| | |
|---|---|
| 공시일 | 2018-01-10 |
| 기준일 | 2018-01-09 |

# 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 | 2018-01-10 |
| 기준일 | 2018-01-09 |

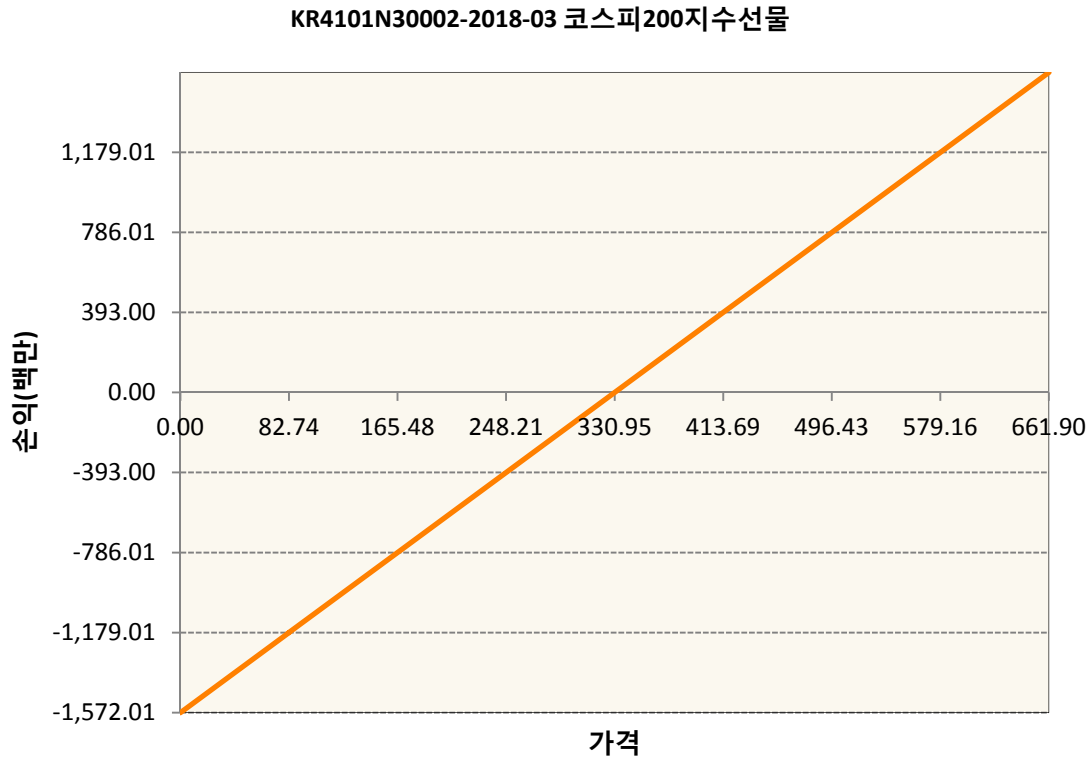
# 스마트인덱스모

## 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 | 1,572 | 0 | 1,572 | 장내 |

## 2. 만기시점의 손익구조




## 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| KR4101N30( 2018-03 코스피200지수선물 | | | | | | | 125 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 기초자산의 변동성 | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | -125 | -125 | -125 | -125 | -125 | -125 | -125 |
| -5.33% | -84 | -84 | -84 | -84 | -84 | -84 | -84 |
| -2.67% | -42 | -42 | -42 | -42 | -42 | -42 | -42 |
| 0% | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 2.67% | 42 | 42 | 42 | 42 | 42 | 42 | 42 |
| 5.33% | 84 | 84 | 84 | 84 | 84 | 84 | 84 |
| 8.00% | 125 | 125 | 125 | 125 | 125 | 125 | 125 |

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

| 75 |
|---|

| 공시일 | 2018-01-10 |
|---|---|
| 기준일 | 2018-01-09 |

# SMART합성-MSCI선진국증권상장지

## 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 지수 | 스왑 | 0 | 0 | 0 | 장외 |
| 누계 | 지수 | 스왑 | 13,365 | 0 | 13,365 | 장외 |

## 2. 만기시점의 손익구조

## 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| SWMXWO0( 신한MXWO 미래S171122 | 1,128 |
|---|---|

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

| **362** |
|---|

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

| 공시일 | 2018-01-10 |
|---|---|
| 기준일 | 2018-01-09 |

# 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 | 418 |

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

| |
|---|
| **379** |

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

| | |
|---|---|
| 공시일 | 2018-01-10 |
| 기준일 | 2018-01-09 |

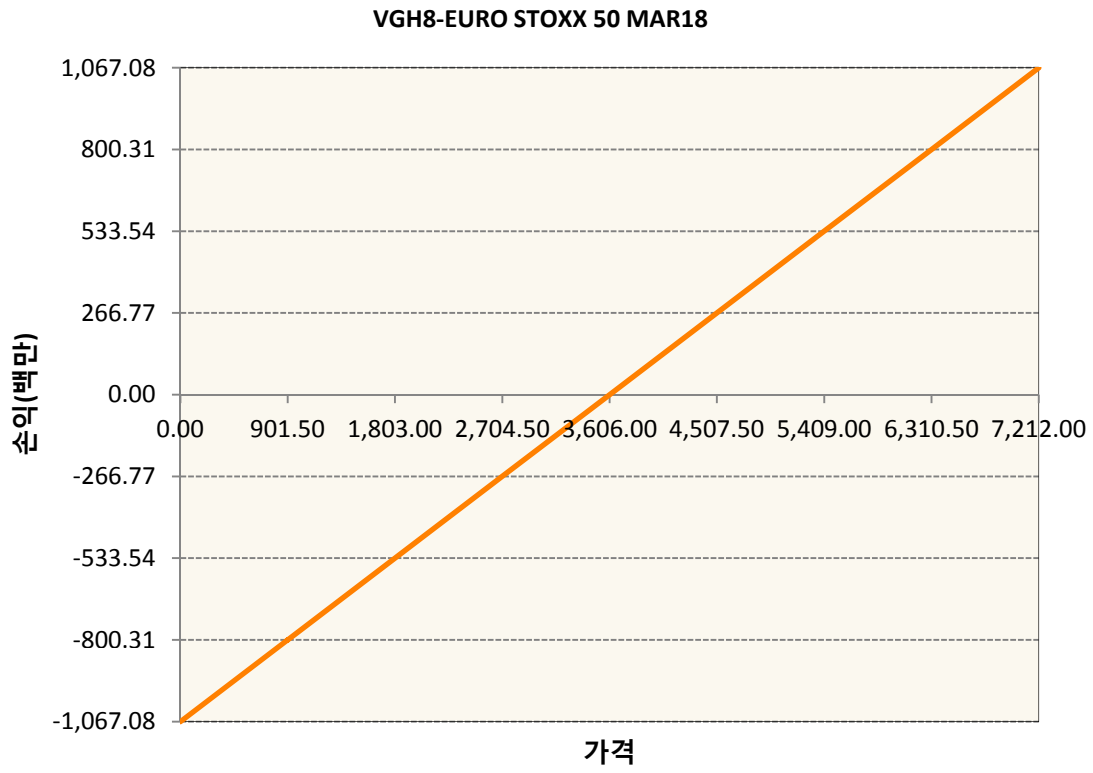
# 유로인덱스모(주식-파생형)

## 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 1,067 | 0 | 1,067 | |

## 2. 만기시점의 손익구조




## 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| | | |
|---|---|---|
| VGH8 | EURO STOXX 50 MAR18 | 85 |

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

(단위:백만원)

**48**

| | |
|---|---|
| 공시일 | 2018-01-10 |
| 기준일 | 2018-01-09 |

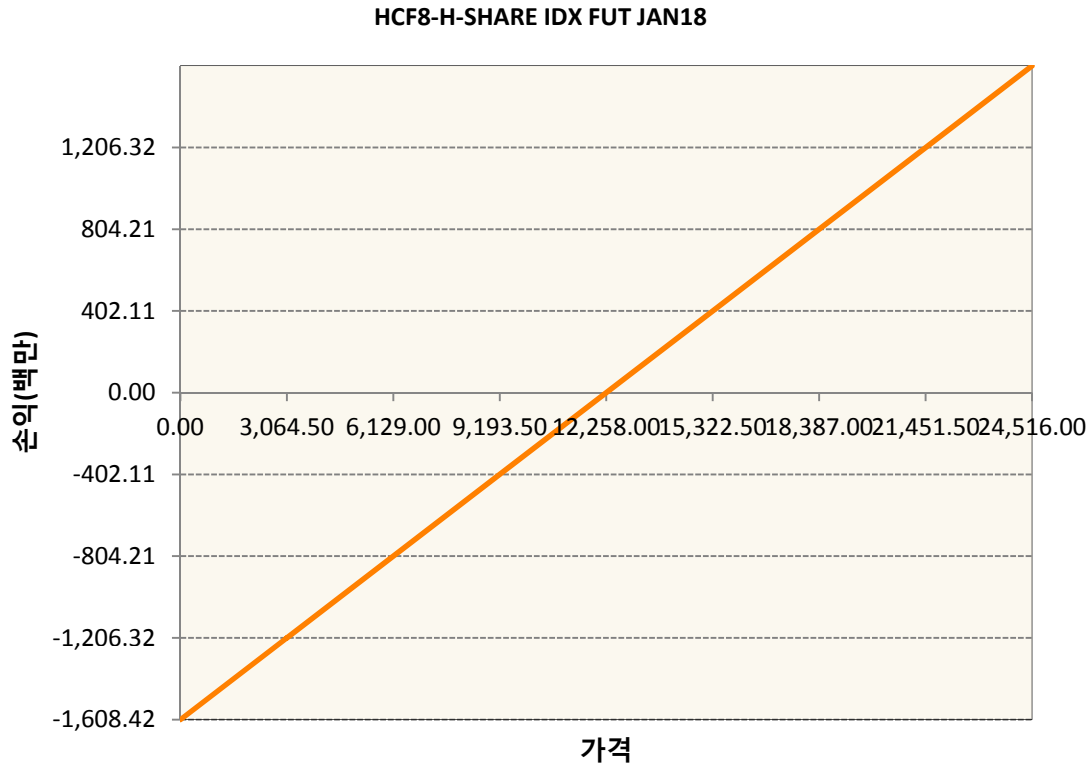
# 차이나인덱스모(주식-파생형)

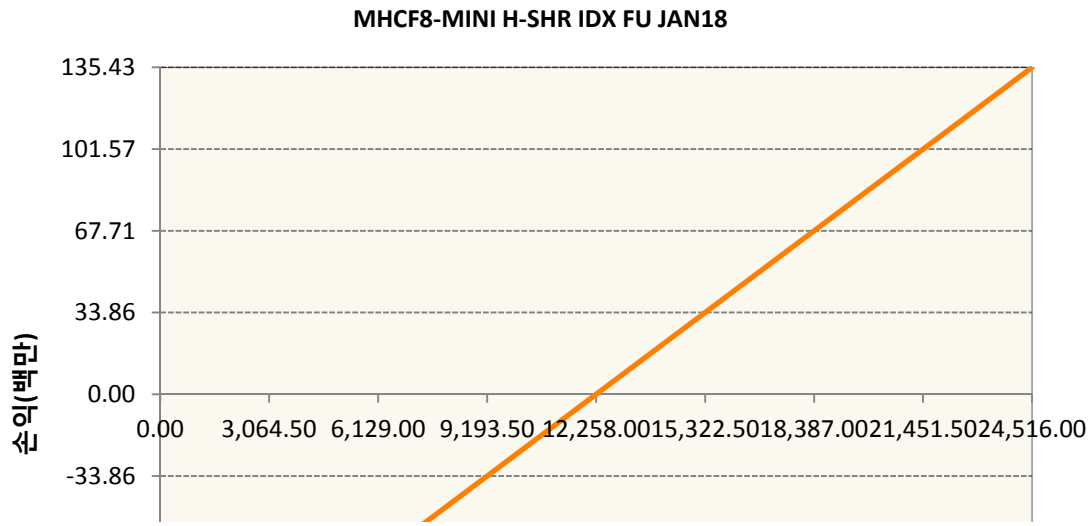
## 1. 계약금액

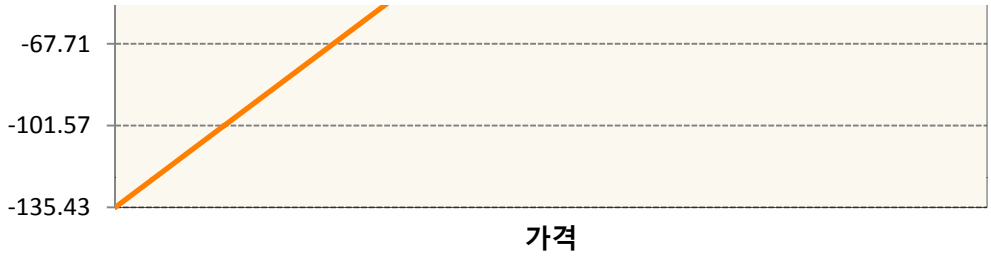
(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 1,744 | 0 | 1,744 | 장내 |

## 2. 만기시점의 손익구조






| 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) | | (단위:백만원) |
|---|---|---|
| HCF8 | H-SHARE IDX FUT JAN18 | 129 |
| MHCF8 | MINI H-SHR IDX FU JAN18 | 11 |

| 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) | (단위:백만원) |
|---|---|
| | **111** |

| | |
|---|---|
| 공시일 | 2018-01-10 |
| 기준일 | 2018-01-09 |

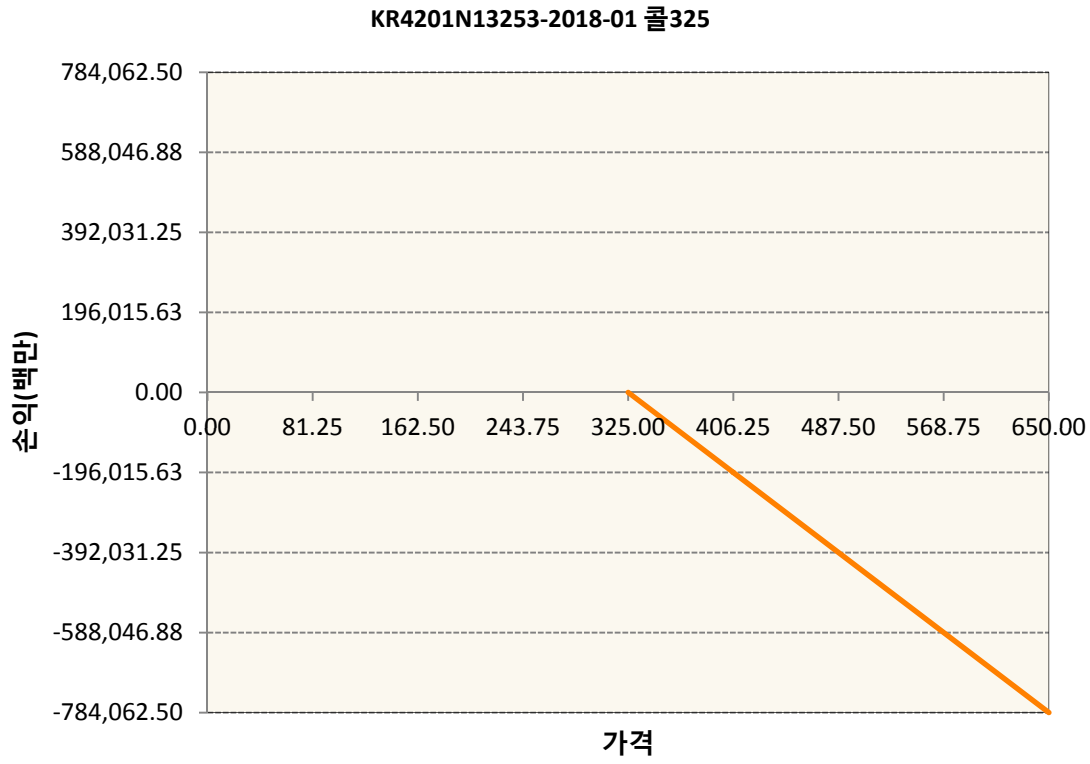
# 커버드콜모(주식혼합-파생형)

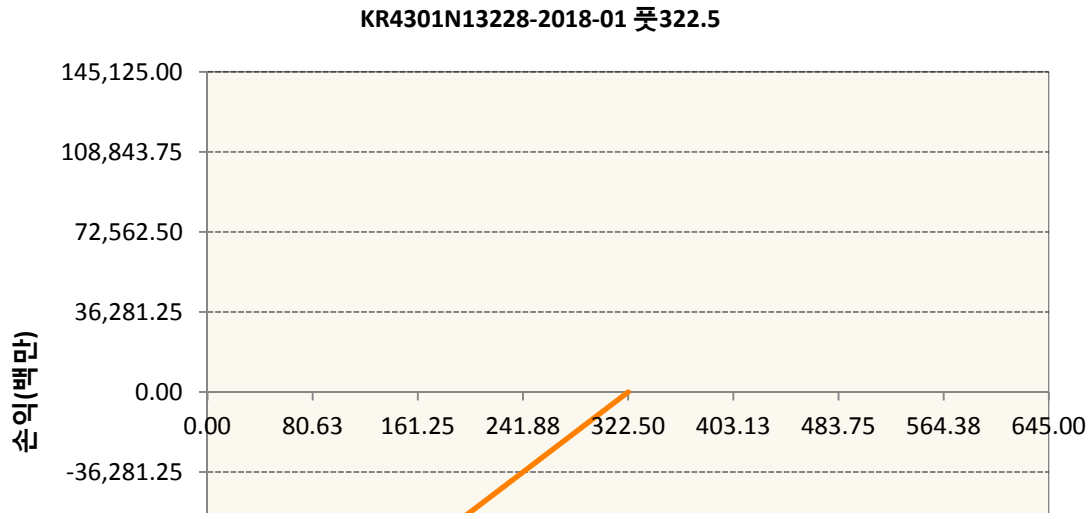
## 1. 계약금액

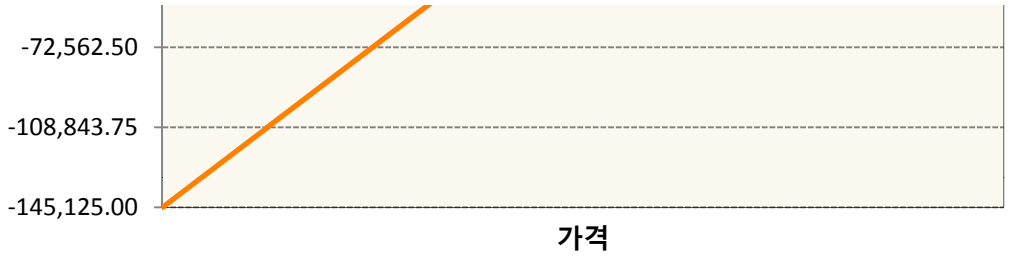
(단위:백만원)

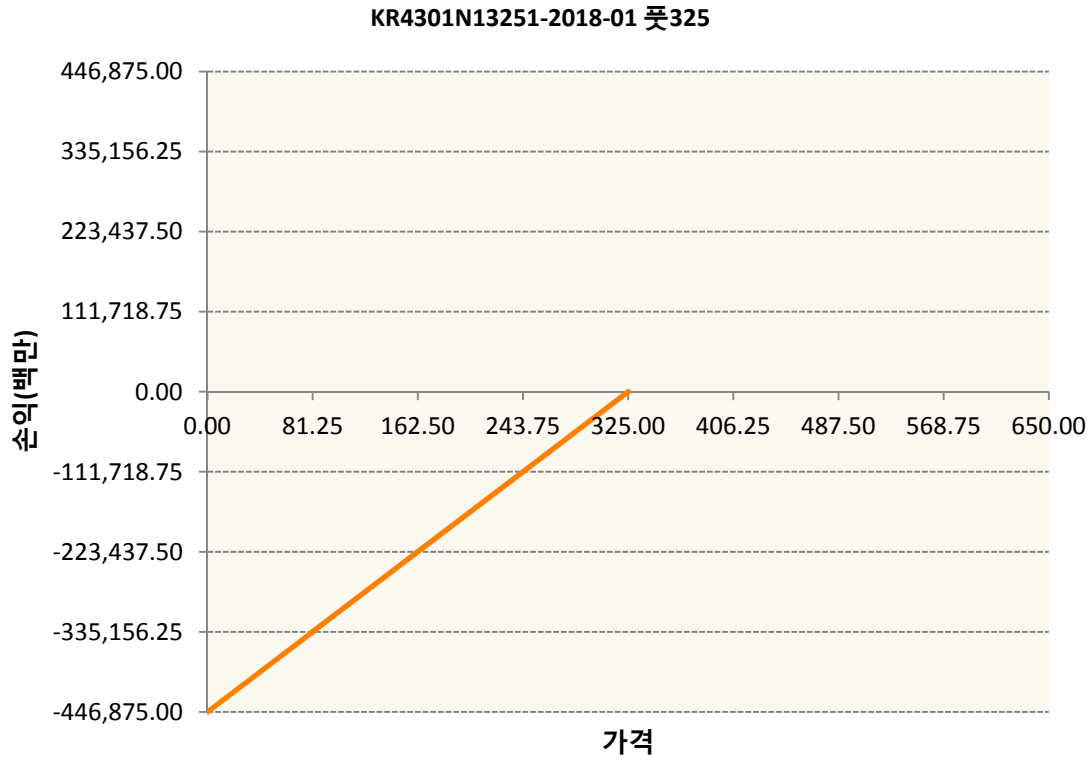
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 유가증권 | 옵션 | 7,969 | 0 | 7,969 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션 | 0 | 1,376,063 | -1,376,063 | 장내 |

## 2. 만기시점의 손익구조






**3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)** (단위:백만원)

| KR4201N132 2018-01 콜325 | | | | | | | 62,221 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 기초자산의 변동성 | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | 14,220 | 14,220 | 14,220 | 14,220 | 14,219 | 14,217 | 14,212 |
| -5.33% | 14,213 | 14,200 | 14,174 | 14,133 | 14,073 | 13,993 | 13,892 |
| -2.67% | 12,927 | 12,570 | 12,194 | 11,803 | 11,401 | 10,989 | 10,569 |
| 0% | 867 | 607 | 316 | 0 | -337 | -692 | -1,062 |
| 2.67% | -19,734 | -19,741 | -19,756 | -19,783 | -19,824 | -19,883 | -19,961 |
| 5.33% | -40,976 | -40,976 | -40,976 | -40,977 | -40,977 | -40,980 | -40,984 |
| 8.00% | -62,221 | -62,221 | -62,221 | -62,221 | -62,221 | -62,221 | -62,221 |
| KR4301N132 2018-01 풋322.5 | | | | | | | 8,391 |
| | 기초자산의 변동성 | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | -8,391 | -8,391 | -8,391 | -8,391 | -8,391 | -8,391 | -8,391 |

| | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| -5.33% | -4,429 | -4,429 | -4,429 | -4,429 | -4,429 | -4,429 | -4,430 |
| -2.67% | -672 | -712 | -753 | -794 | -836 | -878 | -920 |
| 0% | 2 | 2 | 1 | 0 | -2 | -5 | -10 |
| 2.67% | 2 | 2 | 2 | 2 | 2 | 2 | 2 |
| 5.33% | 2 | 2 | 2 | 2 | 2 | 2 | 2 |
| 8.00% | 2 | 2 | 2 | 2 | 2 | 2 | 2 |
| KR4301N132 2018-01 풋325 | | | | | | | 29,018 |
| | 기초자산의 변동성 | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | -29,018 | -29,018 | -29,018 | -29,018 | -29,018 | -29,018 | -29,018 |
| -5.33% | -16,909 | -16,909 | -16,909 | -16,909 | -16,909 | -16,909 | -16,909 |
| -2.67% | -4,873 | -4,916 | -4,969 | -5,032 | -5,102 | -5,179 | -5,262 |
| 0% | 56 | 44 | 26 | 0 | -33 | -74 | -122 |
| 2.67% | 66 | 66 | 66 | 66 | 66 | 66 | 66 |
| 5.33% | 66 | 66 | 66 | 66 | 66 | 66 | 66 |
| 8.00% | 66 | 66 | 66 | 66 | 66 | 66 | 66 |

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

| |
|---|
| **118,711** |

| 공시일 | 2018-01-10 |
|---|---|
| 기준일 | 2018-01-09 |

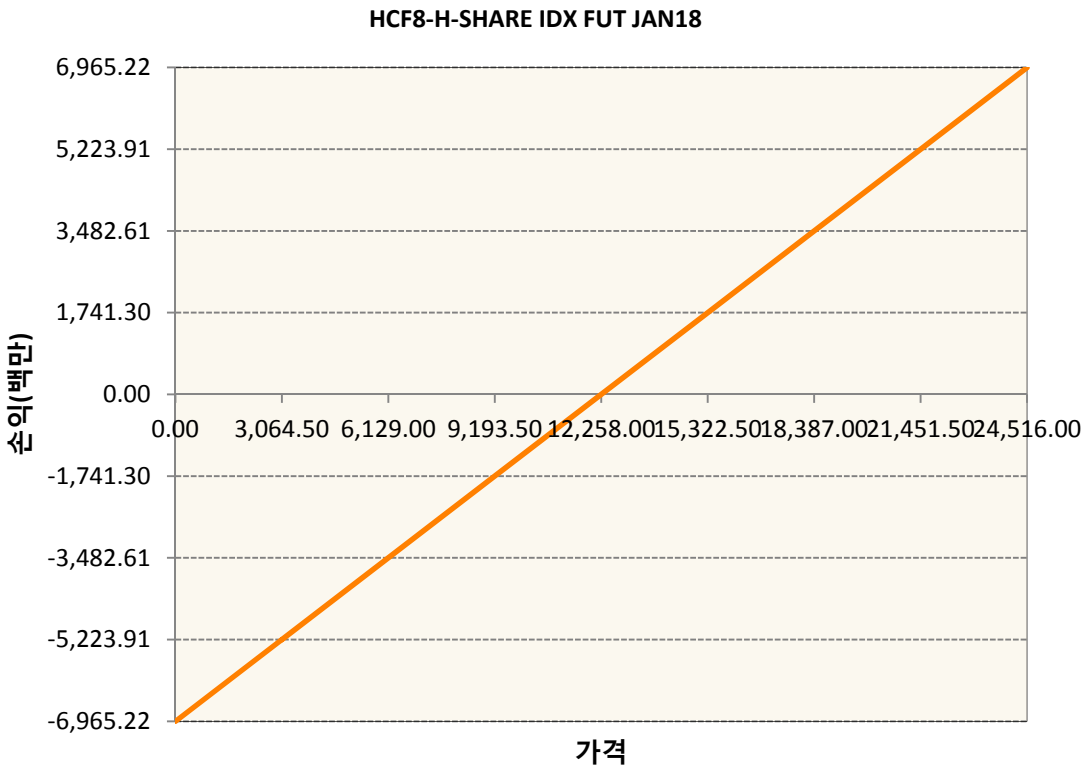
# 홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생

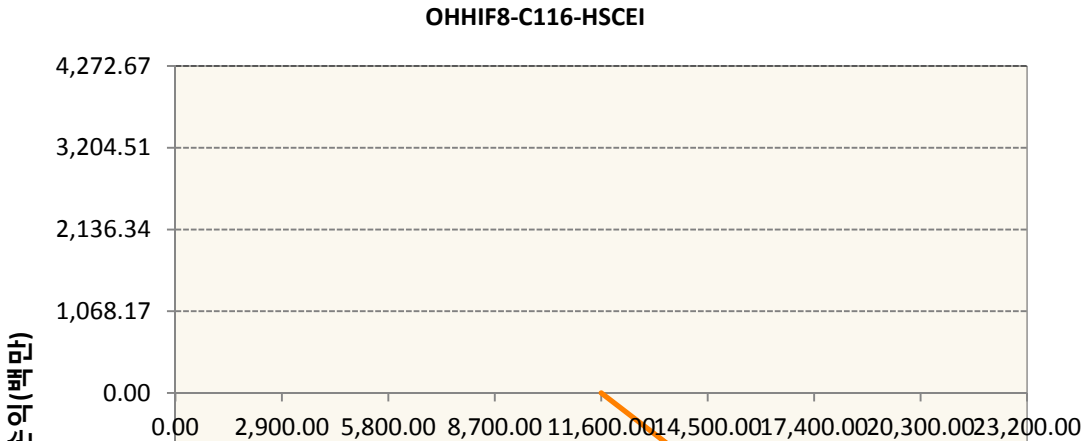
## 1. 계약금액

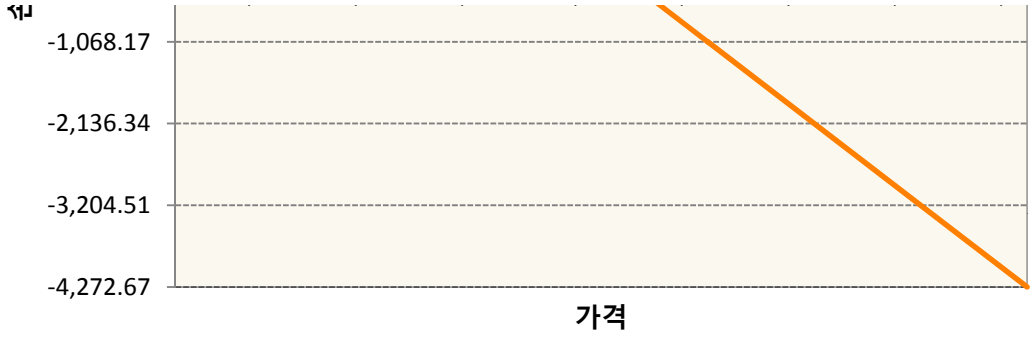
(단위:백만원)

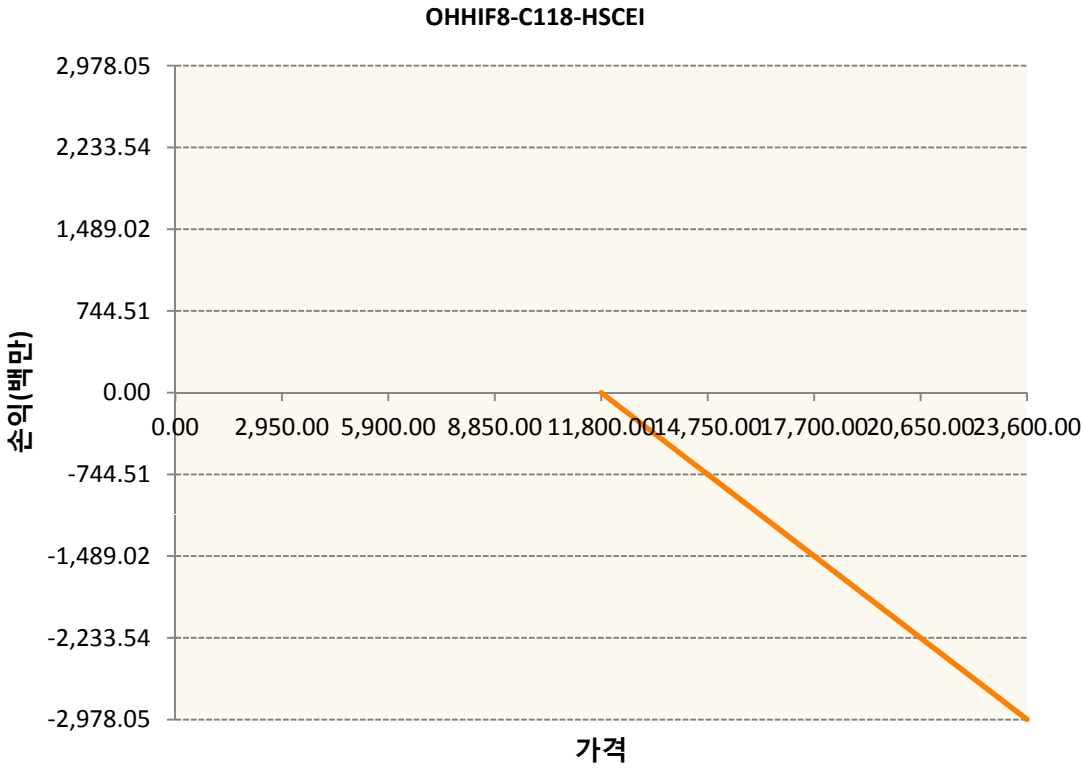
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 신규 | 유가증권 | 옵션 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 6,965 | 0 | 6,965 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션 | 0 | 14,501 | -14,501 | 장내 |

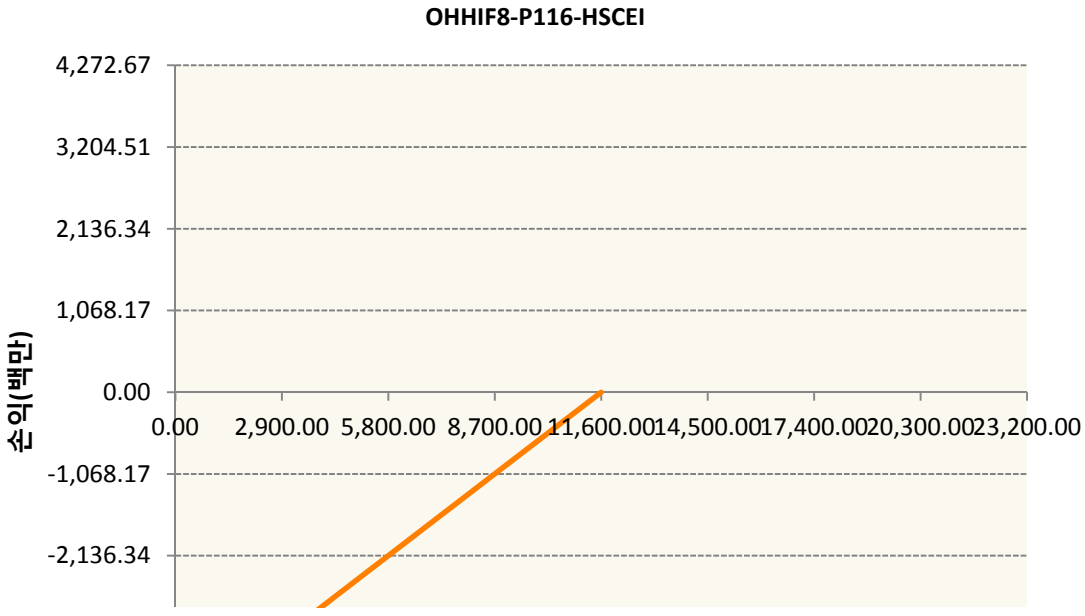
## 2. 만기시점의 손익구조

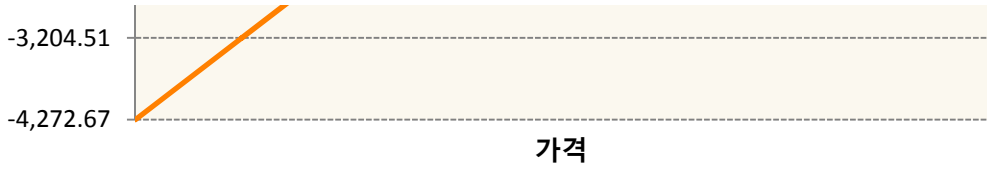


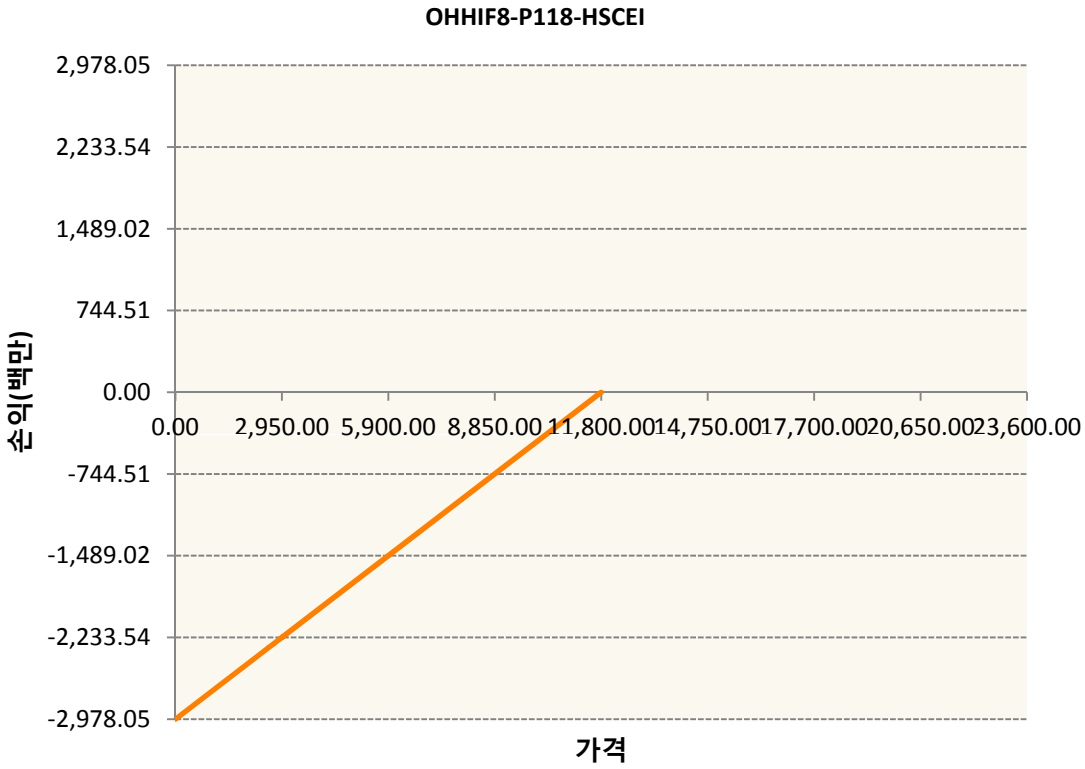




-1,068.17
-2,136.34
-3,204.51
-4,272.67
가격


OHHIF8-C118-HSCEI
2,978.05
2,233.54
1,489.02
744.51
0.00
-744.51
-1,489.02
-2,233.54
-2,978.05
0.00
2,950.00
5,900.00
8,850.00
11,800.00
14,750.00
17,700.00
20,650.00
23,600.00
손익(백만)
가격


OHHIF8-P116-HSCEI
4,272.67
3,204.51
2,136.34
1,068.17
0.00
-1,068.17
-2,136.34
0.00
2,900.00
5,800.00
8,700.00
11,600.00
14,500.00
17,400.00
20,300.00
23,200.00
손익(백만)




| 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) | | (단위:백만원) |
|---|---|---|
| HCF8 | H-SHARE IDX FUT JAN18 | 557 |
| OHHIF8-C11 | HSCEI | 342 |
| OHHIF8-C11 | HSCEI | 238 |
| OHHIF8-P11 | HSCEI | 342 |
| OHHIF8-P11 | HSCEI | 238 |

| 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) | (단위:백만원) |
|---|---|
| | **1,371** |

| | |
|---|---|
| 공시일 | 2018-01-10 |
| 기준일 | 2018-01-09 |

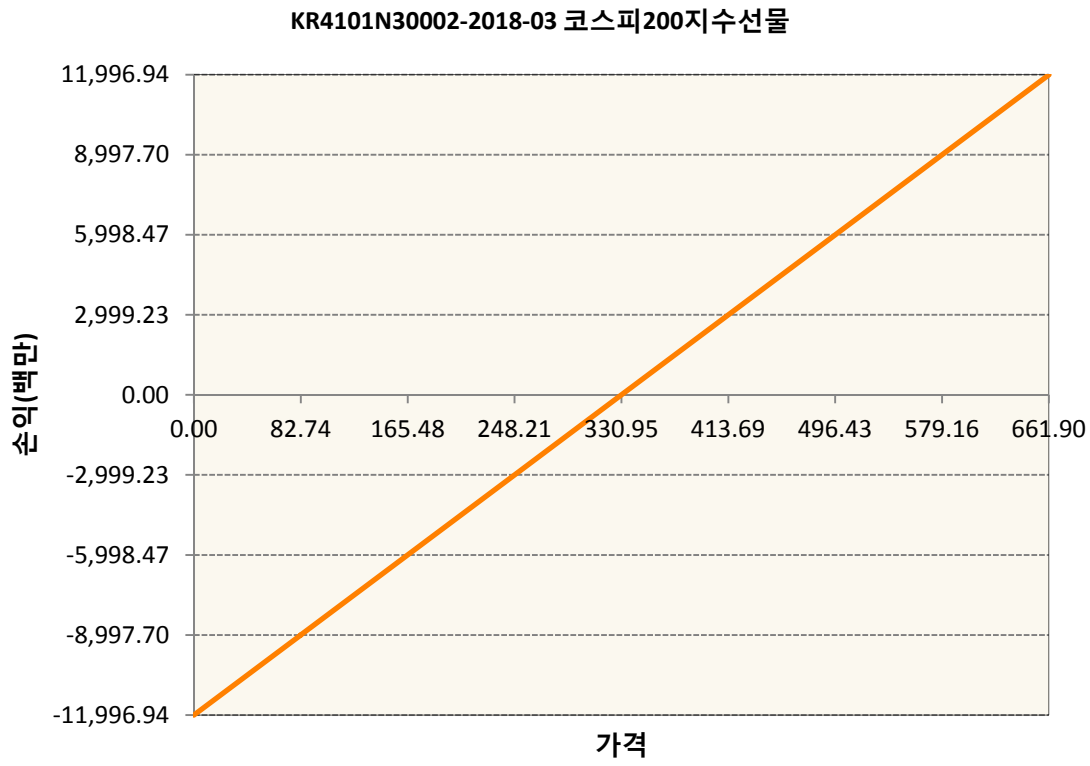
# 코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼

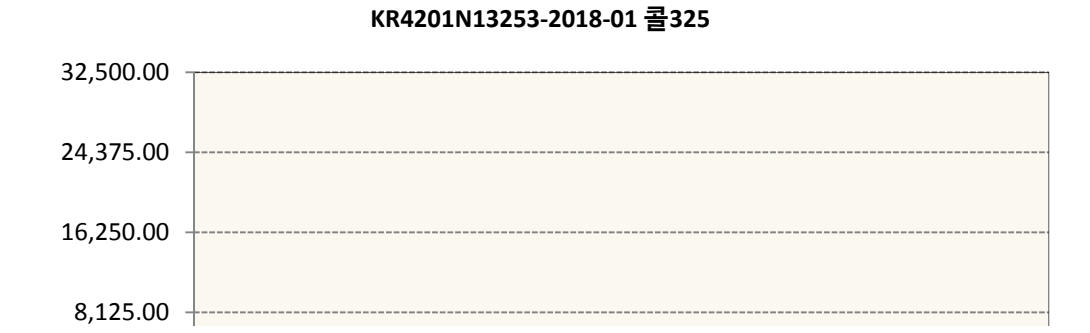
## 1. 계약금액

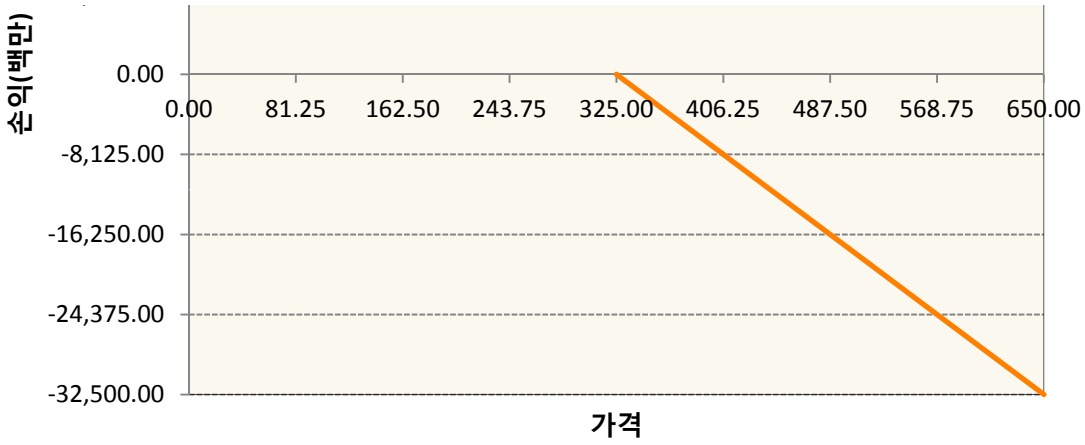
(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 신규 | 유가증권 | 스왑 | 0 | 0 | 0 | 장외 |
| 신규 | 유가증권 | 옵션 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 11,997 | 0 | 11,997 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 스왑 | 60,200 | 0 | 60,200 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션 | 0 | 59,263 | -59,263 | 장내 |

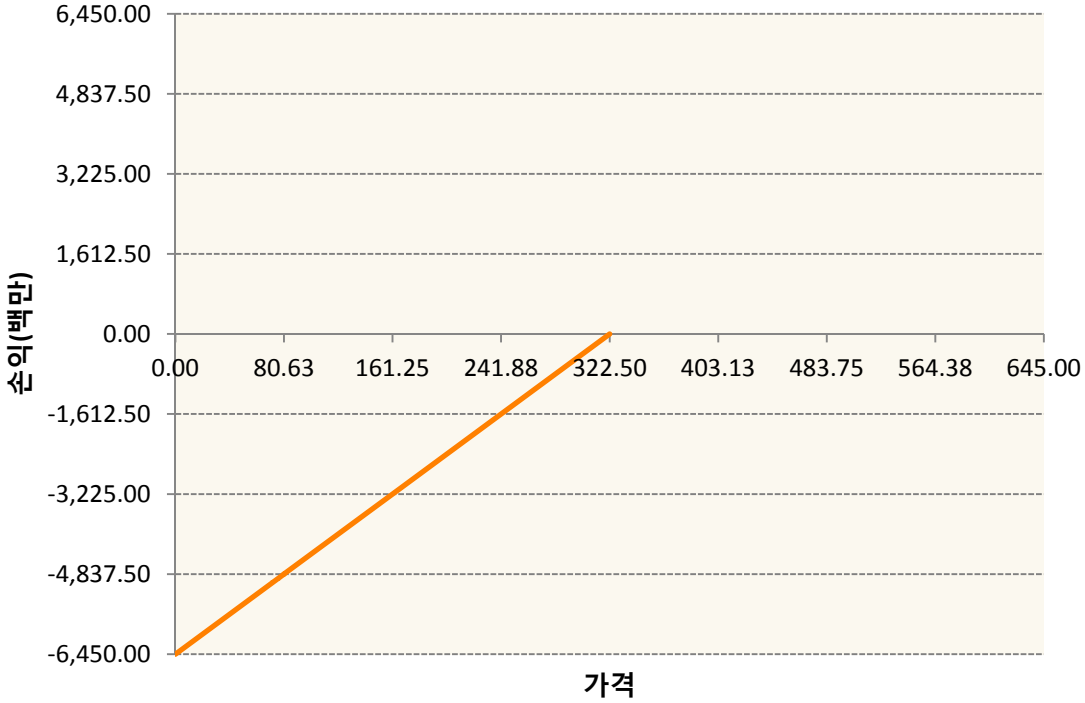
## 2. 만기시점의 손익구조



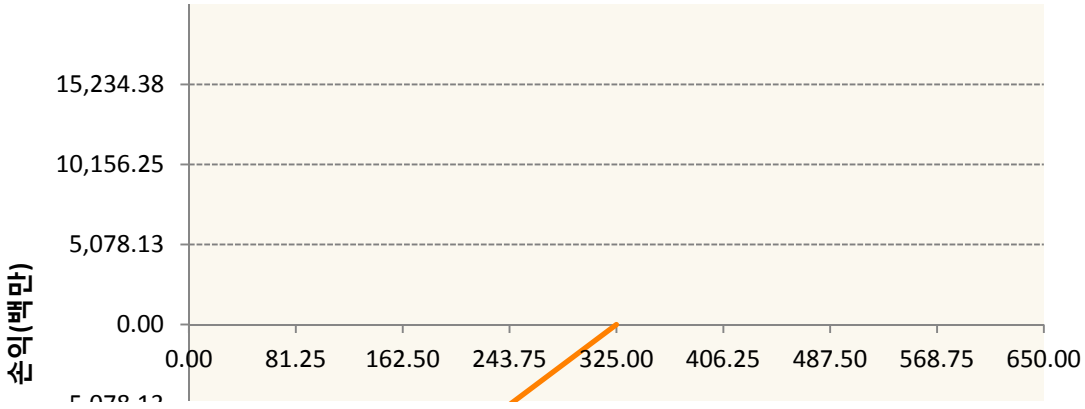






KR4301N13228-2018-01 풋322.5




KR4301N13251-2018-01 풋325






**3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)** (단위:백만원)

| 2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_2 | | | | | | | 1,448 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 기초자산의 변동성 | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | -1,448 | -1,448 | -1,448 | -1,448 | -1,448 | -1,448 | -1,448 |
| -5.33% | -966 | -966 | -966 | -966 | -966 | -966 | -966 |
| -2.67% | -483 | -483 | -483 | -483 | -483 | -483 | -483 |
| 0% | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 2.67% | 483 | 483 | 483 | 483 | 483 | 483 | 483 |
| 5.33% | 966 | 966 | 966 | 966 | 966 | 966 | 966 |
| 8.00% | 1,448 | 1,448 | 1,448 | 1,448 | 1,448 | 1,448 | 1,448 |
| 2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_3 | | | | | | | 274 |
| | 기초자산의 변동성 | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | -274 | -274 | -274 | -274 | -274 | -274 | -274 |
| -5.33% | -183 | -183 | -183 | -183 | -183 | -183 | -183 |
| -2.67% | -91 | -91 | -91 | -91 | -91 | -91 | -91 |
| 0% | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 2.67% | 91 | 91 | 91 | 91 | 91 | 91 | 91 |
| 5.33% | 183 | 183 | 183 | 183 | 183 | 183 | 183 |
| 8.00% | 274 | 274 | 274 | 274 | 274 | 274 | 274 |
| 2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_4 | | | | | | | 157 |
| | 기초자산의 변동성 | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | -157 | -157 | -157 | -157 | -157 | -157 | -157 |
| -5.33% | -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% | 157 | 157 | 157 | 157 | 157 | 157 | 157 |
| 2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_5 | | | | | | | 235 |
| | 기초자산의 변동성 | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |

| | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| -8.00% | -235 | -235 | -235 | -235 | -235 | -235 | -235 |
| -5.33% | -157 | -157 | -157 | -157 | -157 | -157 | -157 |
| -2.67% | -78 | -78 | -78 | -78 | -78 | -78 | -78 |
| 0% | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 2.67% | 78 | 78 | 78 | 78 | 78 | 78 | 78 |
| 5.33% | 157 | 157 | 157 | 157 | 157 | 157 | 157 |
| 8.00% | 235 | 235 | 235 | 235 | 235 | 235 | 235 |
| | 2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_6 | | | | | | 196 |
| | 기초자산의 변동성 | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | -196 | -196 | -196 | -196 | -196 | -196 | -196 |
| -5.33% | -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% | 196 | 196 | 196 | 196 | 196 | 196 | 196 |
| | 2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_7 | | | | | | 251 |
| | 기초자산의 변동성 | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | -251 | -251 | -251 | -251 | -251 | -251 | -251 |
| -5.33% | -167 | -167 | -167 | -167 | -167 | -167 | -167 |
| -2.67% | -84 | -84 | -84 | -84 | -84 | -84 | -84 |
| 0% | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 2.67% | 84 | 84 | 84 | 84 | 84 | 84 | 84 |
| 5.33% | 167 | 167 | 167 | 167 | 167 | 167 | 167 |
| 8.00% | 251 | 251 | 251 | 251 | 251 | 251 | 251 |
| | 2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_8 | | | | | | 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_9 | | | | | | 309 |
| | 기초자산의 변동성 | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | -309 | -309 | -309 | -309 | -309 | -309 | -309 |
| -5.33% | -206 | -206 | -206 | -206 | -206 | -206 | -206 |
| -2.67% | -103 | -103 | -103 | -103 | -103 | -103 | -103 |
| 0% | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |

| | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 2.67% | 103 | 103 | 103 | 103 | 103 | 103 | 103 |
| 5.33% | 206 | 206 | 206 | 206 | 206 | 206 | 206 |
| 8.00% | 309 | 309 | 309 | 309 | 309 | 309 | 309 |
| | 2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_10 | | | | | | 274 |
| | 기초자산의 변동성 | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | -274 | -274 | -274 | -274 | -274 | -274 | -274 |
| -5.33% | -183 | -183 | -183 | -183 | -183 | -183 | -183 |
| -2.67% | -91 | -91 | -91 | -91 | -91 | -91 | -91 |
| 0% | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 2.67% | 91 | 91 | 91 | 91 | 91 | 91 | 91 |
| 5.33% | 183 | 183 | 183 | 183 | 183 | 183 | 183 |
| 8.00% | 274 | 274 | 274 | 274 | 274 | 274 | 274 |
| | 2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_11 | | | | | | 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% | -418 | -418 | -418 | -418 | -418 | -418 | -418 |
| -2.67% | -209 | -209 | -209 | -209 | -209 | -209 | -209 |
| 0% | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 2.67% | 209 | 209 | 209 | 209 | 209 | 209 | 209 |
| 5.33% | 418 | 418 | 418 | 418 | 418 | 418 | 418 |
| 8.00% | 626 | 626 | 626 | 626 | 626 | 626 | 626 |
| | 2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_12 | | | | | | 470 |
| | 기초자산의 변동성 | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | -470 | -470 | -470 | -470 | -470 | -470 | -470 |
| -5.33% | -313 | -313 | -313 | -313 | -313 | -313 | -313 |
| -2.67% | -157 | -157 | -157 | -157 | -157 | -157 | -157 |
| 0% | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 2.67% | 157 | 157 | 157 | 157 | 157 | 157 | 157 |
| 5.33% | 313 | 313 | 313 | 313 | 313 | 313 | 313 |
| 8.00% | 470 | 470 | 470 | 470 | 470 | 470 | 470 |
| | KR4101N30( 2018-03 코스피200지수선물 | | | | | | 958 |
| | 기초자산의 변동성 | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | -958 | -958 | -958 | -958 | -958 | -958 | -958 |
| -5.33% | -638 | -638 | -638 | -638 | -638 | -638 | -638 |
| -2.67% | -319 | -319 | -319 | -319 | -319 | -319 | -319 |
| 0% | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 2.67% | 319 | 319 | 319 | 319 | 319 | 319 | 319 |
| 5.33% | 638 | 638 | 638 | 638 | 638 | 638 | 638 |
| 8.00% | 958 | 958 | 958 | 958 | 958 | 958 | 958 |
| | KR4201N13: 2018-01 콜325 | | | | | | 2,579 |

| | 기초자산의 변동성 | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | 589 | 589 | 589 | 589 | 589 | 589 | 589 |
| -5.33% | 589 | 589 | 588 | 586 | 583 | 580 | 576 |
| -2.67% | 536 | 521 | 505 | 489 | 473 | 455 | 438 |
| 0% | 36 | 25 | 13 | 0 | -14 | -29 | -44 |
| 2.67% | -818 | -818 | -819 | -820 | -822 | -824 | -827 |
| 5.33% | -1,698 | -1,698 | -1,698 | -1,699 | -1,699 | -1,699 | -1,699 |
| 8.00% | -2,579 | -2,579 | -2,579 | -2,579 | -2,579 | -2,579 | -2,579 |
| | KR4301N132 2018-01 풋322.5 | | | | | | 373 |

| | 기초자산의 변동성 | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | -373 | -373 | -373 | -373 | -373 | -373 | -373 |
| -5.33% | -197 | -197 | -197 | -197 | -197 | -197 | -197 |
| -2.67% | -30 | -32 | -33 | -35 | -37 | -39 | -41 |
| 0% | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 2.67% | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 5.33% | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 8.00% | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| | KR4301N132 2018-01 풋325 | | | | | | 1,319 |

| | 기초자산의 변동성 | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | -1,319 | -1,319 | -1,319 | -1,319 | -1,319 | -1,319 | -1,319 |
| -5.33% | -769 | -769 | -769 | -769 | -769 | -769 | -769 |
| -2.67% | -221 | -223 | -226 | -229 | -232 | -235 | -239 |
| 0% | 3 | 2 | 1 | 0 | -2 | -3 | -6 |
| 2.67% | 3 | 3 | 3 | 3 | 3 | 3 | 3 |
| 5.33% | 3 | 3 | 3 | 3 | 3 | 3 | 3 |
| 8.00% | 3 | 3 | 3 | 3 | 3 | 3 | 3 |

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

| |
|---|
| **10,340** |

| 공시일 | 2018-01-10 |
|---|---|
| 기준일 | 2018-01-09 |

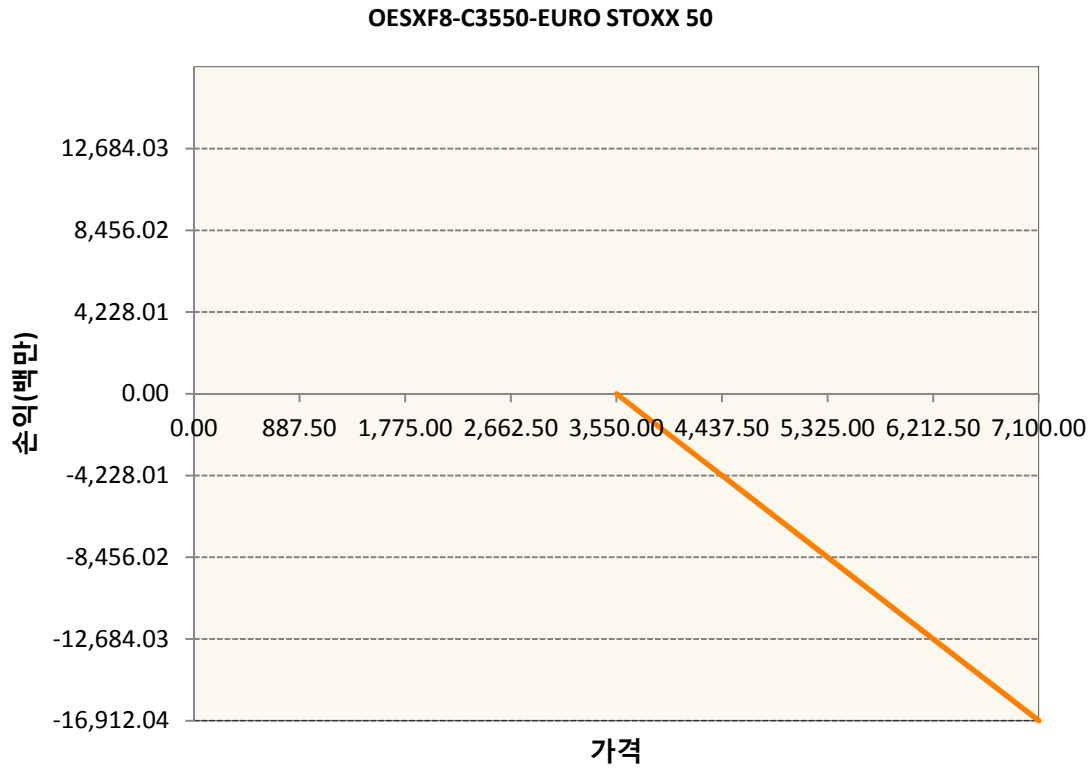
# 유로커버드콜모(주식혼합-파생형

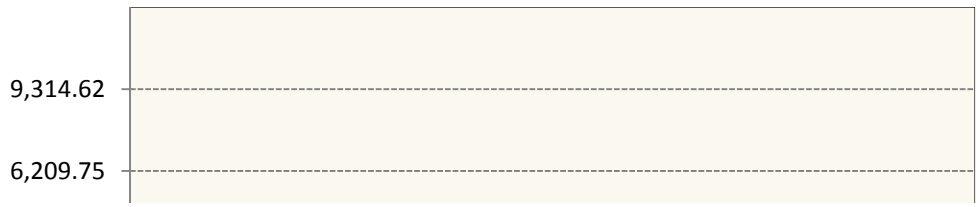
## 1. 계약금액

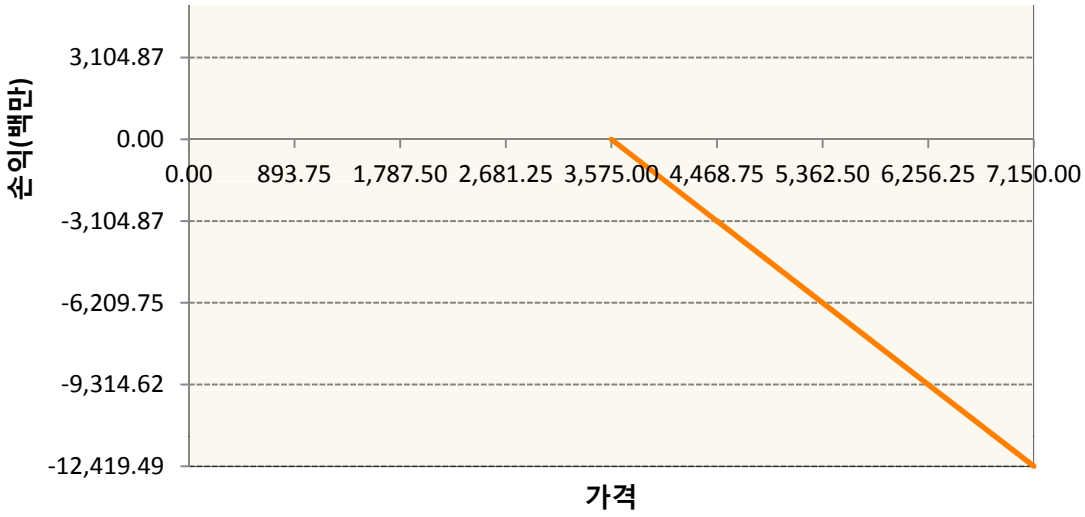
(단위:백만원)

| 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 | 21,428 | 0 | 21,428 | |
| 누계 | 유가증권 | 스왑 | 95,787 | 0 | 95,787 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션 | 0 | 58,663 | -58,663 | 장내 |
| 누계 | 지수 | 스왑 | 51,087 | 0 | 51,087 | 장외 |

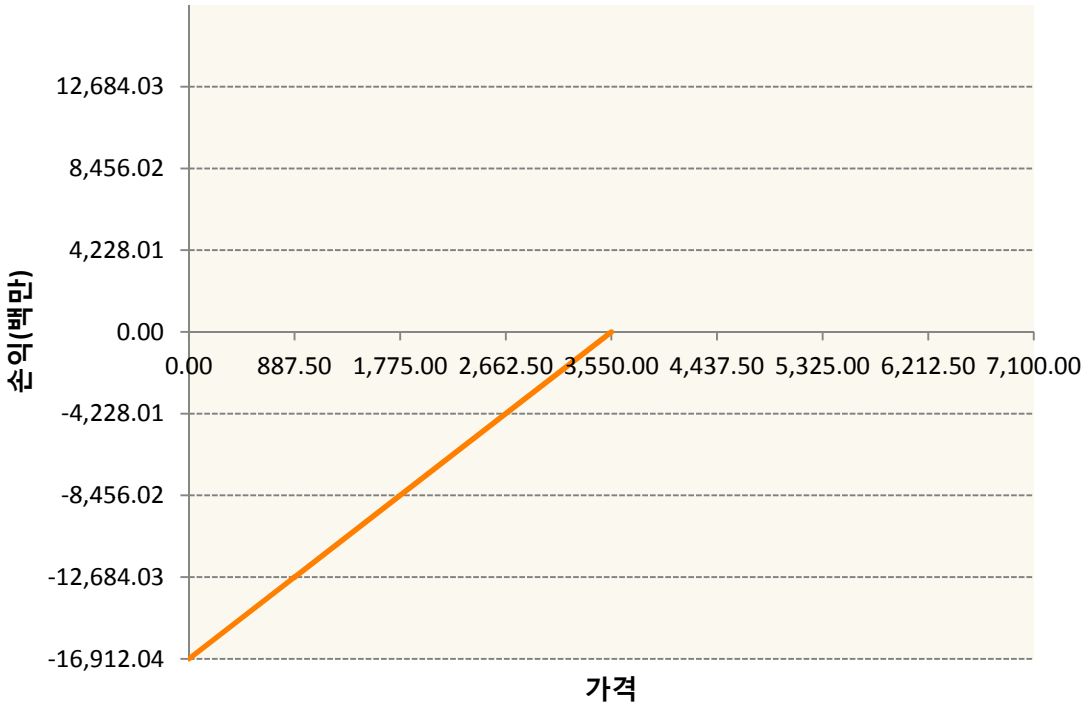
## 2. 만기시점의 손익구조



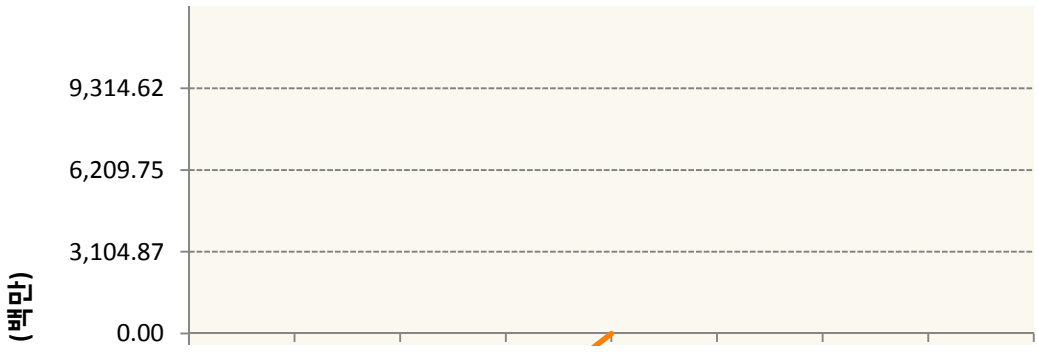



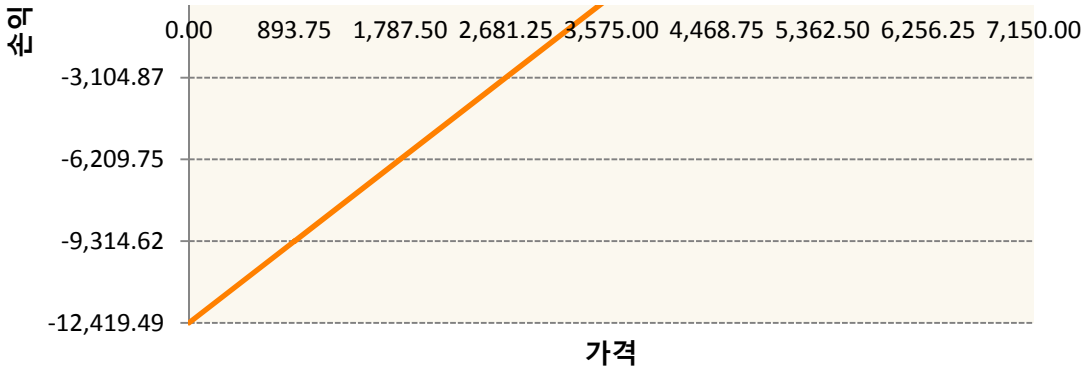


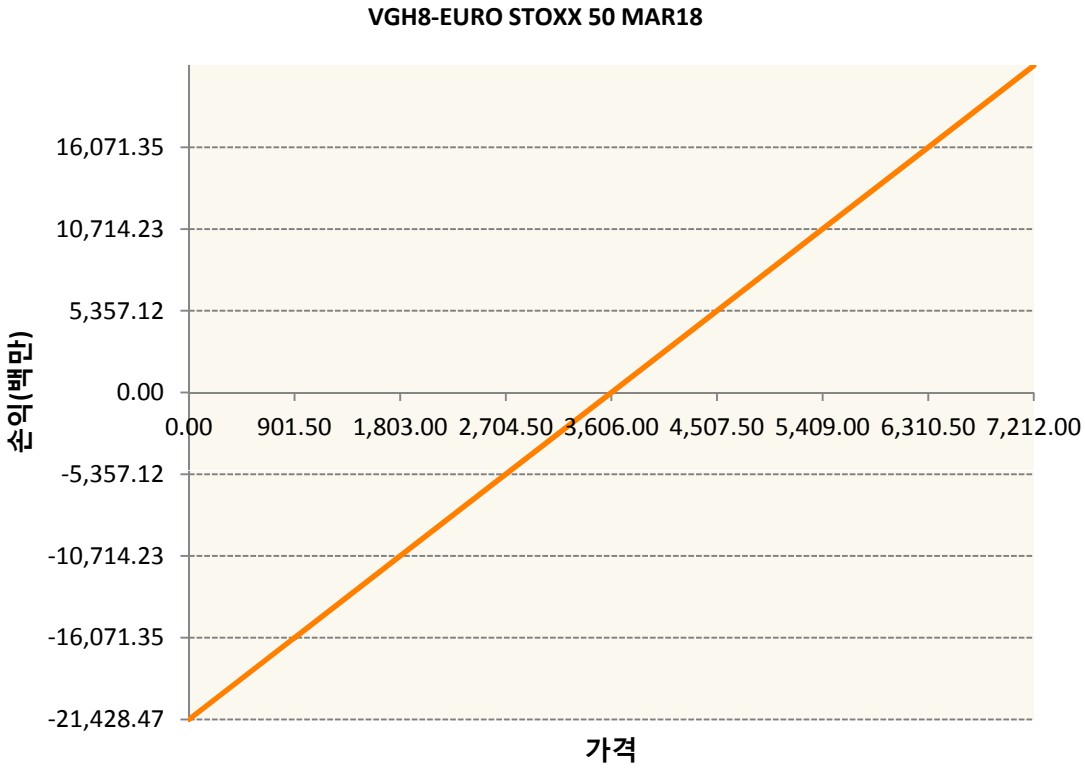

OESXF8-P3550-EURO STOXX 50




OESXF8-P3575-EURO STOXX 50






| 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) | (단위:백만원) |
|---|---|
| 260105SGPX SG EURO Covered CALL STRATEGY - 994.569 | 100 |
| 260105SQPX SG EURO Covered CALL STRATEGY | 145 |
| OESXF8-C35 EURO STOXX 50 | 1,353 |
| OESXF8-C35 EURO STOXX 50 | 994 |
| OESXF8-P35 EURO STOXX 50 | 1,353 |
| OESXF8-P35 EURO STOXX 50 | 994 |
| VGH8 EURO STOXX 50 MAR18 | 1,714 |

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

| |
|---|
| **3,753** |

| 공시일 | 2018-01-10 |
|---|---|
| 기준일 | 2018-01-09 |

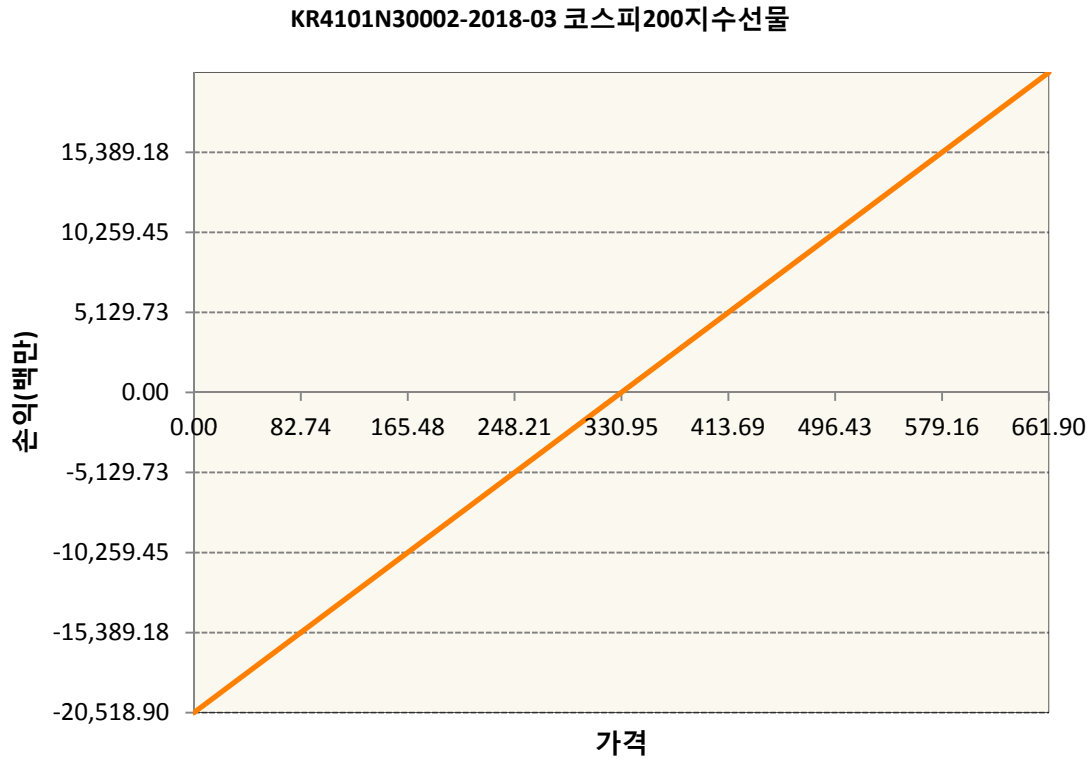
# ETF스마트레버리지목표전환형8호

## 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 | 20,519 | 0 | 20,519 | 장내 |

## 2. 만기시점의 손익구조




## 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| KR4101N30( 2018-03 코스피200지수선물 | | | | | | | 1,638 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 기초자산의 변동성 | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | -1,638 | -1,638 | -1,638 | -1,638 | -1,638 | -1,638 | -1,638 |
| -5.33% | -1,092 | -1,092 | -1,092 | -1,092 | -1,092 | -1,092 | -1,092 |
| -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% | 1,092 | 1,092 | 1,092 | 1,092 | 1,092 | 1,092 | 1,092 |
| 8.00% | 1,638 | 1,638 | 1,638 | 1,638 | 1,638 | 1,638 | 1,638 |

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

| |
|---|
| **980** |

| | |
|---|---|
| 공시일 | 2018-01-10 |
| 기준일 | 2018-01-09 |

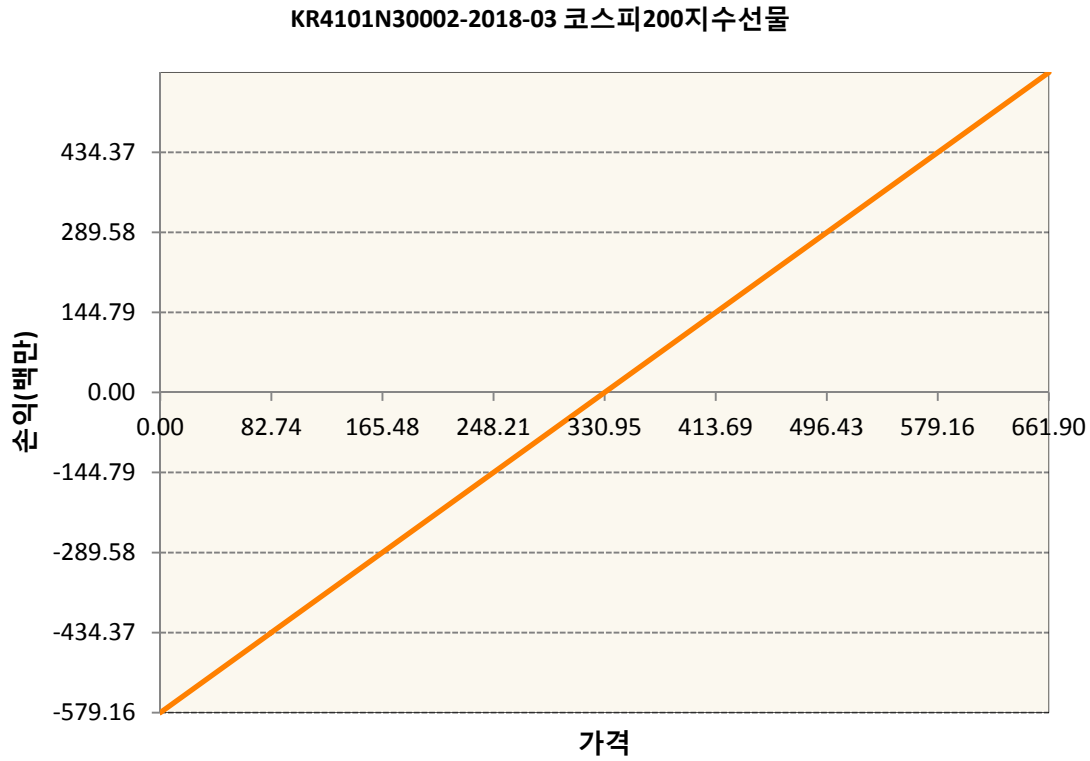
# ETF스마트레버리지목표전환형9호

## 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 | 579 | 0 | 579 | 장내 |

## 2. 만기시점의 손익구조




## 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| KR4101N30( 2018-03 코스피200지수선물 | | | | | | | 46 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 기초자산의 변동성 | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | -46 | -46 | -46 | -46 | -46 | -46 | -46 |
| -5.33% | -31 | -31 | -31 | -31 | -31 | -31 | -31 |
| -2.67% | -15 | -15 | -15 | -15 | -15 | -15 | -15 |
| 0% | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 2.67% | 15 | 15 | 15 | 15 | 15 | 15 | 15 |
| 5.33% | 31 | 31 | 31 | 31 | 31 | 31 | 31 |
| 8.00% | 46 | 46 | 46 | 46 | 46 | 46 | 46 |

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

| 28 |
|---|

| 공시일 | 2018-01-10 |
|---|---|
| 기준일 | 2018-01-09 |

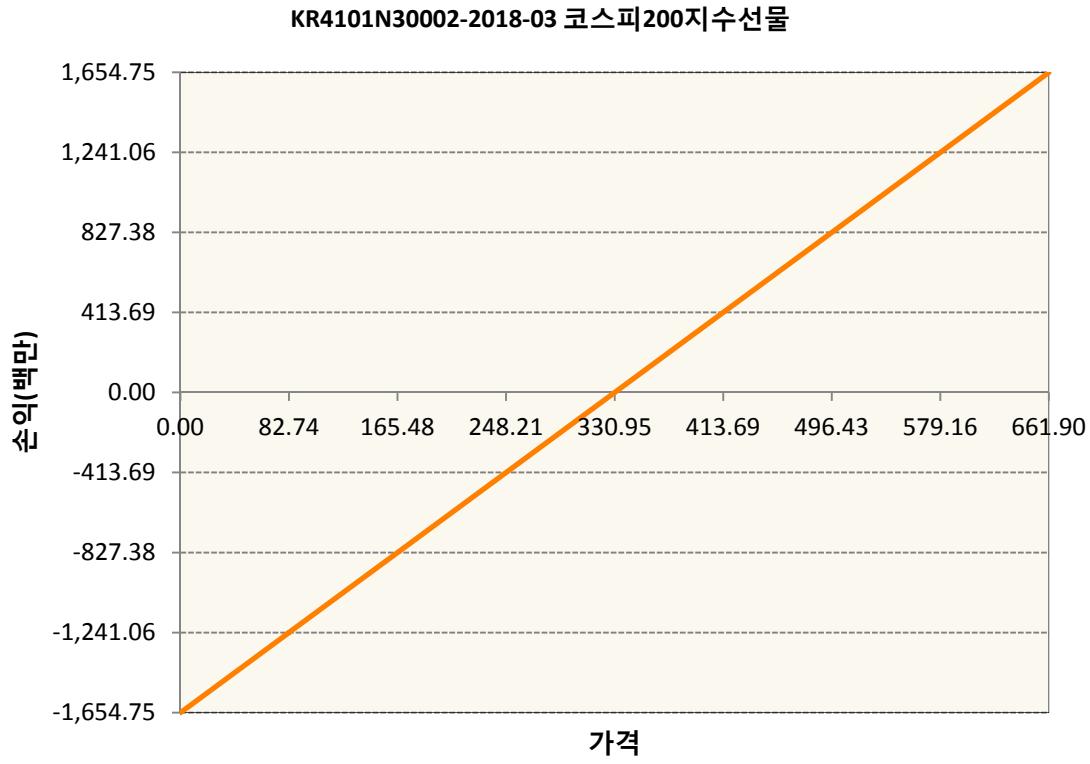
# ETF스마트레버리지목표전환형10

## 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 | 1,655 | 0 | 1,655 | 장내 |

## 2. 만기시점의 손익구조




## 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| KR4101N30( 2018-03 코스피200지수선물 | | | | | | | 132 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 기초자산의 변동성 | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | -132 | -132 | -132 | -132 | -132 | -132 | -132 |
| -5.33% | -88 | -88 | -88 | -88 | -88 | -88 | -88 |
| -2.67% | -44 | -44 | -44 | -44 | -44 | -44 | -44 |
| 0% | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 2.67% | 44 | 44 | 44 | 44 | 44 | 44 | 44 |
| 5.33% | 88 | 88 | 88 | 88 | 88 | 88 | 88 |
| 8.00% | 132 | 132 | 132 | 132 | 132 | 132 | 132 |

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

| 79 |
|---|

| | |
|---|---|
| 공시일 | 2018-01-10 |
| 기준일 | 2018-01-09 |

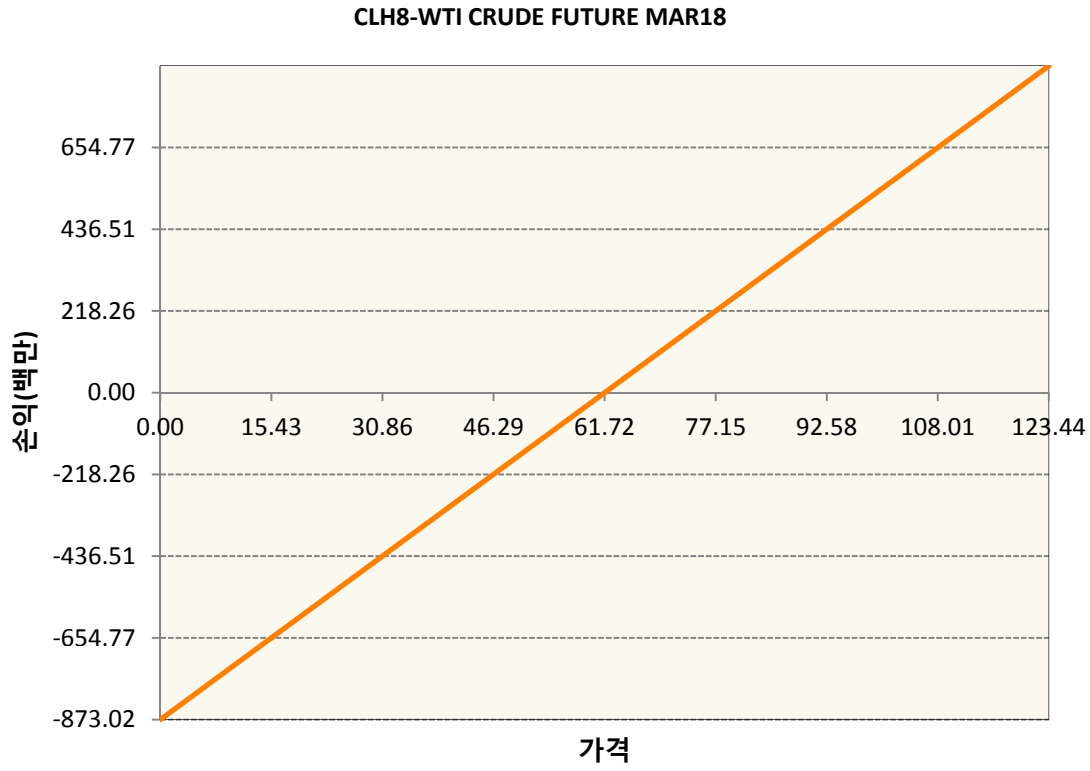
# 에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

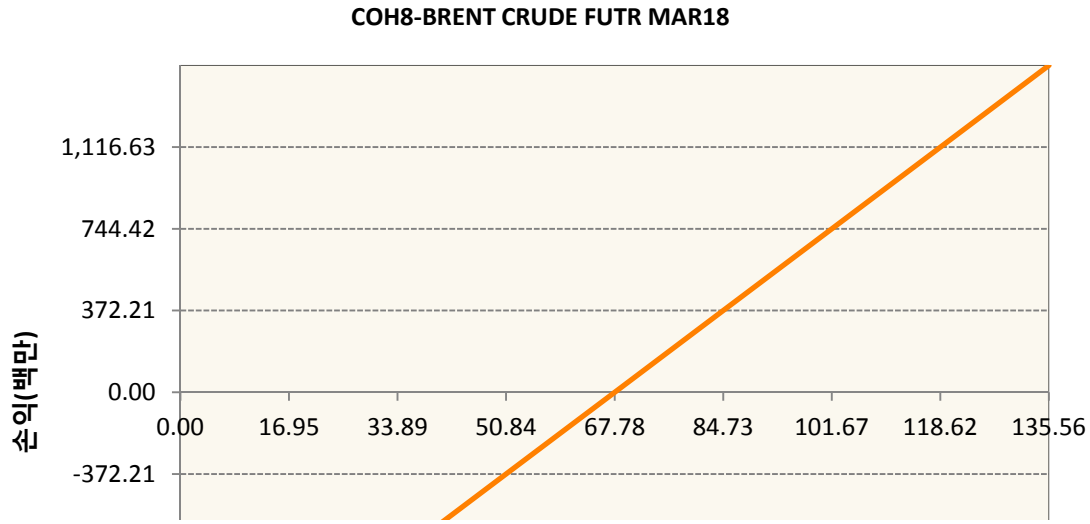
## 1. 계약금액

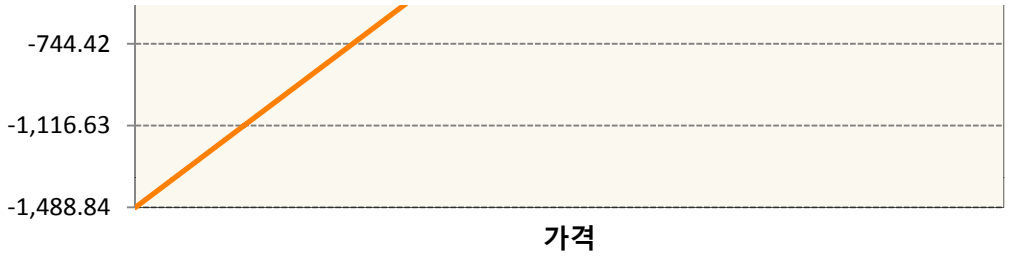
(단위:백만원)

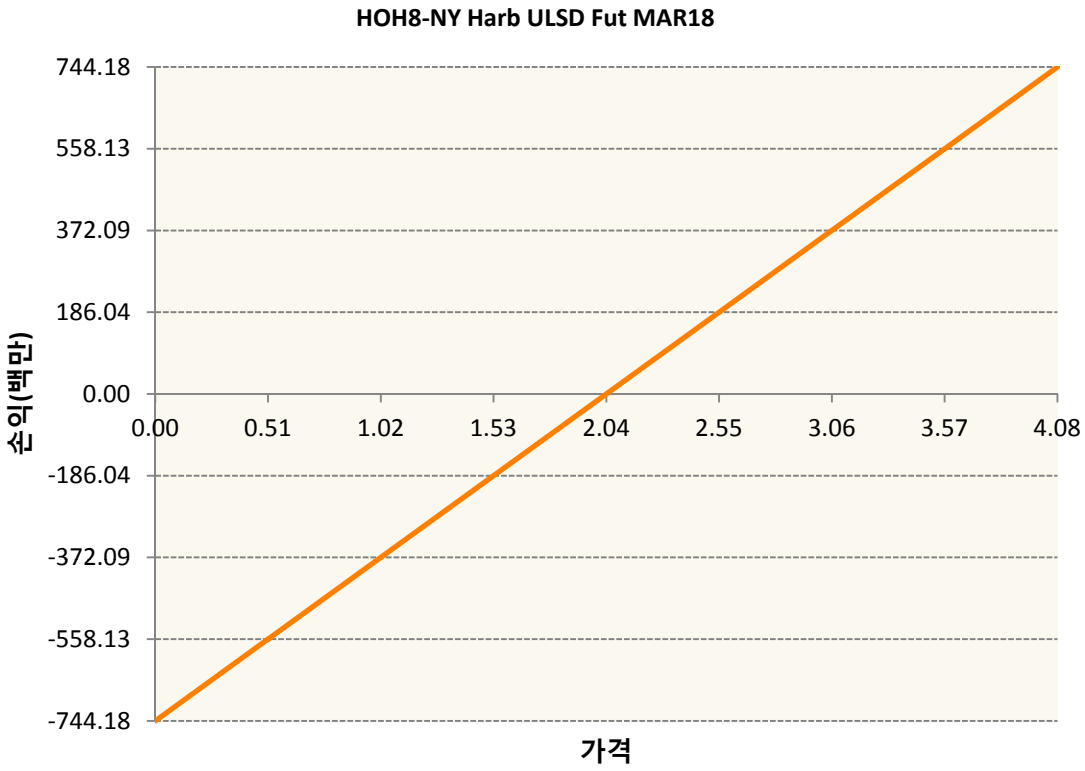
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 4,705 | 854 | 3,852 | |

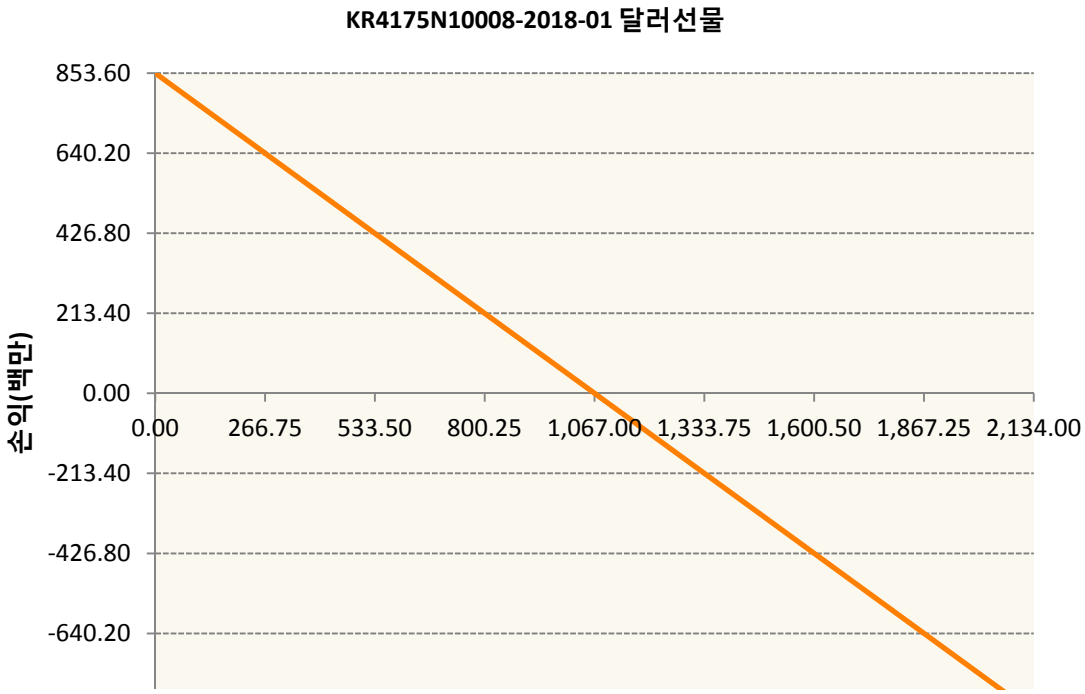
## 2. 만기시점의 손익구조

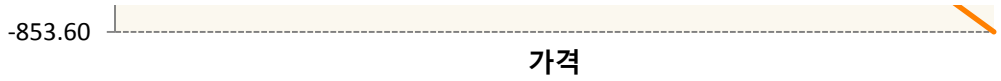


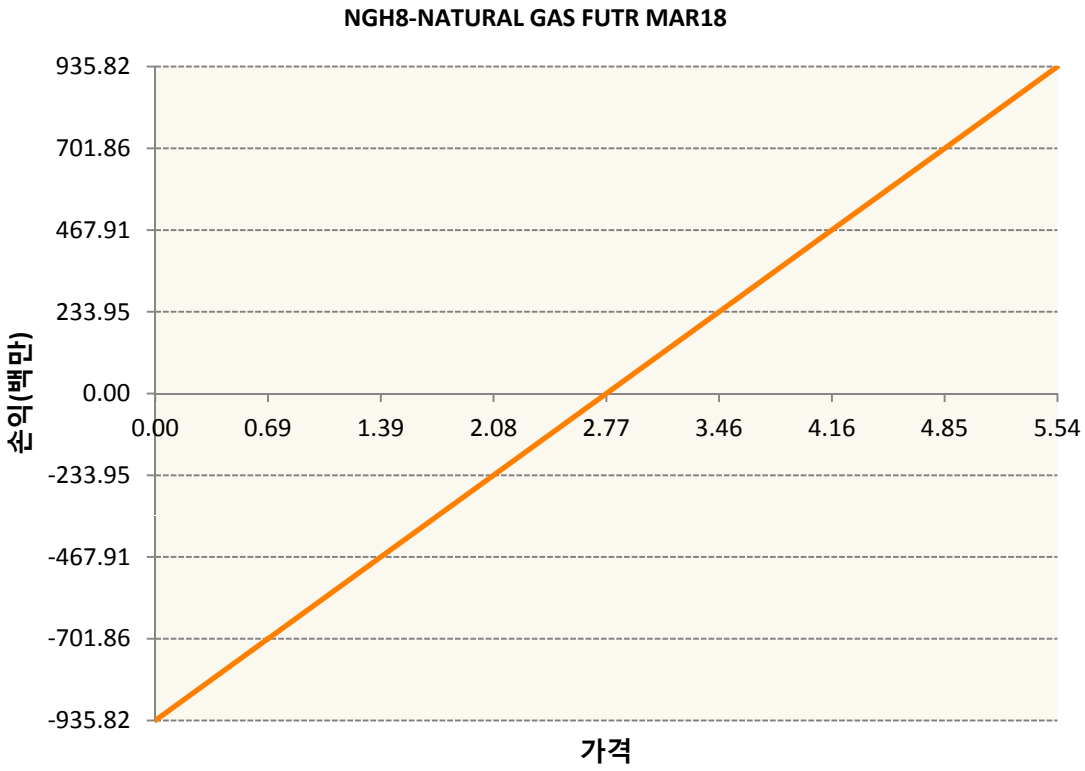



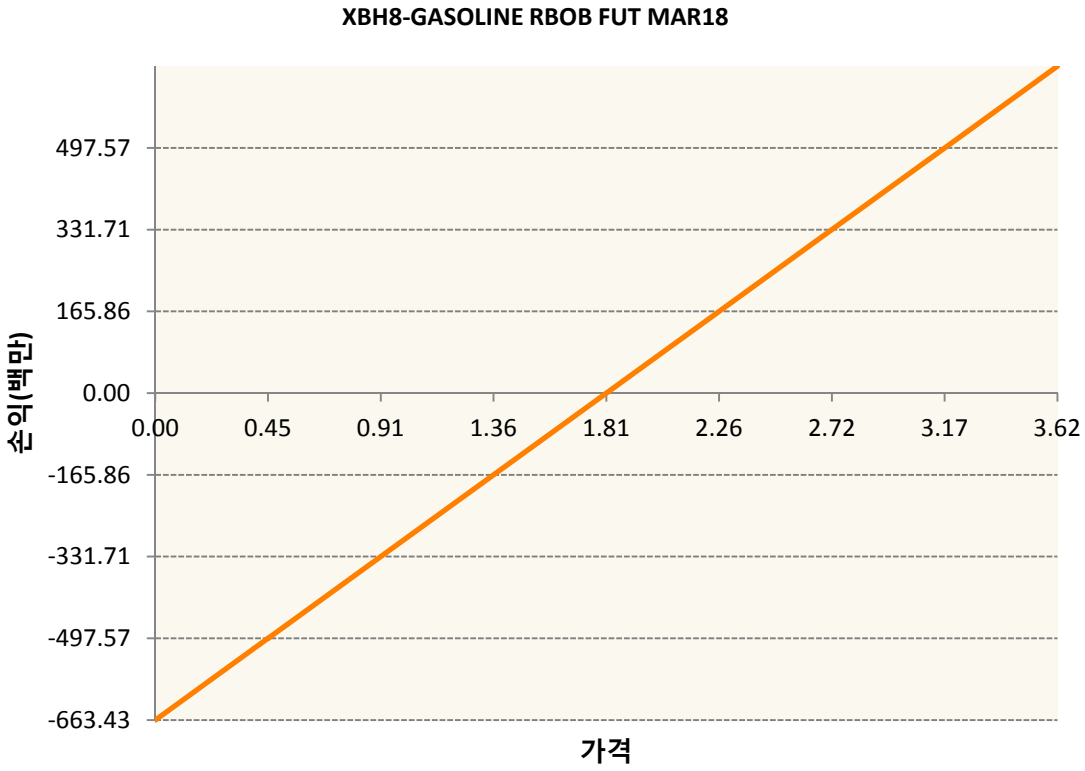

-744.42
-1,116.63
-1,488.84
가격


HOH8-NY Harb ULSD Fut MAR18
744.18
558.13
372.09
186.04
0.00
-186.04
-372.09
-558.13
-744.18
0.00
0.51
1.02
1.53
2.04
2.55
3.06
3.57
4.08
손익(백만)
가격


KR4175N10008-2018-01 달러선물
853.60
640.20
426.80
213.40
0.00
-213.40
-426.80
-640.20
0.00
266.75
533.50
800.25
1,067.00
1,333.75
1,600.50
1,867.25
2,134.00
손익(백만)


-853.60
가격


NGH8-NATURAL GAS FUTR MAR18
935.82
701.86
467.91
233.95
0.00
-233.95
-467.91
-701.86
-935.82
손익(백만)
0.00
0.69
1.39
2.08
2.77
3.46
4.16
4.85
5.54
가격


XBH8-GASOLINE RBOB FUT MAR18
497.57
331.71
165.86
0.00
-165.86
-331.71
-497.57
-663.43
손익(백만)
0.00
0.45
0.91
1.36
1.81
2.26
2.72
3.17
3.62
가격

**3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)** (단위:백만원)

| | | |
|---|---|---|
| CLH8 | WTI CRUDE FUTURE MAR18 | 70 |
| COH8 | BRENT CRUDE FUTR MAR18 | 119 |
| HOH8 | NY Harb ULSD Fut MAR18 | 60 |
| KR4175N10( | 2018-01 달러선물 | 68 |
| NGH8 | NATURAL GAS FUTR MAR18 | 75 |
| XBH8 | GASOLINE RBOB FUT MAR18 | 53 |

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

| |
|---|
| **620** |

| | |
|---|---|
| 공시일 | 2018-01-10 |
| 기준일 | 2018-01-09 |

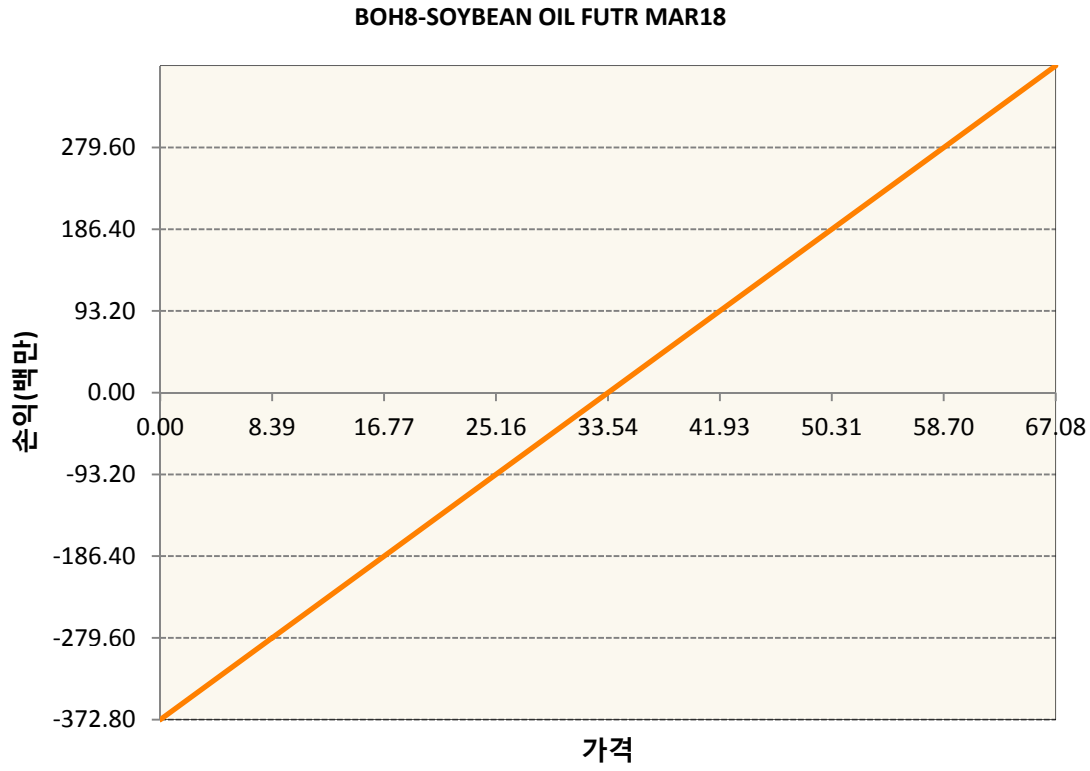
# 애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

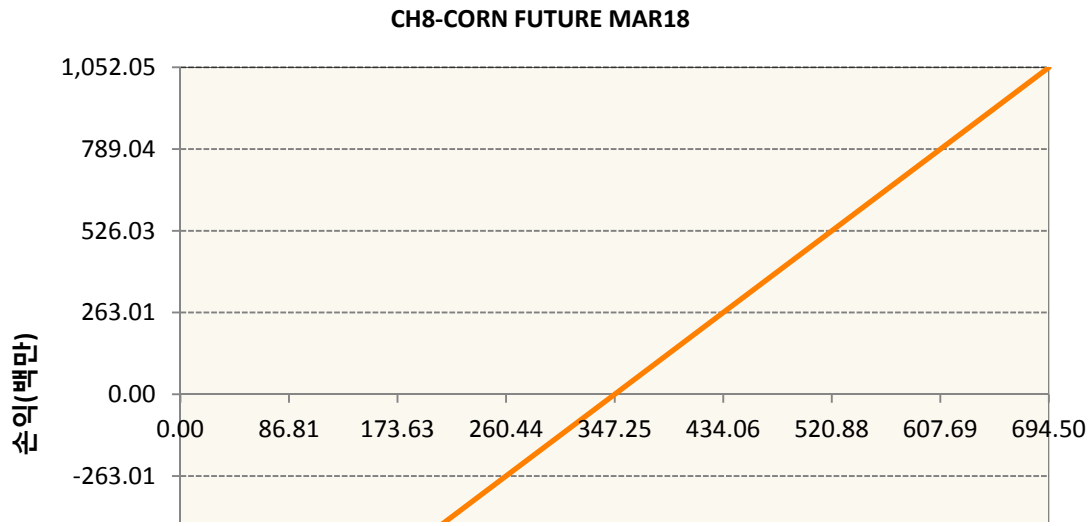
## 1. 계약금액

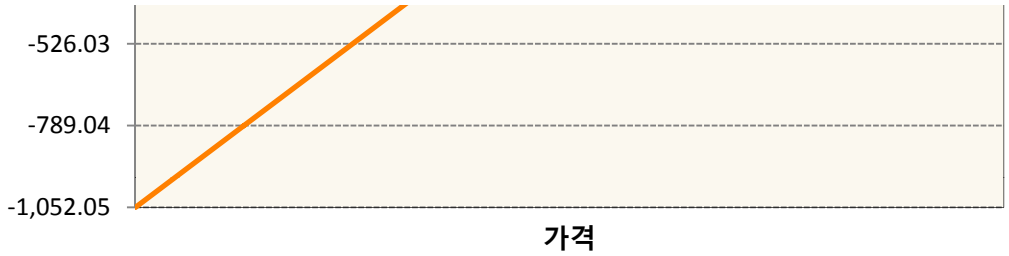
(단위:백만원)

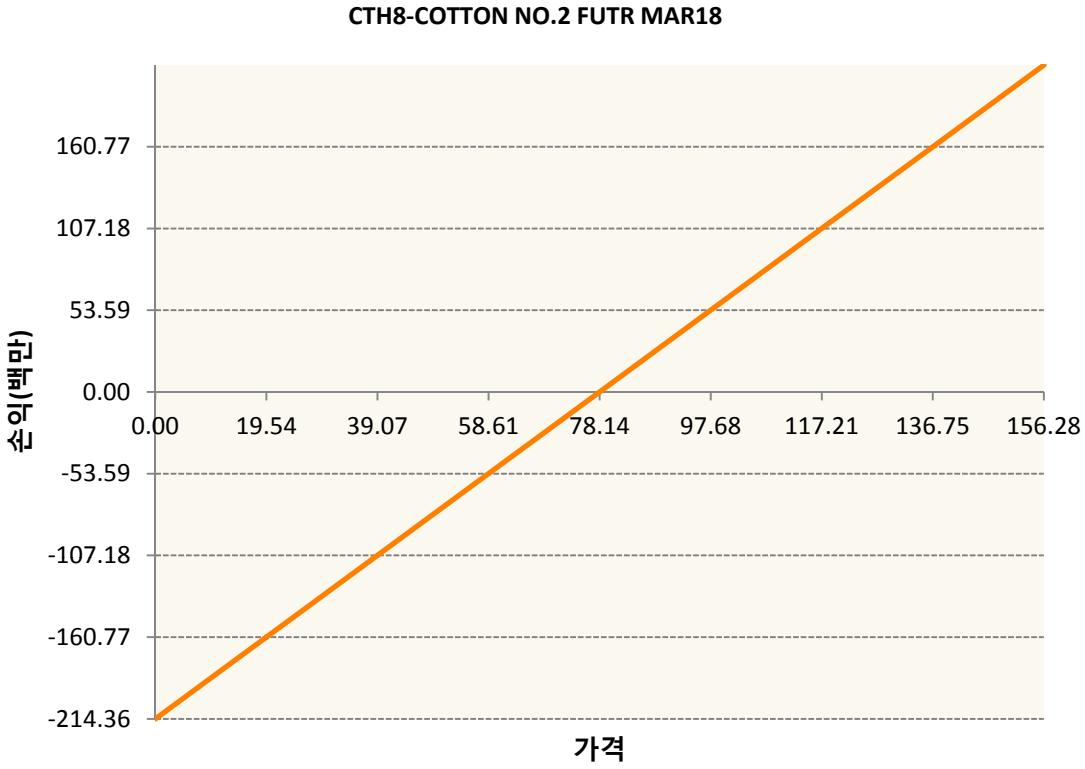
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 4,250 | 320 | 3,929 | |

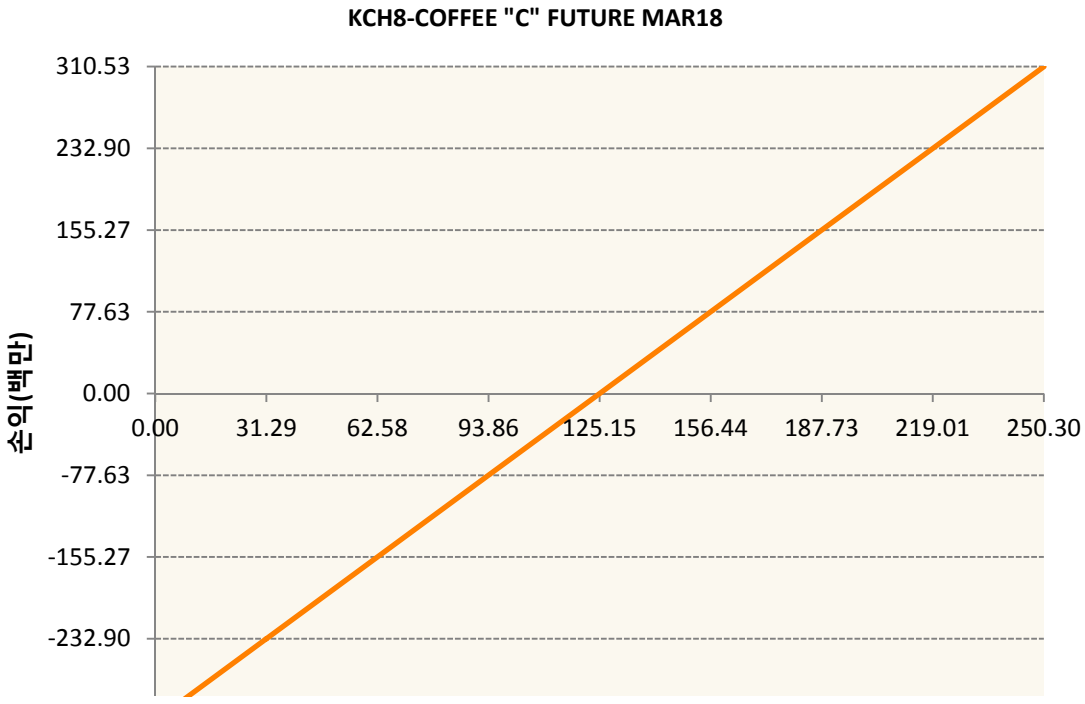
## 2. 만기시점의 손익구조

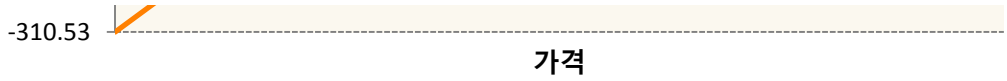


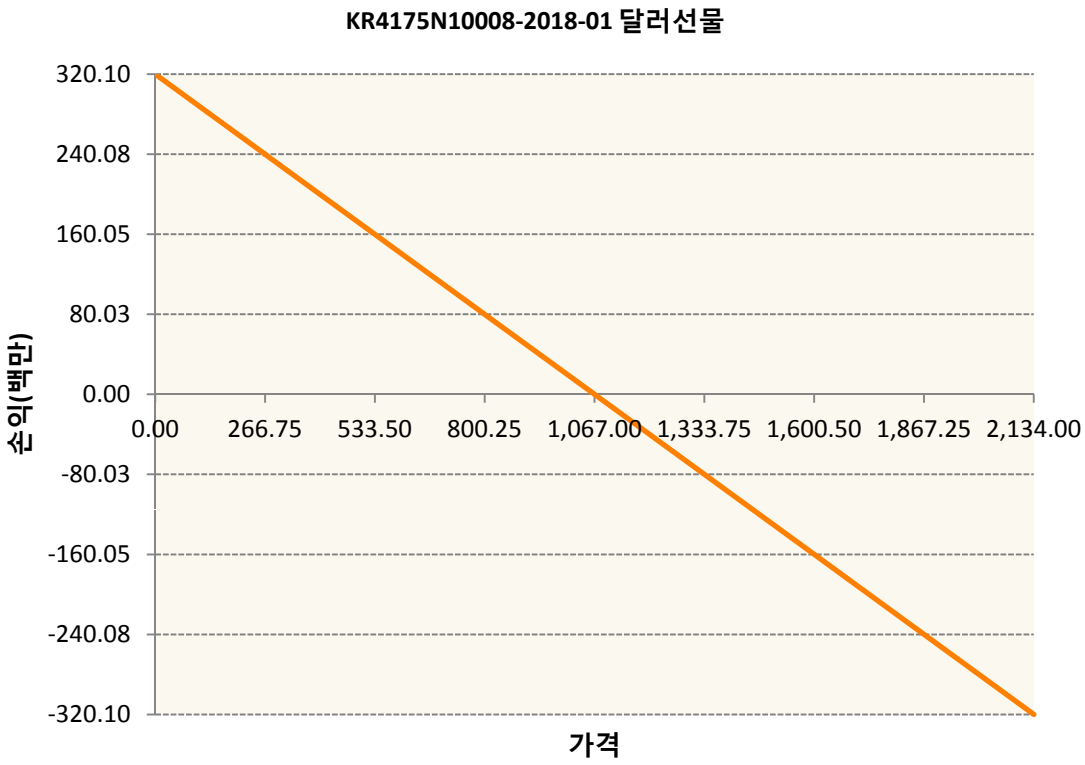



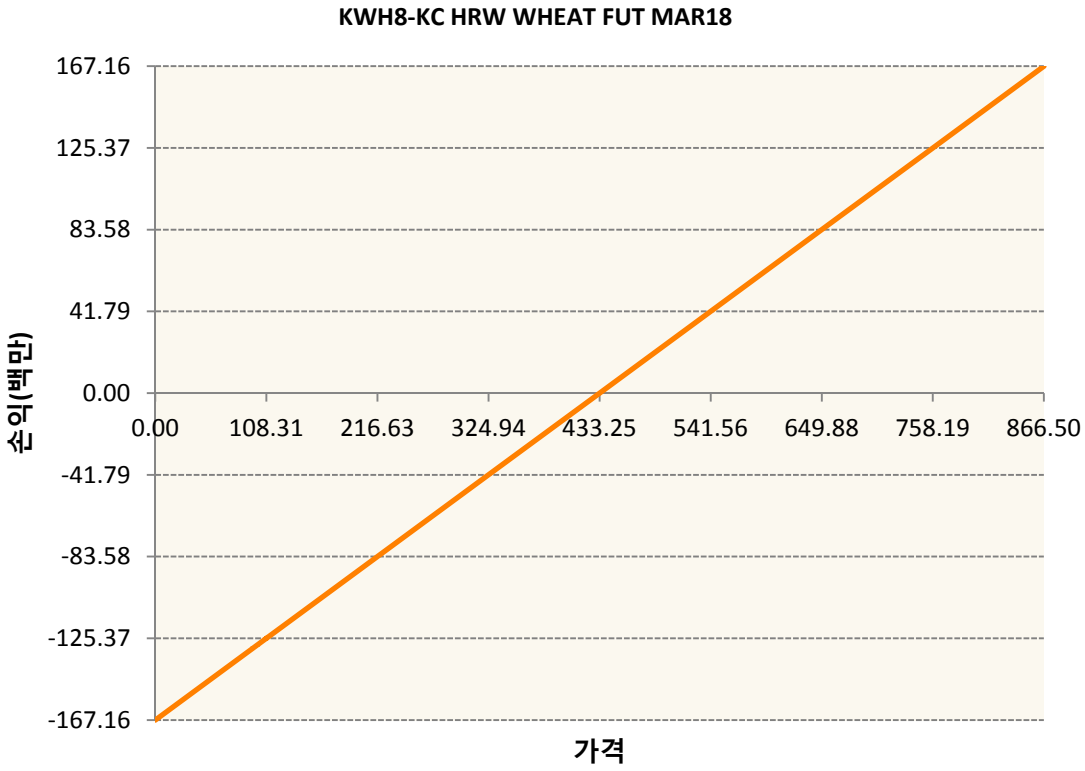

-526.03
-789.04
-1,052.05
가격


CTH8-COTTON NO.2 FUTR MAR18
160.77
107.18
53.59
0.00
-53.59
-107.18
-160.77
-214.36
0.00
19.54
39.07
58.61
78.14
97.68
117.21
136.75
156.28
손익(백만)
가격

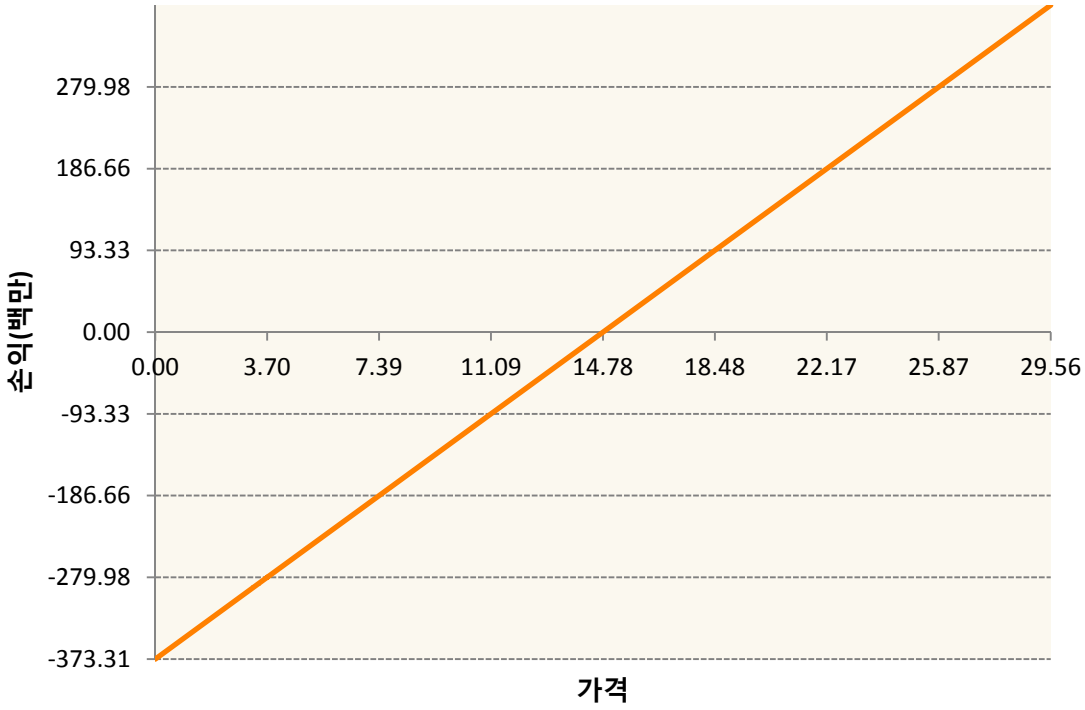

KCH8-COFFEE "C" FUTURE MAR18
310.53
232.90
155.27
77.63
0.00
-77.63
-155.27
-232.90
0.00
31.29
62.58
93.86
125.15
156.44
187.73
219.01
250.30
손익(백만)


-310.53
가격

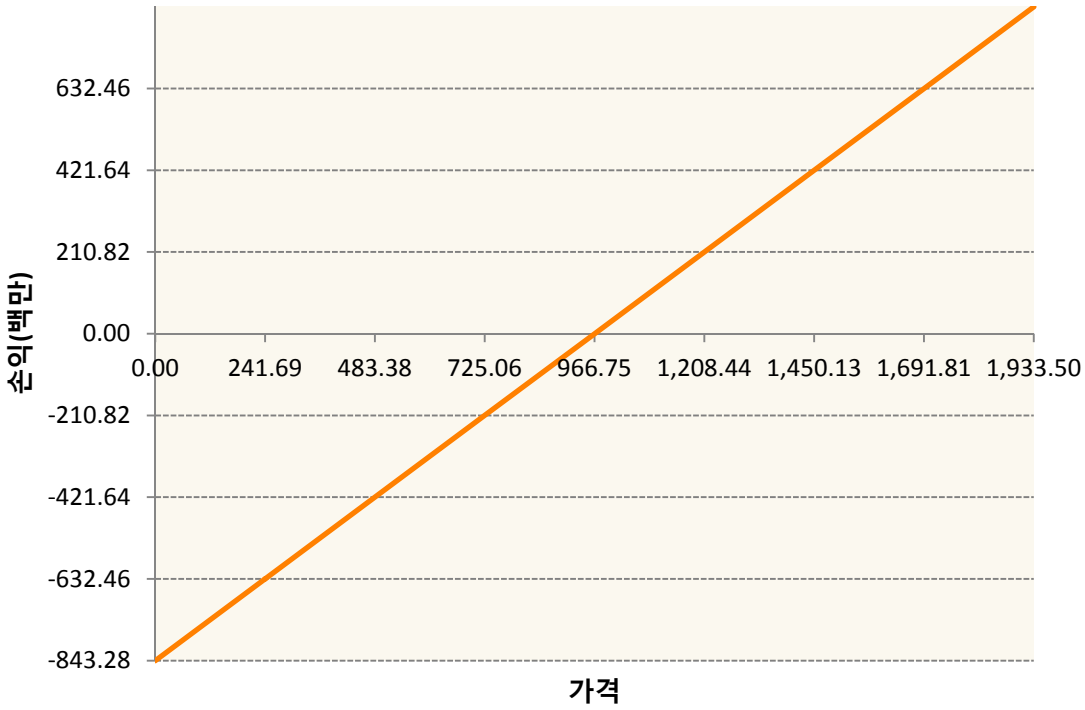

KR4175N10008-2018-01 달러선물
320.10
240.08
160.05
80.03
0.00
-80.03
-160.05
-240.08
-320.10
0.00
266.75
533.50
800.25
1,067.00
1,333.75
1,600.50
1,867.25
2,134.00
손익(백만)
가격


KWH8-KC HRW WHEAT FUT MAR18
167.16
125.37
83.58
41.79
0.00
-41.79
-83.58
-125.37
-167.16
0.00
108.31
216.63
324.94
433.25
541.56
649.88
758.19
866.50
손익(백만)
가격

SBH8-Sugar #11 (WORLD) MAR18

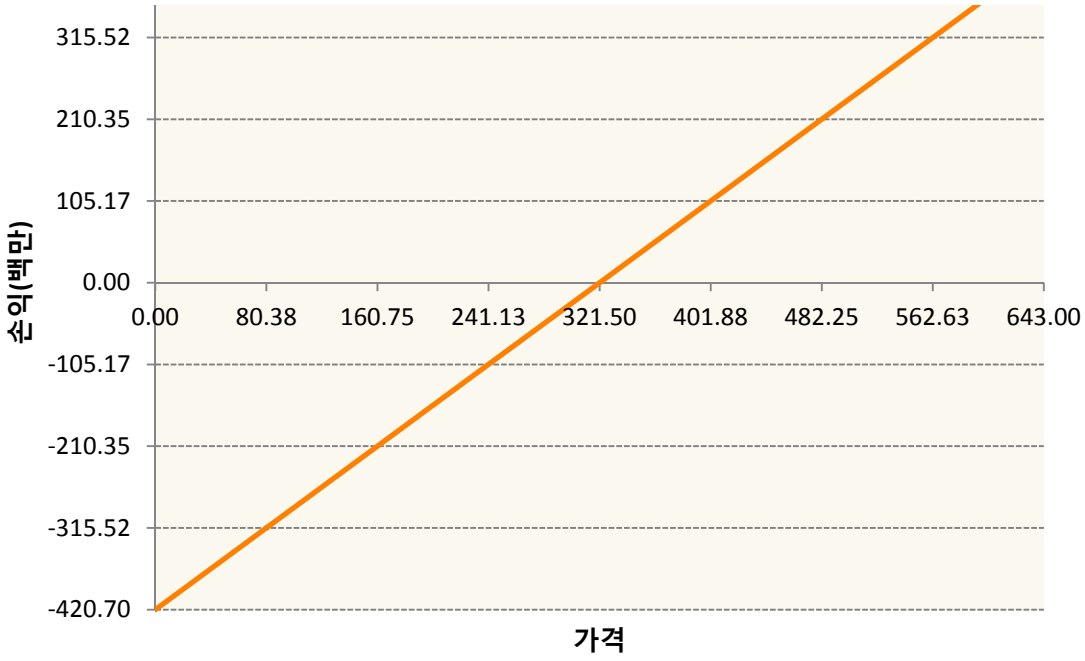


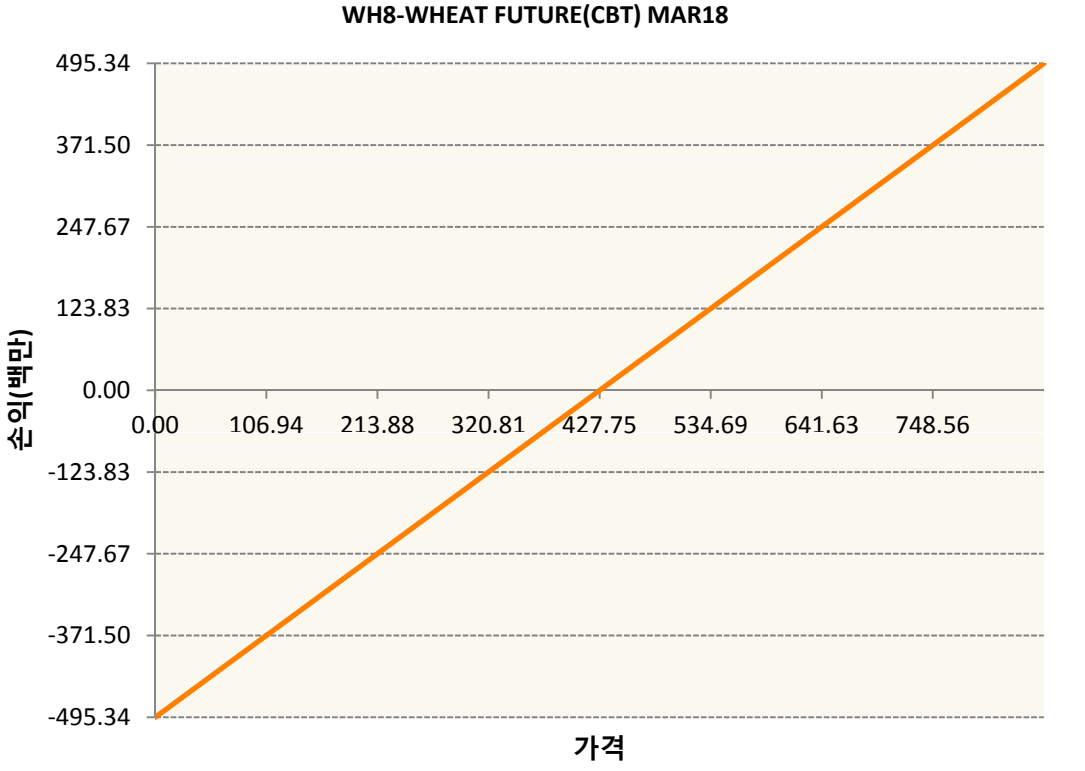

SH8-SOYBEAN FUTURE MAR18




SMH8-SOYBEAN MEAL FUTR MAR18






**3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)** (단위:백만원)

| | | |
|---|---|---|
| BOH8 | SOYBEAN OIL FUTR MAR18 | 30 |
| CH8 | CORN FUTURE MAR18 | 84 |
| CTH8 | COTTON NO.2 FUTR MAR18 | 17 |
| KCH8 | COFFEE "C" FUTURE MAR18 | 25 |
| KR4175N10( | 2018-01 달러선물 | 26 |

| | | |
|---|---|---|
| KWH8 | KC HRW WHEAT FUT MAR18 | 13 |
| SBH8 | Sugar #11 (WORLD) MAR18 | 30 |
| SH8 | SOYBEAN FUTURE MAR18 | 67 |
| SMH8 | SOYBEAN MEAL FUTR MAR18 | 34 |
| WH8 | WHEAT FUTURE(CBT) MAR18 | 40 |

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

| |
|---|
| **355** |