공시일	2018-03-14
기준일	2018-03-13

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	2018-03-14
기준일	2018-03-13

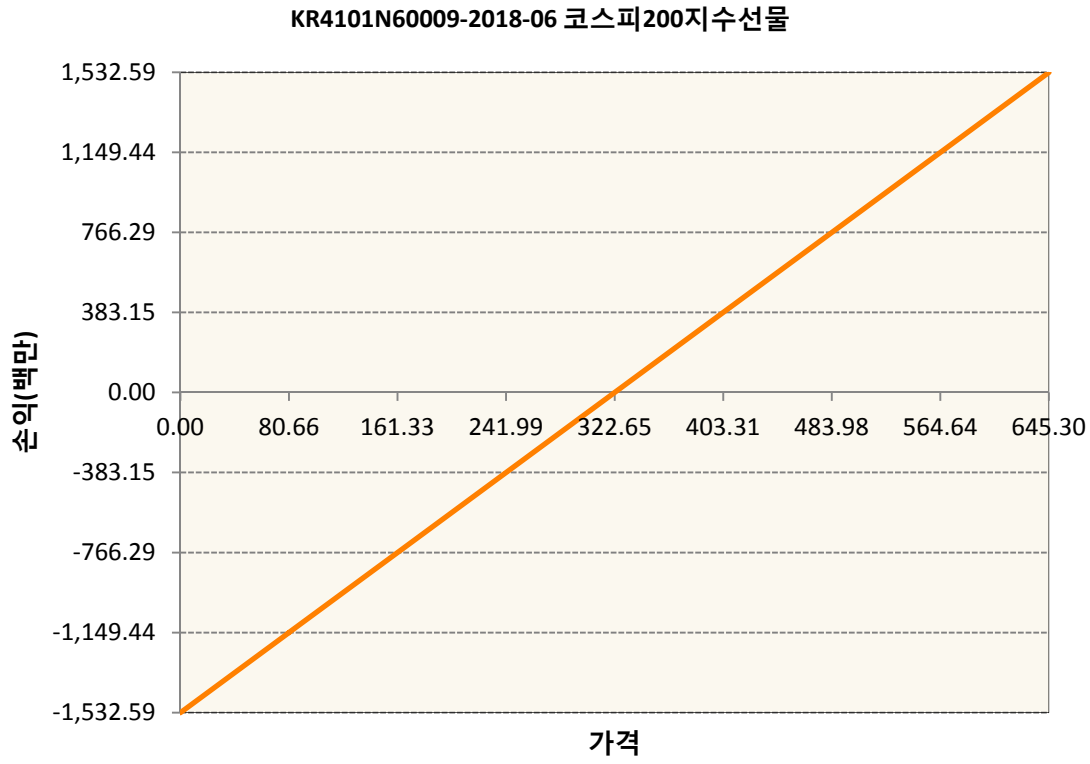
스마트인덱스모

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	1,533	0	1,533	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101N60(2018-06 코스피200지수선물							123
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-123	-123	-123	-123	-123	-123	-123
-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%	123	123	123	123	123	123	123

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

85

공시일	2018-03-14
기준일	2018-03-13

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	1,130

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

424

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2018-03-14
기준일	2018-03-13

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	418

* 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	2018-03-14
기준일	2018-03-13

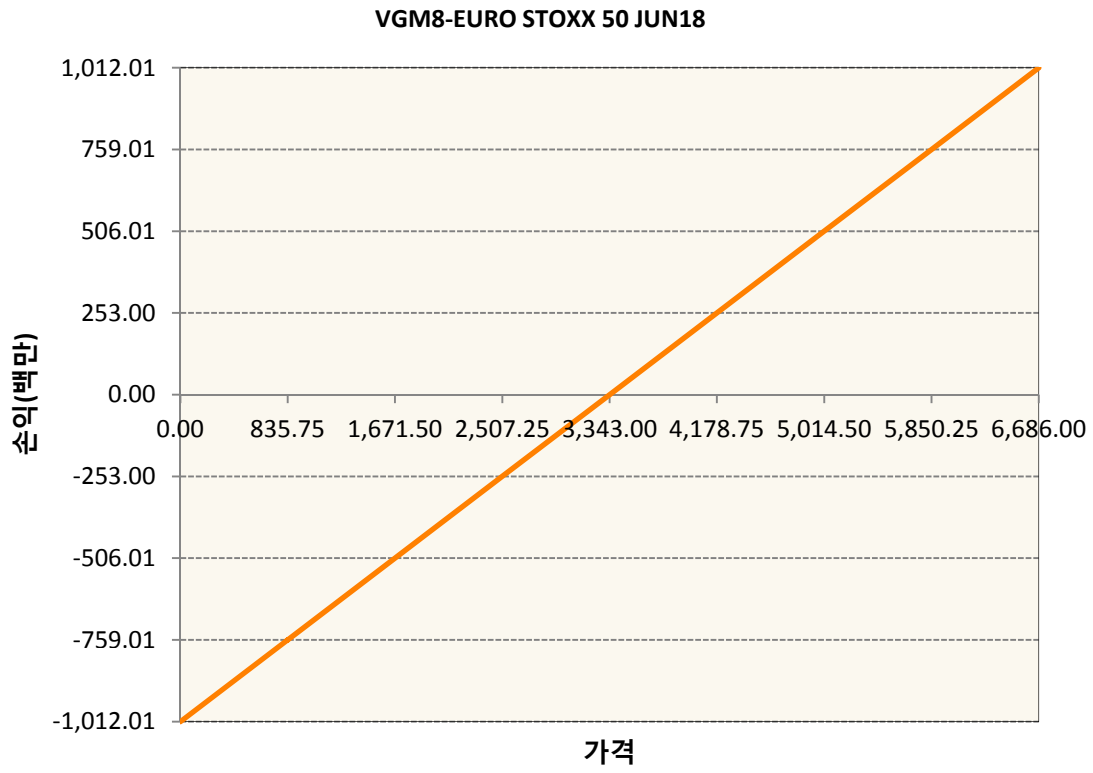
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,012	0	1,012	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGM8	EURO STOXX 50 JUN18	81

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

(단위:백만원)

47

공시일	2018-03-14
기준일	2018-03-13

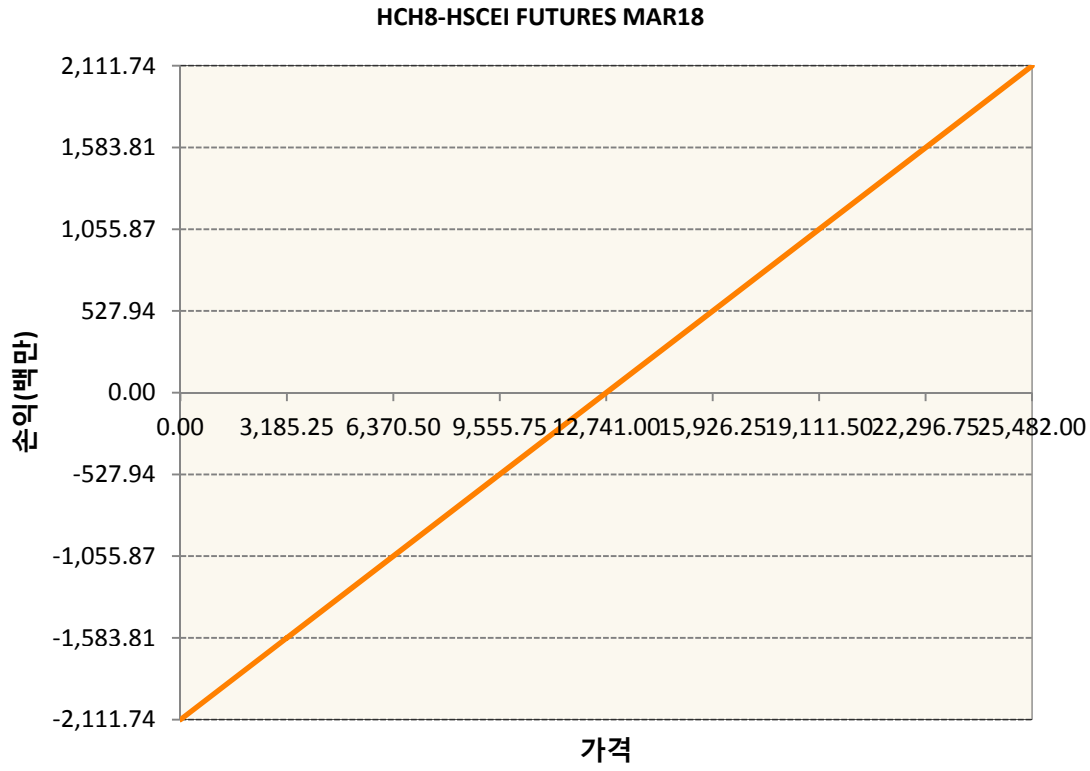
차이나인덱스모(주식-파생형)

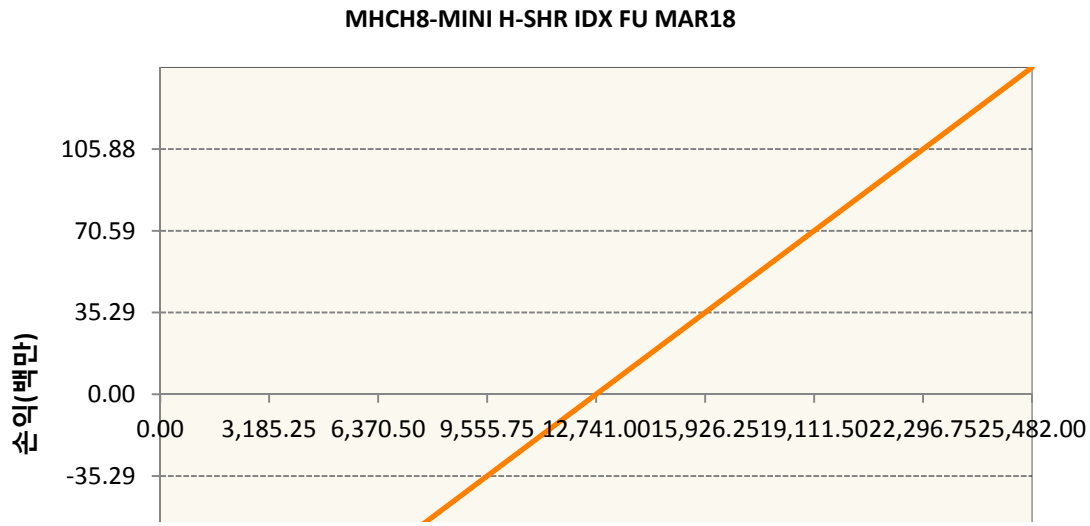
1. 계약금액

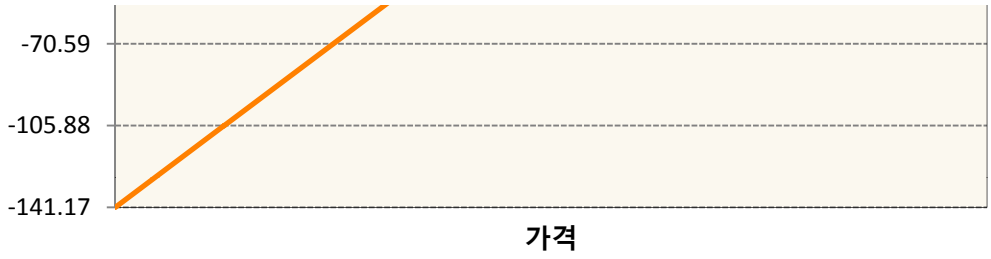
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,253	0	2,253	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCH8	HSCEI FUTURES MAR18	169
MHCH8	MINI H-SHR IDX FU MAR18	11

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	158

공시일	2018-03-14
기준일	2018-03-13

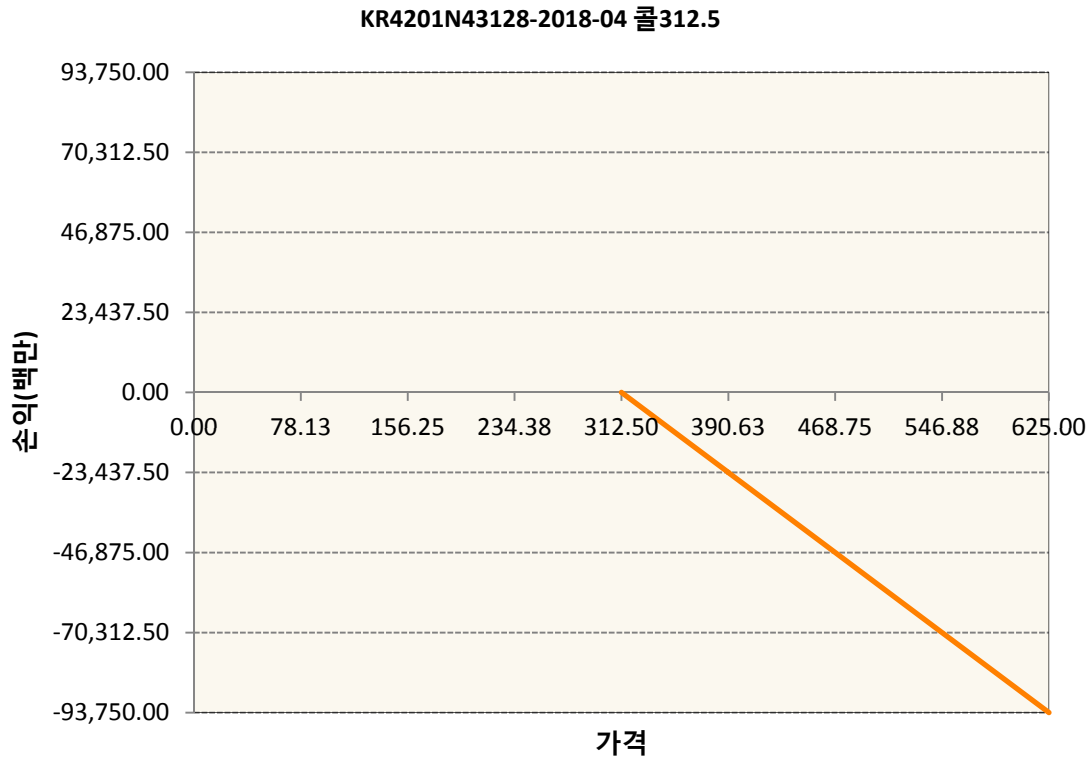
커버드콜모(주식혼합-파생형)

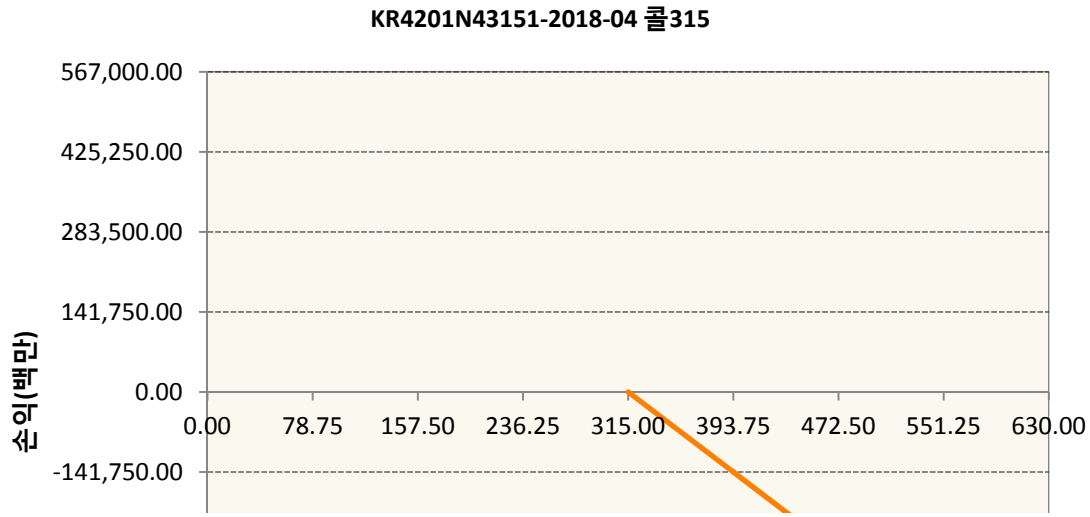
1. 계약금액

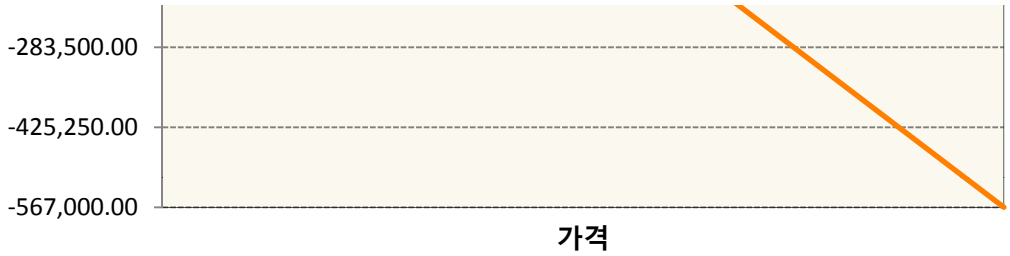
(단위:백만원)

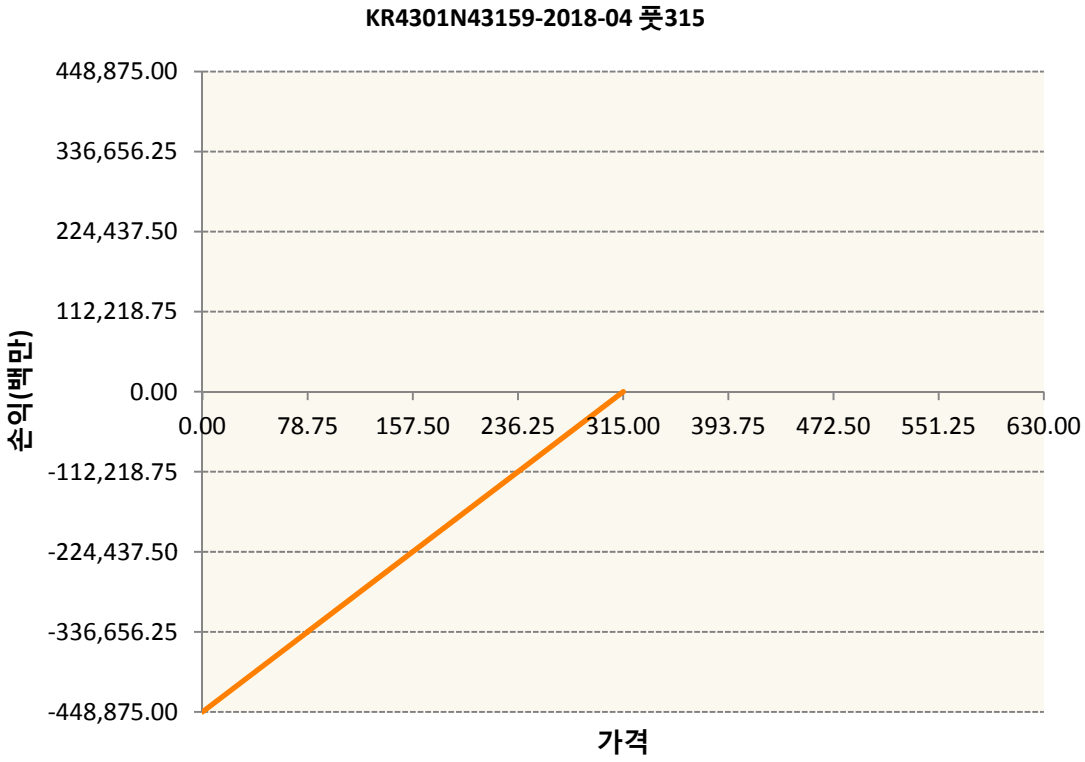
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	7,648	0	7,648	장내
누계	유가증권	옵션	0	1,109,625	-1,109,625	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201N4312018-04 콜312.5							6,730
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	4,206	4,040	3,865	3,681	3,490	3,293	3,093
-5.33%	3,488	3,266	3,042	2,816	2,589	2,360	2,131
-2.67%	2,304	2,066	1,827	1,589	1,350	1,112	873
0%	642	433	219	0	-222	-447	-675
2.67%	-1,413	-1,564	-1,730	-1,907	-2,093	-2,287	-2,486
5.33%	-3,733	-3,826	-3,937	-4,064	-4,205	-4,358	-4,521
8.00%	-6,202	-6,250	-6,316	-6,398	-6,495	-6,606	-6,730
KR4201N4312018-04 콜315							39,389
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	23,132	22,247	21,285	20,261	19,186	18,070	16,920

-5.33%	19,506	18,244	16,954	15,644	14,317	12,977	11,627
-2.67%	13,236	11,795	10,354	8,914	7,473	6,033	4,592
0%	4,078	2,738	1,377	0	-1,389	-2,788	-4,195
2.67%	-7,616	-8,647	-9,749	-10,906	-12,107	-13,344	-14,612
5.33%	-21,128	-21,795	-22,568	-23,431	-24,371	-25,375	-26,433
8.00%	-35,721	-36,089	-36,565	-37,142	-37,811	-38,563	-39,389
KR4301N4312018-04 풋315							23,638

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-22,233	-22,369	-22,548	-22,768	-23,025	-23,316	-23,638
-5.33%	-11,125	-11,546	-11,998	-12,475	-12,972	-13,485	-14,011
-2.67%	-2,820	-3,450	-4,080	-4,710	-5,340	-5,970	-6,600
0%	1,515	1,034	527	0	-543	-1,098	-1,664
2.67%	2,944	2,746	2,499	2,210	1,883	1,523	1,133
5.33%	3,230	3,183	3,108	3,000	2,858	2,681	2,471
8.00%	3,264	3,257	3,242	3,214	3,168	3,101	3,011

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

67,063

공시일	2018-03-14
기준일	2018-03-13

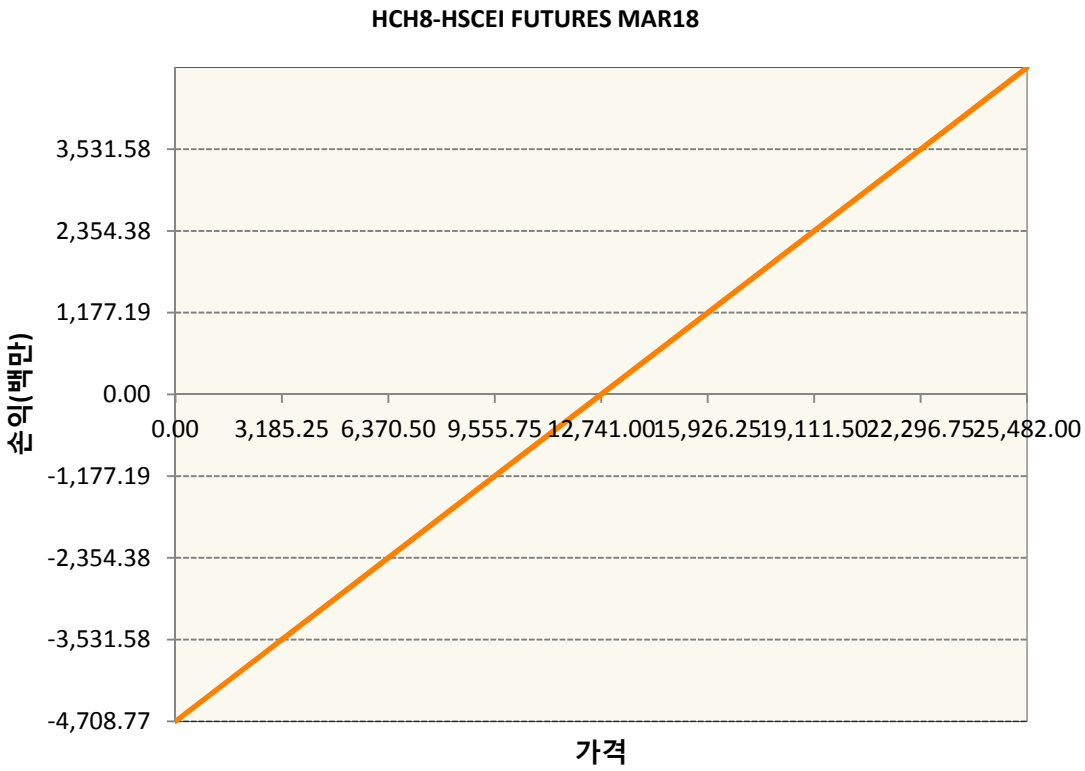
홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생

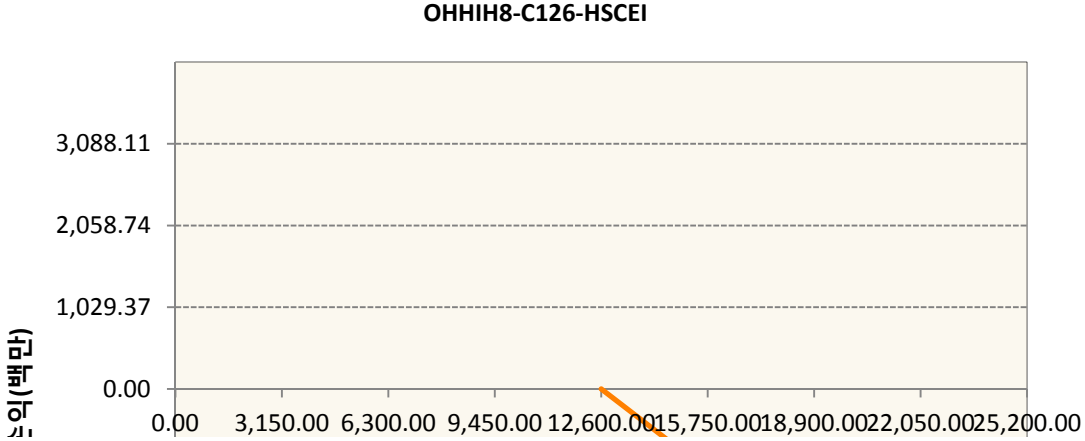
1. 계약금액

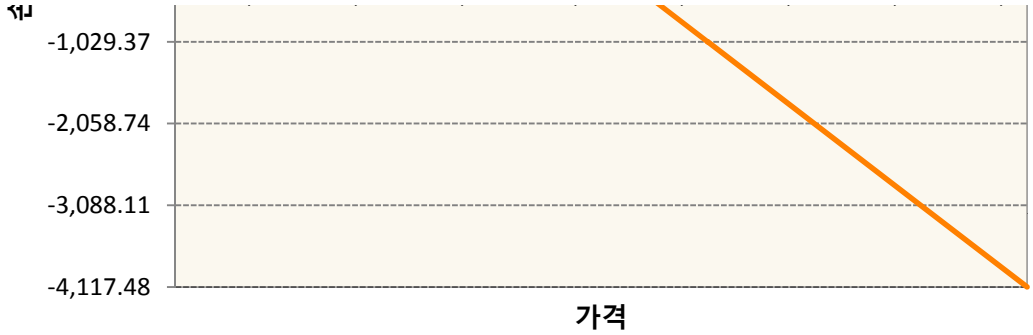
(단위:백만원)

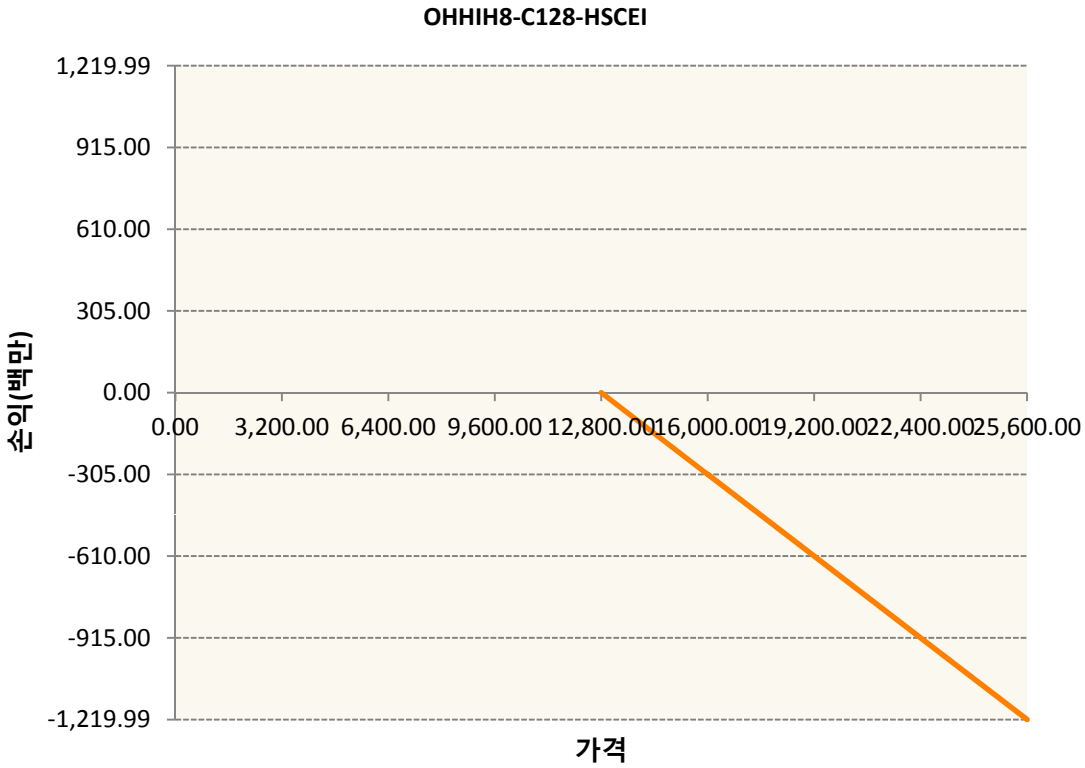
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	4,709	0	4,709	장내
누계	유가증권	옵션	0	10,675	-10,675	장내

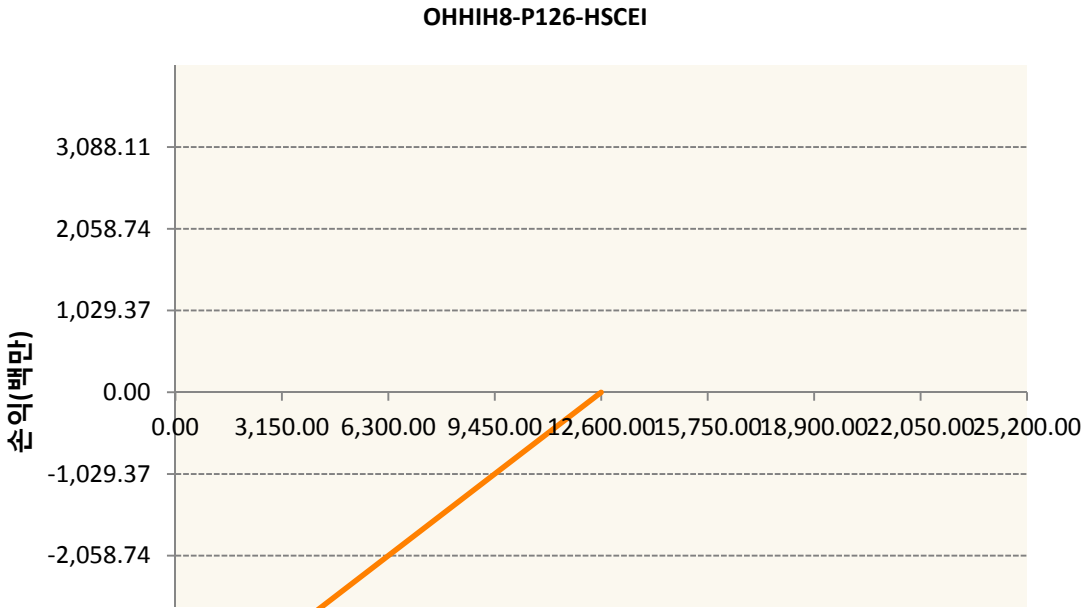
2. 만기시점의 손익구조

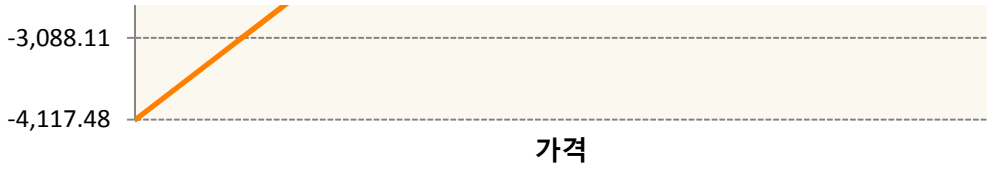


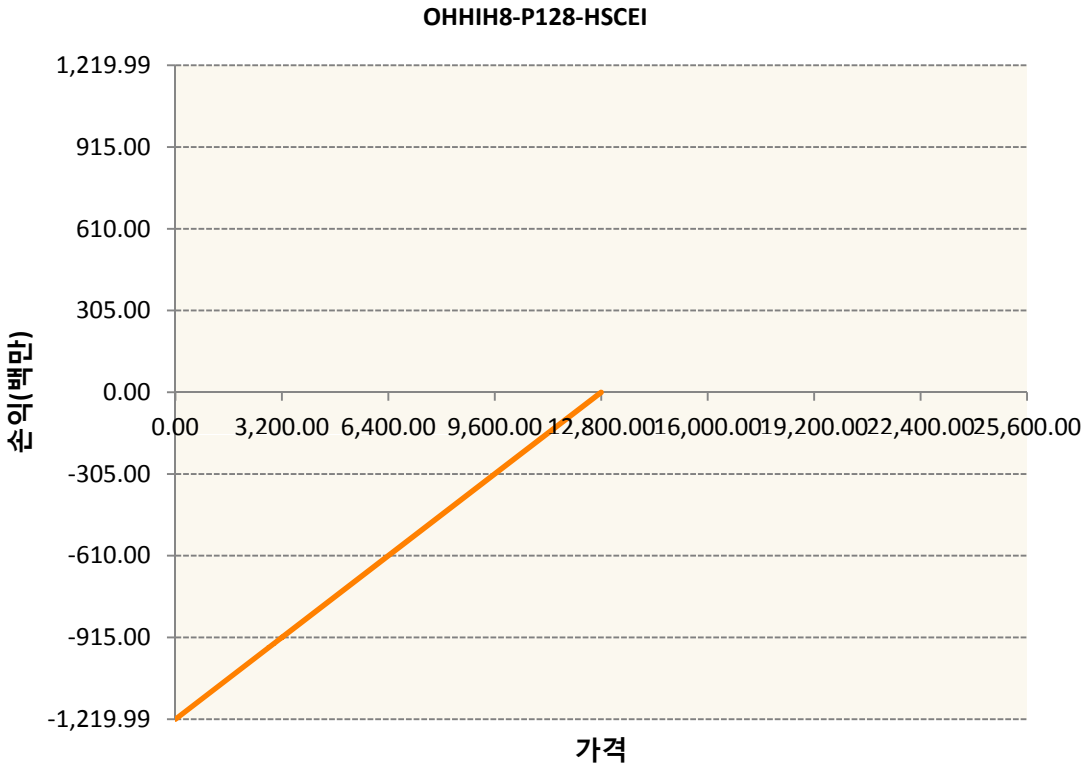



-1,029.37
-2,058.74
-3,088.11
-4,117.48
가격


OHHIH8-C128-HSCEI
1,219.99
915.00
610.00
305.00
0.00
-305.00
-610.00
-915.00
-1,219.99
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
3,088.11
2,058.74
1,029.37
0.00
-1,029.37
-2,058.74
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	377
OHHIH8-C12	HSCEI	329
OHHIH8-C12	HSCEI	98
OHHIH8-P12	HSCEI	329
OHHIH8-P12	HSCEI	98

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

1,077

공시일	2018-03-14
기준일	2018-03-13

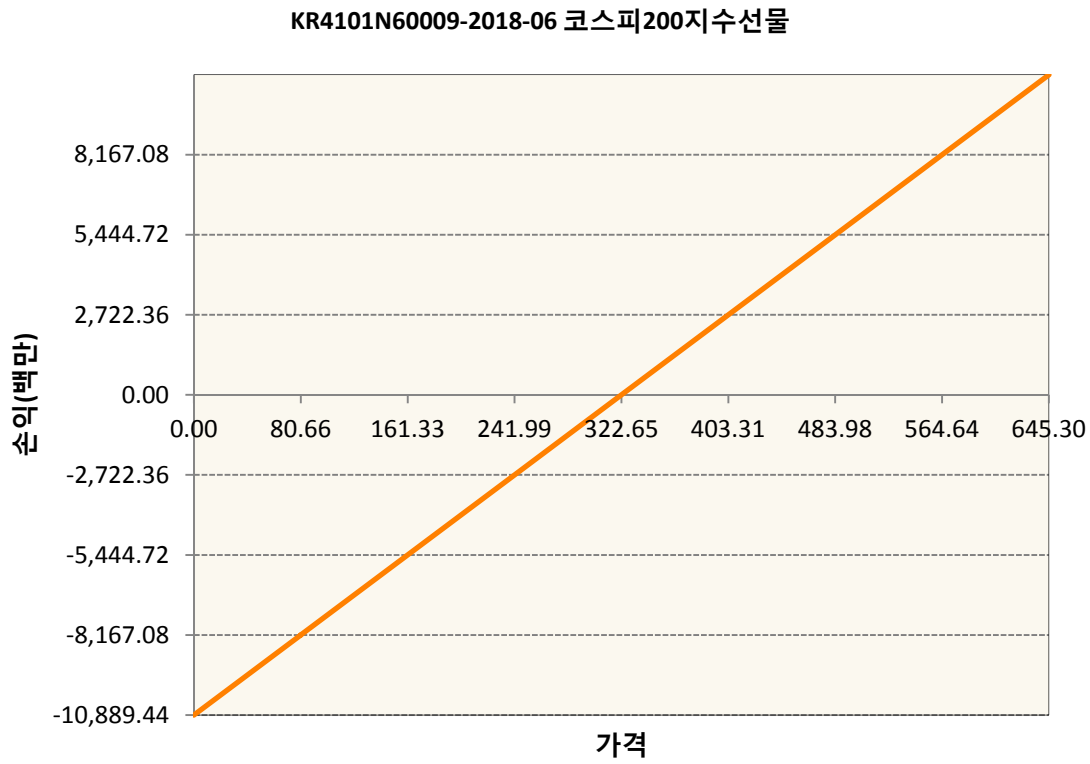
코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼

1. 계약금액

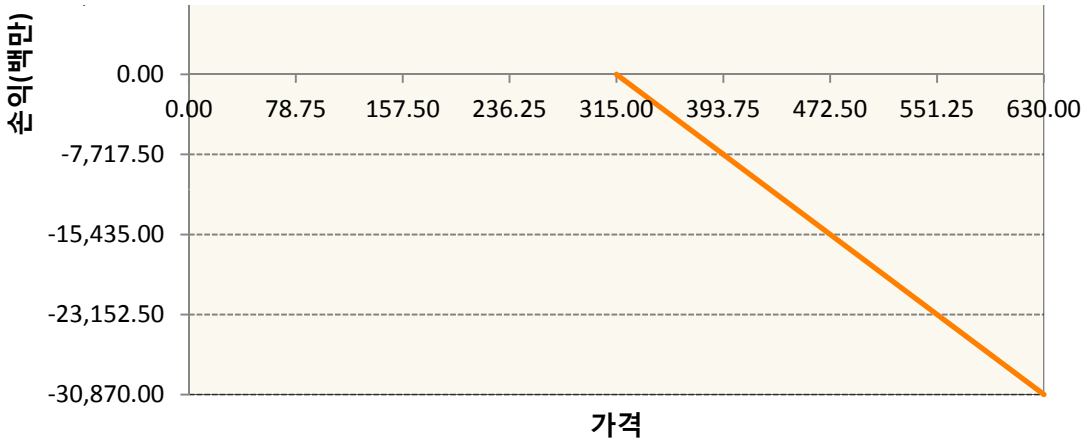
(단위:백만원)

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	10,889	0	10,889	장내
누계	유가증권	스왑	56,200	0	56,200	장외
누계	유가증권	옵션	0	56,033	-56,033	장내

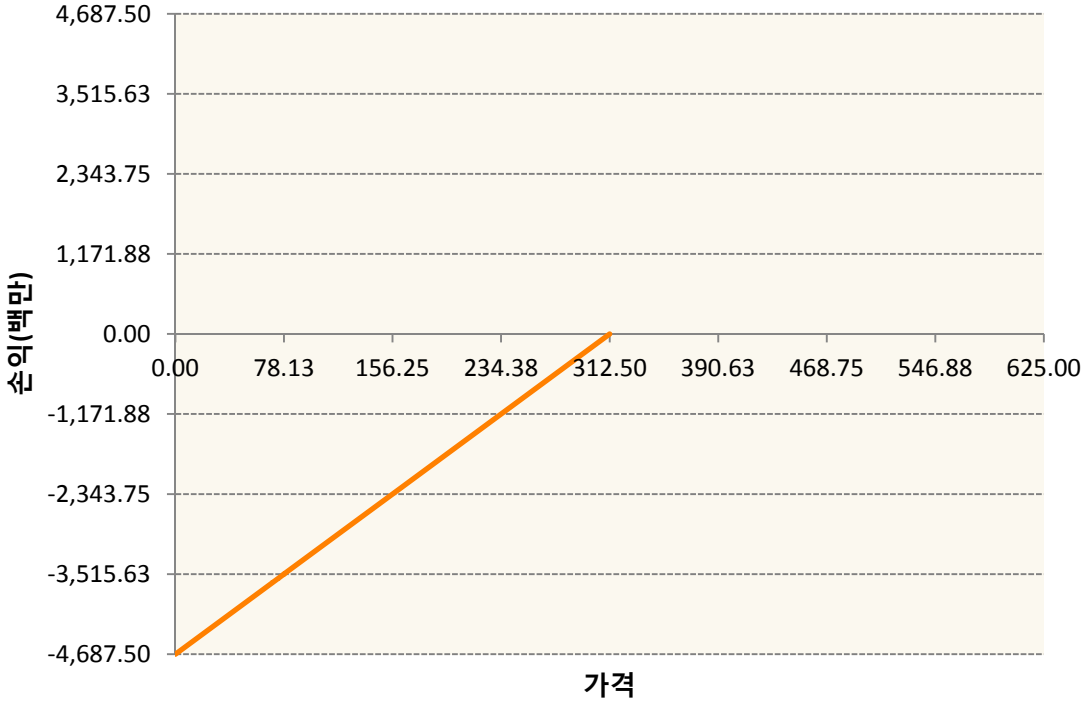
2. 만기시점의 손익구조



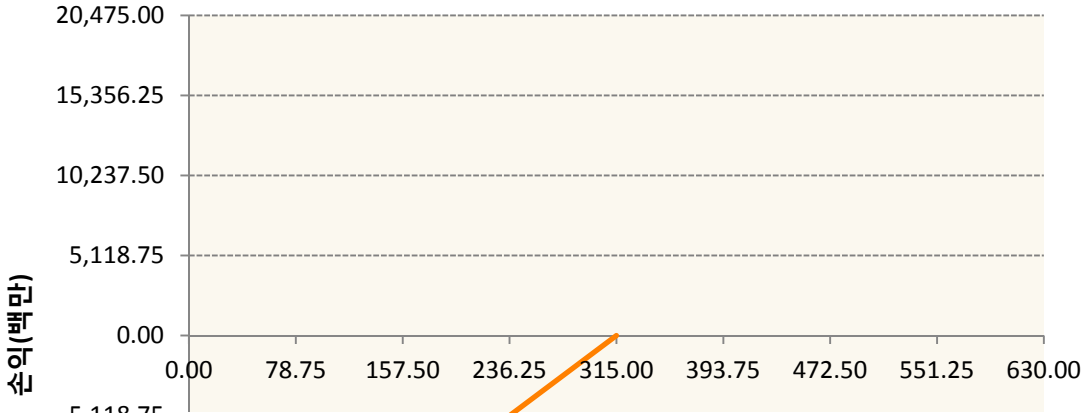




KR4301N43126-2018-04 풋312.5



KR4301N43159-2018-04 풋315





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_2							1,443
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,443	-1,443	-1,443	-1,443	-1,443	-1,443	-1,443
-5.33%	-962	-962	-962	-962	-962	-962	-962
-2.67%	-481	-481	-481	-481	-481	-481	-481
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	481	481	481	481	481	481	481
5.33%	962	962	962	962	962	962	962
8.00%	1,443	1,443	1,443	1,443	1,443	1,443	1,443
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%	-166	-166	-166	-166	-166	-166	-166
-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%	166	166	166	166	166	166	166
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						624
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-624	-624	-624	-624	-624	-624	-624
-5.33%	-416	-416	-416	-416	-416	-416	-416
-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%	416	416	416	416	416	416	416
8.00%	624	624	624	624	624	624	624
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_12						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
	KR4101N60(2018-06 코스피200지수선물						872
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-872	-872	-872	-872	-872	-872	-872
-5.33%	-581	-581	-581	-581	-581	-581	-581
-2.67%	-291	-291	-291	-291	-291	-291	-291
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	291	291	291	291	291	291	291
5.33%	581	581	581	581	581	581	581
8.00%	872	872	872	872	872	872	872
	KR4201N431 2018-04 콜315						2,144
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,259	1,211	1,159	1,103	1,045	984	921
-5.33%	1,062	993	923	852	779	707	633
-2.67%	721	642	564	485	407	328	250
0%	222	149	75	0	-76	-152	-228
2.67%	-415	-471	-531	-594	-659	-727	-796
5.33%	-1,150	-1,187	-1,229	-1,276	-1,327	-1,382	-1,439
8.00%	-1,945	-1,965	-1,991	-2,022	-2,059	-2,100	-2,144
	KR4301N431 2018-04 풋312.5						226

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-208	-210	-212	-215	-219	-222	-226
-5.33%	-97	-102	-108	-113	-119	-125	-131
-2.67%	-21	-28	-34	-41	-47	-54	-60
0%	13	9	5	0	-5	-10	-16
2.67%	23	22	20	18	15	12	8
5.33%	25	24	24	23	22	21	19
8.00%	25	25	25	25	24	24	23
	KR4301N4312018-04 풋315						1,078

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,014	-1,020	-1,029	-1,039	-1,050	-1,064	-1,078
-5.33%	-507	-527	-547	-569	-592	-615	-639
-2.67%	-129	-157	-186	-215	-244	-272	-301
0%	69	47	24	0	-25	-50	-76
2.67%	134	125	114	101	86	69	52
5.33%	147	145	142	137	130	122	113
8.00%	149	149	148	147	145	141	137

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

8,272

공시일	2018-03-14
기준일	2018-03-13

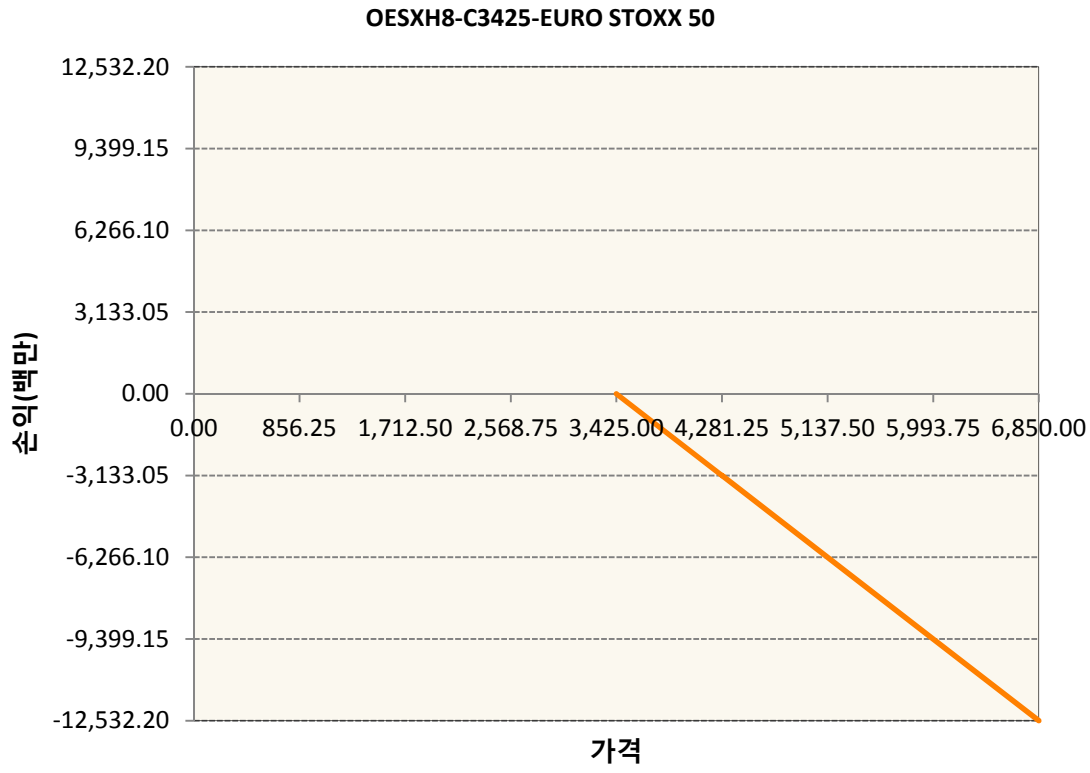
유로커버드콜모(주식혼합-파생형

1. 계약금액

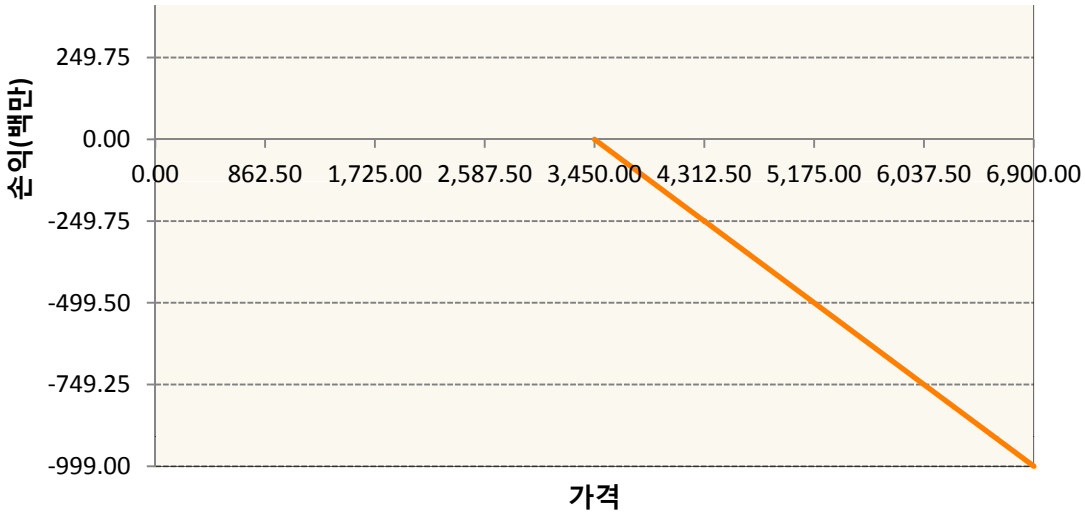
(단위:백만원)

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	5,591	0	5,591	
누계	유가증권	스왑	98,713	0	98,713	장외
누계	유가증권	옵션	0	27,062	-27,062	장내
누계	지수	스왑	52,648	0	52,648	장외

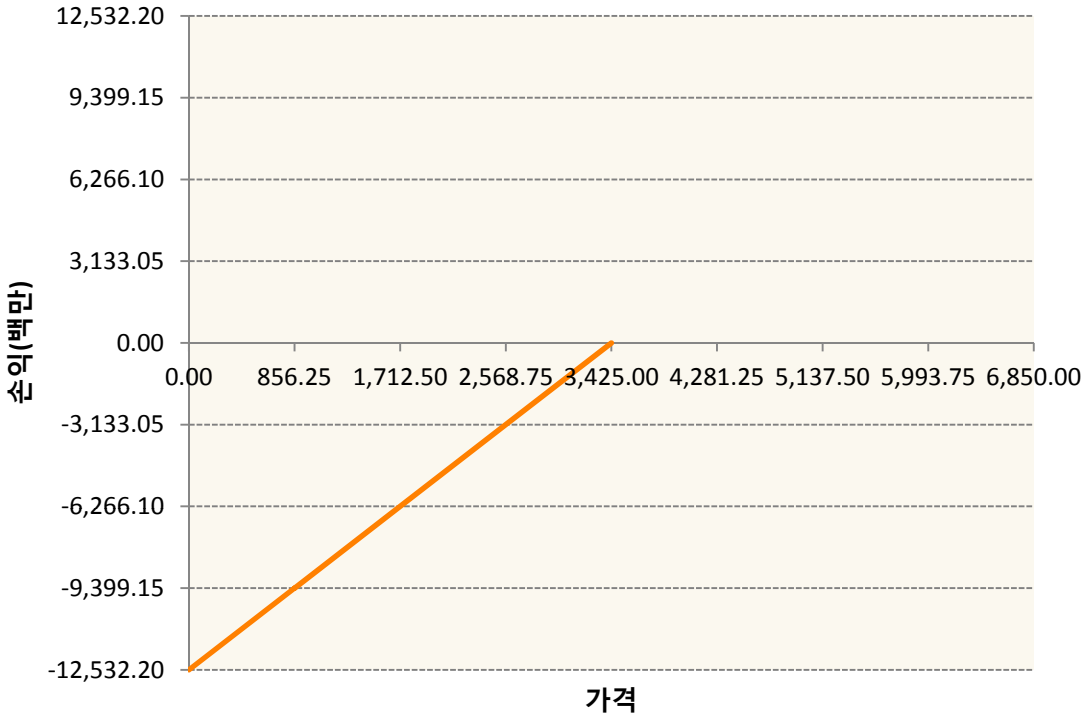
2. 만기시점의 손익구조



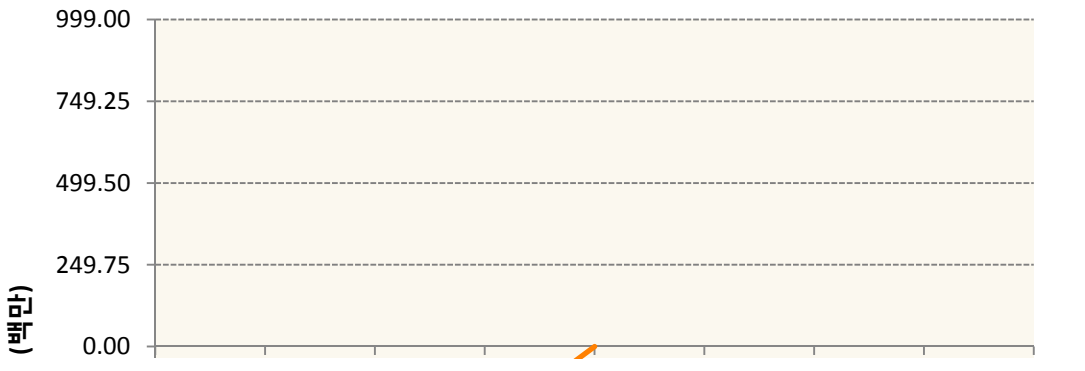


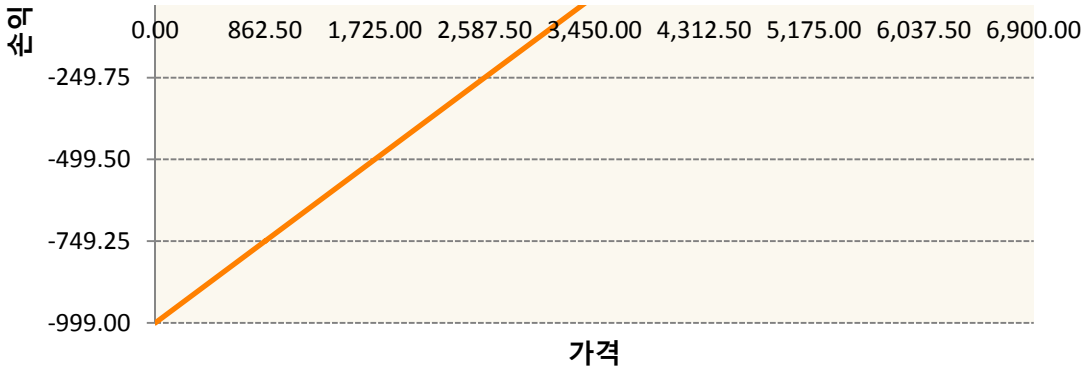


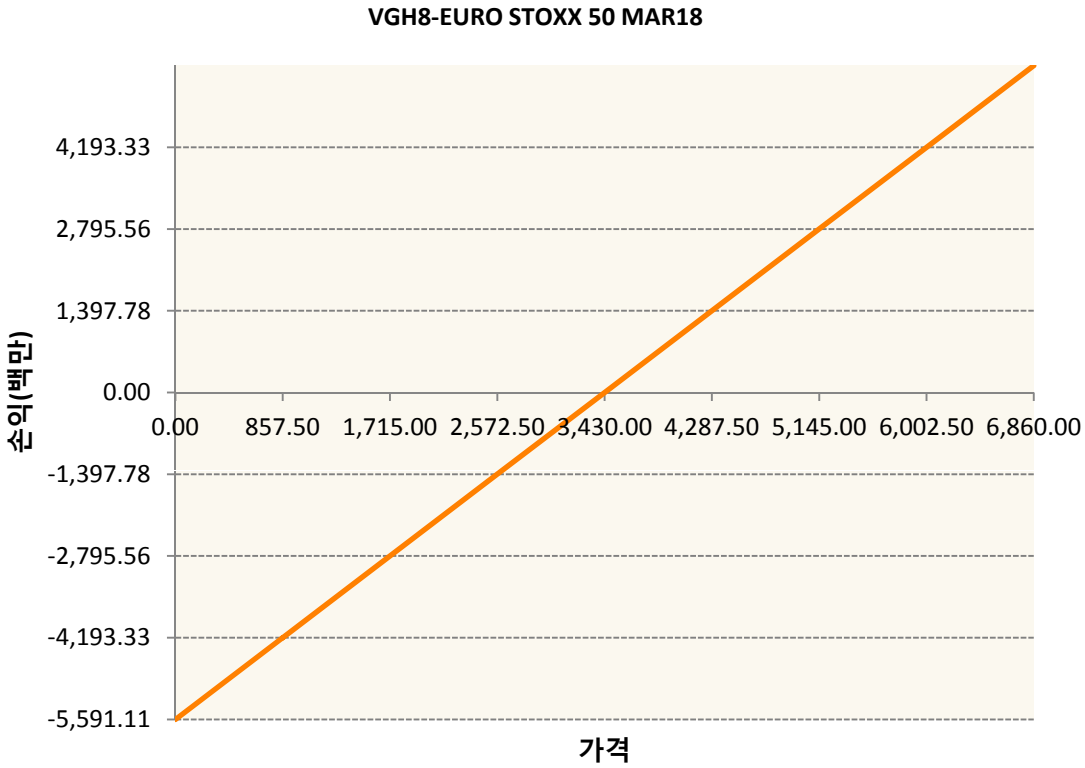
OESXH8-P3425-EURO STOXX 50



OESXH8-P3450-EURO STOXX 50







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

260105SGPX SG EURO Covered CALL STRATEGY - 994.569	173
260105SQPX SG EURO Covered CALL STRATEGY	324
OESXH8-C34 EURO STOXX 50	1,003
OESXH8-C34 EURO STOXX 50	80
OESXH8-P34 EURO STOXX 50	1,003
OESXH8-P34 EURO STOXX 50	80
VGH8 EURO STOXX 50 MAR18	447

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

1,838

공시일	2018-03-14
기준일	2018-03-13

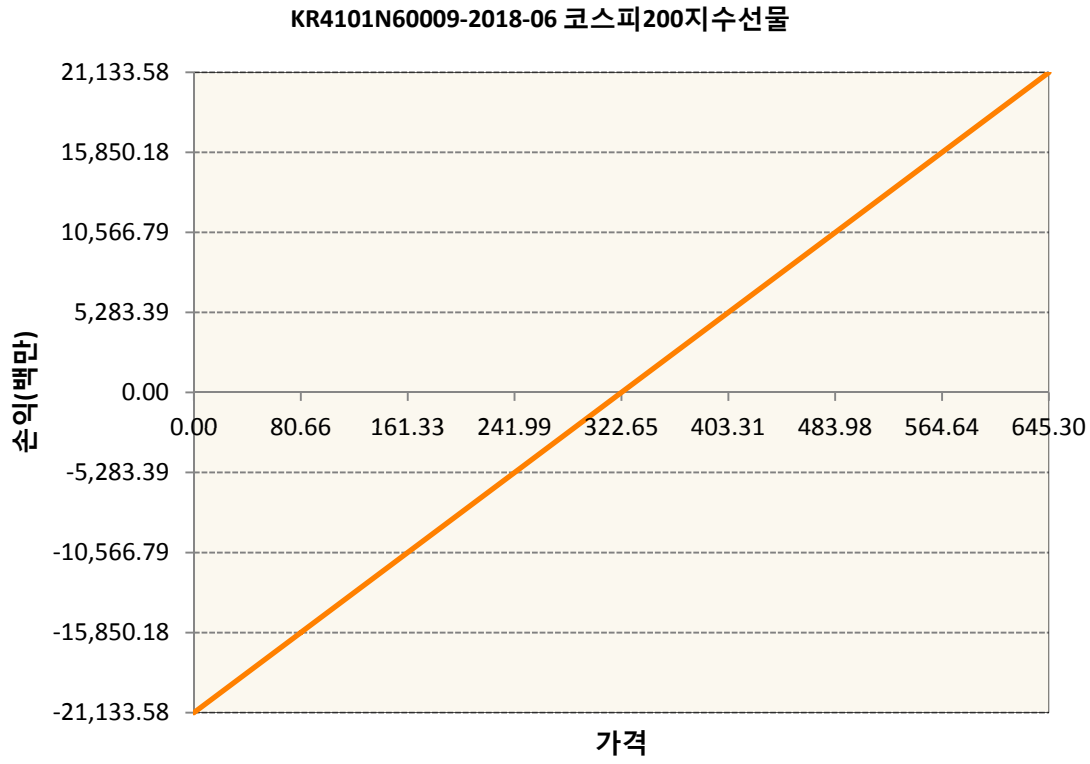
ETF스마트레버리지목표전환형8호

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	21,134	0	21,134	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101N60(2018-06 코스피200지수선물							1,692
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,692	-1,692	-1,692	-1,692	-1,692	-1,692	-1,692
-5.33%	-1,128	-1,128	-1,128	-1,128	-1,128	-1,128	-1,128
-2.67%	-564	-564	-564	-564	-564	-564	-564
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	564	564	564	564	564	564	564
5.33%	1,128	1,128	1,128	1,128	1,128	1,128	1,128
8.00%	1,692	1,692	1,692	1,692	1,692	1,692	1,692

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

1,170

공시일	2018-03-14
기준일	2018-03-13

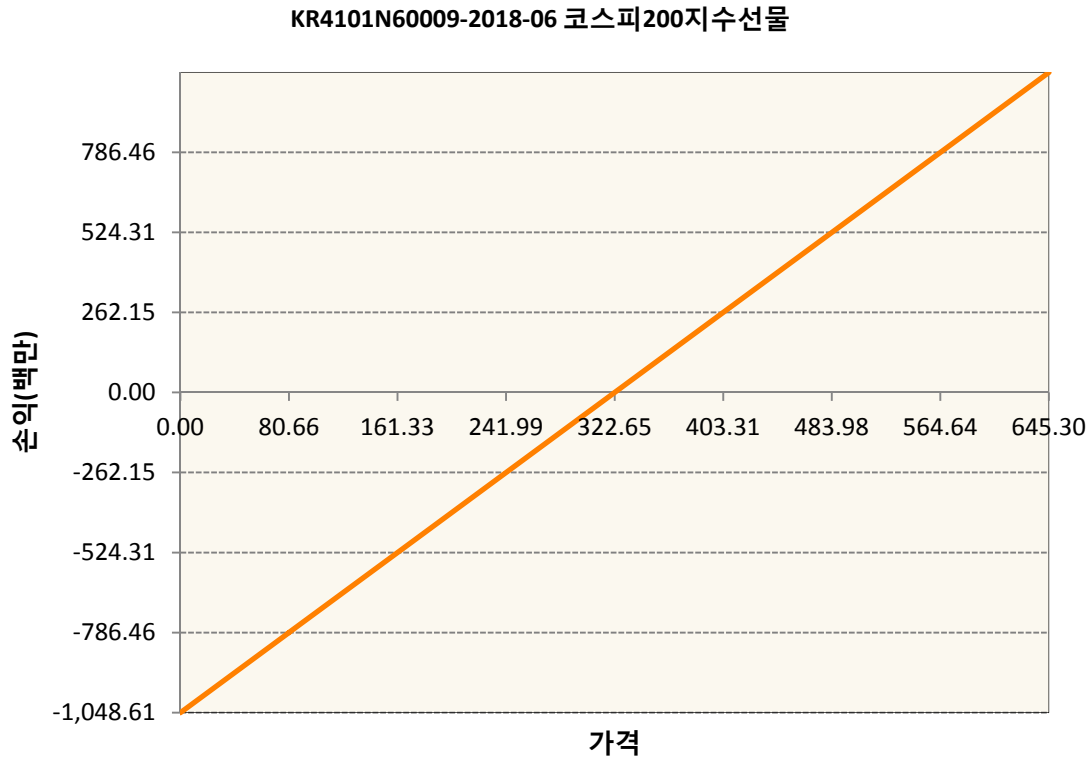
ETF스마트레버리지목표전환형9호

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	1,049	0	1,049	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101N60(2018-06 코스피200지수선물							84
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-84	-84	-84	-84	-84	-84	-84
-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%	84	84	84	84	84	84	84

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

58

공시일	2018-03-14
기준일	2018-03-13

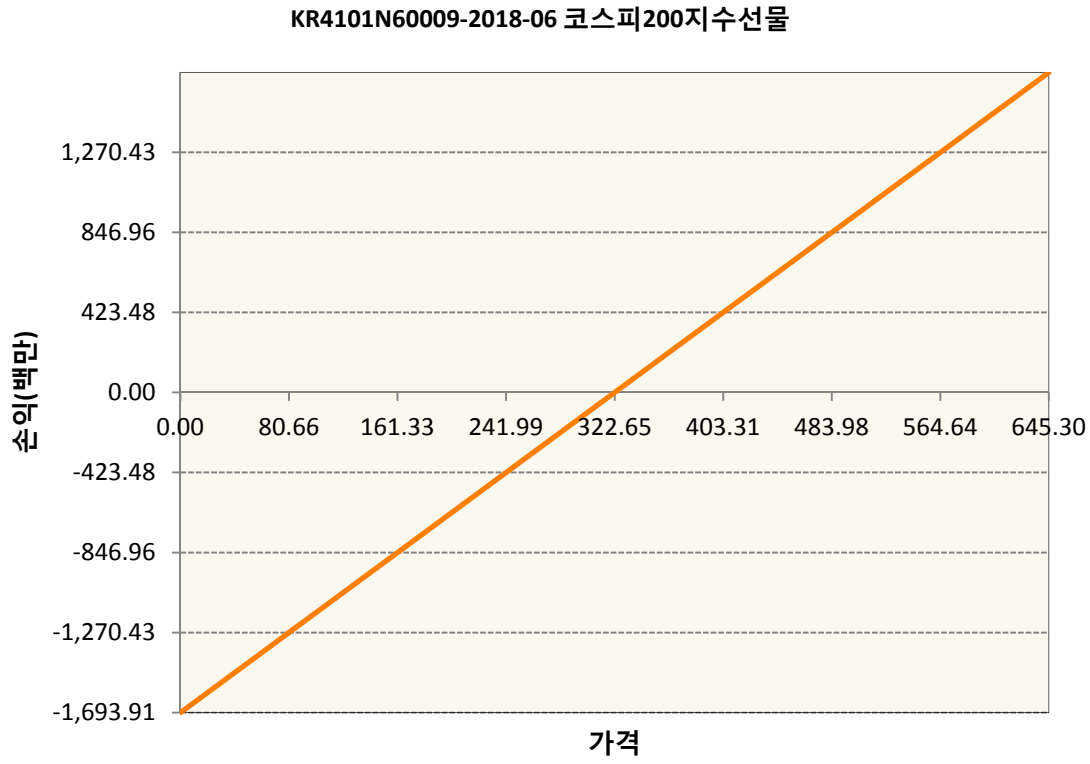
ETF스마트레버리지목표전환형10

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	1,694	0	1,694	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101N60(2018-06 코스피200지수선물							136
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-136	-136	-136	-136	-136	-136	-136
-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%	136	136	136	136	136	136	136

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

94

공시일	2018-03-14
기준일	2018-03-13

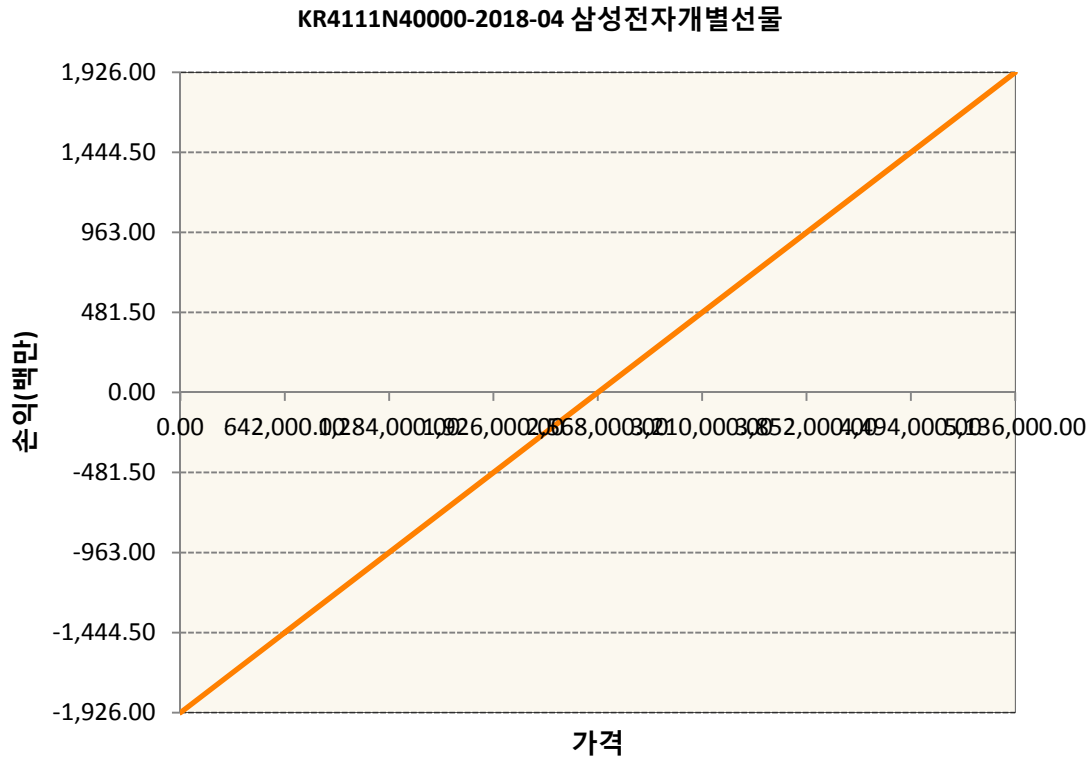
스마트KRX300인덱스1호(주식-파

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	1,926	0	1,926	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4111N40(2018-04 삼성전자개별선물							155
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-155	-155	-155	-155	-155	-155	-155
-5.33%	-103	-103	-103	-103	-103	-103	-103
-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%	103	103	103	103	103	103	103
8.00%	155	155	155	155	155	155	155

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

187

공시일	2018-03-14
기준일	2018-03-13

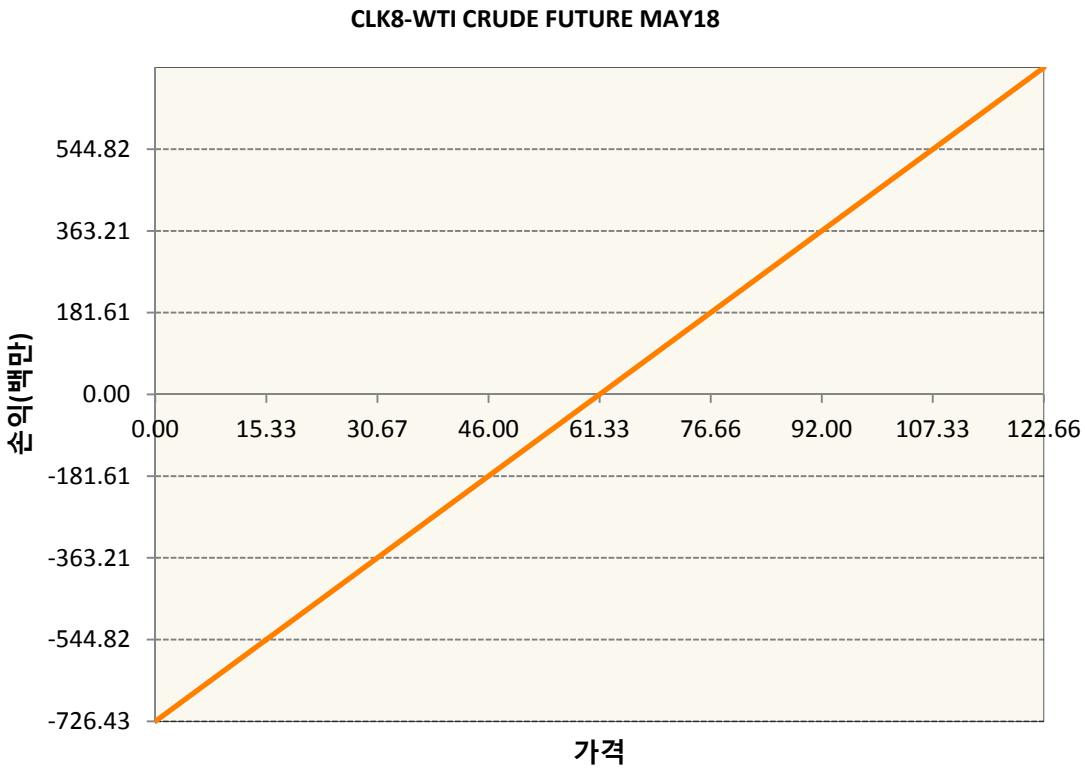
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

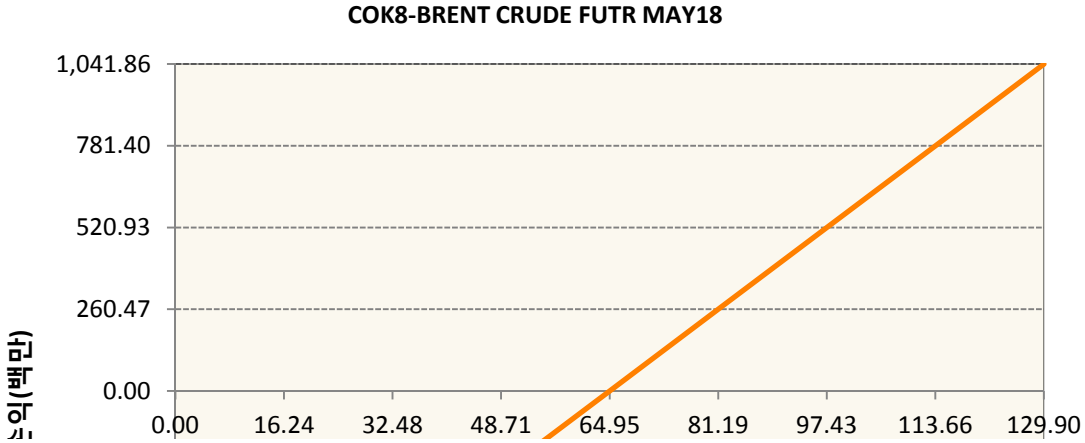
1. 계약금액

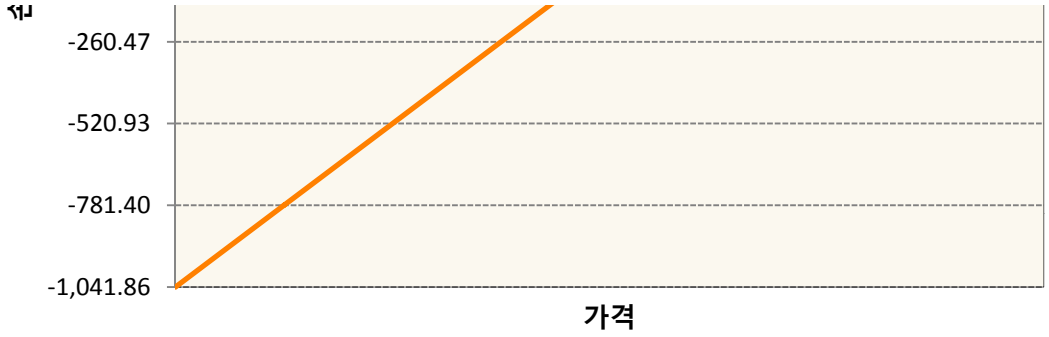
(단위:백만원)

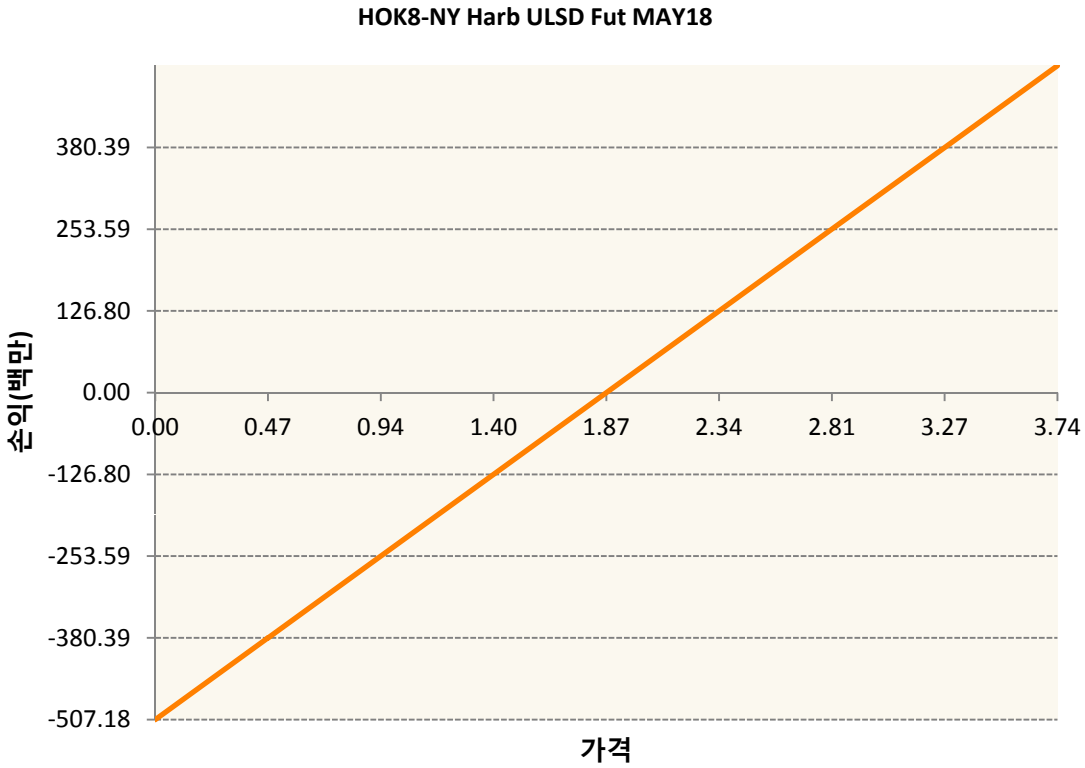
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	선물	유가증권	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	선물	유가증권	726	0	726	
누계	유가증권	선물	3,239	587	2,652	

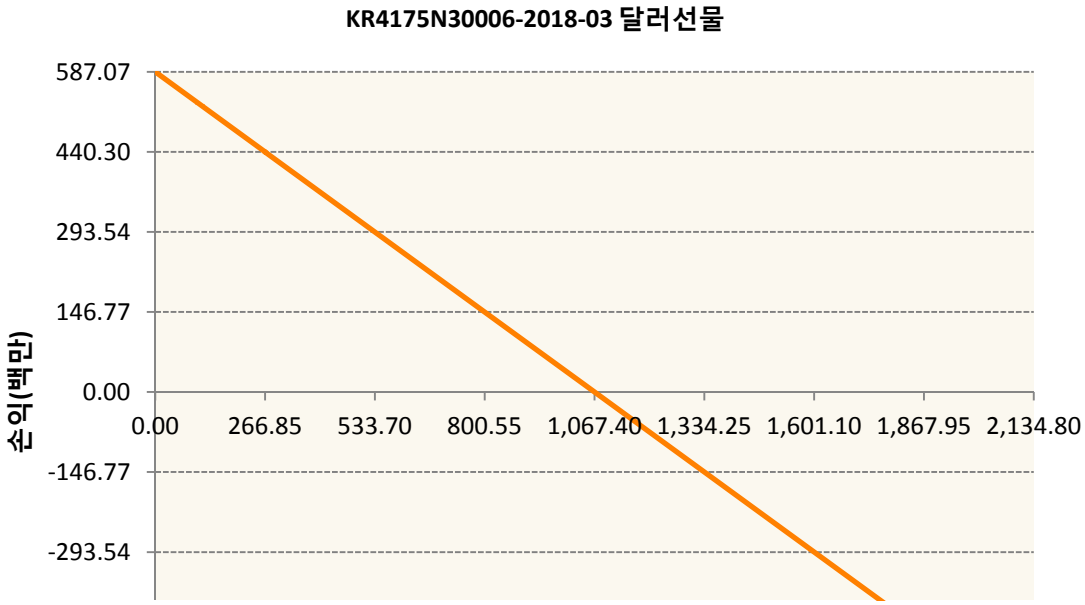
2. 만기시점의 손익구조

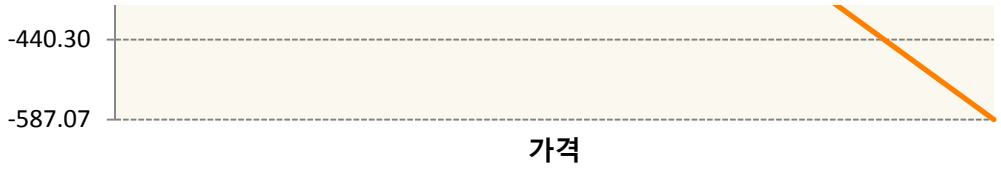




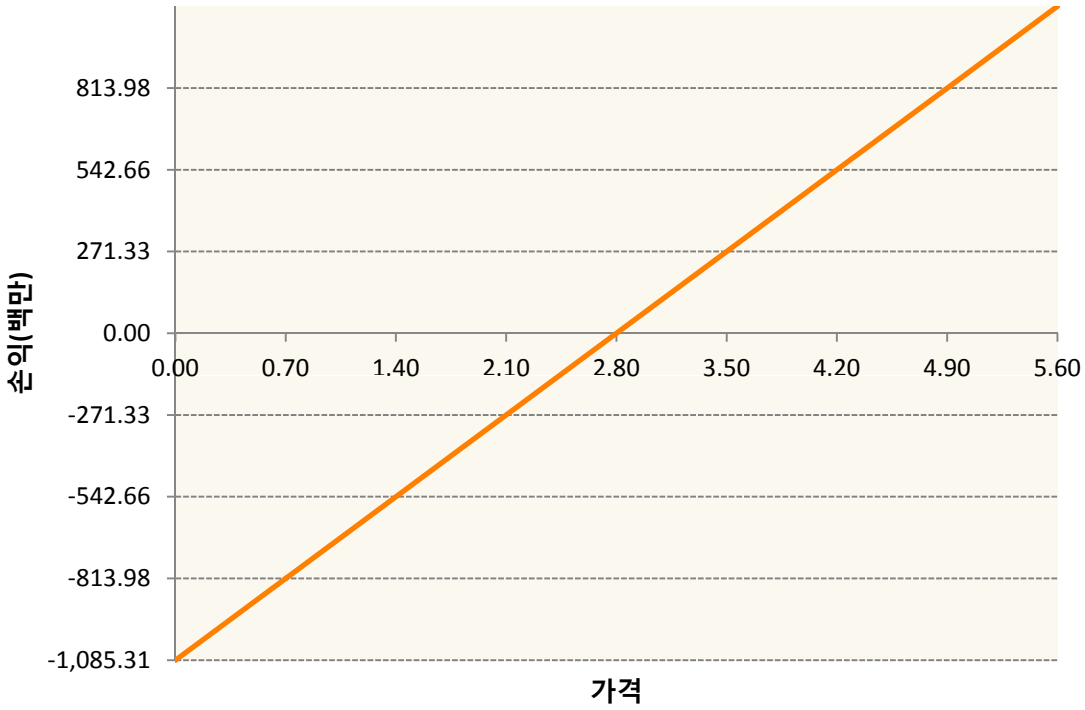

-260.47
-520.93
-781.40
-1,041.86
가격


HOK8-NY Harb ULSD Fut MAY18
380.39
253.59
126.80
0.00
-126.80
-253.59
-380.39
-507.18
0.00
0.47
0.94
1.40
1.87
2.34
2.81
3.27
3.74
손익(백만)
가격

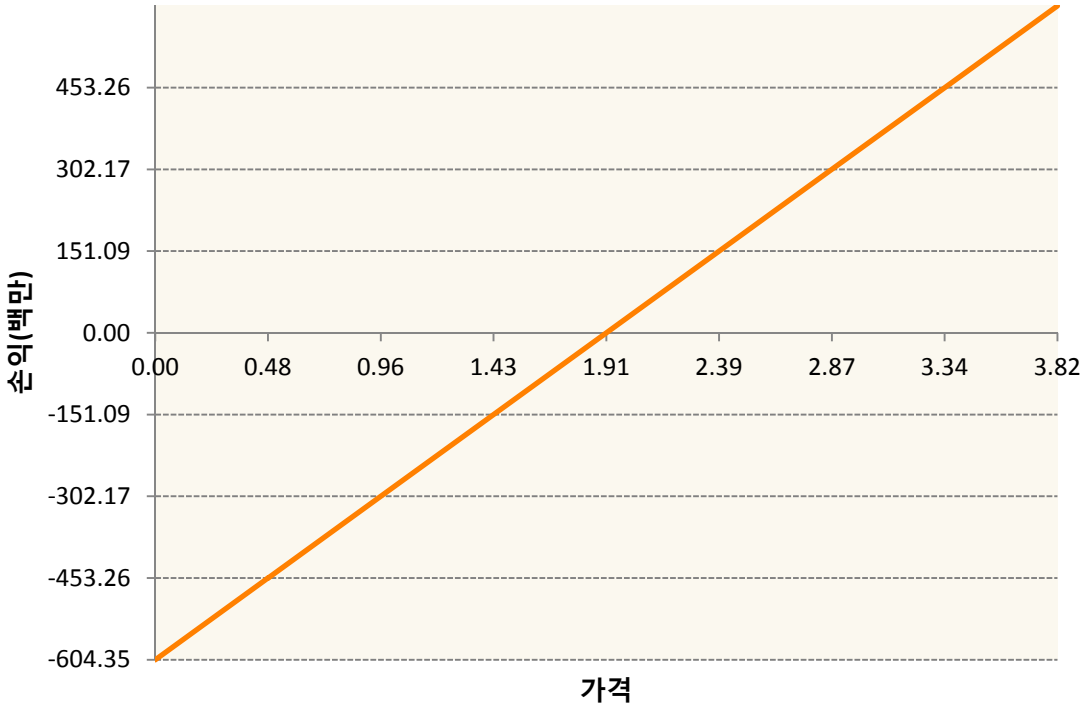

KR4175N30006-2018-03 달러선물
587.07
440.30
293.54
146.77
0.00
-146.77
-293.54
0.00
266.85
533.70
800.55
1,067.40
1,334.25
1,601.10
1,867.95
2,134.80
손익(백만)



NGK8-NATURAL GAS FUTR MAY18



XBK8-GASOLINE RBOB FUT MAY18



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	87
XBK8	GASOLINE RBOB FUT MAY18	48

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

522

공시일	2018-03-14
기준일	2018-03-13

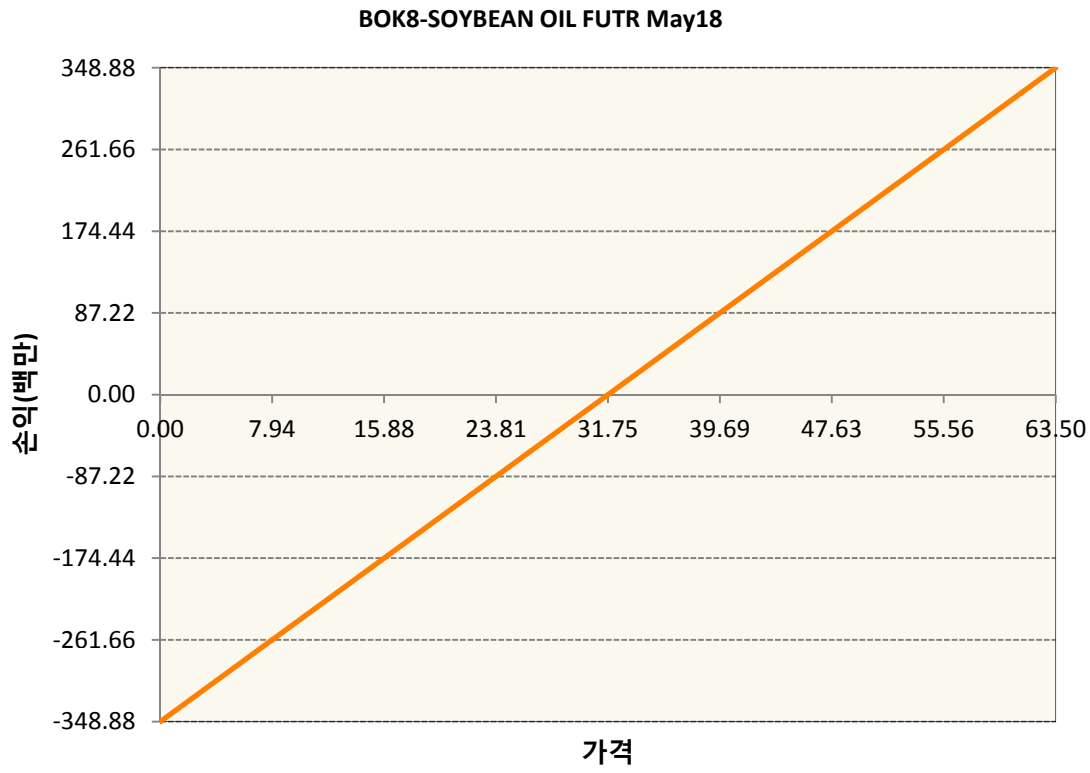
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

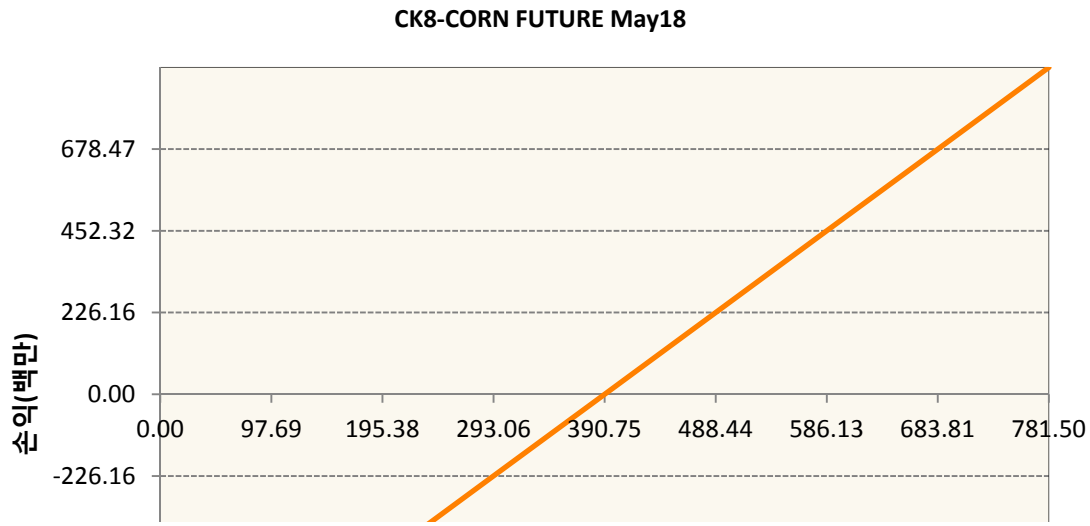
1. 계약금액

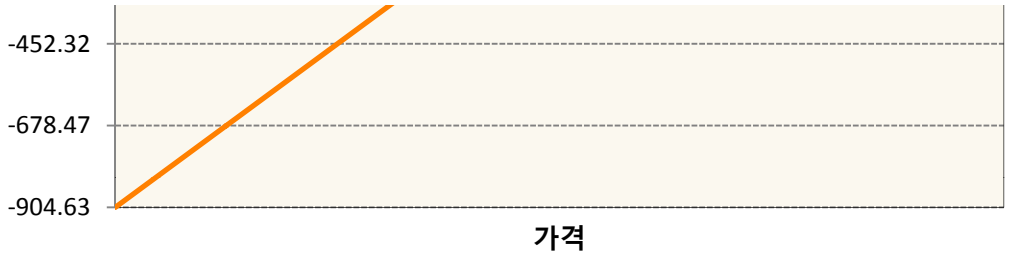
(단위:백만원)

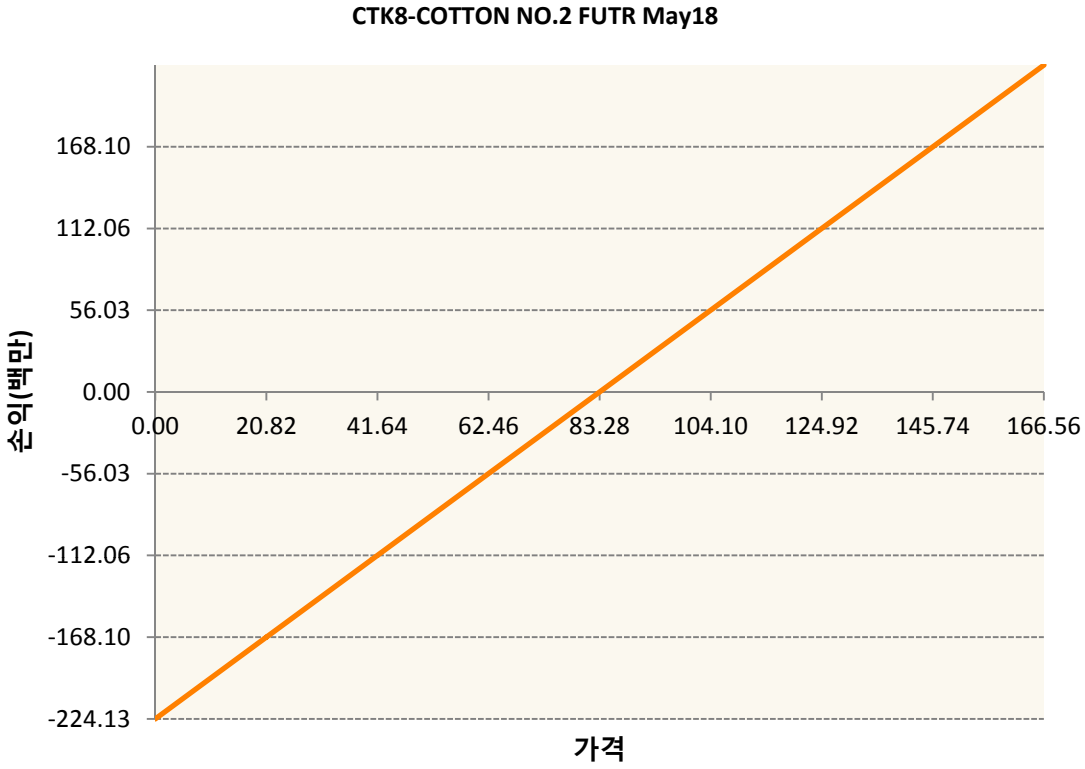
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	4,182	320	3,862	

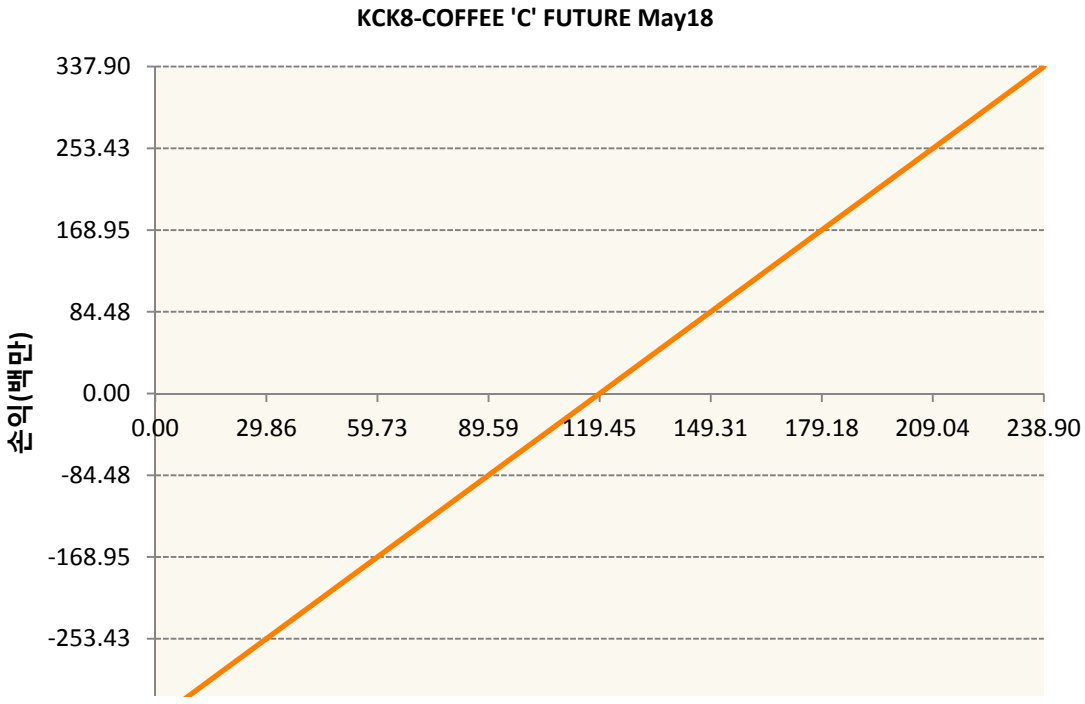
2. 만기시점의 손익구조

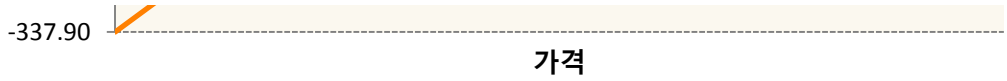


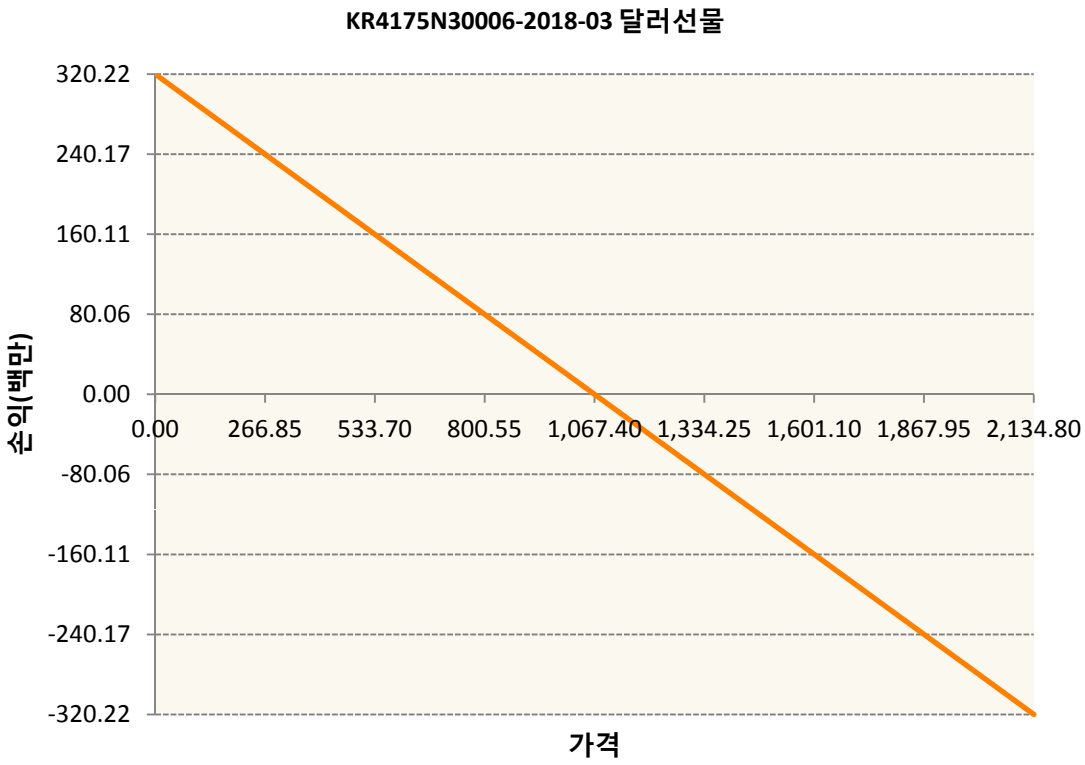


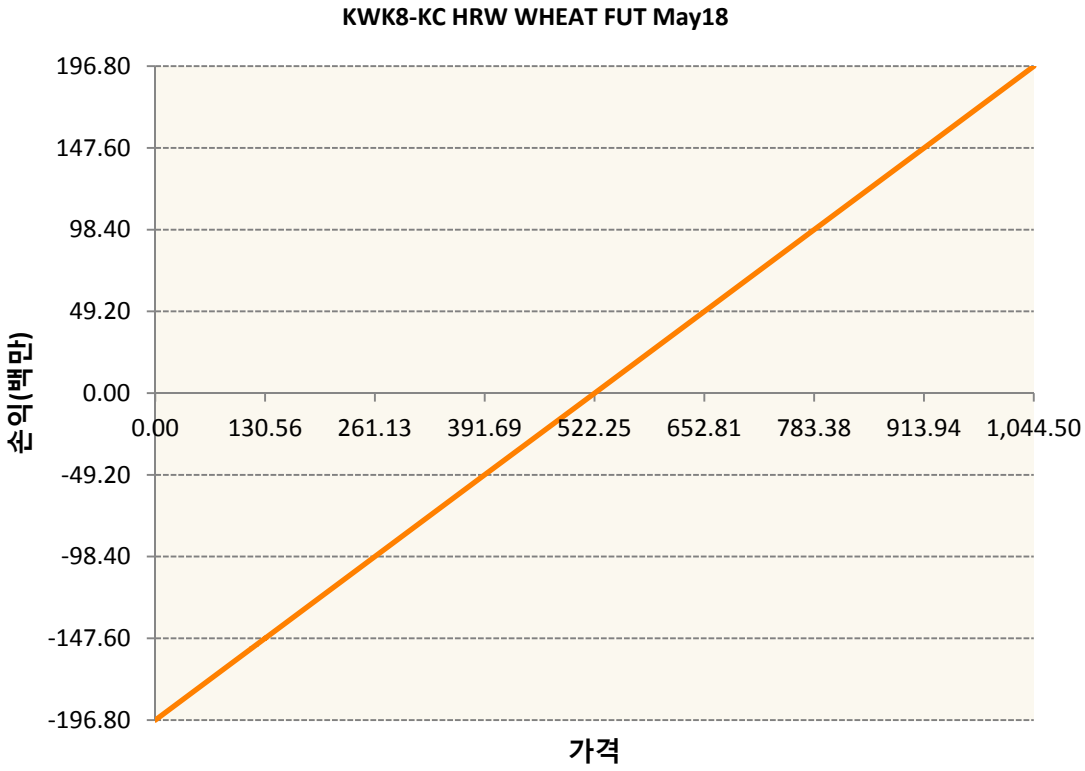

-452.32
-678.47
-904.63
가격

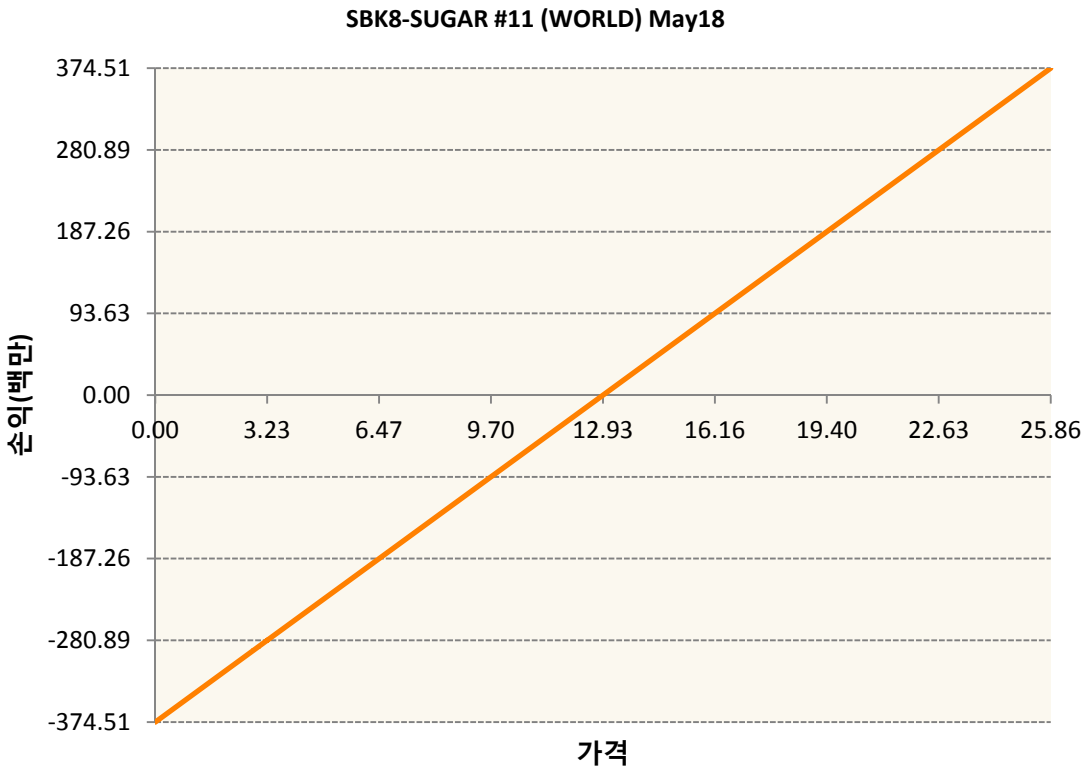

CTK8-COTTON NO.2 FUTR May18
168.10
112.06
56.03
0.00
-56.03
-112.06
-168.10
-224.13
0.00
20.82
41.64
62.46
83.28
104.10
124.92
145.74
166.56
손익(백만)
가격

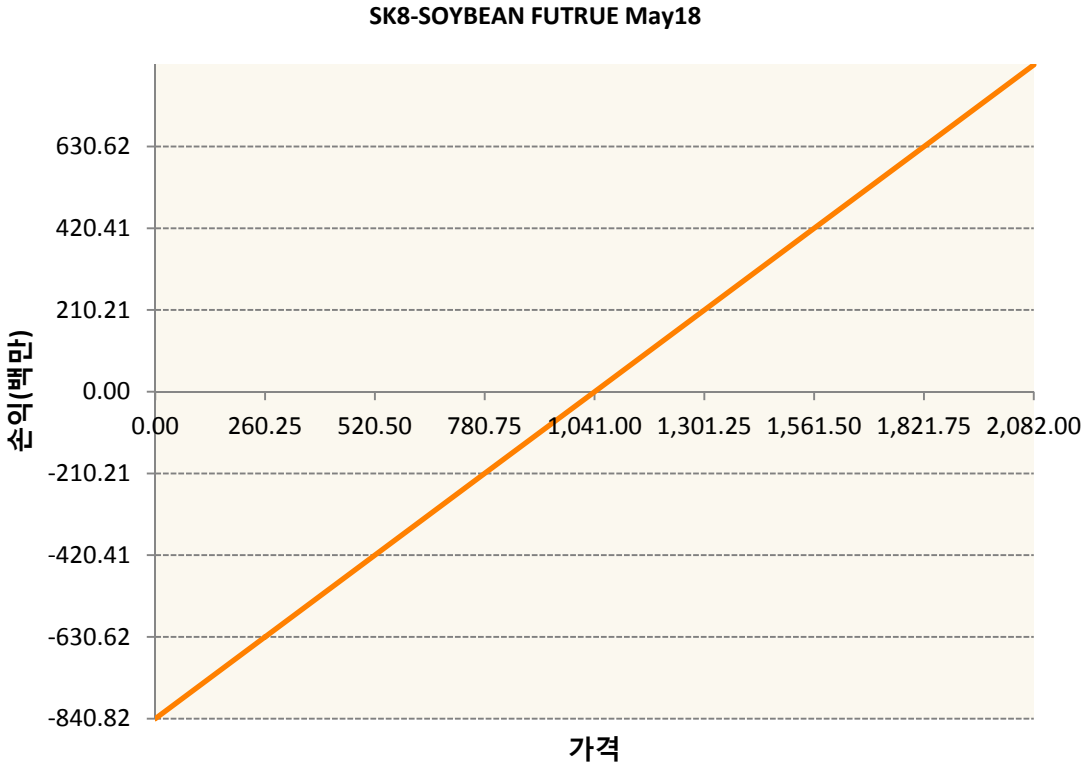

KCK8-COFFEE 'C' FUTURE May18
337.90
253.43
168.95
84.48
0.00
-84.48
-168.95
-253.43
0.00
29.86
59.73
89.59
119.45
149.31
179.18
209.04
238.90
손익(백만)


-337.90
가격

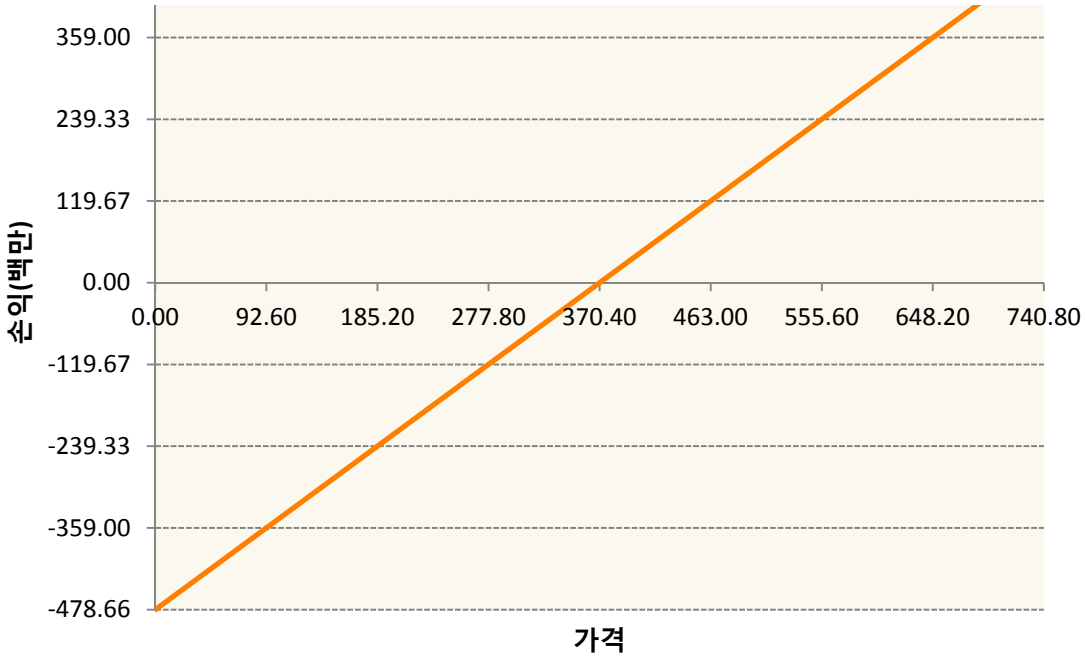

KR4175N30006-2018-03 달러선물
320.22
240.17
160.11
80.06
0.00
-80.06
-160.11
-240.17
-320.22
0.00
266.85
533.70
800.55
1,067.40
1,334.25
1,601.10
1,867.95
2,134.80
손익(백만)
가격

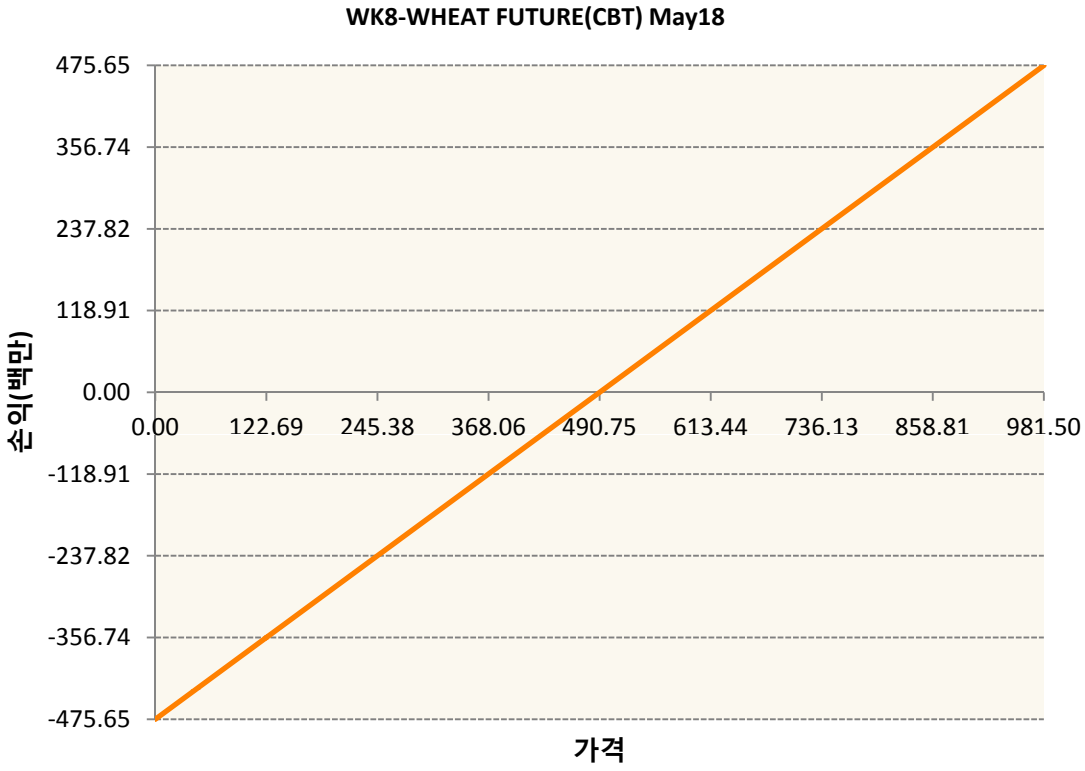

KWK8-KC HRW WHEAT FUT May18
196.80
147.60
98.40
49.20
0.00
-49.20
-98.40
-147.60
-196.80
0.00
130.56
261.13
391.69
522.25
652.81
783.38
913.94
1,044.50
손익(백만)
가격


SBK8-SUGAR #11 (WORLD) May18
374.51
280.89
187.26
93.63
0.00
-93.63
-187.26
-280.89
-374.51
0.00
3.23
6.47
9.70
12.93
16.16
19.40
22.63
25.86
손익(백만)
가격


SK8-SOYBEAN FUTRUE May18
630.62
420.41
210.21
0.00
-210.21
-420.41
-630.62
-840.82
0.00
260.25
520.50
780.75
1,041.00
1,301.25
1,561.50
1,821.75
2,082.00
손익(백만)
가격


SMK8-SOYBEAN MEAL FUTR 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	38
WK8	WHEAT FUTURE(CBT) May18	38

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

337