공시일	2018-03-07
기준일	2018-03-06

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	2018-03-07
기준일	2018-03-06

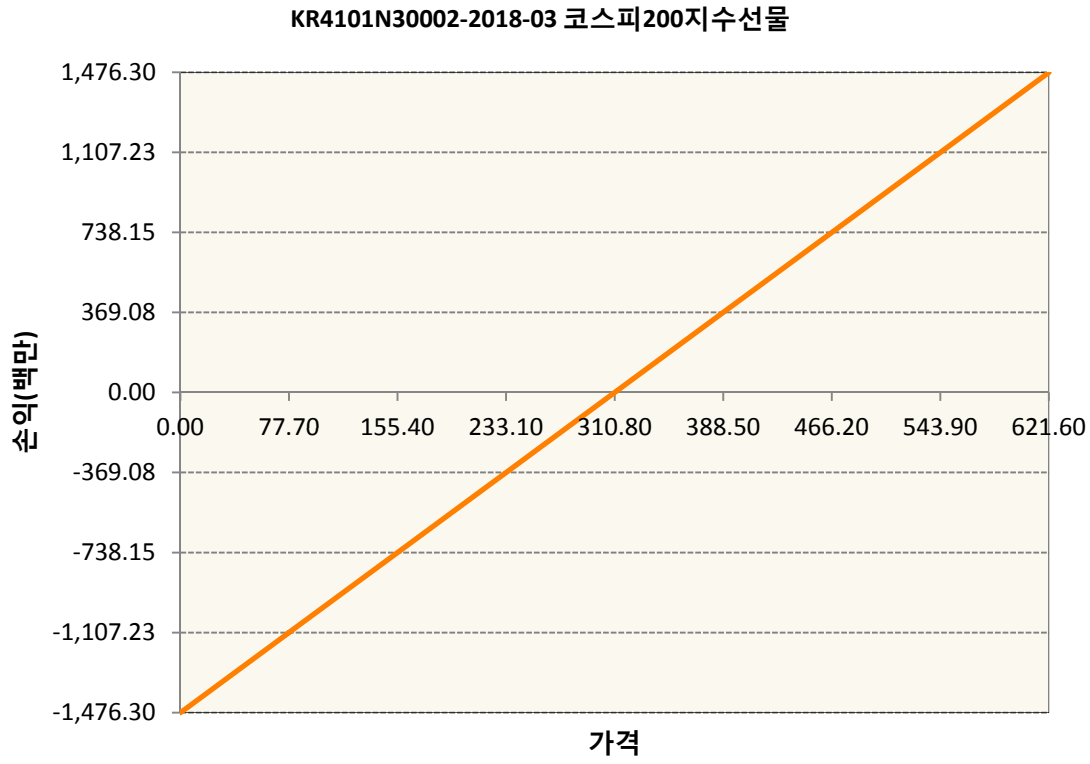
스마트인덱스모

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	1,476	0	1,476	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101N30(2018-03 코스피200지수선물							118
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-118	-118	-118	-118	-118	-118	-118
-5.33%	-79	-79	-79	-79	-79	-79	-79
-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%	79	79	79	79	79	79	79
8.00%	118	118	118	118	118	118	118

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

82

공시일	2018-03-07
기준일	2018-03-06

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	1,104

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

412

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2018-03-07
기준일	2018-03-06

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	410

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

409

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2018-03-07
기준일	2018-03-06

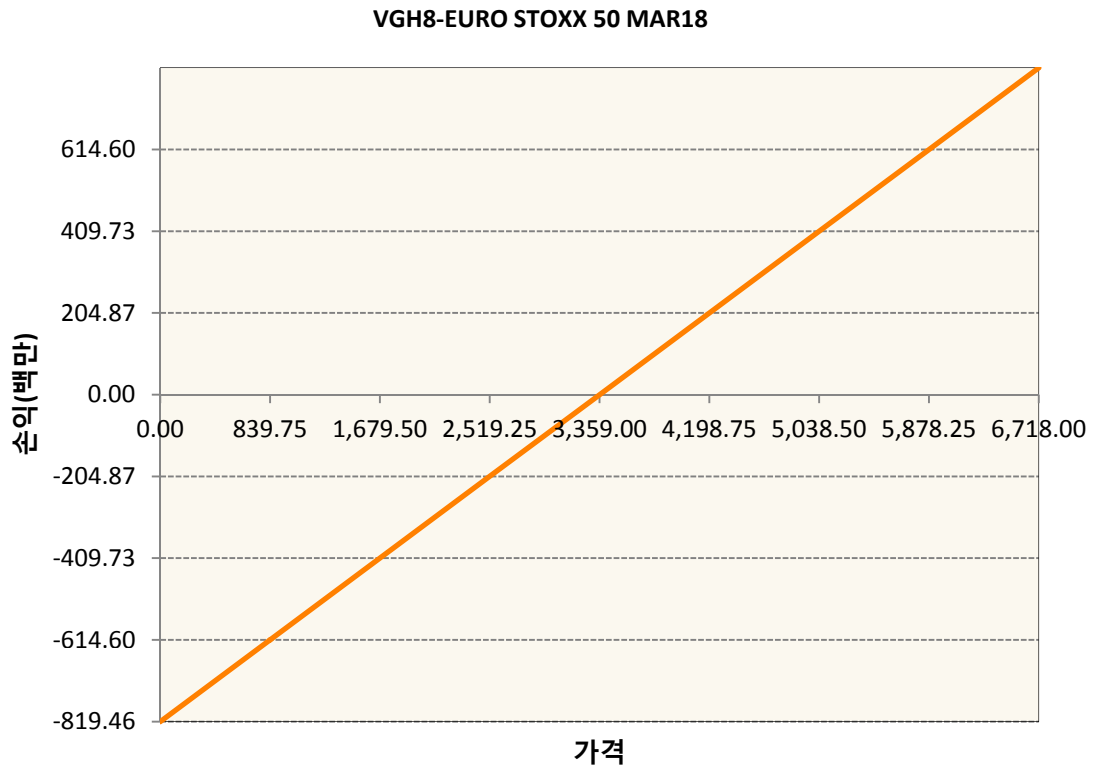
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	819	0	819	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGH8	EURO STOXX 50 MAR18	66

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

(단위:백만원)

38

공시일	2018-03-07
기준일	2018-03-06

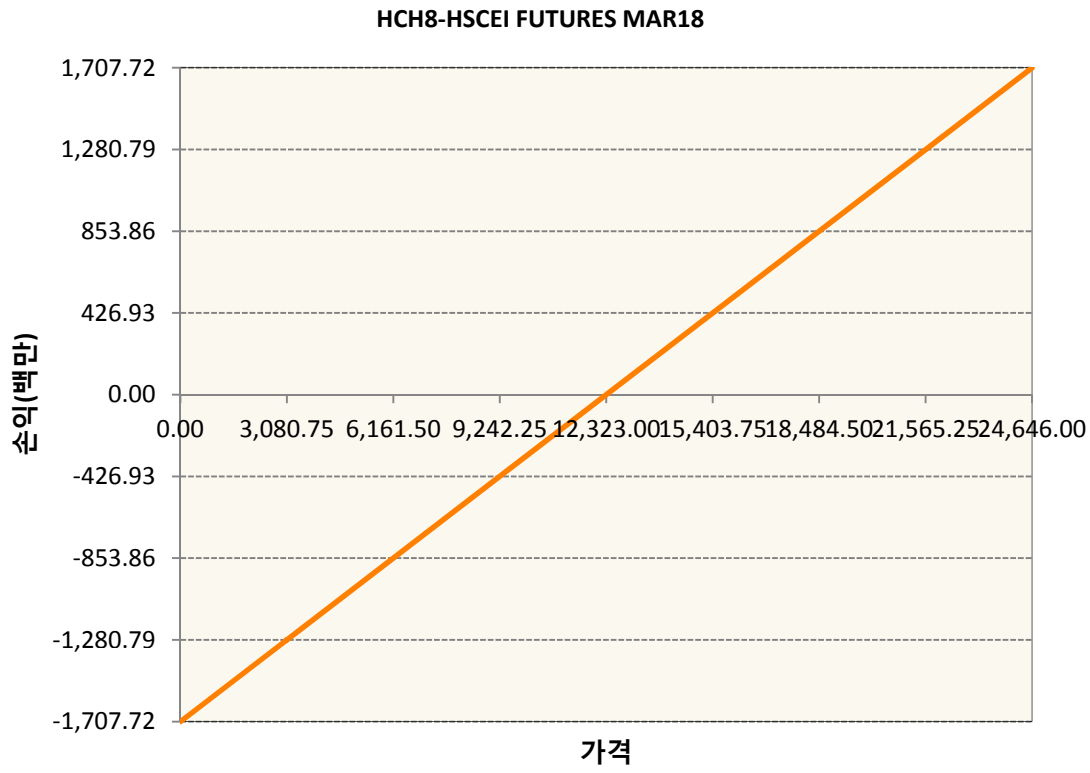
차이나인덱스모(주식-파생형)

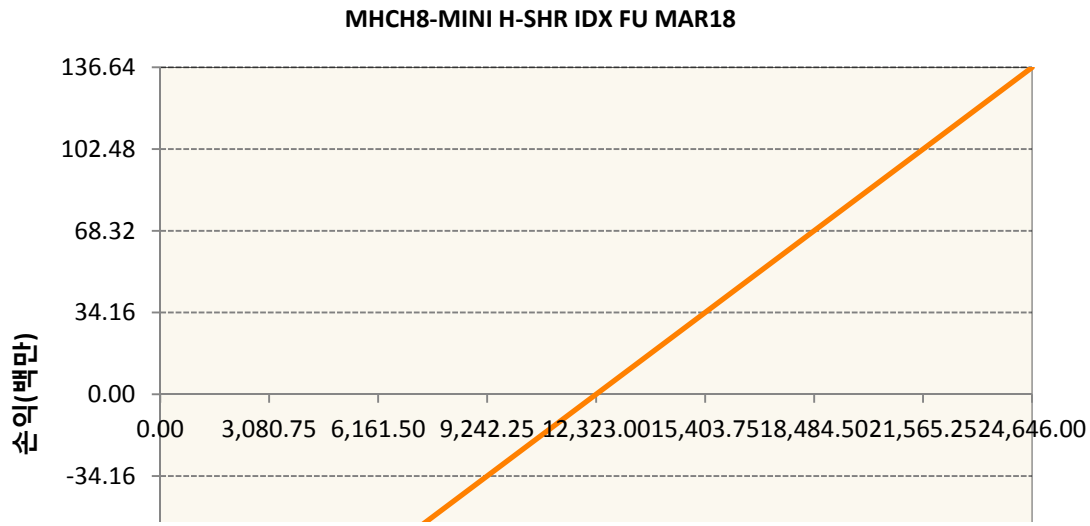
1. 계약금액

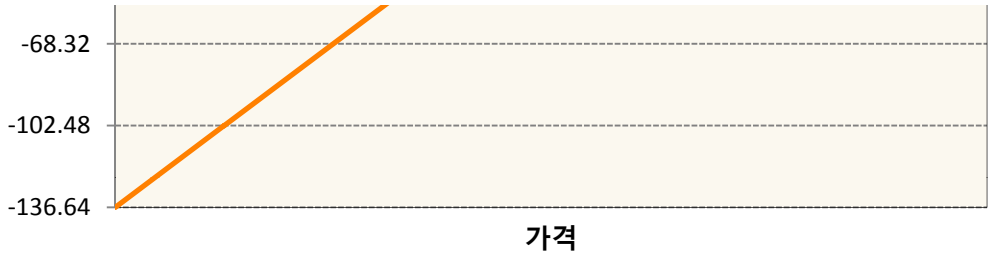
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,844	0	1,844	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCH8	HSCEI FUTURES MAR18	137
MHCH8	MINI H-SHR IDX FU MAR18	11

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

공시일	2018-03-07
기준일	2018-03-06

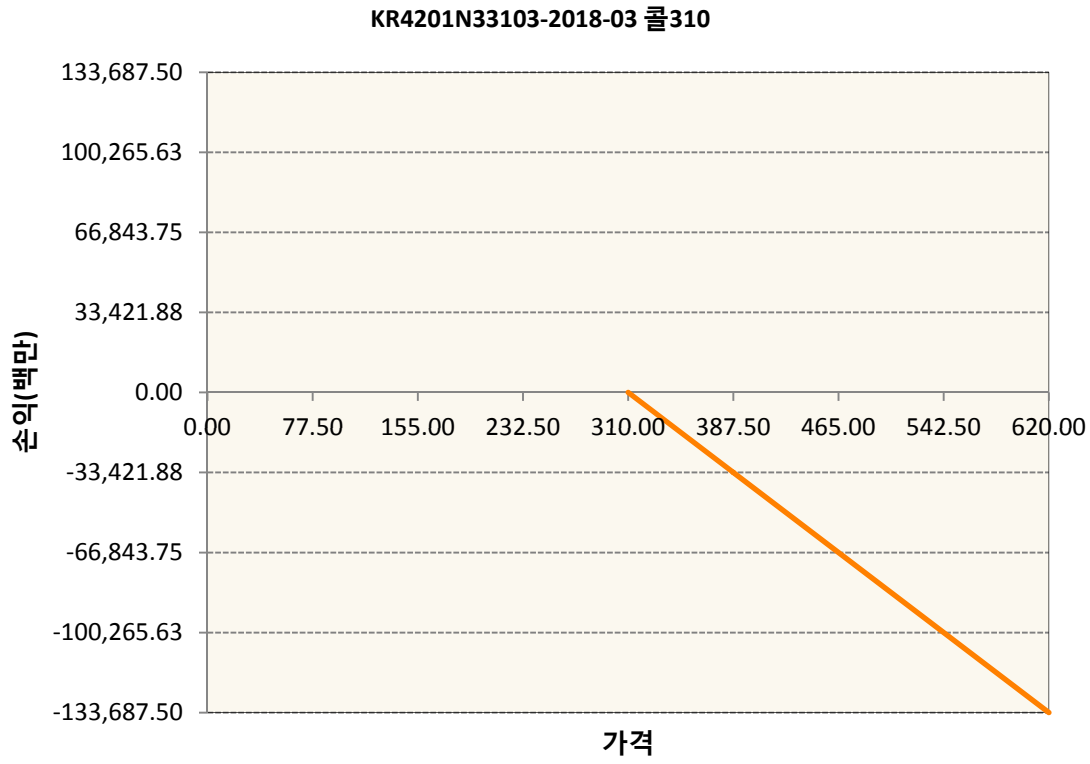
커버드콜모(주식혼합-파생형)

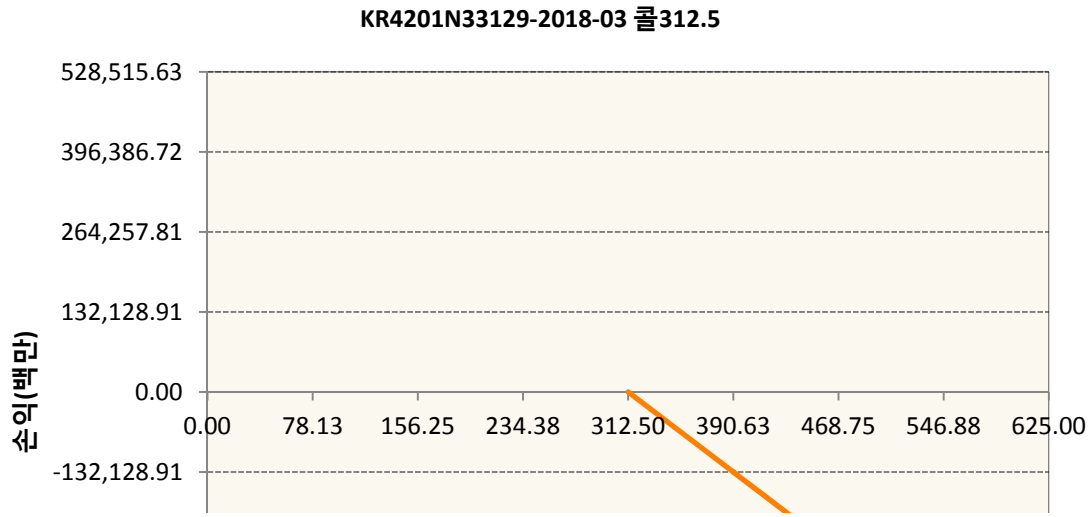
1. 계약금액

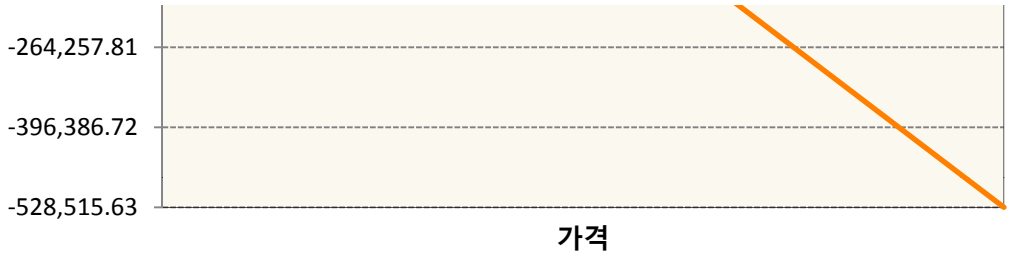
(단위:백만원)

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



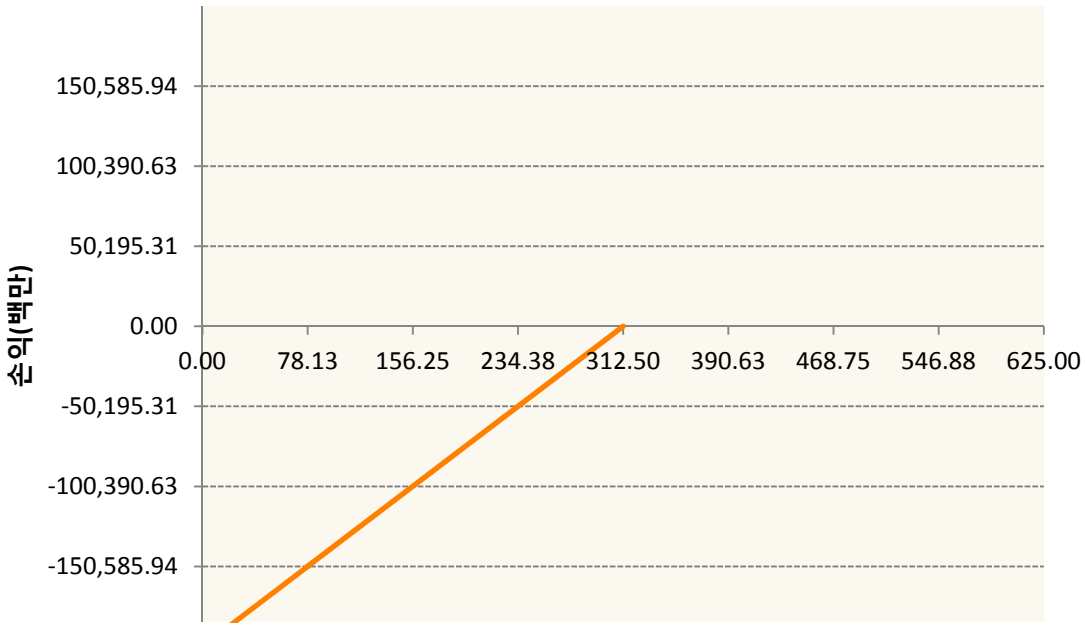




KR4301N33101-2018-03 풋310



KR4301N33127-2018-03 풋312.5





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201N3312018-03 콜310							9,733
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,177	1,177	1,177	1,177	1,177	1,177	1,177
-5.33%	1,177	1,177	1,176	1,174	1,170	1,165	1,157
-2.67%	1,140	1,115	1,085	1,048	1,006	959	908
0%	268	178	89	0	-89	-179	-268
2.67%	-2,619	-2,638	-2,664	-2,697	-2,734	-2,777	-2,824
5.33%	-6,162	-6,163	-6,164	-6,166	-6,169	-6,175	-6,183
8.00%	-9,732	-9,732	-9,732	-9,732	-9,732	-9,732	-9,733
KR4201N3312018-03 콜312.5							35,837
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	2,729	2,729	2,729	2,729	2,729	2,729	2,729
-5.33%	2,729	2,729	2,728	2,726	2,721	2,712	2,698
-2.67%	2,693	2,655	2,599	2,522	2,426	2,310	2,176
0%	986	662	333	0	-336	-674	-1,014
2.67%	-8,185	-8,350	-8,540	-8,751	-8,980	-9,224	-9,481
5.33%	-21,829	-21,835	-21,848	-21,871	-21,906	-21,954	-22,018
8.00%	-35,826	-35,826	-35,826	-35,827	-35,828	-35,831	-35,837
KR4301N3312018-03 풋310							19,146
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-19,146	-19,146	-19,146	-19,146	-19,146	-19,146	-19,146
-5.33%	-12,254	-12,254	-12,254	-12,254	-12,254	-12,254	-12,255
-2.67%	-5,366	-5,371	-5,379	-5,392	-5,410	-5,433	-5,461
0%	329	219	110	0	-110	-220	-330
2.67%	1,142	1,140	1,134	1,125	1,112	1,094	1,072
5.33%	1,144	1,144	1,144	1,144	1,144	1,144	1,143
8.00%	1,144	1,144	1,144	1,144	1,144	1,144	1,144
KR4301N3312018-03 풋312.5							15,452
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-15,452	-15,452	-15,452	-15,452	-15,452	-15,452	-15,452
-5.33%	-10,133	-10,133	-10,133	-10,133	-10,133	-10,133	-10,134
-2.67%	-4,815	-4,815	-4,816	-4,818	-4,822	-4,828	-4,836
0%	217	147	74	0	-76	-154	-232
2.67%	1,798	1,785	1,766	1,742	1,713	1,679	1,640

5.33%	1,813	1,813	1,813	1,813	1,812	1,812	1,811
8.00%	1,813	1,813	1,813	1,813	1,813	1,813	1,813

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

108,002

공시일	2018-03-07
기준일	2018-03-06

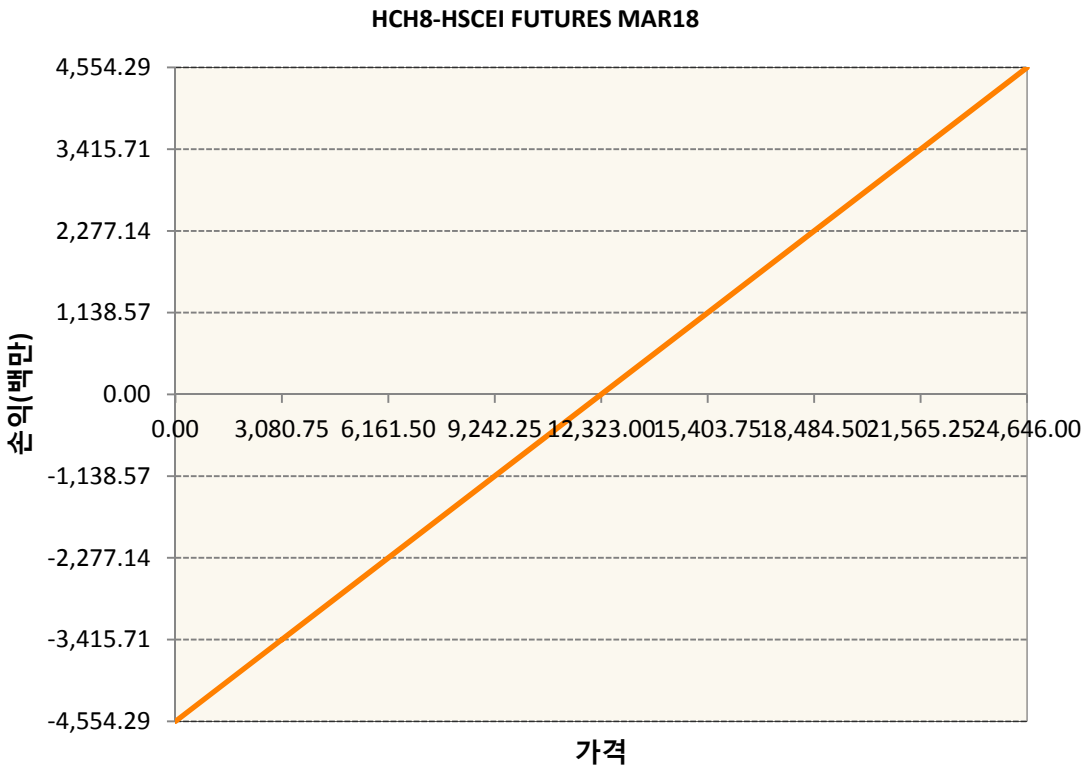
홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생

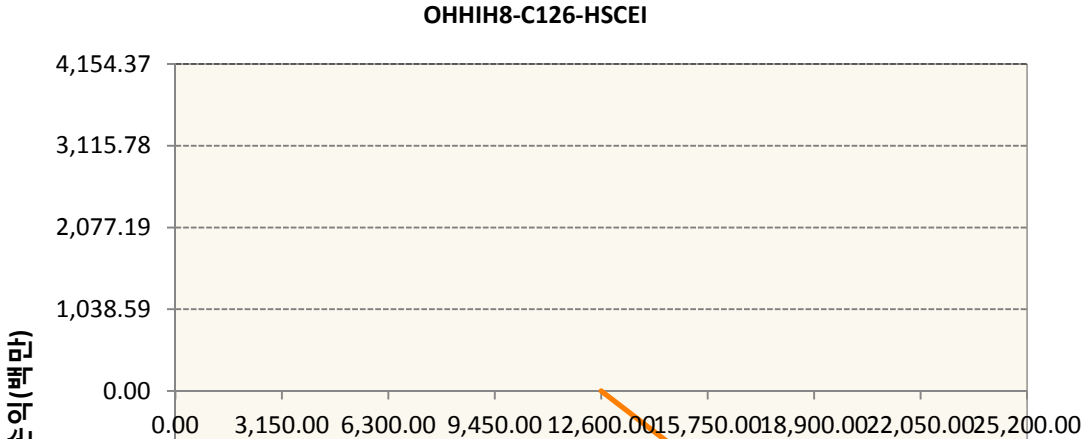
1. 계약금액

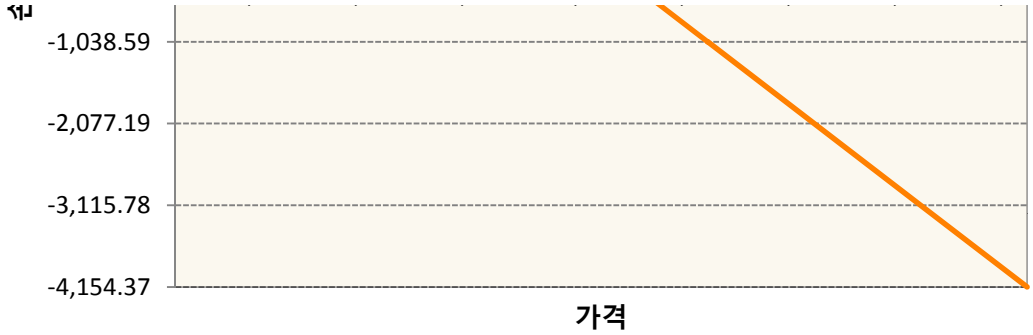
(단위:백만원)

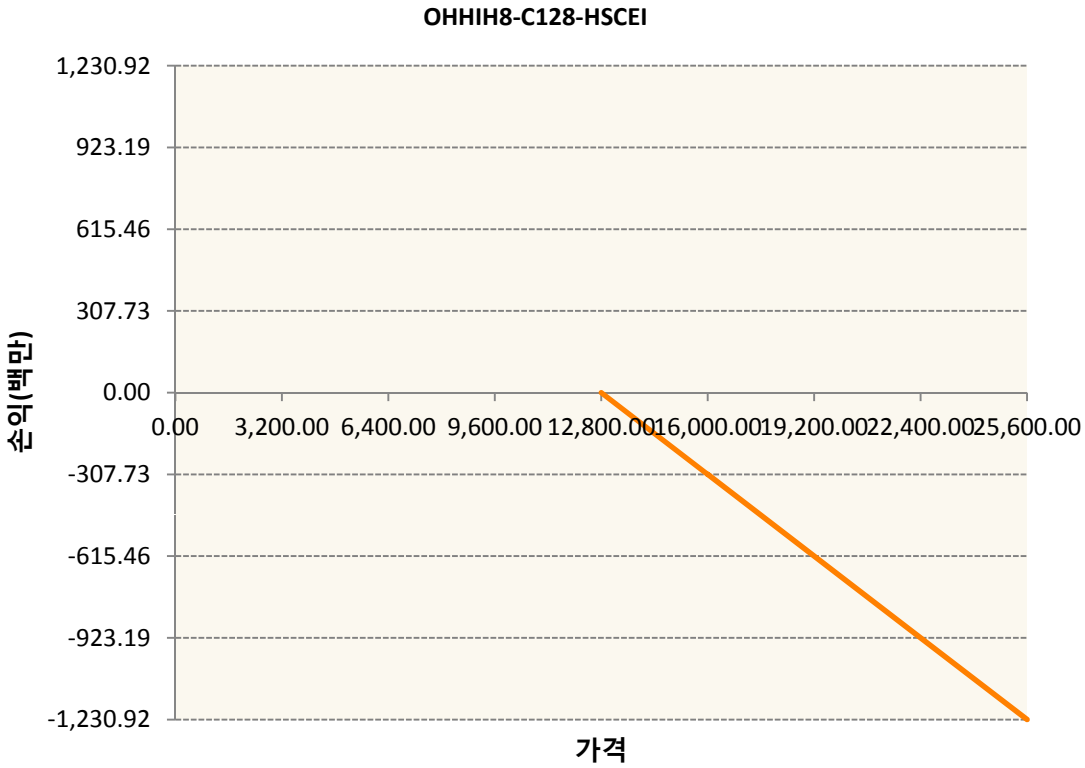
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	4,554	0	4,554	장내
누계	유가증권	옵션	0	10,771	-10,771	장내

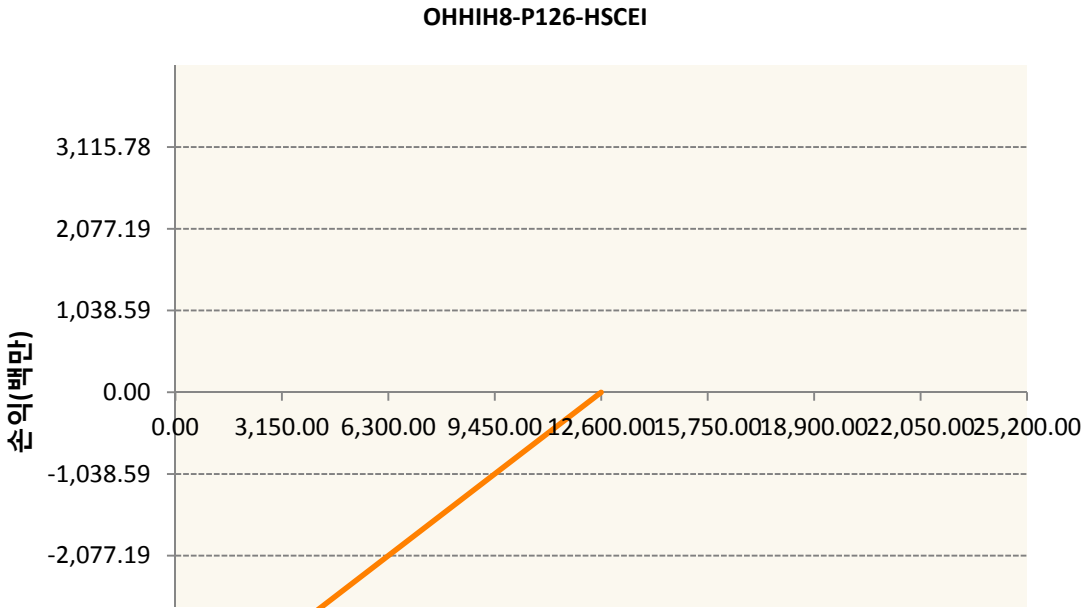
2. 만기시점의 손익구조

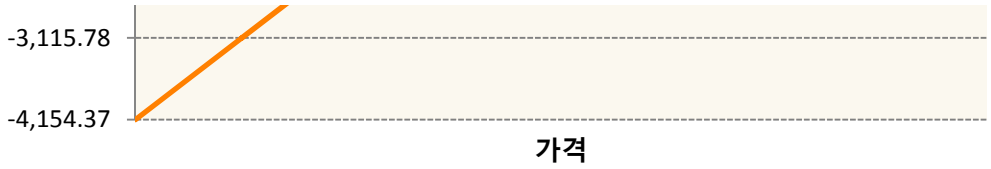


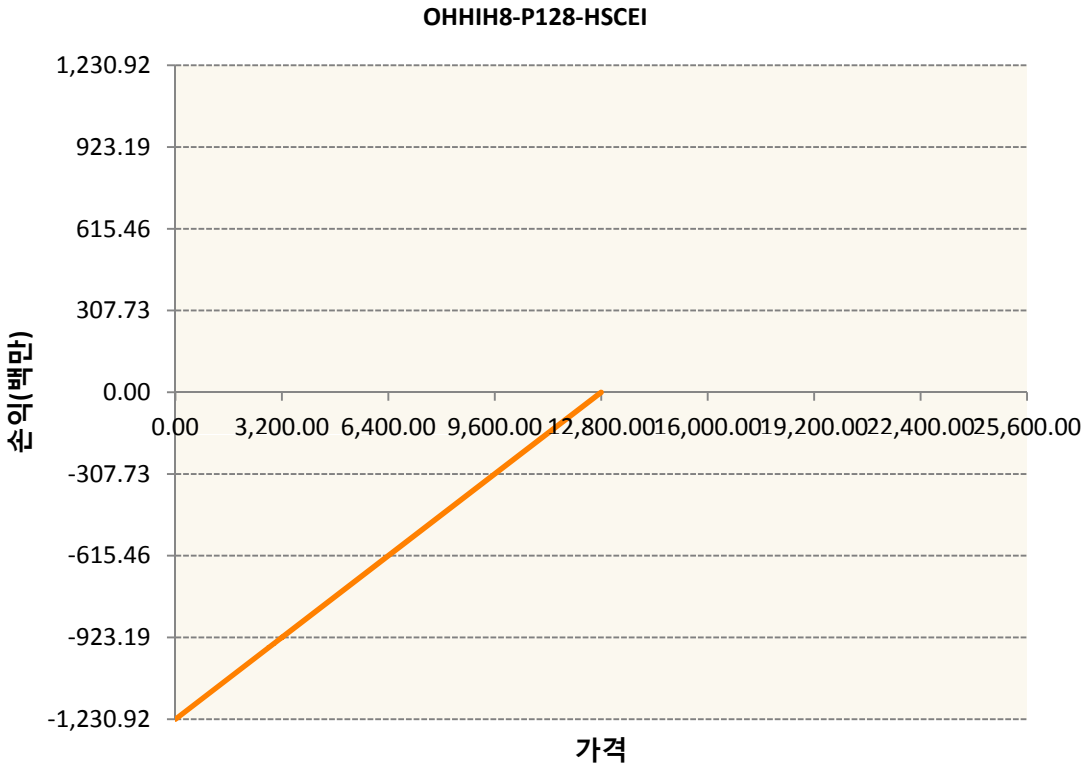



-1,038.59
-2,077.19
-3,115.78
-4,154.37
가격


OHHIH8-C128-HSCEI
1,230.92
923.19
615.46
307.73
0.00
-307.73
-615.46
-923.19
-1,230.92
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
3,115.78
2,077.19
1,038.59
0.00
-1,038.59
-2,077.19
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	364
OHHIH8-C12 HSCEI	332
OHHIH8-C12 HSCEI	98
OHHIH8-P12 HSCEI	332
OHHIH8-P12 HSCEI	98

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,068

공시일	2018-03-07
기준일	2018-03-06

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼

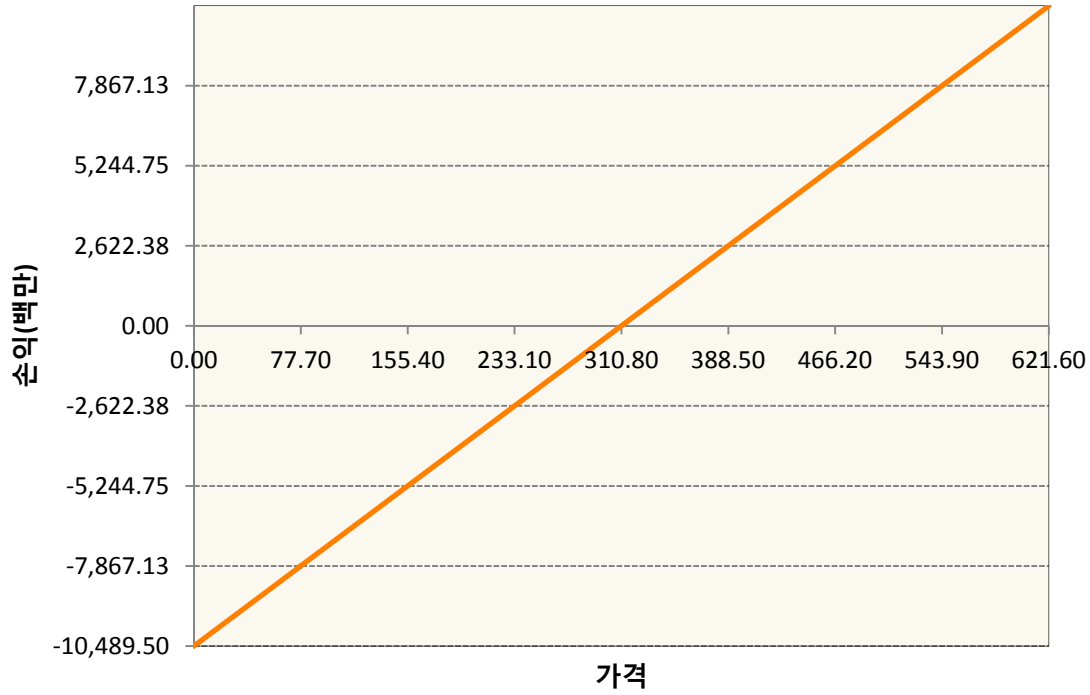
1. 계약금액

(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	10,490	0	10,490	장내
누계	유가증권	스왑	56,200	0	56,200	장외
누계	유가증권	옵션	0	55,313	-55,313	장내

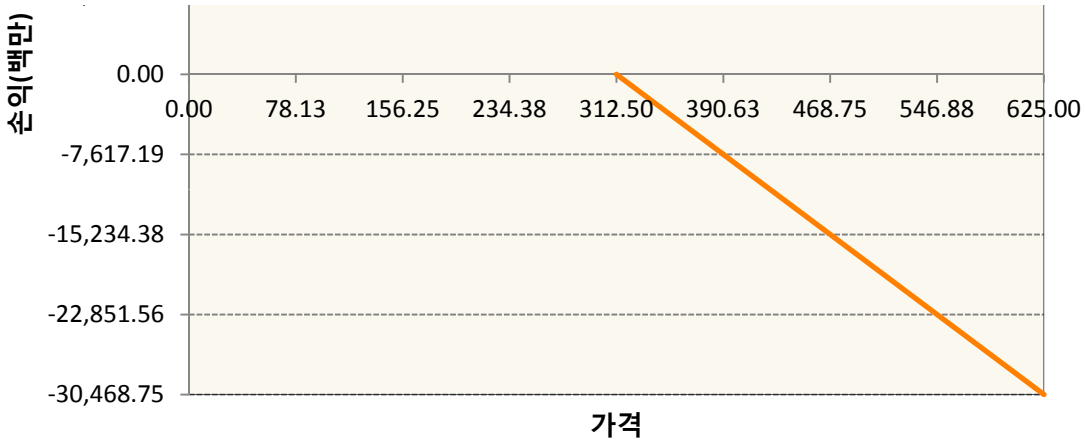
2. 만기시점의 손익구조

KR4101N30002-2018-03 코스피200지수선물

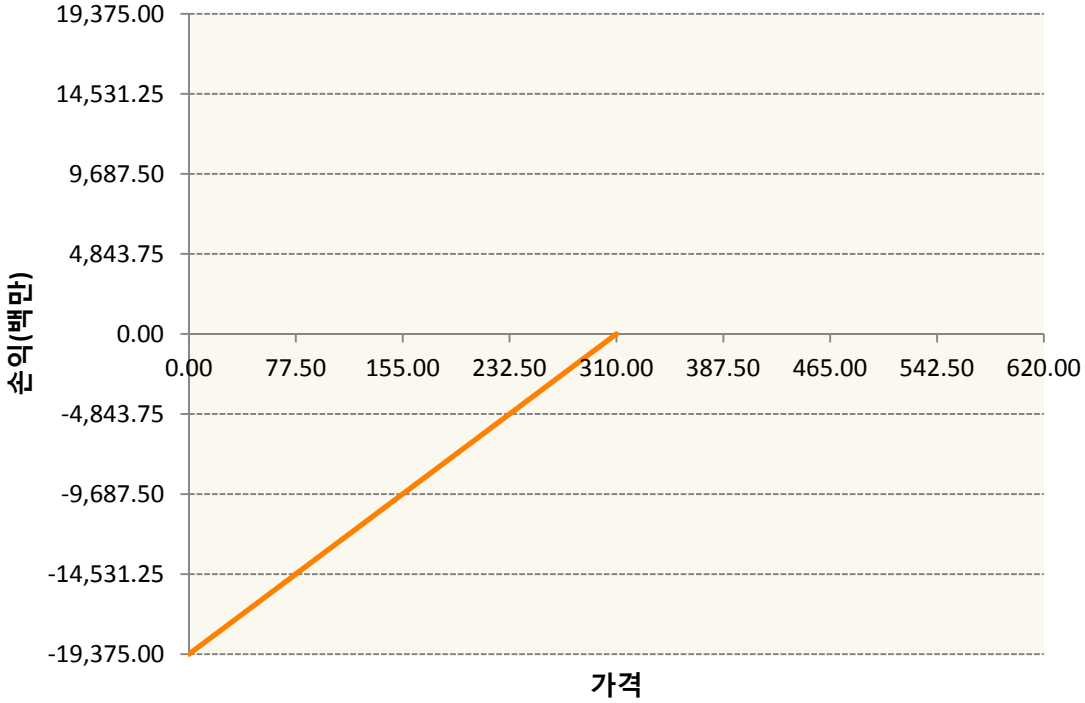


KR4201N33129-2018-03 콜312.5

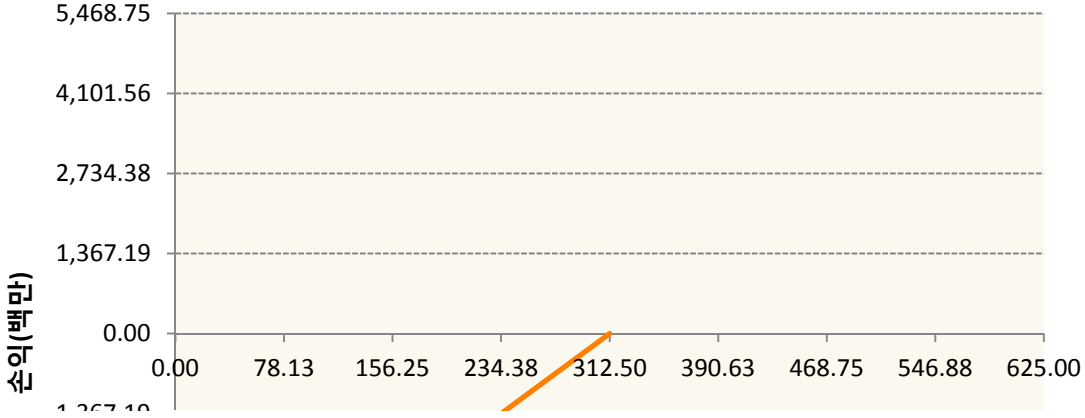




KR4301N33101-2018-03 풋310



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					838
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-838	-838	-838	-838	-838	-838	-838
-5.33%	-559	-559	-559	-559	-559	-559	-559
-2.67%	-279	-279	-279	-279	-279	-279	-279
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	279	279	279	279	279	279	279
5.33%	559	559	559	559	559	559	559
8.00%	838	838	838	838	838	838	838
	KR4201N331	2018-03 콜312.5					2,066
	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%	157	157	157	157	157	156	156
-2.67%	155	153	150	145	140	133	125
0%	57	38	19	0	-19	-39	-58
2.67%	-472	-481	-492	-505	-518	-532	-547
5.33%	-1,258	-1,259	-1,260	-1,261	-1,263	-1,266	-1,269
8.00%	-2,065	-2,065	-2,065	-2,065	-2,065	-2,066	-2,066
	KR4301N331	2018-03 풋310					1,437

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,437	-1,437	-1,437	-1,437	-1,437	-1,437	-1,437
-5.33%	-920	-920	-920	-920	-920	-920	-920
-2.67%	-403	-403	-404	-405	-406	-408	-410
0%	25	16	8	0	-8	-17	-25
2.67%	86	86	85	84	83	82	80
5.33%	86	86	86	86	86	86	86
8.00%	86	86	86	86	86	86	86
	KR4301N3312018-03 풋312.5						421

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-421	-421	-421	-421	-421	-421	-421
-5.33%	-276	-276	-276	-276	-276	-276	-276
-2.67%	-131	-131	-131	-131	-131	-132	-132
0%	6	4	2	0	-2	-4	-6
2.67%	49	49	48	47	47	46	45
5.33%	49	49	49	49	49	49	49
8.00%	49	49	49	49	49	49	49

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

10,290

공시일	2018-03-07
기준일	2018-03-06

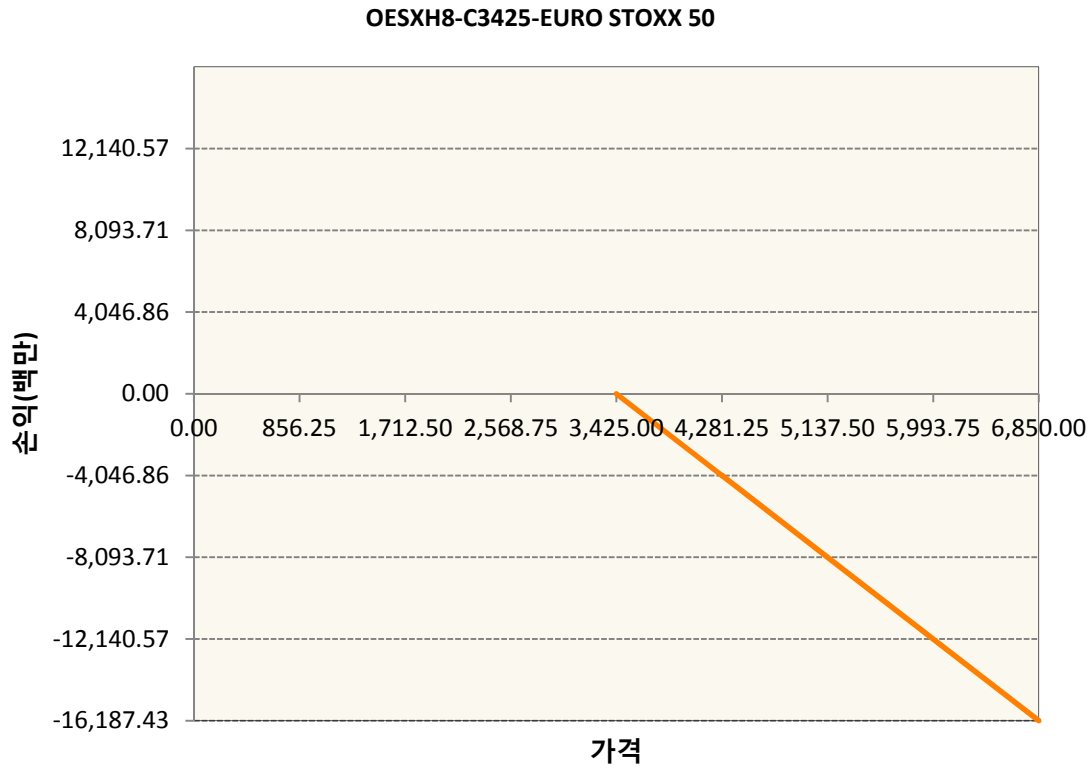
유로커버드콜모(주식혼합-파생형

1. 계약금액

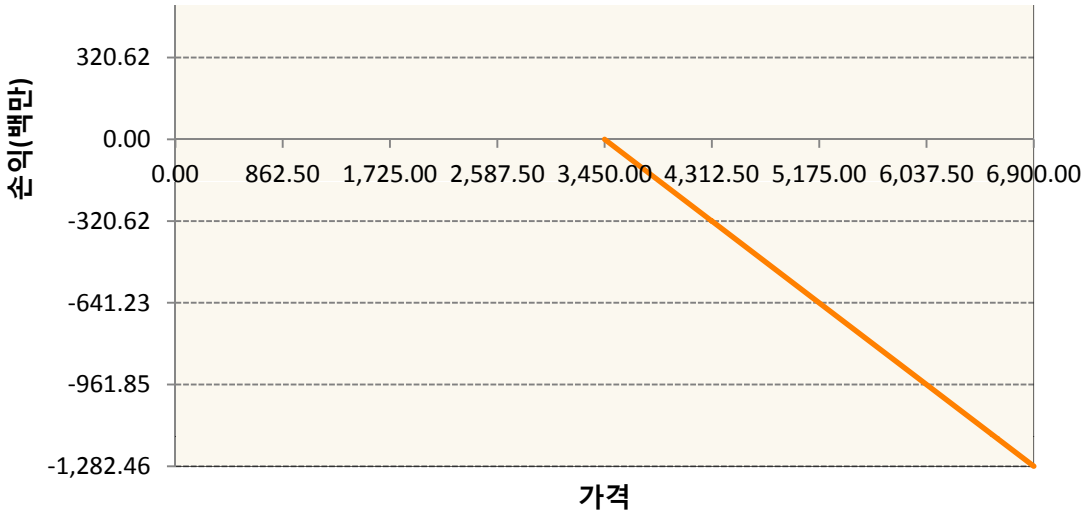
(단위:백만원)

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	9,078	0	9,078	
누계	유가증권	스왑	99,573	0	99,573	장외
누계	유가증권	옵션	0	34,940	-34,940	장내
누계	지수	스왑	53,106	0	53,106	장외

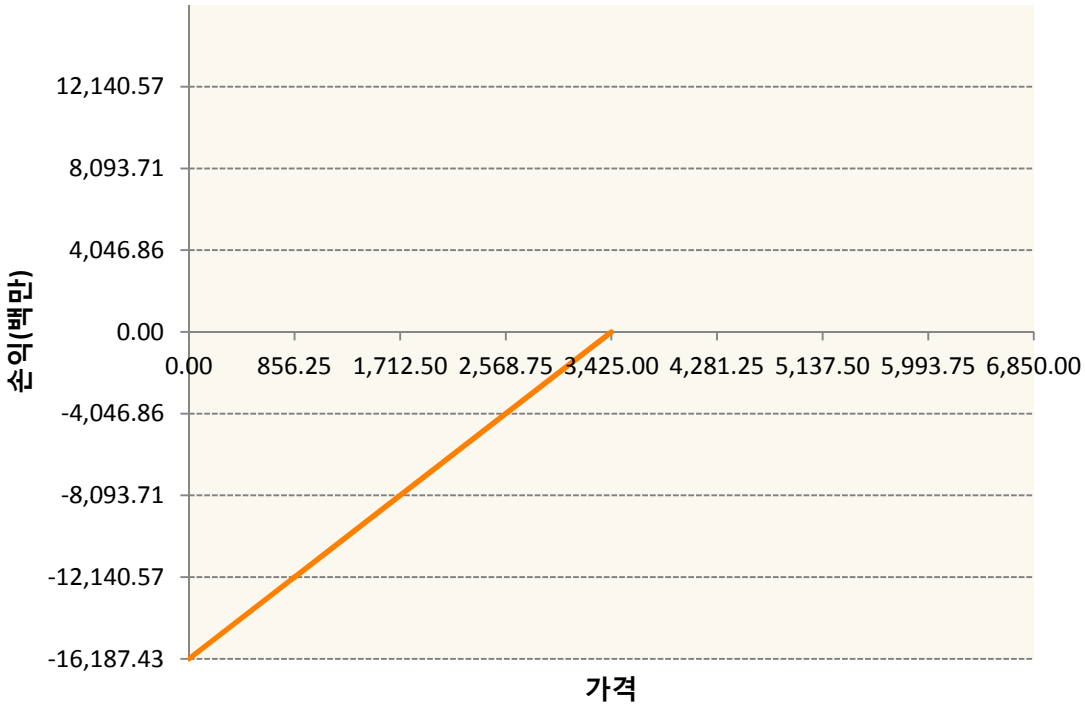
2. 만기시점의 손익구조



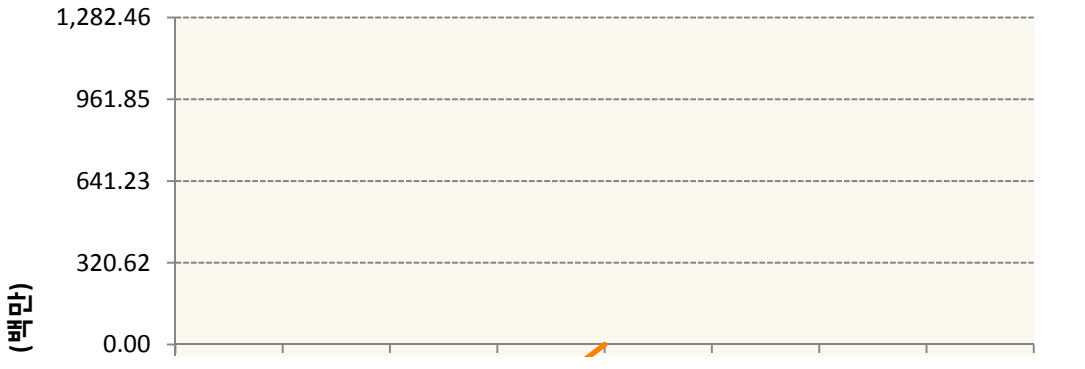


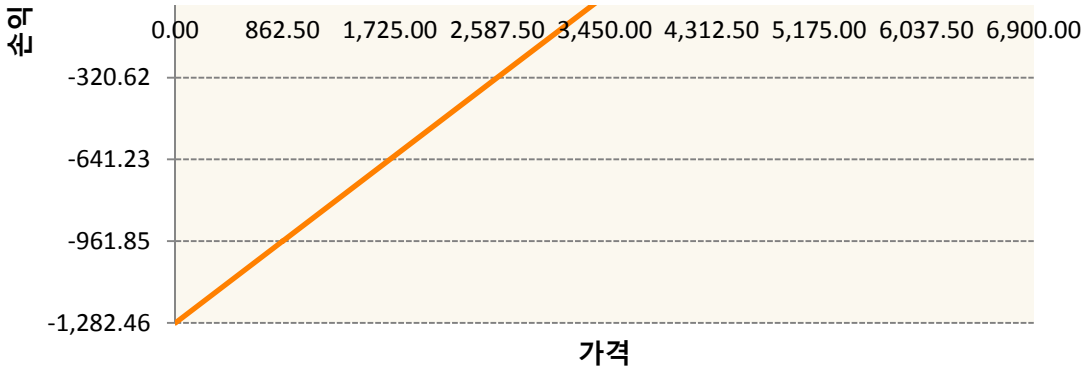


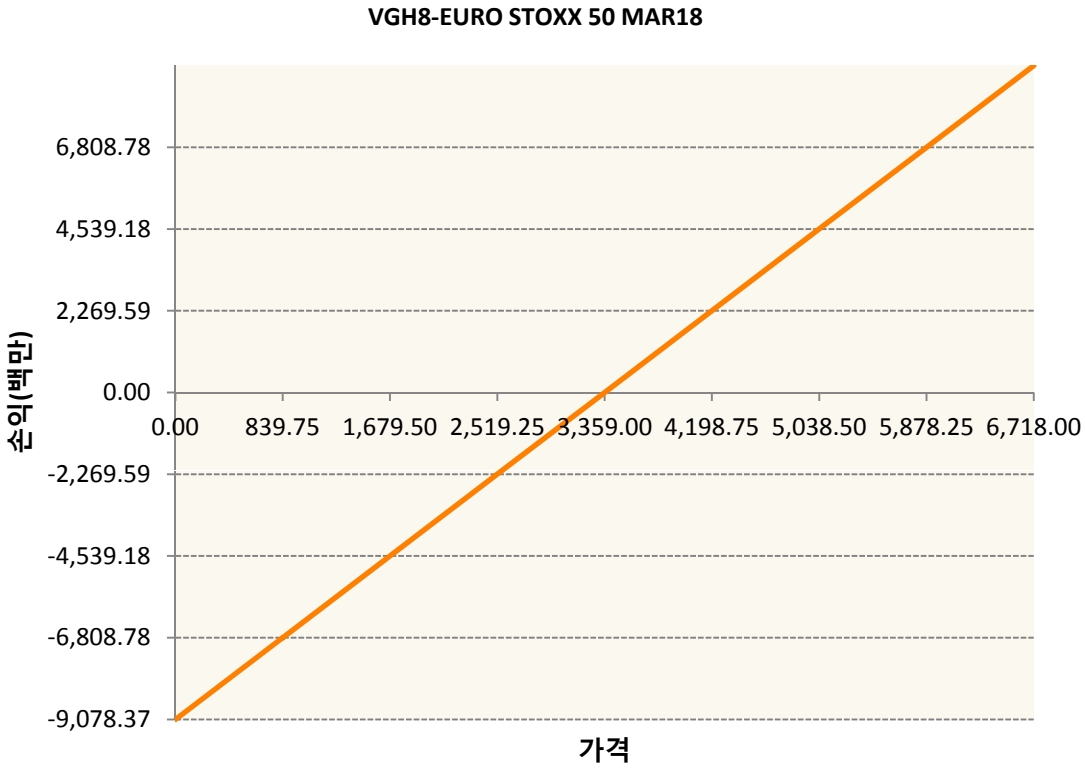
OESXH8-P3425-EURO STOXX 50



OESXH8-P3450-EURO STOXX 50







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)	(단위:백만원)
260105SGPX SG EURO Covered CALL STRATEGY - 994.569	248
260105SQPX SG EURO Covered CALL STRATEGY	464
OESXH8-C34 EURO STOXX 50	1,295
OESXH8-C34 EURO STOXX 50	103
OESXH8-P34 EURO STOXX 50	1,295
OESXH8-P34 EURO STOXX 50	103
VGH8 EURO STOXX 50 MAR18	726

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

2,529

공시일	2018-03-07
기준일	2018-03-06

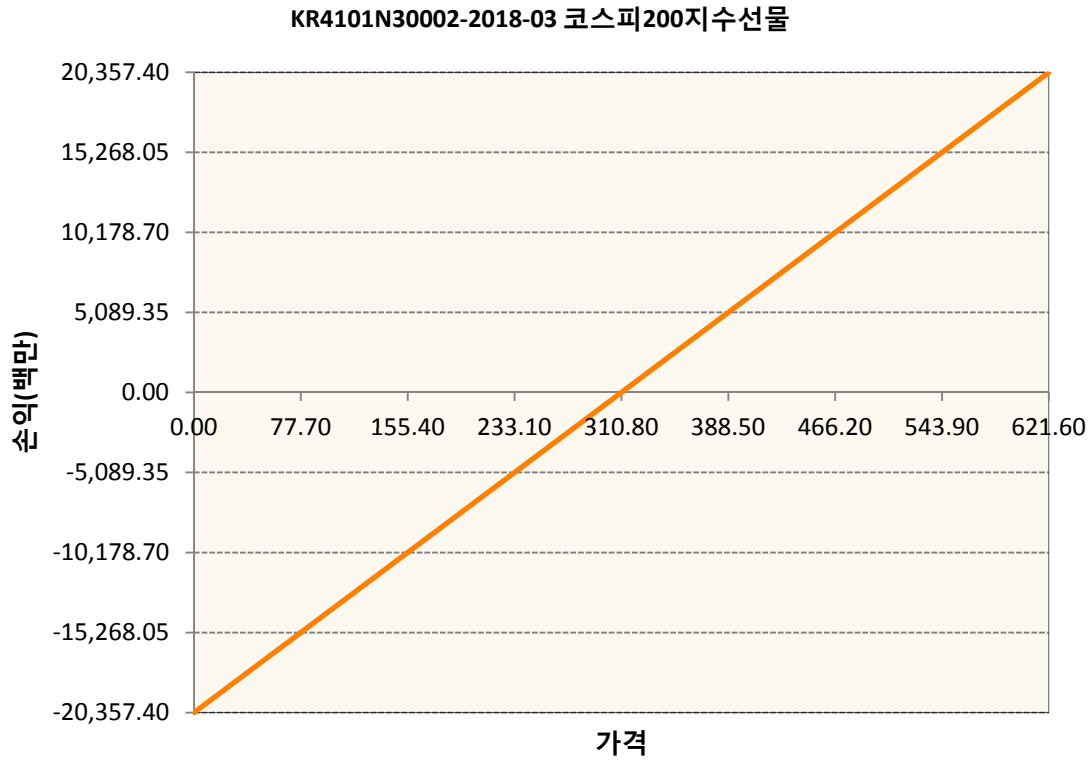
ETF스마트레버리지목표전환형8호

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	20,357	0	20,357	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101N30(2018-03 코스피200지수선물							1,627
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,627	-1,627	-1,627	-1,627	-1,627	-1,627	-1,627
-5.33%	-1,085	-1,085	-1,085	-1,085	-1,085	-1,085	-1,085
-2.67%	-542	-542	-542	-542	-542	-542	-542
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	542	542	542	542	542	542	542
5.33%	1,085	1,085	1,085	1,085	1,085	1,085	1,085
8.00%	1,627	1,627	1,627	1,627	1,627	1,627	1,627

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

1,126

공시일	2018-03-07
기준일	2018-03-06

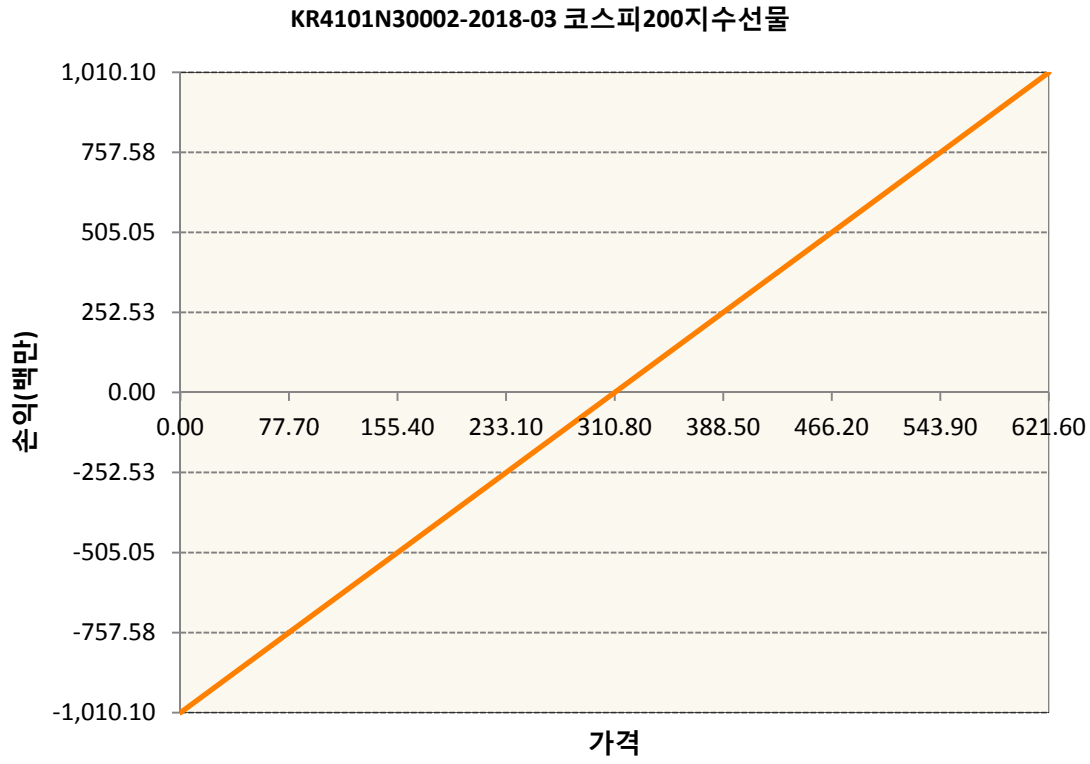
ETF스마트레버리지목표전환형9호

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	1,010	0	1,010	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)

56

공시일	2018-03-07
기준일	2018-03-06

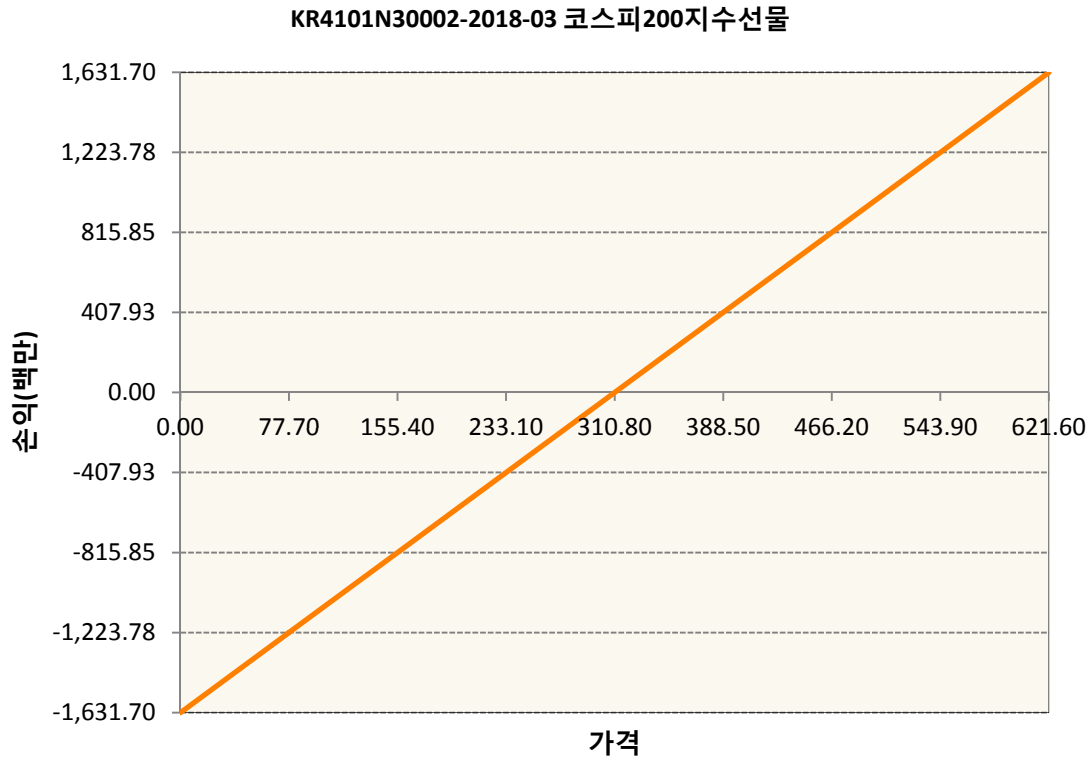
ETF스마트레버리지목표전환형10

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	1,632	0	1,632	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101N30(2018-03 코스피200지수선물							130
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-130	-130	-130	-130	-130	-130	-130
-5.33%	-87	-87	-87	-87	-87	-87	-87
-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%	87	87	87	87	87	87	87
8.00%	130	130	130	130	130	130	130

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

90

공시일	2018-03-07
기준일	2018-03-06

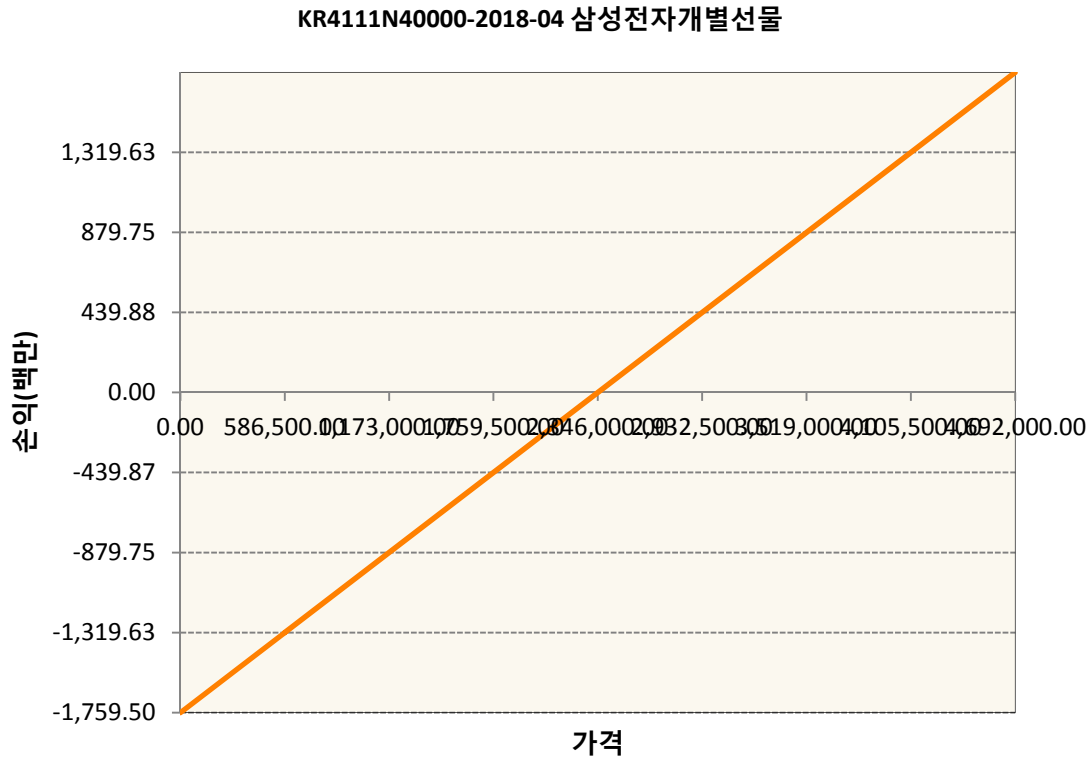
스마트KRX300인덱스1호(주식-파

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	1,753	0	1,753	장내
누계	유가증권	선물	1,760	0	1,760	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4111N40(2018-04 삼성전자개별선물							141
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-141	-141	-141	-141	-141	-141	-141
-5.33%	-94	-94	-94	-94	-94	-94	-94
-2.67%	-47	-47	-47	-47	-47	-47	-47
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	47	47	47	47	47	47	47
5.33%	94	94	94	94	94	94	94
8.00%	141	141	141	141	141	141	141

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

170

공시일	2018-03-07
기준일	2018-03-06

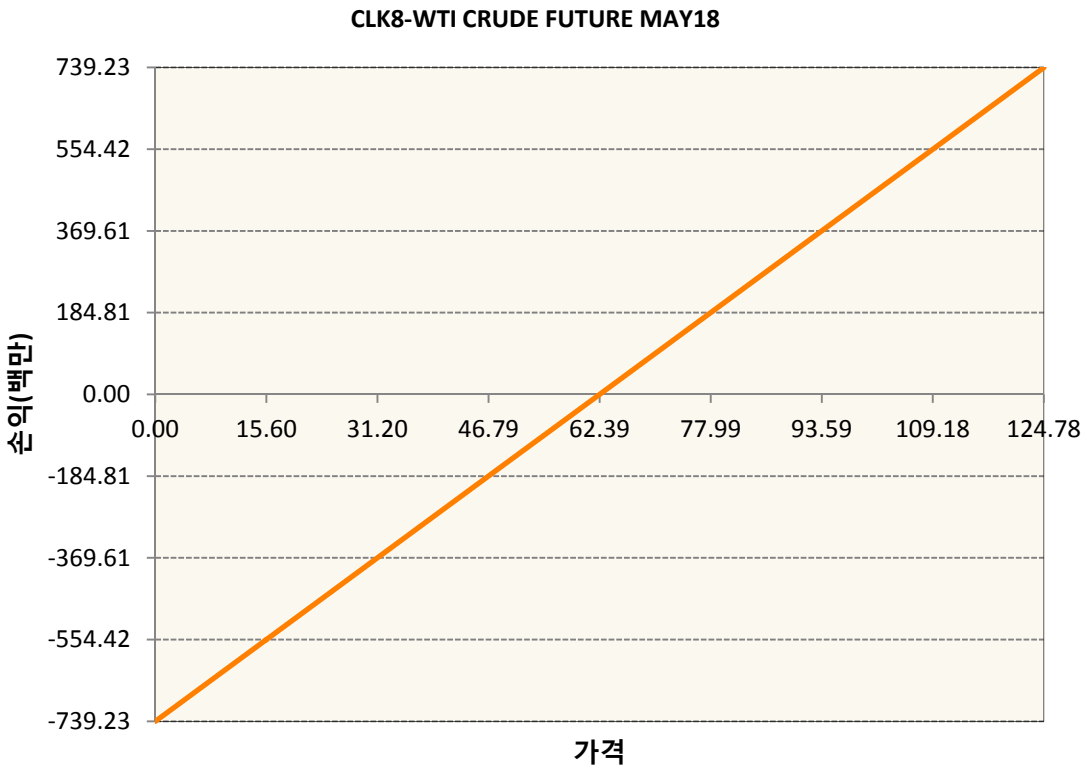
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

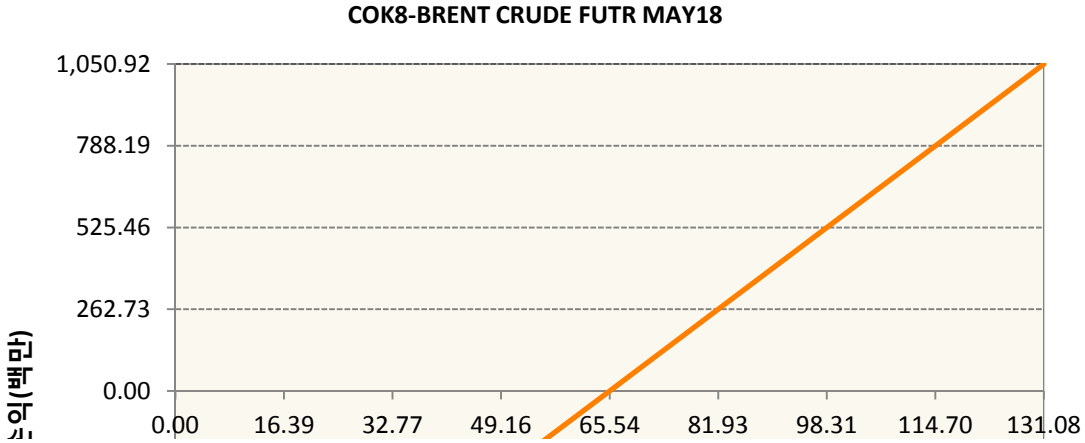
1. 계약금액

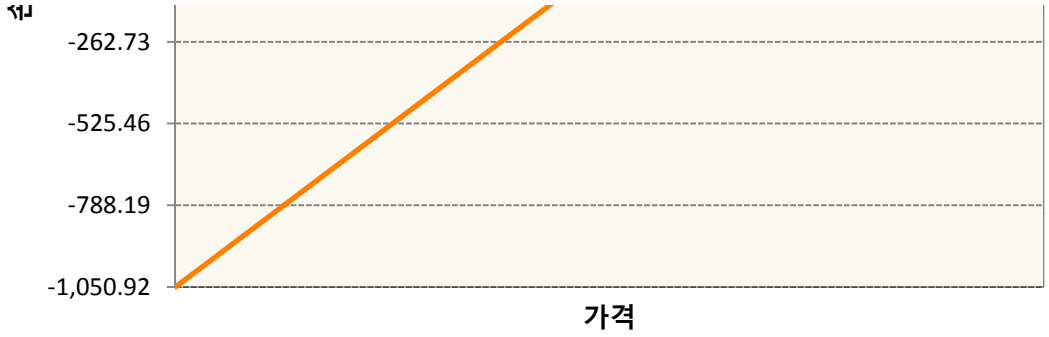
(단위:백만원)

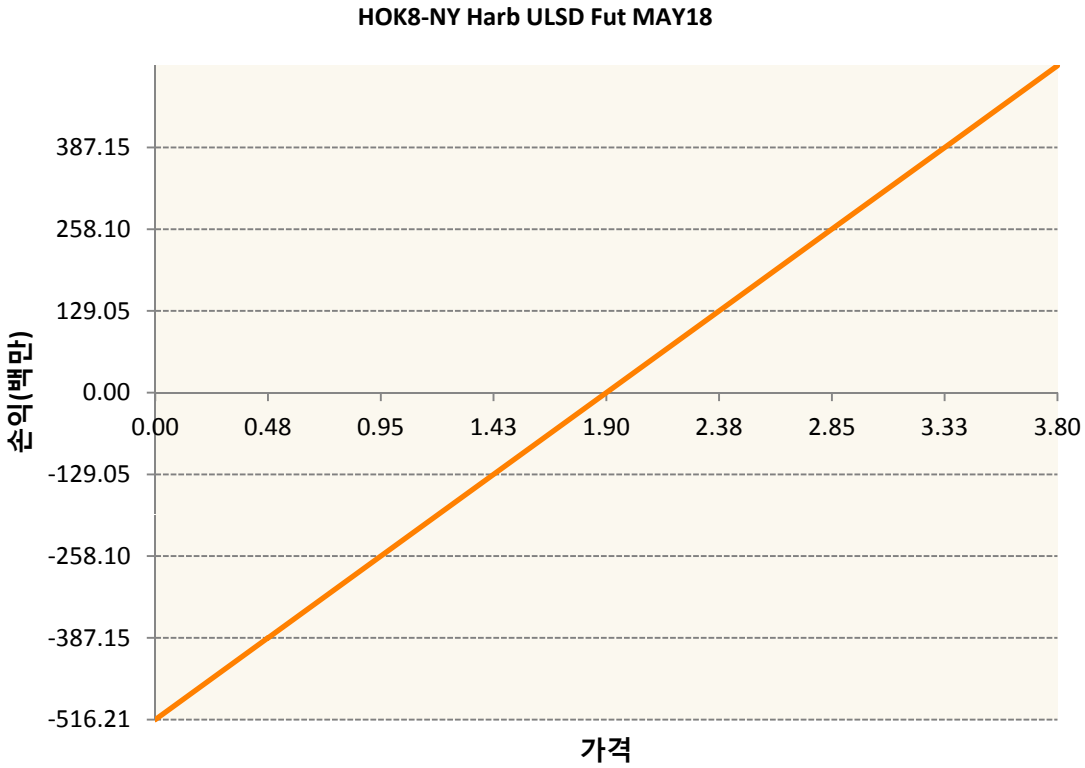
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	선물	유가증권	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	선물	유가증권	739	0	739	
누계	유가증권	선물	3,246	592	2,654	

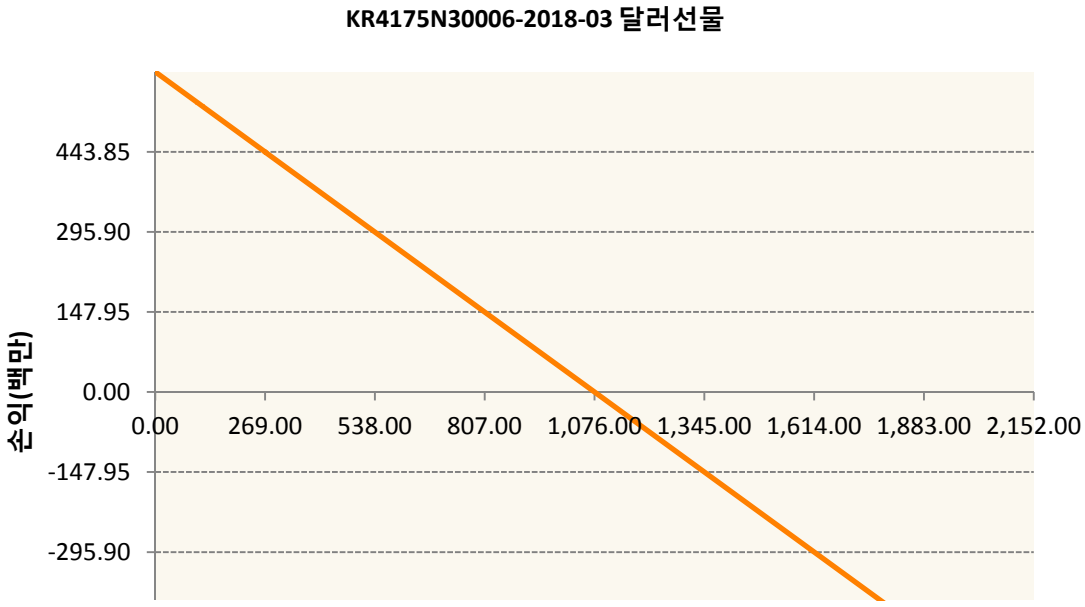
2. 만기시점의 손익구조

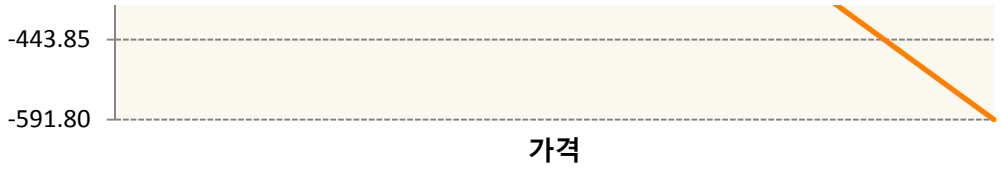


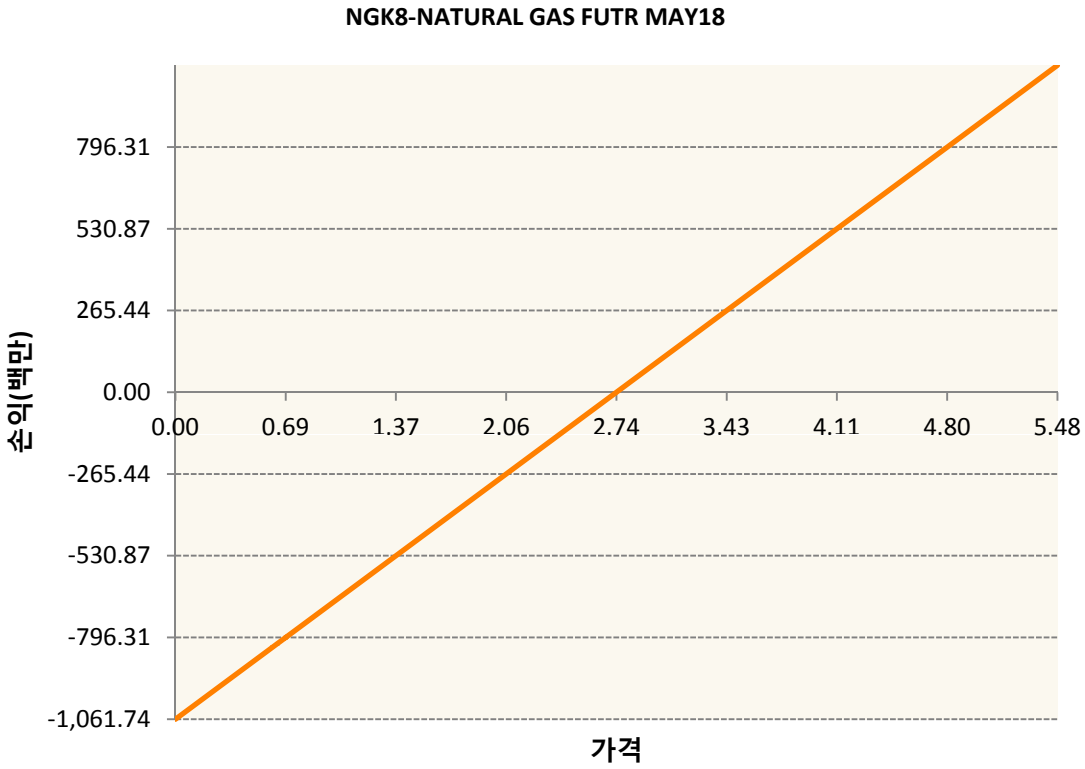


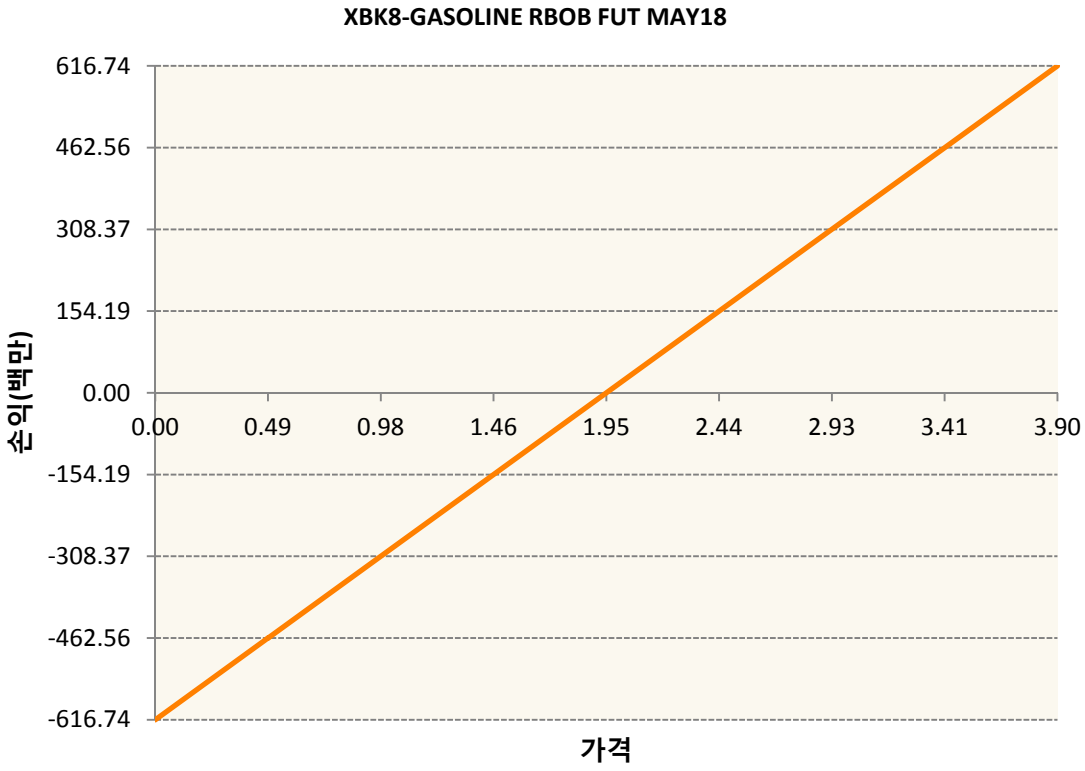

-262.73
-525.46
-788.19
-1,050.92
가격


HOK8-NY Harb ULSD Fut MAY18
387.15
258.10
129.05
0.00
-129.05
-258.10
-387.15
-516.21
손익(백만)
0.00
0.48
0.95
1.43
1.90
2.38
2.85
3.33
3.80
가격


KR4175N30006-2018-03 달러선물
443.85
295.90
147.95
0.00
-147.95
-295.90
손익(백만)
0.00
269.00
538.00
807.00
1,076.00
1,345.00
1,614.00
1,883.00
2,152.00


-443.85
-591.80
가격


NGK8-NATURAL GAS FUTR MAY18
796.31
530.87
265.44
0.00
-265.44
-530.87
-796.31
-1,061.74
0.00
0.69
1.37
2.06
2.74
3.43
4.11
4.80
5.48
손익(백만)
가격


XBK8-GASOLINE RBOB FUT MAY18
616.74
462.56
308.37
154.19
0.00
-154.19
-308.37
-462.56
-616.74
0.00
0.49
0.98
1.46
1.95
2.44
2.93
3.41
3.90
손익(백만)
가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLK8	WTI CRUDE FUTURE MAY18	59
COK8	BRENT CRUDE FUTR MAY18	84
HOK8	NY Harb ULSD Fut MAY18	41
KR4175N30(	2018-03 달러선물	47
NGK8	NATURAL GAS FUTR MAY18	85
XBK8	GASOLINE RBOB FUT MAY18	49

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

522

공시일	2018-03-07
기준일	2018-03-06

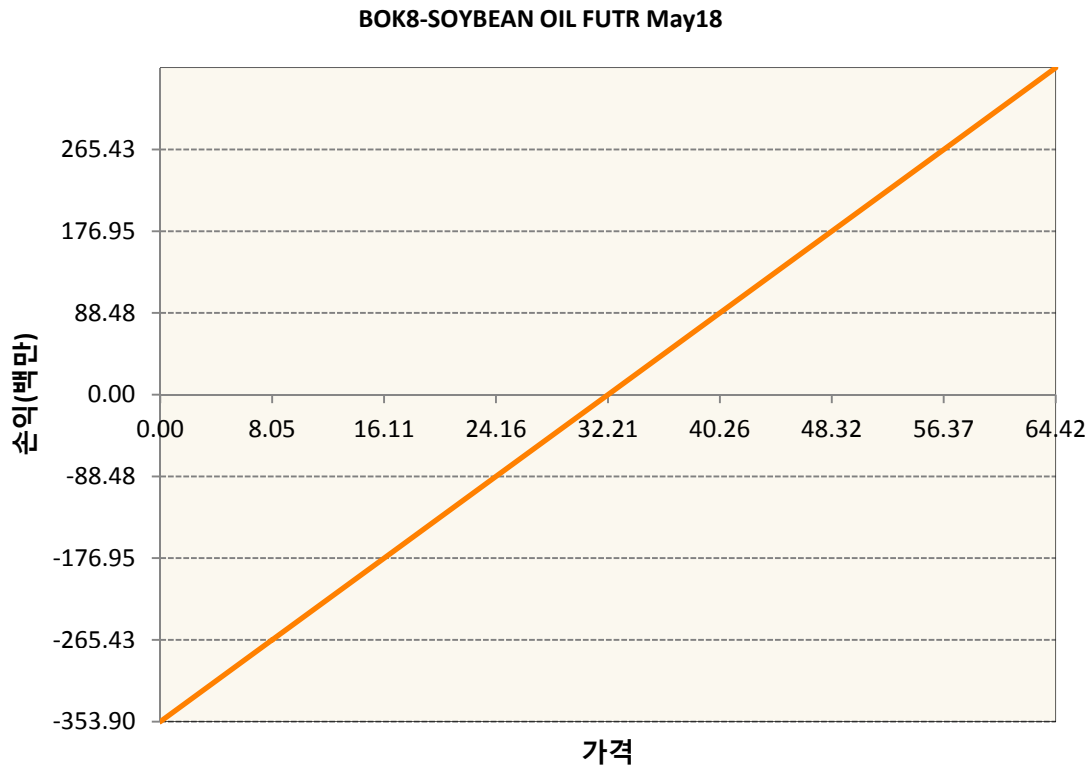
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

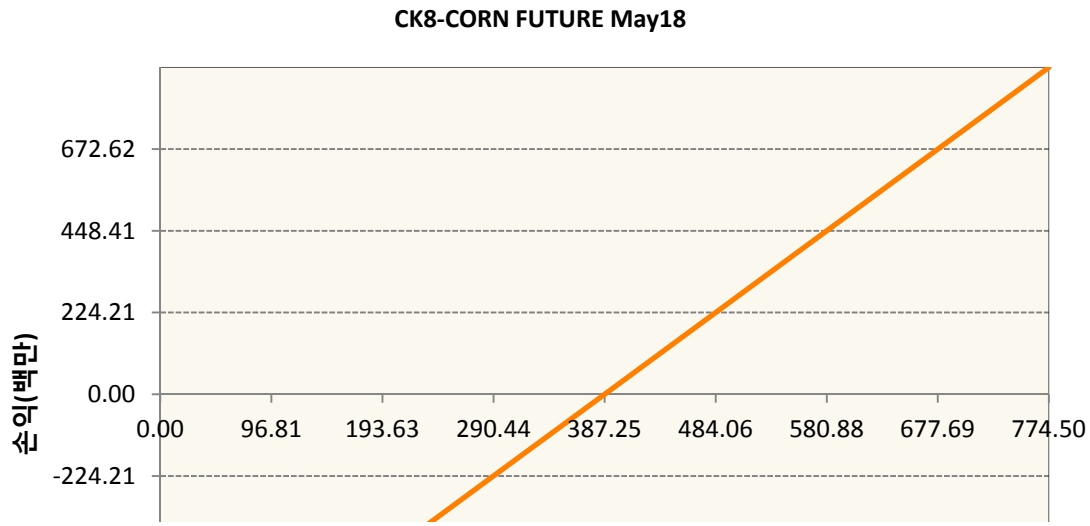
1. 계약금액

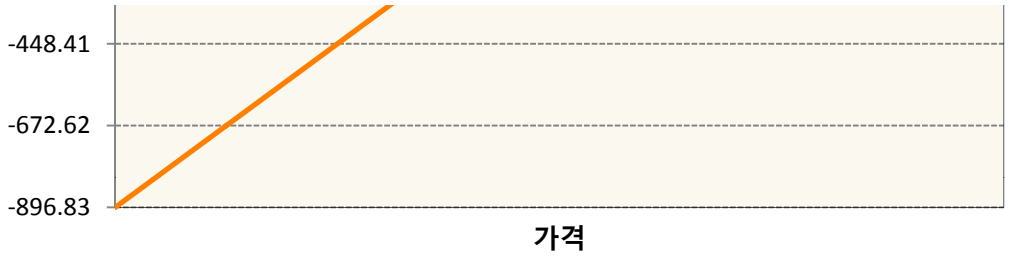
(단위:백만원)

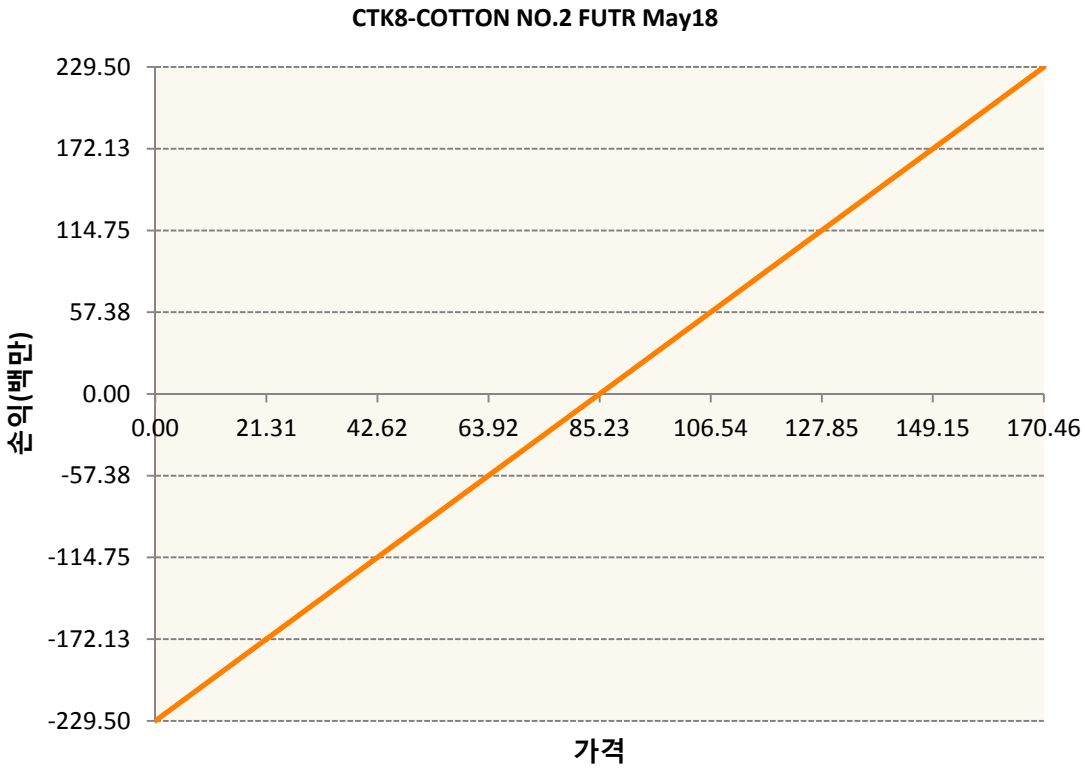
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	4,293	323	3,971	

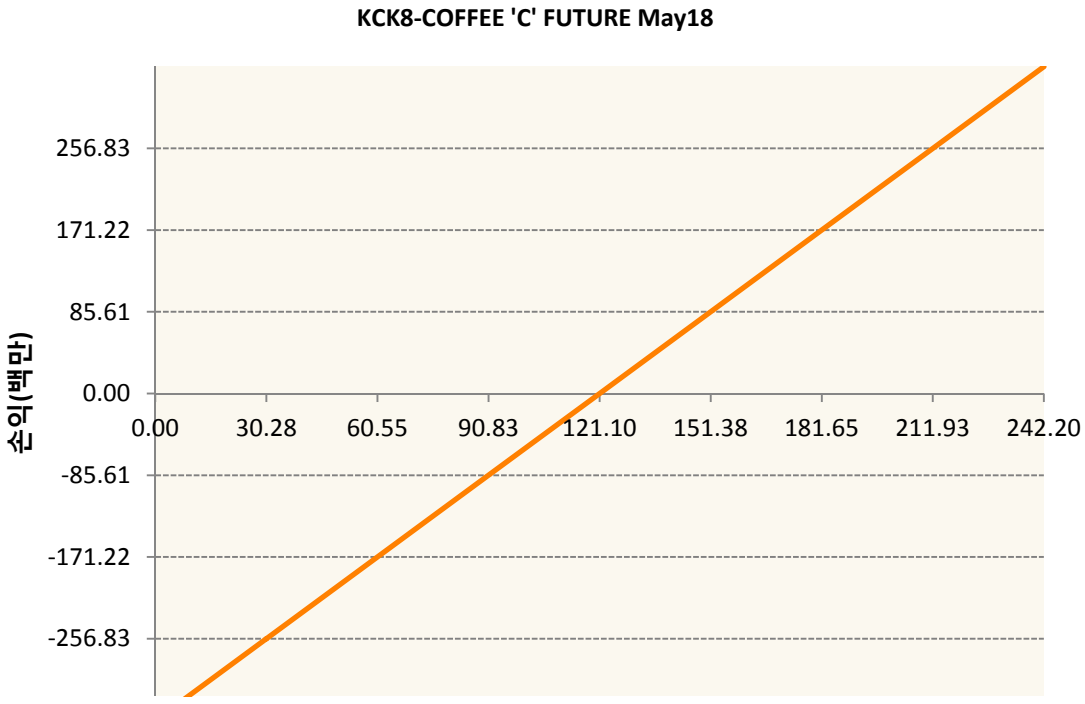
2. 만기시점의 손익구조

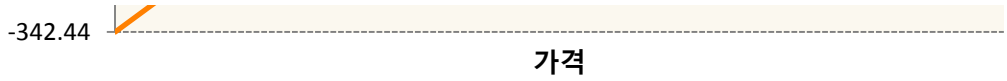


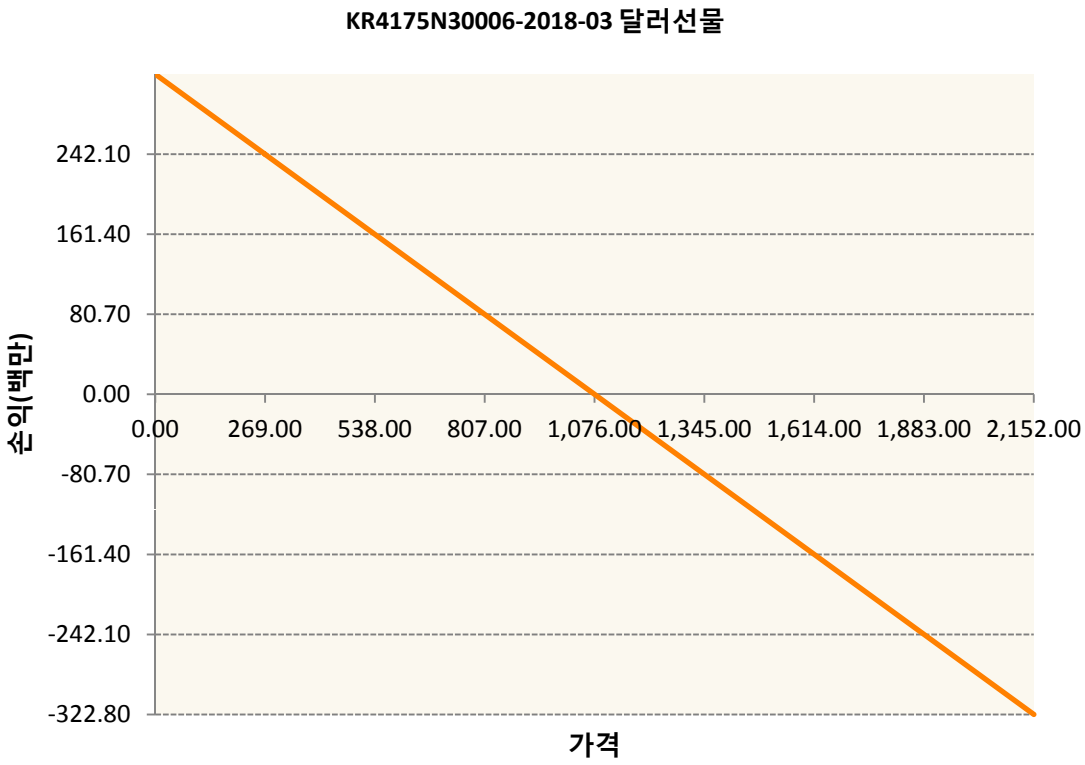


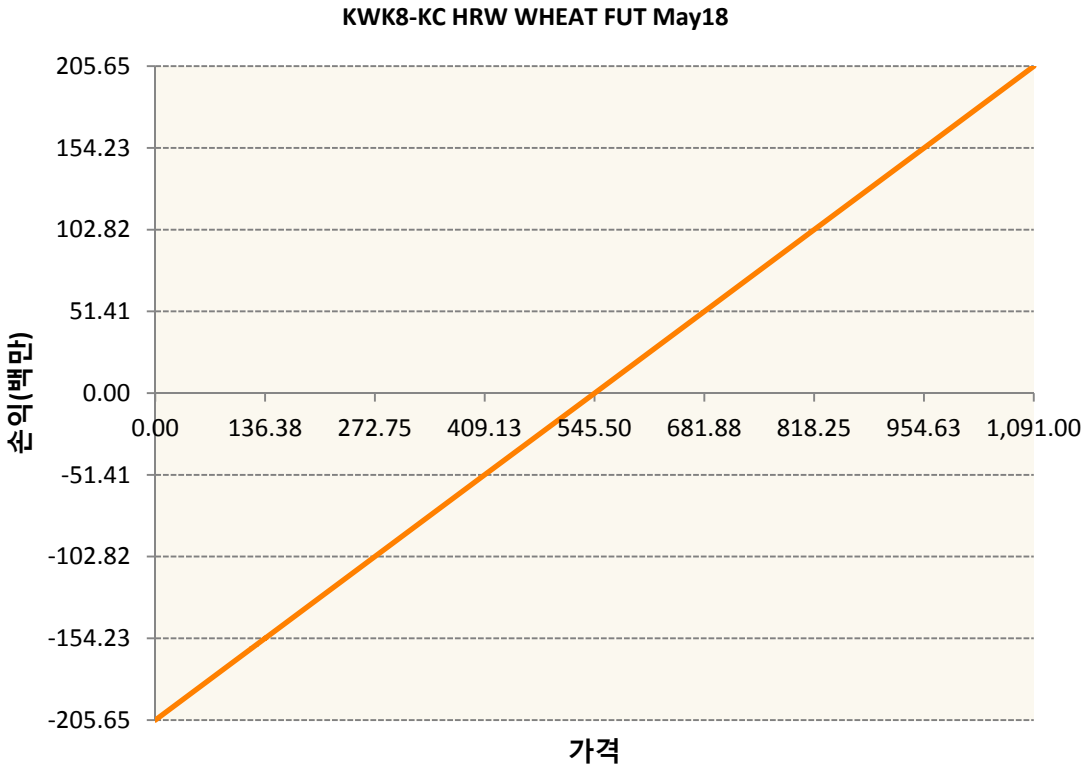

-448.41
-672.62
-896.83
가격

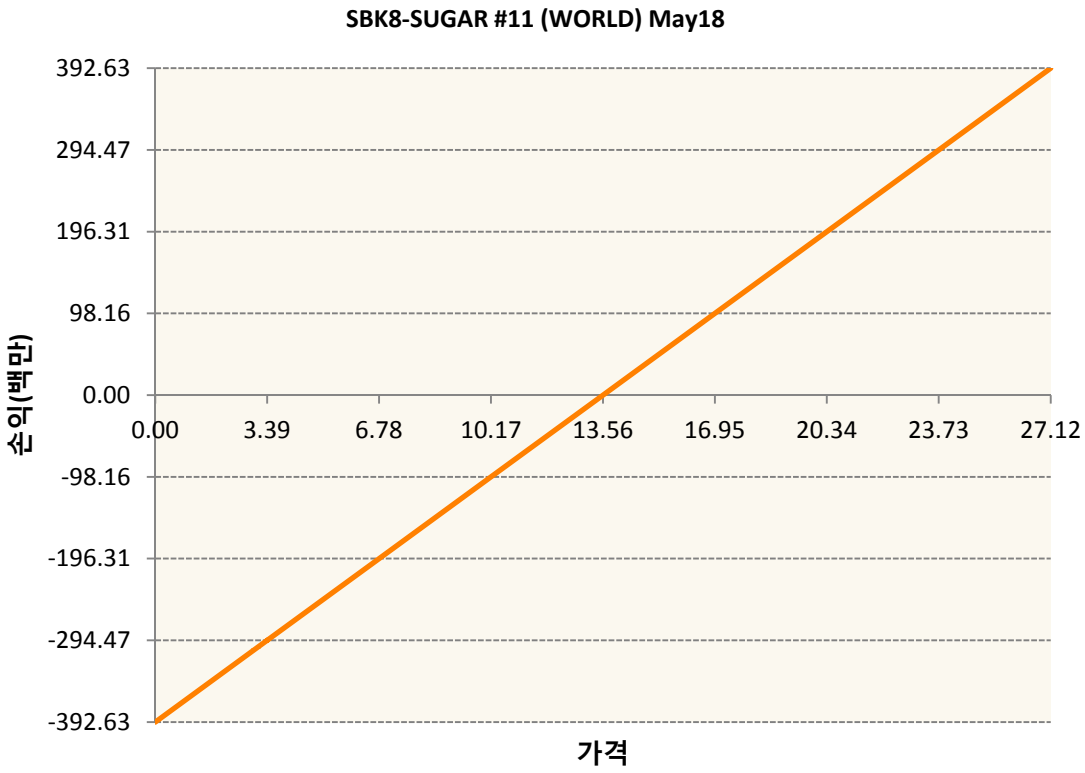

CTK8-COTTON NO.2 FUTR May18
229.50
172.13
114.75
57.38
0.00
-57.38
-114.75
-172.13
-229.50
손익(백만)
0.00
21.31
42.62
63.92
85.23
106.54
127.85
149.15
170.46
가격

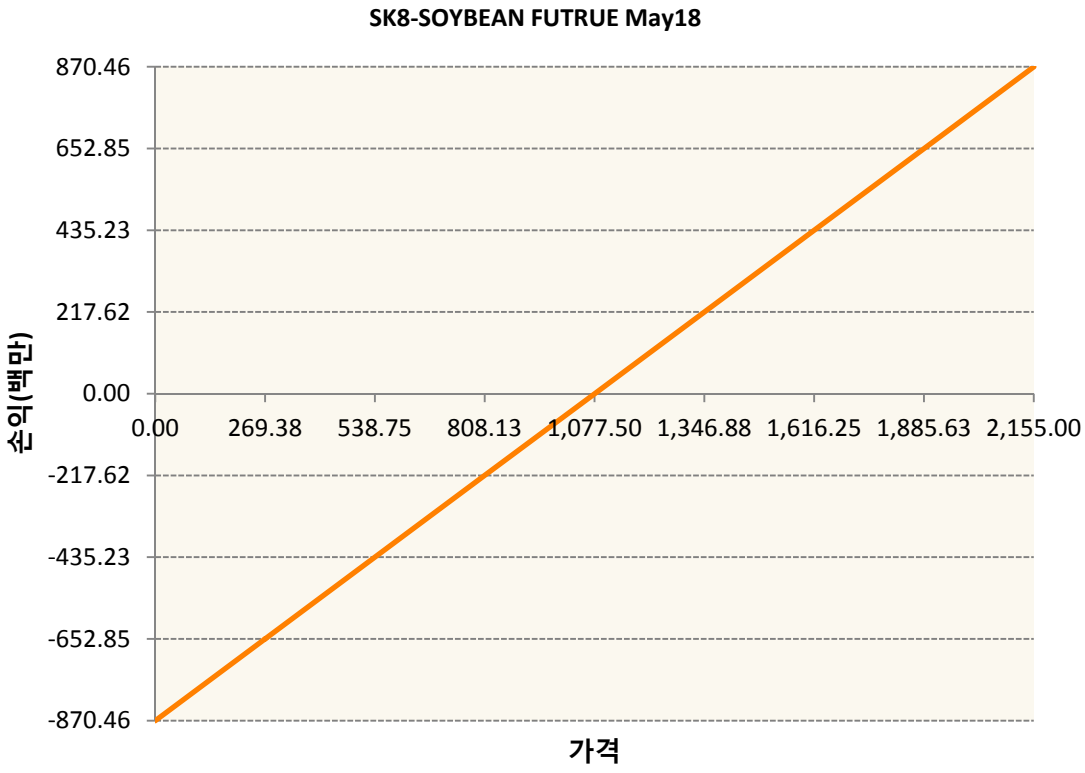

KCK8-COFFEE 'C' FUTURE May18
256.83
171.22
85.61
0.00
-85.61
-171.22
-256.83
손익(백만)
0.00
30.28
60.55
90.83
121.10
151.38
181.65
211.93
242.20


-342.44
가격

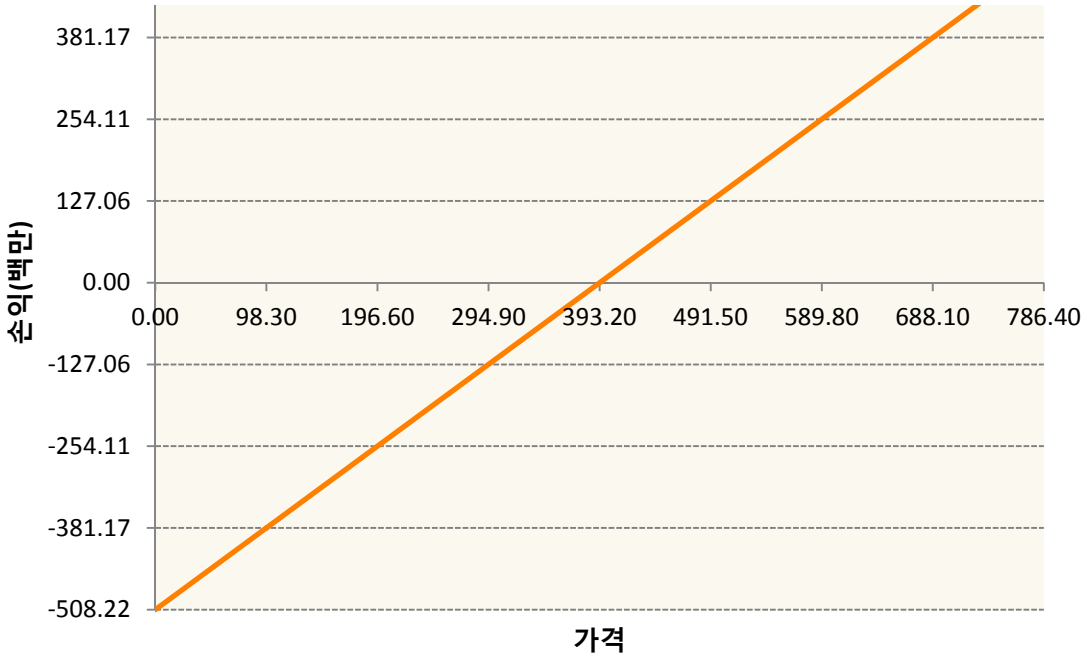

KR4175N30006-2018-03 달러선물
242.10
161.40
80.70
0.00
-80.70
-161.40
-242.10
-322.80
0.00
269.00
538.00
807.00
1,076.00
1,345.00
1,614.00
1,883.00
2,152.00
손익(백만)
가격


KWK8-KC HRW WHEAT FUT May18
205.65
154.23
102.82
51.41
0.00
-51.41
-102.82
-154.23
-205.65
0.00
136.38
272.75
409.13
545.50
681.88
818.25
954.63
1,091.00
손익(백만)
가격

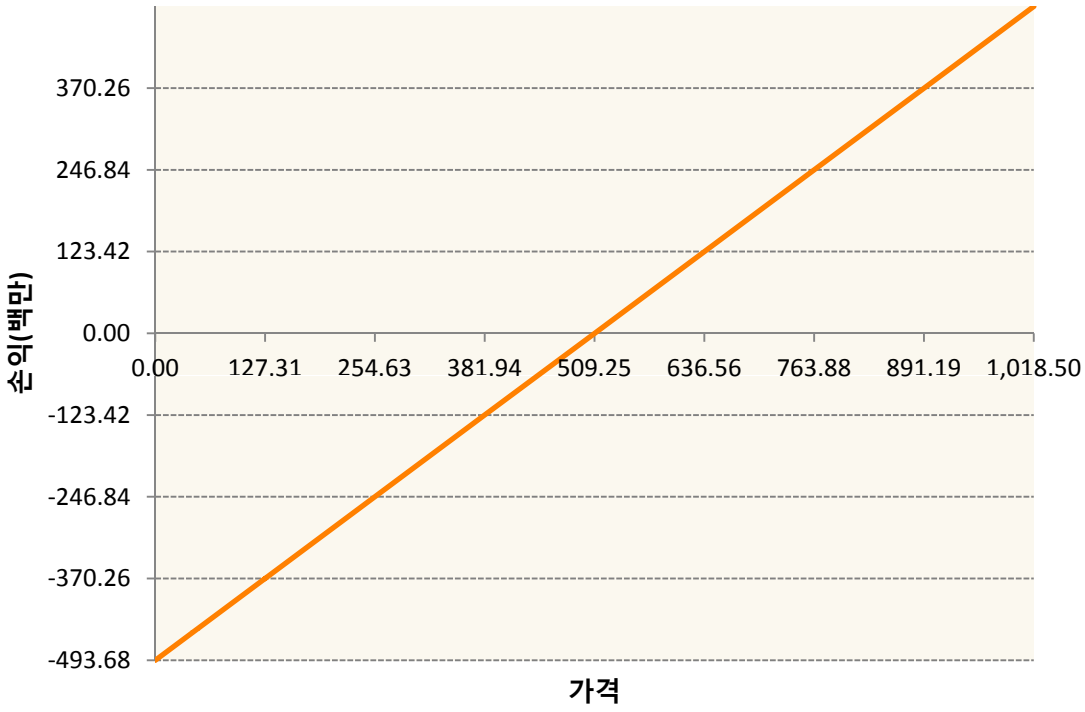

SBK8-SUGAR #11 (WORLD) May18
392.63
294.47
196.31
98.16
0.00
-98.16
-196.31
-294.47
-392.63
손익(백만)
0.00
3.39
6.78
10.17
13.56
16.95
20.34
23.73
27.12
가격


SK8-SOYBEAN FUTRUE May18
870.46
652.85
435.23
217.62
0.00
-217.62
-435.23
-652.85
-870.46
손익(백만)
0.00
269.38
538.75
808.13
1,077.50
1,346.88
1,616.25
1,885.63
2,155.00
가격


SMK8-SOYBEAN MEAL FUTR May18
508.22



WK8-WHEAT FUTURE(CBT) May18



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

BOK8	SOYBEAN OIL FUTR May18	28
CK8	CORN FUTURE May18	72
CTK8	COTTON NO.2 FUTR May18	18
KCK8	COFFEE 'C' FUTURE May18	27
KR4175N30(	2018-03 달러선물	26

KWK8	KC HRW WHEAT FUT May18	16
SBK8	SUGAR #11 (WORLD) May18	31
SK8	SOYBEAN FUTRUE May18	70
SMK8	SOYBEAN MEAL FUTR May18	41
WK8	WHEAT FUTURE(CBT) May18	39

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

346