공시일	2018-02-23
기준일	2018-02-22

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	2018-02-23
기준일	2018-02-22

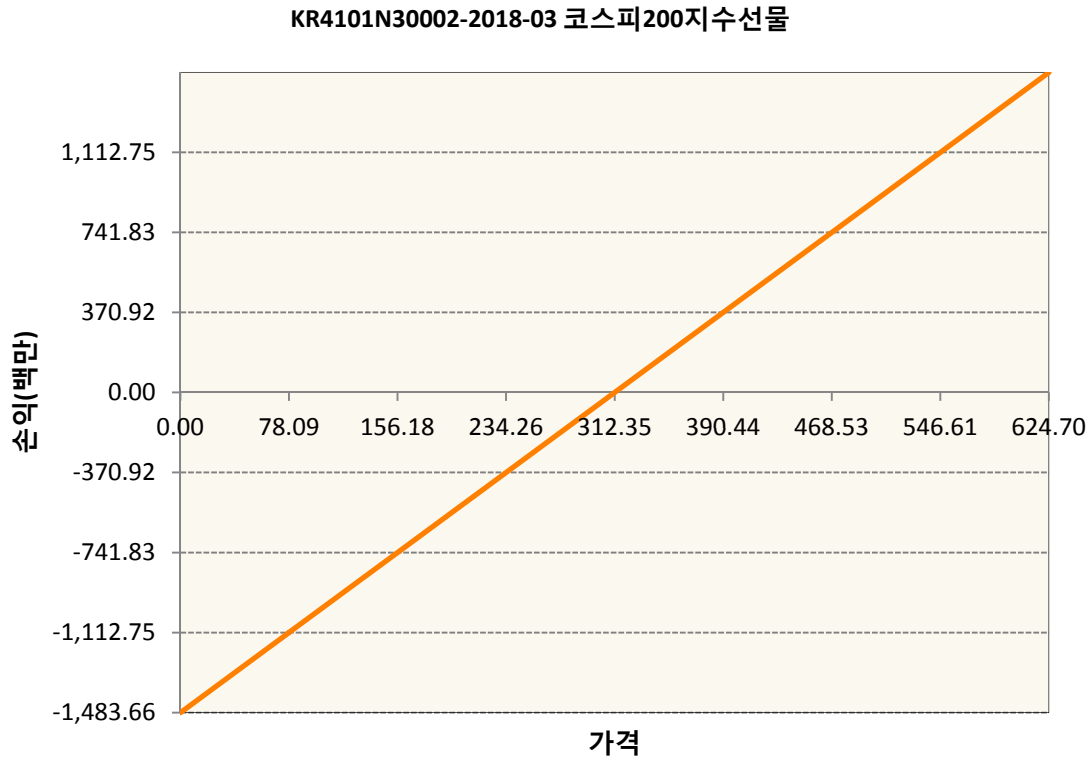
스마트인덱스모

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	2018-02-23
기준일	2018-02-22

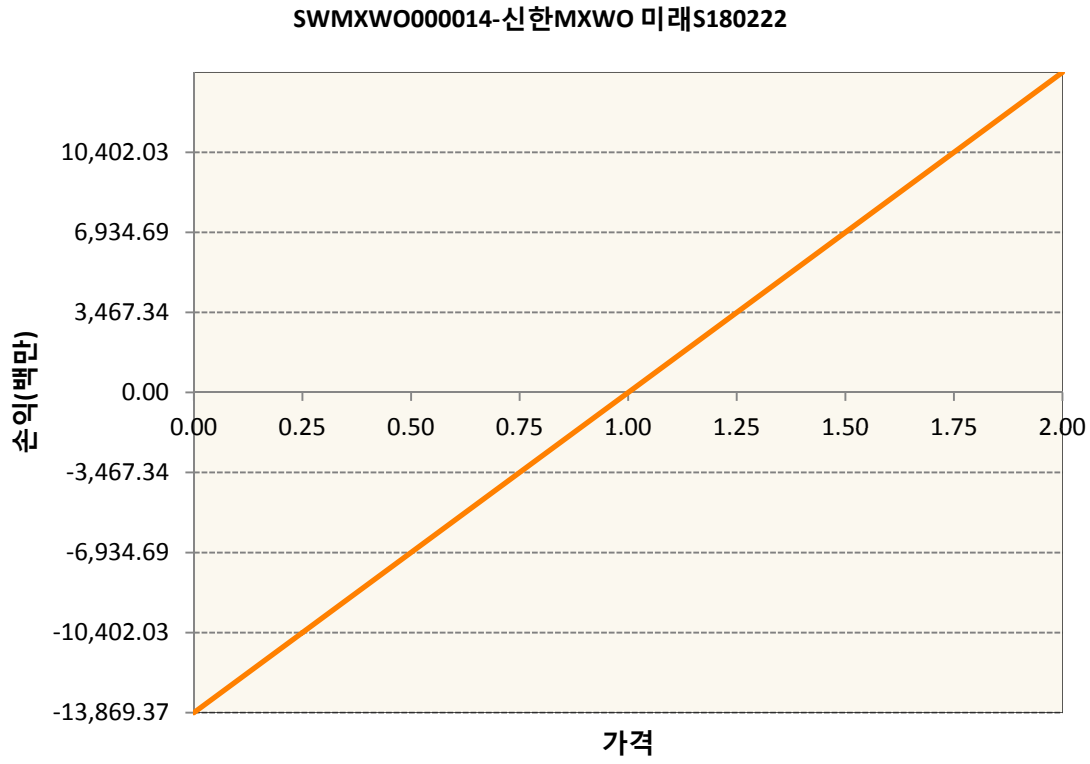
SMART합성-MSCI선진국증권상장지

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	13,869	0	13,869	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWMXWO0(신한MXWO 미래S180222	1,110

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

404

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2018-02-23
기준일	2018-02-22

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	391

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

385

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2018-02-23
기준일	2018-02-22

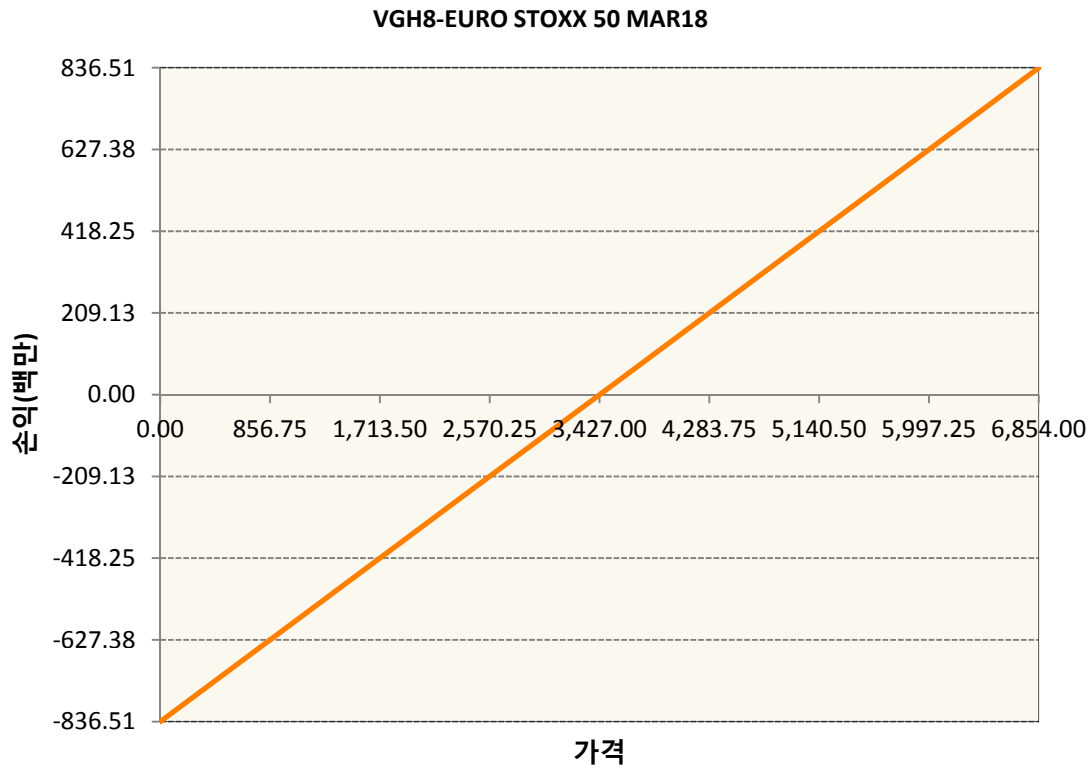
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	837	0	837	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGH8	EURO STOXX 50 MAR18	67

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

(단위:백만원)

39

공시일	2018-02-23
기준일	2018-02-22

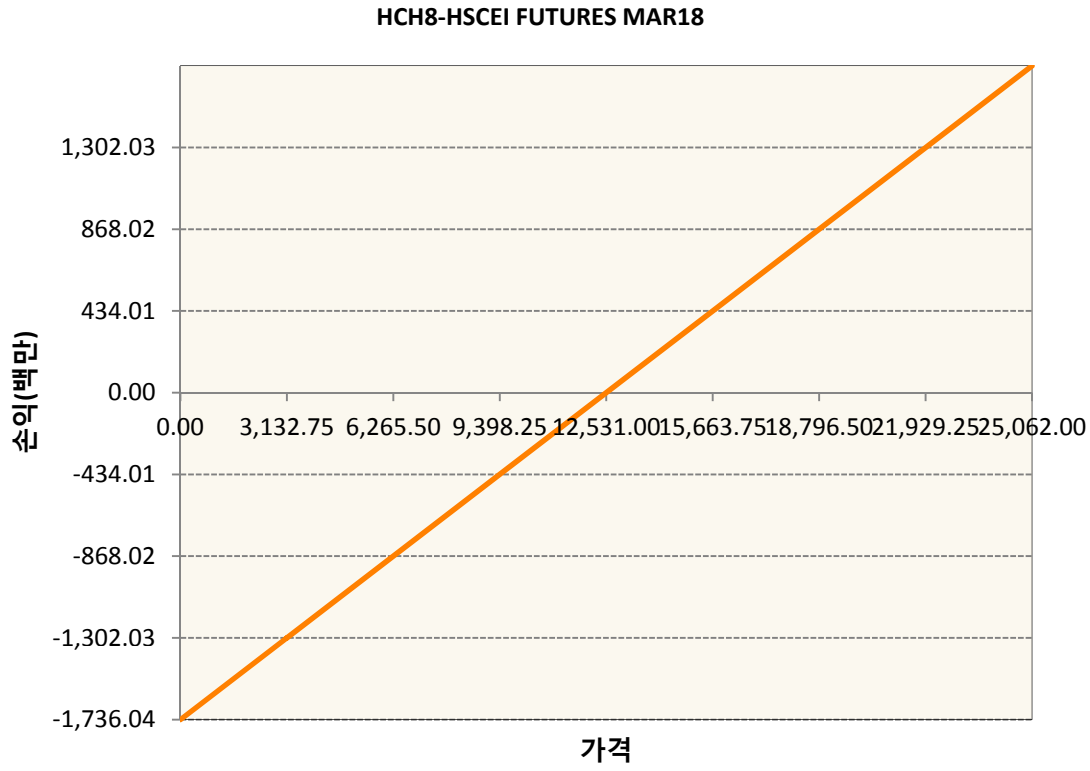
차이나인덱스모(주식-파생형)

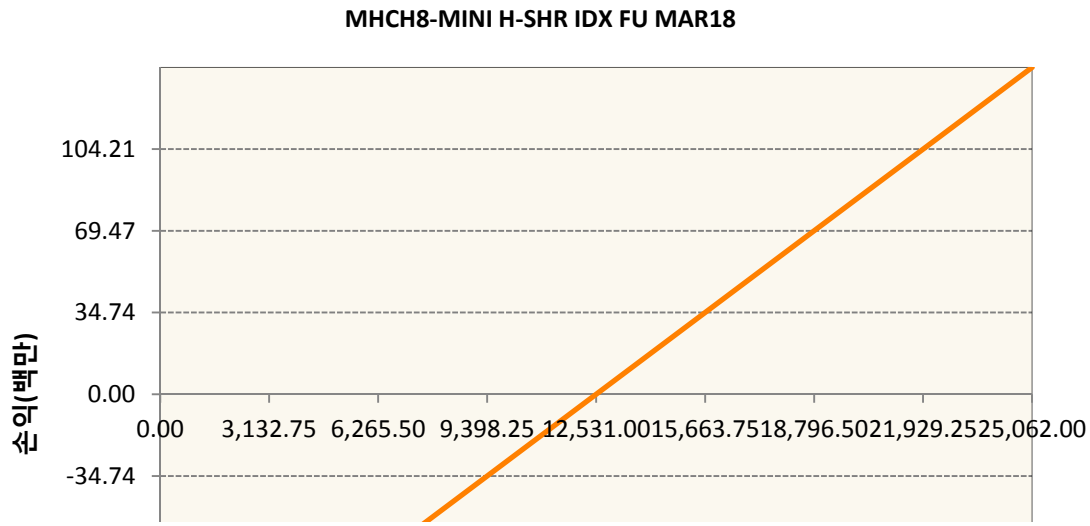
1. 계약금액

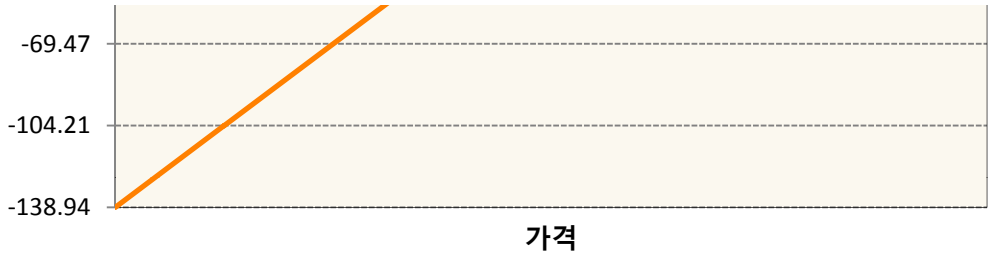
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,875	0	1,875	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCH8	HSCEI FUTURES MAR18	139
MHCH8	MINI H-SHR IDX FU MAR18	11

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	131

공시일	2018-02-23
기준일	2018-02-22

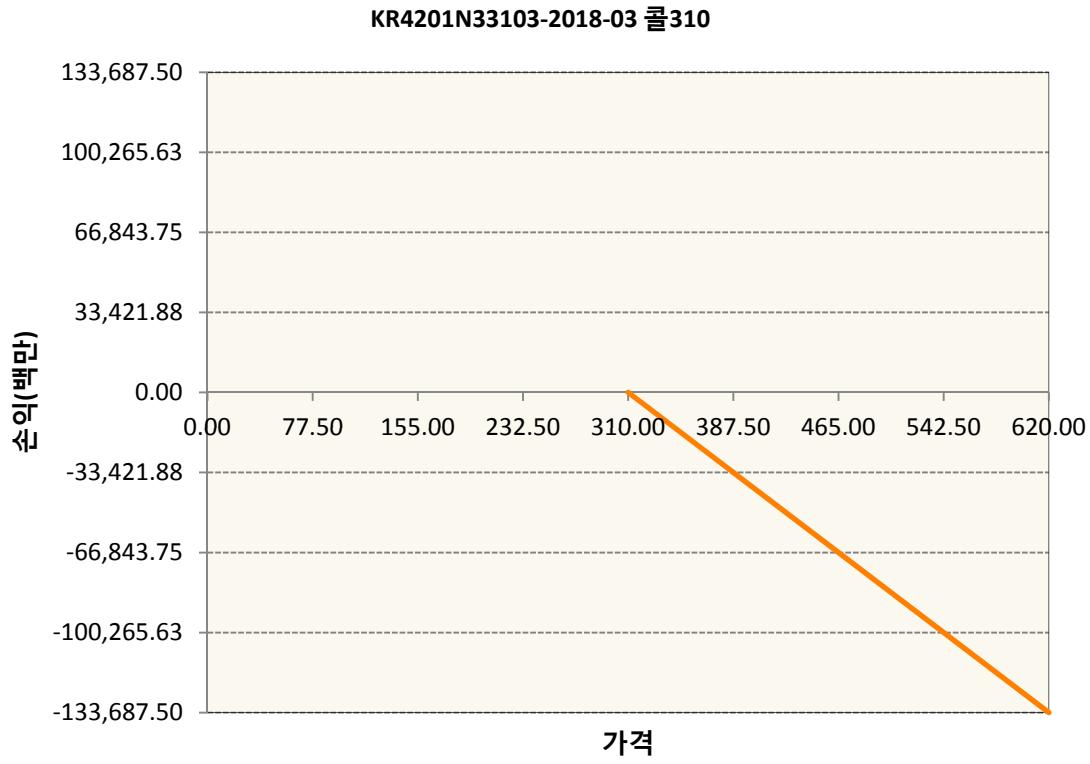
커버드콜모(주식혼합-파생형)

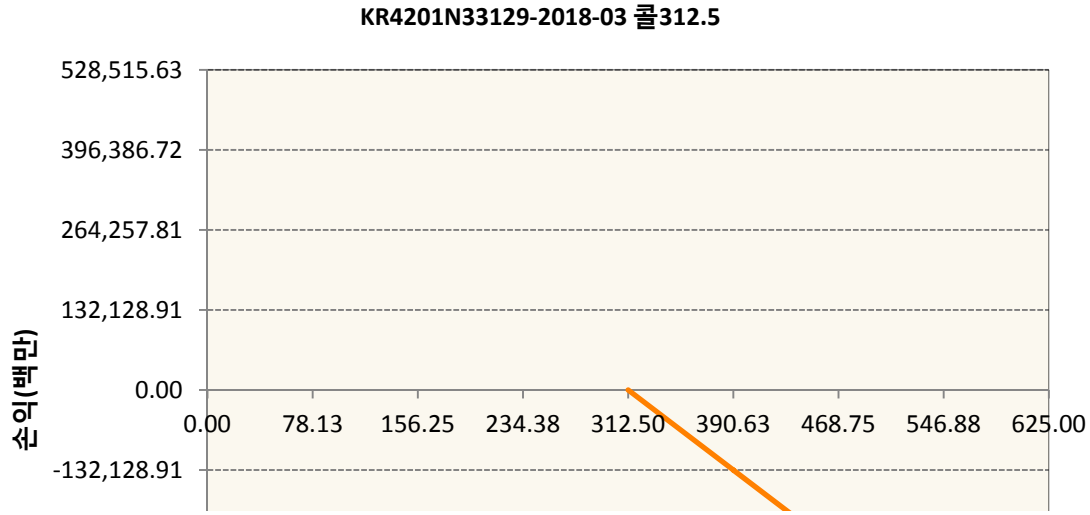
1. 계약금액

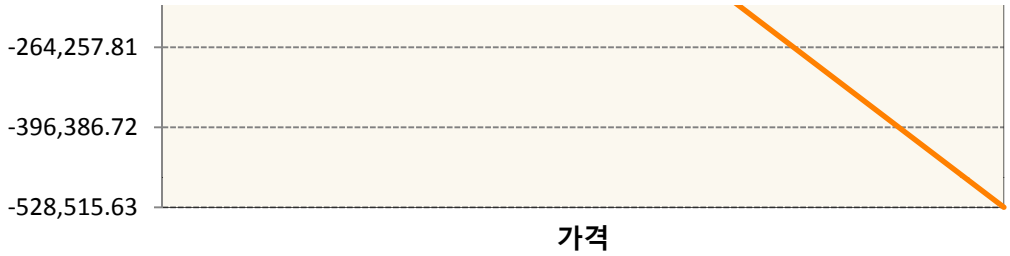
(단위:백만원)

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



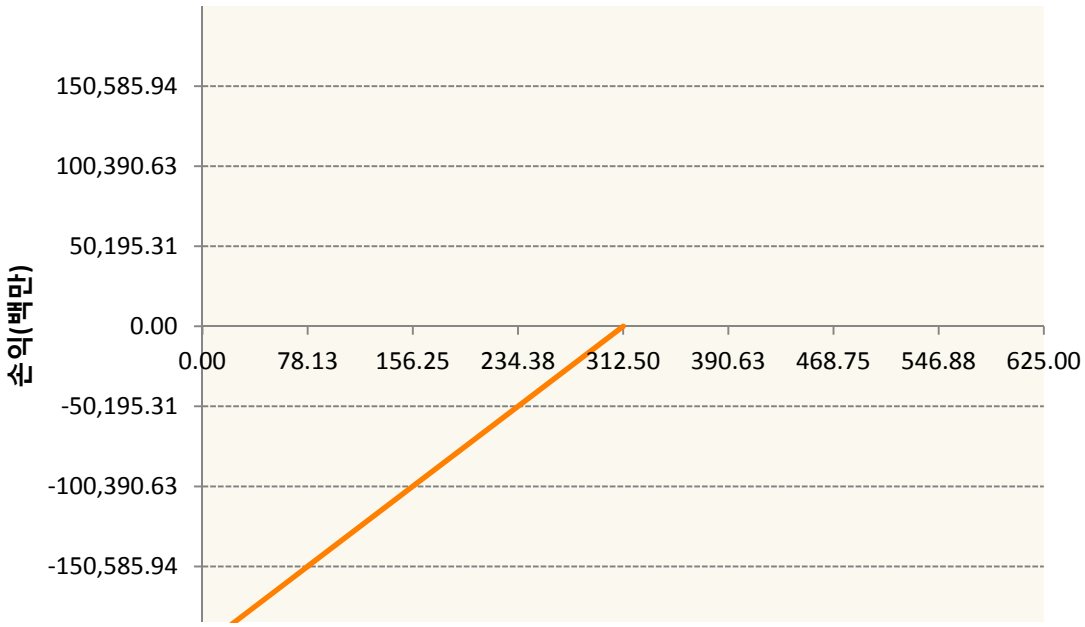




KR4301N33101-2018-03 풋310



KR4301N33127-2018-03 풋312.5





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201N3312018-03 콜310							8,812
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	3,313	3,267	3,206	3,129	3,039	2,935	2,821
-5.33%	3,067	2,943	2,804	2,653	2,491	2,321	2,144
-2.67%	2,310	2,098	1,883	1,664	1,442	1,219	994
0%	710	474	237	0	-237	-475	-713
2.67%	-1,790	-1,968	-2,156	-2,352	-2,555	-2,763	-2,976
5.33%	-4,928	-5,022	-5,133	-5,260	-5,401	-5,553	-5,716
8.00%	-8,378	-8,413	-8,464	-8,529	-8,610	-8,704	-8,812
KR4201N3312018-03 콜312.5							33,016
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	10,923	10,796	10,616	10,380	10,090	9,749	9,361
-5.33%	10,272	9,885	9,432	8,923	8,365	7,767	7,133
-2.67%	8,034	7,286	6,508	5,706	4,886	4,051	3,205
0%	2,826	1,884	942	0	-942	-1,884	-2,826
2.67%	-5,968	-6,767	-7,592	-8,438	-9,299	-10,173	-11,057
5.33%	-17,643	-18,114	-18,650	-19,242	-19,879	-20,556	-21,266
8.00%	-30,899	-31,098	-31,362	-31,691	-32,080	-32,523	-33,016
KR4301N3312018-03 풋310							16,441
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-16,294	-16,299	-16,309	-16,327	-16,354	-16,392	-16,441
-5.33%	-9,440	-9,498	-9,576	-9,672	-9,785	-9,914	-10,057
-2.67%	-3,239	-3,456	-3,685	-3,923	-4,167	-4,418	-4,673
0%	849	567	284	0	-285	-572	-858
2.67%	2,362	2,227	2,070	1,897	1,708	1,508	1,296
5.33%	2,633	2,606	2,565	2,508	2,434	2,345	2,239
8.00%	2,655	2,652	2,647	2,636	2,619	2,592	2,555
KR4301N3312018-03 풋312.5							13,493
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-13,424	-13,425	-13,429	-13,436	-13,449	-13,467	-13,493
-5.33%	-8,102	-8,127	-8,165	-8,215	-8,278	-8,353	-8,439
-2.67%	-3,075	-3,204	-3,347	-3,500	-3,662	-3,832	-4,008
0%	677	451	226	0	-226	-451	-677
2.67%	2,375	2,229	2,070	1,902	1,725	1,542	1,354

5.33%	2,762	2,724	2,672	2,604	2,523	2,429	2,322
8.00%	2,803	2,799	2,790	2,775	2,752	2,720	2,678

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

75,573

공시일	2018-02-23
기준일	2018-02-22

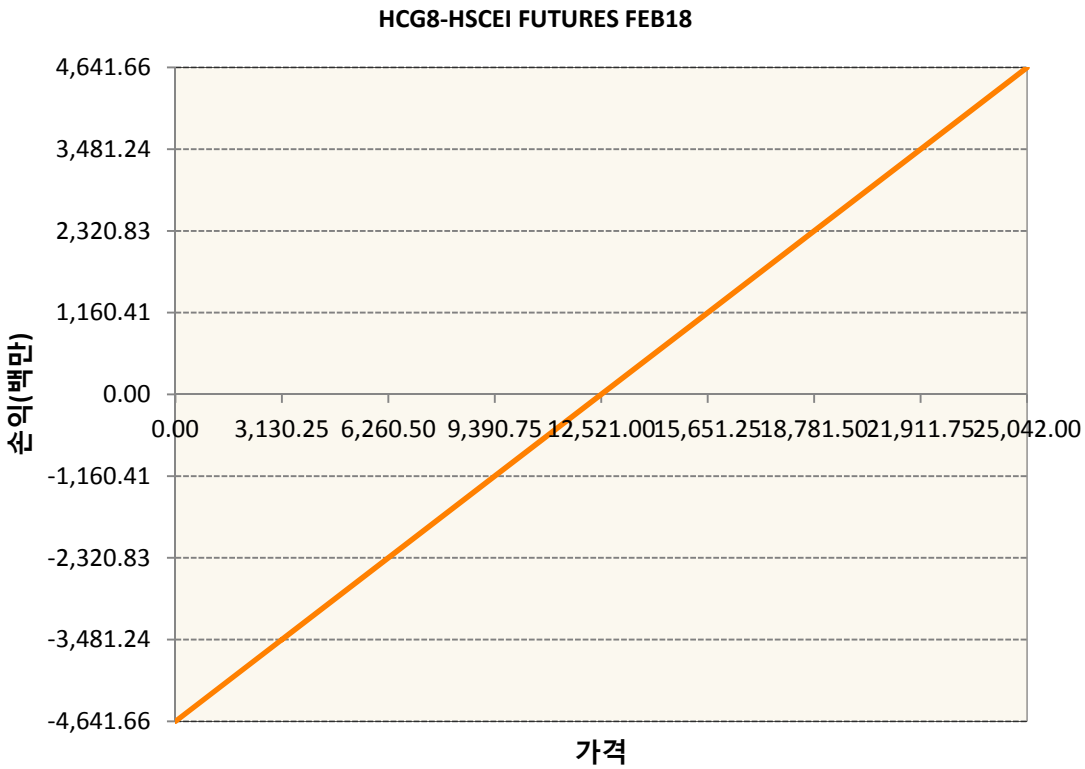
홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생

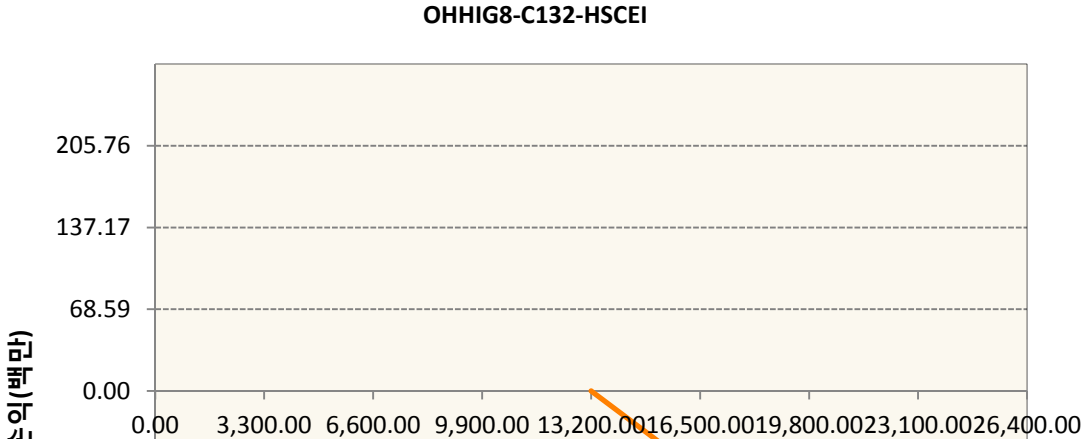
1. 계약금액

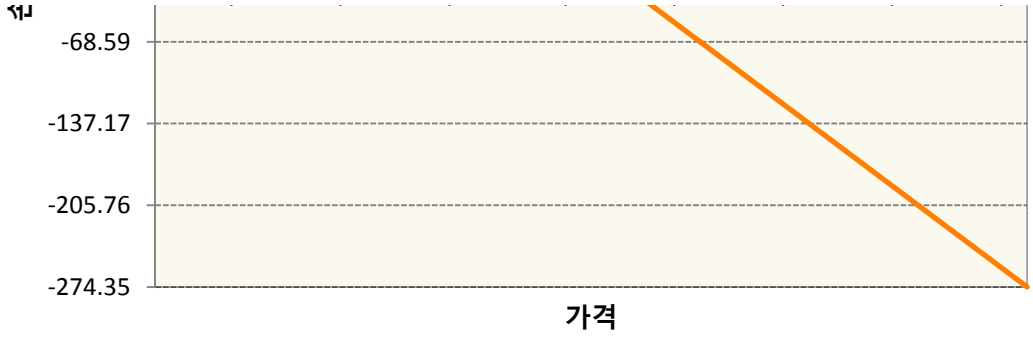
(단위:백만원)

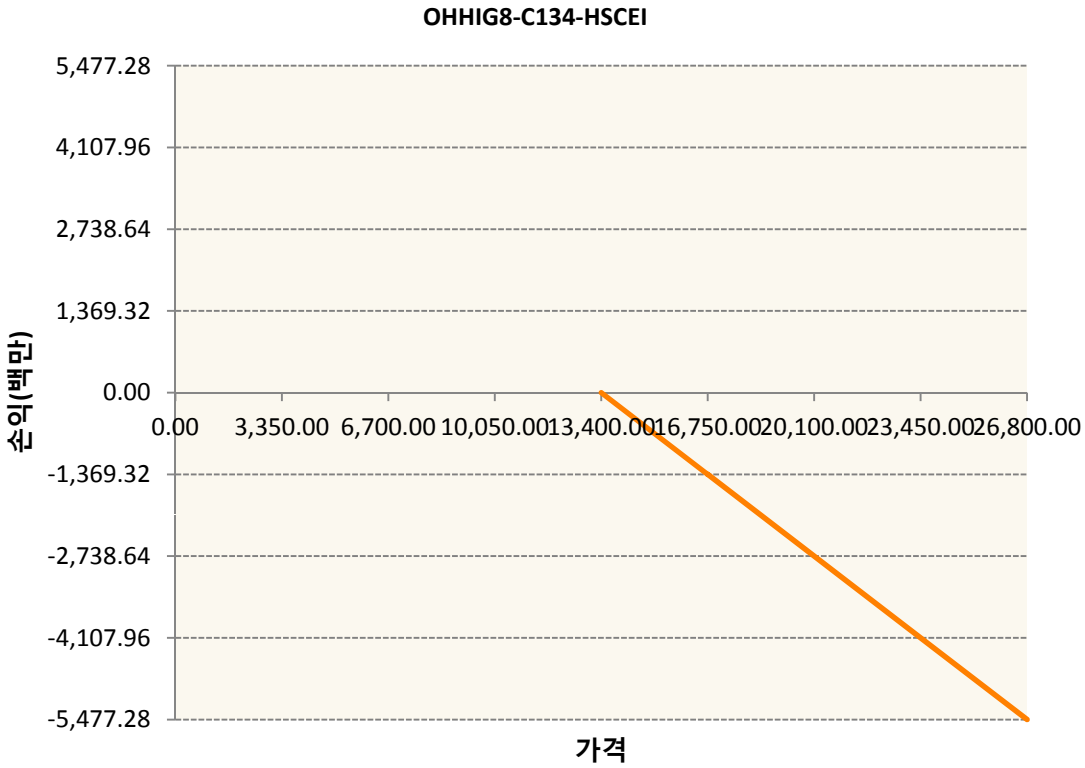
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	4,642	0	4,642	장내
누계	유가증권	옵션	0	11,503	-11,503	장내

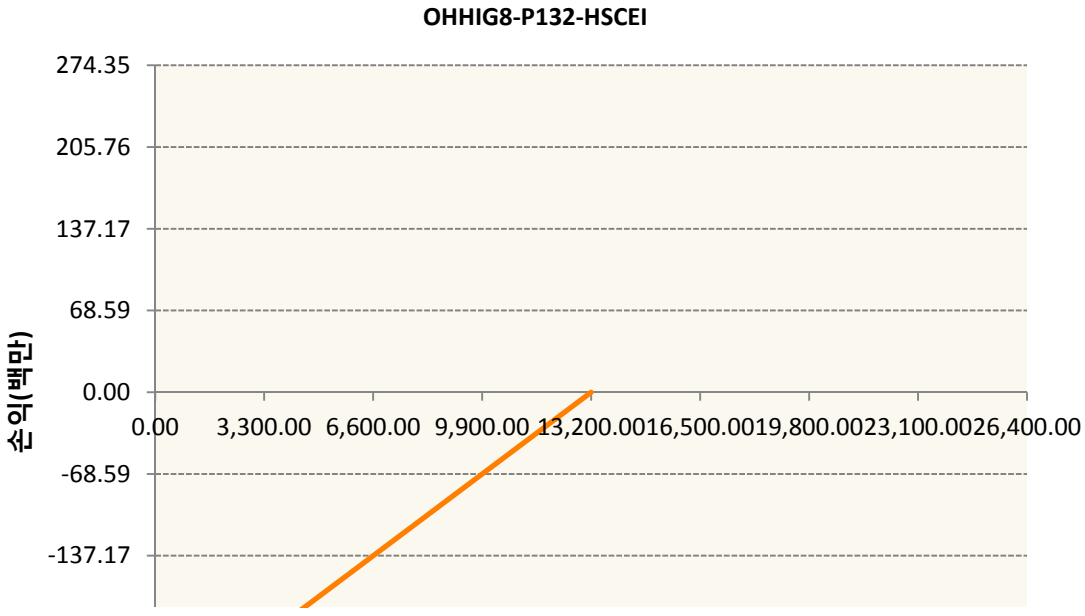
2. 만기시점의 손익구조

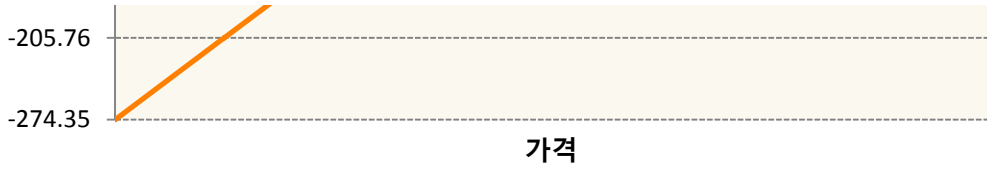


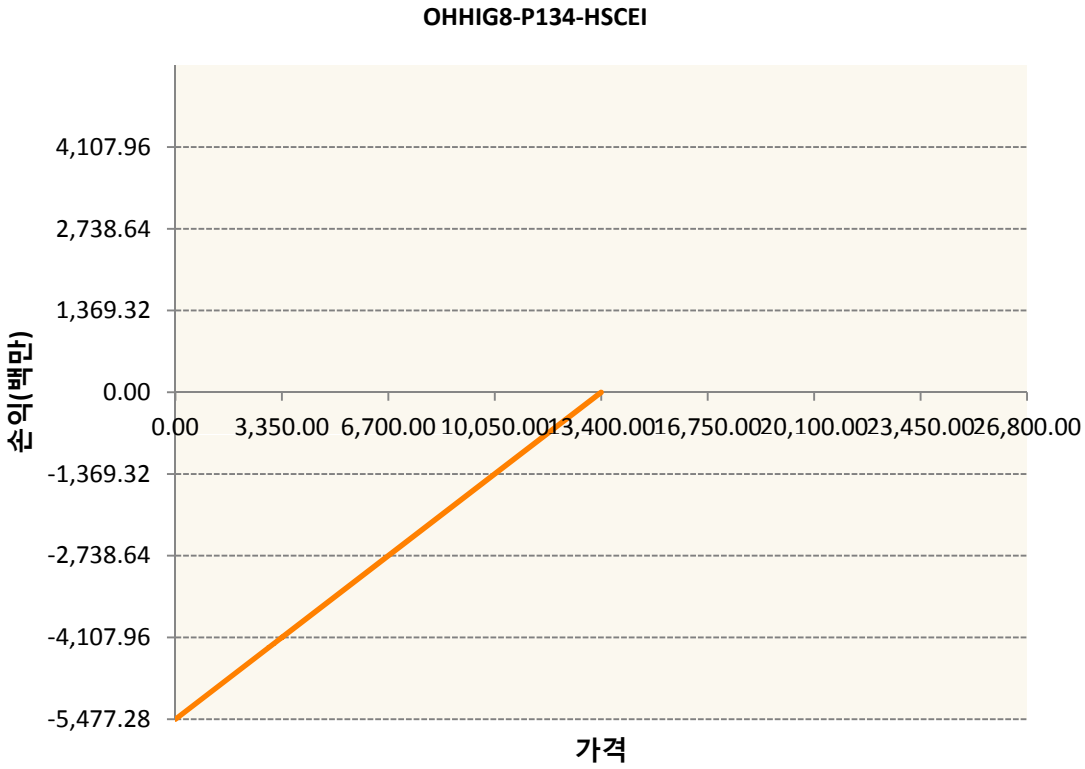



-68.59
-137.17
-205.76
-274.35
가격


OHHIG8-C134-HSCEI
5,477.28
4,107.96
2,738.64
1,369.32
0.00
-1,369.32
-2,738.64
-4,107.96
-5,477.28
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
274.35
205.76
137.17
68.59
0.00
-68.59
-137.17
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	371
OHHIG8-C1	HSCEI	22
OHHIG8-C1	HSCEI	438
OHHIG8-P1	HSCEI	22
OHHIG8-P1	HSCEI	438

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,128

공시일	2018-02-23
기준일	2018-02-22

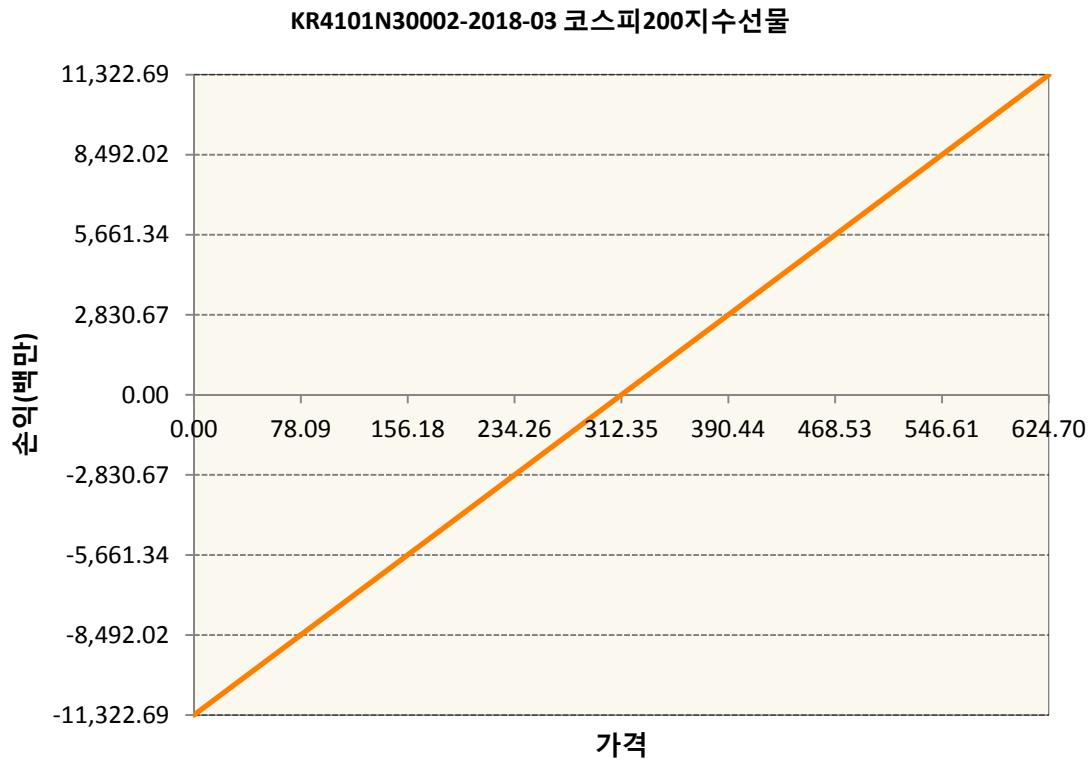
코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼

1. 계약금액

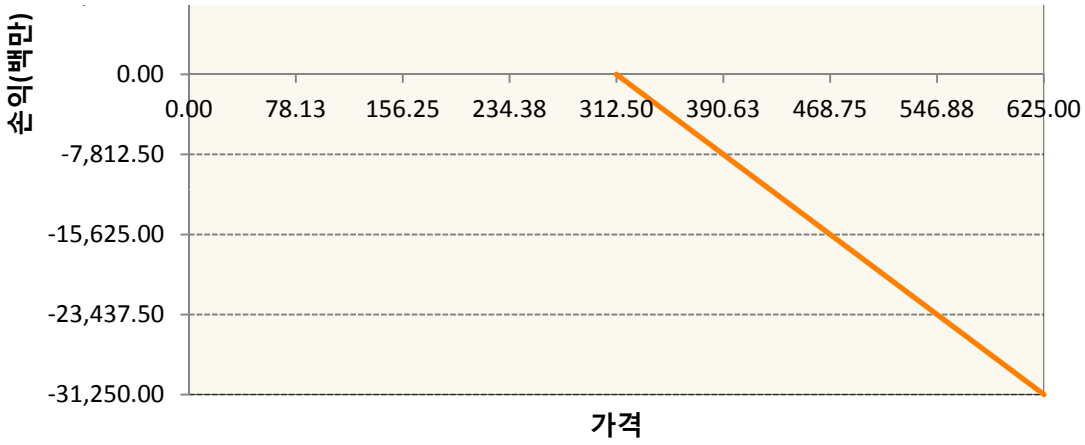
(단위:백만원)

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	11,323	0	11,323	장내
누계	유가증권	스왑	56,200	0	56,200	장외
누계	유가증권	옵션	0	56,094	-56,094	장내

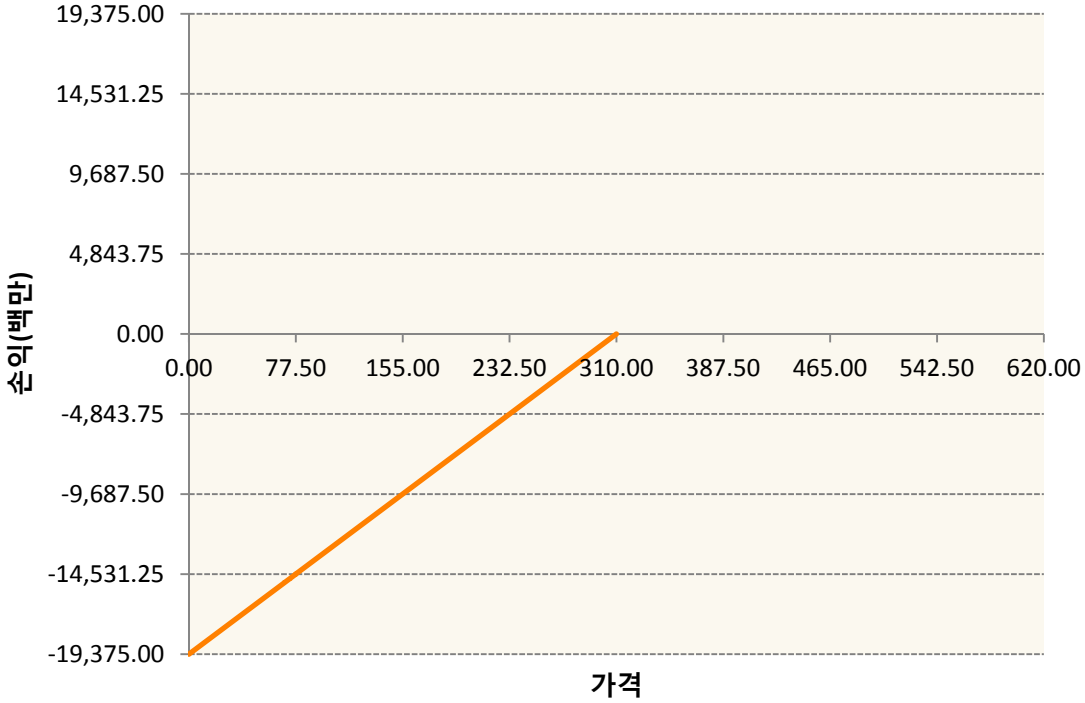
2. 만기시점의 손익구조



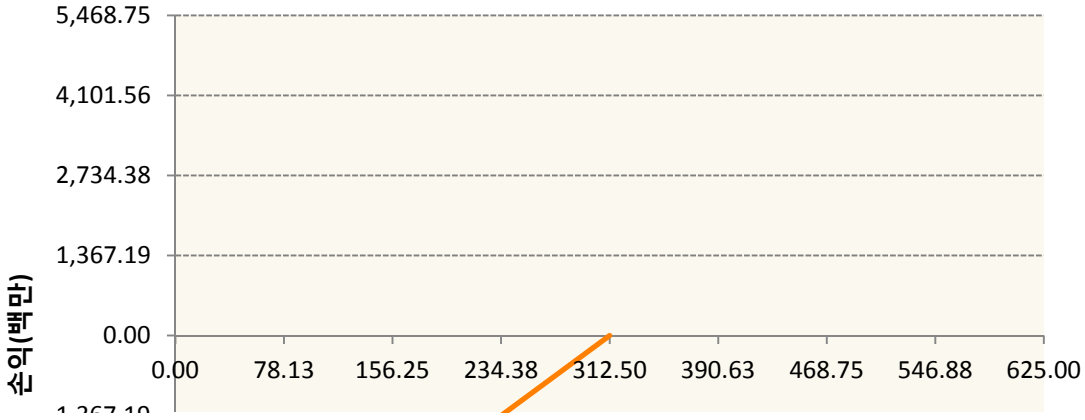




KR4301N33101-2018-03 풋310



KR4301N33127-2018-03 풋312.5





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_2							1,461
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,461	-1,461	-1,461	-1,461	-1,461	-1,461	-1,461
-5.33%	-974	-974	-974	-974	-974	-974	-974
-2.67%	-487	-487	-487	-487	-487	-487	-487
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	487	487	487	487	487	487	487
5.33%	974	974	974	974	974	974	974
8.00%	1,461	1,461	1,461	1,461	1,461	1,461	1,461
2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_3							276
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-276	-276	-276	-276	-276	-276	-276
-5.33%	-184	-184	-184	-184	-184	-184	-184
-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%	184	184	184	184	184	184	184
8.00%	276	276	276	276	276	276	276
2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_4							158
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-158	-158	-158	-158	-158	-158	-158
-5.33%	-105	-105	-105	-105	-105	-105	-105
-2.67%	-53	-53	-53	-53	-53	-53	-53
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	53	53	53	53	53	53	53
5.33%	105	105	105	105	105	105	105
8.00%	158	158	158	158	158	158	158
2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_5							237
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%

-8.00%	-237	-237	-237	-237	-237	-237	-237
-5.33%	-158	-158	-158	-158	-158	-158	-158
-2.67%	-79	-79	-79	-79	-79	-79	-79
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	79	79	79	79	79	79	79
5.33%	158	158	158	158	158	158	158
8.00%	237	237	237	237	237	237	237
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_6						197
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-197	-197	-197	-197	-197	-197	-197
-5.33%	-132	-132	-132	-132	-132	-132	-132
-2.67%	-66	-66	-66	-66	-66	-66	-66
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	66	66	66	66	66	66	66
5.33%	132	132	132	132	132	132	132
8.00%	197	197	197	197	197	197	197
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_7						253
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-253	-253	-253	-253	-253	-253	-253
-5.33%	-168	-168	-168	-168	-168	-168	-168
-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%	168	168	168	168	168	168	168
8.00%	253	253	253	253	253	253	253
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_8						467
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-467	-467	-467	-467	-467	-467	-467
-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%	467	467	467	467	467	467	467
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_10						276
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-276	-276	-276	-276	-276	-276	-276
-5.33%	-184	-184	-184	-184	-184	-184	-184
-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%	184	184	184	184	184	184	184
8.00%	276	276	276	276	276	276	276
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_11						632
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-632	-632	-632	-632	-632	-632	-632
-5.33%	-421	-421	-421	-421	-421	-421	-421
-2.67%	-211	-211	-211	-211	-211	-211	-211
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	211	211	211	211	211	211	211
5.33%	421	421	421	421	421	421	421
8.00%	632	632	632	632	632	632	632
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_12						474
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-474	-474	-474	-474	-474	-474	-474
-5.33%	-316	-316	-316	-316	-316	-316	-316
-2.67%	-158	-158	-158	-158	-158	-158	-158
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	158	158	158	158	158	158	158
5.33%	316	316	316	316	316	316	316
8.00%	474	474	474	474	474	474	474
	KR4101N30(	2018-03 코스피200지수선물					905
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-905	-905	-905	-905	-905	-905	-905
-5.33%	-604	-604	-604	-604	-604	-604	-604
-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%	604	604	604	604	604	604	604
8.00%	905	905	905	905	905	905	905
	KR4201N331	2018-03 콜312.5					1,952
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	646	638	628	614	597	576	553
-5.33%	607	584	558	528	495	459	422
-2.67%	475	431	385	337	289	240	189
0%	167	111	56	0	-56	-111	-167
2.67%	-353	-400	-449	-499	-550	-602	-654
5.33%	-1,043	-1,071	-1,103	-1,138	-1,175	-1,215	-1,257
8.00%	-1,827	-1,839	-1,854	-1,874	-1,897	-1,923	-1,952
	KR4301N331	2018-03 풋310					1,234

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,223	-1,224	-1,224	-1,226	-1,228	-1,231	-1,234
-5.33%	-709	-713	-719	-726	-735	-744	-755
-2.67%	-243	-259	-277	-294	-313	-332	-351
0%	64	43	21	0	-21	-43	-64
2.67%	177	167	155	142	128	113	97
5.33%	198	196	193	188	183	176	168
8.00%	199	199	199	198	197	195	192
	KR4301N3312018-03 풋312.5						368

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-366	-366	-366	-366	-366	-367	-368
-5.33%	-221	-221	-222	-224	-225	-228	-230
-2.67%	-84	-87	-91	-95	-100	-104	-109
0%	18	12	6	0	-6	-12	-18
2.67%	65	61	56	52	47	42	37
5.33%	75	74	73	71	69	66	63
8.00%	76	76	76	76	75	74	73

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

8,765

공시일	2018-02-23
기준일	2018-02-22

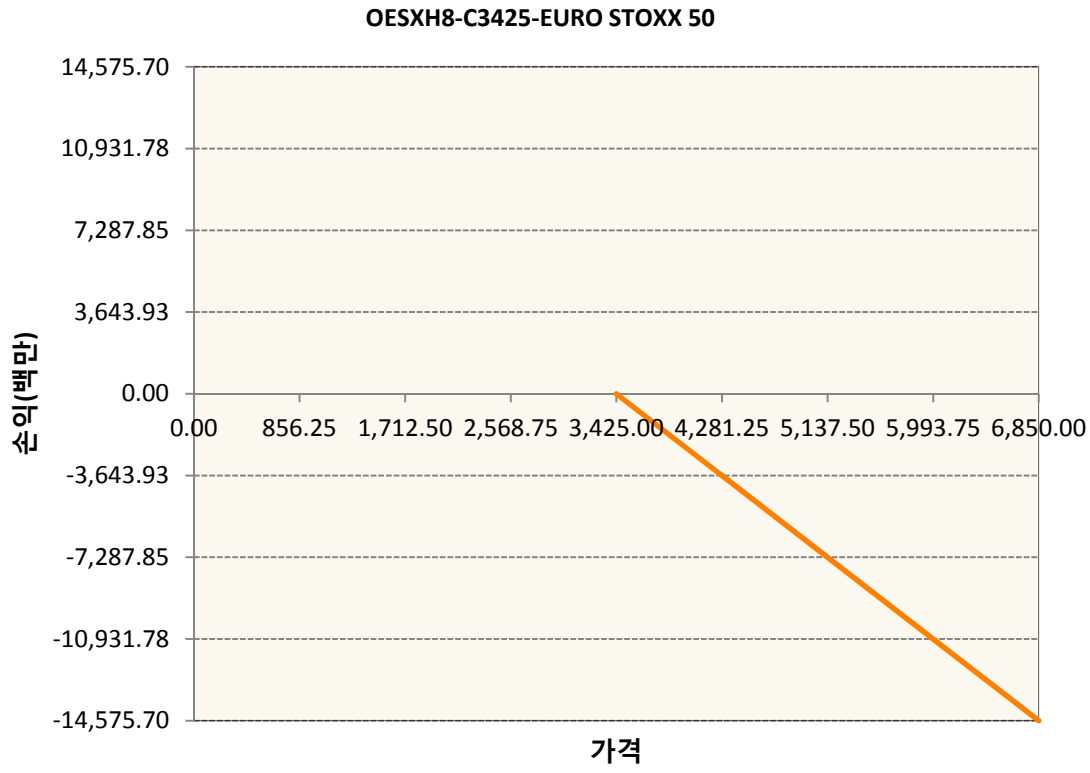
유로커버드콜모(주식혼합-파생형

1. 계약금액

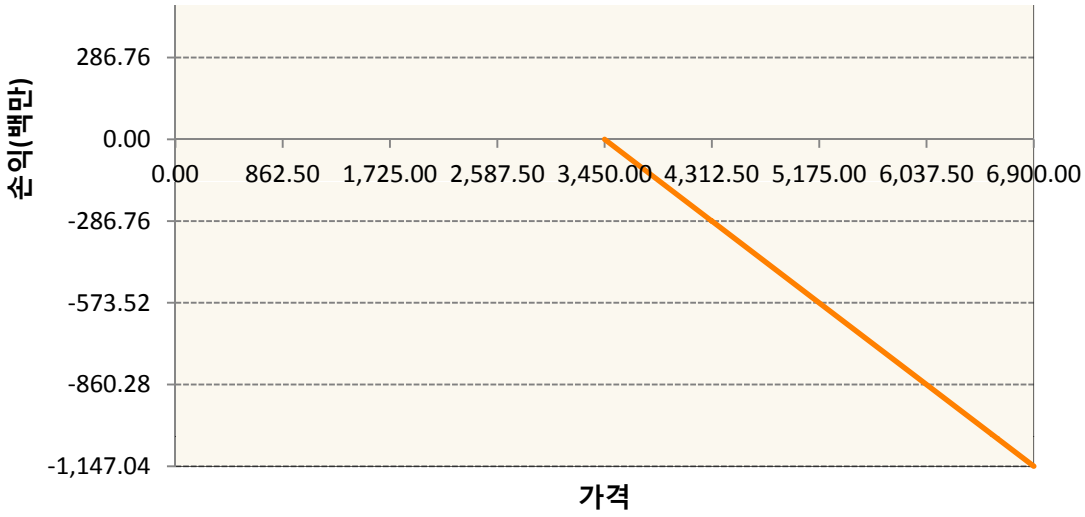
(단위:백만원)

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	7,495	0	7,495	
누계	유가증권	스왑	99,746	0	99,746	장외
누계	유가증권	옵션	0	31,445	-31,445	장내
누계	지수	스왑	53,199	0	53,199	장외

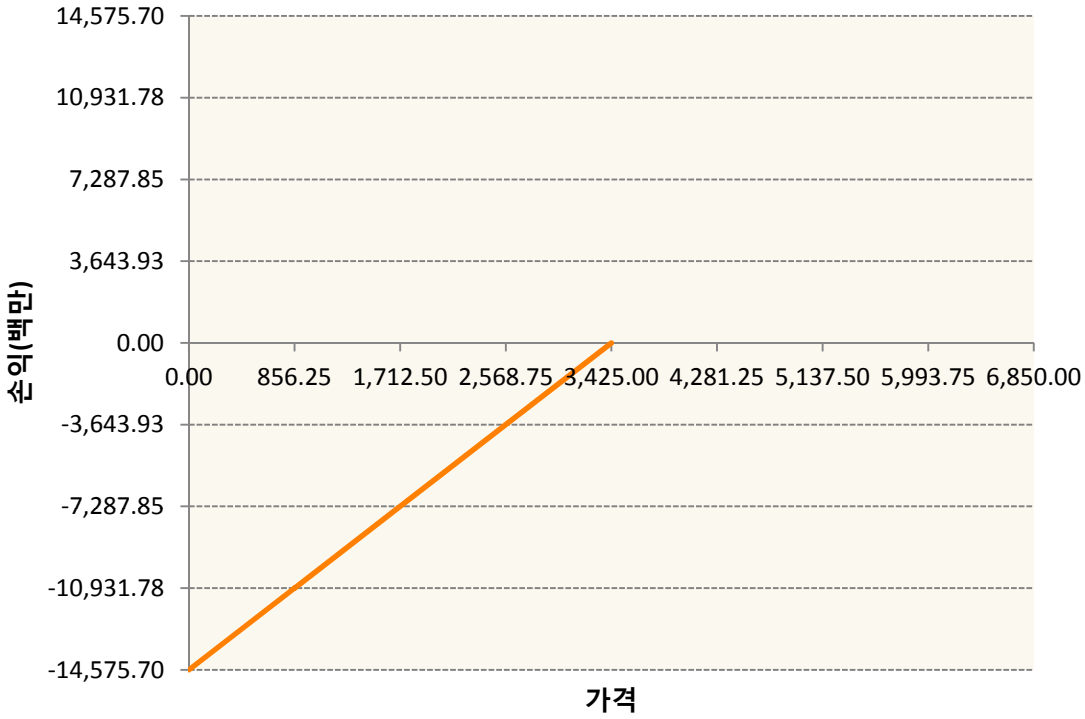
2. 만기시점의 손익구조



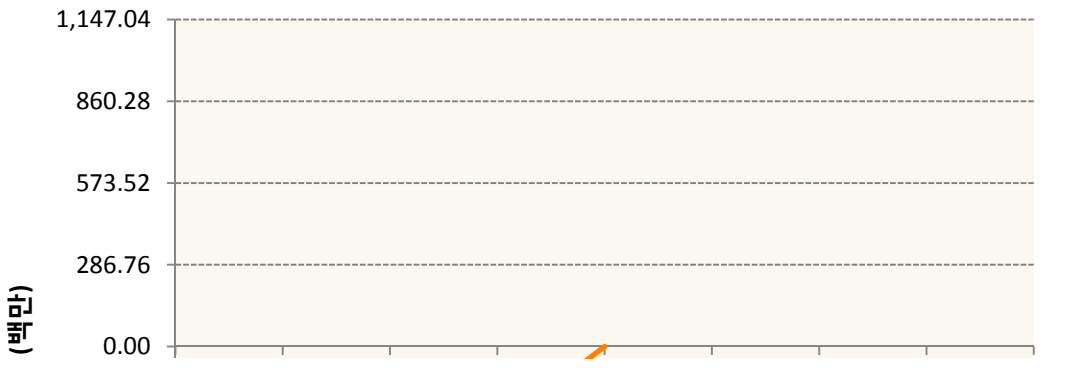


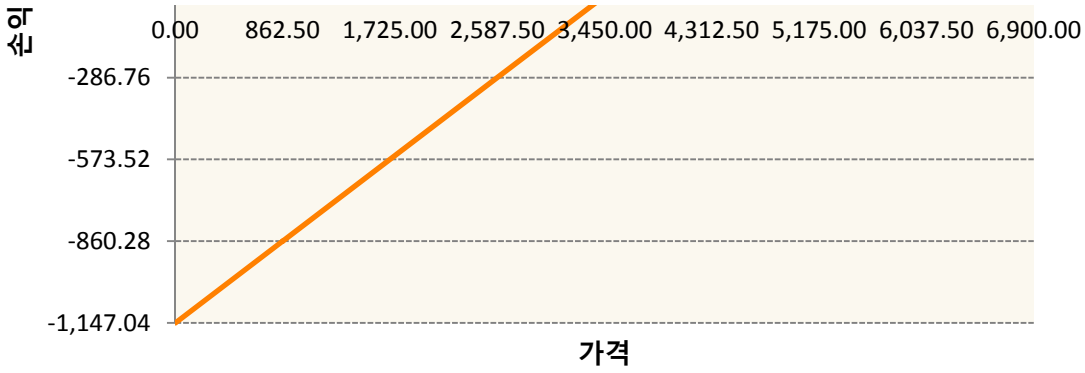


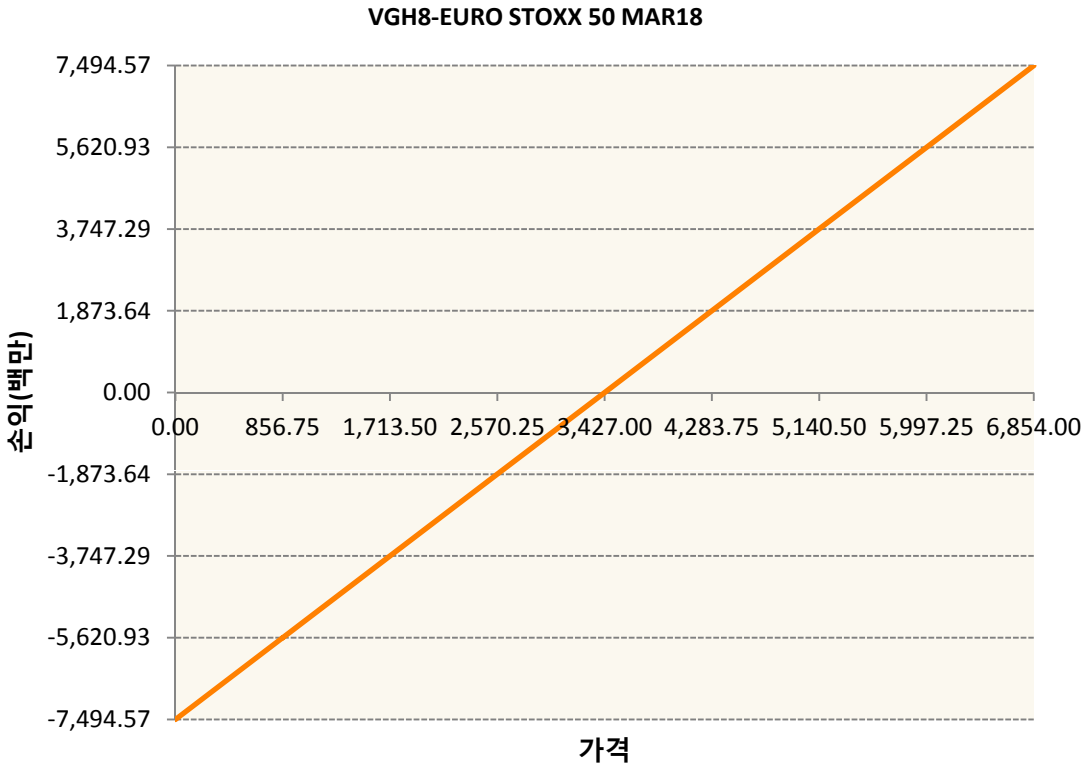
OESXH8-P3425-EURO STOXX 50



OESXH8-P3450-EURO STOXX 50







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
260105SGPX	SG EURO Covered CALL STRATEGY - 994.569	215
260105SQPX	SG EURO Covered CALL STRATEGY	402
OESXH8-C34	EURO STOXX 50	1,166
OESXH8-C34	EURO STOXX 50	92
OESXH8-P34	EURO STOXX 50	1,166
OESXH8-P34	EURO STOXX 50	92
VGH8	EURO STOXX 50 MAR18	600

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

2,210

공시일	2018-02-23
기준일	2018-02-22

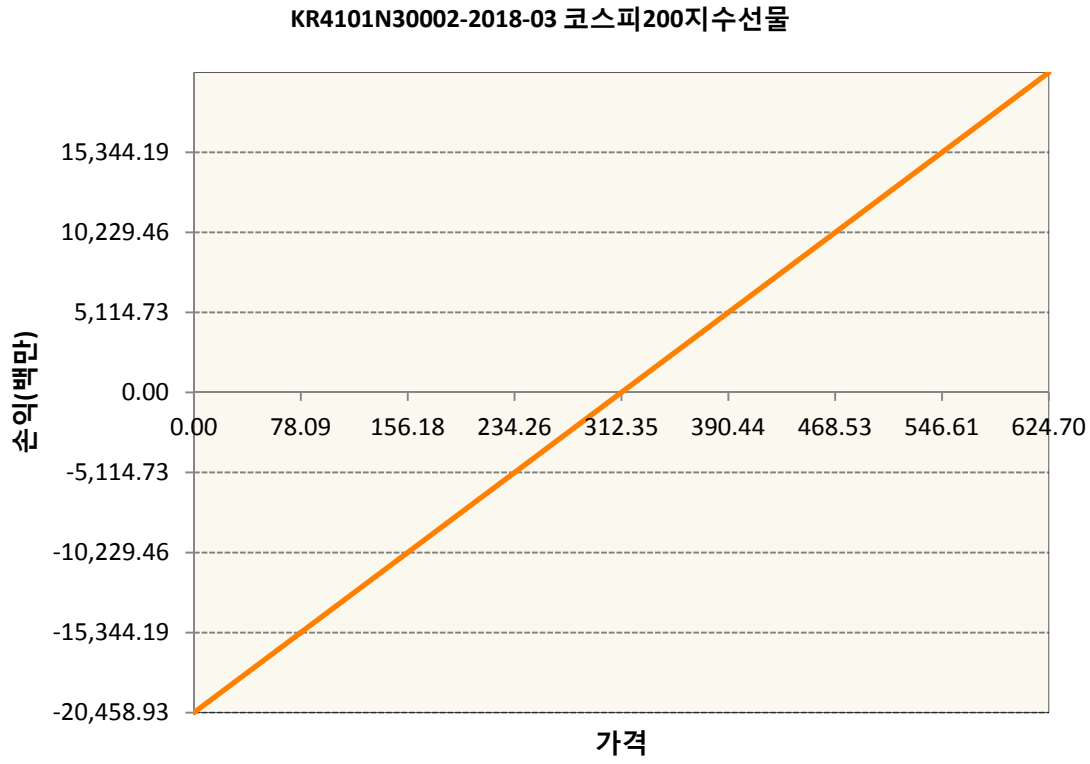
ETF스마트레버리지목표전환형8호

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	20,459	0	20,459	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101N30(2018-03 코스피200지수선물							1,636
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,636	-1,636	-1,636	-1,636	-1,636	-1,636	-1,636
-5.33%	-1,091	-1,091	-1,091	-1,091	-1,091	-1,091	-1,091
-2.67%	-545	-545	-545	-545	-545	-545	-545
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	545	545	545	545	545	545	545
5.33%	1,091	1,091	1,091	1,091	1,091	1,091	1,091
8.00%	1,636	1,636	1,636	1,636	1,636	1,636	1,636

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

1,090

공시일	2018-02-23
기준일	2018-02-22

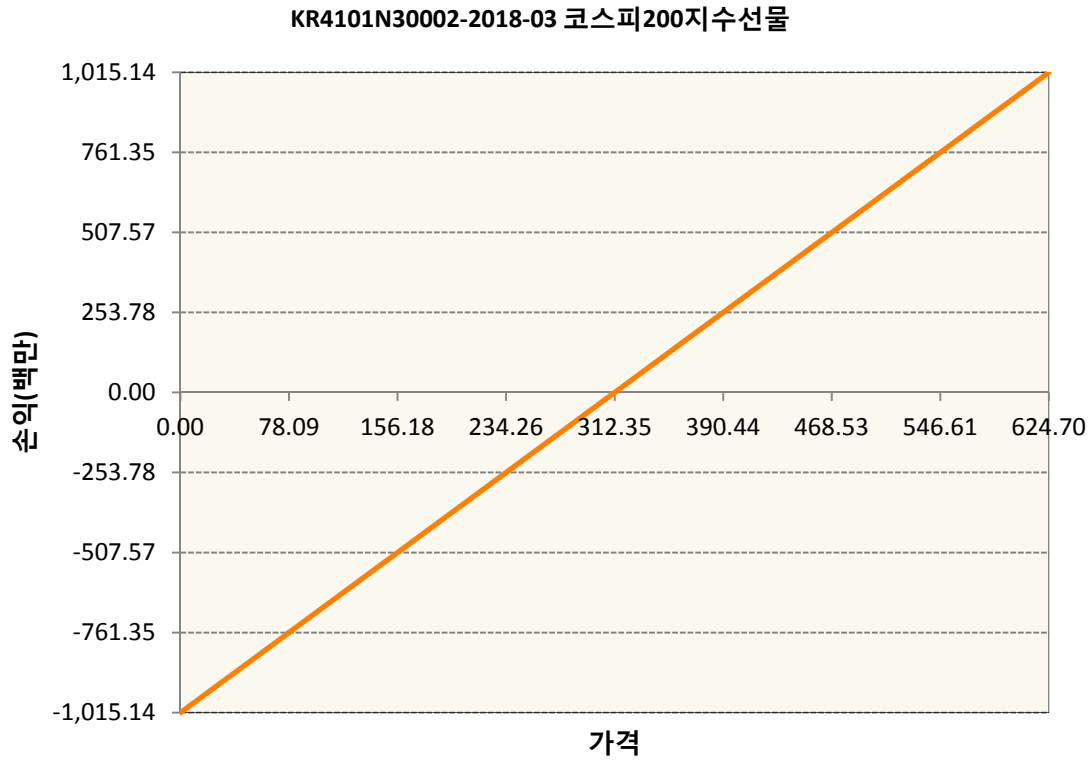
ETF스마트레버리지목표전환형9호

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	1,015	0	1,015	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	2018-02-23
기준일	2018-02-22

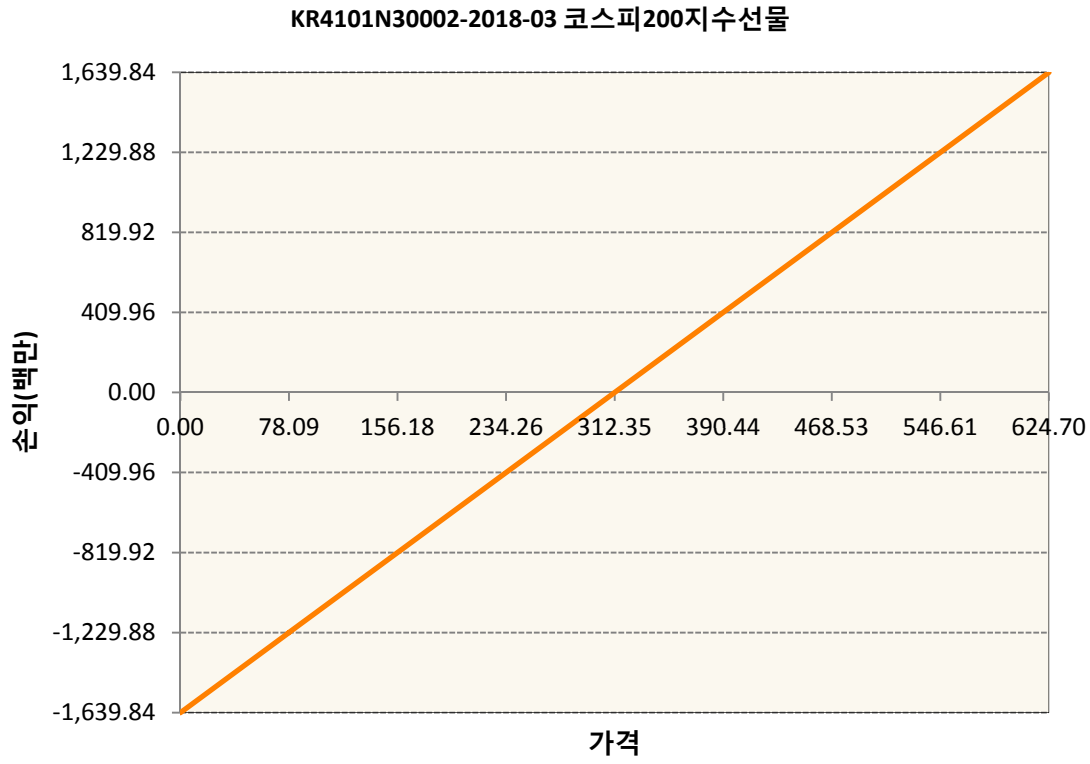
ETF스마트레버리지목표전환형10

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	1,640	0	1,640	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%	-87	-87	-87	-87	-87	-87	-87
-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%	87	87	87	87	87	87	87
8.00%	131	131	131	131	131	131	131

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

87

공시일	2018-02-23
기준일	2018-02-22

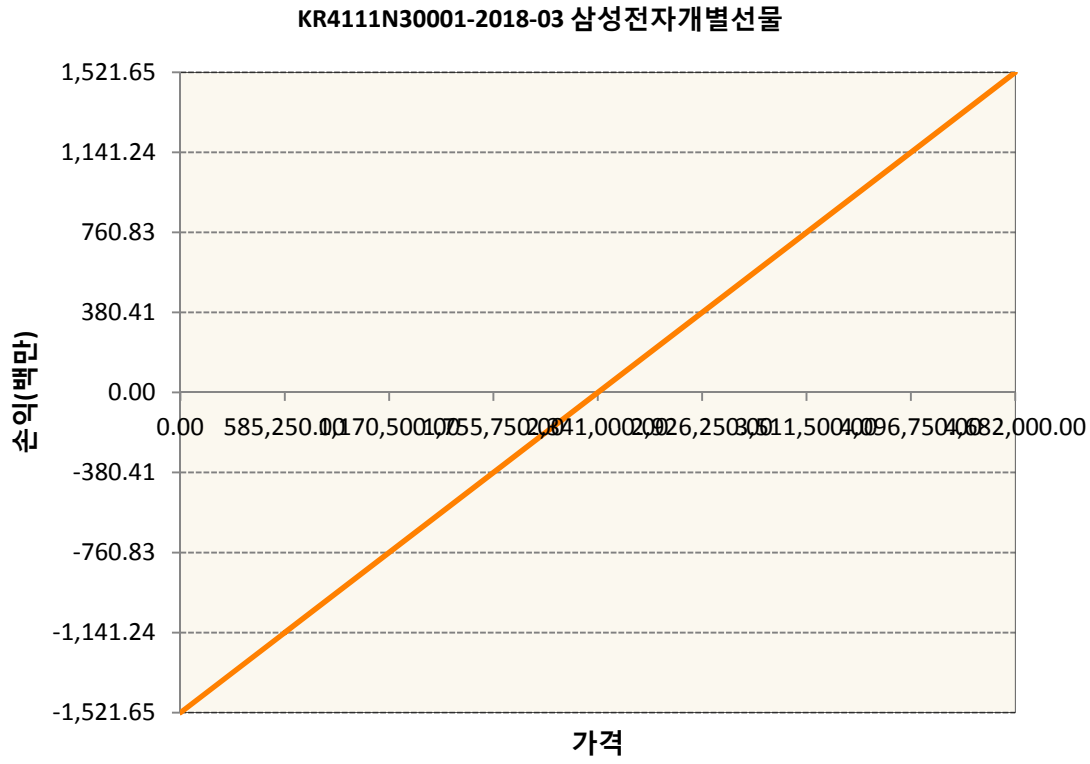
스마트KRX300인덱스1호(주식-파

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	423	0	423	장내
누계	유가증권	선물	1,522	0	1,522	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4111N30(2018-03 삼성전자개별선물							122
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-122	-122	-122	-122	-122	-122	-122
-5.33%	-81	-81	-81	-81	-81	-81	-81
-2.67%	-41	-41	-41	-41	-41	-41	-41
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	41	41	41	41	41	41	41
5.33%	81	81	81	81	81	81	81
8.00%	122	122	122	122	122	122	122

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

145

공시일	2018-02-23
기준일	2018-02-22

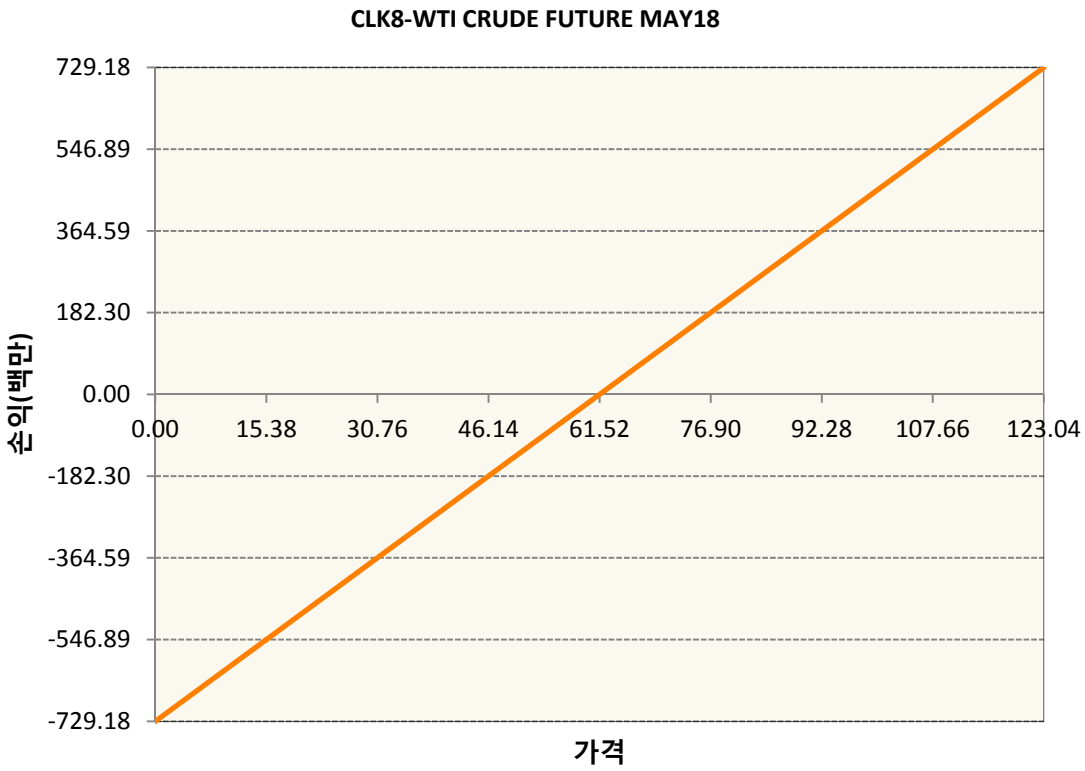
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

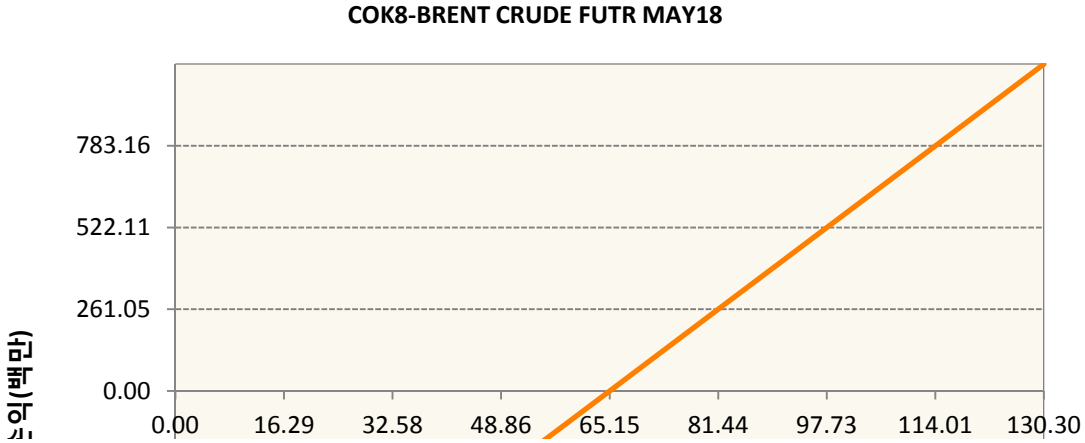
1. 계약금액

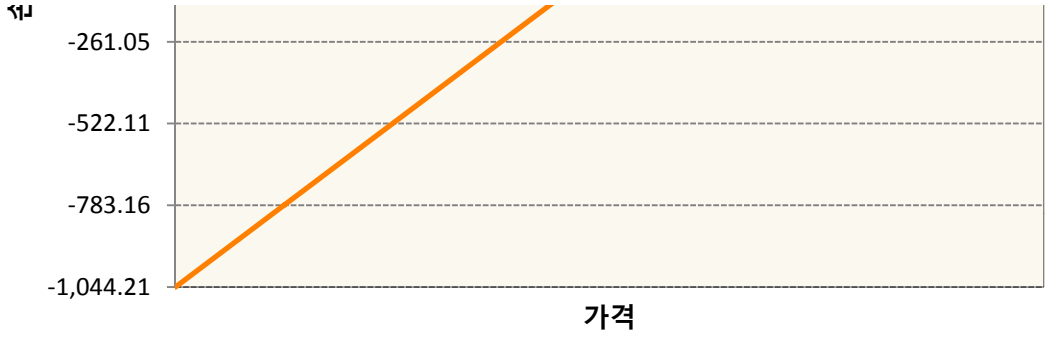
(단위:백만원)

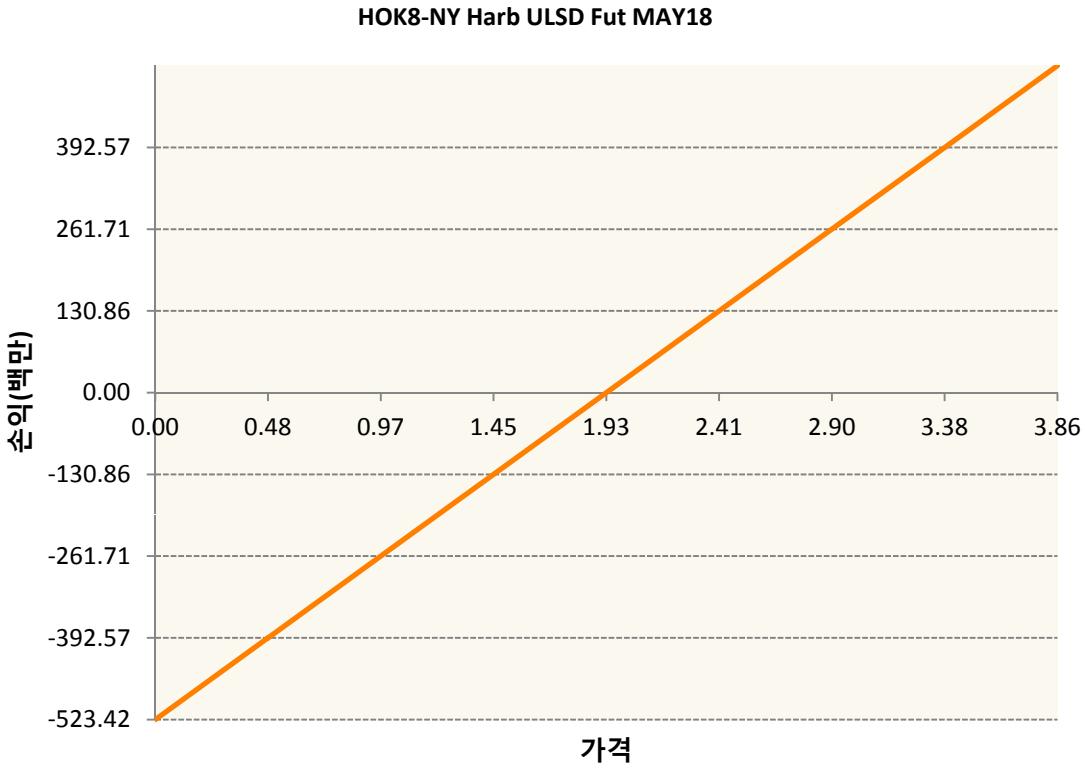
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	선물	유가증권	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	선물	유가증권	729	0	729	
누계	유가증권	선물	3,237	596	2,641	

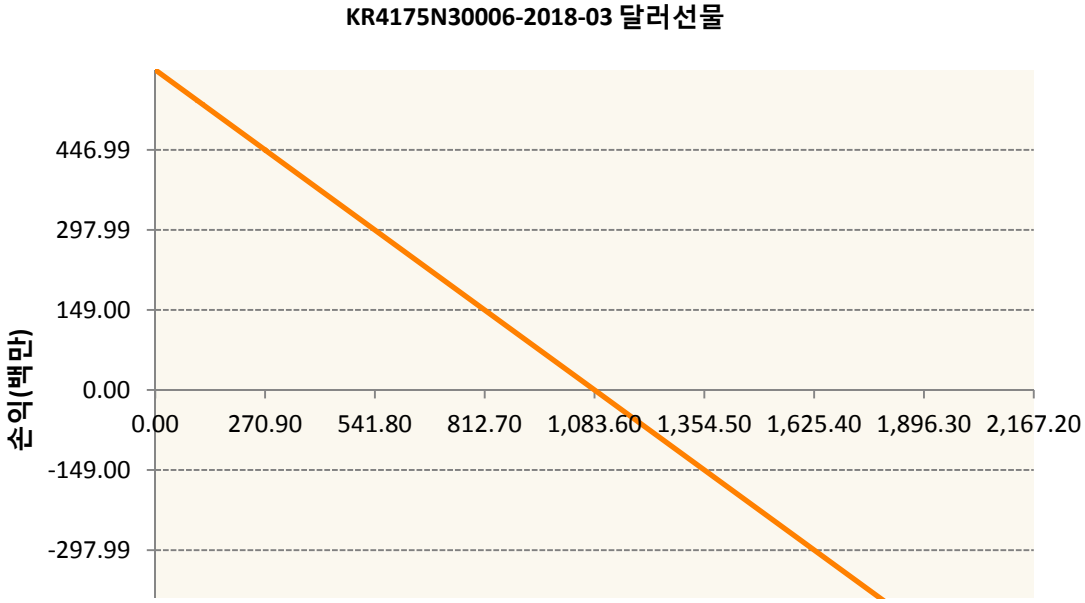
2. 만기시점의 손익구조

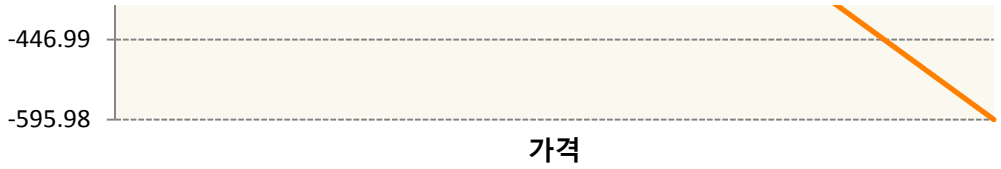


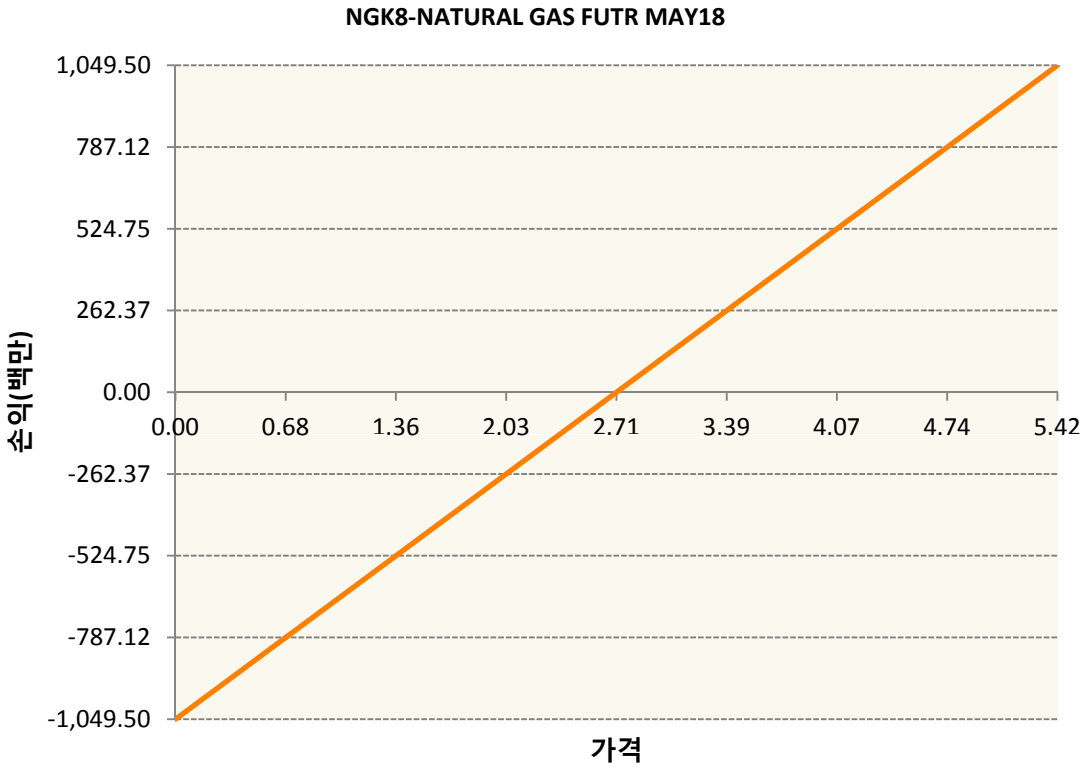


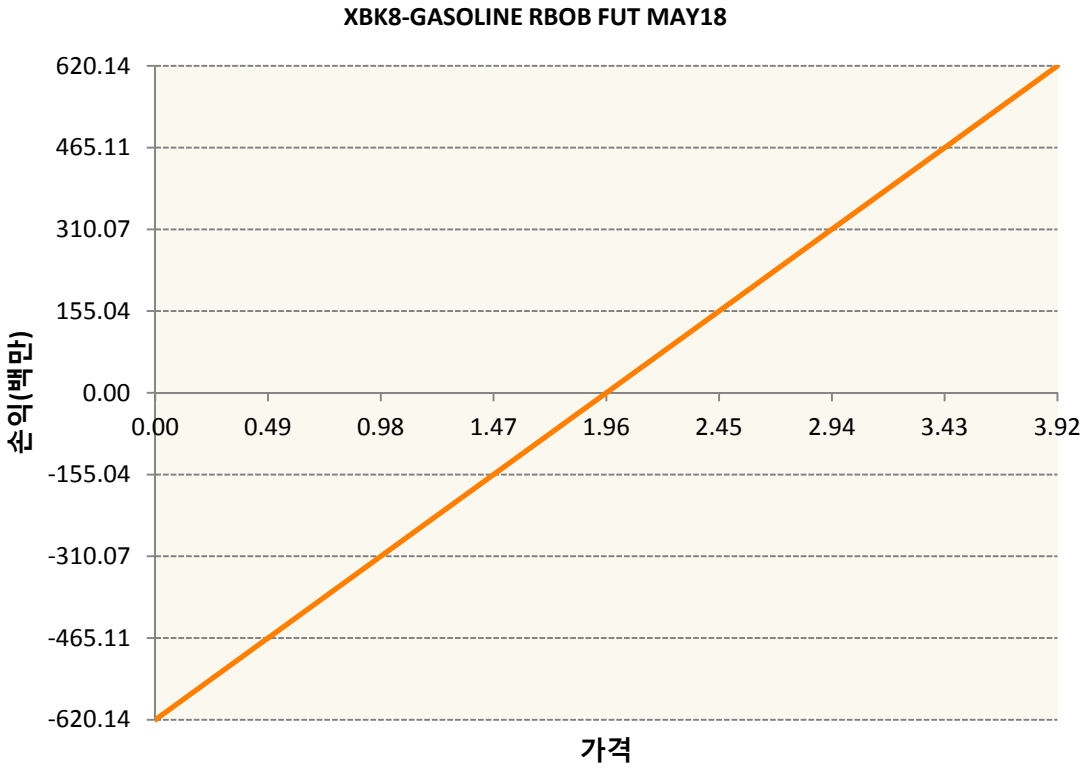

-261.05
-522.11
-783.16
-1,044.21
가격


HOK8-NY Harb ULSD Fut MAY18
392.57
261.71
130.86
0.00
-130.86
-261.71
-392.57
-523.42
0.00
0.48
0.97
1.45
1.93
2.41
2.90
3.38
3.86
손익(백만)
가격


KR4175N30006-2018-03 달러선물
446.99
297.99
149.00
0.00
-149.00
-297.99
0.00
270.90
541.80
812.70
1,083.60
1,354.50
1,625.40
1,896.30
2,167.20
손익(백만)


-446.99
-595.98
가격


NGK8-NATURAL GAS FUTR MAY18
1,049.50
787.12
524.75
262.37
0.00
-262.37
-524.75
-787.12
-1,049.50
0.00
0.68
1.36
2.03
2.71
3.39
4.07
4.74
5.42
손익(백만)
가격


XBK8-GASOLINE RBOB FUT MAY18
620.14
465.11
310.07
155.04
0.00
-155.04
-310.07
-465.11
-620.14
0.00
0.49
0.98
1.47
1.96
2.45
2.94
3.43
3.92
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	42
KR4175N30(	2018-03 달러선물	48
NGK8	NATURAL GAS FUTR MAY18	84
XBK8	GASOLINE RBOB FUT MAY18	50

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

525

공시일	2018-02-23
기준일	2018-02-22

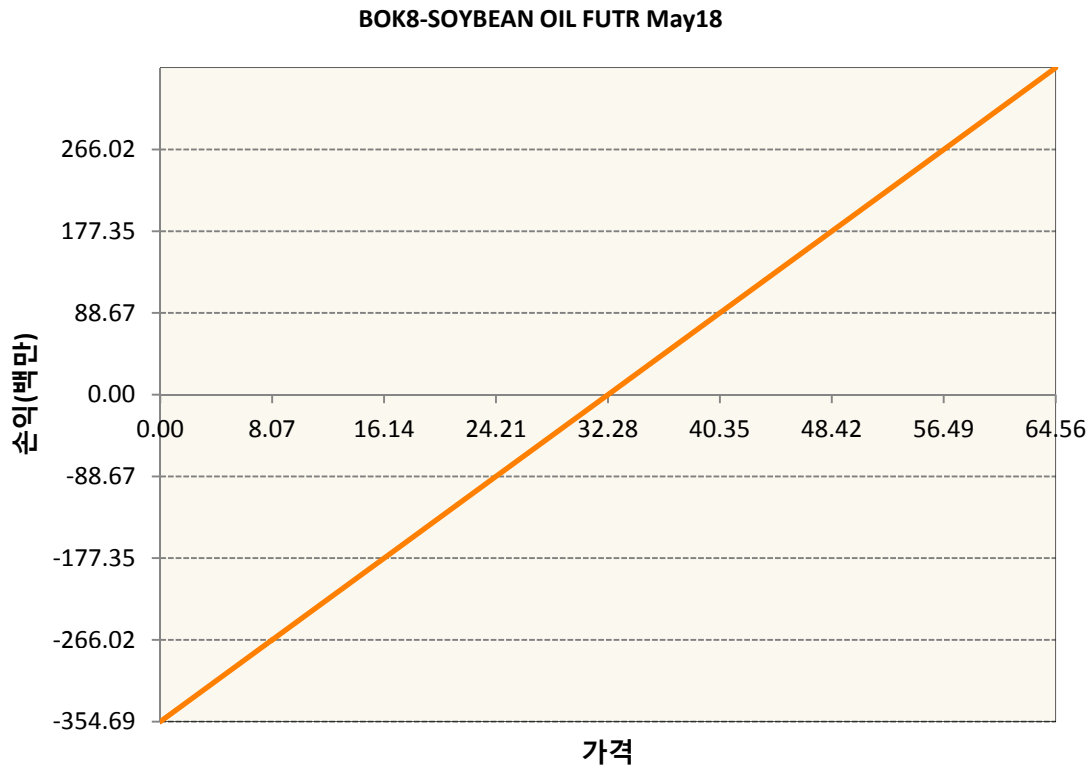
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

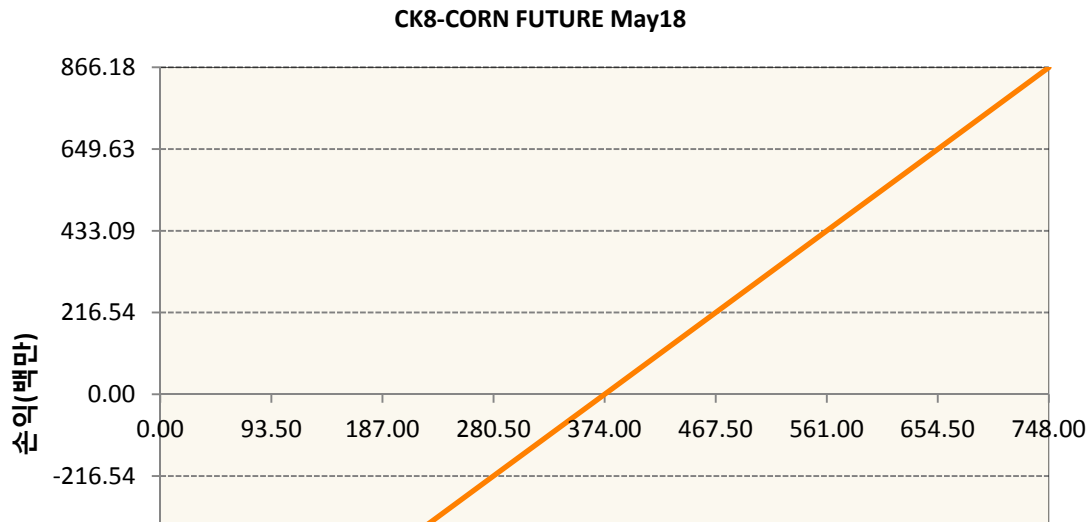
1. 계약금액

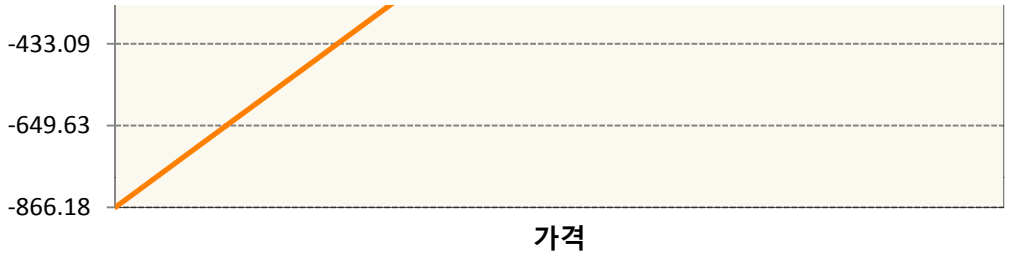
(단위:백만원)

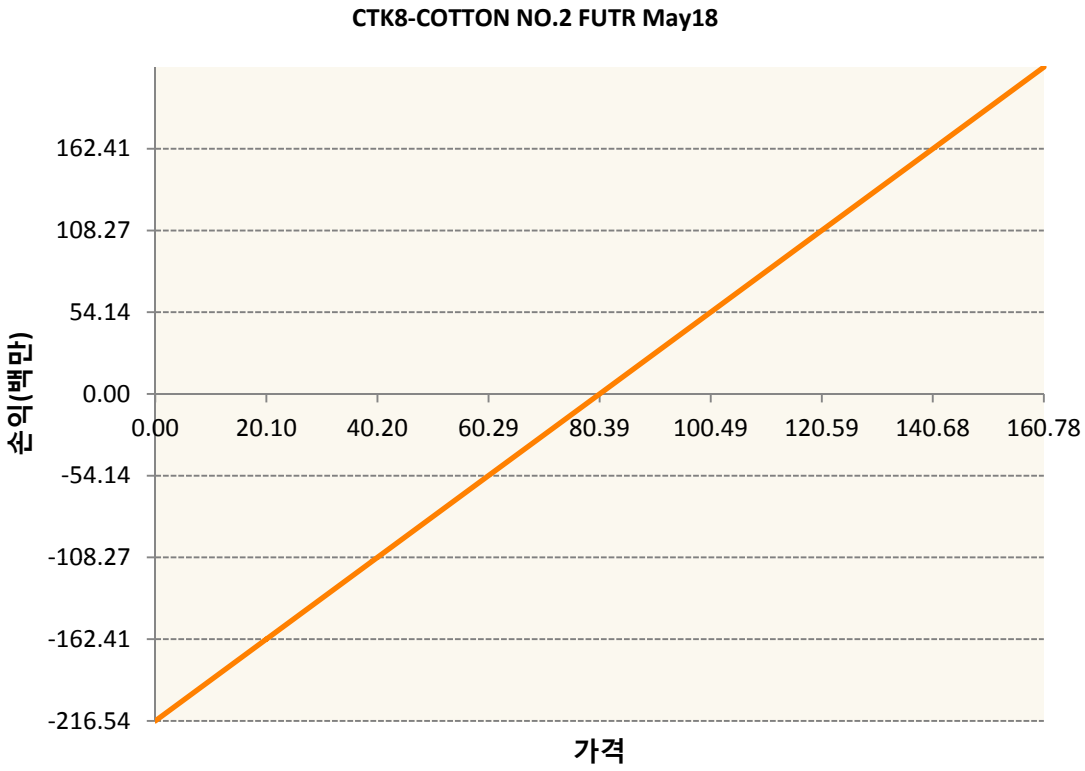
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	4,122	325	3,797	

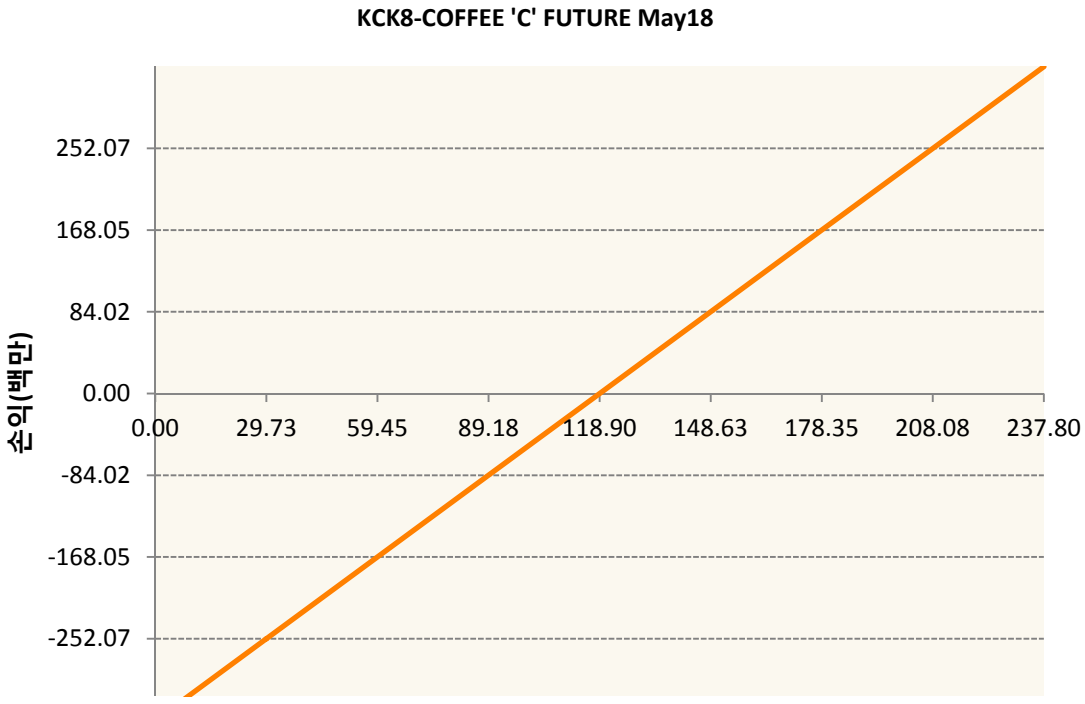
2. 만기시점의 손익구조

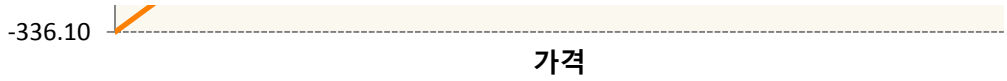


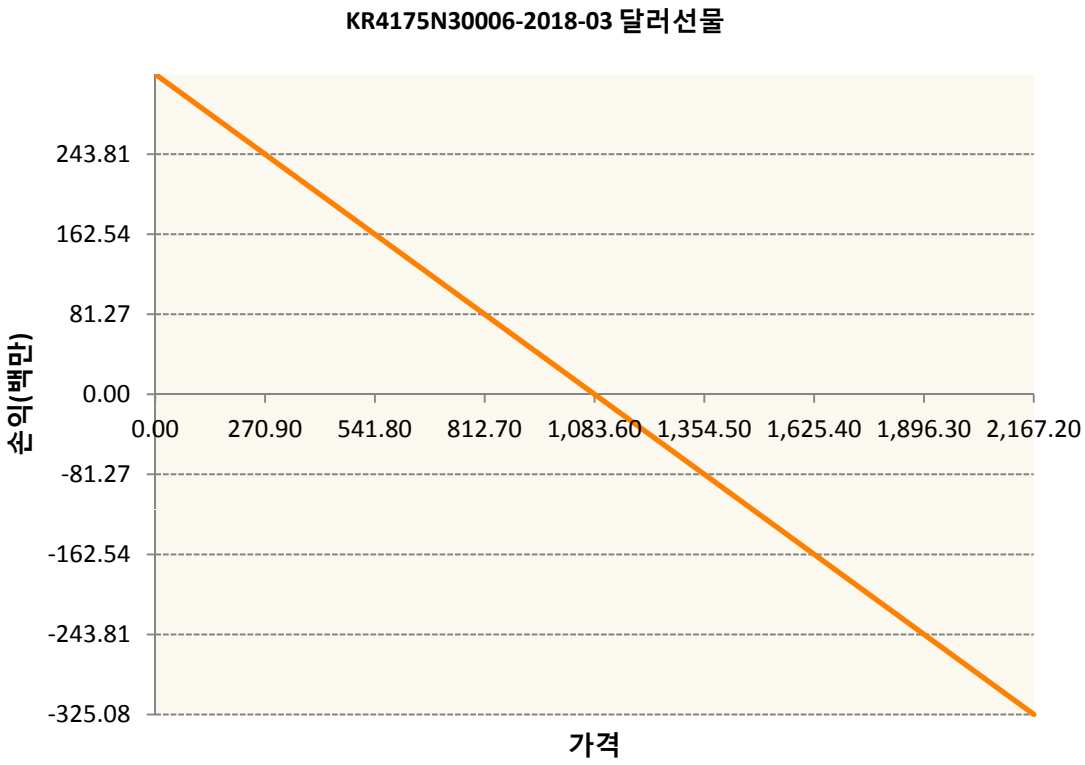


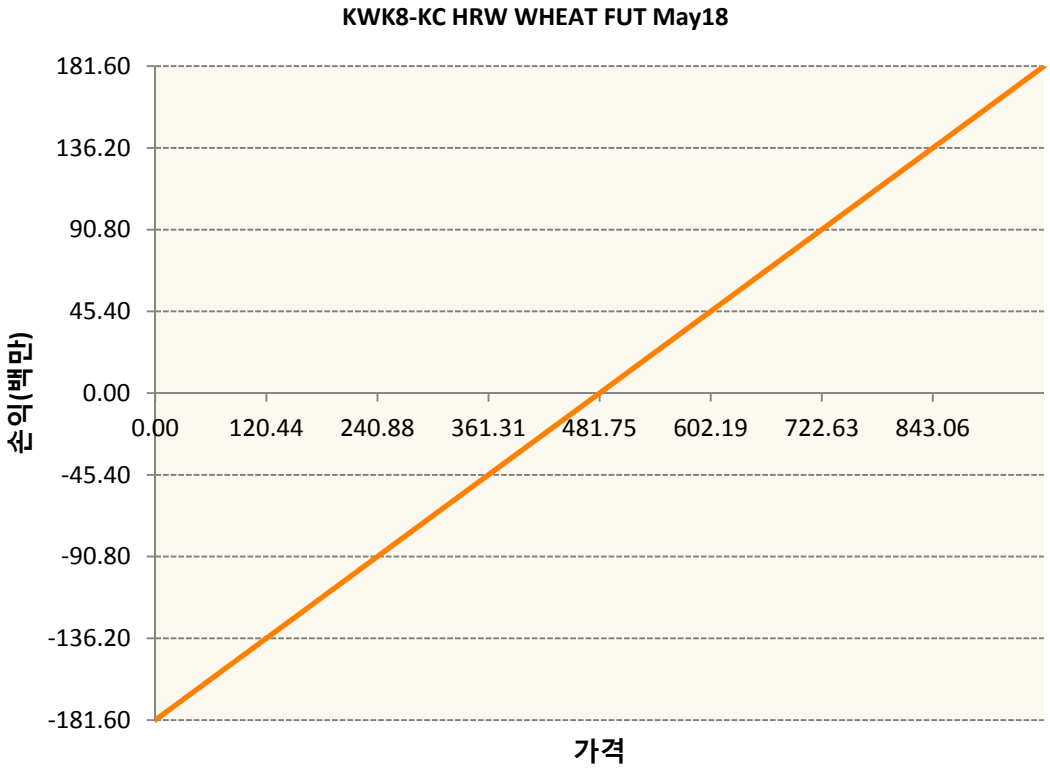

-433.09
-649.63
-866.18
가격

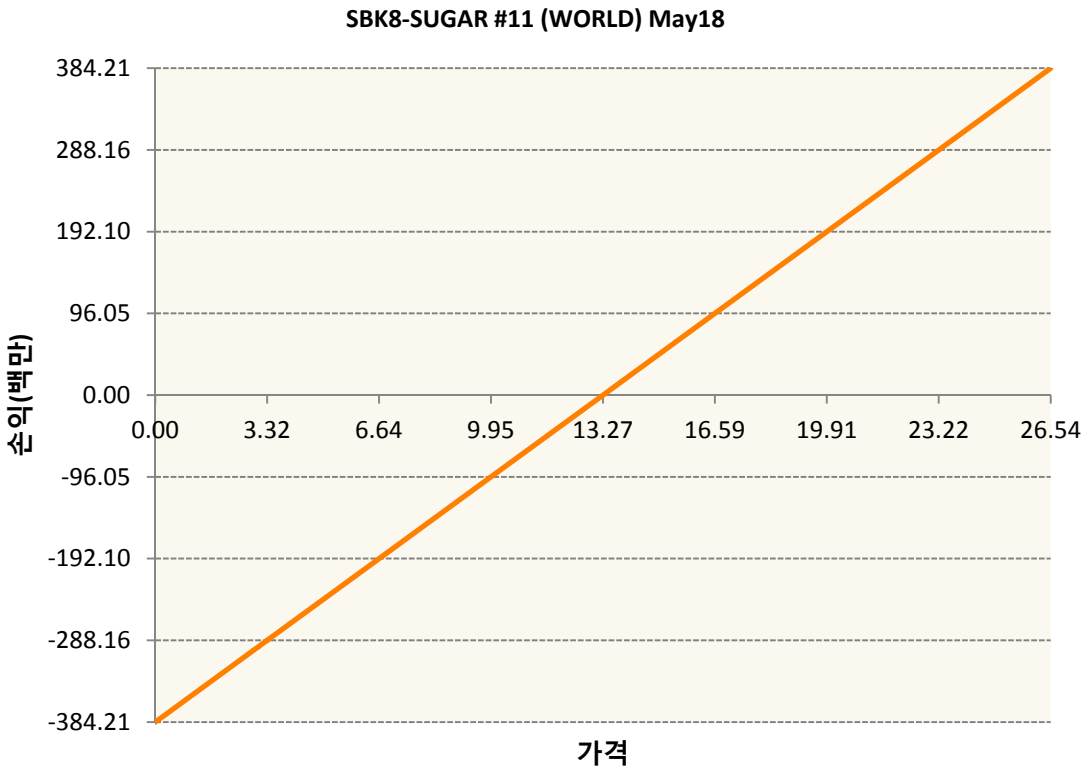

CTK8-COTTON NO.2 FUTR May18
162.41
108.27
54.14
0.00
-54.14
-108.27
-162.41
-216.54
0.00
20.10
40.20
60.29
80.39
100.49
120.59
140.68
160.78
손익(백만)
가격

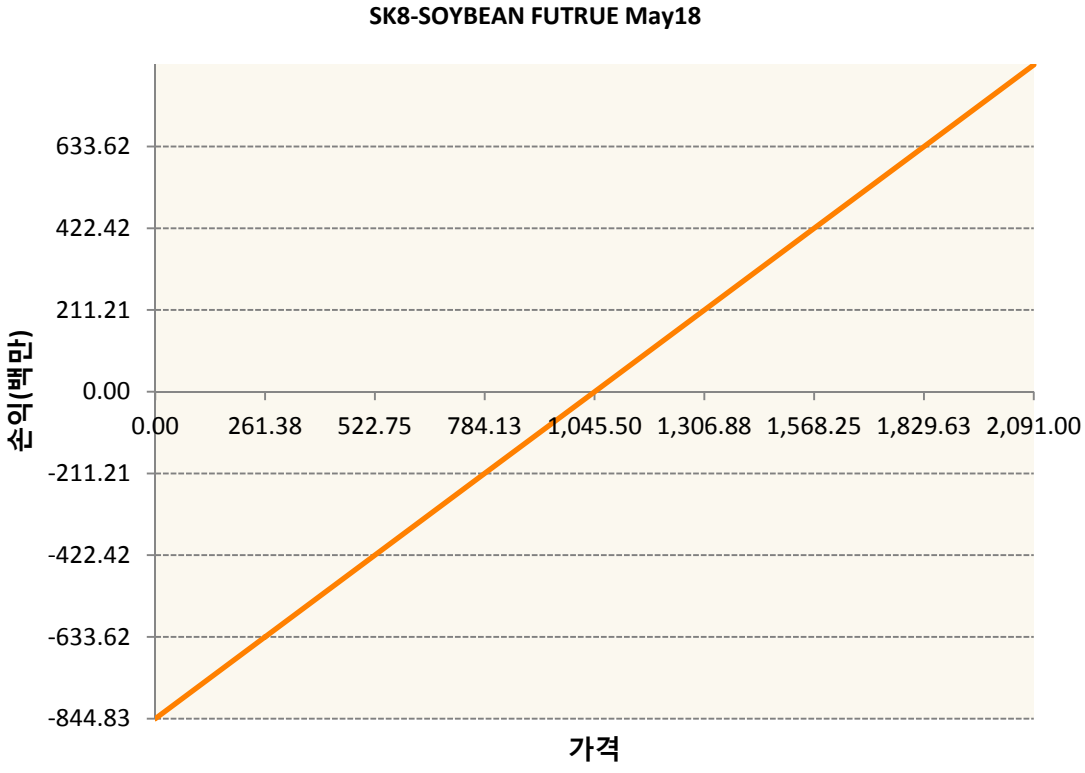

KCK8-COFFEE 'C' FUTURE May18
252.07
168.05
84.02
0.00
-84.02
-168.05
-252.07
0.00
29.73
59.45
89.18
118.90
148.63
178.35
208.08
237.80
손익(백만)


-336.10
가격

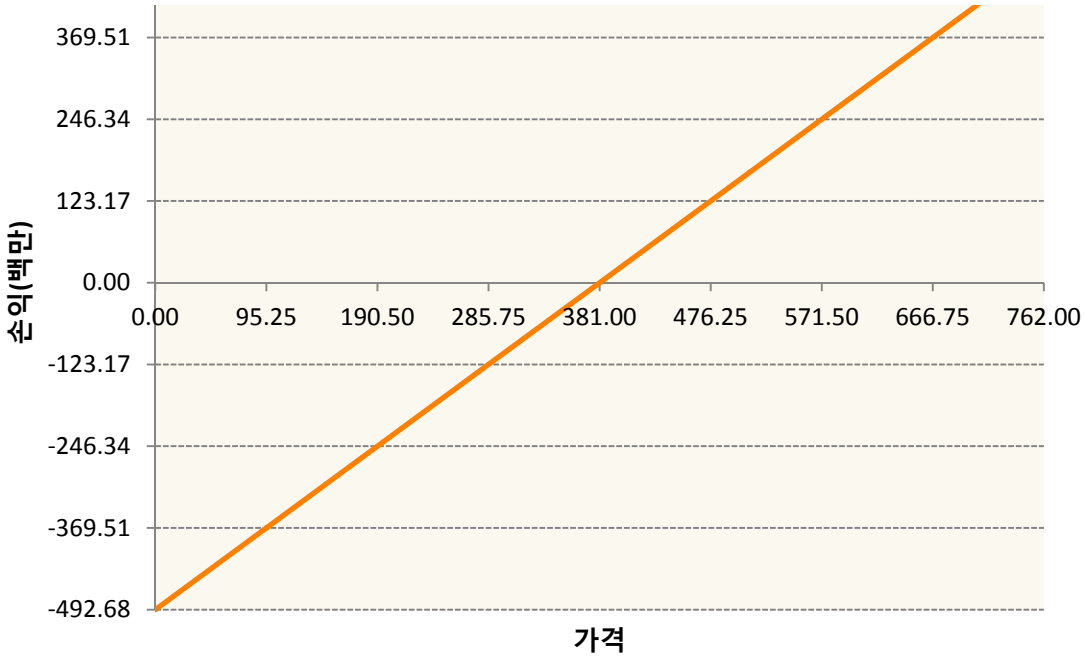

KR4175N30006-2018-03 달러선물
243.81
162.54
81.27
0.00
-81.27
-162.54
-243.81
-325.08
0.00
270.90
541.80
812.70
1,083.60
1,354.50
1,625.40
1,896.30
2,167.20
손익(백만)
가격

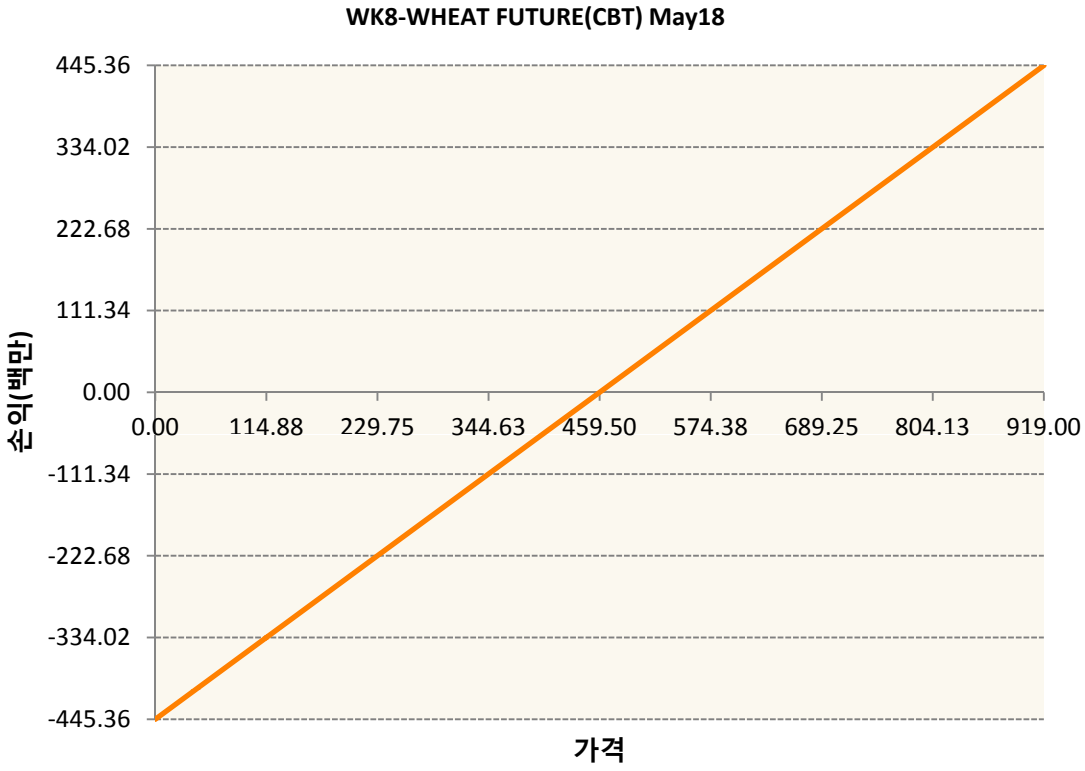

KWK8-KC HRW WHEAT FUT May18
181.60
136.20
90.80
45.40
0.00
-45.40
-90.80
-136.20
-181.60
0.00
120.44
240.88
361.31
481.75
602.19
722.63
843.06
손익(백만)
가격


SBK8-SUGAR #11 (WORLD) May18
384.21
288.16
192.10
96.05
0.00
-96.05
-192.10
-288.16
-384.21
0.00
3.32
6.64
9.95
13.27
16.59
19.91
23.22
26.54
손익(백만)
가격


SK8-SOYBEAN FUTRUE May18
633.62
422.42
211.21
0.00
-211.21
-422.42
-633.62
-844.83
0.00
261.38
522.75
784.13
1,045.50
1,306.88
1,568.25
1,829.63
2,091.00
손익(백만)
가격


SMK8-SOYBEAN MEAL FUTR 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	68
SMK8	SOYBEAN MEAL FUTR May18	39
WK8	WHEAT FUTURE(CBT) May18	36

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

334