공시일	2018-01-25
기준일	2018-01-24

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	2018-01-25
기준일	2018-01-24

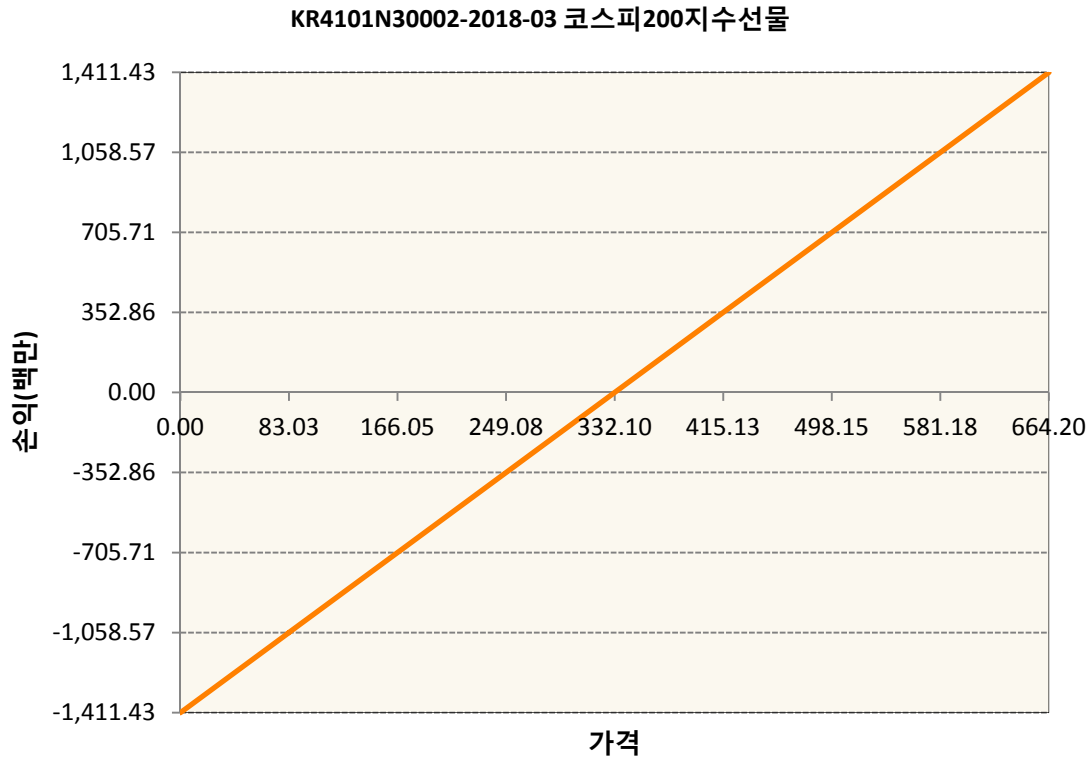
스마트인덱스모

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	1,411	0	1,411	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	2018-01-25
기준일	2018-01-24

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	1,166

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

376

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2018-01-25
기준일	2018-01-24

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	423

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

375

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2018-01-25
기준일	2018-01-24

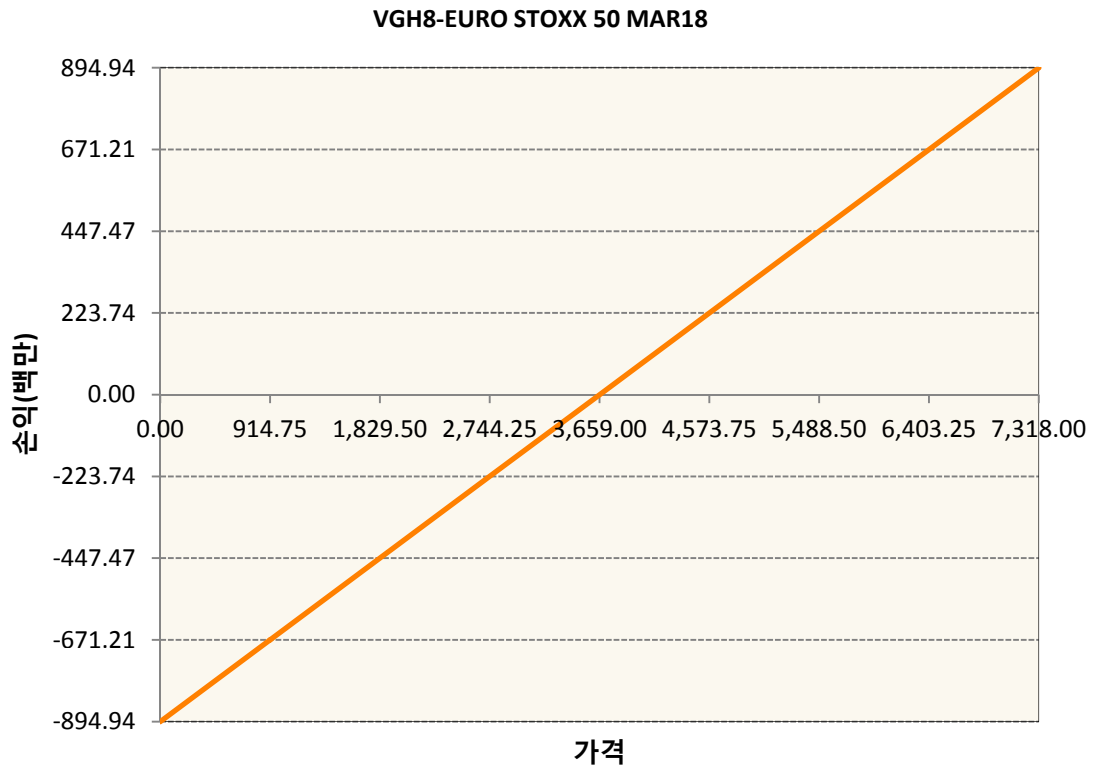
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	895	0	895	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGH8	EURO STOXX 50 MAR18	72

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

(단위:백만원)

40

공시일	2018-01-25
기준일	2018-01-24

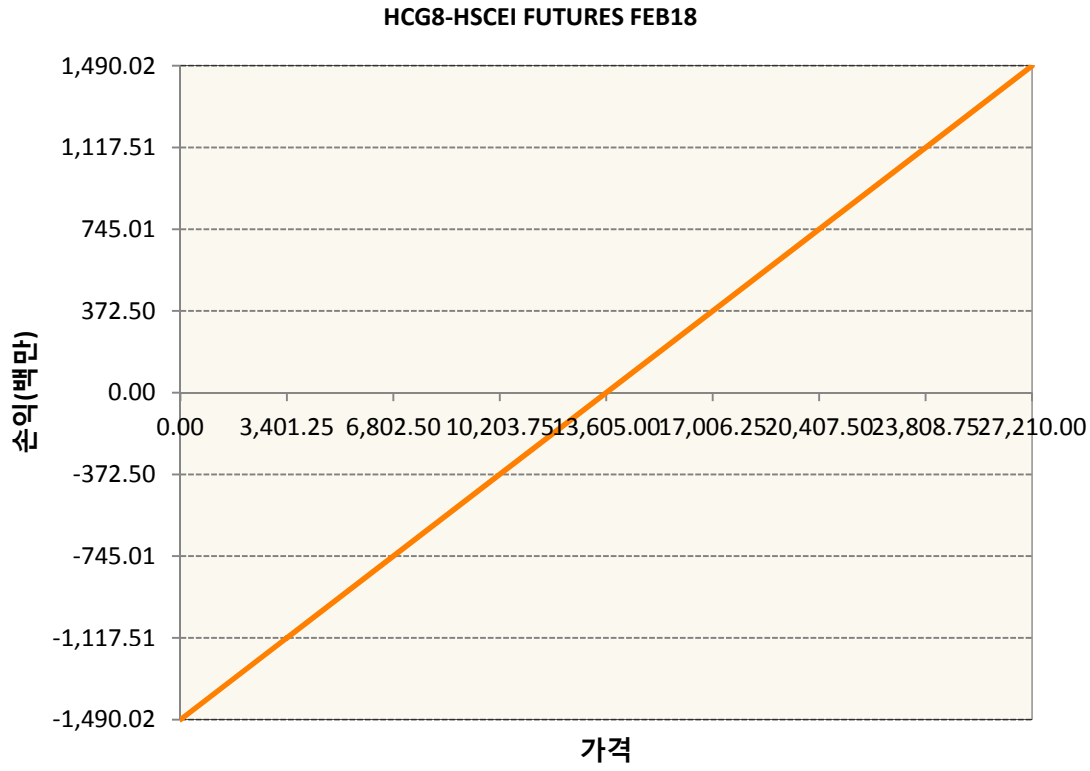
차이나인덱스모(주식-파생형)

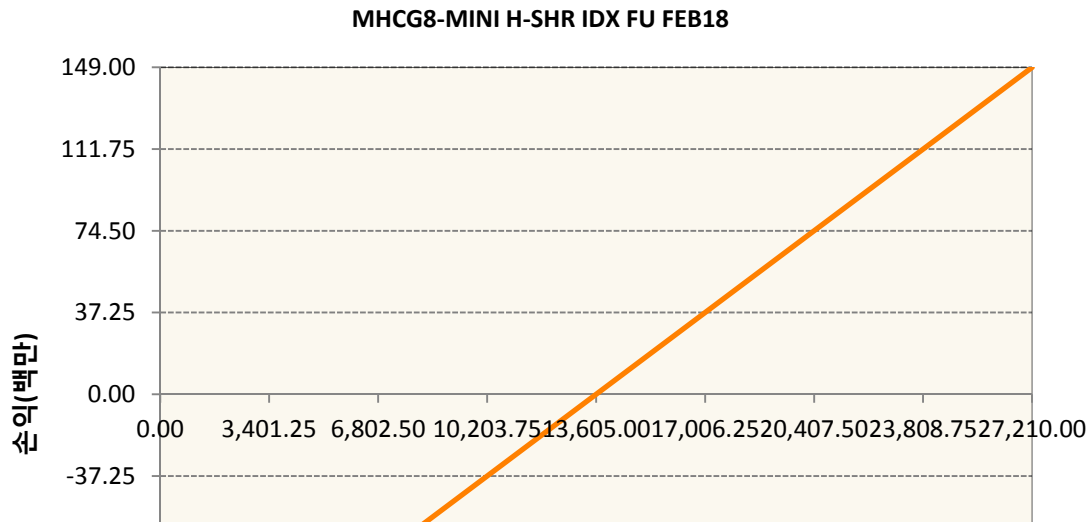
1. 계약금액

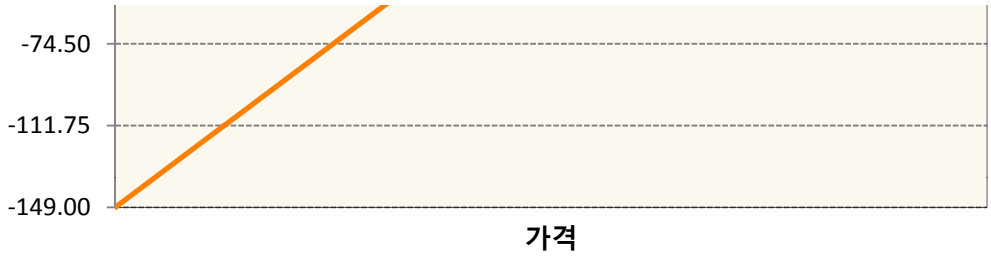
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,639	0	1,639	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCG8	HSCEI FUTURES FEB18	119
MHCG8	MINI H-SHR IDX FU FEB18	12

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	105

공시일	2018-01-25
기준일	2018-01-24

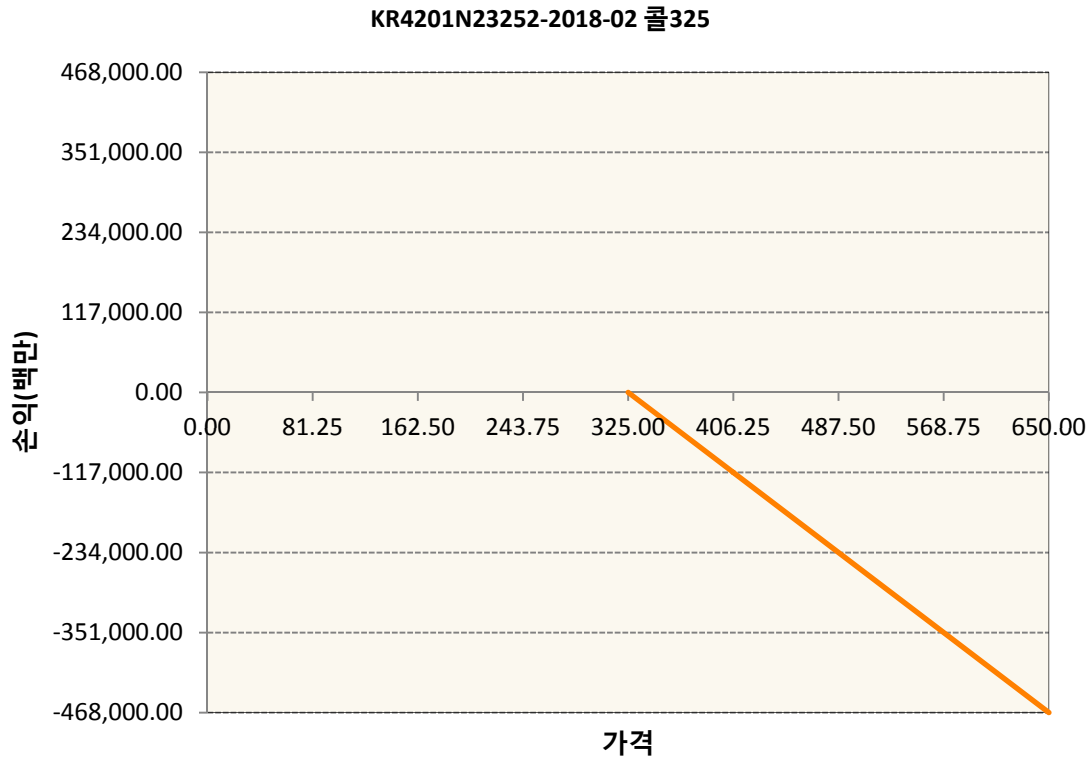
커버드콜모(주식혼합-파생형)

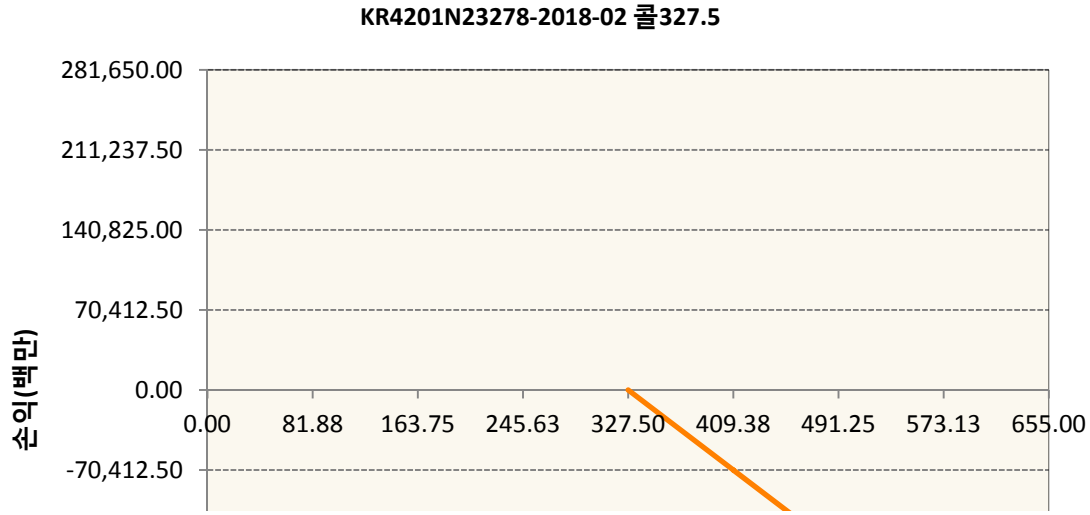
1. 계약금액

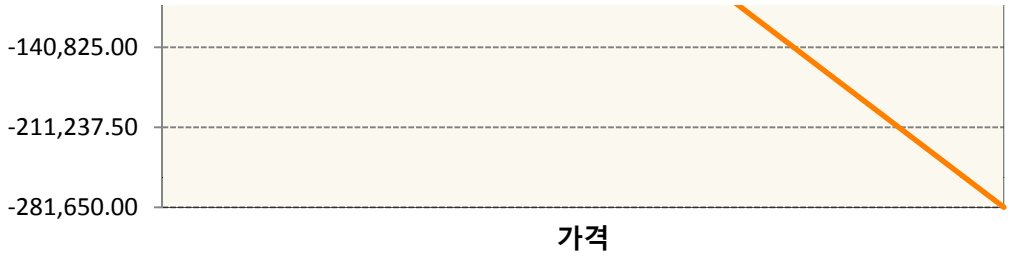
(단위:백만원)

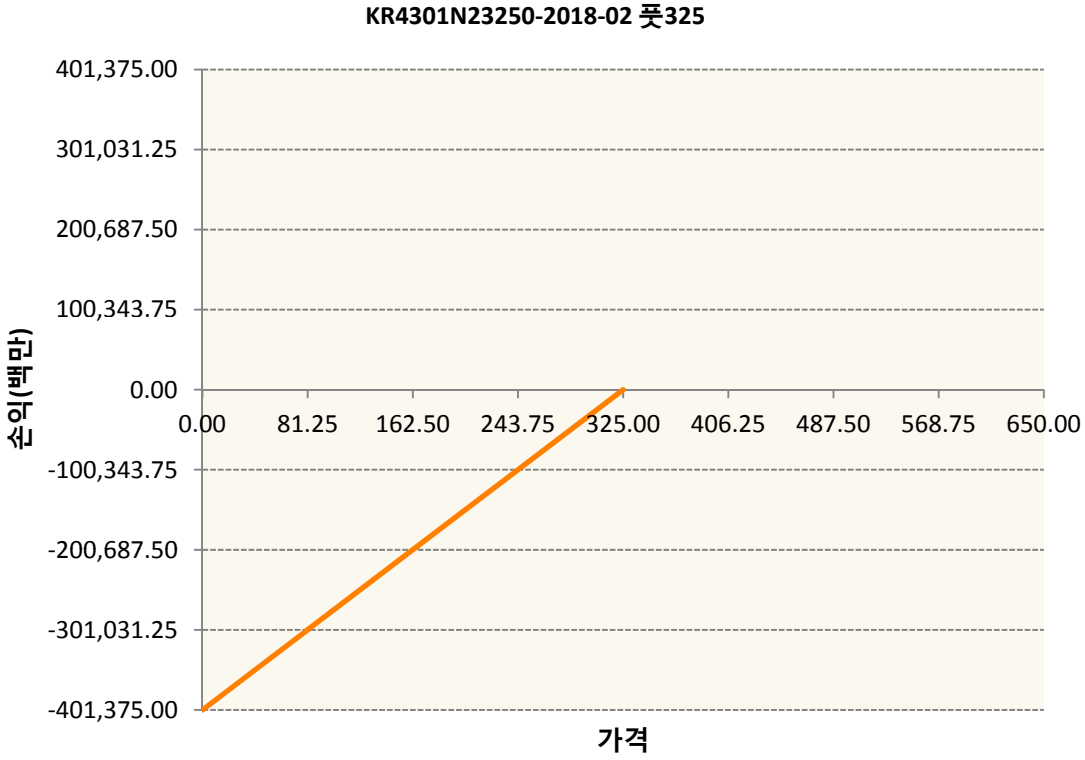
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	16,282	0	16,282	장내
누계	유가증권	옵션	0	1,295,125	-1,295,125	장내

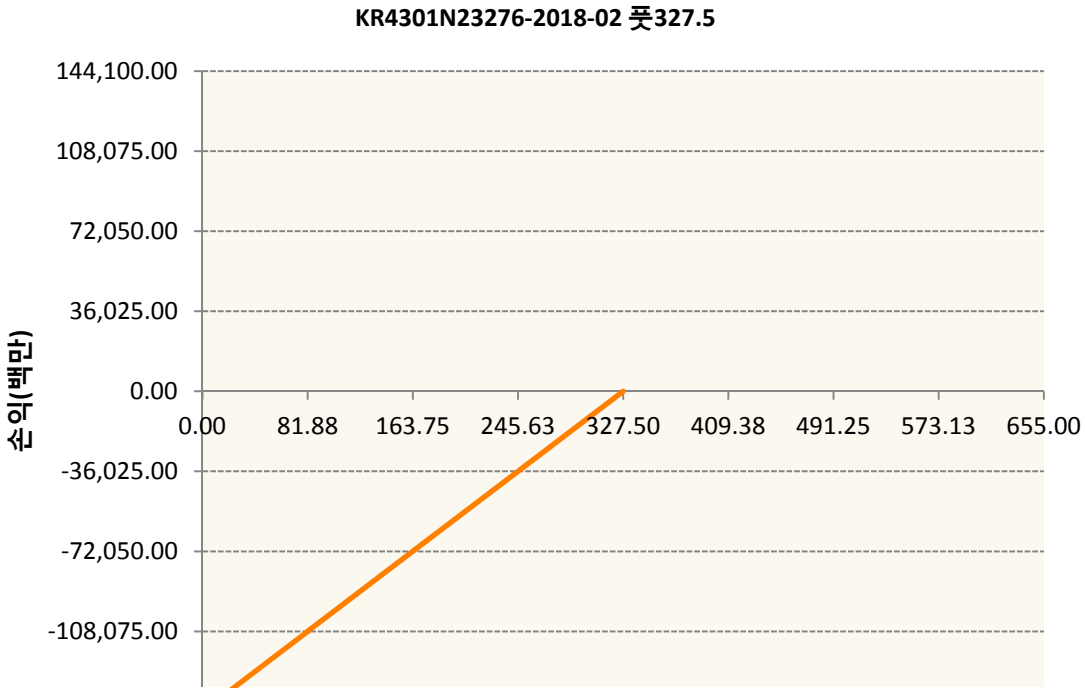
2. 만기시점의 손익구조






-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
144,100.00
108,075.00
72,050.00
36,025.00
0.00
-36,025.00
-72,050.00
-108,075.00
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							33,109
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	14,318	14,101	13,827	13,502	13,130	12,718	12,269
-5.33%	13,006	12,479	11,912	11,314	10,690	10,045	9,383
-2.67%	9,307	8,528	7,746	6,961	6,175	5,387	4,598
0%	2,225	1,496	753	0	-761	-1,529	-2,302
2.67%	-7,869	-8,316	-8,816	-9,358	-9,935	-10,542	-11,174
5.33%	-19,696	-19,883	-20,127	-20,427	-20,777	-21,173	-21,609
8.00%	-32,188	-32,242	-32,332	-32,461	-32,634	-32,850	-33,109
KR4201N232 2018-02 콜327.5							19,094
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	7,336	7,241	7,115	6,958	6,772	6,561	6,326
-5.33%	6,786	6,524	6,232	5,916	5,580	5,227	4,861
-2.67%	5,054	4,613	4,165	3,713	3,257	2,798	2,336
0%	1,411	943	473	0	-474	-950	-1,427
2.67%	-4,165	-4,489	-4,838	-5,208	-5,594	-5,994	-6,404
5.33%	-11,002	-11,154	-11,343	-11,564	-11,815	-12,091	-12,390
8.00%	-18,387	-18,437	-18,513	-18,616	-18,748	-18,908	-19,094
KR4301N232 2018-02 풋325							23,926
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-23,837	-23,839	-23,844	-23,853	-23,868	-23,892	-23,926
-5.33%	-13,021	-13,084	-13,170	-13,277	-13,404	-13,549	-13,712
-2.67%	-3,655	-3,960	-4,271	-4,586	-4,904	-5,224	-5,547
0%	717	495	255	0	-266	-542	-825
2.67%	1,368	1,339	1,295	1,232	1,151	1,051	933
5.33%	1,391	1,391	1,388	1,383	1,373	1,357	1,332
8.00%	1,392	1,392	1,392	1,391	1,391	1,390	1,387
KR4301N232 2018-02 풋327.5							9,292
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-9,276	-9,276	-9,277	-9,278	-9,281	-9,285	-9,292
-5.33%	-5,404	-5,415	-5,431	-5,453	-5,483	-5,518	-5,560
-2.67%	-1,807	-1,893	-1,984	-2,080	-2,179	-2,281	-2,385
0%	323	218	110	0	-112	-225	-339
2.67%	785	763	732	694	649	596	537

5.33%	811	810	808	803	796	785	770
8.00%	811	811	811	811	811	809	807

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

89,535

공시일	2018-01-25
기준일	2018-01-24

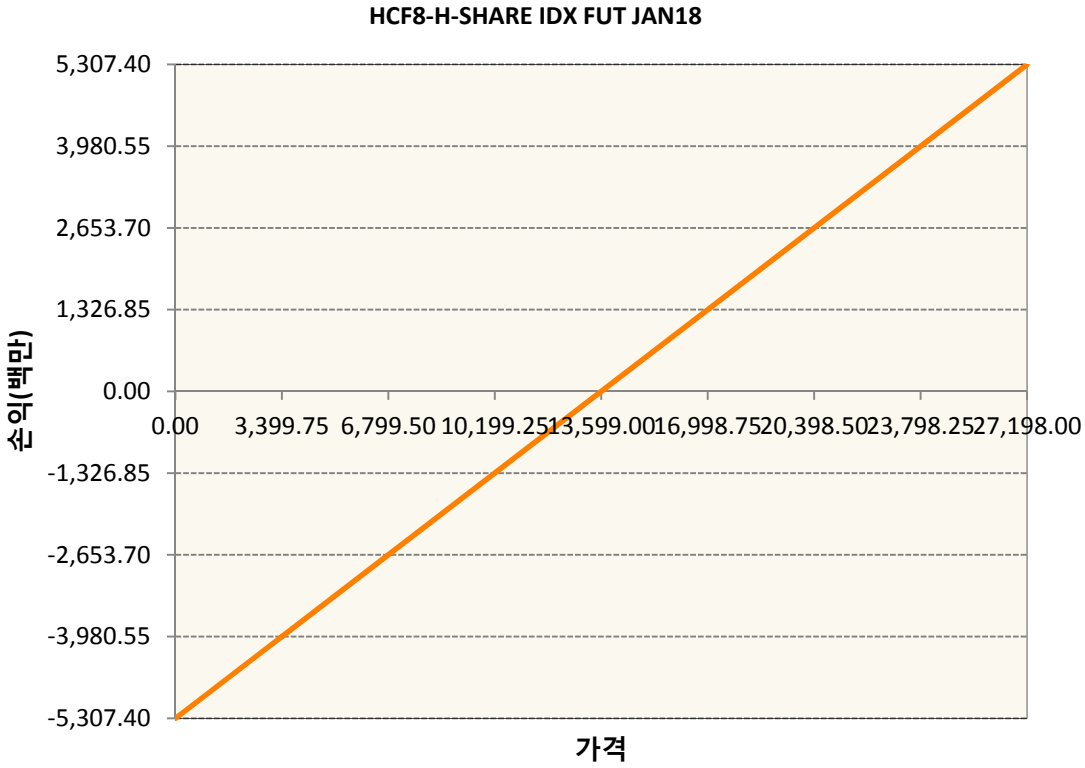
홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생

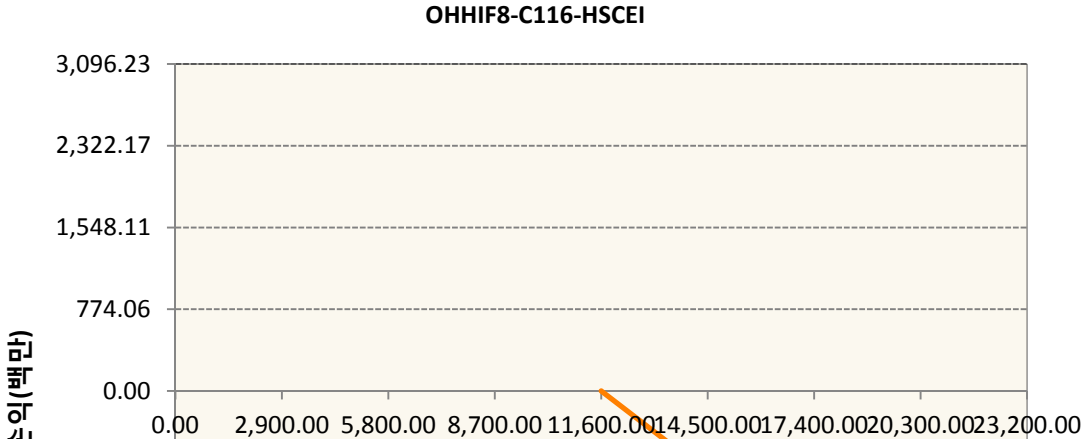
1. 계약금액

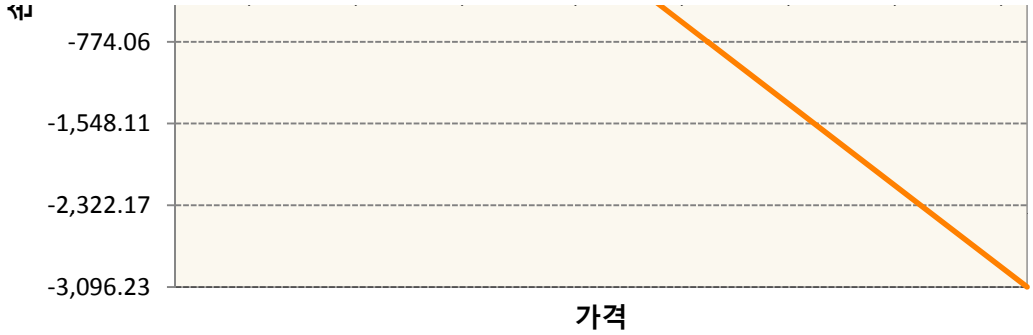
(단위:백만원)

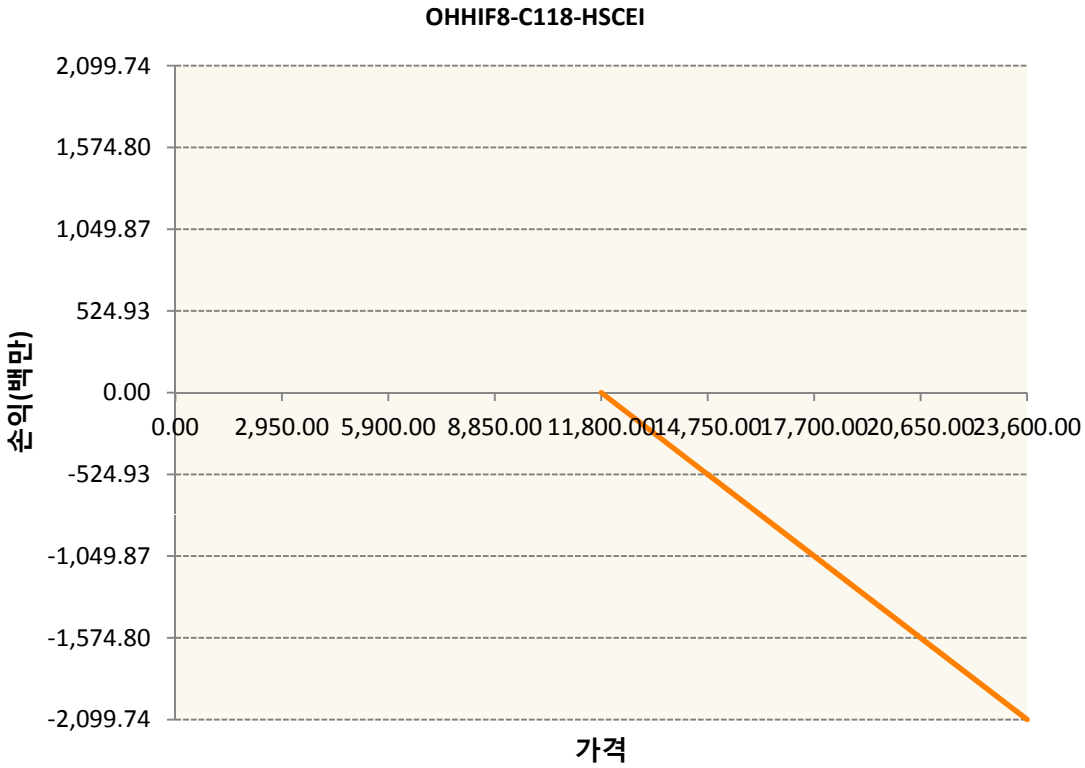
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	5,307	0	5,307	장내
누계	유가증권	옵션	0	10,392	-10,392	장내

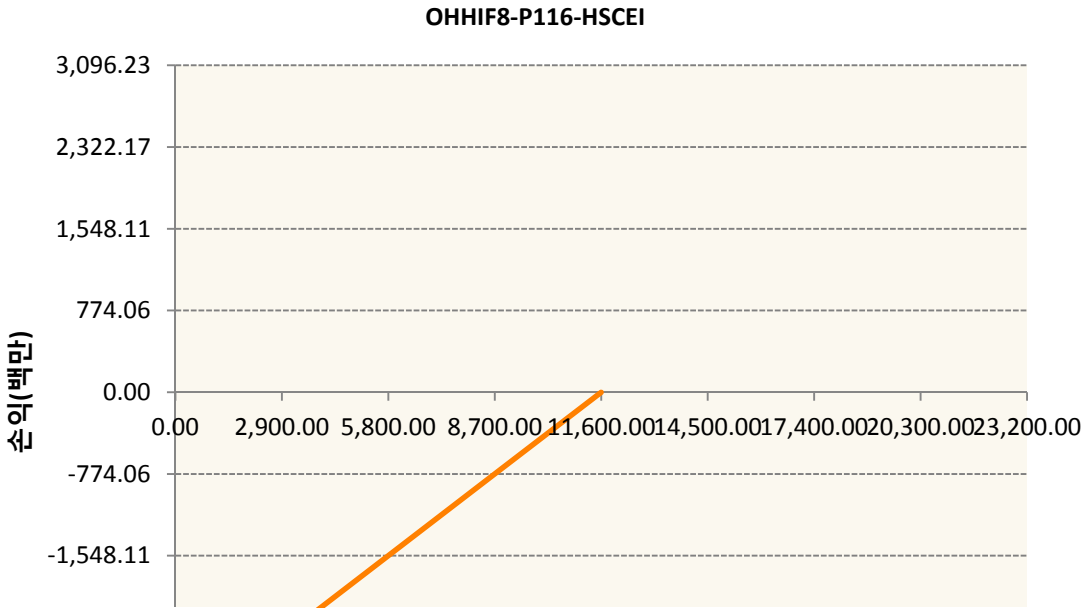
2. 만기시점의 손익구조

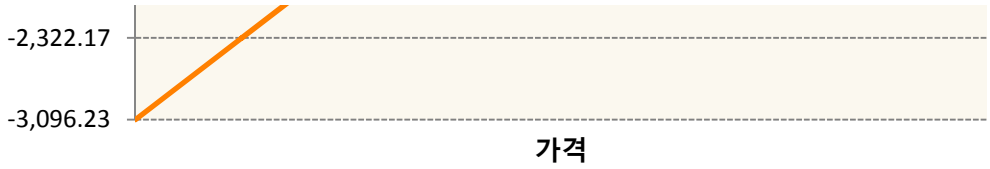


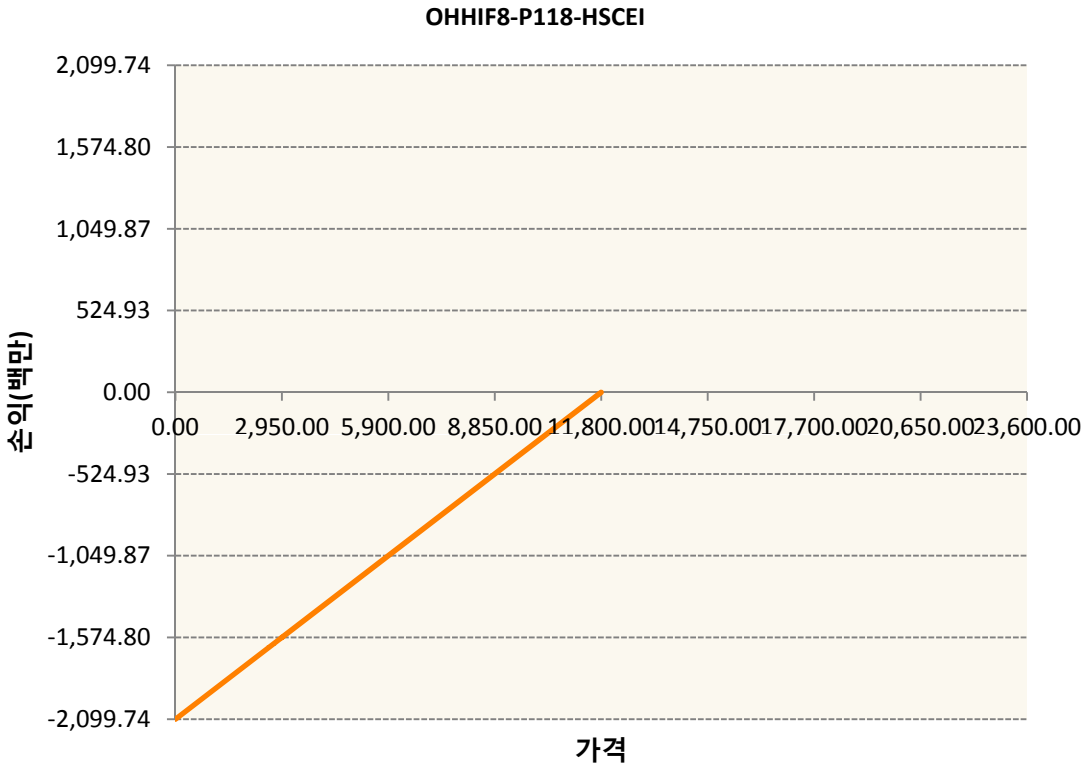



-774.06
-1,548.11
-2,322.17
-3,096.23
가격


OHHIF8-C118-HSCEI
2,099.74
1,574.80
1,049.87
524.93
0.00
-524.93
-1,049.87
-1,574.80
-2,099.74
손익(백만)
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
가격


OHHIF8-P116-HSCEI
3,096.23
2,322.17
1,548.11
774.06
0.00
-774.06
-1,548.11
손익(백만)
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





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCF8	H-SHARE IDX FUT JAN18	425
OHHIF8-C11	HSCEI	248
OHHIF8-C11	HSCEI	168
OHHIF8-P11	HSCEI	248
OHHIF8-P11	HSCEI	168

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,002

공시일	2018-01-25
기준일	2018-01-24

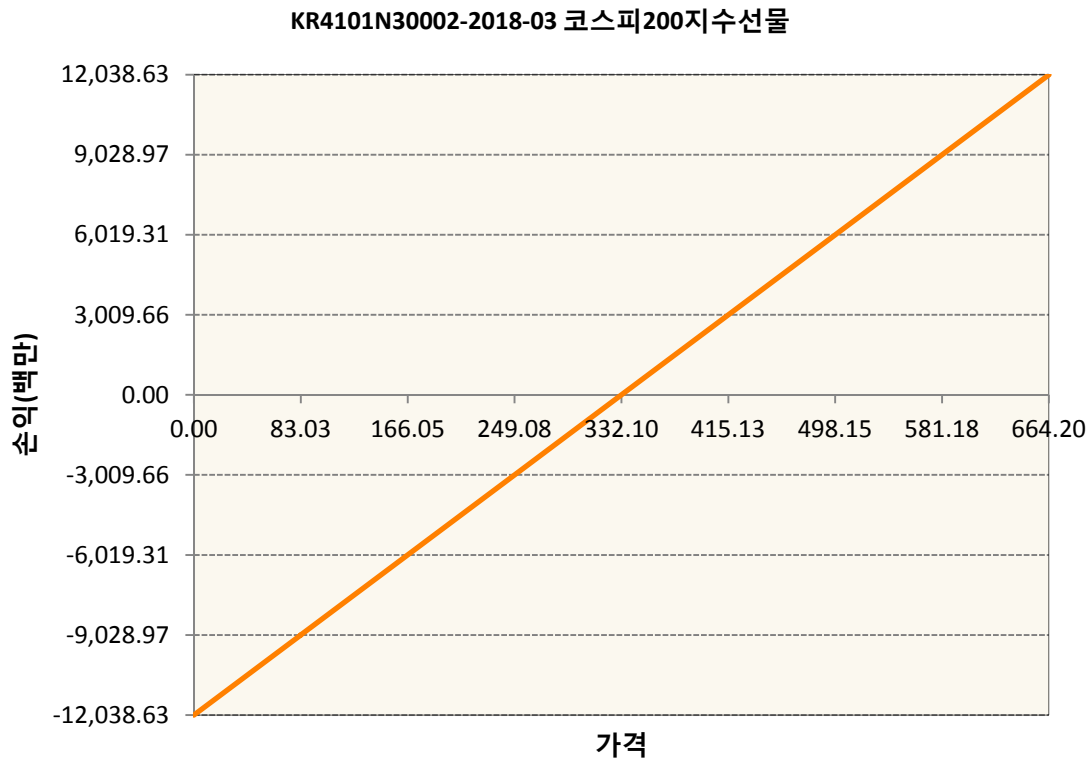
코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼

1. 계약금액

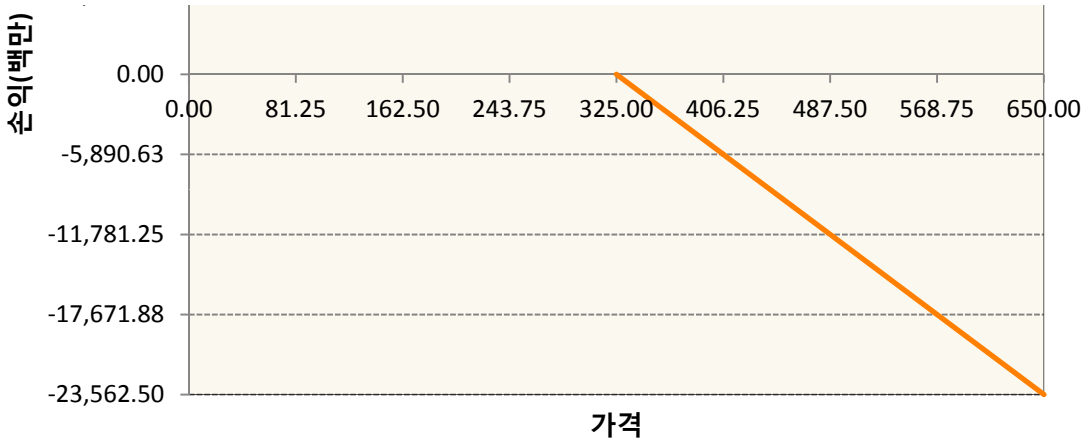
(단위:백만원)

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	12,039	0	12,039	장내
누계	유가증권	스왑	60,200	0	60,200	장외
누계	유가증권	옵션	0	60,250	-60,250	장내

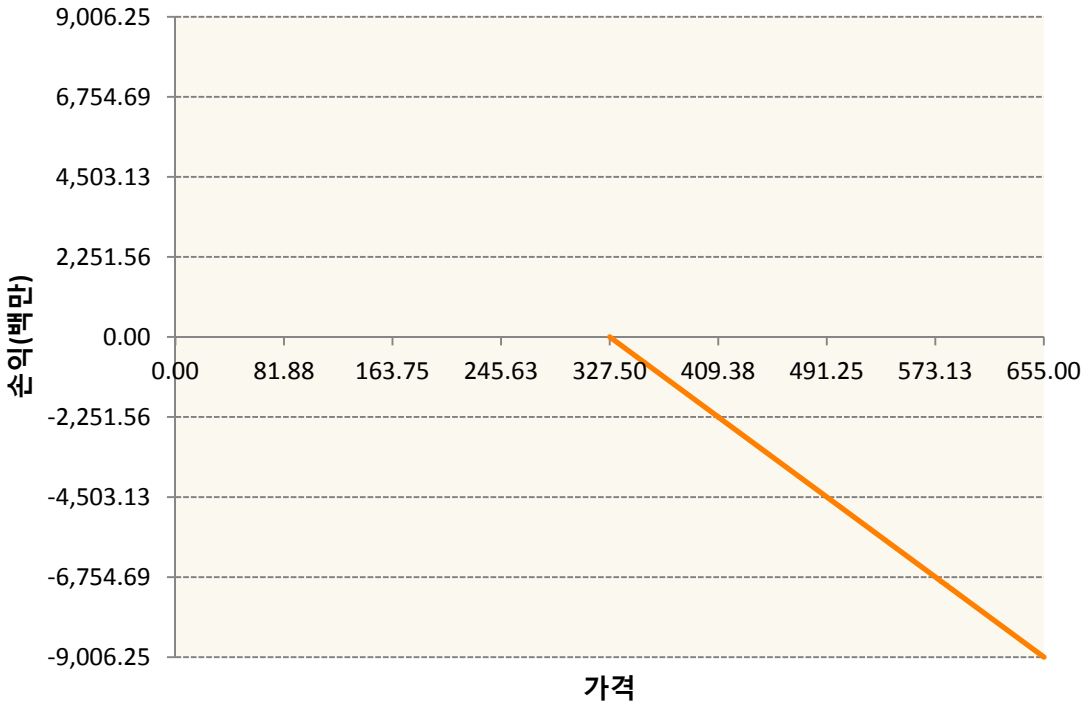
2. 만기시점의 손익구조



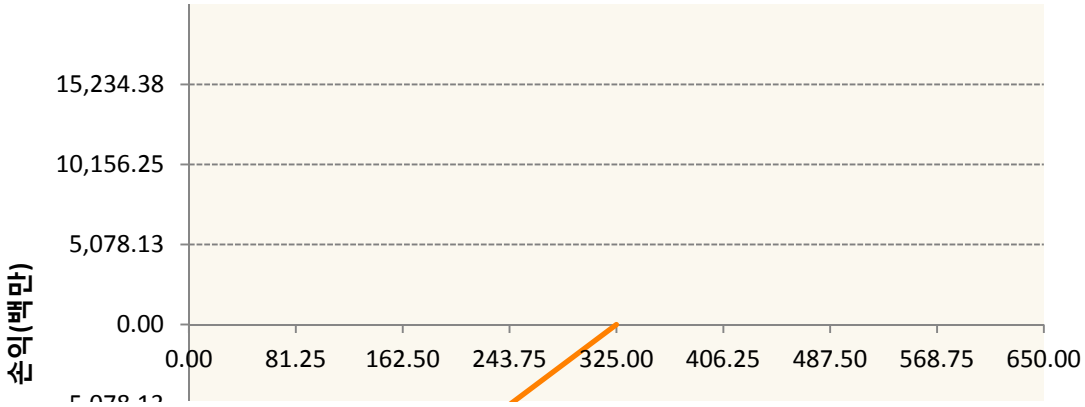




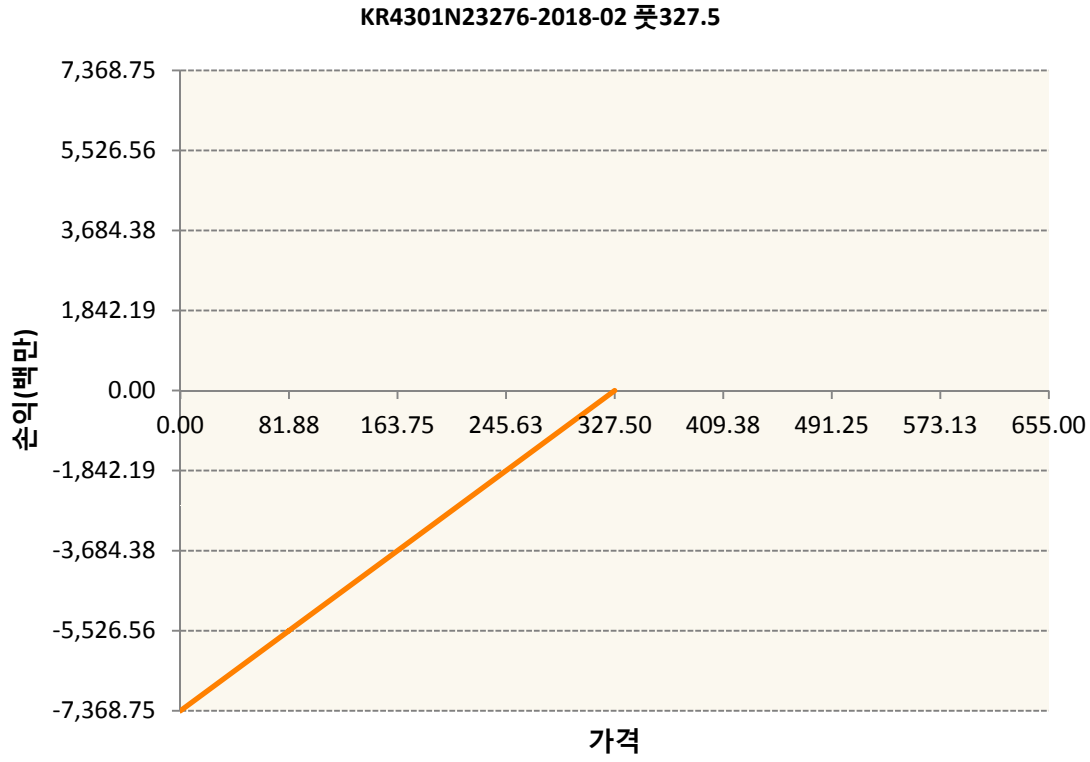
KR4201N23278-2018-02 콜327.5



KR4301N23250-2018-02 풋325







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_2							1,451
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,451	-1,451	-1,451	-1,451	-1,451	-1,451	-1,451
-5.33%	-968	-968	-968	-968	-968	-968	-968
-2.67%	-484	-484	-484	-484	-484	-484	-484
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	484	484	484	484	484	484	484
5.33%	968	968	968	968	968	968	968
8.00%	1,451	1,451	1,451	1,451	1,451	1,451	1,451
2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_3							275
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%

-8.00%	-275	-275	-275	-275	-275	-275	-275
-5.33%	-183	-183	-183	-183	-183	-183	-183
-2.67%	-92	-92	-92	-92	-92	-92	-92
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	92	92	92	92	92	92	92
5.33%	183	183	183	183	183	183	183
8.00%	275	275	275	275	275	275	275
	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%	-310	-310	-310	-310	-310	-310	-310
-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%	310	310	310	310	310	310	310
8.00%	464	464	464	464	464	464	464
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_9						310
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-310	-310	-310	-310	-310	-310	-310
-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%	310	310	310	310	310	310	310
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_10						275
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-275	-275	-275	-275	-275	-275	-275
-5.33%	-183	-183	-183	-183	-183	-183	-183
-2.67%	-92	-92	-92	-92	-92	-92	-92
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	92	92	92	92	92	92	92
5.33%	183	183	183	183	183	183	183
8.00%	275	275	275	275	275	275	275
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_11						628
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-628	-628	-628	-628	-628	-628	-628
-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%	628	628	628	628	628	628	628
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_12						471

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-471	-471	-471	-471	-471	-471	-471
-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%	471	471	471	471	471	471	471
	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						1,667

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	721	710	696	680	661	640	618
-5.33%	655	628	600	570	538	506	472
-2.67%	469	429	390	350	311	271	232
0%	112	75	38	0	-38	-77	-116
2.67%	-396	-419	-444	-471	-500	-531	-563
5.33%	-992	-1,001	-1,013	-1,028	-1,046	-1,066	-1,088
8.00%	-1,621	-1,623	-1,628	-1,634	-1,643	-1,654	-1,667
	KR4201N232 2018-02 콜327.5						611

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	235	232	228	222	217	210	202
-5.33%	217	209	199	189	178	167	155
-2.67%	162	147	133	119	104	89	75
0%	45	30	15	0	-15	-30	-46
2.67%	-133	-144	-155	-167	-179	-192	-205
5.33%	-352	-357	-363	-370	-378	-387	-396
8.00%	-588	-590	-592	-595	-600	-605	-611
	KR4301N232 2018-02 풋325						1,211

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,206	-1,206	-1,207	-1,207	-1,208	-1,209	-1,211
-5.33%	-659	-662	-666	-672	-678	-686	-694

-2.67%	-185	-200	-216	-232	-248	-264	-281
0%	36	25	13	0	-13	-27	-42
2.67%	69	68	66	62	58	53	47
5.33%	70	70	70	70	70	69	67
8.00%	70	70	70	70	70	70	70
	KR4301N232 2018-02 풋327.5						475
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-474	-474	-474	-474	-475	-475	-475
-5.33%	-276	-277	-278	-279	-280	-282	-284
-2.67%	-92	-97	-101	-106	-111	-117	-122
0%	17	11	6	0	-6	-12	-17
2.67%	40	39	37	35	33	30	27
5.33%	41	41	41	41	41	40	39
8.00%	41	41	41	41	41	41	41

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

9,441

공시일	2018-01-25
기준일	2018-01-24

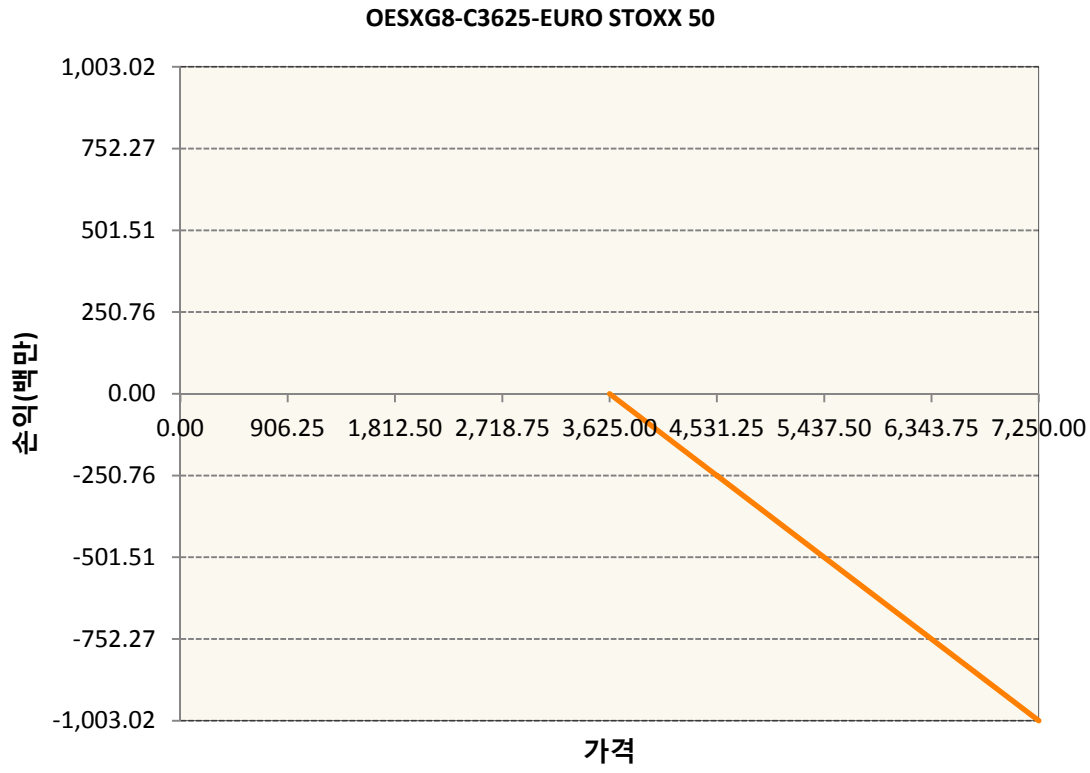
유로커버드콜모(주식혼합-파생형

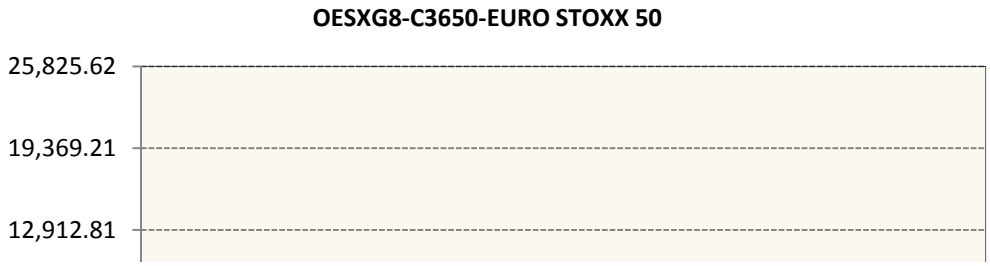
1. 계약금액

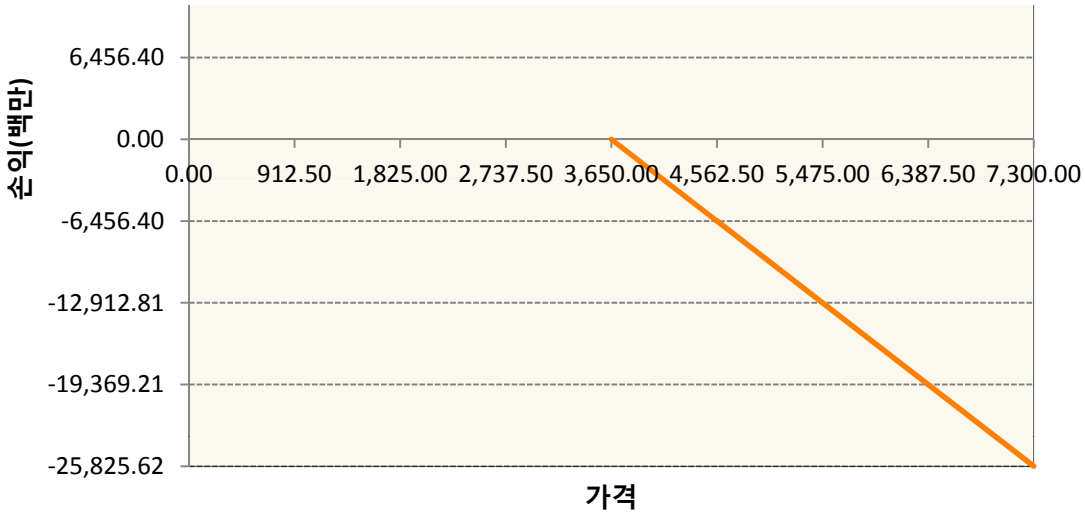
(단위:백만원)

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	17,871	0	17,871	
누계	유가증권	스왑	98,822	0	98,822	장외
누계	유가증권	옵션	0	53,657	-53,657	장내
누계	지수	스왑	52,706	0	52,706	장외

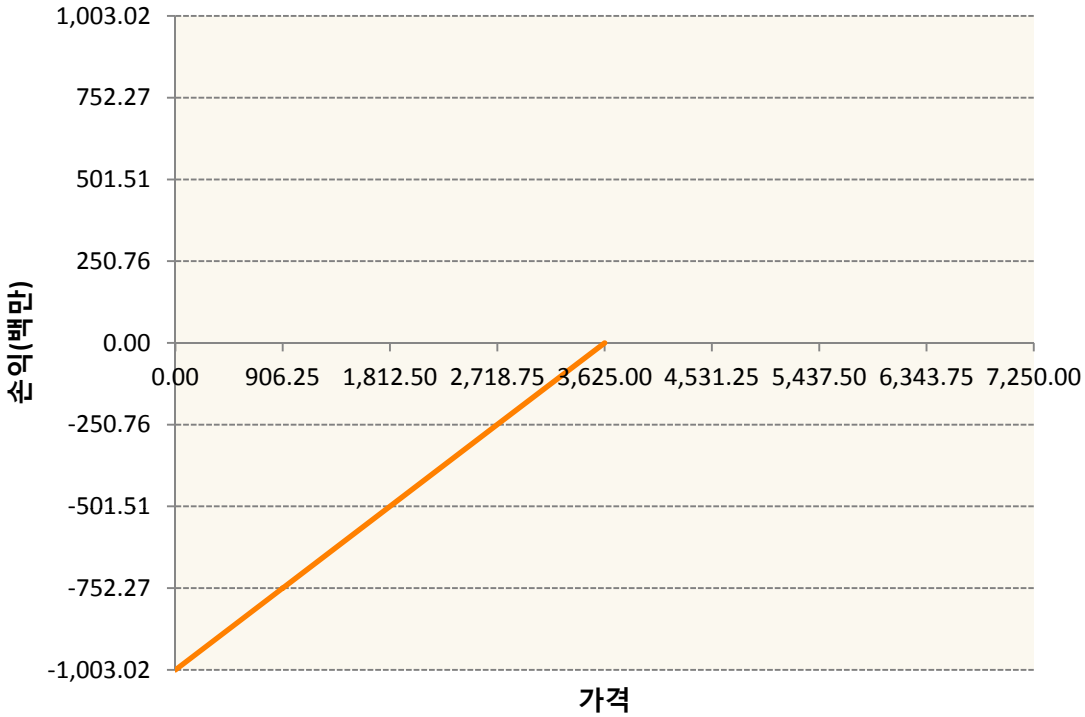
2. 만기시점의 손익구조



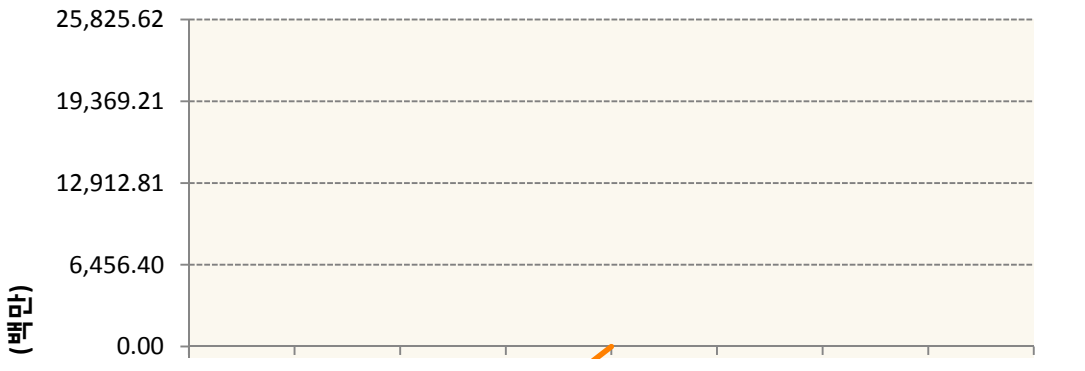


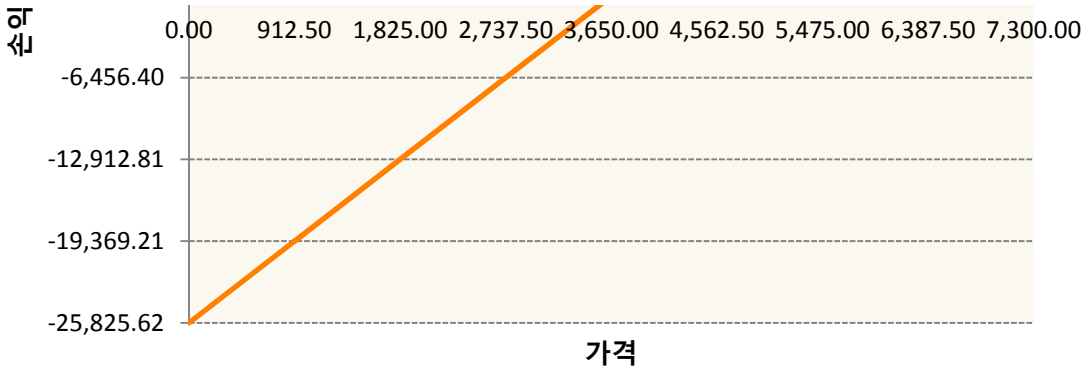


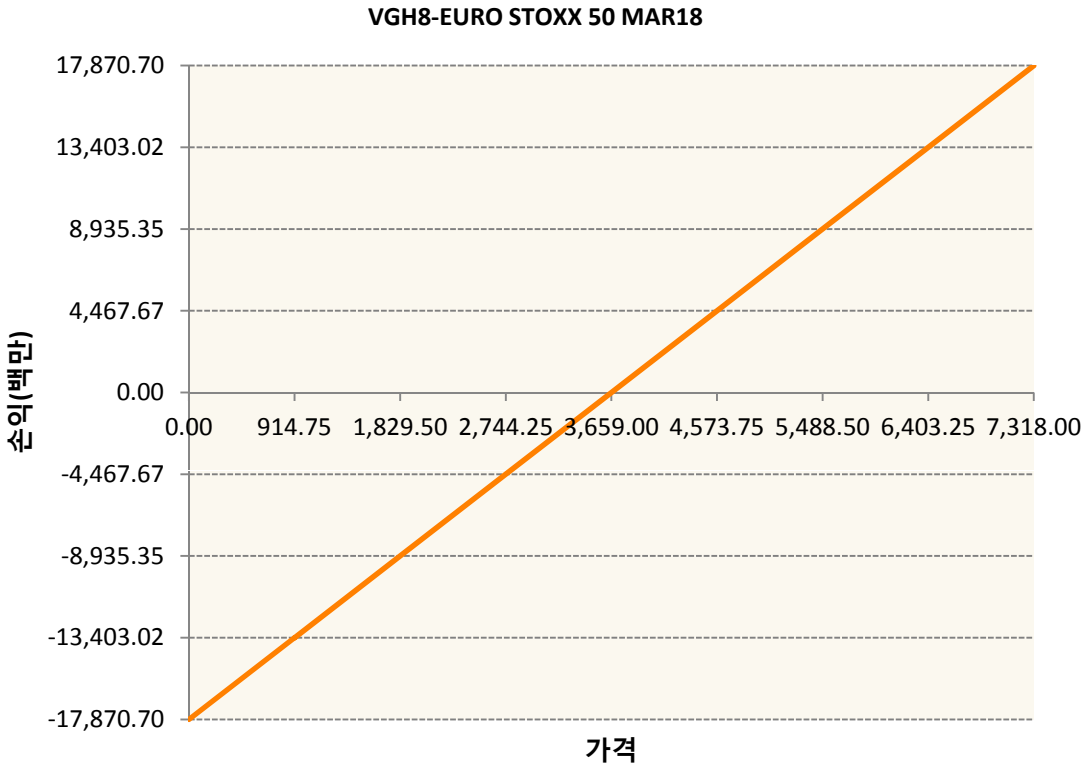
OESXG8-P3625-EURO STOXX 50



OESXG8-P3650-EURO STOXX 50







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)	(단위:백만원)
260105SGPX SG EURO Covered CALL STRATEGY - 994.569	14
260105SQPX SG EURO Covered CALL STRATEGY	27
OESXG8-C3(EURO STOXX 50	80
OESXG8-C3(EURO STOXX 50	2,066
OESXG8-P3(EURO STOXX 50	80
OESXG8-P3(EURO STOXX 50	2,066
VGH8 EURO STOXX 50 MAR18	1,430

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

3,209

공시일	2018-01-25
기준일	2018-01-24

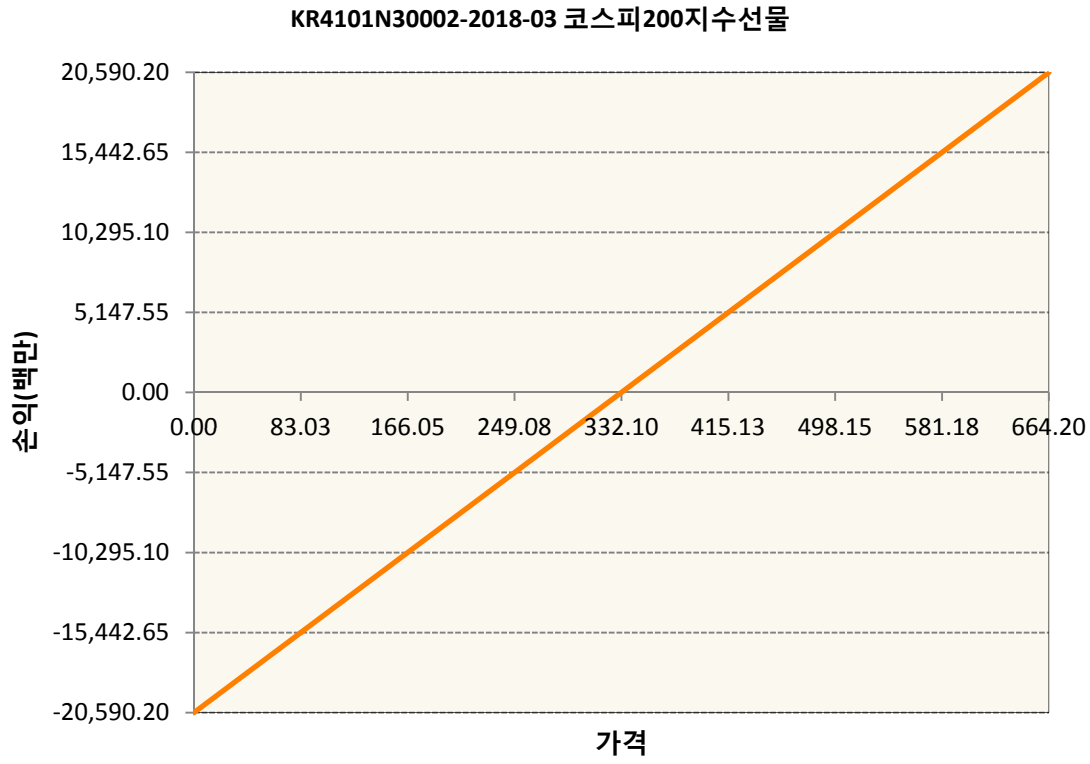
ETF스마트레버리지목표전환형8호

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	20,590	0	20,590	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)

980

공시일	2018-01-25
기준일	2018-01-24

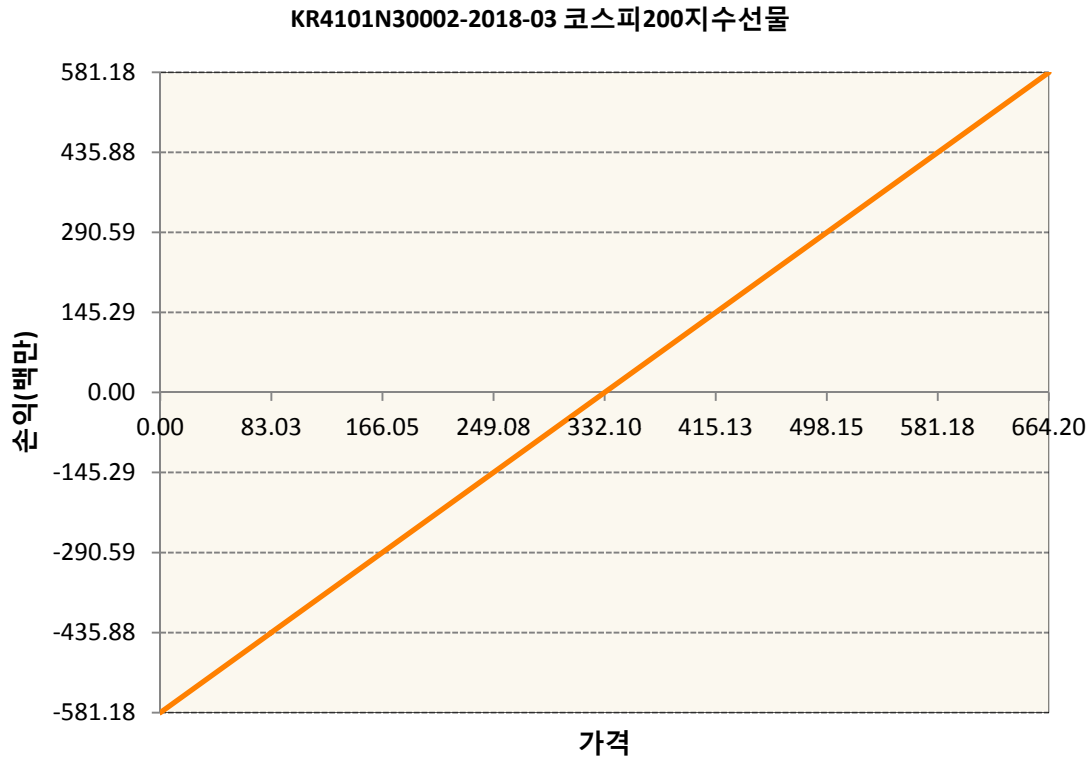
ETF스마트레버리지목표전환형9호

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	2018-01-25
기준일	2018-01-24

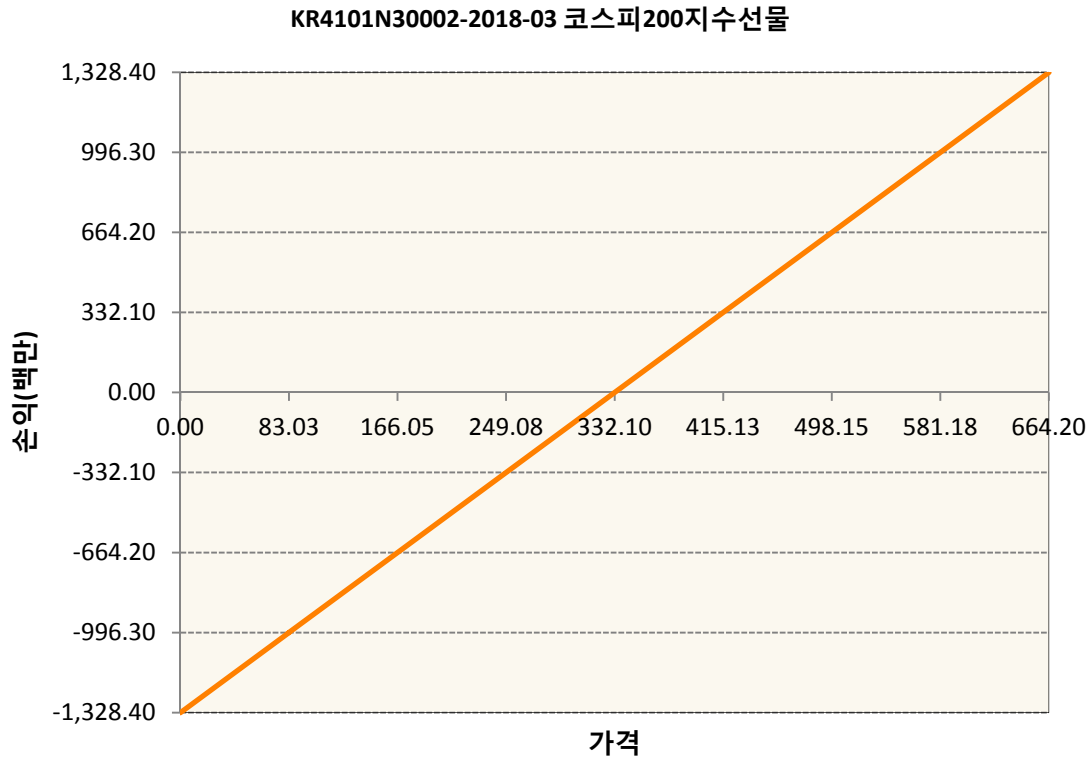
ETF스마트레버리지목표전환형10

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	1,328	0	1,328	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	2018-01-25
기준일	2018-01-24

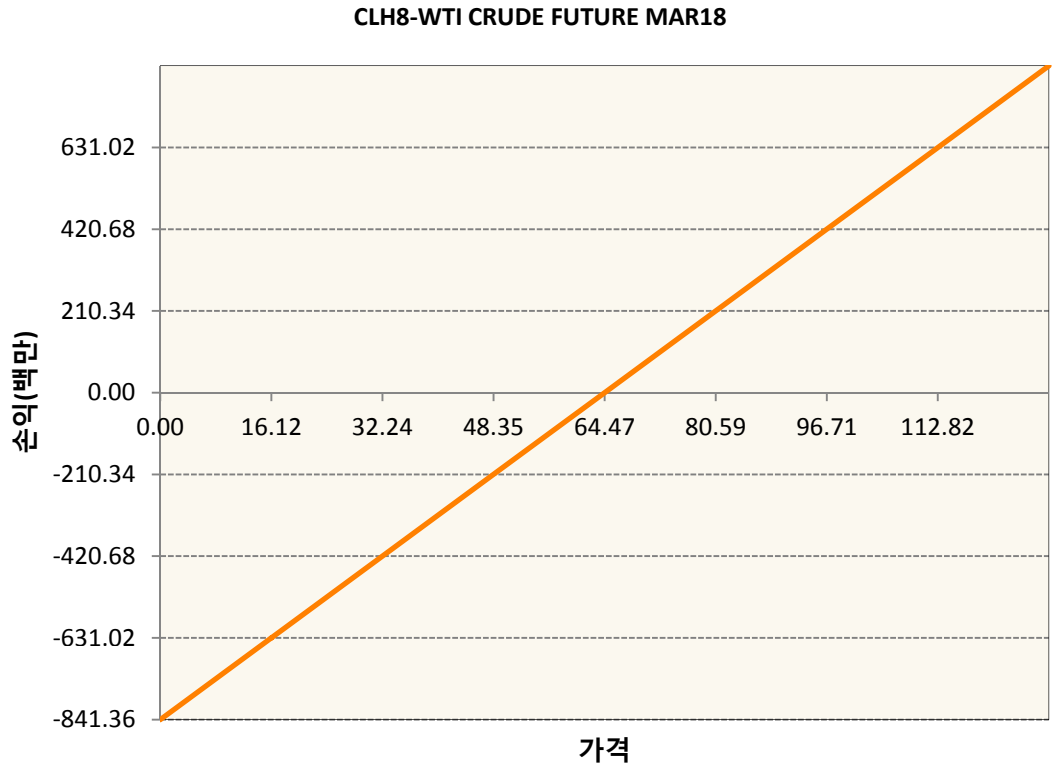
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

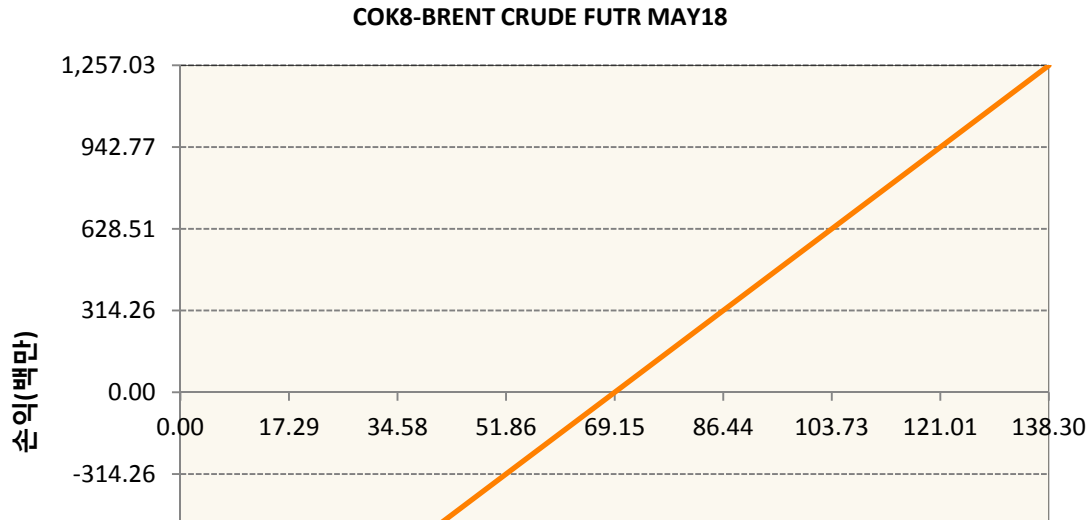
1. 계약금액

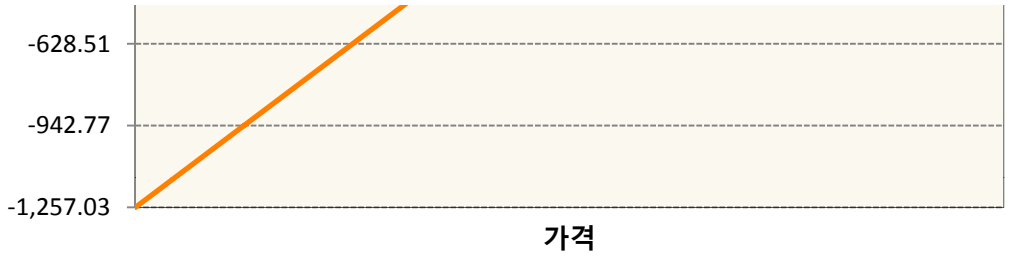
(단위:백만원)

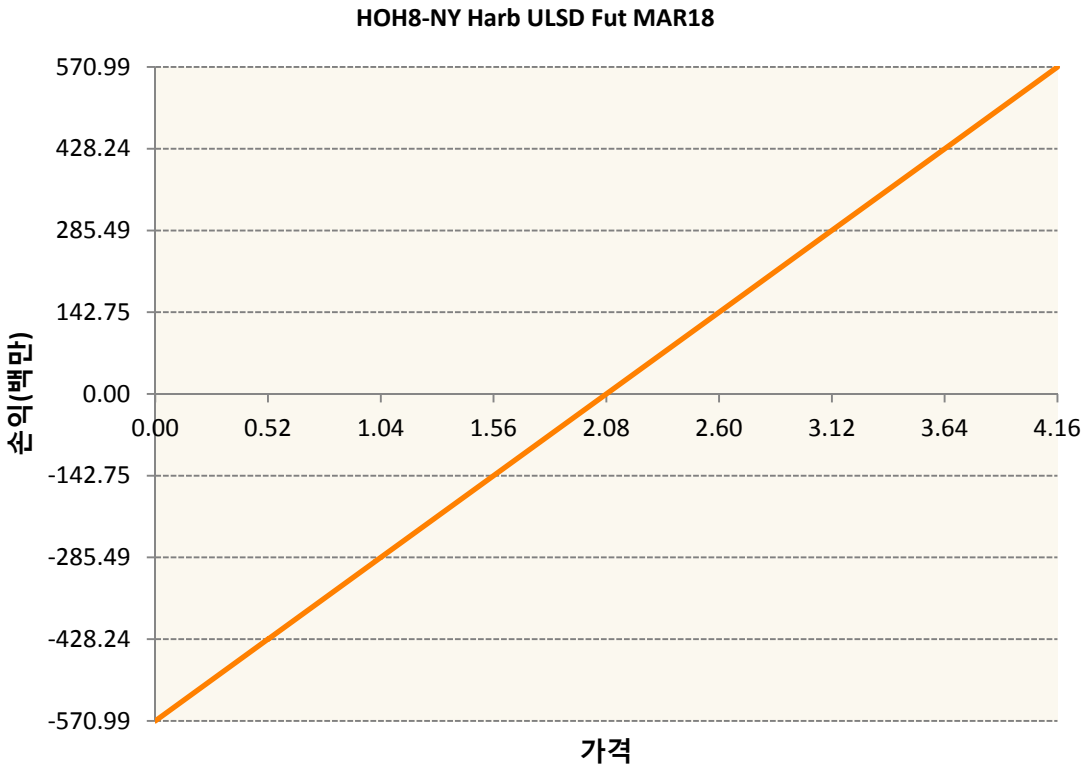
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	4,531	856	3,676	

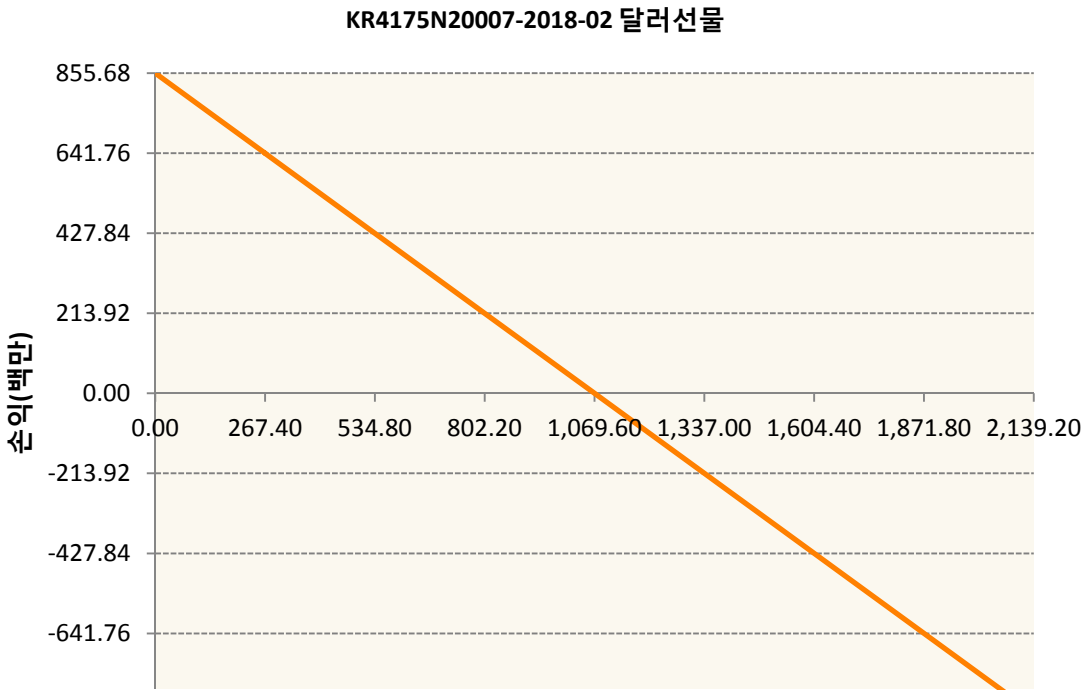
2. 만기시점의 손익구조

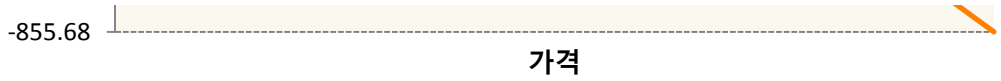


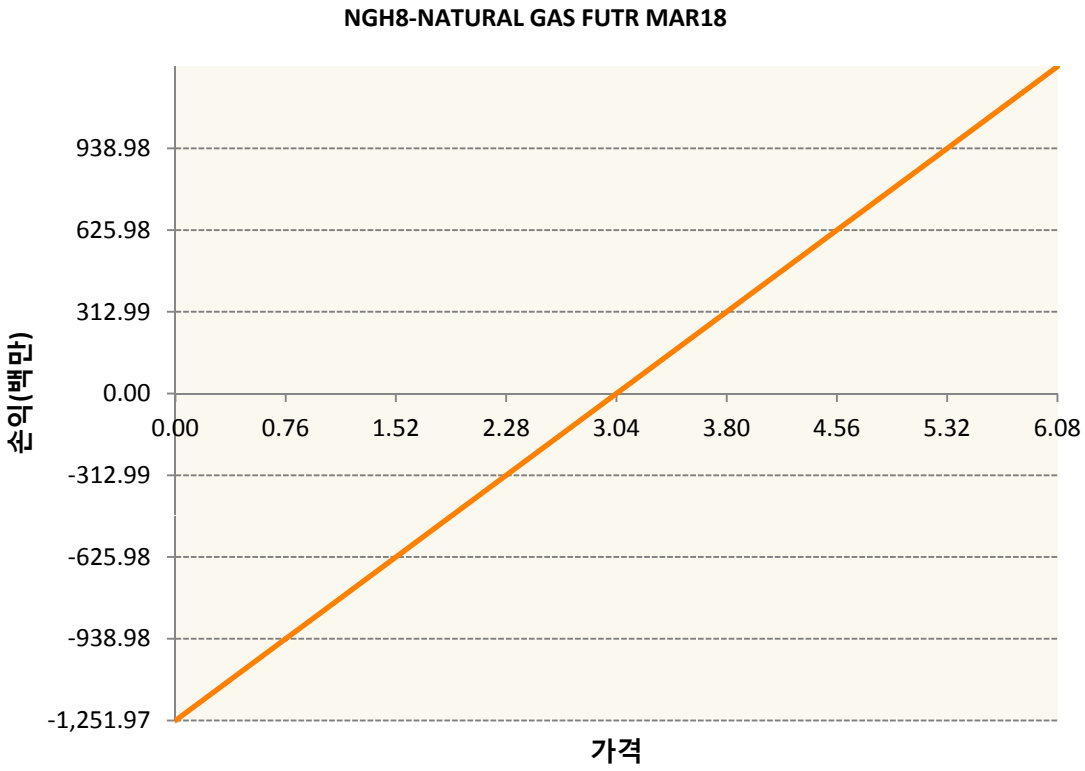


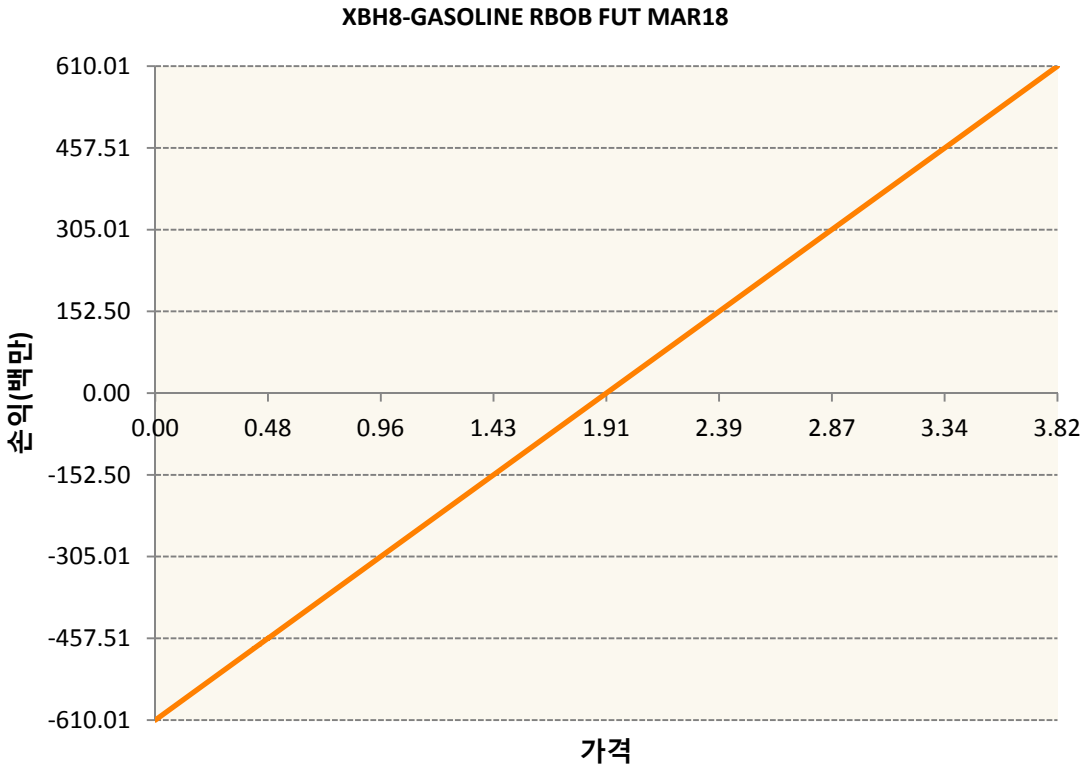

-628.51
-942.77
-1,257.03
가격


HOH8-NY Harb ULSD Fut MAR18
570.99
428.24
285.49
142.75
0.00
-142.75
-285.49
-428.24
-570.99
0.00
0.52
1.04
1.56
2.08
2.60
3.12
3.64
4.16
손익(백만)
가격


KR4175N20007-2018-02 달러선물
855.68
641.76
427.84
213.92
0.00
-213.92
-427.84
-641.76
0.00
267.40
534.80
802.20
1,069.60
1,337.00
1,604.40
1,871.80
2,139.20
손익(백만)


-855.68
가격


NGH8-NATURAL GAS FUTR MAR18
938.98
625.98
312.99
0.00
-312.99
-625.98
-938.98
-1,251.97
손익(백만)
0.00
0.76
1.52
2.28
3.04
3.80
4.56
5.32
6.08
가격


XBH8-GASOLINE RBOB FUT MAR18
610.01
457.51
305.01
152.50
0.00
-152.50
-305.01
-457.51
-610.01
손익(백만)
0.00
0.48
0.96
1.43
1.91
2.39
2.87
3.34
3.82
가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLH8	WTI CRUDE FUTURE MAR18	67
COK8	BRENT CRUDE FUTR MAY18	101
HOH8	NY Harb ULSD Fut MAR18	46
KR4175N20(	2018-02 달러선물	68
NGH8	NATURAL GAS FUTR MAR18	100
XBH8	GASOLINE RBOB FUT MAR18	49

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

614

공시일	2018-01-25
기준일	2018-01-24

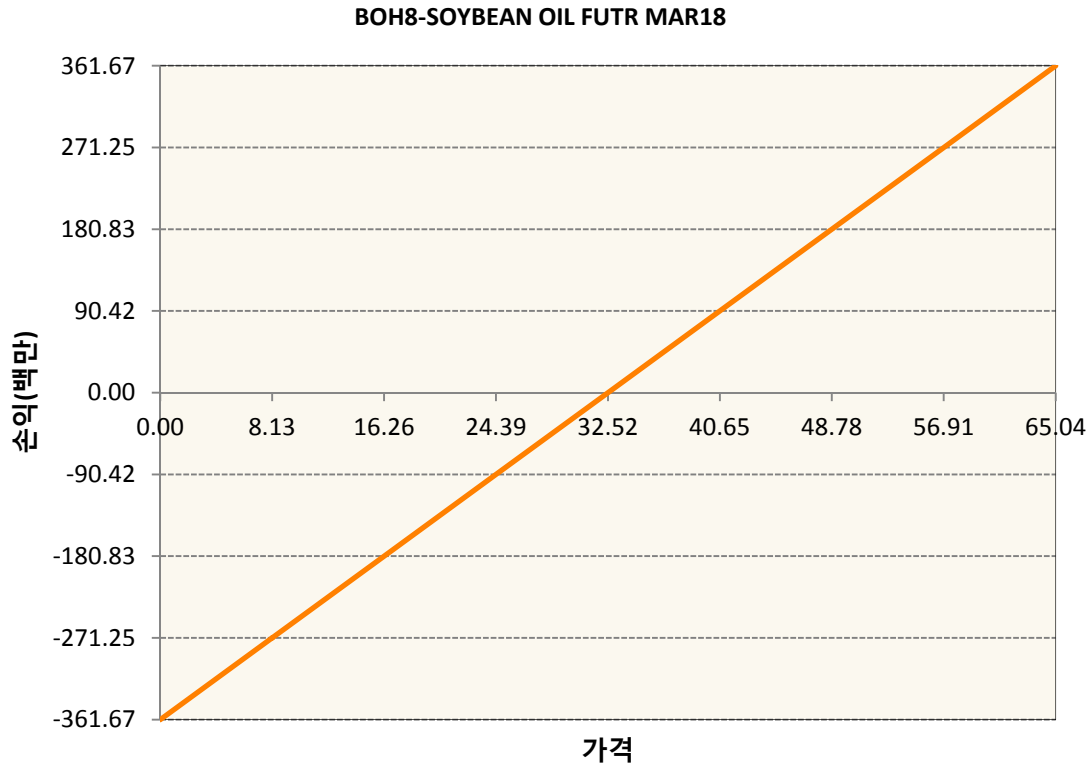
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

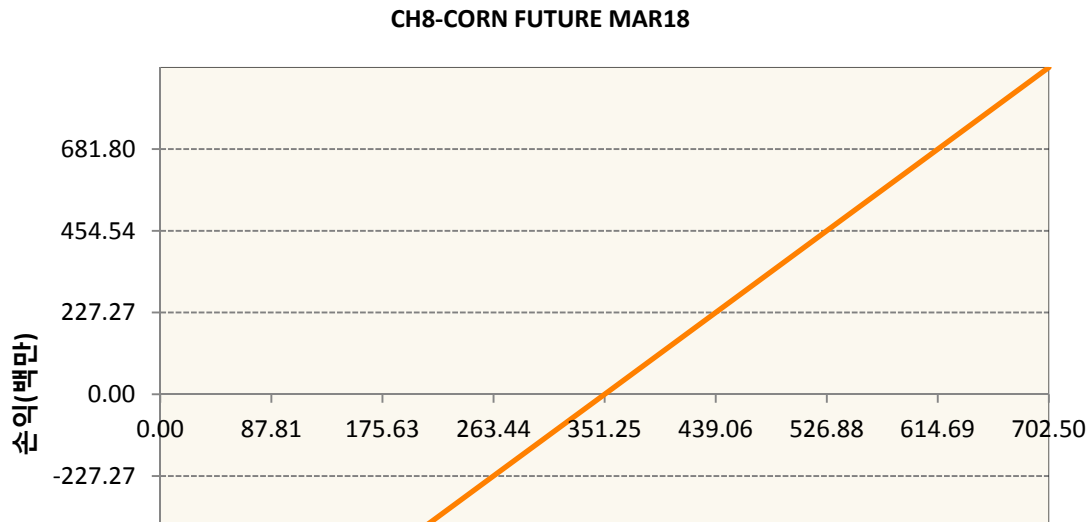
1. 계약금액

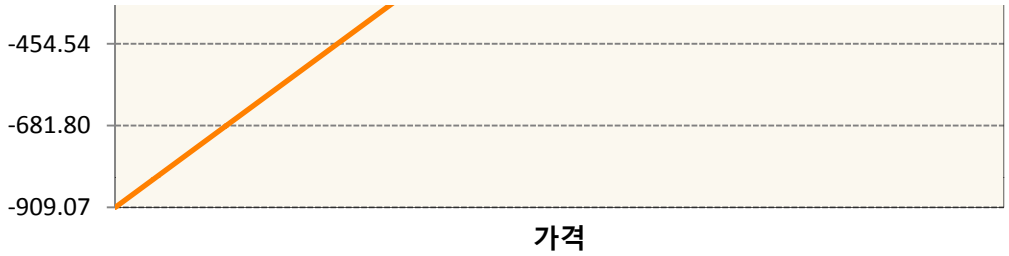
(단위:백만원)

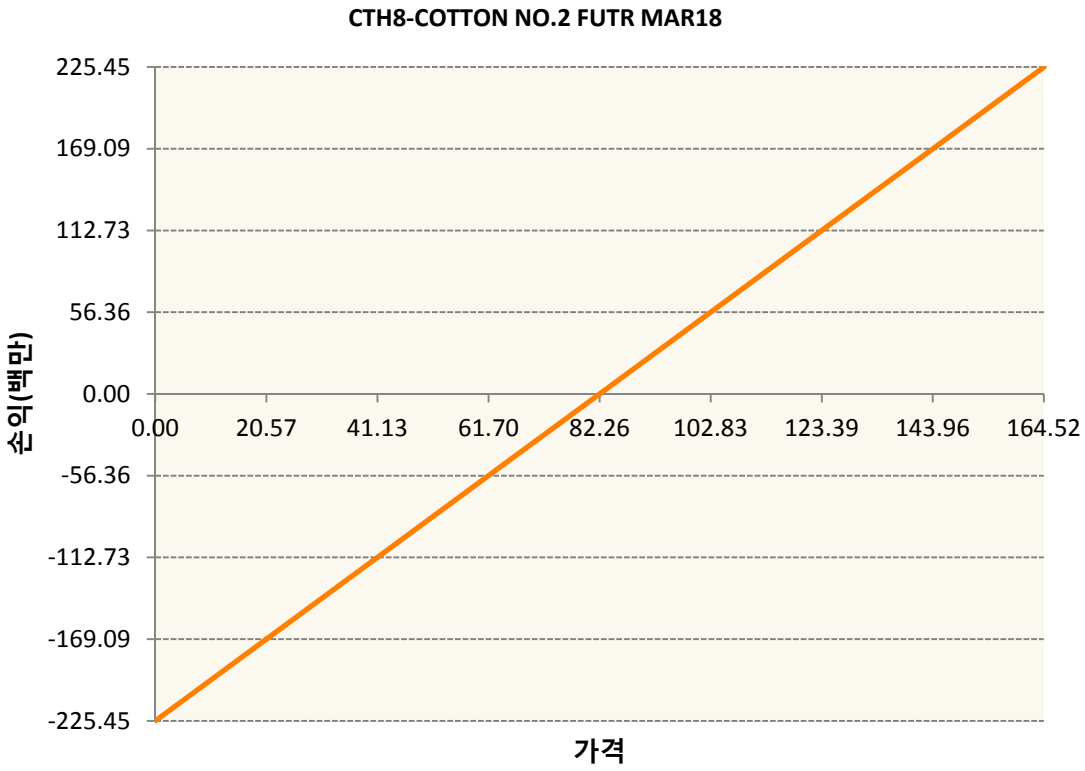
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	4,075	321	3,755	

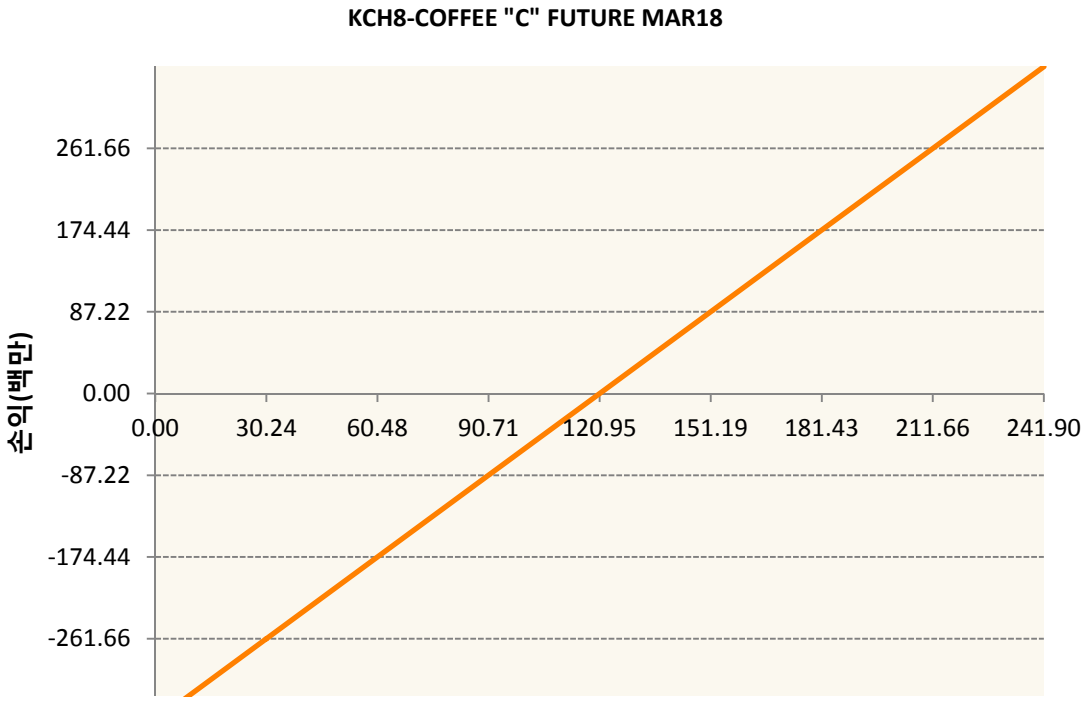
2. 만기시점의 손익구조

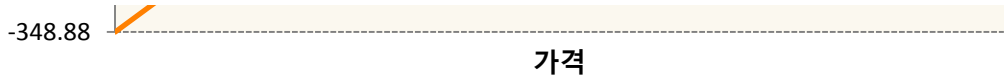


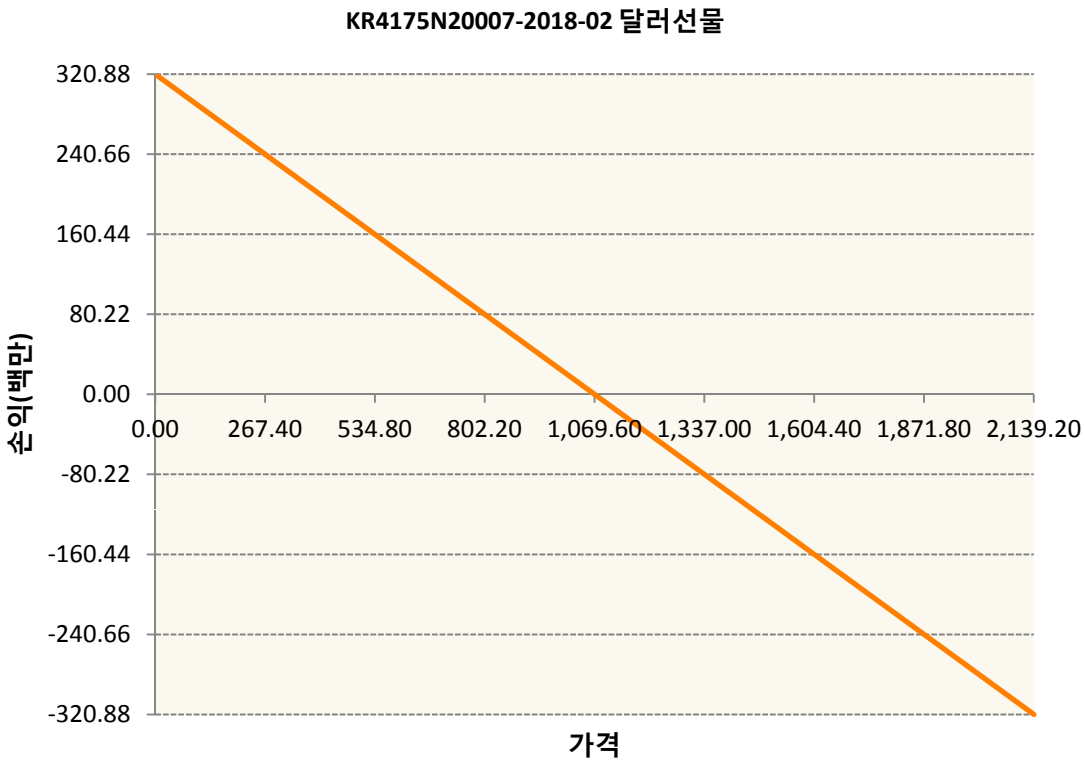


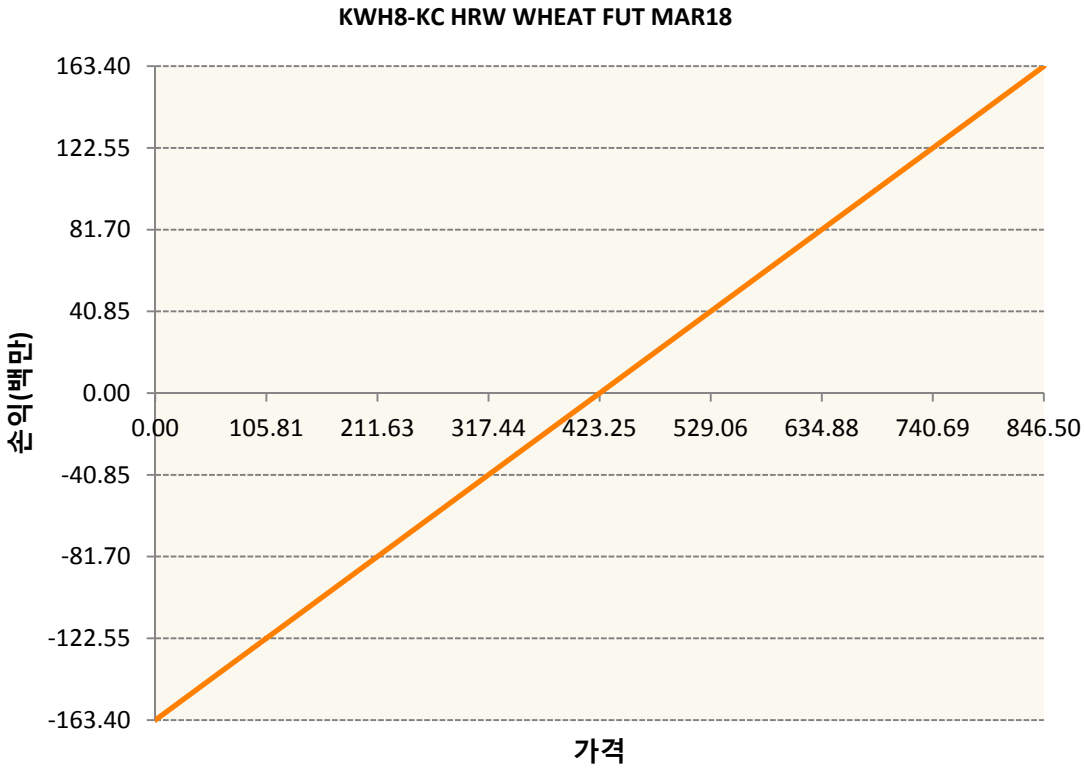

-454.54
-681.80
-909.07
가격


CTH8-COTTON NO.2 FUTR MAR18
225.45
169.09
112.73
56.36
0.00
-56.36
-112.73
-169.09
-225.45
0.00
20.57
41.13
61.70
82.26
102.83
123.39
143.96
164.52
손익(백만)
가격

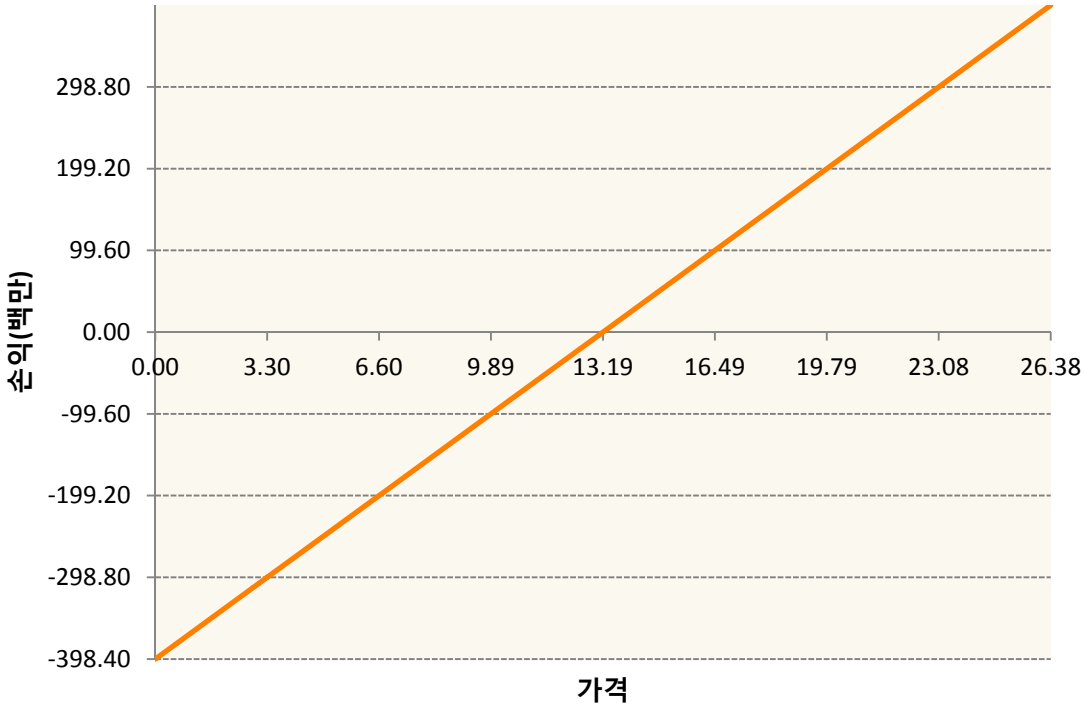

KCH8-COFFEE "C" FUTURE MAR18
261.66
174.44
87.22
0.00
-87.22
-174.44
-261.66
0.00
30.24
60.48
90.71
120.95
151.19
181.43
211.66
241.90
손익(백만)


-348.88
가격

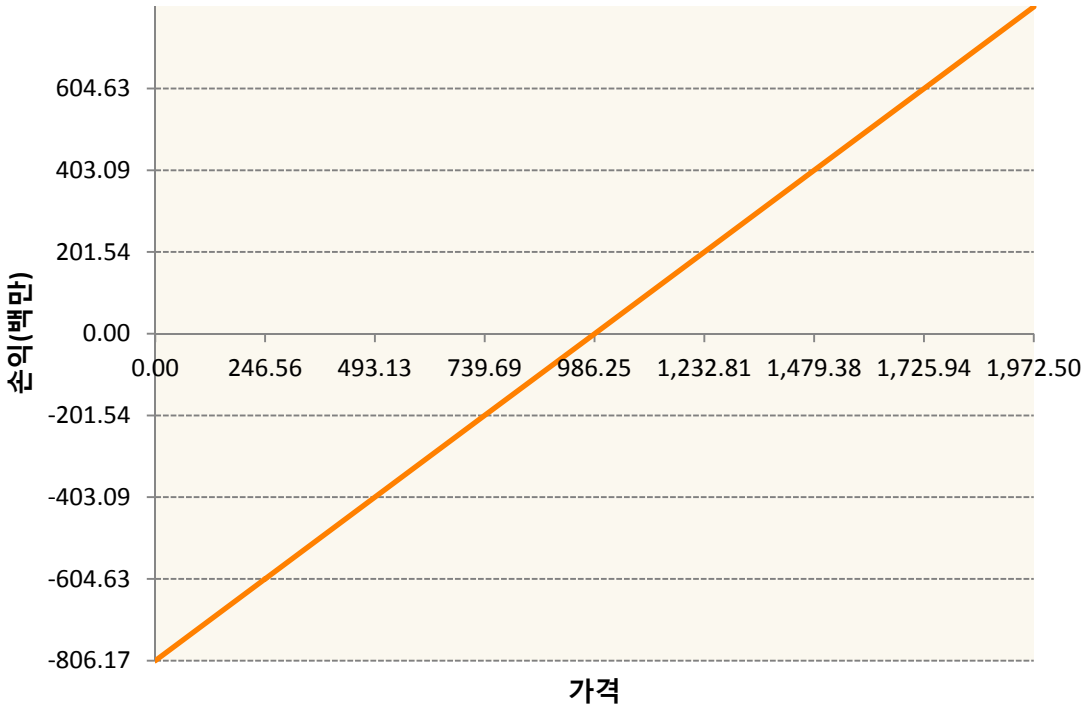

KR4175N20007-2018-02 달러선물
320.88
240.66
160.44
80.22
0.00
-80.22
-160.44
-240.66
-320.88
0.00
267.40
534.80
802.20
1,069.60
1,337.00
1,604.40
1,871.80
2,139.20
손익(백만)
가격


KWH8-KC HRW WHEAT FUT MAR18
163.40
122.55
81.70
40.85
0.00
-40.85
-81.70
-122.55
-163.40
0.00
105.81
211.63
317.44
423.25
529.06
634.88
740.69
846.50
손익(백만)
가격

SBH8-Sugar #11 (WORLD) MAR18

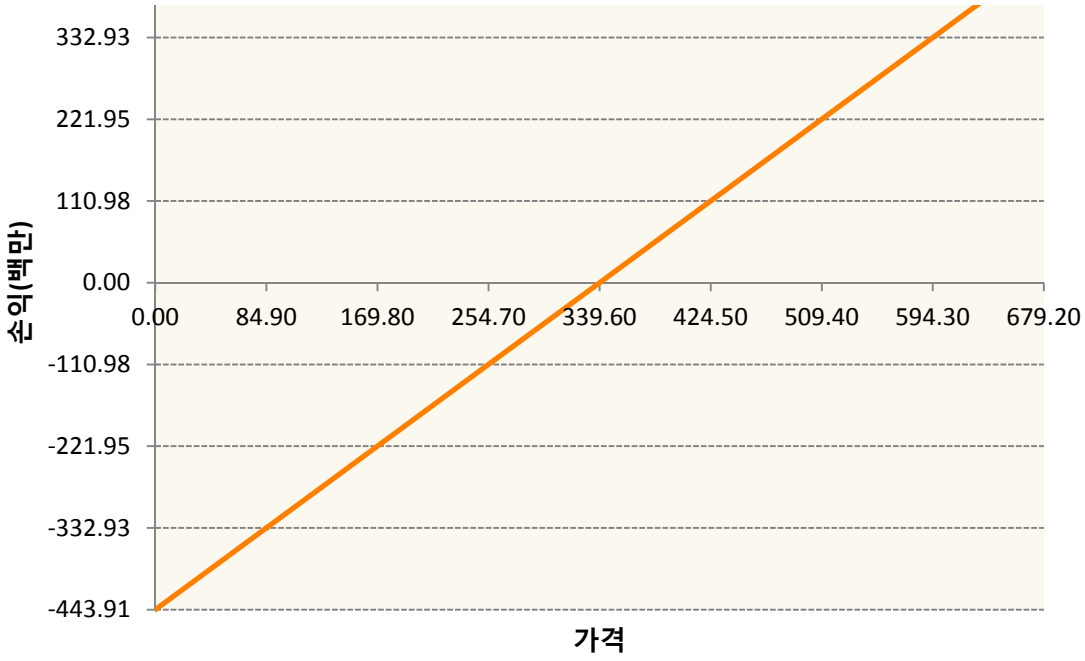


SH8-SOYBEAN FUTURE MAR18

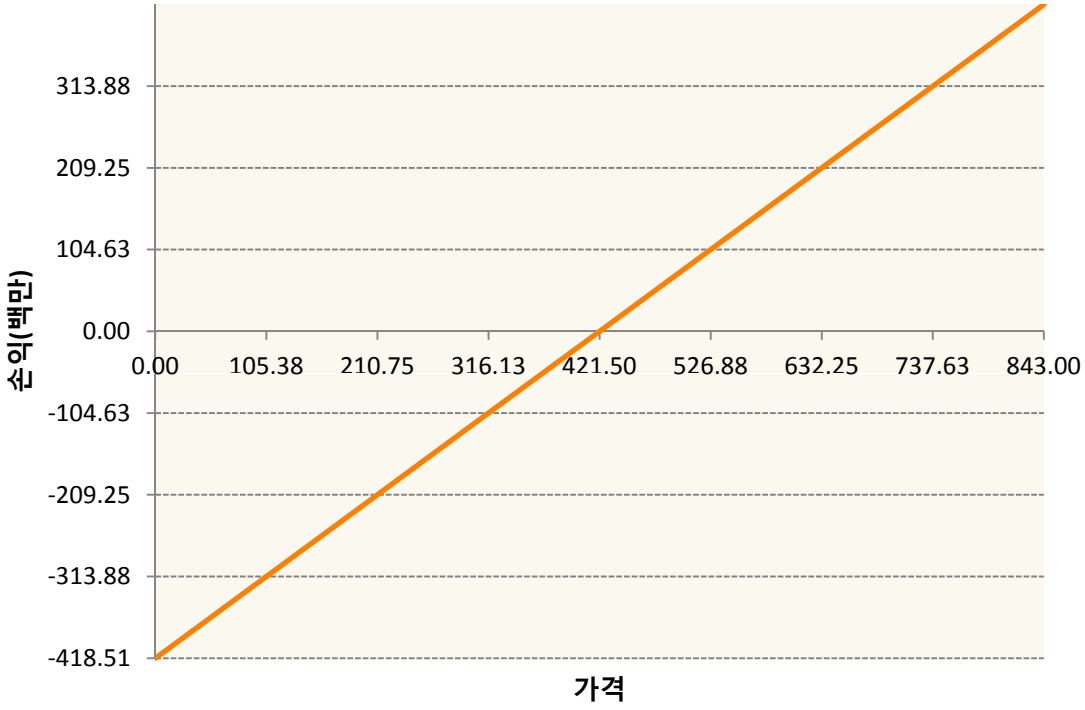


SMH8-SOYBEAN MEAL FUTR MAR18





WH8-WHEAT FUTURE(CBT) MAR18



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

BOH8	SOYBEAN OIL FUTR MAR18	29
CH8	CORN FUTURE MAR18	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	36
WH8	WHEAT FUTURE(CBT) MAR18	33

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

339