공시일	2018-03-13
기준일	2018-03-12

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	2018-03-13
기준일	2018-03-12

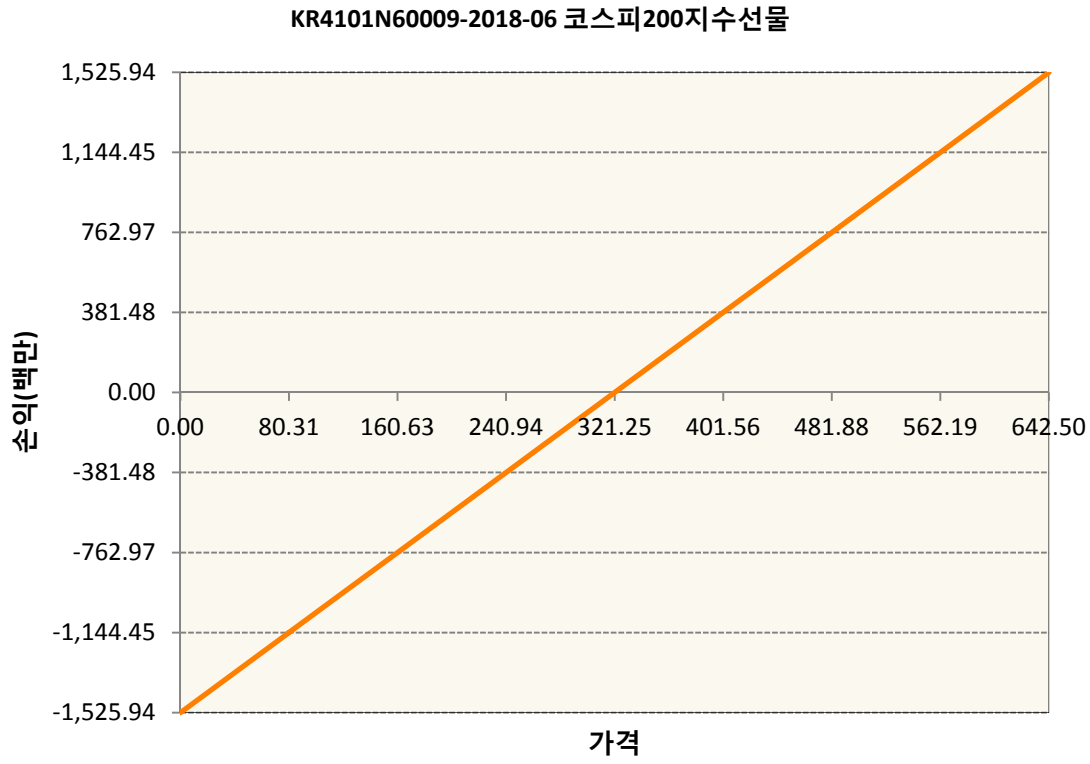
스마트인덱스모

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	1,526	0	1,526	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101N60(2018-06 코스피200지수선물							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%	-81	-81	-81	-81	-81	-81	-81
-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%	81	81	81	81	81	81	81
8.00%	122	122	122	122	122	122	122

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

84

공시일	2018-03-13
기준일	2018-03-12

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	1,127

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

423

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2018-03-13
기준일	2018-03-12

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	5,081	0	5,081	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI50000 신한CSI500미래S180308	420

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

420

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2018-03-13
기준일	2018-03-12

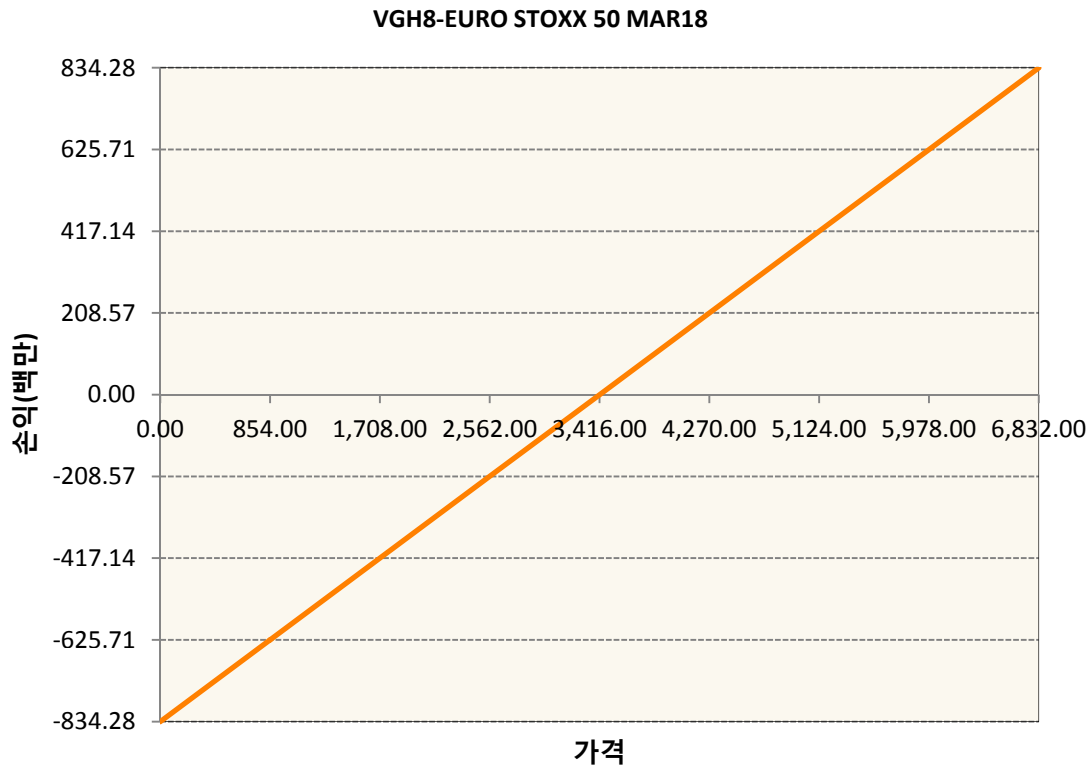
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	834	0	834	

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	2018-03-13
기준일	2018-03-12

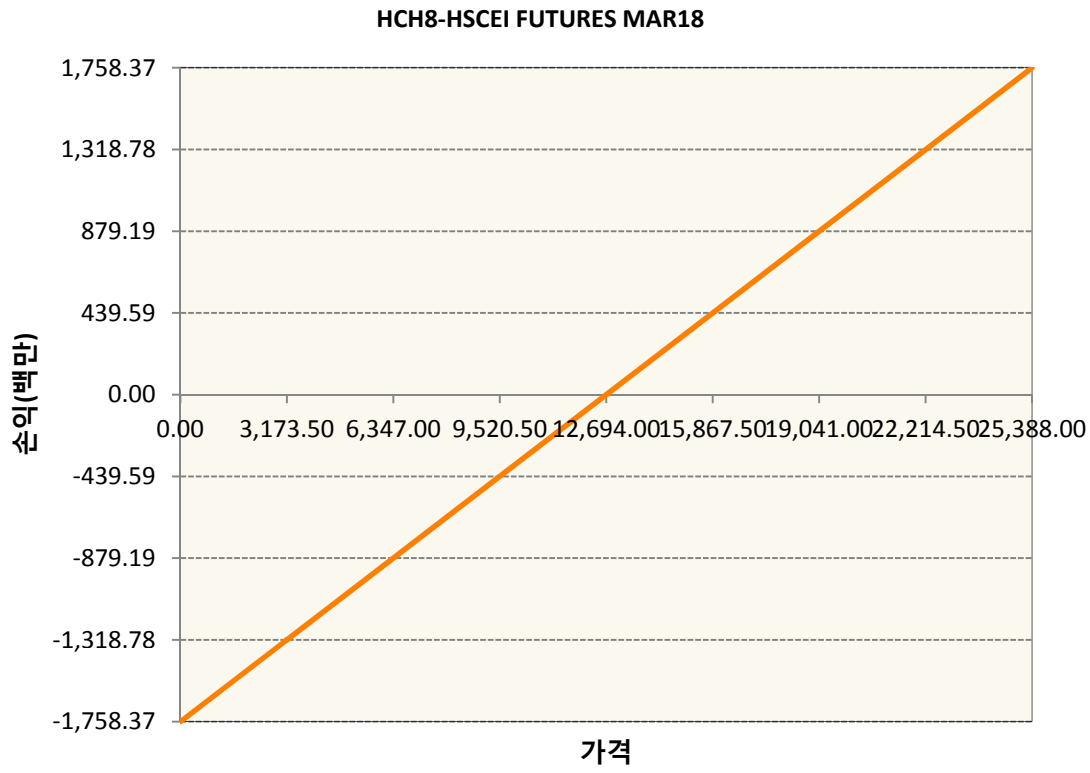
차이나인덱스모(주식-파생형)

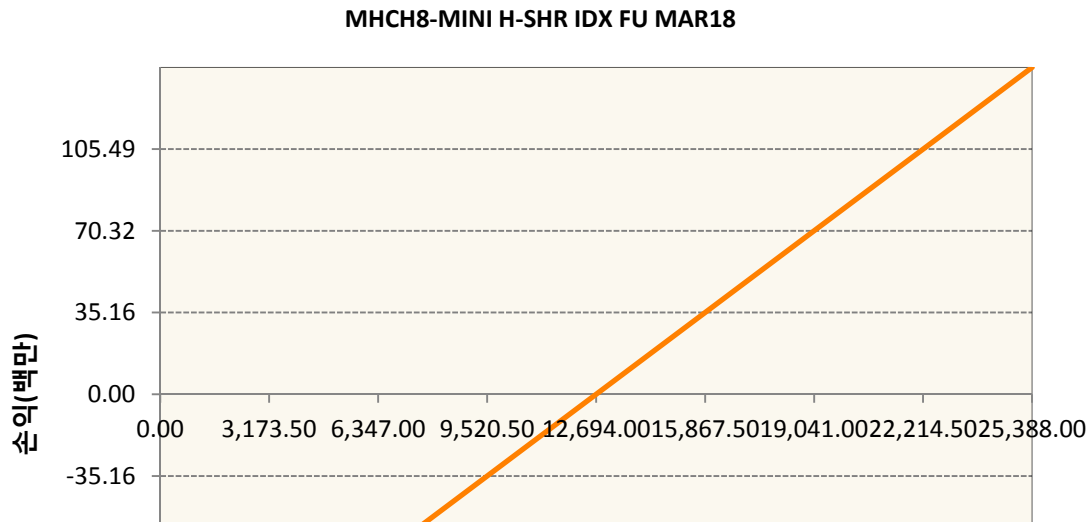
1. 계약금액

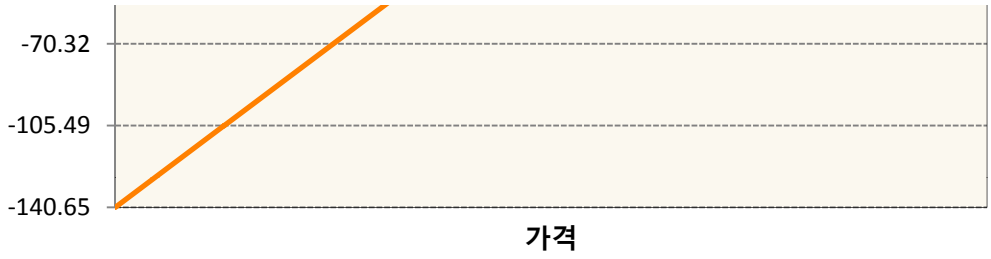
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,899	0	1,899	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCH8	HSCEI FUTURES MAR18	141
MHCH8	MINI H-SHR IDX FU MAR18	11

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	132

공시일	2018-03-13
기준일	2018-03-12

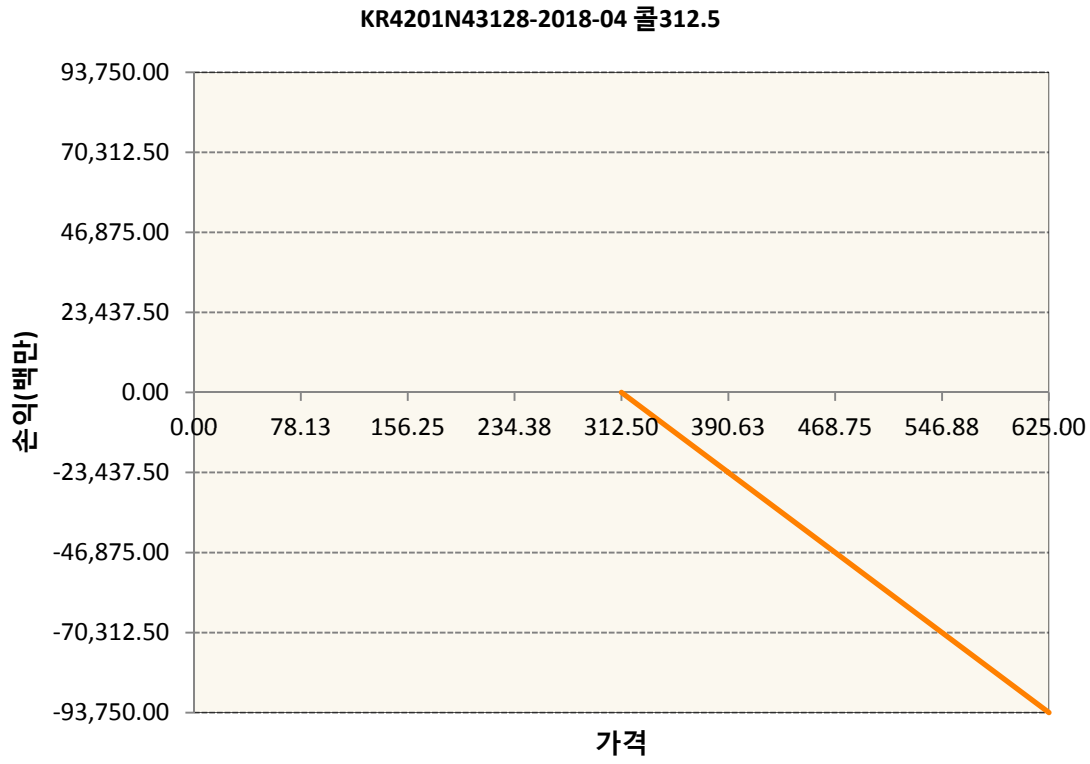
커버드콜모(주식혼합-파생형)

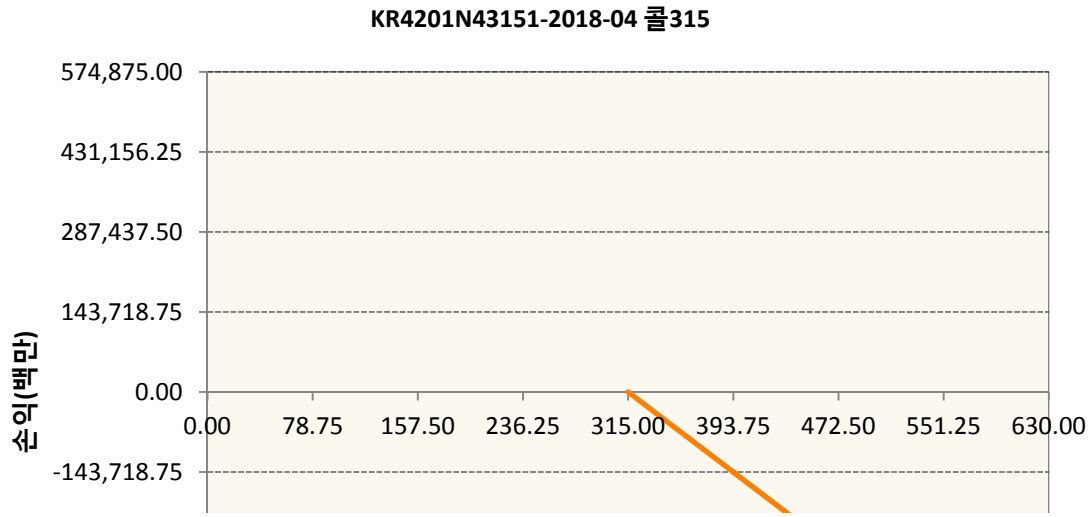
1. 계약금액

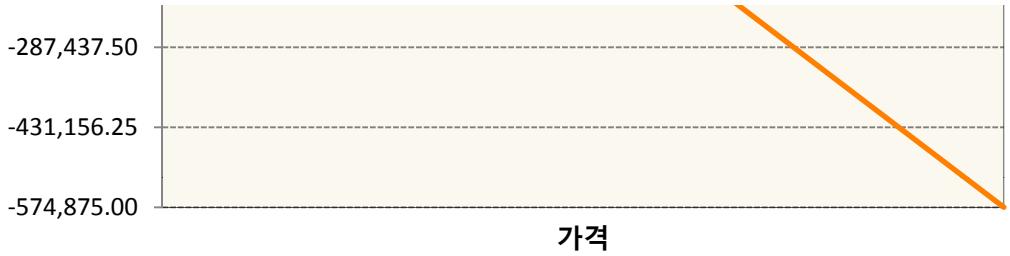
(단위:백만원)

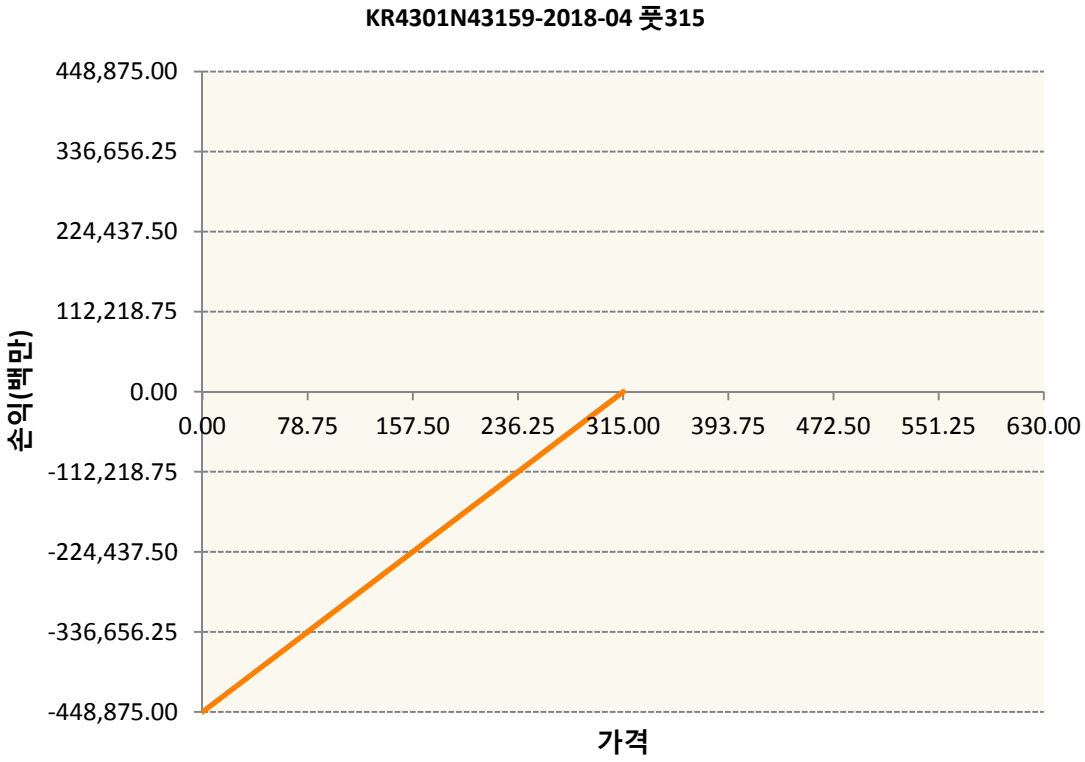
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	1,117,500	-1,117,500	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201N4312018-04 콜312.5							6,525
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	3,894	3,740	3,574	3,398	3,213	3,022	2,826
-5.33%	3,271	3,056	2,836	2,614	2,389	2,161	1,933
-2.67%	2,213	1,970	1,727	1,484	1,241	998	755
0%	686	461	232	0	-234	-469	-706
2.67%	-1,252	-1,426	-1,612	-1,807	-2,010	-2,218	-2,432
5.33%	-3,485	-3,599	-3,730	-3,877	-4,037	-4,207	-4,386
8.00%	-5,896	-5,960	-6,042	-6,141	-6,256	-6,384	-6,525
KR4201N4312018-04 콜315							38,619
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	21,618	20,791	19,876	18,889	17,843	16,748	15,613

-5.33%	18,452	17,224	15,957	14,659	13,337	11,996	10,639
-2.67%	12,819	11,350	9,878	8,405	6,930	5,454	3,977
0%	4,354	2,913	1,460	0	-1,467	-2,939	-4,415
2.67%	-6,745	-7,922	-9,155	-10,433	-11,745	-13,086	-14,449
5.33%	-19,856	-20,667	-21,580	-22,575	-23,640	-24,763	-25,934
8.00%	-34,247	-34,727	-35,321	-36,019	-36,808	-37,679	-38,619
KR4301N4312018-04 풋315							25,180

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-23,936	-24,046	-24,196	-24,387	-24,617	-24,882	-25,180
-5.33%	-12,610	-12,979	-13,387	-13,827	-14,294	-14,782	-15,289
-2.67%	-3,568	-4,199	-4,833	-5,471	-6,111	-6,752	-7,395
0%	1,770	1,193	602	0	-611	-1,229	-1,852
2.67%	3,874	3,579	3,236	2,852	2,434	1,988	1,516
5.33%	4,402	4,313	4,184	4,014	3,804	3,556	3,272
8.00%	4,485	4,469	4,436	4,382	4,303	4,195	4,056

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

68,071

공시일	2018-03-13
기준일	2018-03-12

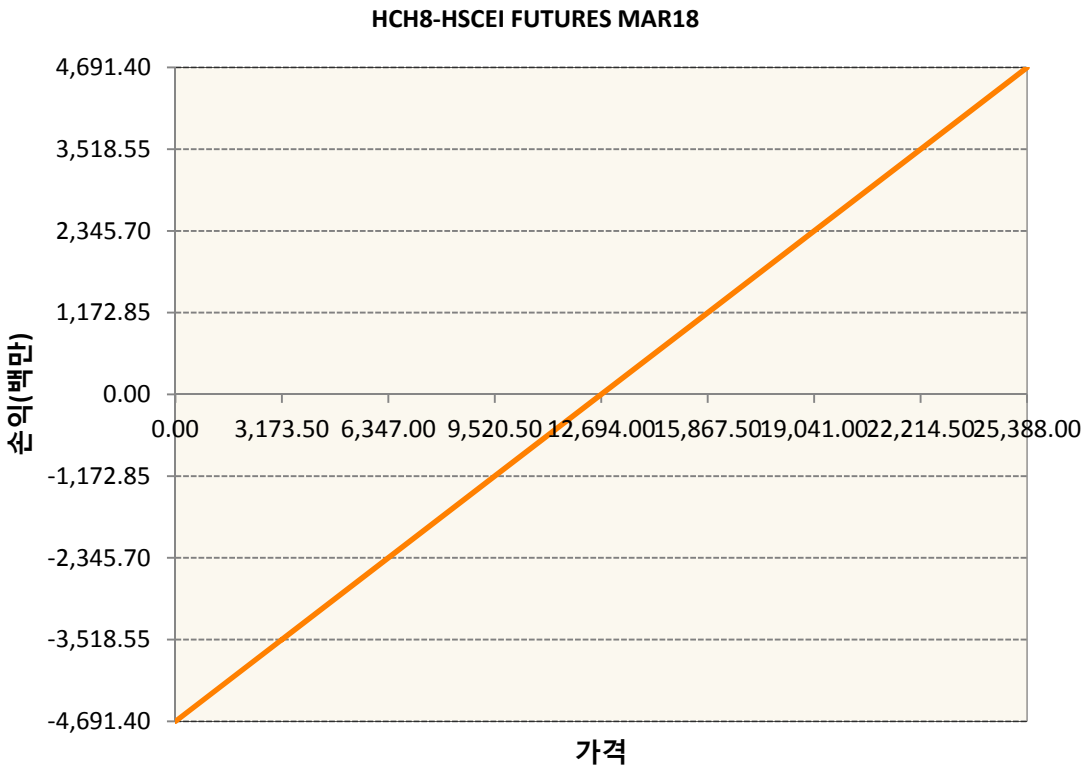
홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생

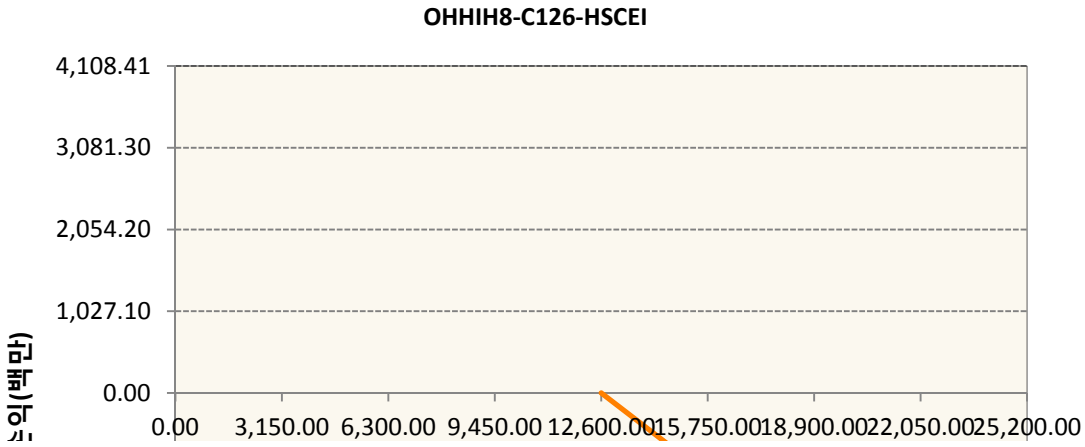
1. 계약금액

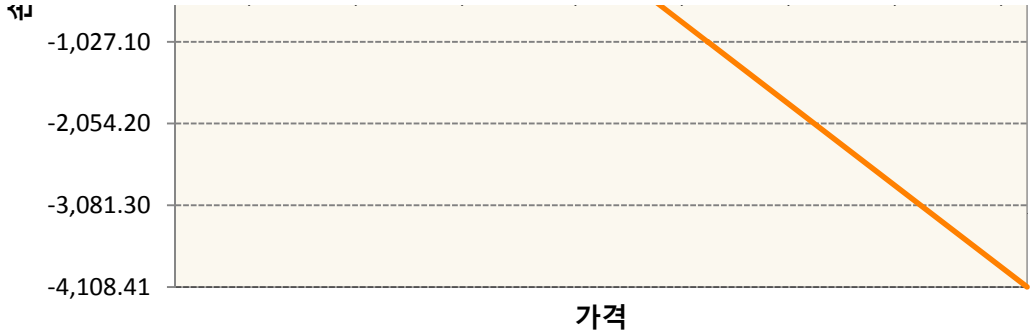
(단위:백만원)

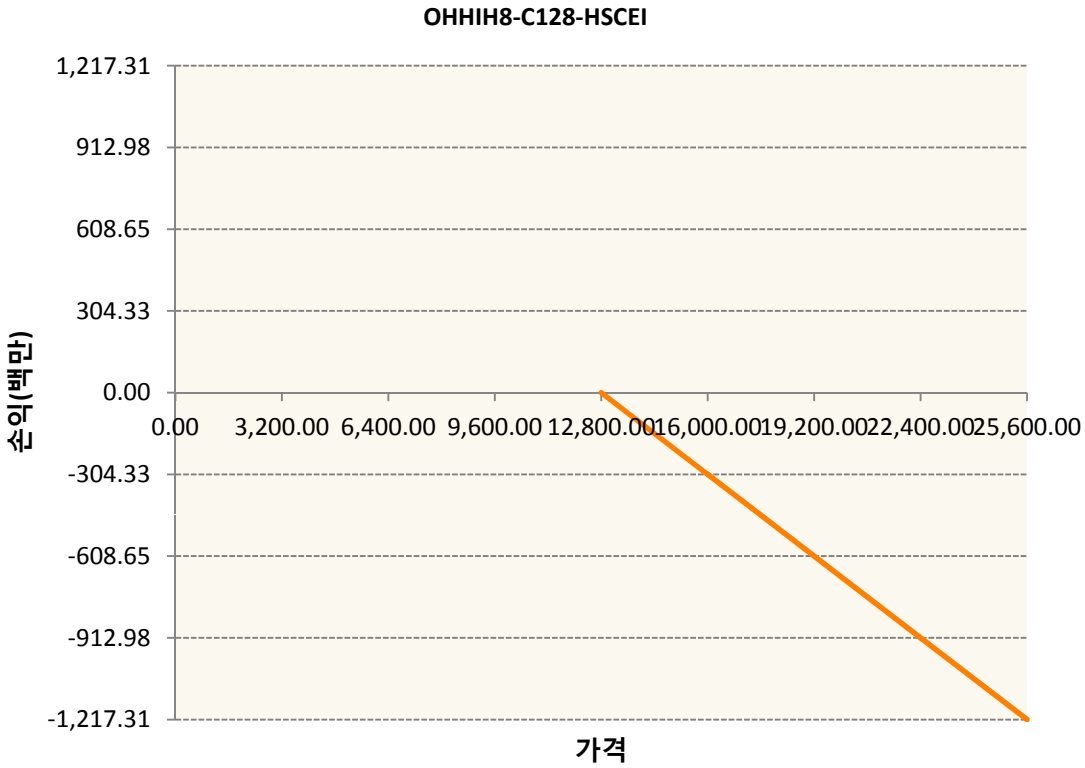
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	4,691	0	4,691	장내
누계	유가증권	옵션	0	10,651	-10,651	장내

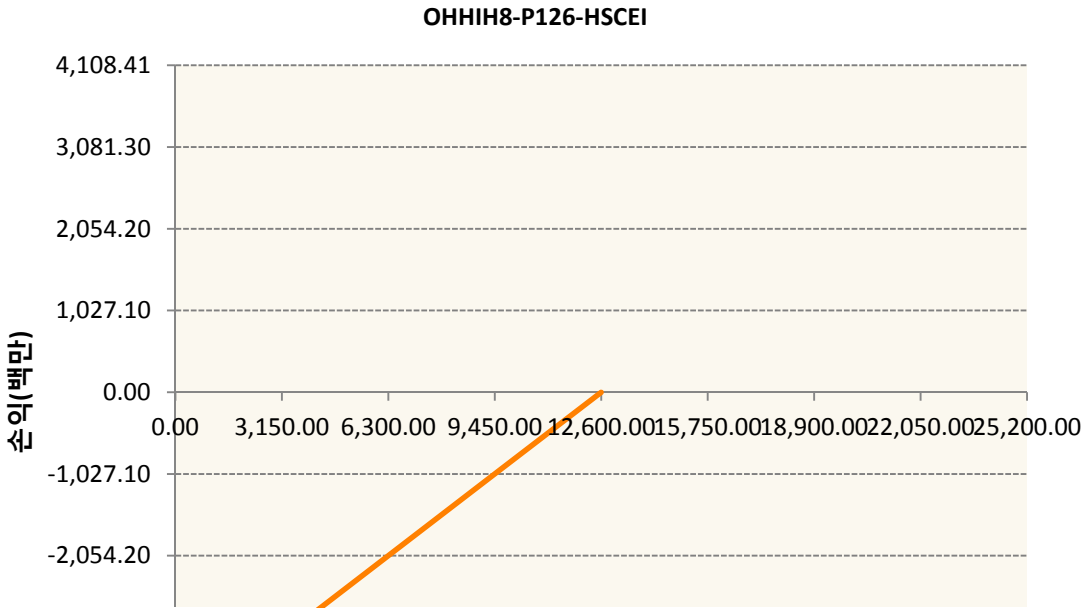
2. 만기시점의 손익구조

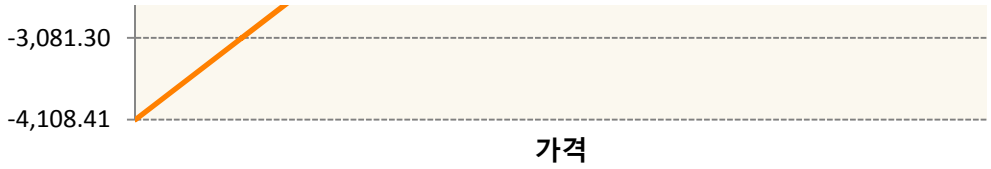


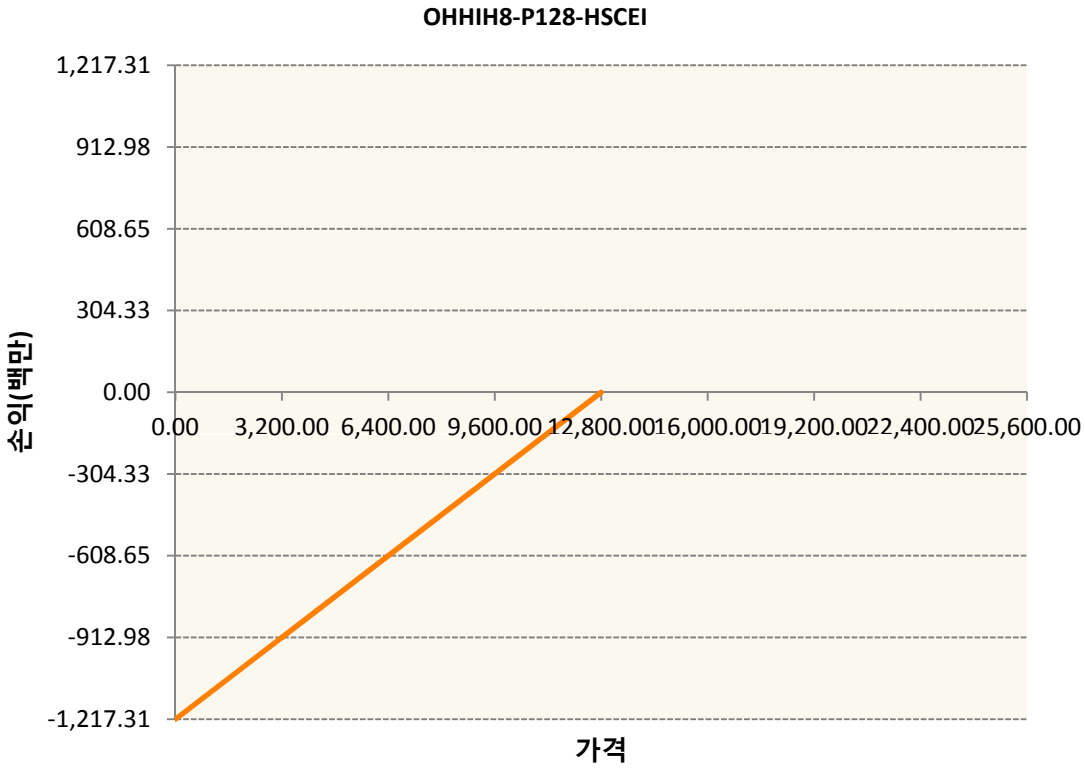



-1,027.10
-2,054.20
-3,081.30
-4,108.41
가격


OHHIH8-C128-HSCEI
1,217.31
912.98
608.65
304.33
0.00
-304.33
-608.65
-912.98
-1,217.31
0.00
3,200.00
6,400.00
9,600.00
12,800.00
16,000.00
19,200.00
22,400.00
25,600.00
손익(백만)
가격


OHHIH8-P126-HSCEI
4,108.41
3,081.30
2,054.20
1,027.10
0.00
-1,027.10
-2,054.20
0.00
3,150.00
6,300.00
9,450.00
12,600.00
15,750.00
18,900.00
22,050.00
25,200.00
손익(백만)





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

HCH8	HSCEI FUTURES MAR18	375
OHHIH8-C12	HSCEI	329
OHHIH8-C12	HSCEI	97
OHHIH8-P12	HSCEI	329
OHHIH8-P12	HSCEI	97

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

1,070

공시일	2018-03-13
기준일	2018-03-12

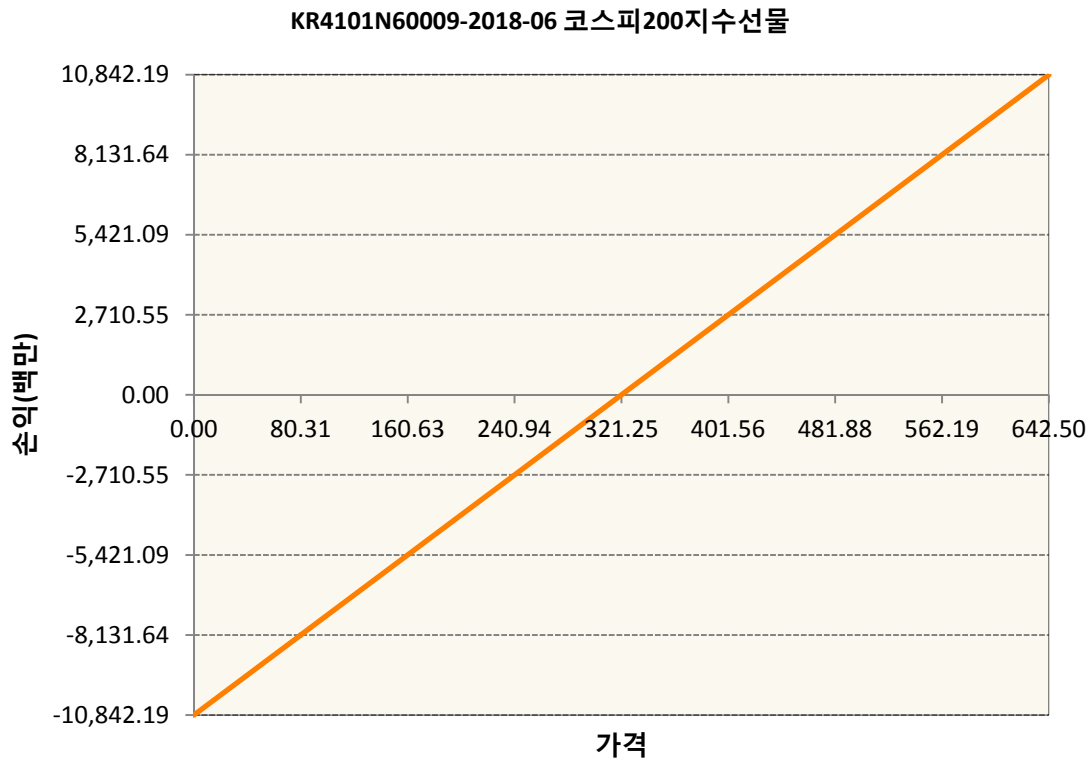
코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼

1. 계약금액

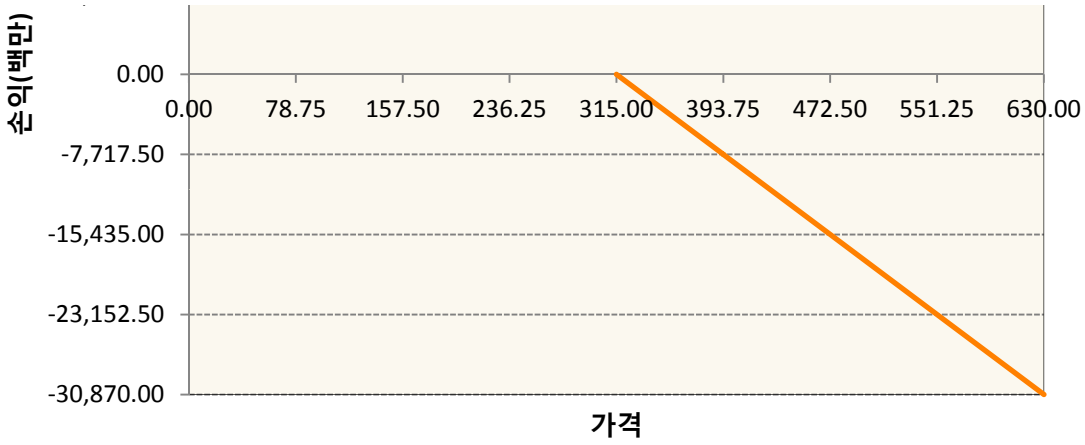
(단위:백만원)

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	10,842	0	10,842	장내
누계	유가증권	스왑	56,200	0	56,200	장외
누계	유가증권	옵션	0	56,033	-56,033	장내

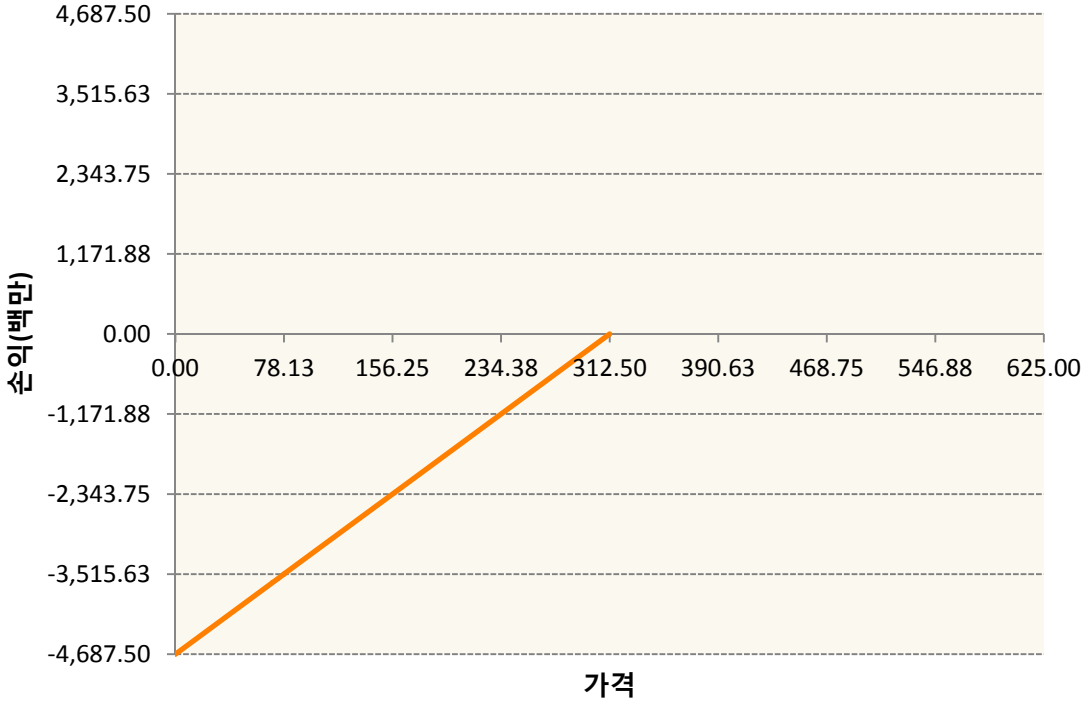
2. 만기시점의 손익구조



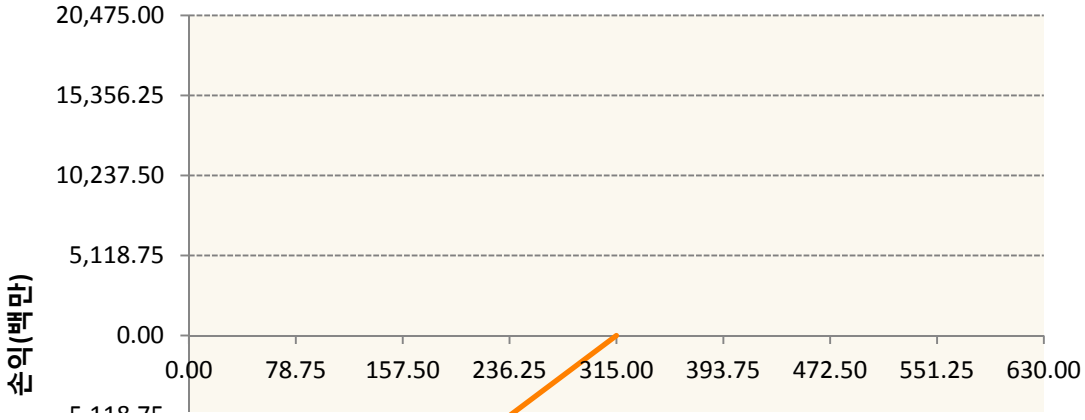




KR4301N43126-2018-04 풋312.5



KR4301N43159-2018-04 풋315





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_2							1,445
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,445	-1,445	-1,445	-1,445	-1,445	-1,445	-1,445
-5.33%	-963	-963	-963	-963	-963	-963	-963
-2.67%	-482	-482	-482	-482	-482	-482	-482
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	482	482	482	482	482	482	482
5.33%	963	963	963	963	963	963	963
8.00%	1,445	1,445	1,445	1,445	1,445	1,445	1,445
2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_3							273
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-273	-273	-273	-273	-273	-273	-273
-5.33%	-182	-182	-182	-182	-182	-182	-182
-2.67%	-91	-91	-91	-91	-91	-91	-91
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	91	91	91	91	91	91	91
5.33%	182	182	182	182	182	182	182
8.00%	273	273	273	273	273	273	273
2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_4							156
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-156	-156	-156	-156	-156	-156	-156
-5.33%	-104	-104	-104	-104	-104	-104	-104
-2.67%	-52	-52	-52	-52	-52	-52	-52
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	52	52	52	52	52	52	52
5.33%	104	104	104	104	104	104	104
8.00%	156	156	156	156	156	156	156
2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_5							234
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%

-8.00%	-234	-234	-234	-234	-234	-234	-234
-5.33%	-156	-156	-156	-156	-156	-156	-156
-2.67%	-78	-78	-78	-78	-78	-78	-78
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	78	78	78	78	78	78	78
5.33%	156	156	156	156	156	156	156
8.00%	234	234	234	234	234	234	234
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_6						195
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-195	-195	-195	-195	-195	-195	-195
-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%	195	195	195	195	195	195	195
	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						462
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-462	-462	-462	-462	-462	-462	-462
-5.33%	-308	-308	-308	-308	-308	-308	-308
-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%	308	308	308	308	308	308	308
8.00%	462	462	462	462	462	462	462
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_10						273
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-273	-273	-273	-273	-273	-273	-273
-5.33%	-182	-182	-182	-182	-182	-182	-182
-2.67%	-91	-91	-91	-91	-91	-91	-91
0%	0	0	0	0	0	0	0

2.67%	91	91	91	91	91	91	91
5.33%	182	182	182	182	182	182	182
8.00%	273	273	273	273	273	273	273
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_11						625
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-625	-625	-625	-625	-625	-625	-625
-5.33%	-417	-417	-417	-417	-417	-417	-417
-2.67%	-208	-208	-208	-208	-208	-208	-208
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	208	208	208	208	208	208	208
5.33%	417	417	417	417	417	417	417
8.00%	625	625	625	625	625	625	625
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_12						469
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-469	-469	-469	-469	-469	-469	-469
-5.33%	-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%	469	469	469	469	469	469	469
	KR4101N60(2018-06 코스피200지수선물						866
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-866	-866	-866	-866	-866	-866	-866
-5.33%	-577	-577	-577	-577	-577	-577	-577
-2.67%	-289	-289	-289	-289	-289	-289	-289
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	289	289	289	289	289	289	289
5.33%	577	577	577	577	577	577	577
8.00%	866	866	866	866	866	866	866
	KR4201N431 2018-04 콜315						2,074
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,161	1,116	1,067	1,014	958	899	838
-5.33%	991	925	857	787	716	644	571
-2.67%	688	609	530	451	372	293	214
0%	234	156	78	0	-79	-158	-237
2.67%	-362	-425	-492	-560	-631	-703	-776
5.33%	-1,066	-1,110	-1,159	-1,212	-1,269	-1,330	-1,393
8.00%	-1,839	-1,865	-1,897	-1,934	-1,977	-2,023	-2,074
	KR4301N431 2018-04 풋312.5						244

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-227	-229	-231	-234	-237	-240	-244
-5.33%	-113	-118	-123	-128	-134	-139	-145
-2.67%	-28	-35	-42	-49	-56	-62	-69
0%	16	11	6	0	-6	-12	-18
2.67%	32	29	27	23	20	16	12
5.33%	35	34	34	32	31	29	26
8.00%	35	35	35	35	34	33	32
	KR4301N4312018-04 풋315						1,149

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,092	-1,097	-1,104	-1,112	-1,123	-1,135	-1,149
-5.33%	-575	-592	-611	-631	-652	-674	-697
-2.67%	-163	-192	-220	-250	-279	-308	-337
0%	81	54	27	0	-28	-56	-84
2.67%	177	163	148	130	111	91	69
5.33%	201	197	191	183	174	162	149
8.00%	205	204	202	200	196	191	185

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

8,323

공시일	2018-03-13
기준일	2018-03-12

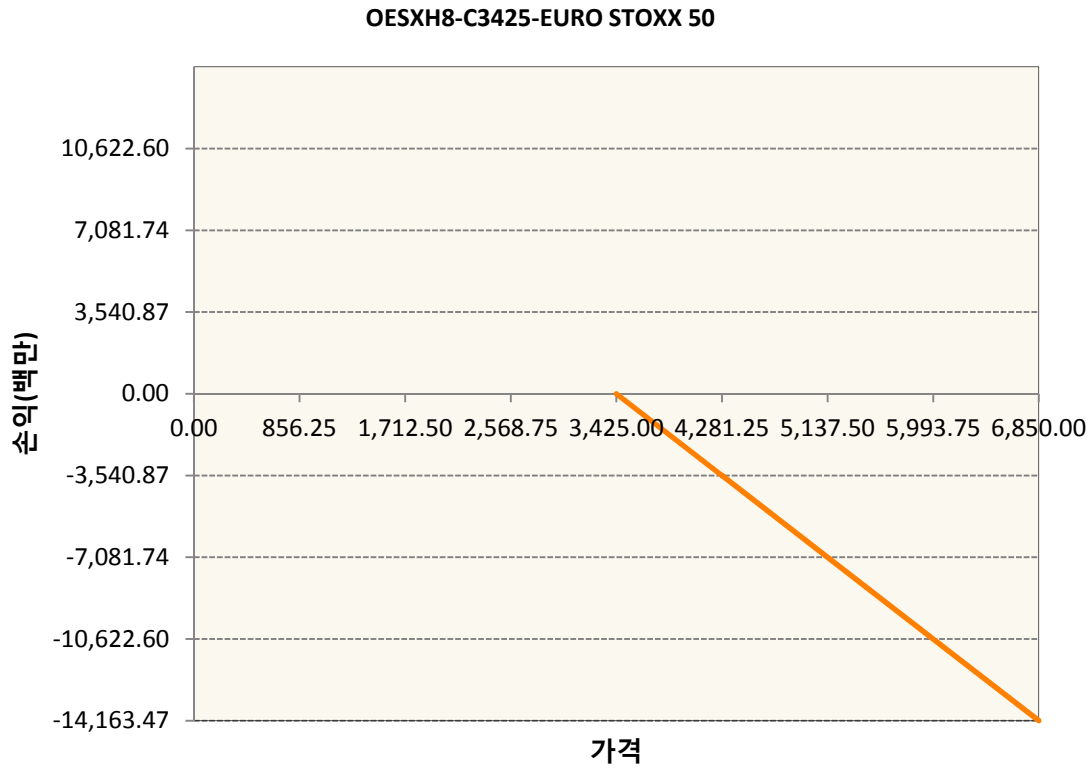
유로커버드콜모(주식혼합-파생형

1. 계약금액

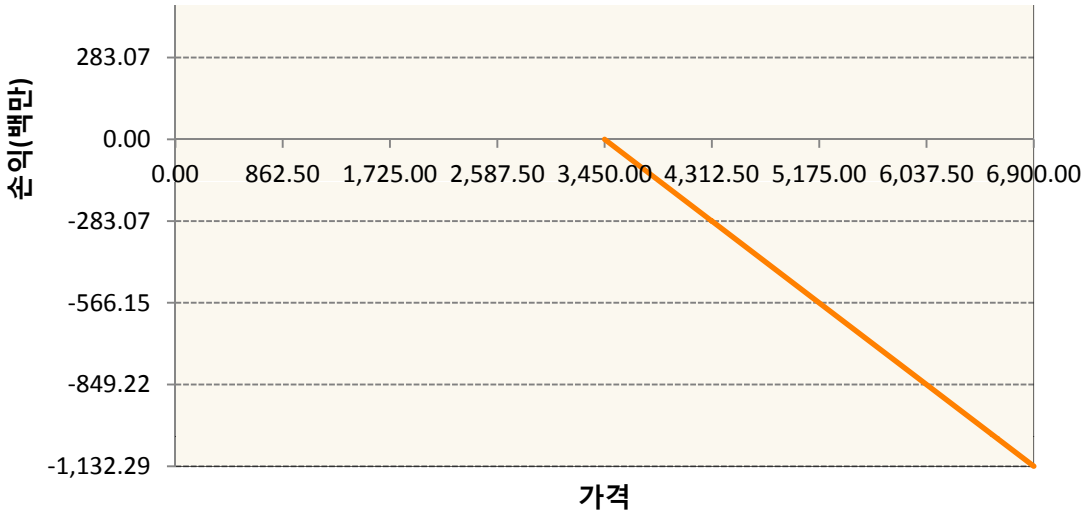
(단위:백만원)

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	7,317	0	7,317	
누계	유가증권	스왑	98,460	0	98,460	장외
누계	유가증권	옵션	0	30,592	-30,592	장내
누계	지수	스왑	52,513	0	52,513	장외

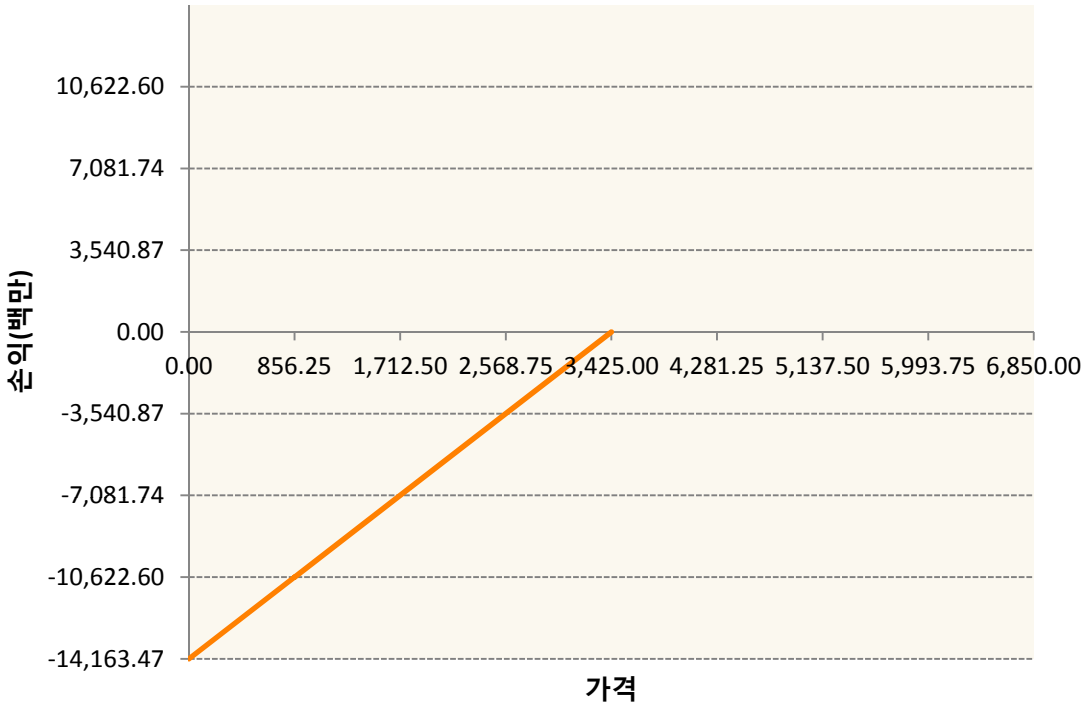
2. 만기시점의 손익구조



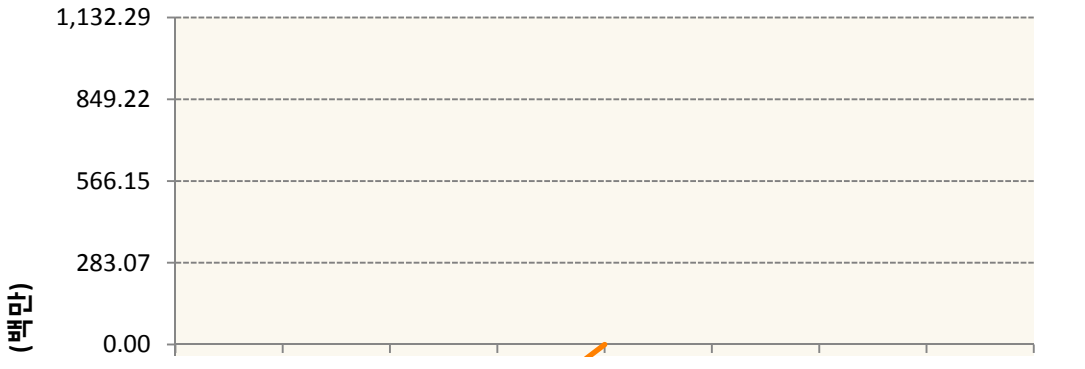


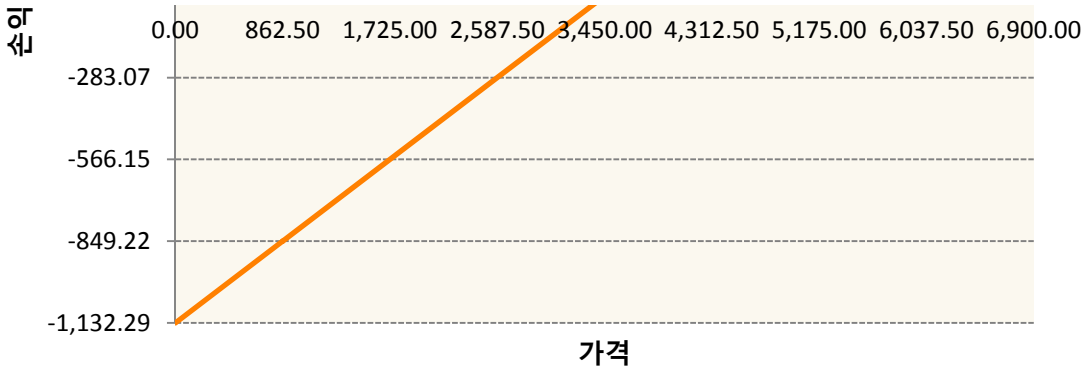


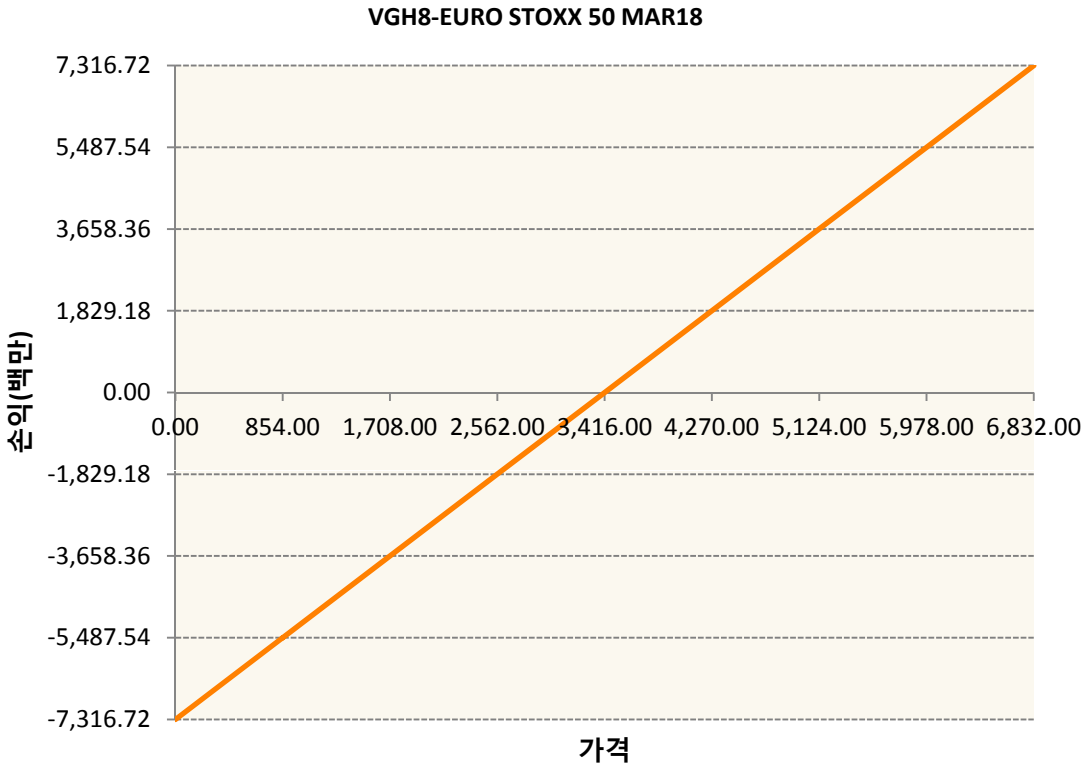
OESXH8-P3425-EURO STOXX 50



OESXH8-P3450-EURO STOXX 50







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

260105SGPX SG EURO Covered CALL STRATEGY - 994.569	180
260105SQPX SG EURO Covered CALL STRATEGY	338
OESXH8-C34 EURO STOXX 50	1,133
OESXH8-C34 EURO STOXX 50	91
OESXH8-P34 EURO STOXX 50	1,133
OESXH8-P34 EURO STOXX 50	91
VGH8 EURO STOXX 50 MAR18	585

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

2,108

공시일	2018-03-13
기준일	2018-03-12

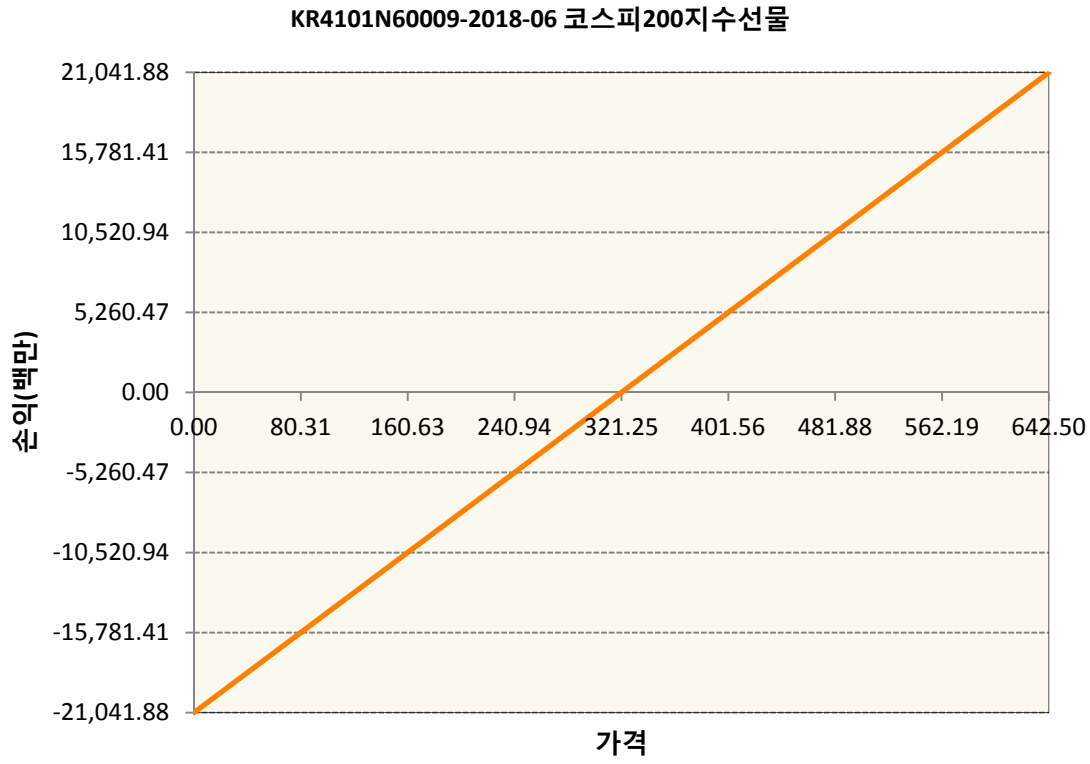
ETF스마트레버리지목표전환형8호

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	21,042	0	21,042	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101N60(2018-06 코스피200지수선물							1,680
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,680	-1,680	-1,680	-1,680	-1,680	-1,680	-1,680
-5.33%	-1,120	-1,120	-1,120	-1,120	-1,120	-1,120	-1,120
-2.67%	-560	-560	-560	-560	-560	-560	-560
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	560	560	560	560	560	560	560
5.33%	1,120	1,120	1,120	1,120	1,120	1,120	1,120
8.00%	1,680	1,680	1,680	1,680	1,680	1,680	1,680

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

1,165

공시일	2018-03-13
기준일	2018-03-12

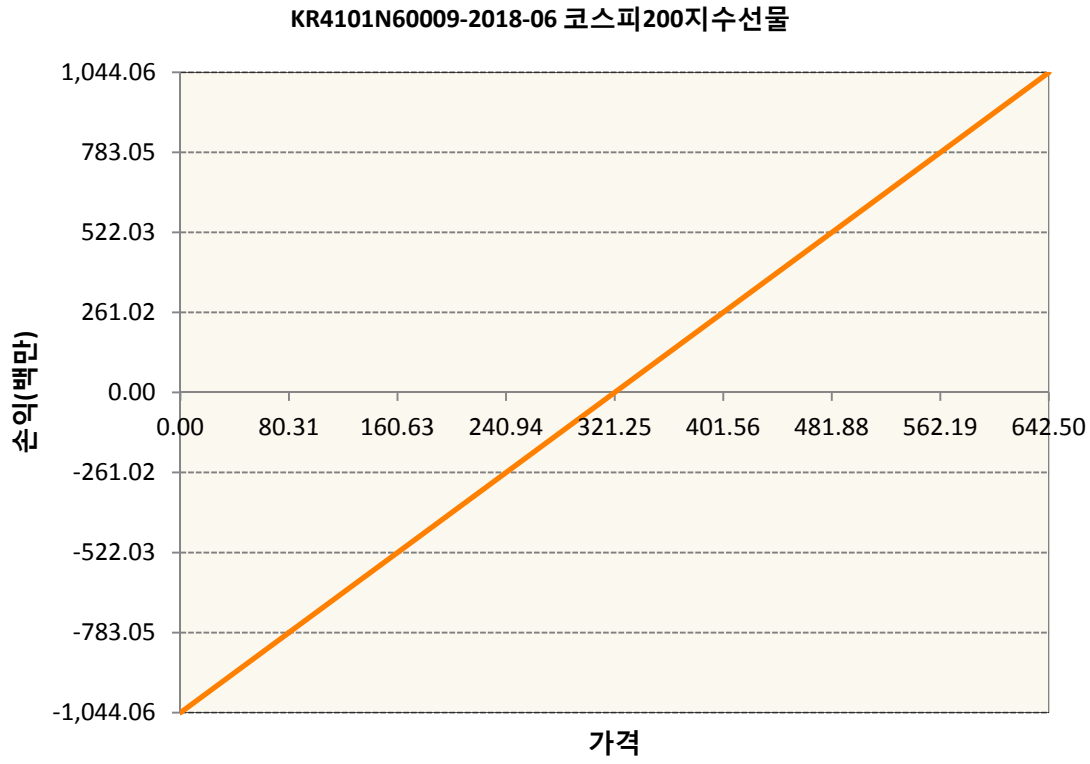
ETF스마트레버리지목표전환형9호

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	1,044	0	1,044	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101N60(2018-06 코스피200지수선물							83
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-83	-83	-83	-83	-83	-83	-83
-5.33%	-56	-56	-56	-56	-56	-56	-56
-2.67%	-28	-28	-28	-28	-28	-28	-28
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	28	28	28	28	28	28	28
5.33%	56	56	56	56	56	56	56
8.00%	83	83	83	83	83	83	83

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

58

공시일	2018-03-13
기준일	2018-03-12

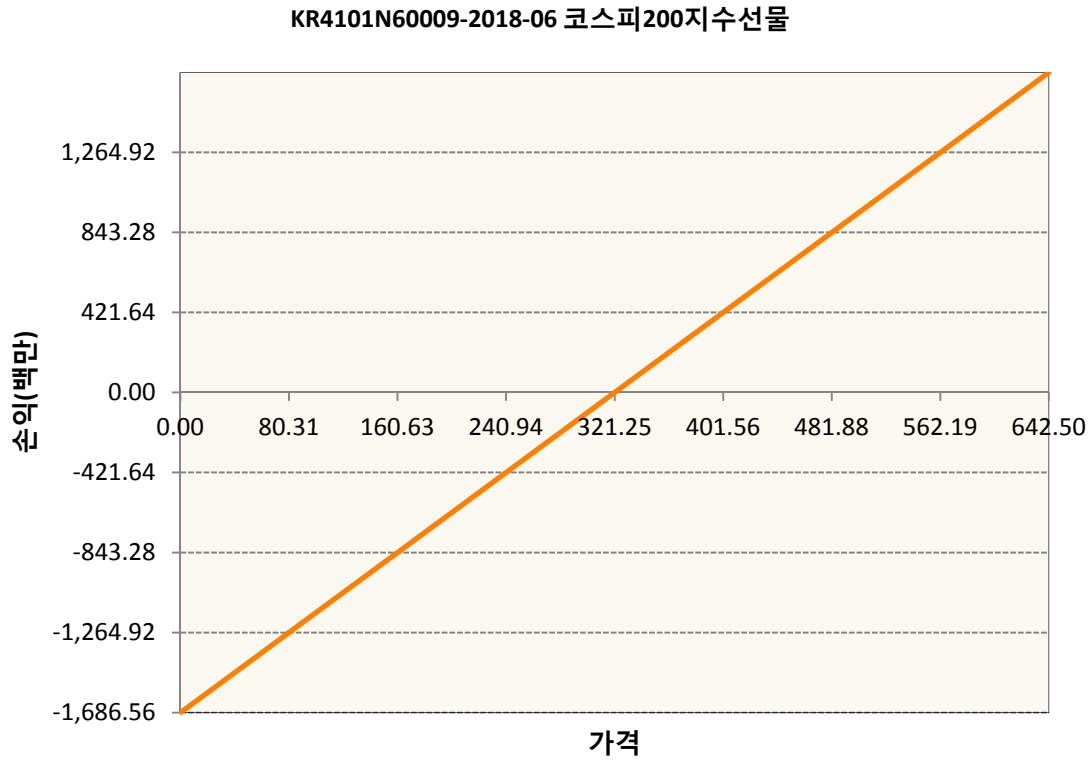
ETF스마트레버리지목표전환형10

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	1,687	0	1,687	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101N60(2018-06 코스피200지수선물							135
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-135	-135	-135	-135	-135	-135	-135
-5.33%	-90	-90	-90	-90	-90	-90	-90
-2.67%	-45	-45	-45	-45	-45	-45	-45
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	45	45	45	45	45	45	45
5.33%	90	90	90	90	90	90	90
8.00%	135	135	135	135	135	135	135

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

93

공시일	2018-03-13
기준일	2018-03-12

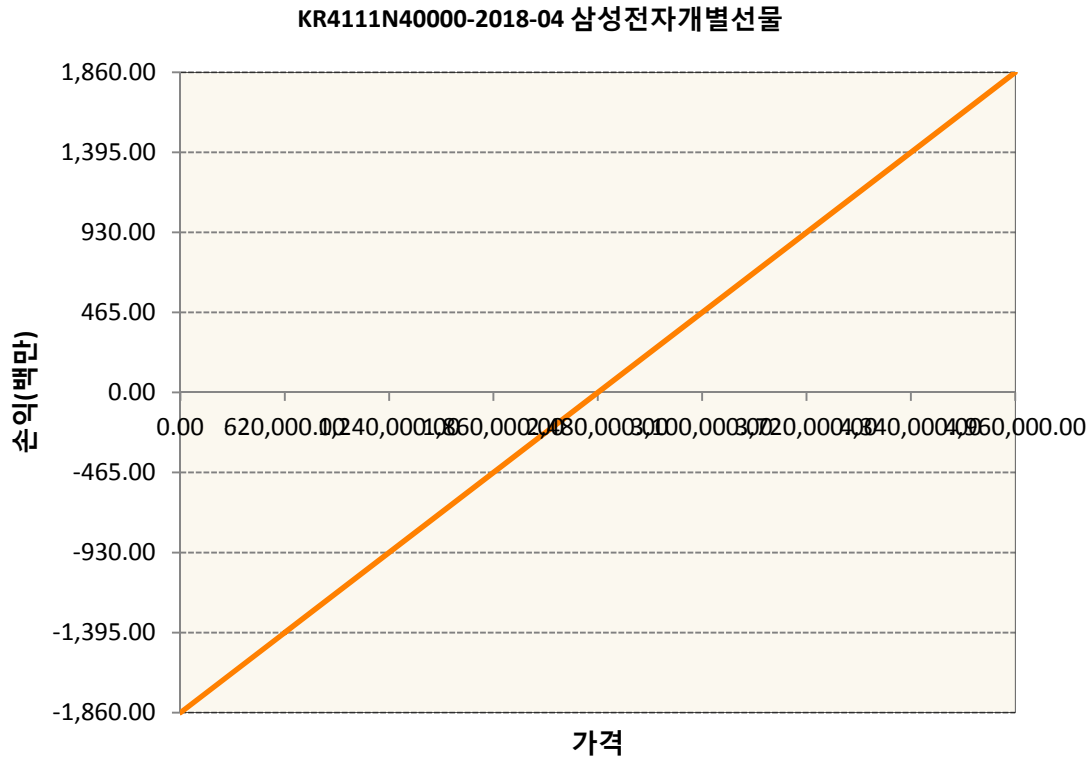
스마트KRX300인덱스1호(주식-파

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	1,860	0	1,860	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4111N40(2018-04 삼성전자개별선물							149
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-149	-149	-149	-149	-149	-149	-149
-5.33%	-99	-99	-99	-99	-99	-99	-99
-2.67%	-50	-50	-50	-50	-50	-50	-50
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	50	50	50	50	50	50	50
5.33%	99	99	99	99	99	99	99
8.00%	149	149	149	149	149	149	149

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

179

공시일	2018-03-13
기준일	2018-03-12

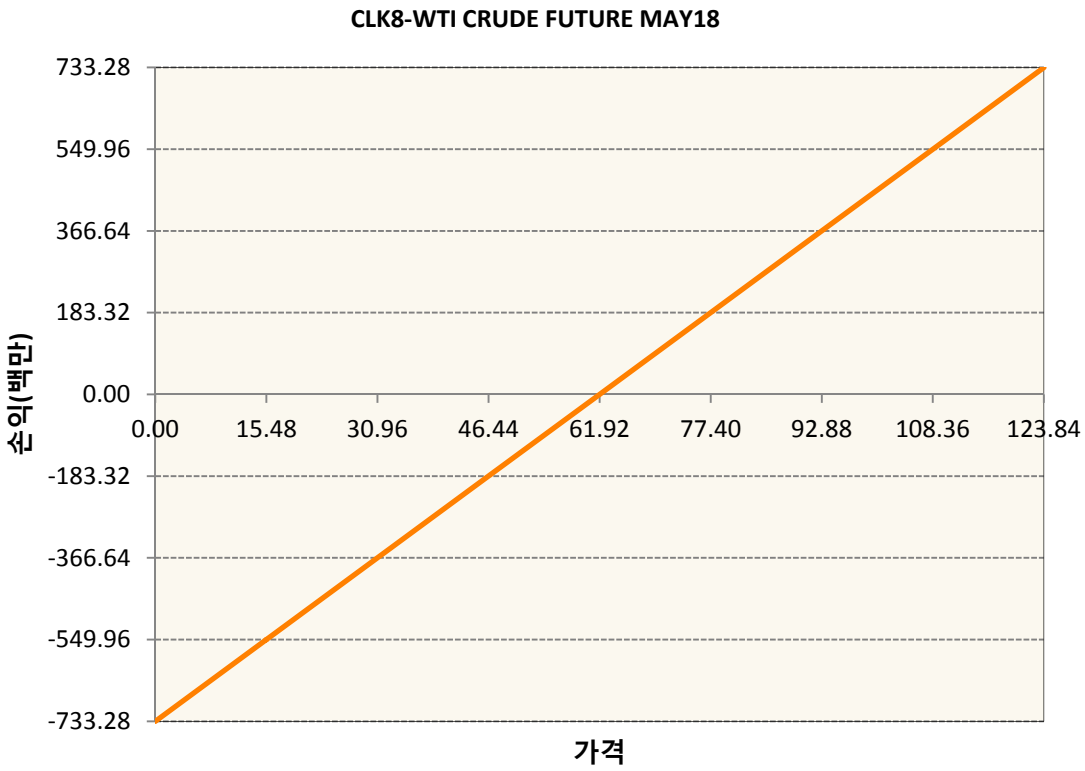
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

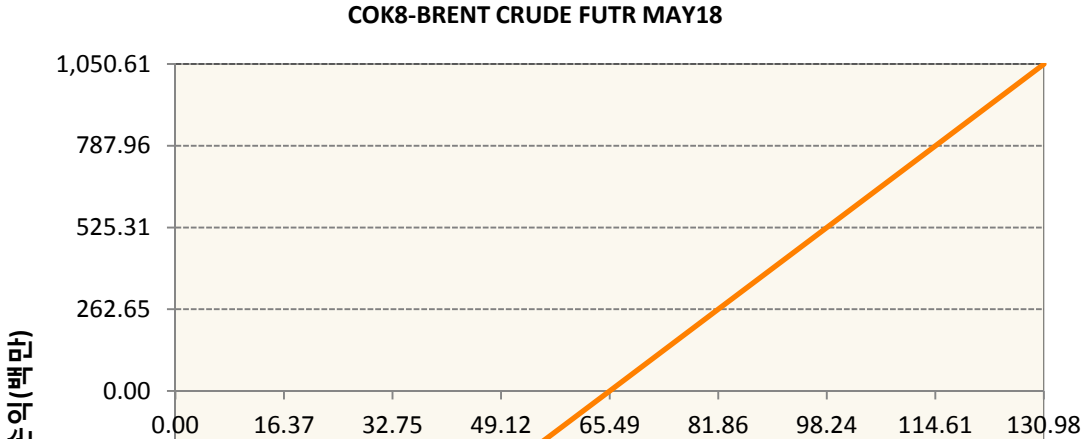
1. 계약금액

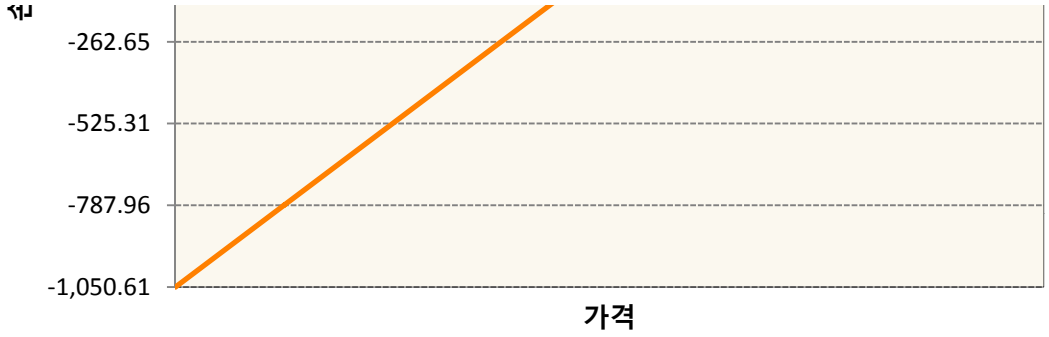
(단위:백만원)

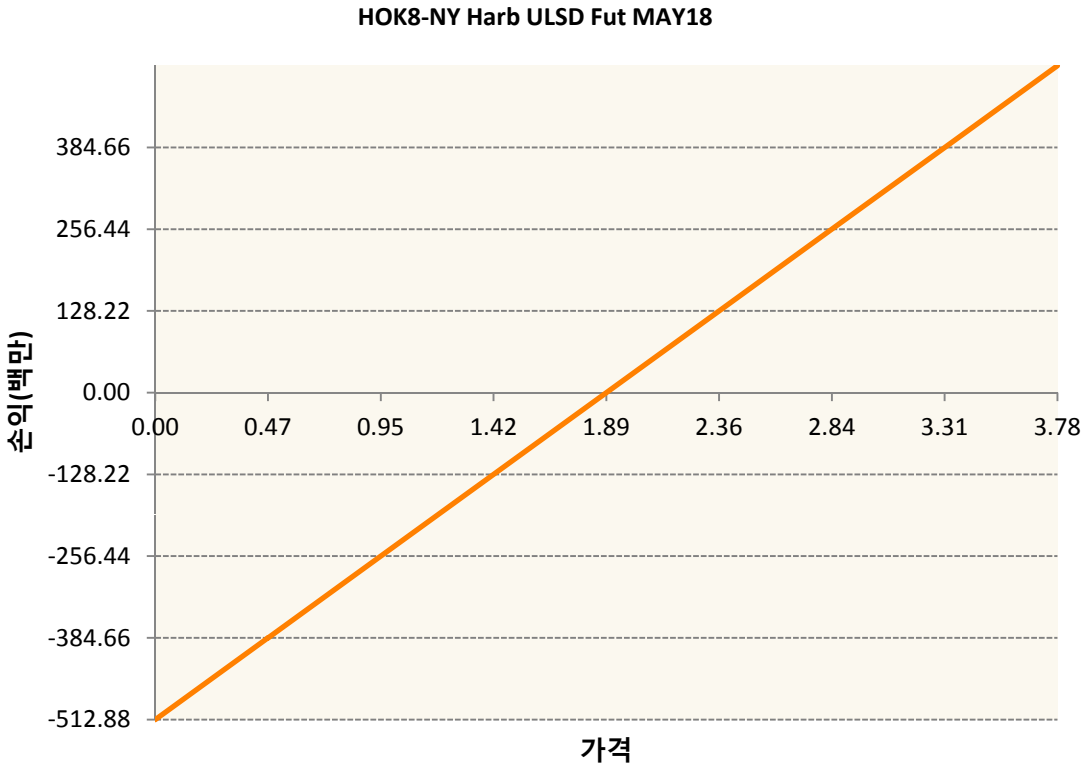
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	선물	유가증권	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	선물	유가증권	733	0	733	
누계	유가증권	선물	3,240	586	2,655	

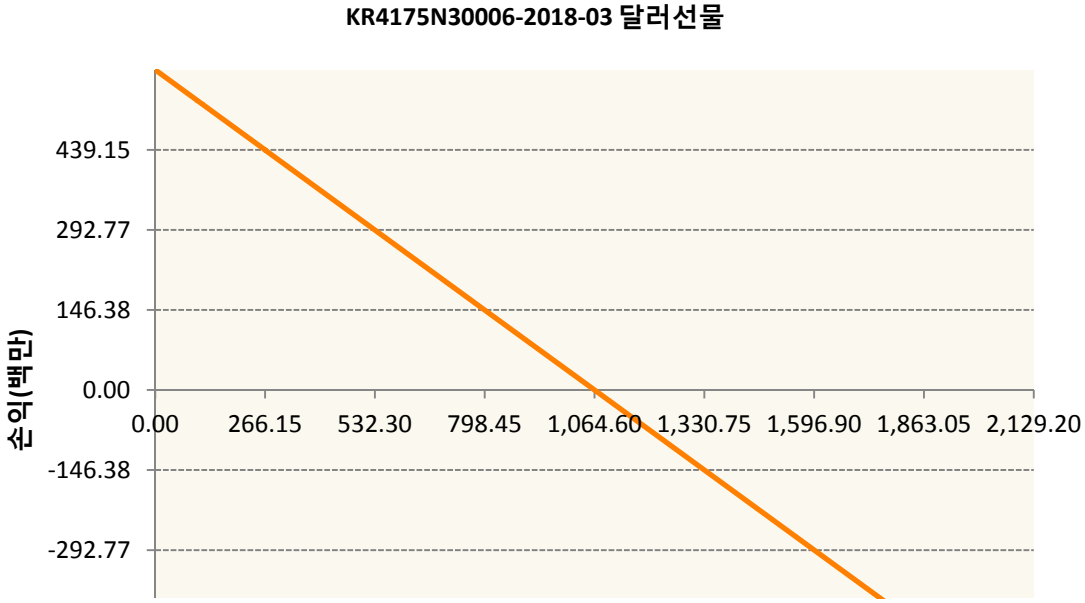
2. 만기시점의 손익구조

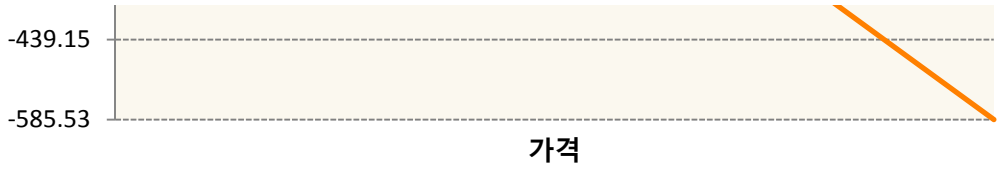


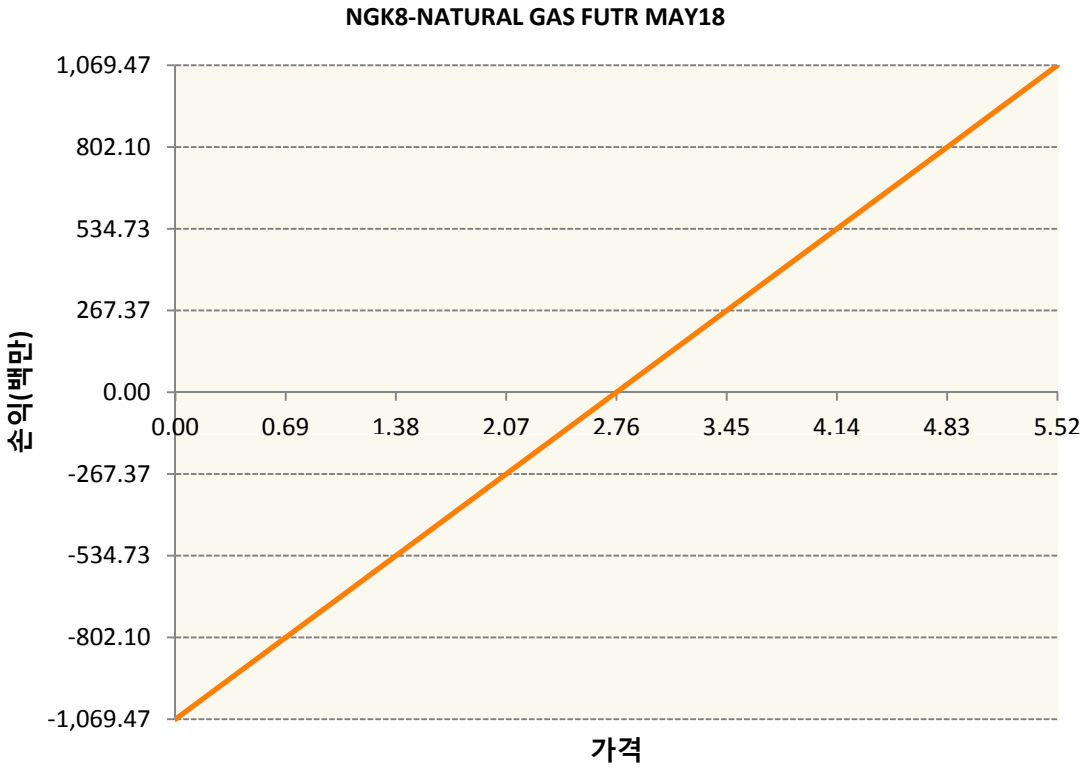


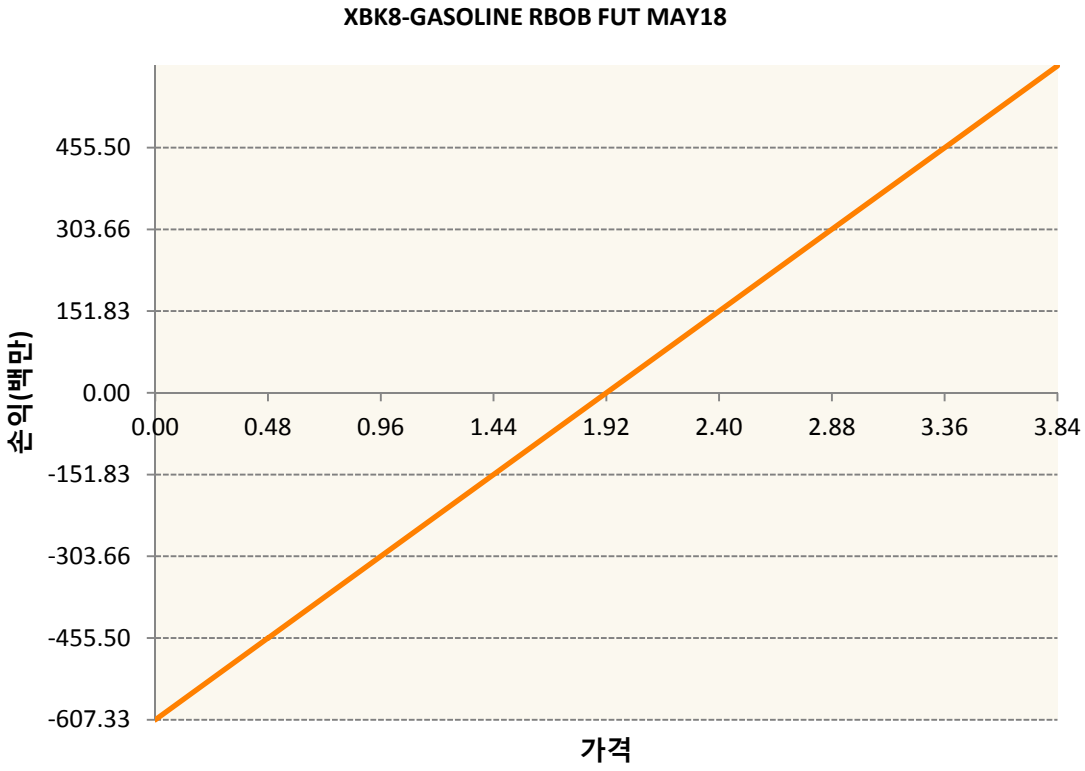

-262.65
-525.31
-787.96
-1,050.61
가격


HOK8-NY Harb ULSD Fut MAY18
384.66
256.44
128.22
0.00
-128.22
-256.44
-384.66
-512.88
0.00
0.47
0.95
1.42
1.89
2.36
2.84
3.31
3.78
손익(백만)
가격


KR4175N30006-2018-03 달러선물
439.15
292.77
146.38
0.00
-146.38
-292.77
0.00
266.15
532.30
798.45
1,064.60
1,330.75
1,596.90
1,863.05
2,129.20
손익(백만)


-439.15
-585.53
가격


NGK8-NATURAL GAS FUTR MAY18
1,069.47
802.10
534.73
267.37
0.00
-267.37
-534.73
-802.10
-1,069.47
0.00
0.69
1.38
2.07
2.76
3.45
4.14
4.83
5.52
손익(백만)
가격


XBK8-GASOLINE RBOB FUT MAY18
455.50
303.66
151.83
0.00
-151.83
-303.66
-455.50
-607.33
0.00
0.48
0.96
1.44
1.92
2.40
2.88
3.36
3.84
손익(백만)
가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLK8	WTI CRUDE FUTURE MAY18	59
COK8	BRENT CRUDE FUTR MAY18	84
HOK8	NY Harb ULSD Fut MAY18	41
KR4175N30(	2018-03 달러선물	47
NGK8	NATURAL GAS FUTR MAY18	86
XBK8	GASOLINE RBOB FUT MAY18	49

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

522

공시일	2018-03-13
기준일	2018-03-12

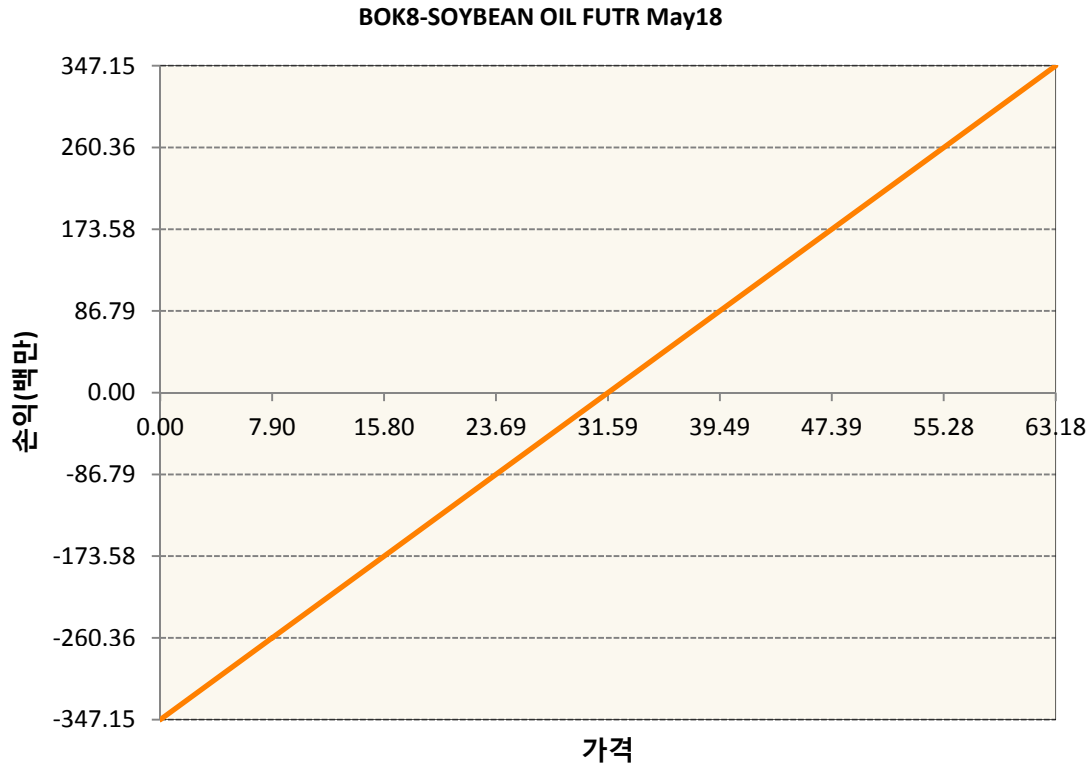
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

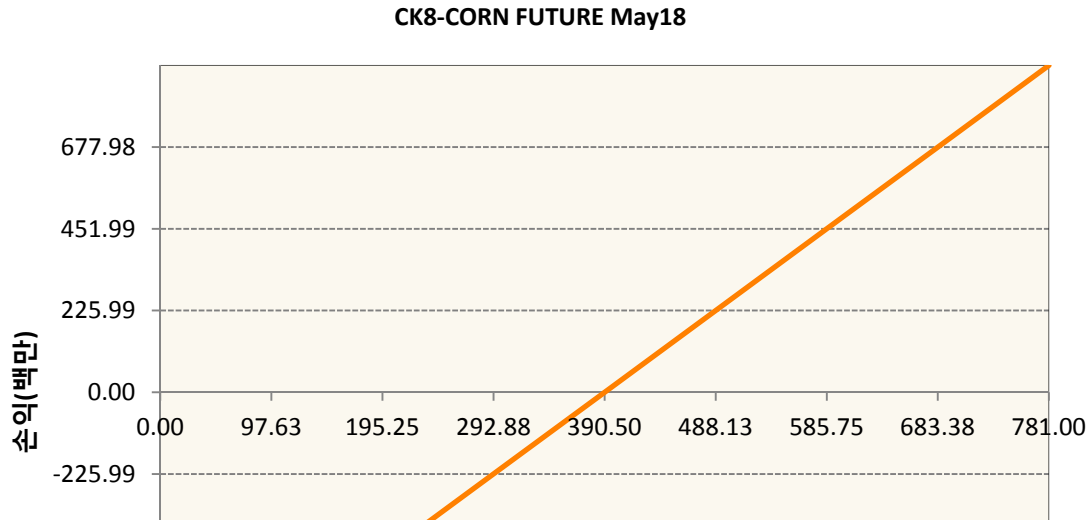
1. 계약금액

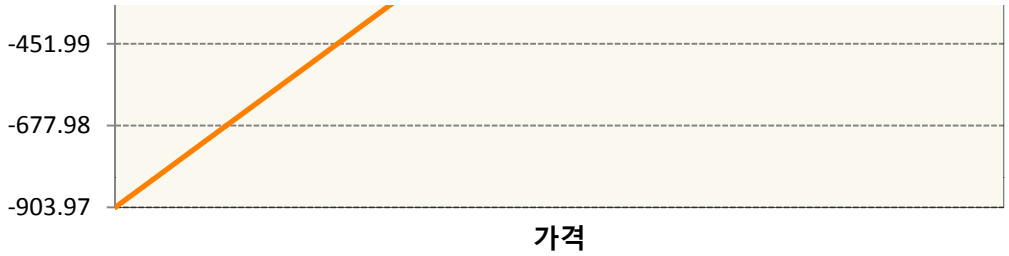
(단위:백만원)

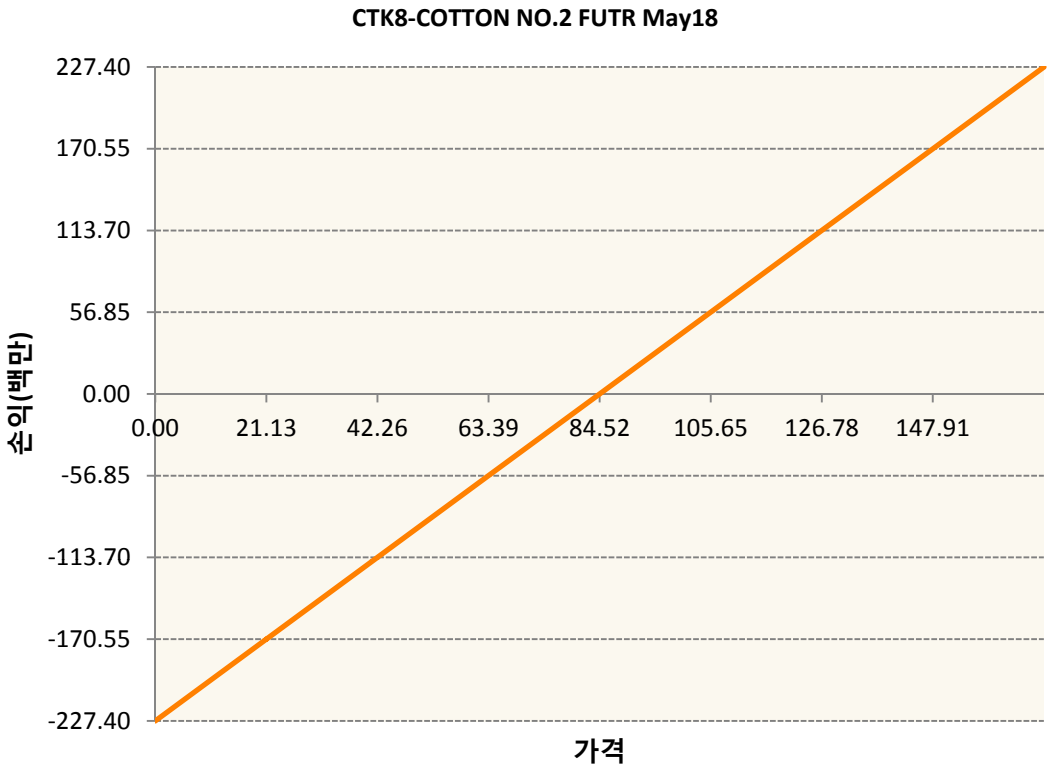
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	4,183	319	3,863	

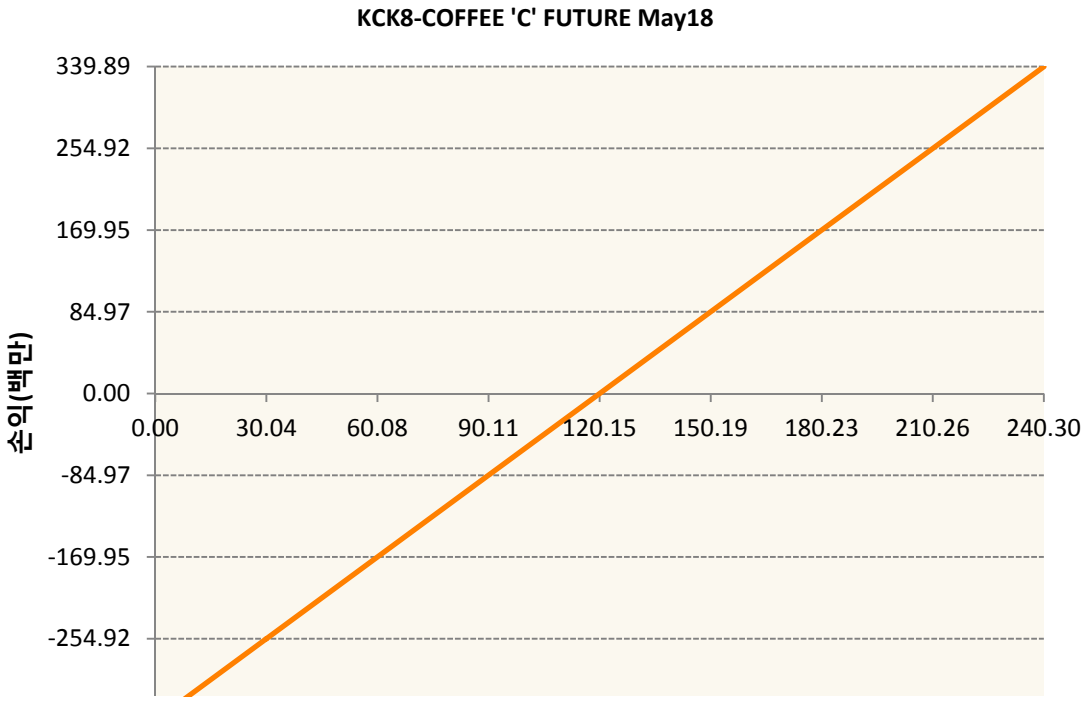
2. 만기시점의 손익구조

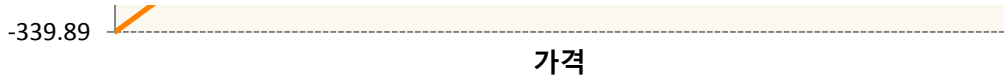


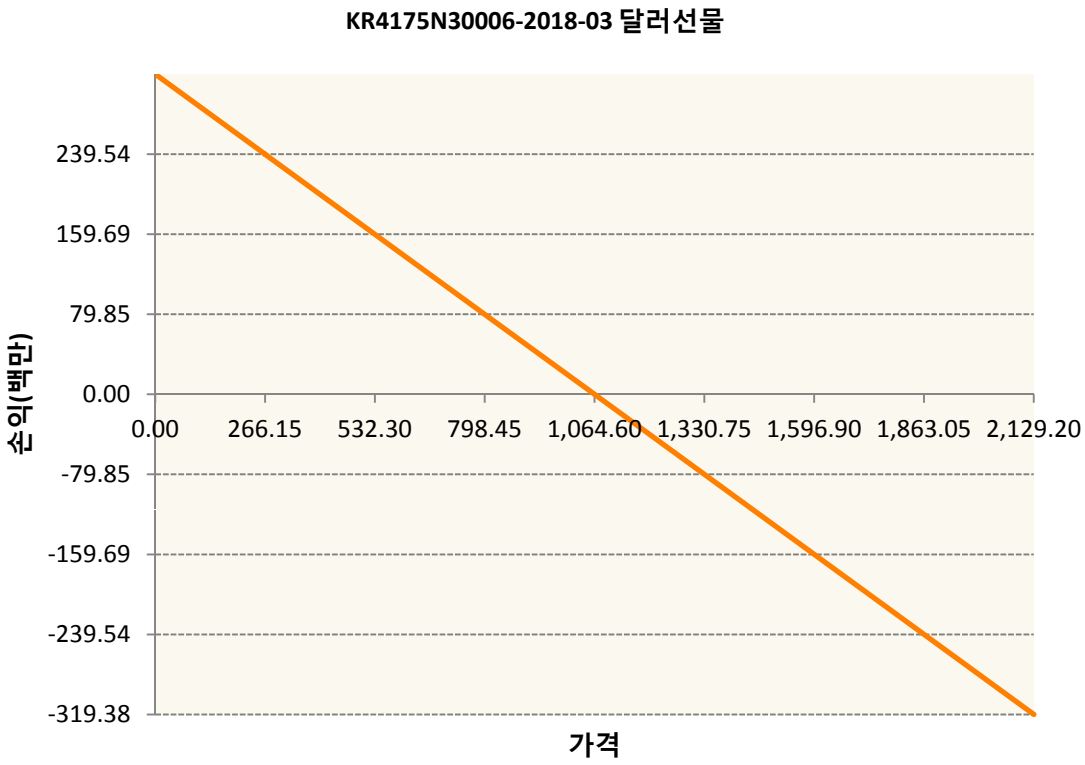


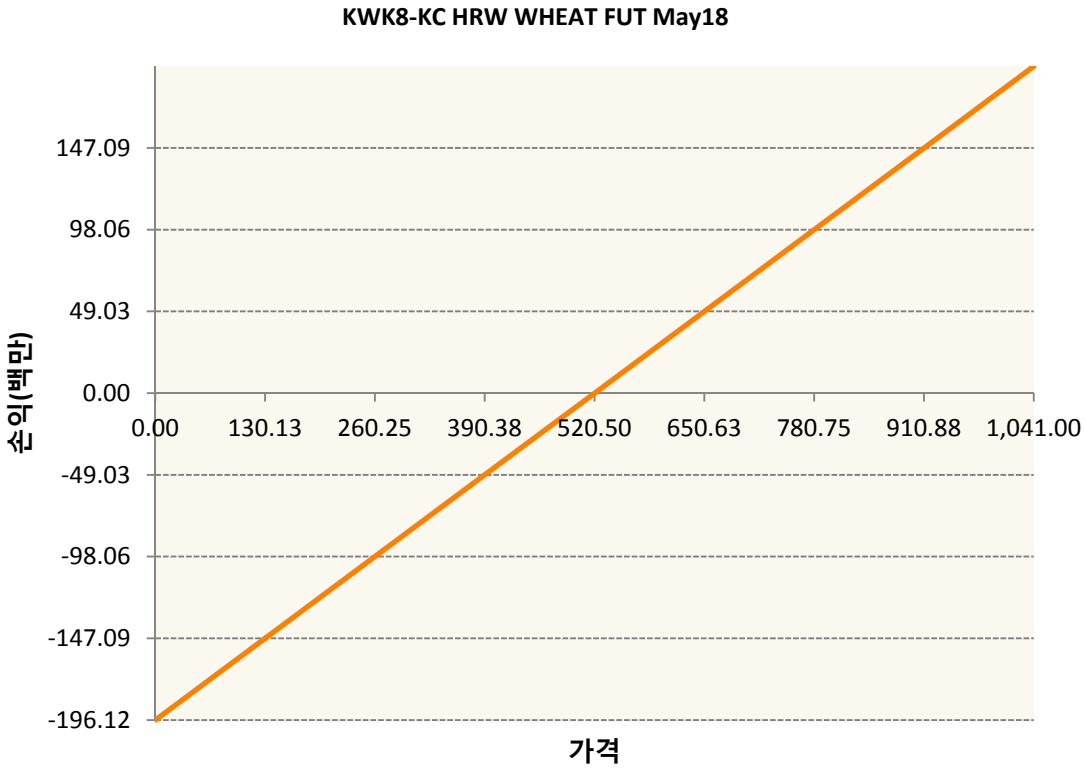

-451.99
-677.98
-903.97
가격


CTK8-COTTON NO.2 FUTR May18
227.40
170.55
113.70
56.85
0.00
-56.85
-113.70
-170.55
-227.40
0.00
21.13
42.26
63.39
84.52
105.65
126.78
147.91
손익(백만)
가격

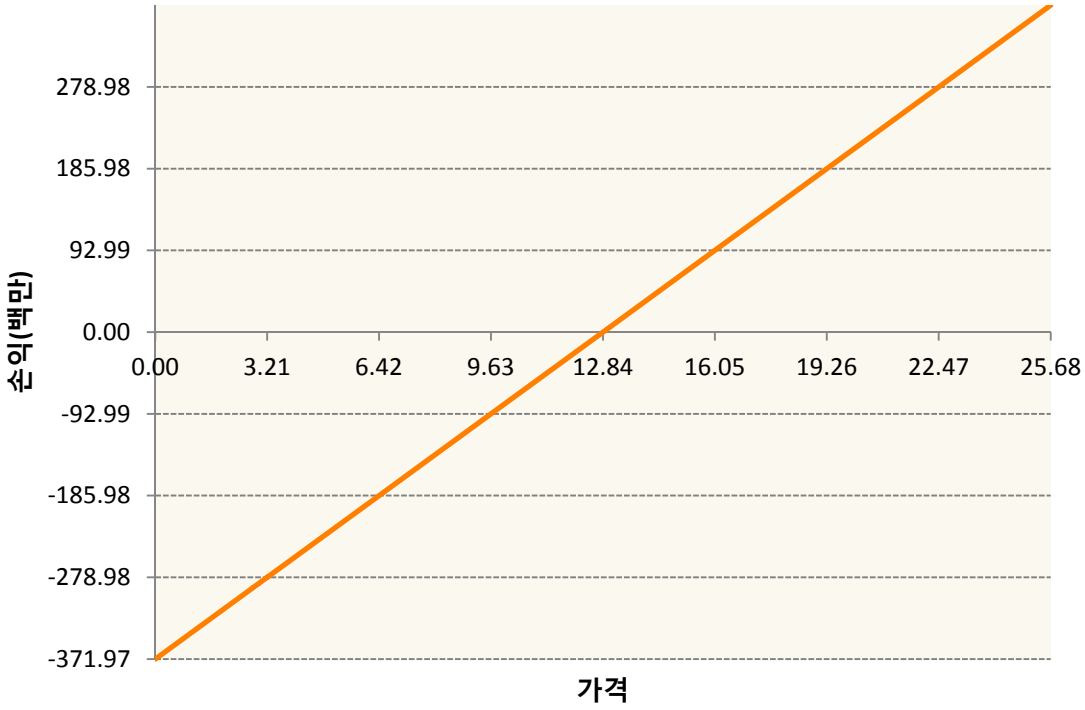

KCK8-COFFEE 'C' FUTURE May18
339.89
254.92
169.95
84.97
0.00
-84.97
-169.95
-254.92
0.00
30.04
60.08
90.11
120.15
150.19
180.23
210.26
240.30
손익(백만)


-339.89
가격

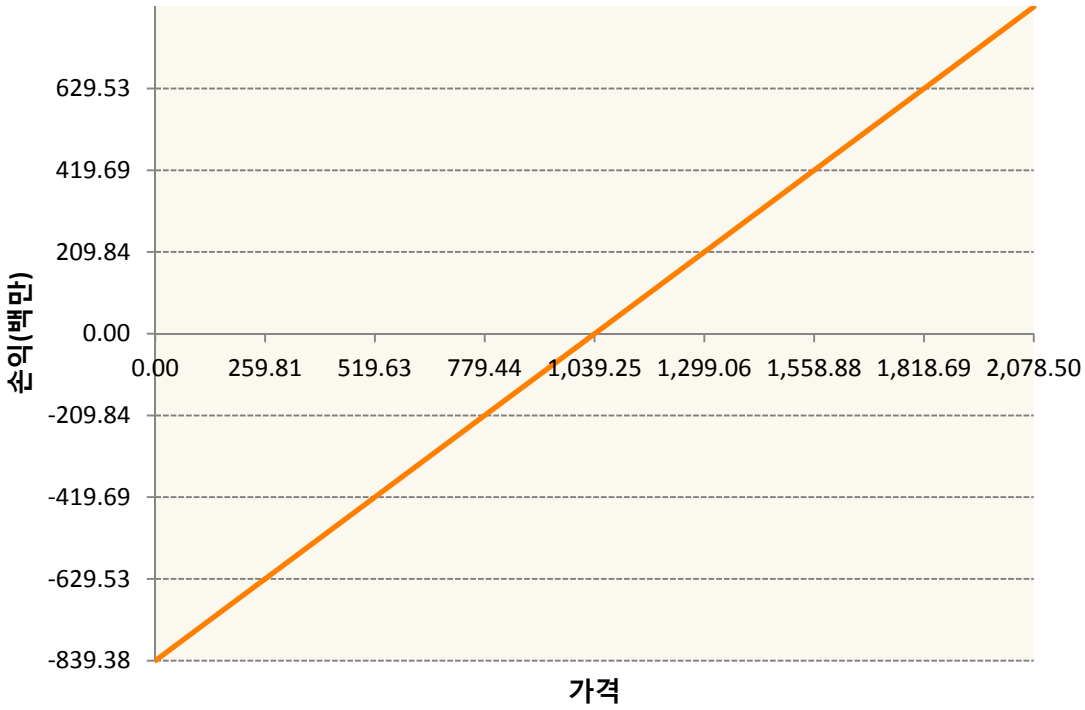

KR4175N30006-2018-03 달러선물
239.54
159.69
79.85
0.00
-79.85
-159.69
-239.54
-319.38
0.00
266.15
532.30
798.45
1,064.60
1,330.75
1,596.90
1,863.05
2,129.20
손익(백만)
가격


KWK8-KC HRW WHEAT FUT May18
147.09
98.06
49.03
0.00
-49.03
-98.06
-147.09
-196.12
0.00
130.13
260.25
390.38
520.50
650.63
780.75
910.88
1,041.00
손익(백만)
가격

SBK8-SUGAR #11 (WORLD) May18

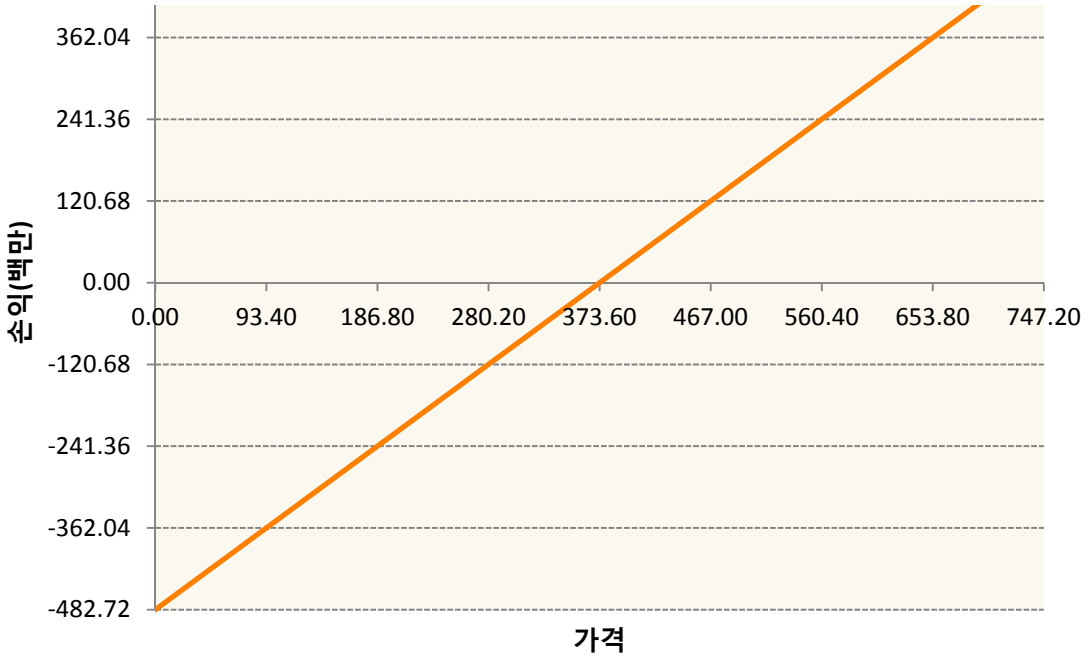


SK8-SOYBEAN FUTRUE May18

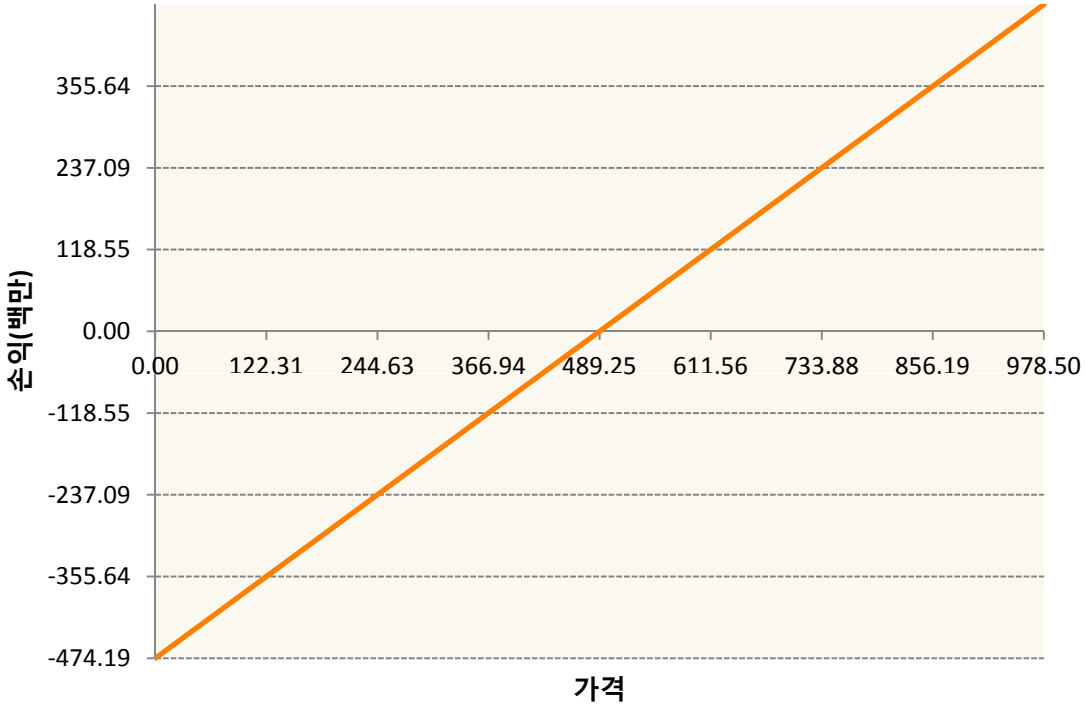


SMK8-SOYBEAN MEAL FUTR May18





WK8-WHEAT FUTURE(CBT) May18



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

BOK8	SOYBEAN OIL FUTR May18	28
CK8	CORN FUTURE May18	72
CTK8	COTTON NO.2 FUTR May18	18
KCK8	COFFEE 'C' FUTURE May18	27
KR4175N30(	2018-03 달러선물	26

KWK8	KC HRW WHEAT FUT May18	16
SBK8	SUGAR #11 (WORLD) May18	30
SK8	SOYBEAN FUTRUE May18	67
SMK8	SOYBEAN MEAL FUTR May18	39
WK8	WHEAT FUTURE(CBT) May18	38

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

337