공시일	2018-01-30
기준일	2018-01-29

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	2018-01-30
기준일	2018-01-29

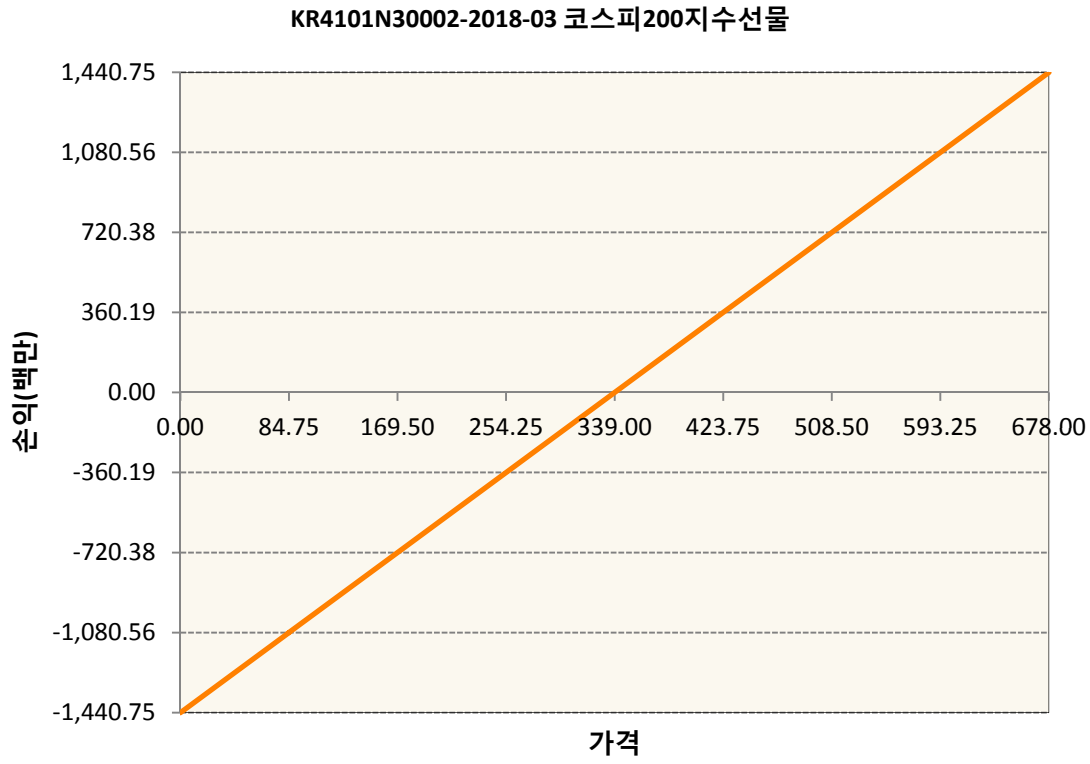
스마트인덱스모

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	1,441	0	1,441	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101N30(2018-03 코스피200지수선물							115
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-115	-115	-115	-115	-115	-115	-115
-5.33%	-77	-77	-77	-77	-77	-77	-77
-2.67%	-38	-38	-38	-38	-38	-38	-38
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	38	38	38	38	38	38	38
5.33%	77	77	77	77	77	77	77
8.00%	115	115	115	115	115	115	115

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

69

공시일	2018-01-30
기준일	2018-01-29

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	1,175

* 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	2018-01-30
기준일	2018-01-29

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	421

* 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	2018-01-30
기준일	2018-01-29

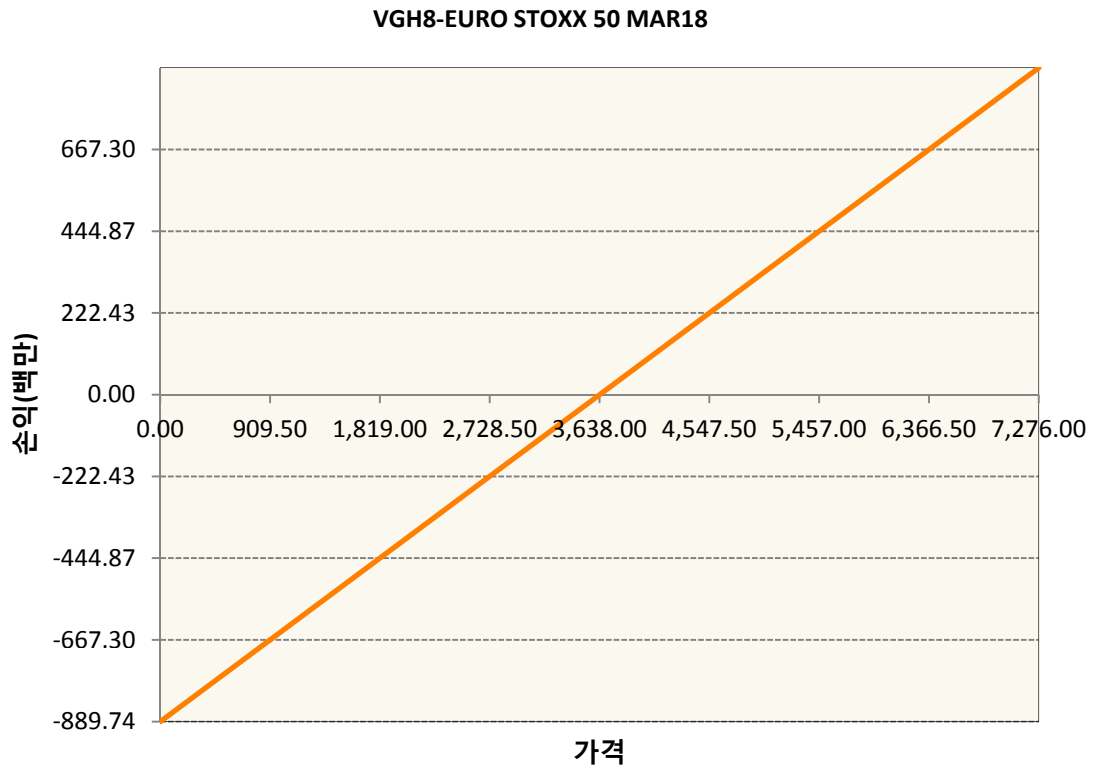
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	890	0	890	

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	2018-01-30
기준일	2018-01-29

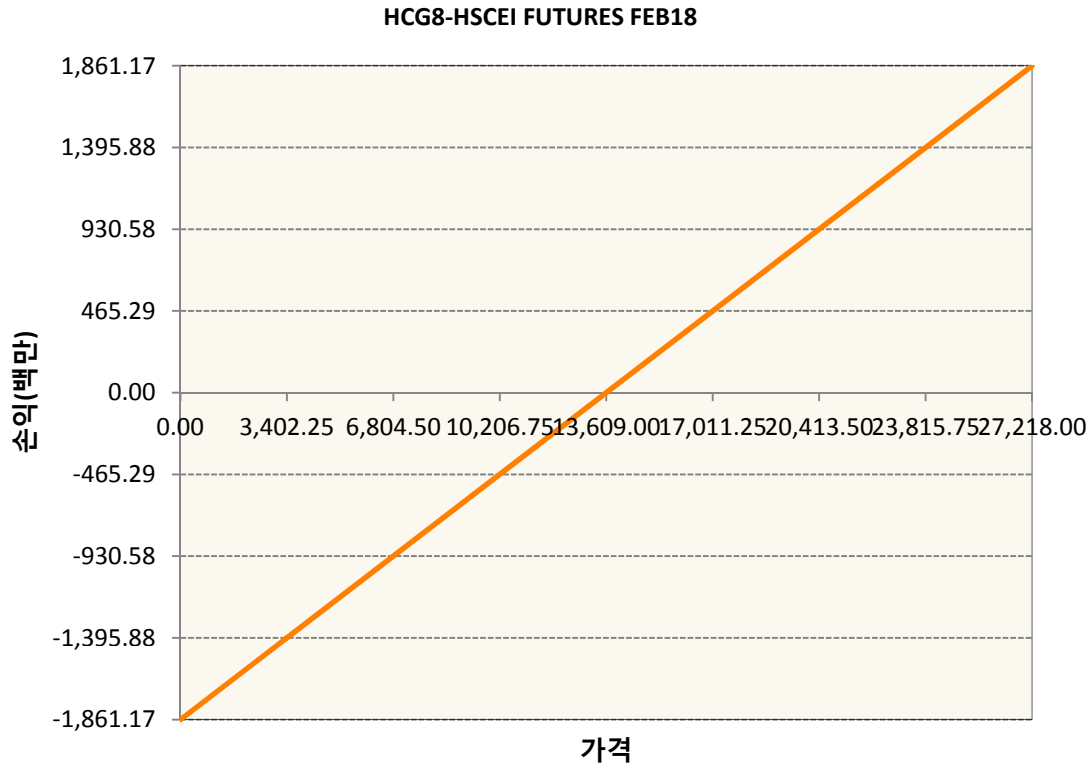
차이나인덱스모(주식-파생형)

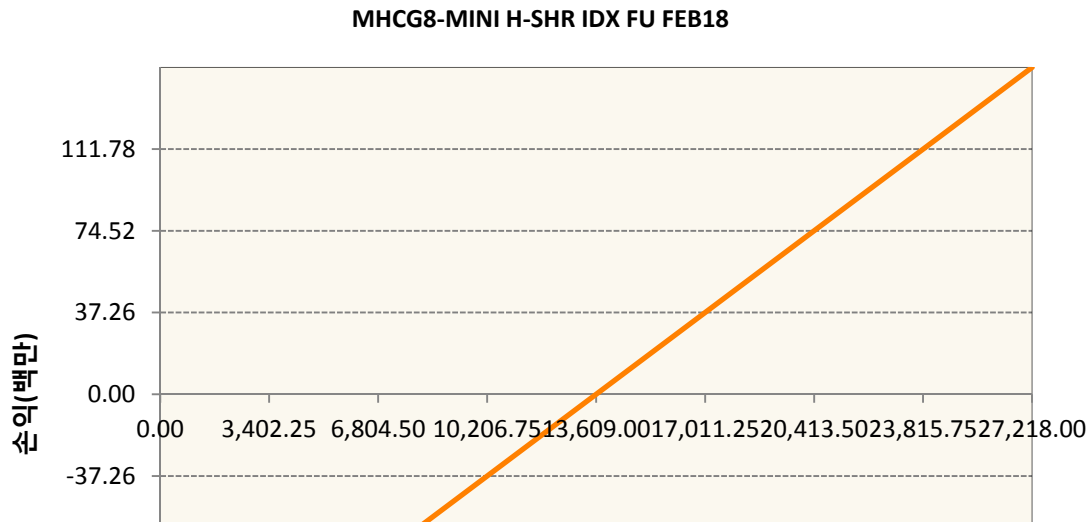
1. 계약금액

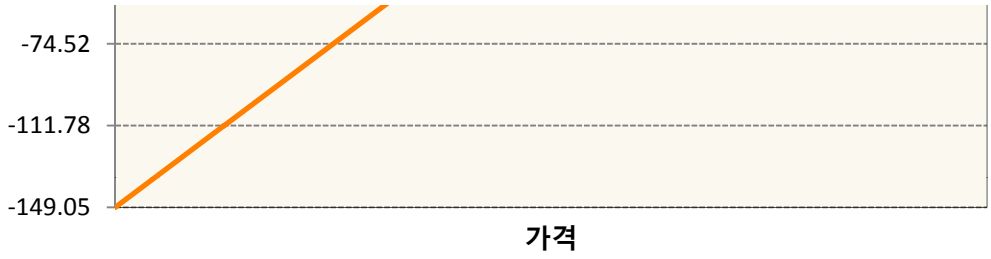
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,010	0	2,010	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCG8	HSCEI FUTURES FEB18	149
MHCG8	MINI H-SHR IDX FU FEB18	12

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	130

공시일	2018-01-30
기준일	2018-01-29

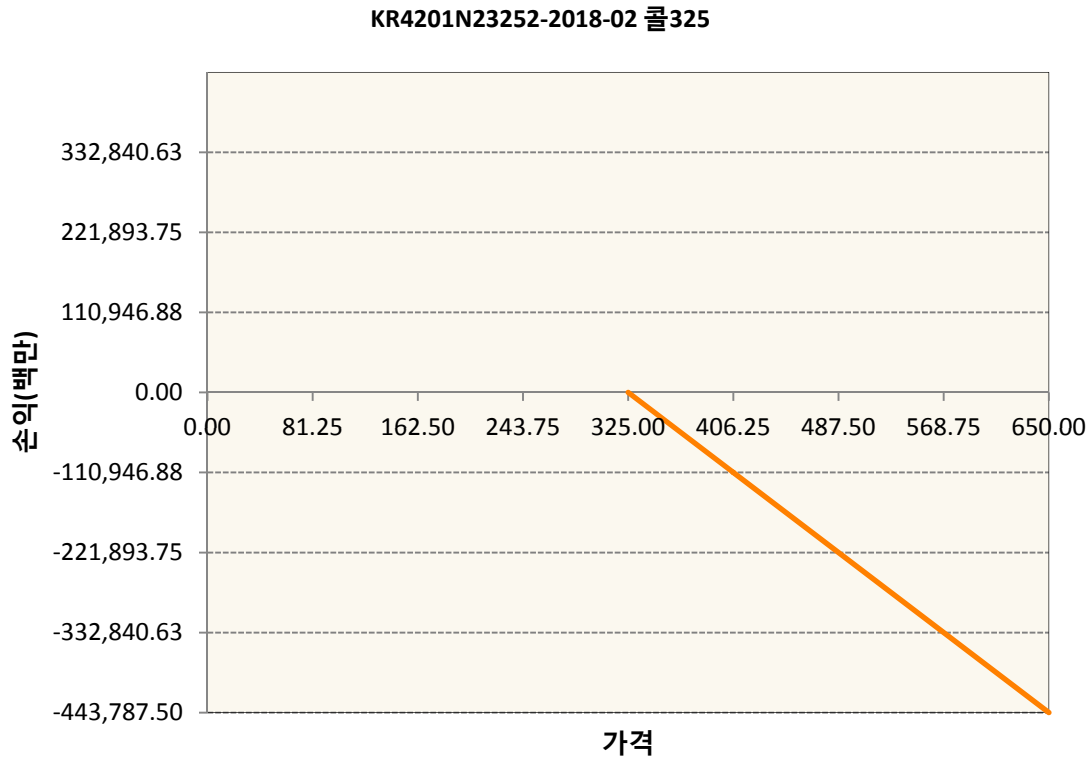
커버드콜모(주식혼합-파생형)

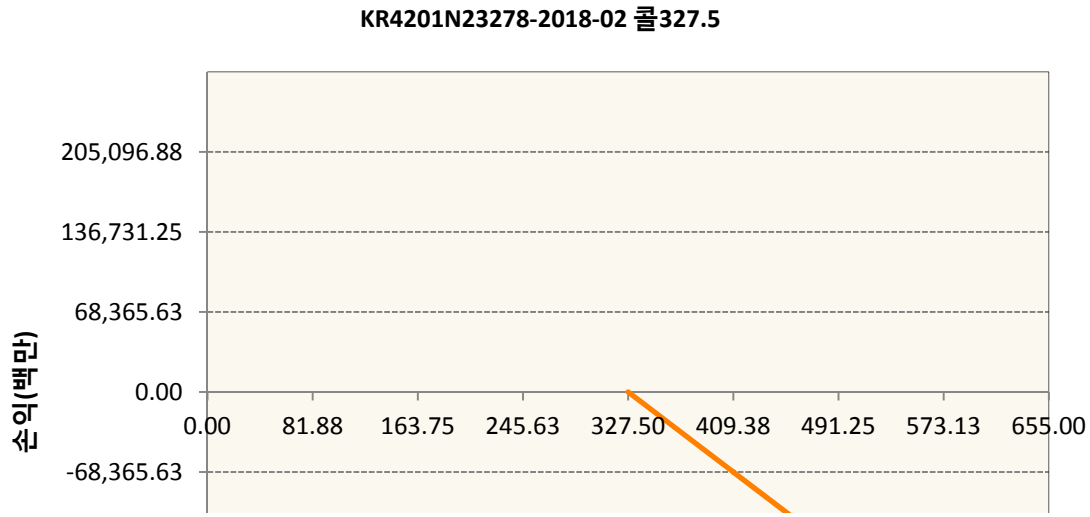
1. 계약금액

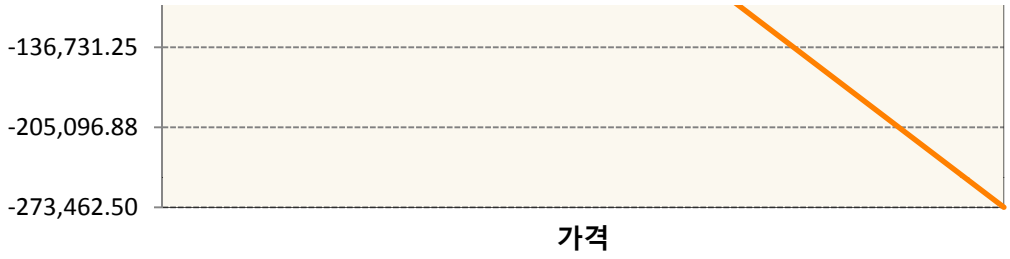
(단위:백만원)

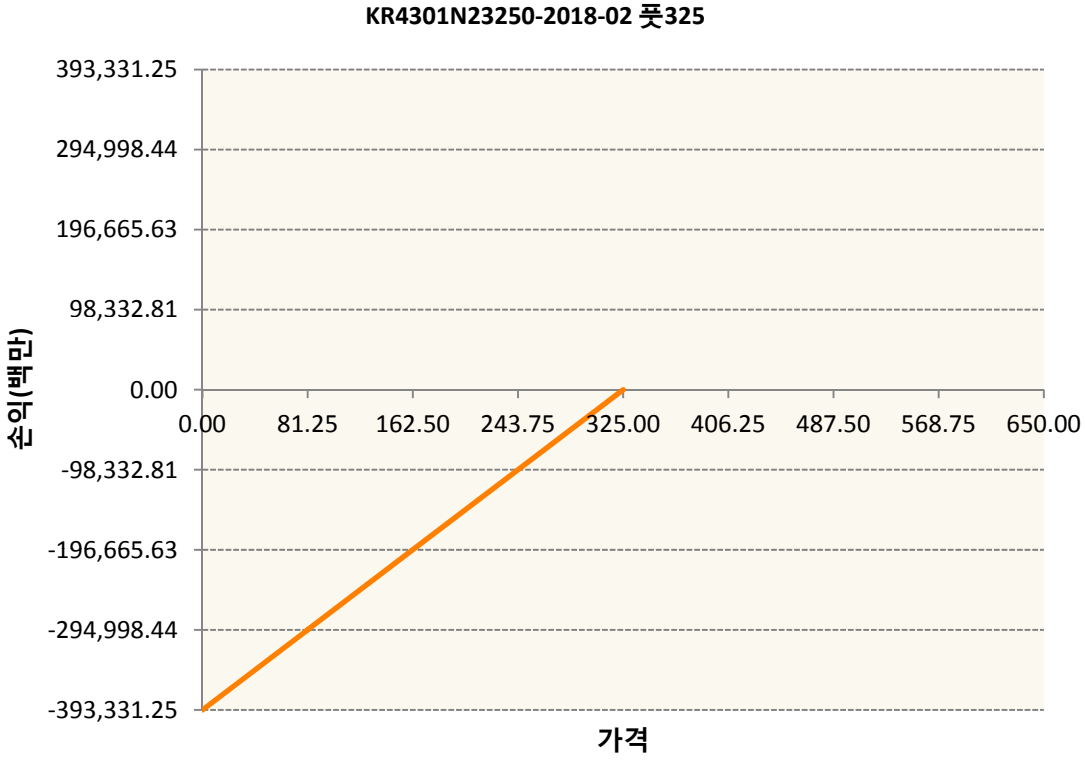
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	23,414	0	23,414	장내
누계	유가증권	옵션	0	1,234,868	-1,234,868	장내

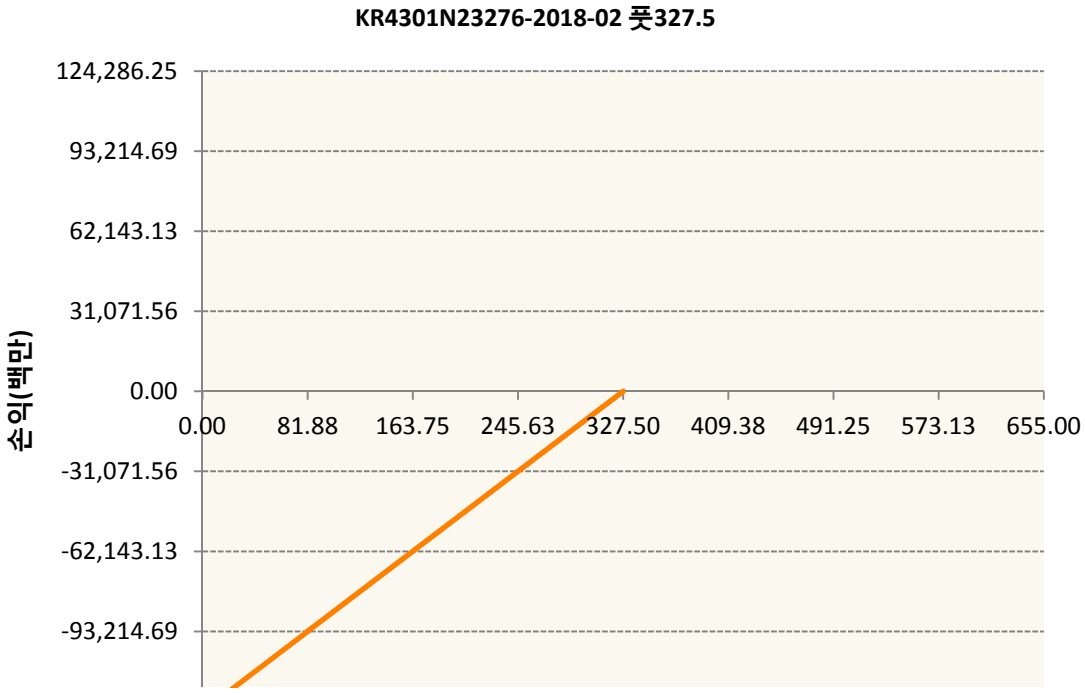
2. 만기시점의 손익구조






-136,731.25
-205,096.88
-273,462.50
가격


KR4301N23250-2018-02 풋325
393,331.25
294,998.44
196,665.63
98,332.81
0.00
-98,332.81
-196,665.63
-294,998.44
-393,331.25
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
124,286.25
93,214.69
62,143.13
31,071.56
0.00
-31,071.56
-62,143.13
-93,214.69
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							35,270
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	19,170	18,916	18,618	18,283	17,916	17,522	17,105
-5.33%	16,865	16,312	15,748	15,176	14,598	14,014	13,427
-2.67%	10,825	10,245	9,658	9,065	8,467	7,866	7,261
0%	1,052	742	389	0	-419	-863	-1,329
2.67%	-10,640	-10,729	-10,857	-11,025	-11,230	-11,472	-11,747
5.33%	-22,858	-22,873	-22,902	-22,951	-23,024	-23,123	-23,250
8.00%	-35,157	-35,159	-35,163	-35,173	-35,192	-35,223	-35,270
KR4201N232 2018-02 콜327.5							21,179
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	10,194	10,081	9,942	9,778	9,592	9,386	9,164
-5.33%	9,210	8,913	8,602	8,281	7,952	7,617	7,276
-2.67%	6,216	5,837	5,458	5,079	4,699	4,318	3,938
0%	792	548	283	0	-297	-605	-923
2.67%	-6,135	-6,220	-6,331	-6,469	-6,631	-6,814	-7,017
5.33%	-13,559	-13,576	-13,606	-13,651	-13,714	-13,796	-13,898
8.00%	-21,075	-21,076	-21,082	-21,092	-21,110	-21,139	-21,179
KR4301N232 2018-02 풋325							16,939
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-16,747	-16,755	-16,771	-16,796	-16,831	-16,879	-16,939
-5.33%	-6,378	-6,556	-6,749	-6,953	-7,166	-7,386	-7,613
-2.67%	-651	-857	-1,075	-1,301	-1,534	-1,773	-2,016
0%	83	67	40	0	-54	-122	-204
2.67%	95	95	94	93	90	84	75
5.33%	95	95	95	95	95	95	94
8.00%	95	95	95	95	95	95	95
KR4301N232 2018-02 풋327.5							6,184
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-6,155	-6,156	-6,157	-6,161	-6,166	-6,174	-6,184
-5.33%	-2,797	-2,830	-2,869	-2,914	-2,963	-3,017	-3,074
-2.67%	-439	-522	-606	-690	-774	-859	-944
0%	58	44	25	0	-30	-65	-105
2.67%	73	73	72	71	68	64	58

5.33%	73	73	73	73	73	73	72
8.00%	73	73	73	73	73	73	73

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

74,560

공시일	2018-01-30
기준일	2018-01-29

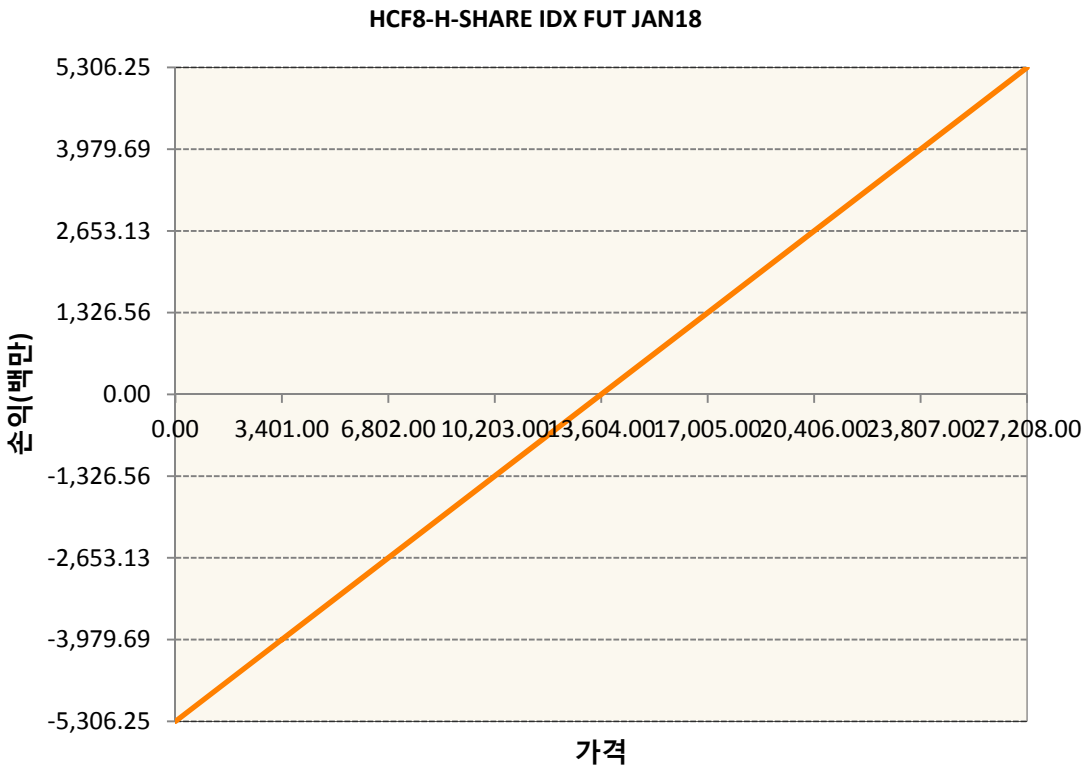
홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생

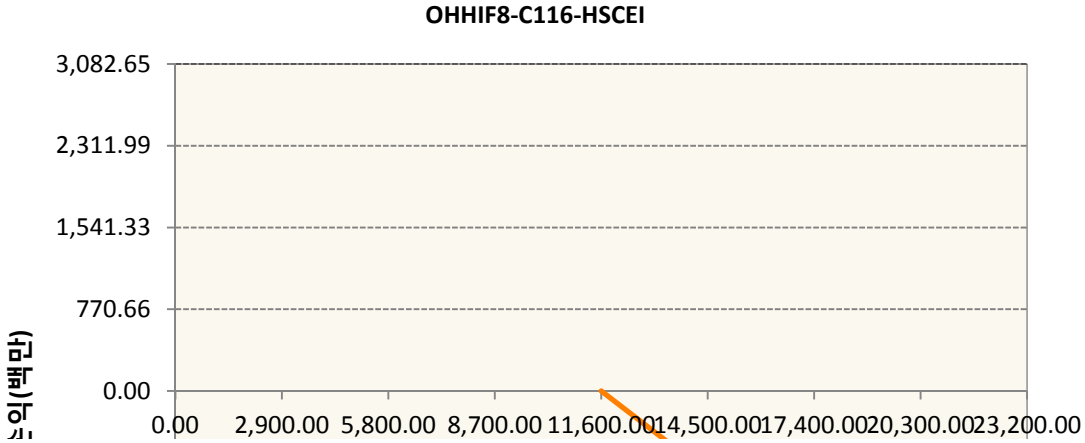
1. 계약금액

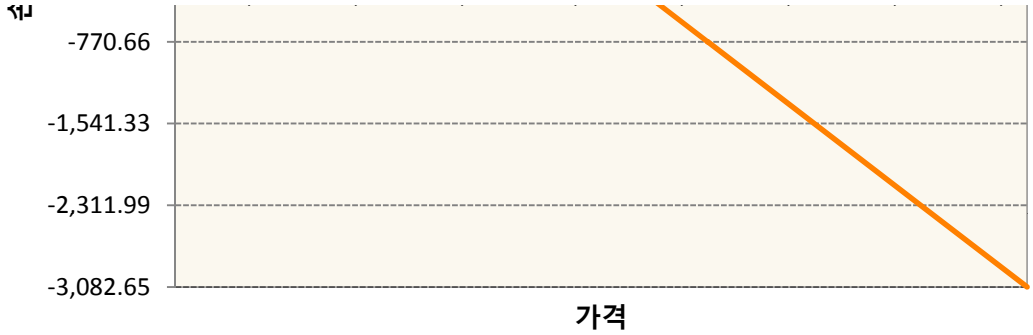
(단위:백만원)

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	5,306	0	5,306	장내
누계	유가증권	옵션	0	10,346	-10,346	장내

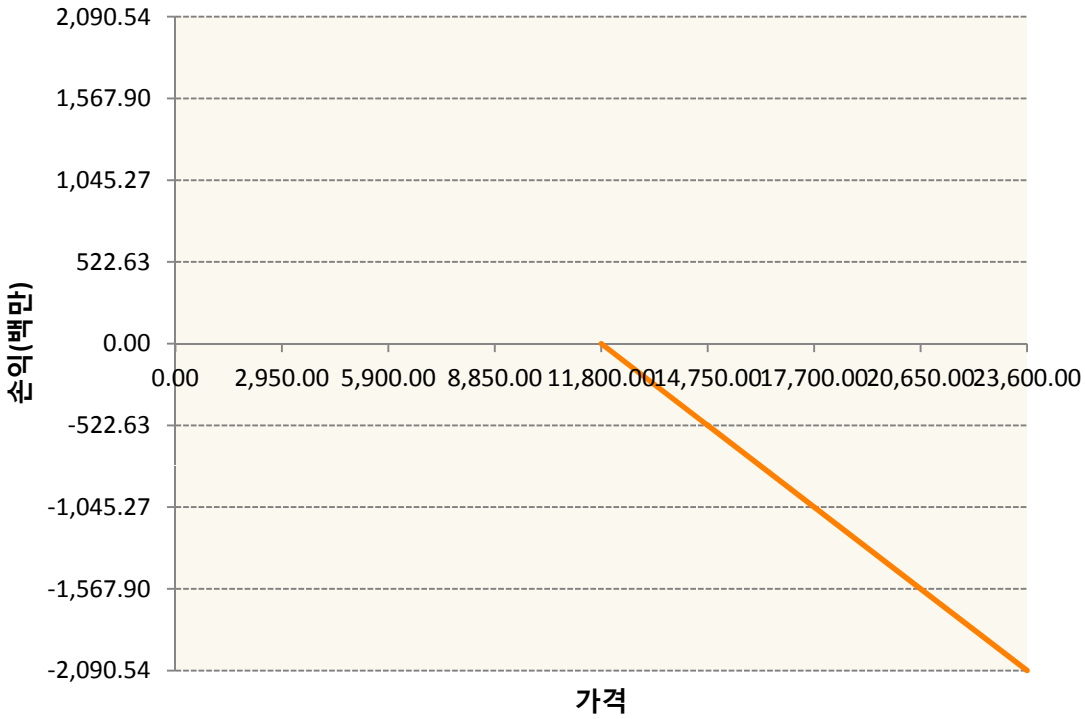
2. 만기시점의 손익구조



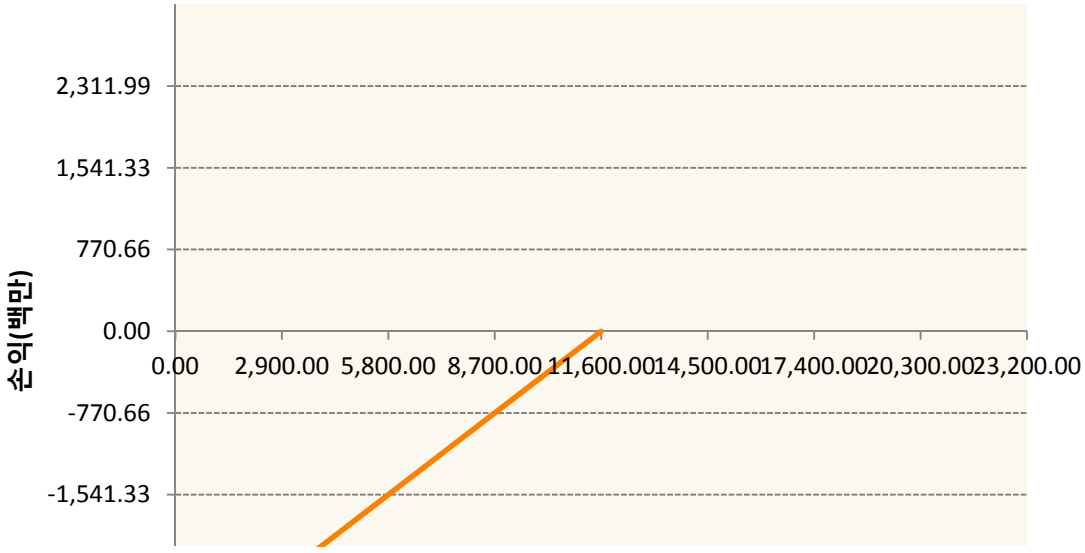


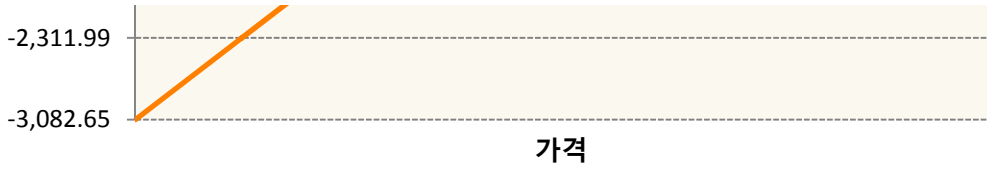


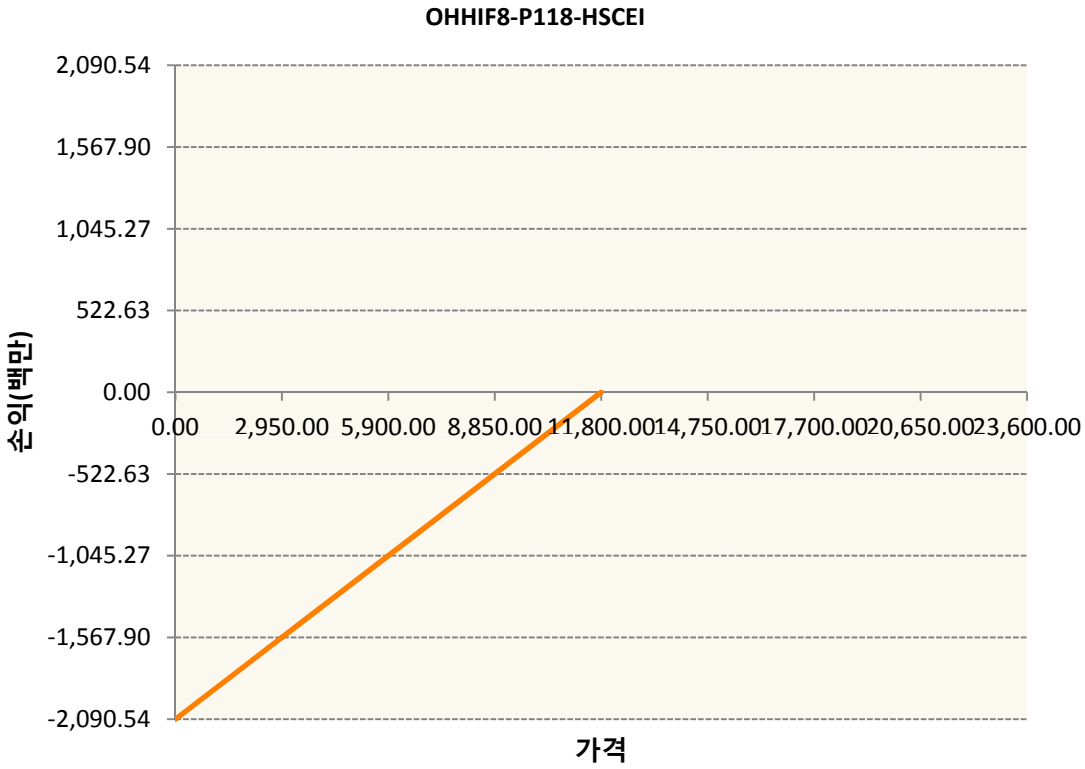
OHHIF8-C118-HSCEI



OHHIF8-P116-HSCEI







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCF8	H-SHARE IDX FUT JAN18	424
OHHIF8-C11	HSCEI	247
OHHIF8-C11	HSCEI	167
OHHIF8-P11	HSCEI	247
OHHIF8-P11	HSCEI	167

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,010

공시일	2018-01-30
기준일	2018-01-29

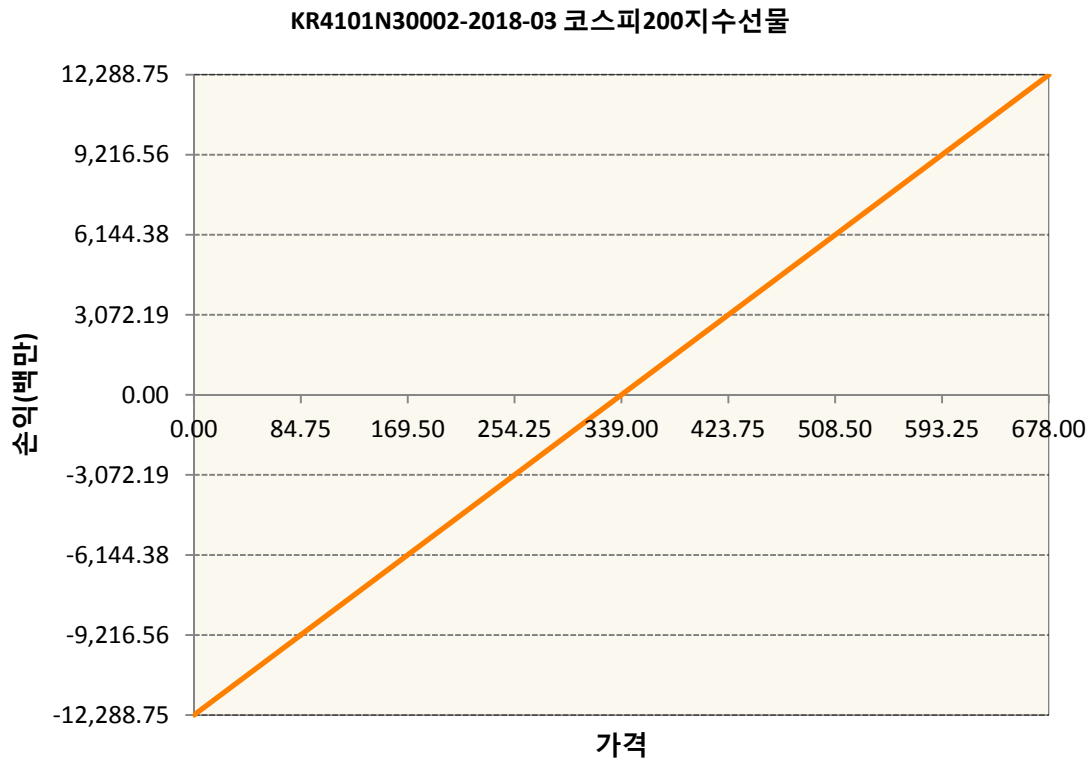
코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼

1. 계약금액

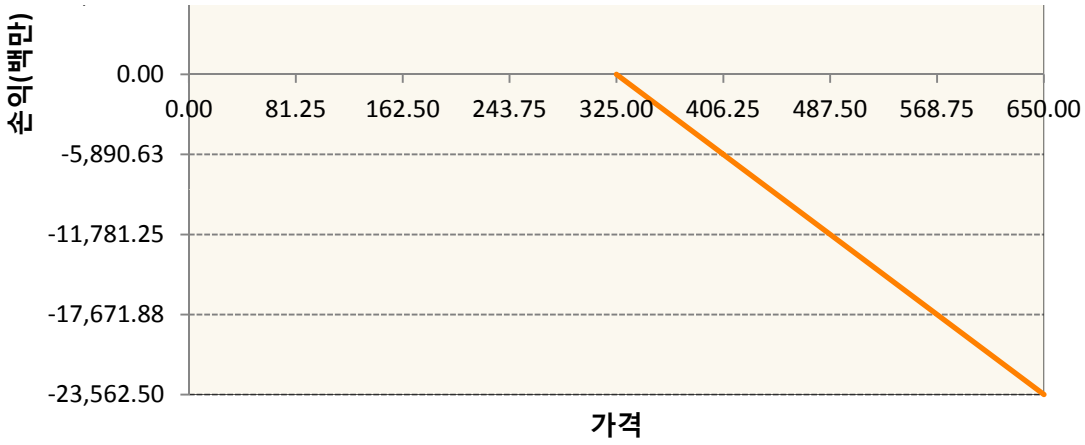
(단위:백만원)

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	12,289	0	12,289	장내
누계	유가증권	스왑	60,200	0	60,200	장외
누계	유가증권	옵션	0	60,250	-60,250	장내

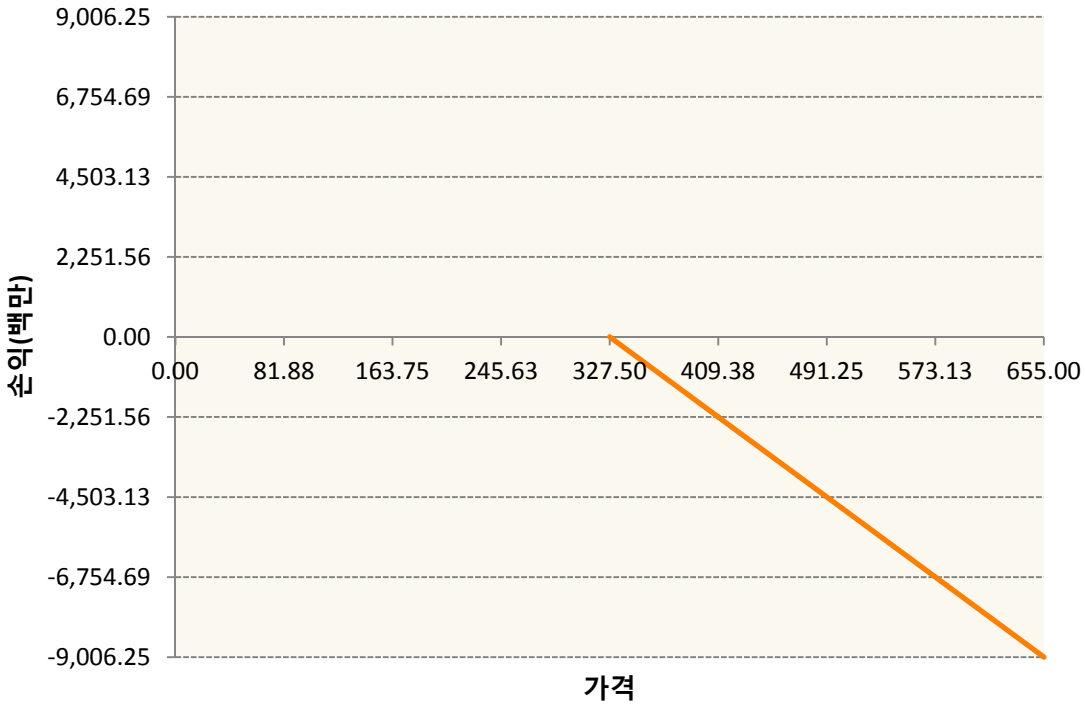
2. 만기시점의 손익구조



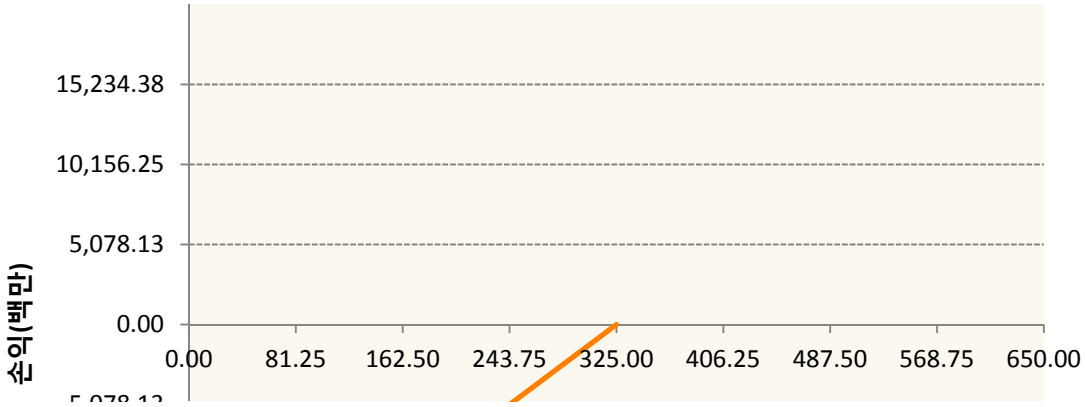




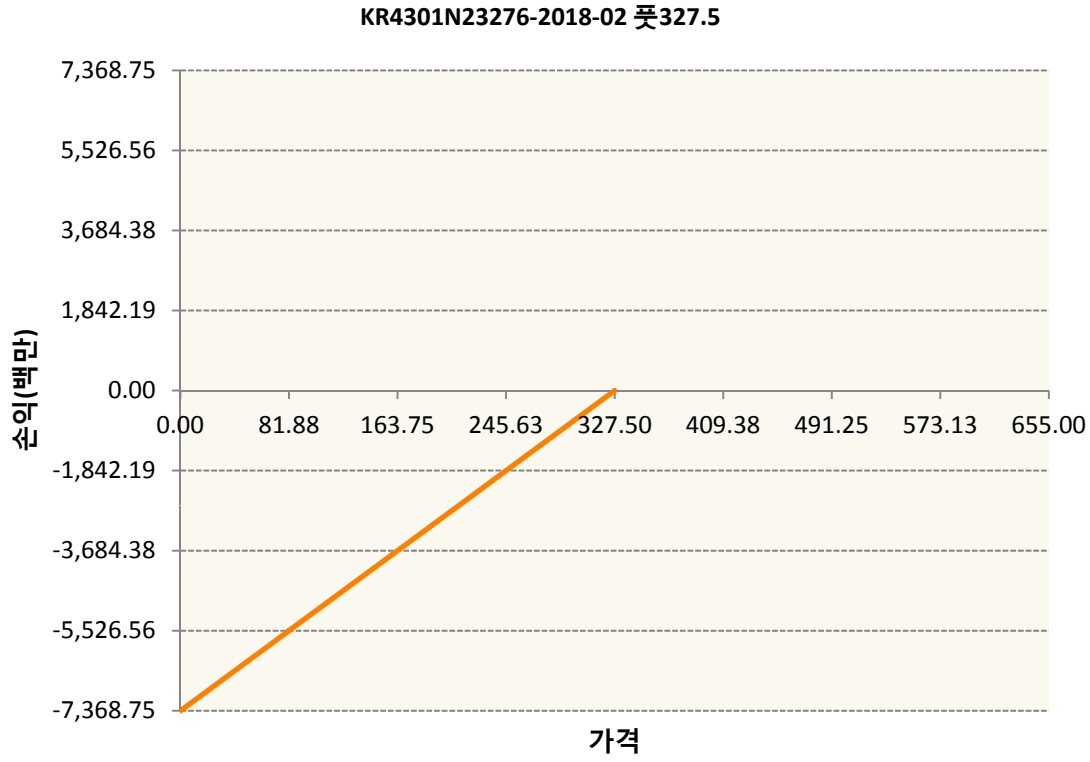
KR4201N23278-2018-02 콜327.5



KR4301N23250-2018-02 풋325







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_2							1,448
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,448	-1,448	-1,448	-1,448	-1,448	-1,448	-1,448
-5.33%	-965	-965	-965	-965	-965	-965	-965
-2.67%	-483	-483	-483	-483	-483	-483	-483
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	483	483	483	483	483	483	483
5.33%	965	965	965	965	965	965	965
8.00%	1,448	1,448	1,448	1,448	1,448	1,448	1,448
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%	-183	-183	-183	-183	-183	-183	-183
-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%	183	183	183	183	183	183	183
8.00%	274	274	274	274	274	274	274
	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%	-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%	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%	-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	196	196	196	196	196	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%	-183	-183	-183	-183	-183	-183	-183
-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%	183	183	183	183	183	183	183
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						470

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-470	-470	-470	-470	-470	-470	-470
-5.33%	-313	-313	-313	-313	-313	-313	-313
-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%	313	313	313	313	313	313	313
8.00%	470	470	470	470	470	470	470
	KR4101N30(	2018-03	코스피200지수선물				980

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-980	-980	-980	-980	-980	-980	-980
-5.33%	-654	-654	-654	-654	-654	-654	-654
-2.67%	-327	-327	-327	-327	-327	-327	-327
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	327	327	327	327	327	327	327
5.33%	654	654	654	654	654	654	654
8.00%	980	980	980	980	980	980	980
	KR4201N232	2018-02	콜325				1,873

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,018	1,004	989	971	951	930	908
-5.33%	895	866	836	806	775	744	713
-2.67%	575	544	513	481	450	418	386
0%	56	39	21	0	-22	-46	-71
2.67%	-565	-570	-576	-585	-596	-609	-624
5.33%	-1,214	-1,214	-1,216	-1,219	-1,222	-1,228	-1,234
8.00%	-1,867	-1,867	-1,867	-1,867	-1,868	-1,870	-1,873
	KR4201N232	2018-02	콜327.5				698

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	336	332	327	322	316	309	302
-5.33%	303	294	283	273	262	251	240
-2.67%	205	192	180	167	155	142	130
0%	26	18	9	0	-10	-20	-30
2.67%	-202	-205	-209	-213	-218	-224	-231
5.33%	-447	-447	-448	-450	-452	-454	-458
8.00%	-694	-694	-694	-695	-695	-696	-698
	KR4301N232	2018-02	풋325				875

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-865	-865	-866	-867	-869	-872	-875
-5.33%	-329	-339	-349	-359	-370	-381	-393

-2.67%	-34	-44	-56	-67	-79	-92	-104
0%	4	3	2	0	-3	-6	-11
2.67%	5	5	5	5	5	4	4
5.33%	5	5	5	5	5	5	5
8.00%	5	5	5	5	5	5	5
	KR4301N232 2018-02 풋327.5						367
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-365	-365	-365	-365	-366	-366	-367
-5.33%	-166	-168	-170	-173	-176	-179	-182
-2.67%	-26	-31	-36	-41	-46	-51	-56
0%	3	3	1	0	-2	-4	-6
2.67%	4	4	4	4	4	4	3
5.33%	4	4	4	4	4	4	4
8.00%	4	4	4	4	4	4	4

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

8,791

공시일	2018-01-30
기준일	2018-01-29

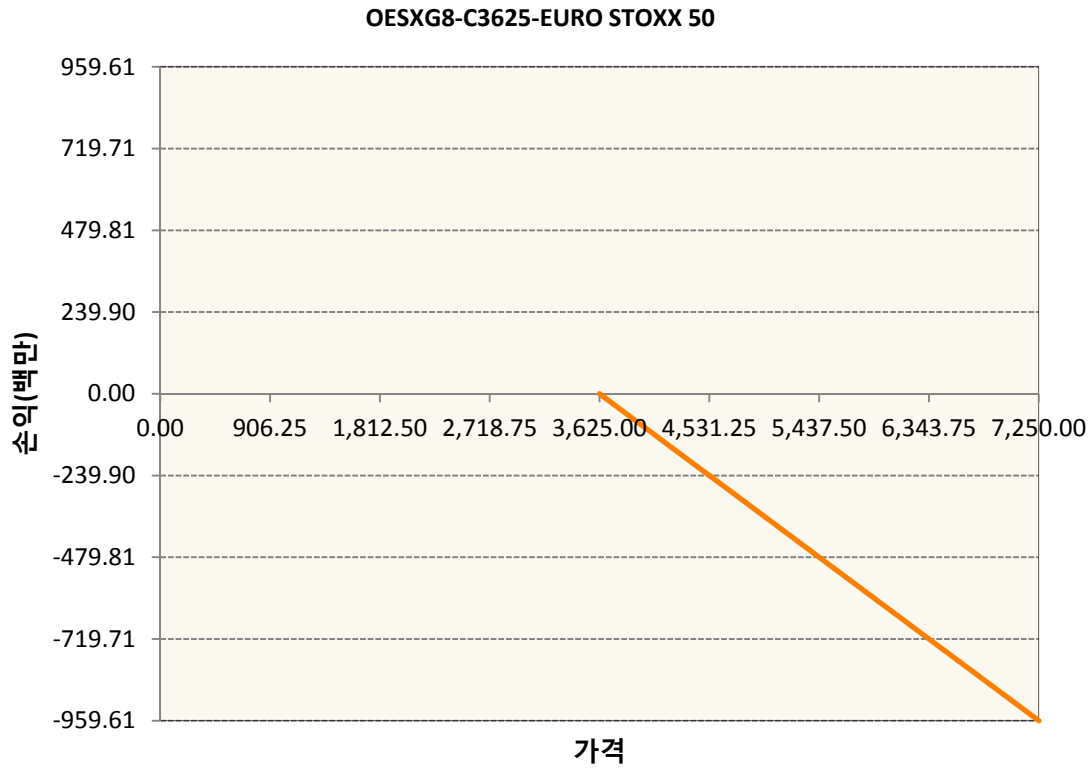
유로커버드콜모(주식혼합-파생형

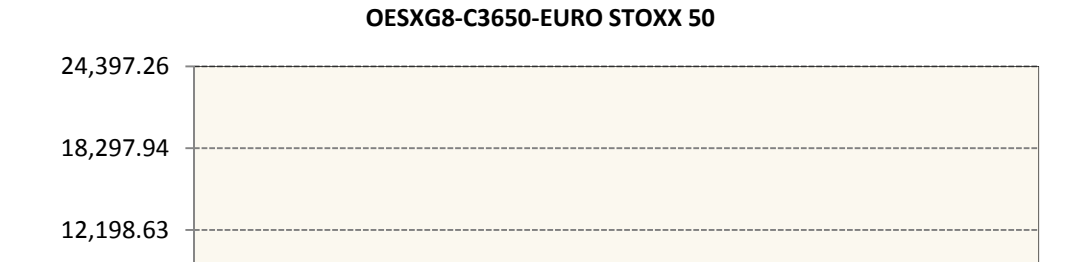
1. 계약금액

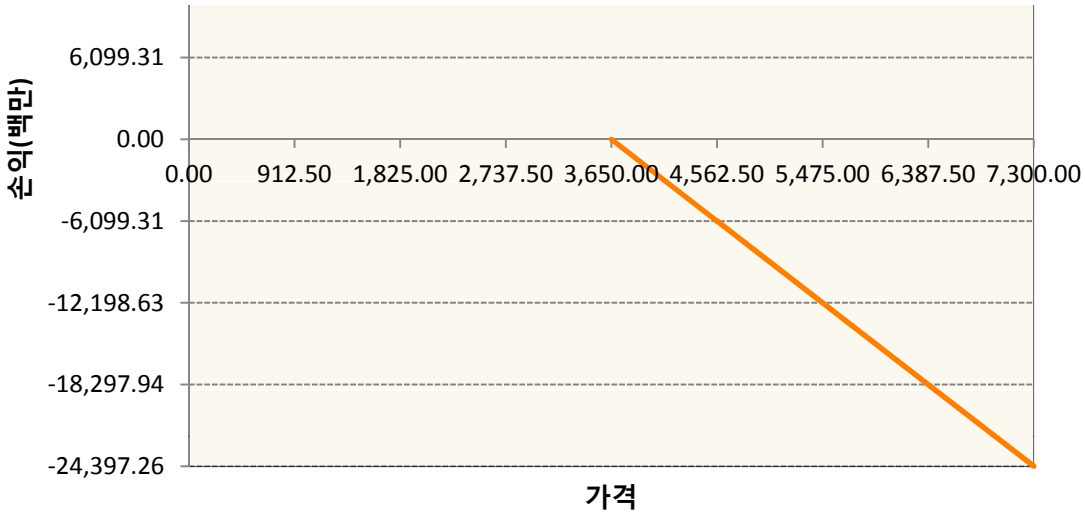
(단위:백만원)

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	16,228	0	16,228	
누계	유가증권	스왑	99,269	0	99,269	장외
누계	유가증권	옵션	0	50,714	-50,714	장내
누계	지수	스왑	52,944	0	52,944	장외

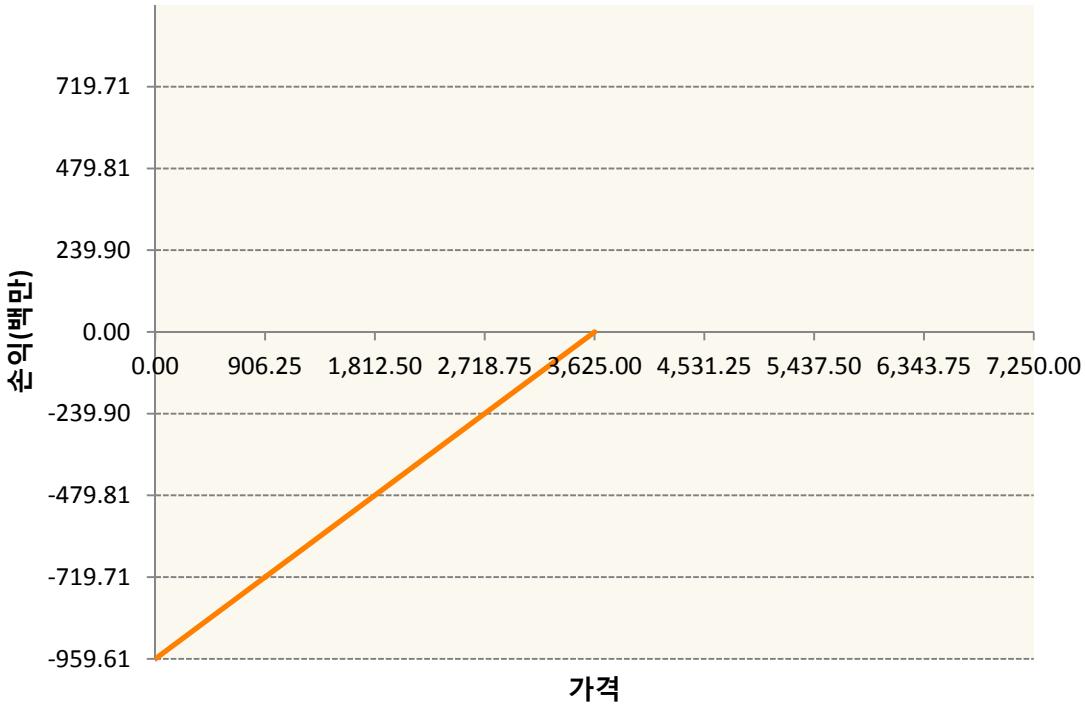
2. 만기시점의 손익구조



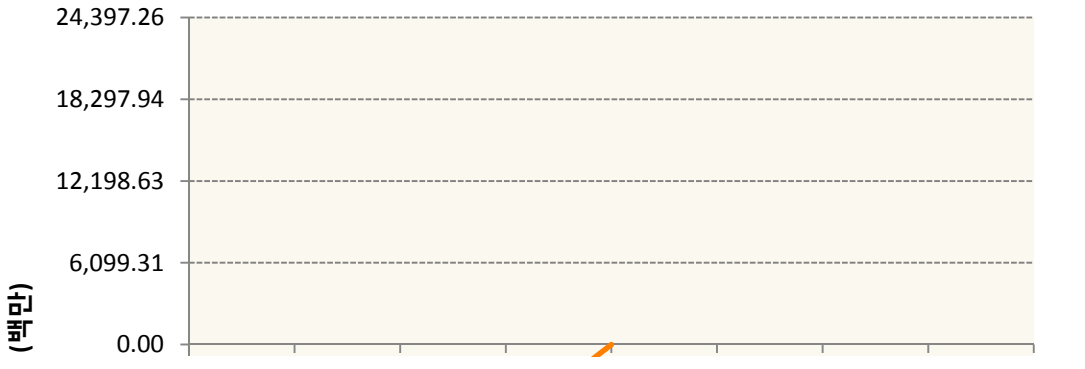


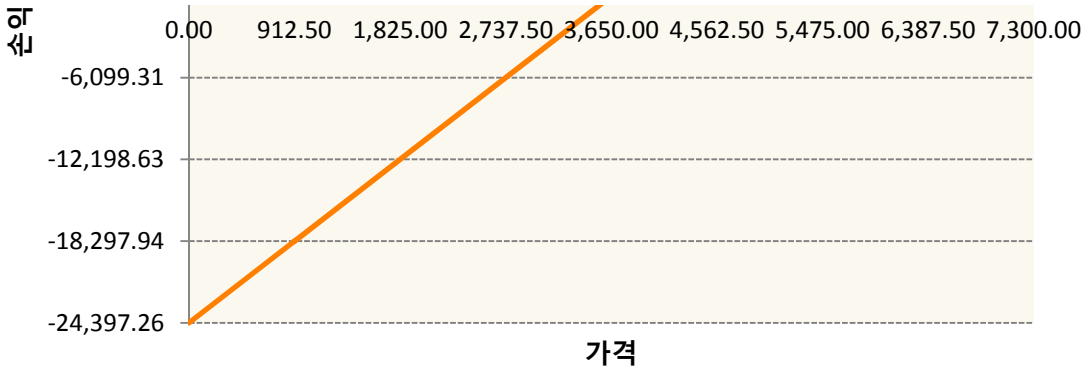


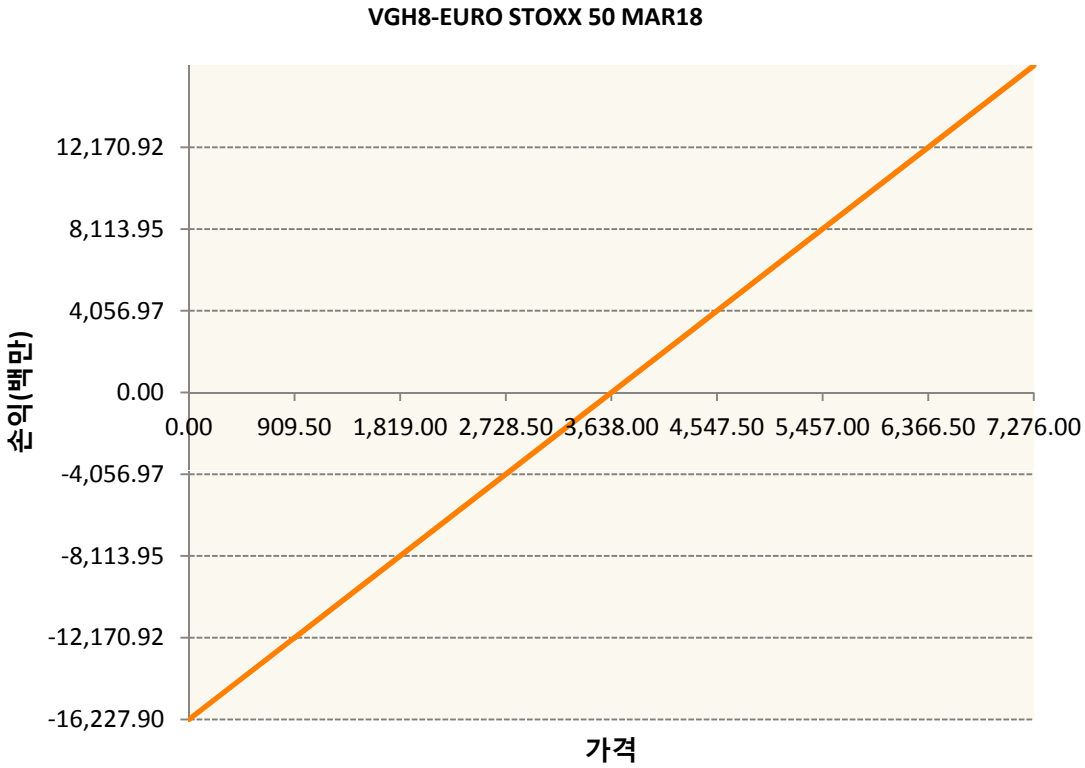
OESXG8-P3625-EURO STOXX 50



OESXG8-P3650-EURO STOXX 50







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)	(단위:백만원)
260105SGPX SG EURO Covered CALL STRATEGY - 994.569	4
260105SQPX SG EURO Covered CALL STRATEGY	7
OESXG8-C3(EURO STOXX 50	77
OESXG8-C3(EURO STOXX 50	1,952
OESXG8-P3(EURO STOXX 50	77
OESXG8-P3(EURO STOXX 50	1,952
VGH8 EURO STOXX 50 MAR18	1,298

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

2,985

공시일	2018-01-30
기준일	2018-01-29

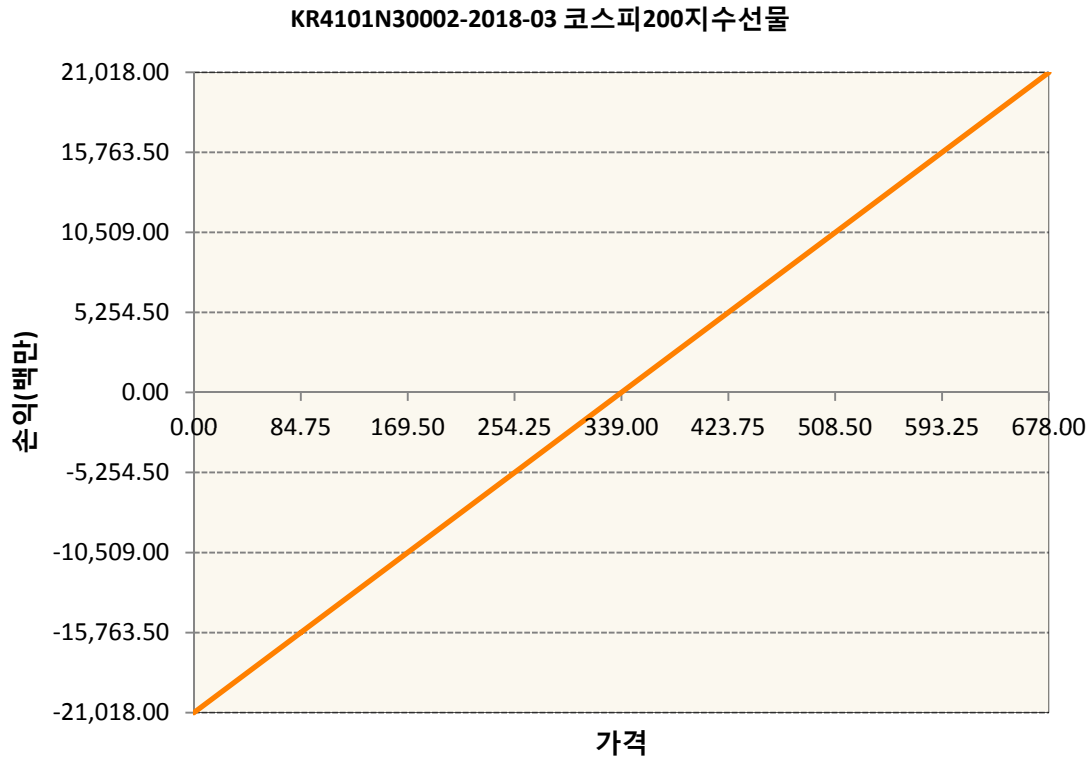
ETF스마트레버리지목표전환형8호

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	21,018	0	21,018	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101N30(2018-03 코스피200지수선물							1,677
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,677	-1,677	-1,677	-1,677	-1,677	-1,677	-1,677
-5.33%	-1,118	-1,118	-1,118	-1,118	-1,118	-1,118	-1,118
-2.67%	-559	-559	-559	-559	-559	-559	-559
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	559	559	559	559	559	559	559
5.33%	1,118	1,118	1,118	1,118	1,118	1,118	1,118
8.00%	1,677	1,677	1,677	1,677	1,677	1,677	1,677

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

1,006

공시일	2018-01-30
기준일	2018-01-29

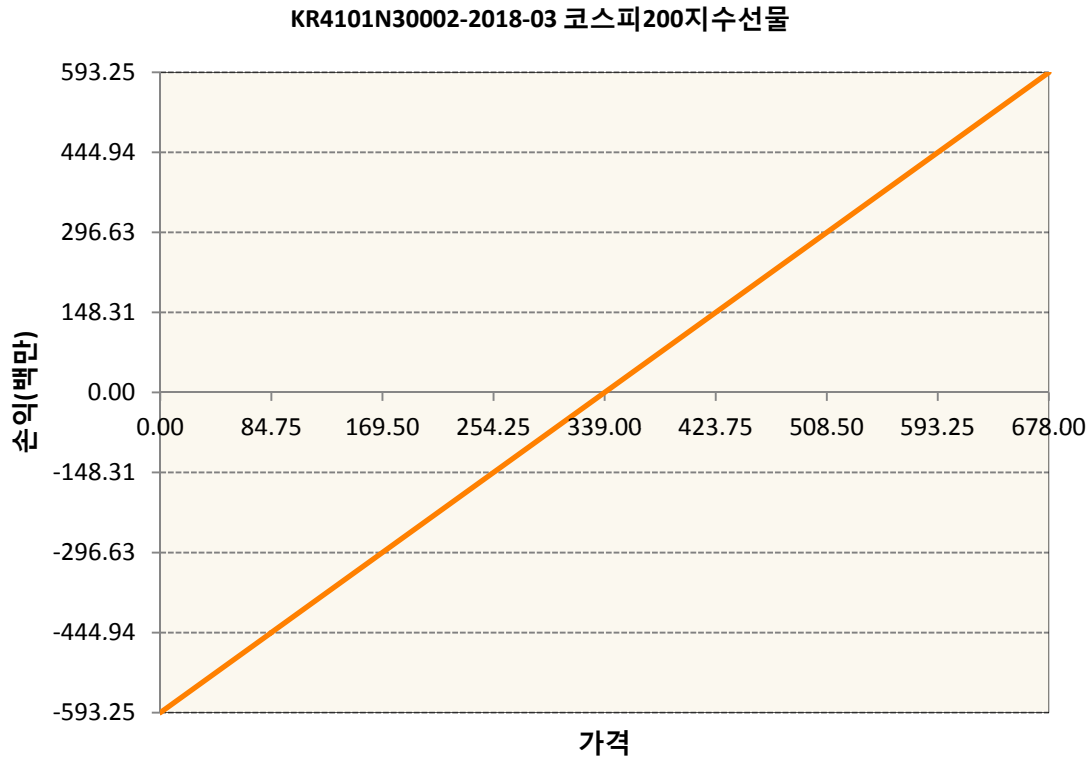
ETF스마트레버리지목표전환형9호

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	593	0	593	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101N30(2018-03 코스피200지수선물							47
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-47	-47	-47	-47	-47	-47	-47
-5.33%	-32	-32	-32	-32	-32	-32	-32
-2.67%	-16	-16	-16	-16	-16	-16	-16
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	16	16	16	16	16	16	16
5.33%	32	32	32	32	32	32	32
8.00%	47	47	47	47	47	47	47

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

28

공시일	2018-01-30
기준일	2018-01-29

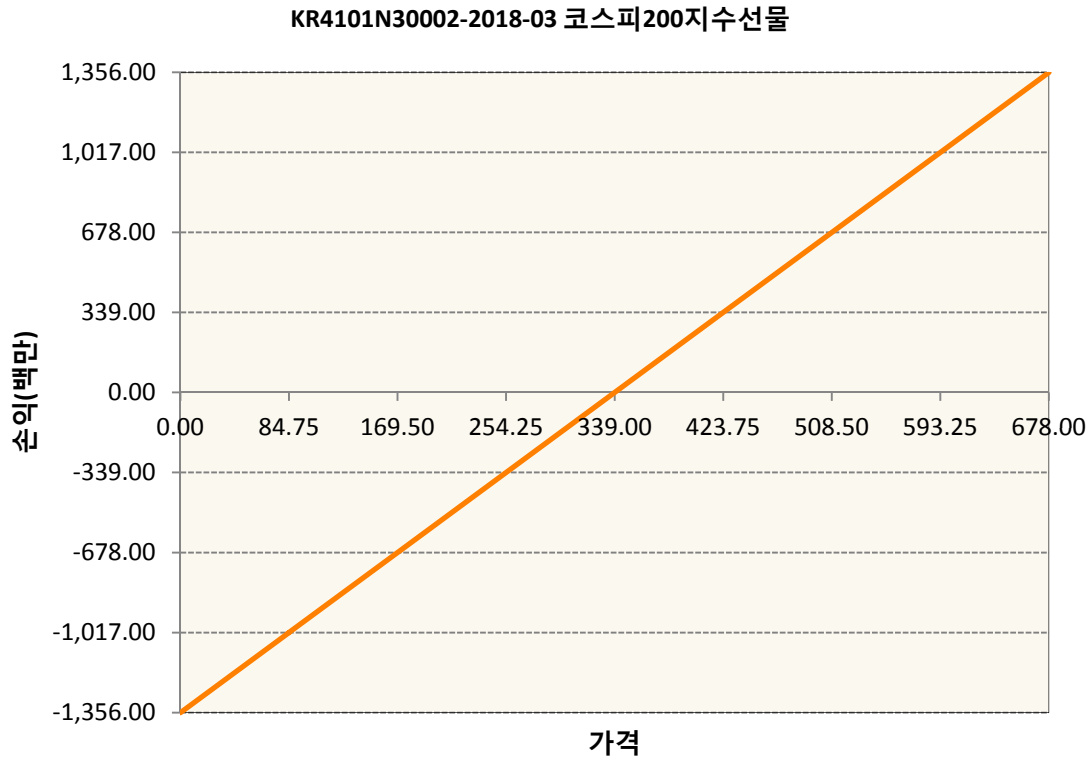
ETF스마트레버리지목표전환형10

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	1,356	0	1,356	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101N30(2018-03 코스피200지수선물							108
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-108	-108	-108	-108	-108	-108	-108
-5.33%	-72	-72	-72	-72	-72	-72	-72
-2.67%	-36	-36	-36	-36	-36	-36	-36
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	36	36	36	36	36	36	36
5.33%	72	72	72	72	72	72	72
8.00%	108	108	108	108	108	108	108

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

65

공시일	2018-01-30
기준일	2018-01-29

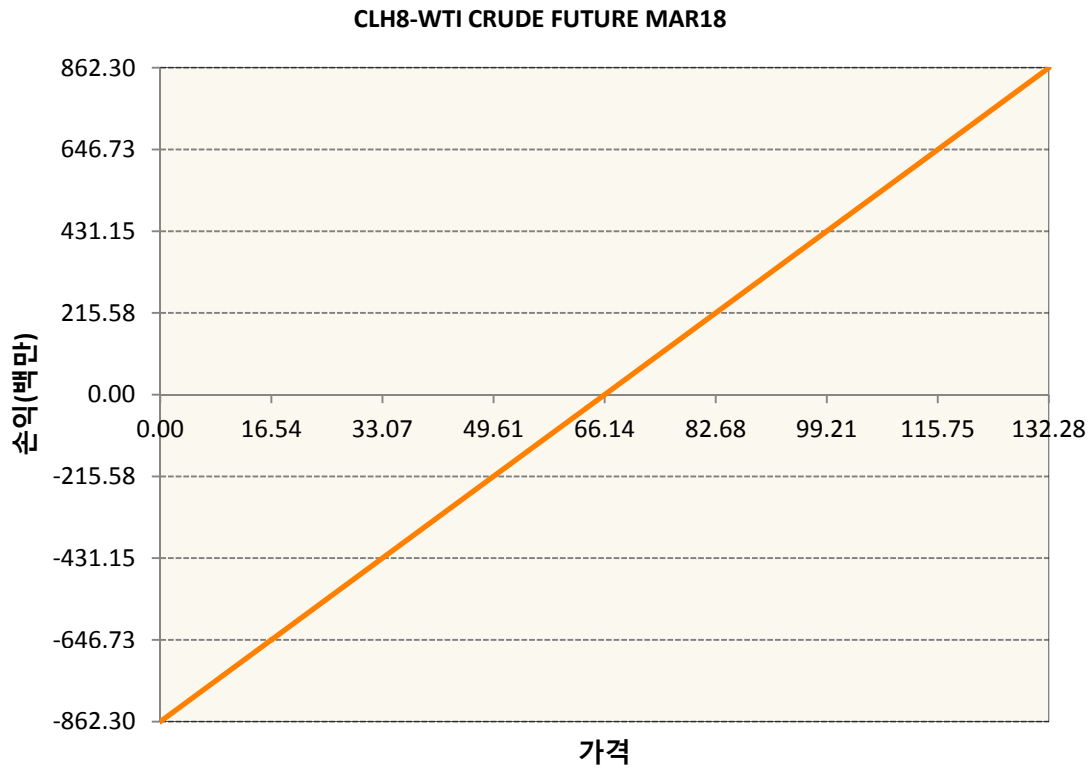
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

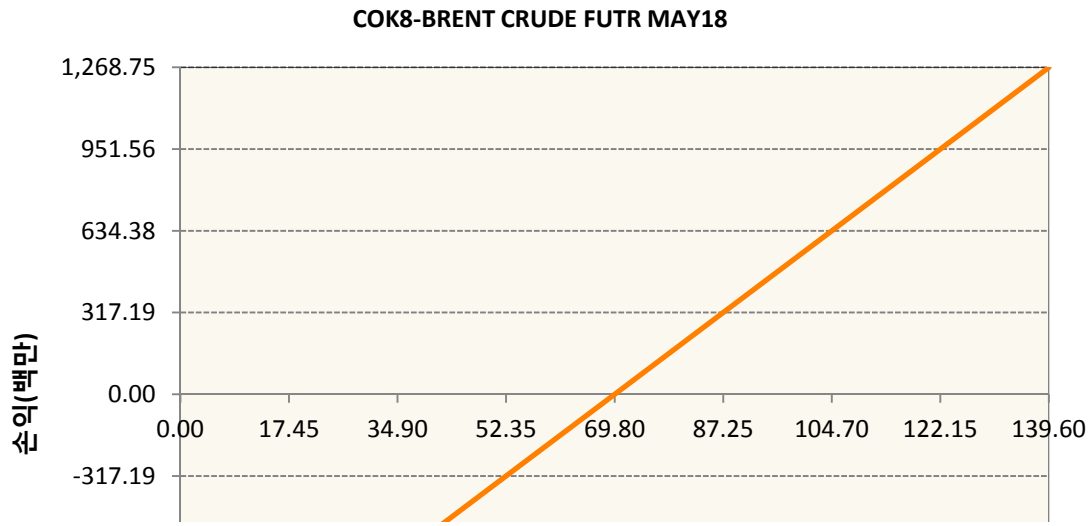
1. 계약금액

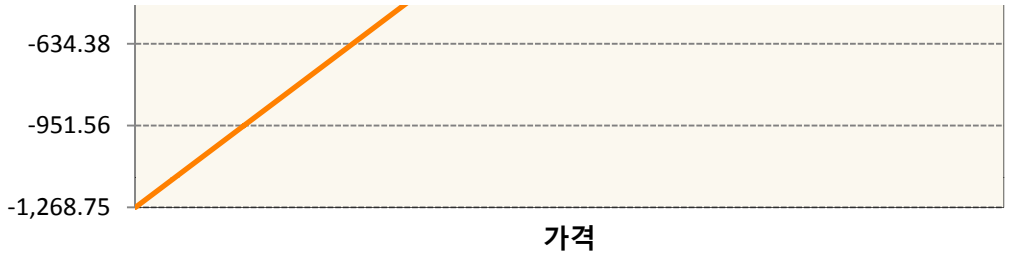
(단위:백만원)

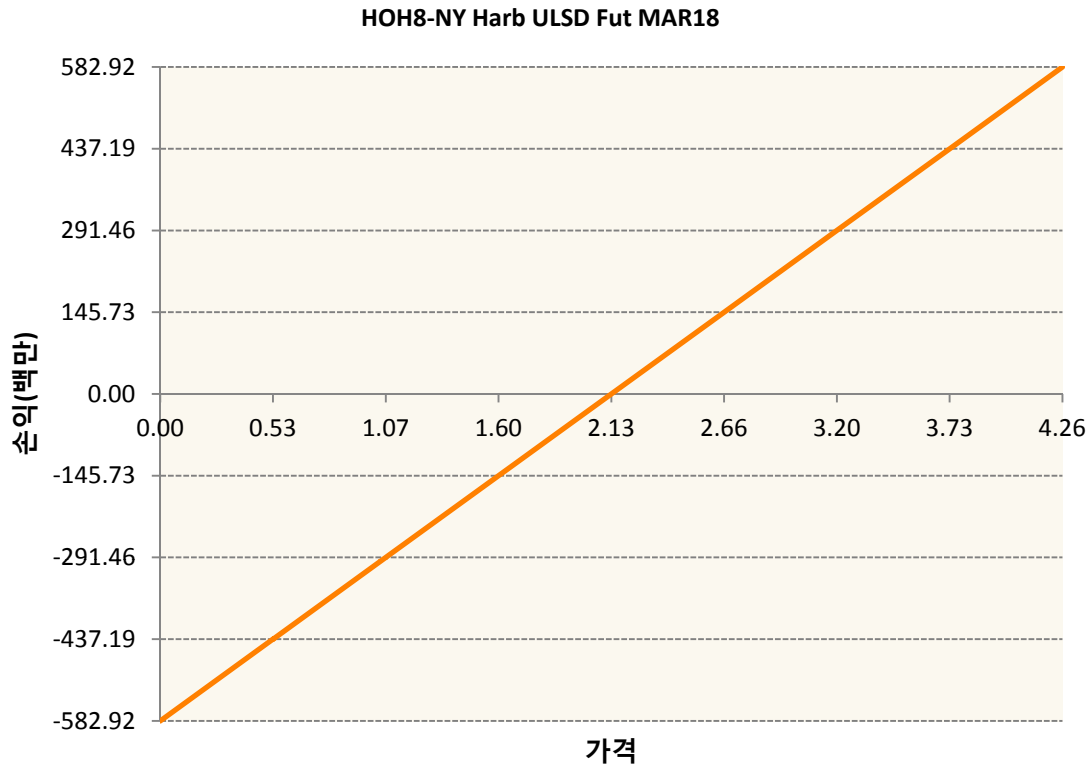
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	4,636	853	3,783	

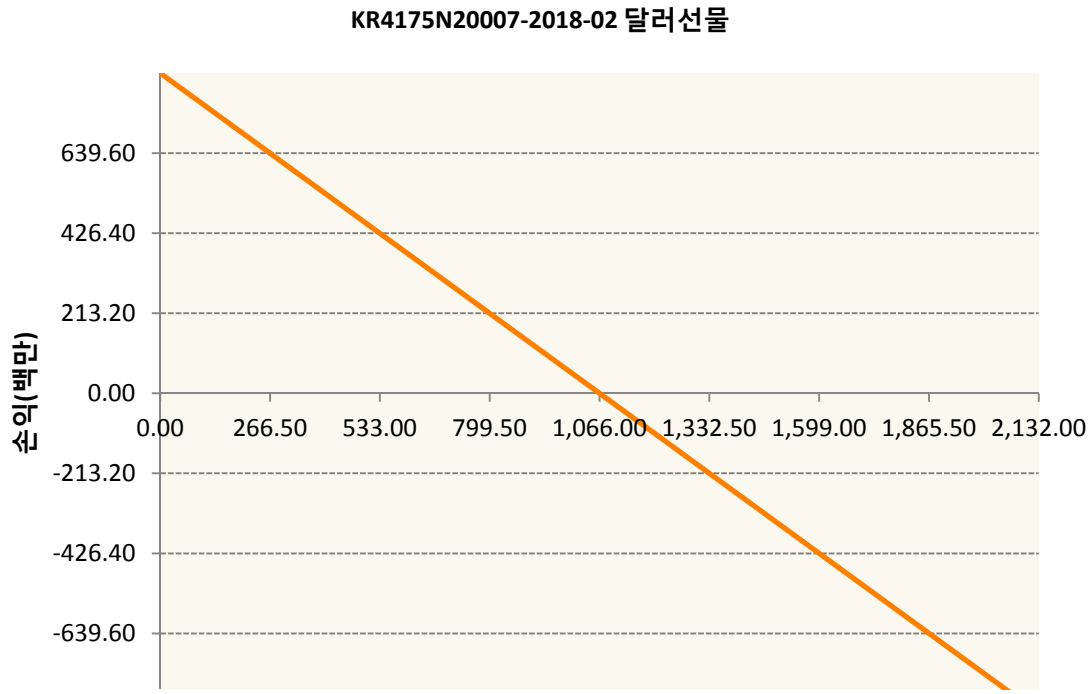
2. 만기시점의 손익구조

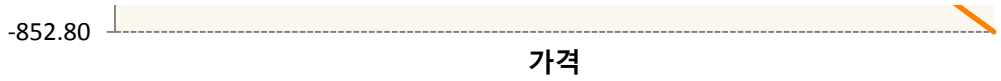


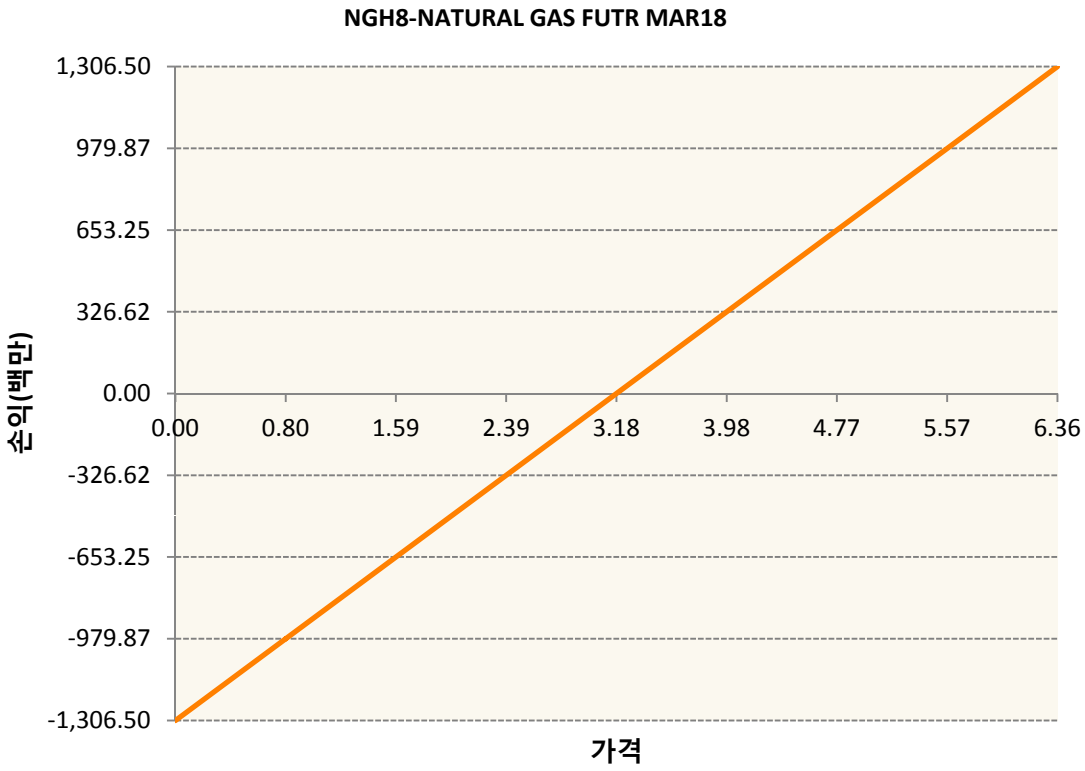


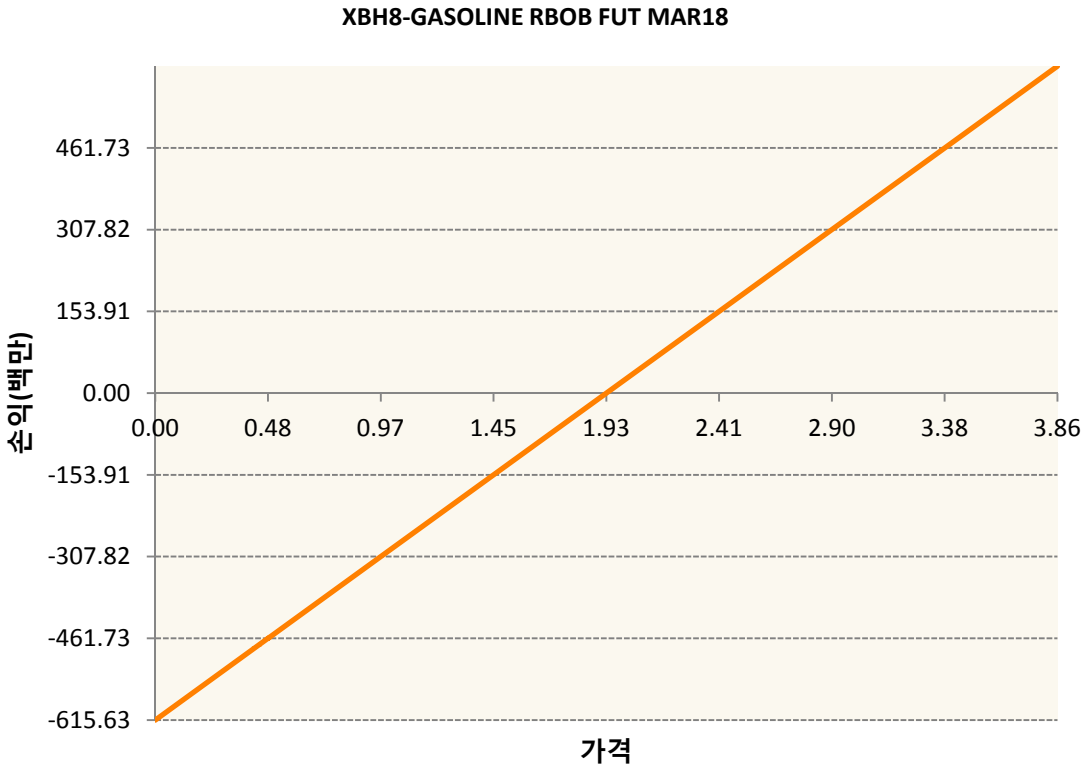

-634.38
-951.56
-1,268.75
가격


HOH8-NY Harb ULSD Fut MAR18
582.92
437.19
291.46
145.73
0.00
-145.73
-291.46
-437.19
-582.92
0.00
0.53
1.07
1.60
2.13
2.66
3.20
3.73
4.26
손익(백만)
가격


KR4175N20007-2018-02 달러선물
639.60
426.40
213.20
0.00
-213.20
-426.40
-639.60
0.00
266.50
533.00
799.50
1,066.00
1,332.50
1,599.00
1,865.50
2,132.00
손익(백만)


-852.80
가격


NGH8-NATURAL GAS FUTR MAR18
1,306.50
979.87
653.25
326.62
0.00
-326.62
-653.25
-979.87
-1,306.50
손익(백만)
0.00
0.80
1.59
2.39
3.18
3.98
4.77
5.57
6.36
가격


XBH8-GASOLINE RBOB FUT MAR18
461.73
307.82
153.91
0.00
-153.91
-307.82
-461.73
-615.63
손익(백만)
0.00
0.48
0.97
1.45
1.93
2.41
2.90
3.38
3.86
가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLH8	WTI CRUDE FUTURE MAR18	69
COK8	BRENT CRUDE FUTR MAY18	102
HOH8	NY Harb ULSD Fut MAR18	47
KR4175N20(	2018-02 달러선물	68
NGH8	NATURAL GAS FUTR MAR18	105
XBH8	GASOLINE RBOB FUT MAR18	49

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

626

공시일	2018-01-30
기준일	2018-01-29

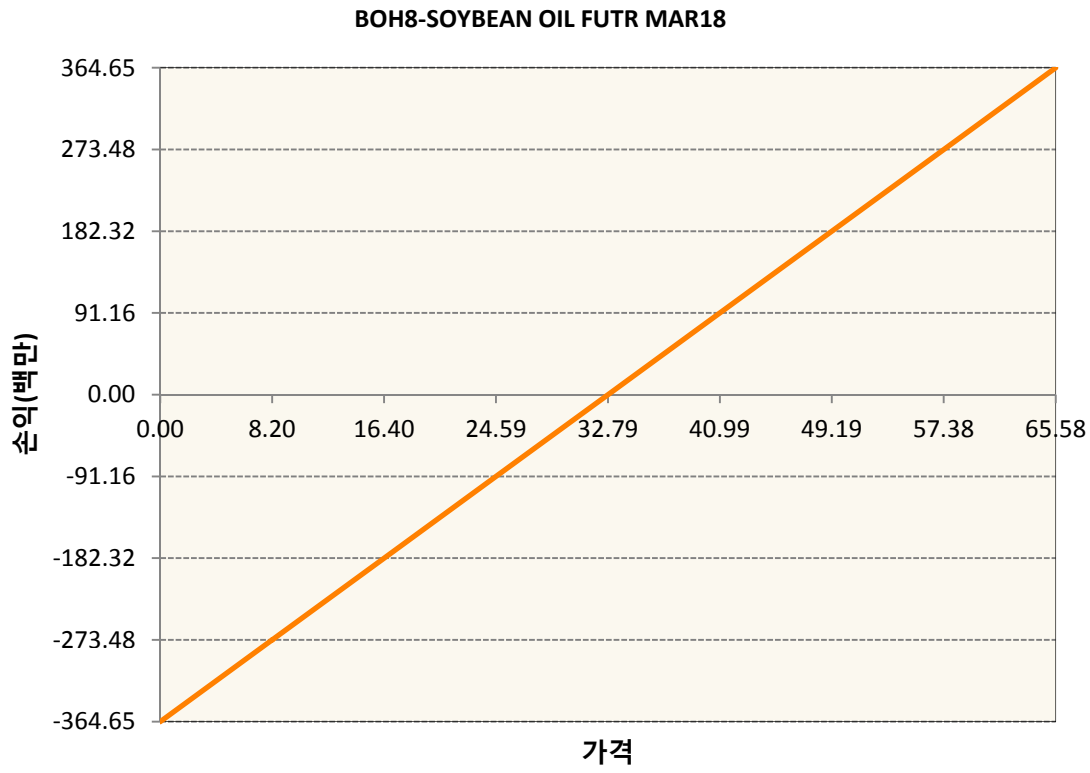
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

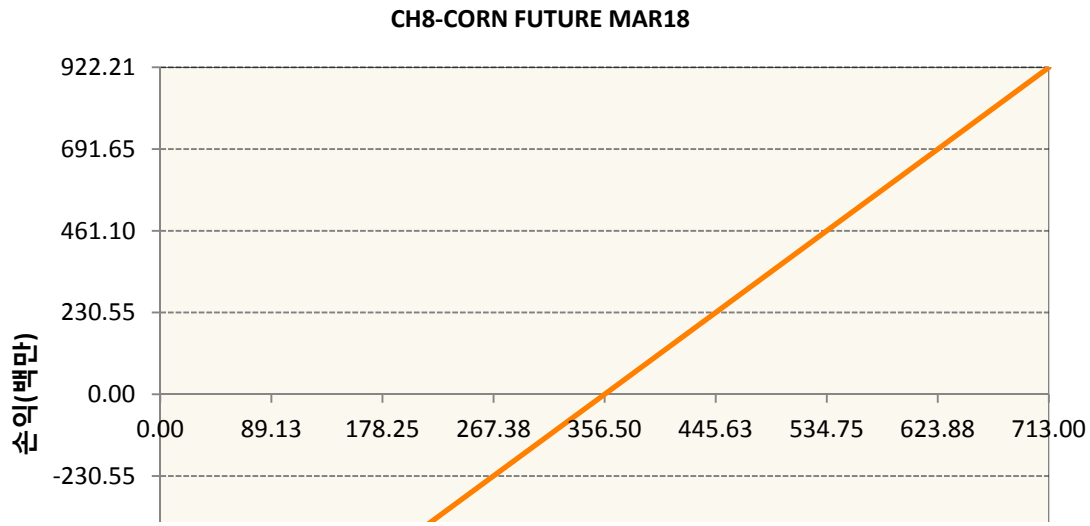
1. 계약금액

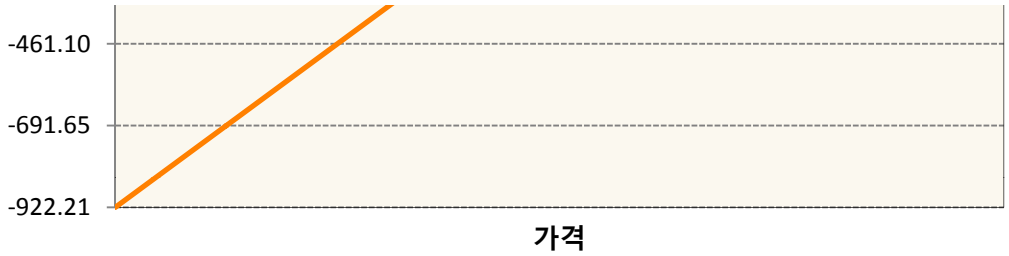
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	4,124	320	3,804	

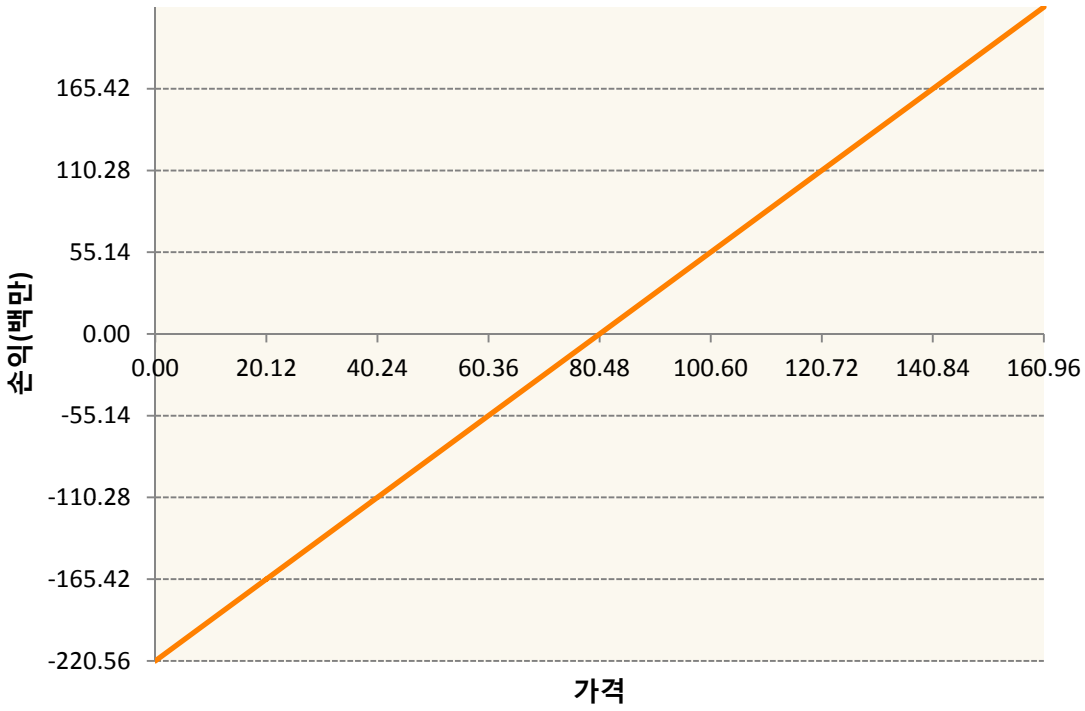
2. 만기시점의 손익구조



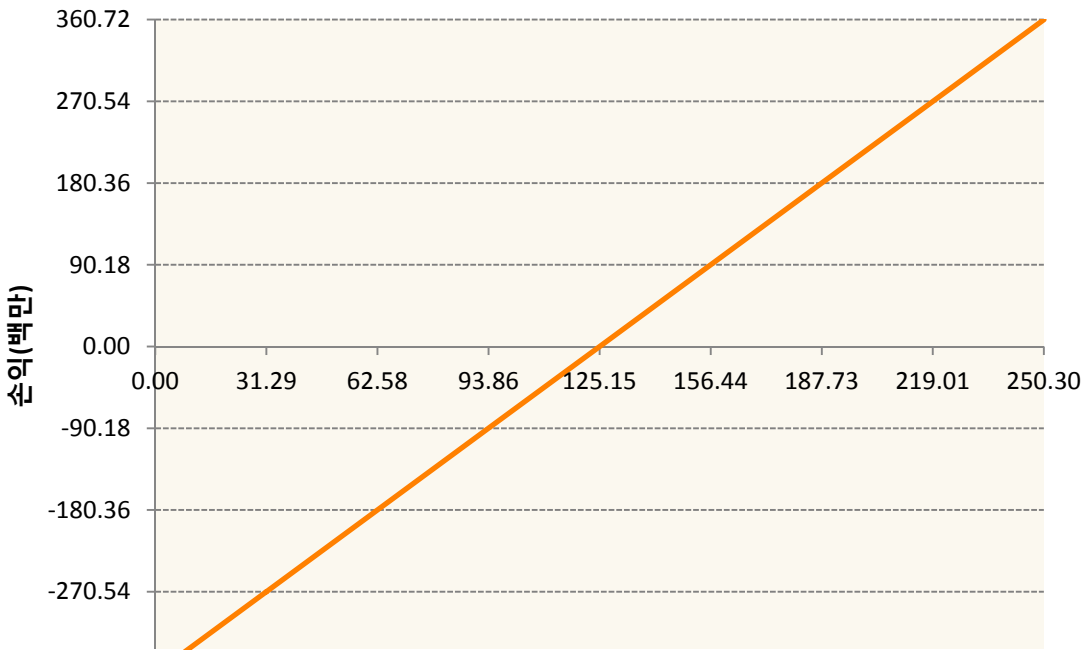


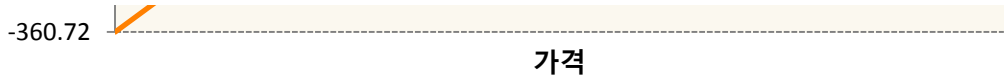


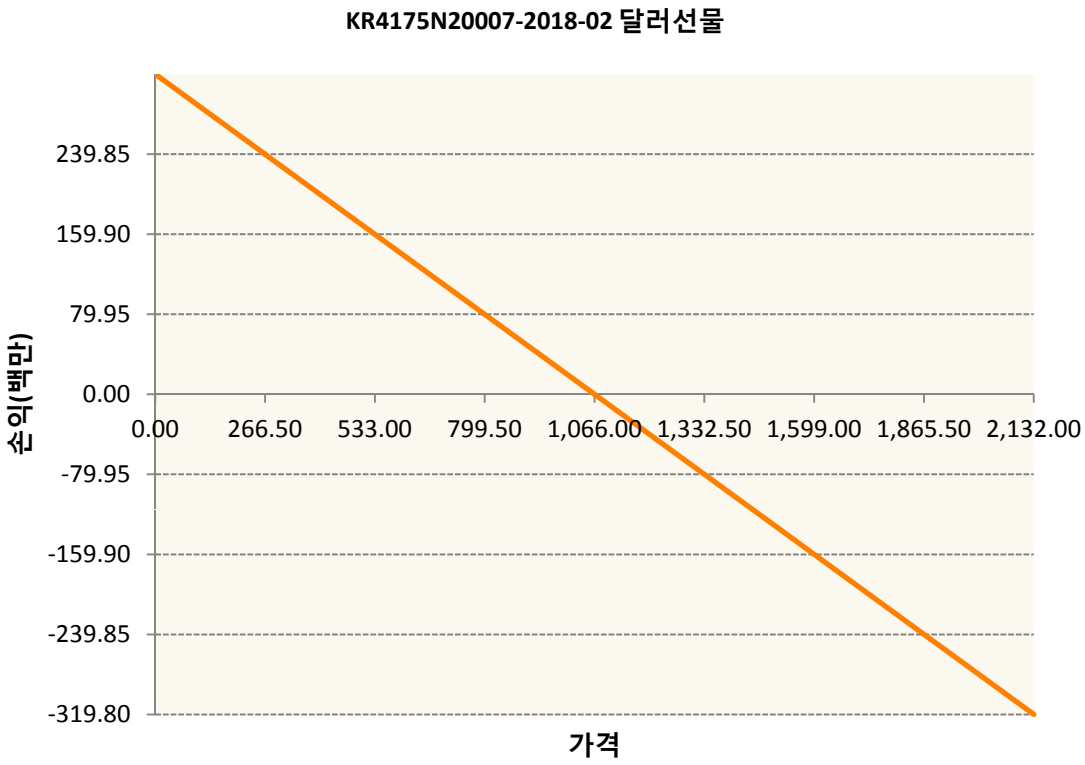
CTH8-COTTON NO.2 FUTR MAR18

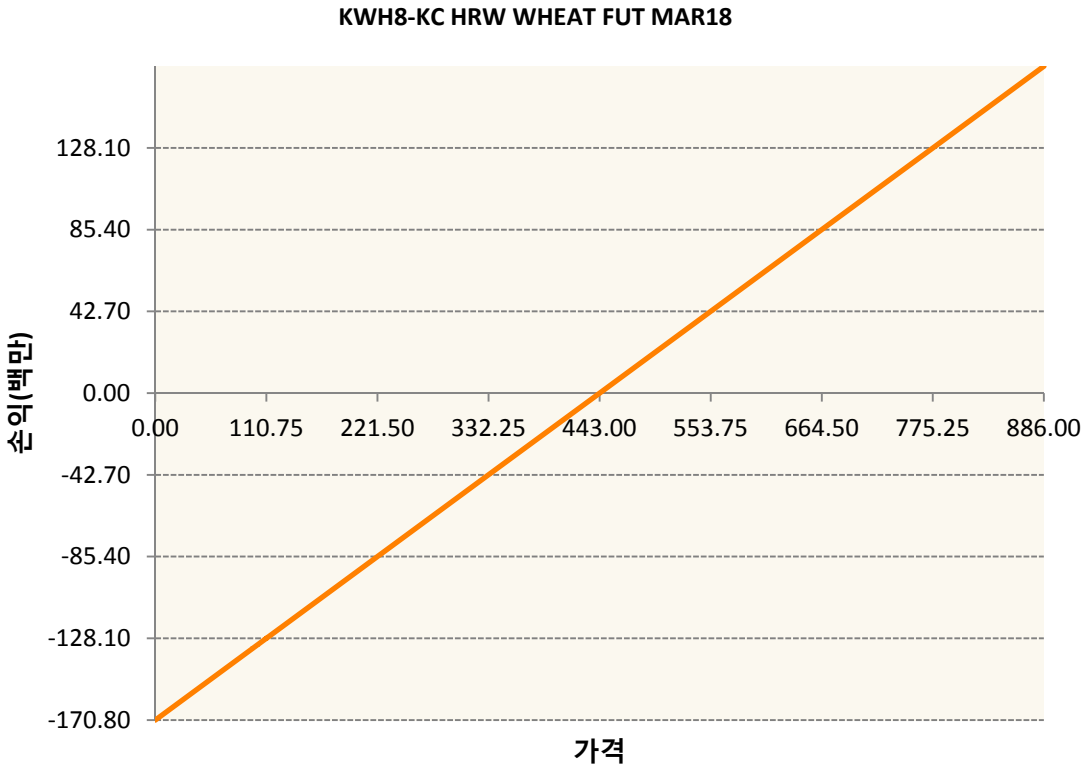


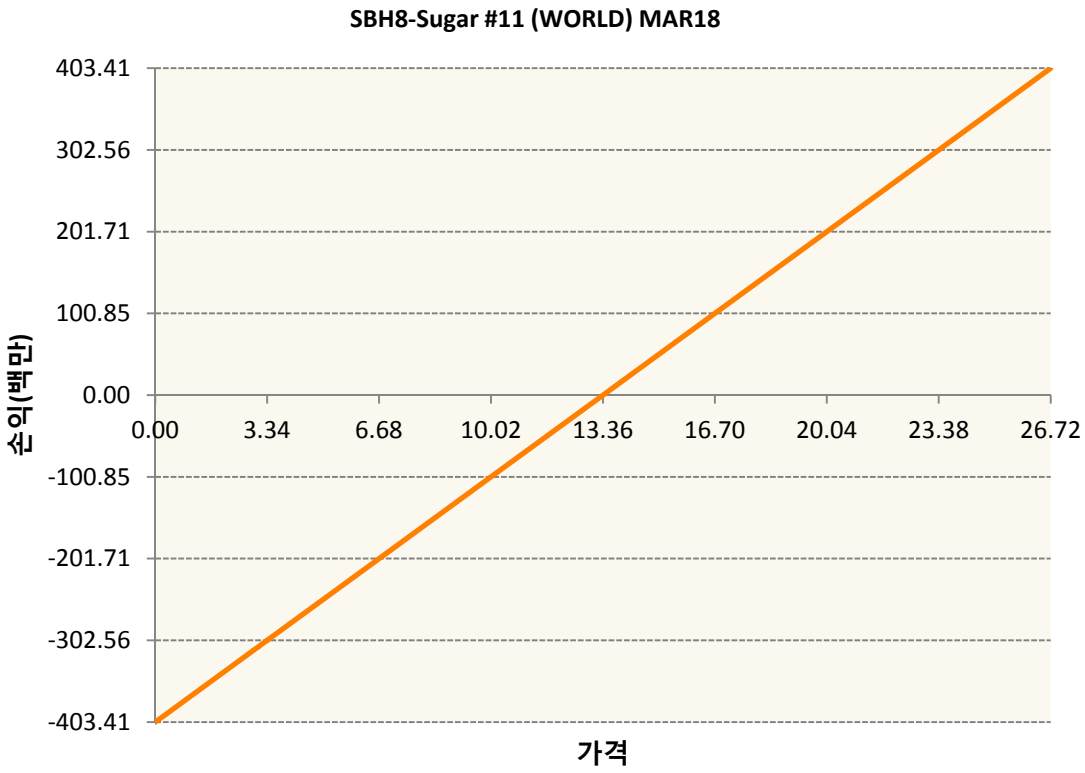
KCH8-COFFEE "C" FUTURE MAR18

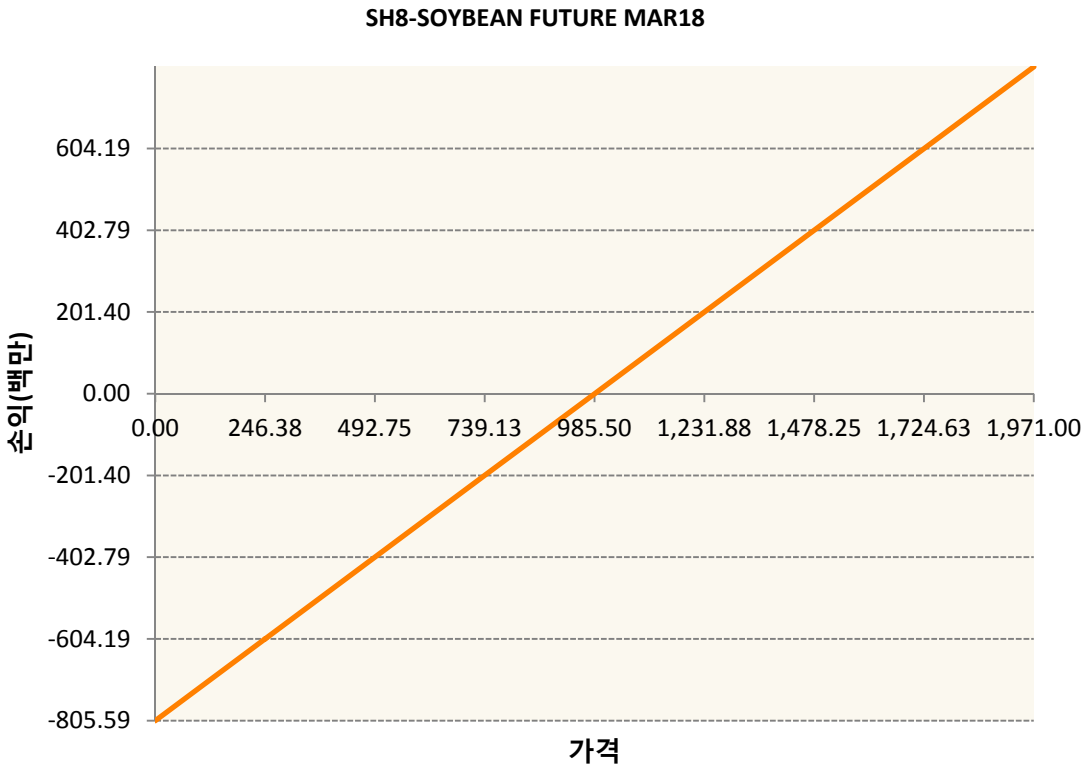



-360.72
가격

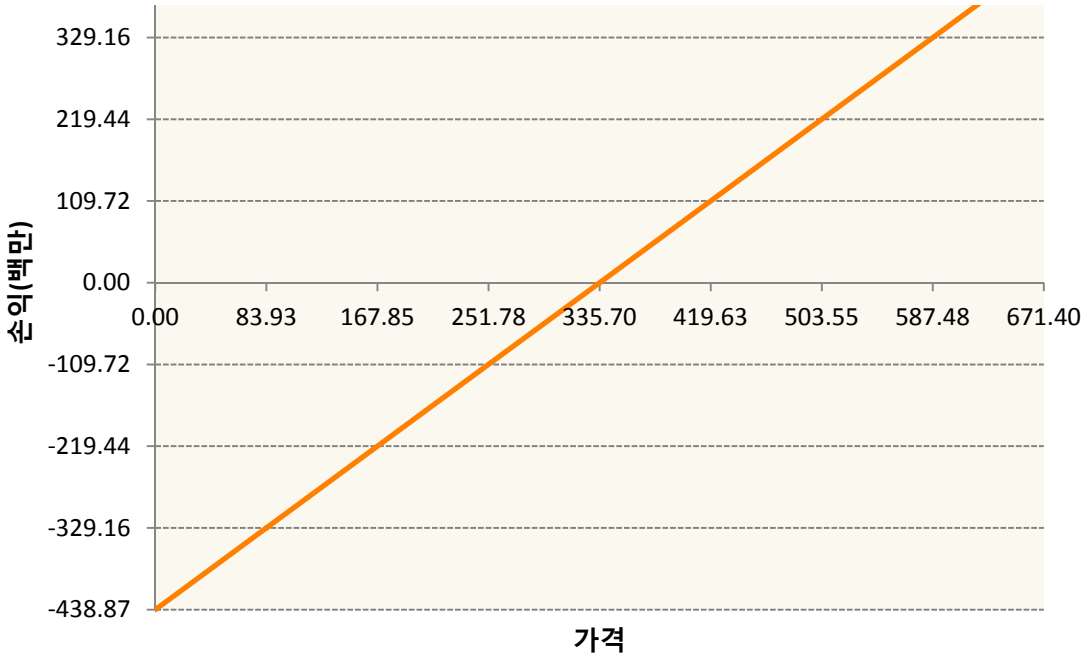

KR4175N20007-2018-02 달러선물
239.85
159.90
79.95
0.00
-79.95
-159.90
-239.85
-319.80
0.00
266.50
533.00
799.50
1,066.00
1,332.50
1,599.00
1,865.50
2,132.00
손익(백만)
가격

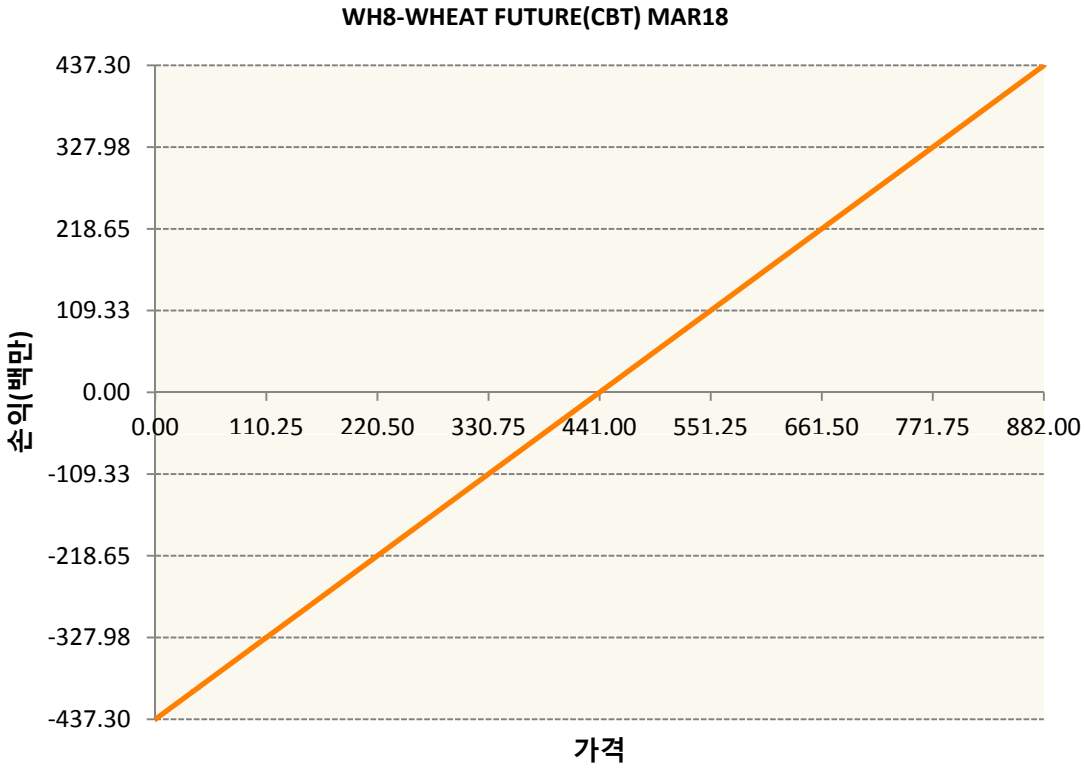

KWH8-KC HRW WHEAT FUT MAR18
128.10
85.40
42.70
0.00
-42.70
-85.40
-128.10
-170.80
0.00
110.75
221.50
332.25
443.00
553.75
664.50
775.25
886.00
손익(백만)
가격


SBH8-Sugar #11 (WORLD) MAR18
403.41
302.56
201.71
100.85
0.00
-100.85
-201.71
-302.56
-403.41
0.00
3.34
6.68
10.02
13.36
16.70
20.04
23.38
26.72
손익(백만)
가격


SH8-SOYBEAN FUTURE MAR18
604.19
402.79
201.40
0.00
-201.40
-402.79
-604.19
-805.59
0.00
246.38
492.75
739.13
985.50
1,231.88
1,478.25
1,724.63
1,971.00
손익(백만)
가격


SMH8-SOYBEAN MEAL FUTR MAR18





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

BOH8	SOYBEAN OIL FUTR MAR18	29
CH8	CORN FUTURE MAR18	74
CTH8	COTTON NO.2 FUTR MAR18	18
KCH8	COFFEE "C" FUTURE MAR18	29
KR4175N20(	2018-02 달러선물	26

KWH8	KC HRW WHEAT FUT MAR18	14
SBH8	Sugar #11 (WORLD) MAR18	32
SH8	SOYBEAN FUTURE MAR18	64
SMH8	SOYBEAN MEAL FUTR MAR18	35
WH8	WHEAT FUTURE(CBT) MAR18	35

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

344