공시일	2018-01-26
기준일	2018-01-25

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	2018-01-26
기준일	2018-01-25

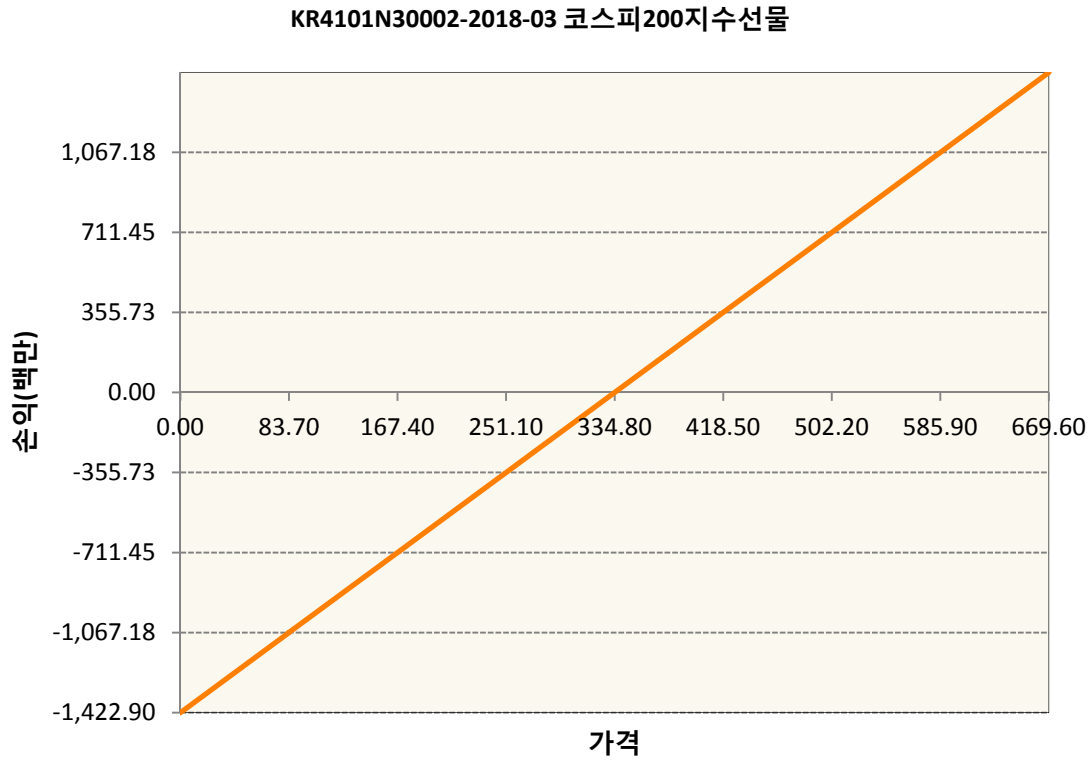
스마트인덱스모

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	1,423	0	1,423	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101N30(2018-03 코스피200지수선물							114
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-114	-114	-114	-114	-114	-114	-114
-5.33%	-76	-76	-76	-76	-76	-76	-76
-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%	76	76	76	76	76	76	76
8.00%	114	114	114	114	114	114	114

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

68

공시일	2018-01-26
기준일	2018-01-25

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	2018-01-26
기준일	2018-01-25

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	2018-01-26
기준일	2018-01-25

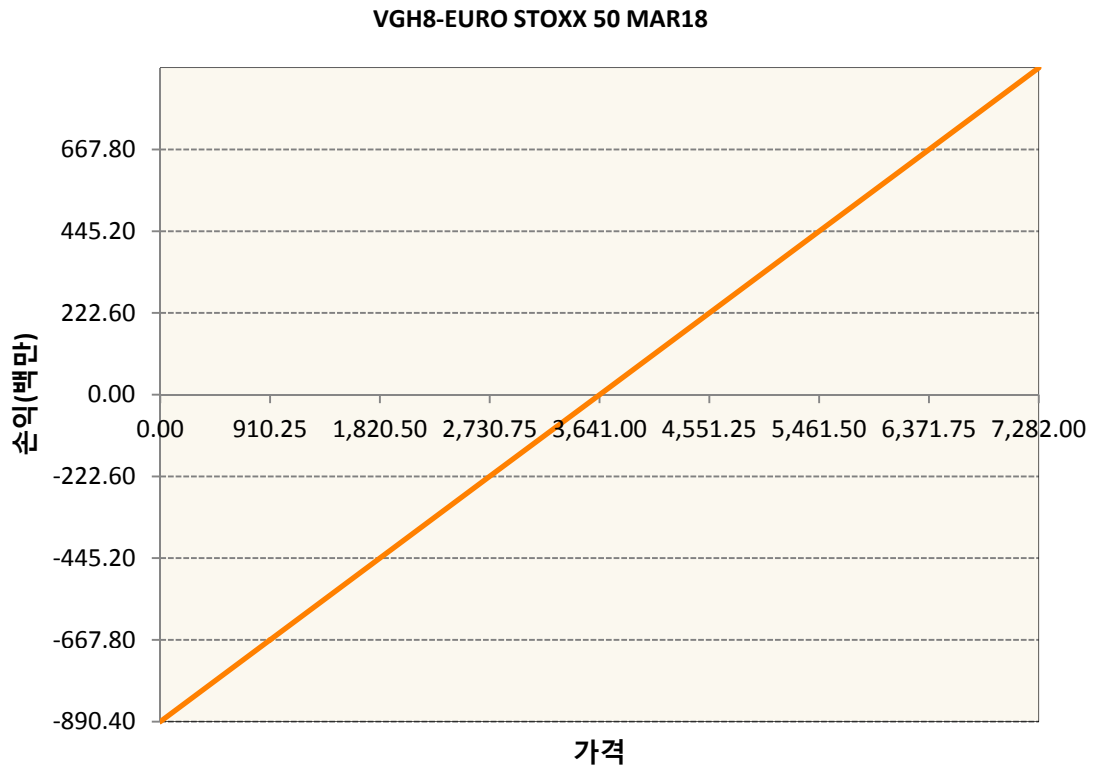
유로인덱스모(주식-파생형)

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	2018-01-26
기준일	2018-01-25

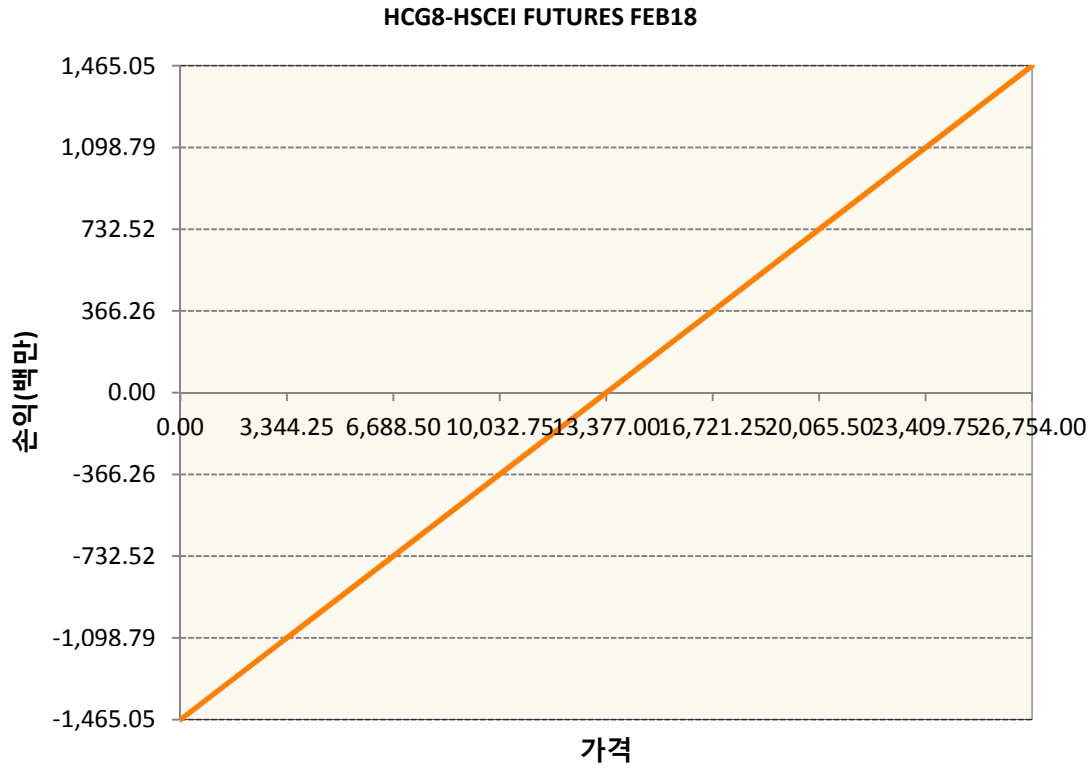
차이나인덱스모(주식-파생형)

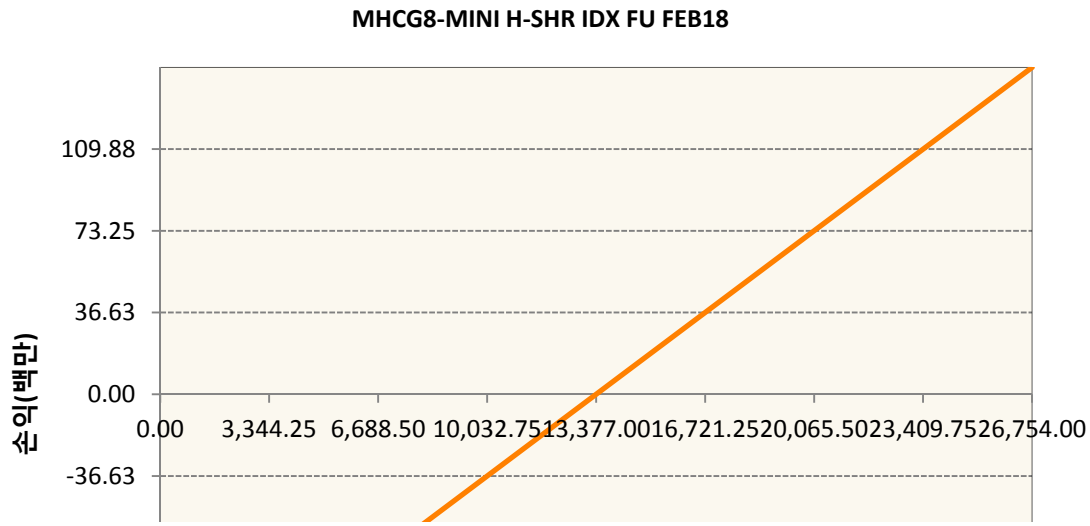
1. 계약금액

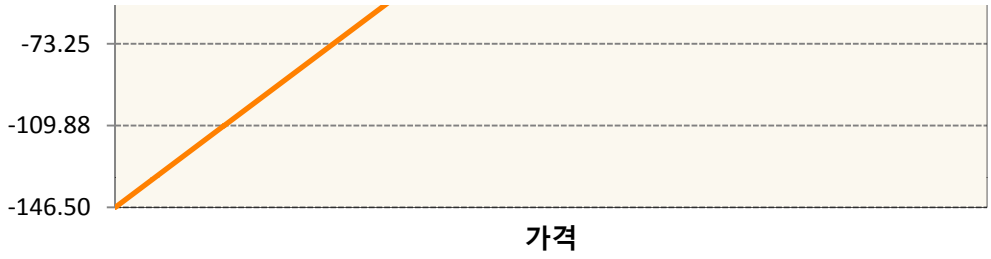
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,612	0	1,612	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCG8	HSCEI FUTURES FEB18	117
MHCG8	MINI H-SHR IDX FU FEB18	12

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

공시일	2018-01-26
기준일	2018-01-25

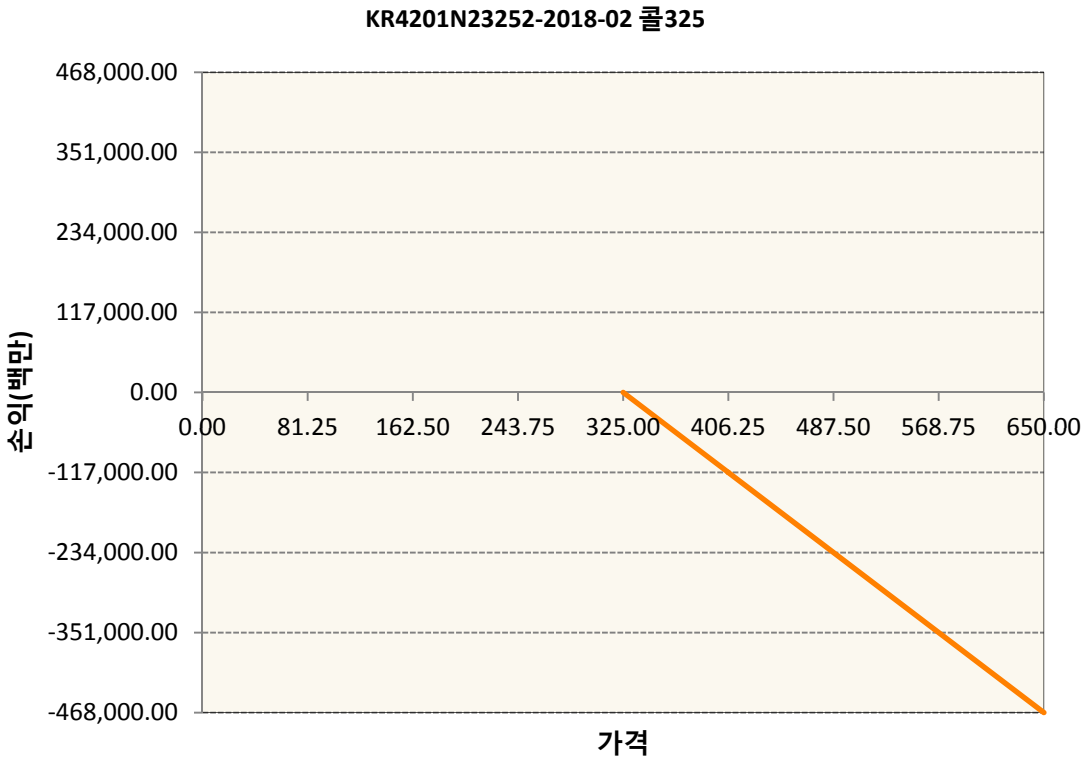
커버드콜모(주식혼합-파생형)

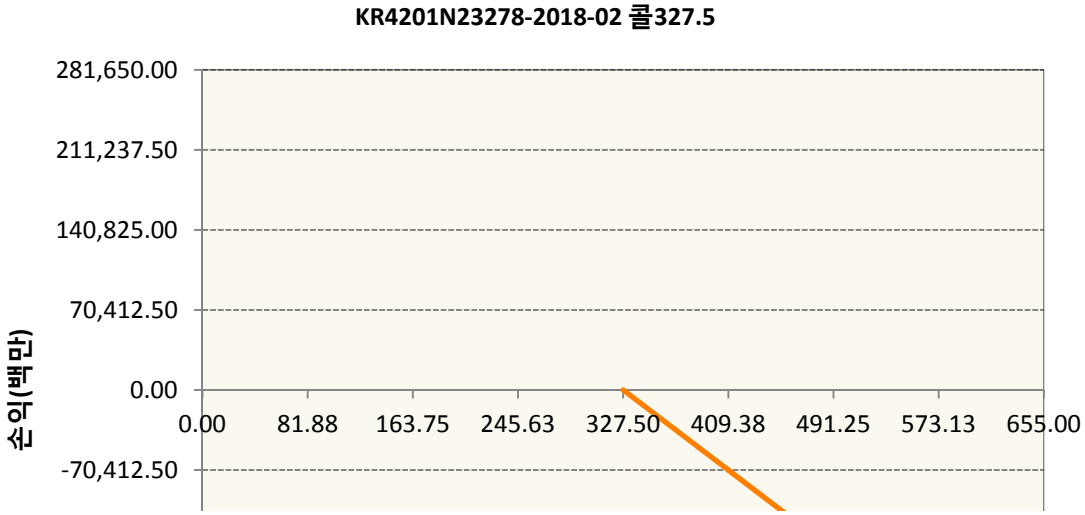
1. 계약금액

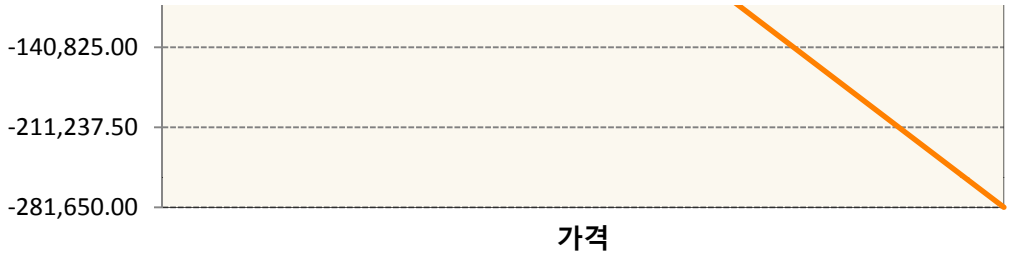
(단위:백만원)

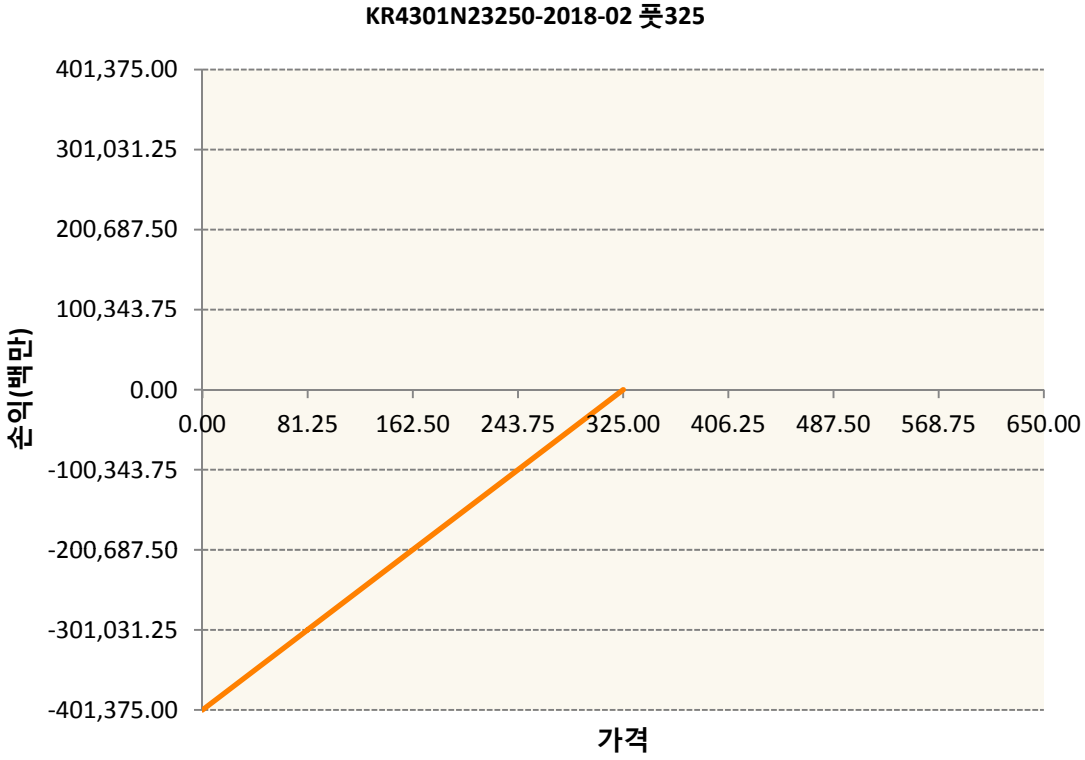
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	19,750	0	19,750	장내
누계	유가증권	옵션	0	1,275,311	-1,275,311	장내

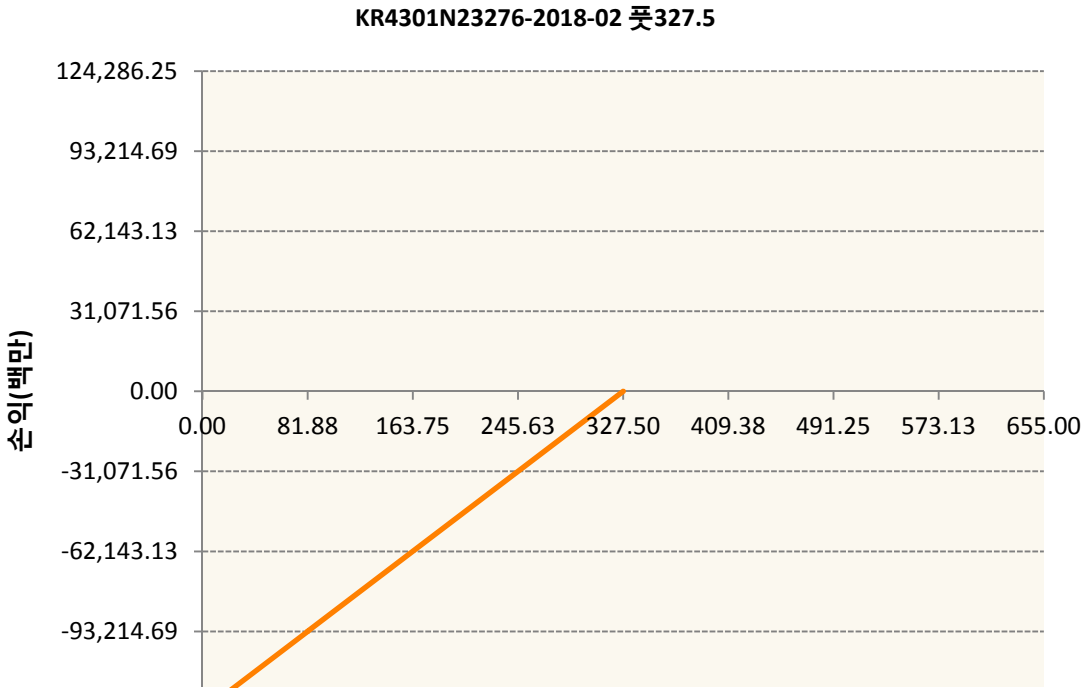
2. 만기시점의 손익구조






-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
124,286.25
93,214.69
62,143.13
31,071.56
0.00
-31,071.56
-62,143.13
-93,214.69
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							34,816
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	16,965	16,686	16,352	15,970	15,546	15,086	14,595
-5.33%	15,103	14,498	13,868	13,217	12,551	11,871	11,181
-2.67%	10,303	9,529	8,755	7,982	7,208	6,435	5,661
0%	1,908	1,299	660	0	-678	-1,370	-2,074
2.67%	-9,172	-9,479	-9,845	-10,260	-10,720	-11,216	-11,745
5.33%	-21,517	-21,620	-21,770	-21,968	-22,213	-22,503	-22,836
8.00%	-34,250	-34,274	-34,319	-34,392	-34,497	-34,638	-34,816
KR4201N232 2018-02 콜327.5							20,218
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	8,794	8,669	8,512	8,324	8,110	7,871	7,611
-5.33%	7,996	7,685	7,351	6,999	6,633	6,255	5,868
-2.67%	5,690	5,233	4,774	4,315	3,855	3,395	2,934
0%	1,263	851	429	0	-435	-876	-1,320
2.67%	-4,980	-5,217	-5,485	-5,781	-6,099	-6,436	-6,788
5.33%	-12,203	-12,293	-12,415	-12,568	-12,751	-12,961	-13,195
8.00%	-19,768	-19,792	-19,832	-19,893	-19,978	-20,086	-20,218
KR4301N232 2018-02 풋325							21,175
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-21,012	-21,018	-21,029	-21,048	-21,078	-21,120	-21,175
-5.33%	-10,242	-10,364	-10,511	-10,677	-10,862	-11,062	-11,275
-2.67%	-2,133	-2,459	-2,785	-3,112	-3,438	-3,764	-4,090
0%	421	304	163	0	-182	-379	-591
2.67%	626	619	606	582	548	499	437
5.33%	630	629	629	628	626	620	612
8.00%	630	630	630	630	629	629	629
KR4301N232 2018-02 풋327.5							7,273
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-7,246	-7,247	-7,248	-7,251	-7,255	-7,263	-7,273
-5.33%	-3,892	-3,913	-3,940	-3,973	-4,013	-4,058	-4,108
-2.67%	-1,035	-1,130	-1,226	-1,322	-1,419	-1,517	-1,615
0%	194	135	70	0	-74	-152	-233
2.67%	347	341	332	317	298	273	243

5.33%	351	351	351	350	348	345	339
8.00%	351	351	351	351	351	351	351

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

83,529

공시일	2018-01-26
기준일	2018-01-25

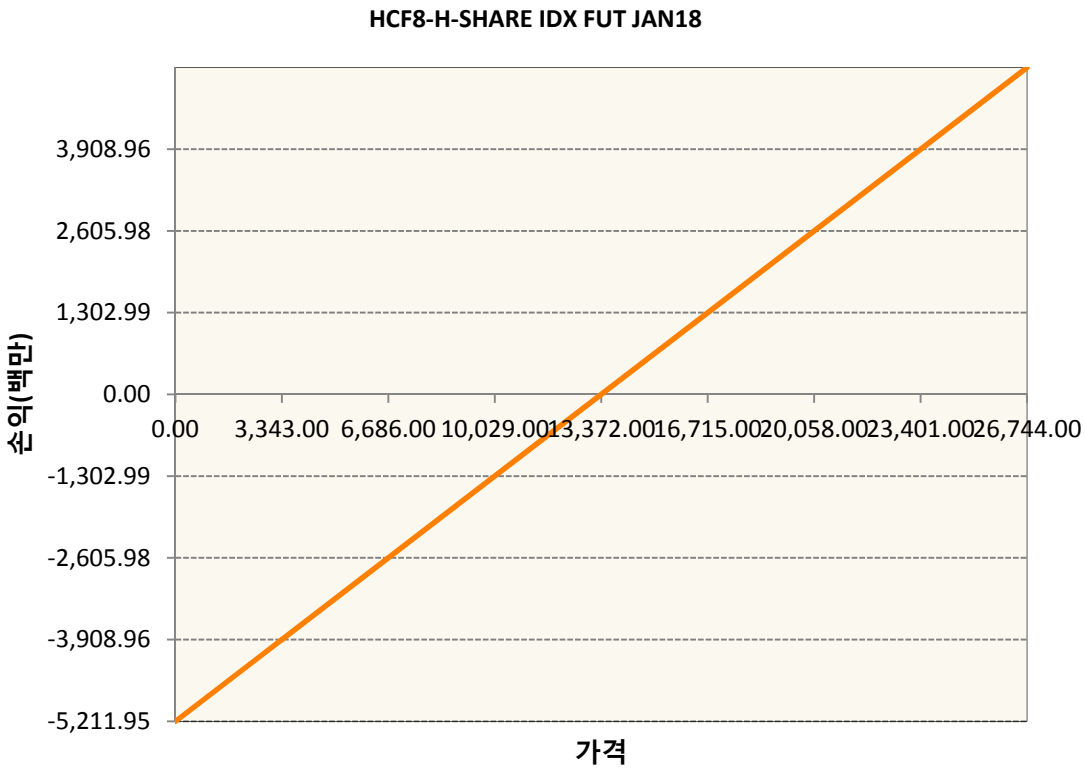
홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생

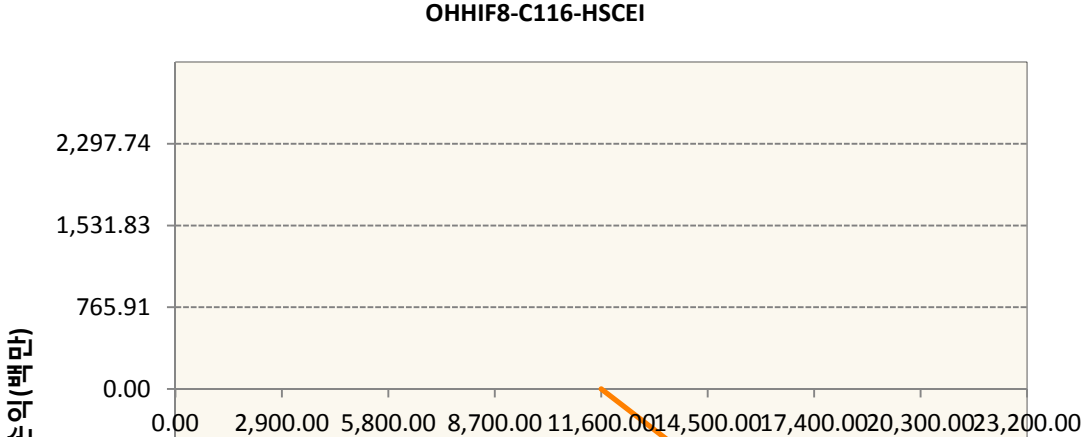
1. 계약금액

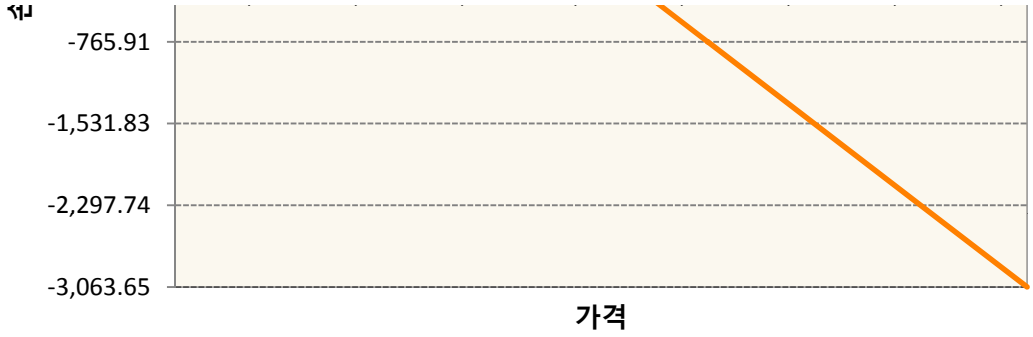
(단위:백만원)

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	5,212	0	5,212	장내
누계	유가증권	옵션	0	10,283	-10,283	장내

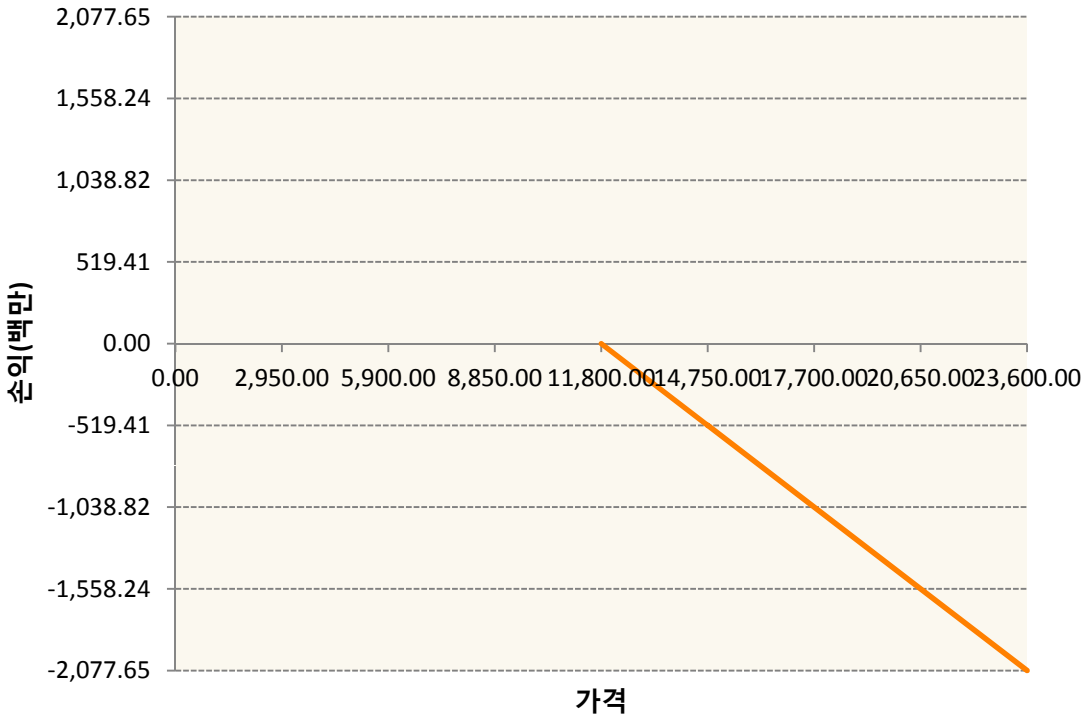
2. 만기시점의 손익구조



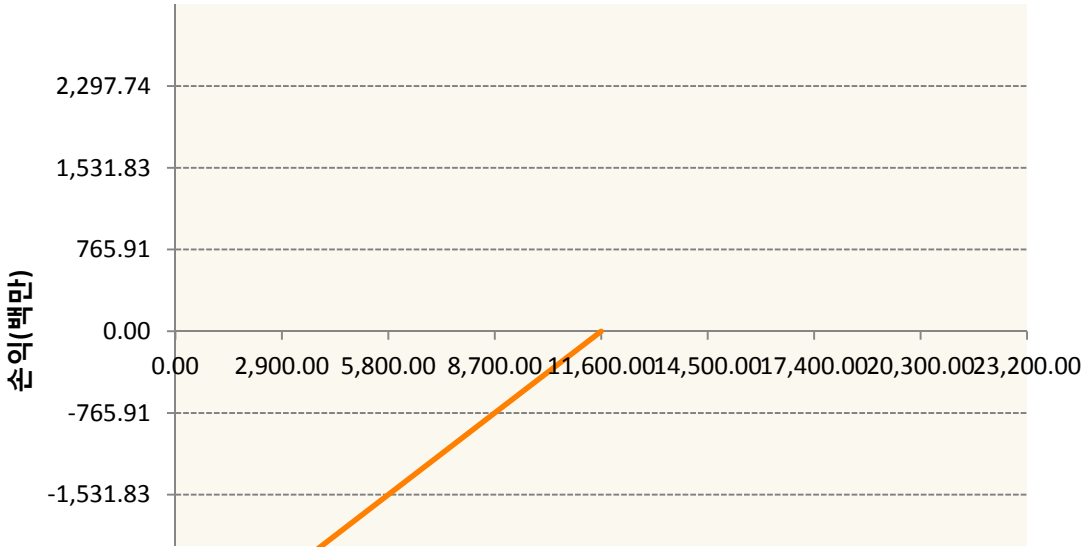


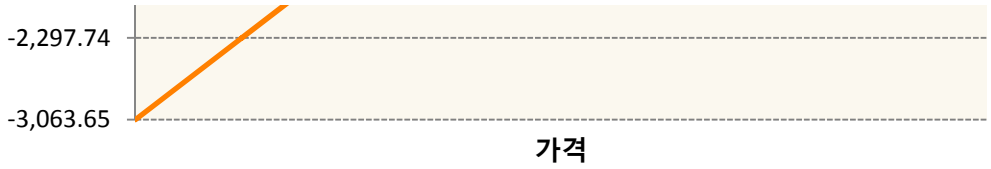


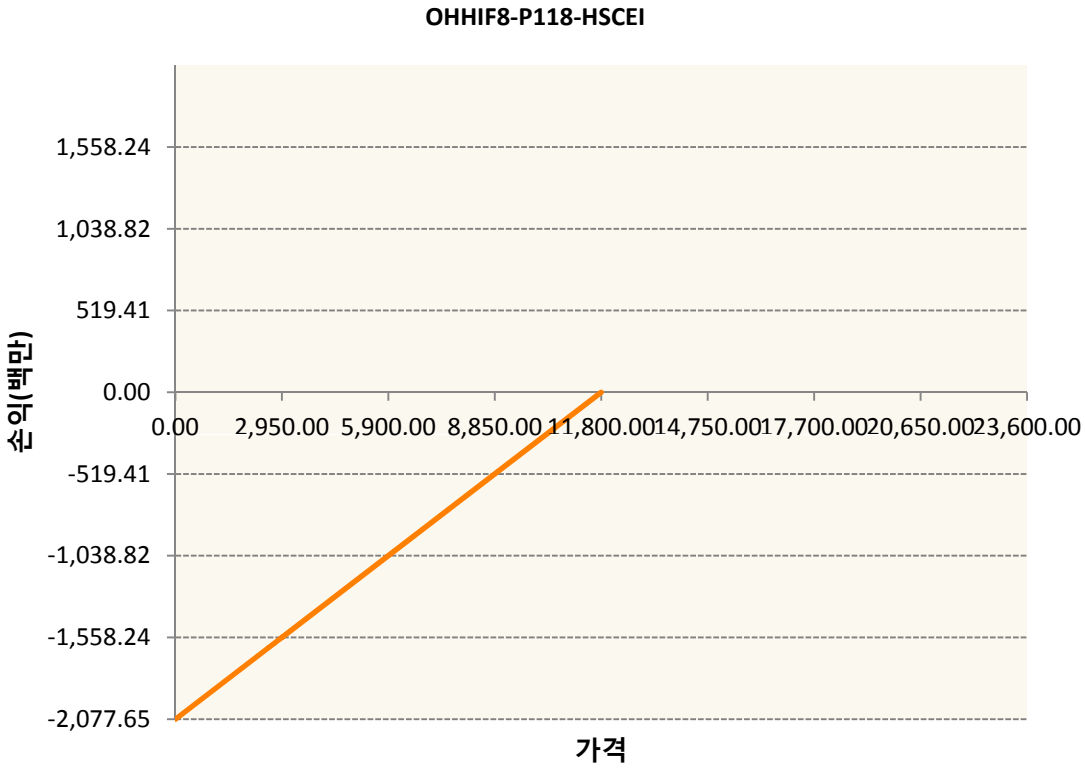
OHHIF8-C118-HSCEI



OHHIF8-P116-HSCEI







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCF8	H-SHARE IDX FUT JAN18	417
OHHIF8-C11	HSCEI	245
OHHIF8-C11	HSCEI	166
OHHIF8-P11	HSCEI	245
OHHIF8-P11	HSCEI	166

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	987

공시일	2018-01-26
기준일	2018-01-25

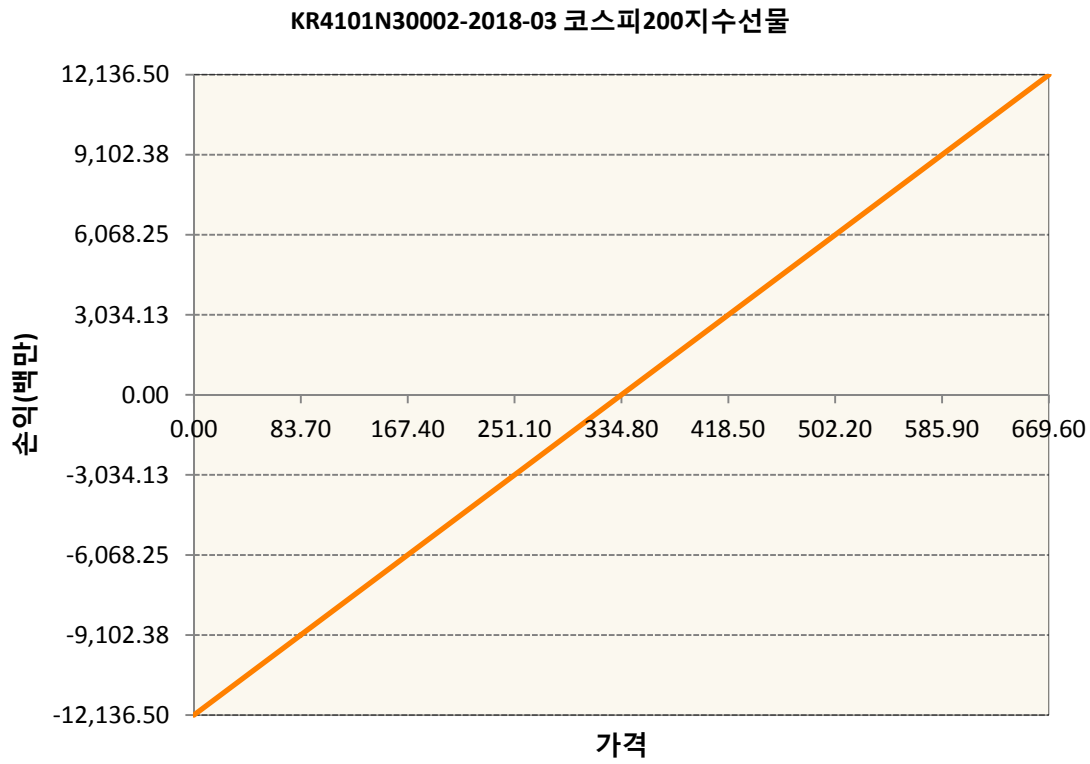
코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼

1. 계약금액

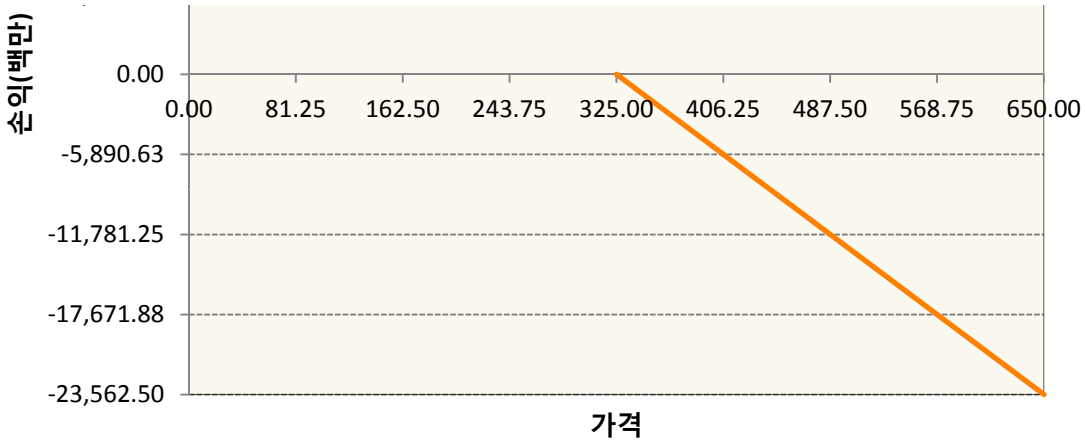
(단위:백만원)

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	12,137	0	12,137	장내
누계	유가증권	스왑	60,200	0	60,200	장외
누계	유가증권	옵션	0	60,250	-60,250	장내

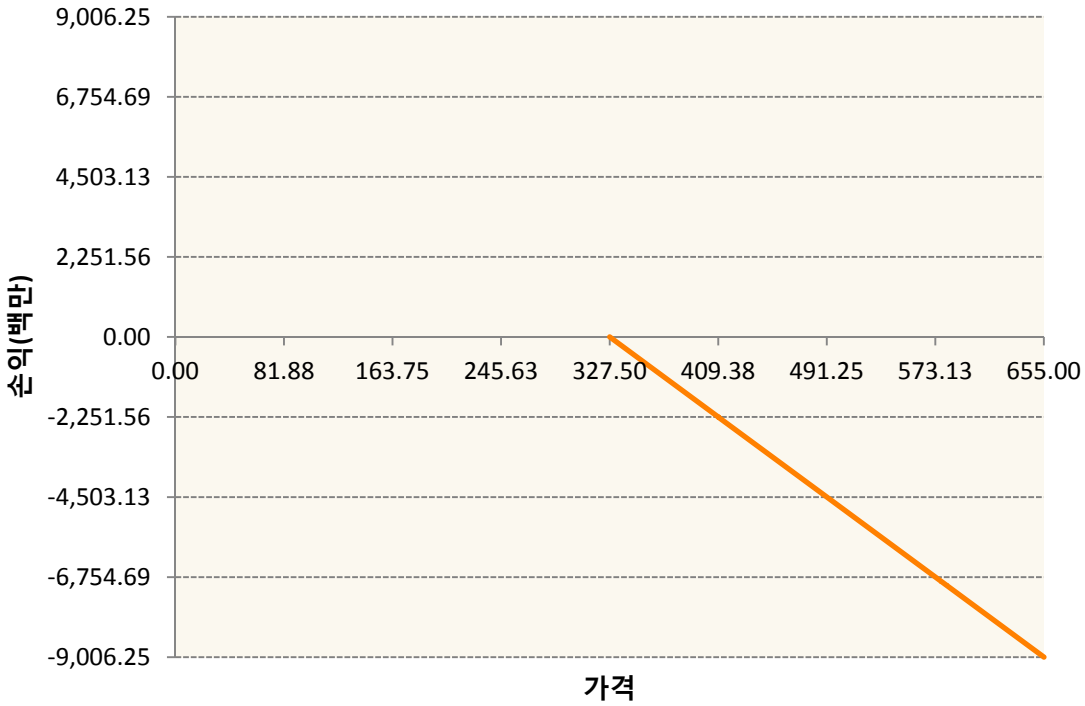
2. 만기시점의 손익구조



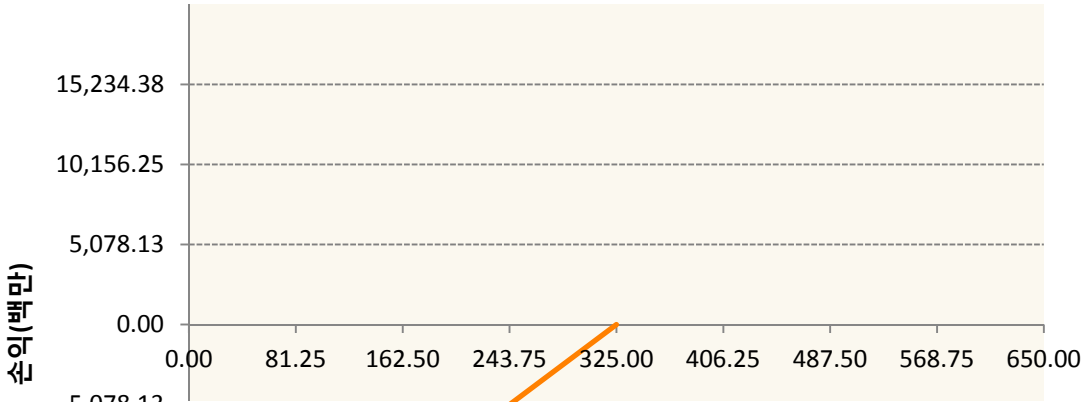




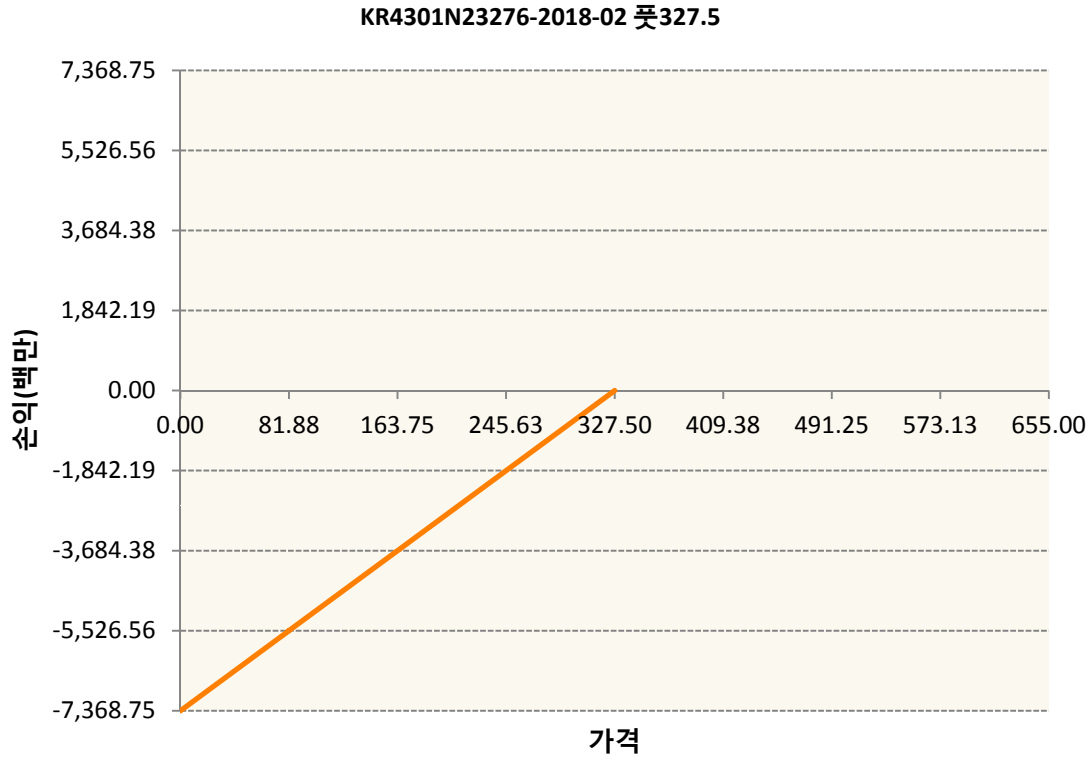
KR4201N23278-2018-02 콜327.5



KR4301N23250-2018-02 풋325







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_2							1,446
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,446	-1,446	-1,446	-1,446	-1,446	-1,446	-1,446
-5.33%	-964	-964	-964	-964	-964	-964	-964
-2.67%	-482	-482	-482	-482	-482	-482	-482
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	482	482	482	482	482	482	482
5.33%	964	964	964	964	964	964	964
8.00%	1,446	1,446	1,446	1,446	1,446	1,446	1,446
2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_3							273
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%

-8.00%	-273	-273	-273	-273	-273	-273	-273
-5.33%	-182	-182	-182	-182	-182	-182	-182
-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%	182	182	182	182	182	182	182
8.00%	273	273	273	273	273	273	273
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_4						156
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-156	-156	-156	-156	-156	-156	-156
-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%	156	156	156	156	156	156	156
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_5						234
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-234	-234	-234	-234	-234	-234	-234
-5.33%	-156	-156	-156	-156	-156	-156	-156
-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%	156	156	156	156	156	156	156
8.00%	234	234	234	234	234	234	234
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_6						195
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-195	-195	-195	-195	-195	-195	-195
-5.33%	-130	-130	-130	-130	-130	-130	-130
-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%	130	130	130	130	130	130	130
8.00%	195	195	195	195	195	195	195
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_7						250
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-250	-250	-250	-250	-250	-250	-250
-5.33%	-167	-167	-167	-167	-167	-167	-167
-2.67%	-83	-83	-83	-83	-83	-83	-83
0%	0	0	0	0	0	0	0

2.67%	83	83	83	83	83	83	83
5.33%	167	167	167	167	167	167	167
8.00%	250	250	250	250	250	250	250
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_8						462
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-462	-462	-462	-462	-462	-462	-462
-5.33%	-308	-308	-308	-308	-308	-308	-308
-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%	308	308	308	308	308	308	308
8.00%	462	462	462	462	462	462	462
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_9						308
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-308	-308	-308	-308	-308	-308	-308
-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%	308	308	308	308	308	308	308
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_10						273
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-273	-273	-273	-273	-273	-273	-273
-5.33%	-182	-182	-182	-182	-182	-182	-182
-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%	182	182	182	182	182	182	182
8.00%	273	273	273	273	273	273	273
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_11						625
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-625	-625	-625	-625	-625	-625	-625
-5.33%	-417	-417	-417	-417	-417	-417	-417
-2.67%	-208	-208	-208	-208	-208	-208	-208
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	208	208	208	208	208	208	208
5.33%	417	417	417	417	417	417	417
8.00%	625	625	625	625	625	625	625
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_12						469

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-469	-469	-469	-469	-469	-469	-469
-5.33%	-313	-313	-313	-313	-313	-313	-313
-2.67%	-156	-156	-156	-156	-156	-156	-156
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	156	156	156	156	156	156	156
5.33%	313	313	313	313	313	313	313
8.00%	469	469	469	469	469	469	469
	KR4101N30(	2018-03	코스피200지수선물				969

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-969	-969	-969	-969	-969	-969	-969
-5.33%	-646	-646	-646	-646	-646	-646	-646
-2.67%	-323	-323	-323	-323	-323	-323	-323
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	323	323	323	323	323	323	323
5.33%	646	646	646	646	646	646	646
8.00%	969	969	969	969	969	969	969
	KR4201N232	2018-02	콜325				1,753

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	854	840	823	804	783	760	735
-5.33%	760	730	698	665	632	598	563
-2.67%	519	480	441	402	363	324	285
0%	96	65	33	0	-34	-69	-104
2.67%	-462	-477	-496	-517	-540	-565	-591
5.33%	-1,083	-1,089	-1,096	-1,106	-1,118	-1,133	-1,150
8.00%	-1,724	-1,726	-1,728	-1,732	-1,737	-1,744	-1,753
	KR4201N232	2018-02	콜327.5				646

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	281	277	272	266	259	252	243
-5.33%	256	246	235	224	212	200	188
-2.67%	182	167	153	138	123	109	94
0%	40	27	14	0	-14	-28	-42
2.67%	-159	-167	-175	-185	-195	-206	-217
5.33%	-390	-393	-397	-402	-408	-414	-422
8.00%	-632	-633	-634	-636	-639	-642	-646
	KR4301N232	2018-02	풋325				1,072

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,063	-1,064	-1,064	-1,065	-1,067	-1,069	-1,072
-5.33%	-518	-525	-532	-540	-550	-560	-571

-2.67%	-108	-124	-141	-157	-174	-190	-207
0%	21	15	8	0	-9	-19	-30
2.67%	32	31	31	29	28	25	22
5.33%	32	32	32	32	32	31	31
8.00%	32	32	32	32	32	32	32
	KR4301N232 2018-02 풋327.5						431
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-430	-430	-430	-430	-430	-431	-431
-5.33%	-231	-232	-234	-236	-238	-241	-244
-2.67%	-61	-67	-73	-78	-84	-90	-96
0%	12	8	4	0	-4	-9	-14
2.67%	21	20	20	19	18	16	14
5.33%	21	21	21	21	21	20	20
8.00%	21	21	21	21	21	21	21

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

9,150

공시일	2018-01-26
기준일	2018-01-25

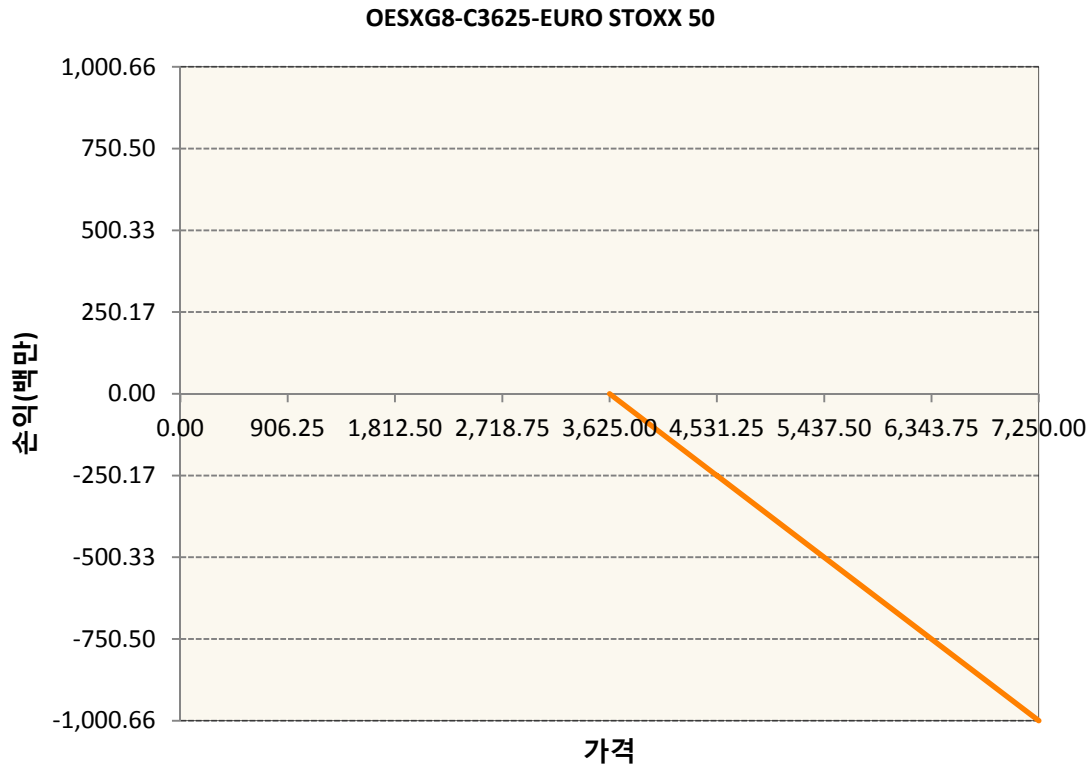
유로커버드콜모(주식혼합-파생형

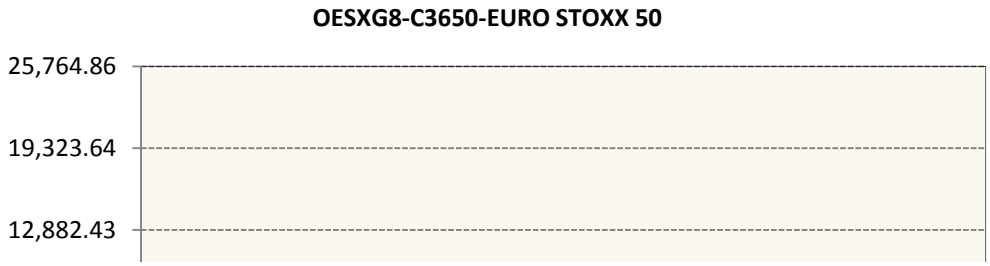
1. 계약금액

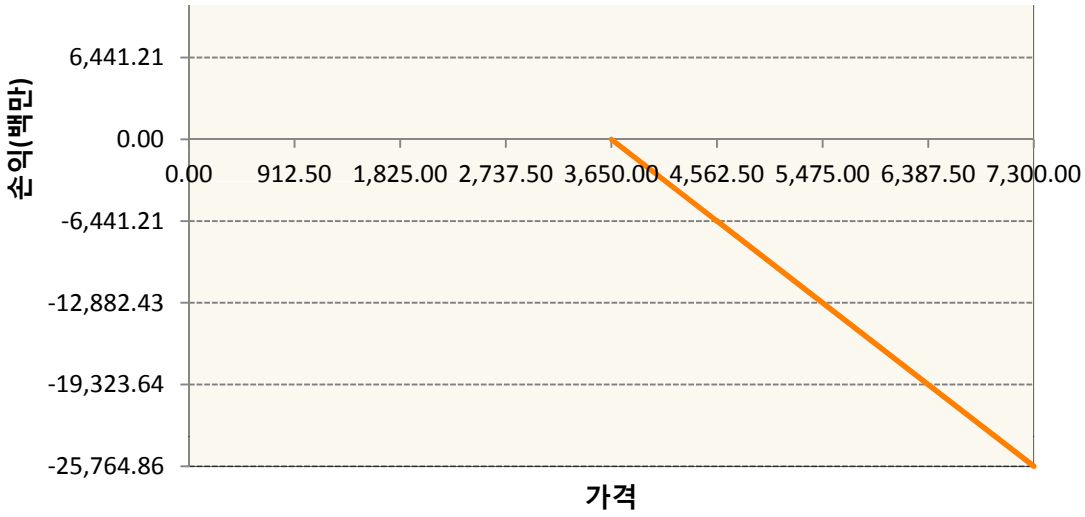
(단위:백만원)

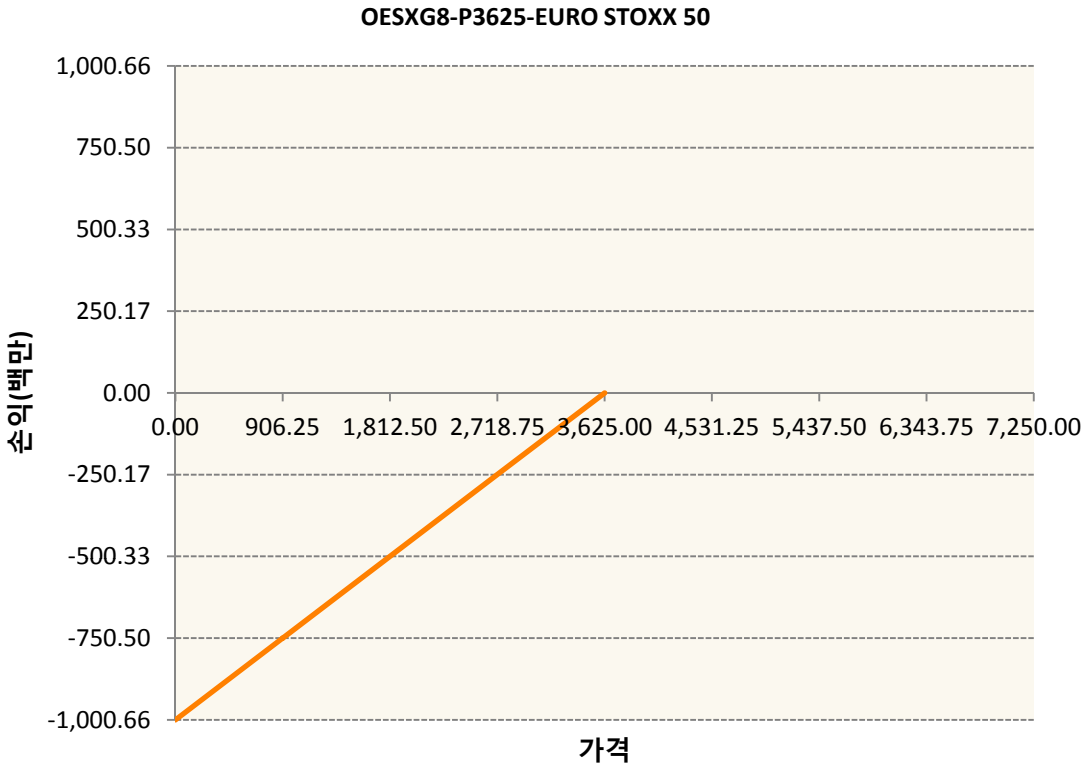
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	17,779	0	17,779	
누계	유가증권	스왑	98,589	0	98,589	장외
누계	유가증권	옵션	0	53,531	-53,531	장내
누계	지수	스왑	52,581	0	52,581	장외

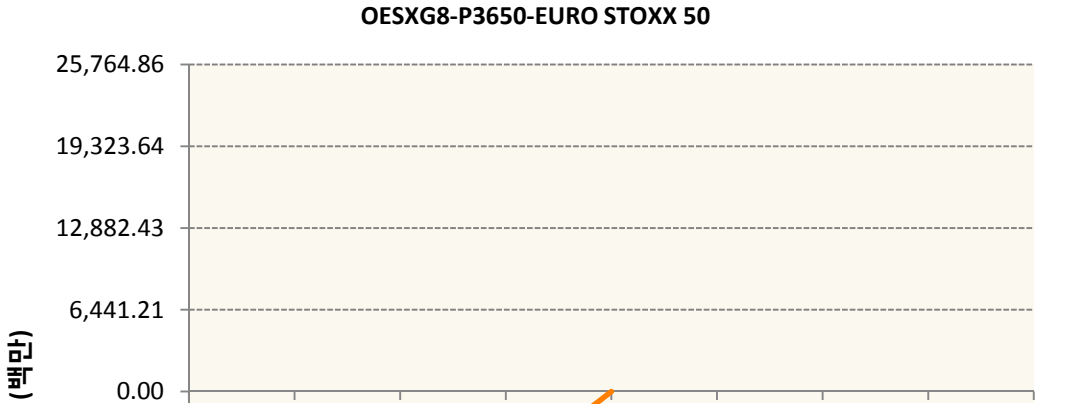
2. 만기시점의 손익구조

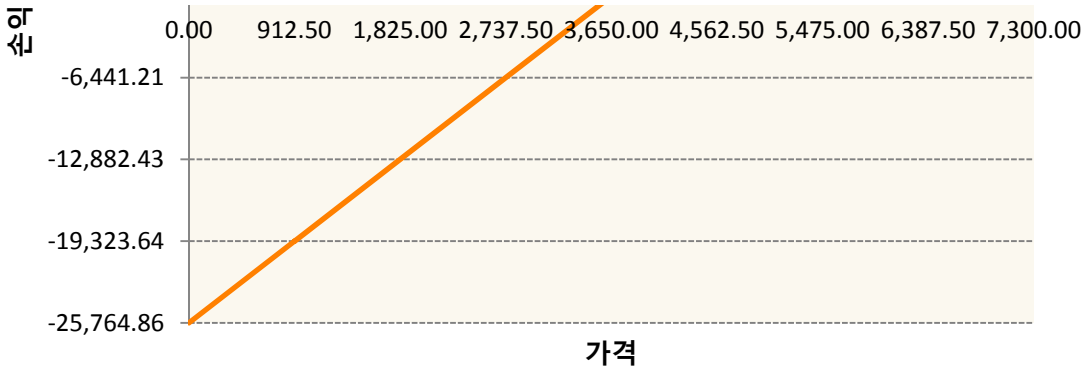


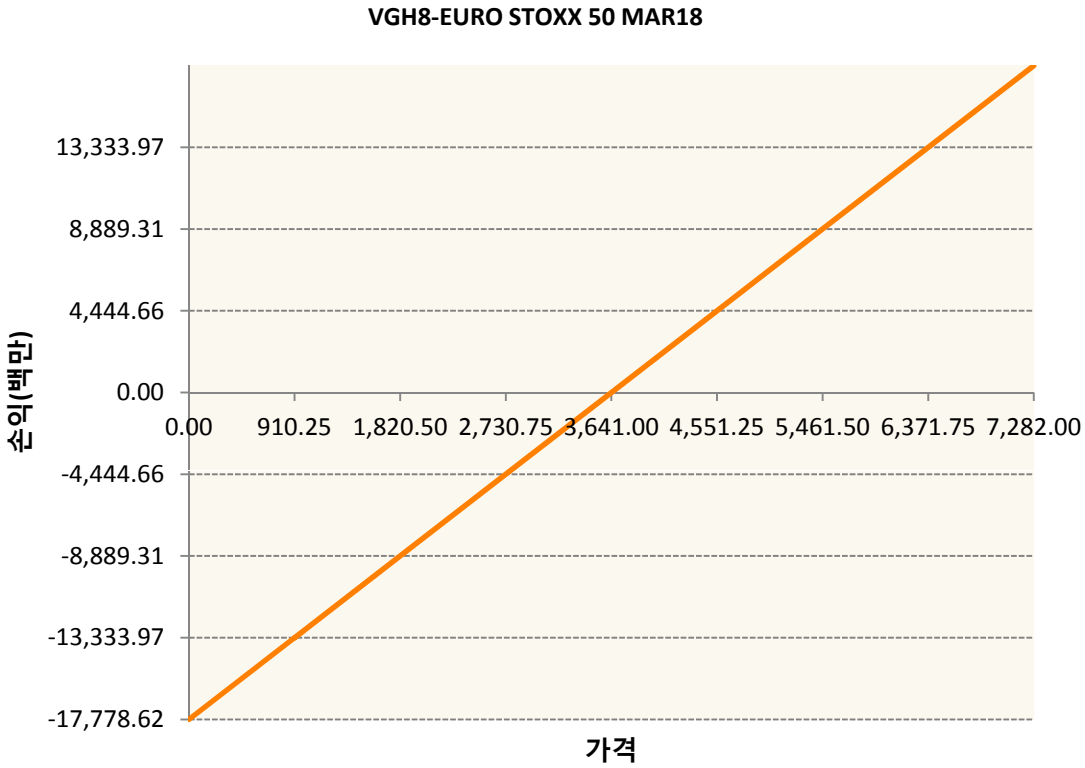



6,441.21
0.00
-6,441.21
-12,882.43
-19,323.64
-25,764.86
0.00
912.50
1,825.00
2,737.50
3,650.00
4,562.50
5,475.00
6,387.50
7,300.00
손익(백만)
가격


OESXG8-P3625-EURO STOXX 50
1,000.66
750.50
500.33
250.17
0.00
-250.17
-500.33
-750.50
-1,000.66
0.00
906.25
1,812.50
2,718.75
3,625.00
4,531.25
5,437.50
6,343.75
7,250.00
손익(백만)
가격


OESXG8-P3650-EURO STOXX 50
25,764.86
19,323.64
12,882.43
6,441.21
0.00
(백만)





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)	(단위:백만원)
260105SGPX SG EURO Covered CALL STRATEGY - 994.569	1
260105SQPX SG EURO Covered CALL STRATEGY	2
OESXG8-C3(EURO STOXX 50	80
OESXG8-C3(EURO STOXX 50	2,061
OESXG8-P3(EURO STOXX 50	80
OESXG8-P3(EURO STOXX 50	2,061
VGH8 EURO STOXX 50 MAR18	1,422

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

3,172

공시일	2018-01-26
기준일	2018-01-25

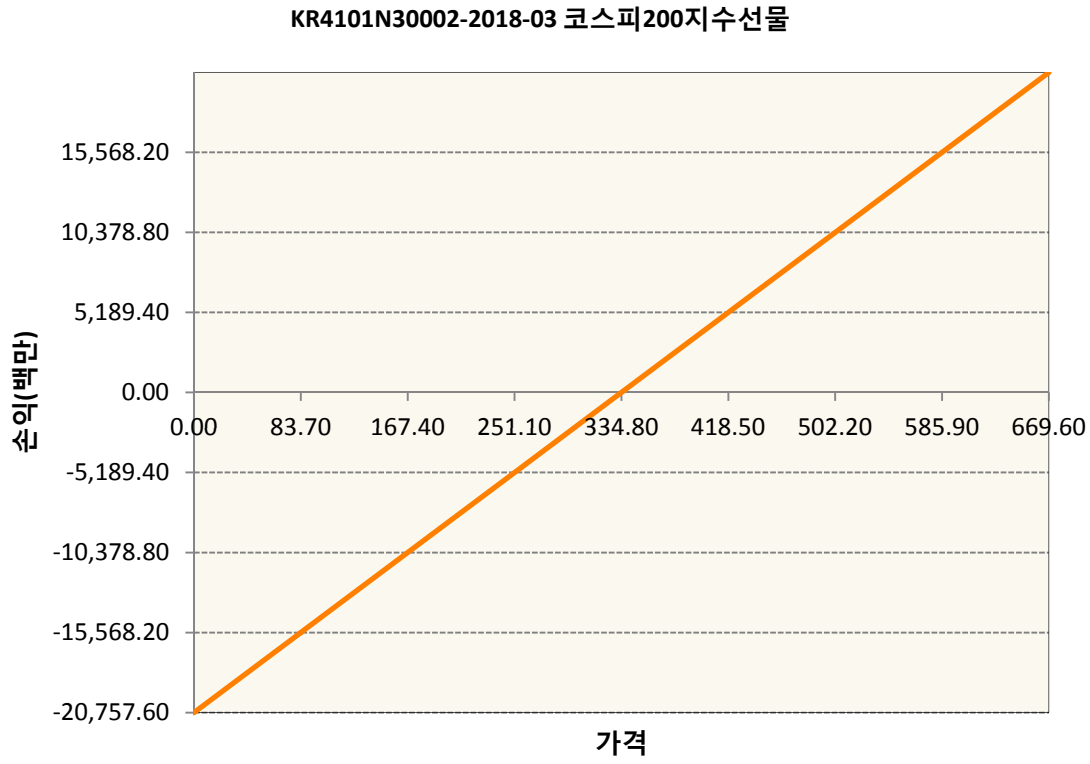
ETF스마트레버리지목표전환형8호

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	20,758	0	20,758	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101N30(2018-03 코스피200지수선물							1,657
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,657	-1,657	-1,657	-1,657	-1,657	-1,657	-1,657
-5.33%	-1,105	-1,105	-1,105	-1,105	-1,105	-1,105	-1,105
-2.67%	-552	-552	-552	-552	-552	-552	-552
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	552	552	552	552	552	552	552
5.33%	1,105	1,105	1,105	1,105	1,105	1,105	1,105
8.00%	1,657	1,657	1,657	1,657	1,657	1,657	1,657

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

992

공시일	2018-01-26
기준일	2018-01-25

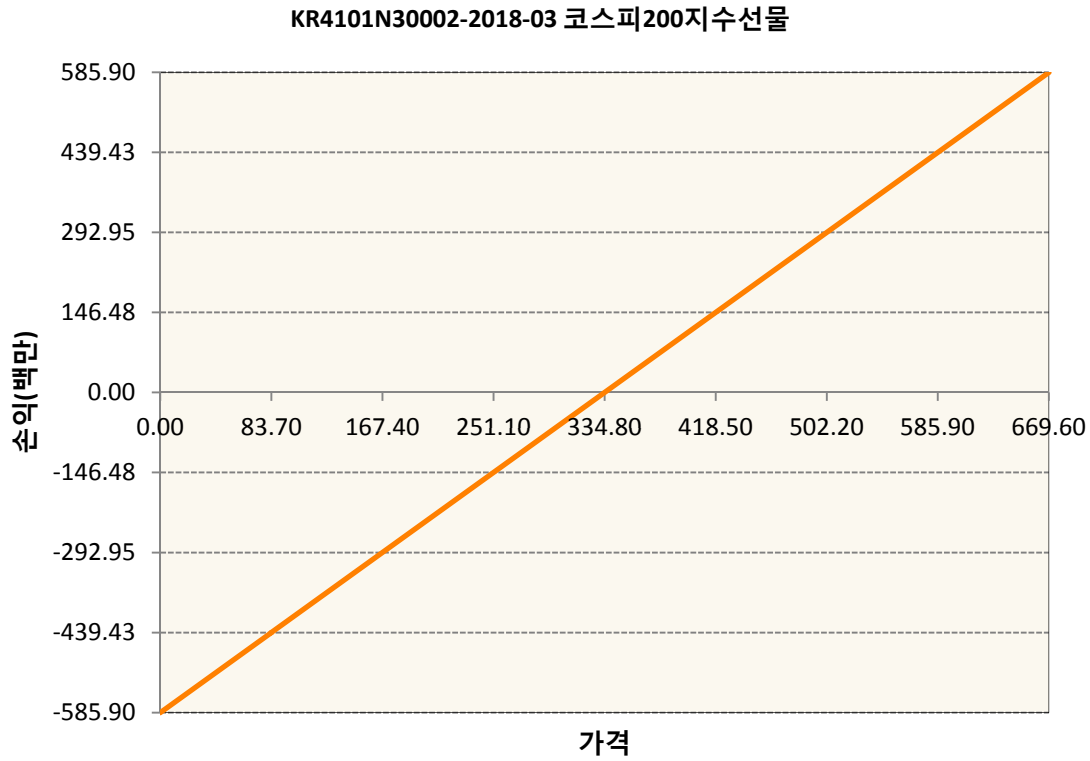
ETF스마트레버리지목표전환형9호

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	586	0	586	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101N30(2018-03 코스피200지수선물							47
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-47	-47	-47	-47	-47	-47	-47
-5.33%	-31	-31	-31	-31	-31	-31	-31
-2.67%	-16	-16	-16	-16	-16	-16	-16
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	16	16	16	16	16	16	16
5.33%	31	31	31	31	31	31	31
8.00%	47	47	47	47	47	47	47

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

28

공시일	2018-01-26
기준일	2018-01-25

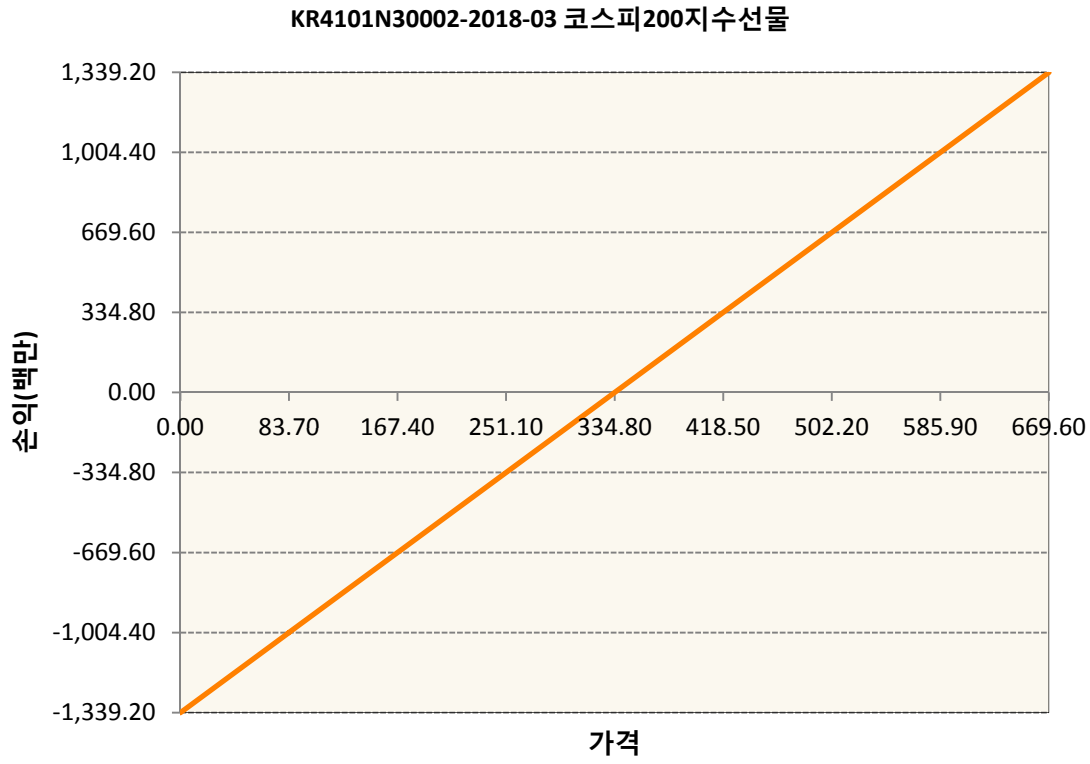
ETF스마트레버리지목표전환형10

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	1,339	0	1,339	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101N30(2018-03 코스피200지수선물							107
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-107	-107	-107	-107	-107	-107	-107
-5.33%	-71	-71	-71	-71	-71	-71	-71
-2.67%	-36	-36	-36	-36	-36	-36	-36
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	36	36	36	36	36	36	36
5.33%	71	71	71	71	71	71	71
8.00%	107	107	107	107	107	107	107

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

64

공시일	2018-01-26
기준일	2018-01-25

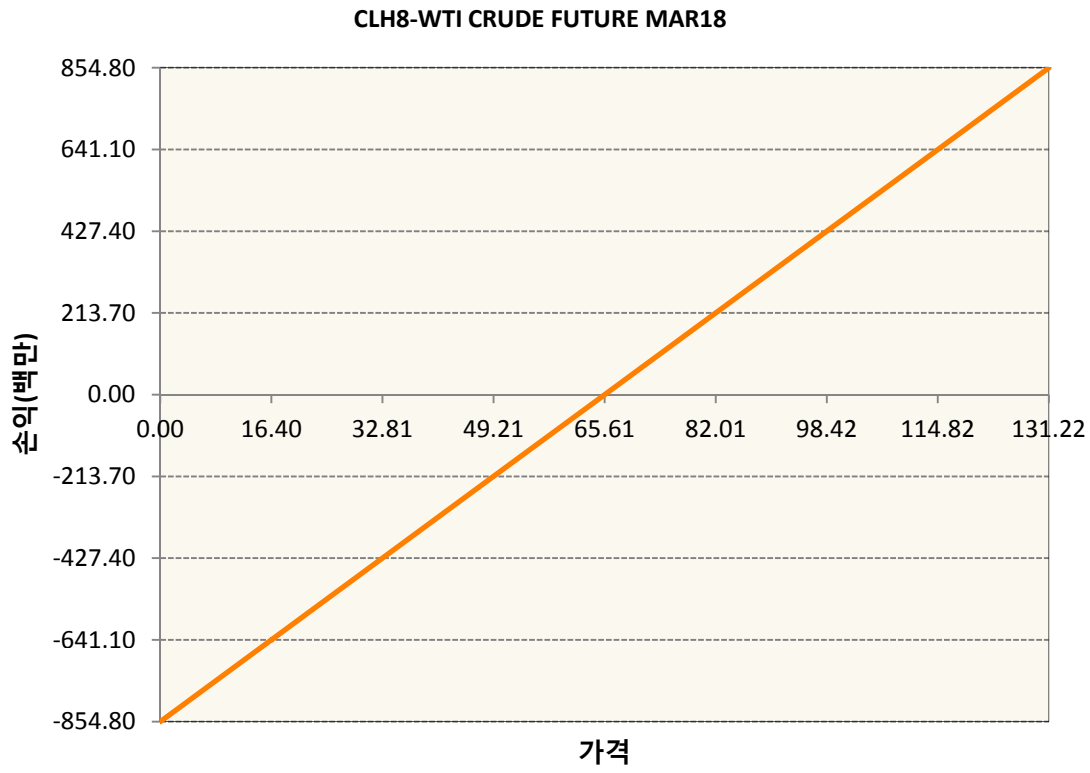
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

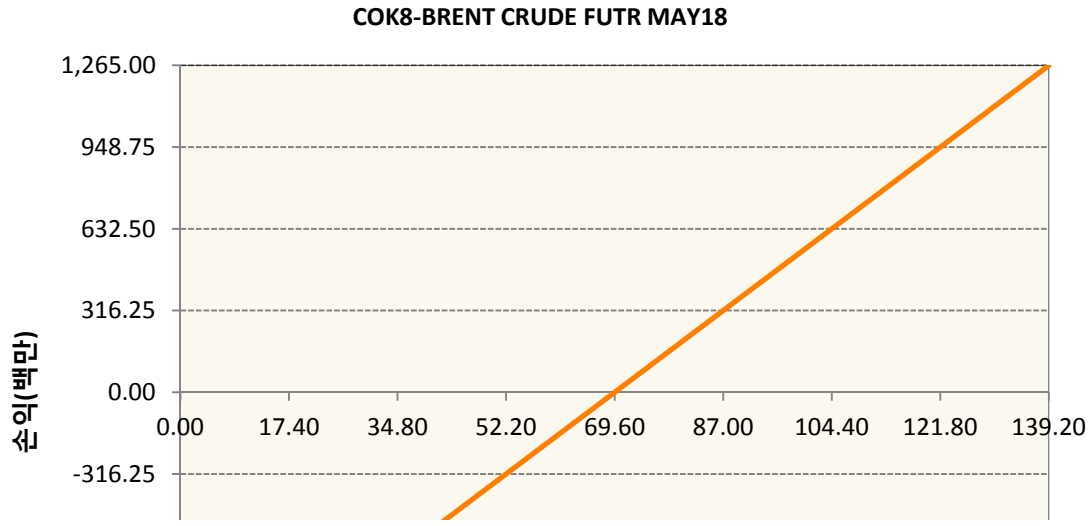
1. 계약금액

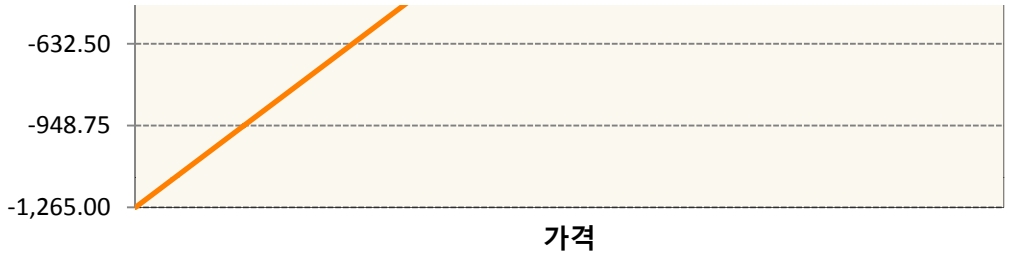
(단위:백만원)

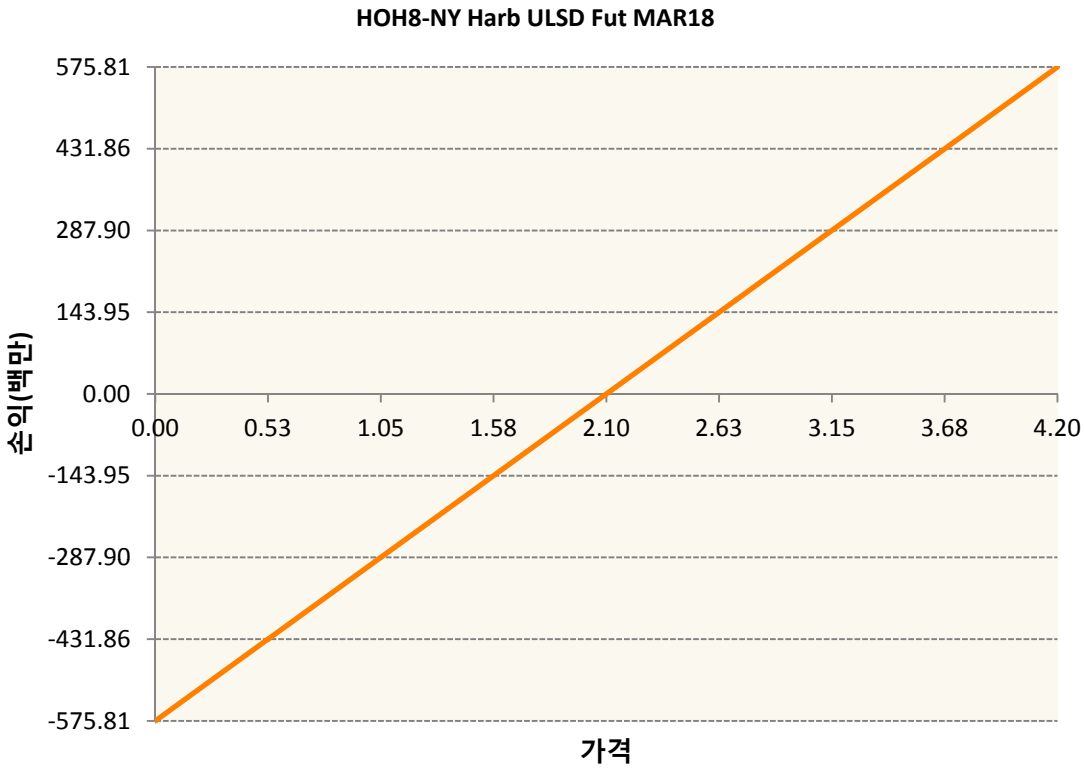
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	4,574	847	3,727	

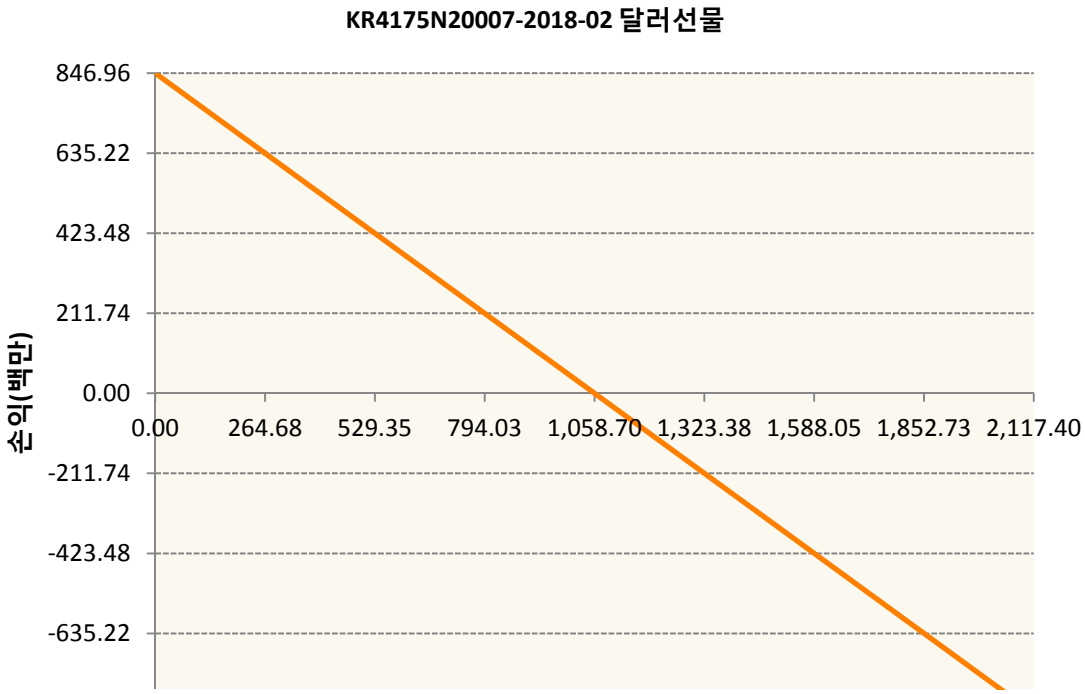
2. 만기시점의 손익구조

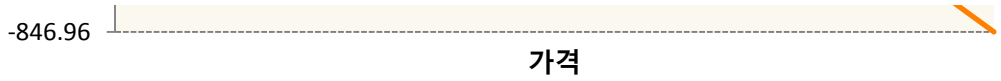


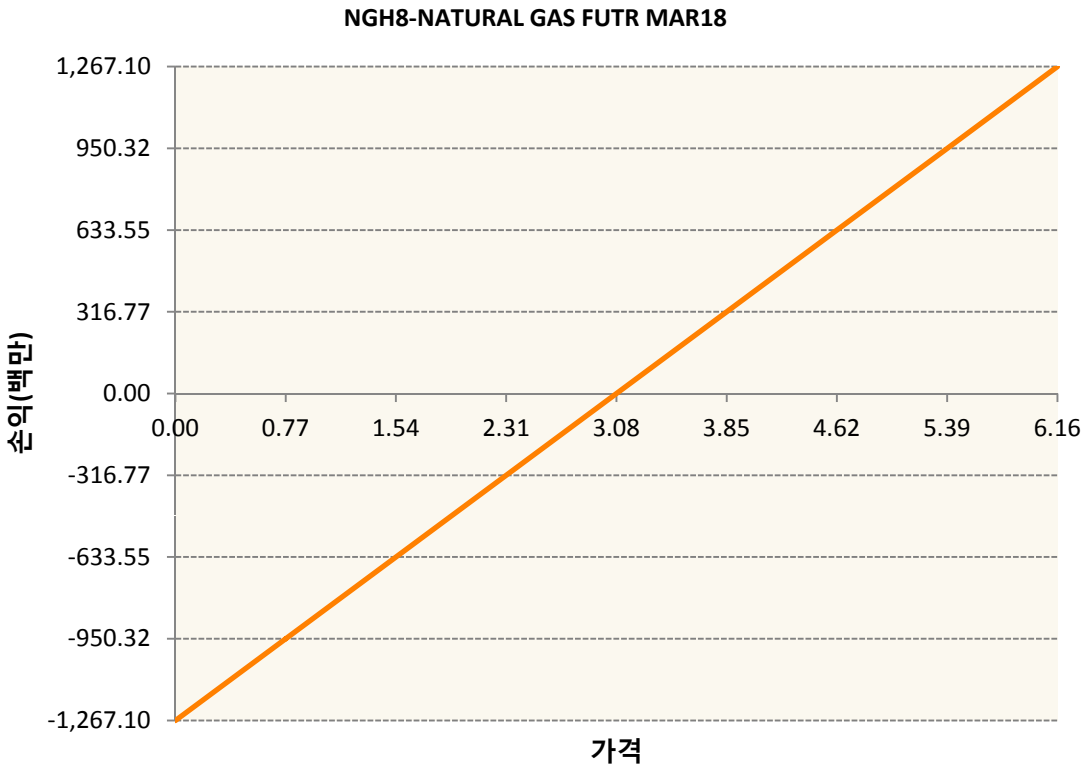


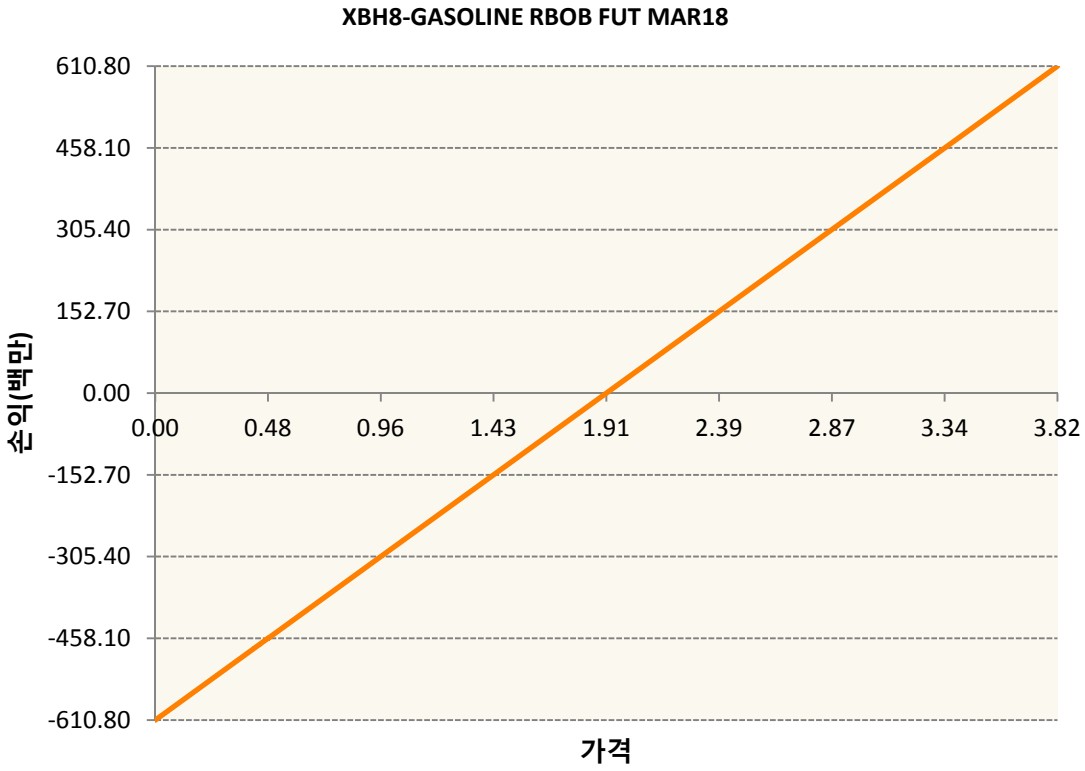

-632.50
-948.75
-1,265.00
가격


HOH8-NY Harb ULSD Fut MAR18
575.81
431.86
287.90
143.95
0.00
-143.95
-287.90
-431.86
-575.81
0.00
0.53
1.05
1.58
2.10
2.63
3.15
3.68
4.20
손익(백만)
가격


KR4175N20007-2018-02 달러선물
846.96
635.22
423.48
211.74
0.00
-211.74
-423.48
-635.22
0.00
264.68
529.35
794.03
1,058.70
1,323.38
1,588.05
1,852.73
2,117.40
손익(백만)


-846.96
가격


NGH8-NATURAL GAS FUTR MAR18
1,267.10
950.32
633.55
316.77
0.00
-316.77
-633.55
-950.32
-1,267.10
0.00
0.77
1.54
2.31
3.08
3.85
4.62
5.39
6.16
손익(백만)
가격


XBH8-GASOLINE RBOB FUT MAR18
610.80
458.10
305.40
152.70
0.00
-152.70
-305.40
-458.10
-610.80
0.00
0.48
0.96
1.43
1.91
2.39
2.87
3.34
3.82
손익(백만)
가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

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

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

619

공시일	2018-01-26
기준일	2018-01-25

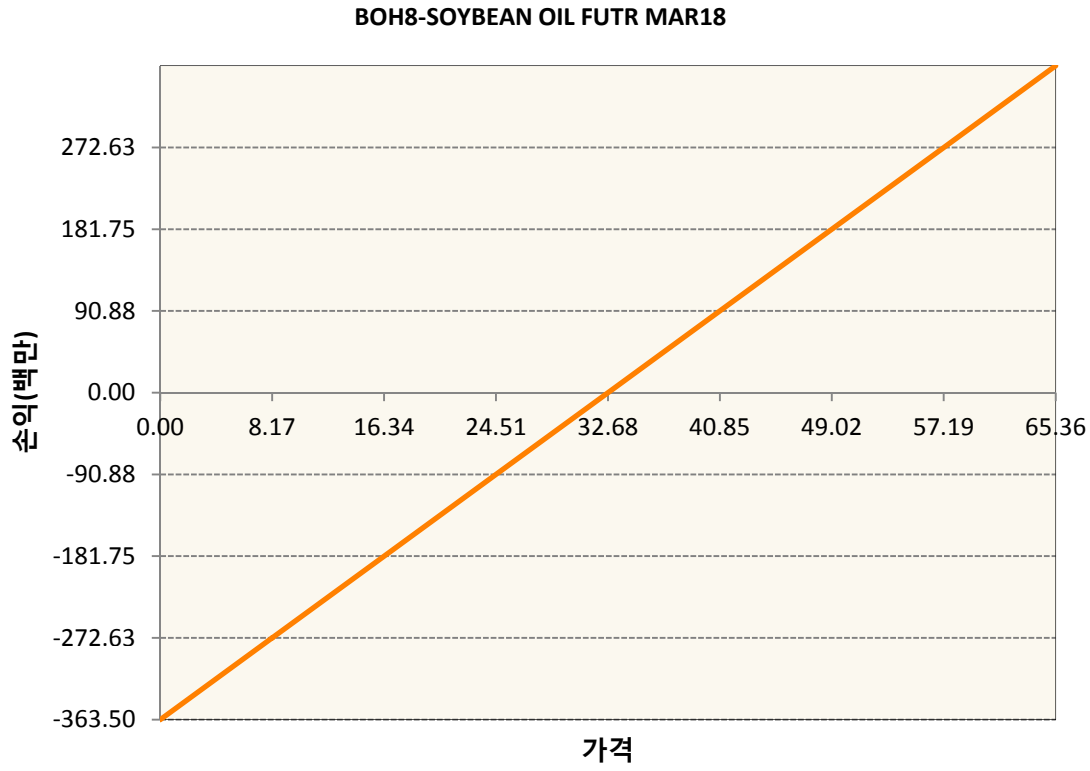
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

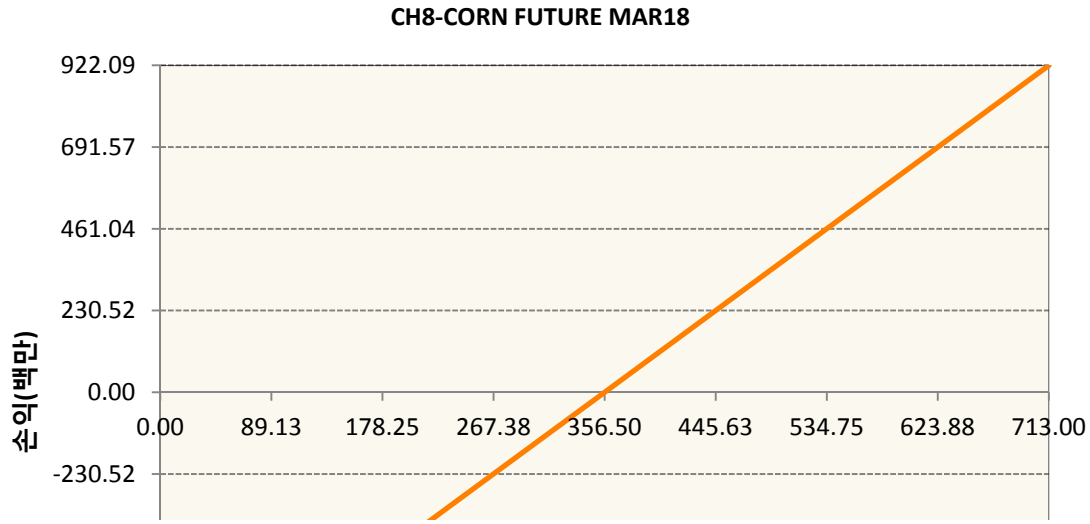
1. 계약금액

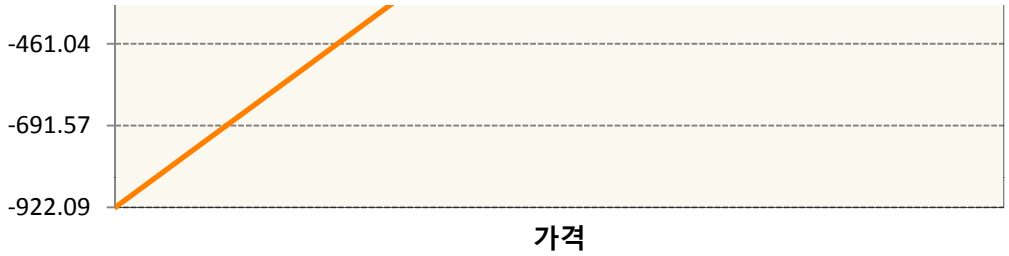
(단위:백만원)

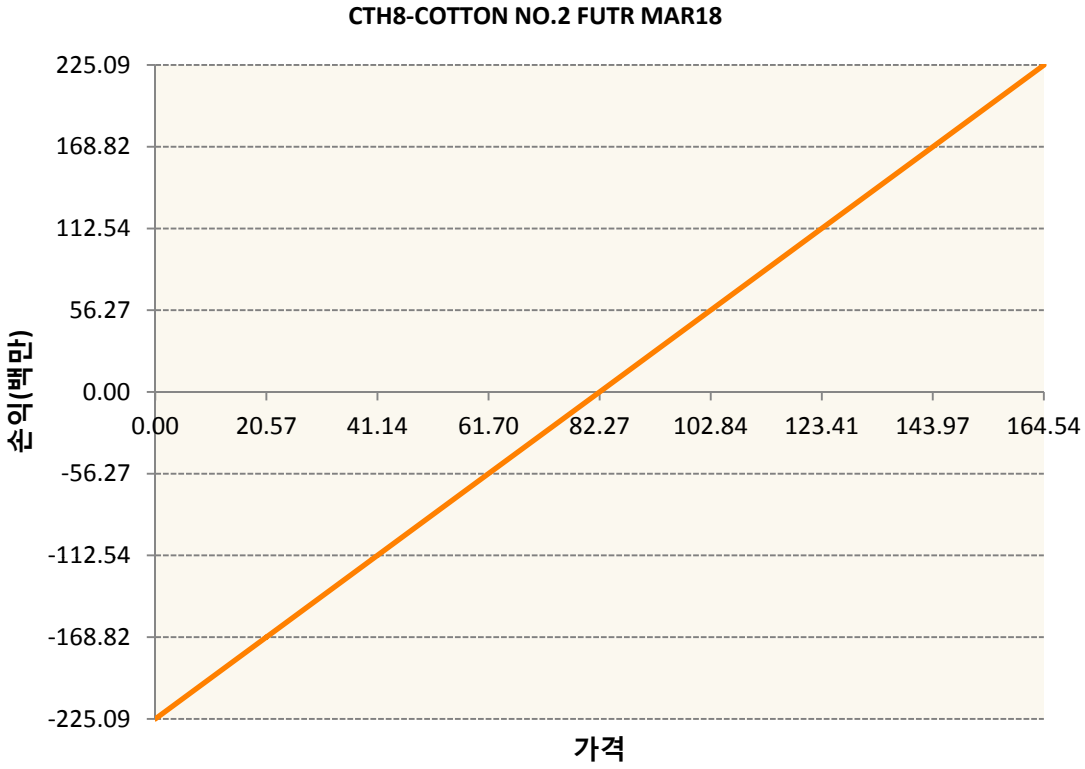
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	4,117	318	3,799	

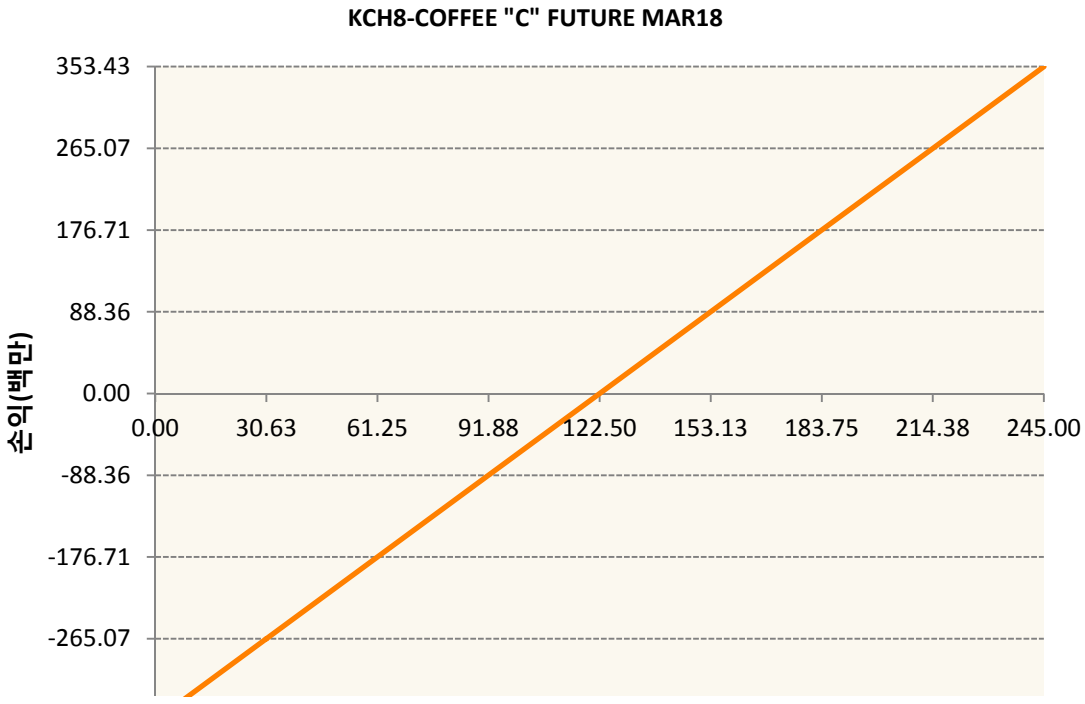
2. 만기시점의 손익구조

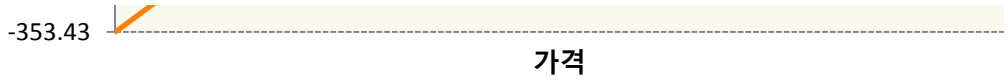


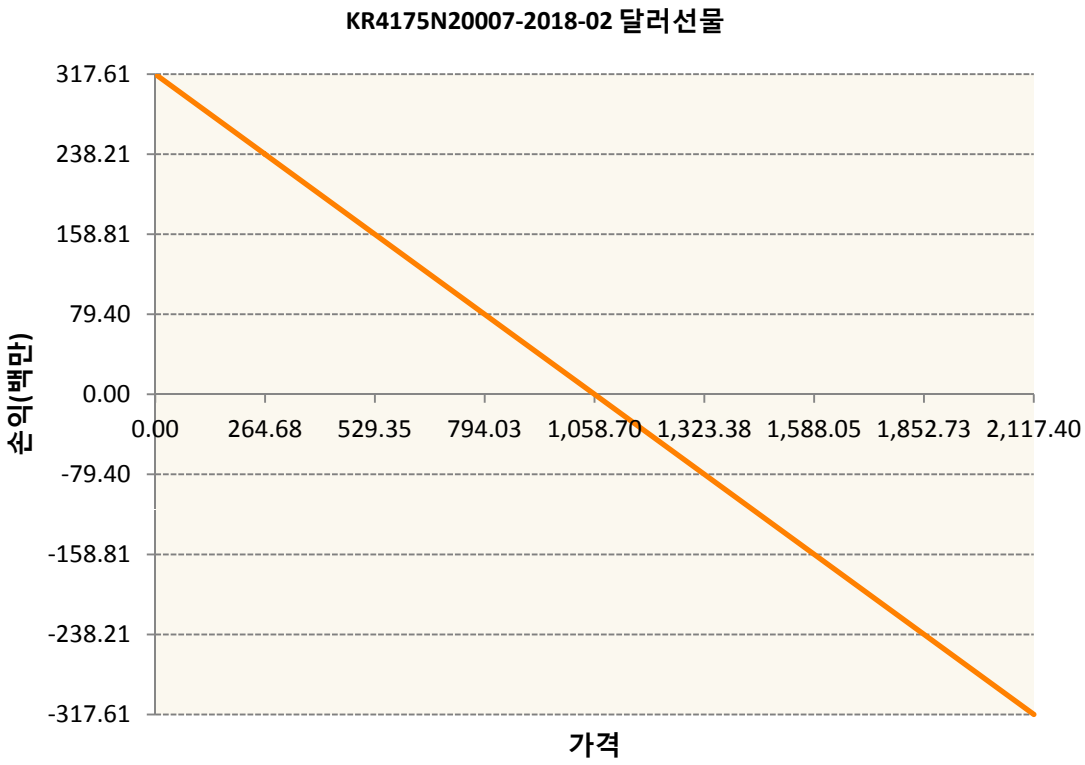


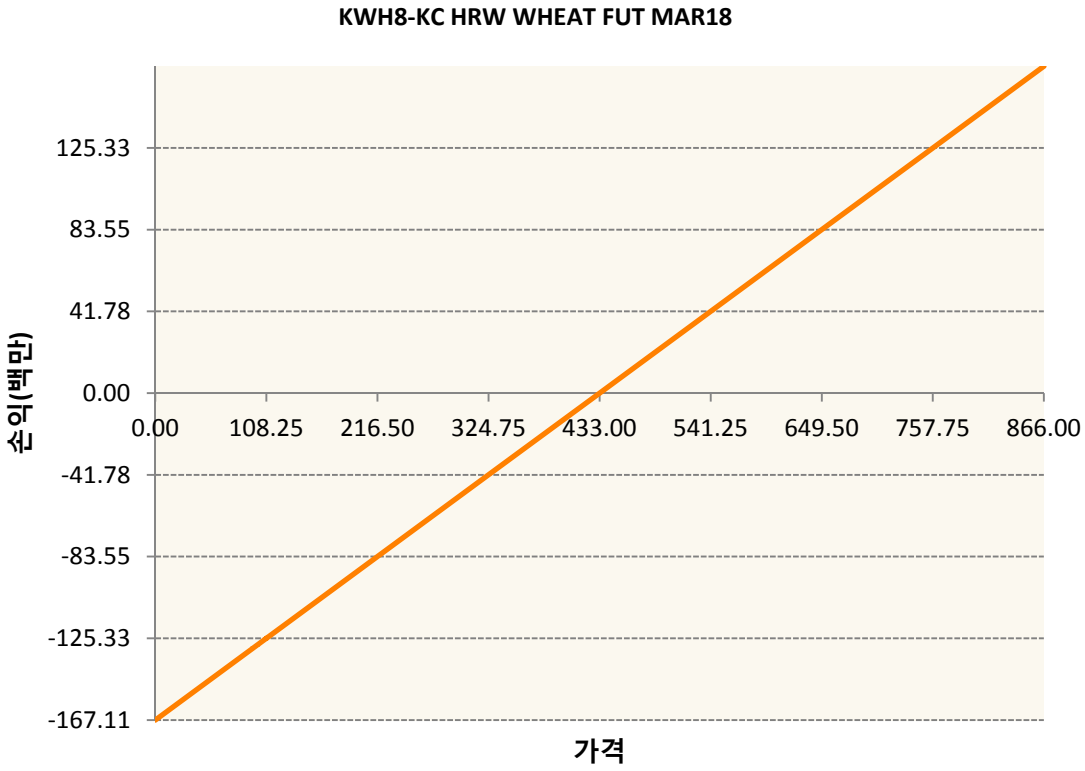

-461.04
-691.57
-922.09
가격


CTH8-COTTON NO.2 FUTR MAR18
225.09
168.82
112.54
56.27
0.00
-56.27
-112.54
-168.82
-225.09
손익(백만)
0.00
20.57
41.14
61.70
82.27
102.84
123.41
143.97
164.54
가격

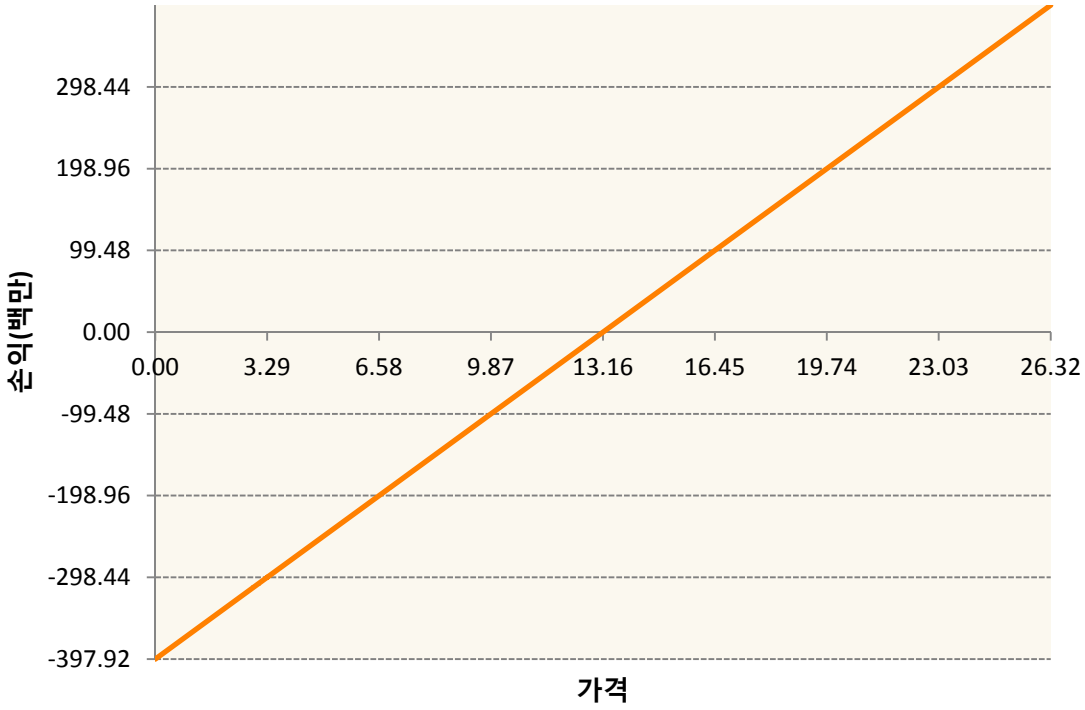

KCH8-COFFEE "C" FUTURE MAR18
353.43
265.07
176.71
88.36
0.00
-88.36
-176.71
-265.07
손익(백만)
0.00
30.63
61.25
91.88
122.50
153.13
183.75
214.38
245.00


-353.43
가격

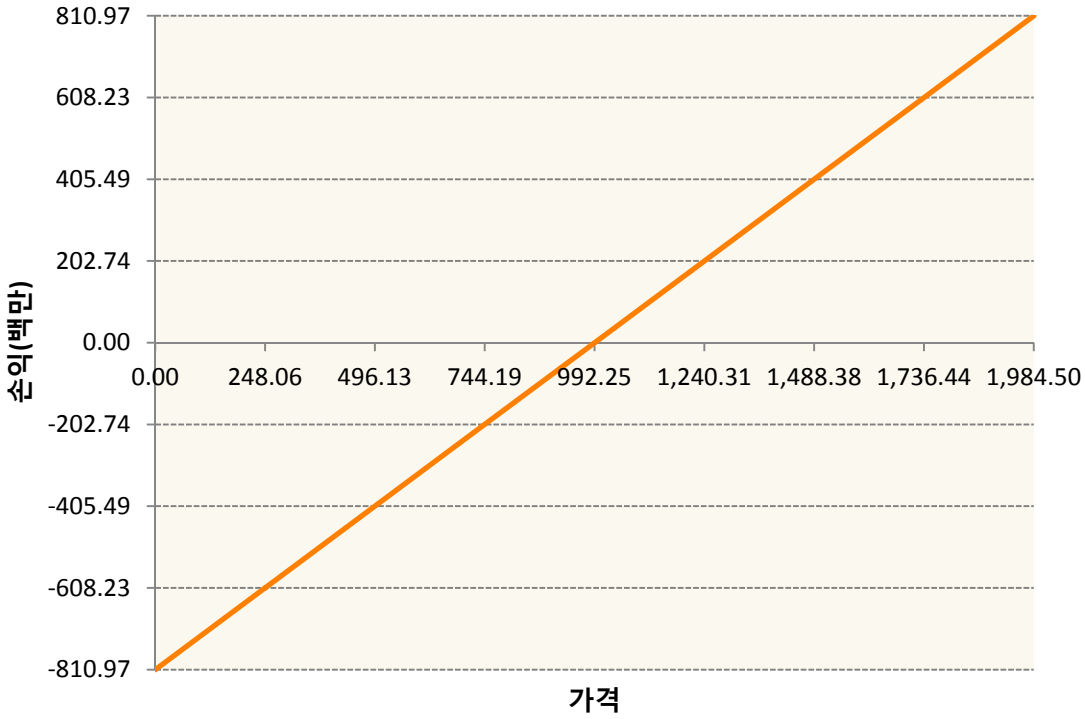

KR4175N20007-2018-02 달러선물
317.61
238.21
158.81
79.40
0.00
-79.40
-158.81
-238.21
-317.61
0.00
264.68
529.35
794.03
1,058.70
1,323.38
1,588.05
1,852.73
2,117.40
손익(백만)
가격


KWH8-KC HRW WHEAT FUT MAR18
125.33
83.55
41.78
0.00
-41.78
-83.55
-125.33
-167.11
0.00
108.25
216.50
324.75
433.00
541.25
649.50
757.75
866.00
손익(백만)
가격

SBH8-Sugar #11 (WORLD) MAR18

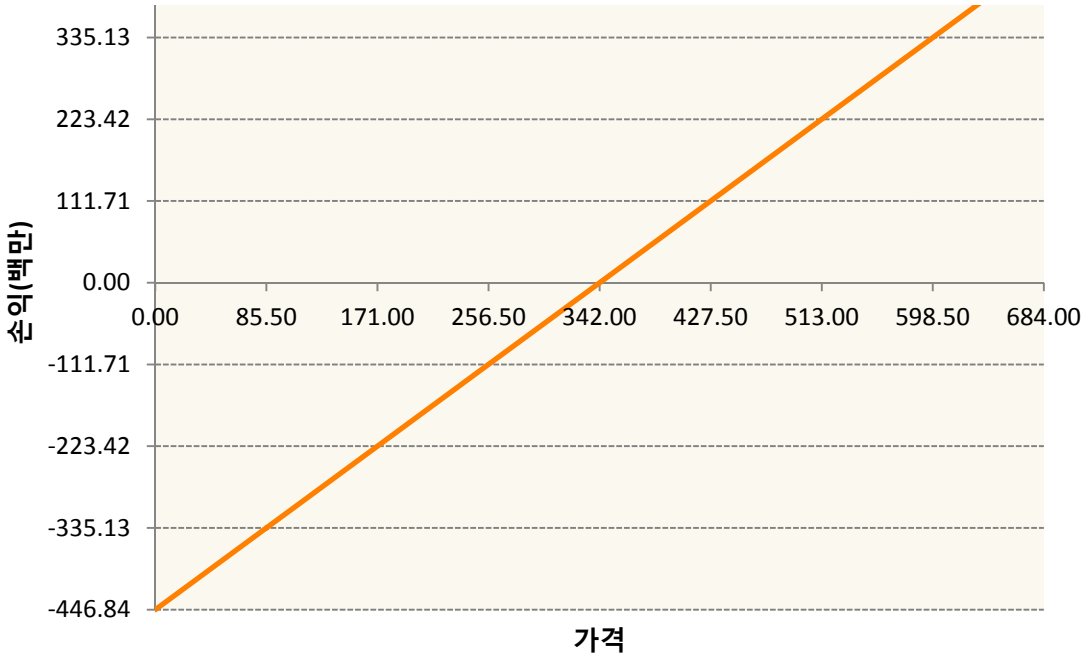


SH8-SOYBEAN FUTURE MAR18

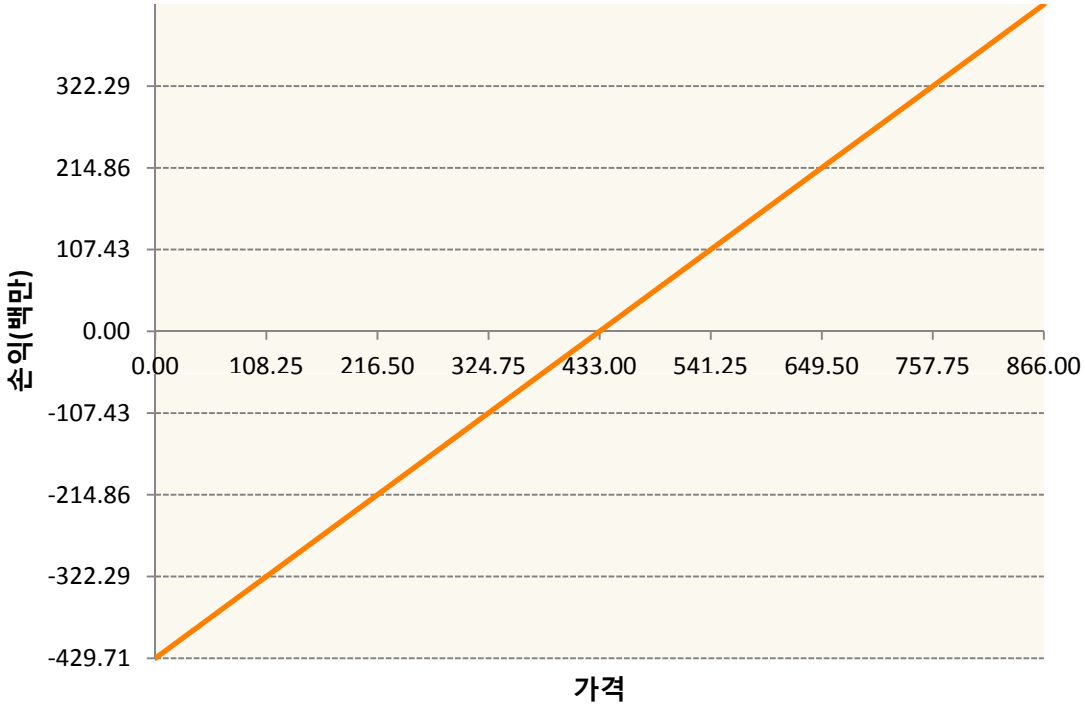


SMH8-SOYBEAN MEAL FUTR MAR18





WH8-WHEAT FUTURE(CBT) MAR18



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

BOH8	SOYBEAN OIL FUTR MAR18	29
CH8	CORN FUTURE MAR18	74
CTH8	COTTON NO.2 FUTR MAR18	18
KCH8	COFFEE "C" FUTURE MAR18	28
KR4175N20(	2018-02 달러선물	25

KWH8	KC HRW WHEAT FUT MAR18	13
SBH8	Sugar #11 (WORLD) MAR18	32
SH8	SOYBEAN FUTURE MAR18	65
SMH8	SOYBEAN MEAL FUTR MAR18	36
WH8	WHEAT FUTURE(CBT) MAR18	34

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

343