공시일	2018-01-23
기준일	2018-01-22

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	2018-01-23
기준일	2018-01-22

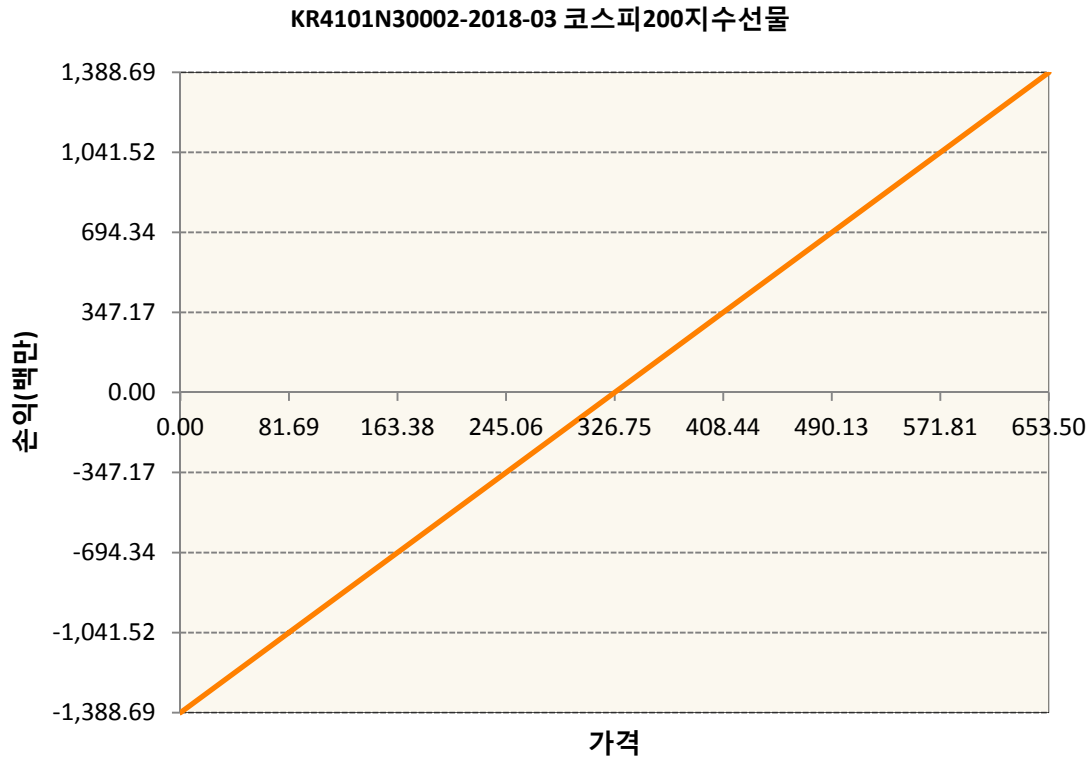
스마트인덱스모

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	1,389	0	1,389	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101N30(2018-03 코스피200지수선물							111
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-111	-111	-111	-111	-111	-111	-111
-5.33%	-74	-74	-74	-74	-74	-74	-74
-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%	74	74	74	74	74	74	74
8.00%	111	111	111	111	111	111	111

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

66

공시일	2018-01-23
기준일	2018-01-22

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	1,154

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

371

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2018-01-23
기준일	2018-01-22

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	419

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

378

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2018-01-23
기준일	2018-01-22

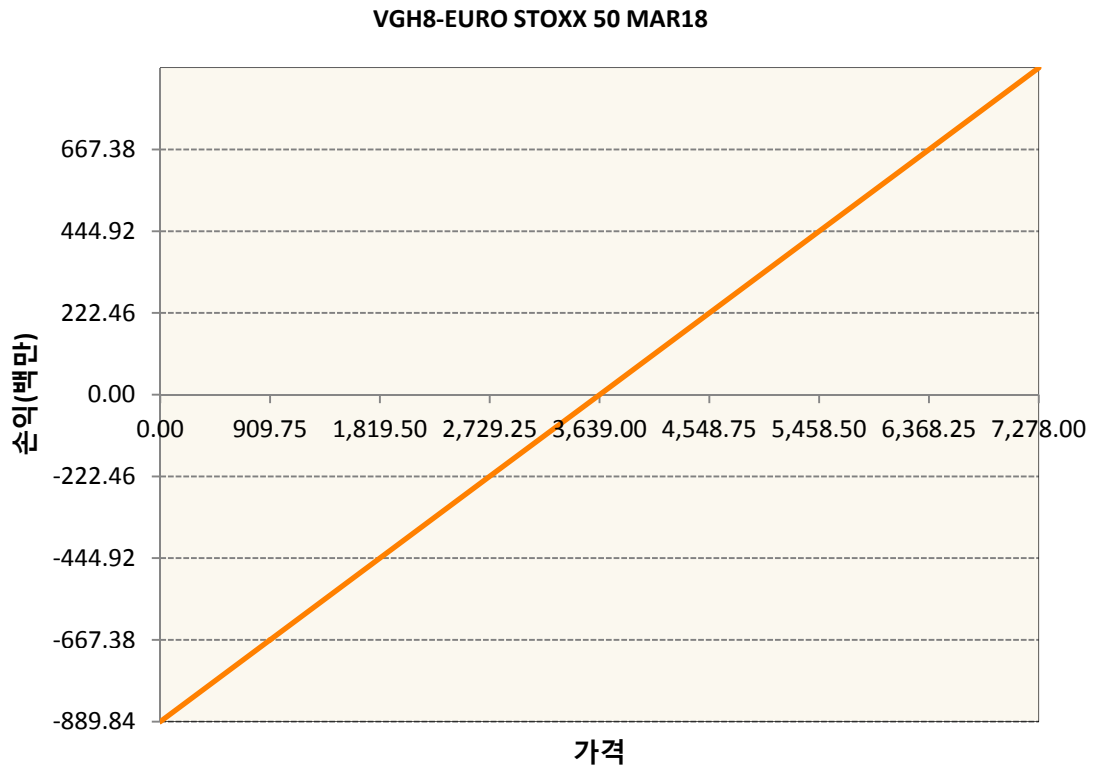
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

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

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	2018-01-23
기준일	2018-01-22

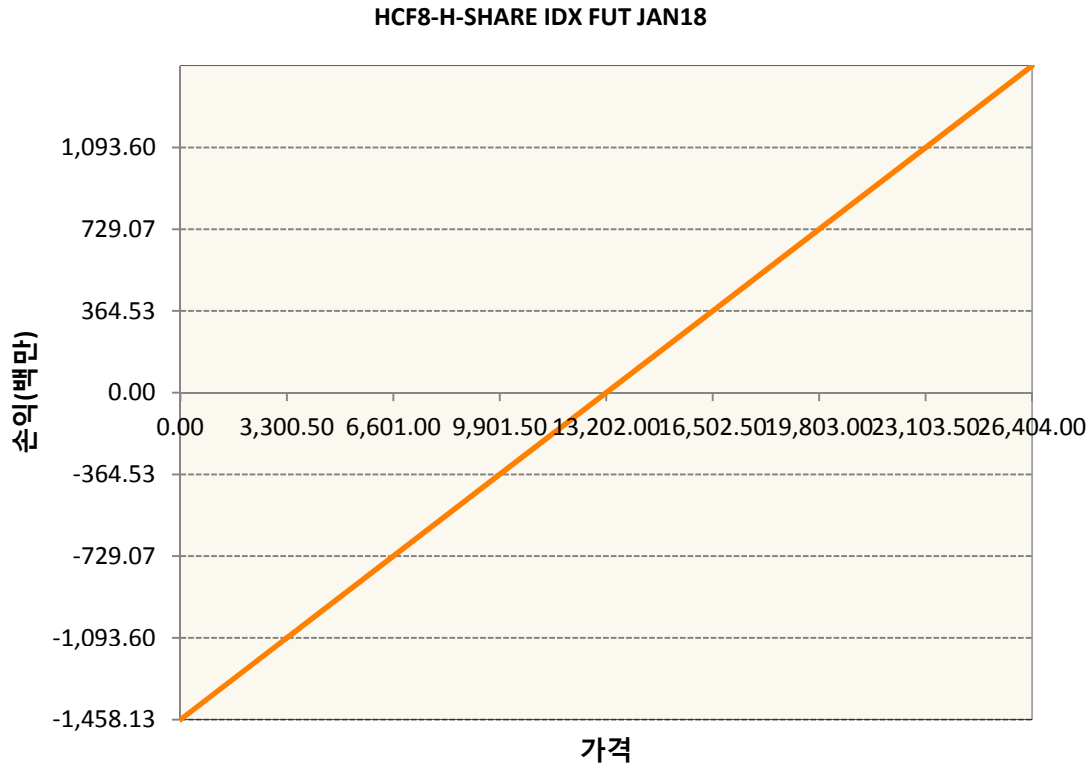
차이나인덱스모(주식-파생형)

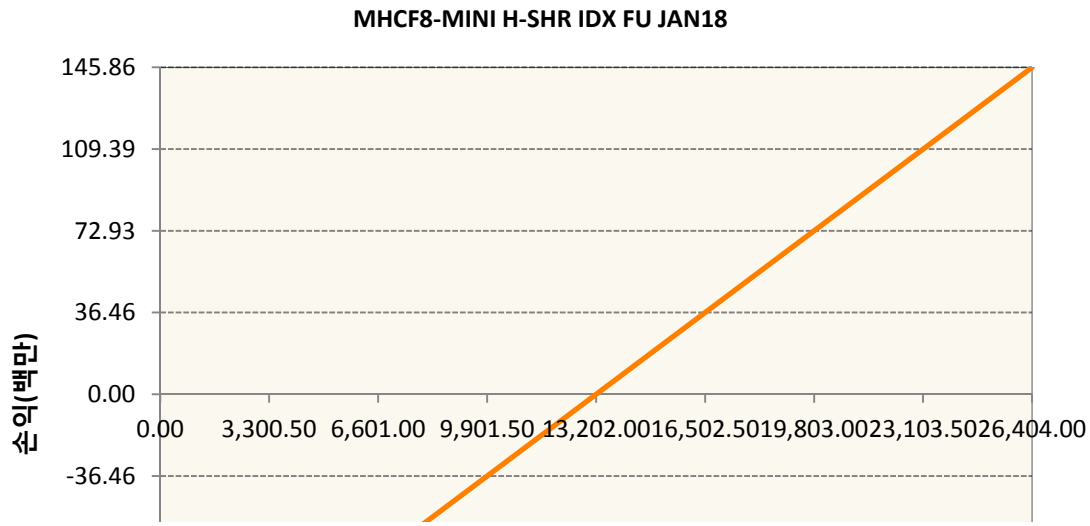
1. 계약금액

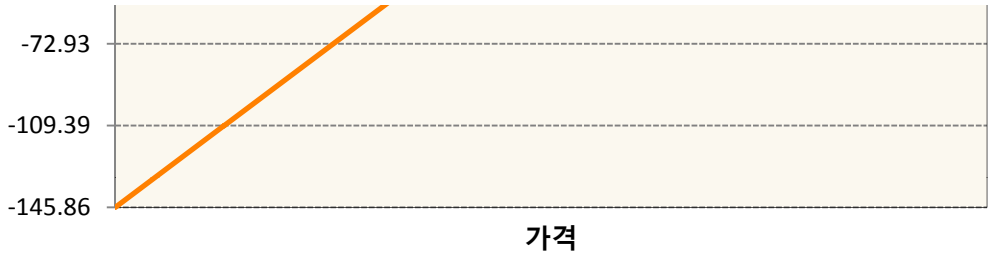
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,604	0	1,604	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCF8	H-SHARE IDX FUT JAN18	117
MHCF8	MINI H-SHR IDX FU JAN18	12

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

공시일	2018-01-23
기준일	2018-01-22

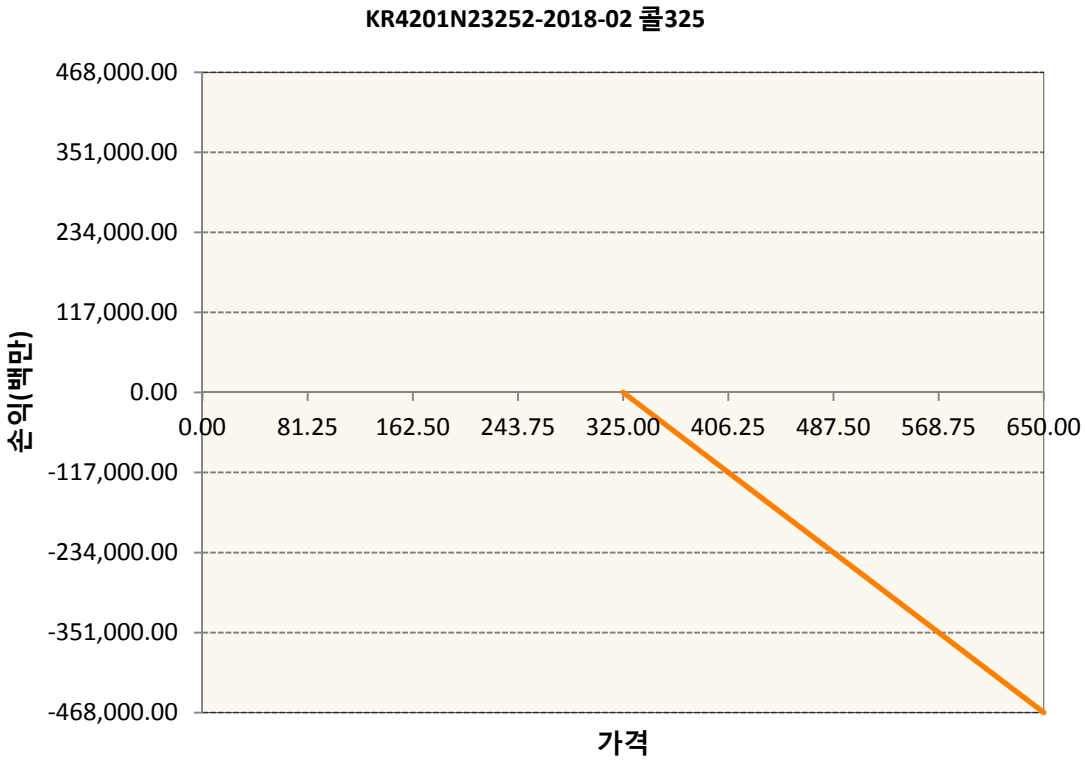
커버드콜모(주식혼합-파생형)

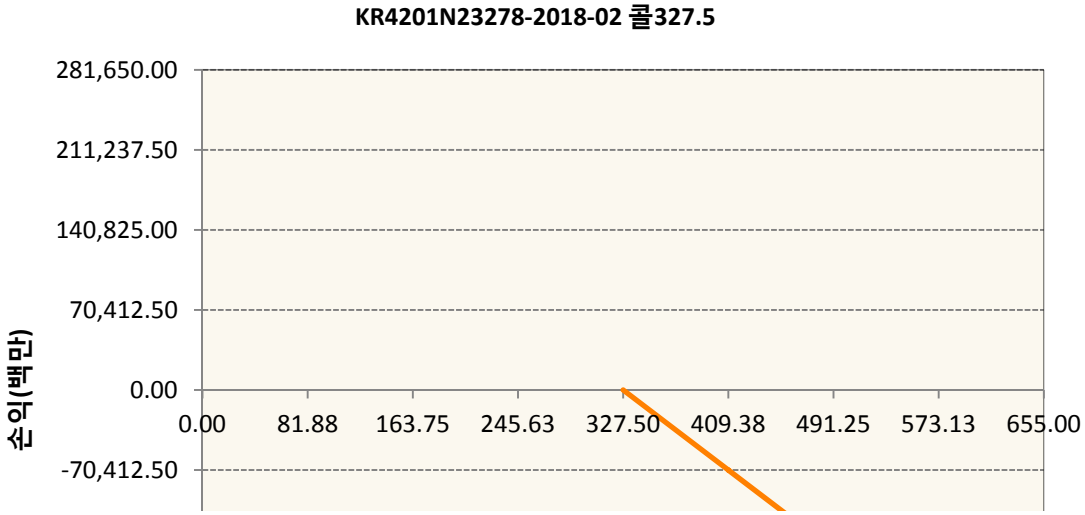
1. 계약금액

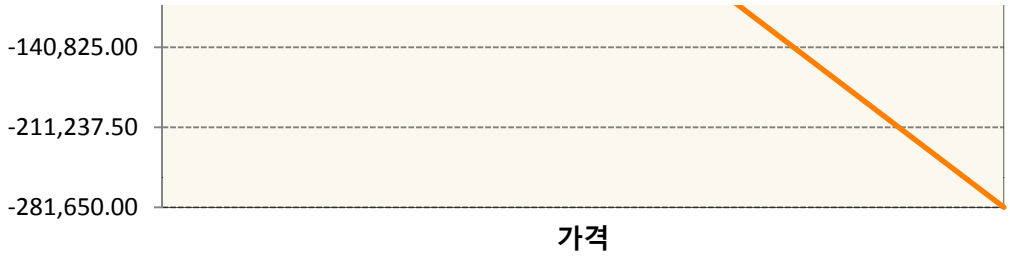
(단위:백만원)

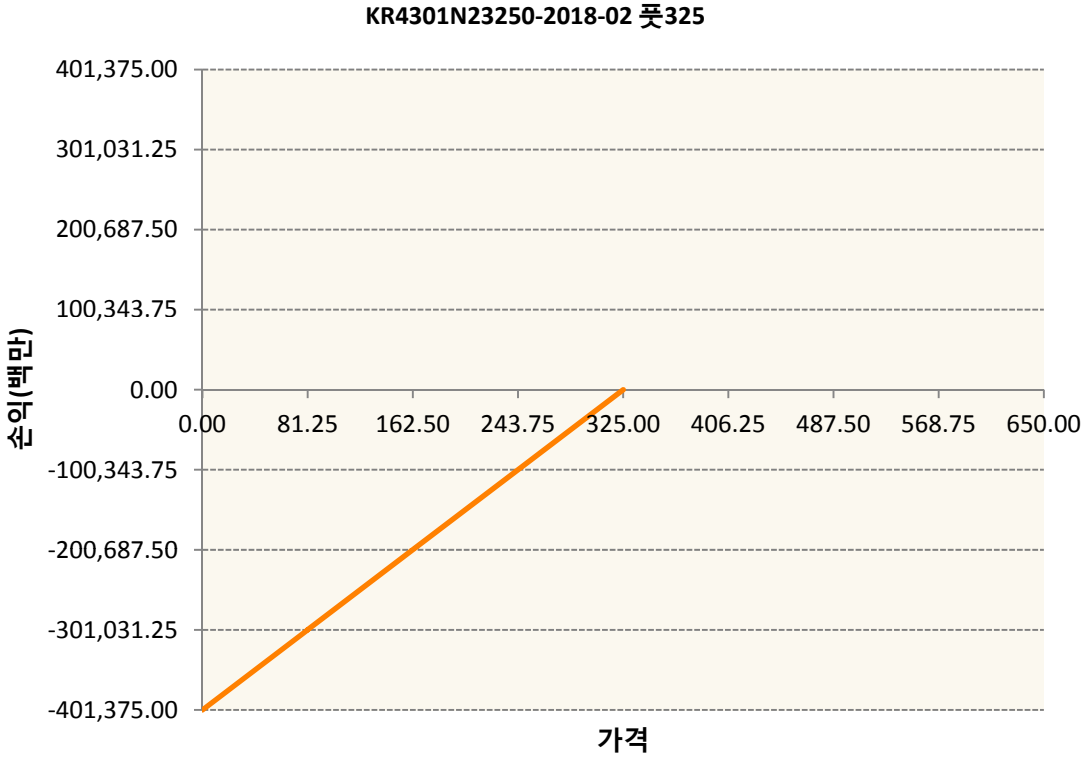
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	458,628	464,631	-6,003	장내
누계	유가증권	옵션	0	1,319,688	-1,319,688	장내

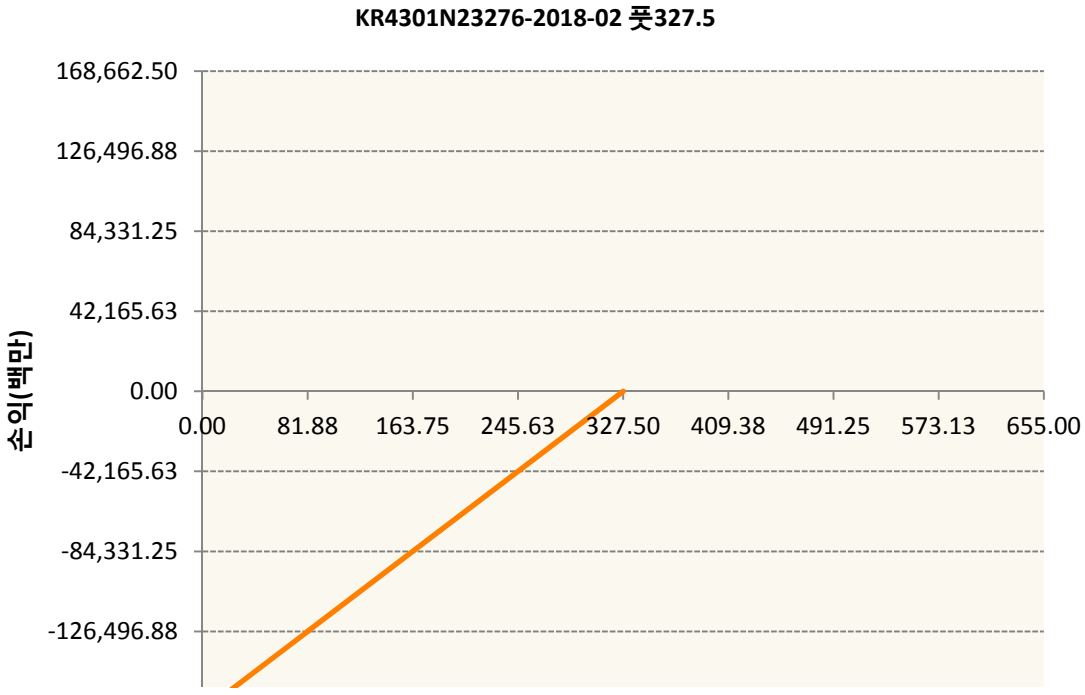
2. 만기시점의 손익구조






-140,825.00
-211,237.50
-281,650.00
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							30,261
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	11,036	10,885	10,680	10,423	10,116	9,763	9,369
-5.33%	10,253	9,838	9,369	8,853	8,299	7,712	7,098
-2.67%	7,804	7,077	6,331	5,571	4,799	4,019	3,232
0%	2,531	1,688	844	0	-845	-1,690	-2,535
2.67%	-5,875	-6,540	-7,238	-7,960	-8,701	-9,458	-10,228
5.33%	-16,616	-16,985	-17,417	-17,902	-18,432	-19,002	-19,604
8.00%	-28,560	-28,708	-28,913	-29,174	-29,488	-29,852	-30,261
KR4201N232 2018-02 콜327.5							17,273
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	5,576	5,511	5,418	5,296	5,145	4,967	4,763
-5.33%	5,255	5,056	4,822	4,557	4,265	3,950	3,616
-2.67%	4,143	3,752	3,343	2,920	2,486	2,043	1,593
0%	1,520	1,014	507	0	-507	-1,014	-1,521
2.67%	-2,983	-3,429	-3,887	-4,353	-4,827	-5,307	-5,791
5.33%	-9,056	-9,331	-9,640	-9,977	-10,337	-10,717	-11,114
8.00%	-16,032	-16,155	-16,314	-16,509	-16,735	-16,991	-17,273
KR4301N232 2018-02 풋325							26,877
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-26,823	-26,824	-26,826	-26,831	-26,840	-26,855	-26,877
-5.33%	-16,104	-16,131	-16,174	-16,235	-16,315	-16,414	-16,532
-2.67%	-5,929	-6,145	-6,384	-6,640	-6,911	-7,194	-7,487
0%	1,100	734	368	0	-368	-737	-1,107
2.67%	3,382	3,239	3,067	2,872	2,656	2,422	2,172
5.33%	3,643	3,628	3,601	3,559	3,501	3,424	3,330
8.00%	3,652	3,651	3,650	3,646	3,638	3,625	3,603
KR4301N232 2018-02 풋327.5							11,843
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-11,831	-11,831	-11,831	-11,832	-11,834	-11,837	-11,843
-5.33%	-7,355	-7,360	-7,368	-7,383	-7,403	-7,431	-7,465
-2.67%	-2,987	-3,046	-3,117	-3,198	-3,287	-3,384	-3,486
0%	464	309	155	0	-155	-310	-465
2.67%	1,919	1,827	1,726	1,617	1,502	1,381	1,256

5.33%	2,152	2,137	2,115	2,085	2,045	1,997	1,941
8.00%	2,164	2,163	2,161	2,158	2,151	2,141	2,126

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

93,554

공시일	2018-01-23
기준일	2018-01-22

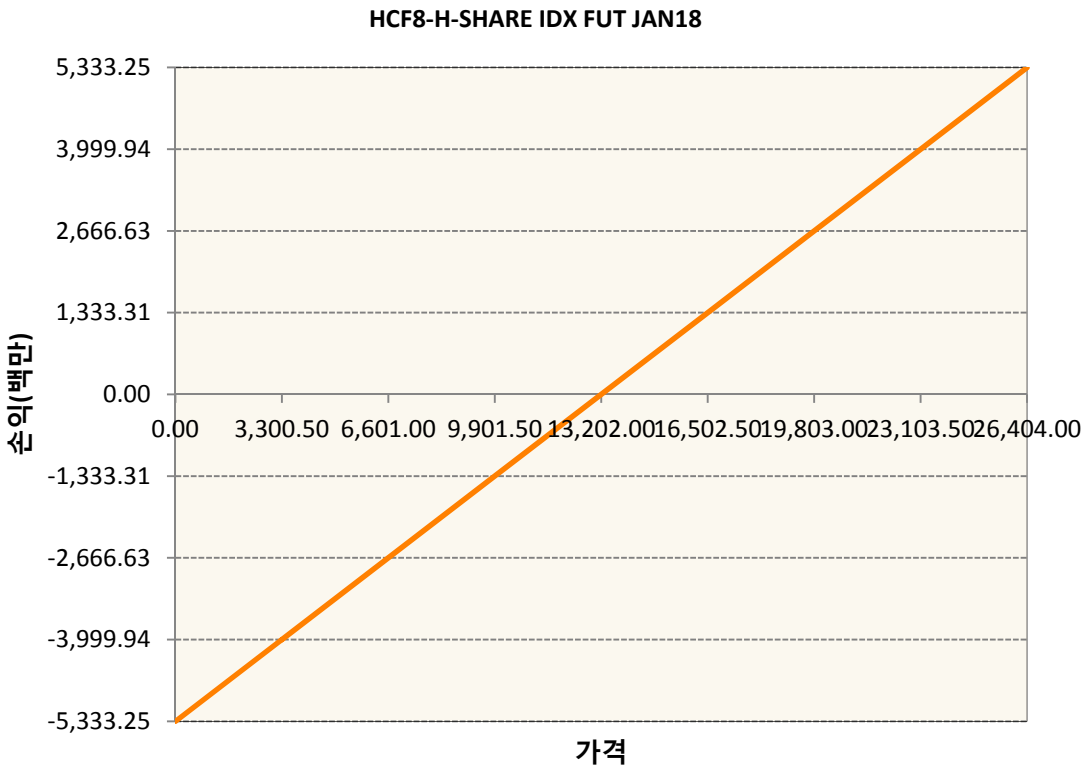
홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생

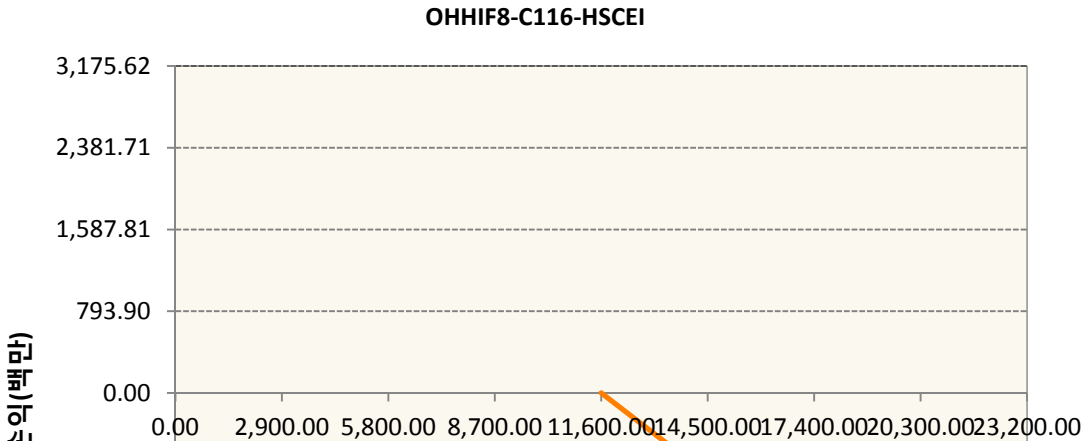
1. 계약금액

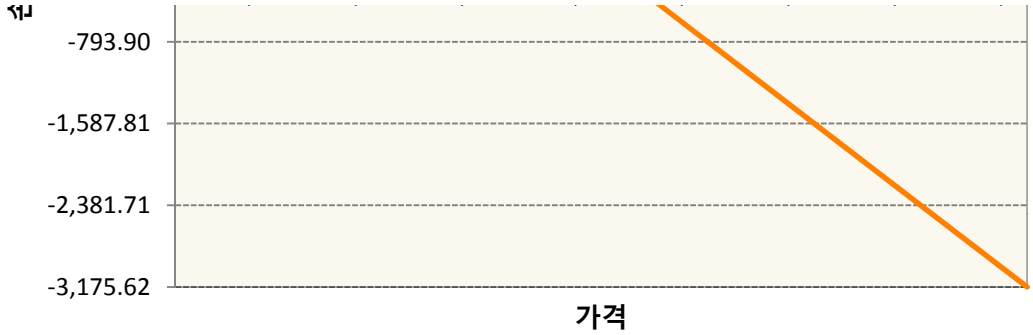
(단위:백만원)

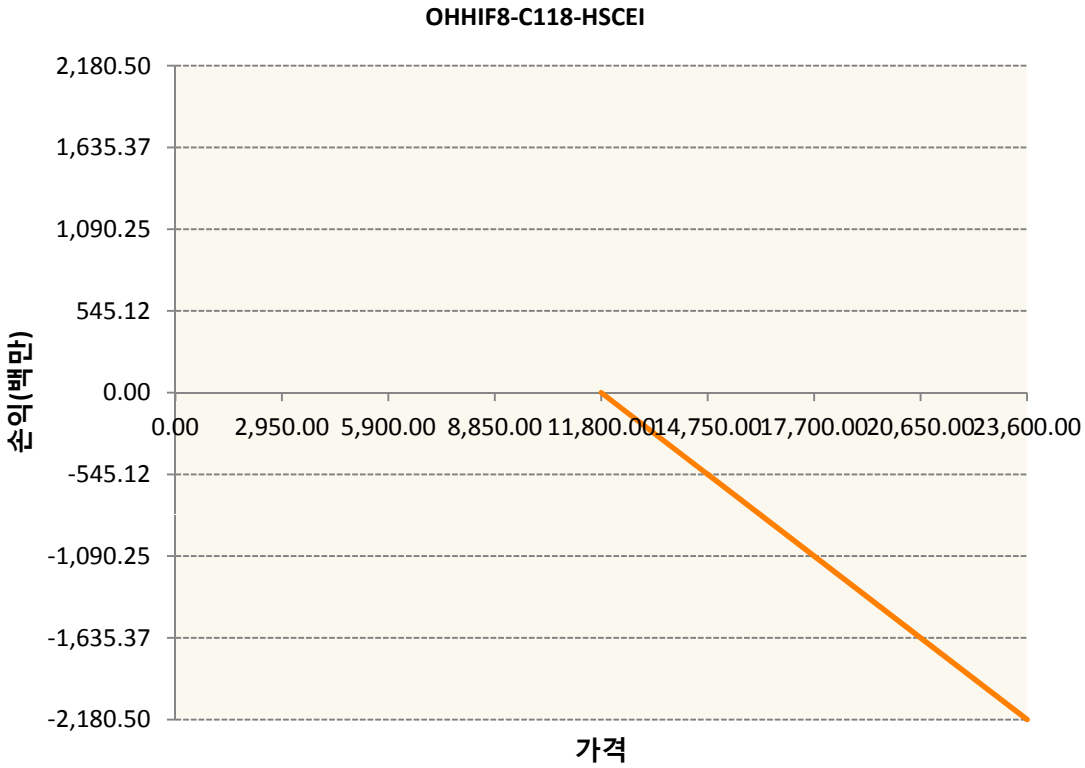
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	5,333	0	5,333	장내
누계	유가증권	옵션	0	10,712	-10,712	장내

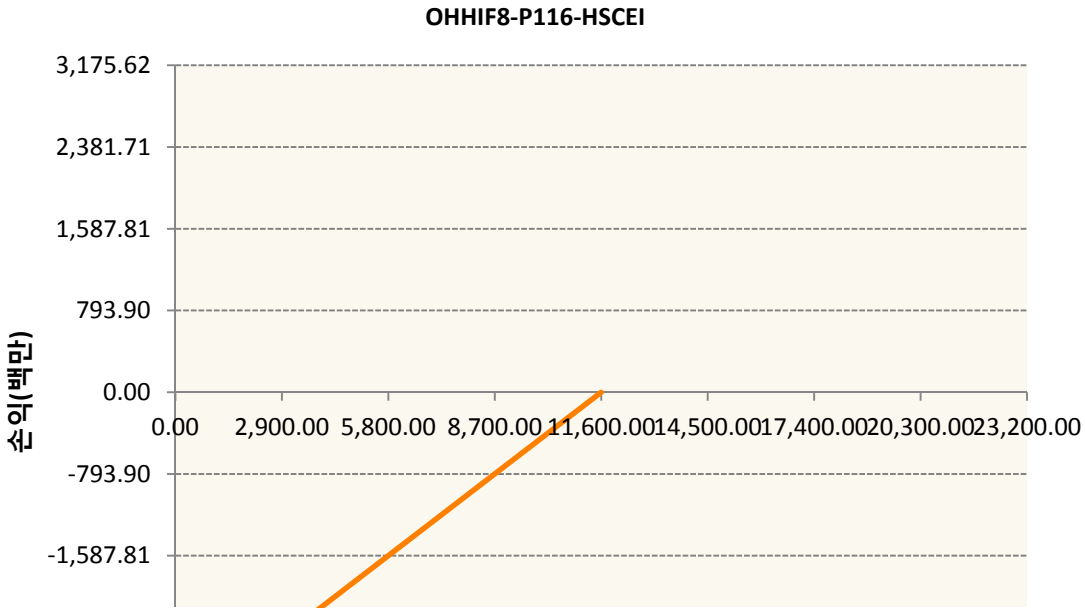
2. 만기시점의 손익구조

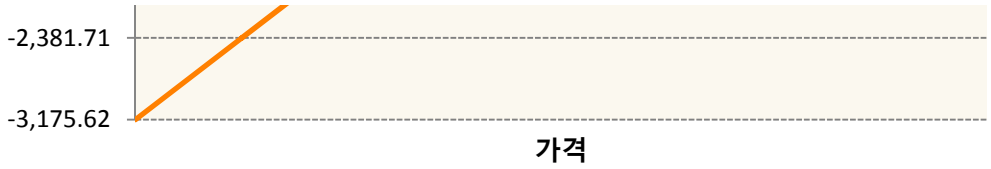


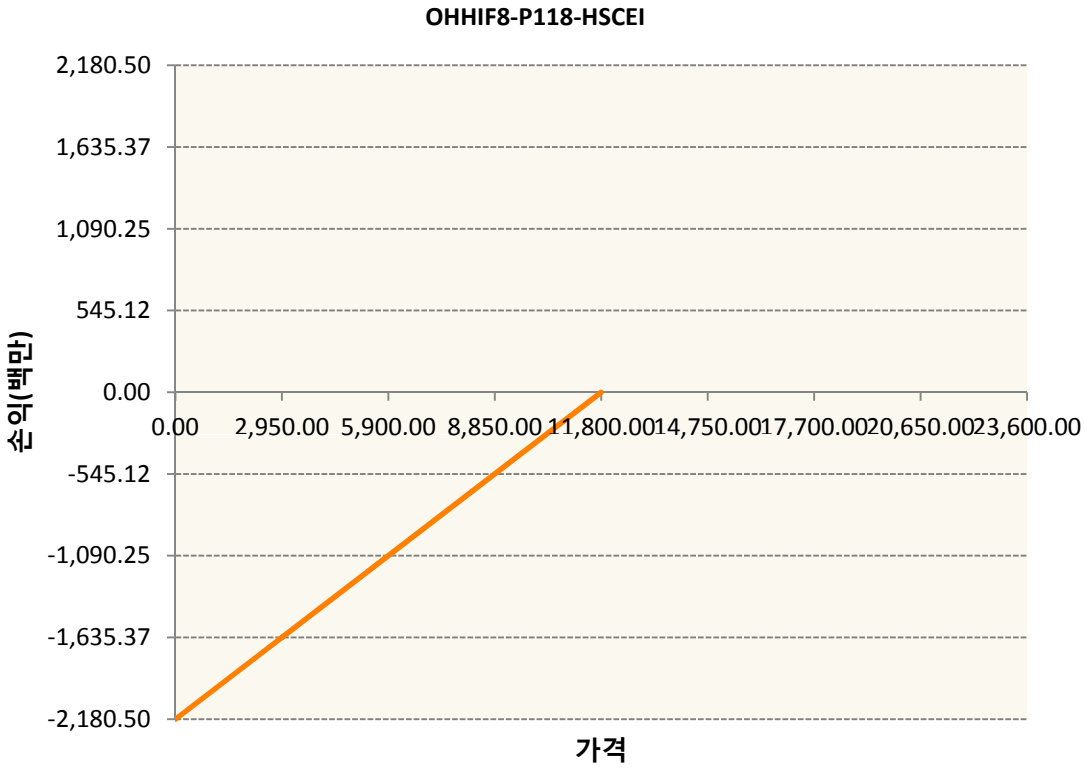



-793.90
-1,587.81
-2,381.71
-3,175.62
가격


OHHIF8-C118-HSCEI
2,180.50
1,635.37
1,090.25
545.12
0.00
-545.12
-1,090.25
-1,635.37
-2,180.50
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
3,175.62
2,381.71
1,587.81
793.90
0.00
-793.90
-1,587.81
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	427
OHHIF8-C11	HSCEI	254
OHHIF8-C11	HSCEI	174
OHHIF8-P11	HSCEI	254
OHHIF8-P11	HSCEI	174

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,023

공시일	2018-01-23
기준일	2018-01-22

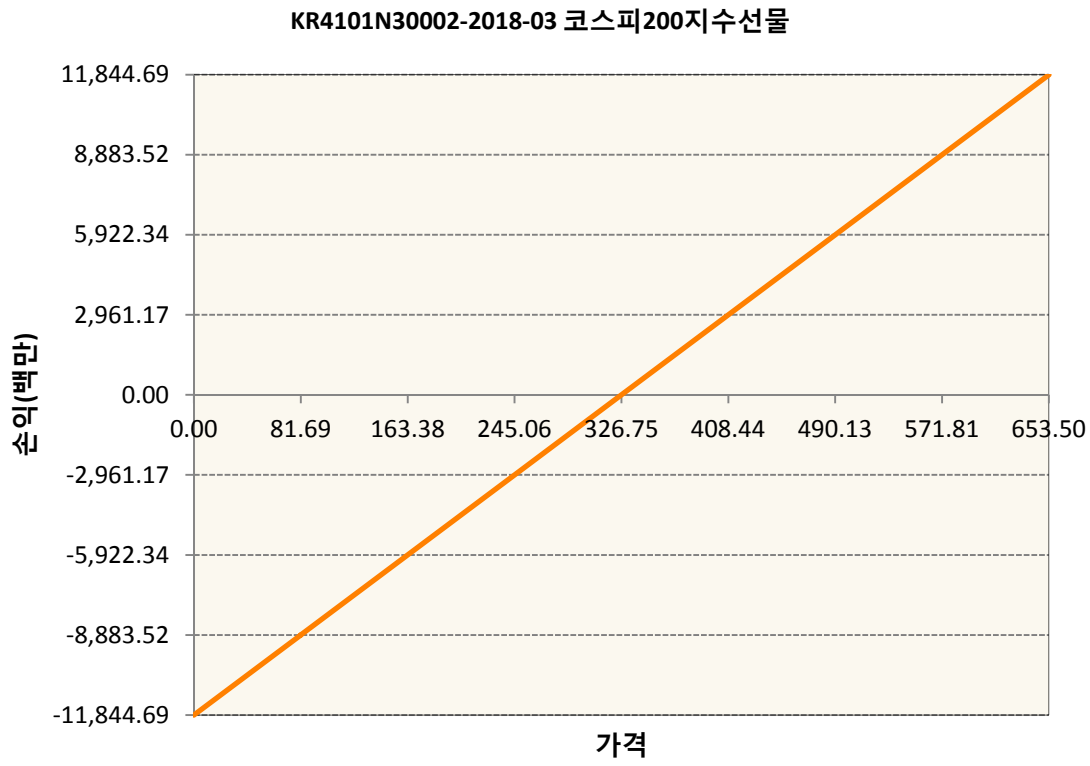
코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼

1. 계약금액

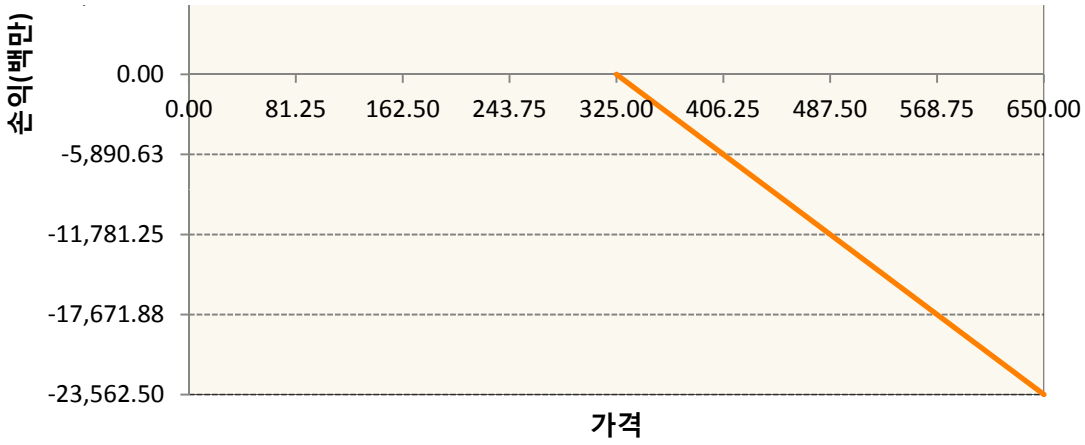
(단위:백만원)

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	23,540	23,849	-308	장내
누계	유가증권	선물	11,845	0	11,845	장내
누계	유가증권	스왑	60,200	0	60,200	장외
누계	유가증권	옵션	0	60,250	-60,250	장내

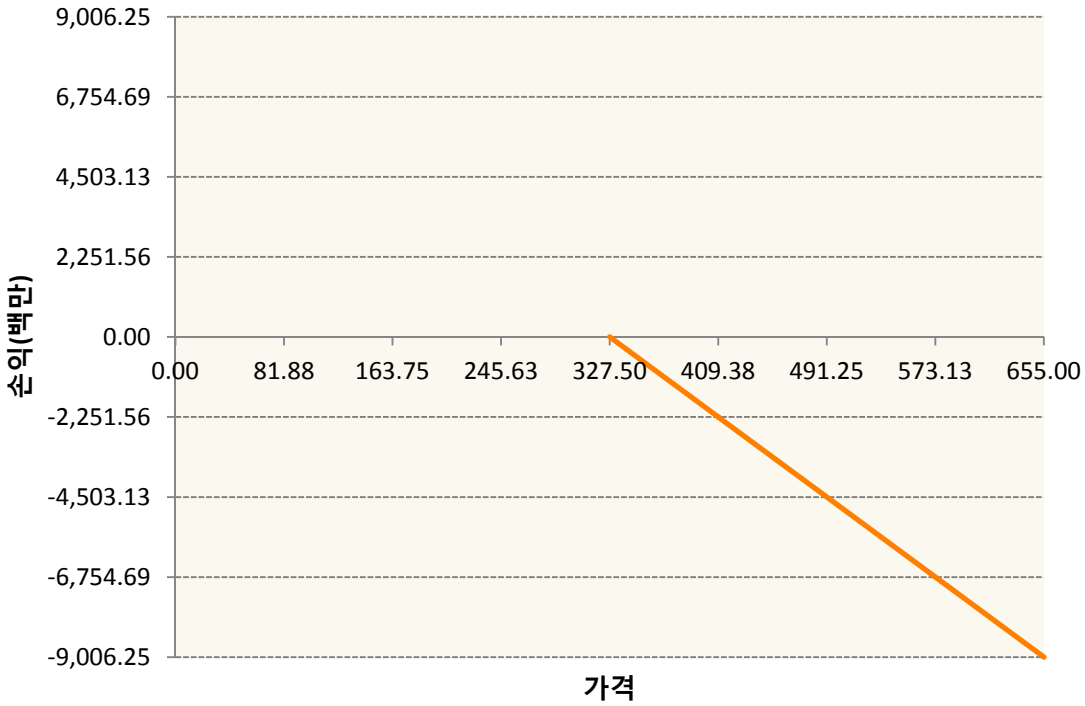
2. 만기시점의 손익구조



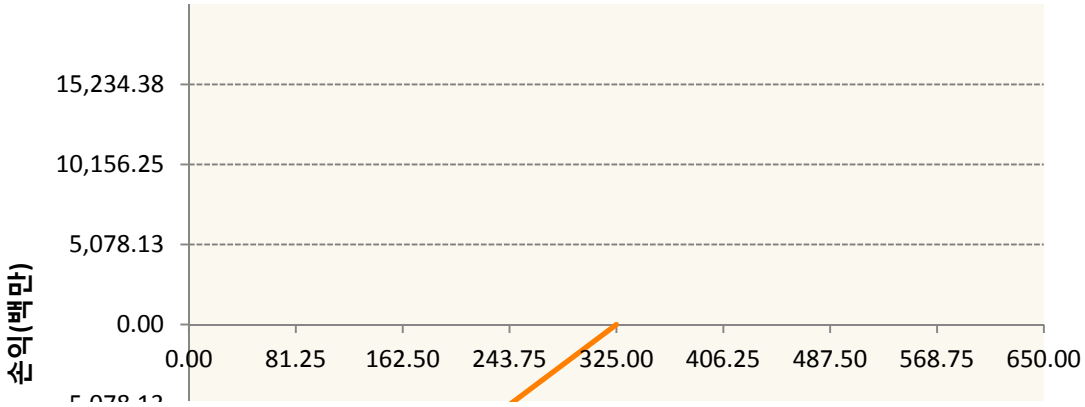




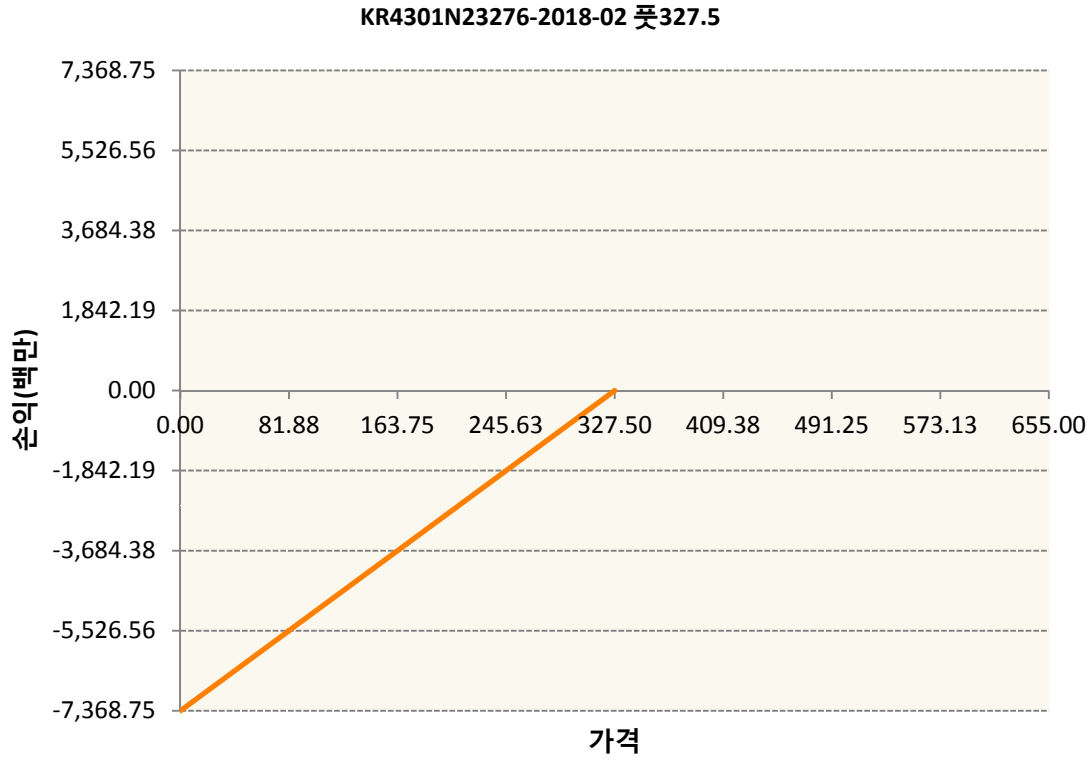
KR4201N23278-2018-02 콜327.5



KR4301N23250-2018-02 풋325







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_2							1,450
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,450	-1,450	-1,450	-1,450	-1,450	-1,450	-1,450
-5.33%	-967	-967	-967	-967	-967	-967	-967
-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%	967	967	967	967	967	967	967
8.00%	1,450	1,450	1,450	1,450	1,450	1,450	1,450
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						946

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-946	-946	-946	-946	-946	-946	-946
-5.33%	-631	-631	-631	-631	-631	-631	-631
-2.67%	-315	-315	-315	-315	-315	-315	-315
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	315	315	315	315	315	315	315
5.33%	631	631	631	631	631	631	631
8.00%	946	946	946	946	946	946	946
	KR4201N232 2018-02 콜325						1,524

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	556	548	538	525	509	492	472
-5.33%	516	495	472	446	418	388	357
-2.67%	393	356	319	280	242	202	163
0%	127	85	43	0	-43	-85	-128
2.67%	-296	-329	-364	-401	-438	-476	-515
5.33%	-837	-855	-877	-901	-928	-957	-987
8.00%	-1,438	-1,445	-1,456	-1,469	-1,485	-1,503	-1,524
	KR4201N232 2018-02 콜327.5						552

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	178	176	173	169	165	159	152
-5.33%	168	162	154	146	136	126	116
-2.67%	132	120	107	93	79	65	51
0%	49	32	16	0	-16	-32	-49
2.67%	-95	-110	-124	-139	-154	-170	-185
5.33%	-290	-298	-308	-319	-331	-343	-355
8.00%	-513	-517	-522	-528	-535	-543	-552
	KR4301N232 2018-02 풋325						1,360

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,357	-1,357	-1,358	-1,358	-1,358	-1,359	-1,360
-5.33%	-815	-816	-819	-822	-826	-831	-837

-2.67%	-300	-311	-323	-336	-350	-364	-379
0%	56	37	19	0	-19	-37	-56
2.67%	171	164	155	145	134	123	110
5.33%	184	184	182	180	177	173	169
8.00%	185	185	185	185	184	183	182
	KR4301N232	2018-02	풋327.5				517
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-517	-517	-517	-517	-517	-517	-517
-5.33%	-321	-322	-322	-323	-323	-325	-326
-2.67%	-130	-133	-136	-140	-144	-148	-152
0%	20	14	7	0	-7	-14	-20
2.67%	84	80	75	71	66	60	55
5.33%	94	93	92	91	89	87	85
8.00%	95	94	94	94	94	94	93

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

9,578

공시일	2018-01-23
기준일	2018-01-22

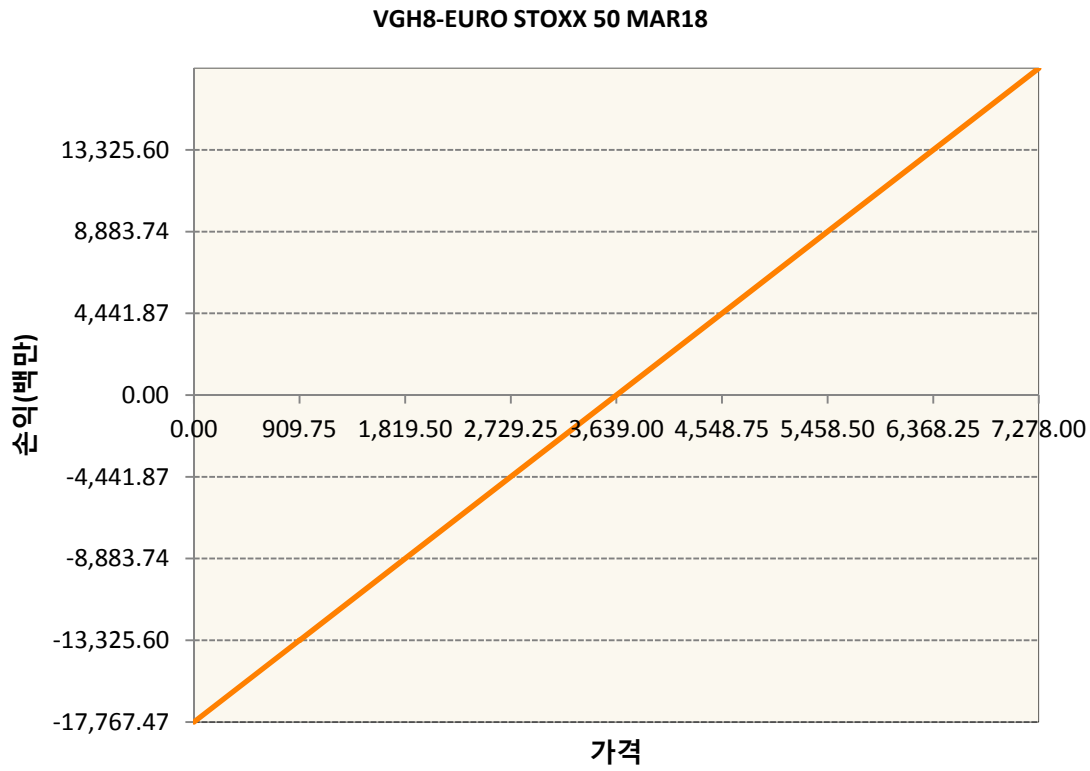
유로커버드콜모(주식혼합-파생형

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	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	17,767	0	17,767	
누계	유가증권	스왑	98,103	0	98,103	장외
누계	지수	스왑	52,322	0	52,322	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

260105SGPX	SG EURO Covered CALL STRATEGY - 994.569	0
260105SQPX	SG EURO Covered CALL STRATEGY	0
VGH8	EURO STOXX 50 MAR18	1,421

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

793

공시일	2018-01-23
기준일	2018-01-22

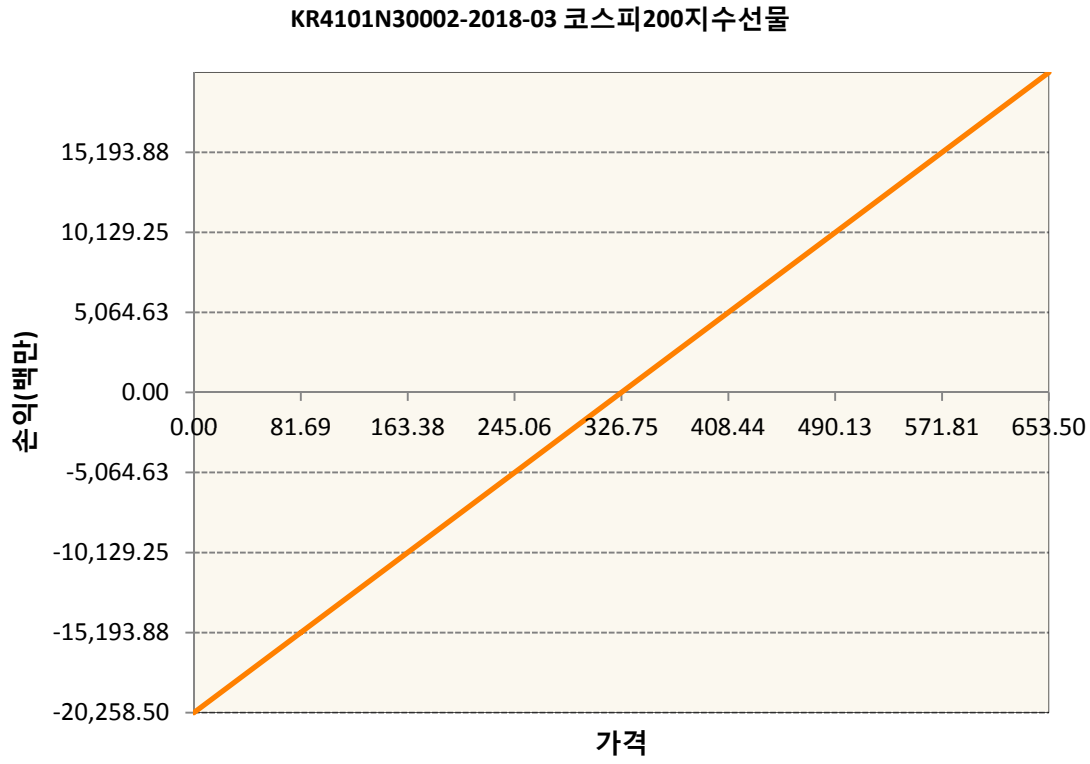
ETF스마트레버리지목표전환형8호

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	20,259	0	20,259	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101N30(2018-03 코스피200지수선물							1,618
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,618	-1,618	-1,618	-1,618	-1,618	-1,618	-1,618
-5.33%	-1,079	-1,079	-1,079	-1,079	-1,079	-1,079	-1,079
-2.67%	-539	-539	-539	-539	-539	-539	-539
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	539	539	539	539	539	539	539
5.33%	1,079	1,079	1,079	1,079	1,079	1,079	1,079
8.00%	1,618	1,618	1,618	1,618	1,618	1,618	1,618

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

964

공시일	2018-01-23
기준일	2018-01-22

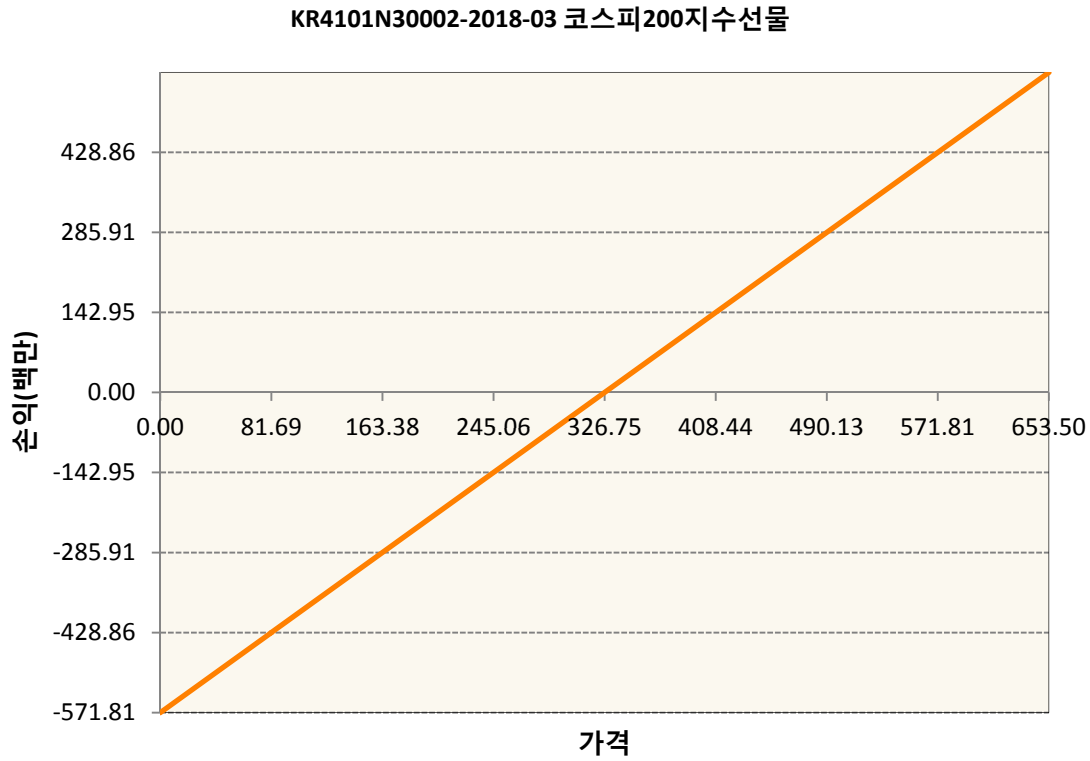
ETF스마트레버리지목표전환형9호

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	572	0	572	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%	-30	-30	-30	-30	-30	-30	-30
-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%	30	30	30	30	30	30	30
8.00%	46	46	46	46	46	46	46

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

27

공시일	2018-01-23
기준일	2018-01-22

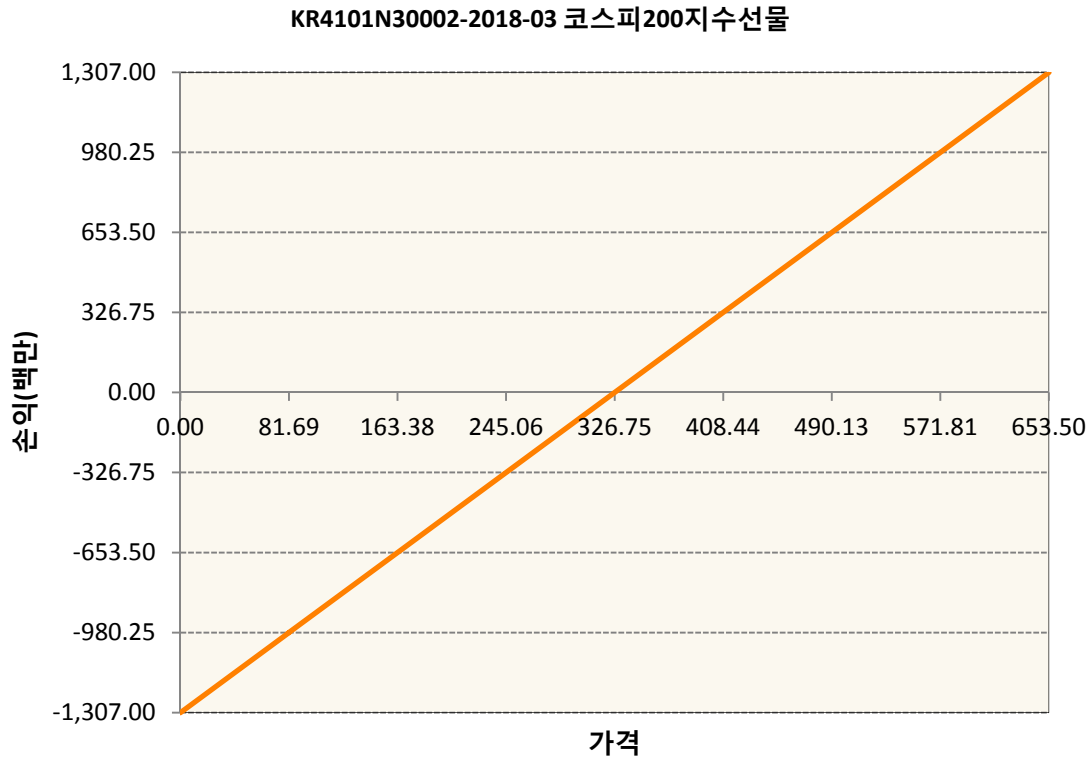
ETF스마트레버리지목표전환형10

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	1,307	0	1,307	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101N30(2018-03 코스피200지수선물							104
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-104	-104	-104	-104	-104	-104	-104
-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%	104	104	104	104	104	104	104

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

62

공시일	2018-01-23
기준일	2018-01-22

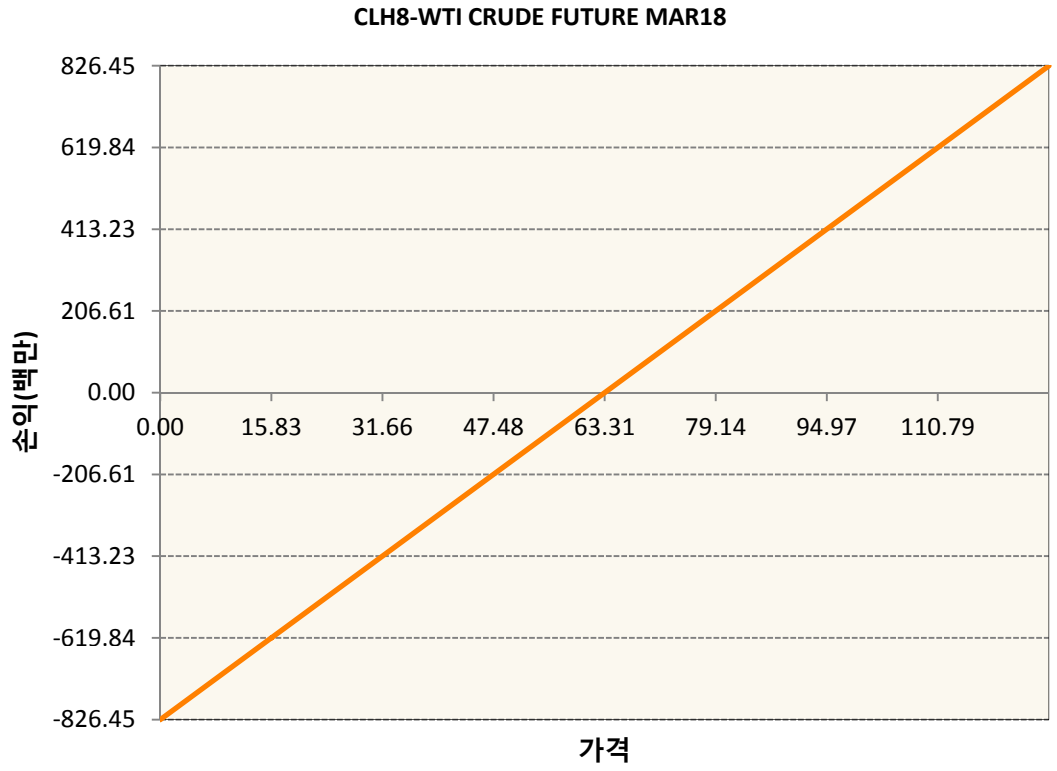
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

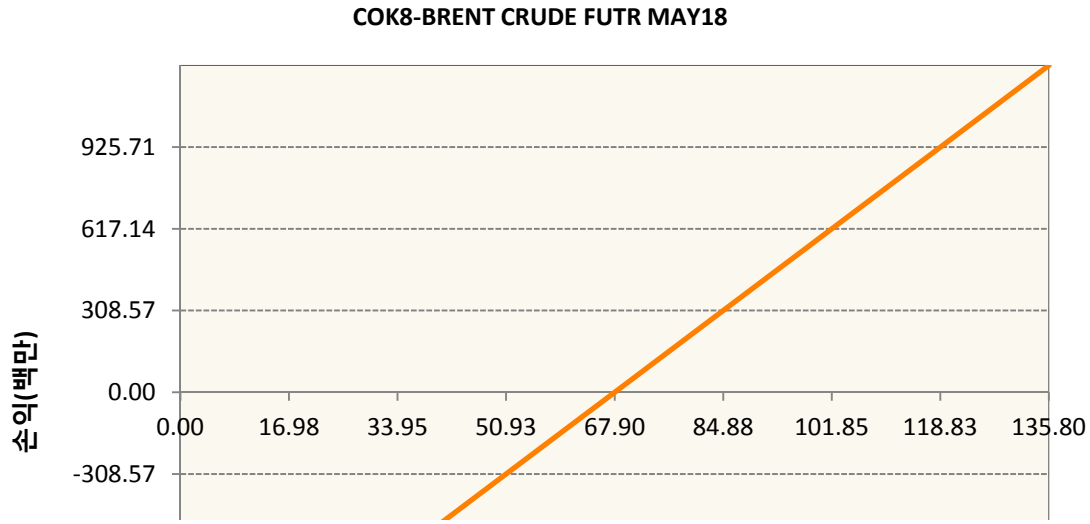
1. 계약금액

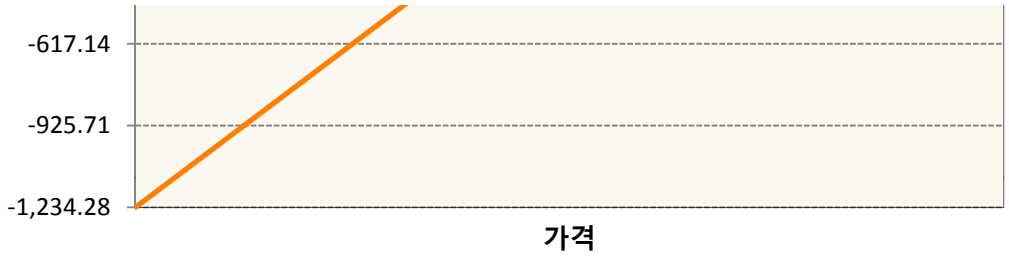
(단위:백만원)

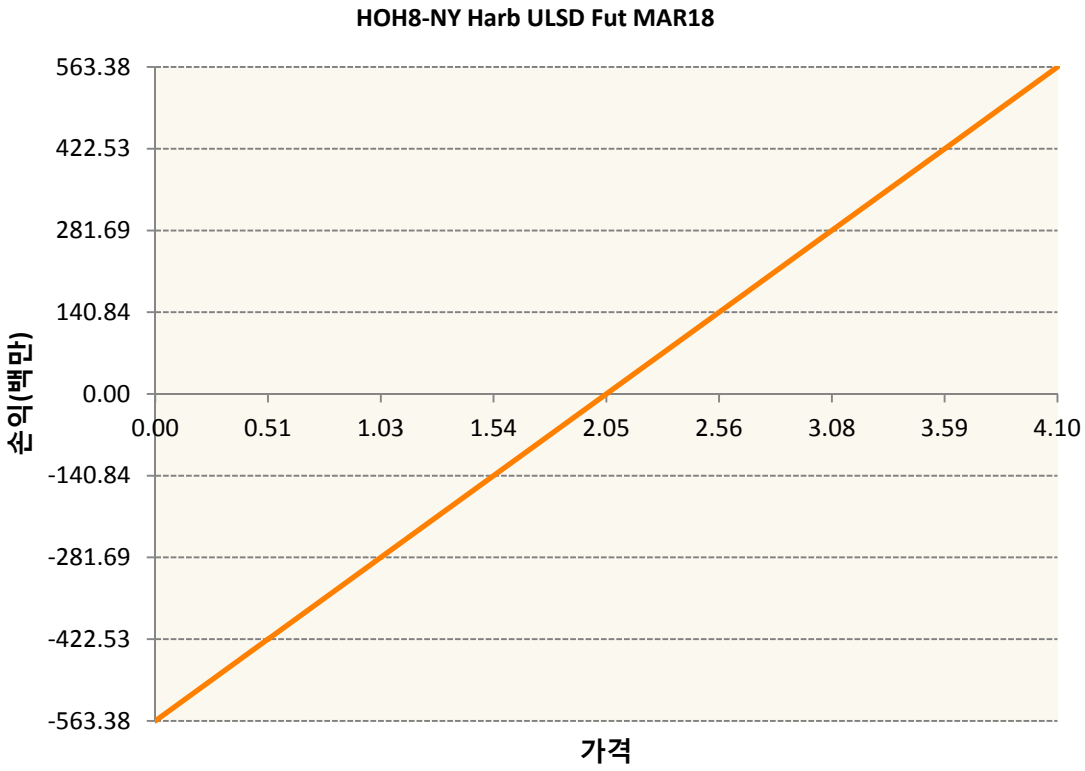
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	4,433	856	3,577	

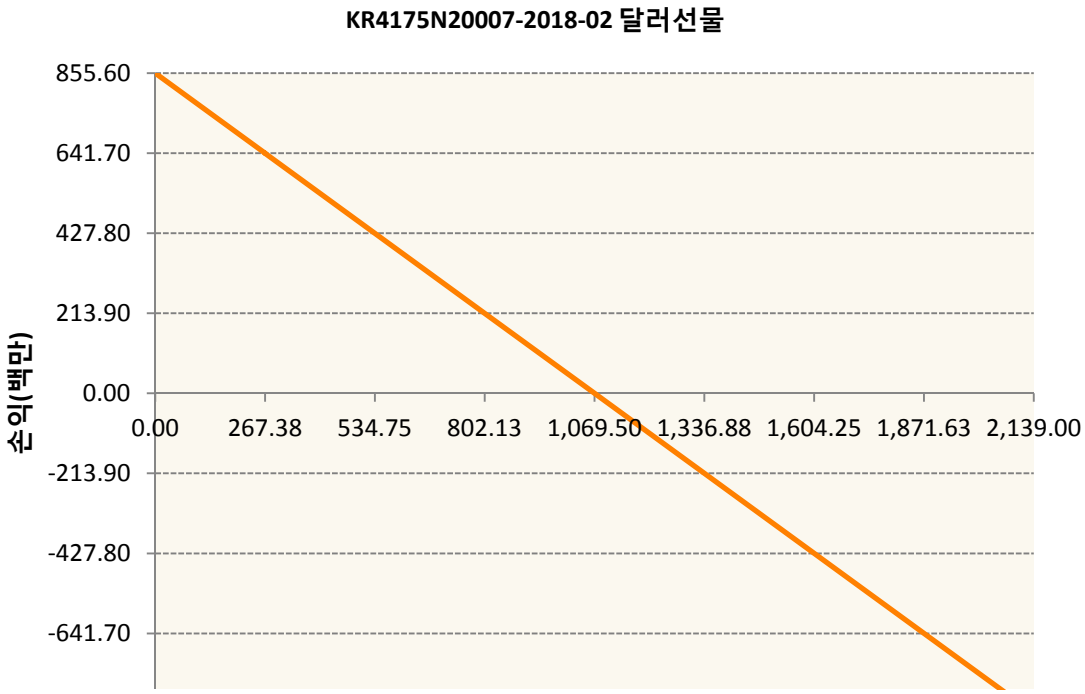
2. 만기시점의 손익구조

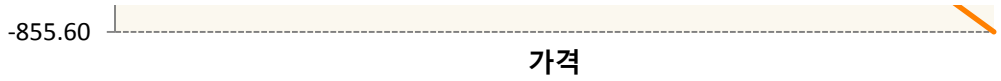


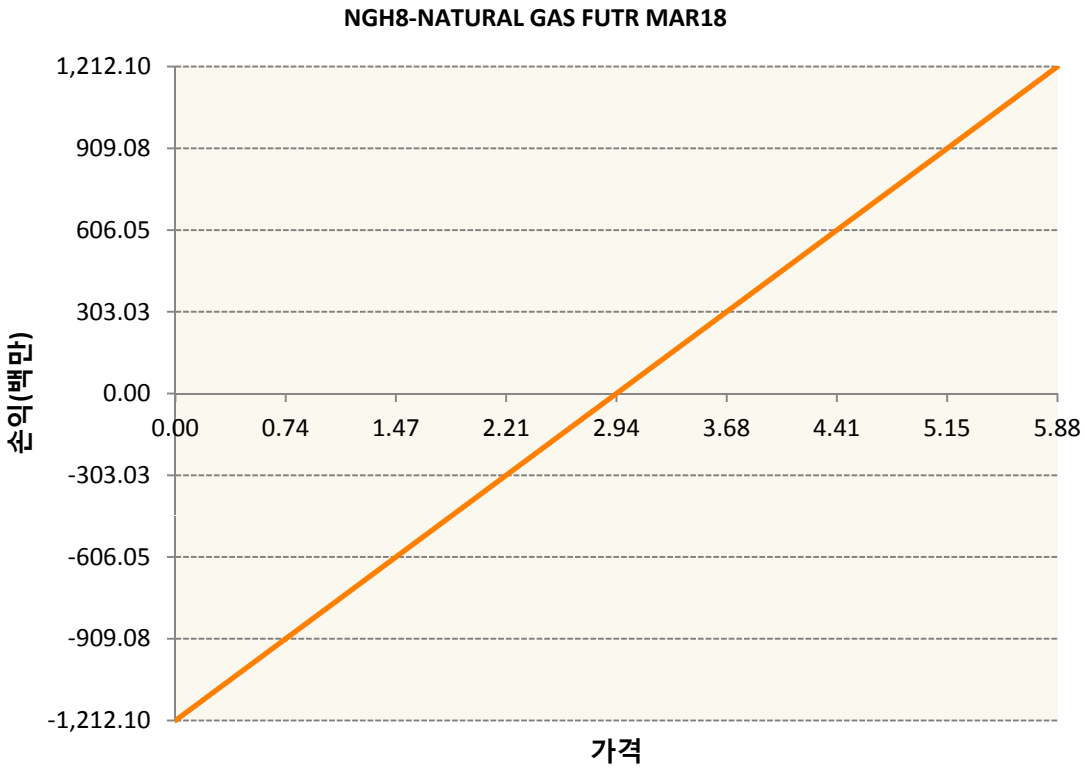


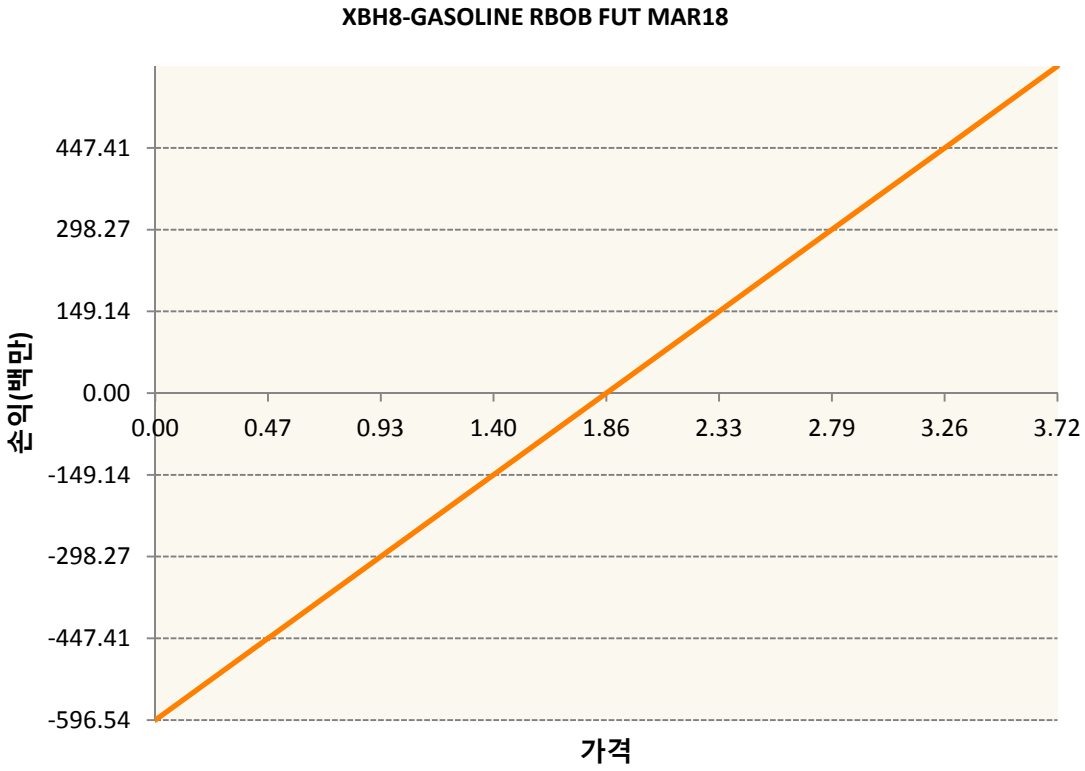

-617.14
-925.71
-1,234.28
가격


HOH8-NY Harb ULSD Fut MAR18
563.38
422.53
281.69
140.84
0.00
-140.84
-281.69
-422.53
-563.38
0.00
0.51
1.03
1.54
2.05
2.56
3.08
3.59
4.10
손익(백만)
가격


KR4175N20007-2018-02 달러선물
855.60
641.70
427.80
213.90
0.00
-213.90
-427.80
-641.70
0.00
267.38
534.75
802.13
1,069.50
1,336.88
1,604.25
1,871.63
2,139.00
손익(백만)


-855.60
가격


NGH8-NATURAL GAS FUTR MAR18
1,212.10
909.08
606.05
303.03
0.00
-303.03
-606.05
-909.08
-1,212.10
0.00
0.74
1.47
2.21
2.94
3.68
4.41
5.15
5.88
손익(백만)
가격


XBH8-GASOLINE RBOB FUT MAR18
447.41
298.27
149.14
0.00
-149.14
-298.27
-447.41
-596.54
0.00
0.47
0.93
1.40
1.86
2.33
2.79
3.26
3.72
손익(백만)
가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLH8	WTI CRUDE FUTURE MAR18	66
COK8	BRENT CRUDE FUTR MAY18	99
HOH8	NY Harb ULSD Fut MAR18	45
KR4175N20(	2018-02 달러선물	68
NGH8	NATURAL GAS FUTR MAR18	97
XBH8	GASOLINE RBOB FUT MAR18	48

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

601

공시일	2018-01-23
기준일	2018-01-22

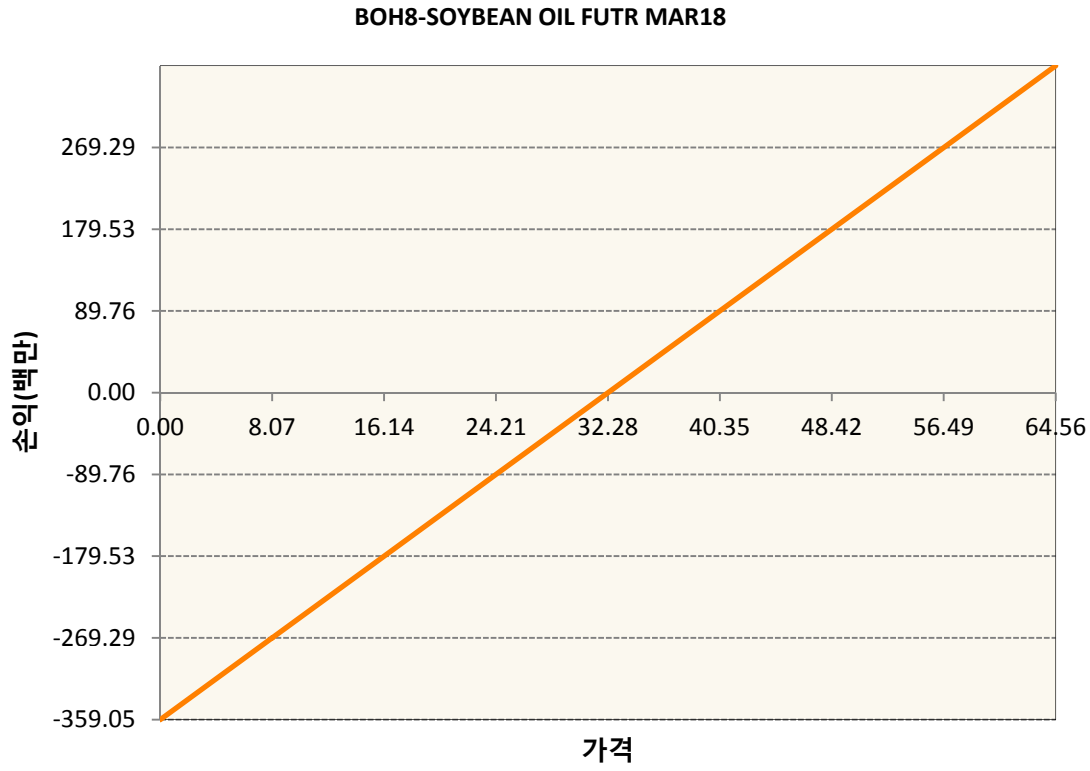
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

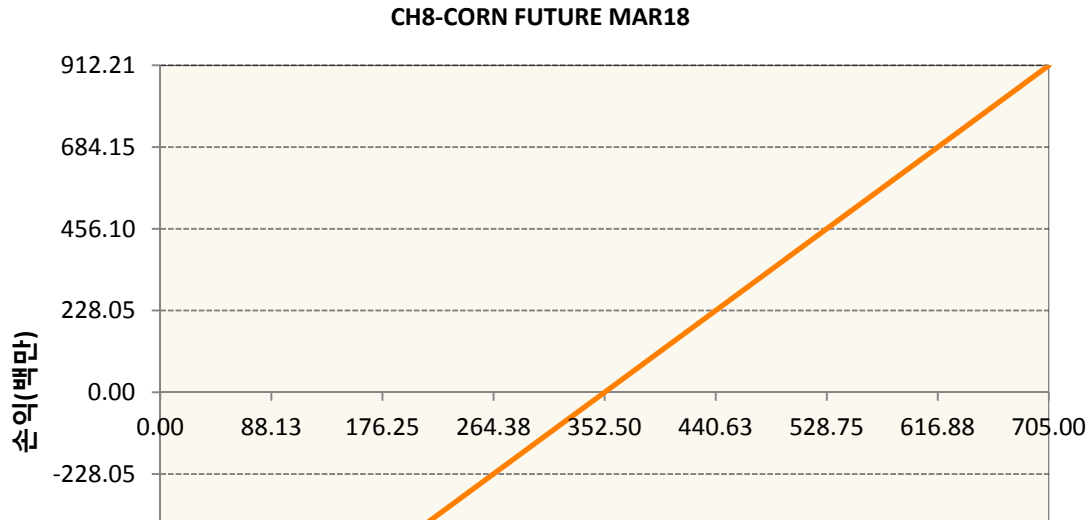
1. 계약금액

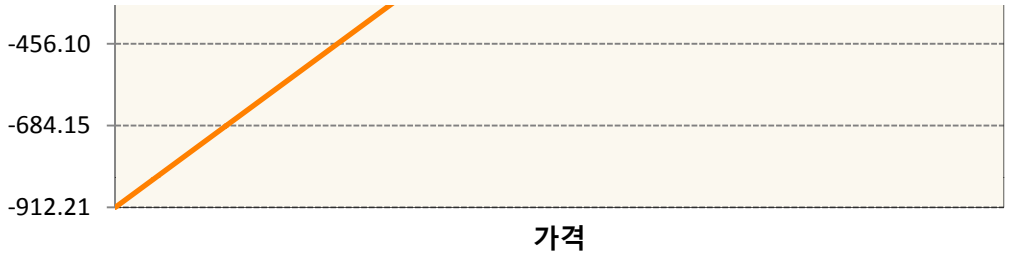
(단위:백만원)

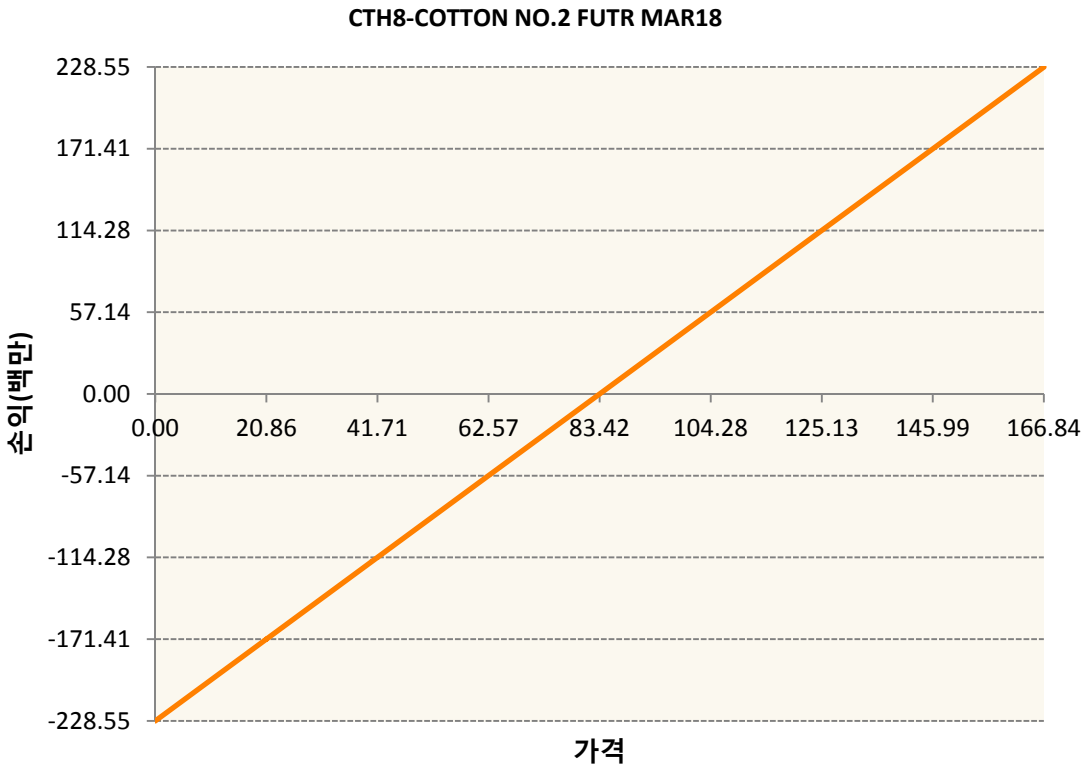
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	4,067	321	3,746	

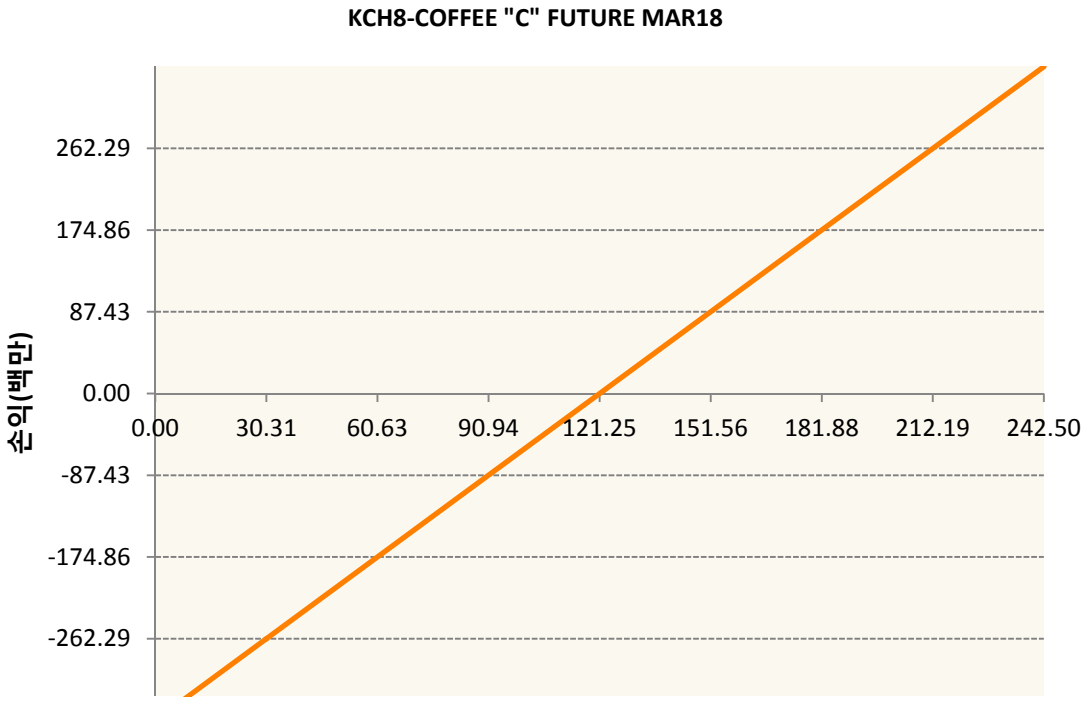
2. 만기시점의 손익구조

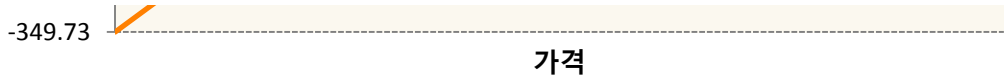


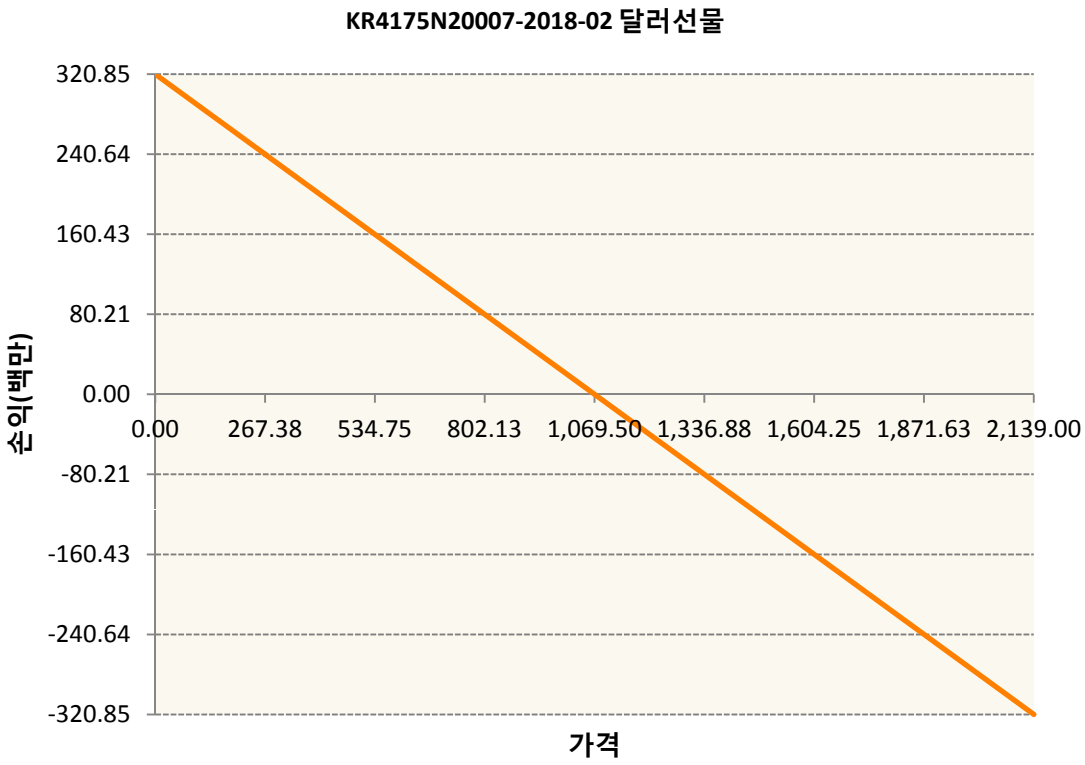


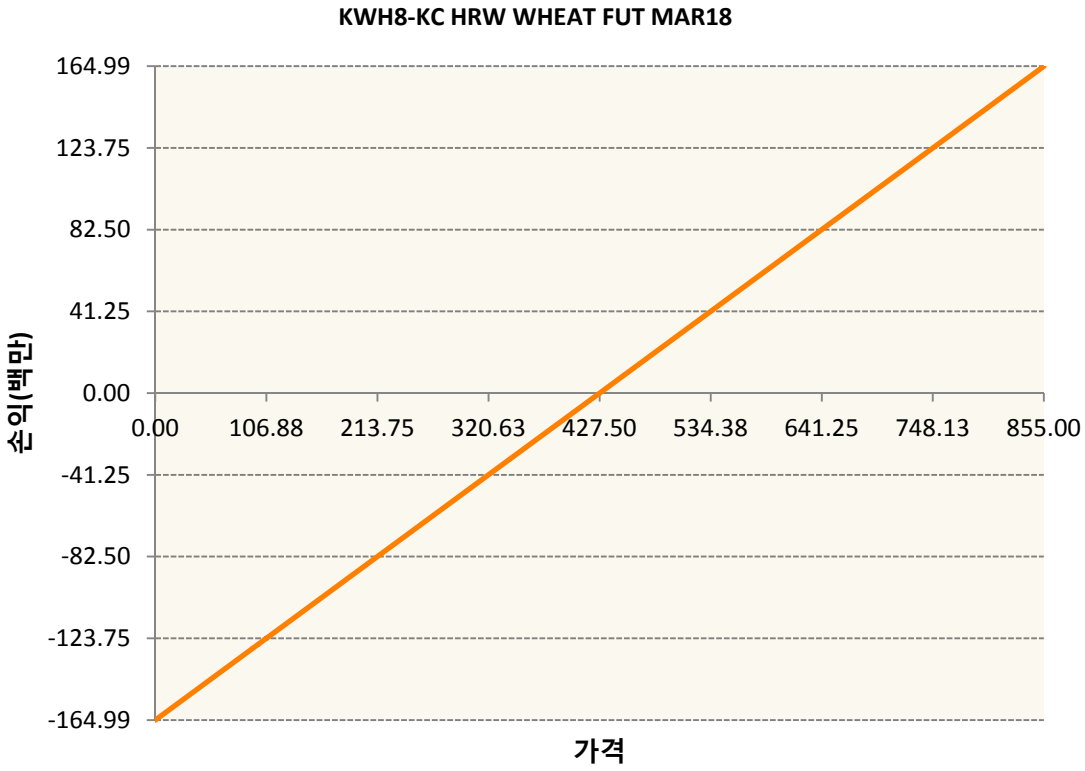

-456.10
-684.15
-912.21
가격

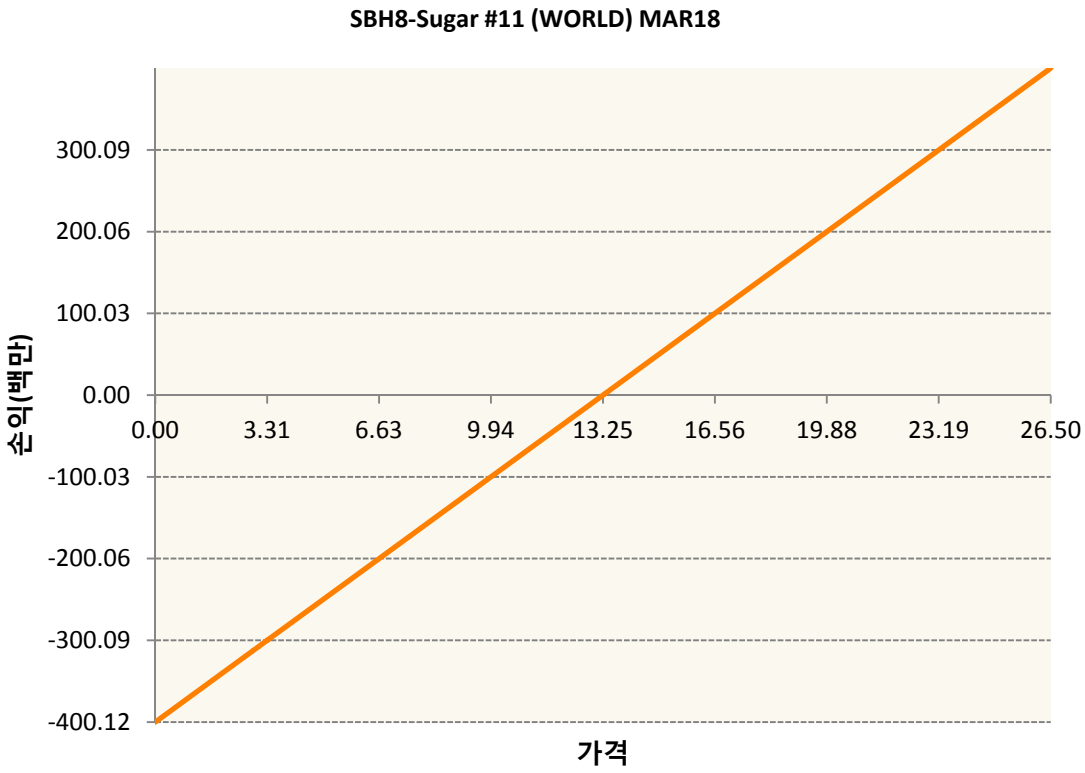

CTH8-COTTON NO.2 FUTR MAR18
228.55
171.41
114.28
57.14
0.00
-57.14
-114.28
-171.41
-228.55
손익(백만)
0.00
20.86
41.71
62.57
83.42
104.28
125.13
145.99
166.84
가격

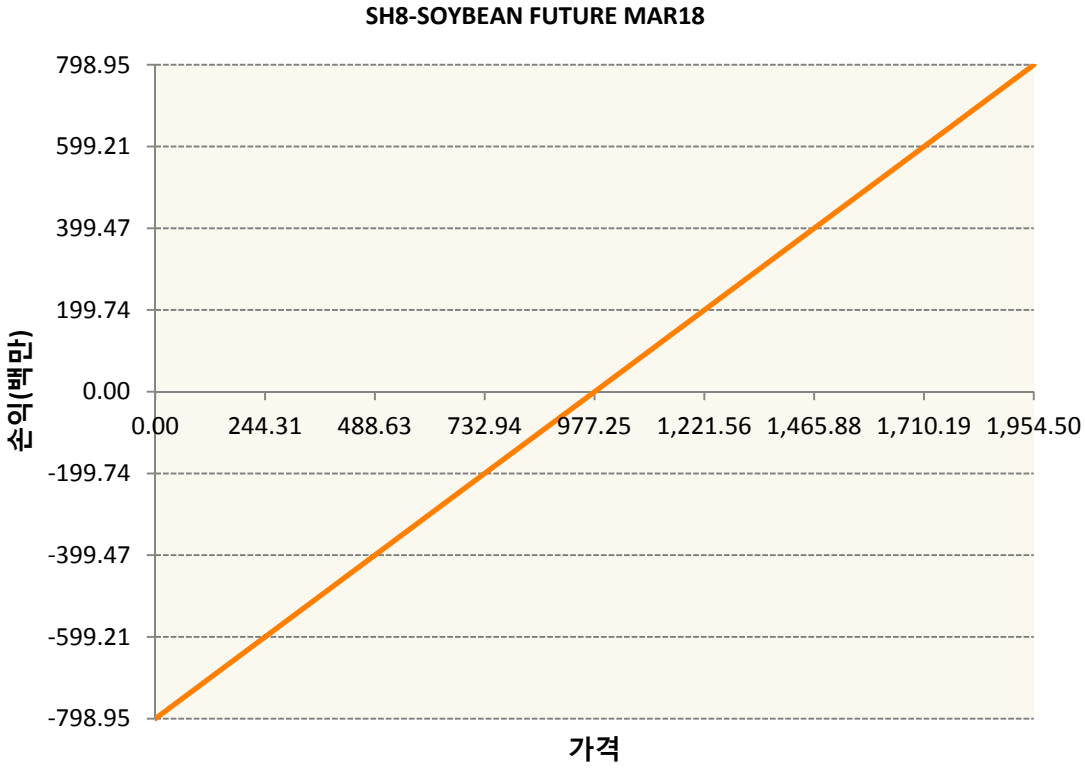

KCH8-COFFEE "C" FUTURE MAR18
262.29
174.86
87.43
0.00
-87.43
-174.86
-262.29
손익(백만)
0.00
30.31
60.63
90.94
121.25
151.56
181.88
212.19
242.50


-349.73
가격

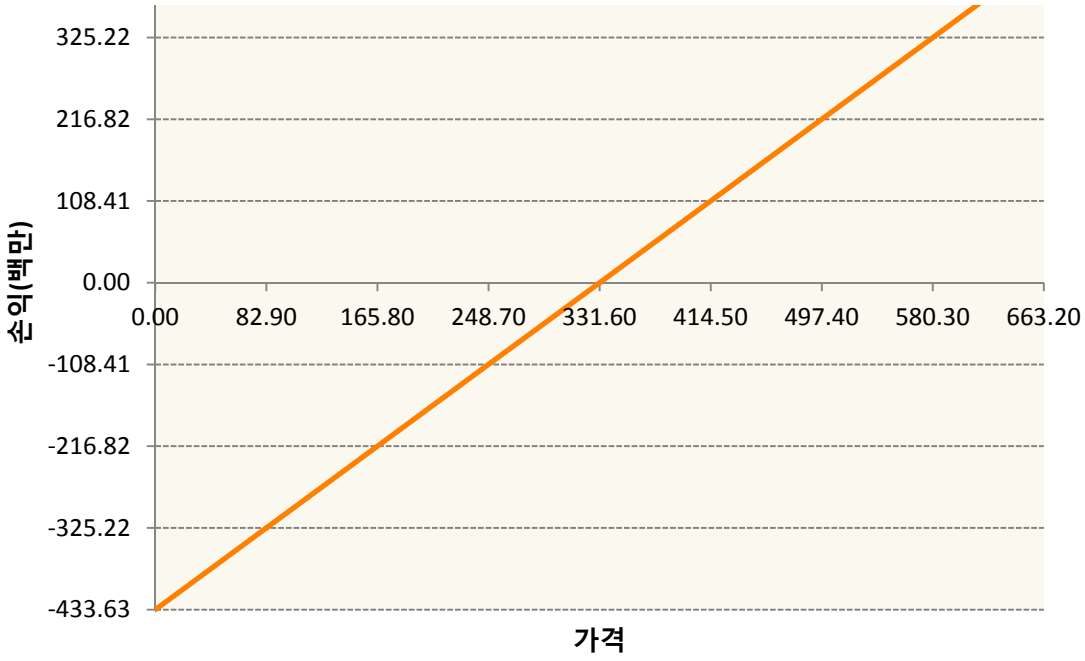

KR4175N20007-2018-02 달러선물
320.85
240.64
160.43
80.21
0.00
-80.21
-160.43
-240.64
-320.85
0.00
267.38
534.75
802.13
1,069.50
1,336.88
1,604.25
1,871.63
2,139.00
손익(백만)
가격

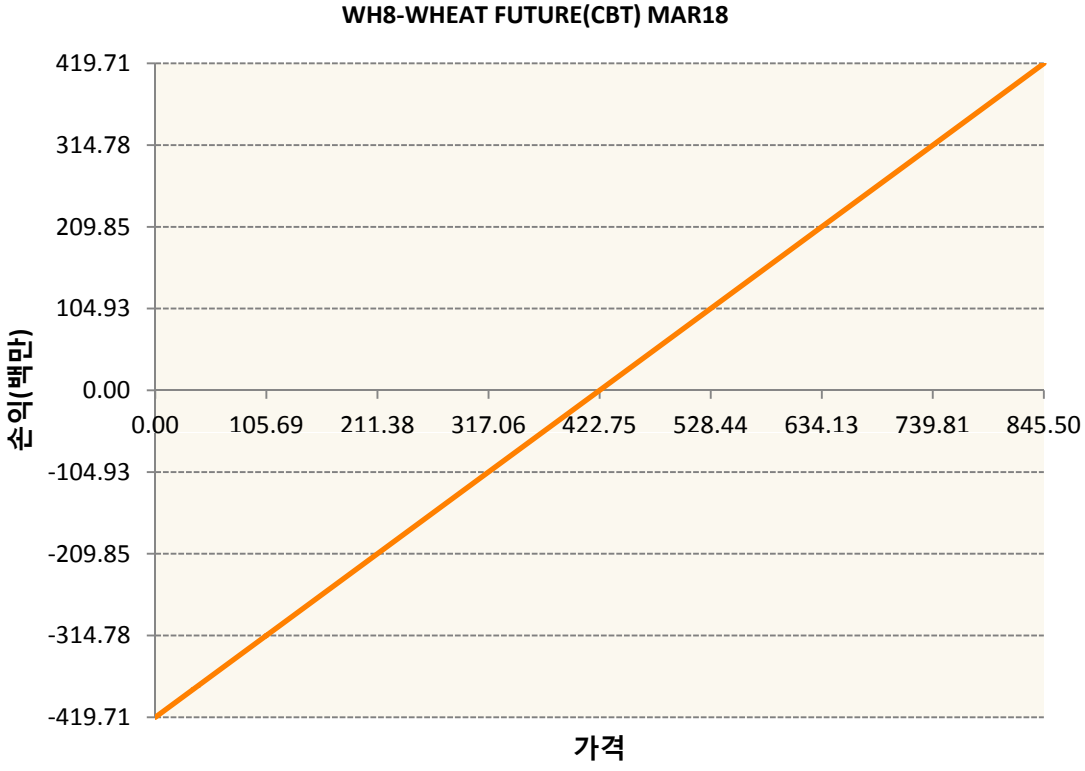

KWH8-KC HRW WHEAT FUT MAR18
164.99
123.75
82.50
41.25
0.00
-41.25
-82.50
-123.75
-164.99
0.00
106.88
213.75
320.63
427.50
534.38
641.25
748.13
855.00
손익(백만)
가격


SBH8-Sugar #11 (WORLD) MAR18
300.09
200.06
100.03
0.00
-100.03
-200.06
-300.09
-400.12
손익(백만)
0.00
3.31
6.63
9.94
13.25
16.56
19.88
23.19
26.50
가격


SH8-SOYBEAN FUTURE MAR18
798.95
599.21
399.47
199.74
0.00
-199.74
-399.47
-599.21
-798.95
손익(백만)
0.00
244.31
488.63
732.94
977.25
1,221.56
1,465.88
1,710.19
1,954.50
가격


SMH8-SOYBEAN MEAL FUTR MAR18
433.63





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	35
WH8	WHEAT FUTURE(CBT) MAR18	34

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

340