공시일	2018-03-06
기준일	2018-03-05

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	2018-03-06
기준일	2018-03-05

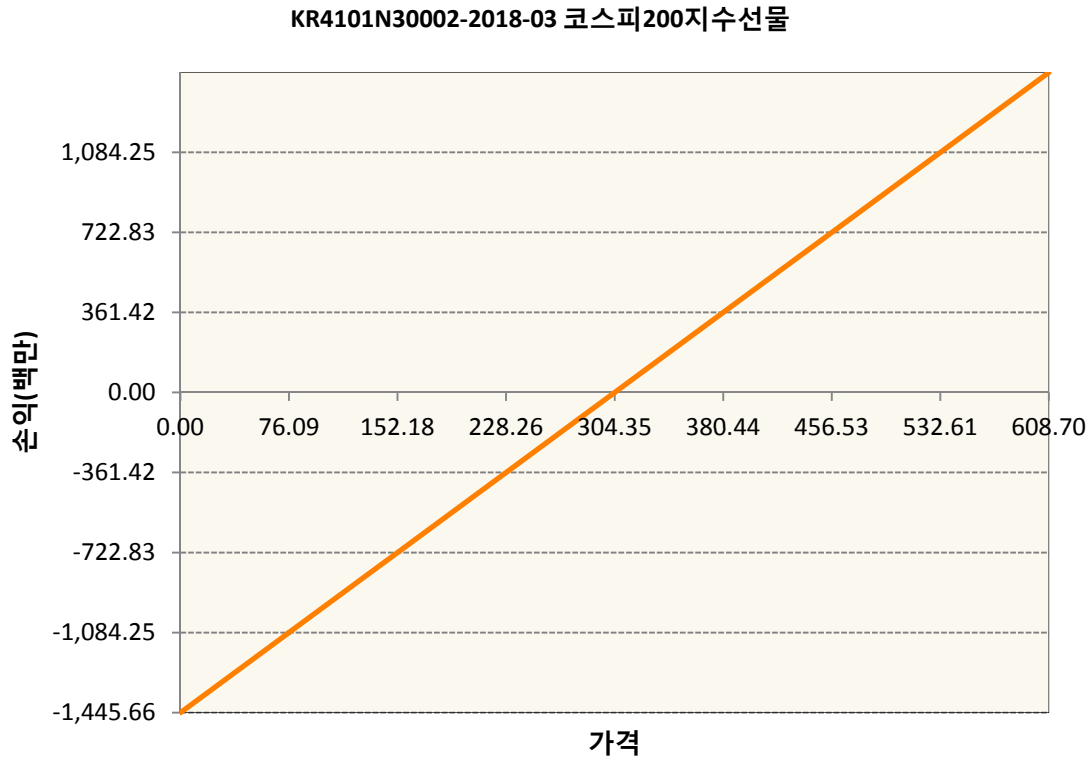
스마트인덱스모

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	1,446	0	1,446	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101N30(2018-03 코스피200지수선물							116
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-116	-116	-116	-116	-116	-116	-116
-5.33%	-77	-77	-77	-77	-77	-77	-77
-2.67%	-39	-39	-39	-39	-39	-39	-39
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	39	39	39	39	39	39	39
5.33%	77	77	77	77	77	77	77
8.00%	116	116	116	116	116	116	116

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

79

공시일	2018-03-06
기준일	2018-03-05

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	1,096

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

408

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2018-03-06
기준일	2018-03-05

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	404

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

403

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2018-03-06
기준일	2018-03-05

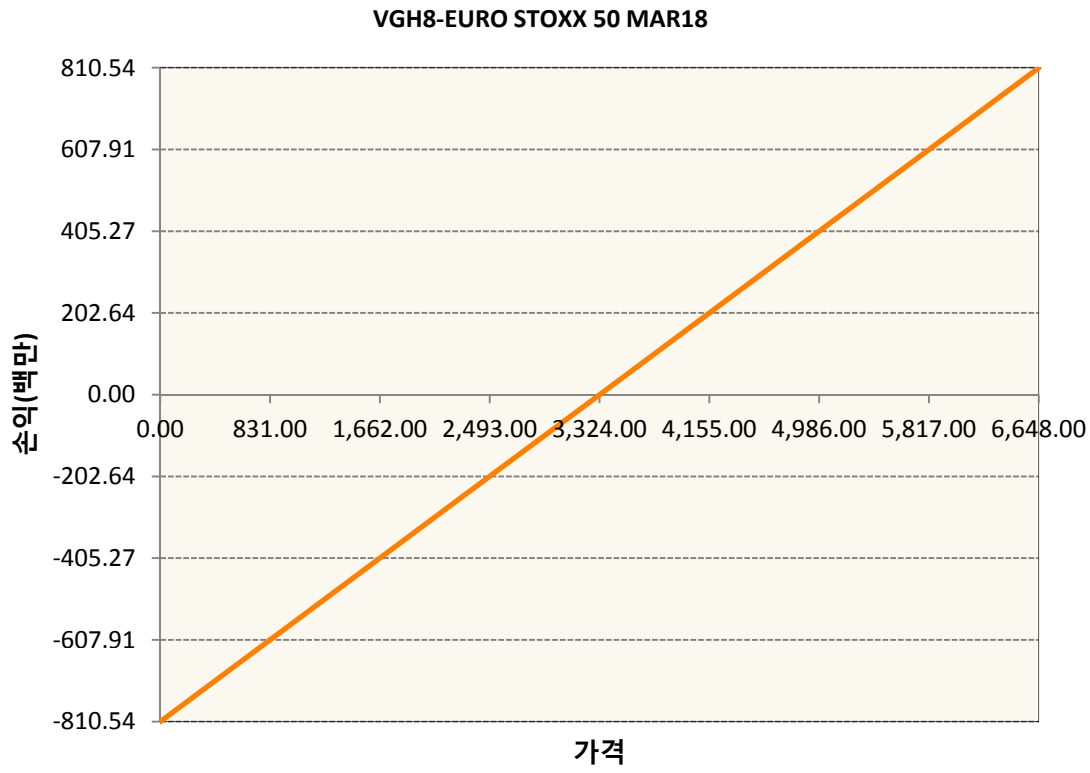
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	811	0	811	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGH8	EURO STOXX 50 MAR18	65

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

(단위:백만원)

38

공시일	2018-03-06
기준일	2018-03-05

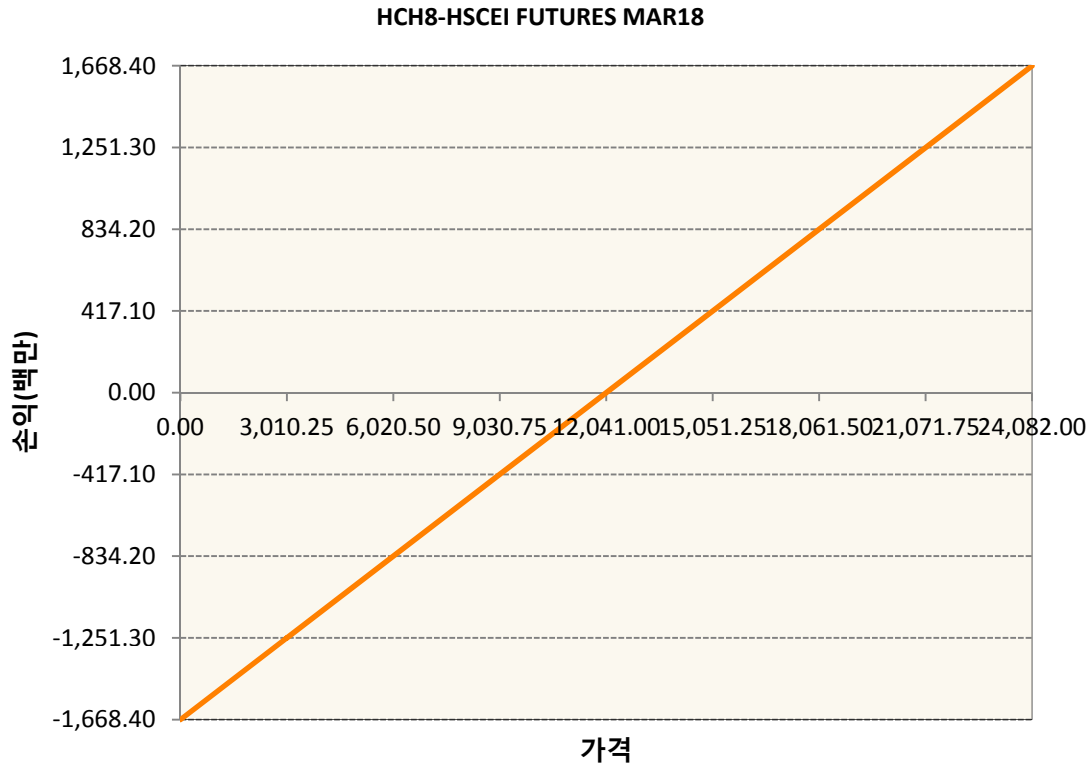
차이나인덱스모(주식-파생형)

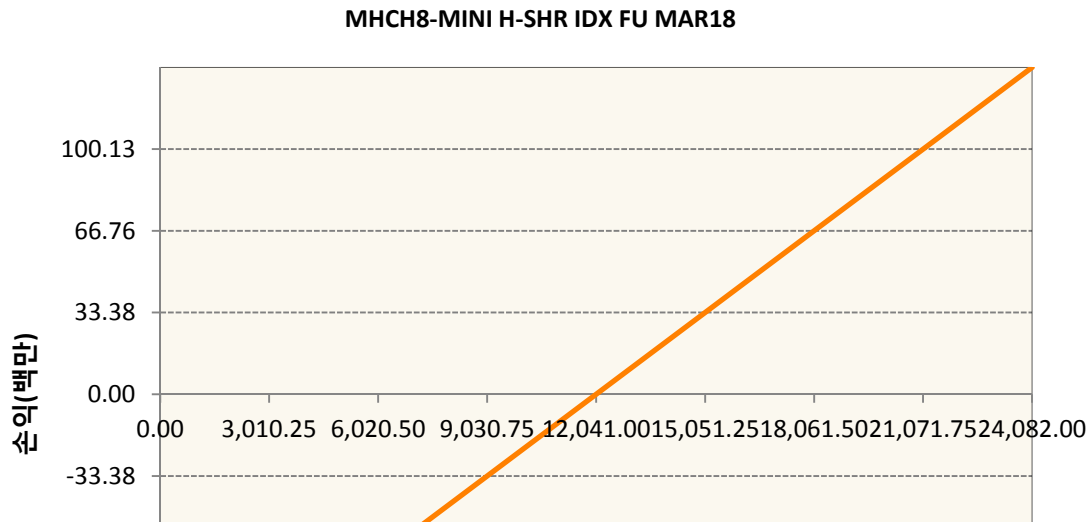
1. 계약금액

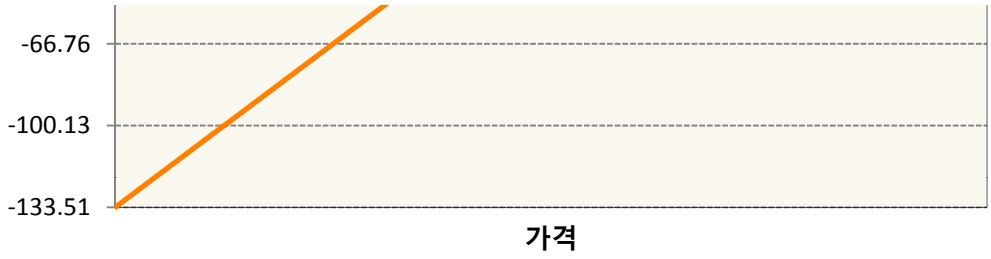
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,802	0	1,802	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCH8	HSCEI FUTURES MAR18	133
MHCH8	MINI H-SHR IDX FU MAR18	11

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	125

공시일	2018-03-06
기준일	2018-03-05

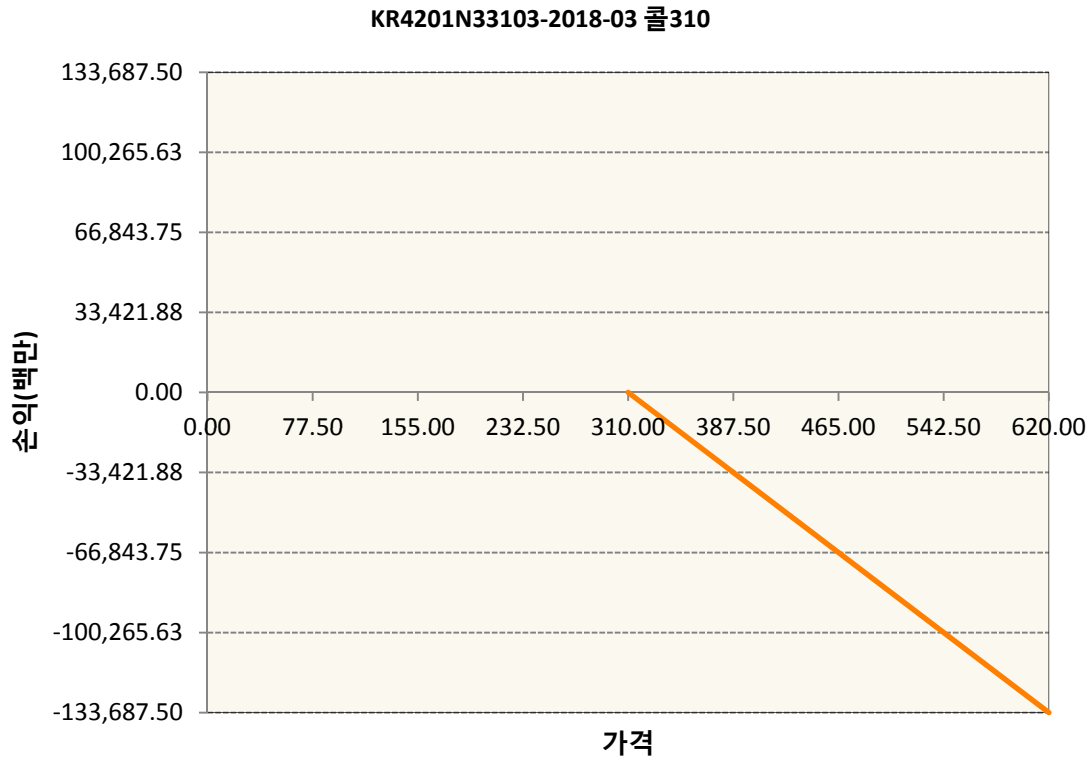
커버드콜모(주식혼합-파생형)

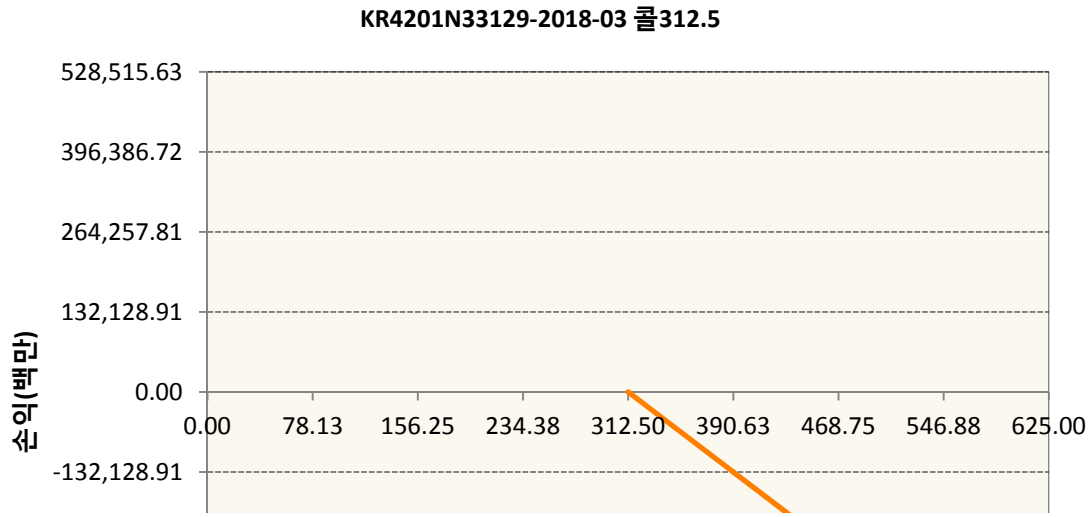
1. 계약금액

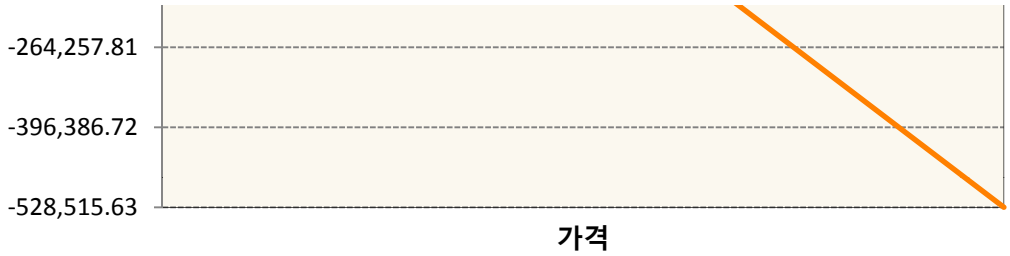
(단위:백만원)

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



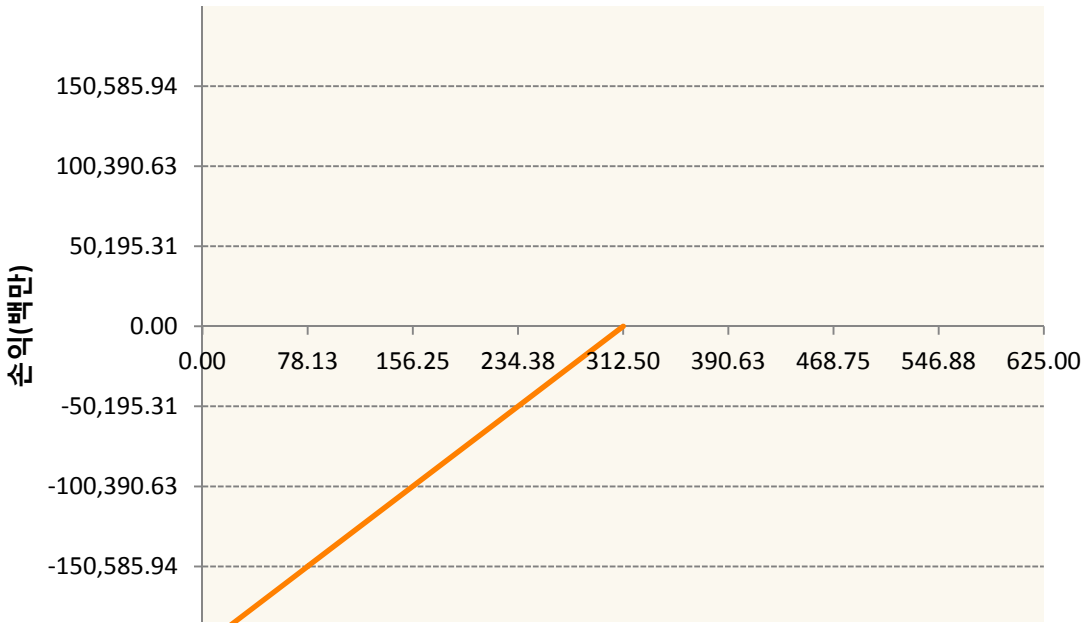




KR4301N33101-2018-03 풋310



KR4301N33127-2018-03 풋312.5





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201N3312018-03 콜310							7,728
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	499	499	499	498	498	498	498
-5.33%	498	498	498	496	493	488	481
-2.67%	490	480	464	442	415	381	341
0%	249	171	88	0	-91	-185	-282
2.67%	-1,220	-1,325	-1,432	-1,539	-1,648	-1,758	-1,868
5.33%	-4,209	-4,237	-4,274	-4,317	-4,369	-4,426	-4,489
8.00%	-7,673	-7,675	-7,678	-7,685	-7,695	-7,709	-7,728
KR4201N3312018-03 콜312.5							27,103
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,121	1,121	1,121	1,121	1,121	1,121	1,120
-5.33%	1,121	1,121	1,120	1,118	1,113	1,104	1,089
-2.67%	1,112	1,096	1,068	1,023	959	876	771
0%	693	491	259	0	-282	-582	-899
2.67%	-3,120	-3,572	-4,024	-4,475	-4,927	-5,378	-5,830
5.33%	-13,369	-13,568	-13,799	-14,057	-14,340	-14,642	-14,962
8.00%	-26,707	-26,726	-26,761	-26,814	-26,888	-26,984	-27,103
KR4301N3312018-03 풋310							19,893
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-19,893	-19,893	-19,893	-19,893	-19,893	-19,893	-19,893
-5.33%	-13,132	-13,132	-13,132	-13,132	-13,132	-13,133	-13,133
-2.67%	-6,372	-6,373	-6,375	-6,380	-6,389	-6,402	-6,419
0%	239	169	89	0	-97	-200	-309
2.67%	4,359	4,231	4,100	3,965	3,827	3,687	3,545
5.33%	4,893	4,885	4,871	4,850	4,821	4,785	4,741
8.00%	4,898	4,898	4,898	4,898	4,897	4,895	4,891
KR4301N3312018-03 풋312.5							15,534
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-15,534	-15,534	-15,534	-15,534	-15,534	-15,534	-15,534
-5.33%	-10,316	-10,316	-10,316	-10,316	-10,316	-10,316	-10,316
-2.67%	-5,098	-5,099	-5,099	-5,100	-5,102	-5,106	-5,112
0%	91	69	38	0	-45	-97	-155
2.67%	4,198	4,079	3,959	3,840	3,721	3,602	3,483

5.33%	5,180	5,159	5,129	5,092	5,048	4,997	4,940
8.00%	5,205	5,205	5,205	5,203	5,200	5,196	5,189

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

76,916

공시일	2018-03-06
기준일	2018-03-05

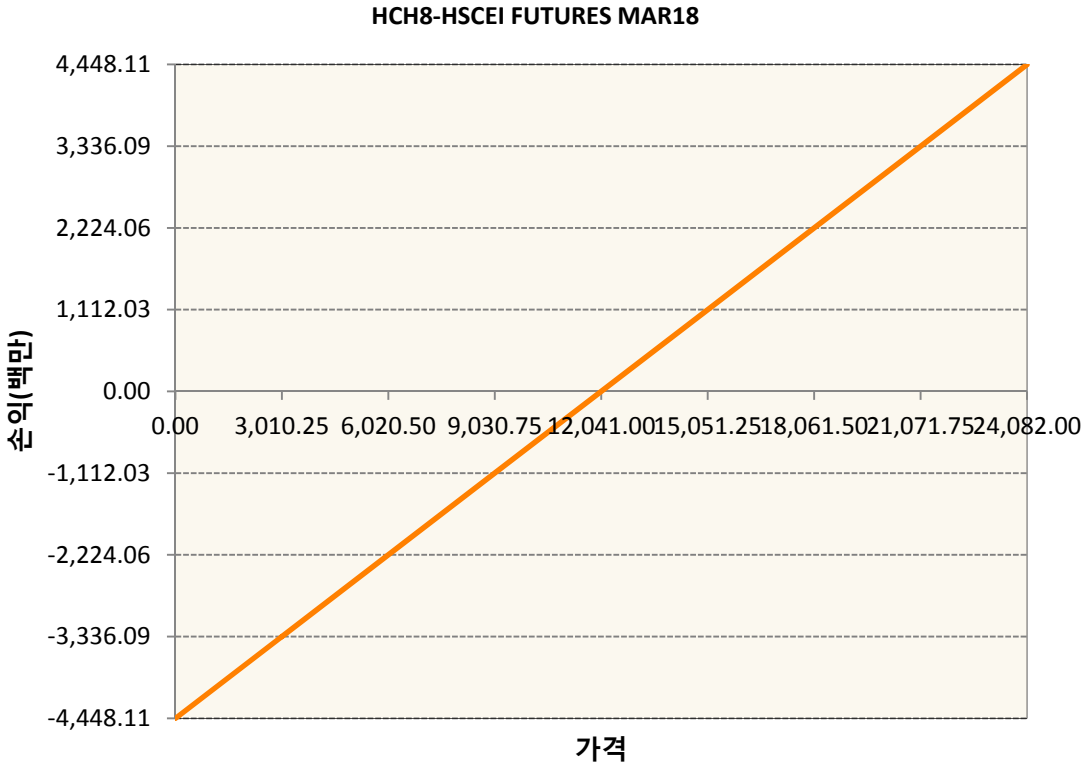
홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생

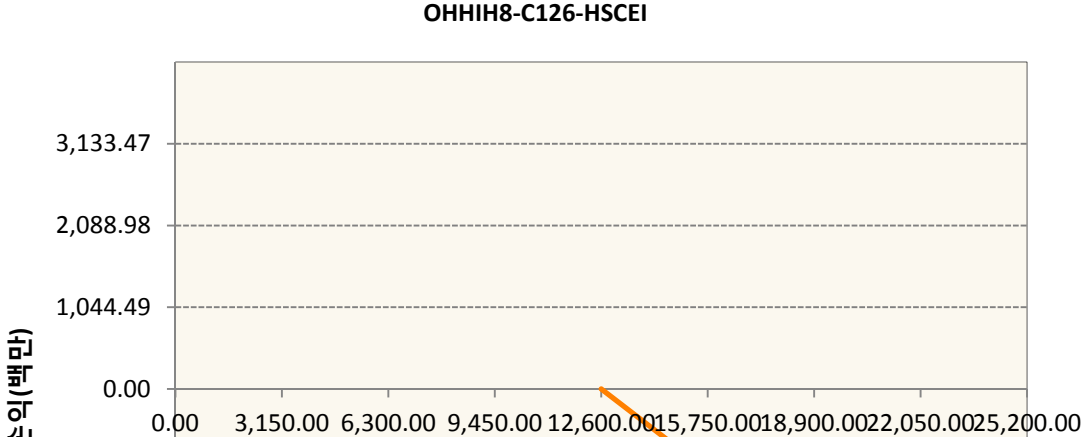
1. 계약금액

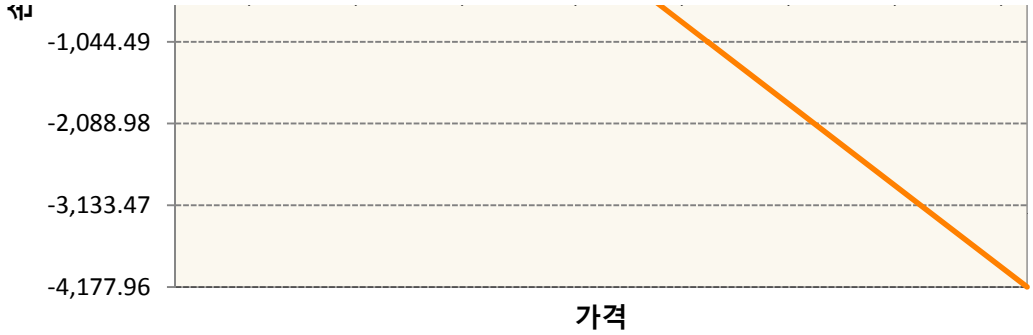
(단위:백만원)

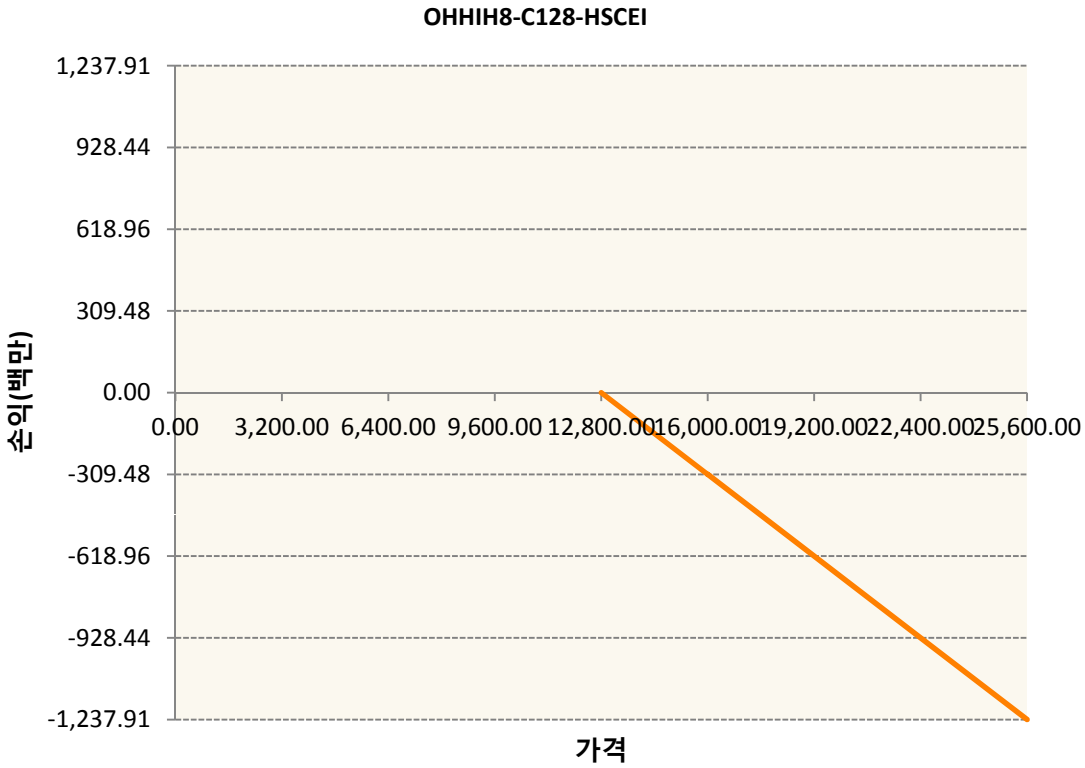
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	4,448	0	4,448	장내
누계	유가증권	옵션	0	10,832	-10,832	장내

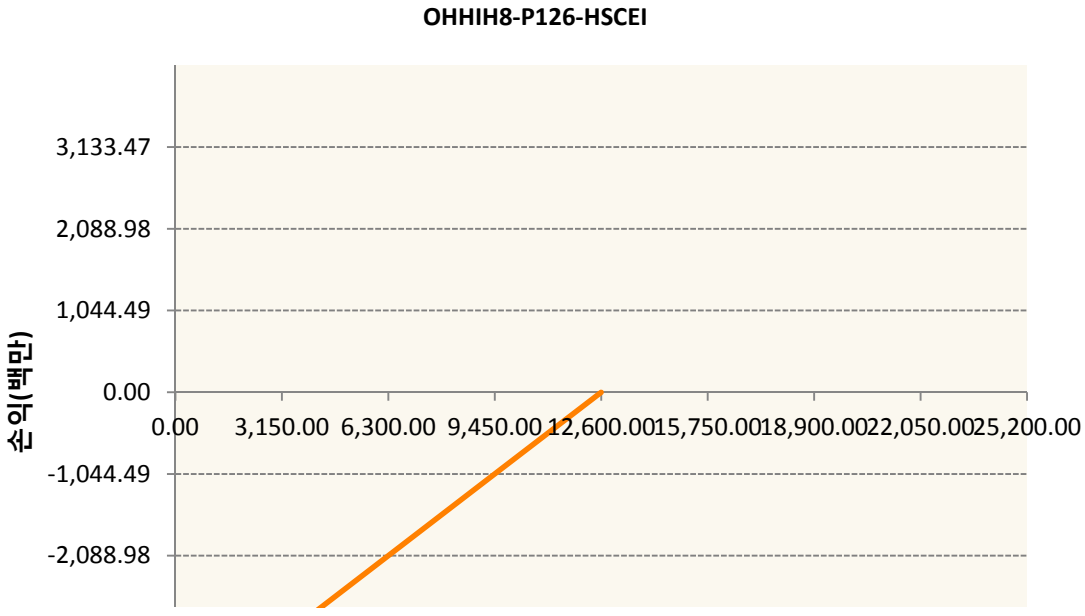
2. 만기시점의 손익구조

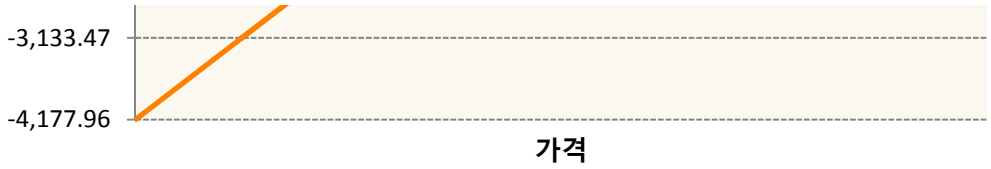


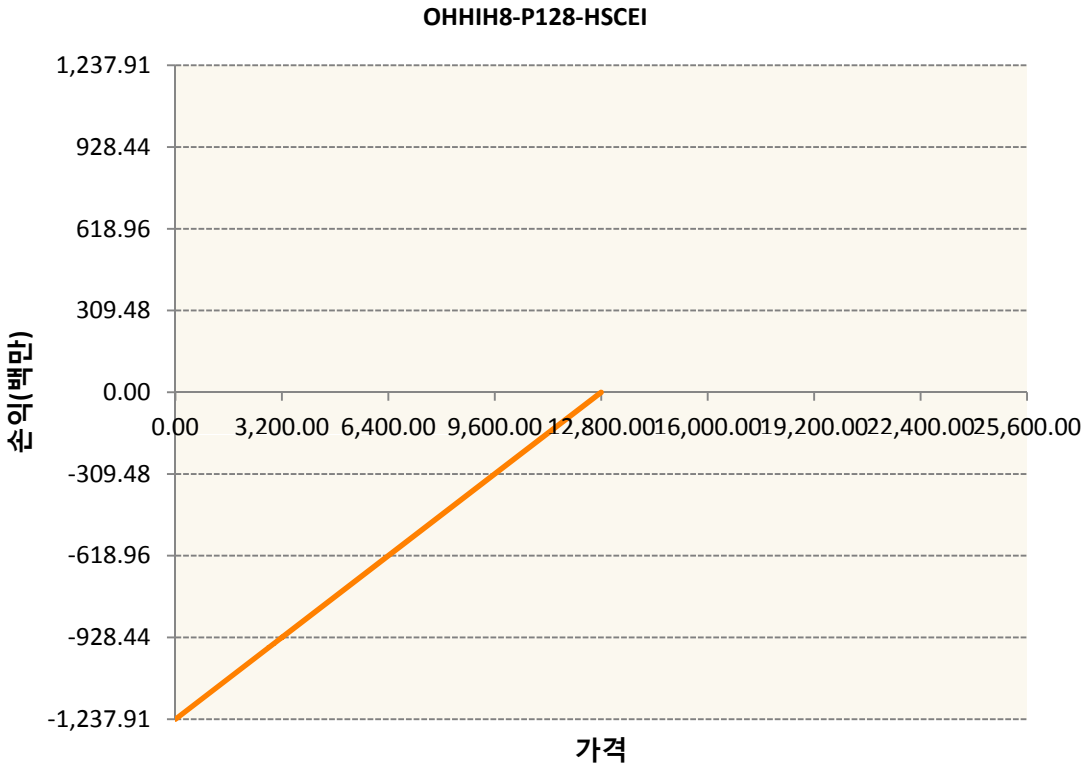



-1,044.49
-2,088.98
-3,133.47
-4,177.96
가격


OHHIH8-C128-HSCEI
1,237.91
928.44
618.96
309.48
0.00
-309.48
-618.96
-928.44
-1,237.91
0.00
3,200.00
6,400.00
9,600.00
12,800.00
16,000.00
19,200.00
22,400.00
25,600.00
손익(백만)
가격


OHHIH8-P126-HSCEI
3,133.47
2,088.98
1,044.49
0.00
-1,044.49
-2,088.98
0.00
3,150.00
6,300.00
9,450.00
12,600.00
15,750.00
18,900.00
22,050.00
25,200.00
손익(백만)





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCH8	HSCEI FUTURES MAR18	356
OHHIH8-C12	HSCEI	334
OHHIH8-C12	HSCEI	99
OHHIH8-P12	HSCEI	334
OHHIH8-P12	HSCEI	99

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,064

공시일	2018-03-06
기준일	2018-03-05

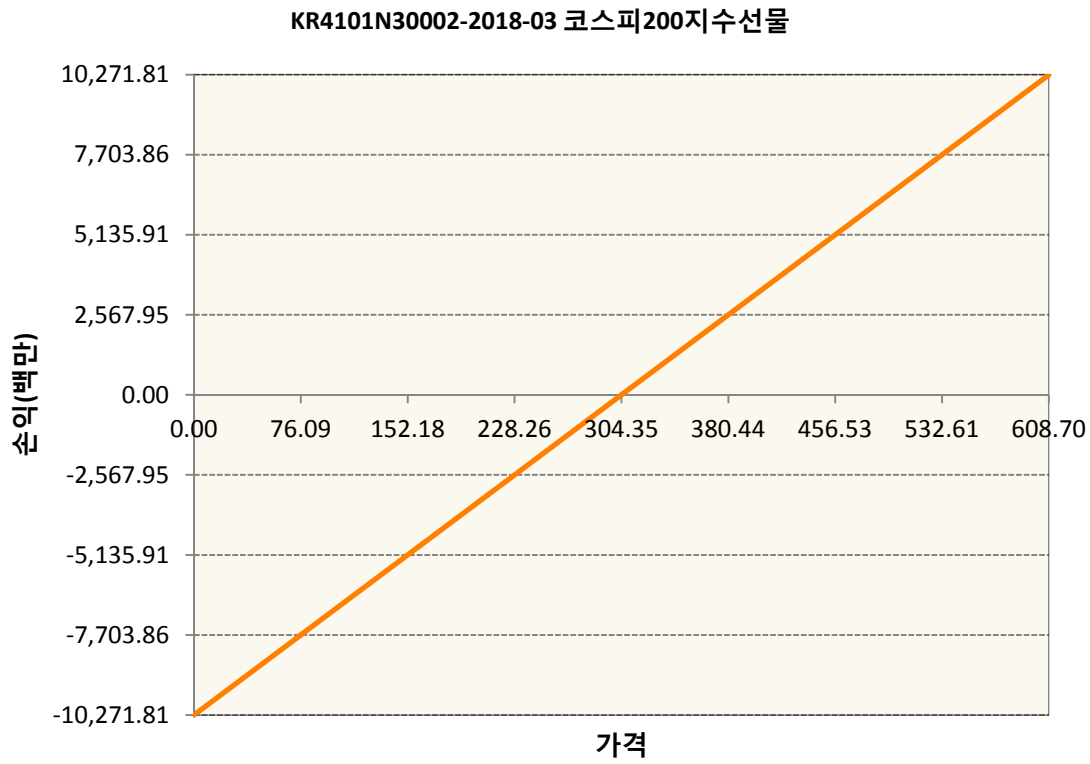
코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼

1. 계약금액

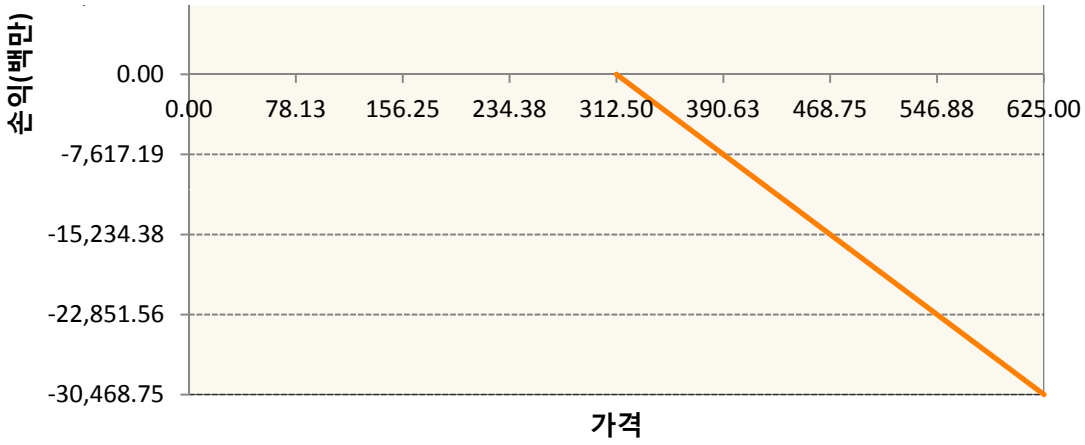
(단위:백만원)

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	10,272	0	10,272	장내
누계	유가증권	스왑	56,200	0	56,200	장외
누계	유가증권	옵션	0	55,313	-55,313	장내

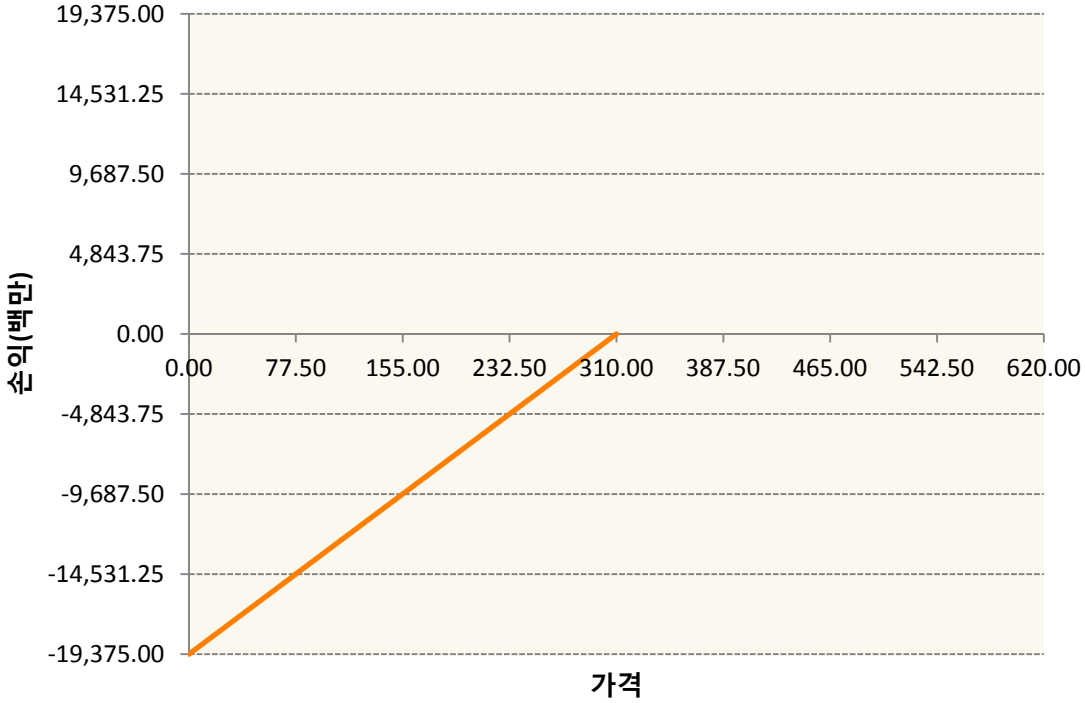
2. 만기시점의 손익구조



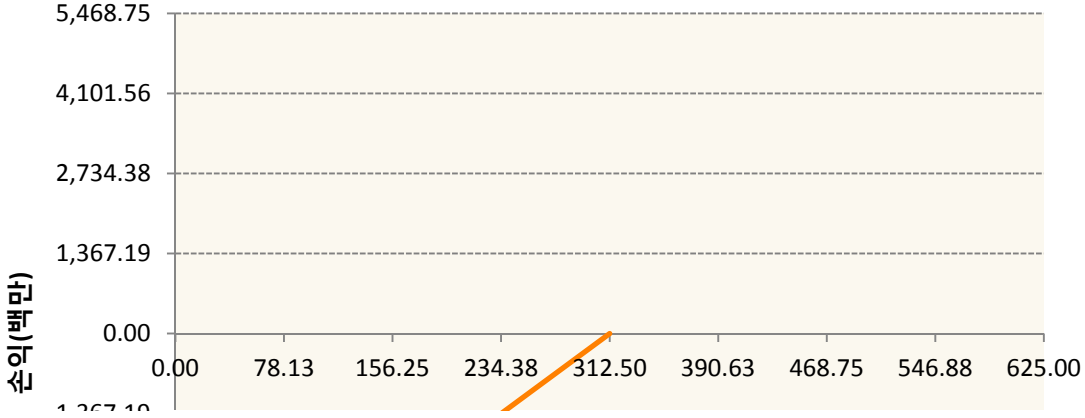




KR4301N33101-2018-03 풋310



KR4301N33127-2018-03 풋312.5





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_2							1,459
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,459	-1,459	-1,459	-1,459	-1,459	-1,459	-1,459
-5.33%	-973	-973	-973	-973	-973	-973	-973
-2.67%	-486	-486	-486	-486	-486	-486	-486
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	486	486	486	486	486	486	486
5.33%	973	973	973	973	973	973	973
8.00%	1,459	1,459	1,459	1,459	1,459	1,459	1,459
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%	-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						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%	-311	-311	-311	-311	-311	-311	-311
-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%	311	311	311	311	311	311	311
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						631
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-631	-631	-631	-631	-631	-631	-631
-5.33%	-421	-421	-421	-421	-421	-421	-421
-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%	421	421	421	421	421	421	421
8.00%	631	631	631	631	631	631	631
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_12						473
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-473	-473	-473	-473	-473	-473	-473
-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%	473	473	473	473	473	473	473
	KR4101N30(	2018-03 코스피200지수선물					822
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-822	-822	-822	-822	-822	-822	-822
-5.33%	-548	-548	-548	-548	-548	-548	-548
-2.67%	-274	-274	-274	-274	-274	-274	-274
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	274	274	274	274	274	274	274
5.33%	548	548	548	548	548	548	548
8.00%	822	822	822	822	822	822	822
	KR4201N331	2018-03 콜312.5					1,562
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	65	65	65	65	65	65	65
-5.33%	65	65	65	64	64	64	63
-2.67%	64	63	62	59	55	50	44
0%	40	28	15	0	-16	-34	-52
2.67%	-180	-206	-232	-258	-284	-310	-336
5.33%	-771	-782	-795	-810	-827	-844	-863
8.00%	-1,540	-1,541	-1,543	-1,546	-1,550	-1,556	-1,562
	KR4301N331	2018-03 풋310					1,493

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,493	-1,493	-1,493	-1,493	-1,493	-1,493	-1,493
-5.33%	-986	-986	-986	-986	-986	-986	-986
-2.67%	-478	-478	-479	-479	-480	-481	-482
0%	18	13	7	0	-7	-15	-23
2.67%	327	318	308	298	287	277	266
5.33%	367	367	366	364	362	359	356
8.00%	368	368	368	368	368	367	367
KR4301N3312018-03 풋312.5							423

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-423	-423	-423	-423	-423	-423	-423
-5.33%	-281	-281	-281	-281	-281	-281	-281
-2.67%	-139	-139	-139	-139	-139	-139	-139
0%	2	2	1	0	-1	-3	-4
2.67%	114	111	108	105	101	98	95
5.33%	141	141	140	139	137	136	135
8.00%	142	142	142	142	142	142	141

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

8,845

공시일	2018-03-06
기준일	2018-03-05

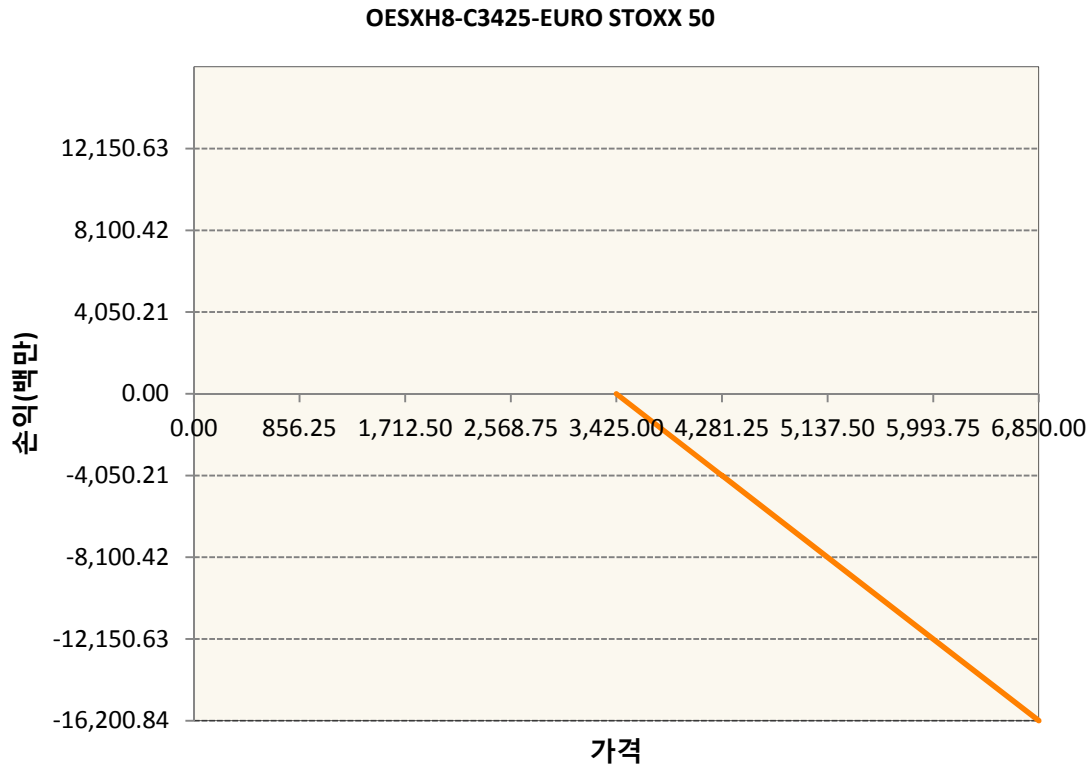
유로커버드콜모(주식혼합-파생형

1. 계약금액

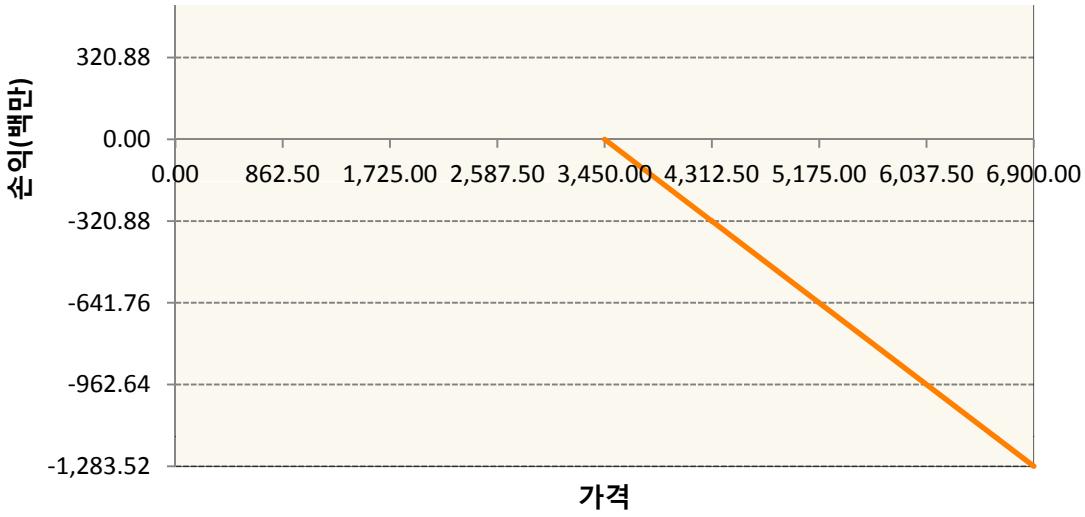
(단위:백만원)

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	8,980	0	8,980	
누계	유가증권	스왑	99,652	0	99,652	장외
누계	유가증권	옵션	0	34,969	-34,969	장내
누계	지수	스왑	53,149	0	53,149	장외

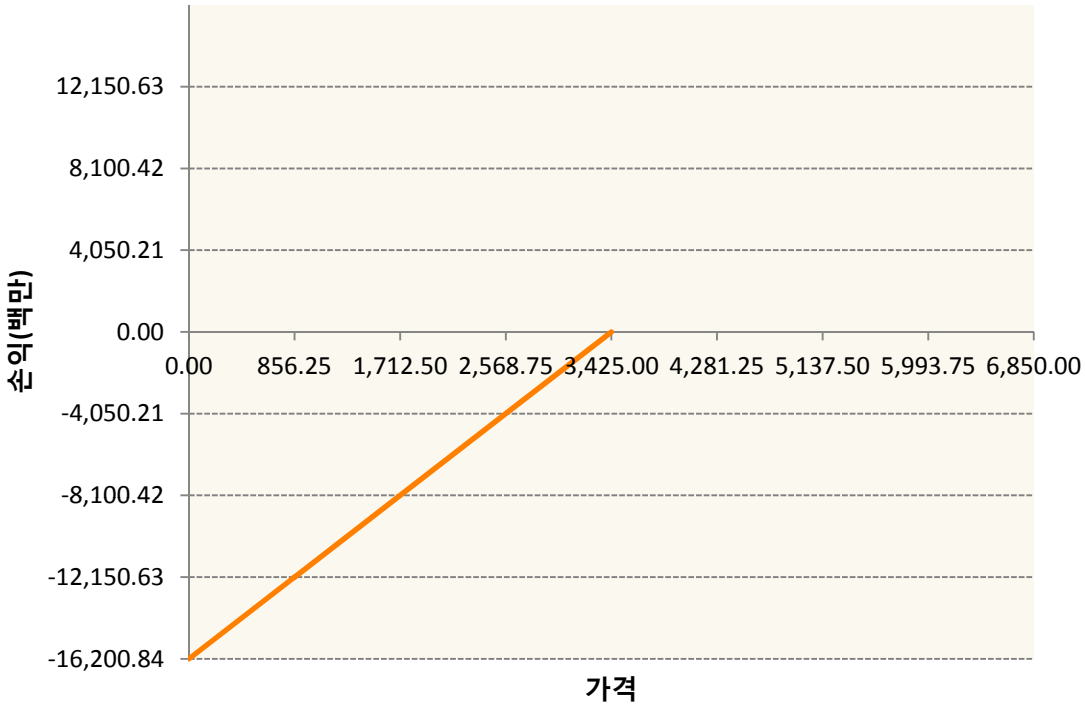
2. 만기시점의 손익구조



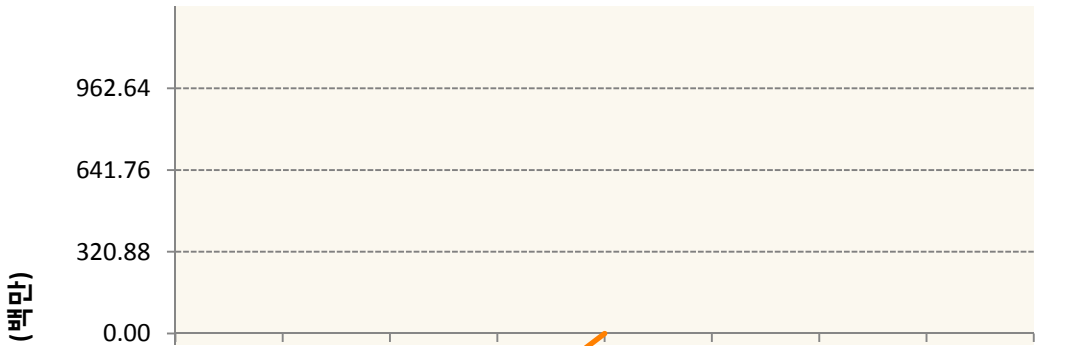


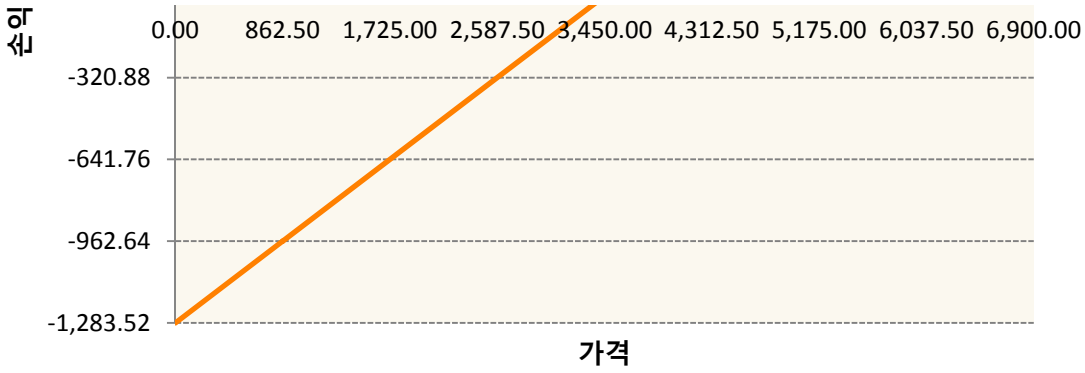


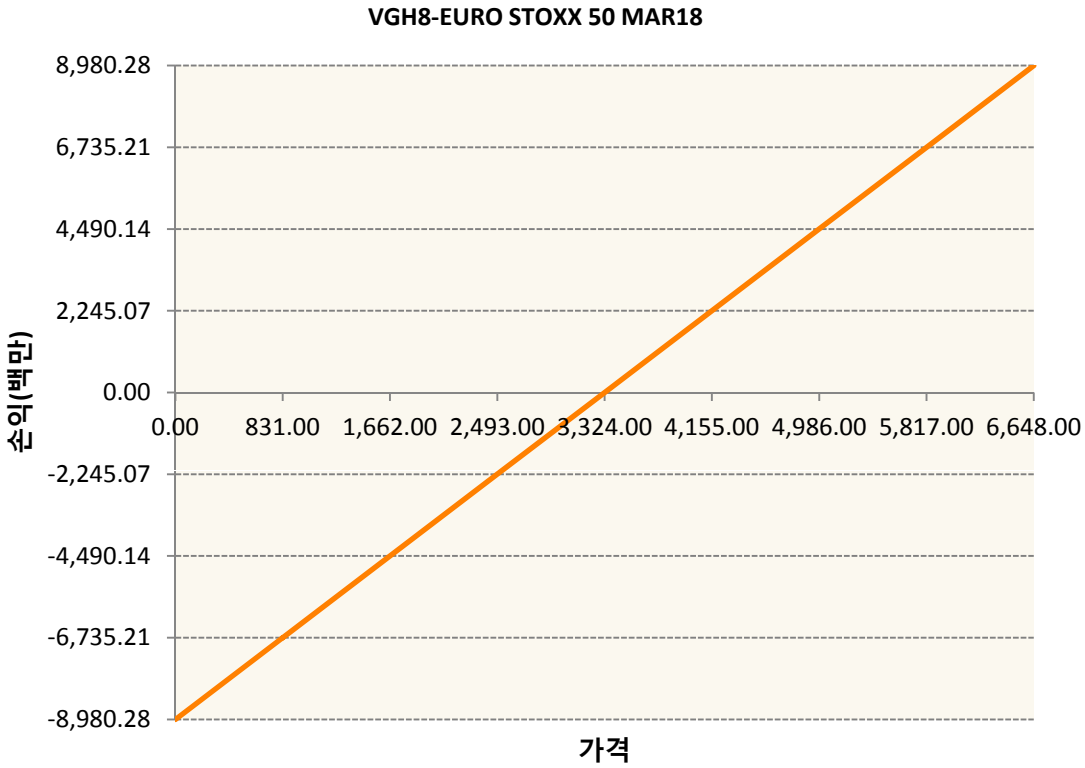
OESXH8-P3425-EURO STOXX 50



OESXH8-P3450-EURO STOXX 50







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)	(단위:백만원)
260105SGPX SG EURO Covered CALL STRATEGY - 994.569	288
260105SQPX SG EURO Covered CALL STRATEGY	540
OESXH8-C34 EURO STOXX 50	1,296
OESXH8-C34 EURO STOXX 50	103
OESXH8-P34 EURO STOXX 50	1,296
OESXH8-P34 EURO STOXX 50	103
VGH8 EURO STOXX 50 MAR18	718

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

2,611

공시일	2018-03-06
기준일	2018-03-05

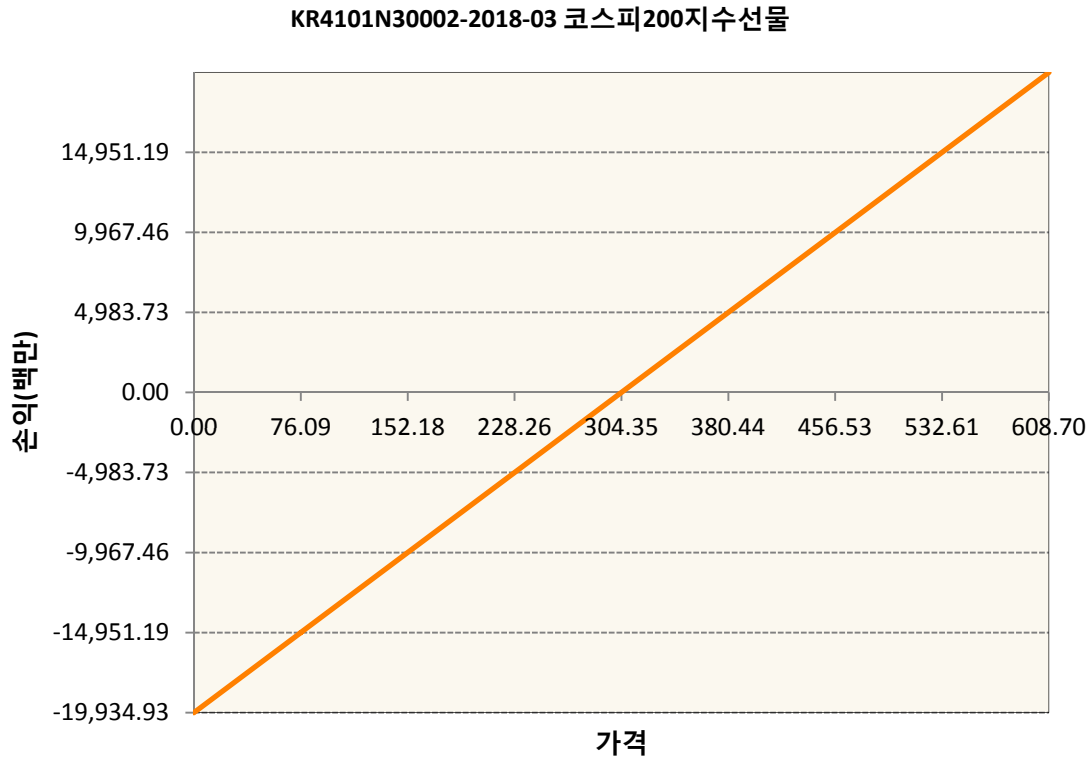
ETF스마트레버리지목표전환형8호

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	19,935	0	19,935	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101N30(2018-03 코스피200지수선물							1,596
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,596	-1,596	-1,596	-1,596	-1,596	-1,596	-1,596
-5.33%	-1,064	-1,064	-1,064	-1,064	-1,064	-1,064	-1,064
-2.67%	-532	-532	-532	-532	-532	-532	-532
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	532	532	532	532	532	532	532
5.33%	1,064	1,064	1,064	1,064	1,064	1,064	1,064
8.00%	1,596	1,596	1,596	1,596	1,596	1,596	1,596

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

1,091

공시일	2018-03-06
기준일	2018-03-05

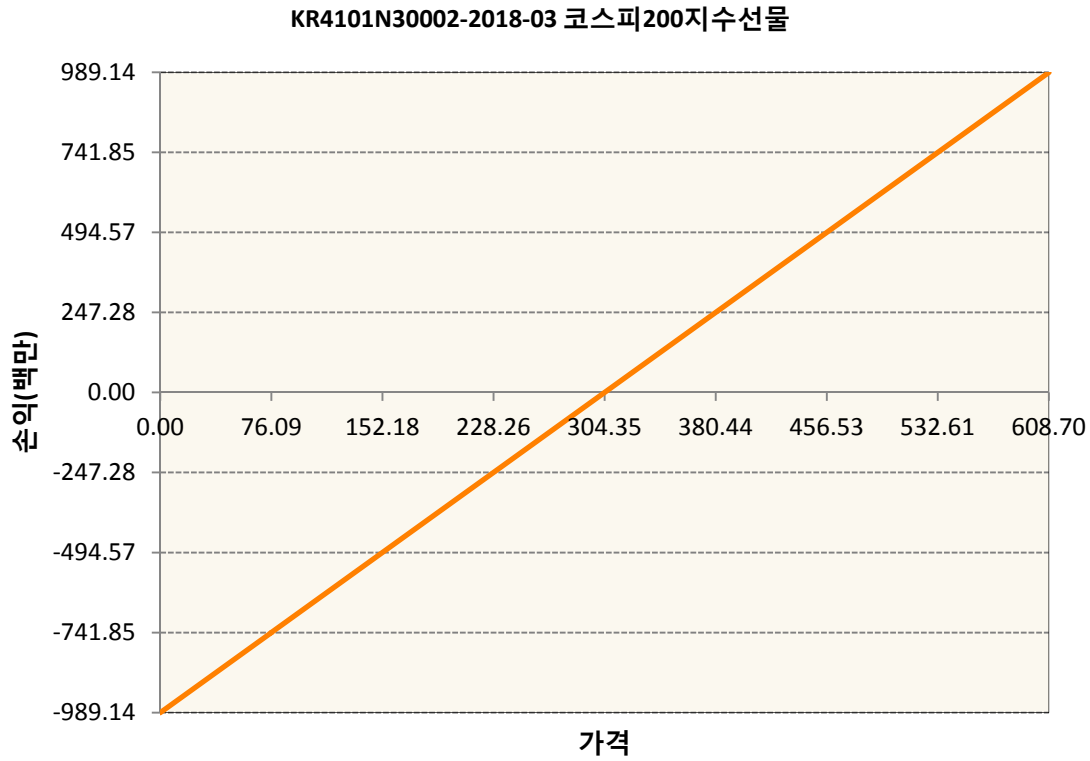
ETF스마트레버리지목표전환형9호

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	989	0	989	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101N30(2018-03 코스피200지수선물							79
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-79	-79	-79	-79	-79	-79	-79
-5.33%	-53	-53	-53	-53	-53	-53	-53
-2.67%	-26	-26	-26	-26	-26	-26	-26
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	26	26	26	26	26	26	26
5.33%	53	53	53	53	53	53	53
8.00%	79	79	79	79	79	79	79

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

54

공시일	2018-03-06
기준일	2018-03-05

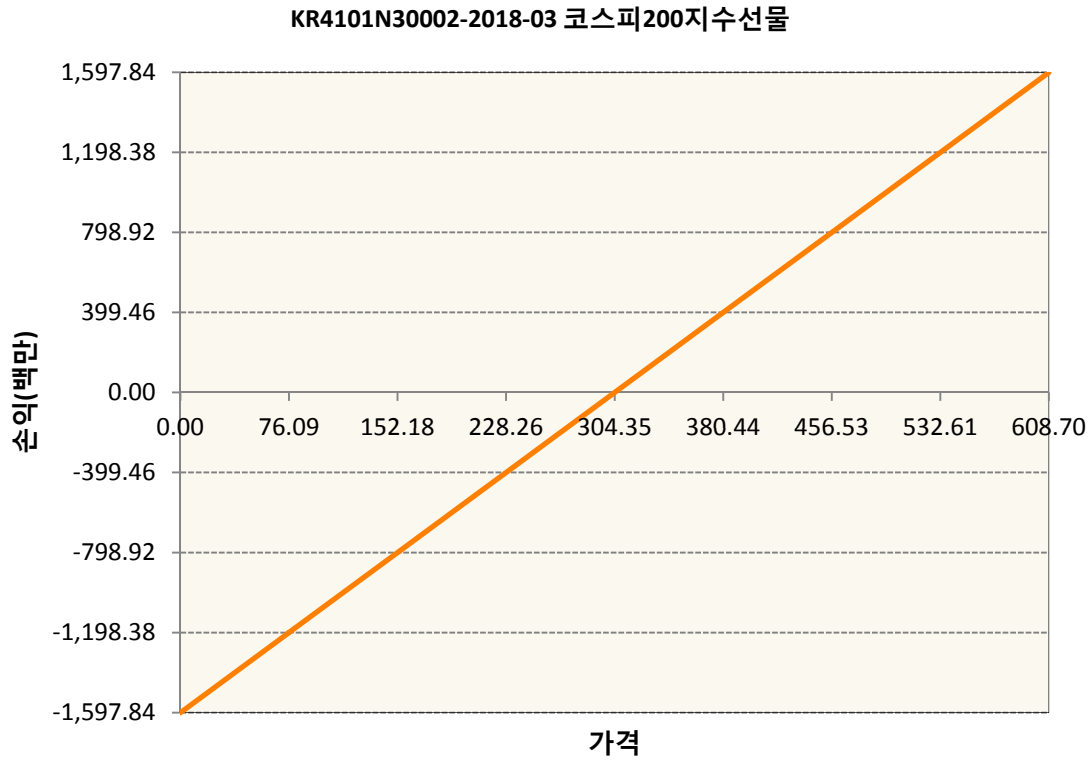
ETF스마트레버리지목표전환형10

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	1,598	0	1,598	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101N30(2018-03 코스피200지수선물							128
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-128	-128	-128	-128	-128	-128	-128
-5.33%	-85	-85	-85	-85	-85	-85	-85
-2.67%	-43	-43	-43	-43	-43	-43	-43
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	43	43	43	43	43	43	43
5.33%	85	85	85	85	85	85	85
8.00%	128	128	128	128	128	128	128

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

87

공시일	2018-03-06
기준일	2018-03-05

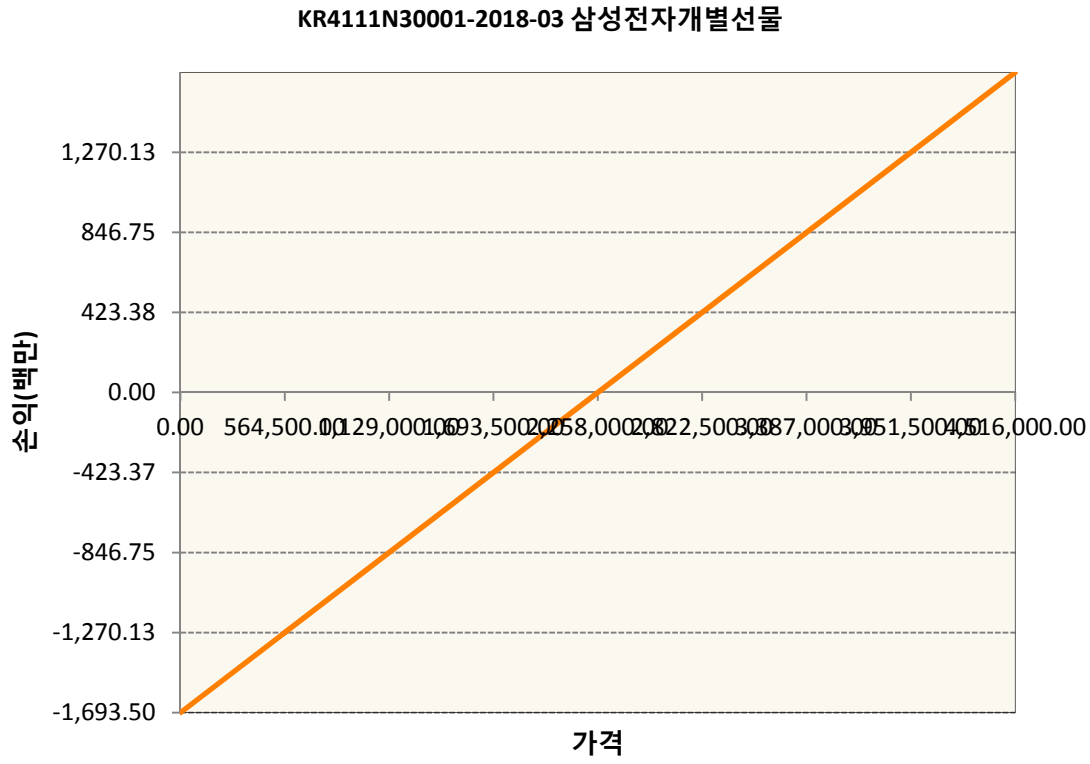
스마트KRX300인덱스1호(주식-파

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	1,694	0	1,694	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4111N30(2018-03 삼성전자개별선물							136
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-136	-136	-136	-136	-136	-136	-136
-5.33%	-90	-90	-90	-90	-90	-90	-90
-2.67%	-45	-45	-45	-45	-45	-45	-45
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	45	45	45	45	45	45	45
5.33%	90	90	90	90	90	90	90
8.00%	136	136	136	136	136	136	136

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

161

공시일	2018-03-06
기준일	2018-03-05

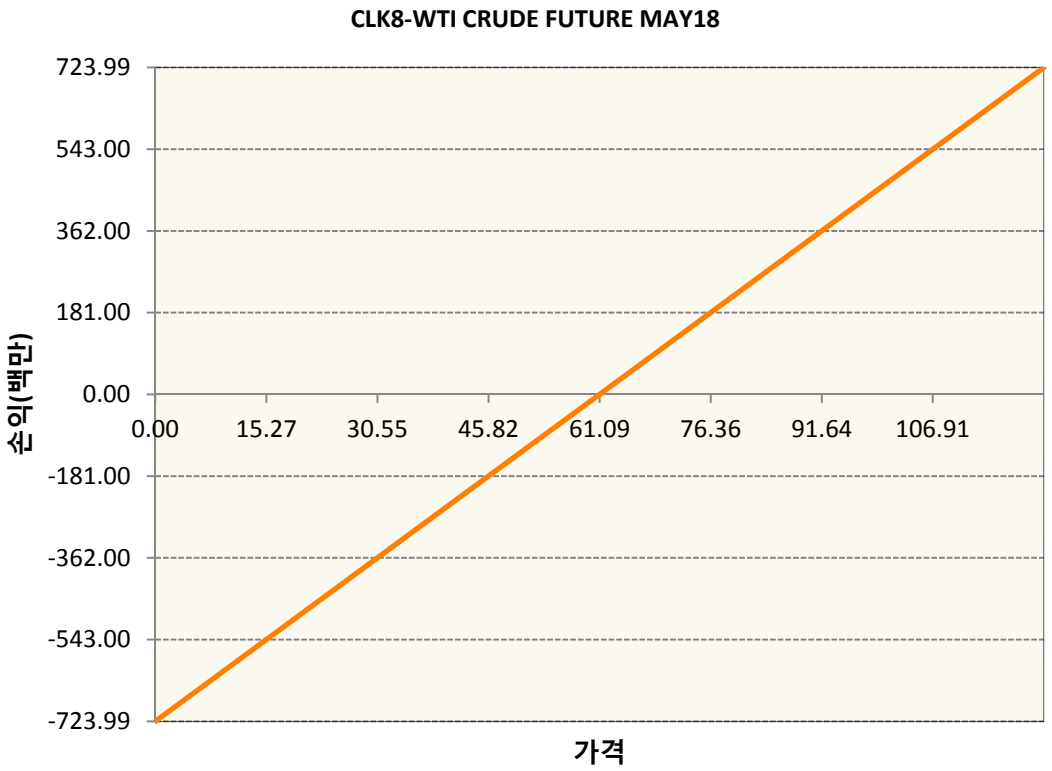
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

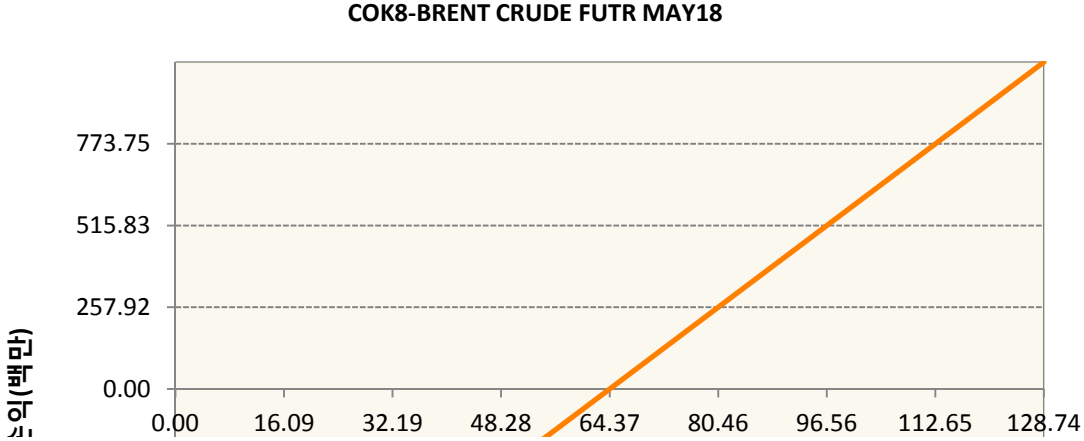
1. 계약금액

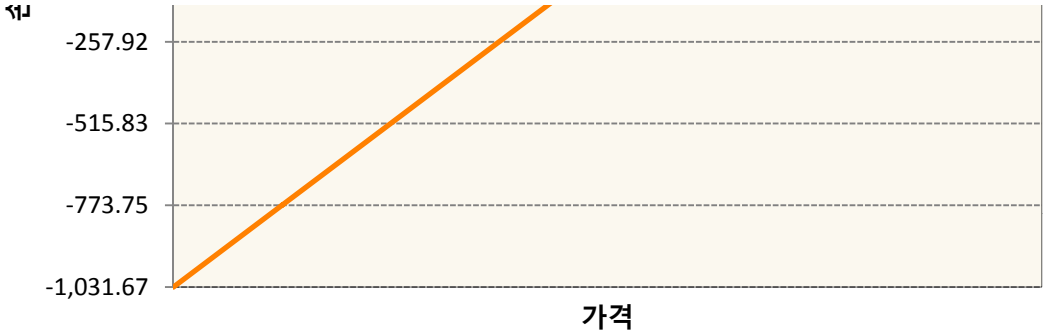
(단위:백만원)

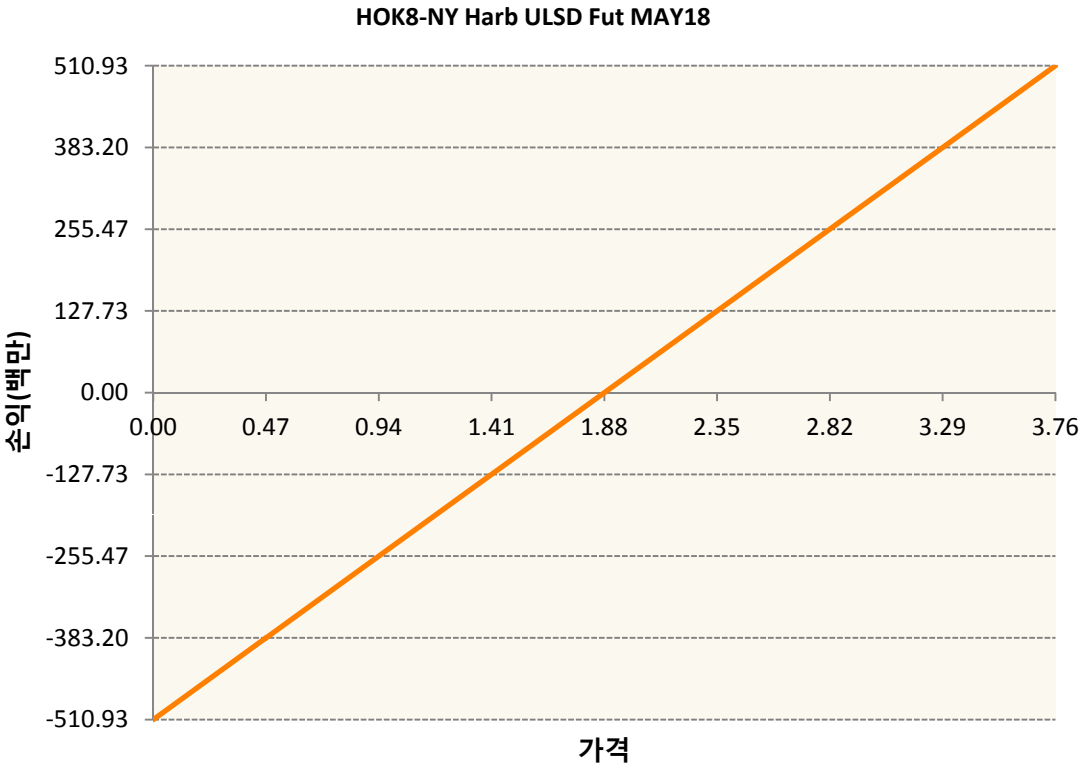
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	선물	유가증권	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	선물	유가증권	724	0	724	
누계	유가증권	선물	3,207	595	2,611	

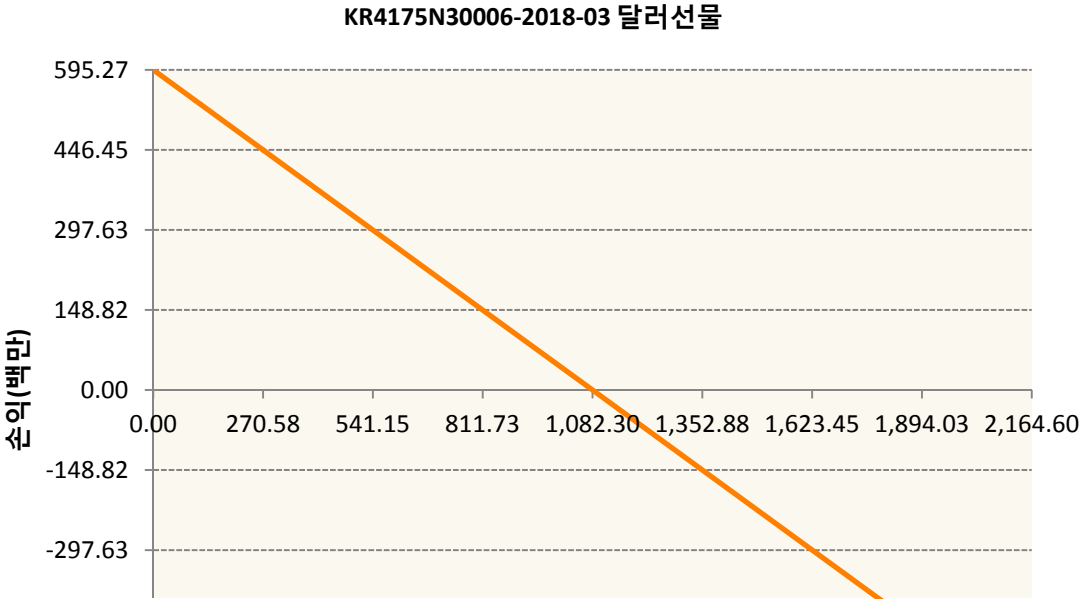
2. 만기시점의 손익구조

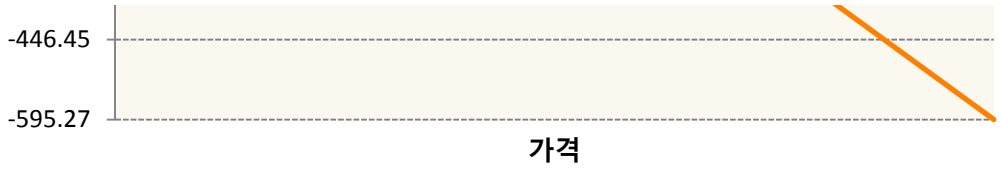


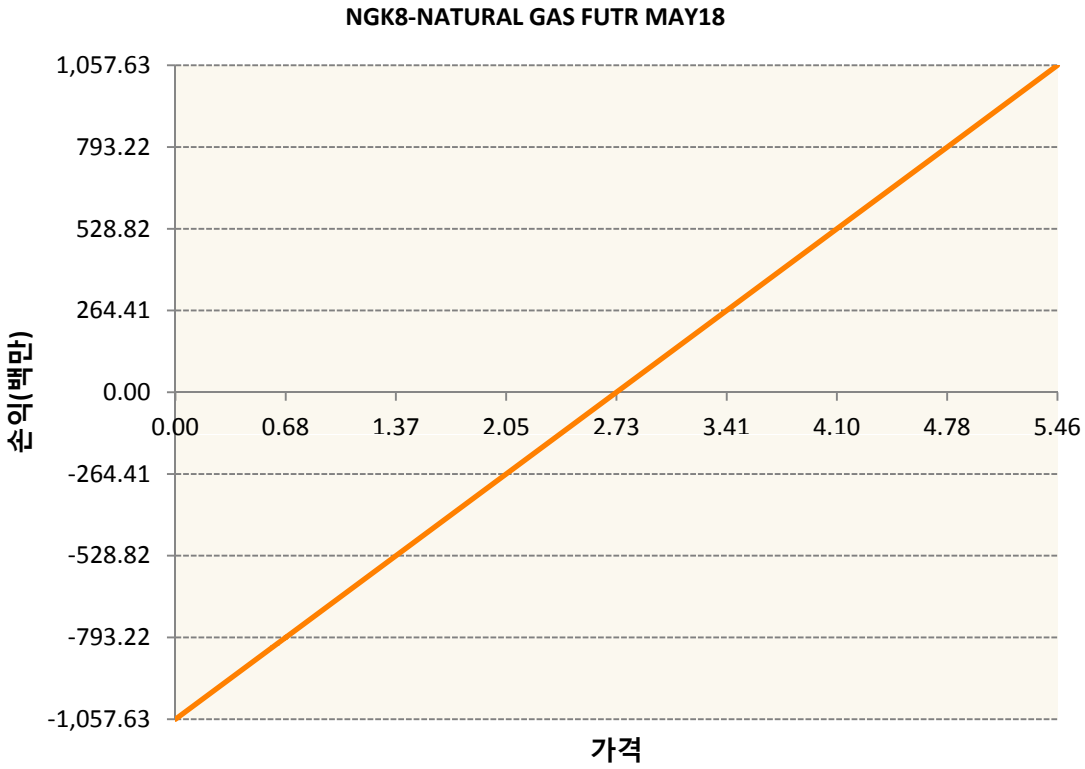


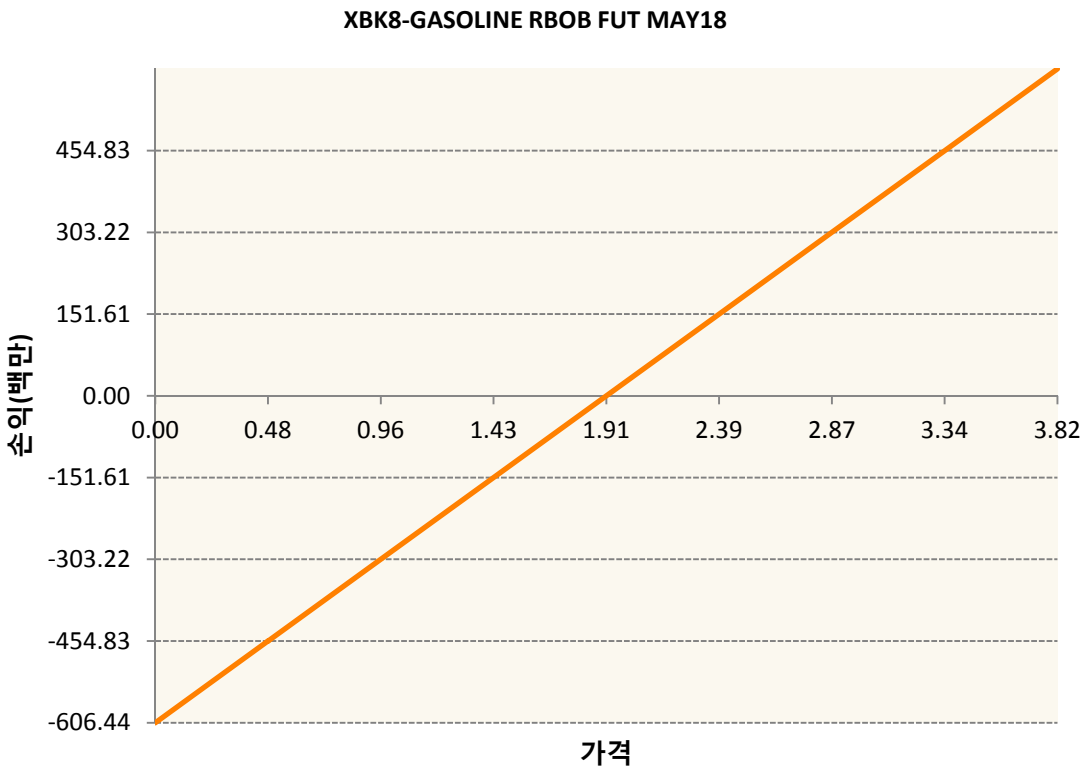

-257.92
-515.83
-773.75
-1,031.67
가격


HOK8-NY Harb ULSD Fut MAY18
510.93
383.20
255.47
127.73
0.00
-127.73
-255.47
-383.20
-510.93
0.00
0.47
0.94
1.41
1.88
2.35
2.82
3.29
3.76
손익(백만)
가격


KR4175N30006-2018-03 달러선물
595.27
446.45
297.63
148.82
0.00
-148.82
-297.63
0.00
270.58
541.15
811.73
1,082.30
1,352.88
1,623.45
1,894.03
2,164.60
손익(백만)


-446.45
-595.27
가격


NGK8-NATURAL GAS FUTR MAY18
1,057.63
793.22
528.82
264.41
0.00
-264.41
-528.82
-793.22
-1,057.63
0.00
0.68
1.37
2.05
2.73
3.41
4.10
4.78
5.46
손익(백만)
가격


XBK8-GASOLINE RBOB FUT MAY18
454.83
303.22
151.61
0.00
-151.61
-303.22
-454.83
-606.44
0.00
0.48
0.96
1.43
1.91
2.39
2.87
3.34
3.82
손익(백만)
가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLK8	WTI CRUDE FUTURE MAY18	58
COK8	BRENT CRUDE FUTR MAY18	83
HOK8	NY Harb ULSD Fut MAY18	41
KR4175N30(	2018-03 달러선물	48
NGK8	NATURAL GAS FUTR MAY18	85
XBK8	GASOLINE RBOB FUT MAY18	49

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

518

공시일	2018-03-06
기준일	2018-03-05

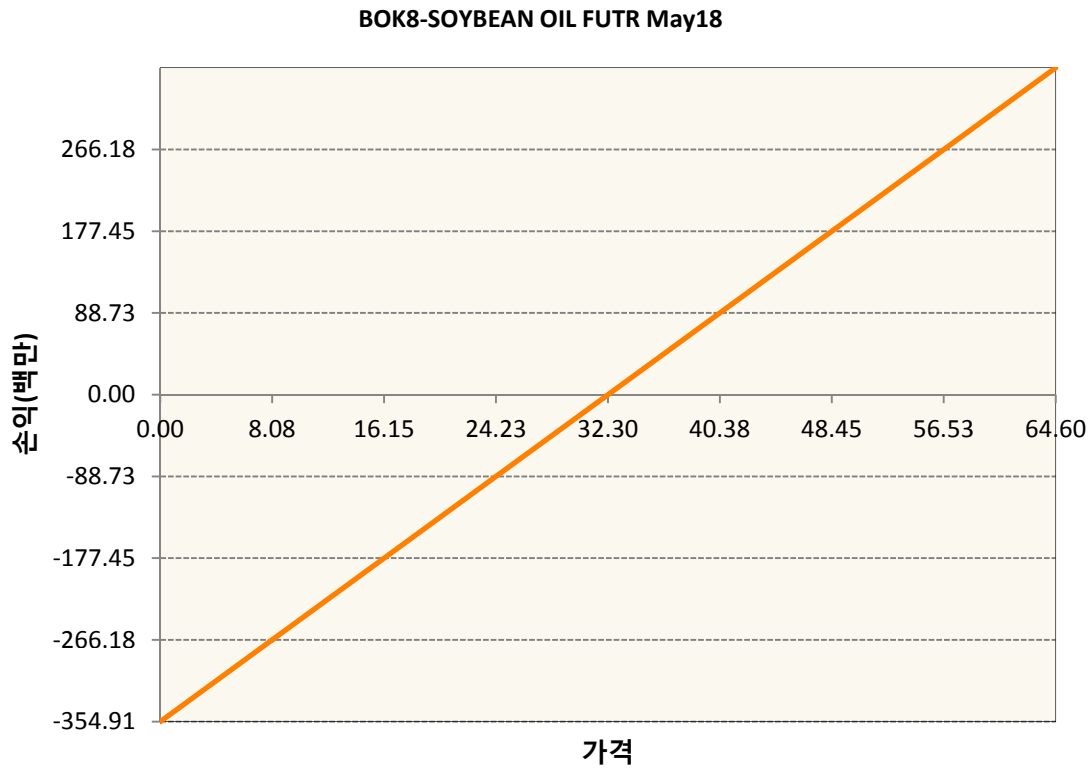
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

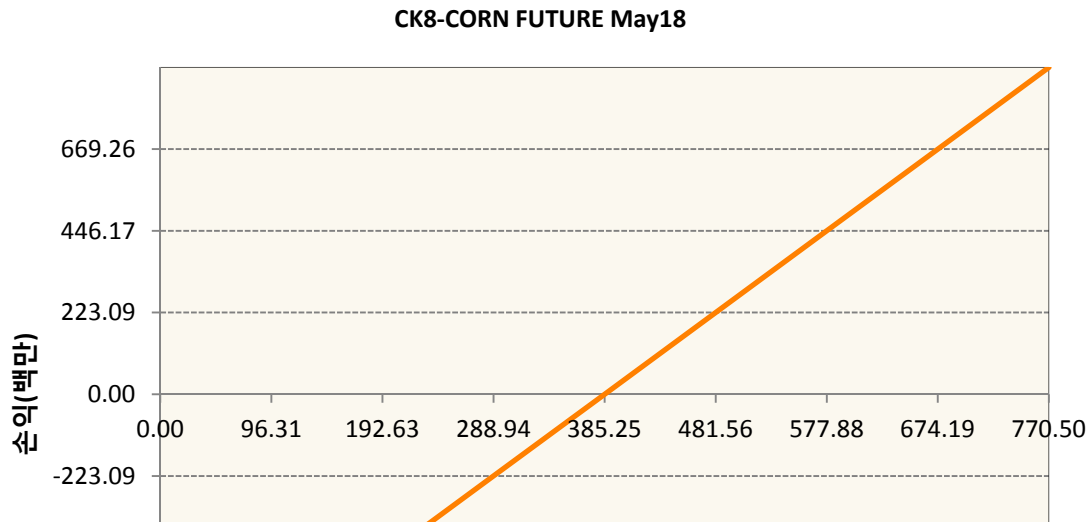
1. 계약금액

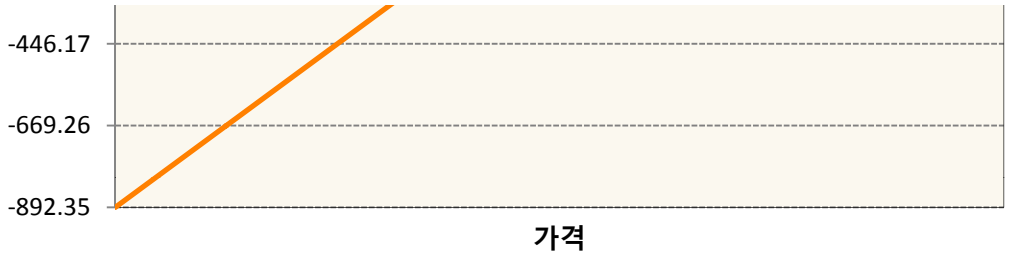
(단위:백만원)

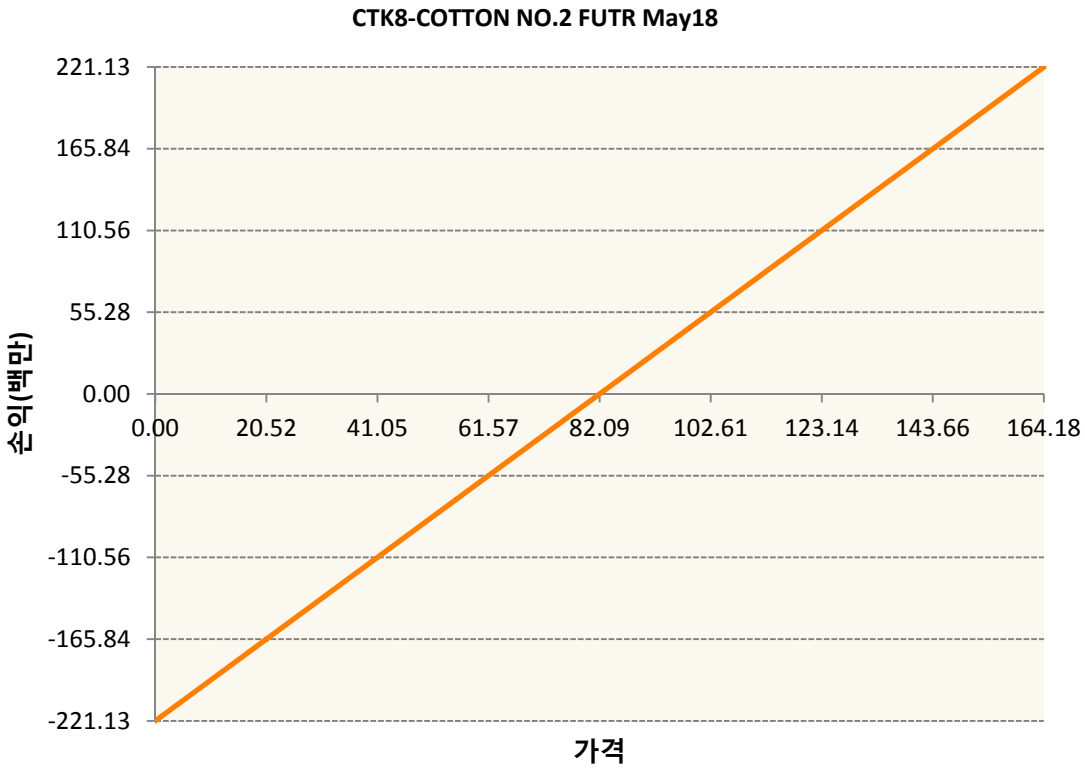
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	4,262	325	3,937	

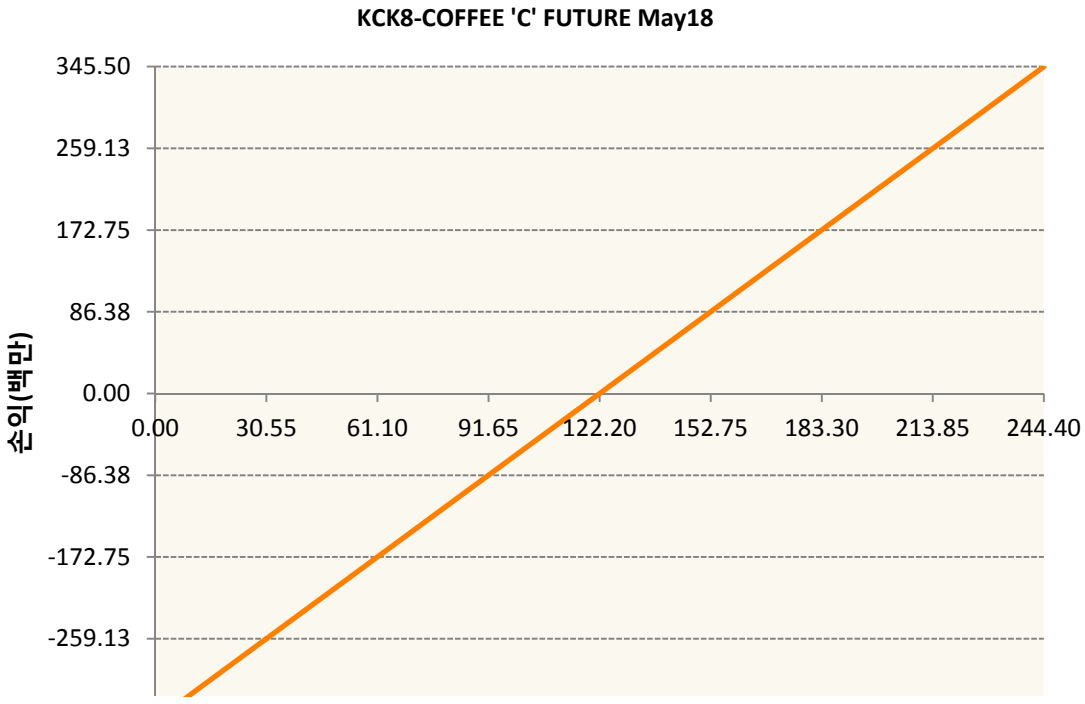
2. 만기시점의 손익구조

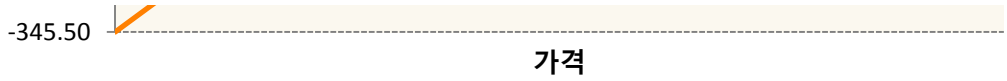


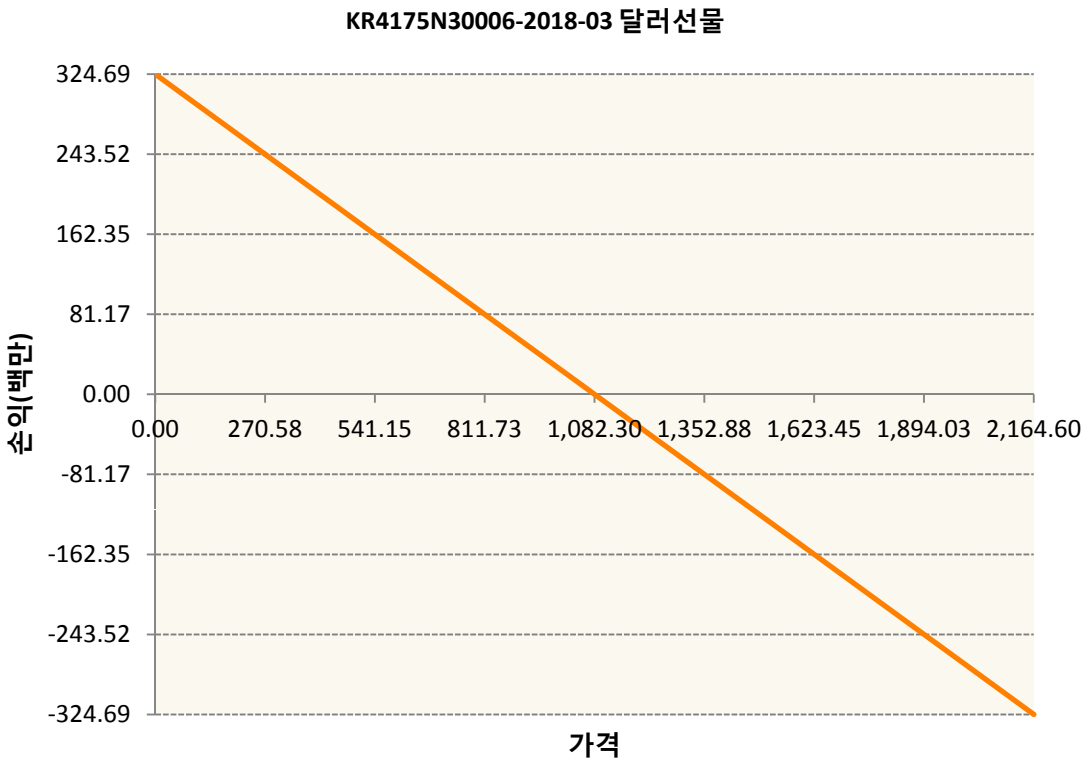


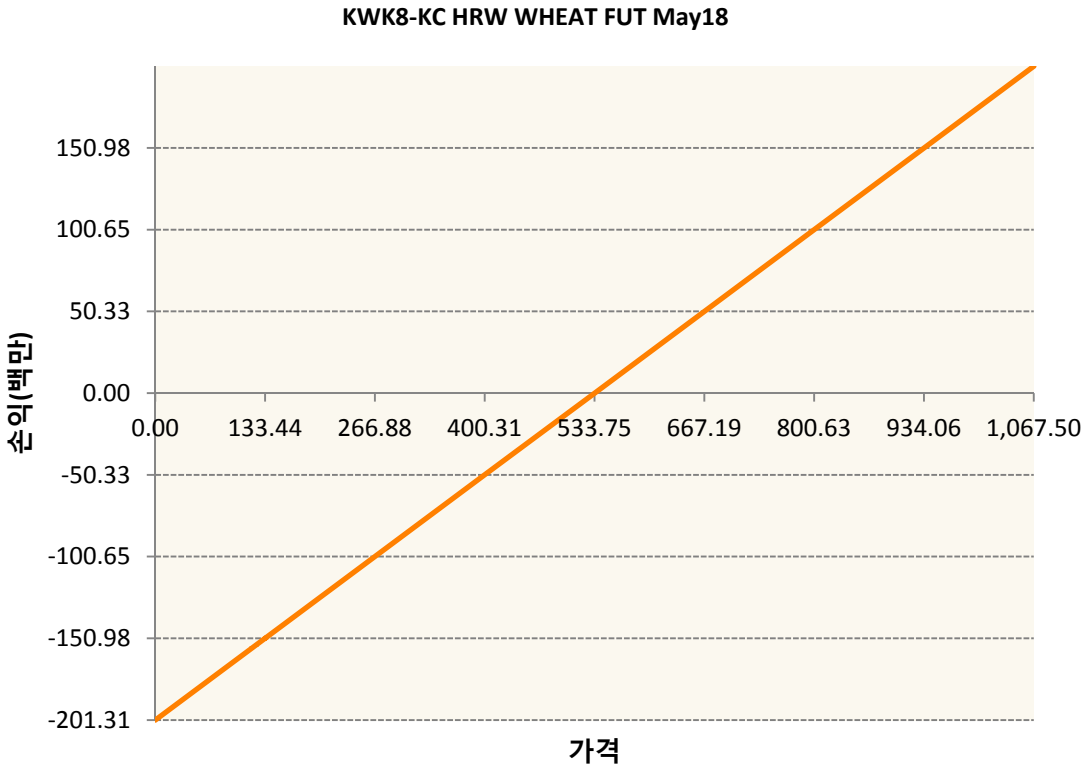

-446.17
-669.26
-892.35
가격

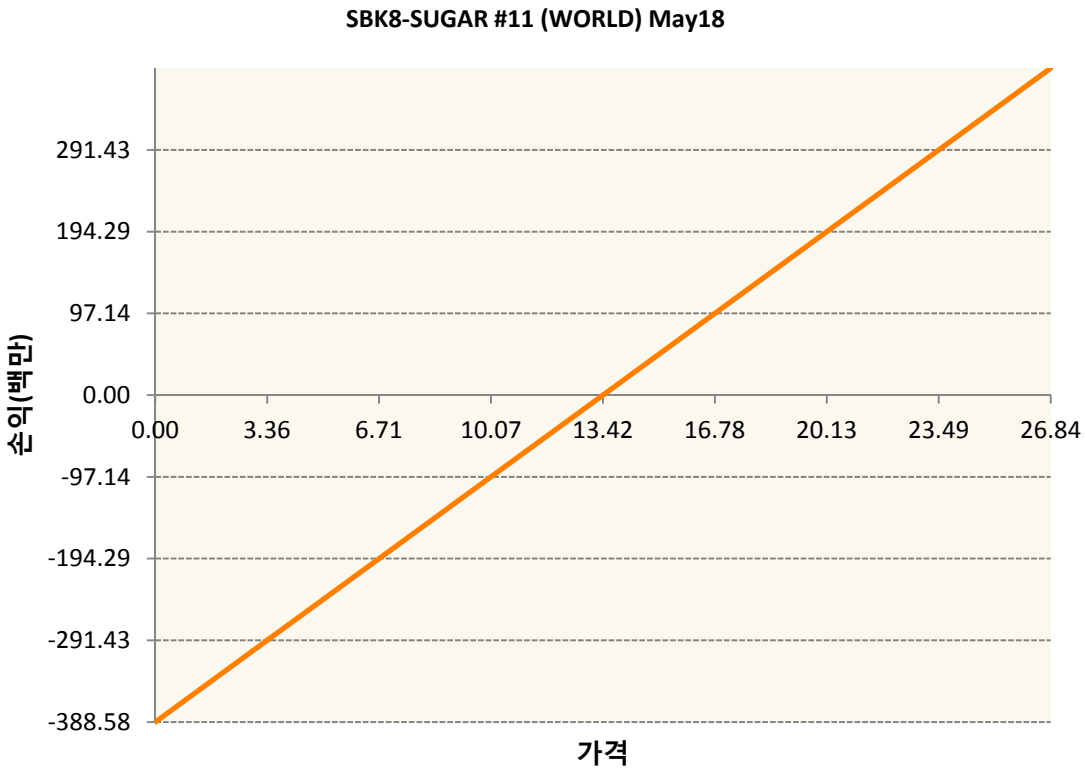

CTK8-COTTON NO.2 FUTR May18
221.13
165.84
110.56
55.28
0.00
-55.28
-110.56
-165.84
-221.13
0.00
20.52
41.05
61.57
82.09
102.61
123.14
143.66
164.18
손익(백만)
가격

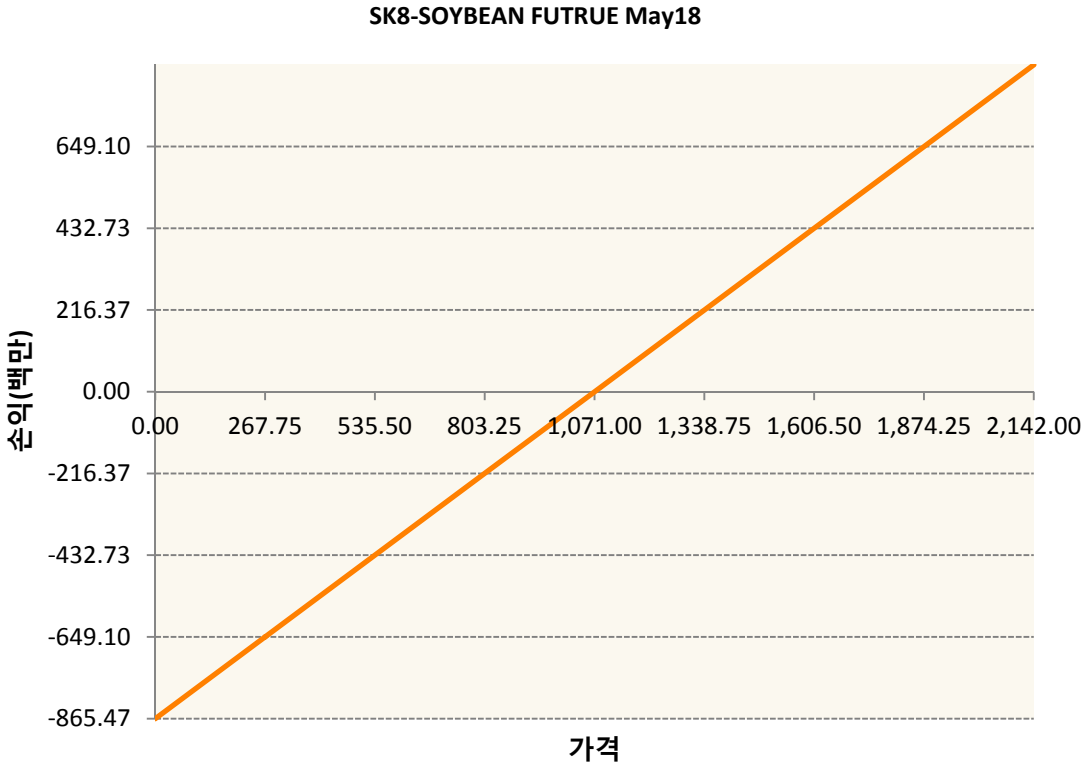

KCK8-COFFEE 'C' FUTURE May18
345.50
259.13
172.75
86.38
0.00
-86.38
-172.75
-259.13
0.00
30.55
61.10
91.65
122.20
152.75
183.30
213.85
244.40
손익(백만)


-345.50
가격

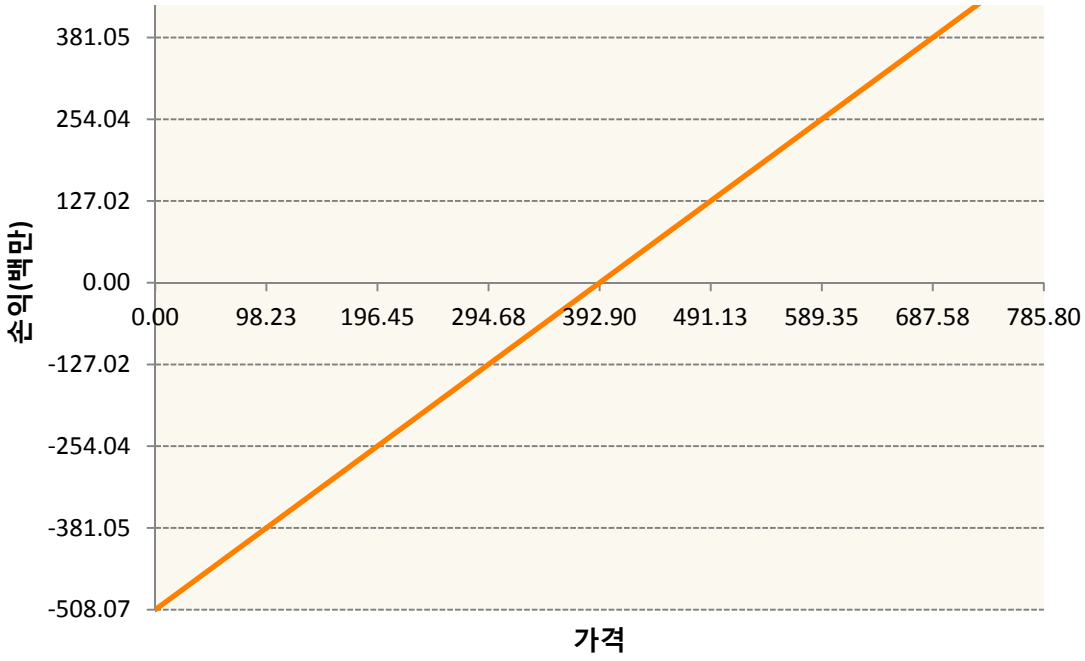

KR4175N30006-2018-03 달러선물
324.69
243.52
162.35
81.17
0.00
-81.17
-162.35
-243.52
-324.69
0.00
270.58
541.15
811.73
1,082.30
1,352.88
1,623.45
1,894.03
2,164.60
손익(백만)
가격

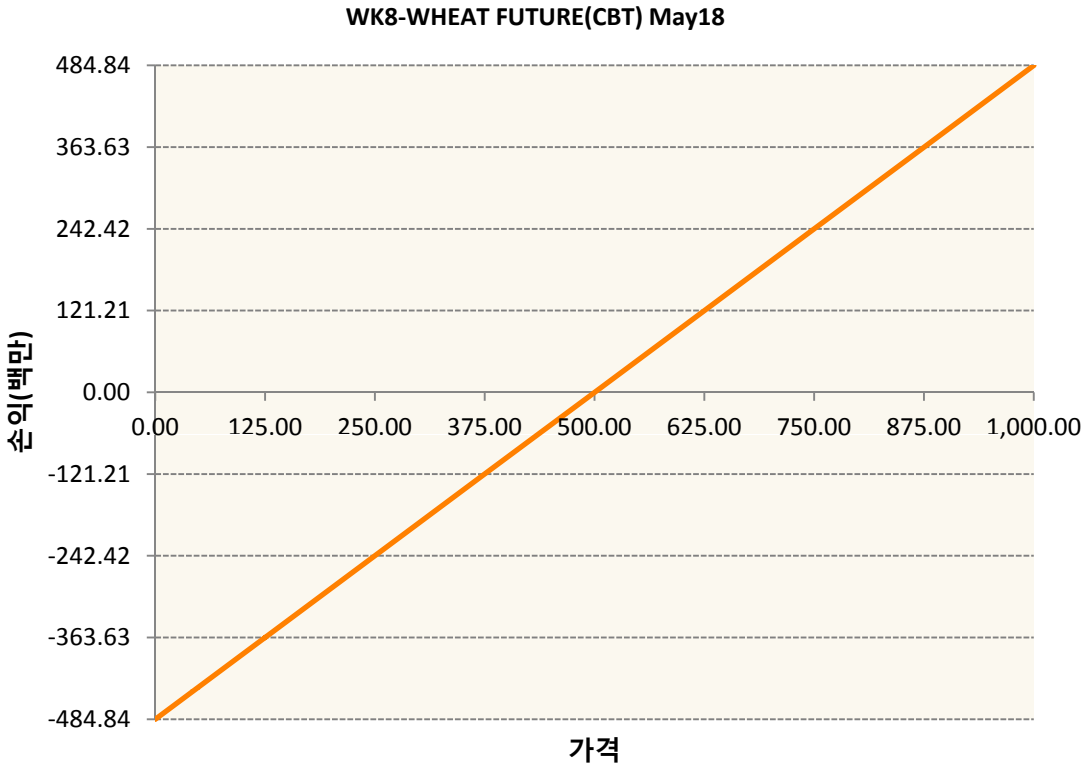

KWK8-KC HRW WHEAT FUT May18
150.98
100.65
50.33
0.00
-50.33
-100.65
-150.98
-201.31
0.00
133.44
266.88
400.31
533.75
667.19
800.63
934.06
1,067.50
손익(백만)
가격


SBK8-SUGAR #11 (WORLD) May18
291.43
194.29
97.14
0.00
-97.14
-194.29
-291.43
-388.58
손익(백만)
0.00
3.36
6.71
10.07
13.42
16.78
20.13
23.49
26.84
가격


SK8-SOYBEAN FUTRUE May18
649.10
432.73
216.37
0.00
-216.37
-432.73
-649.10
-865.47
손익(백만)
0.00
267.75
535.50
803.25
1,071.00
1,338.75
1,606.50
1,874.25
2,142.00
가격


SMK8-SOYBEAN MEAL FUTR May18
508.07





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

BOK8	SOYBEAN OIL FUTR May18	28
CK8	CORN FUTURE May18	71
CTK8	COTTON NO.2 FUTR May18	18
KCK8	COFFEE 'C' FUTURE May18	28
KR4175N30(	2018-03 달러선물	26

KWK8	KC HRW WHEAT FUT May18	16
SBK8	SUGAR #11 (WORLD) May18	31
SK8	SOYBEAN FUTRUE May18	69
SMK8	SOYBEAN MEAL FUTR May18	41
WK8	WHEAT FUTURE(CBT) May18	39

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

347