공시일	2018-02-22
기준일	2018-02-21

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	2018-02-22
기준일	2018-02-21

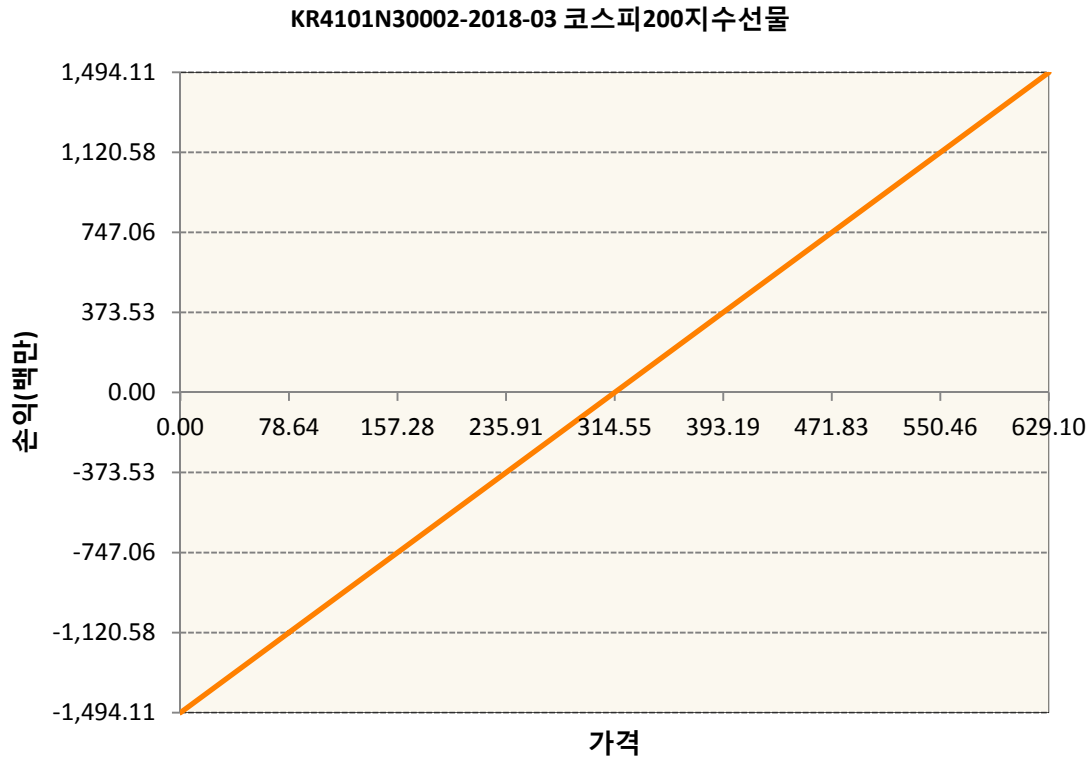
스마트인덱스모

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	1,494	0	1,494	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101N30(2018-03 코스피200지수선물							119
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-119	-119	-119	-119	-119	-119	-119
-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%	119	119	119	119	119	119	119

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

79

공시일	2018-02-22
기준일	2018-02-21

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	1,114

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

406

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2018-02-22
기준일	2018-02-21

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)

378

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2018-02-22
기준일	2018-02-21

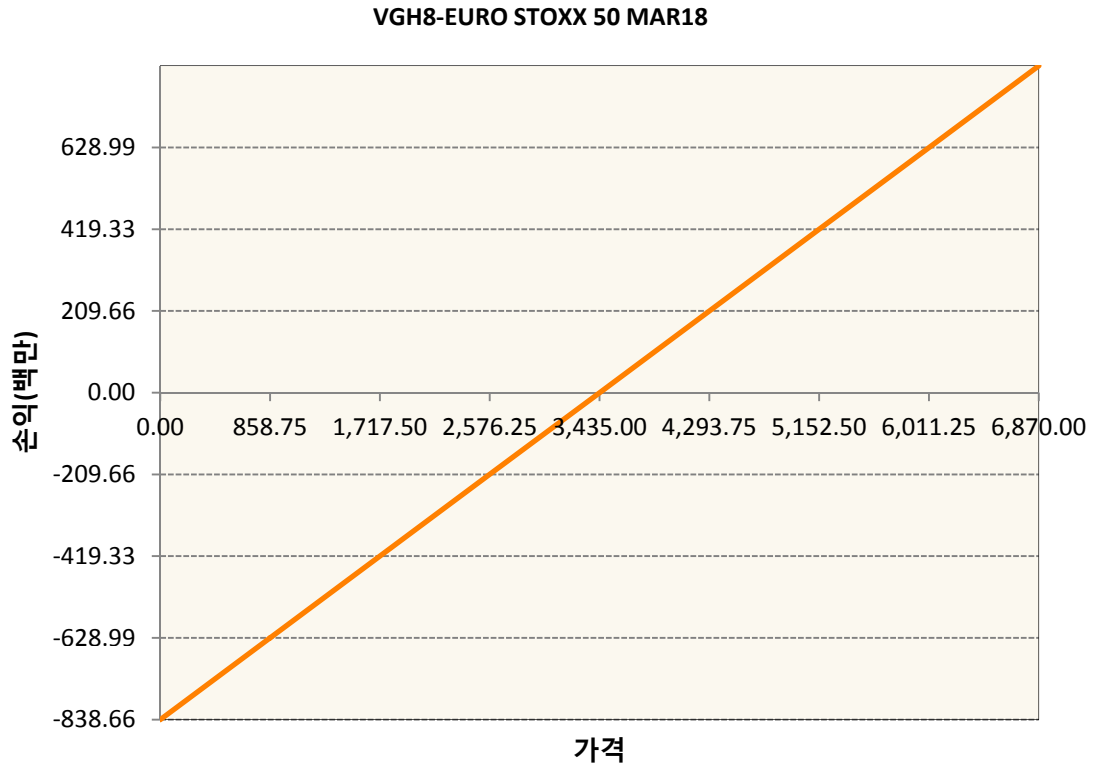
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	839	0	839	

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	2018-02-22
기준일	2018-02-21

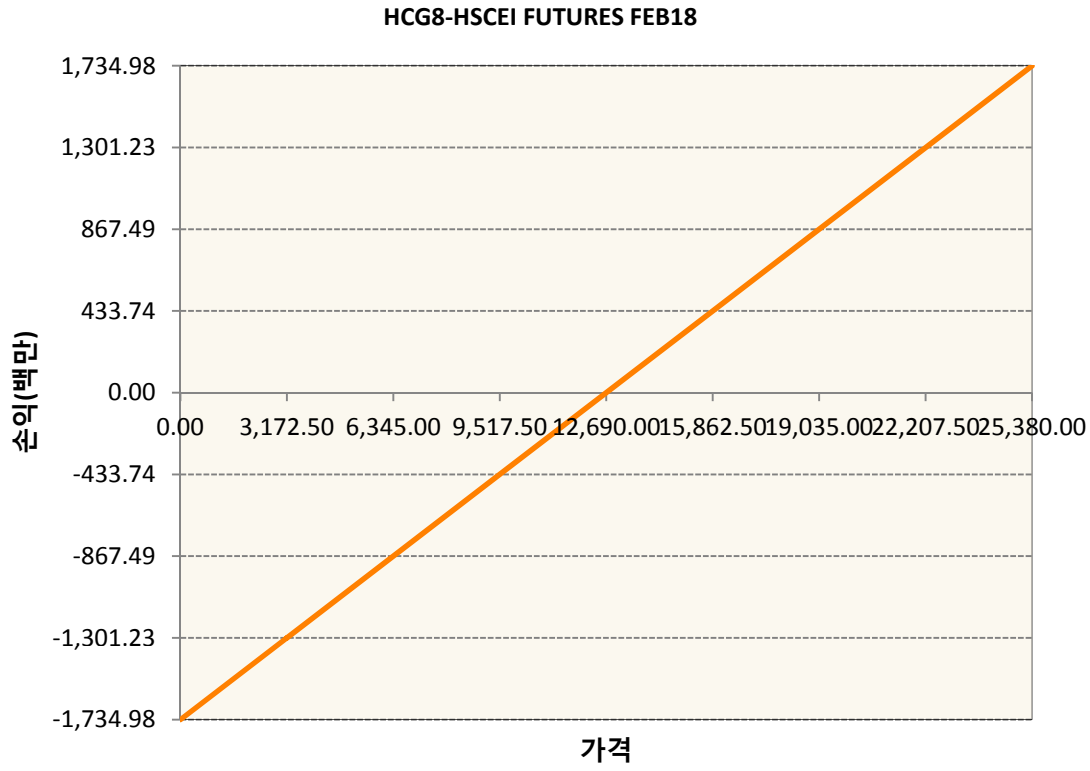
차이나인덱스모(주식-파생형)

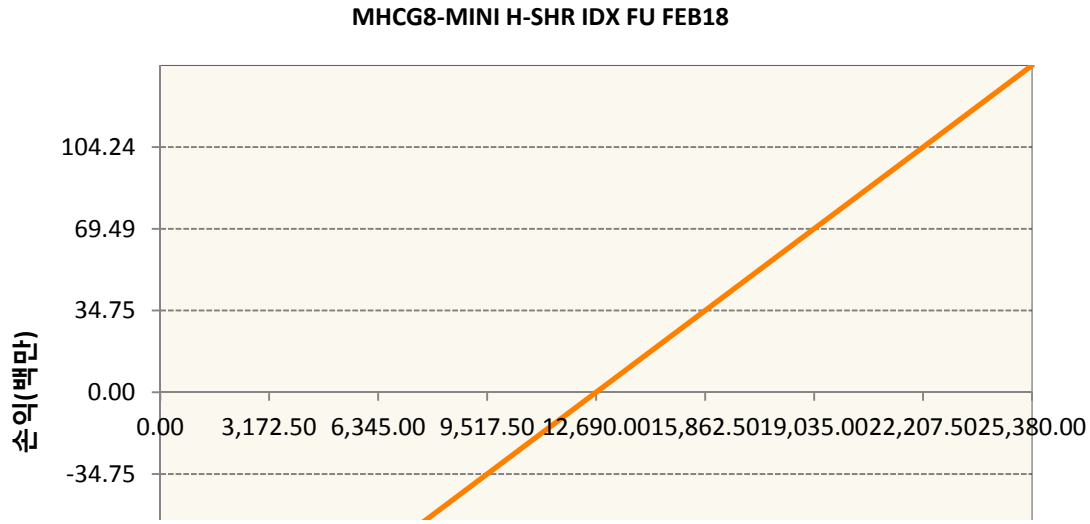
1. 계약금액

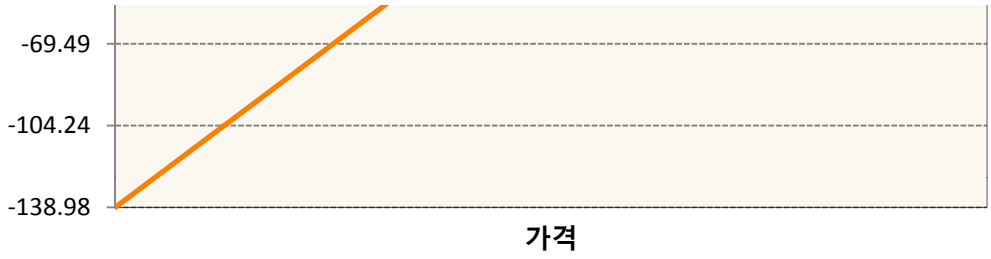
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,874	0	1,874	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCG8	HSCEI FUTURES FEB18	139
MHCG8	MINI H-SHR IDX FU FEB18	11

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

공시일	2018-02-22
기준일	2018-02-21

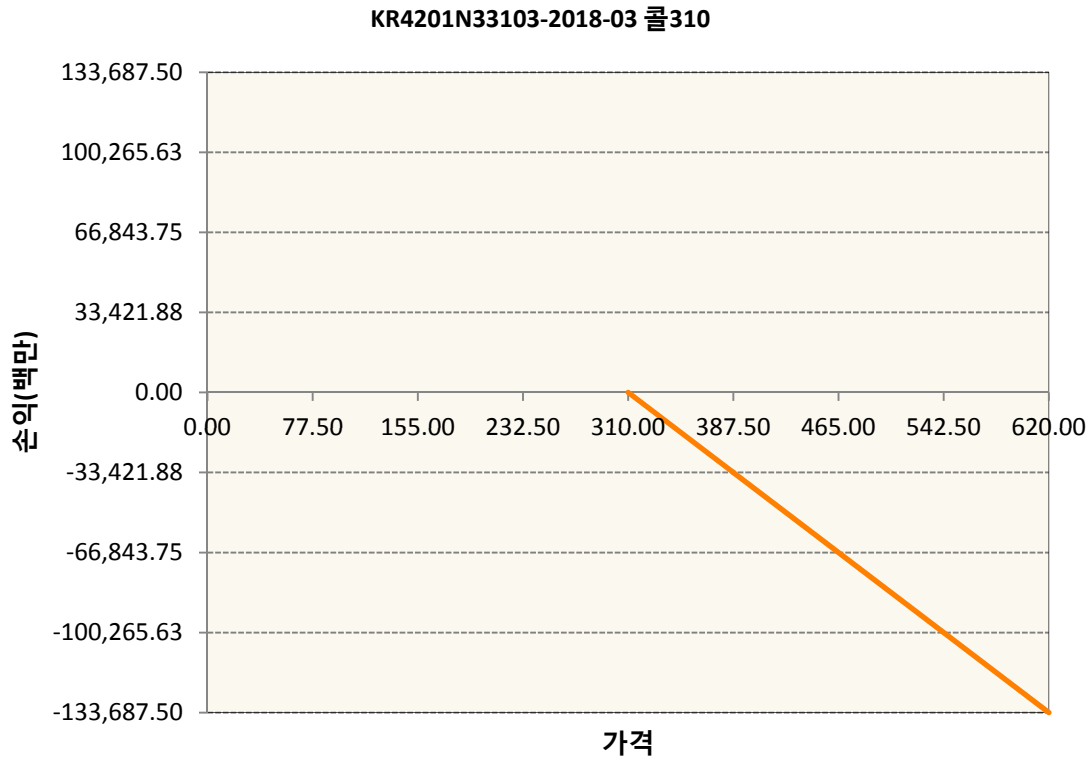
커버드콜모(주식혼합-파생형)

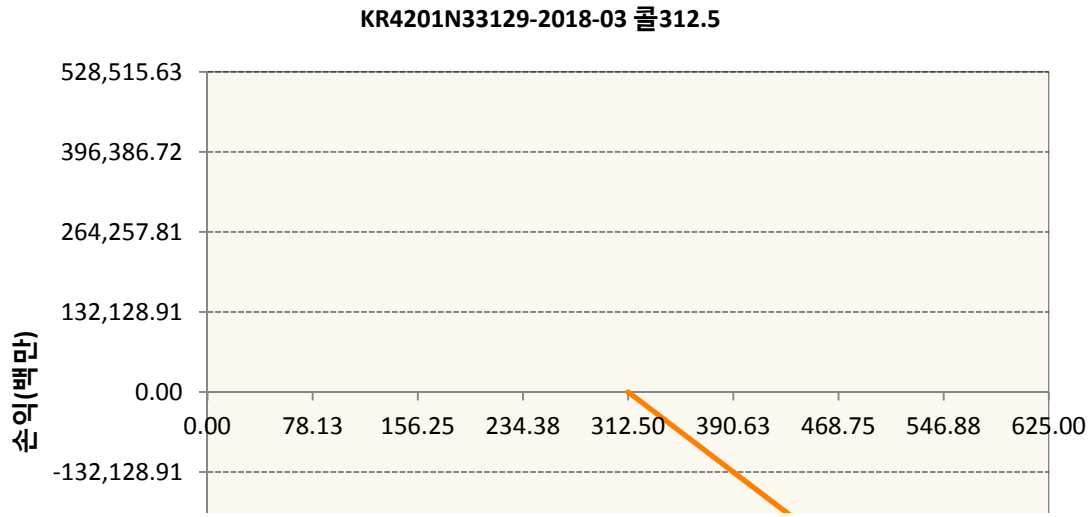
1. 계약금액

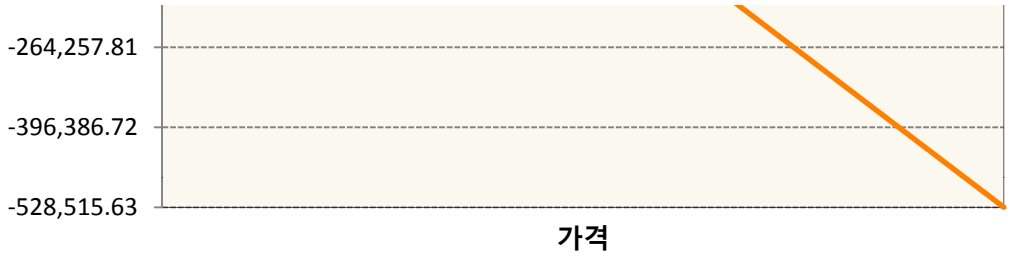
(단위:백만원)

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

2. 만기시점의 손익구조

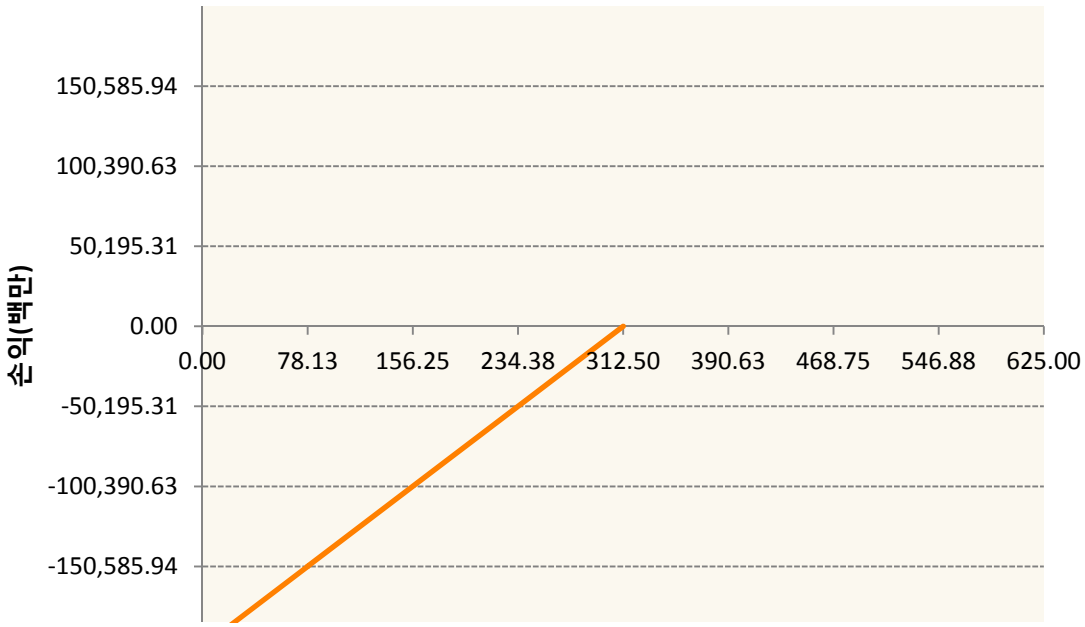






KR4301N33101-2018-03 풋310

KR4301N33127-2018-03 풋312.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201N3312018-03 콜310							9,161
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	3,939	3,870	3,783	3,681	3,564	3,435	3,295
-5.33%	3,568	3,410	3,240	3,059	2,870	2,675	2,474
-2.67%	2,581	2,346	2,110	1,872	1,633	1,393	1,153
0%	711	476	239	0	-240	-482	-724
2.67%	-2,000	-2,163	-2,339	-2,526	-2,722	-2,925	-3,134
5.33%	-5,258	-5,339	-5,438	-5,555	-5,686	-5,831	-5,986
8.00%	-8,766	-8,796	-8,839	-8,898	-8,972	-9,060	-9,161
KR4201N3312018-03 콜312.5							34,549
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	13,227	13,026	12,760	12,432	12,047	11,610	11,127
-5.33%	12,198	11,681	11,104	10,478	9,809	9,107	8,376
-2.67%	9,166	8,304	7,424	6,531	5,628	4,716	3,798
0%	2,903	1,937	969	0	-970	-1,941	-2,913
2.67%	-6,820	-7,569	-8,357	-9,175	-10,017	-10,879	-11,756
5.33%	-19,071	-19,484	-19,970	-20,518	-21,118	-21,765	-22,450
8.00%	-32,614	-32,781	-33,013	-33,309	-33,667	-34,082	-34,549
KR4301N3312018-03 풋310							15,404
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-15,152	-15,165	-15,187	-15,221	-15,268	-15,329	-15,404
-5.33%	-8,340	-8,440	-8,561	-8,702	-8,859	-9,031	-9,215
-2.67%	-2,549	-2,816	-3,088	-3,364	-3,643	-3,925	-4,208
0%	804	542	273	0	-277	-558	-841
2.67%	1,862	1,760	1,636	1,492	1,330	1,153	963
5.33%	2,024	2,007	1,979	1,936	1,878	1,805	1,717
8.00%	2,036	2,035	2,031	2,024	2,011	1,990	1,961
KR4301N3312018-03 풋312.5							12,797
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-12,670	-12,675	-12,684	-12,699	-12,723	-12,755	-12,797
-5.33%	-7,347	-7,395	-7,459	-7,538	-7,631	-7,736	-7,853
-2.67%	-2,533	-2,706	-2,888	-3,078	-3,273	-3,473	-3,677
0%	683	456	229	0	-229	-459	-689
2.67%	1,929	1,813	1,681	1,535	1,378	1,212	1,038

5.33%	2,173	2,147	2,109	2,057	1,992	1,914	1,822
8.00%	2,195	2,193	2,187	2,176	2,159	2,134	2,100

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

74,458

공시일	2018-02-22
기준일	2018-02-21

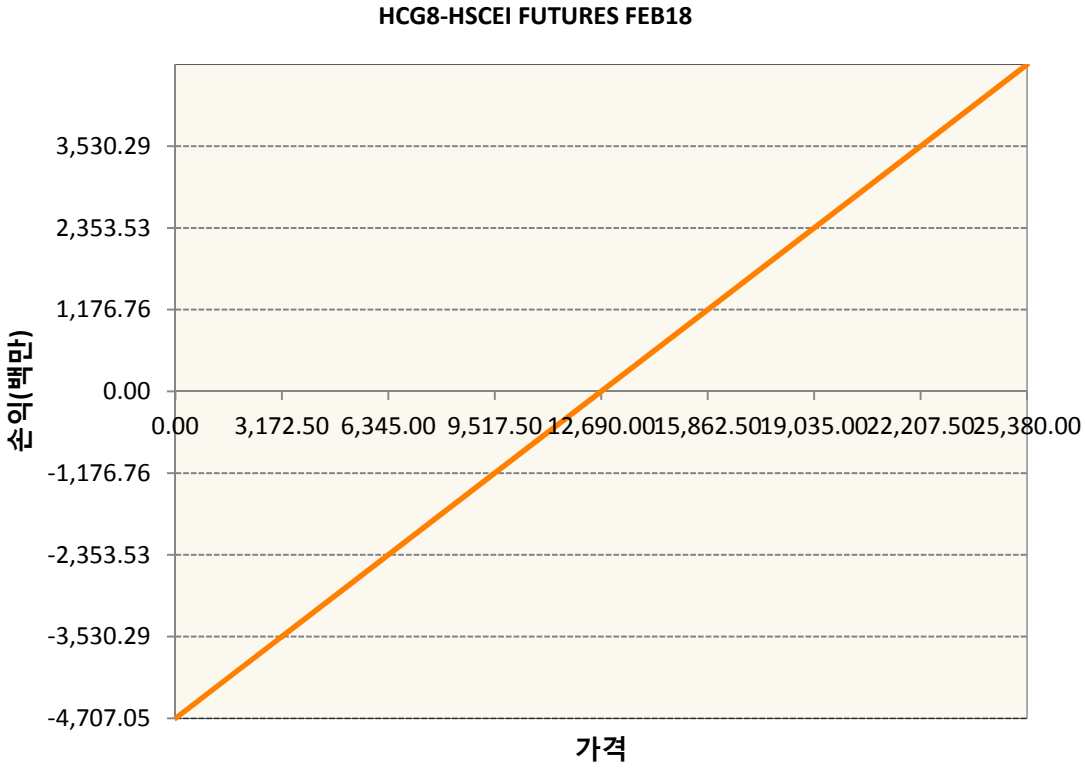
홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생

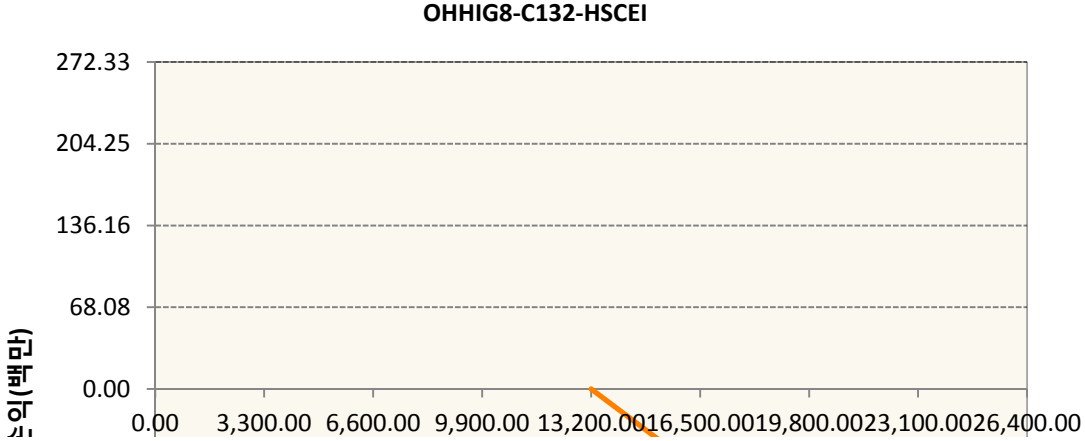
1. 계약금액

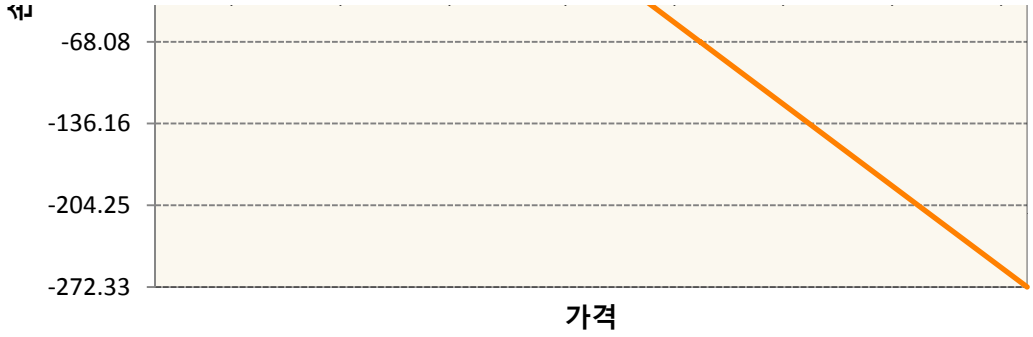
(단위:백만원)

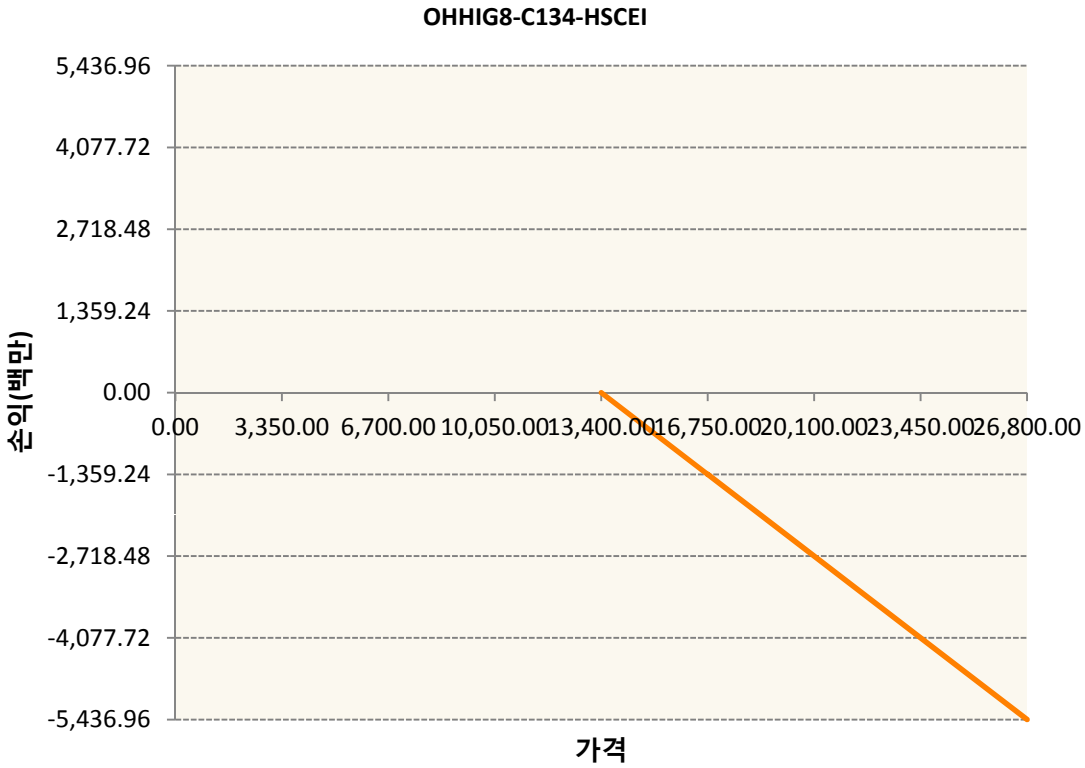
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	4,707	0	4,707	장내
누계	유가증권	옵션	0	11,419	-11,419	장내

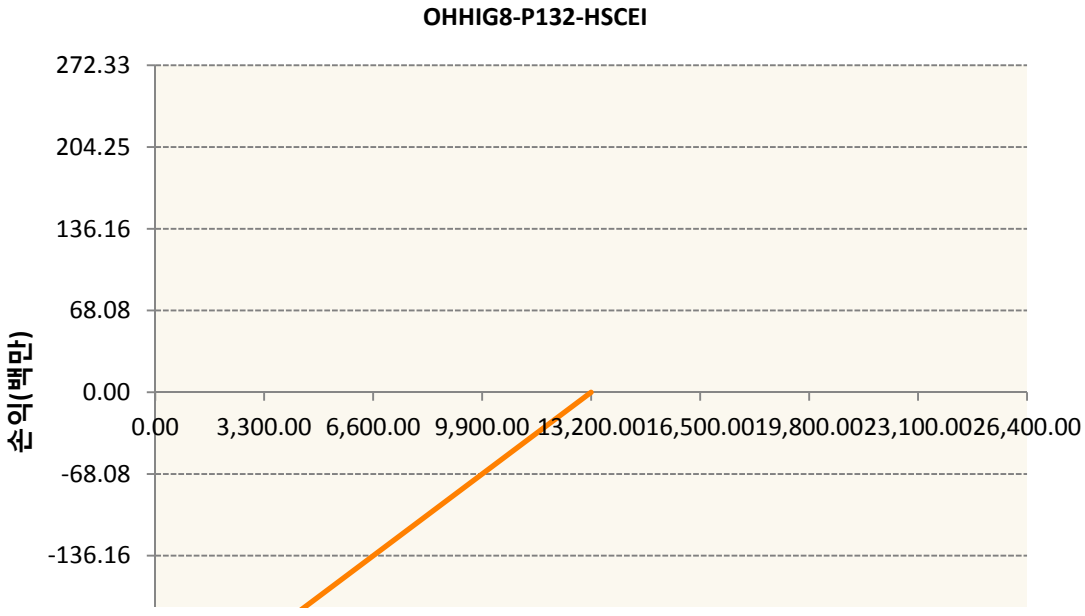
2. 만기시점의 손익구조

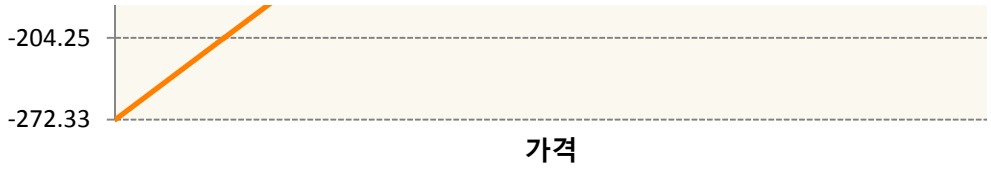


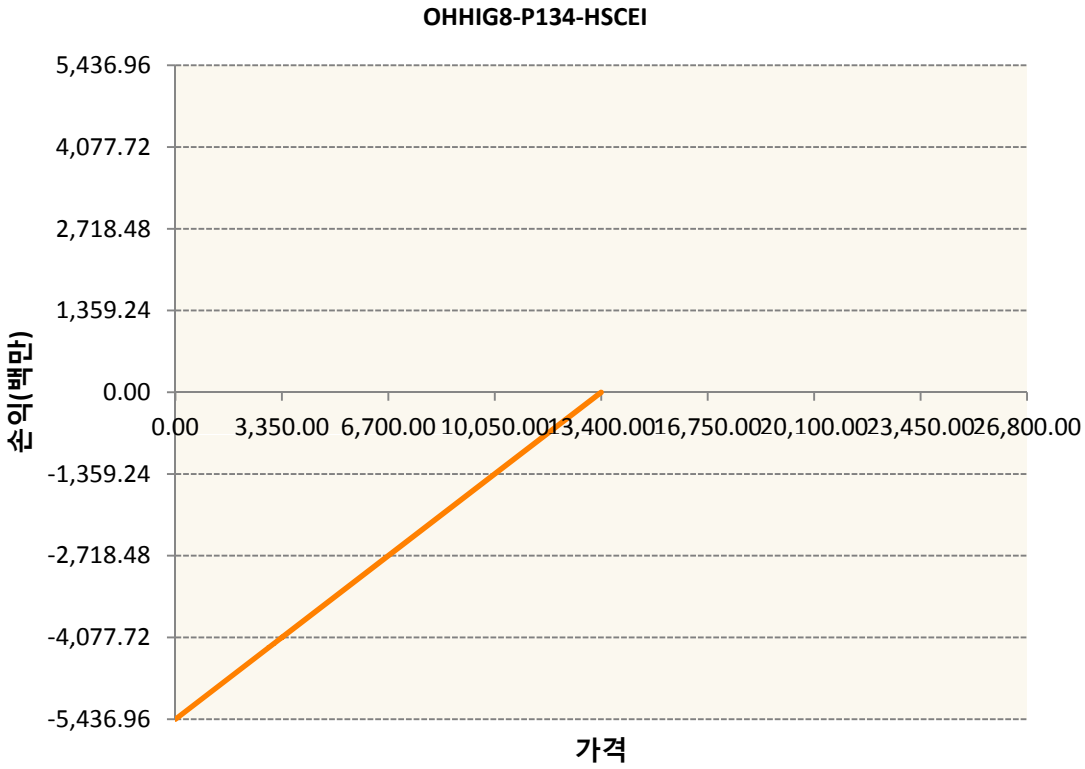



-68.08
-136.16
-204.25
-272.33
가격


OHHIG8-C134-HSCEI
5,436.96
4,077.72
2,718.48
1,359.24
0.00
-1,359.24
-2,718.48
-4,077.72
-5,436.96
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
272.33
204.25
136.16
68.08
0.00
-68.08
-136.16
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	377
OHHIG8-C1	HSCEI	22
OHHIG8-C1	HSCEI	435
OHHIG8-P1	HSCEI	22
OHHIG8-P1	HSCEI	435

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,120

공시일	2018-02-22
기준일	2018-02-21

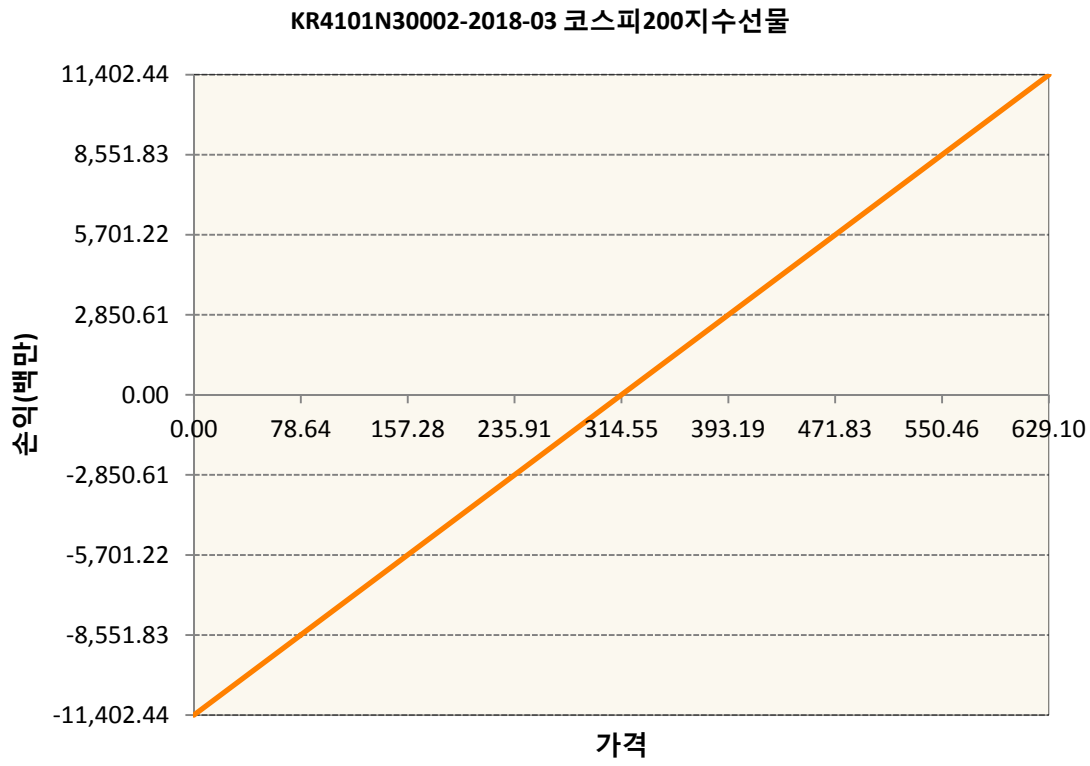
코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼

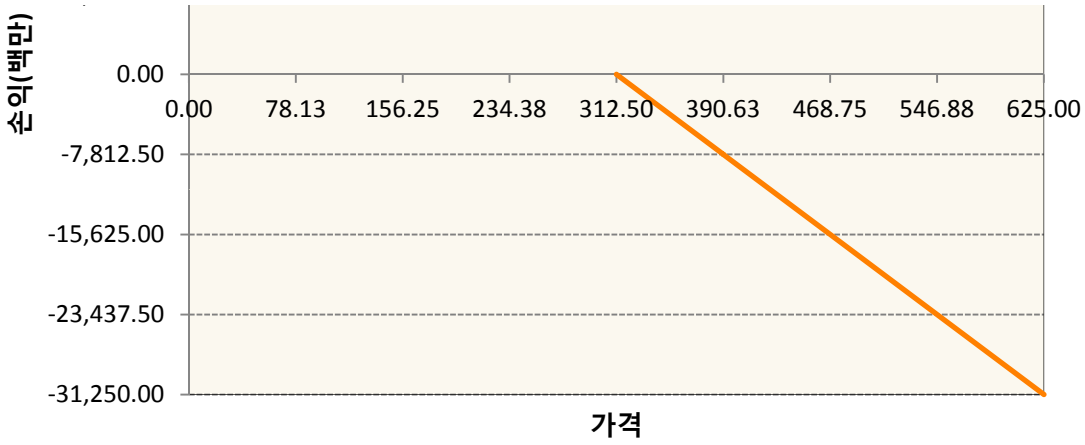
1. 계약금액

(단위:백만원)

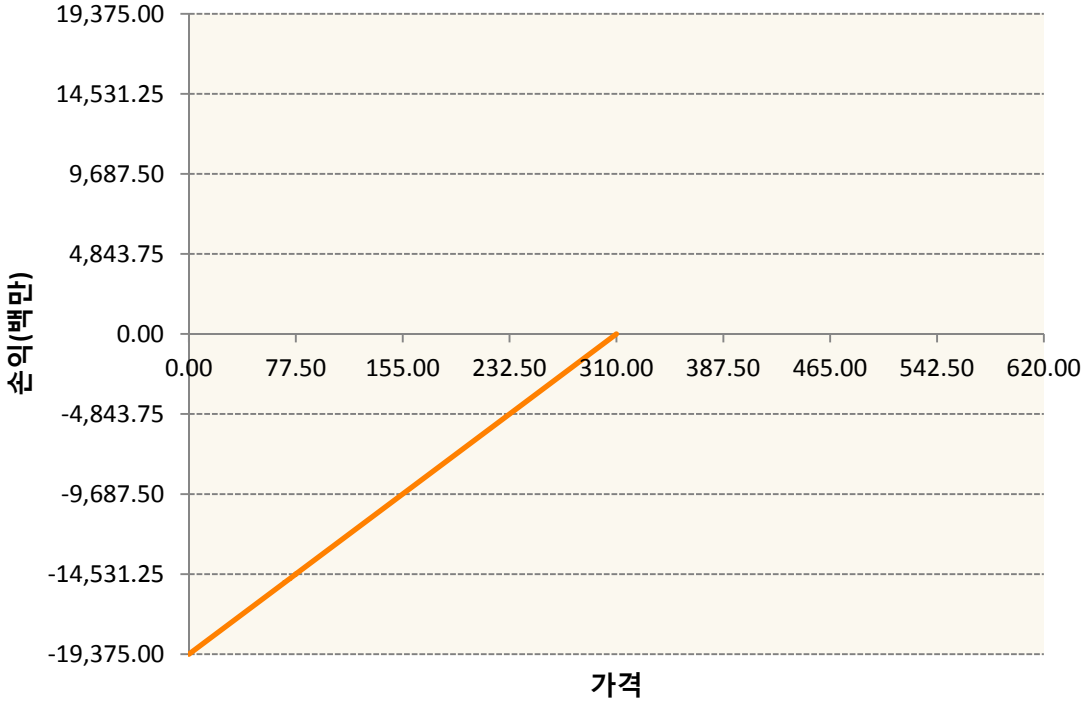
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	11,402	0	11,402	장내
누계	유가증권	스왑	56,200	0	56,200	장외
누계	유가증권	옵션	0	56,094	-56,094	장내

2. 만기시점의 손익구조

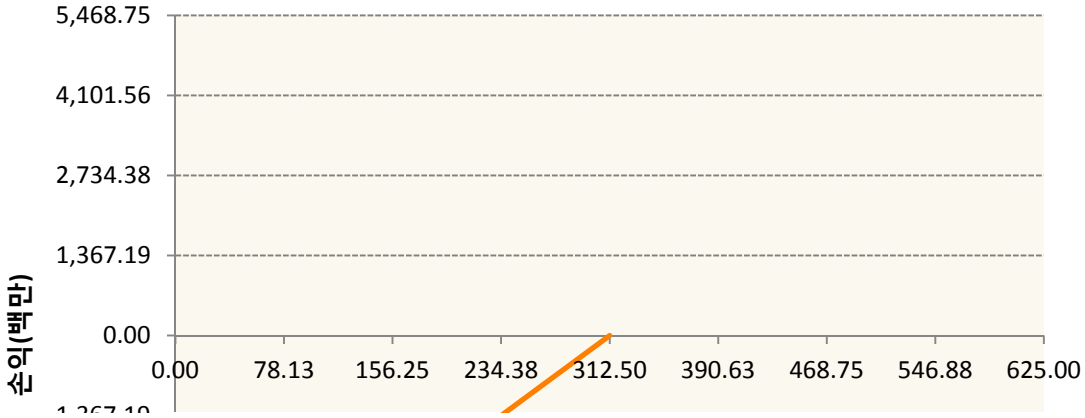




KR4301N33101-2018-03 풋310



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						912
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-912	-912	-912	-912	-912	-912	-912
-5.33%	-608	-608	-608	-608	-608	-608	-608
-2.67%	-304	-304	-304	-304	-304	-304	-304
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	304	304	304	304	304	304	304
5.33%	608	608	608	608	608	608	608
8.00%	912	912	912	912	912	912	912
	KR4201N331 2018-03 콜312.5						2,043
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	782	770	754	735	712	686	658
-5.33%	721	691	657	620	580	538	495
-2.67%	542	491	439	386	333	279	225
0%	172	115	57	0	-57	-115	-172
2.67%	-403	-448	-494	-542	-592	-643	-695
5.33%	-1,128	-1,152	-1,181	-1,213	-1,249	-1,287	-1,327
8.00%	-1,928	-1,938	-1,952	-1,969	-1,991	-2,015	-2,043
	KR4301N331 2018-03 풋310						1,156

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,138	-1,138	-1,140	-1,143	-1,146	-1,151	-1,156
-5.33%	-626	-634	-643	-653	-665	-678	-692
-2.67%	-191	-211	-232	-253	-274	-295	-316
0%	60	41	21	0	-21	-42	-63
2.67%	140	132	123	112	100	87	72
5.33%	152	151	149	145	141	136	129
8.00%	153	153	152	152	151	149	147
KR4301N3312018-03 풋312.5							349

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-345	-345	-345	-346	-347	-347	-349
-5.33%	-200	-201	-203	-205	-208	-211	-214
-2.67%	-69	-74	-79	-84	-89	-95	-100
0%	19	12	6	0	-6	-12	-19
2.67%	53	49	46	42	38	33	28
5.33%	59	58	57	56	54	52	50
8.00%	60	60	60	59	59	58	57

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

8,657

공시일	2018-02-22
기준일	2018-02-21

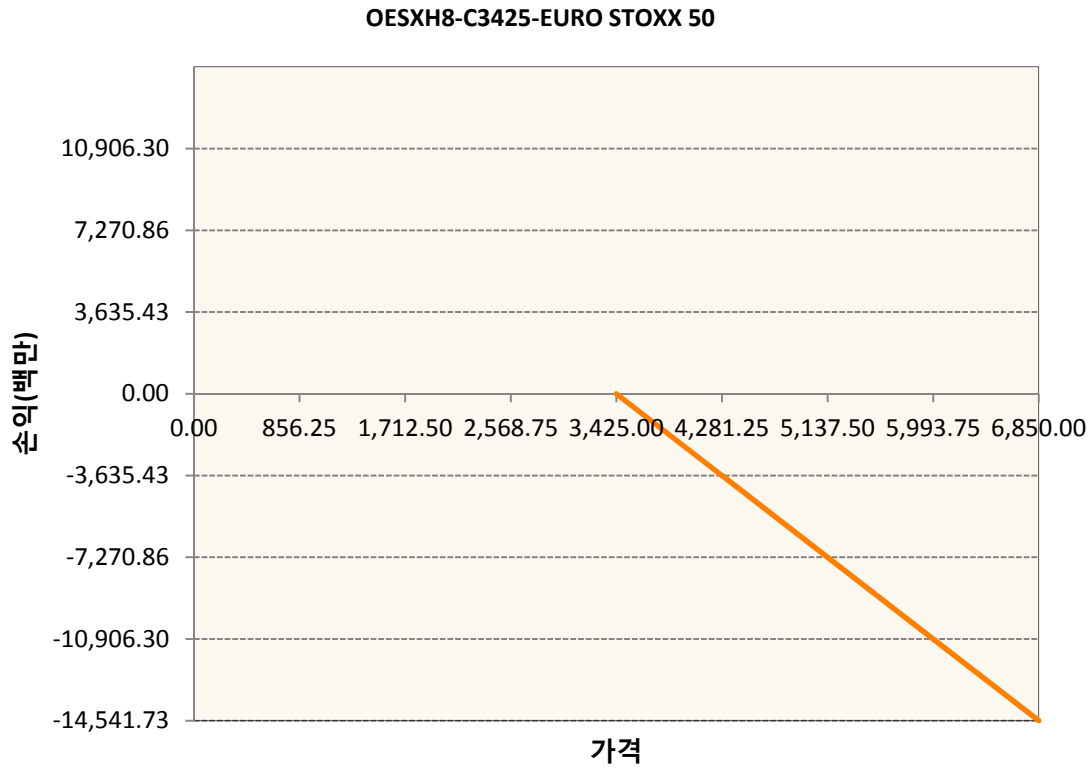
유로커버드콜모(주식혼합-파생형

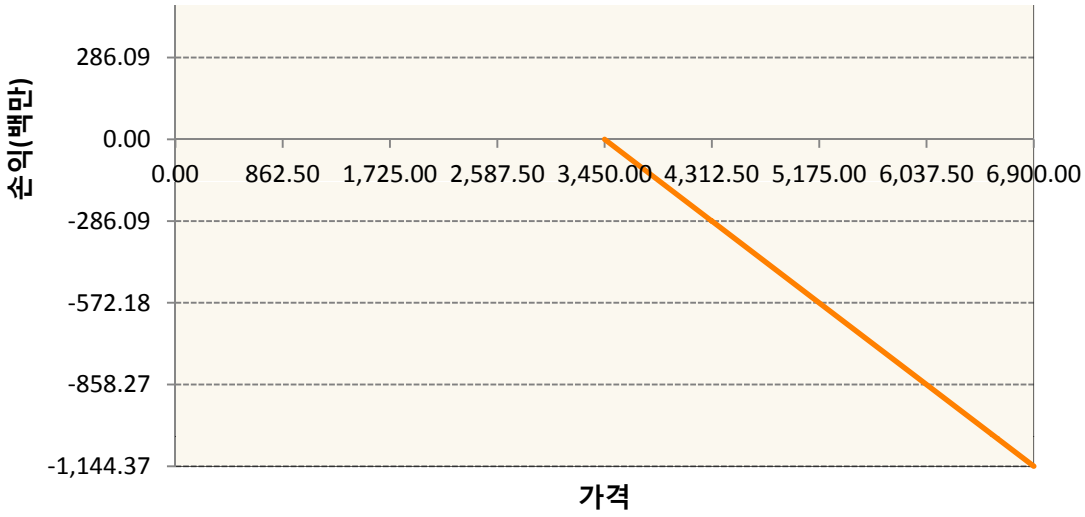
1. 계약금액

(단위:백만원)

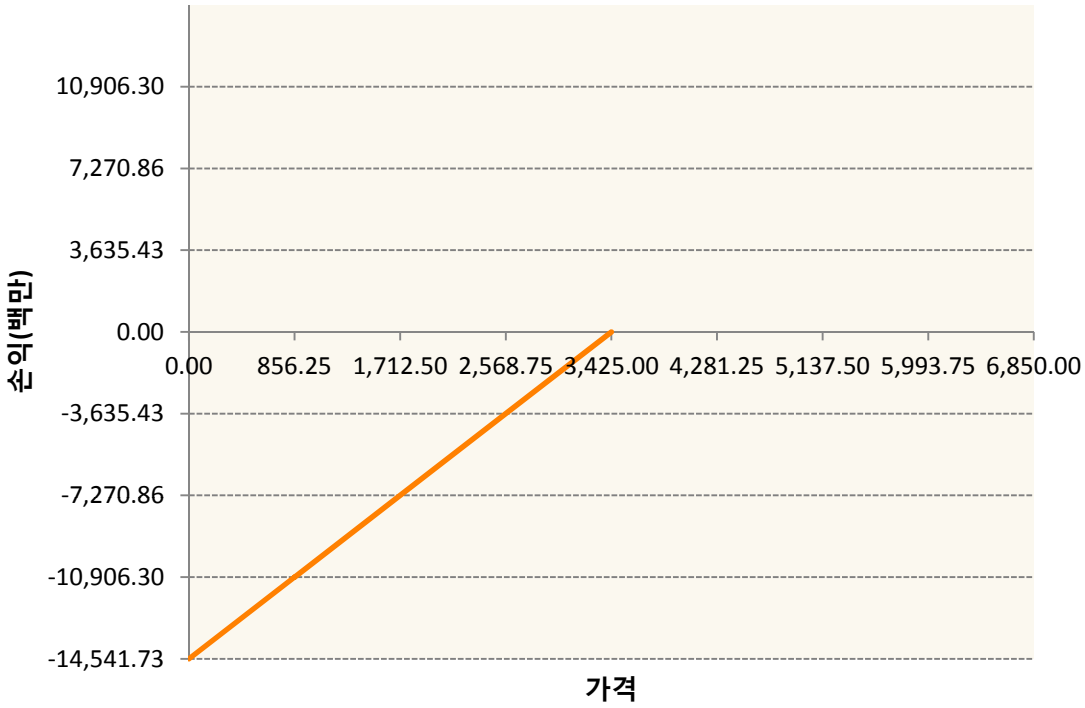
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	7,513	0	7,513	
누계	유가증권	스왑	99,514	0	99,514	장외
누계	유가증권	옵션	0	31,372	-31,372	장내
누계	지수	스왑	53,075	0	53,075	장외

2. 만기시점의 손익구조

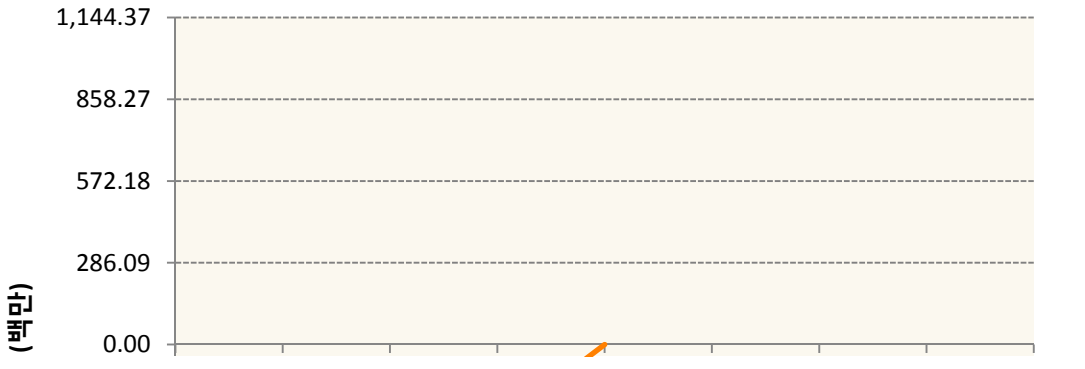


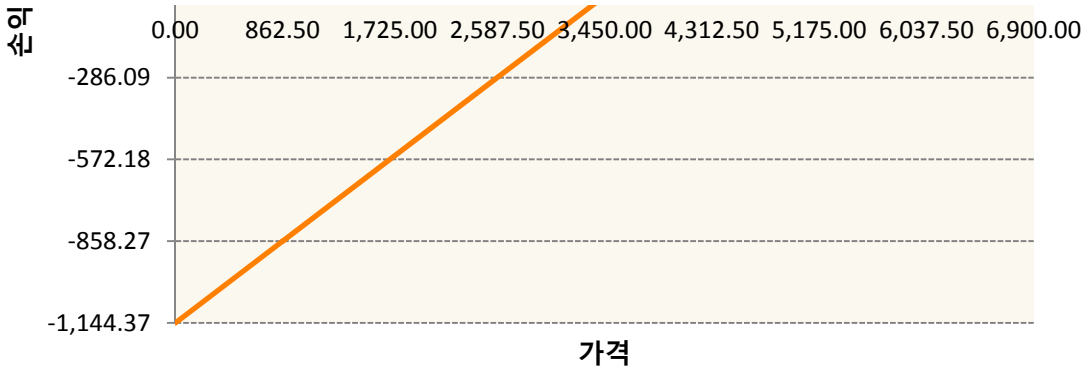


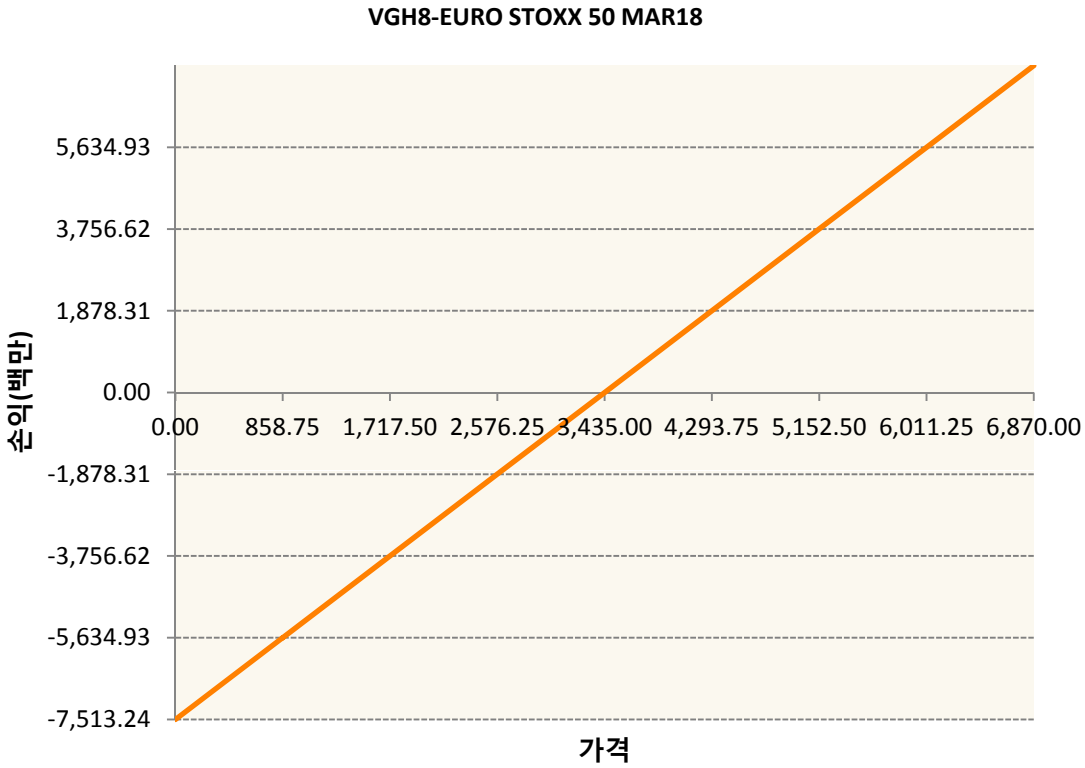
OESXH8-P3425-EURO STOXX 50



OESXH8-P3450-EURO STOXX 50







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)	(단위:백만원)
260105SGPX SG EURO Covered CALL STRATEGY - 994.569	212
260105SQPX SG EURO Covered CALL STRATEGY	398
OESXH8-C34 EURO STOXX 50	1,163
OESXH8-C34 EURO STOXX 50	92
OESXH8-P34 EURO STOXX 50	1,163
OESXH8-P34 EURO STOXX 50	92
VGH8 EURO STOXX 50 MAR18	601

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

2,204

공시일	2018-02-22
기준일	2018-02-21

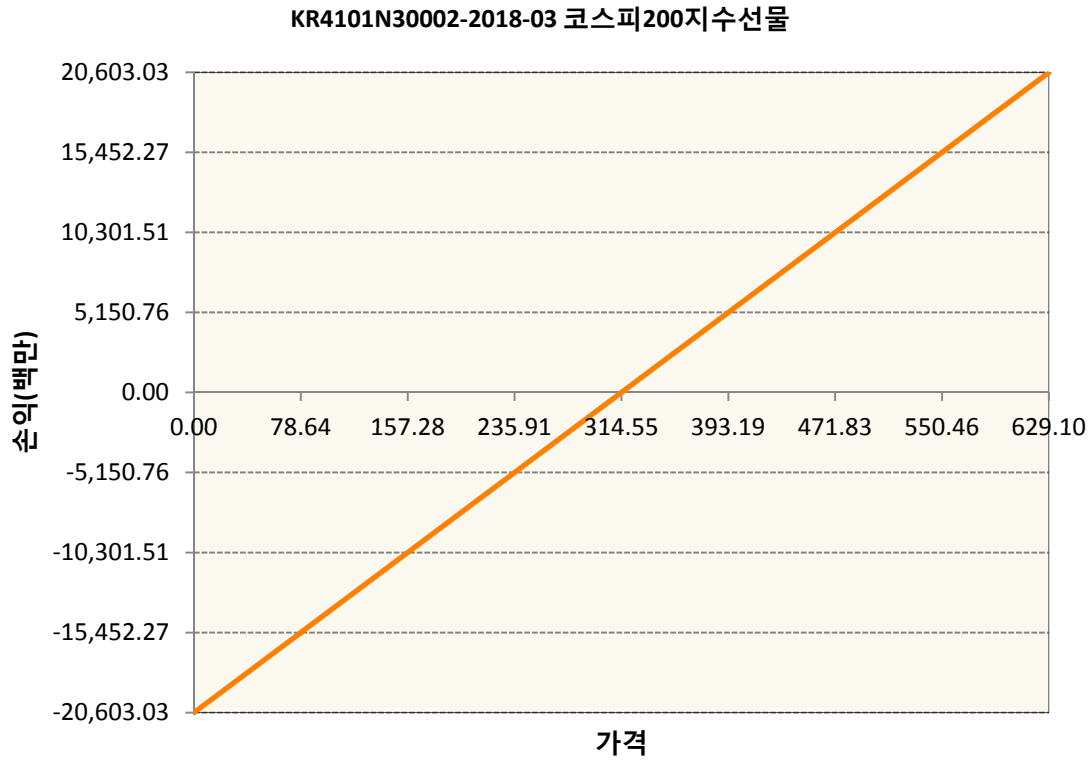
ETF스마트레버리지목표전환형8호

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	157	-157	장내
누계	유가증권	선물	20,603	0	20,603	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101N30(2018-03 코스피200지수선물							1,648
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,648	-1,648	-1,648	-1,648	-1,648	-1,648	-1,648
-5.33%	-1,099	-1,099	-1,099	-1,099	-1,099	-1,099	-1,099
-2.67%	-549	-549	-549	-549	-549	-549	-549
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	549	549	549	549	549	549	549
5.33%	1,099	1,099	1,099	1,099	1,099	1,099	1,099
8.00%	1,648	1,648	1,648	1,648	1,648	1,648	1,648

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

1,096

공시일	2018-02-22
기준일	2018-02-21

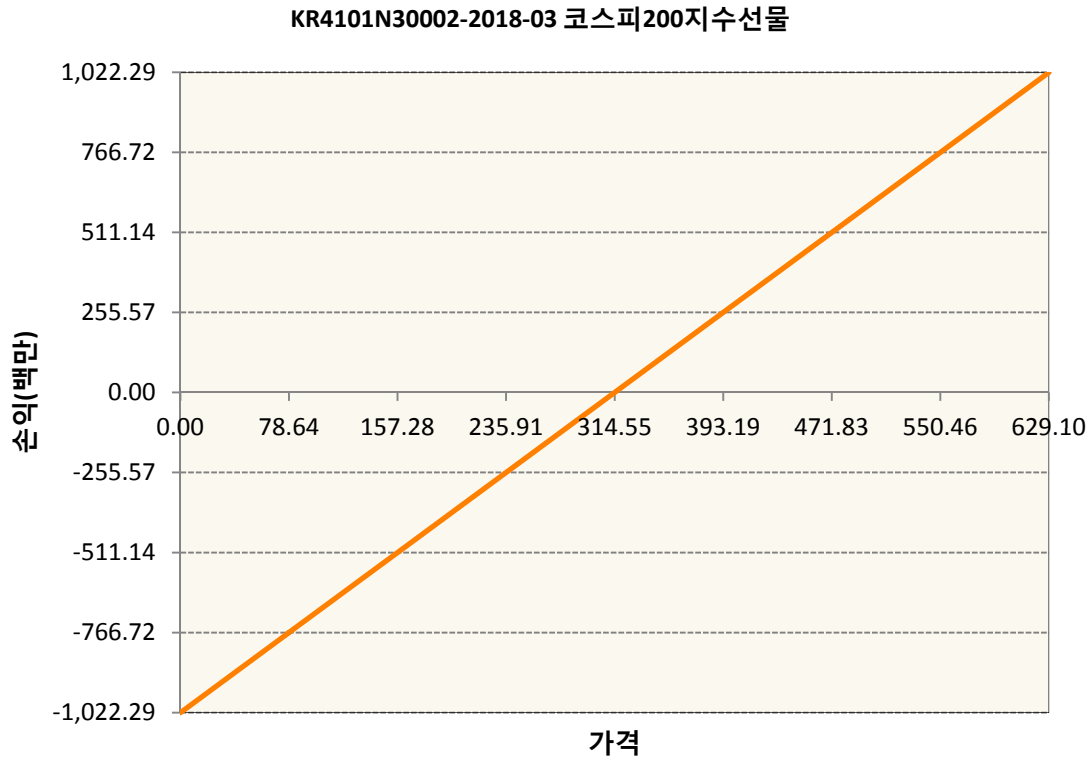
ETF스마트레버리지목표전환형9호

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	1,022	0	1,022	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	2018-02-22
기준일	2018-02-21

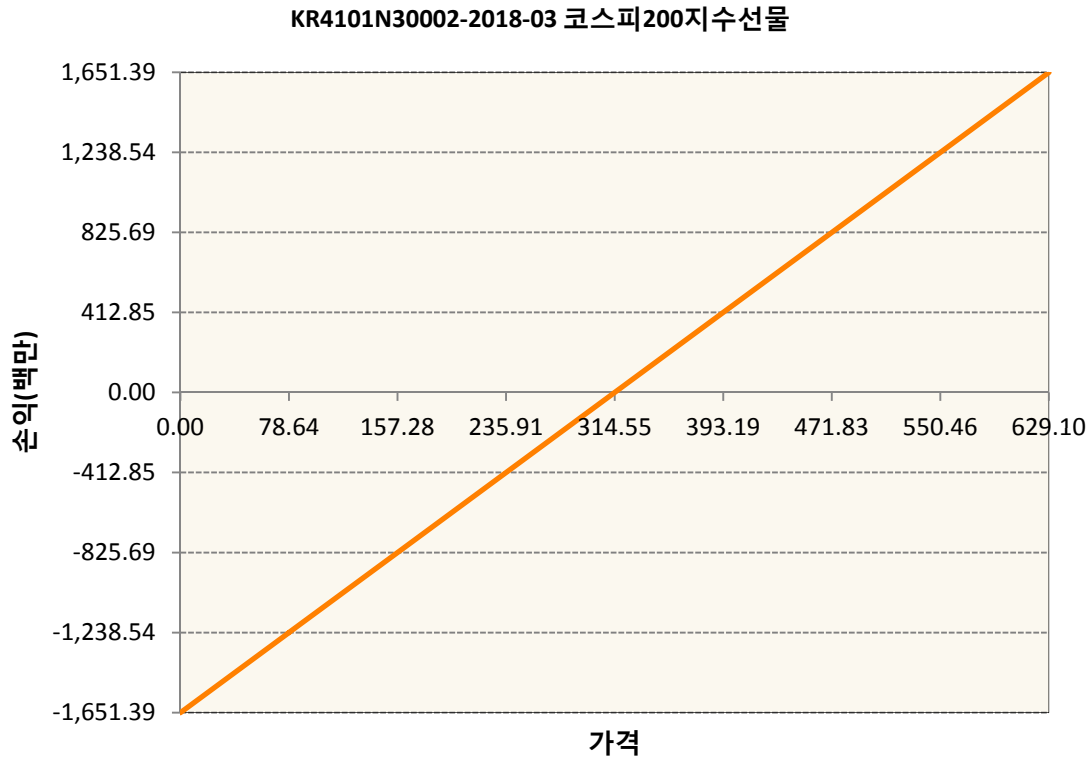
ETF스마트레버리지목표전환형10

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	1,651	0	1,651	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101N30(2018-03 코스피200지수선물							132
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-132	-132	-132	-132	-132	-132	-132
-5.33%	-88	-88	-88	-88	-88	-88	-88
-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%	88	88	88	88	88	88	88
8.00%	132	132	132	132	132	132	132

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

88

공시일	2018-02-22
기준일	2018-02-21

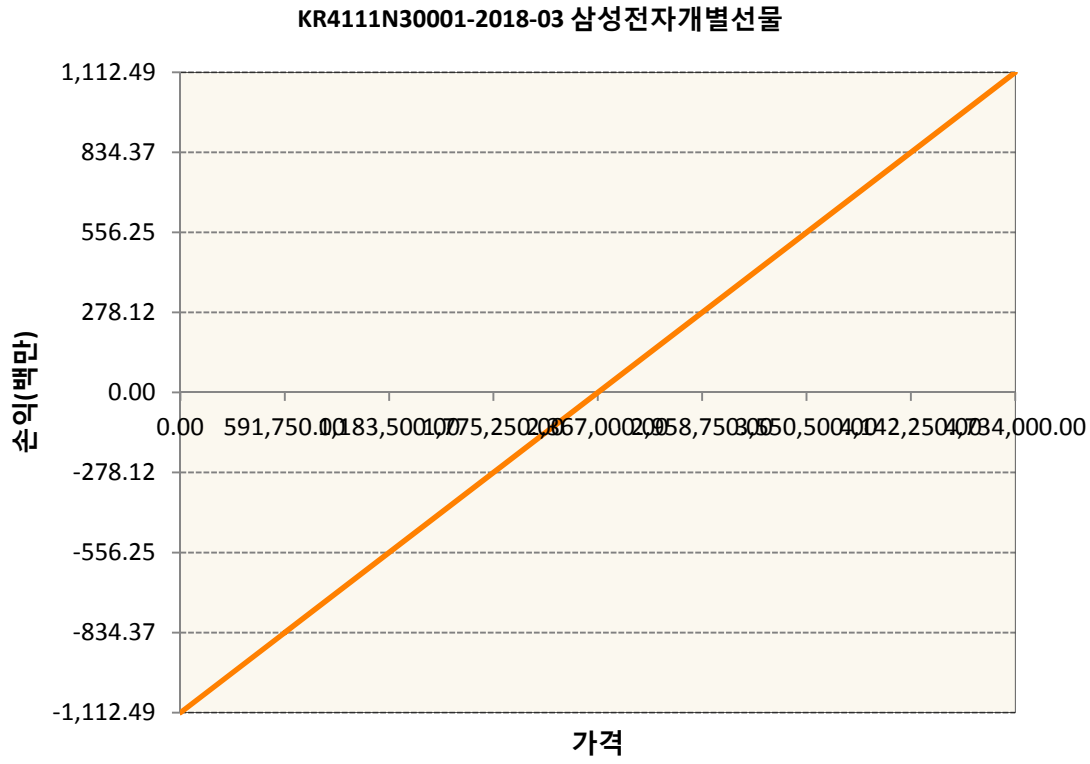
스마트KRX300인덱스1호(주식-파

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	283	0	283	장내
누계	유가증권	선물	1,112	0	1,112	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4111N30(2018-03 삼성전자개별선물							89
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-89	-89	-89	-89	-89	-89	-89
-5.33%	-59	-59	-59	-59	-59	-59	-59
-2.67%	-30	-30	-30	-30	-30	-30	-30
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	30	30	30	30	30	30	30
5.33%	59	59	59	59	59	59	59
8.00%	89	89	89	89	89	89	89

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

107

공시일	2018-02-22
기준일	2018-02-21

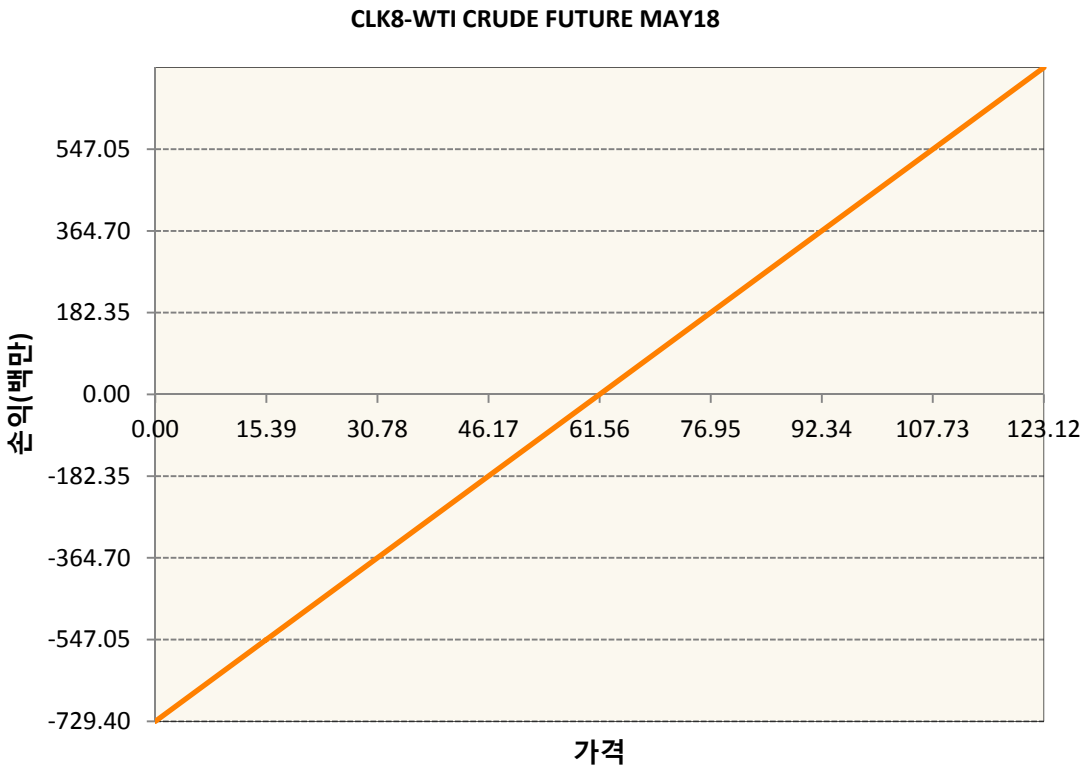
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

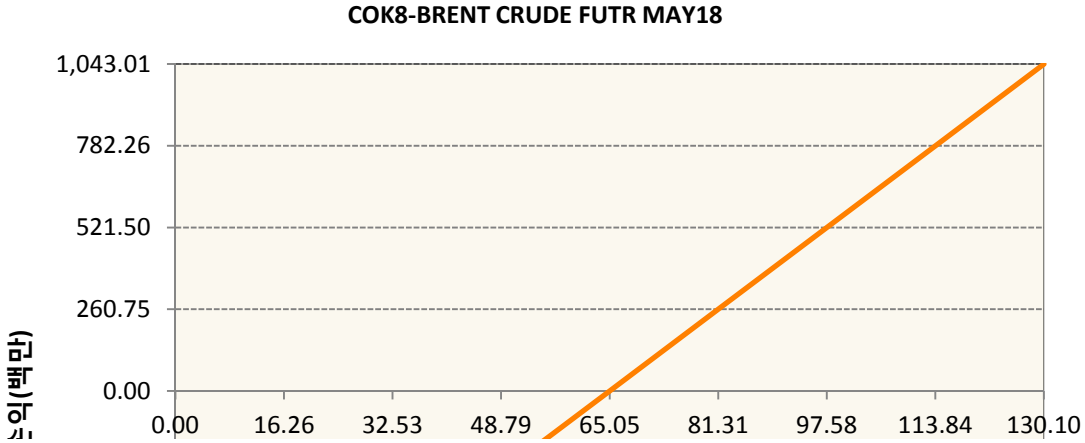
1. 계약금액

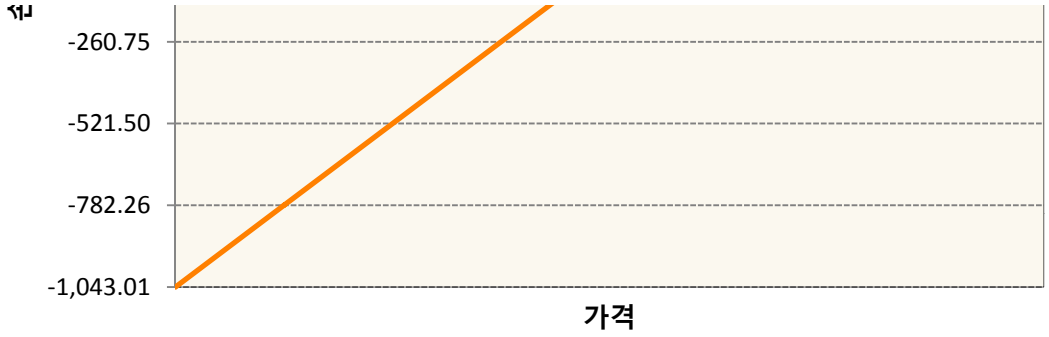
(단위:백만원)

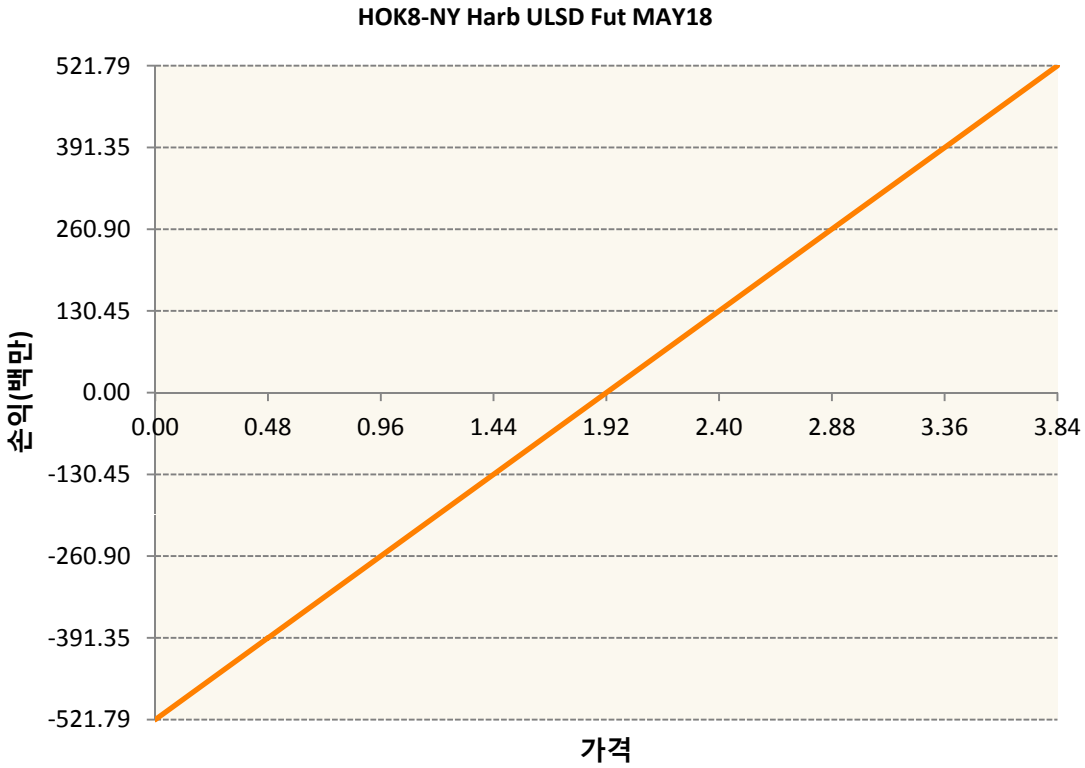
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	선물	유가증권	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	선물	유가증권	729	0	729	
누계	유가증권	선물	3,220	592	2,628	

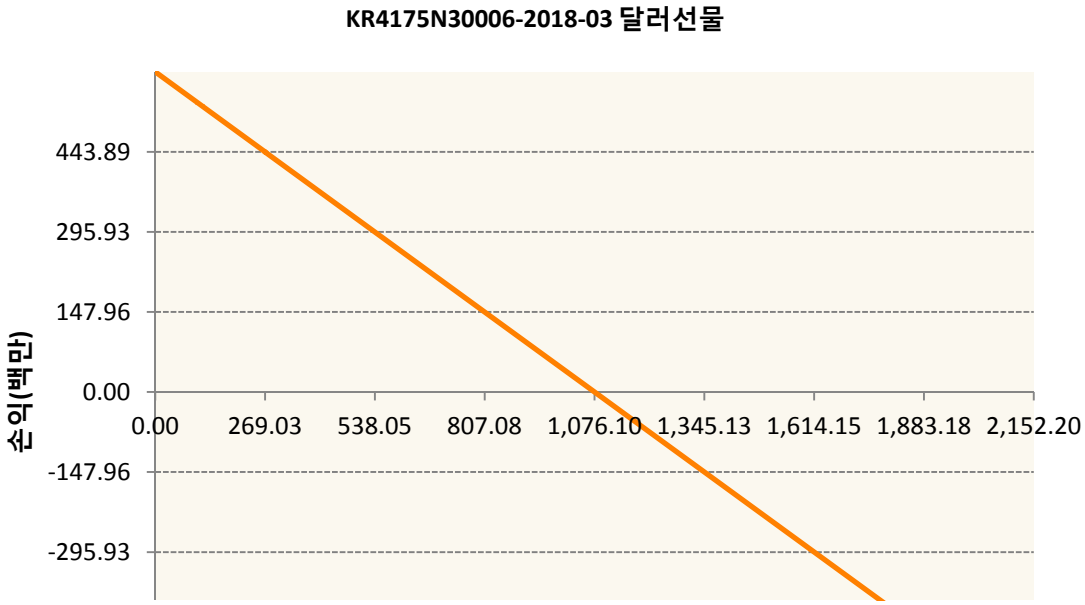
2. 만기시점의 손익구조

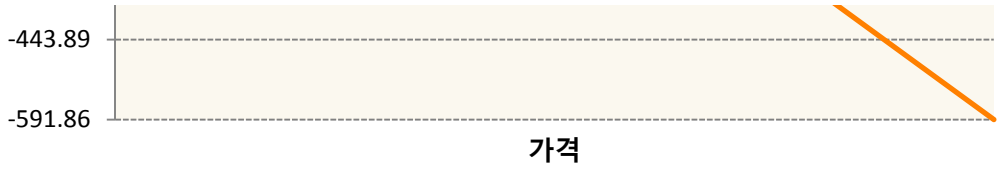


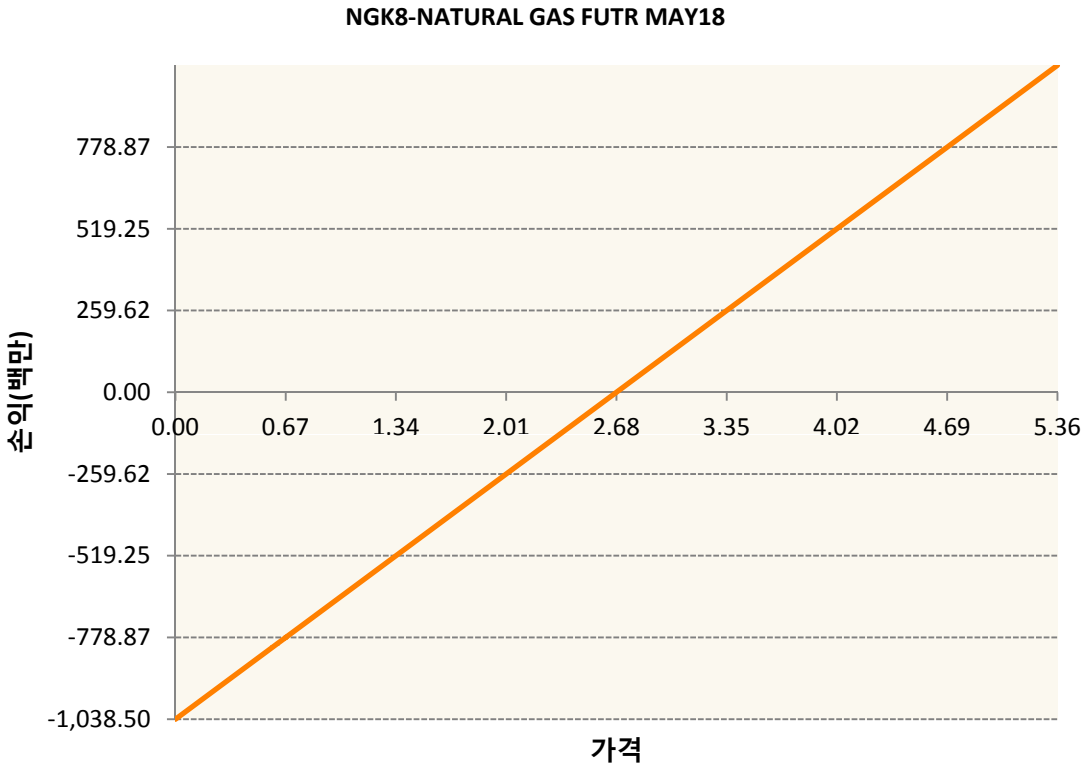


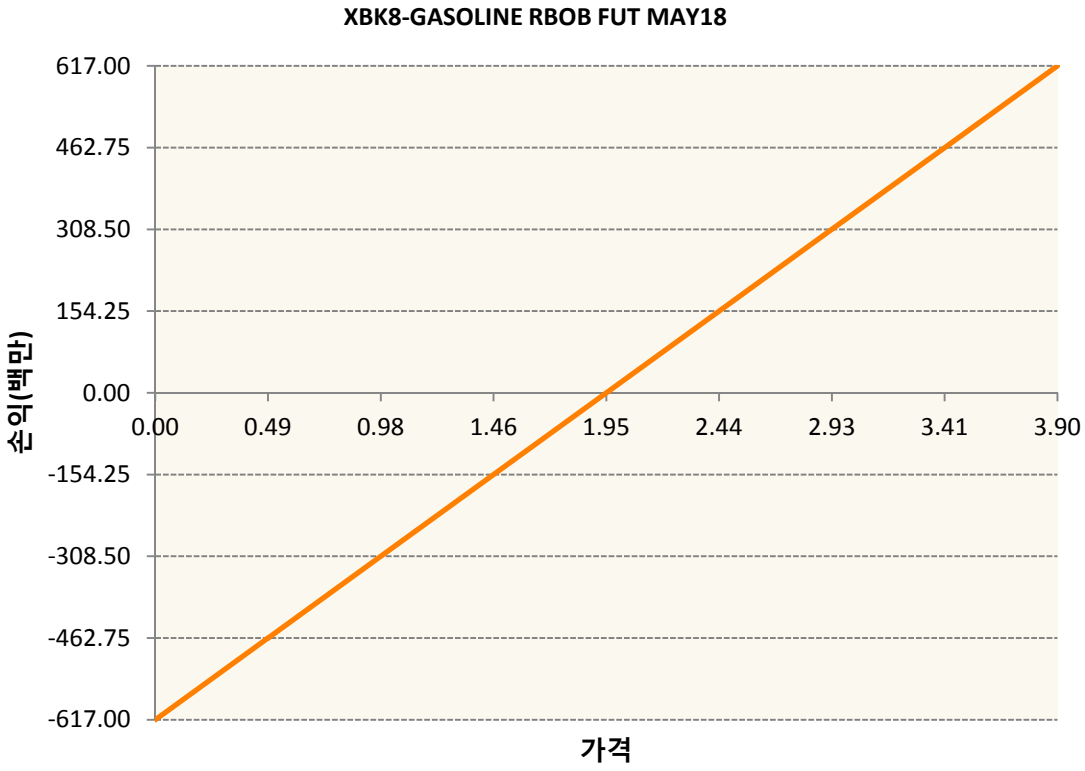

-260.75
-521.50
-782.26
-1,043.01
가격


HOK8-NY Harb ULSD Fut MAY18
521.79
391.35
260.90
130.45
0.00
-130.45
-260.90
-391.35
-521.79
0.00
0.48
0.96
1.44
1.92
2.40
2.88
3.36
3.84
손익(백만)
가격


KR4175N30006-2018-03 달러선물
443.89
295.93
147.96
0.00
-147.96
-295.93
0.00
269.03
538.05
807.08
1,076.10
1,345.13
1,614.15
1,883.18
2,152.20
손익(백만)


-443.89
-591.86
가격


NGK8-NATURAL GAS FUTR MAY18
778.87
519.25
259.62
0.00
-259.62
-519.25
-778.87
-1,038.50
0.00
0.67
1.34
2.01
2.68
3.35
4.02
4.69
5.36
손익(백만)
가격


XBK8-GASOLINE RBOB FUT MAY18
617.00
462.75
308.50
154.25
0.00
-154.25
-308.50
-462.75
-617.00
0.00
0.49
0.98
1.46
1.95
2.44
2.93
3.41
3.90
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	42
KR4175N30(	2018-03 달러선물	47
NGK8	NATURAL GAS FUTR MAY18	83
XBK8	GASOLINE RBOB FUT MAY18	49

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

522

공시일	2018-02-22
기준일	2018-02-21

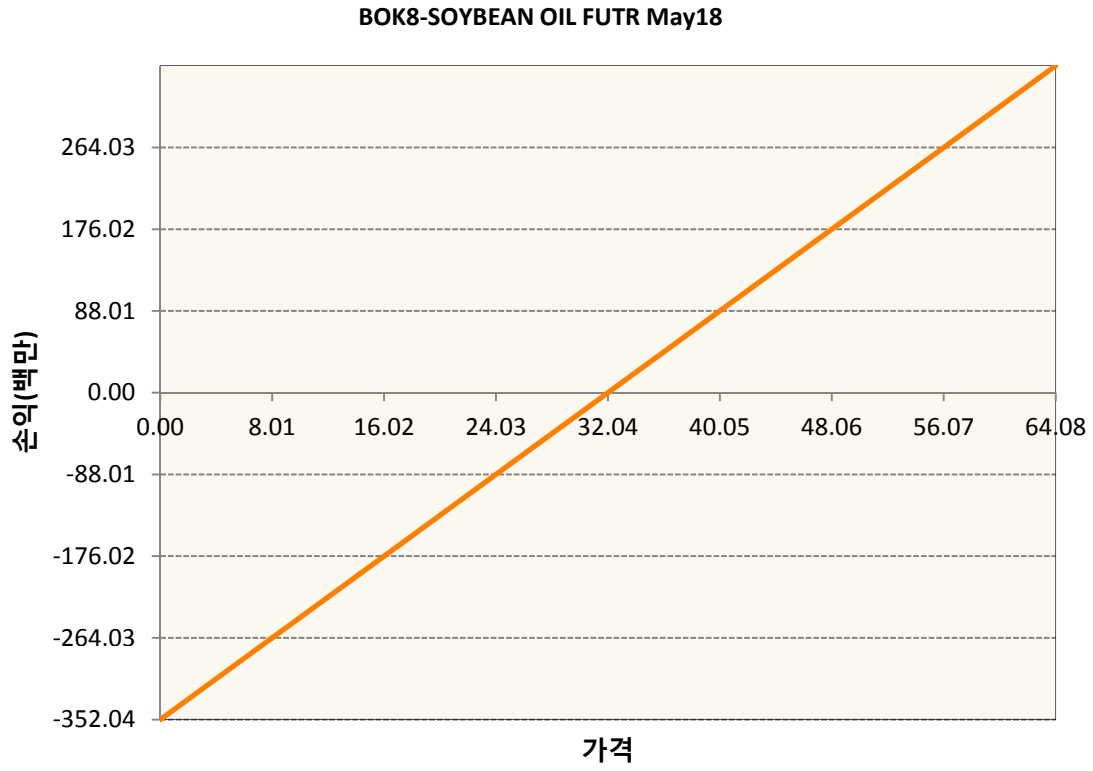
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

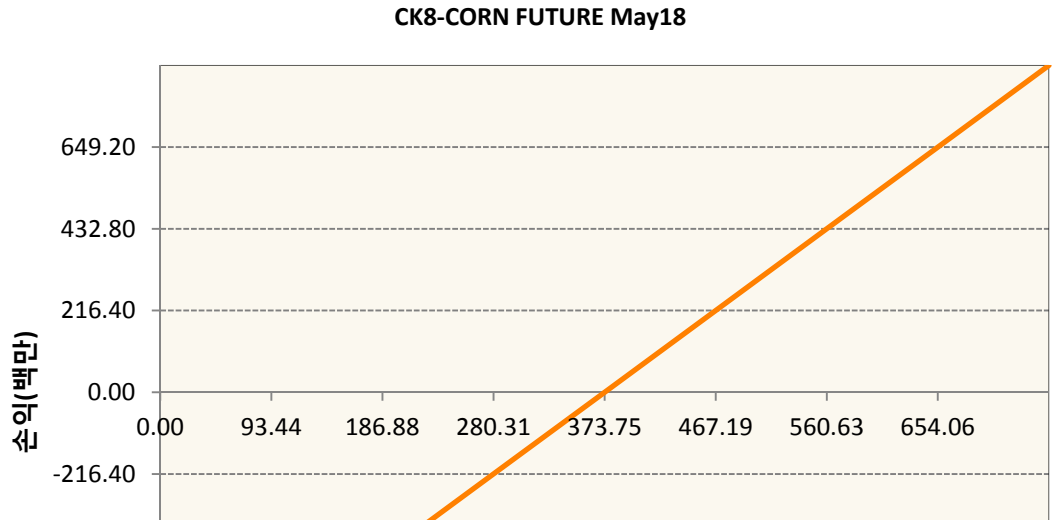
1. 계약금액

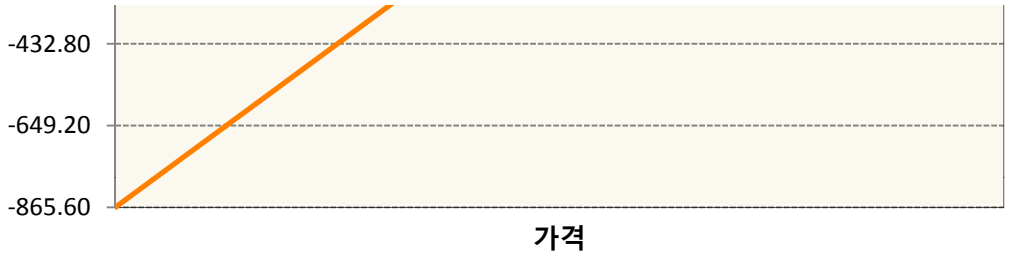
(단위:백만원)

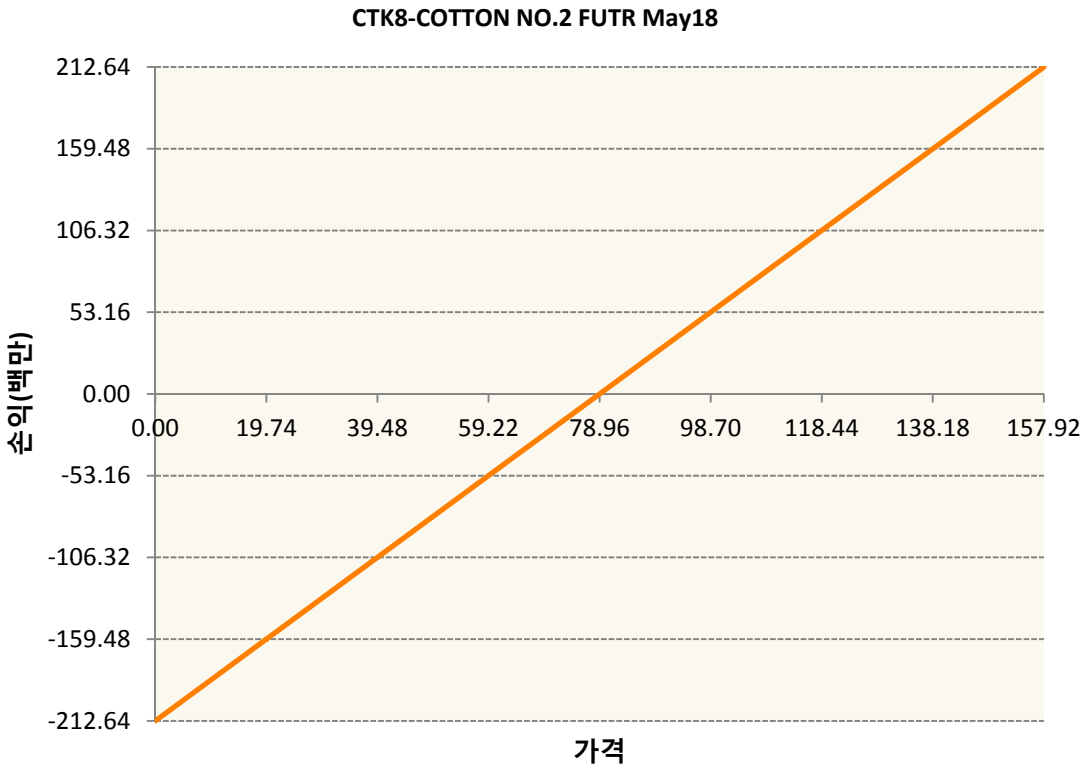
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	4,114	323	3,791	

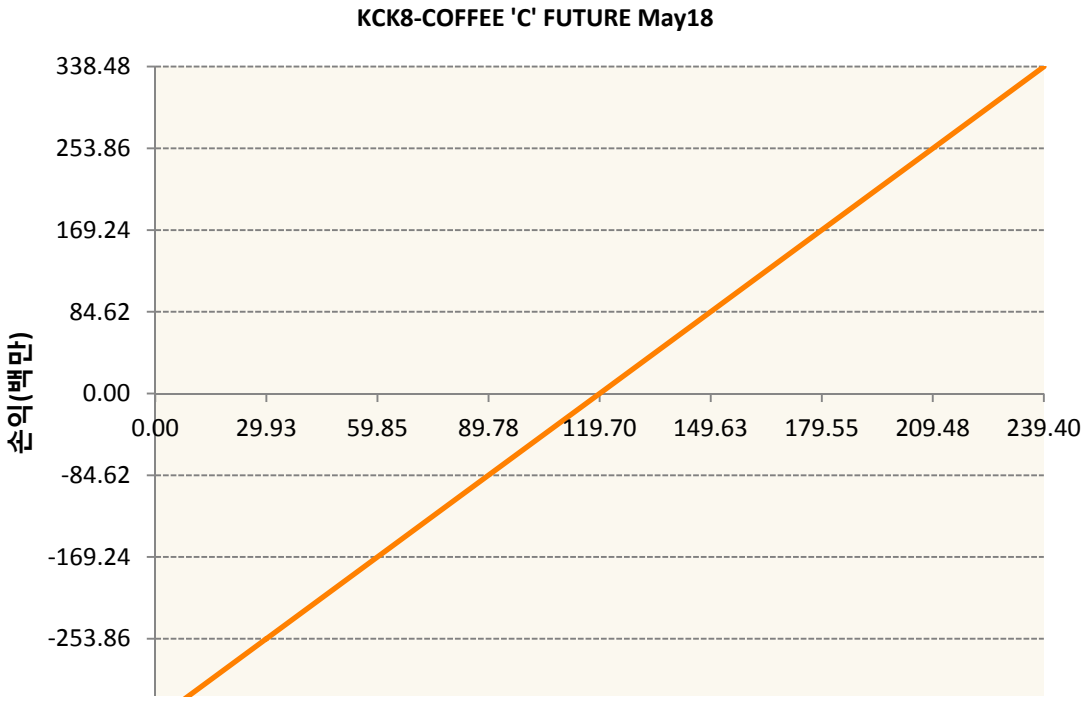
2. 만기시점의 손익구조

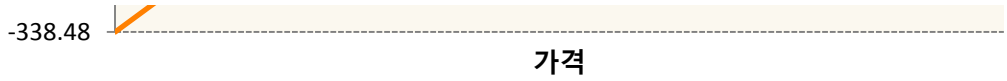


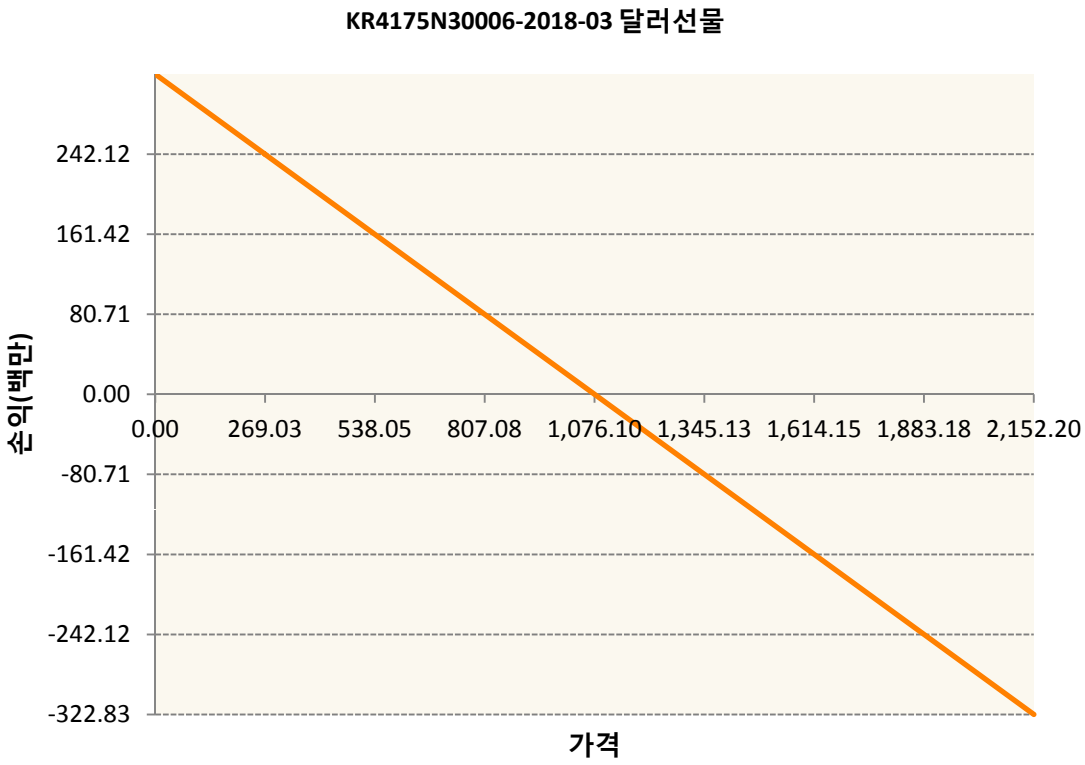


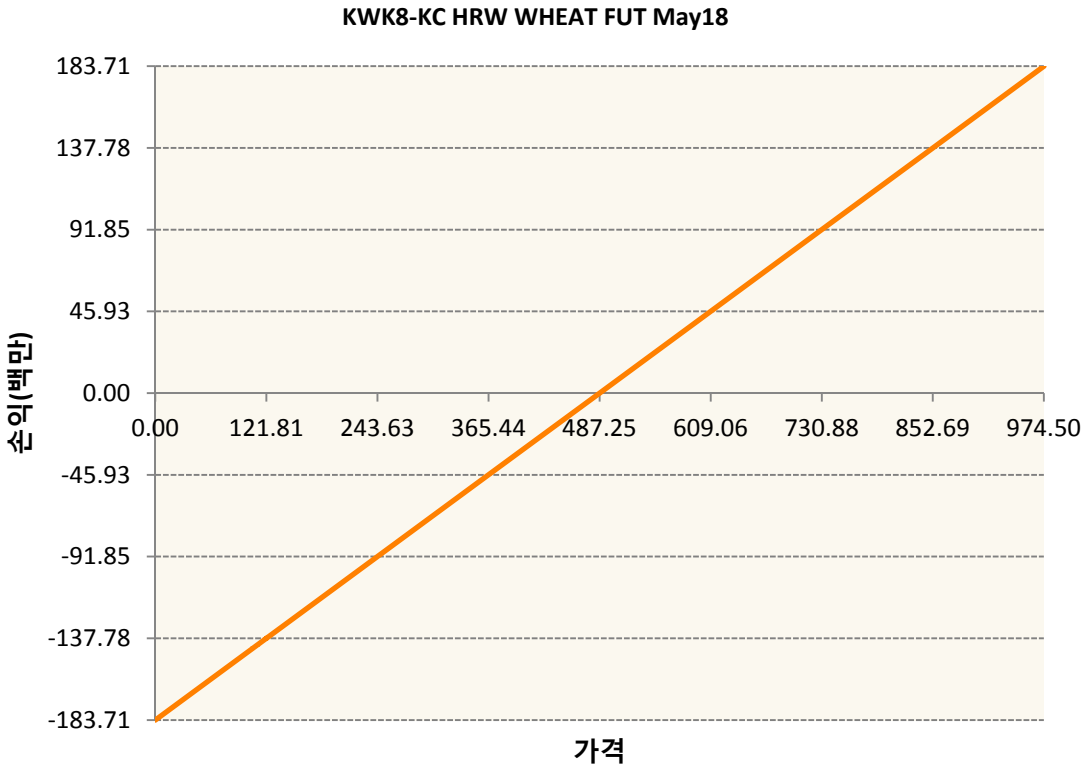

-432.80
-649.20
-865.60
가격


CTK8-COTTON NO.2 FUTR May18
212.64
159.48
106.32
53.16
0.00
-53.16
-106.32
-159.48
-212.64
0.00
19.74
39.48
59.22
78.96
98.70
118.44
138.18
157.92
손익(백만)
가격

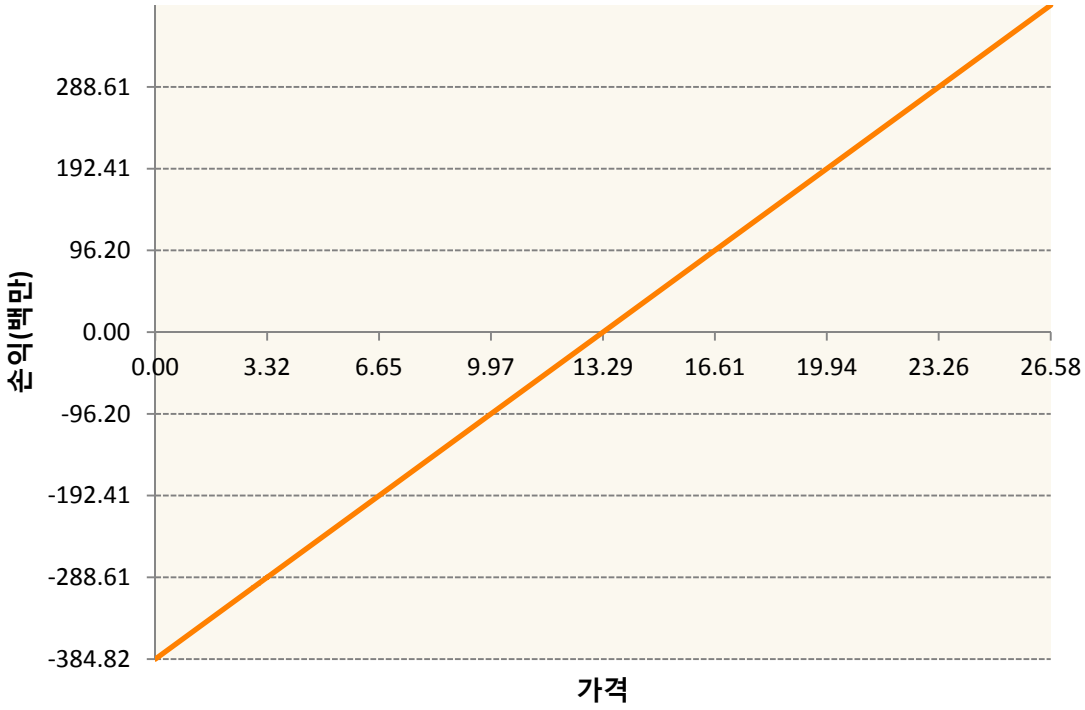

KCK8-COFFEE 'C' FUTURE May18
338.48
253.86
169.24
84.62
0.00
-84.62
-169.24
-253.86
0.00
29.93
59.85
89.78
119.70
149.63
179.55
209.48
239.40
손익(백만)


-338.48
가격

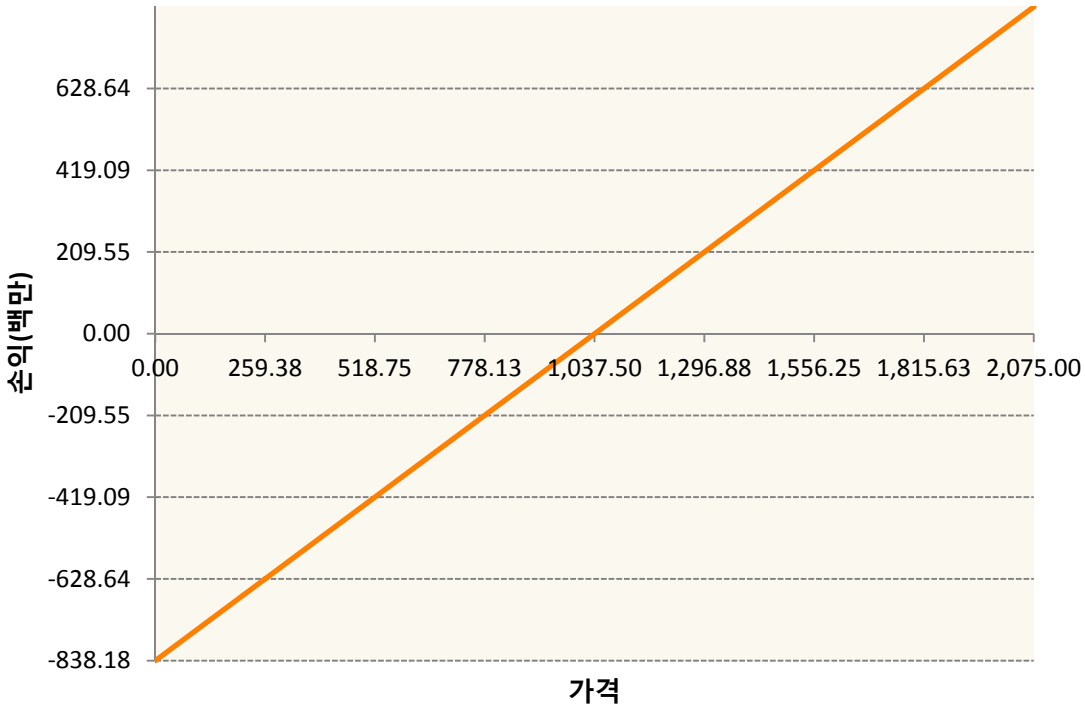

KR4175N30006-2018-03 달러선물
242.12
161.42
80.71
0.00
-80.71
-161.42
-242.12
-322.83
0.00
269.03
538.05
807.08
1,076.10
1,345.13
1,614.15
1,883.18
2,152.20
손익(백만)
가격


KWK8-KC HRW WHEAT FUT May18
183.71
137.78
91.85
45.93
0.00
-45.93
-91.85
-137.78
-183.71
0.00
121.81
243.63
365.44
487.25
609.06
730.88
852.69
974.50
손익(백만)
가격

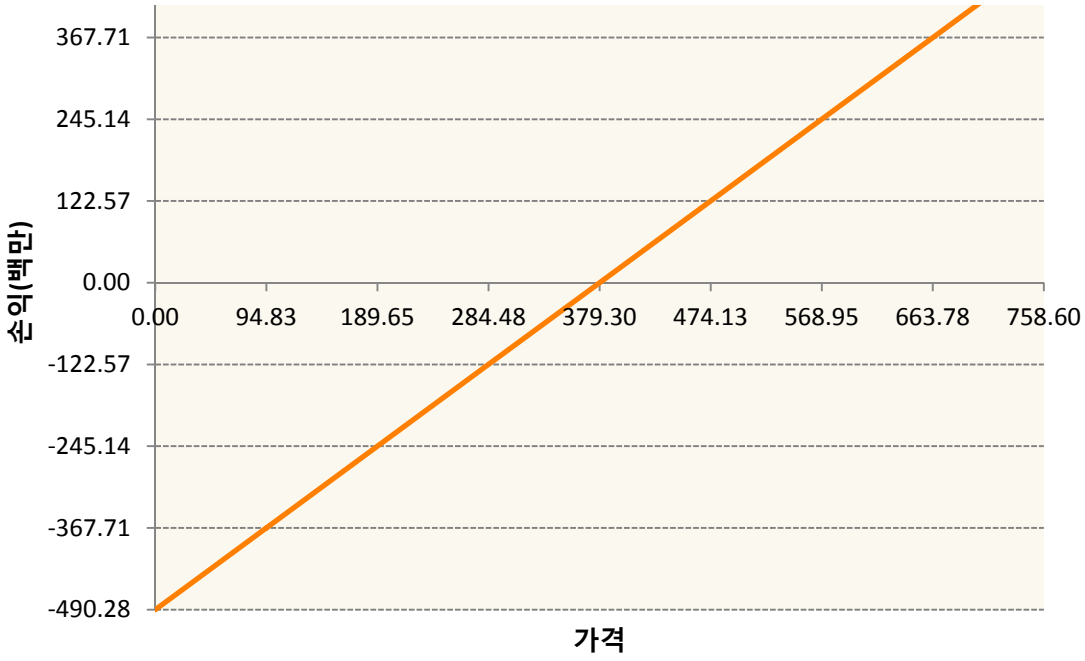
SBK8-SUGAR #11 (WORLD) May18



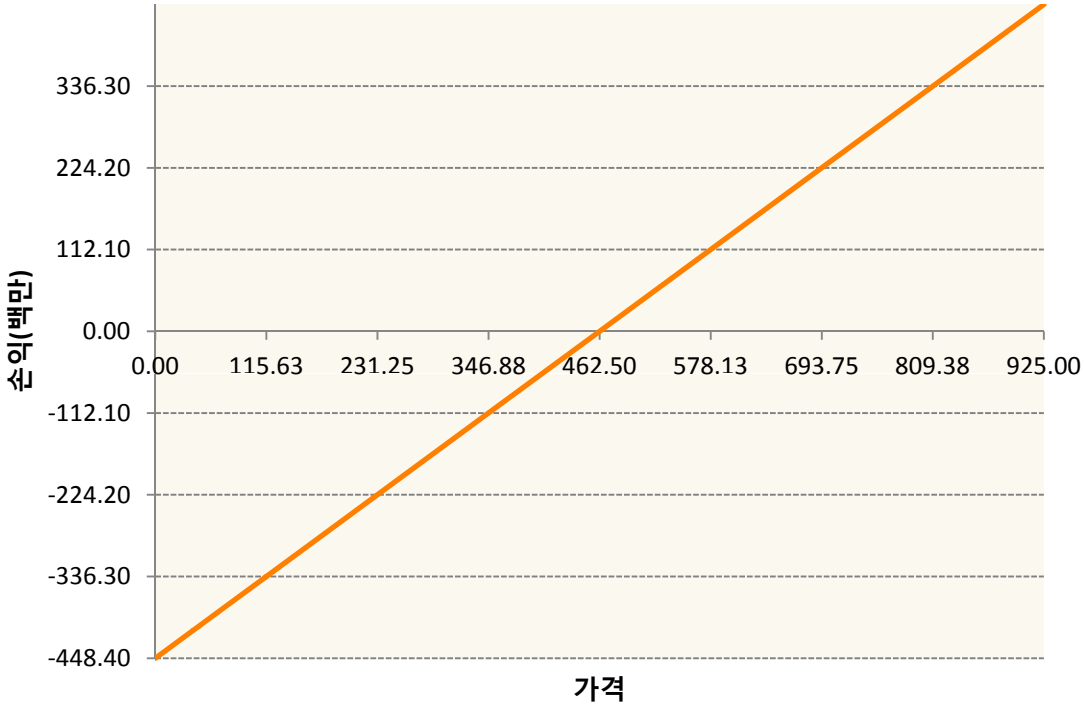
SK8-SOYBEAN FUTRUE May18



SMK8-SOYBEAN MEAL FUTR May18



WK8-WHEAT FUTURE(CBT) 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	36

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

335