공시일	2018-01-16
기준일	2018-01-15

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	2018-01-16
기준일	2018-01-15

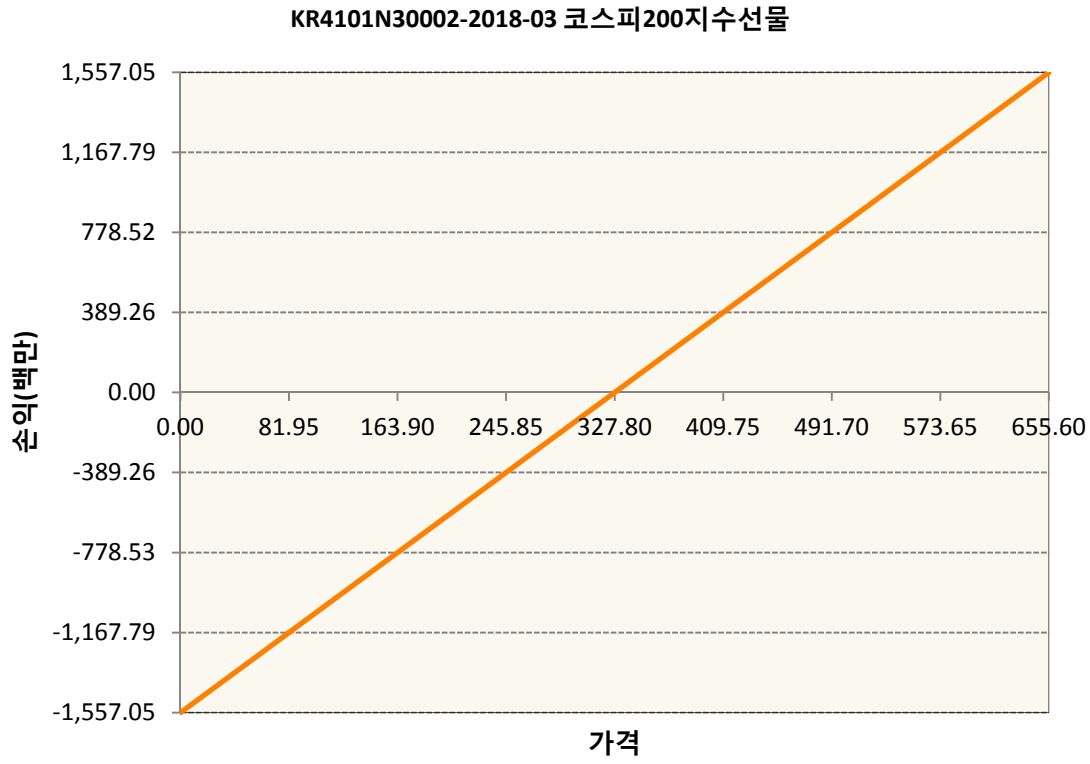
스마트인덱스모

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	1,557	0	1,557	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101N30(2018-03 코스피200지수선물							124
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-124	-124	-124	-124	-124	-124	-124
-5.33%	-83	-83	-83	-83	-83	-83	-83
-2.67%	-41	-41	-41	-41	-41	-41	-41
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	41	41	41	41	41	41	41
5.33%	83	83	83	83	83	83	83
8.00%	124	124	124	124	124	124	124

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

75

공시일	2018-01-16
기준일	2018-01-15

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	13,365	0	13,365	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWMXWO0(신한MXWO 미래S171122	1,142

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

367

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2018-01-16
기준일	2018-01-15

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	409

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

369

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2018-01-16
기준일	2018-01-15

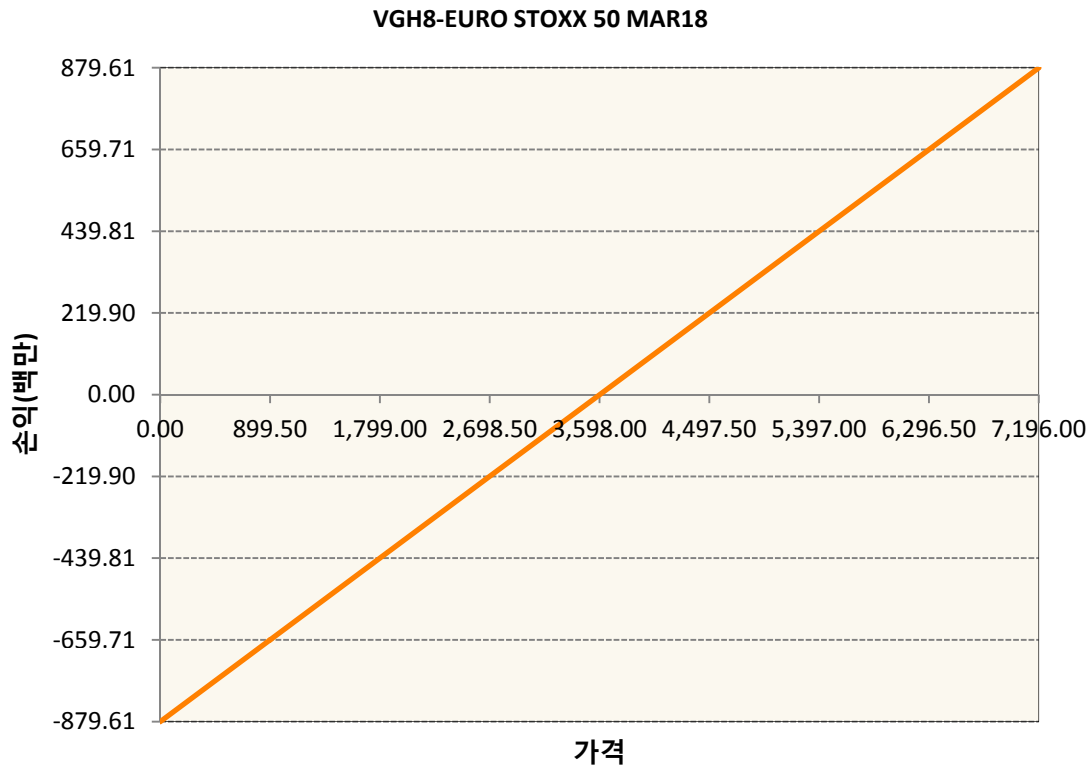
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	880	0	880	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGH8	EURO STOXX 50 MAR18	70

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

(단위:백만원)

39

공시일	2018-01-16
기준일	2018-01-15

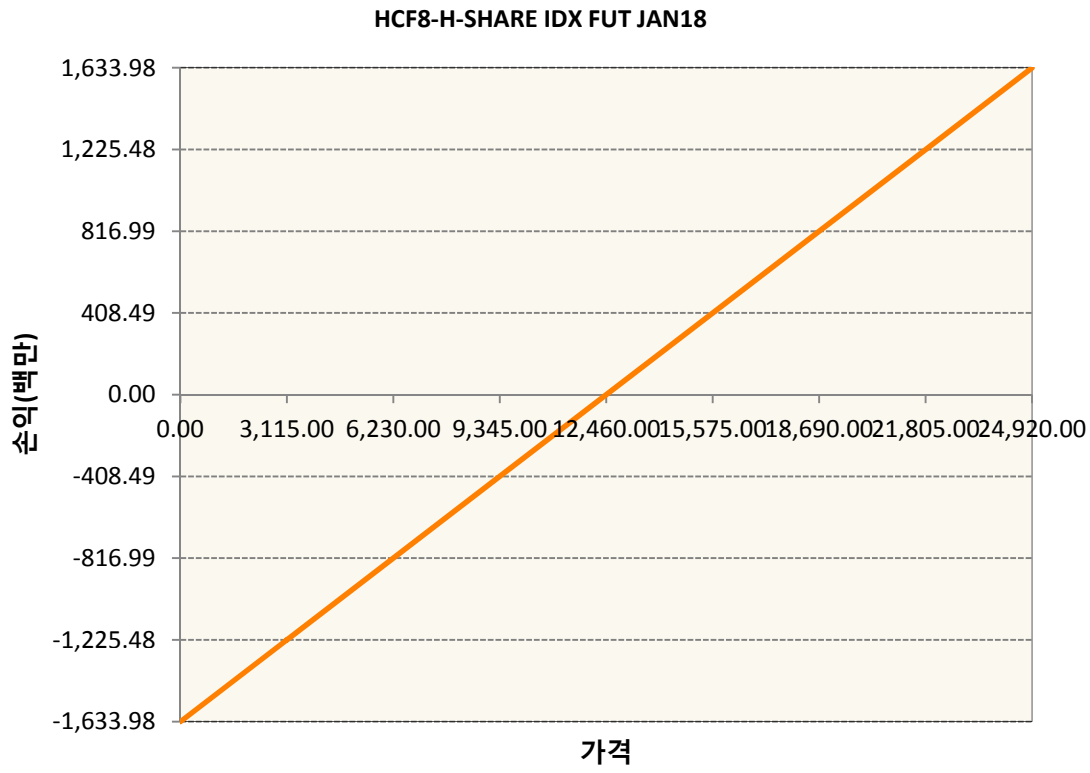
차이나인덱스모(주식-파생형)

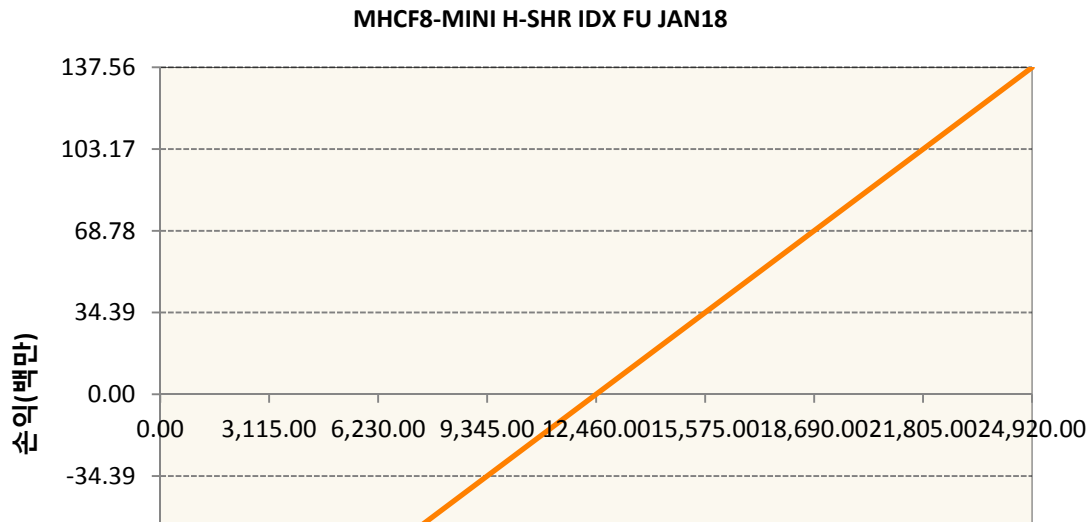
1. 계약금액

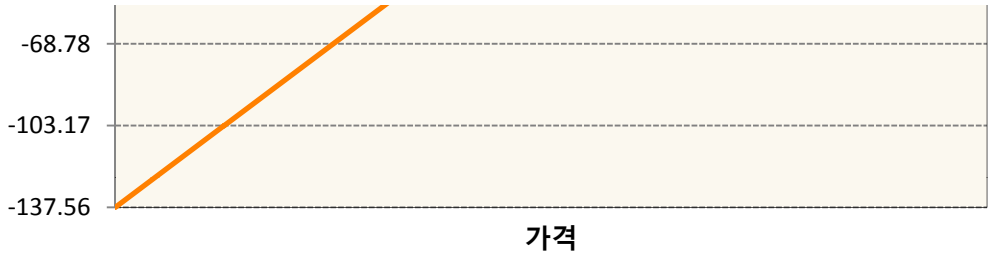
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,772	0	1,772	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCF8	H-SHARE IDX FUT JAN18	131
MHCF8	MINI H-SHR IDX FU JAN18	11

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	112

공시일	2018-01-16
기준일	2018-01-15

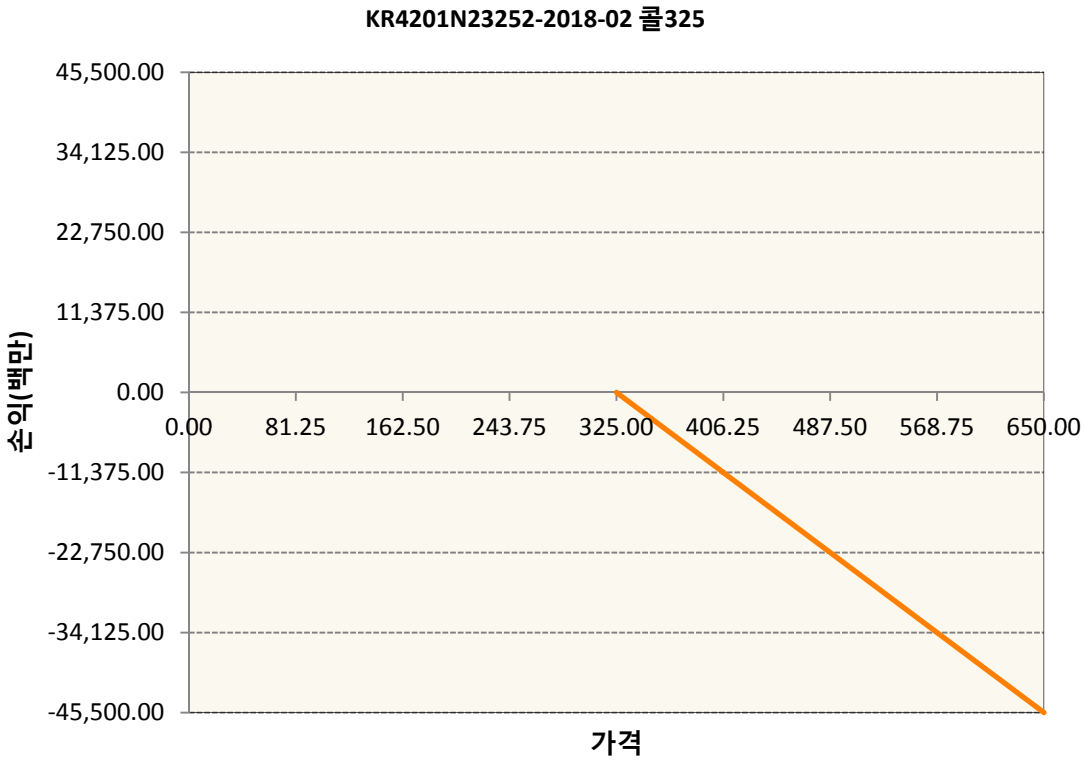
커버드콜모(주식혼합-파생형)

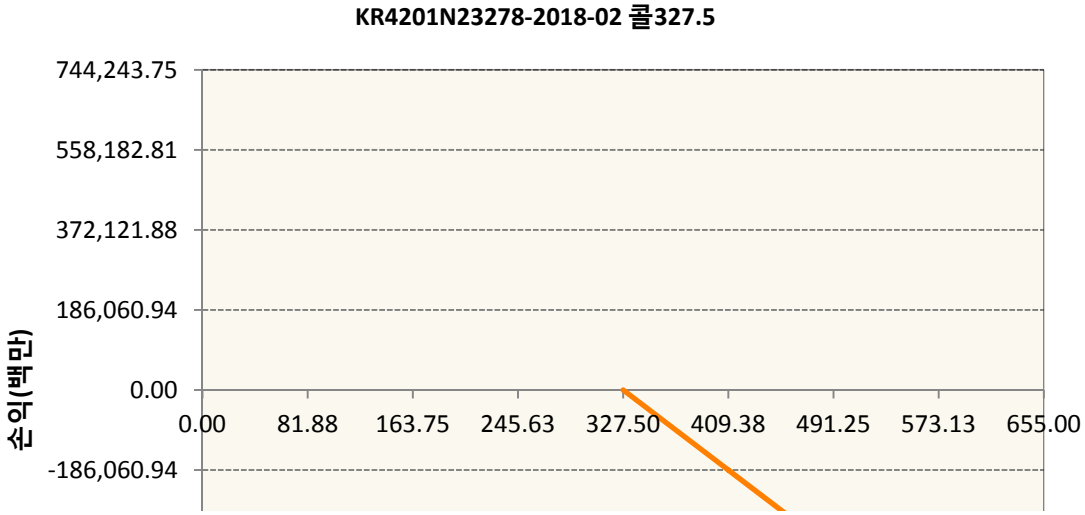
1. 계약금액

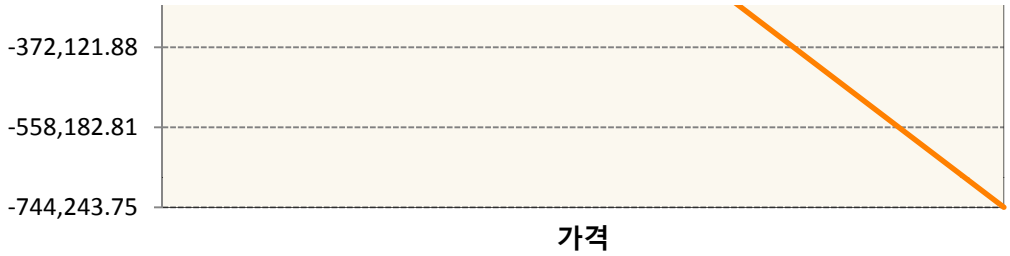
(단위:백만원)

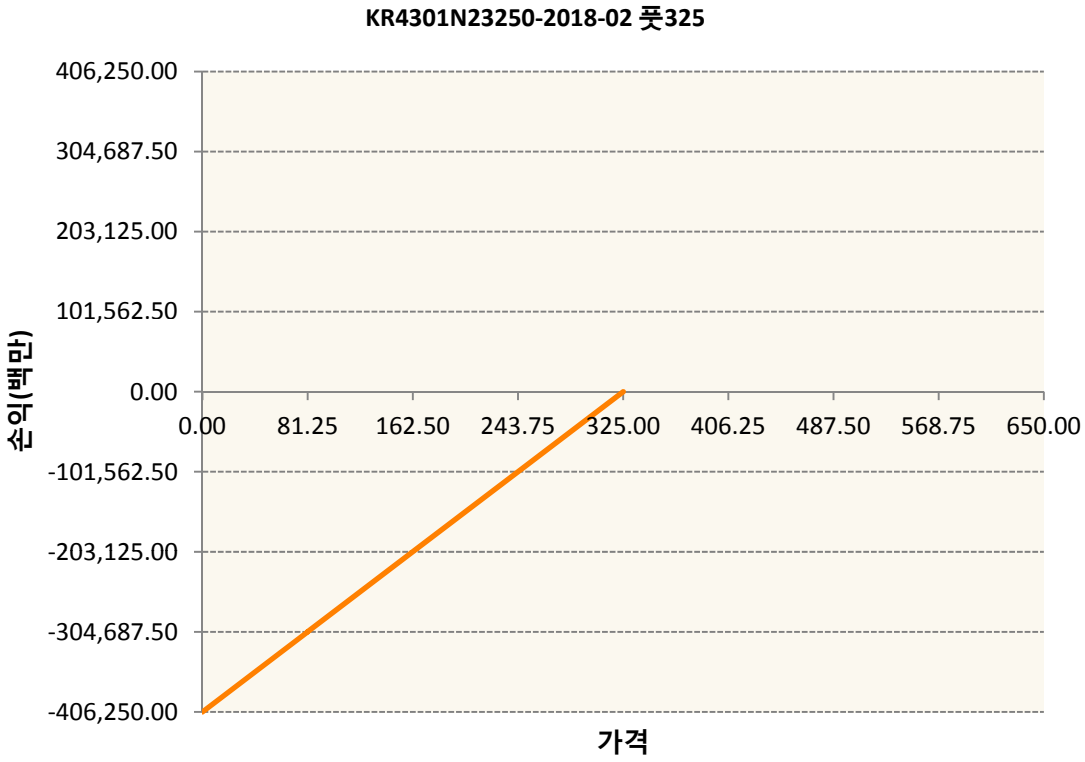
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	1,384,306	-1,384,306	장내

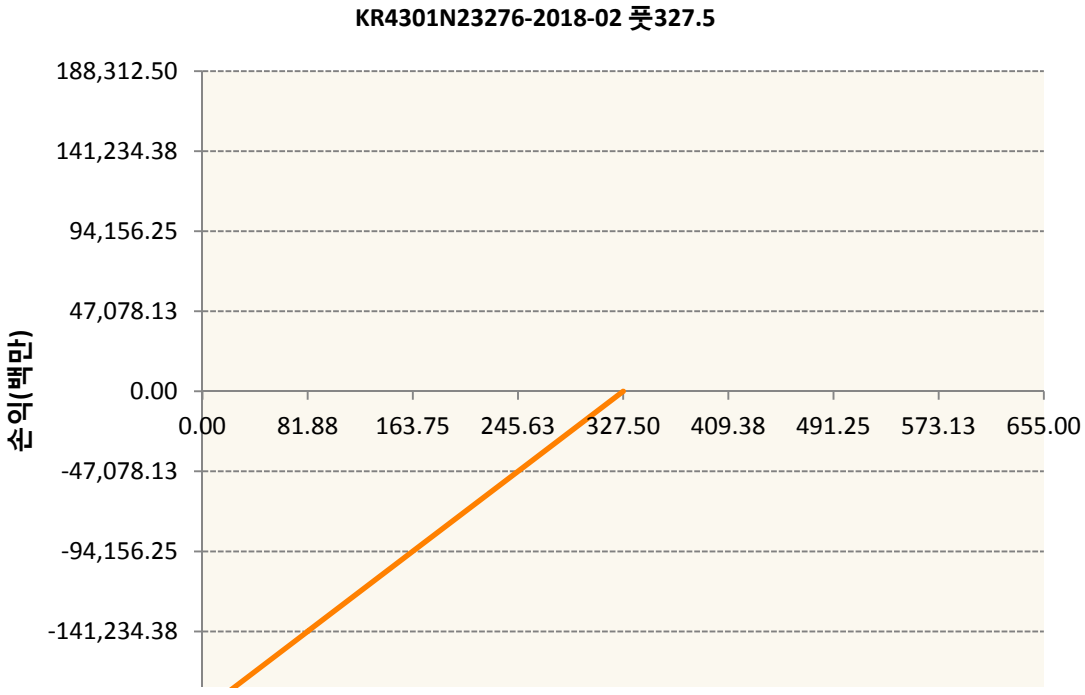
2. 만기시점의 손익구조






-372,121.88
-558,182.81
-744,243.75
가격


KR4301N23250-2018-02 풋325
406,250.00
304,687.50
203,125.00
101,562.50
0.00
-101,562.50
-203,125.00
-304,687.50
-406,250.00
0.00
81.25
162.50
243.75
325.00
406.25
487.50
568.75
650.00
손익(백만)
가격


KR4301N23276-2018-02 풋327.5
188,312.50
141,234.38
94,156.25
47,078.13
0.00
-47,078.13
-94,156.25
-141,234.38
0.00
81.88
163.75
245.63
327.50
409.38
491.25
573.13
655.00
손익(백만)



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201N232 2018-02 콜325							2,957
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,292	1,263	1,226	1,184	1,136	1,084	1,028
-5.33%	1,162	1,102	1,037	968	895	820	743
-2.67%	851	763	674	584	494	402	311
0%	284	190	95	0	-95	-190	-286
2.67%	-545	-622	-702	-784	-869	-956	-1,043
5.33%	-1,575	-1,623	-1,677	-1,737	-1,802	-1,871	-1,943
8.00%	-2,720	-2,744	-2,774	-2,811	-2,855	-2,903	-2,957
KR4201N232 2018-02 콜327.5							46,157
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	18,316	17,939	17,454	16,870	16,195	15,438	14,610
-5.33%	16,729	15,890	14,956	13,943	12,865	11,733	10,555
-2.67%	12,641	11,305	9,935	8,537	7,119	5,684	4,235
0%	4,685	3,123	1,561	0	-1,561	-3,123	-4,684
2.67%	-7,607	-8,980	-10,388	-11,825	-13,282	-14,757	-16,245
5.33%	-23,498	-24,426	-25,450	-26,554	-27,723	-28,945	-30,213
8.00%	-41,651	-42,143	-42,754	-43,472	-44,287	-45,185	-46,157
KR4301N232 2018-02 풋325							26,254
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-26,150	-26,152	-26,157	-26,168	-26,186	-26,214	-26,254
-5.33%	-15,295	-15,346	-15,419	-15,516	-15,636	-15,777	-15,939
-2.67%	-5,283	-5,563	-5,860	-6,172	-6,495	-6,827	-7,167
0%	1,135	761	382	0	-384	-770	-1,158
2.67%	3,088	2,952	2,787	2,596	2,381	2,146	1,894
5.33%	3,312	3,297	3,270	3,228	3,168	3,090	2,992
8.00%	3,321	3,321	3,319	3,314	3,306	3,290	3,267
KR4301N232 2018-02 풋327.5							12,845
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-12,819	-12,819	-12,820	-12,822	-12,827	-12,834	-12,845
-5.33%	-7,810	-7,822	-7,841	-7,868	-7,904	-7,950	-8,005
-2.67%	-3,007	-3,101	-3,206	-3,322	-3,445	-3,576	-3,712
0%	551	367	184	0	-184	-367	-551
2.67%	1,943	1,846	1,738	1,619	1,492	1,357	1,217

5.33%	2,161	2,146	2,122	2,089	2,045	1,991	1,928
8.00%	2,173	2,173	2,171	2,166	2,158	2,146	2,128

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

92,349

공시일	2018-01-16
기준일	2018-01-15

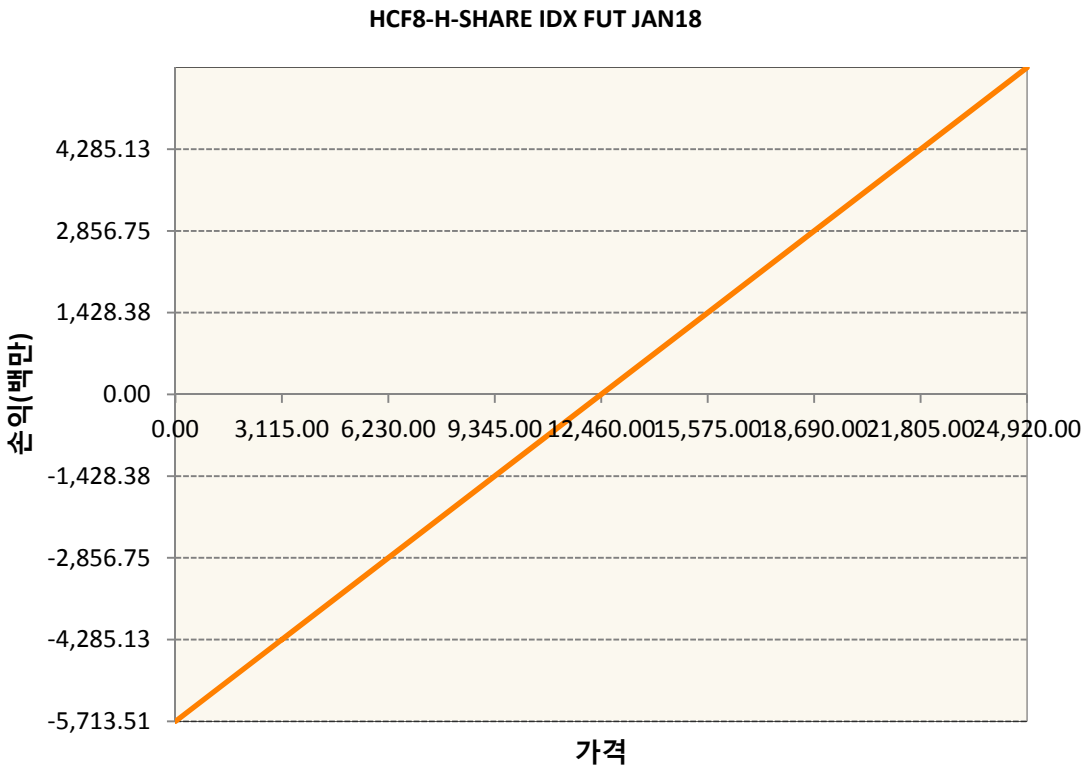
홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생

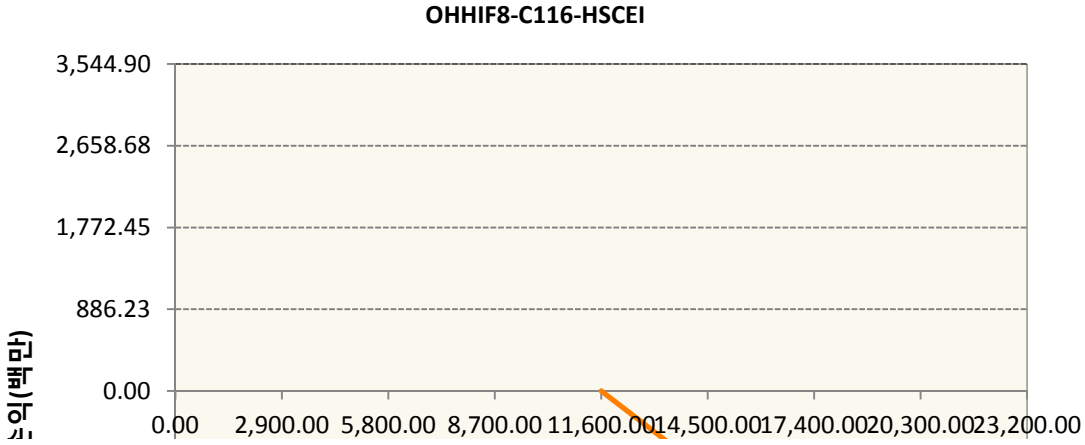
1. 계약금액

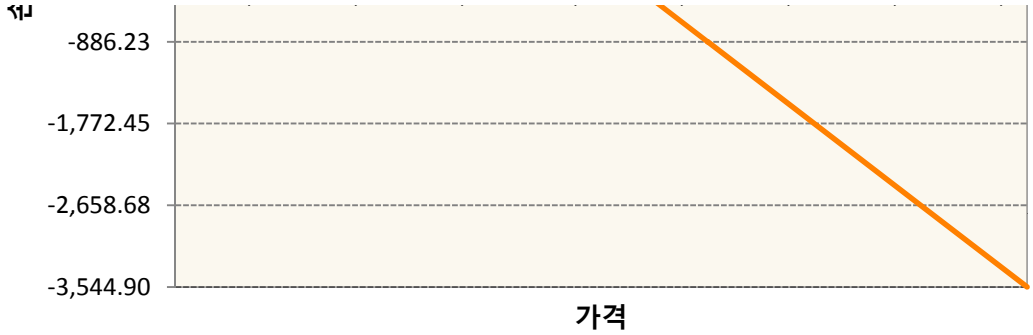
(단위:백만원)

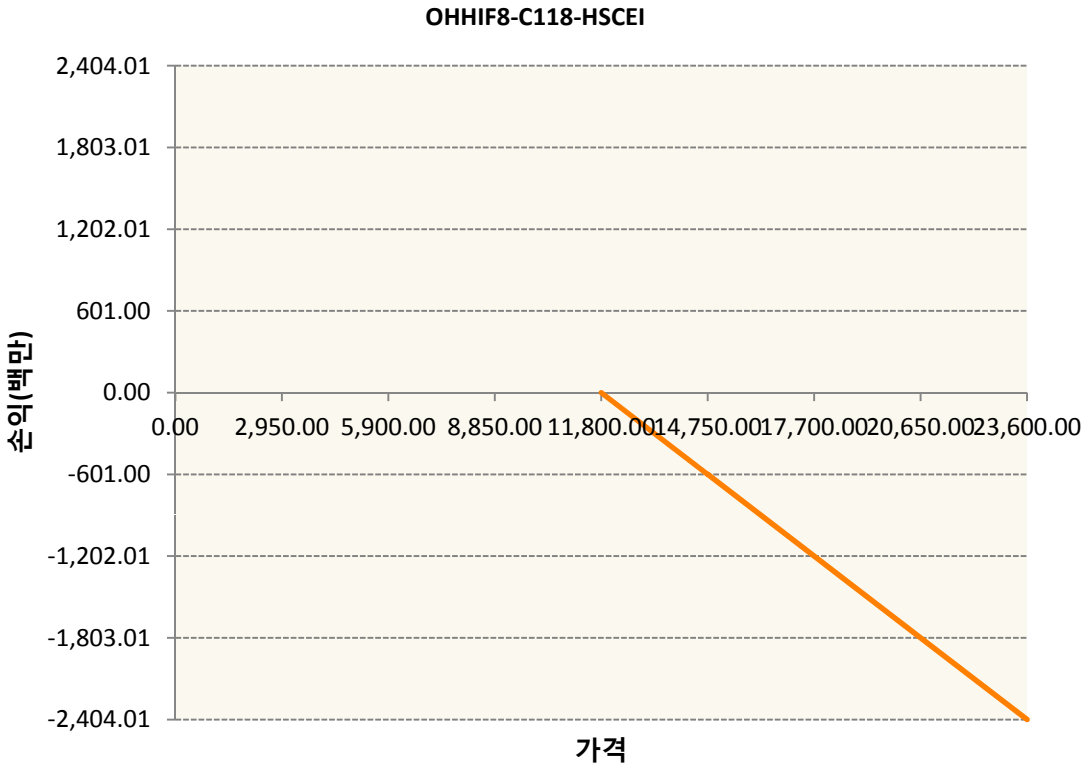
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	5,714	0	5,714	장내
누계	유가증권	옵션	0	11,898	-11,898	장내

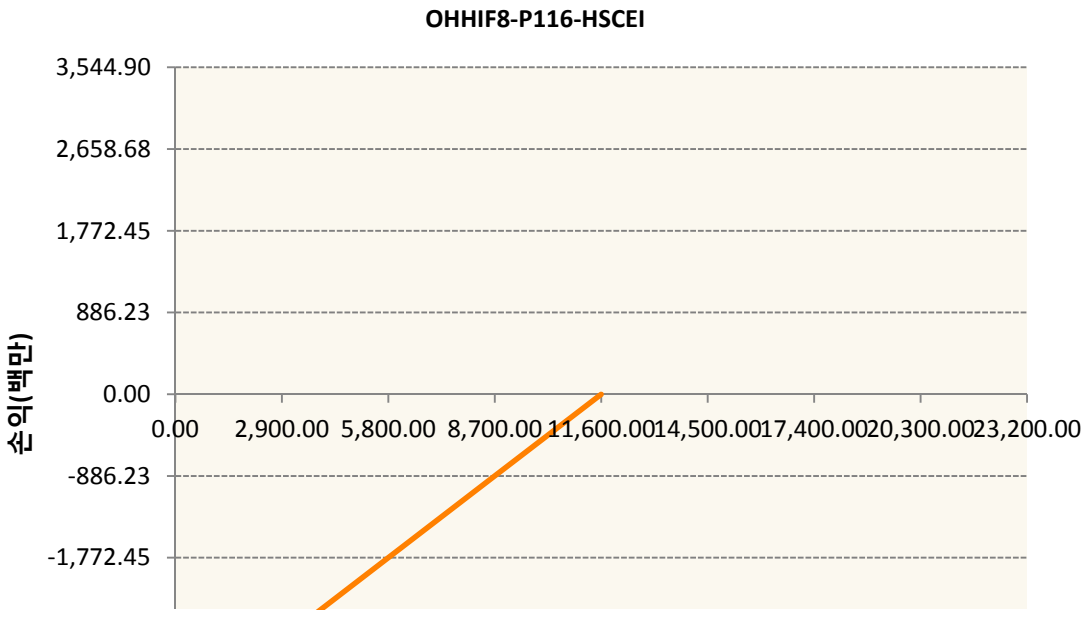
2. 만기시점의 손익구조

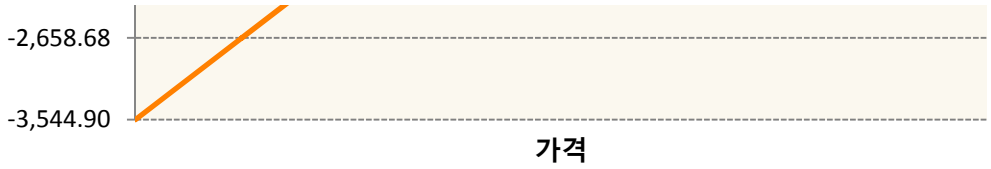


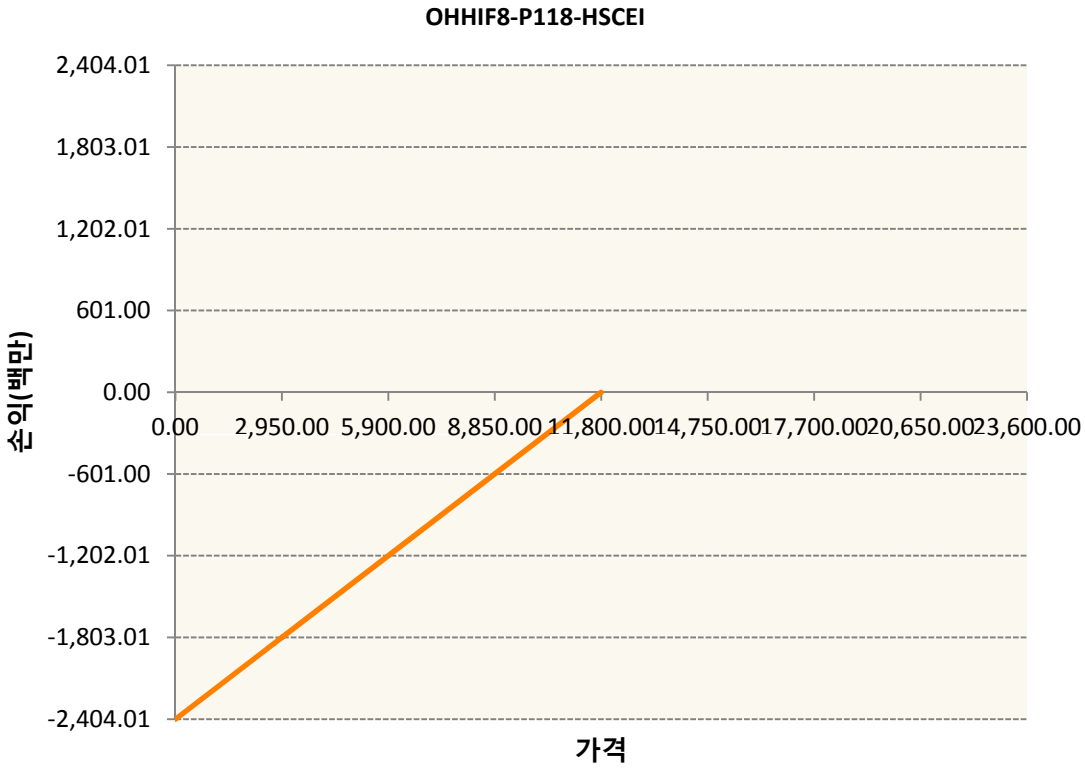



-886.23
-1,772.45
-2,658.68
-3,544.90
가격


OHHIF8-C118-HSCEI
2,404.01
1,803.01
1,202.01
601.00
0.00
-601.00
-1,202.01
-1,803.01
-2,404.01
0.00
2,950.00
5,900.00
8,850.00
11,800.00
14,750.00
17,700.00
20,650.00
23,600.00
손익(백만)
가격


OHHIF8-P116-HSCEI
3,544.90
2,658.68
1,772.45
886.23
0.00
-886.23
-1,772.45
0.00
2,900.00
5,800.00
8,700.00
11,600.00
14,500.00
17,400.00
20,300.00
23,200.00
손익(백만)





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

HCF8	H-SHARE IDX FUT JAN18	457
OHHIF8-C11	HSCEI	284
OHHIF8-C11	HSCEI	192
OHHIF8-P11	HSCEI	284
OHHIF8-P11	HSCEI	192

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

1,116

공시일	2018-01-16
기준일	2018-01-15

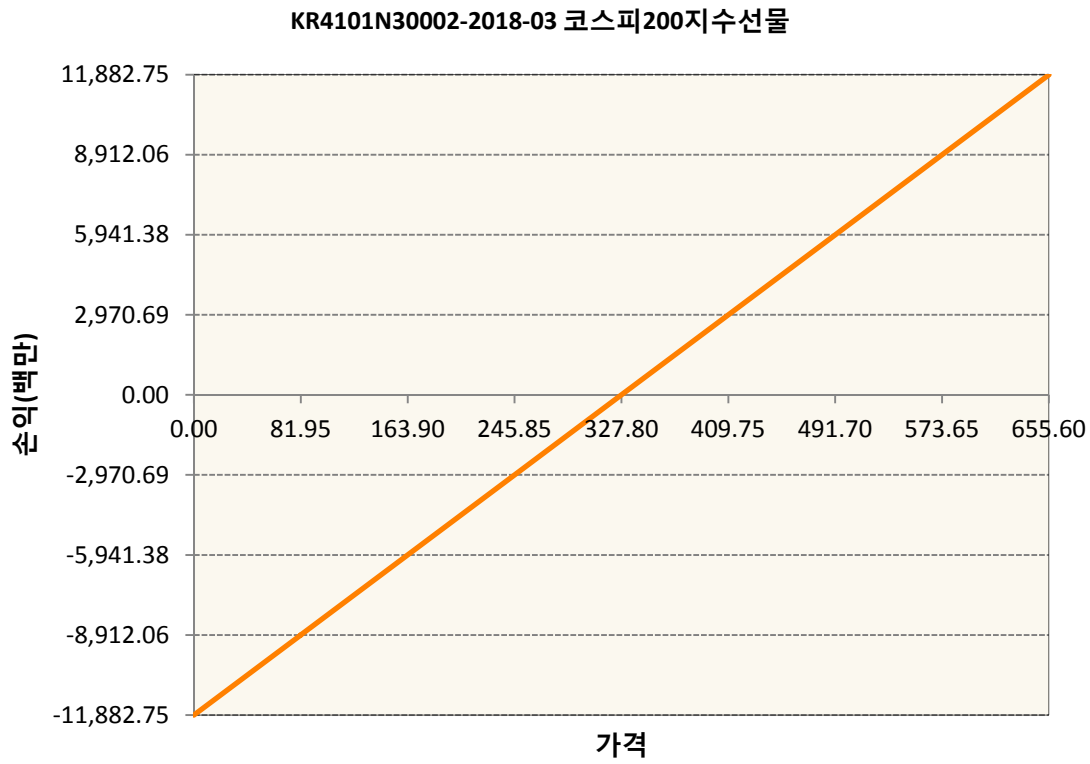
코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼

1. 계약금액

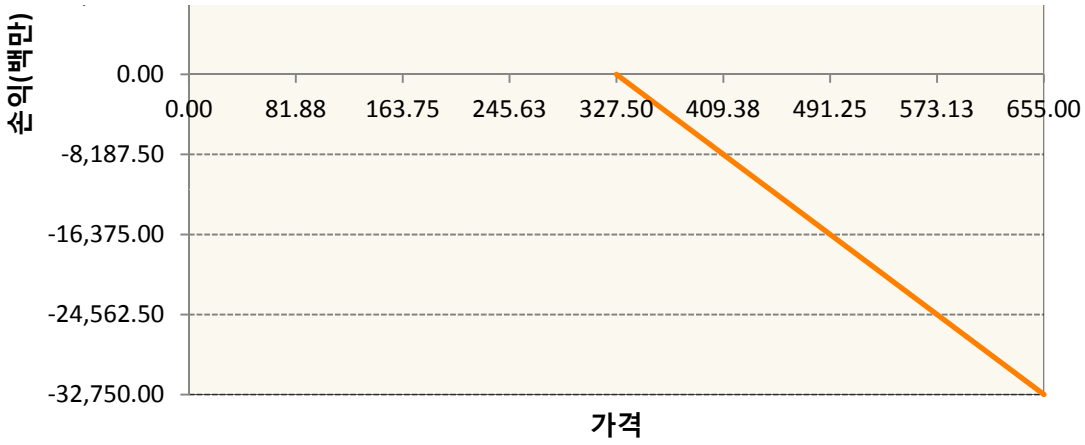
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	11,883	0	11,883	장내
누계	유가증권	스왑	60,200	0	60,200	장외
누계	유가증권	옵션	0	60,431	-60,431	장내

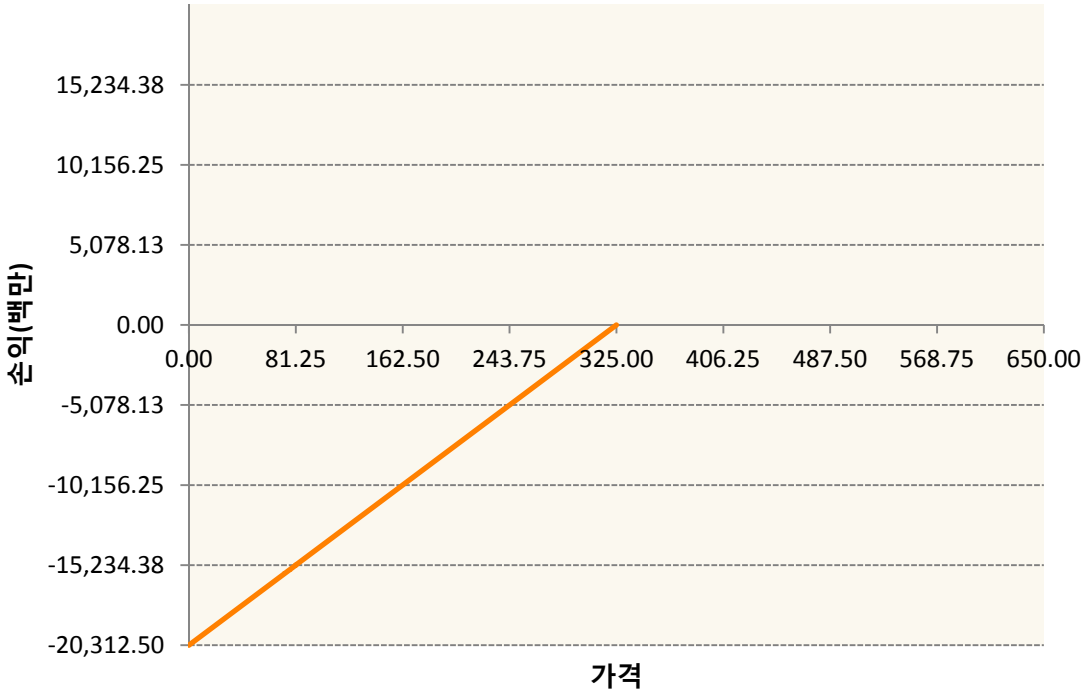
2. 만기시점의 손익구조



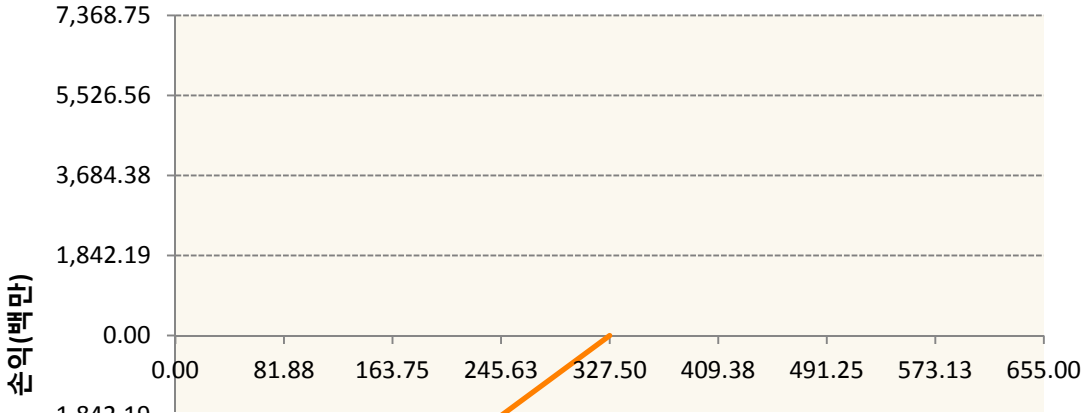




KR4301N23250-2018-02 풋325



KR4301N23276-2018-02 풋327.5





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_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							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_9						308
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-308	-308	-308	-308	-308	-308	-308
-5.33%	-205	-205	-205	-205	-205	-205	-205
-2.67%	-103	-103	-103	-103	-103	-103	-103
0%	0	0	0	0	0	0	0

2.67%	103	103	103	103	103	103	103
5.33%	205	205	205	205	205	205	205
8.00%	308	308	308	308	308	308	308
	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
	KR4101N30(	2018-03 코스피200지수선물					949
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-949	-949	-949	-949	-949	-949	-949
-5.33%	-633	-633	-633	-633	-633	-633	-633
-2.67%	-316	-316	-316	-316	-316	-316	-316
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	316	316	316	316	316	316	316
5.33%	633	633	633	633	633	633	633
8.00%	949	949	949	949	949	949	949
	KR4201N23:	2018-02 콜327.5					2,031

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	806	789	768	742	713	679	643
-5.33%	736	699	658	614	566	516	464
-2.67%	556	497	437	376	313	250	186
0%	206	137	69	0	-69	-137	-206
2.67%	-335	-395	-457	-520	-584	-649	-715
5.33%	-1,034	-1,075	-1,120	-1,168	-1,220	-1,274	-1,329
8.00%	-1,833	-1,854	-1,881	-1,913	-1,949	-1,988	-2,031
	KR4301N232 2018-02 풋325						1,313

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,308	-1,308	-1,308	-1,308	-1,309	-1,311	-1,313
-5.33%	-765	-767	-771	-776	-782	-789	-797
-2.67%	-264	-278	-293	-309	-325	-341	-358
0%	57	38	19	0	-19	-39	-58
2.67%	154	148	139	130	119	107	95
5.33%	166	165	164	161	158	154	150
8.00%	166	166	166	166	165	165	163
	KR4301N232 2018-02 풋327.5						503

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-502	-502	-502	-502	-502	-502	-503
-5.33%	-306	-306	-307	-308	-309	-311	-313
-2.67%	-118	-121	-125	-130	-135	-140	-145
0%	22	14	7	0	-7	-14	-22
2.67%	76	72	68	63	58	53	48
5.33%	85	84	83	82	80	78	75
8.00%	85	85	85	85	84	84	83

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

9,293

공시일	2018-01-16
기준일	2018-01-15

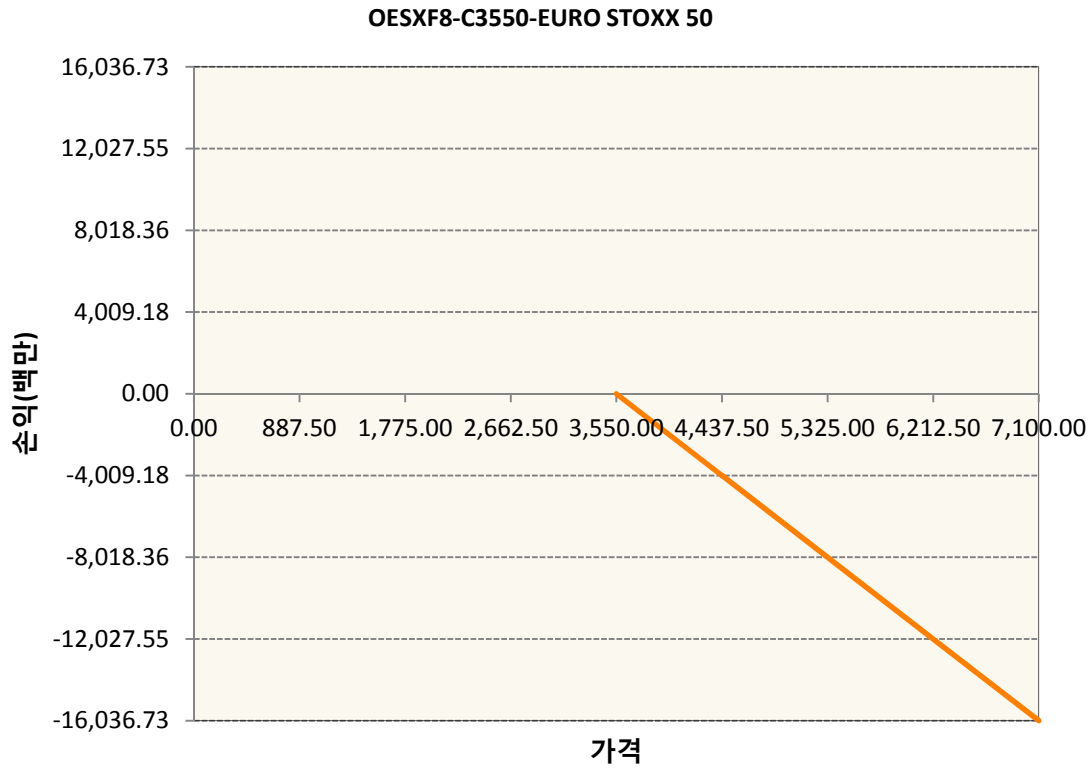
유로커버드콜모(주식혼합-파생형

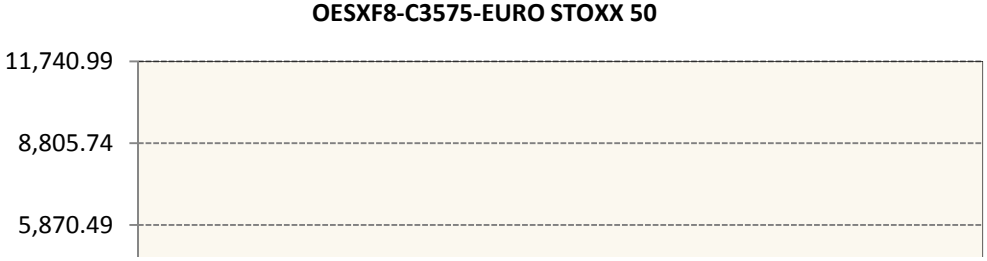
1. 계약금액

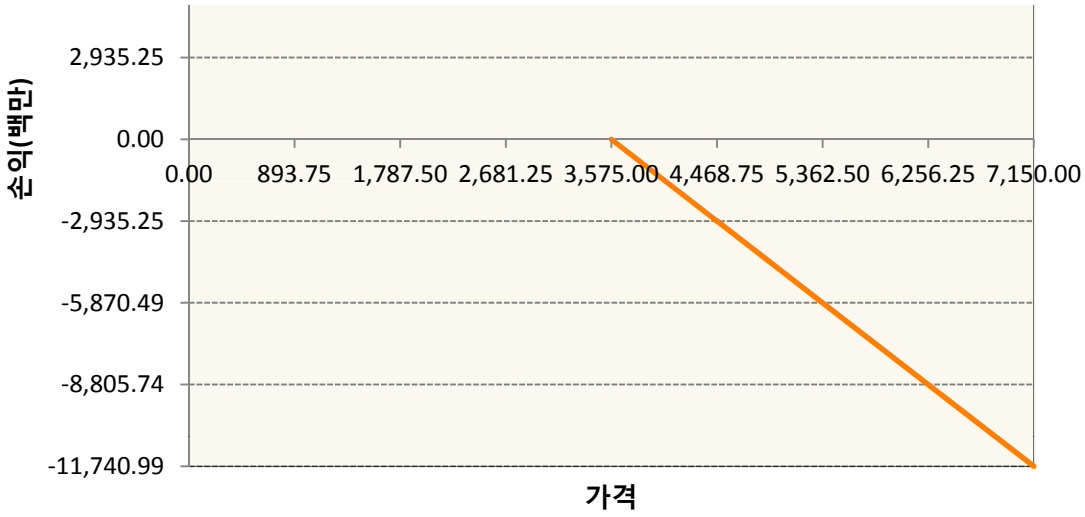
(단위:백만원)

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	19,358	0	19,358	
누계	유가증권	스왑	97,357	0	97,357	장외
누계	유가증권	옵션	0	55,555	-55,555	장내
누계	지수	스왑	51,924	0	51,924	장외

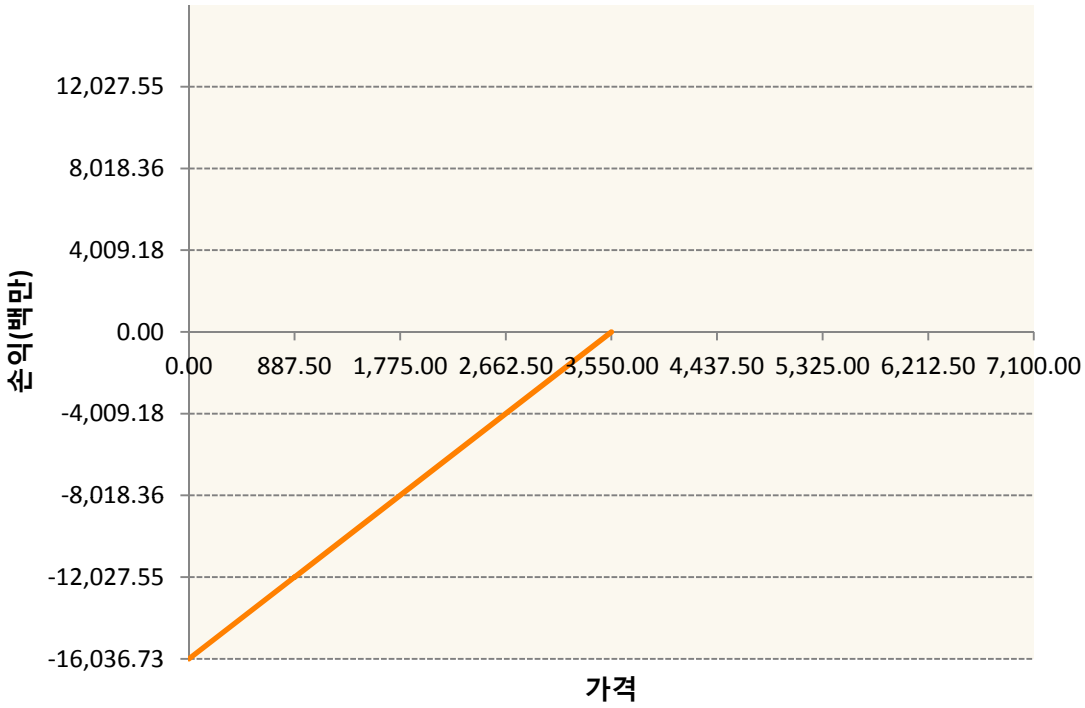
2. 만기시점의 손익구조



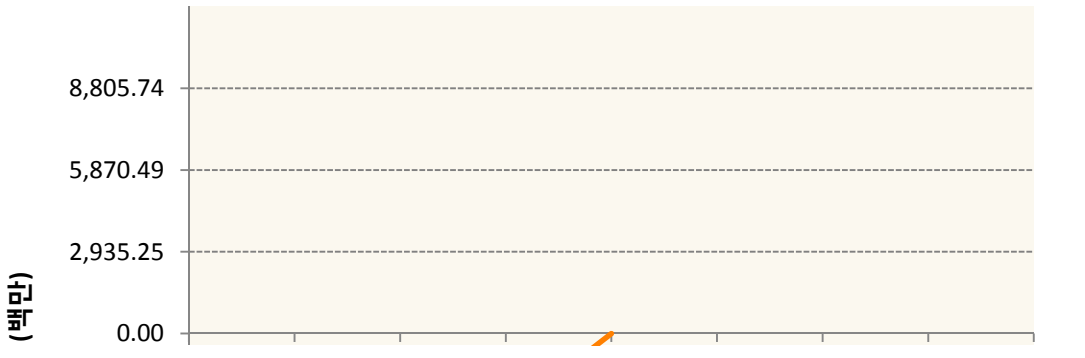


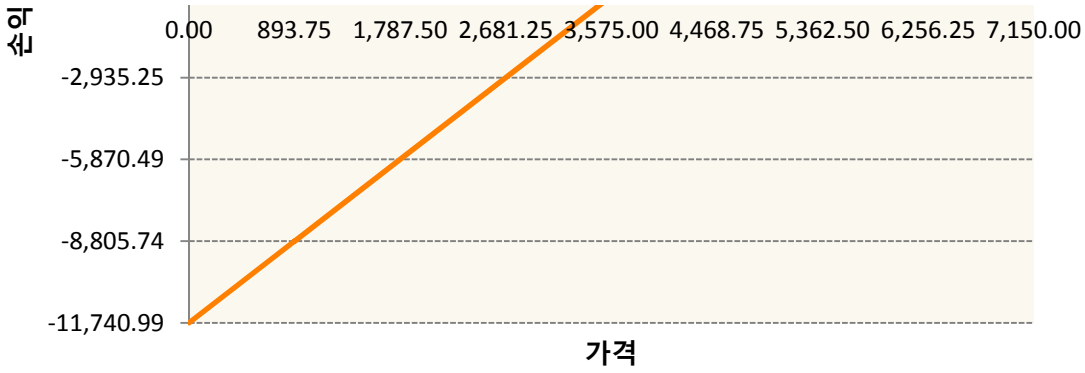


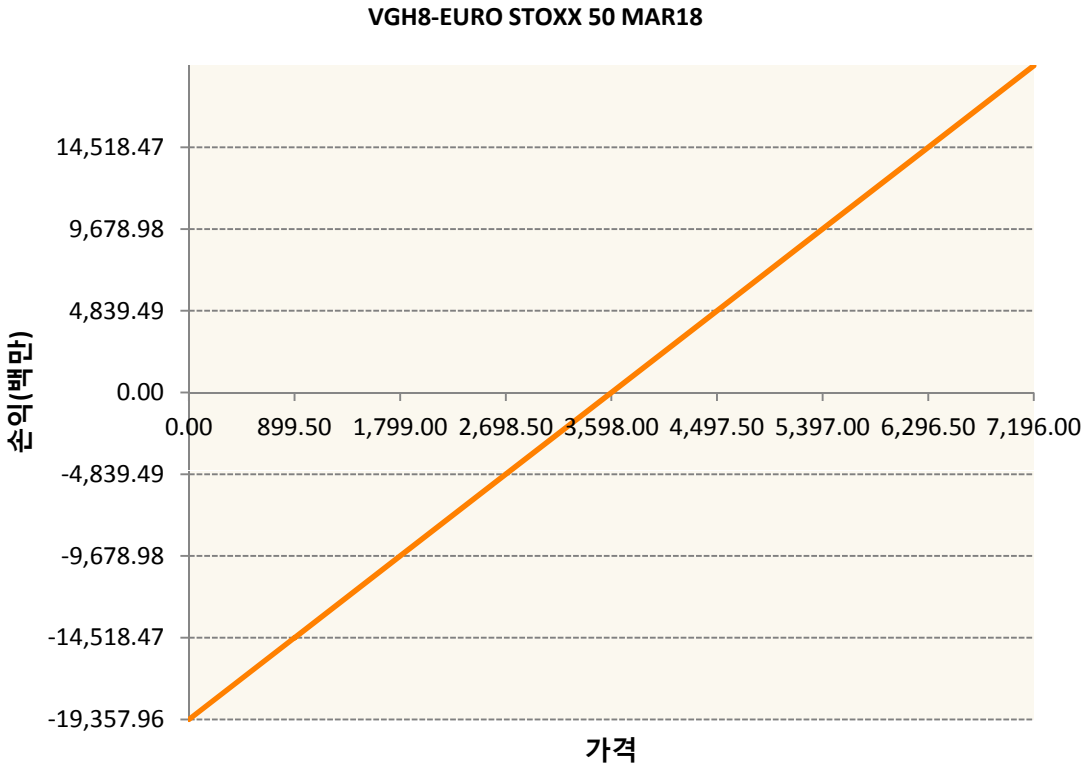
OESXF8-P3550-EURO STOXX 50



OESXF8-P3575-EURO STOXX 50







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)	(단위:백만원)
260105SGPX SG EURO Covered CALL STRATEGY - 994.569	106
260105SQPX SG EURO Covered CALL STRATEGY	154
OESXF8-C35 EURO STOXX 50	1,283
OESXF8-C35 EURO STOXX 50	939
OESXF8-P35 EURO STOXX 50	1,283
OESXF8-P35 EURO STOXX 50	939
VGH8 EURO STOXX 50 MAR18	1,549

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

3,508

공시일	2018-01-16
기준일	2018-01-15

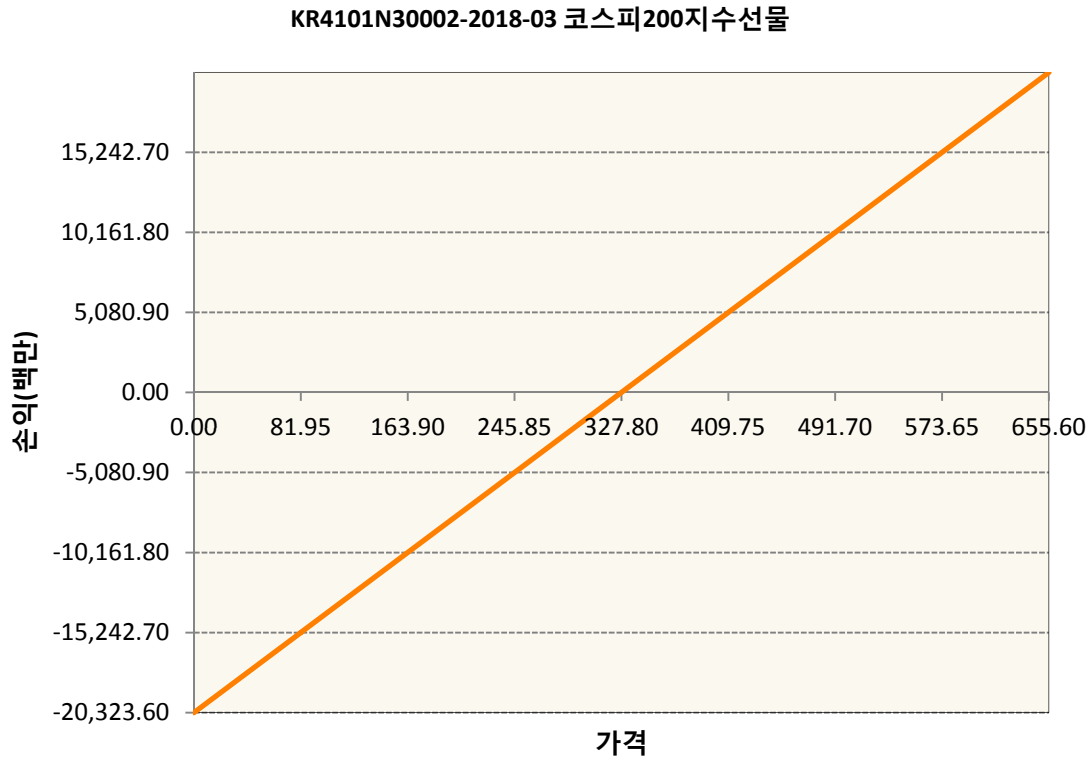
ETF스마트레버리지목표전환형8호

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	20,324	0	20,324	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101N30(2018-03 코스피200지수선물							1,624
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,624	-1,624	-1,624	-1,624	-1,624	-1,624	-1,624
-5.33%	-1,083	-1,083	-1,083	-1,083	-1,083	-1,083	-1,083
-2.67%	-541	-541	-541	-541	-541	-541	-541
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	541	541	541	541	541	541	541
5.33%	1,083	1,083	1,083	1,083	1,083	1,083	1,083
8.00%	1,624	1,624	1,624	1,624	1,624	1,624	1,624

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

973

공시일	2018-01-16
기준일	2018-01-15

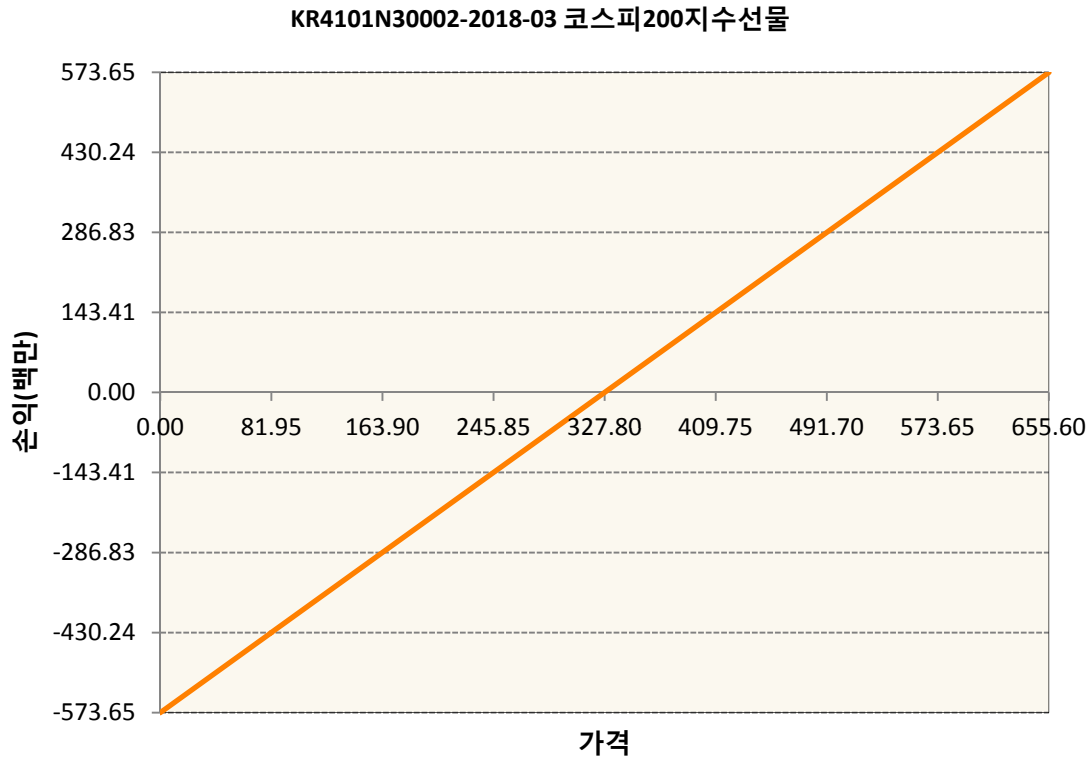
ETF스마트레버리지목표전환형9호

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	574	0	574	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101N30(2018-03 코스피200지수선물							46
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-46	-46	-46	-46	-46	-46	-46
-5.33%	-31	-31	-31	-31	-31	-31	-31
-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%	31	31	31	31	31	31	31
8.00%	46	46	46	46	46	46	46

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

27

공시일	2018-01-16
기준일	2018-01-15

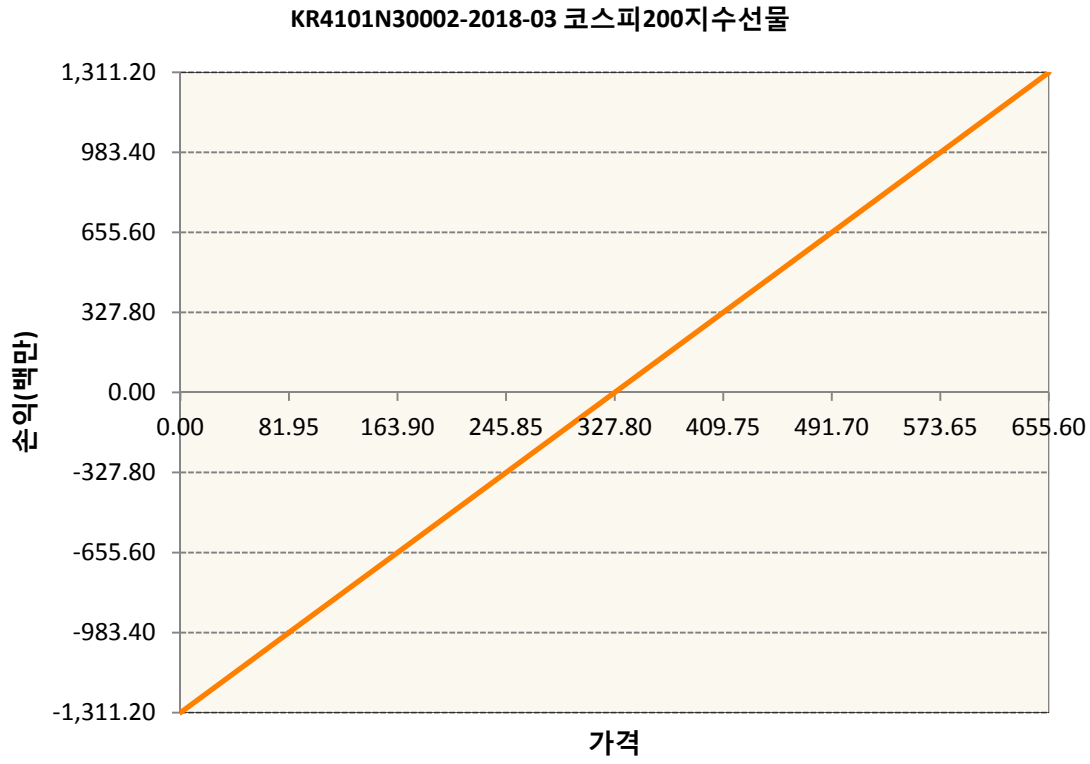
ETF스마트레버리지목표전환형10

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	1,311	0	1,311	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101N30(2018-03 코스피200지수선물							105
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-105	-105	-105	-105	-105	-105	-105
-5.33%	-70	-70	-70	-70	-70	-70	-70
-2.67%	-35	-35	-35	-35	-35	-35	-35
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	35	35	35	35	35	35	35
5.33%	70	70	70	70	70	70	70
8.00%	105	105	105	105	105	105	105

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

63

공시일	2018-01-16
기준일	2018-01-15

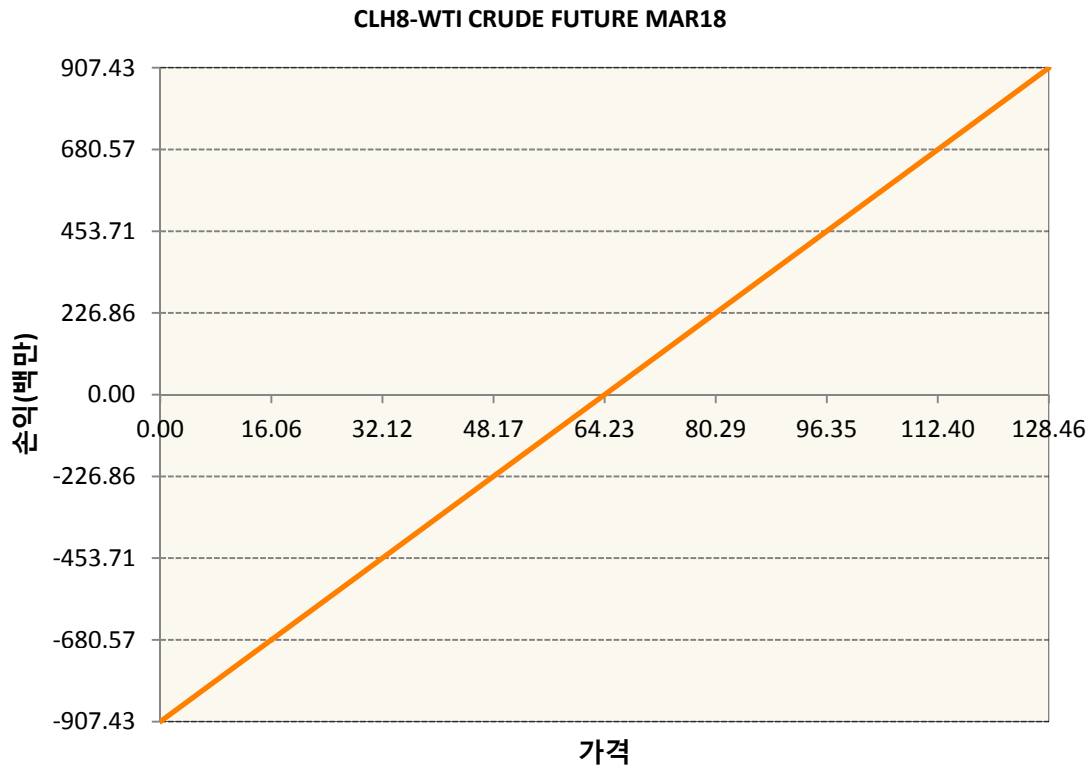
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

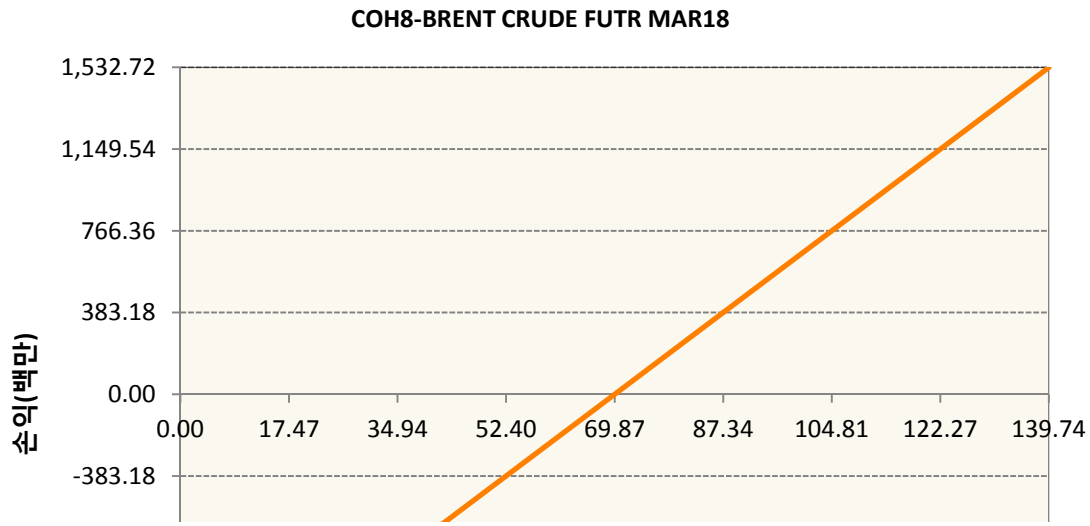
1. 계약금액

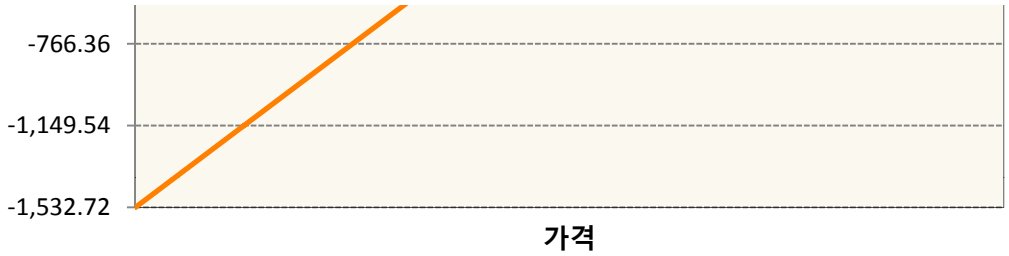
(단위:백만원)

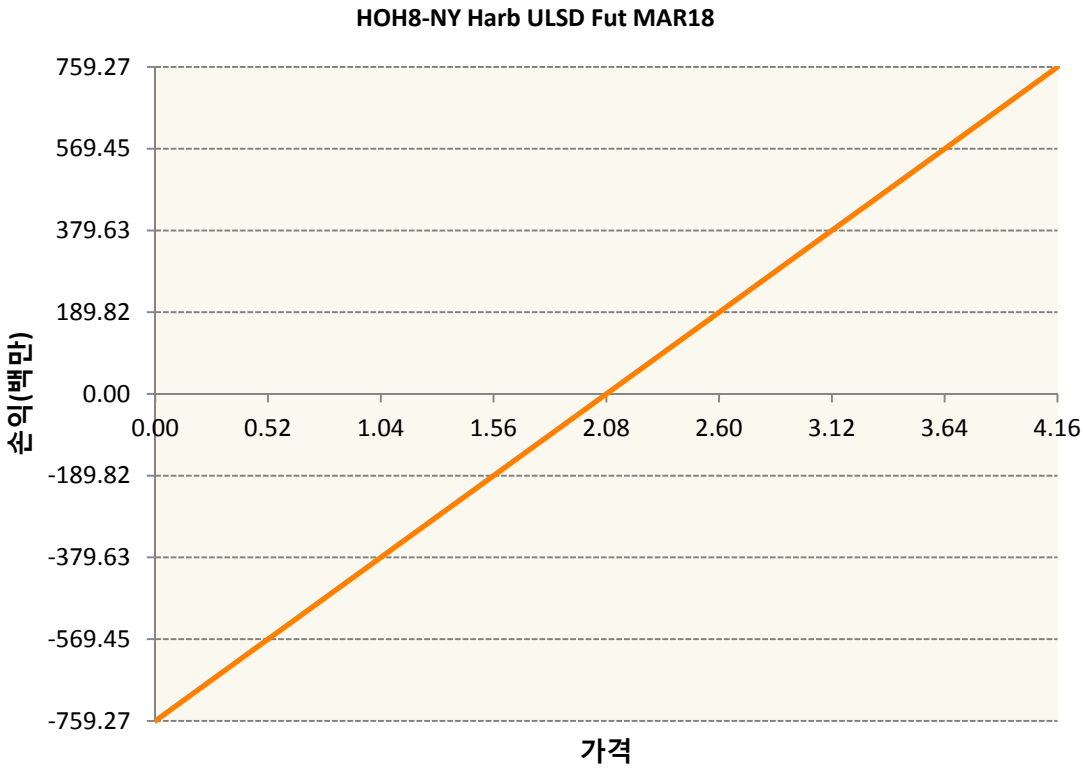
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	4,890	849	4,040	

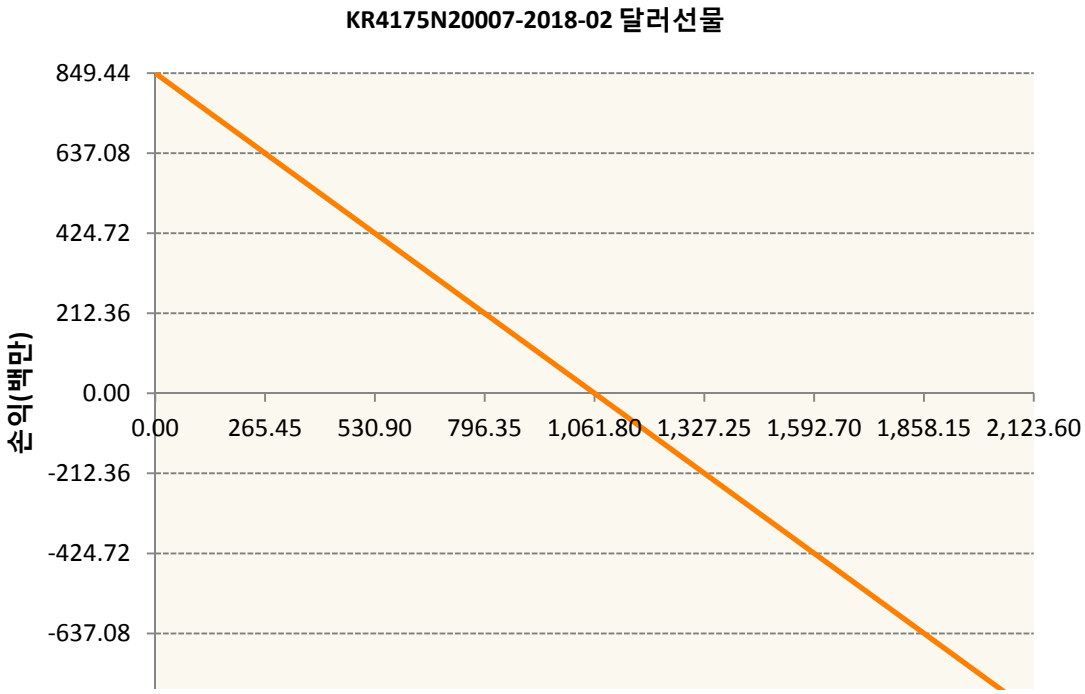
2. 만기시점의 손익구조

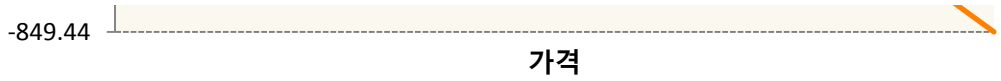


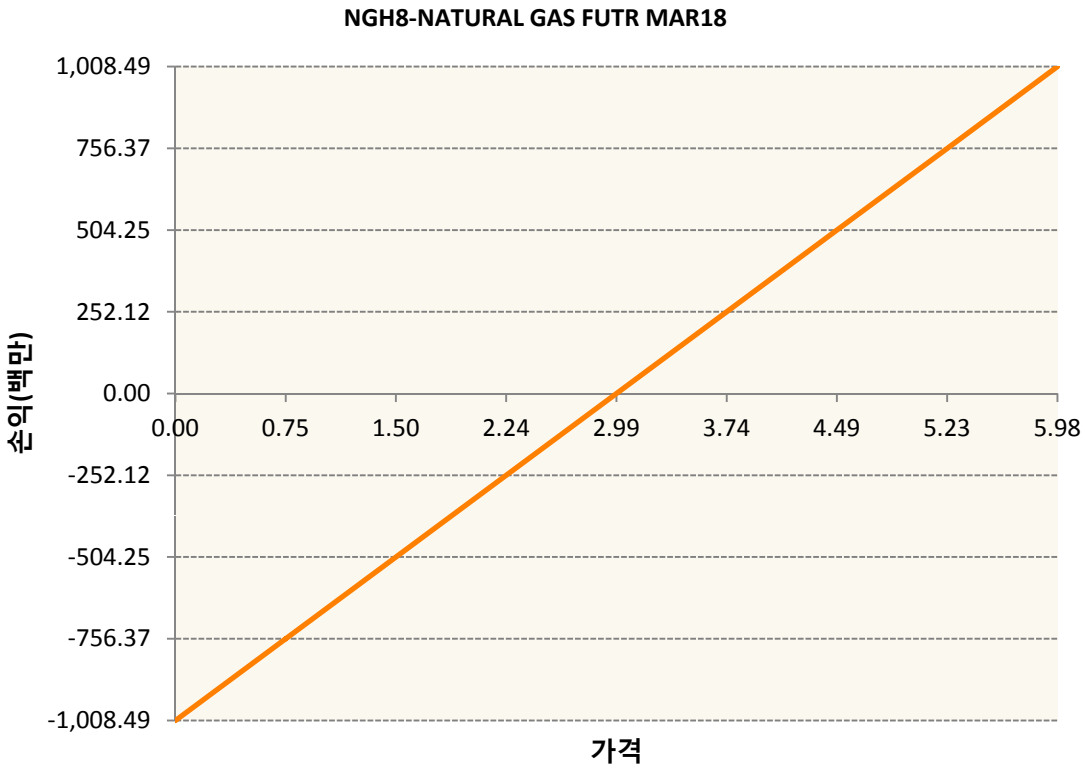


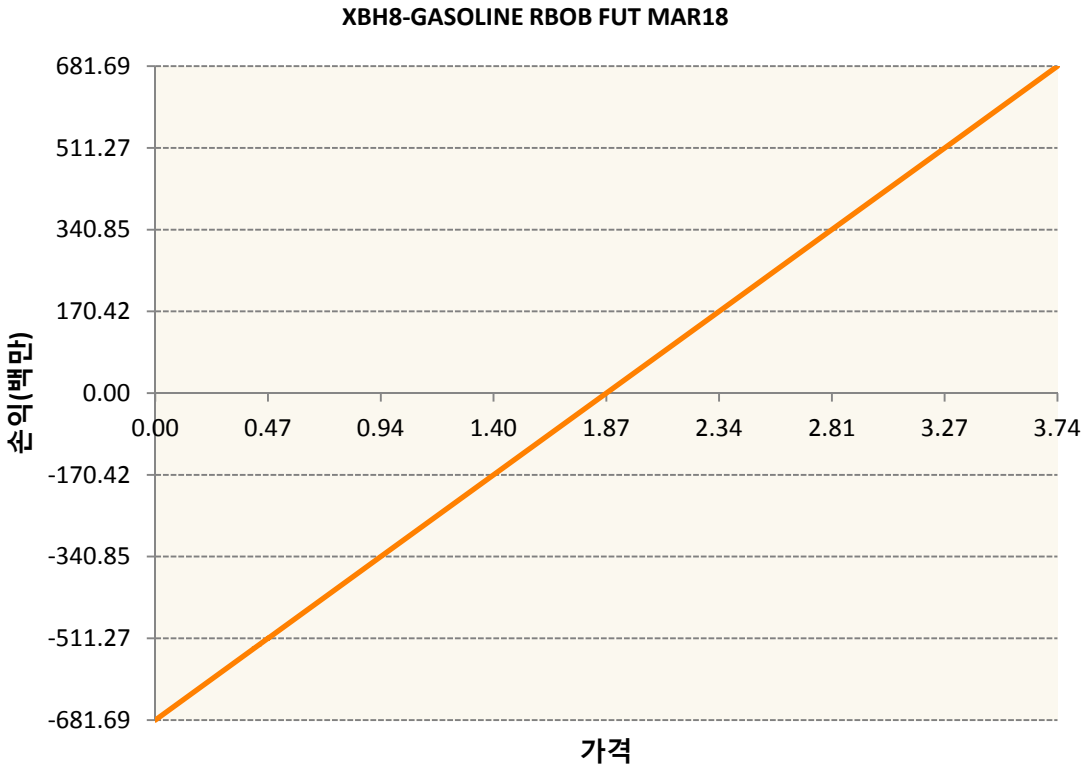

-766.36
-1,149.54
-1,532.72
가격


HOH8-NY Harb ULSD Fut MAR18
759.27
569.45
379.63
189.82
0.00
-189.82
-379.63
-569.45
-759.27
0.00
0.52
1.04
1.56
2.08
2.60
3.12
3.64
4.16
손익(백만)
가격


KR4175N20007-2018-02 달러선물
849.44
637.08
424.72
212.36
0.00
-212.36
-424.72
-637.08
0.00
265.45
530.90
796.35
1,061.80
1,327.25
1,592.70
1,858.15
2,123.60
손익(백만)


-849.44
가격


NGH8-NATURAL GAS FUTR MAR18
1,008.49
756.37
504.25
252.12
0.00
-252.12
-504.25
-756.37
-1,008.49
0.00
0.75
1.50
2.24
2.99
3.74
4.49
5.23
5.98
손익(백만)
가격


XBH8-GASOLINE RBOB FUT MAR18
681.69
511.27
340.85
170.42
0.00
-170.42
-340.85
-511.27
-681.69
0.00
0.47
0.94
1.40
1.87
2.34
2.81
3.27
3.74
손익(백만)
가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLH8	WTI CRUDE FUTURE MAR18	73
COH8	BRENT CRUDE FUTR MAR18	123
HOH8	NY Harb ULSD Fut MAR18	61
KR4175N20(	2018-02 달러선물	68
NGH8	NATURAL GAS FUTR MAR18	81
XBH8	GASOLINE RBOB FUT MAR18	55

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

644

공시일	2018-01-16
기준일	2018-01-15

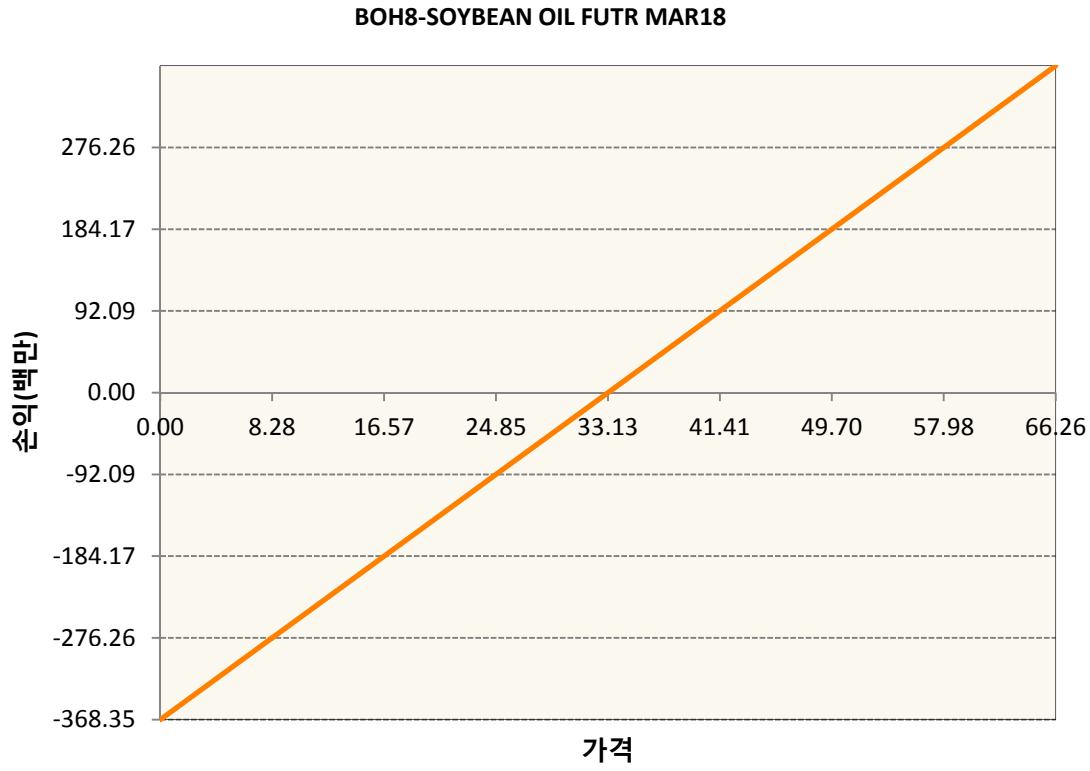
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

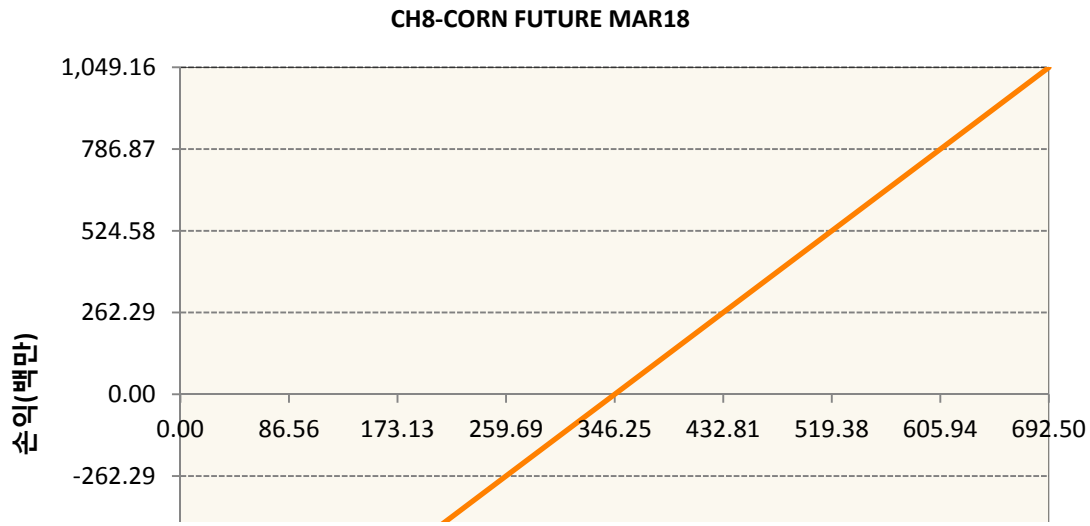
1. 계약금액

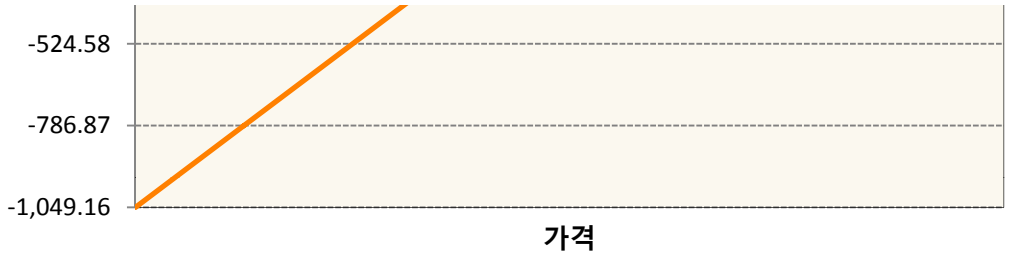
(단위:백만원)

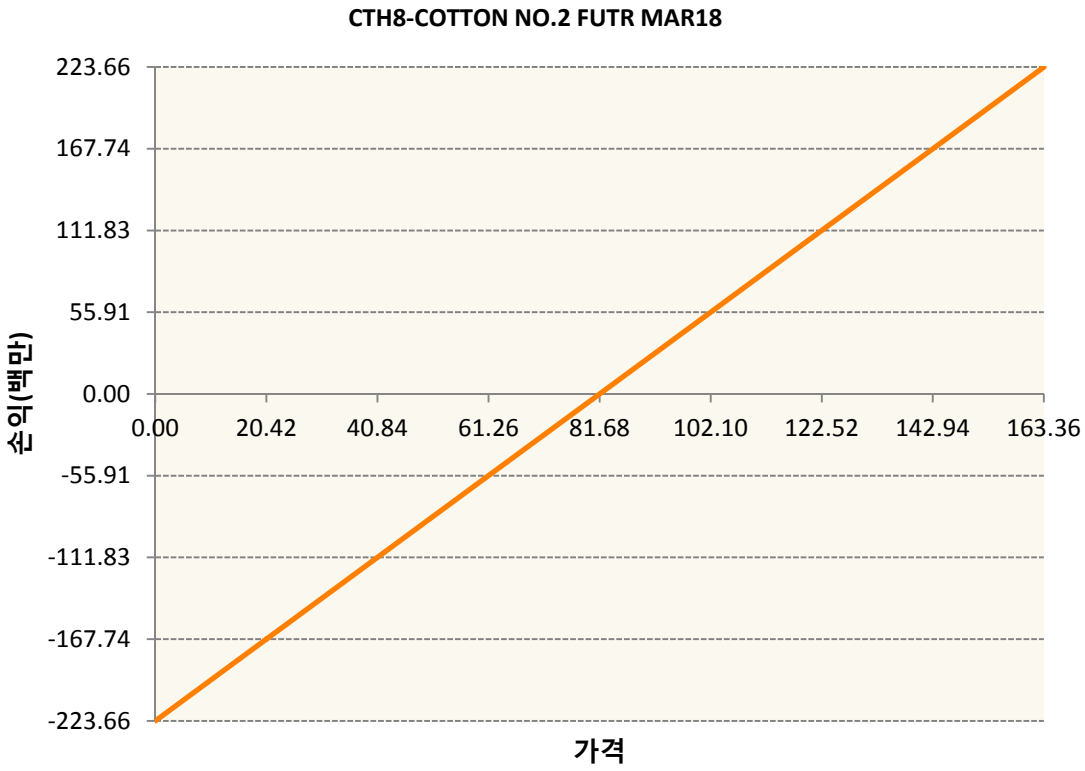
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	4,209	319	3,890	

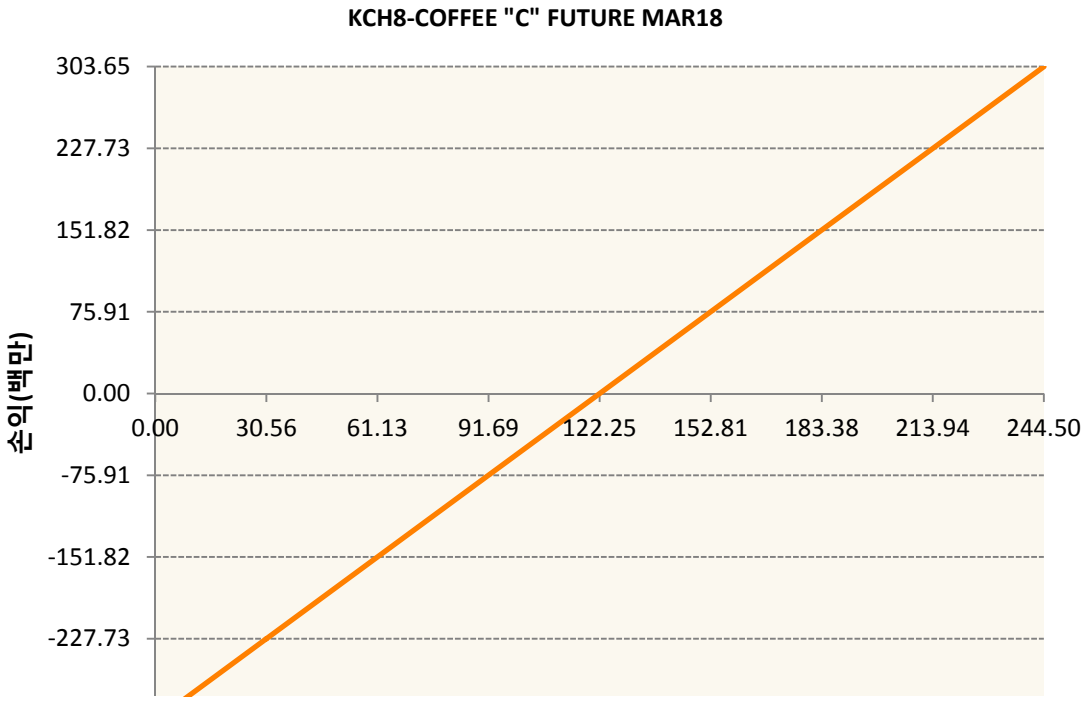
2. 만기시점의 손익구조

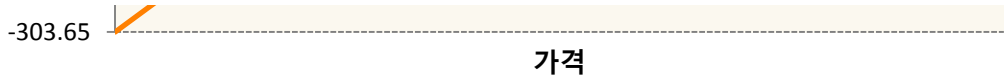


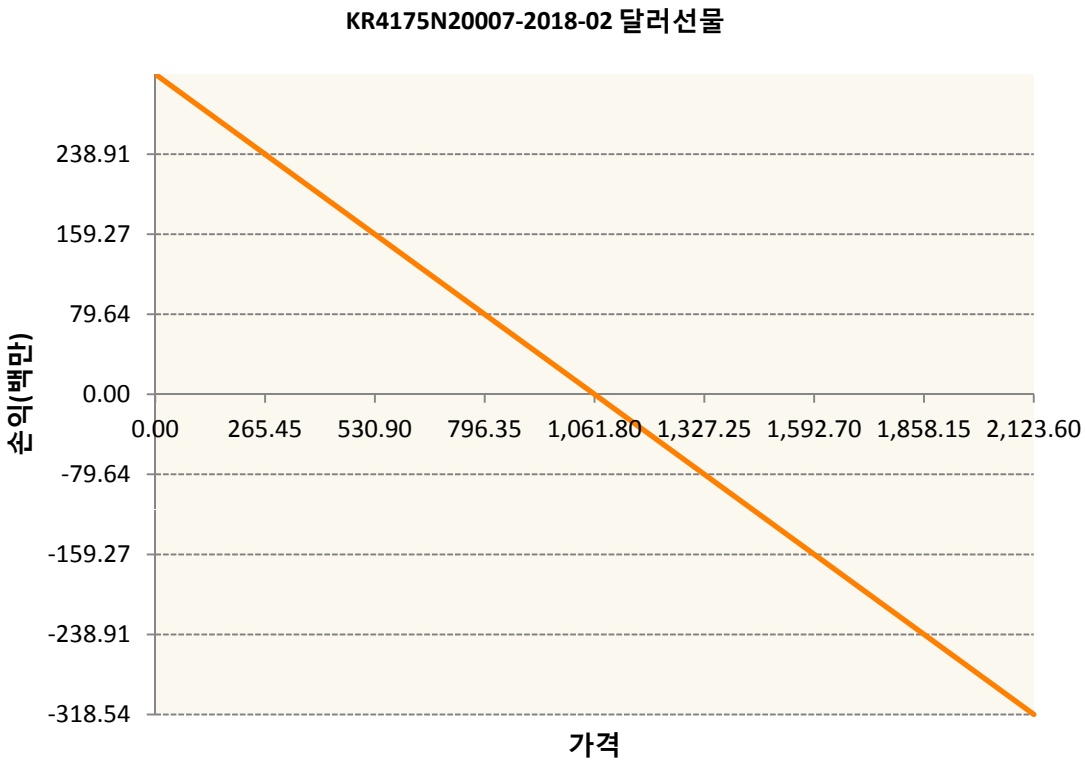


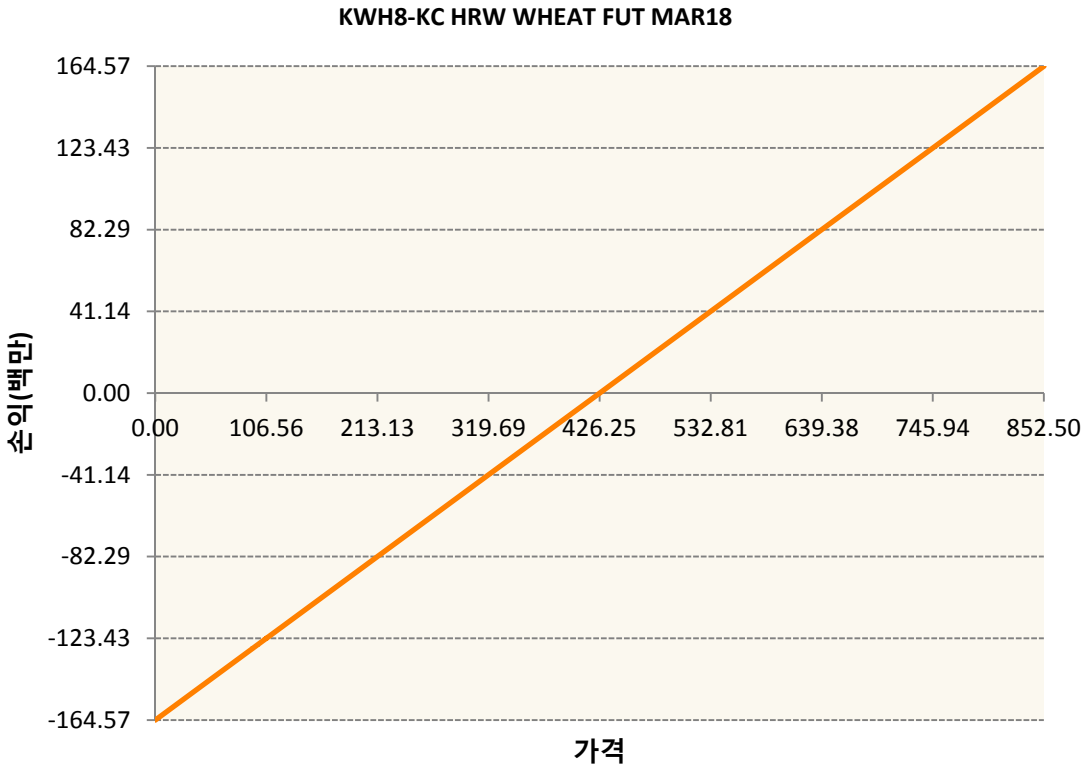

-524.58
-786.87
-1,049.16
가격


CTH8-COTTON NO.2 FUTR MAR18
223.66
167.74
111.83
55.91
0.00
-55.91
-111.83
-167.74
-223.66
0.00
20.42
40.84
61.26
81.68
102.10
122.52
142.94
163.36
손익(백만)
가격

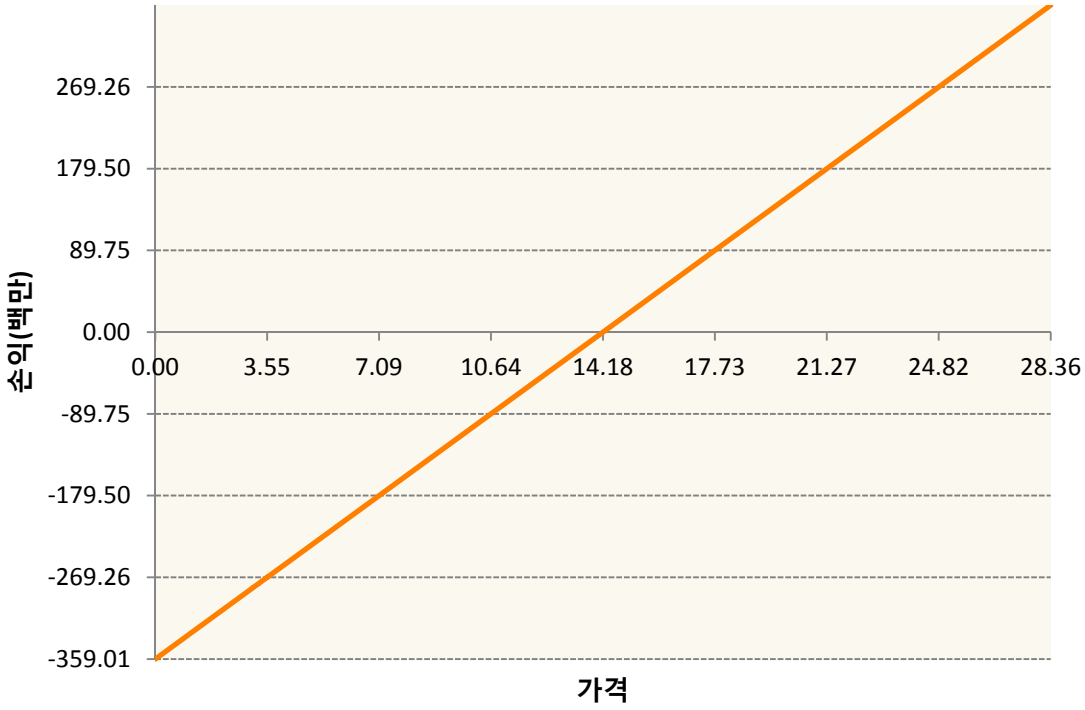

KCH8-COFFEE "C" FUTURE MAR18
303.65
227.73
151.82
75.91
0.00
-75.91
-151.82
-227.73
0.00
30.56
61.13
91.69
122.25
152.81
183.38
213.94
244.50
손익(백만)


-303.65
가격

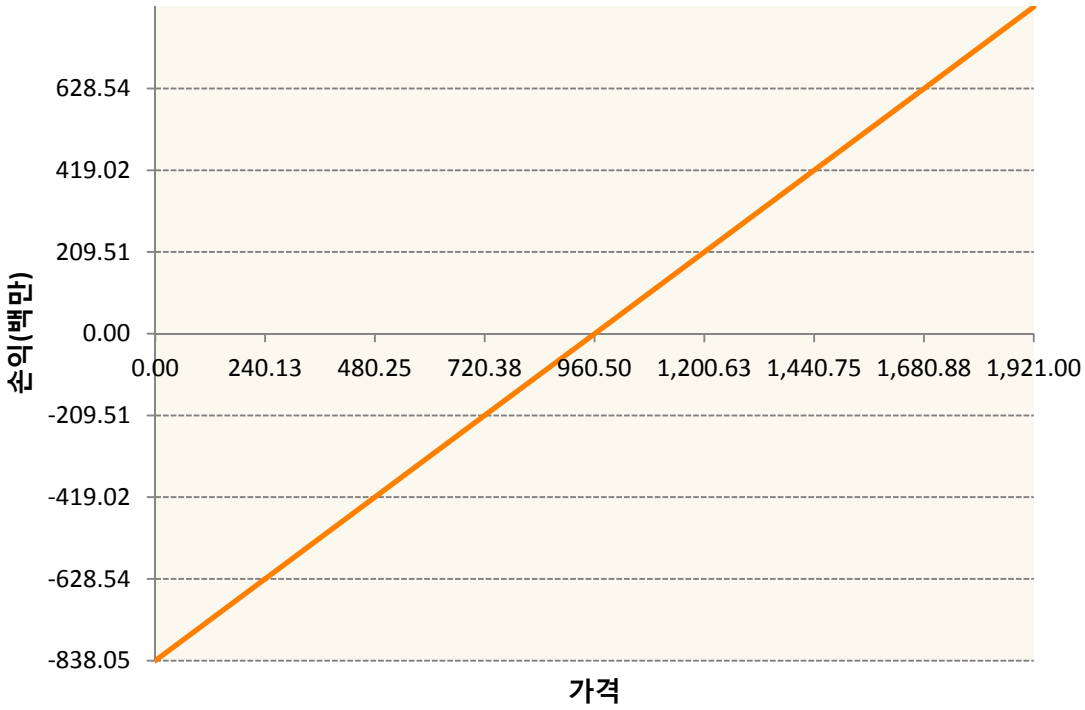

KR4175N20007-2018-02 달러선물
238.91
159.27
79.64
0.00
-79.64
-159.27
-238.91
-318.54
0.00
265.45
530.90
796.35
1,061.80
1,327.25
1,592.70
1,858.15
2,123.60
손익(백만)
가격


KWH8-KC HRW WHEAT FUT MAR18
164.57
123.43
82.29
41.14
0.00
-41.14
-82.29
-123.43
-164.57
0.00
106.56
213.13
319.69
426.25
532.81
639.38
745.94
852.50
손익(백만)
가격

SBH8-Sugar #11 (WORLD) MAR18

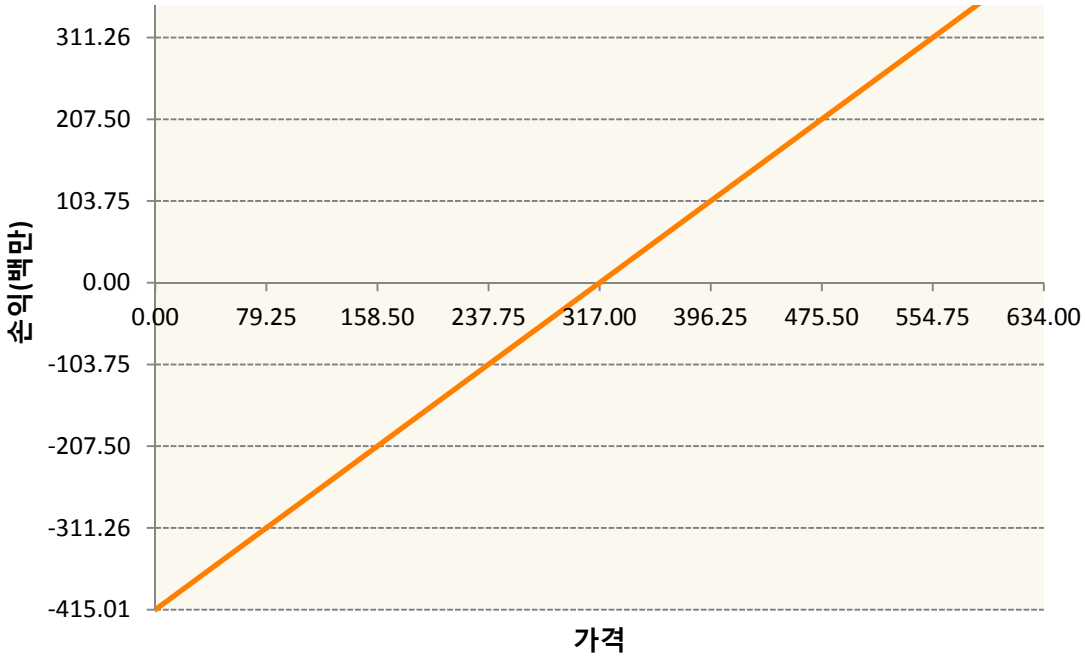


SH8-SOYBEAN FUTURE MAR18

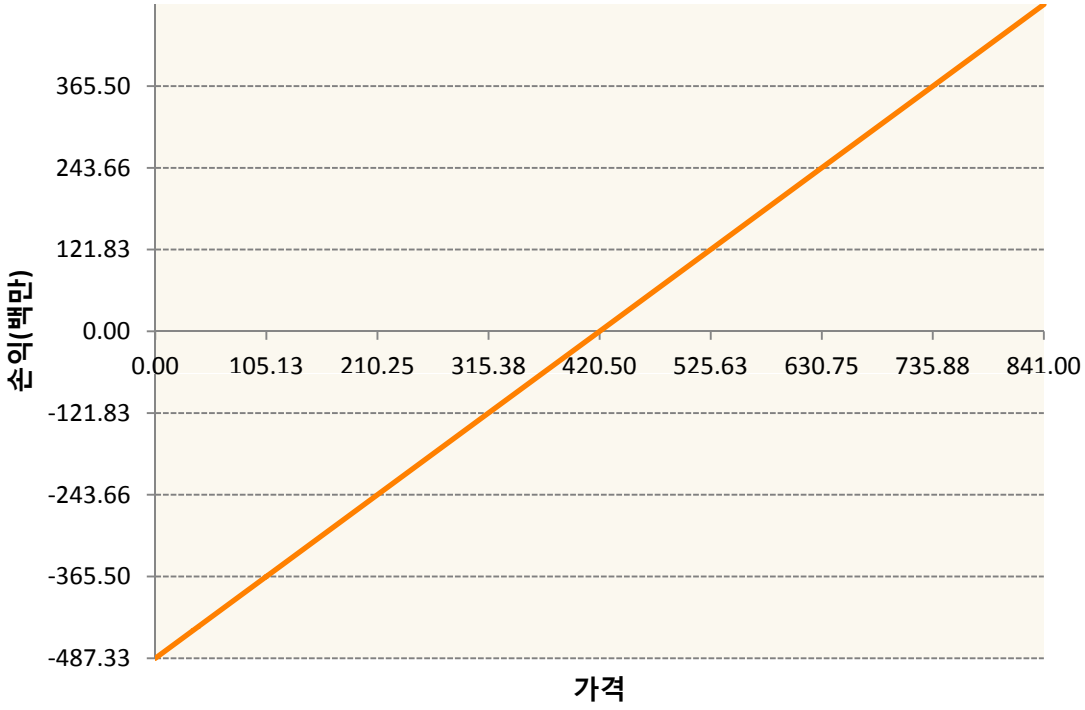


SMH8-SOYBEAN MEAL FUTR MAR18





WH8-WHEAT FUTURE(CBT) MAR18



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

BOH8	SOYBEAN OIL FUTR MAR18	29
CH8	CORN FUTURE MAR18	84
CTH8	COTTON NO.2 FUTR MAR18	18
KCH8	COFFEE "C" FUTURE MAR18	24
KR4175N20(	2018-02 달러선물	25

KWH8	KC HRW WHEAT FUT MAR18	13
SBH8	Sugar #11 (WORLD) MAR18	29
SH8	SOYBEAN FUTURE MAR18	67
SMH8	SOYBEAN MEAL FUTR MAR18	33
WH8	WHEAT FUTURE(CBT) MAR18	39

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

350