공시일	2018-03-19
기준일	2018-03-16

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	2018-03-19
기준일	2018-03-16

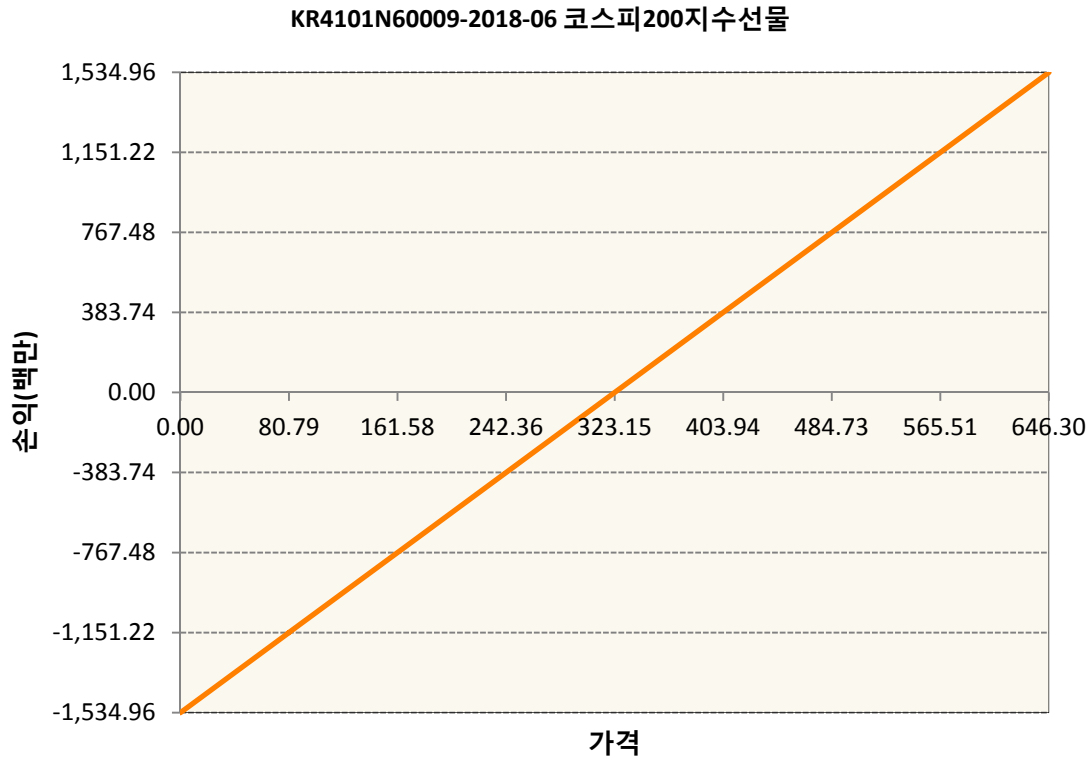
스마트인덱스모

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	1,535	0	1,535	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	2018-03-19
기준일	2018-03-16

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	1,119

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

421

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2018-03-19
기준일	2018-03-16

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	411

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

413

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2018-03-19
기준일	2018-03-16

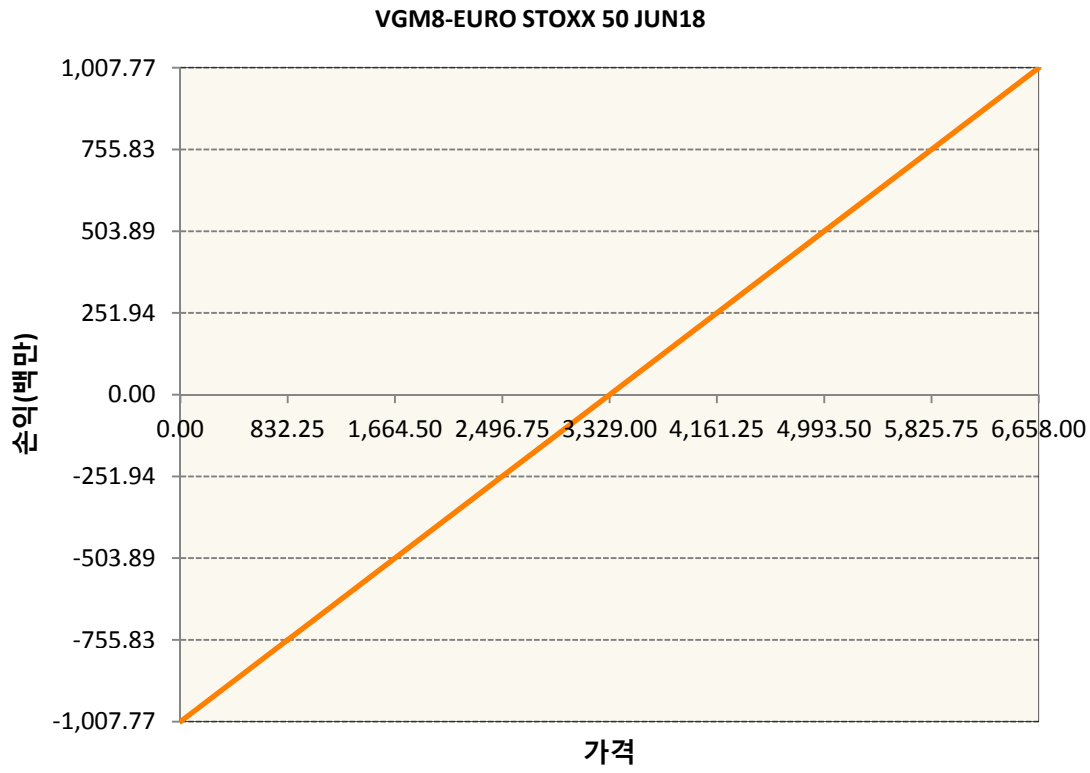
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,008	0	1,008	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGM8	EURO STOXX 50 JUN18	81

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

(단위:백만원)

46

공시일	2018-03-19
기준일	2018-03-16

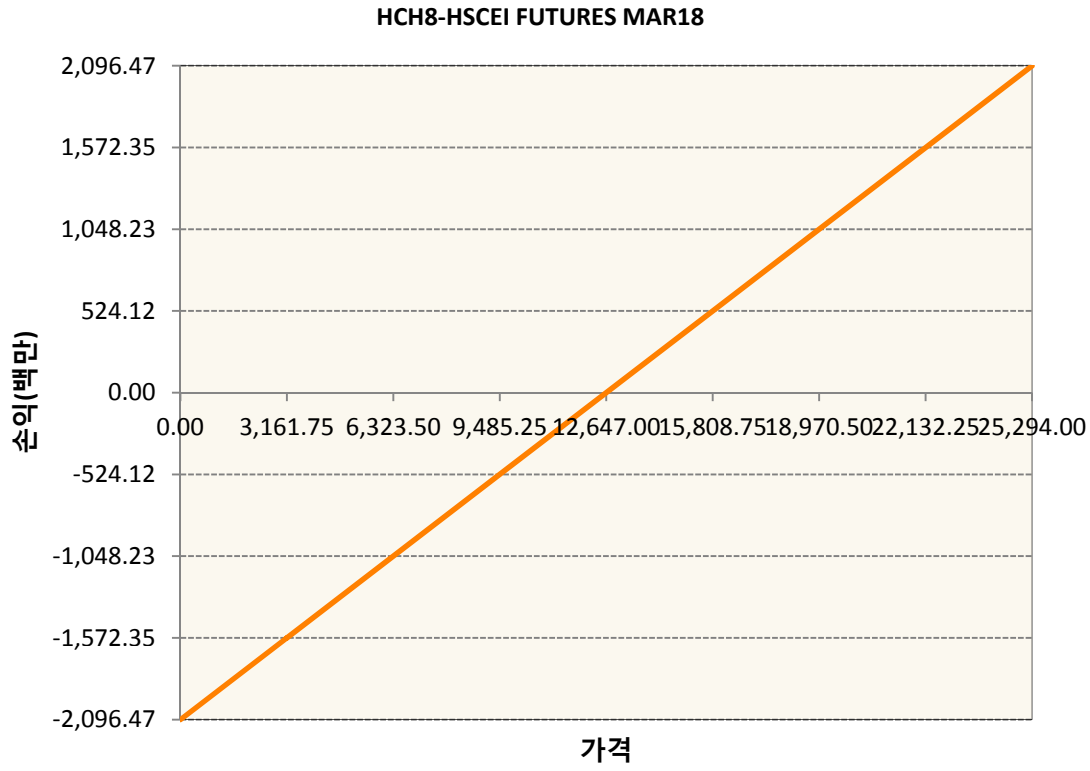
차이나인덱스모(주식-파생형)

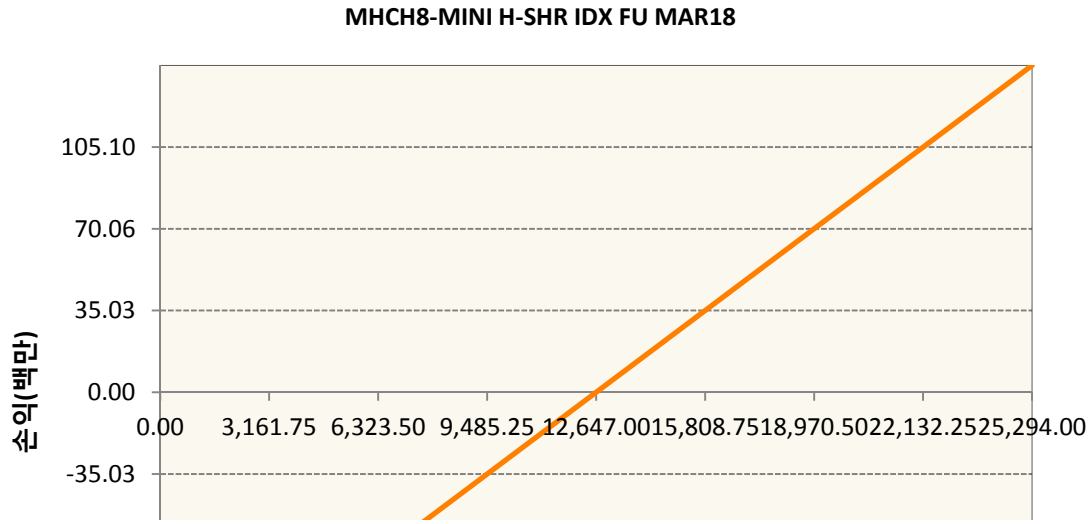
1. 계약금액

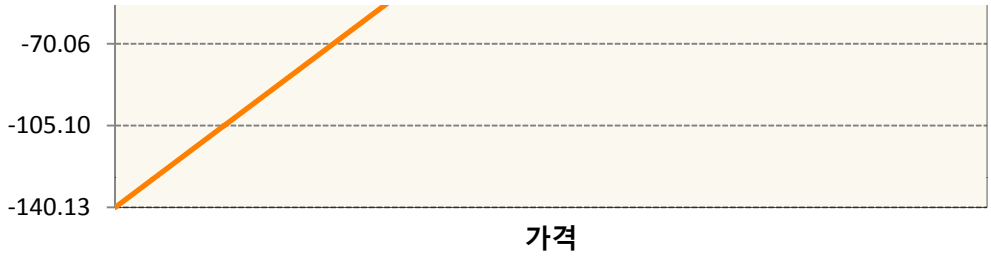
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,237	0	2,237	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCH8	HSCEI FUTURES MAR18	168
MHCH8	MINI H-SHR IDX FU MAR18	11

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	156

공시일	2018-03-19
기준일	2018-03-16

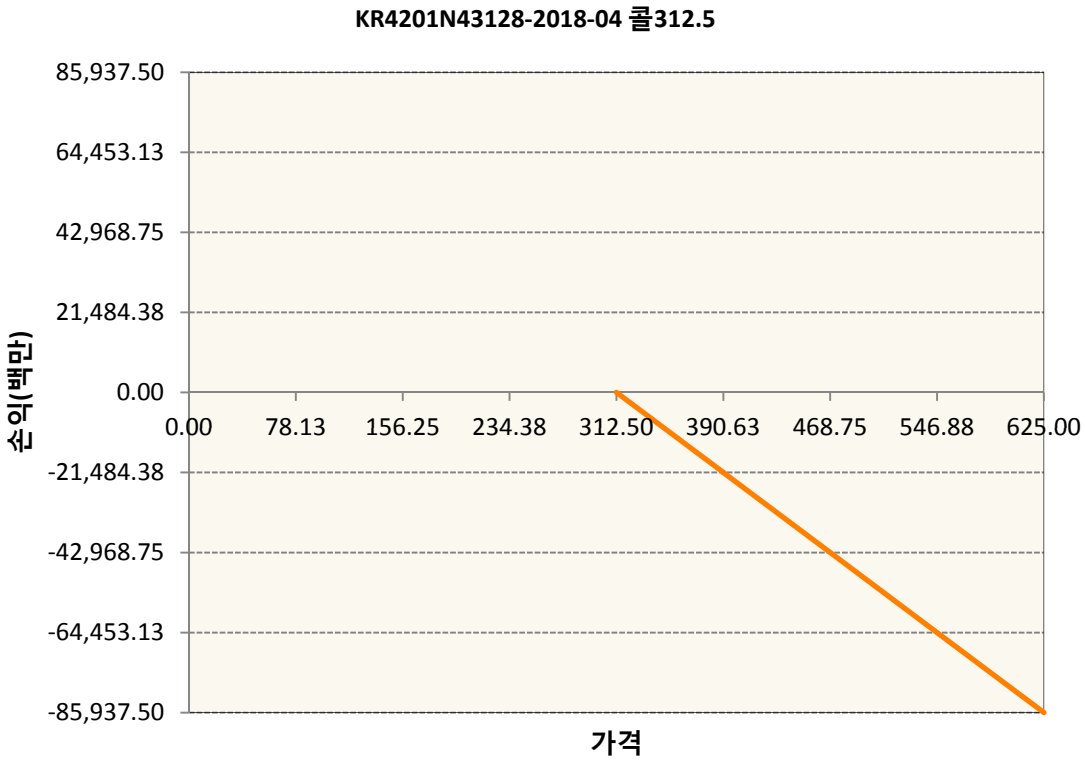
커버드콜모(주식혼합-파생형)

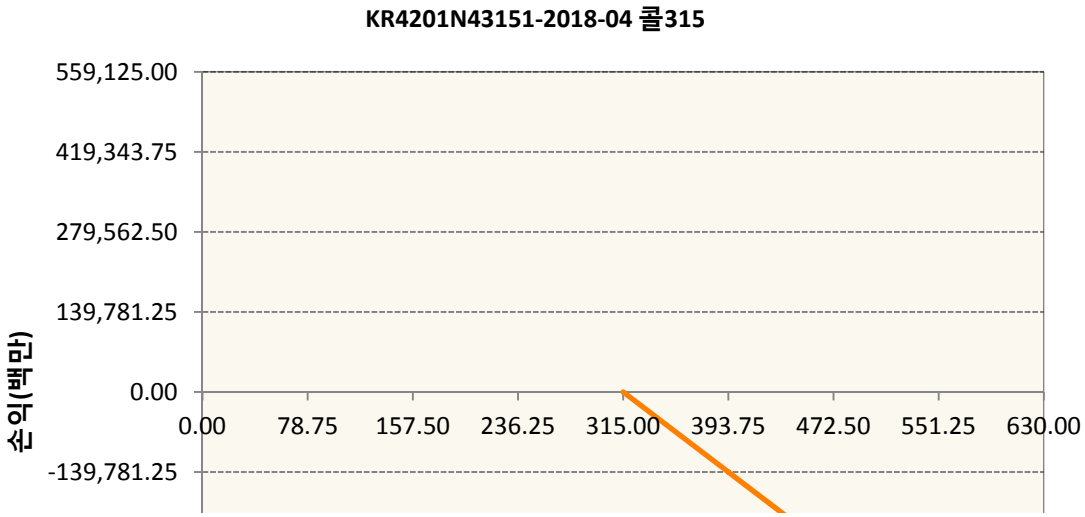
1. 계약금액

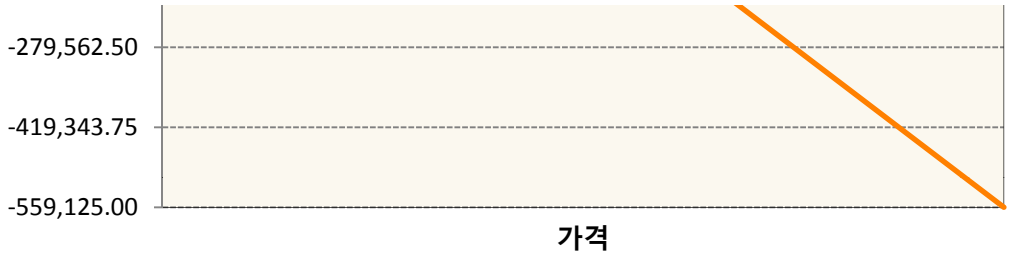
(단위:백만원)

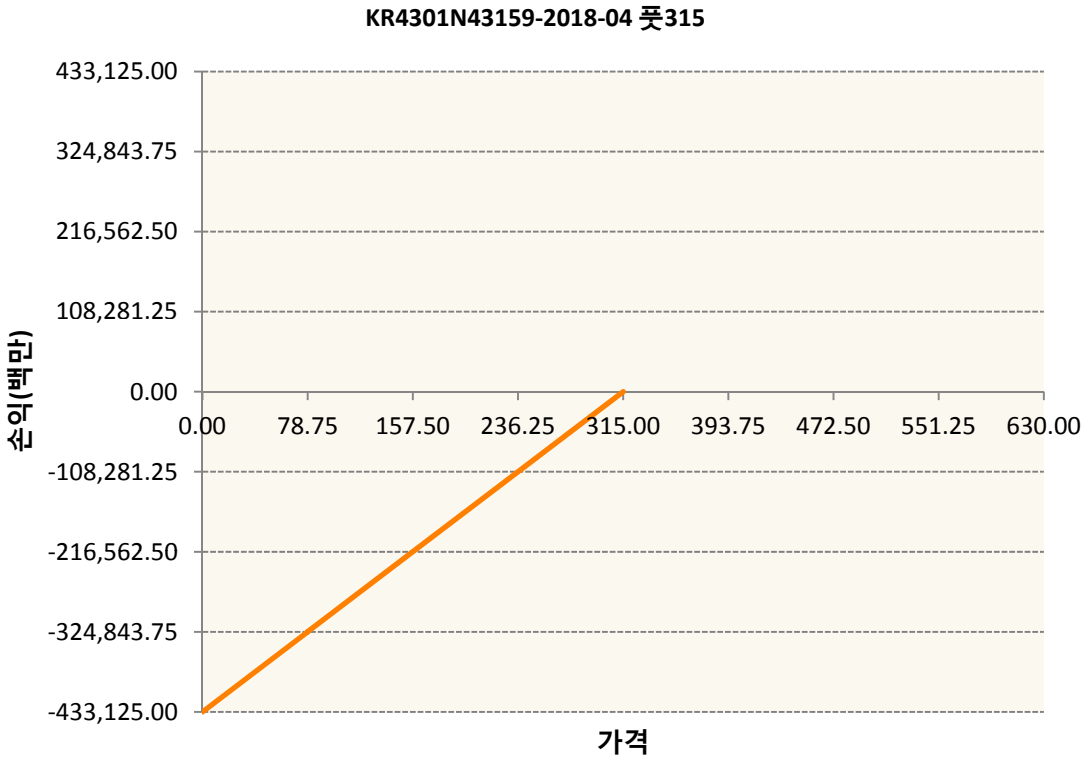
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	15,454	0	15,454	장내
누계	유가증권	옵션	0	1,078,188	-1,078,188	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201N4312018-04 콜312.5							6,189
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	3,796	3,655	3,505	3,346	3,181	3,011	2,837
-5.33%	3,163	2,969	2,773	2,576	2,376	2,176	1,974
-2.67%	2,089	1,880	1,670	1,460	1,250	1,040	830
0%	561	379	192	0	-195	-392	-591
2.67%	-1,339	-1,468	-1,610	-1,762	-1,923	-2,090	-2,263
5.33%	-3,483	-3,559	-3,651	-3,757	-3,876	-4,006	-4,145
8.00%	-5,758	-5,796	-5,848	-5,914	-5,993	-6,086	-6,189
KR4201N4312018-04 콜315							38,945
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	22,359	21,557	20,679	19,738	18,746	17,712	16,643

-5.33%	18,958	17,778	16,569	15,339	14,092	12,831	11,559
-2.67%	12,882	11,518	10,153	8,789	7,425	6,061	4,697
0%	3,847	2,584	1,300	0	-1,312	-2,634	-3,964
2.67%	-7,776	-8,729	-9,750	-10,827	-11,949	-13,106	-14,293
5.33%	-21,216	-21,811	-22,508	-23,292	-24,151	-25,074	-26,051
8.00%	-35,697	-36,009	-36,422	-36,929	-37,524	-38,199	-38,945
KR4301N4312018-04 풋315							22,875

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-21,492	-21,627	-21,804	-22,020	-22,273	-22,559	-22,875
-5.33%	-10,782	-11,193	-11,634	-12,099	-12,583	-13,083	-13,596
-2.67%	-2,748	-3,362	-3,976	-4,590	-5,204	-5,819	-6,433
0%	1,494	1,018	518	0	-533	-1,078	-1,633
2.67%	2,924	2,722	2,474	2,184	1,858	1,499	1,113
5.33%	3,219	3,170	3,091	2,981	2,836	2,657	2,444
8.00%	3,256	3,249	3,232	3,202	3,154	3,085	2,992

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

65,827

공시일	2018-03-19
기준일	2018-03-16

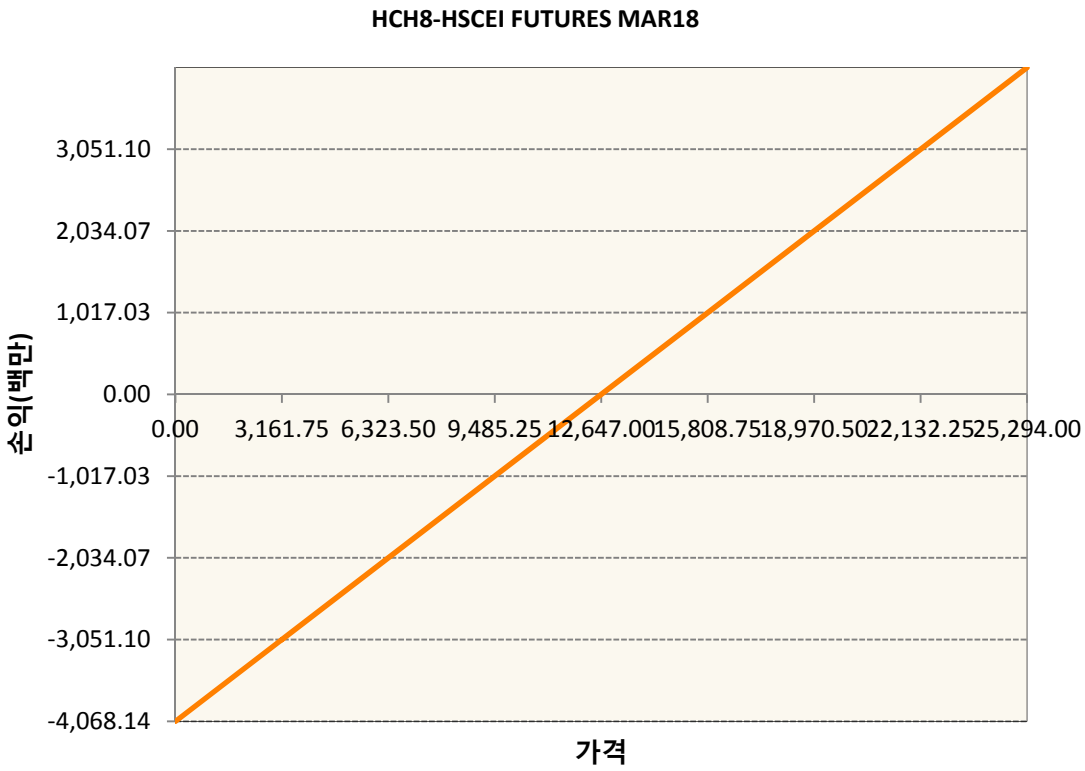
홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생

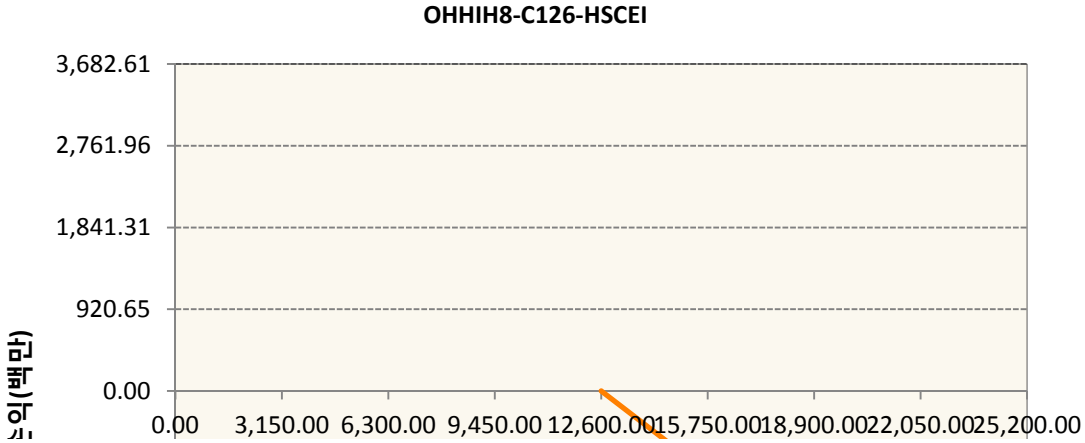
1. 계약금액

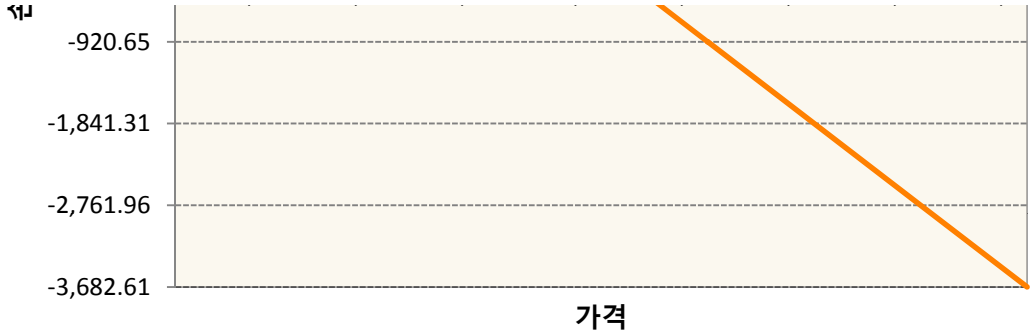
(단위:백만원)

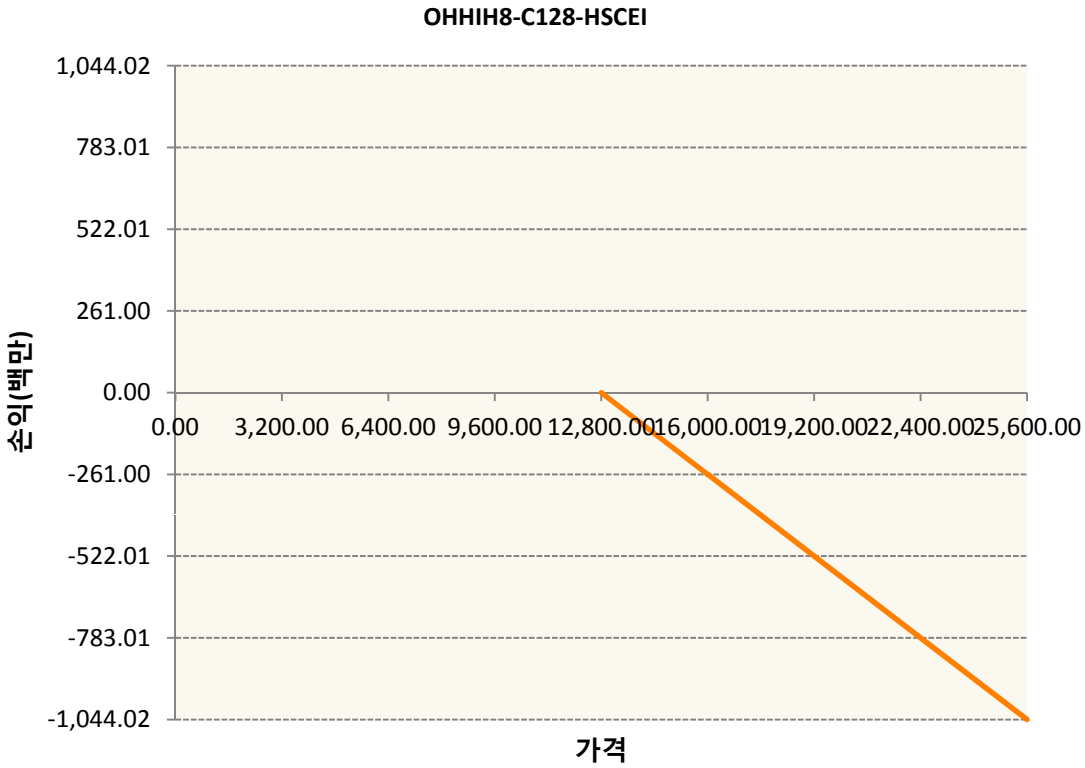
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	4,068	0	4,068	장내
누계	유가증권	옵션	0	9,453	-9,453	장내

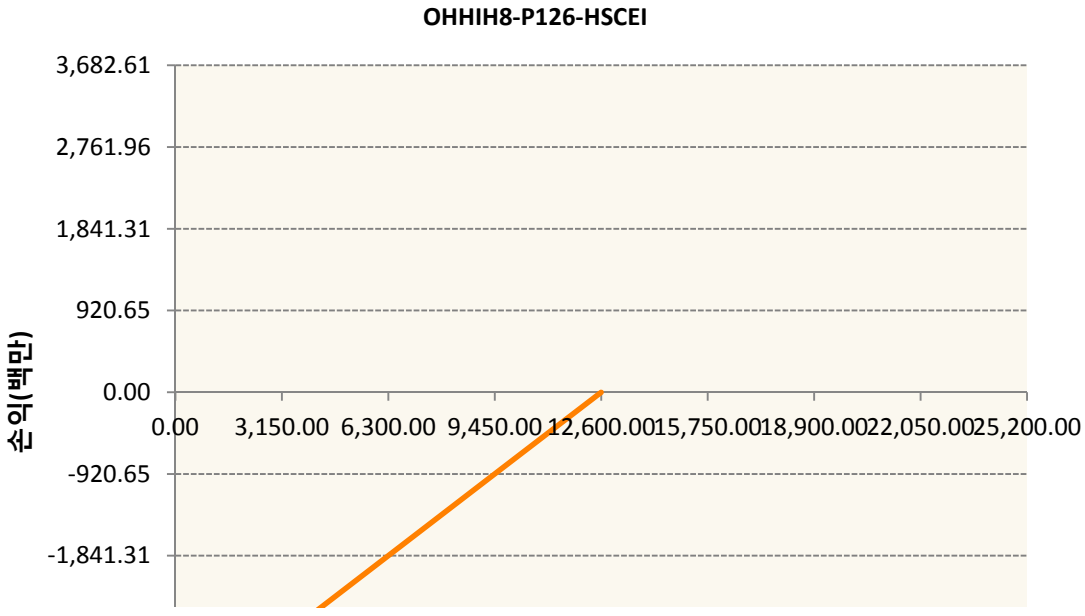
2. 만기시점의 손익구조

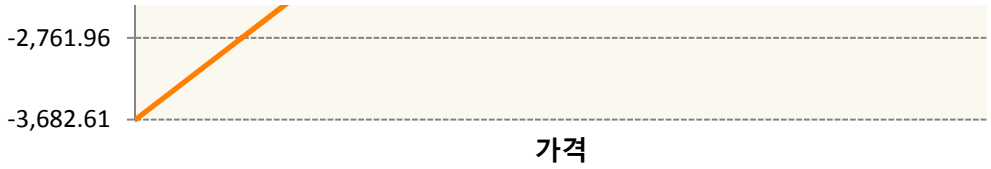


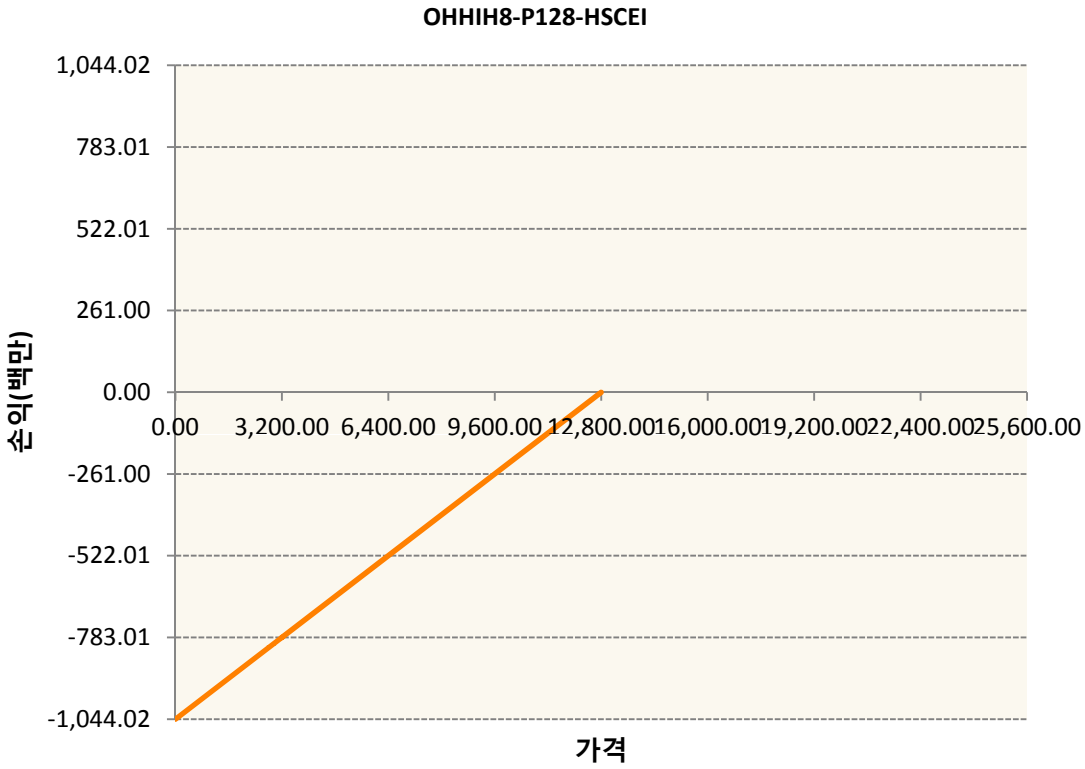



-920.65
-1,841.31
-2,761.96
-3,682.61
가격


OHHIH8-C128-HSCEI
1,044.02
783.01
522.01
261.00
0.00
-261.00
-522.01
-783.01
-1,044.02
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
3,682.61
2,761.96
1,841.31
920.65
0.00
-920.65
-1,841.31
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	325
OHHIH8-C12	HSCEI	295
OHHIH8-C12	HSCEI	84
OHHIH8-P12	HSCEI	295
OHHIH8-P12	HSCEI	84

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	943

공시일	2018-03-19
기준일	2018-03-16

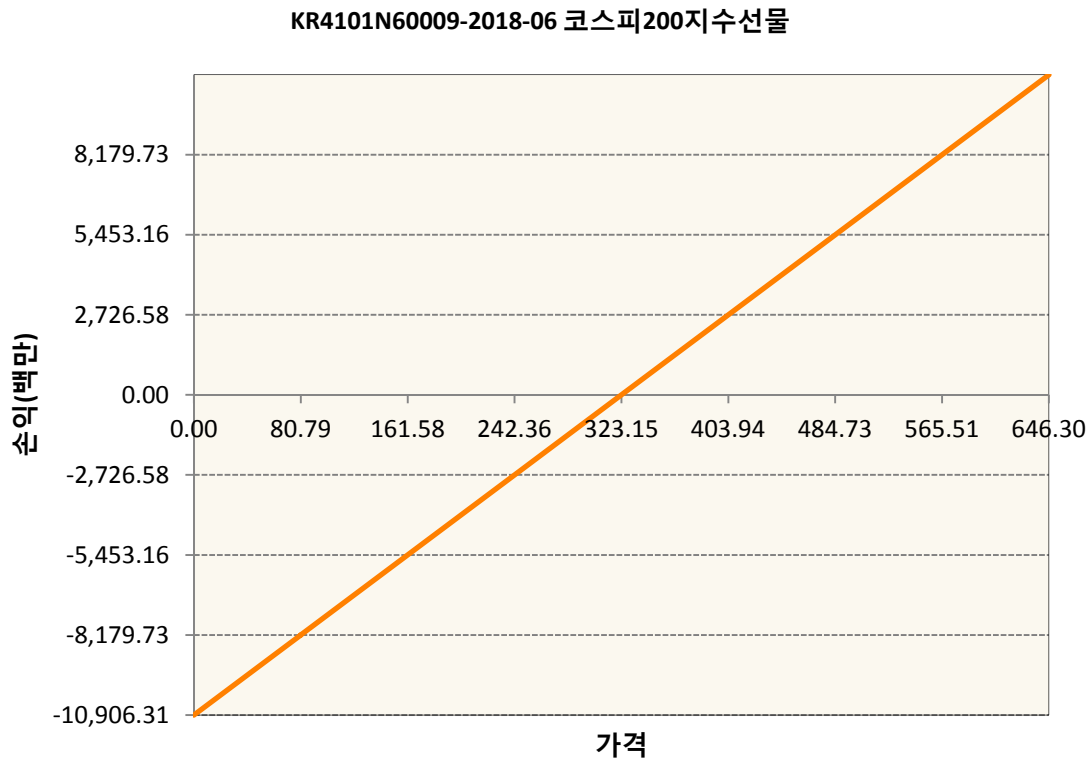
코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼

1. 계약금액

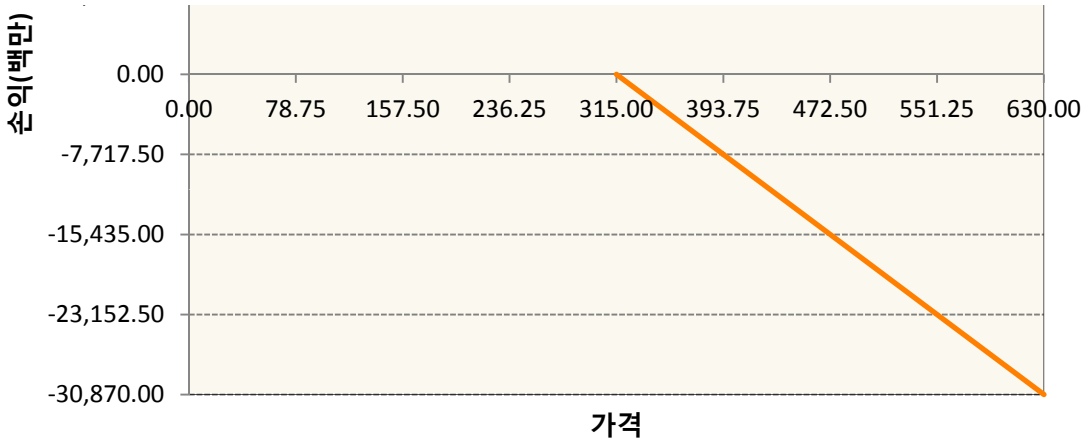
(단위:백만원)

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	10,906	0	10,906	장내
누계	유가증권	스왑	54,200	0	54,200	장외
누계	유가증권	옵션	0	56,033	-56,033	장내

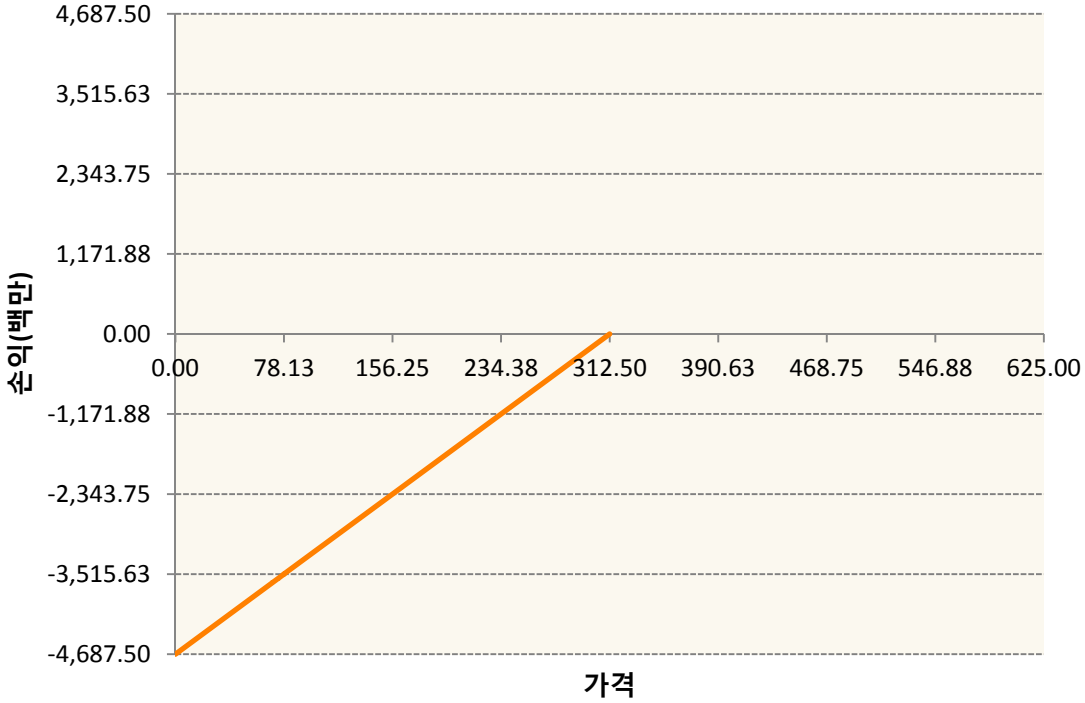
2. 만기시점의 손익구조



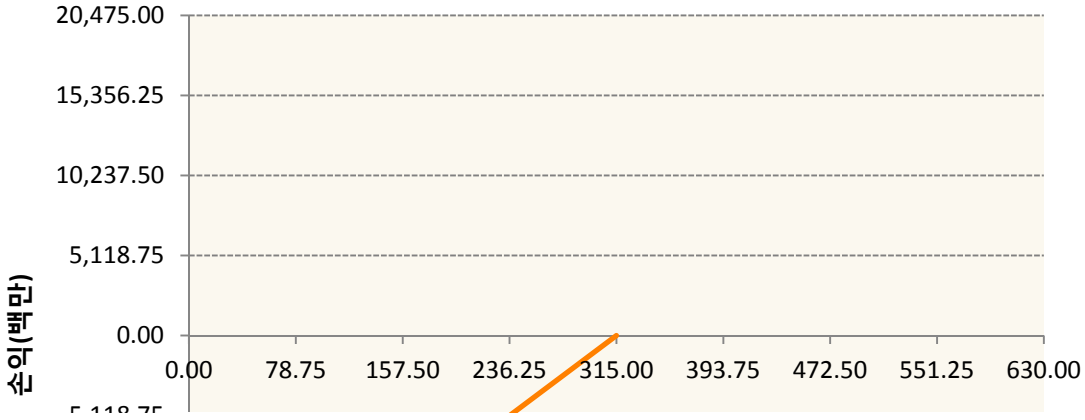




KR4301N43126-2018-04 풋312.5



KR4301N43159-2018-04 풋315





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_2							1,447
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,447	-1,447	-1,447	-1,447	-1,447	-1,447	-1,447
-5.33%	-964	-964	-964	-964	-964	-964	-964
-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%	964	964	964	964	964	964	964
8.00%	1,447	1,447	1,447	1,447	1,447	1,447	1,447
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%	-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%	274	274	274	274	274	274	274
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%	-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%	235	235	235	235	235	235	235
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						463
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-463	-463	-463	-463	-463	-463	-463
-5.33%	-309	-309	-309	-309	-309	-309	-309
-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%	309	309	309	309	309	309	309
8.00%	463	463	463	463	463	463	463
	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%	-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%	274	274	274	274	274	274	274
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_11						626
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-626	-626	-626	-626	-626	-626	-626
-5.33%	-417	-417	-417	-417	-417	-417	-417
-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%	417	417	417	417	417	417	417
8.00%	626	626	626	626	626	626	626
	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%	-313	-313	-313	-313	-313	-313	-313
-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%	313	313	313	313	313	313	313
8.00%	469	469	469	469	469	469	469
	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						2,150
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,234	1,190	1,142	1,090	1,035	978	919
-5.33%	1,047	982	915	847	778	708	638
-2.67%	711	636	561	485	410	335	259
0%	212	143	72	0	-72	-145	-219
2.67%	-429	-482	-538	-598	-660	-724	-789
5.33%	-1,171	-1,204	-1,243	-1,286	-1,333	-1,384	-1,438
8.00%	-1,971	-1,988	-2,011	-2,039	-2,072	-2,109	-2,150
	KR4301N431 2018-04 풋312.5						227
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-208	-210	-213	-216	-219	-223	-227
-5.33%	-98	-103	-108	-114	-120	-126	-132
-2.67%	-22	-28	-35	-41	-48	-55	-61
0%	14	10	5	0	-5	-11	-16
2.67%	24	22	20	18	15	12	8
5.33%	26	25	25	24	23	21	20
8.00%	26	26	26	26	25	25	24
	KR4301N431 2018-04 풋315						1,081

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,016	-1,022	-1,031	-1,041	-1,053	-1,066	-1,081
-5.33%	-510	-529	-550	-572	-595	-618	-643
-2.67%	-130	-159	-188	-217	-246	-275	-304
0%	71	48	25	0	-25	-51	-77
2.67%	138	129	117	103	88	71	53
5.33%	152	150	146	141	134	126	116
8.00%	154	154	153	151	149	146	141

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

8,156

공시일	2018-03-19
기준일	2018-03-16

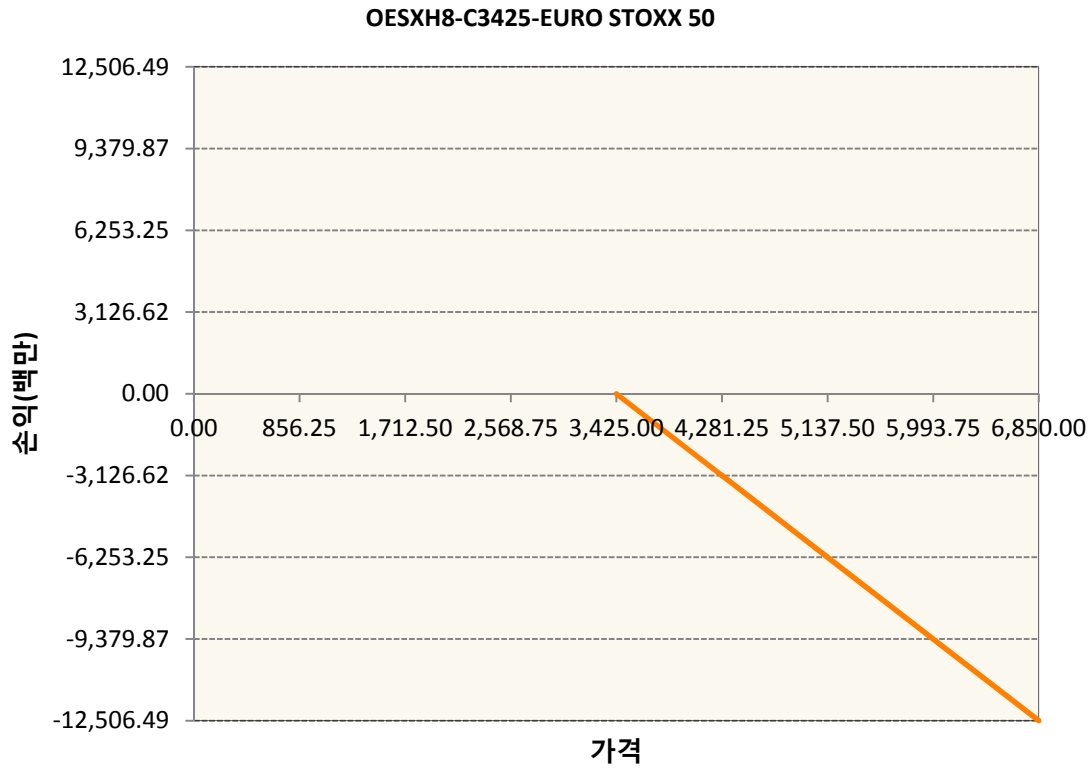
유로커버드콜모(주식혼합-파생형

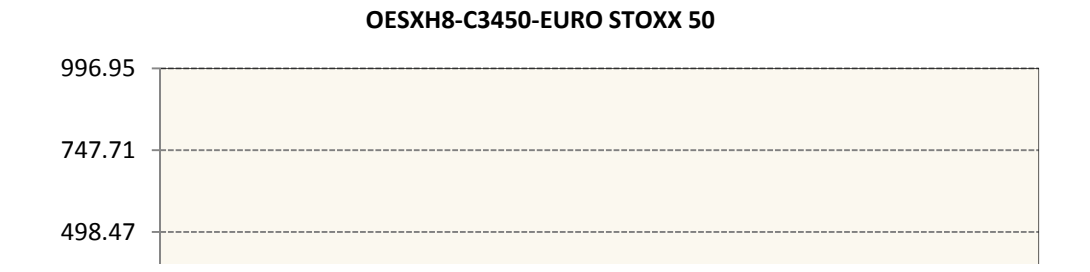
1. 계약금액

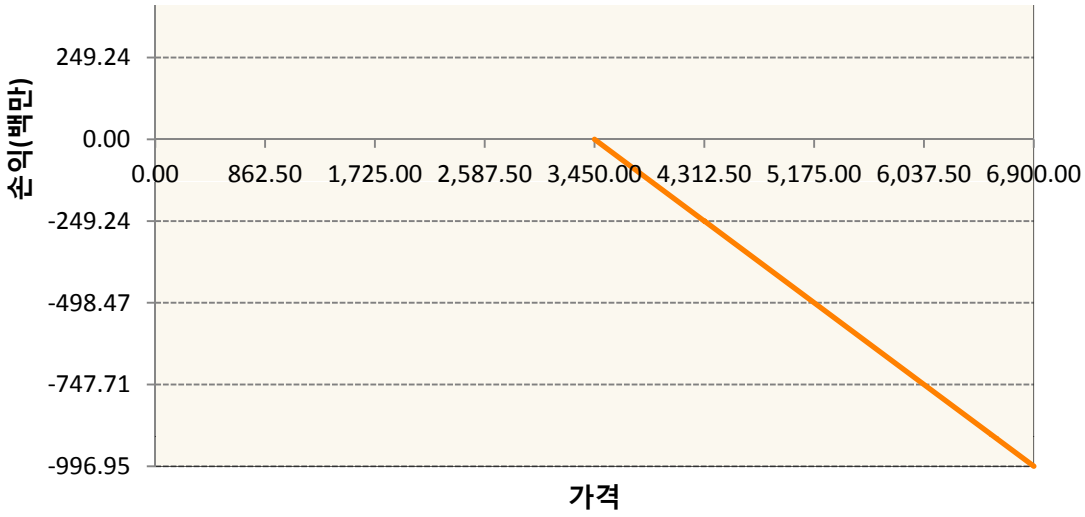
(단위:백만원)

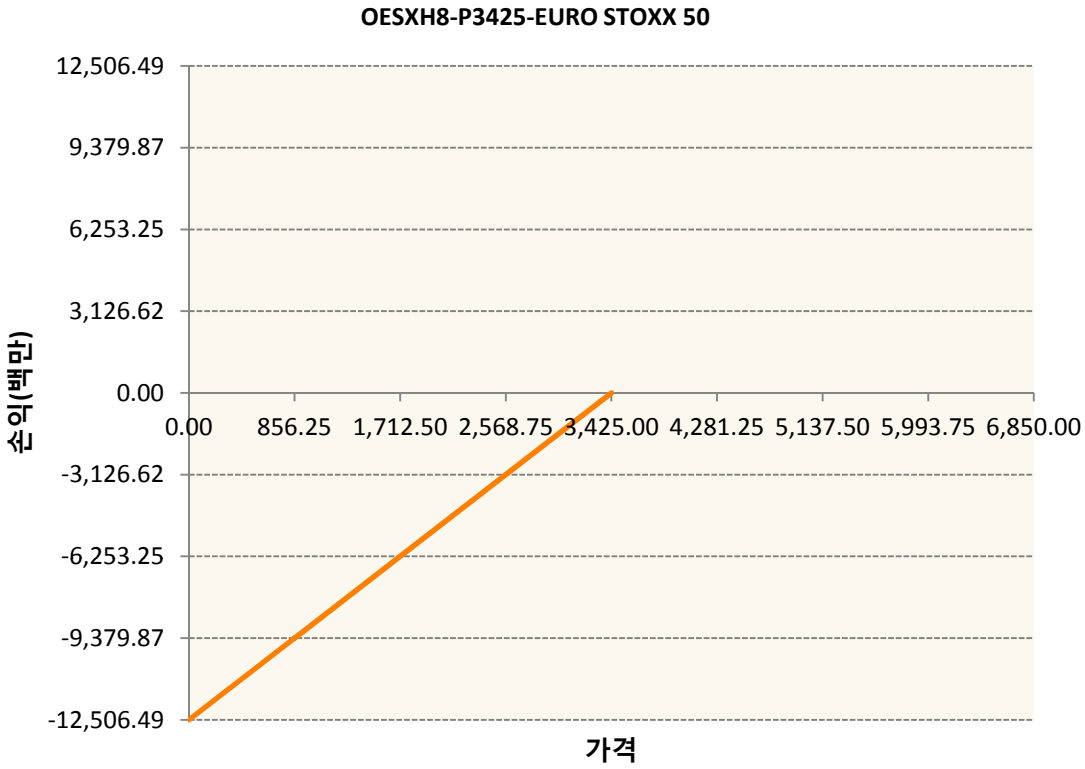
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	5,573	0	5,573	
누계	유가증권	스왑	98,509	0	98,509	장외
누계	유가증권	옵션	0	27,007	-27,007	장내
누계	지수	스왑	52,539	0	52,539	장외

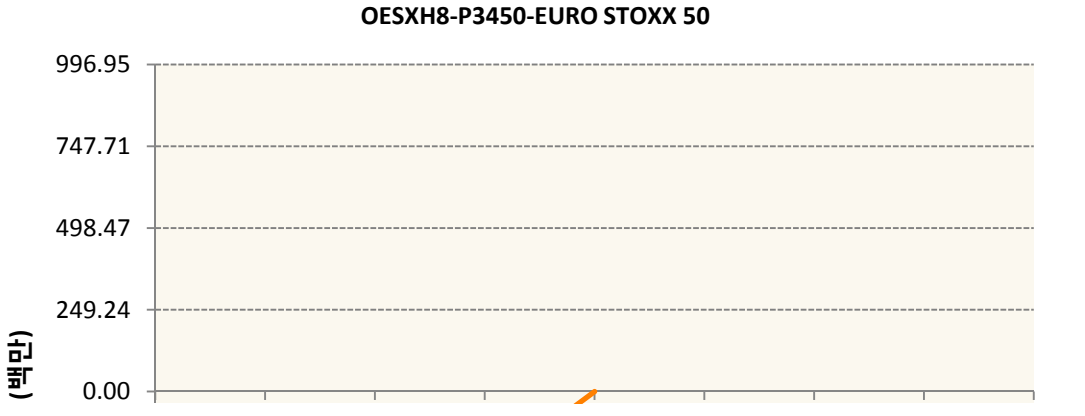
2. 만기시점의 손익구조

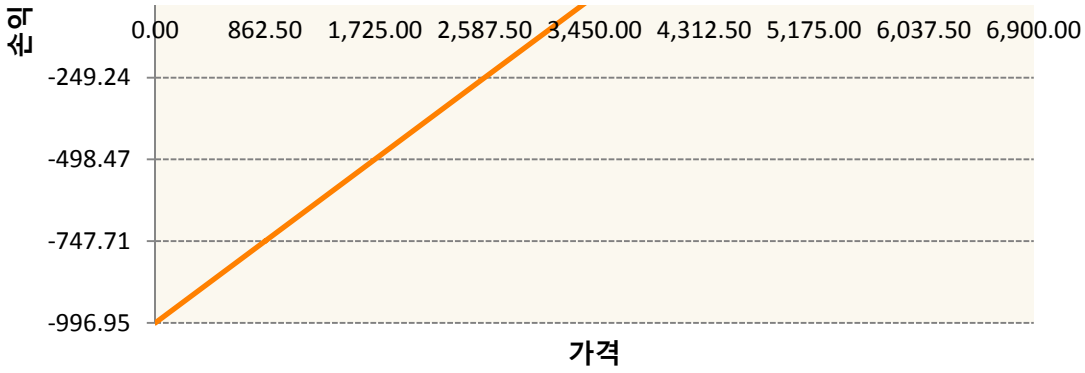


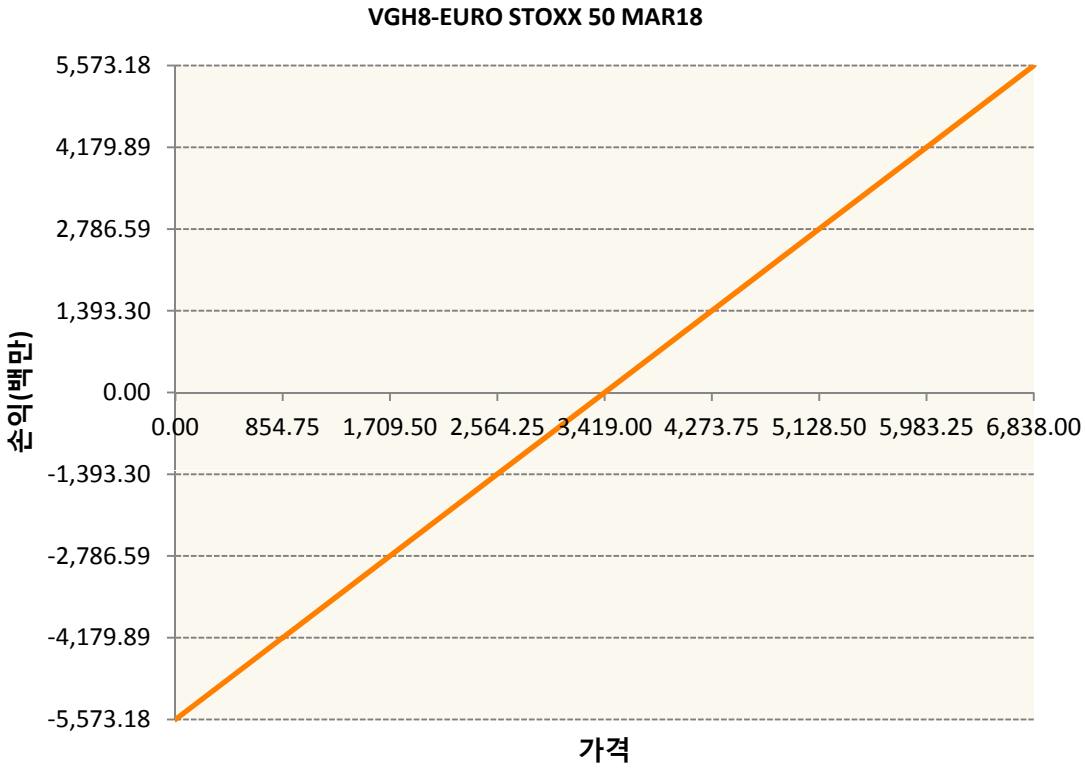



249.24
0.00
-249.24
-498.47
-747.71
-996.95
손익(백만)
0.00
862.50
1,725.00
2,587.50
3,450.00
4,312.50
5,175.00
6,037.50
6,900.00
가격


OESXH8-P3425-EURO STOXX 50
12,506.49
9,379.87
6,253.25
3,126.62
0.00
-3,126.62
-6,253.25
-9,379.87
-12,506.49
손익(백만)
0.00
856.25
1,712.50
2,568.75
3,425.00
4,281.25
5,137.50
5,993.75
6,850.00
가격


OESXH8-P3450-EURO STOXX 50
996.95
747.71
498.47
249.24
0.00
(백만)





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)	(단위:백만원)
260105SGPX SG EURO Covered CALL STRATEGY - 994.569	171
260105SQPX SG EURO Covered CALL STRATEGY	321
OESXH8-C34 EURO STOXX 50	1,000
OESXH8-C34 EURO STOXX 50	80
OESXH8-P34 EURO STOXX 50	1,000
OESXH8-P34 EURO STOXX 50	80
VGH8 EURO STOXX 50 MAR18	446

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

1,832

공시일	2018-03-19
기준일	2018-03-16

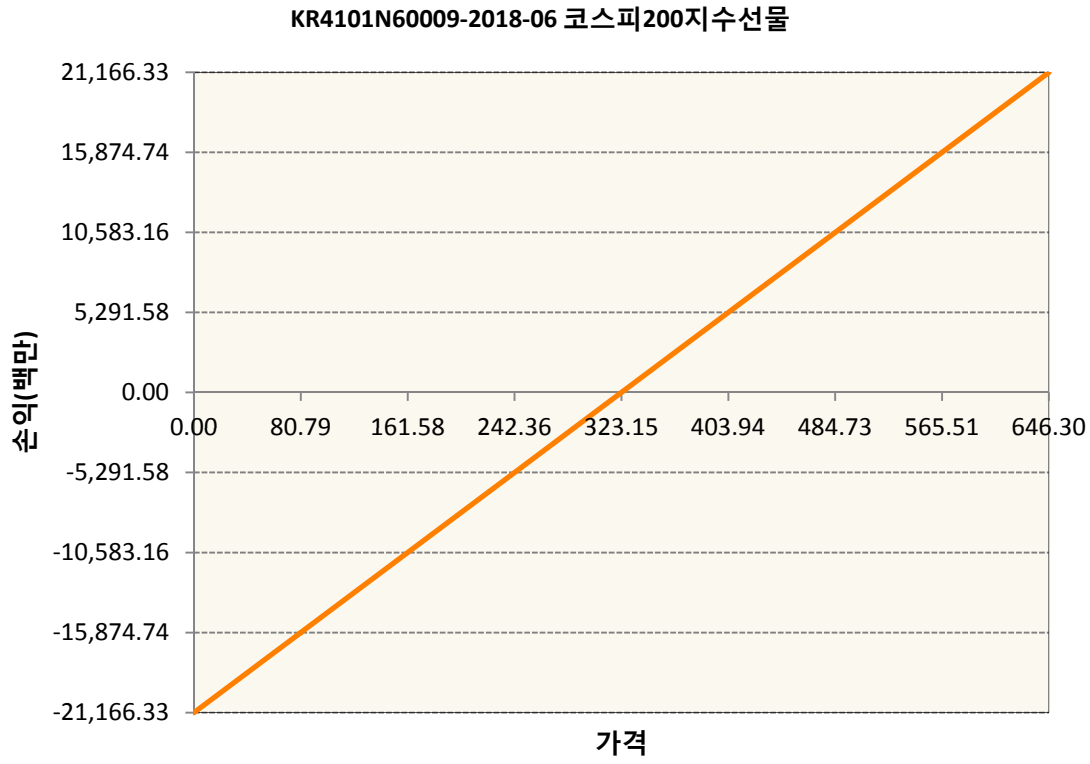
ETF스마트레버리지목표전환형8호

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	21,166	0	21,166	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)

1,169

공시일	2018-03-19
기준일	2018-03-16

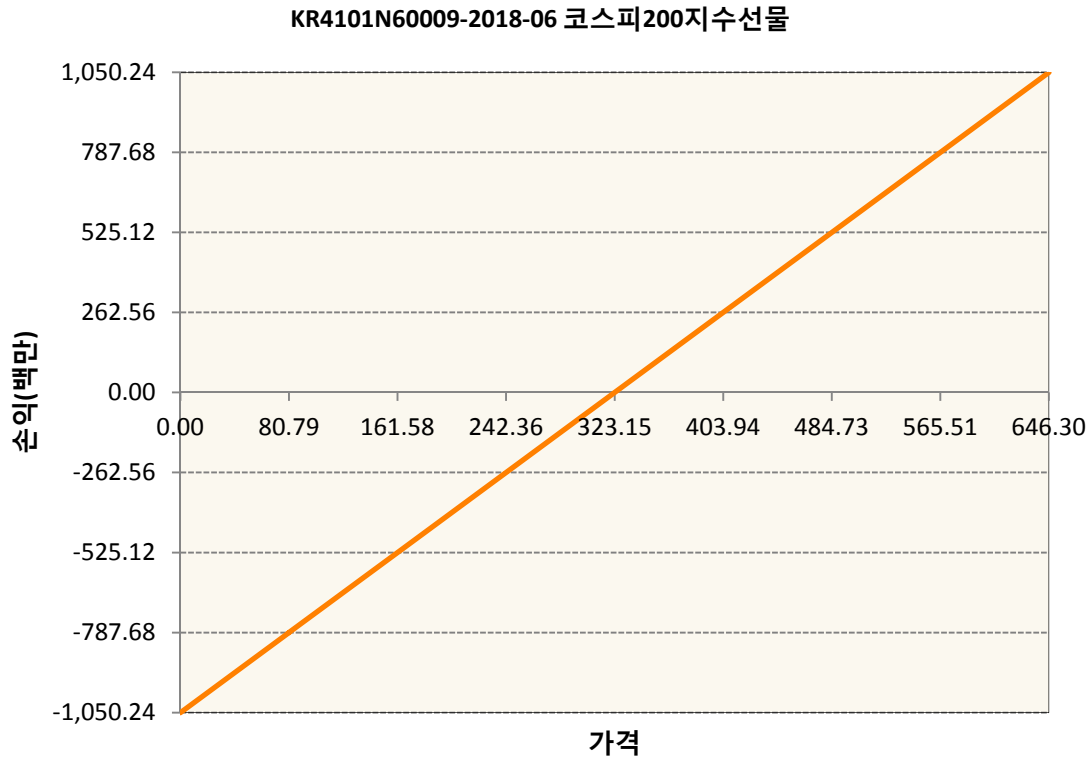
ETF스마트레버리지목표전환형9호

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	1,050	0	1,050	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	2018-03-19
기준일	2018-03-16

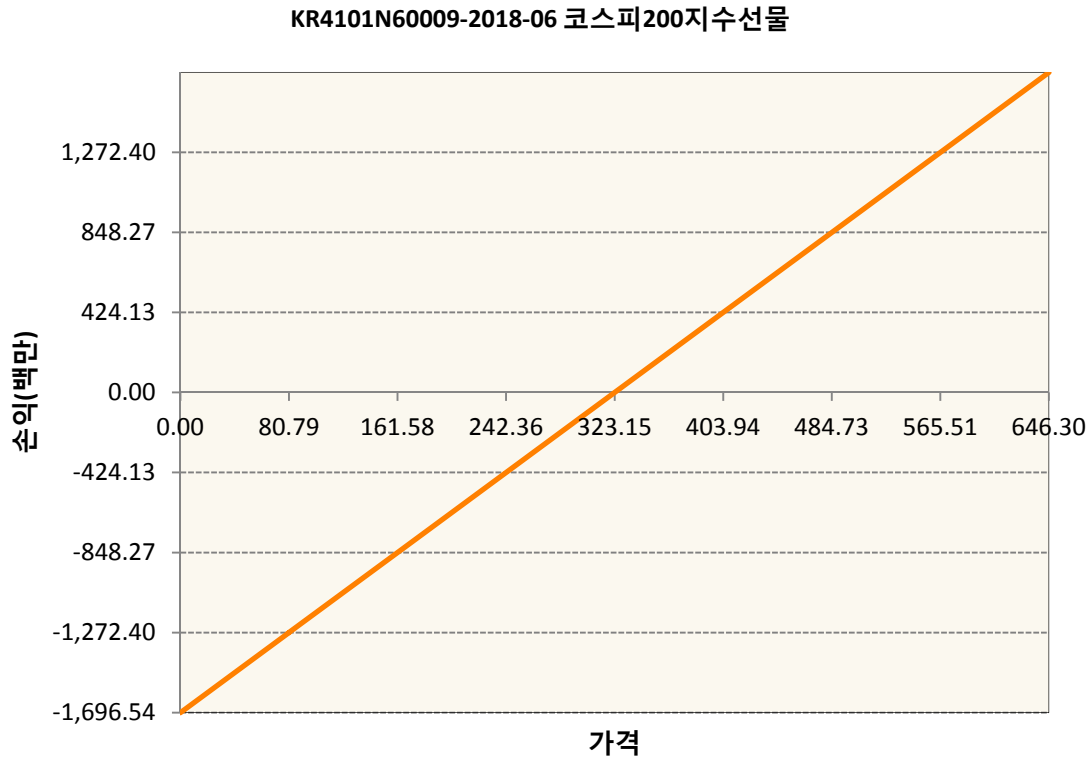
ETF스마트레버리지목표전환형10

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	1,697	0	1,697	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	2018-03-19
기준일	2018-03-16

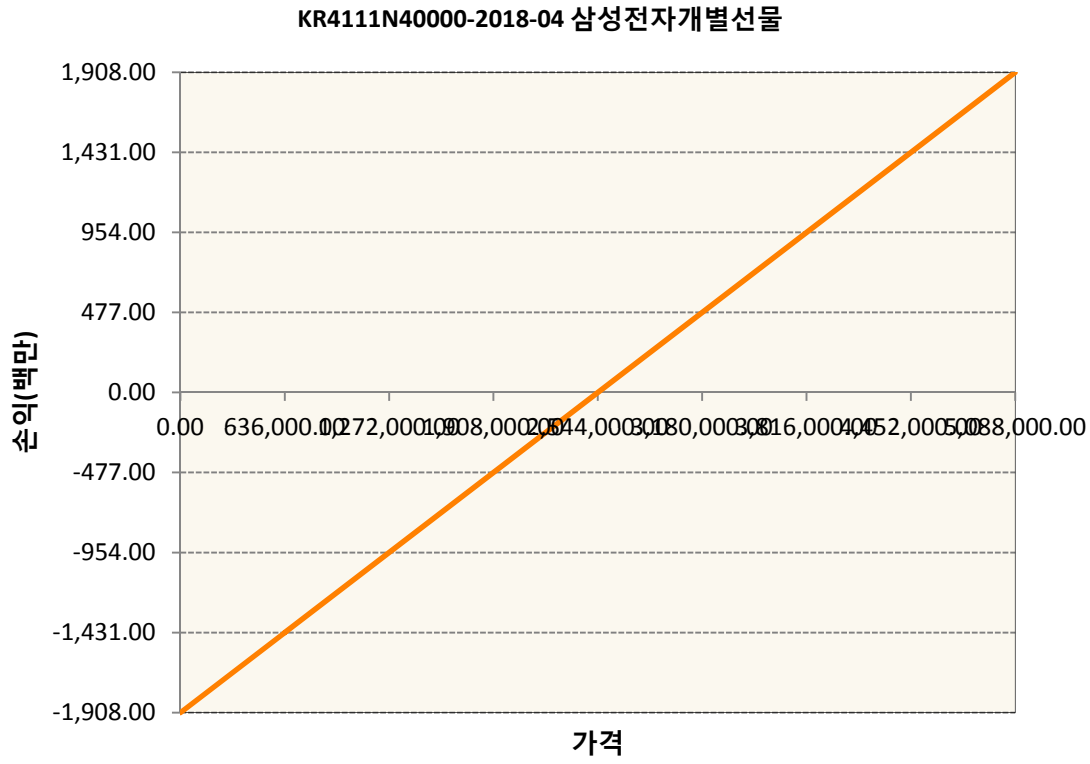
스마트KRX300인덱스1호(주식-파

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	1,908	0	1,908	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4111N40(2018-04 삼성전자개별선물							153
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-153	-153	-153	-153	-153	-153	-153
-5.33%	-102	-102	-102	-102	-102	-102	-102
-2.67%	-51	-51	-51	-51	-51	-51	-51
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	51	51	51	51	51	51	51
5.33%	102	102	102	102	102	102	102
8.00%	153	153	153	153	153	153	153

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

184

공시일	2018-03-19
기준일	2018-03-16

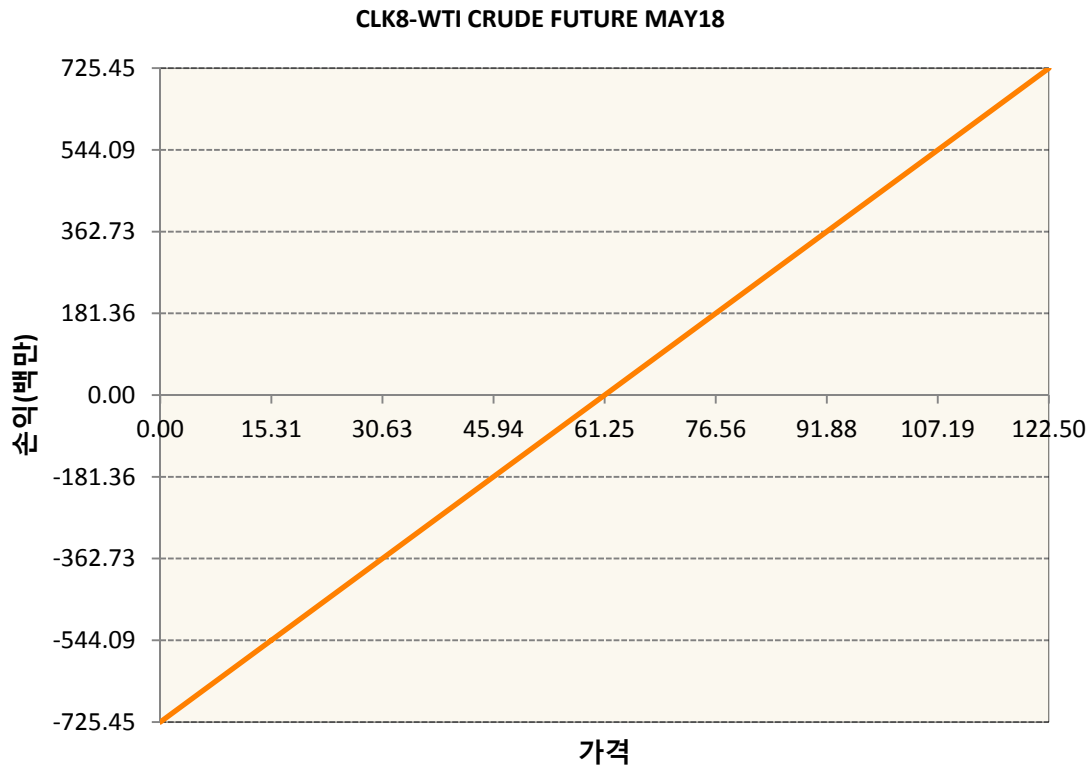
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

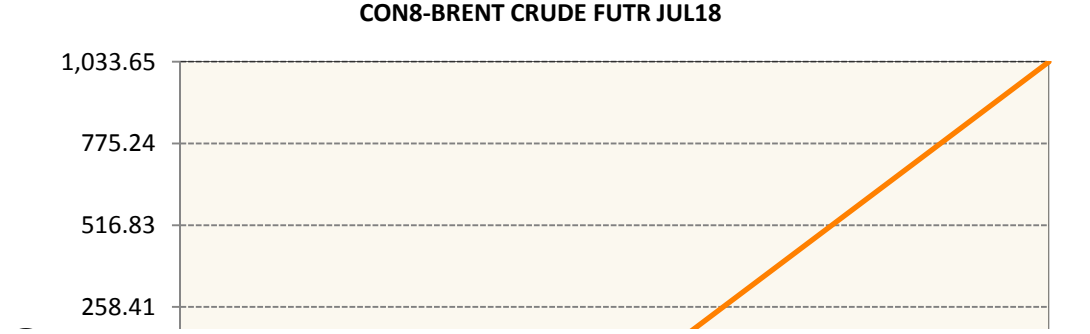
1. 계약금액

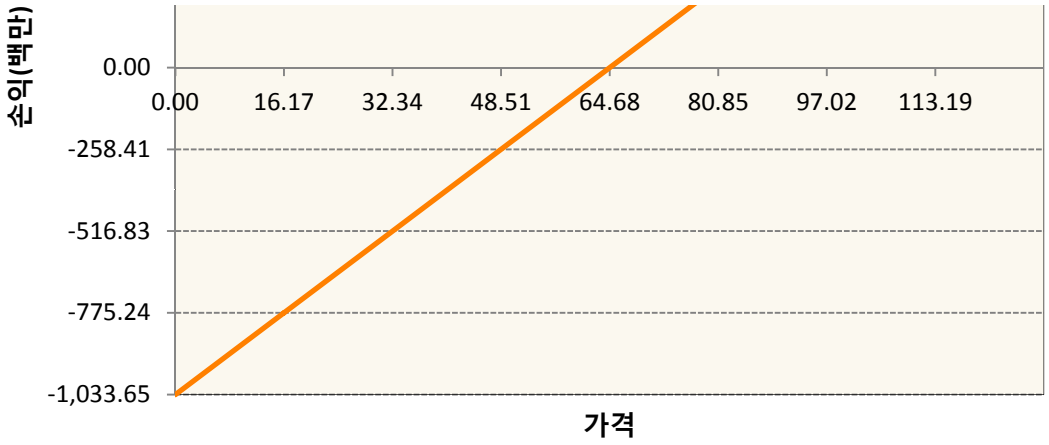
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	선물	유가증권	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	통화	선물	0	588	-588	장내
누계	선물	유가증권	725	0	725	
누계	유가증권	선물	3,213	0	3,213	
누계	통화	선물	0	586	-586	장내

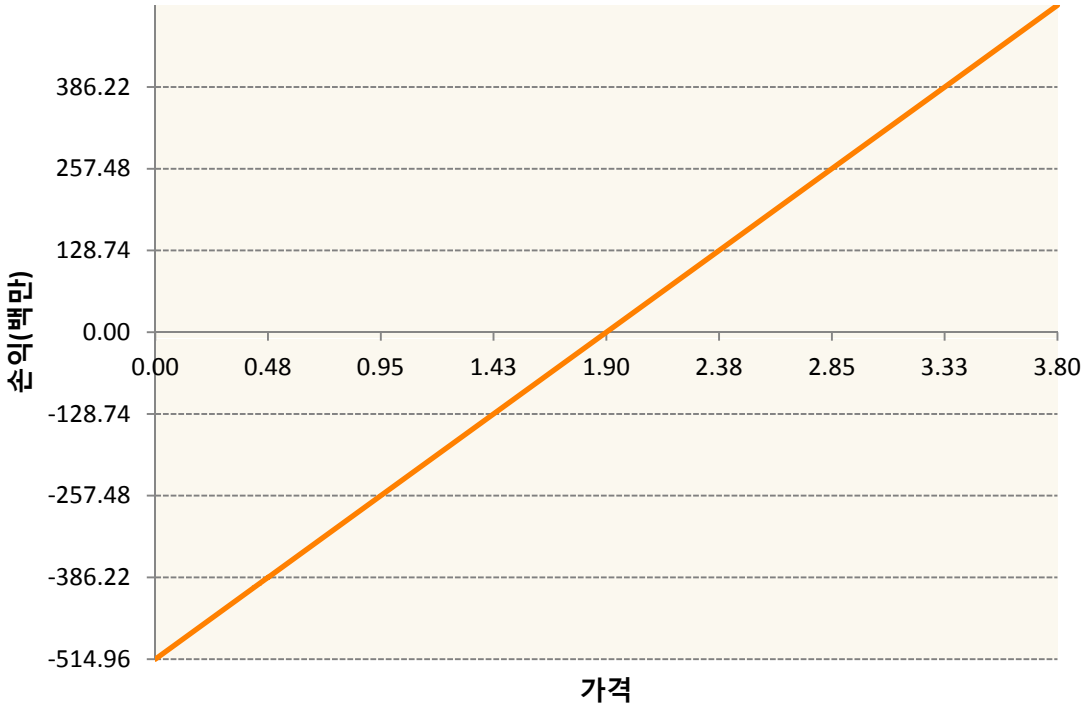
2. 만기시점의 손익구조



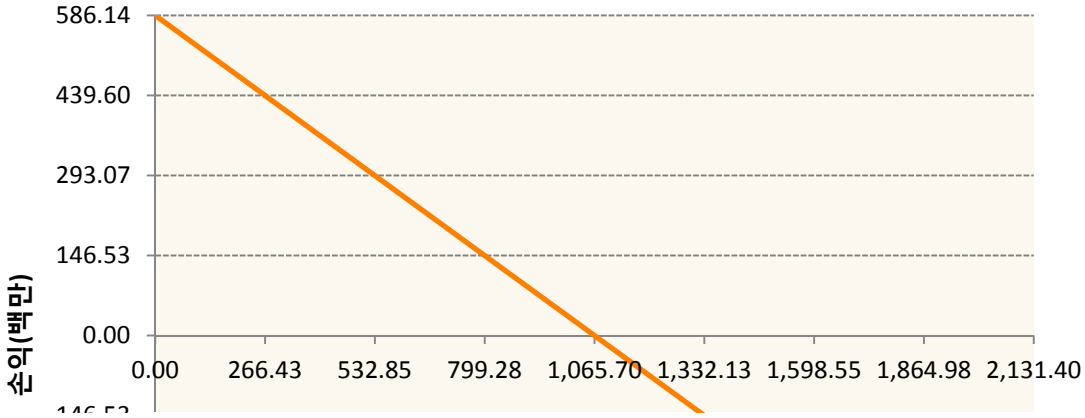


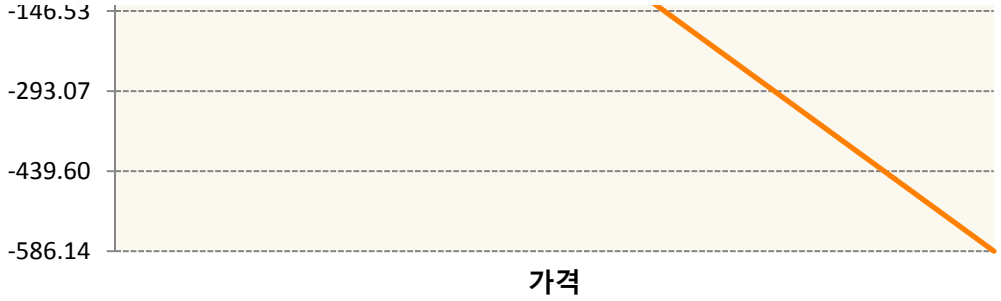


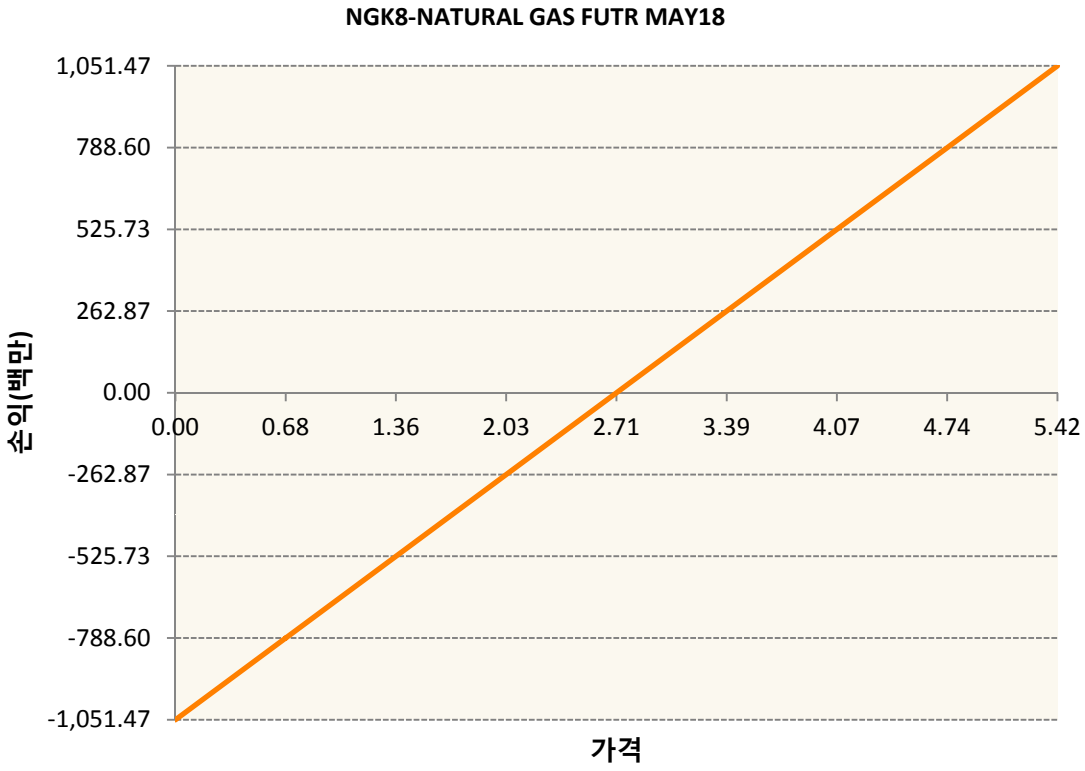
HOK8-NY Harb ULSD Fut MAY18

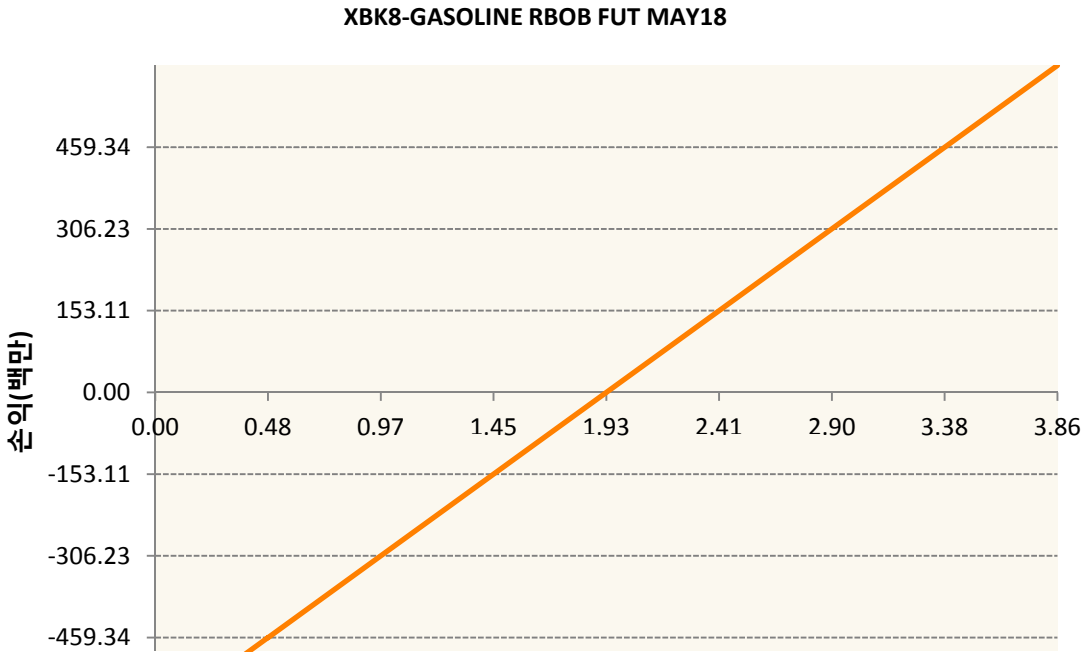


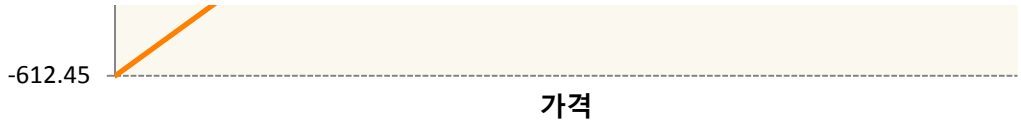
KR4175N40005-2018-04 달러선물




-146.53
-293.07
-439.60
-586.14
가격


NGK8-NATURAL GAS FUTR MAY18
1,051.47
788.60
525.73
262.87
0.00
-262.87
-525.73
-788.60
-1,051.47
손익(백만)
0.00
0.68
1.36
2.03
2.71
3.39
4.07
4.74
5.42
가격


XBK8-GASOLINE RBOB FUT MAY18
459.34
306.23
153.11
0.00
-153.11
-306.23
-459.34
손익(백만)
0.00
0.48
0.97
1.45
1.93
2.41
2.90
3.38
3.86



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
CLK8	WTI CRUDE FUTURE MAY18	58
CON8	BRENT CRUDE FUTR JUL18	83
HOK8	NY Harb ULSD Fut MAY18	41
KR4175N40(	2018-04 달러선물	47
NGK8	NATURAL GAS FUTR MAY18	84
XBK8	GASOLINE RBOB FUT MAY18	49

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	515

공시일	2018-03-19
기준일	2018-03-16

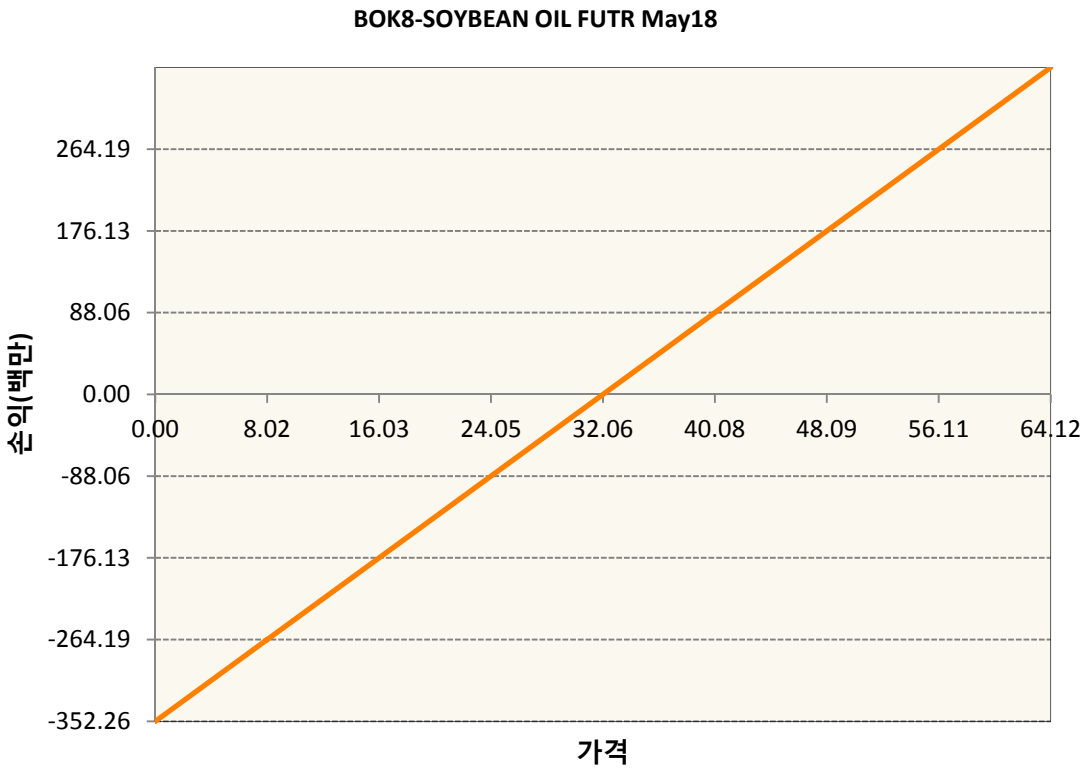
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

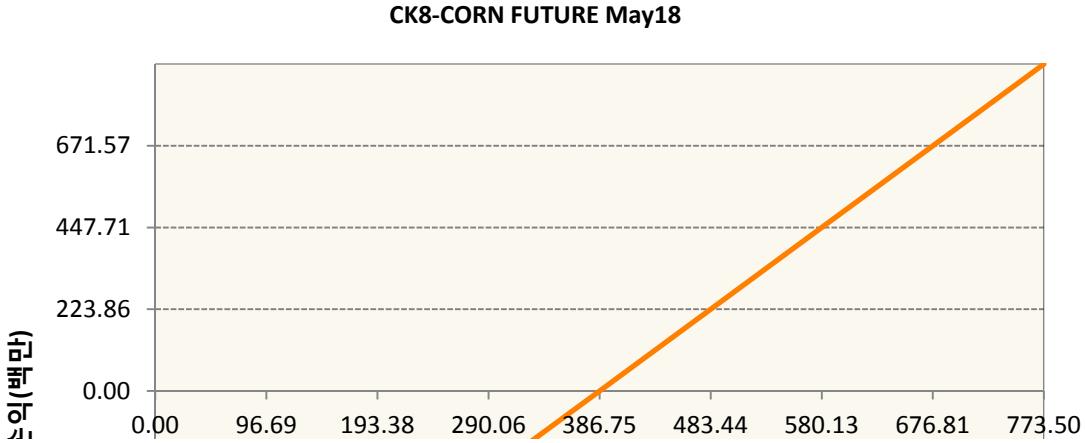
1. 계약금액

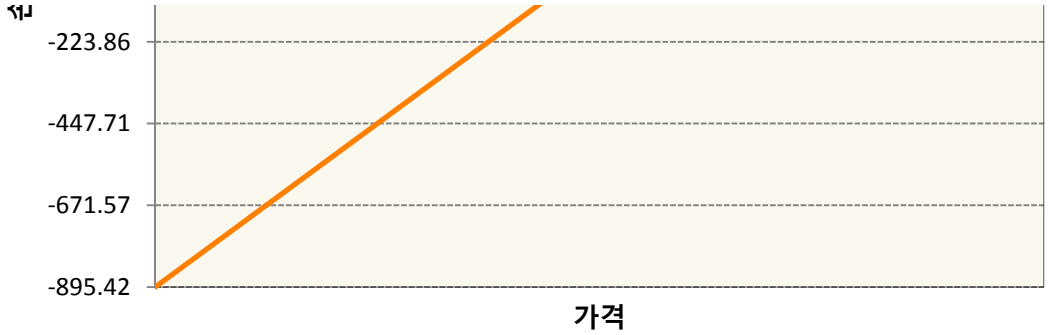
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	통화	선물	0	321	-321	장내
누계	유가증권	선물	4,155	0	4,155	
누계	통화	선물	0	320	-320	장내

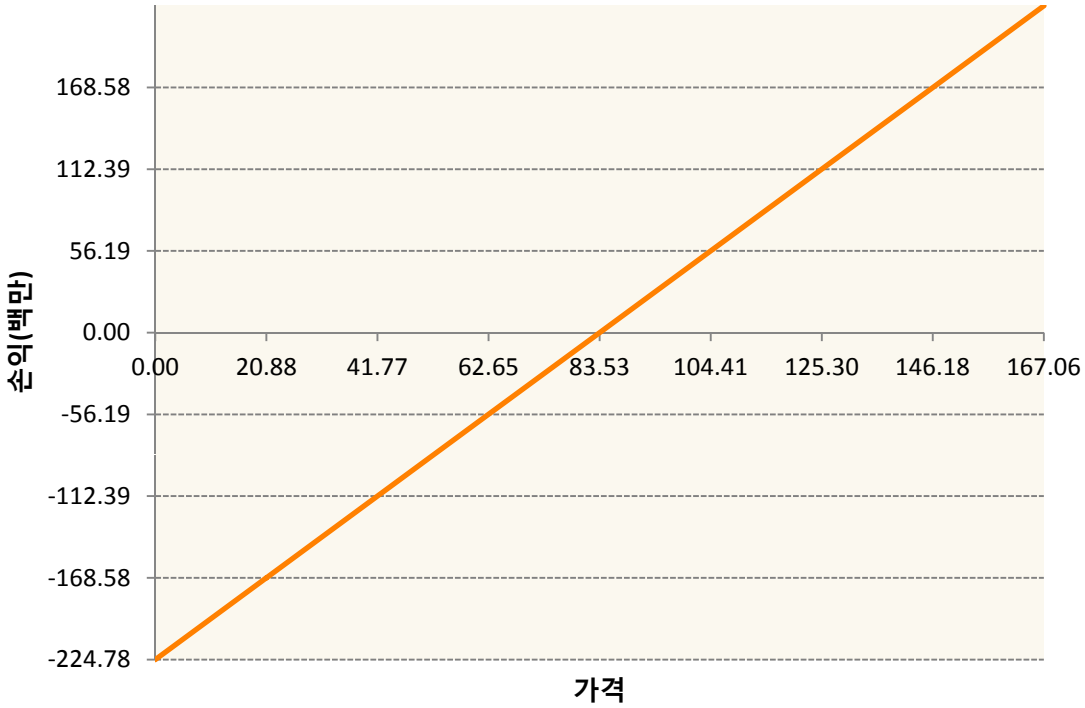
2. 만기시점의 손익구조



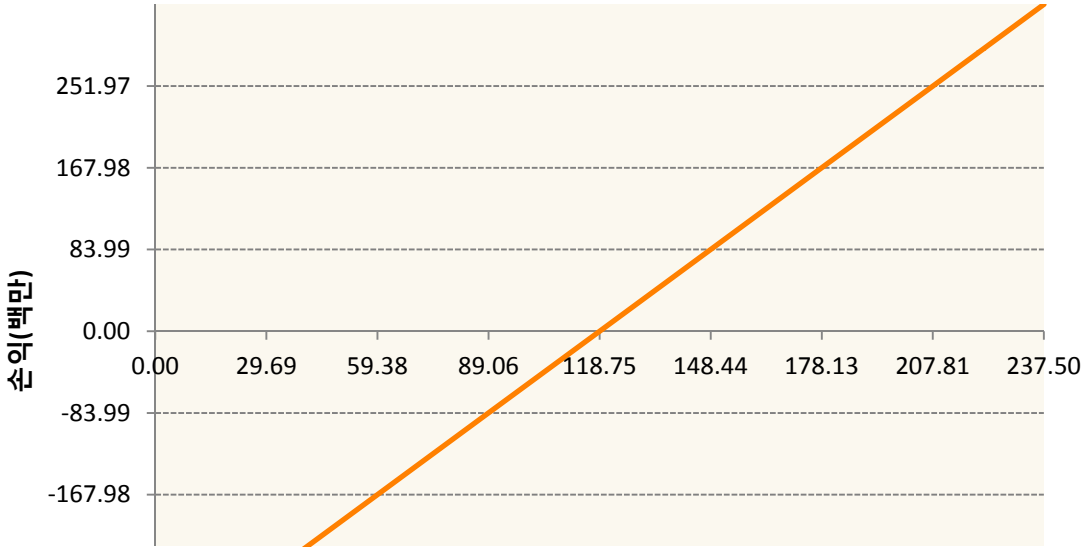


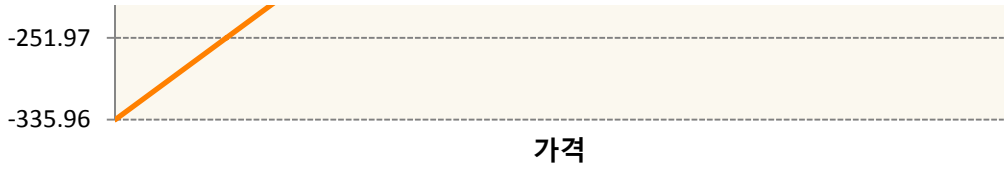


CTK8-COTTON NO.2 FUTR May18

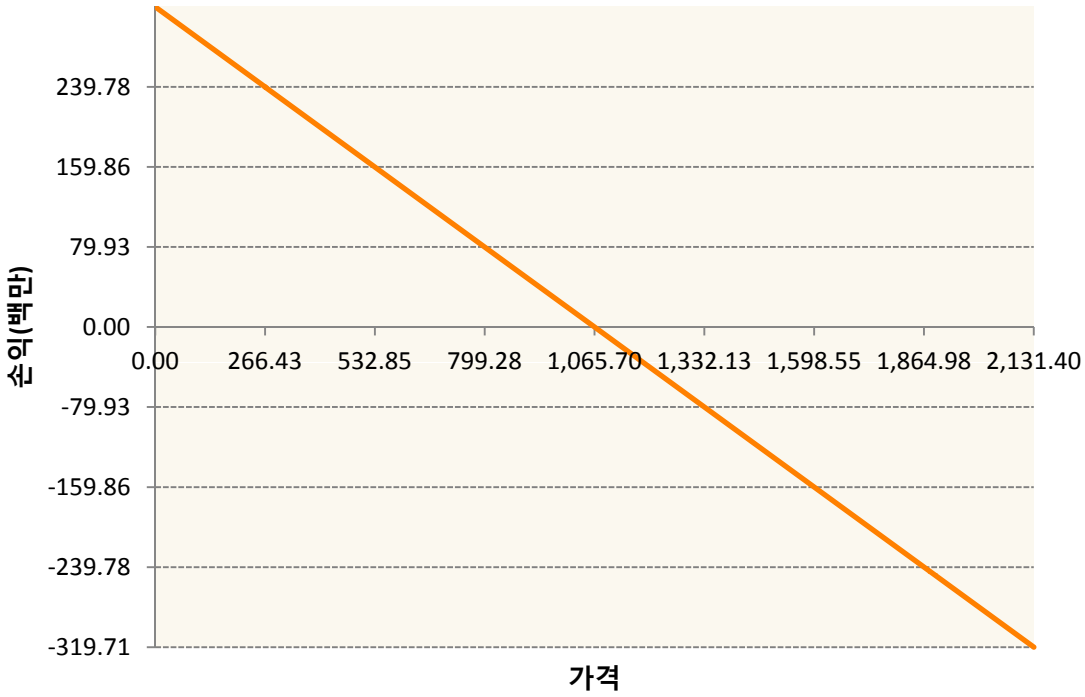


KCK8-COFFEE 'C' FUTURE May18

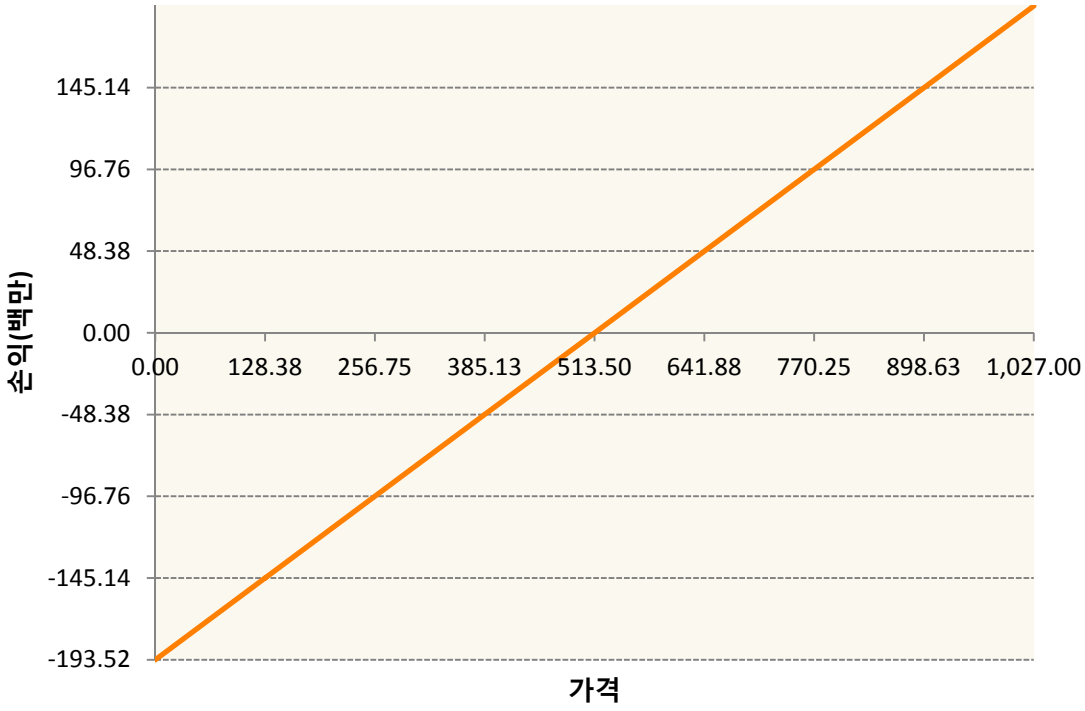




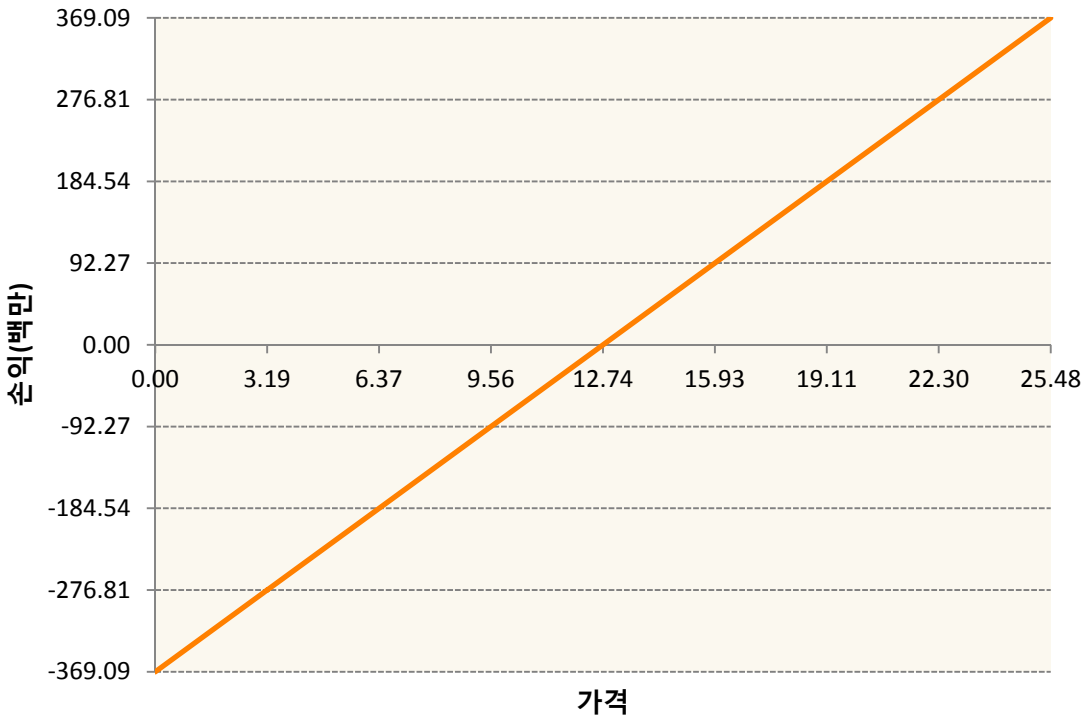
KR4175N40005-2018-04 달러선물



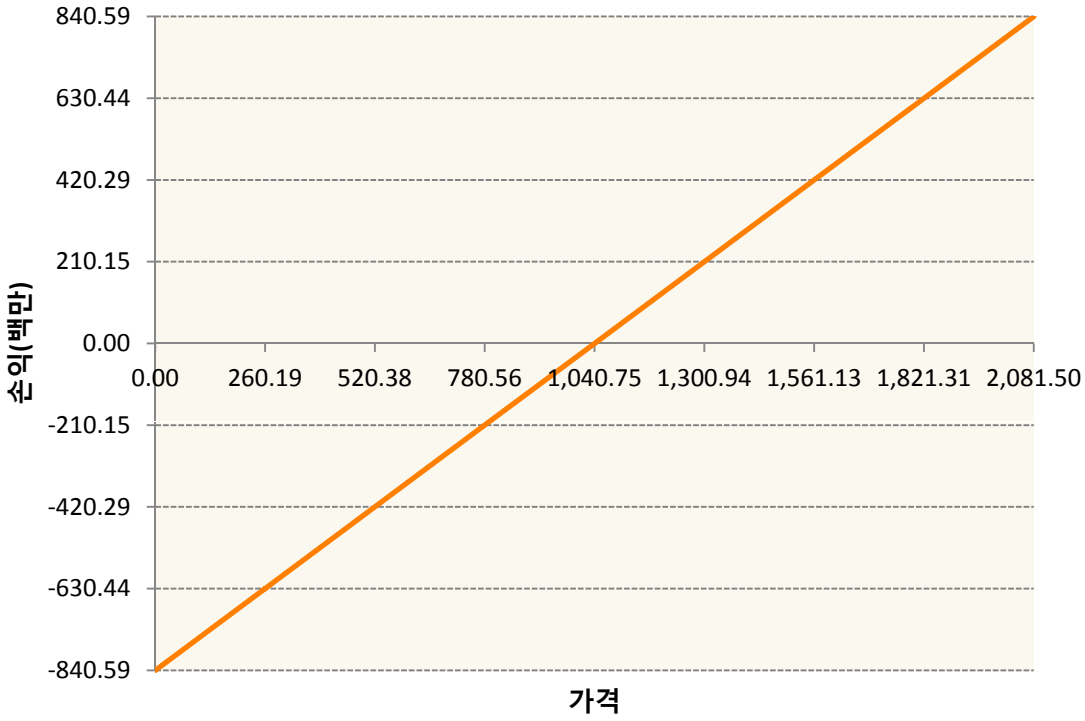
KWK8-KC HRW WHEAT FUT May18



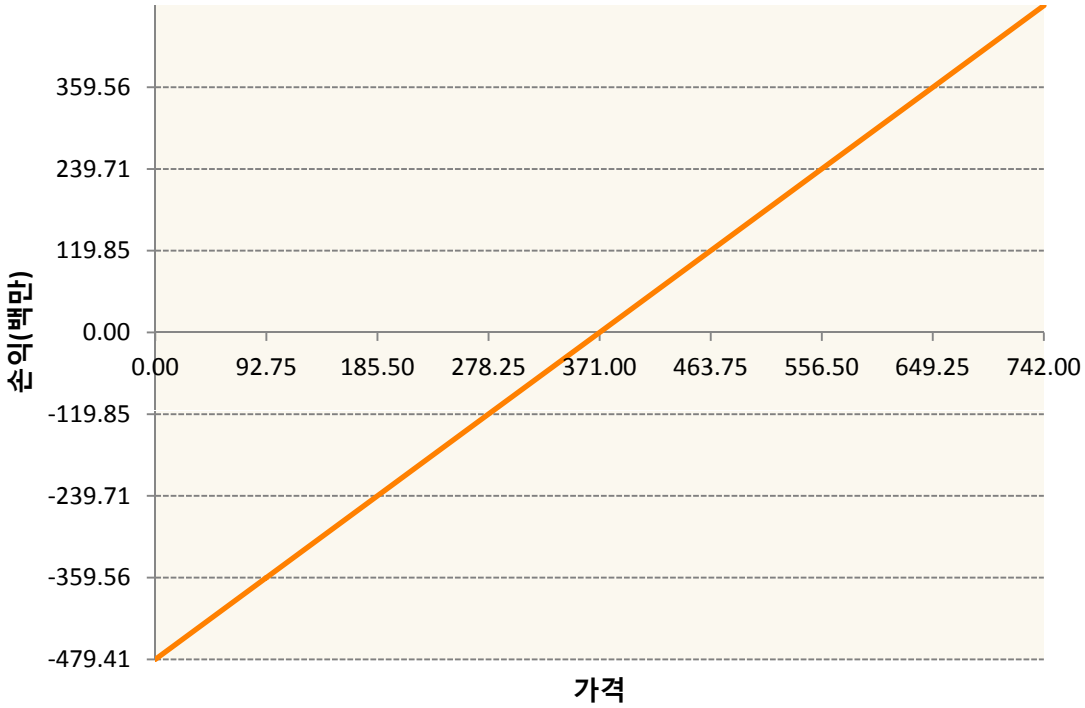
SBK8-SUGAR #11 (WORLD) May18



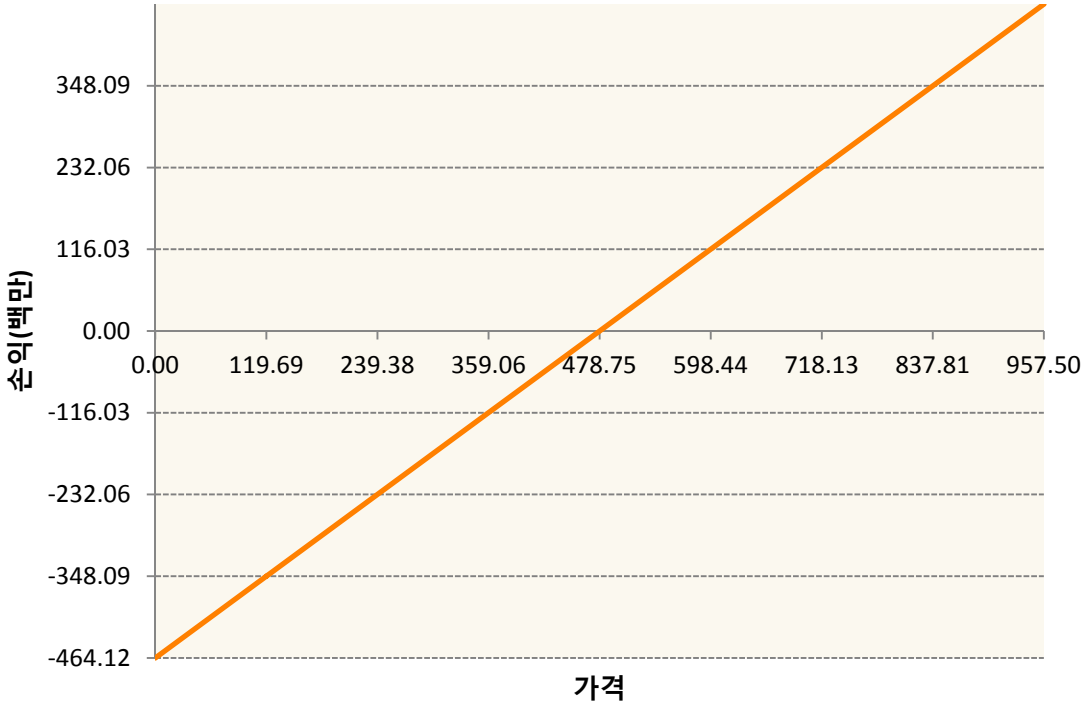
SK8-SOYBEAN FUTRUE May18



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
KR4175N40(	2018-04 달러선물	26
KWK8	KC HRW WHEAT FUT May18	15
SBK8	SUGAR #11 (WORLD) May18	30
SK8	SOYBEAN FUTRUE May18	67
SMK8	SOYBEAN MEAL FUTR May18	38
WK8	WHEAT FUTURE(CBT) May18	37

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

334