공시일	2018-01-17
기준일	2018-01-16

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	2018-01-17
기준일	2018-01-16

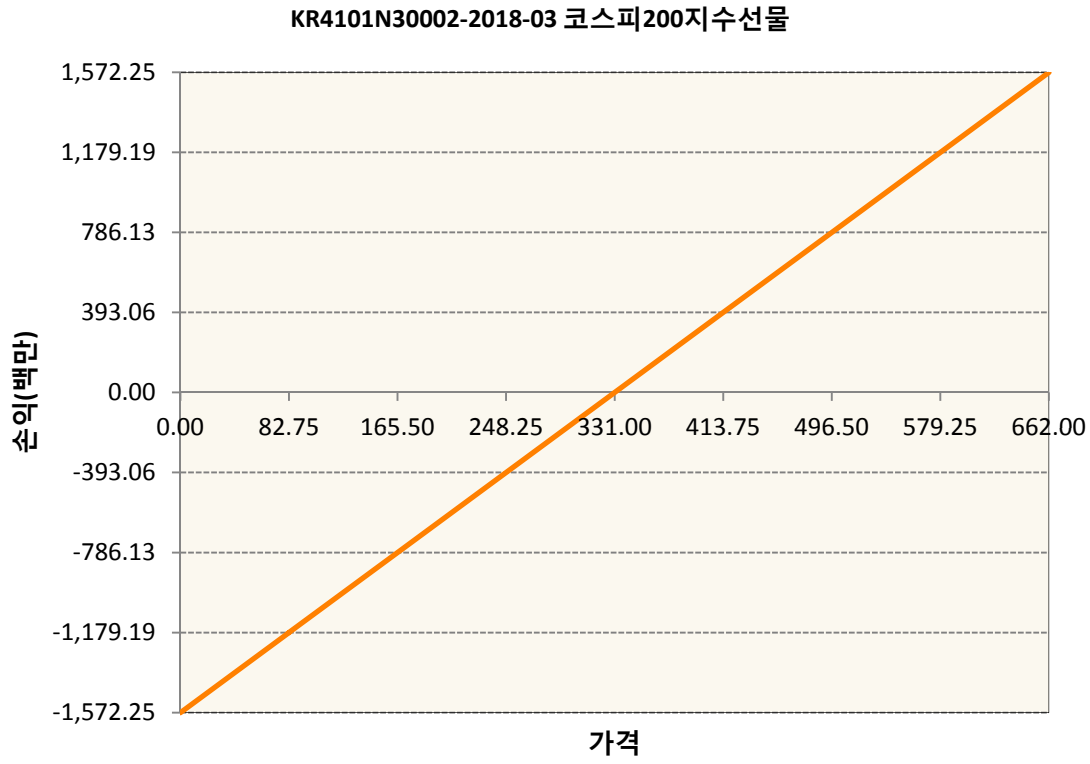
스마트인덱스모

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	1,572	0	1,572	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101N30(2018-03 코스피200지수선물							125
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-125	-125	-125	-125	-125	-125	-125
-5.33%	-84	-84	-84	-84	-84	-84	-84
-2.67%	-42	-42	-42	-42	-42	-42	-42
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	42	42	42	42	42	42	42
5.33%	84	84	84	84	84	84	84
8.00%	125	125	125	125	125	125	125

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

75

공시일	2018-01-17
기준일	2018-01-16

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	1,147

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

368

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2018-01-17
기준일	2018-01-16

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	413

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

374

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2018-01-17
기준일	2018-01-16

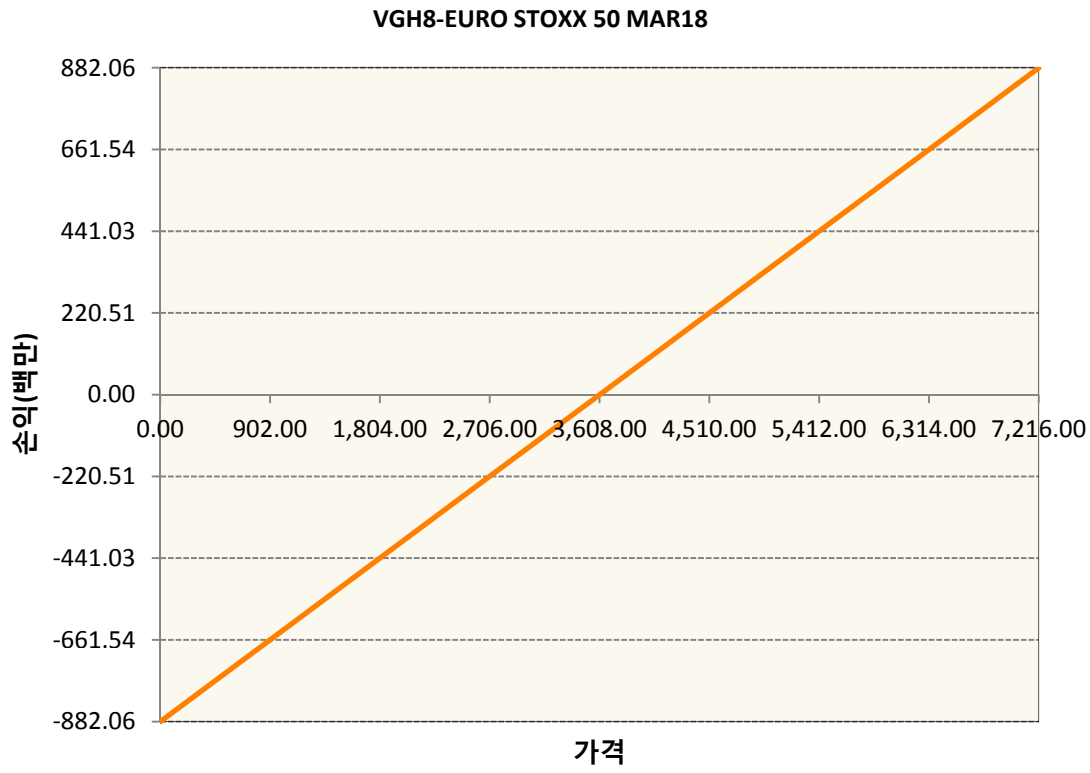
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	882	0	882	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGH8	EURO STOXX 50 MAR18	71

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

(단위:백만원)

40

공시일	2018-01-17
기준일	2018-01-16

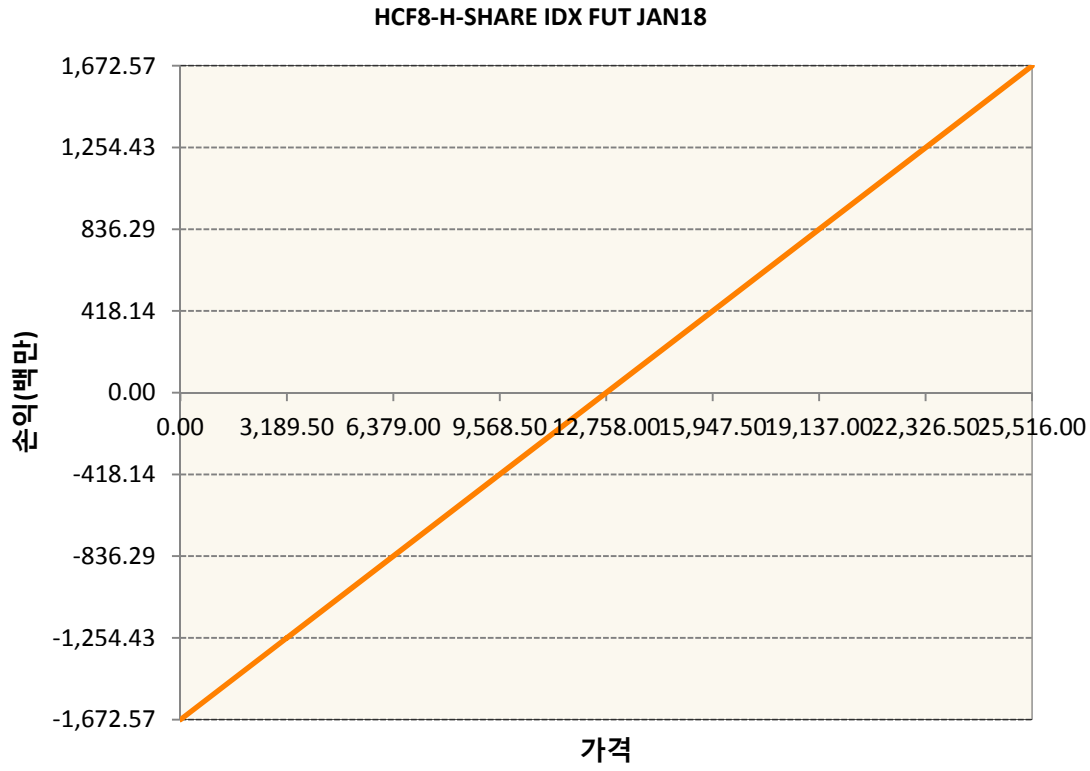
차이나인덱스모(주식-파생형)

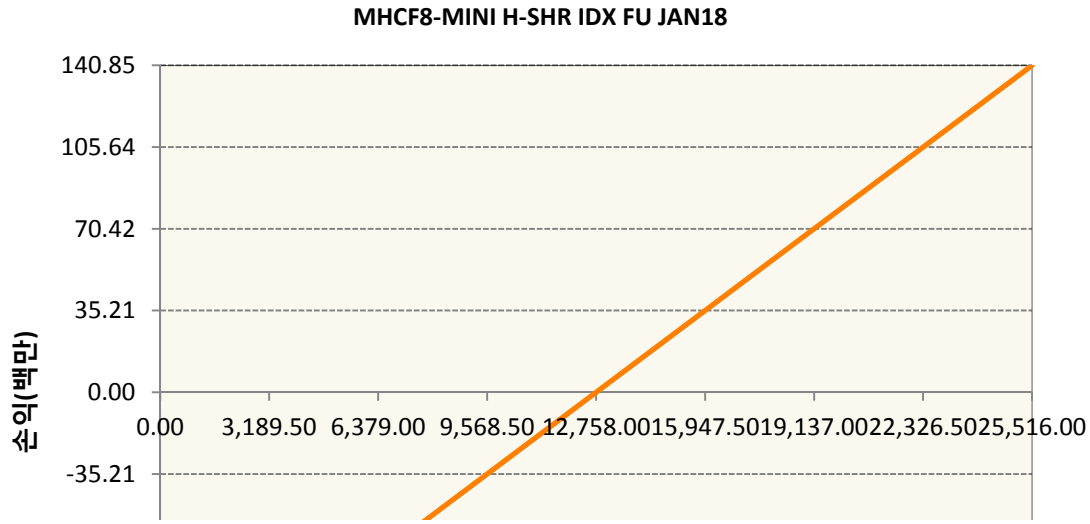
1. 계약금액

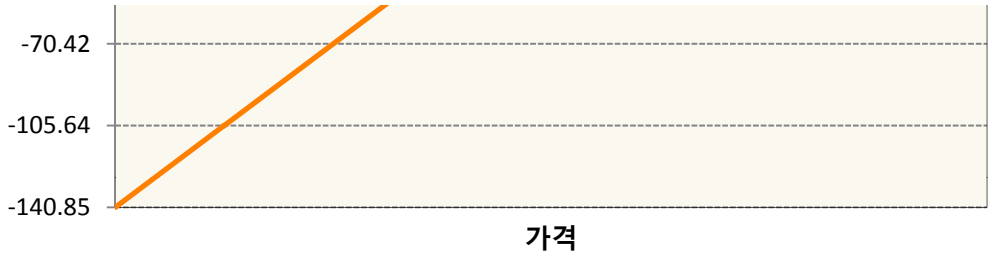
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,813	0	1,813	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCF8	H-SHARE IDX FUT JAN18	134
MHCF8	MINI H-SHR IDX FU JAN18	11

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	115

공시일	2018-01-17
기준일	2018-01-16

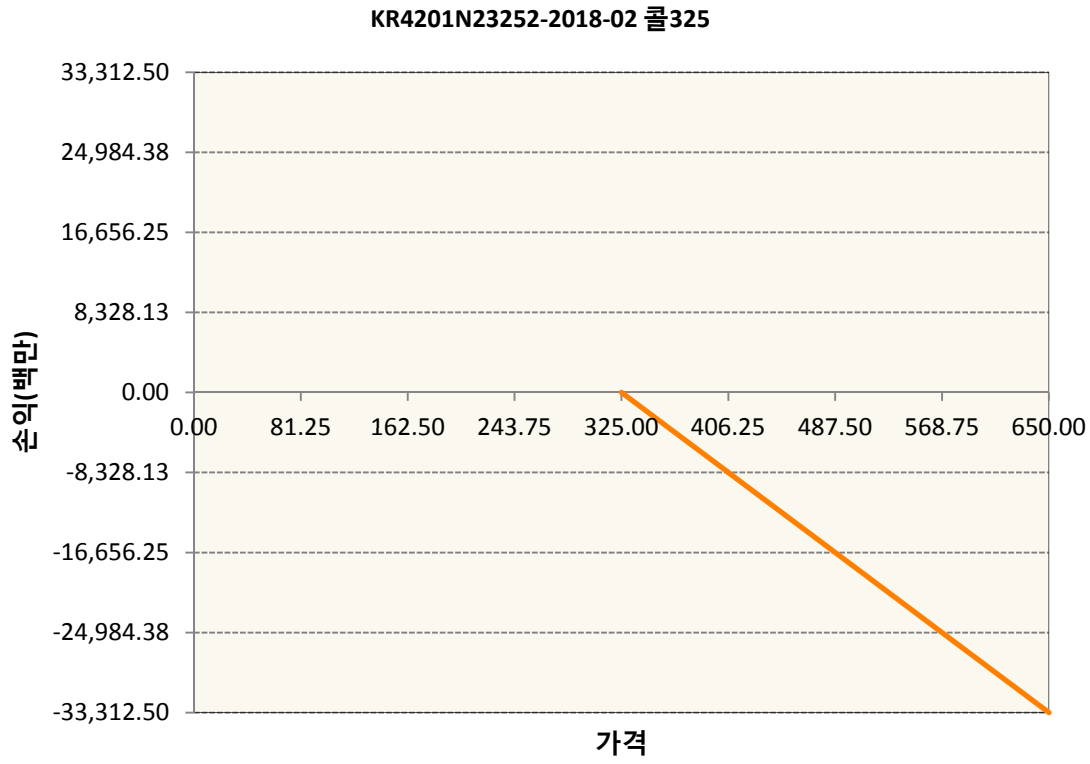
커버드콜모(주식혼합-파생형)

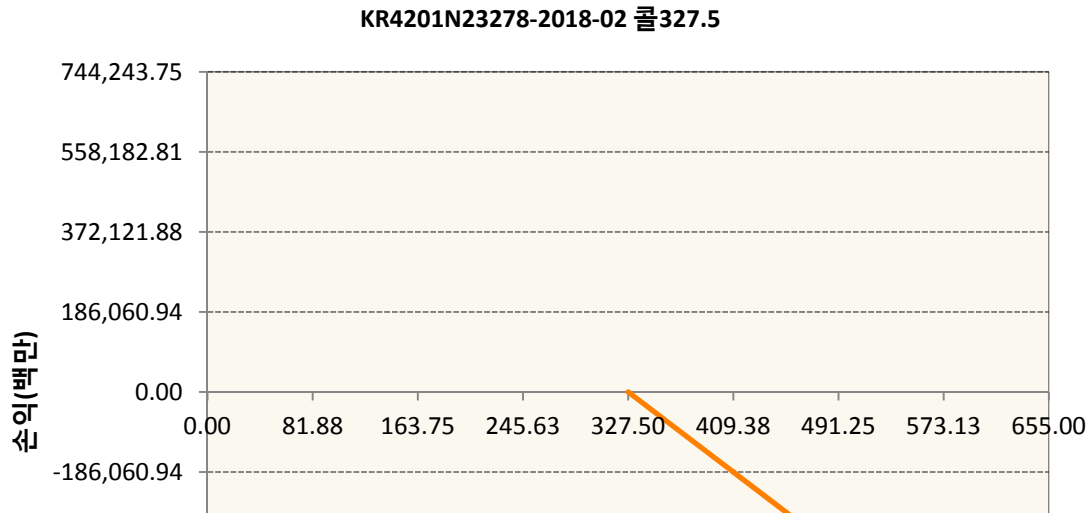
1. 계약금액

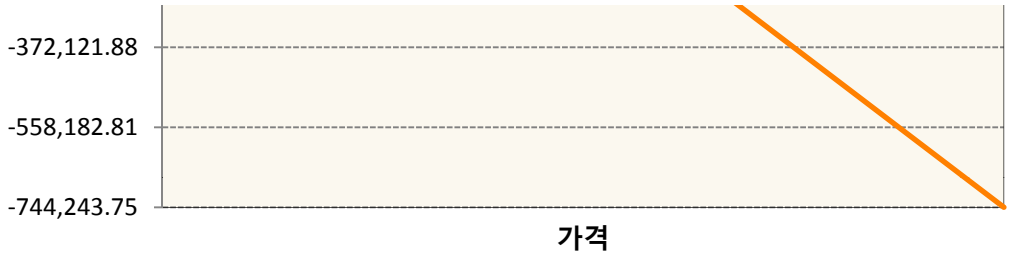
(단위:백만원)

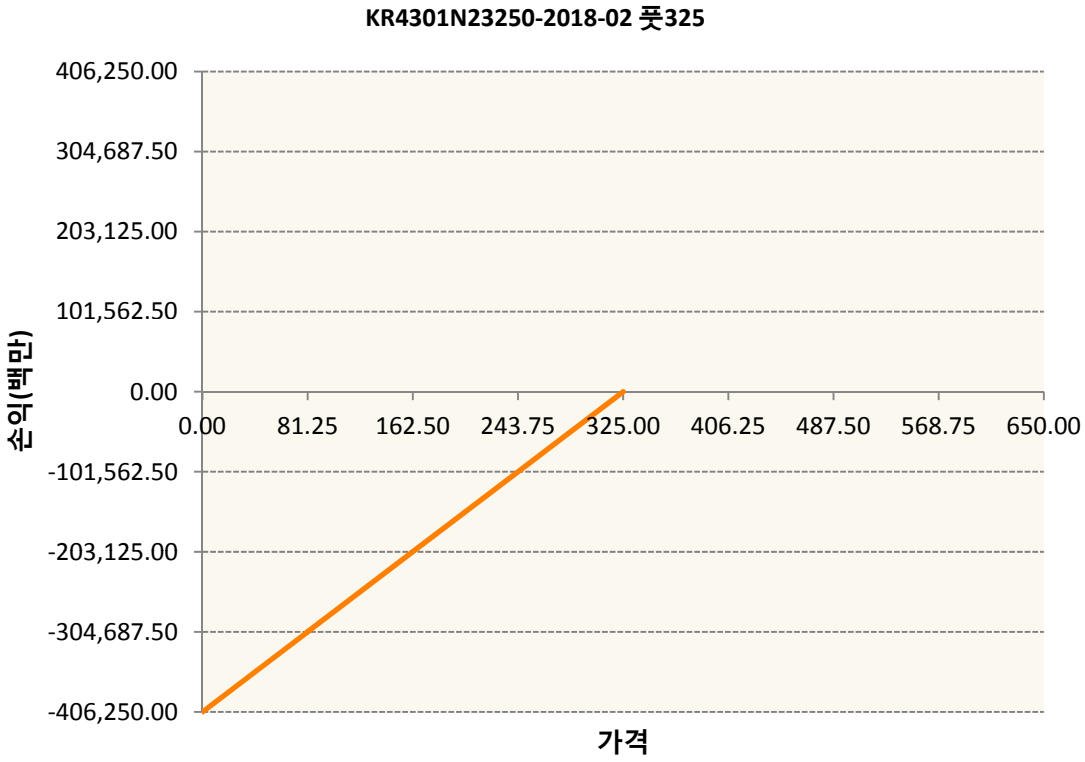
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	11,964	0	11,964	장내
누계	유가증권	옵션	0	1,372,119	-1,372,119	장내

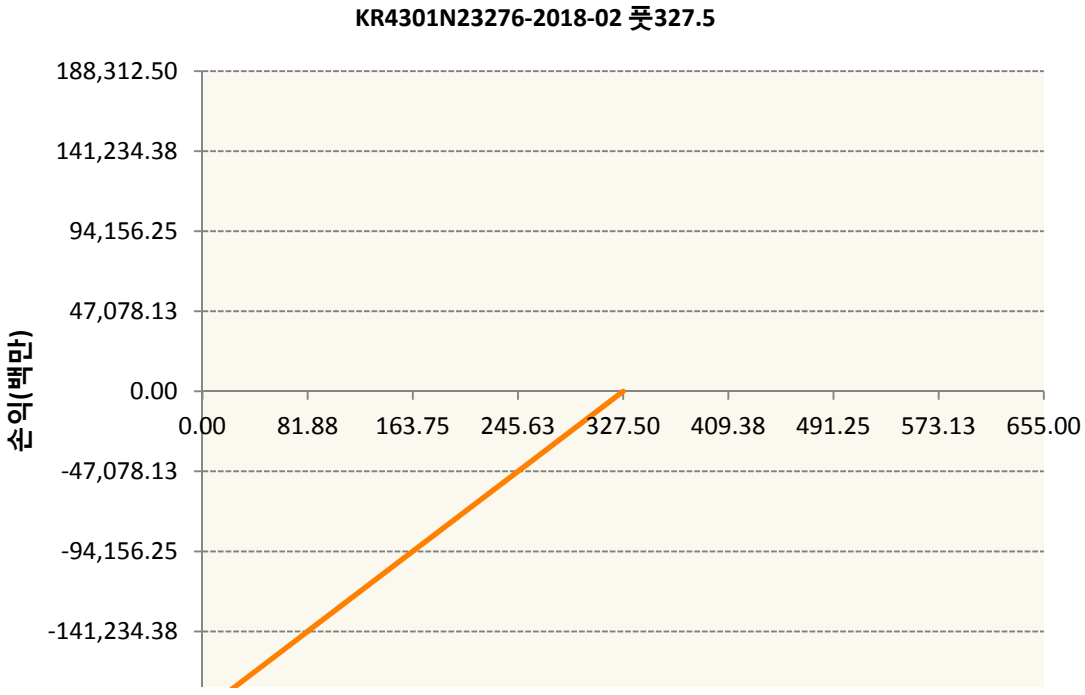
2. 만기시점의 손익구조






-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							2,265
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,080	1,054	1,023	987	948	906	861
-5.33%	956	906	854	799	742	684	625
-2.67%	678	611	544	476	408	341	273
0%	200	134	67	0	-68	-136	-204
2.67%	-465	-514	-567	-622	-679	-738	-798
5.33%	-1,260	-1,288	-1,321	-1,359	-1,400	-1,445	-1,493
8.00%	-2,123	-2,136	-2,153	-2,175	-2,201	-2,231	-2,265
KR4201N232 2018-02 콜327.5							48,514
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	21,096	20,626	20,046	19,369	18,604	17,763	16,856
-5.33%	18,993	18,024	16,973	15,858	14,689	13,477	12,229
-2.67%	13,912	12,488	11,045	9,588	8,121	6,644	5,161
0%	4,599	3,069	1,536	0	-1,538	-3,078	-4,619
2.67%	-9,052	-10,282	-11,568	-12,898	-14,262	-15,653	-17,068
5.33%	-25,981	-26,739	-27,606	-28,565	-29,602	-30,704	-31,862
8.00%	-44,777	-45,143	-45,621	-46,206	-46,890	-47,662	-48,514
KR4301N232 2018-02 풋325							24,390
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-24,192	-24,199	-24,213	-24,236	-24,272	-24,323	-24,390
-5.33%	-13,341	-13,441	-13,570	-13,725	-13,903	-14,103	-14,322
-2.67%	-3,988	-4,344	-4,708	-5,078	-5,452	-5,829	-6,209
0%	1,001	680	345	0	-354	-714	-1,080
2.67%	2,165	2,084	1,975	1,839	1,678	1,494	1,289
5.33%	2,265	2,258	2,245	2,220	2,183	2,130	2,061
8.00%	2,268	2,268	2,267	2,265	2,260	2,251	2,237
KR4301N232 2018-02 풋327.5							12,118
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-12,064	-12,065	-12,068	-12,074	-12,083	-12,098	-12,118
-5.33%	-7,034	-7,060	-7,096	-7,144	-7,203	-7,272	-7,350
-2.67%	-2,413	-2,547	-2,689	-2,837	-2,990	-3,148	-3,308
0%	531	356	179	0	-180	-361	-542
2.67%	1,432	1,368	1,290	1,200	1,098	988	869

5.33%	1,538	1,531	1,517	1,497	1,468	1,430	1,384
8.00%	1,542	1,542	1,541	1,539	1,534	1,527	1,515

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

89,227

공시일	2018-01-17
기준일	2018-01-16

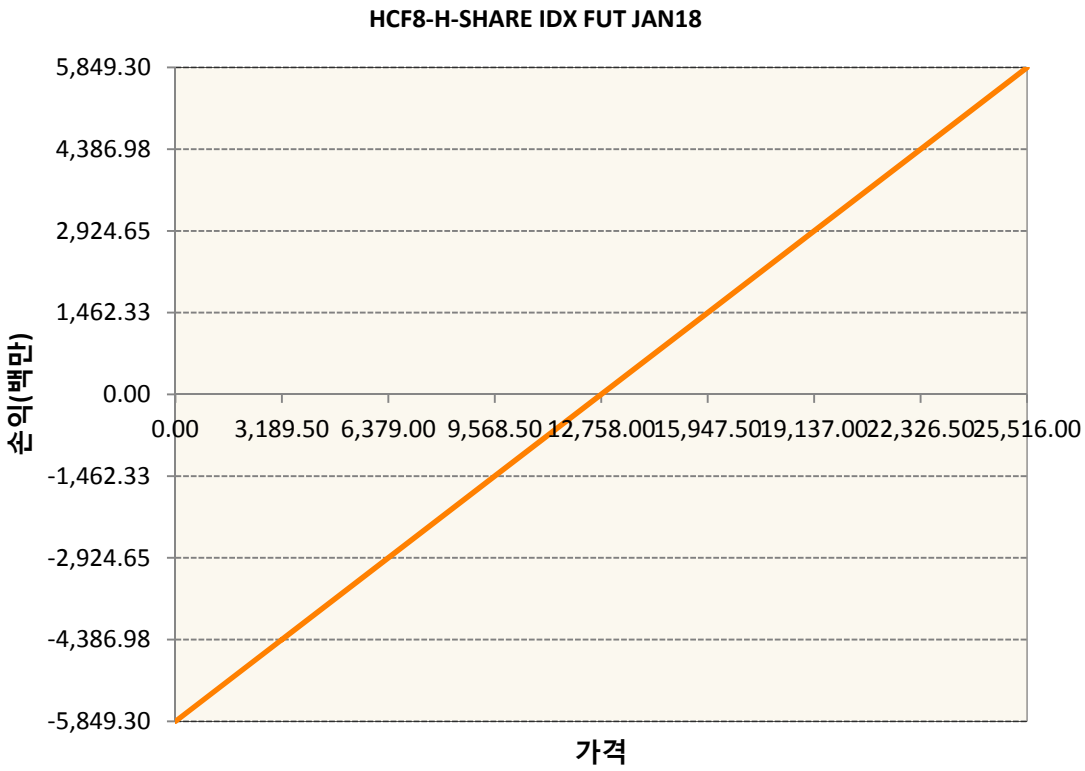
홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생

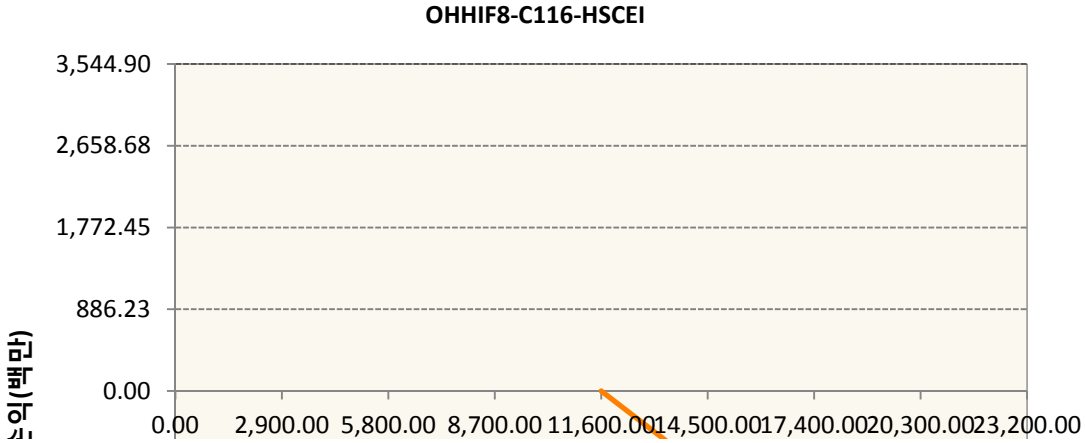
1. 계약금액

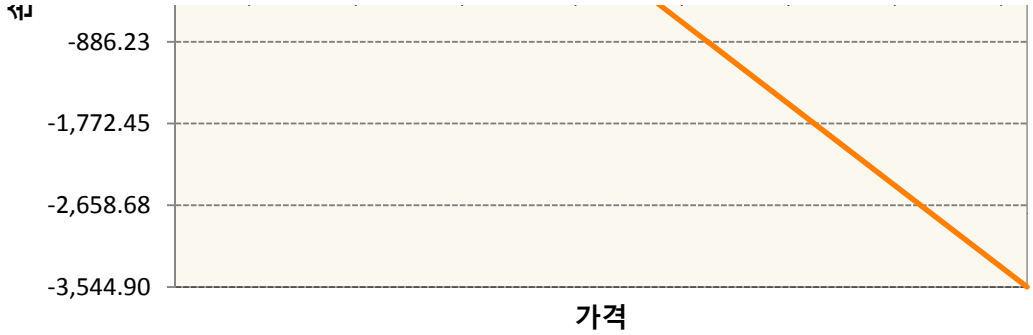
(단위:백만원)

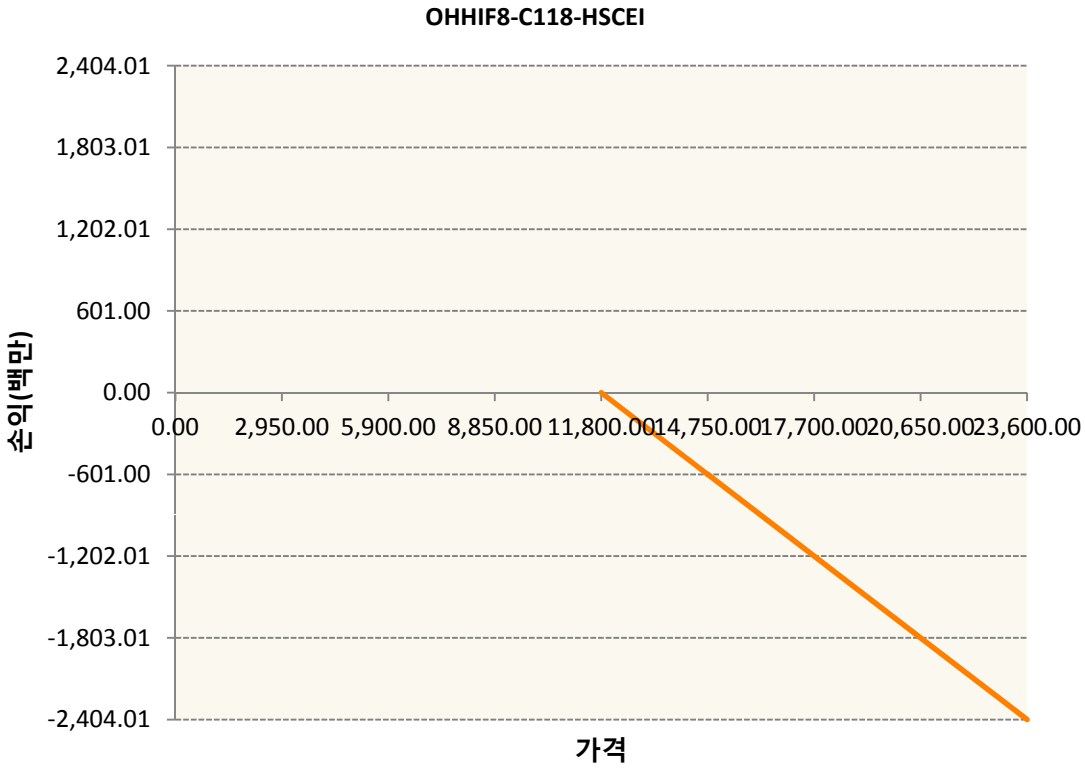
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	5,849	0	5,849	장내
누계	유가증권	옵션	0	11,898	-11,898	장내

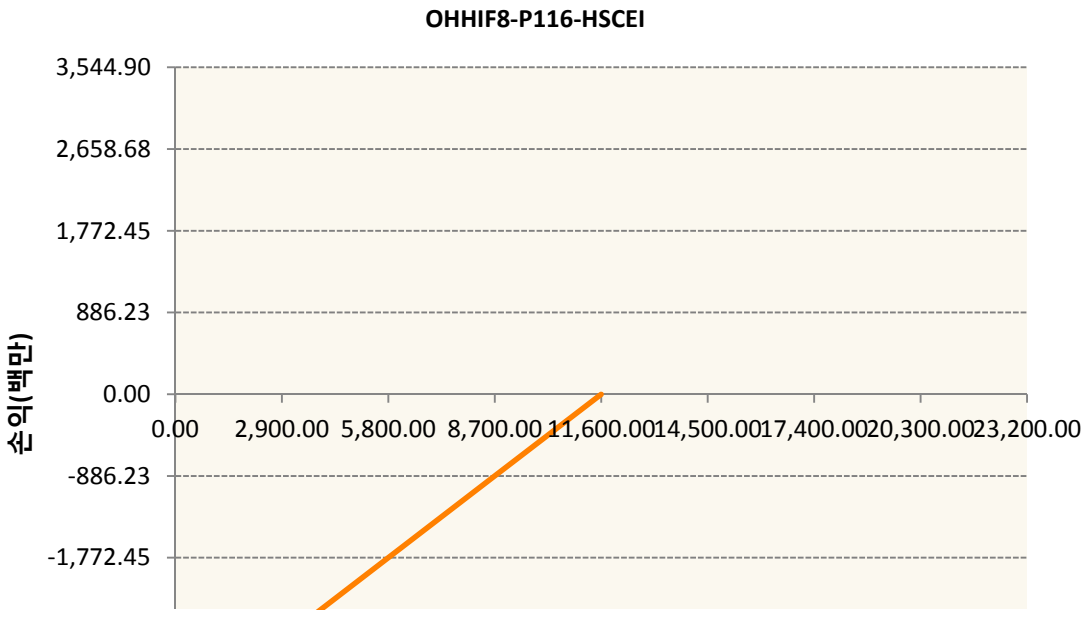
2. 만기시점의 손익구조

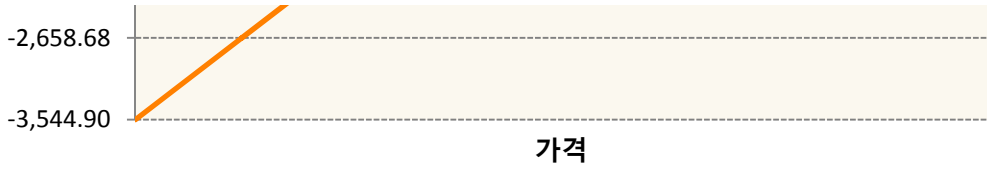


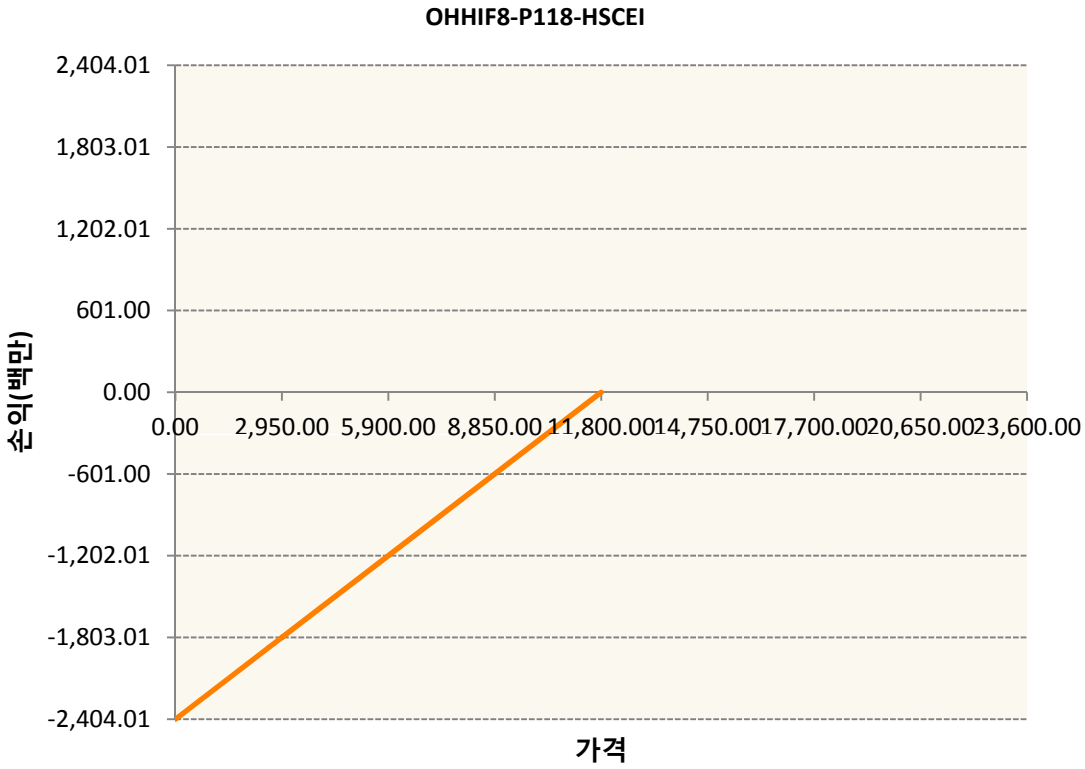



-886.23
-1,772.45
-2,658.68
-3,544.90
가격


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	468
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)

1,124

공시일	2018-01-17
기준일	2018-01-16

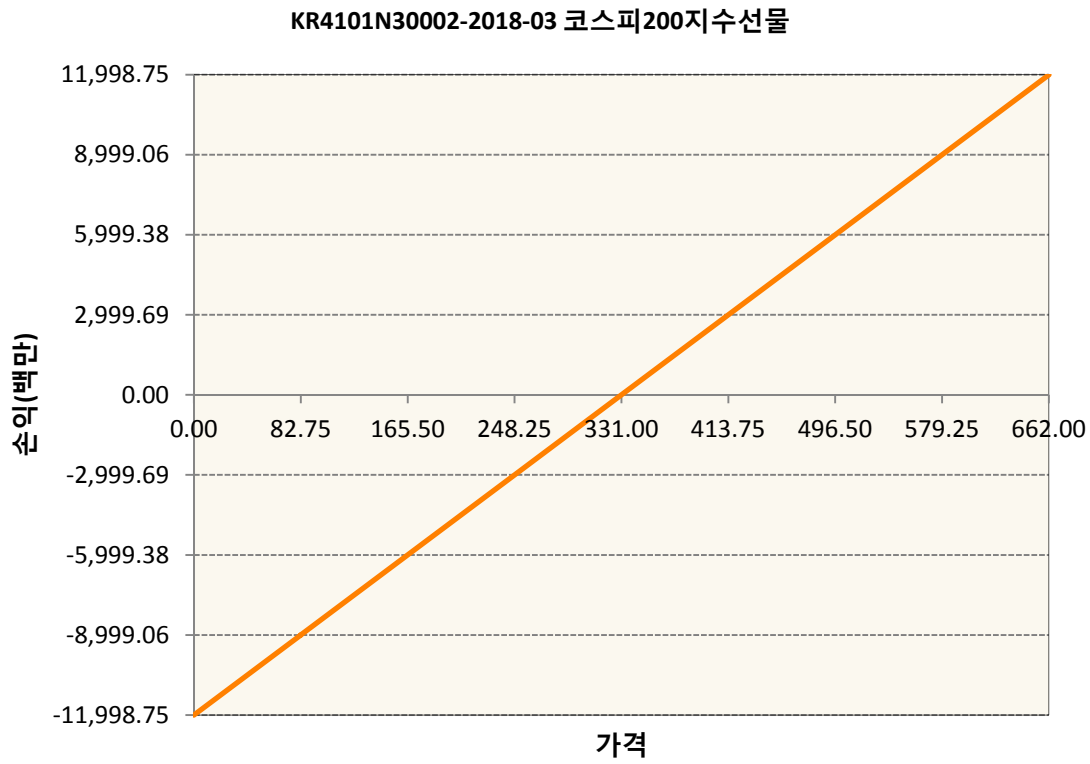
코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼

1. 계약금액

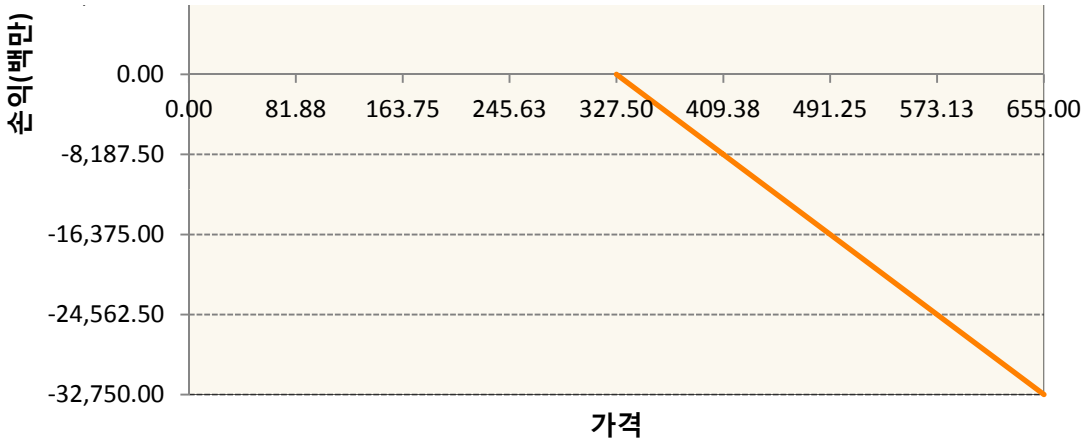
(단위:백만원)

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	11,999	0	11,999	장내
누계	유가증권	스왑	60,200	0	60,200	장외
누계	유가증권	옵션	0	60,431	-60,431	장내

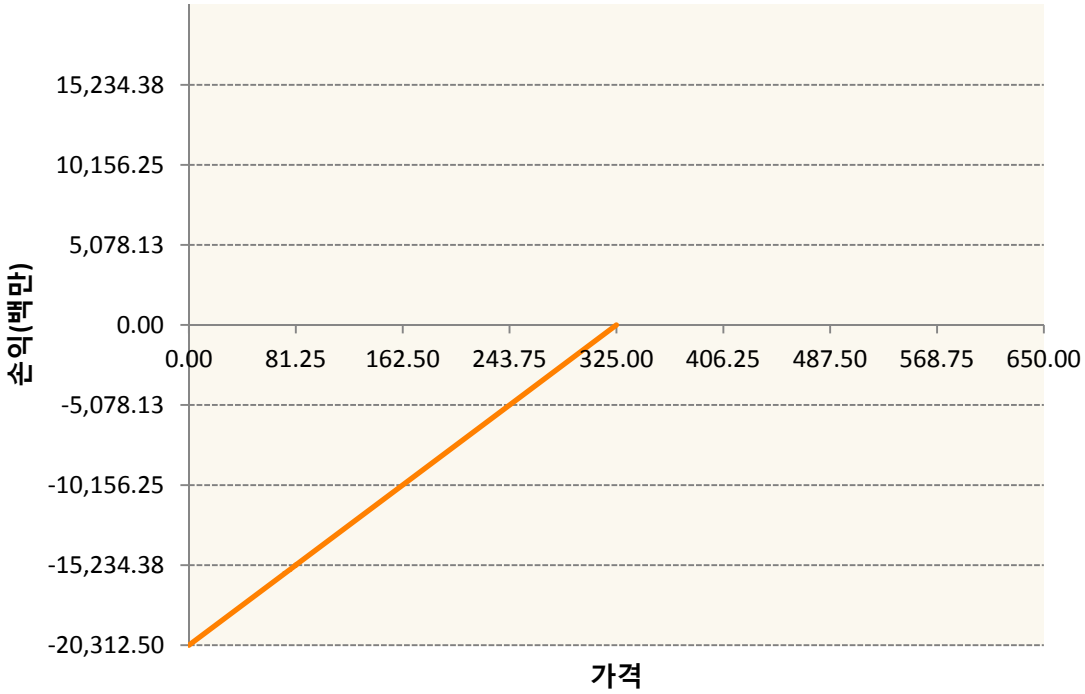
2. 만기시점의 손익구조



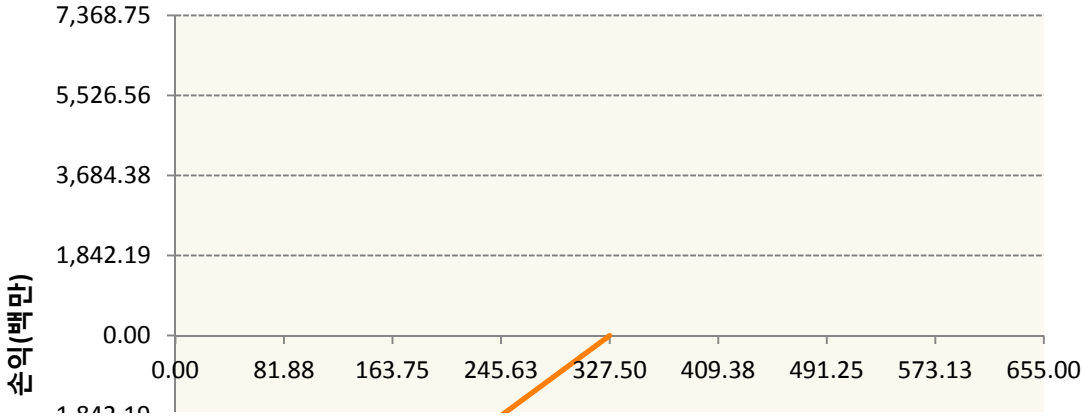




KR4301N23250-2018-02 풋325



KR4301N23276-2018-02 풋327.5





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_2							1,445
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,445	-1,445	-1,445	-1,445	-1,445	-1,445	-1,445
-5.33%	-963	-963	-963	-963	-963	-963	-963
-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%	963	963	963	963	963	963	963
8.00%	1,445	1,445	1,445	1,445	1,445	1,445	1,445
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%	-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						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						625
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-625	-625	-625	-625	-625	-625	-625
-5.33%	-417	-417	-417	-417	-417	-417	-417
-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%	417	417	417	417	417	417	417
8.00%	625	625	625	625	625	625	625
	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%	-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%	469	469	469	469	469	469	469
	KR4101N30(2018-03 코스피200지수선물						957
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-957	-957	-957	-957	-957	-957	-957
-5.33%	-638	-638	-638	-638	-638	-638	-638
-2.67%	-319	-319	-319	-319	-319	-319	-319
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	319	319	319	319	319	319	319
5.33%	638	638	638	638	638	638	638
8.00%	957	957	957	957	957	957	957
	KR4201N23: 2018-02 콜327.5						2,135

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	928	908	882	852	819	782	742
-5.33%	836	793	747	698	646	593	538
-2.67%	612	550	486	422	357	292	227
0%	202	135	68	0	-68	-135	-203
2.67%	-398	-452	-509	-568	-628	-689	-751
5.33%	-1,143	-1,177	-1,215	-1,257	-1,303	-1,351	-1,402
8.00%	-1,970	-1,986	-2,008	-2,033	-2,063	-2,097	-2,135
	KR4301N232 2018-02 풋325						1,219

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,210	-1,210	-1,211	-1,212	-1,214	-1,216	-1,219
-5.33%	-667	-672	-678	-686	-695	-705	-716
-2.67%	-199	-217	-235	-254	-273	-291	-310
0%	50	34	17	0	-18	-36	-54
2.67%	108	104	99	92	84	75	64
5.33%	113	113	112	111	109	107	103
8.00%	113	113	113	113	113	113	112
	KR4301N232 2018-02 풋327.5						474

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-472	-472	-472	-472	-473	-473	-474
-5.33%	-275	-276	-278	-280	-282	-285	-288
-2.67%	-94	-100	-105	-111	-117	-123	-129
0%	21	14	7	0	-7	-14	-21
2.67%	56	54	50	47	43	39	34
5.33%	60	60	59	59	57	56	54
8.00%	60	60	60	60	60	60	59

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

9,178

공시일	2018-01-17
기준일	2018-01-16

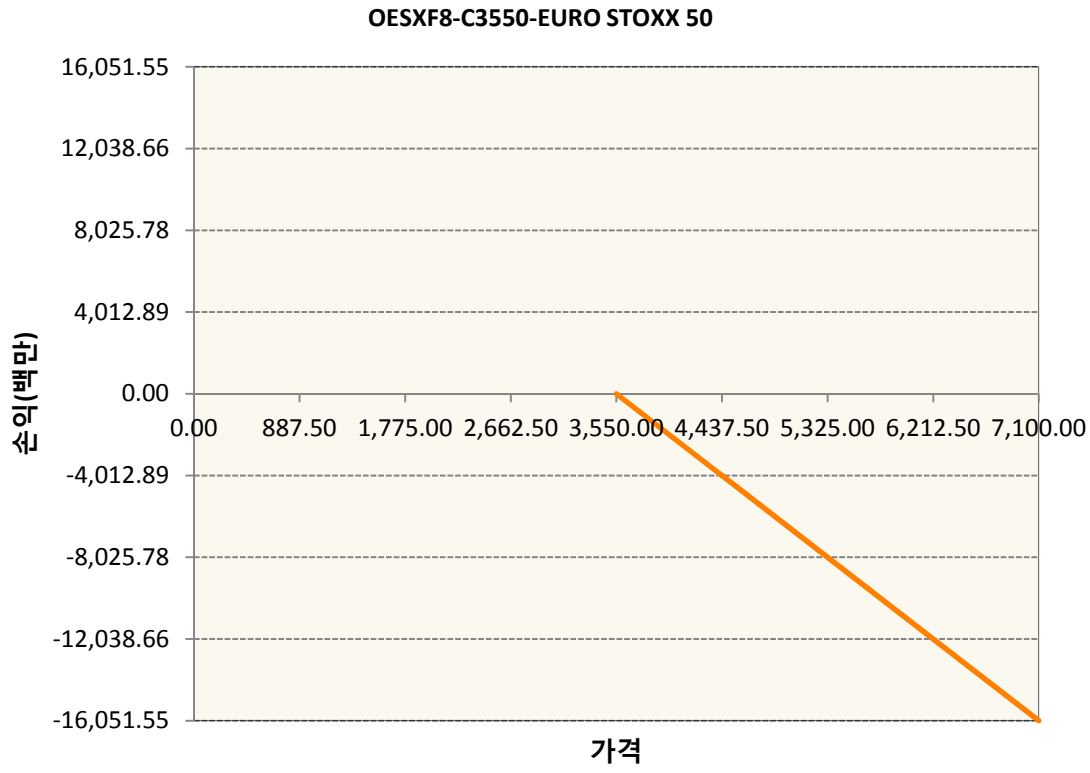
유로커버드콜모(주식혼합-파생형

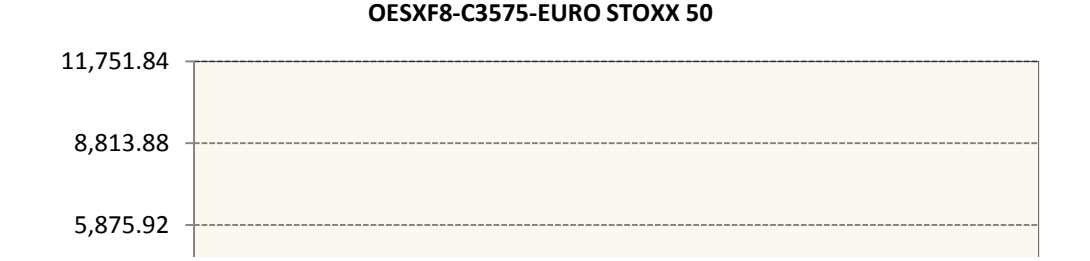
1. 계약금액

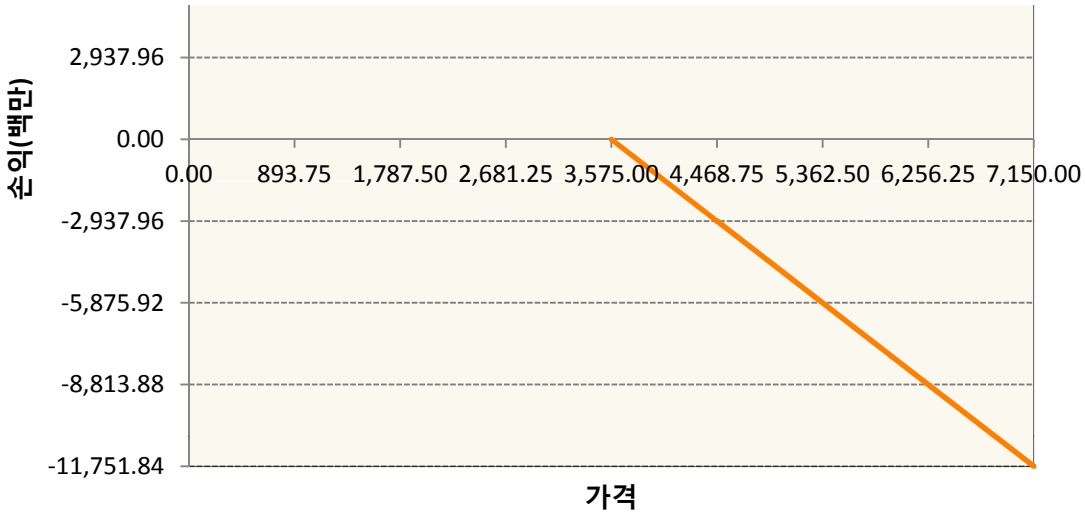
(단위:백만원)

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	19,413	0	19,413	
누계	유가증권	스왑	97,444	0	97,444	장외
누계	유가증권	옵션	0	55,607	-55,607	장내
누계	지수	스왑	51,971	0	51,971	장외

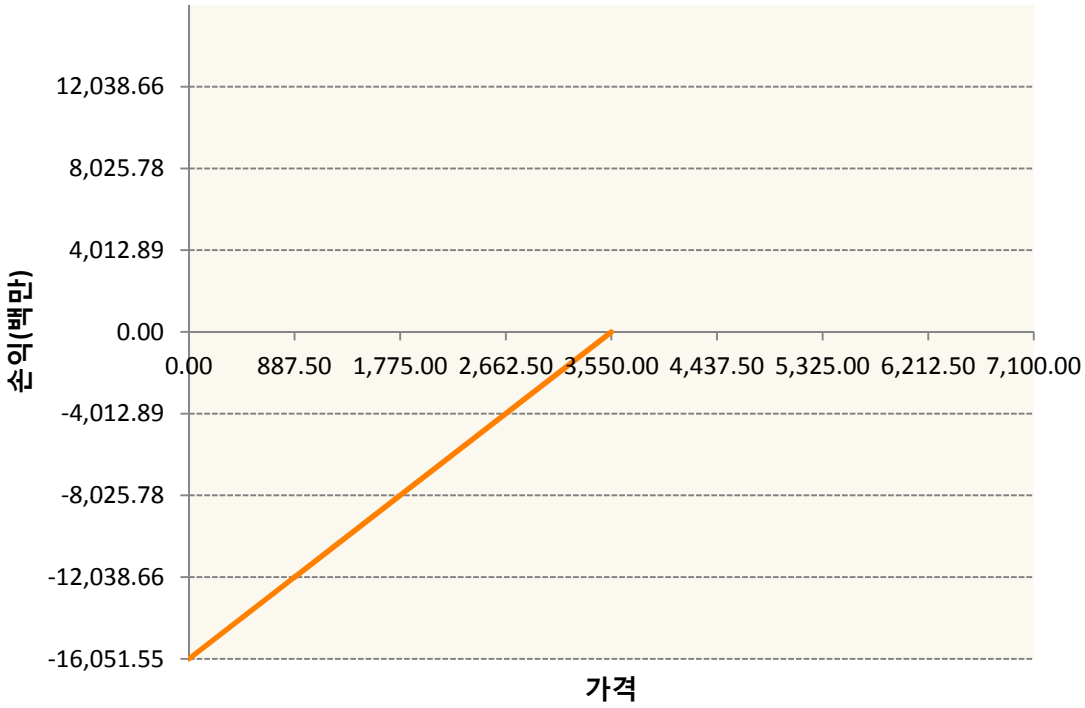
2. 만기시점의 손익구조



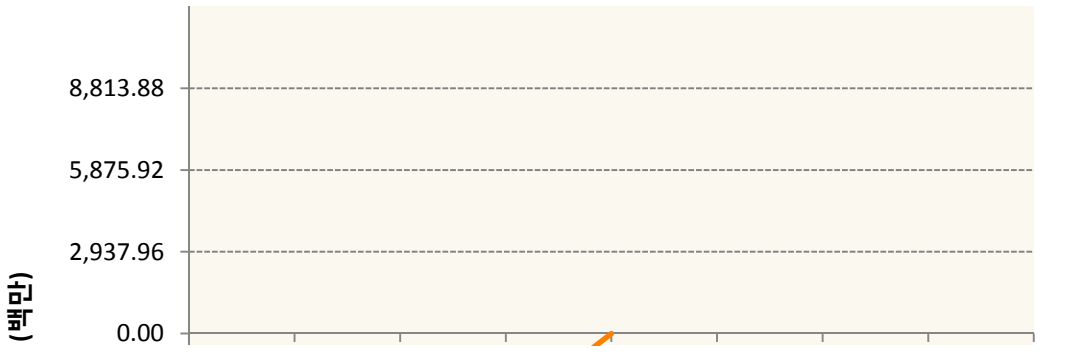


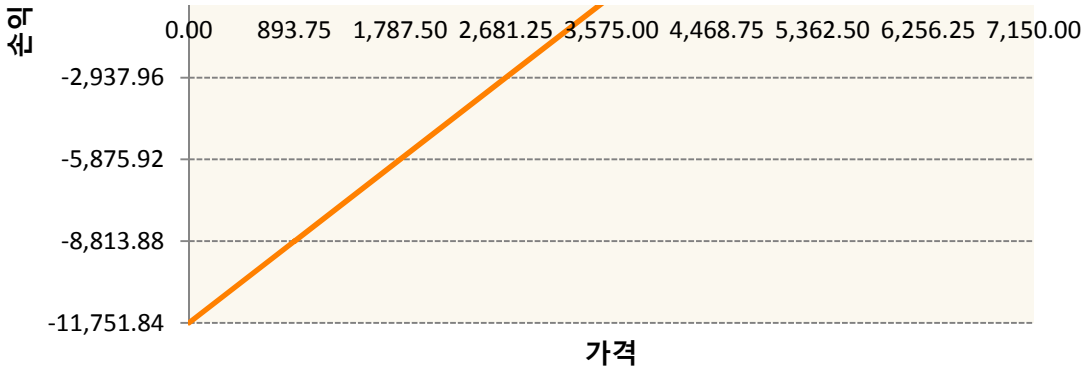


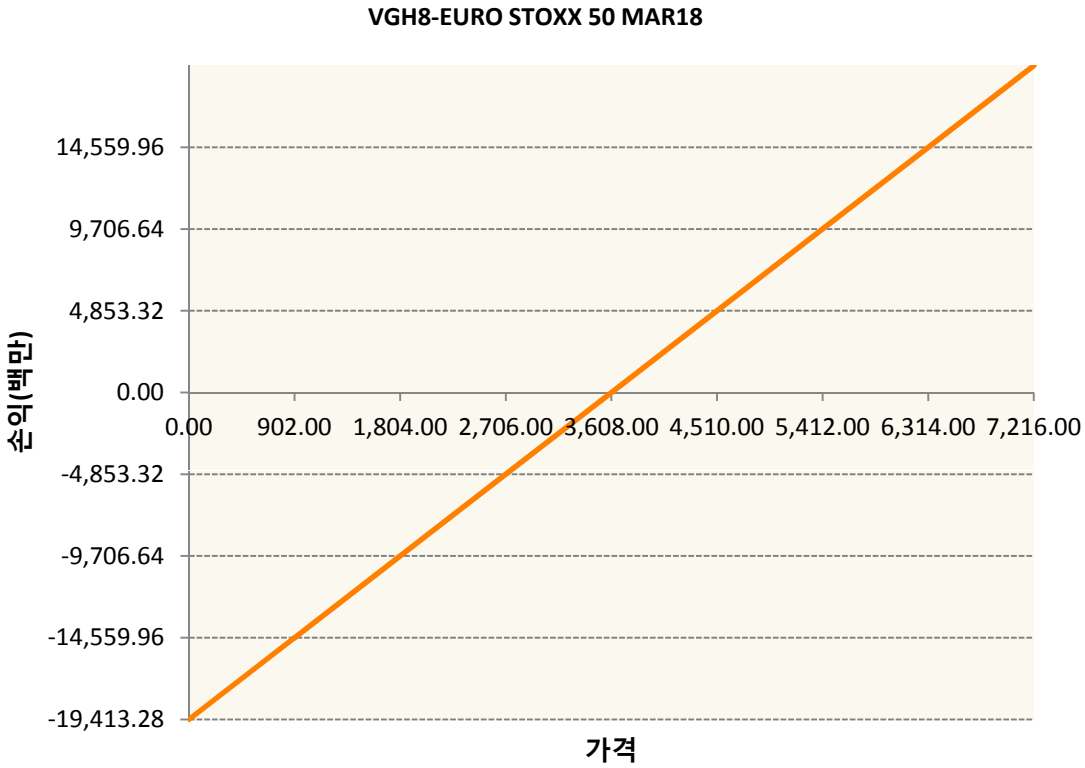
OESXF8-P3550-EURO STOXX 50



OESXF8-P3575-EURO STOXX 50







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)	(단위:백만원)
260105SGPX SG EURO Covered CALL STRATEGY - 994.569	107
260105SQPX SG EURO Covered CALL STRATEGY	156
OESXF8-C35 EURO STOXX 50	1,284
OESXF8-C35 EURO STOXX 50	940
OESXF8-P35 EURO STOXX 50	1,284
OESXF8-P35 EURO STOXX 50	940
VGH8 EURO STOXX 50 MAR18	1,553

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

3,508

공시일	2018-01-17
기준일	2018-01-16

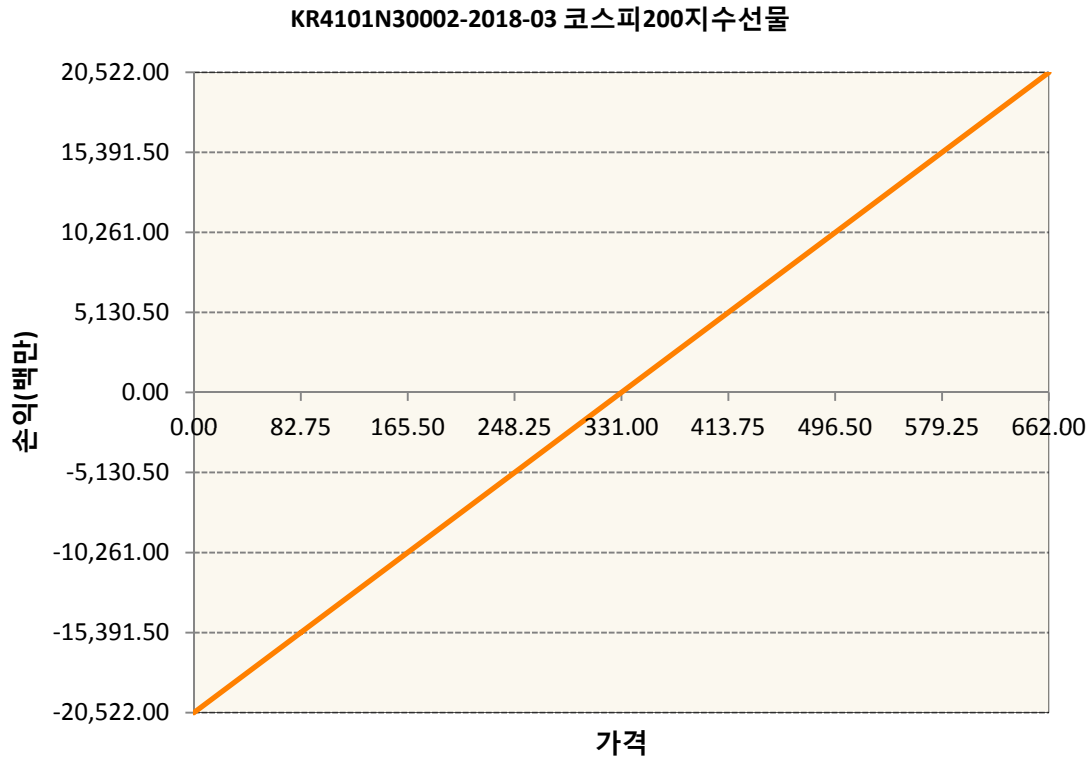
ETF스마트레버리지목표전환형8호

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	20,522	0	20,522	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101N30(2018-03 코스피200지수선물							1,637
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,637	-1,637	-1,637	-1,637	-1,637	-1,637	-1,637
-5.33%	-1,091	-1,091	-1,091	-1,091	-1,091	-1,091	-1,091
-2.67%	-546	-546	-546	-546	-546	-546	-546
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	546	546	546	546	546	546	546
5.33%	1,091	1,091	1,091	1,091	1,091	1,091	1,091
8.00%	1,637	1,637	1,637	1,637	1,637	1,637	1,637

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

982

공시일	2018-01-17
기준일	2018-01-16

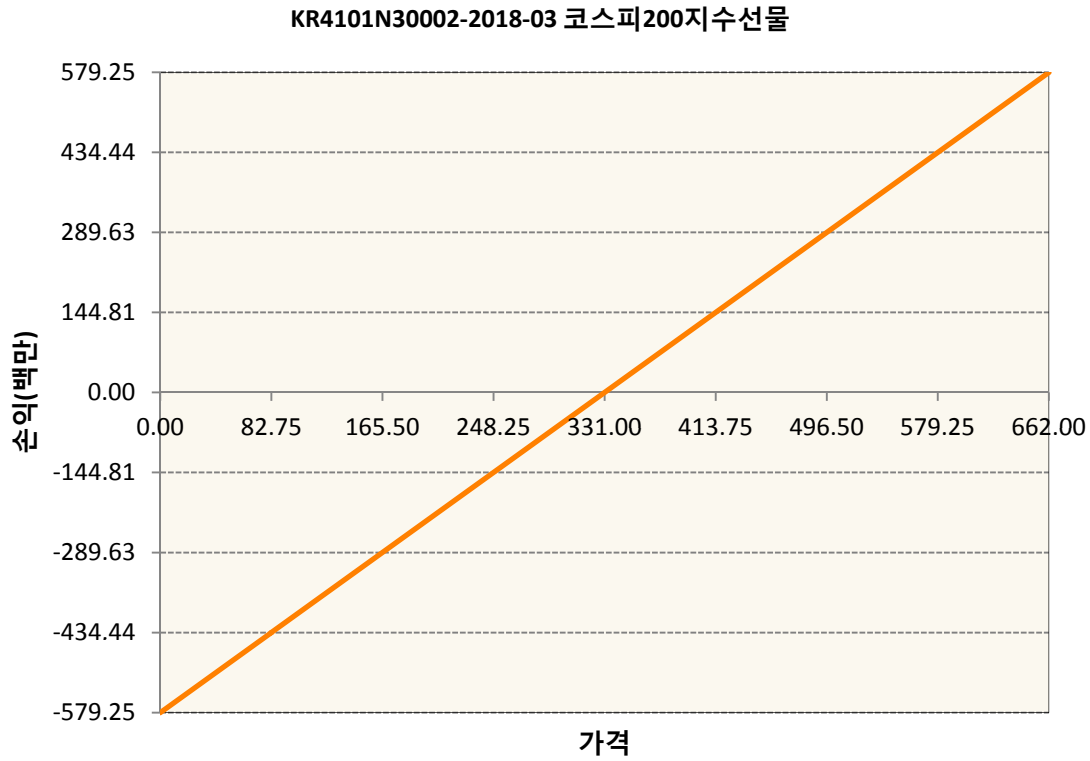
ETF스마트레버리지목표전환형9호

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	579	0	579	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)

28

공시일	2018-01-17
기준일	2018-01-16

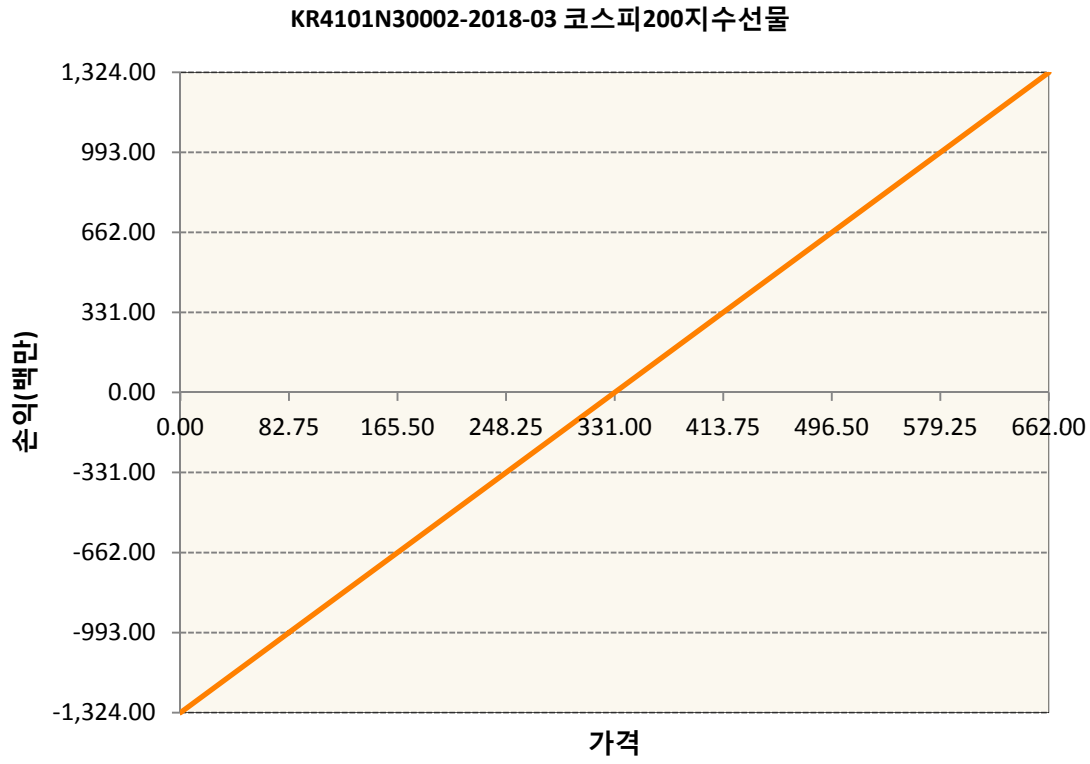
ETF스마트레버리지목표전환형10

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	1,324	0	1,324	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101N30(2018-03 코스피200지수선물							106
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-106	-106	-106	-106	-106	-106	-106
-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%	106	106	106	106	106	106	106

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

63

공시일	2018-01-17
기준일	2018-01-16

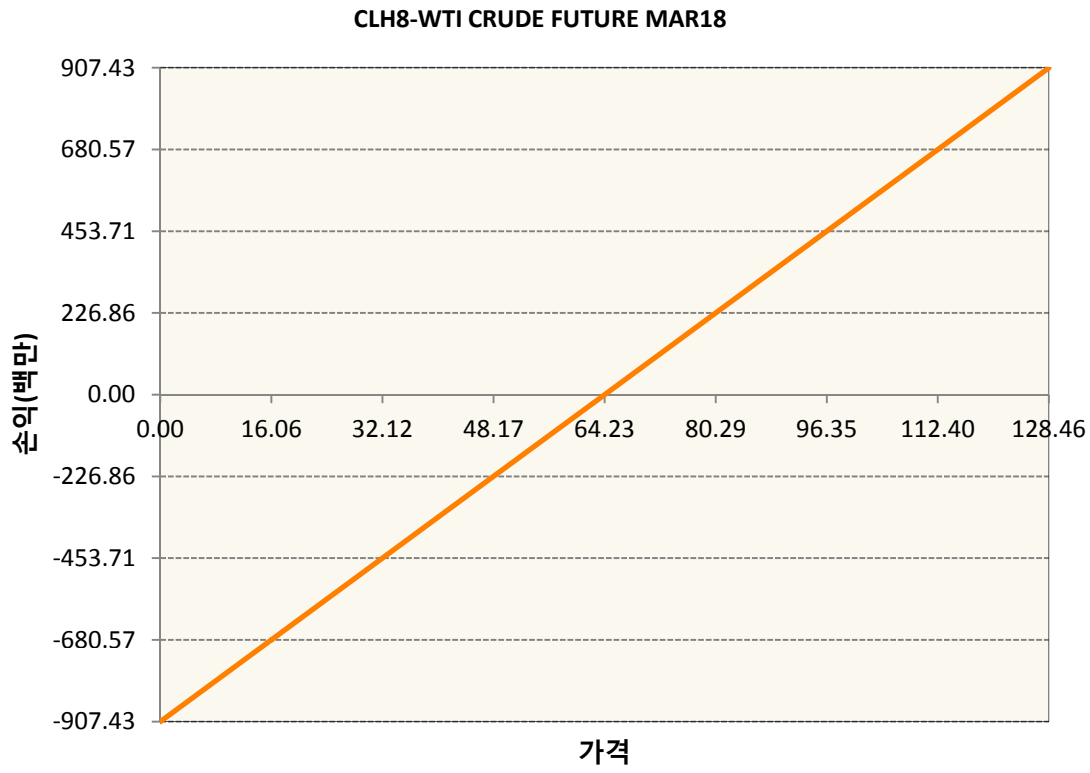
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

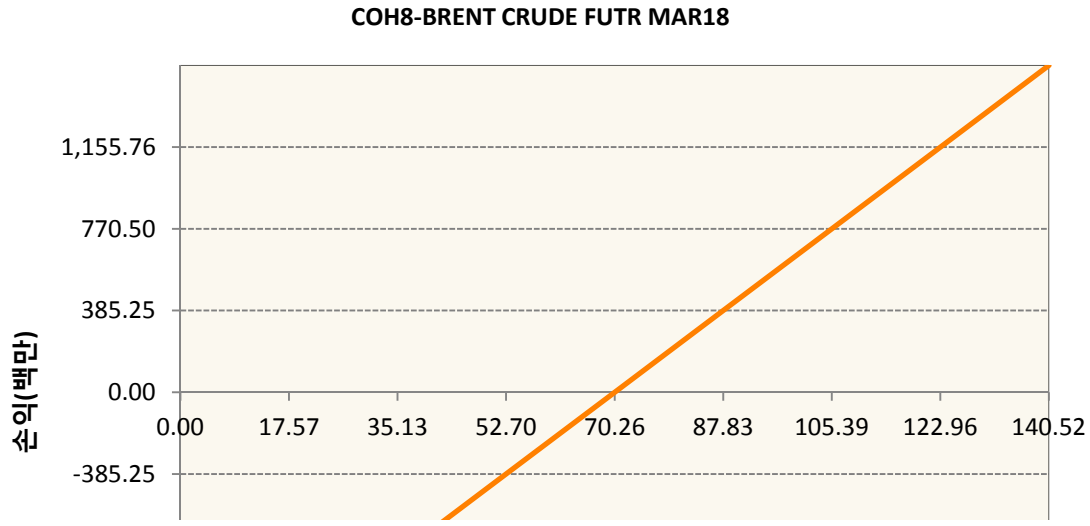
1. 계약금액

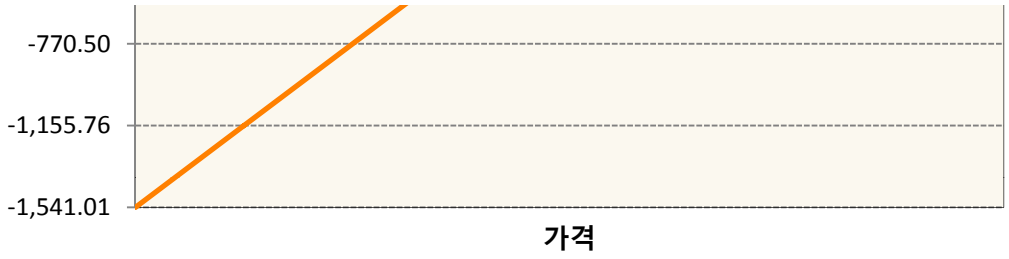
(단위:백만원)

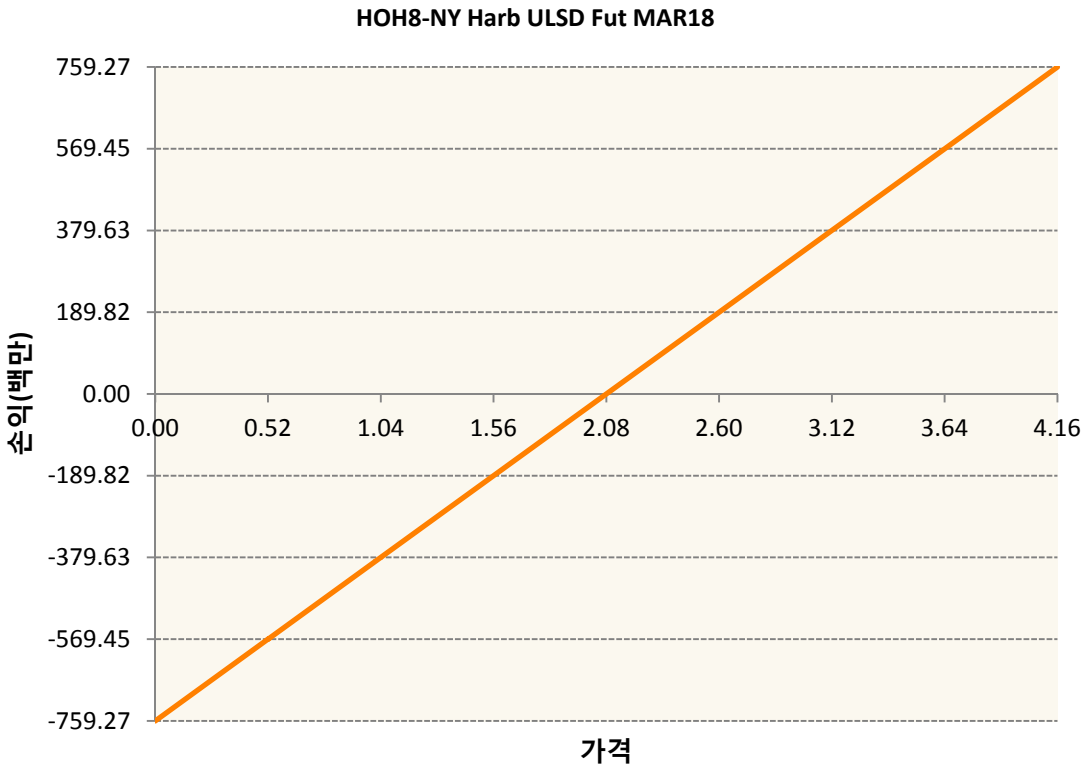
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	4,898	849	4,049	

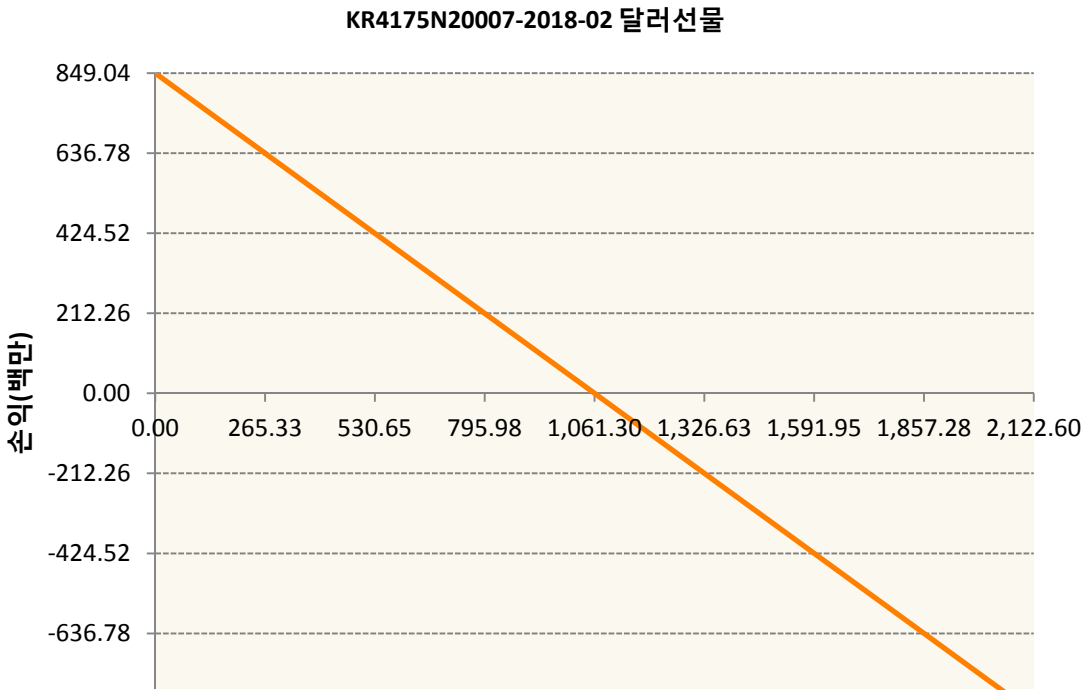
2. 만기시점의 손익구조

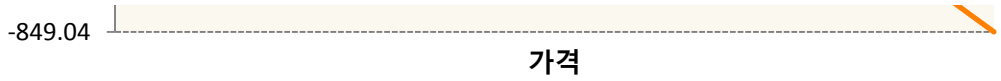


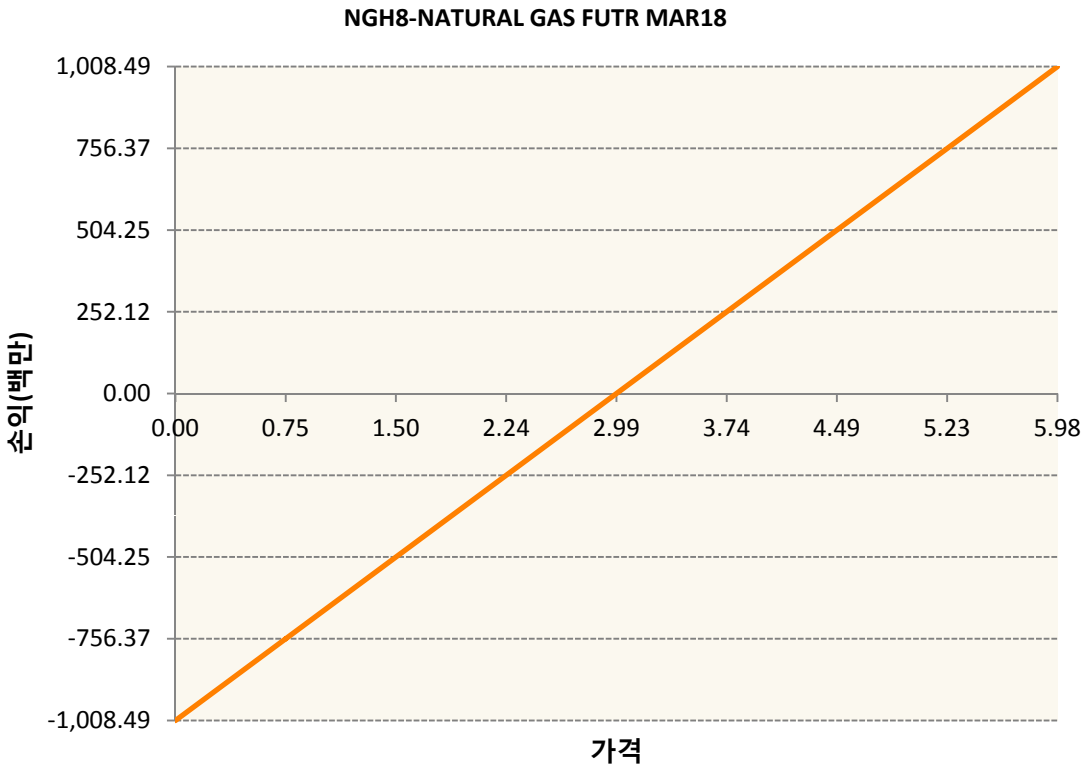


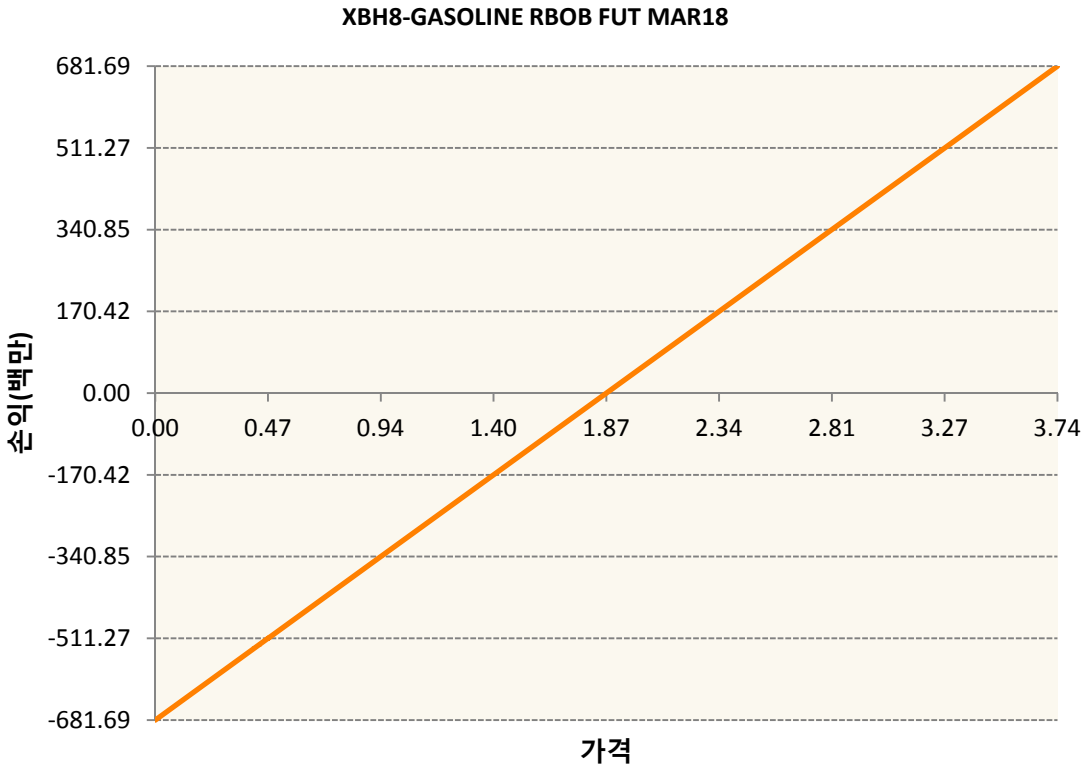

-770.50
-1,155.76
-1,541.01
가격


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
849.04
636.78
424.52
212.26
0.00
-212.26
-424.52
-636.78
0.00
265.33
530.65
795.98
1,061.30
1,326.63
1,591.95
1,857.28
2,122.60
손익(백만)


-849.04
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)

642

공시일	2018-01-17
기준일	2018-01-16

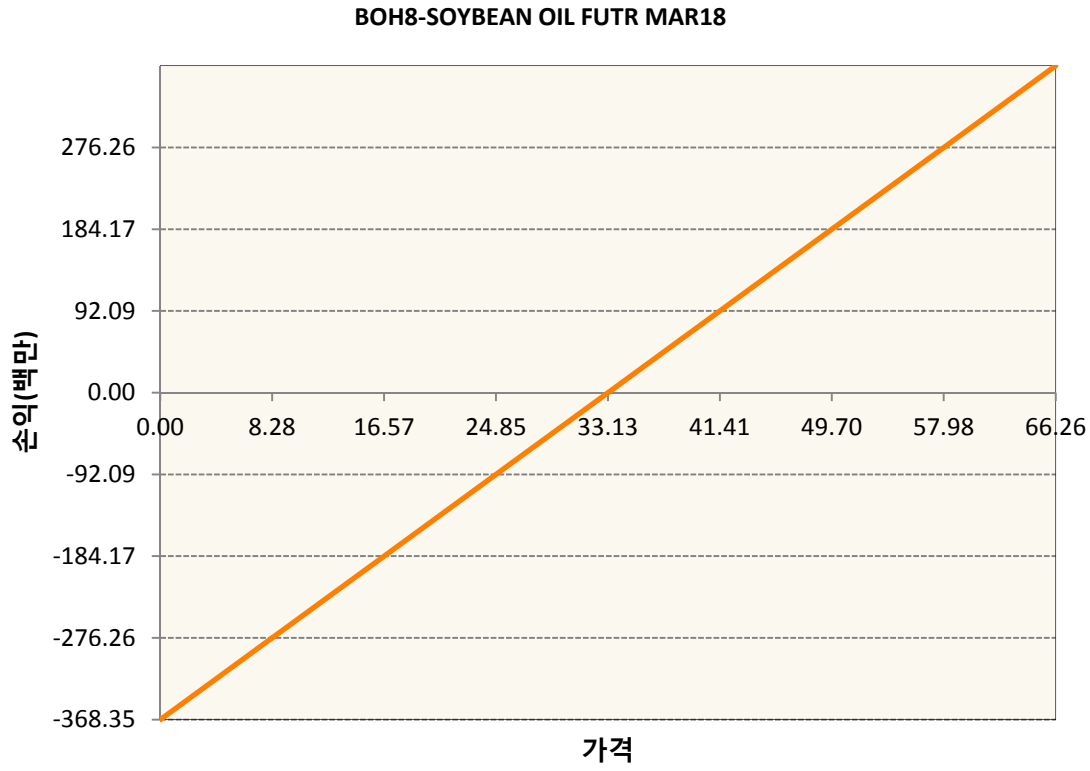
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

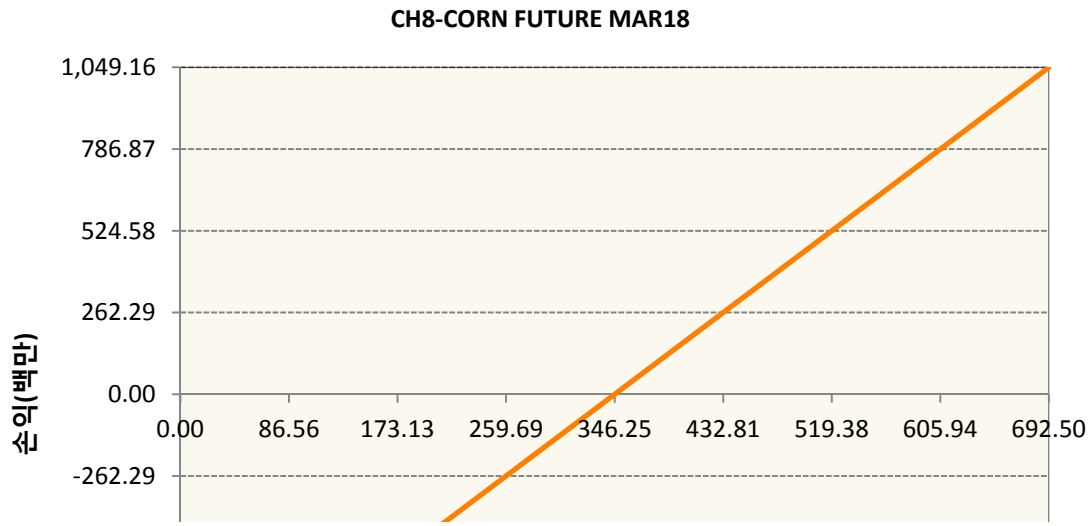
1. 계약금액

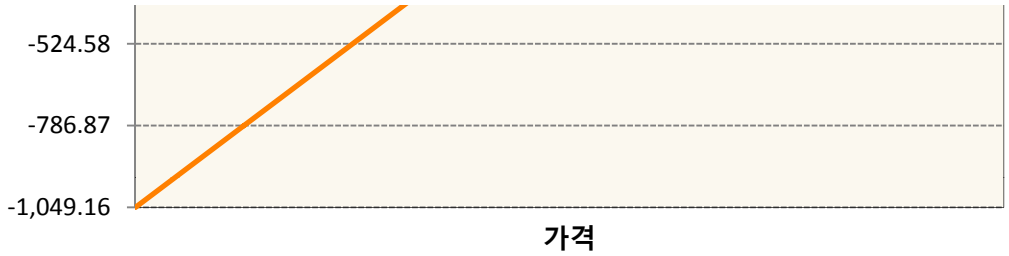
(단위:백만원)

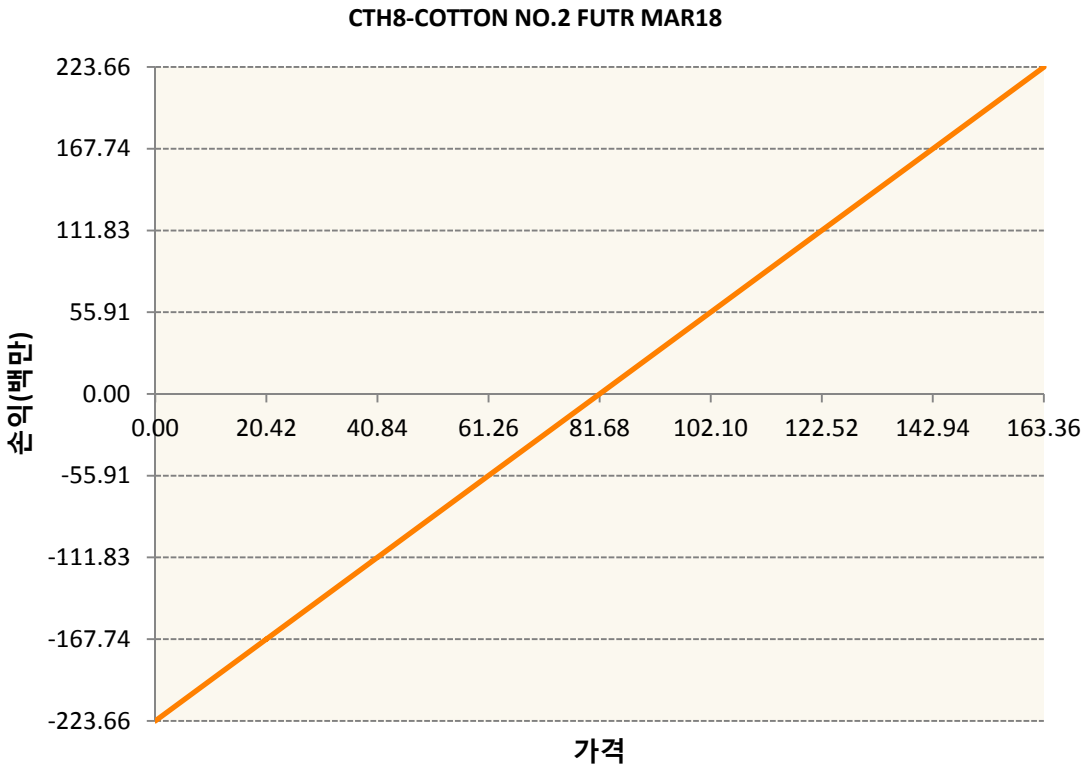
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	4,209	318	3,890	

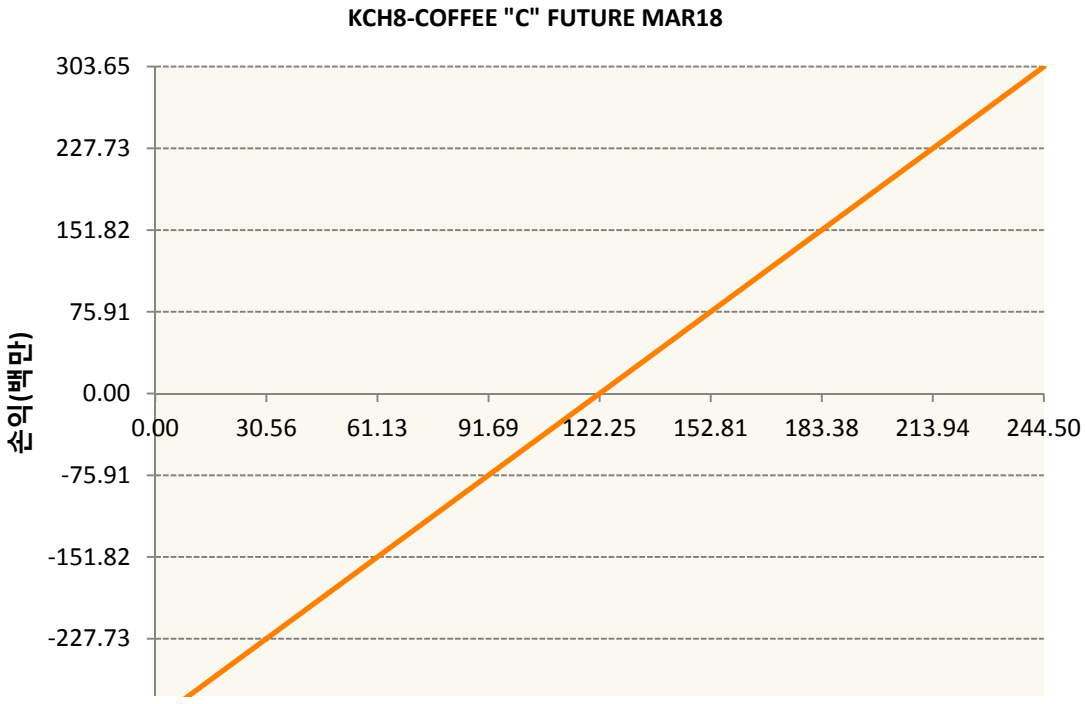
2. 만기시점의 손익구조

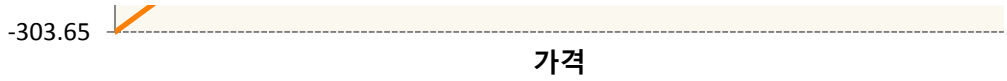


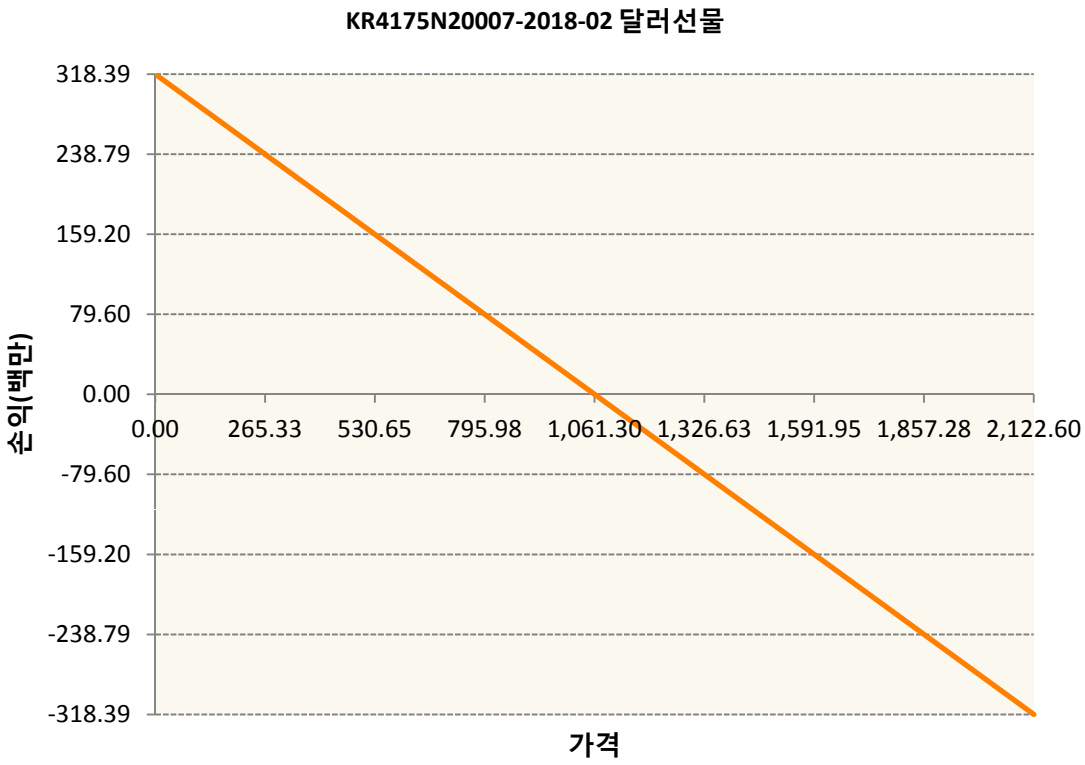


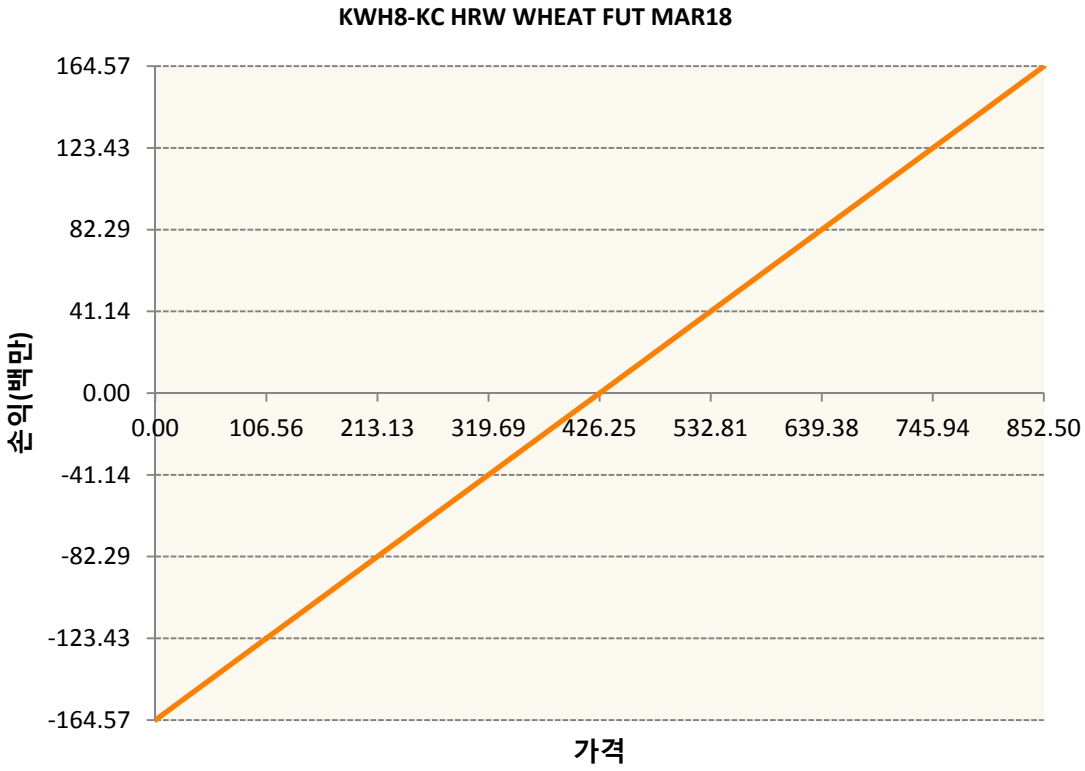

-524.58
-786.87
-1,049.16
가격


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

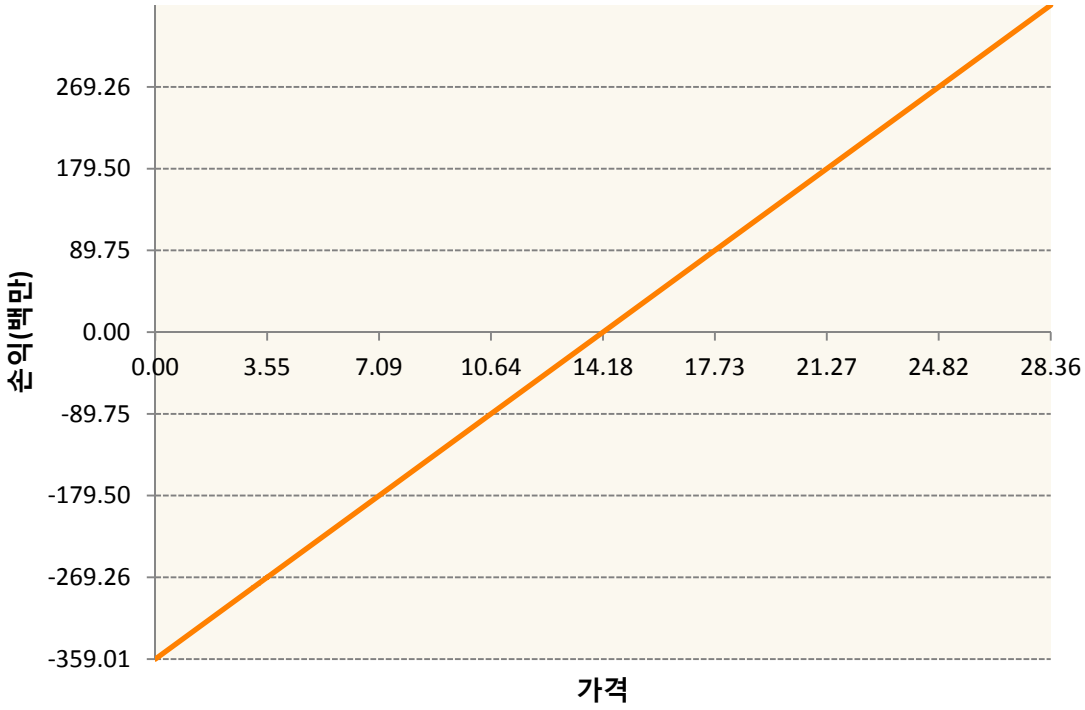

KCH8-COFFEE "C" FUTURE MAR18
303.65
227.73
151.82
75.91
0.00
-75.91
-151.82
-227.73
0.00
30.56
61.13
91.69
122.25
152.81
183.38
213.94
244.50
손익(백만)


-303.65
가격

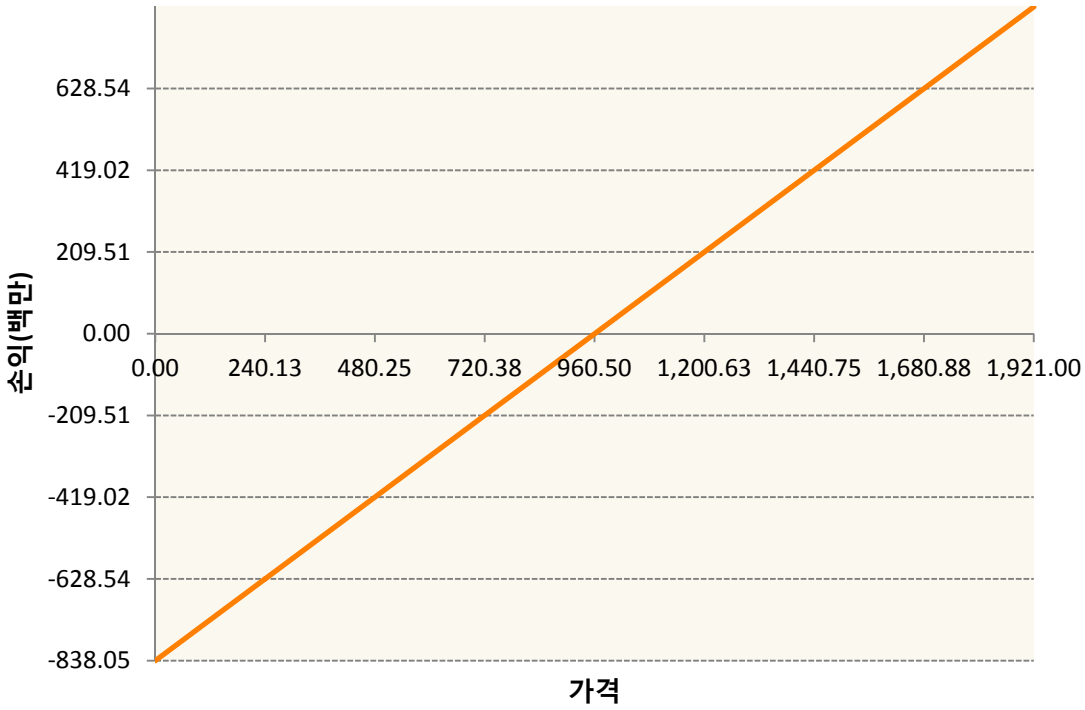

KR4175N20007-2018-02 달러선물
318.39
238.79
159.20
79.60
0.00
-79.60
-159.20
-238.79
-318.39
0.00
265.33
530.65
795.98
1,061.30
1,326.63
1,591.95
1,857.28
2,122.60
손익(백만)
가격


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

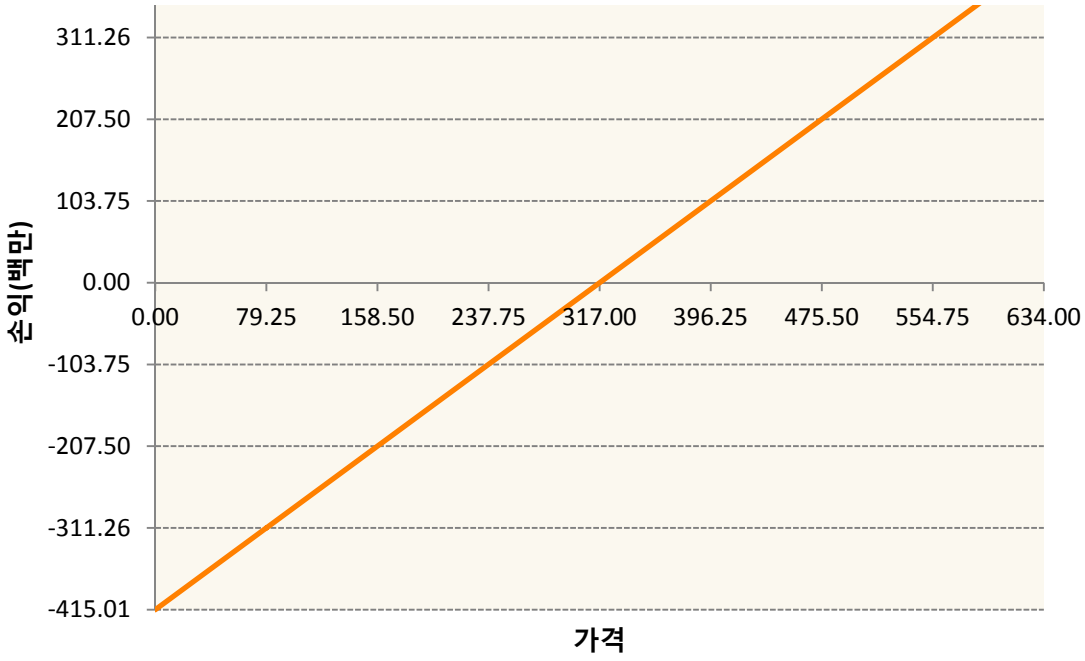


SH8-SOYBEAN FUTURE MAR18

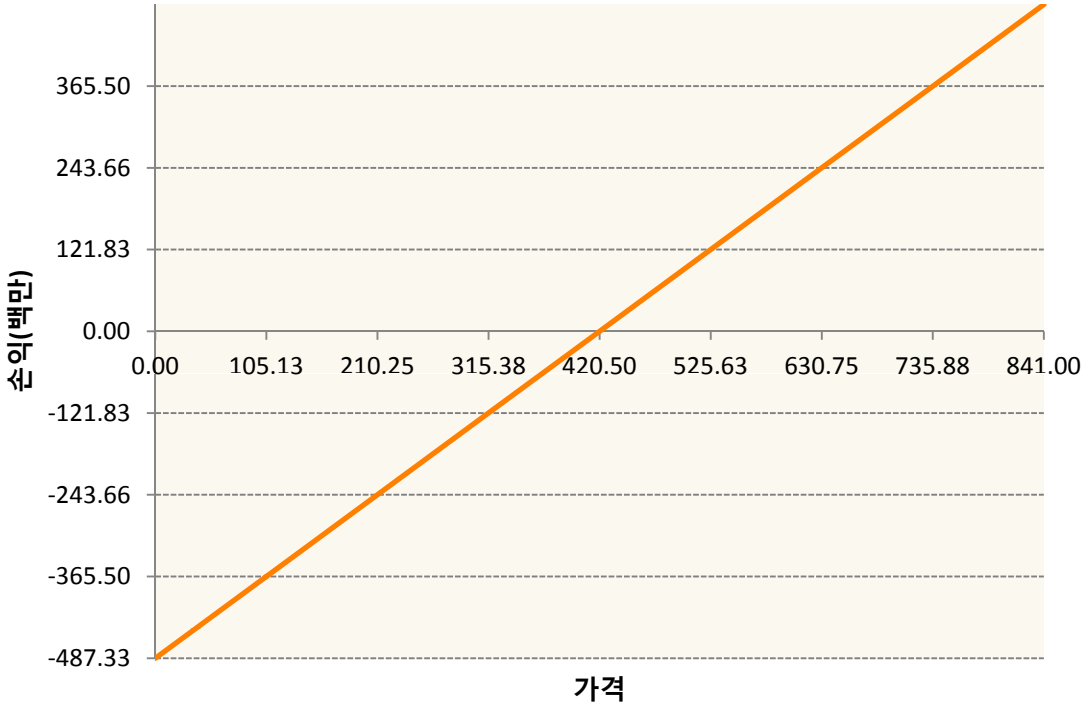


SMH8-SOYBEAN MEAL FUTR MAR18





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