공시일	2018-02-21
기준일	2018-02-20

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	2018-02-21
기준일	2018-02-20

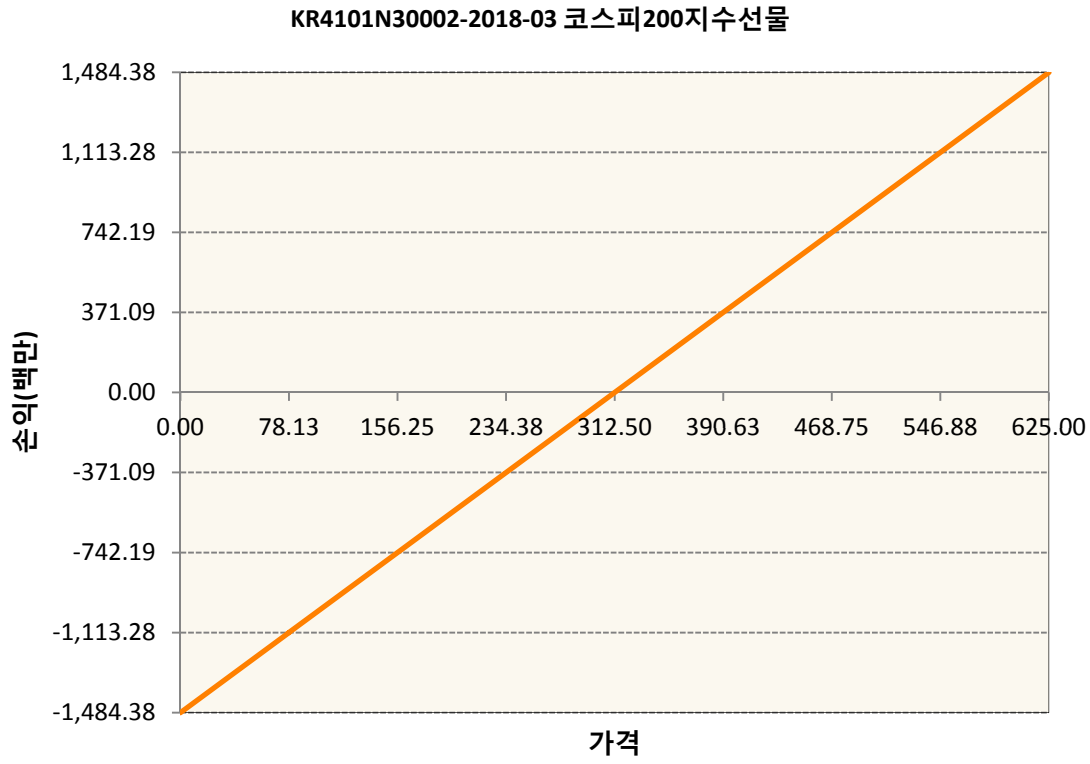
스마트인덱스모

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	1,484	0	1,484	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%	-79	-79	-79	-79	-79	-79	-79
-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%	79	79	79	79	79	79	79
8.00%	119	119	119	119	119	119	119

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

79

공시일	2018-02-21
기준일	2018-02-20

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	1,119

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

406

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2018-02-21
기준일	2018-02-20

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	2018-02-21
기준일	2018-02-20

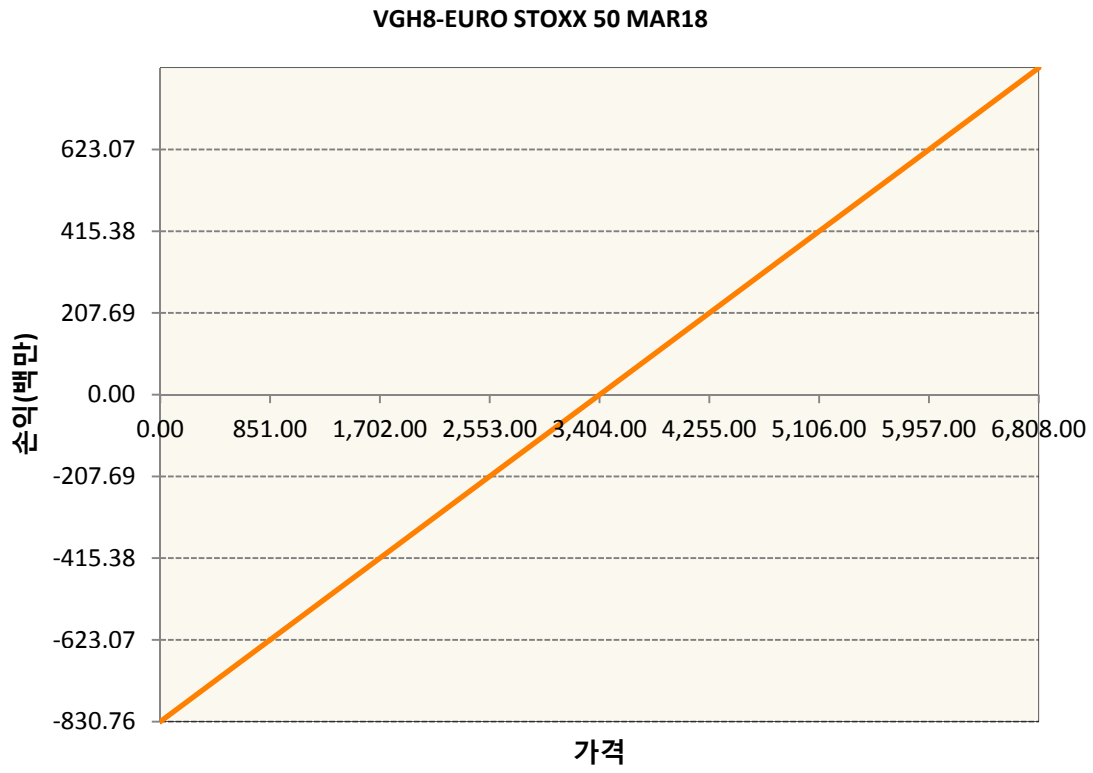
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	831	0	831	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGH8	EURO STOXX 50 MAR18	66

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

(단위:백만원)

39

공시일	2018-02-21
기준일	2018-02-20

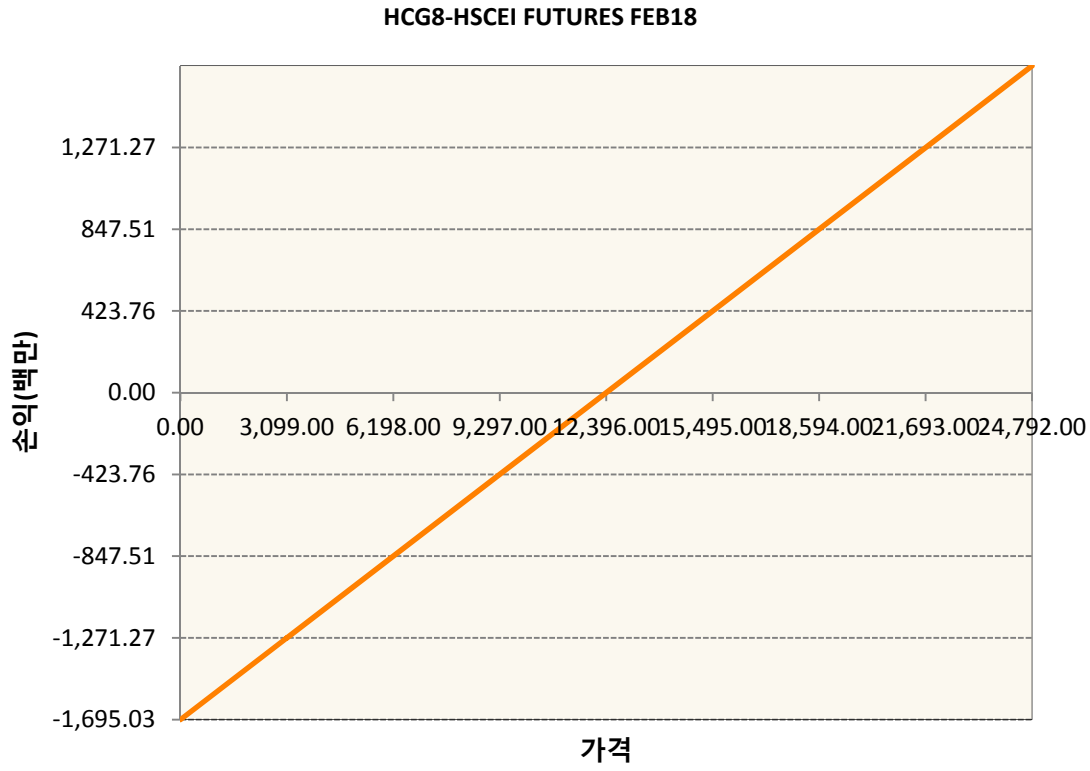
차이나인덱스모(주식-파생형)

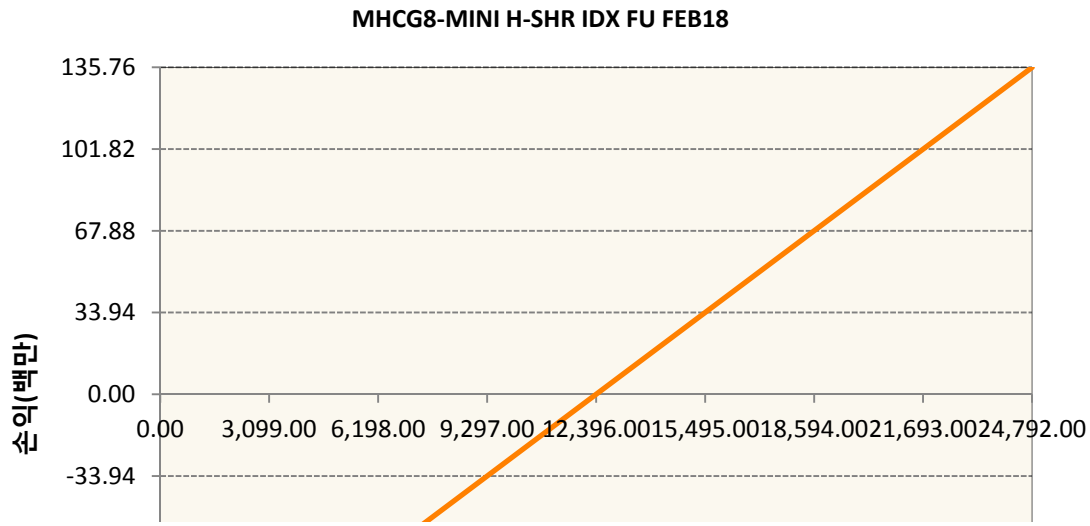
1. 계약금액

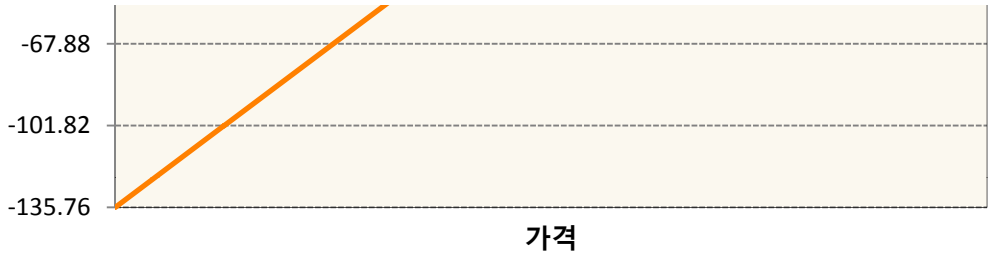
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,831	0	1,831	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCG8	HSCEI FUTURES FEB18	136
MHCG8	MINI H-SHR IDX FU FEB18	11

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	126

공시일	2018-02-21
기준일	2018-02-20

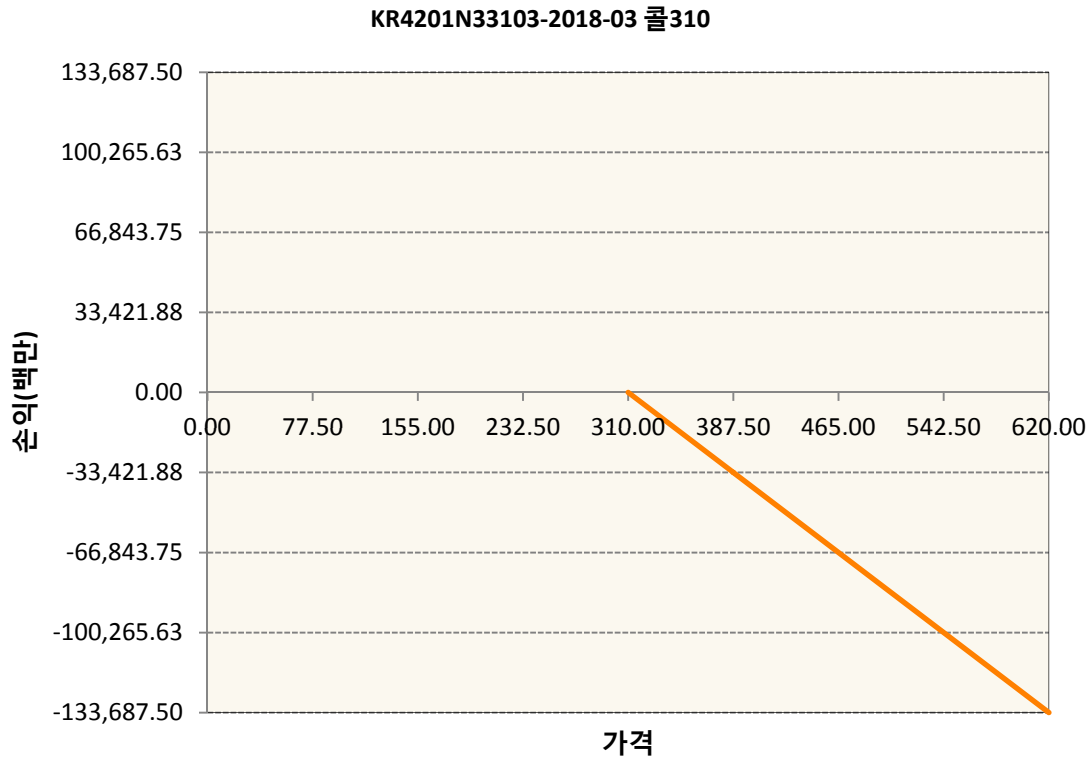
커버드콜모(주식혼합-파생형)

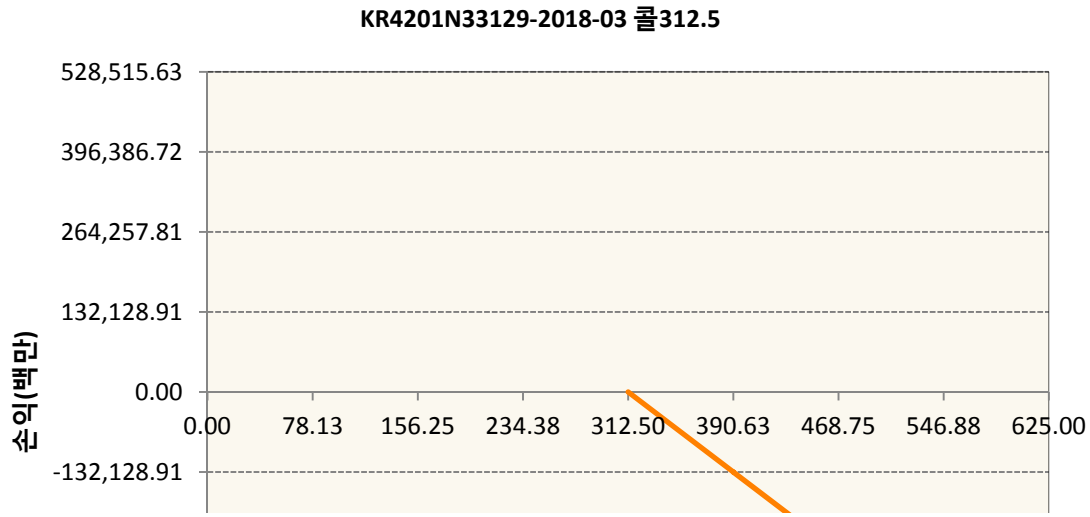
1. 계약금액

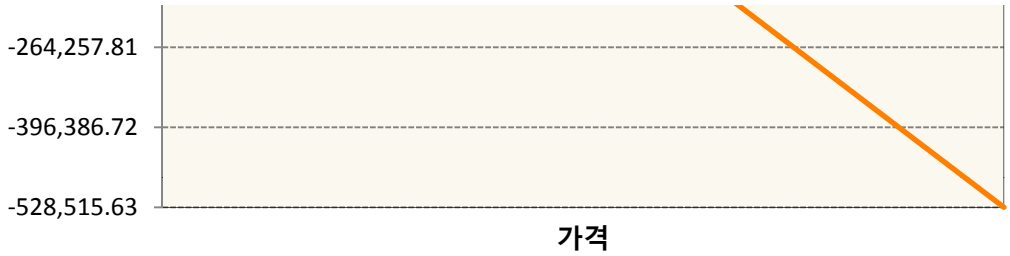
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	1,121,059	-1,121,059	장내

2. 만기시점의 손익구조



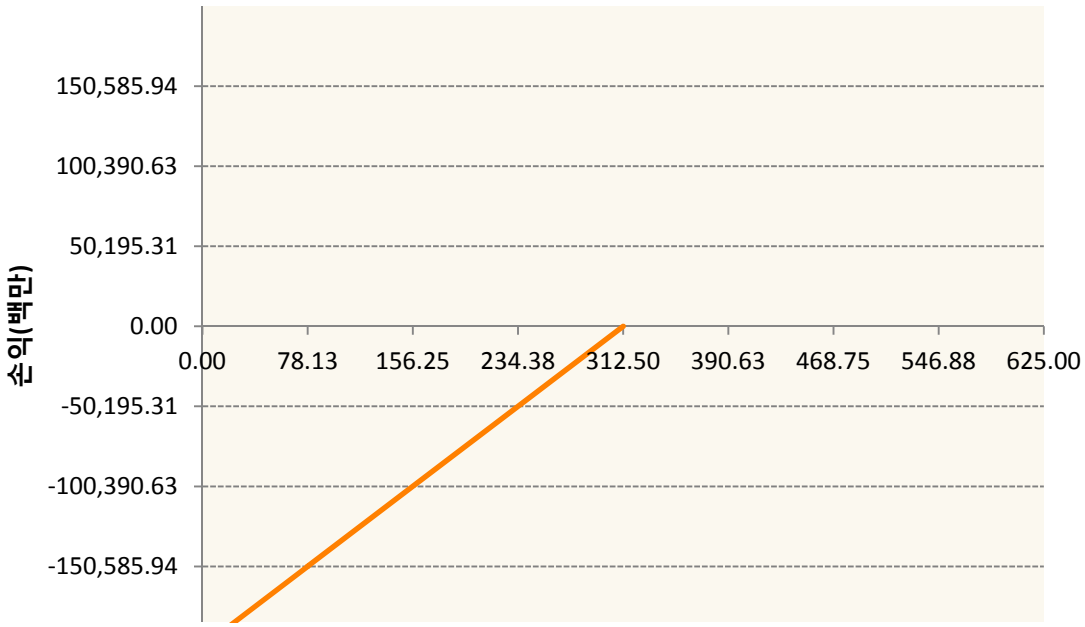




KR4301N33101-2018-03 풋310



KR4301N33127-2018-03 풋312.5





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201N3312018-03 콜310							8,850
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	3,638	3,573	3,490	3,391	3,277	3,150	3,011
-5.33%	3,315	3,164	2,999	2,822	2,635	2,441	2,240
-2.67%	2,445	2,211	1,974	1,734	1,492	1,248	1,004
0%	756	505	253	0	-253	-507	-761
2.67%	-1,772	-1,963	-2,166	-2,377	-2,594	-2,818	-3,045
5.33%	-4,901	-5,007	-5,133	-5,275	-5,431	-5,599	-5,777
8.00%	-8,339	-8,383	-8,444	-8,523	-8,617	-8,727	-8,850
KR4201N3312018-03 콜312.5							33,265
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	12,194	12,004	11,750	11,432	11,055	10,623	10,143
-5.33%	11,296	10,806	10,250	9,639	8,981	8,285	7,557
-2.67%	8,637	7,790	6,918	6,026	5,119	4,200	3,271
0%	3,027	2,018	1,009	0	-1,009	-2,018	-3,027
2.67%	-5,952	-6,804	-7,684	-8,587	-9,507	-10,441	-11,387
5.33%	-17,619	-18,142	-18,735	-19,385	-20,083	-20,821	-21,594
8.00%	-30,819	-31,059	-31,373	-31,756	-32,204	-32,709	-33,265
KR4301N3312018-03 풋310							15,958
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-15,705	-15,717	-15,739	-15,773	-15,820	-15,882	-15,958
-5.33%	-8,902	-8,993	-9,107	-9,241	-9,393	-9,562	-9,745
-2.67%	-2,926	-3,186	-3,455	-3,731	-4,012	-4,298	-4,587
0%	914	612	307	0	-308	-618	-929
2.67%	2,394	2,240	2,065	1,871	1,662	1,439	1,205
5.33%	2,700	2,664	2,610	2,537	2,445	2,335	2,209
8.00%	2,733	2,728	2,719	2,702	2,675	2,637	2,586
KR4301N3312018-03 풋312.5							13,127
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-12,998	-13,002	-13,011	-13,027	-13,051	-13,084	-13,127
-5.33%	-7,693	-7,737	-7,798	-7,873	-7,963	-8,067	-8,183
-2.67%	-2,799	-2,963	-3,139	-3,325	-3,518	-3,718	-3,923
0%	738	492	246	0	-246	-492	-738
2.67%	2,362	2,202	2,029	1,844	1,652	1,452	1,246

5.33%	2,775	2,727	2,662	2,581	2,484	2,373	2,249
8.00%	2,831	2,824	2,810	2,788	2,755	2,712	2,657

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

73,558

공시일	2018-02-21
기준일	2018-02-20

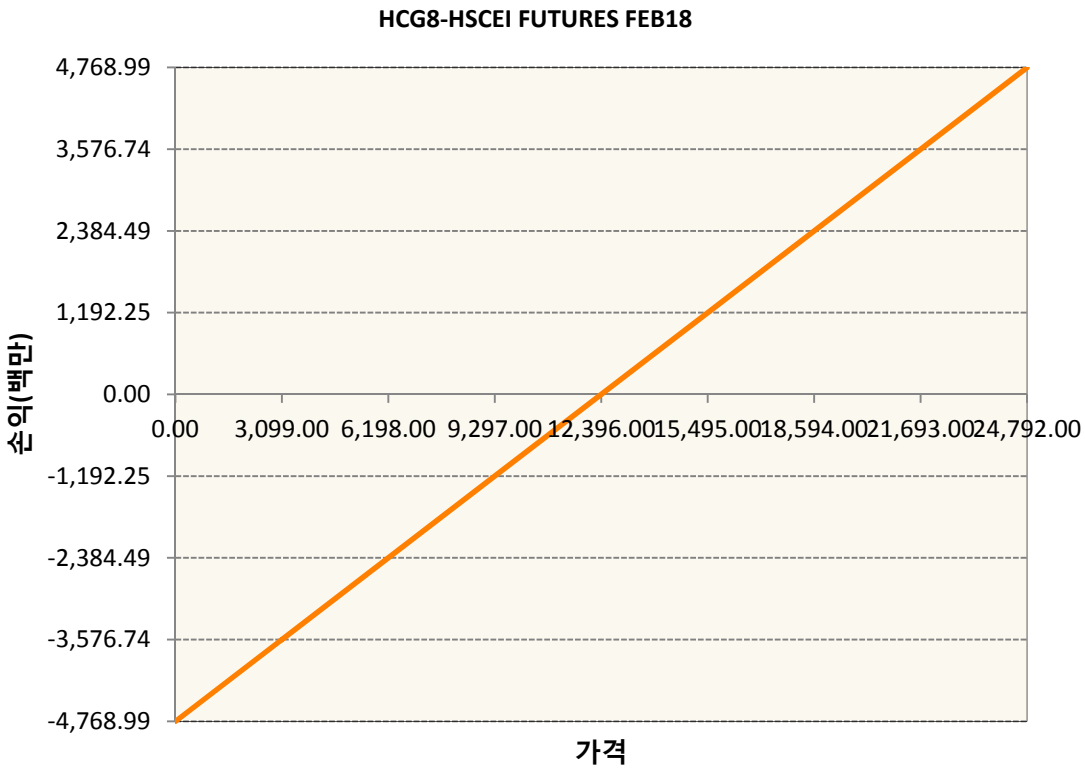
홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생

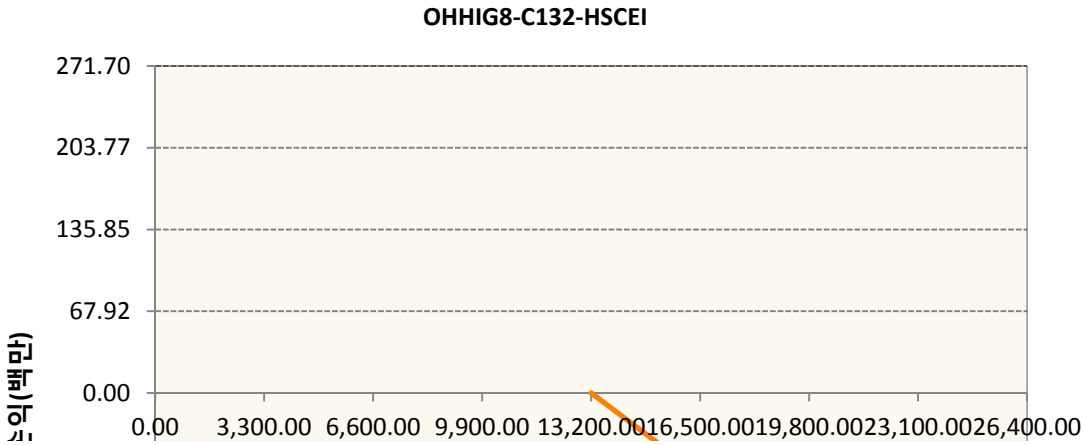
1. 계약금액

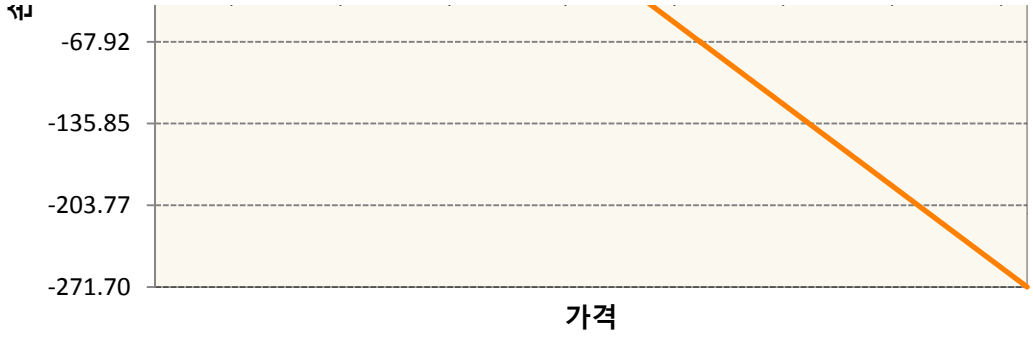
(단위:백만원)

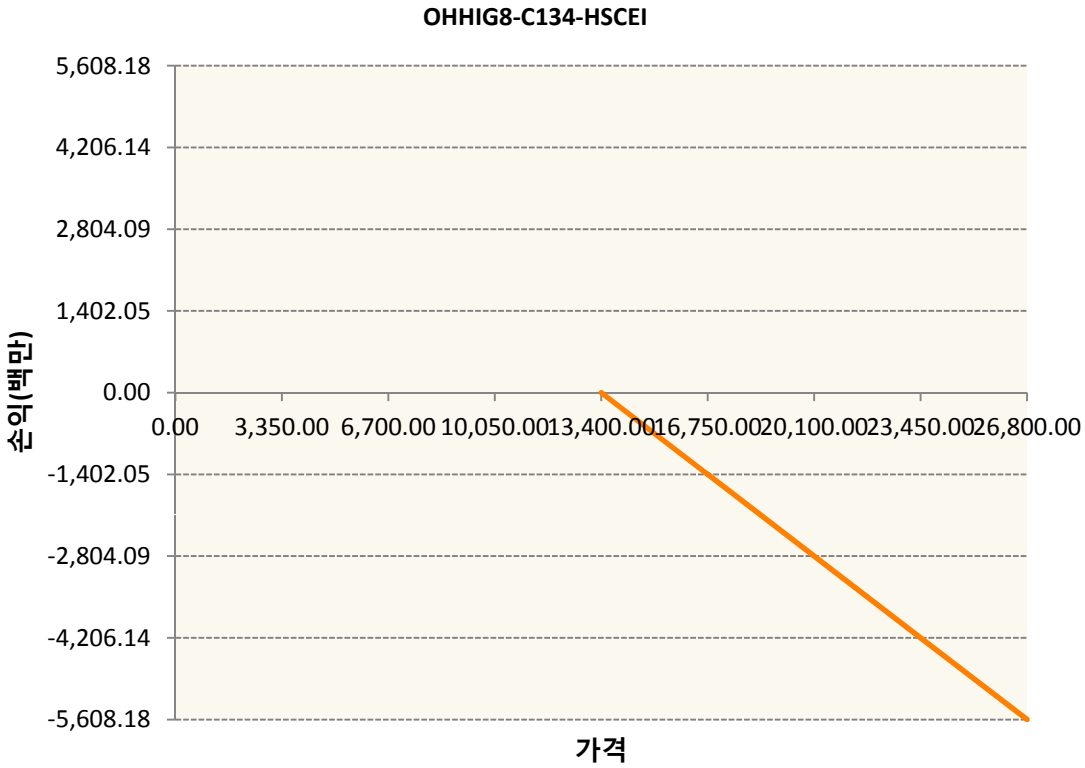
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	4,769	0	4,769	장내
누계	유가증권	옵션	0	11,760	-11,760	장내

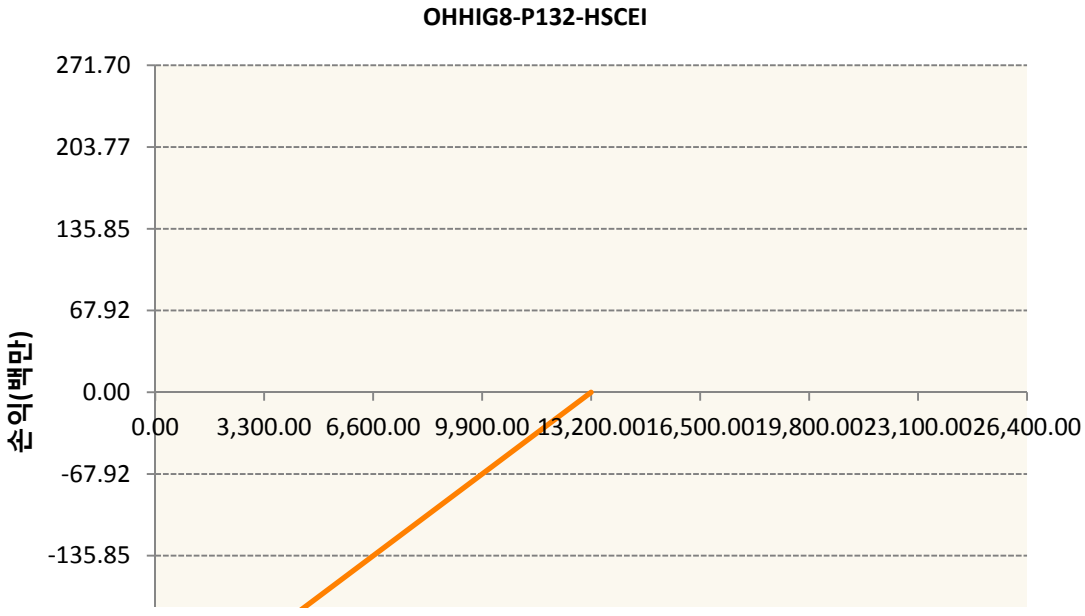
2. 만기시점의 손익구조

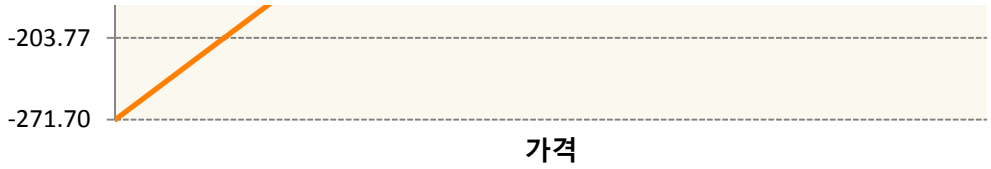


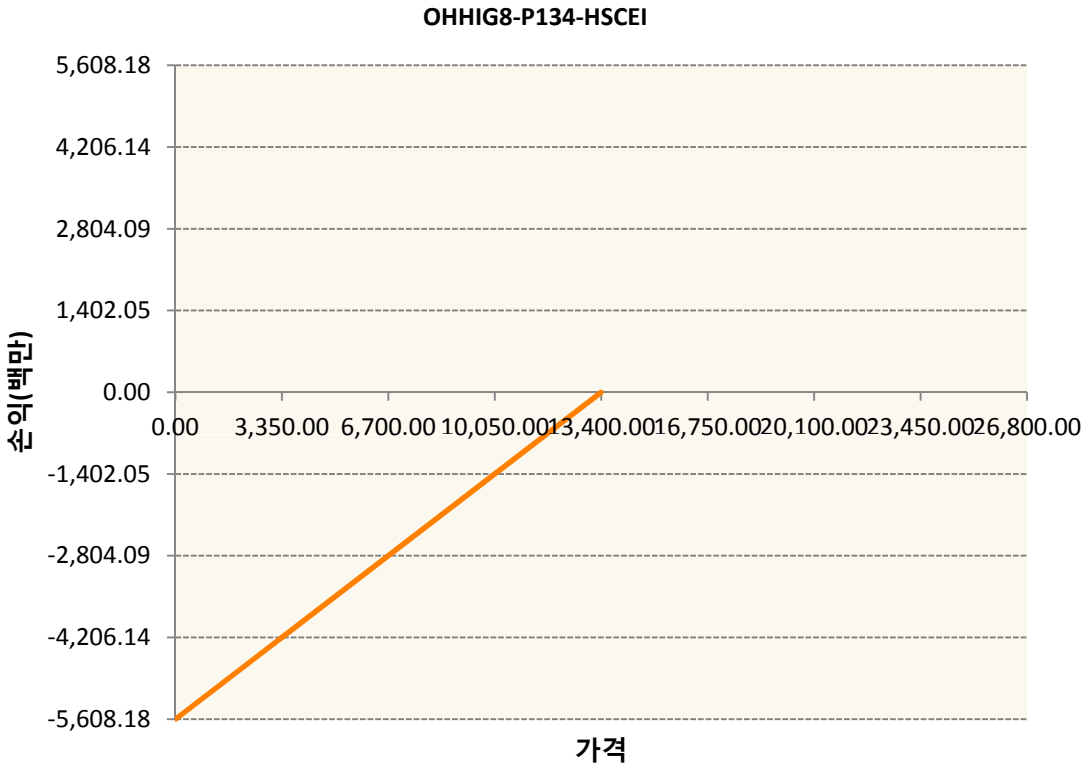



-67.92
-135.85
-203.77
-271.70
가격


OHHIG8-C134-HSCEI
5,608.18
4,206.14
2,804.09
1,402.05
0.00
-1,402.05
-2,804.09
-4,206.14
-5,608.18
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
손익(백만)
가격


OHHIG8-P132-HSCEI
271.70
203.77
135.85
67.92
0.00
-67.92
-135.85
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
손익(백만)





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCG8	HSCEI FUTURES FEB18	381
OHHIG8-C1	HSCEI	22
OHHIG8-C1	HSCEI	449
OHHIG8-P1	HSCEI	22
OHHIG8-P1	HSCEI	449

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,139

공시일	2018-02-21
기준일	2018-02-20

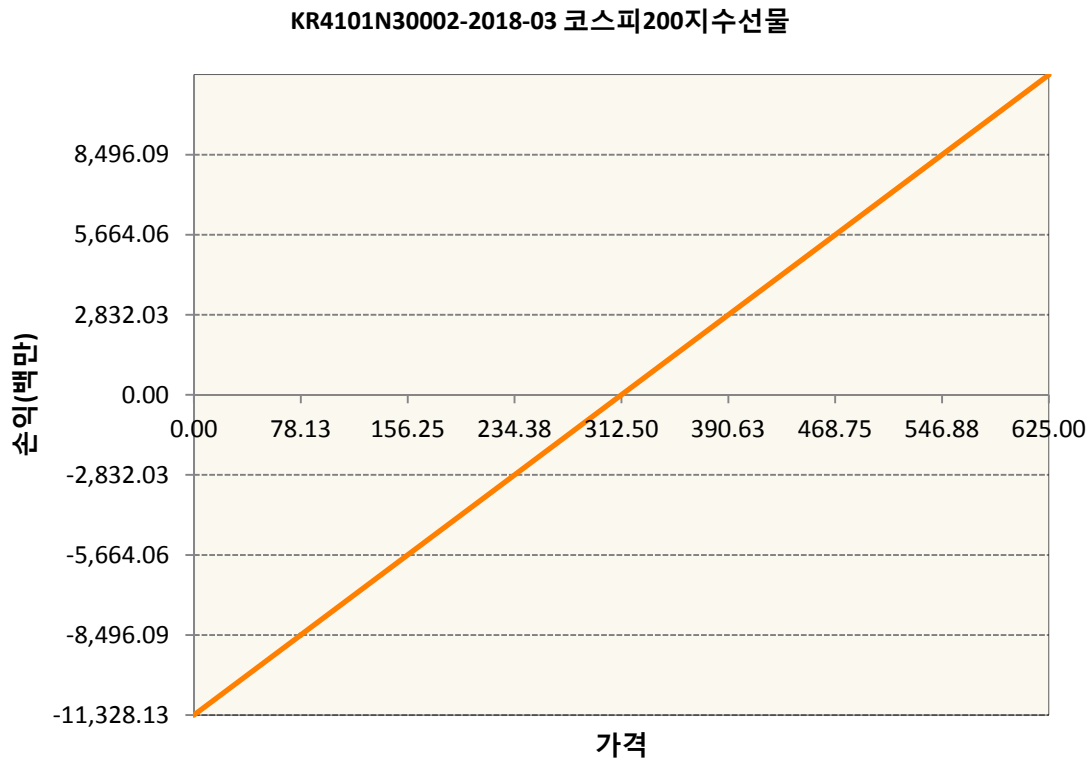
코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼

1. 계약금액

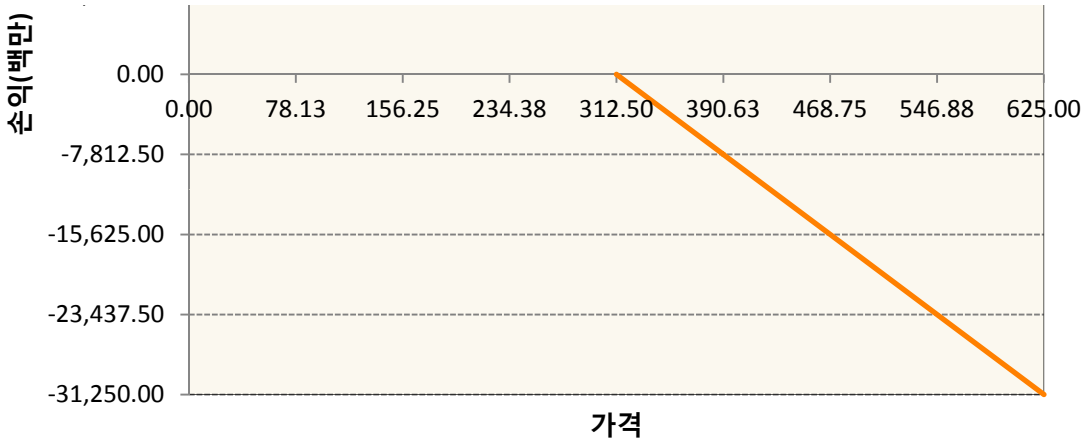
(단위:백만원)

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	11,328	0	11,328	장내
누계	유가증권	스왑	56,200	0	56,200	장외
누계	유가증권	옵션	0	56,094	-56,094	장내

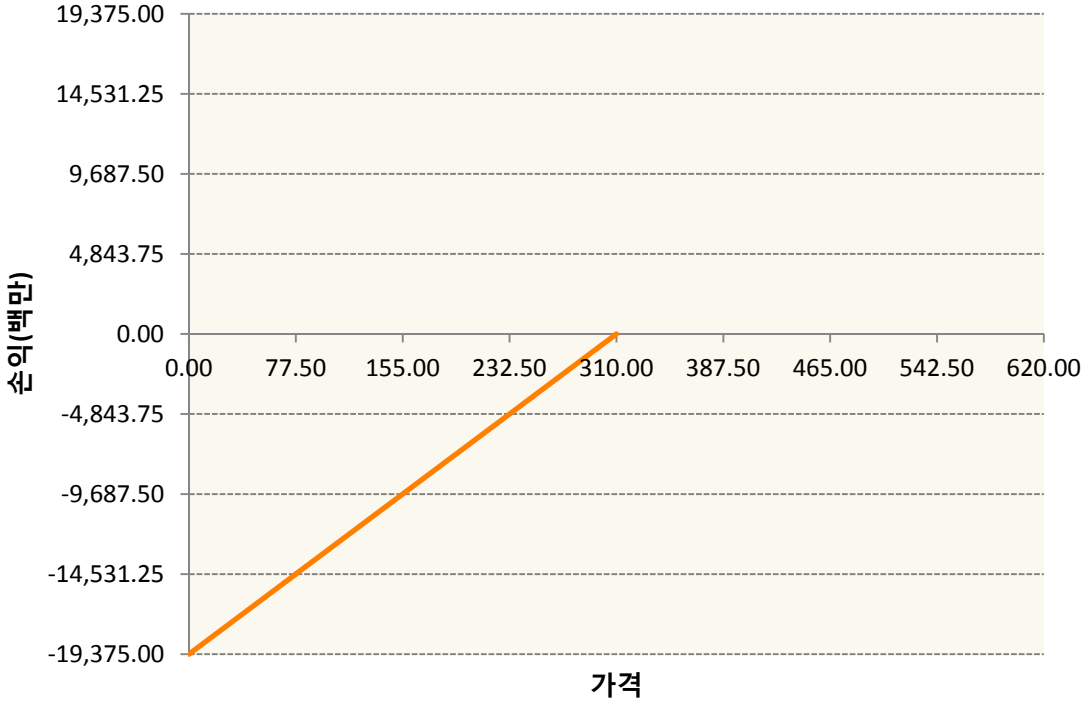
2. 만기시점의 손익구조



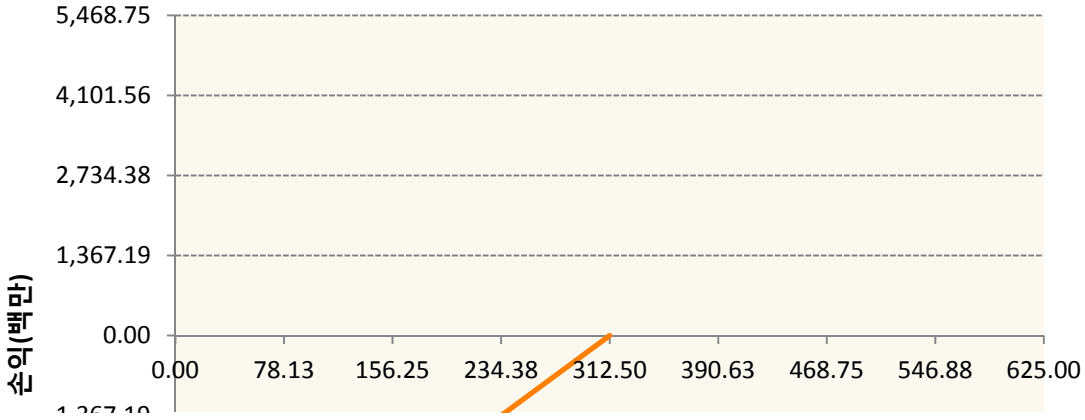




KR4301N33101-2018-03 풋310



KR4301N33127-2018-03 풋312.5





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_2							1,445
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,445	-1,445	-1,445	-1,445	-1,445	-1,445	-1,445
-5.33%	-963	-963	-963	-963	-963	-963	-963
-2.67%	-482	-482	-482	-482	-482	-482	-482
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	482	482	482	482	482	482	482
5.33%	963	963	963	963	963	963	963
8.00%	1,445	1,445	1,445	1,445	1,445	1,445	1,445
2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_3							273
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-273	-273	-273	-273	-273	-273	-273
-5.33%	-182	-182	-182	-182	-182	-182	-182
-2.67%	-91	-91	-91	-91	-91	-91	-91
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	91	91	91	91	91	91	91
5.33%	182	182	182	182	182	182	182
8.00%	273	273	273	273	273	273	273
2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_4							156
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-156	-156	-156	-156	-156	-156	-156
-5.33%	-104	-104	-104	-104	-104	-104	-104
-2.67%	-52	-52	-52	-52	-52	-52	-52
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	52	52	52	52	52	52	52
5.33%	104	104	104	104	104	104	104
8.00%	156	156	156	156	156	156	156
2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_5							234
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%

-8.00%	-234	-234	-234	-234	-234	-234	-234
-5.33%	-156	-156	-156	-156	-156	-156	-156
-2.67%	-78	-78	-78	-78	-78	-78	-78
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	78	78	78	78	78	78	78
5.33%	156	156	156	156	156	156	156
8.00%	234	234	234	234	234	234	234
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_6						195
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-195	-195	-195	-195	-195	-195	-195
-5.33%	-130	-130	-130	-130	-130	-130	-130
-2.67%	-65	-65	-65	-65	-65	-65	-65
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	65	65	65	65	65	65	65
5.33%	130	130	130	130	130	130	130
8.00%	195	195	195	195	195	195	195
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_7						250
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-250	-250	-250	-250	-250	-250	-250
-5.33%	-167	-167	-167	-167	-167	-167	-167
-2.67%	-83	-83	-83	-83	-83	-83	-83
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	83	83	83	83	83	83	83
5.33%	167	167	167	167	167	167	167
8.00%	250	250	250	250	250	250	250
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_8						462
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-462	-462	-462	-462	-462	-462	-462
-5.33%	-308	-308	-308	-308	-308	-308	-308
-2.67%	-154	-154	-154	-154	-154	-154	-154
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	154	154	154	154	154	154	154
5.33%	308	308	308	308	308	308	308
8.00%	462	462	462	462	462	462	462
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_10						273
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-273	-273	-273	-273	-273	-273	-273
-5.33%	-182	-182	-182	-182	-182	-182	-182
-2.67%	-91	-91	-91	-91	-91	-91	-91
0%	0	0	0	0	0	0	0

2.67%	91	91	91	91	91	91	91
5.33%	182	182	182	182	182	182	182
8.00%	273	273	273	273	273	273	273
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_11						625
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-625	-625	-625	-625	-625	-625	-625
-5.33%	-417	-417	-417	-417	-417	-417	-417
-2.67%	-208	-208	-208	-208	-208	-208	-208
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	208	208	208	208	208	208	208
5.33%	417	417	417	417	417	417	417
8.00%	625	625	625	625	625	625	625
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_12						469
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-469	-469	-469	-469	-469	-469	-469
-5.33%	-312	-312	-312	-312	-312	-312	-312
-2.67%	-156	-156	-156	-156	-156	-156	-156
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	156	156	156	156	156	156	156
5.33%	312	312	312	312	312	312	312
8.00%	469	469	469	469	469	469	469
	KR4101N30(	2018-03 코스피200지수선물					907
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-907	-907	-907	-907	-907	-907	-907
-5.33%	-605	-605	-605	-605	-605	-605	-605
-2.67%	-302	-302	-302	-302	-302	-302	-302
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	302	302	302	302	302	302	302
5.33%	605	605	605	605	605	605	605
8.00%	907	907	907	907	907	907	907
	KR4201N331	2018-03 콜312.5					1,967
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	721	710	695	676	654	628	600
-5.33%	668	639	606	570	531	490	447
-2.67%	511	461	409	356	303	248	193
0%	179	119	60	0	-60	-119	-179
2.67%	-352	-402	-454	-508	-562	-617	-673
5.33%	-1,042	-1,073	-1,108	-1,146	-1,187	-1,231	-1,277
8.00%	-1,822	-1,836	-1,855	-1,878	-1,904	-1,934	-1,967
	KR4301N331	2018-03 풋310					1,198

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,179	-1,180	-1,182	-1,184	-1,188	-1,192	-1,198
-5.33%	-668	-675	-684	-694	-705	-718	-732
-2.67%	-220	-239	-259	-280	-301	-323	-344
0%	69	46	23	0	-23	-46	-70
2.67%	180	168	155	140	125	108	90
5.33%	203	200	196	190	184	175	166
8.00%	205	205	204	203	201	198	194
KR4301N3312018-03 풋312.5							358

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-354	-354	-354	-355	-355	-356	-358
-5.33%	-210	-211	-212	-214	-217	-220	-223
-2.67%	-76	-81	-85	-91	-96	-101	-107
0%	20	13	7	0	-7	-13	-20
2.67%	64	60	55	50	45	40	34
5.33%	76	74	73	70	68	65	61
8.00%	77	77	77	76	75	74	72

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

4,226

공시일	2018-02-21
기준일	2018-02-20

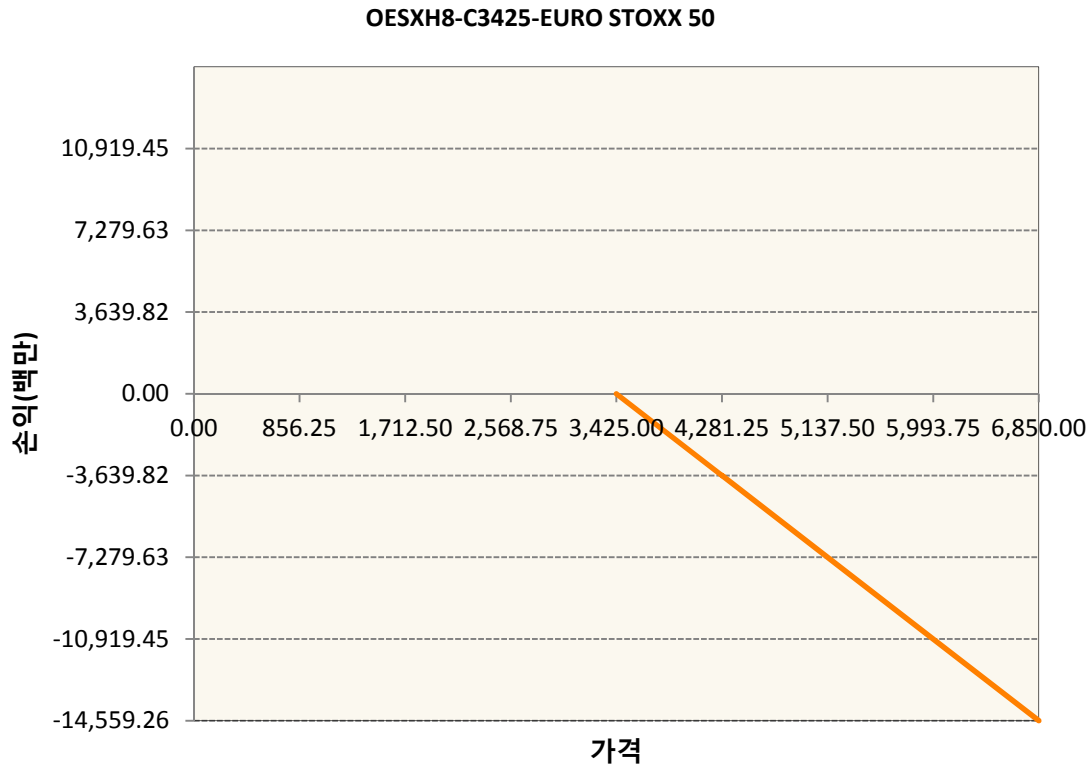
유로커버드콜모(주식혼합-파생형

1. 계약금액

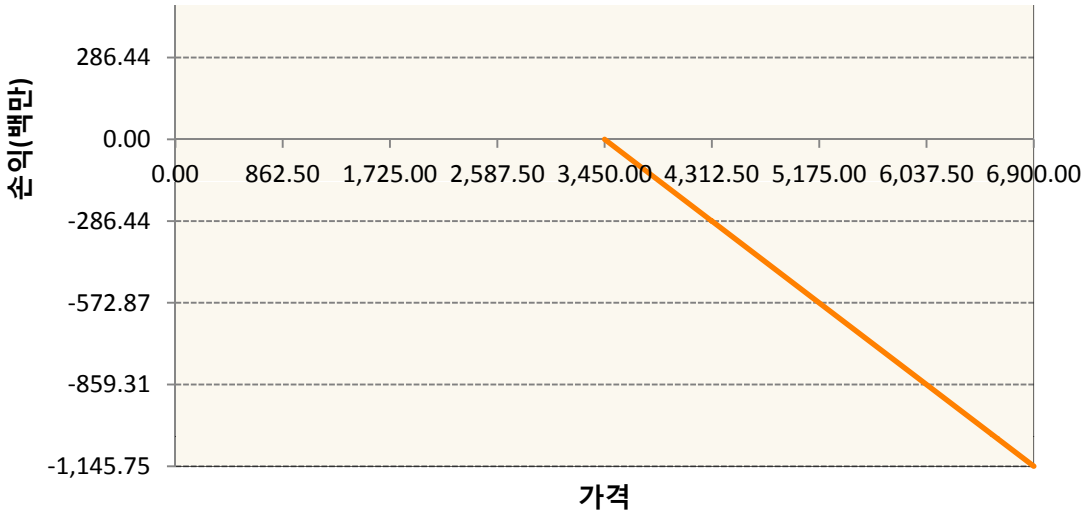
(단위:백만원)

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	7,443	0	7,443	
누계	유가증권	스왑	99,630	0	99,630	장외
누계	유가증권	옵션	0	31,410	-31,410	장내
누계	지수	스왑	53,137	0	53,137	장외

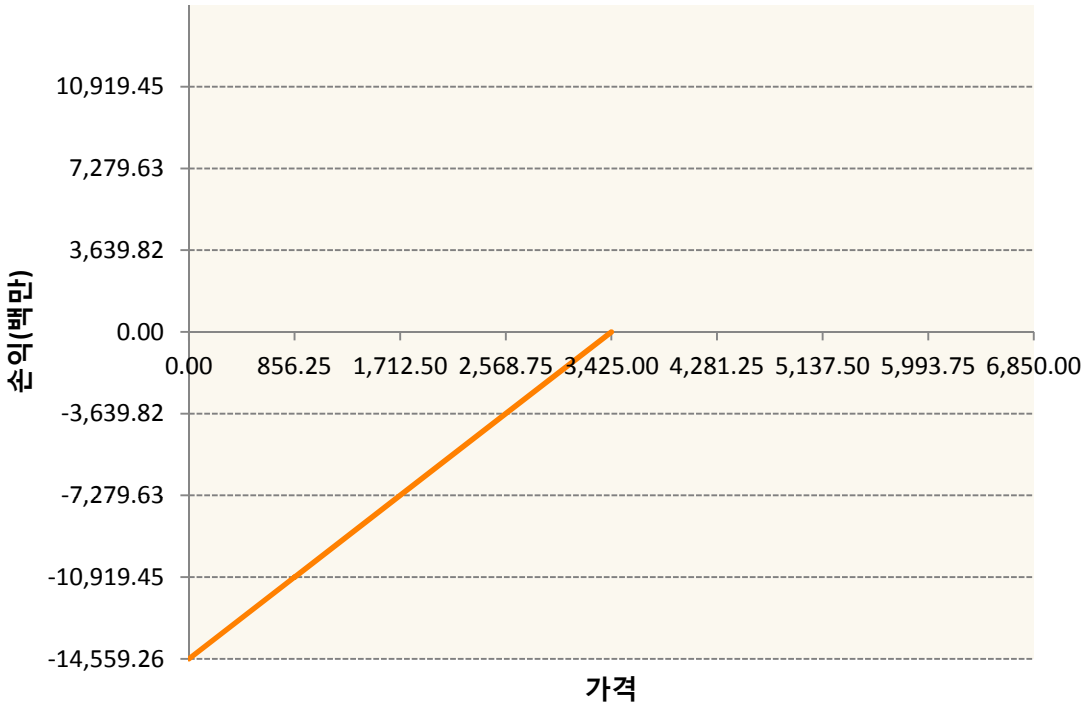
2. 만기시점의 손익구조



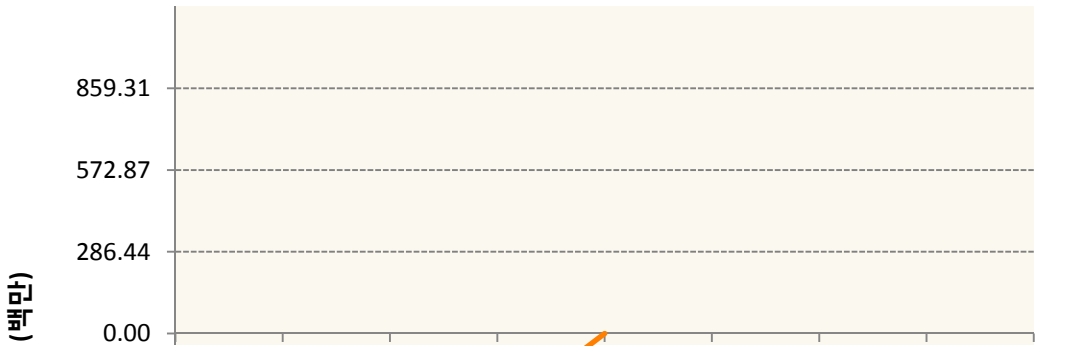


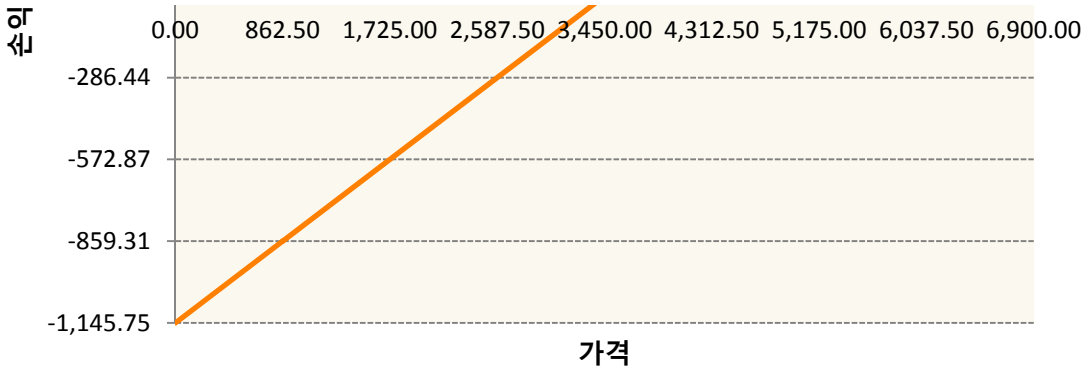


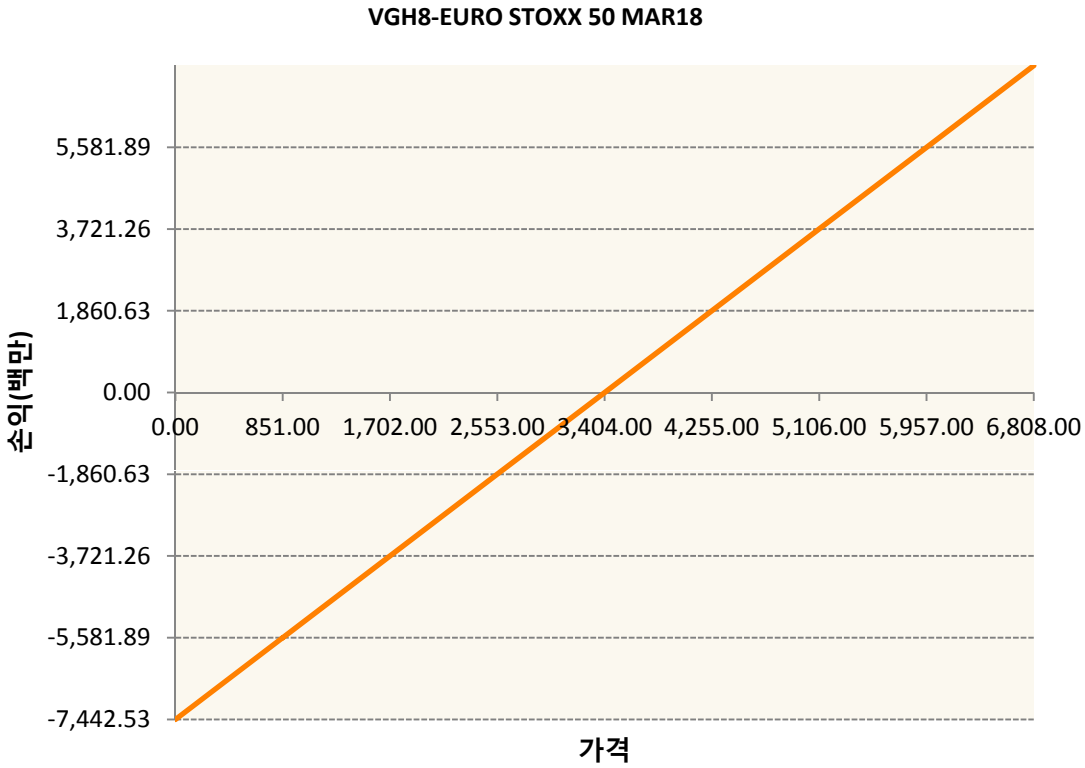
OESXH8-P3425-EURO STOXX 50



OESXH8-P3450-EURO STOXX 50







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)	(단위:백만원)
260105SGPX SG EURO Covered CALL STRATEGY - 994.569	230
260105SQPX SG EURO Covered CALL STRATEGY	430
OESXH8-C34 EURO STOXX 50	1,165
OESXH8-C34 EURO STOXX 50	92
OESXH8-P34 EURO STOXX 50	1,165
OESXH8-P34 EURO STOXX 50	92
VGH8 EURO STOXX 50 MAR18	595

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

2,251

공시일	2018-02-21
기준일	2018-02-20

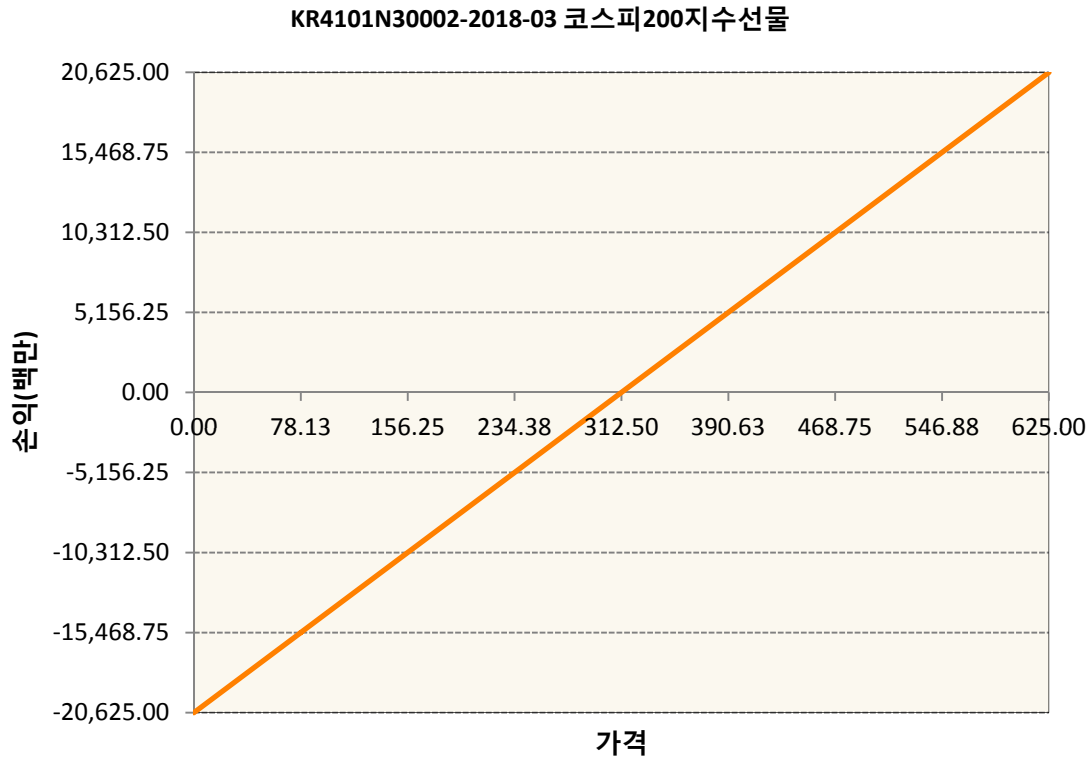
ETF스마트레버리지목표전환형8호

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	20,625	0	20,625	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101N30(2018-03 코스피200지수선물							1,652
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,652	-1,652	-1,652	-1,652	-1,652	-1,652	-1,652
-5.33%	-1,101	-1,101	-1,101	-1,101	-1,101	-1,101	-1,101
-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%	1,101	1,101	1,101	1,101	1,101	1,101	1,101
8.00%	1,652	1,652	1,652	1,652	1,652	1,652	1,652

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

1,098

공시일	2018-02-21
기준일	2018-02-20

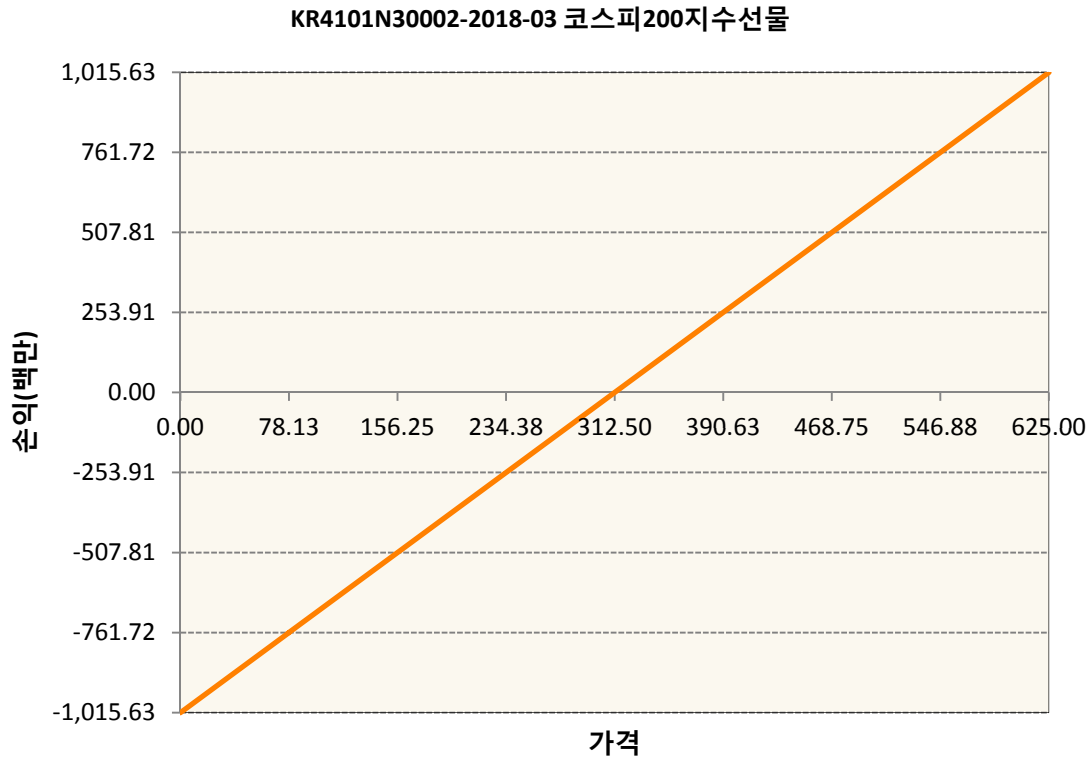
ETF스마트레버리지목표전환형9호

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	1,016	0	1,016	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101N30(2018-03 코스피200지수선물 81

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-81	-81	-81	-81	-81	-81	-81
-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%	81	81	81	81	81	81	81

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

54

공시일	2018-02-21
기준일	2018-02-20

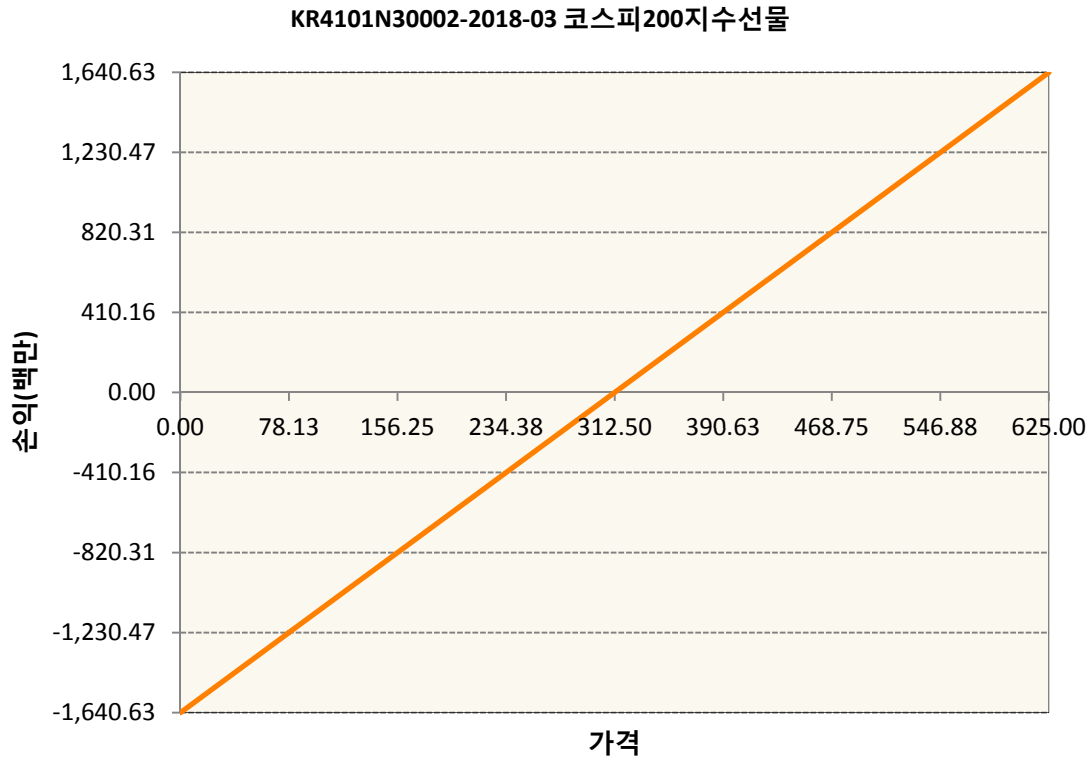
ETF스마트레버리지목표전환형10

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	1,641	0	1,641	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101N30(2018-03 코스피200지수선물							131
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-131	-131	-131	-131	-131	-131	-131
-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%	131	131	131	131	131	131	131

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

87

공시일	2018-02-21
기준일	2018-02-20

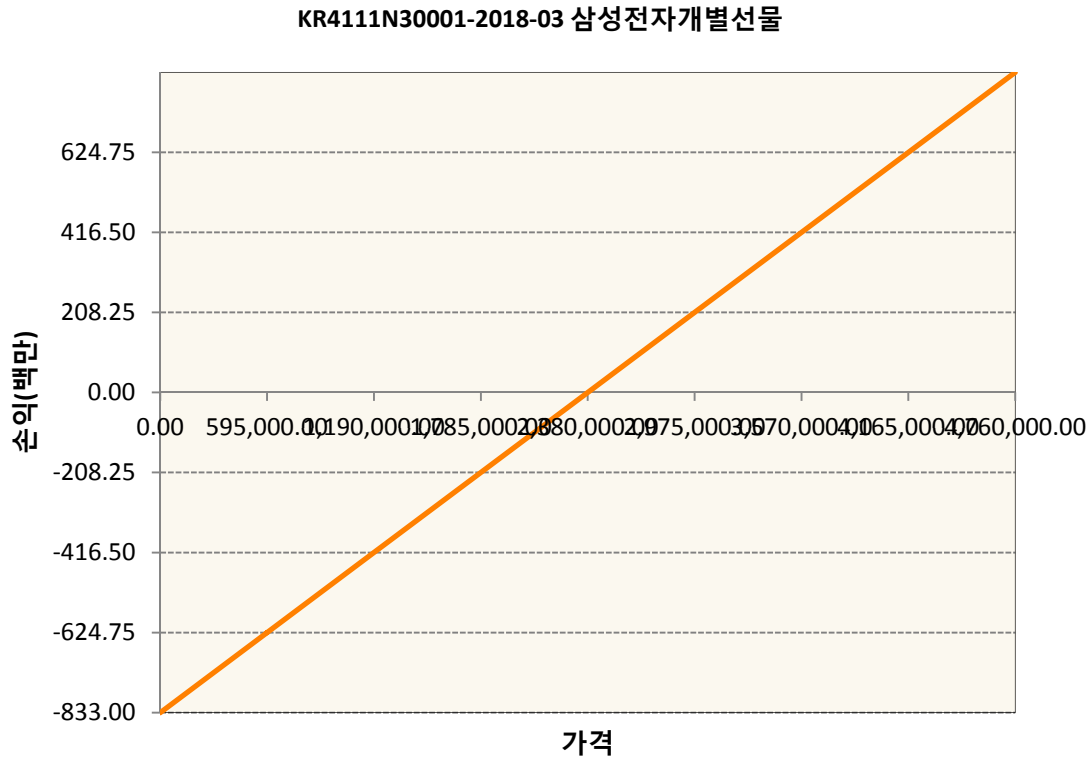
스마트KRX300인덱스1호(주식-파

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	238	0	238	장내
누계	유가증권	선물	833	0	833	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4111N30(2018-03 삼성전자개별선물							66
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-66	-66	-66	-66	-66	-66	-66
-5.33%	-44	-44	-44	-44	-44	-44	-44
-2.67%	-22	-22	-22	-22	-22	-22	-22
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	22	22	22	22	22	22	22
5.33%	44	44	44	44	44	44	44
8.00%	66	66	66	66	66	66	66

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

80

공시일	2018-02-21
기준일	2018-02-20

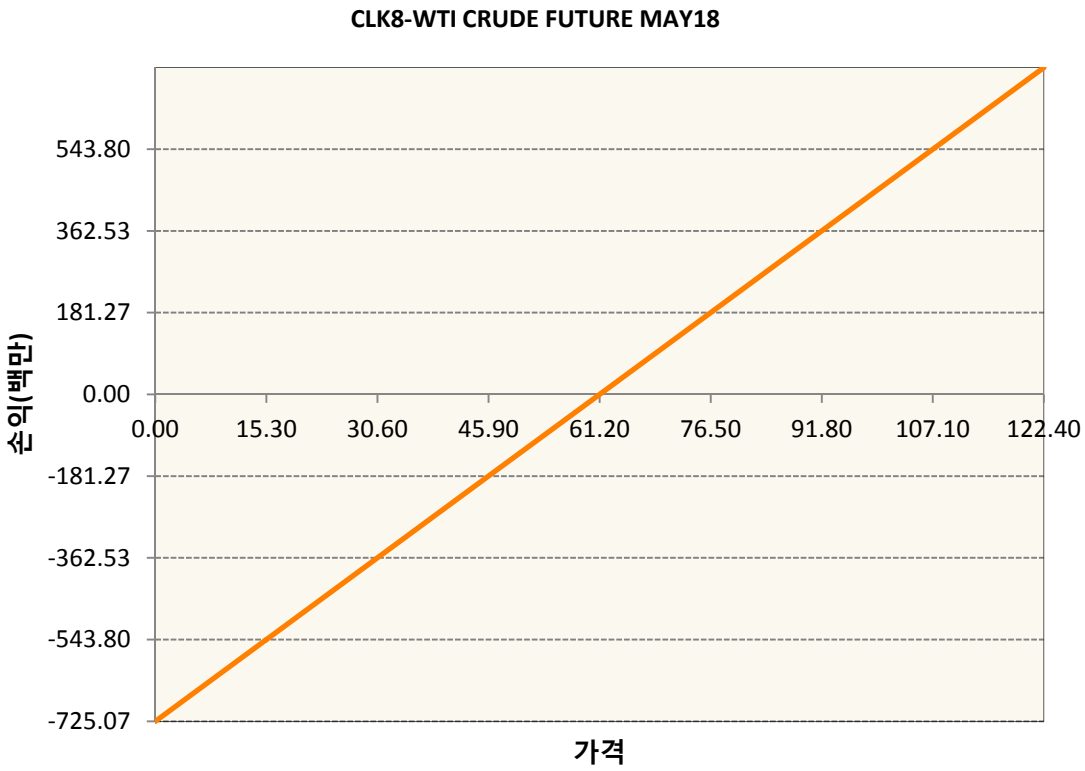
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

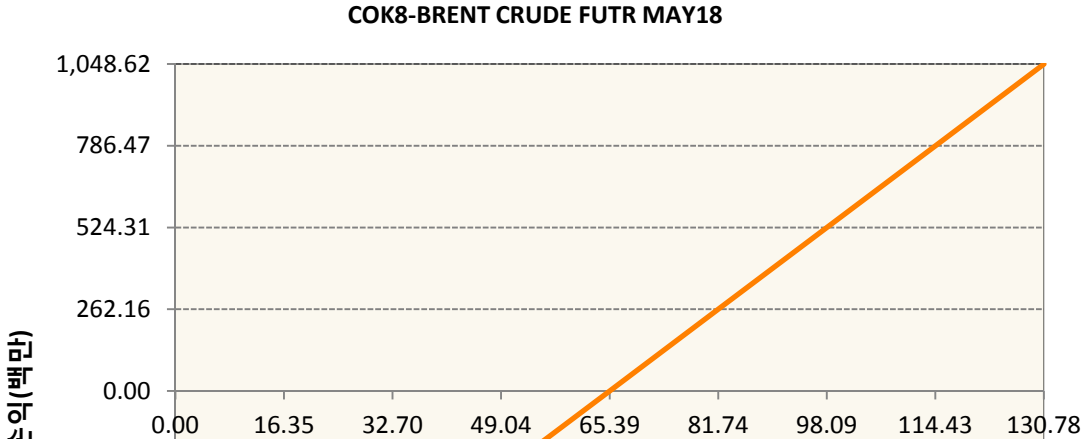
1. 계약금액

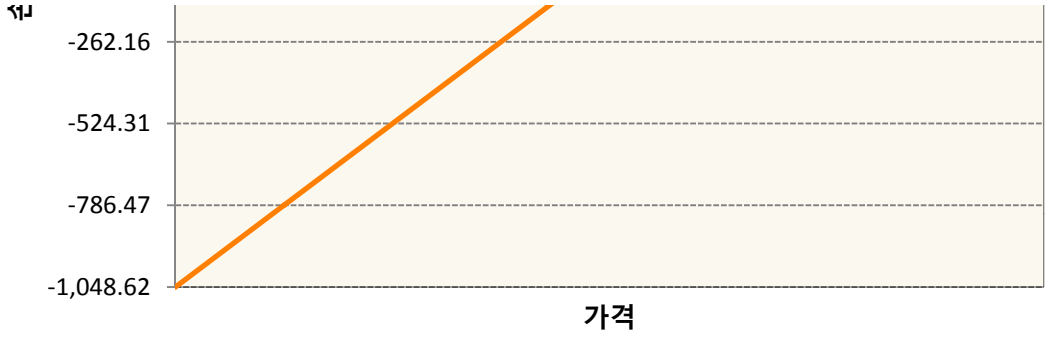
(단위:백만원)

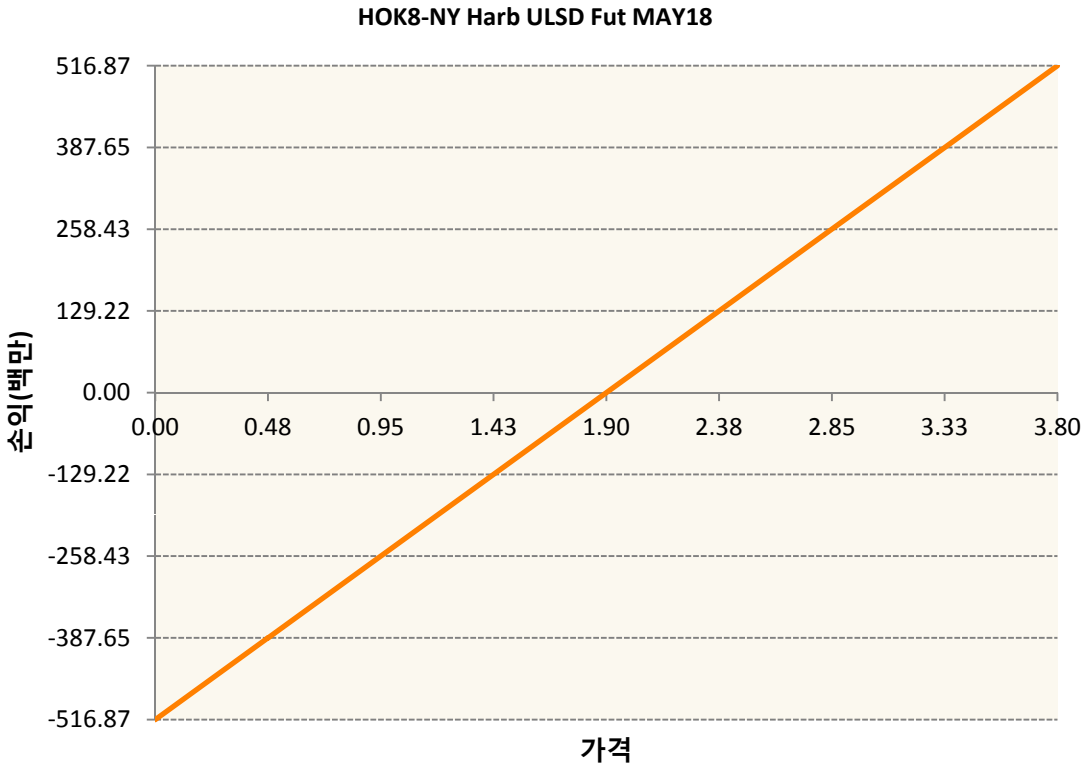
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	선물	유가증권	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	선물	유가증권	725	0	725	
누계	유가증권	선물	3,201	590	2,611	

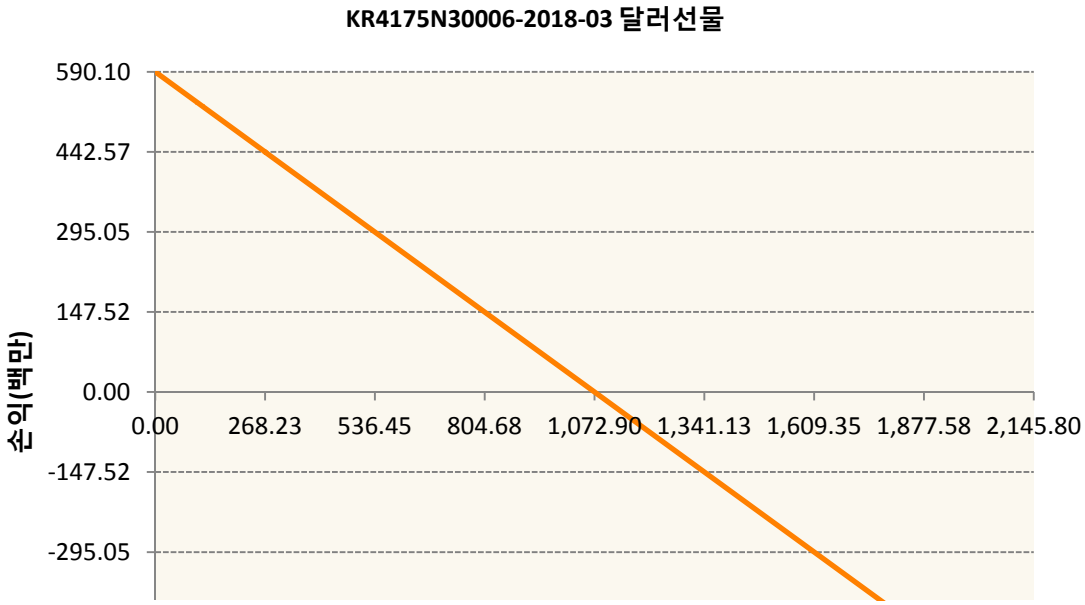
2. 만기시점의 손익구조

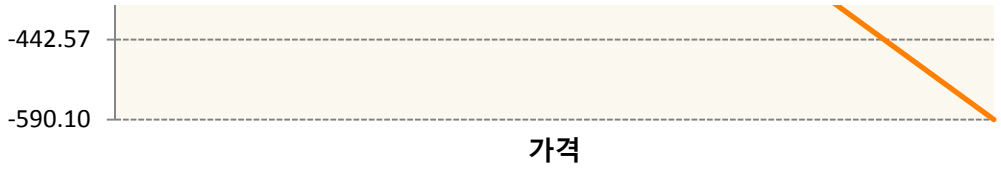


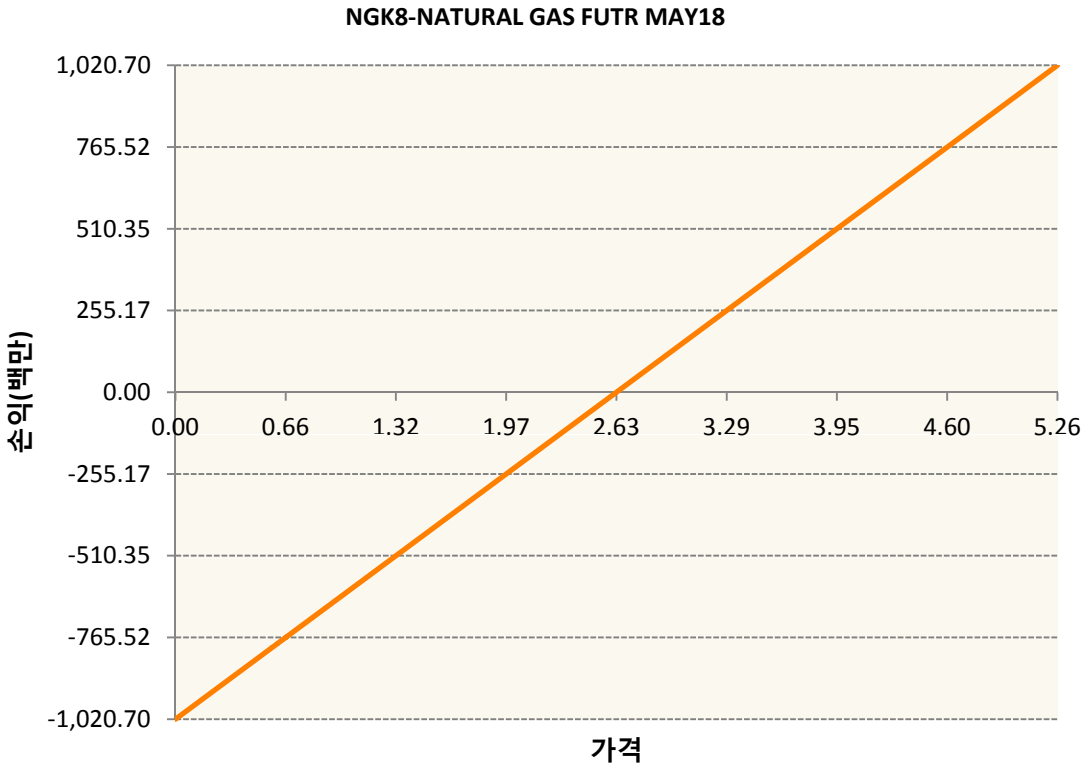


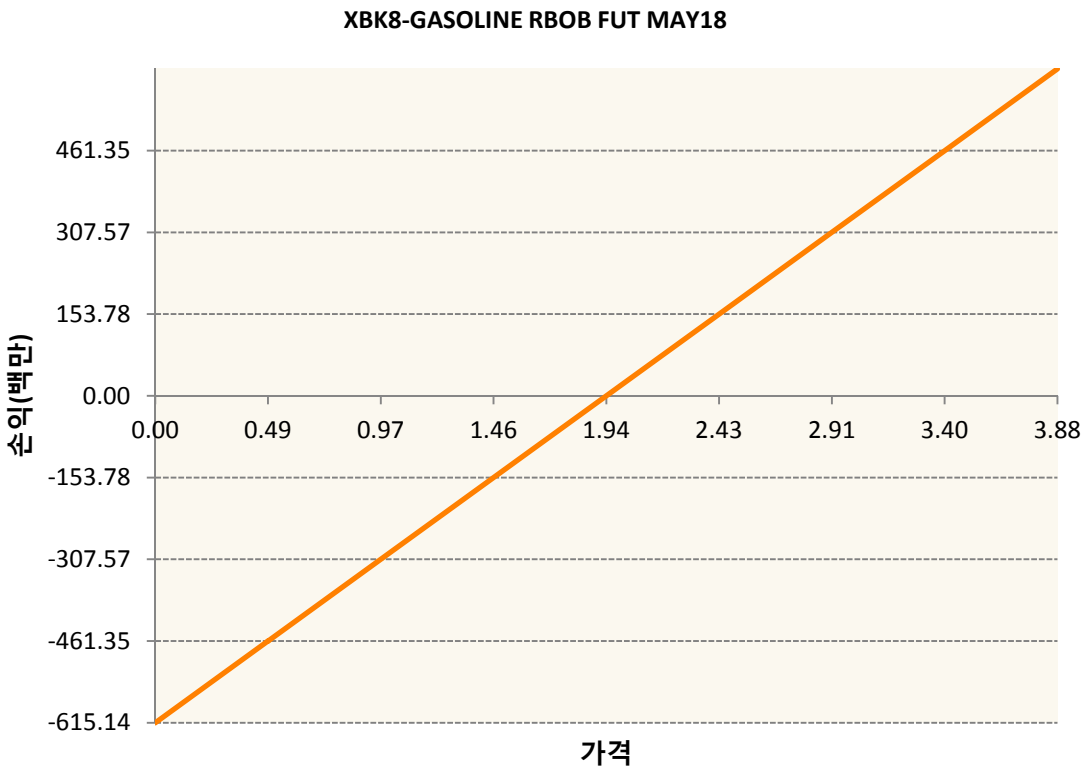

-262.16
-524.31
-786.47
-1,048.62
가격


HOK8-NY Harb ULSD Fut MAY18
516.87
387.65
258.43
129.22
0.00
-129.22
-258.43
-387.65
-516.87
손익(백만)
0.00
0.48
0.95
1.43
1.90
2.38
2.85
3.33
3.80
가격


KR4175N30006-2018-03 달러선물
590.10
442.57
295.05
147.52
0.00
-147.52
-295.05
손익(백만)
0.00
268.23
536.45
804.68
1,072.90
1,341.13
1,609.35
1,877.58
2,145.80


-442.57
-590.10
가격


NGK8-NATURAL GAS FUTR MAY18
1,020.70
765.52
510.35
255.17
0.00
-255.17
-510.35
-765.52
-1,020.70
0.00
0.66
1.32
1.97
2.63
3.29
3.95
4.60
5.26
손익(백만)
가격


XBK8-GASOLINE RBOB FUT MAY18
461.35
307.57
153.78
0.00
-153.78
-307.57
-461.35
-615.14
0.00
0.49
0.97
1.46
1.94
2.43
2.91
3.40
3.88
손익(백만)
가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLK8	WTI CRUDE FUTURE MAY18	58
COK8	BRENT CRUDE FUTR MAY18	84
HOK8	NY Harb ULSD Fut MAY18	41
KR4175N30(	2018-03 달러선물	47
NGK8	NATURAL GAS FUTR MAY18	82
XBK8	GASOLINE RBOB FUT MAY18	49

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

518

공시일	2018-02-21
기준일	2018-02-20

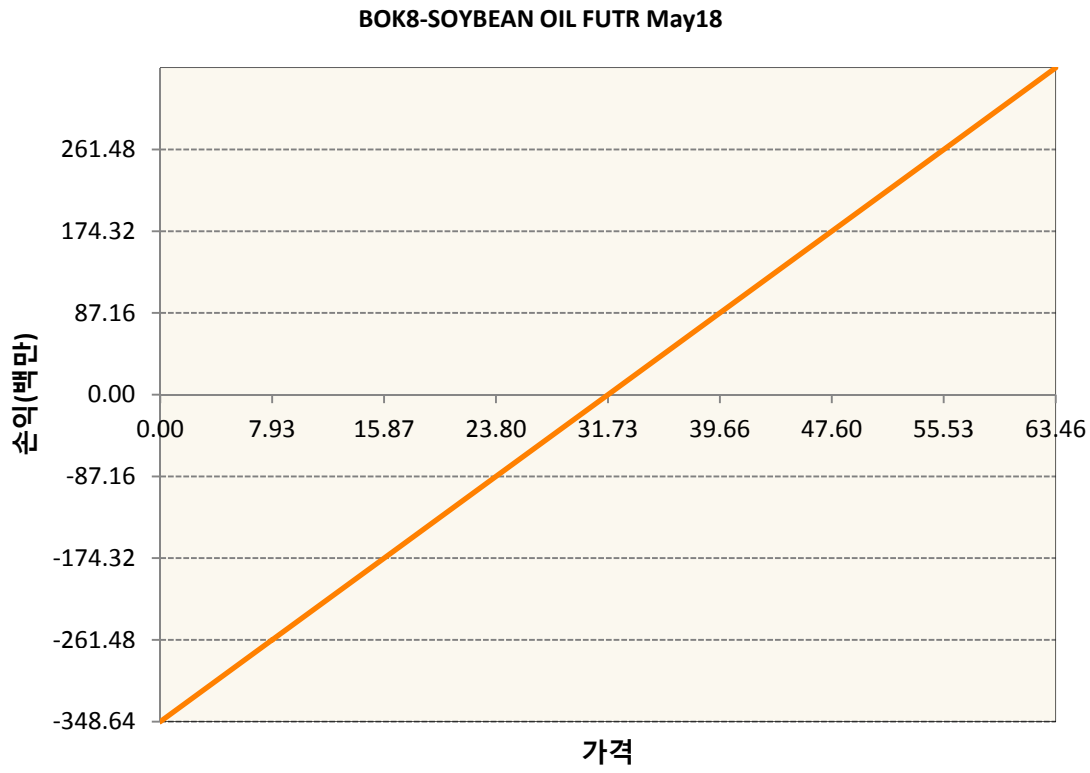
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

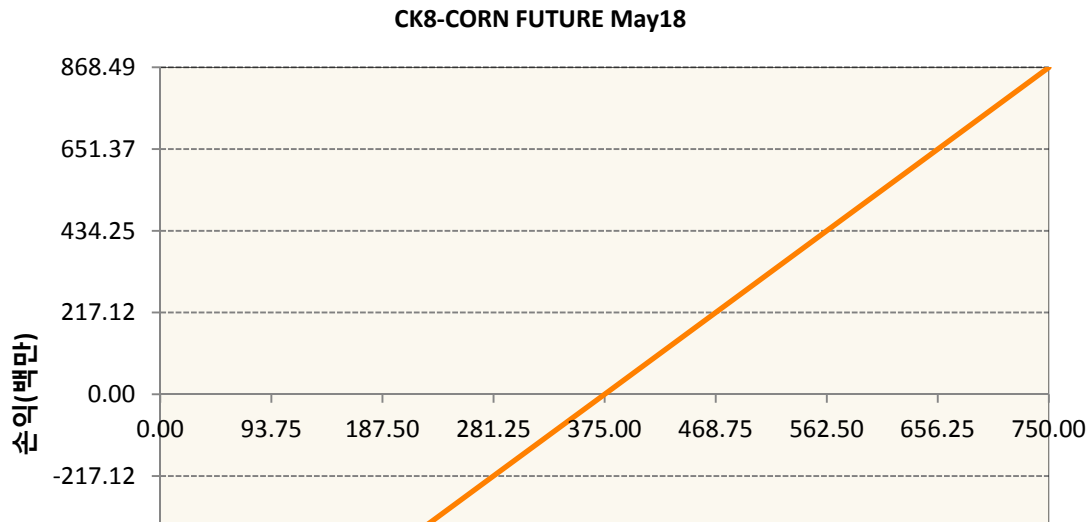
1. 계약금액

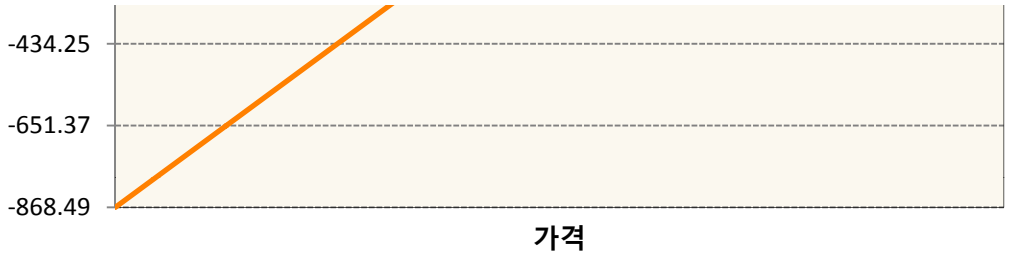
(단위:백만원)

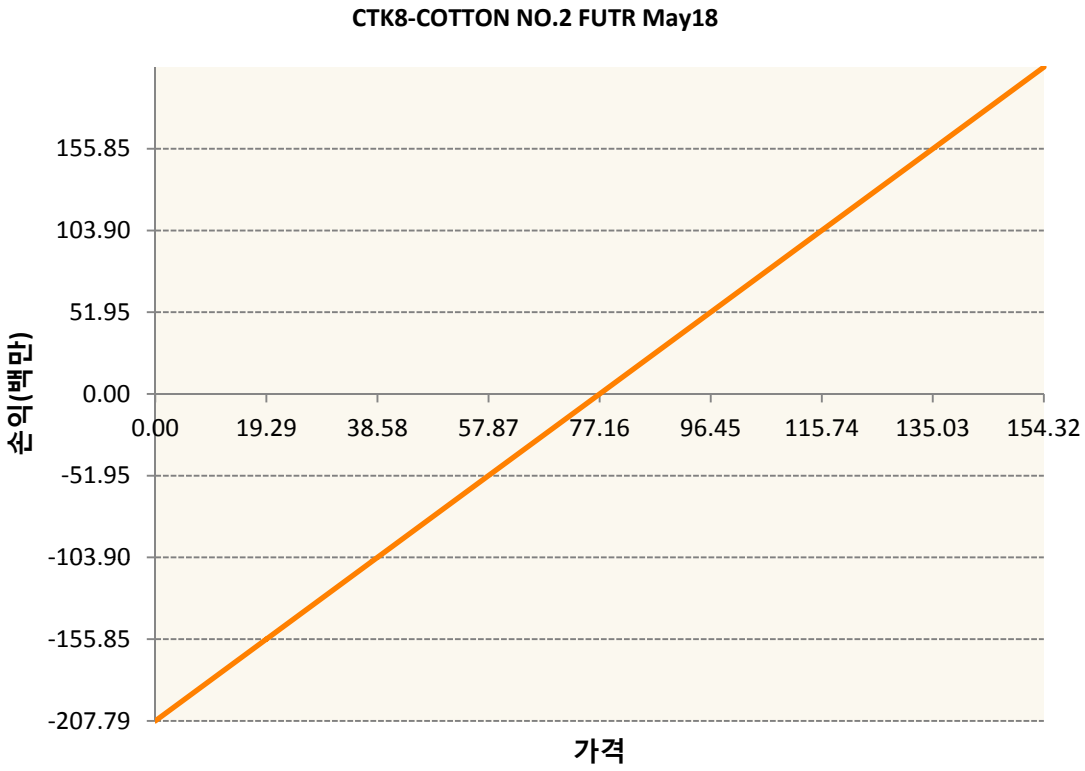
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	4,113	322	3,791	

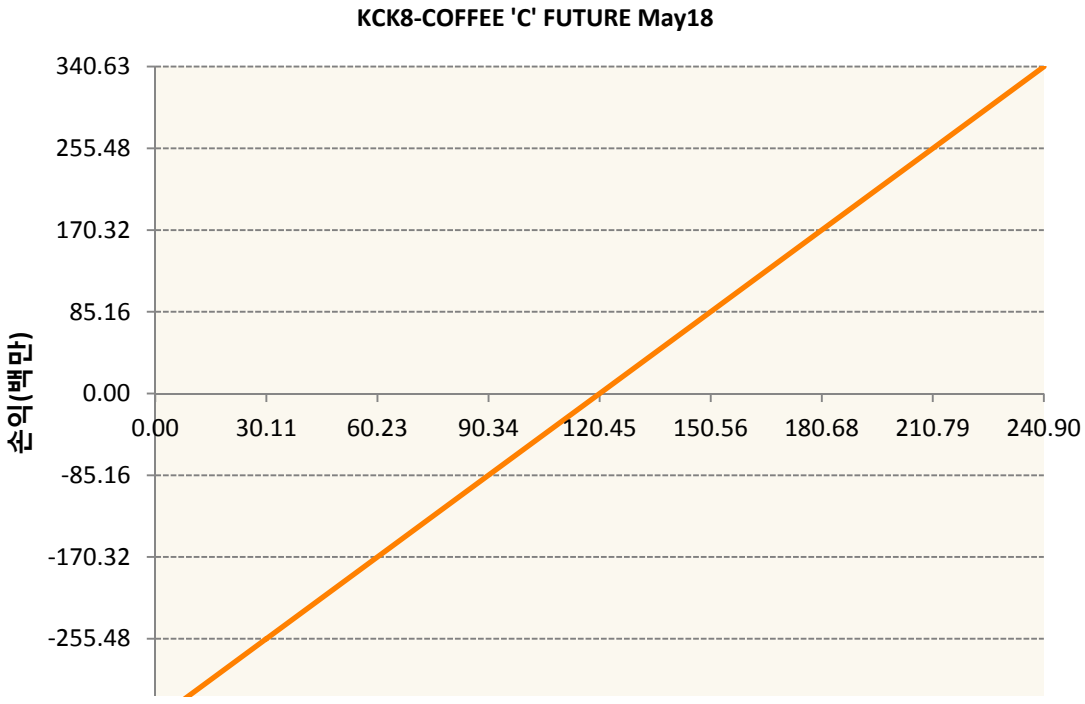
2. 만기시점의 손익구조

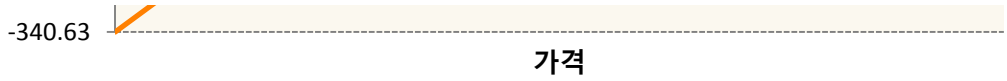


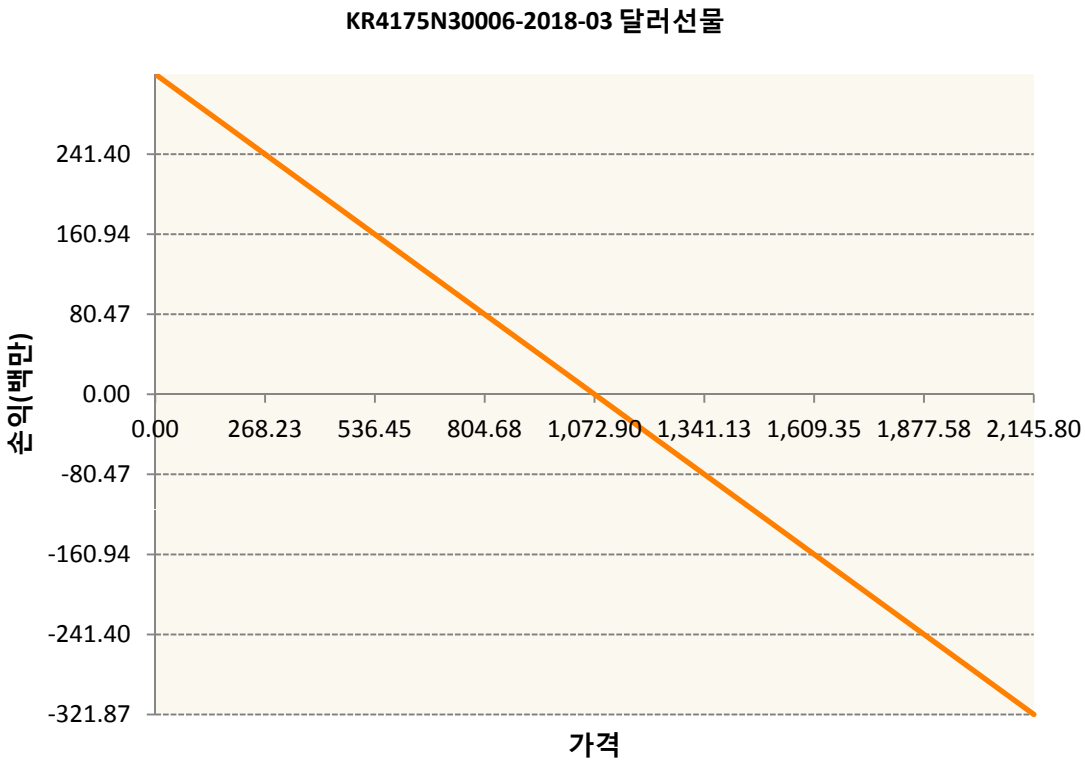


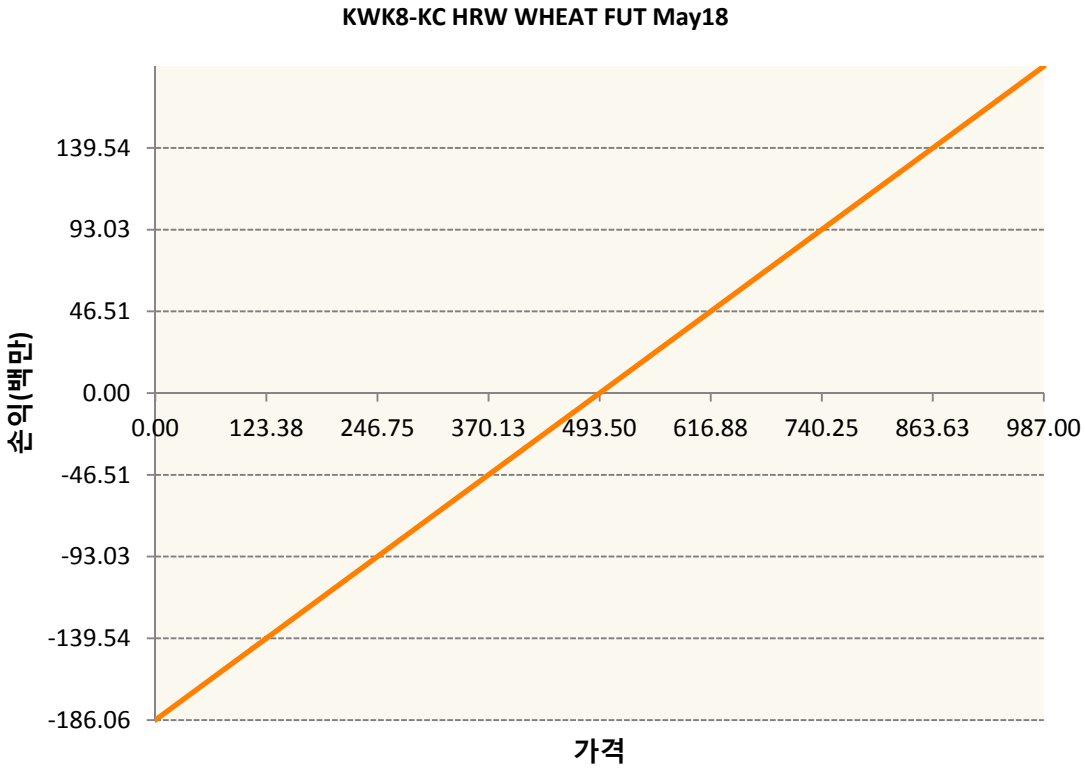

-434.25
-651.37
-868.49
가격

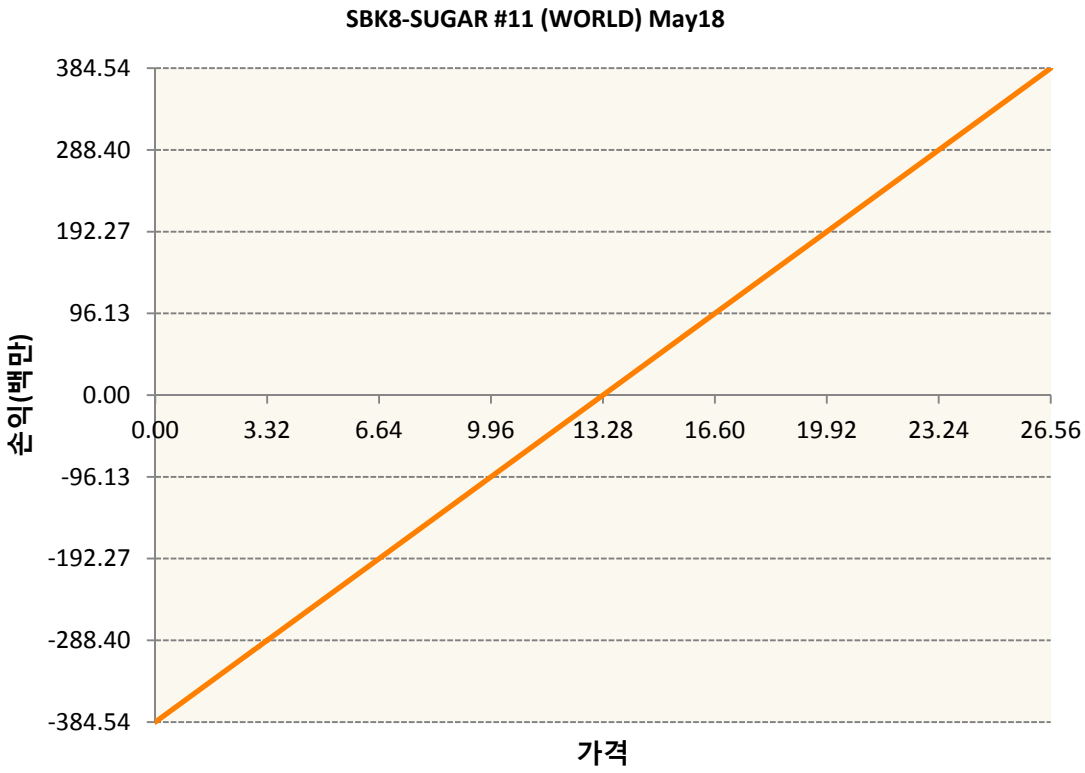

CTK8-COTTON NO.2 FUTR May18
155.85
103.90
51.95
0.00
-51.95
-103.90
-155.85
-207.79
0.00
19.29
38.58
57.87
77.16
96.45
115.74
135.03
154.32
손익(백만)
가격

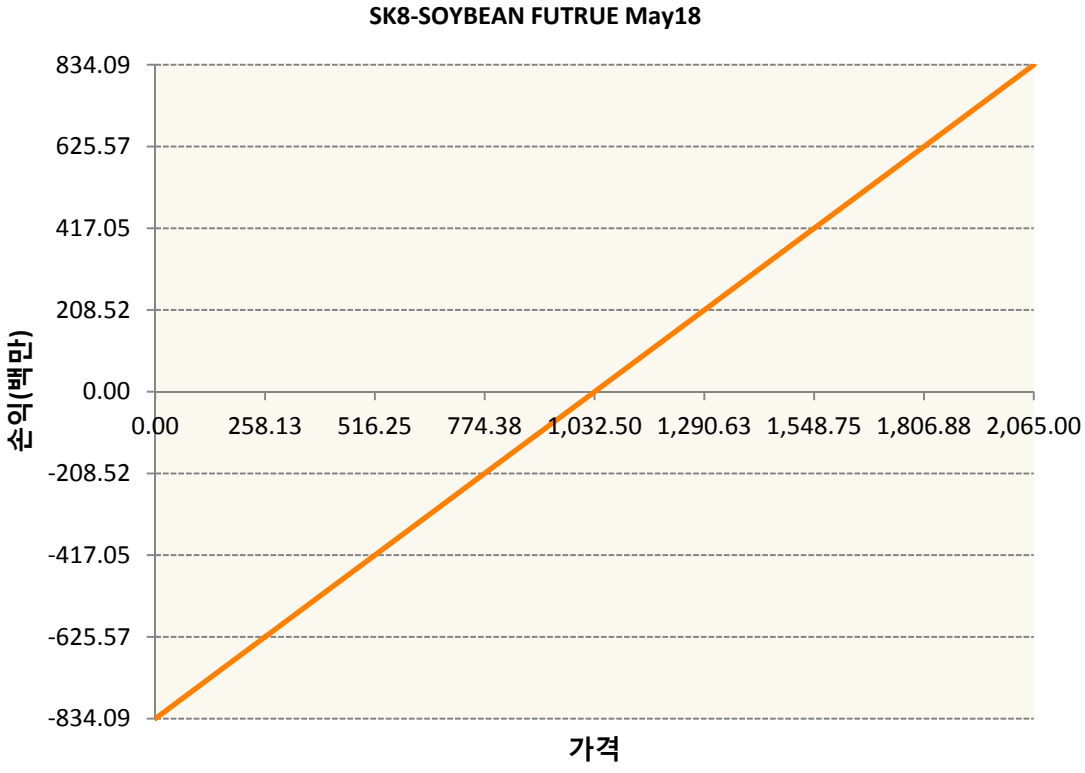

KCK8-COFFEE 'C' FUTURE May18
340.63
255.48
170.32
85.16
0.00
-85.16
-170.32
-255.48
0.00
30.11
60.23
90.34
120.45
150.56
180.68
210.79
240.90
손익(백만)


-340.63
가격

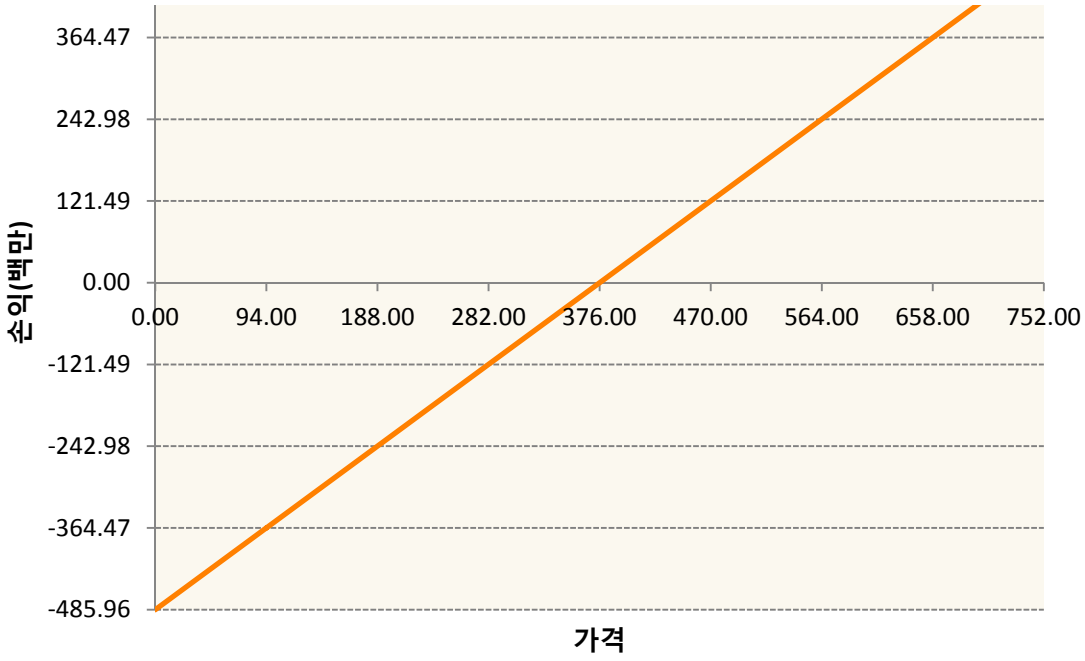

KR4175N30006-2018-03 달러선물
241.40
160.94
80.47
0.00
-80.47
-160.94
-241.40
-321.87
0.00
268.23
536.45
804.68
1,072.90
1,341.13
1,609.35
1,877.58
2,145.80
손익(백만)
가격


KWK8-KC HRW WHEAT FUT May18
139.54
93.03
46.51
0.00
-46.51
-93.03
-139.54
-186.06
0.00
123.38
246.75
370.13
493.50
616.88
740.25
863.63
987.00
손익(백만)
가격

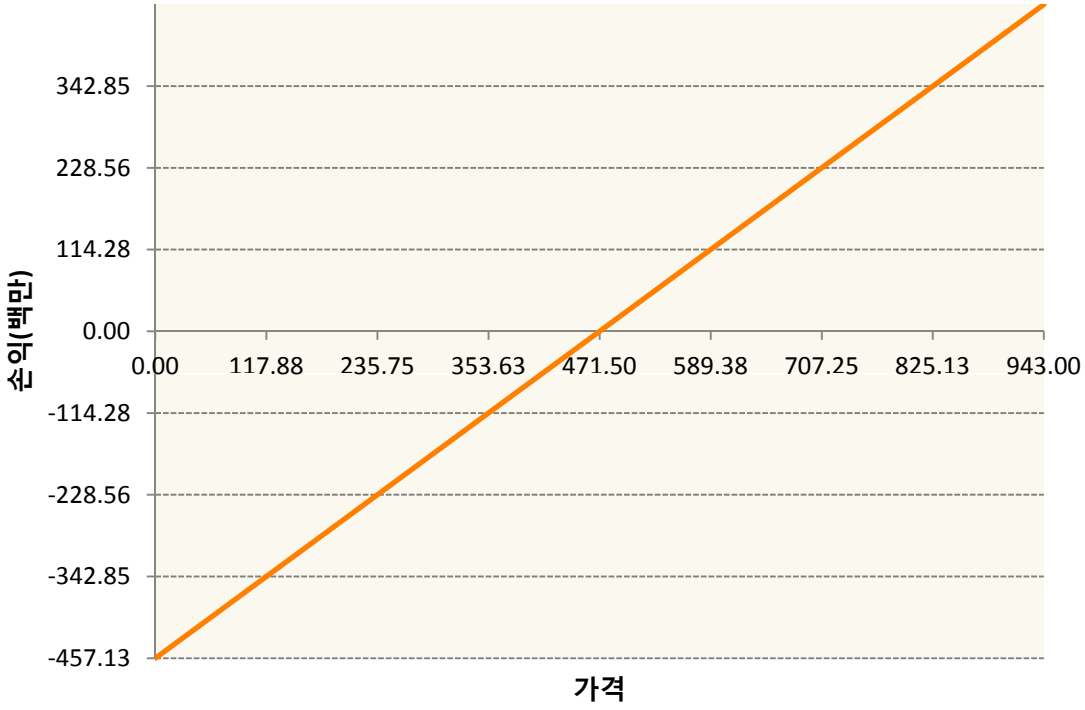

SBK8-SUGAR #11 (WORLD) May18
384.54
288.40
192.27
96.13
0.00
-96.13
-192.27
-288.40
-384.54
0.00
3.32
6.64
9.96
13.28
16.60
19.92
23.24
26.56
손익(백만)
가격


SK8-SOYBEAN FUTRUE May18
834.09
625.57
417.05
208.52
0.00
-208.52
-417.05
-625.57
-834.09
0.00
258.13
516.25
774.38
1,032.50
1,290.63
1,548.75
1,806.88
2,065.00
손익(백만)
가격


SMK8-SOYBEAN MEAL FUTR May18



WK8-WHEAT FUTURE(CBT) May18



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

BOK8	SOYBEAN OIL FUTR May18	28
CK8	CORN FUTURE May18	69
CTK8	COTTON NO.2 FUTR May18	17
KCK8	COFFEE 'C' FUTURE May18	27
KR4175N30(	2018-03 달러선물	26

KWK8	KC HRW WHEAT FUT May18	15
SBK8	SUGAR #11 (WORLD) May18	31
SK8	SOYBEAN FUTRUE May18	67
SMK8	SOYBEAN MEAL FUTR May18	39
WK8	WHEAT FUTURE(CBT) May18	37

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

337