공시일	2018-02-20
기준일	2018-02-19

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	2018-02-20
기준일	2018-02-19

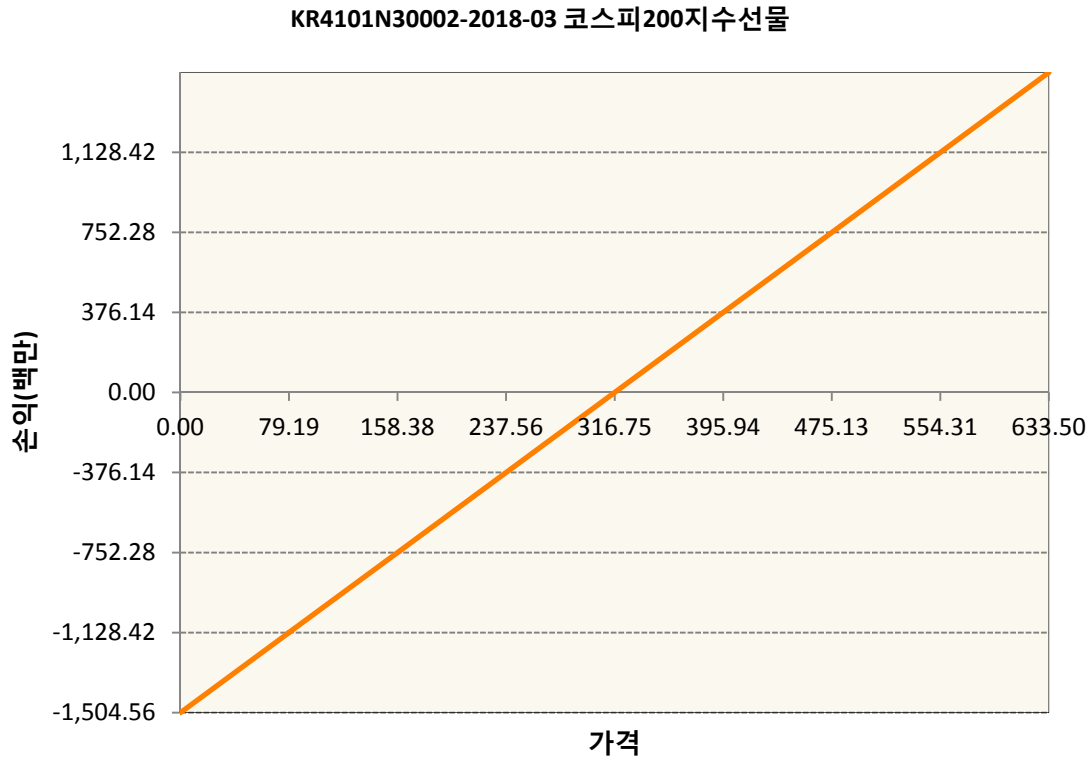
스마트인덱스모

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	1,505	0	1,505	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101N30(2018-03 코스피200지수선물							120
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-120	-120	-120	-120	-120	-120	-120
-5.33%	-80	-80	-80	-80	-80	-80	-80
-2.67%	-40	-40	-40	-40	-40	-40	-40
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	40	40	40	40	40	40	40
5.33%	80	80	80	80	80	80	80
8.00%	120	120	120	120	120	120	120

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

79

공시일	2018-02-20
기준일	2018-02-19

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	1,120

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

407

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2018-02-20
기준일	2018-02-19

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	384

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

379

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2018-02-20
기준일	2018-02-19

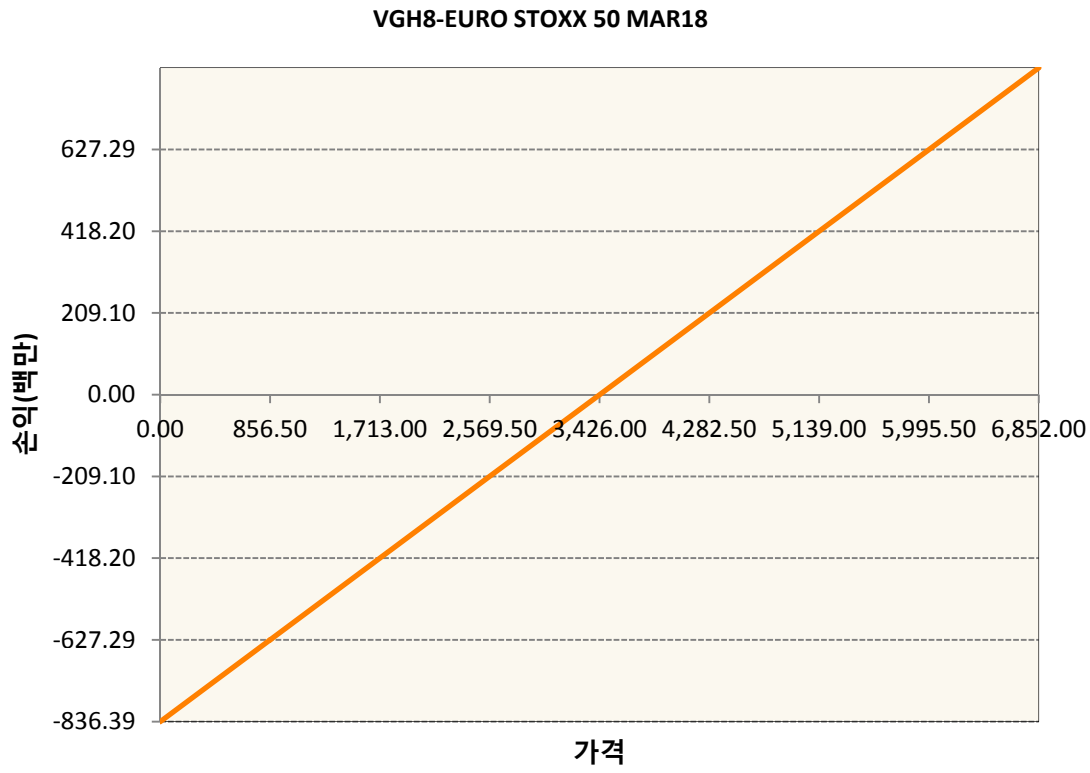
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	836	0	836	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGH8	EURO STOXX 50 MAR18	67

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

(단위:백만원)

39

공시일	2018-02-20
기준일	2018-02-19

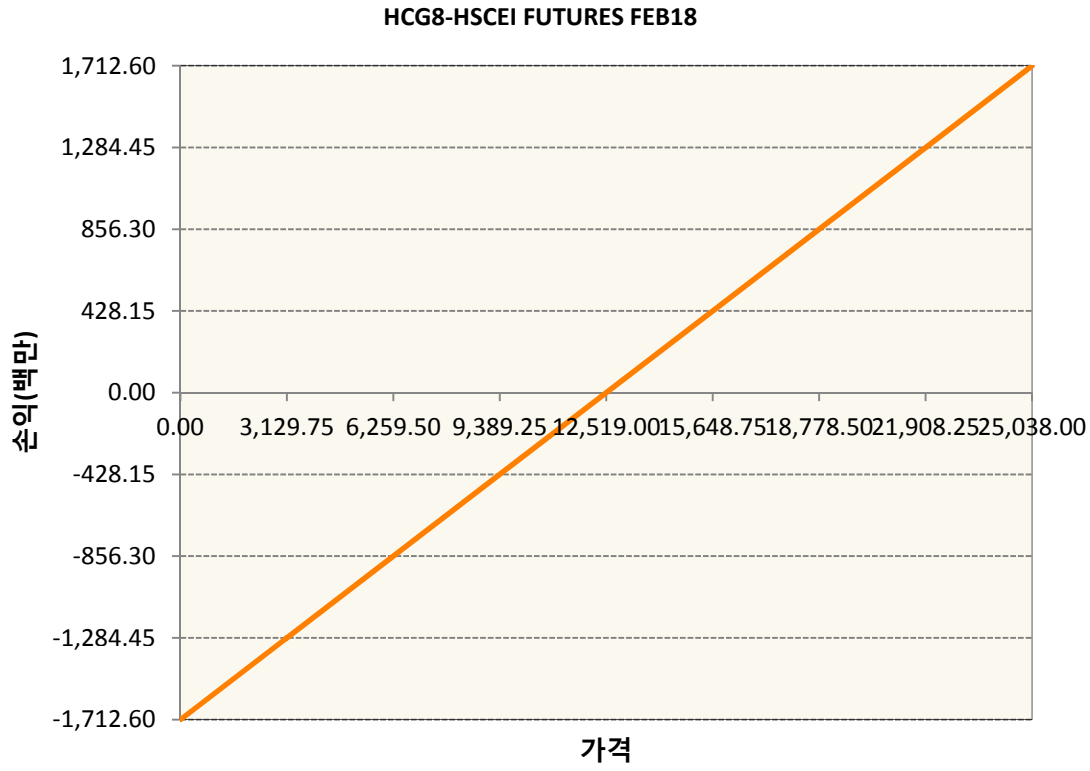
차이나인덱스모(주식-파생형)

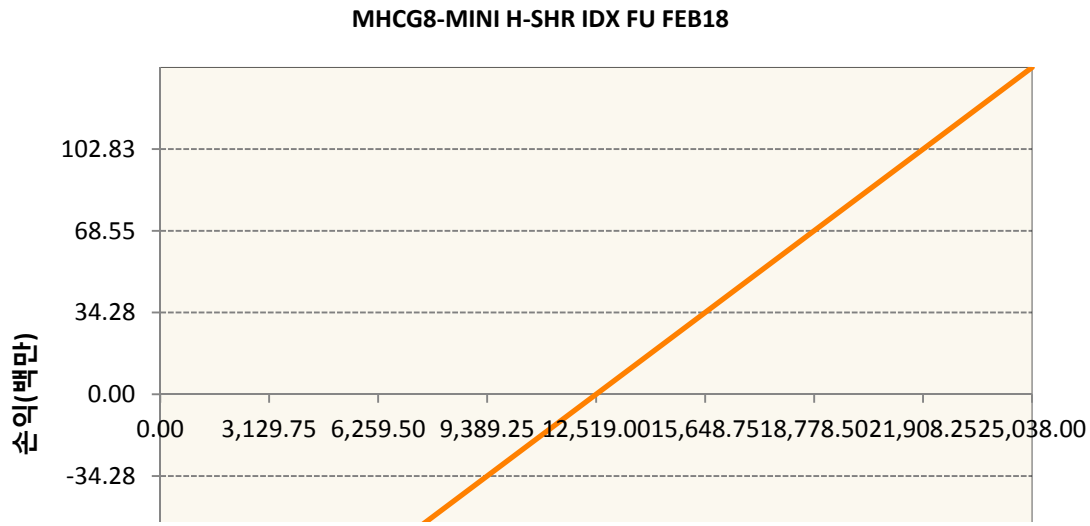
1. 계약금액

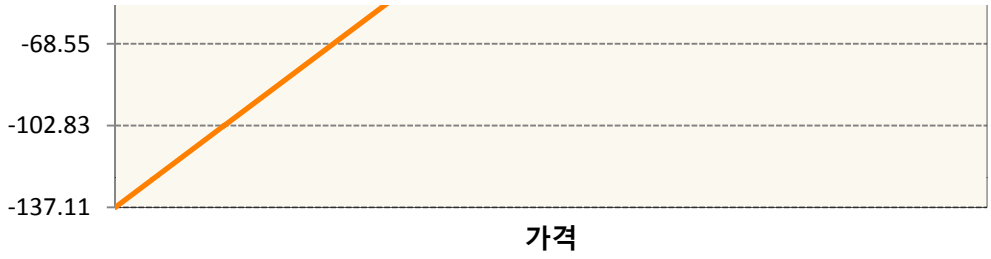
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,850	0	1,850	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCG8	HSCEI FUTURES FEB18	137
MHCG8	MINI H-SHR IDX FU FEB18	11

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	127

공시일	2018-02-20
기준일	2018-02-19

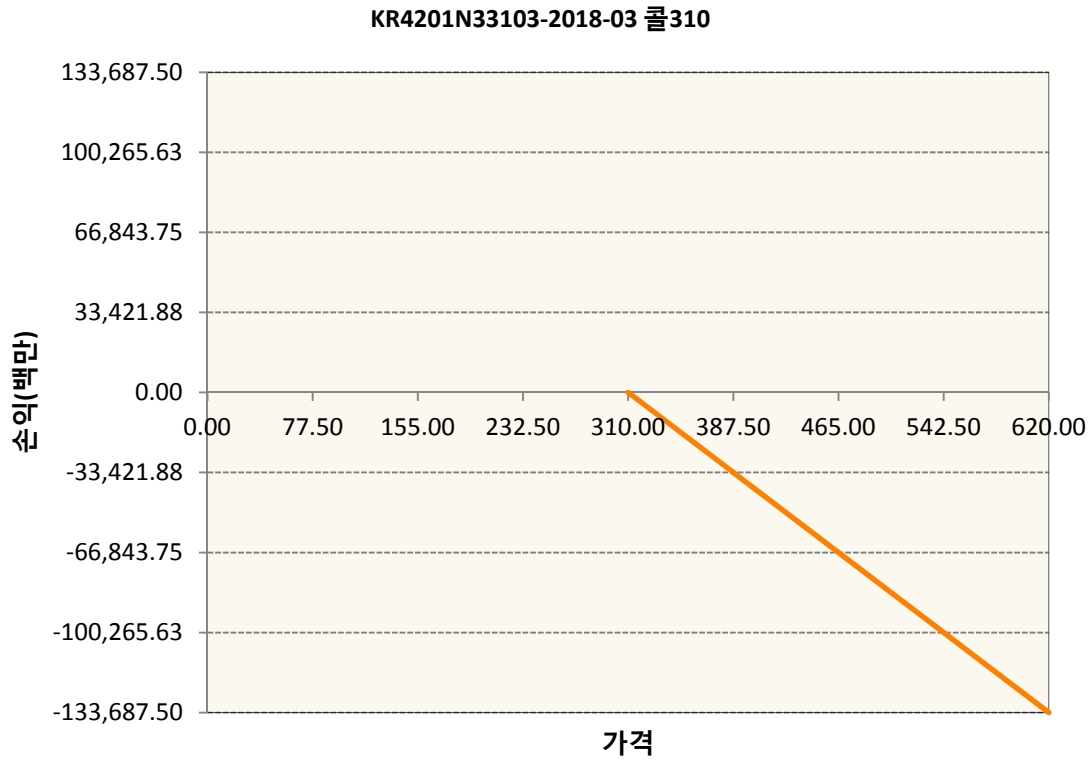
커버드콜모(주식혼합-파생형)

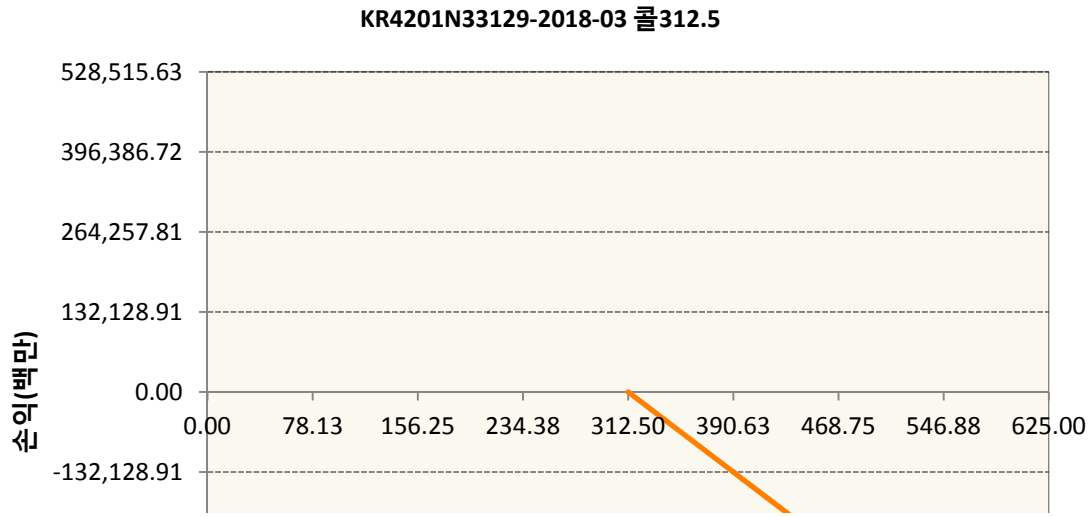
1. 계약금액

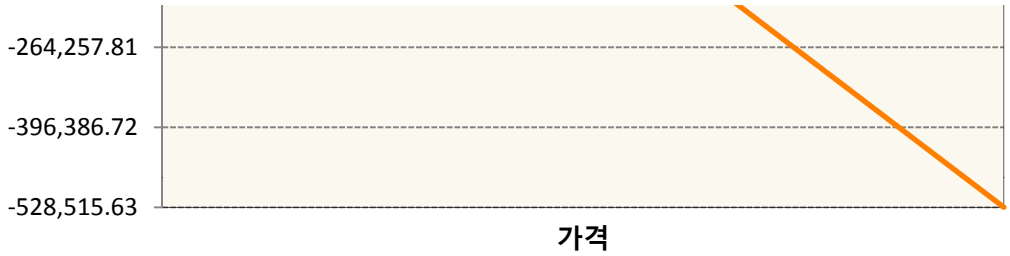
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	7,589	0	7,589	장내
누계	유가증권	옵션	0	1,121,059	-1,121,059	장내

2. 만기시점의 손익구조



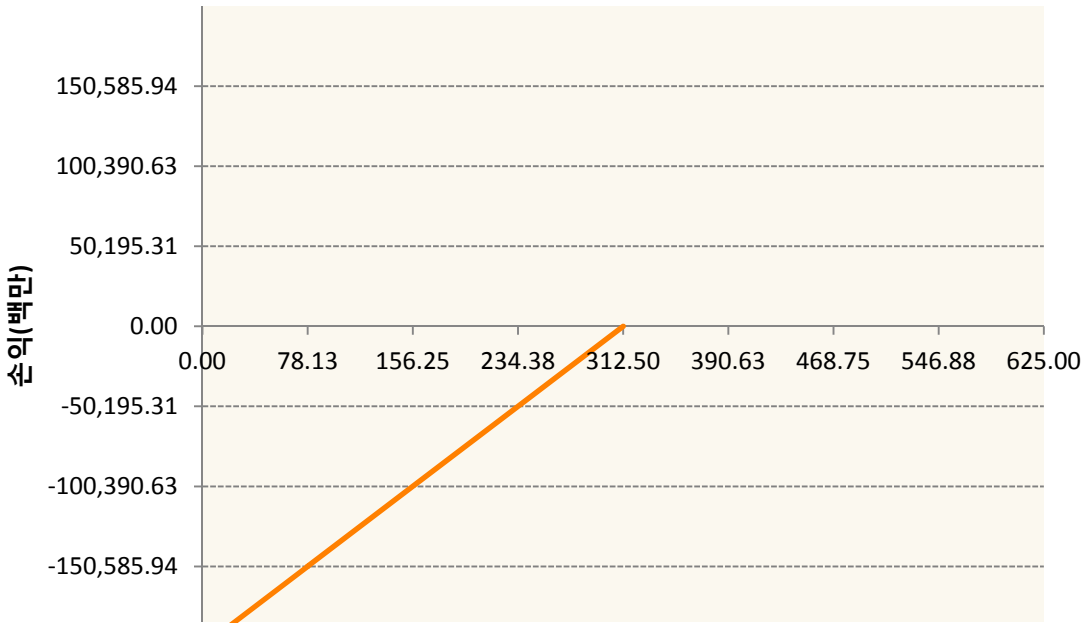




KR4301N33101-2018-03 풋310



KR4301N33127-2018-03 풋312.5





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201N3312018-03 콜310							9,405
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	4,613	4,508	4,384	4,244	4,091	3,926	3,752
-5.33%	4,067	3,868	3,658	3,442	3,219	2,992	2,760
-2.67%	2,831	2,571	2,311	2,050	1,790	1,529	1,268
0%	731	491	247	0	-250	-502	-756
2.67%	-2,123	-2,284	-2,460	-2,649	-2,849	-3,057	-3,272
5.33%	-5,448	-5,528	-5,629	-5,747	-5,881	-6,030	-6,191
8.00%	-8,989	-9,020	-9,065	-9,127	-9,204	-9,297	-9,405
KR4201N3312018-03 콜312.5							35,663
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	15,820	15,494	15,094	14,628	14,104	13,529	12,910
-5.33%	14,218	13,533	12,797	12,020	11,210	10,374	9,516
-2.67%	10,262	9,275	8,279	7,278	6,273	5,264	4,252
0%	3,033	2,029	1,017	0	-1,021	-2,046	-3,073
2.67%	-7,364	-8,105	-8,896	-9,726	-10,588	-11,476	-12,385
5.33%	-19,953	-20,360	-20,846	-21,400	-22,013	-22,676	-23,384
8.00%	-33,651	-33,821	-34,060	-34,367	-34,739	-35,173	-35,663
KR4301N3312018-03 풋310							14,284
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-13,793	-13,831	-13,885	-13,958	-14,050	-14,159	-14,284
-5.33%	-7,155	-7,326	-7,517	-7,726	-7,948	-8,183	-8,427
-2.67%	-1,944	-2,262	-2,581	-2,901	-3,222	-3,543	-3,864
0%	800	544	277	0	-284	-574	-869
2.67%	1,630	1,535	1,416	1,275	1,114	935	741
5.33%	1,765	1,748	1,718	1,674	1,613	1,536	1,442
8.00%	1,777	1,775	1,771	1,762	1,746	1,722	1,687
KR4301N3312018-03 풋312.5							11,971
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-11,702	-11,718	-11,744	-11,782	-11,832	-11,895	-11,971
-5.33%	-6,447	-6,542	-6,655	-6,783	-6,925	-7,079	-7,243
-2.67%	-1,994	-2,220	-2,450	-2,684	-2,920	-3,158	-3,398
0%	704	473	238	0	-241	-483	-727
2.67%	1,686	1,578	1,451	1,309	1,152	984	807

5.33%	1,882	1,857	1,819	1,767	1,700	1,619	1,524
8.00%	1,903	1,900	1,893	1,881	1,862	1,833	1,795

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

71,994

공시일	2018-02-20
기준일	2018-02-19

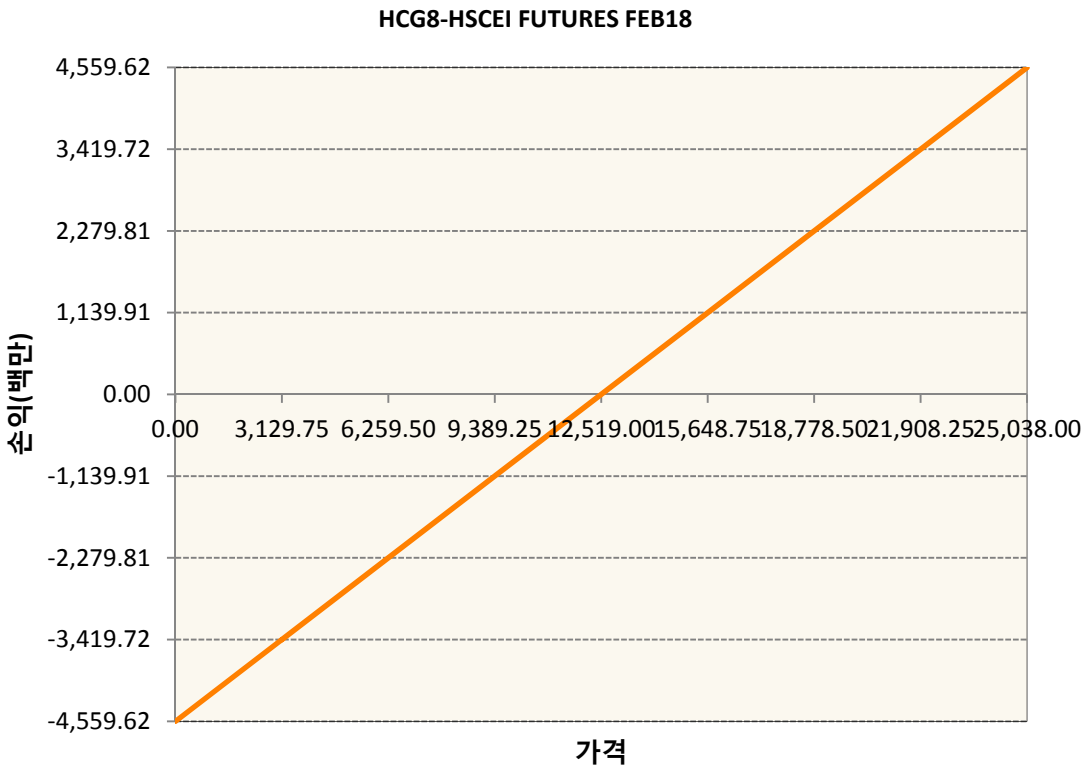
홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생

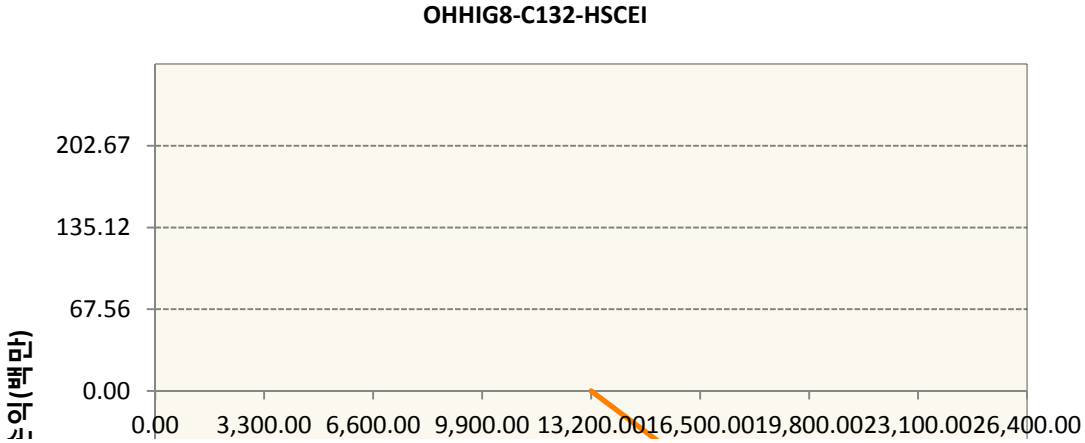
1. 계약금액

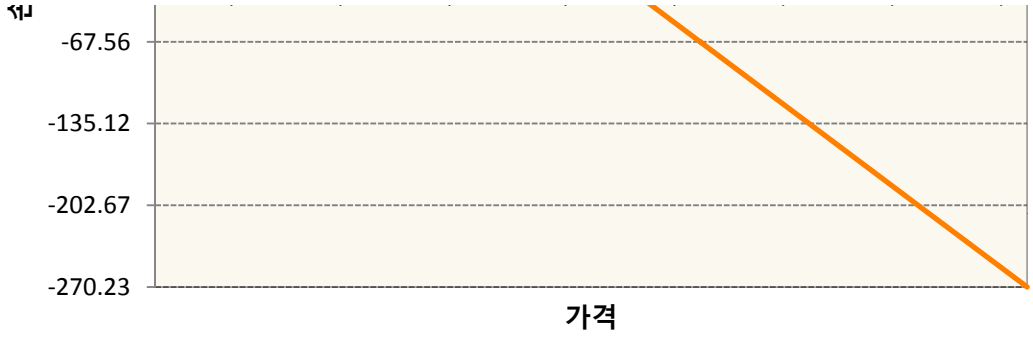
(단위:백만원)

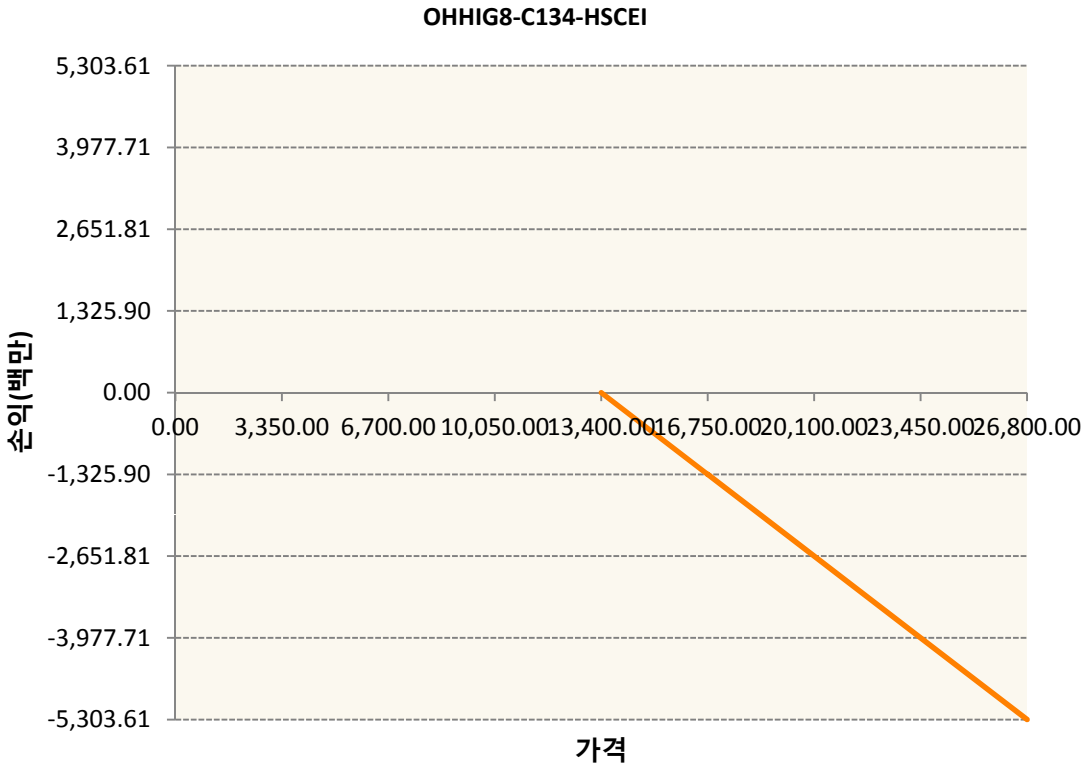
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	4,560	0	4,560	장내
누계	유가증권	옵션	0	11,148	-11,148	장내

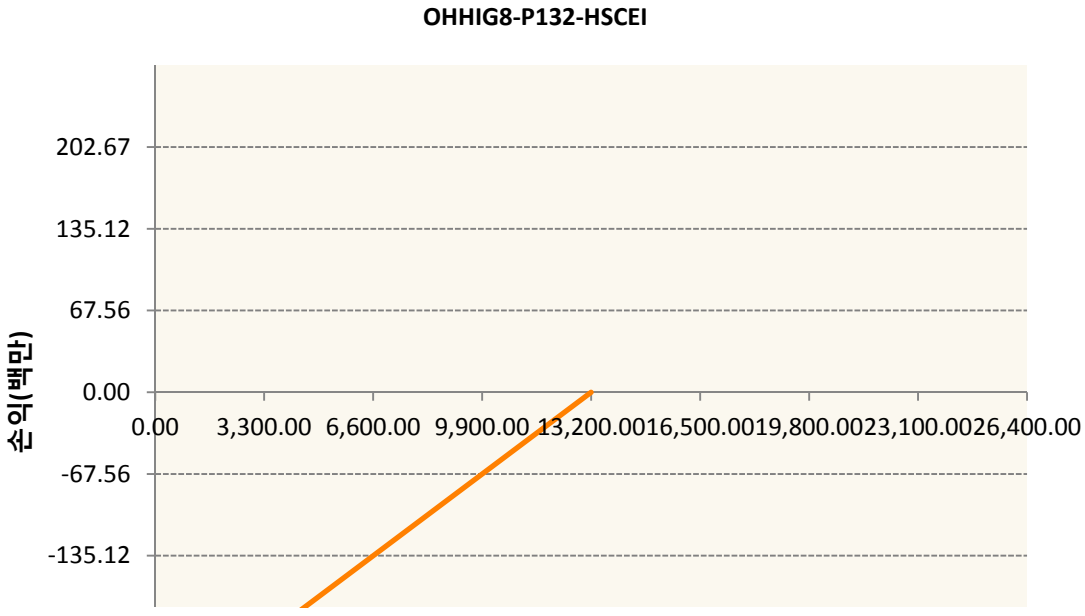
2. 만기시점의 손익구조

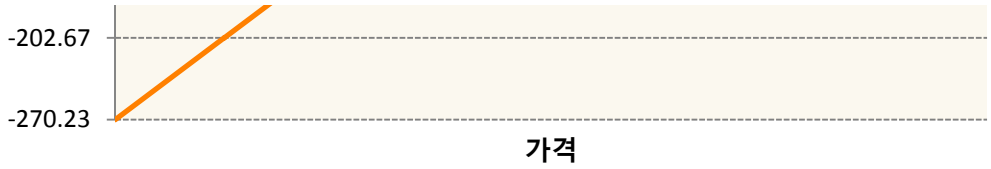


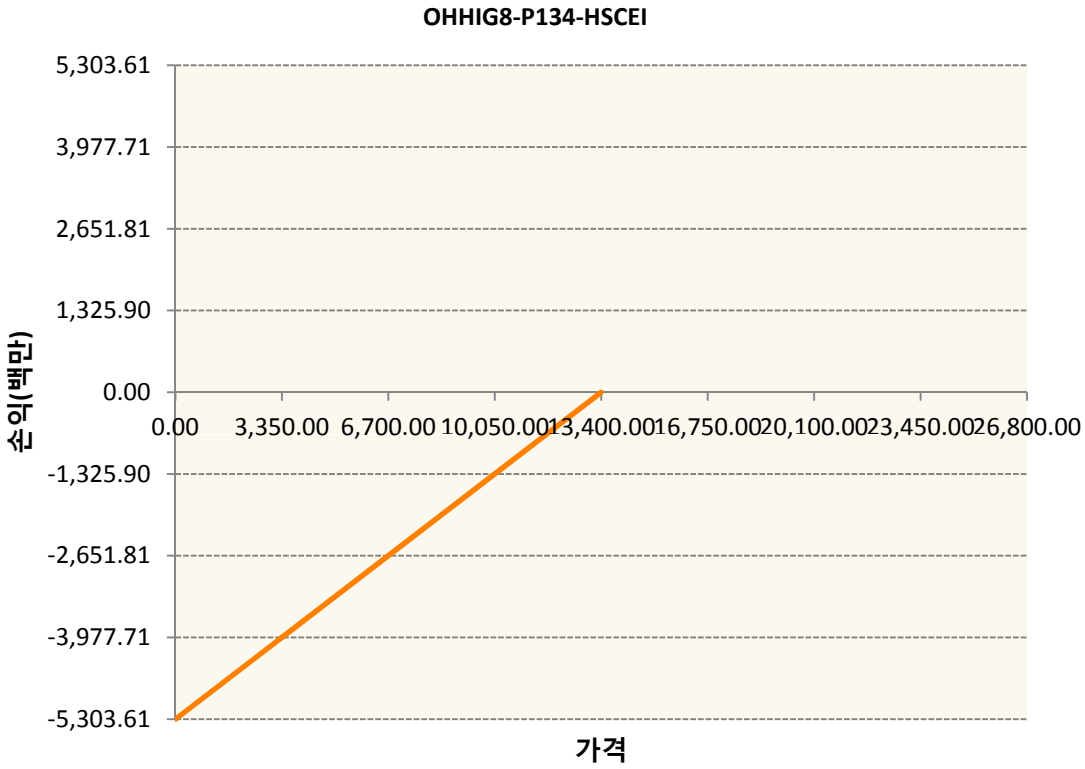



-67.56
-135.12
-202.67
-270.23
가격


OHHIG8-C134-HSCEI
5,303.61
3,977.71
2,651.81
1,325.90
0.00
-1,325.90
-2,651.81
-3,977.71
-5,303.61
0.00
3,350.00
6,700.00
10,050.00
13,400.00
16,750.00
20,100.00
23,450.00
26,800.00
손익(백만)
가격


OHHIG8-P132-HSCEI
202.67
135.12
67.56
0.00
-67.56
-135.12
0.00
3,300.00
6,600.00
9,900.00
13,200.00
16,500.00
19,800.00
23,100.00
26,400.00
손익(백만)





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)	(단위:백만원)
HCG8 HSCEI FUTURES FEB18	365
OHHIG8-C1: HSCEI	22
OHHIG8-C1: HSCEI	424
OHHIG8-P1: HSCEI	22
OHHIG8-P1: HSCEI	424

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,082

공시일	2018-02-20
기준일	2018-02-19

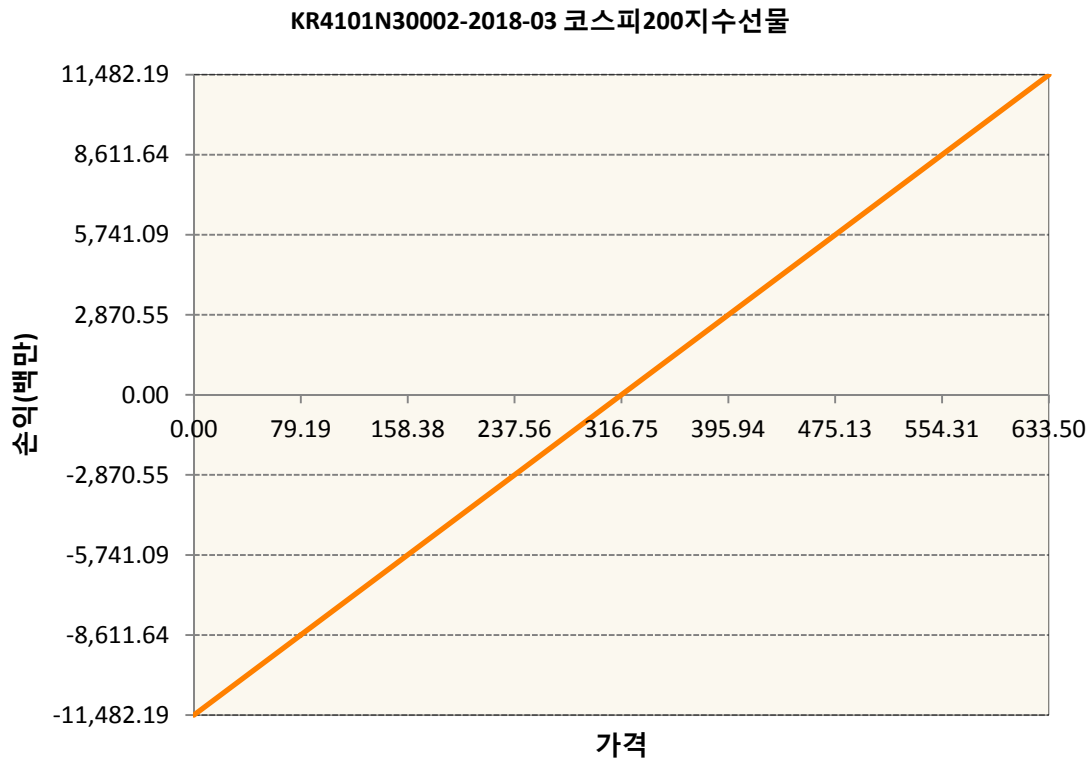
코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼

1. 계약금액

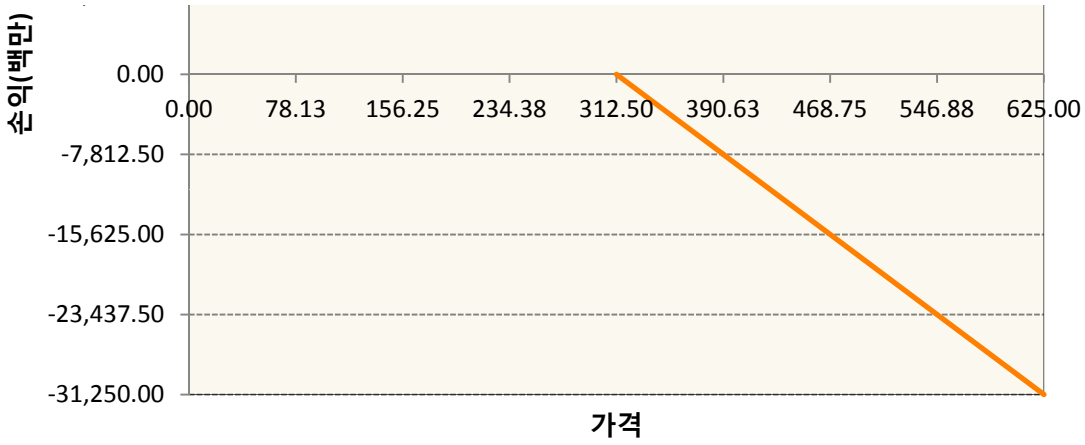
(단위:백만원)

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	11,482	0	11,482	장내
누계	유가증권	스왑	56,200	0	56,200	장외
누계	유가증권	옵션	0	56,094	-56,094	장내

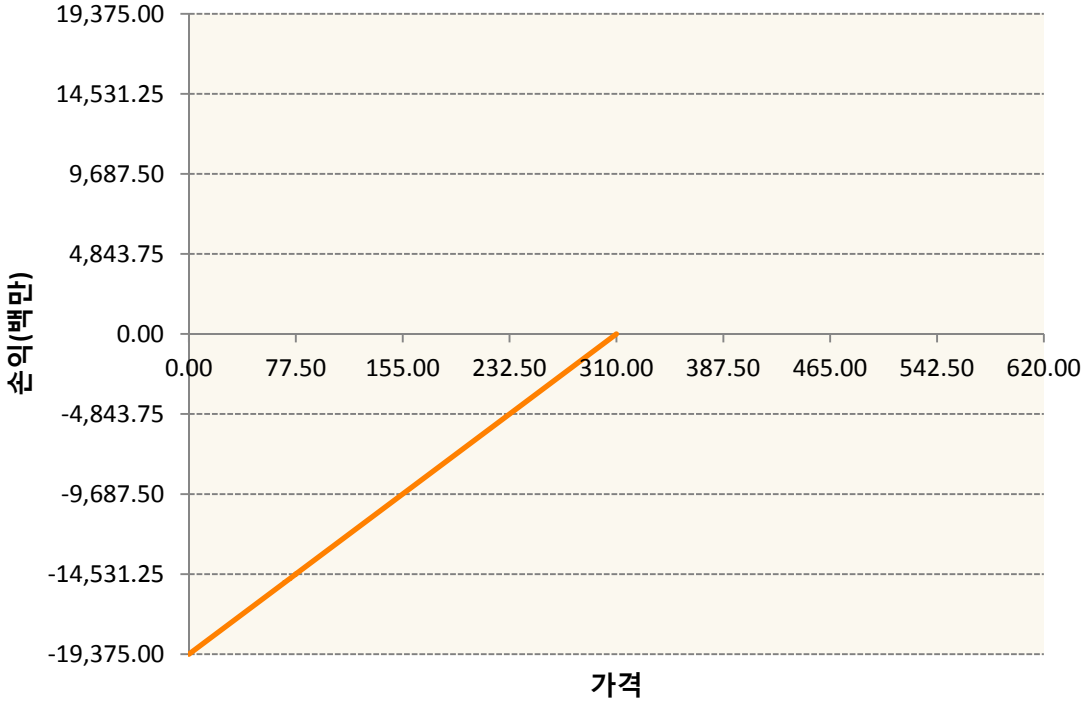
2. 만기시점의 손익구조



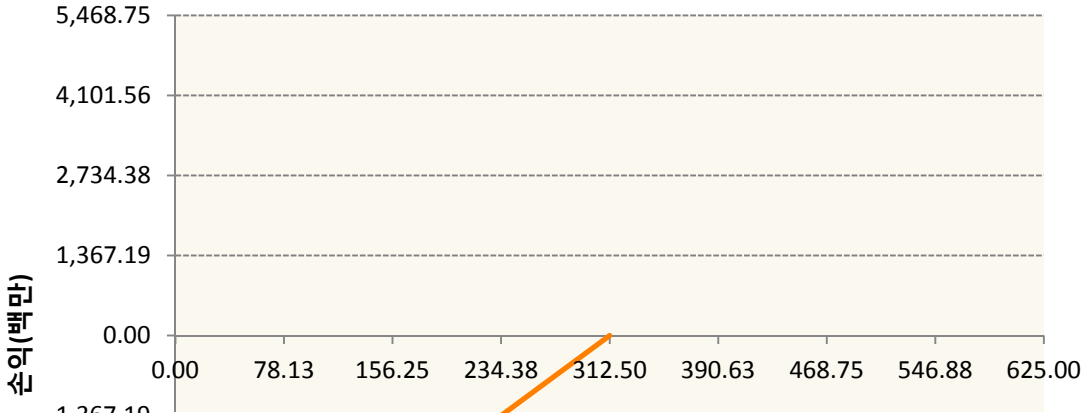




KR4301N33101-2018-03 풋310



KR4301N33127-2018-03 풋312.5





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_2							1,450
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,450	-1,450	-1,450	-1,450	-1,450	-1,450	-1,450
-5.33%	-967	-967	-967	-967	-967	-967	-967
-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%	967	967	967	967	967	967	967
8.00%	1,450	1,450	1,450	1,450	1,450	1,450	1,450
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%	-105	-105	-105	-105	-105	-105	-105
-2.67%	-52	-52	-52	-52	-52	-52	-52
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	52	52	52	52	52	52	52
5.33%	105	105	105	105	105	105	105
8.00%	157	157	157	157	157	157	157
2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_5							235
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%

-8.00%	-235	-235	-235	-235	-235	-235	-235
-5.33%	-157	-157	-157	-157	-157	-157	-157
-2.67%	-78	-78	-78	-78	-78	-78	-78
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	78	78	78	78	78	78	78
5.33%	157	157	157	157	157	157	157
8.00%	235	235	235	235	235	235	235
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_6						196
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-196	-196	-196	-196	-196	-196	-196
-5.33%	-131	-131	-131	-131	-131	-131	-131
-2.67%	-65	-65	-65	-65	-65	-65	-65
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	65	65	65	65	65	65	65
5.33%	131	131	131	131	131	131	131
8.00%	196	196	196	196	196	196	196
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_7						251
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-251	-251	-251	-251	-251	-251	-251
-5.33%	-167	-167	-167	-167	-167	-167	-167
-2.67%	-84	-84	-84	-84	-84	-84	-84
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	84	84	84	84	84	84	84
5.33%	167	167	167	167	167	167	167
8.00%	251	251	251	251	251	251	251
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_8						464
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-464	-464	-464	-464	-464	-464	-464
-5.33%	-309	-309	-309	-309	-309	-309	-309
-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%	309	309	309	309	309	309	309
8.00%	464	464	464	464	464	464	464
	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						627
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-627	-627	-627	-627	-627	-627	-627
-5.33%	-418	-418	-418	-418	-418	-418	-418
-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%	418	418	418	418	418	418	418
8.00%	627	627	627	627	627	627	627
	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%	-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%	470	470	470	470	470	470	470
	KR4101N30(2018-03 코스피200지수선물						918
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-918	-918	-918	-918	-918	-918	-918
-5.33%	-612	-612	-612	-612	-612	-612	-612
-2.67%	-306	-306	-306	-306	-306	-306	-306
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	306	306	306	306	306	306	306
5.33%	612	612	612	612	612	612	612
8.00%	918	918	918	918	918	918	918
	KR4201N331 2018-03 콜312.5						2,109
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	935	916	892	865	834	800	763
-5.33%	841	800	757	711	663	613	563
-2.67%	607	548	490	430	371	311	251
0%	179	120	60	0	-60	-121	-182
2.67%	-435	-479	-526	-575	-626	-679	-732
5.33%	-1,180	-1,204	-1,233	-1,265	-1,302	-1,341	-1,383
8.00%	-1,990	-2,000	-2,014	-2,032	-2,054	-2,080	-2,109
	KR4301N331 2018-03 풋310						1,072

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,036	-1,038	-1,042	-1,048	-1,055	-1,063	-1,072
-5.33%	-537	-550	-564	-580	-597	-614	-633
-2.67%	-146	-170	-194	-218	-242	-266	-290
0%	60	41	21	0	-21	-43	-65
2.67%	122	115	106	96	84	70	56
5.33%	133	131	129	126	121	115	108
8.00%	133	133	133	132	131	129	127
	KR4301N3312018-03 풋312.5						326

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-319	-319	-320	-321	-322	-324	-326
-5.33%	-176	-178	-181	-185	-189	-193	-197
-2.67%	-54	-60	-67	-73	-80	-86	-93
0%	19	13	6	0	-7	-13	-20
2.67%	46	43	40	36	31	27	22
5.33%	51	51	50	48	46	44	42
8.00%	52	52	52	51	51	50	49

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

4,117

공시일	2018-02-20
기준일	2018-02-19

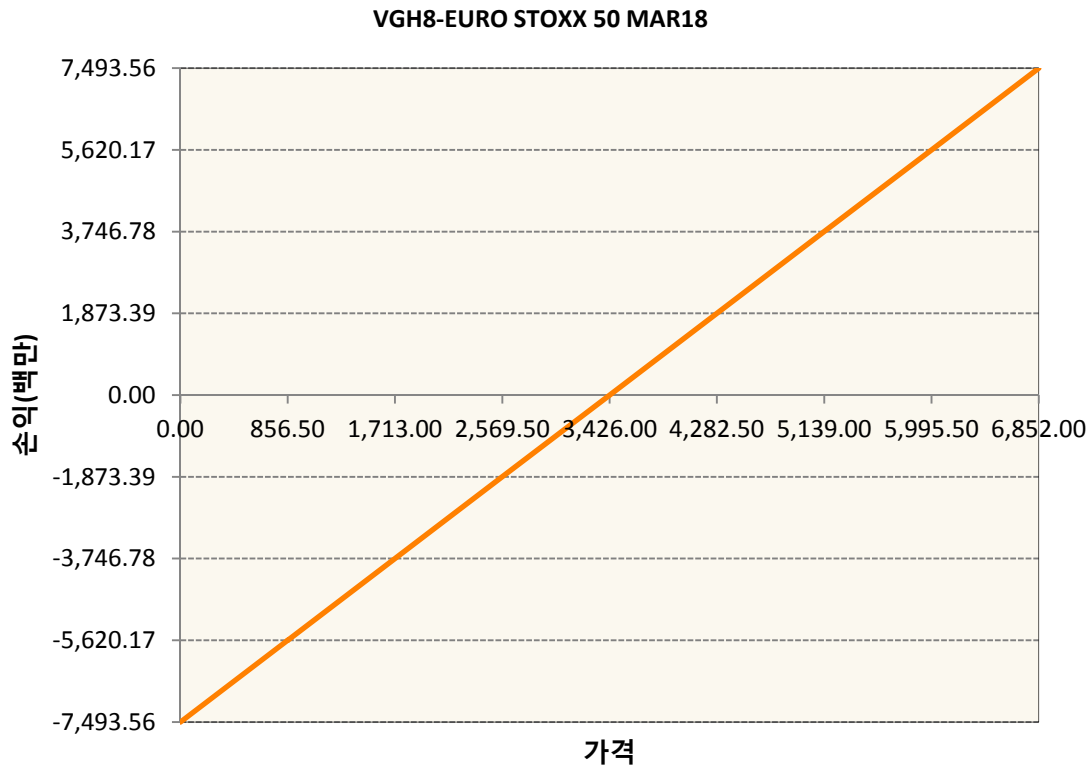
유로커버드콜모(주식혼합-파생형

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	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	7,494	0	7,494	
누계	유가증권	스왑	99,343	0	99,343	장외
누계	지수	스왑	52,984	0	52,984	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

260105SGPX	SG EURO Covered CALL STRATEGY - 994.569	215
260105SQPX	SG EURO Covered CALL STRATEGY	403
VGH8	EURO STOXX 50 MAR18	599

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

756

공시일	2018-02-20
기준일	2018-02-19

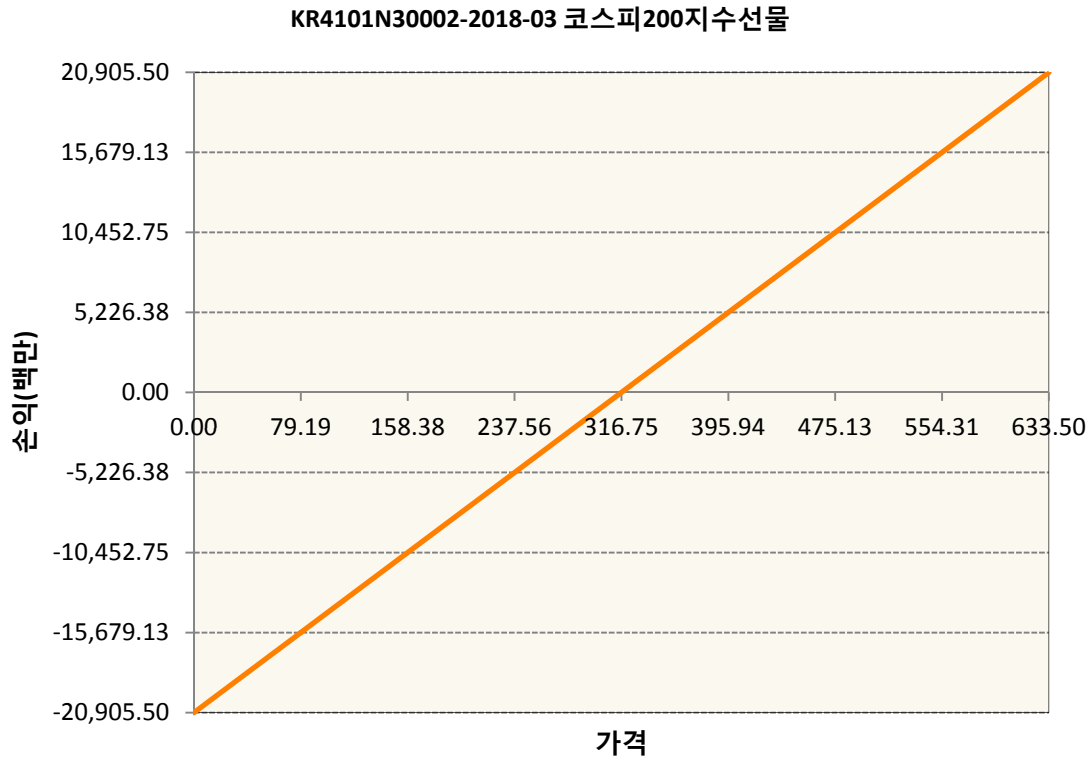
ETF스마트레버리지목표전환형8호

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	20,906	0	20,906	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101N30(2018-03 코스피200지수선물							1,672
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,672	-1,672	-1,672	-1,672	-1,672	-1,672	-1,672
-5.33%	-1,114	-1,114	-1,114	-1,114	-1,114	-1,114	-1,114
-2.67%	-557	-557	-557	-557	-557	-557	-557
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	557	557	557	557	557	557	557
5.33%	1,114	1,114	1,114	1,114	1,114	1,114	1,114
8.00%	1,672	1,672	1,672	1,672	1,672	1,672	1,672

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

1,104

공시일	2018-02-20
기준일	2018-02-19

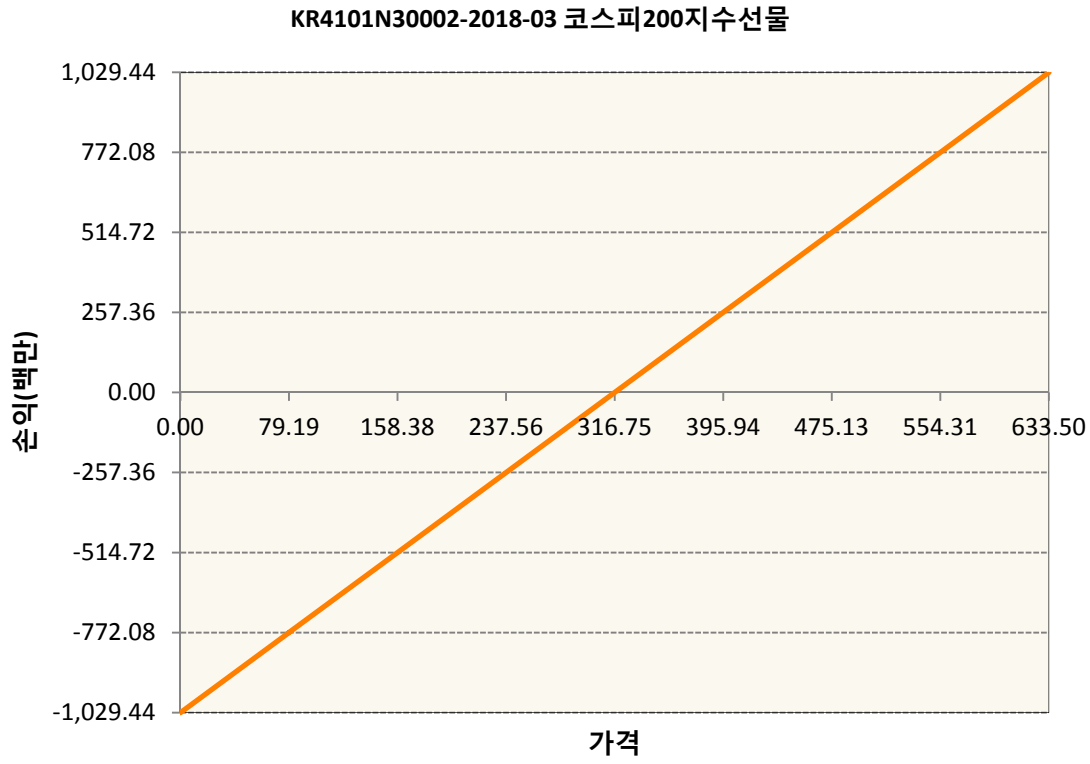
ETF스마트레버리지목표전환형9호

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	1,029	0	1,029	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101N30(2018-03 코스피200지수선물							82
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-82	-82	-82	-82	-82	-82	-82
-5.33%	-55	-55	-55	-55	-55	-55	-55
-2.67%	-27	-27	-27	-27	-27	-27	-27
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	27	27	27	27	27	27	27
5.33%	55	55	55	55	55	55	55
8.00%	82	82	82	82	82	82	82

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

54

공시일	2018-02-20
기준일	2018-02-19

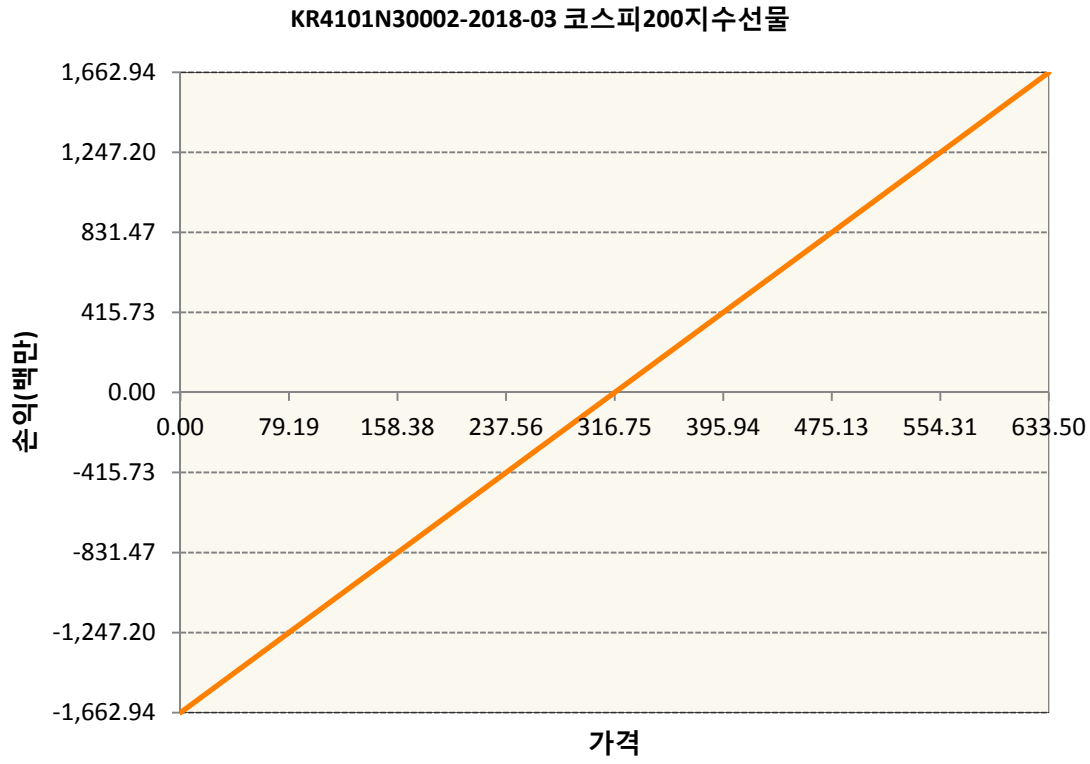
ETF스마트레버리지목표전환형10

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	1,663	0	1,663	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101N30(2018-03 코스피200지수선물							133
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-133	-133	-133	-133	-133	-133	-133
-5.33%	-89	-89	-89	-89	-89	-89	-89
-2.67%	-44	-44	-44	-44	-44	-44	-44
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	44	44	44	44	44	44	44
5.33%	89	89	89	89	89	89	89
8.00%	133	133	133	133	133	133	133

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

88

공시일	2018-02-20
기준일	2018-02-19

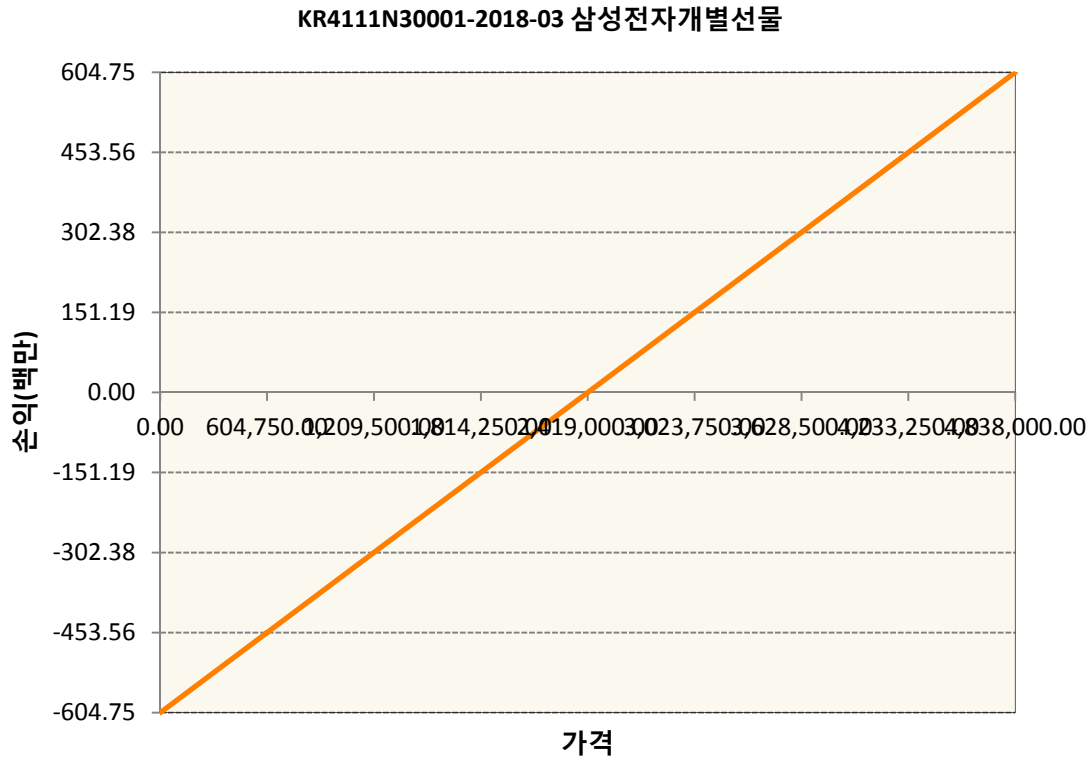
스마트KRX300인덱스1호(주식-파

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	219	0	219	장내
누계	유가증권	선물	605	0	605	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4111N30(2018-03 삼성전자개별선물							48
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-48	-48	-48	-48	-48	-48	-48
-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%	48	48	48	48	48	48	48

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

58

공시일	2018-02-20
기준일	2018-02-19

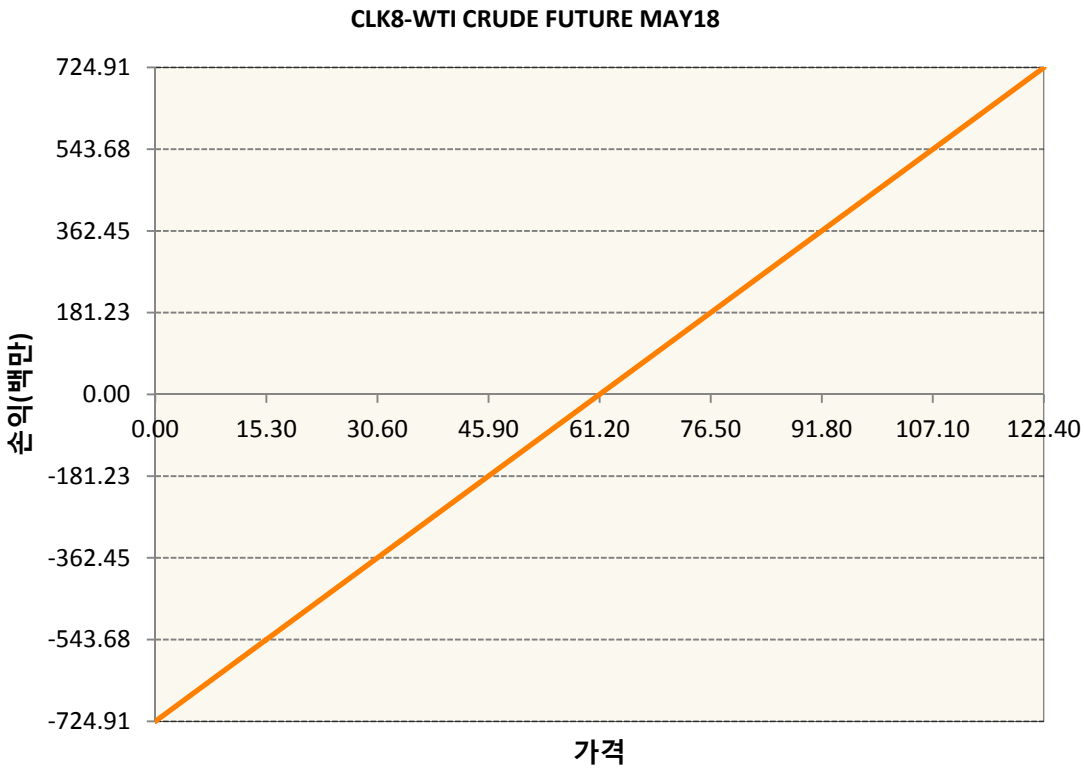
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

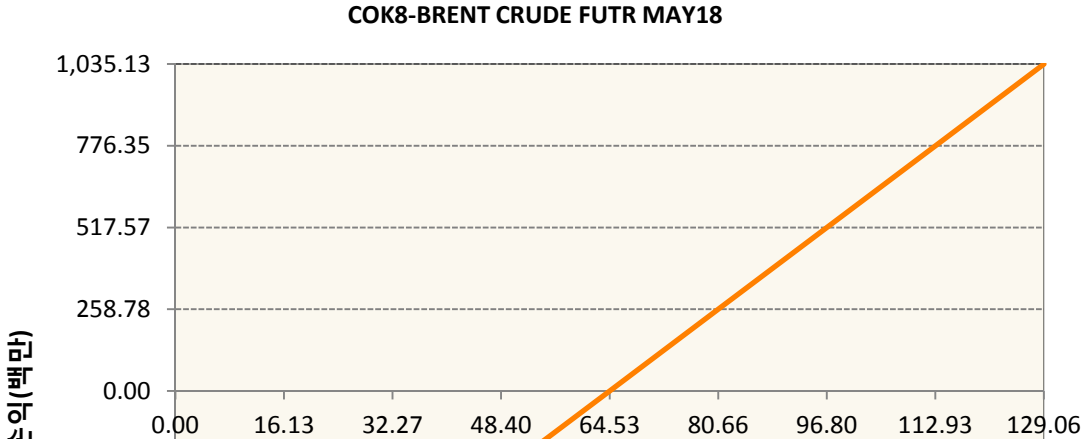
1. 계약금액

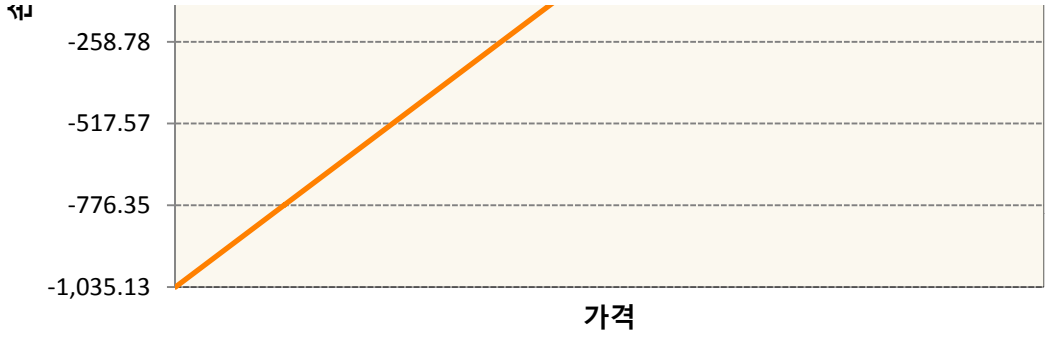
(단위:백만원)

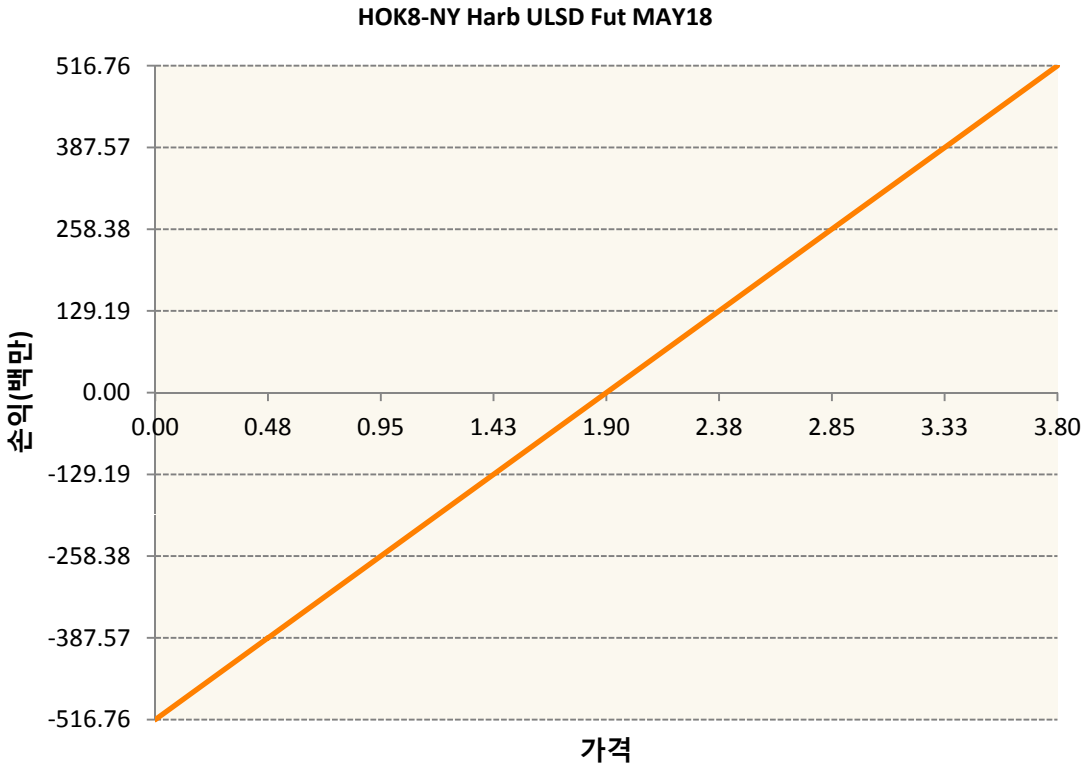
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	선물	유가증권	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	선물	유가증권	725	0	725	
누계	유가증권	선물	3,188	586	2,601	

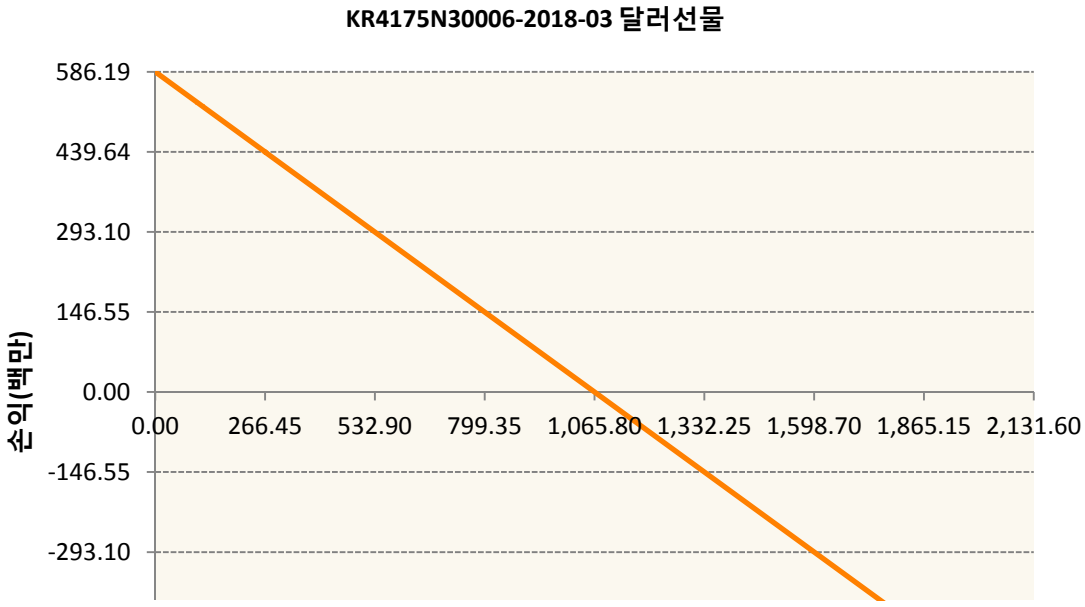
2. 만기시점의 손익구조

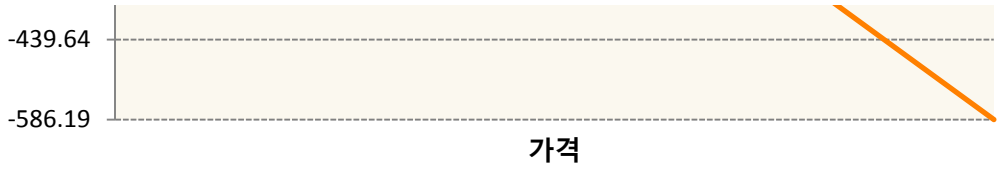


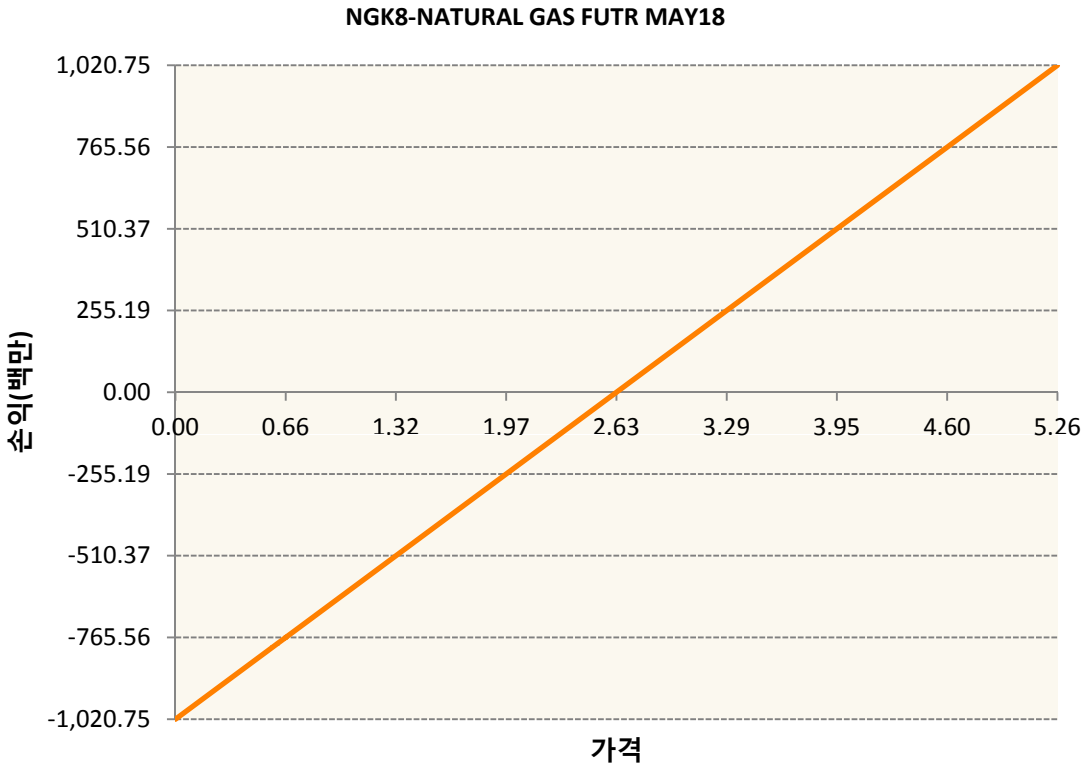


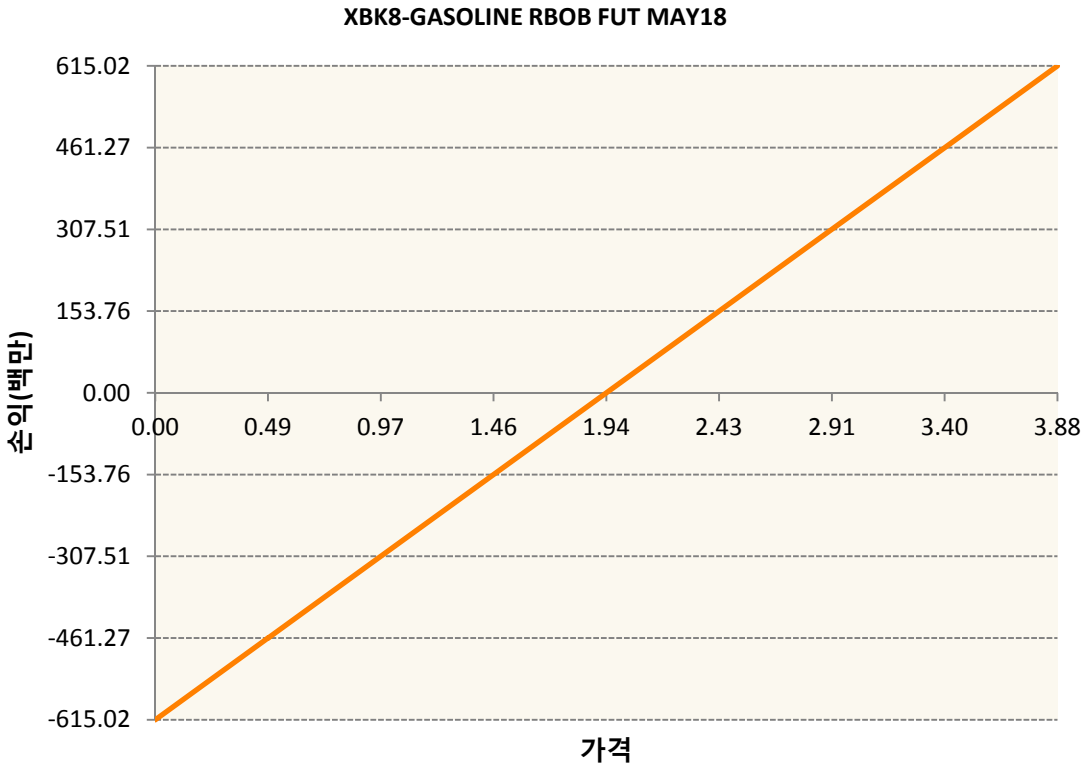

-258.78
-517.57
-776.35
-1,035.13
가격


HOK8-NY Harb ULSD Fut MAY18
516.76
387.57
258.38
129.19
0.00
-129.19
-258.38
-387.57
-516.76
0.00
0.48
0.95
1.43
1.90
2.38
2.85
3.33
3.80
손익(백만)
가격


KR4175N30006-2018-03 달러선물
586.19
439.64
293.10
146.55
0.00
-146.55
-293.10
0.00
266.45
532.90
799.35
1,065.80
1,332.25
1,598.70
1,865.15
2,131.60
손익(백만)


-439.64
-586.19
가격


NGK8-NATURAL GAS FUTR MAY18
1,020.75
765.56
510.37
255.19
0.00
-255.19
-510.37
-765.56
-1,020.75
0.00
0.66
1.32
1.97
2.63
3.29
3.95
4.60
5.26
손익(백만)
가격


XBK8-GASOLINE RBOB FUT MAY18
615.02
461.27
307.51
153.76
0.00
-153.76
-307.51
-461.27
-615.02
0.00
0.49
0.97
1.46
1.94
2.43
2.91
3.40
3.88
손익(백만)
가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLK8	WTI CRUDE FUTURE MAY18	58
COK8	BRENT CRUDE FUTR MAY18	83
HOK8	NY Harb ULSD Fut MAY18	41
KR4175N30(	2018-03 달러선물	47
NGK8	NATURAL GAS FUTR MAY18	82
XBK8	GASOLINE RBOB FUT MAY18	49

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

519

공시일	2018-02-20
기준일	2018-02-19

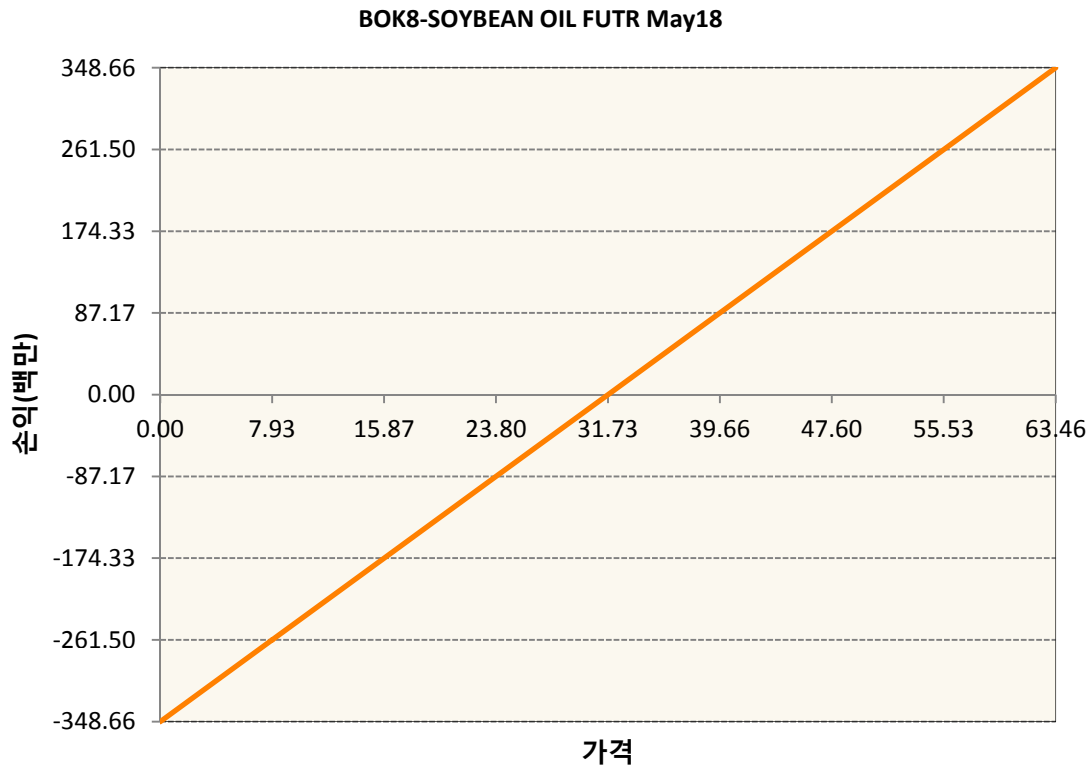
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

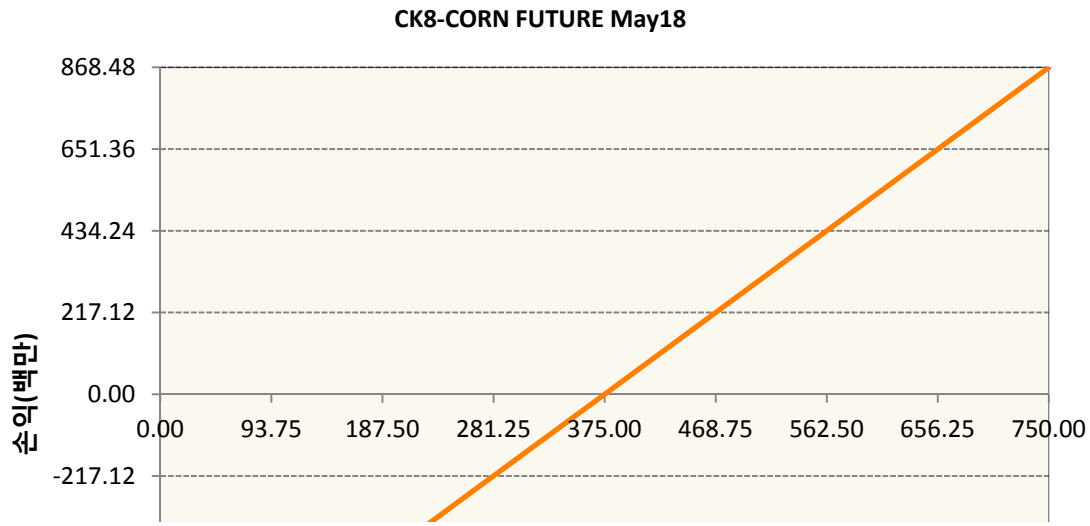
1. 계약금액

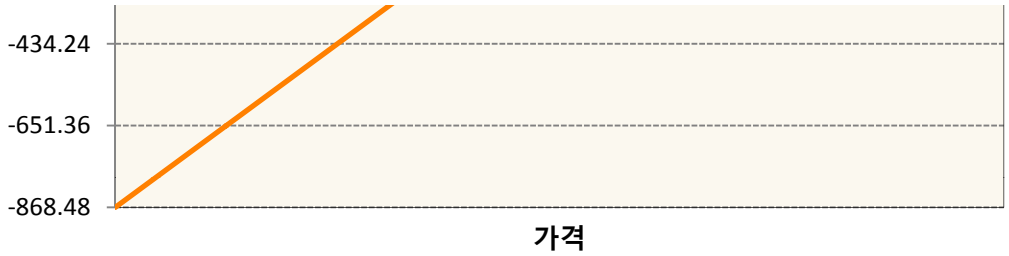
(단위:백만원)

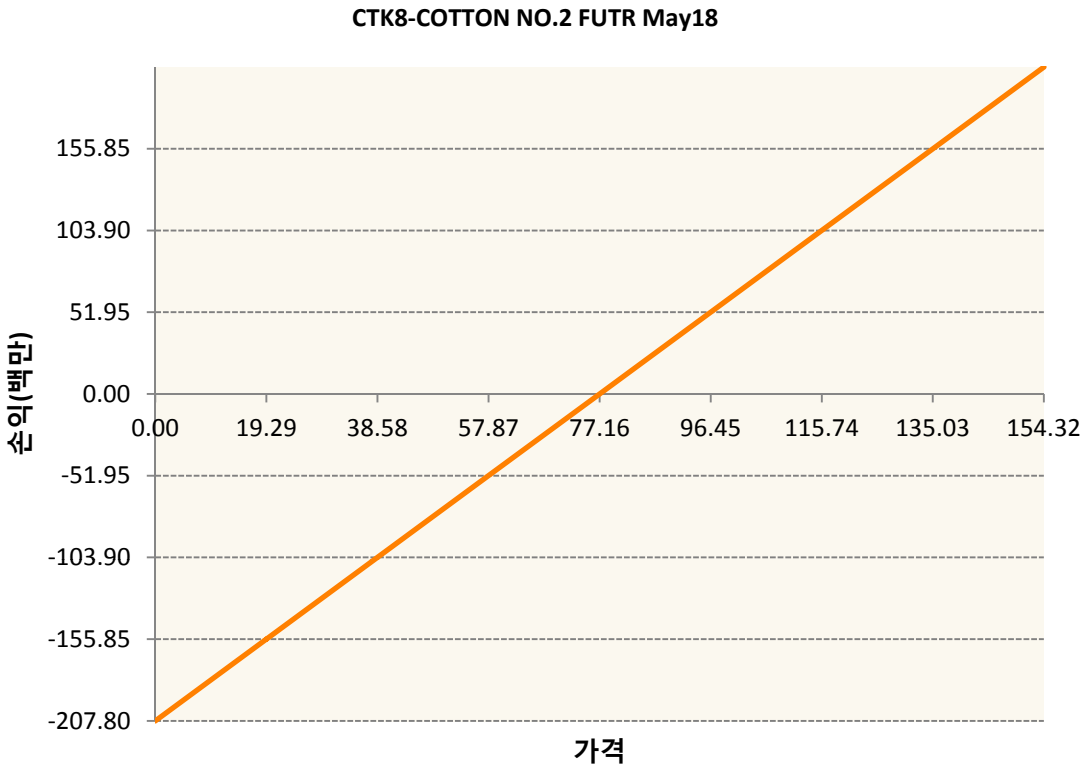
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	4,113	320	3,794	

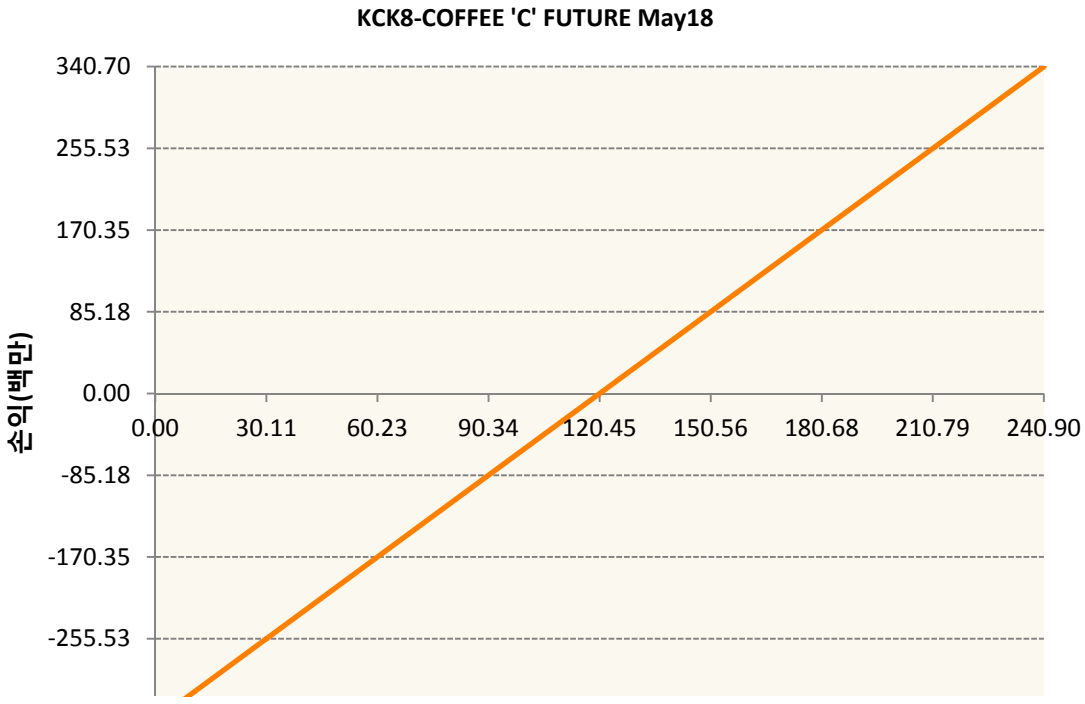
2. 만기시점의 손익구조

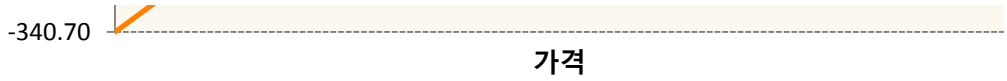


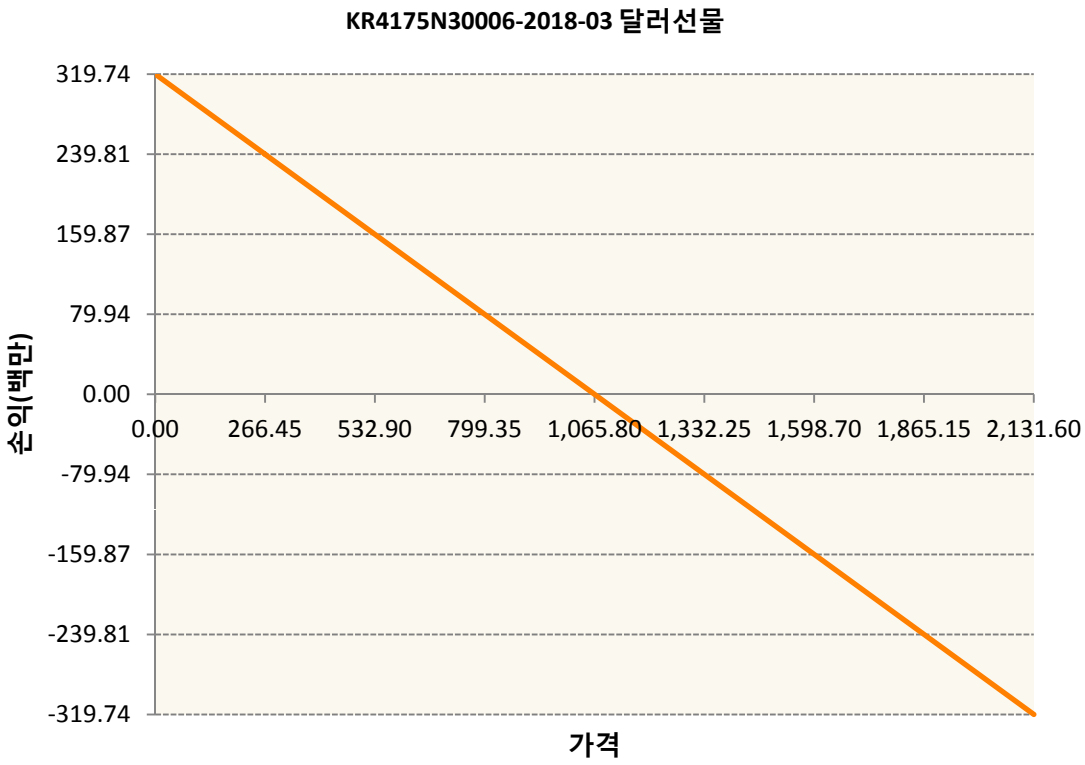


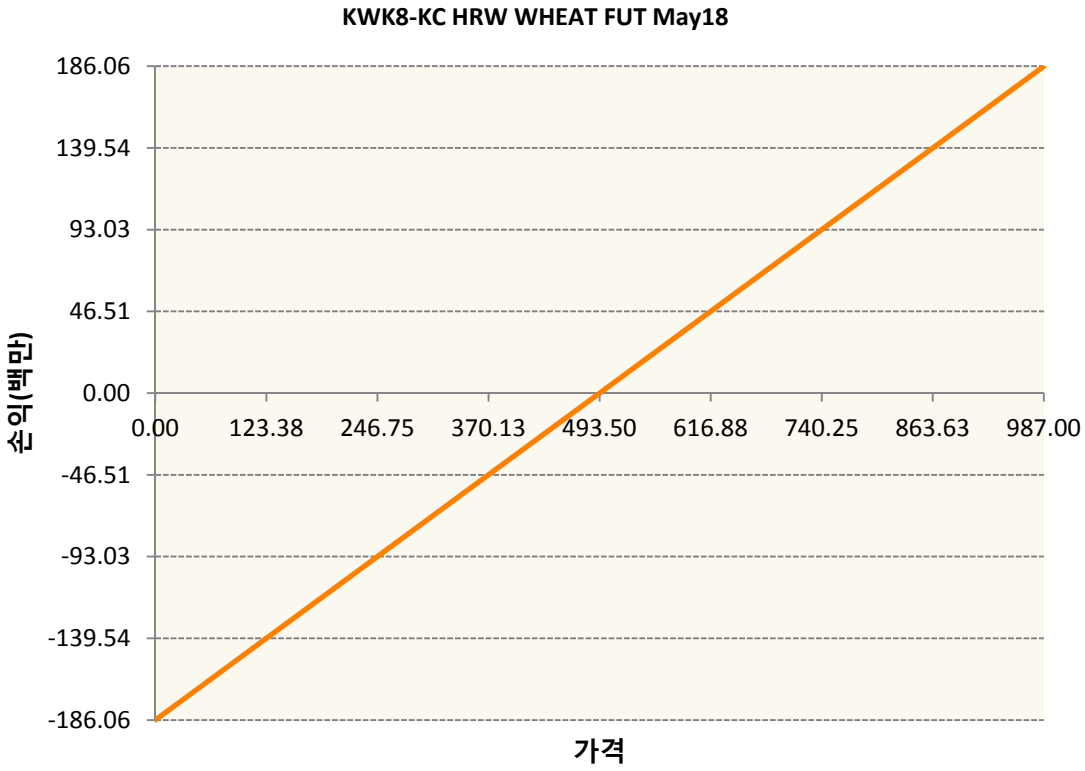

-434.24
-651.36
-868.48
가격


CTK8-COTTON NO.2 FUTR May18
155.85
103.90
51.95
0.00
-51.95
-103.90
-155.85
-207.80
0.00
19.29
38.58
57.87
77.16
96.45
115.74
135.03
154.32
손익(백만)
가격

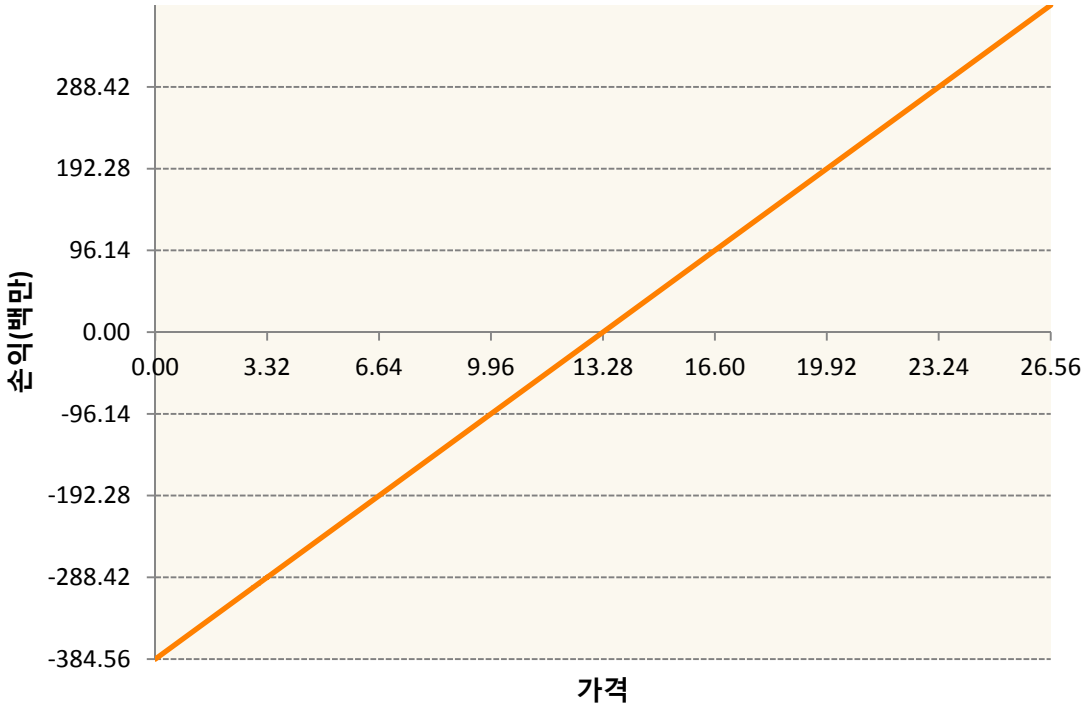

KCK8-COFFEE 'C' FUTURE May18
340.70
255.53
170.35
85.18
0.00
-85.18
-170.35
-255.53
0.00
30.11
60.23
90.34
120.45
150.56
180.68
210.79
240.90
손익(백만)


-340.70
가격

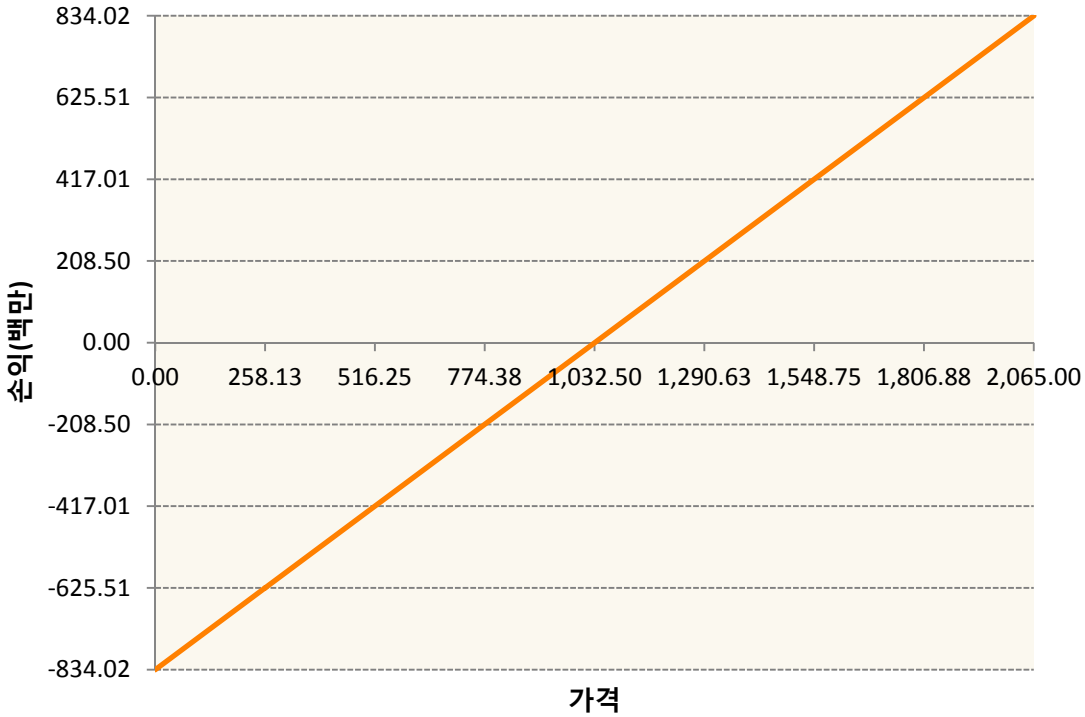

KR4175N30006-2018-03 달러선물
319.74
239.81
159.87
79.94
0.00
-79.94
-159.87
-239.81
-319.74
0.00
266.45
532.90
799.35
1,065.80
1,332.25
1,598.70
1,865.15
2,131.60
손익(백만)
가격


KWK8-KC HRW WHEAT FUT May18
186.06
139.54
93.03
46.51
0.00
-46.51
-93.03
-139.54
-186.06
0.00
123.38
246.75
370.13
493.50
616.88
740.25
863.63
987.00
손익(백만)
가격

SBK8-SUGAR #11 (WORLD) May18

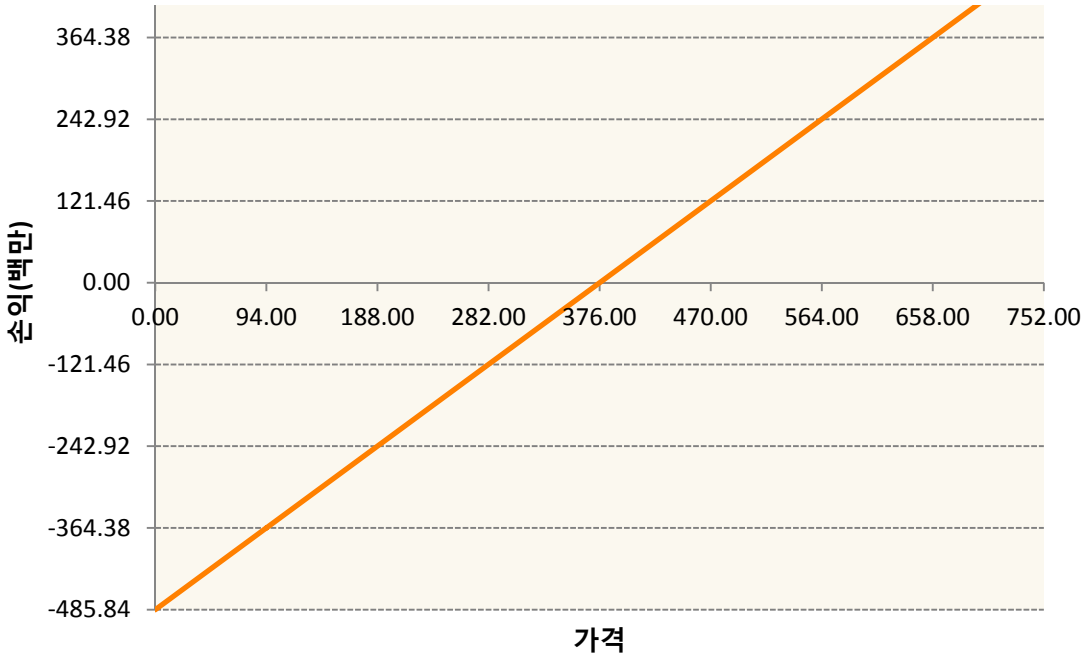


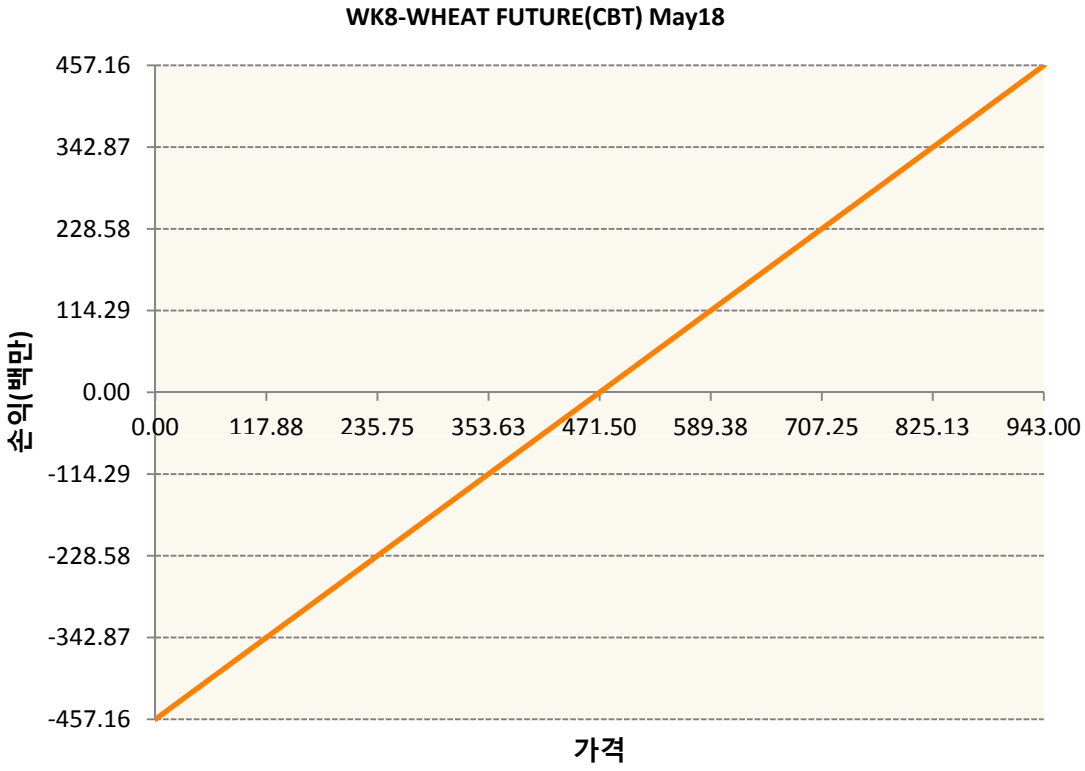
SK8-SOYBEAN FUTRUE May18



SMK8-SOYBEAN MEAL FUTR May18







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

BOK8	SOYBEAN OIL FUTR May18	28
CK8	CORN FUTURE May18	69
CTK8	COTTON NO.2 FUTR May18	17
KCK8	COFFEE 'C' FUTURE May18	27
KR4175N30(	2018-03 달러선물	26

KWK8	KC HRW WHEAT FUT May18	15
SBK8	SUGAR #11 (WORLD) May18	31
SK8	SOYBEAN FUTRUE May18	67
SMK8	SOYBEAN MEAL FUTR May18	39
WK8	WHEAT FUTURE(CBT) May18	37

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

337