공시일	2018-03-02
기준일	2018-02-28

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	2018-03-02
기준일	2018-02-28

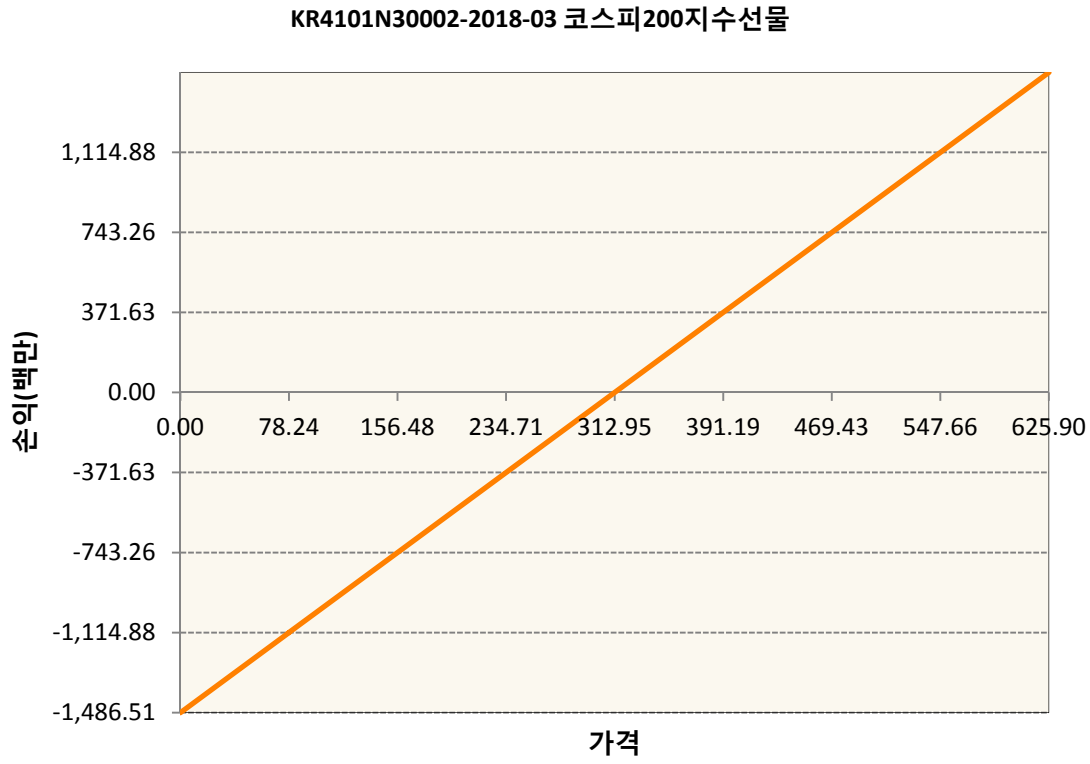
스마트인덱스모

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	1,487	0	1,487	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%	-79	-79	-79	-79	-79	-79	-79
-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%	79	79	79	79	79	79	79
8.00%	119	119	119	119	119	119	119

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

80

공시일	2018-03-02
기준일	2018-02-28

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	13,869	0	13,869	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWMXWO0(신한MXWO 미래S180222	1,122

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

411

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2018-03-02
기준일	2018-02-28

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	403

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

402

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2018-03-02
기준일	2018-02-28

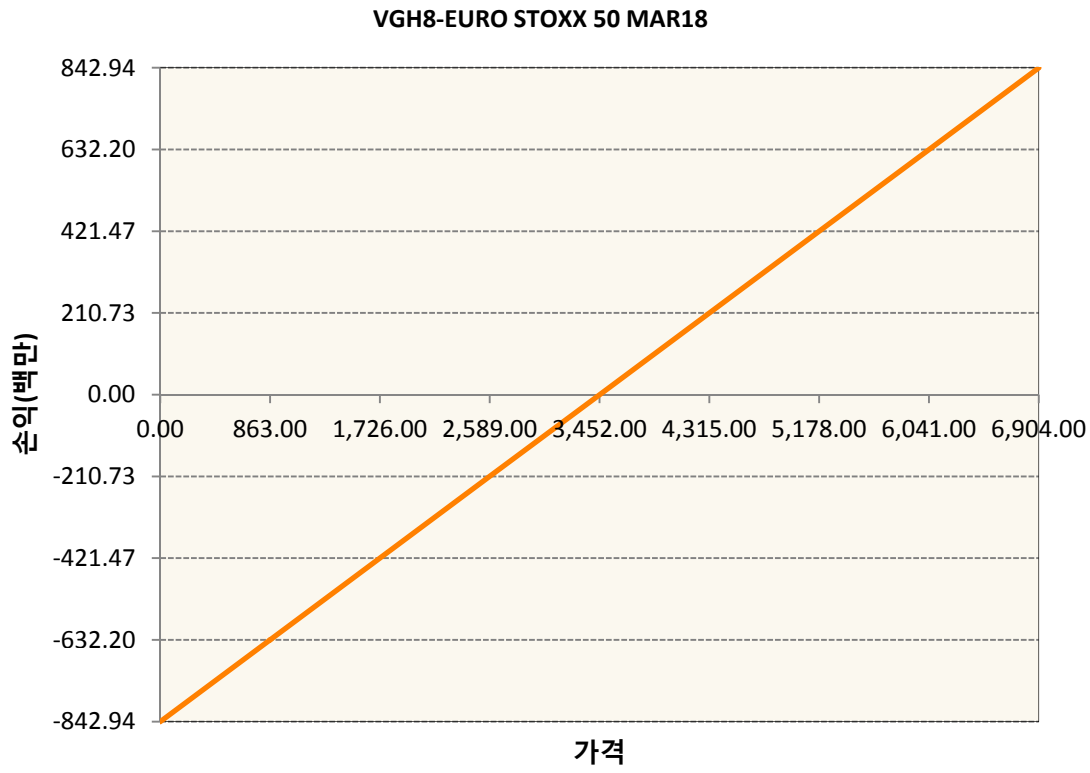
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	843	0	843	

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	2018-03-02
기준일	2018-02-28

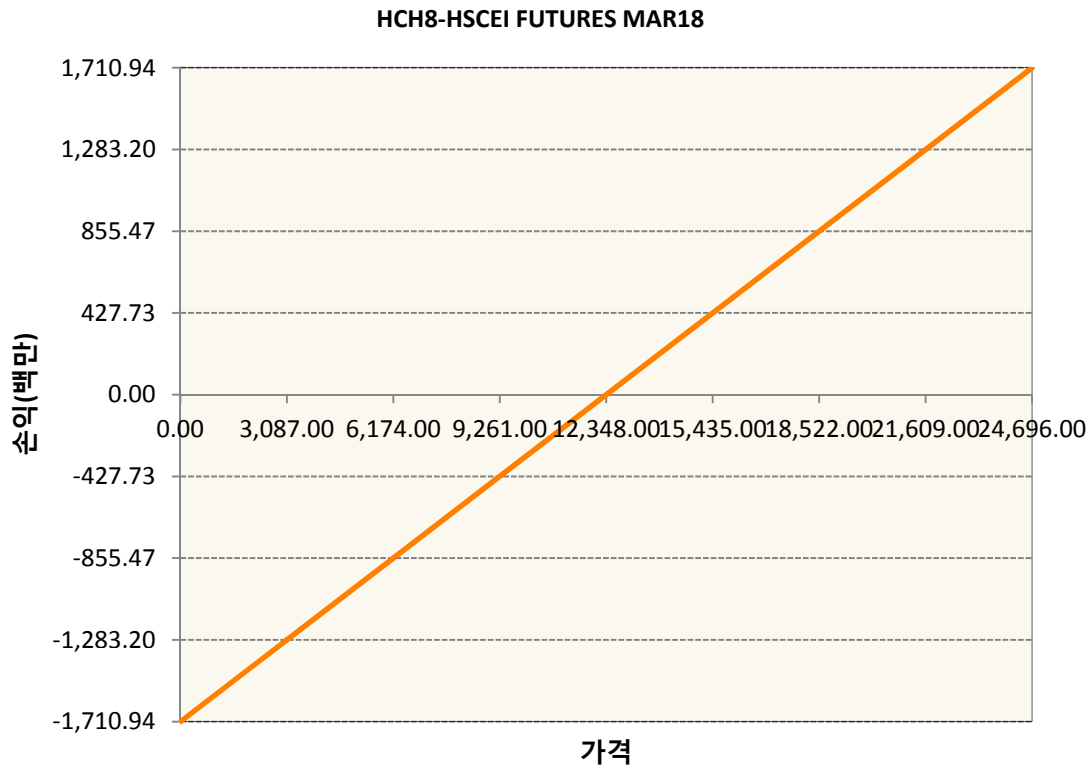
차이나인덱스모(주식-파생형)

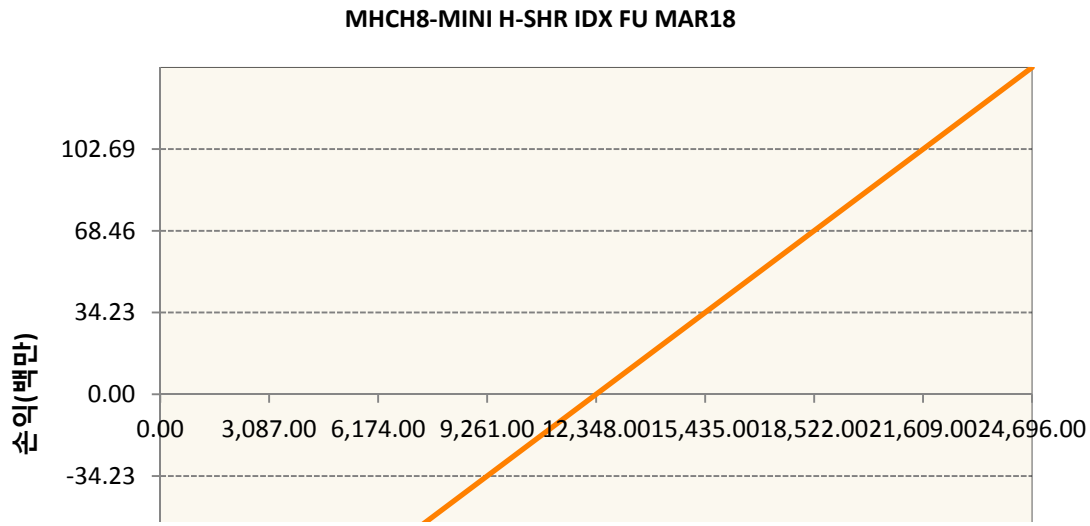
1. 계약금액

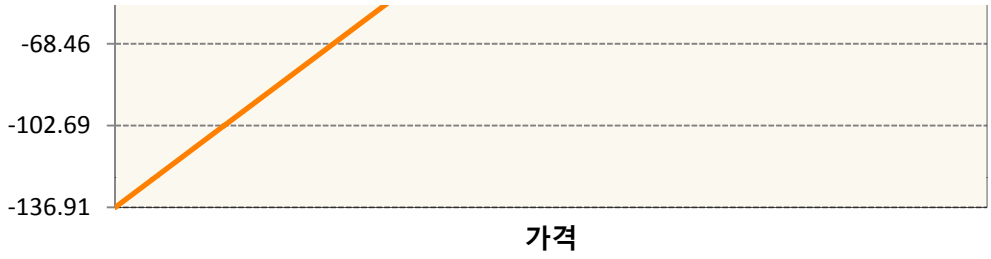
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,848	0	1,848	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCH8	HSCEI FUTURES MAR18	137
MHCH8	MINI H-SHR IDX FU MAR18	11

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

공시일	2018-03-02
기준일	2018-02-28

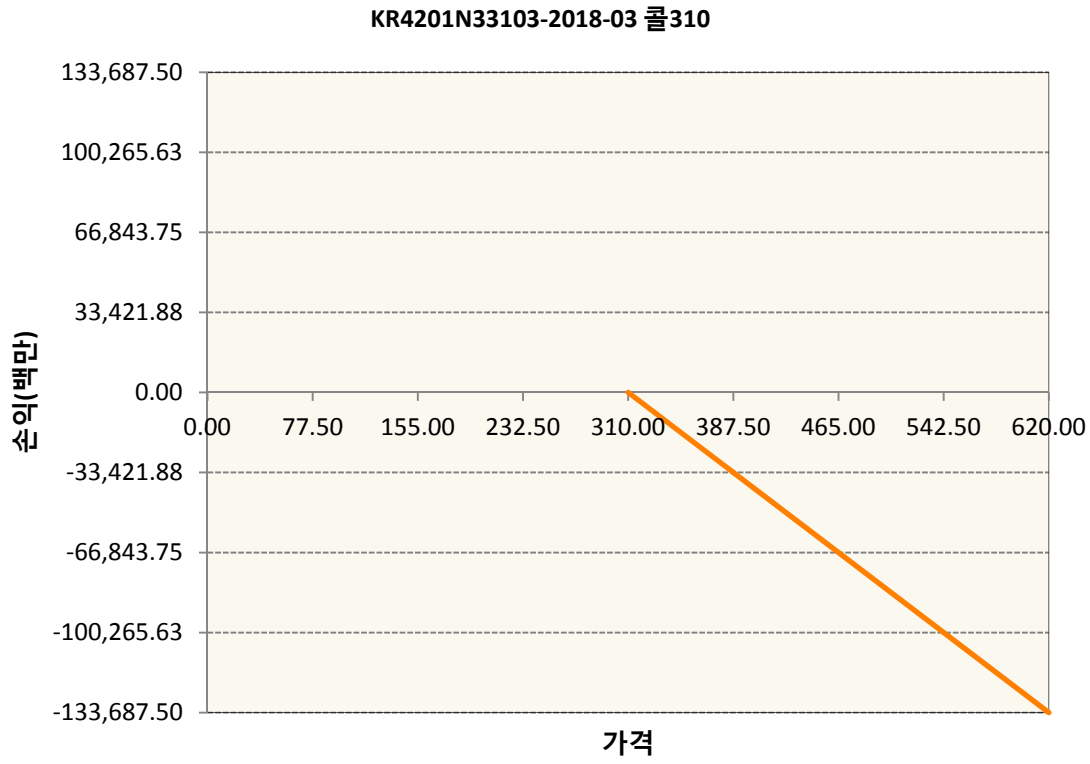
커버드콜모(주식혼합-파생형)

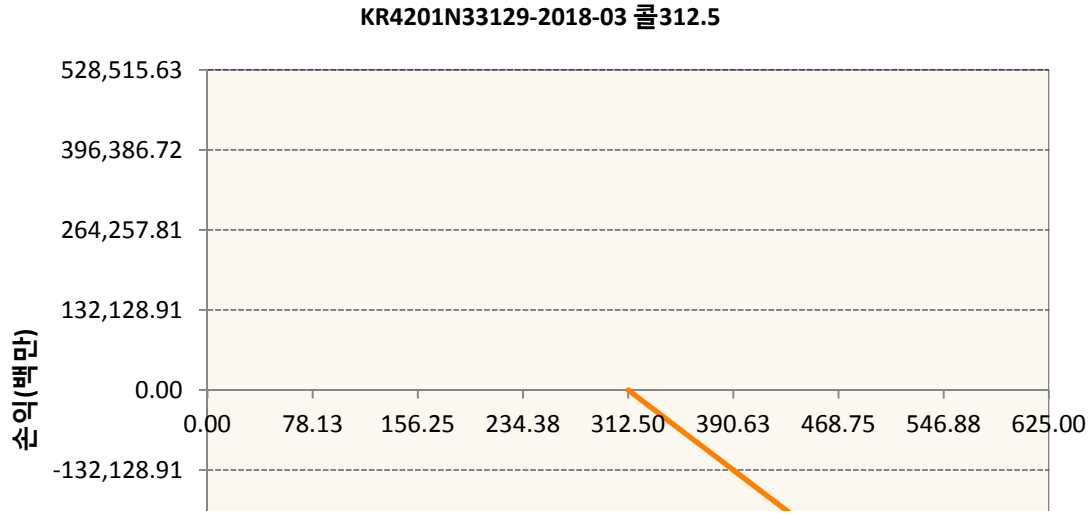
1. 계약금액

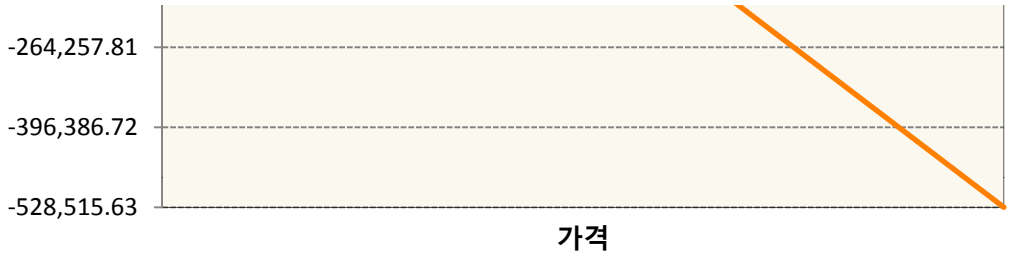
(단위:백만원)

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



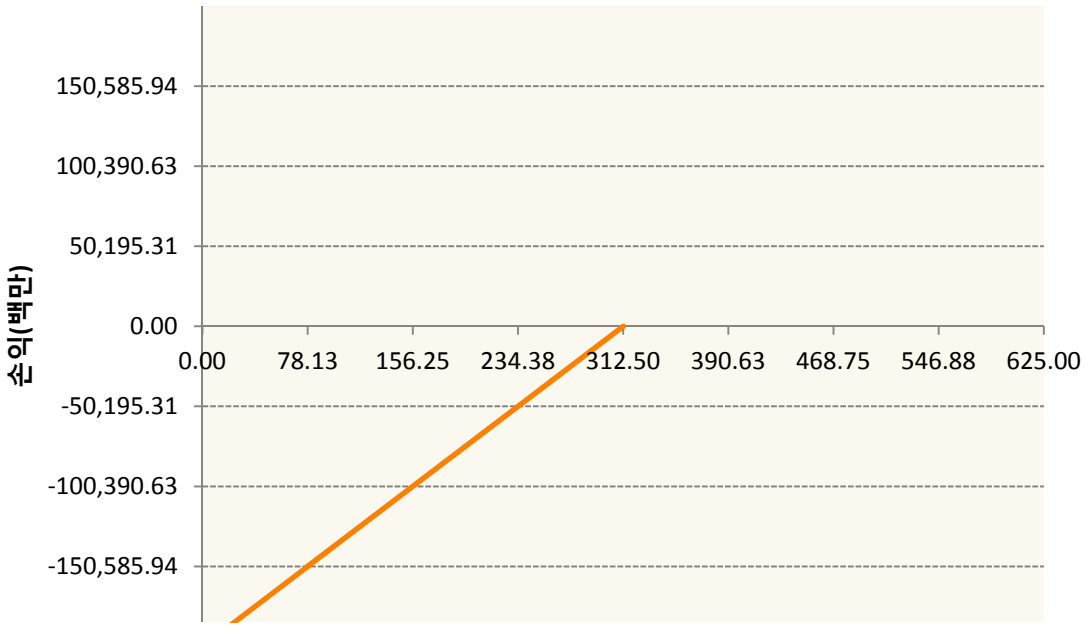




KR4301N33101-2018-03 풋310



KR4301N33127-2018-03 풋312.5





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201N3312018-03 콜310							9,353
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	2,779	2,769	2,753	2,728	2,695	2,653	2,603
-5.33%	2,684	2,625	2,554	2,472	2,379	2,279	2,171
-2.67%	2,129	1,982	1,830	1,675	1,517	1,357	1,196
0%	508	340	171	0	-171	-343	-516
2.67%	-2,273	-2,366	-2,470	-2,584	-2,707	-2,836	-2,971
5.33%	-5,674	-5,700	-5,737	-5,786	-5,845	-5,915	-5,994
8.00%	-9,244	-9,248	-9,256	-9,270	-9,290	-9,317	-9,353
KR4201N3312018-03 콜312.5							34,967
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	8,615	8,594	8,555	8,492	8,403	8,284	8,135
-5.33%	8,418	8,264	8,063	7,818	7,531	7,207	6,850
-2.67%	7,005	6,521	6,006	5,465	4,906	4,329	3,740
0%	2,075	1,384	692	0	-692	-1,384	-2,076
2.67%	-7,610	-8,085	-8,595	-9,132	-9,692	-10,271	-10,864
5.33%	-20,444	-20,610	-20,826	-21,090	-21,396	-21,742	-22,123
8.00%	-34,340	-34,371	-34,426	-34,511	-34,628	-34,780	-34,967
KR4301N3312018-03 풋310							17,109
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-17,099	-17,099	-17,100	-17,100	-17,101	-17,104	-17,109
-5.33%	-10,161	-10,169	-10,182	-10,203	-10,233	-10,271	-10,319
-2.67%	-3,544	-3,661	-3,790	-3,927	-4,072	-4,223	-4,379
0%	524	353	178	0	-181	-364	-548
2.67%	1,309	1,281	1,242	1,190	1,126	1,051	966
5.33%	1,338	1,338	1,336	1,332	1,325	1,314	1,297
8.00%	1,339	1,339	1,339	1,338	1,338	1,338	1,336
KR4301N3312018-03 풋312.5							14,141
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-14,138	-14,138	-14,138	-14,138	-14,138	-14,139	-14,141
-5.33%	-8,780	-8,782	-8,786	-8,793	-8,804	-8,820	-8,841
-2.67%	-3,515	-3,568	-3,632	-3,705	-3,787	-3,876	-3,972
0%	453	302	151	0	-151	-302	-453
2.67%	1,621	1,574	1,515	1,447	1,369	1,283	1,191

5.33%	1,697	1,695	1,691	1,683	1,671	1,653	1,629
8.00%	1,698	1,698	1,698	1,697	1,697	1,695	1,693

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

86,196

공시일	2018-03-02
기준일	2018-02-28

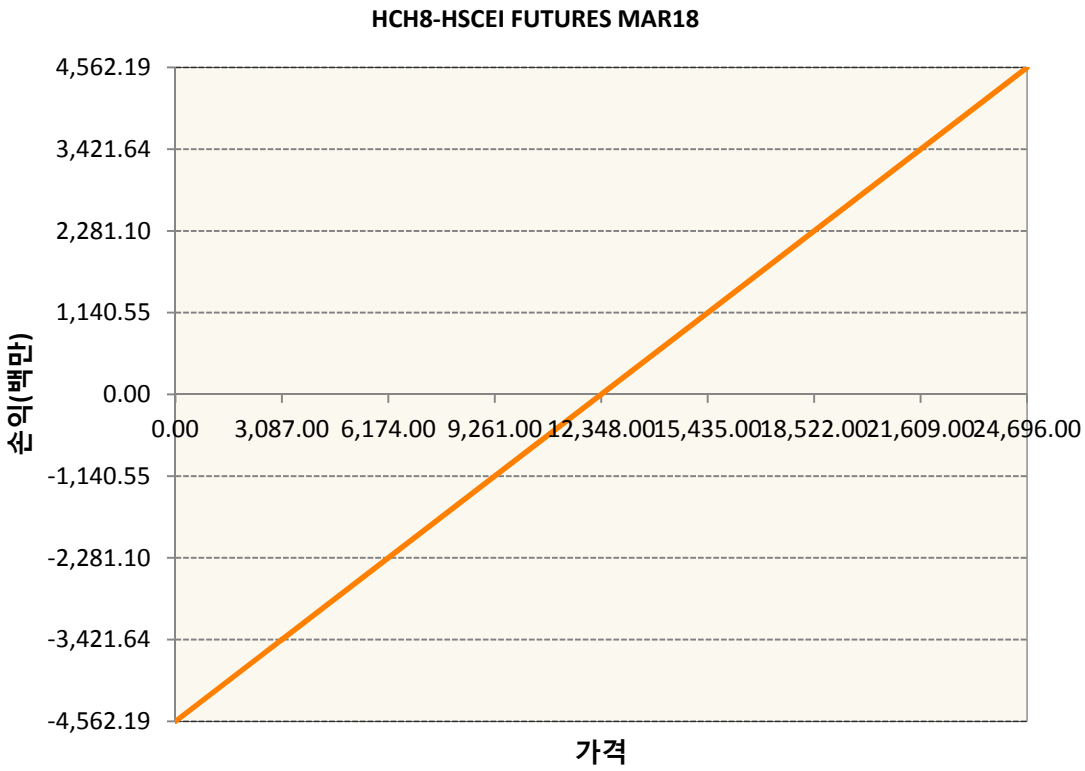
홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생

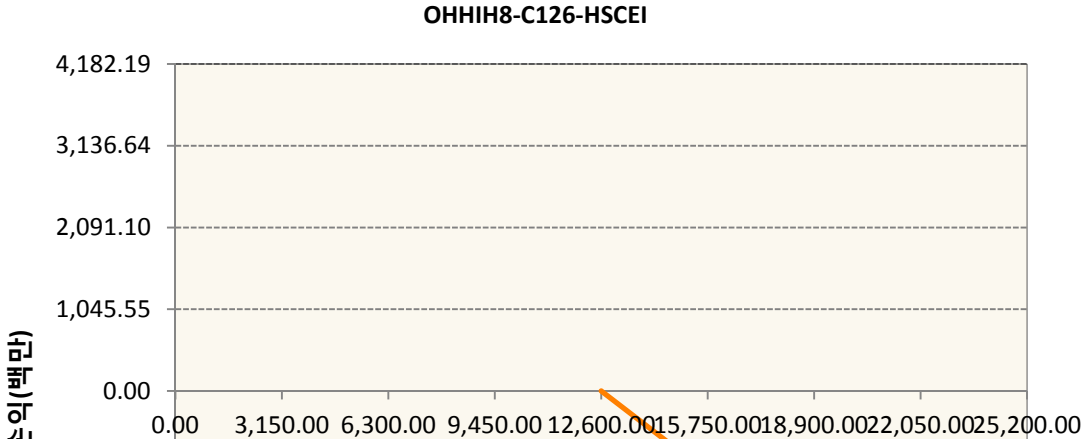
1. 계약금액

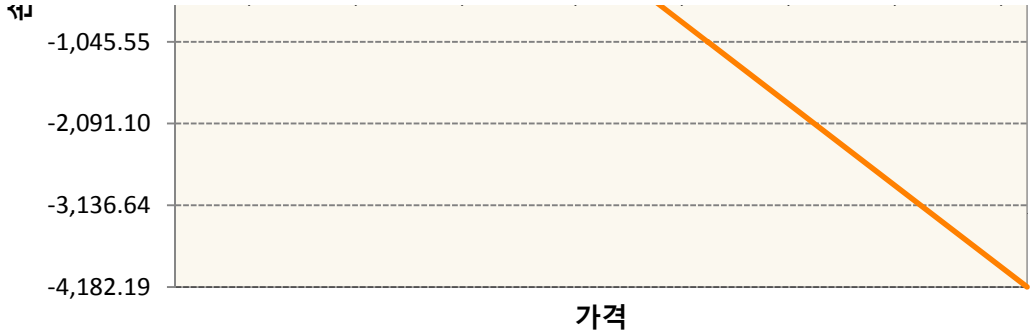
(단위:백만원)

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	4,562	0	4,562	장내
누계	유가증권	옵션	0	10,843	-10,843	장내

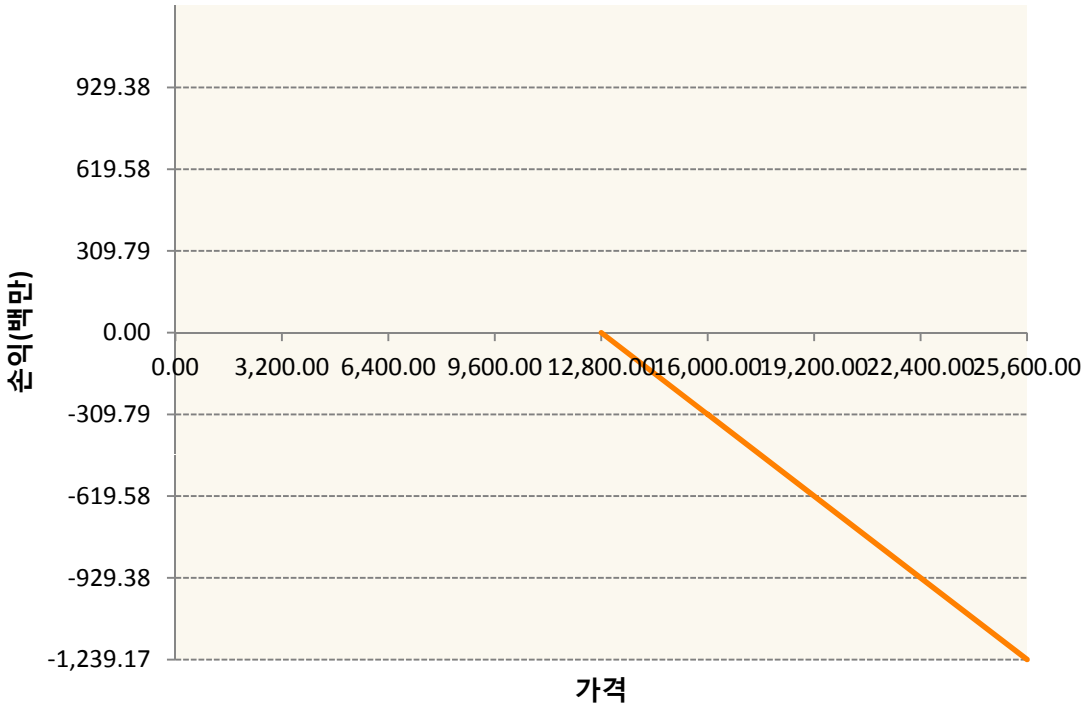
2. 만기시점의 손익구조



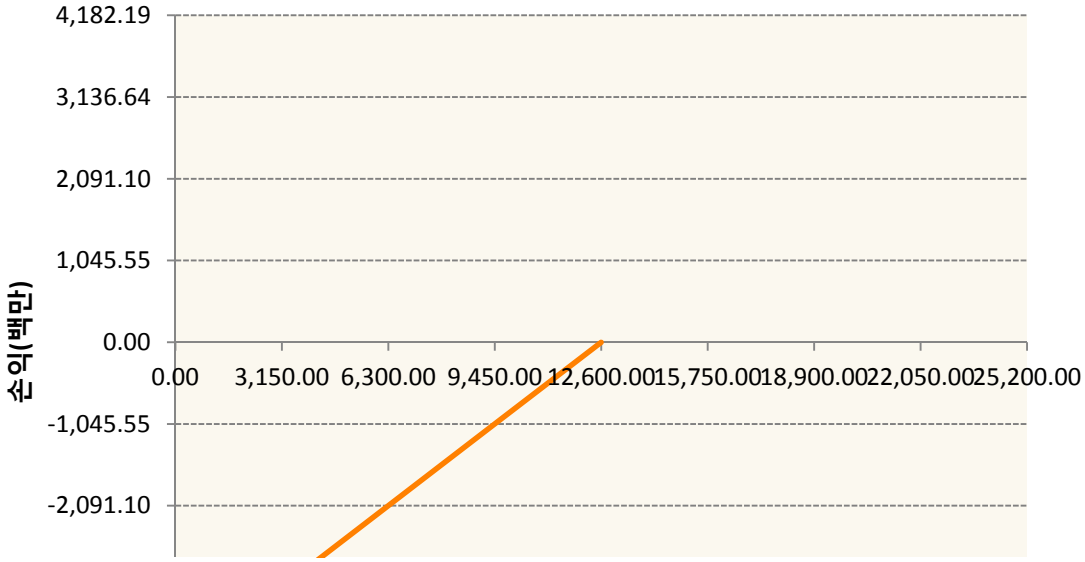


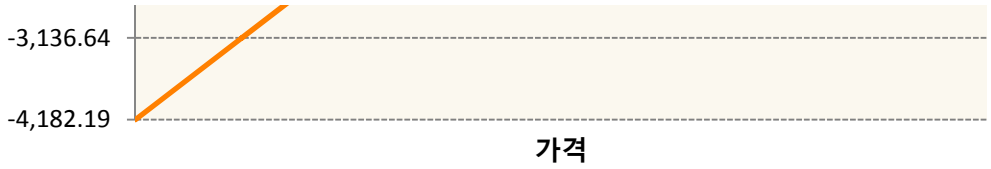


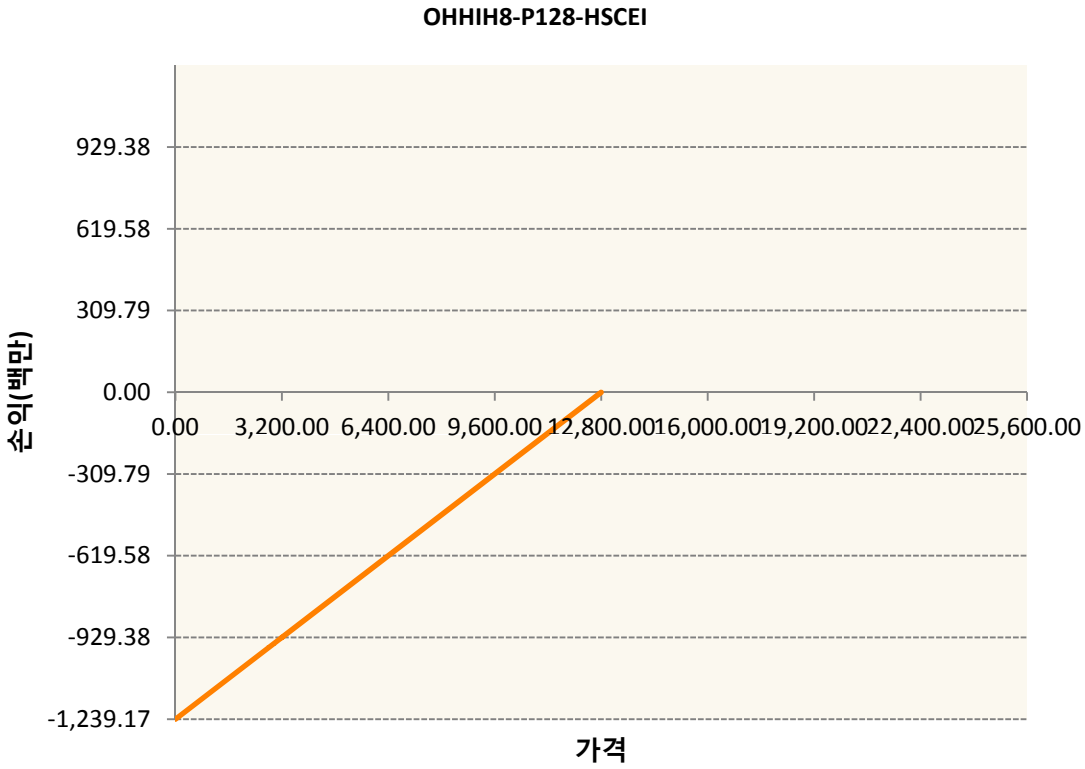
OHHIH8-C128-HSCEI



OHHIH8-P126-HSCEI







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCH8	HSCEI FUTURES MAR18	365
OHHIH8-C12	HSCEI	335
OHHIH8-C12	HSCEI	99
OHHIH8-P12	HSCEI	335
OHHIH8-P12	HSCEI	99

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

공시일	2018-03-02
기준일	2018-02-28

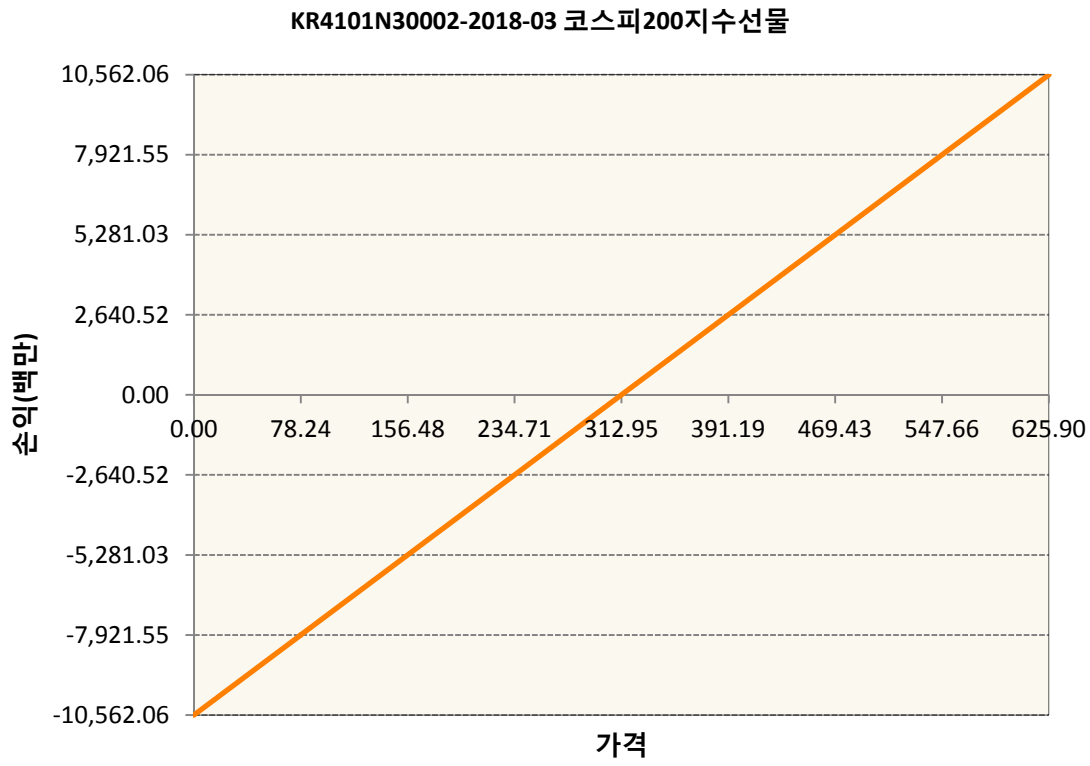
코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼

1. 계약금액

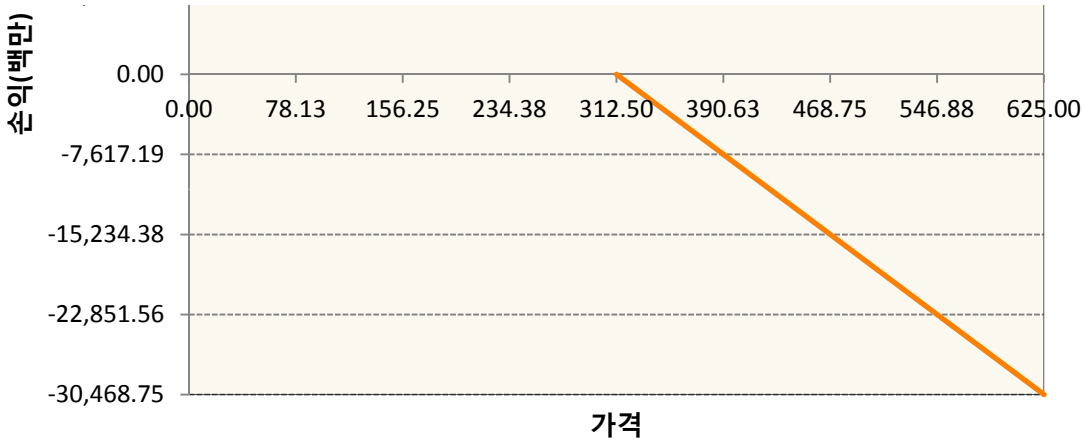
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	784	-784	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	772	0	772	장내
누계	유가증권	선물	10,562	0	10,562	장내
누계	유가증권	스왑	56,200	0	56,200	장외
누계	유가증권	옵션	0	55,313	-55,313	장내

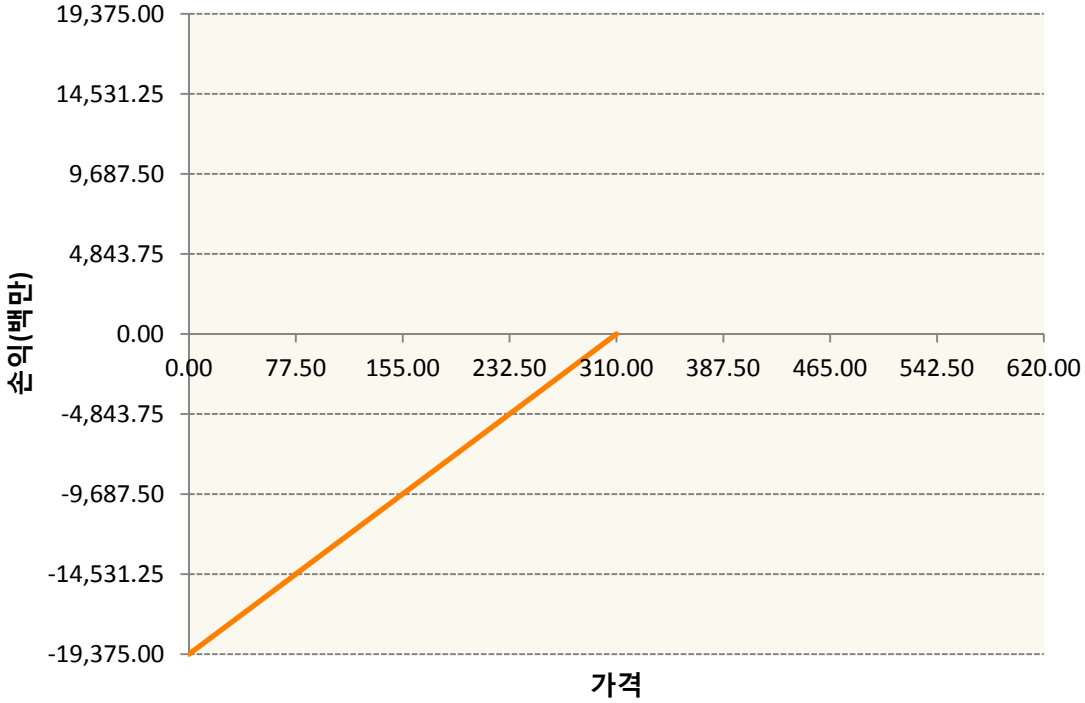
2. 만기시점의 손익구조



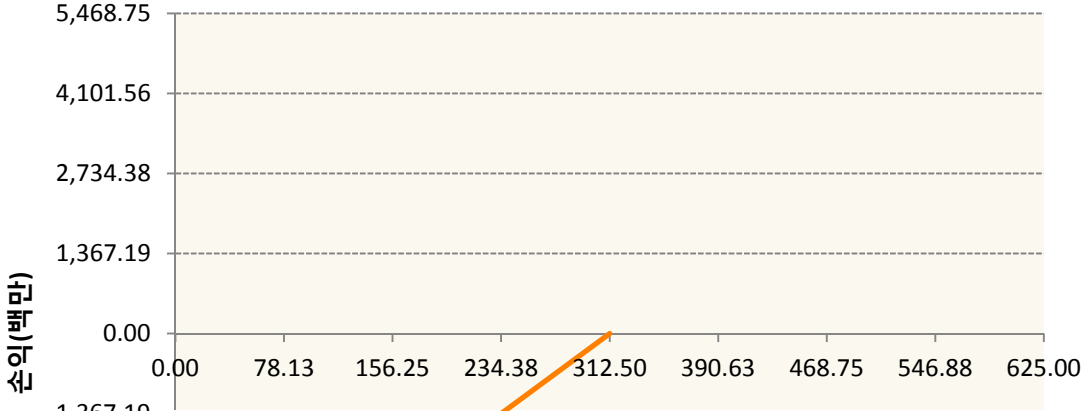




KR4301N33101-2018-03 풋310



KR4301N33127-2018-03 풋312.5





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_2							1,463
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,463	-1,463	-1,463	-1,463	-1,463	-1,463	-1,463
-5.33%	-975	-975	-975	-975	-975	-975	-975
-2.67%	-488	-488	-488	-488	-488	-488	-488
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	488	488	488	488	488	488	488
5.33%	975	975	975	975	975	975	975
8.00%	1,463	1,463	1,463	1,463	1,463	1,463	1,463
2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_3							277
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-277	-277	-277	-277	-277	-277	-277
-5.33%	-184	-184	-184	-184	-184	-184	-184
-2.67%	-92	-92	-92	-92	-92	-92	-92
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	92	92	92	92	92	92	92
5.33%	184	184	184	184	184	184	184
8.00%	277	277	277	277	277	277	277
2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_4							158
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-158	-158	-158	-158	-158	-158	-158
-5.33%	-105	-105	-105	-105	-105	-105	-105
-2.67%	-53	-53	-53	-53	-53	-53	-53
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	53	53	53	53	53	53	53
5.33%	105	105	105	105	105	105	105
8.00%	158	158	158	158	158	158	158
2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_5							237
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%

-8.00%	-237	-237	-237	-237	-237	-237	-237
-5.33%	-158	-158	-158	-158	-158	-158	-158
-2.67%	-79	-79	-79	-79	-79	-79	-79
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	79	79	79	79	79	79	79
5.33%	158	158	158	158	158	158	158
8.00%	237	237	237	237	237	237	237
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_6						198
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-198	-198	-198	-198	-198	-198	-198
-5.33%	-132	-132	-132	-132	-132	-132	-132
-2.67%	-66	-66	-66	-66	-66	-66	-66
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	66	66	66	66	66	66	66
5.33%	132	132	132	132	132	132	132
8.00%	198	198	198	198	198	198	198
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_7						253
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-253	-253	-253	-253	-253	-253	-253
-5.33%	-169	-169	-169	-169	-169	-169	-169
-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%	169	169	169	169	169	169	169
8.00%	253	253	253	253	253	253	253
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_8						468
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-468	-468	-468	-468	-468	-468	-468
-5.33%	-312	-312	-312	-312	-312	-312	-312
-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%	312	312	312	312	312	312	312
8.00%	468	468	468	468	468	468	468
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_10						277
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-277	-277	-277	-277	-277	-277	-277
-5.33%	-184	-184	-184	-184	-184	-184	-184
-2.67%	-92	-92	-92	-92	-92	-92	-92
0%	0	0	0	0	0	0	0

2.67%	92	92	92	92	92	92	92
5.33%	184	184	184	184	184	184	184
8.00%	277	277	277	277	277	277	277
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_11						632
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-632	-632	-632	-632	-632	-632	-632
-5.33%	-422	-422	-422	-422	-422	-422	-422
-2.67%	-211	-211	-211	-211	-211	-211	-211
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	211	211	211	211	211	211	211
5.33%	422	422	422	422	422	422	422
8.00%	632	632	632	632	632	632	632
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_12						474
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-474	-474	-474	-474	-474	-474	-474
-5.33%	-316	-316	-316	-316	-316	-316	-316
-2.67%	-158	-158	-158	-158	-158	-158	-158
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	158	158	158	158	158	158	158
5.33%	316	316	316	316	316	316	316
8.00%	474	474	474	474	474	474	474
	KR4101N30(	2018-03 코스피200지수선물					845
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-845	-845	-845	-845	-845	-845	-845
-5.33%	-563	-563	-563	-563	-563	-563	-563
-2.67%	-282	-282	-282	-282	-282	-282	-282
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	282	282	282	282	282	282	282
5.33%	563	563	563	563	563	563	563
8.00%	845	845	845	845	845	845	845
	KR4201N331	2018-03 콜312.5					2,016
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	497	495	493	490	484	478	469
-5.33%	485	476	465	451	434	415	395
-2.67%	404	376	346	315	283	250	216
0%	120	80	40	0	-40	-80	-120
2.67%	-439	-466	-495	-526	-559	-592	-626
5.33%	-1,179	-1,188	-1,201	-1,216	-1,233	-1,253	-1,275
8.00%	-1,980	-1,981	-1,985	-1,990	-1,996	-2,005	-2,016
	KR4301N331	2018-03 풋310					1,284

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,284	-1,284	-1,284	-1,284	-1,284	-1,284	-1,284
-5.33%	-763	-763	-764	-766	-768	-771	-775
-2.67%	-266	-275	-285	-295	-306	-317	-329
0%	39	27	13	0	-14	-27	-41
2.67%	98	96	93	89	85	79	73
5.33%	100	100	100	100	99	99	97
8.00%	100	100	100	100	100	100	100
	KR4301N3312018-03 풋312.5						385

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-385	-385	-385	-385	-385	-385	-385
-5.33%	-239	-239	-239	-239	-240	-240	-241
-2.67%	-96	-97	-99	-101	-103	-106	-108
0%	12	8	4	0	-4	-8	-12
2.67%	44	43	41	39	37	35	32
5.33%	46	46	46	46	46	45	44
8.00%	46	46	46	46	46	46	46

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

9,187

공시일	2018-03-02
기준일	2018-02-28

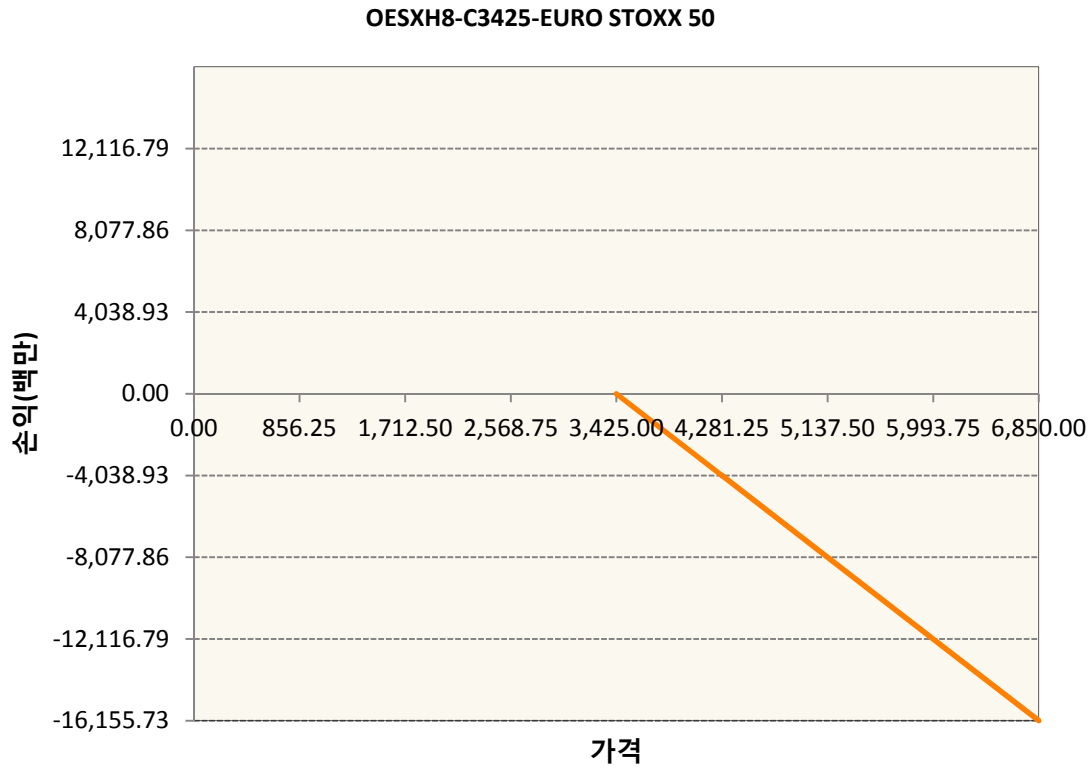
유로커버드콜모(주식혼합-파생형

1. 계약금액

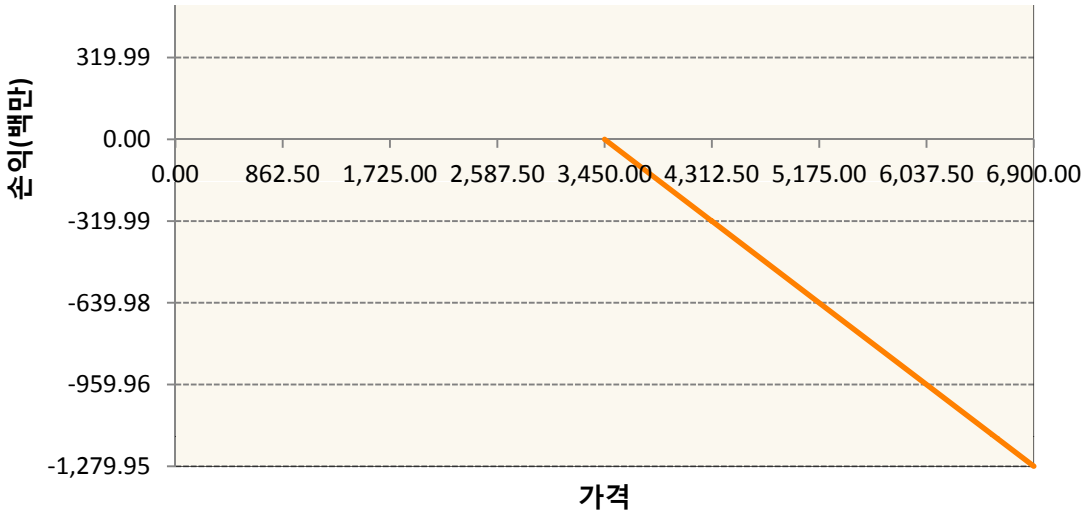
(단위:백만원)

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	9,338	0	9,338	
누계	유가증권	스왑	99,373	0	99,373	장외
누계	유가증권	옵션	0	34,871	-34,871	장내
누계	지수	스왑	52,999	0	52,999	장외

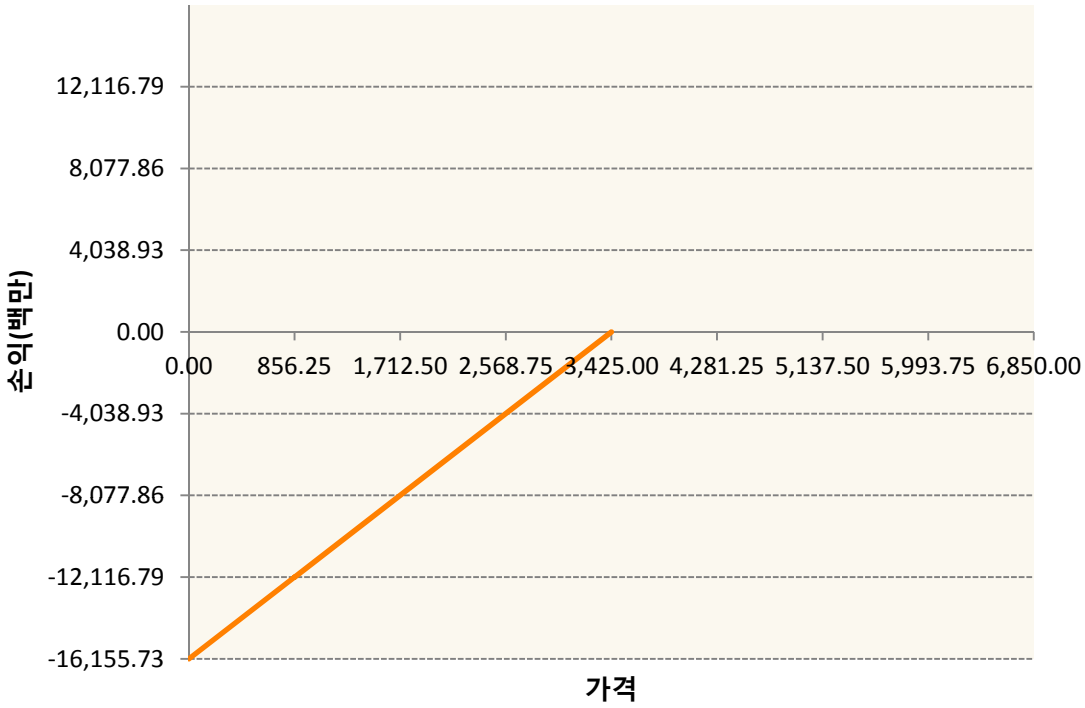
2. 만기시점의 손익구조



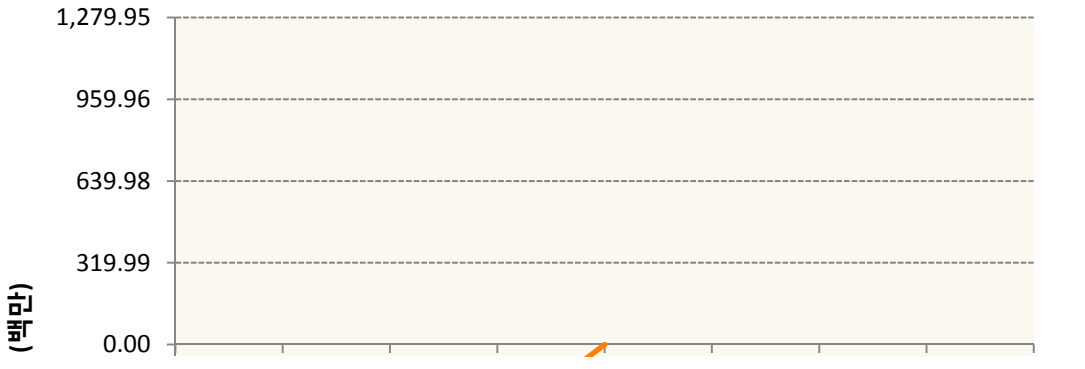


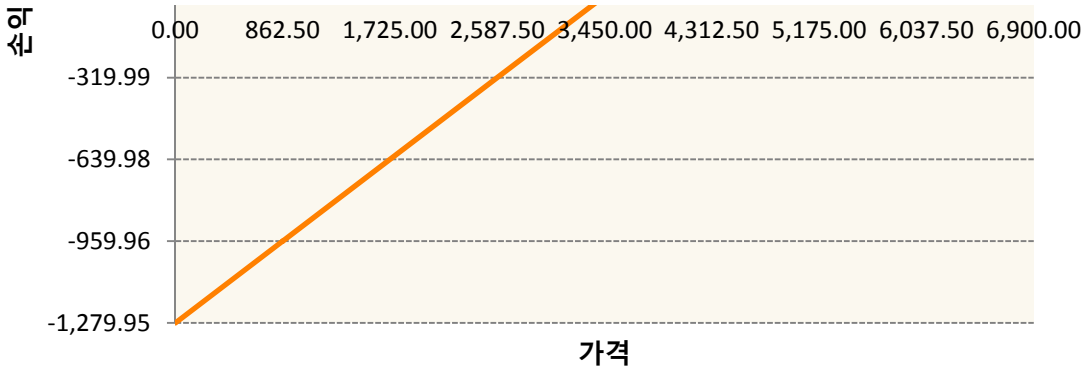


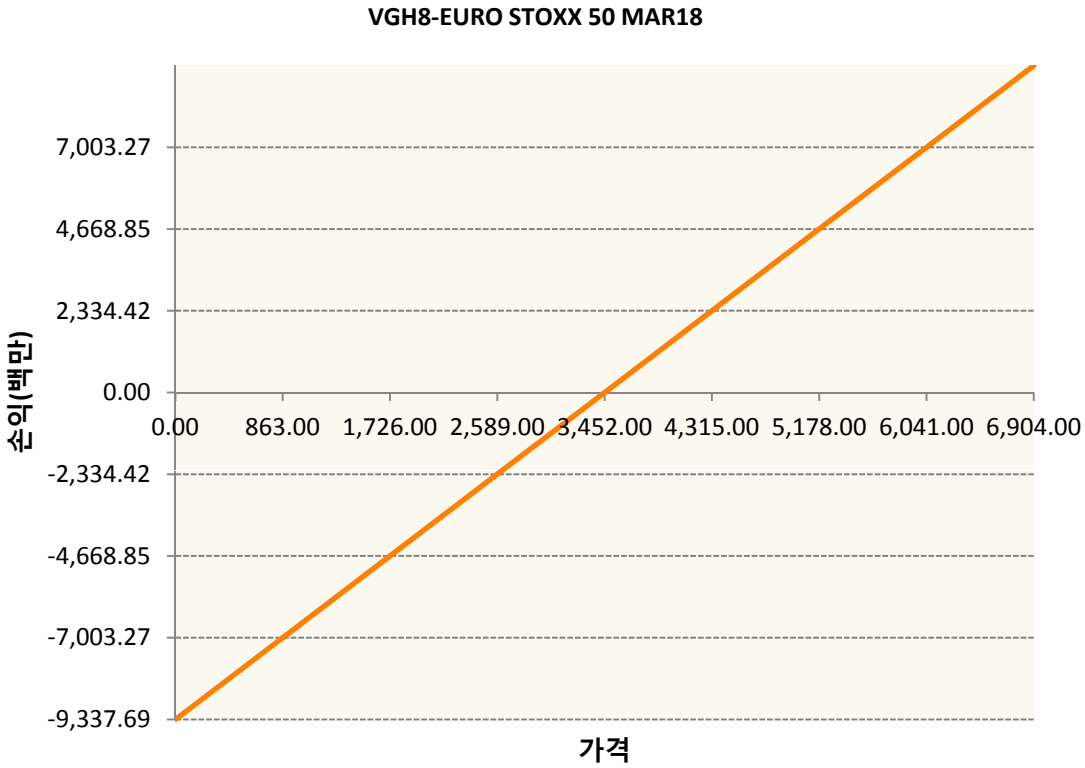
OESXH8-P3425-EURO STOXX 50



OESXH8-P3450-EURO STOXX 50







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)	(단위:백만원)
260105SGPX SG EURO Covered CALL STRATEGY - 994.569	190
260105SQPX SG EURO Covered CALL STRATEGY	356
OESXH8-C34 EURO STOXX 50	1,292
OESXH8-C34 EURO STOXX 50	102
OESXH8-P34 EURO STOXX 50	1,292
OESXH8-P34 EURO STOXX 50	102
VGH8 EURO STOXX 50 MAR18	747

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

2,399

공시일	2018-03-02
기준일	2018-02-28

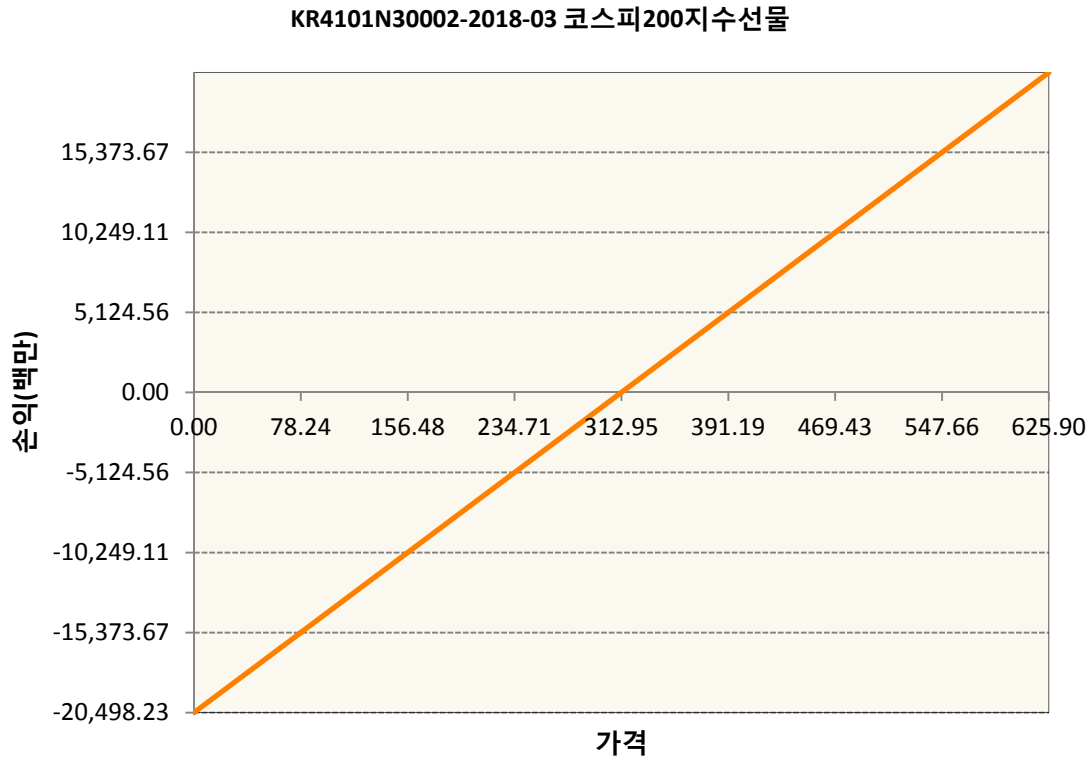
ETF스마트레버리지목표전환형8호

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	20,498	0	20,498	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101N30(2018-03 코스피200지수선물							1,639
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,639	-1,639	-1,639	-1,639	-1,639	-1,639	-1,639
-5.33%	-1,093	-1,093	-1,093	-1,093	-1,093	-1,093	-1,093
-2.67%	-546	-546	-546	-546	-546	-546	-546
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	546	546	546	546	546	546	546
5.33%	1,093	1,093	1,093	1,093	1,093	1,093	1,093
8.00%	1,639	1,639	1,639	1,639	1,639	1,639	1,639

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

1,107

공시일	2018-03-02
기준일	2018-02-28

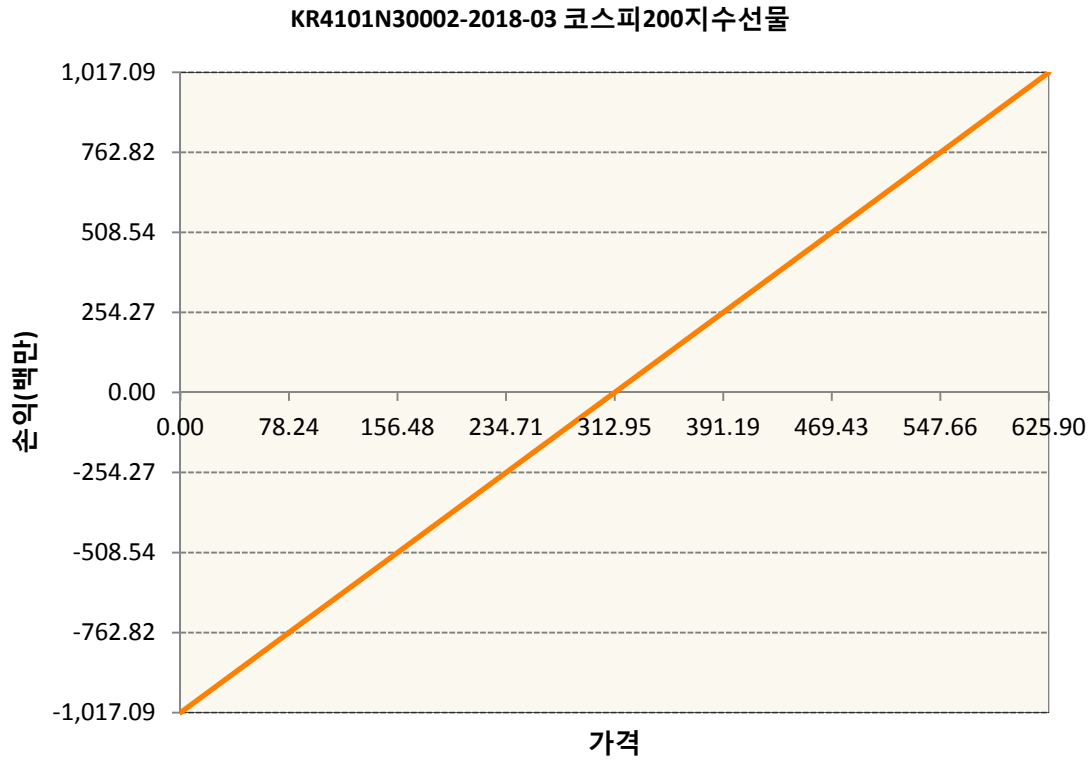
ETF스마트레버리지목표전환형9호

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	1,017	0	1,017	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101N30(2018-03 코스피200지수선물							81
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-81	-81	-81	-81	-81	-81	-81
-5.33%	-54	-54	-54	-54	-54	-54	-54
-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%	54	54	54	54	54	54	54
8.00%	81	81	81	81	81	81	81

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

55

공시일	2018-03-02
기준일	2018-02-28

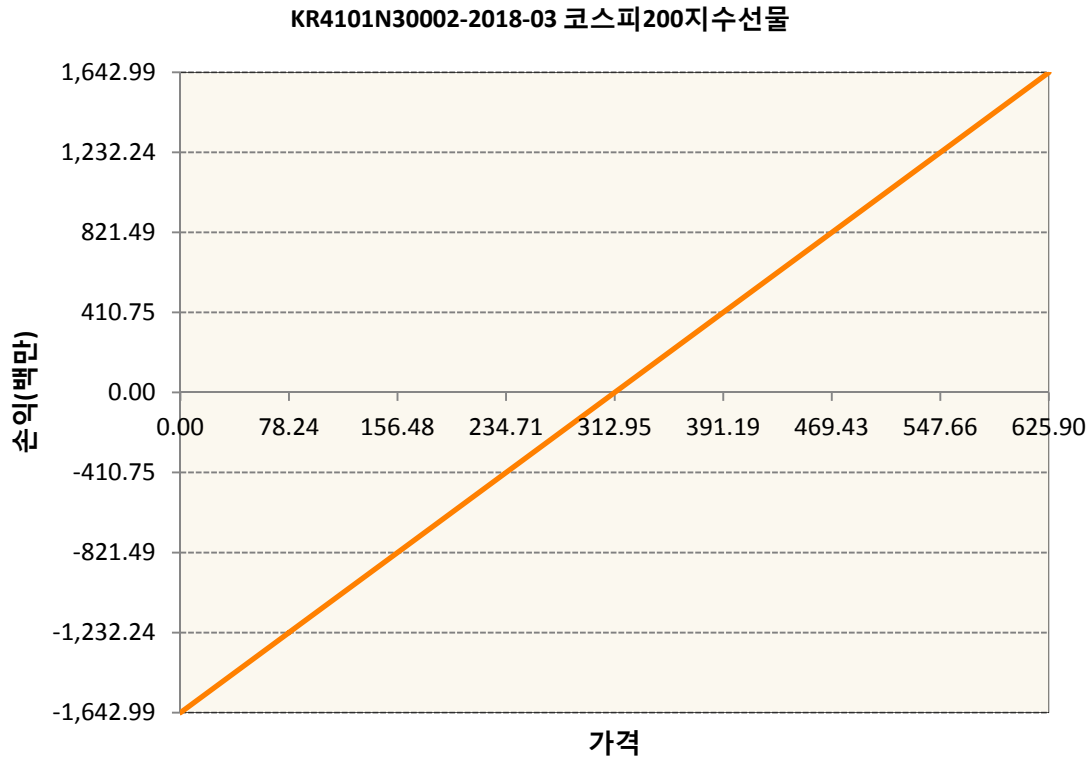
ETF스마트레버리지목표전환형10

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	1,643	0	1,643	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101N30(2018-03 코스피200지수선물							131
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-131	-131	-131	-131	-131	-131	-131
-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%	131	131	131	131	131	131	131

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

89

공시일	2018-03-02
기준일	2018-02-28

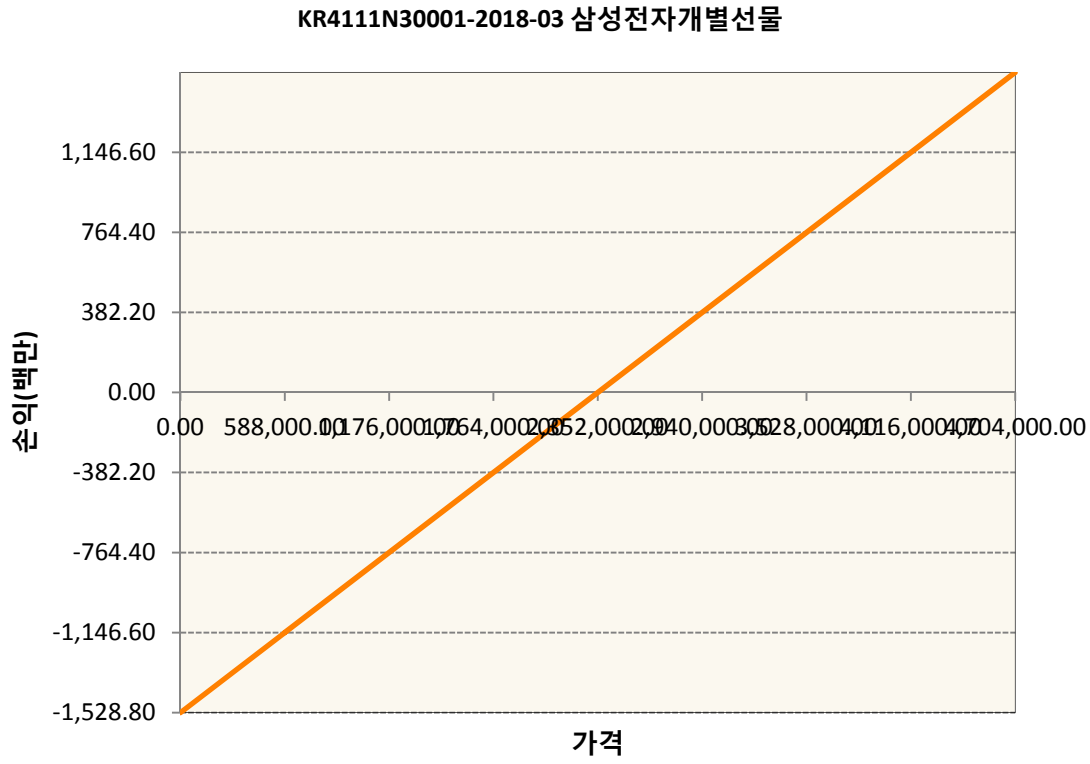
스마트KRX300인덱스1호(주식-파

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	1,529	0	1,529	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4111N30(2018-03 삼성전자개별선물							122
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-122	-122	-122	-122	-122	-122	-122
-5.33%	-82	-82	-82	-82	-82	-82	-82
-2.67%	-41	-41	-41	-41	-41	-41	-41
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	41	41	41	41	41	41	41
5.33%	82	82	82	82	82	82	82
8.00%	122	122	122	122	122	122	122

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

144

공시일	2018-03-02
기준일	2018-02-28

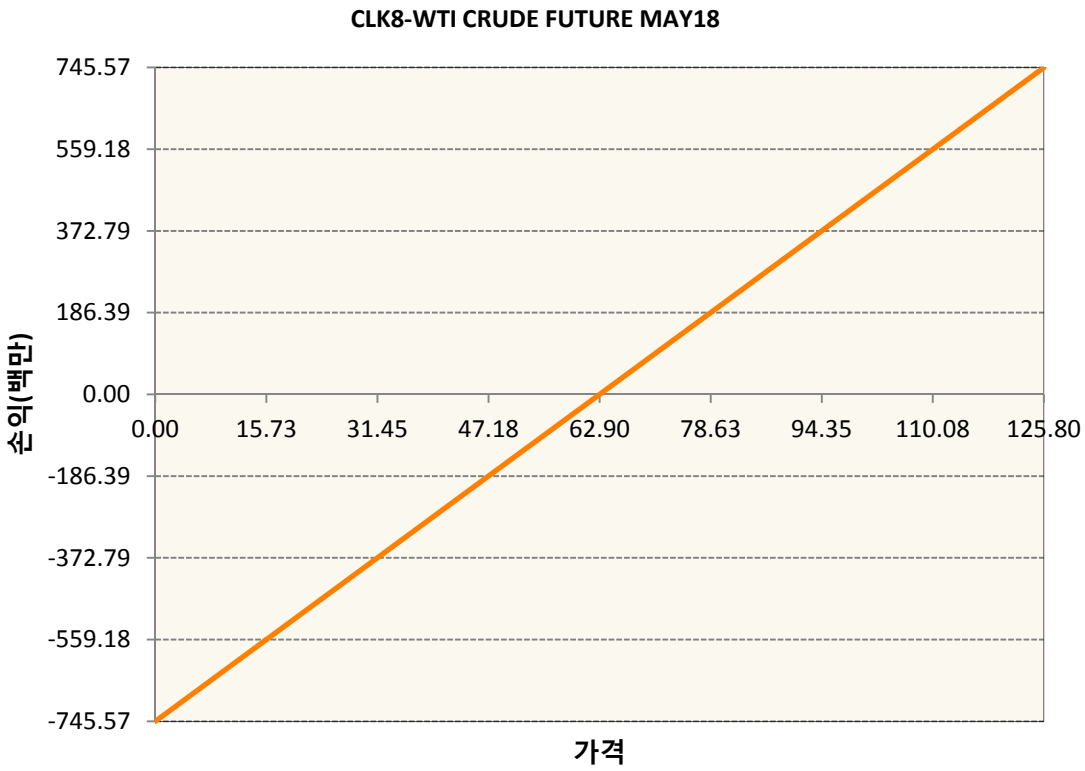
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

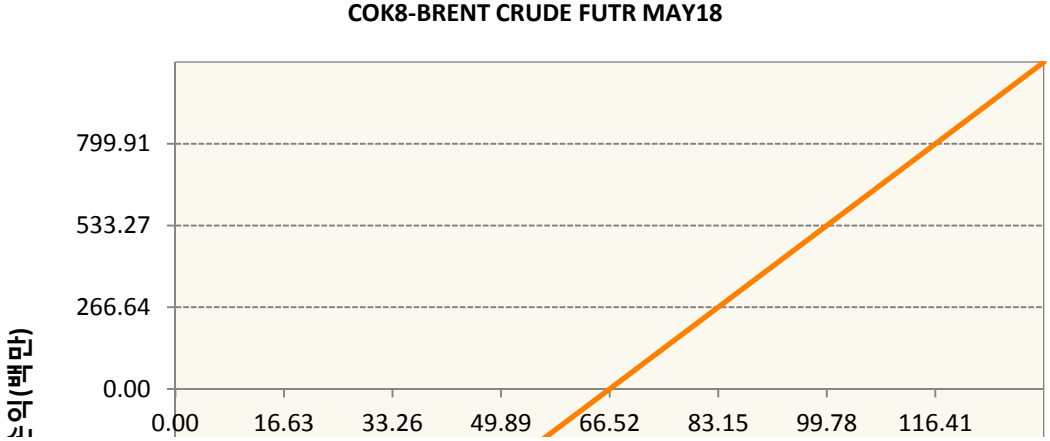
1. 계약금액

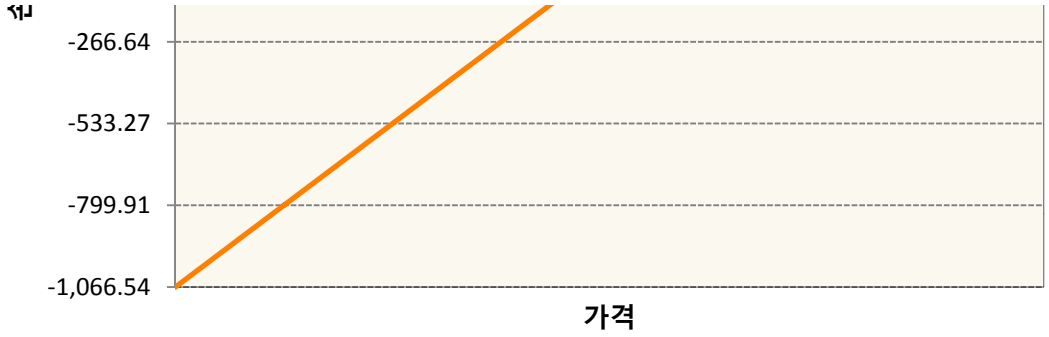
(단위:백만원)

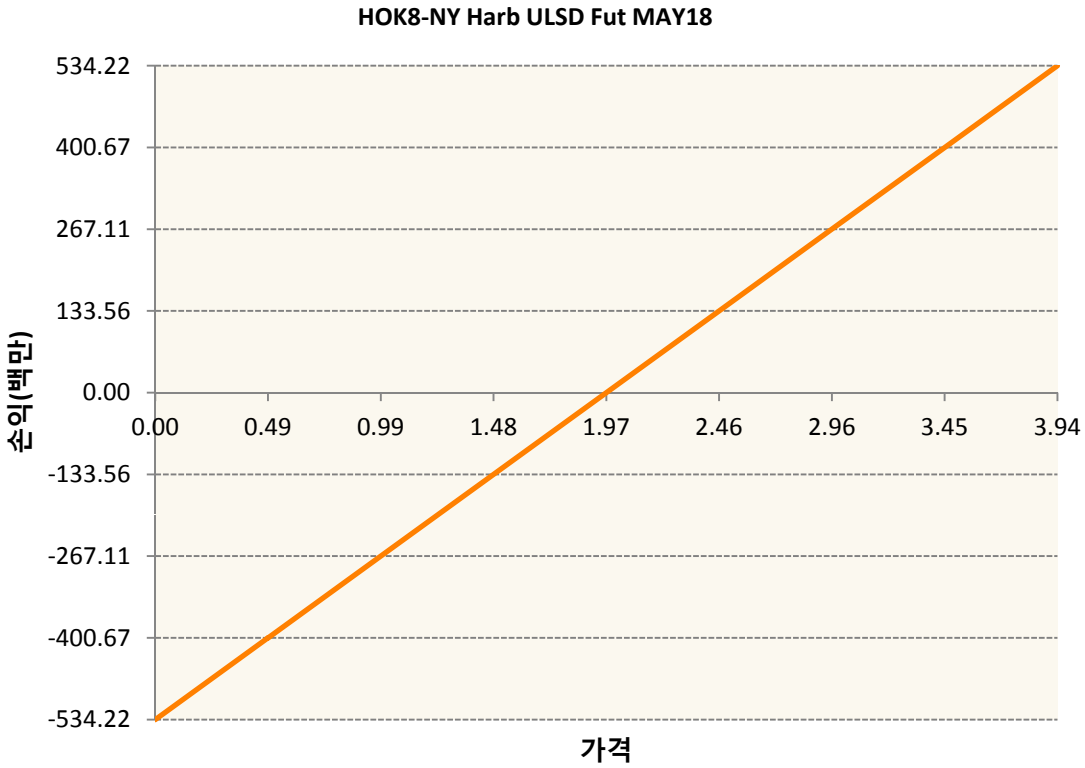
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	선물	유가증권	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	선물	유가증권	746	0	746	
누계	유가증권	선물	3,286	596	2,690	

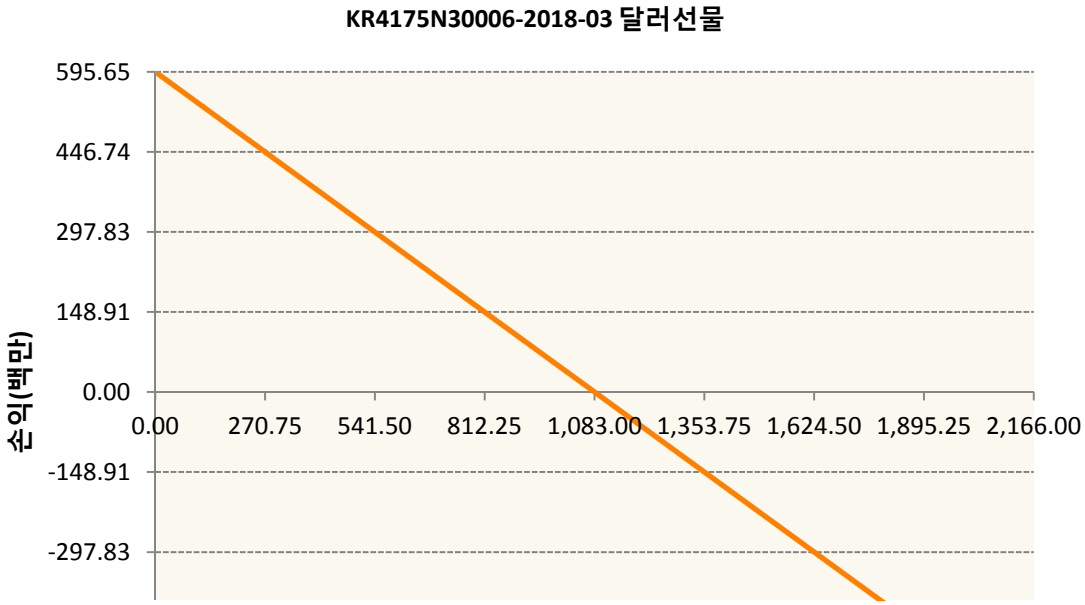
2. 만기시점의 손익구조

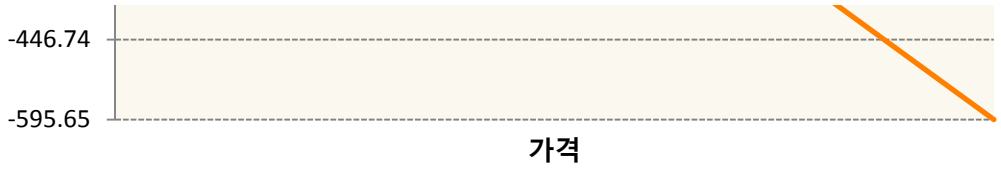


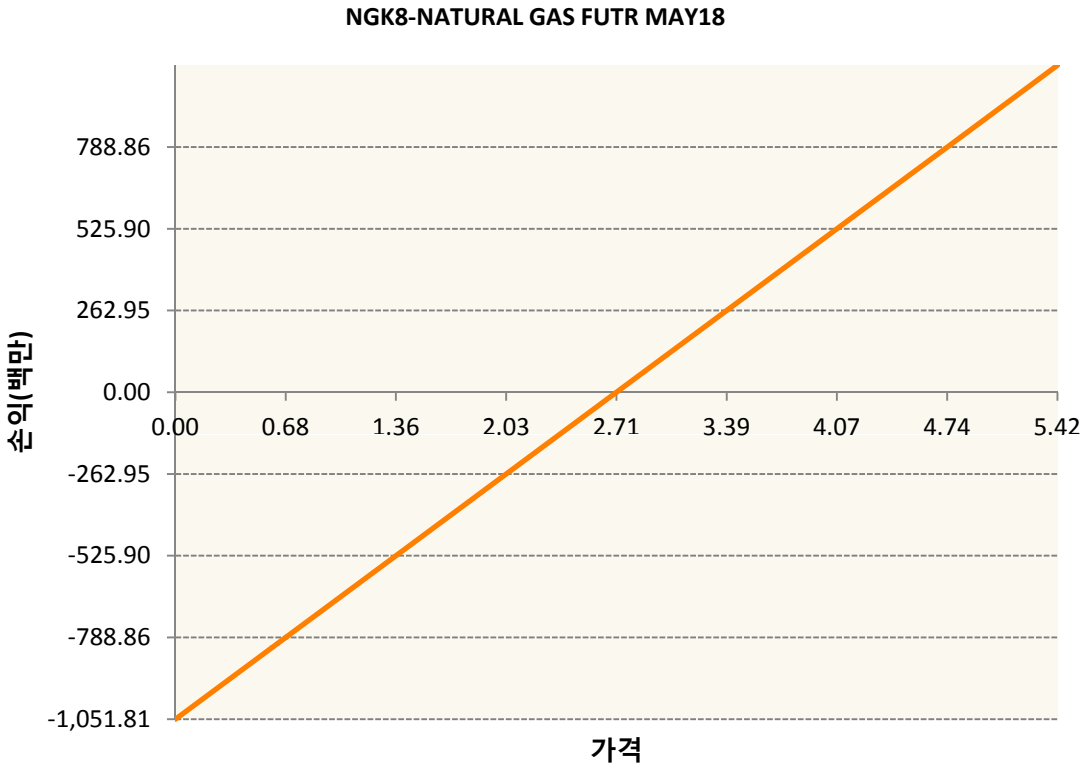


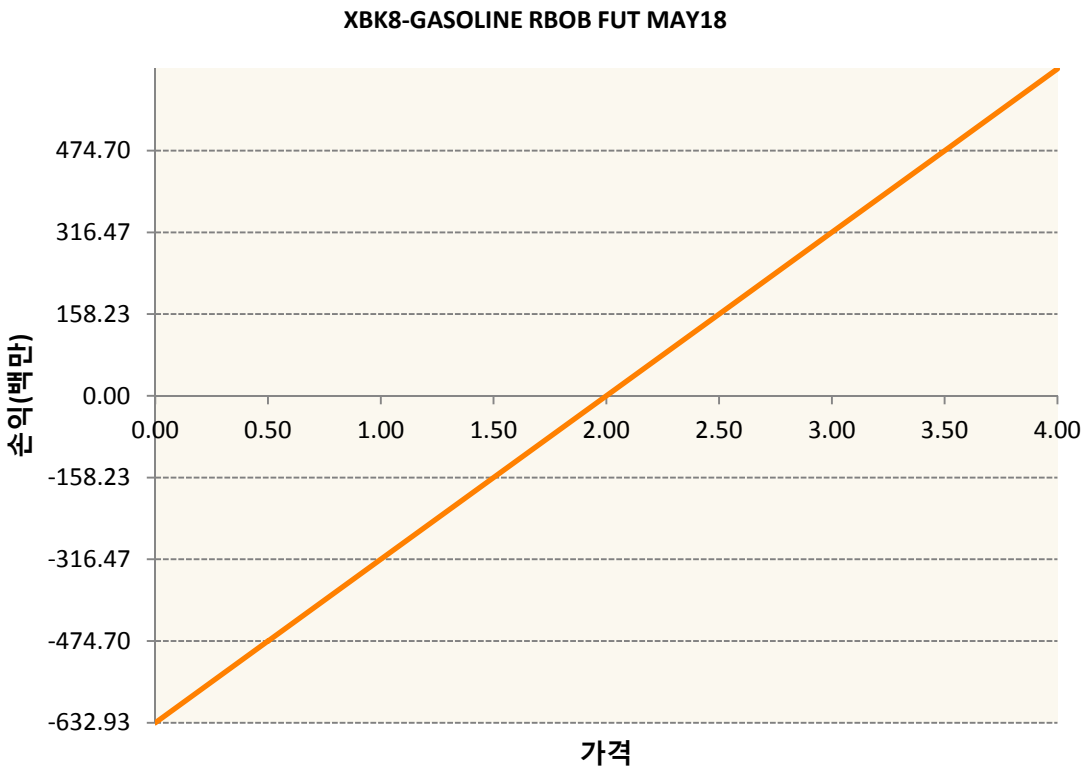

-266.64
-533.27
-799.91
-1,066.54
가격


HOK8-NY Harb ULSD Fut MAY18
534.22
400.67
267.11
133.56
0.00
-133.56
-267.11
-400.67
-534.22
0.00
0.49
0.99
1.48
1.97
2.46
2.96
3.45
3.94
손익(백만)
가격


KR4175N30006-2018-03 달러선물
595.65
446.74
297.83
148.91
0.00
-148.91
-297.83
0.00
270.75
541.50
812.25
1,083.00
1,353.75
1,624.50
1,895.25
2,166.00
손익(백만)


-446.74
-595.65
가격


NGK8-NATURAL GAS FUTR MAY18
788.86
525.90
262.95
0.00
-262.95
-525.90
-788.86
-1,051.81
0.00
0.68
1.36
2.03
2.71
3.39
4.07
4.74
5.42
손익(백만)
가격


XBK8-GASOLINE RBOB FUT MAY18
474.70
316.47
158.23
0.00
-158.23
-316.47
-474.70
-632.93
0.00
0.50
1.00
1.50
2.00
2.50
3.00
3.50
4.00
손익(백만)
가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLK8	WTI CRUDE FUTURE MAY18	60
COK8	BRENT CRUDE FUTR MAY18	85
HOK8	NY Harb ULSD Fut MAY18	43
KR4175N30(	2018-03 달러선물	48
NGK8	NATURAL GAS FUTR MAY18	84
XBK8	GASOLINE RBOB FUT MAY18	51

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

529

공시일	2018-03-02
기준일	2018-02-28

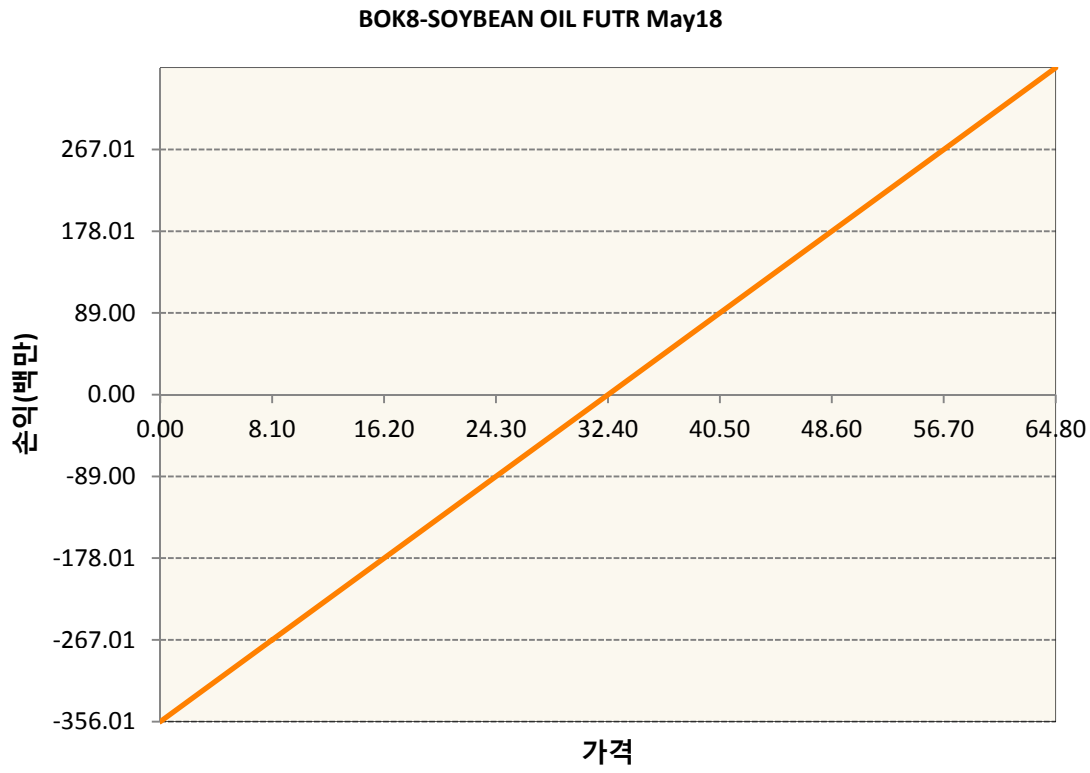
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

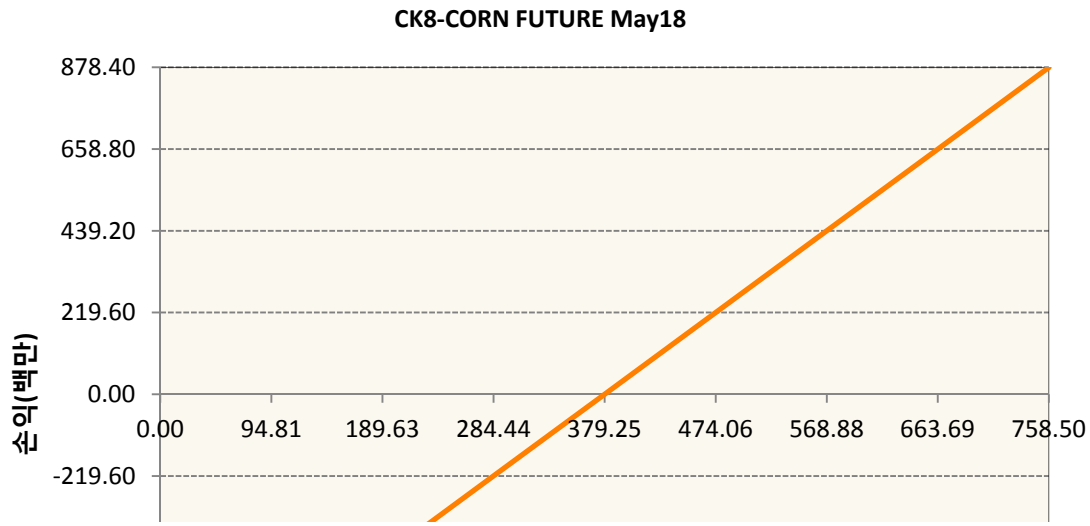
1. 계약금액

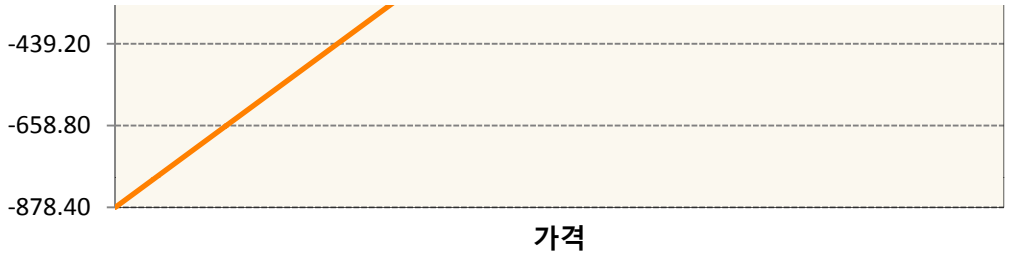
(단위:백만원)

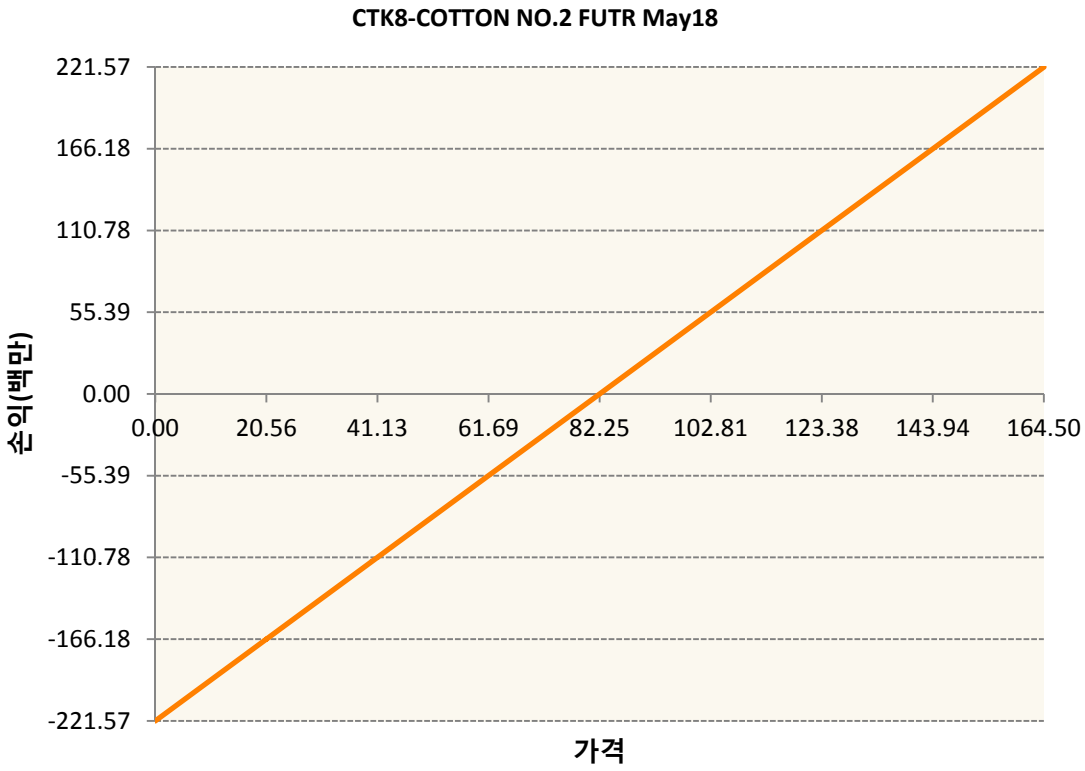
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	4,175	325	3,850	

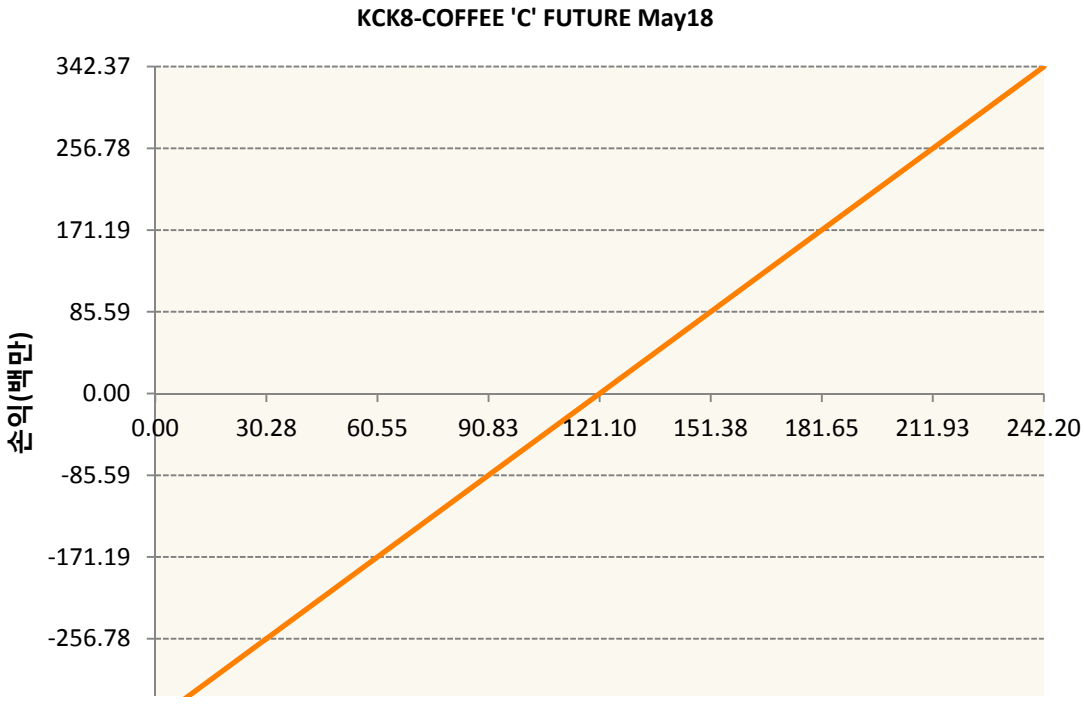
2. 만기시점의 손익구조

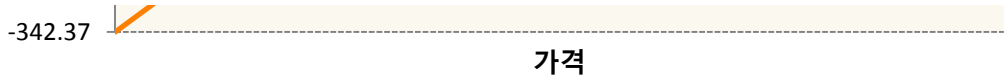


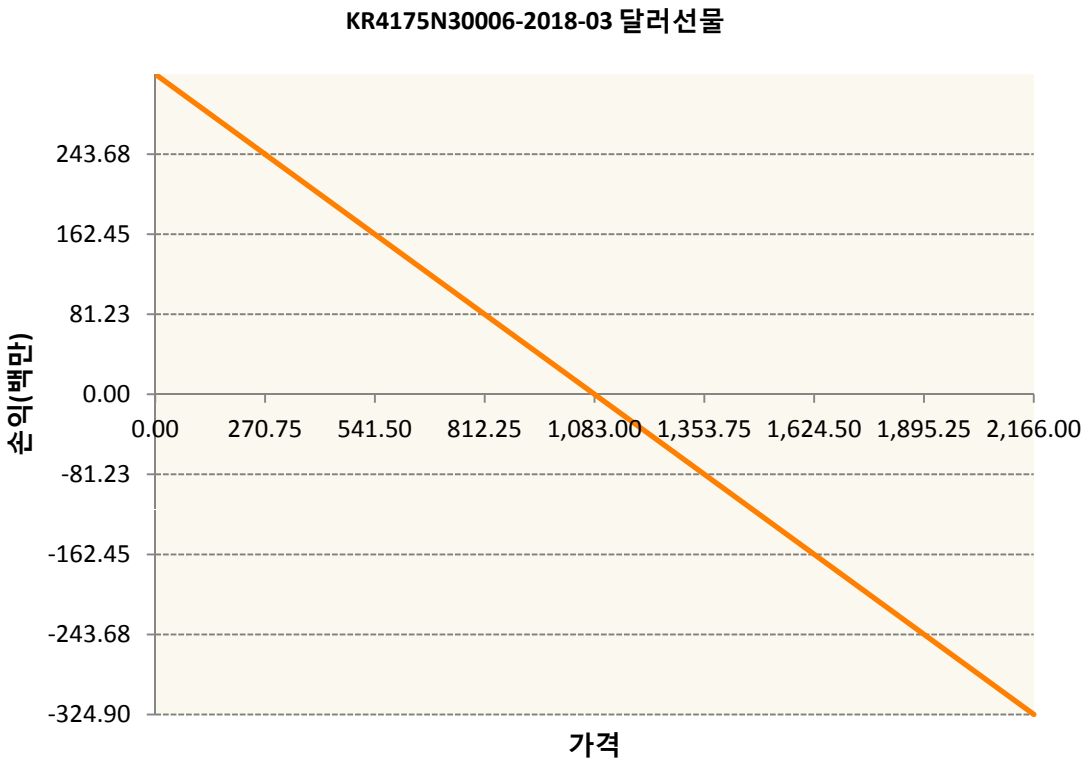


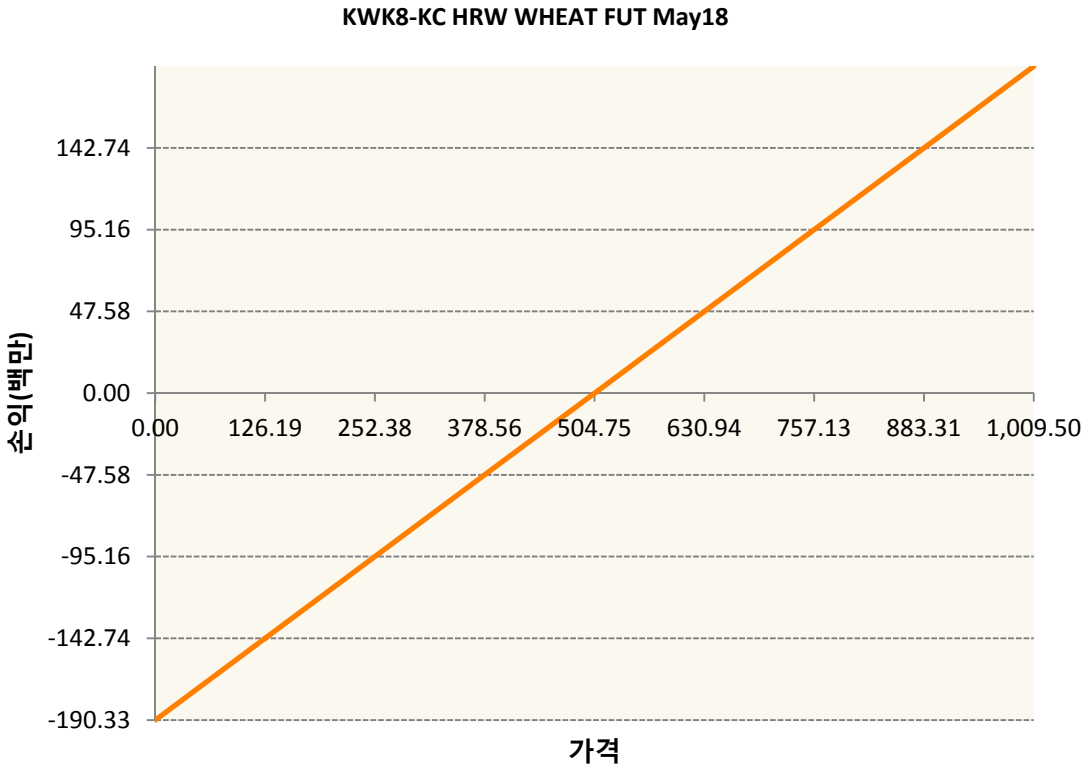

-439.20
-658.80
-878.40
가격

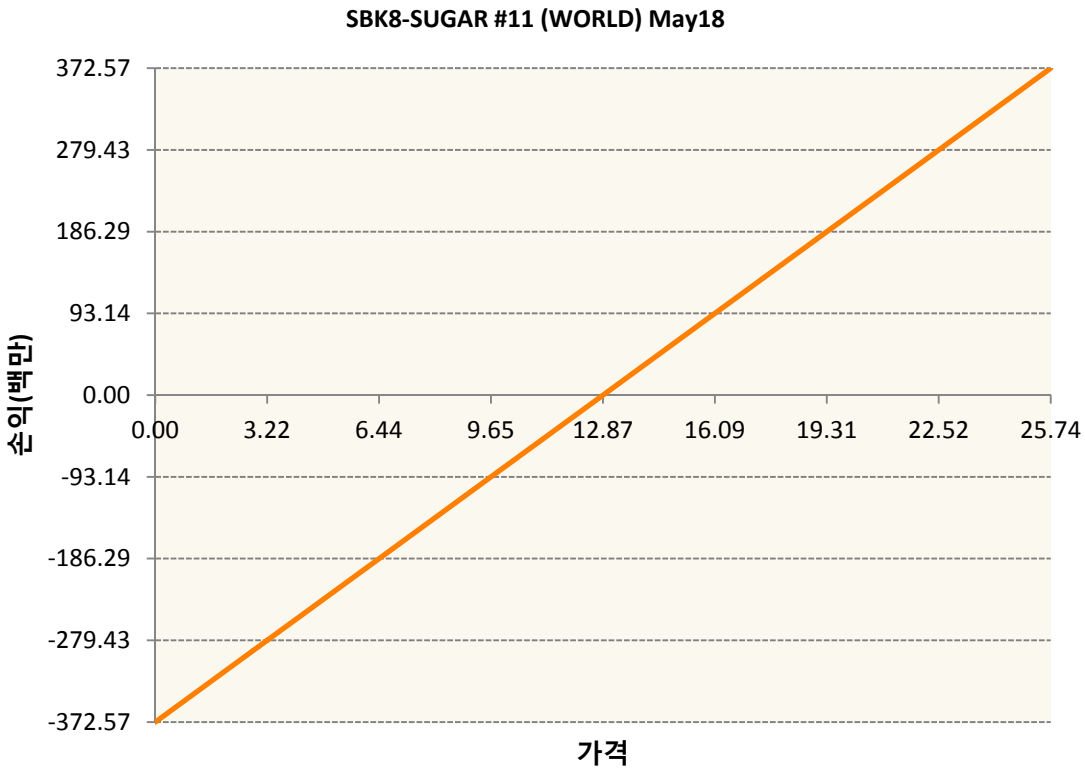

CTK8-COTTON NO.2 FUTR May18
221.57
166.18
110.78
55.39
0.00
-55.39
-110.78
-166.18
-221.57
0.00
20.56
41.13
61.69
82.25
102.81
123.38
143.94
164.50
손익(백만)
가격

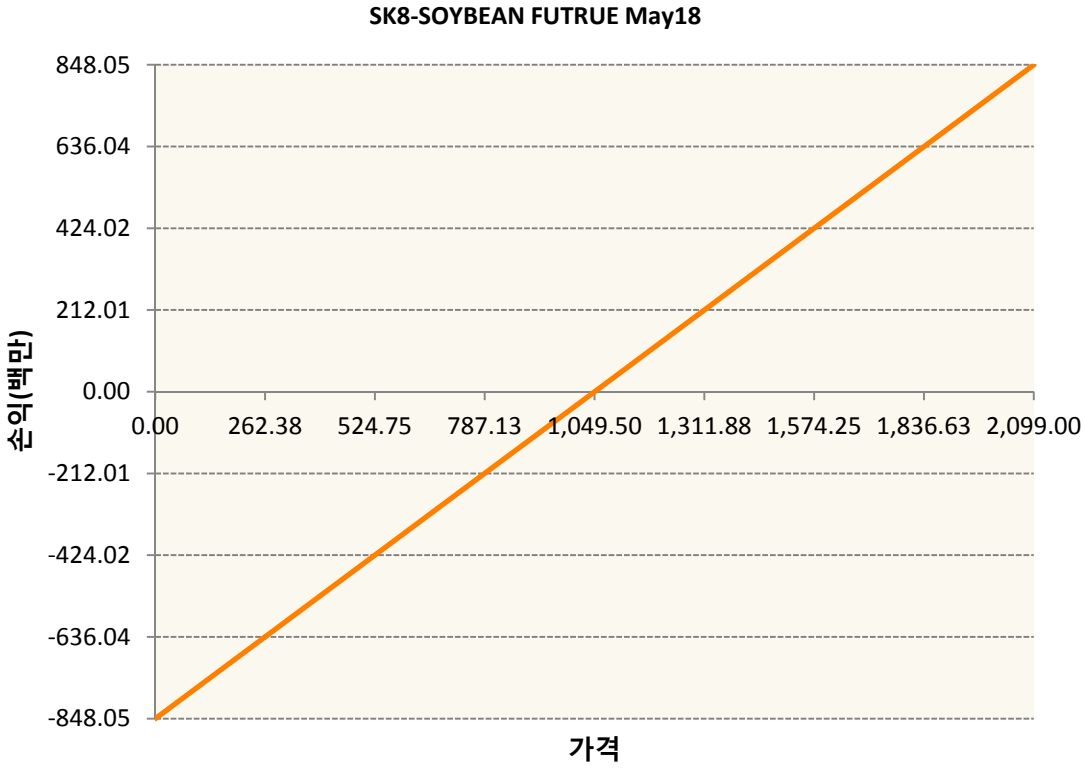

KCK8-COFFEE 'C' FUTURE May18
342.37
256.78
171.19
85.59
0.00
-85.59
-171.19
-256.78
0.00
30.28
60.55
90.83
121.10
151.38
181.65
211.93
242.20
손익(백만)


-342.37
가격

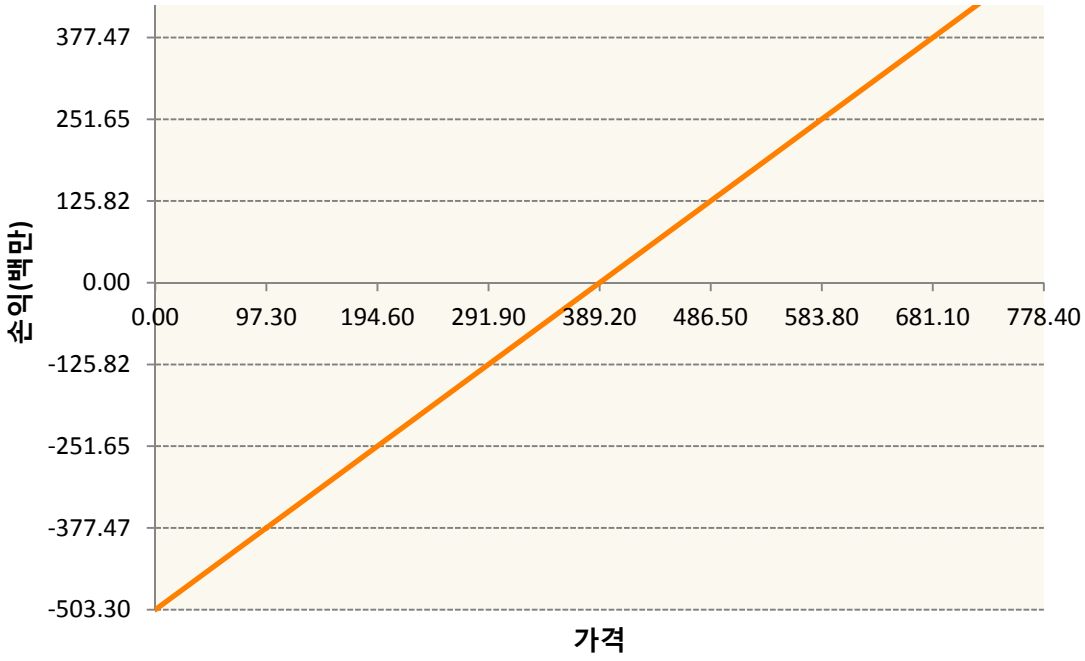

KR4175N30006-2018-03 달러선물
243.68
162.45
81.23
0.00
-81.23
-162.45
-243.68
-324.90
0.00
270.75
541.50
812.25
1,083.00
1,353.75
1,624.50
1,895.25
2,166.00
손익(백만)
가격


KWK8-KC HRW WHEAT FUT May18
142.74
95.16
47.58
0.00
-47.58
-95.16
-142.74
-190.33
0.00
126.19
252.38
378.56
504.75
630.94
757.13
883.31
1,009.50
손익(백만)
가격

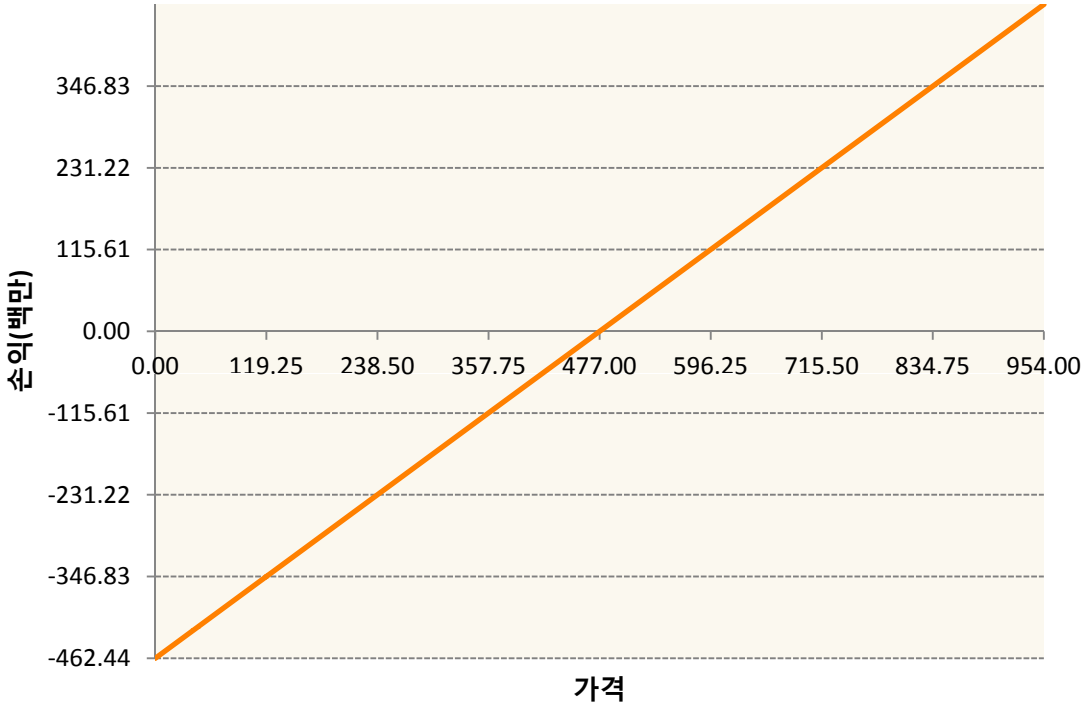

SBK8-SUGAR #11 (WORLD) May18
372.57
279.43
186.29
93.14
0.00
-93.14
-186.29
-279.43
-372.57
0.00
3.22
6.44
9.65
12.87
16.09
19.31
22.52
25.74
손익(백만)
가격


SK8-SOYBEAN FUTRUE May18
848.05
636.04
424.02
212.01
0.00
-212.01
-424.02
-636.04
-848.05
0.00
262.38
524.75
787.13
1,049.50
1,311.88
1,574.25
1,836.63
2,099.00
손익(백만)
가격


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	70
CTK8	COTTON NO.2 FUTR May18	18
KCK8	COFFEE 'C' FUTURE May18	27
KR4175N30(	2018-03 달러선물	26

KWK8	KC HRW WHEAT FUT May18	15
SBK8	SUGAR #11 (WORLD) May18	30
SK8	SOYBEAN FUTRUE May18	68
SMK8	SOYBEAN MEAL FUTR May18	40
WK8	WHEAT FUTURE(CBT) May18	37

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

334