공시일	2018-01-22
기준일	2018-01-19

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	2018-01-22
기준일	2018-01-19

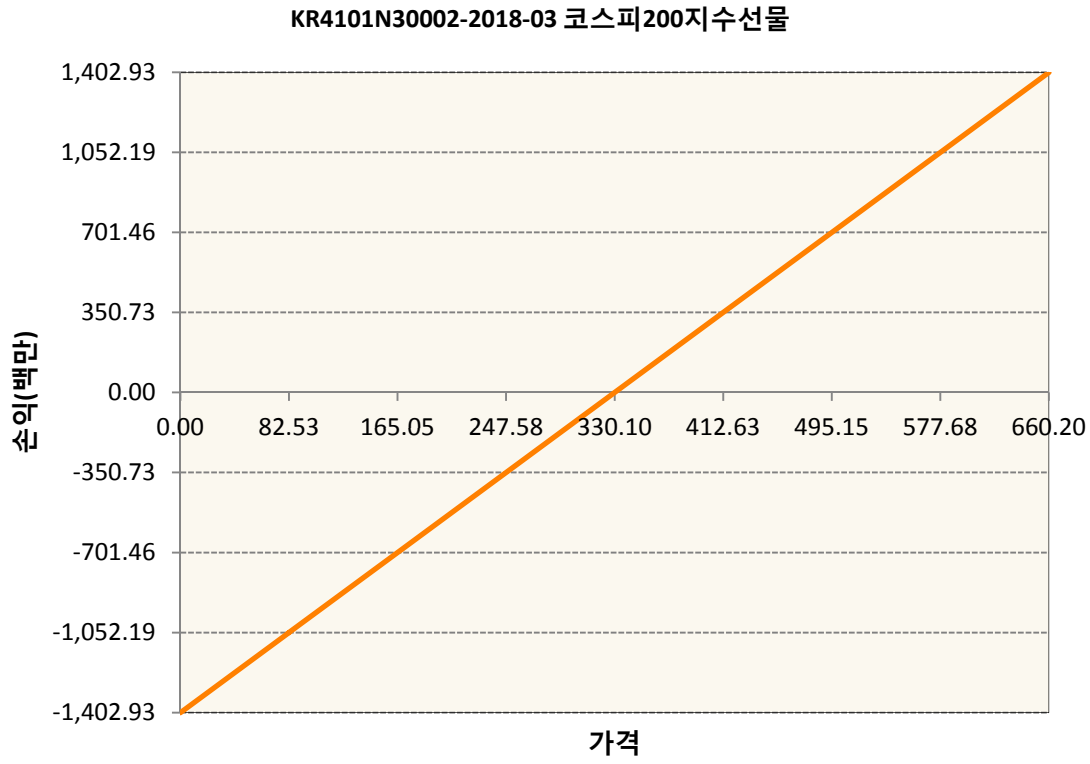
스마트인덱스모

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	1,403	0	1,403	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)

66

공시일	2018-01-22
기준일	2018-01-19

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	1,148

* 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	2018-01-22
기준일	2018-01-19

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)

373

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2018-01-22
기준일	2018-01-19

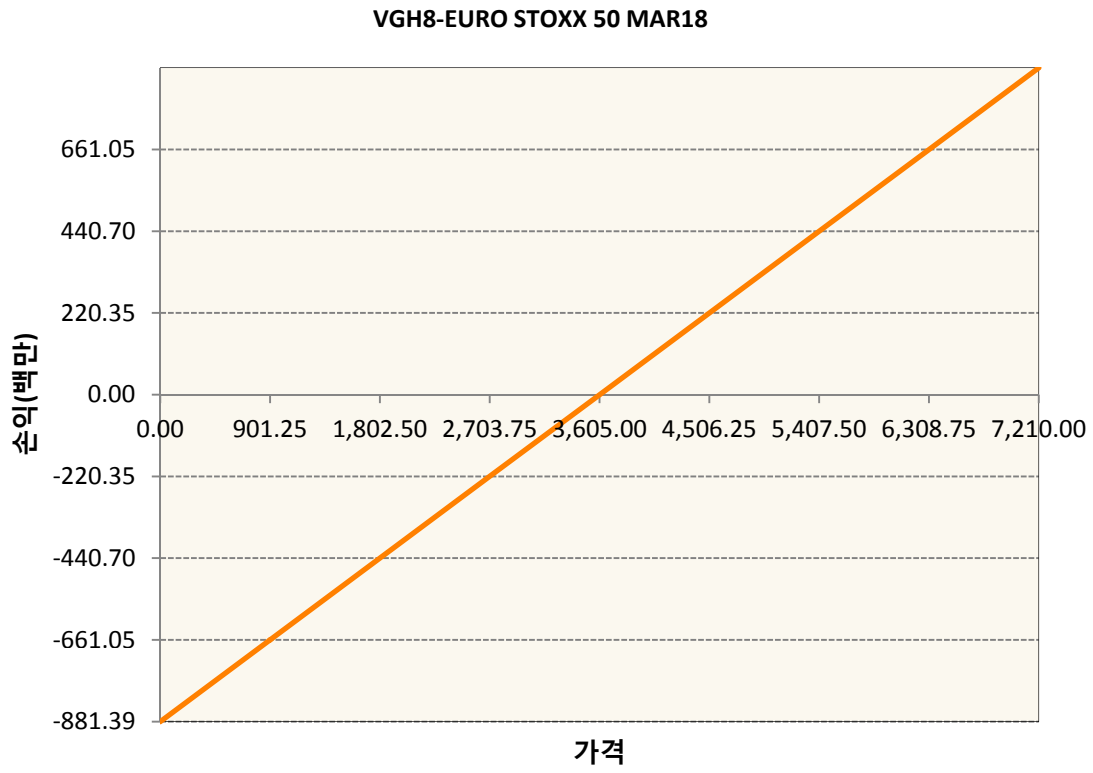
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	881	0	881	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGH8	EURO STOXX 50 MAR18	71

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

(단위:백만원)

39

공시일	2018-01-22
기준일	2018-01-19

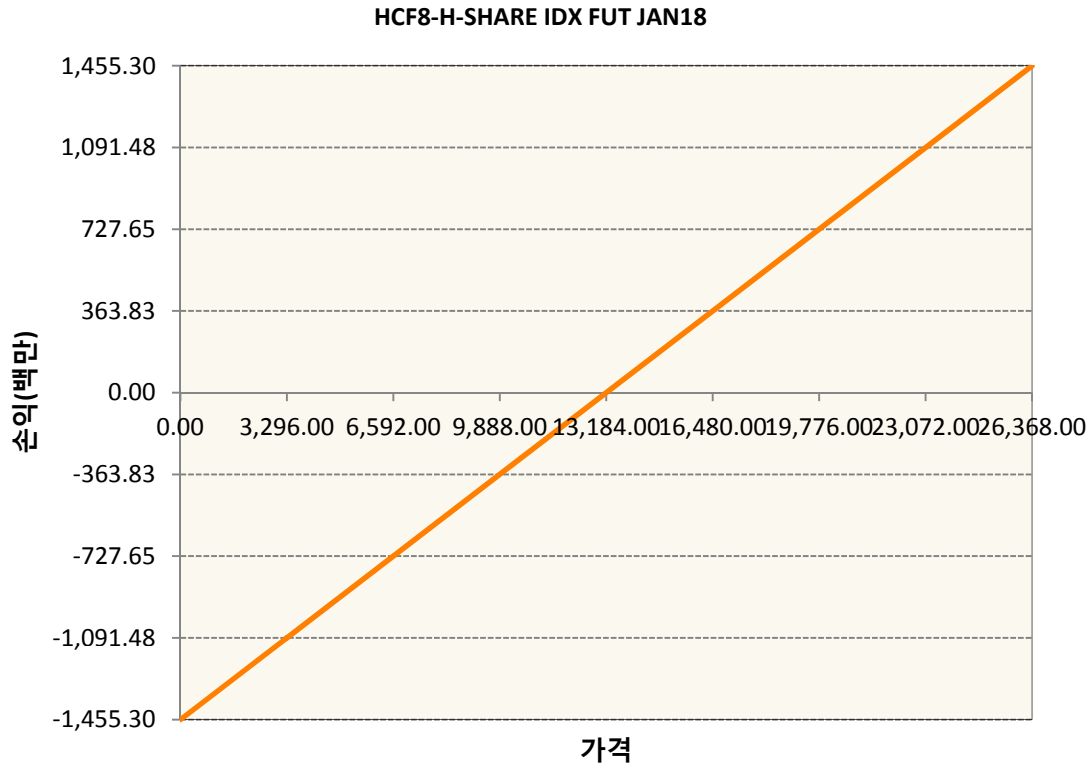
차이나인덱스모(주식-파생형)

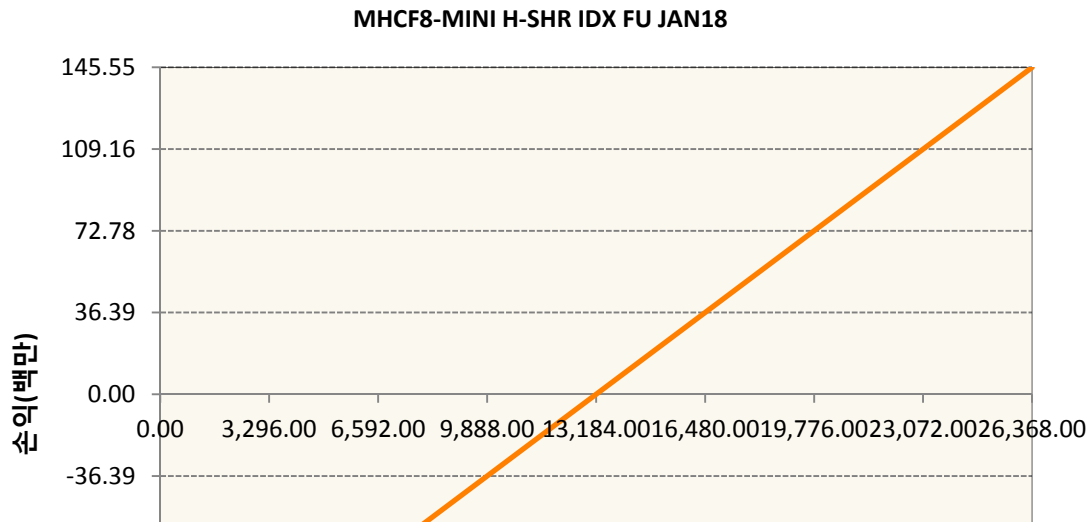
1. 계약금액

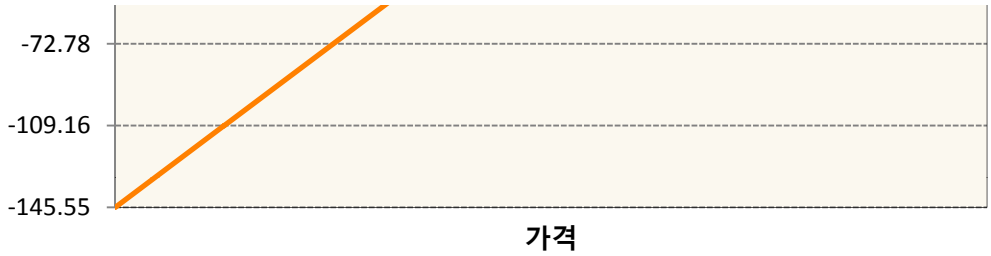
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,601	0	1,601	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCF8	H-SHARE IDX FUT JAN18	116
MHCF8	MINI H-SHR IDX FU JAN18	12

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	102

공시일	2018-01-22
기준일	2018-01-19

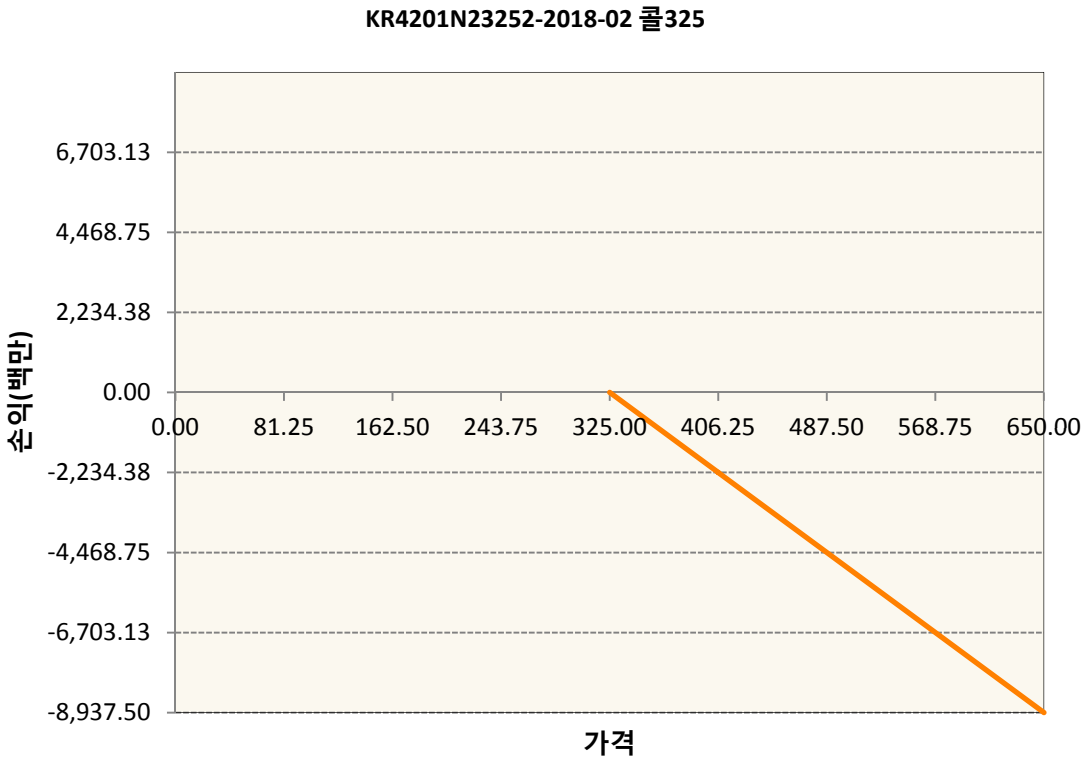
커버드콜모(주식혼합-파생형)

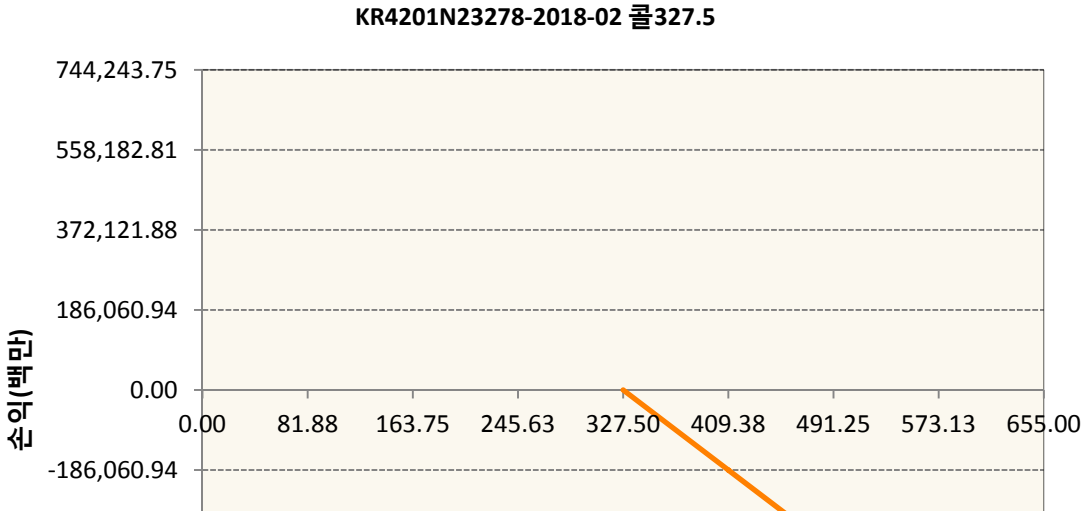
1. 계약금액

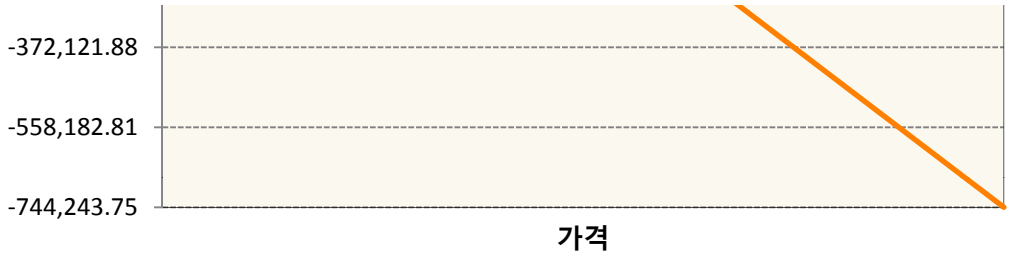
(단위:백만원)

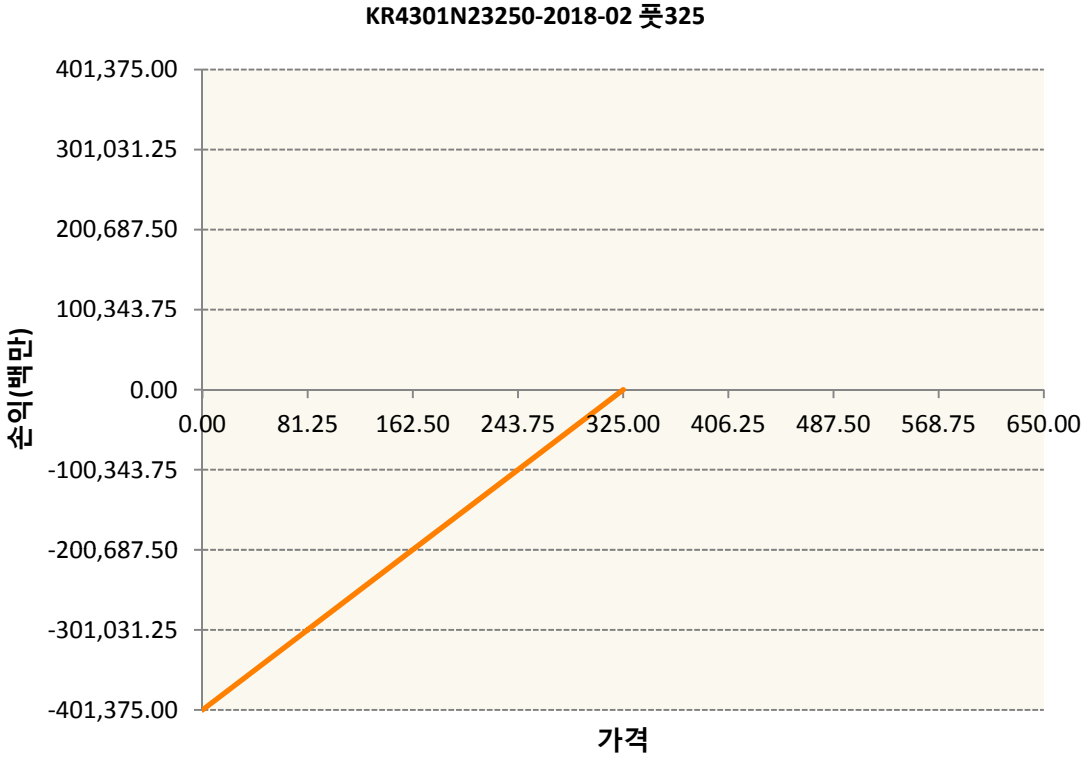
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	16,080	0	16,080	장내
누계	유가증권	옵션	0	1,323,219	-1,323,219	장내

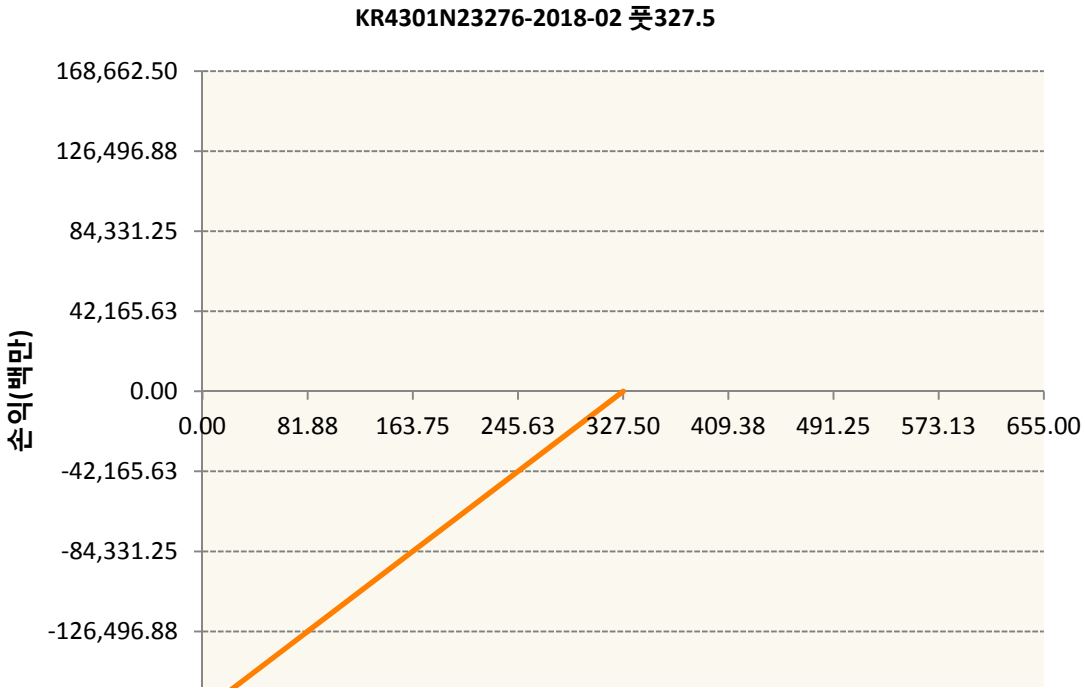
2. 만기시점의 손익구조






-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
168,662.50
126,496.88
84,331.25
42,165.63
0.00
-42,165.63
-84,331.25
-126,496.88
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							607
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	272	266	260	252	243	233	222
-5.33%	244	232	220	207	193	179	164
-2.67%	175	159	142	125	108	91	74
0%	51	34	17	0	-17	-34	-51
2.67%	-128	-140	-153	-166	-181	-196	-211
5.33%	-342	-349	-357	-366	-376	-387	-398
8.00%	-575	-577	-581	-586	-592	-599	-607
KR4201N232 2018-02 콜327.5							48,382
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	19,577	19,217	18,757	18,203	17,565	16,852	16,072
-5.33%	17,867	17,036	16,121	15,137	14,095	13,007	11,880
-2.67%	13,287	11,980	10,650	9,303	7,942	6,571	5,190
0%	4,336	2,893	1,448	0	-1,449	-2,899	-4,350
2.67%	-9,225	-10,374	-11,576	-12,820	-14,097	-15,401	-16,727
5.33%	-26,241	-26,917	-27,698	-28,568	-29,514	-30,524	-31,588
8.00%	-45,138	-45,440	-45,844	-46,348	-46,944	-47,625	-48,382
KR4301N232 2018-02 풋325							24,538
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-24,378	-24,383	-24,393	-24,411	-24,440	-24,482	-24,538
-5.33%	-13,639	-13,722	-13,832	-13,967	-14,125	-14,304	-14,503
-2.67%	-4,210	-4,543	-4,886	-5,236	-5,591	-5,951	-6,314
0%	1,005	680	345	0	-352	-709	-1,071
2.67%	2,262	2,177	2,064	1,925	1,761	1,576	1,370
5.33%	2,371	2,364	2,350	2,325	2,287	2,234	2,164
8.00%	2,374	2,374	2,373	2,371	2,366	2,358	2,343
KR4301N232 2018-02 풋327.5							11,019
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-10,981	-10,982	-10,984	-10,987	-10,994	-11,004	-11,019
-5.33%	-6,476	-6,494	-6,521	-6,558	-6,604	-6,659	-6,722
-2.67%	-2,284	-2,394	-2,512	-2,637	-2,767	-2,901	-3,038
0%	477	319	160	0	-161	-322	-483
2.67%	1,351	1,291	1,218	1,135	1,042	941	833

5.33%	1,456	1,449	1,437	1,418	1,391	1,357	1,314
8.00%	1,460	1,460	1,459	1,457	1,453	1,446	1,436

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

87,573

공시일	2018-01-22
기준일	2018-01-19

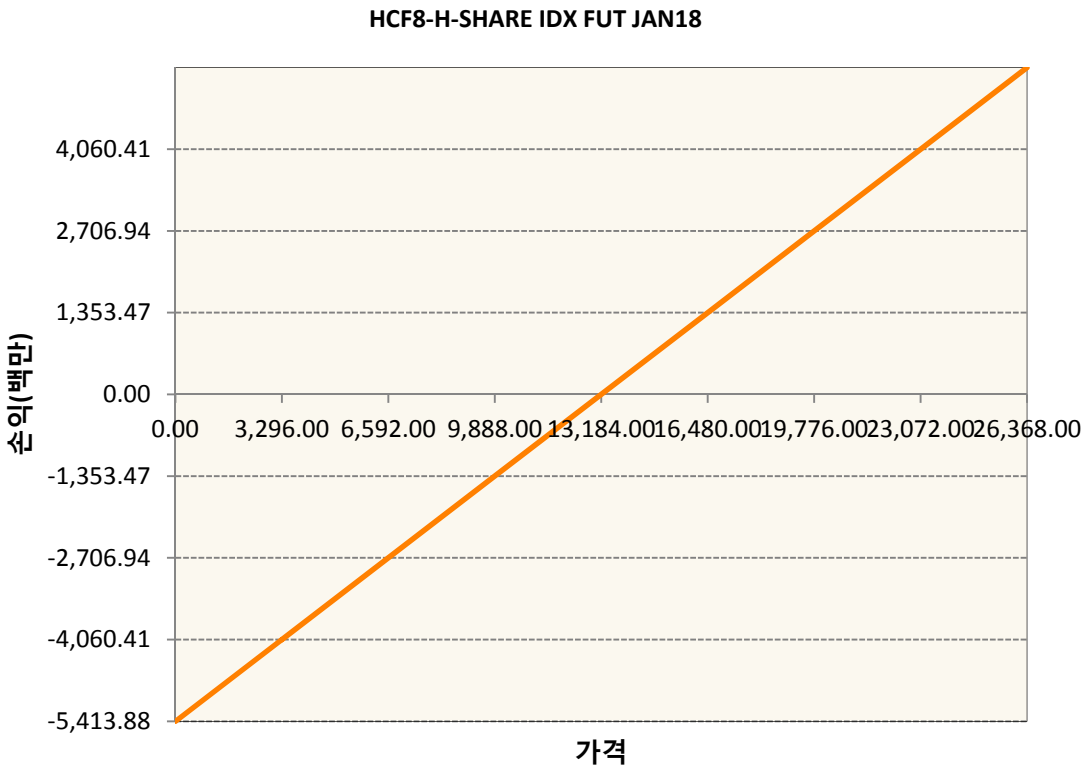
홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생

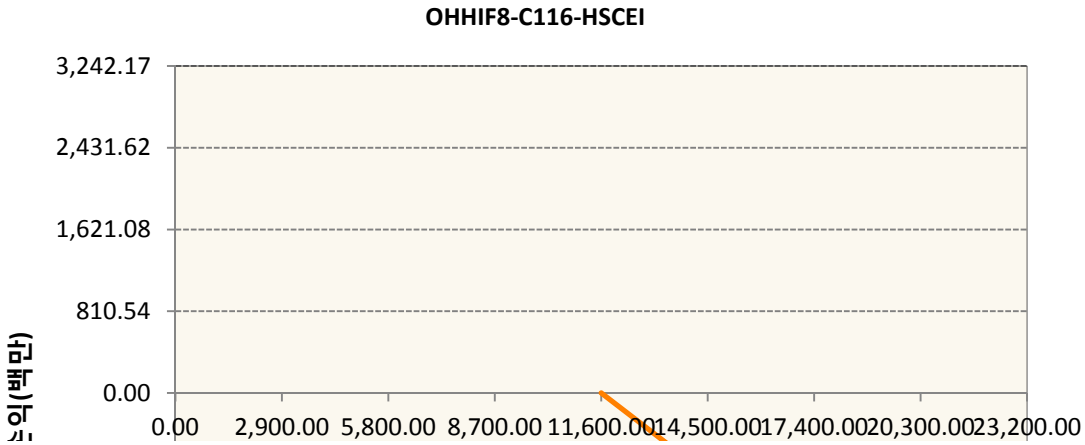
1. 계약금액

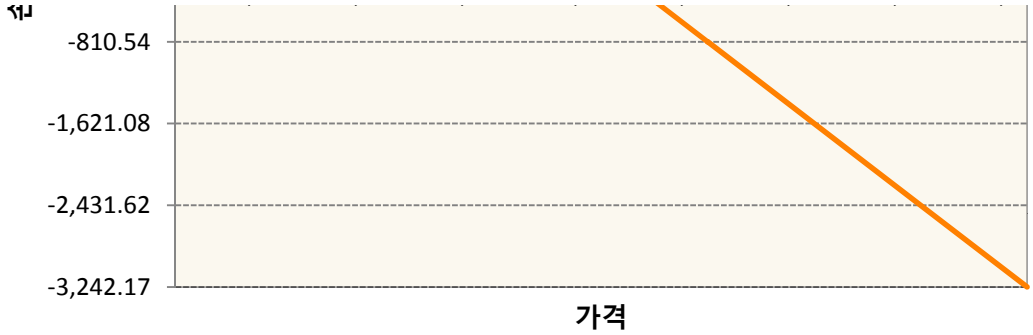
(단위:백만원)

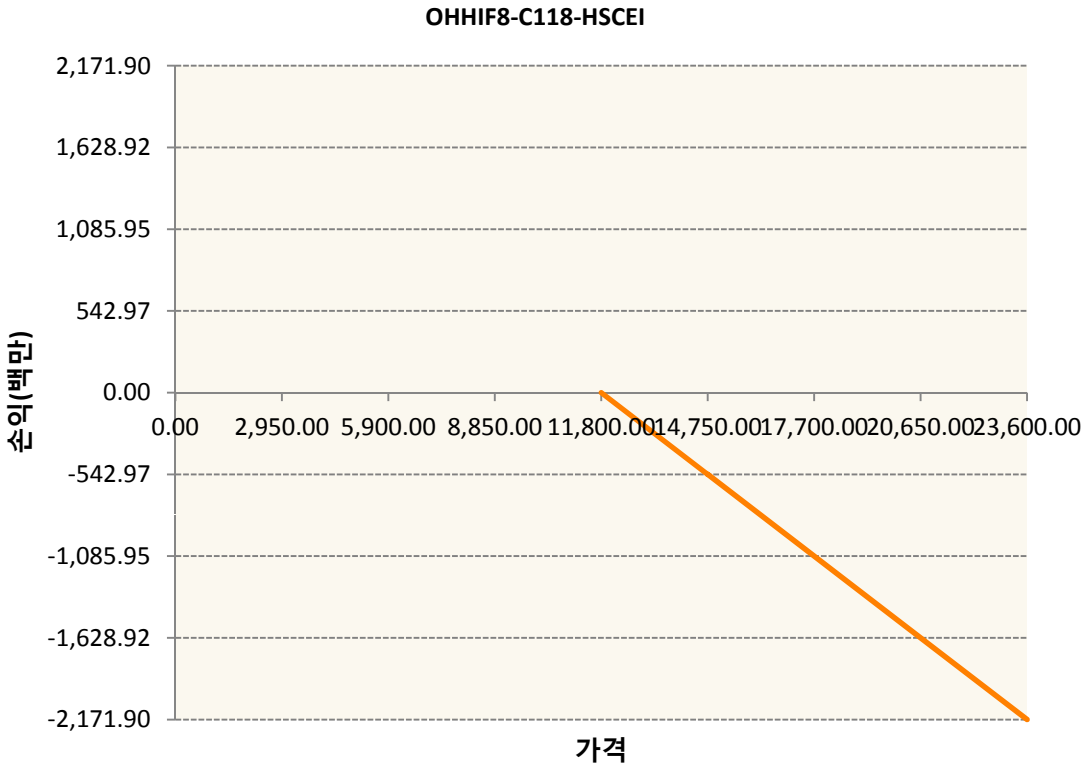
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	5,414	0	5,414	장내
누계	유가증권	옵션	0	10,828	-10,828	장내

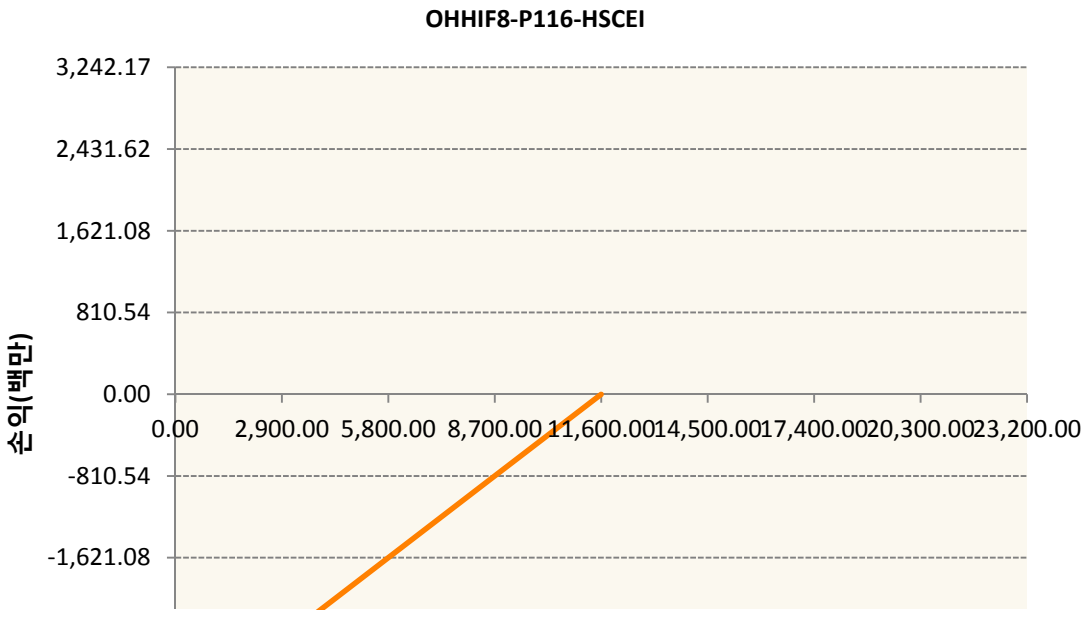
2. 만기시점의 손익구조

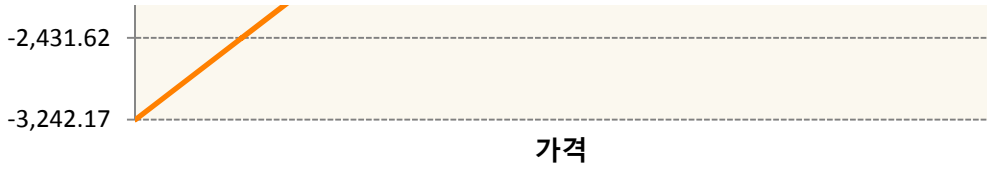


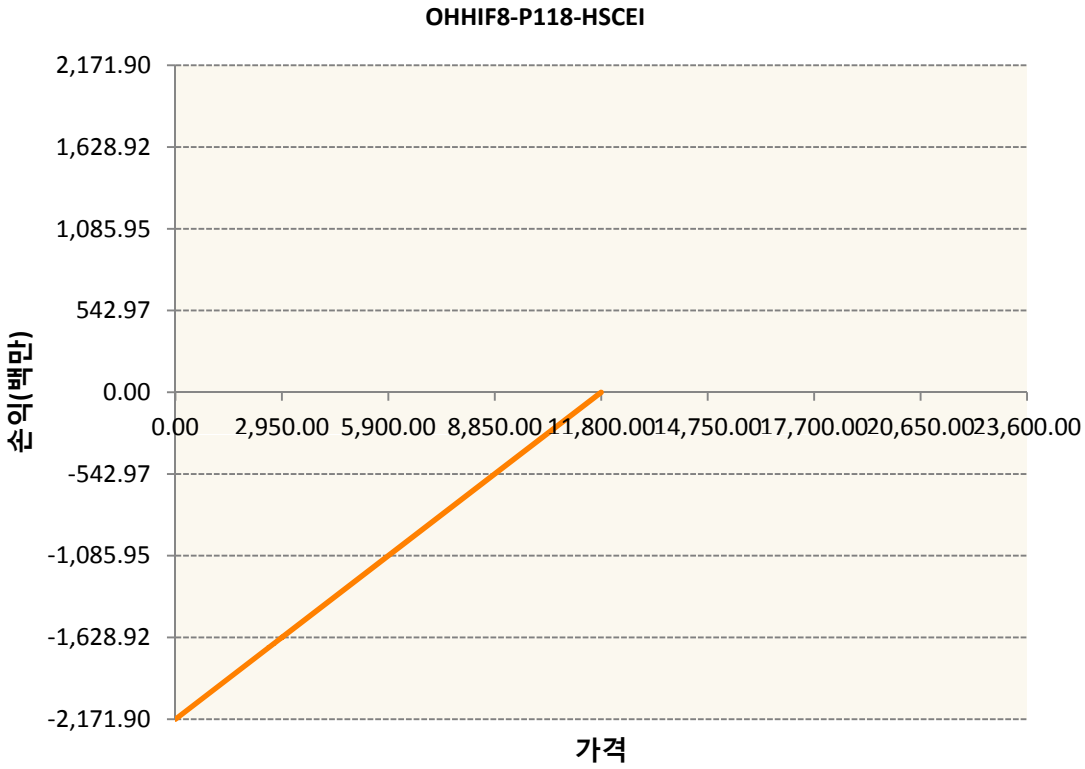



-810.54
-1,621.08
-2,431.62
-3,242.17
가격


OHHIF8-C118-HSCEI
2,171.90
1,628.92
1,085.95
542.97
0.00
-542.97
-1,085.95
-1,628.92
-2,171.90
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
3,242.17
2,431.62
1,621.08
810.54
0.00
-810.54
-1,621.08
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	433
OHHIF8-C11	HSCEI	259
OHHIF8-C11	HSCEI	174
OHHIF8-P11	HSCEI	259
OHHIF8-P11	HSCEI	174

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

1,034

공시일	2018-01-22
기준일	2018-01-19

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼

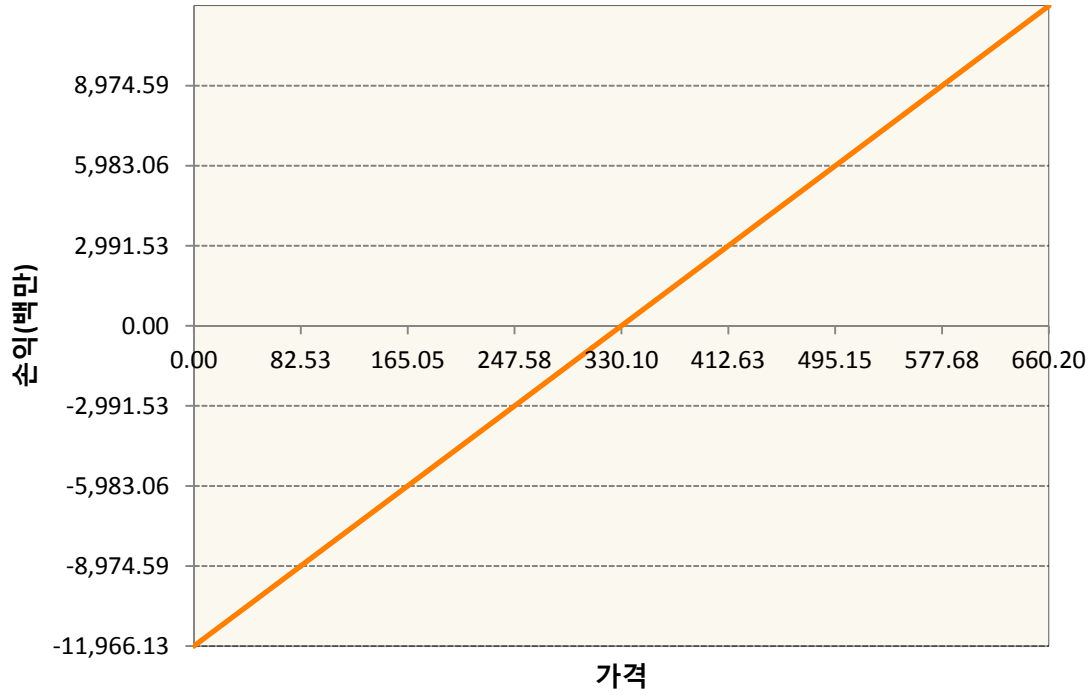
1. 계약금액

(단위:백만원)

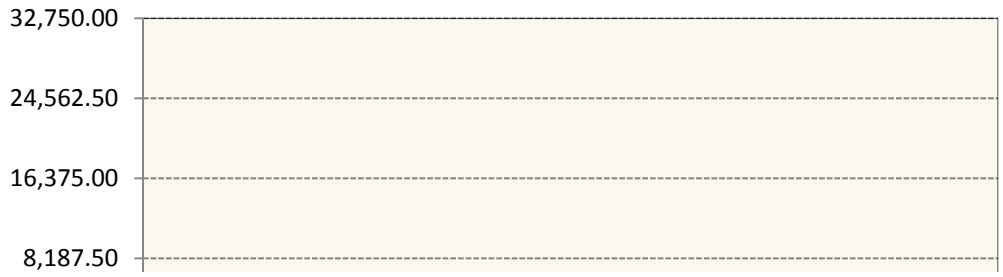
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	11,966	0	11,966	장내
누계	유가증권	스왑	60,200	0	60,200	장외
누계	유가증권	옵션	0	60,431	-60,431	장내

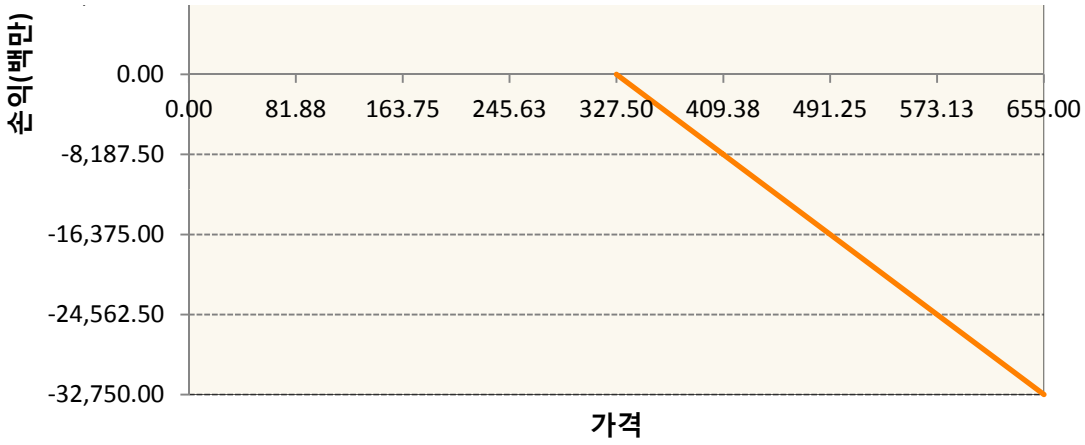
2. 만기시점의 손익구조

KR4101N30002-2018-03 코스피200지수선물

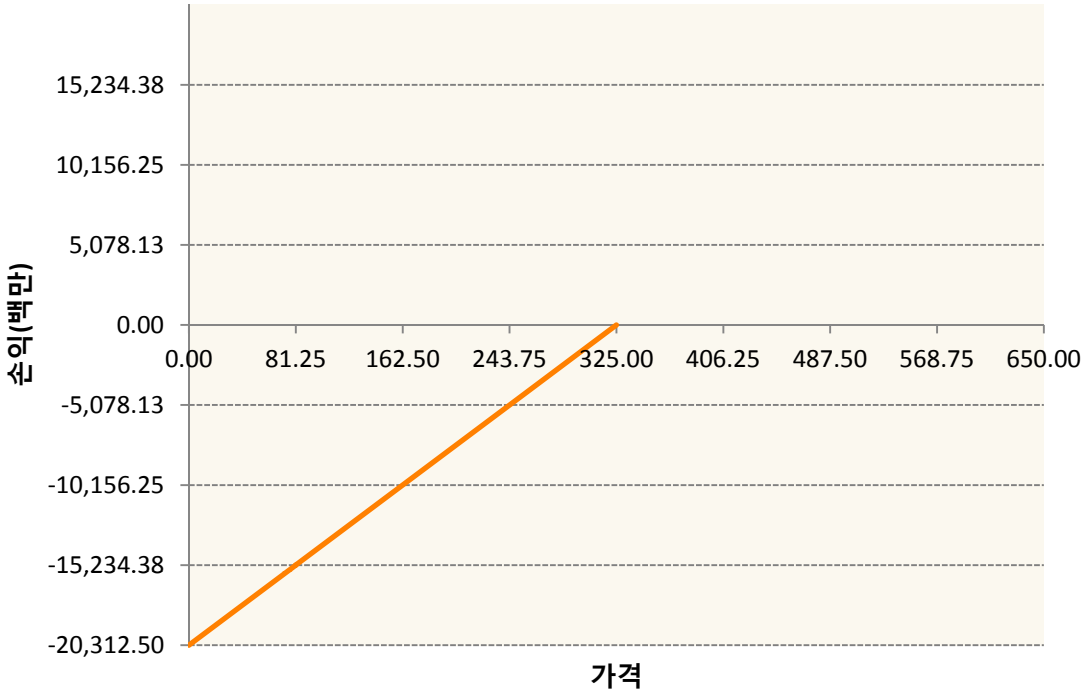


KR4201N23278-2018-02 콜327.5

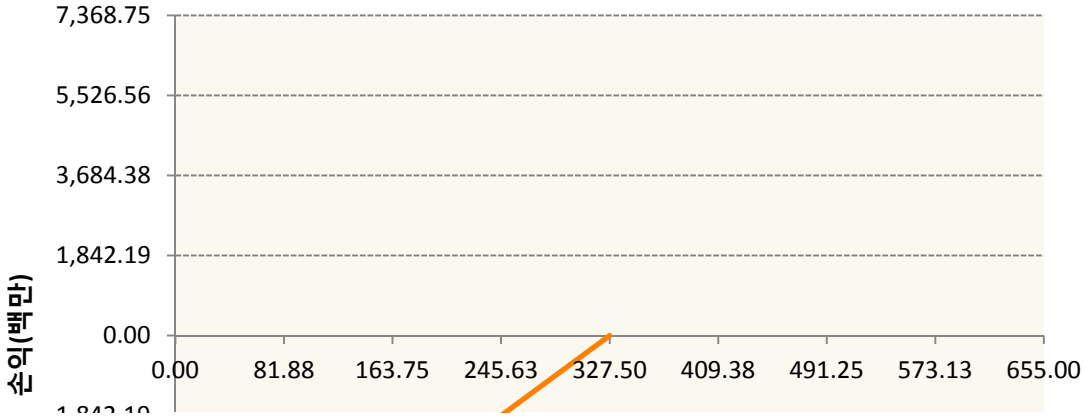




KR4301N23250-2018-02 풋325



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						463
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-463	-463	-463	-463	-463	-463	-463
-5.33%	-309	-309	-309	-309	-309	-309	-309
-2.67%	-154	-154	-154	-154	-154	-154	-154
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	154	154	154	154	154	154	154
5.33%	309	309	309	309	309	309	309
8.00%	463	463	463	463	463	463	463
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_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						626
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-626	-626	-626	-626	-626	-626	-626
-5.33%	-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%	626	626	626	626	626	626	626
	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						956
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-956	-956	-956	-956	-956	-956	-956
-5.33%	-637	-637	-637	-637	-637	-637	-637
-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%	637	637	637	637	637	637	637
8.00%	956	956	956	956	956	956	956
	KR4201N232 2018-02 콜327.5						2,129

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	861	846	825	801	773	742	707
-5.33%	786	750	709	666	620	572	523
-2.67%	585	527	469	409	349	289	228
0%	191	127	64	0	-64	-128	-191
2.67%	-406	-456	-509	-564	-620	-678	-736
5.33%	-1,155	-1,184	-1,219	-1,257	-1,299	-1,343	-1,390
8.00%	-1,986	-2,000	-2,017	-2,040	-2,066	-2,096	-2,129
	KR4301N232 2018-02 풋325						1,242

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,234	-1,234	-1,234	-1,235	-1,237	-1,239	-1,242
-5.33%	-690	-694	-700	-707	-715	-724	-734
-2.67%	-213	-230	-247	-265	-283	-301	-320
0%	51	34	17	0	-18	-36	-54
2.67%	114	110	104	97	89	80	69
5.33%	120	120	119	118	116	113	110
8.00%	120	120	120	120	120	119	119
	KR4301N232 2018-02 풋327.5						481

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-480	-480	-480	-480	-480	-481	-481
-5.33%	-283	-284	-285	-287	-289	-291	-294
-2.67%	-100	-105	-110	-115	-121	-127	-133
0%	21	14	7	0	-7	-14	-21
2.67%	59	56	53	50	46	41	36
5.33%	64	63	63	62	61	59	57
8.00%	64	64	64	64	63	63	63

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

9,264

공시일	2018-01-22
기준일	2018-01-19

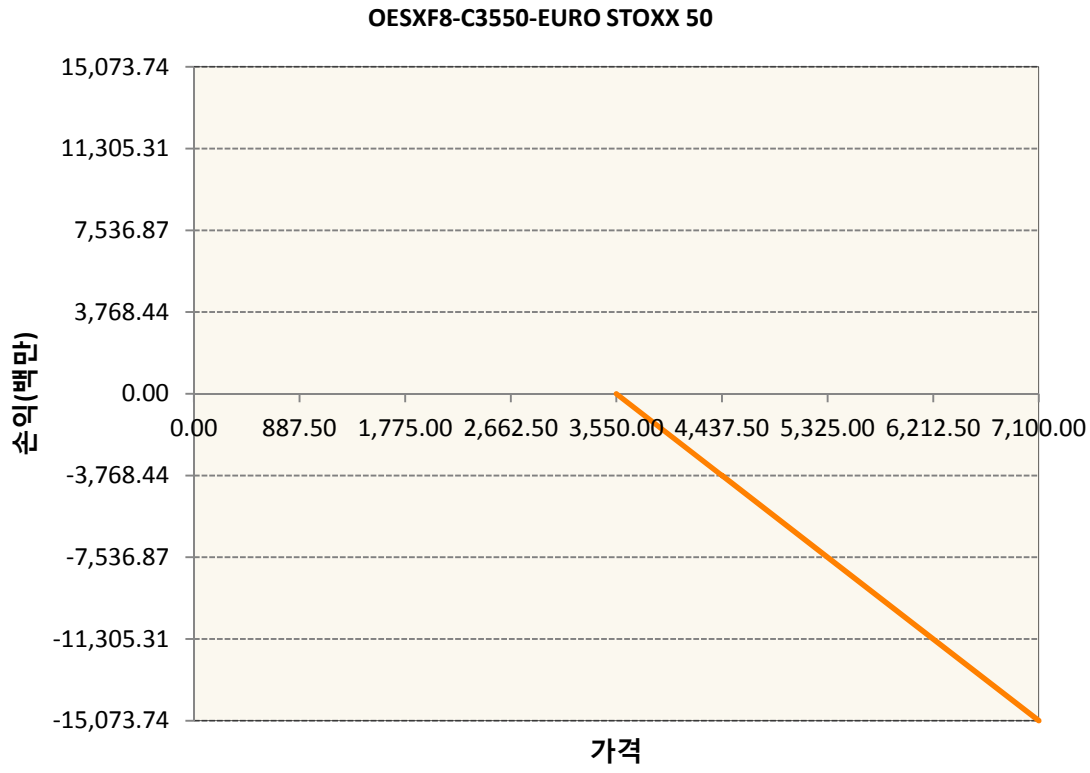
유로커버드콜모(주식혼합-파생형

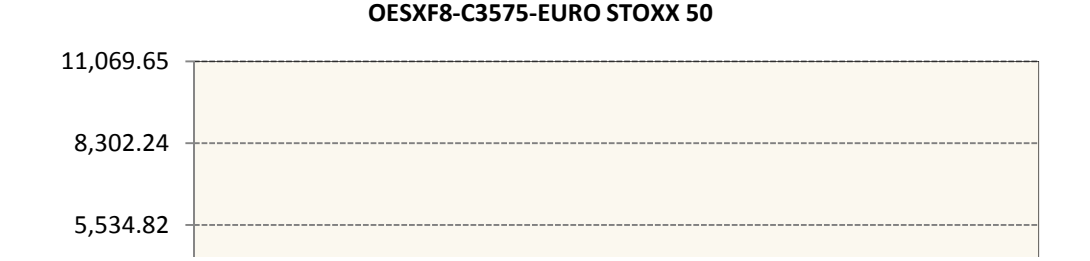
1. 계약금액

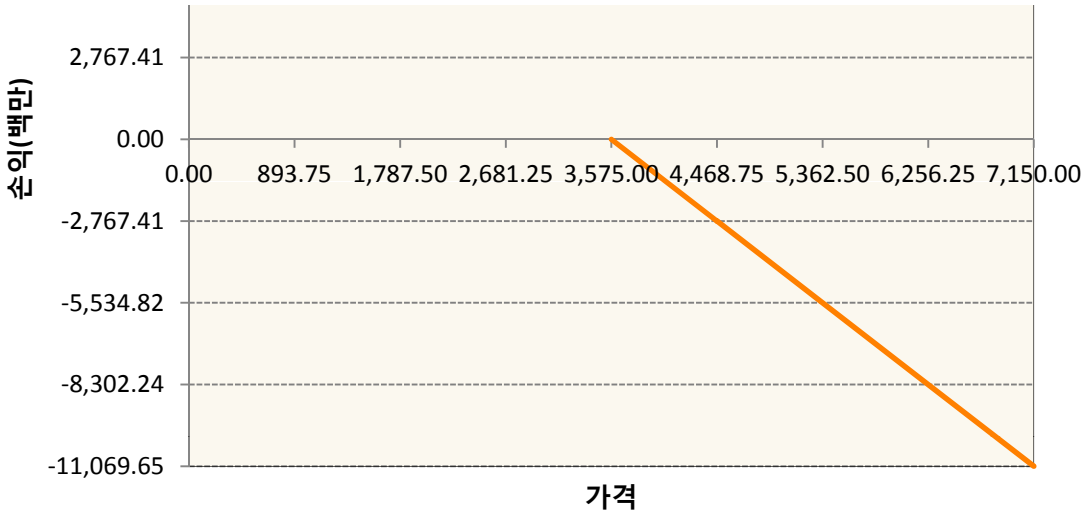
(단위:백만원)

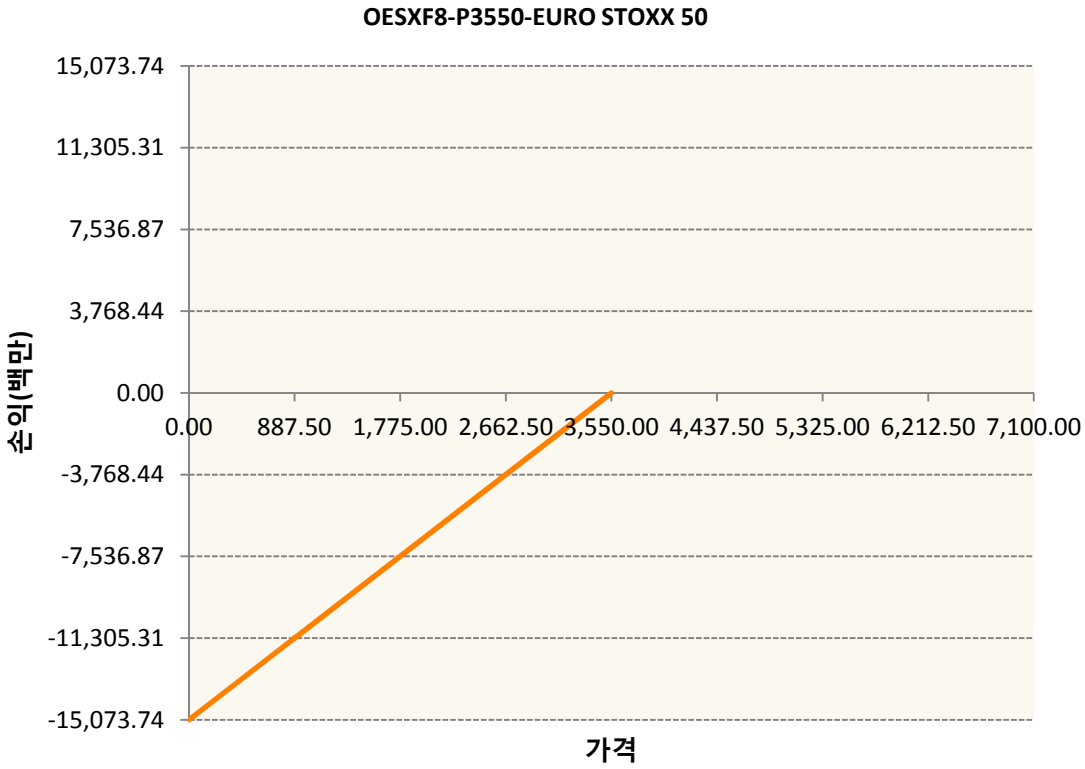
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	17,597	0	17,597	
누계	유가증권	스왑	97,986	0	97,986	장외
누계	유가증권	옵션	0	52,287	-52,287	장내
누계	지수	스왑	52,260	0	52,260	장외

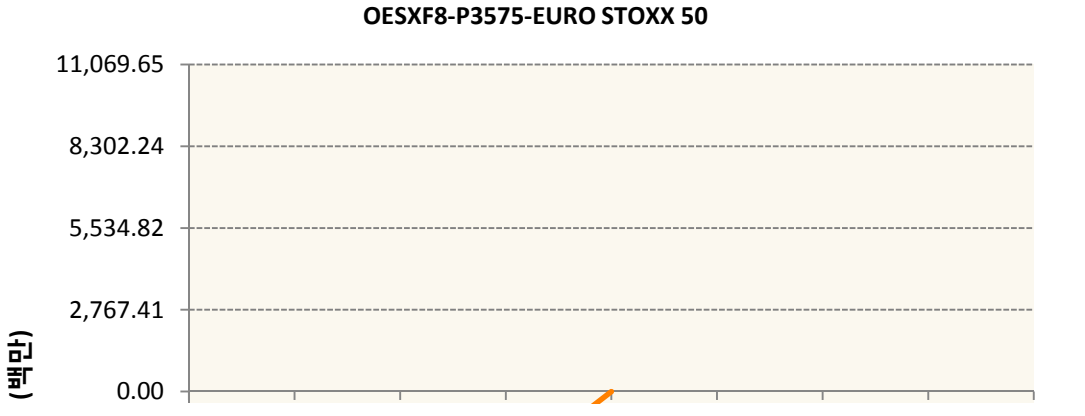
2. 만기시점의 손익구조

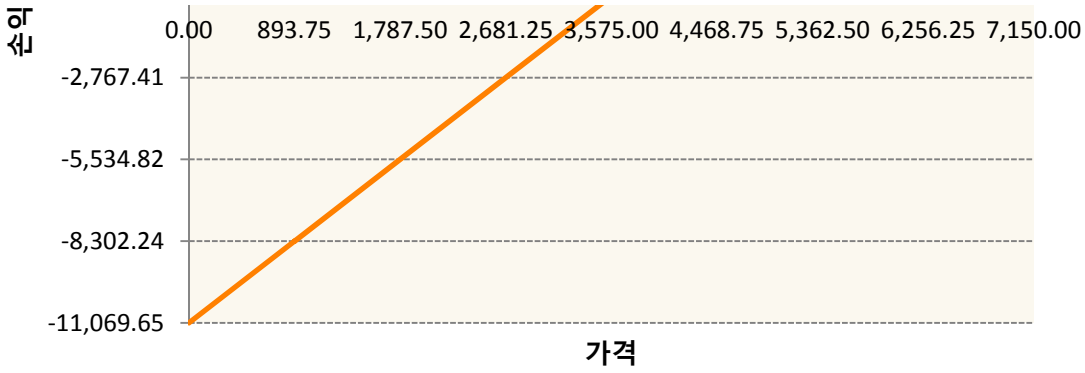


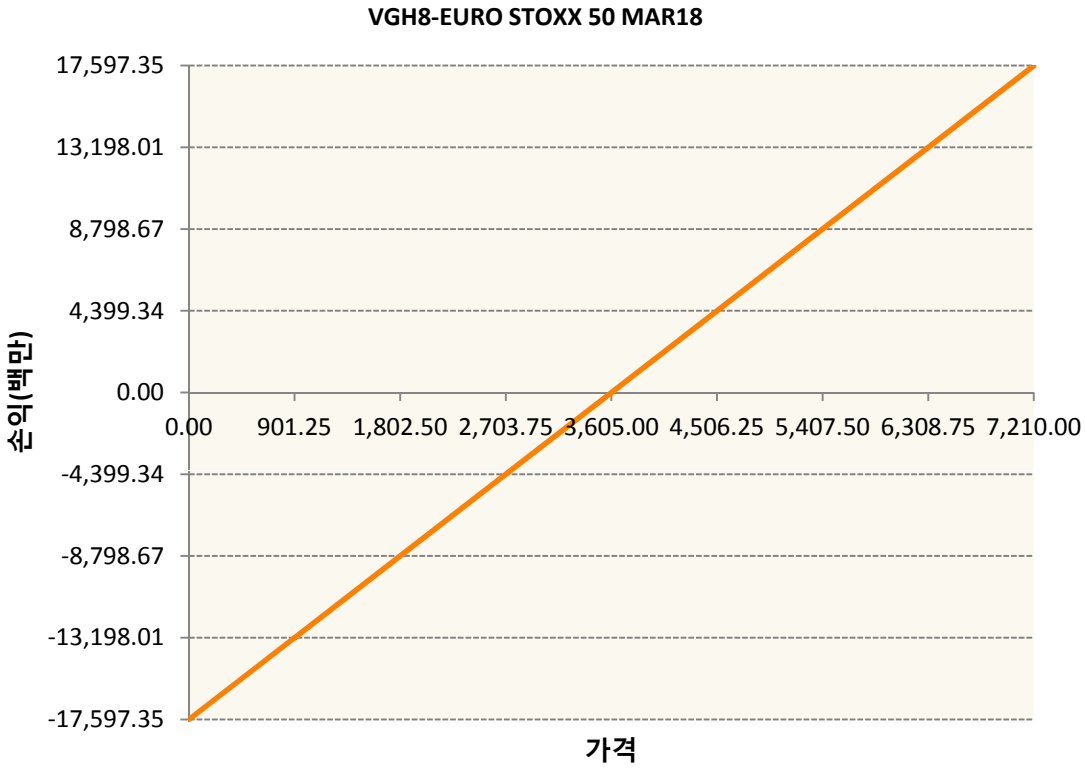



2,767.41
0.00
-2,767.41
-5,534.82
-8,302.24
-11,069.65
0.00
893.75
1,787.50
2,681.25
3,575.00
4,468.75
5,362.50
6,256.25
7,150.00
손익(백만)
가격


OESXF8-P3550-EURO STOXX 50
15,073.74
11,305.31
7,536.87
3,768.44
0.00
-3,768.44
-7,536.87
-11,305.31
-15,073.74
0.00
887.50
1,775.00
2,662.50
3,550.00
4,437.50
5,325.00
6,212.50
7,100.00
손익(백만)
가격


OESXF8-P3575-EURO STOXX 50
11,069.65
8,302.24
5,534.82
2,767.41
0.00
(백만)





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)	(단위:백만원)
260105SGPX SG EURO Covered CALL STRATEGY - 994.569	110
260105SQPX SG EURO Covered CALL STRATEGY	162
OESXF8-C35 EURO STOXX 50	1,206
OESXF8-C35 EURO STOXX 50	886
OESXF8-P35 EURO STOXX 50	1,206
OESXF8-P35 EURO STOXX 50	886
VGH8 EURO STOXX 50 MAR18	1,408

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

3,267

공시일	2018-01-22
기준일	2018-01-19

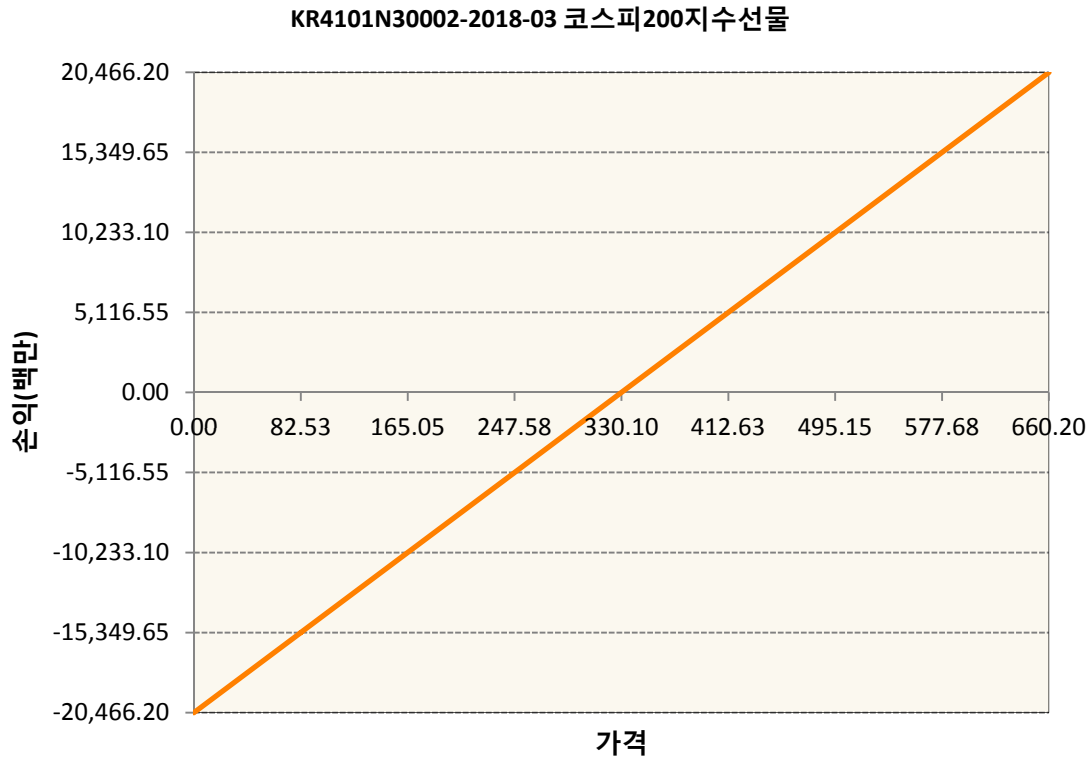
ETF스마트레버리지목표전환형8호

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	20,466	0	20,466	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101N30(2018-03 코스피200지수선물							1,634
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,634	-1,634	-1,634	-1,634	-1,634	-1,634	-1,634
-5.33%	-1,090	-1,090	-1,090	-1,090	-1,090	-1,090	-1,090
-2.67%	-545	-545	-545	-545	-545	-545	-545
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	545	545	545	545	545	545	545
5.33%	1,090	1,090	1,090	1,090	1,090	1,090	1,090
8.00%	1,634	1,634	1,634	1,634	1,634	1,634	1,634

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

970

공시일	2018-01-22
기준일	2018-01-19

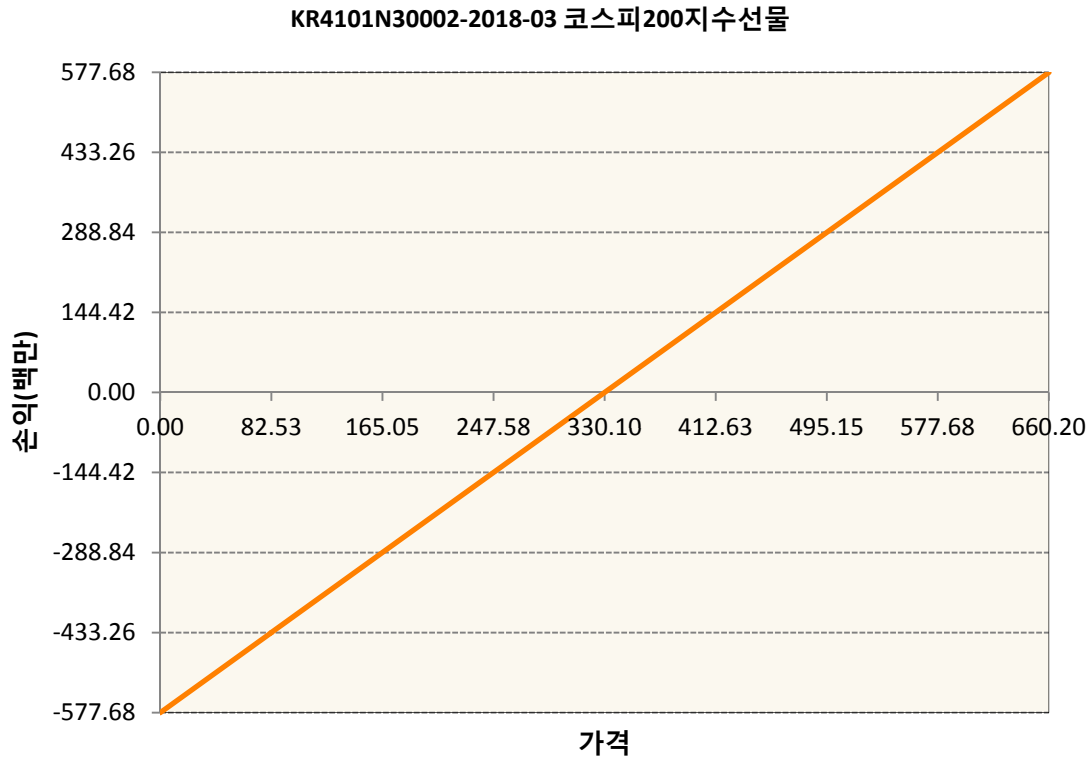
ETF스마트레버리지목표전환형9호

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	578	0	578	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	2018-01-22
기준일	2018-01-19

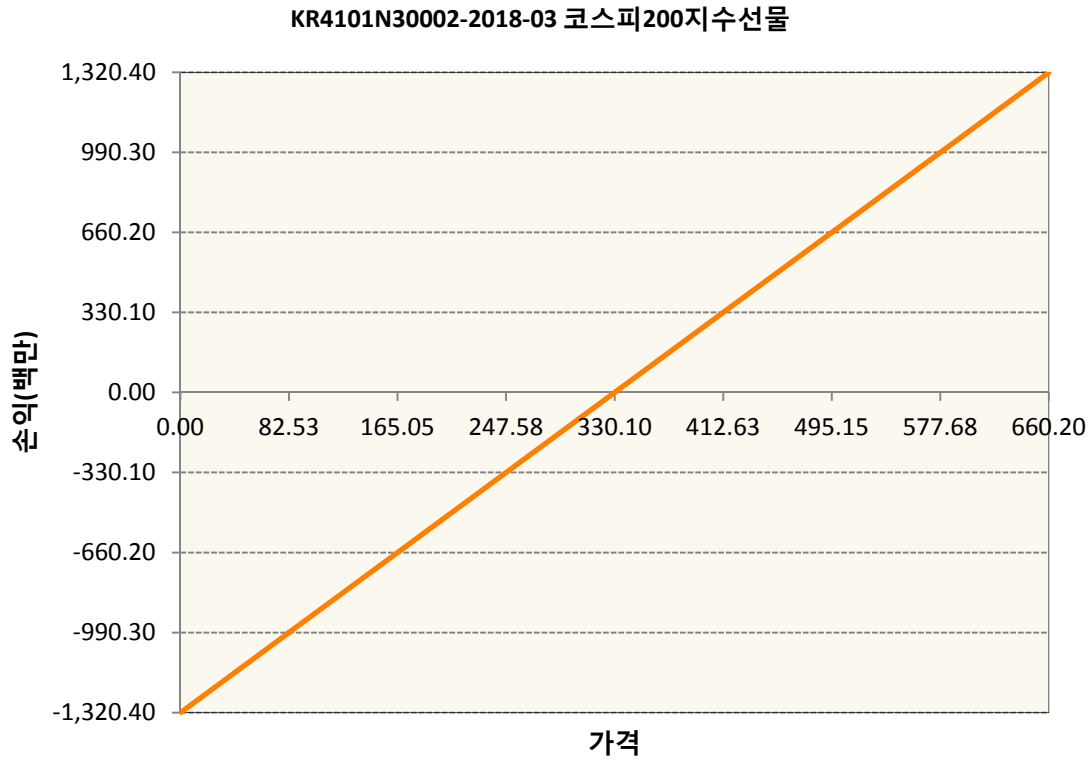
ETF스마트레버리지목표전환형10

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	2018-01-22
기준일	2018-01-19

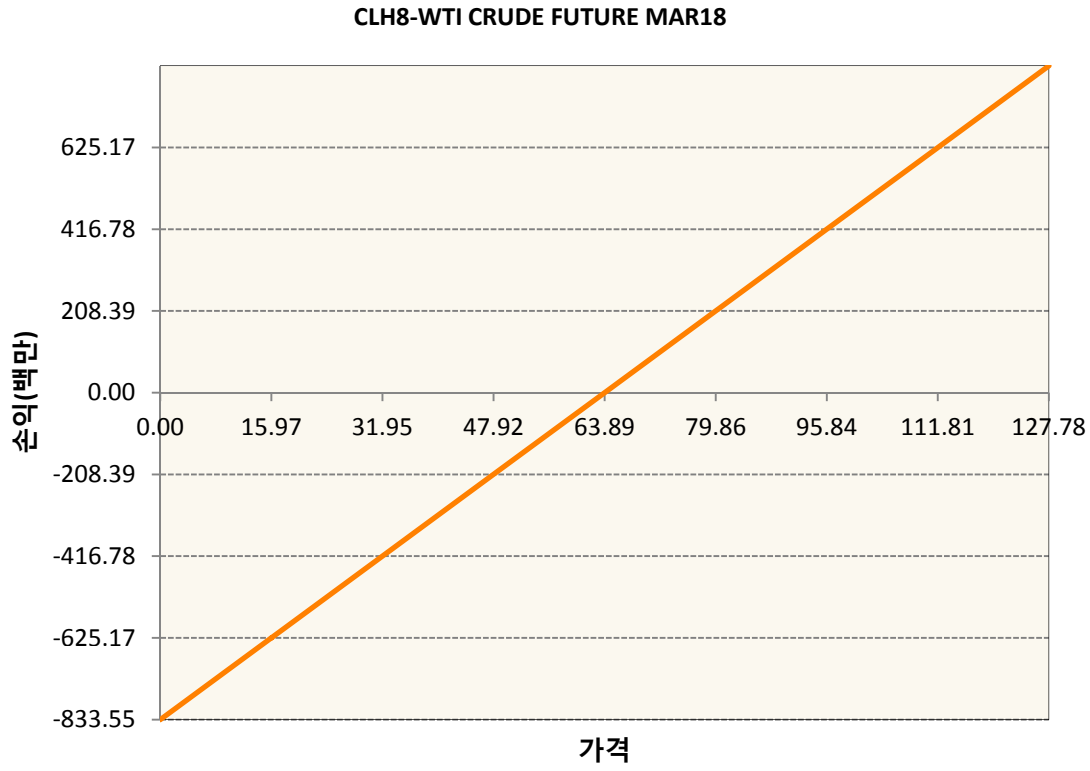
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

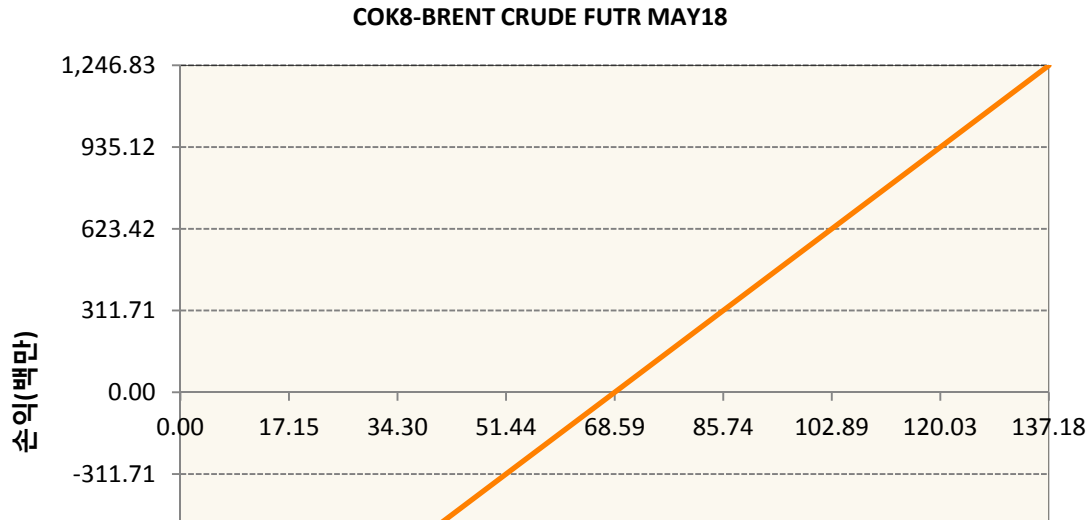
1. 계약금액

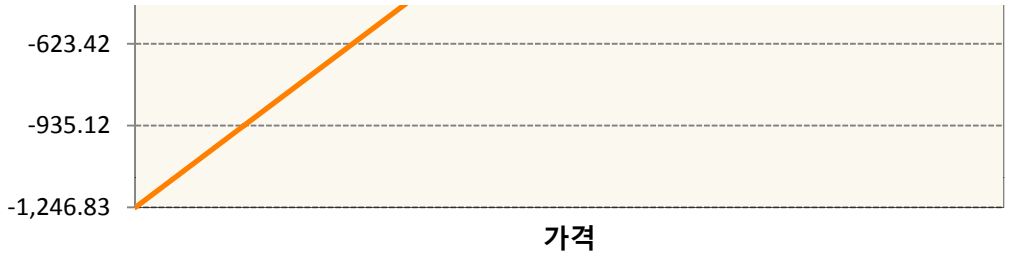
(단위:백만원)

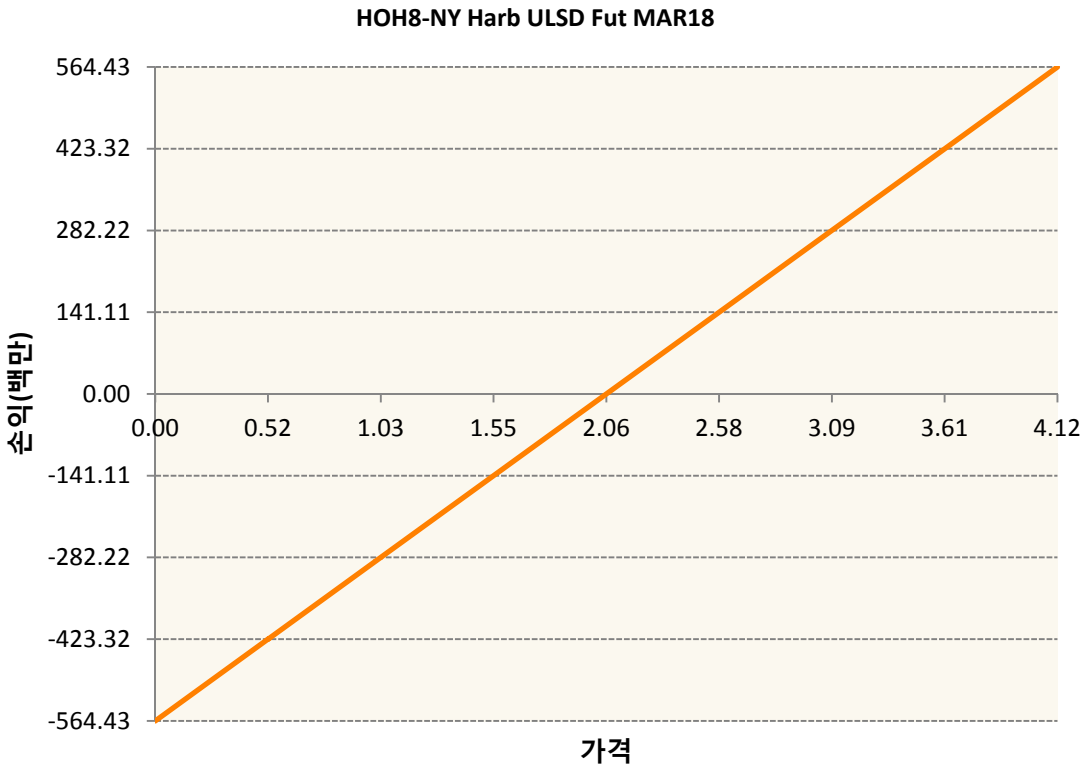
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	4,479	852	3,627	

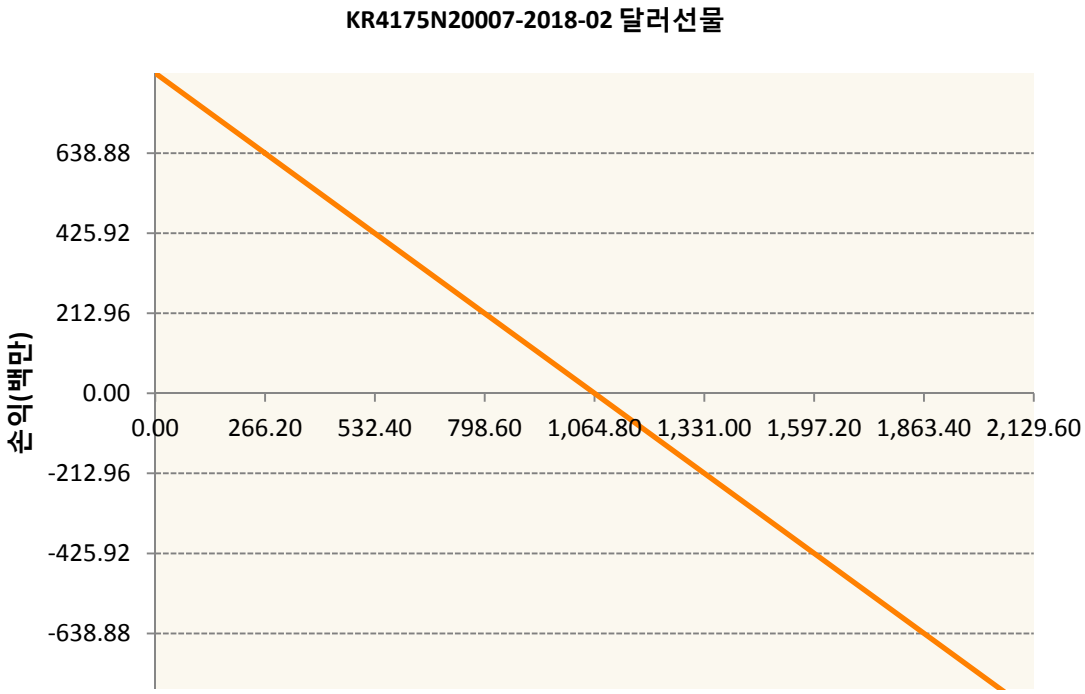
2. 만기시점의 손익구조

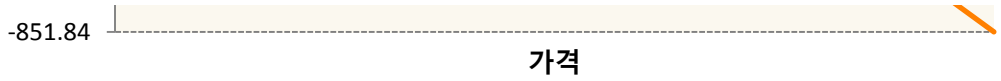


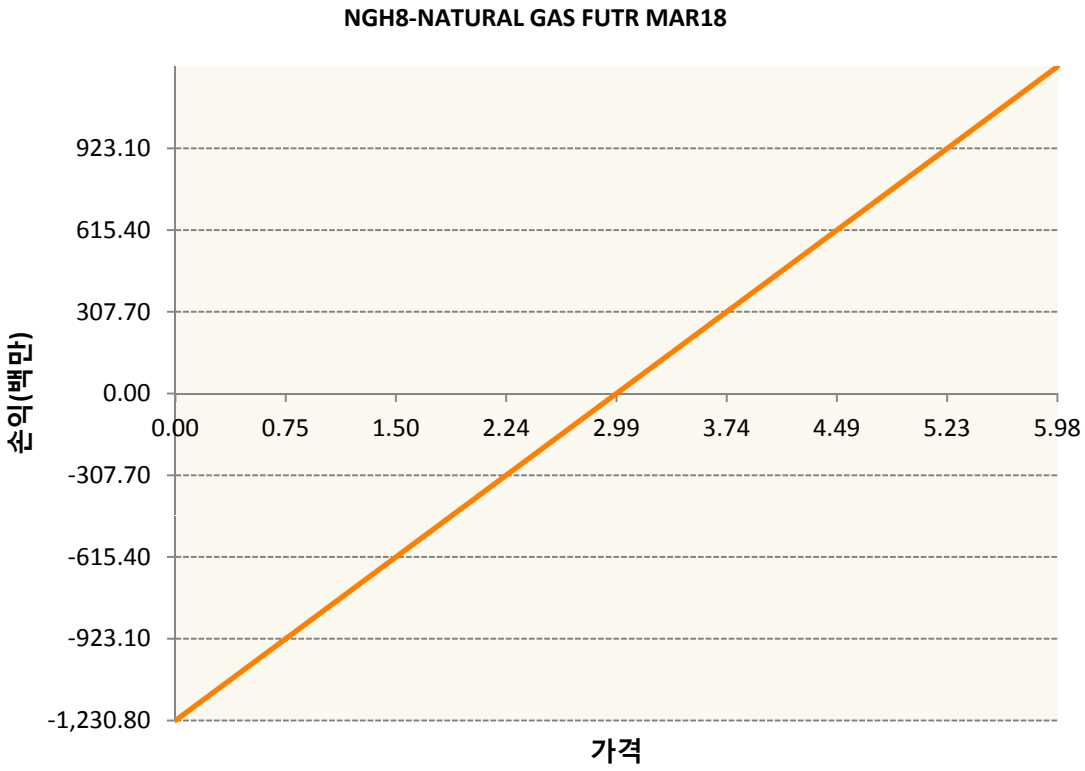


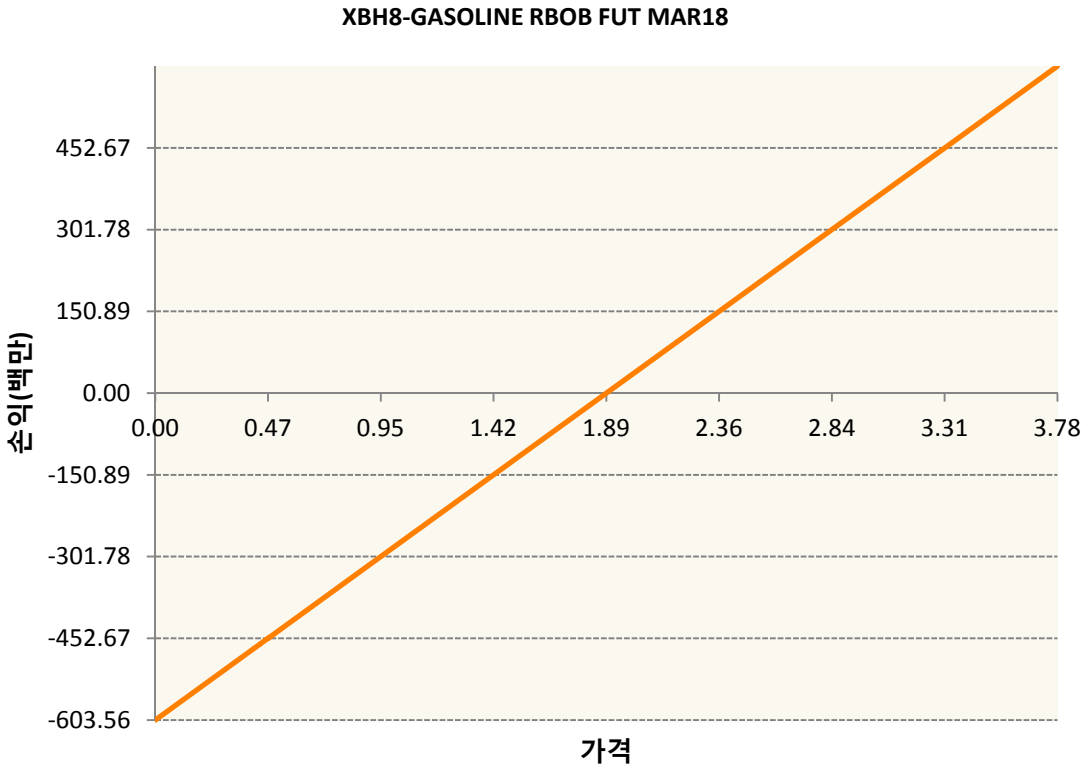

-623.42
-935.12
-1,246.83
가격


HOH8-NY Harb ULSD Fut MAR18
564.43
423.32
282.22
141.11
0.00
-141.11
-282.22
-423.32
-564.43
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
638.88
425.92
212.96
0.00
-212.96
-425.92
-638.88
0.00
266.20
532.40
798.60
1,064.80
1,331.00
1,597.20
1,863.40
2,129.60
손익(백만)


-851.84
가격


NGH8-NATURAL GAS FUTR MAR18
923.10
615.40
307.70
0.00
-307.70
-615.40
-923.10
-1,230.80
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
452.67
301.78
150.89
0.00
-150.89
-301.78
-452.67
-603.56
0.00
0.47
0.95
1.42
1.89
2.36
2.84
3.31
3.78
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	98
XBH8	GASOLINE RBOB FUT MAR18	48

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

608

공시일	2018-01-22
기준일	2018-01-19

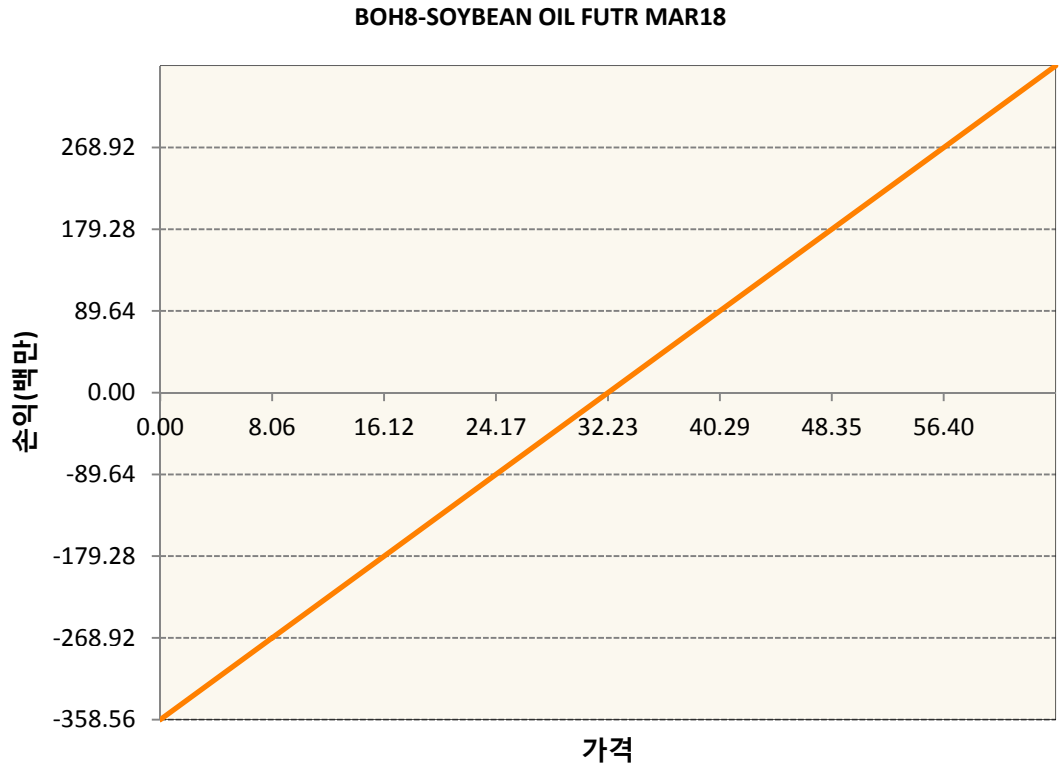
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

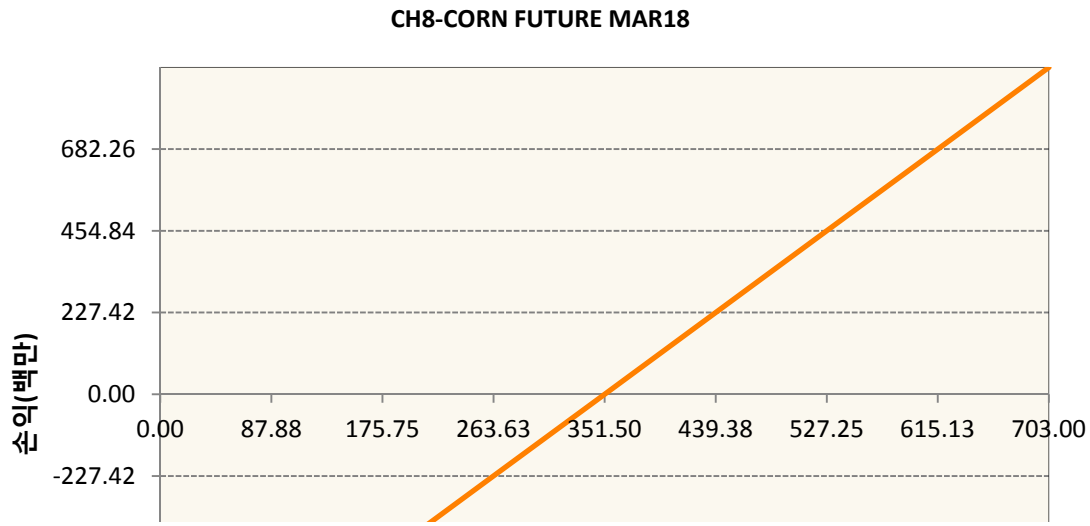
1. 계약금액

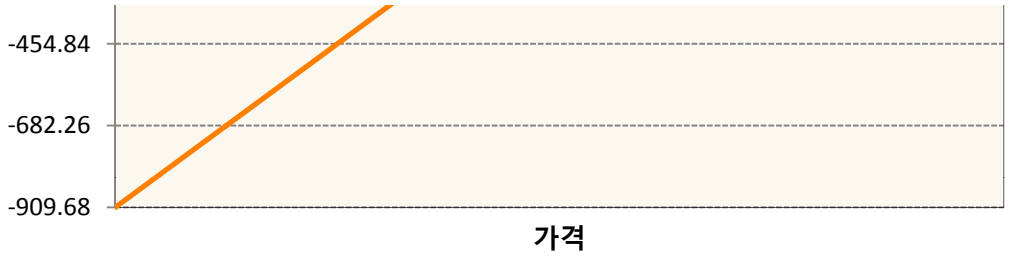
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	4,052	319	3,733	

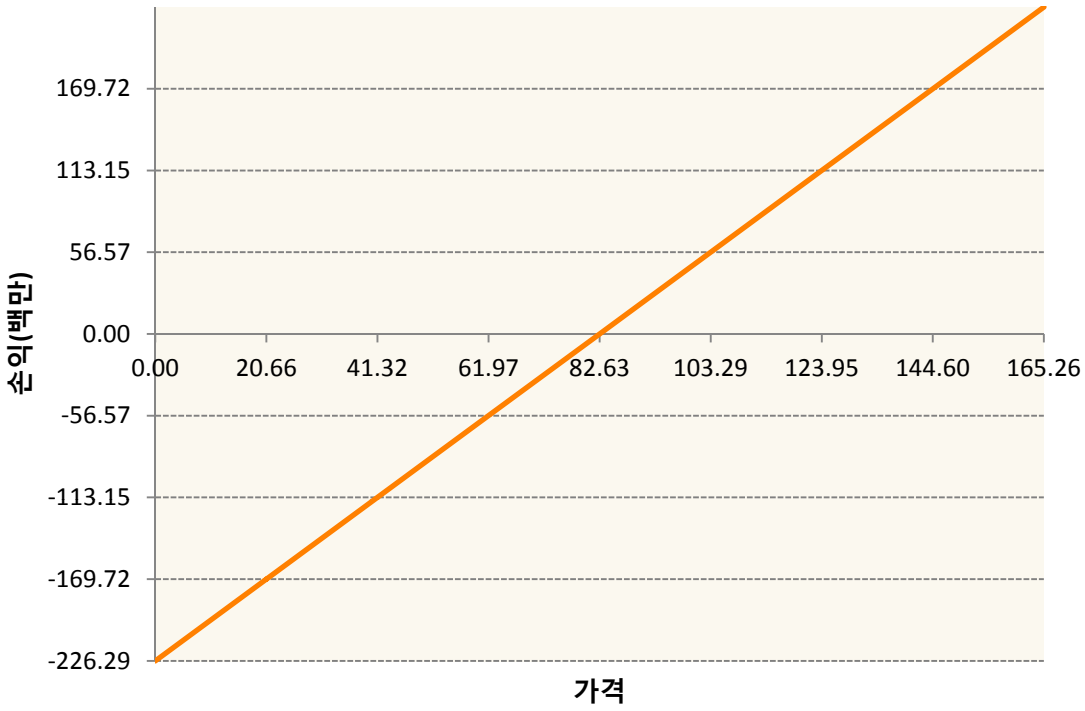
2. 만기시점의 손익구조



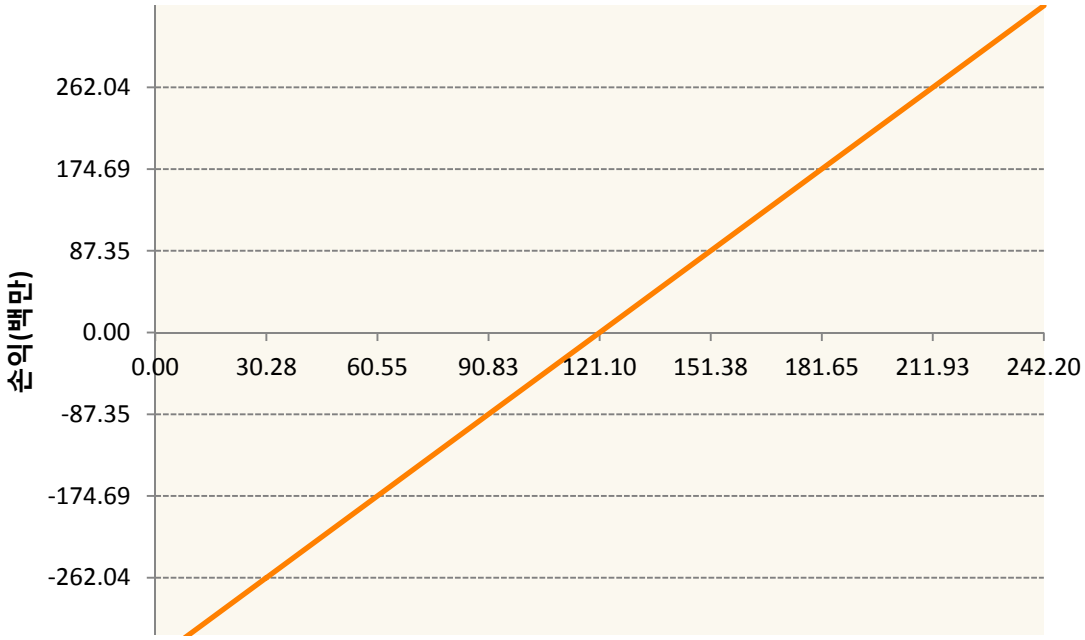


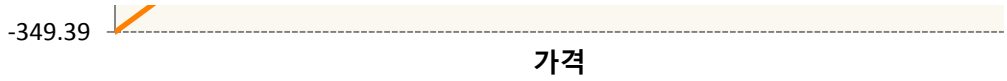


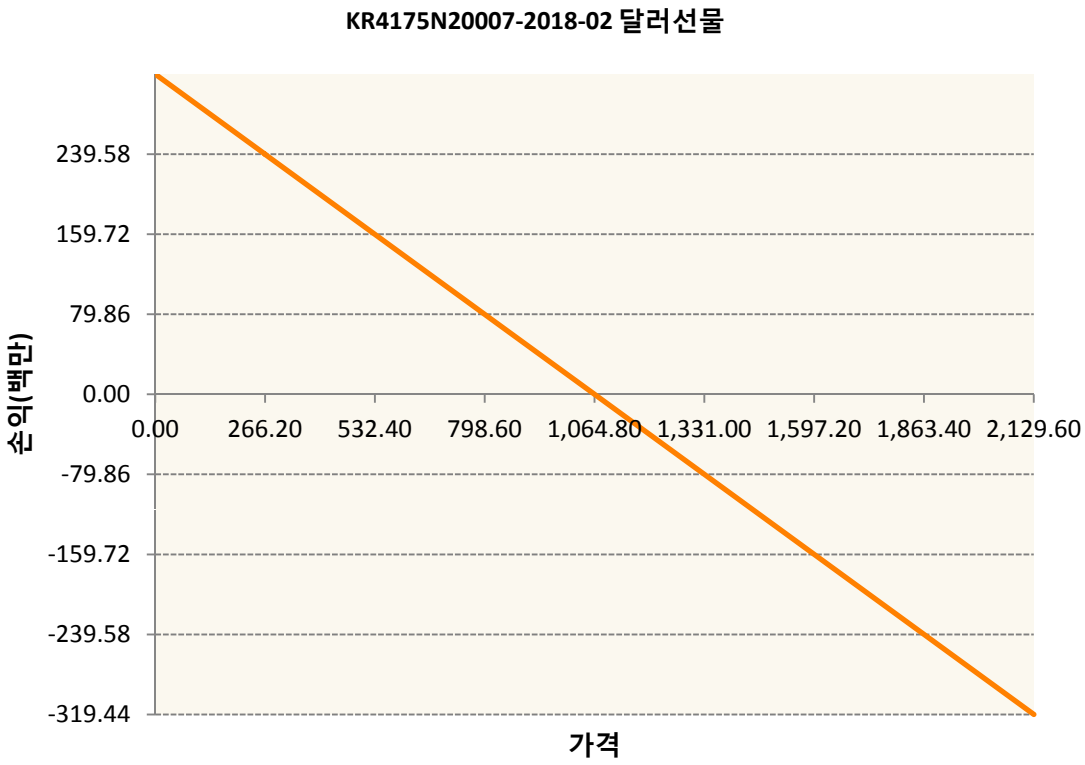
CTH8-COTTON NO.2 FUTR MAR18

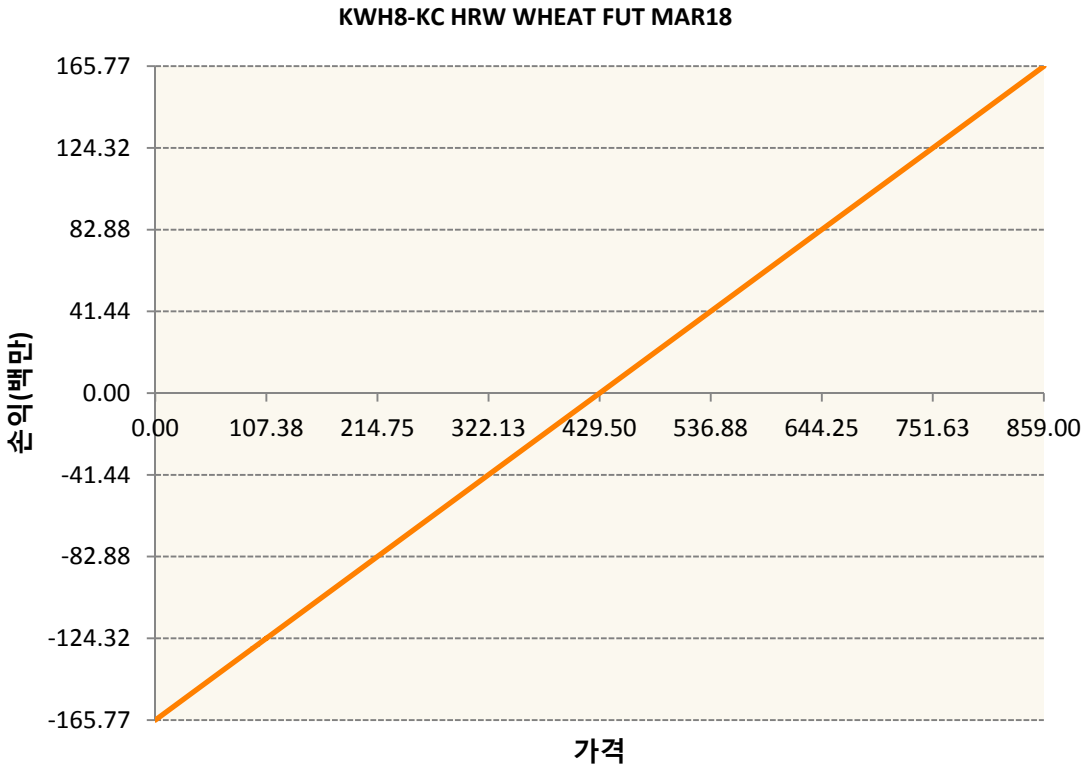


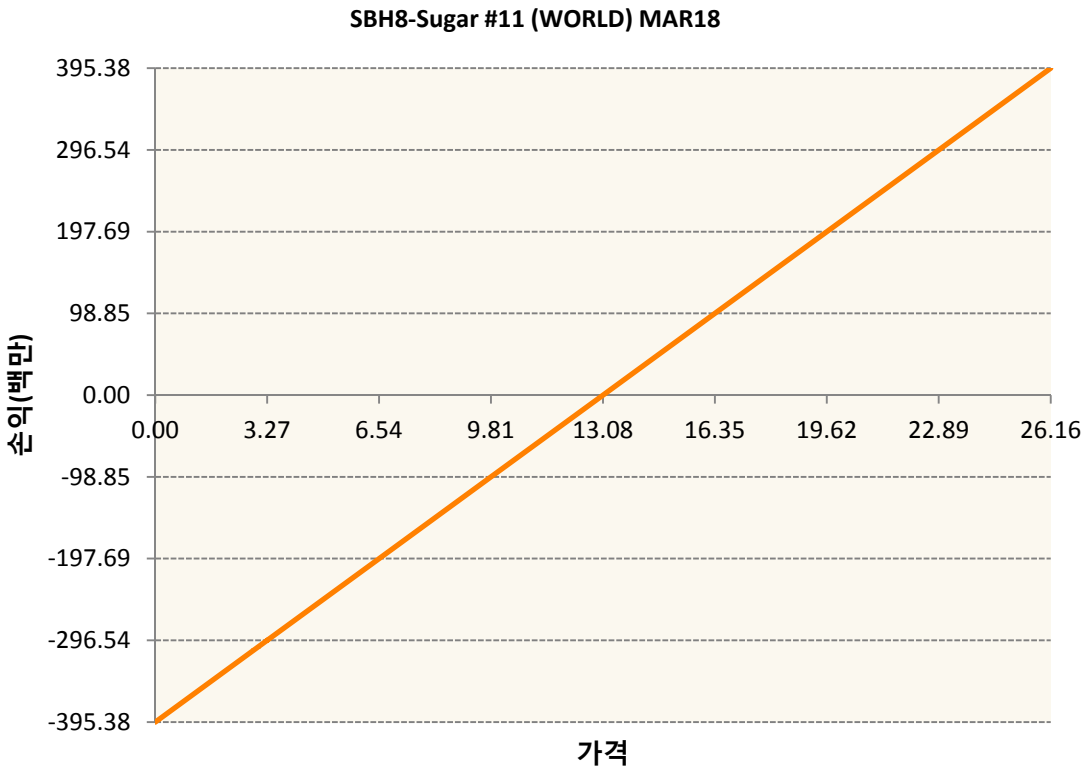
KCH8-COFFEE "C" FUTURE MAR18

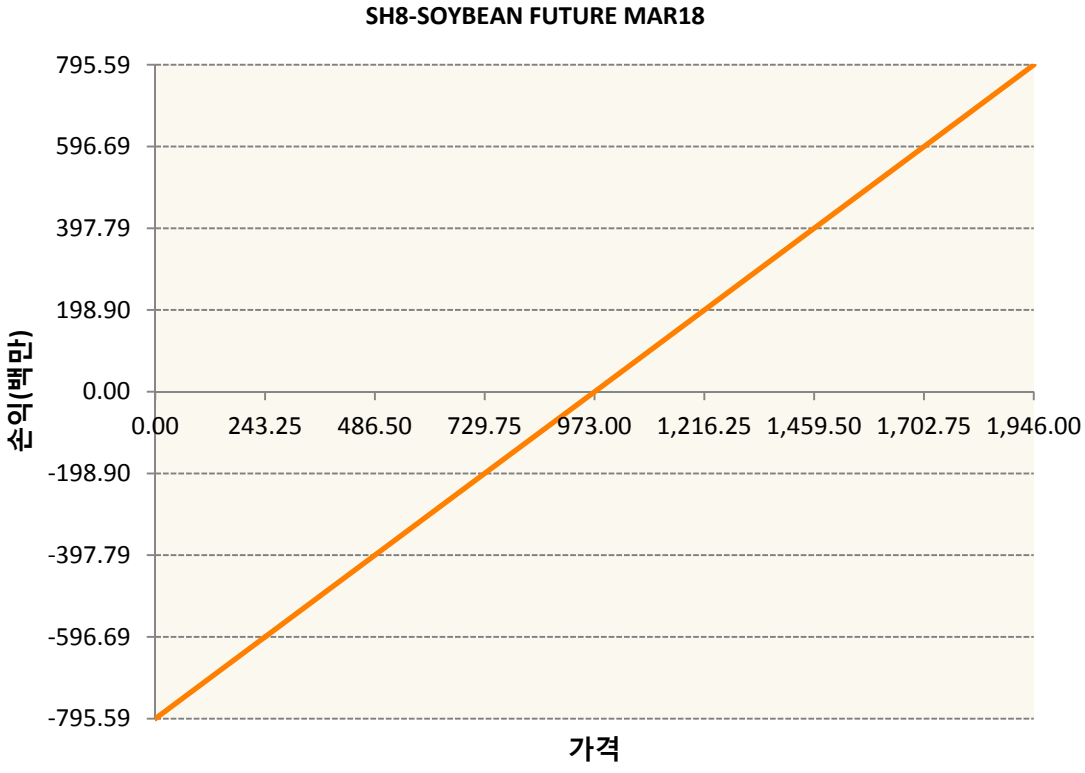



-349.39
가격

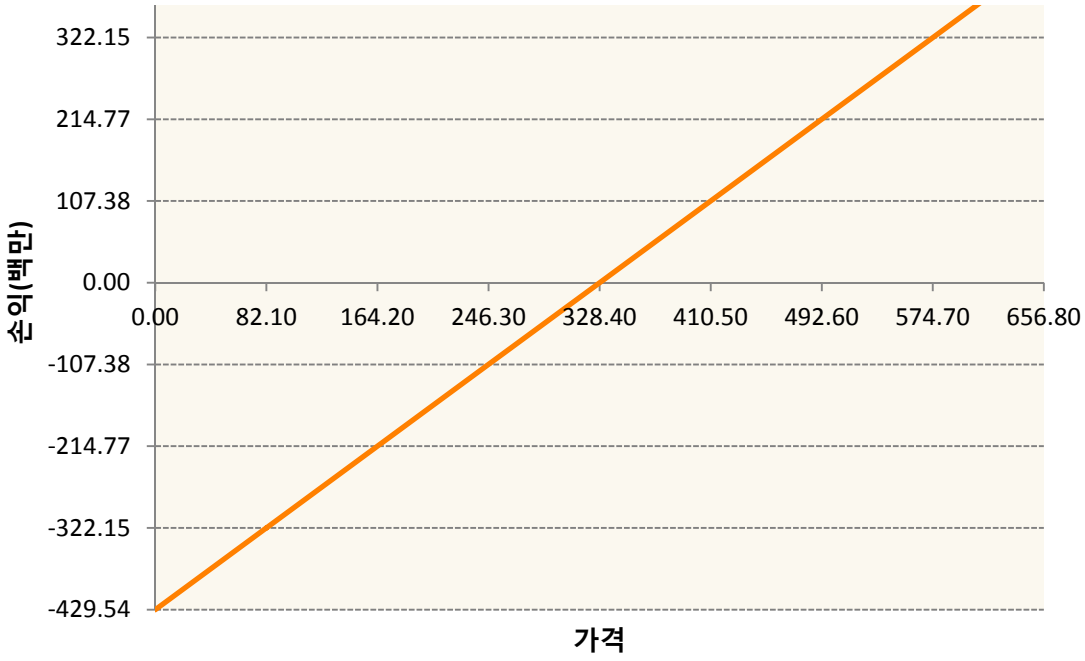

KR4175N20007-2018-02 달러선물
239.58
159.72
79.86
0.00
-79.86
-159.72
-239.58
-319.44
0.00
266.20
532.40
798.60
1,064.80
1,331.00
1,597.20
1,863.40
2,129.60
손익(백만)
가격


KWH8-KC HRW WHEAT FUT MAR18
165.77
124.32
82.88
41.44
0.00
-41.44
-82.88
-124.32
-165.77
0.00
107.38
214.75
322.13
429.50
536.88
644.25
751.63
859.00
손익(백만)
가격

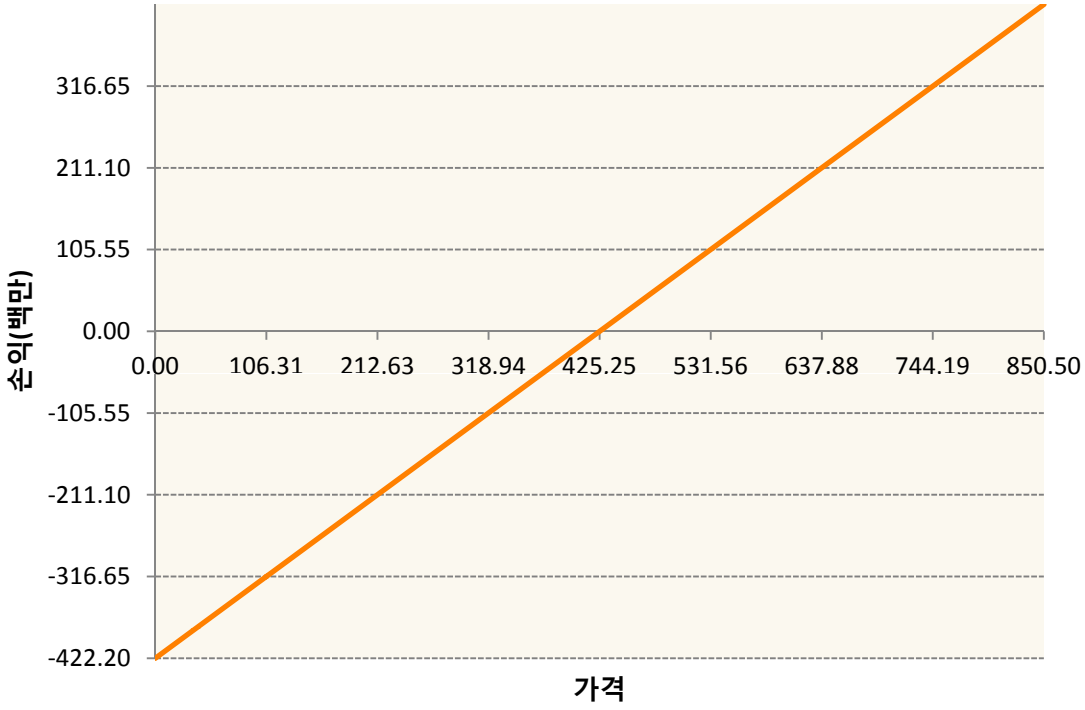

SBH8-Sugar #11 (WORLD) MAR18
395.38
296.54
197.69
98.85
0.00
-98.85
-197.69
-296.54
-395.38
0.00
3.27
6.54
9.81
13.08
16.35
19.62
22.89
26.16
손익(백만)
가격


SH8-SOYBEAN FUTURE MAR18
795.59
596.69
397.79
198.90
0.00
-198.90
-397.79
-596.69
-795.59
0.00
243.25
486.50
729.75
973.00
1,216.25
1,459.50
1,702.75
1,946.00
손익(백만)
가격


SMH8-SOYBEAN MEAL FUTR MAR18
429.54



WH8-WHEAT FUTURE(CBT) 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	64
SMH8	SOYBEAN MEAL FUTR MAR18	34
WH8	WHEAT FUTURE(CBT) MAR18	34

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

339