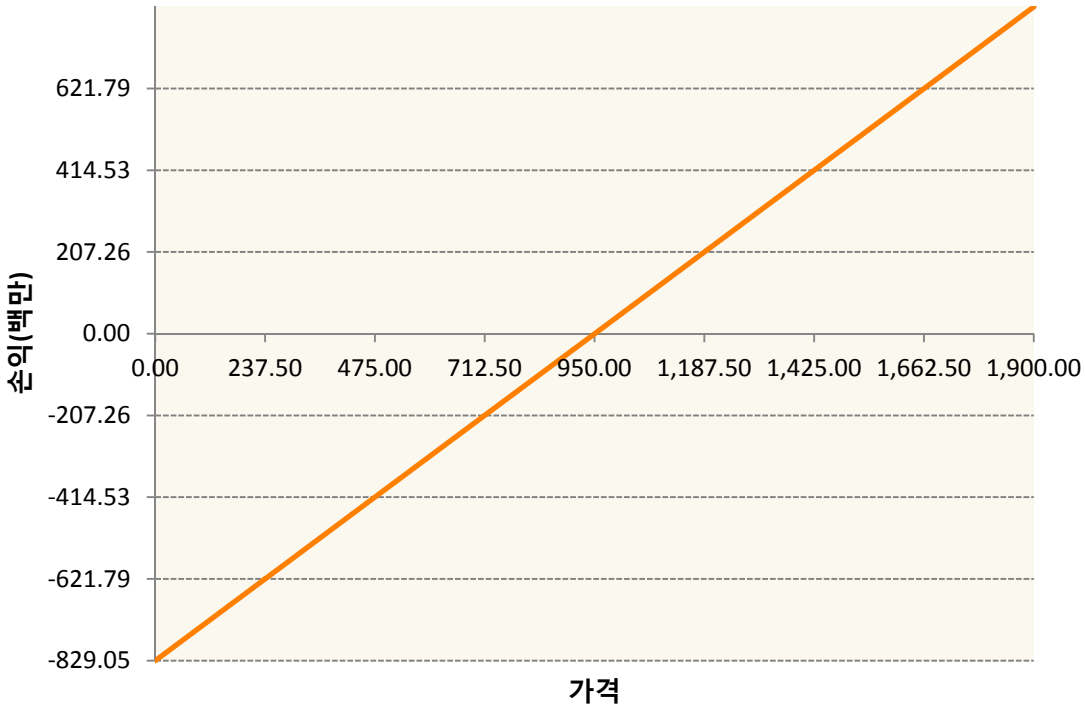

KR4175N20007-2018-02 달러선물
318.60
238.95
159.30
79.65
0.00
-79.65
-159.30
-238.95
-318.60
0.00
265.50
531.00
796.50
1,062.00
1,327.50
1,593.00
1,858.50
2,124.00
손익(백만)
가격


KWH8-KC HRW WHEAT FUT MAR18
127.33
84.89
42.44
0.00
-42.44
-84.89
-127.33
-169.78
0.00
110.06
220.13
330.19
440.25
550.31
660.38
770.44
880.50
손익(백만)
가격

SBH8-Sugar #11 (WORLD) MAR18

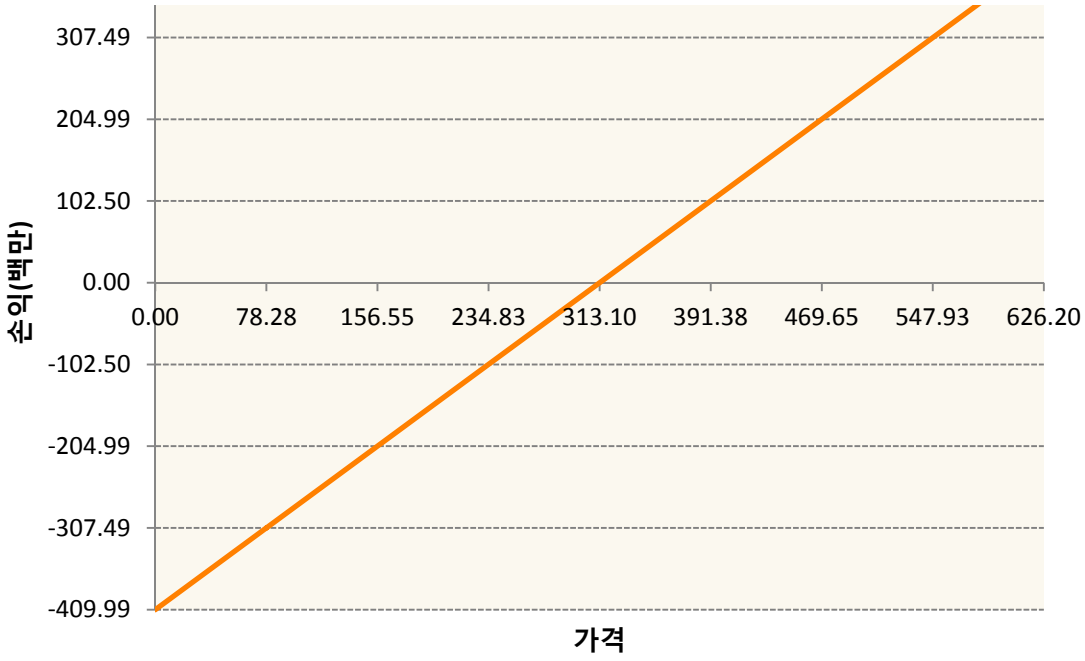


SH8-SOYBEAN FUTURE MAR18

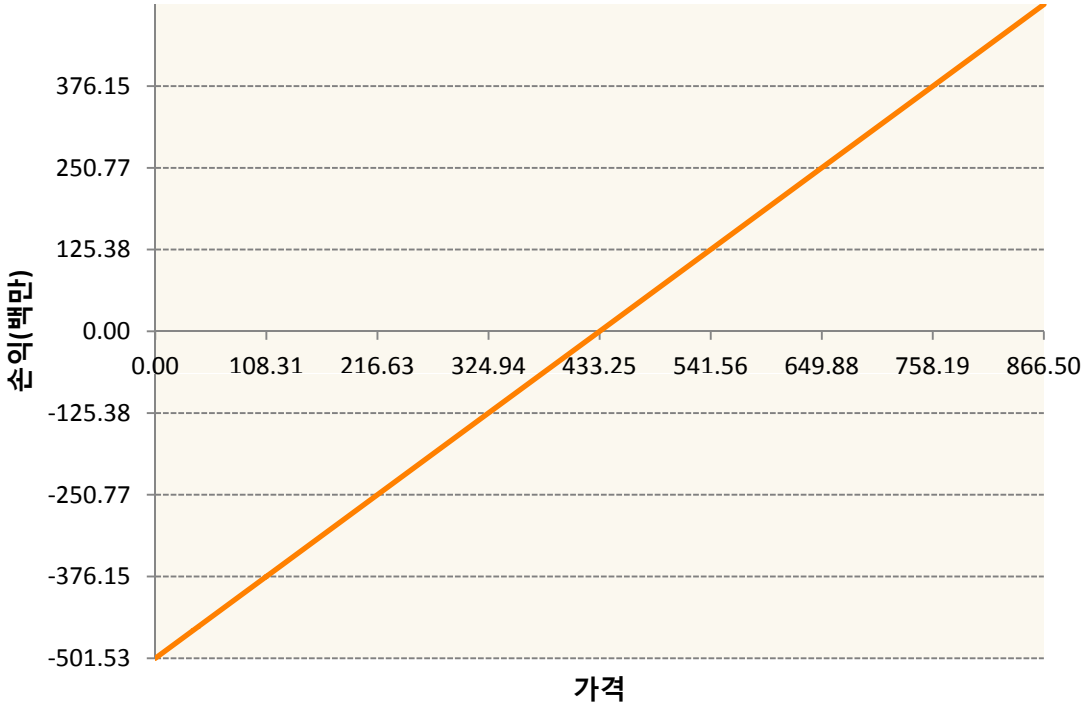


SMH8-SOYBEAN MEAL FUTR MAR18





WH8-WHEAT FUTURE(CBT) MAR18



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

BOH8	SOYBEAN OIL FUTR MAR18	29
CH8	CORN FUTURE MAR18	85
CTH8	COTTON NO.2 FUTR MAR18	18
KCH8	COFFEE "C" FUTURE MAR18	24
KR4175N20(	2018-02 달러선물	25

KWH8	KC HRW WHEAT FUT MAR18	14
SBH8	Sugar #11 (WORLD) MAR18	29
SH8	SOYBEAN FUTURE MAR18	66
SMH8	SOYBEAN MEAL FUTR MAR18	33
WH8	WHEAT FUTURE(CBT) MAR18	40

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

353