| | |
|---|---|
| 공시일 | 2018-01-31 |
| 기준일 | 2018-01-30 |

# 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 | 2018-01-31 |
| 기준일 | 2018-01-30 |

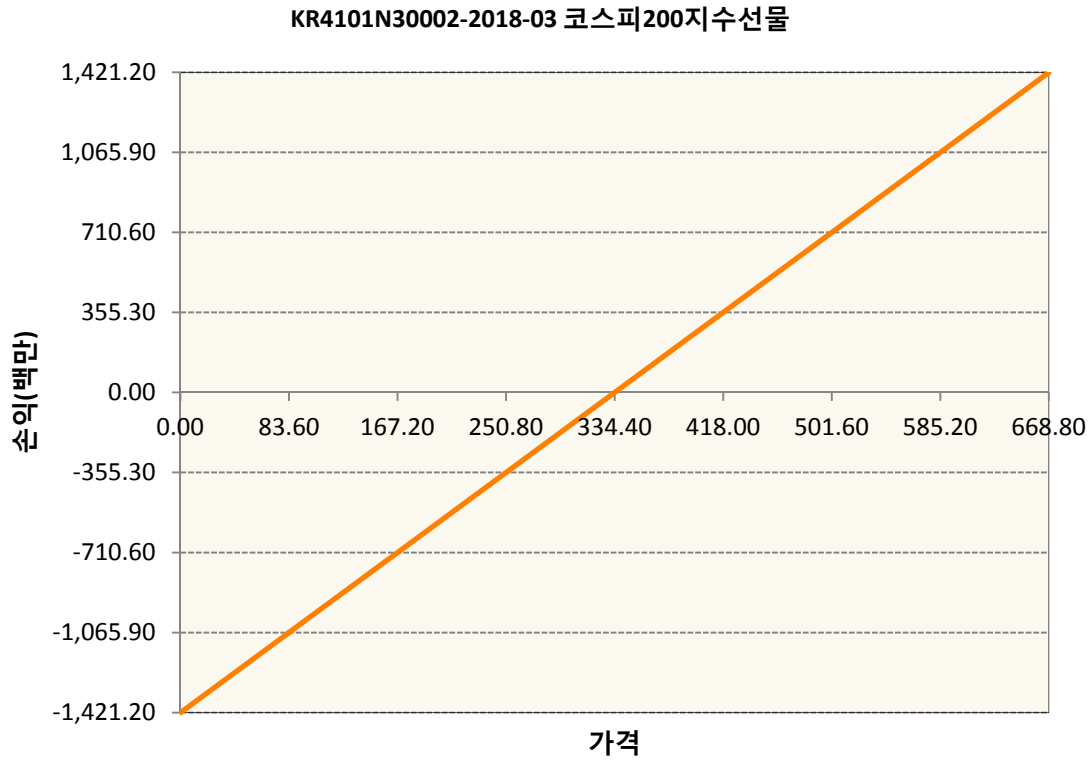
# 스마트인덱스모

## 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 | 1,421 | 0 | 1,421 | 장내 |

## 2. 만기시점의 손익구조




## 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| KR4101N30( 2018-03 코스피200지수선물 | | | | | | | 113 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 기초자산의 변동성 | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | -113 | -113 | -113 | -113 | -113 | -113 | -113 |
| -5.33% | -76 | -76 | -76 | -76 | -76 | -76 | -76 |
| -2.67% | -38 | -38 | -38 | -38 | -38 | -38 | -38 |
| 0% | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 2.67% | 38 | 38 | 38 | 38 | 38 | 38 | 38 |
| 5.33% | 76 | 76 | 76 | 76 | 76 | 76 | 76 |
| 8.00% | 113 | 113 | 113 | 113 | 113 | 113 | 113 |

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

| 69 |
|---|

| 공시일 | 2018-01-31 |
|---|---|
| 기준일 | 2018-01-30 |

# 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 | 1,168 |
|---|---|

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

| **358** |
|---|

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

| 공시일 | 2018-01-31 |
|---|---|
| 기준일 | 2018-01-30 |

# 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 | 421 |

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

| |
|---|
| **374** |

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

| | |
|---|---|
| 공시일 | 2018-01-31 |
| 기준일 | 2018-01-30 |

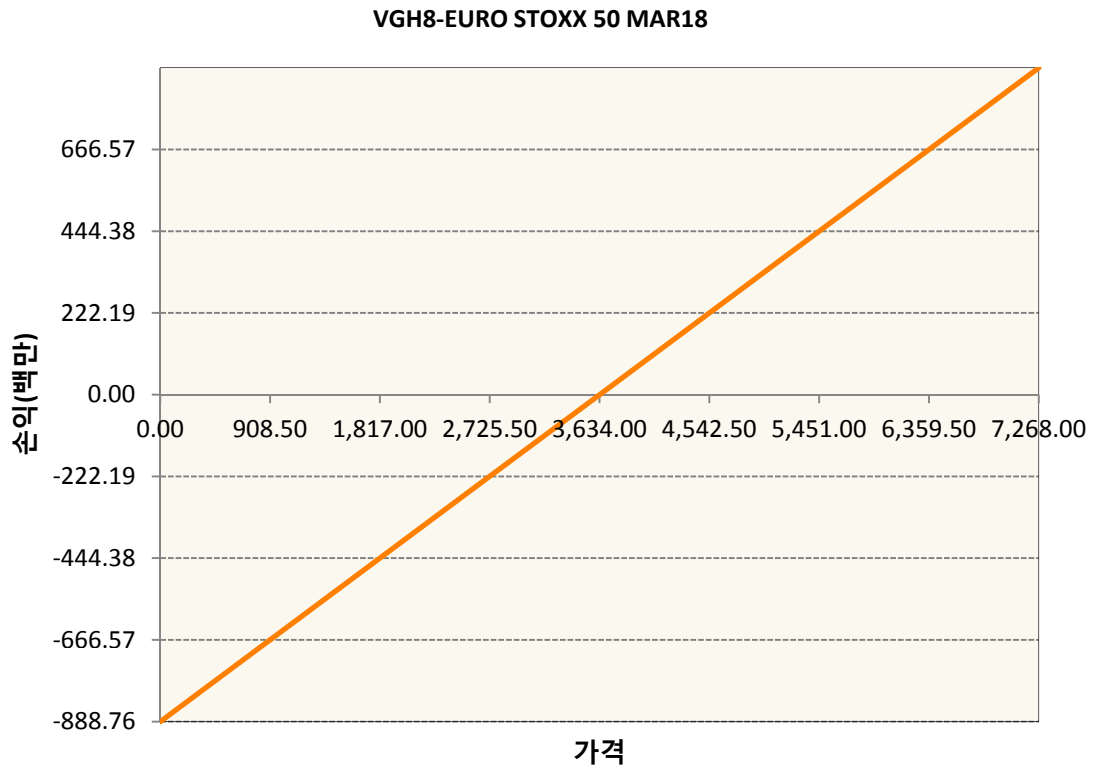
# 유로인덱스모(주식-파생형)

## 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 889 | 0 | 889 | |

## 2. 만기시점의 손익구조




## 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| | | |
|---|---|---|
| VGH8 | EURO STOXX 50 MAR18 | 71 |

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

(단위:백만원)

**39**

| | |
|---|---|
| 공시일 | 2018-01-31 |
| 기준일 | 2018-01-30 |

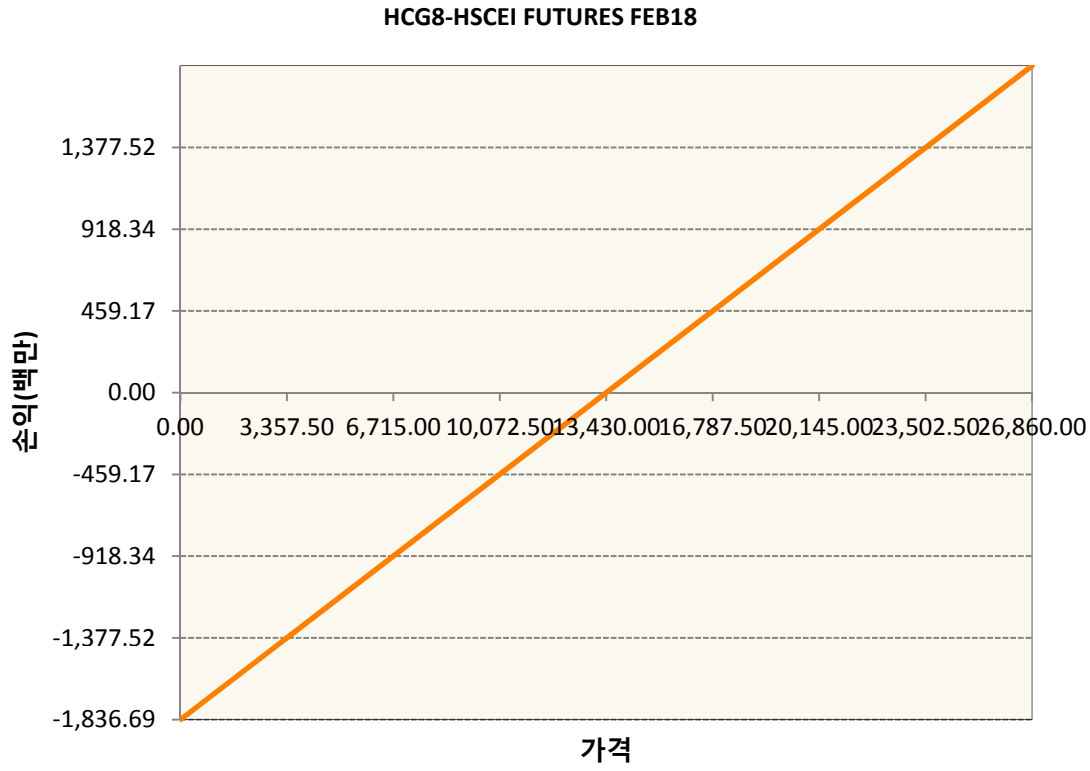
# 차이나인덱스모(주식-파생형)

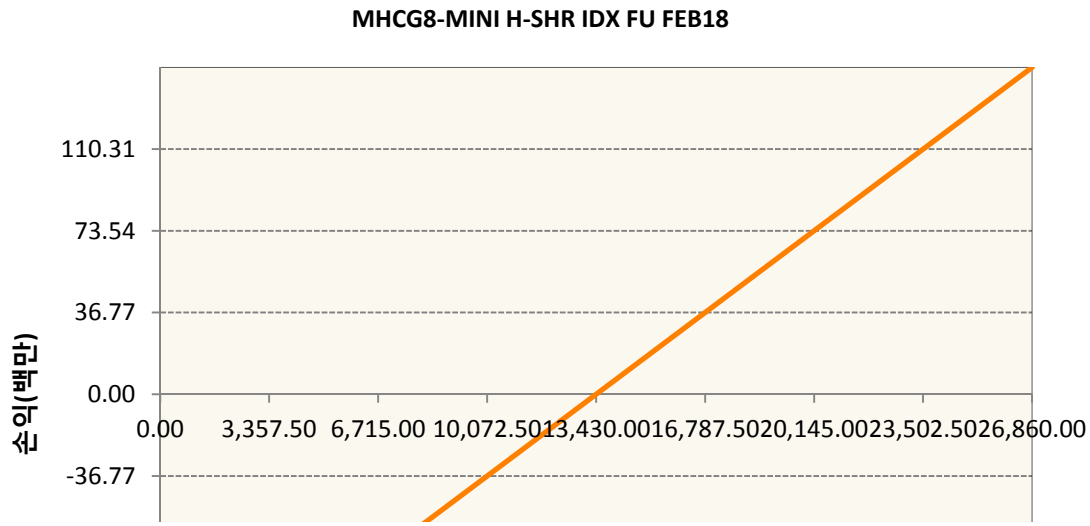
## 1. 계약금액

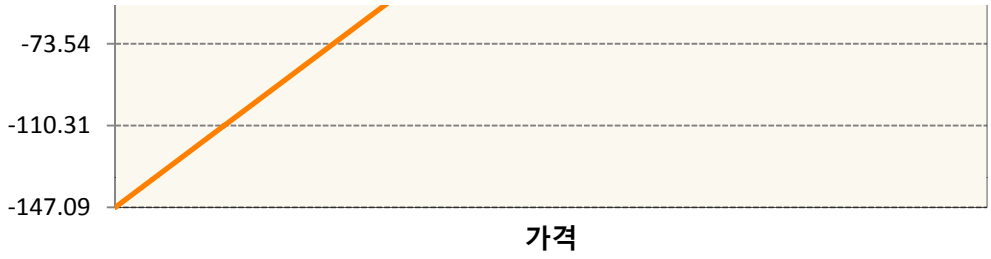
(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 1,984 | 0 | 1,984 | 장내 |

## 2. 만기시점의 손익구조






| 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) | | (단위:백만원) |
|---|---|---|
| HCG8 | HSCEI FUTURES FEB18 | 147 |
| MHCG8 | MINI H-SHR IDX FU FEB18 | 12 |

| 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) | (단위:백만원) |
|---|---|
| | **128** |

| | |
|---|---|
| 공시일 | 2018-01-31 |
| 기준일 | 2018-01-30 |

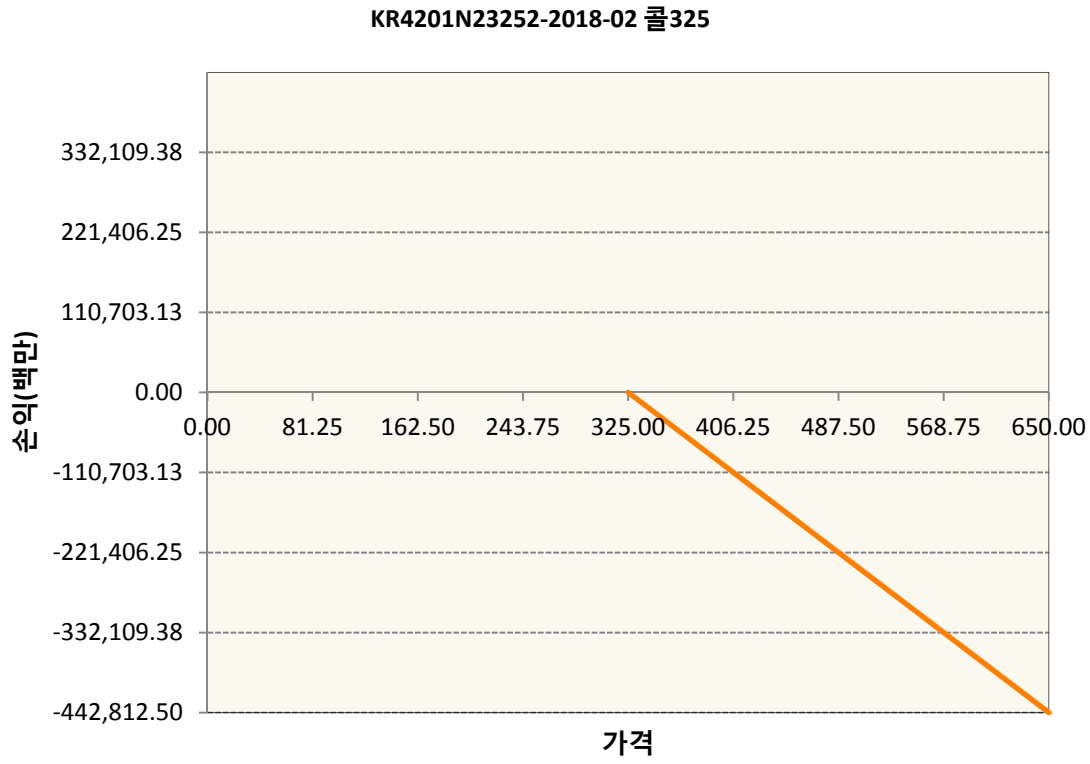
# 커버드콜모(주식혼합-파생형)

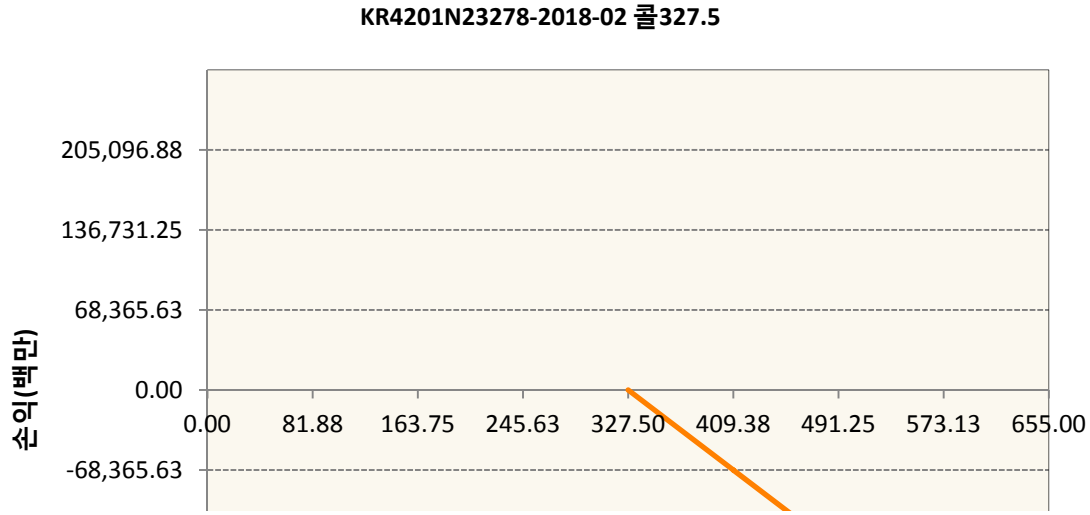
## 1. 계약금액

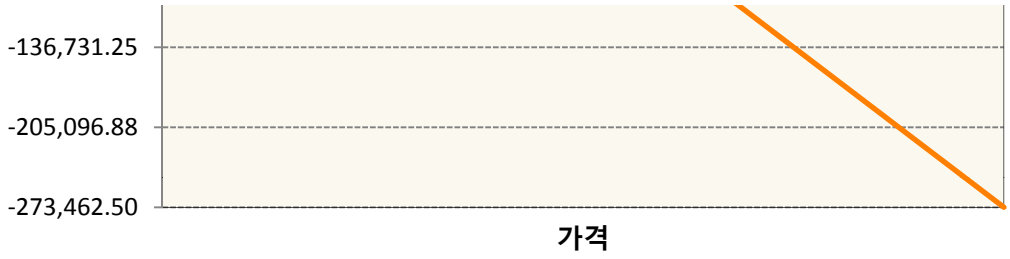
(단위:백만원)

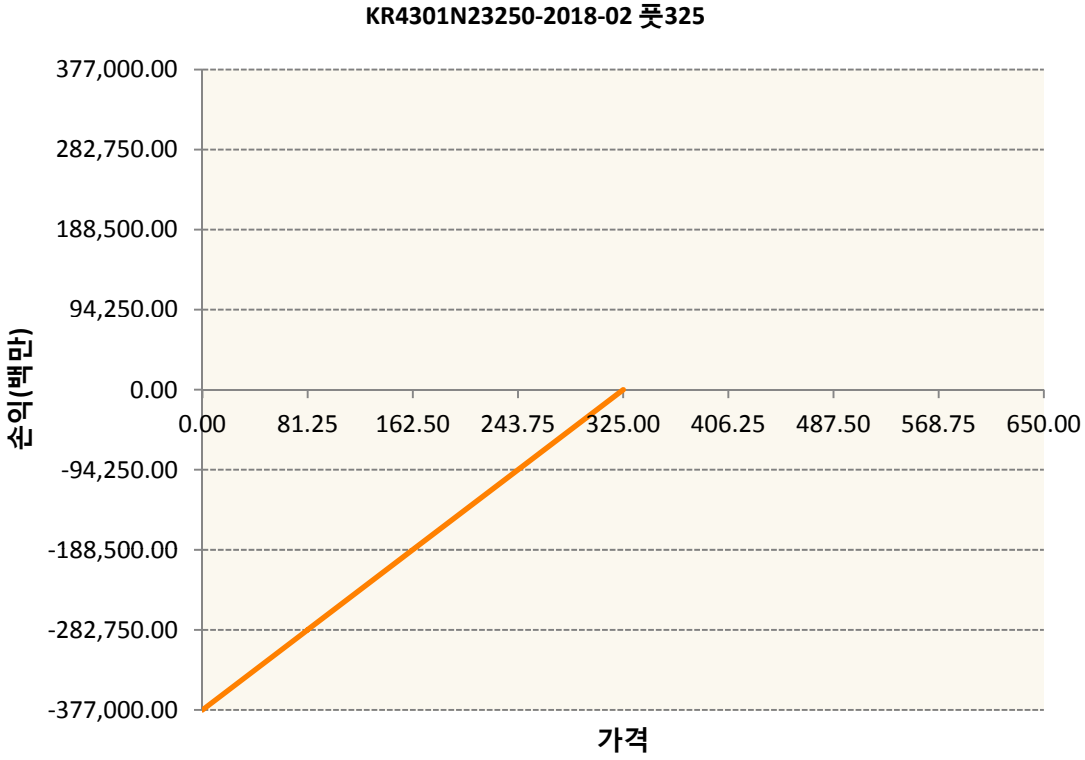
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 유가증권 | 옵션 | 17,254 | 0 | 17,254 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션 | 0 | 1,217,561 | -1,217,561 | 장내 |

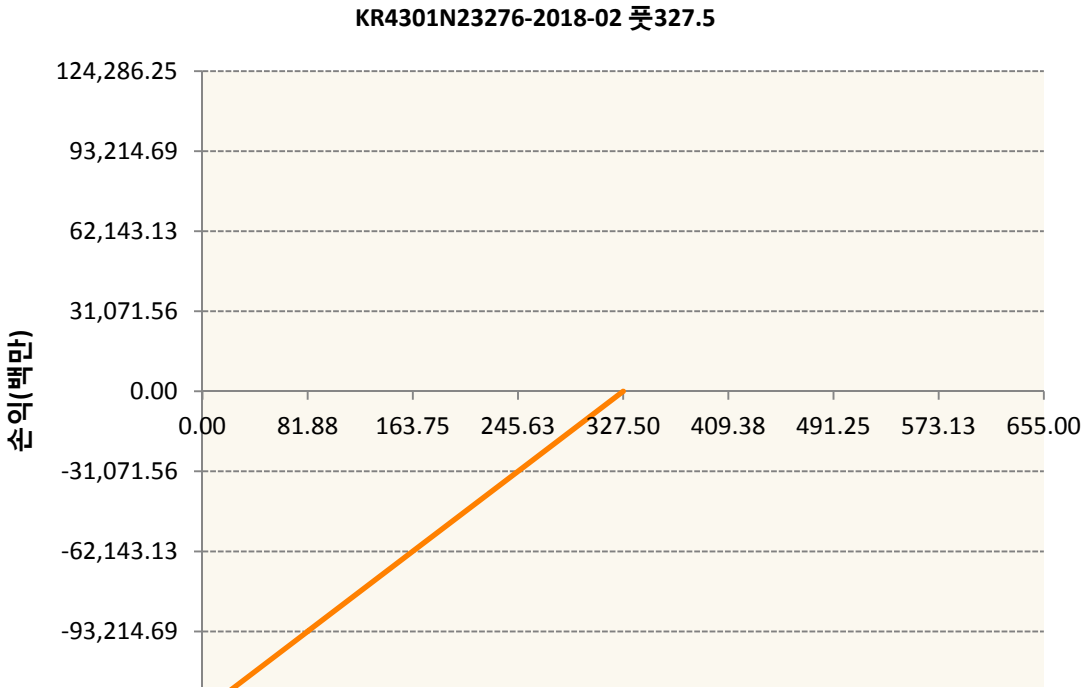
## 2. 만기시점의 손익구조




-136,731.25
-205,096.88
-273,462.50
가격


KR4301N23250-2018-02 풋325
377,000.00
282,750.00
188,500.00
94,250.00
0.00
-94,250.00
-188,500.00
-282,750.00
-377,000.00
0.00
81.25
162.50
243.75
325.00
406.25
487.50
568.75
650.00
손익(백만)
가격


KR4301N23276-2018-02 풋327.5
124,286.25
93,214.69
62,143.13
31,071.56
0.00
-31,071.56
-62,143.13
-93,214.69
0.00
81.88
163.75
245.63
327.50
409.38
491.25
573.13
655.00
손익(백만)




### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| KR4201N232 2018-02 콜325 | | | | | | | 33,672 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 기초자산의 변동성 | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | 14,233 | 14,123 | 13,974 | 13,788 | 13,567 | 13,313 | 13,031 |
| -5.33% | 13,205 | 12,823 | 12,411 | 11,974 | 11,518 | 11,045 | 10,559 |
| -2.67% | 9,344 | 8,754 | 8,165 | 7,576 | 6,986 | 6,397 | 5,807 |
| 0% | 1,365 | 934 | 478 | 0 | -494 | -1,002 | -1,521 |
| 2.67% | -9,509 | -9,667 | -9,868 | -10,110 | -10,389 | -10,700 | -11,041 |
| 5.33% | -21,408 | -21,439 | -21,493 | -21,572 | -21,681 | -21,821 | -21,990 |
| 8.00% | -33,499 | -33,502 | -33,511 | -33,528 | -33,559 | -33,606 | -33,672 |
| KR4201N232 2018-02 콜327.5 | | | | | | | 20,064 |
| | 기초자산의 변동성 | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | 7,304 | 7,261 | 7,198 | 7,115 | 7,011 | 6,888 | 6,745 |
| -5.33% | 6,912 | 6,729 | 6,522 | 6,296 | 6,053 | 5,796 | 5,528 |
| -2.67% | 5,155 | 4,807 | 4,455 | 4,102 | 3,748 | 3,392 | 3,035 |
| 0% | 964 | 651 | 329 | 0 | -335 | -674 | -1,017 |
| 2.67% | -5,320 | -5,460 | -5,628 | -5,819 | -6,031 | -6,260 | -6,505 |
| 5.33% | -12,510 | -12,543 | -12,595 | -12,667 | -12,760 | -12,873 | -13,006 |
| 8.00% | -19,905 | -19,909 | -19,919 | -19,937 | -19,966 | -20,008 | -20,064 |
| KR4301N232 2018-02 풋325 | | | | | | | 20,671 |
| | 기초자산의 변동성 | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | -20,605 | -20,606 | -20,609 | -20,616 | -20,627 | -20,645 | -20,671 |
| -5.33% | -10,391 | -10,459 | -10,547 | -10,652 | -10,774 | -10,911 | -11,061 |
| -2.67% | -2,231 | -2,507 | -2,782 | -3,058 | -3,334 | -3,609 | -3,885 |
| 0% | 343 | 248 | 133 | 0 | -149 | -313 | -488 |
| 2.67% | 504 | 501 | 493 | 479 | 457 | 426 | 384 |
| 5.33% | 505 | 505 | 505 | 505 | 504 | 502 | 498 |
| 8.00% | 505 | 505 | 505 | 505 | 505 | 505 | 505 |
| KR4301N232 2018-02 풋327.5 | | | | | | | 7,543 |
| | 기초자산의 변동성 | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | -7,533 | -7,533 | -7,534 | -7,534 | -7,536 | -7,539 | -7,543 |
| -5.33% | -4,169 | -4,179 | -4,194 | -4,214 | -4,238 | -4,268 | -4,303 |
| -2.67% | -1,166 | -1,245 | -1,327 | -1,410 | -1,494 | -1,579 | -1,664 |
| 0% | 177 | 123 | 64 | 0 | -67 | -138 | -211 |
| 2.67% | 319 | 315 | 308 | 298 | 284 | 265 | 242 |

| | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 5.33% | 321 | 321 | 321 | 321 | 320 | 318 | 315 |
| 8.00% | 321 | 321 | 321 | 321 | 321 | 321 | 321 |

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

| |
|---|
| **85,202** |

| | |
|---|---|
| 공시일 | 2018-01-31 |
| 기준일 | 2018-01-30 |

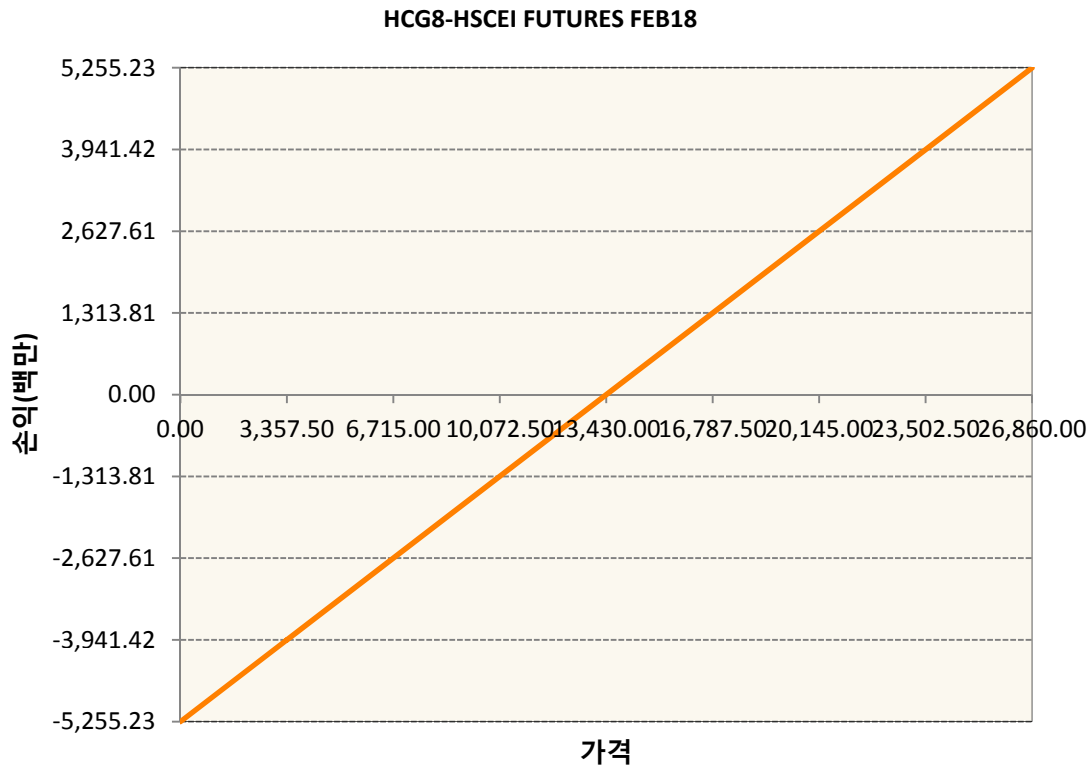
# 홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생

## 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 1 | 0 | 1 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 5,255 | 0 | 5,255 | 장내 |

## 2. 만기시점의 손익구조




## 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| | | |
|---|---|---|
| HCG8 | HSCEI FUTURES FEB18 | 420 |

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

(단위:백만원)

| |
|---|
| **340** |

| | |
|---|---|
| 공시일 | 2018-01-31 |
| 기준일 | 2018-01-30 |

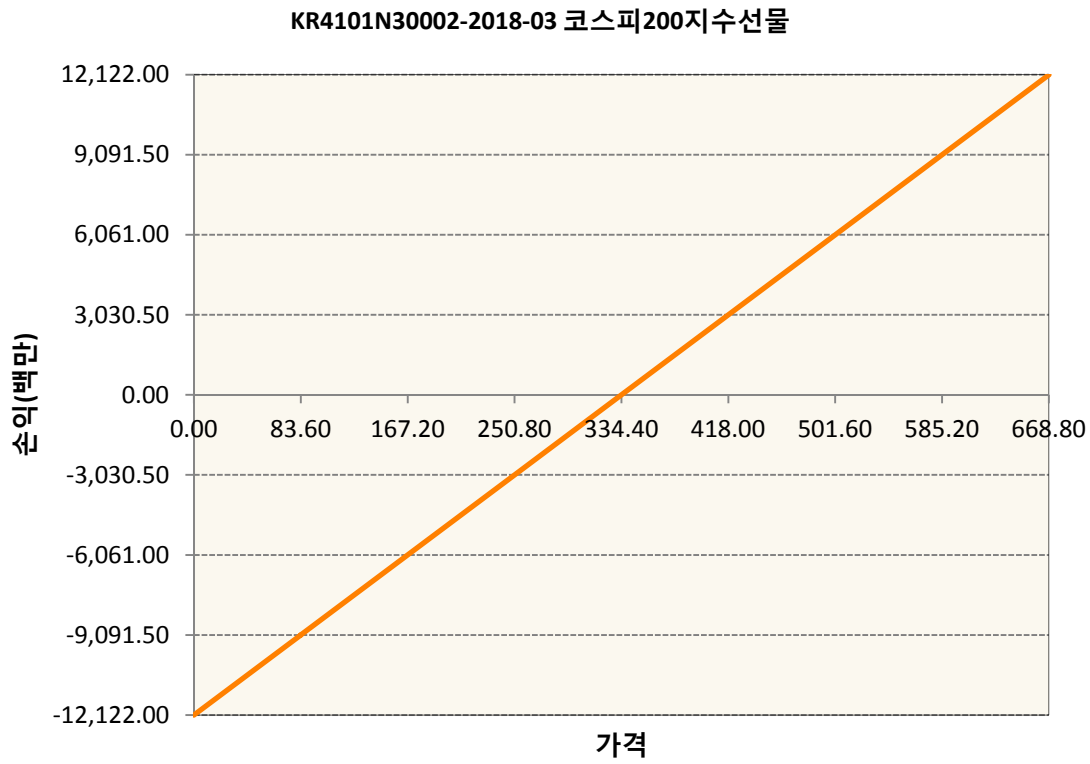
# 코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼

## 1. 계약금액

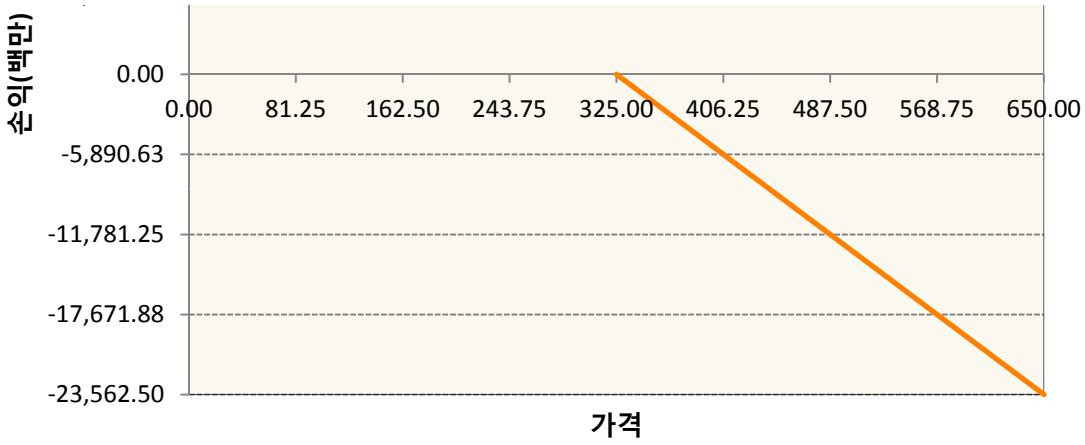
(단위:백만원)

| 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 | 12,122 | 0 | 12,122 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 스왑 | 60,200 | 0 | 60,200 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션 | 0 | 60,250 | -60,250 | 장내 |

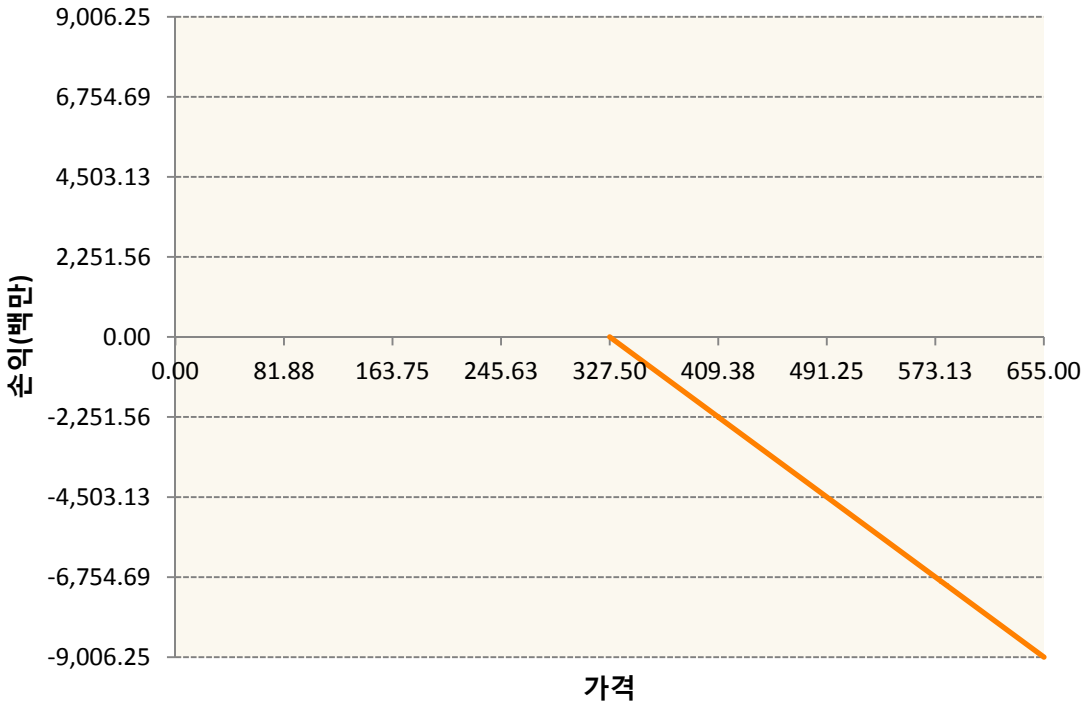
## 2. 만기시점의 손익구조



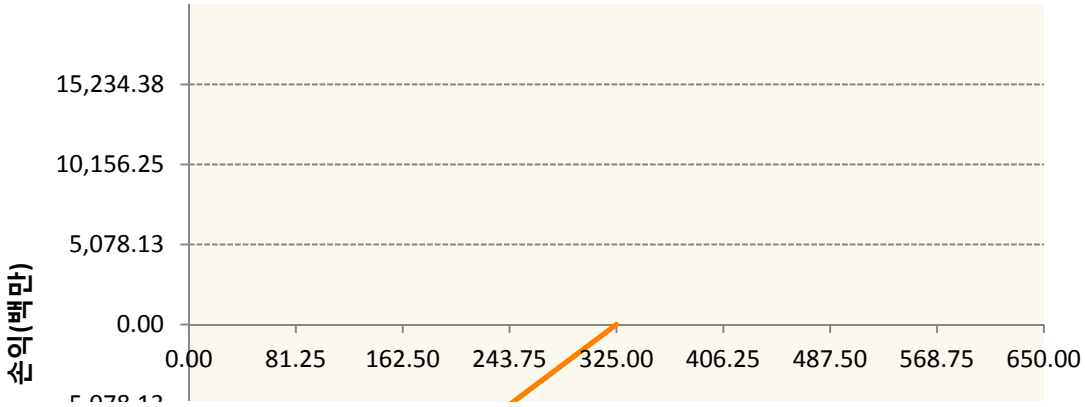


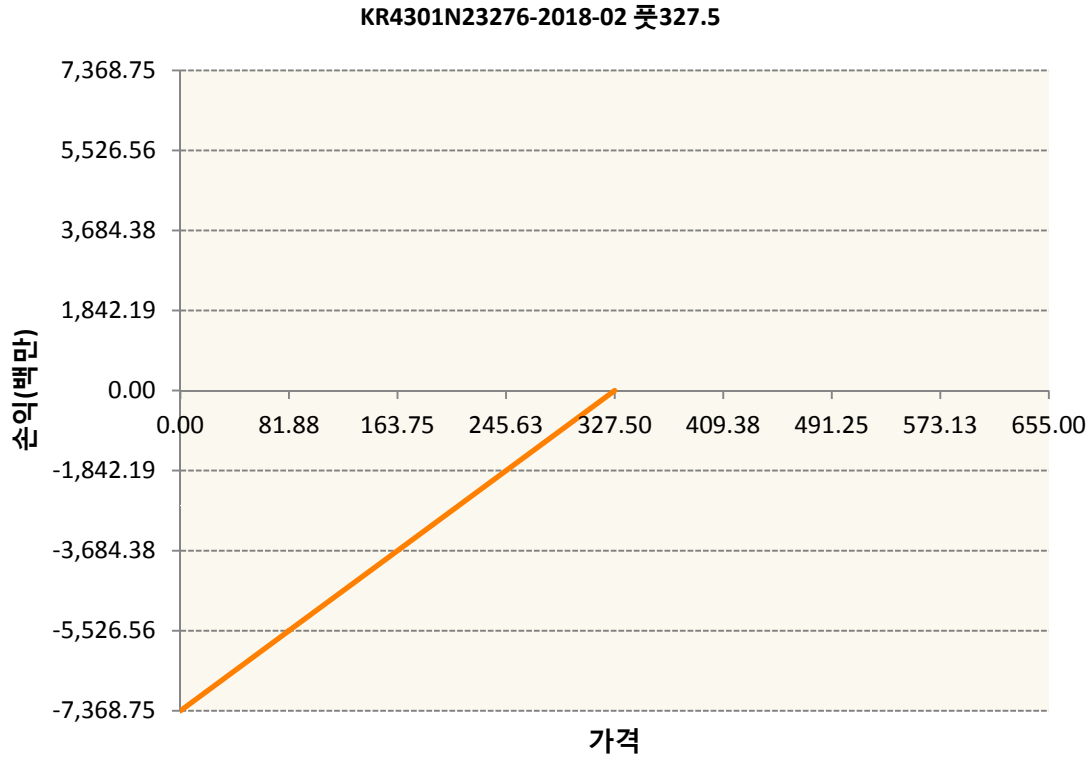

KR4201N23278-2018-02 콜327.5




KR4301N23250-2018-02 풋325






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

| 2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_2 | | | | | | | 1,452 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 기초자산의 변동성 | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | -1,452 | -1,452 | -1,452 | -1,452 | -1,452 | -1,452 | -1,452 |
| -5.33% | -968 | -968 | -968 | -968 | -968 | -968 | -968 |
| -2.67% | -484 | -484 | -484 | -484 | -484 | -484 | -484 |
| 0% | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 2.67% | 484 | 484 | 484 | 484 | 484 | 484 | 484 |
| 5.33% | 968 | 968 | 968 | 968 | 968 | 968 | 968 |
| 8.00% | 1,452 | 1,452 | 1,452 | 1,452 | 1,452 | 1,452 | 1,452 |
| 2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_3 | | | | | | | 275 |
| | 기초자산의 변동성 | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |

| | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| -8.00% | -275 | -275 | -275 | -275 | -275 | -275 | -275 |
| -5.33% | -183 | -183 | -183 | -183 | -183 | -183 | -183 |
| -2.67% | -92 | -92 | -92 | -92 | -92 | -92 | -92 |
| 0% | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 2.67% | 92 | 92 | 92 | 92 | 92 | 92 | 92 |
| 5.33% | 183 | 183 | 183 | 183 | 183 | 183 | 183 |
| 8.00% | 275 | 275 | 275 | 275 | 275 | 275 | 275 |
| | 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% | -105 | -105 | -105 | -105 | -105 | -105 | -105 |
| -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% | 105 | 105 | 105 | 105 | 105 | 105 | 105 |
| 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% | -131 | -131 | -131 | -131 | -131 | -131 | -131 |
| -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% | 131 | 131 | 131 | 131 | 131 | 131 | 131 |
| 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 | | | | | | 465 |
| | 기초자산의 변동성 | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | -465 | -465 | -465 | -465 | -465 | -465 | -465 |
| -5.33% | -310 | -310 | -310 | -310 | -310 | -310 | -310 |
| -2.67% | -155 | -155 | -155 | -155 | -155 | -155 | -155 |
| 0% | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 2.67% | 155 | 155 | 155 | 155 | 155 | 155 | 155 |
| 5.33% | 310 | 310 | 310 | 310 | 310 | 310 | 310 |
| 8.00% | 465 | 465 | 465 | 465 | 465 | 465 | 465 |
| | 2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_9 | | | | | | 310 |
| | 기초자산의 변동성 | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | -310 | -310 | -310 | -310 | -310 | -310 | -310 |
| -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% | 310 | 310 | 310 | 310 | 310 | 310 | 310 |
| | 2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_10 | | | | | | 275 |
| | 기초자산의 변동성 | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | -275 | -275 | -275 | -275 | -275 | -275 | -275 |
| -5.33% | -183 | -183 | -183 | -183 | -183 | -183 | -183 |
| -2.67% | -92 | -92 | -92 | -92 | -92 | -92 | -92 |
| 0% | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 2.67% | 92 | 92 | 92 | 92 | 92 | 92 | 92 |
| 5.33% | 183 | 183 | 183 | 183 | 183 | 183 | 183 |
| 8.00% | 275 | 275 | 275 | 275 | 275 | 275 | 275 |
| | 2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_11 | | | | | | 628 |
| | 기초자산의 변동성 | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | -628 | -628 | -628 | -628 | -628 | -628 | -628 |
| -5.33% | -419 | -419 | -419 | -419 | -419 | -419 | -419 |
| -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% | 419 | 419 | 419 | 419 | 419 | 419 | 419 |
| 8.00% | 628 | 628 | 628 | 628 | 628 | 628 | 628 |
| | 2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_12 | | | | | | 471 |

| | 기초자산의 변동성 | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | -471 | -471 | -471 | -471 | -471 | -471 | -471 |
| -5.33% | -314 | -314 | -314 | -314 | -314 | -314 | -314 |
| -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% | 314 | 314 | 314 | 314 | 314 | 314 | 314 |
| 8.00% | 471 | 471 | 471 | 471 | 471 | 471 | 471 |
| | KR4101N30( | 2018-03 | 코스피200지수선물 | | | | 967 |

| | 기초자산의 변동성 | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | -967 | -967 | -967 | -967 | -967 | -967 | -967 |
| -5.33% | -645 | -645 | -645 | -645 | -645 | -645 | -645 |
| -2.67% | -322 | -322 | -322 | -322 | -322 | -322 | -322 |
| 0% | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 2.67% | 322 | 322 | 322 | 322 | 322 | 322 | 322 |
| 5.33% | 645 | 645 | 645 | 645 | 645 | 645 | 645 |
| 8.00% | 967 | 967 | 967 | 967 | 967 | 967 | 967 |
| | KR4201N232 | 2018-02 | 콜325 | | | | 1,792 |

| | 기초자산의 변동성 | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | 757 | 751 | 744 | 734 | 722 | 708 | 693 |
| -5.33% | 703 | 682 | 660 | 637 | 613 | 588 | 562 |
| -2.67% | 497 | 466 | 434 | 403 | 372 | 340 | 309 |
| 0% | 73 | 50 | 25 | 0 | -26 | -53 | -81 |
| 2.67% | -506 | -514 | -525 | -538 | -553 | -569 | -587 |
| 5.33% | -1,139 | -1,141 | -1,144 | -1,148 | -1,154 | -1,161 | -1,170 |
| 8.00% | -1,782 | -1,783 | -1,783 | -1,784 | -1,786 | -1,788 | -1,792 |
| | KR4201N232 | 2018-02 | 콜327.5 | | | | 661 |

| | 기초자산의 변동성 | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | 241 | 239 | 237 | 234 | 231 | 227 | 222 |
| -5.33% | 228 | 222 | 215 | 207 | 199 | 191 | 182 |
| -2.67% | 170 | 158 | 147 | 135 | 123 | 112 | 100 |
| 0% | 32 | 21 | 11 | 0 | -11 | -22 | -34 |
| 2.67% | -175 | -180 | -185 | -192 | -199 | -206 | -214 |
| 5.33% | -412 | -413 | -415 | -417 | -420 | -424 | -428 |
| 8.00% | -656 | -656 | -656 | -657 | -658 | -659 | -661 |
| | KR4301N232 | 2018-02 | 풋325 | | | | 1,114 |

| | 기초자산의 변동성 | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | -1,110 | -1,110 | -1,110 | -1,111 | -1,111 | -1,112 | -1,114 |
| -5.33% | -560 | -564 | -568 | -574 | -581 | -588 | -596 |

| | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| -2.67% | -120 | -135 | -150 | -165 | -180 | -194 | -209 |
| 0% | 18 | 13 | 7 | 0 | -8 | -17 | -26 |
| 2.67% | 27 | 27 | 27 | 26 | 25 | 23 | 21 |
| 5.33% | 27 | 27 | 27 | 27 | 27 | 27 | 27 |
| 8.00% | 27 | 27 | 27 | 27 | 27 | 27 | 27 |
| | KR4301N232 2018-02 풋327.5 | | | | | | 447 |
| | 기초자산의 변동성 | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | -447 | -447 | -447 | -447 | -447 | -447 | -447 |
| -5.33% | -247 | -248 | -249 | -250 | -251 | -253 | -255 |
| -2.67% | -69 | -74 | -79 | -84 | -89 | -94 | -99 |
| 0% | 10 | 7 | 4 | 0 | -4 | -8 | -13 |
| 2.67% | 19 | 19 | 18 | 18 | 17 | 16 | 14 |
| 5.33% | 19 | 19 | 19 | 19 | 19 | 19 | 19 |
| 8.00% | 19 | 19 | 19 | 19 | 19 | 19 | 19 |

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

| |
|---|
| **9,438** |

| | |
|---|---|
| 공시일 | 2018-01-31 |
| 기준일 | 2018-01-30 |

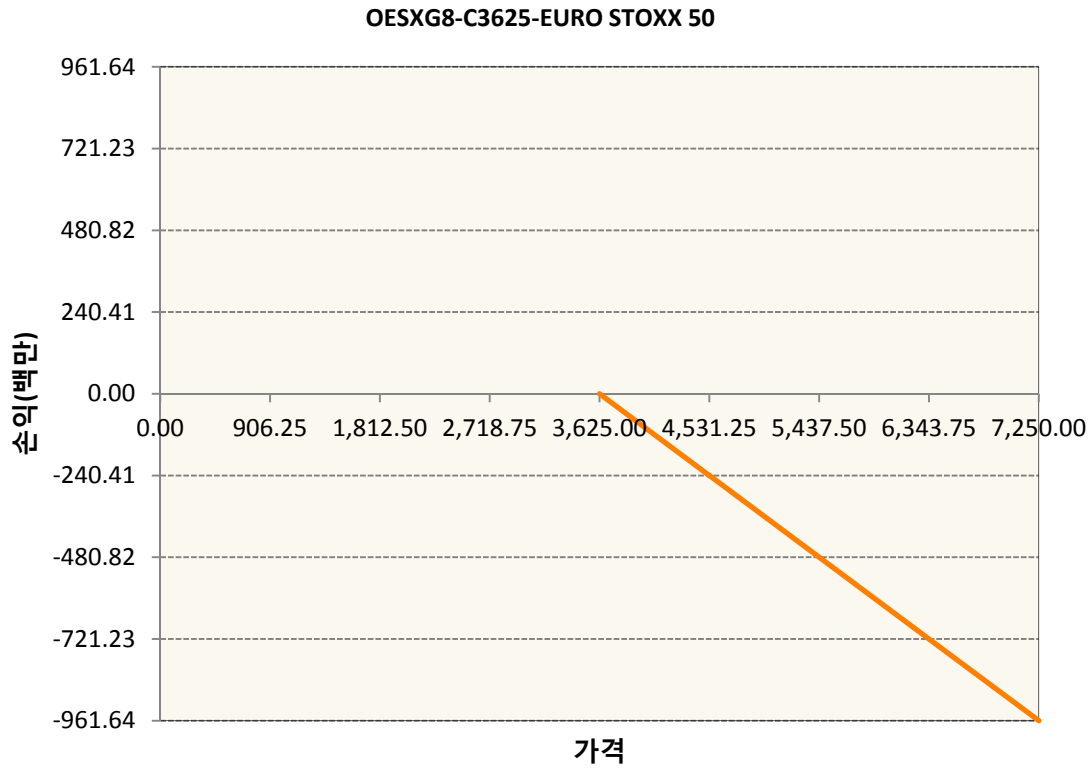
# 유로커버드콜모(주식혼합-파생형

## 1. 계약금액

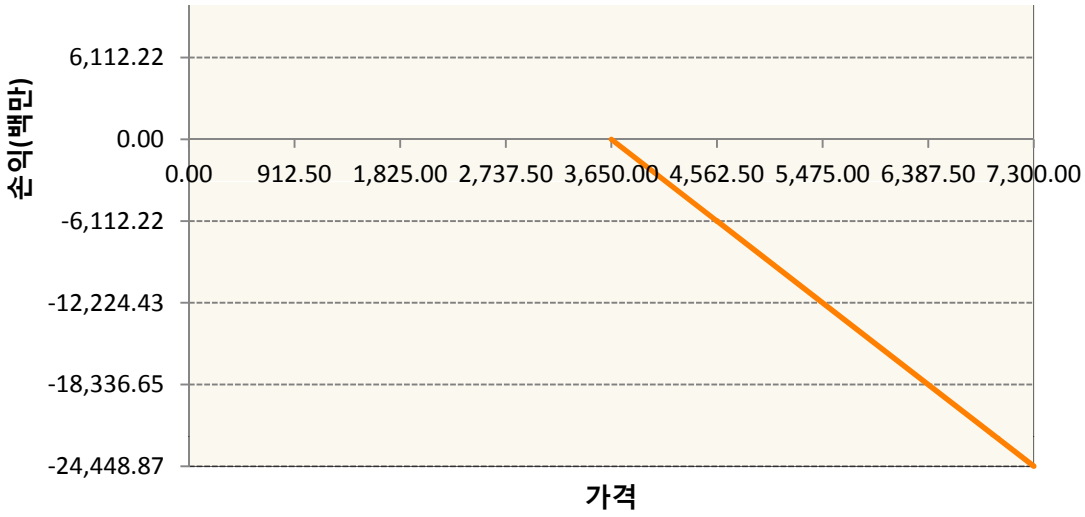
(단위:백만원)

| 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 | 16,210 | 0 | 16,210 | |
| 누계 | 유가증권 | 스왑 | 99,478 | 0 | 99,478 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션 | 0 | 50,821 | -50,821 | 장내 |
| 누계 | 지수 | 스왑 | 53,056 | 0 | 53,056 | 장외 |

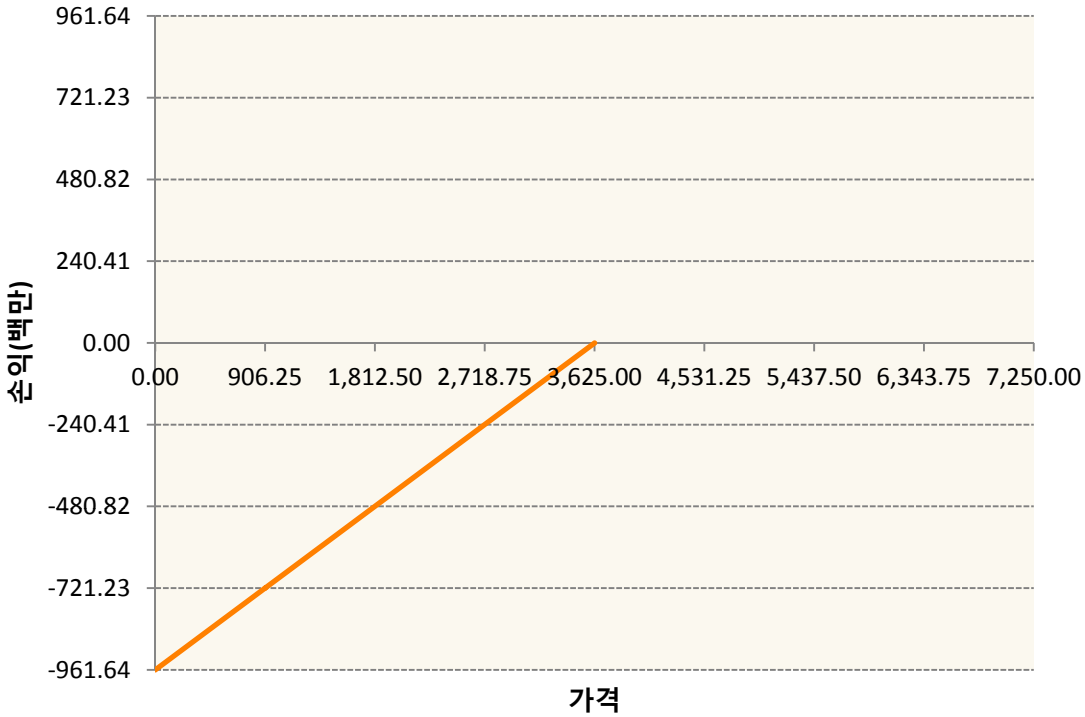
## 2. 만기시점의 손익구조



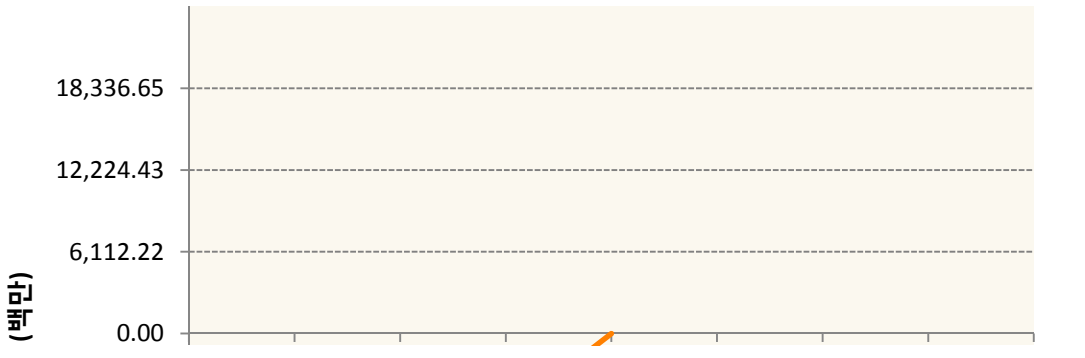


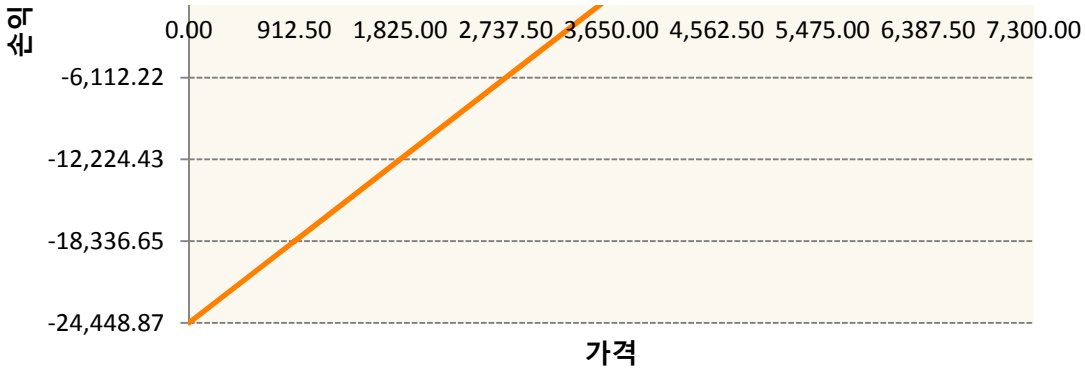



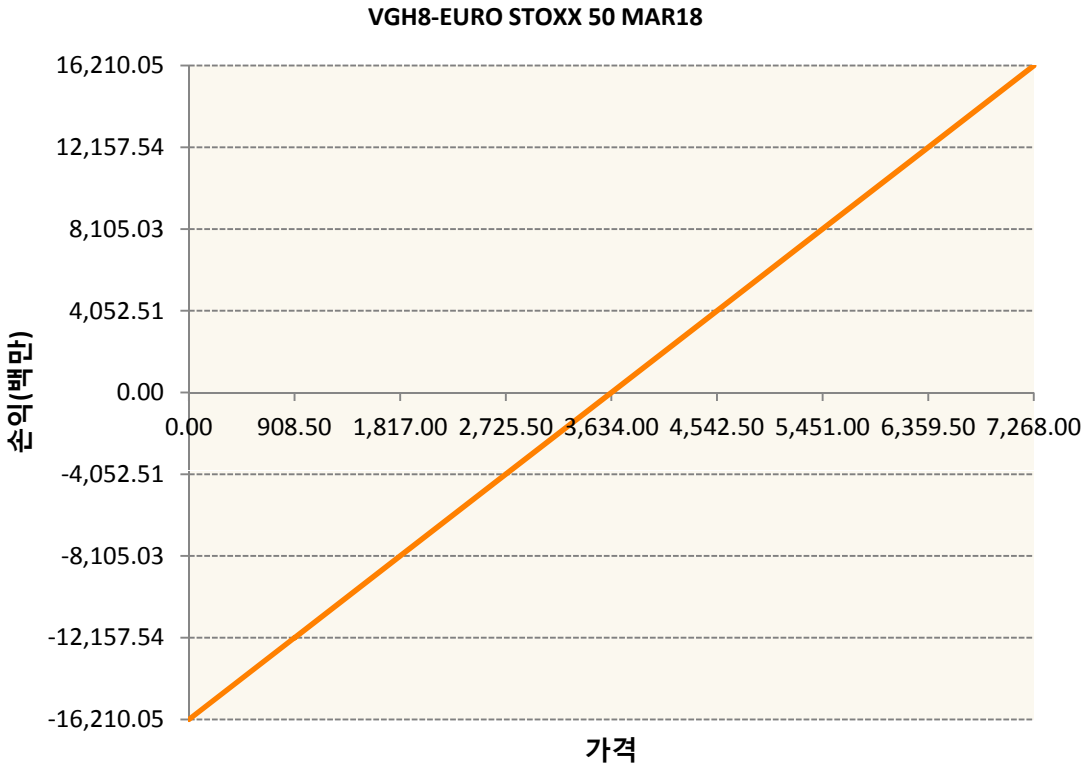

OESXG8-P3625-EURO STOXX 50




OESXG8-P3650-EURO STOXX 50






| 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) | | (단위:백만원) |
|---|---|---|
| 260105SGPX | SG EURO Covered CALL STRATEGY - 994.569 | 2 |
| 260105SQPX | SG EURO Covered CALL STRATEGY | 4 |
| OESXG8-C3( | EURO STOXX 50 | 77 |
| OESXG8-C3( | EURO STOXX 50 | 1,956 |
| OESXG8-P3( | EURO STOXX 50 | 77 |
| OESXG8-P3( | EURO STOXX 50 | 1,956 |
| VGH8 | EURO STOXX 50 MAR18 | 1,297 |

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

| |
|---|
| **2,947** |

| 공시일 | 2018-01-31 |
|---|---|
| 기준일 | 2018-01-30 |

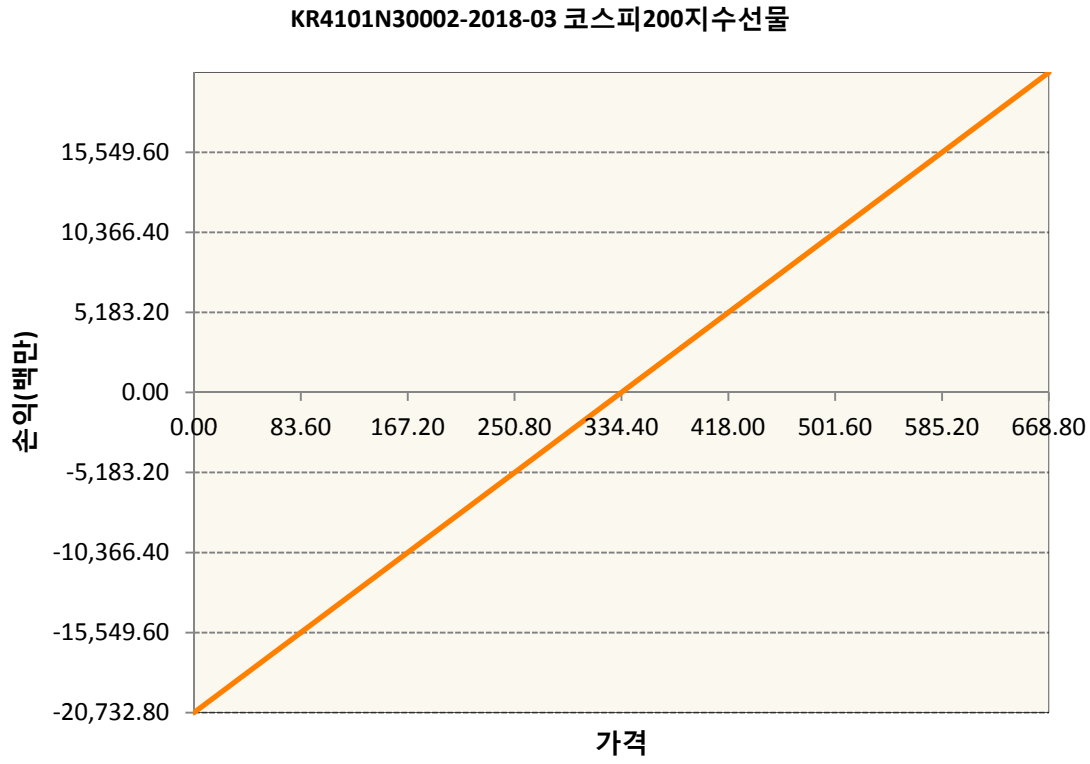
# ETF스마트레버리지목표전환형8호

## 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 | 20,733 | 0 | 20,733 | 장내 |

## 2. 만기시점의 손익구조




## 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| KR4101N30( 2018-03 코스피200지수선물 | | | | | | | 1,654 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 기초자산의 변동성 | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | -1,654 | -1,654 | -1,654 | -1,654 | -1,654 | -1,654 | -1,654 |
| -5.33% | -1,102 | -1,102 | -1,102 | -1,102 | -1,102 | -1,102 | -1,102 |
| -2.67% | -551 | -551 | -551 | -551 | -551 | -551 | -551 |
| 0% | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 2.67% | 551 | 551 | 551 | 551 | 551 | 551 | 551 |
| 5.33% | 1,102 | 1,102 | 1,102 | 1,102 | 1,102 | 1,102 | 1,102 |
| 8.00% | 1,654 | 1,654 | 1,654 | 1,654 | 1,654 | 1,654 | 1,654 |

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

| 1,001 |
|---|

| | |
|---|---|
| 공시일 | 2018-01-31 |
| 기준일 | 2018-01-30 |

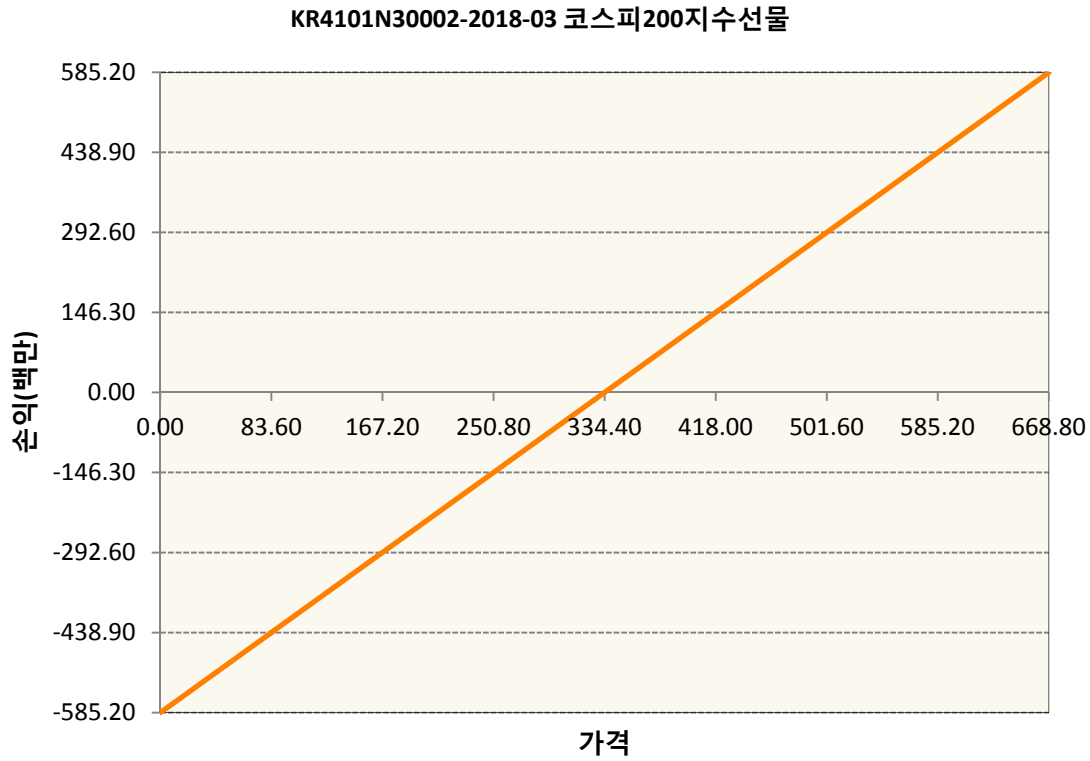
# ETF스마트레버리지목표전환형9호

## 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 | 585 | 0 | 585 | 장내 |

## 2. 만기시점의 손익구조




## 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| KR4101N30( 2018-03 코스피200지수선물 | | | | | | | 47 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 기초자산의 변동성 | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | -47 | -47 | -47 | -47 | -47 | -47 | -47 |
| -5.33% | -31 | -31 | -31 | -31 | -31 | -31 | -31 |
| -2.67% | -16 | -16 | -16 | -16 | -16 | -16 | -16 |
| 0% | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 2.67% | 16 | 16 | 16 | 16 | 16 | 16 | 16 |
| 5.33% | 31 | 31 | 31 | 31 | 31 | 31 | 31 |
| 8.00% | 47 | 47 | 47 | 47 | 47 | 47 | 47 |

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

| 28 |
|---|

| | |
|---|---|
| 공시일 | 2018-01-31 |
| 기준일 | 2018-01-30 |

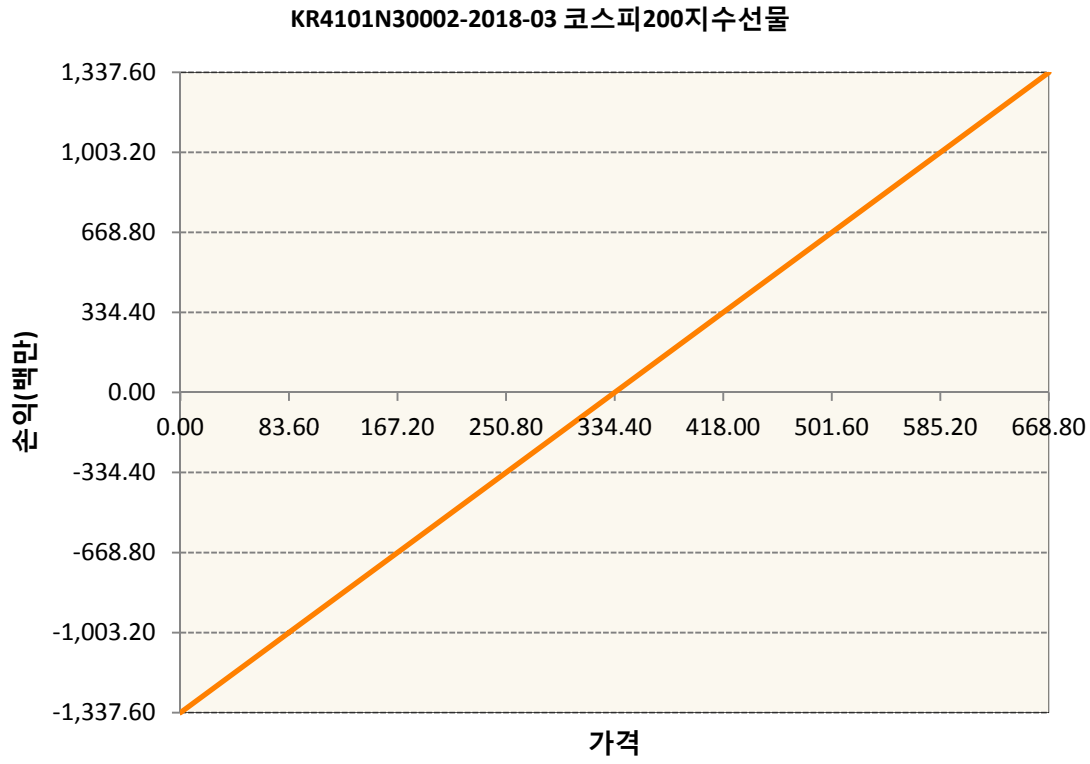
# ETF스마트레버리지목표전환형10

## 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 | 1,338 | 0 | 1,338 | 장내 |

## 2. 만기시점의 손익구조




## 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| KR4101N30( 2018-03 코스피200지수선물 | | | | | | | 107 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 기초자산의 변동성 | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | -107 | -107 | -107 | -107 | -107 | -107 | -107 |
| -5.33% | -71 | -71 | -71 | -71 | -71 | -71 | -71 |
| -2.67% | -36 | -36 | -36 | -36 | -36 | -36 | -36 |
| 0% | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 2.67% | 36 | 36 | 36 | 36 | 36 | 36 | 36 |
| 5.33% | 71 | 71 | 71 | 71 | 71 | 71 | 71 |
| 8.00% | 107 | 107 | 107 | 107 | 107 | 107 | 107 |

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

| |
|---|
| **65** |

| | |
|---|---|
| 공시일 | 2018-01-31 |
| 기준일 | 2018-01-30 |

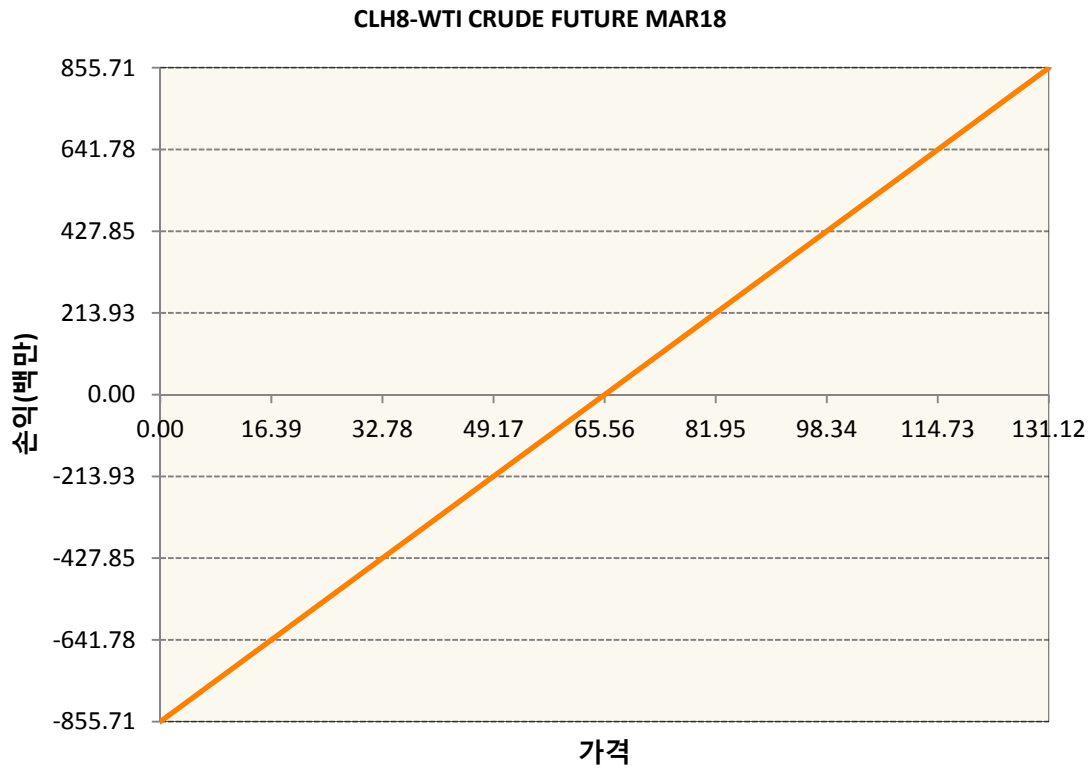
# 에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

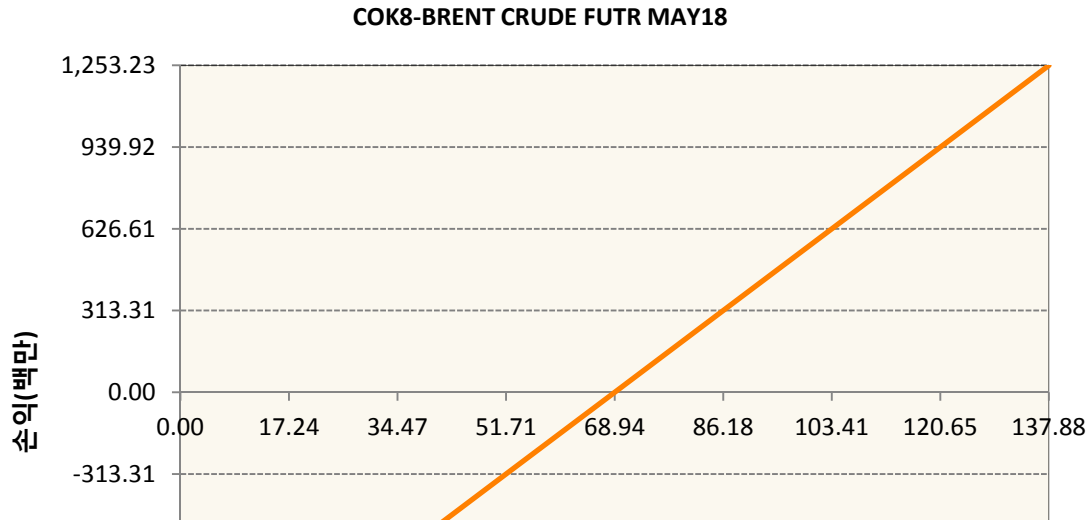
## 1. 계약금액

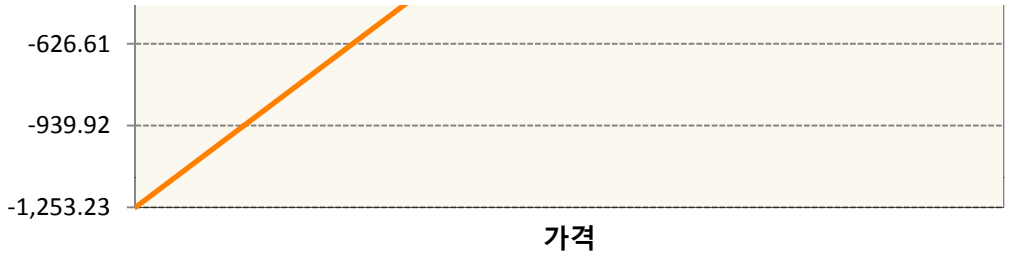
(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 4,602 | 859 | 3,743 | |

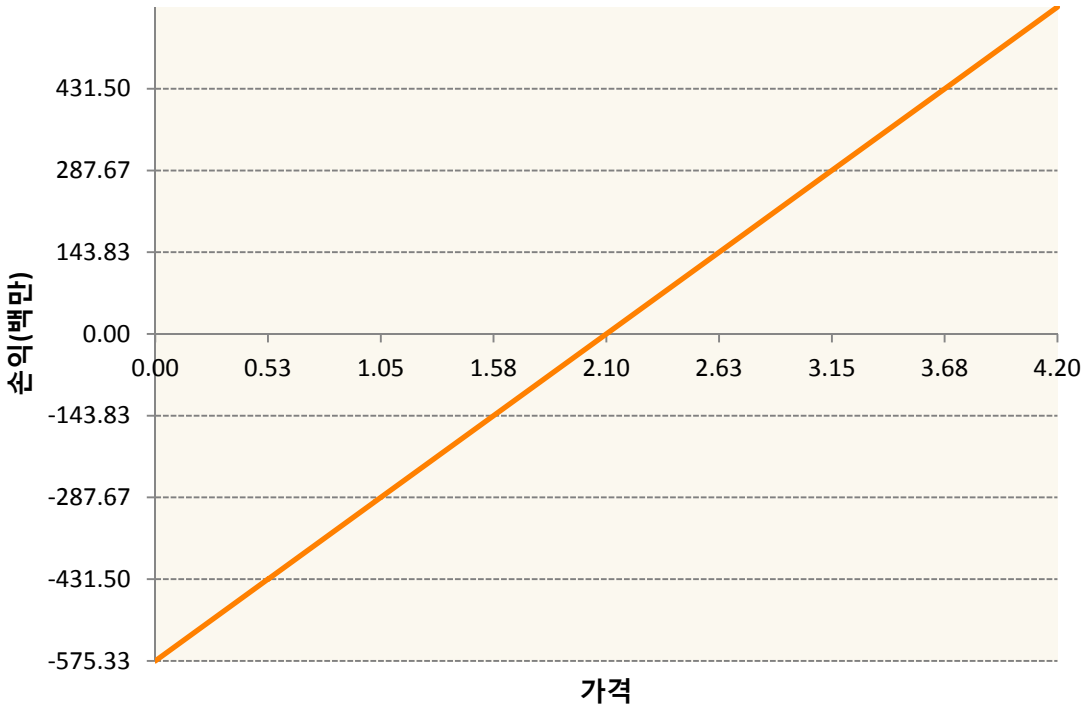
## 2. 만기시점의 손익구조



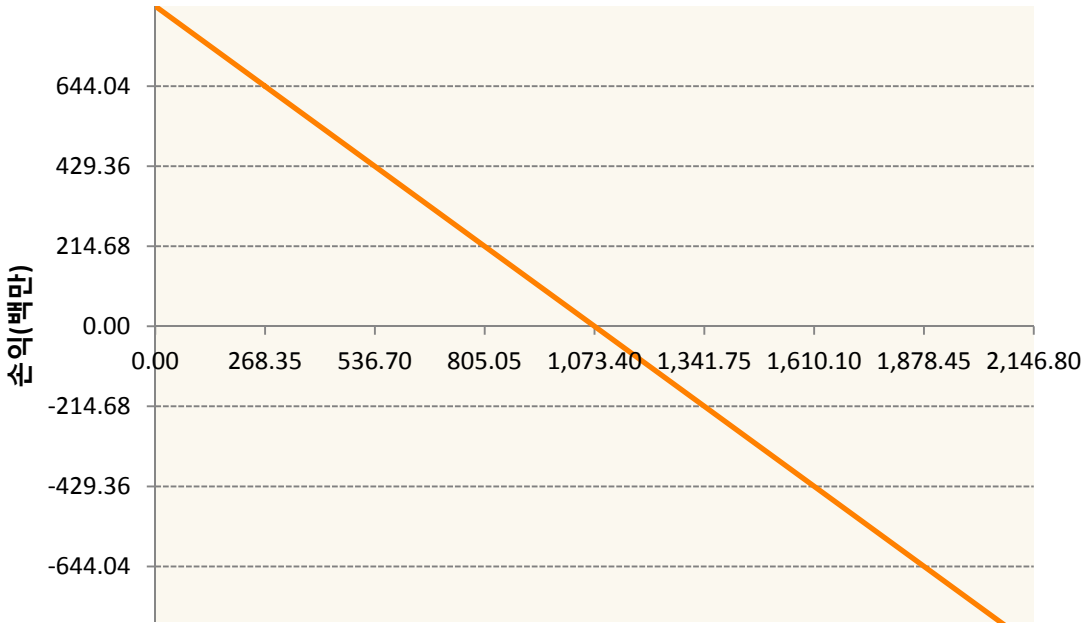



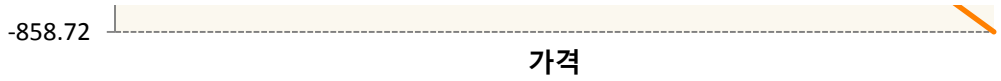


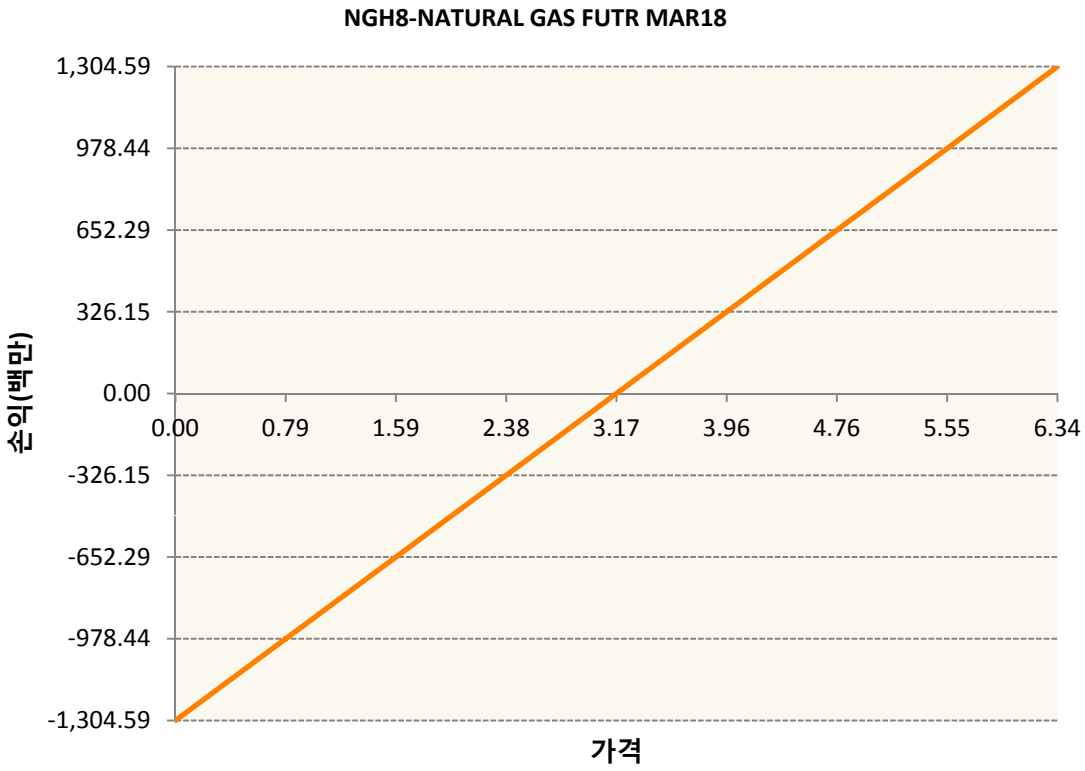

**HOH8-NY Harb ULSD Fut MAR18**

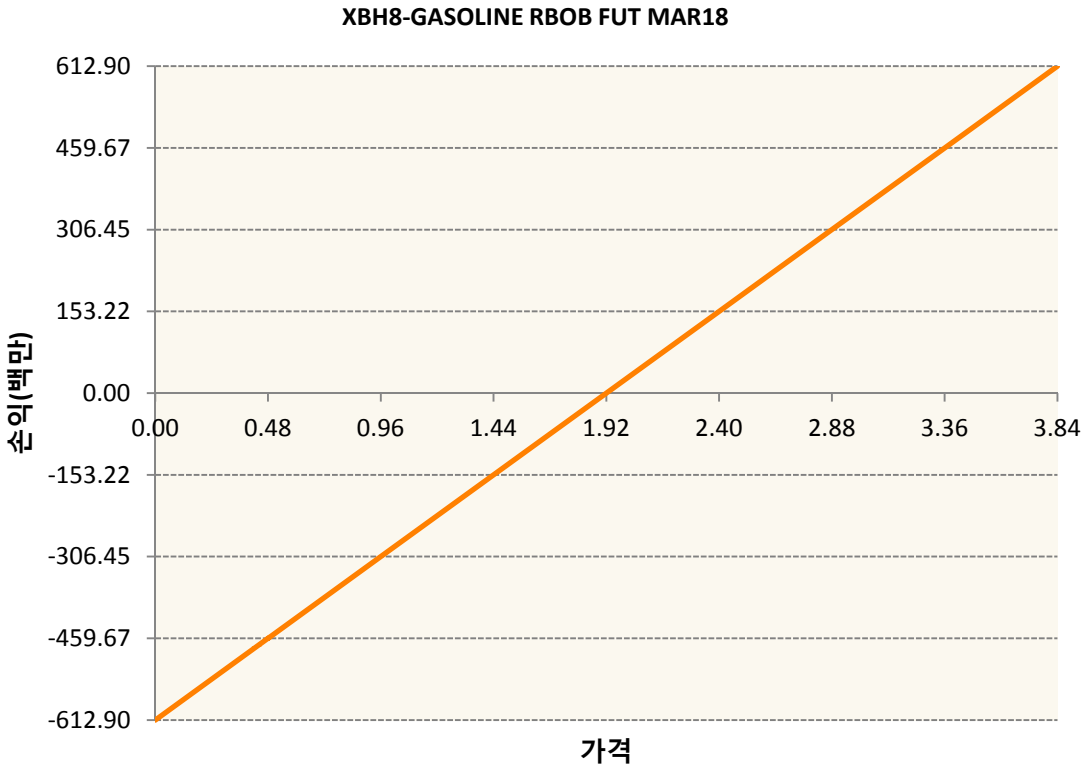



**KR4175N20007-2018-02 달러선물**




-858.72
가격


NGH8-NATURAL GAS FUTR MAR18
1,304.59
978.44
652.29
326.15
0.00
-326.15
-652.29
-978.44
-1,304.59
0.00
0.79
1.59
2.38
3.17
3.96
4.76
5.55
6.34
손익(백만)
가격


XBH8-GASOLINE RBOB FUT MAR18
612.90
459.67
306.45
153.22
0.00
-153.22
-306.45
-459.67
-612.90
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)

| | | |
|---|---|---|
| CLH8 | WTI CRUDE FUTURE MAR18 | 68 |
| COK8 | BRENT CRUDE FUTR MAY18 | 100 |
| HOH8 | NY Harb ULSD Fut MAR18 | 46 |
| KR4175N20( | 2018-02 달러선물 | 69 |
| NGH8 | NATURAL GAS FUTR MAR18 | 104 |
| XBH8 | GASOLINE RBOB FUT MAR18 | 49 |

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

| |
|---|
| **623** |

| | |
|---|---|
| 공시일 | 2018-01-31 |
| 기준일 | 2018-01-30 |

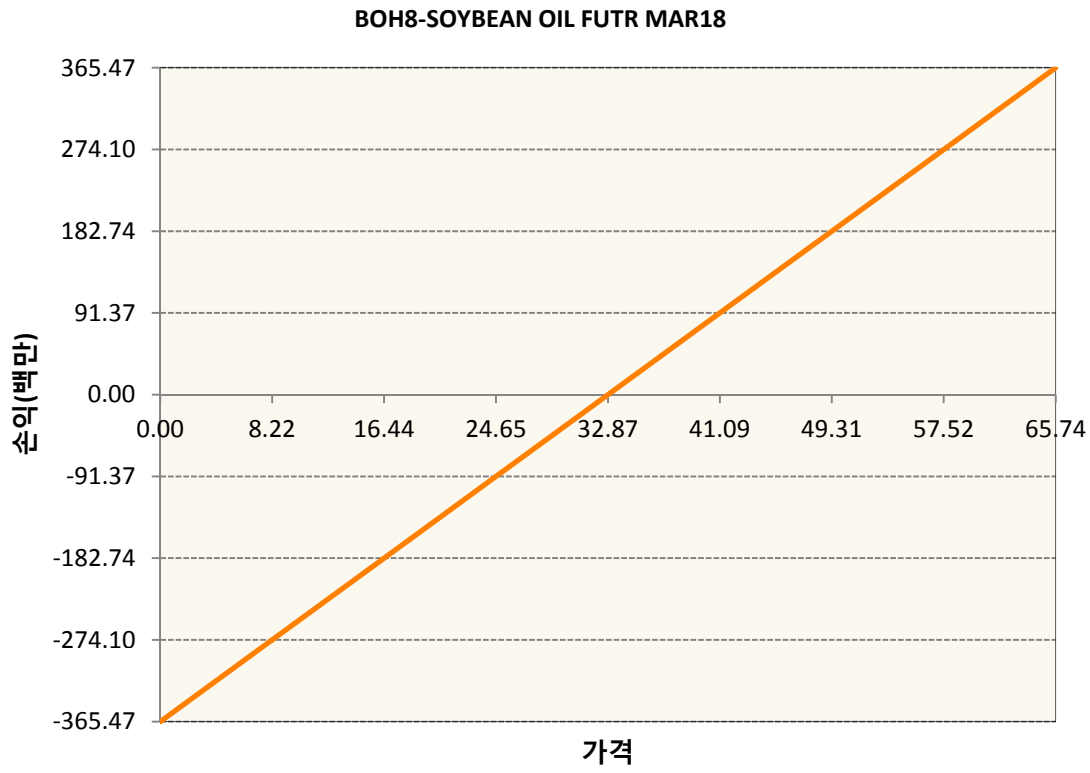
# 애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

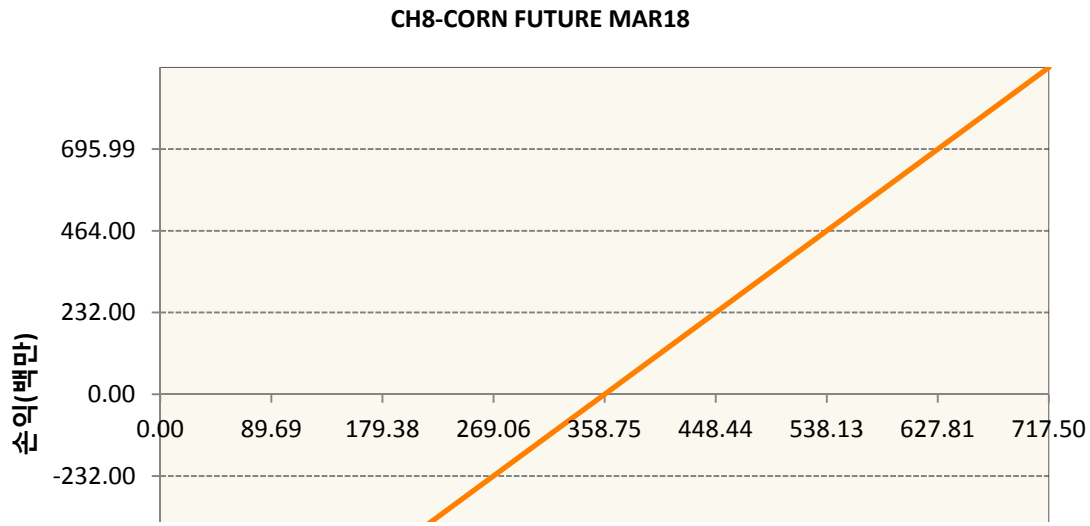
## 1. 계약금액

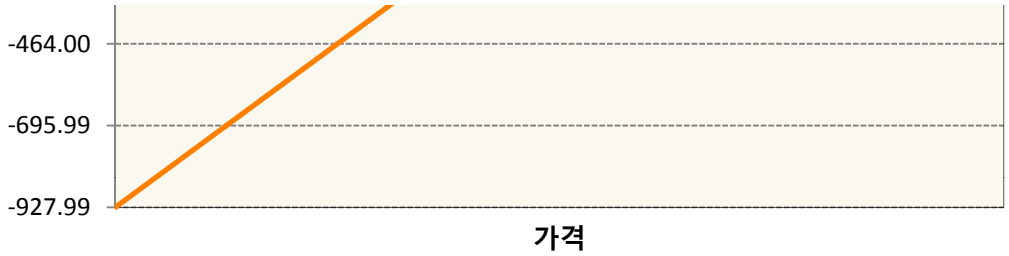
(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 4,152 | 322 | 3,830 | |

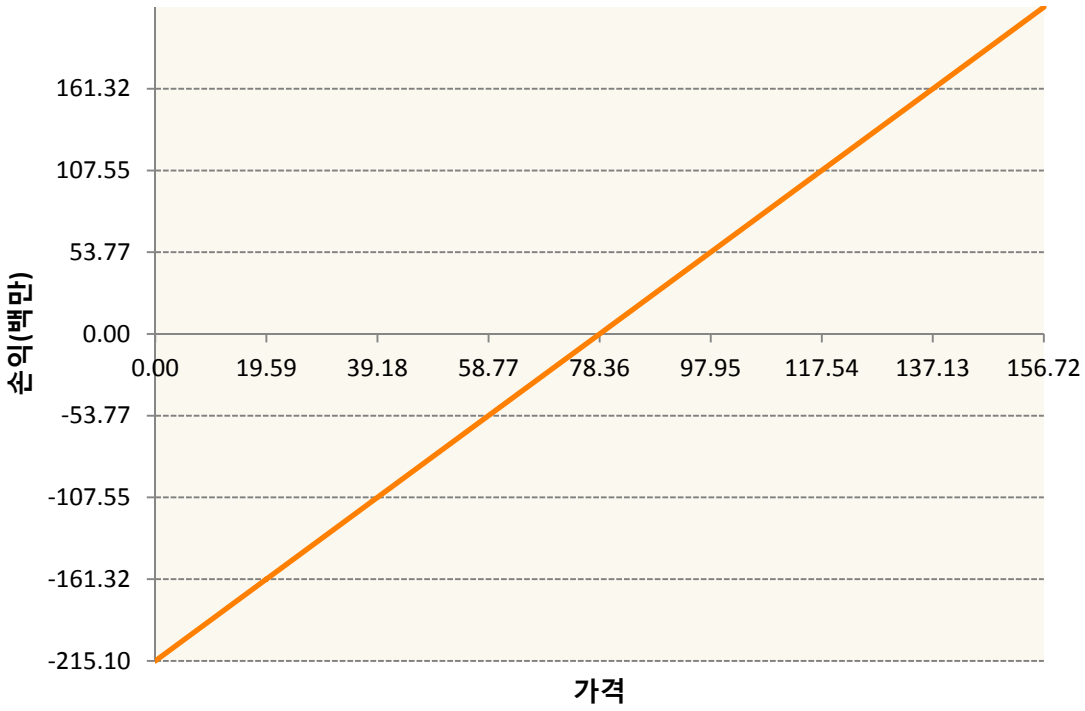
## 2. 만기시점의 손익구조



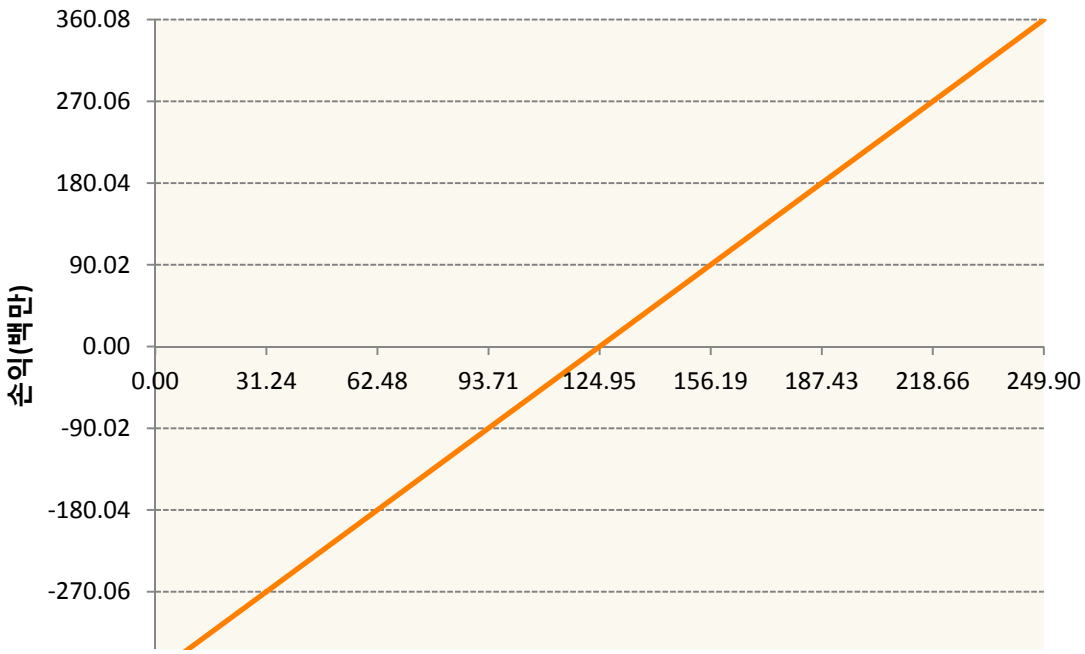



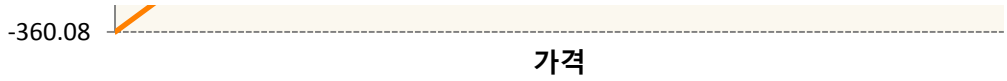


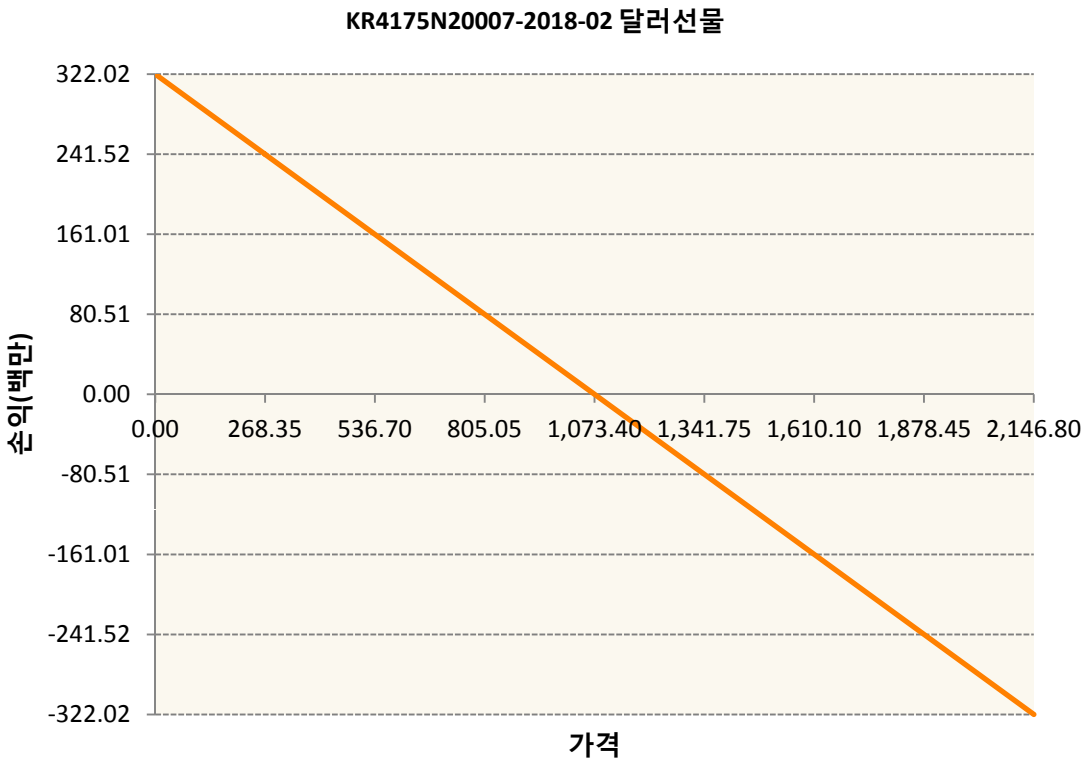

CTH8-COTTON NO.2 FUTR MAR18

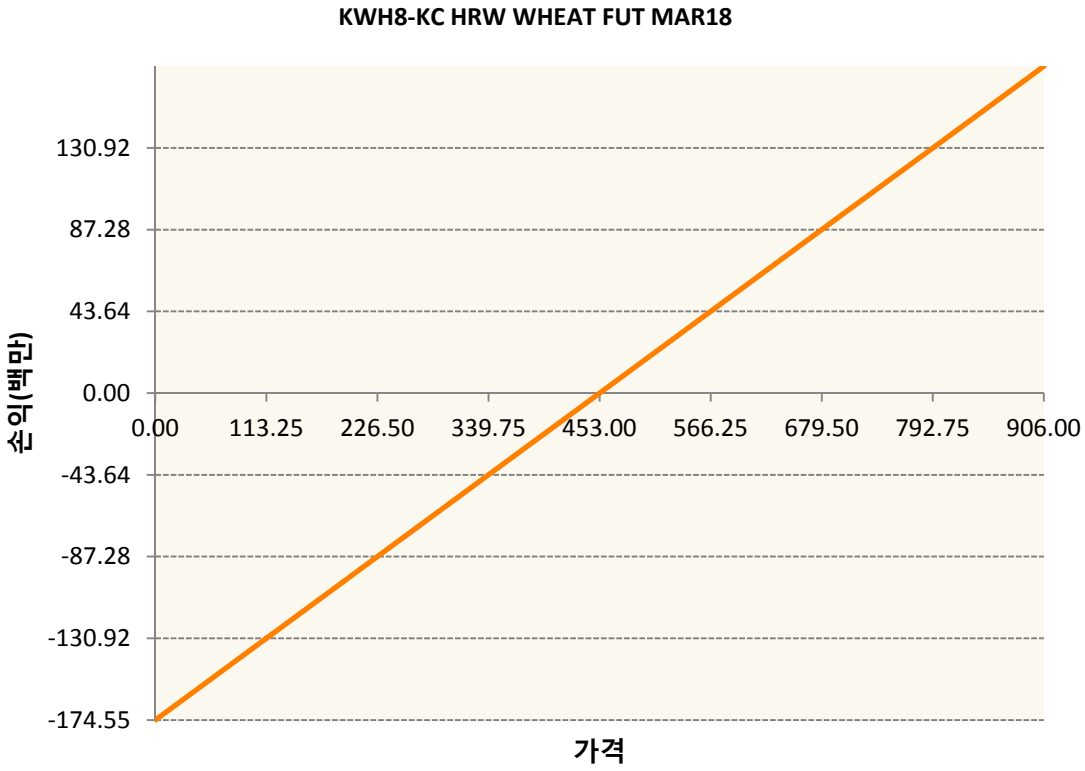



KCH8-COFFEE "C" FUTURE MAR18

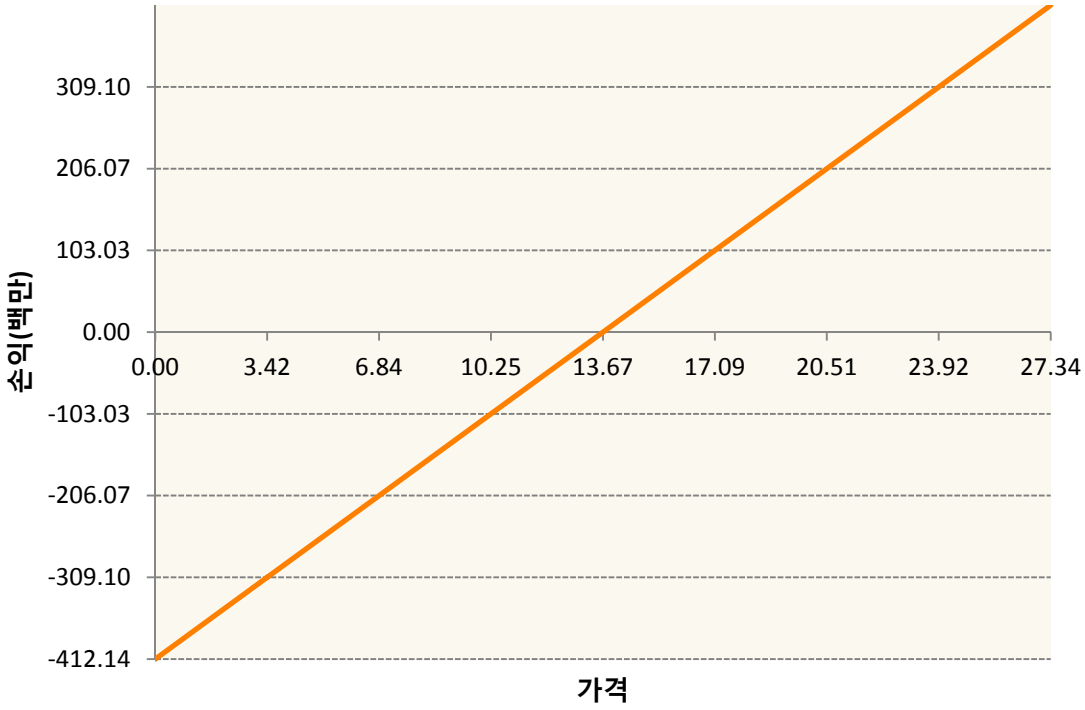



-360.08
가격

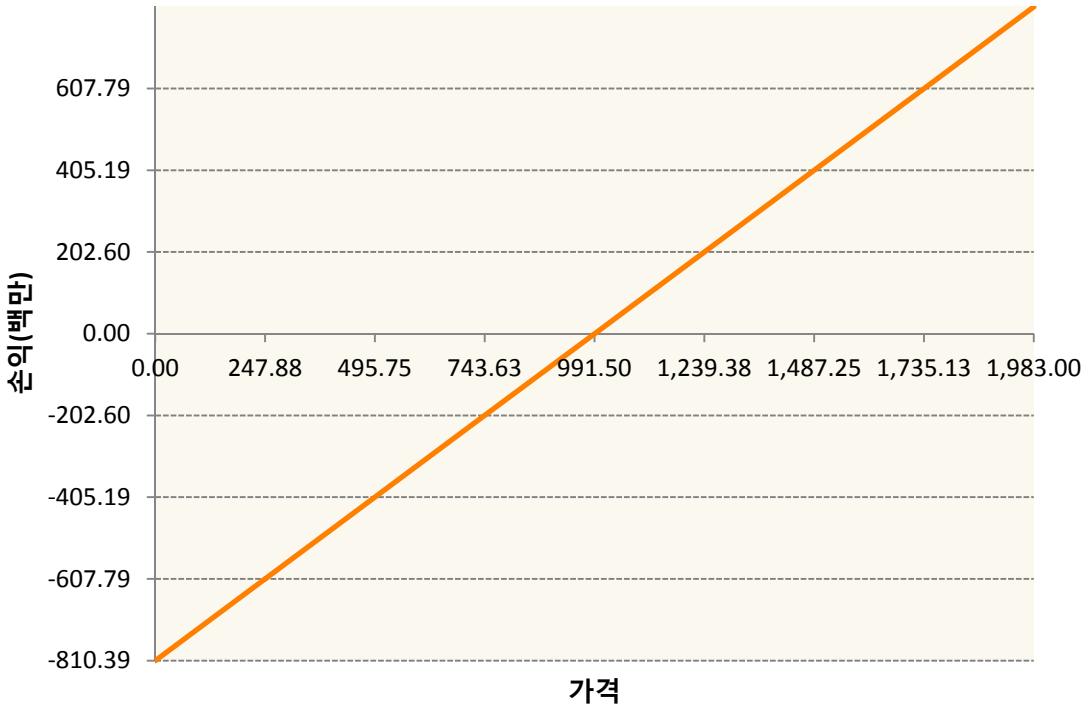

KR4175N20007-2018-02 달러선물
322.02
241.52
161.01
80.51
0.00
-80.51
-161.01
-241.52
-322.02
0.00
268.35
536.70
805.05
1,073.40
1,341.75
1,610.10
1,878.45
2,146.80
손익(백만)
가격


KWH8-KC HRW WHEAT FUT MAR18
130.92
87.28
43.64
0.00
-43.64
-87.28
-130.92
-174.55
0.00
113.25
226.50
339.75
453.00
566.25
679.50
792.75
906.00
손익(백만)
가격

SBH8-Sugar #11 (WORLD) MAR18

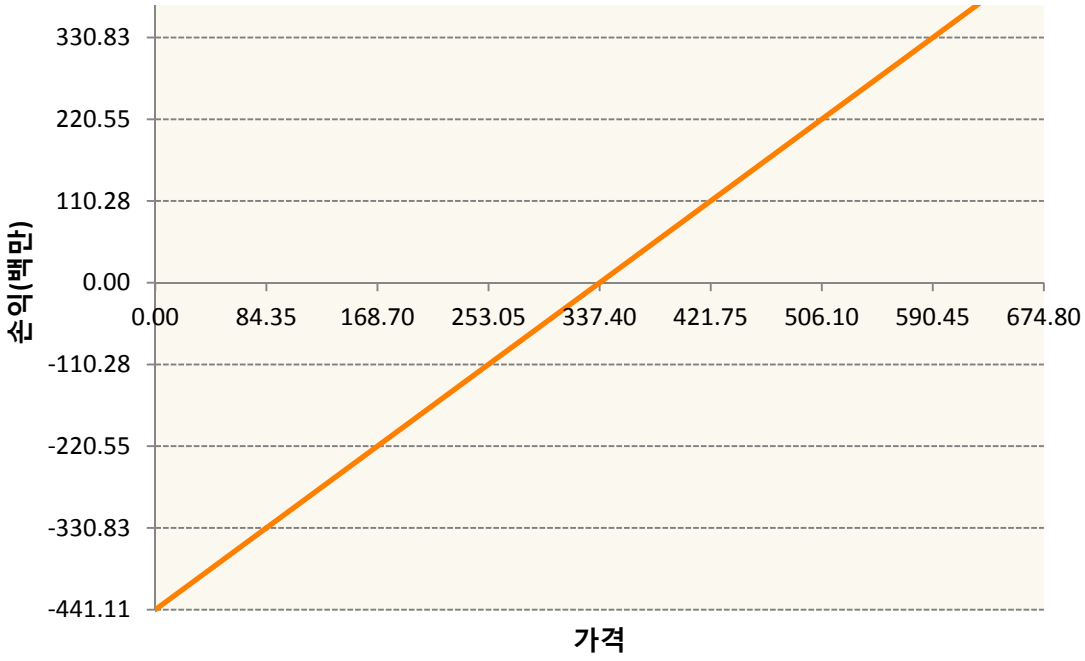



SH8-SOYBEAN FUTURE MAR18

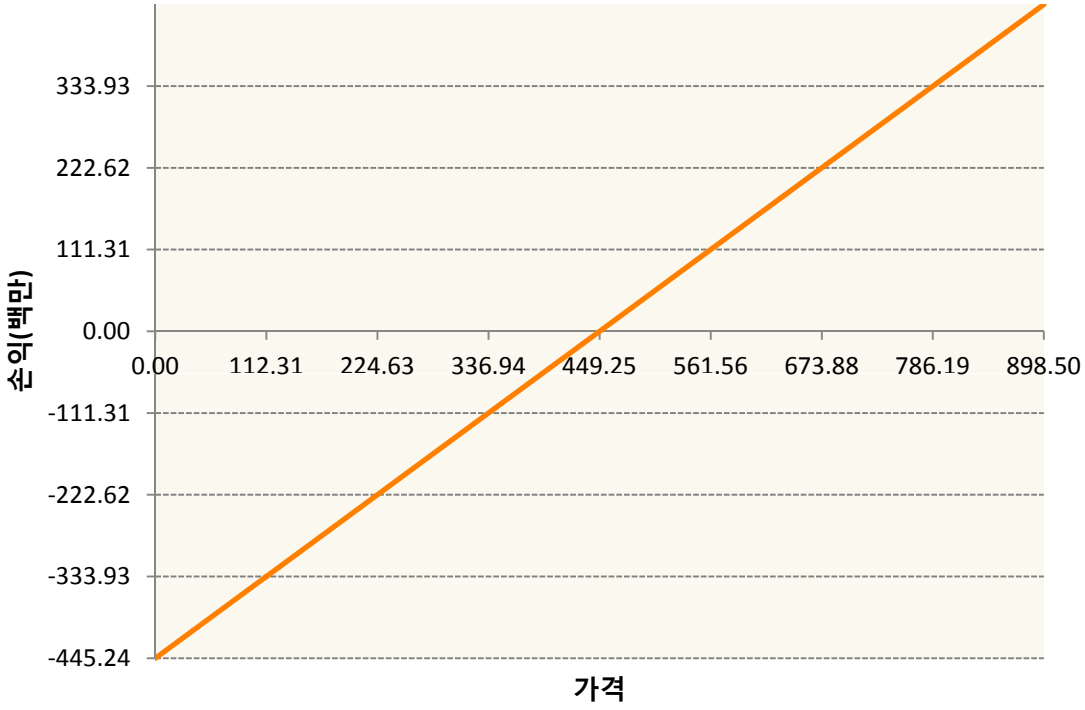



SMH8-SOYBEAN MEAL FUTR MAR18






WH8-WHEAT FUTURE(CBT) MAR18




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

| | | |
|---|---|---|
| BOH8 | SOYBEAN OIL FUTR MAR18 | 29 |
| CH8 | CORN FUTURE MAR18 | 74 |
| CTH8 | COTTON NO.2 FUTR MAR18 | 17 |
| KCH8 | COFFEE "C" FUTURE MAR18 | 29 |
| KR4175N20( | 2018-02 달러선물 | 26 |

| | | |
|---|---|---|
| KWH8 | KC HRW WHEAT FUT MAR18 | 14 |
| SBH8 | Sugar #11 (WORLD) MAR18 | 33 |
| SH8 | SOYBEAN FUTURE MAR18 | 65 |
| SMH8 | SOYBEAN MEAL FUTR MAR18 | 35 |
| WH8 | WHEAT FUTURE(CBT) MAR18 | 36 |

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

| |
|---|
| **346** |