공시일	2018-01-19
기준일	2018-01-18

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	2018-01-19
기준일	2018-01-18

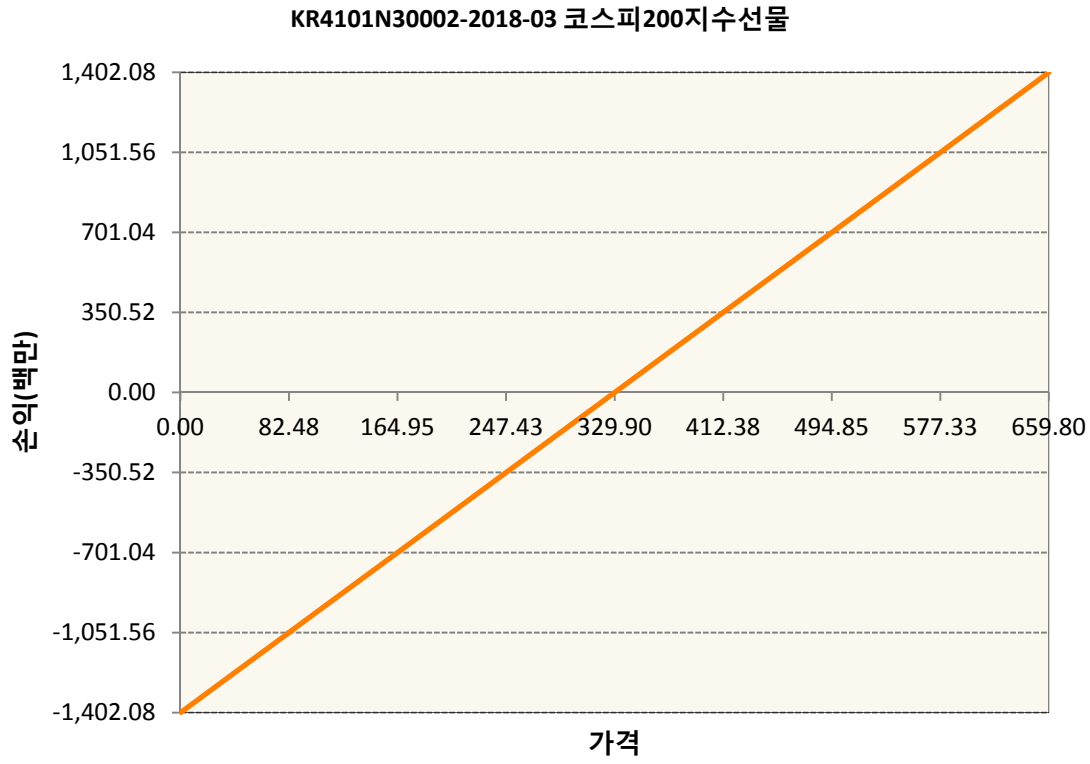
스마트인덱스모

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	165	-165	장내
누계	유가증권	선물	1,402	0	1,402	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101N30(2018-03 코스피200지수선물							112
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-112	-112	-112	-112	-112	-112	-112
-5.33%	-75	-75	-75	-75	-75	-75	-75
-2.67%	-37	-37	-37	-37	-37	-37	-37
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	37	37	37	37	37	37	37
5.33%	75	75	75	75	75	75	75
8.00%	112	112	112	112	112	112	112

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

67

공시일	2018-01-19
기준일	2018-01-18

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	1,150

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

370

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2018-01-19
기준일	2018-01-18

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	2018-01-19
기준일	2018-01-18

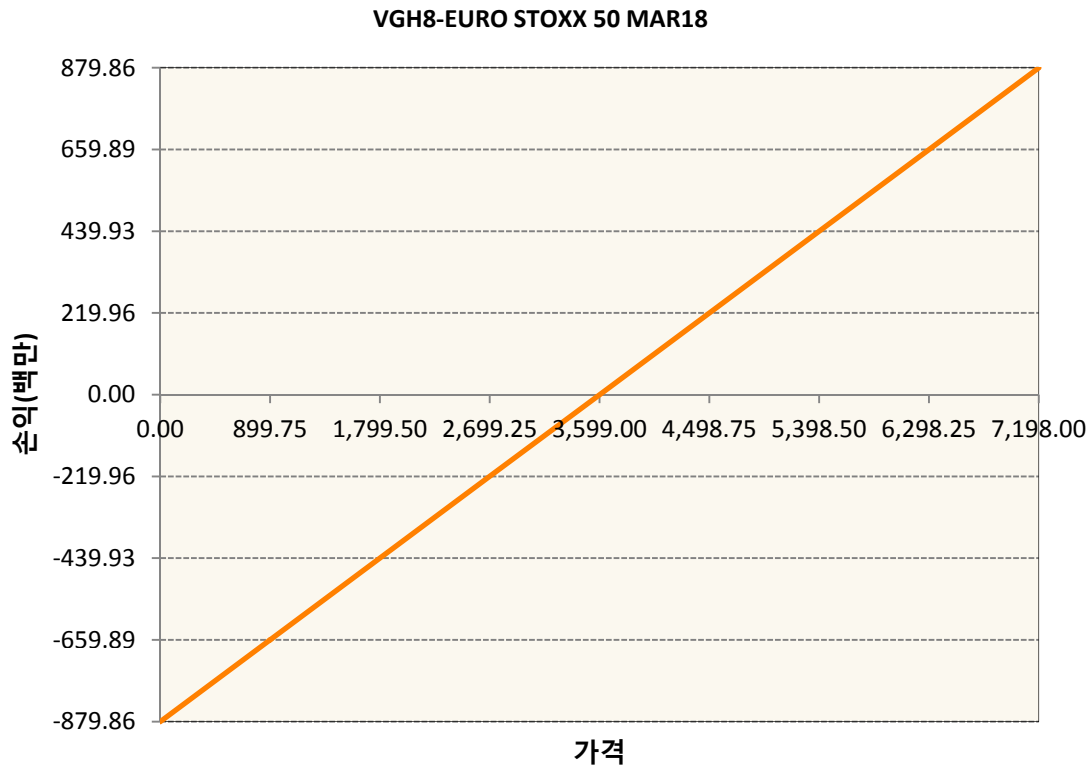
유로인덱스모(주식-파생형)

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	2018-01-19
기준일	2018-01-18

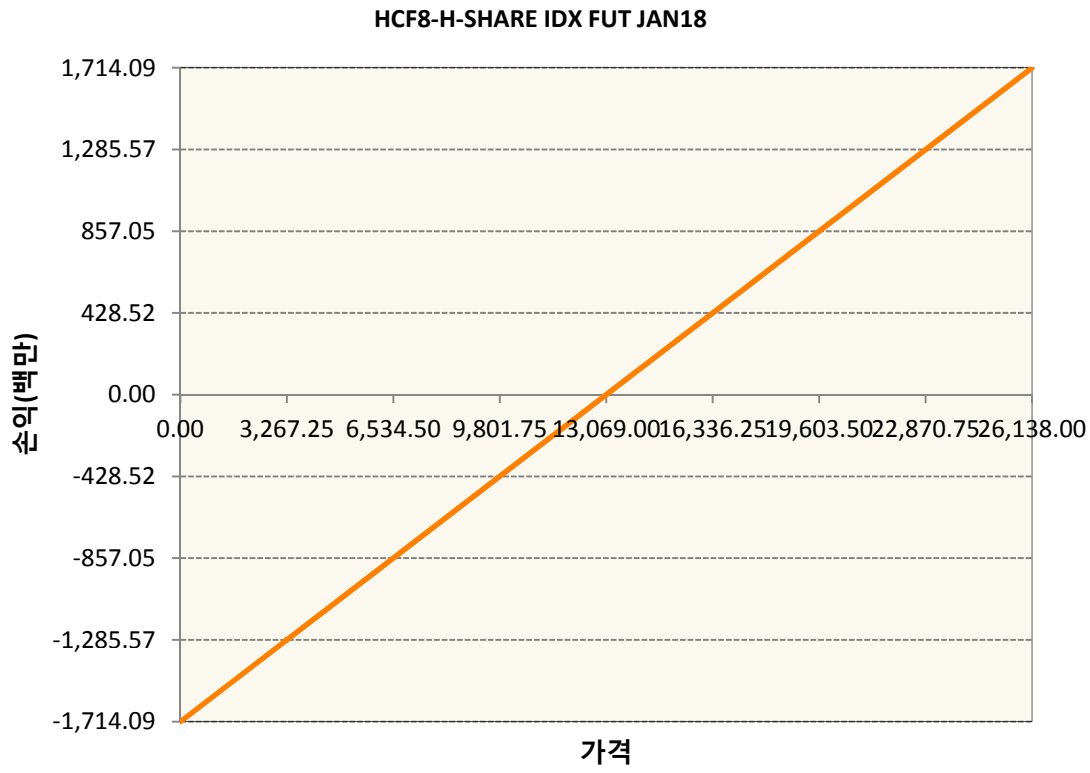
차이나인덱스모(주식-파생형)

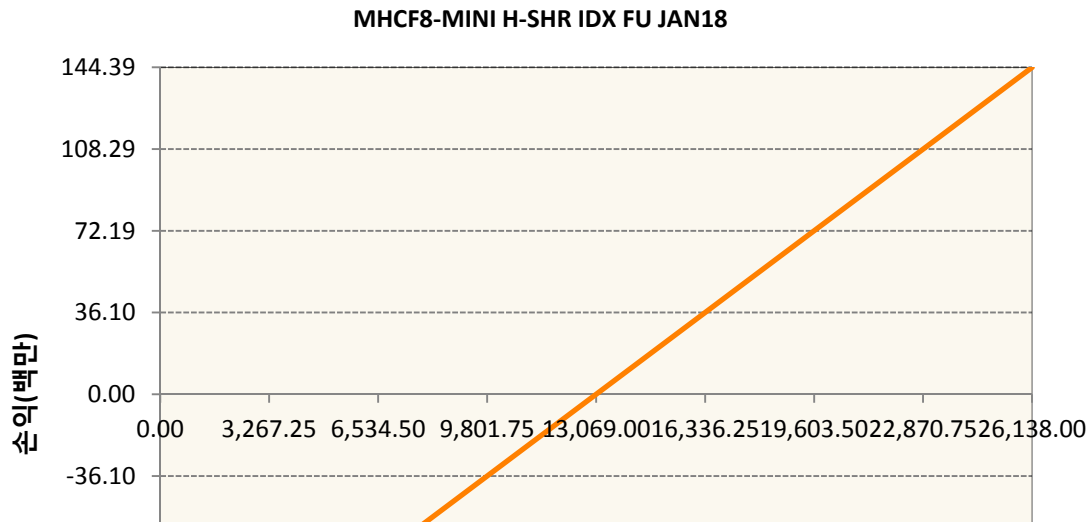
1. 계약금액

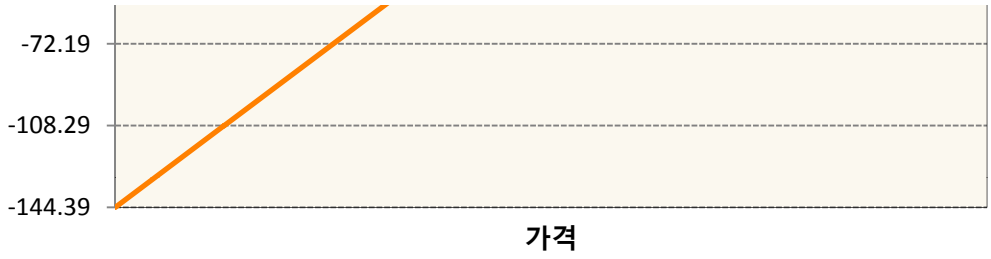
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,858	0	1,858	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCF8	H-SHARE IDX FUT JAN18	137
MHCF8	MINI H-SHR IDX FU JAN18	12

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	118

공시일	2018-01-19
기준일	2018-01-18

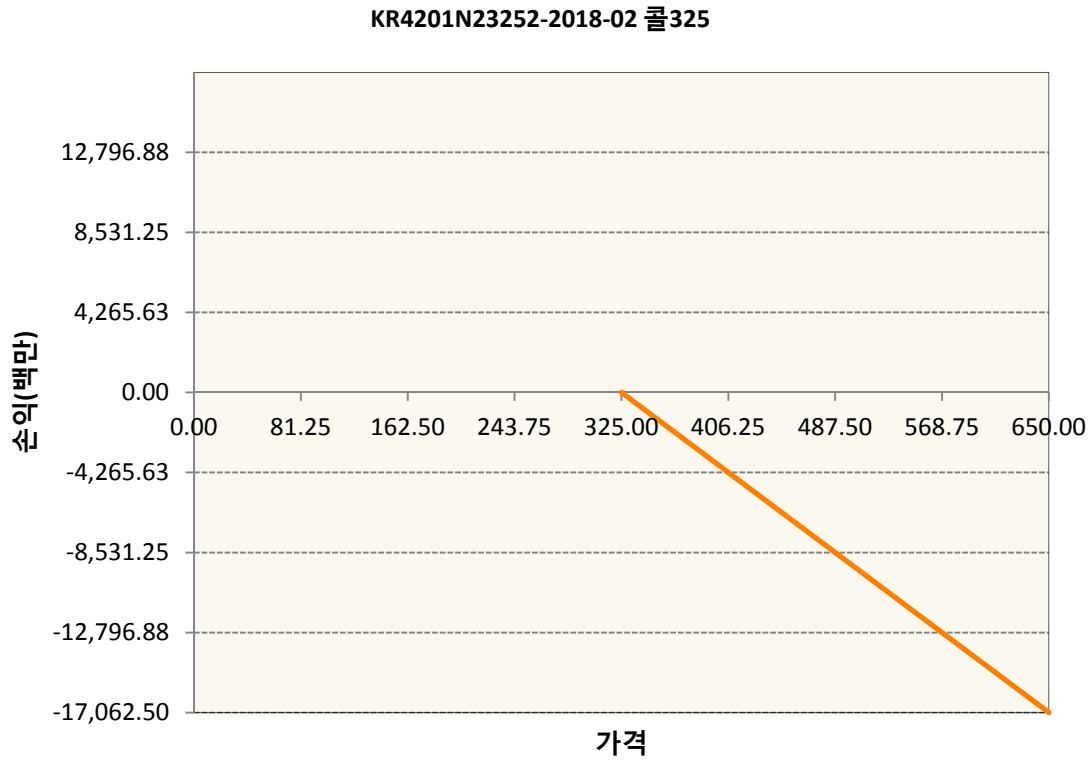
커버드콜모(주식혼합-파생형)

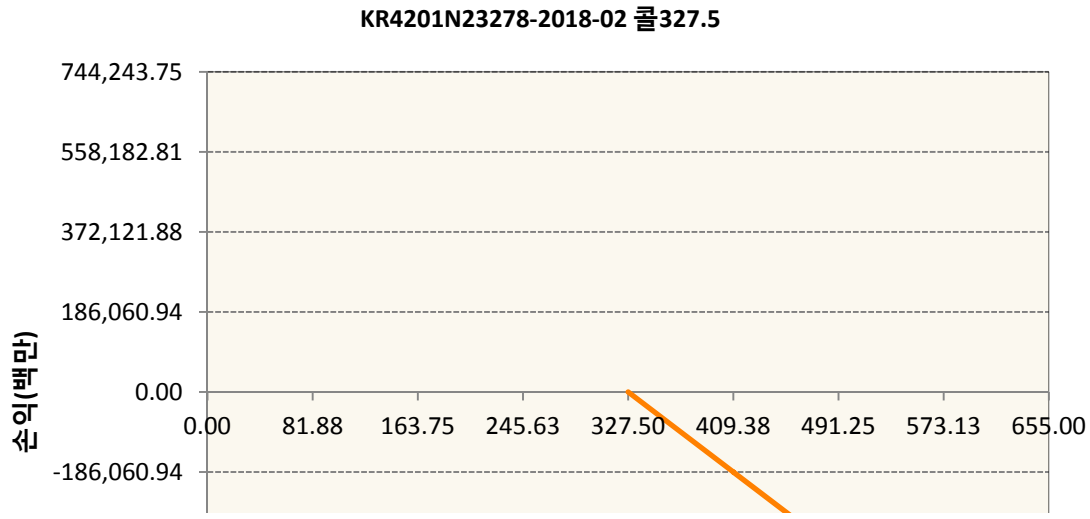
1. 계약금액

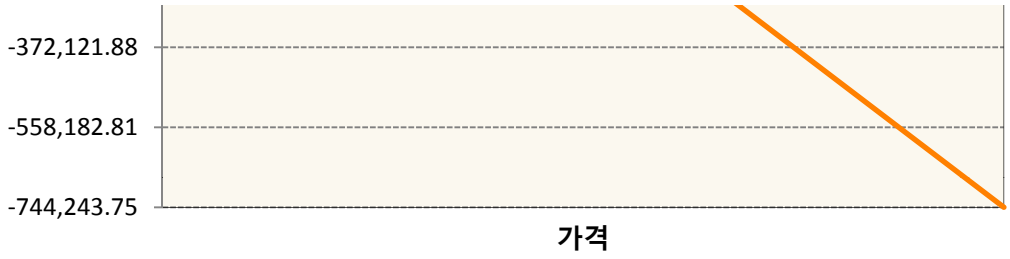
(단위:백만원)

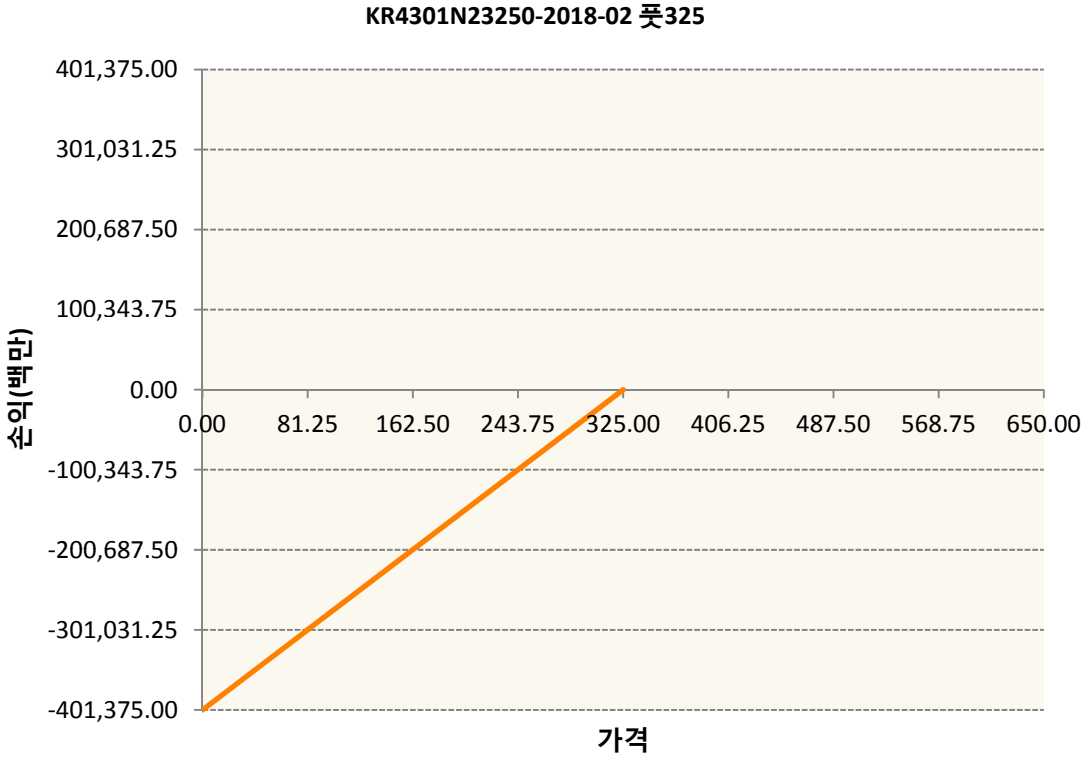
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	15,884	0	15,884	장내
누계	유가증권	옵션	0	1,339,531	-1,339,531	장내

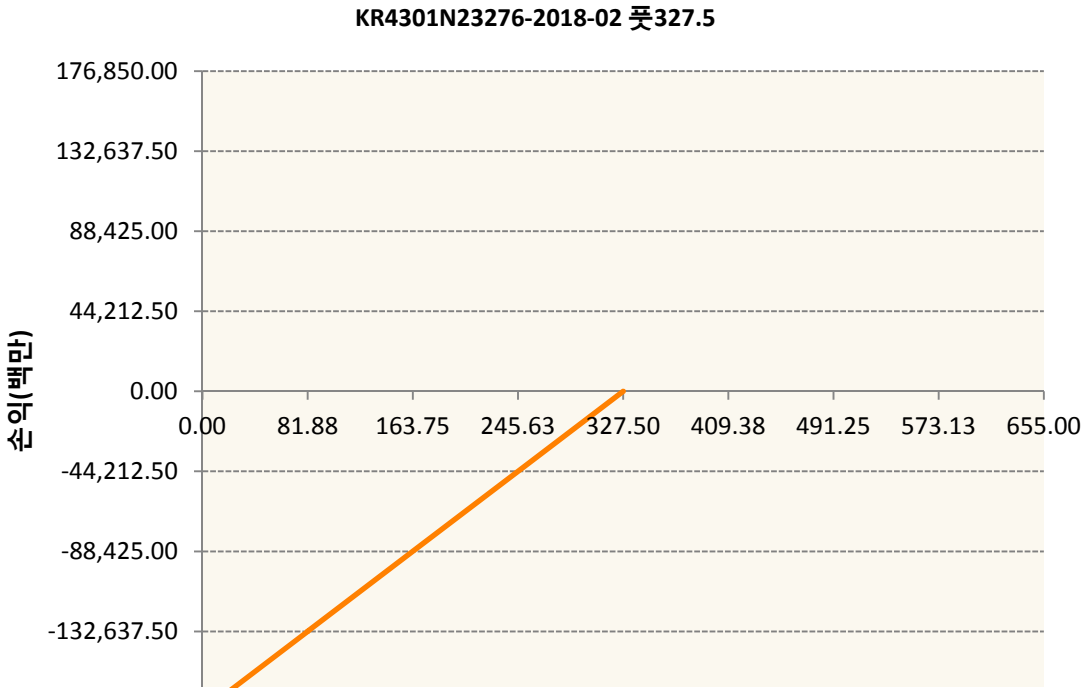
2. 만기시점의 손익구조






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


KR4301N23250-2018-02 풋325
401,375.00
301,031.25
200,687.50
100,343.75
0.00
-100,343.75
-200,687.50
-301,031.25
-401,375.00
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
176,850.00
132,637.50
88,425.00
44,212.50
0.00
-44,212.50
-88,425.00
-132,637.50
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							1,148
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	517	506	492	476	458	439	418
-5.33%	463	440	416	390	363	335	306
-2.67%	333	301	268	235	202	168	135
0%	100	67	34	0	-34	-68	-101
2.67%	-234	-258	-285	-312	-341	-371	-401
5.33%	-638	-652	-668	-687	-708	-730	-754
8.00%	-1,078	-1,084	-1,093	-1,103	-1,116	-1,131	-1,148
KR4201N232 2018-02 콜327.5							47,895
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	19,539	19,157	18,671	18,089	17,421	16,676	15,863
-5.33%	17,793	16,937	15,994	14,980	13,908	12,788	11,628
-2.67%	13,246	11,911	10,551	9,172	7,779	6,374	4,959
0%	4,468	2,980	1,491	0	-1,492	-2,984	-4,477
2.67%	-8,817	-10,032	-11,298	-12,602	-13,937	-15,296	-16,675
5.33%	-25,568	-26,315	-27,165	-28,104	-29,117	-30,191	-31,318
8.00%	-44,291	-44,644	-45,105	-45,669	-46,328	-47,074	-47,895
KR4301N232 2018-02 풋325							24,747
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-24,583	-24,587	-24,598	-24,617	-24,646	-24,689	-24,747
-5.33%	-13,854	-13,936	-14,045	-14,179	-14,337	-14,517	-14,717
-2.67%	-4,367	-4,699	-5,042	-5,393	-5,750	-6,112	-6,478
0%	1,053	711	359	0	-365	-735	-1,109
2.67%	2,459	2,359	2,230	2,075	1,895	1,692	1,470
5.33%	2,596	2,586	2,568	2,538	2,492	2,430	2,350
8.00%	2,600	2,600	2,599	2,596	2,590	2,579	2,560
KR4301N232 2018-02 풋327.5							11,622
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-11,580	-11,581	-11,583	-11,587	-11,594	-11,606	-11,622
-5.33%	-6,862	-6,881	-6,910	-6,948	-6,996	-7,054	-7,121
-2.67%	-2,455	-2,570	-2,693	-2,823	-2,959	-3,100	-3,245
0%	515	344	172	0	-173	-346	-519
2.67%	1,514	1,442	1,358	1,263	1,158	1,044	924

5.33%	1,647	1,638	1,622	1,598	1,565	1,524	1,474
8.00%	1,653	1,653	1,652	1,649	1,643	1,634	1,621

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

88,408

공시일	2018-01-19
기준일	2018-01-18

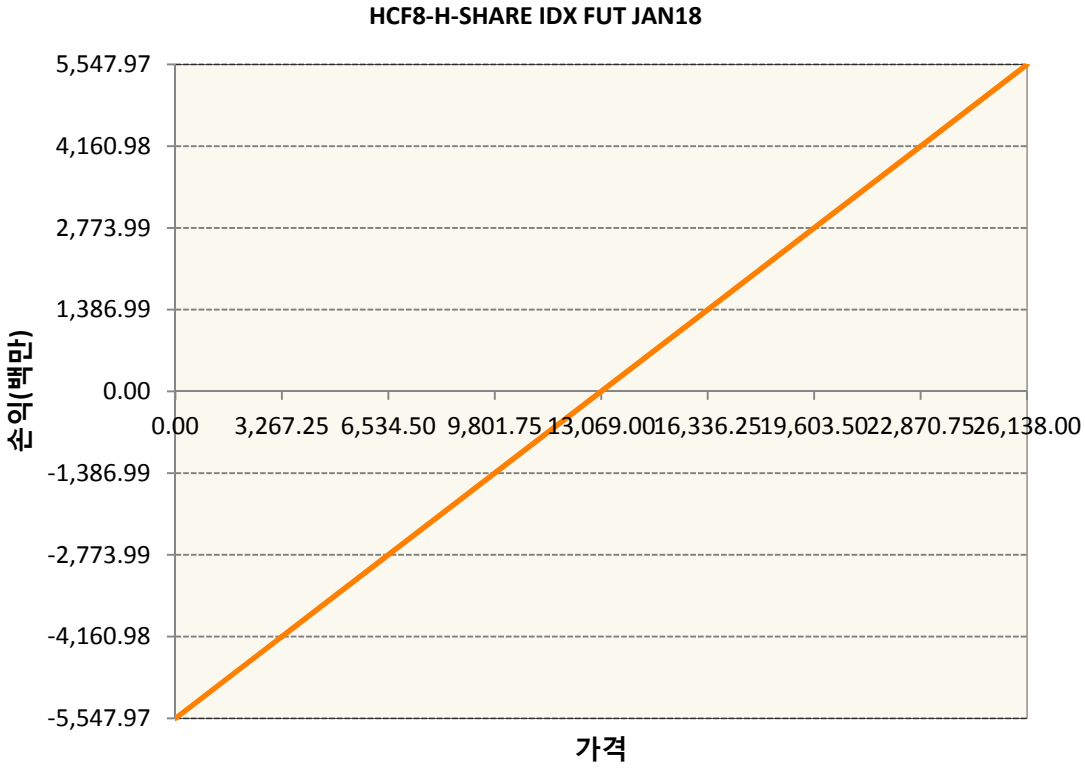
홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생

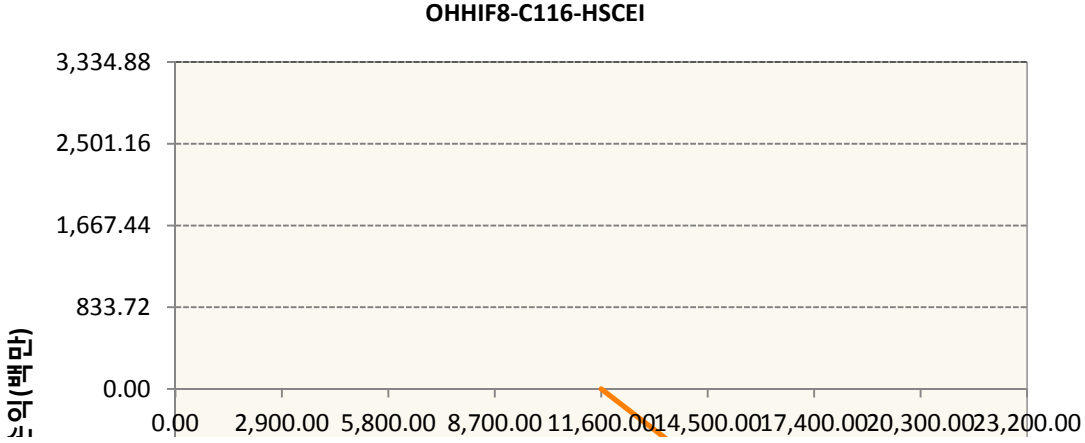
1. 계약금액

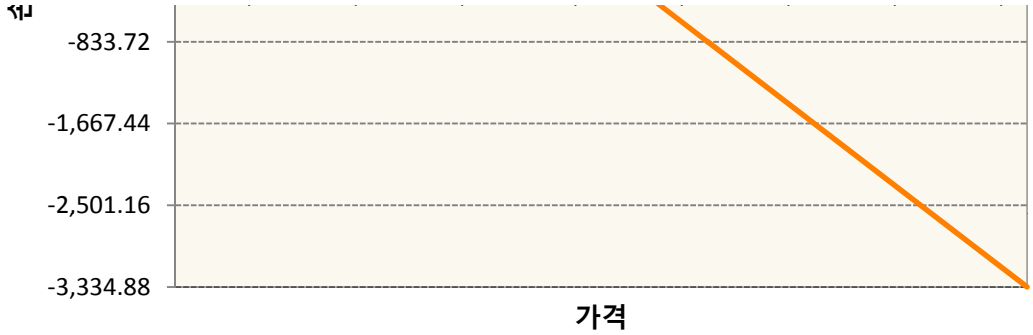
(단위:백만원)

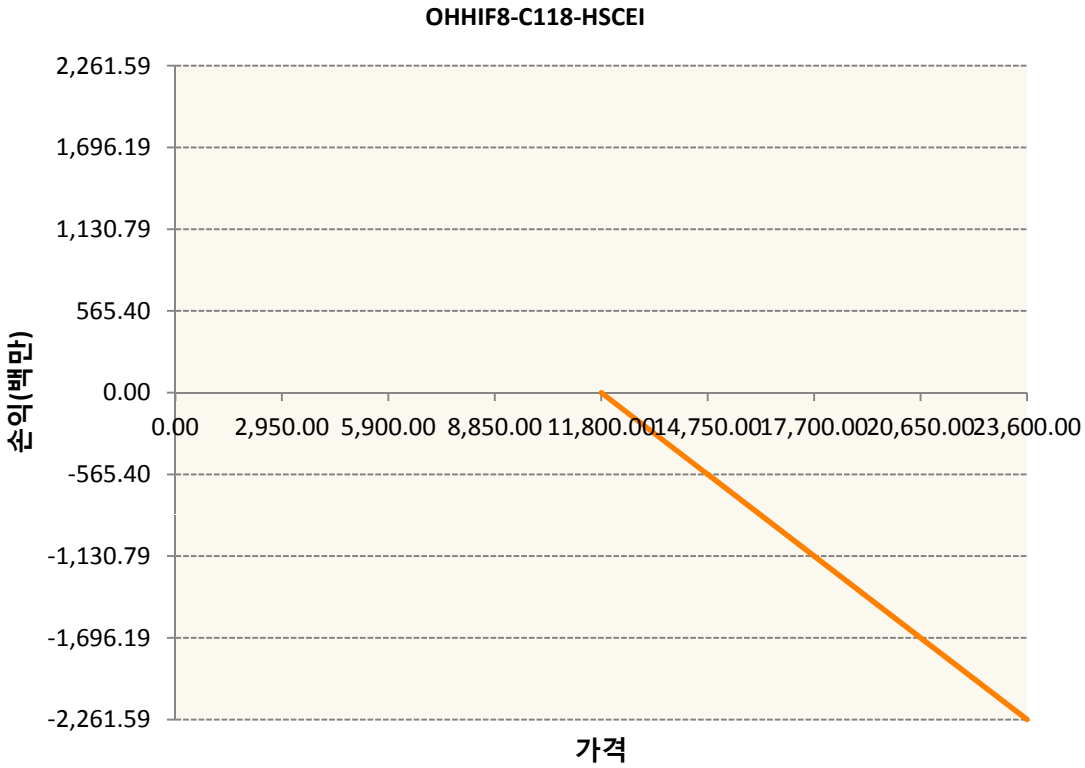
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	5,548	0	5,548	장내
누계	유가증권	옵션	0	11,193	-11,193	장내

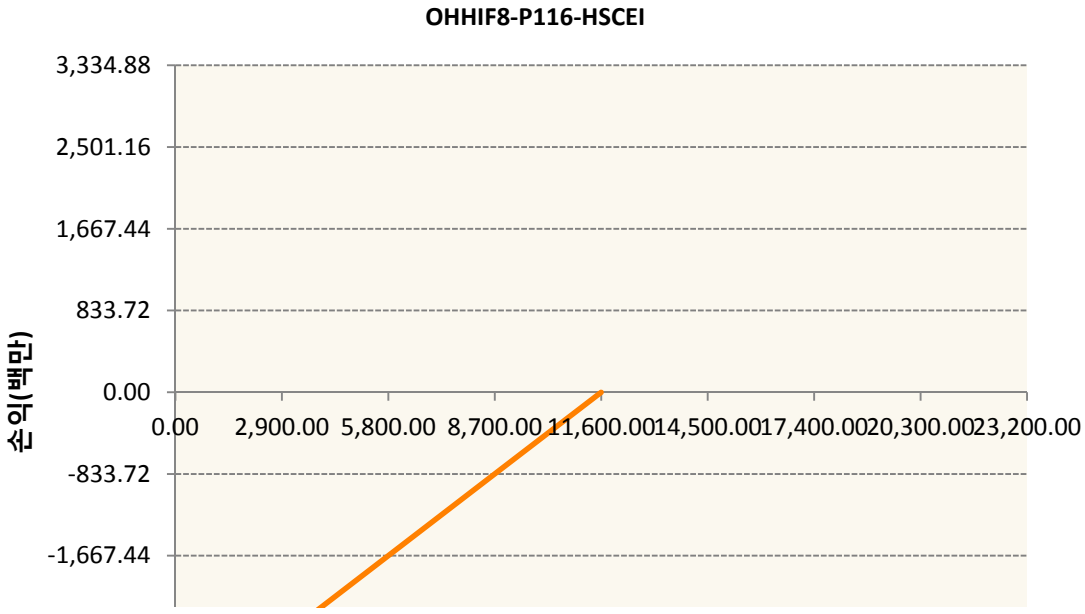
2. 만기시점의 손익구조

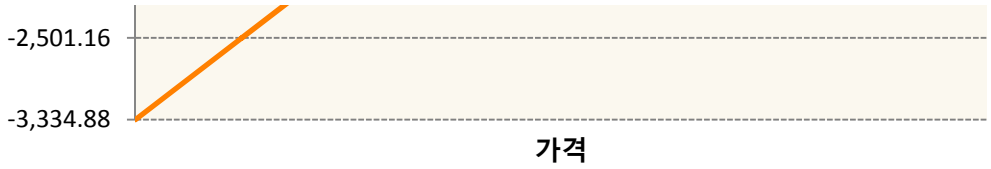


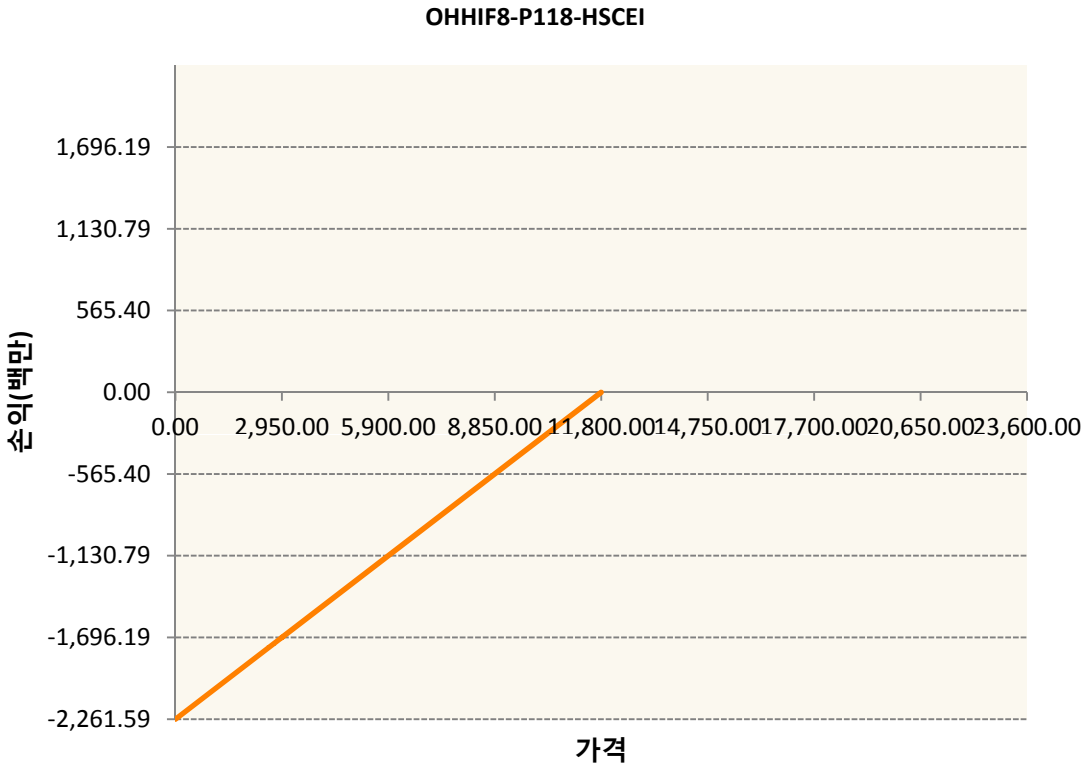



-833.72
-1,667.44
-2,501.16
-3,334.88
가격


OHHIF8-C118-HSCEI
2,261.59
1,696.19
1,130.79
565.40
0.00
-565.40
-1,130.79
-1,696.19
-2,261.59
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
3,334.88
2,501.16
1,667.44
833.72
0.00
-833.72
-1,667.44
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	444
OHHIF8-C11	HSCEI	267
OHHIF8-C11	HSCEI	181
OHHIF8-P11	HSCEI	267
OHHIF8-P11	HSCEI	181

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,064

공시일	2018-01-19
기준일	2018-01-18

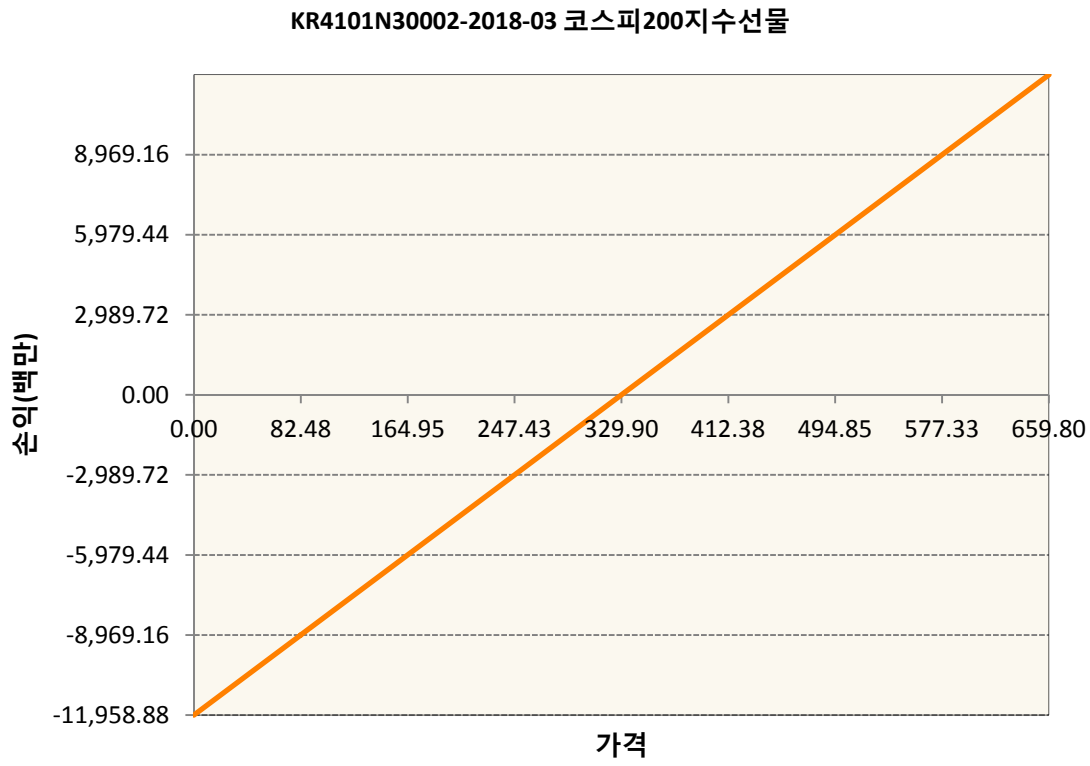
코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼

1. 계약금액

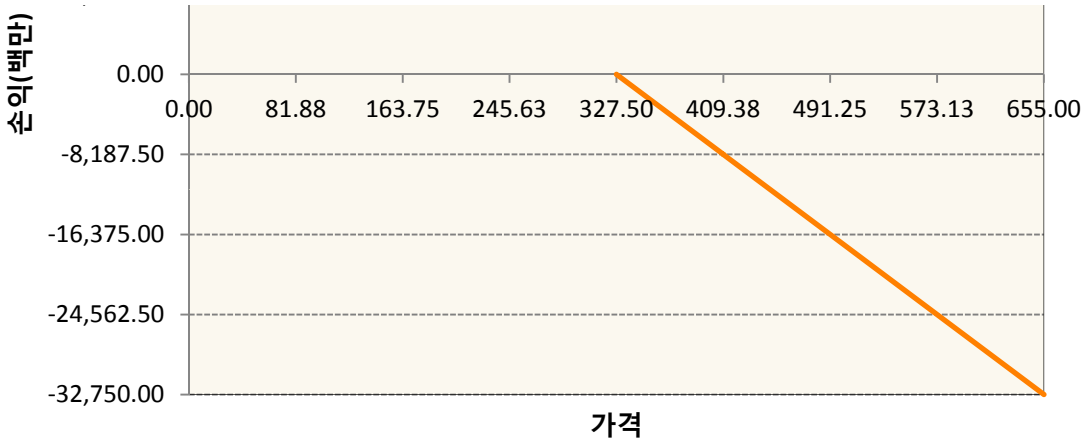
(단위:백만원)

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	11,959	0	11,959	장내
누계	유가증권	스왑	60,200	0	60,200	장외
누계	유가증권	옵션	0	60,431	-60,431	장내

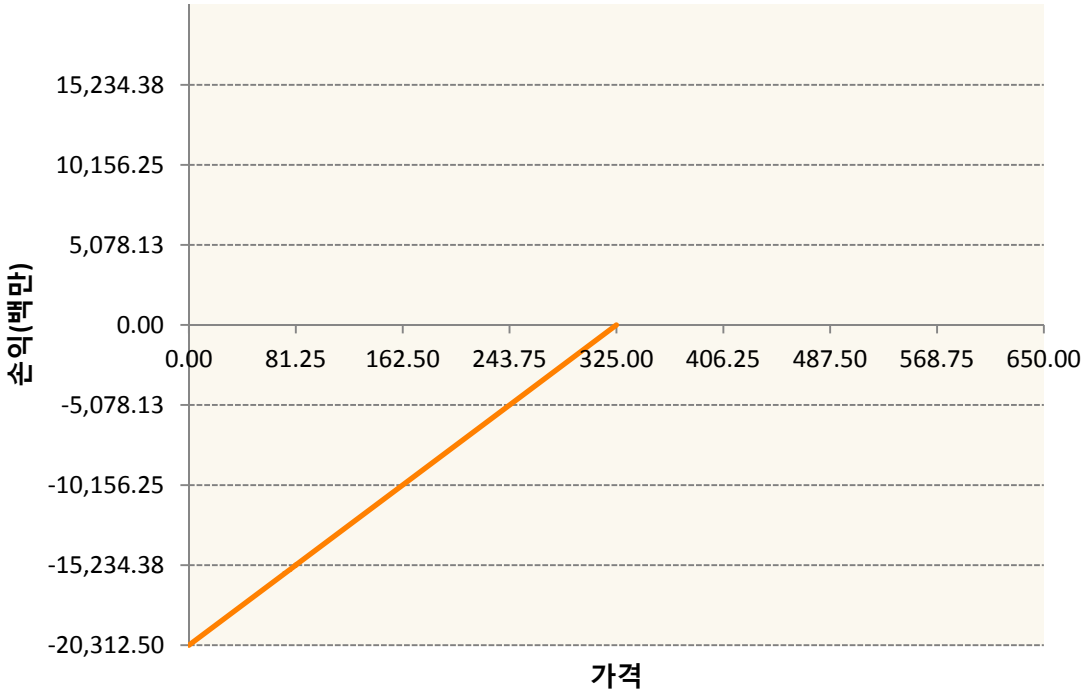
2. 만기시점의 손익구조



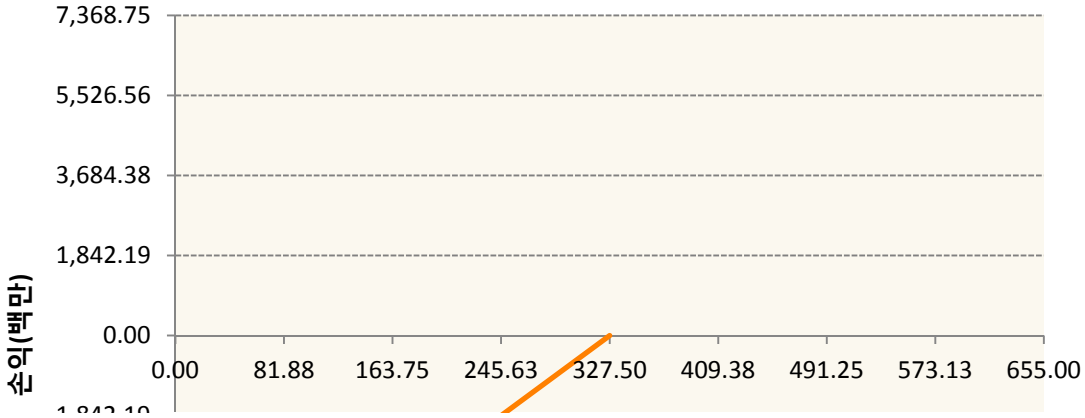




KR4301N23250-2018-02 풋325



KR4301N23276-2018-02 풋327.5





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_2							1,449
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,449	-1,449	-1,449	-1,449	-1,449	-1,449	-1,449
-5.33%	-966	-966	-966	-966	-966	-966	-966
-2.67%	-483	-483	-483	-483	-483	-483	-483
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	483	483	483	483	483	483	483
5.33%	966	966	966	966	966	966	966
8.00%	1,449	1,449	1,449	1,449	1,449	1,449	1,449
2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_3							274
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-274	-274	-274	-274	-274	-274	-274
-5.33%	-183	-183	-183	-183	-183	-183	-183
-2.67%	-91	-91	-91	-91	-91	-91	-91
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	91	91	91	91	91	91	91
5.33%	183	183	183	183	183	183	183
8.00%	274	274	274	274	274	274	274
2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_4							157
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-157	-157	-157	-157	-157	-157	-157
-5.33%	-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%	157	157	157	157	157	157	157
2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_5							235
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%

-8.00%	-235	-235	-235	-235	-235	-235	-235
-5.33%	-157	-157	-157	-157	-157	-157	-157
-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%	157	157	157	157	157	157	157
8.00%	235	235	235	235	235	235	235
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_6						196
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-196	-196	-196	-196	-196	-196	-196
-5.33%	-131	-131	-131	-131	-131	-131	-131
-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%	131	131	131	131	131	131	131
8.00%	196	196	196	196	196	196	196
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_7						251
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-251	-251	-251	-251	-251	-251	-251
-5.33%	-167	-167	-167	-167	-167	-167	-167
-2.67%	-84	-84	-84	-84	-84	-84	-84
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	84	84	84	84	84	84	84
5.33%	167	167	167	167	167	167	167
8.00%	251	251	251	251	251	251	251
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_8						464
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-464	-464	-464	-464	-464	-464	-464
-5.33%	-309	-309	-309	-309	-309	-309	-309
-2.67%	-155	-155	-155	-155	-155	-155	-155
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	155	155	155	155	155	155	155
5.33%	309	309	309	309	309	309	309
8.00%	464	464	464	464	464	464	464
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_9						309
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-309	-309	-309	-309	-309	-309	-309
-5.33%	-206	-206	-206	-206	-206	-206	-206
-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%	206	206	206	206	206	206	206
8.00%	309	309	309	309	309	309	309
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_10						274
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-274	-274	-274	-274	-274	-274	-274
-5.33%	-183	-183	-183	-183	-183	-183	-183
-2.67%	-91	-91	-91	-91	-91	-91	-91
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	91	91	91	91	91	91	91
5.33%	183	183	183	183	183	183	183
8.00%	274	274	274	274	274	274	274
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_11						627
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-627	-627	-627	-627	-627	-627	-627
-5.33%	-418	-418	-418	-418	-418	-418	-418
-2.67%	-209	-209	-209	-209	-209	-209	-209
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	209	209	209	209	209	209	209
5.33%	418	418	418	418	418	418	418
8.00%	627	627	627	627	627	627	627
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_12						470
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-470	-470	-470	-470	-470	-470	-470
-5.33%	-313	-313	-313	-313	-313	-313	-313
-2.67%	-157	-157	-157	-157	-157	-157	-157
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	157	157	157	157	157	157	157
5.33%	313	313	313	313	313	313	313
8.00%	470	470	470	470	470	470	470
	KR4101N30(2018-03 코스피200지수선물						954
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-954	-954	-954	-954	-954	-954	-954
-5.33%	-636	-636	-636	-636	-636	-636	-636
-2.67%	-318	-318	-318	-318	-318	-318	-318
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	318	318	318	318	318	318	318
5.33%	636	636	636	636	636	636	636
8.00%	954	954	954	954	954	954	954
	KR4201N23: 2018-02 콜327.5						2,108

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	860	843	822	796	767	734	698
-5.33%	783	745	704	659	612	563	512
-2.67%	583	524	464	404	342	280	218
0%	197	131	66	0	-66	-131	-197
2.67%	-388	-441	-497	-555	-613	-673	-734
5.33%	-1,125	-1,158	-1,195	-1,237	-1,281	-1,329	-1,378
8.00%	-1,949	-1,965	-1,985	-2,010	-2,039	-2,071	-2,108
	KR4301N232 2018-02 풋325						1,252

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,244	-1,244	-1,245	-1,246	-1,247	-1,249	-1,252
-5.33%	-701	-705	-711	-718	-726	-735	-745
-2.67%	-221	-238	-255	-273	-291	-309	-328
0%	53	36	18	0	-18	-37	-56
2.67%	124	119	113	105	96	86	74
5.33%	131	131	130	128	126	123	119
8.00%	132	132	132	131	131	130	130
	KR4301N232 2018-02 풋327.5						484

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-483	-483	-483	-483	-483	-484	-484
-5.33%	-286	-287	-288	-290	-292	-294	-297
-2.67%	-102	-107	-112	-118	-123	-129	-135
0%	21	14	7	0	-7	-14	-22
2.67%	63	60	57	53	48	44	39
5.33%	69	68	68	67	65	63	61
8.00%	69	69	69	69	68	68	68

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

9,262

공시일	2018-01-19
기준일	2018-01-18

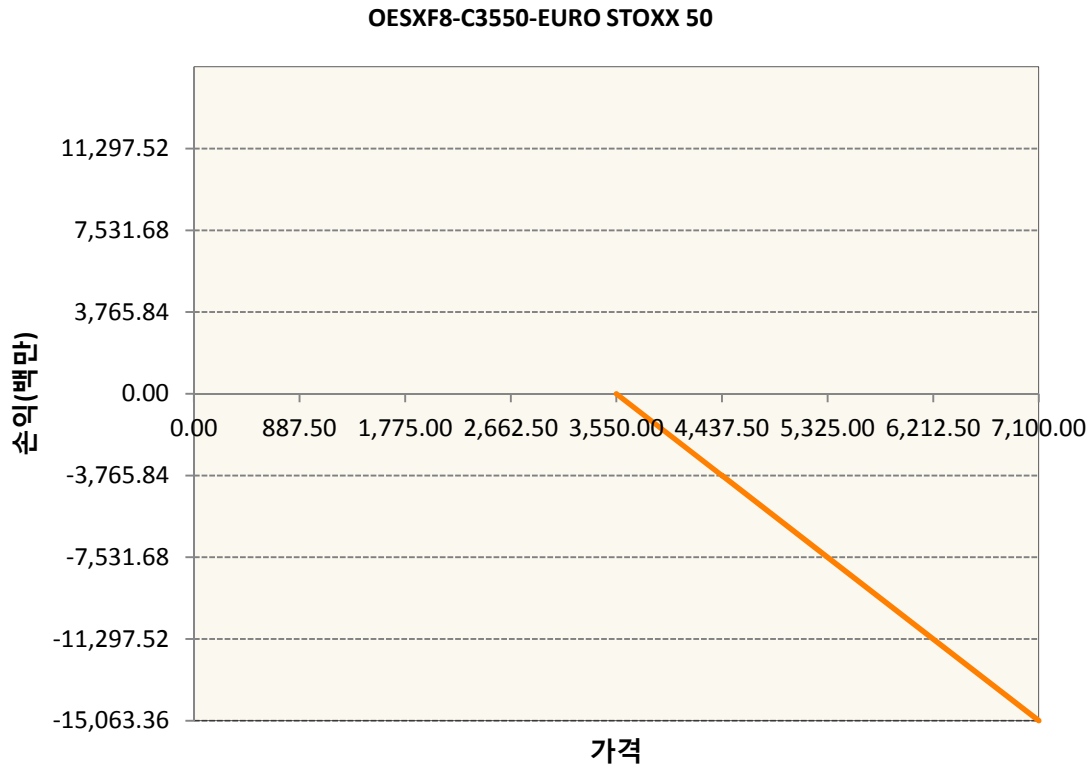
유로커버드콜모(주식혼합-파생형

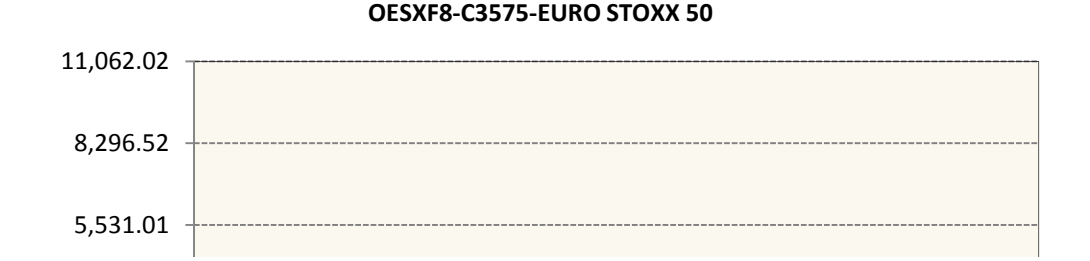
1. 계약금액

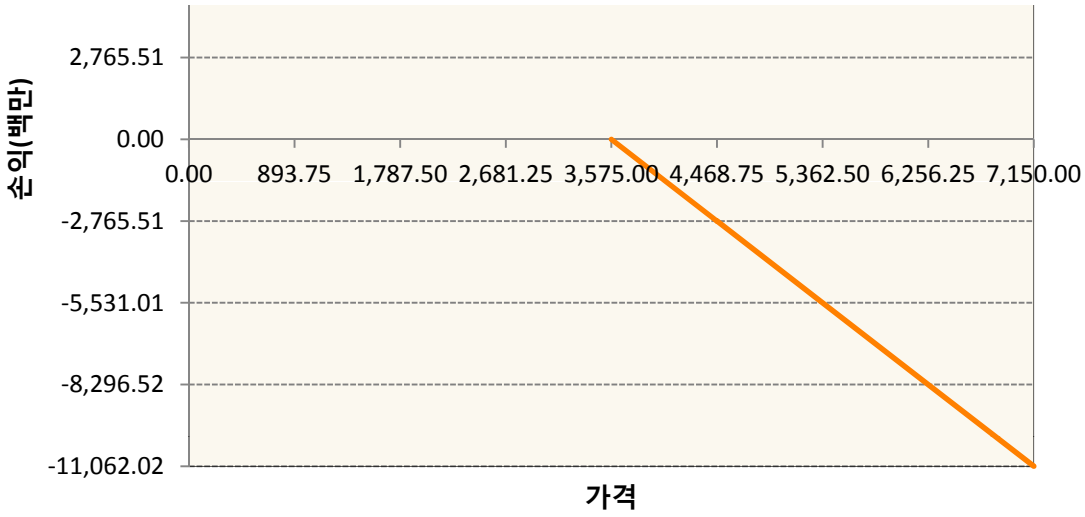
(단위:백만원)

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	17,567	0	17,567	
누계	유가증권	스왑	97,917	0	97,917	장외
누계	유가증권	옵션	0	52,251	-52,251	장내
누계	지수	스왑	52,223	0	52,223	장외

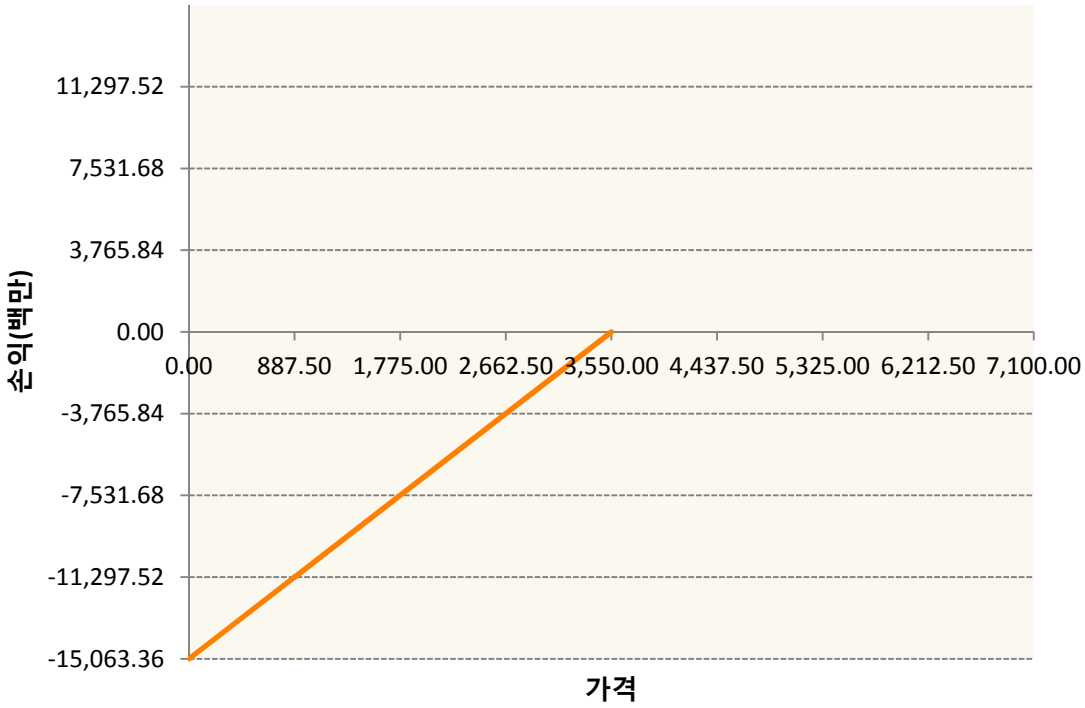
2. 만기시점의 손익구조



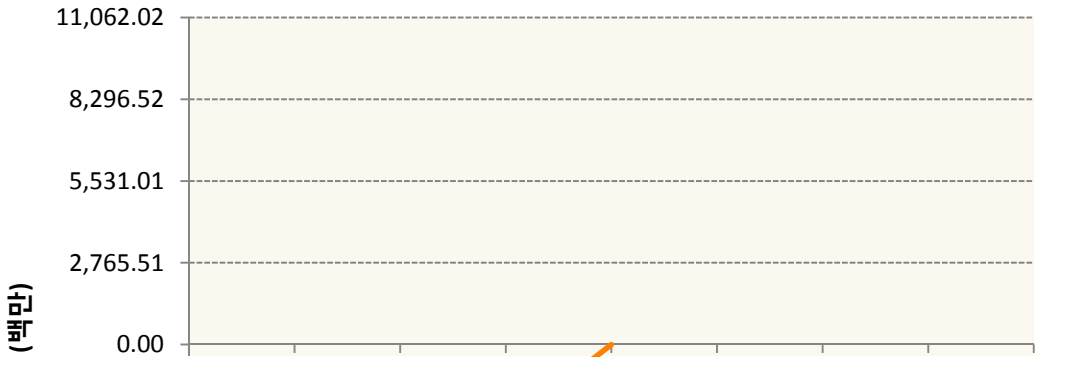


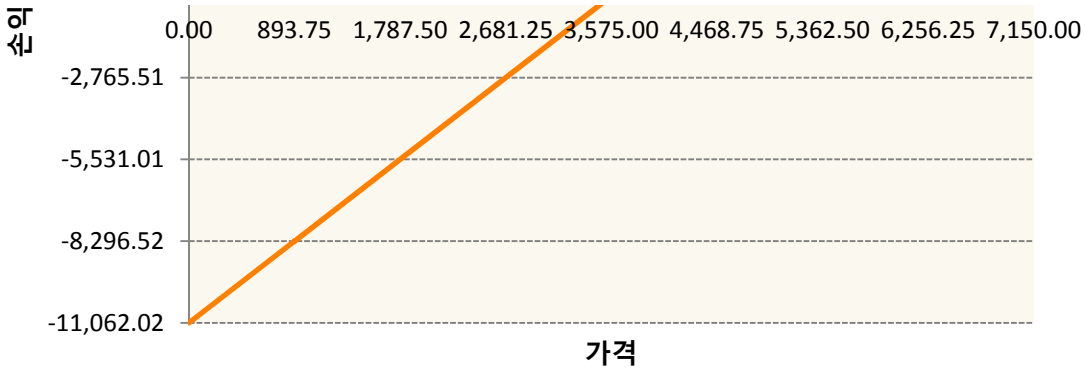


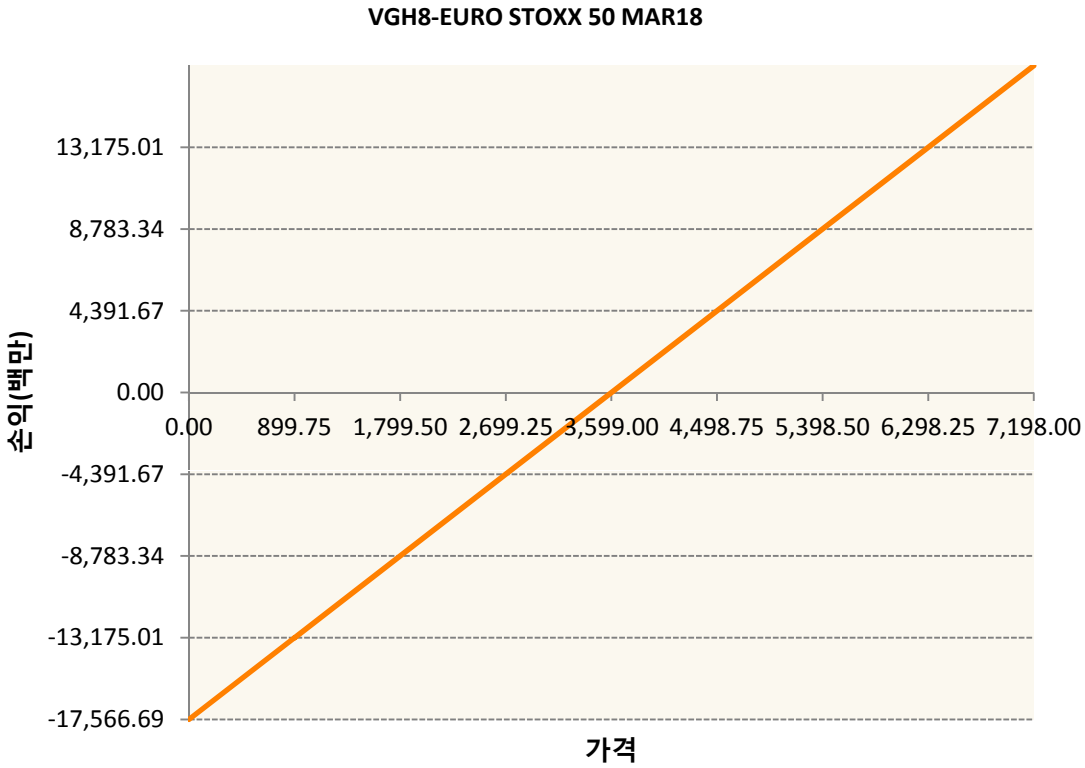
OESXF8-P3550-EURO STOXX 50



OESXF8-P3575-EURO STOXX 50







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)	(단위:백만원)
260105SGPX SG EURO Covered CALL STRATEGY - 994.569	109
260105SQPX SG EURO Covered CALL STRATEGY	161
OESXF8-C35 EURO STOXX 50	1,205
OESXF8-C35 EURO STOXX 50	885
OESXF8-P35 EURO STOXX 50	1,205
OESXF8-P35 EURO STOXX 50	885
VGH8 EURO STOXX 50 MAR18	1,405

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

3,266

공시일	2018-01-19
기준일	2018-01-18

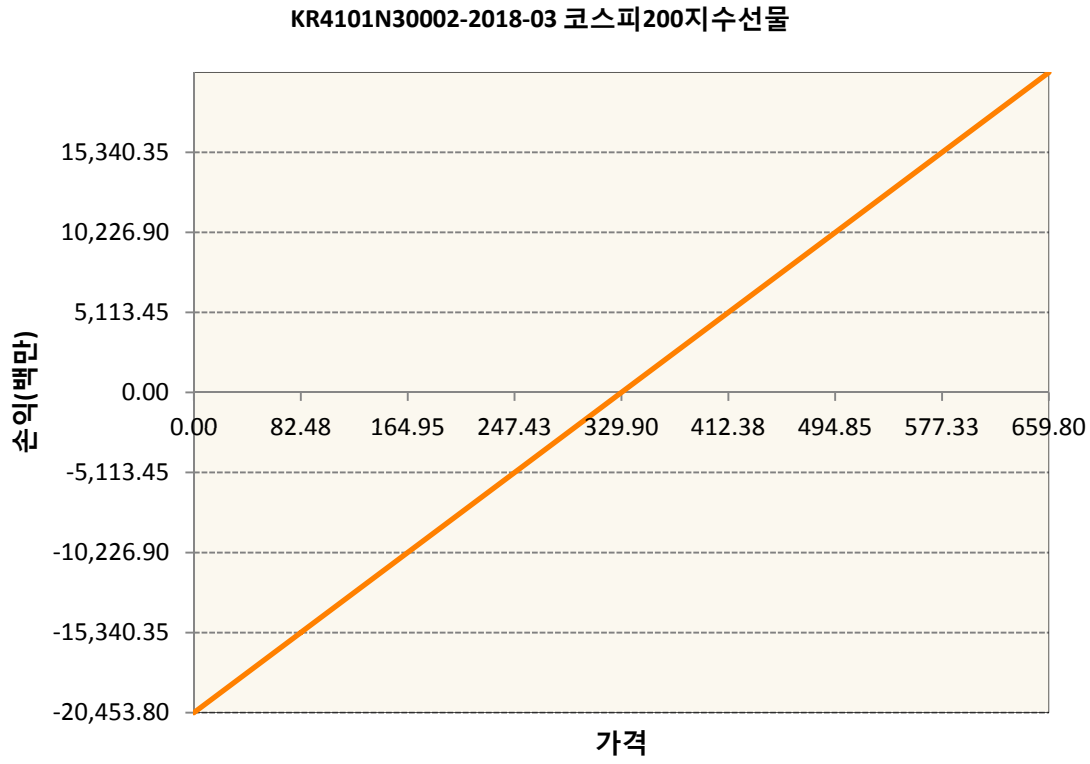
ETF스마트레버리지목표전환형8호

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	20,454	0	20,454	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101N30(2018-03 코스피200지수선물							1,632
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,632	-1,632	-1,632	-1,632	-1,632	-1,632	-1,632
-5.33%	-1,088	-1,088	-1,088	-1,088	-1,088	-1,088	-1,088
-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%	1,088	1,088	1,088	1,088	1,088	1,088	1,088
8.00%	1,632	1,632	1,632	1,632	1,632	1,632	1,632

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

980

공시일	2018-01-19
기준일	2018-01-18

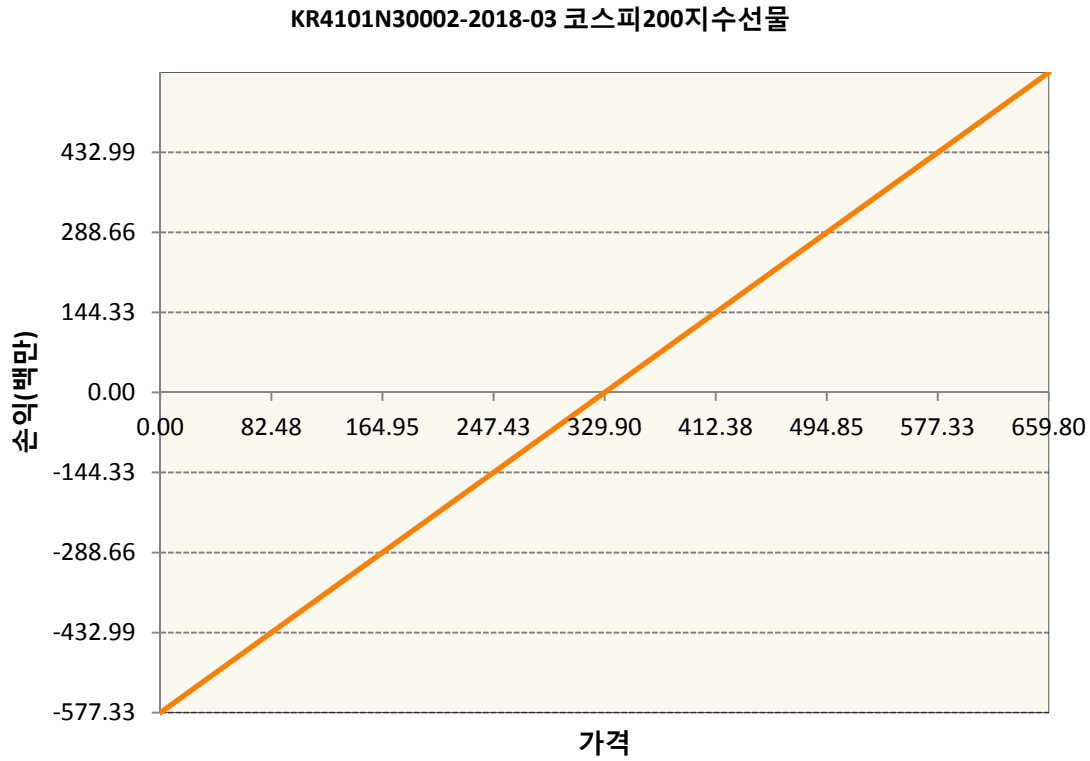
ETF스마트레버리지목표전환형9호

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	577	0	577	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	2018-01-19
기준일	2018-01-18

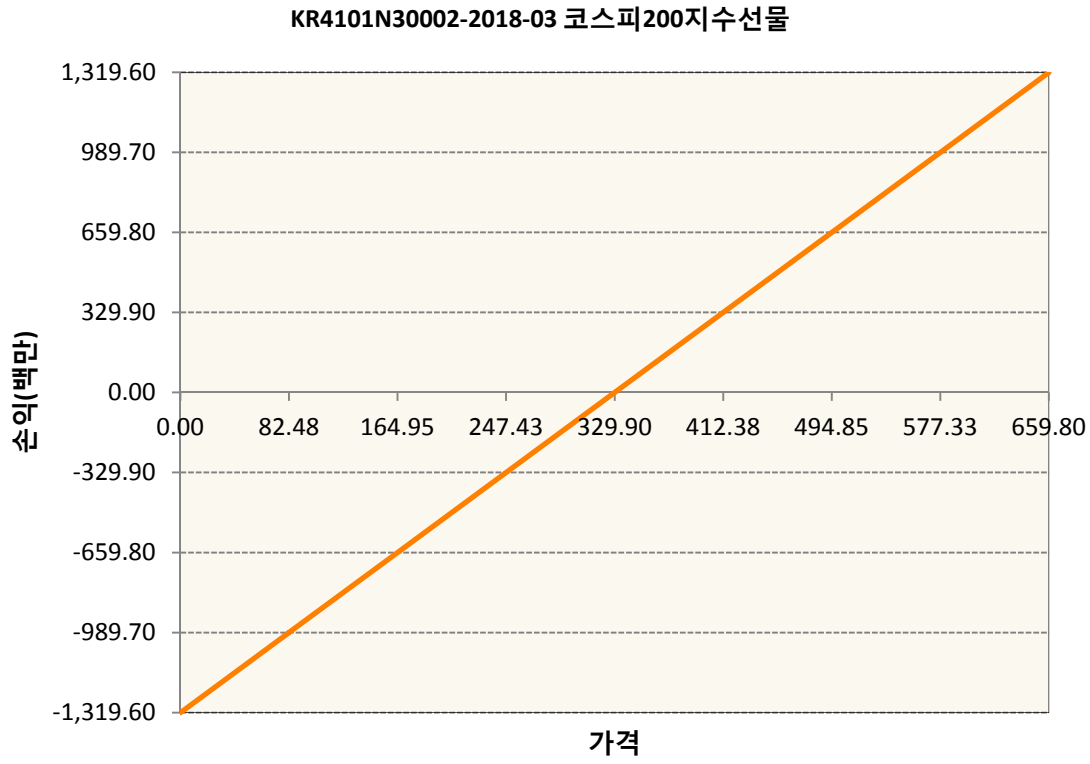
ETF스마트레버리지목표전환형10

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	1,320	0	1,320	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	2018-01-19
기준일	2018-01-18

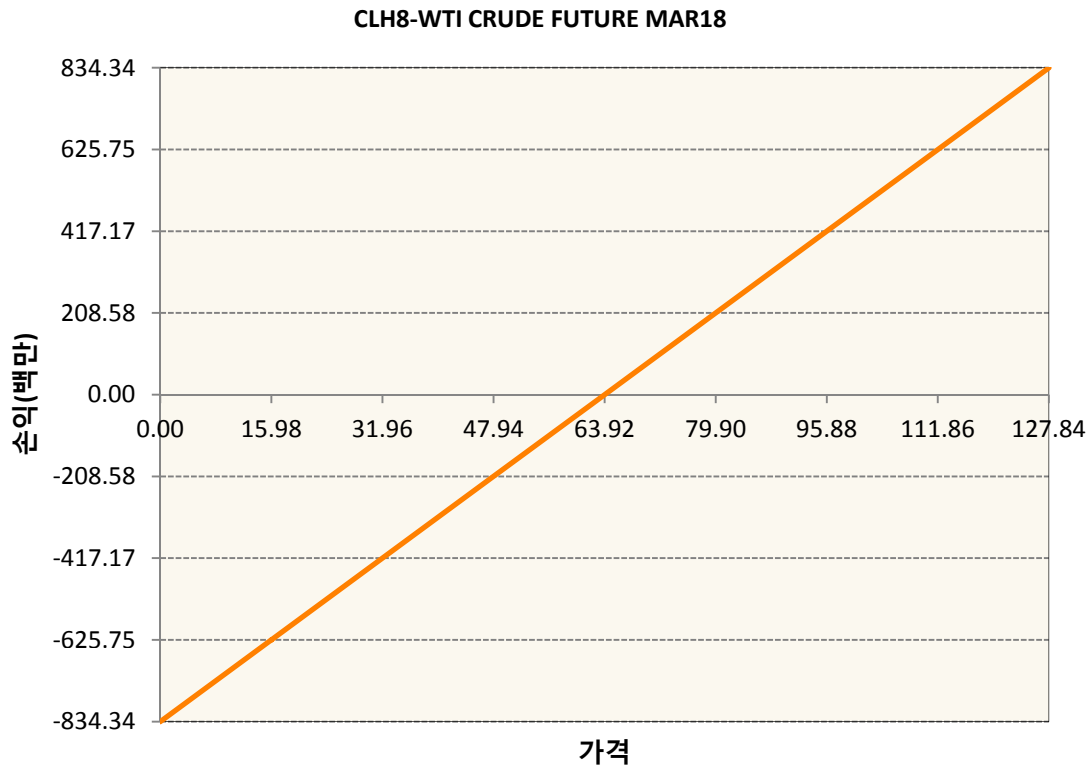
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

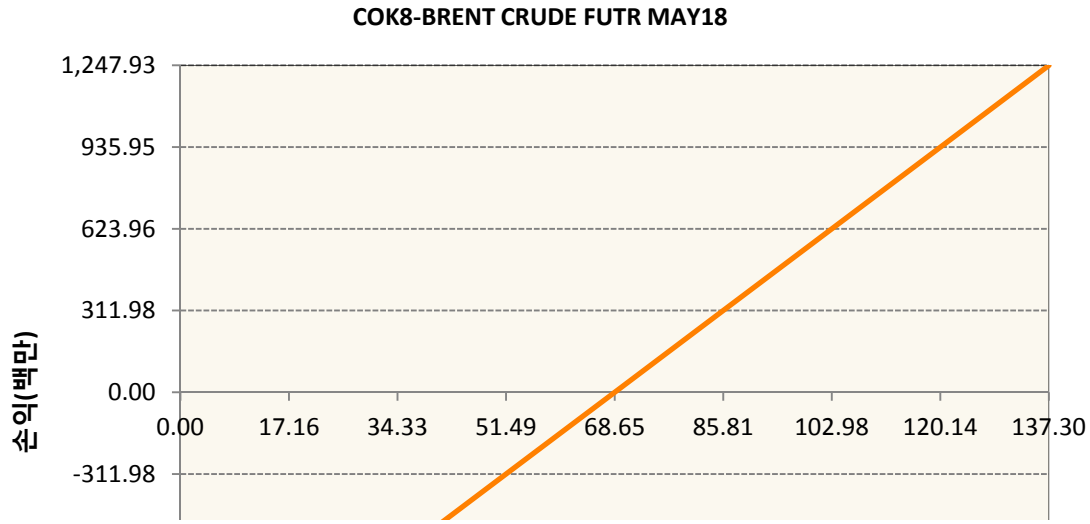
1. 계약금액

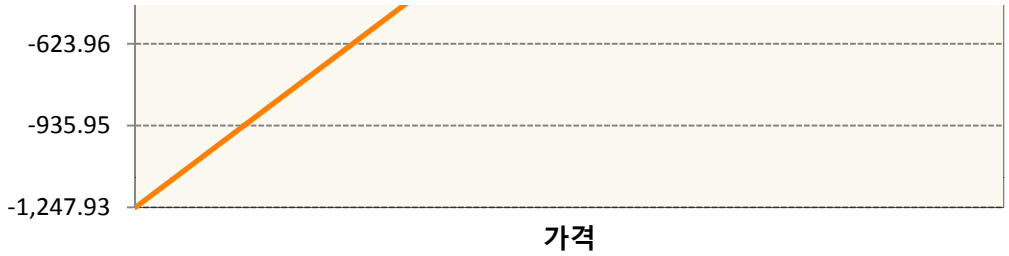
(단위:백만원)

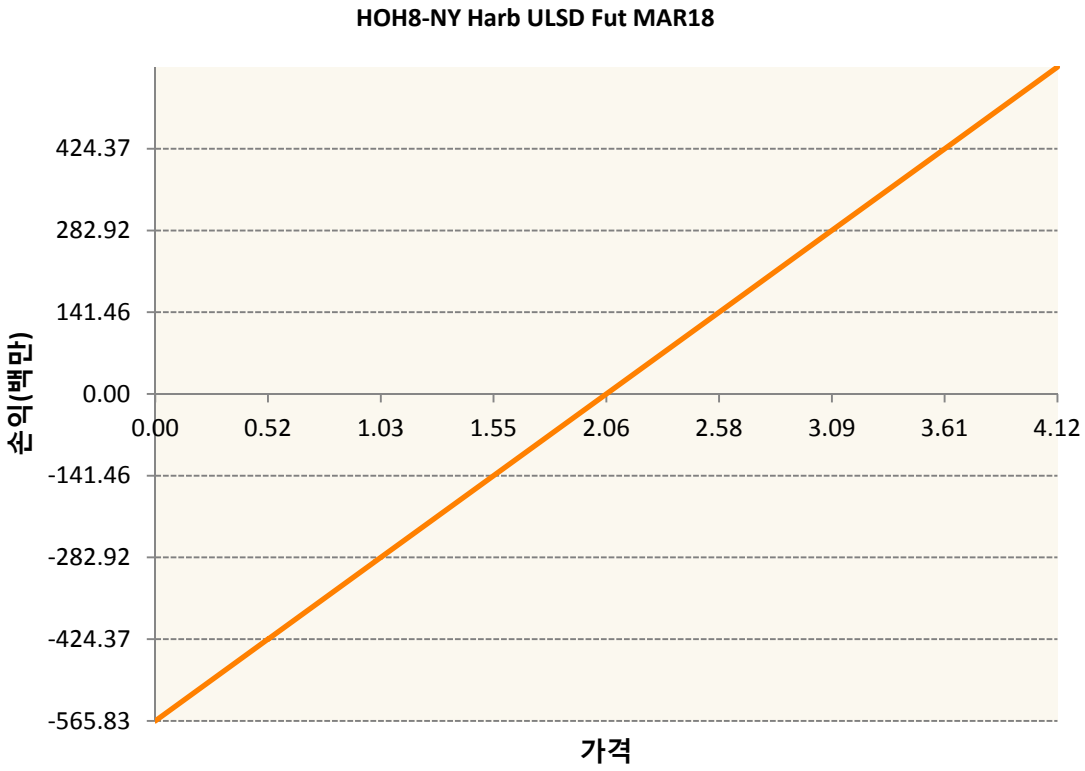
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	4,492	856	3,636	

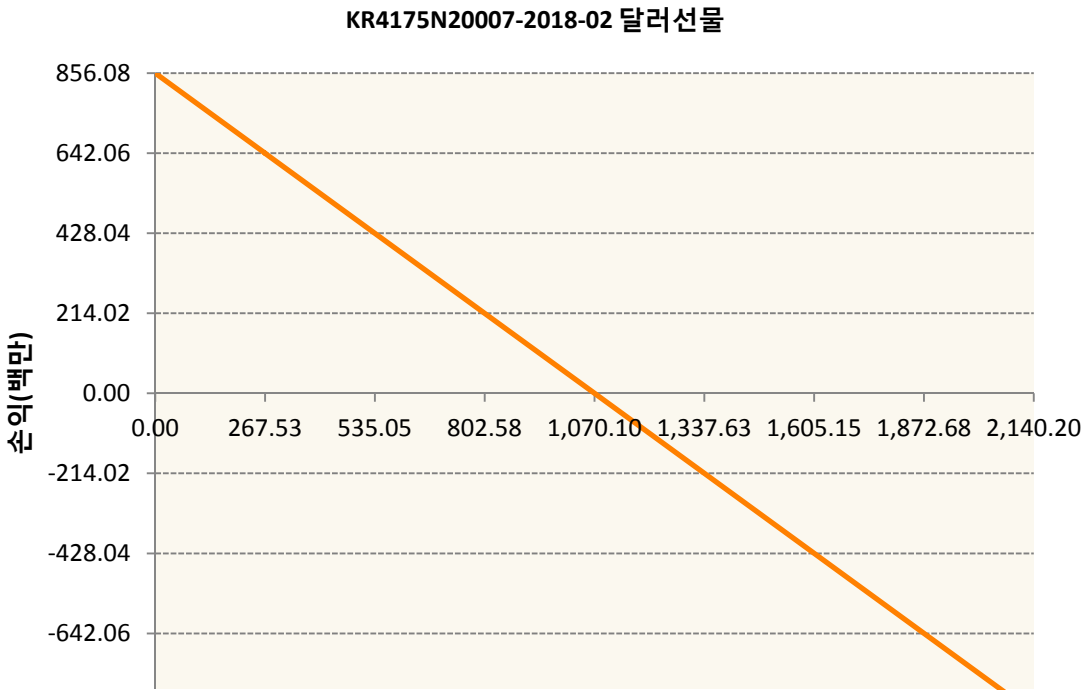
2. 만기시점의 손익구조

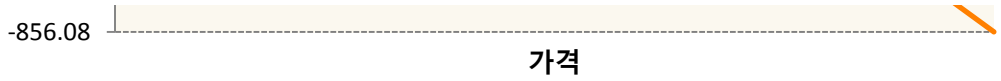


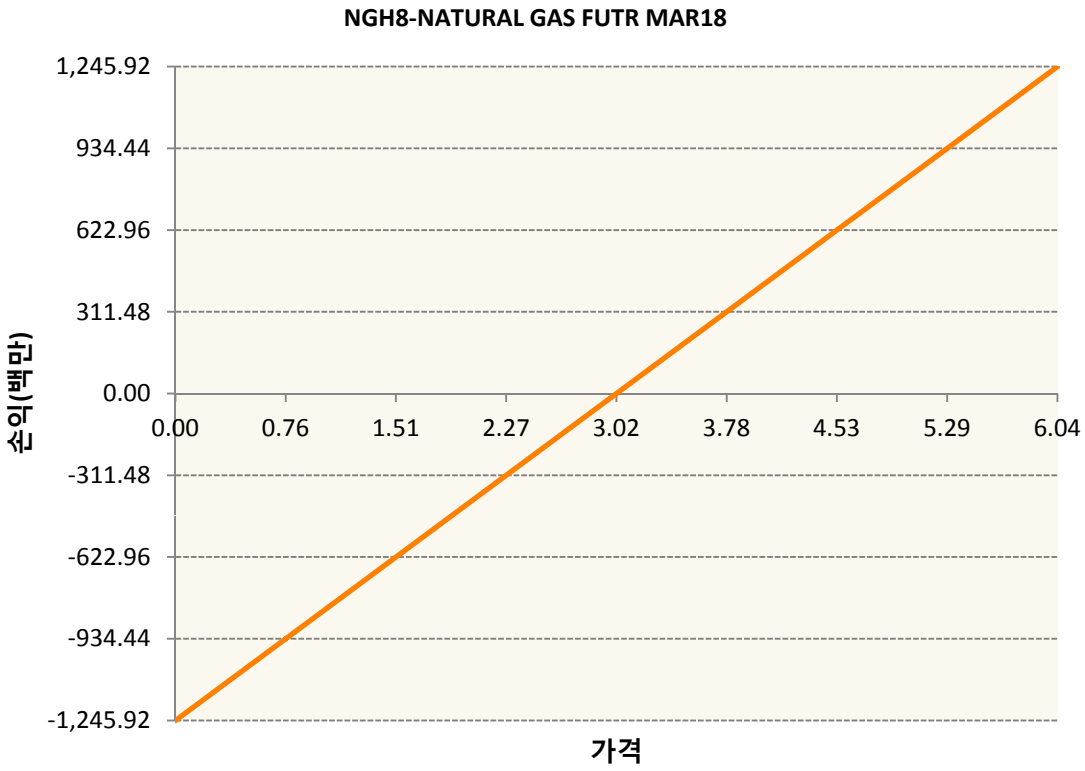


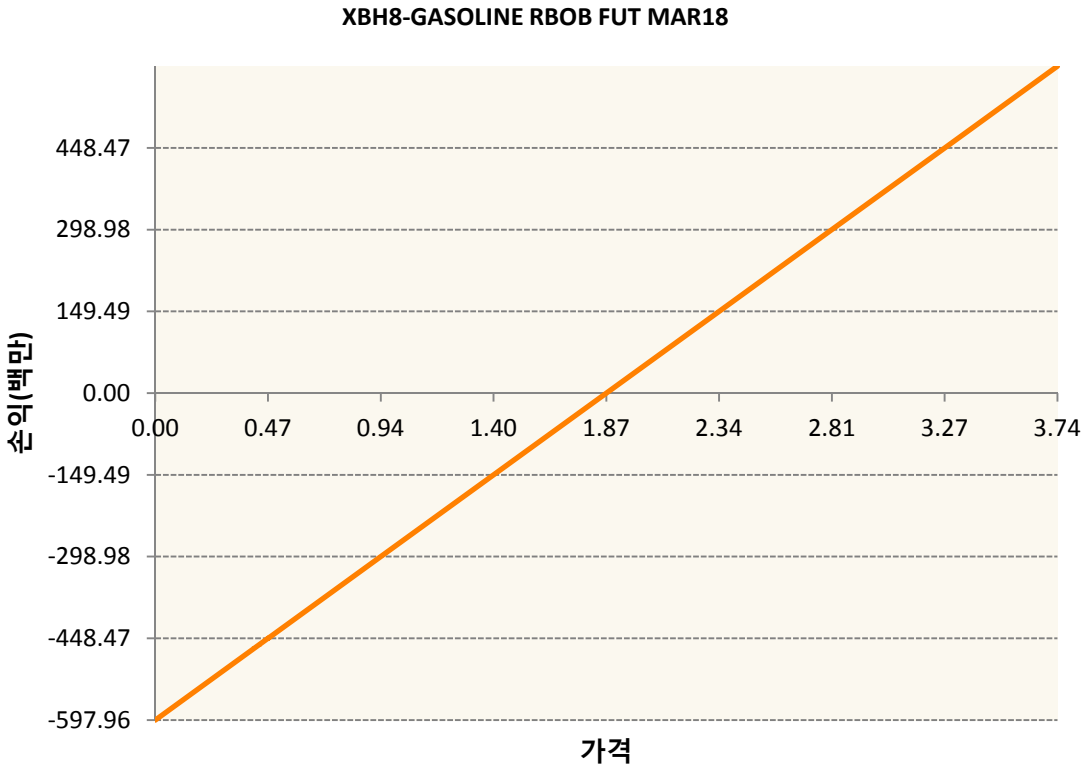

-623.96
-935.95
-1,247.93
가격


HOH8-NY Harb ULSD Fut MAR18
424.37
282.92
141.46
0.00
-141.46
-282.92
-424.37
-565.83
0.00
0.52
1.03
1.55
2.06
2.58
3.09
3.61
4.12
손익(백만)
가격


KR4175N20007-2018-02 달러선물
856.08
642.06
428.04
214.02
0.00
-214.02
-428.04
-642.06
0.00
267.53
535.05
802.58
1,070.10
1,337.63
1,605.15
1,872.68
2,140.20
손익(백만)


-856.08
가격


NGH8-NATURAL GAS FUTR MAR18
1,245.92
934.44
622.96
311.48
0.00
-311.48
-622.96
-934.44
-1,245.92
0.00
0.76
1.51
2.27
3.02
3.78
4.53
5.29
6.04
손익(백만)
가격


XBH8-GASOLINE RBOB FUT MAR18
448.47
298.98
149.49
0.00
-149.49
-298.98
-448.47
-597.96
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	67
COK8	BRENT CRUDE FUTR MAY18	100
HOH8	NY Harb ULSD Fut MAR18	45
KR4175N20(	2018-02 달러선물	68
NGH8	NATURAL GAS FUTR MAR18	100
XBH8	GASOLINE RBOB FUT MAR18	48

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

610

공시일	2018-01-19
기준일	2018-01-18

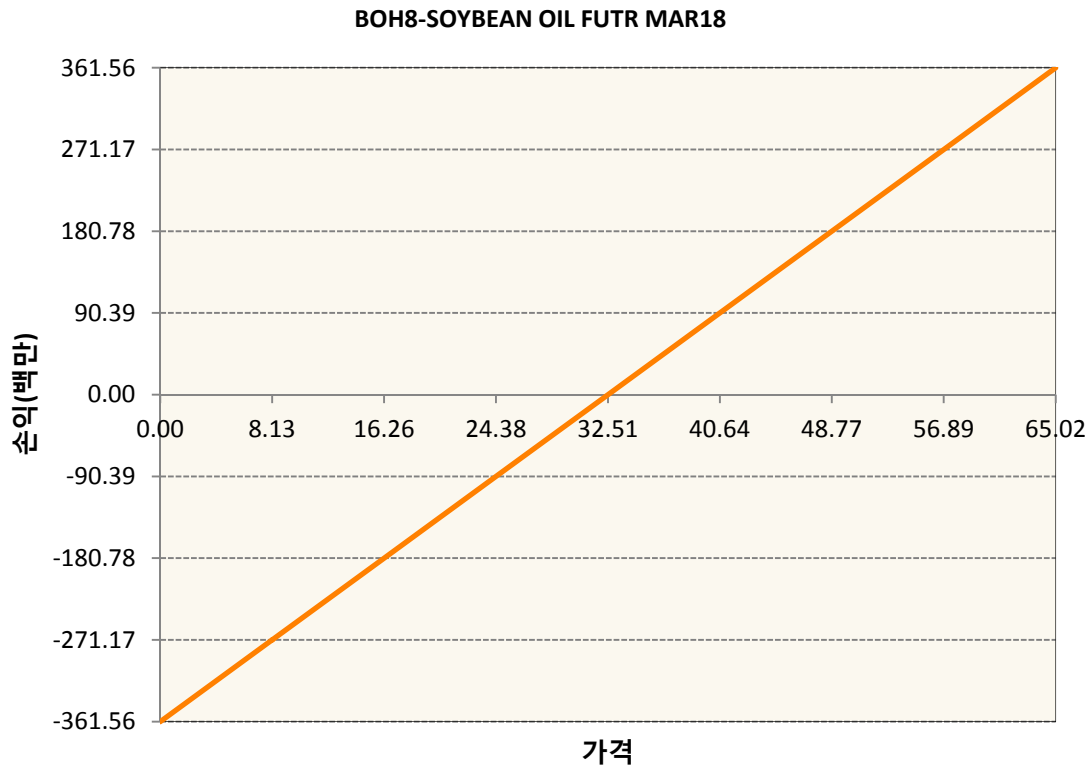
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

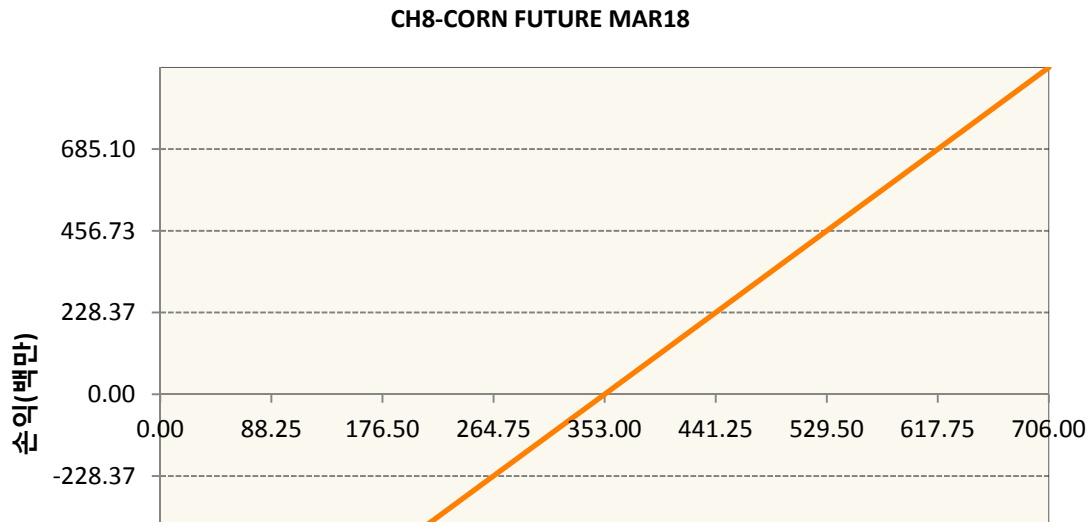
1. 계약금액

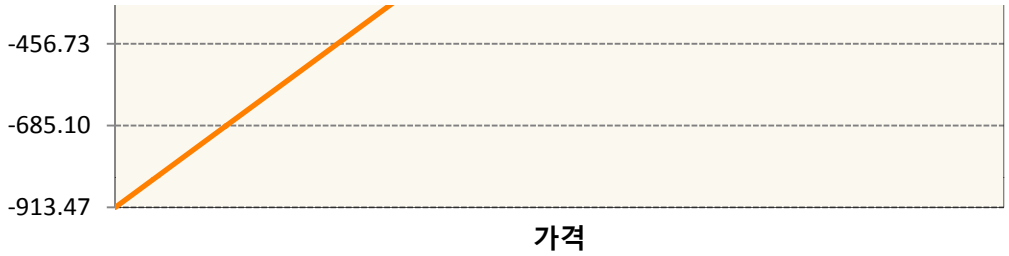
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	4,060	321	3,739	

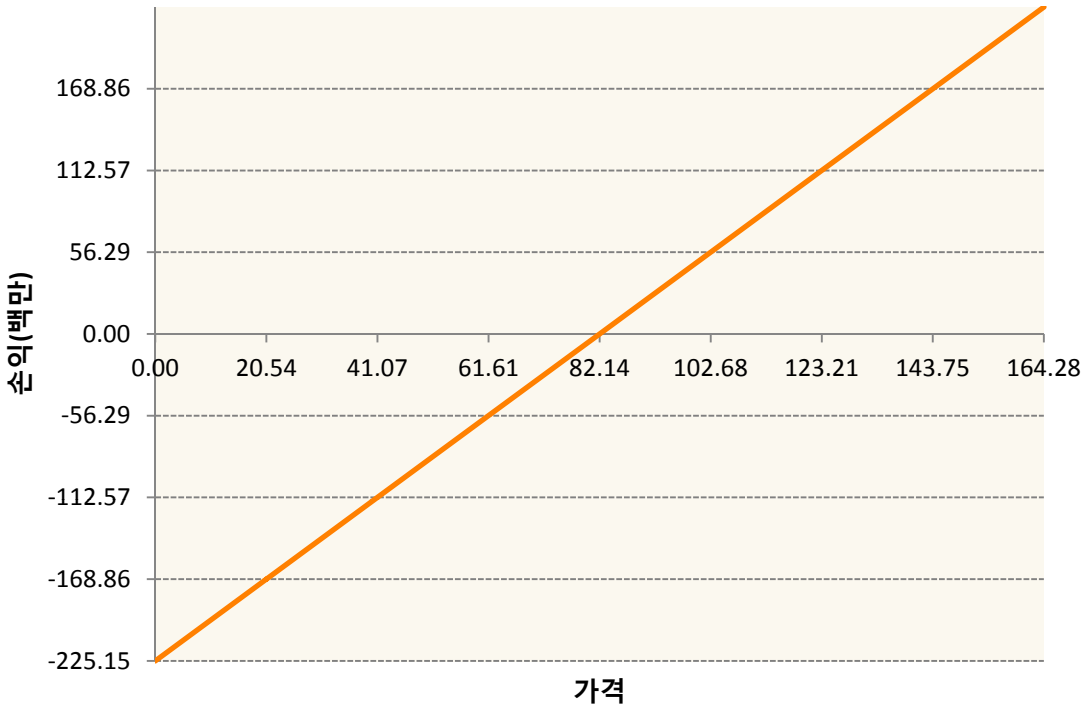
2. 만기시점의 손익구조



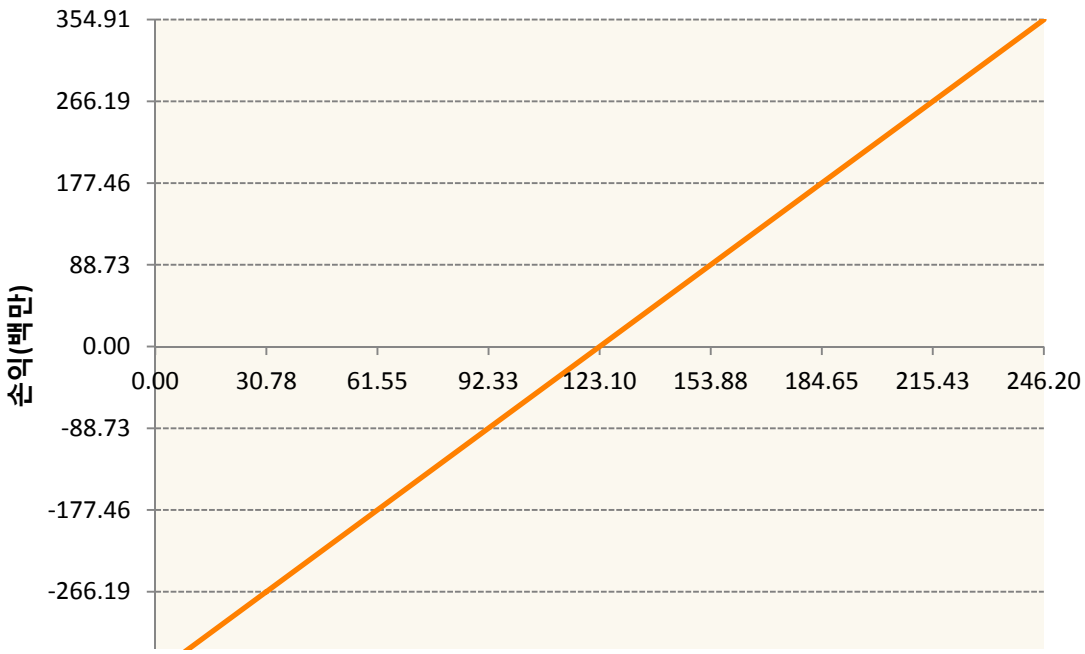


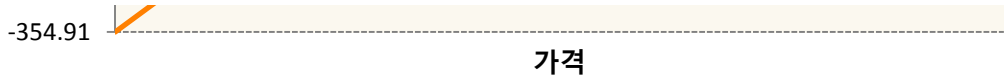


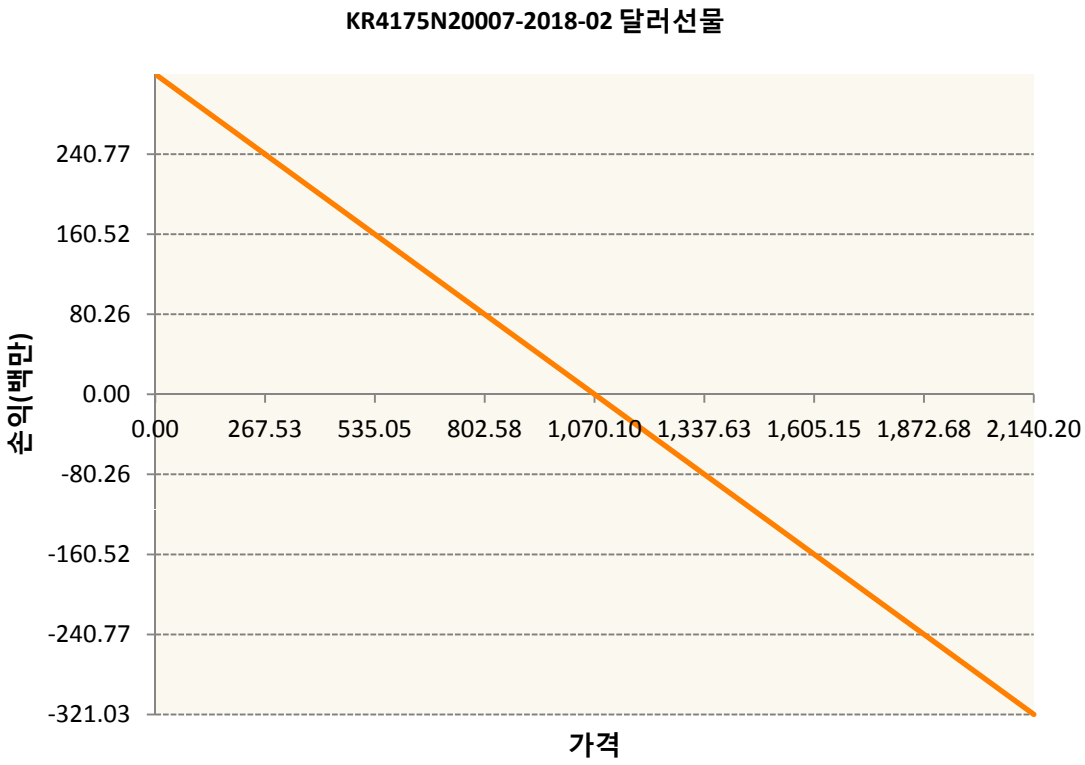
CTH8-COTTON NO.2 FUTR MAR18

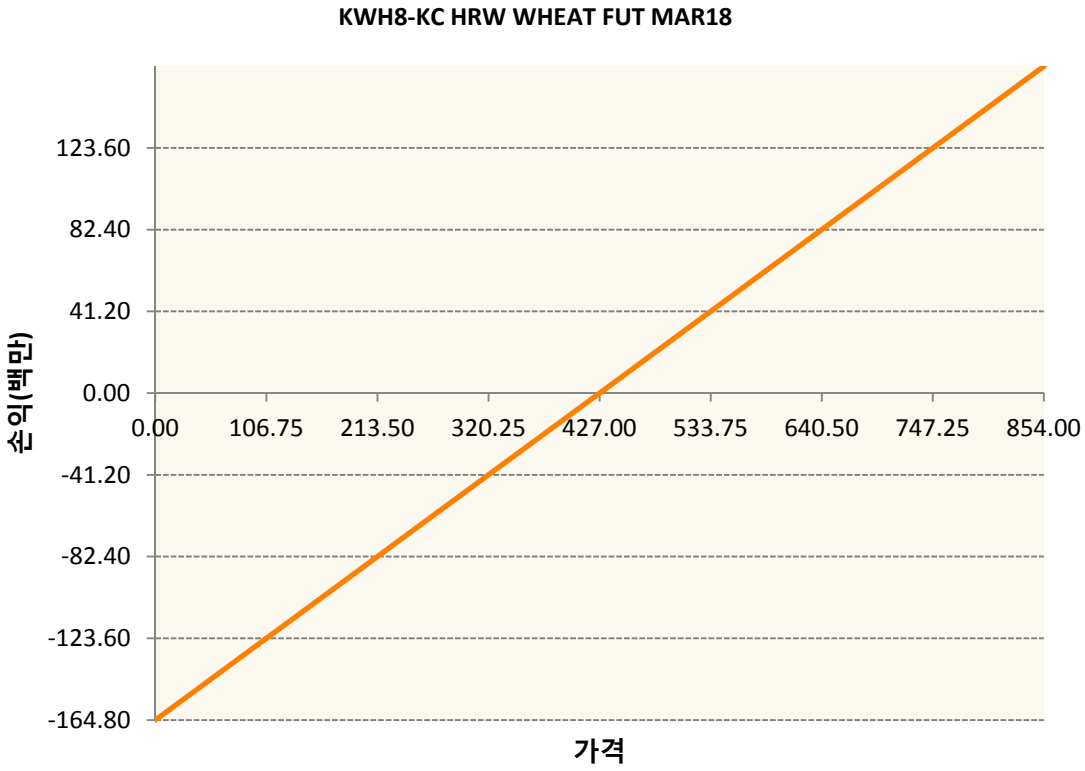


KCH8-COFFEE "C" FUTURE MAR18

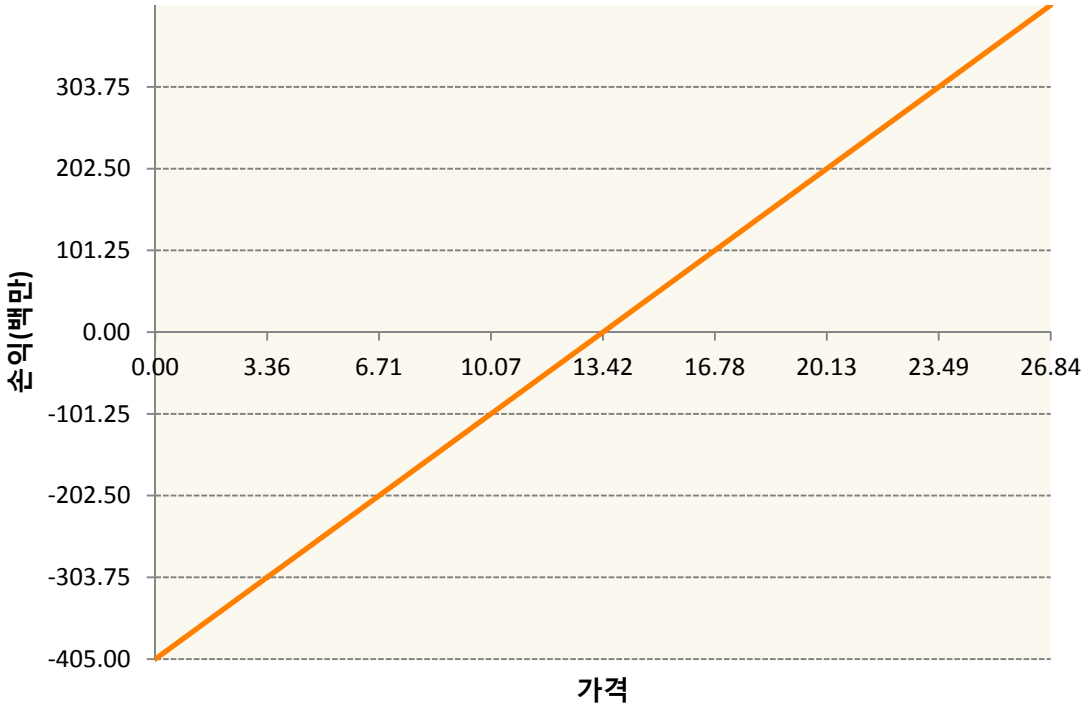



-354.91
가격

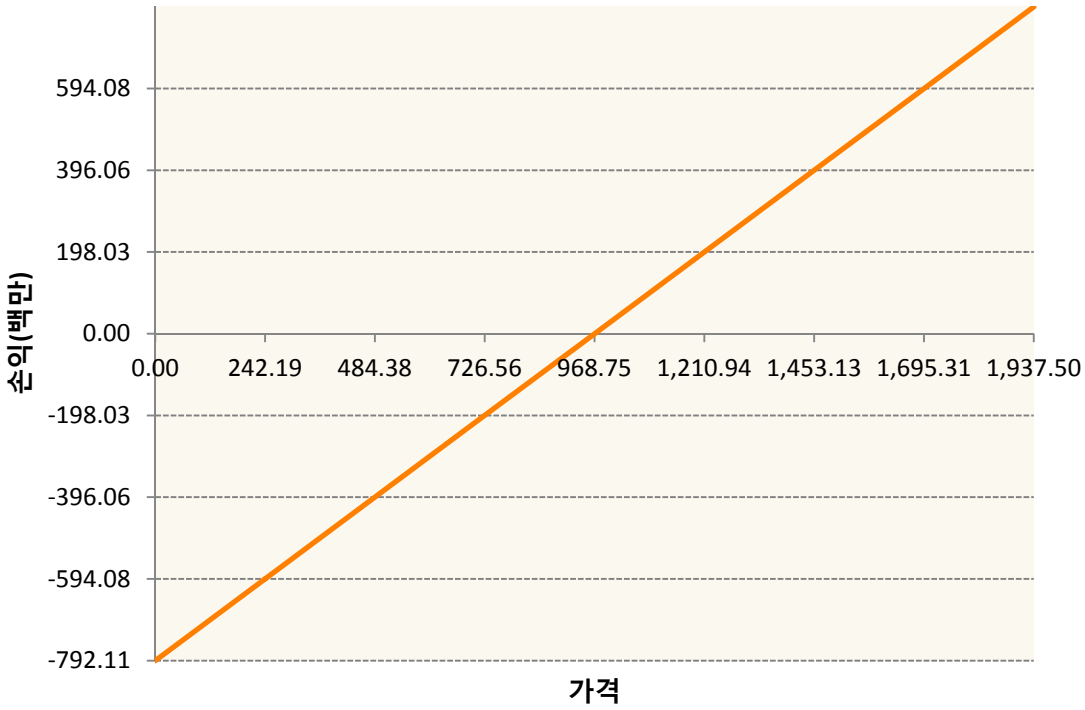

KR4175N20007-2018-02 달러선물
240.77
160.52
80.26
0.00
-80.26
-160.52
-240.77
-321.03
0.00
267.53
535.05
802.58
1,070.10
1,337.63
1,605.15
1,872.68
2,140.20
손익(백만)
가격


KWH8-KC HRW WHEAT FUT MAR18
123.60
82.40
41.20
0.00
-41.20
-82.40
-123.60
-164.80
0.00
106.75
213.50
320.25
427.00
533.75
640.50
747.25
854.00
손익(백만)
가격

SBH8-Sugar #11 (WORLD) MAR18

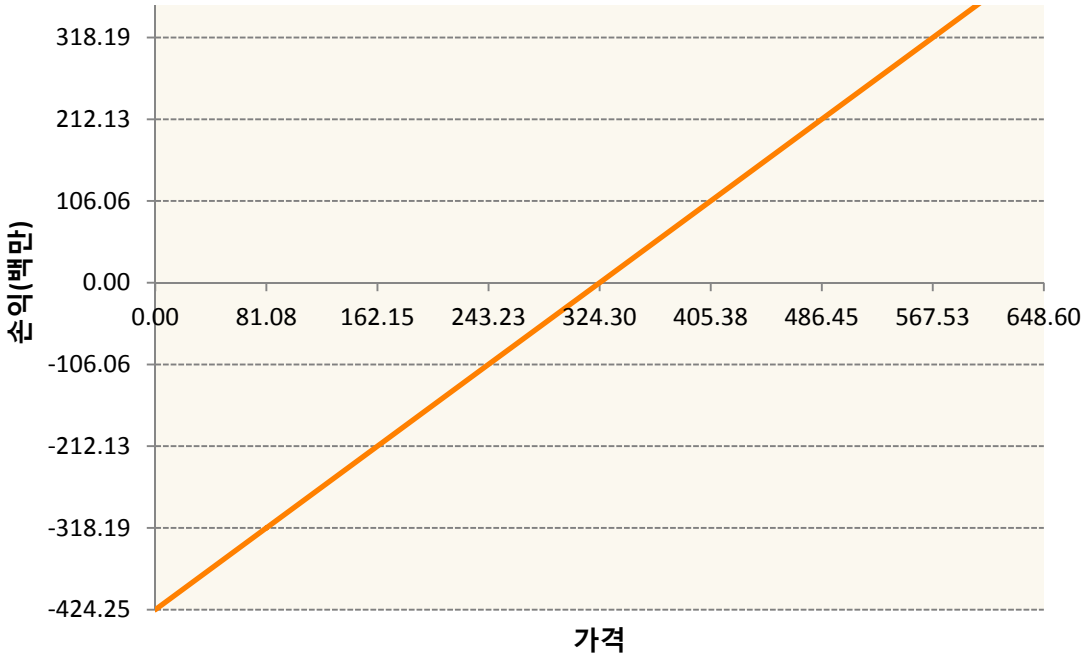


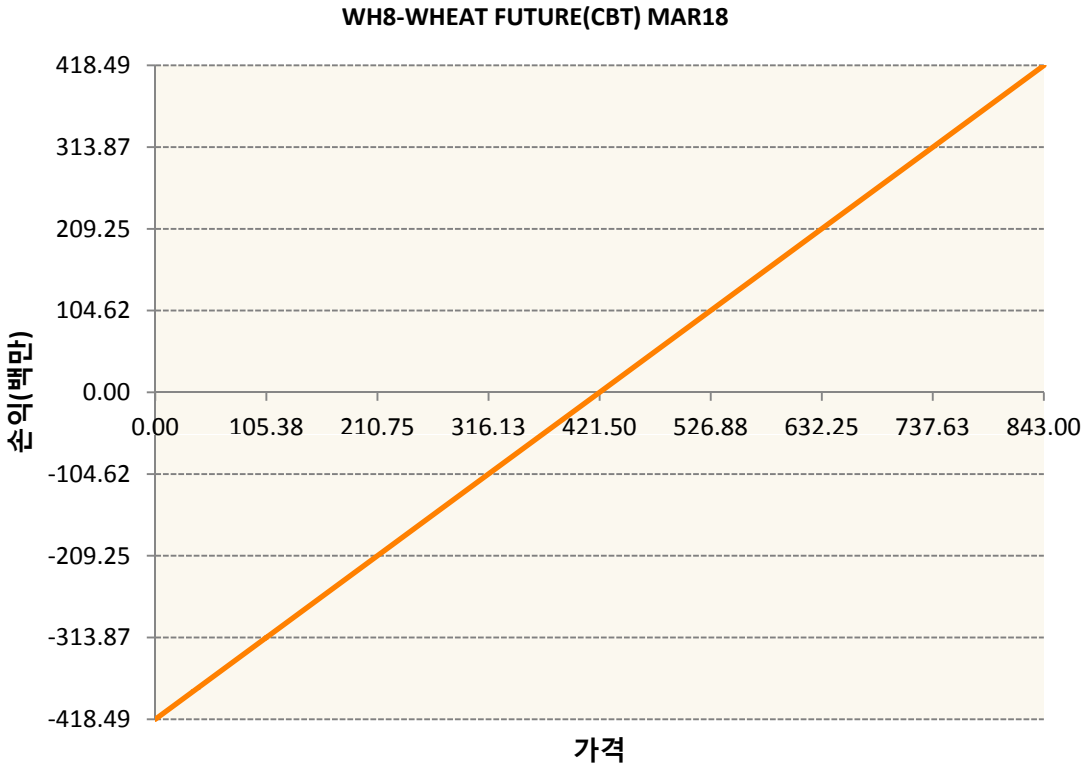
SH8-SOYBEAN FUTURE MAR18



SMH8-SOYBEAN MEAL FUTR MAR18







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

BOH8	SOYBEAN OIL FUTR MAR18	29
CH8	CORN FUTURE MAR18	73
CTH8	COTTON NO.2 FUTR MAR18	18
KCH8	COFFEE "C" FUTURE MAR18	28
KR4175N20(	2018-02 달러선물	26

KWH8	KC HRW WHEAT FUT MAR18	13
SBH8	Sugar #11 (WORLD) MAR18	32
SH8	SOYBEAN FUTURE MAR18	63
SMH8	SOYBEAN MEAL FUTR MAR18	34
WH8	WHEAT FUTURE(CBT) MAR18	33

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

341