공시일	2018-03-08
기준일	2018-03-07

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	2018-03-08
기준일	2018-03-07

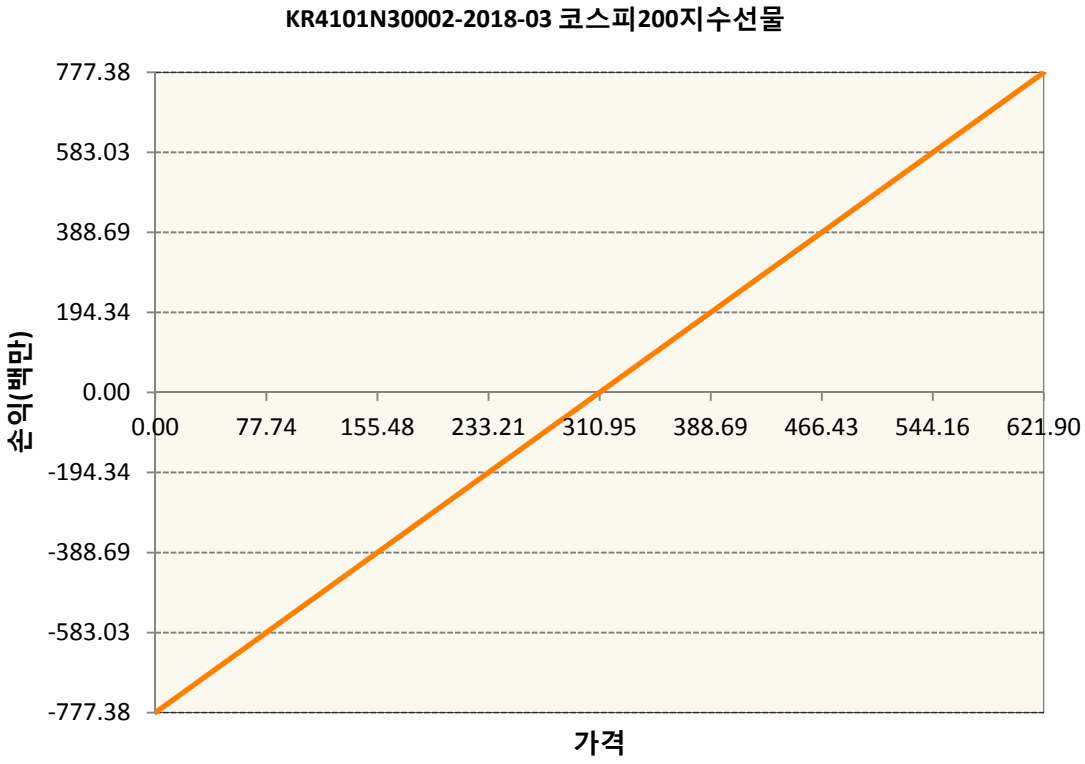
스마트인덱스모

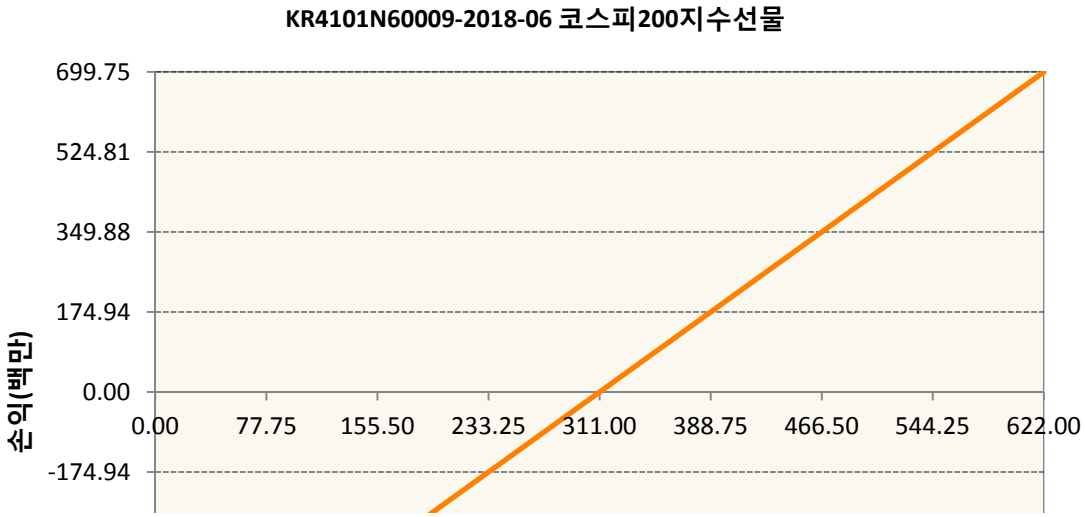
1. 계약금액

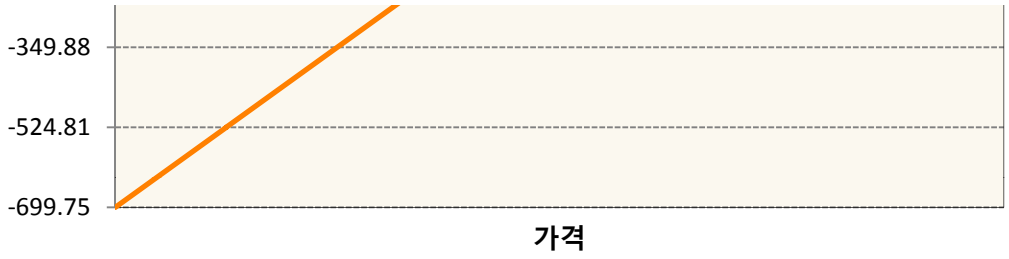
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	704	702	2	장내
누계	유가증권	선물	1,477	0	1,477	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101N30(2018-03 코스피200지수선물							62
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-62	-62	-62	-62	-62	-62	-62
-5.33%	-41	-41	-41	-41	-41	-41	-41
-2.67%	-21	-21	-21	-21	-21	-21	-21
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	21	21	21	21	21	21	21
5.33%	41	41	41	41	41	41	41
8.00%	62	62	62	62	62	62	62

KR4101N60(2018-06 코스피200지수선물							56
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-56	-56	-56	-56	-56	-56	-56
-5.33%	-37	-37	-37	-37	-37	-37	-37
-2.67%	-19	-19	-19	-19	-19	-19	-19
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	19	19	19	19	19	19	19
5.33%	37	37	37	37	37	37	37
8.00%	56	56	56	56	56	56	56

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

82

공시일	2018-03-08
기준일	2018-03-07

SMART합성-MSCI선진국증권상장지

1. 계약금액

(단위:백만원)

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

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWMXWO0(신한MXWO 미래S180222	1,110

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

415

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2018-03-08
기준일	2018-03-07

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	405

* 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	2018-03-08
기준일	2018-03-07

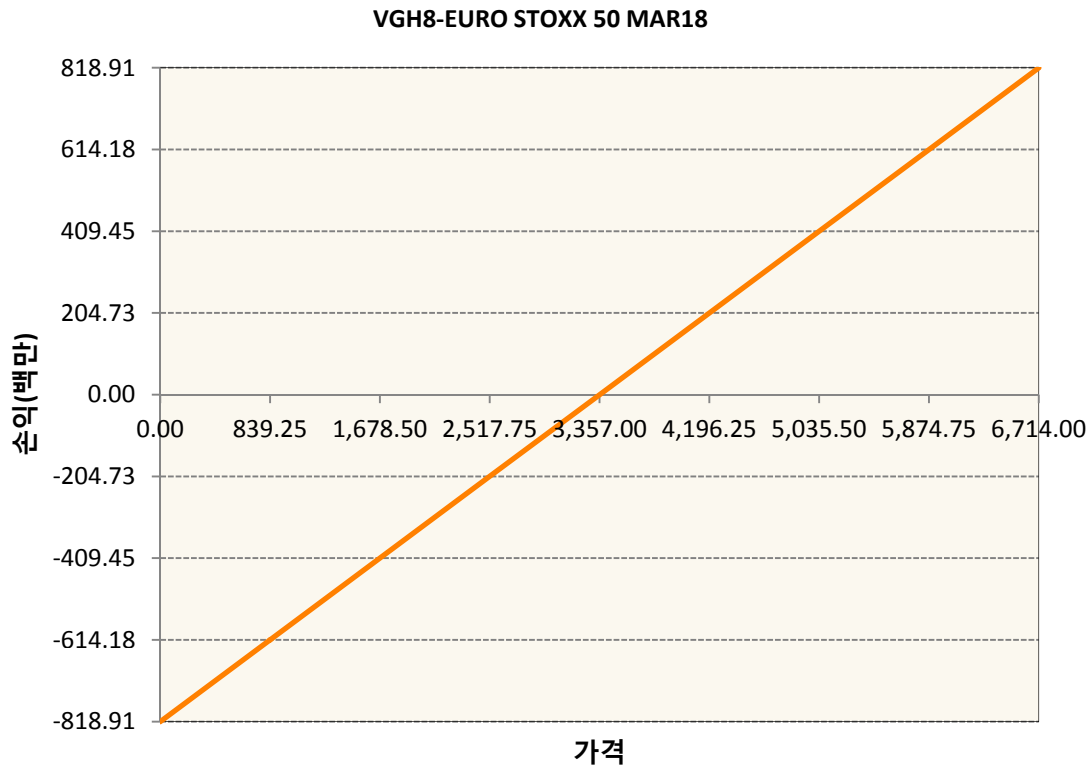
유로인덱스모(주식-파생형)

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	2018-03-08
기준일	2018-03-07

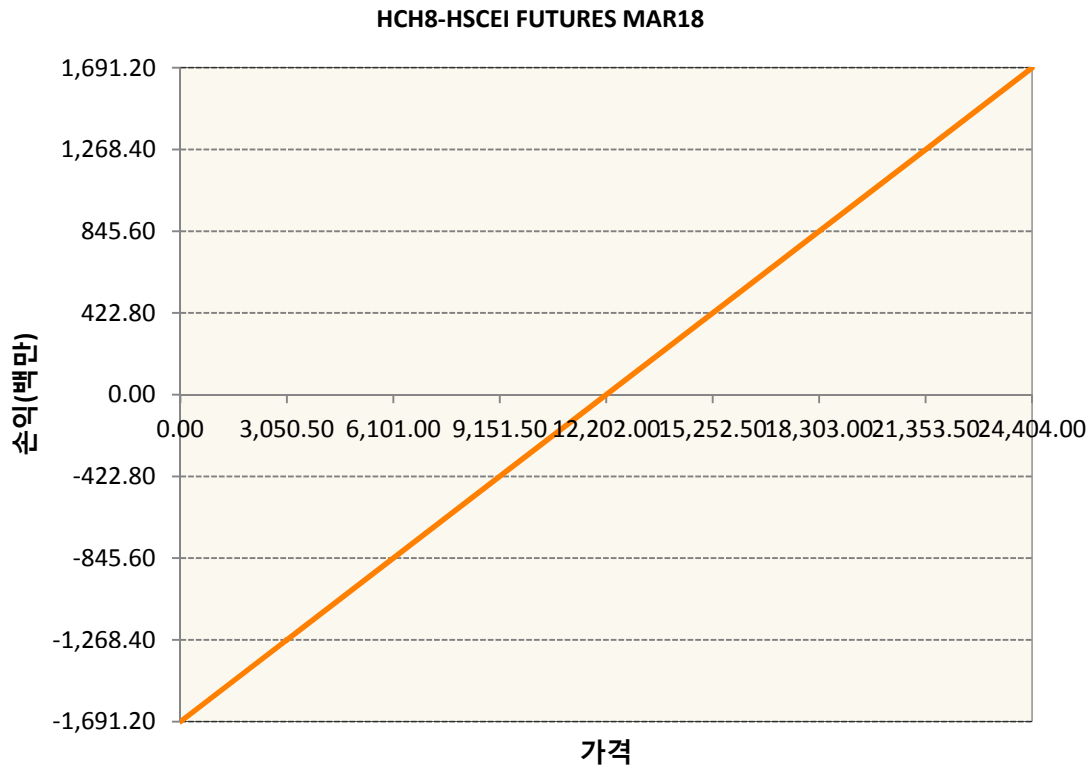
차이나인덱스모(주식-파생형)

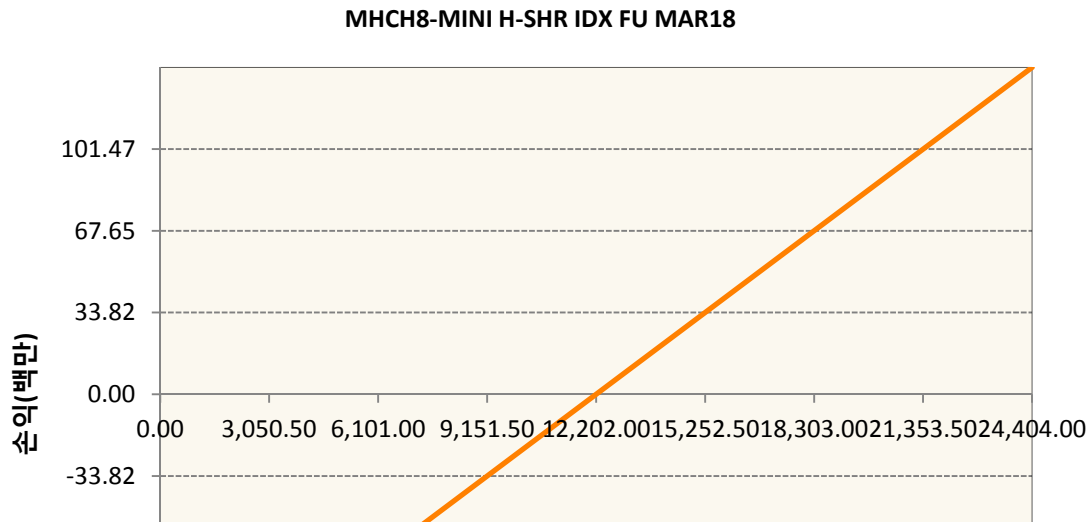
1. 계약금액

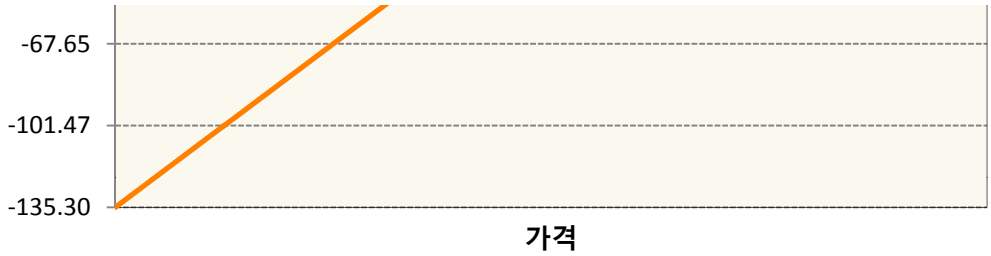
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,826	0	1,826	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCH8	HSCEI FUTURES MAR18	135
MHCH8	MINI H-SHR IDX FU MAR18	11

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

공시일	2018-03-08
기준일	2018-03-07

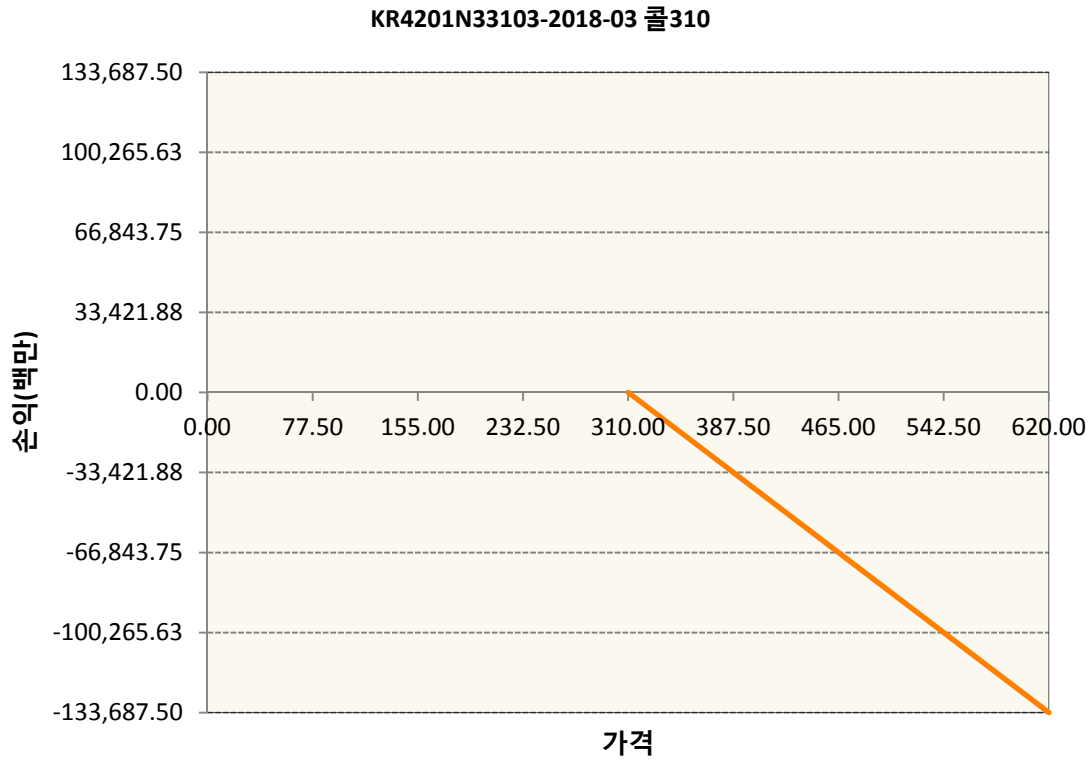
커버드콜모(주식혼합-파생형)

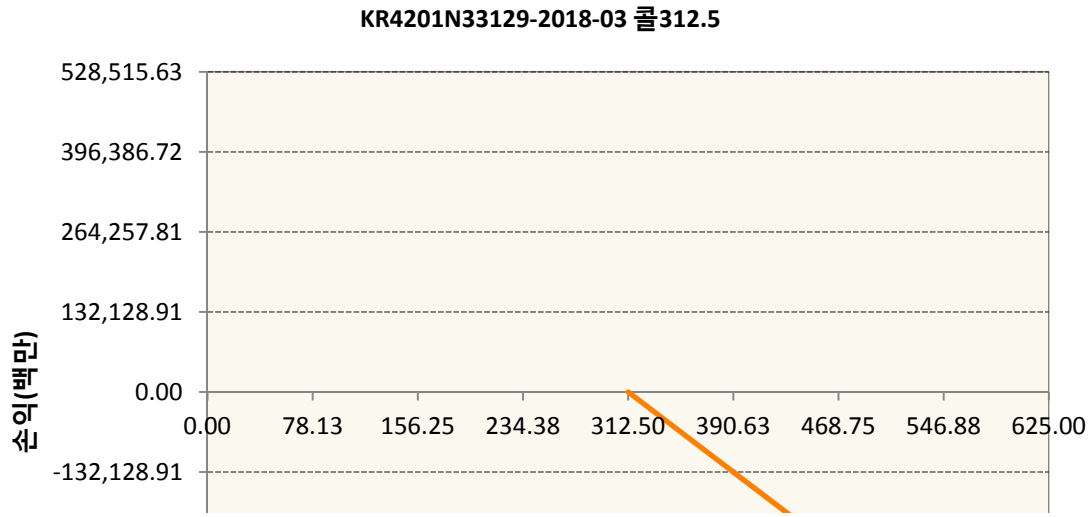
1. 계약금액

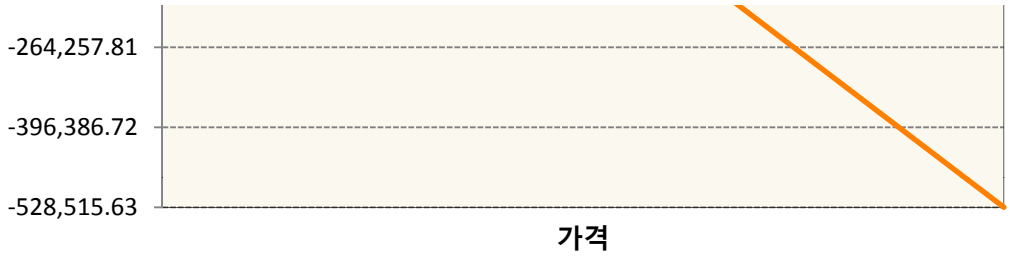
(단위:백만원)

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



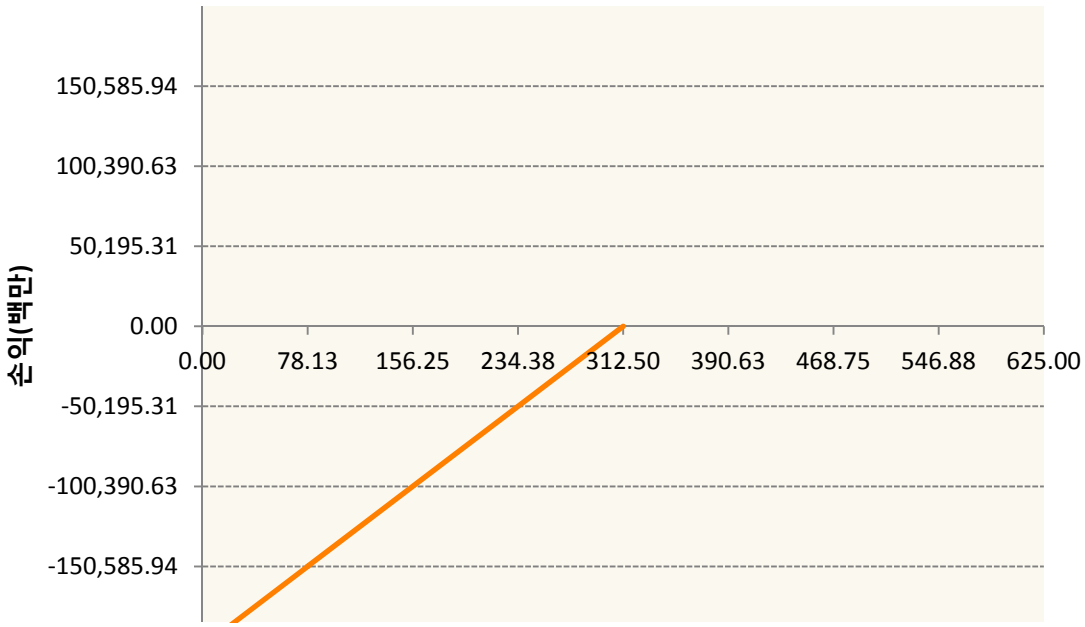




KR4301N33101-2018-03 풋310



KR4301N33127-2018-03 풋312.5





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201N3312018-03 콜310							10,190
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,036	1,036	1,036	1,036	1,036	1,036	1,036
-5.33%	1,036	1,036	1,036	1,036	1,036	1,035	1,034
-2.67%	1,028	1,021	1,010	995	977	955	929
0%	183	123	61	0	-62	-124	-186
2.67%	-3,035	-3,037	-3,041	-3,047	-3,055	-3,067	-3,081
5.33%	-6,612	-6,612	-6,612	-6,612	-6,612	-6,612	-6,613
8.00%	-10,190	-10,190	-10,190	-10,190	-10,190	-10,190	-10,190
KR4201N3312018-03 콜312.5							37,797
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	2,001	2,001	2,001	2,001	2,001	2,001	2,001
-5.33%	2,001	2,001	2,001	2,001	2,001	2,000	2,000
-2.67%	1,998	1,993	1,982	1,964	1,937	1,899	1,852
0%	708	475	239	0	-240	-482	-725
2.67%	-9,776	-9,815	-9,870	-9,940	-10,026	-10,127	-10,240
5.33%	-23,765	-23,765	-23,765	-23,766	-23,767	-23,771	-23,776
8.00%	-37,797	-37,797	-37,797	-37,797	-37,797	-37,797	-37,797
KR4301N3312018-03 풋310							19,207
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-19,207	-19,207	-19,207	-19,207	-19,207	-19,207	-19,207
-5.33%	-12,300	-12,300	-12,300	-12,300	-12,300	-12,300	-12,300
-2.67%	-5,393	-5,394	-5,395	-5,398	-5,402	-5,409	-5,419
0%	218	147	74	0	-75	-151	-227
2.67%	564	564	564	563	563	561	559
5.33%	564	564	564	564	564	564	564
8.00%	564	564	564	564	564	564	564
KR4301N3312018-03 풋312.5							15,601
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-15,601	-15,601	-15,601	-15,601	-15,601	-15,601	-15,601
-5.33%	-10,270	-10,270	-10,270	-10,270	-10,270	-10,270	-10,270
-2.67%	-4,939	-4,939	-4,939	-4,940	-4,940	-4,941	-4,942
0%	162	109	55	0	-56	-114	-172
2.67%	1,264	1,263	1,261	1,258	1,253	1,246	1,236

5.33%	1,264	1,264	1,264	1,264	1,264	1,264	1,264
8.00%	1,264	1,264	1,264	1,264	1,264	1,264	1,264

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

121,100

공시일	2018-03-08
기준일	2018-03-07

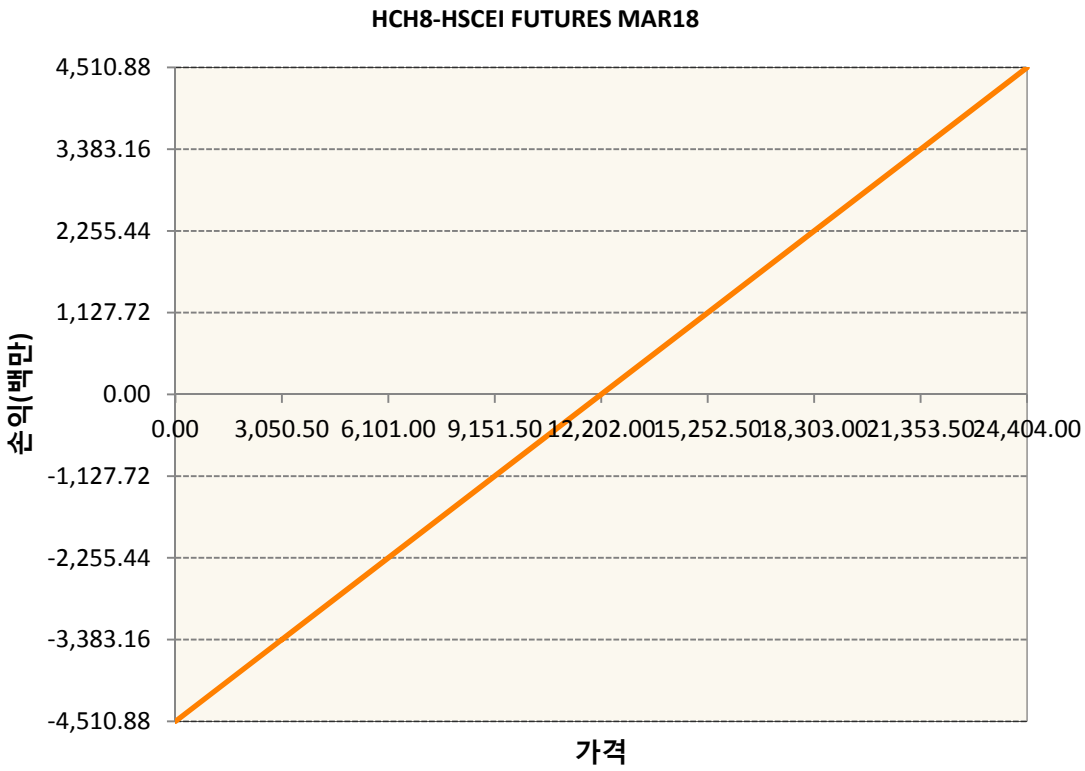
홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생

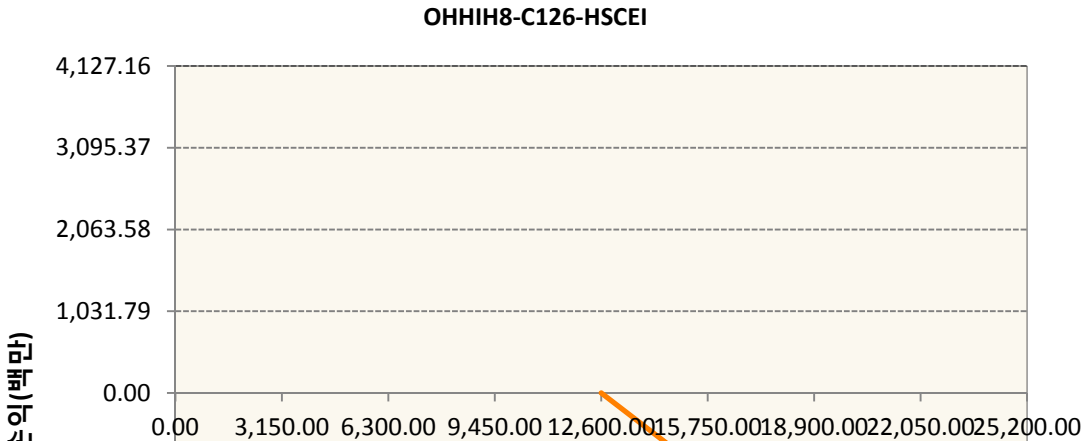
1. 계약금액

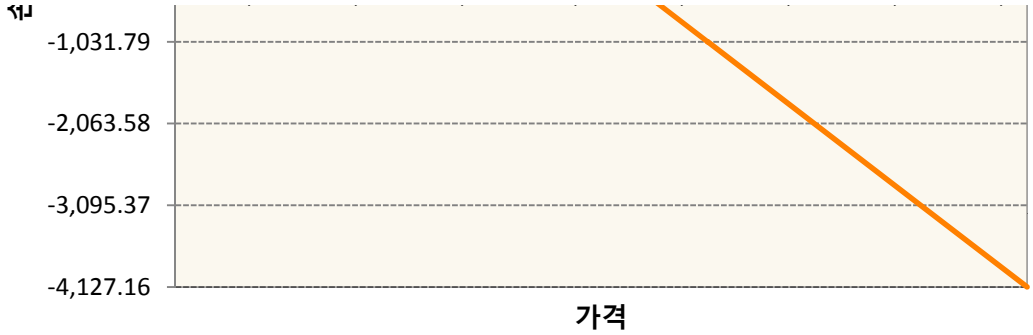
(단위:백만원)

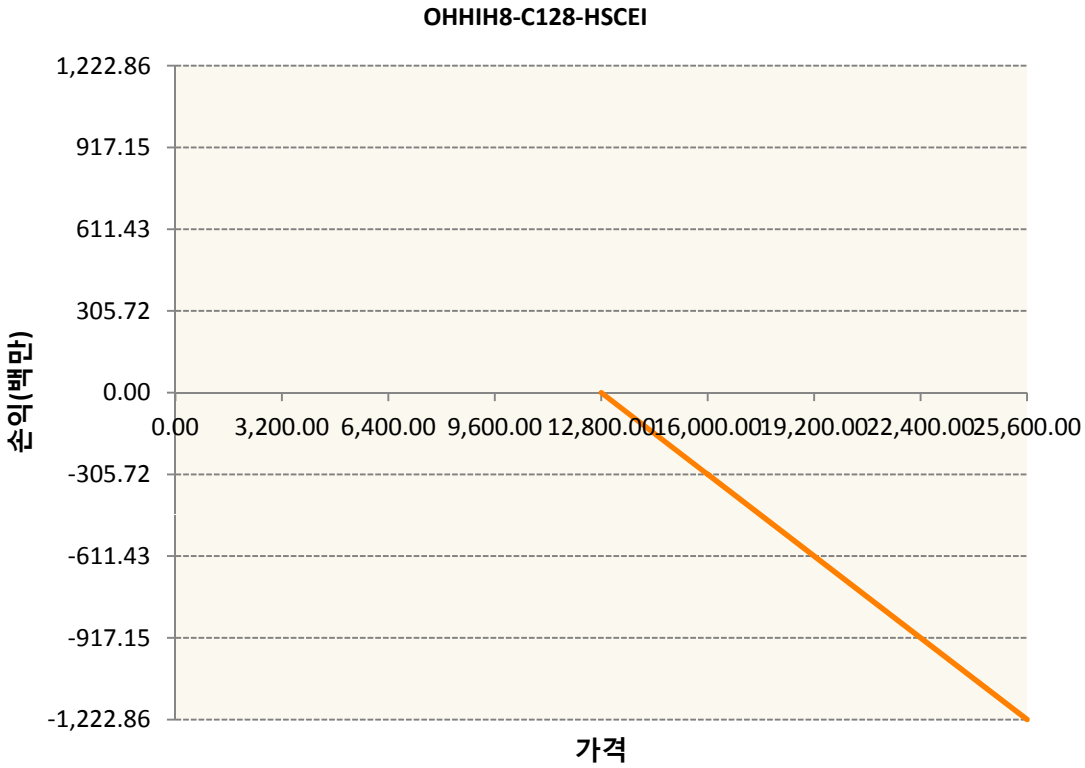
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	4,511	0	4,511	장내
누계	유가증권	옵션	0	10,700	-10,700	장내

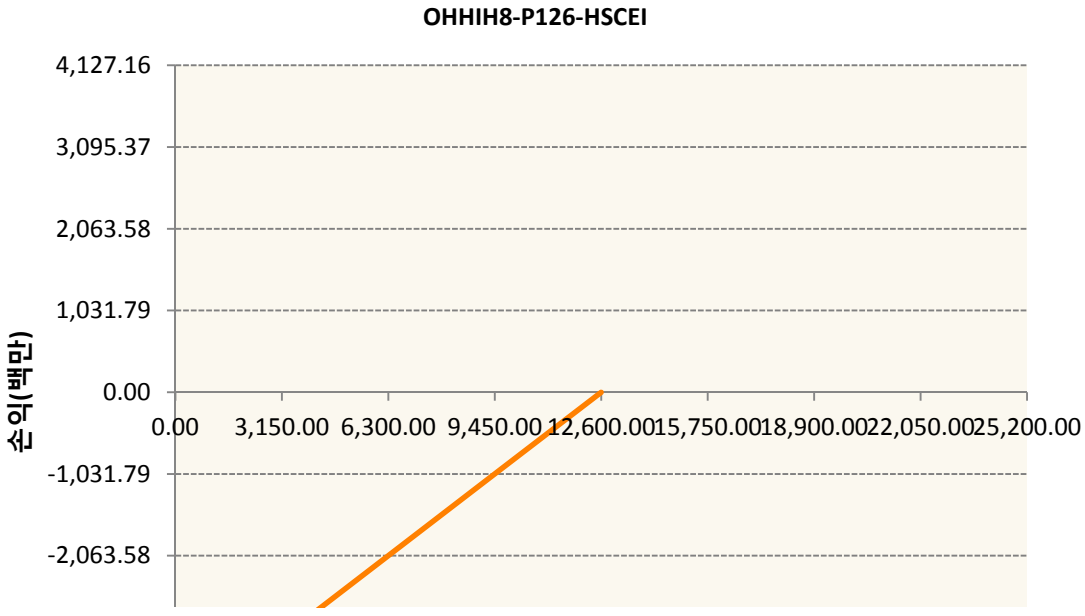
2. 만기시점의 손익구조

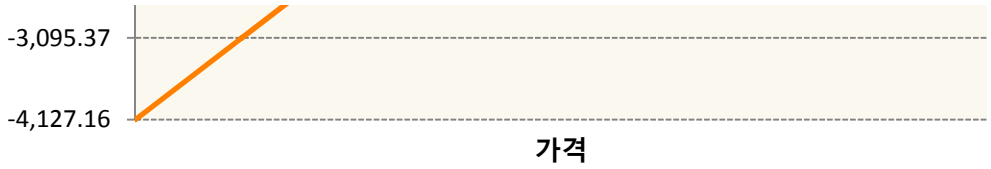


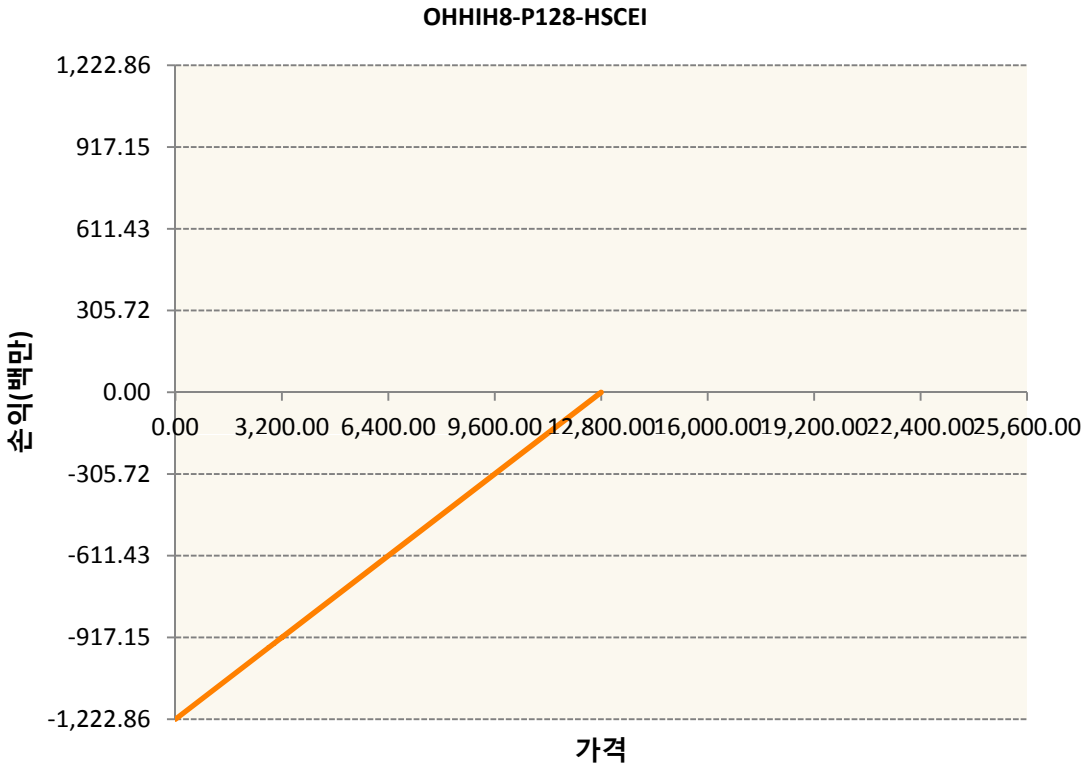



-1,031.79
-2,063.58
-3,095.37
-4,127.16
가격


OHHIH8-C128-HSCEI
1,222.86
917.15
611.43
305.72
0.00
-305.72
-611.43
-917.15
-1,222.86
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
4,127.16
3,095.37
2,063.58
1,031.79
0.00
-1,031.79
-2,063.58
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	361
OHHIH8-C12 HSCEI	330
OHHIH8-C12 HSCEI	98
OHHIH8-P12 HSCEI	330
OHHIH8-P12 HSCEI	98

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

1,066

공시일	2018-03-08
기준일	2018-03-07

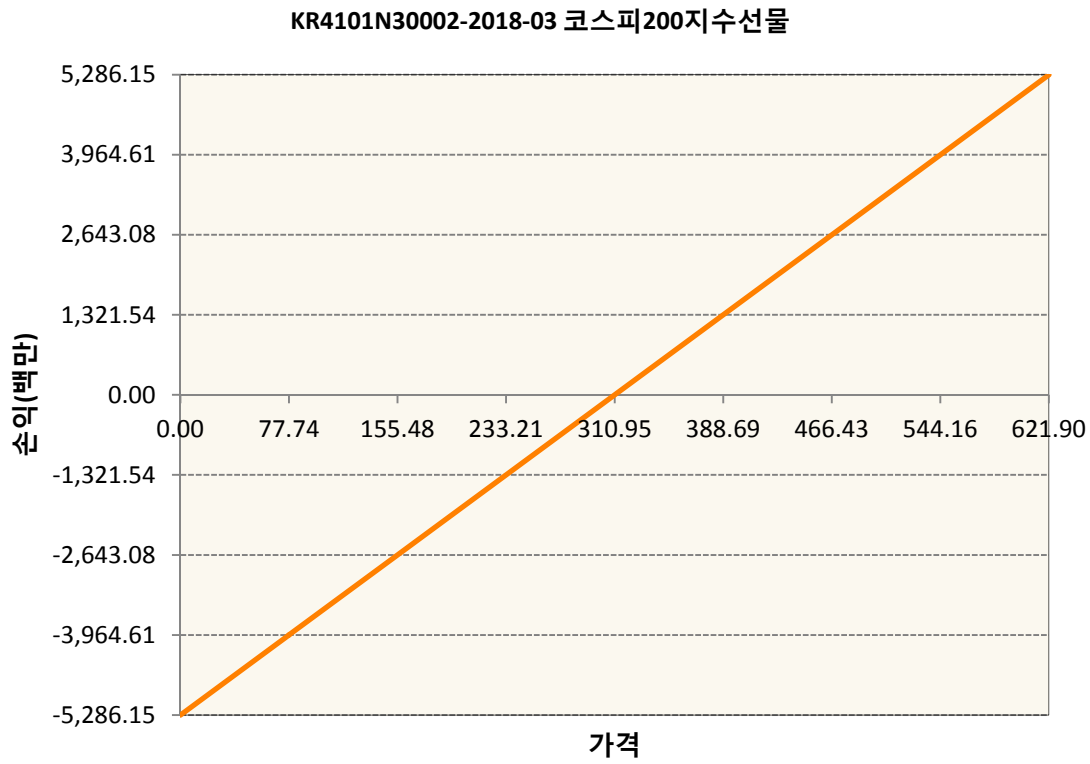
코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼

1. 계약금액

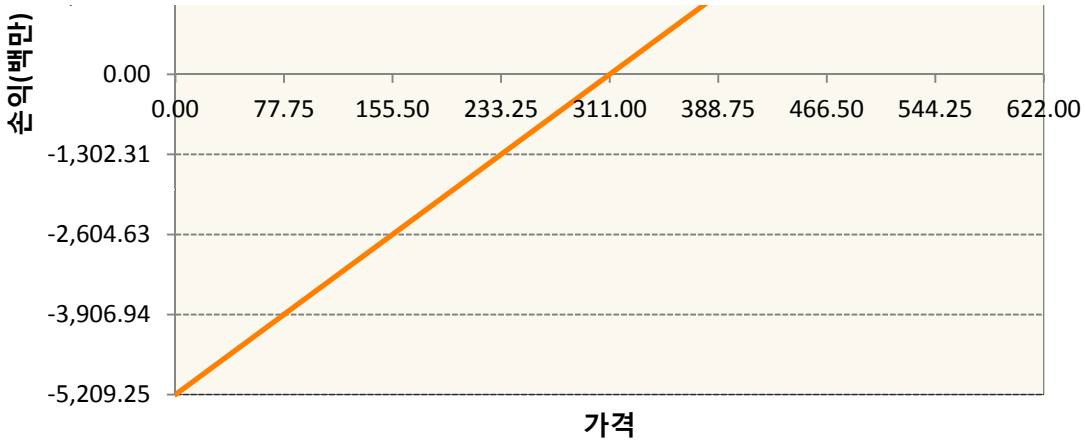
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	5,244	5,230	13	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	10,495	0	10,495	장내
누계	유가증권	스왑	56,200	0	56,200	장외
누계	유가증권	옵션	0	55,313	-55,313	장내

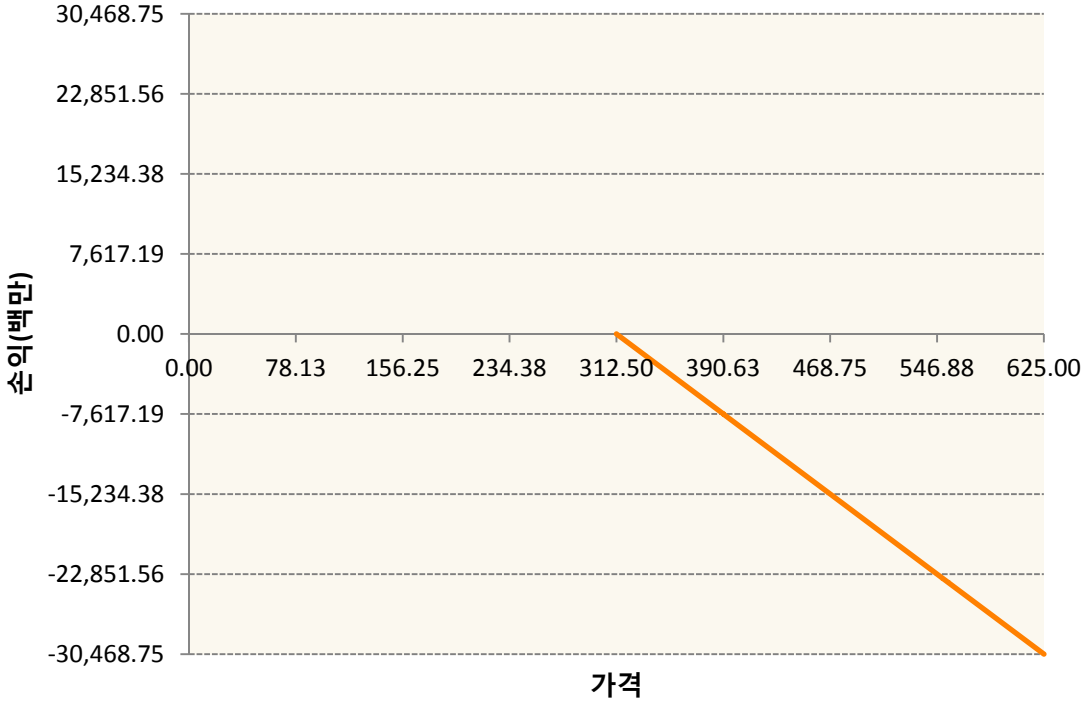
2. 만기시점의 손익구조



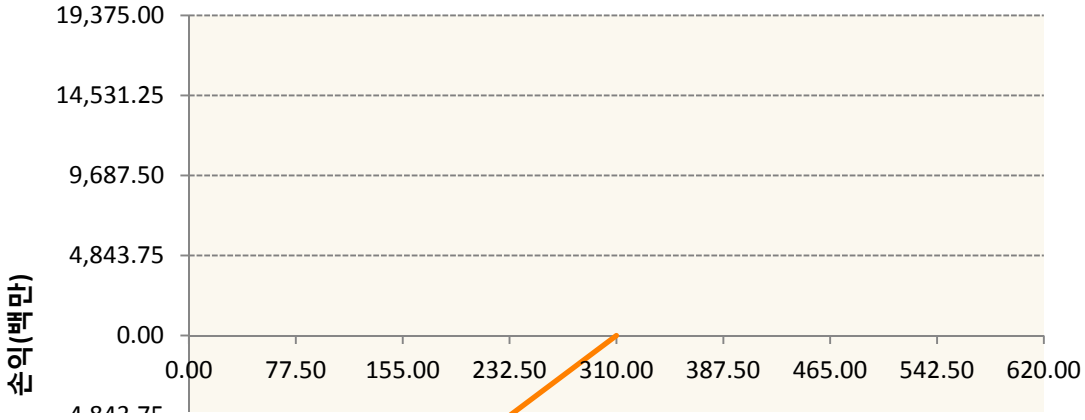




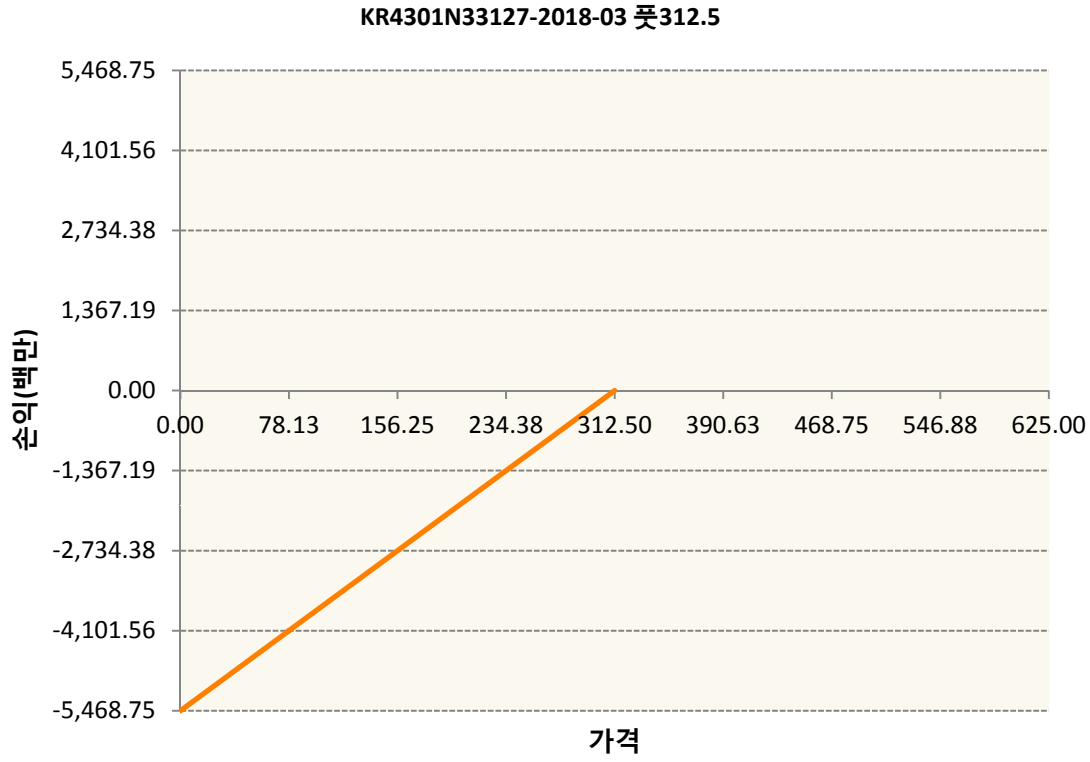
KR4201N33129-2018-03 콜312.5



KR4301N33101-2018-03 풋310







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_2							1,447
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,447	-1,447	-1,447	-1,447	-1,447	-1,447	-1,447
-5.33%	-965	-965	-965	-965	-965	-965	-965
-2.67%	-482	-482	-482	-482	-482	-482	-482
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	482	482	482	482	482	482	482
5.33%	965	965	965	965	965	965	965
8.00%	1,447	1,447	1,447	1,447	1,447	1,447	1,447
2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_3							274
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%

-8.00%	-274	-274	-274	-274	-274	-274	-274
-5.33%	-183	-183	-183	-183	-183	-183	-183
-2.67%	-91	-91	-91	-91	-91	-91	-91
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	91	91	91	91	91	91	91
5.33%	183	183	183	183	183	183	183
8.00%	274	274	274	274	274	274	274
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_4						156
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-156	-156	-156	-156	-156	-156	-156
-5.33%	-104	-104	-104	-104	-104	-104	-104
-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%	104	104	104	104	104	104	104
8.00%	156	156	156	156	156	156	156
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_5						235
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-235	-235	-235	-235	-235	-235	-235
-5.33%	-156	-156	-156	-156	-156	-156	-156
-2.67%	-78	-78	-78	-78	-78	-78	-78
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	78	78	78	78	78	78	78
5.33%	156	156	156	156	156	156	156
8.00%	235	235	235	235	235	235	235
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_6						196
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-196	-196	-196	-196	-196	-196	-196
-5.33%	-130	-130	-130	-130	-130	-130	-130
-2.67%	-65	-65	-65	-65	-65	-65	-65
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	65	65	65	65	65	65	65
5.33%	130	130	130	130	130	130	130
8.00%	196	196	196	196	196	196	196
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_7						250
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-250	-250	-250	-250	-250	-250	-250
-5.33%	-167	-167	-167	-167	-167	-167	-167
-2.67%	-83	-83	-83	-83	-83	-83	-83
0%	0	0	0	0	0	0	0

2.67%	83	83	83	83	83	83	83
5.33%	167	167	167	167	167	167	167
8.00%	250	250	250	250	250	250	250
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_8						463
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-463	-463	-463	-463	-463	-463	-463
-5.33%	-309	-309	-309	-309	-309	-309	-309
-2.67%	-154	-154	-154	-154	-154	-154	-154
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	154	154	154	154	154	154	154
5.33%	309	309	309	309	309	309	309
8.00%	463	463	463	463	463	463	463
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_10						274
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-274	-274	-274	-274	-274	-274	-274
-5.33%	-183	-183	-183	-183	-183	-183	-183
-2.67%	-91	-91	-91	-91	-91	-91	-91
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	91	91	91	91	91	91	91
5.33%	183	183	183	183	183	183	183
8.00%	274	274	274	274	274	274	274
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_11						626
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-626	-626	-626	-626	-626	-626	-626
-5.33%	-417	-417	-417	-417	-417	-417	-417
-2.67%	-209	-209	-209	-209	-209	-209	-209
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	209	209	209	209	209	209	209
5.33%	417	417	417	417	417	417	417
8.00%	626	626	626	626	626	626	626
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_12						469
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-469	-469	-469	-469	-469	-469	-469
-5.33%	-313	-313	-313	-313	-313	-313	-313
-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%	313	313	313	313	313	313	313
8.00%	469	469	469	469	469	469	469
	KR4101N30(2018-03 코스피200지수선물						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%	-282	-282	-282	-282	-282	-282	-282
-2.67%	-141	-141	-141	-141	-141	-141	-141
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	141	141	141	141	141	141	141
5.33%	282	282	282	282	282	282	282
8.00%	423	423	423	423	423	423	423
	KR4101N60(	2018-06	코스피200지수선물				417

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-417	-417	-417	-417	-417	-417	-417
-5.33%	-278	-278	-278	-278	-278	-278	-278
-2.67%	-139	-139	-139	-139	-139	-139	-139
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	139	139	139	139	139	139	139
5.33%	278	278	278	278	278	278	278
8.00%	417	417	417	417	417	417	417
	KR4201N331	2018-03	콜312.5				2,179

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	115	115	115	115	115	115	115
-5.33%	115	115	115	115	115	115	115
-2.67%	115	115	114	113	112	110	107
0%	41	27	14	0	-14	-28	-42
2.67%	-564	-566	-569	-573	-578	-584	-590
5.33%	-1,370	-1,370	-1,370	-1,370	-1,370	-1,370	-1,371
8.00%	-2,179	-2,179	-2,179	-2,179	-2,179	-2,179	-2,179
	KR4301N331	2018-03	풋310				1,442

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,442	-1,442	-1,442	-1,442	-1,442	-1,442	-1,442
-5.33%	-923	-923	-923	-923	-923	-923	-923
-2.67%	-405	-405	-405	-405	-406	-406	-407
0%	16	11	6	0	-6	-11	-17
2.67%	42	42	42	42	42	42	42
5.33%	42	42	42	42	42	42	42
8.00%	42	42	42	42	42	42	42
	KR4301N331	2018-03	풋312.5				425

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-425	-425	-425	-425	-425	-425	-425
-5.33%	-280	-280	-280	-280	-280	-280	-280

-2.67%	-135	-135	-135	-135	-135	-135	-135
0%	4	3	2	0	-2	-3	-5
2.67%	34	34	34	34	34	34	34
5.33%	34	34	34	34	34	34	34
8.00%	34	34	34	34	34	34	34

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

10,862

공시일	2018-03-08
기준일	2018-03-07

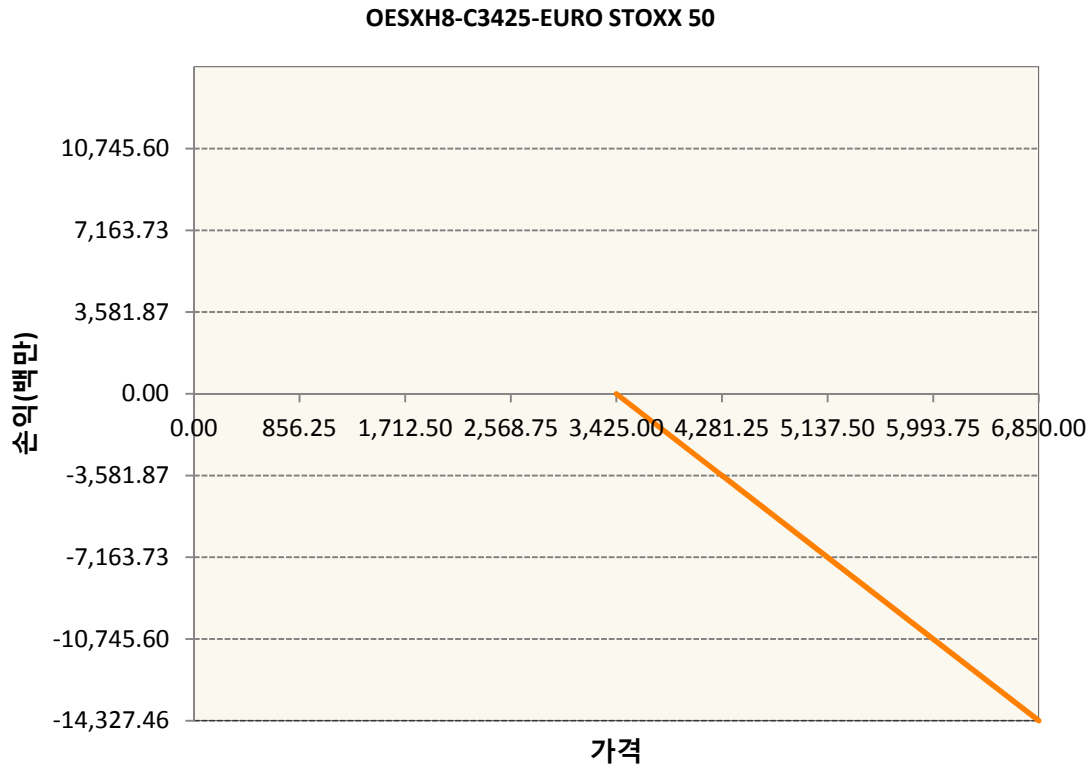
유로커버드콜모(주식혼합-파생형

1. 계약금액

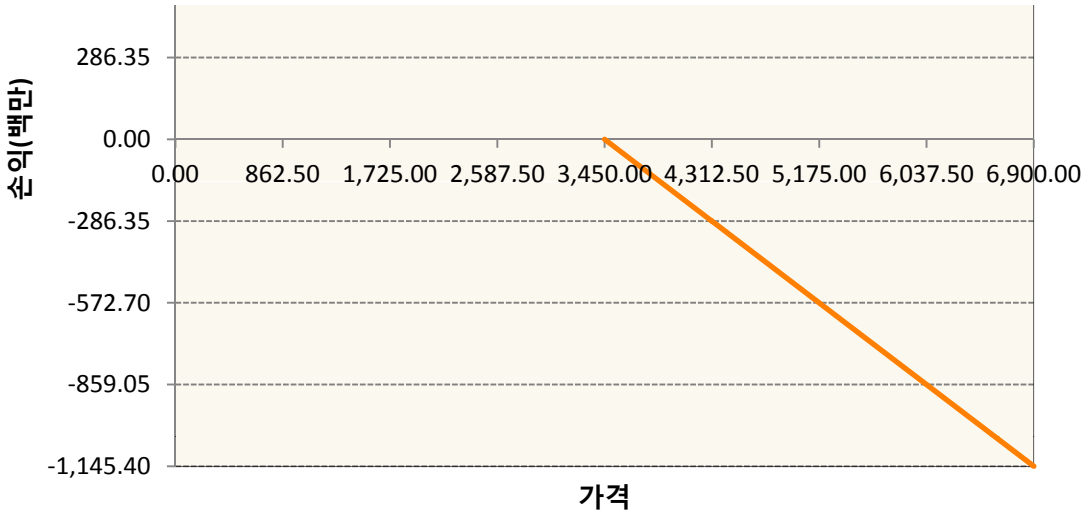
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	7,184	0	7,184	
누계	유가증권	스왑	99,603	0	99,603	장외
누계	유가증권	옵션	0	30,946	-30,946	장내
누계	지수	스왑	53,122	0	53,122	장외

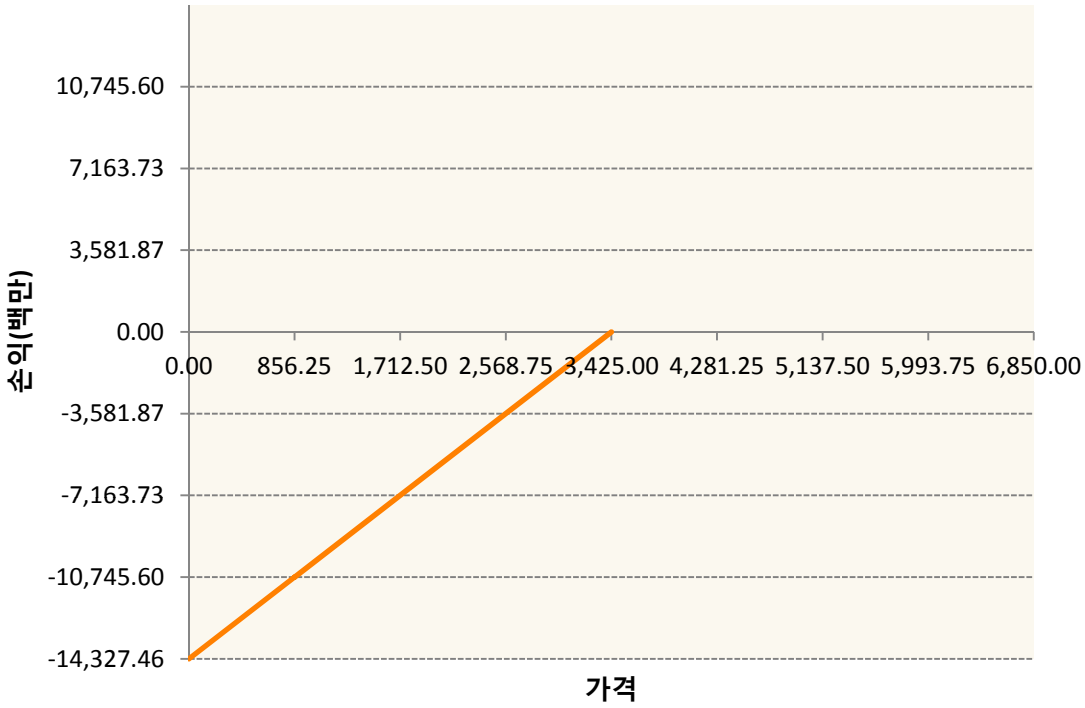
2. 만기시점의 손익구조



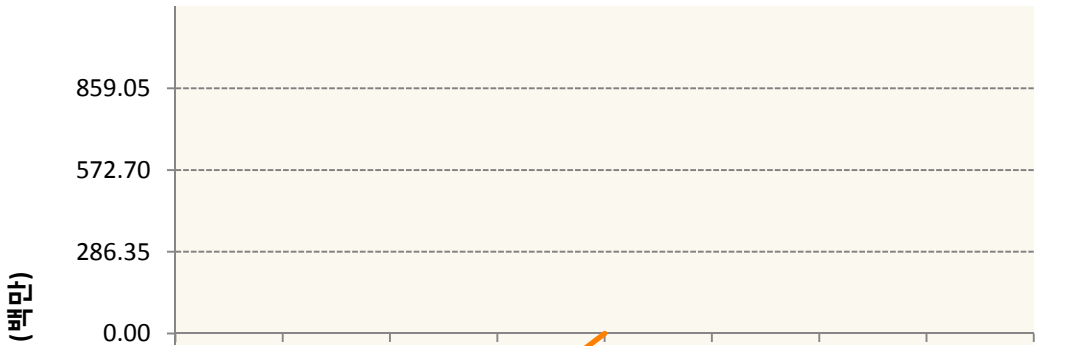


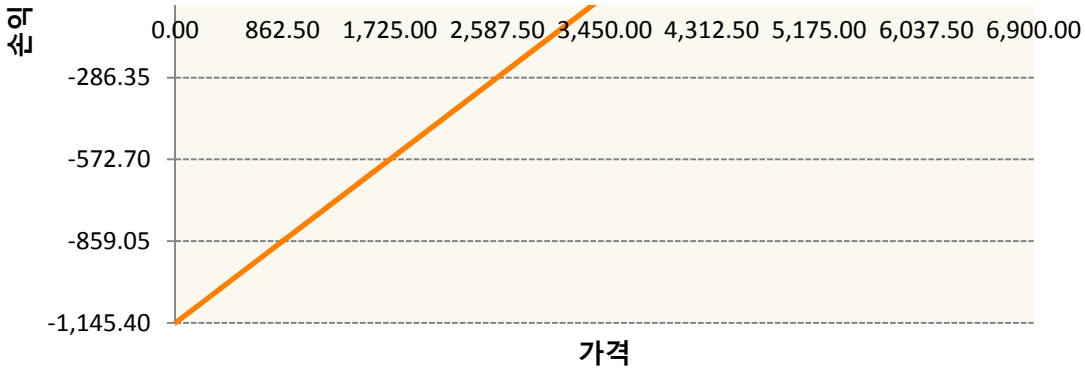


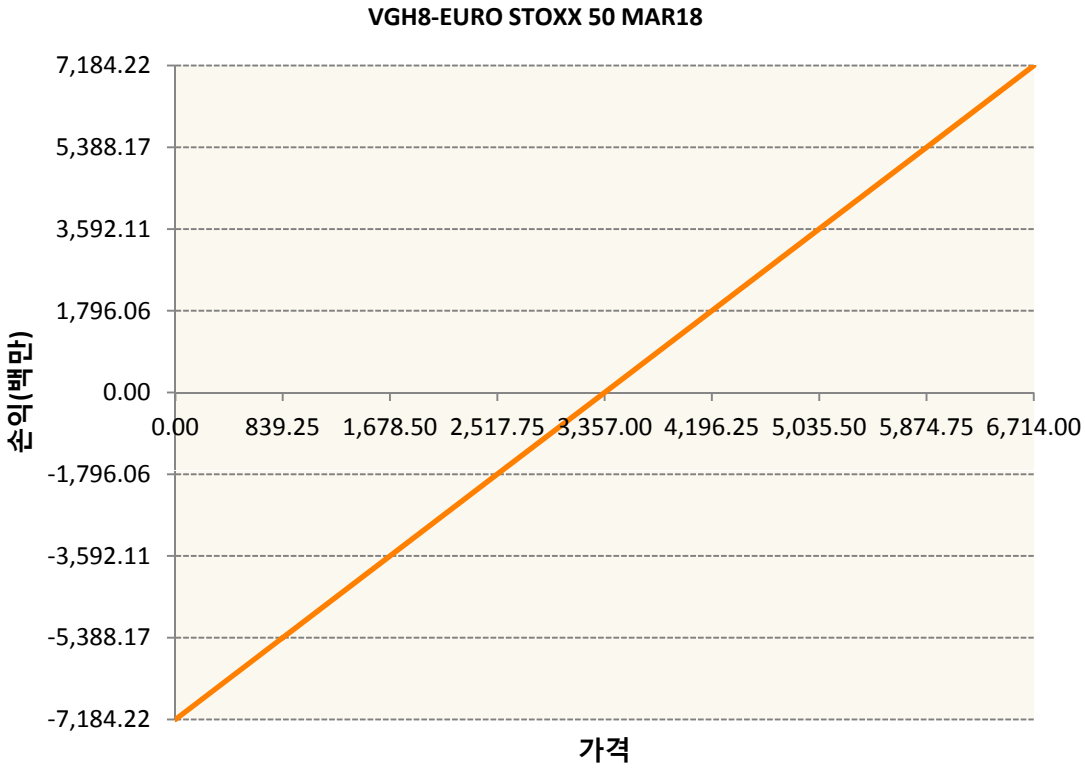
OESXH8-P3425-EURO STOXX 50



OESXH8-P3450-EURO STOXX 50







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)	(단위:백만원)
260105SGPX SG EURO Covered CALL STRATEGY - 994.569	245
260105SQPX SG EURO Covered CALL STRATEGY	459
OESXH8-C34 EURO STOXX 50	1,146
OESXH8-C34 EURO STOXX 50	92
OESXH8-P34 EURO STOXX 50	1,146
OESXH8-P34 EURO STOXX 50	92
VGH8 EURO STOXX 50 MAR18	575

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

2,242

공시일	2018-03-08
기준일	2018-03-07

ETF스마트레버리지목표전환형8호

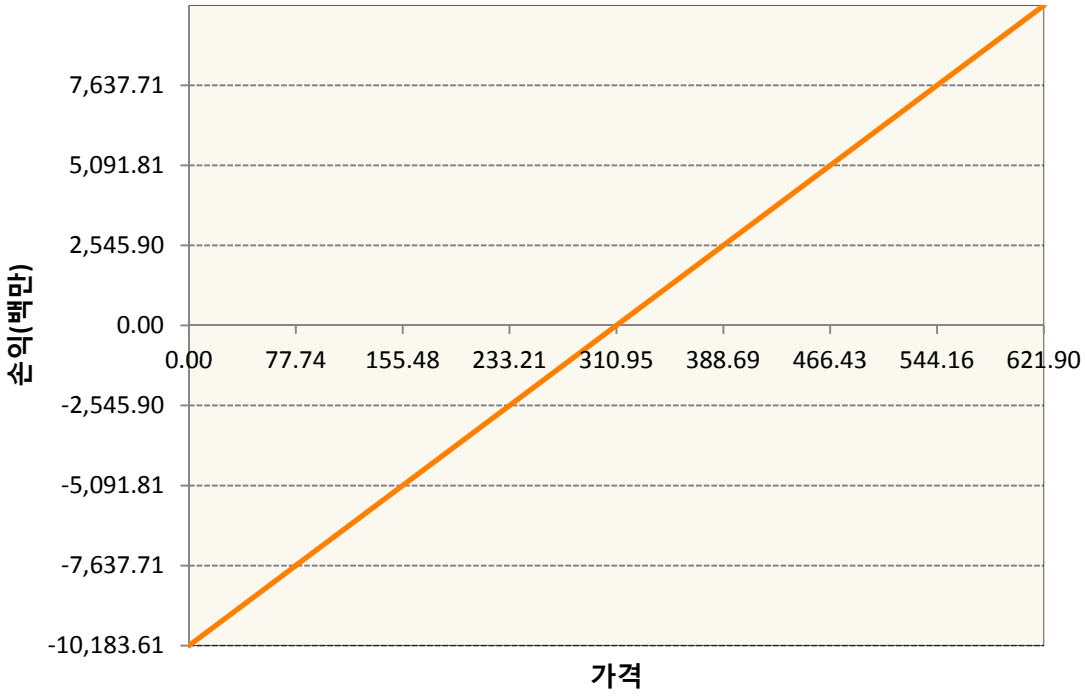
1. 계약금액

(단위:백만원)

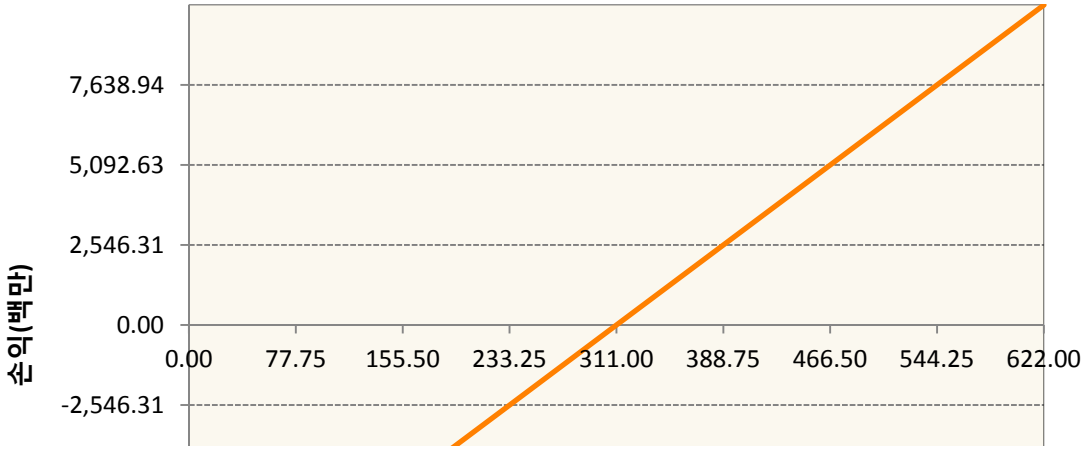
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	10,244	10,219	25	장내
누계	유가증권	선물	20,369	0	20,369	장내

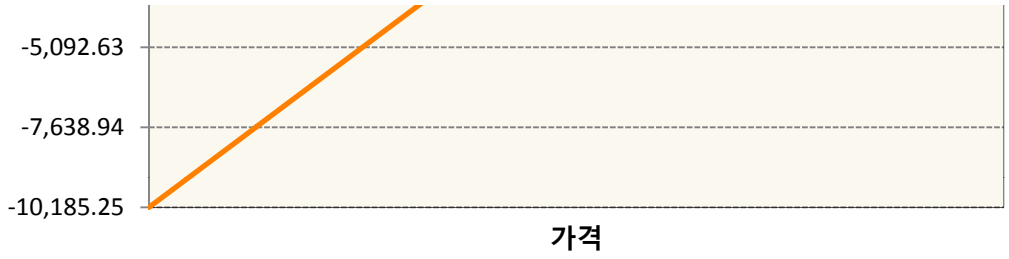
2. 만기시점의 손익구조

KR4101N30002-2018-03 코스피200지수선물



KR4101N60009-2018-06 코스피200지수선물





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101N30(2018-03 코스피200지수선물							815
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-815	-815	-815	-815	-815	-815	-815
-5.33%	-543	-543	-543	-543	-543	-543	-543
-2.67%	-272	-272	-272	-272	-272	-272	-272
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	272	272	272	272	272	272	272
5.33%	543	543	543	543	543	543	543
8.00%	815	815	815	815	815	815	815
KR4101N60(2018-06 코스피200지수선물							815
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-815	-815	-815	-815	-815	-815	-815
-5.33%	-543	-543	-543	-543	-543	-543	-543
-2.67%	-272	-272	-272	-272	-272	-272	-272
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	272	272	272	272	272	272	272
5.33%	543	543	543	543	543	543	543
8.00%	815	815	815	815	815	815	815

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

1,125

공시일	2018-03-08
기준일	2018-03-07

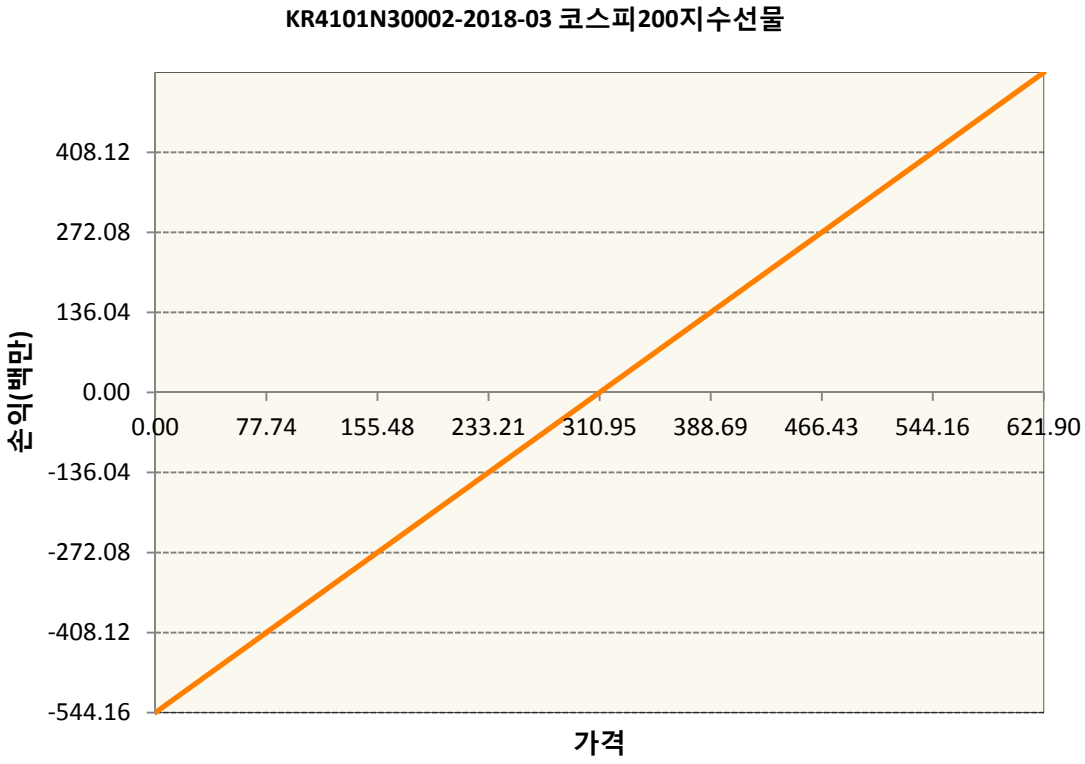
ETF스마트레버리지목표전환형9호

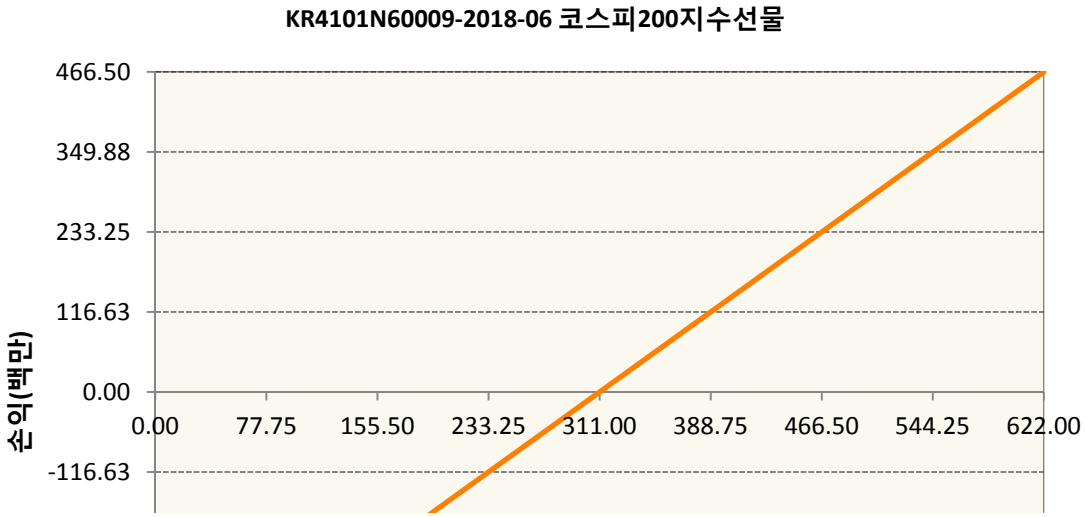
1. 계약금액

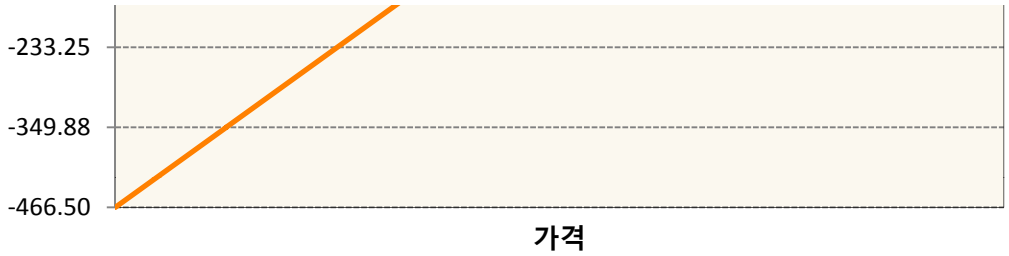
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	469	468	1	장내
누계	유가증권	선물	1,011	0	1,011	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101N30(2018-03 코스피200지수선물							44
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-44	-44	-44	-44	-44	-44	-44
-5.33%	-29	-29	-29	-29	-29	-29	-29
-2.67%	-15	-15	-15	-15	-15	-15	-15
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	15	15	15	15	15	15	15
5.33%	29	29	29	29	29	29	29
8.00%	44	44	44	44	44	44	44
KR4101N60(2018-06 코스피200지수선물							37
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-37	-37	-37	-37	-37	-37	-37
-5.33%	-25	-25	-25	-25	-25	-25	-25
-2.67%	-12	-12	-12	-12	-12	-12	-12
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	12	12	12	12	12	12	12
5.33%	25	25	25	25	25	25	25
8.00%	37	37	37	37	37	37	37

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

56

공시일	2018-03-08
기준일	2018-03-07

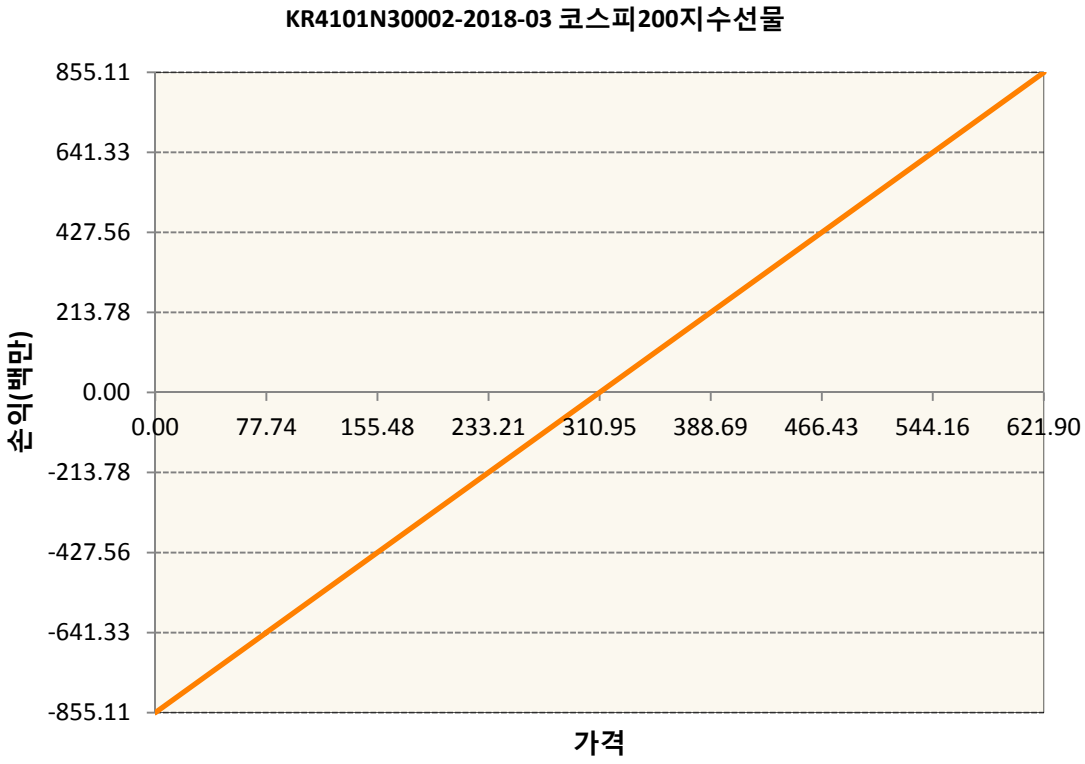
ETF스마트레버리지목표전환형10

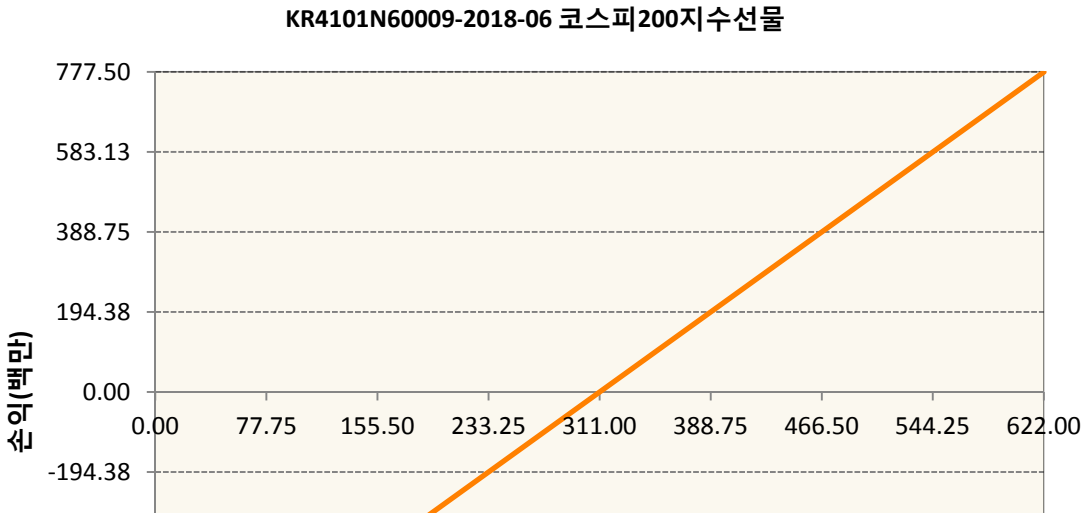
1. 계약금액

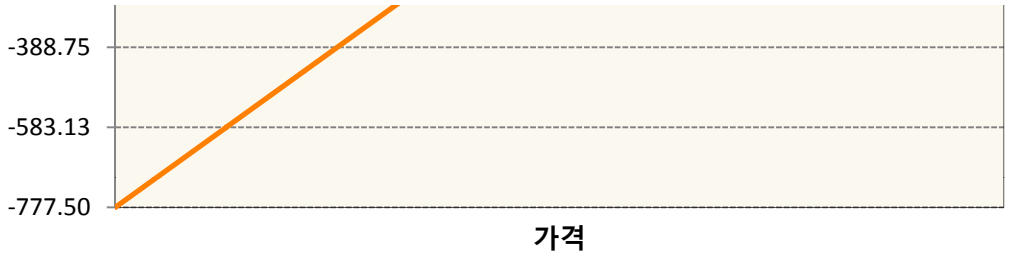
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	782	780	2	장내
누계	유가증권	선물	1,633	0	1,633	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101N30(2018-03 코스피200지수선물							68
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-68	-68	-68	-68	-68	-68	-68
-5.33%	-46	-46	-46	-46	-46	-46	-46
-2.67%	-23	-23	-23	-23	-23	-23	-23
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	23	23	23	23	23	23	23
5.33%	46	46	46	46	46	46	46
8.00%	68	68	68	68	68	68	68
KR4101N60(2018-06 코스피200지수선물							62
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-62	-62	-62	-62	-62	-62	-62
-5.33%	-41	-41	-41	-41	-41	-41	-41
-2.67%	-21	-21	-21	-21	-21	-21	-21
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	21	21	21	21	21	21	21
5.33%	41	41	41	41	41	41	41
8.00%	62	62	62	62	62	62	62

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

90

공시일	2018-03-08
기준일	2018-03-07

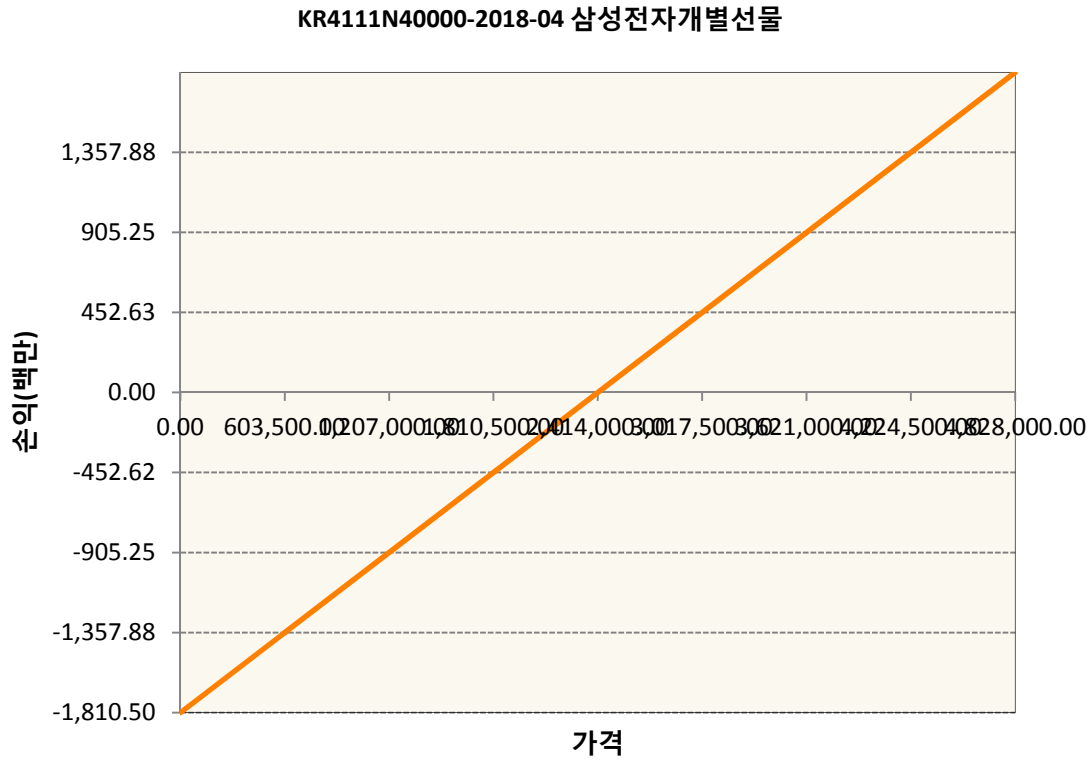
스마트KRX300인덱스1호(주식-파

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	1,811	0	1,811	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4111N40(2018-04 삼성전자개별선물							146
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-146	-146	-146	-146	-146	-146	-146
-5.33%	-97	-97	-97	-97	-97	-97	-97
-2.67%	-49	-49	-49	-49	-49	-49	-49
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	49	49	49	49	49	49	49
5.33%	97	97	97	97	97	97	97
8.00%	146	146	146	146	146	146	146

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

176

공시일	2018-03-08
기준일	2018-03-07

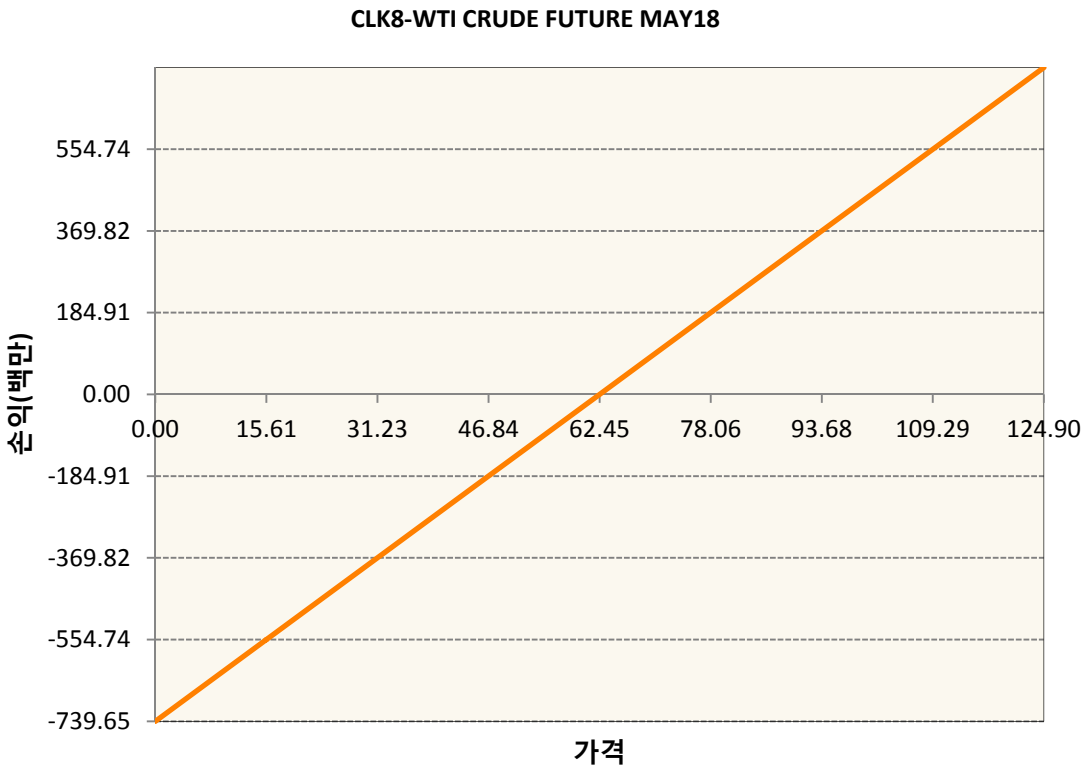
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

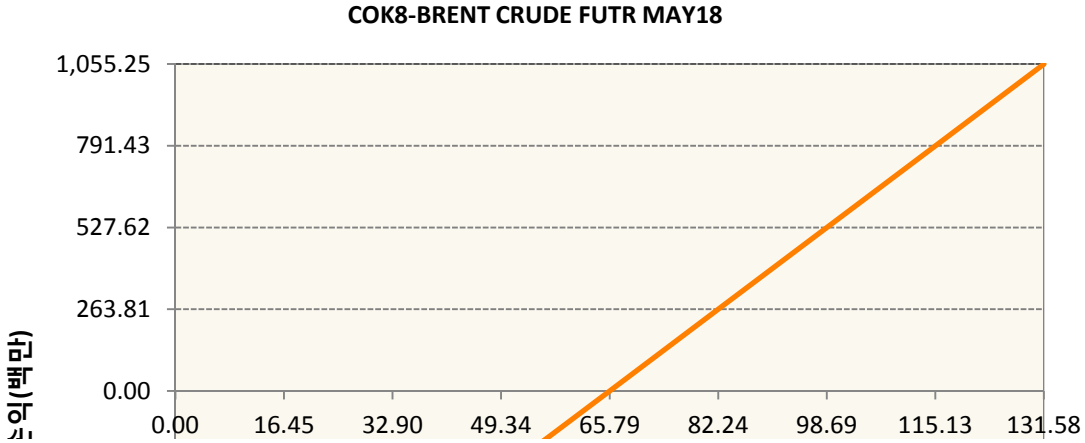
1. 계약금액

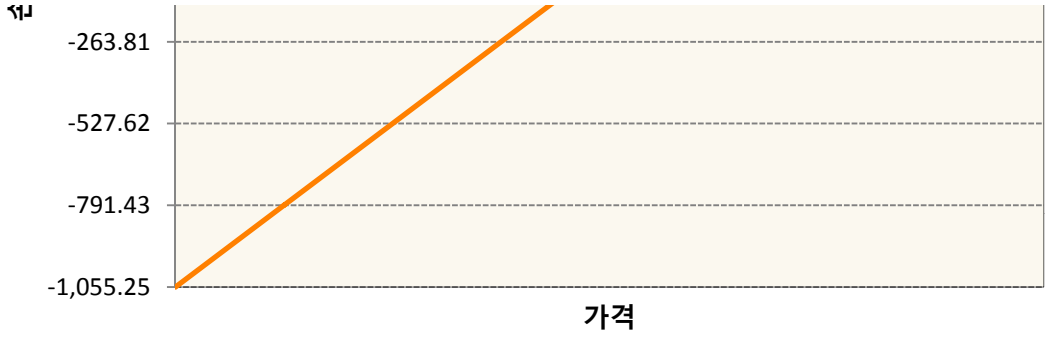
(단위:백만원)

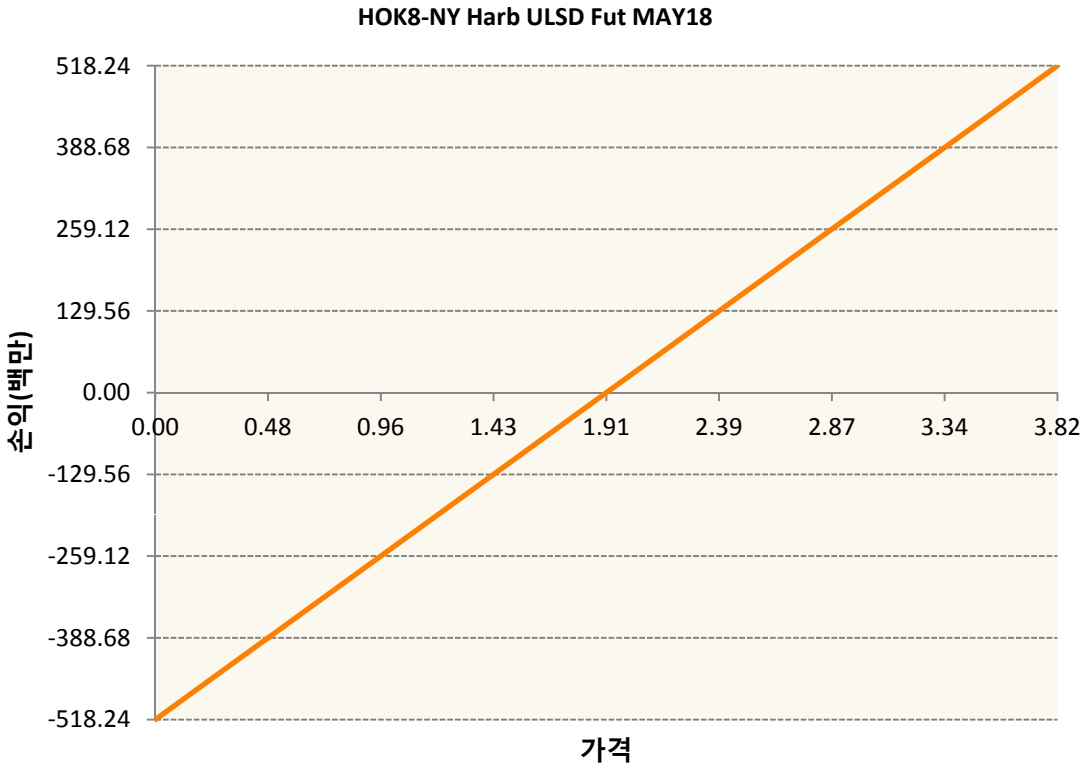
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	선물	유가증권	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	선물	유가증권	740	0	740	
누계	유가증권	선물	3,267	588	2,679	

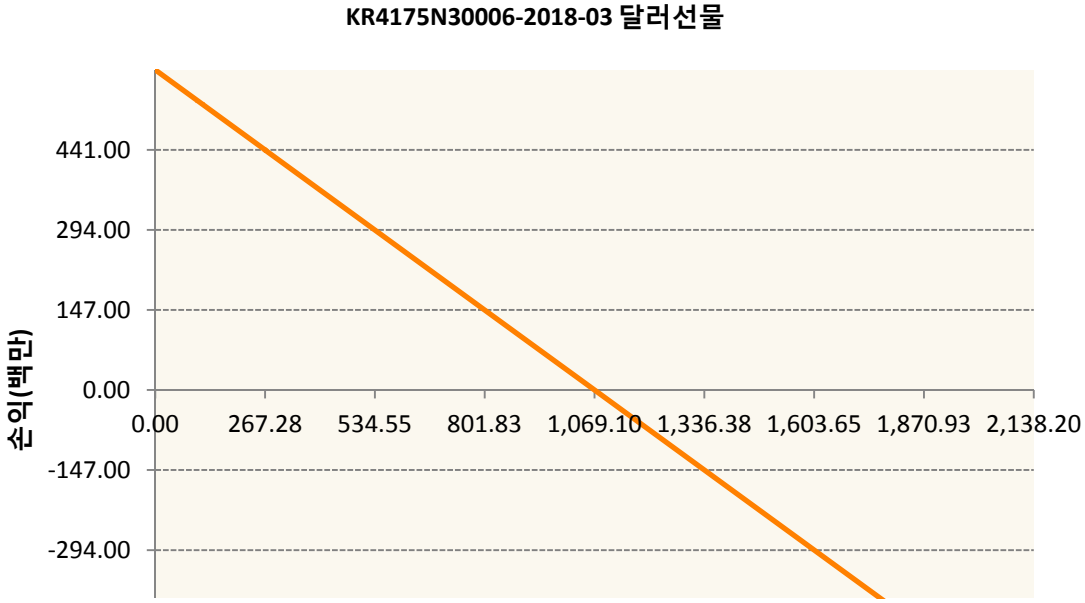
2. 만기시점의 손익구조

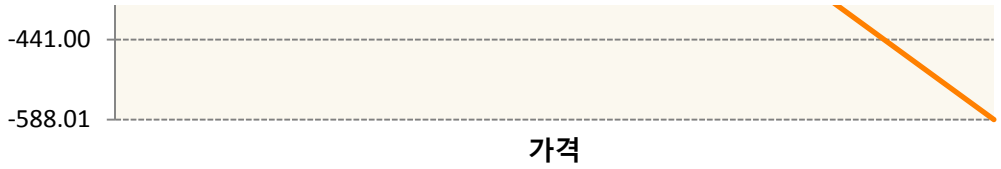


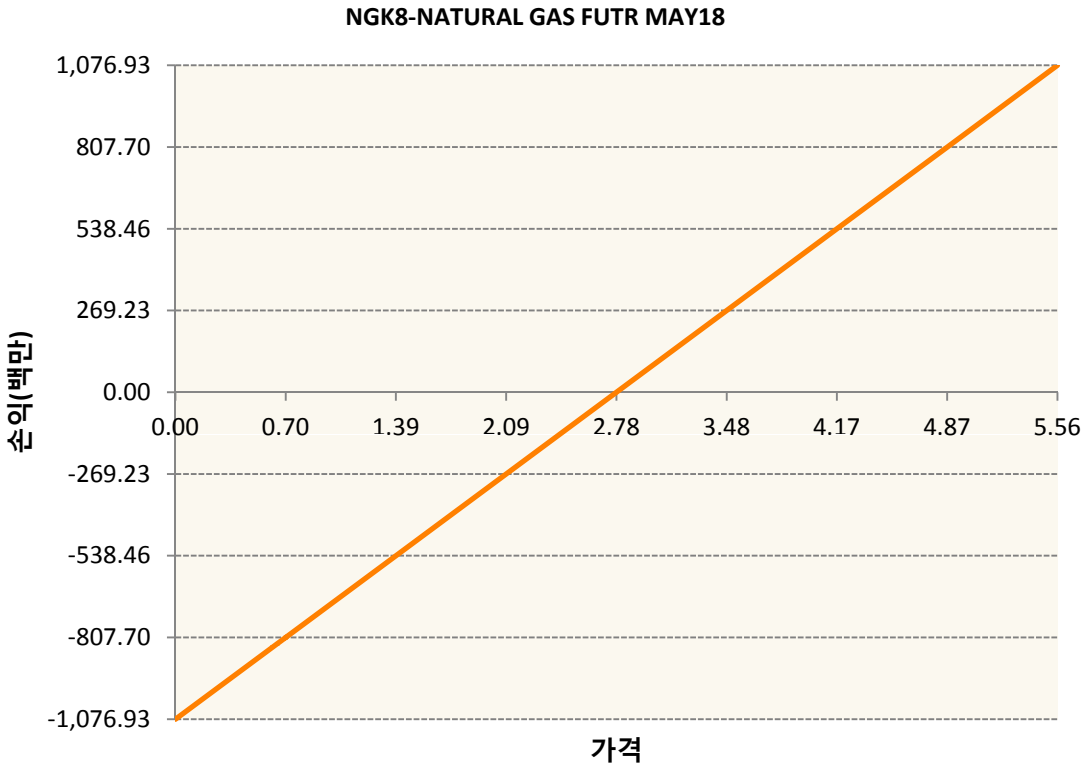


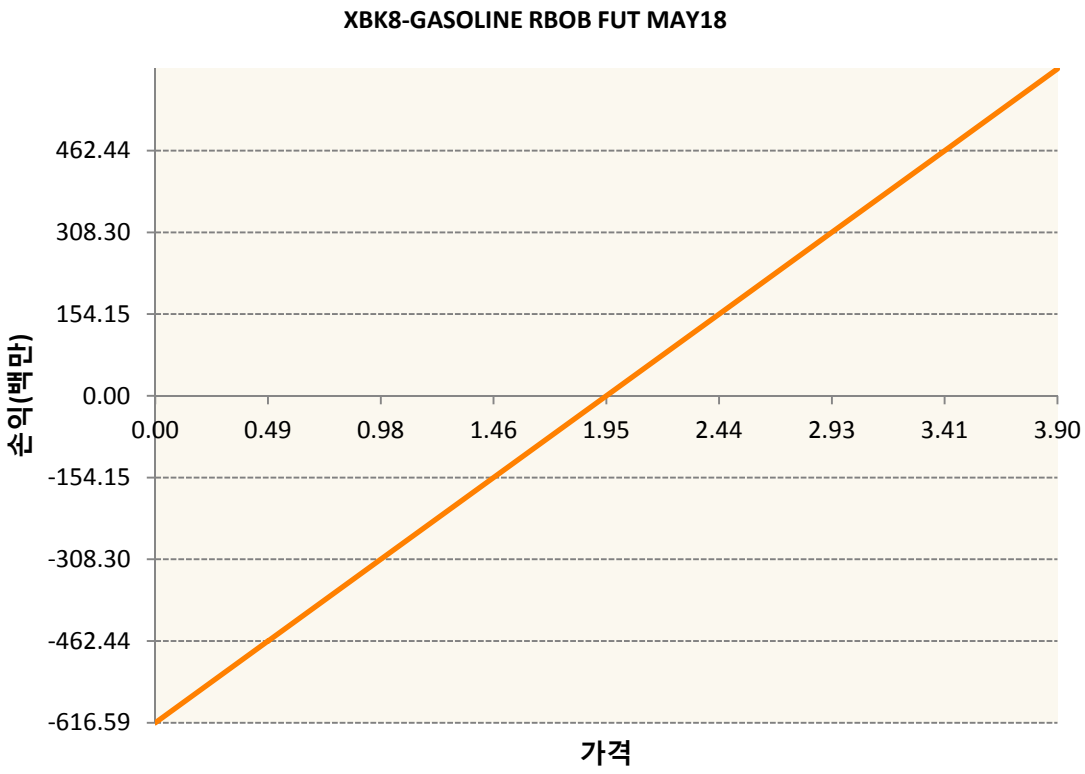

-263.81
-527.62
-791.43
-1,055.25
가격


HOK8-NY Harb ULSD Fut MAY18
518.24
388.68
259.12
129.56
0.00
-129.56
-259.12
-388.68
-518.24
손익(백만)
0.00
0.48
0.96
1.43
1.91
2.39
2.87
3.34
3.82
가격


KR4175N30006-2018-03 달러선물
441.00
294.00
147.00
0.00
-147.00
-294.00
손익(백만)
0.00
267.28
534.55
801.83
1,069.10
1,336.38
1,603.65
1,870.93
2,138.20


-441.00
-588.01
가격


NGK8-NATURAL GAS FUTR MAY18
1,076.93
807.70
538.46
269.23
0.00
-269.23
-538.46
-807.70
-1,076.93
0.00
0.70
1.39
2.09
2.78
3.48
4.17
4.87
5.56
손익(백만)
가격


XBK8-GASOLINE RBOB FUT MAY18
462.44
308.30
154.15
0.00
-154.15
-308.30
-462.44
-616.59
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	86
XBK8	GASOLINE RBOB FUT MAY18	49

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

525

공시일	2018-03-08
기준일	2018-03-07

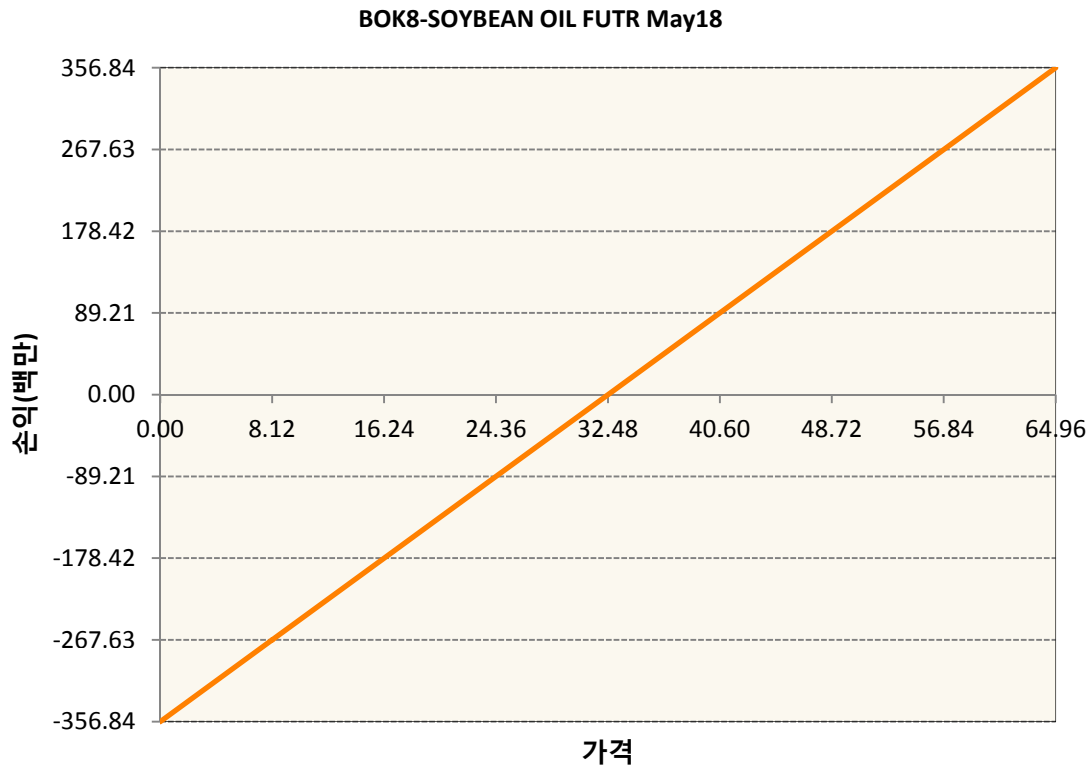
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

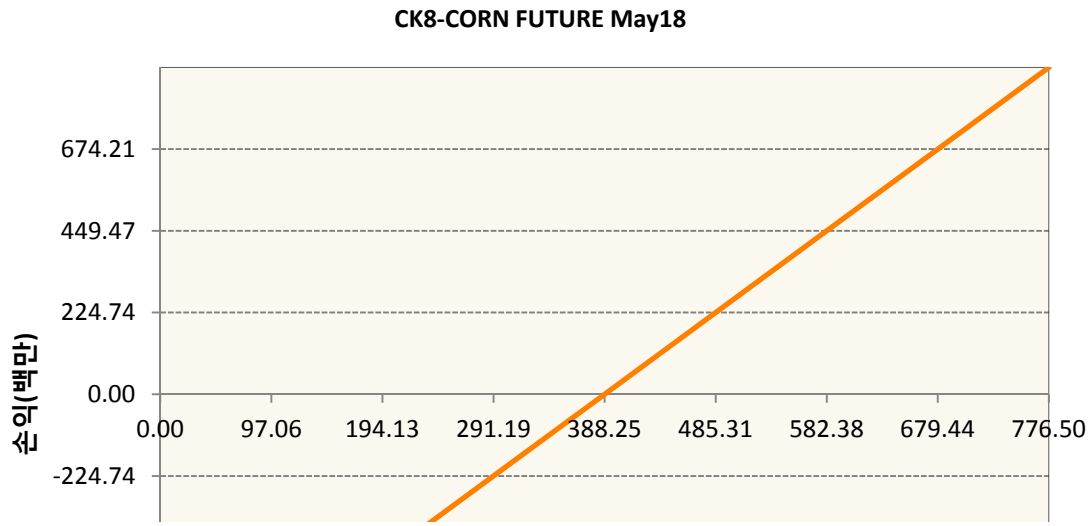
1. 계약금액

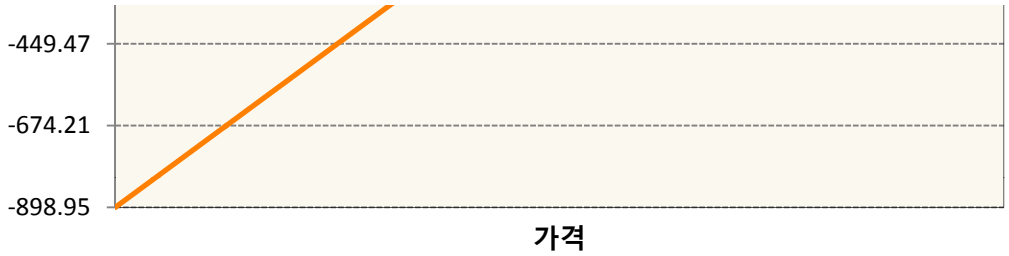
(단위:백만원)

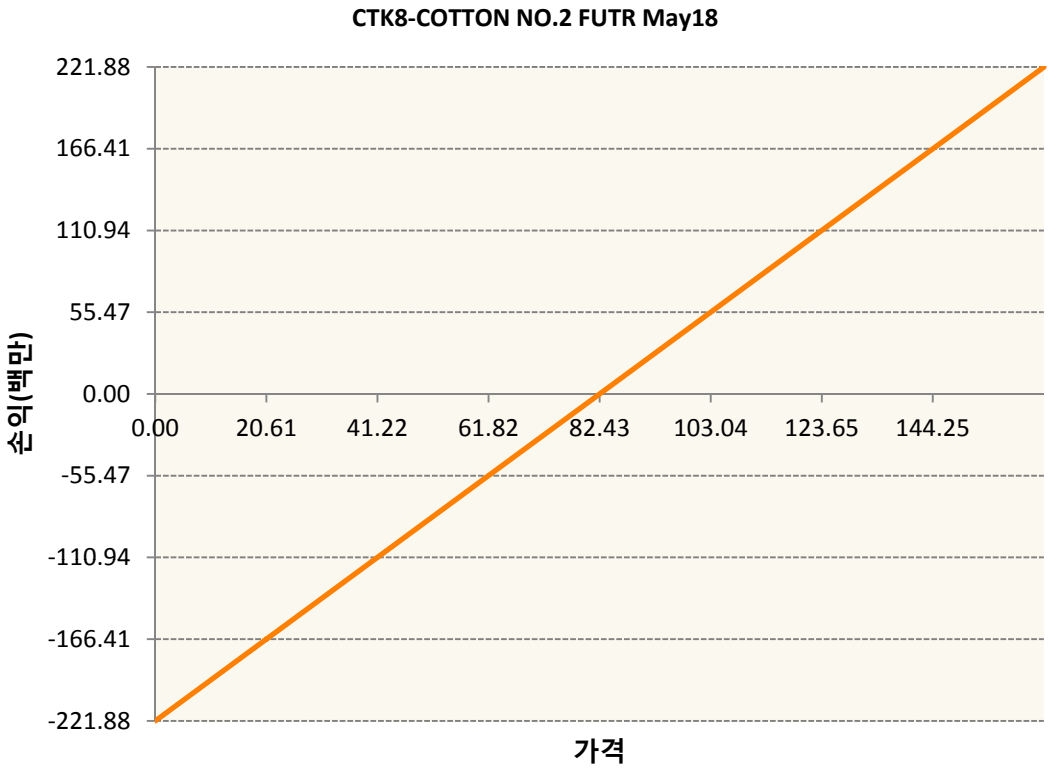
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	4,275	321	3,954	

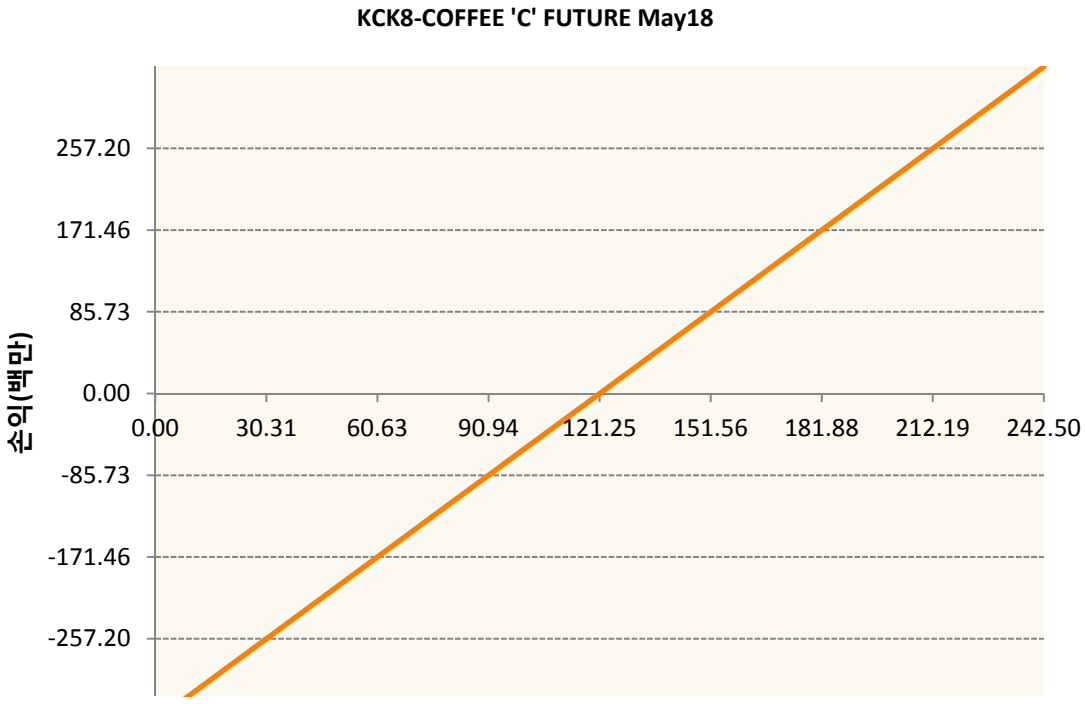
2. 만기시점의 손익구조

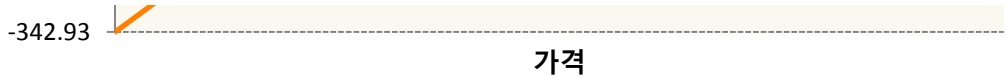


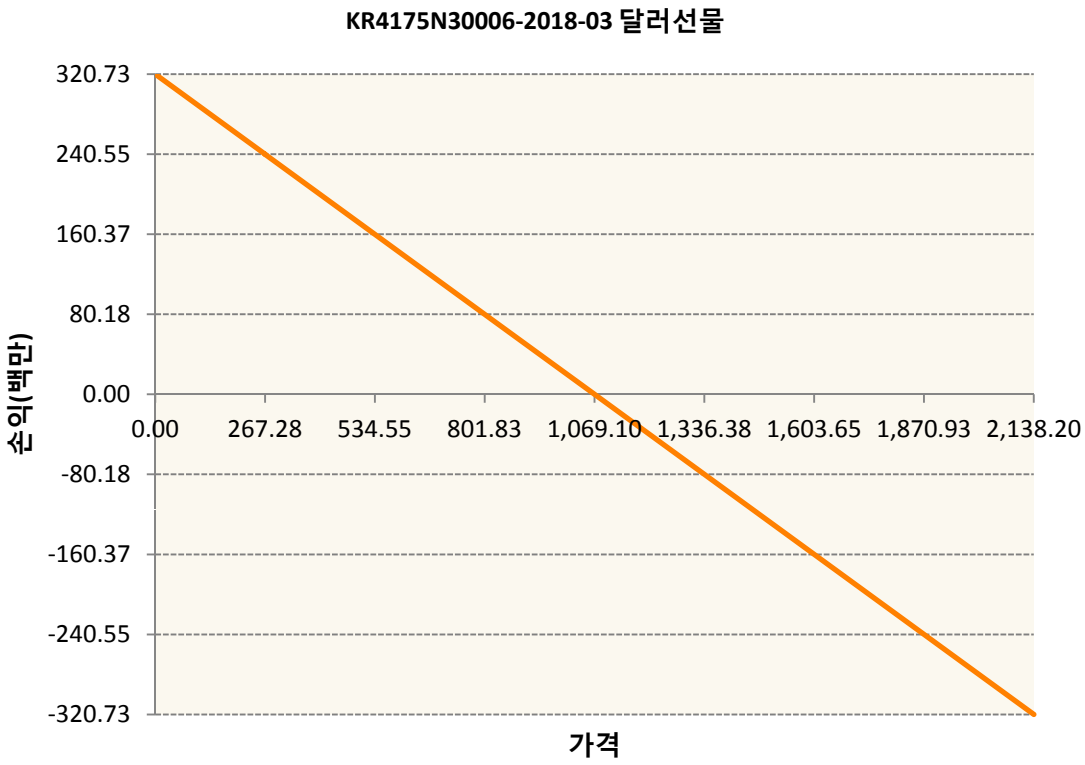


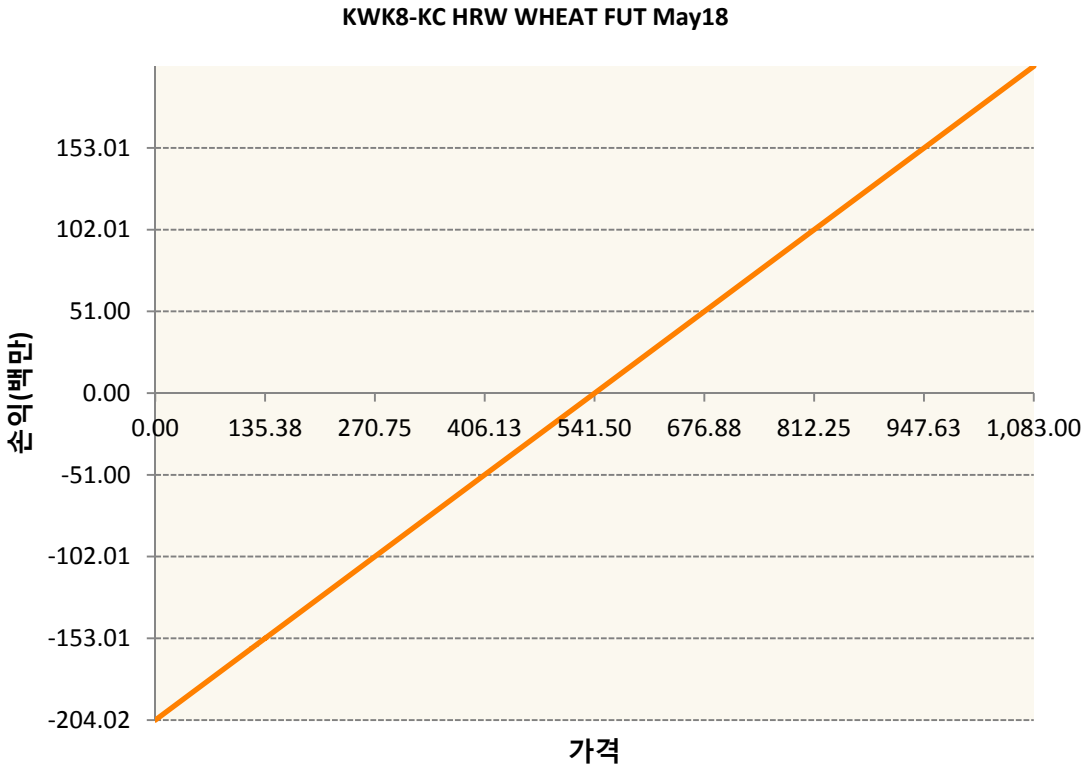

-449.47
-674.21
-898.95
가격

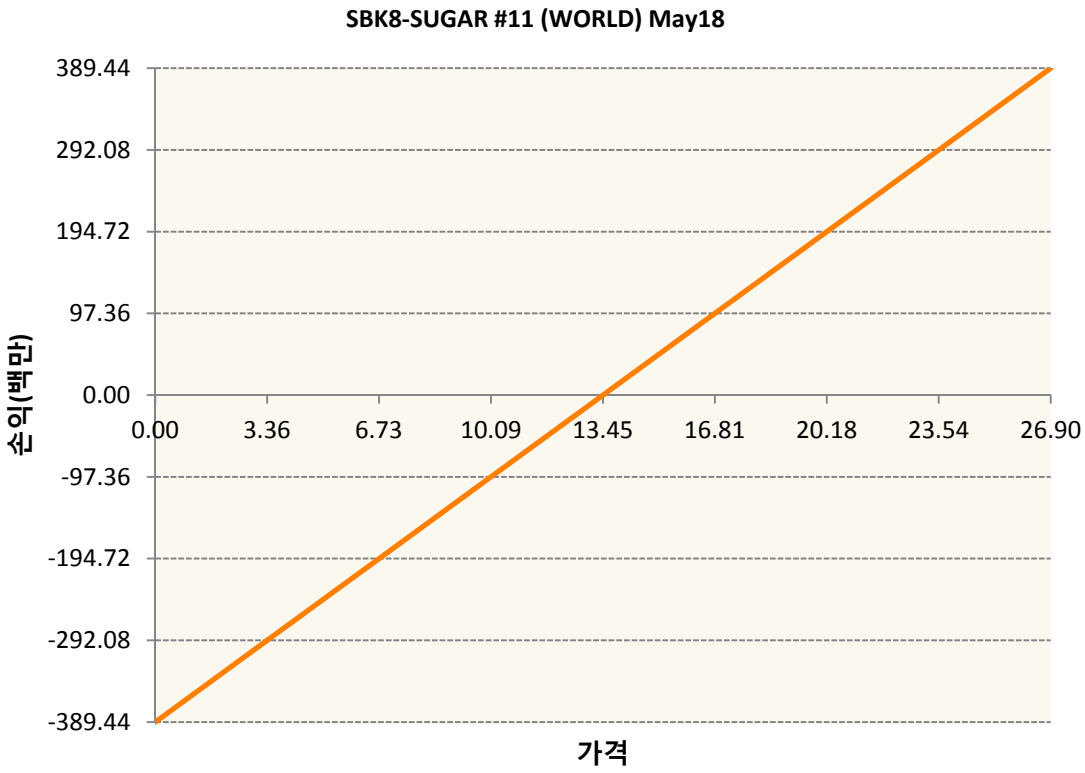

CTK8-COTTON NO.2 FUTR May18
221.88
166.41
110.94
55.47
0.00
-55.47
-110.94
-166.41
-221.88
0.00
20.61
41.22
61.82
82.43
103.04
123.65
144.25
손익(백만)
가격

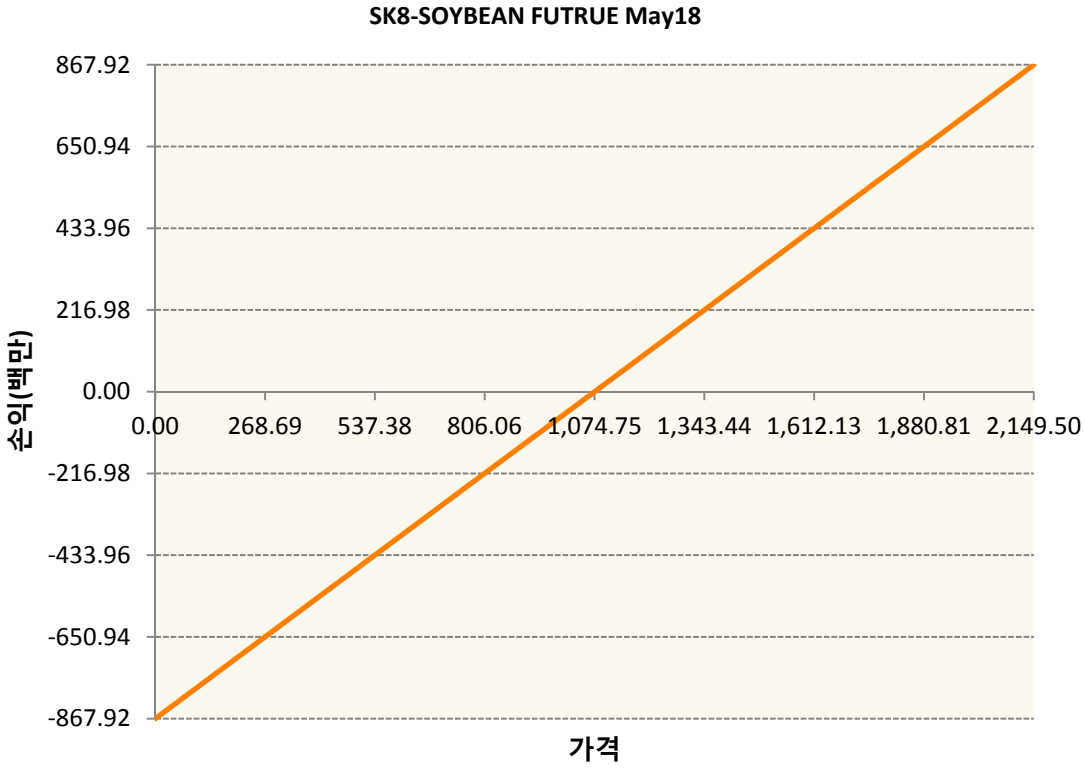

KCK8-COFFEE 'C' FUTURE May18
257.20
171.46
85.73
0.00
-85.73
-171.46
-257.20
0.00
30.31
60.63
90.94
121.25
151.56
181.88
212.19
242.50
손익(백만)


-342.93
가격

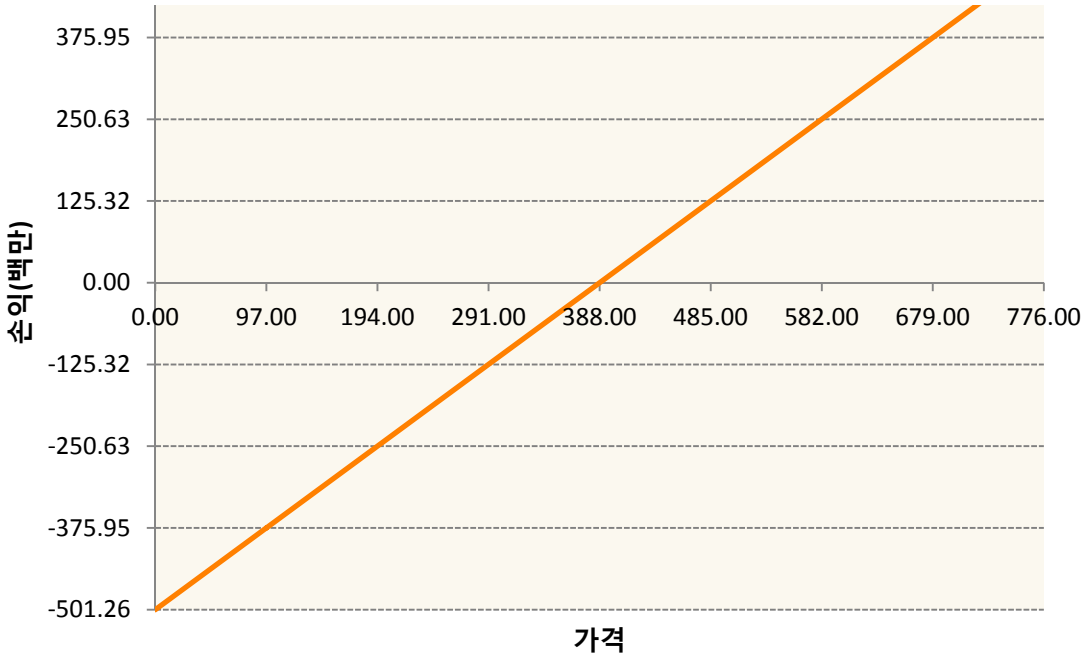

KR4175N30006-2018-03 달러선물
320.73
240.55
160.37
80.18
0.00
-80.18
-160.37
-240.55
-320.73
0.00
267.28
534.55
801.83
1,069.10
1,336.38
1,603.65
1,870.93
2,138.20
손익(백만)
가격

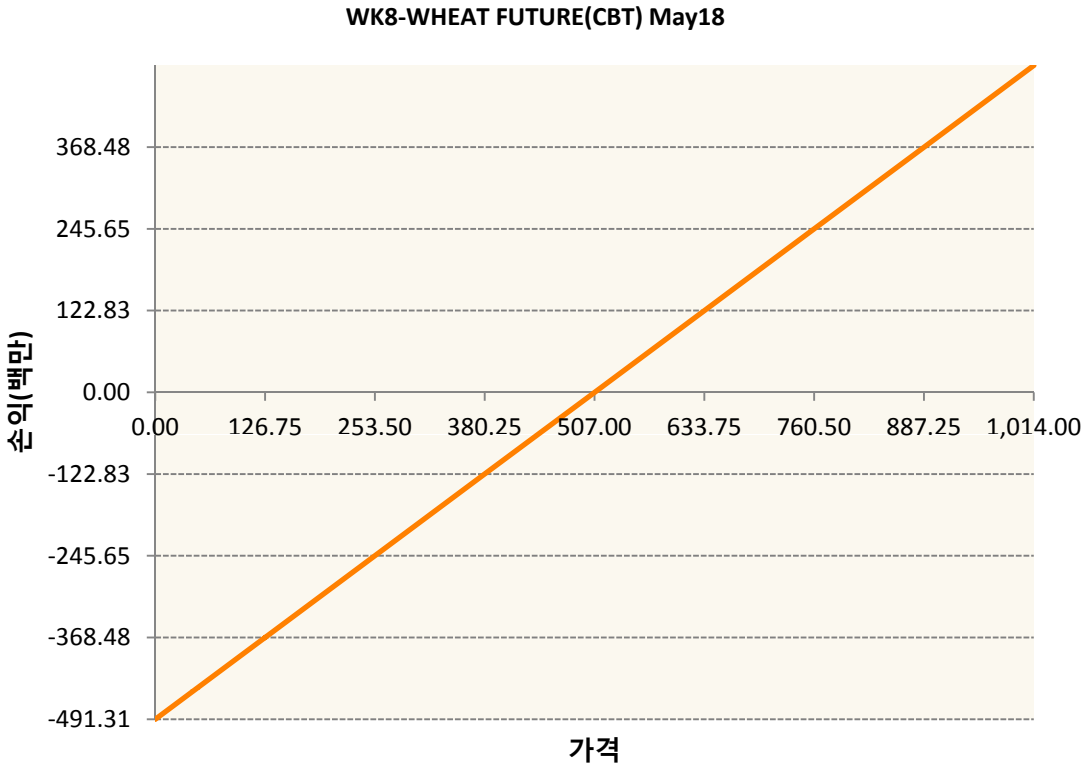

KWK8-KC HRW WHEAT FUT May18
153.01
102.01
51.00
0.00
-51.00
-102.01
-153.01
-204.02
0.00
135.38
270.75
406.13
541.50
676.88
812.25
947.63
1,083.00
손익(백만)
가격


SBK8-SUGAR #11 (WORLD) May18
389.44
292.08
194.72
97.36
0.00
-97.36
-194.72
-292.08
-389.44
0.00
3.36
6.73
10.09
13.45
16.81
20.18
23.54
26.90
손익(백만)
가격


SK8-SOYBEAN FUTRUE May18
867.92
650.94
433.96
216.98
0.00
-216.98
-433.96
-650.94
-867.92
0.00
268.69
537.38
806.06
1,074.75
1,343.44
1,612.13
1,880.81
2,149.50
손익(백만)
가격


SMK8-SOYBEAN MEAL FUTR May18





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

BOK8	SOYBEAN OIL FUTR May18	29
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	69
SMK8	SOYBEAN MEAL FUTR May18	40
WK8	WHEAT FUTURE(CBT) May18	39

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

345