공시일	2018-02-19
기준일	2018-02-14

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	2018-02-19
기준일	2018-02-14

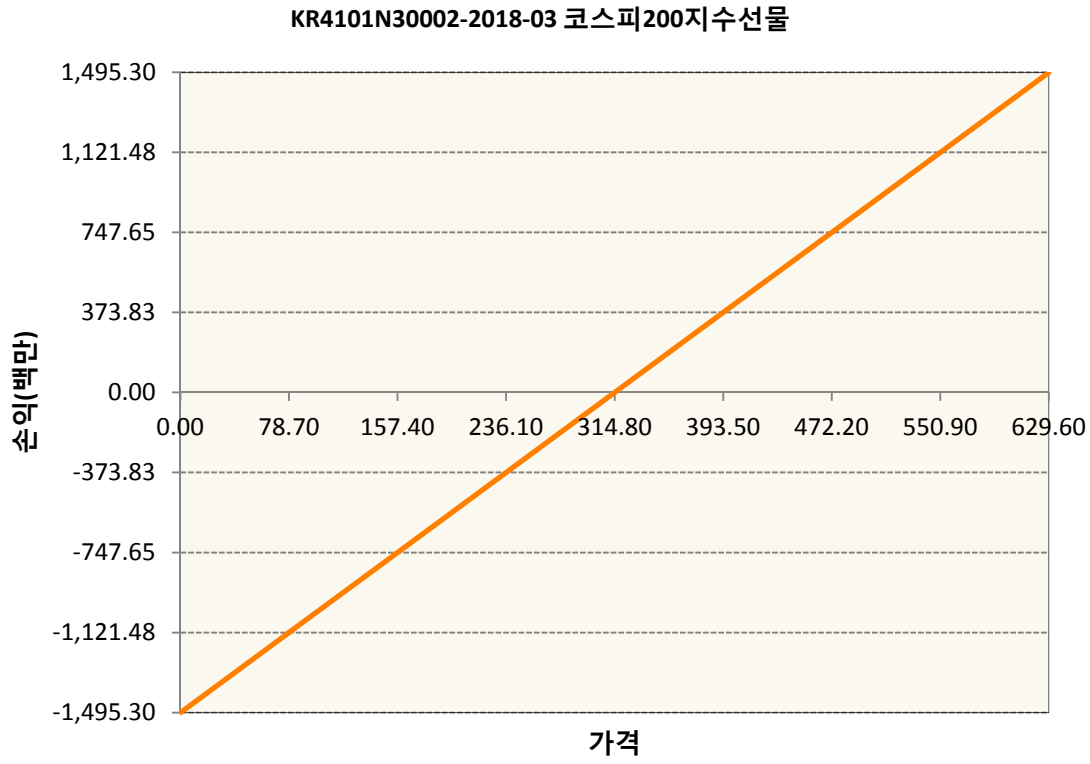
스마트인덱스모

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	1,495	0	1,495	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101N30(2018-03 코스피200지수선물							119
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-119	-119	-119	-119	-119	-119	-119
-5.33%	-80	-80	-80	-80	-80	-80	-80
-2.67%	-40	-40	-40	-40	-40	-40	-40
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	40	40	40	40	40	40	40
5.33%	80	80	80	80	80	80	80
8.00%	119	119	119	119	119	119	119

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

79

공시일	2018-02-19
기준일	2018-02-14

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	1,090

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

390

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2018-02-19
기준일	2018-02-14

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	384

* 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	2018-02-19
기준일	2018-02-14

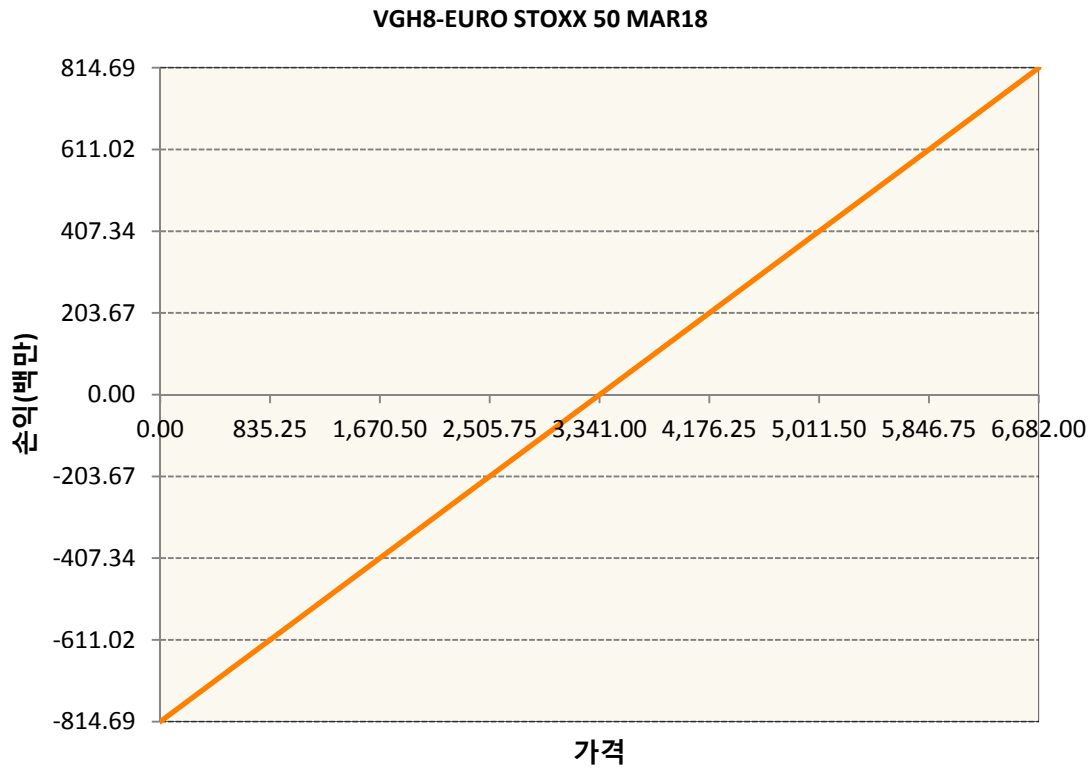
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	815	0	815	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGH8	EURO STOXX 50 MAR18	65

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

(단위:백만원)

38

공시일	2018-02-19
기준일	2018-02-14

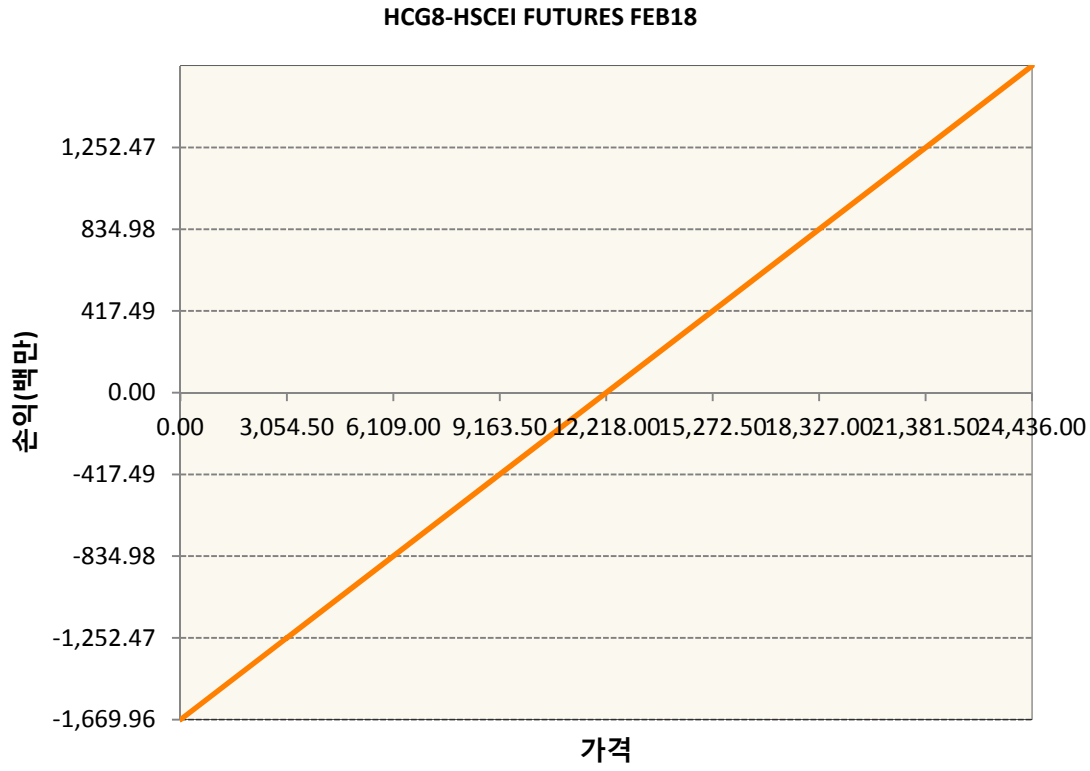
차이나인덱스모(주식-파생형)

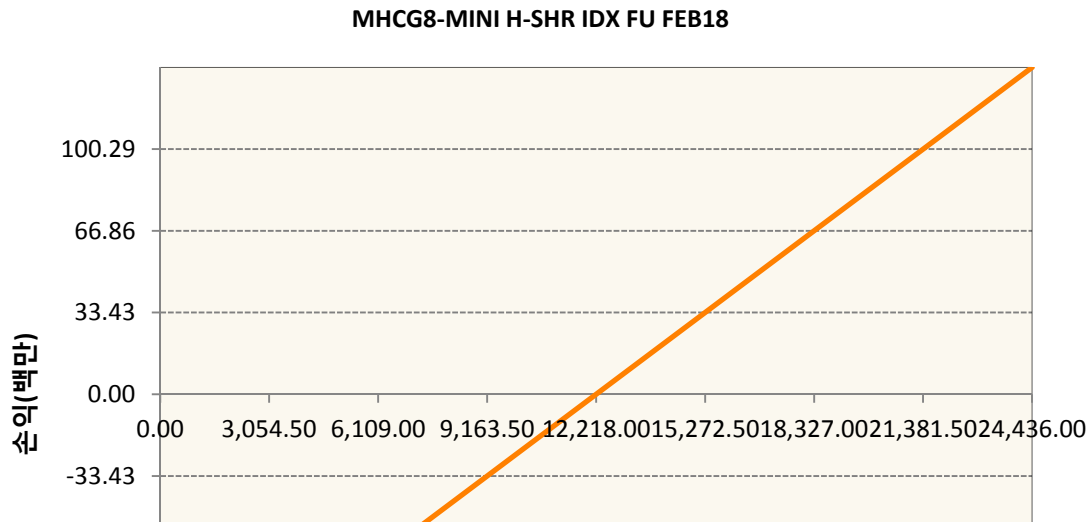
1. 계약금액

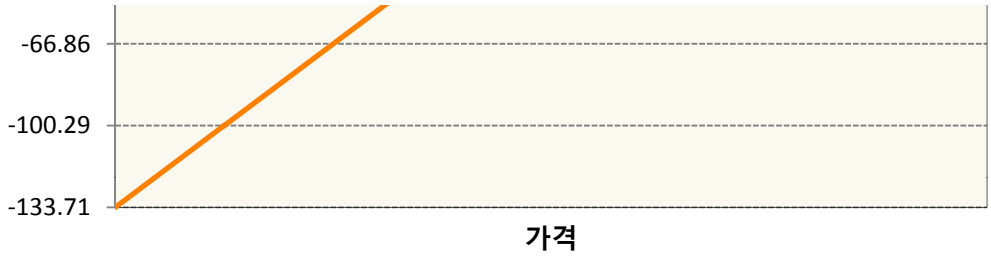
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,804	0	1,804	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCG8	HSCEI FUTURES FEB18	134
MHCG8	MINI H-SHR IDX FU FEB18	11

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	124

공시일	2018-02-19
기준일	2018-02-14

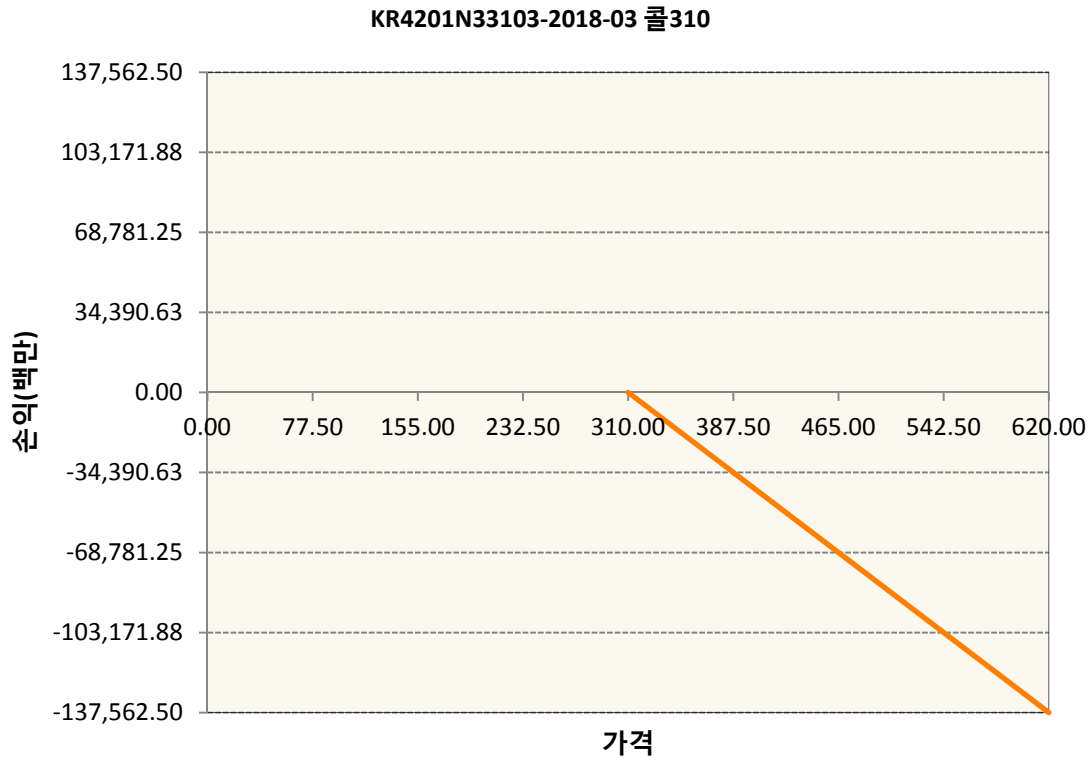
커버드콜모(주식혼합-파생형)

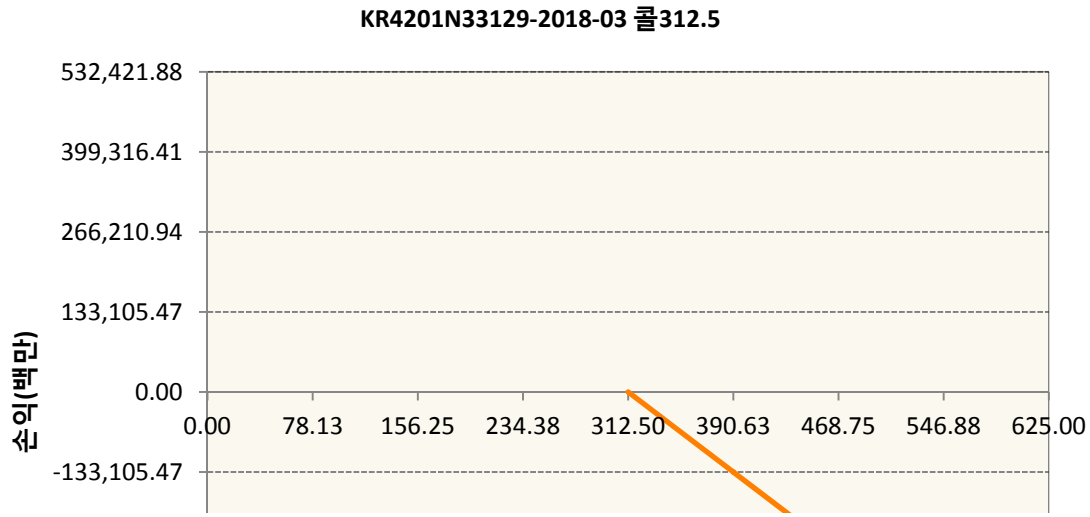
1. 계약금액

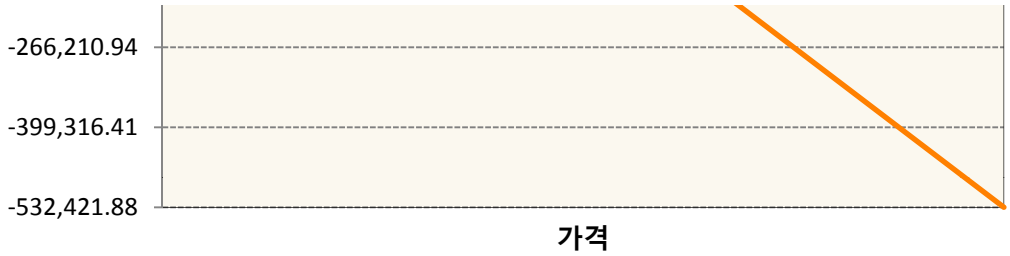
(단위:백만원)

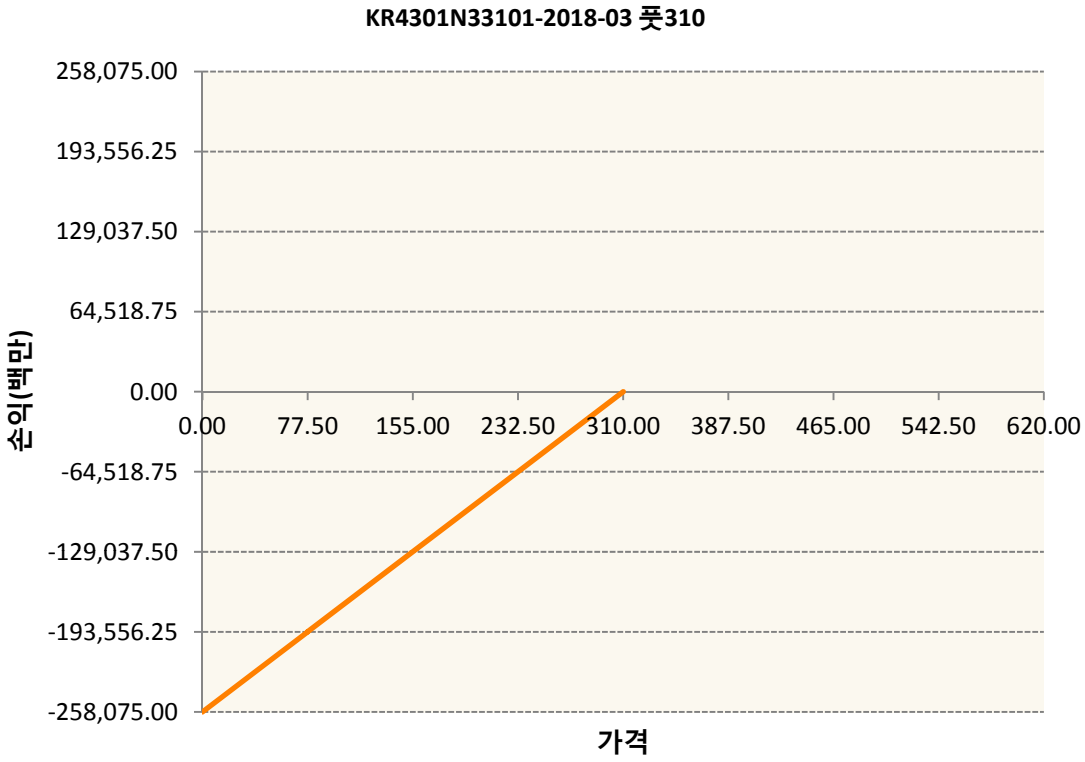
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	7,679	0	7,679	장내
누계	유가증권	옵션	0	1,128,841	-1,128,841	장내

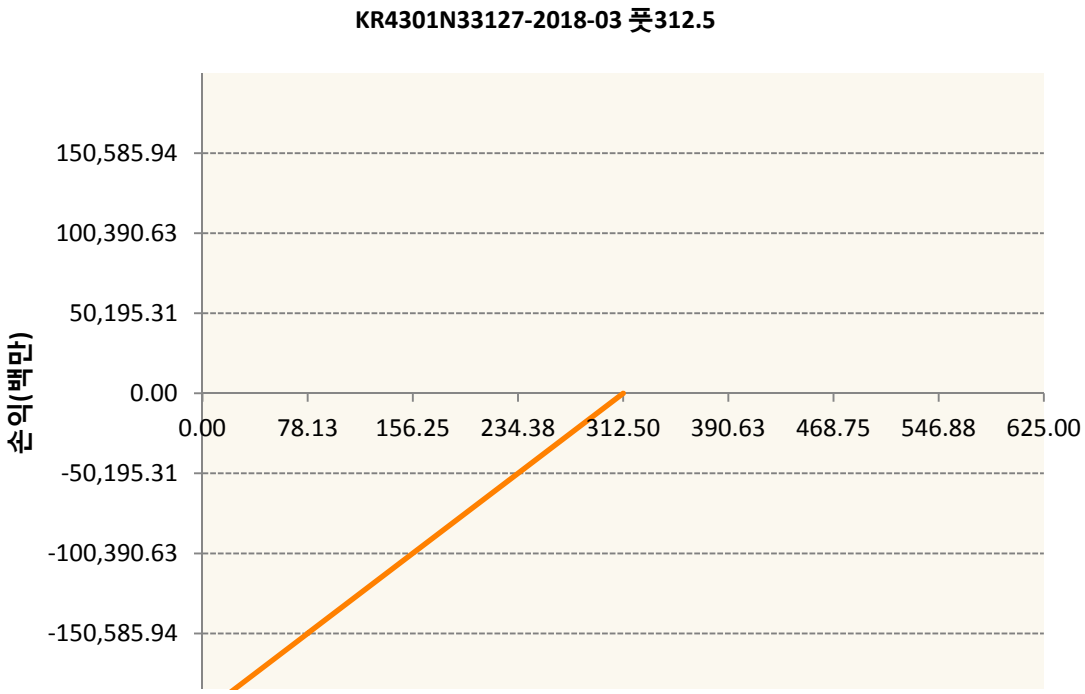
2. 만기시점의 손익구조






-266,210.94
-399,316.41
-532,421.88
가격


KR4301N33101-2018-03 풋310
258,075.00
193,556.25
129,037.50
64,518.75
0.00
-64,518.75
-129,037.50
-193,556.25
-258,075.00
손익(백만)
0.00
77.50
155.00
232.50
310.00
387.50
465.00
542.50
620.00
가격


KR4301N33127-2018-03 풋312.5
150,585.94
100,390.63
50,195.31
0.00
-50,195.31
-100,390.63
-150,585.94
손익(백만)
0.00
78.13
156.25
234.38
312.50
390.63
468.75
546.88
625.00



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201N3312018-03 콜310							9,181
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	4,566	4,433	4,278	4,105	3,916	3,715	3,502
-5.33%	4,001	3,770	3,527	3,274	3,014	2,748	2,476
-2.67%	2,837	2,535	2,231	1,927	1,621	1,315	1,009
0%	917	613	307	0	-308	-617	-927
2.67%	-1,725	-1,966	-2,219	-2,482	-2,753	-3,030	-3,312
5.33%	-4,902	-5,055	-5,230	-5,423	-5,633	-5,856	-6,090
8.00%	-8,393	-8,472	-8,574	-8,698	-8,842	-9,003	-9,181
KR4201N3312018-03 콜312.5							34,018
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	15,522	15,100	14,594	14,012	13,365	12,662	11,910
-5.33%	13,831	13,042	12,194	11,297	10,362	9,396	8,404
-2.67%	10,109	8,998	7,872	6,734	5,588	4,435	3,276
0%	3,618	2,413	1,207	0	-1,208	-2,416	-3,625
2.67%	-5,740	-6,765	-7,824	-8,910	-10,017	-11,139	-12,276
5.33%	-17,393	-18,090	-18,865	-19,704	-20,595	-21,529	-22,499
8.00%	-30,493	-30,879	-31,358	-31,921	-32,557	-33,259	-34,018
KR4301N3312018-03 풋310							14,834
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-14,054	-14,124	-14,219	-14,339	-14,483	-14,649	-14,834
-5.33%	-7,552	-7,771	-8,013	-8,277	-8,557	-8,852	-9,158
-2.67%	-2,230	-2,607	-2,989	-3,373	-3,760	-4,149	-4,540
0%	1,145	768	386	0	-389	-780	-1,173
2.67%	2,664	2,438	2,185	1,911	1,620	1,314	995
5.33%	3,129	3,043	2,930	2,788	2,621	2,431	2,220
8.00%	3,224	3,203	3,167	3,113	3,038	2,943	2,827
KR4301N3312018-03 풋312.5							12,212
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-11,743	-11,778	-11,830	-11,900	-11,987	-12,092	-12,212
-5.33%	-6,593	-6,724	-6,876	-7,047	-7,234	-7,435	-7,647
-2.67%	-2,147	-2,412	-2,686	-2,964	-3,248	-3,535	-3,825
0%	932	622	311	0	-312	-624	-937
2.67%	2,487	2,270	2,037	1,792	1,536	1,273	1,002

5.33%	3,028	2,933	2,815	2,675	2,515	2,339	2,148
8.00%	3,156	3,129	3,086	3,027	2,950	2,855	2,743

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

69,268

공시일	2018-02-19
기준일	2018-02-14

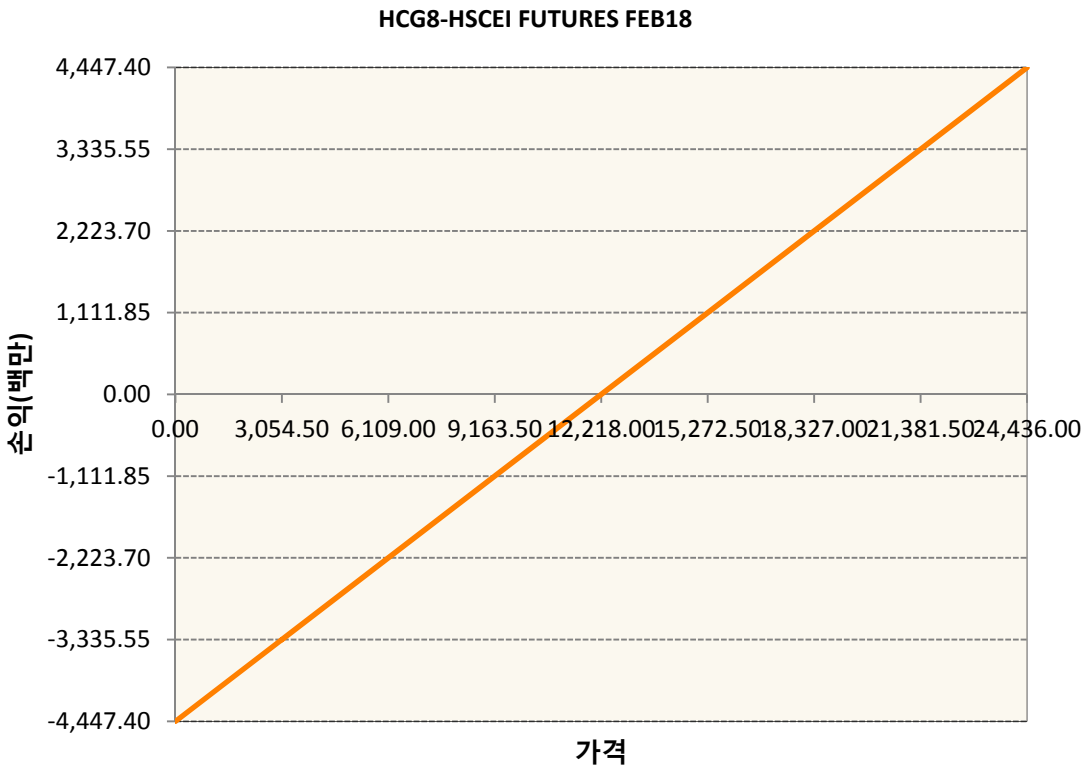
홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생

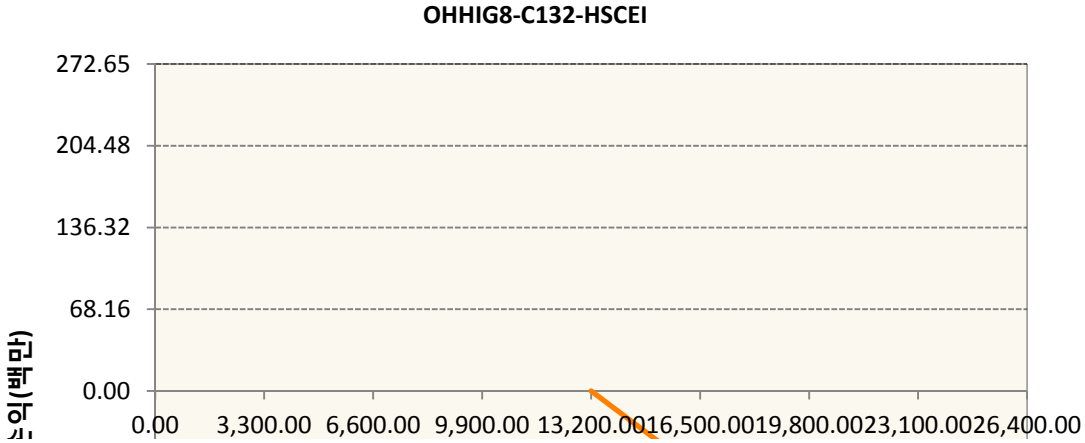
1. 계약금액

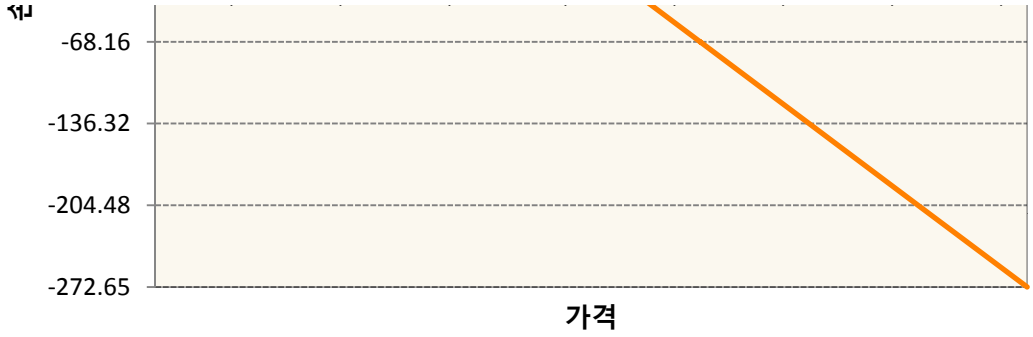
(단위:백만원)

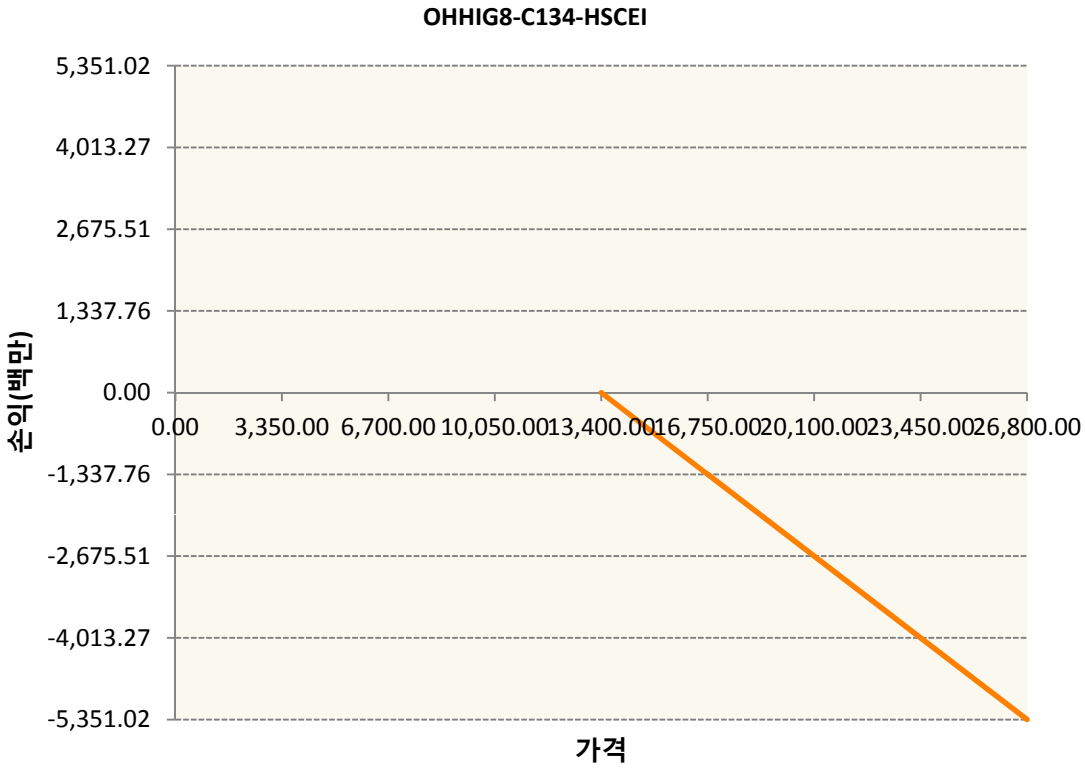
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	4,447	0	4,447	장내
누계	유가증권	옵션	0	11,247	-11,247	장내

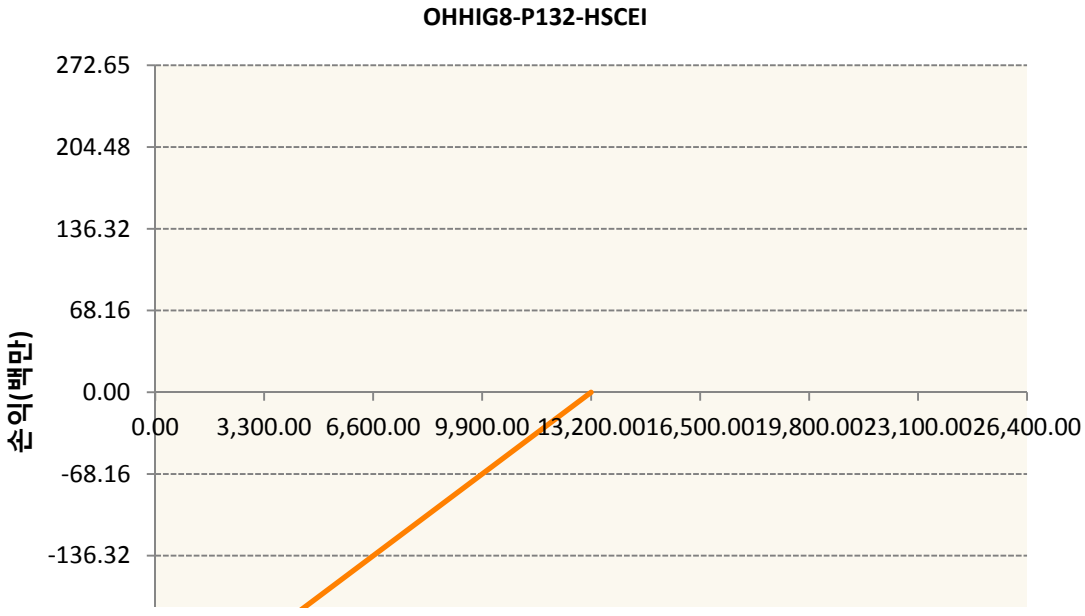
2. 만기시점의 손익구조

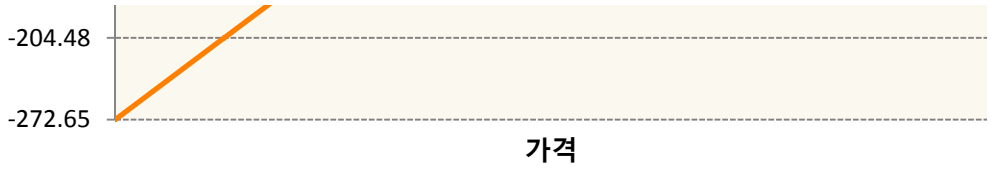


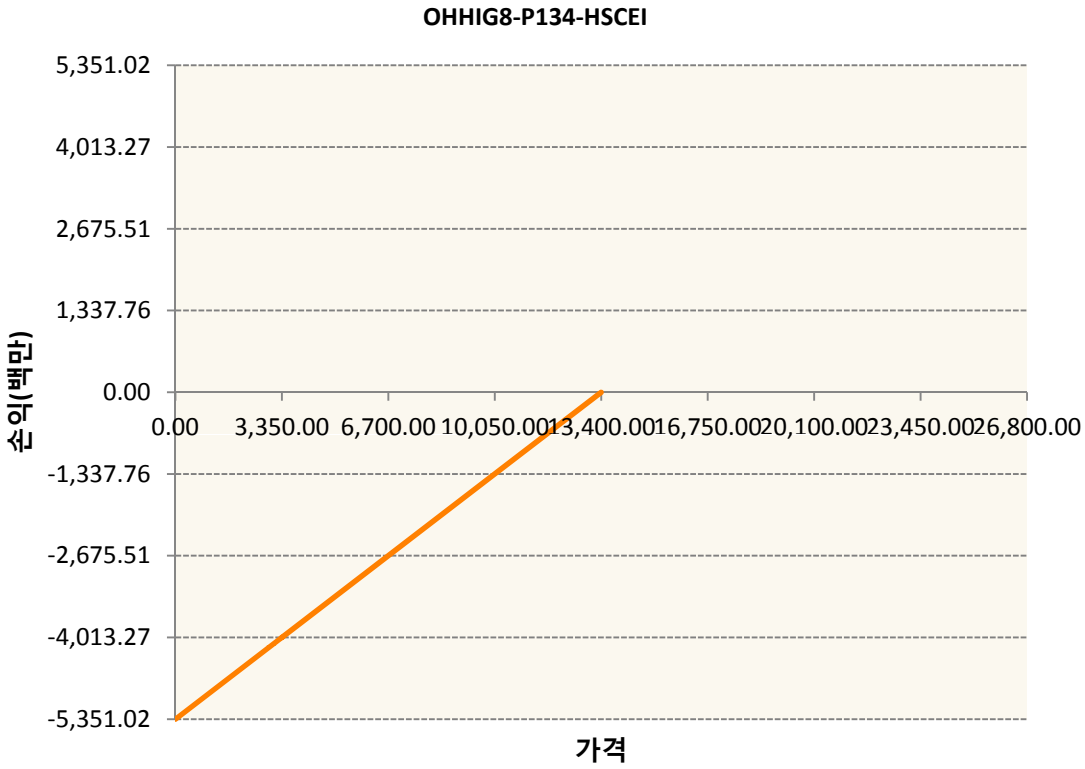



-68.16
-136.32
-204.48
-272.65
가격


OHHIG8-C134-HSCEI
5,351.02
4,013.27
2,675.51
1,337.76
0.00
-1,337.76
-2,675.51
-4,013.27
-5,351.02
손익(백만)
0.00
3,350.00
6,700.00
10,050.00
13,400.00
16,750.00
20,100.00
23,450.00
26,800.00
가격


OHHIG8-P132-HSCEI
272.65
204.48
136.32
68.16
0.00
-68.16
-136.32
손익(백만)
0.00
3,300.00
6,600.00
9,900.00
13,200.00
16,500.00
19,800.00
23,100.00
26,400.00





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCG8	HSCEI FUTURES FEB18	356
OHHIG8-C1	HSCEI	22
OHHIG8-C1	HSCEI	428
OHHIG8-P1	HSCEI	22
OHHIG8-P1	HSCEI	428

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,081

공시일	2018-02-19
기준일	2018-02-14

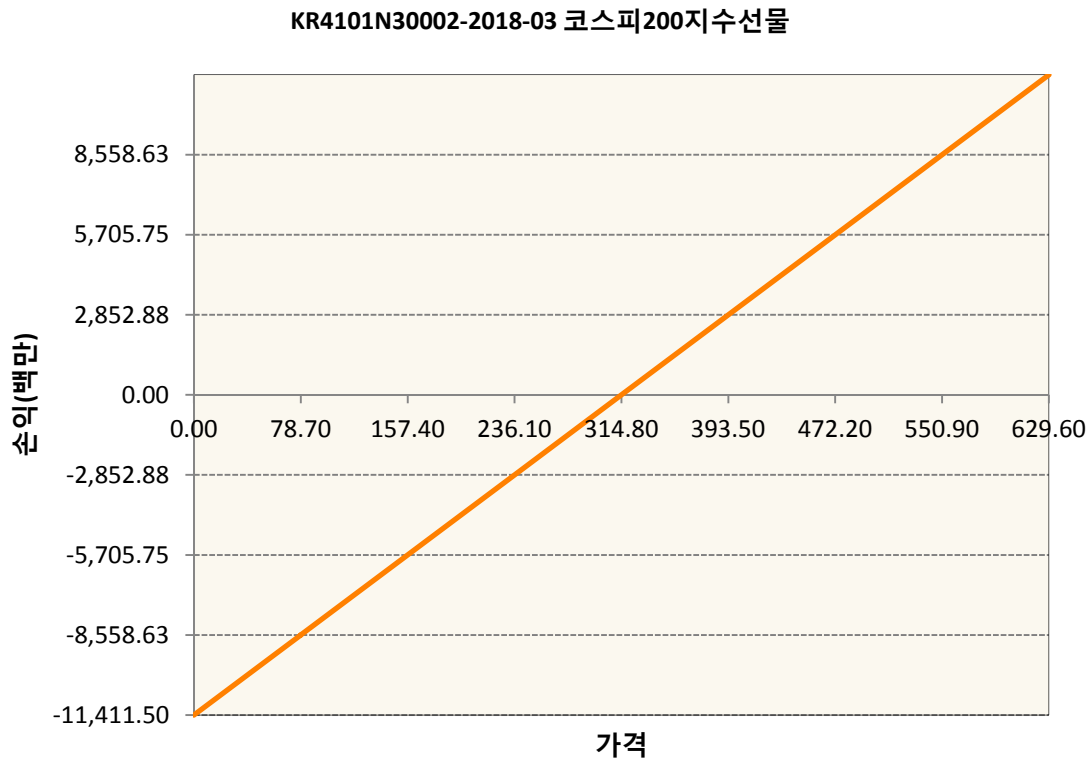
코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼

1. 계약금액

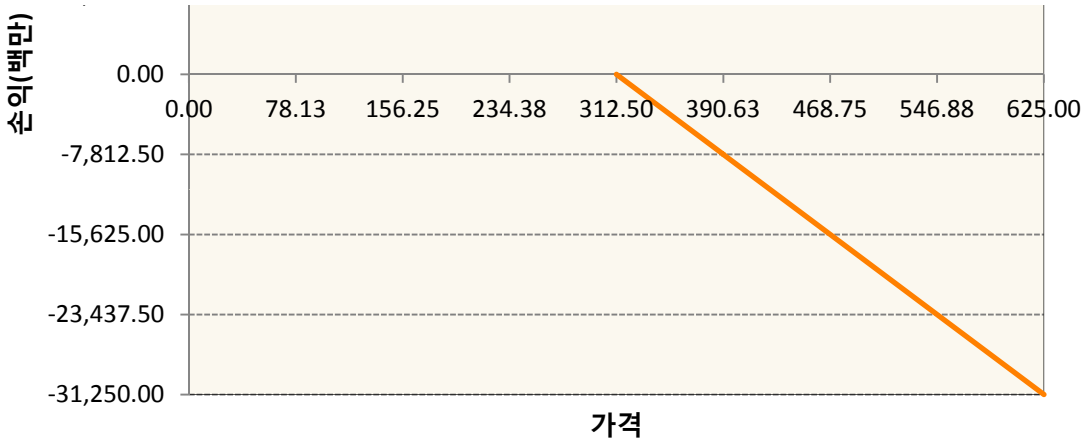
(단위:백만원)

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	11,412	0	11,412	장내
누계	유가증권	스왑	56,200	0	56,200	장외
누계	유가증권	옵션	0	56,094	-56,094	장내

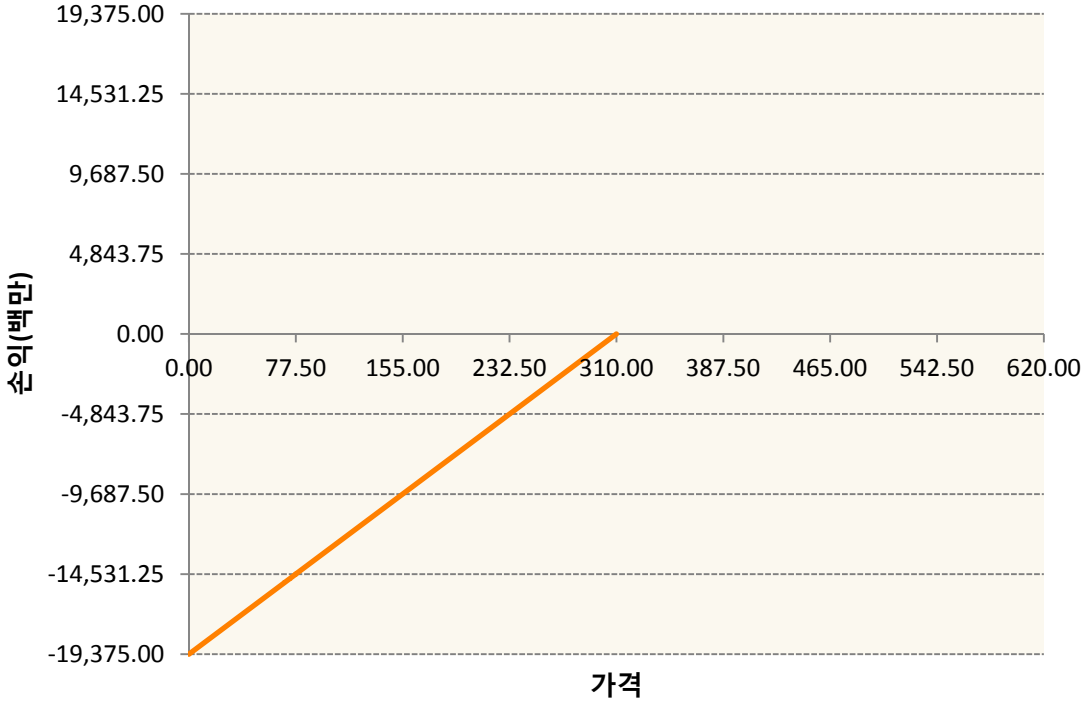
2. 만기시점의 손익구조



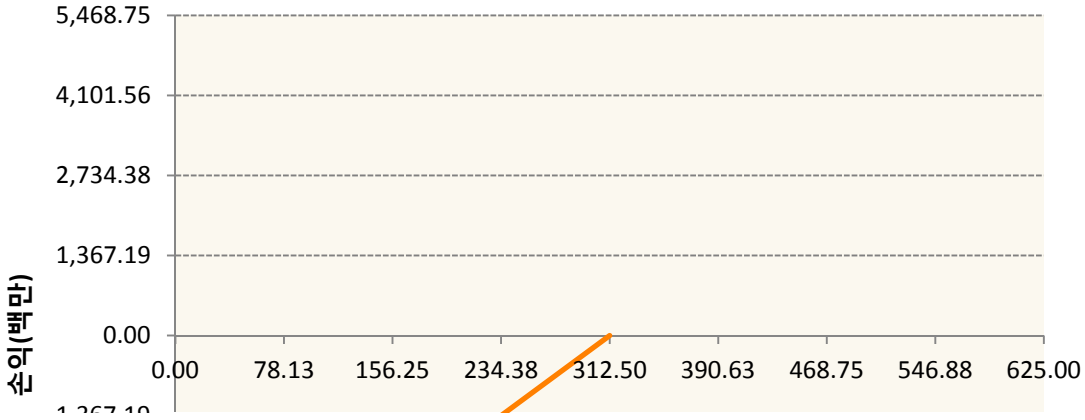




KR4301N33101-2018-03 풋310



KR4301N33127-2018-03 풋312.5





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						464
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-464	-464	-464	-464	-464	-464	-464
-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%	464	464	464	464	464	464	464
	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					912
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-912	-912	-912	-912	-912	-912	-912
-5.33%	-608	-608	-608	-608	-608	-608	-608
-2.67%	-304	-304	-304	-304	-304	-304	-304
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	304	304	304	304	304	304	304
5.33%	608	608	608	608	608	608	608
8.00%	912	912	912	912	912	912	912
	KR4201N331	2018-03 콜312.5					1,997
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	911	886	857	822	784	743	699
-5.33%	812	766	716	663	608	551	493
-2.67%	593	528	462	395	328	260	192
0%	212	142	71	0	-71	-142	-213
2.67%	-337	-397	-459	-523	-588	-654	-721
5.33%	-1,021	-1,062	-1,107	-1,156	-1,209	-1,264	-1,321
8.00%	-1,790	-1,812	-1,841	-1,874	-1,911	-1,952	-1,997
	KR4301N331	2018-03 풋310					1,114

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,055	-1,060	-1,067	-1,076	-1,087	-1,100	-1,114
-5.33%	-567	-583	-602	-621	-642	-665	-688
-2.67%	-167	-196	-224	-253	-282	-312	-341
0%	86	58	29	0	-29	-59	-88
2.67%	200	183	164	143	122	99	75
5.33%	235	228	220	209	197	183	167
8.00%	242	240	238	234	228	221	212
	KR4301N3312018-03 풋312.5						333

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-320	-321	-322	-324	-327	-329	-333
-5.33%	-180	-183	-187	-192	-197	-203	-208
-2.67%	-58	-66	-73	-81	-88	-96	-104
0%	25	17	8	0	-8	-17	-26
2.67%	68	62	55	49	42	35	27
5.33%	82	80	77	73	69	64	59
8.00%	86	85	84	82	80	78	75

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

8,386

공시일	2018-02-19
기준일	2018-02-14

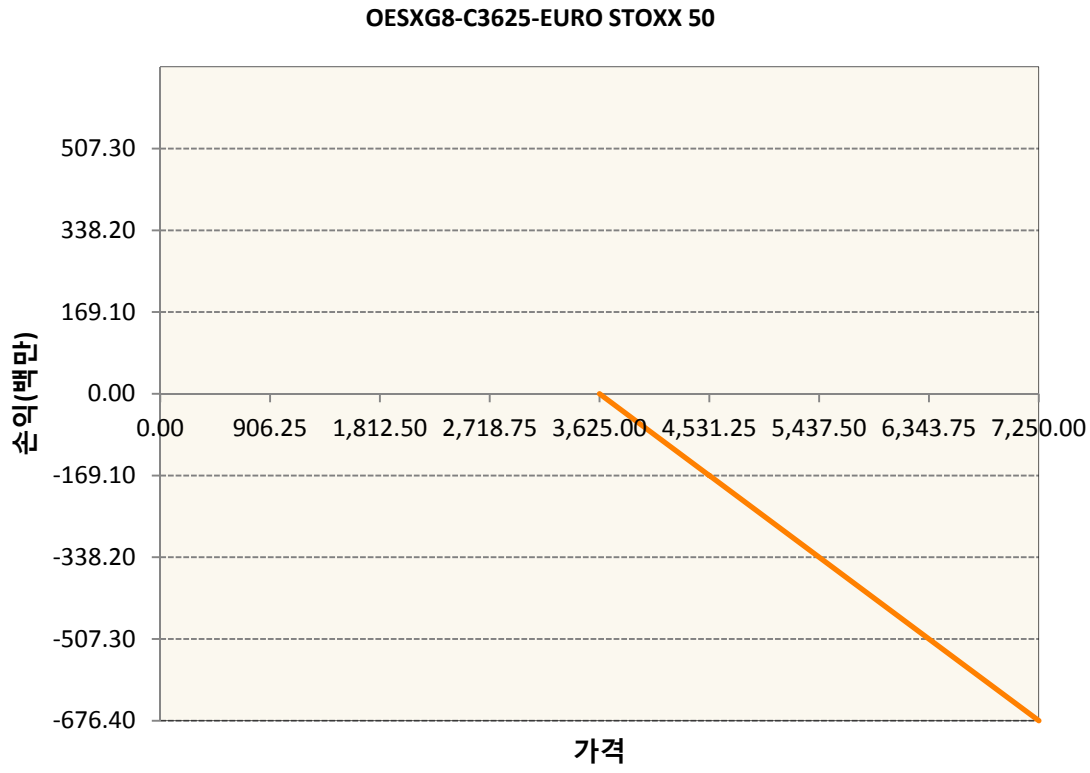
유로커버드콜모(주식혼합-파생형

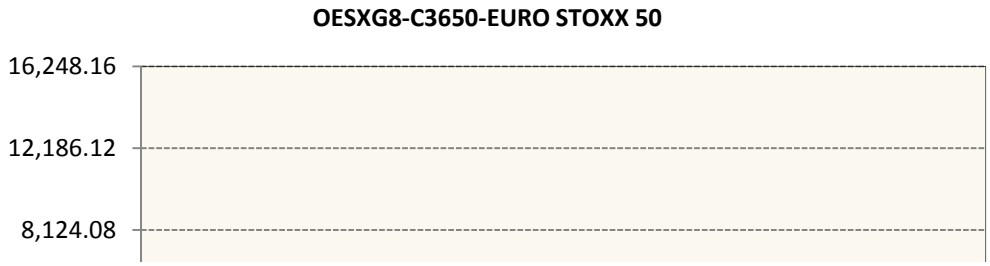
1. 계약금액

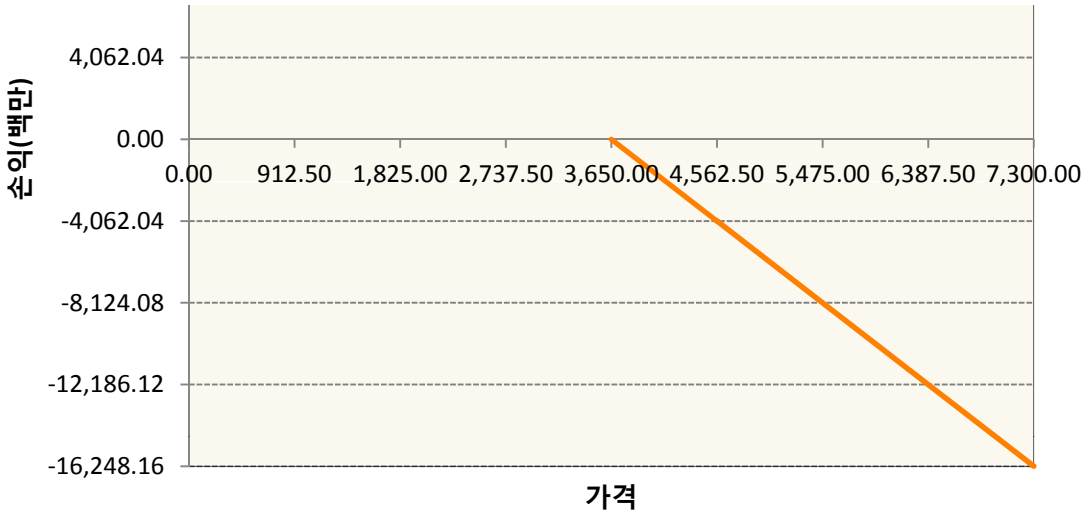
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	7,298	0	7,298	
누계	유가증권	스왑	99,961	0	99,961	장외
누계	유가증권	옵션	0	33,849	-33,849	장내
누계	지수	스왑	53,314	0	53,314	장외

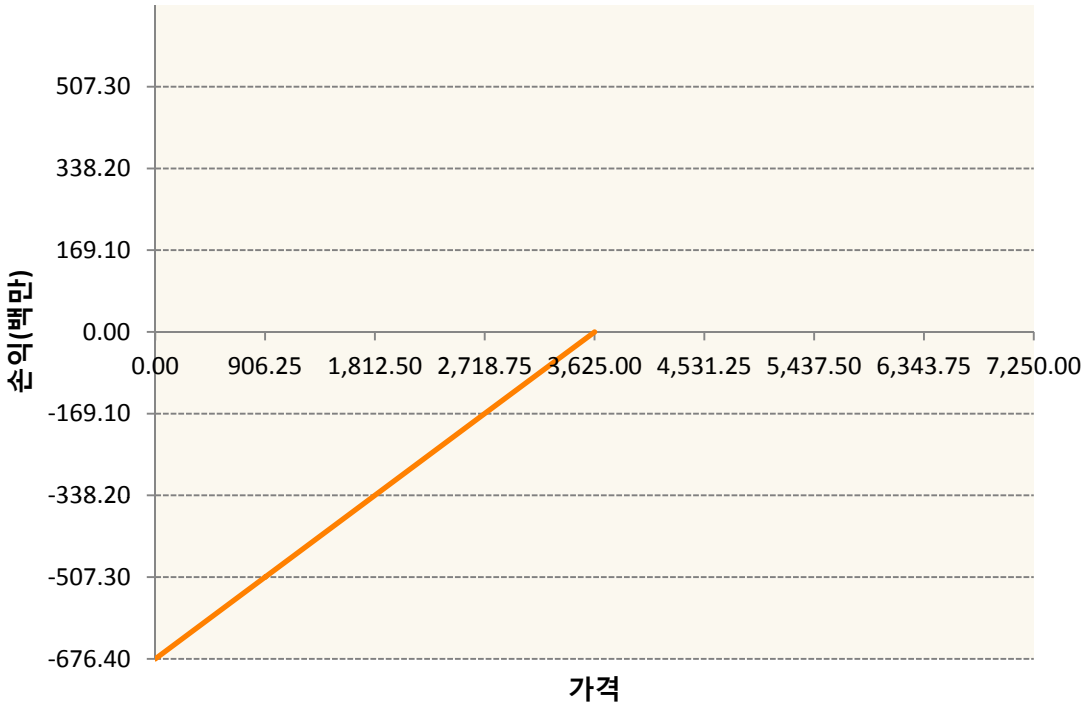
2. 만기시점의 손익구조



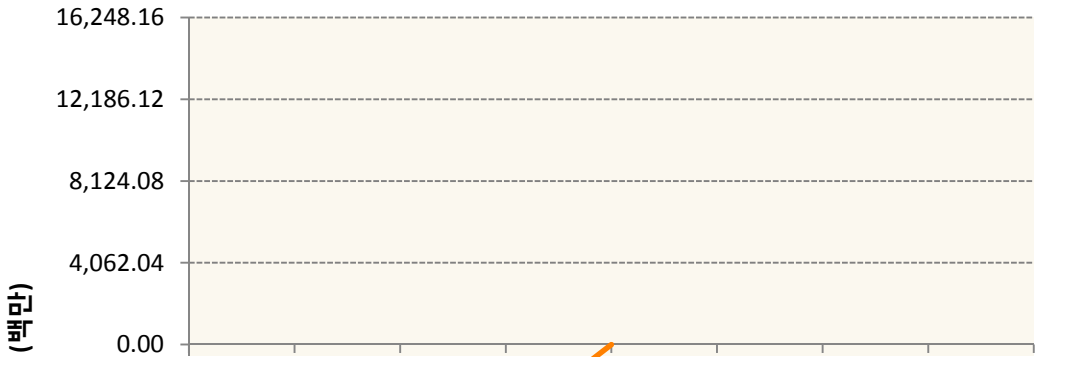


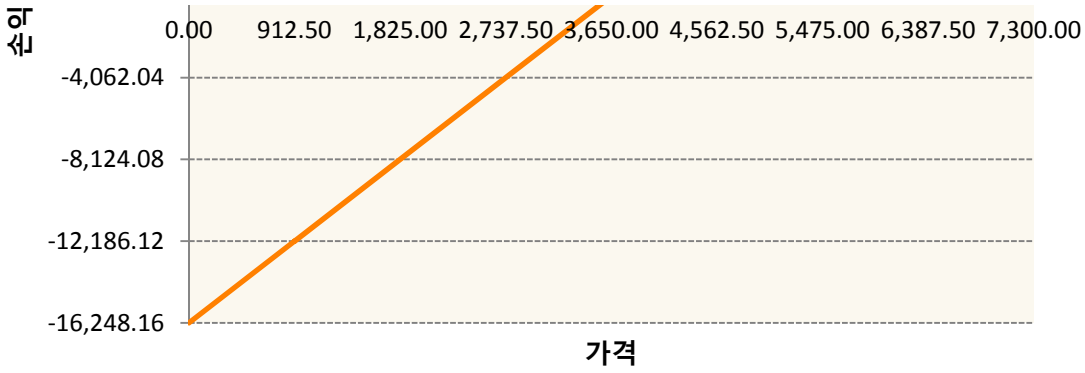


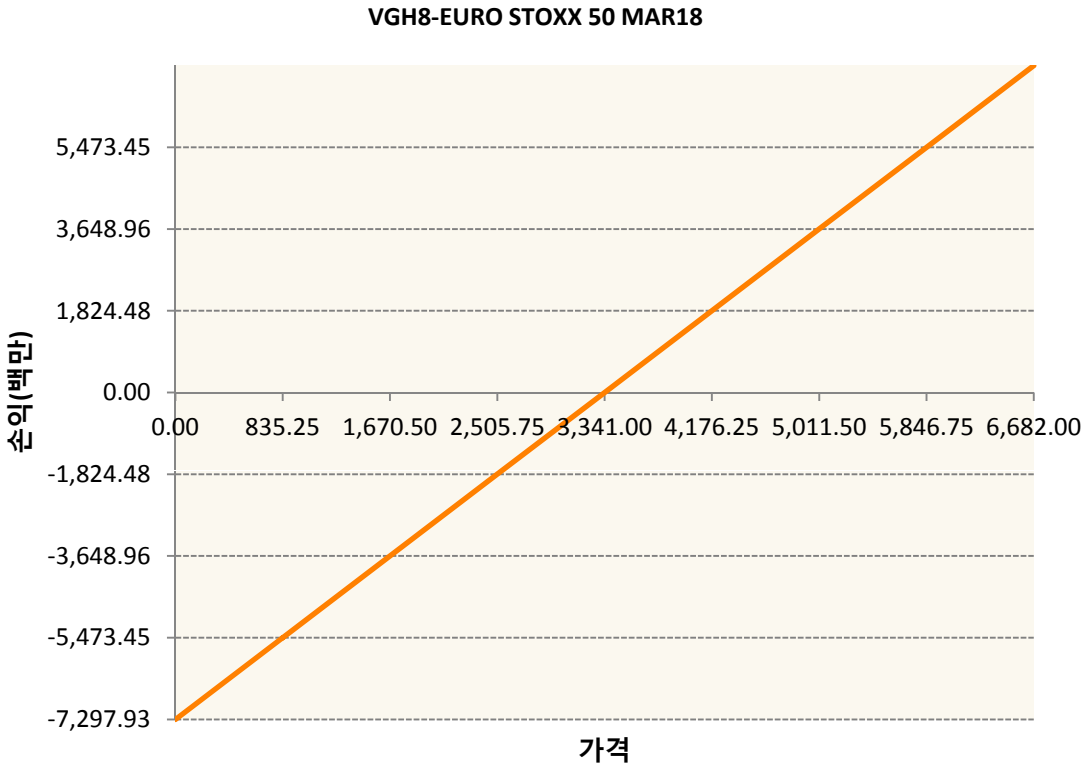
OESXG8-P3625-EURO STOXX 50



OESXG8-P3650-EURO STOXX 50







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)	(단위:백만원)
260105SGPX SG EURO Covered CALL STRATEGY - 994.569	319
260105SQPX SG EURO Covered CALL STRATEGY	598
OESXG8-C3(EURO STOXX 50	54
OESXG8-C3(EURO STOXX 50	1,300
OESXG8-P3(EURO STOXX 50	54
OESXG8-P3(EURO STOXX 50	1,300
VGH8 EURO STOXX 50 MAR18	584

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

2,529

공시일	2018-02-19
기준일	2018-02-14

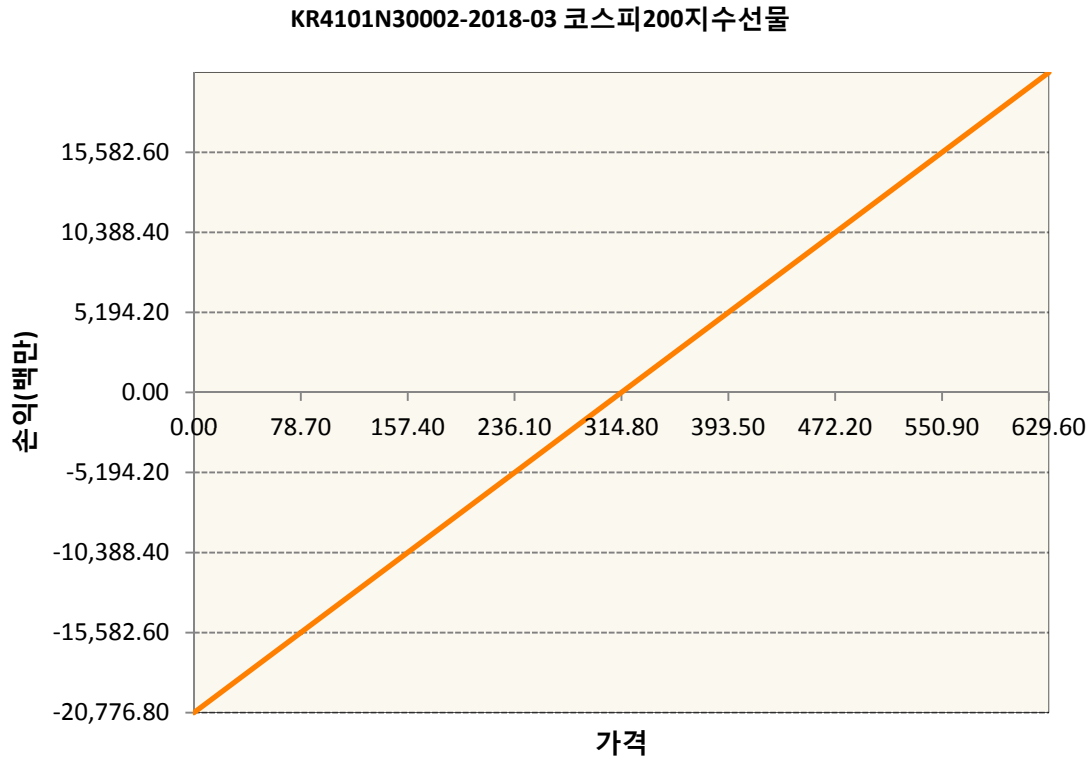
ETF스마트레버리지목표전환형8호

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	20,777	0	20,777	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101N30(2018-03 코스피200지수선물							1,660
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,660	-1,660	-1,660	-1,660	-1,660	-1,660	-1,660
-5.33%	-1,107	-1,107	-1,107	-1,107	-1,107	-1,107	-1,107
-2.67%	-553	-553	-553	-553	-553	-553	-553
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	553	553	553	553	553	553	553
5.33%	1,107	1,107	1,107	1,107	1,107	1,107	1,107
8.00%	1,660	1,660	1,660	1,660	1,660	1,660	1,660

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

1,095

공시일	2018-02-19
기준일	2018-02-14

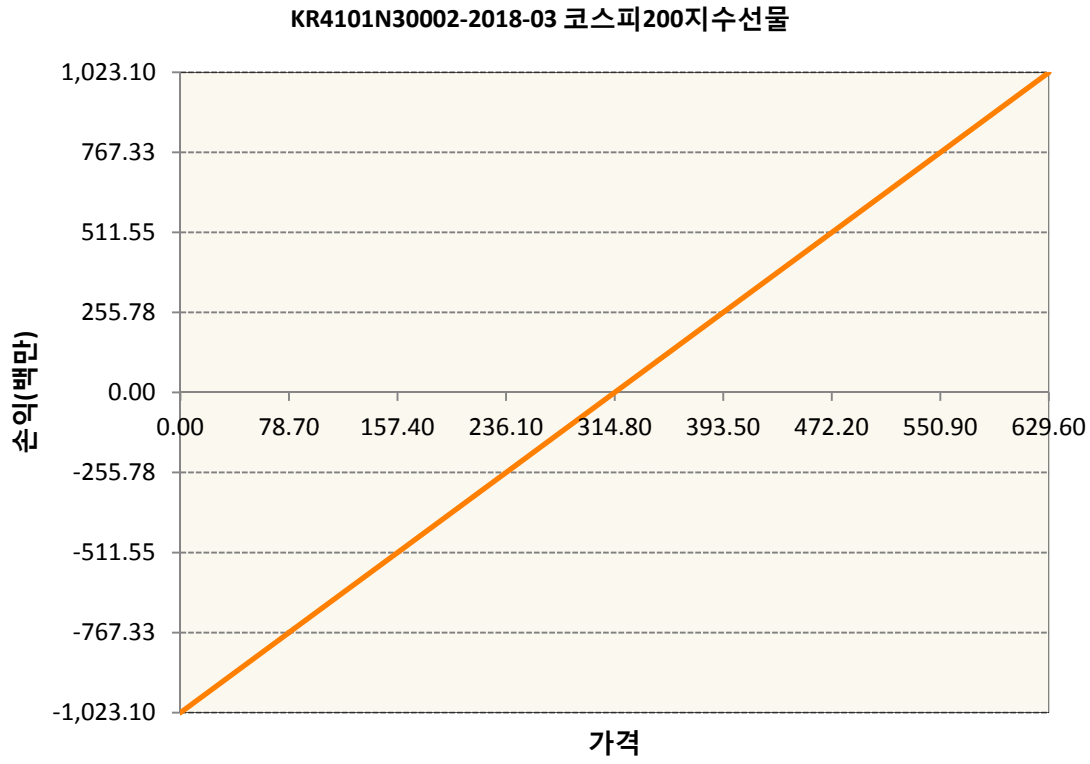
ETF스마트레버리지목표전환형9호

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	1,023	0	1,023	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101N30(2018-03 코스피200지수선물							82
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-82	-82	-82	-82	-82	-82	-82
-5.33%	-54	-54	-54	-54	-54	-54	-54
-2.67%	-27	-27	-27	-27	-27	-27	-27
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	27	27	27	27	27	27	27
5.33%	54	54	54	54	54	54	54
8.00%	82	82	82	82	82	82	82

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

54

공시일	2018-02-19
기준일	2018-02-14

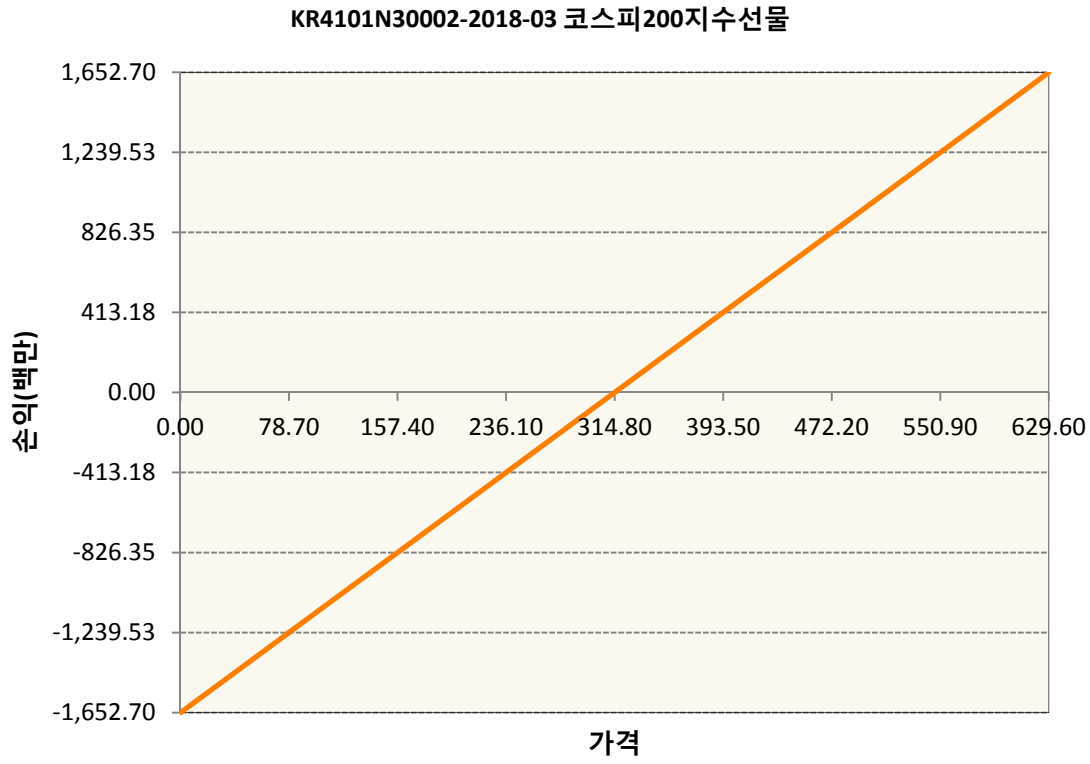
ETF스마트레버리지목표전환형10

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	1,653	0	1,653	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)

87

공시일	2018-02-19
기준일	2018-02-14

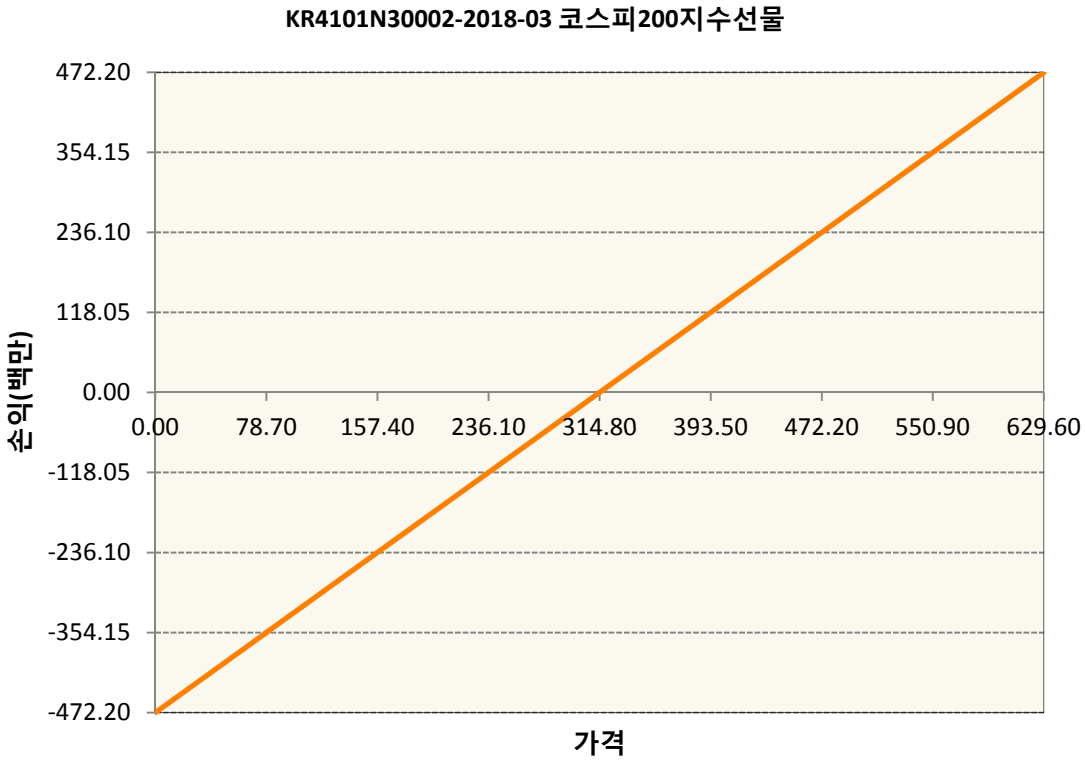
스마트KRX300인덱스1호(주식-파

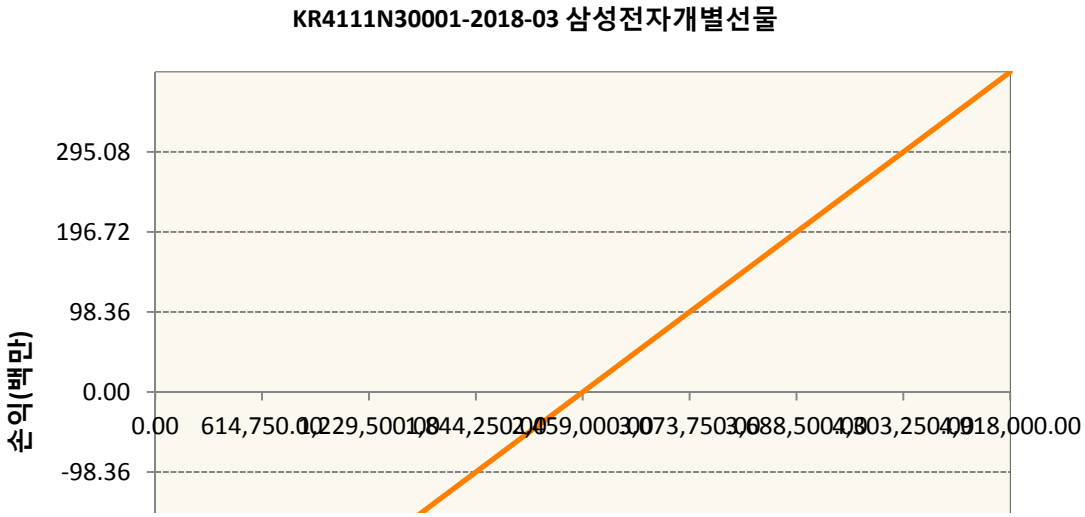
1. 계약금액

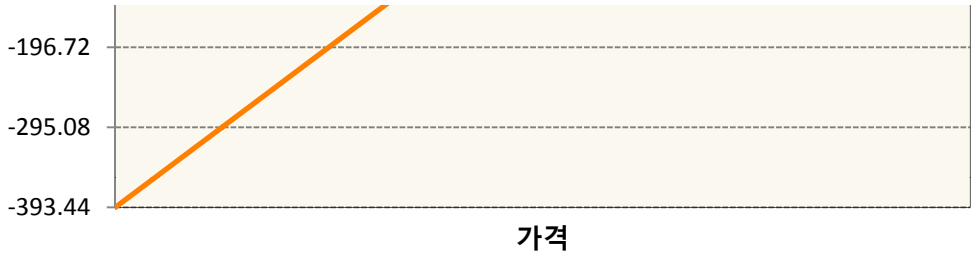
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	147	788	-641	장내
누계	유가증권	선물	866	0	866	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101N30(2018-03 코스피200지수선물							38
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-38	-38	-38	-38	-38	-38	-38
-5.33%	-25	-25	-25	-25	-25	-25	-25
-2.67%	-13	-13	-13	-13	-13	-13	-13
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	13	13	13	13	13	13	13
5.33%	25	25	25	25	25	25	25
8.00%	38	38	38	38	38	38	38
KR4111N30(2018-03 삼성전자개별선물							31
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-31	-31	-31	-31	-31	-31	-31
-5.33%	-21	-21	-21	-21	-21	-21	-21
-2.67%	-10	-10	-10	-10	-10	-10	-10
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	10	10	10	10	10	10	10
5.33%	21	21	21	21	21	21	21
8.00%	31	31	31	31	31	31	31

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

(단위:백만원)

63

공시일	2018-02-19
기준일	2018-02-14

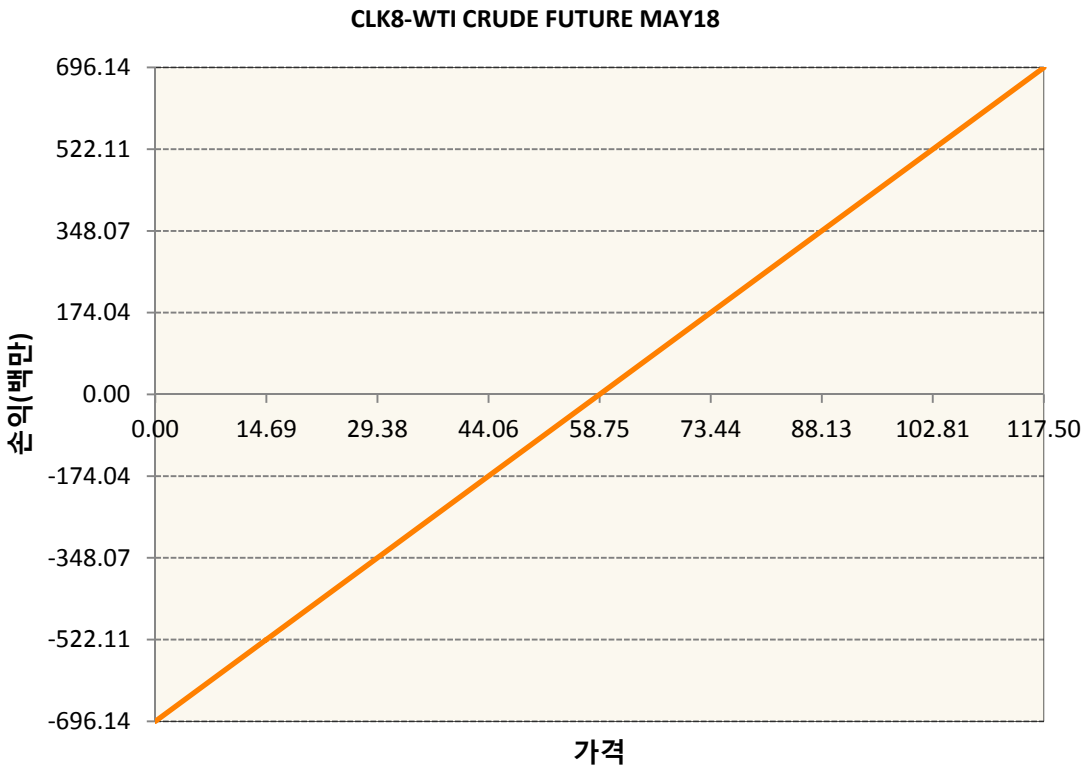
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

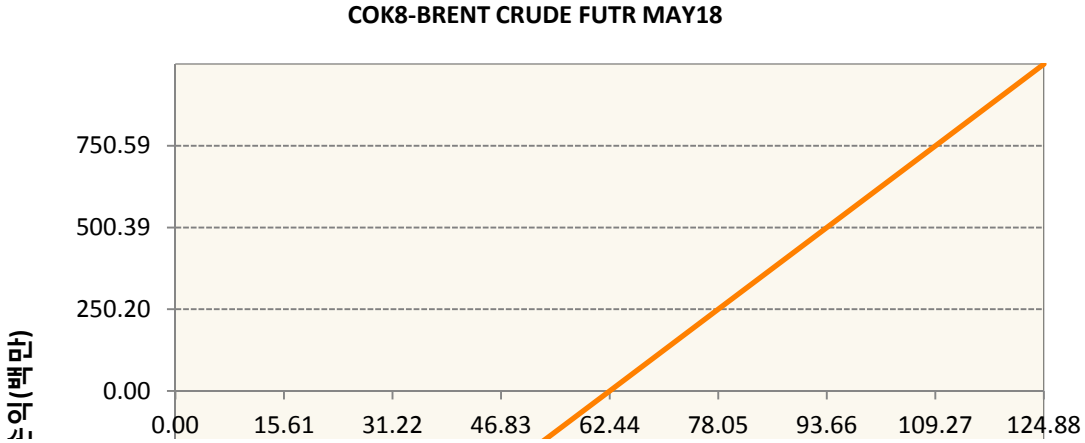
1. 계약금액

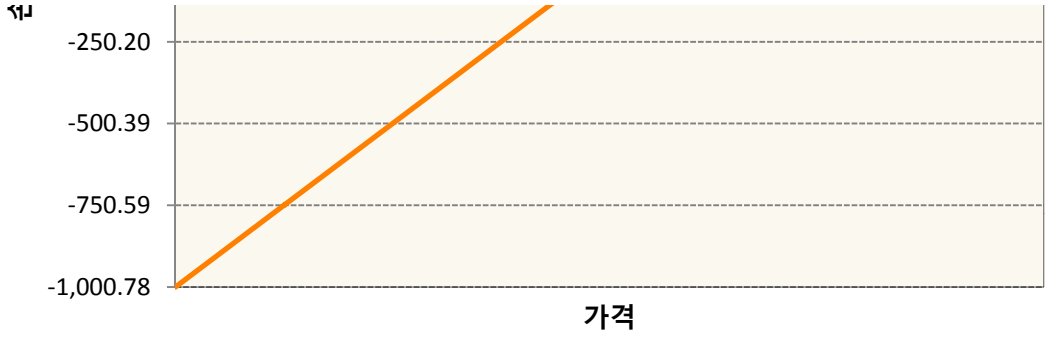
(단위:백만원)

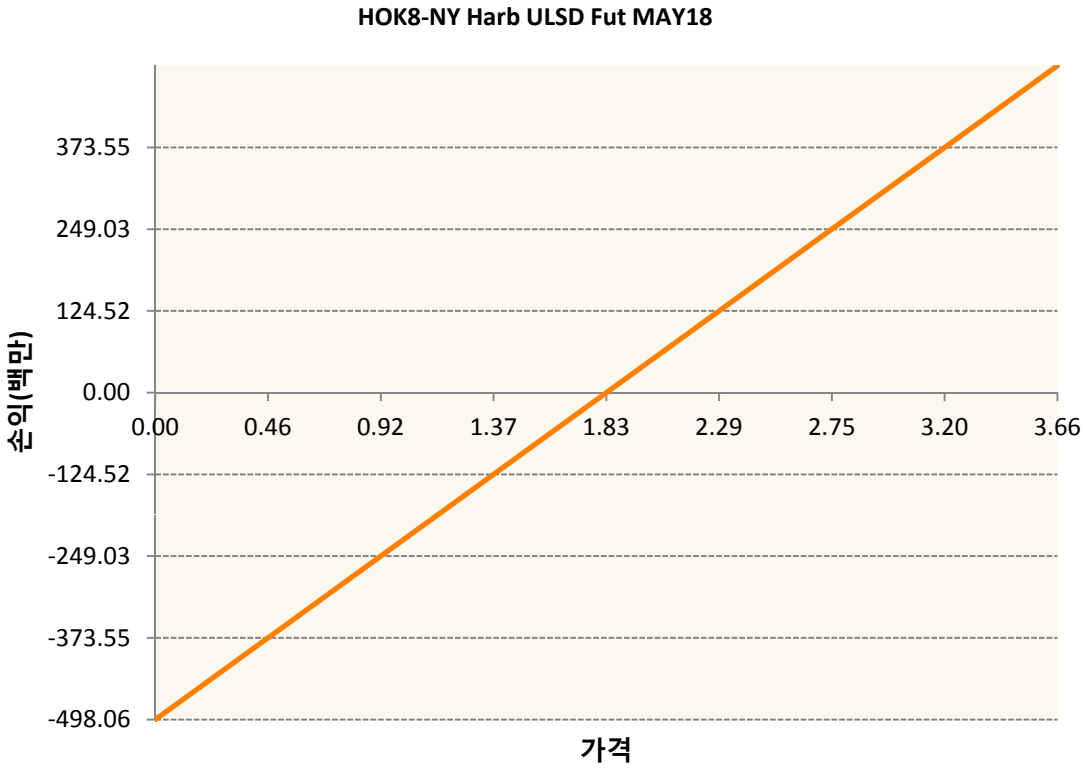
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	선물	유가증권	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	선물	유가증권	696	0	696	
누계	유가증권	선물	3,122	592	2,530	

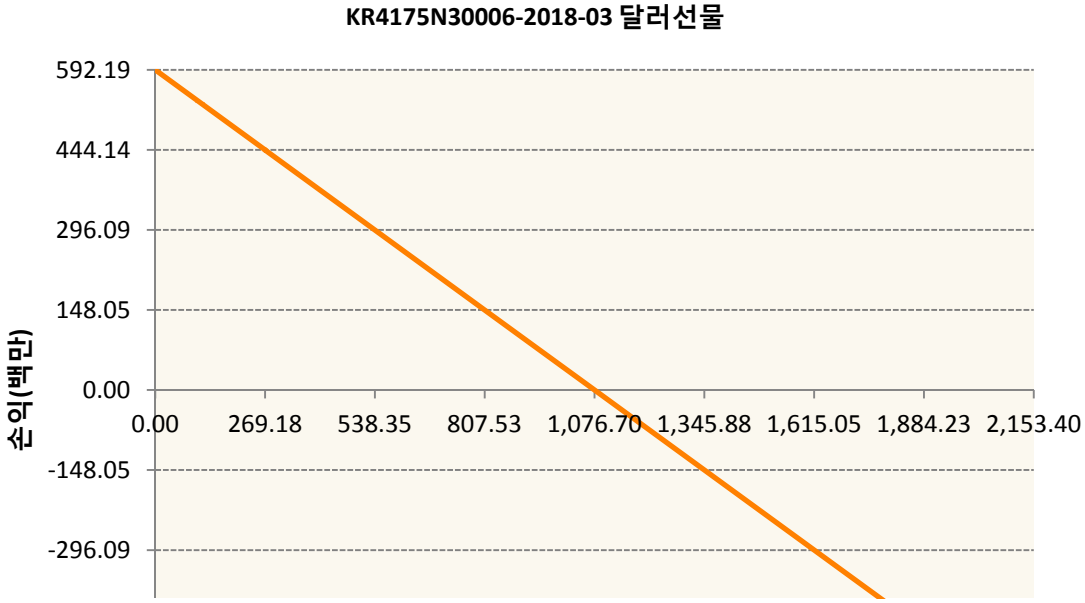
2. 만기시점의 손익구조

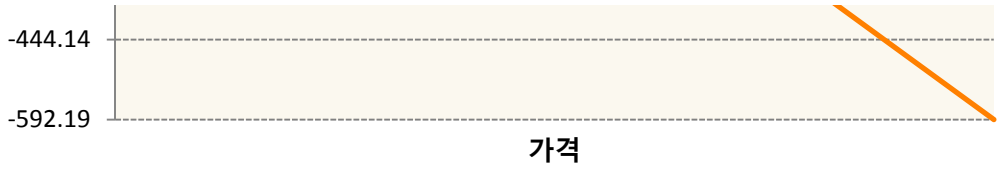


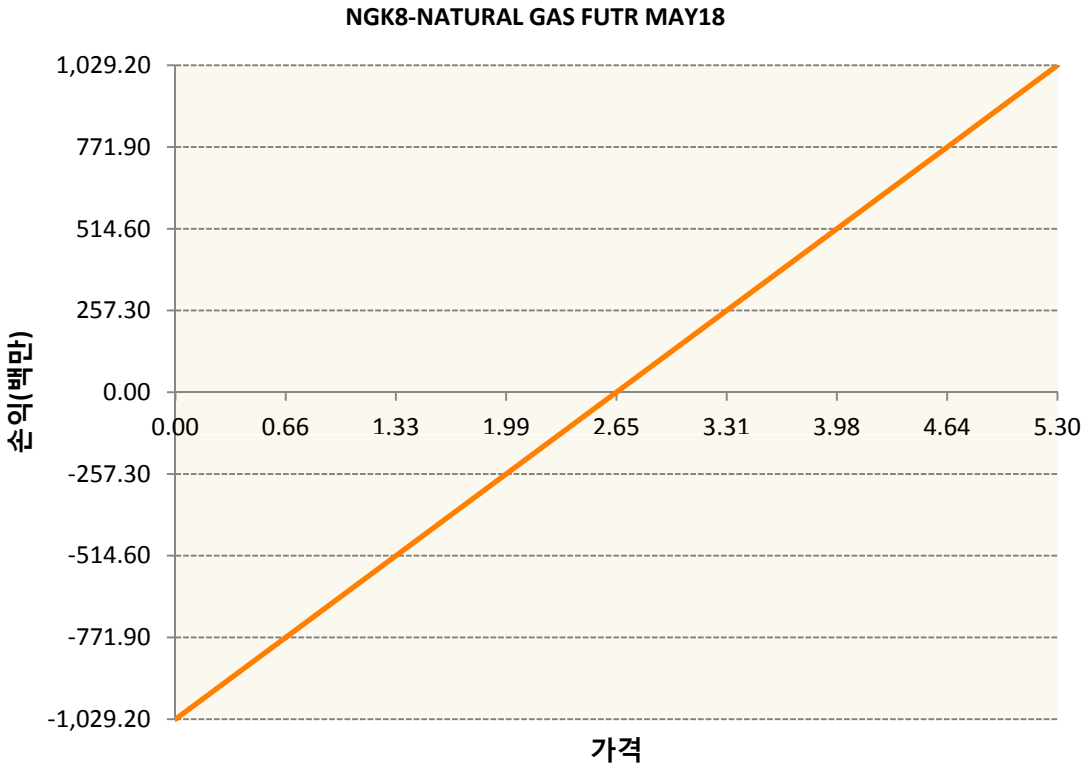


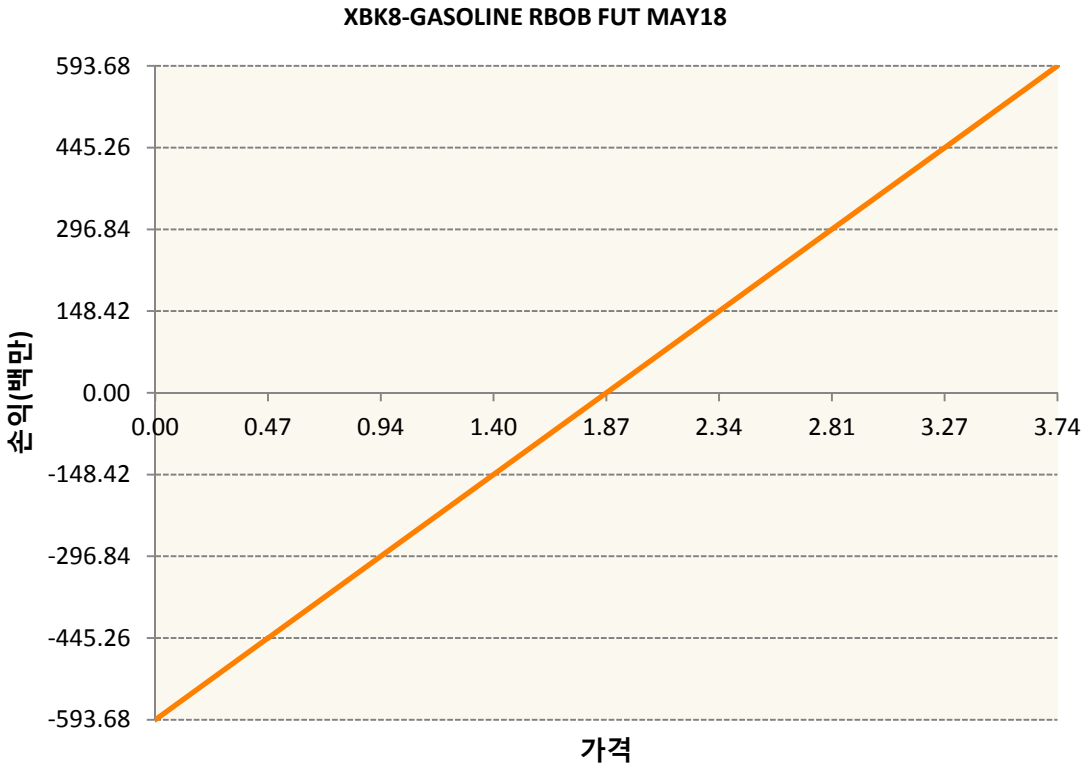

-250.20
-500.39
-750.59
-1,000.78
가격


HOK8-NY Harb ULSD Fut MAY18
373.55
249.03
124.52
0.00
-124.52
-249.03
-373.55
-498.06
0.00
0.46
0.92
1.37
1.83
2.29
2.75
3.20
3.66
손익(백만)
가격


KR4175N30006-2018-03 달러선물
592.19
444.14
296.09
148.05
0.00
-148.05
-296.09
0.00
269.18
538.35
807.53
1,076.70
1,345.88
1,615.05
1,884.23
2,153.40
손익(백만)


-444.14
-592.19
가격


NGK8-NATURAL GAS FUTR MAY18
1,029.20
771.90
514.60
257.30
0.00
-257.30
-514.60
-771.90
-1,029.20
0.00
0.66
1.33
1.99
2.65
3.31
3.98
4.64
5.30
손익(백만)
가격


XBK8-GASOLINE RBOB FUT MAY18
593.68
445.26
296.84
148.42
0.00
-148.42
-296.84
-445.26
-593.68
0.00
0.47
0.94
1.40
1.87
2.34
2.81
3.27
3.74
손익(백만)
가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLK8	WTI CRUDE FUTURE MAY18	56
COK8	BRENT CRUDE FUTR MAY18	80
HOK8	NY Harb ULSD Fut MAY18	40
KR4175N30(	2018-03 달러선물	47
NGK8	NATURAL GAS FUTR MAY18	82
XBK8	GASOLINE RBOB FUT MAY18	47

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

512

공시일	2018-02-19
기준일	2018-02-14

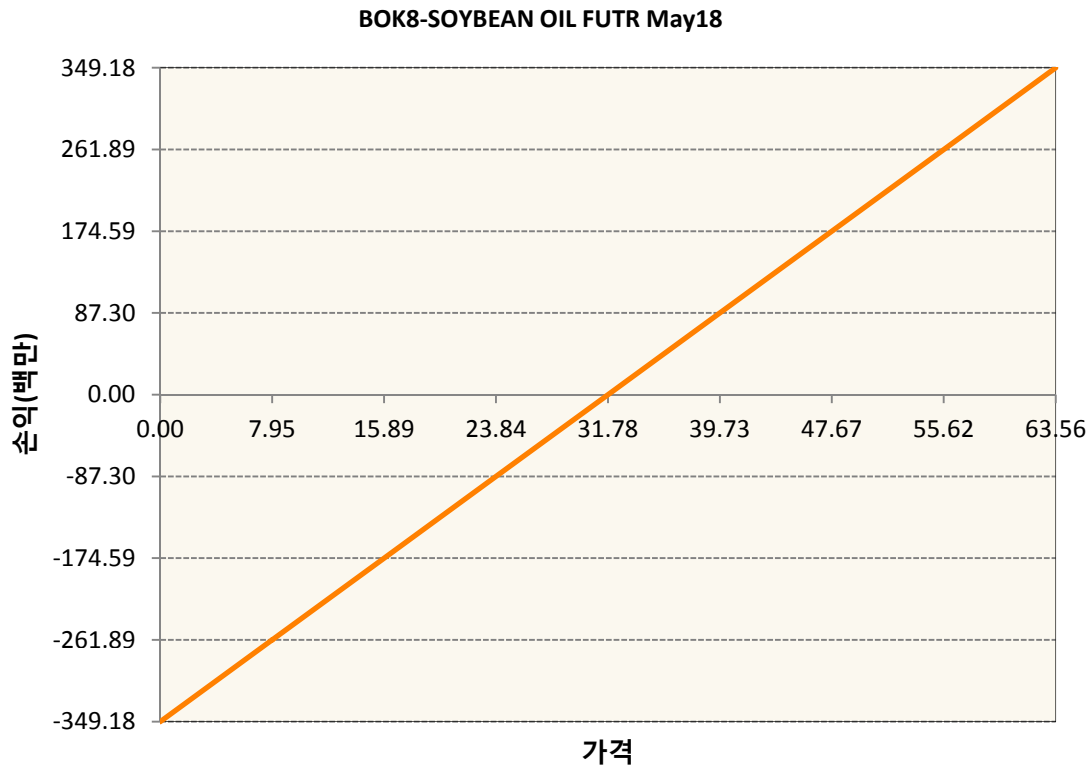
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

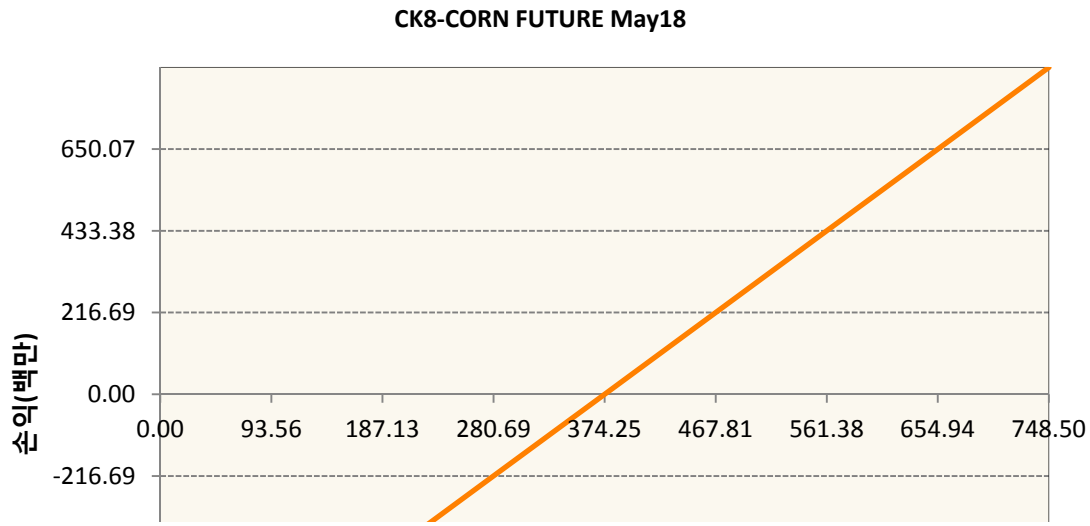
1. 계약금액

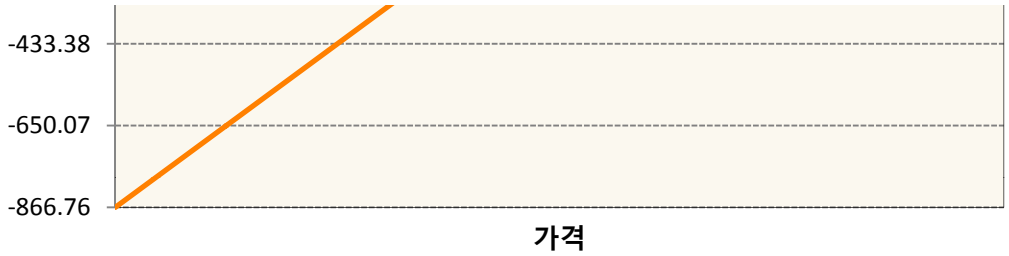
(단위:백만원)

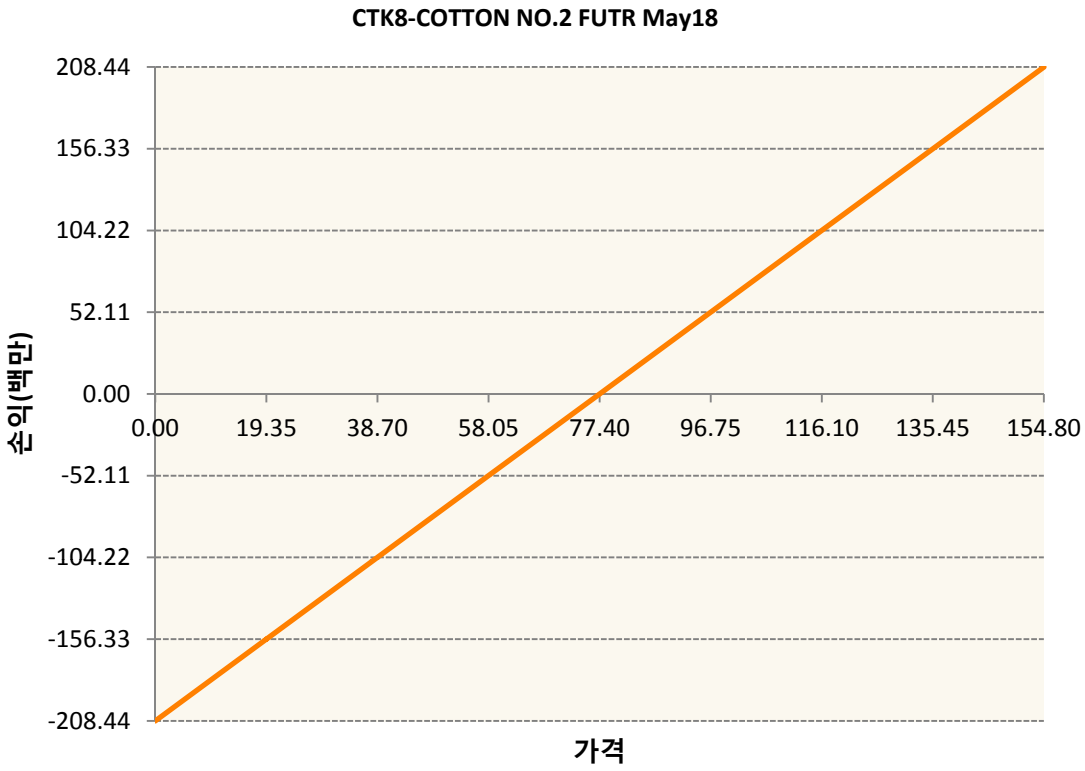
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	4,111	323	3,788	

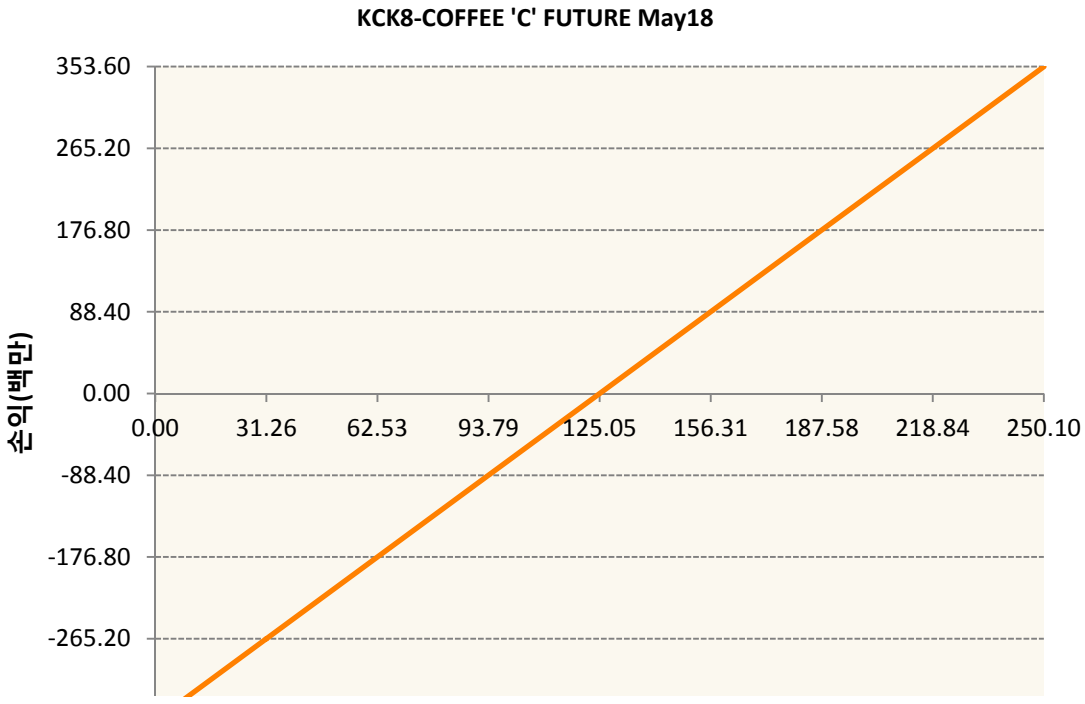
2. 만기시점의 손익구조

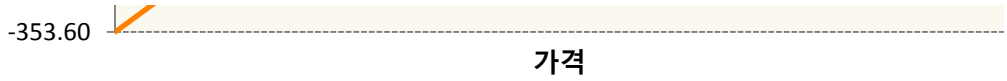


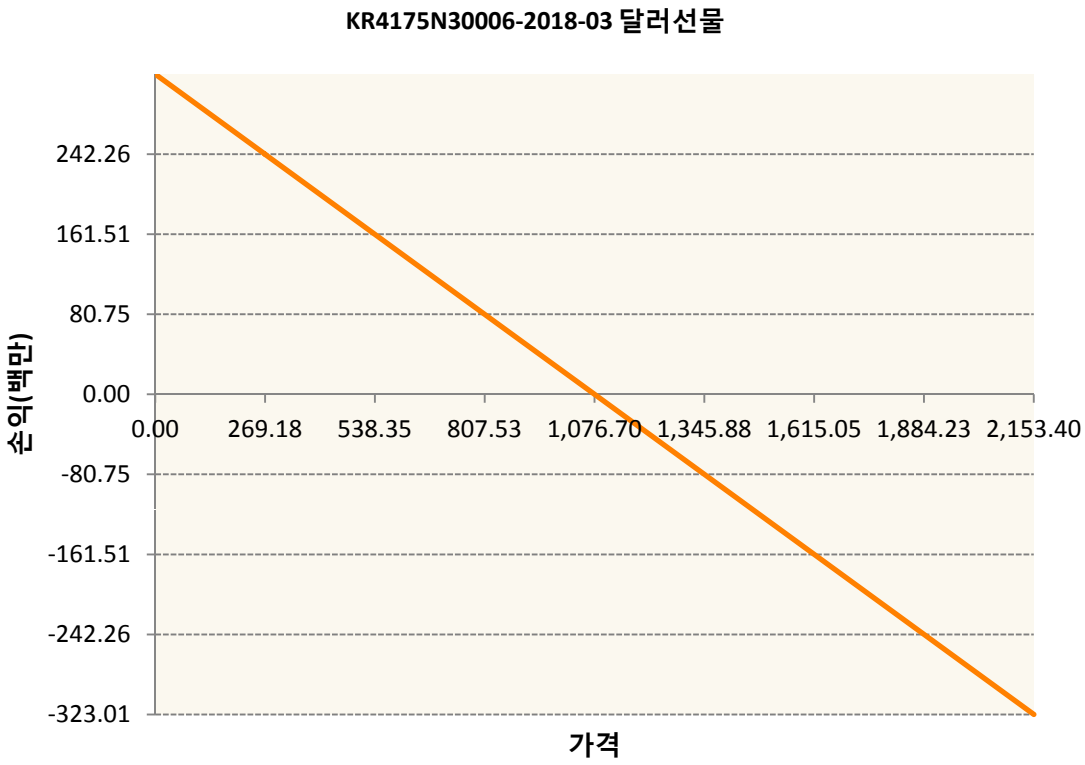


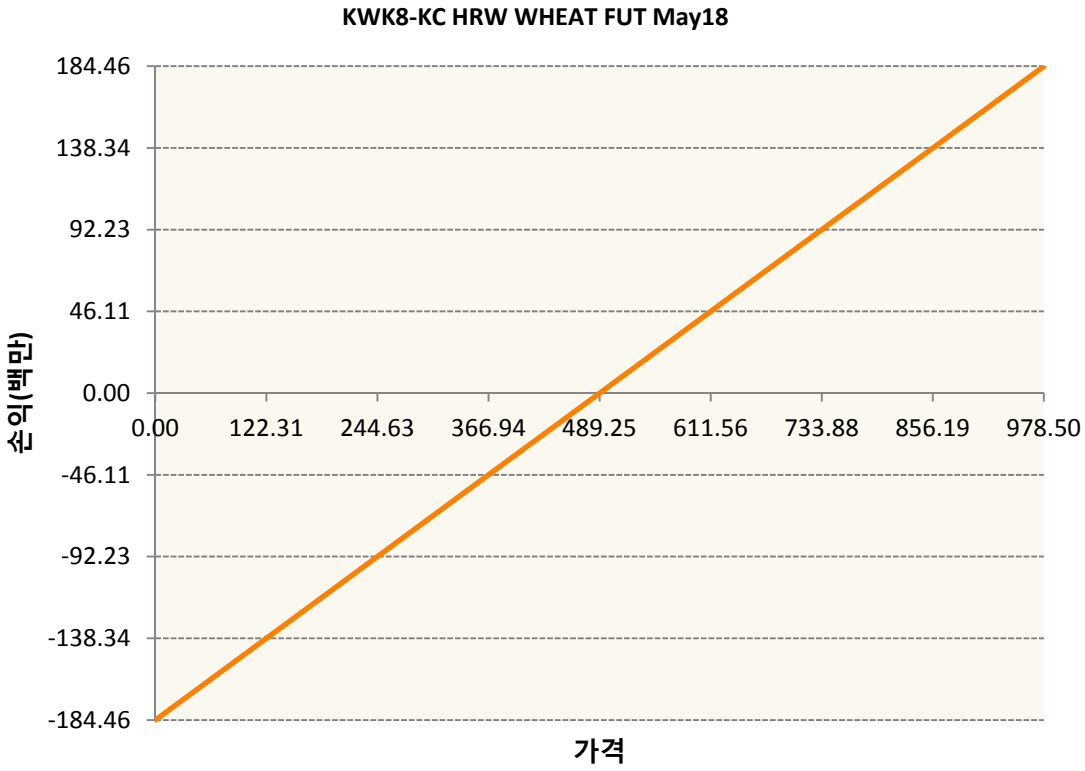

-433.38
-650.07
-866.76
가격

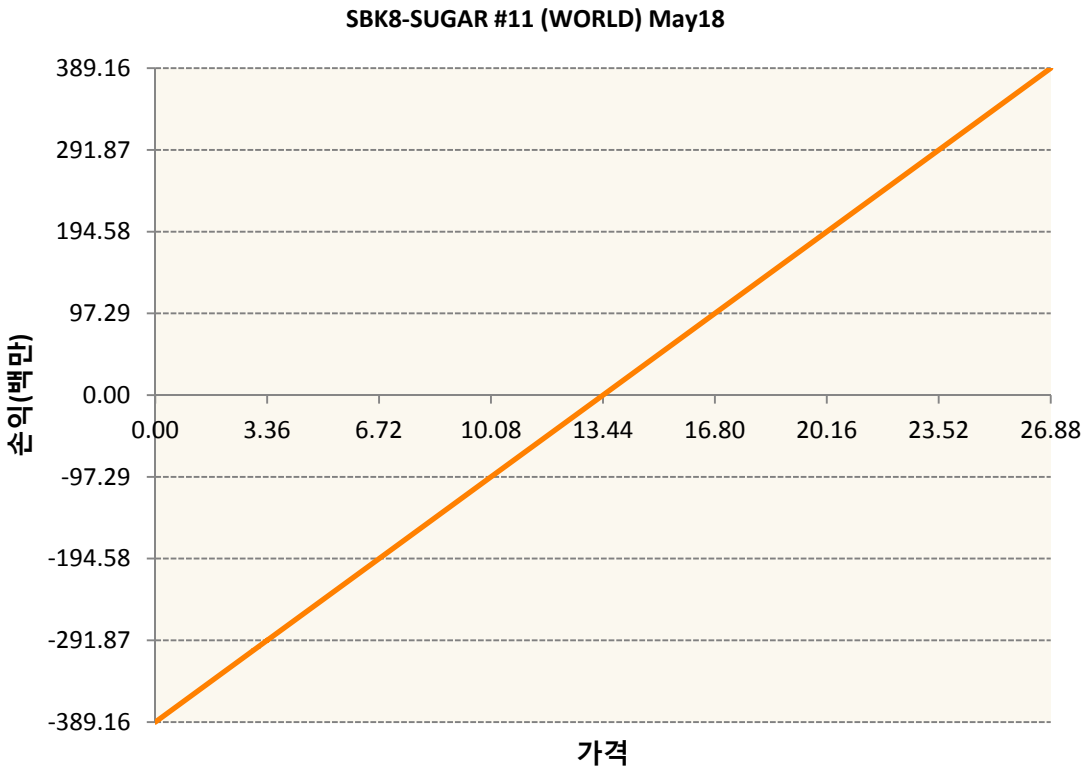

CTK8-COTTON NO.2 FUTR May18
208.44
156.33
104.22
52.11
0.00
-52.11
-104.22
-156.33
-208.44
0.00
19.35
38.70
58.05
77.40
96.75
116.10
135.45
154.80
손익(백만)
가격

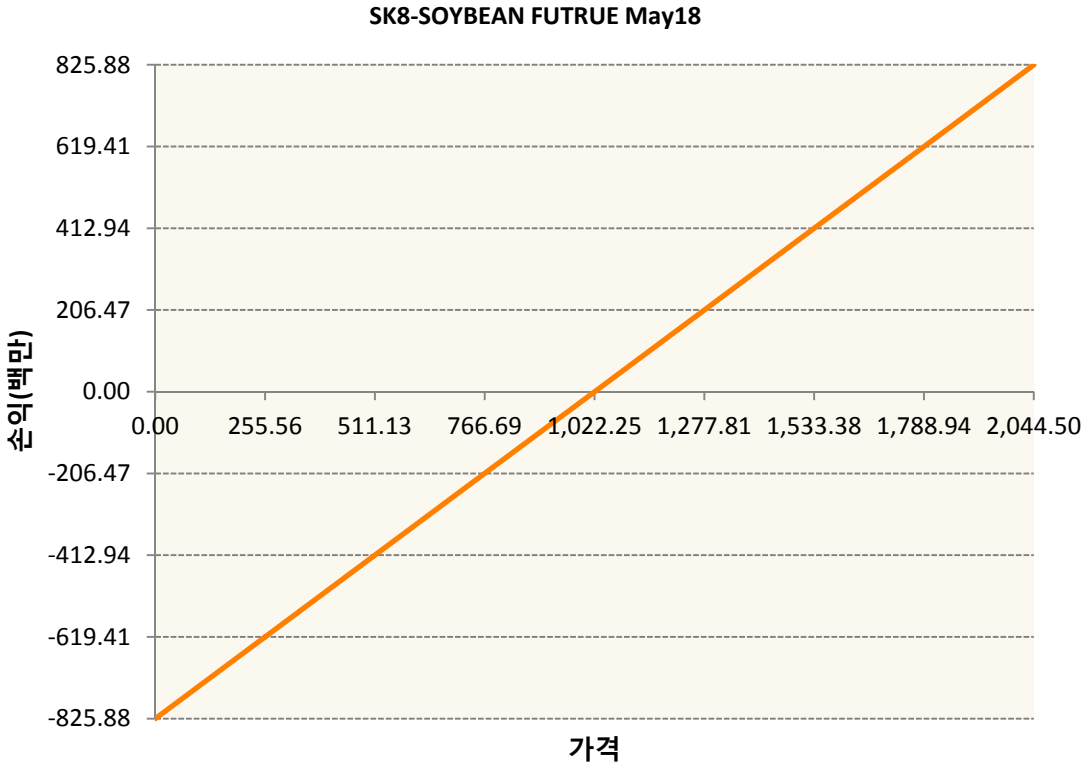

KCK8-COFFEE 'C' FUTURE May18
353.60
265.20
176.80
88.40
0.00
-88.40
-176.80
-265.20
0.00
31.26
62.53
93.79
125.05
156.31
187.58
218.84
250.10
손익(백만)


-353.60
가격

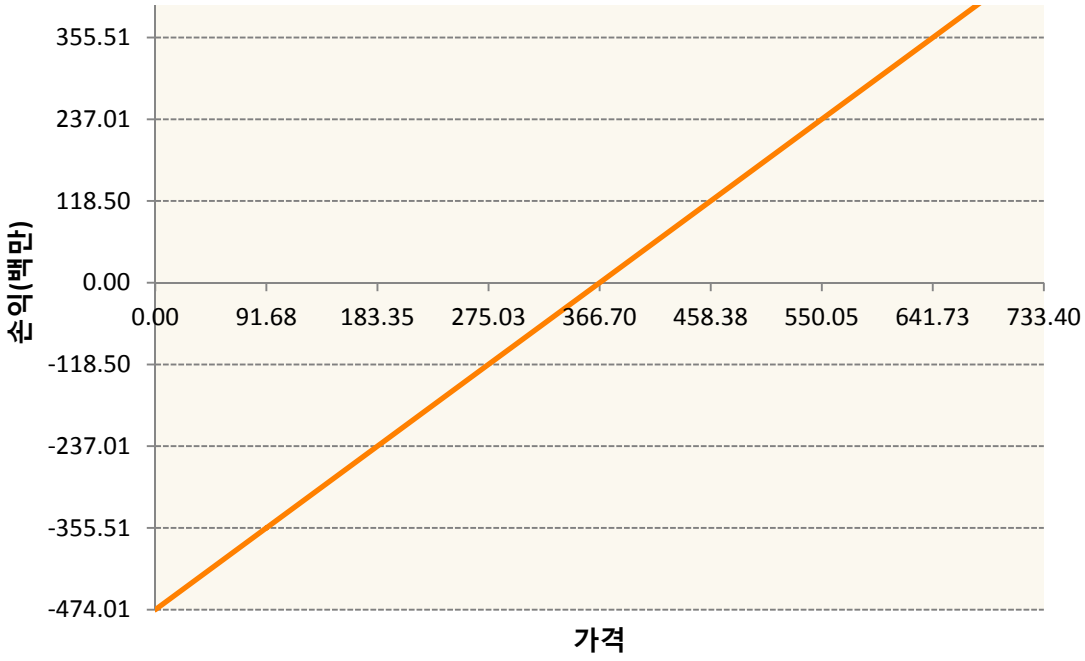

KR4175N30006-2018-03 달러선물
242.26
161.51
80.75
0.00
-80.75
-161.51
-242.26
-323.01
0.00
269.18
538.35
807.53
1,076.70
1,345.88
1,615.05
1,884.23
2,153.40
손익(백만)
가격

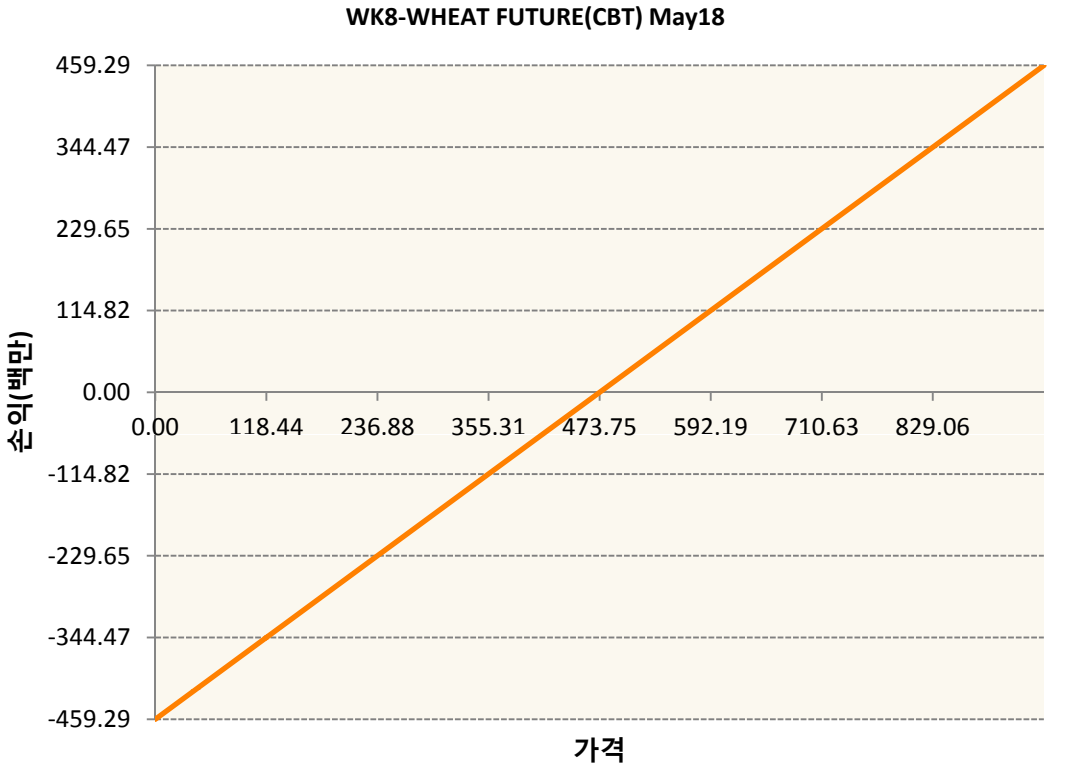

KWK8-KC HRW WHEAT FUT May18
184.46
138.34
92.23
46.11
0.00
-46.11
-92.23
-138.34
-184.46
0.00
122.31
244.63
366.94
489.25
611.56
733.88
856.19
978.50
손익(백만)
가격


SBK8-SUGAR #11 (WORLD) May18
389.16
291.87
194.58
97.29
0.00
-97.29
-194.58
-291.87
-389.16
0.00
3.36
6.72
10.08
13.44
16.80
20.16
23.52
26.88
손익(백만)
가격


SK8-SOYBEAN FUTRUE May18
825.88
619.41
412.94
206.47
0.00
-206.47
-412.94
-619.41
-825.88
0.00
255.56
511.13
766.69
1,022.25
1,277.81
1,533.38
1,788.94
2,044.50
손익(백만)
가격


SMK8-SOYBEAN MEAL FUTR May18
474.01





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

BOK8	SOYBEAN OIL FUTR May18	28
CK8	CORN FUTURE May18	69
CTK8	COTTON NO.2 FUTR May18	17
KCK8	COFFEE 'C' FUTURE May18	28
KR4175N30(	2018-03 달러선물	26

KWK8	KC HRW WHEAT FUT May18	15
SBK8	SUGAR #11 (WORLD) May18	31
SK8	SOYBEAN FUTRUE May18	66
SMK8	SOYBEAN MEAL FUTR May18	38
WK8	WHEAT FUTURE(CBT) May18	37

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

339