공시일	2018-02-26
기준일	2018-02-23

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	2018-02-26
기준일	2018-02-23

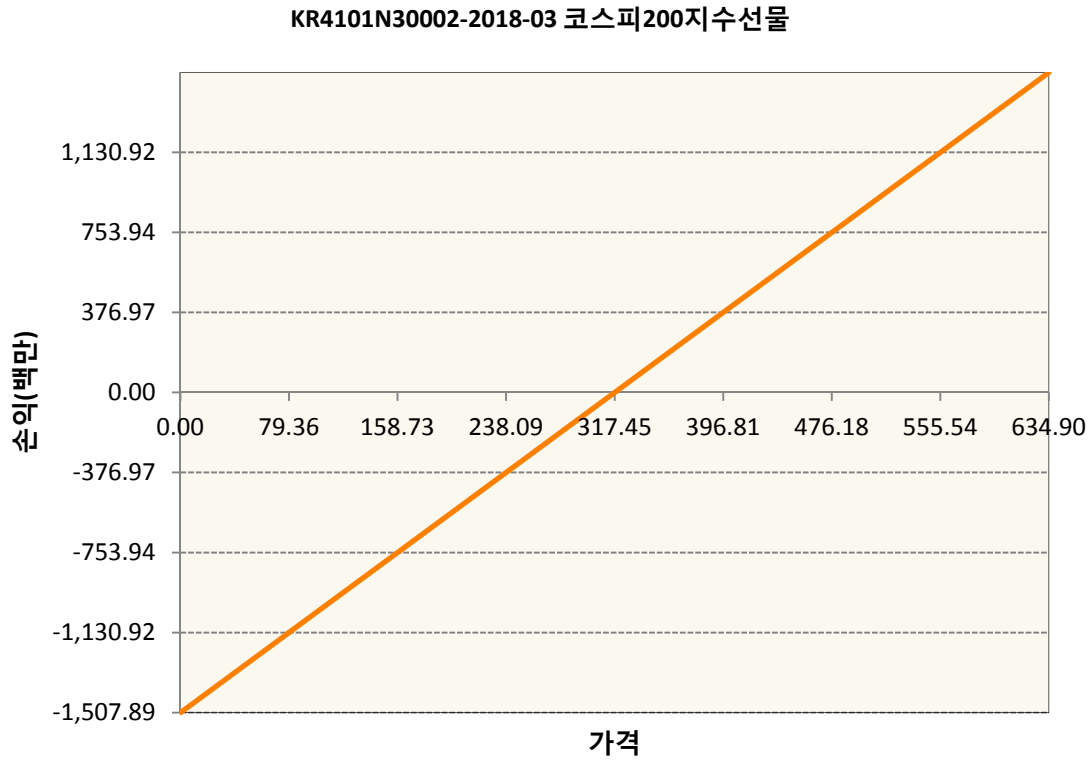
스마트인덱스모

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	1,508	0	1,508	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101N30(2018-03 코스피200지수선물							120
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-120	-120	-120	-120	-120	-120	-120
-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%	120	120	120	120	120	120	120

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

81

공시일	2018-02-26
기준일	2018-02-23

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	1,109

* 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	2018-02-26
기준일	2018-02-23

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	393

* 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	2018-02-26
기준일	2018-02-23

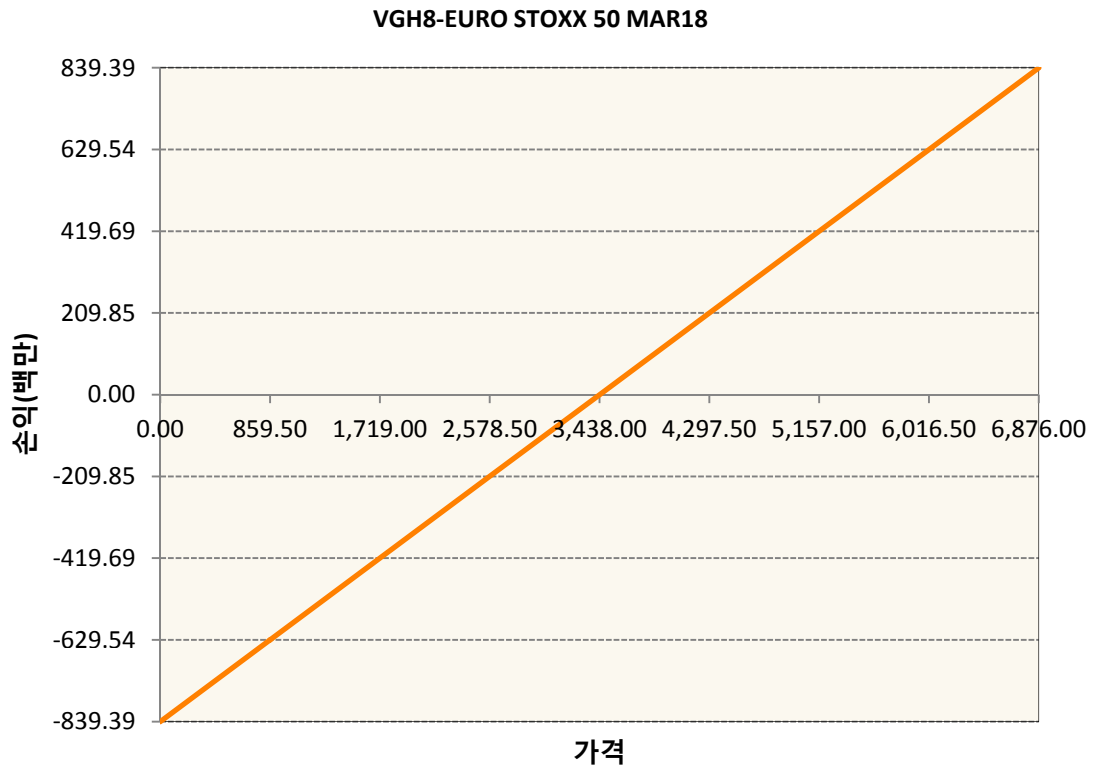
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	839	0	839	

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	2018-02-26
기준일	2018-02-23

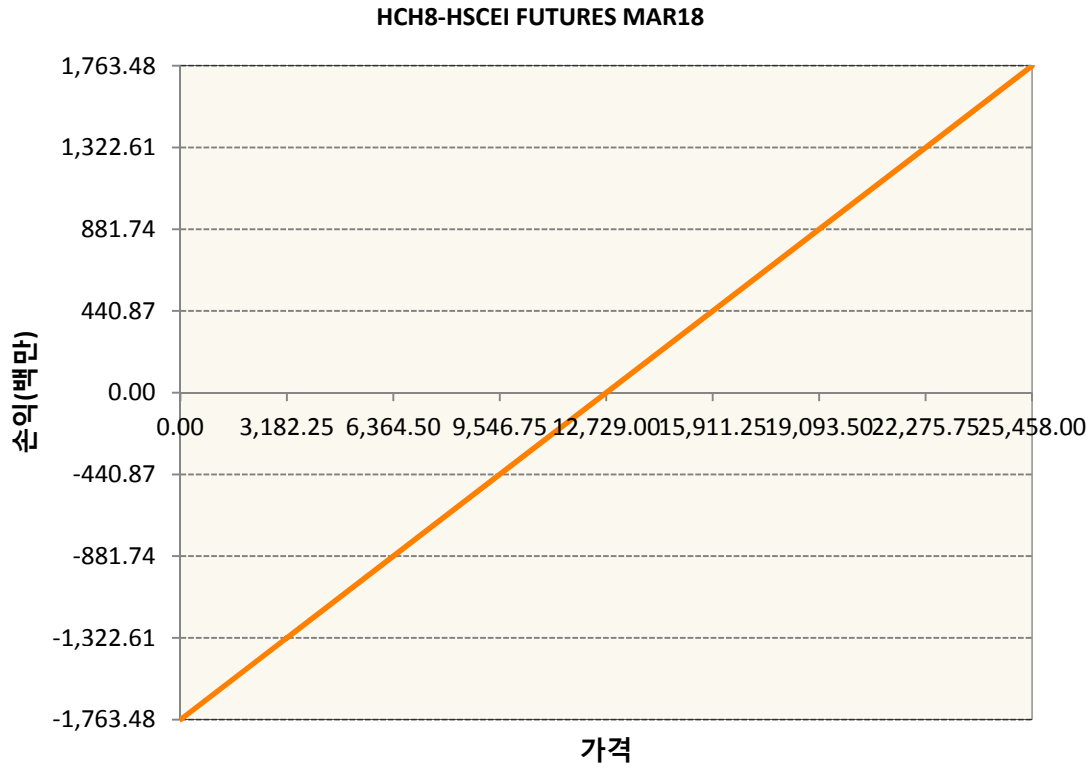
차이나인덱스모(주식-파생형)

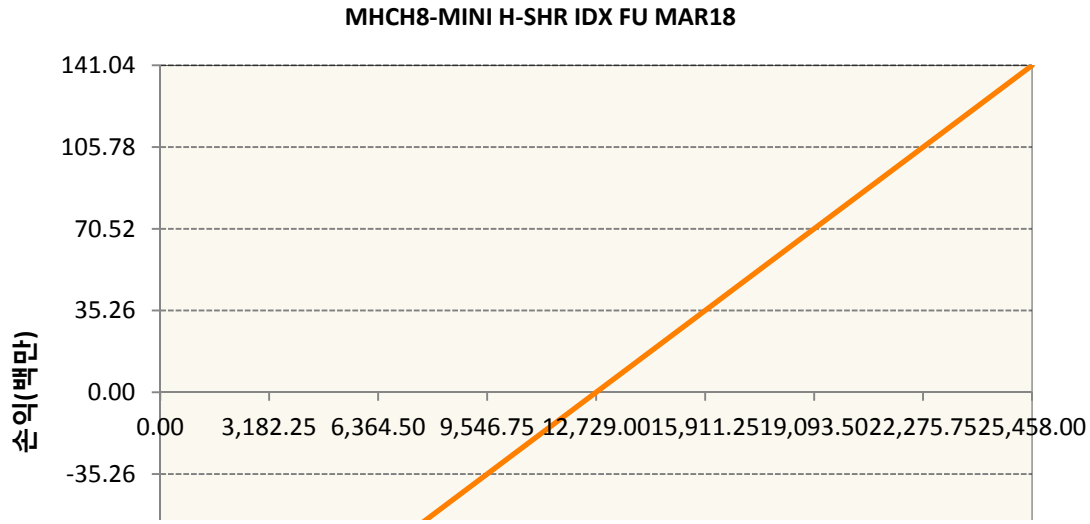
1. 계약금액

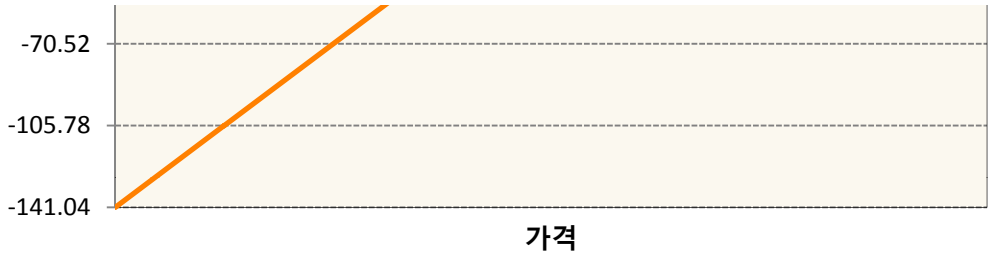
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,905	0	1,905	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCH8	HSCEI FUTURES MAR18	141
MHCH8	MINI H-SHR IDX FU MAR18	11

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	135

공시일	2018-02-26
기준일	2018-02-23

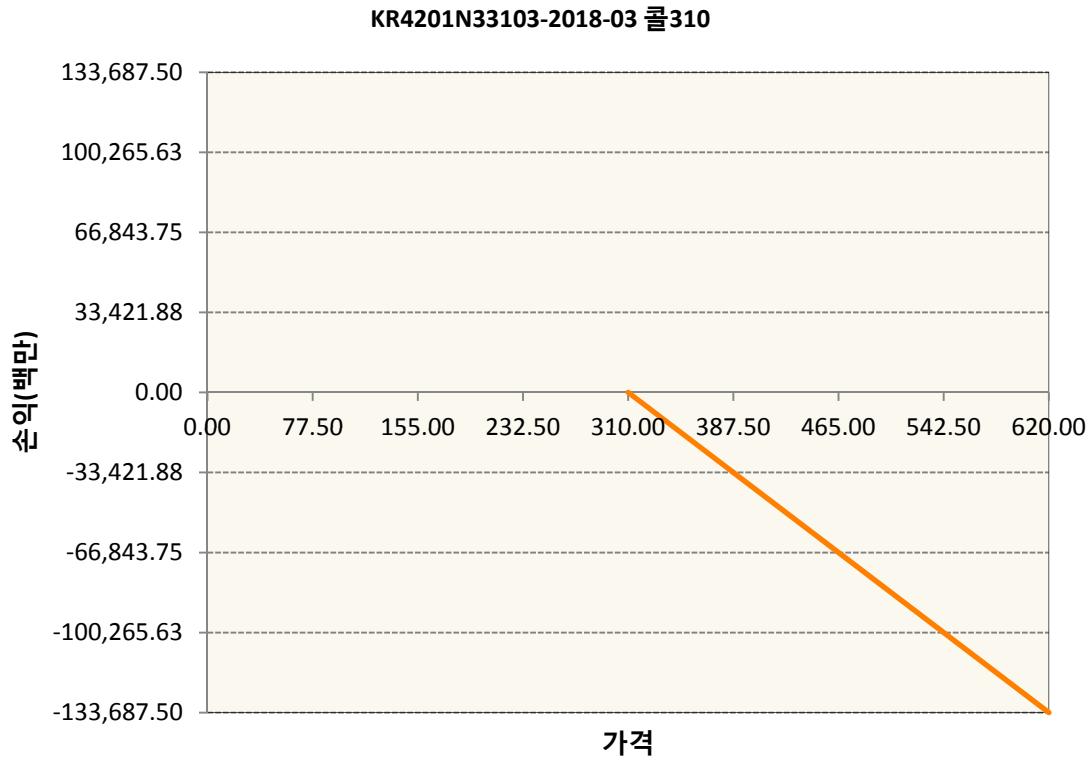
커버드콜모(주식혼합-파생형)

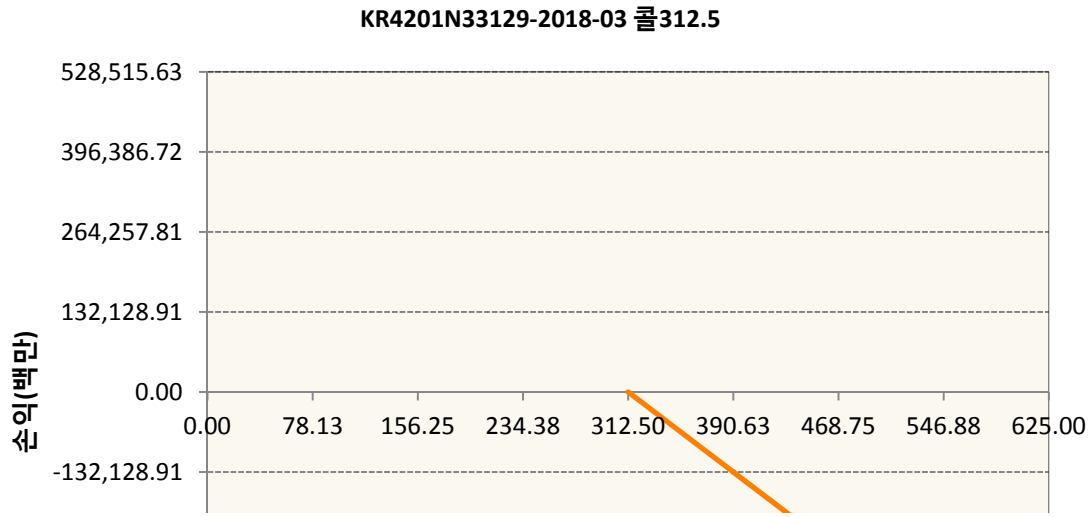
1. 계약금액

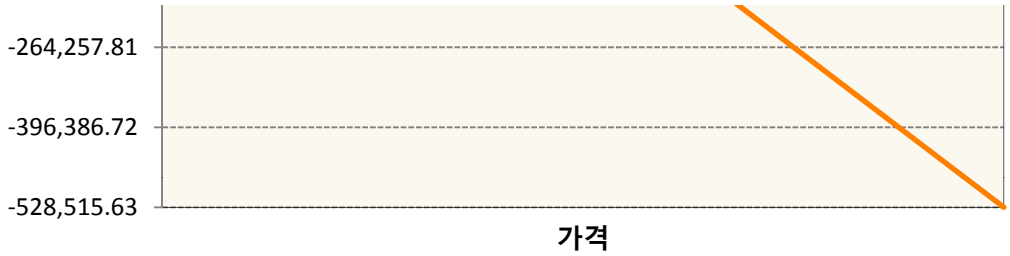
(단위:백만원)

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



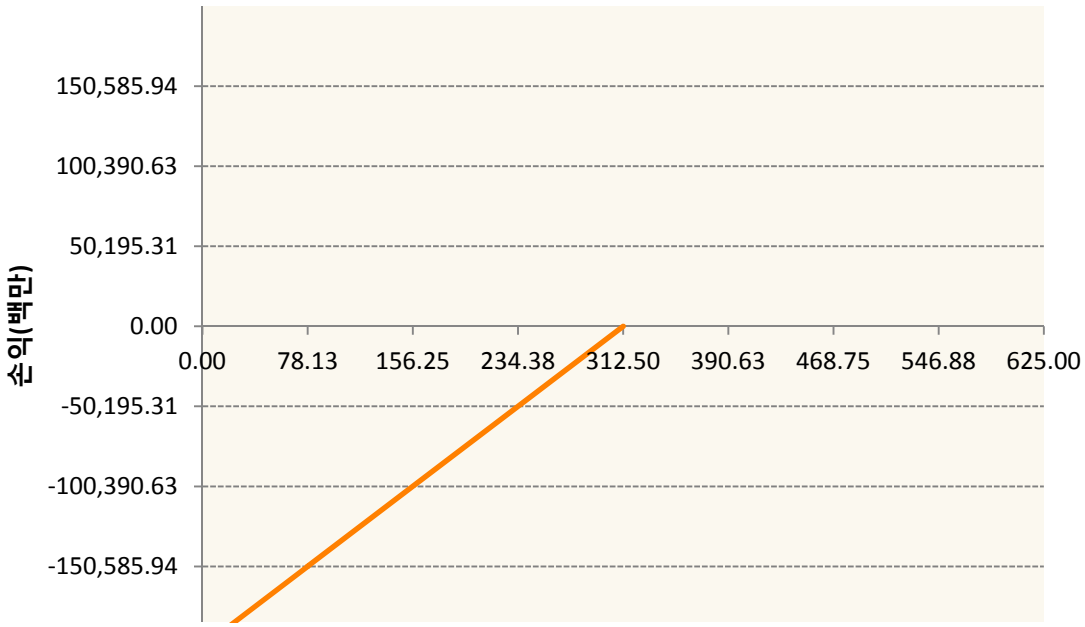




KR4301N33101-2018-03 풋310



KR4301N33127-2018-03 풋312.5





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201N3312018-03 콜310							9,642
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	4,348	4,281	4,197	4,099	3,988	3,865	3,733
-5.33%	3,924	3,766	3,597	3,421	3,239	3,051	2,859
-2.67%	2,762	2,539	2,316	2,092	1,868	1,644	1,420
0%	605	408	206	0	-209	-421	-635
2.67%	-2,386	-2,499	-2,627	-2,769	-2,921	-3,083	-3,253
5.33%	-5,824	-5,867	-5,926	-6,001	-6,089	-6,191	-6,304
8.00%	-9,420	-9,432	-9,452	-9,482	-9,524	-9,577	-9,642
KR4201N3312018-03 콜312.5							36,543
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	14,576	14,384	14,131	13,822	13,460	13,050	12,597
-5.33%	13,420	12,902	12,332	11,720	11,073	10,399	9,700
-2.67%	9,859	9,021	8,173	7,320	6,462	5,600	4,735
0%	2,564	1,718	862	0	-868	-1,739	-2,614
2.67%	-8,322	-8,875	-9,480	-10,127	-10,809	-11,520	-12,254
5.33%	-21,414	-21,656	-21,964	-22,334	-22,759	-23,234	-23,753
8.00%	-35,398	-35,472	-35,588	-35,752	-35,966	-36,230	-36,543
KR4301N3312018-03 풋310							14,537
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-14,350	-14,359	-14,374	-14,398	-14,433	-14,479	-14,537
-5.33%	-7,492	-7,587	-7,700	-7,829	-7,972	-8,127	-8,293
-2.67%	-1,975	-2,223	-2,473	-2,724	-2,976	-3,228	-3,480
0%	544	375	193	0	-202	-411	-626
2.67%	1,020	987	939	876	797	703	596
5.33%	1,052	1,050	1,045	1,036	1,020	996	963
8.00%	1,053	1,053	1,053	1,052	1,050	1,047	1,040
KR4301N3312018-03 풋312.5							12,312
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-12,227	-12,229	-12,235	-12,245	-12,260	-12,283	-12,312
-5.33%	-6,858	-6,901	-6,958	-7,027	-7,109	-7,201	-7,303
-2.67%	-2,138	-2,306	-2,480	-2,658	-2,838	-3,021	-3,206
0%	521	352	178	0	-182	-366	-552
2.67%	1,197	1,149	1,087	1,011	923	823	714

5.33%	1,261	1,257	1,248	1,234	1,212	1,182	1,143
8.00%	1,264	1,263	1,263	1,262	1,259	1,253	1,244

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

75,721

공시일	2018-02-26
기준일	2018-02-23

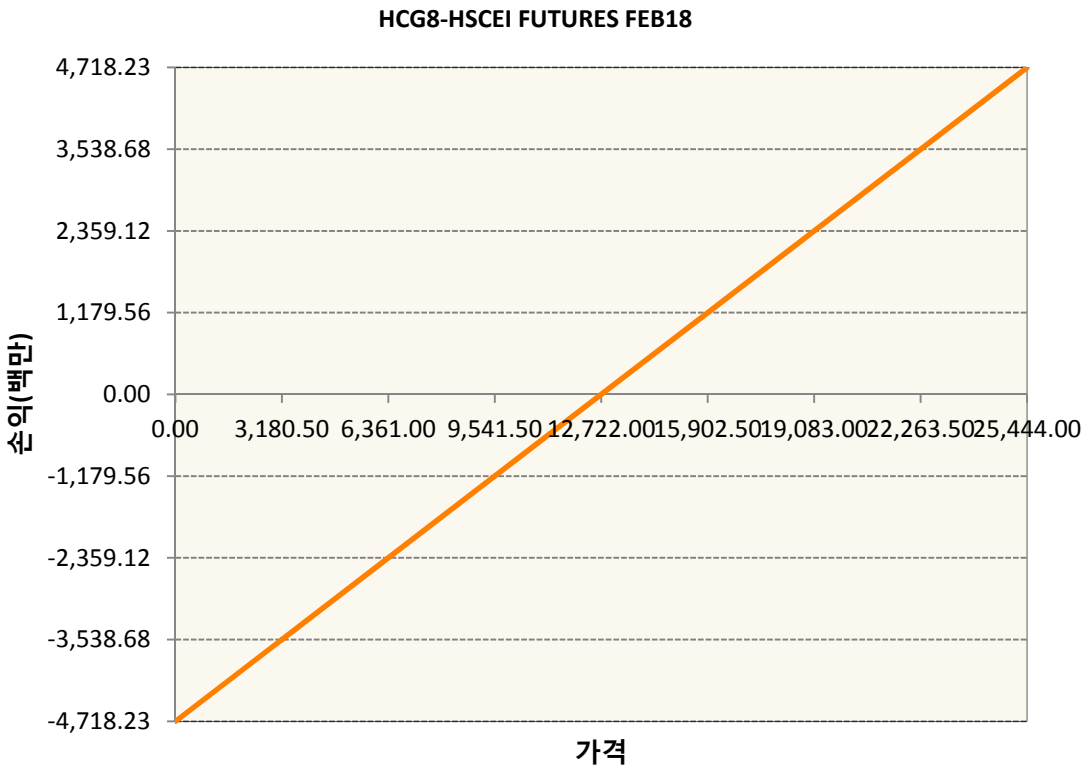
홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생

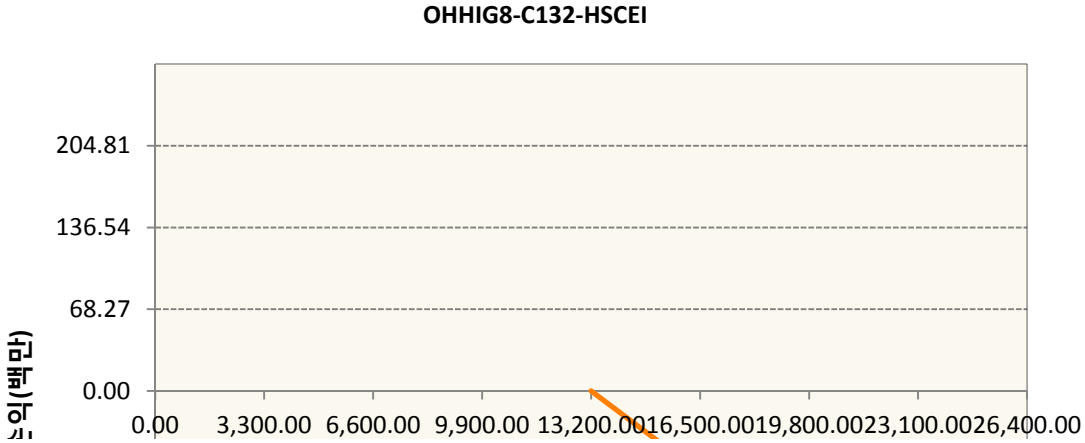
1. 계약금액

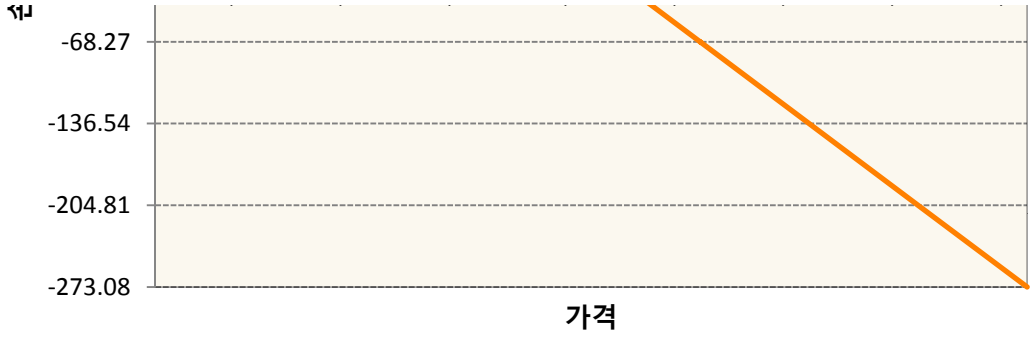
(단위:백만원)

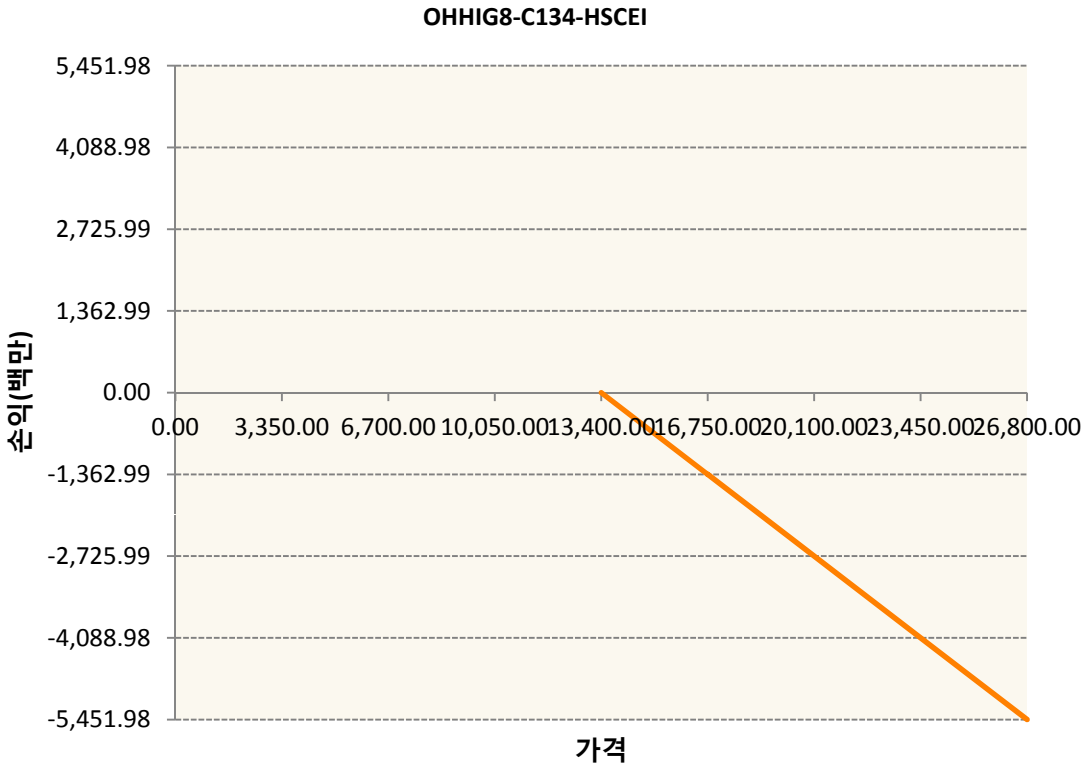
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	4,718	0	4,718	장내
누계	유가증권	옵션	0	11,450	-11,450	장내

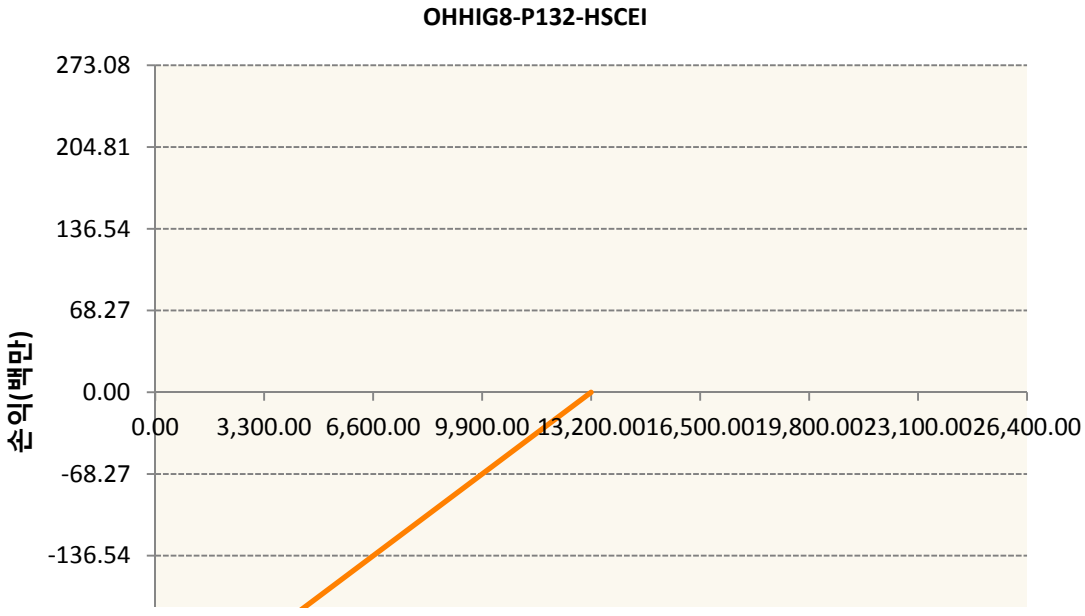
2. 만기시점의 손익구조

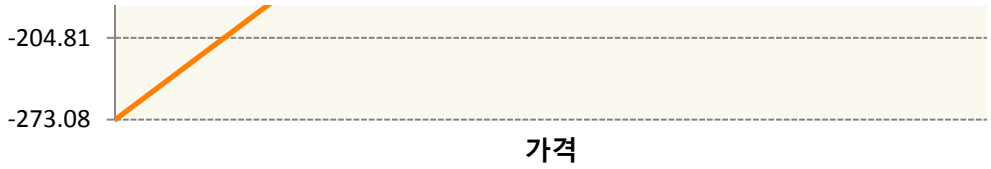


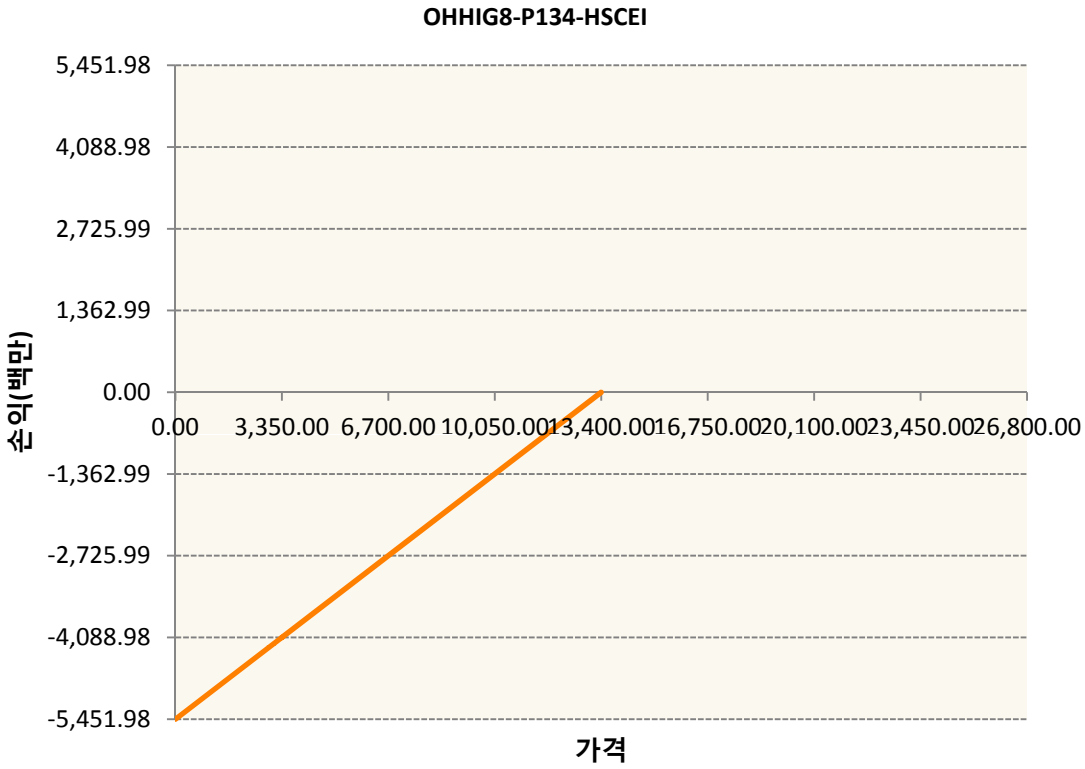



-68.27
-136.54
-204.81
-273.08
가격


OHHIG8-C134-HSCEI
5,451.98
4,088.98
2,725.99
1,362.99
0.00
-1,362.99
-2,725.99
-4,088.98
-5,451.98
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
273.08
204.81
136.54
68.27
0.00
-68.27
-136.54
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	377
OHHIG8-C1: HSCEI	22
OHHIG8-C1: HSCEI	436
OHHIG8-P1: HSCEI	22
OHHIG8-P1: HSCEI	436

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,150

공시일	2018-02-26
기준일	2018-02-23

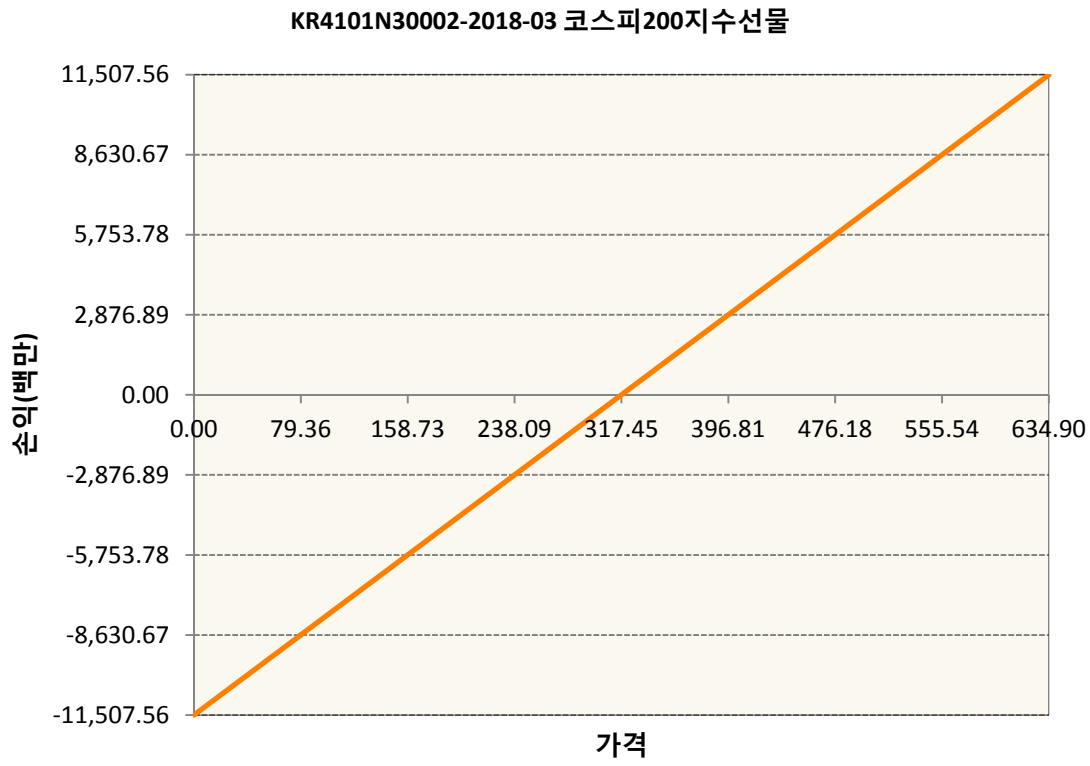
코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼

1. 계약금액

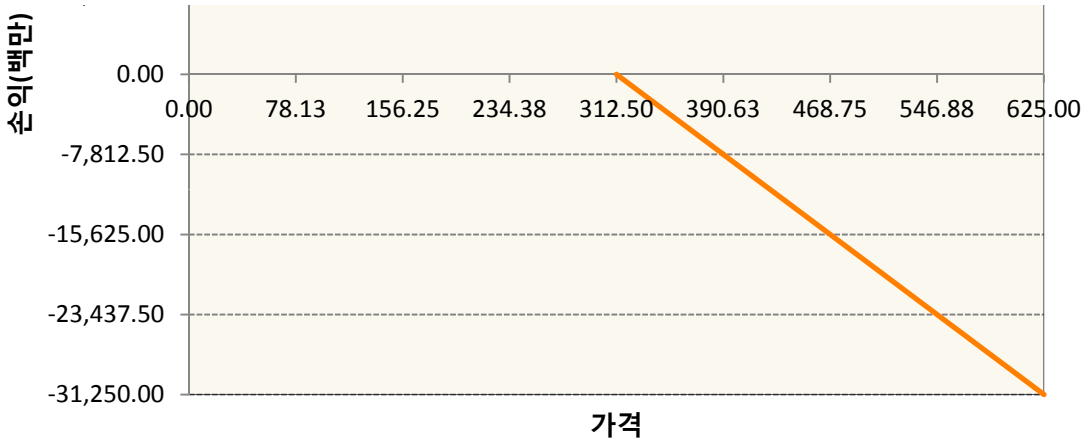
(단위:백만원)

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	11,508	0	11,508	장내
누계	유가증권	스왑	56,200	0	56,200	장외
누계	유가증권	옵션	0	56,094	-56,094	장내

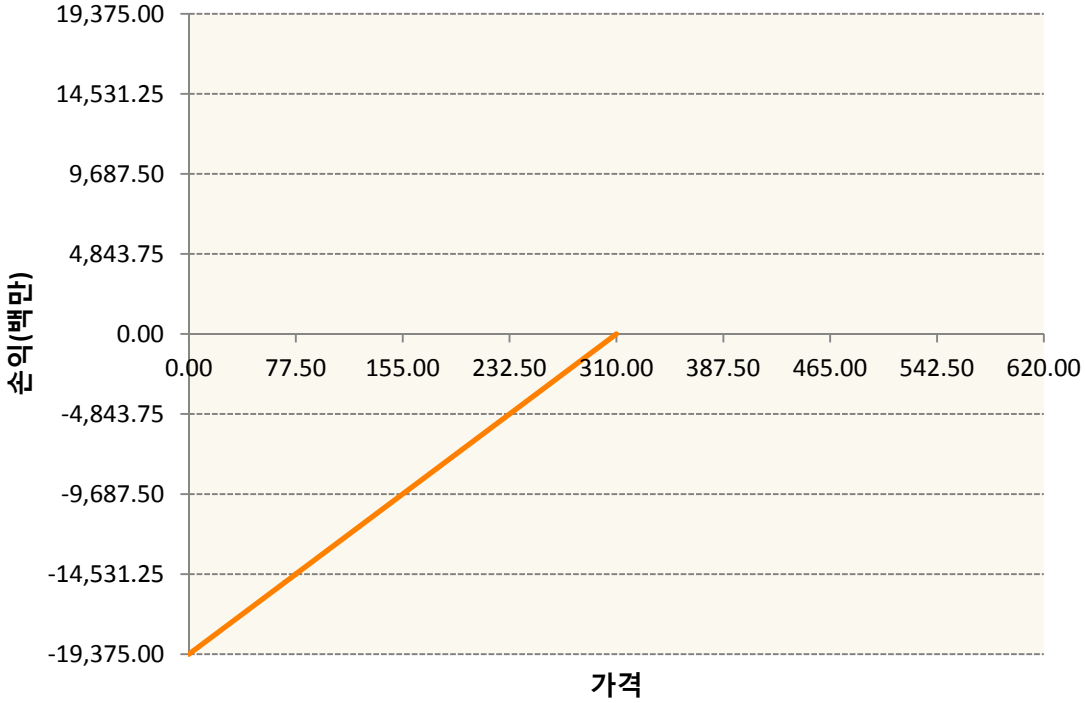
2. 만기시점의 손익구조



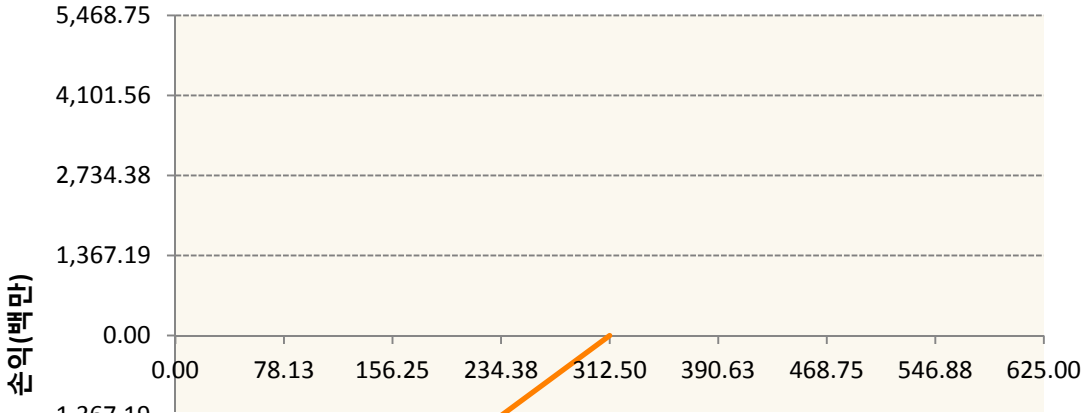




KR4301N33101-2018-03 풋310



KR4301N33127-2018-03 풋312.5





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_2							1,456
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,456	-1,456	-1,456	-1,456	-1,456	-1,456	-1,456
-5.33%	-970	-970	-970	-970	-970	-970	-970
-2.67%	-485	-485	-485	-485	-485	-485	-485
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	485	485	485	485	485	485	485
5.33%	970	970	970	970	970	970	970
8.00%	1,456	1,456	1,456	1,456	1,456	1,456	1,456
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%	-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%	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							236
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%

-8.00%	-236	-236	-236	-236	-236	-236	-236
-5.33%	-157	-157	-157	-157	-157	-157	-157
-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%	157	157	157	157	157	157	157
8.00%	236	236	236	236	236	236	236
	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%	-131	-131	-131	-131	-131	-131	-131
-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%	131	131	131	131	131	131	131
8.00%	197	197	197	197	197	197	197
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_7						252
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-252	-252	-252	-252	-252	-252	-252
-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%	252	252	252	252	252	252	252
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_8						466
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-466	-466	-466	-466	-466	-466	-466
-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%	466	466	466	466	466	466	466
	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%	-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%	275	275	275	275	275	275	275
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_11						630
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-630	-630	-630	-630	-630	-630	-630
-5.33%	-420	-420	-420	-420	-420	-420	-420
-2.67%	-210	-210	-210	-210	-210	-210	-210
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	210	210	210	210	210	210	210
5.33%	420	420	420	420	420	420	420
8.00%	630	630	630	630	630	630	630
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_12						472
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-472	-472	-472	-472	-472	-472	-472
-5.33%	-315	-315	-315	-315	-315	-315	-315
-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%	315	315	315	315	315	315	315
8.00%	472	472	472	472	472	472	472
	KR4101N30(2018-03 코스피200지수선물						919
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-919	-919	-919	-919	-919	-919	-919
-5.33%	-612	-612	-612	-612	-612	-612	-612
-2.67%	-306	-306	-306	-306	-306	-306	-306
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	306	306	306	306	306	306	306
5.33%	612	612	612	612	612	612	612
8.00%	919	919	919	919	919	919	919
	KR4201N331 2018-03 콜312.5						2,161
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	862	850	836	817	796	772	745
-5.33%	794	763	729	693	655	615	574
-2.67%	583	533	483	433	382	331	280
0%	152	102	51	0	-51	-103	-155
2.67%	-492	-525	-561	-599	-639	-681	-725
5.33%	-1,266	-1,280	-1,299	-1,321	-1,346	-1,374	-1,404
8.00%	-2,093	-2,097	-2,104	-2,114	-2,127	-2,142	-2,161
	KR4301N331 2018-03 풋310						1,091

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,077	-1,078	-1,079	-1,081	-1,084	-1,087	-1,091
-5.33%	-562	-570	-578	-588	-599	-610	-623
-2.67%	-148	-167	-186	-205	-223	-242	-261
0%	41	28	14	0	-15	-31	-47
2.67%	77	74	71	66	60	53	45
5.33%	79	79	78	78	77	75	72
8.00%	79	79	79	79	79	79	78
	KR4301N3312018-03 풋312.5						335

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-333	-333	-333	-334	-334	-335	-335
-5.33%	-187	-188	-190	-191	-194	-196	-199
-2.67%	-58	-63	-68	-72	-77	-82	-87
0%	14	10	5	0	-5	-10	-15
2.67%	33	31	30	28	25	22	19
5.33%	34	34	34	34	33	32	31
8.00%	34	34	34	34	34	34	34

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

8,711

공시일	2018-02-26
기준일	2018-02-23

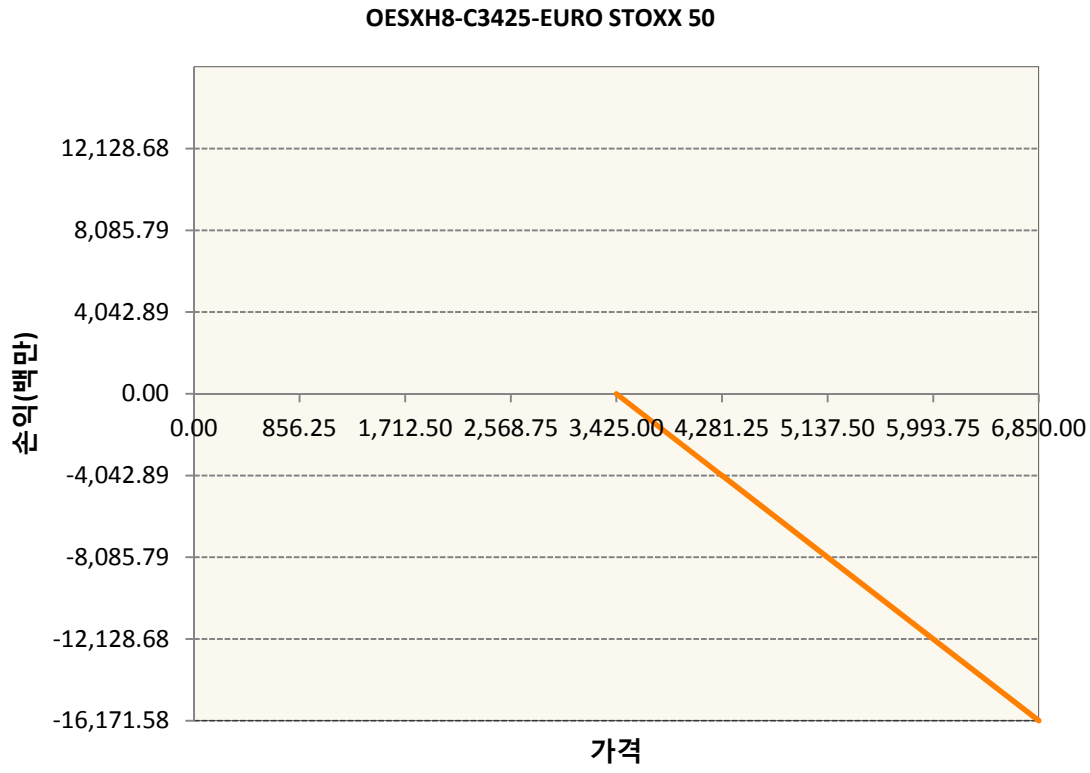
유로커버드콜모(주식혼합-파생형

1. 계약금액

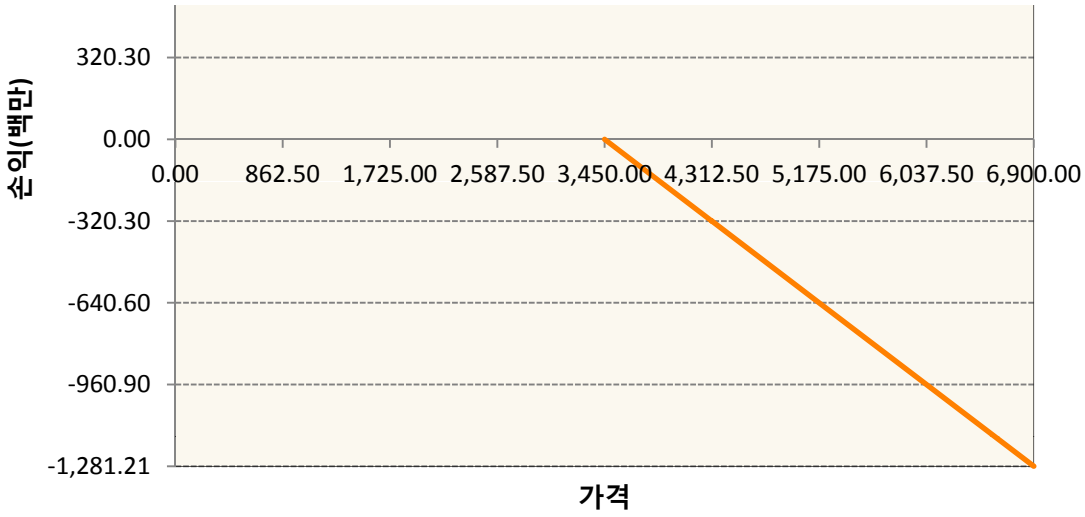
(단위:백만원)

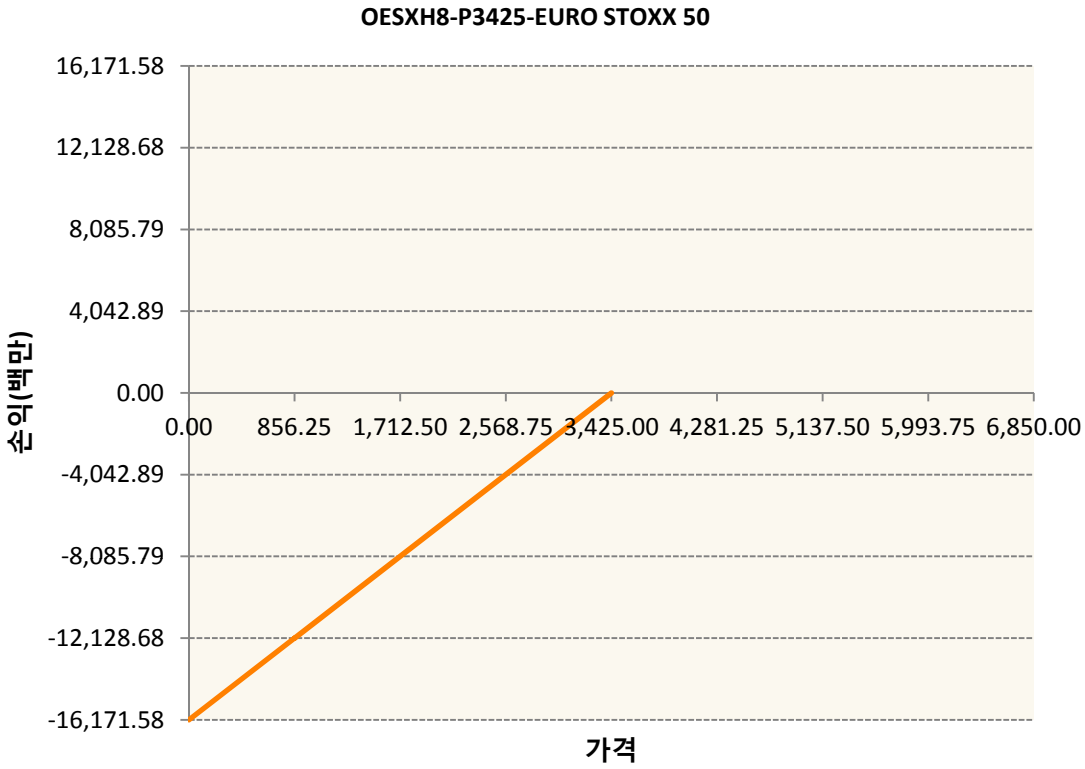
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	9,298	0	9,298	
누계	유가증권	스왑	99,469	0	99,469	장외
누계	유가증권	옵션	0	34,906	-34,906	장내
누계	지수	스왑	53,051	0	53,051	장외

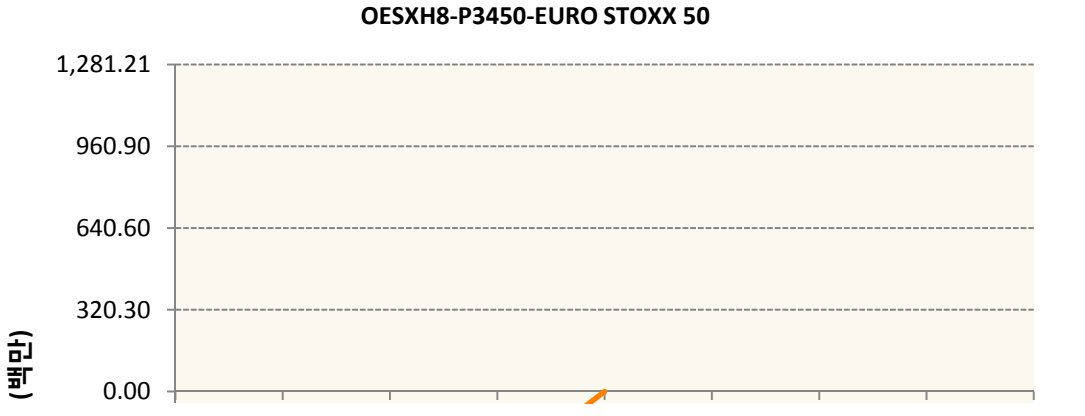
2. 만기시점의 손익구조

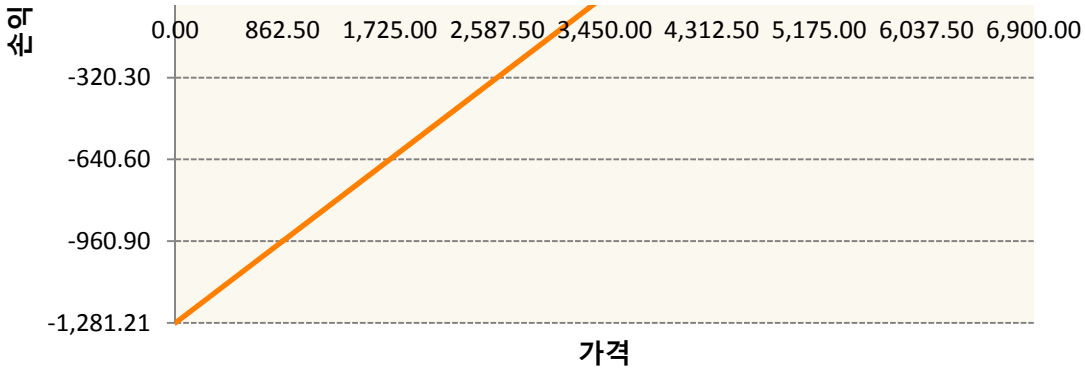


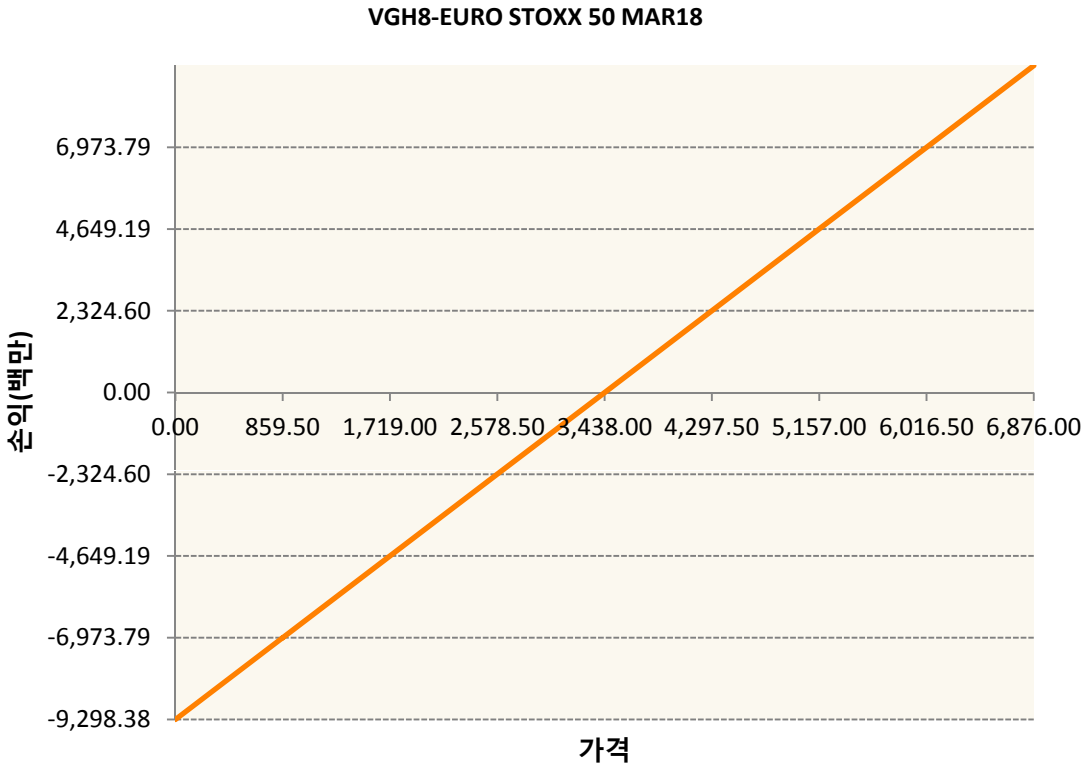



320.30
0.00
-320.30
-640.60
-960.90
-1,281.21
0.00
862.50
1,725.00
2,587.50
3,450.00
4,312.50
5,175.00
6,037.50
6,900.00
손익(백만)
가격


OESXH8-P3425-EURO STOXX 50
16,171.58
12,128.68
8,085.79
4,042.89
0.00
-4,042.89
-8,085.79
-12,128.68
-16,171.58
0.00
856.25
1,712.50
2,568.75
3,425.00
4,281.25
5,137.50
5,993.75
6,850.00
손익(백만)
가격


OESXH8-P3450-EURO STOXX 50
1,281.21
960.90
640.60
320.30
0.00
(백만)





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)	(단위:백만원)
260105SGPX SG EURO Covered CALL STRATEGY - 994.569	212
260105SQPX SG EURO Covered CALL STRATEGY	397
OESXH8-C34 EURO STOXX 50	1,294
OESXH8-C34 EURO STOXX 50	102
OESXH8-P34 EURO STOXX 50	1,294
OESXH8-P34 EURO STOXX 50	102
VGH8 EURO STOXX 50 MAR18	744

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

2,443

공시일	2018-02-26
기준일	2018-02-23

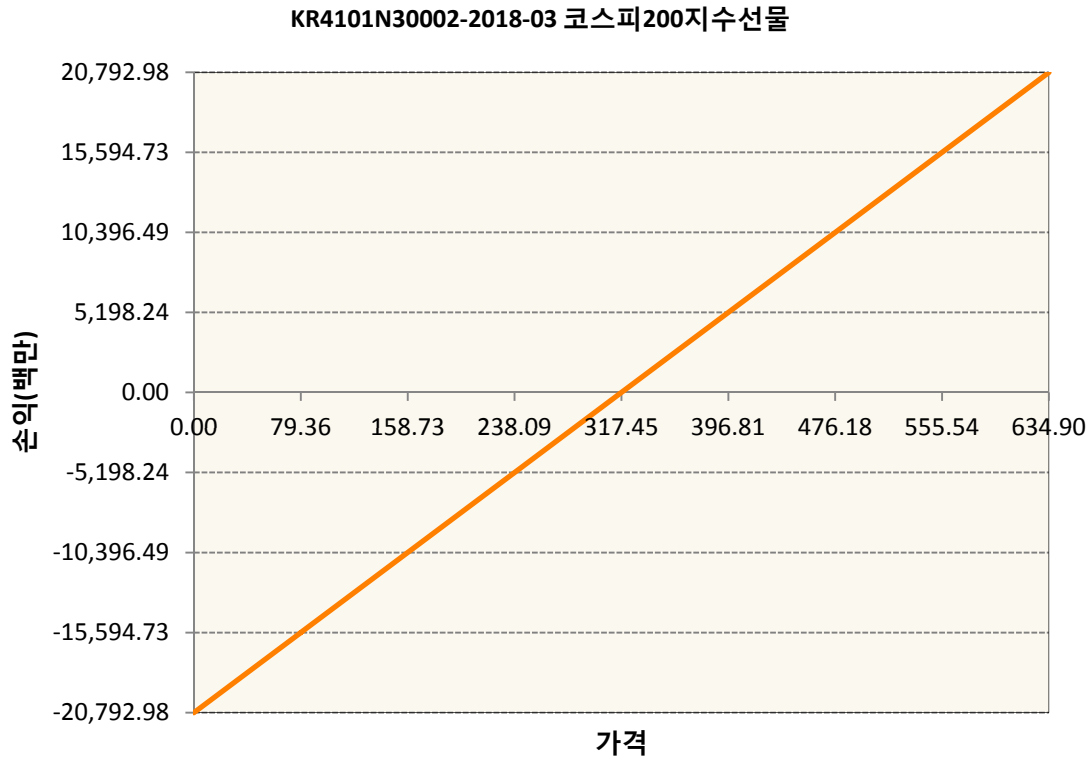
ETF스마트레버리지목표전환형8호

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	20,793	0	20,793	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)

1,114

공시일	2018-02-26
기준일	2018-02-23

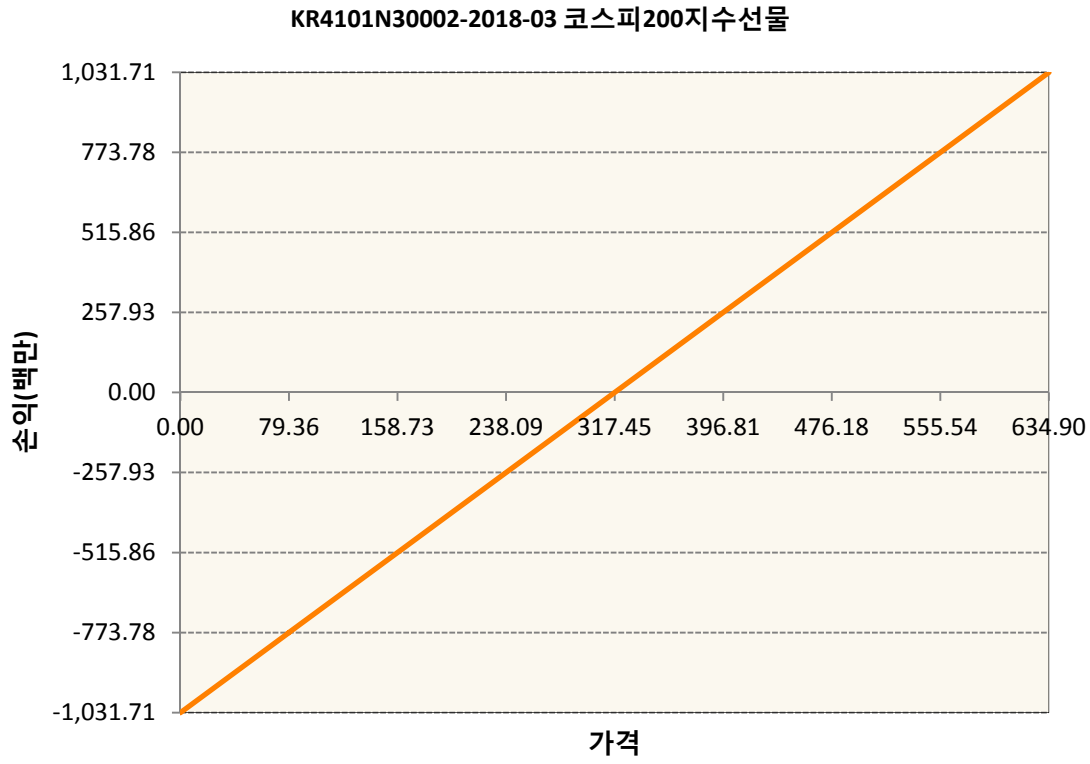
ETF스마트레버리지목표전환형9호

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	1,032	0	1,032	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%	-55	-55	-55	-55	-55	-55	-55
-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%	55	55	55	55	55	55	55
8.00%	82	82	82	82	82	82	82

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

55

공시일	2018-02-26
기준일	2018-02-23

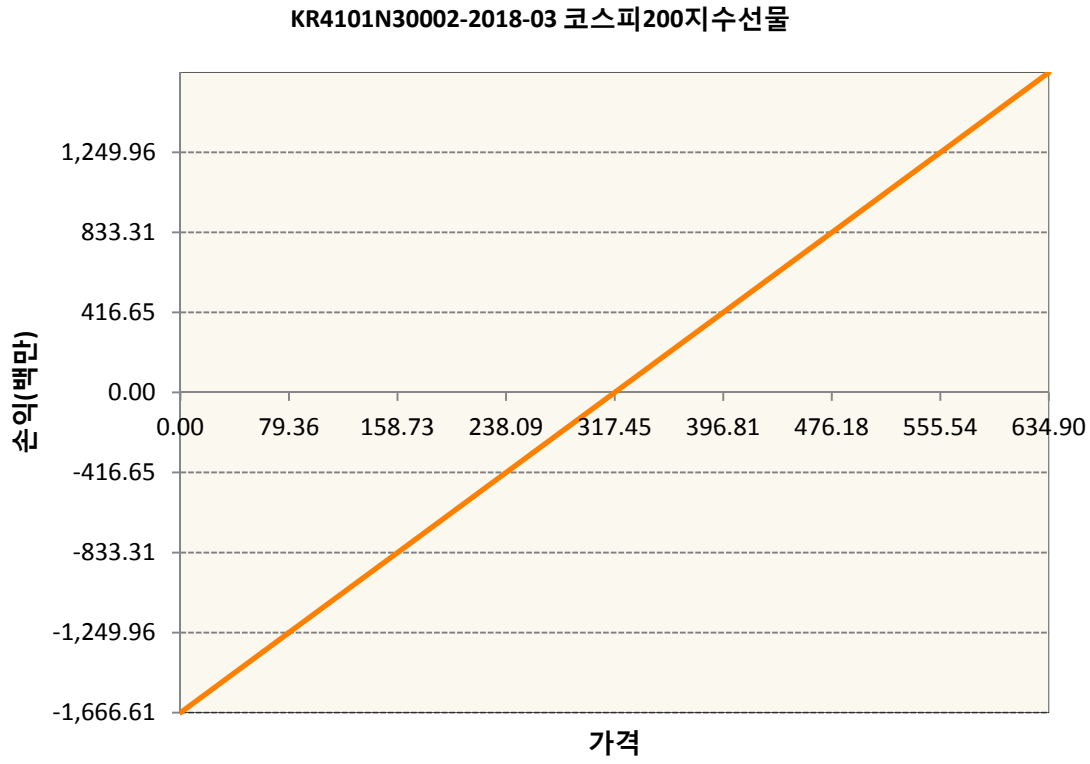
ETF스마트레버리지목표전환형10

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	1,667	0	1,667	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101N30(2018-03 코스피200지수선물							133
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-133	-133	-133	-133	-133	-133	-133
-5.33%	-89	-89	-89	-89	-89	-89	-89
-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%	89	89	89	89	89	89	89
8.00%	133	133	133	133	133	133	133

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

89

공시일	2018-02-26
기준일	2018-02-23

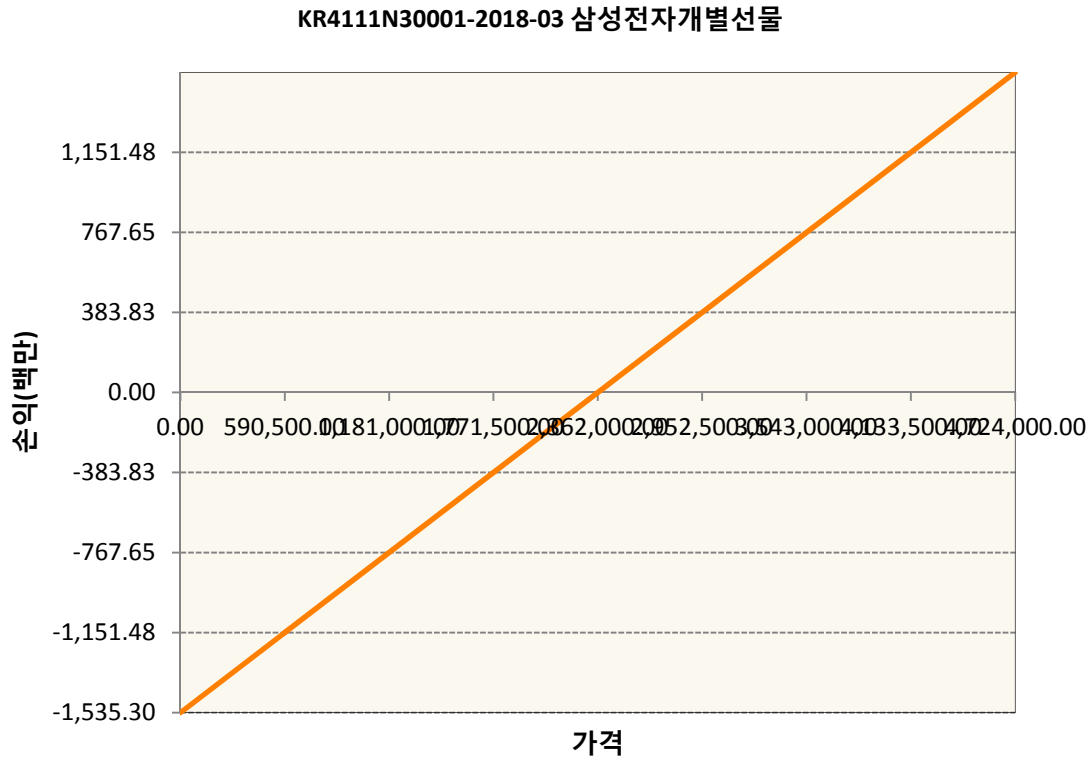
스마트KRX300인덱스1호(주식-파

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	1,535	0	1,535	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4111N30(2018-03 삼성전자개별선물							123
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-123	-123	-123	-123	-123	-123	-123
-5.33%	-82	-82	-82	-82	-82	-82	-82
-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%	82	82	82	82	82	82	82
8.00%	123	123	123	123	123	123	123

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

146

공시일	2018-02-26
기준일	2018-02-23

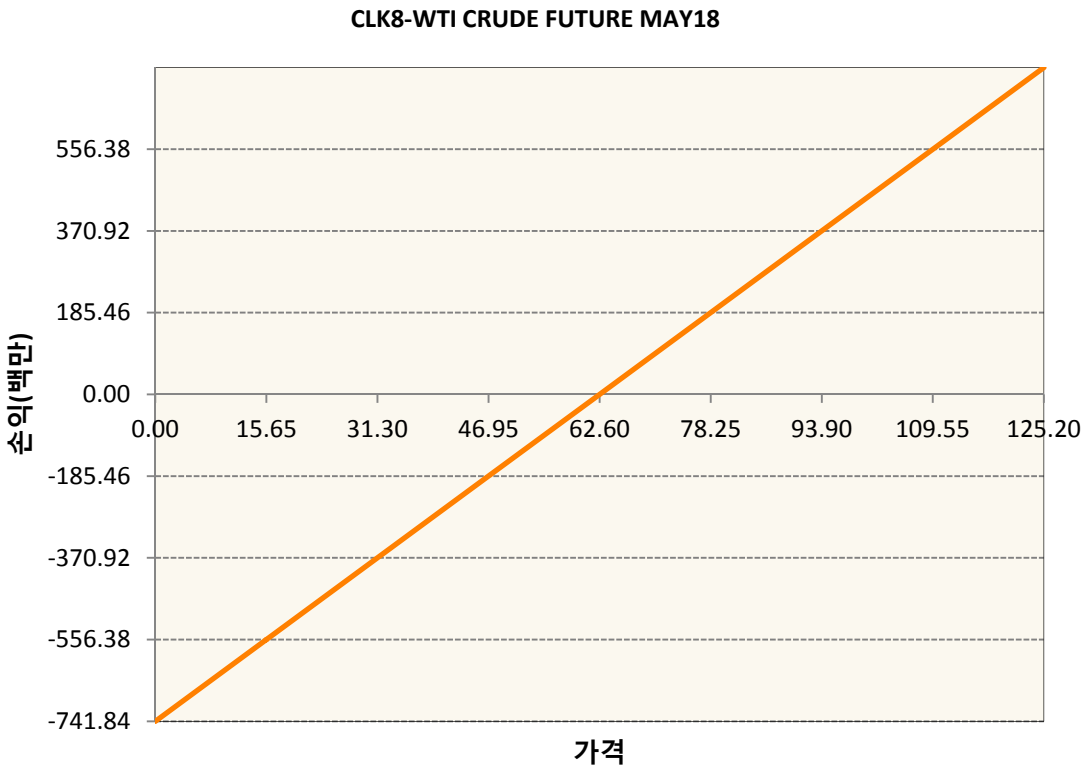
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

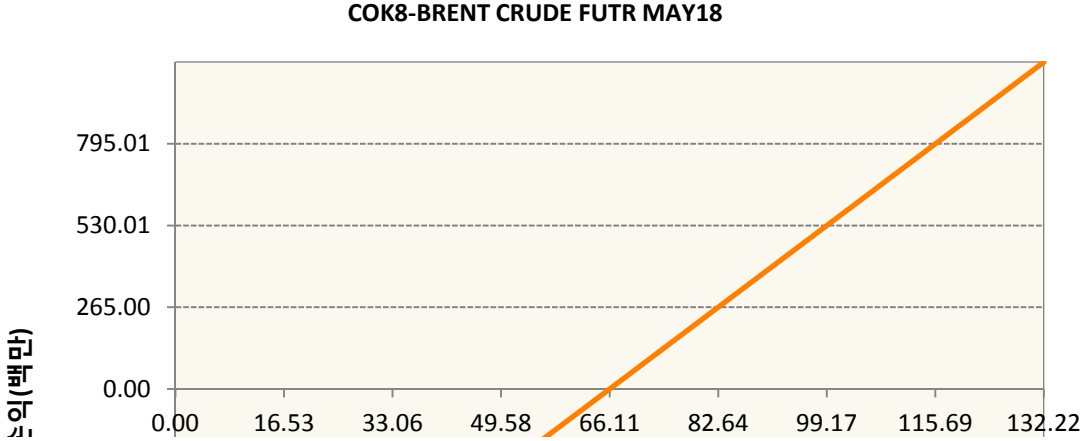
1. 계약금액

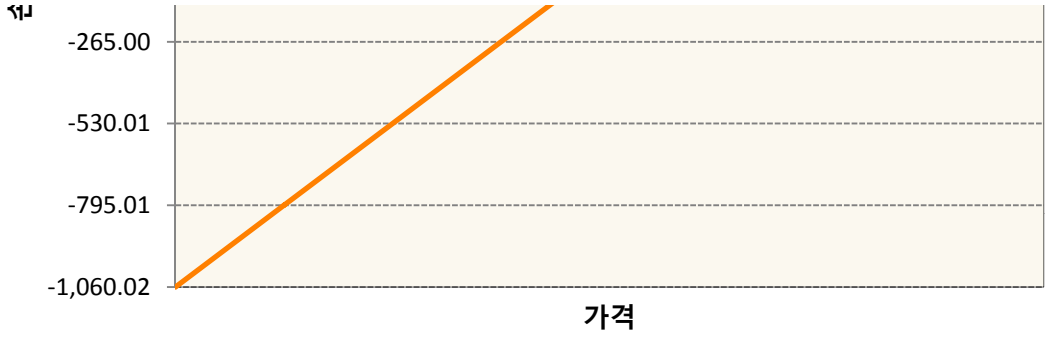
(단위:백만원)

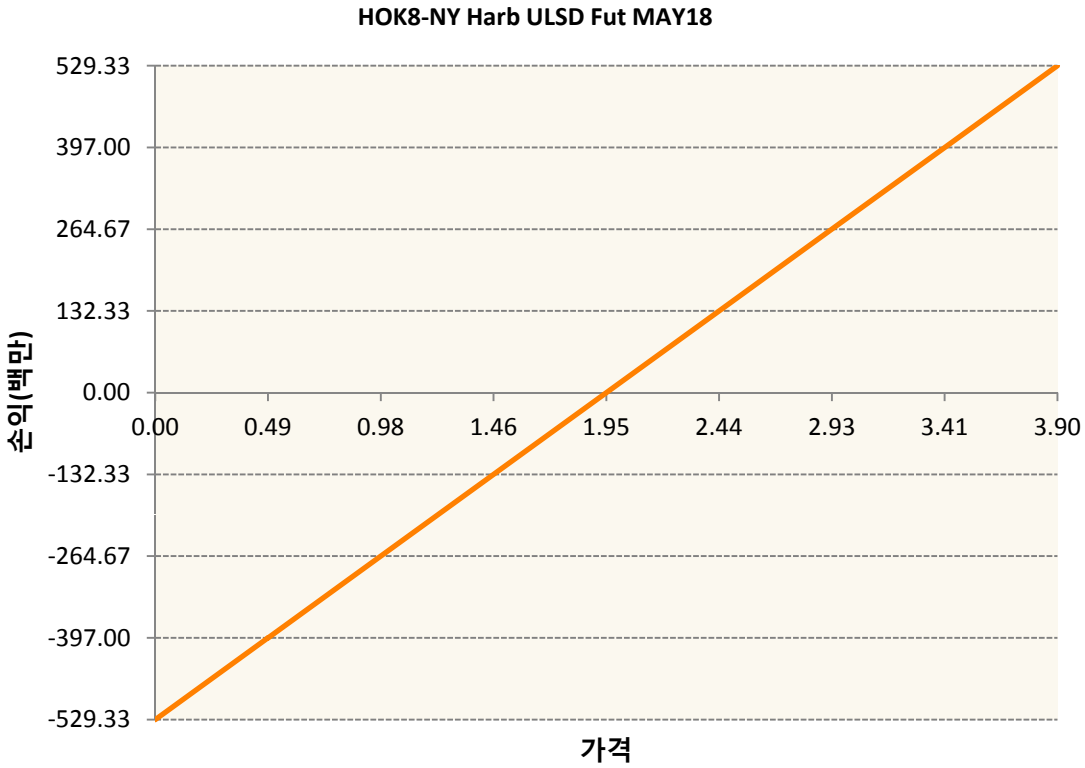
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	선물	유가증권	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	선물	유가증권	742	0	742	
누계	유가증권	선물	3,263	593	2,670	

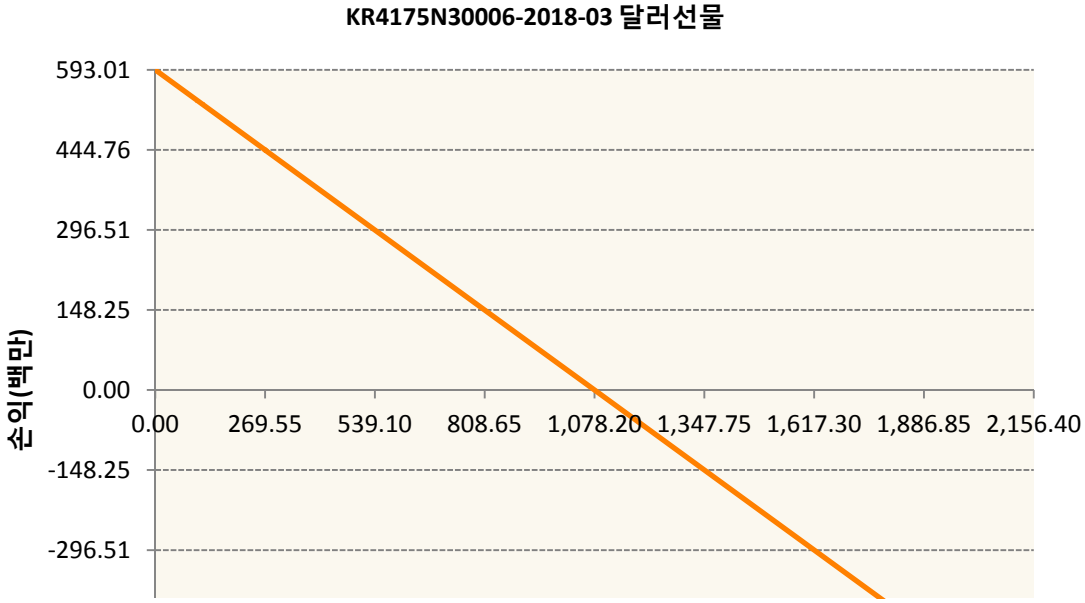
2. 만기시점의 손익구조

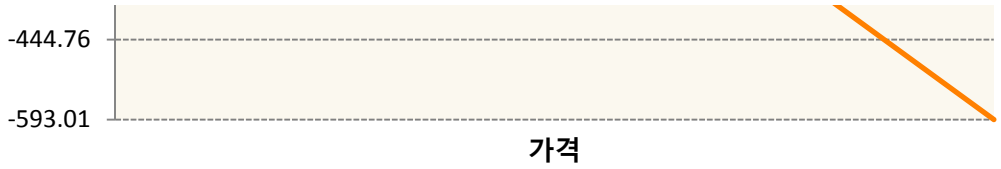


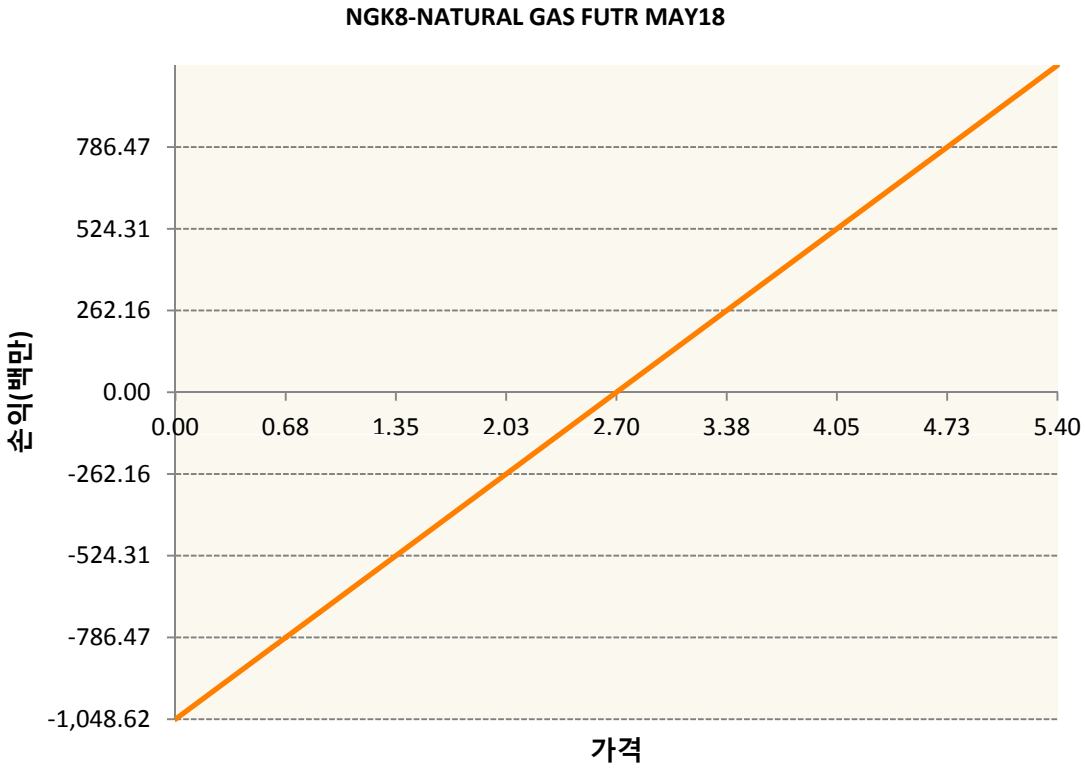


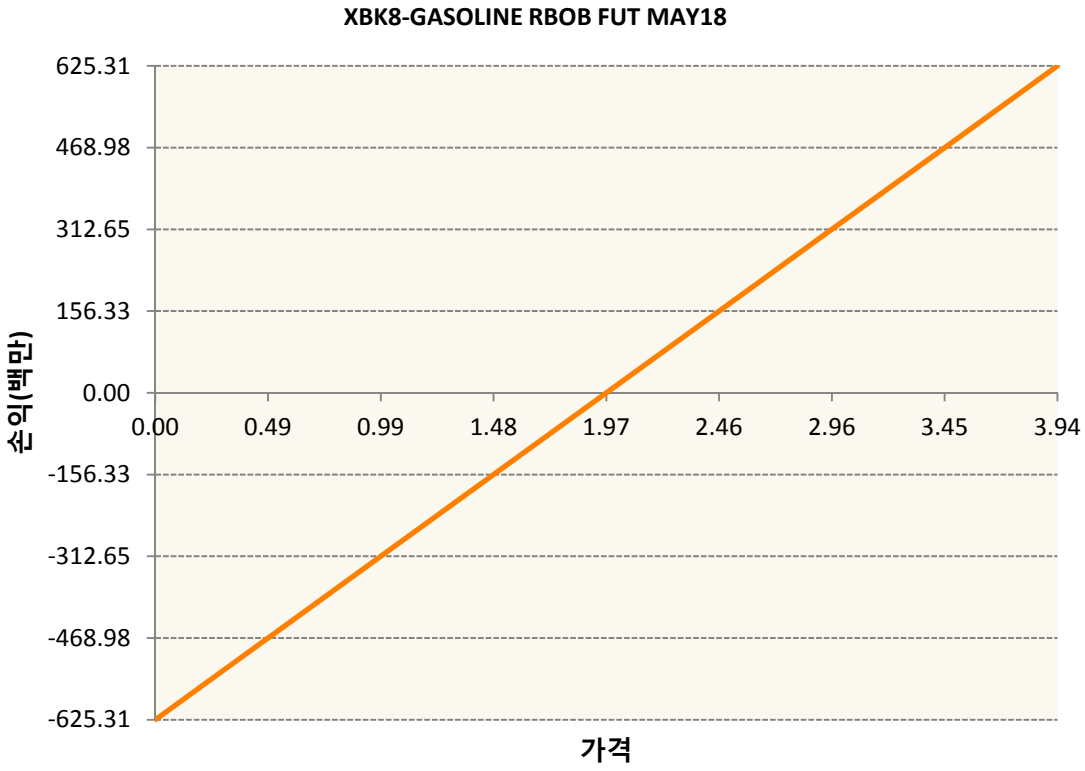

-265.00
-530.01
-795.01
-1,060.02
가격


HOK8-NY Harb ULSD Fut MAY18
529.33
397.00
264.67
132.33
0.00
-132.33
-264.67
-397.00
-529.33
0.00
0.49
0.98
1.46
1.95
2.44
2.93
3.41
3.90
손익(백만)
가격


KR4175N30006-2018-03 달러선물
593.01
444.76
296.51
148.25
0.00
-148.25
-296.51
0.00
269.55
539.10
808.65
1,078.20
1,347.75
1,617.30
1,886.85
2,156.40
손익(백만)


-444.76
-593.01
가격


NGK8-NATURAL GAS FUTR MAY18
786.47
524.31
262.16
0.00
-262.16
-524.31
-786.47
-1,048.62
0.00
0.68
1.35
2.03
2.70
3.38
4.05
4.73
5.40
손익(백만)
가격


XBK8-GASOLINE RBOB FUT MAY18
625.31
468.98
312.65
156.33
0.00
-156.33
-312.65
-468.98
-625.31
0.00
0.49
0.99
1.48
1.97
2.46
2.96
3.45
3.94
손익(백만)
가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLK8	WTI CRUDE FUTURE MAY18	59
COK8	BRENT CRUDE FUTR MAY18	85
HOK8	NY Harb ULSD Fut MAY18	42
KR4175N30(	2018-03 달러선물	47
NGK8	NATURAL GAS FUTR MAY18	84
XBK8	GASOLINE RBOB FUT MAY18	50

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

511

공시일	2018-02-26
기준일	2018-02-23

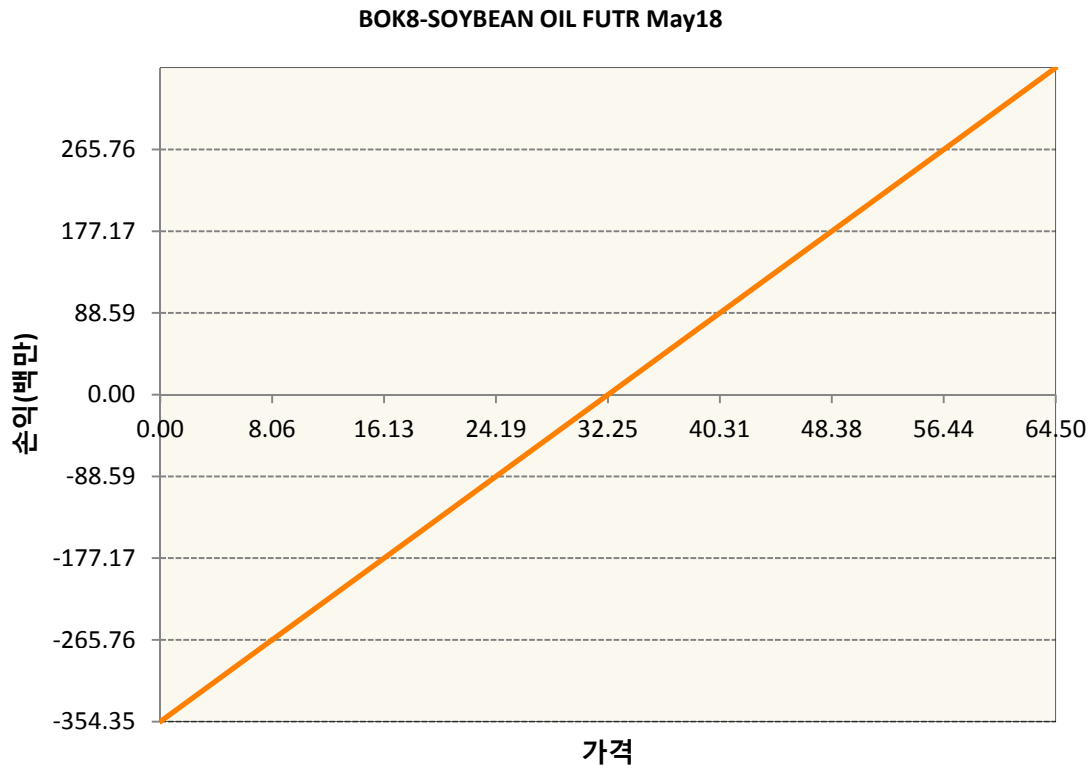
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

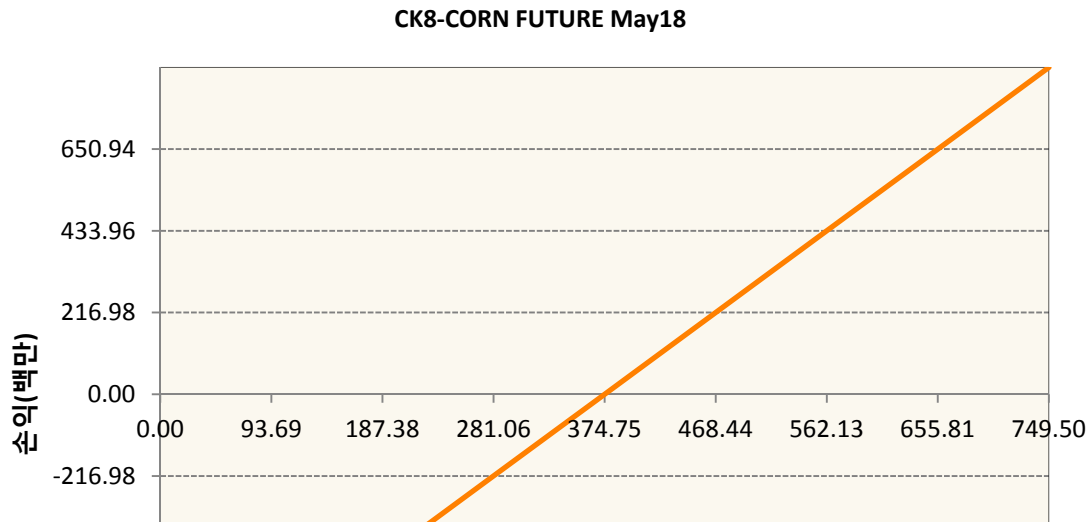
1. 계약금액

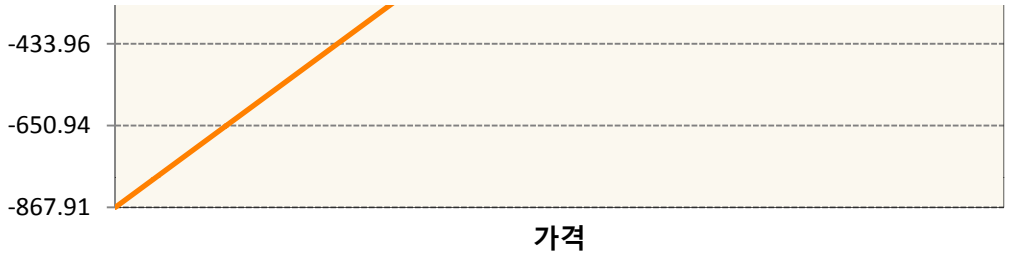
(단위:백만원)

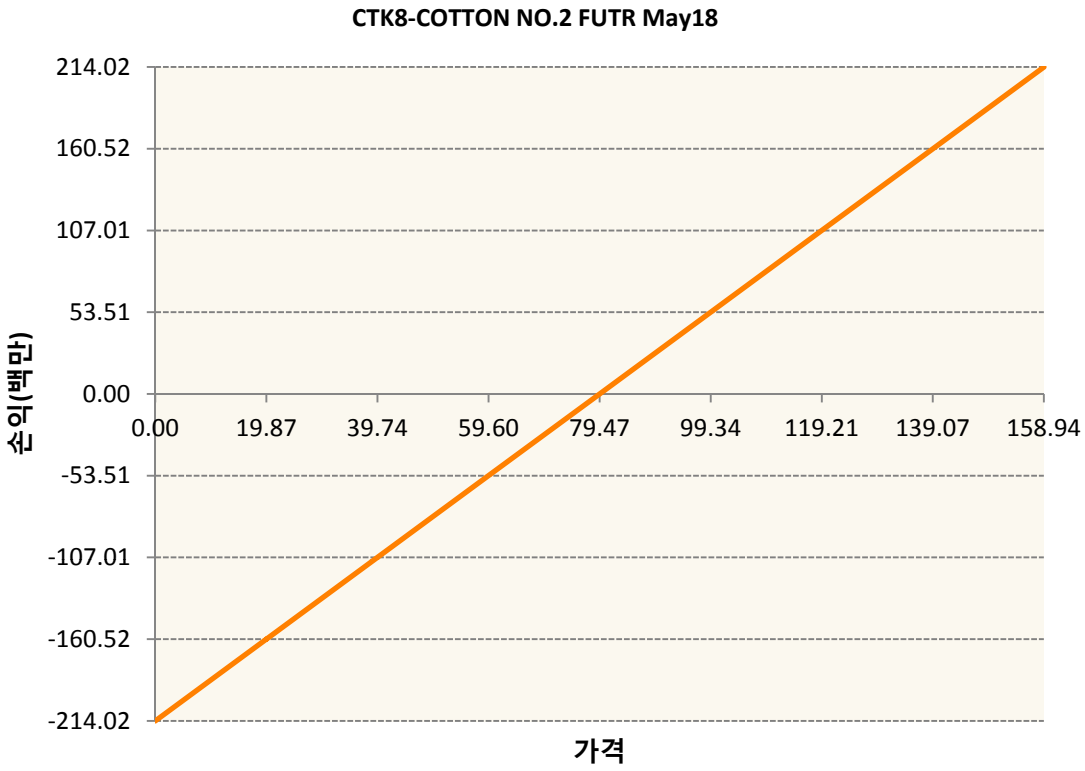
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	4,138	323	3,815	

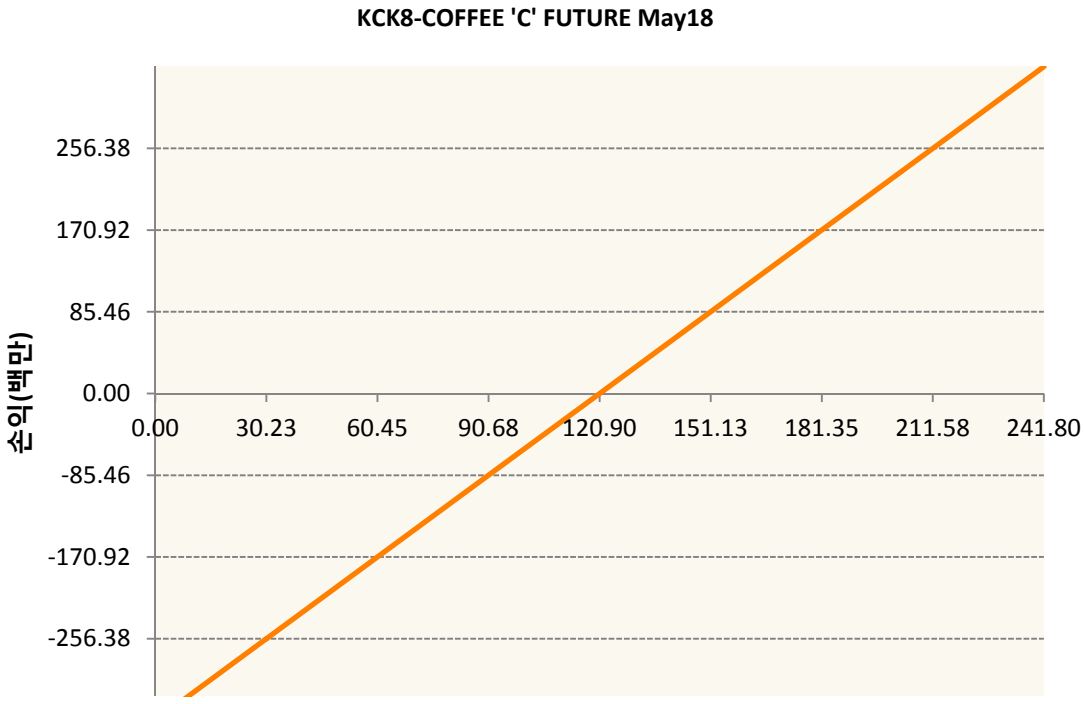
2. 만기시점의 손익구조

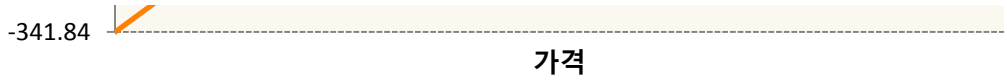


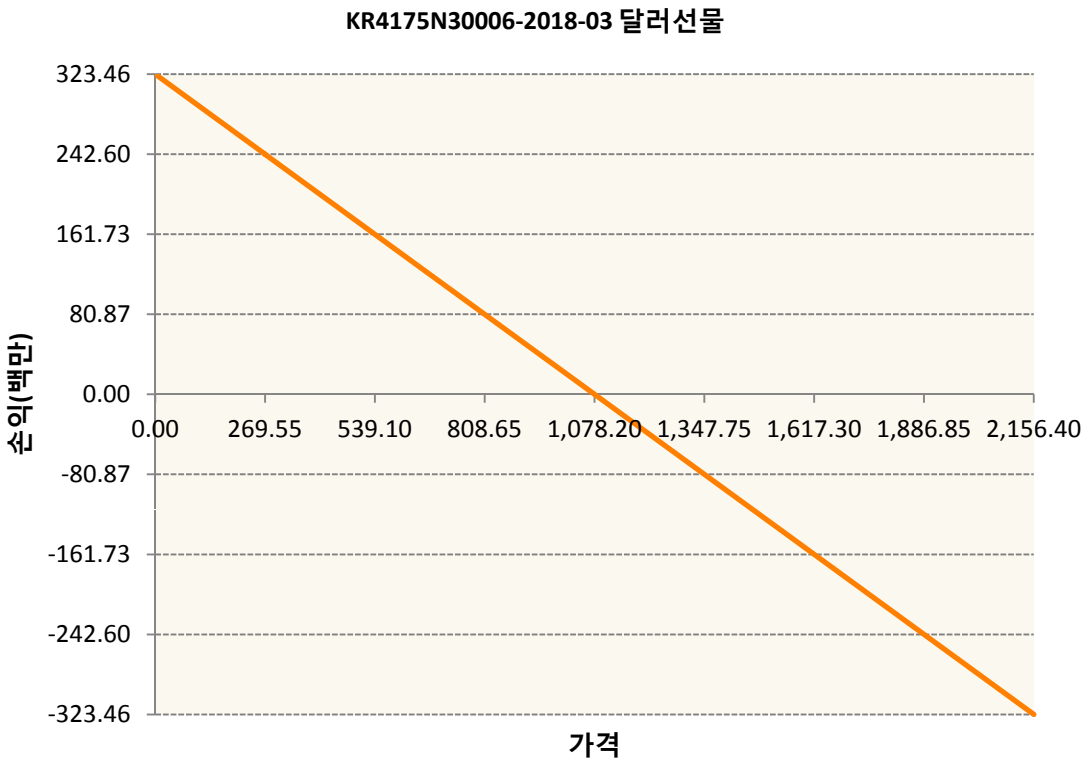


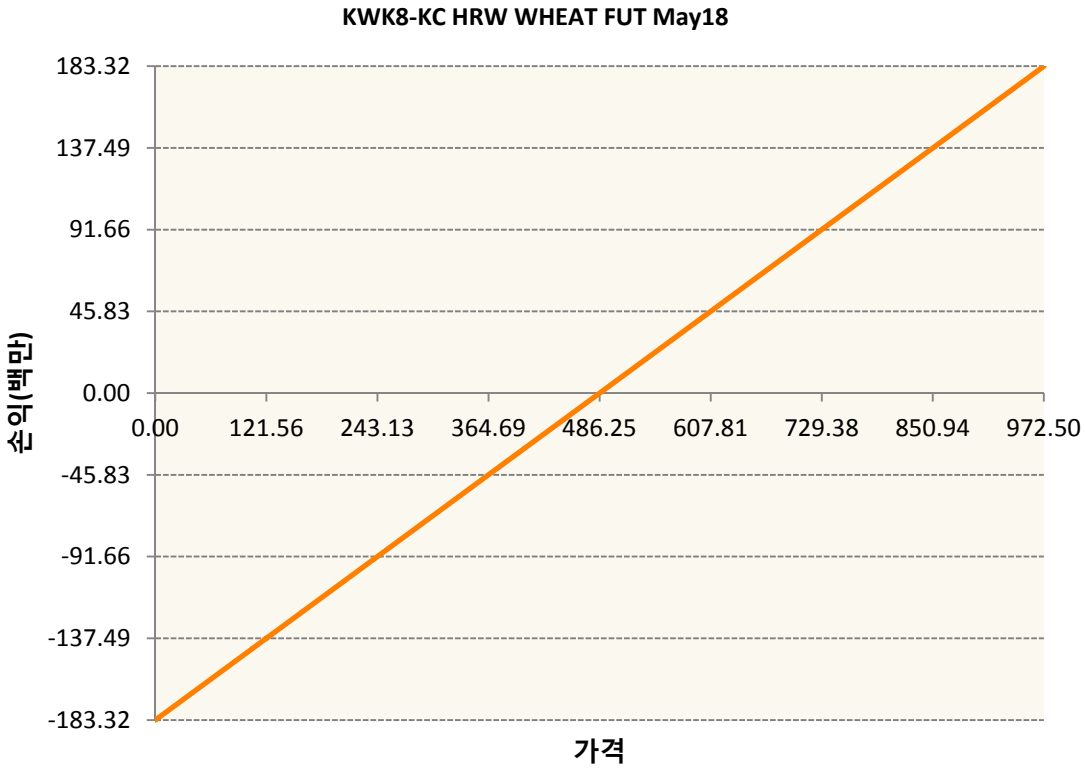

-433.96
-650.94
-867.91
가격


CTK8-COTTON NO.2 FUTR May18
214.02
160.52
107.01
53.51
0.00
-53.51
-107.01
-160.52
-214.02
손익(백만)
0.00
19.87
39.74
59.60
79.47
99.34
119.21
139.07
158.94
가격

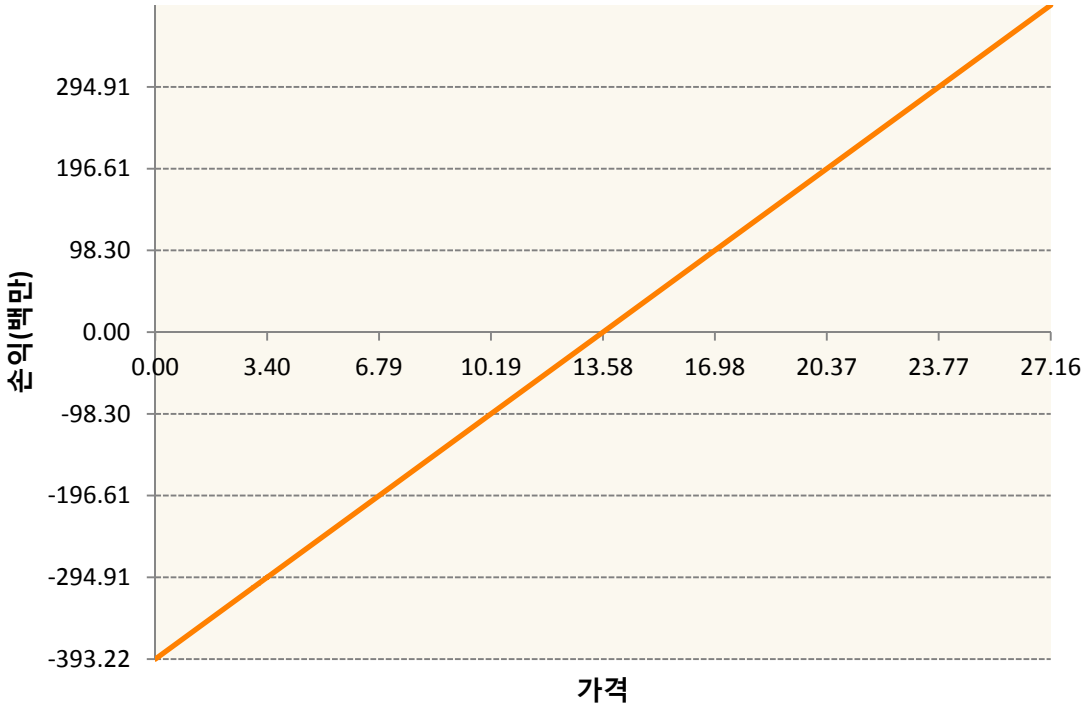

KCK8-COFFEE 'C' FUTURE May18
256.38
170.92
85.46
0.00
-85.46
-170.92
-256.38
손익(백만)
0.00
30.23
60.45
90.68
120.90
151.13
181.35
211.58
241.80


-341.84
가격

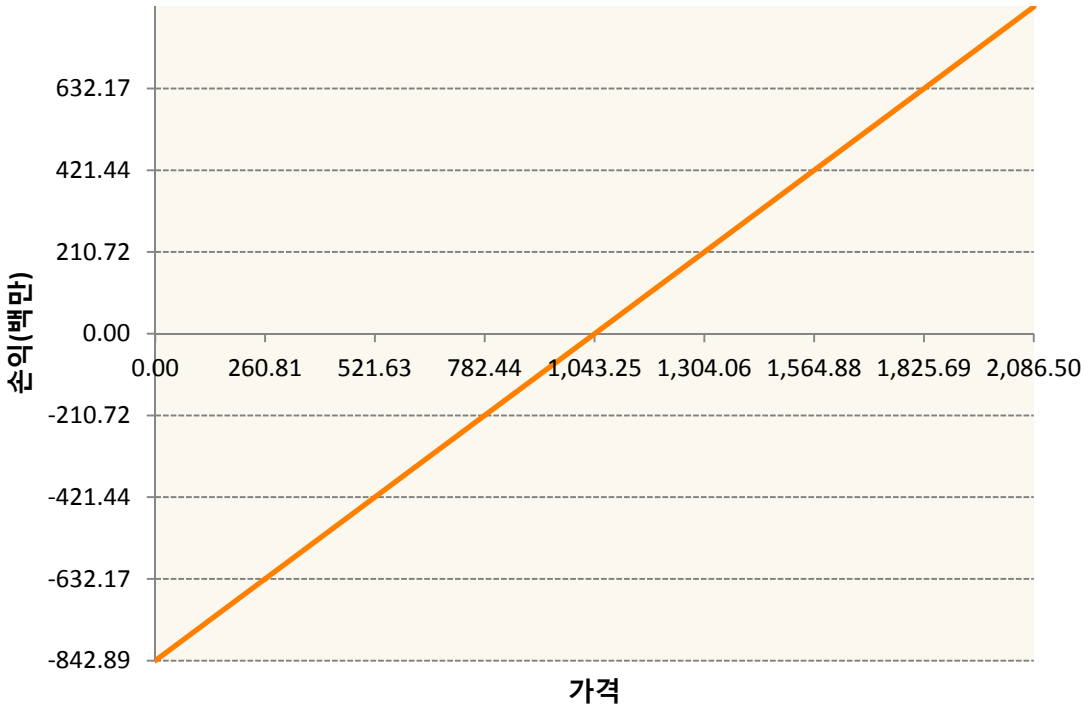

KR4175N30006-2018-03 달러선물
323.46
242.60
161.73
80.87
0.00
-80.87
-161.73
-242.60
-323.46
0.00
269.55
539.10
808.65
1,078.20
1,347.75
1,617.30
1,886.85
2,156.40
손익(백만)
가격


KWK8-KC HRW WHEAT FUT May18
183.32
137.49
91.66
45.83
0.00
-45.83
-91.66
-137.49
-183.32
0.00
121.56
243.13
364.69
486.25
607.81
729.38
850.94
972.50
손익(백만)
가격

SBK8-SUGAR #11 (WORLD) May18

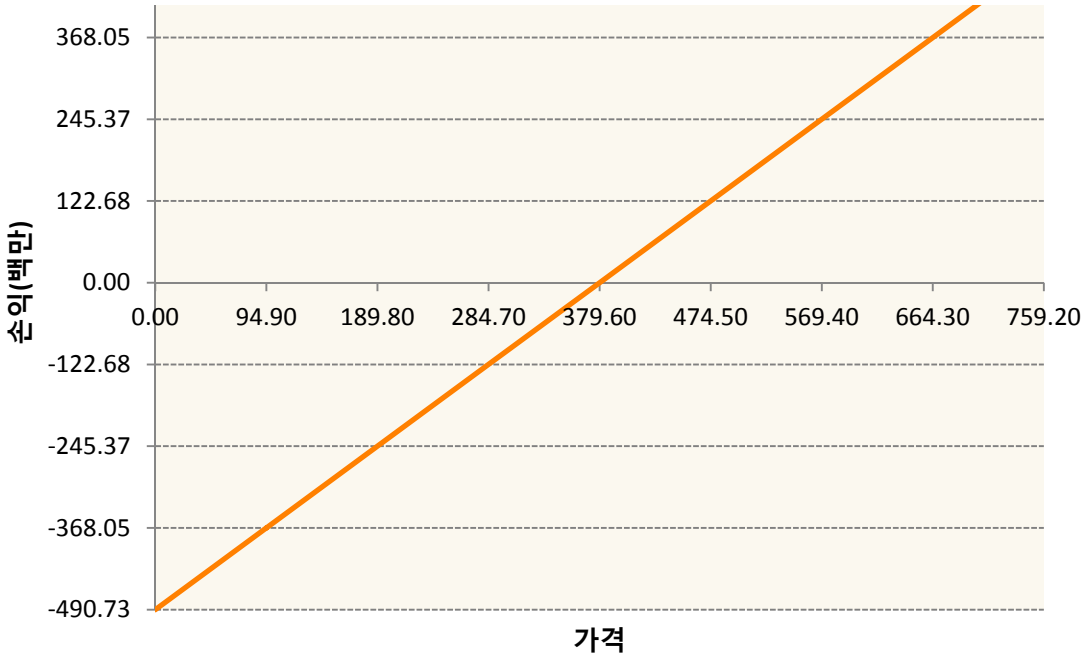


SK8-SOYBEAN FUTRUE May18

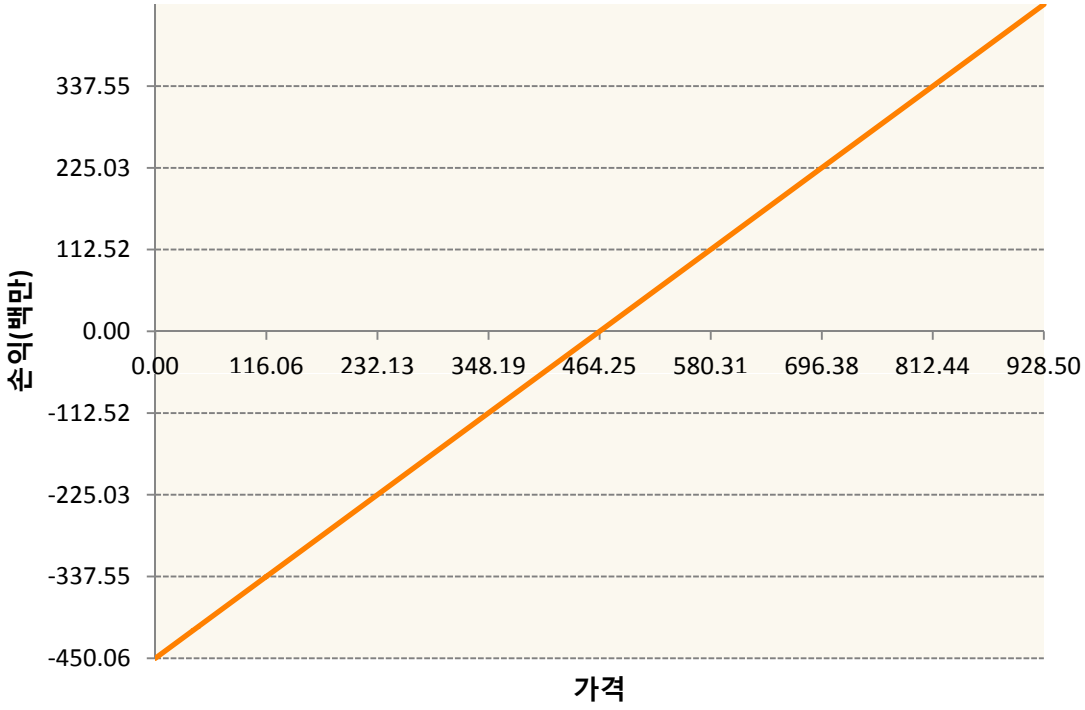


SMK8-SOYBEAN MEAL FUTR May18





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	36

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

308