공시일	2018-02-02
기준일	2018-02-01

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	2018-02-02
기준일	2018-02-01

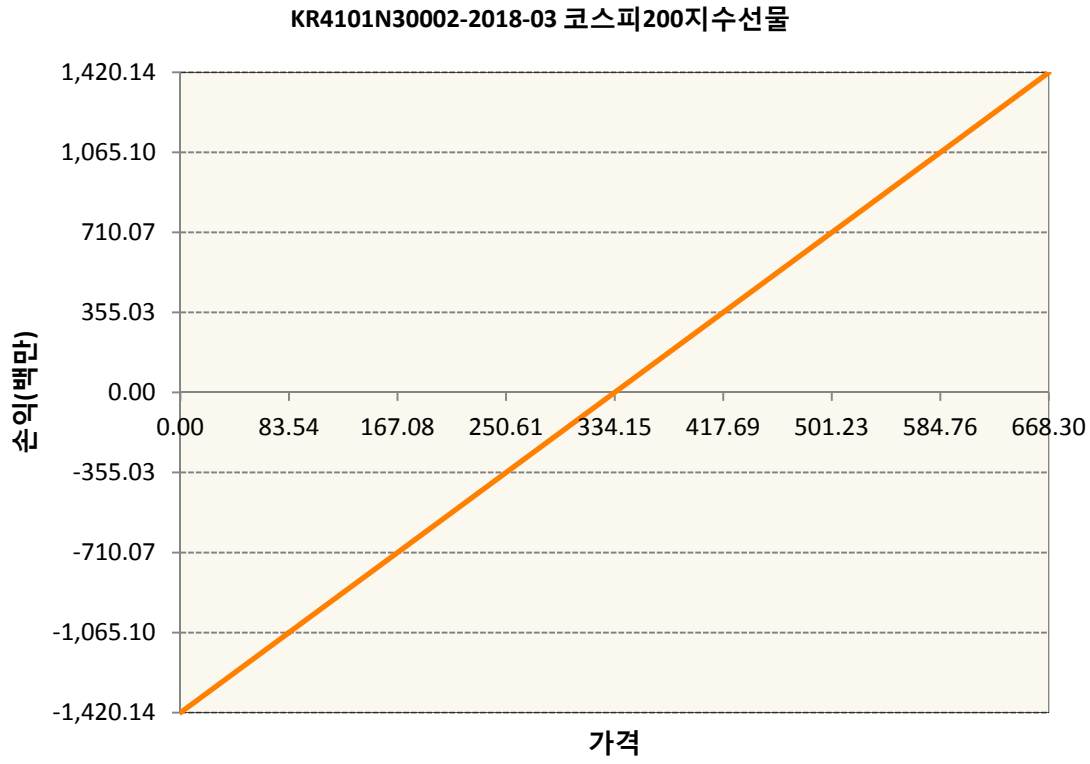
스마트인덱스모

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	1,420	0	1,420	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%	-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%	113	113	113	113	113	113	113

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

69

공시일	2018-02-02
기준일	2018-02-01

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	1,157

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

356

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2018-02-02
기준일	2018-02-01

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	401

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

357

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2018-02-02
기준일	2018-02-01

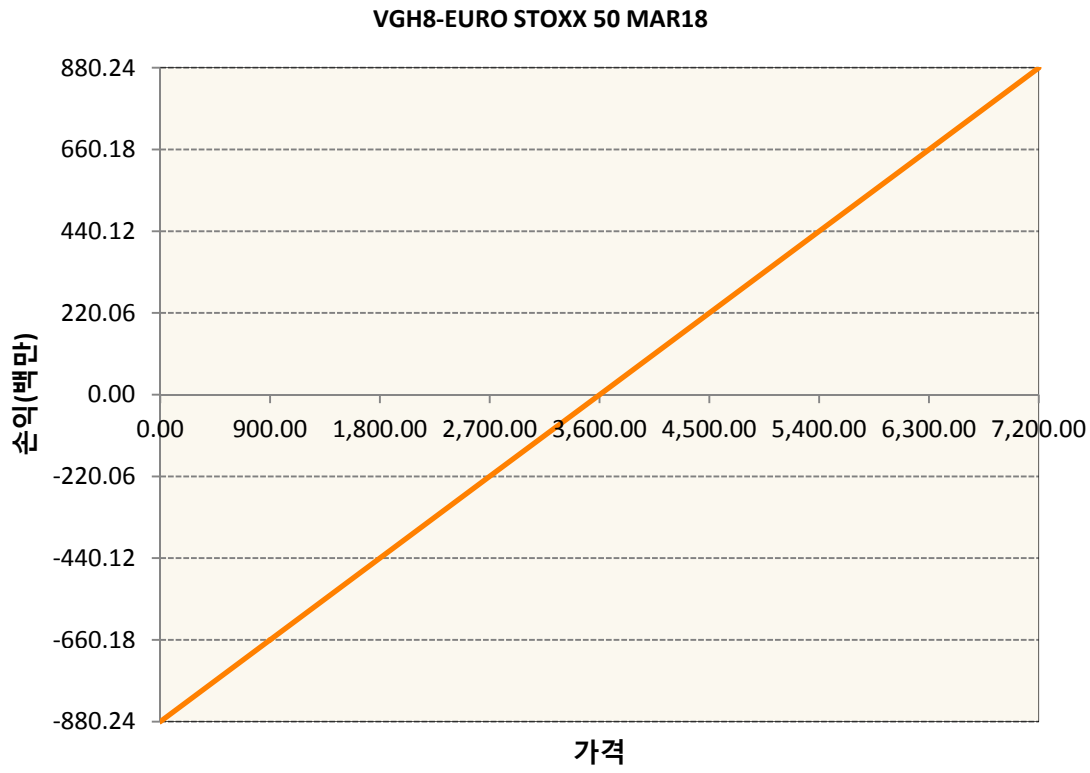
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	880	0	880	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGH8	EURO STOXX 50 MAR18	70

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

(단위:백만원)

39

공시일	2018-02-02
기준일	2018-02-01

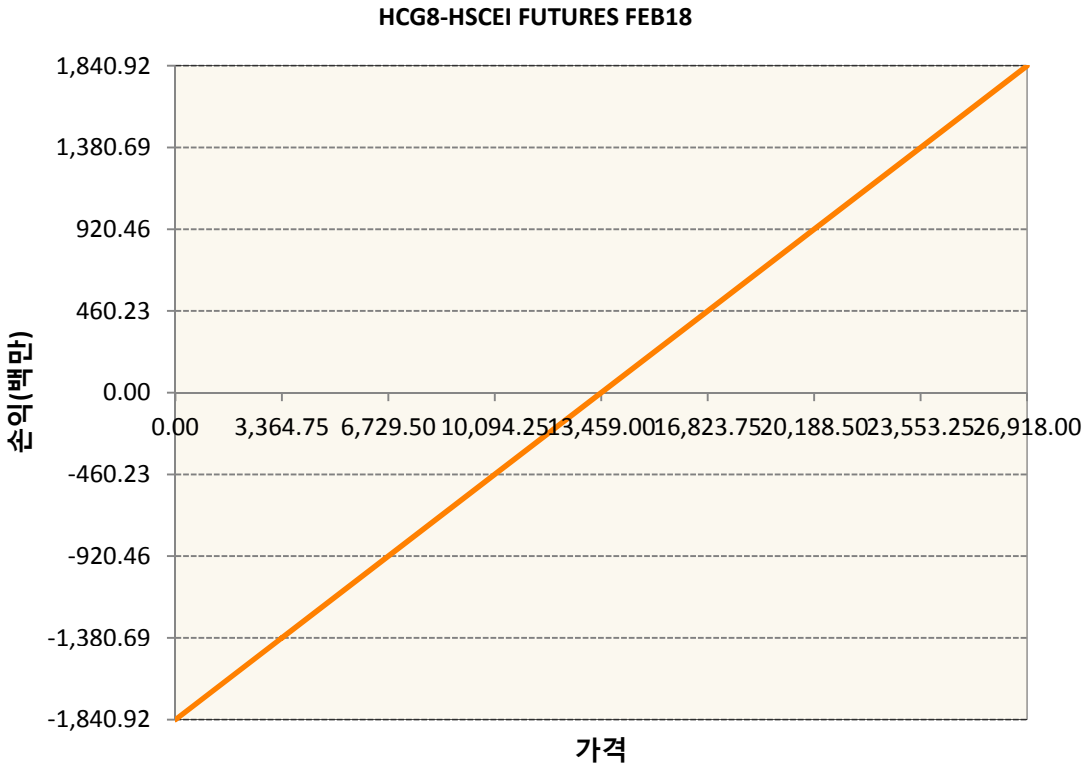
차이나인덱스모(주식-파생형)

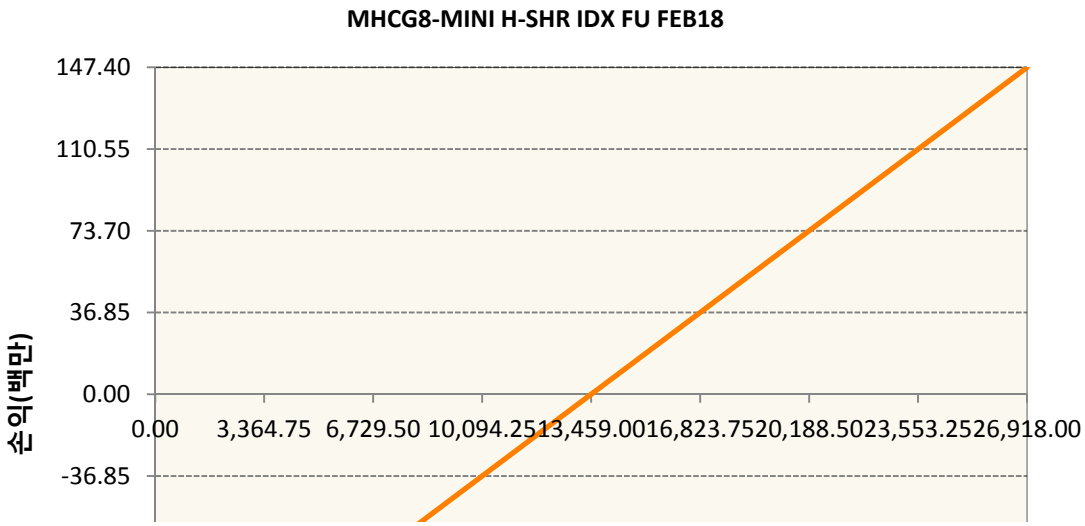
1. 계약금액

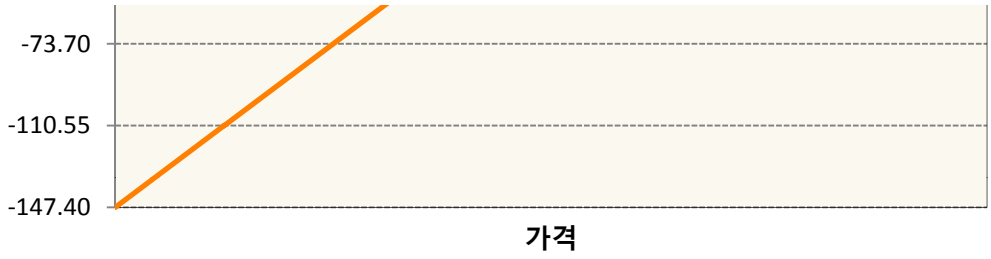
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,988	0	1,988	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCG8	HSCEI FUTURES FEB18	147
MHCG8	MINI H-SHR IDX FU FEB18	12

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	129

공시일	2018-02-02
기준일	2018-02-01

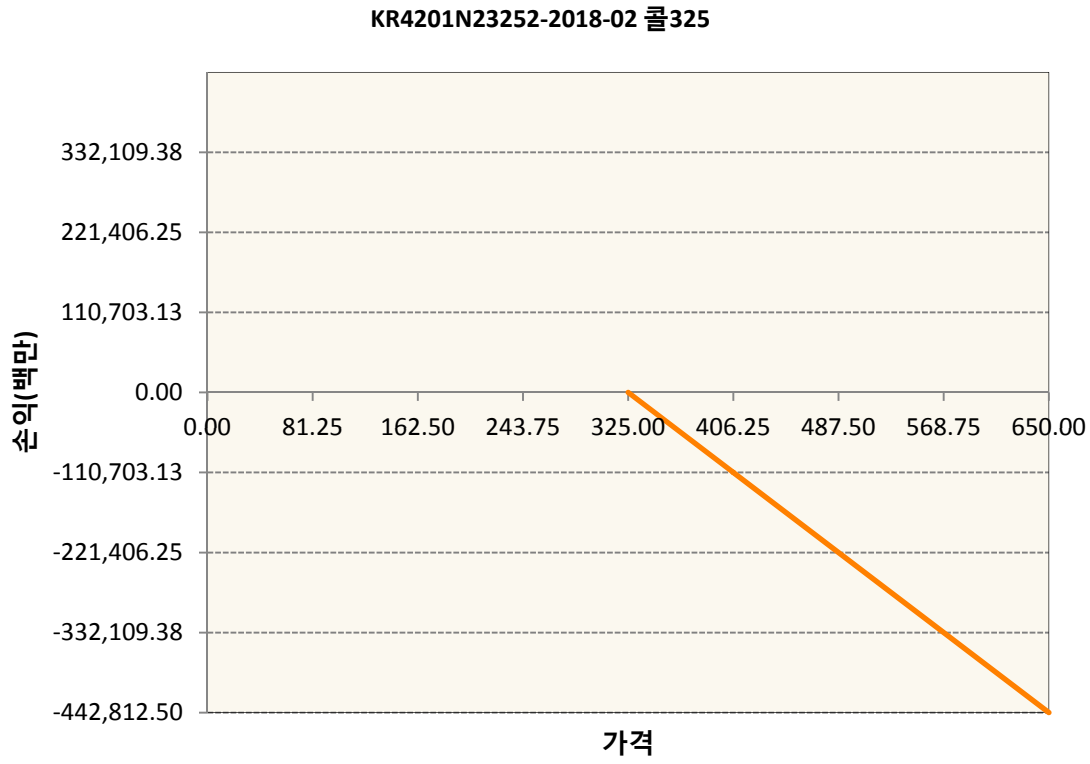
커버드콜모(주식혼합-파생형)

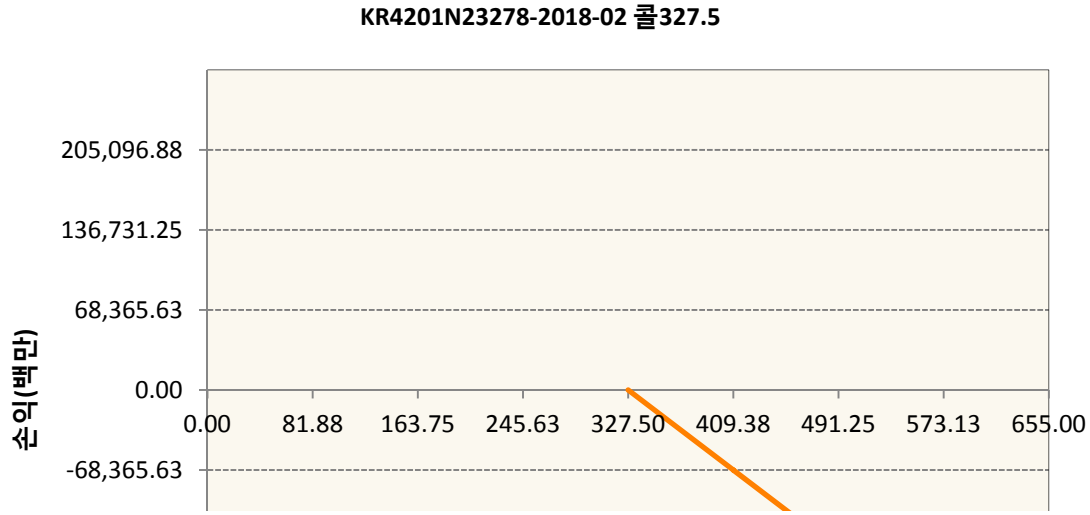
1. 계약금액

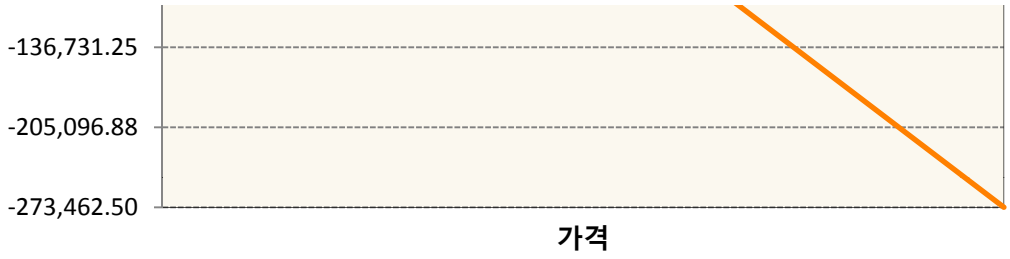
(단위:백만원)

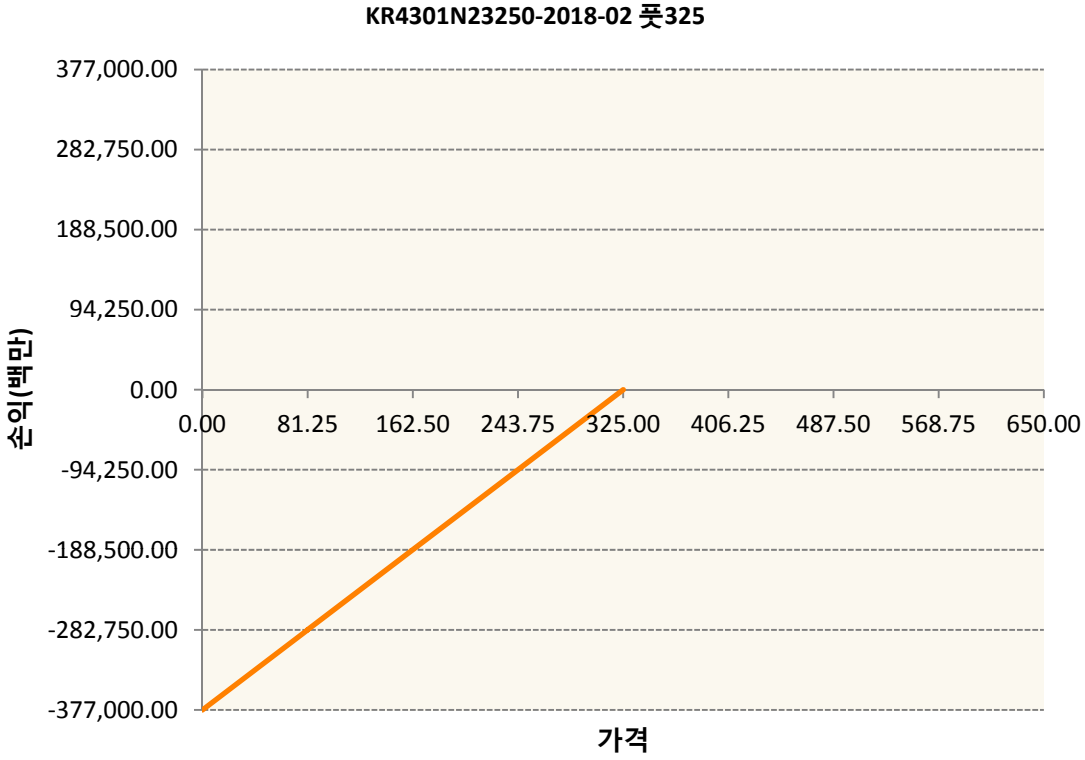
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	1,217,561	-1,217,561	장내

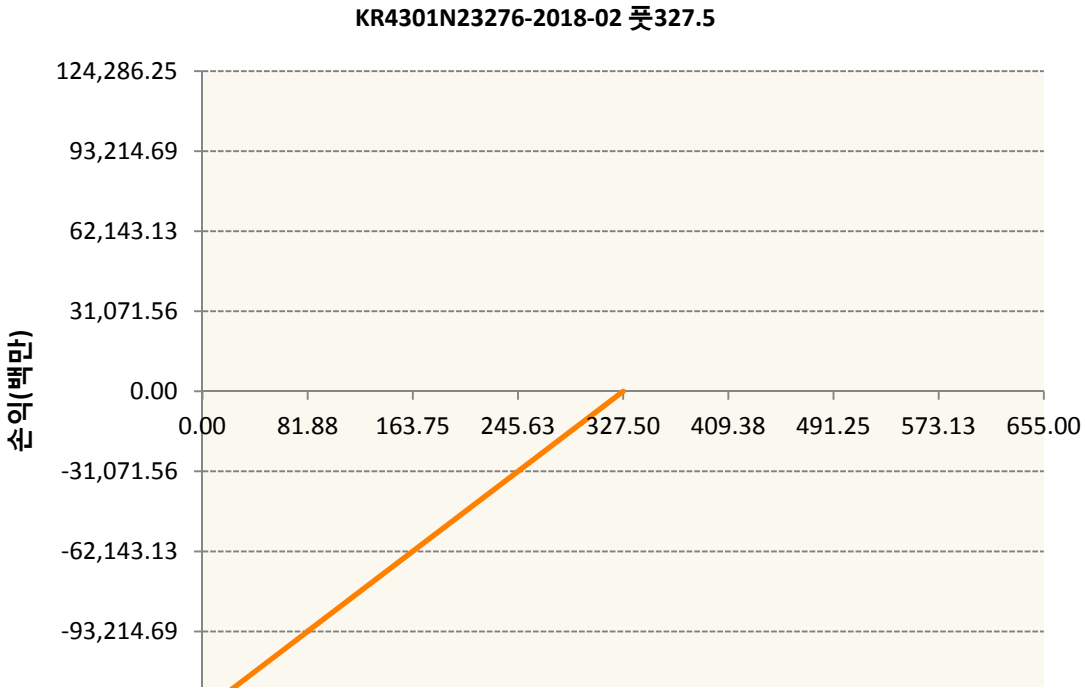
2. 만기시점의 손익구조






-136,731.25
-205,096.88
-273,462.50
가격


KR4301N23250-2018-02 풋325
377,000.00
282,750.00
188,500.00
94,250.00
0.00
-94,250.00
-188,500.00
-282,750.00
-377,000.00
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							34,310
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	13,459	13,407	13,327	13,220	13,084	12,921	12,732
-5.33%	12,779	12,496	12,183	11,844	11,485	11,107	10,716
-2.67%	9,264	8,757	8,249	7,742	7,234	6,726	6,218
0%	1,077	744	383	0	-401	-816	-1,244
2.67%	-10,133	-10,220	-10,340	-10,494	-10,679	-10,894	-11,135
5.33%	-22,146	-22,156	-22,176	-22,211	-22,263	-22,336	-22,431
8.00%	-34,250	-34,251	-34,253	-34,257	-34,267	-34,284	-34,310
KR4201N232 2018-02 콜327.5							20,485
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	6,746	6,729	6,700	6,657	6,599	6,525	6,437
-5.33%	6,518	6,394	6,248	6,083	5,901	5,705	5,497
-2.67%	5,020	4,724	4,426	4,125	3,822	3,518	3,213
0%	797	540	274	0	-280	-566	-855
2.67%	-5,713	-5,801	-5,911	-6,043	-6,194	-6,363	-6,547
5.33%	-13,011	-13,023	-13,046	-13,082	-13,131	-13,196	-13,277
8.00%	-20,424	-20,425	-20,427	-20,433	-20,443	-20,460	-20,485
KR4301N232 2018-02 풋325							20,880
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-20,853	-20,853	-20,854	-20,856	-20,860	-20,868	-20,880
-5.33%	-10,591	-10,632	-10,688	-10,760	-10,847	-10,947	-11,060
-2.67%	-2,170	-2,414	-2,659	-2,904	-3,149	-3,394	-3,639
0%	247	182	99	0	-114	-242	-382
2.67%	342	341	338	332	322	306	282
5.33%	342	342	342	342	342	341	340
8.00%	342	342	342	342	342	342	342
KR4301N232 2018-02 풋327.5							7,642
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-7,639	-7,639	-7,639	-7,639	-7,640	-7,641	-7,642
-5.33%	-4,270	-4,274	-4,282	-4,294	-4,309	-4,329	-4,353
-2.67%	-1,189	-1,256	-1,326	-1,398	-1,471	-1,545	-1,620
0%	142	100	52	0	-56	-115	-177
2.67%	243	241	238	233	225	213	199

5.33%	243	243	243	243	243	242	241
8.00%	243	243	243	243	243	243	243

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

87,978

공시일	2018-02-02
기준일	2018-02-01

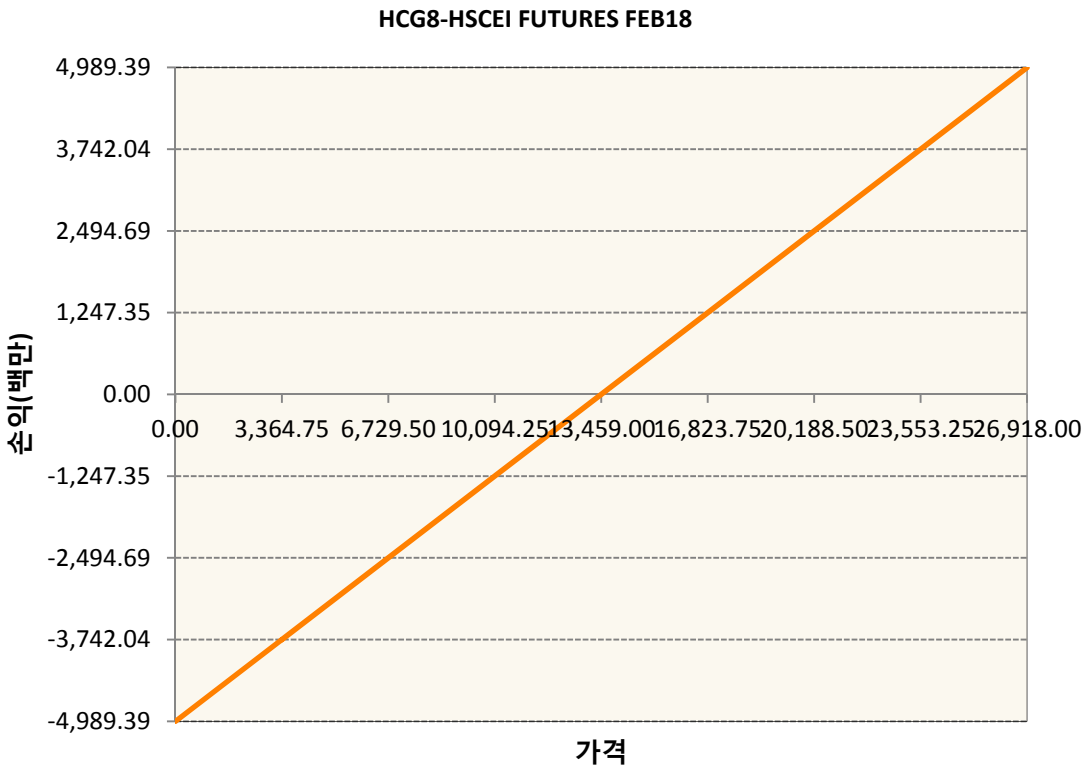
홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생

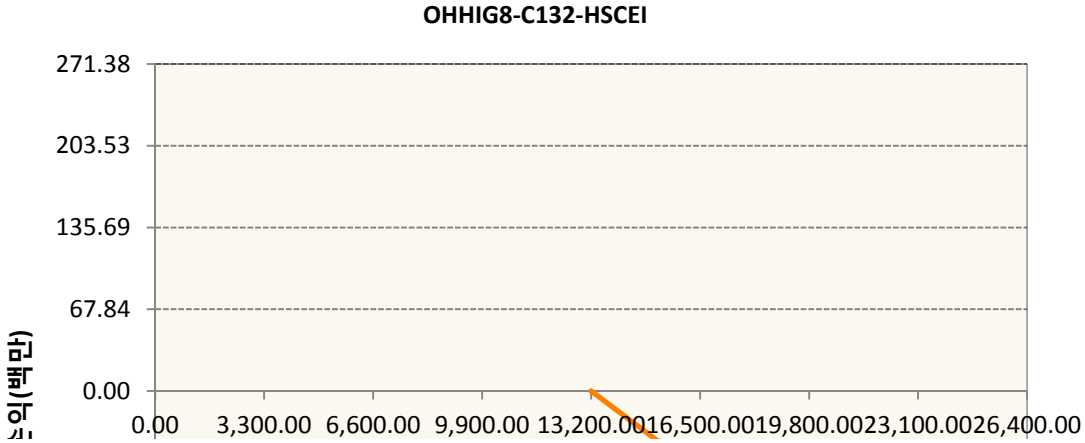
1. 계약금액

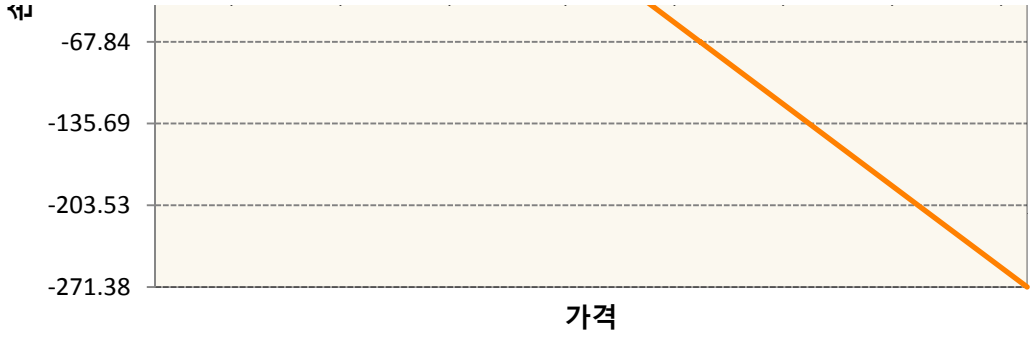
(단위:백만원)

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	4,989	0	4,989	장내
누계	유가증권	옵션	0	11,379	-11,379	장내

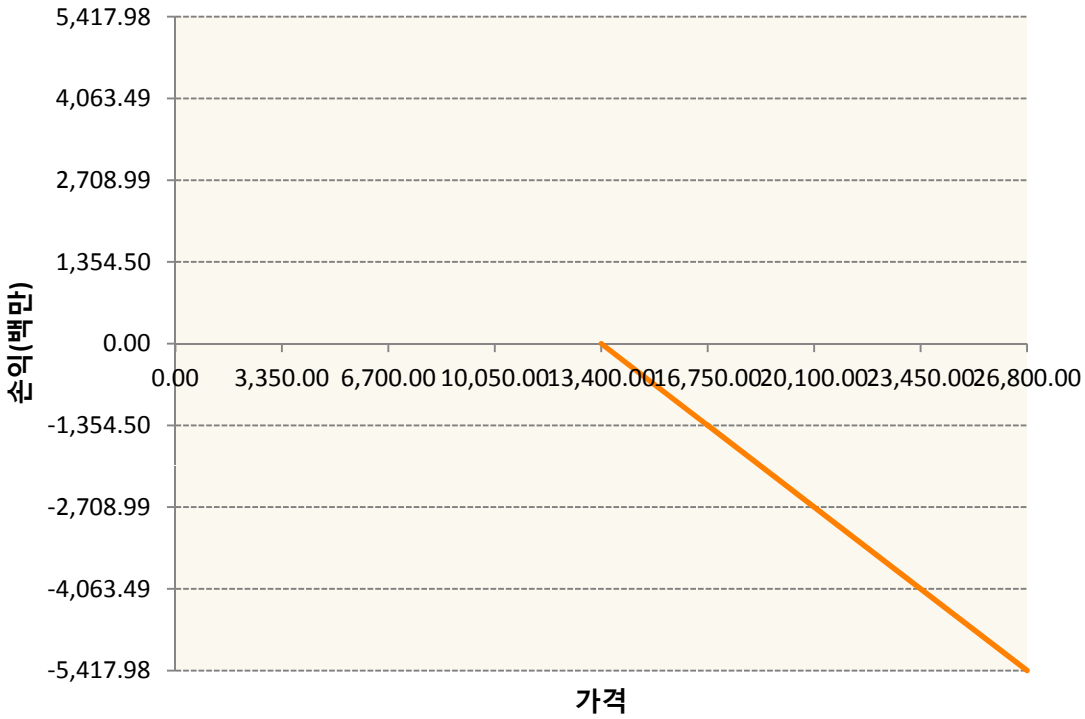
2. 만기시점의 손익구조



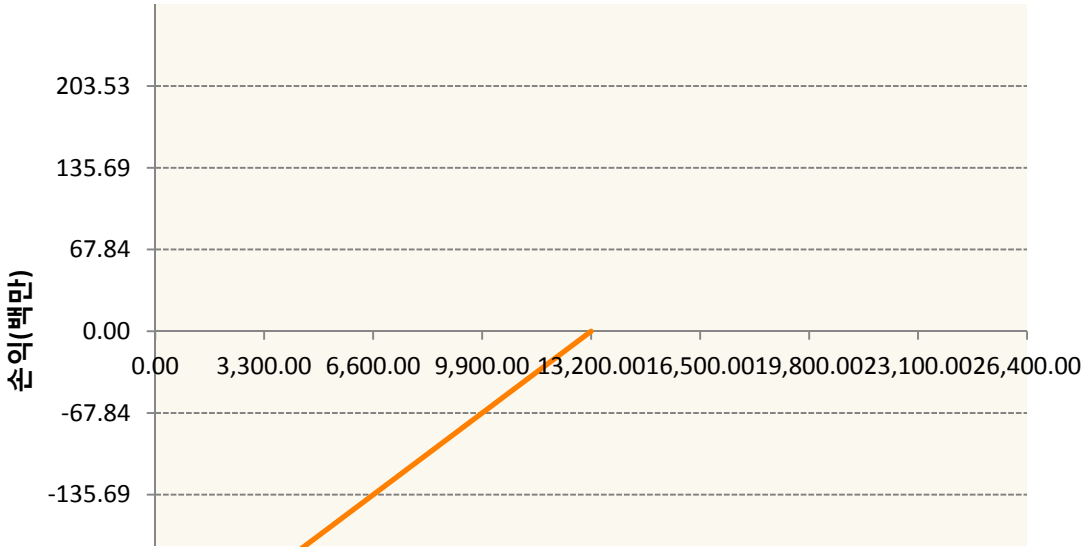


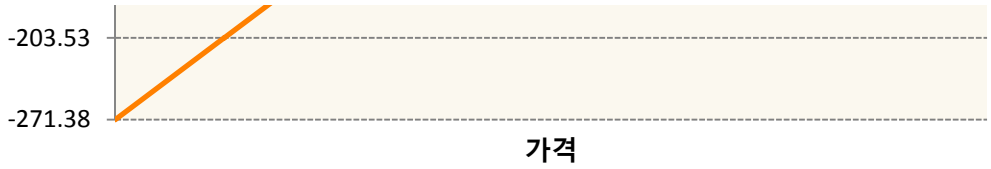


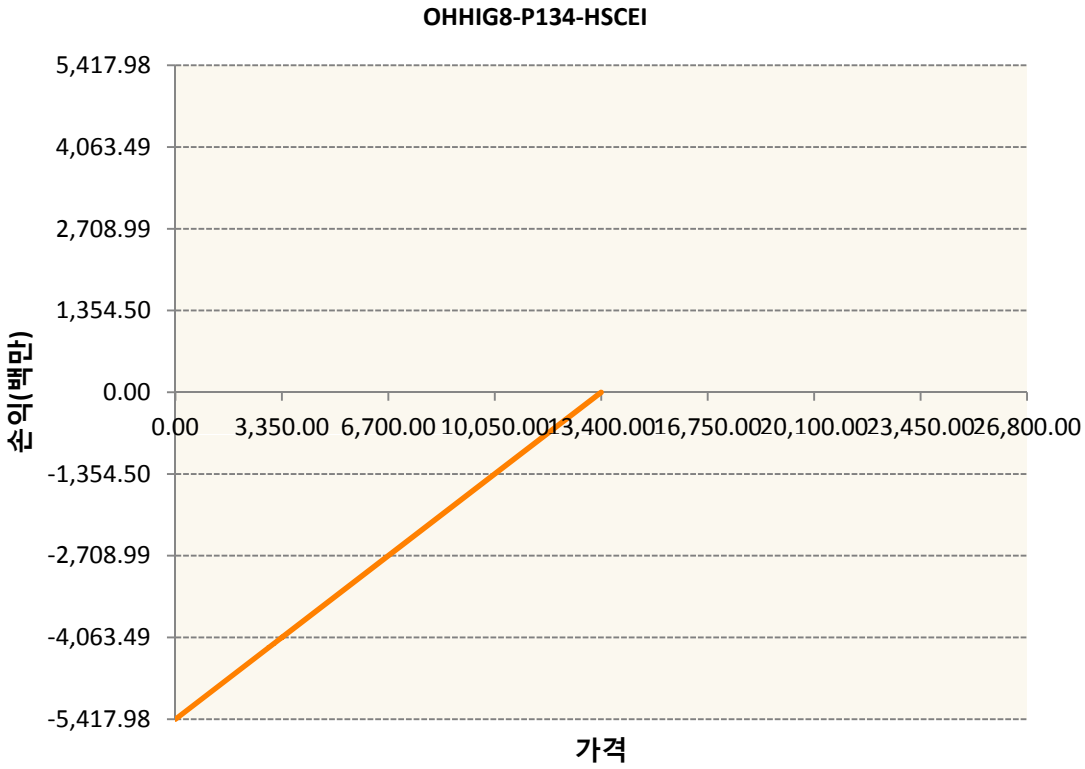
OHHIG8-C134-HSCEI



OHHIG8-P132-HSCEI







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)	(단위:백만원)
HCG8 HSCEI FUTURES FEB18	399
OHHIG8-C1: HSCEI	22
OHHIG8-C1: HSCEI	433
OHHIG8-P1: HSCEI	22
OHHIG8-P1: HSCEI	433

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,060

공시일	2018-02-02
기준일	2018-02-01

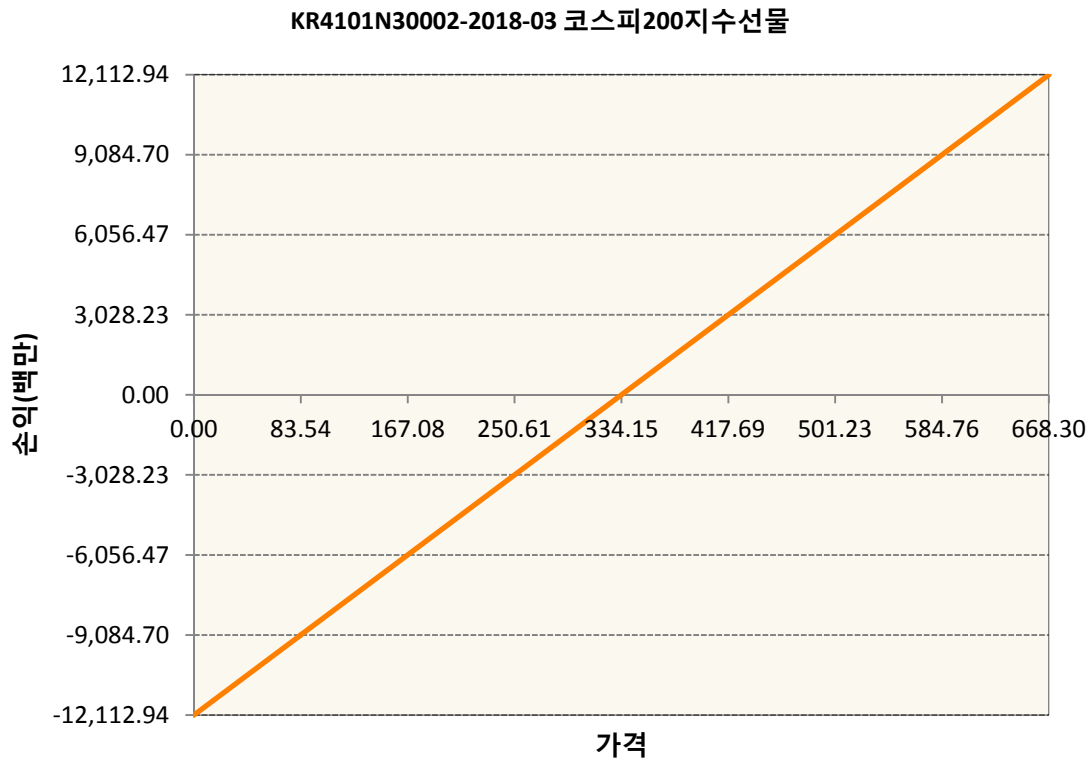
코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼

1. 계약금액

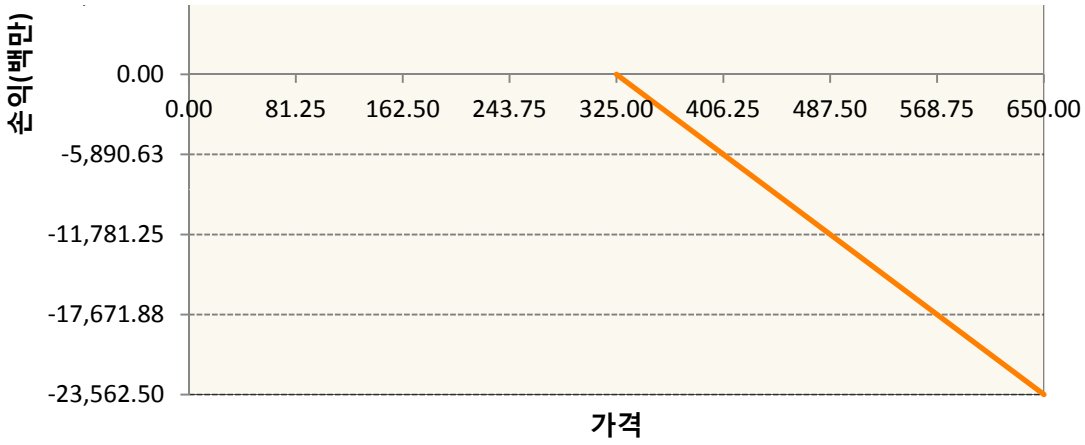
(단위:백만원)

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	12,113	0	12,113	장내
누계	유가증권	스왑	60,200	0	60,200	장외
누계	유가증권	옵션	0	60,250	-60,250	장내

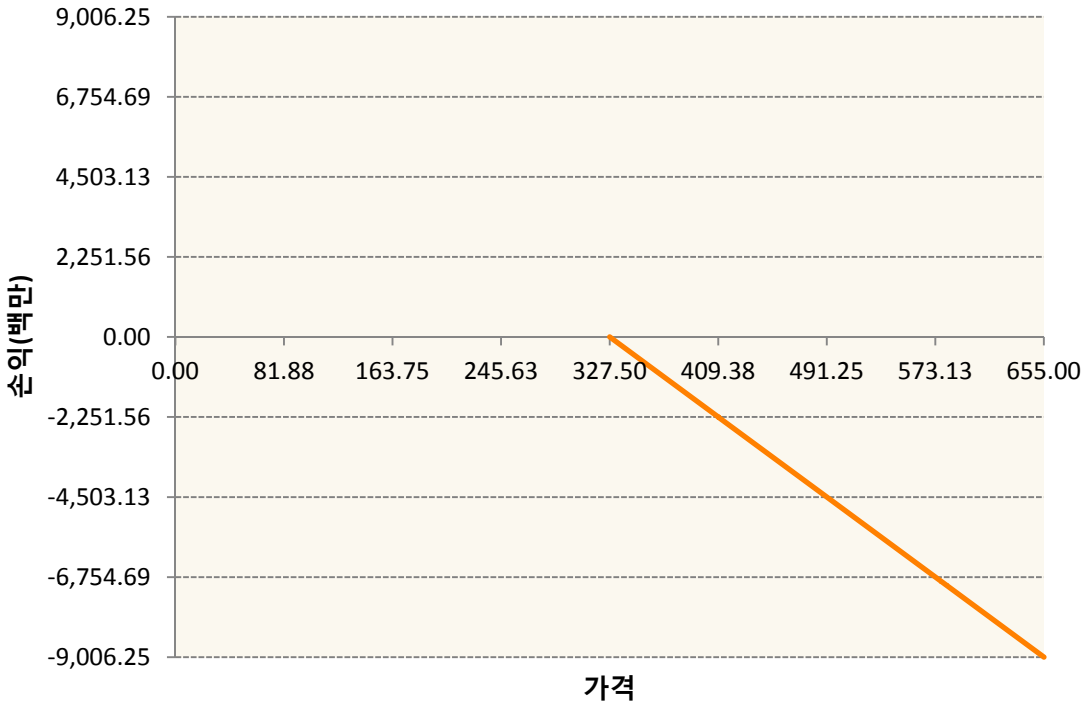
2. 만기시점의 손익구조



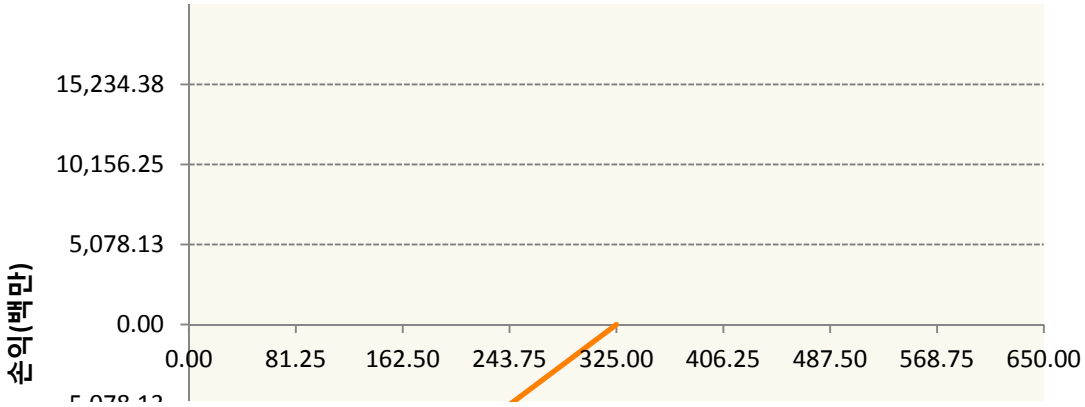




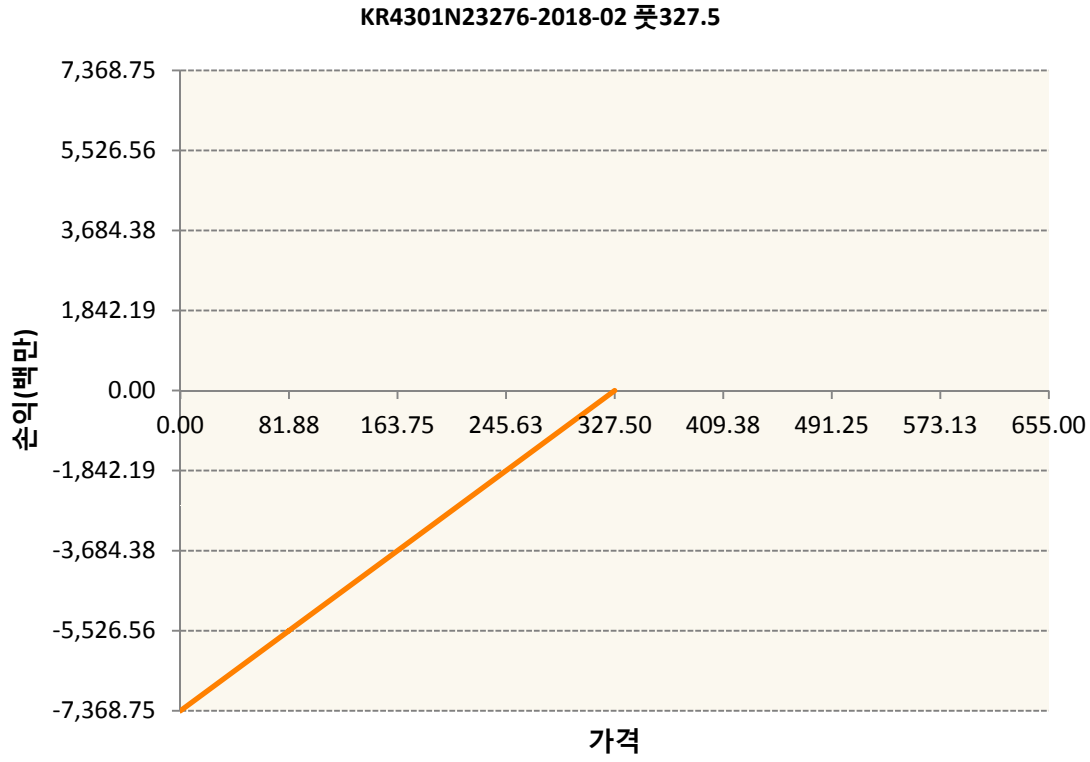
KR4201N23278-2018-02 콜327.5



KR4301N23250-2018-02 풋325







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_2							1,453
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,453	-1,453	-1,453	-1,453	-1,453	-1,453	-1,453
-5.33%	-969	-969	-969	-969	-969	-969	-969
-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%	969	969	969	969	969	969	969
8.00%	1,453	1,453	1,453	1,453	1,453	1,453	1,453
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						236
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-236	-236	-236	-236	-236	-236	-236
-5.33%	-157	-157	-157	-157	-157	-157	-157
-2.67%	-79	-79	-79	-79	-79	-79	-79
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	79	79	79	79	79	79	79
5.33%	157	157	157	157	157	157	157
8.00%	236	236	236	236	236	236	236
	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%	-168	-168	-168	-168	-168	-168	-168
-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%	168	168	168	168	168	168	168
8.00%	251	251	251	251	251	251	251
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_8						465
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-465	-465	-465	-465	-465	-465	-465
-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%	465	465	465	465	465	465	465
	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%	-207	-207	-207	-207	-207	-207	-207
-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%	207	207	207	207	207	207	207
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%	-419	-419	-419	-419	-419	-419	-419
-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%	419	419	419	419	419	419	419
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						967

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-967	-967	-967	-967	-967	-967	-967
-5.33%	-644	-644	-644	-644	-644	-644	-644
-2.67%	-322	-322	-322	-322	-322	-322	-322
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	322	322	322	322	322	322	322
5.33%	644	644	644	644	644	644	644
8.00%	967	967	967	967	967	967	967
	KR4201N232 2018-02 콜325						1,826

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	716	713	709	703	696	688	677
-5.33%	680	665	648	630	611	591	570
-2.67%	493	466	439	412	385	358	331
0%	57	40	20	0	-21	-43	-66
2.67%	-539	-544	-550	-558	-568	-580	-593
5.33%	-1,178	-1,179	-1,180	-1,182	-1,185	-1,189	-1,194
8.00%	-1,823	-1,823	-1,823	-1,823	-1,823	-1,824	-1,826
	KR4201N232 2018-02 콜327.5						675

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	222	222	221	219	217	215	212
-5.33%	215	211	206	200	194	188	181
-2.67%	165	156	146	136	126	116	106
0%	26	18	9	0	-9	-19	-28
2.67%	-188	-191	-195	-199	-204	-210	-216
5.33%	-428	-429	-430	-431	-432	-435	-437
8.00%	-673	-673	-673	-673	-673	-674	-675
	KR4301N232 2018-02 풋325						1,125

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,124	-1,124	-1,124	-1,124	-1,124	-1,124	-1,125
-5.33%	-571	-573	-576	-580	-584	-590	-596

-2.67%	-117	-130	-143	-156	-170	-183	-196
0%	13	10	5	0	-6	-13	-21
2.67%	18	18	18	18	17	16	15
5.33%	18	18	18	18	18	18	18
8.00%	18	18	18	18	18	18	18
	KR4301N232 2018-02 풋327.5						453
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-453	-453	-453	-453	-453	-453	-453
-5.33%	-253	-253	-254	-255	-256	-257	-258
-2.67%	-70	-74	-79	-83	-87	-92	-96
0%	8	6	3	0	-3	-7	-10
2.67%	14	14	14	14	13	13	12
5.33%	14	14	14	14	14	14	14
8.00%	14	14	14	14	14	14	14

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

9,563

공시일	2018-02-02
기준일	2018-02-01

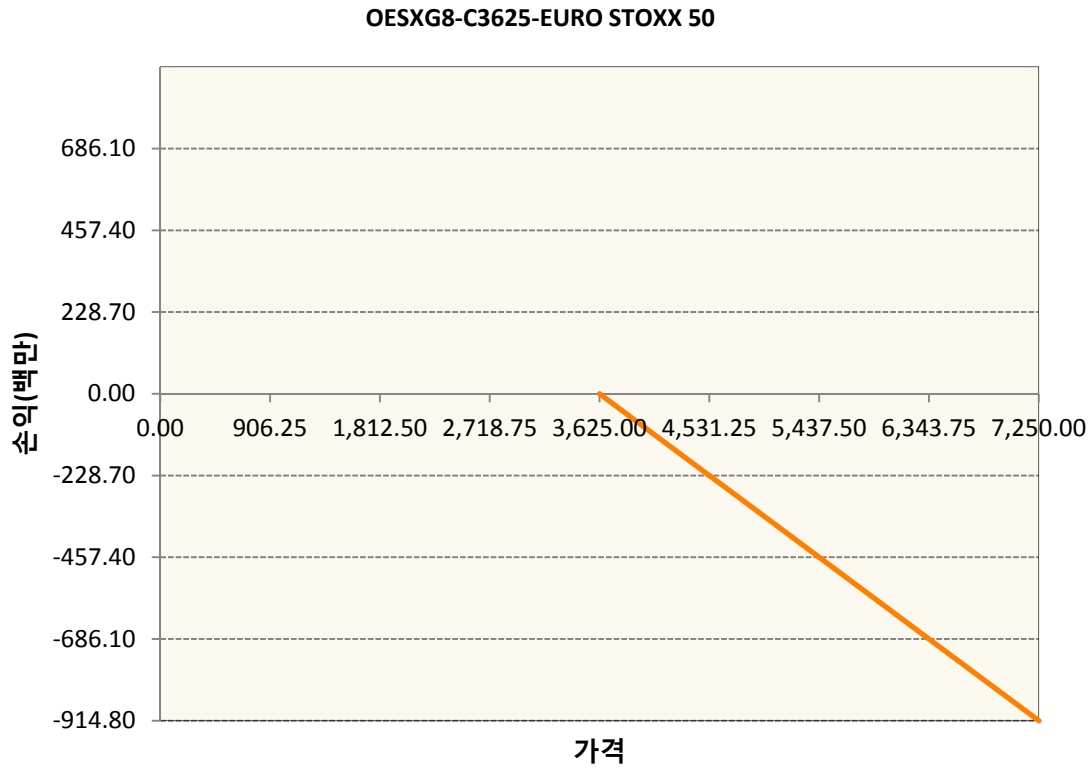
유로커버드콜모(주식혼합-파생형

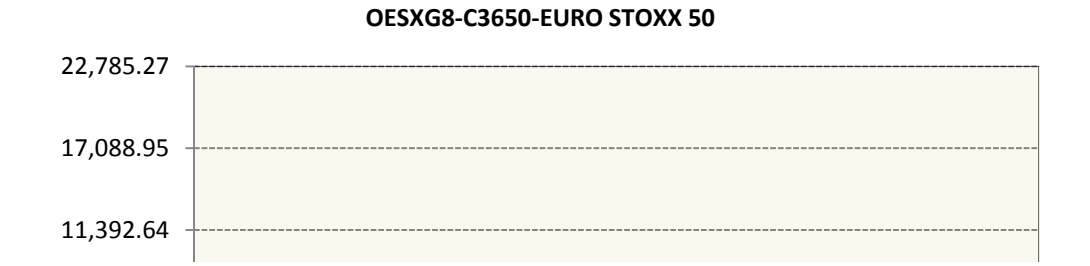
1. 계약금액

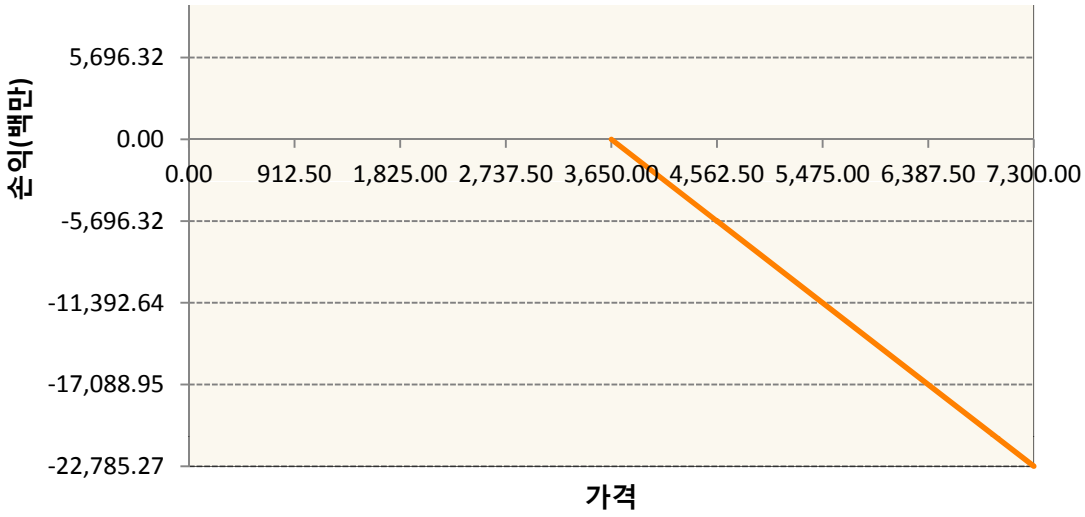
(단위:백만원)

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	14,393	0	14,393	
누계	유가증권	스왑	99,618	0	99,618	장외
누계	유가증권	옵션	0	47,400	-47,400	장내
누계	지수	스왑	53,131	0	53,131	장외

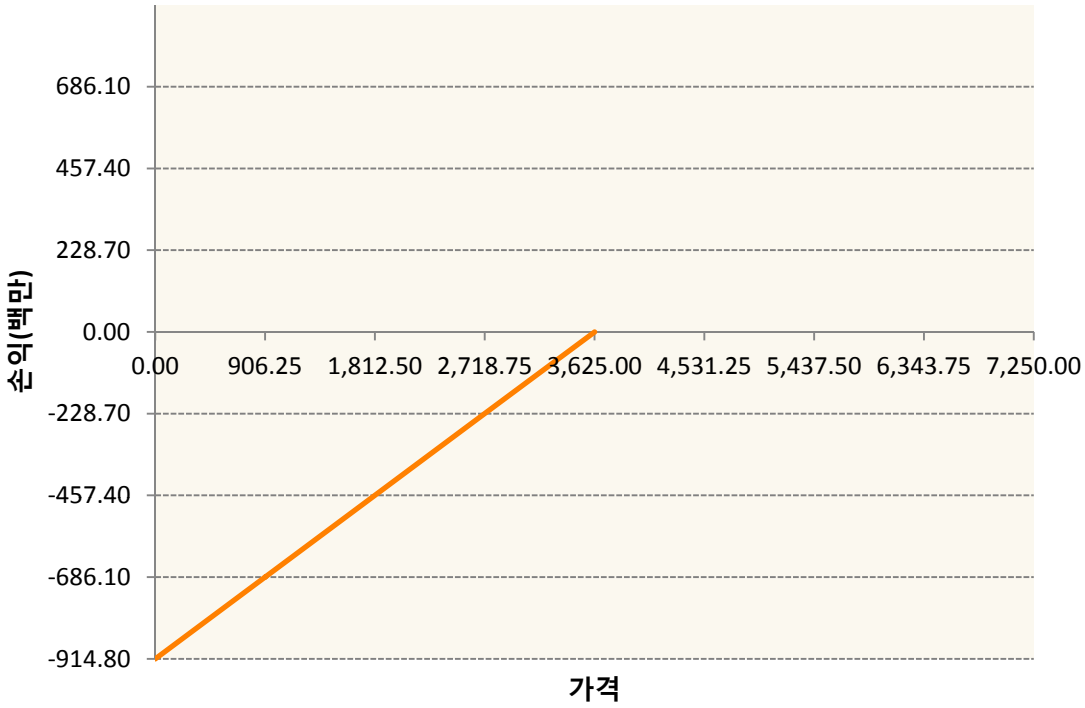
2. 만기시점의 손익구조



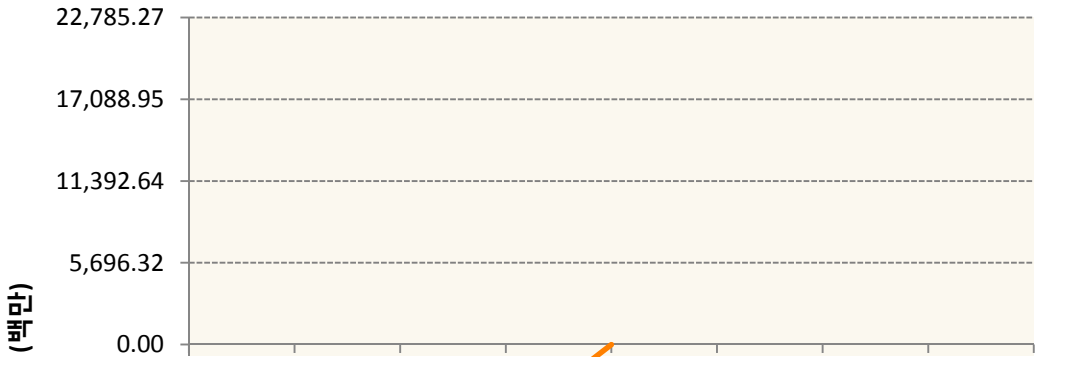


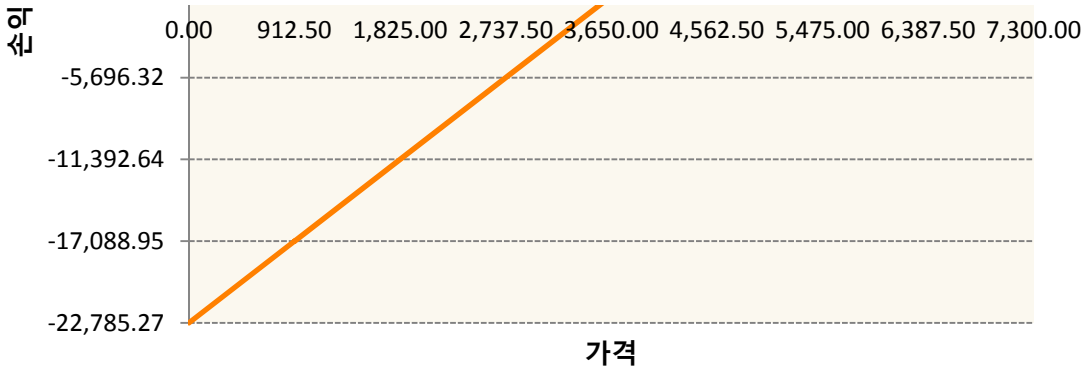


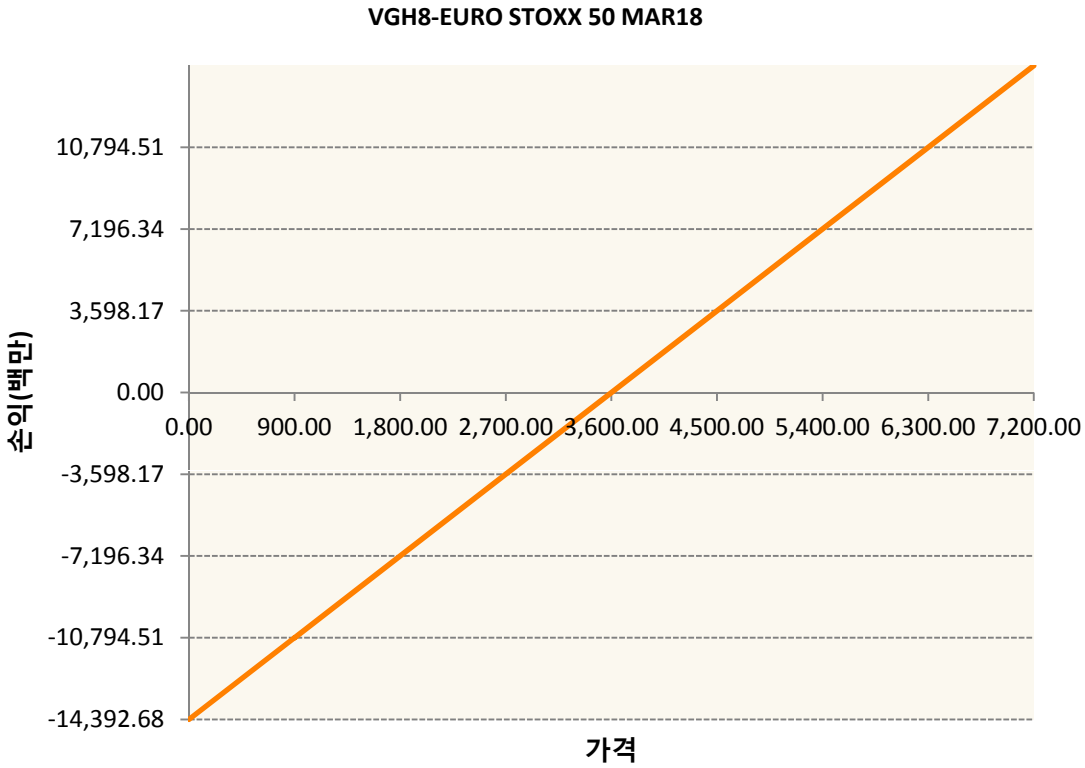
OESXG8-P3625-EURO STOXX 50



OESXG8-P3650-EURO STOXX 50







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)	(단위:백만원)
260105SGPX SG EURO Covered CALL STRATEGY - 994.569	24
260105SQPX SG EURO Covered CALL STRATEGY	45
OESXG8-C3(EURO STOXX 50	73
OESXG8-C3(EURO STOXX 50	1,823
OESXG8-P3(EURO STOXX 50	73
OESXG8-P3(EURO STOXX 50	1,823
VGH8 EURO STOXX 50 MAR18	1,151

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

2,759

공시일	2018-02-02
기준일	2018-02-01

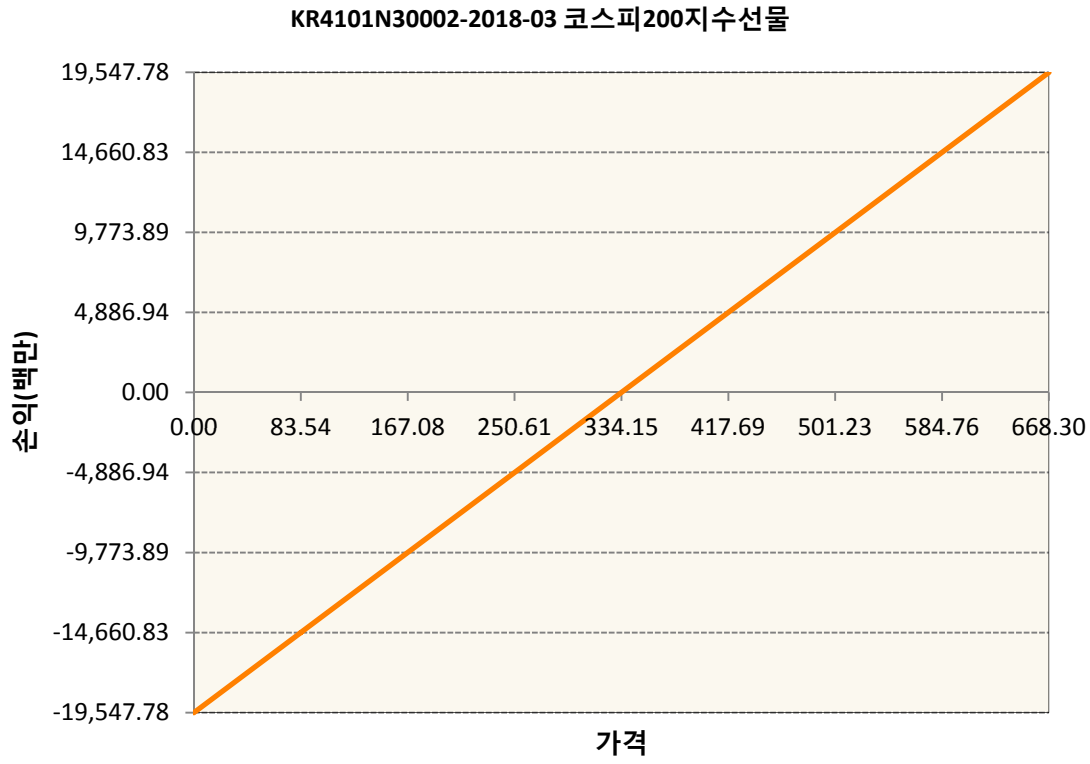
ETF스마트레버리지목표전환형8호

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	19,548	0	19,548	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101N30(2018-03 코스피200지수선물							1,560
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,560	-1,560	-1,560	-1,560	-1,560	-1,560	-1,560
-5.33%	-1,040	-1,040	-1,040	-1,040	-1,040	-1,040	-1,040
-2.67%	-520	-520	-520	-520	-520	-520	-520
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	520	520	520	520	520	520	520
5.33%	1,040	1,040	1,040	1,040	1,040	1,040	1,040
8.00%	1,560	1,560	1,560	1,560	1,560	1,560	1,560

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

945

공시일	2018-02-02
기준일	2018-02-01

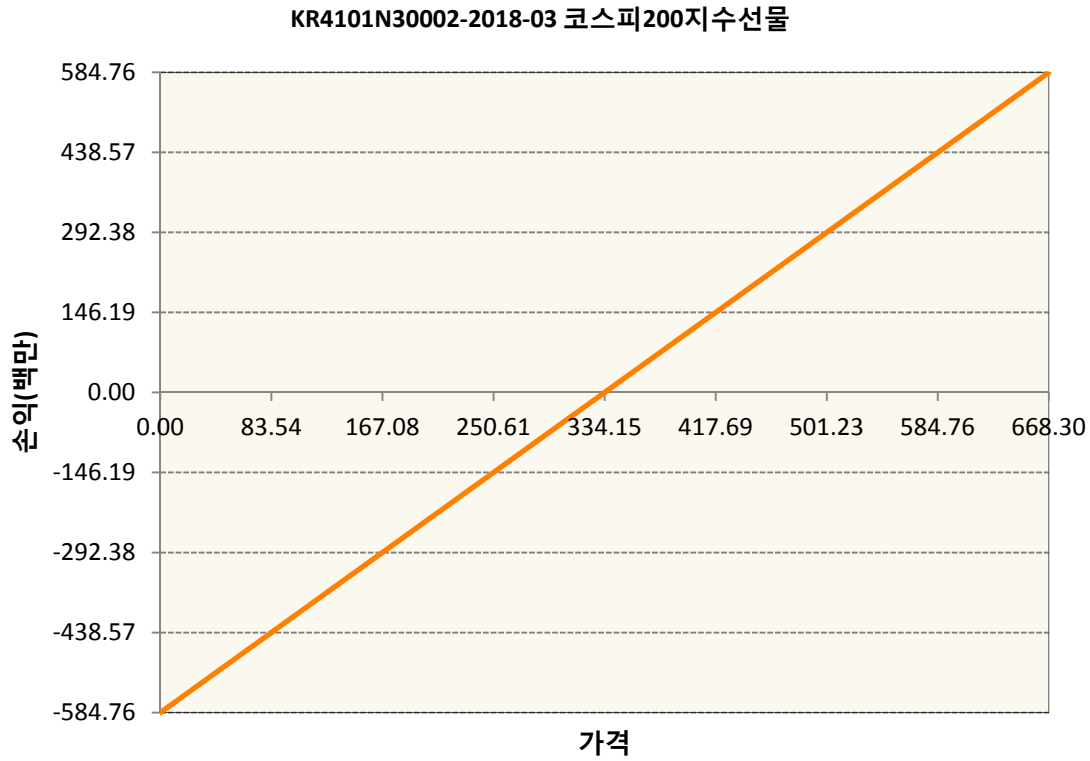
ETF스마트레버리지목표전환형9호

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	585	0	585	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	2018-02-02
기준일	2018-02-01

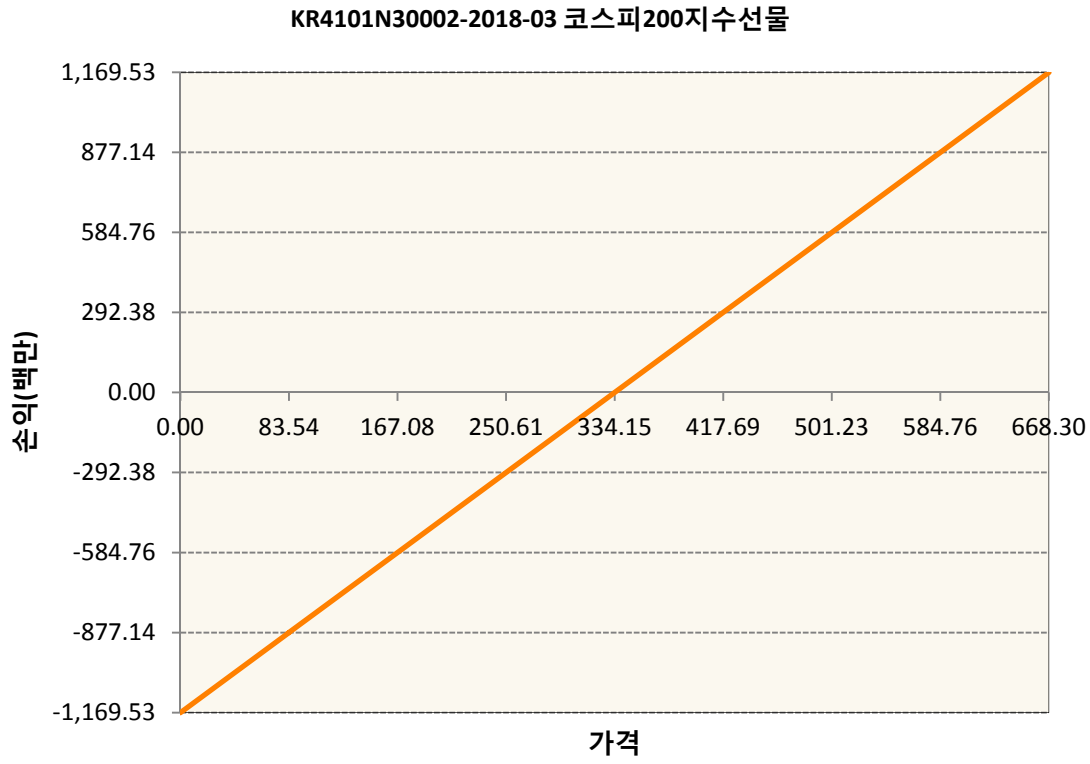
ETF스마트레버리지목표전환형10

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	167	-167	장내
누계	유가증권	선물	1,170	0	1,170	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101N30(2018-03 코스피200지수선물							93
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-93	-93	-93	-93	-93	-93	-93
-5.33%	-62	-62	-62	-62	-62	-62	-62
-2.67%	-31	-31	-31	-31	-31	-31	-31
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	31	31	31	31	31	31	31
5.33%	62	62	62	62	62	62	62
8.00%	93	93	93	93	93	93	93

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

57

공시일	2018-02-02
기준일	2018-02-01

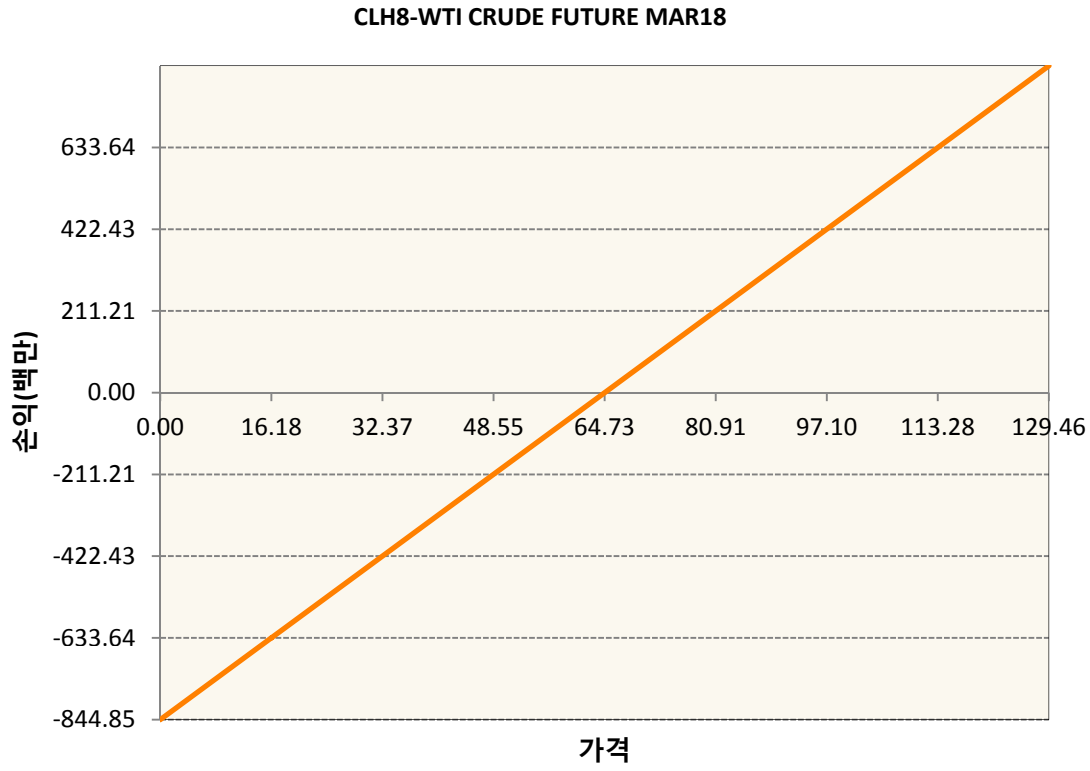
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

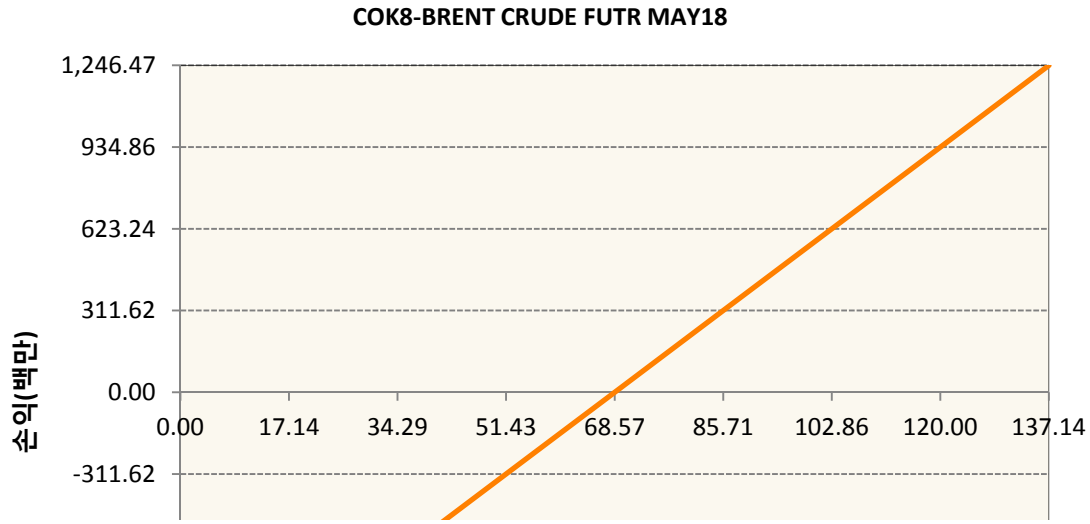
1. 계약금액

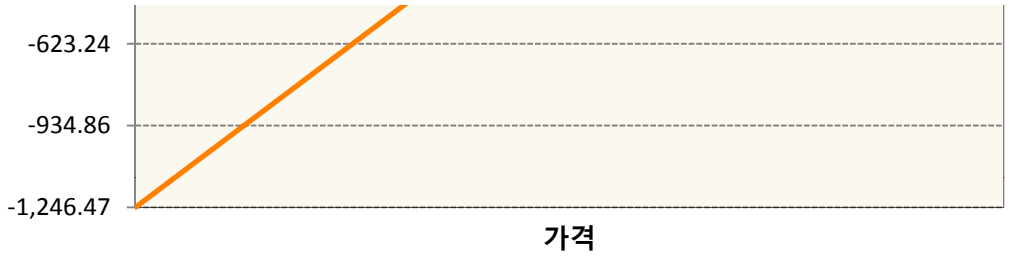
(단위:백만원)

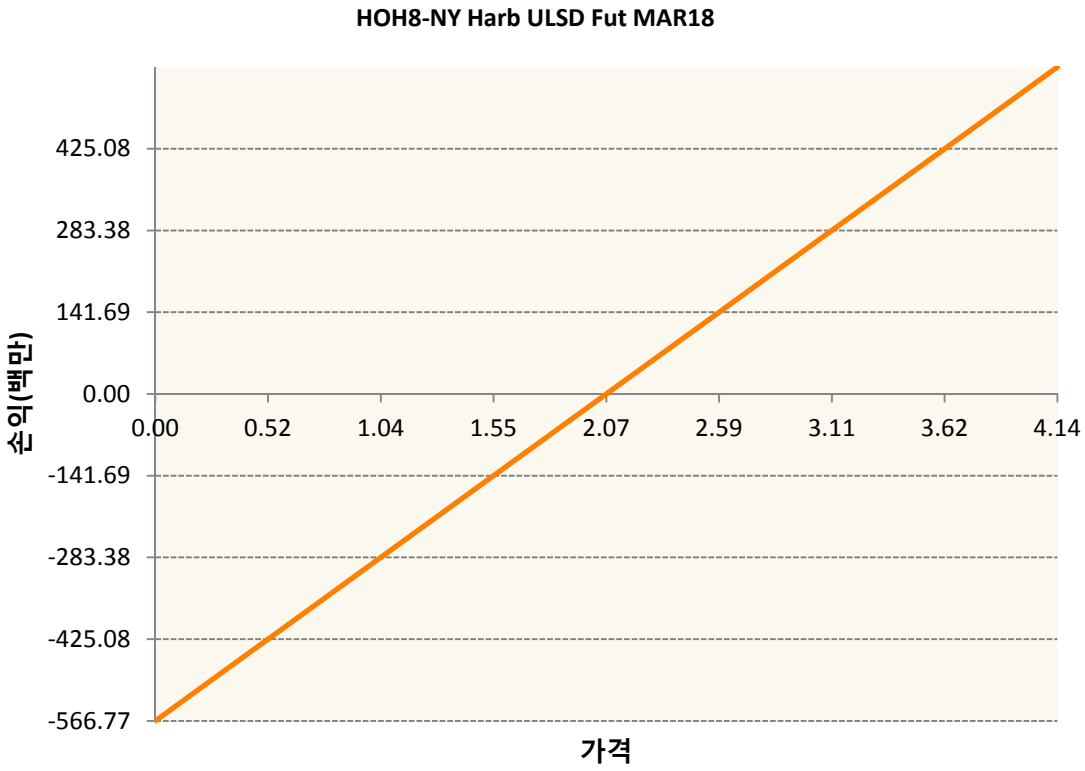
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	4,498	858	3,641	

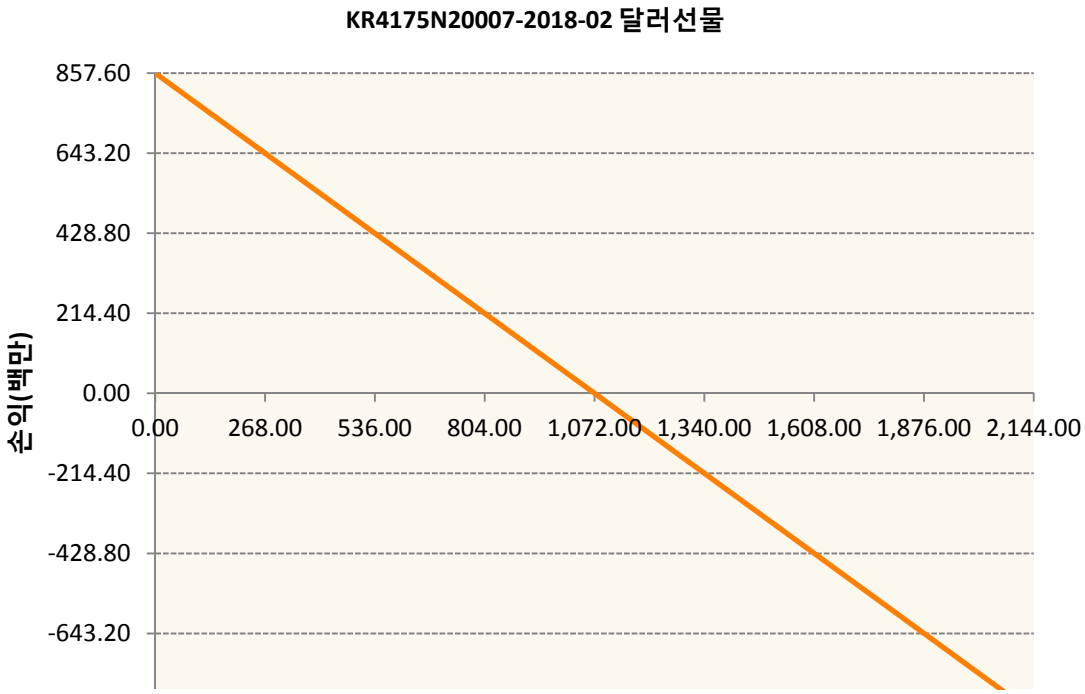
2. 만기시점의 손익구조

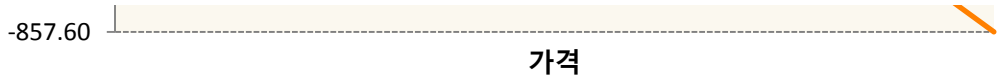


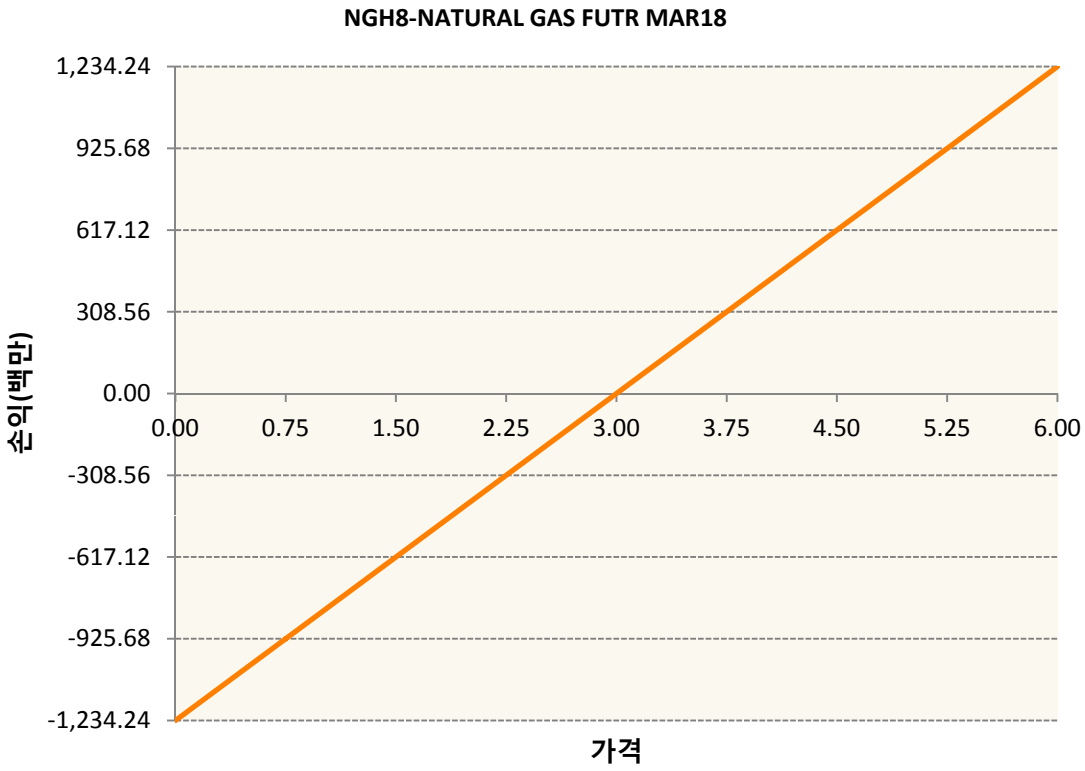


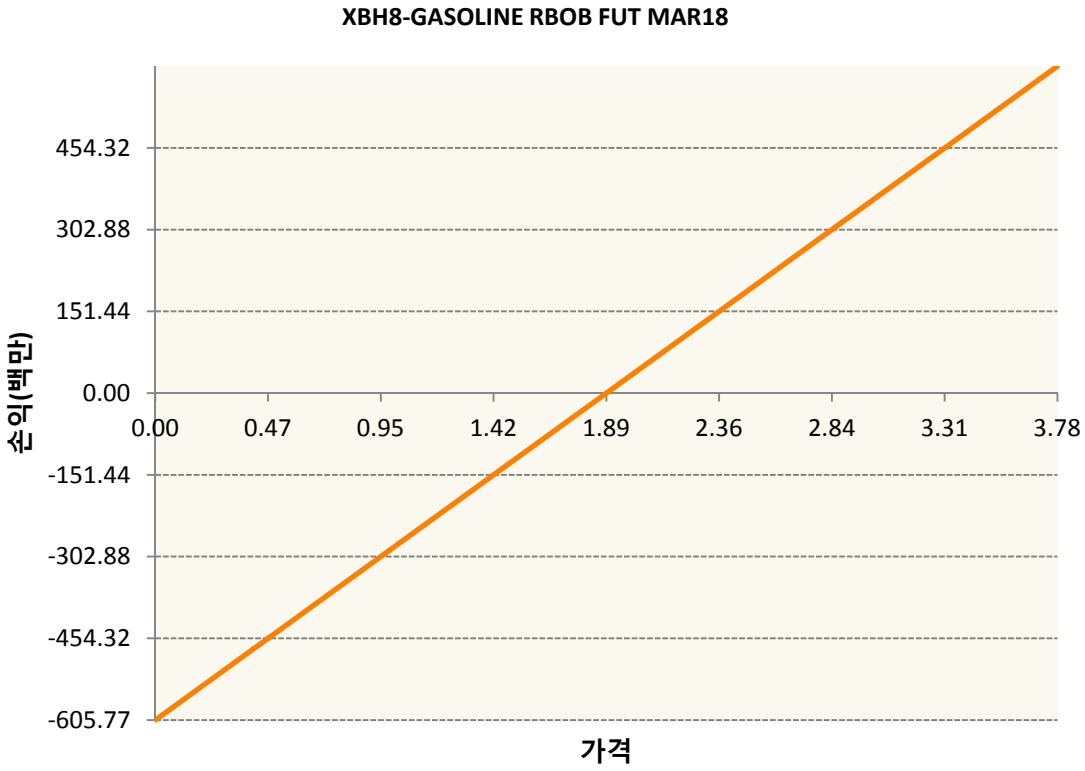

-623.24
-934.86
-1,246.47
가격


HOH8-NY Harb ULSD Fut MAR18
425.08
283.38
141.69
0.00
-141.69
-283.38
-425.08
-566.77
0.00
0.52
1.04
1.55
2.07
2.59
3.11
3.62
4.14
손익(백만)
가격


KR4175N20007-2018-02 달러선물
857.60
643.20
428.80
214.40
0.00
-214.40
-428.80
-643.20
0.00
268.00
536.00
804.00
1,072.00
1,340.00
1,608.00
1,876.00
2,144.00
손익(백만)


-857.60
가격


NGH8-NATURAL GAS FUTR MAR18
1,234.24
925.68
617.12
308.56
0.00
-308.56
-617.12
-925.68
-1,234.24
0.00
0.75
1.50
2.25
3.00
3.75
4.50
5.25
6.00
손익(백만)
가격


XBH8-GASOLINE RBOB FUT MAR18
454.32
302.88
151.44
0.00
-151.44
-302.88
-454.32
-605.77
0.00
0.47
0.95
1.42
1.89
2.36
2.84
3.31
3.78
손익(백만)
가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLH8	WTI CRUDE FUTURE MAR18	68
COK8	BRENT CRUDE FUTR MAY18	100
HOH8	NY Harb ULSD Fut MAR18	45
KR4175N20(	2018-02 달러선물	69
NGH8	NATURAL GAS FUTR MAR18	99
XBH8	GASOLINE RBOB FUT MAR18	48

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

613

공시일	2018-02-02
기준일	2018-02-01

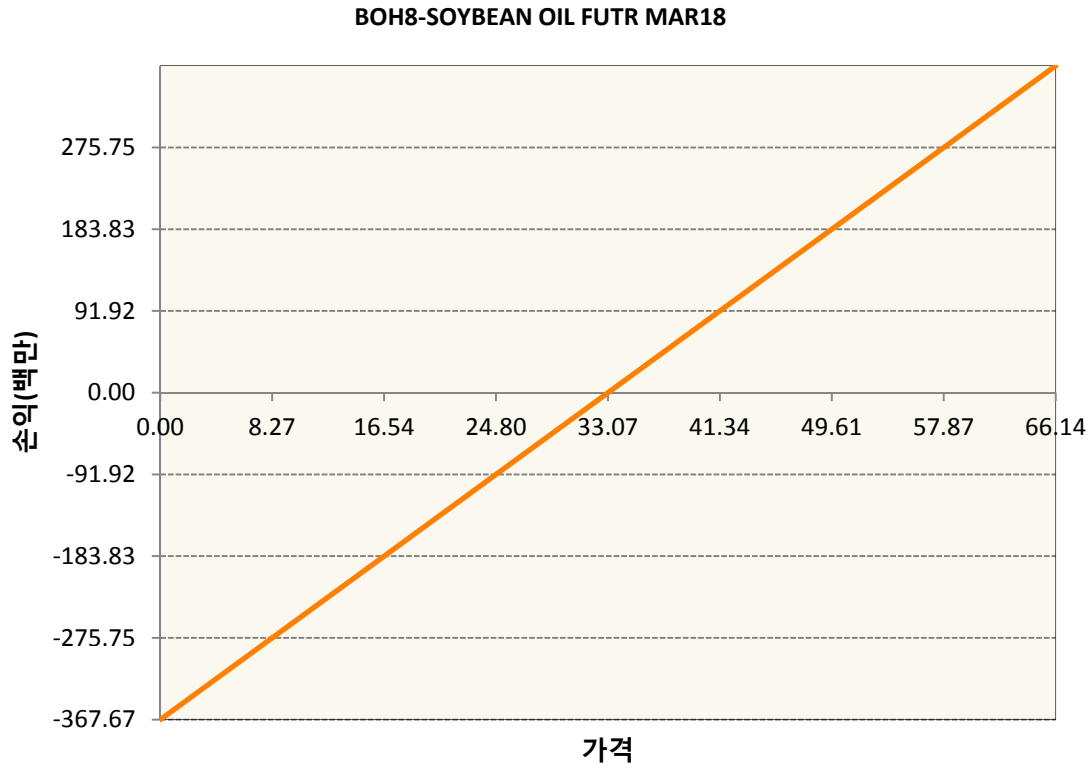
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

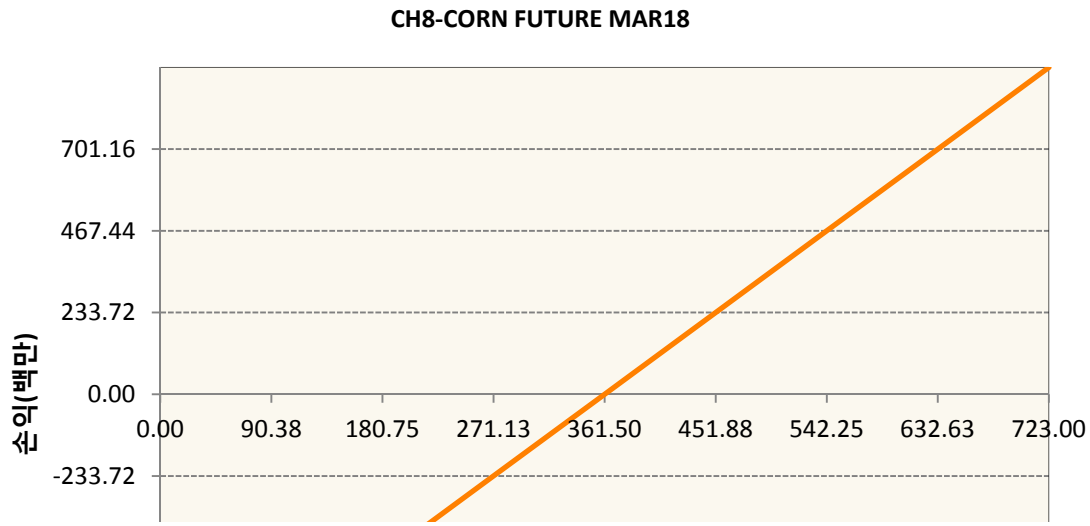
1. 계약금액

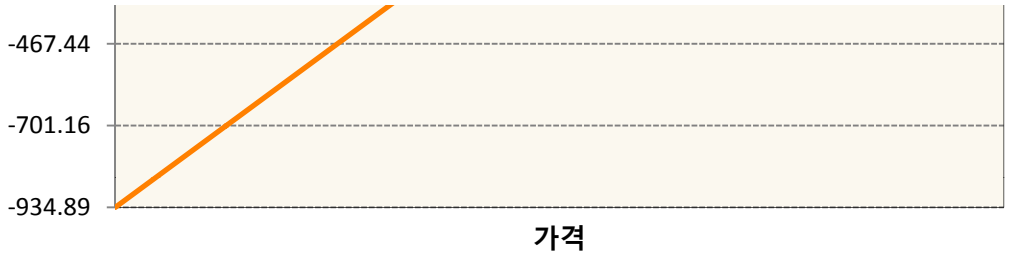
(단위:백만원)

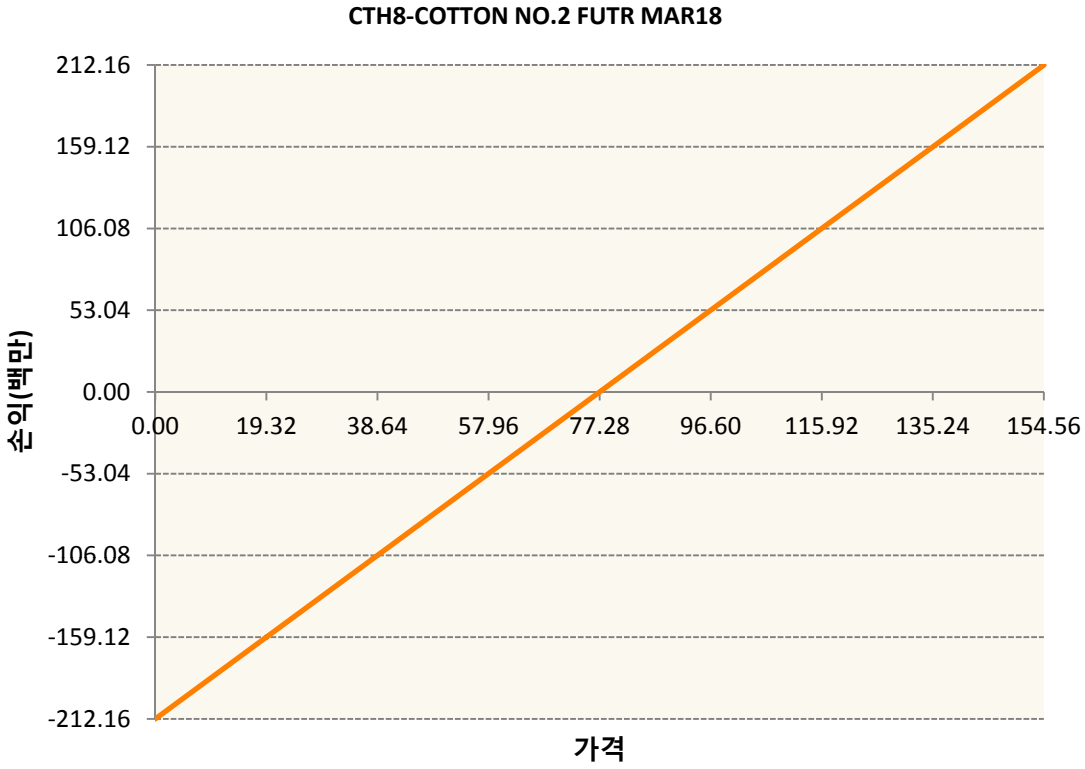
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	4,149	322	3,827	

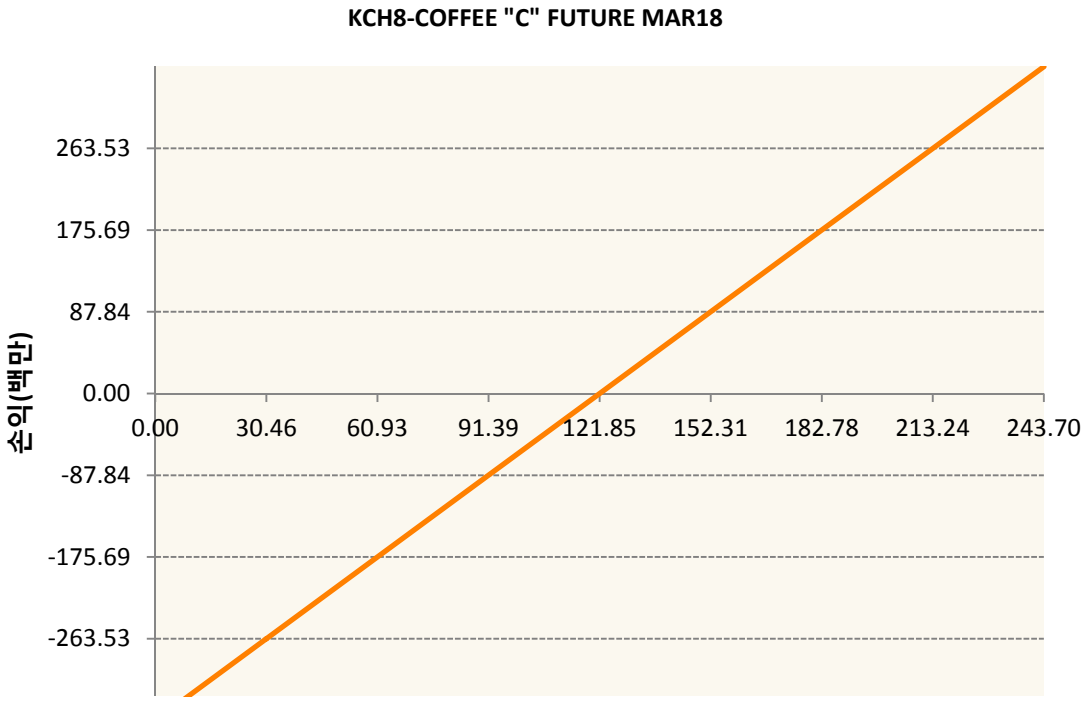
2. 만기시점의 손익구조

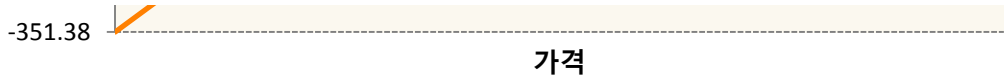


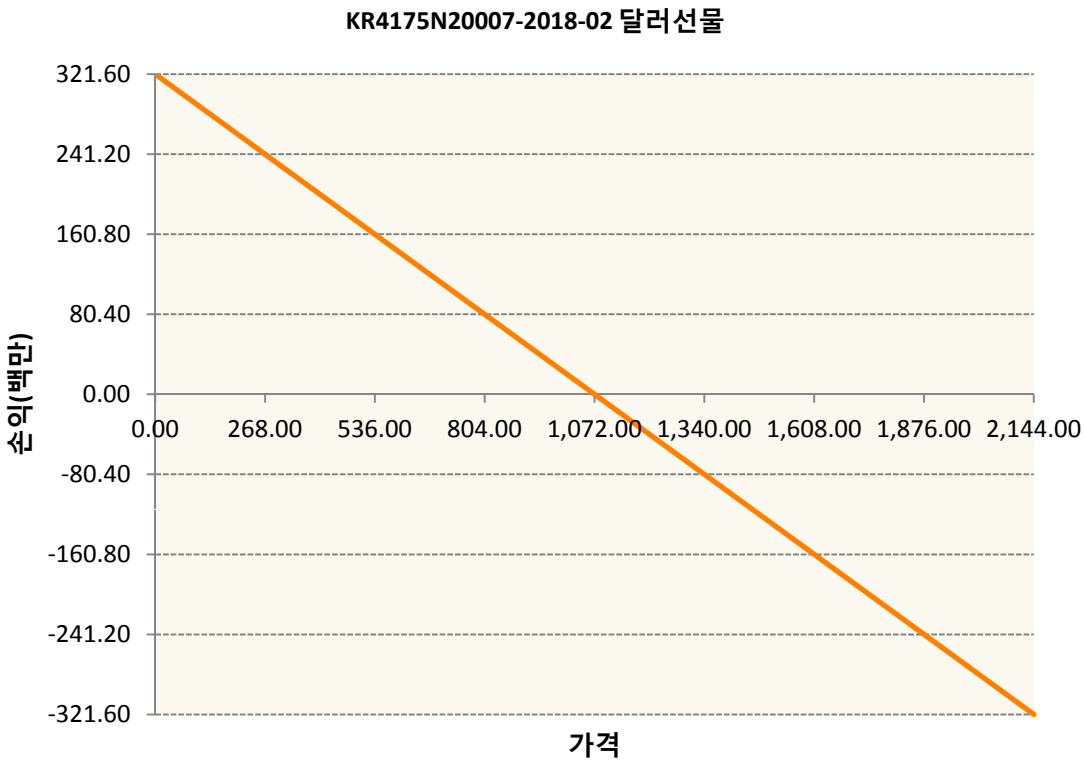


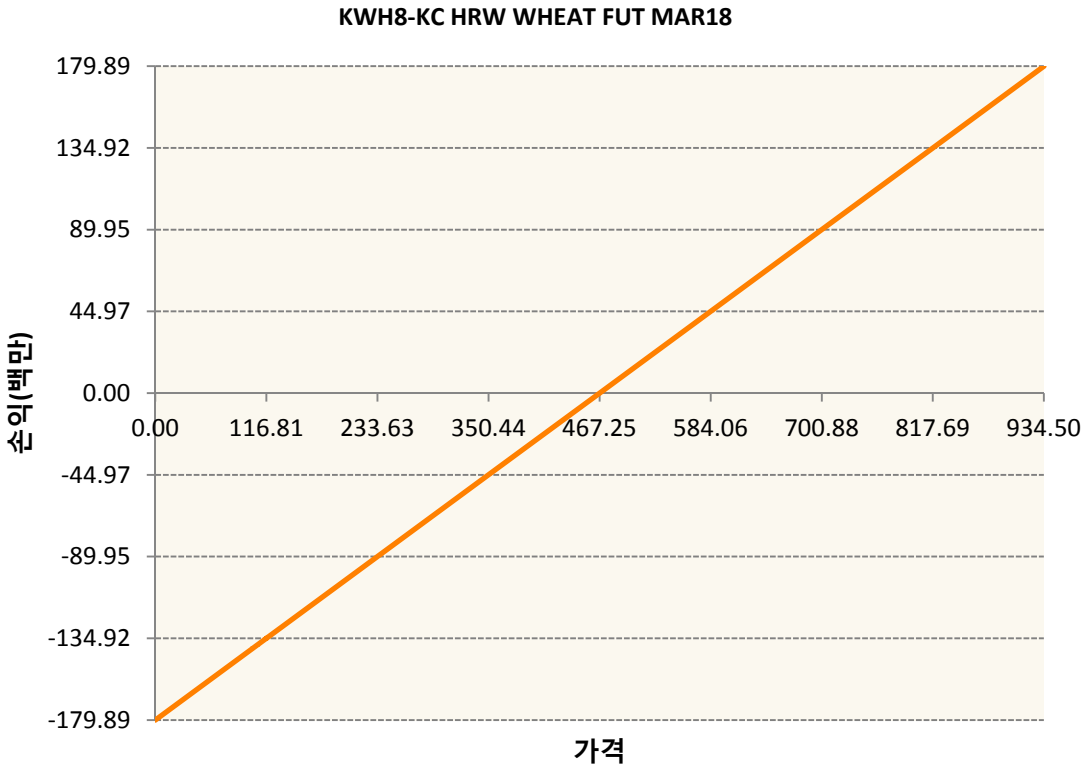

-467.44
-701.16
-934.89
가격


CTH8-COTTON NO.2 FUTR MAR18
212.16
159.12
106.08
53.04
0.00
-53.04
-106.08
-159.12
-212.16
손익(백만)
0.00
19.32
38.64
57.96
77.28
96.60
115.92
135.24
154.56
가격

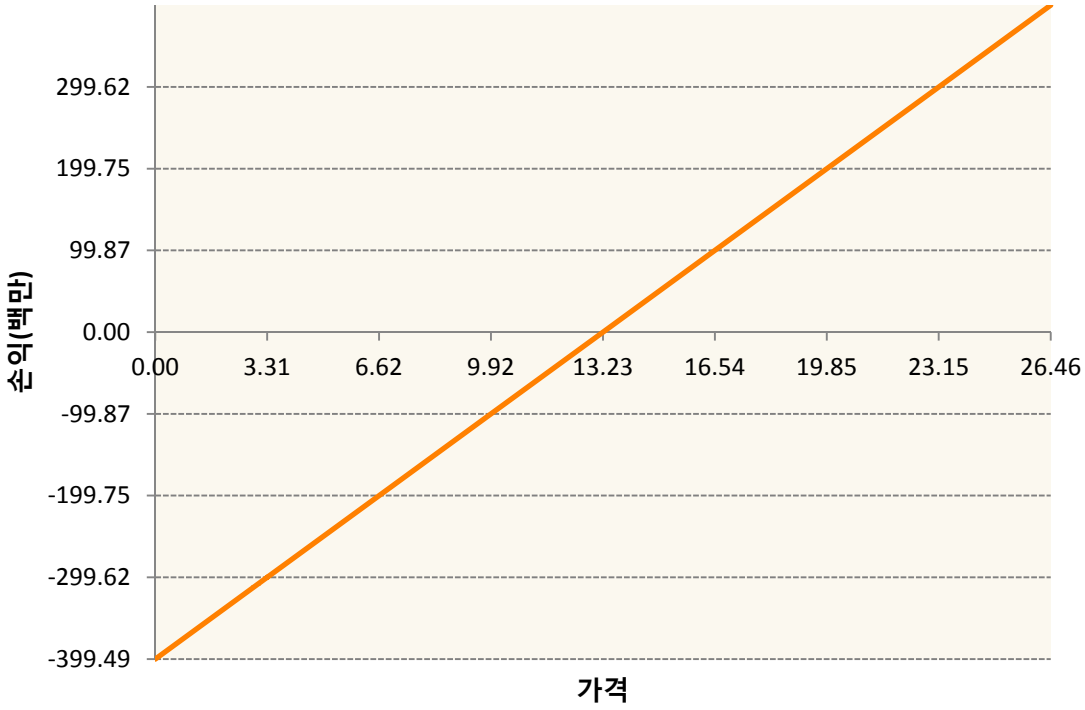

KCH8-COFFEE "C" FUTURE MAR18
263.53
175.69
87.84
0.00
-87.84
-175.69
-263.53
손익(백만)
0.00
30.46
60.93
91.39
121.85
152.31
182.78
213.24
243.70


-351.38
가격

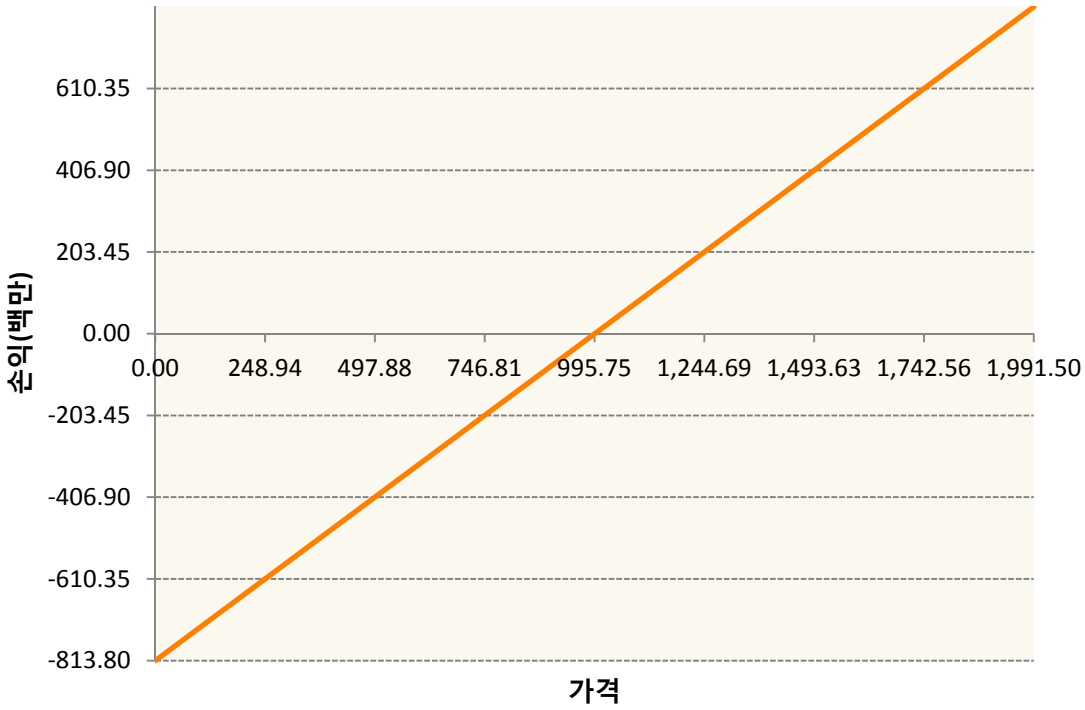

KR4175N20007-2018-02 달러선물
321.60
241.20
160.80
80.40
0.00
-80.40
-160.80
-241.20
-321.60
0.00
268.00
536.00
804.00
1,072.00
1,340.00
1,608.00
1,876.00
2,144.00
손익(백만)
가격


KWH8-KC HRW WHEAT FUT MAR18
179.89
134.92
89.95
44.97
0.00
-44.97
-89.95
-134.92
-179.89
0.00
116.81
233.63
350.44
467.25
584.06
700.88
817.69
934.50
손익(백만)
가격

SBH8-Sugar #11 (WORLD) MAR18

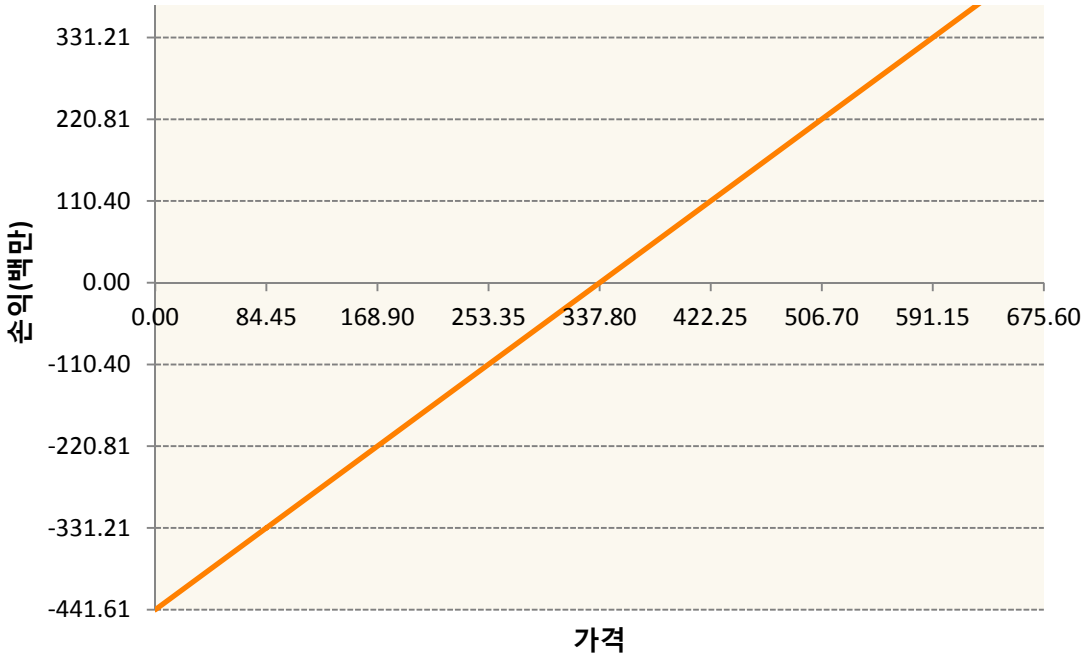


SH8-SOYBEAN FUTURE MAR18

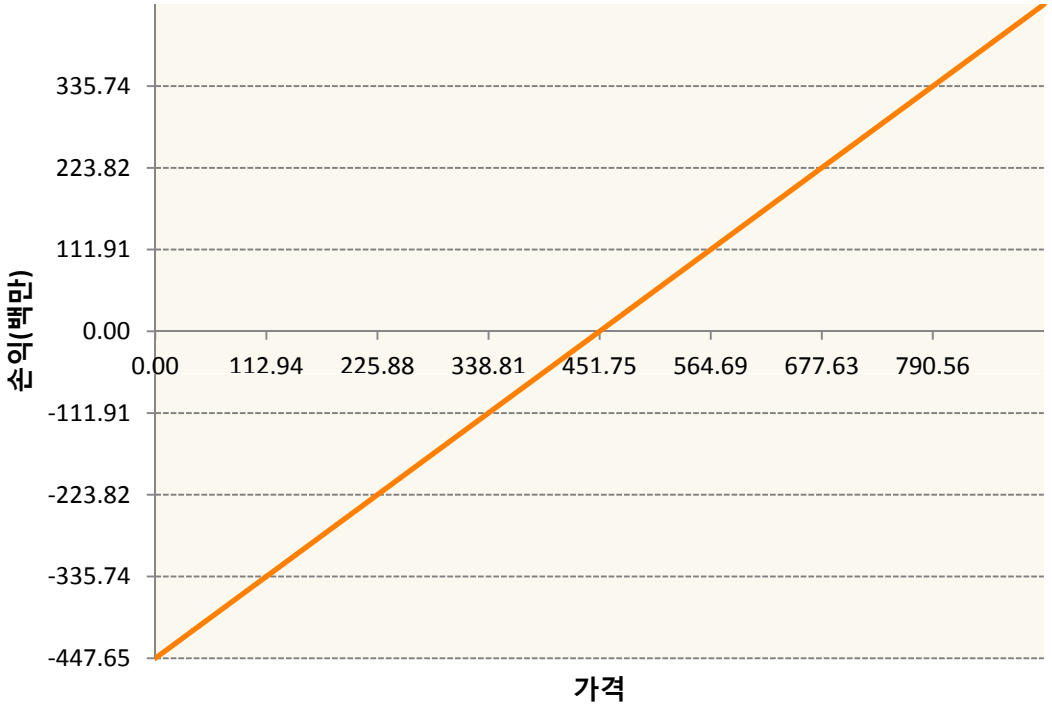


SMH8-SOYBEAN MEAL FUTR MAR18





WH8-WHEAT FUTURE(CBT) MAR18



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

BOH8	SOYBEAN OIL FUTR MAR18	29
CH8	CORN FUTURE MAR18	75
CTH8	COTTON NO.2 FUTR MAR18	17
KCH8	COFFEE "C" FUTURE MAR18	28
KR4175N20(	2018-02 달러선물	26

KWH8	KC HRW WHEAT FUT MAR18	14
SBH8	Sugar #11 (WORLD) MAR18	32
SH8	SOYBEAN FUTURE MAR18	65
SMH8	SOYBEAN MEAL FUTR MAR18	35
WH8	WHEAT FUTURE(CBT) MAR18	36

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

344