공시일	2018-01-29
기준일	2018-01-26

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	2018-01-29
기준일	2018-01-26

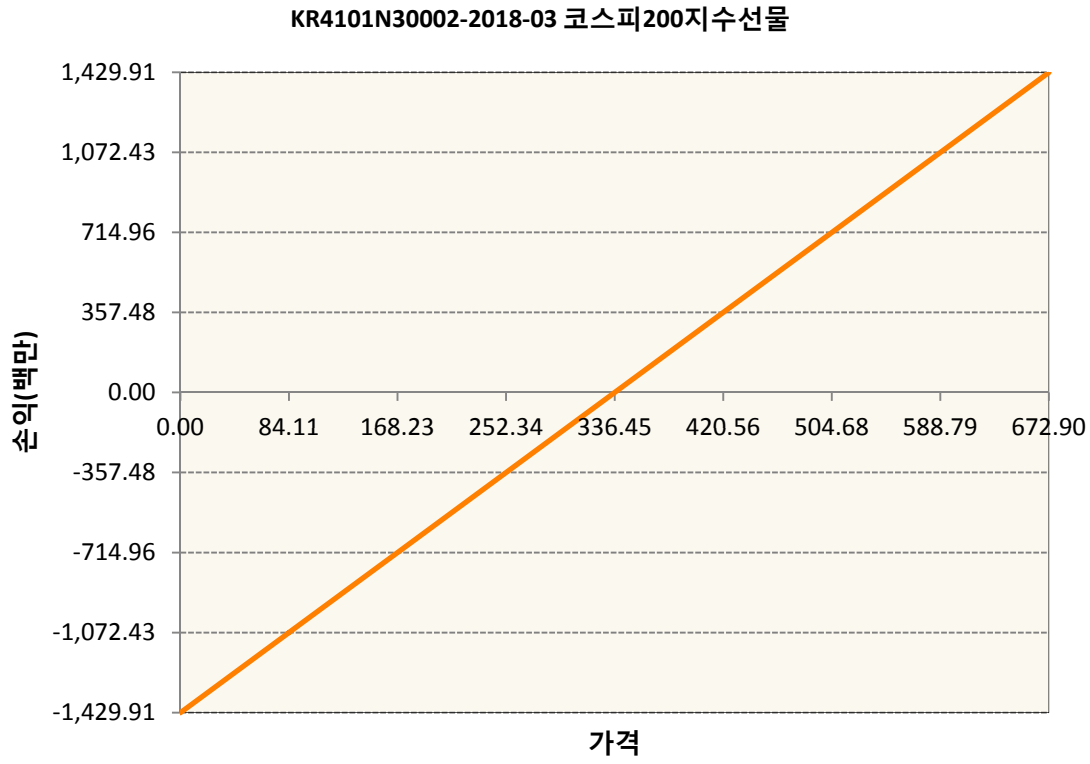
스마트인덱스모

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	1,430	0	1,430	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	2018-01-29
기준일	2018-01-26

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	1,168

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

361

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2018-01-29
기준일	2018-01-26

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	426

* 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	2018-01-29
기준일	2018-01-26

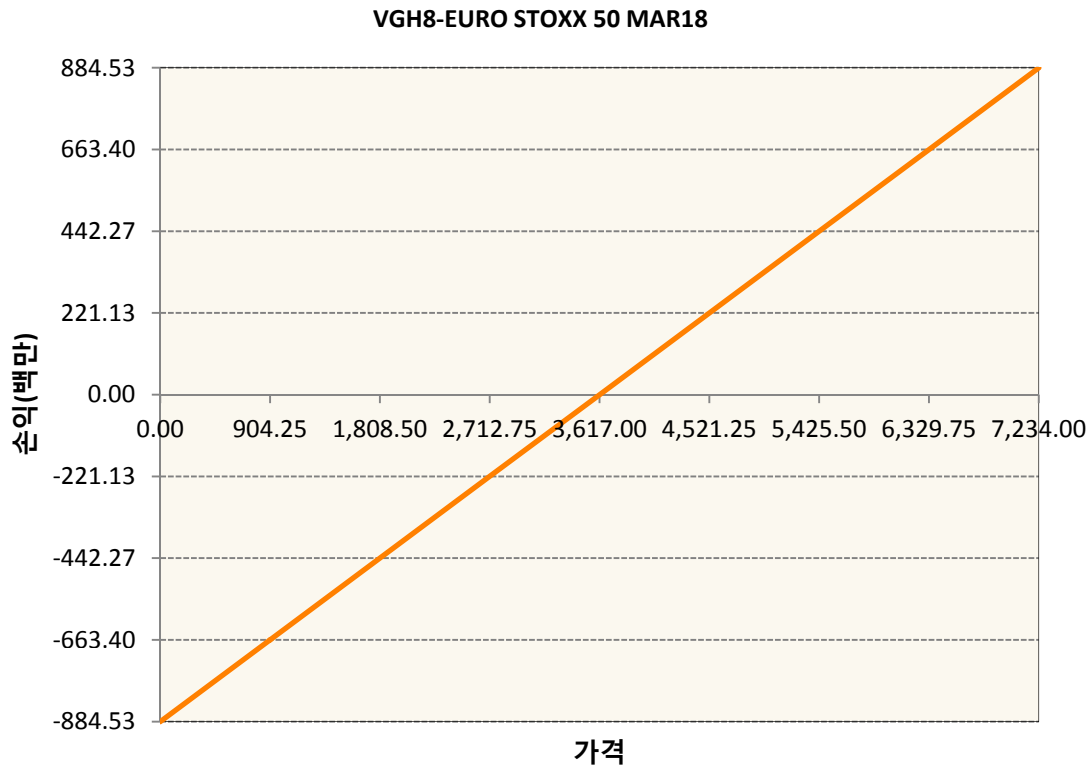
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	885	0	885	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGH8	EURO STOXX 50 MAR18	71

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

(단위:백만원)

39

공시일	2018-01-29
기준일	2018-01-26

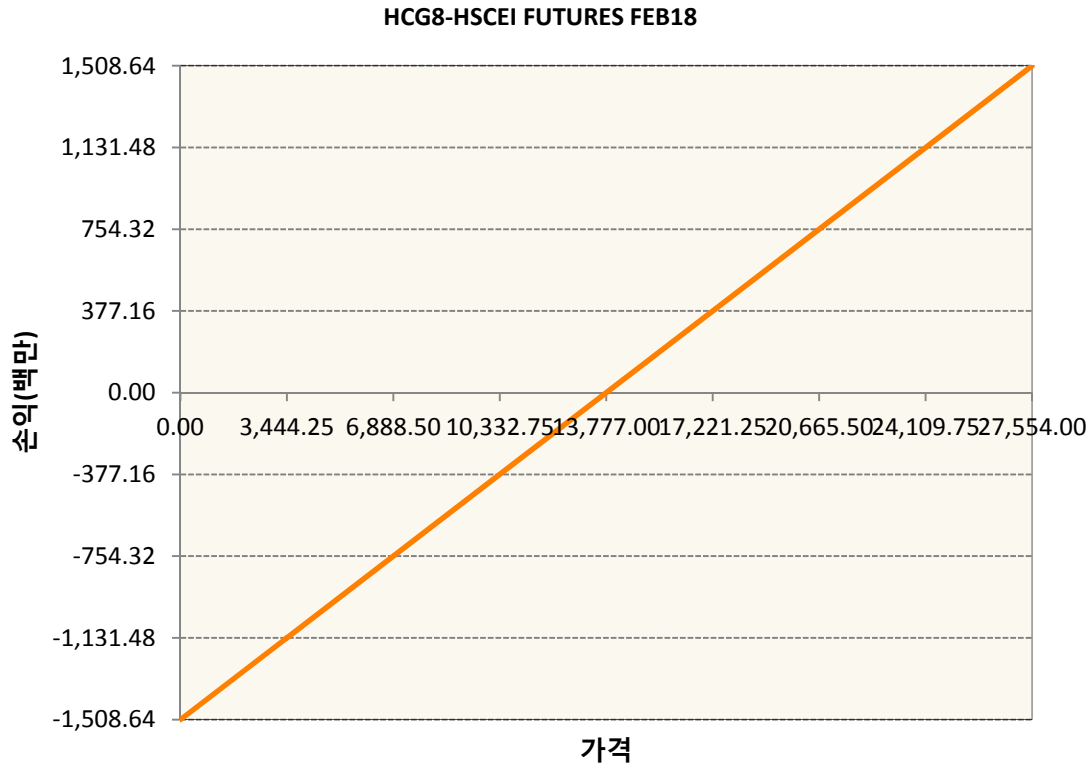
차이나인덱스모(주식-파생형)

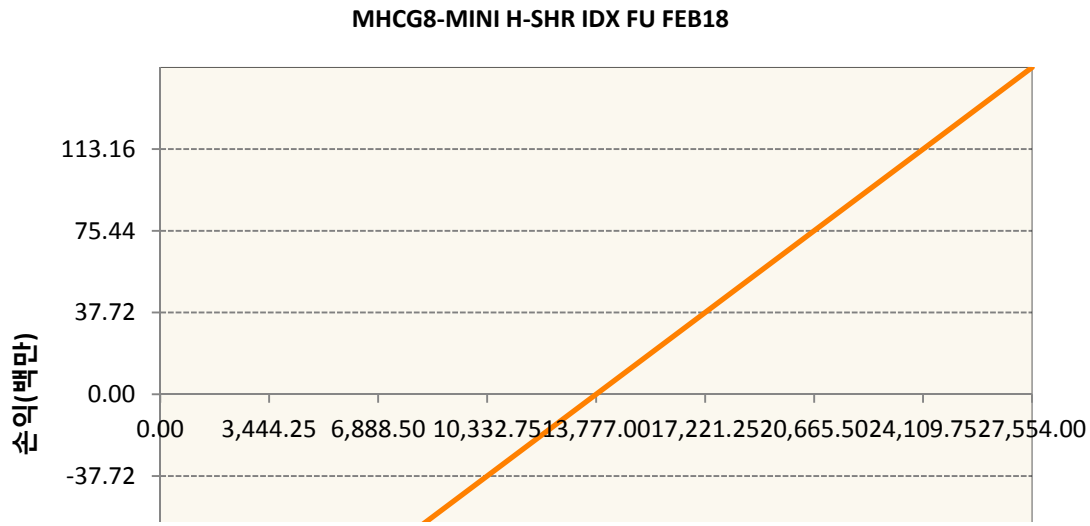
1. 계약금액

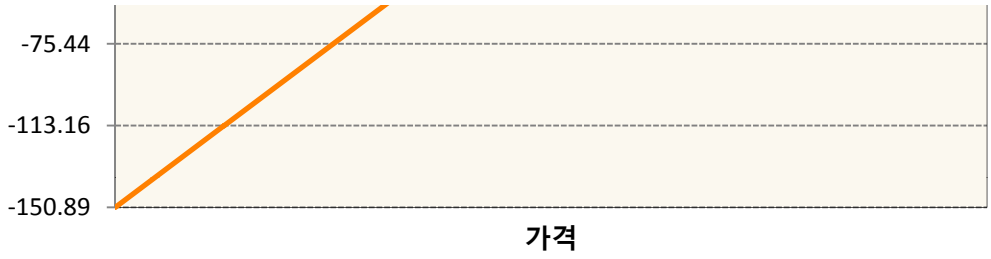
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,660	0	1,660	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCG8	HSCEI FUTURES FEB18	121
MHCG8	MINI H-SHR IDX FU FEB18	12

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	106

공시일	2018-01-29
기준일	2018-01-26

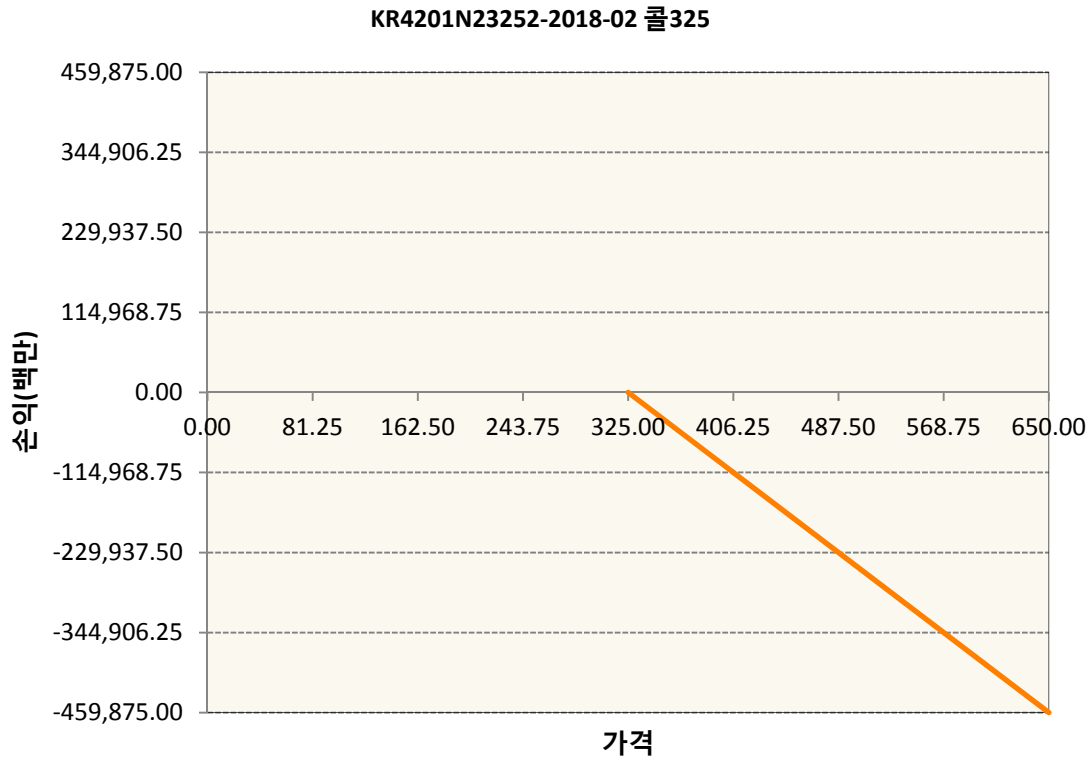
커버드콜모(주식혼합-파생형)

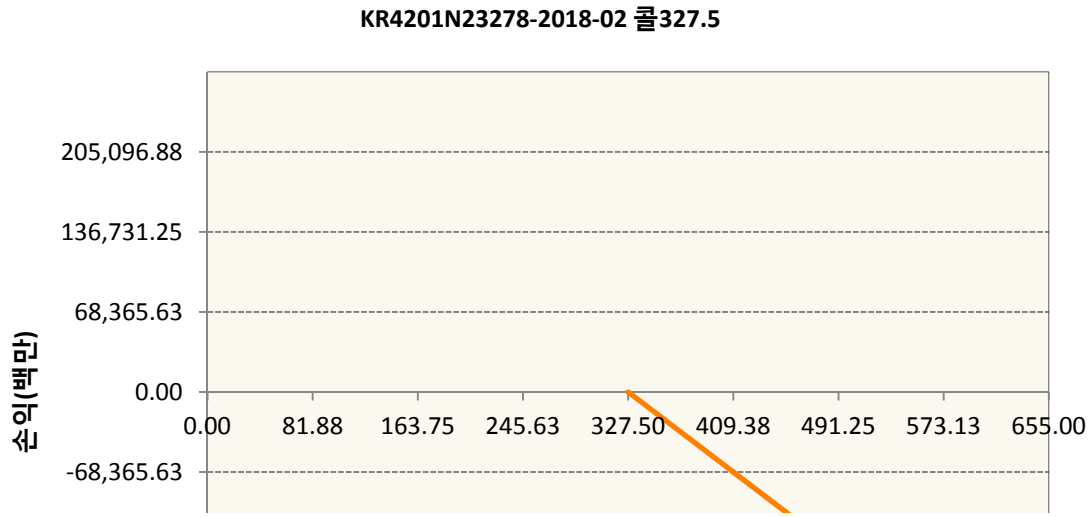
1. 계약금액

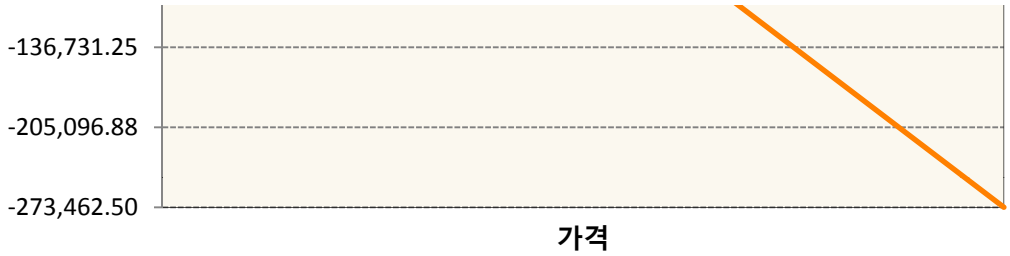
(단위:백만원)

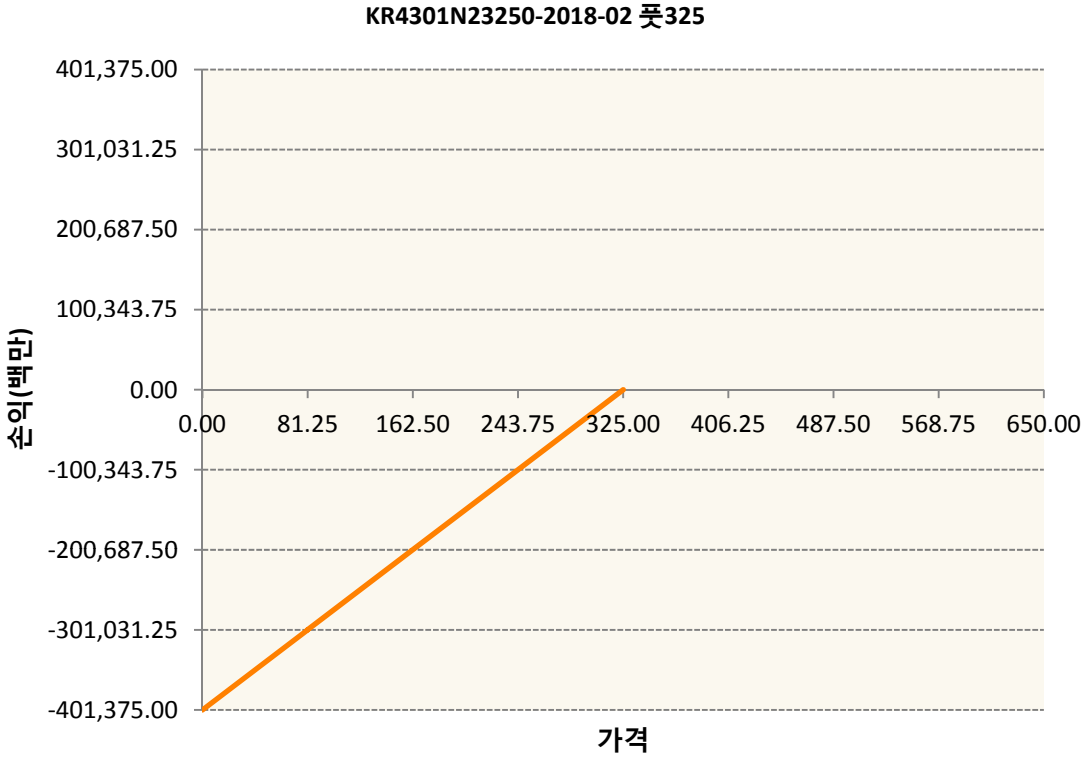
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	15,855	0	15,855	장내
누계	유가증권	옵션	0	1,258,999	-1,258,999	장내

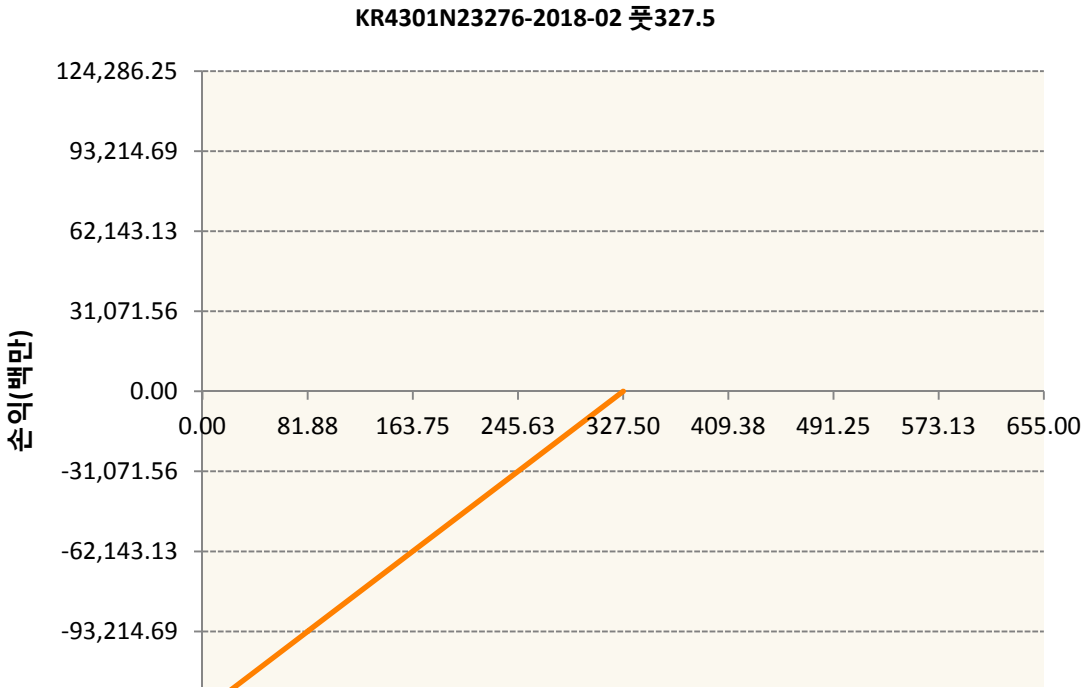
2. 만기시점의 손익구조






-136,731.25
-205,096.88
-273,462.50
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							34,952
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	17,681	17,400	17,066	16,688	16,271	15,822	15,343
-5.33%	15,656	15,055	14,434	13,797	13,147	12,488	11,820
-2.67%	10,480	9,753	9,024	8,295	7,565	6,835	6,105
0%	1,665	1,142	585	0	-607	-1,231	-1,870
2.67%	-9,632	-9,865	-10,153	-10,490	-10,872	-11,293	-11,748
5.33%	-21,961	-22,028	-22,132	-22,276	-22,462	-22,690	-22,958
8.00%	-34,560	-34,573	-34,600	-34,647	-34,719	-34,819	-34,952
KR4201N232 2018-02 콜327.5							20,113
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	9,073	8,949	8,794	8,611	8,403	8,173	7,923
-5.33%	8,217	7,909	7,582	7,239	6,885	6,521	6,150
-2.67%	5,748	5,315	4,882	4,449	4,015	3,582	3,148
0%	1,116	756	383	0	-392	-790	-1,193
2.67%	-5,225	-5,409	-5,625	-5,869	-6,136	-6,424	-6,729
5.33%	-12,387	-12,447	-12,534	-12,649	-12,790	-12,956	-13,147
8.00%	-19,797	-19,810	-19,835	-19,876	-19,934	-20,013	-20,113
KR4301N232 2018-02 풋325							19,980
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-19,808	-19,815	-19,827	-19,848	-19,880	-19,924	-19,980
-5.33%	-9,068	-9,208	-9,371	-9,551	-9,747	-9,956	-10,175
-2.67%	-1,579	-1,880	-2,184	-2,489	-2,794	-3,101	-3,408
0%	281	209	115	0	-134	-286	-454
2.67%	378	376	370	359	341	313	275
5.33%	379	379	379	379	378	376	372
8.00%	379	379	379	379	379	379	379
KR4301N232 2018-02 풋327.5							6,948
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-6,921	-6,922	-6,923	-6,926	-6,931	-6,938	-6,948
-5.33%	-3,562	-3,586	-3,617	-3,653	-3,696	-3,744	-3,796
-2.67%	-831	-926	-1,021	-1,116	-1,212	-1,307	-1,403
0%	145	103	54	0	-60	-123	-191
2.67%	228	226	221	213	202	186	166

5.33%	229	229	229	229	228	227	224
8.00%	229	229	229	229	229	229	229

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

80,246

공시일	2018-01-29
기준일	2018-01-26

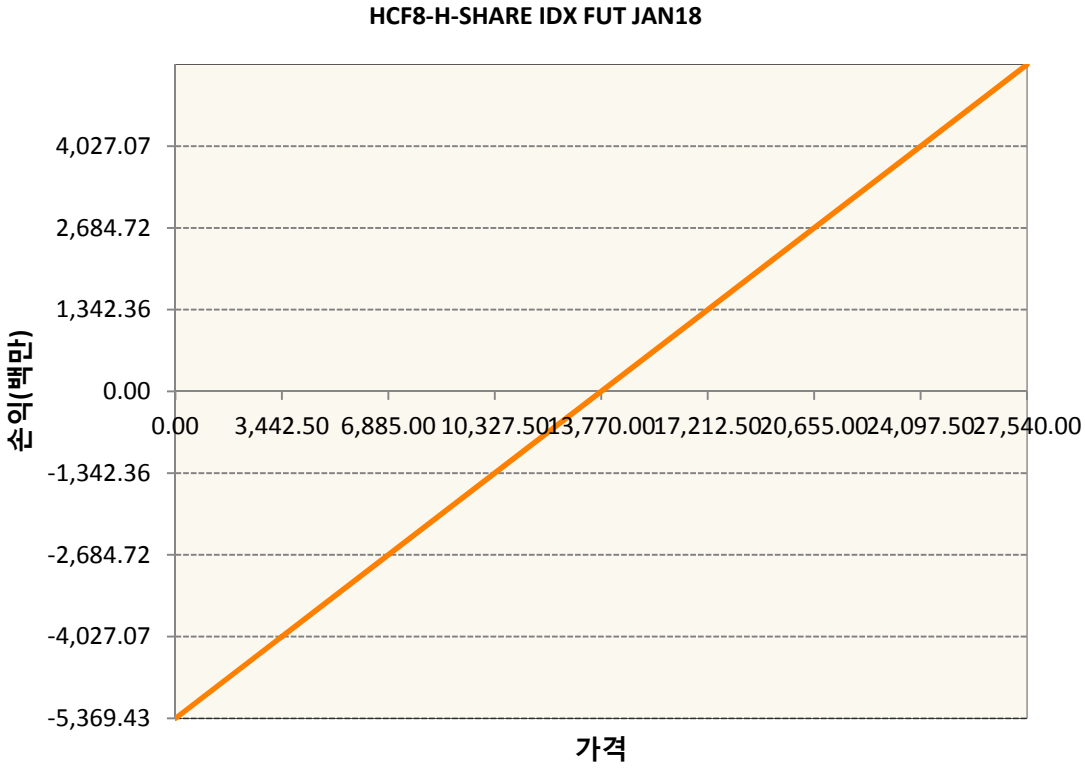
홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생

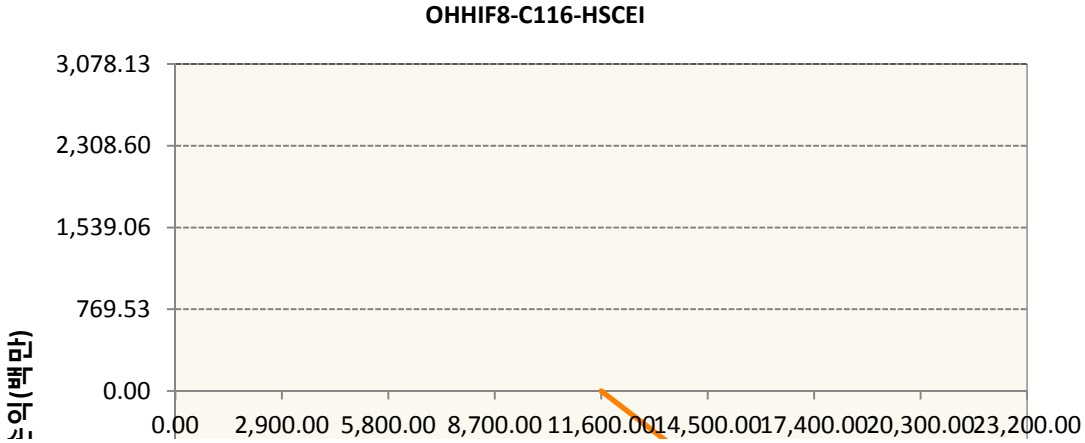
1. 계약금액

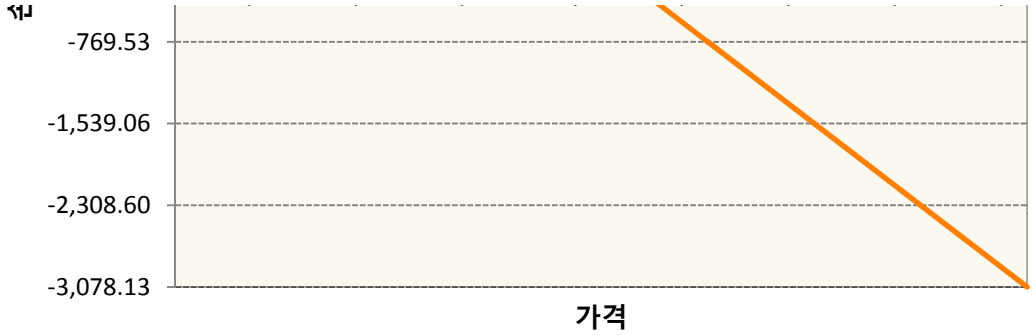
(단위:백만원)

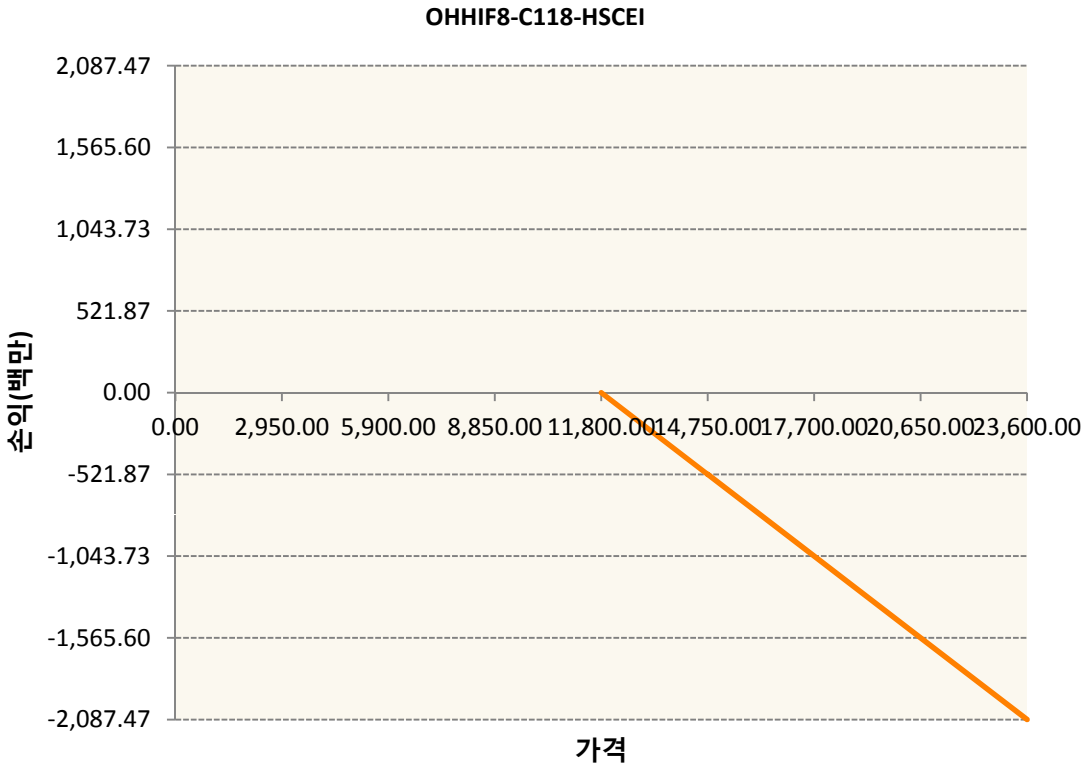
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	5,369	0	5,369	장내
누계	유가증권	옵션	0	10,331	-10,331	장내

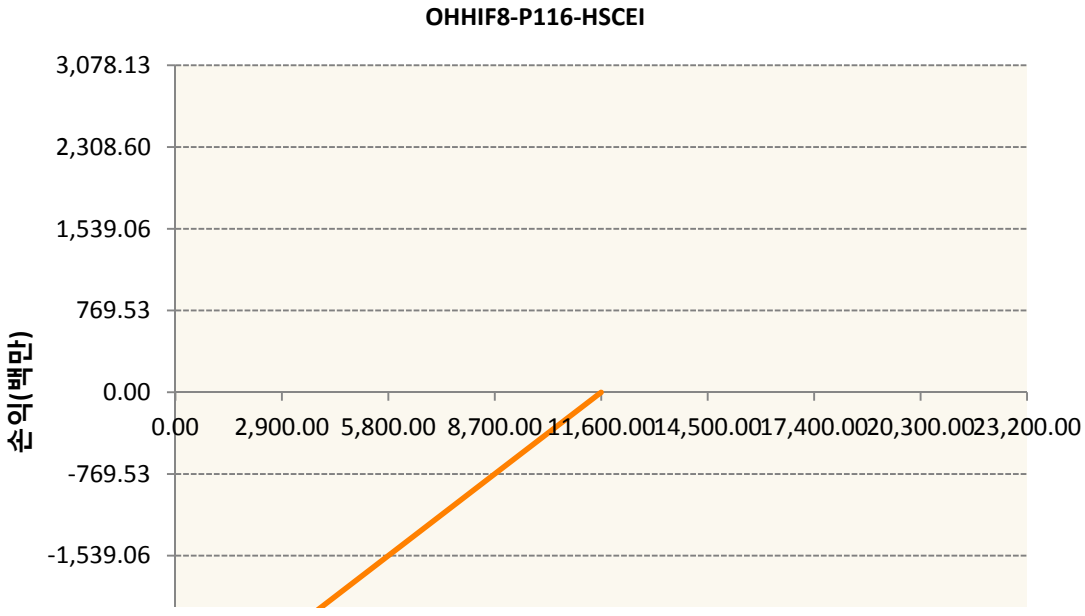
2. 만기시점의 손익구조

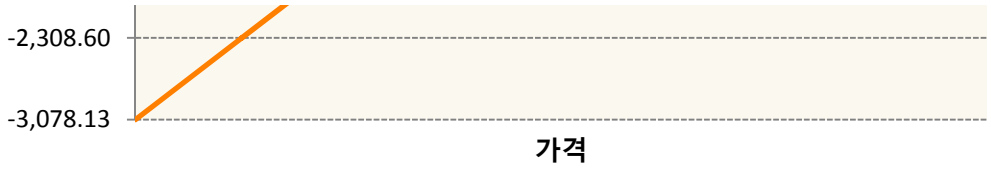


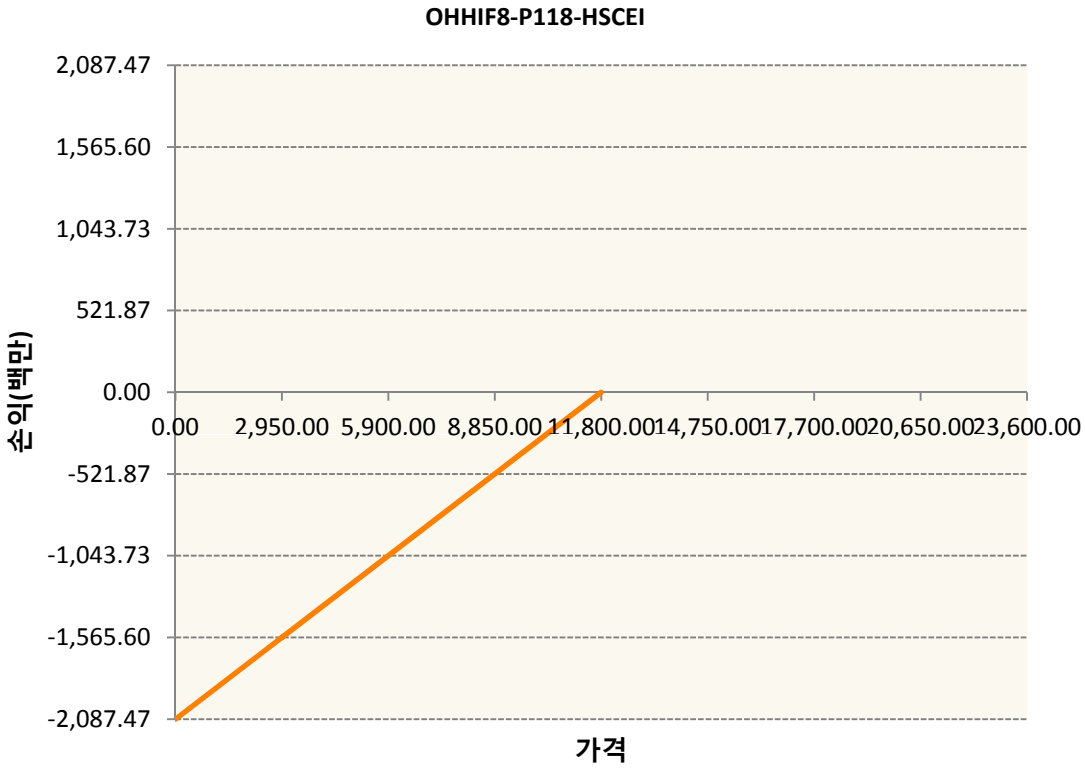



-769.53
-1,539.06
-2,308.60
-3,078.13
가격


OHHIF8-C118-HSCEI
2,087.47
1,565.60
1,043.73
521.87
0.00
-521.87
-1,043.73
-1,565.60
-2,087.47
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
3,078.13
2,308.60
1,539.06
769.53
0.00
-769.53
-1,539.06
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	430
OHHIF8-C11	HSCEI	246
OHHIF8-C11	HSCEI	167
OHHIF8-P11	HSCEI	246
OHHIF8-P11	HSCEI	167

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,004

공시일	2018-01-29
기준일	2018-01-26

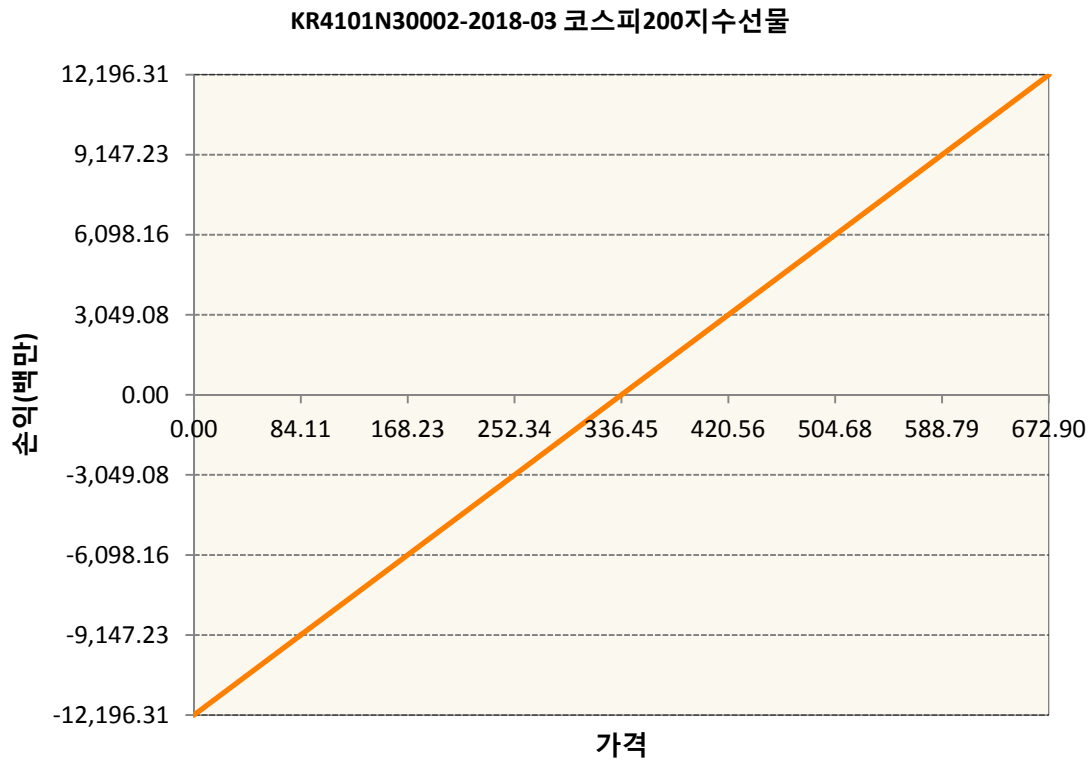
코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼

1. 계약금액

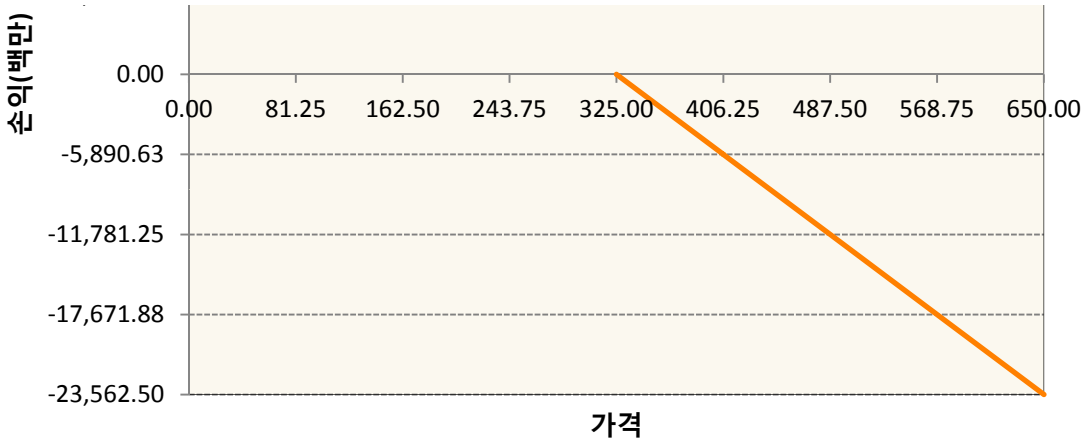
(단위:백만원)

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	12,196	0	12,196	장내
누계	유가증권	스왑	60,200	0	60,200	장외
누계	유가증권	옵션	0	60,250	-60,250	장내

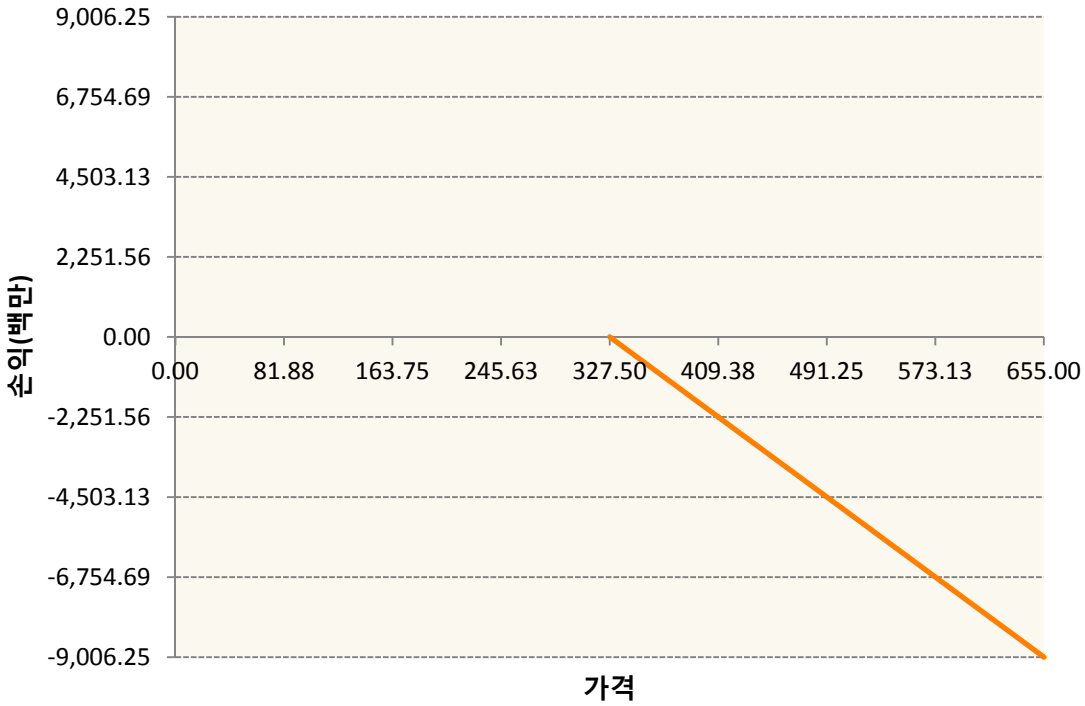
2. 만기시점의 손익구조



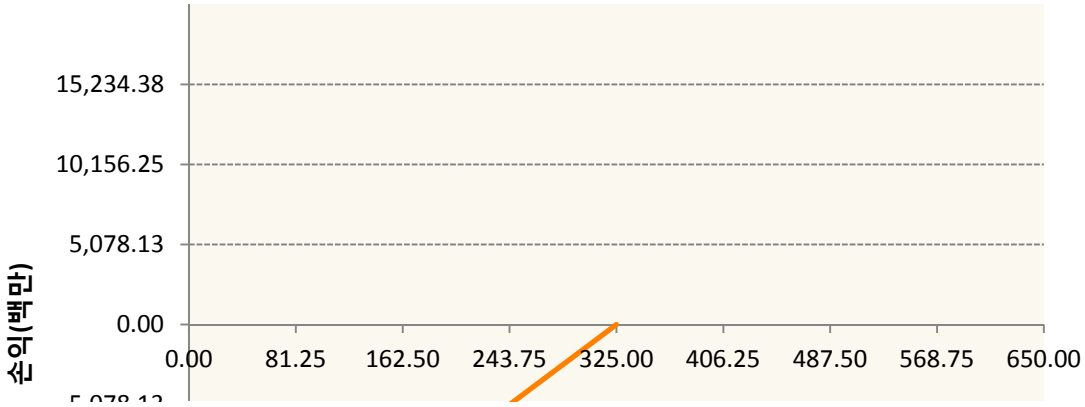




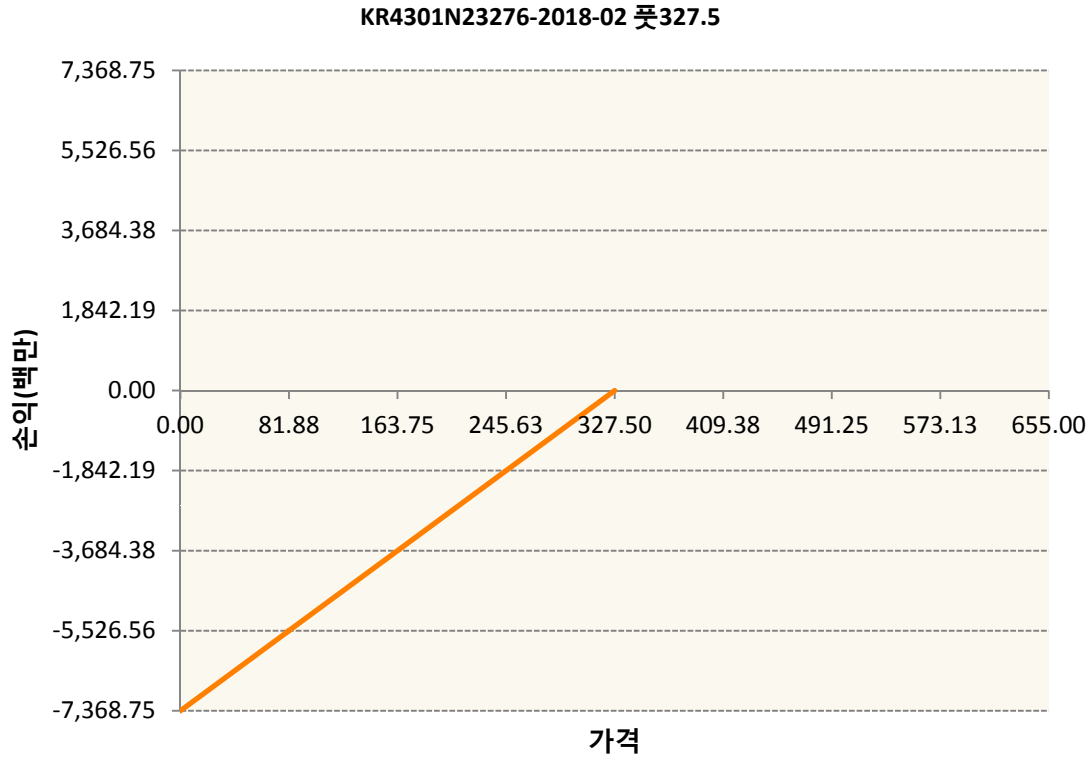
KR4201N23278-2018-02 콜327.5



KR4301N23250-2018-02 풋325







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_2							1,448
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,448	-1,448	-1,448	-1,448	-1,448	-1,448	-1,448
-5.33%	-965	-965	-965	-965	-965	-965	-965
-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%	965	965	965	965	965	965	965
8.00%	1,448	1,448	1,448	1,448	1,448	1,448	1,448
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%	-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%	196	196	196	196	196	196	196
	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						463
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-463	-463	-463	-463	-463	-463	-463
-5.33%	-309	-309	-309	-309	-309	-309	-309
-2.67%	-154	-154	-154	-154	-154	-154	-154
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	154	154	154	154	154	154	154
5.33%	309	309	309	309	309	309	309
8.00%	463	463	463	463	463	463	463
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_9						309
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-309	-309	-309	-309	-309	-309	-309
-5.33%	-206	-206	-206	-206	-206	-206	-206
-2.67%	-103	-103	-103	-103	-103	-103	-103
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	103	103	103	103	103	103	103
5.33%	206	206	206	206	206	206	206
8.00%	309	309	309	309	309	309	309
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_10						274
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-274	-274	-274	-274	-274	-274	-274
-5.33%	-183	-183	-183	-183	-183	-183	-183
-2.67%	-91	-91	-91	-91	-91	-91	-91
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	91	91	91	91	91	91	91
5.33%	183	183	183	183	183	183	183
8.00%	274	274	274	274	274	274	274
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_11						626
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-626	-626	-626	-626	-626	-626	-626
-5.33%	-417	-417	-417	-417	-417	-417	-417
-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%	417	417	417	417	417	417	417
8.00%	626	626	626	626	626	626	626
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_12						470

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-470	-470	-470	-470	-470	-470	-470
-5.33%	-313	-313	-313	-313	-313	-313	-313
-2.67%	-157	-157	-157	-157	-157	-157	-157
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	157	157	157	157	157	157	157
5.33%	313	313	313	313	313	313	313
8.00%	470	470	470	470	470	470	470
	KR4101N30(	2018-03	코스피200지수선물				973

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-973	-973	-973	-973	-973	-973	-973
-5.33%	-648	-648	-648	-648	-648	-648	-648
-2.67%	-324	-324	-324	-324	-324	-324	-324
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	324	324	324	324	324	324	324
5.33%	648	648	648	648	648	648	648
8.00%	973	973	973	973	973	973	973
	KR4201N232	2018-02	콜325				1,791

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	906	891	874	855	834	811	786
-5.33%	802	771	740	707	674	640	606
-2.67%	537	500	462	425	388	350	313
0%	85	59	30	0	-31	-63	-96
2.67%	-494	-505	-520	-537	-557	-579	-602
5.33%	-1,125	-1,129	-1,134	-1,141	-1,151	-1,163	-1,176
8.00%	-1,771	-1,771	-1,773	-1,775	-1,779	-1,784	-1,791
	KR4201N232	2018-02	콜327.5				662

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	299	295	290	284	277	269	261
-5.33%	271	260	250	238	227	215	203
-2.67%	189	175	161	147	132	118	104
0%	37	25	13	0	-13	-26	-39
2.67%	-172	-178	-185	-193	-202	-212	-222
5.33%	-408	-410	-413	-417	-421	-427	-433
8.00%	-652	-652	-653	-655	-657	-659	-662
	KR4301N232	2018-02	풋325				1,011

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,002	-1,003	-1,003	-1,004	-1,006	-1,008	-1,011
-5.33%	-459	-466	-474	-483	-493	-504	-515

-2.67%	-80	-95	-111	-126	-141	-157	-172
0%	14	11	6	0	-7	-14	-23
2.67%	19	19	19	18	17	16	14
5.33%	19	19	19	19	19	19	19
8.00%	19	19	19	19	19	19	19
	KR4301N232 2018-02 풋327.5						412
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-410	-410	-410	-411	-411	-411	-412
-5.33%	-211	-213	-214	-217	-219	-222	-225
-2.67%	-49	-55	-61	-66	-72	-77	-83
0%	9	6	3	0	-4	-7	-11
2.67%	14	13	13	13	12	11	10
5.33%	14	14	14	14	14	13	13
8.00%	14	14	14	14	14	14	14

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

9,039

공시일	2018-01-29
기준일	2018-01-26

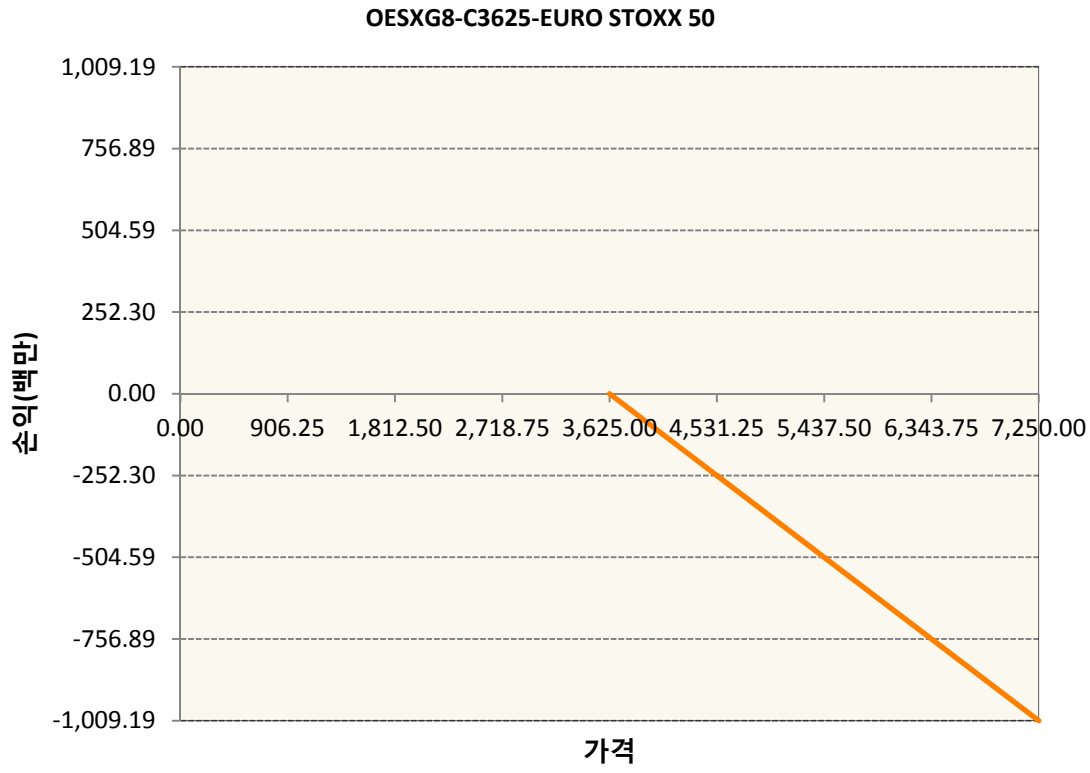
유로커버드콜모(주식혼합-파생형

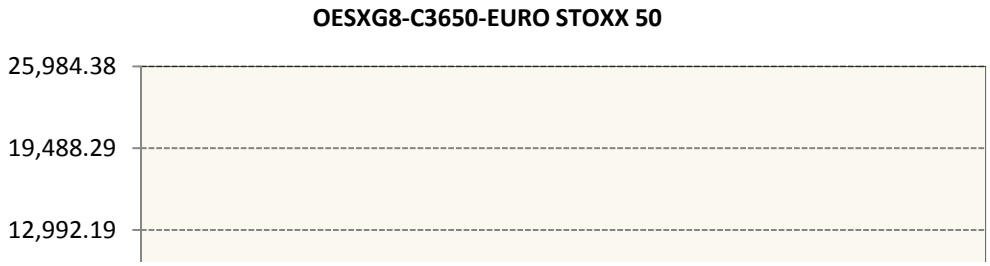
1. 계약금액

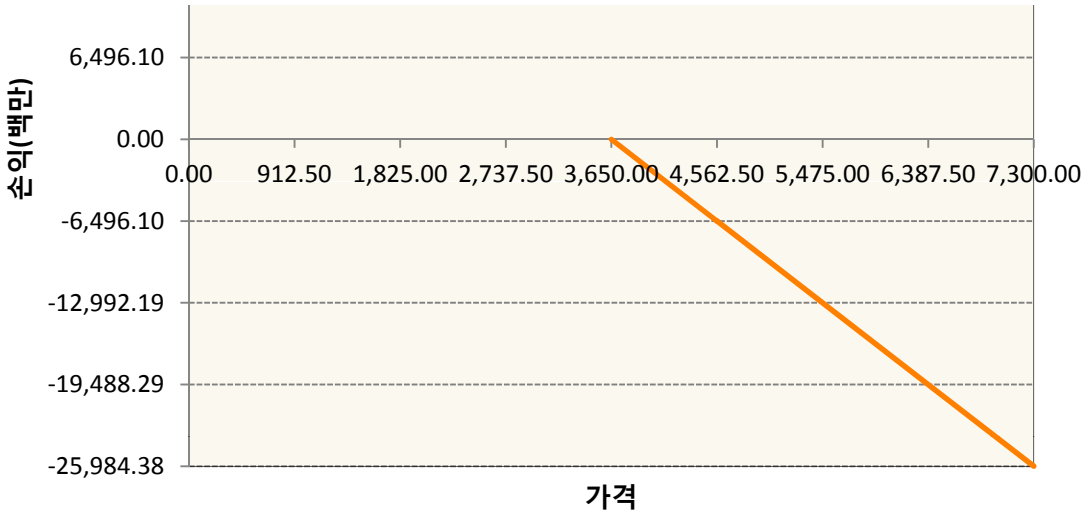
(단위:백만원)

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	17,661	0	17,661	
누계	유가증권	스왑	99,429	0	99,429	장외
누계	유가증권	옵션	0	53,987	-53,987	장내
누계	지수	스왑	53,030	0	53,030	장외

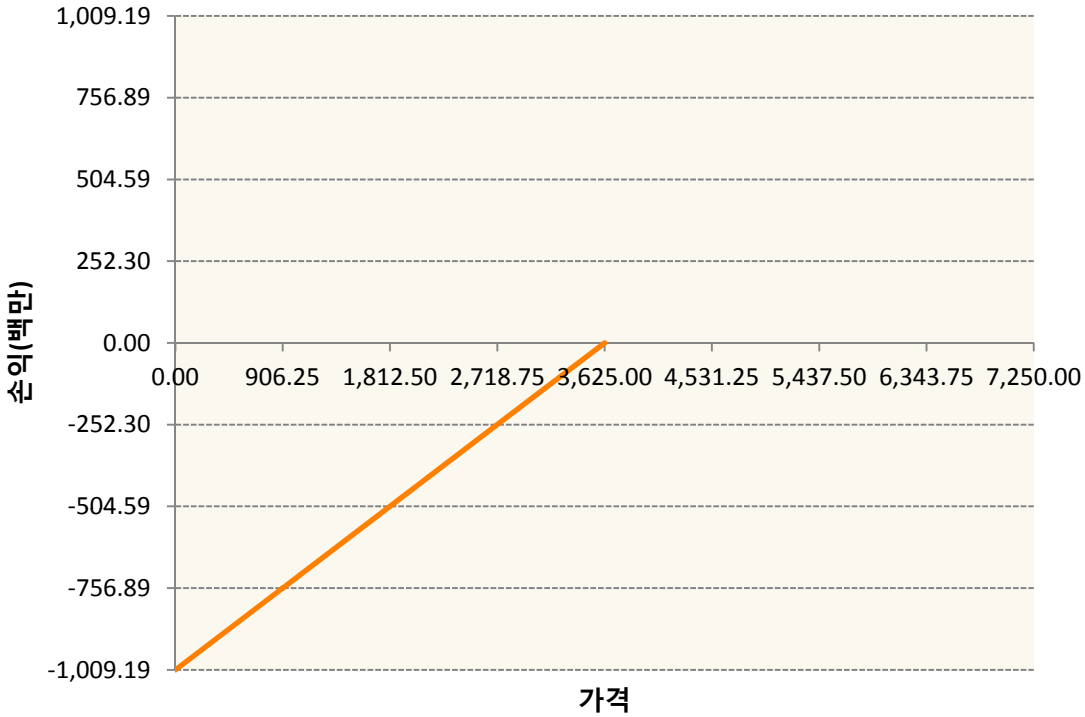
2. 만기시점의 손익구조



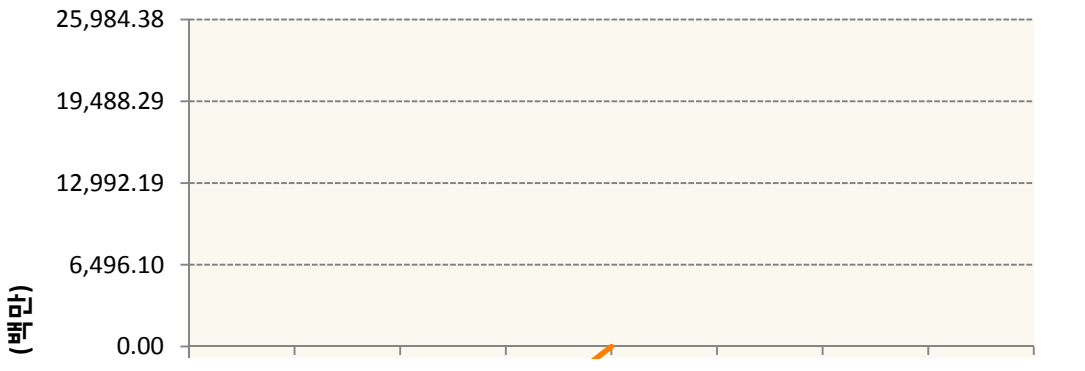


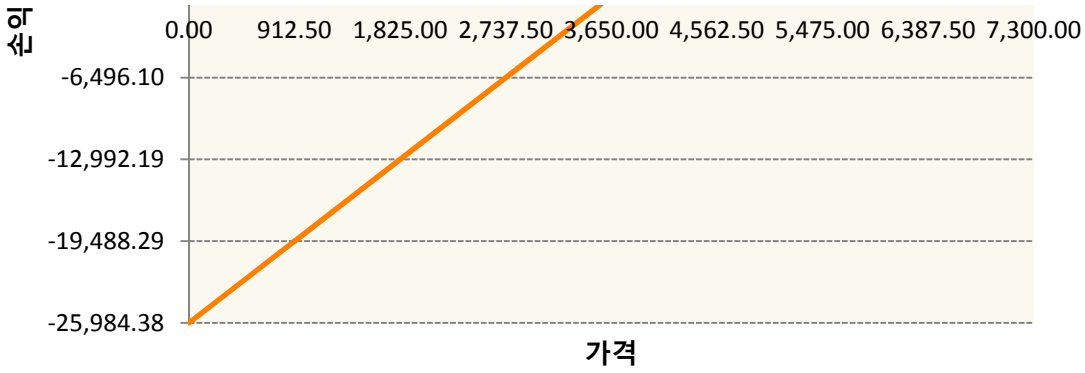


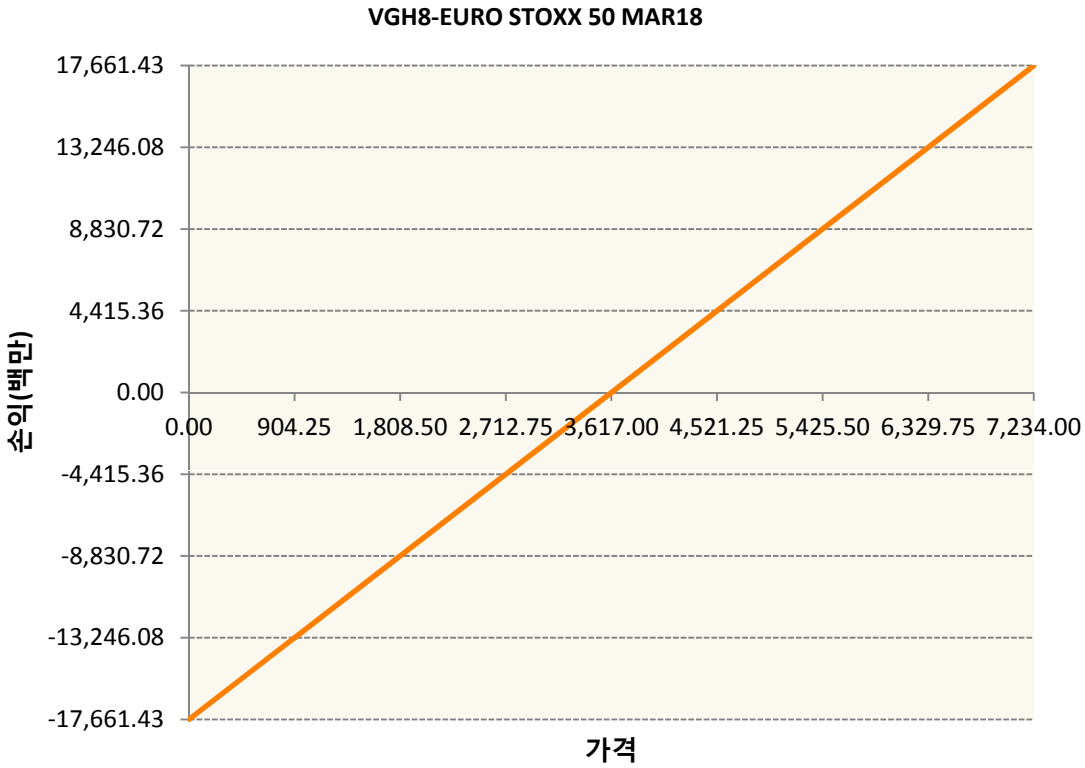
OESXG8-P3625-EURO STOXX 50



OESXG8-P3650-EURO STOXX 50







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)	(단위:백만원)
260105SGPX SG EURO Covered CALL STRATEGY - 994.569	8
260105SQPX SG EURO Covered CALL STRATEGY	15
OESXG8-C3(EURO STOXX 50	81
OESXG8-C3(EURO STOXX 50	2,079
OESXG8-P3(EURO STOXX 50	81
OESXG8-P3(EURO STOXX 50	2,079
VGH8 EURO STOXX 50 MAR18	1,413

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

3,202

공시일	2018-01-29
기준일	2018-01-26

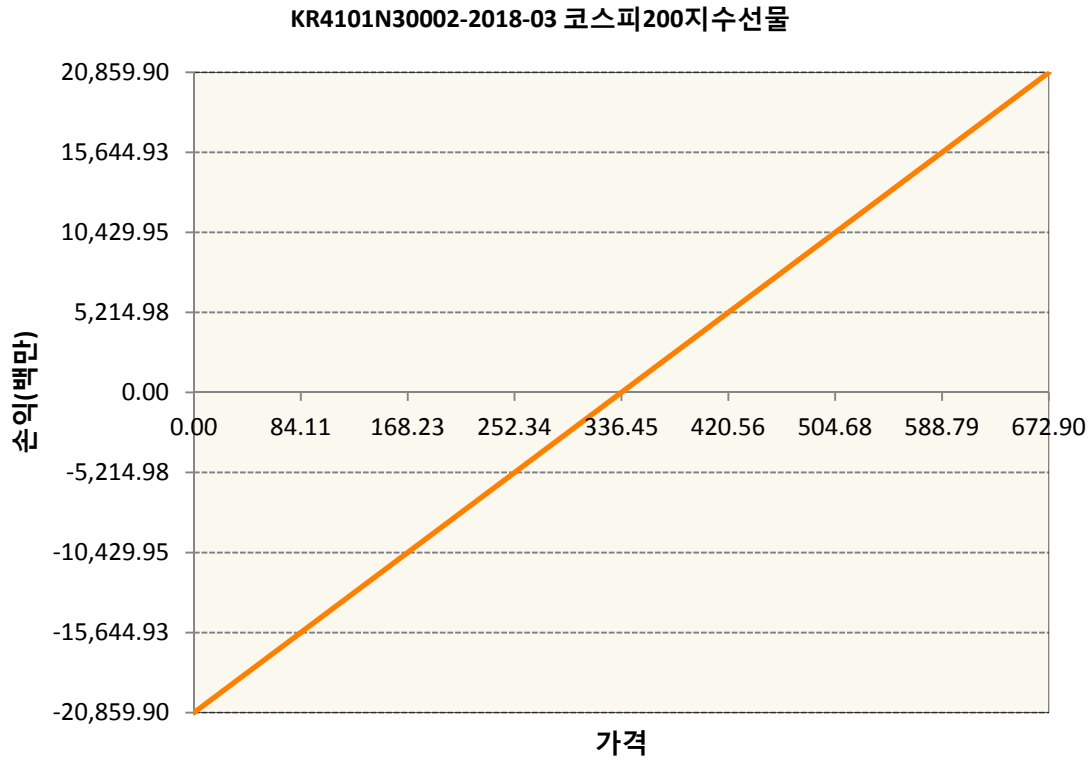
ETF스마트레버리지목표전환형8호

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	20,860	0	20,860	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101N30(2018-03 코스피200지수선물							1,663
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,663	-1,663	-1,663	-1,663	-1,663	-1,663	-1,663
-5.33%	-1,109	-1,109	-1,109	-1,109	-1,109	-1,109	-1,109
-2.67%	-554	-554	-554	-554	-554	-554	-554
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	554	554	554	554	554	554	554
5.33%	1,109	1,109	1,109	1,109	1,109	1,109	1,109
8.00%	1,663	1,663	1,663	1,663	1,663	1,663	1,663

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

996

공시일	2018-01-29
기준일	2018-01-26

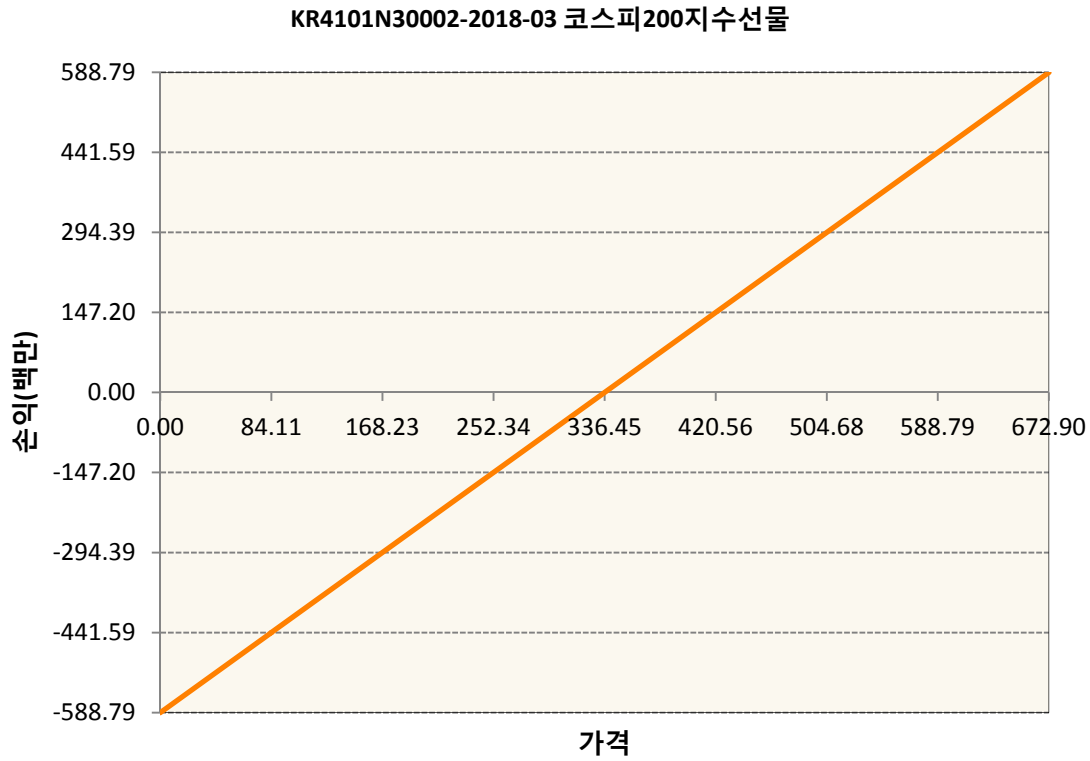
ETF스마트레버리지목표전환형9호

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	589	0	589	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	2018-01-29
기준일	2018-01-26

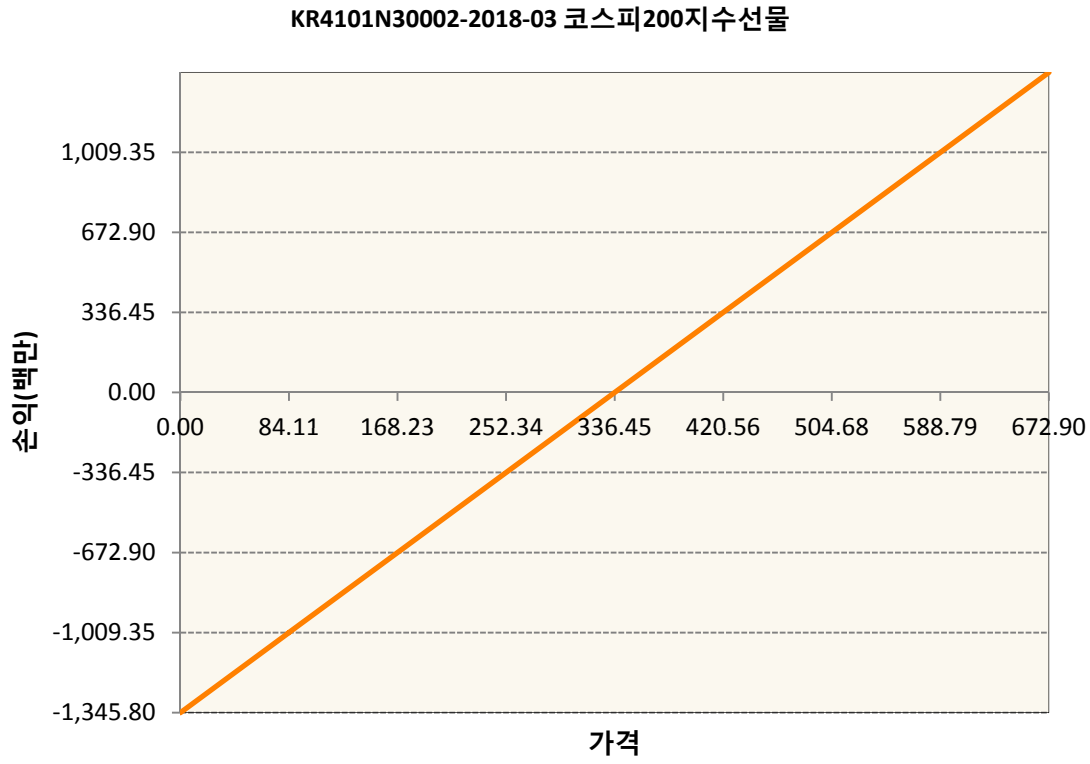
ETF스마트레버리지목표전환형10

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	1,346	0	1,346	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%	-72	-72	-72	-72	-72	-72	-72
-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%	72	72	72	72	72	72	72
8.00%	107	107	107	107	107	107	107

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

64

공시일	2018-01-29
기준일	2018-01-26

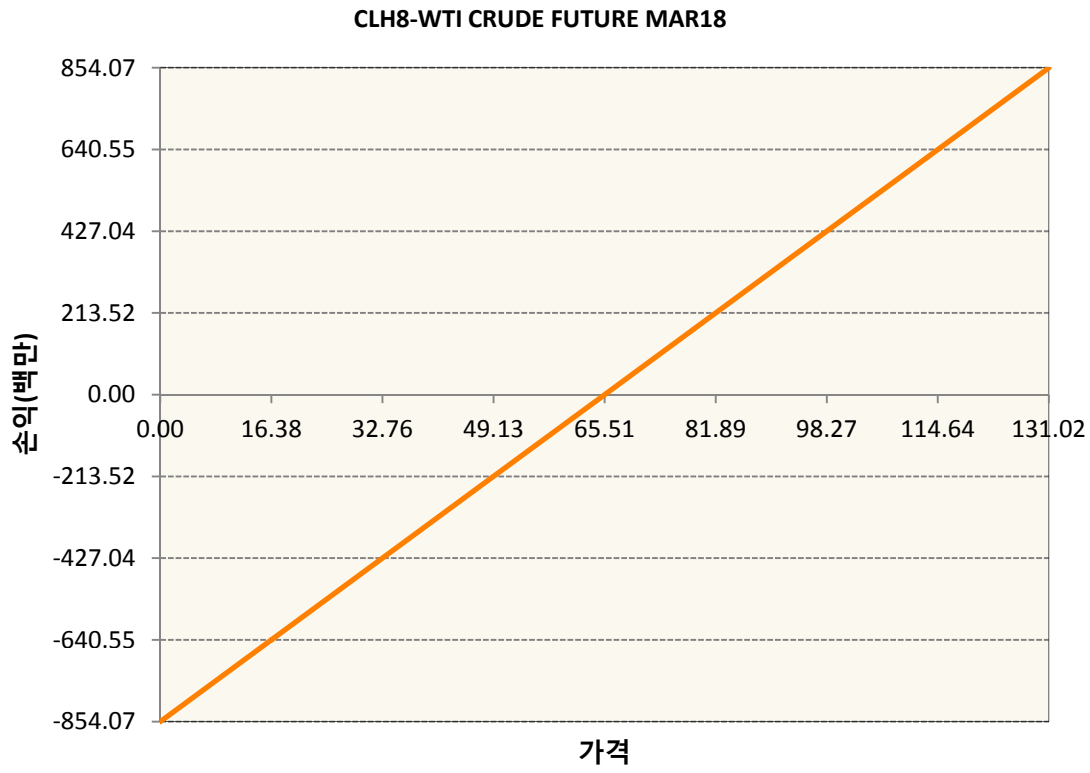
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

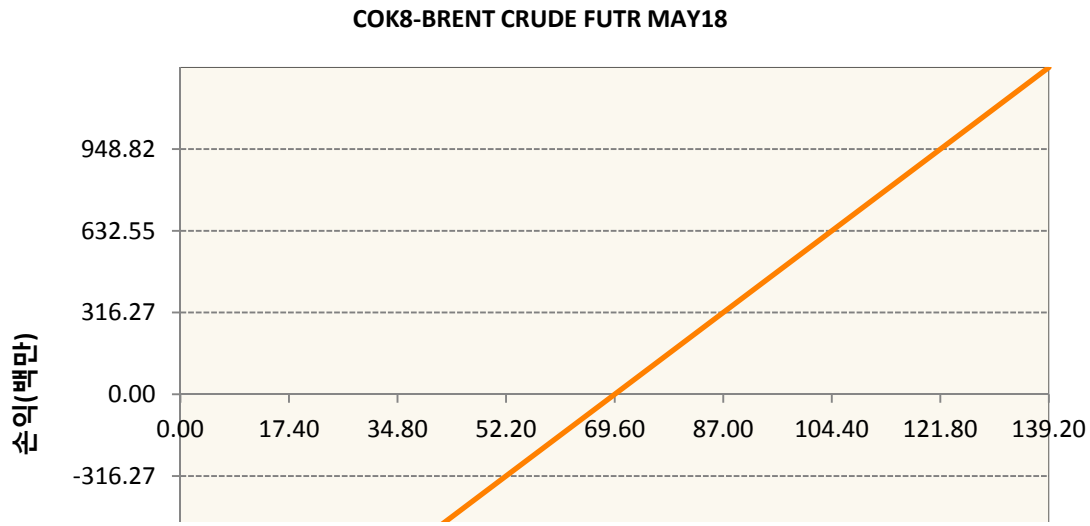
1. 계약금액

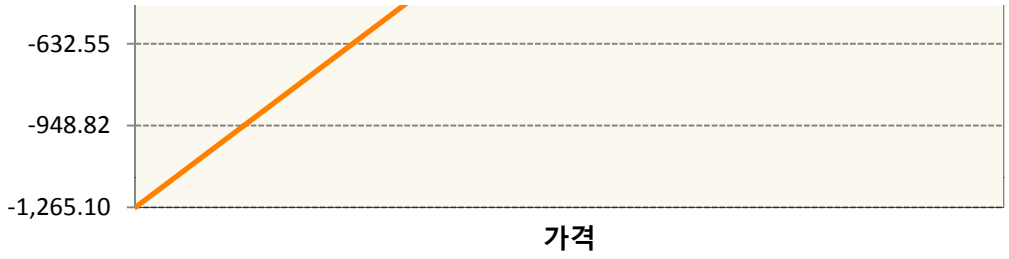
(단위:백만원)

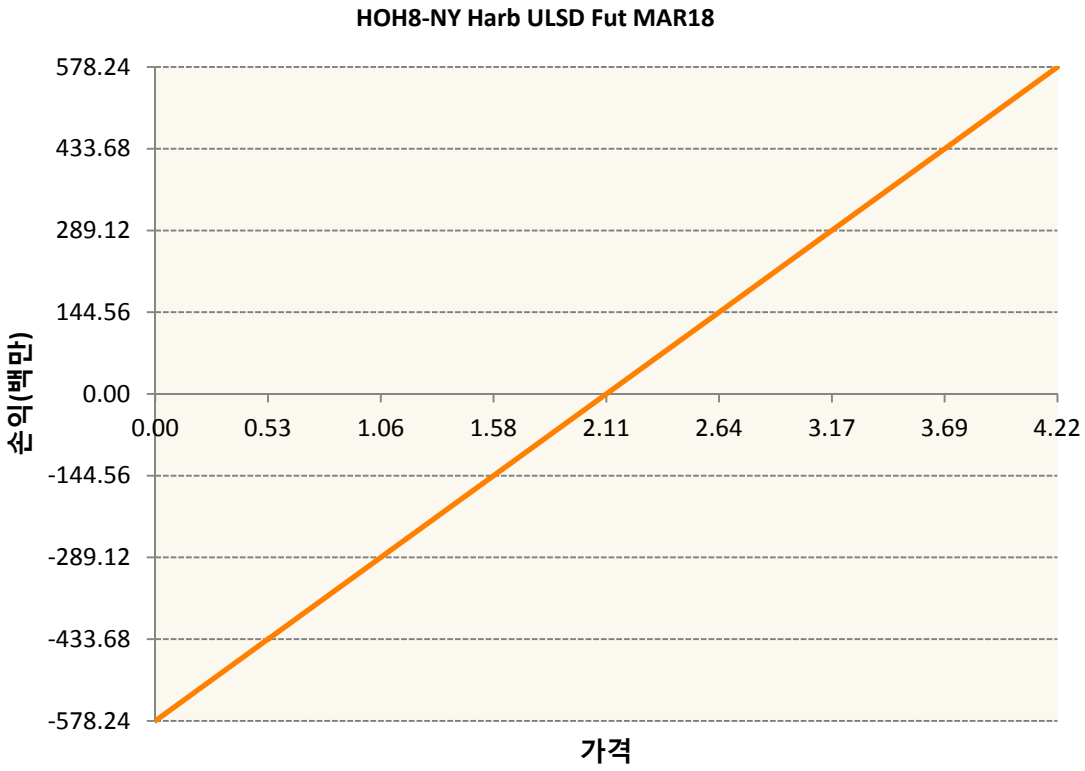
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	4,583	851	3,732	

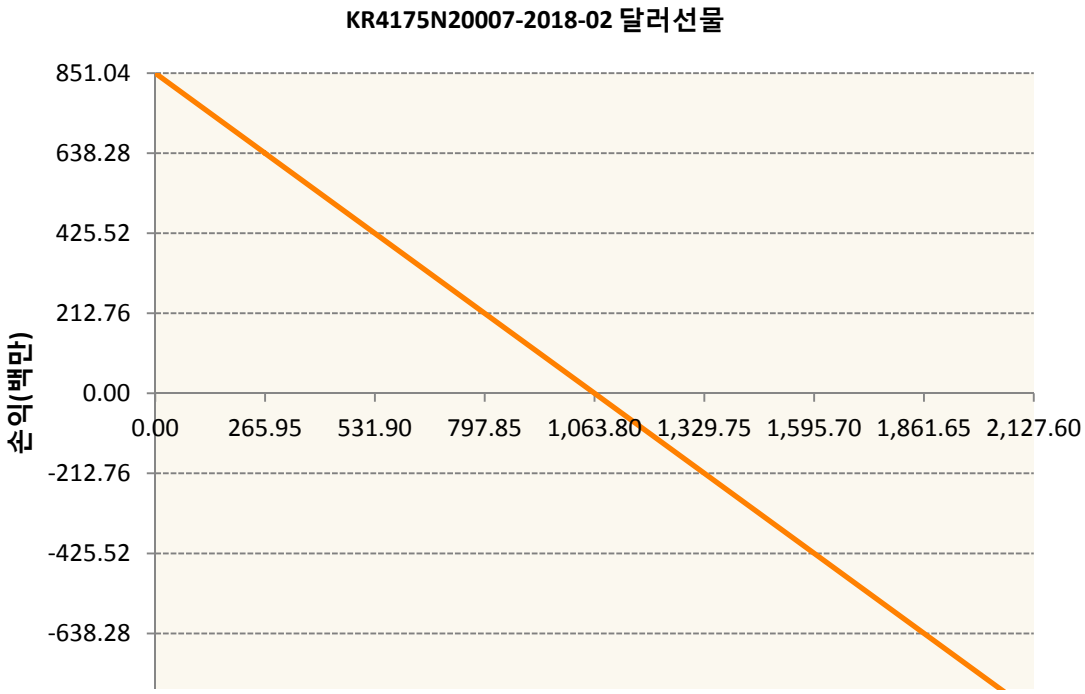
2. 만기시점의 손익구조

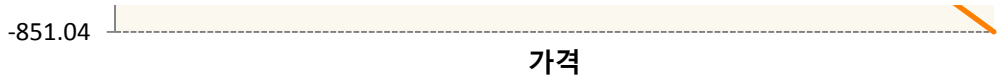


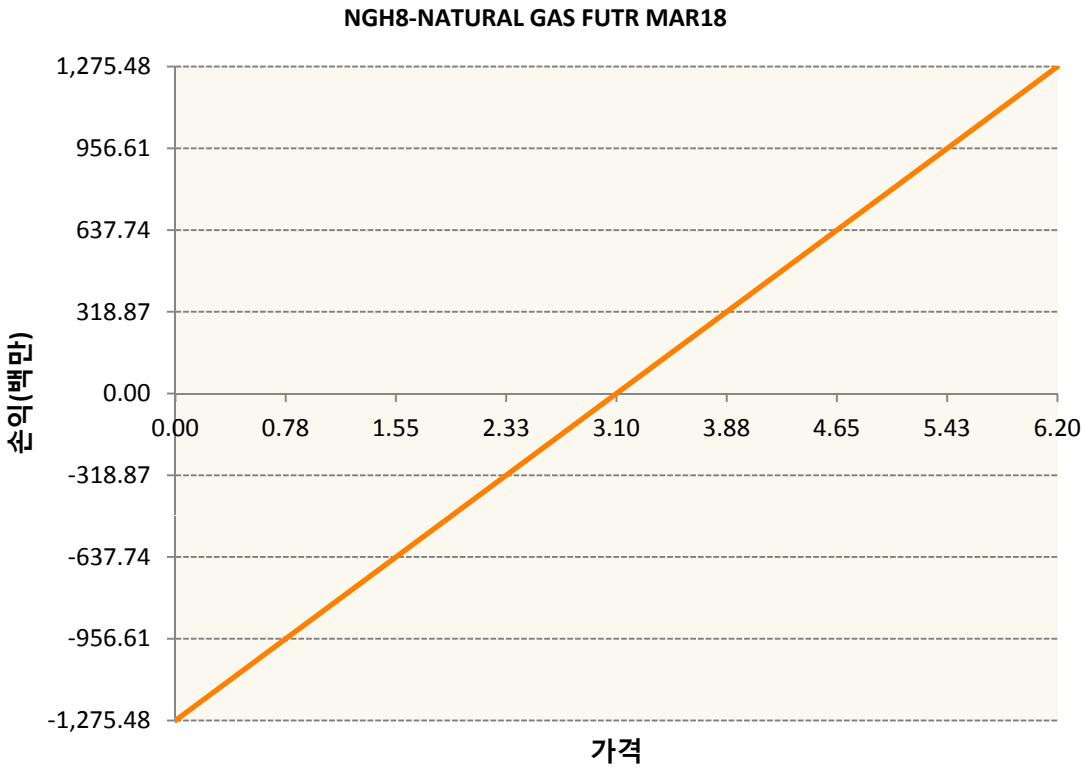


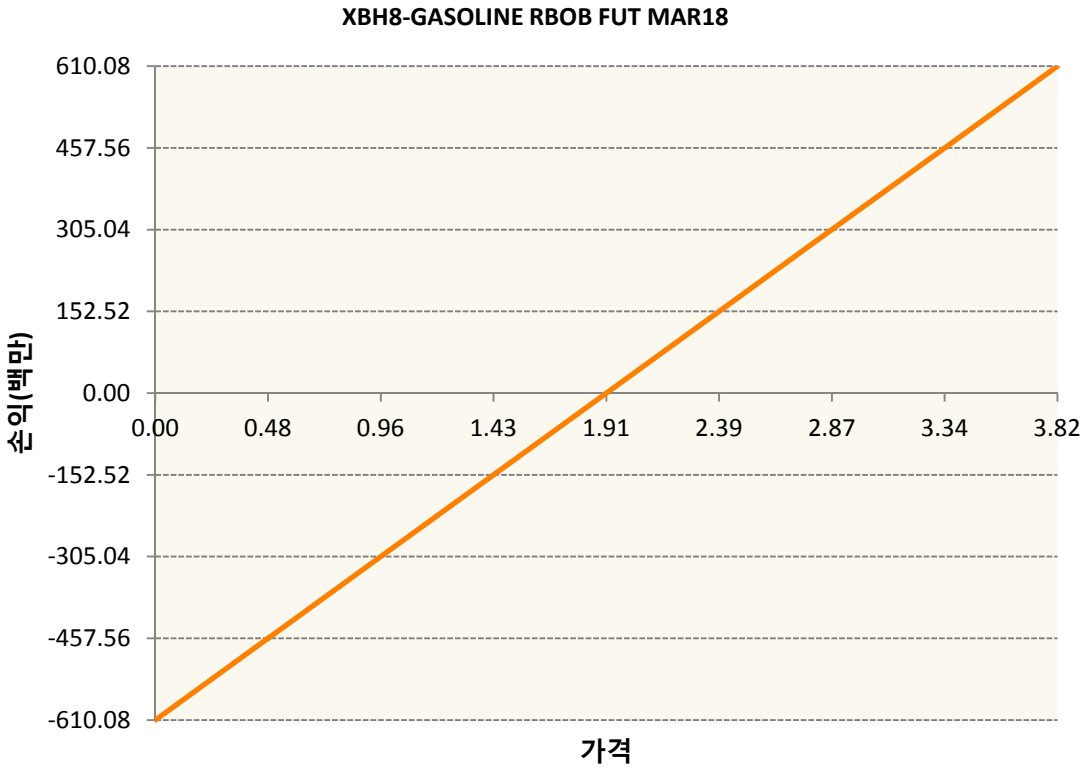

-632.55
-948.82
-1,265.10
가격


HOH8-NY Harb ULSD Fut MAR18
578.24
433.68
289.12
144.56
0.00
-144.56
-289.12
-433.68
-578.24
0.00
0.53
1.06
1.58
2.11
2.64
3.17
3.69
4.22
손익(백만)
가격


KR4175N20007-2018-02 달러선물
851.04
638.28
425.52
212.76
0.00
-212.76
-425.52
-638.28
0.00
265.95
531.90
797.85
1,063.80
1,329.75
1,595.70
1,861.65
2,127.60
손익(백만)


-851.04
가격


NGH8-NATURAL GAS FUTR MAR18
1,275.48
956.61
637.74
318.87
0.00
-318.87
-637.74
-956.61
-1,275.48
0.00
0.78
1.55
2.33
3.10
3.88
4.65
5.43
6.20
손익(백만)
가격


XBH8-GASOLINE RBOB FUT MAR18
610.08
457.56
305.04
152.52
0.00
-152.52
-305.04
-457.56
-610.08
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	102
XBH8	GASOLINE RBOB FUT MAR18	49

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

619

공시일	2018-01-29
기준일	2018-01-26

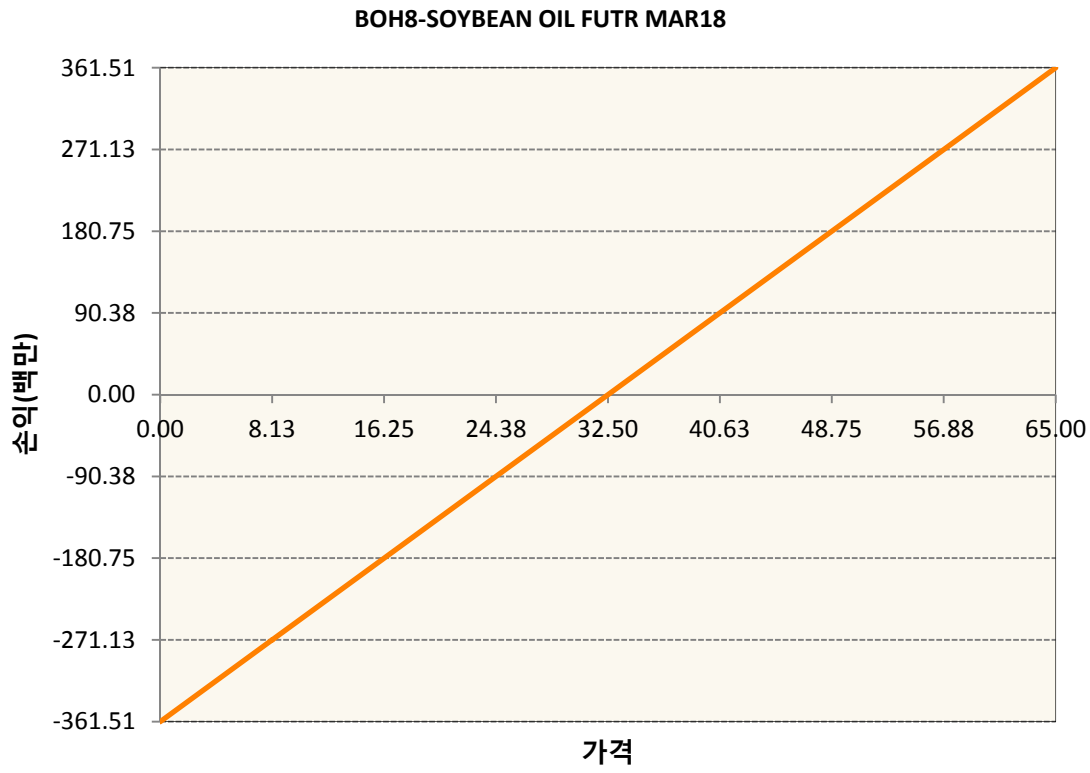
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

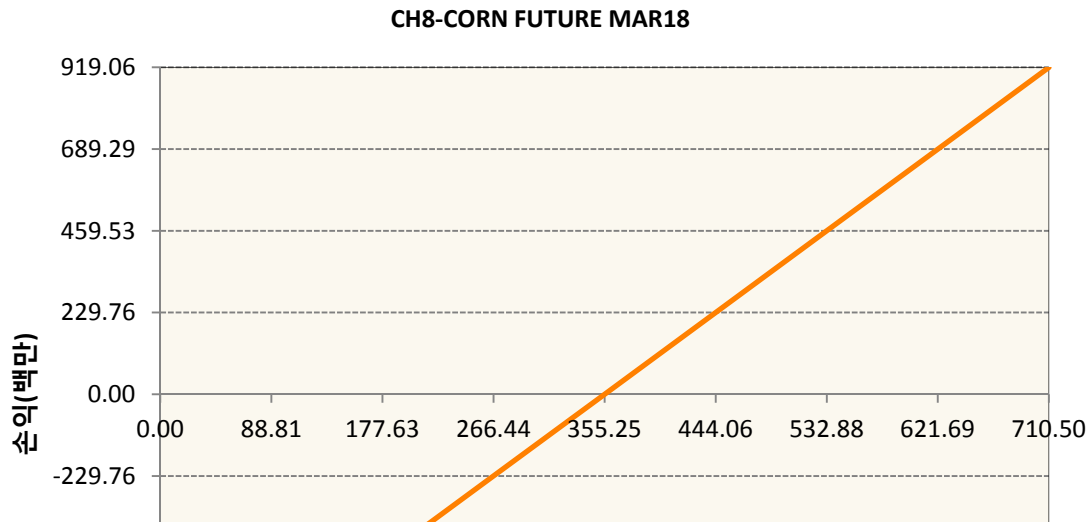
1. 계약금액

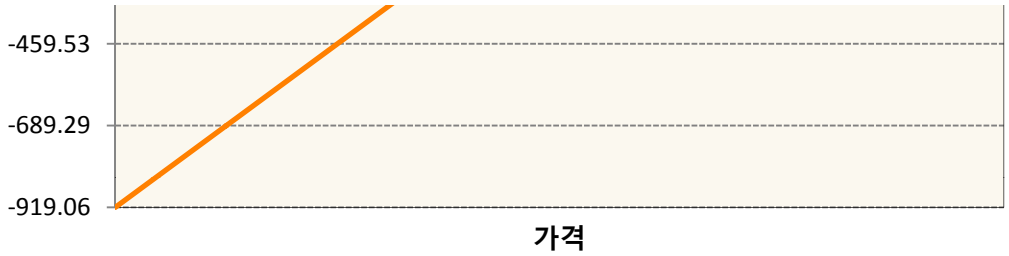
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	4,116	319	3,797	

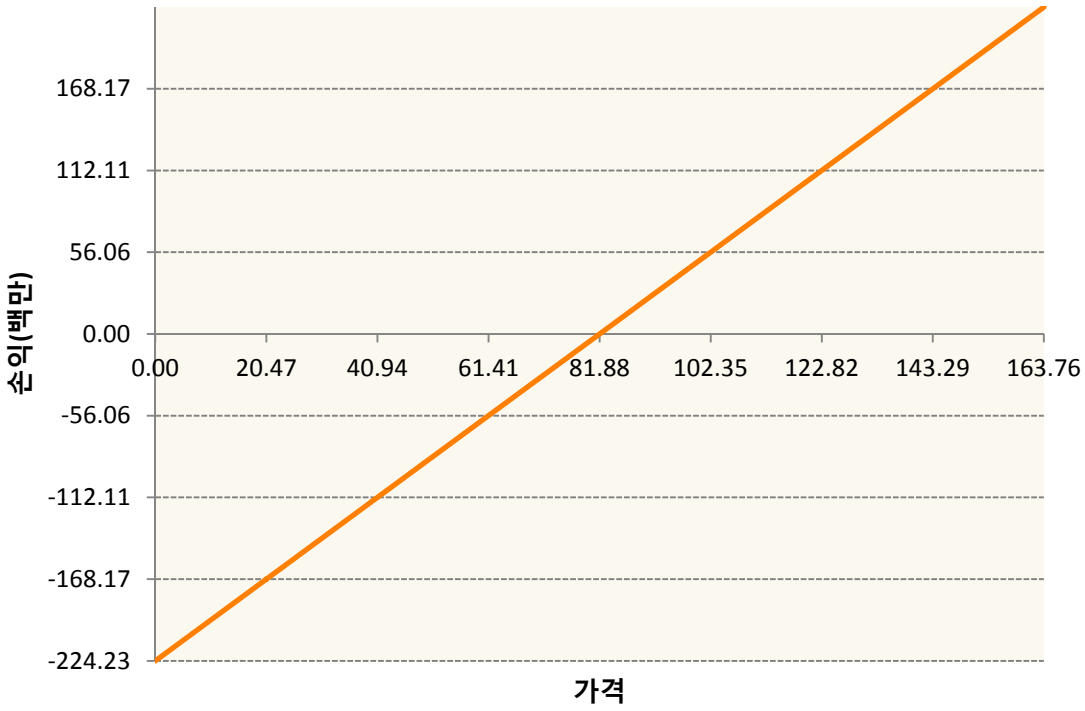
2. 만기시점의 손익구조



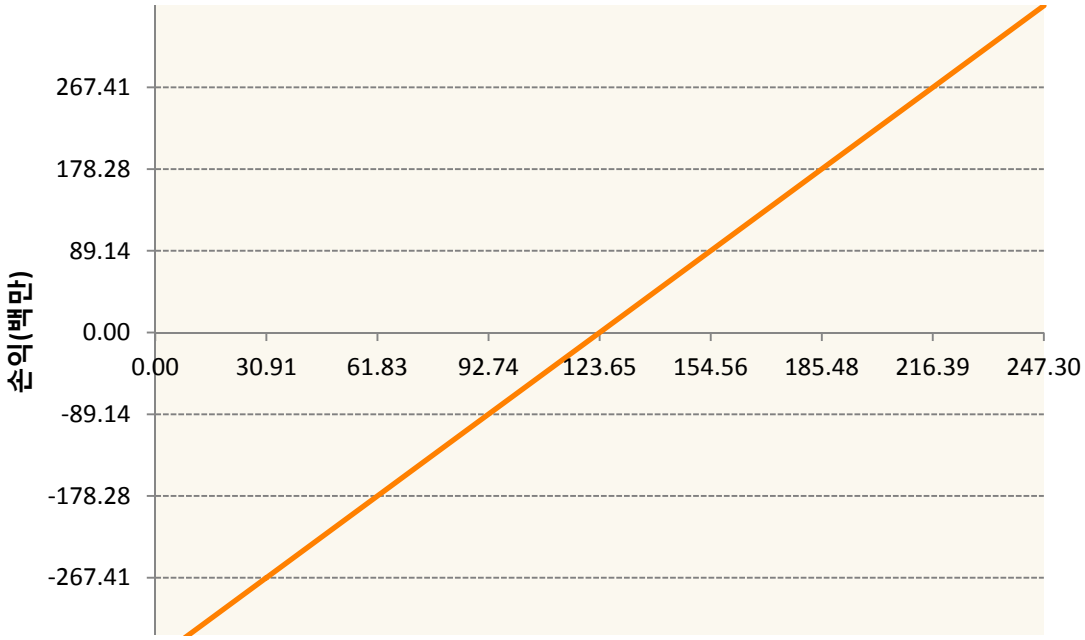


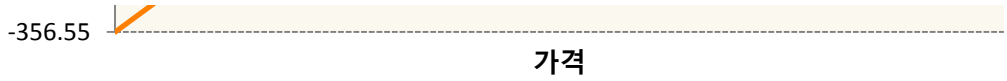


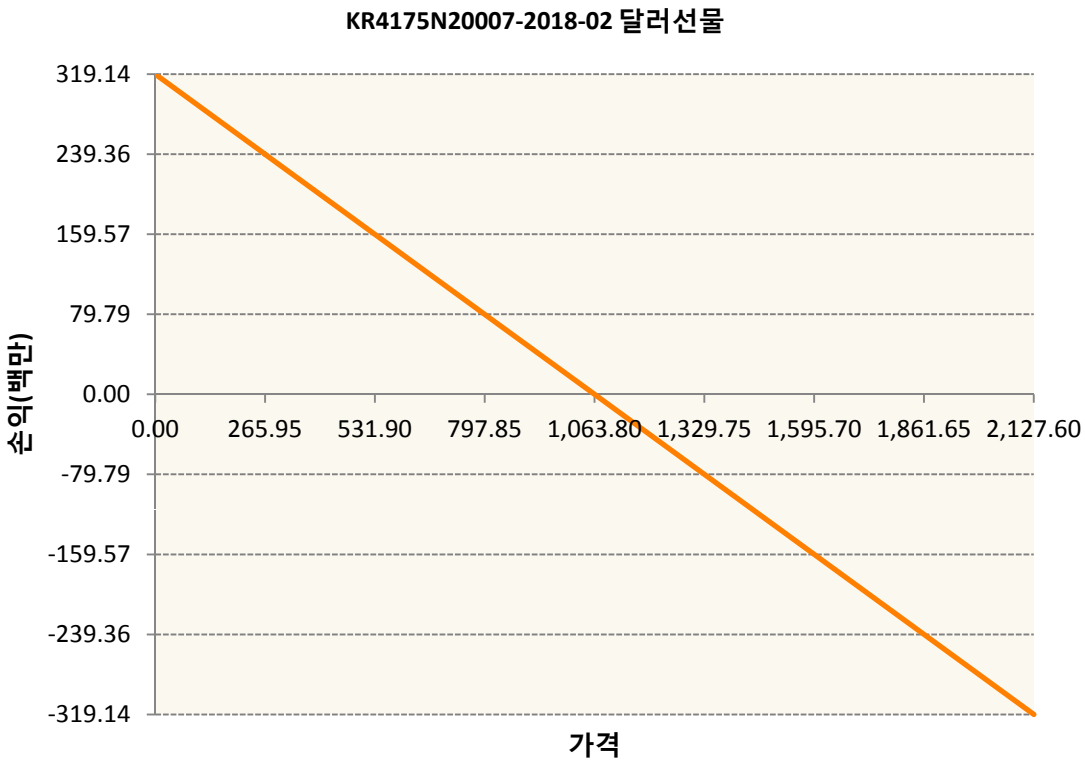
CTH8-COTTON NO.2 FUTR MAR18

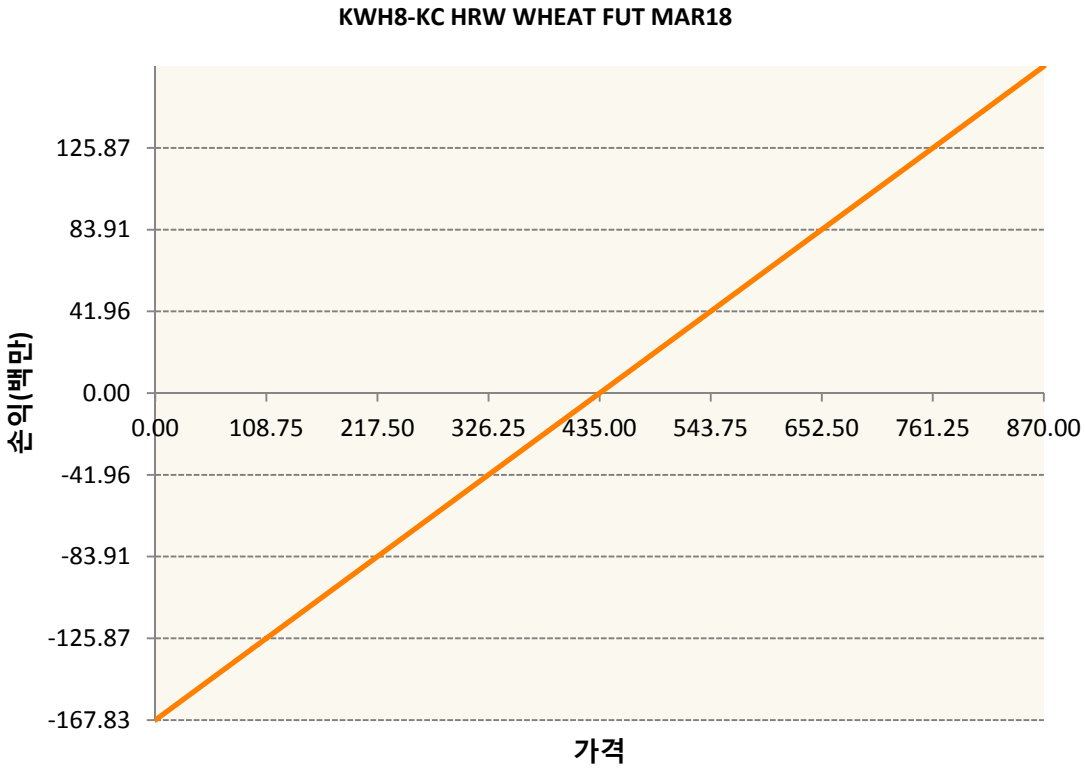


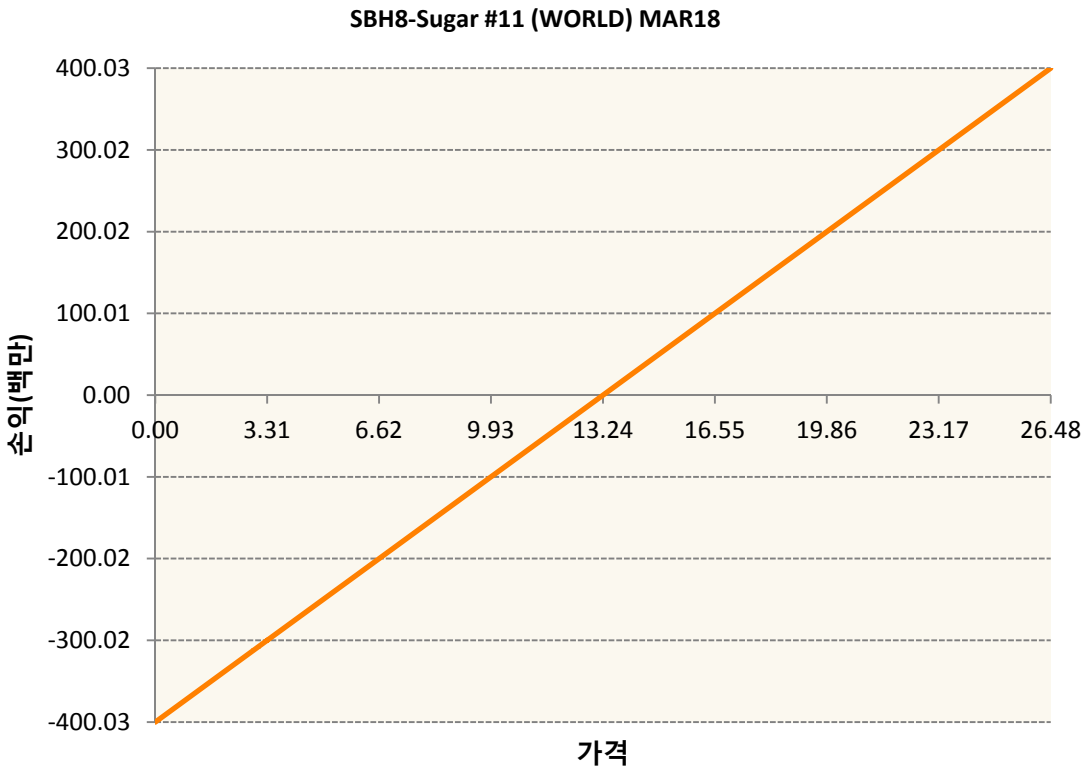
KCH8-COFFEE "C" FUTURE MAR18

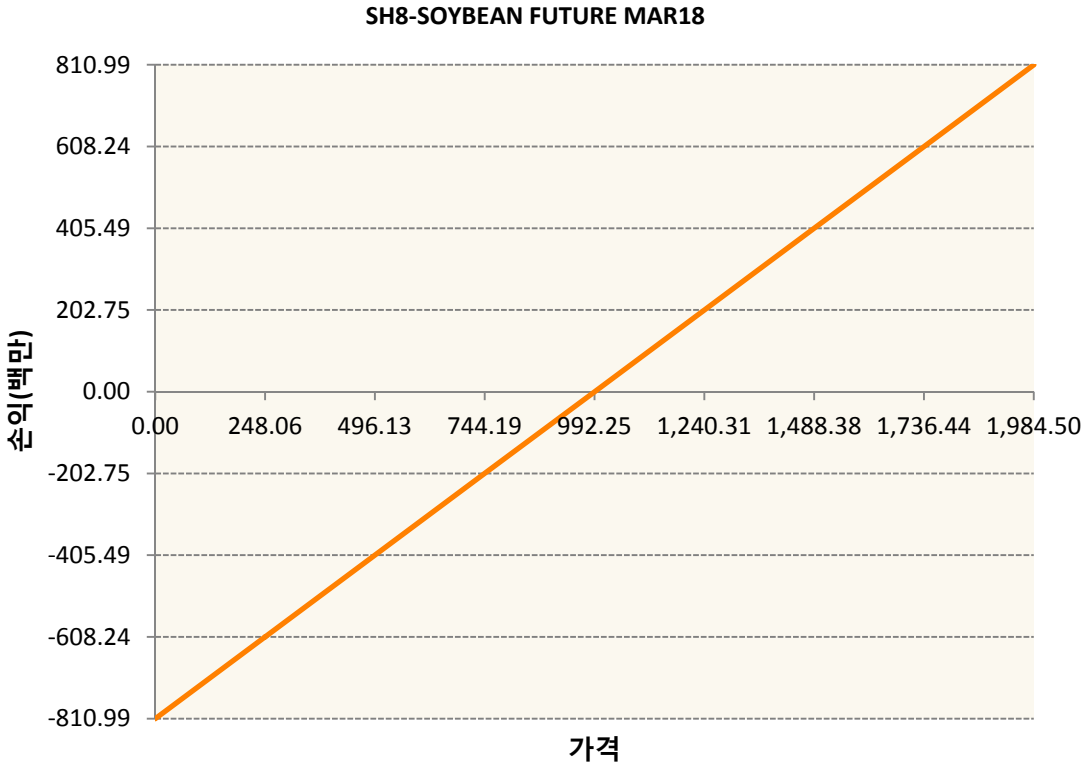



-356.55
가격

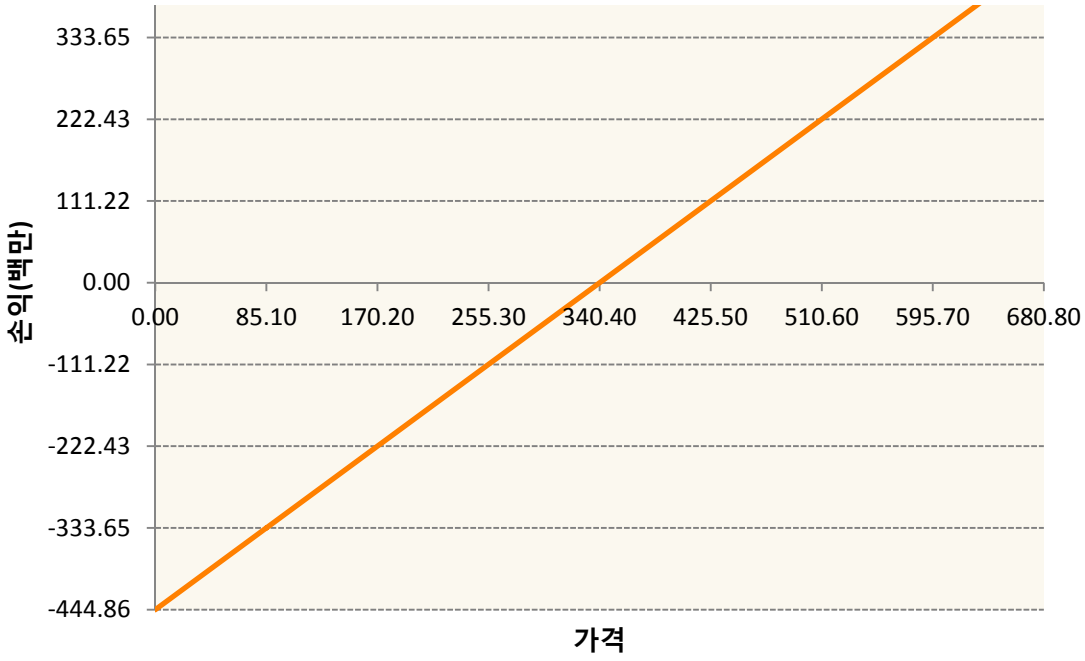

KR4175N20007-2018-02 달러선물
319.14
239.36
159.57
79.79
0.00
-79.79
-159.57
-239.36
-319.14
0.00
265.95
531.90
797.85
1,063.80
1,329.75
1,595.70
1,861.65
2,127.60
손익(백만)
가격

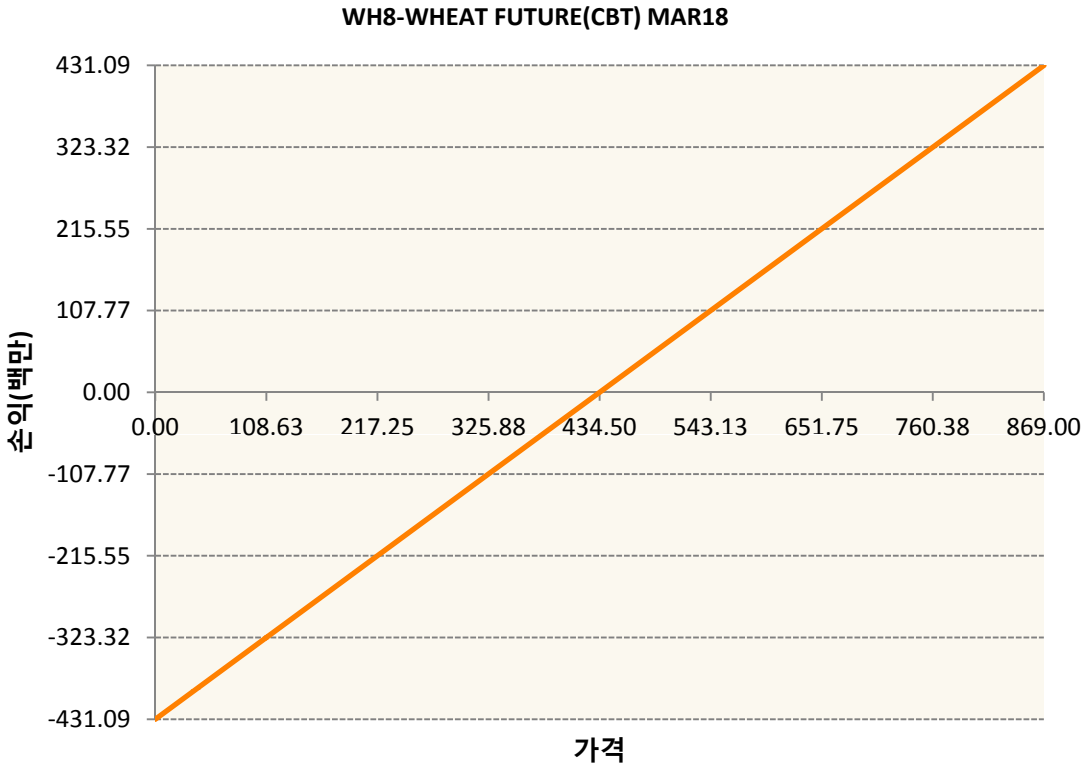

KWH8-KC HRW WHEAT FUT MAR18
125.87
83.91
41.96
0.00
-41.96
-83.91
-125.87
-167.83
0.00
108.75
217.50
326.25
435.00
543.75
652.50
761.25
870.00
손익(백만)
가격


SBH8-Sugar #11 (WORLD) MAR18
400.03
300.02
200.02
100.01
0.00
-100.01
-200.02
-300.02
-400.03
0.00
3.31
6.62
9.93
13.24
16.55
19.86
23.17
26.48
손익(백만)
가격


SH8-SOYBEAN FUTURE MAR18
810.99
608.24
405.49
202.75
0.00
-202.75
-405.49
-608.24
-810.99
0.00
248.06
496.13
744.19
992.25
1,240.31
1,488.38
1,736.44
1,984.50
손익(백만)
가격


SMH8-SOYBEAN MEAL FUTR MAR18
444.86





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	29
KR4175N20(	2018-02 달러선물	26

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)

342