공시일	2018-01-18
기준일	2018-01-17

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	2018-01-18
기준일	2018-01-17

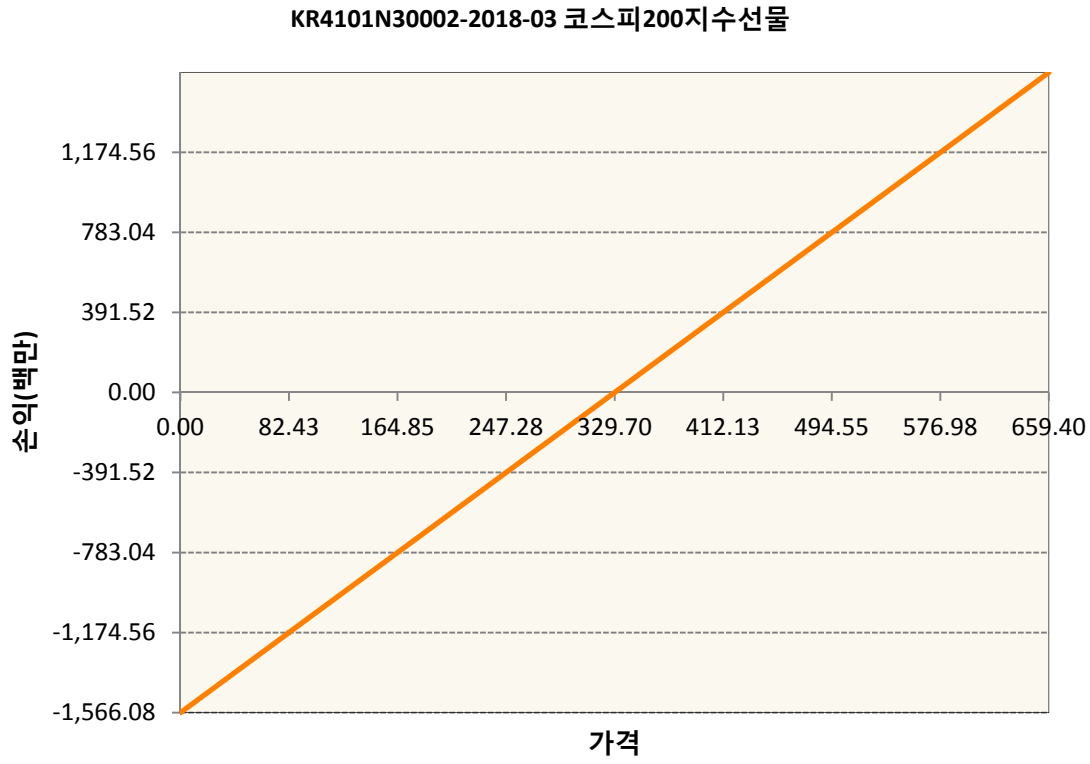
스마트인덱스모

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	1,566	0	1,566	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101N30(2018-03 코스피200지수선물							125
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-125	-125	-125	-125	-125	-125	-125
-5.33%	-83	-83	-83	-83	-83	-83	-83
-2.67%	-42	-42	-42	-42	-42	-42	-42
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	42	42	42	42	42	42	42
5.33%	83	83	83	83	83	83	83
8.00%	125	125	125	125	125	125	125

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

75

공시일	2018-01-18
기준일	2018-01-17

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	1,144

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

368

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2018-01-18
기준일	2018-01-17

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	412

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

373

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2018-01-18
기준일	2018-01-17

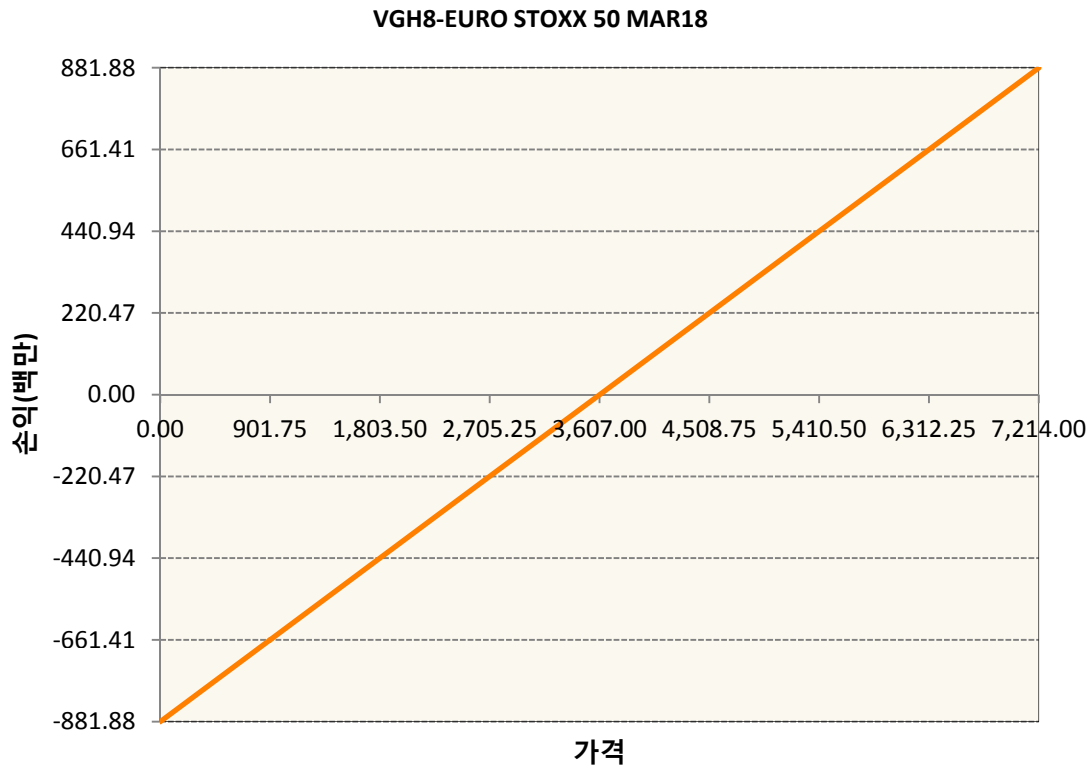
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	882	0	882	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGH8	EURO STOXX 50 MAR18	71

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

(단위:백만원)

39

공시일	2018-01-18
기준일	2018-01-17

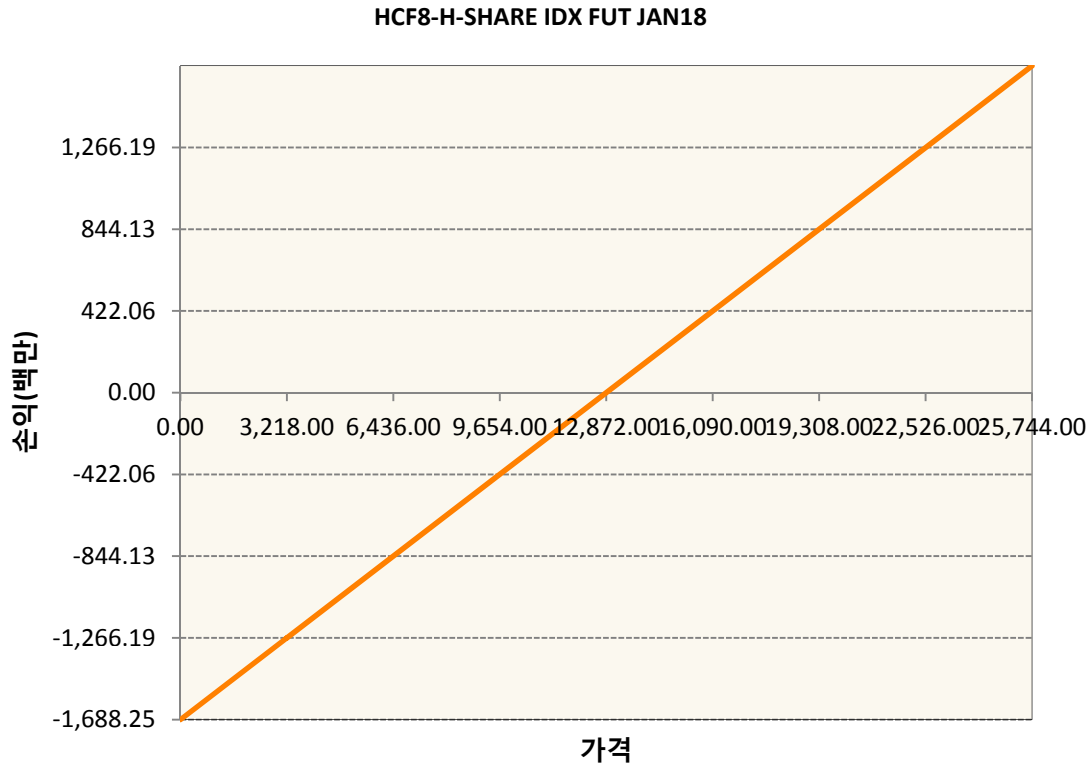
차이나인덱스모(주식-파생형)

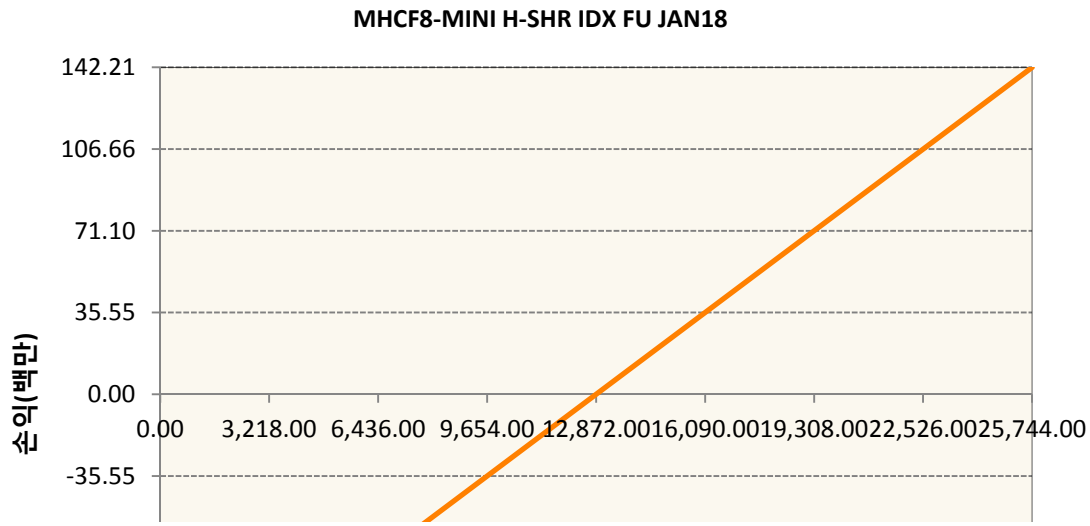
1. 계약금액

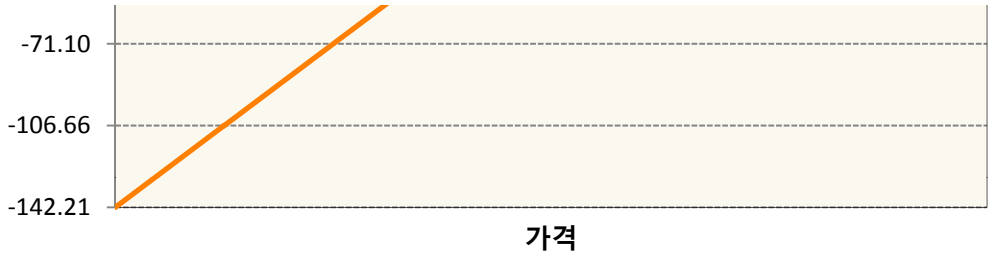
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,830	0	1,830	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCF8	H-SHARE IDX FUT JAN18	135
MHCF8	MINI H-SHR IDX FU JAN18	11

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	117

공시일	2018-01-18
기준일	2018-01-17

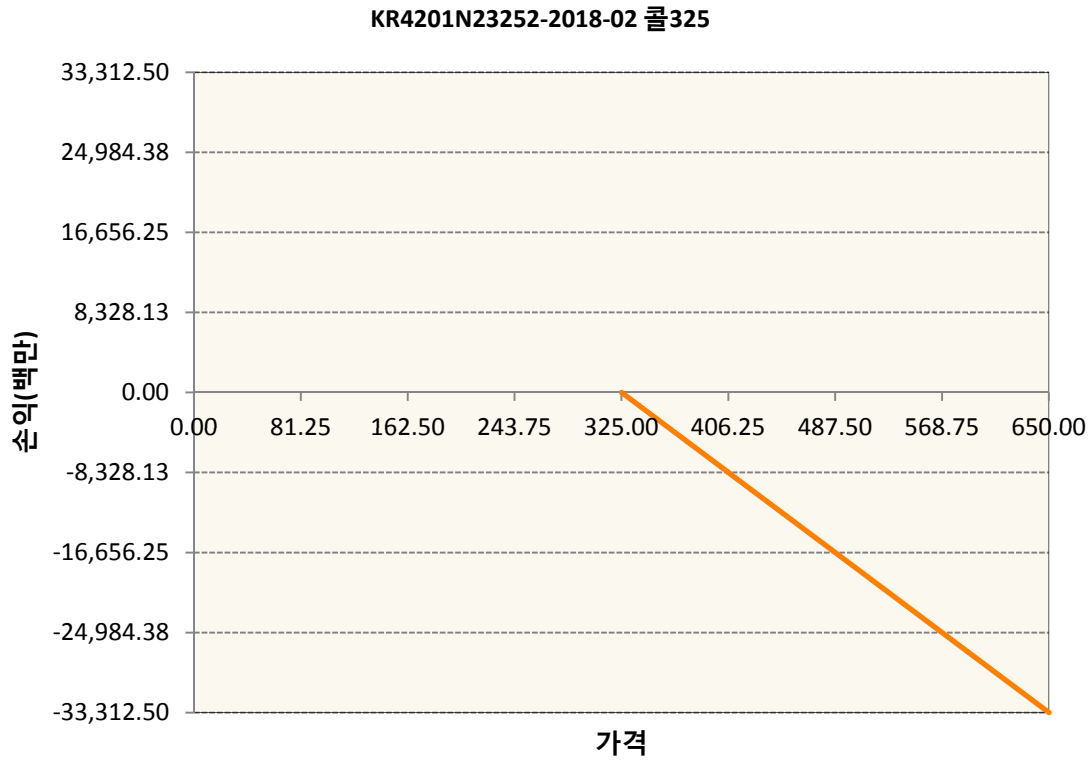
커버드콜모(주식혼합-파생형)

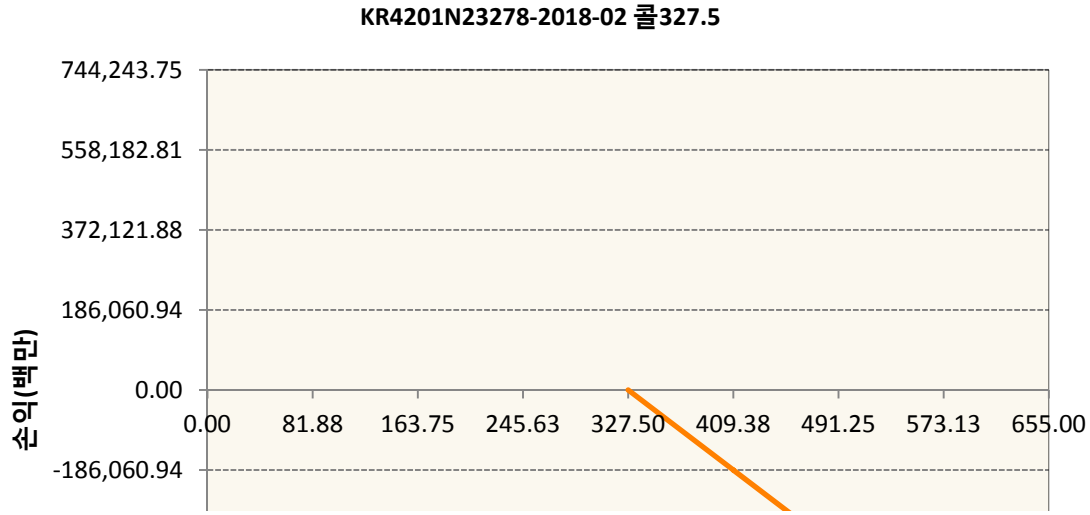
1. 계약금액

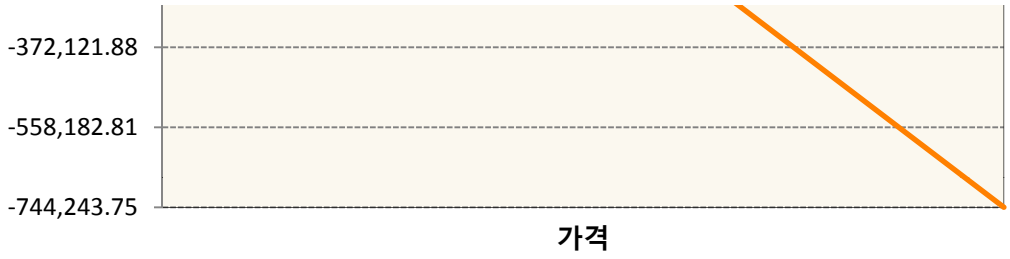
(단위:백만원)

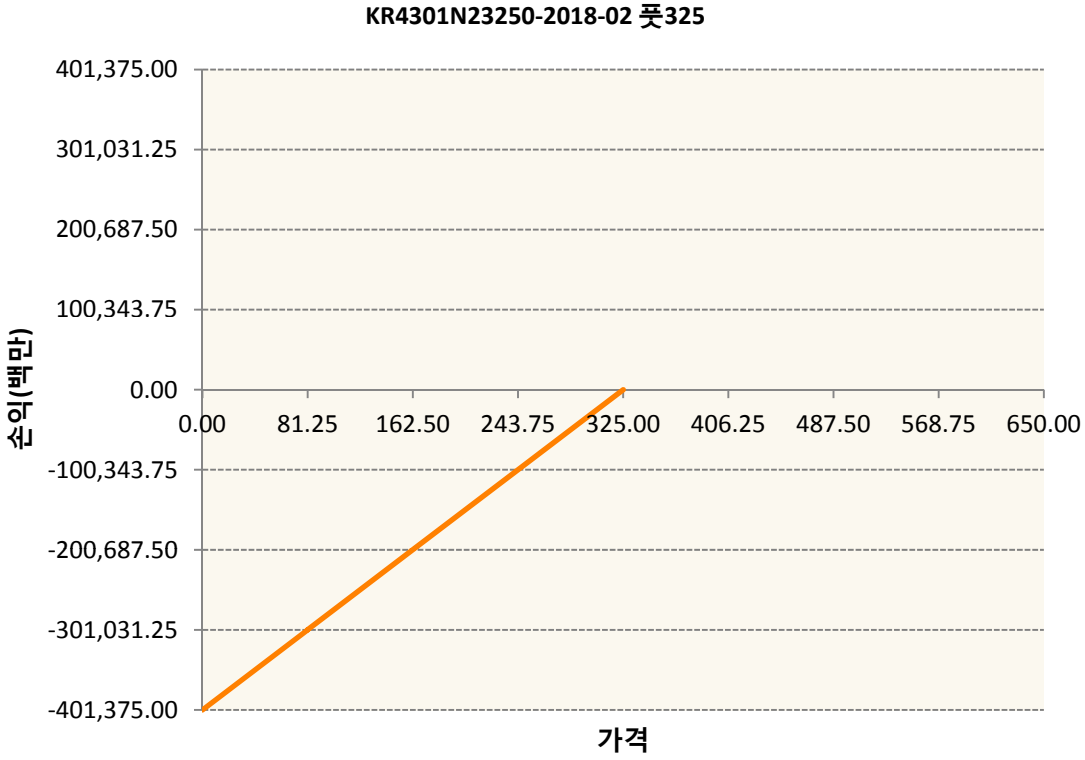
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	16,209	0	16,209	장내
누계	유가증권	옵션	0	1,355,781	-1,355,781	장내

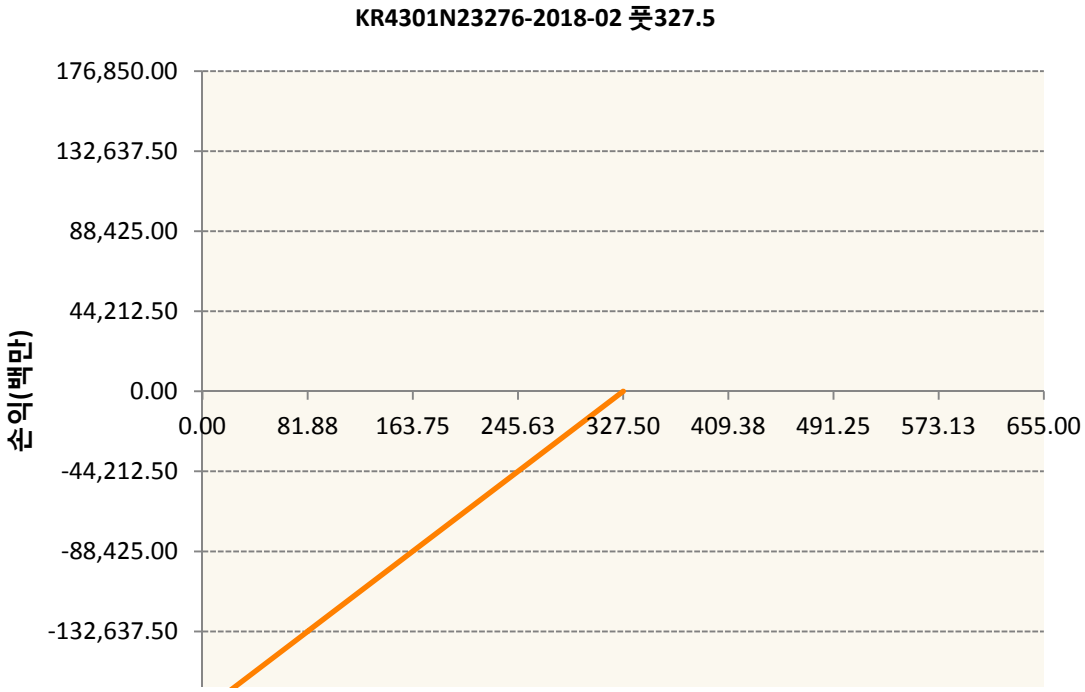
2. 만기시점의 손익구조






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


KR4301N23250-2018-02 풋325
401,375.00
301,031.25
200,687.50
100,343.75
0.00
-100,343.75
-200,687.50
-301,031.25
-401,375.00
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
176,850.00
132,637.50
88,425.00
44,212.50
0.00
-44,212.50
-88,425.00
-132,637.50
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							2,239
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,023	1,000	972	940	904	864	822
-5.33%	914	867	818	766	712	657	600
-2.67%	656	591	526	460	394	328	262
0%	199	133	67	0	-67	-134	-201
2.67%	-452	-501	-554	-609	-666	-725	-785
5.33%	-1,239	-1,267	-1,301	-1,338	-1,380	-1,425	-1,472
8.00%	-2,098	-2,110	-2,127	-2,149	-2,175	-2,206	-2,239
KR4201N232 2018-02 콜327.5							47,880
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	19,862	19,455	18,941	18,330	17,632	16,856	16,012
-5.33%	18,031	17,142	16,167	15,122	14,019	12,869	11,680
-2.67%	13,380	12,016	10,629	9,223	7,803	6,371	4,931
0%	4,538	3,027	1,514	0	-1,515	-3,031	-4,548
2.67%	-8,741	-9,981	-11,271	-12,599	-13,959	-15,343	-16,746
5.33%	-25,448	-26,219	-27,096	-28,061	-29,100	-30,201	-31,355
8.00%	-44,129	-44,501	-44,985	-45,574	-46,259	-47,030	-47,880
KR4301N232 2018-02 풋325							24,768
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-24,622	-24,626	-24,635	-24,651	-24,677	-24,716	-24,768
-5.33%	-13,881	-13,957	-14,059	-14,186	-14,335	-14,507	-14,697
-2.67%	-4,362	-4,686	-5,021	-5,363	-5,712	-6,065	-6,423
0%	1,019	689	348	0	-354	-714	-1,077
2.67%	2,351	2,261	2,144	2,000	1,832	1,642	1,433
5.33%	2,470	2,462	2,447	2,421	2,382	2,327	2,255
8.00%	2,473	2,473	2,472	2,470	2,465	2,456	2,441
KR4301N232 2018-02 풋327.5							11,642
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-11,605	-11,606	-11,608	-11,611	-11,617	-11,627	-11,642
-5.33%	-6,884	-6,901	-6,927	-6,963	-7,008	-7,063	-7,126
-2.67%	-2,464	-2,574	-2,694	-2,820	-2,953	-3,090	-3,231
0%	502	335	168	0	-169	-337	-507
2.67%	1,466	1,400	1,321	1,231	1,132	1,024	910

5.33%	1,585	1,577	1,563	1,542	1,514	1,476	1,430
8.00%	1,590	1,589	1,589	1,586	1,582	1,574	1,563

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

89,472

공시일	2018-01-18
기준일	2018-01-17

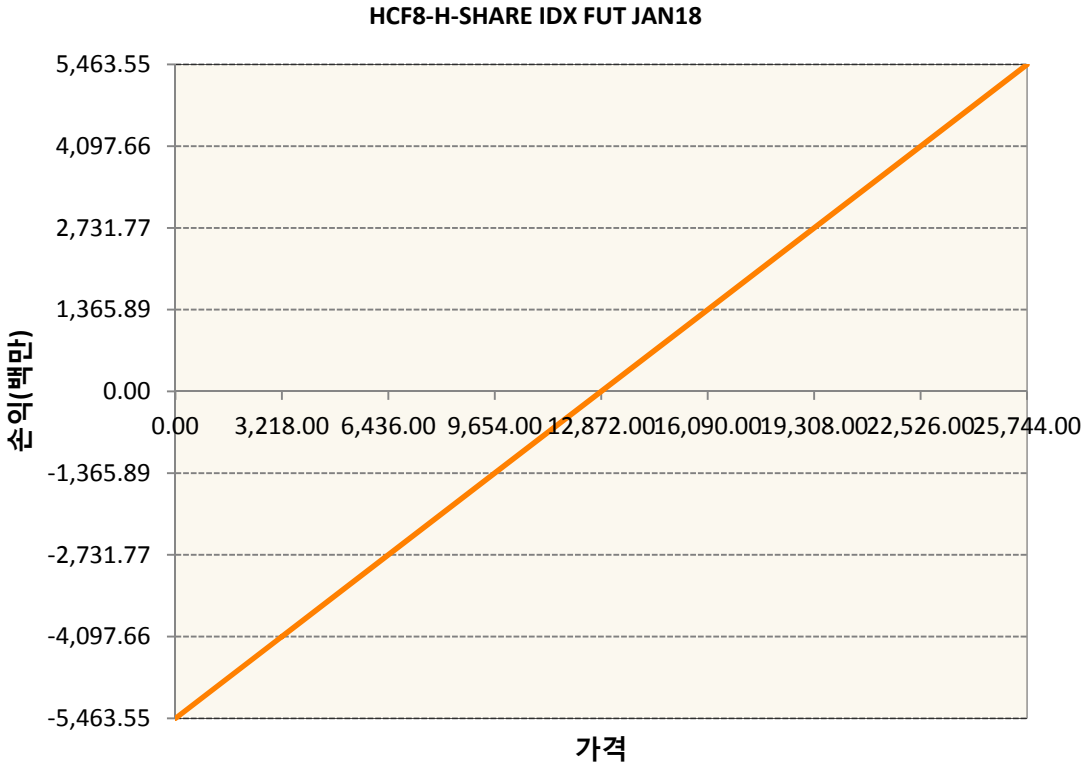
홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생

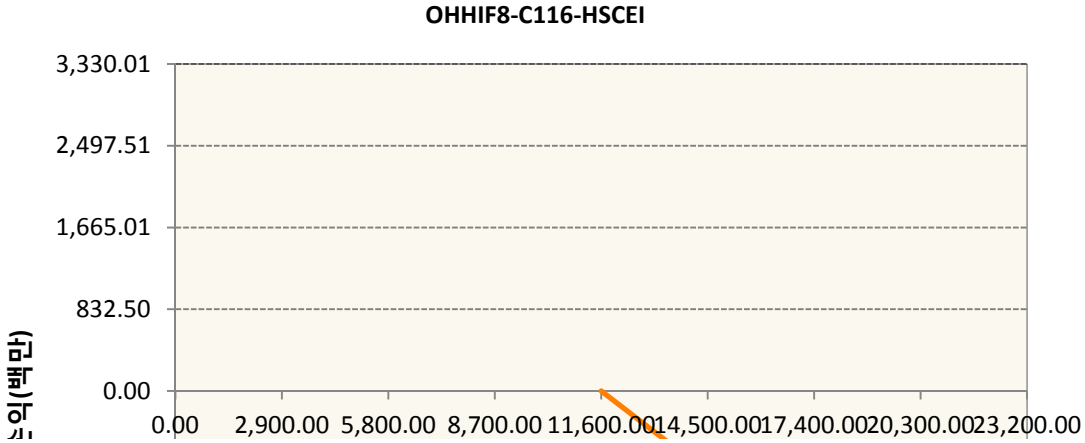
1. 계약금액

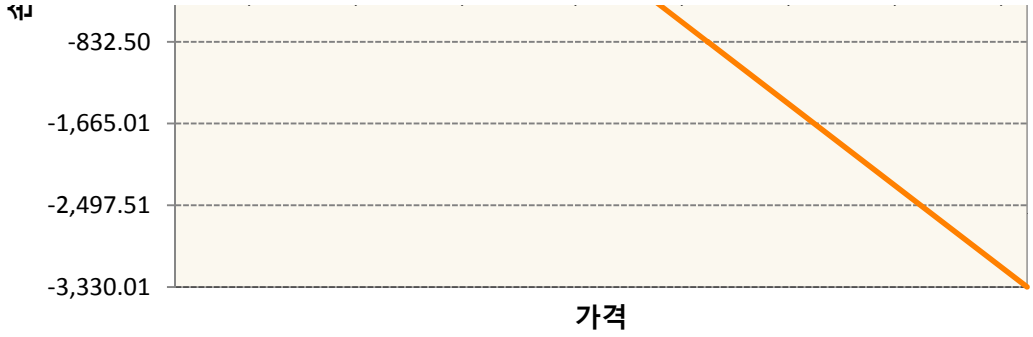
(단위:백만원)

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	5,464	0	5,464	장내
누계	유가증권	옵션	0	11,177	-11,177	장내

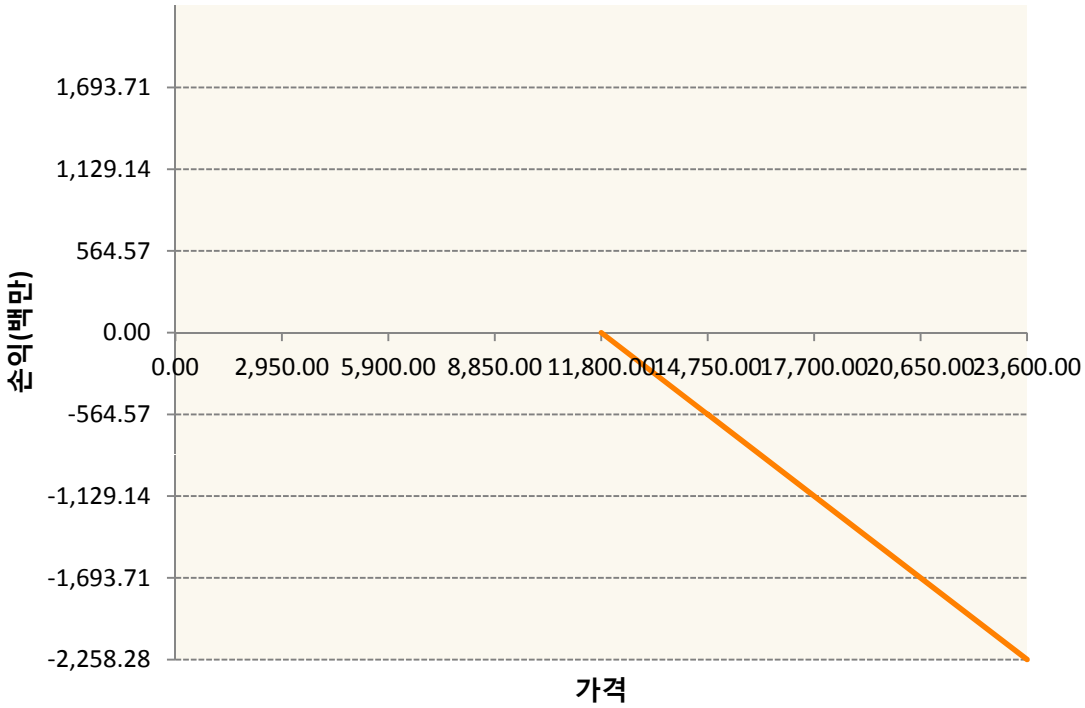
2. 만기시점의 손익구조



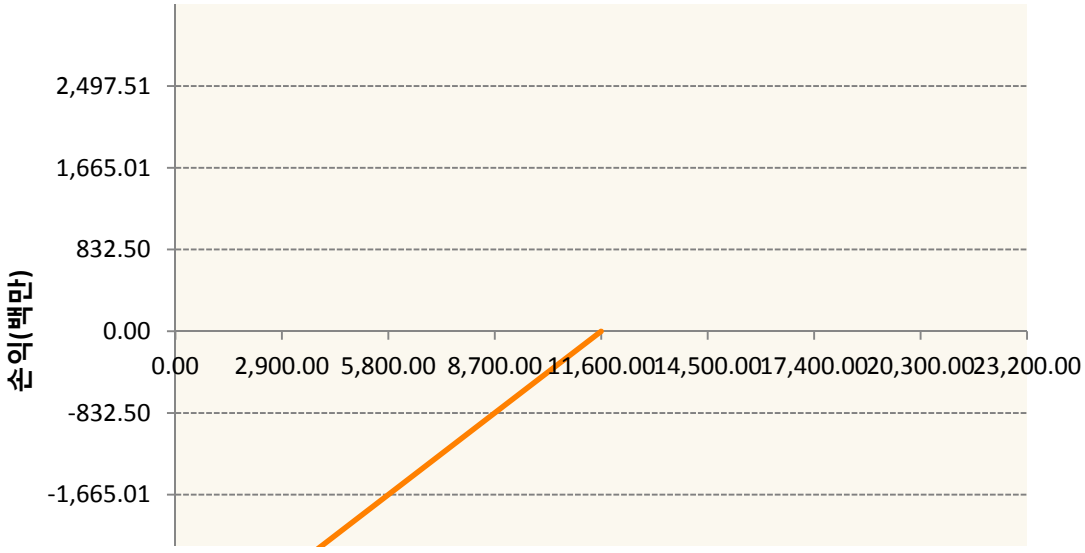


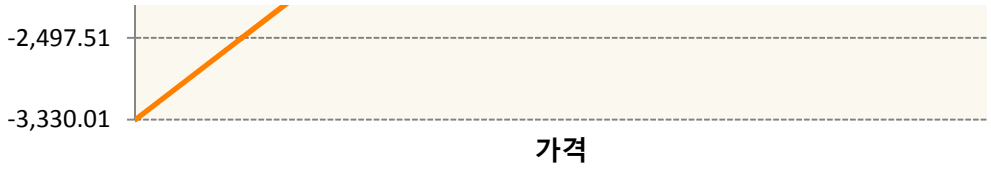


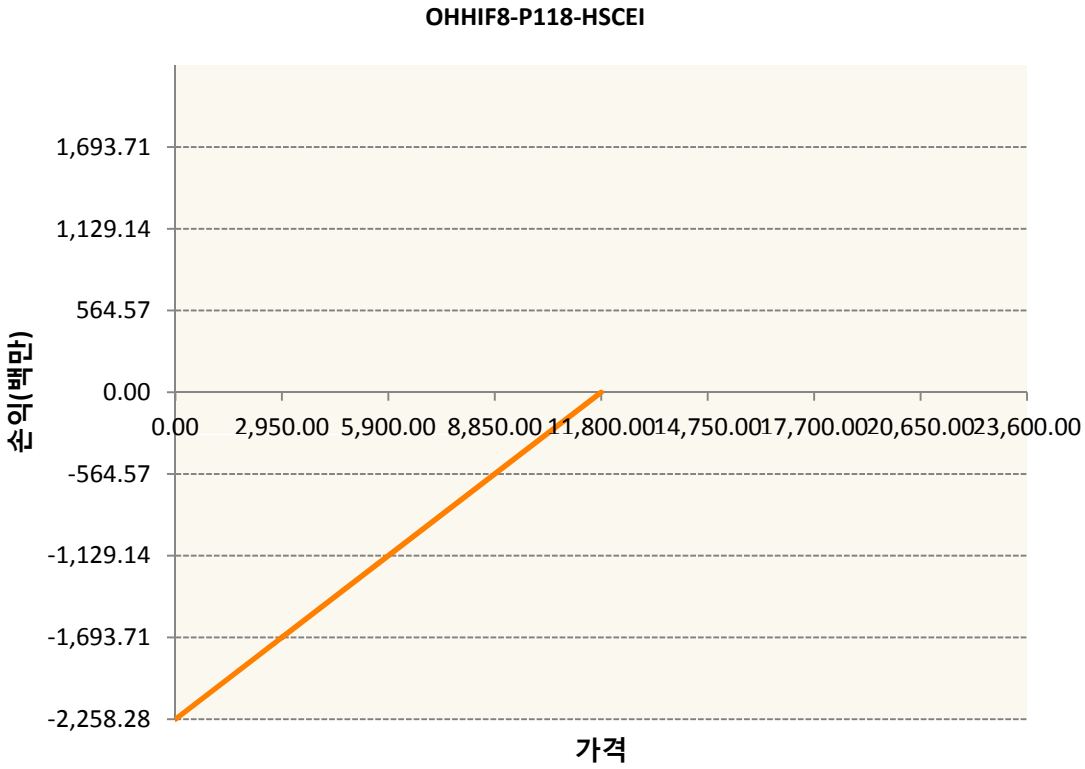
OHHIF8-C118-HSCEI



OHHIF8-P116-HSCEI







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCF8	H-SHARE IDX FUT JAN18	437
OHHIF8-C11	HSCEI	266
OHHIF8-C11	HSCEI	181
OHHIF8-P11	HSCEI	266
OHHIF8-P11	HSCEI	181

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,060

공시일	2018-01-18
기준일	2018-01-17

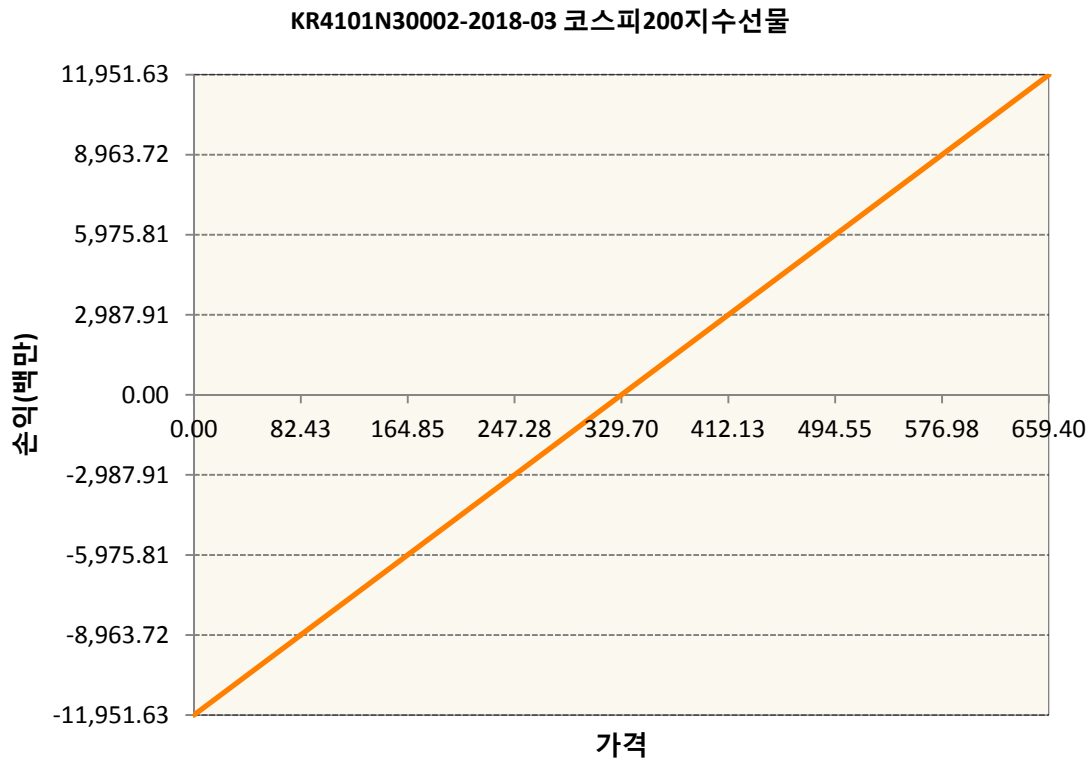
코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼

1. 계약금액

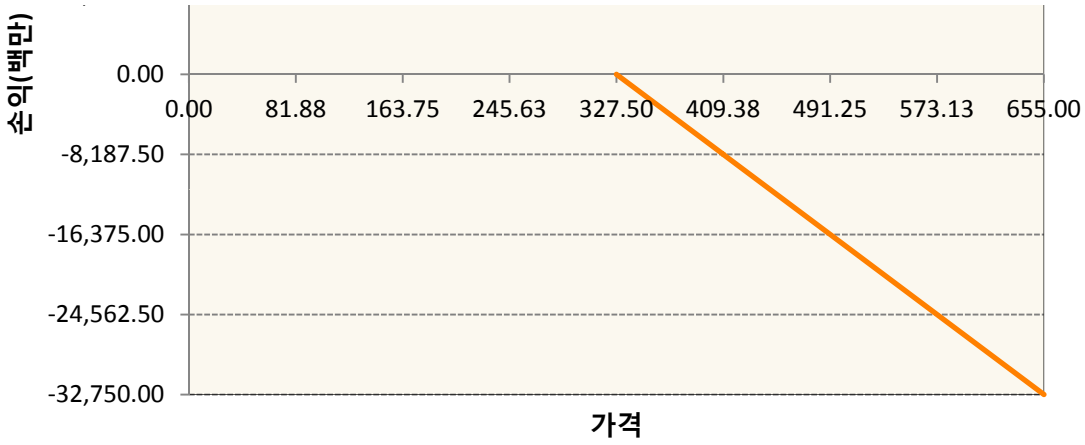
(단위:백만원)

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	11,952	0	11,952	장내
누계	유가증권	스왑	60,200	0	60,200	장외
누계	유가증권	옵션	0	60,431	-60,431	장내

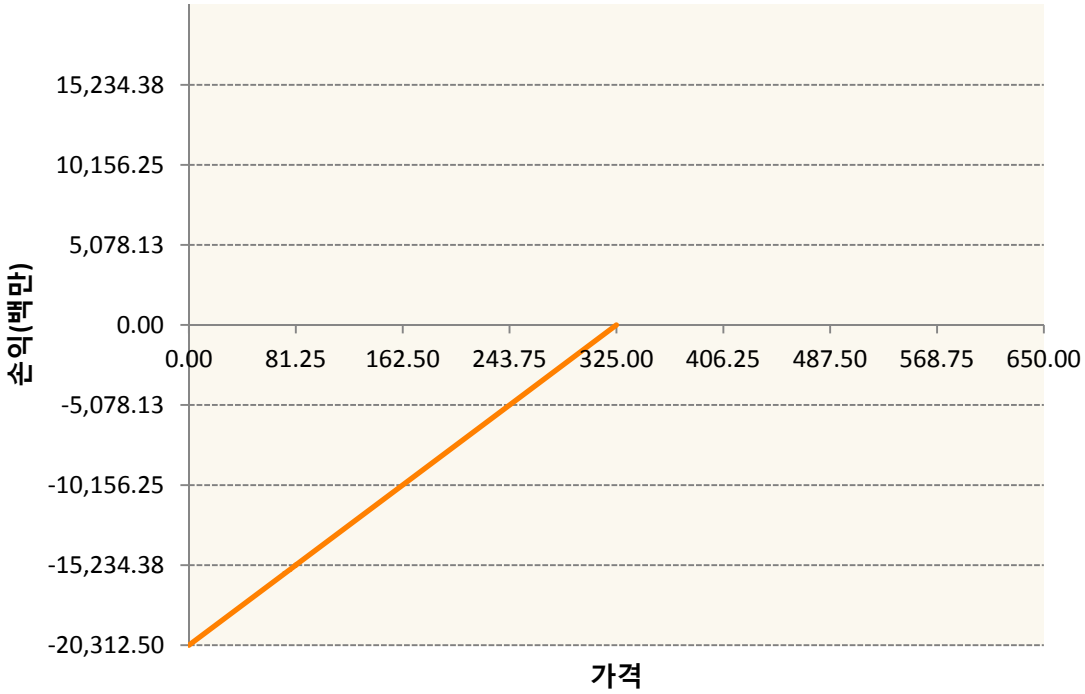
2. 만기시점의 손익구조



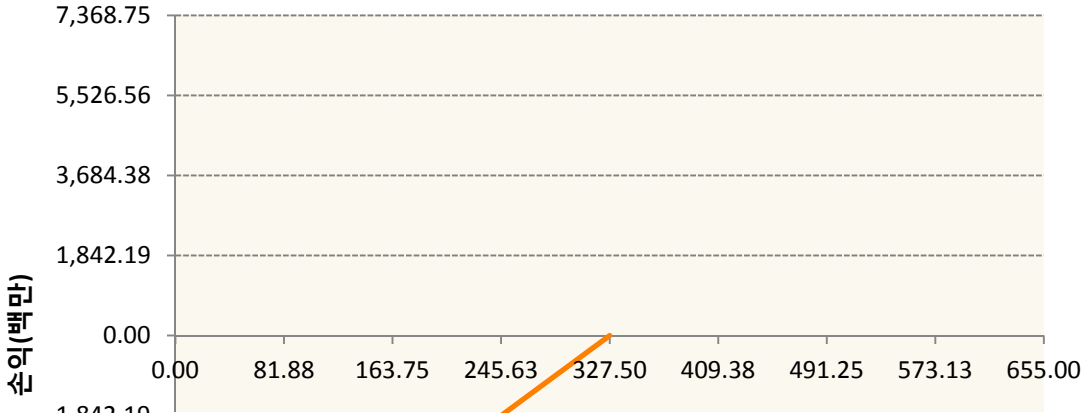




KR4301N23250-2018-02 풋325



KR4301N23276-2018-02 풋327.5





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_2							1,447
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,447	-1,447	-1,447	-1,447	-1,447	-1,447	-1,447
-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%	1,447	1,447	1,447	1,447	1,447	1,447	1,447
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						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%	-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%	196	195	195	195	195	195	196
	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%	-309	-309	-309	-309	-309	-309	-309
-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%	309	309	309	309	309	309	309
8.00%	463	463	463	463	463	463	463
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_9						309
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-309	-309	-309	-309	-309	-309	-309
-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%	309	309	309	309	309	309	309
	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					626
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-626	-626	-626	-626	-626	-626	-626
-5.33%	-417	-417	-417	-417	-417	-417	-417
-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%	417	417	417	417	417	417	417
8.00%	626	626	626	626	626	626	626
	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				955
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-955	-955	-955	-955	-955	-955	-955
-5.33%	-636	-636	-636	-636	-636	-636	-636
-2.67%	-318	-318	-318	-318	-318	-318	-318
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	318	318	318	318	318	318	318
5.33%	636	636	636	636	636	636	636
8.00%	955	955	955	955	955	955	955
	KR4201N23:	2018-02	콜327.5				2,107

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	874	856	833	807	776	742	705
-5.33%	793	754	711	665	617	566	514
-2.67%	589	529	468	406	343	280	217
0%	200	133	67	0	-67	-133	-200
2.67%	-385	-439	-496	-554	-614	-675	-737
5.33%	-1,120	-1,154	-1,192	-1,235	-1,281	-1,329	-1,380
8.00%	-1,942	-1,958	-1,980	-2,005	-2,036	-2,070	-2,107
	KR4301N232 2018-02 풋325						1,253

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,246	-1,246	-1,247	-1,248	-1,249	-1,251	-1,253
-5.33%	-702	-706	-711	-718	-725	-734	-744
-2.67%	-221	-237	-254	-271	-289	-307	-325
0%	52	35	18	0	-18	-36	-55
2.67%	119	114	108	101	93	83	73
5.33%	125	125	124	123	121	118	114
8.00%	125	125	125	125	125	124	124
	KR4301N232 2018-02 풋327.5						485

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-484	-484	-484	-484	-484	-484	-485
-5.33%	-287	-288	-289	-290	-292	-294	-297
-2.67%	-103	-107	-112	-118	-123	-129	-135
0%	21	14	7	0	-7	-14	-21
2.67%	61	58	55	51	47	43	38
5.33%	66	66	65	64	63	62	60
8.00%	66	66	66	66	66	66	65

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

9,251

공시일	2018-01-18
기준일	2018-01-17

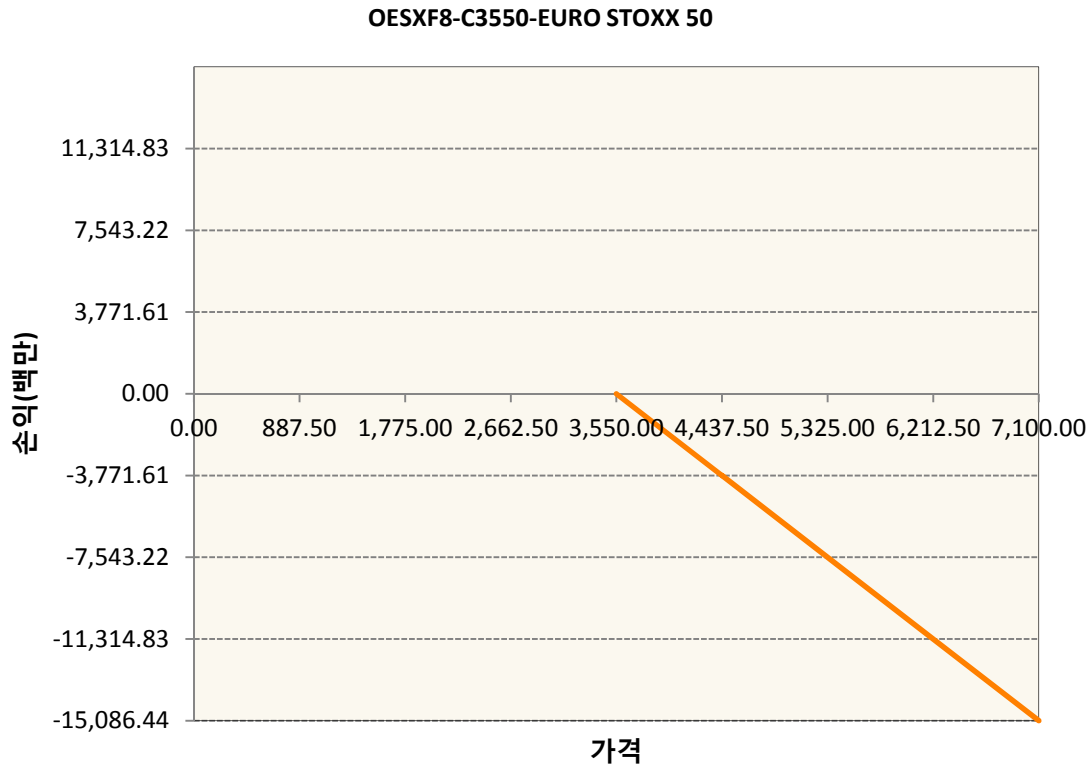
유로커버드콜모(주식혼합-파생형

1. 계약금액

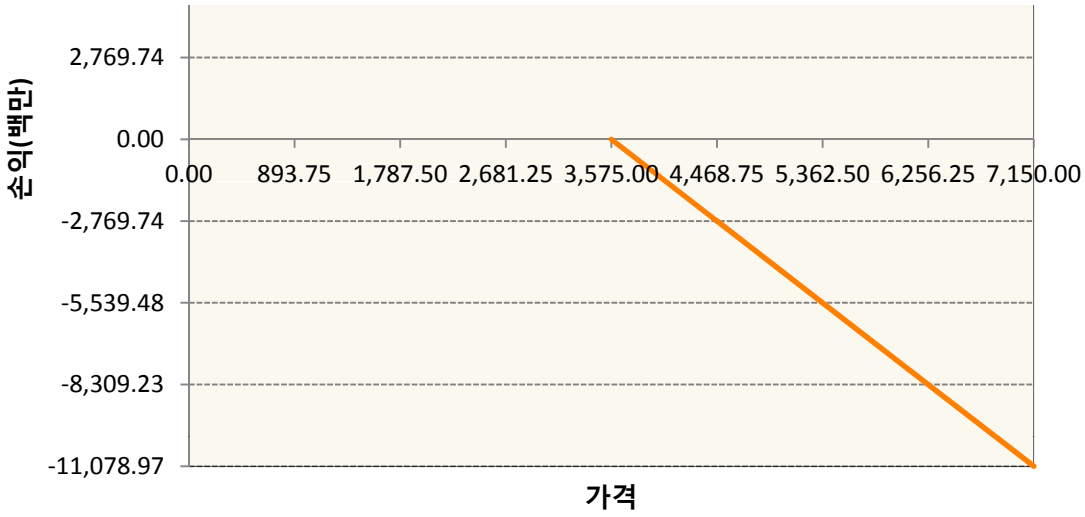
(단위:백만원)

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	17,607	0	17,607	
누계	유가증권	스왑	98,070	0	98,070	장외
누계	유가증권	옵션	0	52,331	-52,331	장내
누계	지수	스왑	52,304	0	52,304	장외

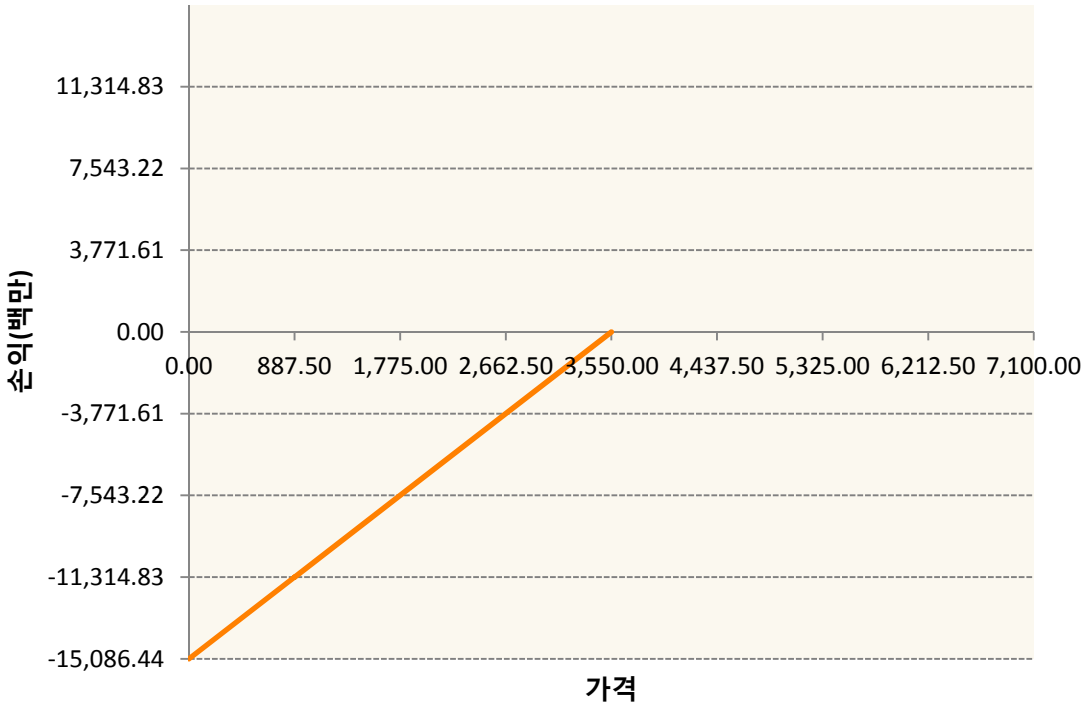
2. 만기시점의 손익구조



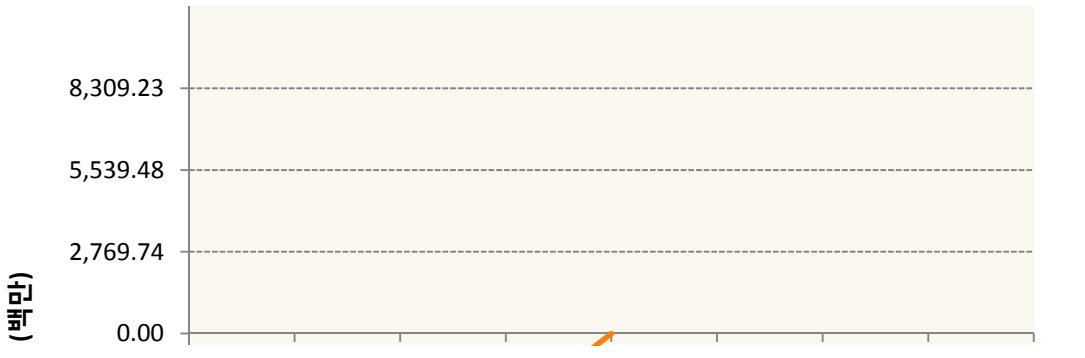


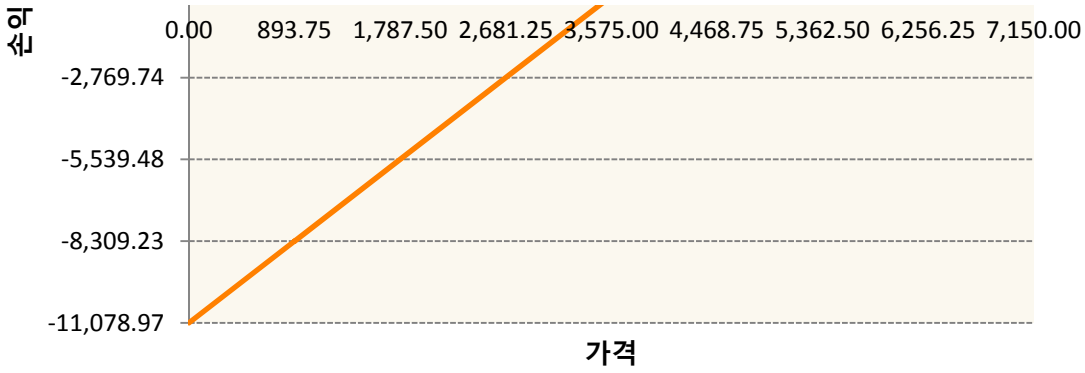


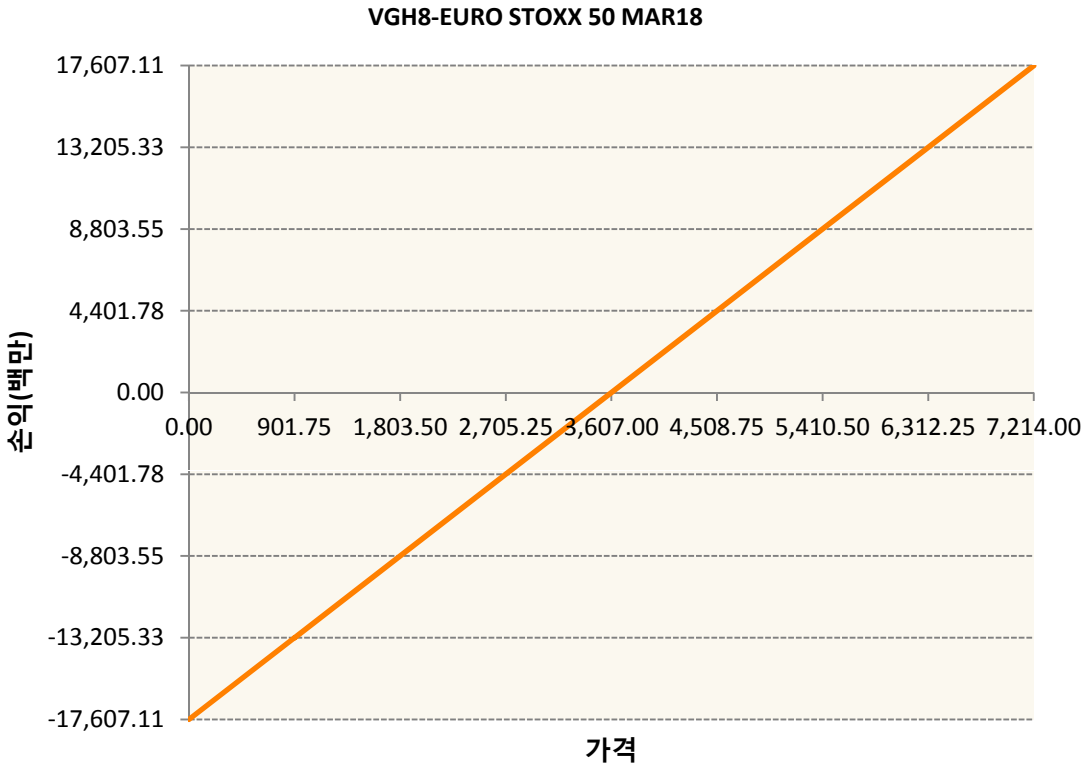
OESXF8-P3550-EURO STOXX 50



OESXF8-P3575-EURO STOXX 50







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)	(단위:백만원)
260105SGPX SG EURO Covered CALL STRATEGY - 994.569	109
260105SQPX SG EURO Covered CALL STRATEGY	161
OESXF8-C35 EURO STOXX 50	1,207
OESXF8-C35 EURO STOXX 50	886
OESXF8-P35 EURO STOXX 50	1,207
OESXF8-P35 EURO STOXX 50	886
VGH8 EURO STOXX 50 MAR18	1,409

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

3,282

공시일	2018-01-18
기준일	2018-01-17

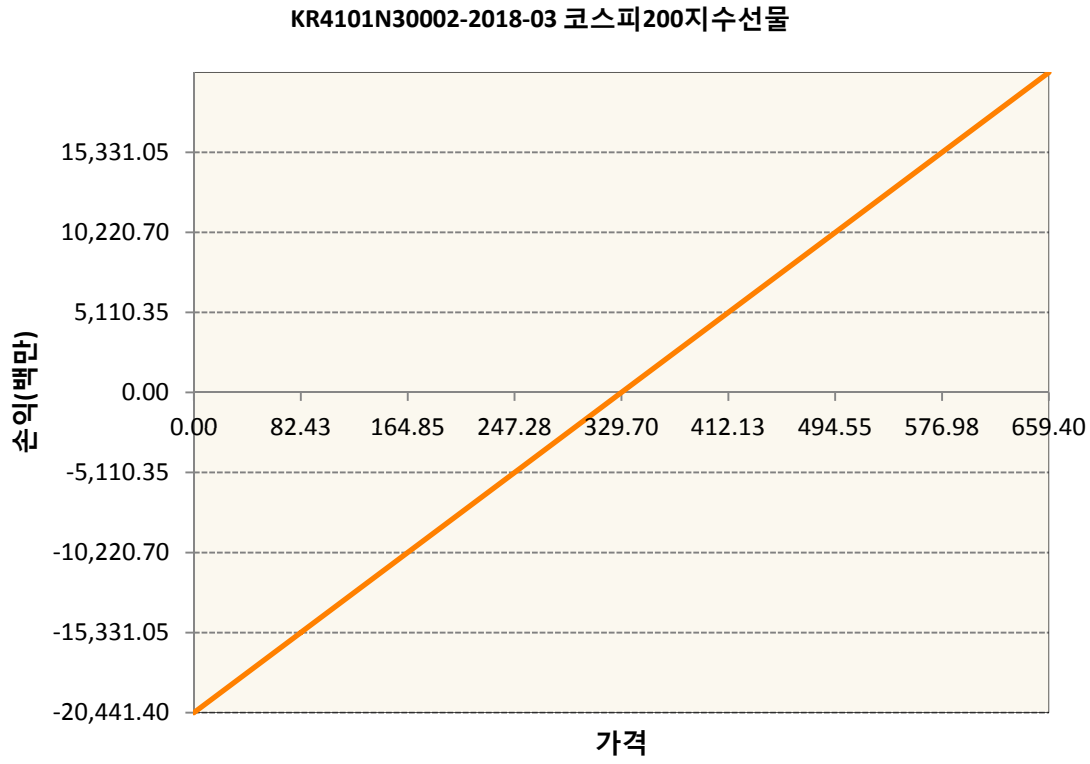
ETF스마트레버리지목표전환형8호

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	20,441	0	20,441	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101N30(2018-03 코스피200지수선물							1,633
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,633	-1,633	-1,633	-1,633	-1,633	-1,633	-1,633
-5.33%	-1,089	-1,089	-1,089	-1,089	-1,089	-1,089	-1,089
-2.67%	-544	-544	-544	-544	-544	-544	-544
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	544	544	544	544	544	544	544
5.33%	1,089	1,089	1,089	1,089	1,089	1,089	1,089
8.00%	1,633	1,633	1,633	1,633	1,633	1,633	1,633

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

980

공시일	2018-01-18
기준일	2018-01-17

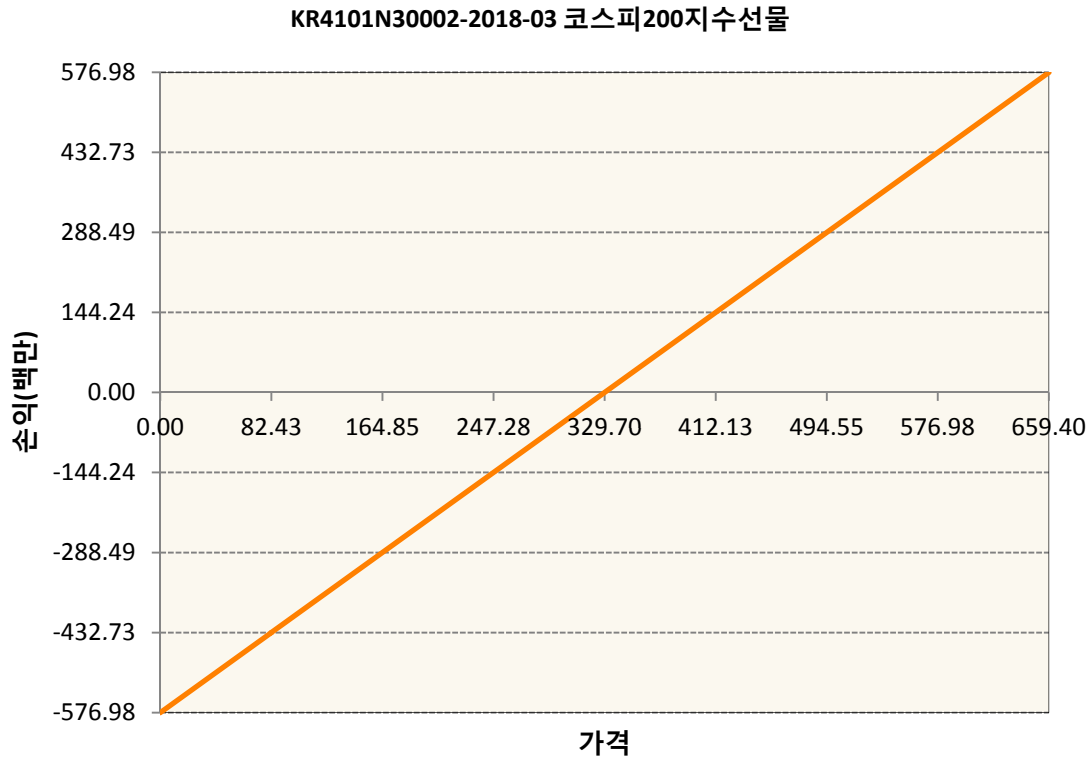
ETF스마트레버리지목표전환형9호

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	577	0	577	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	2018-01-18
기준일	2018-01-17

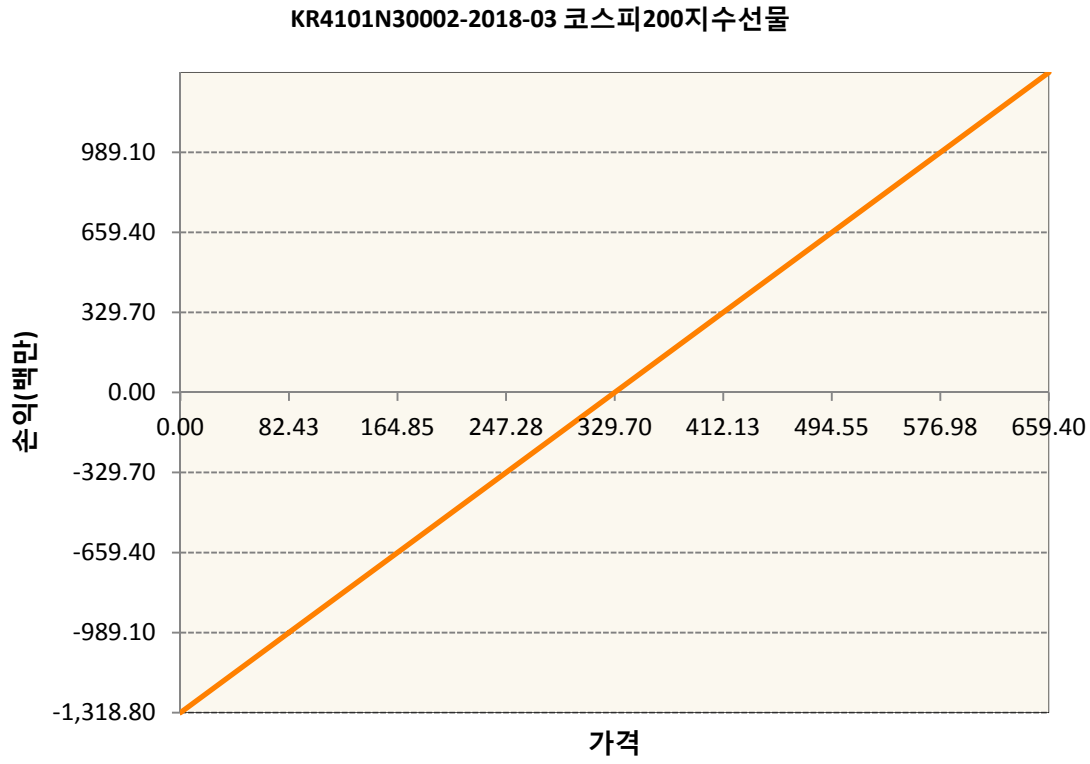
ETF스마트레버리지목표전환형10

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	1,319	0	1,319	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	2018-01-18
기준일	2018-01-17

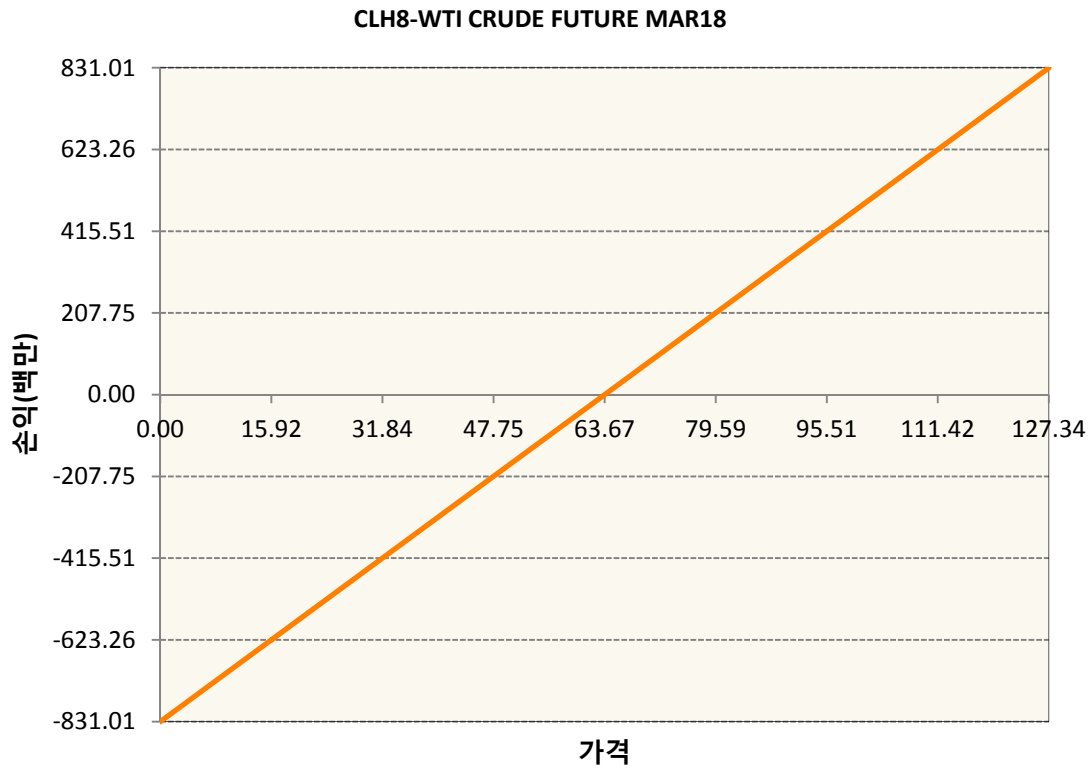
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

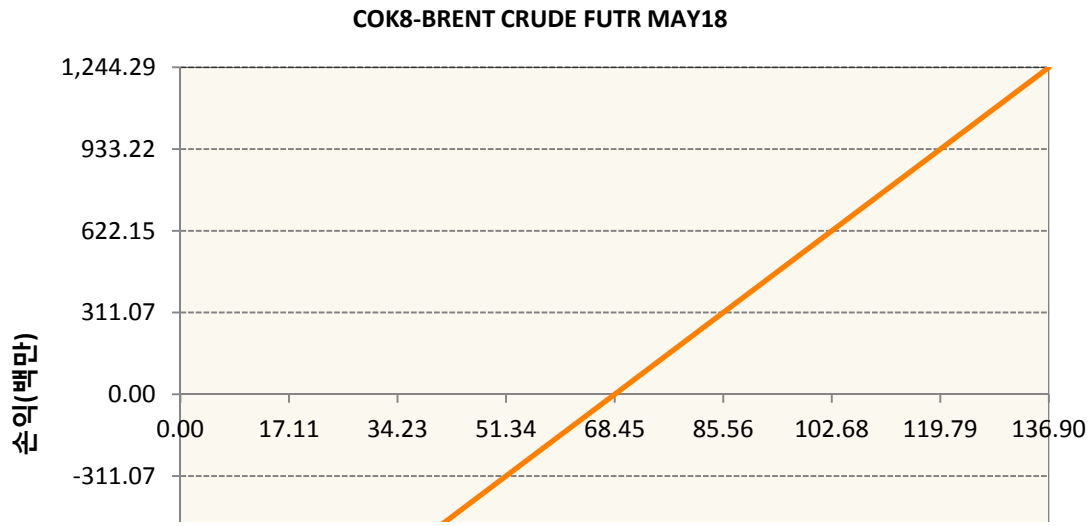
1. 계약금액

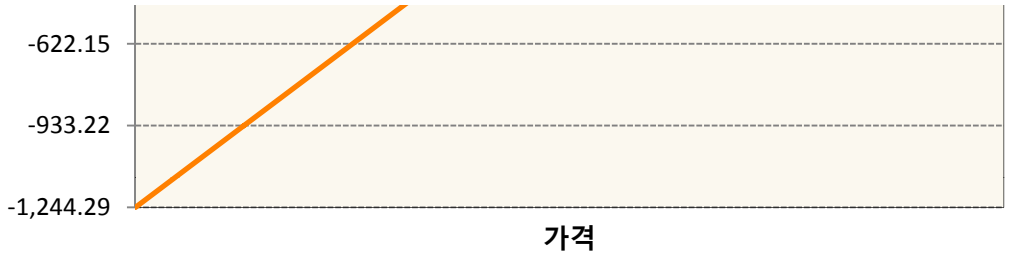
(단위:백만원)

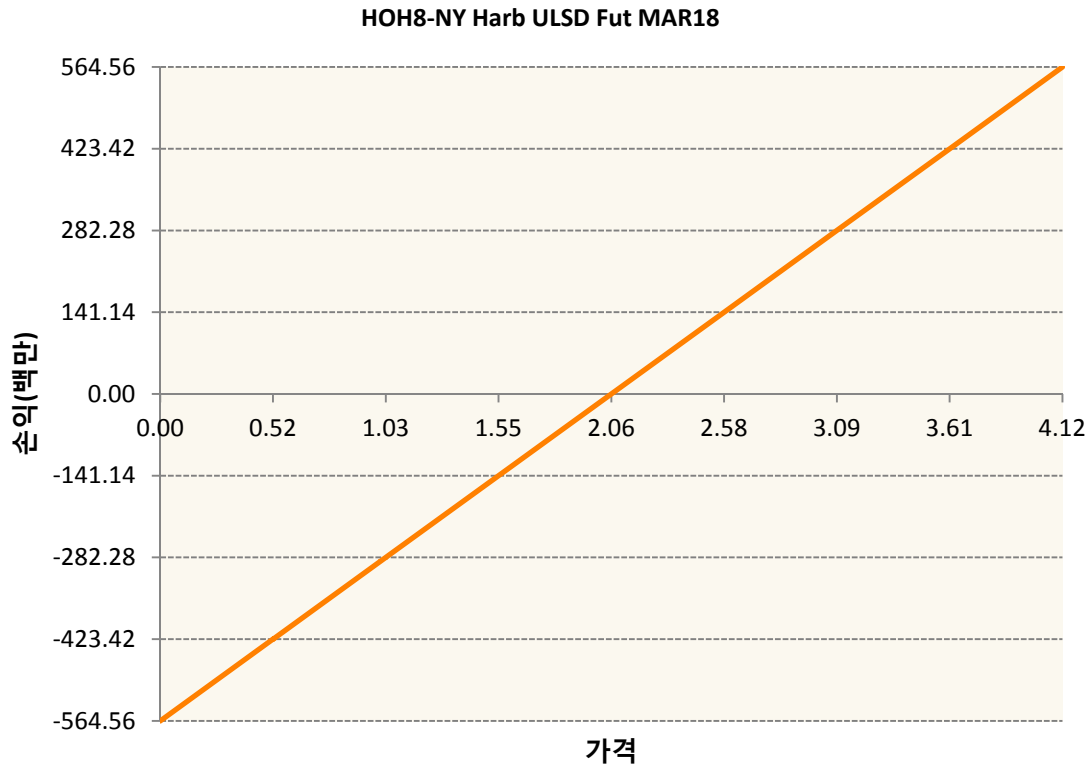
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	4,453	855	3,598	

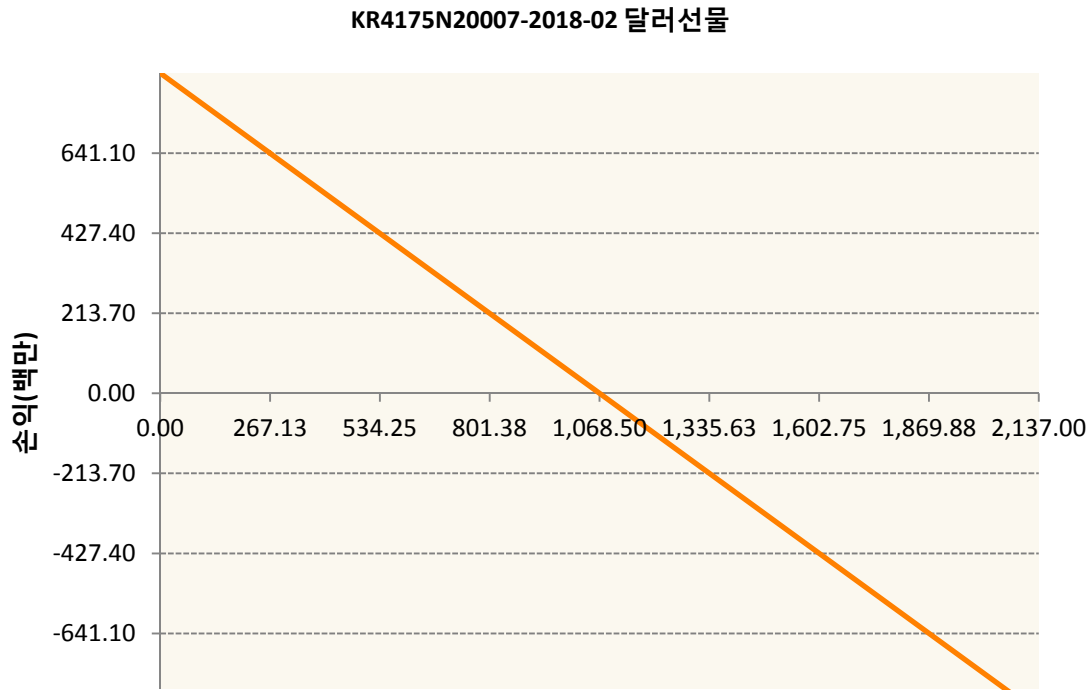
2. 만기시점의 손익구조

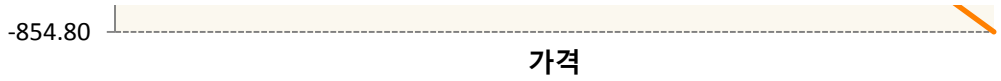


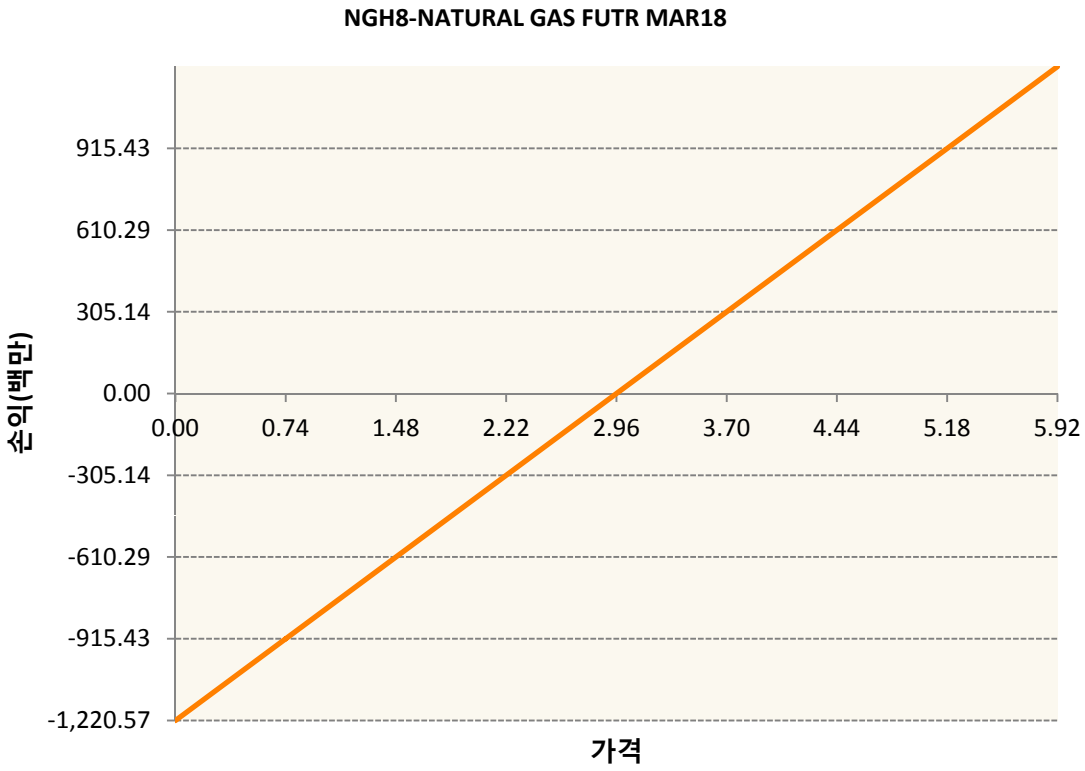


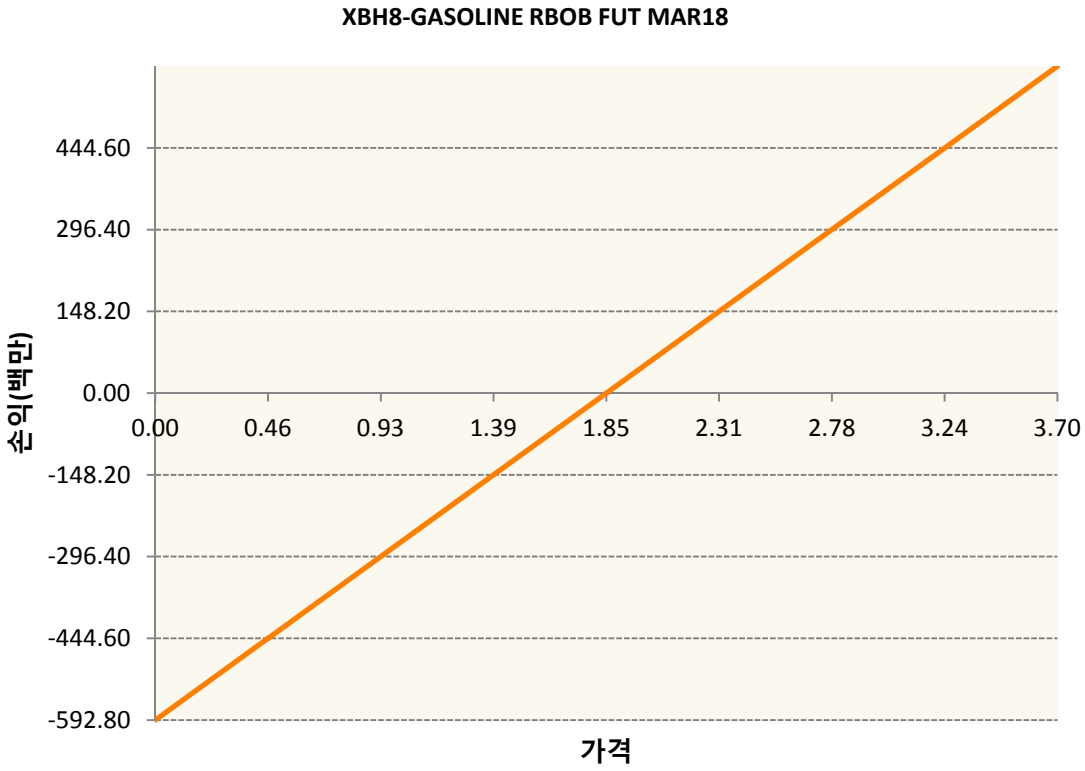

-622.15
-933.22
-1,244.29
가격


HOH8-NY Harb ULSD Fut MAR18
564.56
423.42
282.28
141.14
0.00
-141.14
-282.28
-423.42
-564.56
0.00
0.52
1.03
1.55
2.06
2.58
3.09
3.61
4.12
손익(백만)
가격


KR4175N20007-2018-02 달러선물
641.10
427.40
213.70
0.00
-213.70
-427.40
-641.10
0.00
267.13
534.25
801.38
1,068.50
1,335.63
1,602.75
1,869.88
2,137.00
손익(백만)


-854.80
가격


NGH8-NATURAL GAS FUTR MAR18
915.43
610.29
305.14
0.00
-305.14
-610.29
-915.43
-1,220.57
0.00
0.74
1.48
2.22
2.96
3.70
4.44
5.18
5.92
손익(백만)
가격


XBH8-GASOLINE RBOB FUT MAR18
444.60
296.40
148.20
0.00
-148.20
-296.40
-444.60
-592.80
0.00
0.46
0.93
1.39
1.85
2.31
2.78
3.24
3.70
손익(백만)
가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLH8	WTI CRUDE FUTURE MAR18	66
COK8	BRENT CRUDE FUTR MAY18	100
HOH8	NY Harb ULSD Fut MAR18	45
KR4175N20(	2018-02 달러선물	68
NGH8	NATURAL GAS FUTR MAR18	98
XBH8	GASOLINE RBOB FUT MAR18	47

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

603

공시일	2018-01-18
기준일	2018-01-17

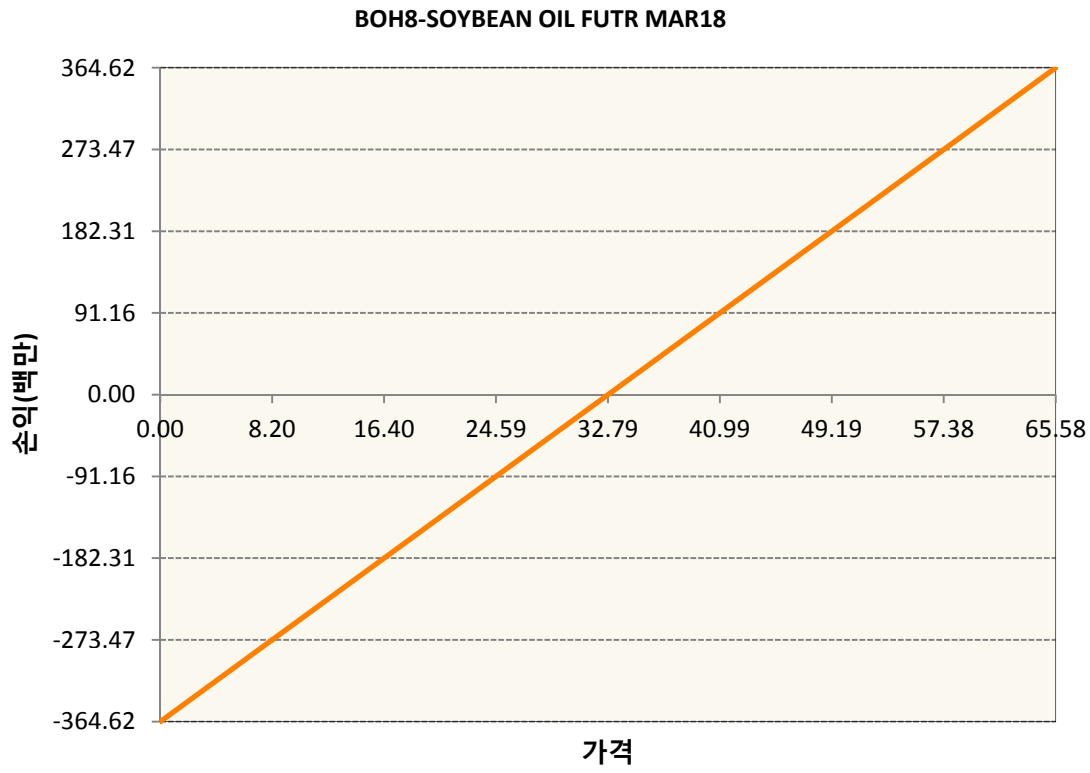
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

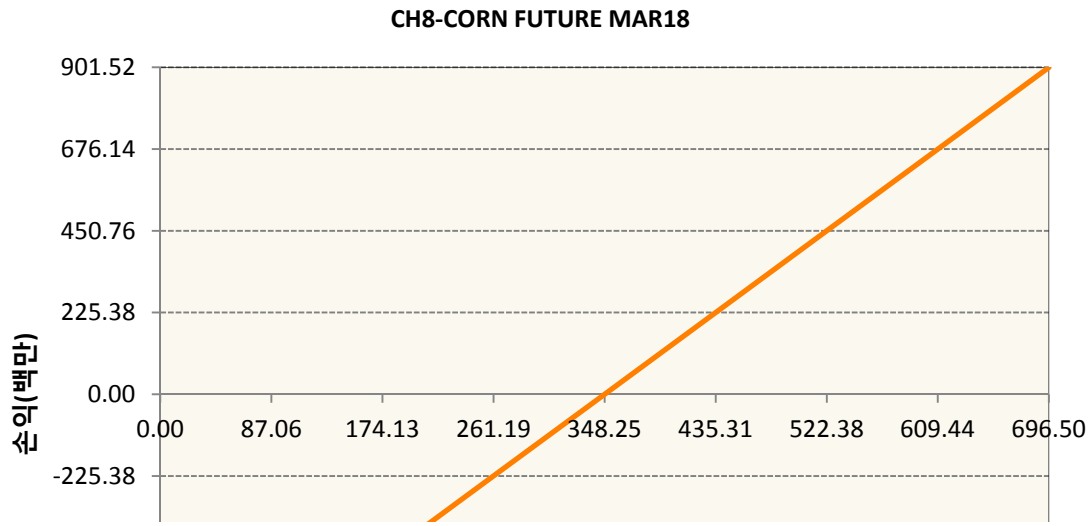
1. 계약금액

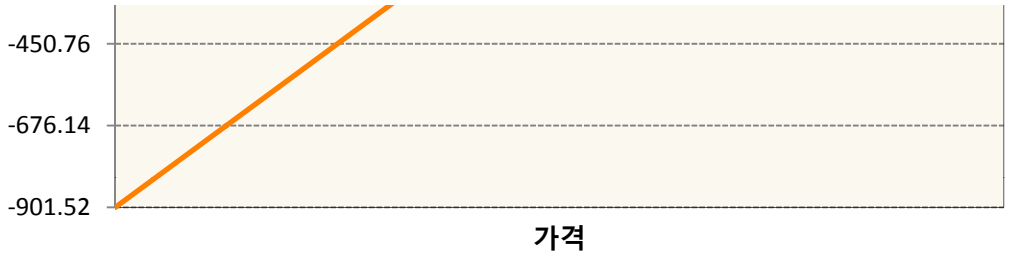
(단위:백만원)

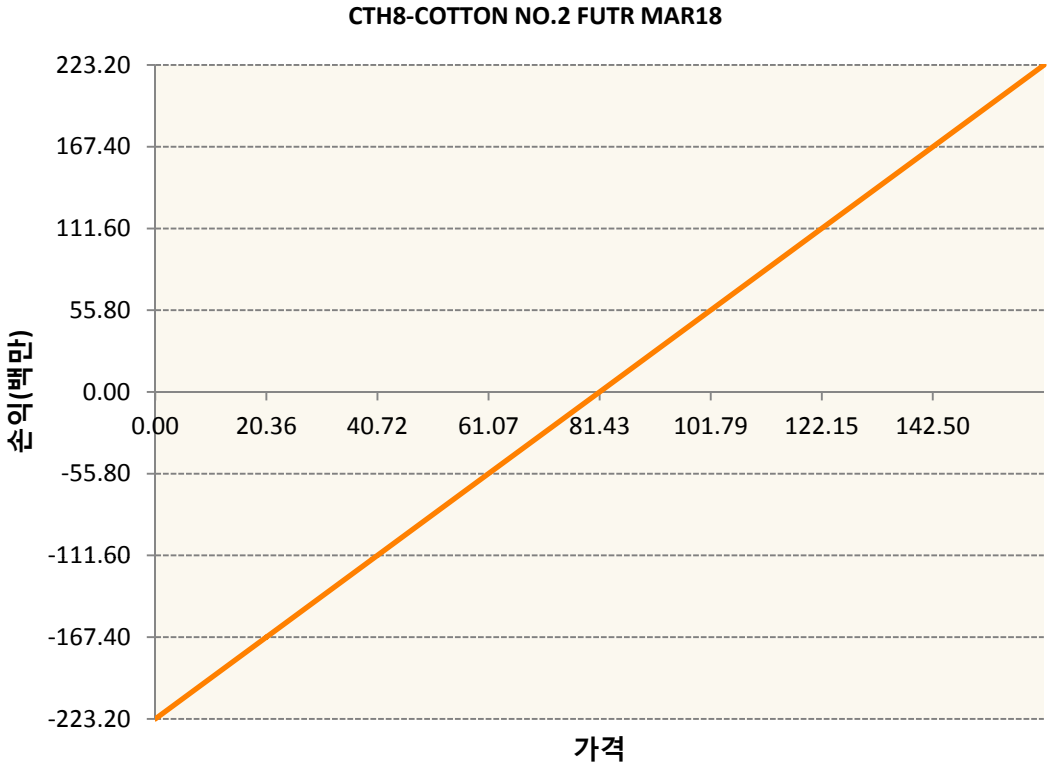
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	4,037	321	3,717	

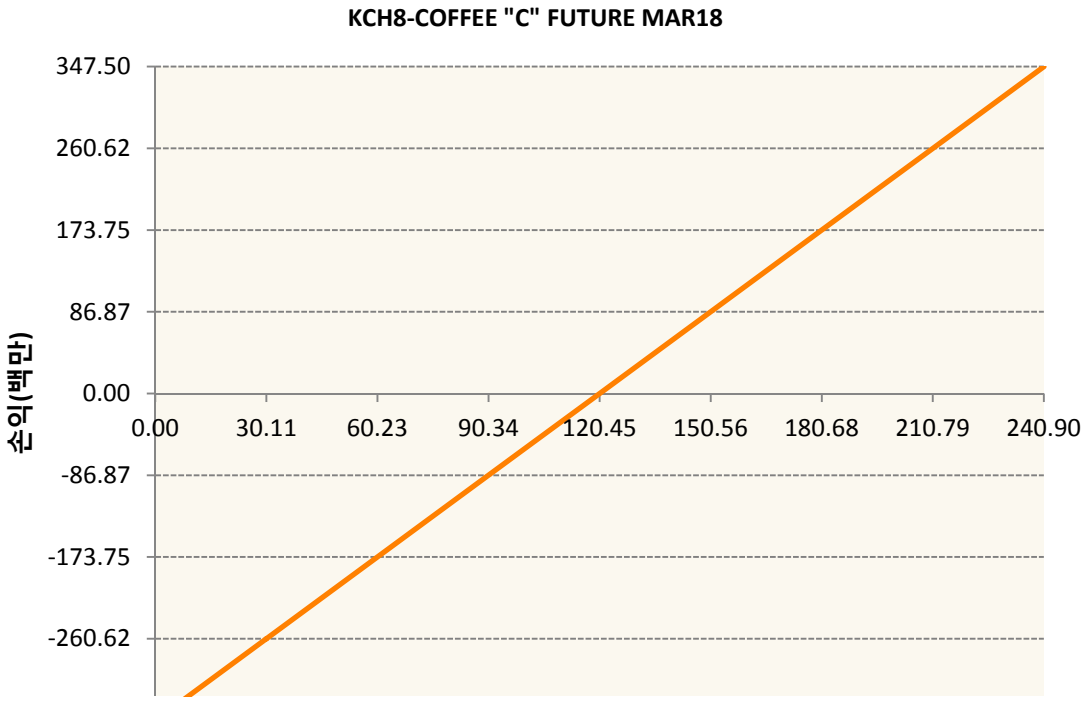
2. 만기시점의 손익구조

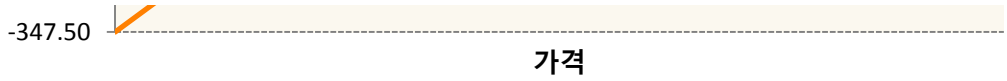


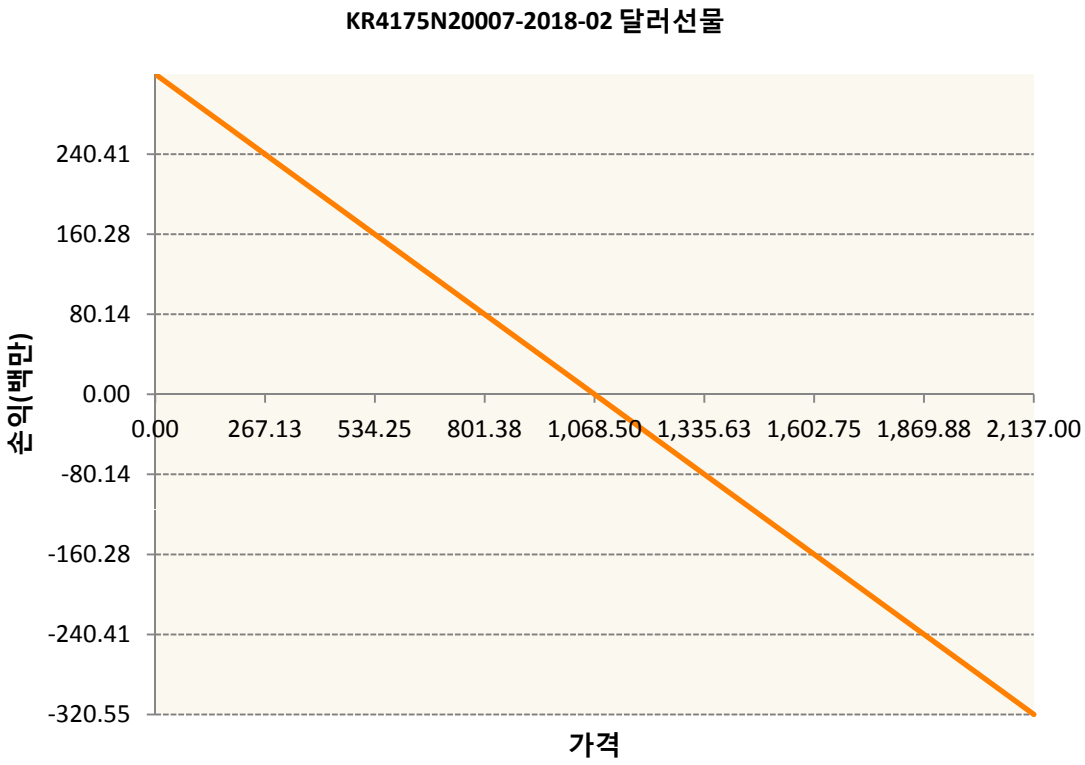


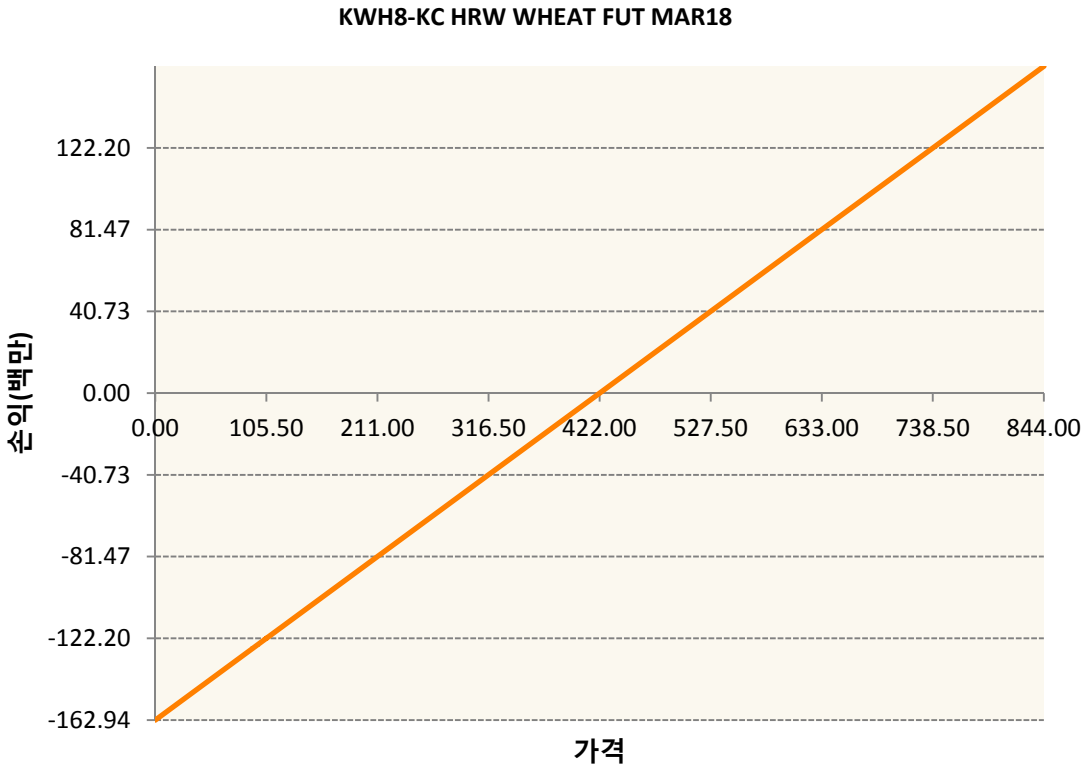

-450.76
-676.14
-901.52
가격


CTH8-COTTON NO.2 FUTR MAR18
223.20
167.40
111.60
55.80
0.00
-55.80
-111.60
-167.40
-223.20
0.00
20.36
40.72
61.07
81.43
101.79
122.15
142.50
손익(백만)
가격

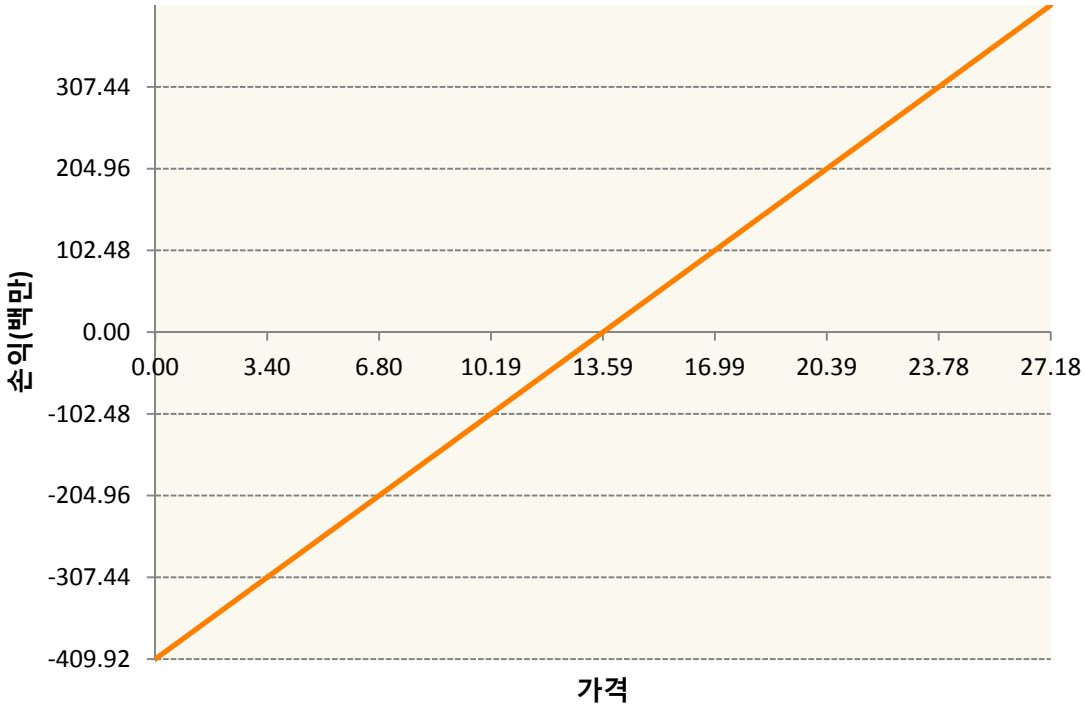

KCH8-COFFEE "C" FUTURE MAR18
347.50
260.62
173.75
86.87
0.00
-86.87
-173.75
-260.62
0.00
30.11
60.23
90.34
120.45
150.56
180.68
210.79
240.90
손익(백만)


-347.50
가격

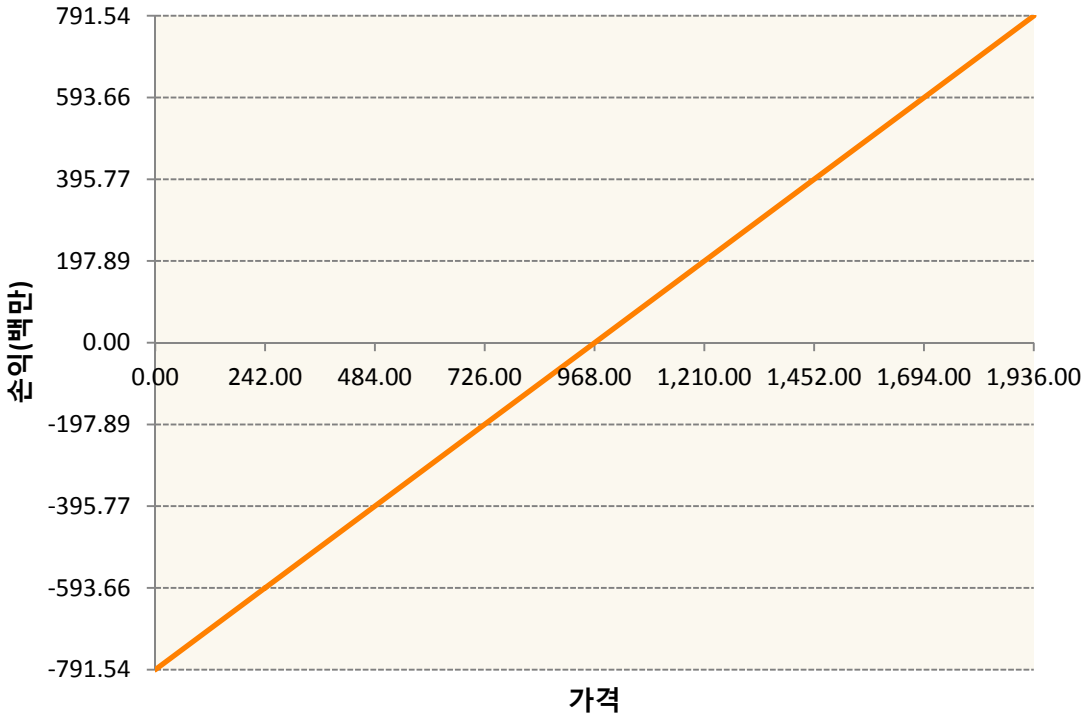

KR4175N20007-2018-02 달러선물
240.41
160.28
80.14
0.00
-80.14
-160.28
-240.41
-320.55
0.00
267.13
534.25
801.38
1,068.50
1,335.63
1,602.75
1,869.88
2,137.00
손익(백만)
가격


KWH8-KC HRW WHEAT FUT MAR18
122.20
81.47
40.73
0.00
-40.73
-81.47
-122.20
-162.94
0.00
105.50
211.00
316.50
422.00
527.50
633.00
738.50
844.00
손익(백만)
가격

SBH8-Sugar #11 (WORLD) MAR18

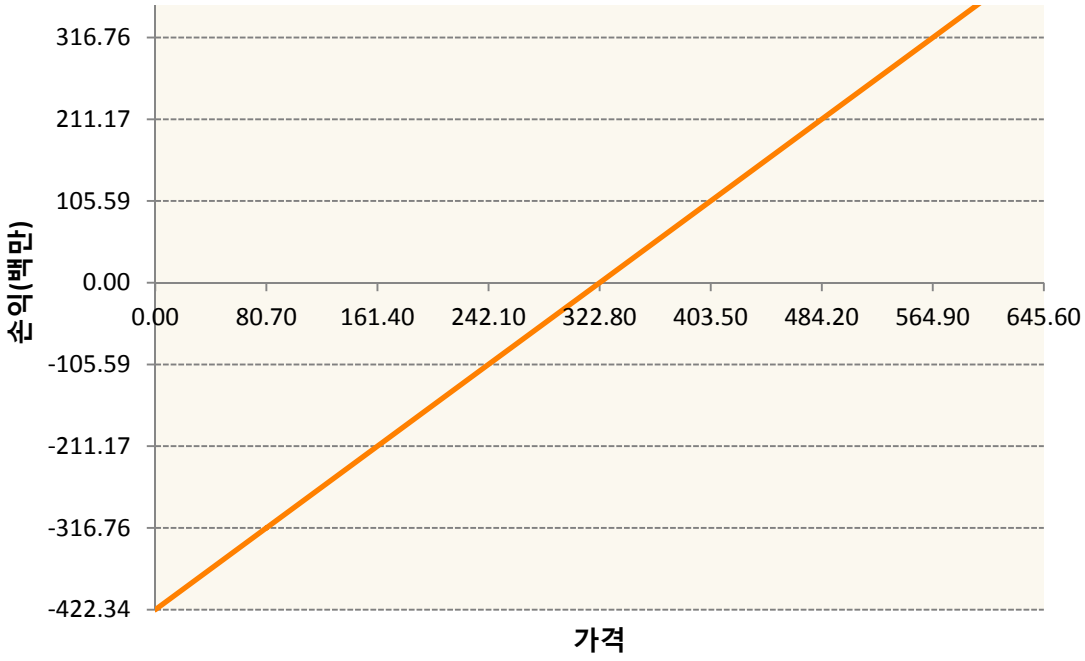


SH8-SOYBEAN FUTURE MAR18

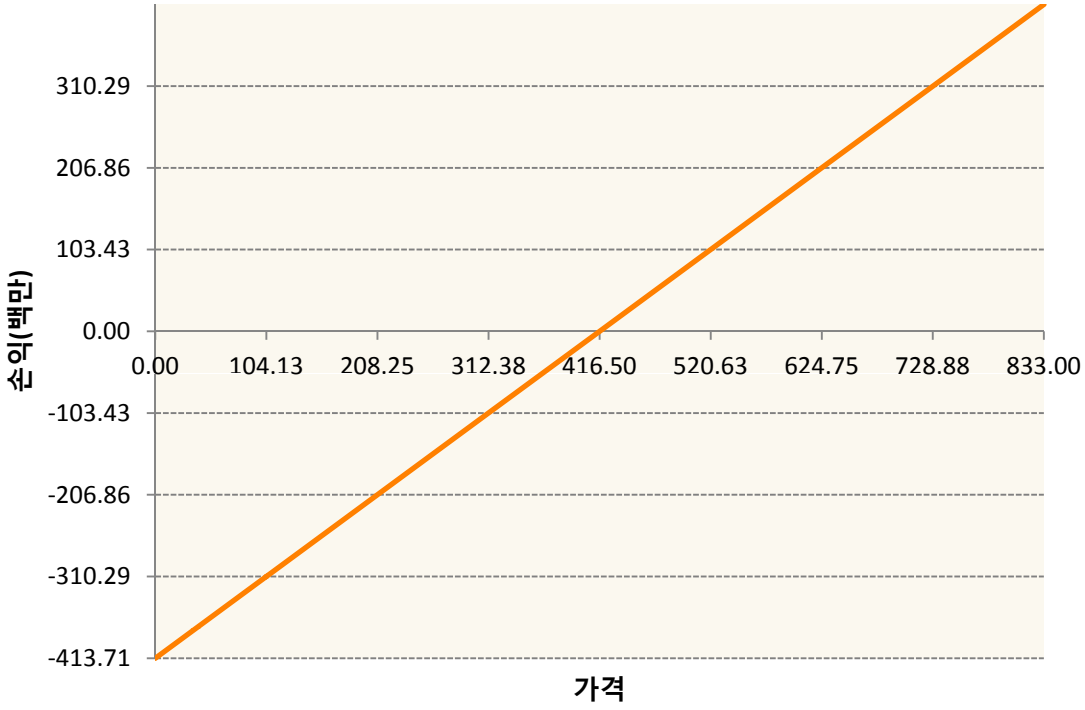


SMH8-SOYBEAN MEAL FUTR MAR18





WH8-WHEAT FUTURE(CBT) MAR18



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
BOH8	SOYBEAN OIL FUTR MAR18	29
CH8	CORN FUTURE MAR18	72
CTH8	COTTON NO.2 FUTR MAR18	18
KCH8	COFFEE "C" FUTURE MAR18	28
KR4175N20(	2018-02 달러선물	26

KWH8	KC HRW WHEAT FUT MAR18	13
SBH8	Sugar #11 (WORLD) MAR18	33
SH8	SOYBEAN FUTURE MAR18	63
SMH8	SOYBEAN MEAL FUTR MAR18	34
WH8	WHEAT FUTURE(CBT) MAR18	33

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

339