공시일	2018-02-27
기준일	2018-02-26

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	2018-02-27
기준일	2018-02-26

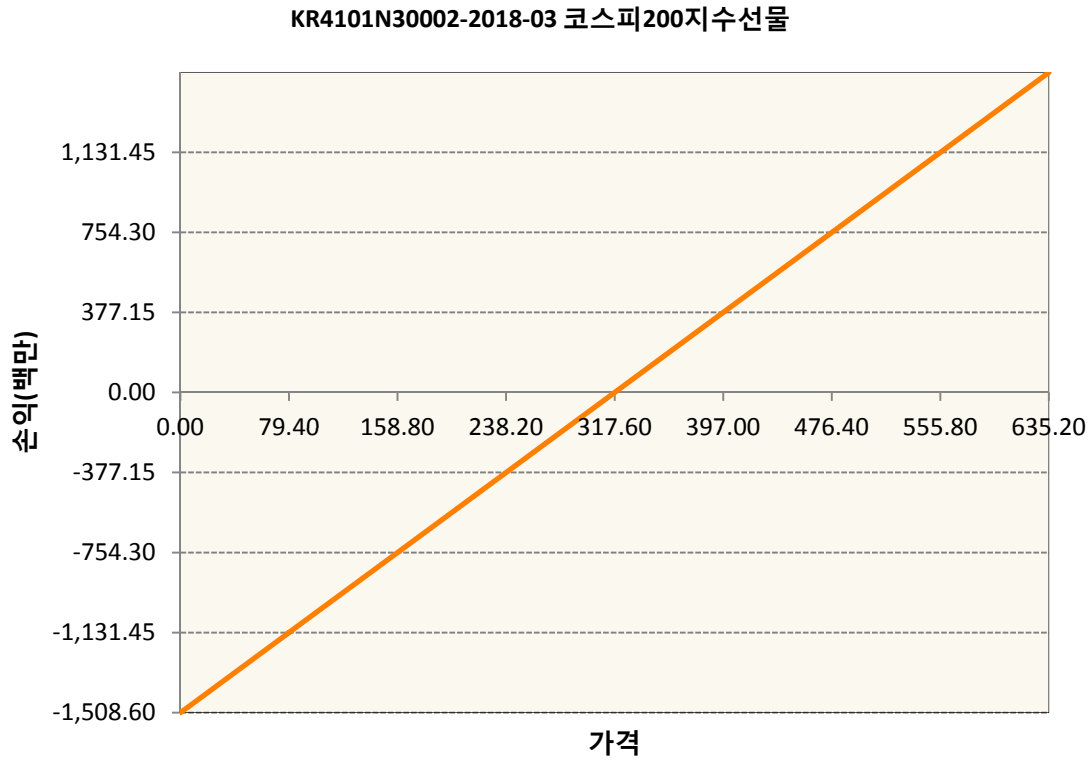
스마트인덱스모

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	1,509	0	1,509	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101N30(2018-03 코스피200지수선물							121
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-121	-121	-121	-121	-121	-121	-121
-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%	121	121	121	121	121	121	121

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

81

공시일	2018-02-27
기준일	2018-02-26

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	1,122

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

411

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2018-02-27
기준일	2018-02-26

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	403

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

399

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2018-02-27
기준일	2018-02-26

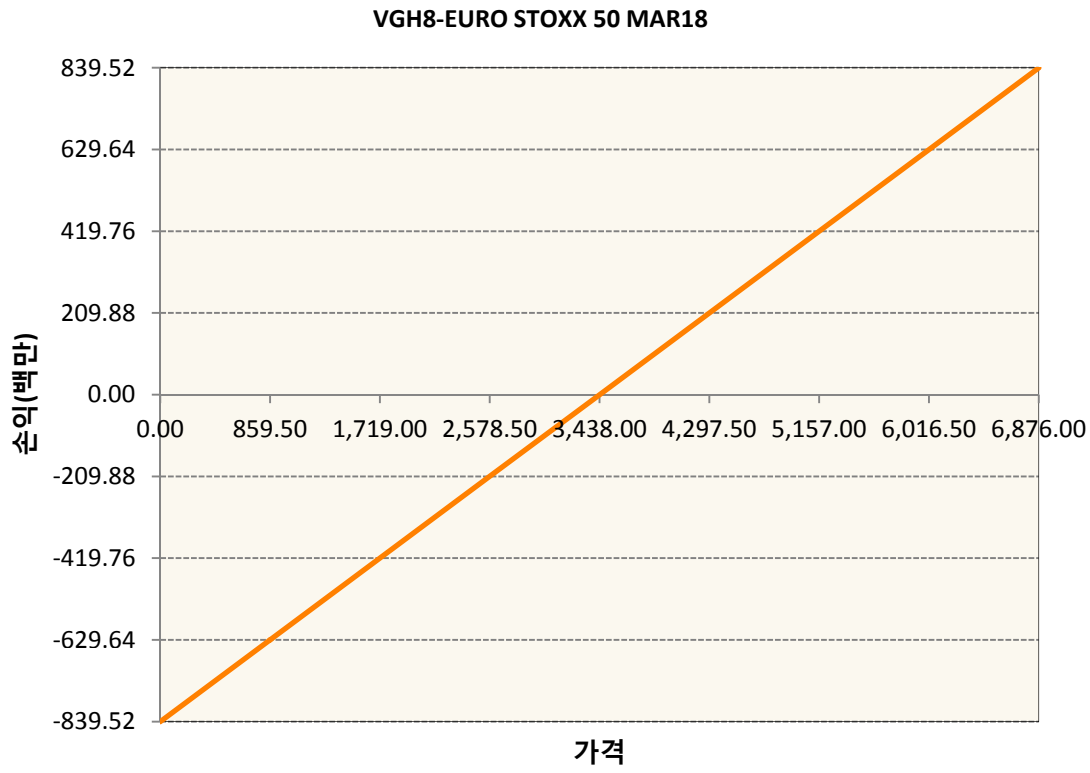
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	840	0	840	

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	2018-02-27
기준일	2018-02-26

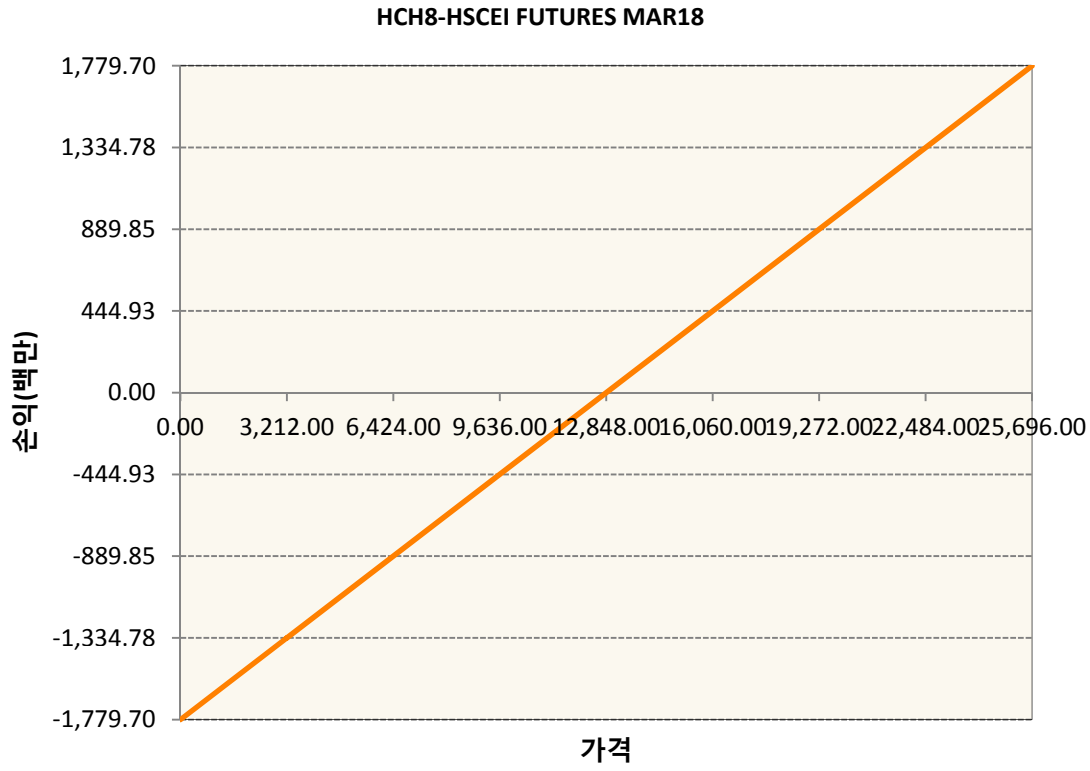
차이나인덱스모(주식-파생형)

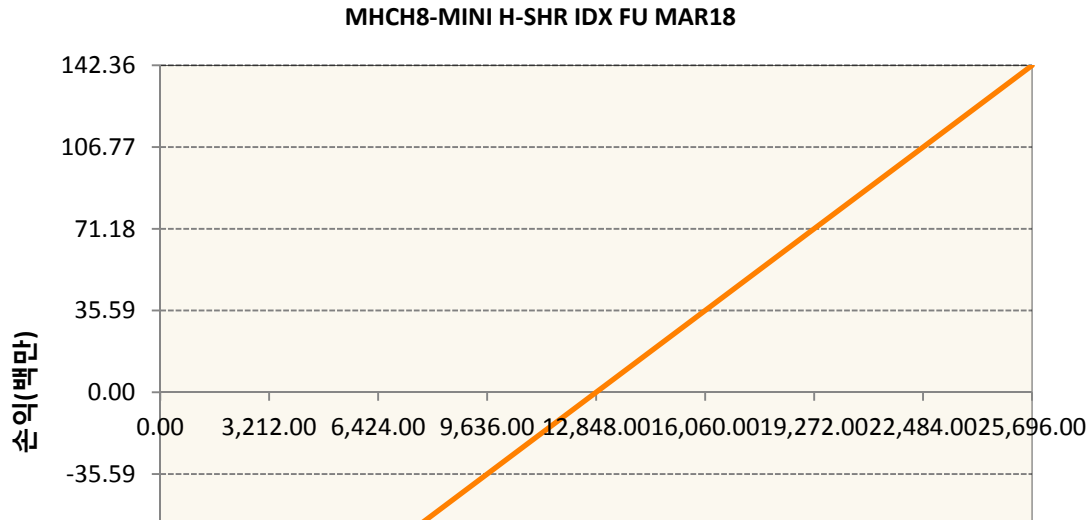
1. 계약금액

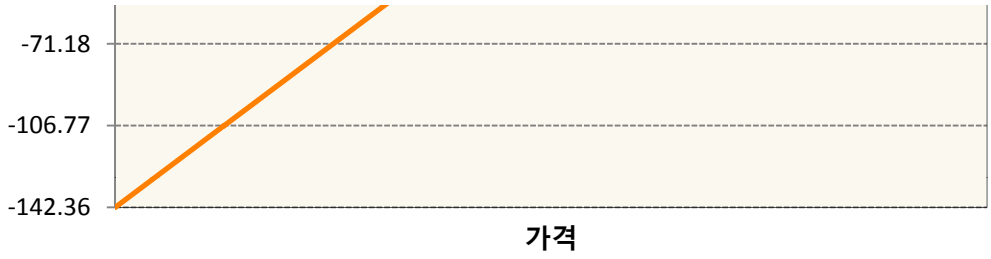
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,922	0	1,922	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCH8	HSCEI FUTURES MAR18	142
MHCH8	MINI H-SHR IDX FU MAR18	11

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	132

공시일	2018-02-27
기준일	2018-02-26

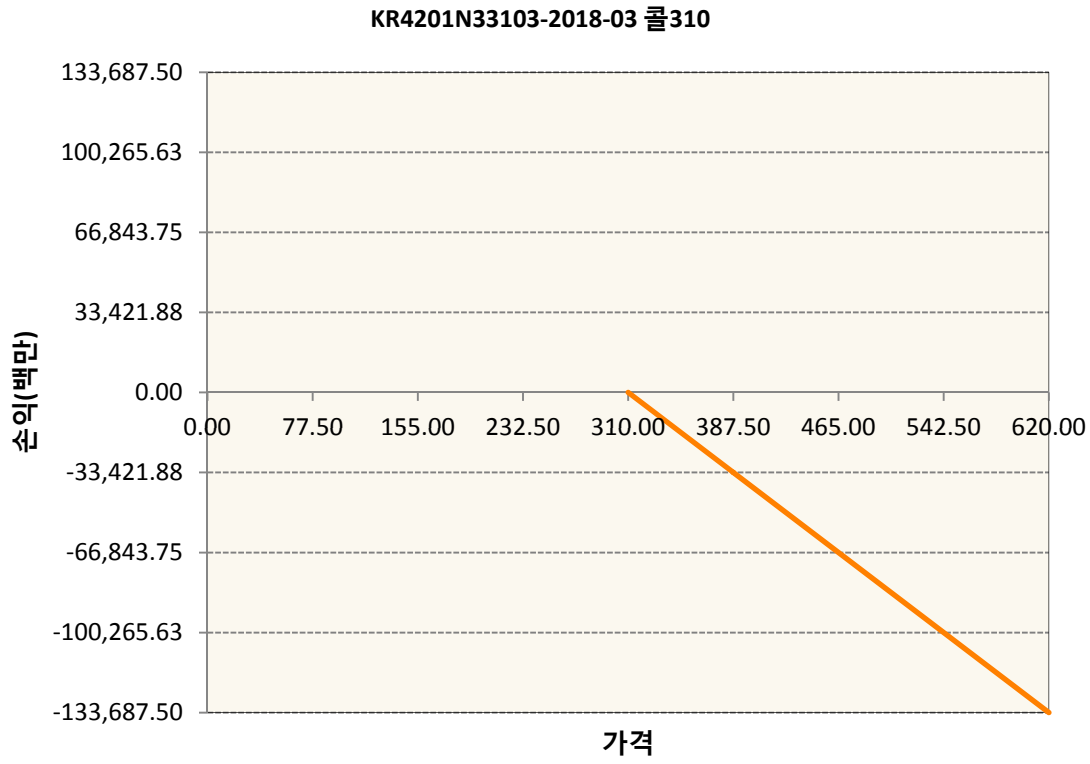
커버드콜모(주식혼합-파생형)

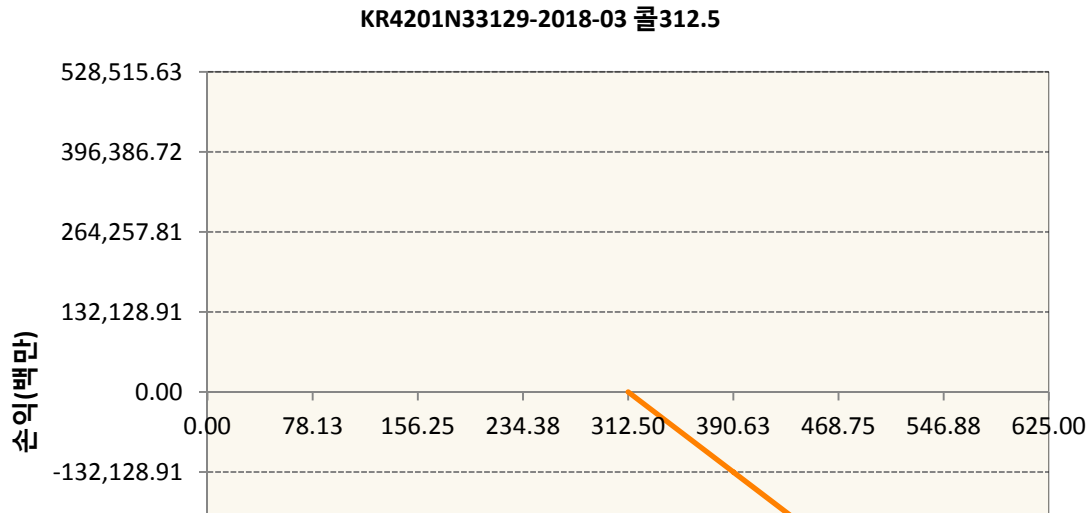
1. 계약금액

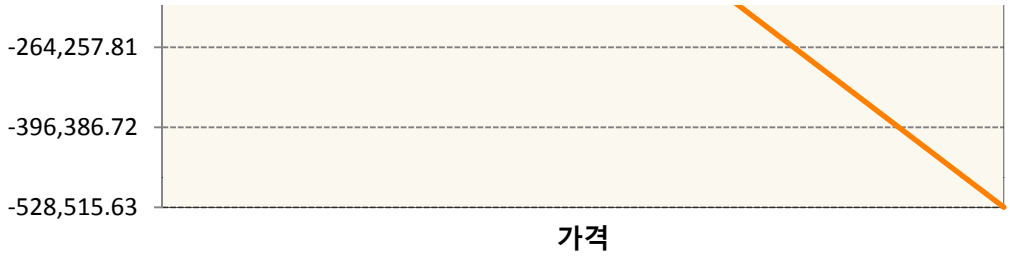
(단위:백만원)

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



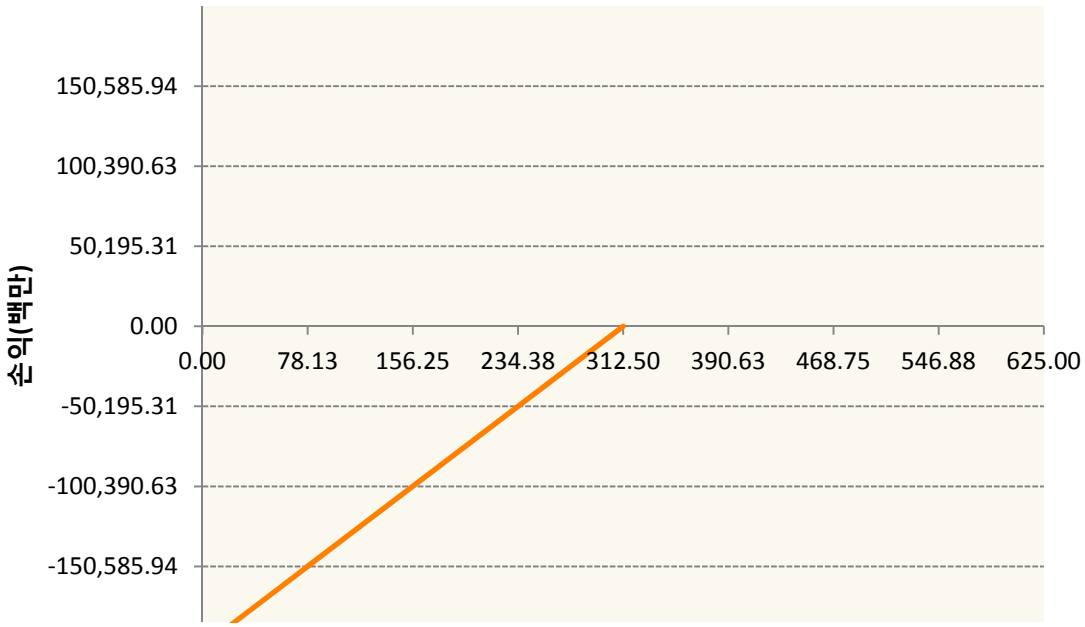




KR4301N33101-2018-03 풋310



KR4301N33127-2018-03 풋312.5





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201N3312018-03 콜310							9,920
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	4,243	4,198	4,140	4,070	3,988	3,895	3,793
-5.33%	3,898	3,768	3,629	3,481	3,327	3,168	3,005
-2.67%	2,763	2,567	2,372	2,176	1,980	1,784	1,588
0%	496	337	171	0	-175	-353	-534
2.67%	-2,651	-2,724	-2,813	-2,914	-3,027	-3,149	-3,280
5.33%	-6,183	-6,203	-6,234	-6,276	-6,330	-6,395	-6,471
8.00%	-9,814	-9,817	-9,825	-9,837	-9,857	-9,884	-9,920
KR4201N3312018-03 콜312.5							37,655
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	13,955	13,840	13,678	13,469	13,215	12,918	12,582
-5.33%	13,087	12,681	12,226	11,730	11,200	10,641	10,060
-2.67%	9,745	9,013	8,273	7,528	6,779	6,026	5,270
0%	2,170	1,458	734	0	-741	-1,489	-2,241
2.67%	-9,333	-9,724	-10,169	-10,658	-11,186	-11,745	-12,331
5.33%	-22,887	-23,014	-23,192	-23,420	-23,697	-24,020	-24,384
8.00%	-37,064	-37,090	-37,138	-37,215	-37,325	-37,471	-37,655
KR4301N3312018-03 풋310							14,456
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-14,367	-14,369	-14,375	-14,385	-14,401	-14,425	-14,456
-5.33%	-7,424	-7,488	-7,567	-7,660	-7,766	-7,883	-8,010
-2.67%	-1,812	-2,026	-2,241	-2,456	-2,671	-2,886	-3,102
0%	375	264	138	0	-148	-305	-470
2.67%	628	618	600	572	535	486	426
5.33%	635	635	634	633	629	622	611
8.00%	635	635	635	635	635	635	634
KR4301N3312018-03 풋312.5							12,364
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-12,329	-12,330	-12,331	-12,335	-12,341	-12,350	-12,364
-5.33%	-6,921	-6,945	-6,979	-7,024	-7,079	-7,143	-7,216
-2.67%	-2,090	-2,233	-2,380	-2,530	-2,683	-2,838	-2,994
0%	400	273	139	0	-144	-291	-441
2.67%	835	815	785	746	696	637	568

5.33%	854	853	851	848	841	830	814
8.00%	854	854	854	854	854	853	851

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

78,261

공시일	2018-02-27
기준일	2018-02-26

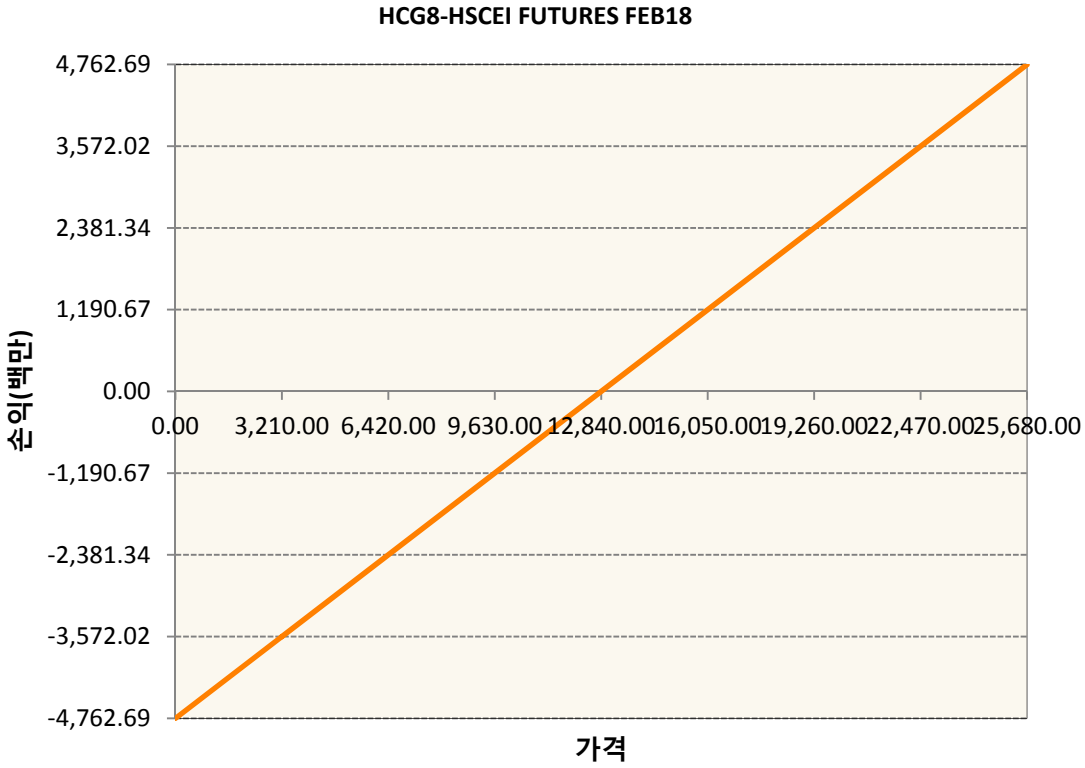
홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생

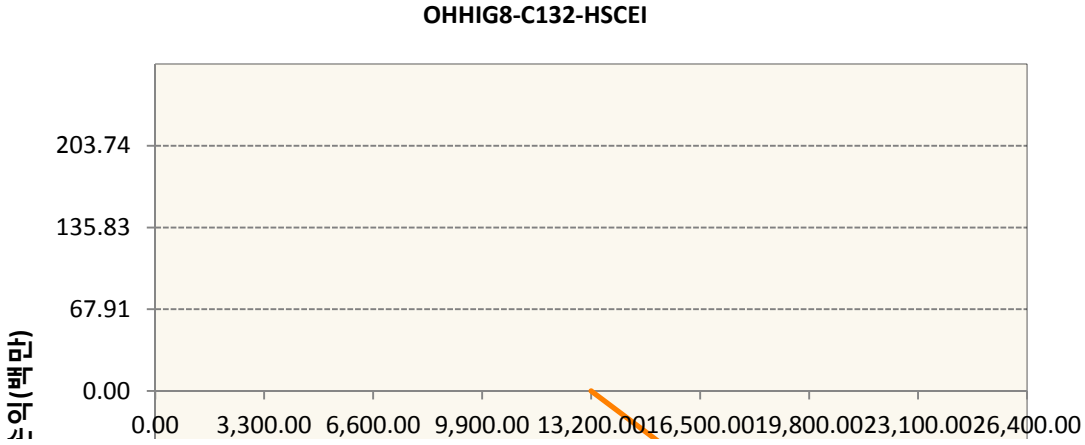
1. 계약금액

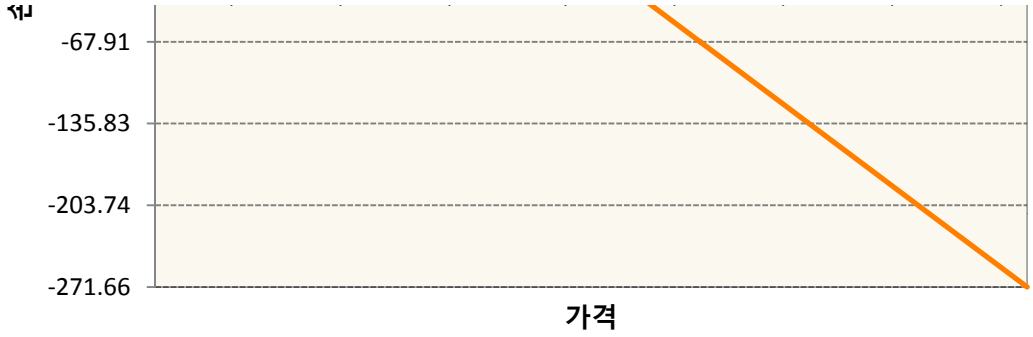
(단위:백만원)

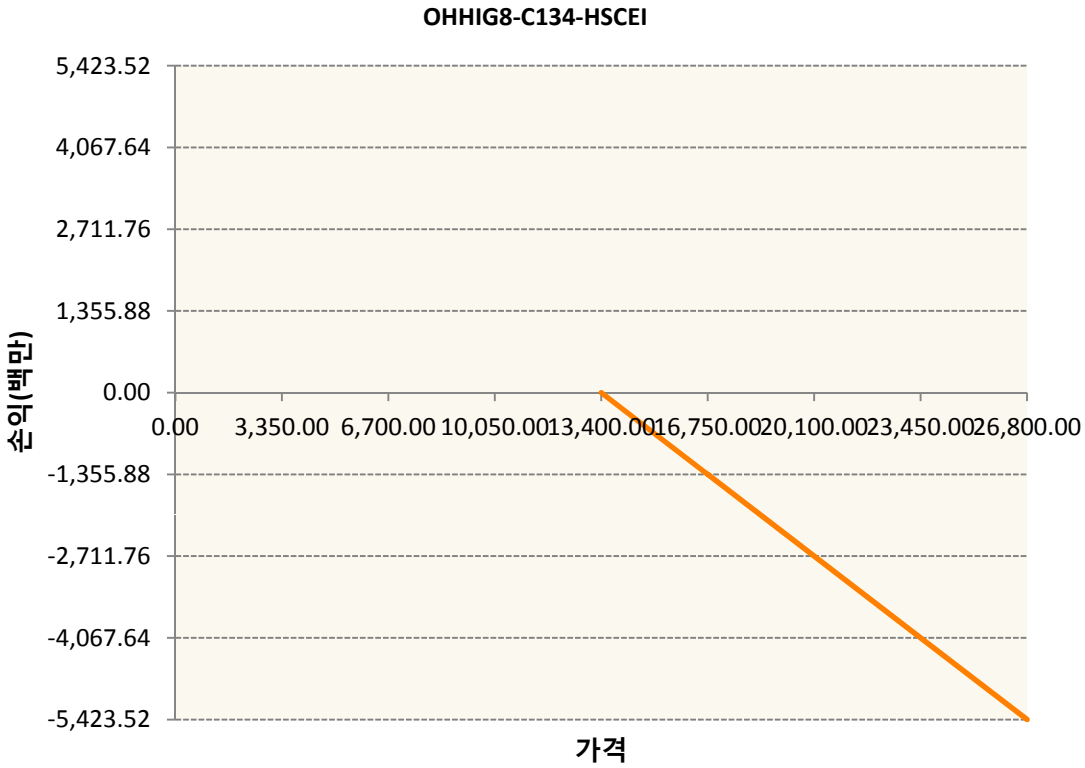
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	4,763	0	4,763	장내
누계	유가증권	옵션	0	11,390	-11,390	장내

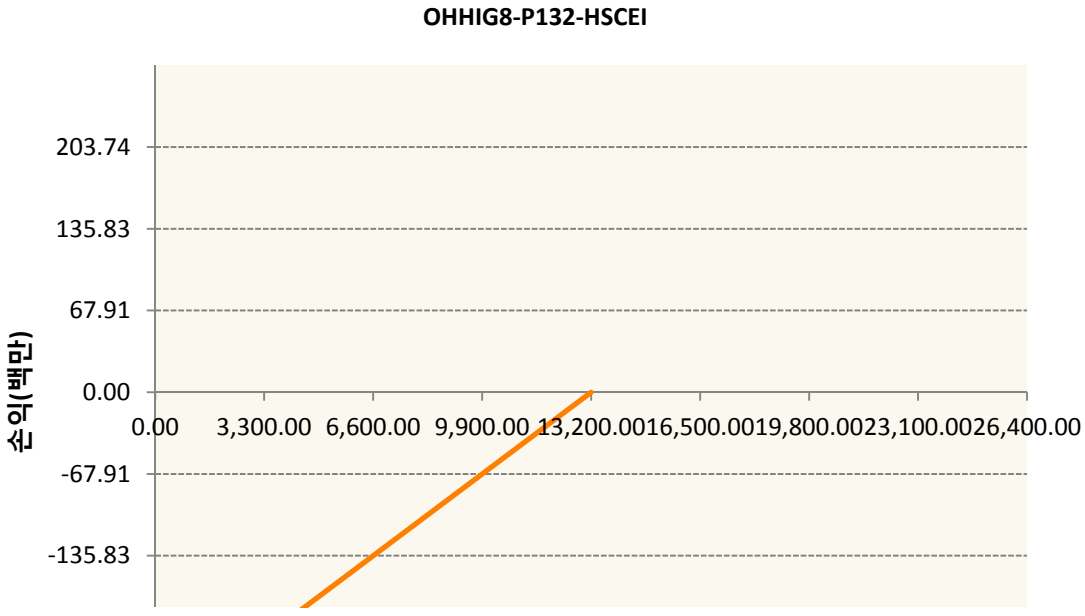
2. 만기시점의 손익구조

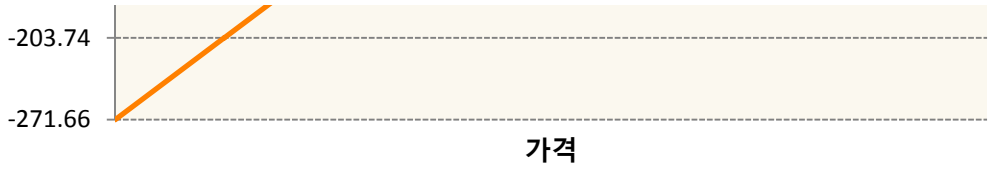


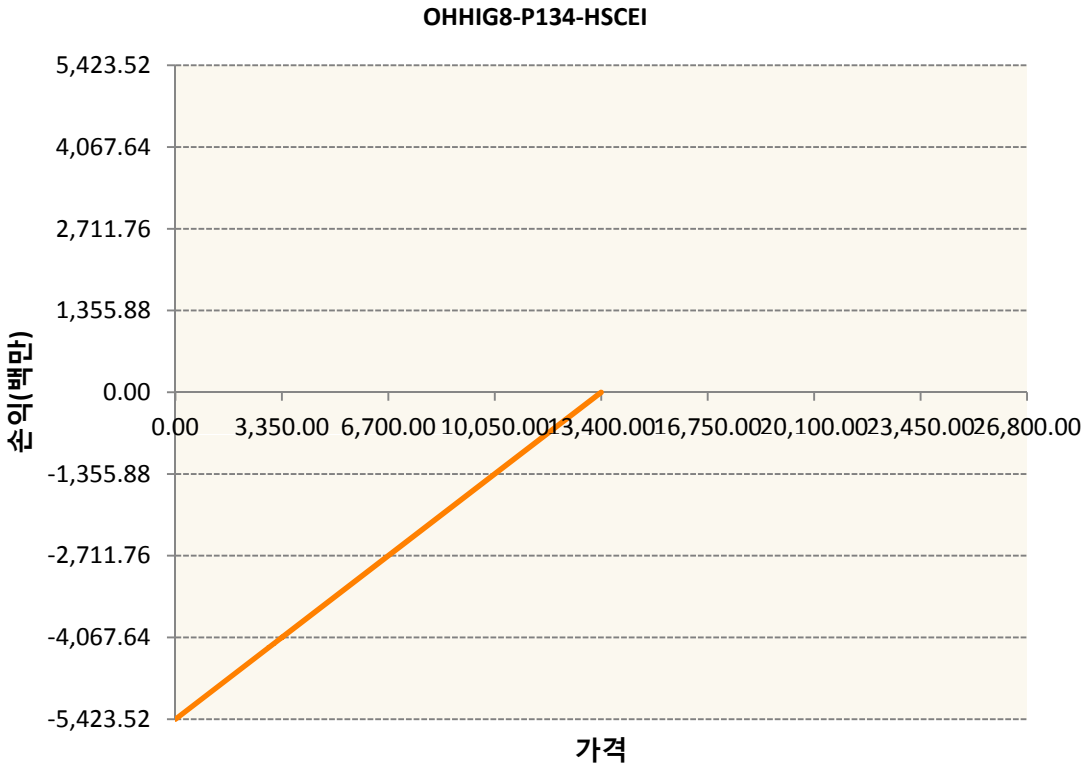



-67.91
-135.83
-203.74
-271.66
가격


OHHIG8-C134-HSCEI
5,423.52
4,067.64
2,711.76
1,355.88
0.00
-1,355.88
-2,711.76
-4,067.64
-5,423.52
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
203.74
135.83
67.91
0.00
-67.91
-135.83
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	434
OHHIG8-P1: HSCEI	22
OHHIG8-P1: HSCEI	434

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,110

공시일	2018-02-27
기준일	2018-02-26

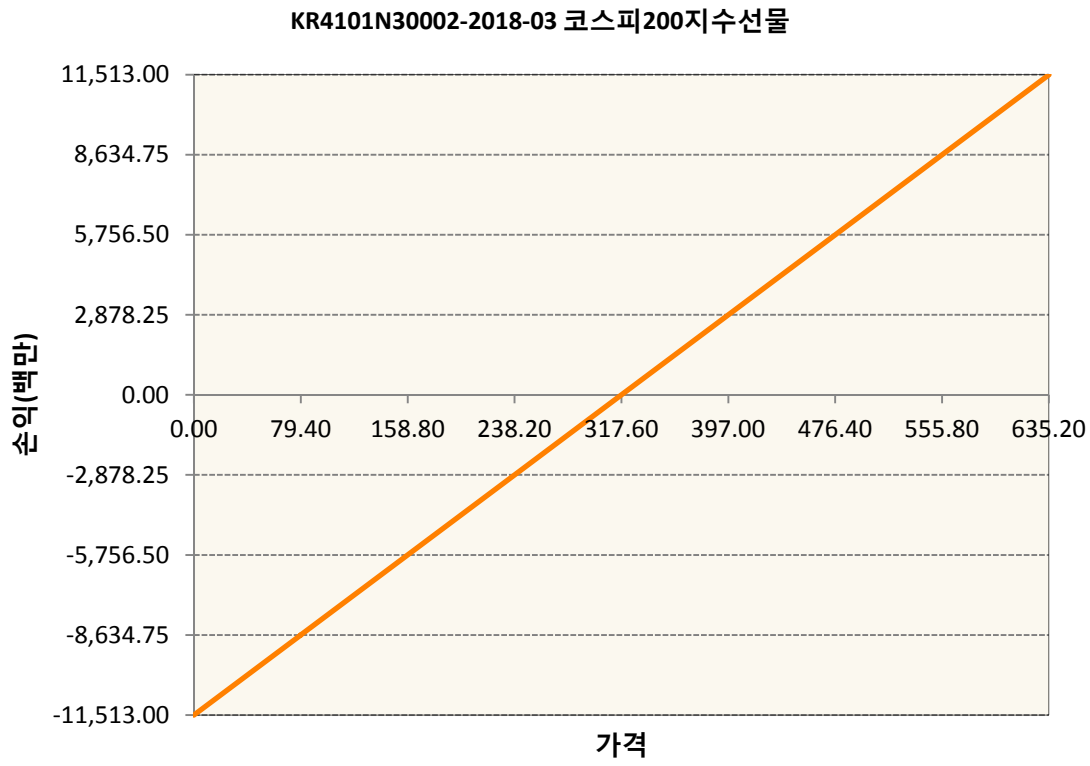
코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼

1. 계약금액

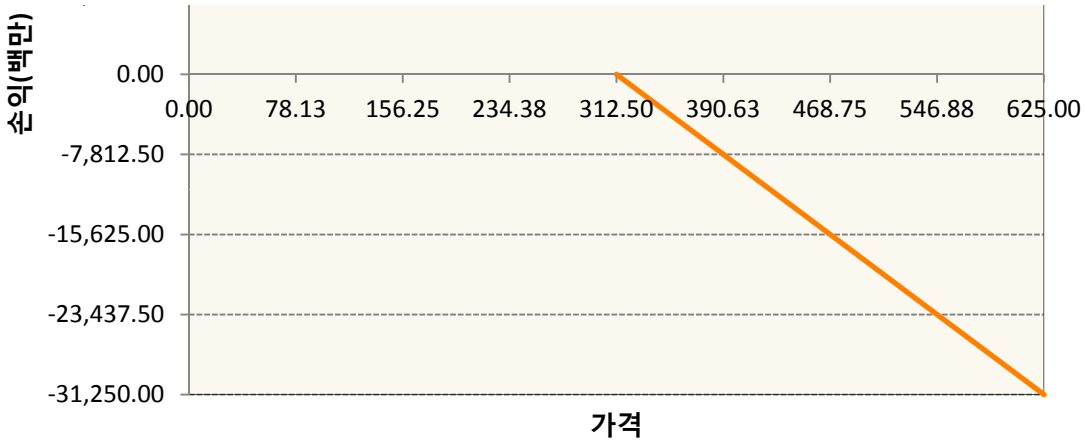
(단위:백만원)

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	11,513	0	11,513	장내
누계	유가증권	스왑	56,200	0	56,200	장외
누계	유가증권	옵션	0	56,094	-56,094	장내

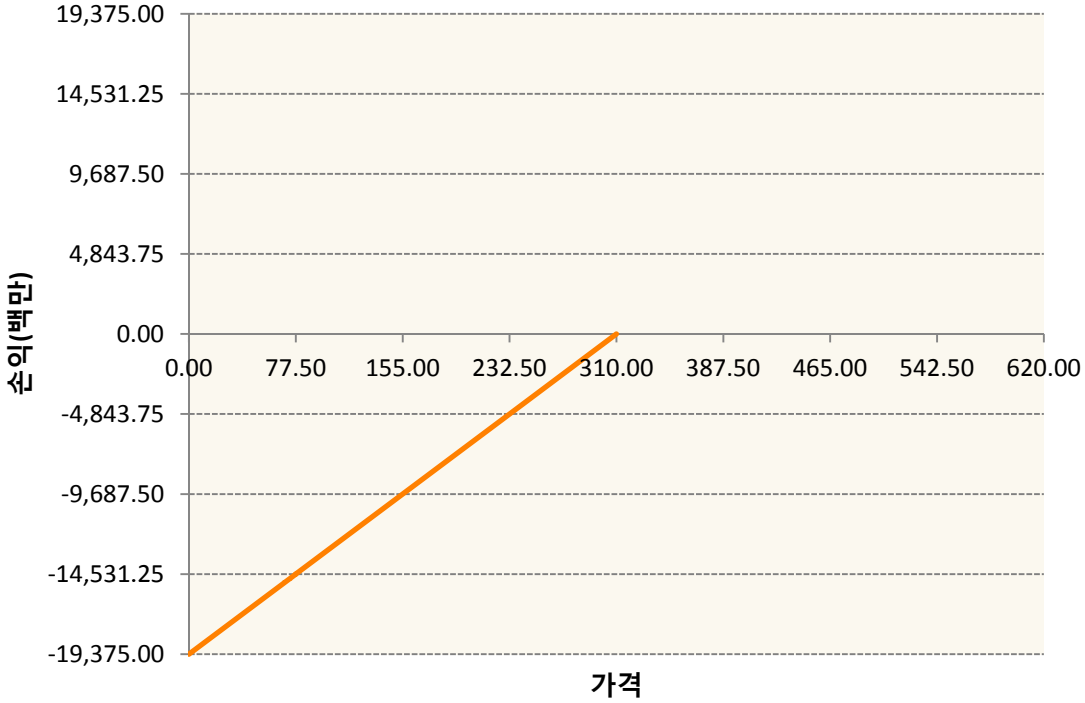
2. 만기시점의 손익구조



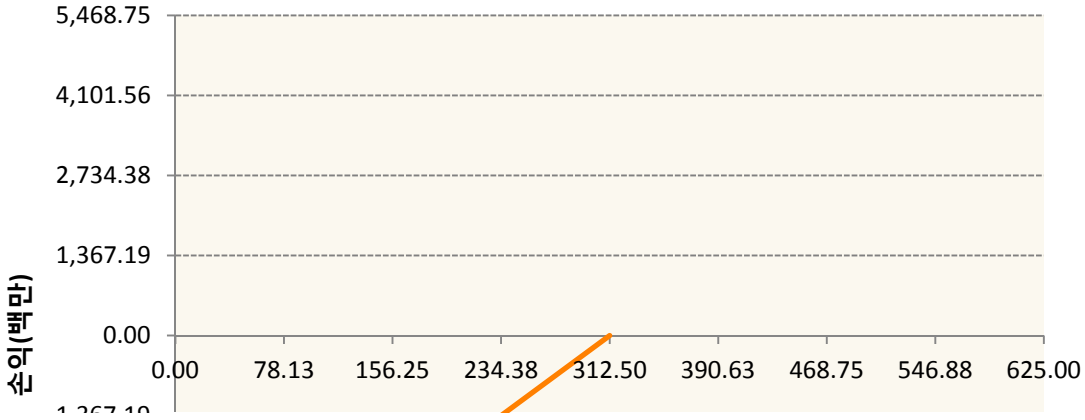




KR4301N33101-2018-03 풋310



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						920
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-920	-920	-920	-920	-920	-920	-920
-5.33%	-614	-614	-614	-614	-614	-614	-614
-2.67%	-307	-307	-307	-307	-307	-307	-307
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	307	307	307	307	307	307	307
5.33%	614	614	614	614	614	614	614
8.00%	920	920	920	920	920	920	920
	KR4201N331 2018-03 콜312.5						2,226
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	825	818	809	796	781	764	744
-5.33%	774	750	723	694	662	629	595
-2.67%	576	533	489	445	401	356	312
0%	128	86	43	0	-44	-88	-132
2.67%	-552	-575	-601	-630	-661	-694	-729
5.33%	-1,353	-1,361	-1,371	-1,385	-1,401	-1,420	-1,442
8.00%	-2,192	-2,193	-2,196	-2,200	-2,207	-2,216	-2,226
	KR4301N331 2018-03 풋310						1,085

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,079	-1,079	-1,079	-1,080	-1,081	-1,083	-1,085
-5.33%	-557	-562	-568	-575	-583	-592	-601
-2.67%	-136	-152	-168	-184	-201	-217	-233
0%	28	20	10	0	-11	-23	-35
2.67%	47	46	45	43	40	36	32
5.33%	48	48	48	47	47	47	46
8.00%	48	48	48	48	48	48	48
	KR4301N3312018-03 풋312.5						337

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-336	-336	-336	-336	-336	-336	-337
-5.33%	-189	-189	-190	-191	-193	-195	-197
-2.67%	-57	-61	-65	-69	-73	-77	-82
0%	11	7	4	0	-4	-8	-12
2.67%	23	22	21	20	19	17	15
5.33%	23	23	23	23	23	23	22
8.00%	23	23	23	23	23	23	23

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

8,830

공시일	2018-02-27
기준일	2018-02-26

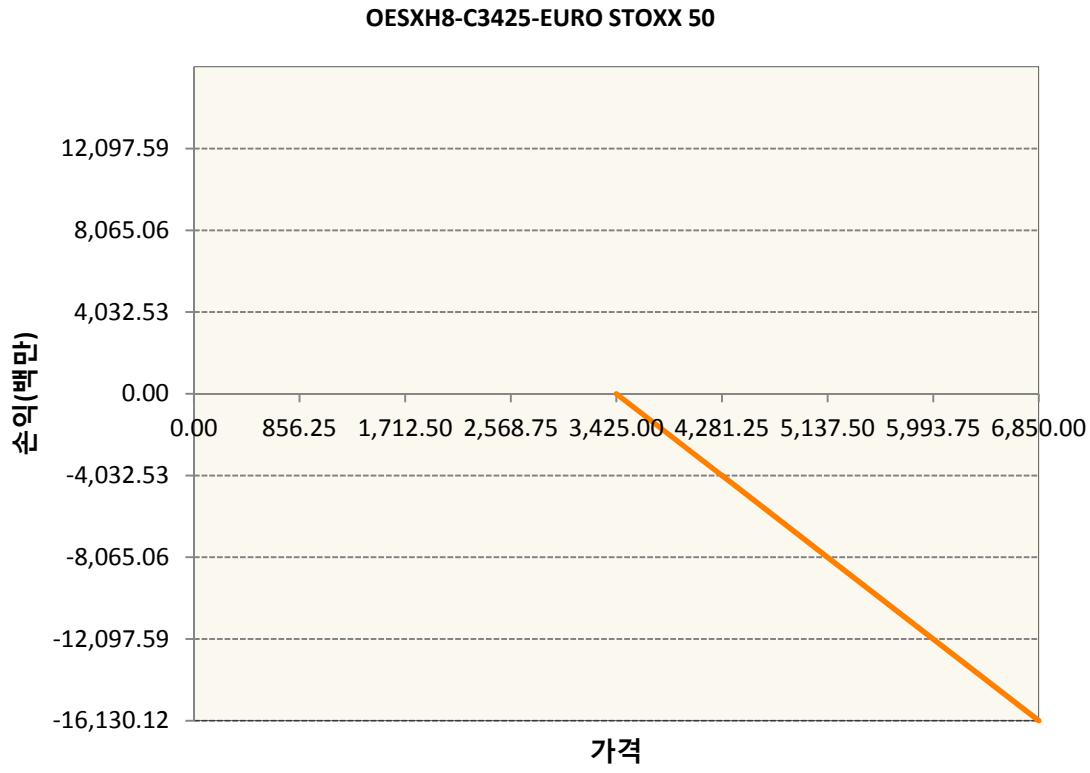
유로커버드콜모(주식혼합-파생형

1. 계약금액

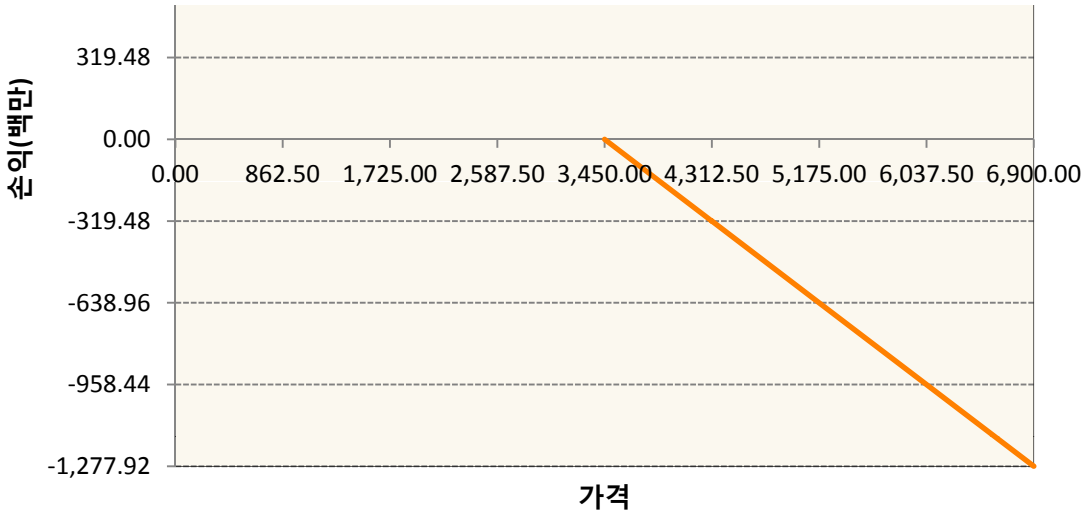
(단위:백만원)

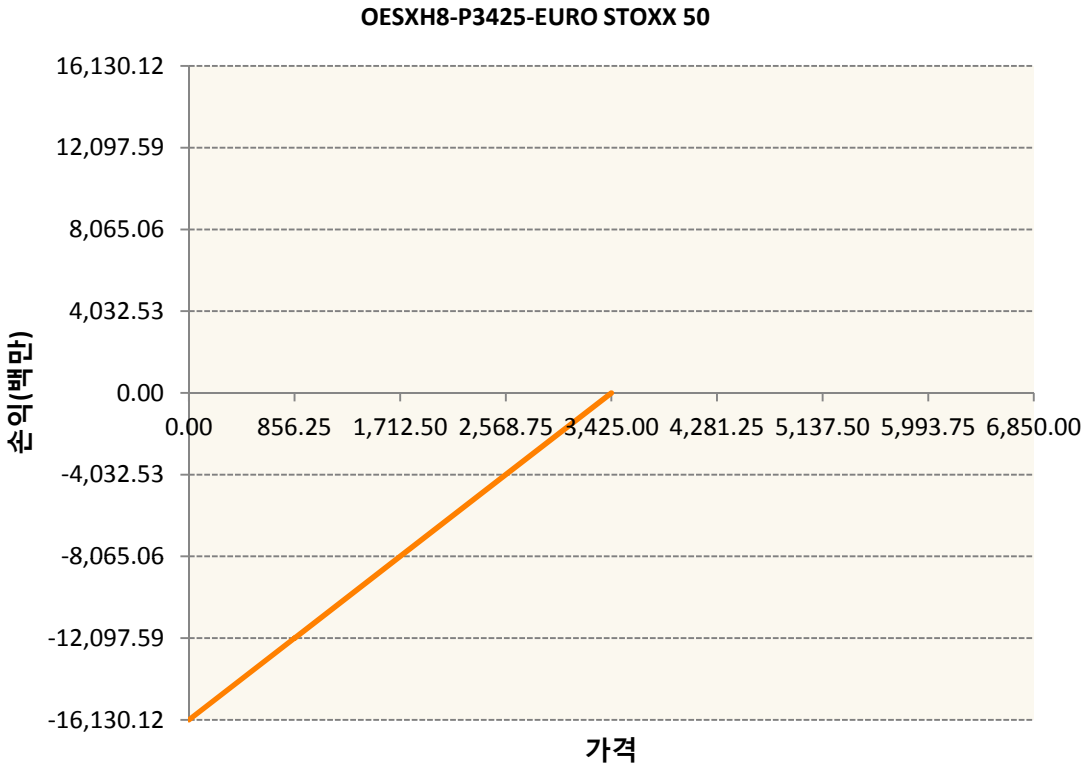
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	9,299	0	9,299	
누계	유가증권	스왑	99,214	0	99,214	장외
누계	유가증권	옵션	0	34,816	-34,816	장내
누계	지수	스왑	52,915	0	52,915	장외

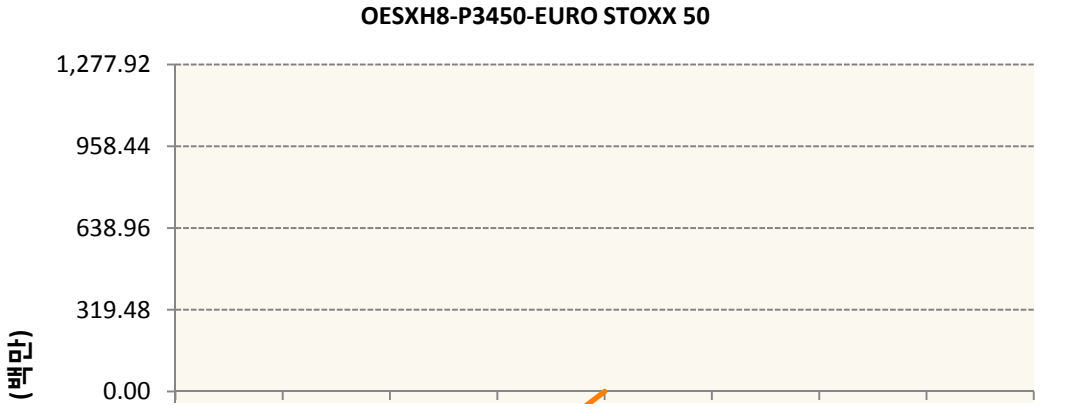
2. 만기시점의 손익구조

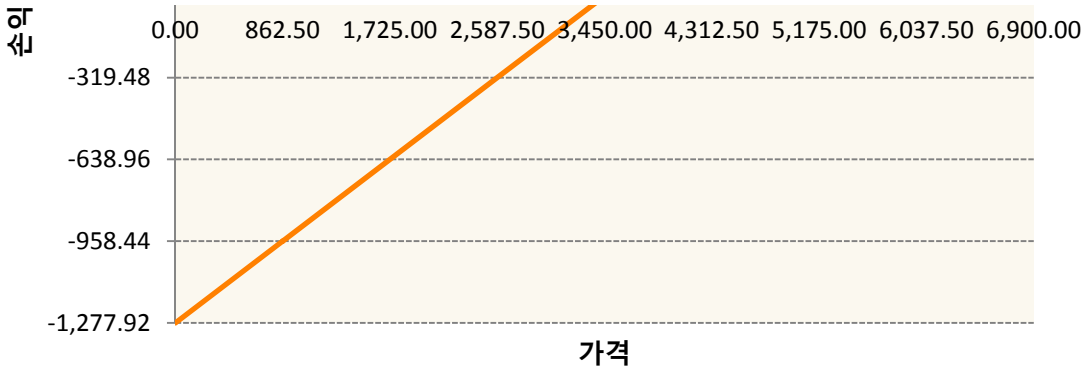


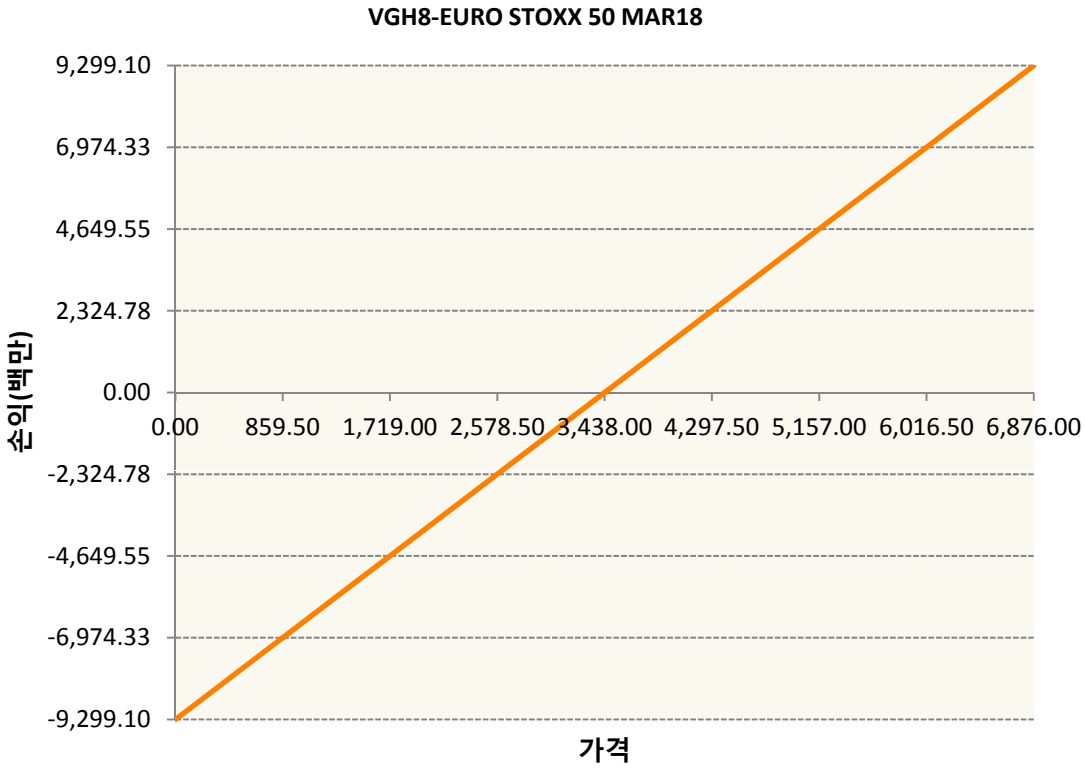



319.48
0.00
-319.48
-638.96
-958.44
-1,277.92
0.00
862.50
1,725.00
2,587.50
3,450.00
4,312.50
5,175.00
6,037.50
6,900.00
손익(백만)
가격


OESXH8-P3425-EURO STOXX 50
16,130.12
12,097.59
8,065.06
4,032.53
0.00
-4,032.53
-8,065.06
-12,097.59
-16,130.12
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
1,277.92
958.44
638.96
319.48
0.00
(백만)





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)	(단위:백만원)
260105SGPX SG EURO Covered CALL STRATEGY - 994.569	211
260105SQPX SG EURO Covered CALL STRATEGY	396
OESXH8-C34 EURO STOXX 50	1,290
OESXH8-C34 EURO STOXX 50	102
OESXH8-P34 EURO STOXX 50	1,290
OESXH8-P34 EURO STOXX 50	102
VGH8 EURO STOXX 50 MAR18	744

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

2,441

공시일	2018-02-27
기준일	2018-02-26

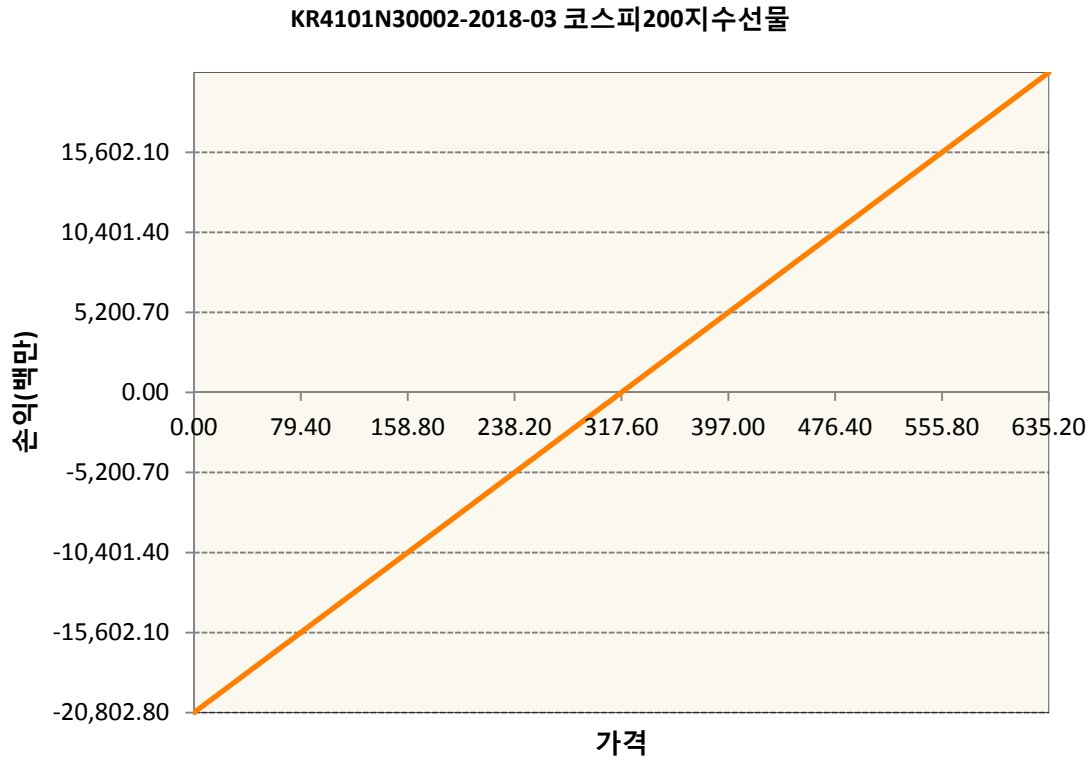
ETF스마트레버리지목표전환형8호

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	20,803	0	20,803	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101N30(2018-03 코스피200지수선물							1,663
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,663	-1,663	-1,663	-1,663	-1,663	-1,663	-1,663
-5.33%	-1,109	-1,109	-1,109	-1,109	-1,109	-1,109	-1,109
-2.67%	-554	-554	-554	-554	-554	-554	-554
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	554	554	554	554	554	554	554
5.33%	1,109	1,109	1,109	1,109	1,109	1,109	1,109
8.00%	1,663	1,663	1,663	1,663	1,663	1,663	1,663

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

1,116

공시일	2018-02-27
기준일	2018-02-26

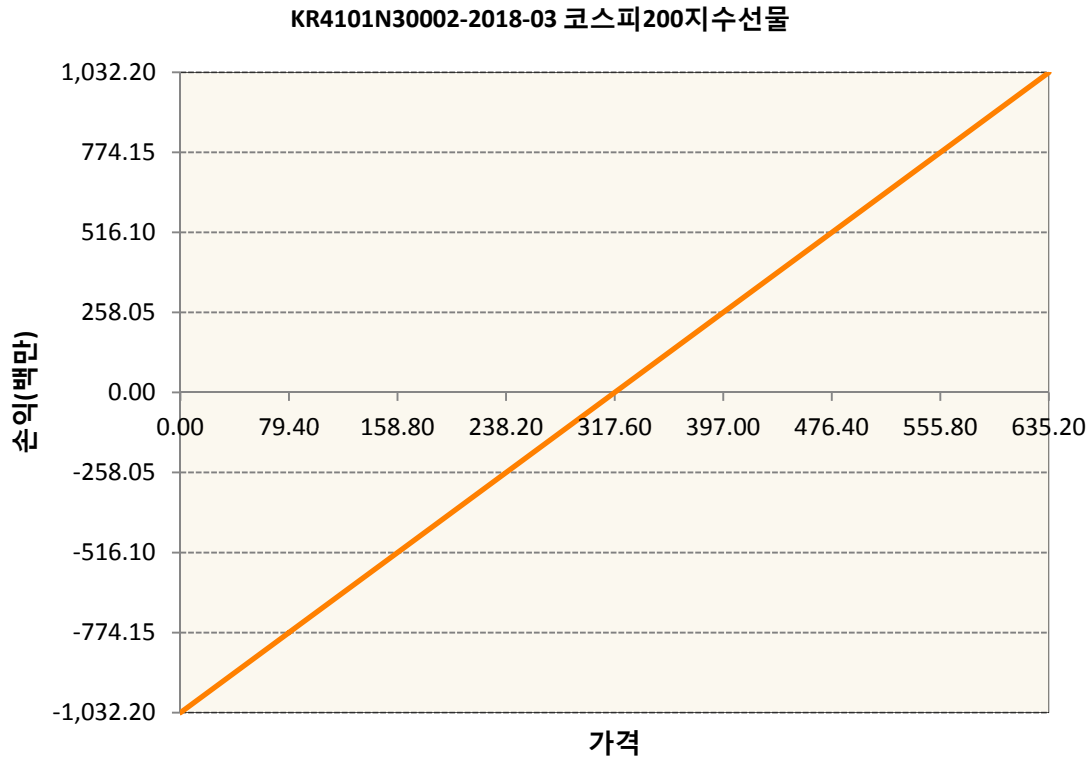
ETF스마트레버리지목표전환형9호

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							83
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-83	-83	-83	-83	-83	-83	-83
-5.33%	-55	-55	-55	-55	-55	-55	-55
-2.67%	-28	-28	-28	-28	-28	-28	-28
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	28	28	28	28	28	28	28
5.33%	55	55	55	55	55	55	55
8.00%	83	83	83	83	83	83	83

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

55

공시일	2018-02-27
기준일	2018-02-26

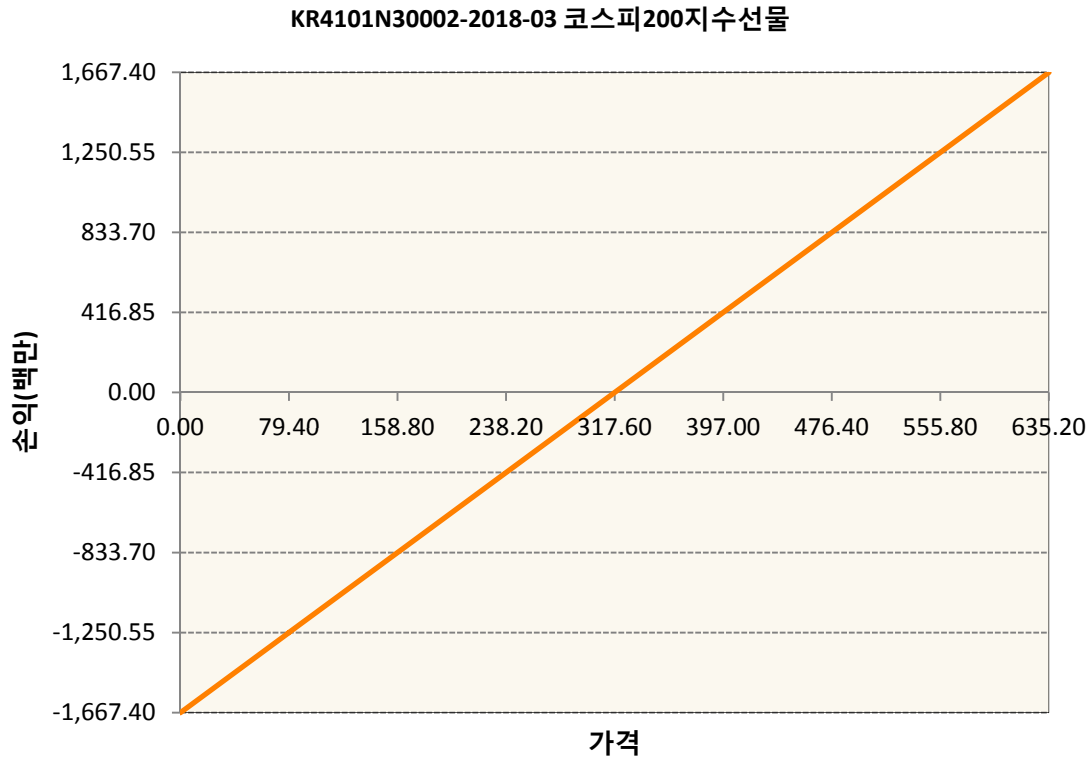
ETF스마트레버리지목표전환형10

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	2018-02-27
기준일	2018-02-26

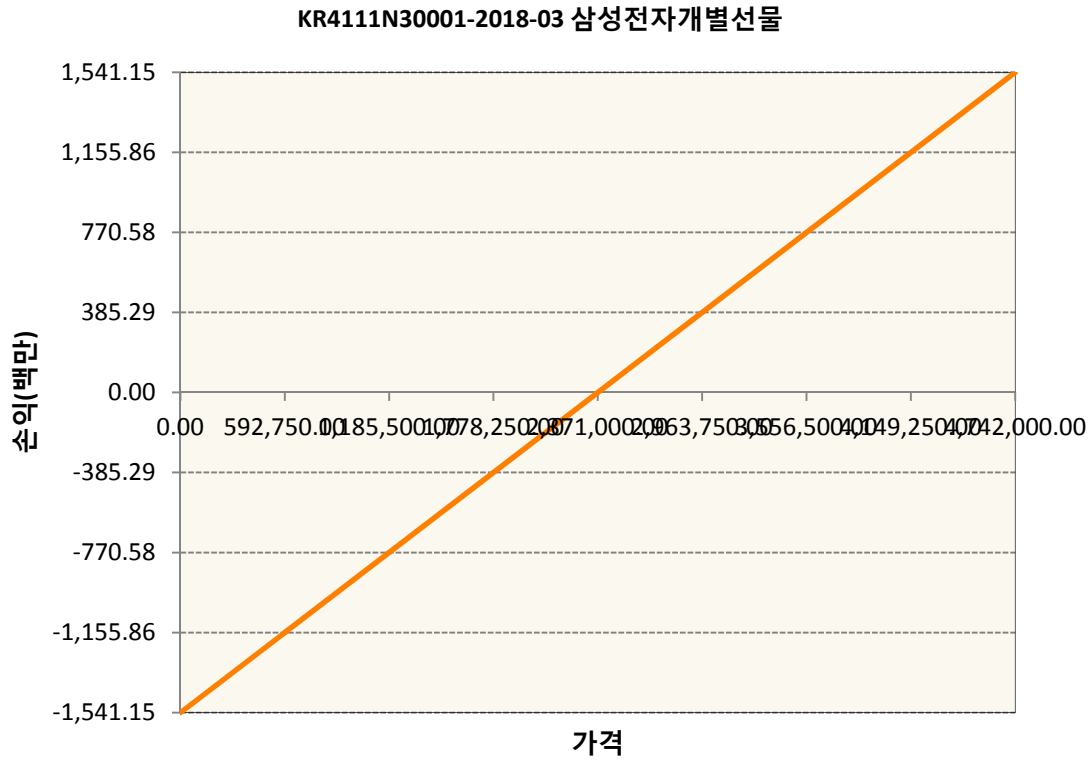
스마트KRX300인덱스1호(주식-파

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	1,541	0	1,541	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)

147

공시일	2018-02-27
기준일	2018-02-26

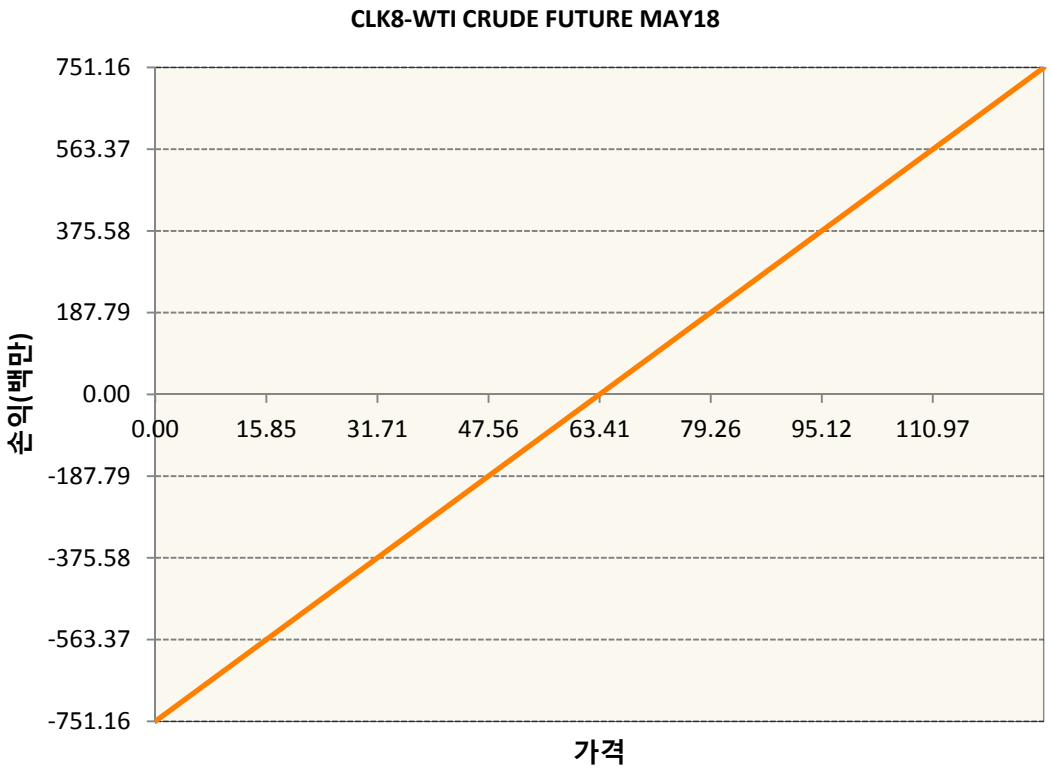
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

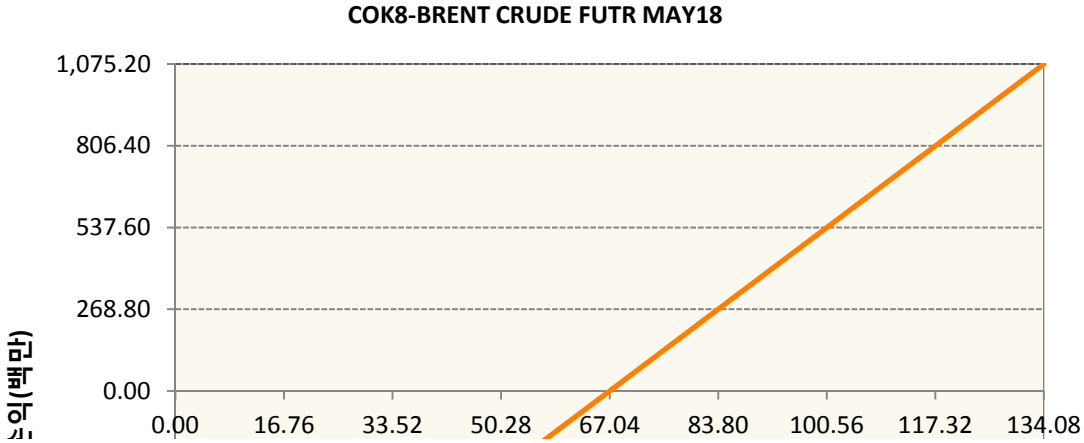
1. 계약금액

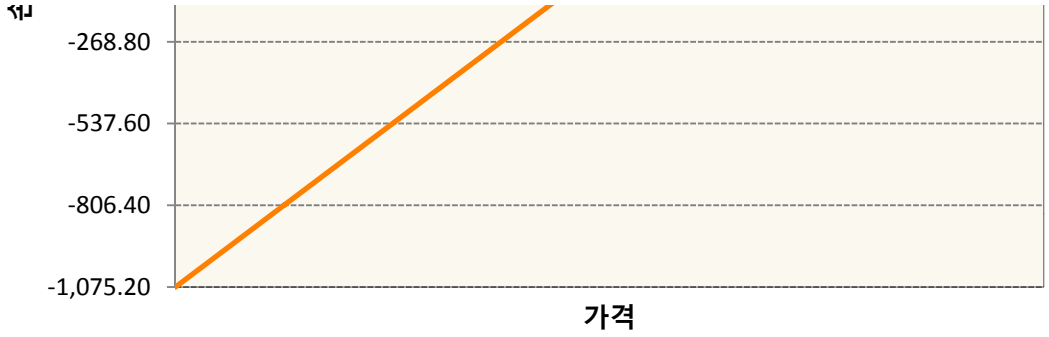
(단위:백만원)

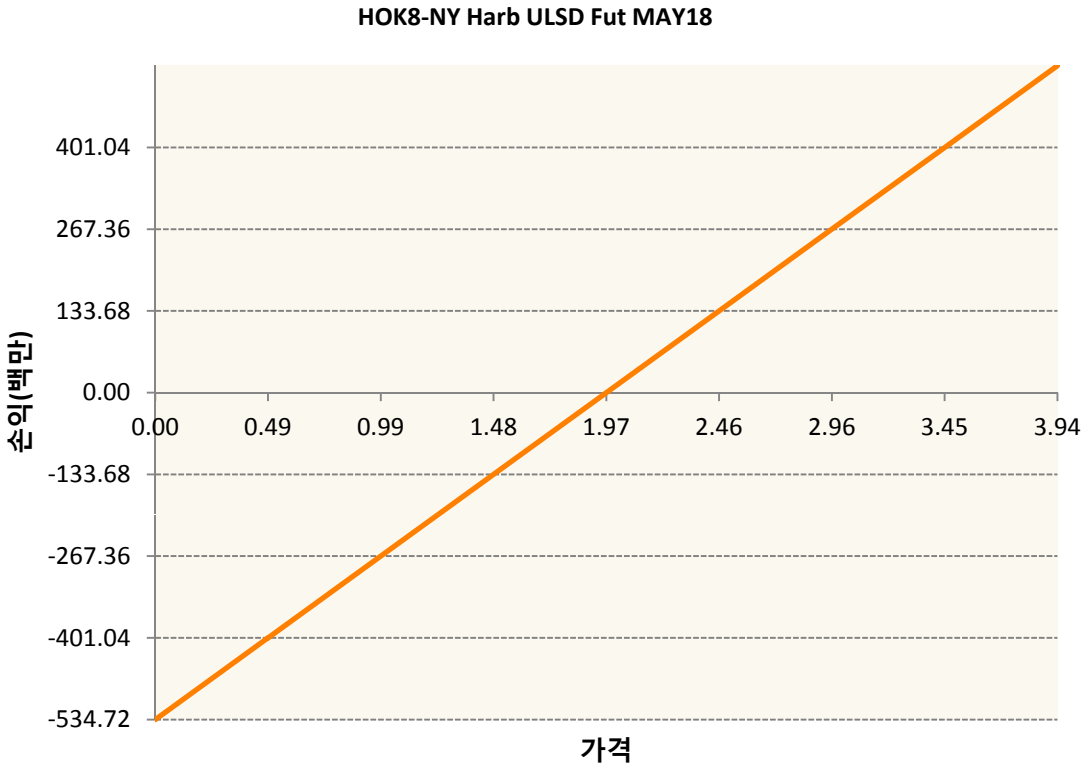
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	선물	유가증권	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	선물	유가증권	751	0	751	
누계	유가증권	선물	3,285	590	2,695	

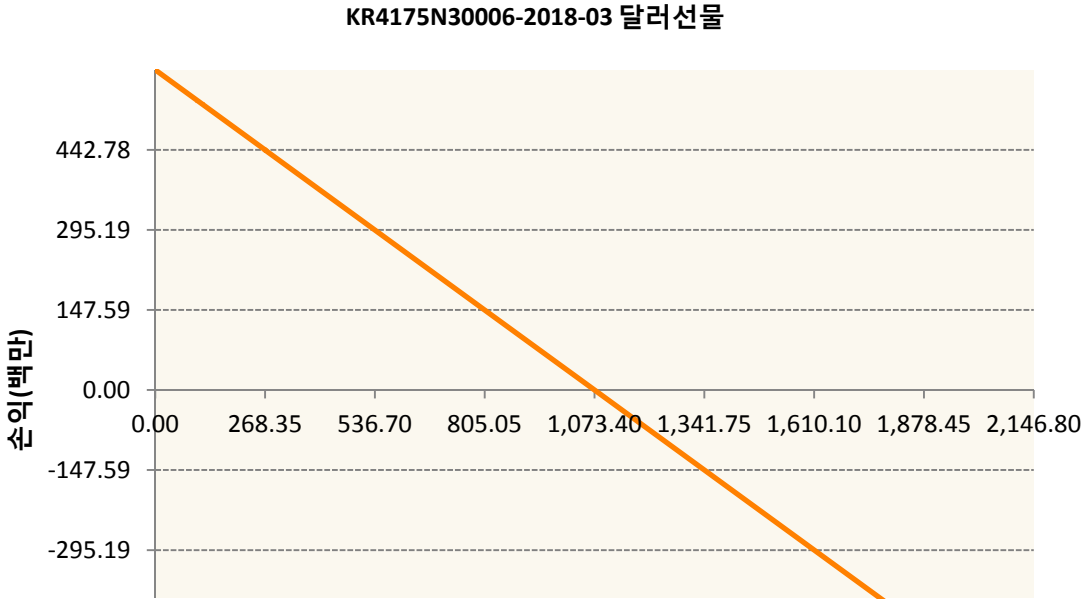
2. 만기시점의 손익구조

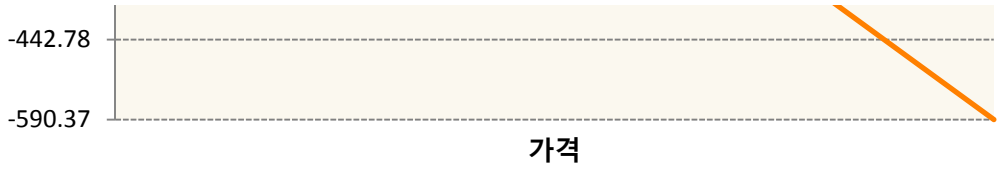


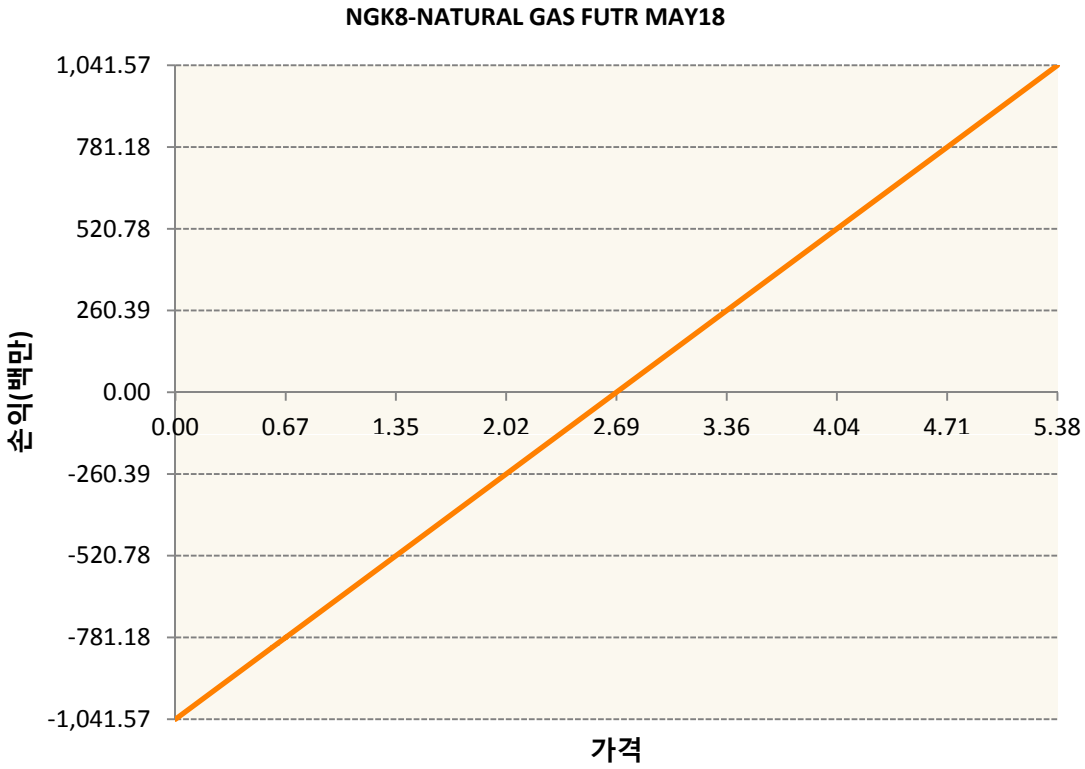


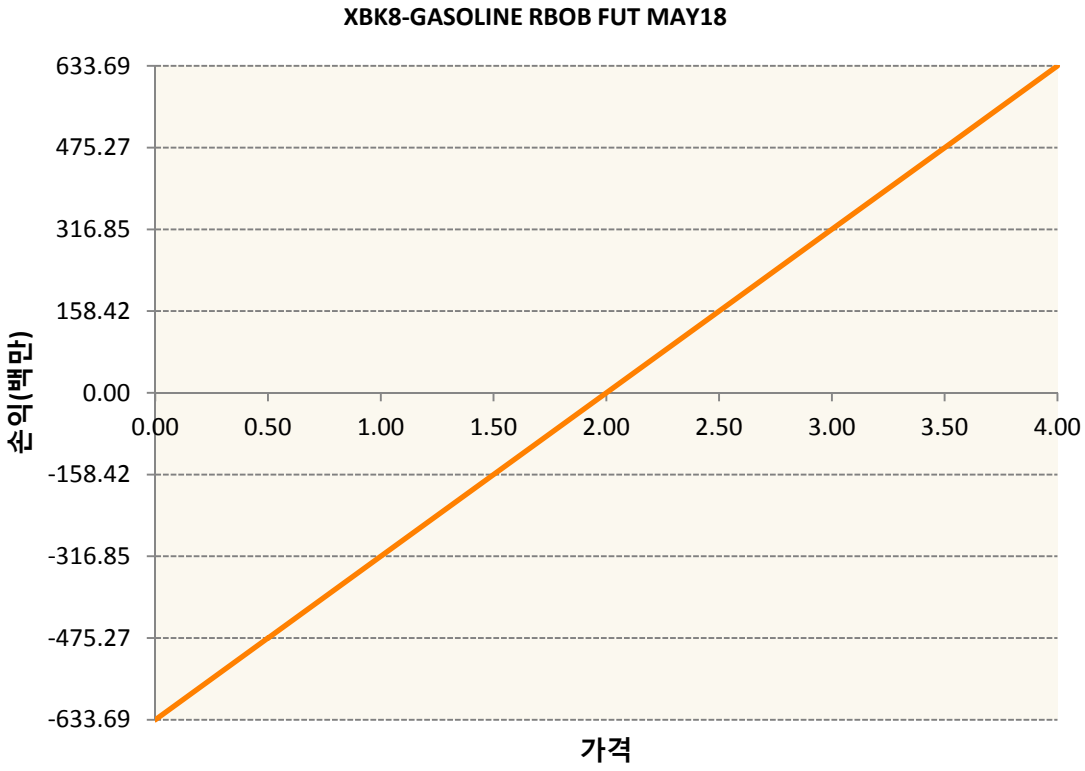

-268.80
-537.60
-806.40
-1,075.20
가격


HOK8-NY Harb ULSD Fut MAY18
401.04
267.36
133.68
0.00
-133.68
-267.36
-401.04
-534.72
0.00
0.49
0.99
1.48
1.97
2.46
2.96
3.45
3.94
손익(백만)
가격


KR4175N30006-2018-03 달러선물
442.78
295.19
147.59
0.00
-147.59
-295.19
0.00
268.35
536.70
805.05
1,073.40
1,341.75
1,610.10
1,878.45
2,146.80
손익(백만)


-442.78
-590.37
가격


NGK8-NATURAL GAS FUTR MAY18
1,041.57
781.18
520.78
260.39
0.00
-260.39
-520.78
-781.18
-1,041.57
0.00
0.67
1.35
2.02
2.69
3.36
4.04
4.71
5.38
손익(백만)
가격


XBK8-GASOLINE RBOB FUT MAY18
633.69
475.27
316.85
158.42
0.00
-158.42
-316.85
-475.27
-633.69
0.00
0.50
1.00
1.50
2.00
2.50
3.00
3.50
4.00
손익(백만)
가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLK8	WTI CRUDE FUTURE MAY18	60
COK8	BRENT CRUDE FUTR MAY18	86
HOK8	NY Harb ULSD Fut MAY18	43
KR4175N30(	2018-03 달러선물	47
NGK8	NATURAL GAS FUTR MAY18	83
XBK8	GASOLINE RBOB FUT MAY18	51

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

530

공시일	2018-02-27
기준일	2018-02-26

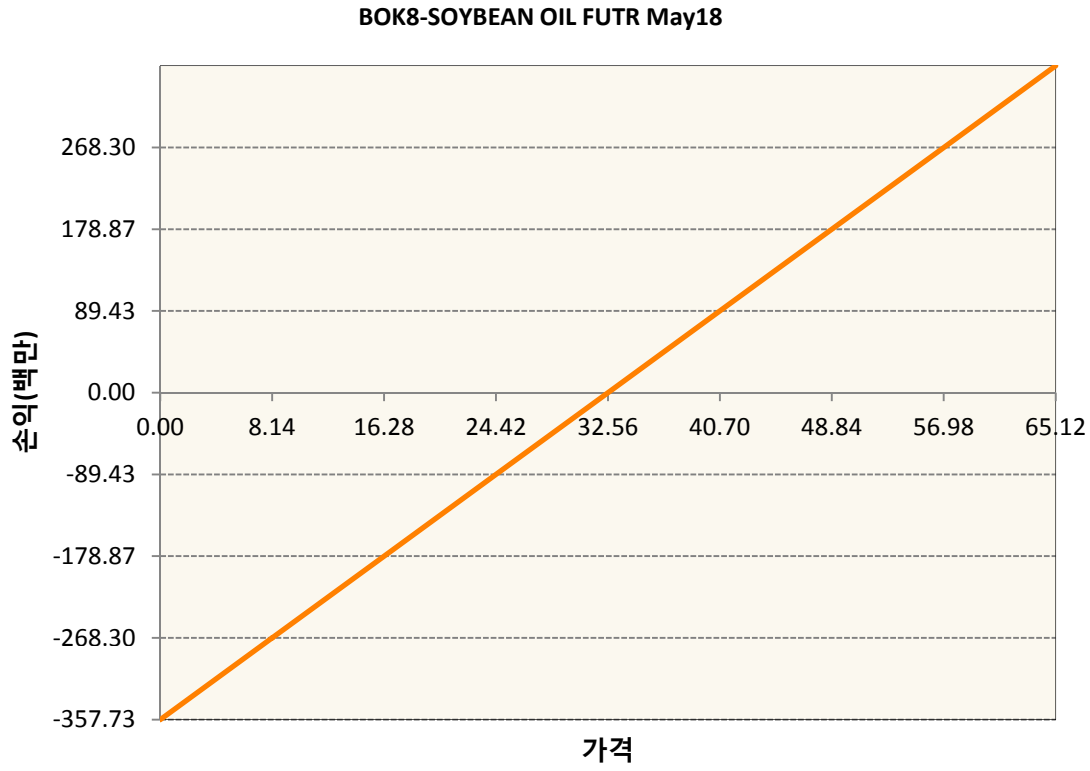
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

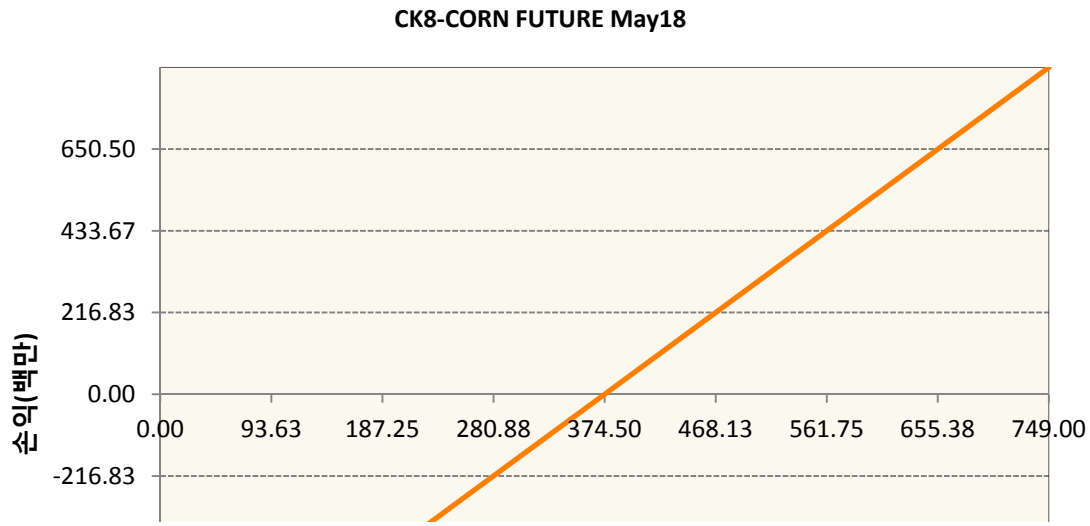
1. 계약금액

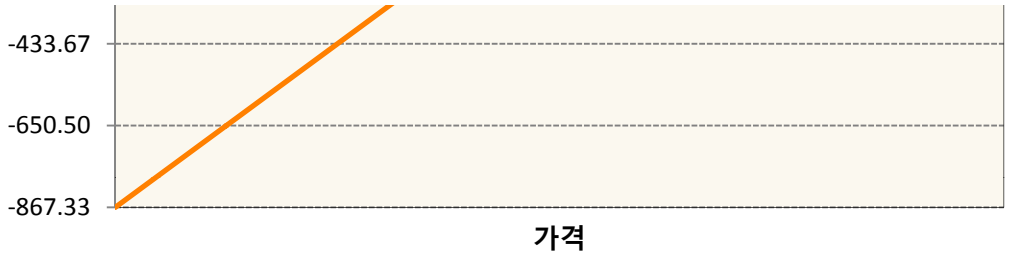
(단위:백만원)

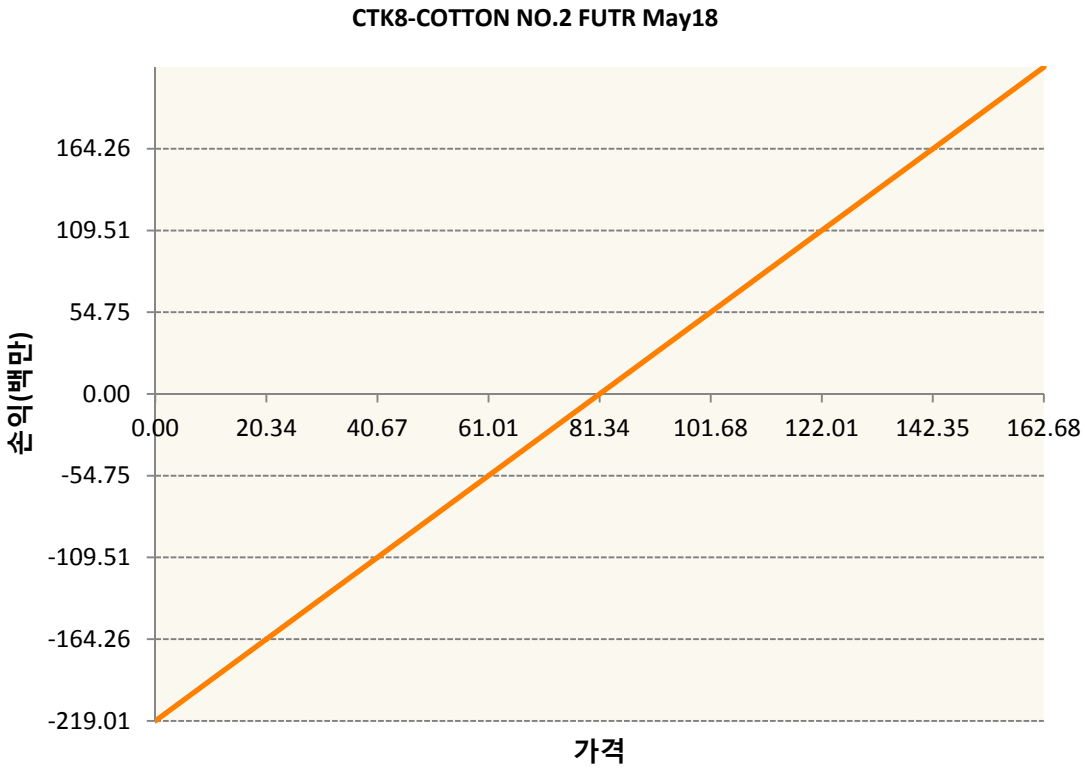
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	4,144	322	3,822	

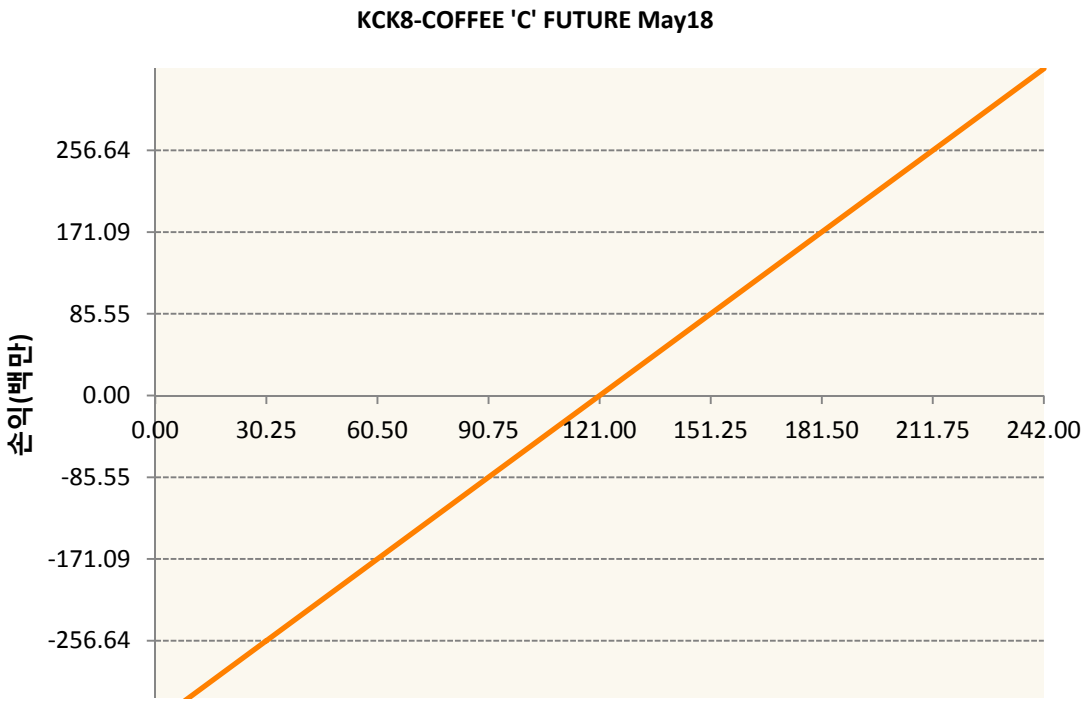
2. 만기시점의 손익구조

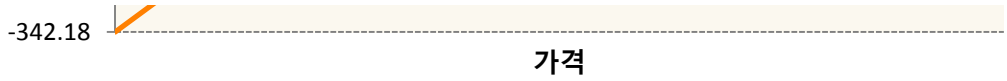


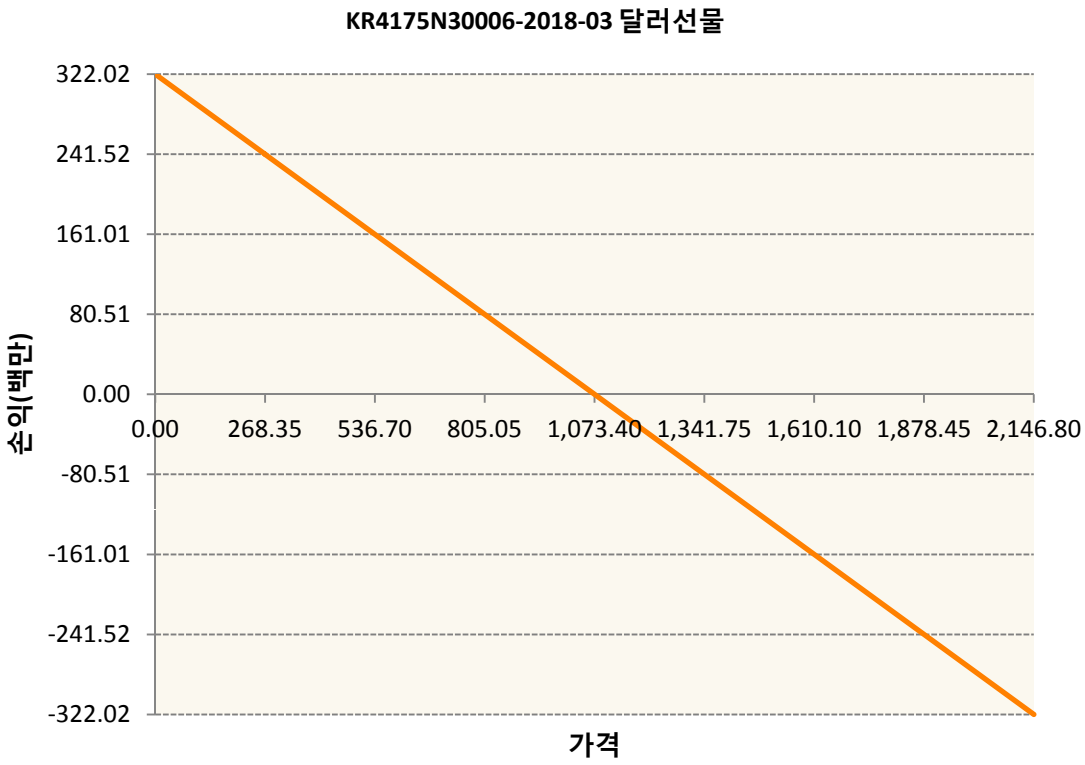


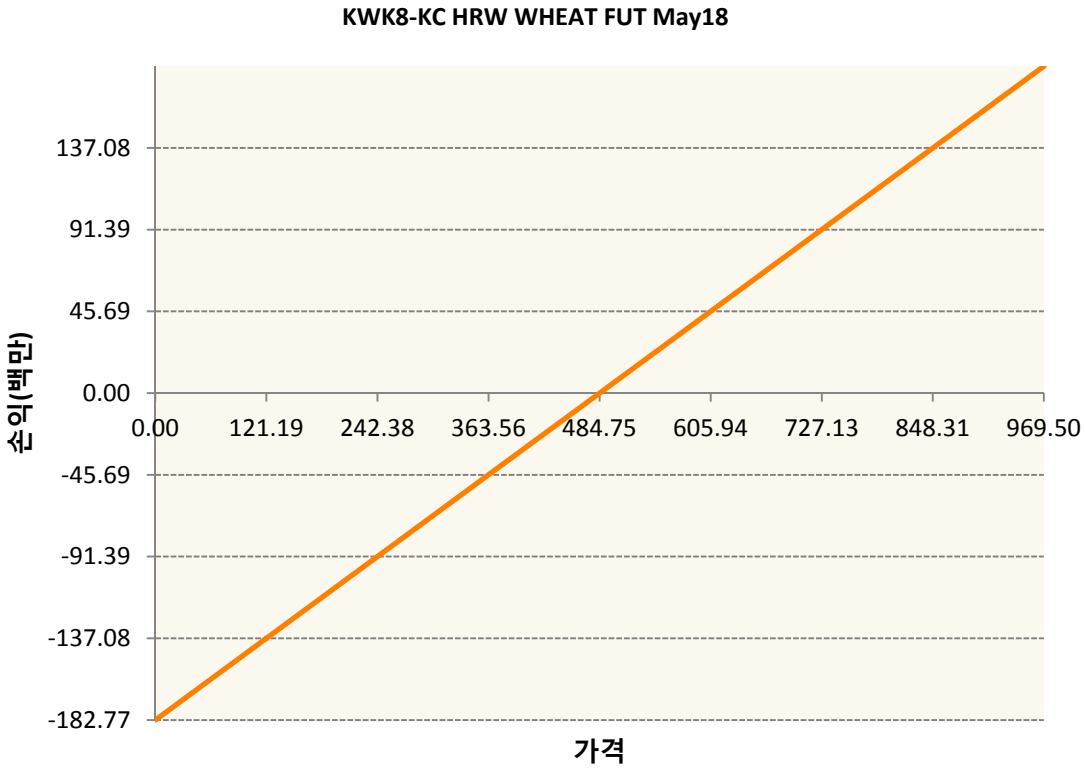

-433.67
-650.50
-867.33
가격

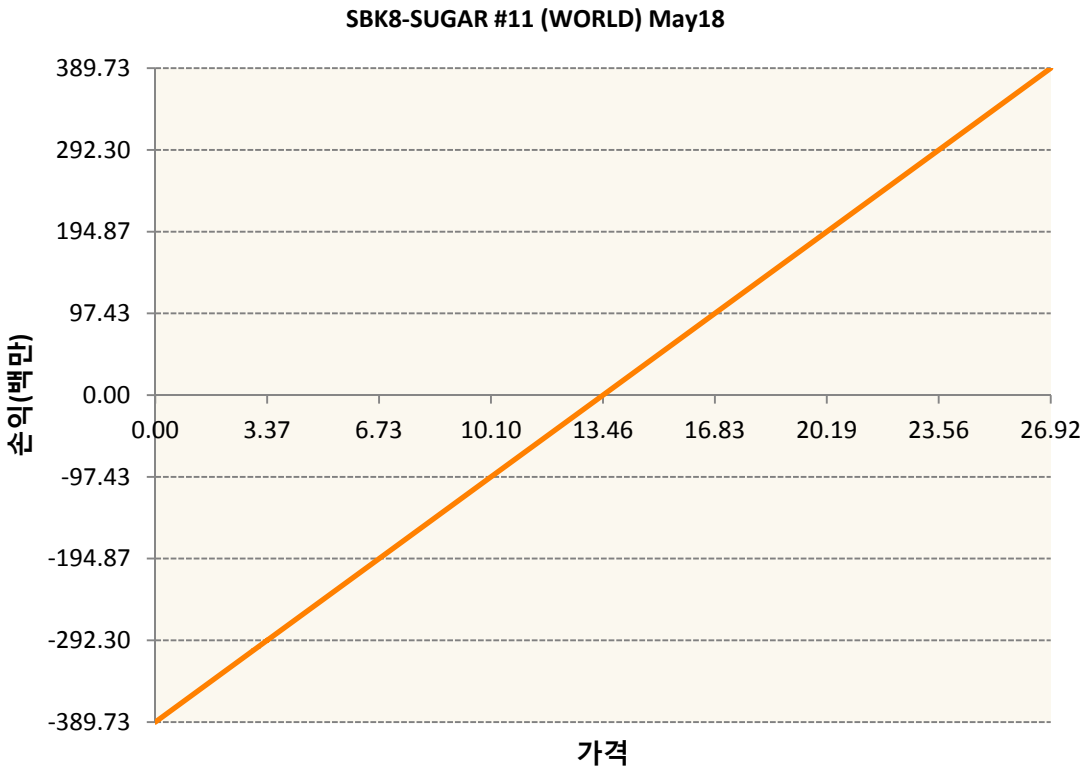

CTK8-COTTON NO.2 FUTR May18
164.26
109.51
54.75
0.00
-54.75
-109.51
-164.26
-219.01
0.00
20.34
40.67
61.01
81.34
101.68
122.01
142.35
162.68
손익(백만)
가격

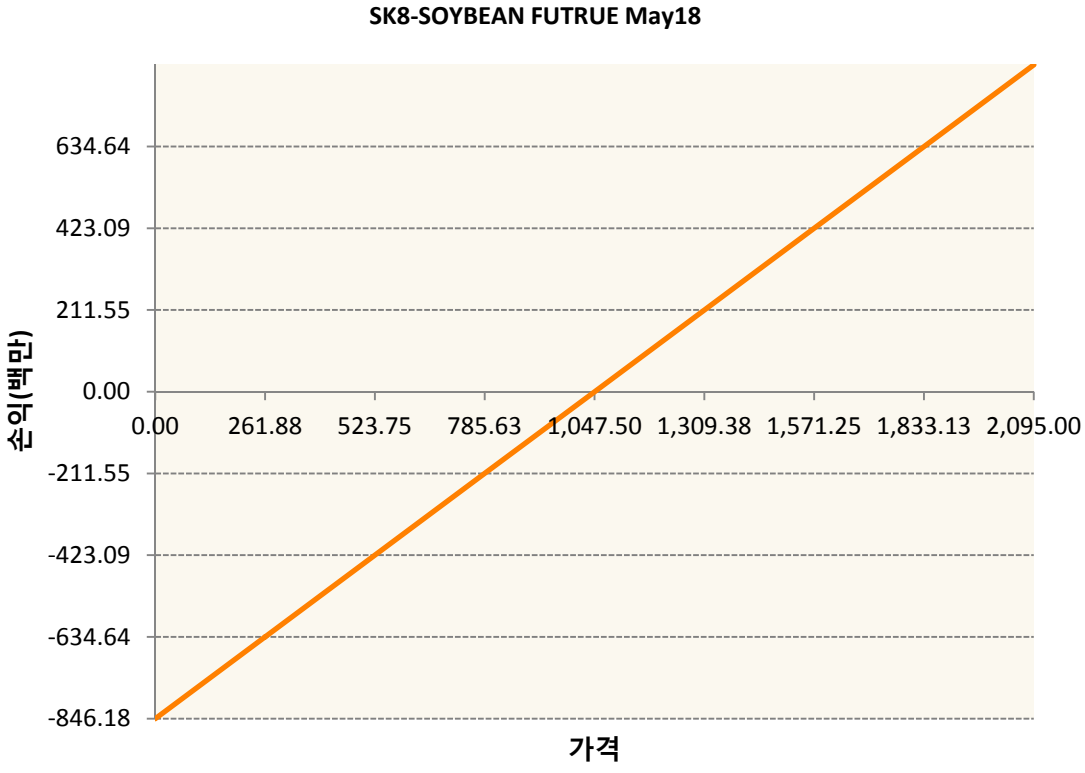

KCK8-COFFEE 'C' FUTURE May18
256.64
171.09
85.55
0.00
-85.55
-171.09
-256.64
0.00
30.25
60.50
90.75
121.00
151.25
181.50
211.75
242.00
손익(백만)


-342.18
가격

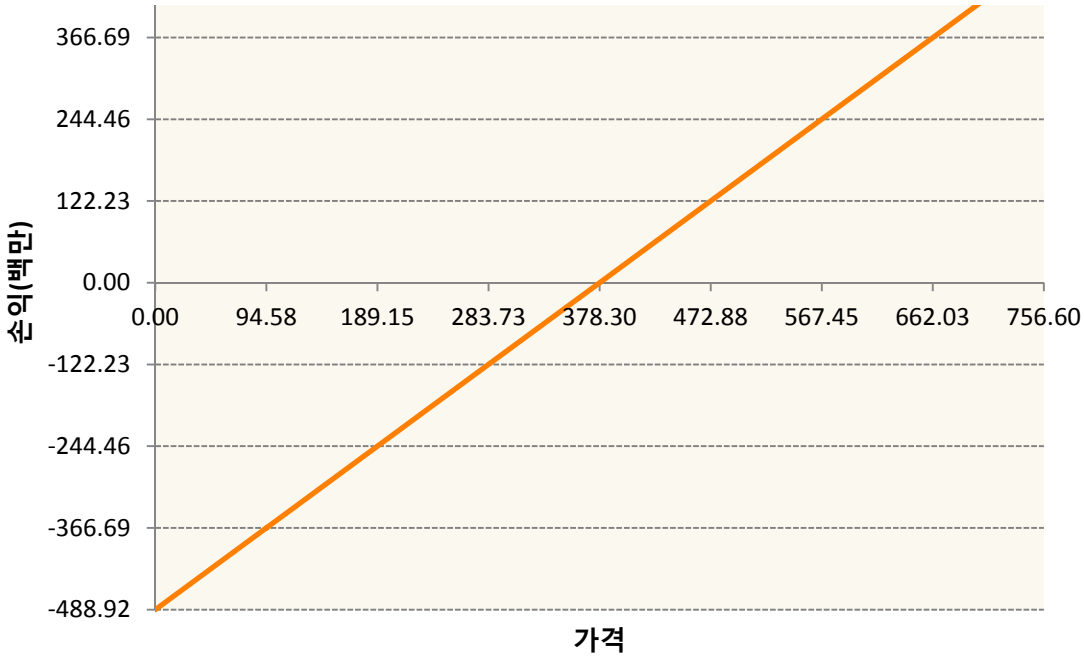

KR4175N30006-2018-03 달러선물
322.02
241.52
161.01
80.51
0.00
-80.51
-161.01
-241.52
-322.02
0.00
268.35
536.70
805.05
1,073.40
1,341.75
1,610.10
1,878.45
2,146.80
손익(백만)
가격

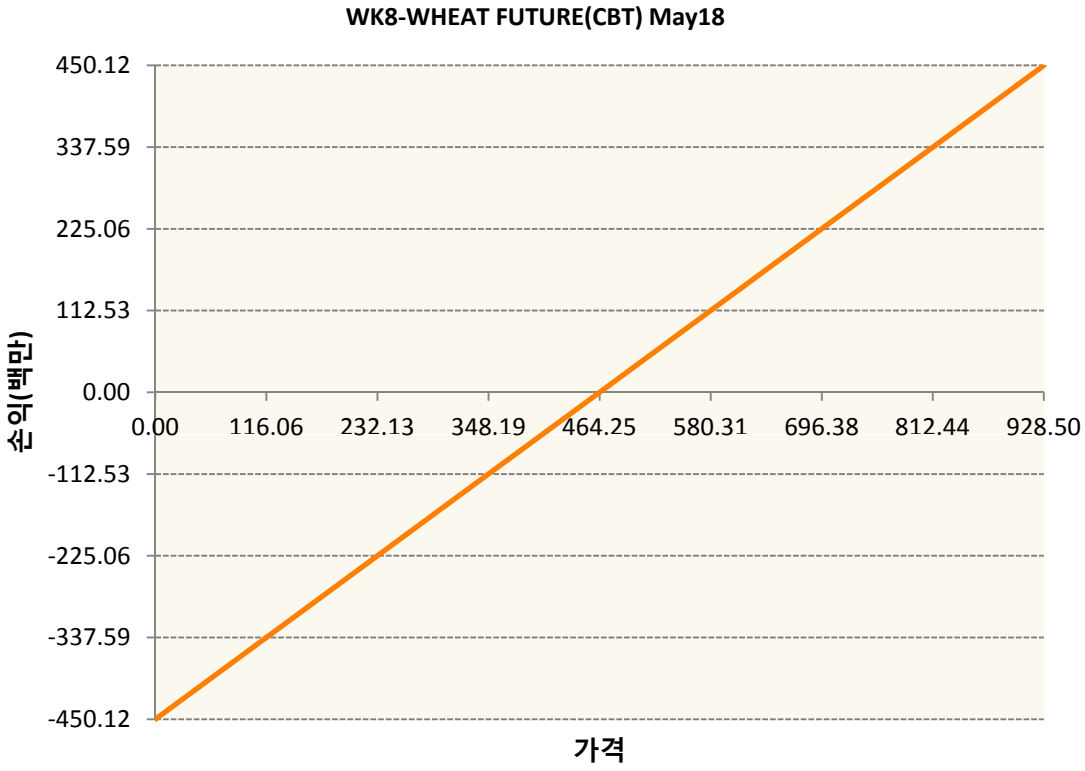

KWK8-KC HRW WHEAT FUT May18
137.08
91.39
45.69
0.00
-45.69
-91.39
-137.08
-182.77
0.00
121.19
242.38
363.56
484.75
605.94
727.13
848.31
969.50
손익(백만)
가격


SBK8-SUGAR #11 (WORLD) May18
389.73
292.30
194.87
97.43
0.00
-97.43
-194.87
-292.30
-389.73
0.00
3.37
6.73
10.10
13.46
16.83
20.19
23.56
26.92
손익(백만)
가격


SK8-SOYBEAN FUTRUE May18
634.64
423.09
211.55
0.00
-211.55
-423.09
-634.64
-846.18
0.00
261.88
523.75
785.63
1,047.50
1,309.38
1,571.25
1,833.13
2,095.00
손익(백만)
가격


SMK8-SOYBEAN MEAL FUTR May18
488.92





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

BOK8	SOYBEAN OIL FUTR May18	29
CK8	CORN FUTURE May18	69
CTK8	COTTON NO.2 FUTR May18	18
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)

336