공시일	2018-01-24
기준일	2018-01-23

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	2018-01-24
기준일	2018-01-23

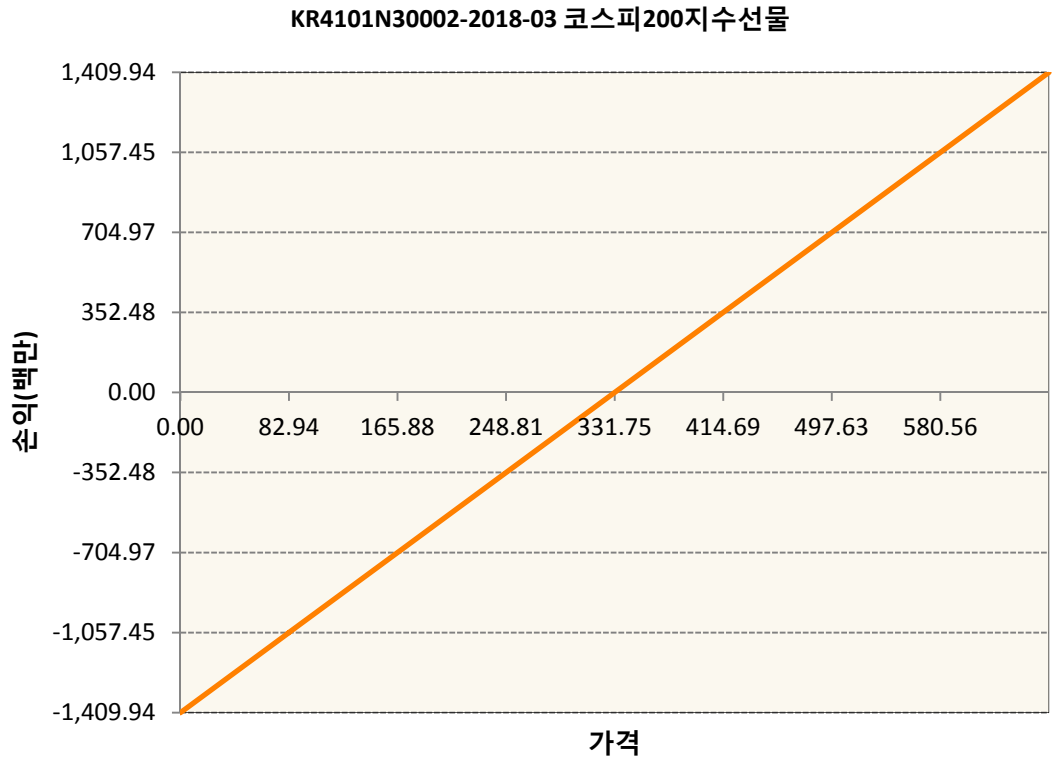
스마트인덱스모

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	1,410	0	1,410	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101N30(2018-03 코스피200지수선물							113
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-113	-113	-113	-113	-113	-113	-113
-5.33%	-75	-75	-75	-75	-75	-75	-75
-2.67%	-38	-38	-38	-38	-38	-38	-38
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	38	38	38	38	38	38	38
5.33%	75	75	75	75	75	75	75
8.00%	113	113	113	113	113	113	113

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

67

공시일	2018-01-24
기준일	2018-01-23

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	1,161

* 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	2018-01-24
기준일	2018-01-23

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	418

* 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	2018-01-24
기준일	2018-01-23

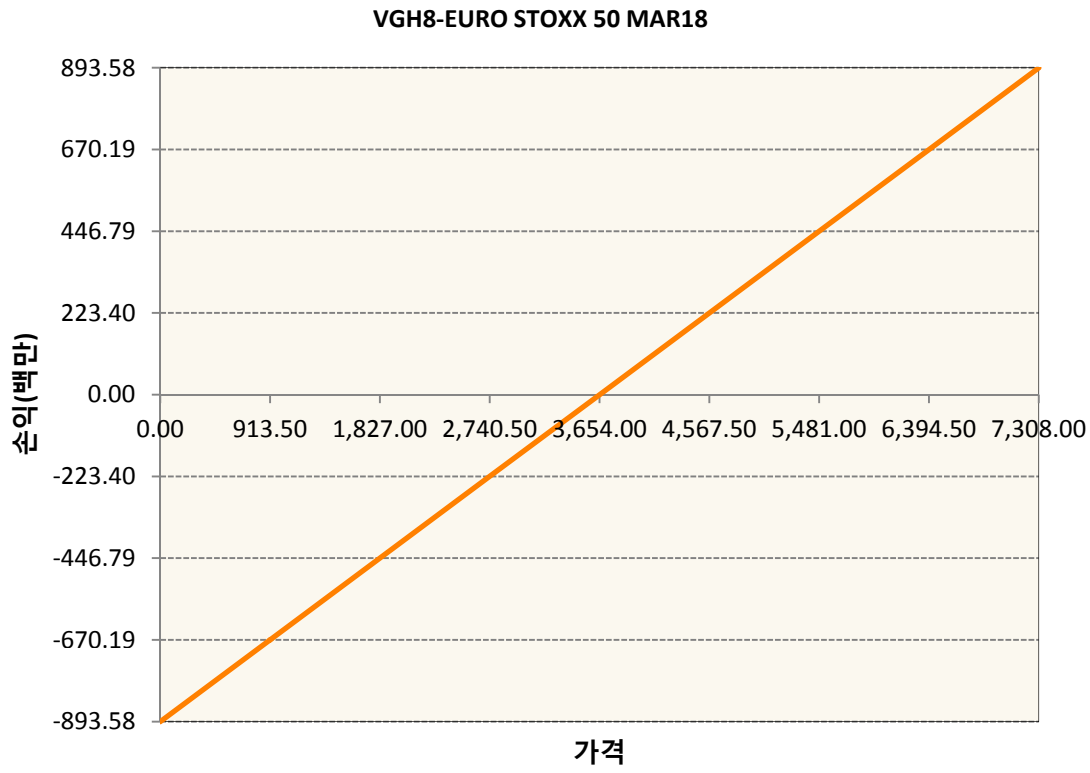
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	894	0	894	

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	2018-01-24
기준일	2018-01-23

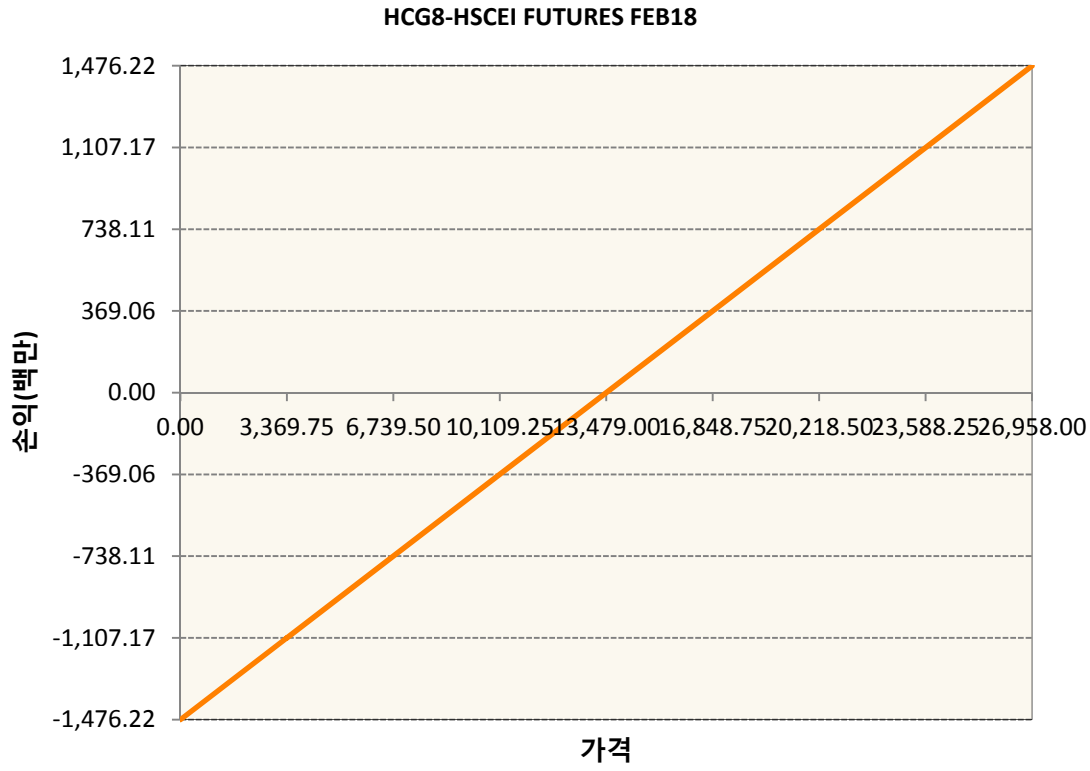
차이나인덱스모(주식-파생형)

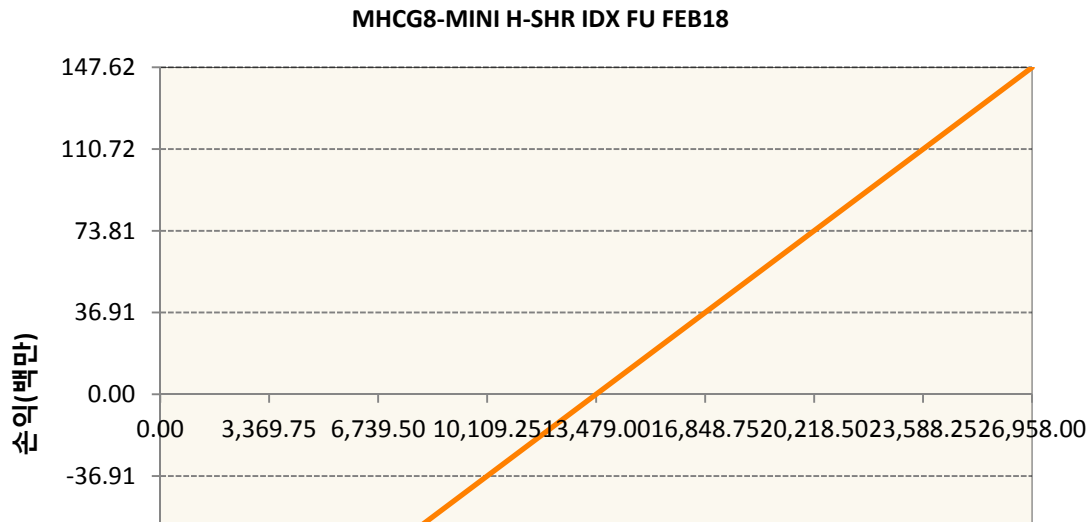
1. 계약금액

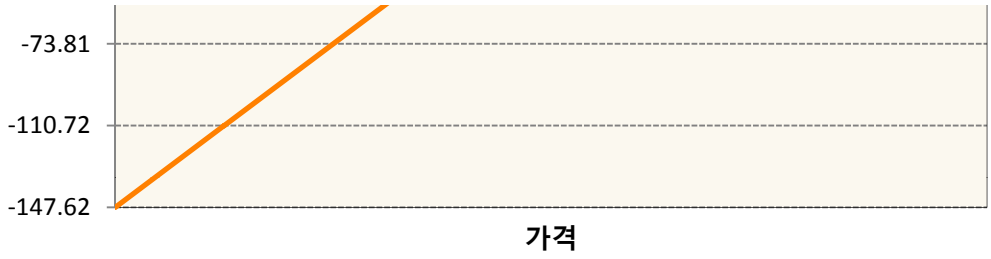
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,624	0	1,624	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCG8	HSCEI FUTURES FEB18	118
MHCG8	MINI H-SHR IDX FU FEB18	12

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	103

공시일	2018-01-24
기준일	2018-01-23

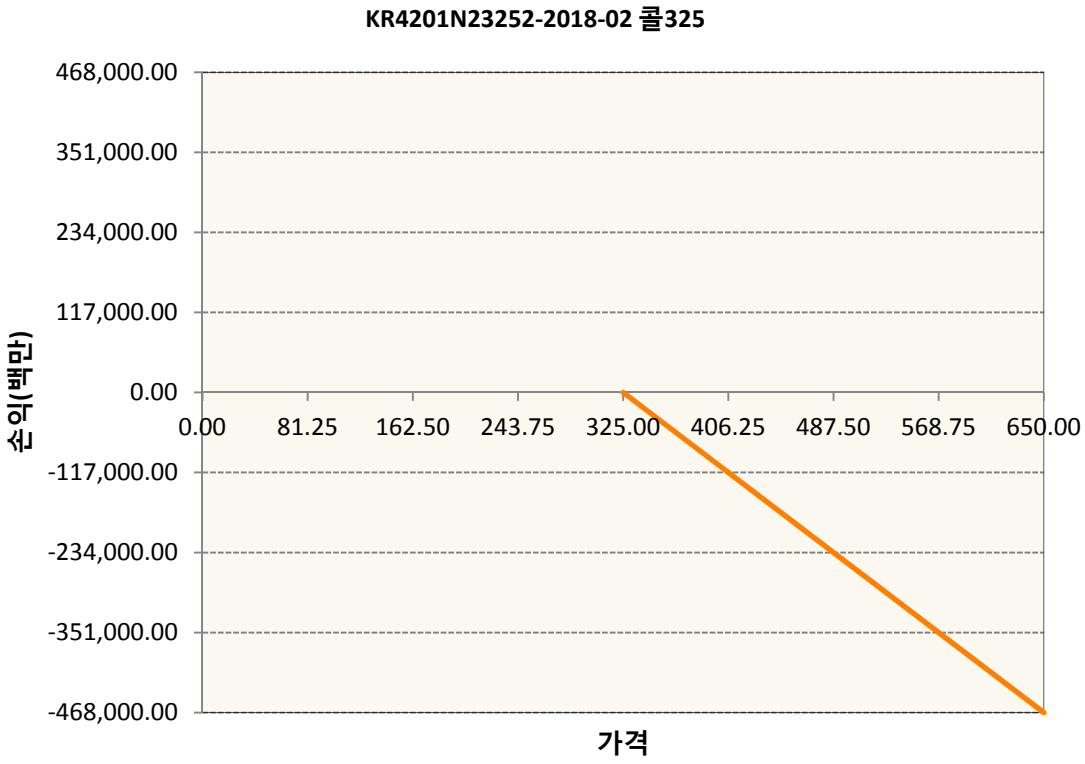
커버드콜모(주식혼합-파생형)

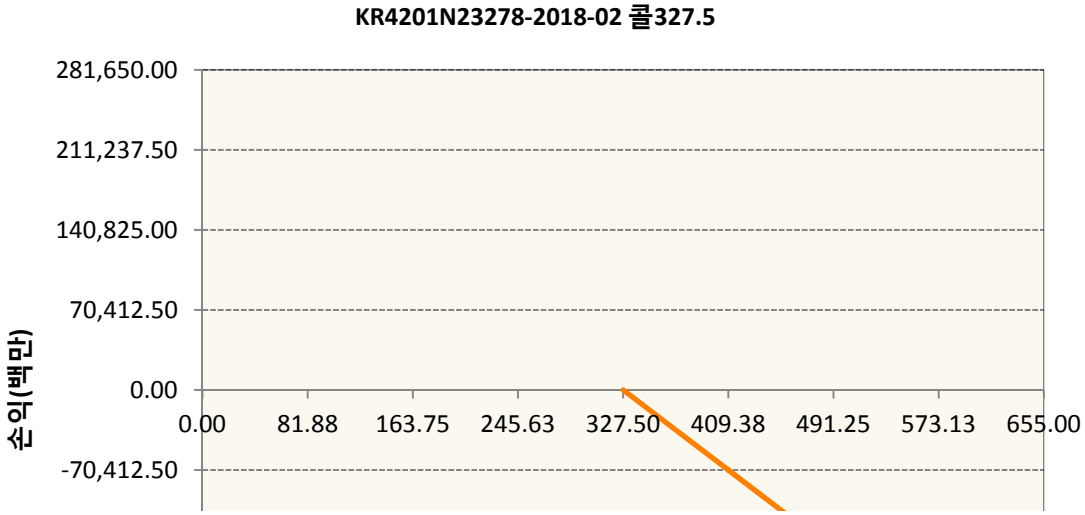
1. 계약금액

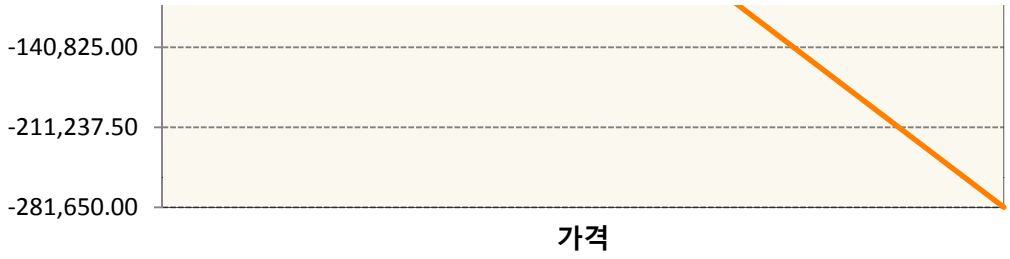
(단위:백만원)

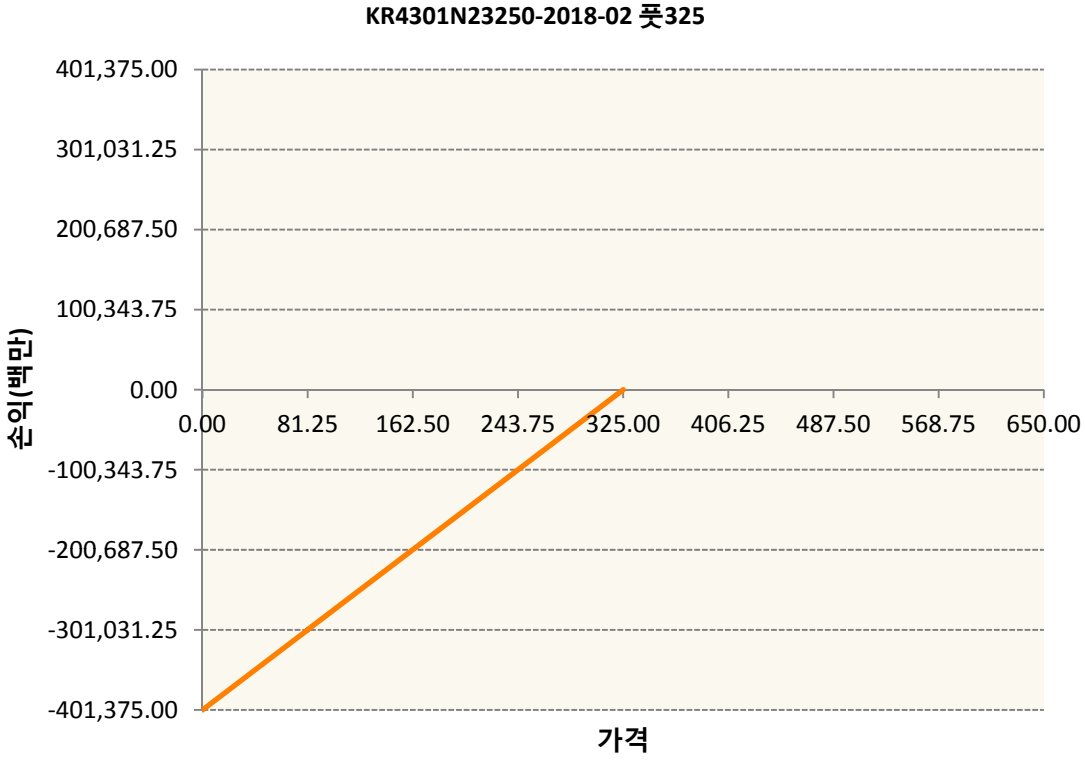
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	8,127	0	8,127	장내
누계	유가증권	옵션	0	1,311,500	-1,311,500	장내

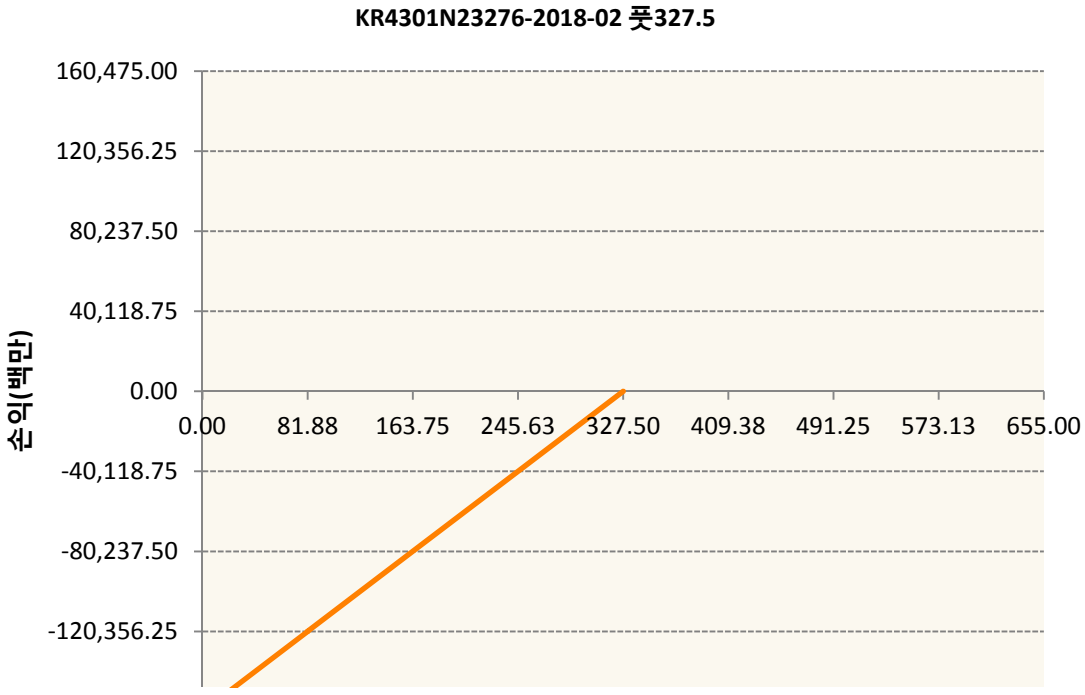
2. 만기시점의 손익구조






-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
160,475.00
120,356.25
80,237.50
40,118.75
0.00
-40,118.75
-80,237.50
-120,356.25
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							32,966
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	14,586	14,342	14,039	13,684	13,281	12,837	12,356
-5.33%	13,175	12,615	12,017	11,387	10,733	10,058	9,366
-2.67%	9,387	8,580	7,771	6,960	6,146	5,332	4,516
0%	2,309	1,552	781	0	-789	-1,584	-2,384
2.67%	-7,705	-8,185	-8,716	-9,290	-9,899	-10,537	-11,199
5.33%	-19,460	-19,671	-19,942	-20,271	-20,652	-21,080	-21,549
8.00%	-31,917	-31,983	-32,089	-32,240	-32,436	-32,679	-32,966
KR4201N232 2018-02 콜327.5							19,017
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	7,514	7,405	7,263	7,089	6,885	6,655	6,402
-5.33%	6,911	6,629	6,318	5,983	5,628	5,256	4,871
-2.67%	5,118	4,659	4,195	3,726	3,253	2,778	2,300
0%	1,459	976	489	0	-491	-983	-1,475
2.67%	-4,077	-4,420	-4,788	-5,176	-5,581	-5,998	-6,427
5.33%	-10,866	-11,034	-11,240	-11,481	-11,750	-12,046	-12,364
8.00%	-18,223	-18,282	-18,370	-18,488	-18,636	-18,813	-19,017
KR4301N232 2018-02 풋325							23,789
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-23,671	-23,674	-23,681	-23,693	-23,714	-23,746	-23,789
-5.33%	-12,878	-12,954	-13,054	-13,177	-13,322	-13,485	-13,666
-2.67%	-3,620	-3,942	-4,269	-4,600	-4,934	-5,270	-5,608
0%	769	529	272	0	-283	-575	-875
2.67%	1,490	1,454	1,399	1,324	1,229	1,114	980
5.33%	1,522	1,521	1,517	1,510	1,496	1,474	1,443
8.00%	1,523	1,523	1,523	1,522	1,521	1,519	1,515
KR4301N232 2018-02 풋327.5							10,280
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-10,255	-10,256	-10,257	-10,259	-10,263	-10,270	-10,280
-5.33%	-5,947	-5,962	-5,984	-6,015	-6,053	-6,099	-6,152
-2.67%	-1,977	-2,080	-2,189	-2,303	-2,420	-2,540	-2,663
0%	379	256	129	0	-131	-263	-397
2.67%	927	897	858	809	752	686	614

5.33%	964	962	958	952	941	926	905
8.00%	964	964	964	964	963	961	958

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

89,708

공시일	2018-01-24
기준일	2018-01-23

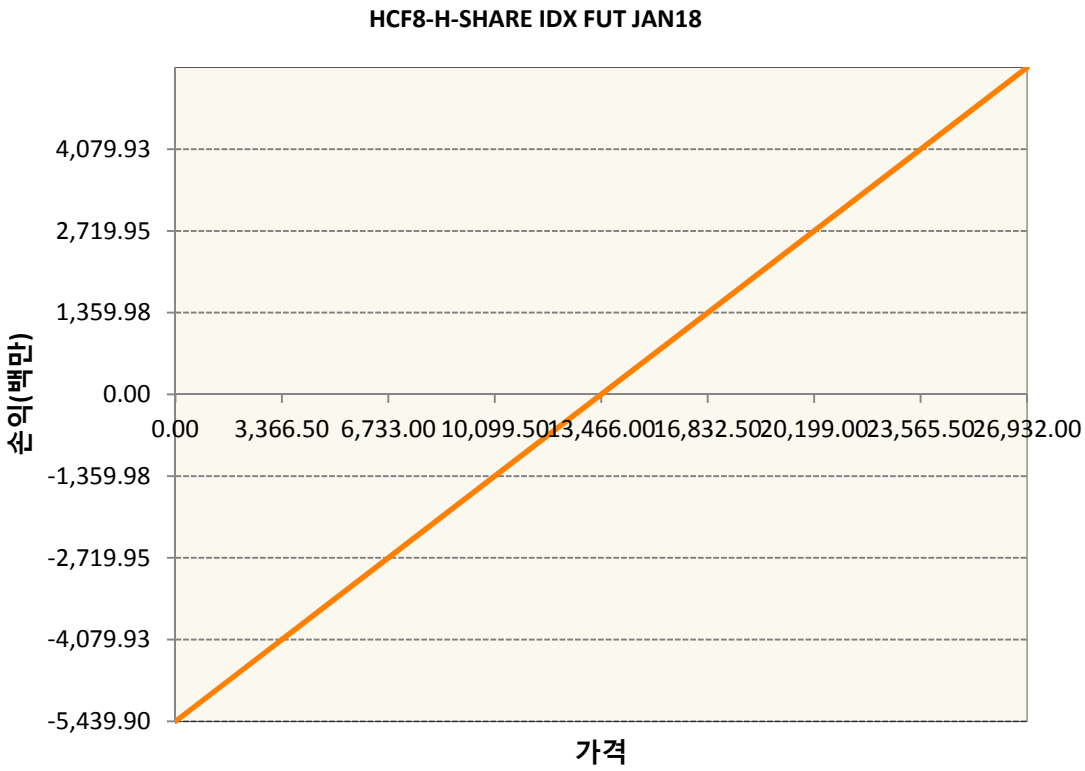
홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생

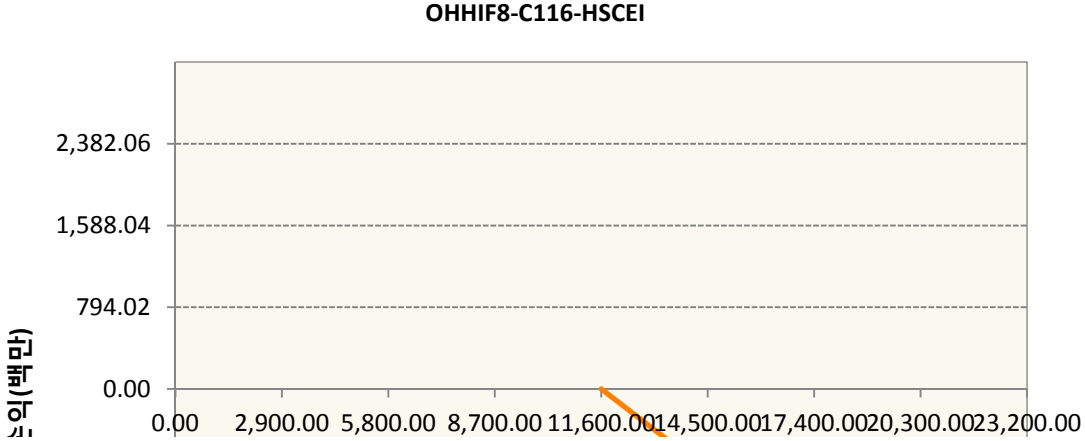
1. 계약금액

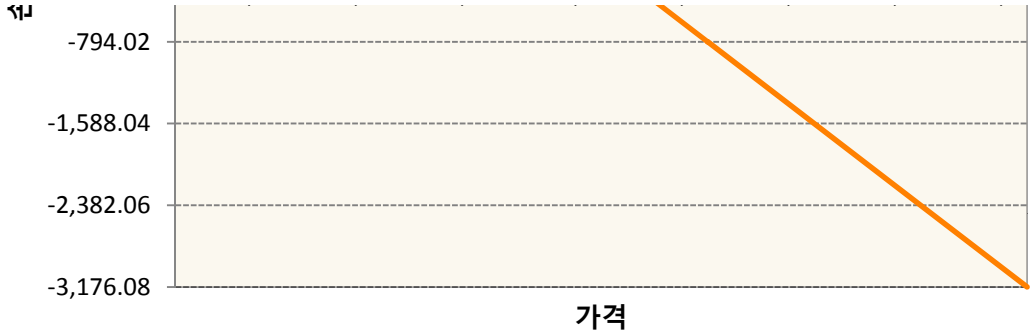
(단위:백만원)

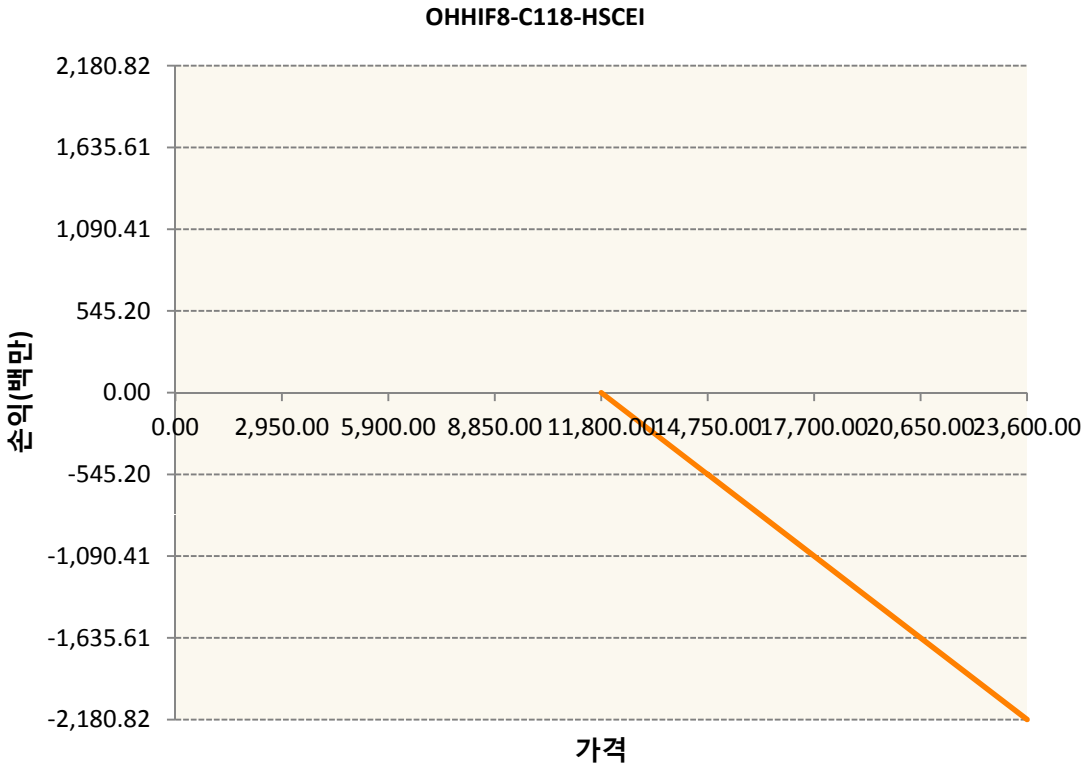
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	5,440	0	5,440	장내
누계	유가증권	옵션	0	10,714	-10,714	장내

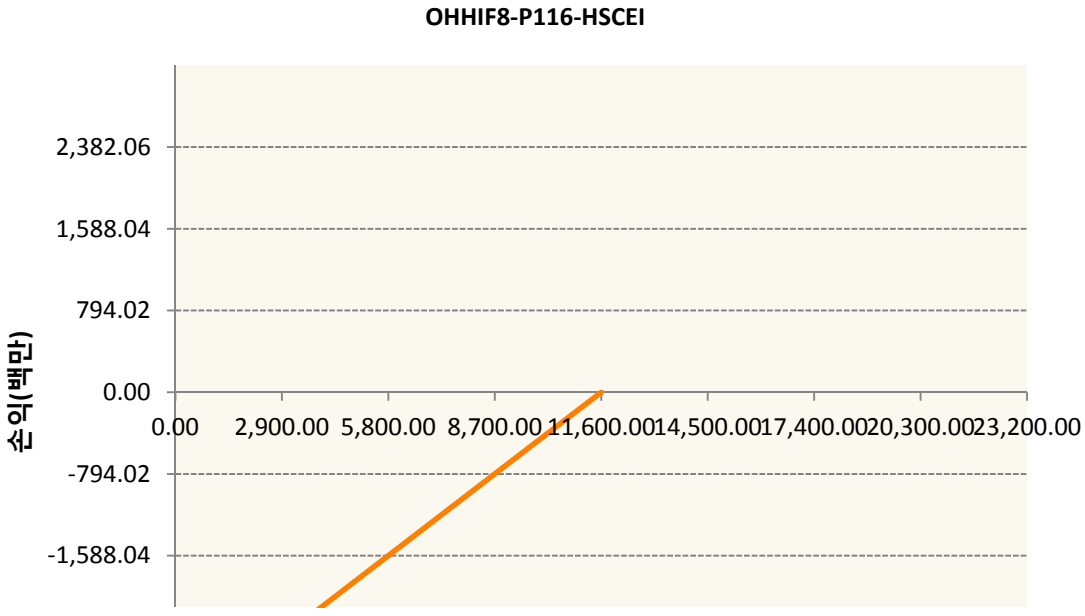
2. 만기시점의 손익구조

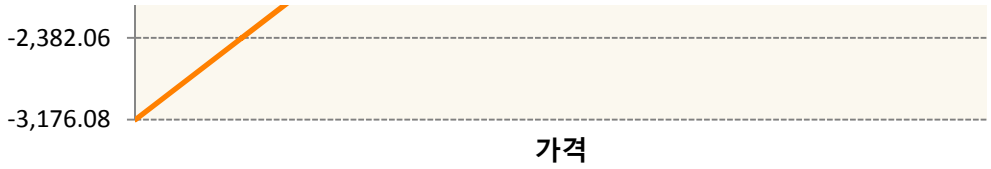


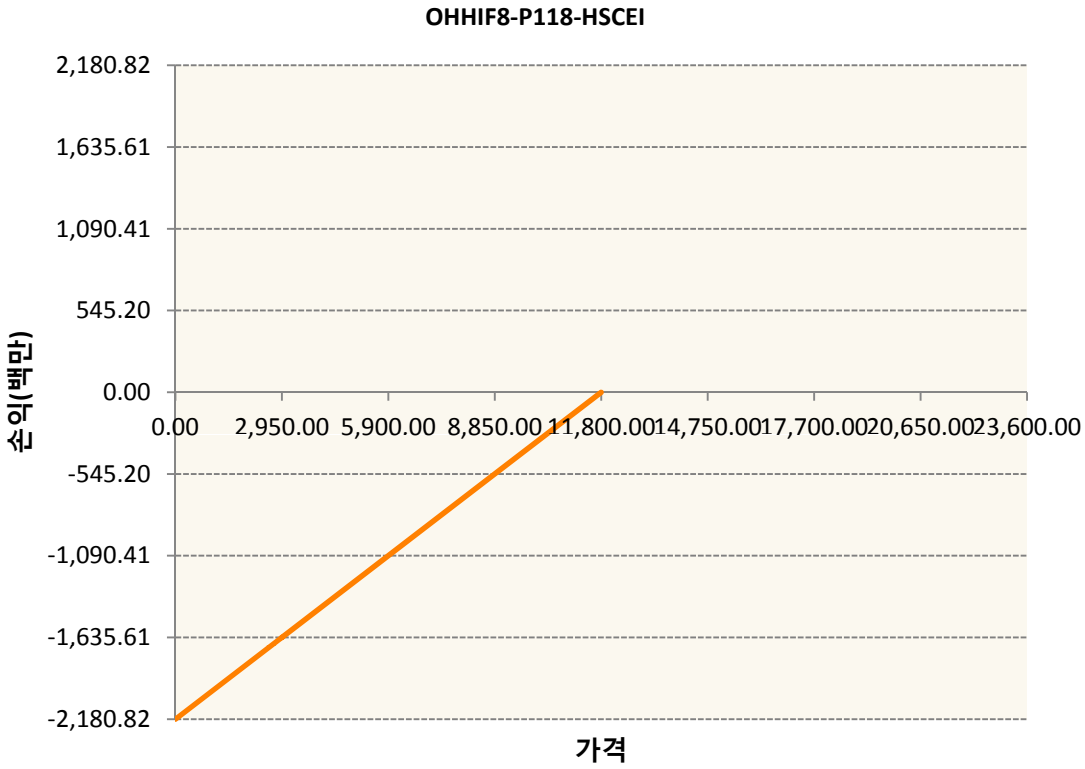



-794.02
-1,588.04
-2,382.06
-3,176.08
가격


OHHIF8-C118-HSCEI
2,180.82
1,635.61
1,090.41
545.20
0.00
-545.20
-1,090.41
-1,635.61
-2,180.82
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
2,382.06
1,588.04
794.02
0.00
-794.02
-1,588.04
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	435
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)
	1,028

공시일	2018-01-24
기준일	2018-01-23

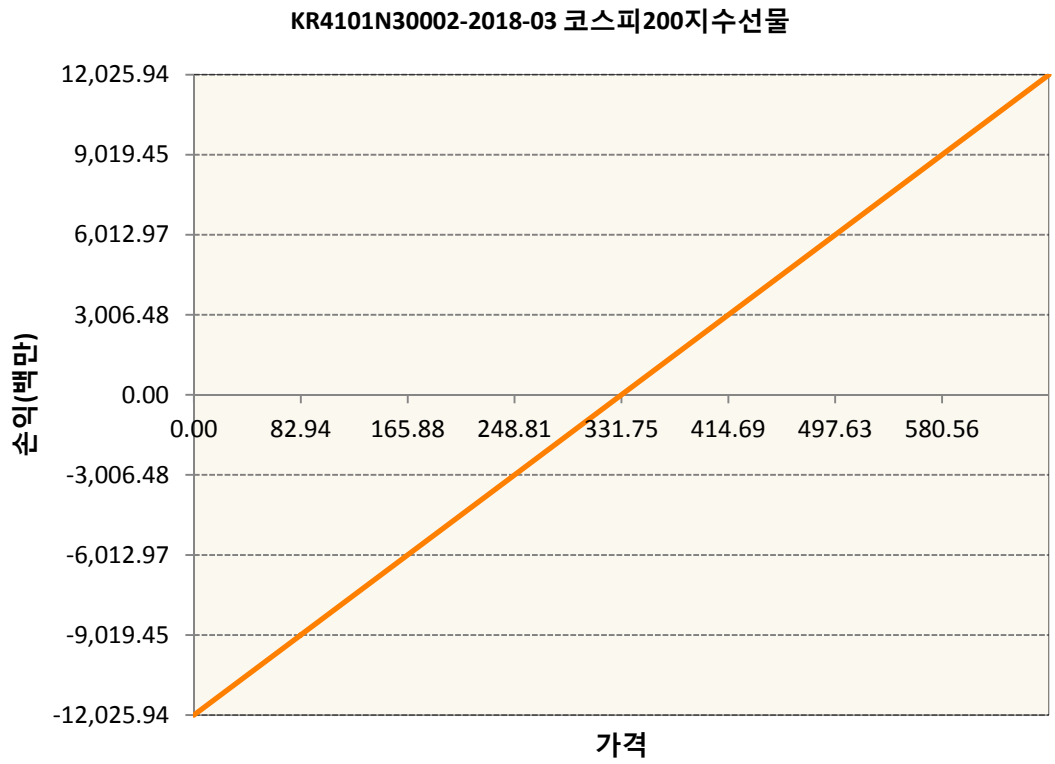
코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼

1. 계약금액

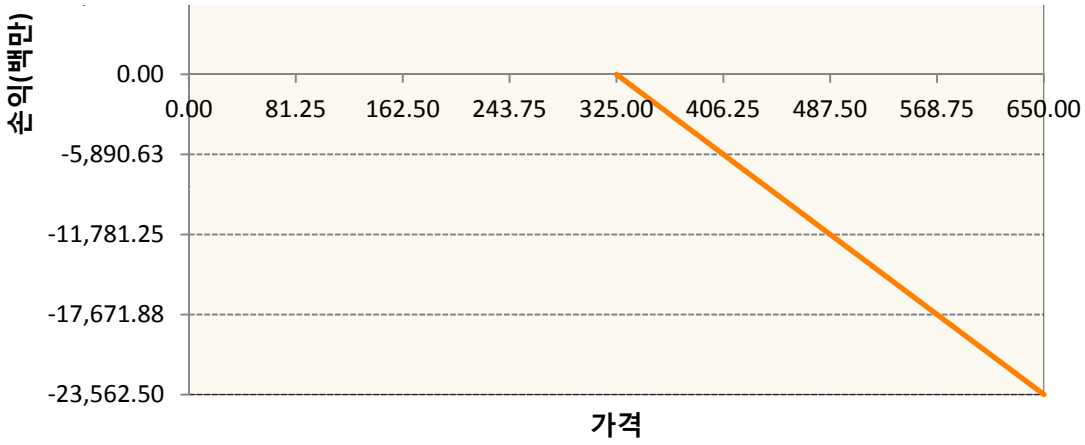
(단위:백만원)

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	12,026	0	12,026	장내
누계	유가증권	스왑	60,200	0	60,200	장외
누계	유가증권	옵션	0	60,250	-60,250	장내

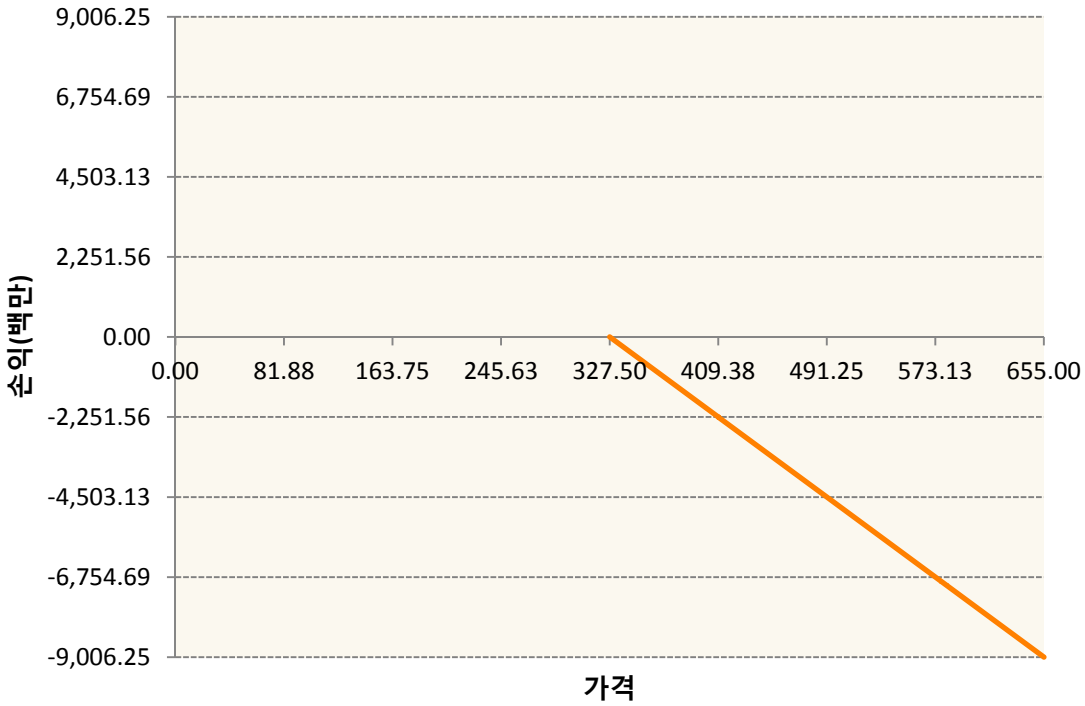
2. 만기시점의 손익구조



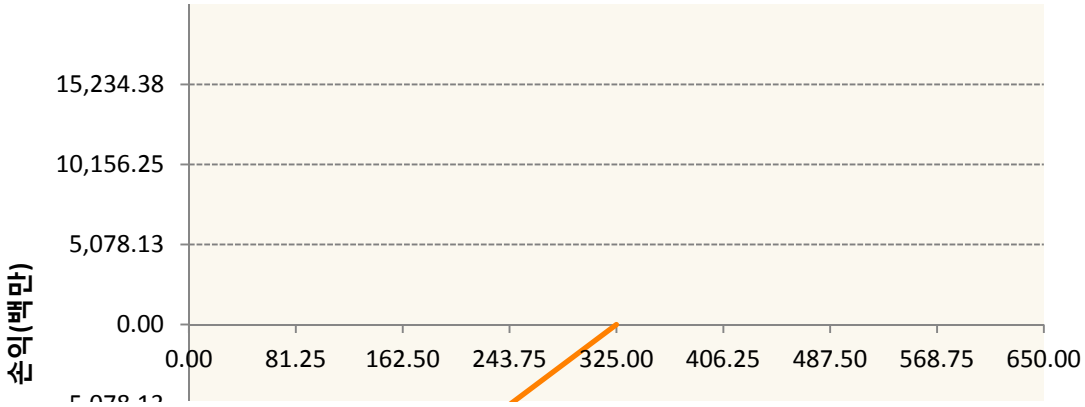




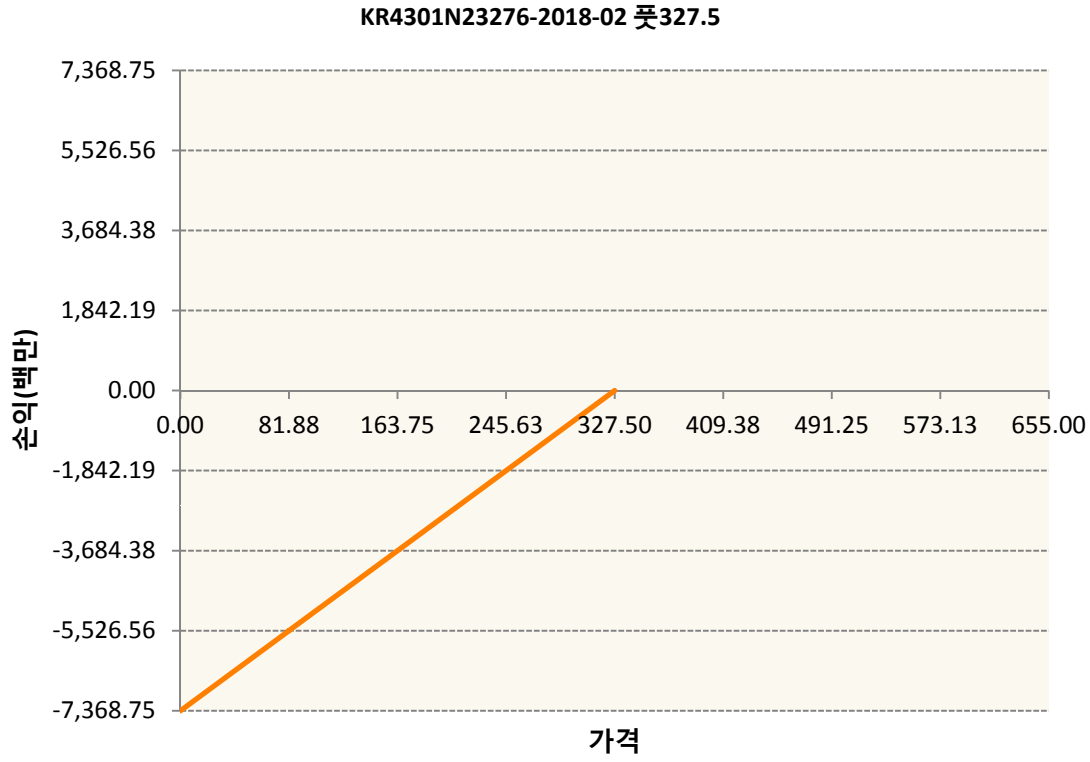
KR4201N23278-2018-02 콜327.5



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%	-105	-105	-105	-105	-105	-105	-105
-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%	105	105	105	105	105	105	105
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%	-314	-314	-314	-314	-314	-314	-314
-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%	314	314	314	314	314	314	314
8.00%	470	470	470	470	470	470	470
	KR4101N30(2018-03 코스피200지수선물						960

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-960	-960	-960	-960	-960	-960	-960
-5.33%	-640	-640	-640	-640	-640	-640	-640
-2.67%	-320	-320	-320	-320	-320	-320	-320
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	320	320	320	320	320	320	320
5.33%	640	640	640	640	640	640	640
8.00%	960	960	960	960	960	960	960
	KR4201N232 2018-02 콜325						1,660

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	734	722	707	689	669	646	622
-5.33%	663	635	605	573	540	506	472
-2.67%	473	432	391	350	309	268	227
0%	116	78	39	0	-40	-80	-120
2.67%	-388	-412	-439	-468	-498	-531	-564
5.33%	-980	-990	-1,004	-1,021	-1,040	-1,061	-1,085
8.00%	-1,607	-1,610	-1,616	-1,623	-1,633	-1,645	-1,660
	KR4201N232 2018-02 콜327.5						608

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	240	237	232	227	220	213	205
-5.33%	221	212	202	191	180	168	156
-2.67%	164	149	134	119	104	89	74
0%	47	31	16	0	-16	-31	-47
2.67%	-130	-141	-153	-166	-178	-192	-206
5.33%	-347	-353	-359	-367	-376	-385	-395
8.00%	-583	-585	-587	-591	-596	-602	-608
	KR4301N232 2018-02 풋325						1,204

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,198	-1,198	-1,198	-1,199	-1,200	-1,202	-1,204
-5.33%	-652	-656	-661	-667	-674	-682	-692

-2.67%	-183	-200	-216	-233	-250	-267	-284
0%	39	27	14	0	-14	-29	-44
2.67%	75	74	71	67	62	56	50
5.33%	77	77	77	76	76	75	73
8.00%	77	77	77	77	77	77	77
	KR4301N232 2018-02 풋327.5						472
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-471	-471	-471	-471	-471	-472	-472
-5.33%	-273	-274	-275	-276	-278	-280	-282
-2.67%	-91	-96	-101	-106	-111	-117	-122
0%	17	12	6	0	-6	-12	-18
2.67%	43	41	39	37	35	32	28
5.33%	44	44	44	44	43	42	42
8.00%	44	44	44	44	44	44	44

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

9,394

공시일	2018-01-24
기준일	2018-01-23

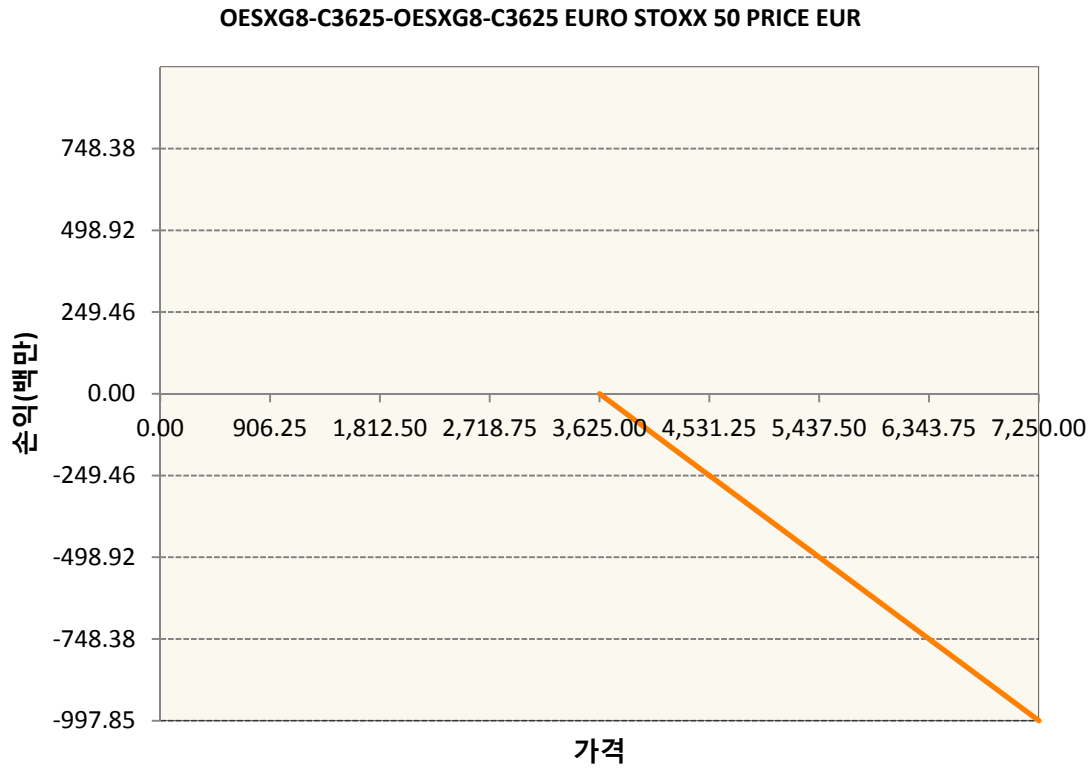
유로커버드콜모(주식혼합-파생형

1. 계약금액

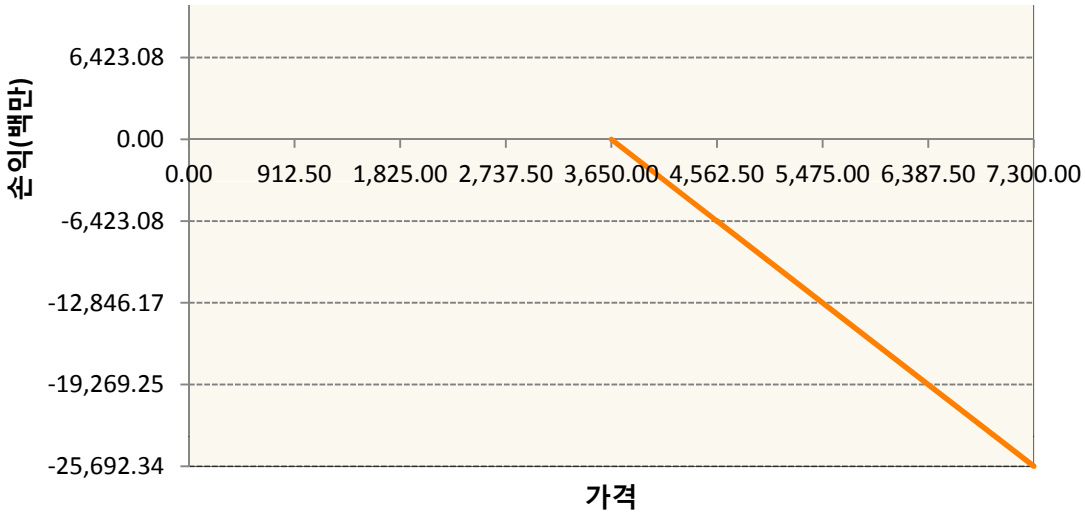
(단위:백만원)

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	17,842	0	17,842	
누계	유가증권	스왑	98,309	0	98,309	장외
누계	유가증권	옵션	0	53,380	-53,380	장내
누계	지수	스왑	52,432	0	52,432	장외

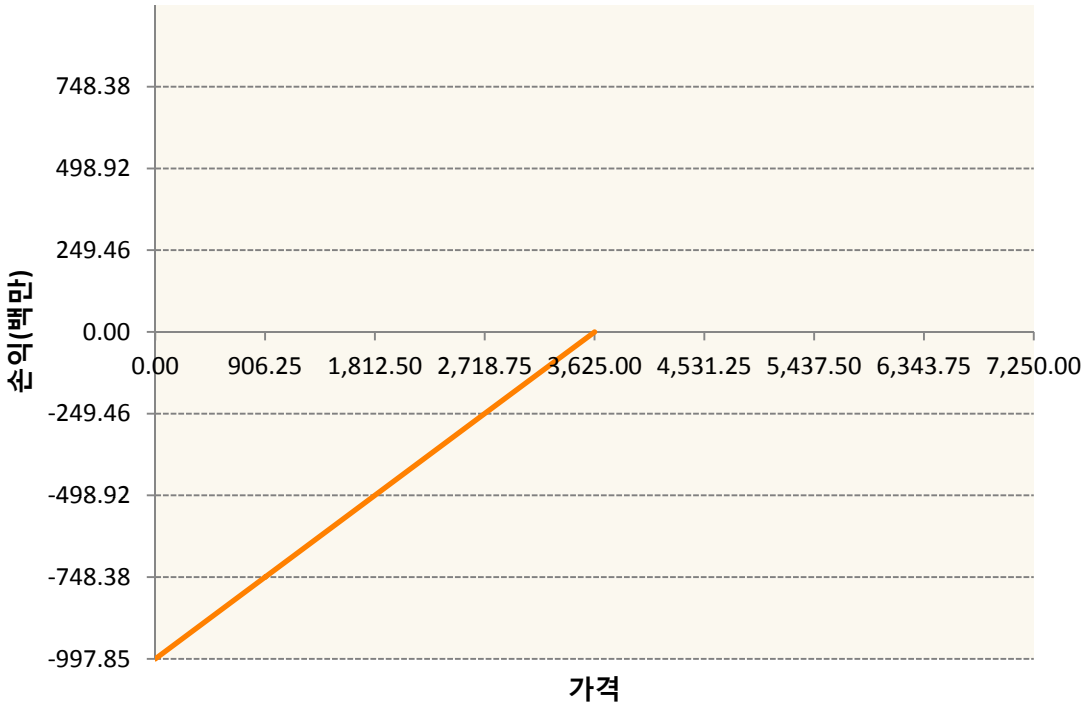
2. 만기시점의 손익구조



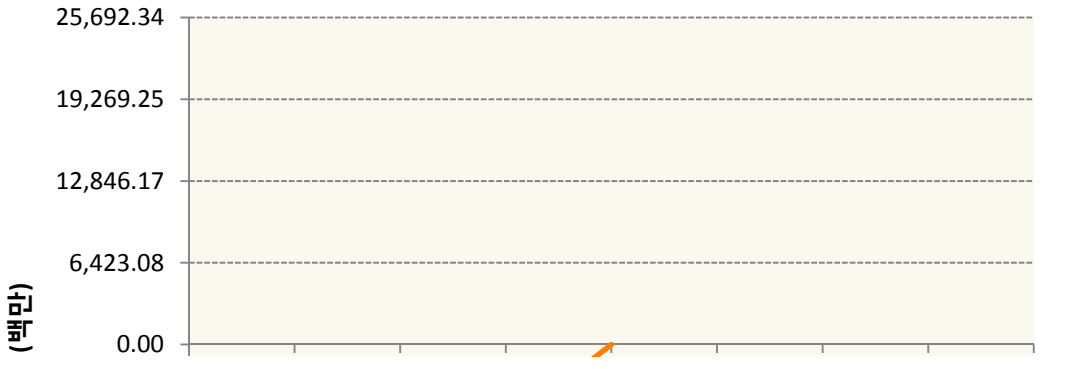


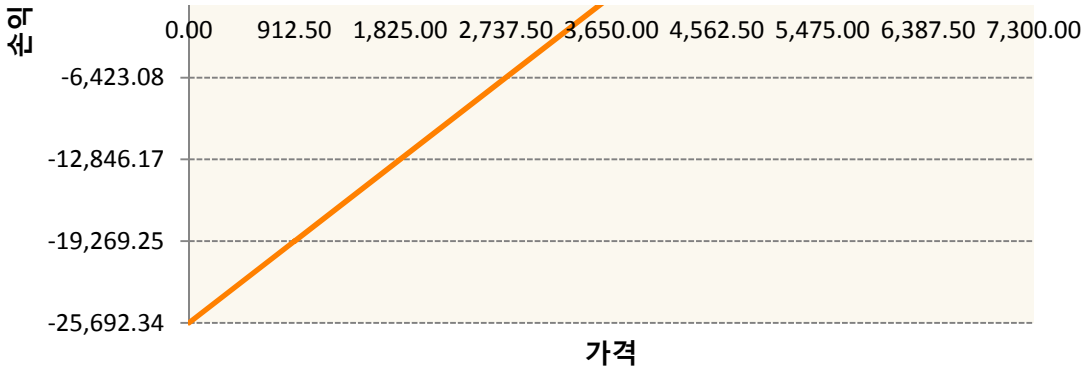


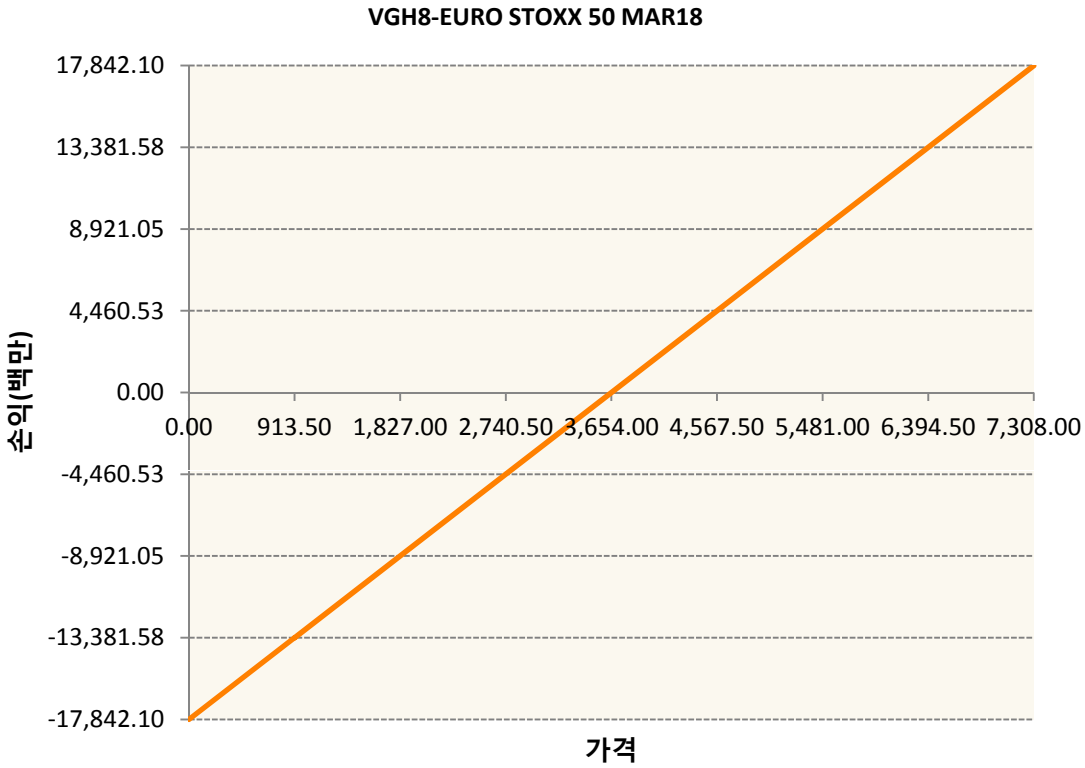
OESXG8-P3625-OESXG8-P3625 EURO STOXX 50 PRICE EUR



OESXG8-P3650-OESXG8-P3650 EURO STOXX 50 PRICE EUR







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)	(단위:백만원)
260105SGPX SG EURO Covered CALL STRATEGY - 994.569	11
260105SQPX SG EURO Covered CALL STRATEGY	21
OESXG8-C3(OESXG8-C3625 EURO STOXX 50 PRICE EUR	80
OESXG8-C3(OESXG8-C3650 EURO STOXX 50 PRICE EUR	2,055
OESXG8-P3(OESXG8-P3625 EURO STOXX 50 PRICE EUR	80
OESXG8-P3(OESXG8-P3650 EURO STOXX 50 PRICE EUR	2,055
VGH8 EURO STOXX 50 MAR18	1,427

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

3,194

공시일	2018-01-24
기준일	2018-01-23

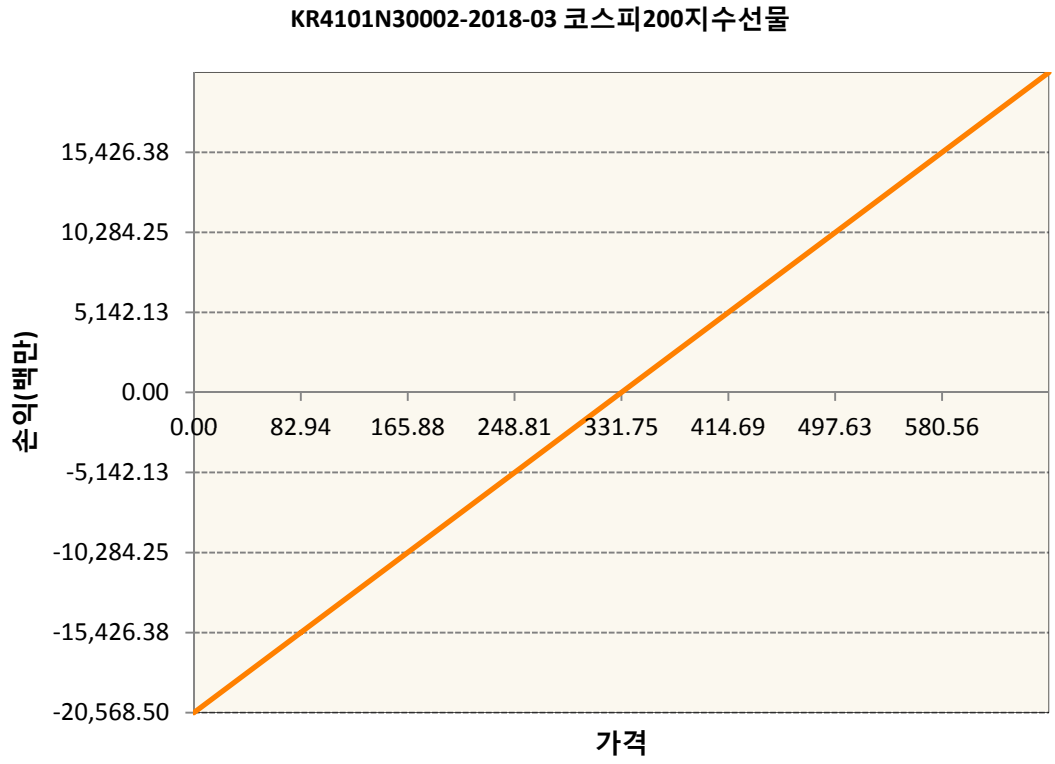
ETF스마트레버리지목표전환형8호

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	20,569	0	20,569	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101N30(2018-03 코스피200지수선물							1,641
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,641	-1,641	-1,641	-1,641	-1,641	-1,641	-1,641
-5.33%	-1,094	-1,094	-1,094	-1,094	-1,094	-1,094	-1,094
-2.67%	-547	-547	-547	-547	-547	-547	-547
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	547	547	547	547	547	547	547
5.33%	1,094	1,094	1,094	1,094	1,094	1,094	1,094
8.00%	1,641	1,641	1,641	1,641	1,641	1,641	1,641

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

983

공시일	2018-01-24
기준일	2018-01-23

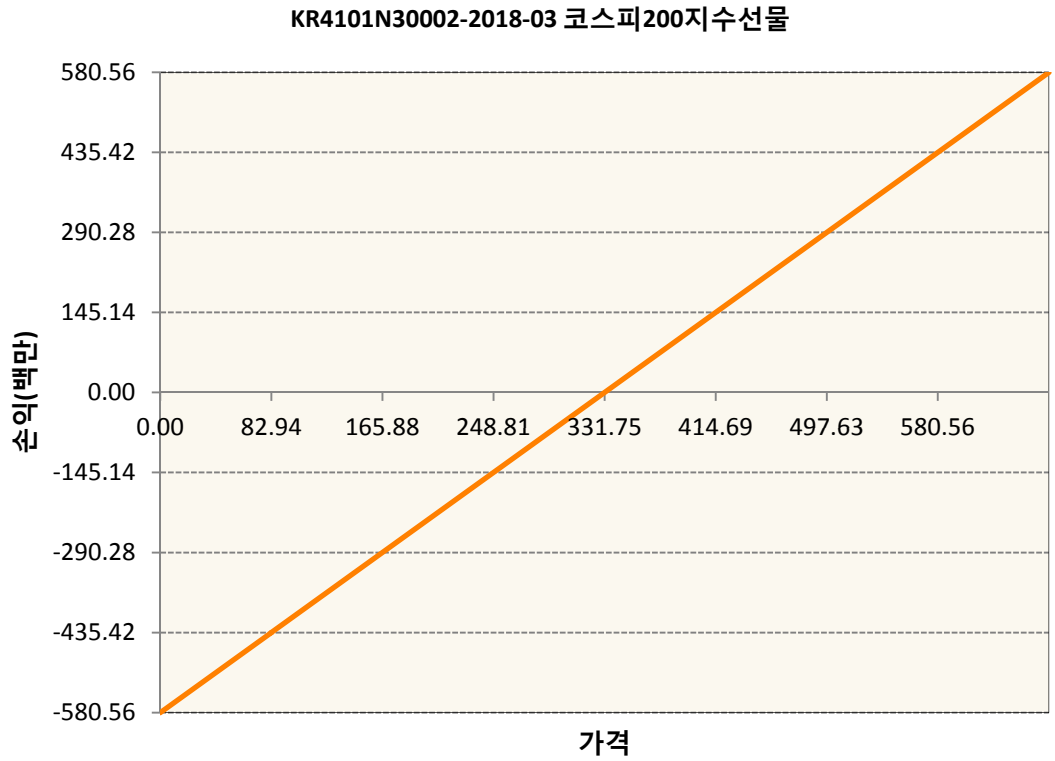
ETF스마트레버리지목표전환형9호

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	581	0	581	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	2018-01-24
기준일	2018-01-23

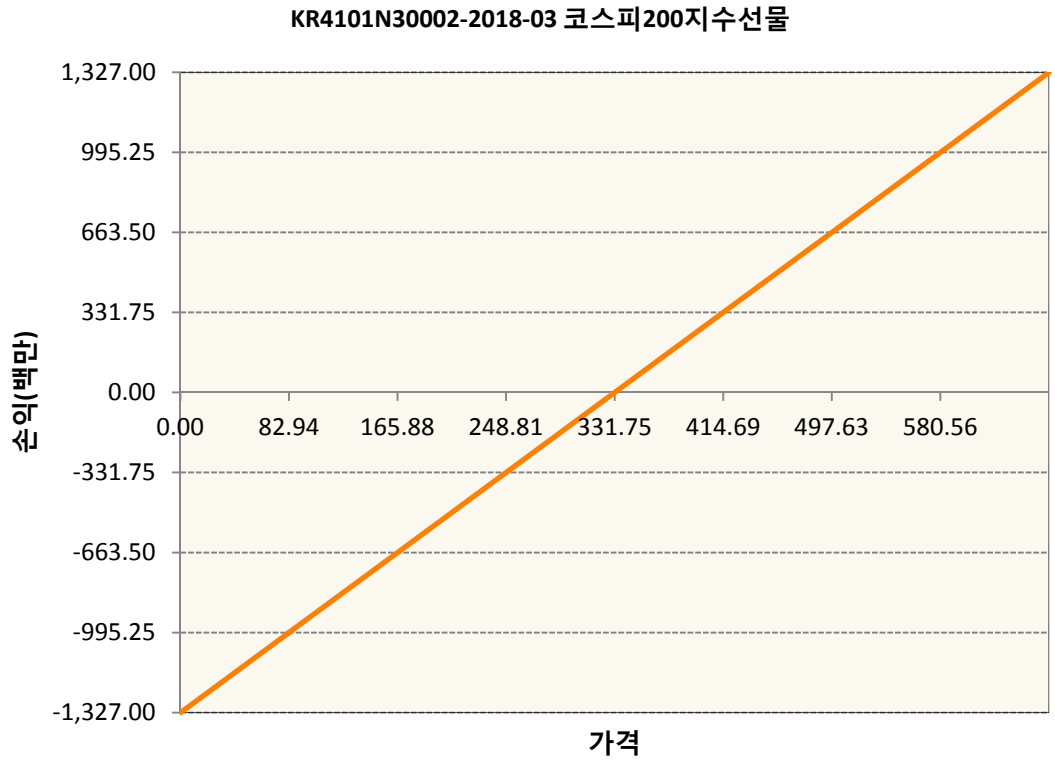
ETF스마트레버리지목표전환형10

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	1,327	0	1,327	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%	-71	-71	-71	-71	-71	-71	-71
-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%	71	71	71	71	71	71	71
8.00%	106	106	106	106	106	106	106

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

63

공시일	2018-01-24
기준일	2018-01-23

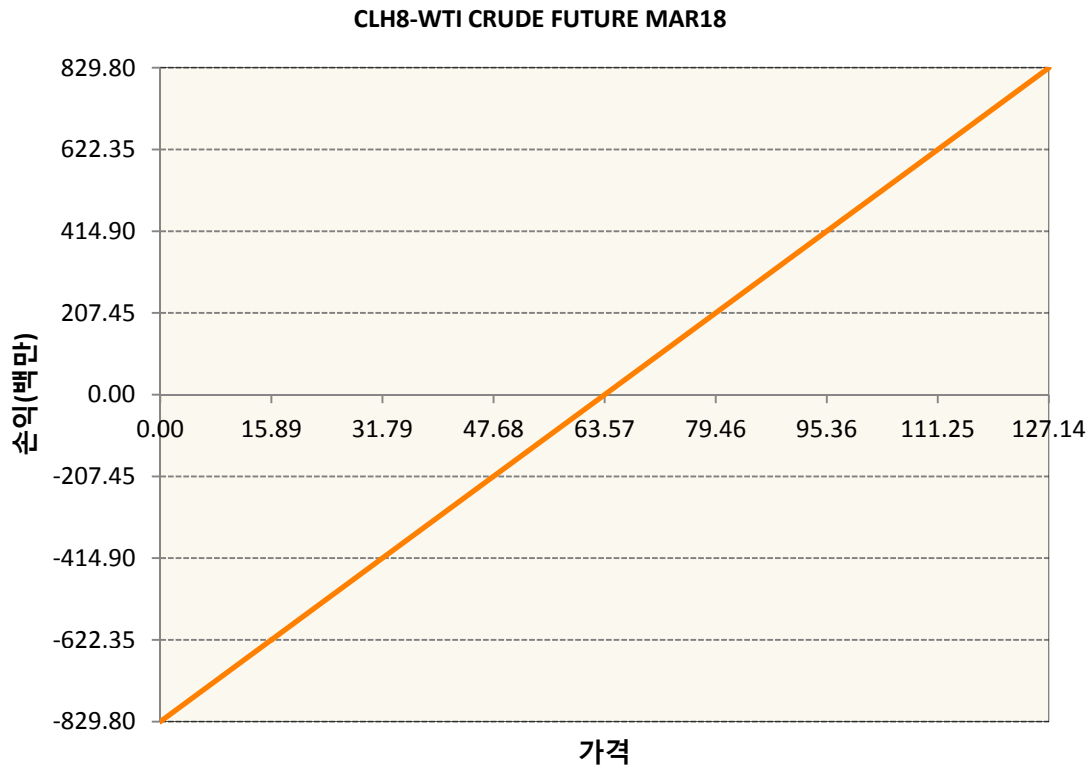
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

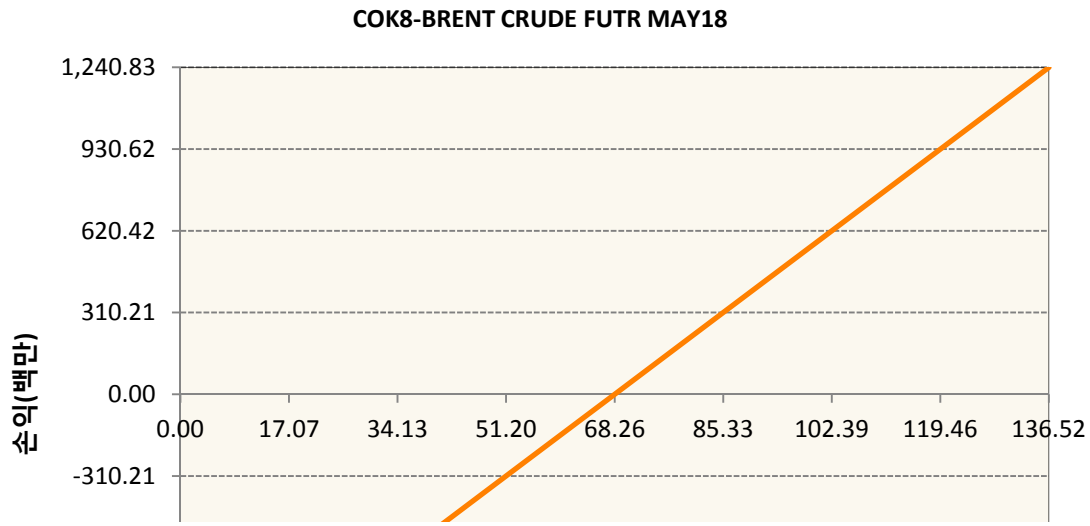
1. 계약금액

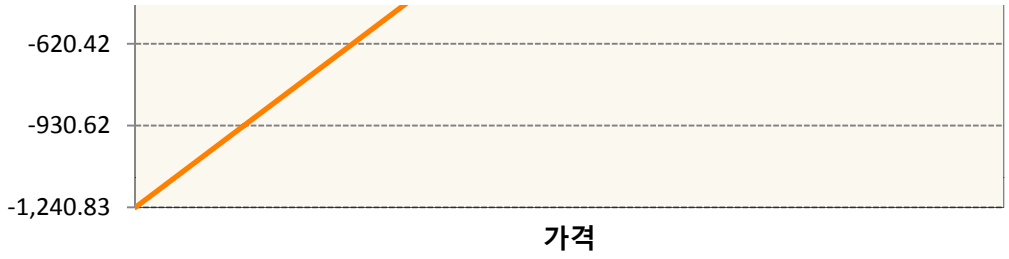
(단위:백만원)

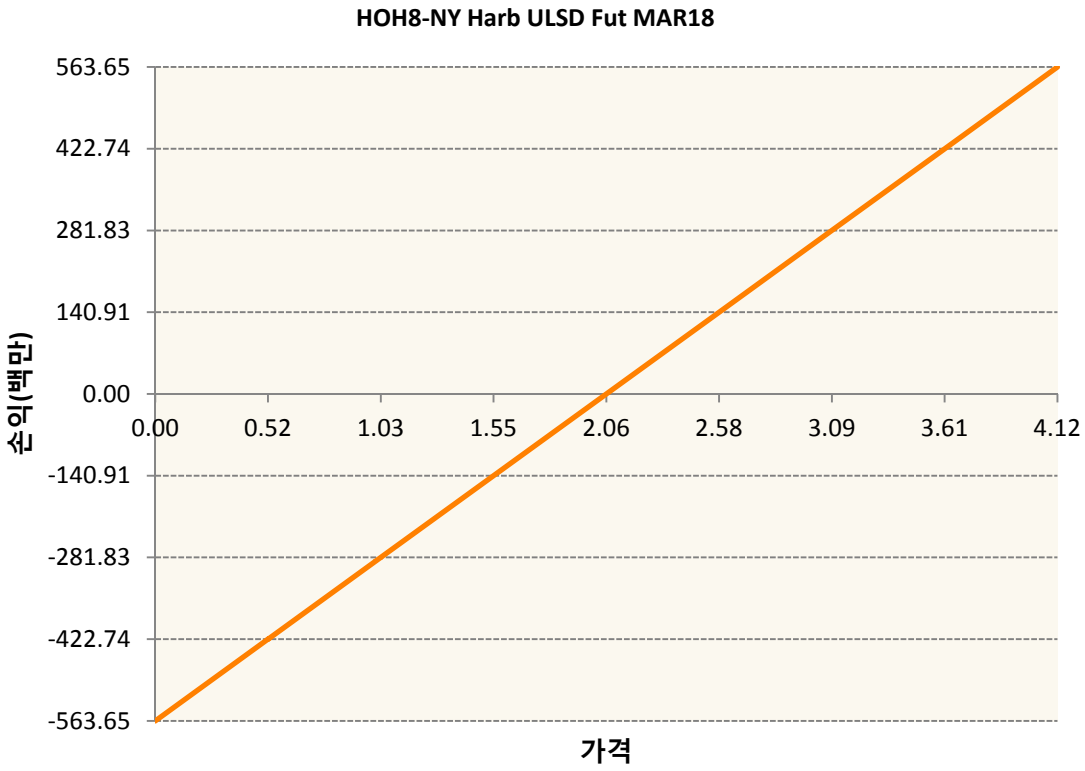
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	4,444	856	3,588	

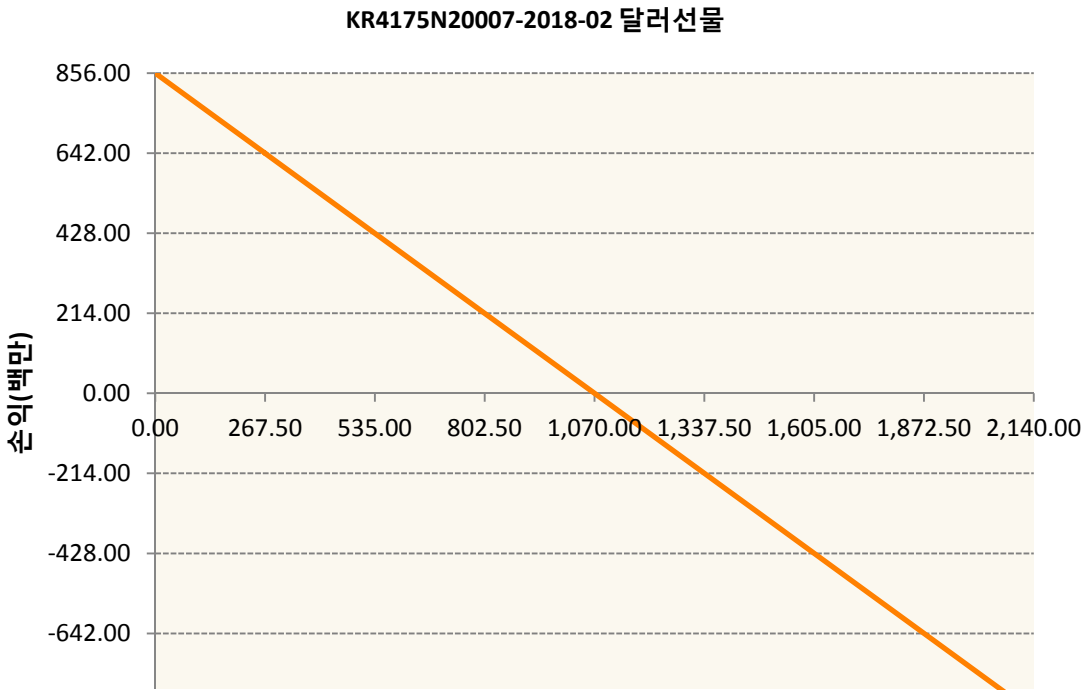
2. 만기시점의 손익구조

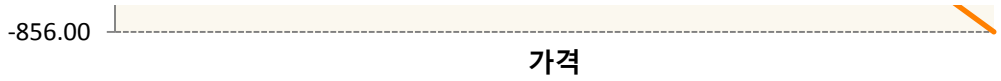


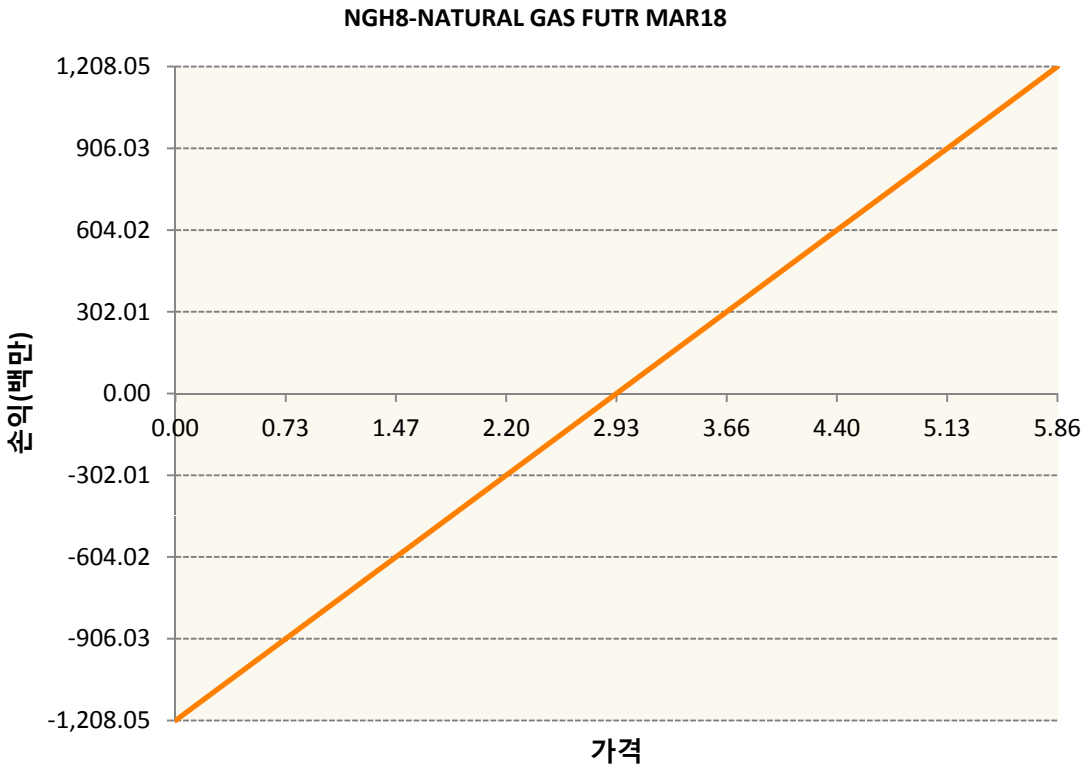


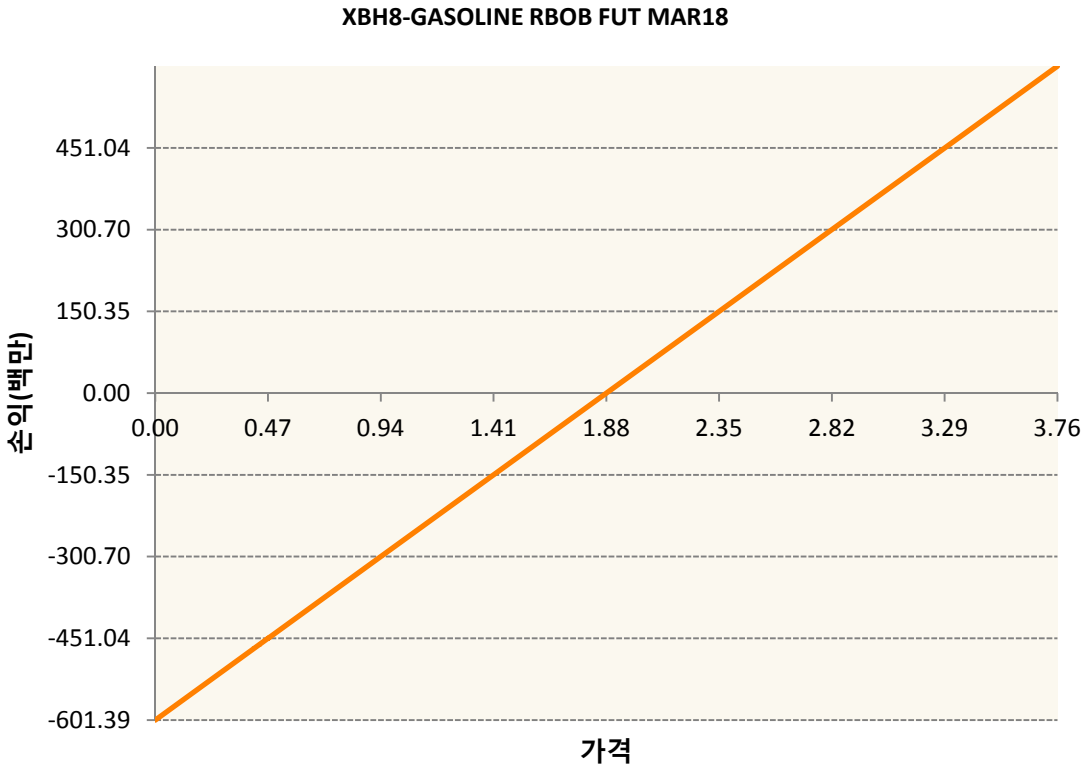

-620.42
-930.62
-1,240.83
가격


HOH8-NY Harb ULSD Fut MAR18
563.65
422.74
281.83
140.91
0.00
-140.91
-281.83
-422.74
-563.65
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
856.00
642.00
428.00
214.00
0.00
-214.00
-428.00
-642.00
0.00
267.50
535.00
802.50
1,070.00
1,337.50
1,605.00
1,872.50
2,140.00
손익(백만)


-856.00
가격


NGH8-NATURAL GAS FUTR MAR18
1,208.05
906.03
604.02
302.01
0.00
-302.01
-604.02
-906.03
-1,208.05
0.00
0.73
1.47
2.20
2.93
3.66
4.40
5.13
5.86
손익(백만)
가격


XBH8-GASOLINE RBOB FUT MAR18
451.04
300.70
150.35
0.00
-150.35
-300.70
-451.04
-601.39
0.00
0.47
0.94
1.41
1.88
2.35
2.82
3.29
3.76
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)

602

공시일	2018-01-24
기준일	2018-01-23

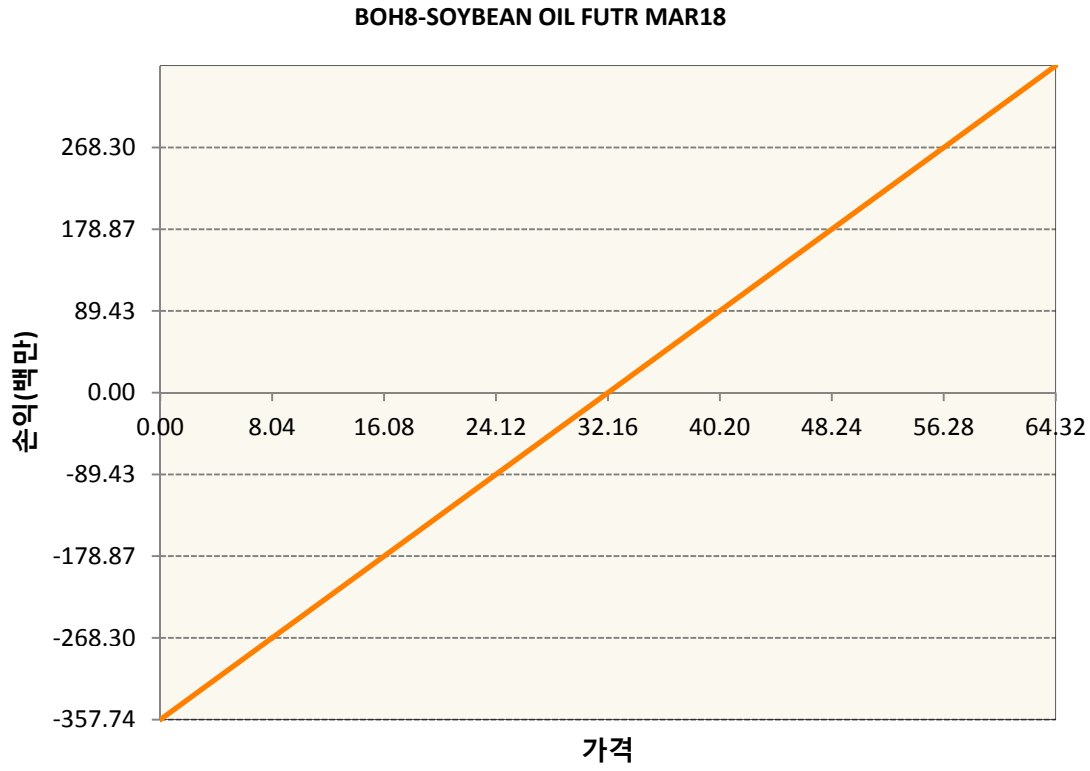
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

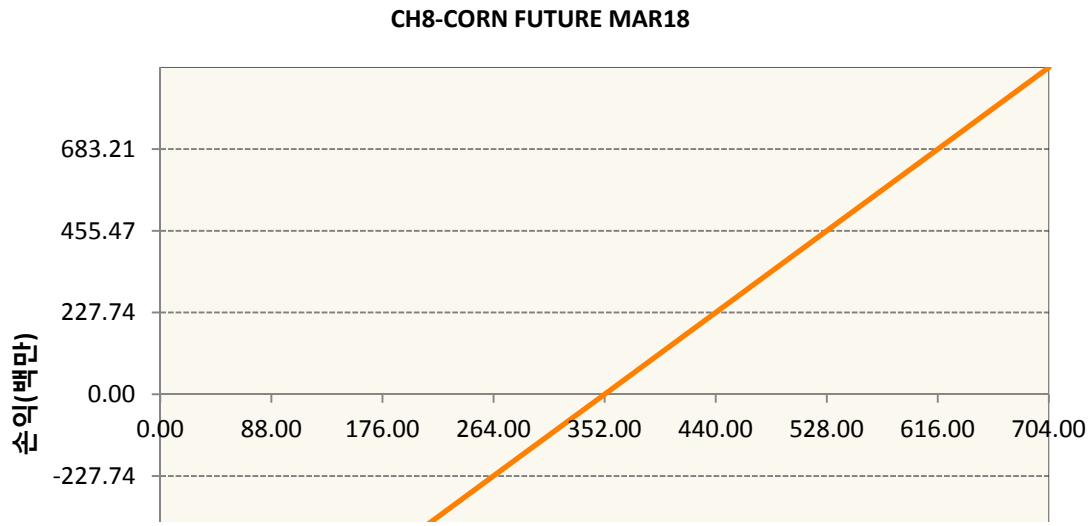
1. 계약금액

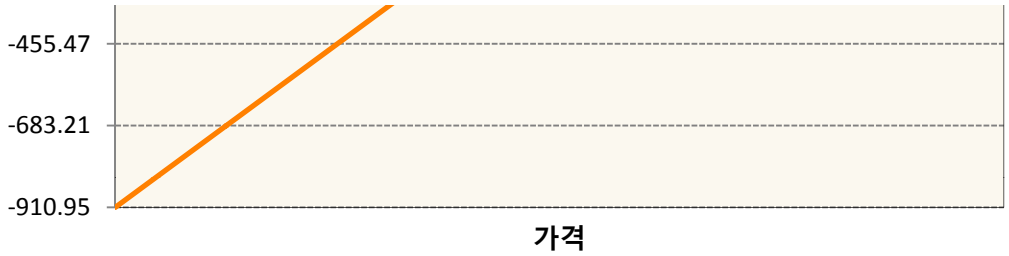
(단위:백만원)

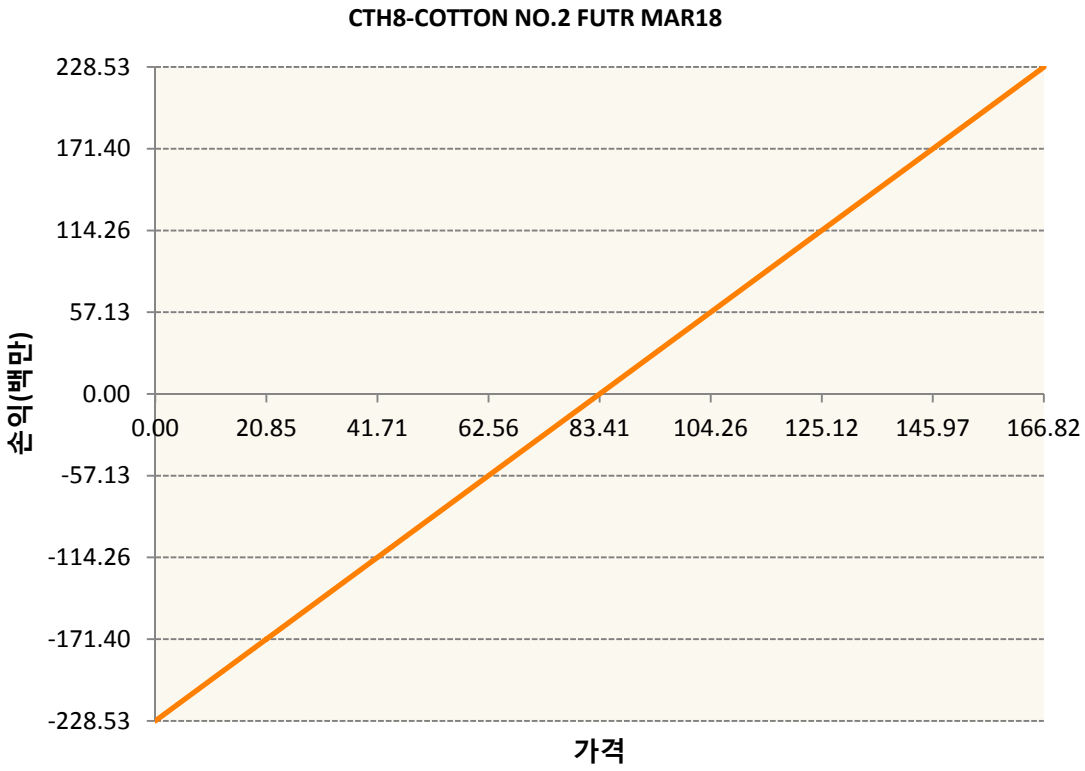
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	4,084	321	3,763	

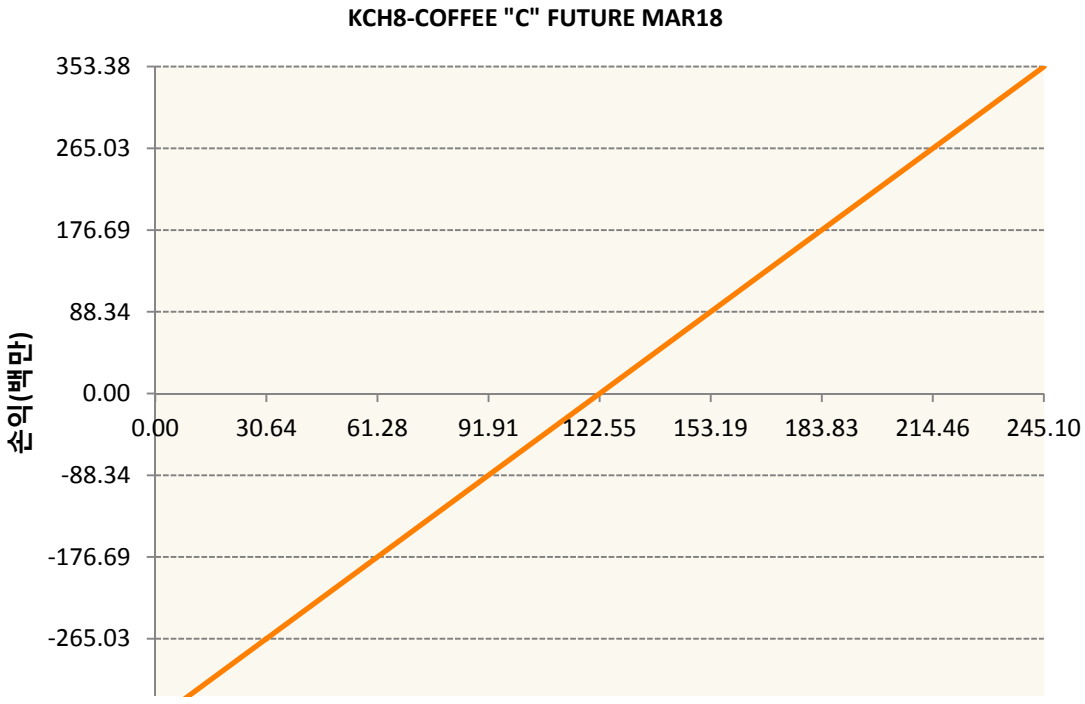
2. 만기시점의 손익구조

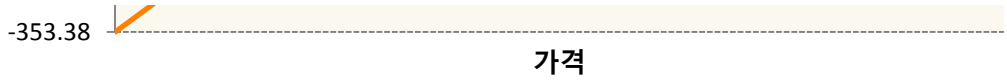


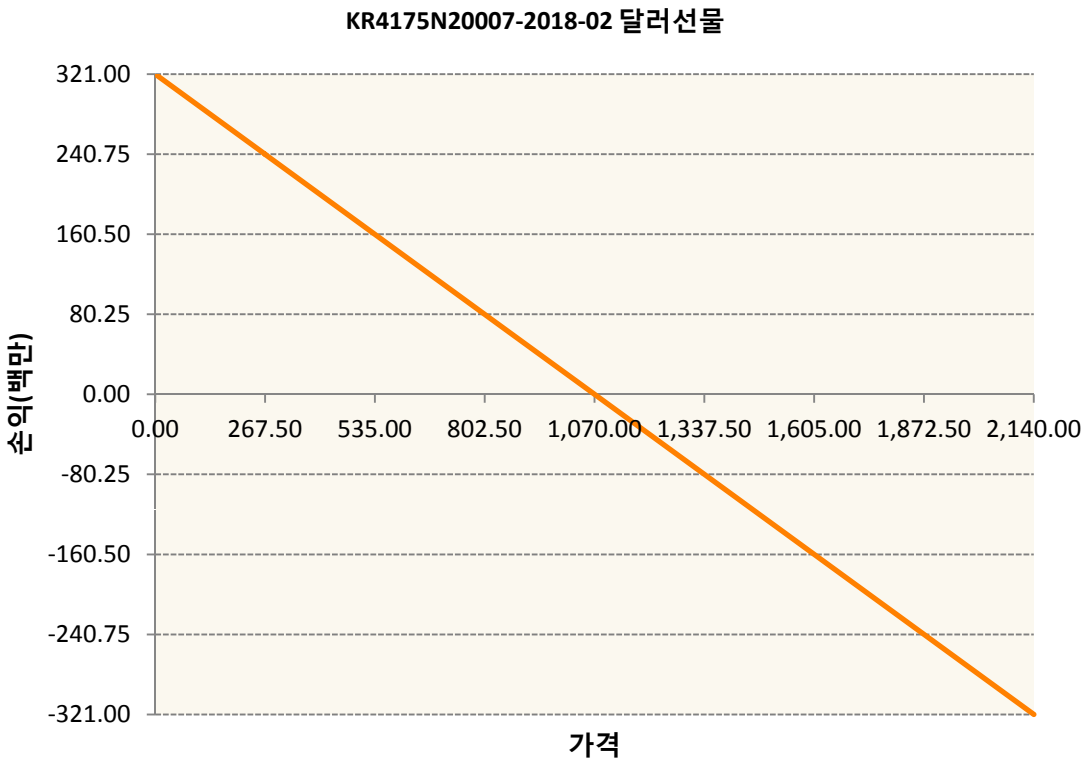


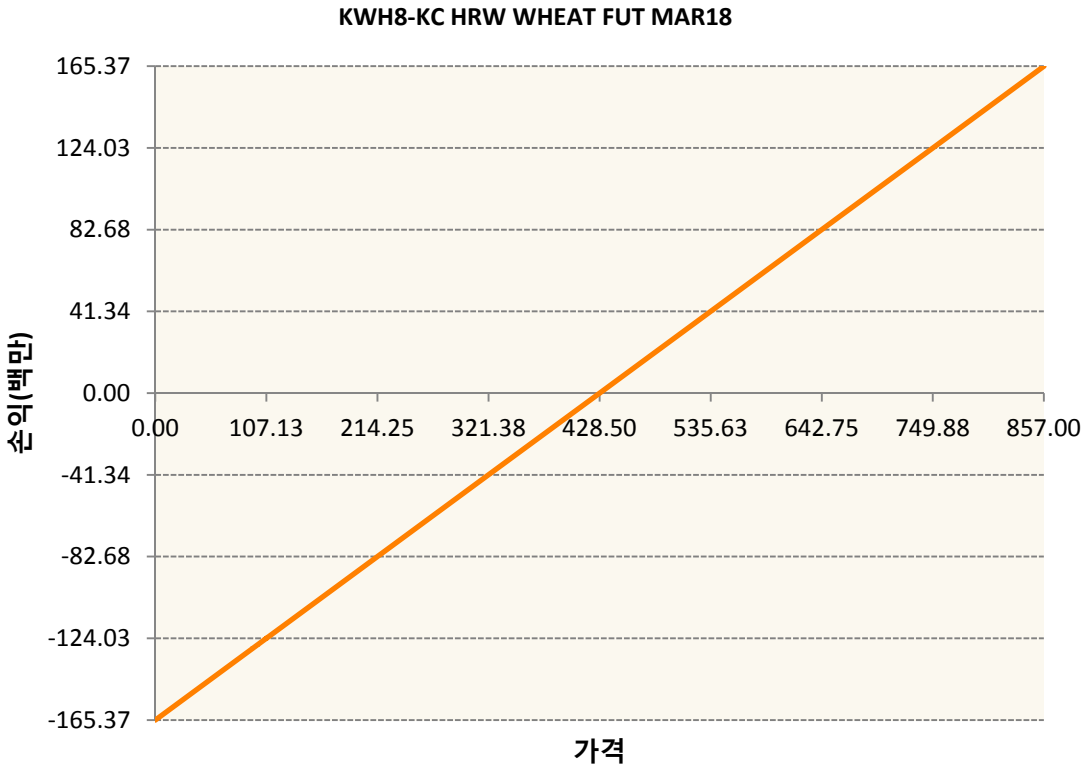

-455.47
-683.21
-910.95
가격


CTH8-COTTON NO.2 FUTR MAR18
228.53
171.40
114.26
57.13
0.00
-57.13
-114.26
-171.40
-228.53
손익(백만)
0.00
20.85
41.71
62.56
83.41
104.26
125.12
145.97
166.82
가격

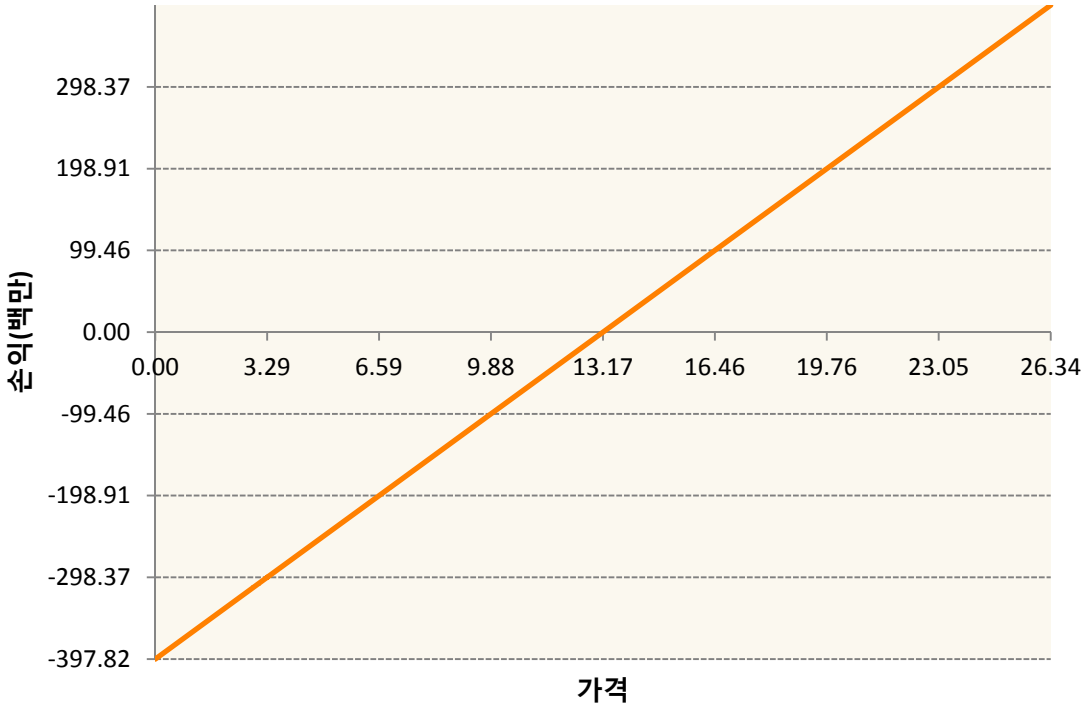

KCH8-COFFEE "C" FUTURE MAR18
353.38
265.03
176.69
88.34
0.00
-88.34
-176.69
-265.03
손익(백만)
0.00
30.64
61.28
91.91
122.55
153.19
183.83
214.46
245.10


-353.38
가격

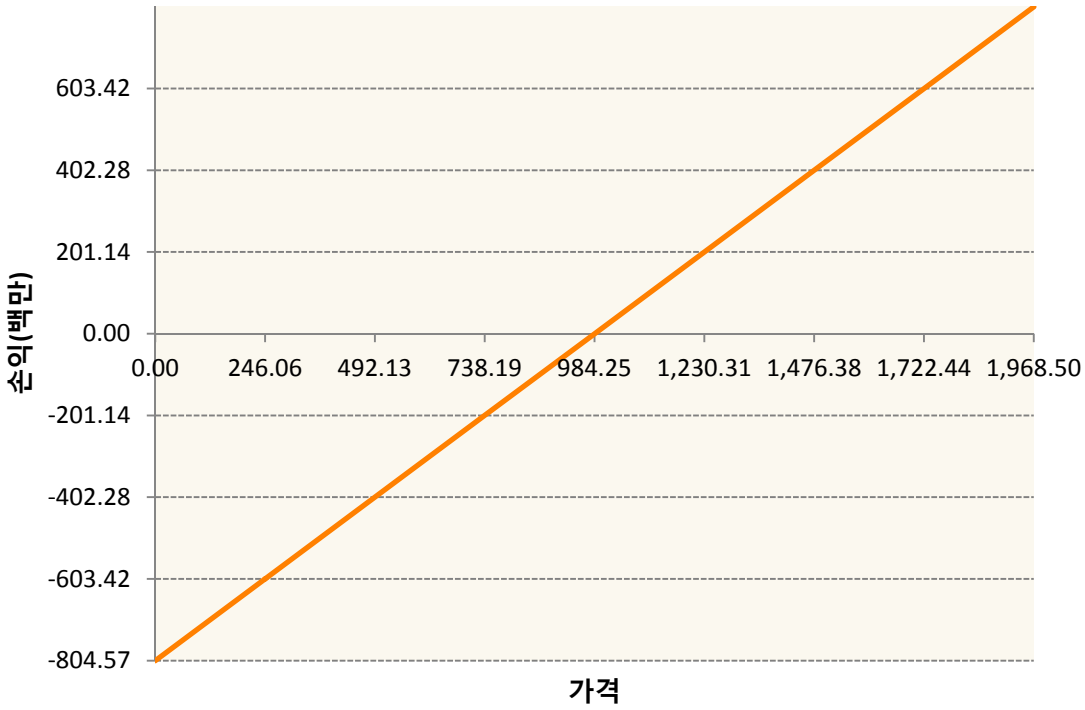

KR4175N20007-2018-02 달러선물
321.00
240.75
160.50
80.25
0.00
-80.25
-160.50
-240.75
-321.00
0.00
267.50
535.00
802.50
1,070.00
1,337.50
1,605.00
1,872.50
2,140.00
손익(백만)
가격


KWH8-KC HRW WHEAT FUT MAR18
165.37
124.03
82.68
41.34
0.00
-41.34
-82.68
-124.03
-165.37
0.00
107.13
214.25
321.38
428.50
535.63
642.75
749.88
857.00
손익(백만)
가격

SBH8-Sugar #11 (WORLD) MAR18

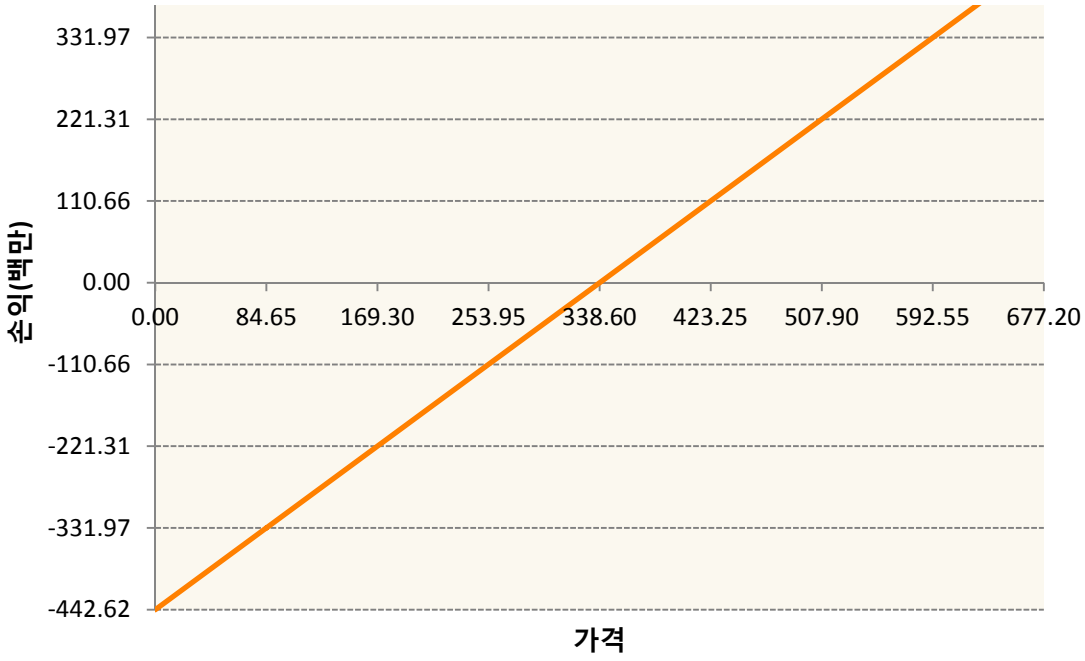


SH8-SOYBEAN FUTURE MAR18

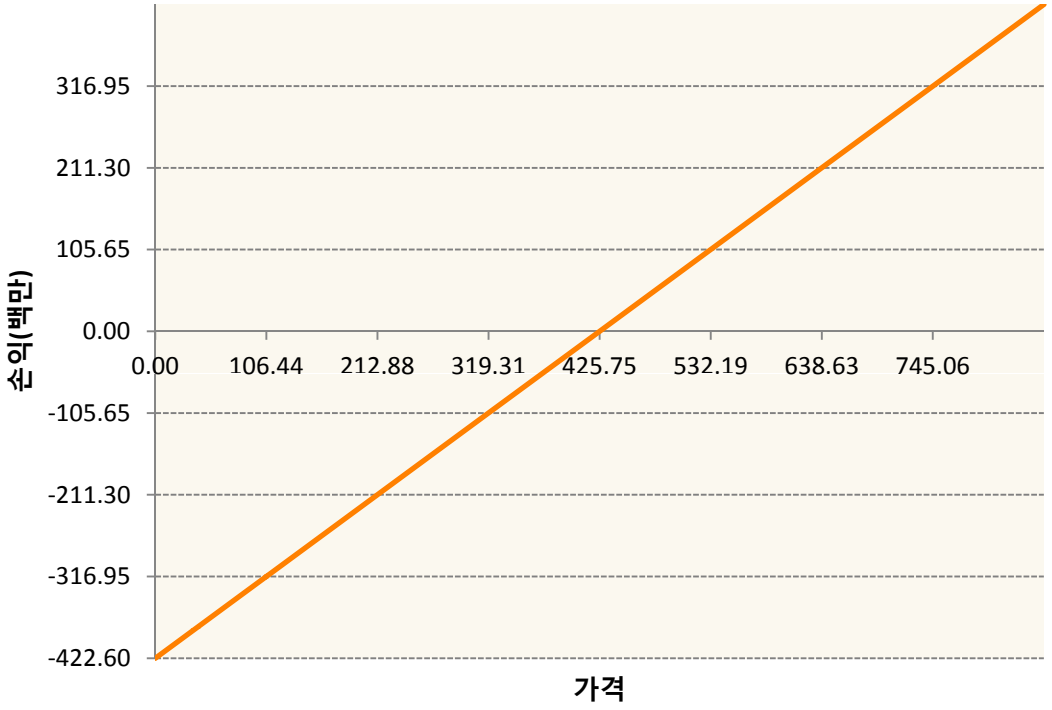


SMH8-SOYBEAN MEAL FUTR MAR18





WH8-WHEAT FUTURE(CBT) MAR18



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

BOH8	SOYBEAN OIL FUTR MAR18	29
CH8	CORN FUTURE MAR18	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