| 공시일 | 2018-04-03 |
|---|---|
| 기준일 | 2018-04-02 |

# 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 | 2018-04-03 |
| 기준일 | 2018-04-02 |

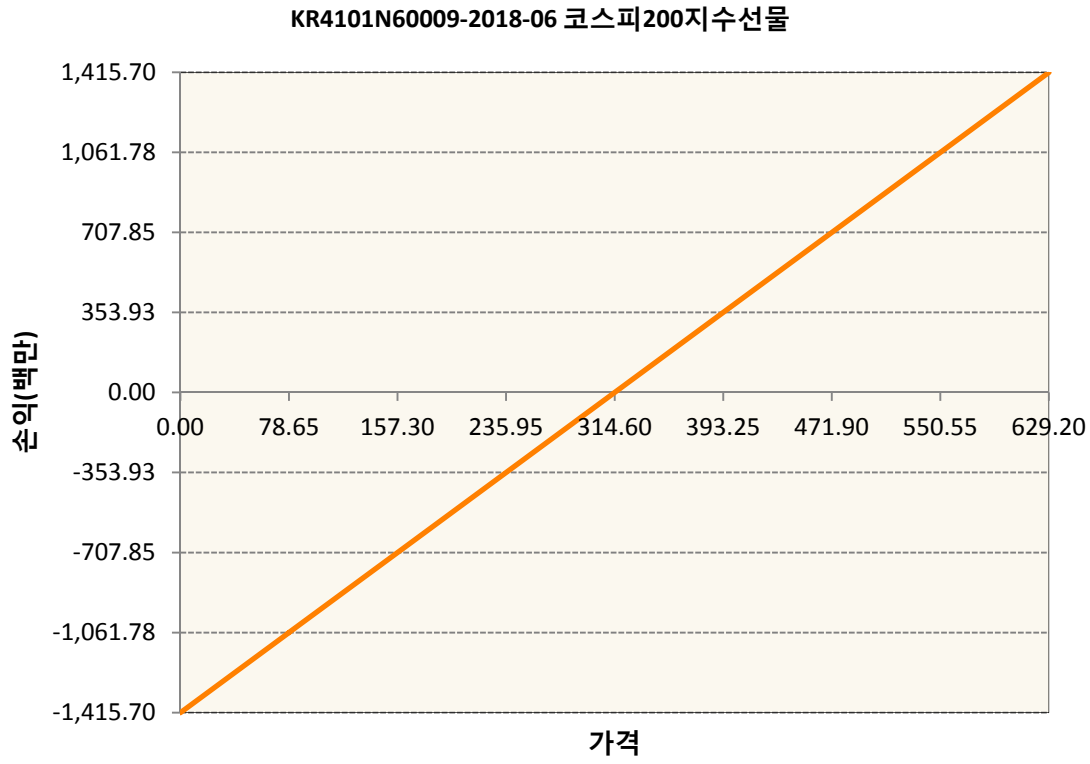
# 스마트인덱스모

## 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 | 1,416 | 0 | 1,416 | 장내 |

## 2. 만기시점의 손익구조




## 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| KR4101N60( 2018-06 코스피200지수선물 | | | | | | | 113 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 기초자산의 변동성 | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | -113 | -113 | -113 | -113 | -113 | -113 | -113 |
| -5.33% | -75 | -75 | -75 | -75 | -75 | -75 | -75 |
| -2.67% | -38 | -38 | -38 | -38 | -38 | -38 | -38 |
| 0% | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 2.67% | 38 | 38 | 38 | 38 | 38 | 38 | 38 |
| 5.33% | 75 | 75 | 75 | 75 | 75 | 75 | 75 |
| 8.00% | 113 | 113 | 113 | 113 | 113 | 113 | 113 |

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

| 81 |
|---|

| 공시일 | 2018-04-03 |
|---|---|
| 기준일 | 2018-04-02 |

# 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 | 1,087 |
|---|---|

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

| **428** |
|---|

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

| 공시일 | 2018-04-03 |
|---|---|
| 기준일 | 2018-04-02 |

# 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 | 5,081 | 0 | 5,081 | 장외 |

## 2. 만기시점의 손익구조

## 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| | |
|---|---|
| SWCSI50000 신한CSI500미래S180308 | 412 |

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

| |
|---|
| **444** |

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

| | |
|---|---|
| 공시일 | 2018-04-03 |
| 기준일 | 2018-04-02 |

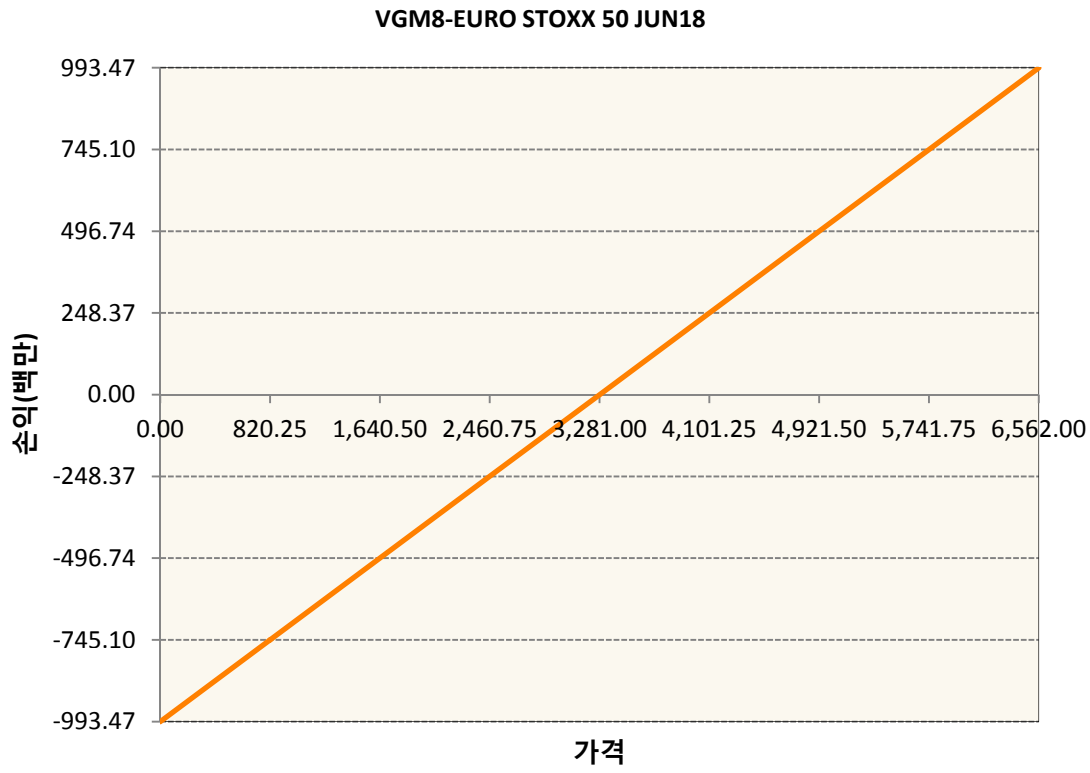
# 유로인덱스모(주식-파생형)

## 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 993 | 0 | 993 | |

## 2. 만기시점의 손익구조




## 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| | | |
|---|---|---|
| VGM8 | EURO STOXX 50 JUN18 | 79 |

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

(단위:백만원)

**48**

| | |
|---|---|
| 공시일 | 2018-04-03 |
| 기준일 | 2018-04-02 |

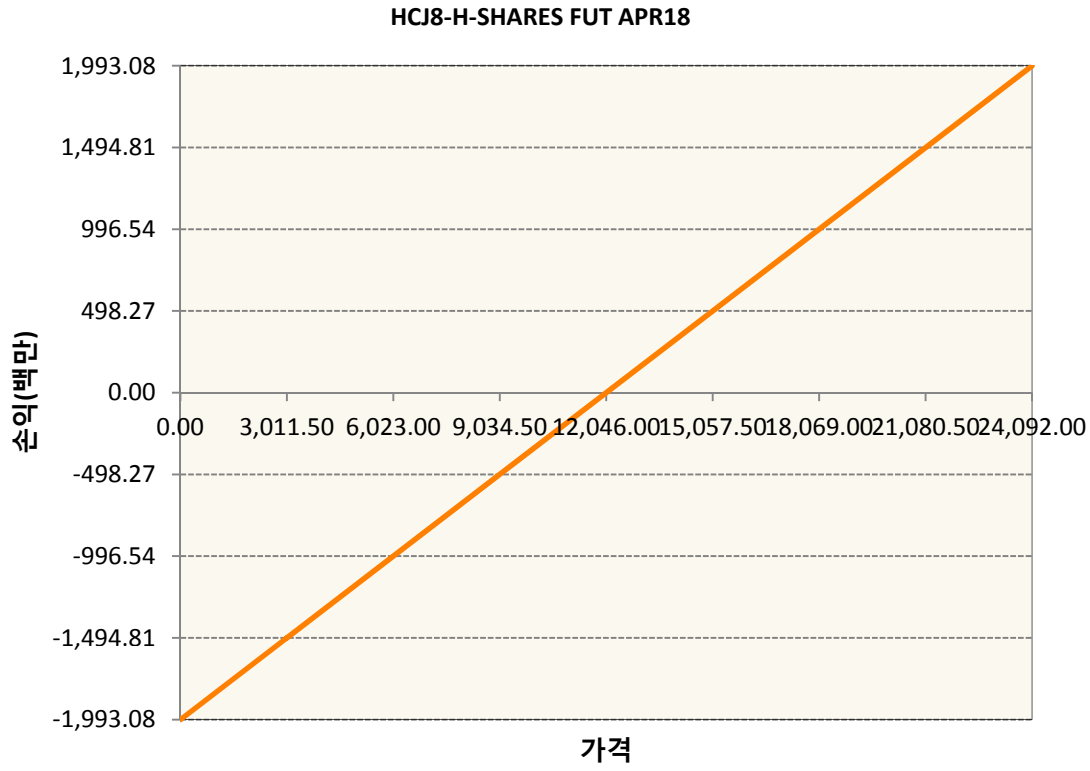
# 차이나인덱스모(주식-파생형)

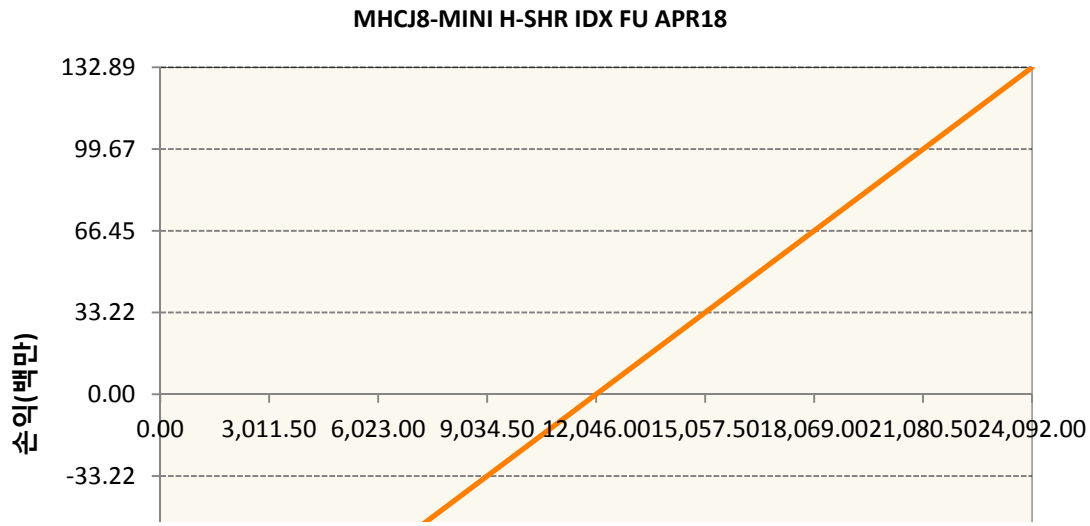
## 1. 계약금액

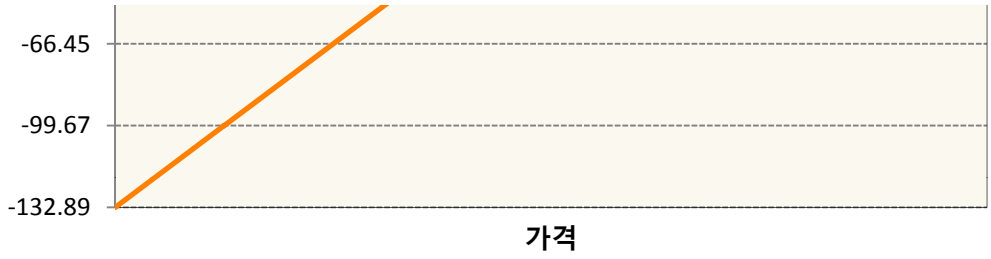
(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 2,126 | 0 | 2,126 | 장내 |

## 2. 만기시점의 손익구조






| 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) | | (단위:백만원) |
|---|---|---|
| HCJ8 | H-SHARES FUT APR18 | 159 |
| MHCJ8 | MINI H-SHR IDX FU APR18 | 11 |

| 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) | (단위:백만원) |
|---|---|
| | **148** |

| | |
|---|---|
| 공시일 | 2018-04-03 |
| 기준일 | 2018-04-02 |

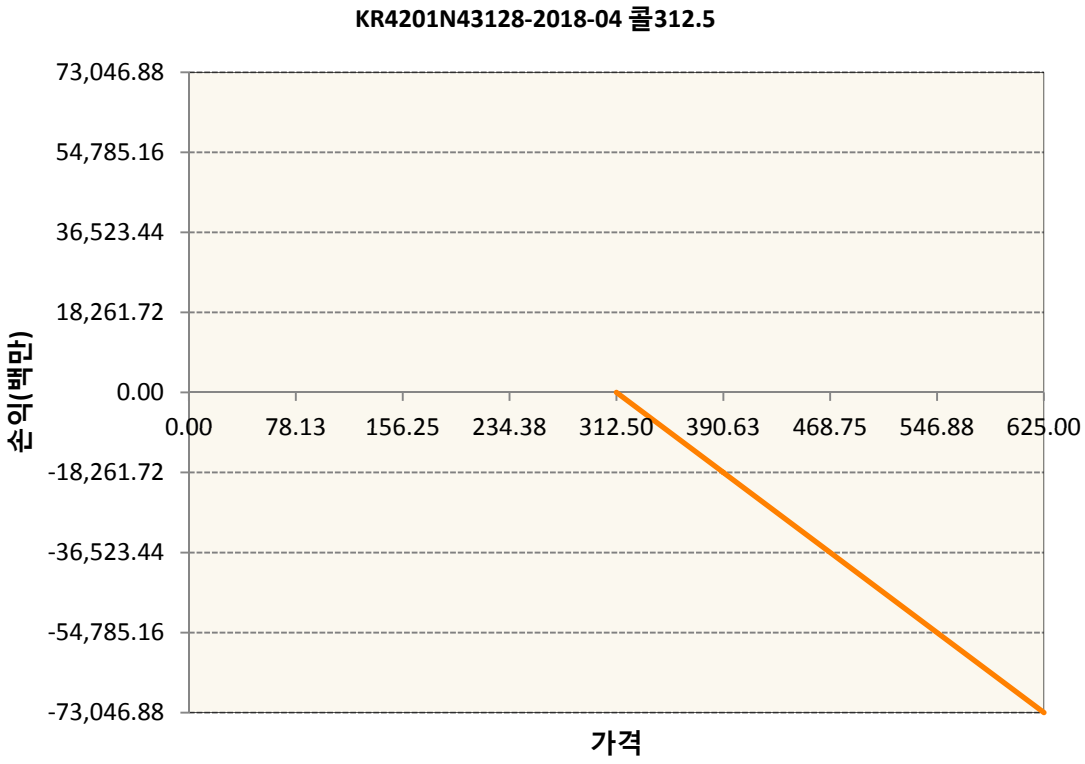
# 커버드콜모(주식혼합-파생형)

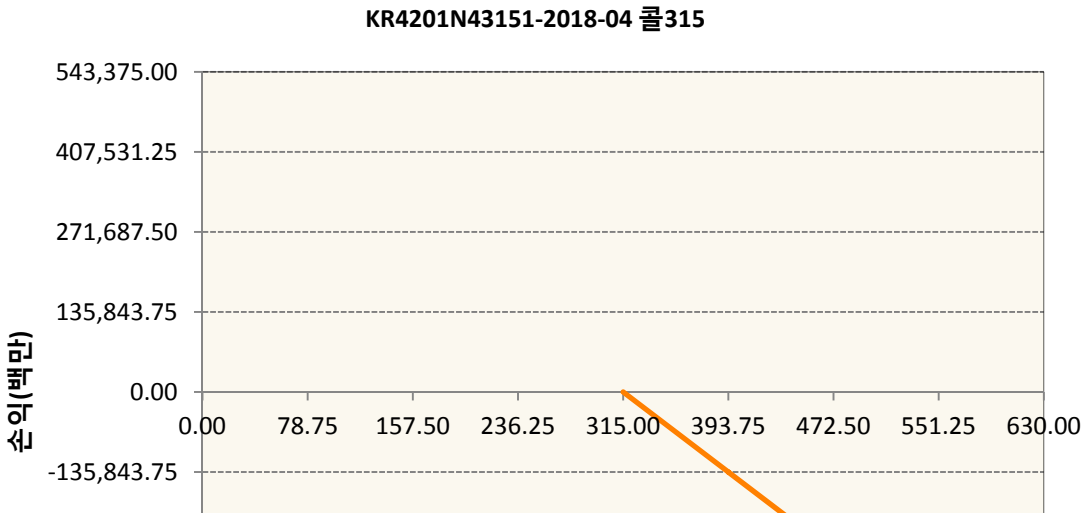
## 1. 계약금액

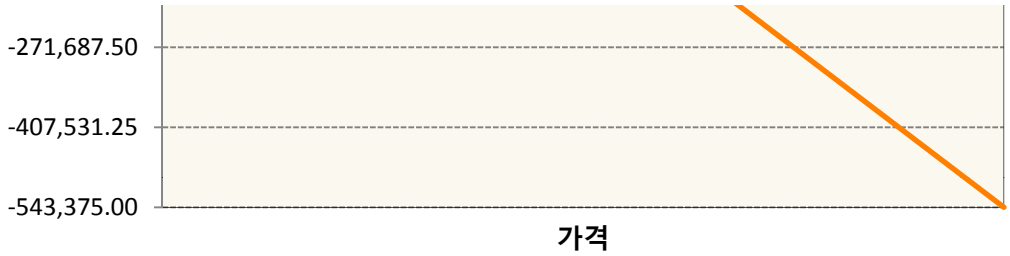
(단위:백만원)

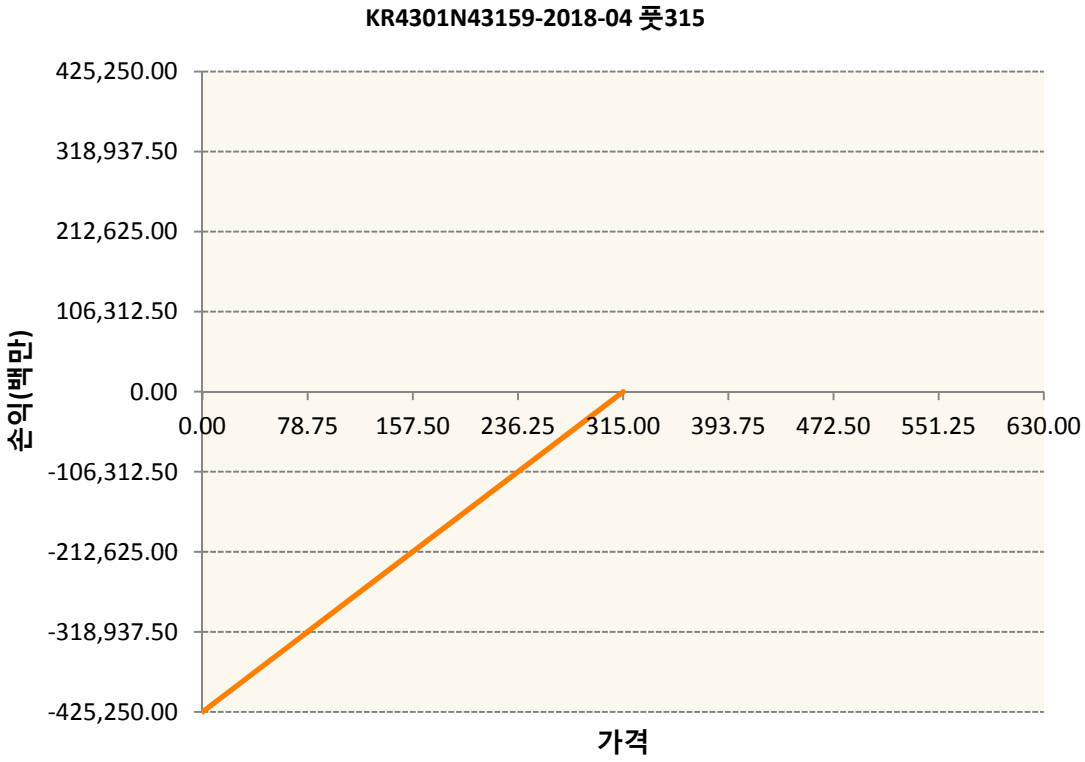
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 유가증권 | 옵션 | 3,888 | 0 | 3,888 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션 | 0 | 1,041,672 | -1,041,672 | 장내 |

## 2. 만기시점의 손익구조






**3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)** (단위:백만원)

| KR4201N4312018-04 콜312.5 | | | | | | | 4,818 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 기초자산의 변동성 | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | 1,576 | 1,563 | 1,543 | 1,517 | 1,484 | 1,445 | 1,399 |
| -5.33% | 1,492 | 1,444 | 1,387 | 1,324 | 1,255 | 1,181 | 1,102 |
| -2.67% | 1,160 | 1,063 | 962 | 860 | 755 | 649 | 541 |
| 0% | 349 | 233 | 116 | 0 | -116 | -233 | -350 |
| 2.67% | -1,009 | -1,094 | -1,184 | -1,279 | -1,376 | -1,477 | -1,579 |
| 5.33% | -2,746 | -2,785 | -2,834 | -2,890 | -2,953 | -3,022 | -3,096 |
| 8.00% | -4,646 | -4,659 | -4,677 | -4,702 | -4,734 | -4,773 | -4,818 |
| KR4201N4312018-04 콜315 | | | | | | | 33,835 |
| | 기초자산의 변동성 | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | 9,531 | 9,468 | 9,367 | 9,224 | 9,037 | 8,805 | 8,530 |

| | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| -5.33% | 9,146 | 8,881 | 8,554 | 8,171 | 7,739 | 7,264 | 6,751 |
| -2.67% | 7,405 | 6,780 | 6,118 | 5,428 | 4,714 | 3,982 | 3,235 |
| 0% | 2,594 | 1,730 | 865 | 0 | -865 | -1,731 | -2,596 |
| 2.67% | -6,282 | -7,011 | -7,765 | -8,539 | -9,328 | -10,129 | -10,940 |
| 5.33% | -18,419 | -18,809 | -19,263 | -19,770 | -20,323 | -20,914 | -21,539 |
| 8.00% | -32,194 | -32,332 | -32,525 | -32,775 | -33,079 | -33,434 | -33,835 |
| KR4301N4312018-04 풋315 | | | | | | | 29,288 |
| | 기초자산의 변동성 | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | -29,211 | -29,212 | -29,215 | -29,222 | -29,235 | -29,257 | -29,288 |
| -5.33% | -17,934 | -17,963 | -18,010 | -18,078 | -18,168 | -18,281 | -18,415 |
| -2.67% | -7,083 | -7,293 | -7,532 | -7,797 | -8,083 | -8,387 | -8,706 |
| 0% | 1,321 | 881 | 441 | 0 | -441 | -883 | -1,325 |
| 2.67% | 5,137 | 4,846 | 4,532 | 4,198 | 3,849 | 3,487 | 3,115 |
| 5.33% | 5,935 | 5,869 | 5,775 | 5,653 | 5,503 | 5,328 | 5,129 |
| 8.00% | 6,004 | 5,998 | 5,986 | 5,963 | 5,926 | 5,874 | 5,805 |

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

| |
|---|
| **73,912** |

| 공시일 | 2018-04-03 |
|---|---|
| 기준일 | 2018-04-02 |

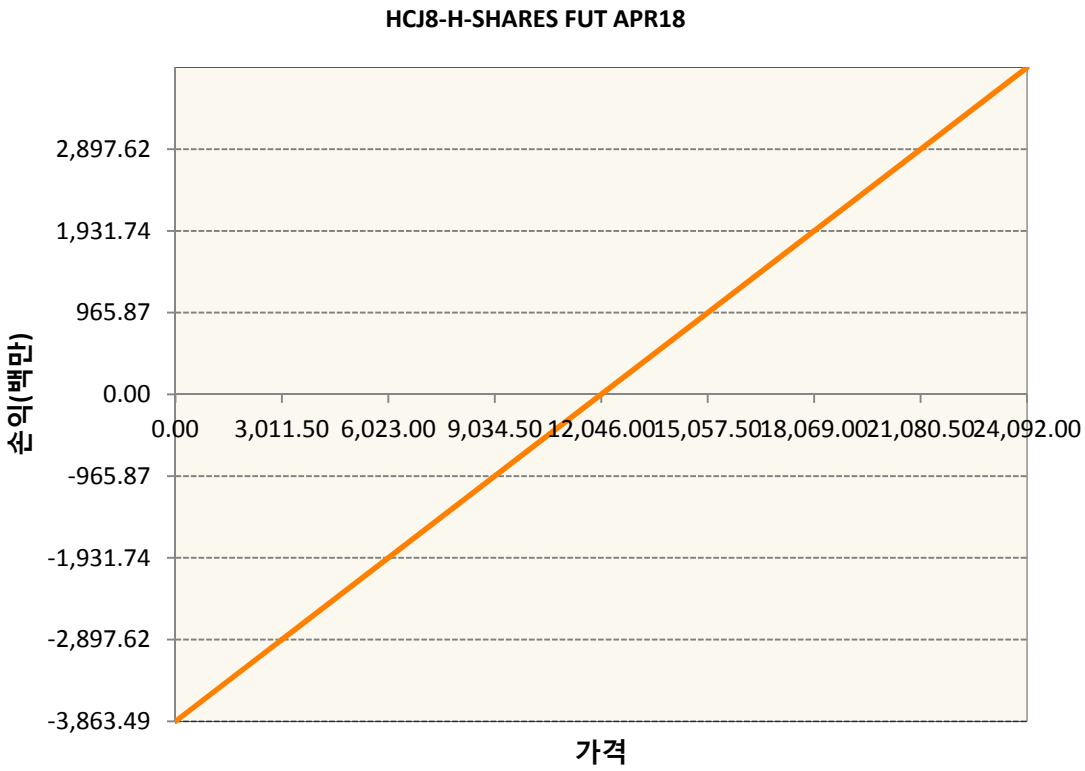
# 홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생

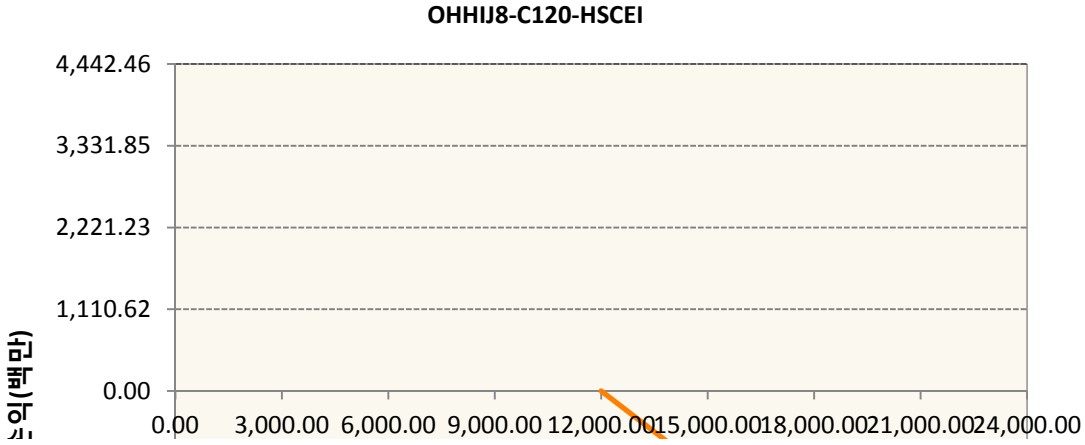
## 1. 계약금액

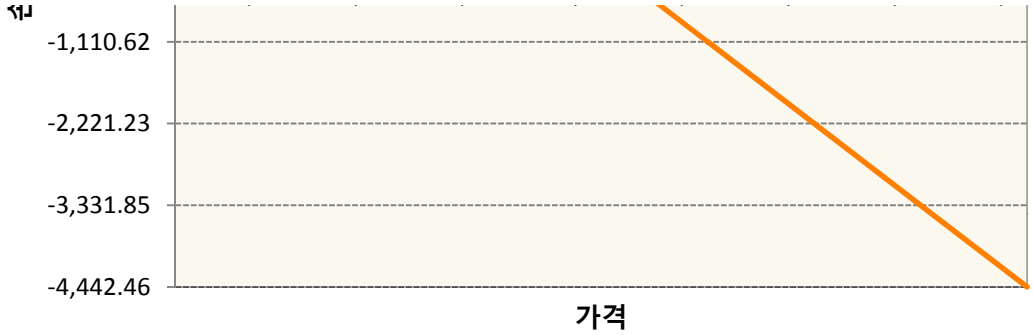
(단위:백만원)

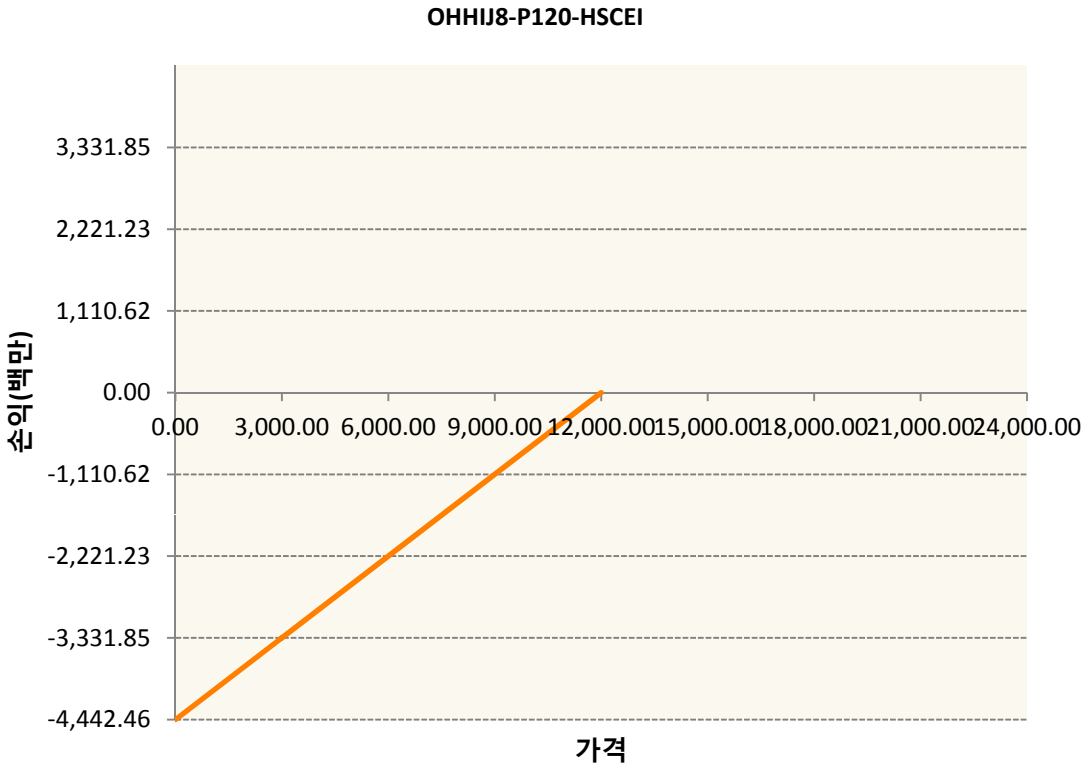
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 신규 | 유가증권 | 옵션 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 3,863 | 0 | 3,863 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션 | 0 | 8,885 | -8,885 | 장내 |

## 2. 만기시점의 손익구조






| 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) | | (단위:백만원) |
|---|---|---|
| HCJ8 | H-SHARES FUT APR18 | 309 |
| OHHIJ8-C12 | HSCEI | 355 |
| OHHIJ8-P12 | HSCEI | 355 |

| 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) | (단위:백만원) |
|---|---|
| | **889** |

| | |
|---|---|
| 공시일 | 2018-04-03 |
| 기준일 | 2018-04-02 |

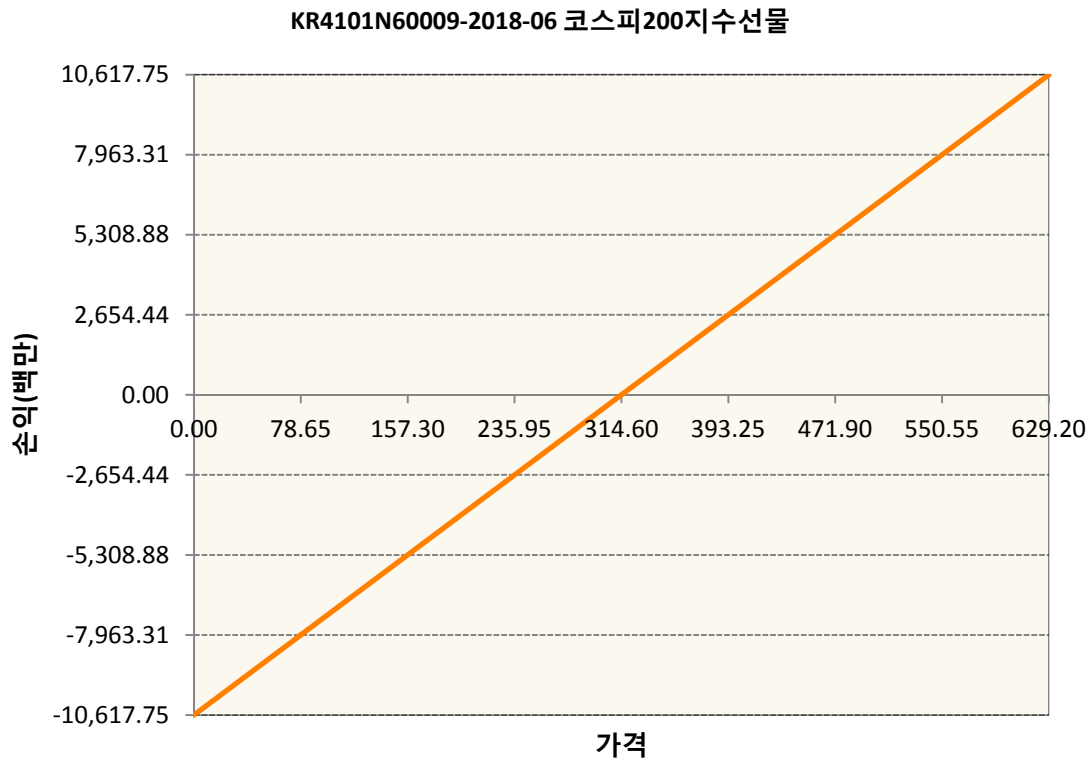
# 코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼

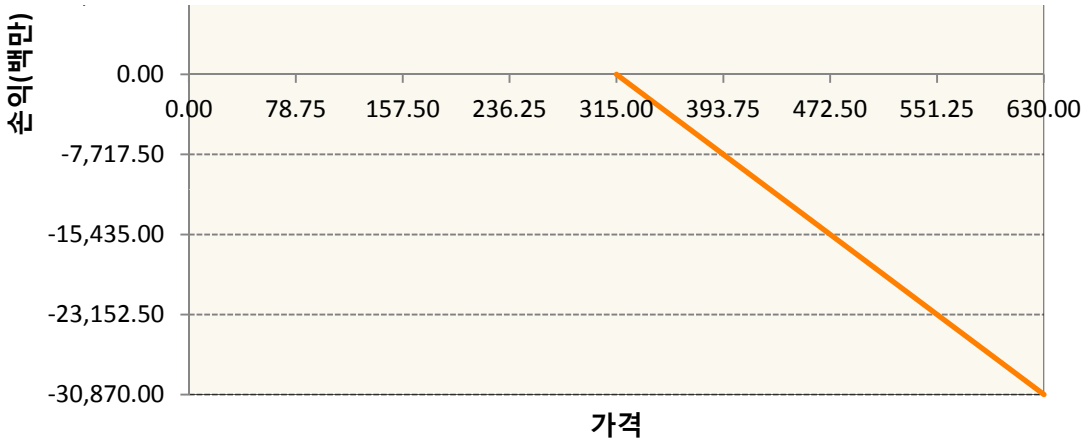
## 1. 계약금액

(단위:백만원)

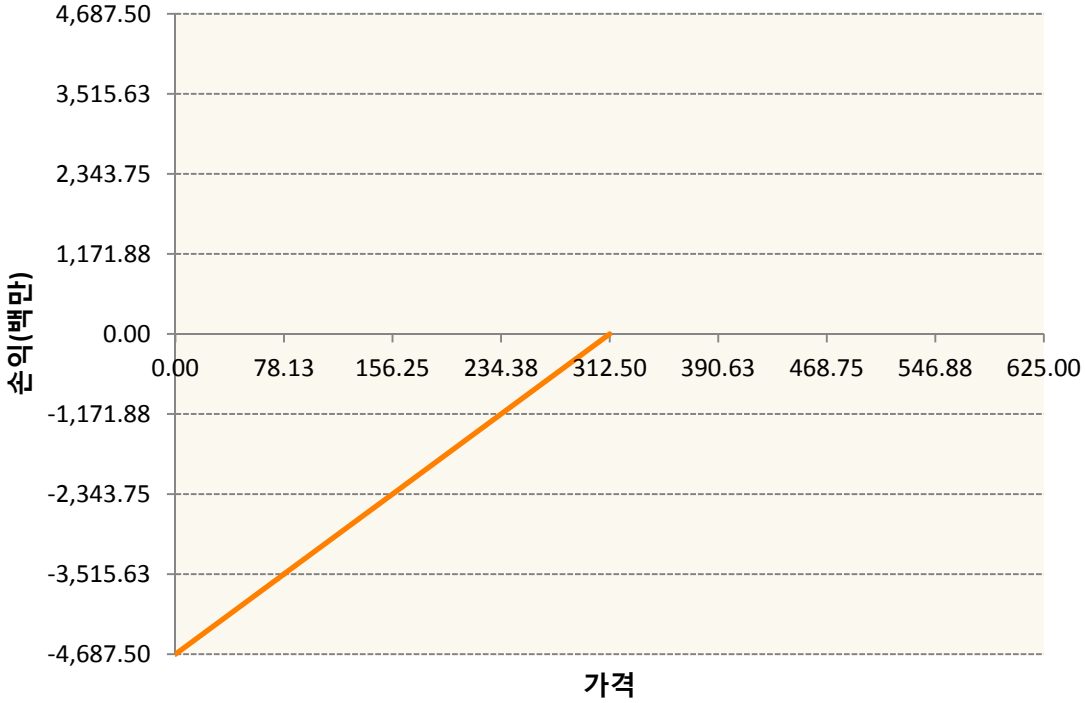
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 신규 | 유가증권 | 스왑 | 0 | 0 | 0 | 장외 |
| 신규 | 유가증권 | 옵션 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 10,618 | 0 | 10,618 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 스왑 | 54,200 | 0 | 54,200 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션 | 0 | 55,718 | -55,718 | 장내 |

## 2. 만기시점의 손익구조

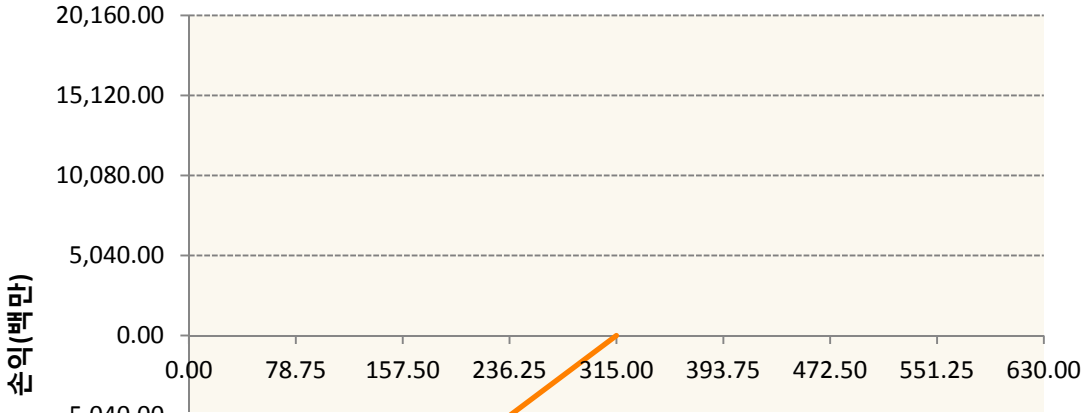





KR4301N43126-2018-04 풋312.5




KR4301N43159-2018-04 풋315



**3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)** (단위:백만원)

| 2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_2 | | | | | | | 1,443 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 기초자산의 변동성 | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | -1,443 | -1,443 | -1,443 | -1,443 | -1,443 | -1,443 | -1,443 |
| -5.33% | -962 | -962 | -962 | -962 | -962 | -962 | -962 |
| -2.67% | -481 | -481 | -481 | -481 | -481 | -481 | -481 |
| 0% | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 2.67% | 481 | 481 | 481 | 481 | 481 | 481 | 481 |
| 5.33% | 962 | 962 | 962 | 962 | 962 | 962 | 962 |
| 8.00% | 1,443 | 1,443 | 1,443 | 1,443 | 1,443 | 1,443 | 1,443 |
| 2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_3 | | | | | | | 273 |
| | 기초자산의 변동성 | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | -273 | -273 | -273 | -273 | -273 | -273 | -273 |
| -5.33% | -182 | -182 | -182 | -182 | -182 | -182 | -182 |
| -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% | 182 | 182 | 182 | 182 | 182 | 182 | 182 |
| 8.00% | 273 | 273 | 273 | 273 | 273 | 273 | 273 |
| 2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_5 | | | | | | | 234 |
| | 기초자산의 변동성 | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | -234 | -234 | -234 | -234 | -234 | -234 | -234 |
| -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% | 234 | 234 | 234 | 234 | 234 | 234 | 234 |
| 2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_6 | | | | | | | 195 |
| | 기초자산의 변동성 | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |

| | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| -8.00% | -195 | -195 | -195 | -195 | -195 | -195 | -195 |
| -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% | 195 | 195 | 195 | 195 | 195 | 195 | 195 |
| | 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% | -166 | -166 | -166 | -166 | -166 | -166 | -166 |
| -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% | 166 | 166 | 166 | 166 | 166 | 166 | 166 |
| 8.00% | 250 | 250 | 250 | 250 | 250 | 250 | 250 |
| | 2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_8 | | | | | | 462 |
| | 기초자산의 변동성 | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | -462 | -462 | -462 | -462 | -462 | -462 | -462 |
| -5.33% | -308 | -308 | -308 | -308 | -308 | -308 | -308 |
| -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% | 308 | 308 | 308 | 308 | 308 | 308 | 308 |
| 8.00% | 462 | 462 | 462 | 462 | 462 | 462 | 462 |
| | 2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_10 | | | | | | 273 |
| | 기초자산의 변동성 | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | -273 | -273 | -273 | -273 | -273 | -273 | -273 |
| -5.33% | -182 | -182 | -182 | -182 | -182 | -182 | -182 |
| -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% | 182 | 182 | 182 | 182 | 182 | 182 | 182 |
| 8.00% | 273 | 273 | 273 | 273 | 273 | 273 | 273 |
| | 2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_11 | | | | | | 624 |
| | 기초자산의 변동성 | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | -624 | -624 | -624 | -624 | -624 | -624 | -624 |
| -5.33% | -416 | -416 | -416 | -416 | -416 | -416 | -416 |
| -2.67% | -208 | -208 | -208 | -208 | -208 | -208 | -208 |
| 0% | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |

| | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 2.67% | 208 | 208 | 208 | 208 | 208 | 208 | 208 |
| 5.33% | 416 | 416 | 416 | 416 | 416 | 416 | 416 |
| 8.00% | 624 | 624 | 624 | 624 | 624 | 624 | 624 |
| | 2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_12 | | | | | | 468 |
| | 기초자산의 변동성 | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | -468 | -468 | -468 | -468 | -468 | -468 | -468 |
| -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% | 468 | 468 | 468 | 468 | 468 | 468 | 468 |
| | KR4101N60( 2018-06 코스피200지수선물 | | | | | | 848 |
| | 기초자산의 변동성 | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | -848 | -848 | -848 | -848 | -848 | -848 | -848 |
| -5.33% | -565 | -565 | -565 | -565 | -565 | -565 | -565 |
| -2.67% | -283 | -283 | -283 | -283 | -283 | -283 | -283 |
| 0% | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 2.67% | 283 | 283 | 283 | 283 | 283 | 283 | 283 |
| 5.33% | 565 | 565 | 565 | 565 | 565 | 565 | 565 |
| 8.00% | 848 | 848 | 848 | 848 | 848 | 848 | 848 |
| | KR4201N431 2018-04 콜315 | | | | | | 1,922 |
| | 기초자산의 변동성 | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | 541 | 538 | 532 | 524 | 513 | 500 | 485 |
| -5.33% | 520 | 505 | 486 | 464 | 440 | 413 | 384 |
| -2.67% | 421 | 385 | 348 | 308 | 268 | 226 | 184 |
| 0% | 147 | 98 | 49 | 0 | -49 | -98 | -147 |
| 2.67% | -357 | -398 | -441 | -485 | -530 | -575 | -622 |
| 5.33% | -1,046 | -1,069 | -1,094 | -1,123 | -1,155 | -1,188 | -1,224 |
| 8.00% | -1,829 | -1,837 | -1,848 | -1,862 | -1,879 | -1,899 | -1,922 |
| | KR4301N431 2018-04 풋312.5 | | | | | | 307 |
| | 기초자산의 변동성 | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | -306 | -306 | -306 | -306 | -306 | -307 | -307 |
| -5.33% | -181 | -181 | -182 | -184 | -185 | -187 | -189 |
| -2.67% | -65 | -68 | -71 | -75 | -79 | -83 | -87 |
| 0% | 14 | 10 | 5 | 0 | -5 | -10 | -15 |
| 2.67% | 43 | 41 | 38 | 36 | 32 | 29 | 25 |
| 5.33% | 48 | 48 | 47 | 46 | 45 | 44 | 42 |
| 8.00% | 48 | 48 | 48 | 48 | 48 | 47 | 47 |
| | KR4301N431 2018-04 풋315 | | | | | | 1,388 |

| | 기초자산의 변동성 | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | -1,385 | -1,385 | -1,385 | -1,385 | -1,386 | -1,387 | -1,388 |
| -5.33% | -850 | -852 | -854 | -857 | -861 | -867 | -873 |
| -2.67% | -336 | -346 | -357 | -370 | -383 | -398 | -413 |
| 0% | 63 | 42 | 21 | 0 | -21 | -42 | -63 |
| 2.67% | 244 | 230 | 215 | 199 | 182 | 165 | 148 |
| 5.33% | 281 | 278 | 274 | 268 | 261 | 253 | 243 |
| 8.00% | 285 | 284 | 284 | 283 | 281 | 278 | 275 |

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

| |
|---|
| **8,768** |

| 공시일 | 2018-04-03 |
|---|---|
| 기준일 | 2018-04-02 |

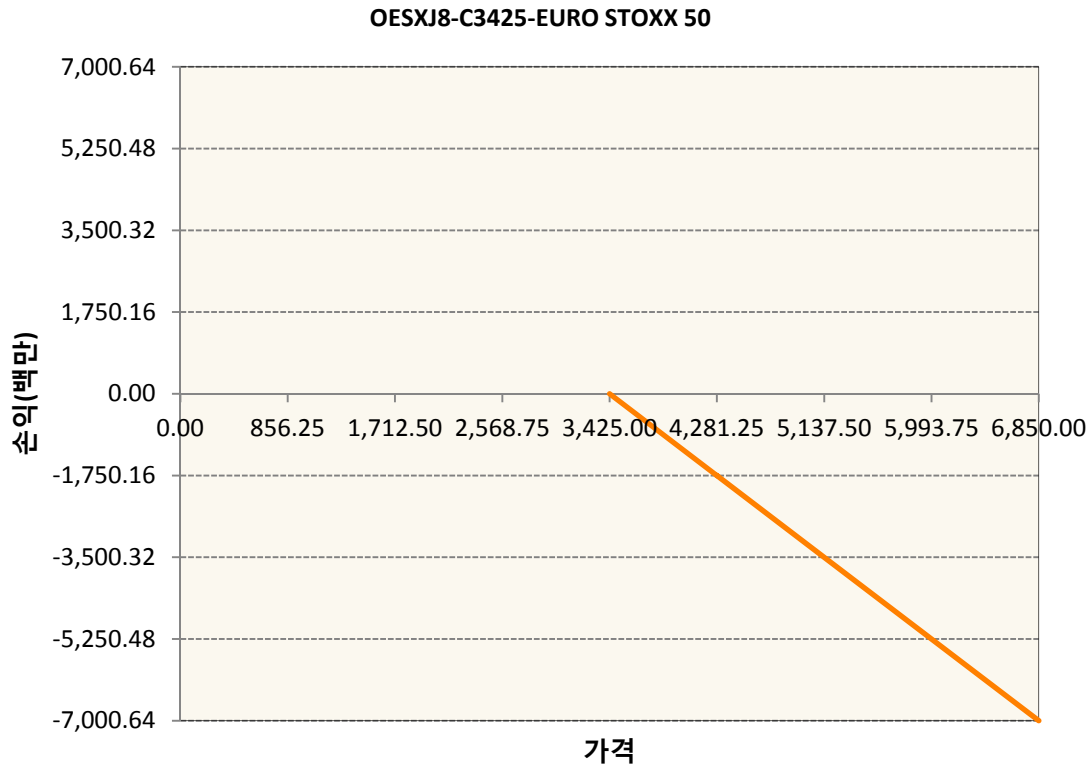
# 유로커버드콜모(주식혼합-파생형

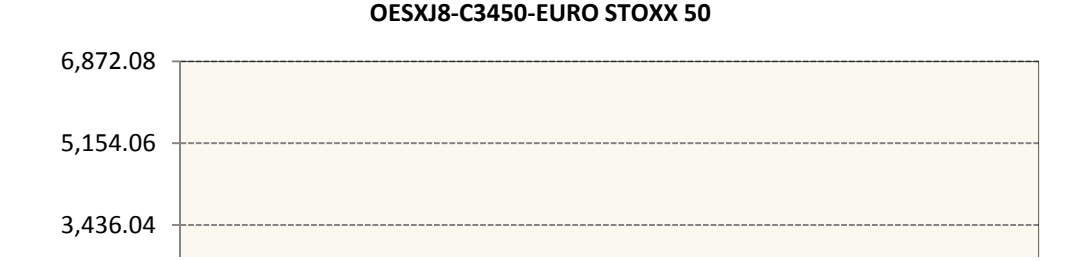
## 1. 계약금액

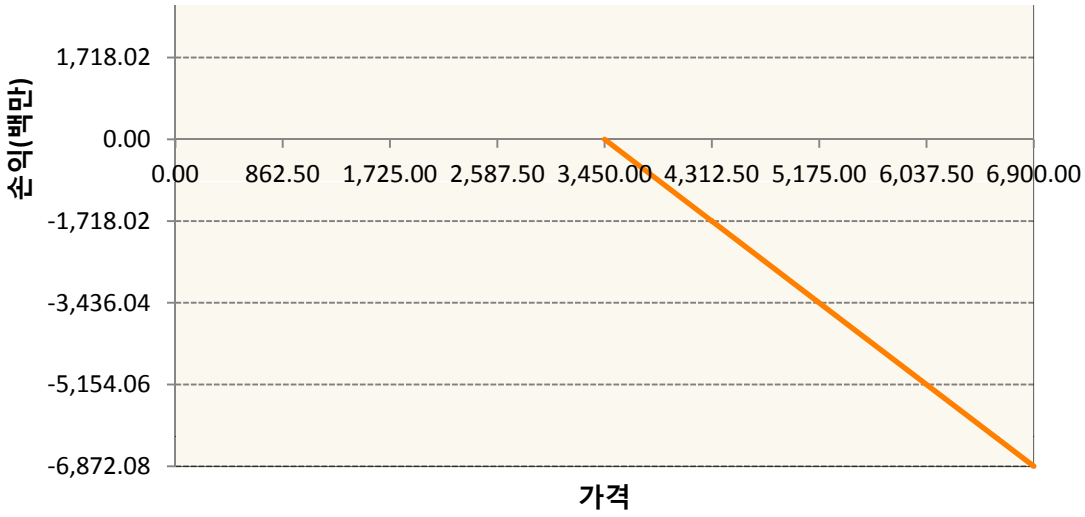
(단위:백만원)

| 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 | 5,437 | 0 | 5,437 | |
| 누계 | 유가증권 | 스왑 | 97,642 | 0 | 97,642 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션 | 0 | 27,745 | -27,745 | 장내 |
| 누계 | 지수 | 스왑 | 52,076 | 0 | 52,076 | 장외 |

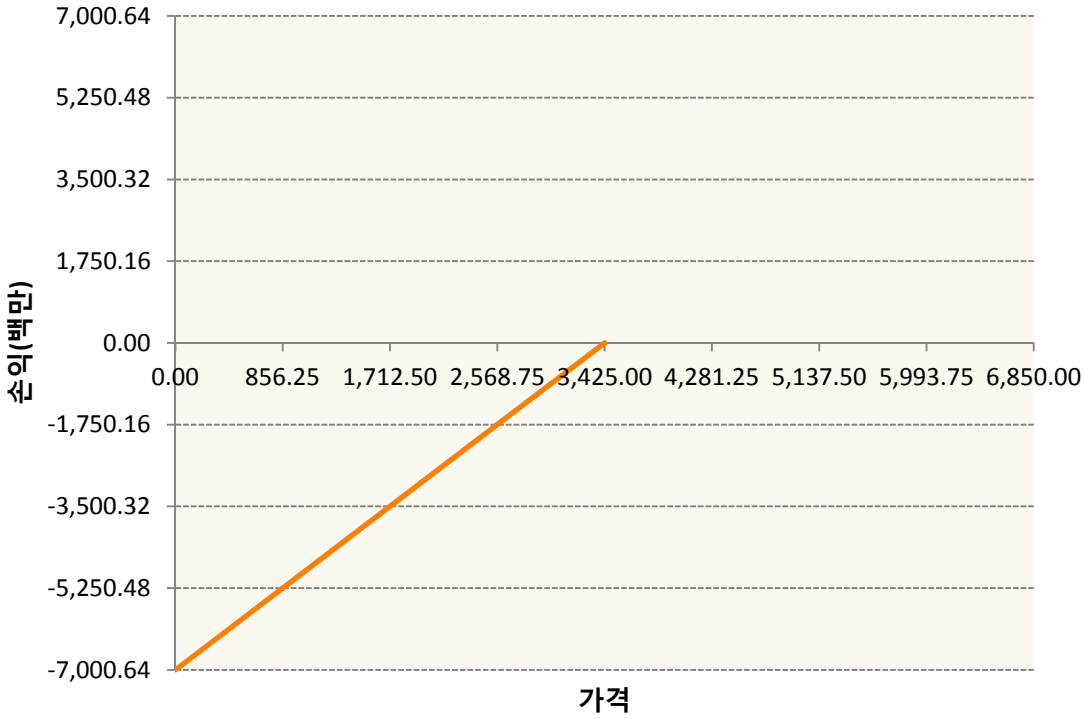
## 2. 만기시점의 손익구조



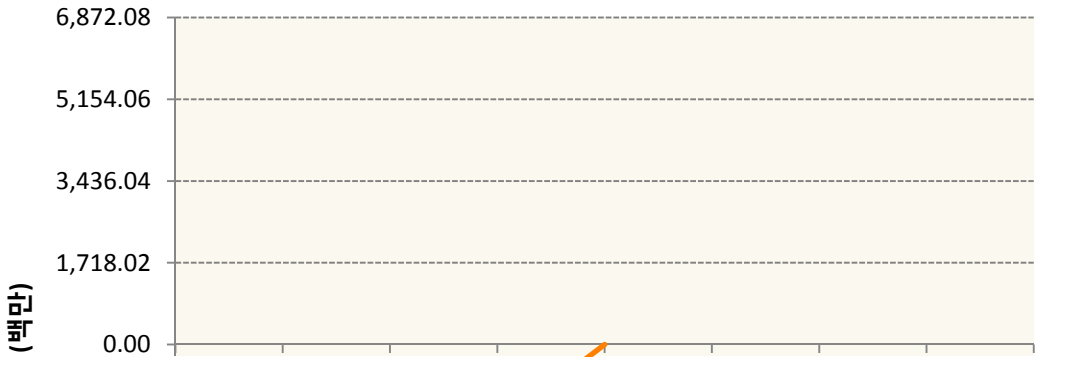



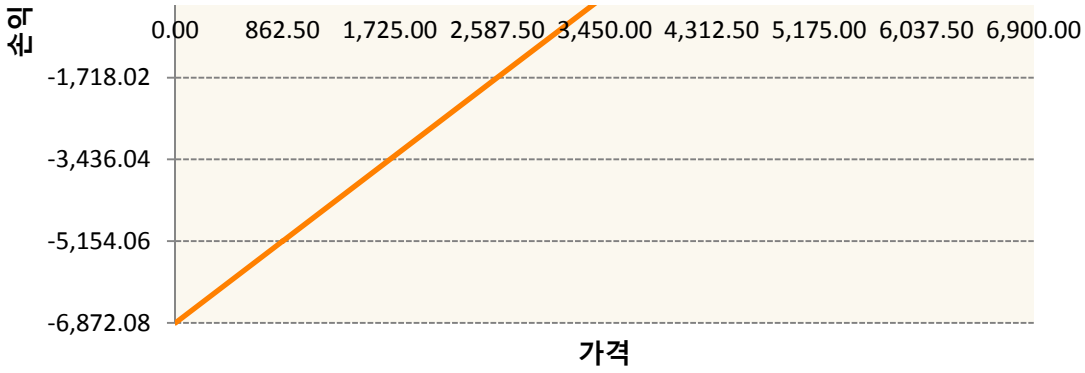


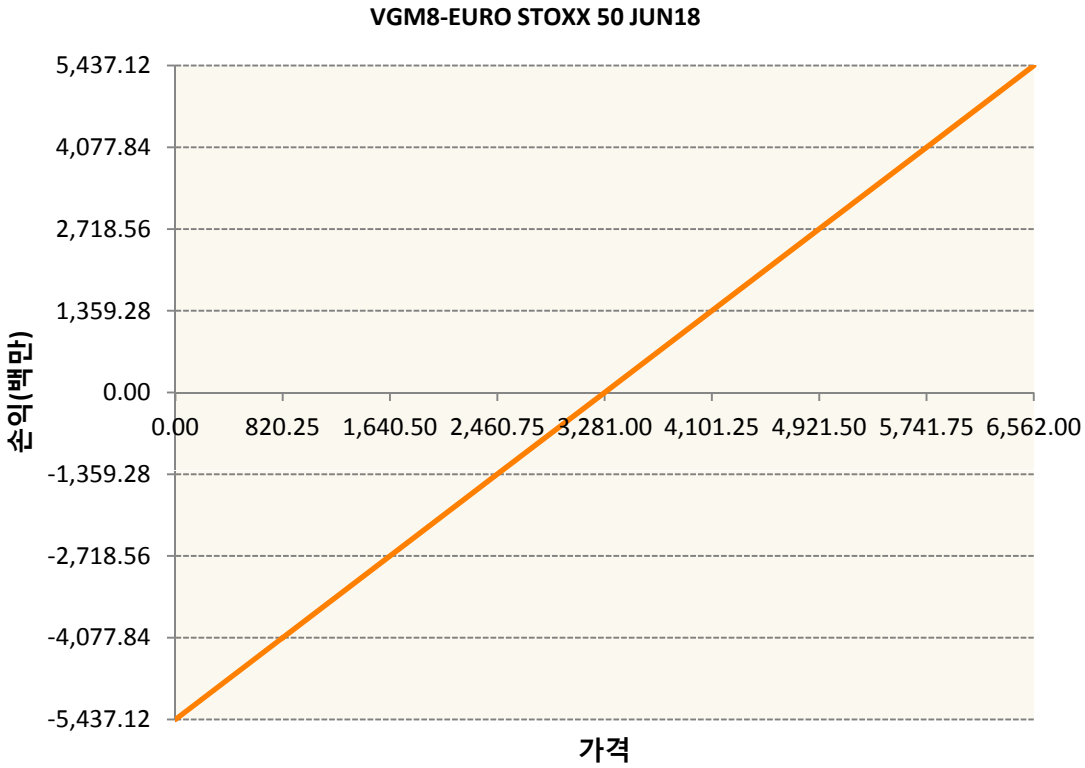

OESXJ8-P3425-EURO STOXX 50




OESXJ8-P3450-EURO STOXX 50






| 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) | | (단위:백만원) |
|---|---|---|
| 260105SGPX | SG EURO Covered CALL STRATEGY - 994.569 | 204 |
| 260105SQPX | SG EURO Covered CALL STRATEGY | 382 |
| OESXJ8-C34 | EURO STOXX 50 | 560 |
| OESXJ8-C34 | EURO STOXX 50 | 550 |
| OESXJ8-P34 | EURO STOXX 50 | 560 |
| OESXJ8-P34 | EURO STOXX 50 | 550 |
| VGM8 | EURO STOXX 50 JUN18 | 435 |

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

| |
|---|
| **2,037** |

| | |
|---|---|
| 공시일 | 2018-04-03 |
| 기준일 | 2018-04-02 |

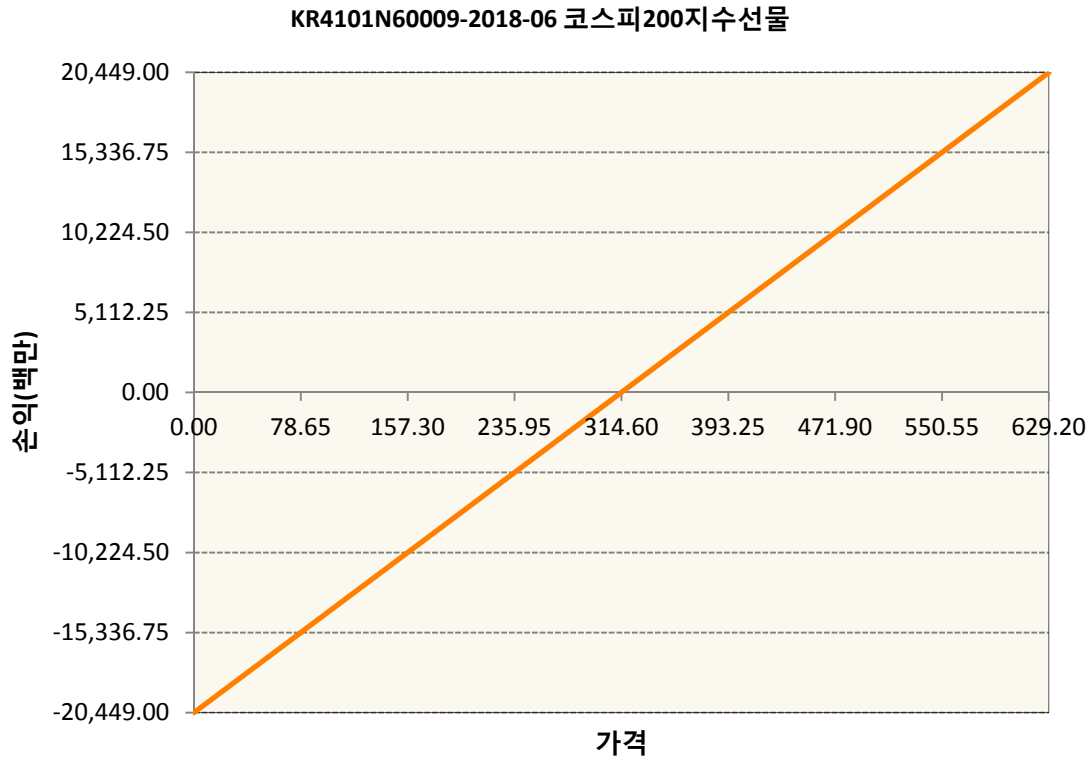
# ETF스마트레버리지목표전환형8호

## 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 | 20,449 | 0 | 20,449 | 장내 |

## 2. 만기시점의 손익구조




## 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| KR4101N60( 2018-06 코스피200지수선물 | | | | | | | 1,633 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 기초자산의 변동성 | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | -1,633 | -1,633 | -1,633 | -1,633 | -1,633 | -1,633 | -1,633 |
| -5.33% | -1,089 | -1,089 | -1,089 | -1,089 | -1,089 | -1,089 | -1,089 |
| -2.67% | -544 | -544 | -544 | -544 | -544 | -544 | -544 |
| 0% | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 2.67% | 544 | 544 | 544 | 544 | 544 | 544 | 544 |
| 5.33% | 1,089 | 1,089 | 1,089 | 1,089 | 1,089 | 1,089 | 1,089 |
| 8.00% | 1,633 | 1,633 | 1,633 | 1,633 | 1,633 | 1,633 | 1,633 |

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

| |
|---|
| **1,176** |

| | |
|---|---|
| 공시일 | 2018-04-03 |
| 기준일 | 2018-04-02 |

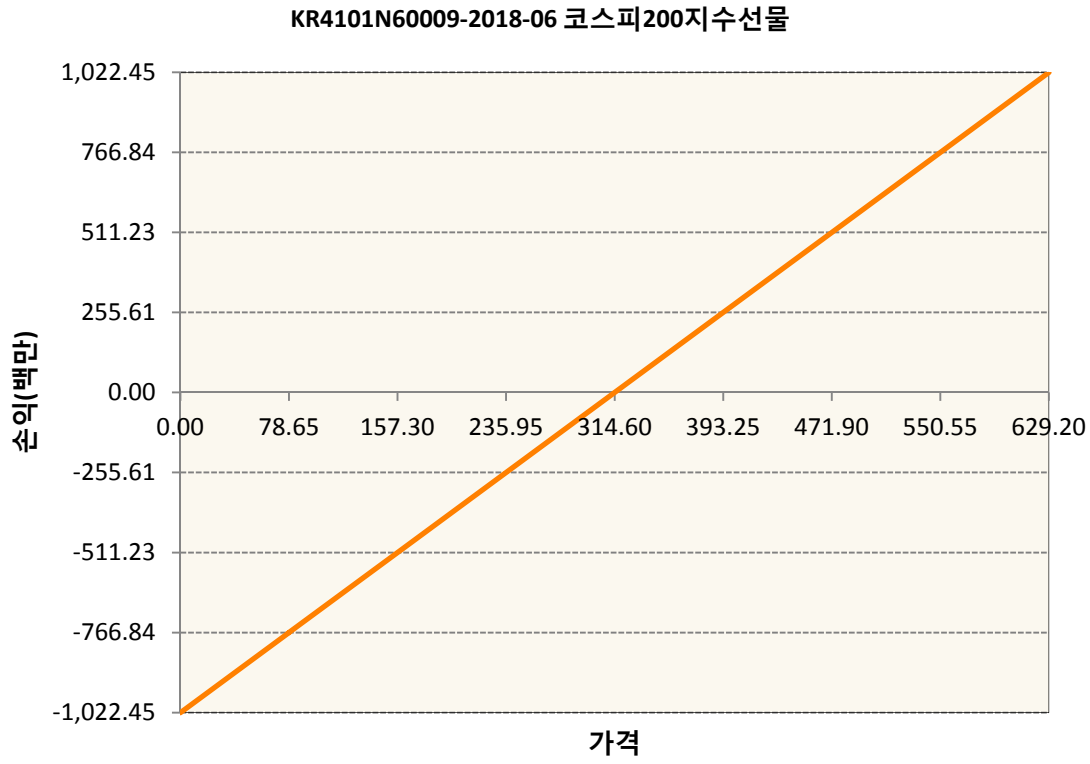
# ETF스마트레버리지목표전환형9호

## 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 | 1,022 | 0 | 1,022 | 장내 |

## 2. 만기시점의 손익구조




## 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| KR4101N60( 2018-06 코스피200지수선물 | | | | | | | 82 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 기초자산의 변동성 | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | -82 | -82 | -82 | -82 | -82 | -82 | -82 |
| -5.33% | -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% | 82 | 82 | 82 | 82 | 82 | 82 | 82 |

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

| 59 |
|---|

| | |
|---|---|
| 공시일 | 2018-04-03 |
| 기준일 | 2018-04-02 |

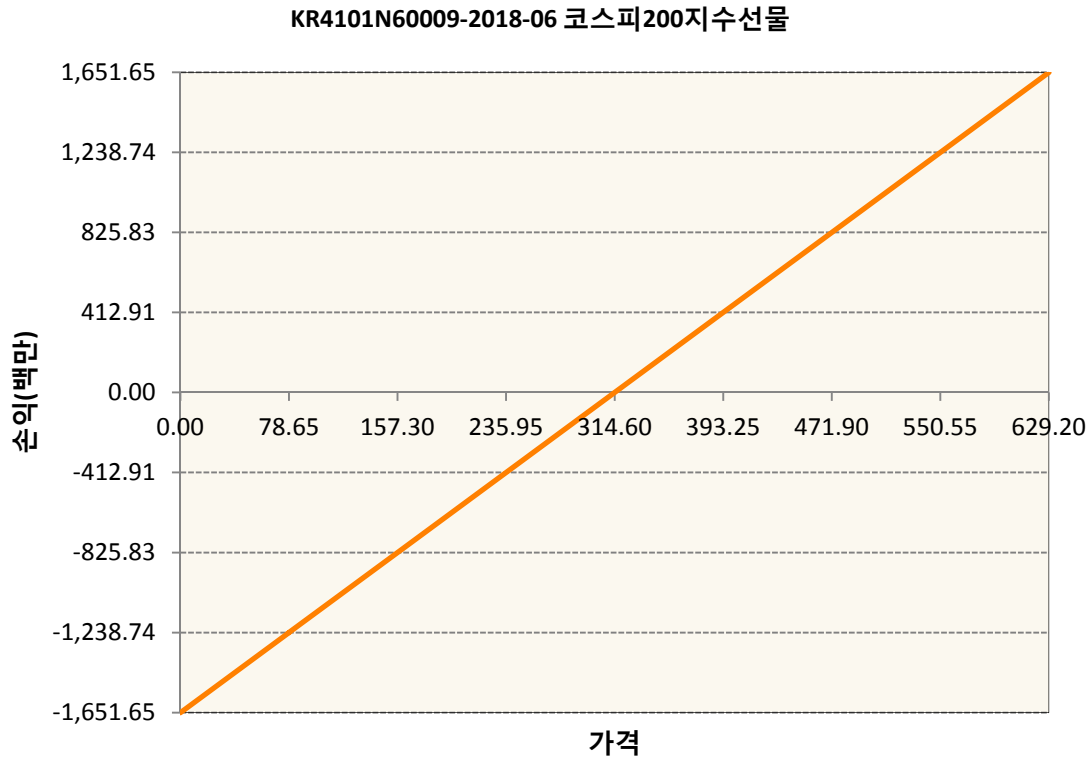
# ETF스마트레버리지목표전환형10

## 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 | 1,652 | 0 | 1,652 | 장내 |

## 2. 만기시점의 손익구조




## 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| KR4101N60( 2018-06 코스피200지수선물 | | | | | | | 132 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 기초자산의 변동성 | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | -132 | -132 | -132 | -132 | -132 | -132 | -132 |
| -5.33% | -88 | -88 | -88 | -88 | -88 | -88 | -88 |
| -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% | 88 | 88 | 88 | 88 | 88 | 88 | 88 |
| 8.00% | 132 | 132 | 132 | 132 | 132 | 132 | 132 |

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

| |
|---|
| **95** |

| | |
|---|---|
| 공시일 | 2018-04-03 |
| 기준일 | 2018-04-02 |

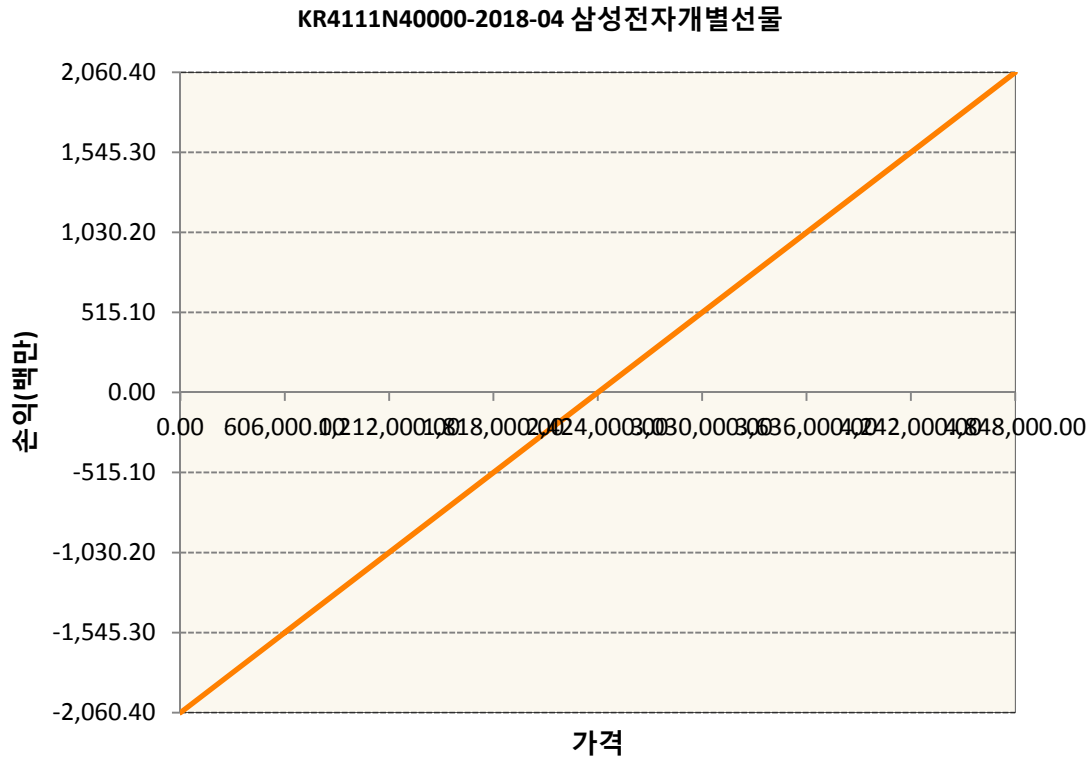
# 스마트KRX300인덱스1호(주식-파

## 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 | 2,060 | 0 | 2,060 | 장내 |

## 2. 만기시점의 손익구조




## 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| KR4111N40( 2018-04 삼성전자개별선물 | | | | | | | 165 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 기초자산의 변동성 | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | -165 | -165 | -165 | -165 | -165 | -165 | -165 |
| -5.33% | -110 | -110 | -110 | -110 | -110 | -110 | -110 |
| -2.67% | -55 | -55 | -55 | -55 | -55 | -55 | -55 |
| 0% | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 2.67% | 55 | 55 | 55 | 55 | 55 | 55 | 55 |
| 5.33% | 110 | 110 | 110 | 110 | 110 | 110 | 110 |
| 8.00% | 165 | 165 | 165 | 165 | 165 | 165 | 165 |

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

| |
|---|
| **199** |

| 공시일 | 2018-04-03 |
|---|---|
| 기준일 | 2018-04-02 |

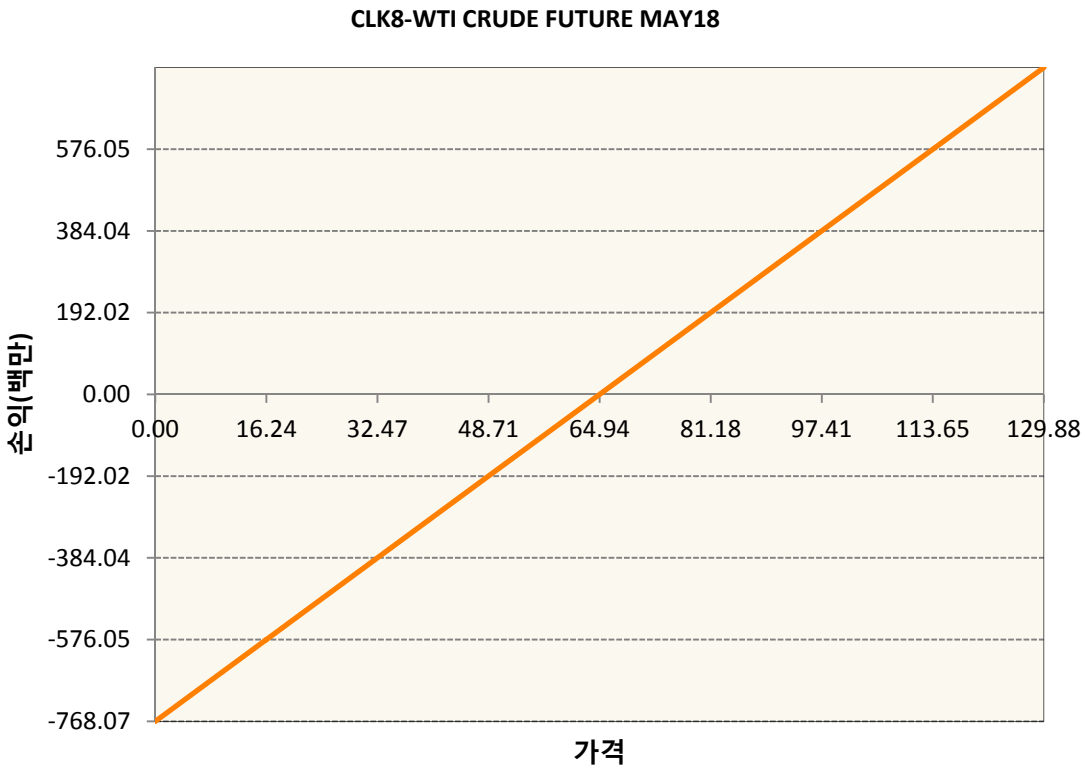
# 에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

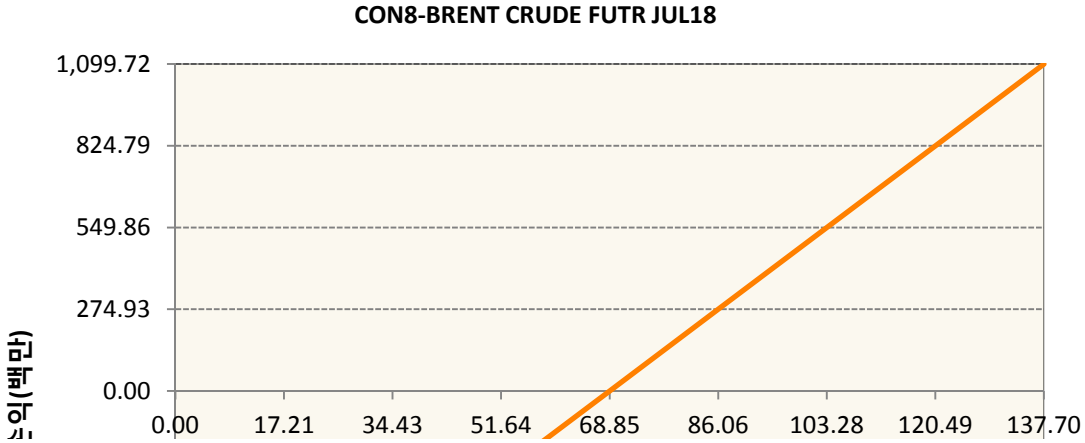
## 1. 계약금액

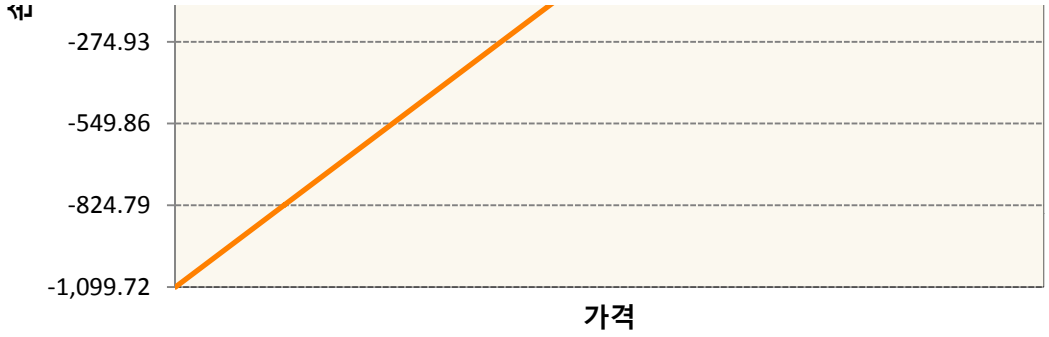
(단위:백만원)

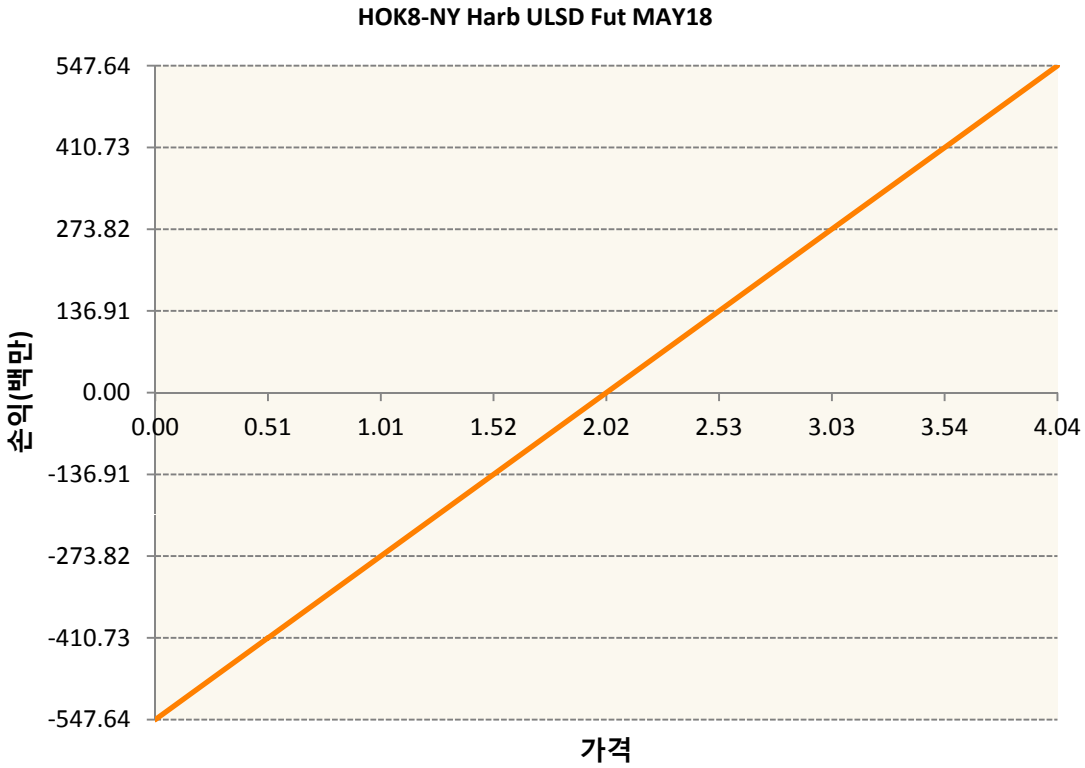
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 선물 | 유가증권 | 0 | 0 | 0 | |
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | |
| 누계 | 선물 | 유가증권 | 768 | 0 | 768 | |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 3,254 | 580 | 2,674 | |

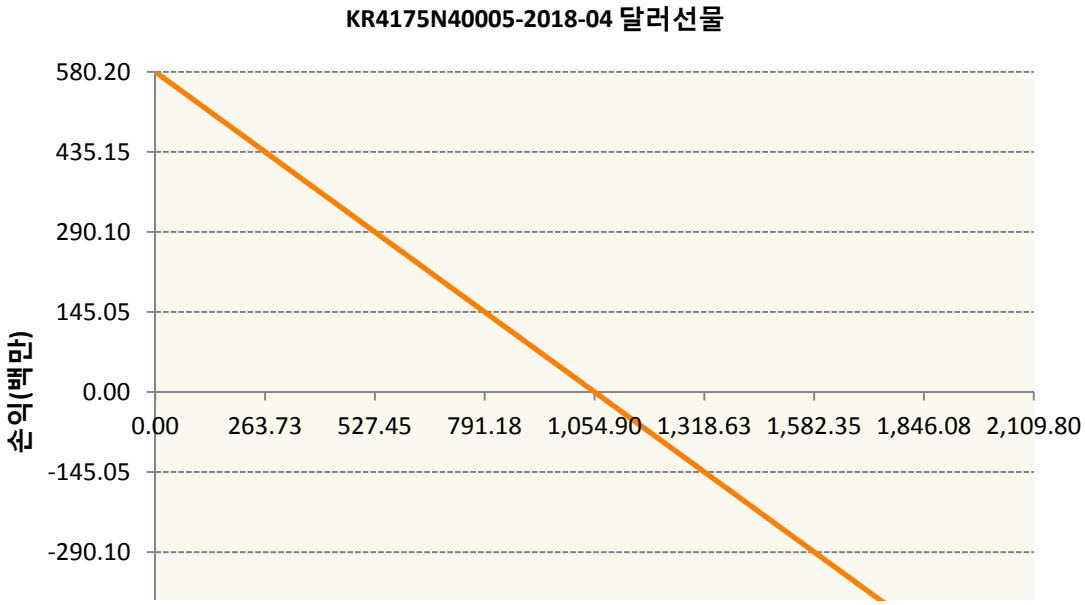
## 2. 만기시점의 손익구조

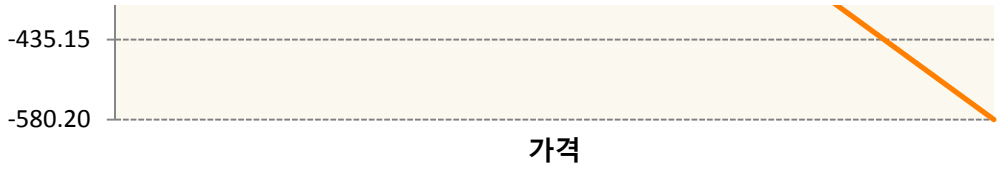


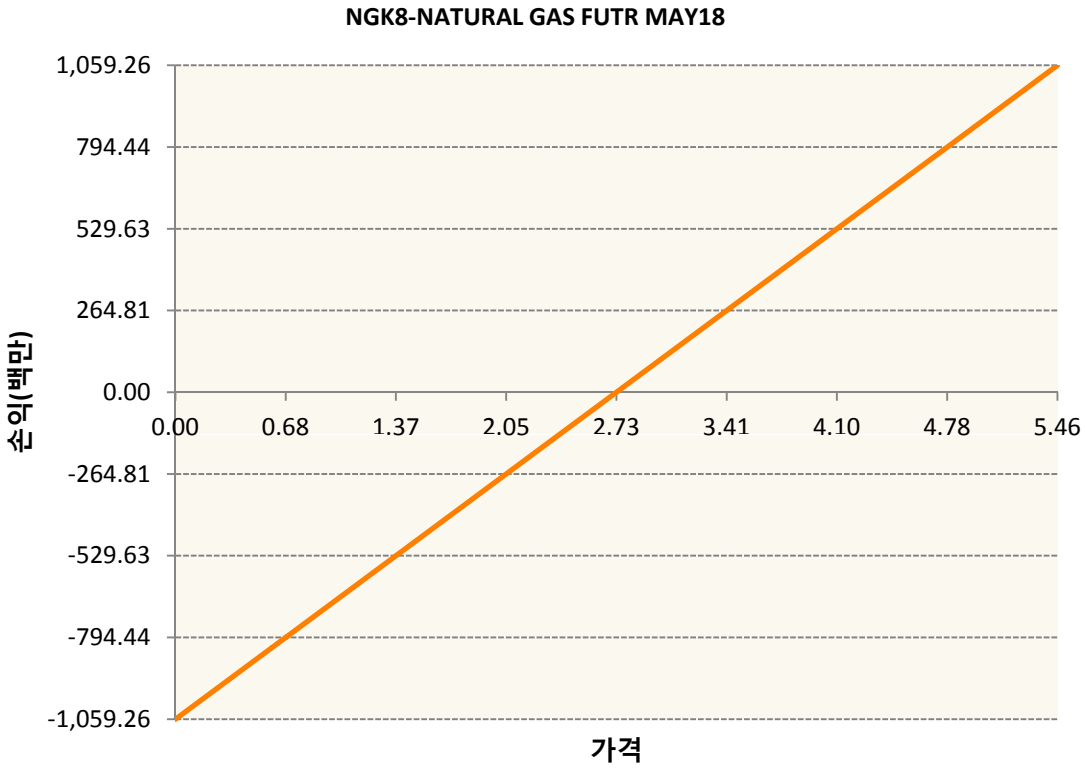



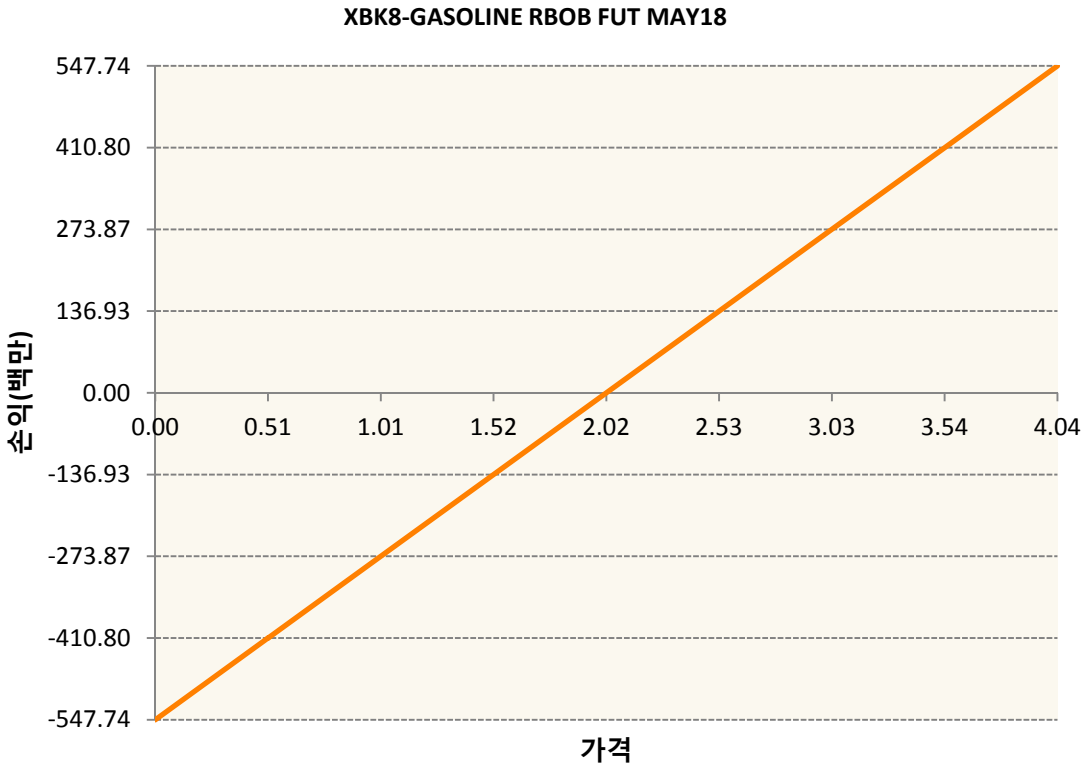

-274.93
-549.86
-824.79
-1,099.72
가격


HOK8-NY Harb ULSD Fut MAY18
547.64
410.73
273.82
136.91
0.00
-136.91
-273.82
-410.73
-547.64
0.00
0.51
1.01
1.52
2.02
2.53
3.03
3.54
4.04
손익(백만)
가격


KR4175N40005-2018-04 달러선물
580.20
435.15
290.10
145.05
0.00
-145.05
-290.10
0.00
263.73
527.45
791.18
1,054.90
1,318.63
1,582.35
1,846.08
2,109.80
손익(백만)


-435.15
-580.20
가격


NGK8-NATURAL GAS FUTR MAY18
1,059.26
794.44
529.63
264.81
0.00
-264.81
-529.63
-794.44
-1,059.26
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
547.74
410.80
273.87
136.93
0.00
-136.93
-273.87
-410.80
-547.74
0.00
0.51
1.01
1.52
2.02
2.53
3.03
3.54
4.04
손익(백만)
가격

**3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)** (단위:백만원)

| | | |
|---|---|---|
| CLK8 | WTI CRUDE FUTURE MAY18 | 61 |
| CON8 | BRENT CRUDE FUTR JUL18 | 88 |
| HOK8 | NY Harb ULSD Fut MAY18 | 44 |
| KR4175N40( | 2018-04 달러선물 | 46 |
| NGK8 | NATURAL GAS FUTR MAY18 | 85 |
| XBK8 | GASOLINE RBOB FUT MAY18 | 44 |

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

| |
|---|
| **516** |

| | |
|---|---|
| 공시일 | 2018-04-03 |
| 기준일 | 2018-04-02 |

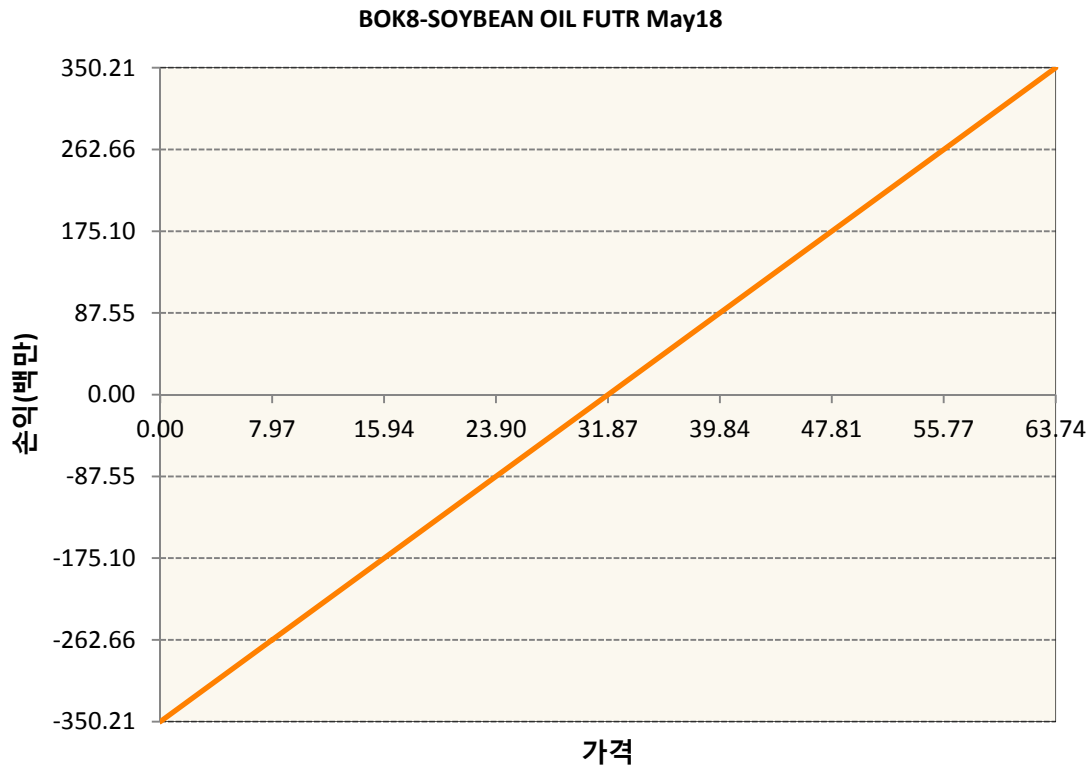
# 애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

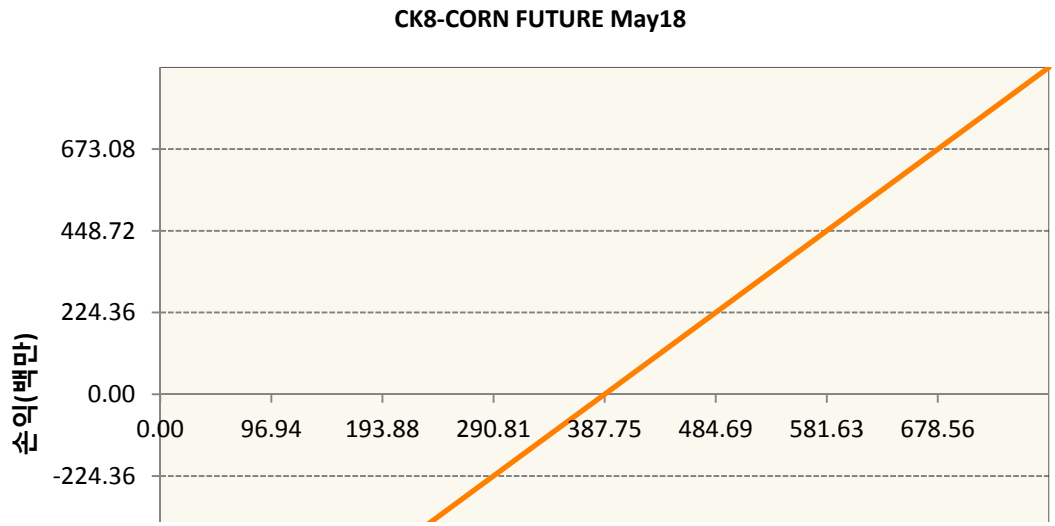
## 1. 계약금액

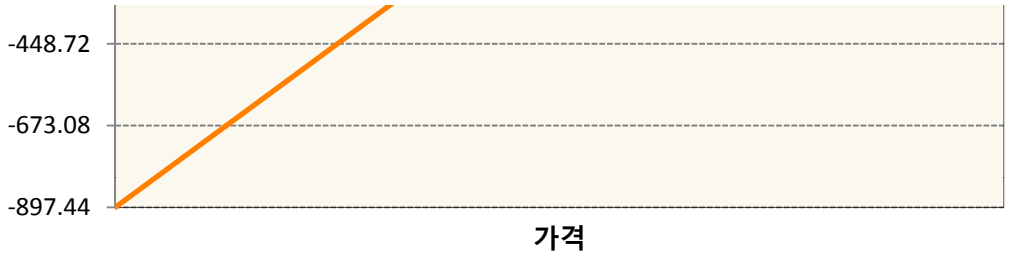
(단위:백만원)

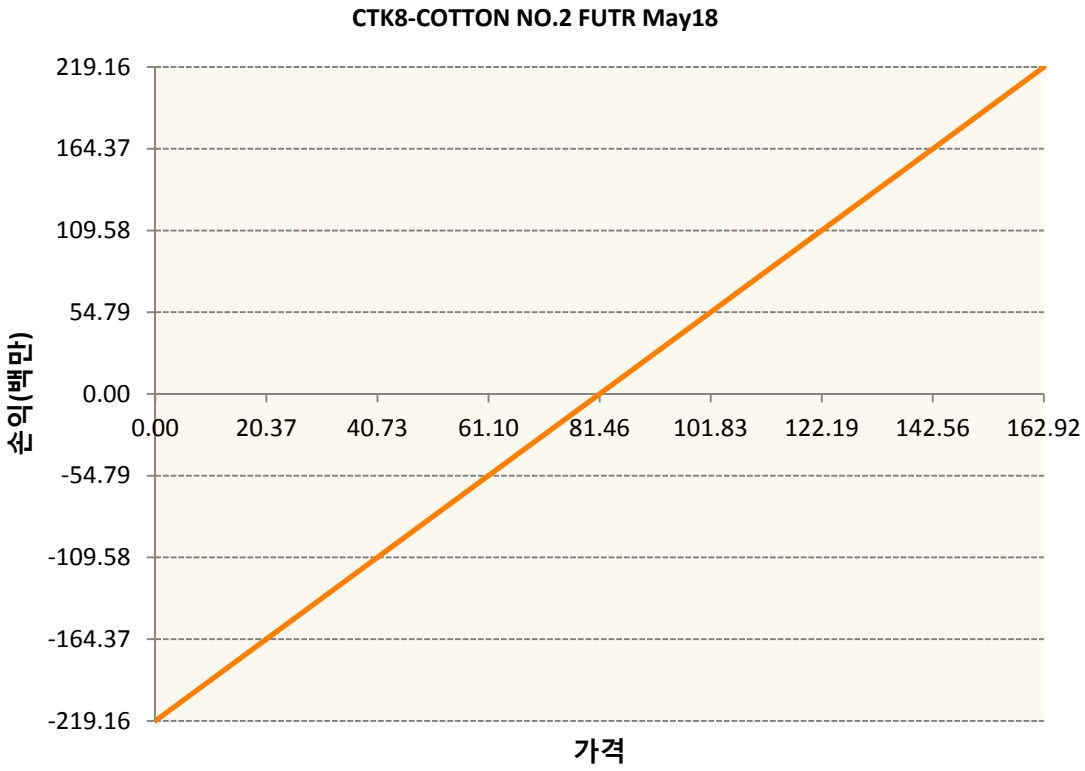
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 4,113 | 316 | 3,796 | |

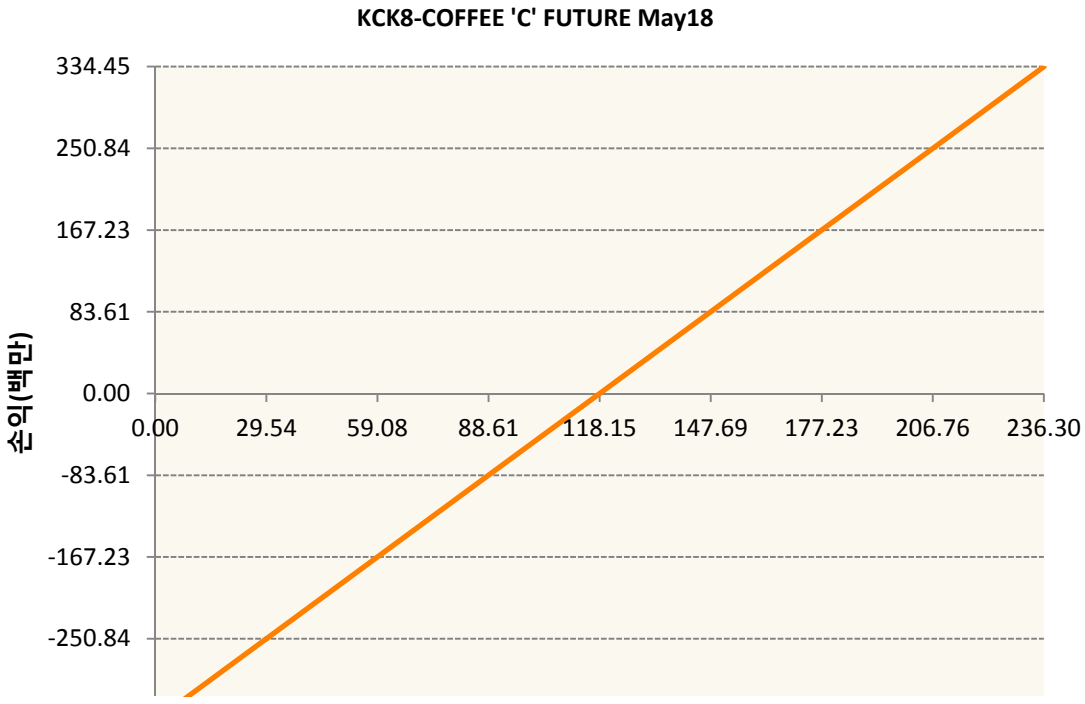
## 2. 만기시점의 손익구조

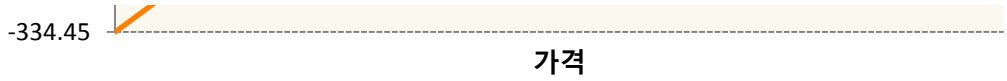


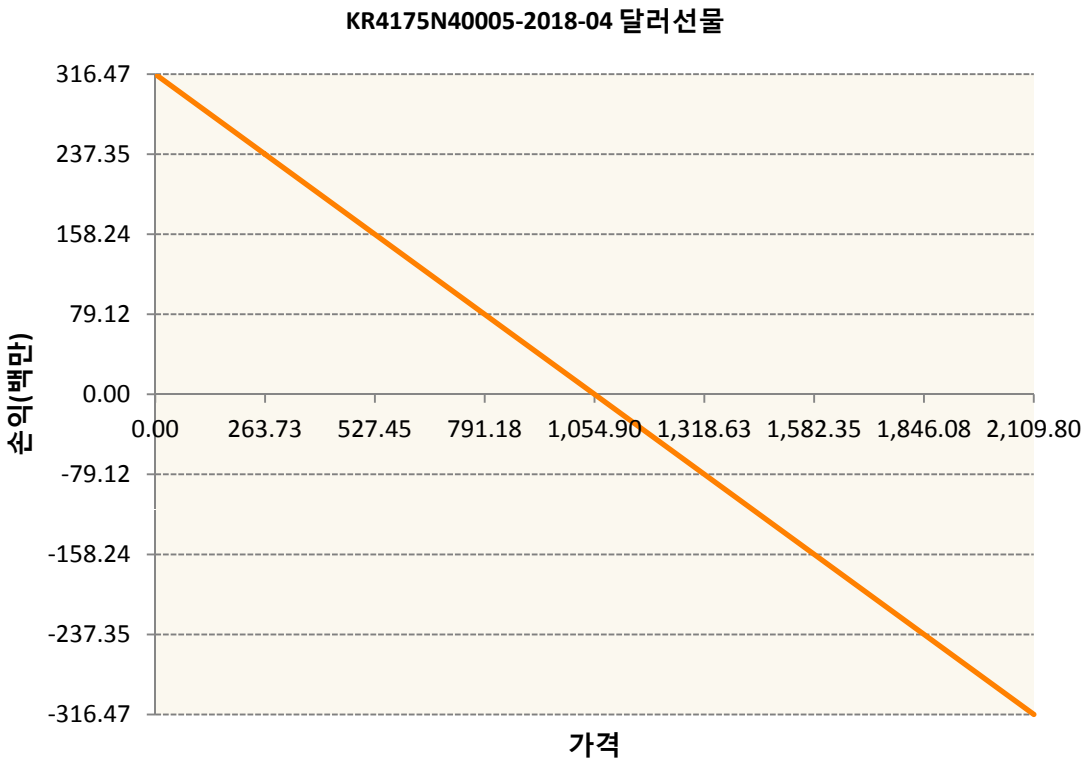



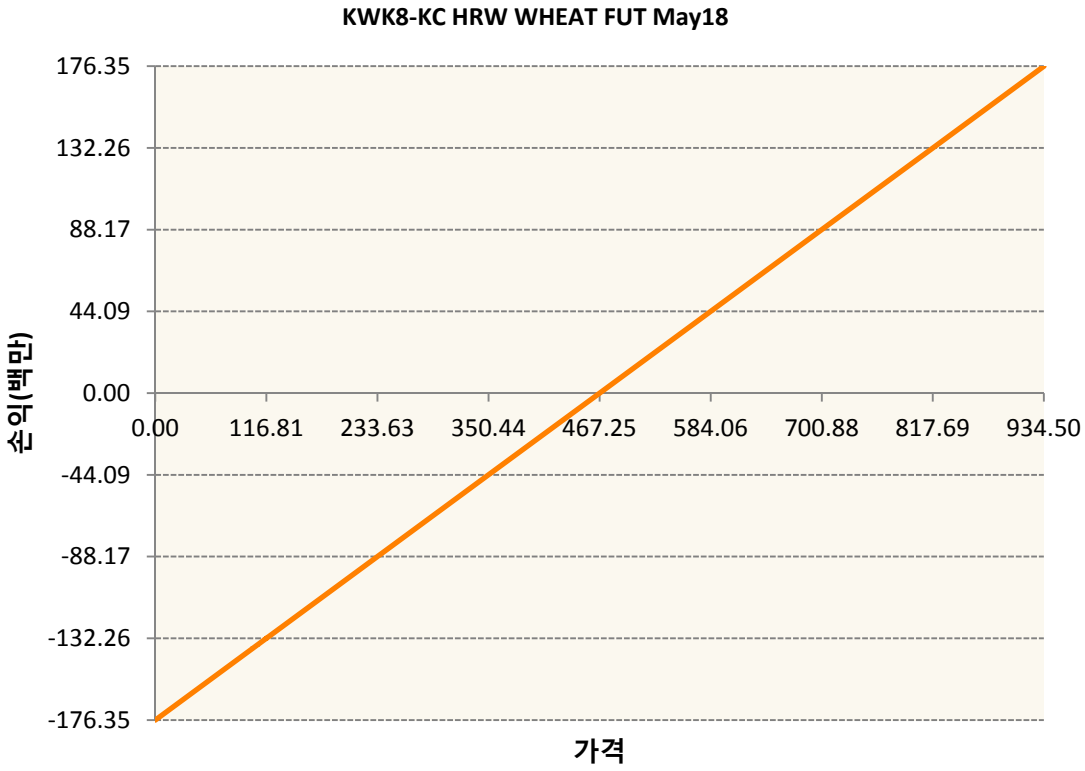

-448.72
-673.08
-897.44
가격

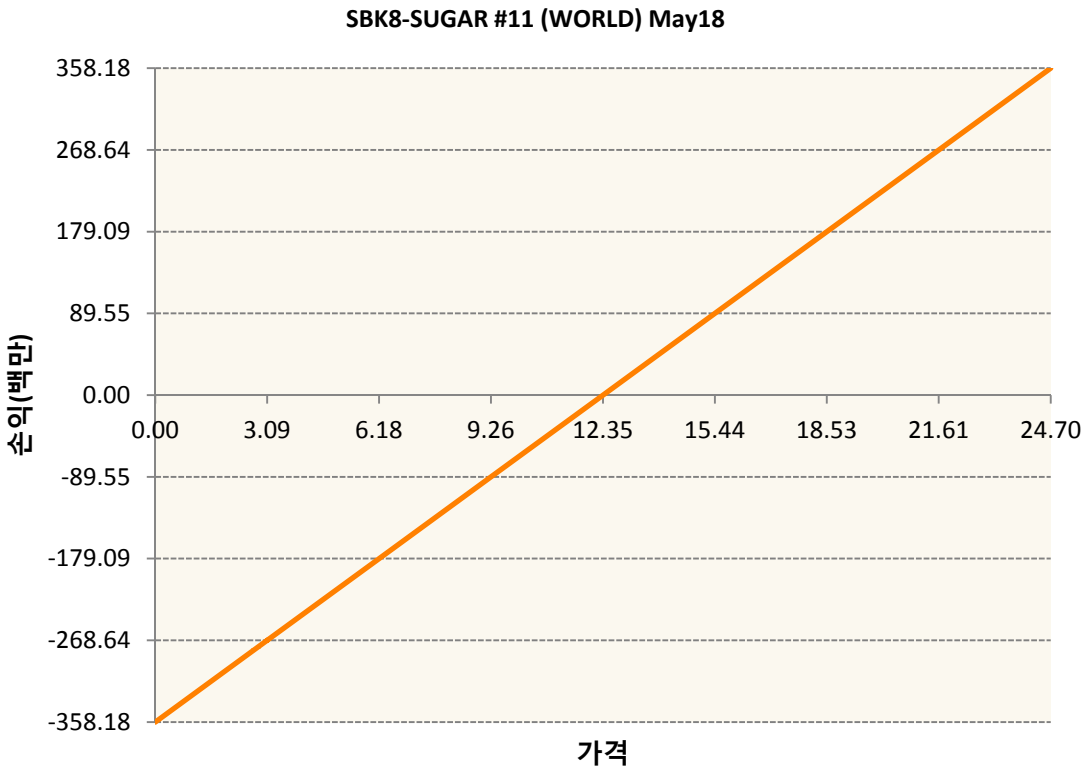

CTK8-COTTON NO.2 FUTR May18
219.16
164.37
109.58
54.79
0.00
-54.79
-109.58
-164.37
-219.16
손익(백만)
0.00
20.37
40.73
61.10
81.46
101.83
122.19
142.56
162.92
가격

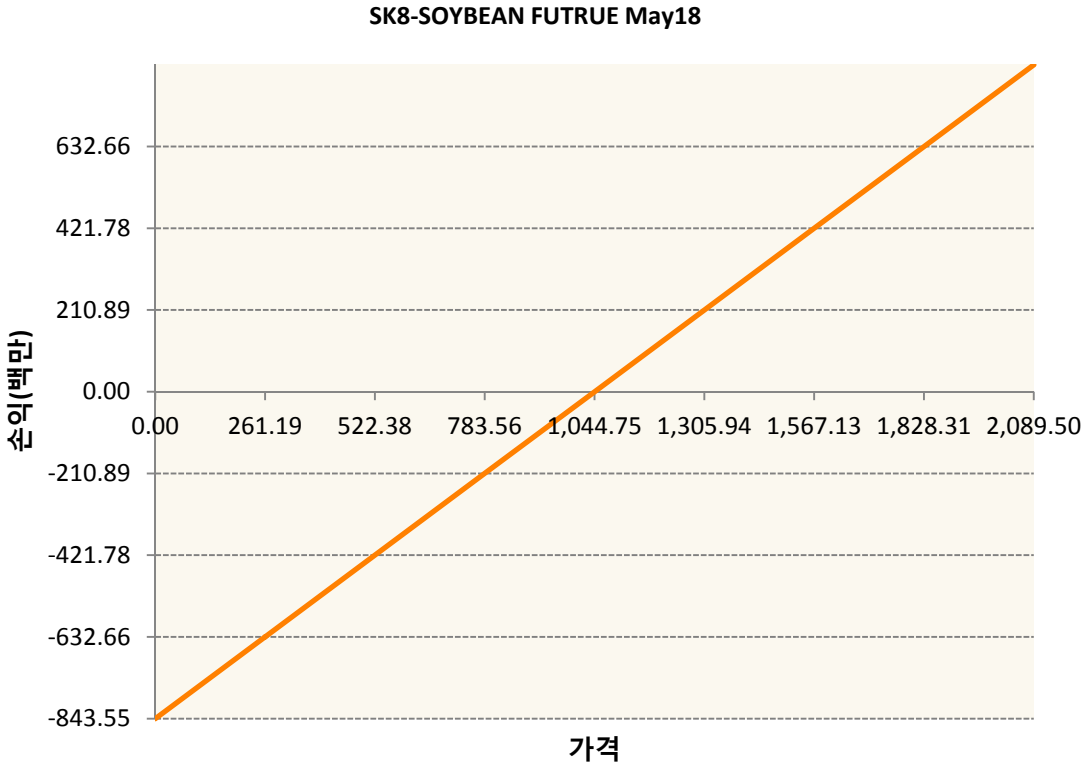

KCK8-COFFEE 'C' FUTURE May18
334.45
250.84
167.23
83.61
0.00
-83.61
-167.23
-250.84
손익(백만)
0.00
29.54
59.08
88.61
118.15
147.69
177.23
206.76
236.30


-334.45
가격

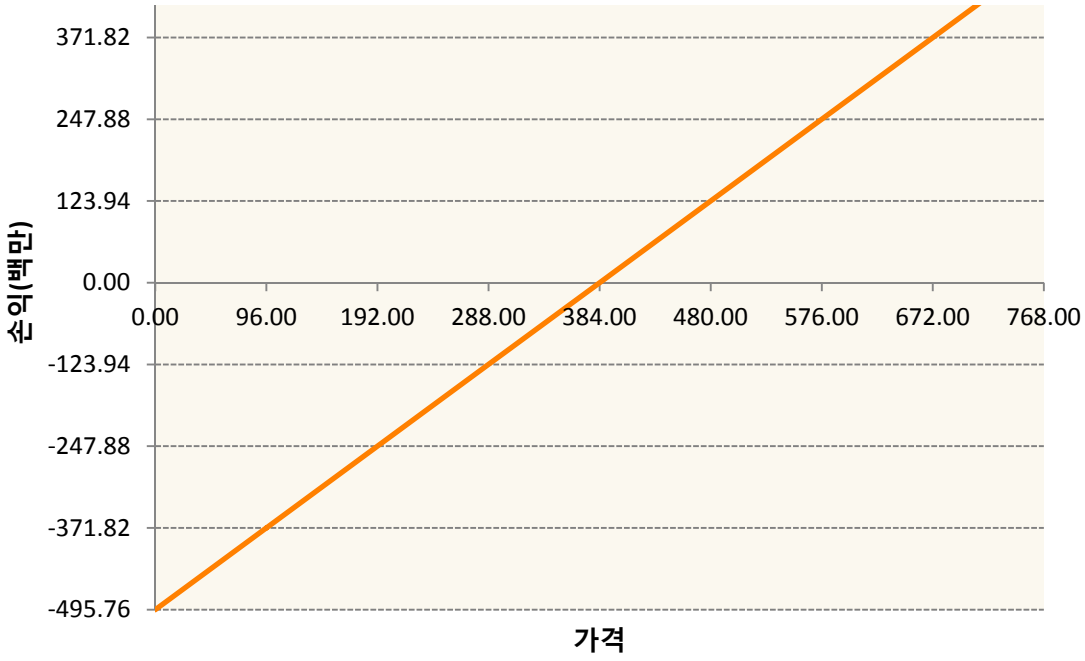

KR4175N40005-2018-04 달러선물
316.47
237.35
158.24
79.12
0.00
-79.12
-158.24
-237.35
-316.47
0.00
263.73
527.45
791.18
1,054.90
1,318.63
1,582.35
1,846.08
2,109.80
손익(백만)
가격

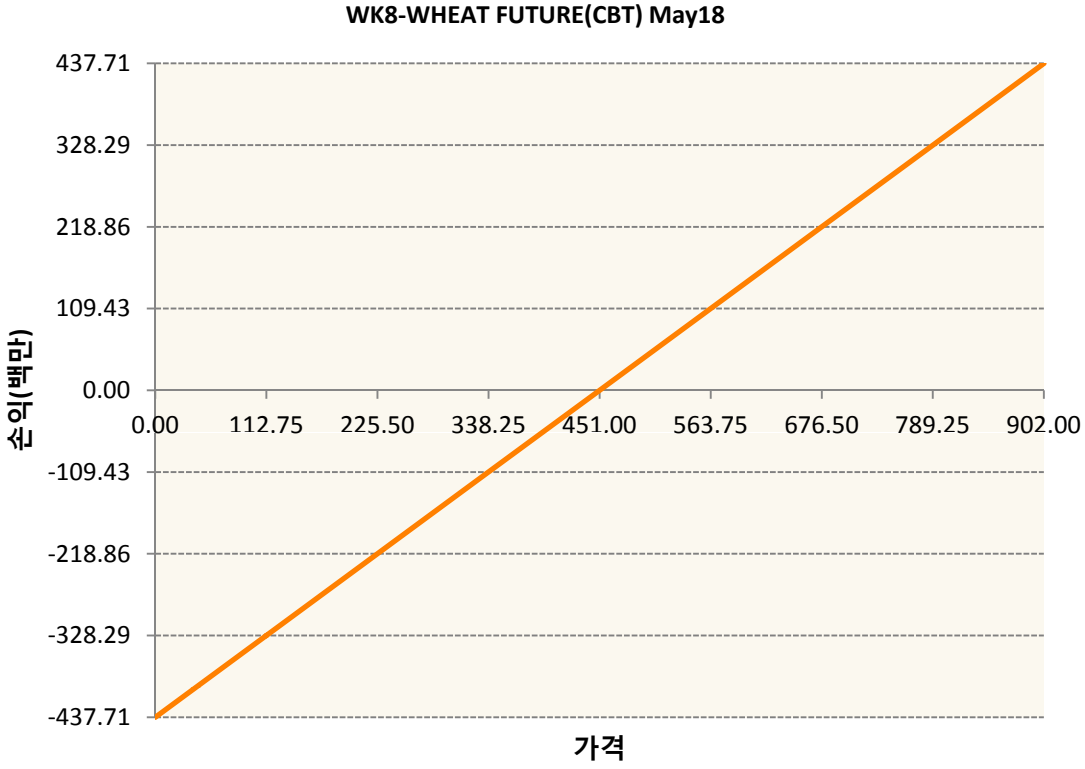

KWK8-KC HRW WHEAT FUT May18
176.35
132.26
88.17
44.09
0.00
-44.09
-88.17
-132.26
-176.35
0.00
116.81
233.63
350.44
467.25
584.06
700.88
817.69
934.50
손익(백만)
가격


SBK8-SUGAR #11 (WORLD) May18
358.18
268.64
179.09
89.55
0.00
-89.55
-179.09
-268.64
-358.18
0.00
3.09
6.18
9.26
12.35
15.44
18.53
21.61
24.70
손익(백만)
가격


SK8-SOYBEAN FUTRUE May18
632.66
421.78
210.89
0.00
-210.89
-421.78
-632.66
-843.55
0.00
261.19
522.38
783.56
1,044.75
1,305.94
1,567.13
1,828.31
2,089.50
손익(백만)
가격

SMK8-SOYBEAN MEAL FUTR 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 |
| KR4175N40( | 2018-04 달러선물 | 25 |

| | | |
|---|---|---|
| KWK8 | KC HRW WHEAT FUT May18 | 14 |
| SBK8 | SUGAR #11 (WORLD) May18 | 29 |
| SK8 | SOYBEAN FUTRUE May18 | 67 |
| SMK8 | SOYBEAN MEAL FUTR May18 | 40 |
| WK8 | WHEAT FUTURE(CBT) May18 | 35 |

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

| |
|---|
| **331** |