공시일	2018-02-05
기준일	2018-02-02

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	2018-02-05
기준일	2018-02-02

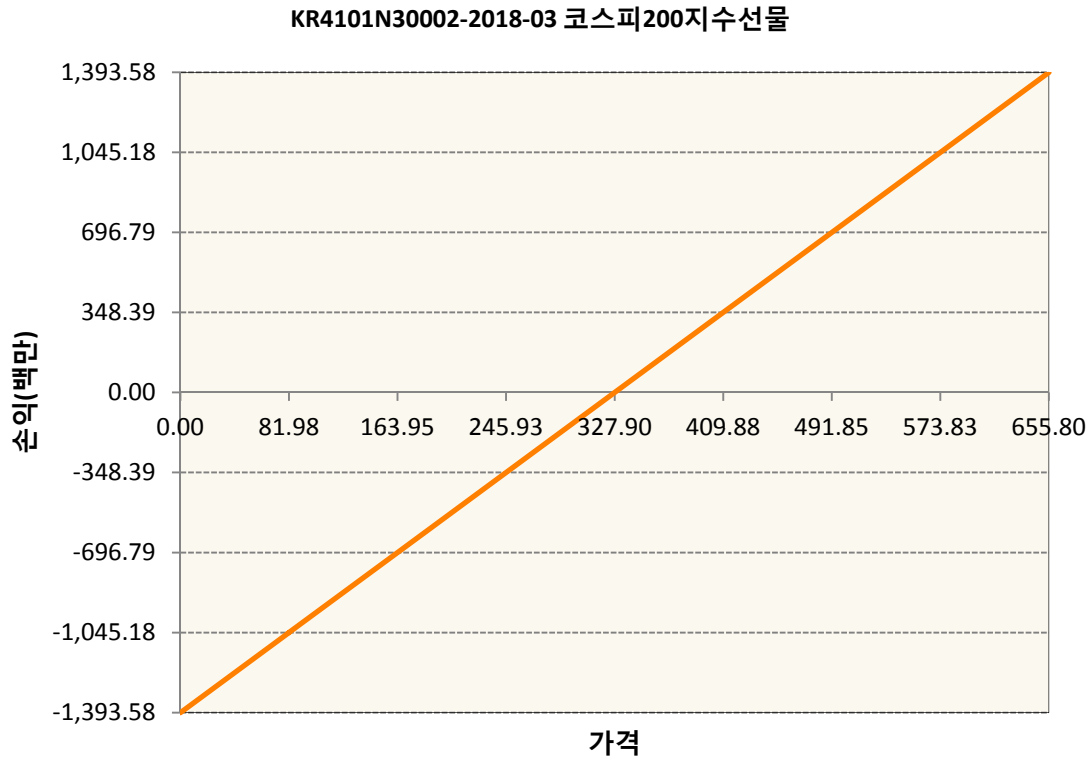
스마트인덱스모

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	1,394	0	1,394	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101N30(2018-03 코스피200지수선물							111
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-111	-111	-111	-111	-111	-111	-111
-5.33%	-74	-74	-74	-74	-74	-74	-74
-2.67%	-37	-37	-37	-37	-37	-37	-37
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	37	37	37	37	37	37	37
5.33%	74	74	74	74	74	74	74
8.00%	111	111	111	111	111	111	111

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

69

공시일	2018-02-05
기준일	2018-02-02

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	1,158

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

355

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2018-02-05
기준일	2018-02-02

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	404

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

368

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2018-02-05
기준일	2018-02-02

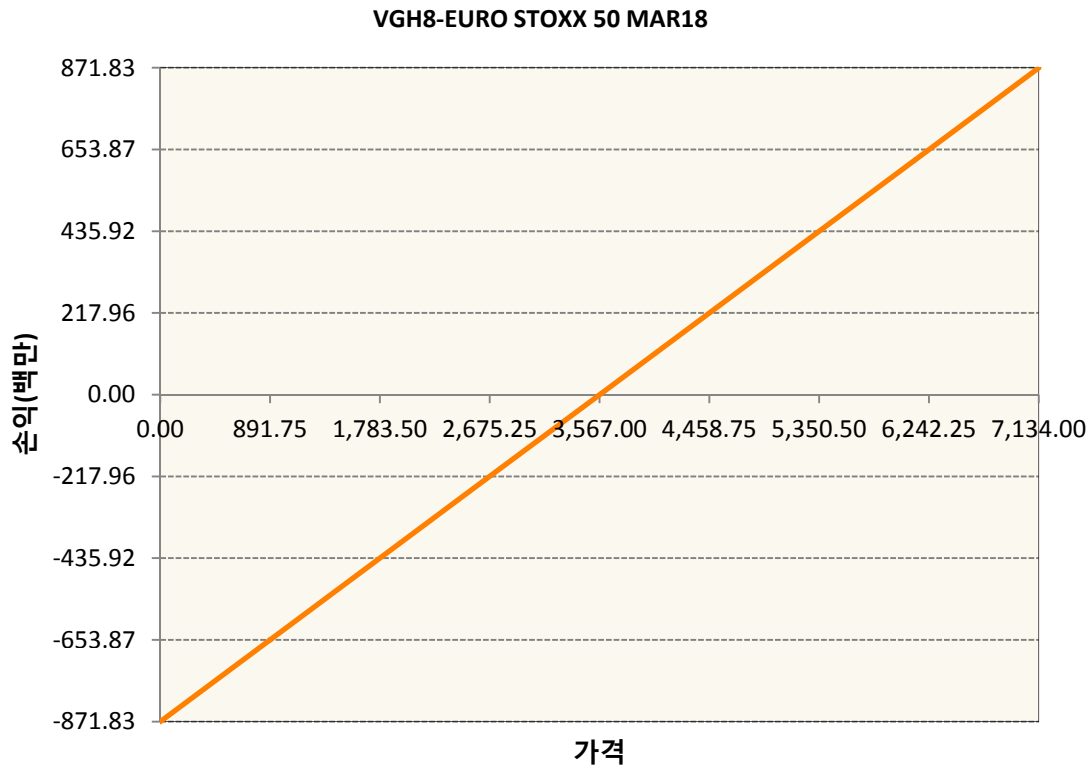
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	872	0	872	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGH8	EURO STOXX 50 MAR18	70

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

(단위:백만원)

38

공시일	2018-02-05
기준일	2018-02-02

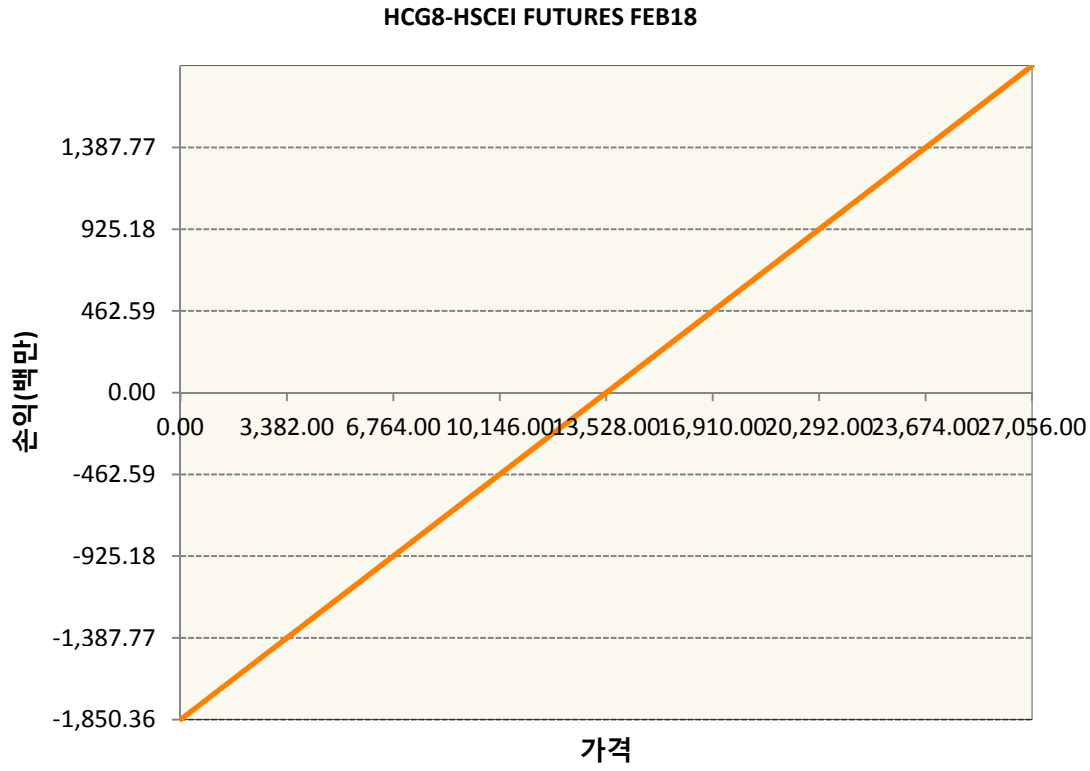
차이나인덱스모(주식-파생형)

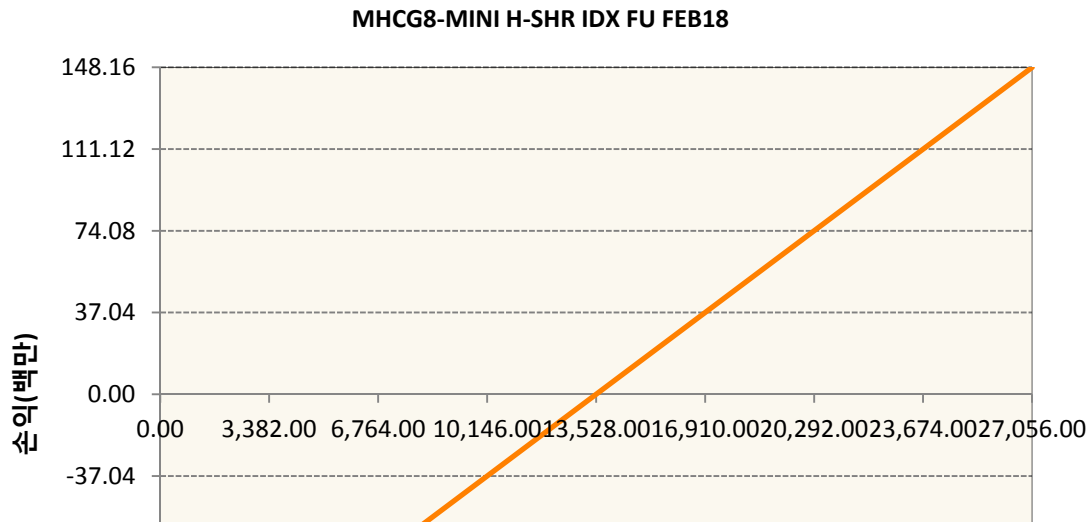
1. 계약금액

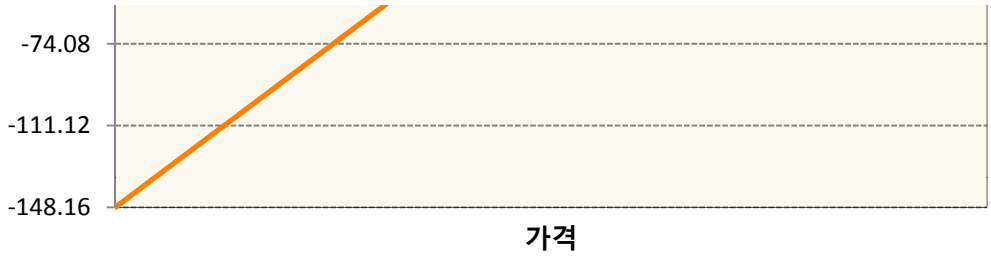
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,999	0	1,999	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCG8	HSCEI FUTURES FEB18	148
MHCG8	MINI H-SHR IDX FU FEB18	12

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

공시일	2018-02-05
기준일	2018-02-02

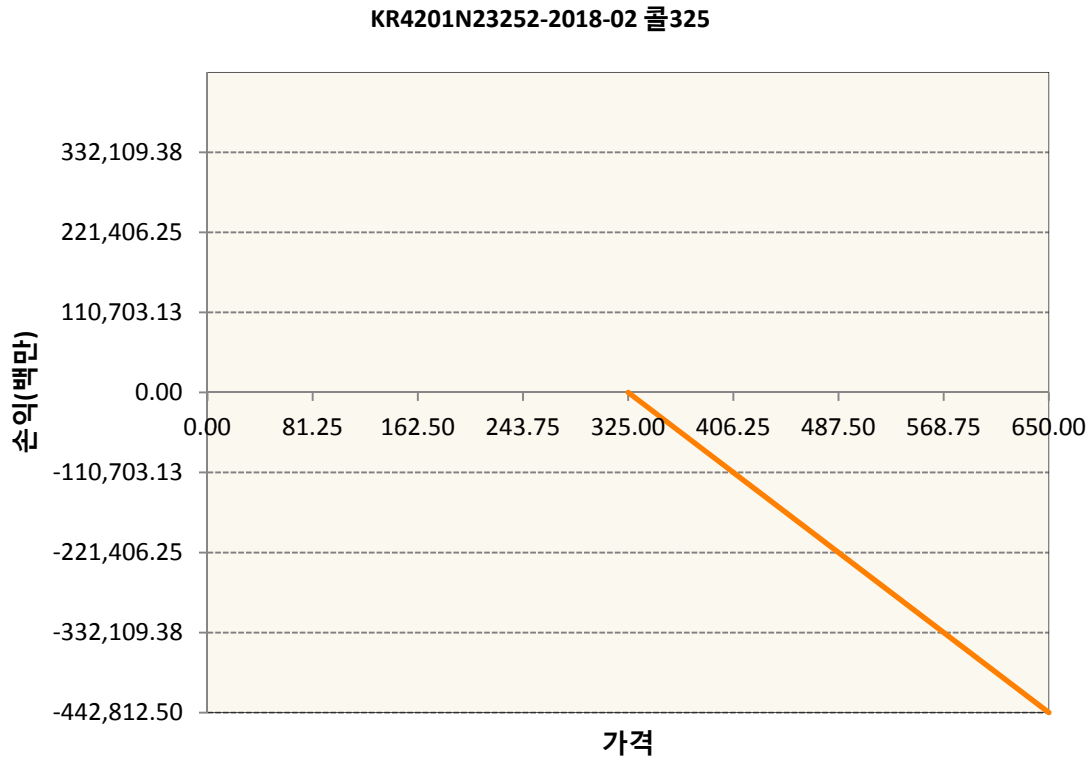
커버드콜모(주식혼합-파생형)

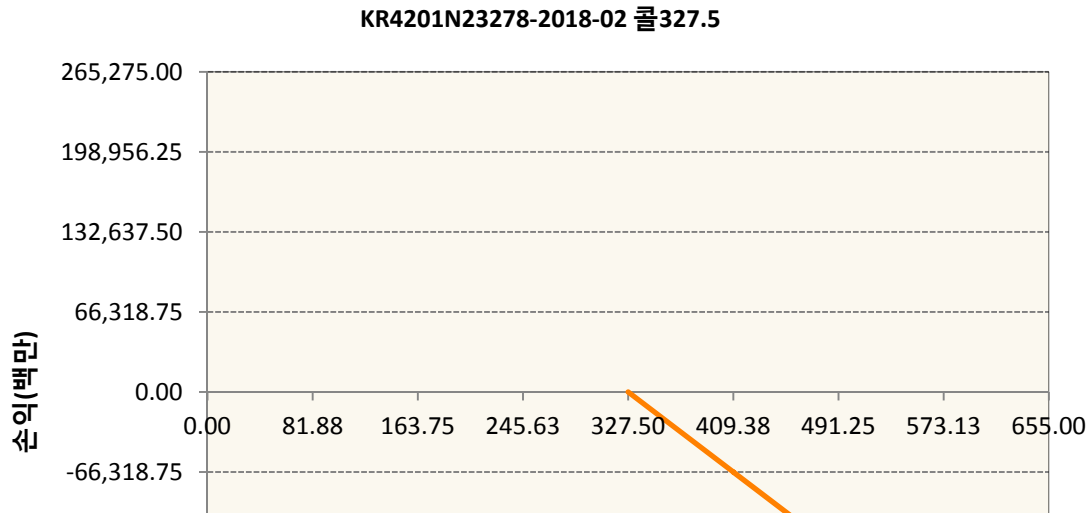
1. 계약금액

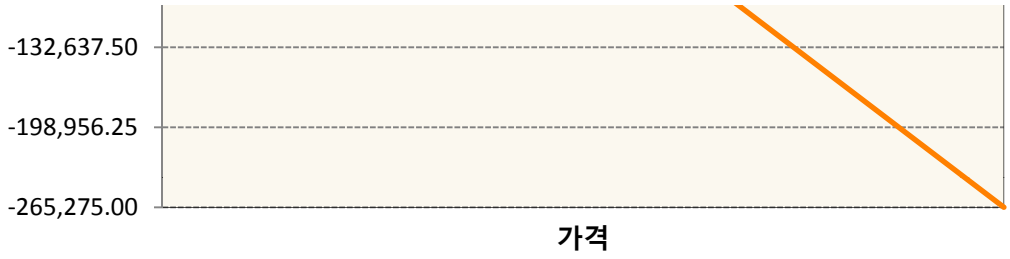
(단위:백만원)

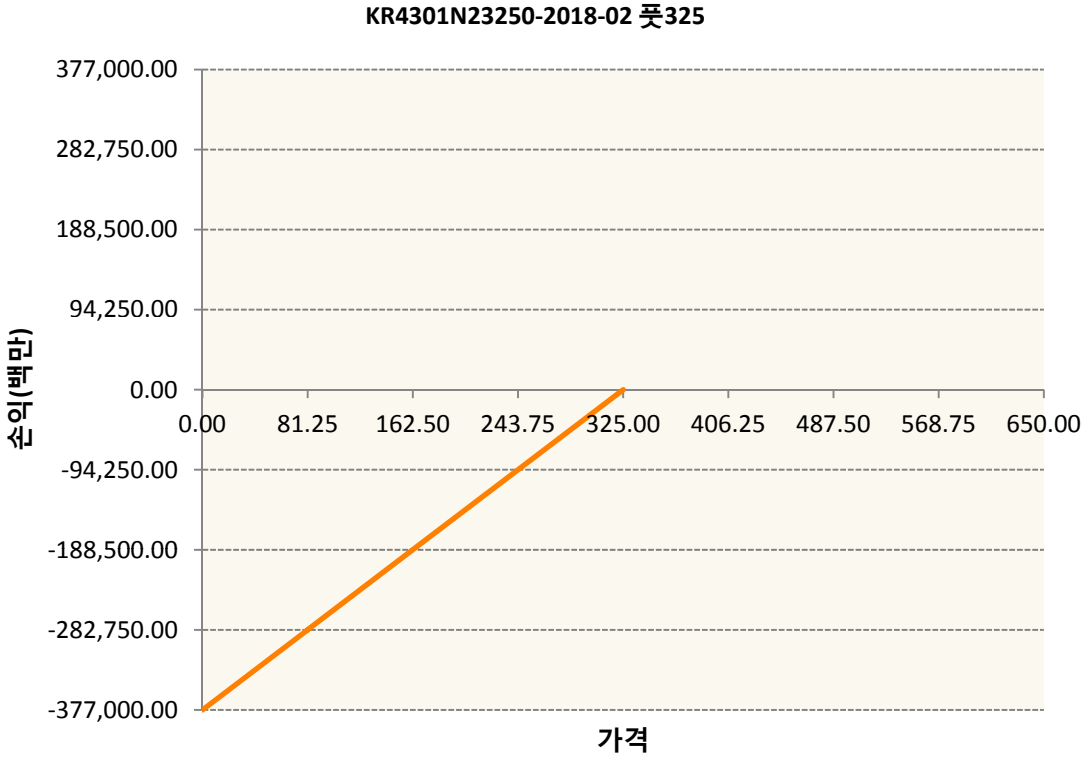
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	8,120	0	8,120	장내
누계	유가증권	옵션	0	1,209,374	-1,209,374	장내

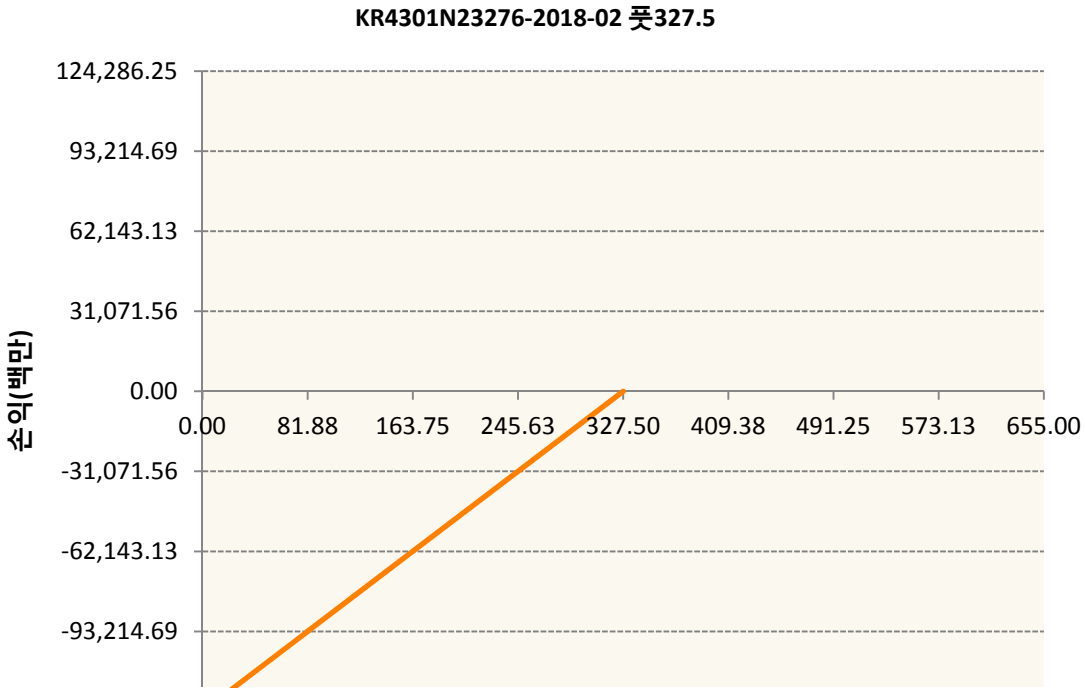
2. 만기시점의 손익구조






-132,637.50
-198,956.25
-265,275.00
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							31,399
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	7,133	7,129	7,119	7,100	7,070	7,026	6,965
-5.33%	7,055	6,983	6,883	6,755	6,598	6,416	6,210
-2.67%	6,026	5,696	5,346	4,978	4,598	4,206	3,805
0%	1,374	918	460	0	-462	-924	-1,388
2.67%	-7,946	-8,152	-8,392	-8,661	-8,955	-9,269	-9,602
5.33%	-19,425	-19,459	-19,513	-19,591	-19,694	-19,823	-19,976
8.00%	-31,278	-31,280	-31,286	-31,298	-31,319	-31,352	-31,399
KR4201N232 2018-02 콜327.5							17,752
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	3,181	3,180	3,177	3,171	3,161	3,145	3,121
-5.33%	3,162	3,139	3,104	3,054	2,989	2,909	2,816
-2.67%	2,825	2,679	2,514	2,335	2,144	1,942	1,732
0%	840	560	280	0	-280	-560	-840
2.67%	-3,998	-4,172	-4,362	-4,566	-4,780	-5,003	-5,233
5.33%	-10,608	-10,647	-10,702	-10,775	-10,865	-10,971	-11,093
8.00%	-17,632	-17,635	-17,642	-17,656	-17,678	-17,709	-17,752
KR4301N232 2018-02 풋325							26,230
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-26,229	-26,229	-26,229	-26,229	-26,229	-26,230	-26,230
-5.33%	-16,116	-16,117	-16,120	-16,125	-16,134	-16,148	-16,168
-2.67%	-6,150	-6,232	-6,331	-6,444	-6,571	-6,708	-6,855
0%	641	431	217	0	-219	-439	-661
2.67%	1,731	1,712	1,682	1,640	1,585	1,518	1,438
5.33%	1,747	1,747	1,747	1,746	1,744	1,739	1,731
8.00%	1,747	1,747	1,747	1,747	1,747	1,747	1,747
KR4301N232 2018-02 풋327.5							9,101
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-9,101	-9,101	-9,101	-9,101	-9,101	-9,101	-9,101
-5.33%	-5,793	-5,793	-5,793	-5,793	-5,794	-5,796	-5,799
-2.67%	-2,496	-2,507	-2,523	-2,543	-2,568	-2,597	-2,629
0%	227	151	76	0	-76	-151	-227
2.67%	976	958	935	907	874	837	796

5.33%	1,000	1,000	999	998	996	992	986
8.00%	1,000	1,000	1,000	1,000	1,000	1,000	1,000

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

102,537

공시일	2018-02-05
기준일	2018-02-02

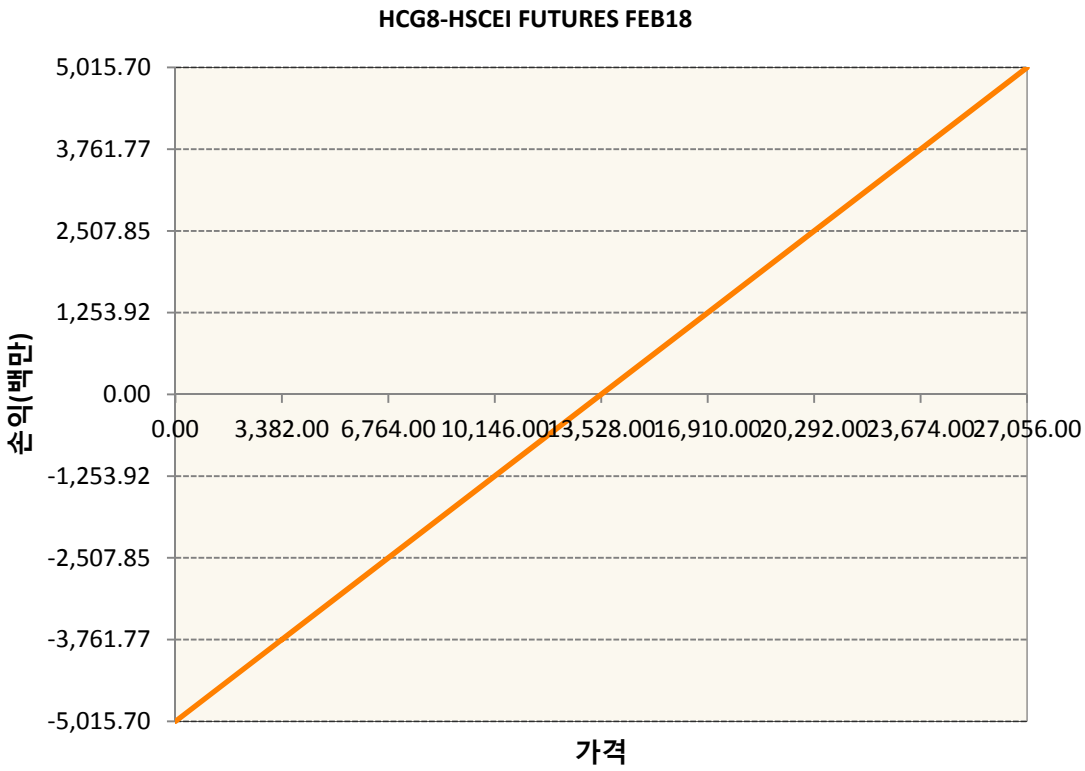
홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생

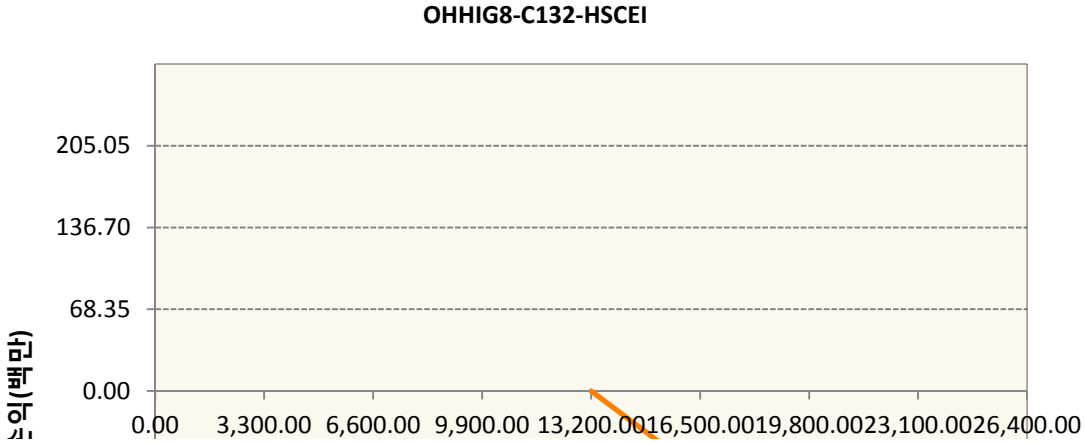
1. 계약금액

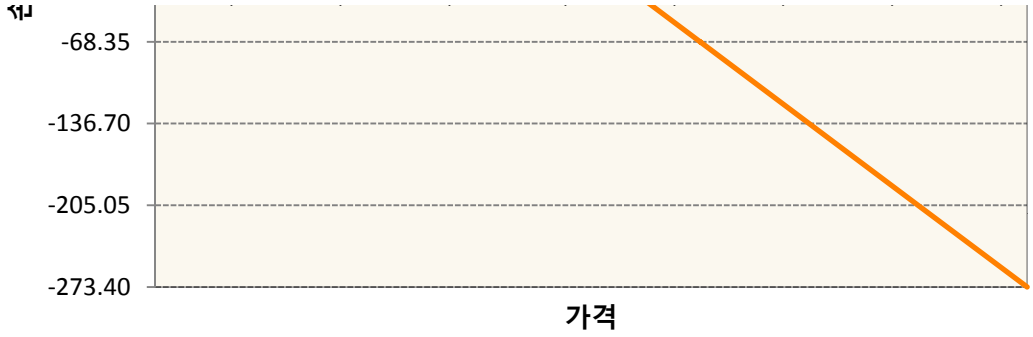
(단위:백만원)

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	5,016	0	5,016	장내
누계	유가증권	옵션	0	11,463	-11,463	장내

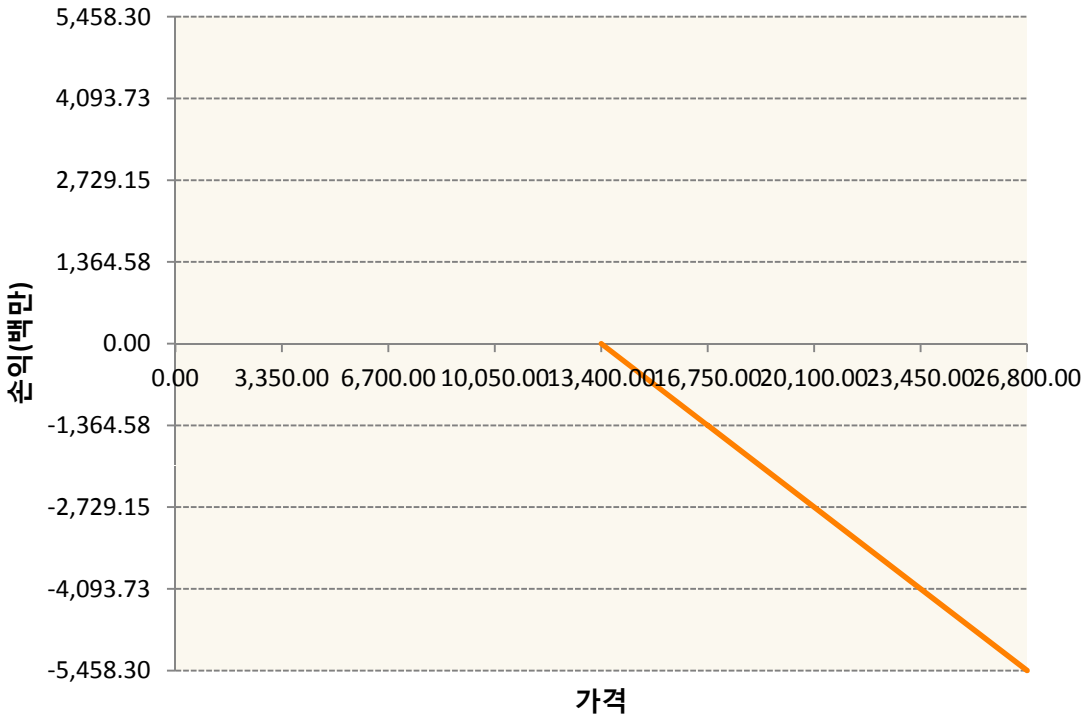
2. 만기시점의 손익구조



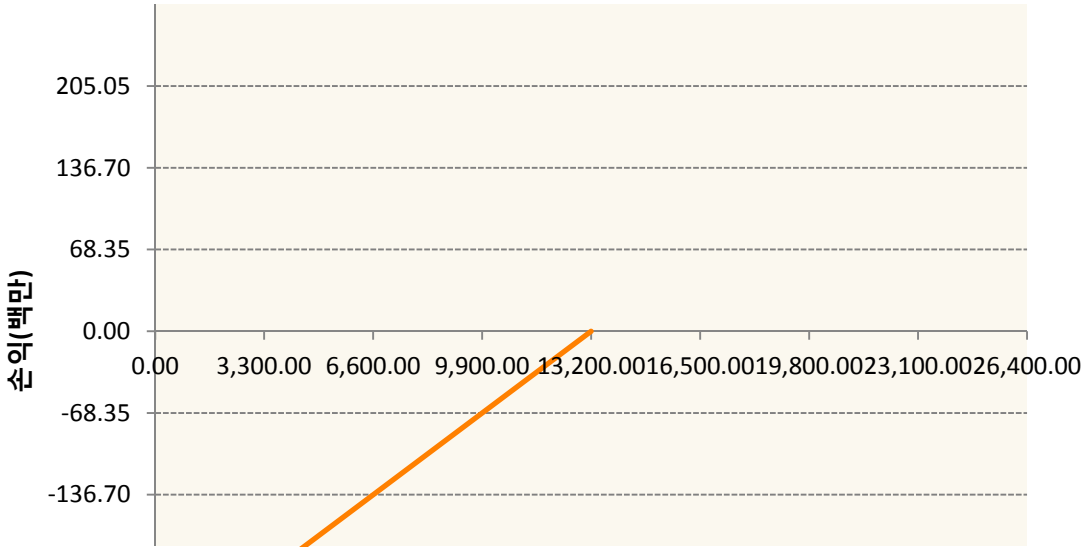


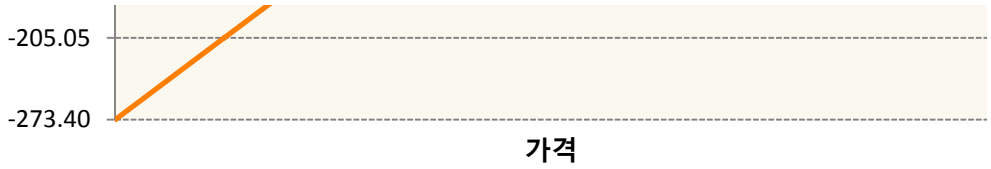


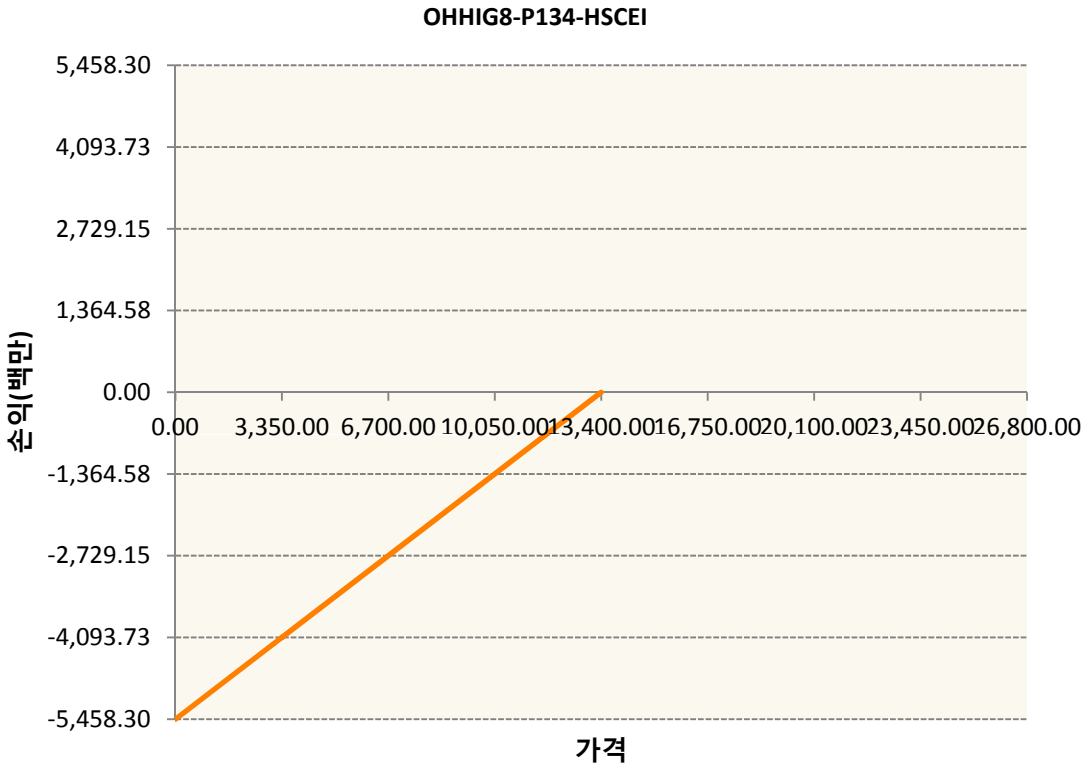
OHHIG8-C134-HSCEI



OHHIG8-P132-HSCEI







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)	(단위:백만원)
HCG8 HSCEI FUTURES FEB18	401
OHHIG8-C1: HSCEI	22
OHHIG8-C1: HSCEI	437
OHHIG8-P1: HSCEI	22
OHHIG8-P1: HSCEI	437

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,069

공시일	2018-02-05
기준일	2018-02-02

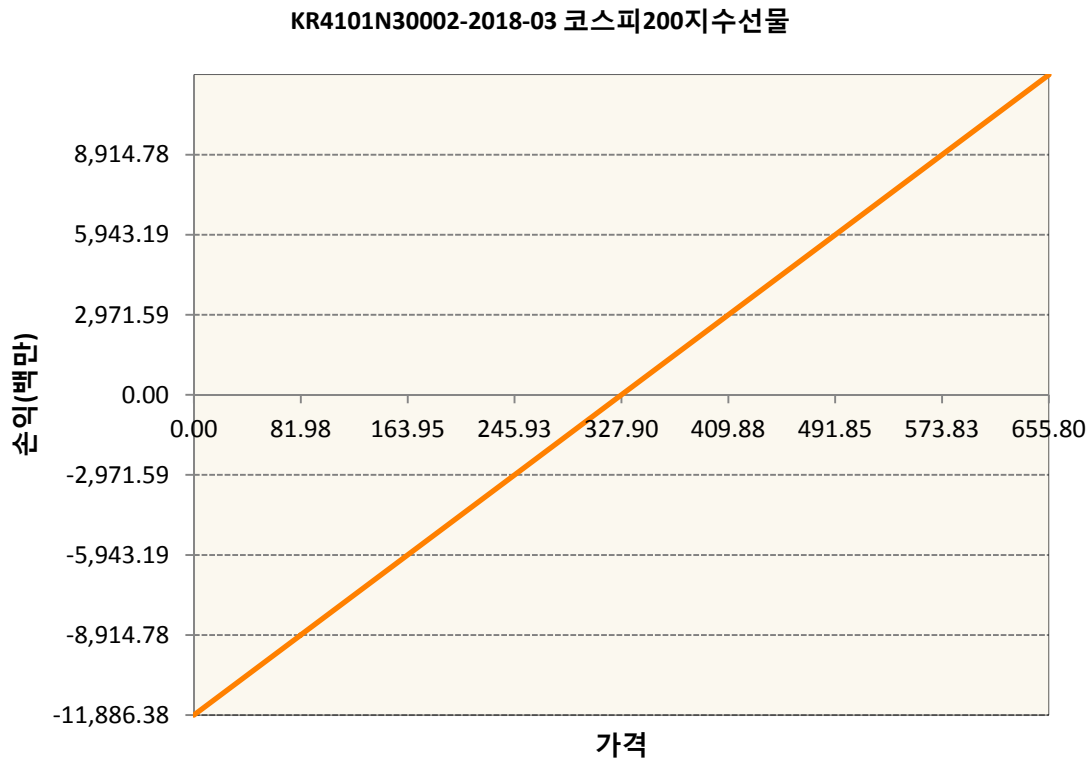
코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼

1. 계약금액

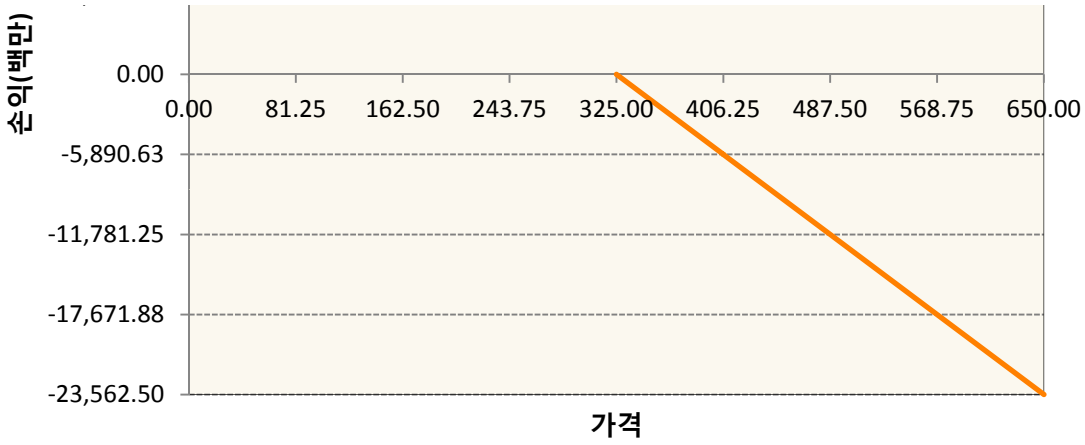
(단위:백만원)

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	11,886	0	11,886	장내
누계	유가증권	스왑	60,200	0	60,200	장외
누계	유가증권	옵션	0	60,250	-60,250	장내

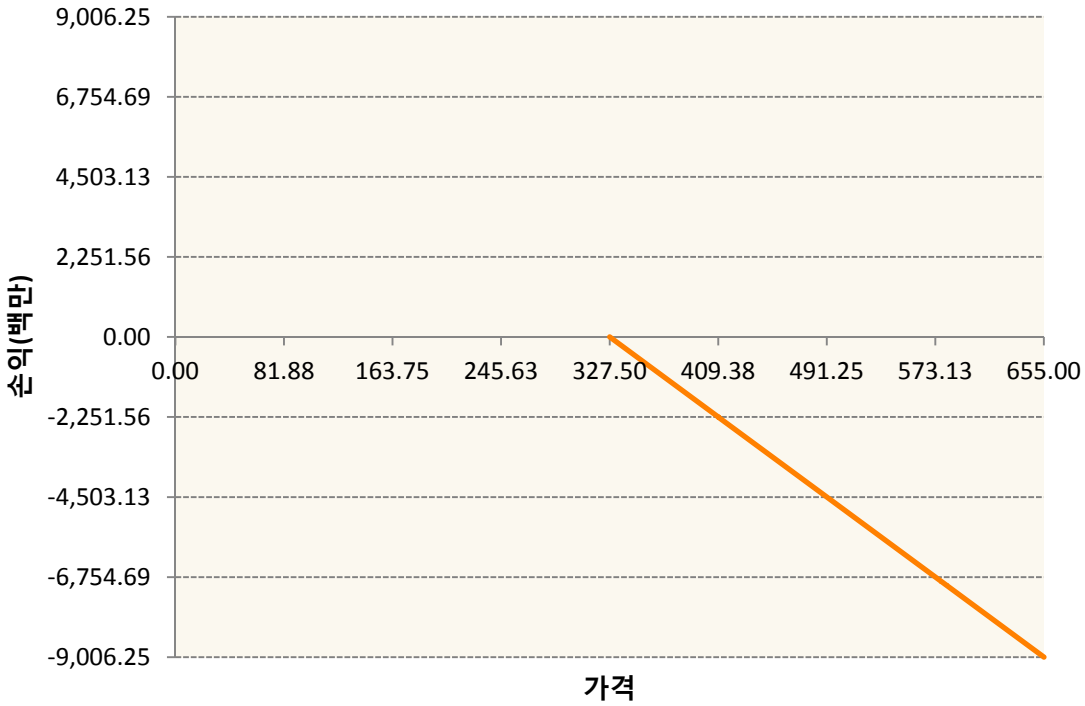
2. 만기시점의 손익구조



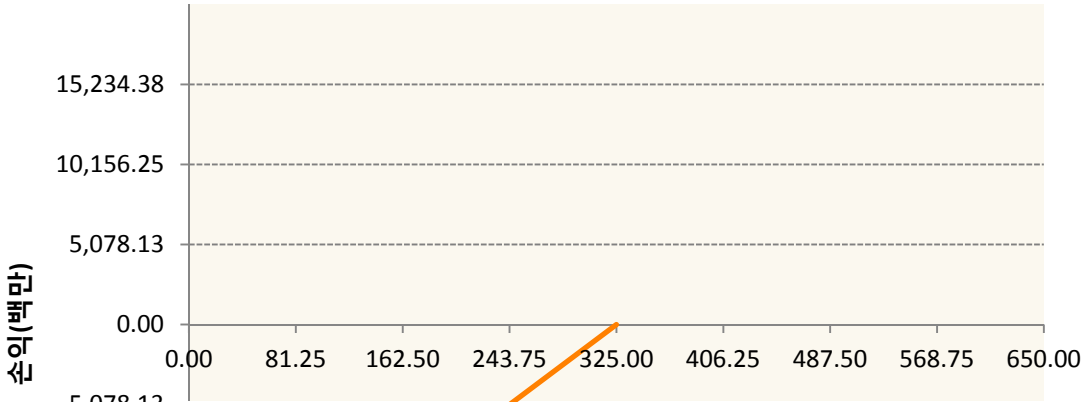




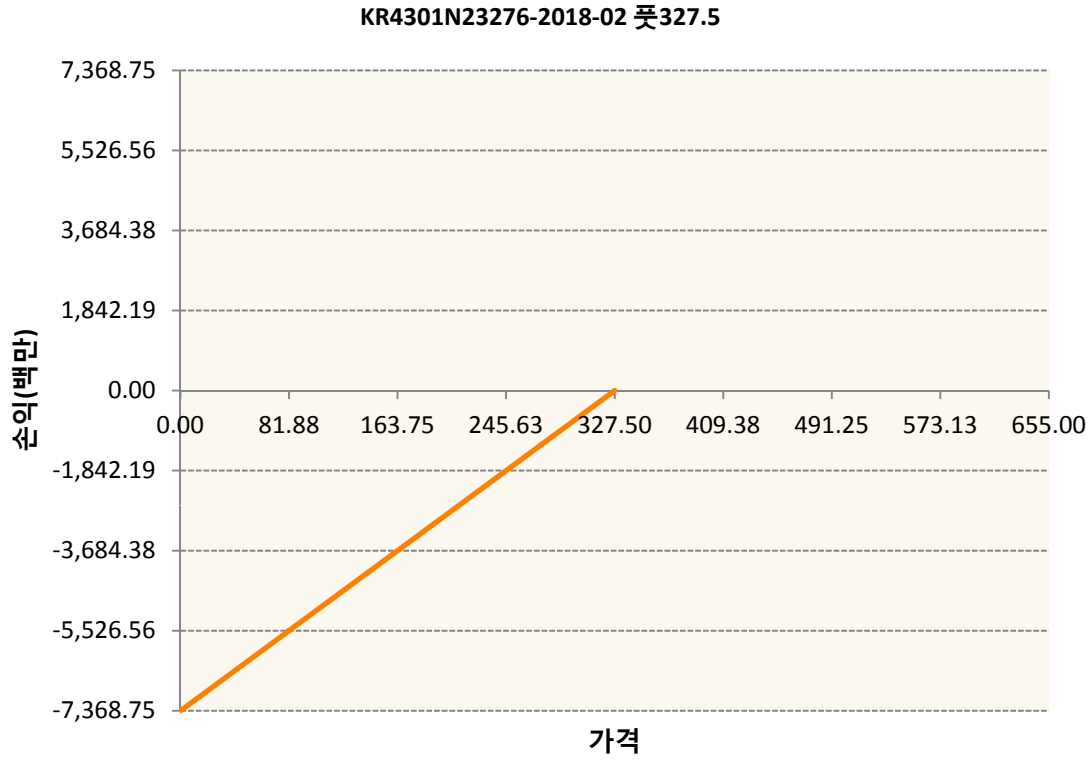
KR4201N23278-2018-02 콜327.5



KR4301N23250-2018-02 풋325







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_2							1,455
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,455	-1,455	-1,455	-1,455	-1,455	-1,455	-1,455
-5.33%	-970	-970	-970	-970	-970	-970	-970
-2.67%	-485	-485	-485	-485	-485	-485	-485
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	485	485	485	485	485	485	485
5.33%	970	970	970	970	970	970	970
8.00%	1,455	1,455	1,455	1,455	1,455	1,455	1,455
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						197
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-197	-197	-197	-197	-197	-197	-197
-5.33%	-131	-131	-131	-131	-131	-131	-131
-2.67%	-66	-66	-66	-66	-66	-66	-66
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	66	66	66	66	66	66	66
5.33%	131	131	131	131	131	131	131
8.00%	197	197	197	197	197	197	197
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_7						252
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-252	-252	-252	-252	-252	-252	-252
-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%	252	252	252	252	252	252	252
	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						629
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-629	-629	-629	-629	-629	-629	-629
-5.33%	-419	-419	-419	-419	-419	-419	-419
-2.67%	-210	-210	-210	-210	-210	-210	-210
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	210	210	210	210	210	210	210
5.33%	419	419	419	419	419	419	419
8.00%	629	629	629	629	629	629	629
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_12						472

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-472	-472	-472	-472	-472	-472	-472
-5.33%	-315	-315	-315	-315	-315	-315	-315
-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%	315	315	315	315	315	315	315
8.00%	472	472	472	472	472	472	472
	KR4101N30(	2018-03	코스피200지수선물				948

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-948	-948	-948	-948	-948	-948	-948
-5.33%	-632	-632	-632	-632	-632	-632	-632
-2.67%	-316	-316	-316	-316	-316	-316	-316
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	316	316	316	316	316	316	316
5.33%	632	632	632	632	632	632	632
8.00%	948	948	948	948	948	948	948
	KR4201N23(	2018-02	콜325				1,671

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	380	379	379	378	376	374	371
-5.33%	375	372	366	359	351	341	330
-2.67%	321	303	284	265	245	224	202
0%	73	49	24	0	-25	-49	-74
2.67%	-423	-434	-447	-461	-476	-493	-511
5.33%	-1,034	-1,035	-1,038	-1,042	-1,048	-1,055	-1,063
8.00%	-1,664	-1,664	-1,665	-1,665	-1,667	-1,668	-1,671
	KR4201N23(	2018-02	콜327.5				603

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	108	108	108	108	107	107	106
-5.33%	107	107	105	104	101	99	96
-2.67%	96	91	85	79	73	66	59
0%	29	19	10	0	-10	-19	-29
2.67%	-136	-142	-148	-155	-162	-170	-178
5.33%	-360	-361	-363	-366	-369	-372	-377
8.00%	-599	-599	-599	-599	-600	-601	-603
	KR4301N23(	2018-02	풋325				1,413

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,413	-1,413	-1,413	-1,413	-1,413	-1,413	-1,413
-5.33%	-868	-868	-869	-869	-869	-870	-871

-2.67%	-331	-336	-341	-347	-354	-361	-369
0%	35	23	12	0	-12	-24	-36
2.67%	93	92	91	88	85	82	77
5.33%	94	94	94	94	94	94	93
8.00%	94	94	94	94	94	94	94
	KR4301N232 2018-02 풋327.5						540
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-540	-540	-540	-540	-540	-540	-540
-5.33%	-343	-343	-343	-343	-344	-344	-344
-2.67%	-148	-149	-150	-151	-152	-154	-156
0%	13	9	4	0	-4	-9	-13
2.67%	58	57	55	54	52	50	47
5.33%	59	59	59	59	59	59	58
8.00%	59	59	59	59	59	59	59

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

10,473

공시일	2018-02-05
기준일	2018-02-02

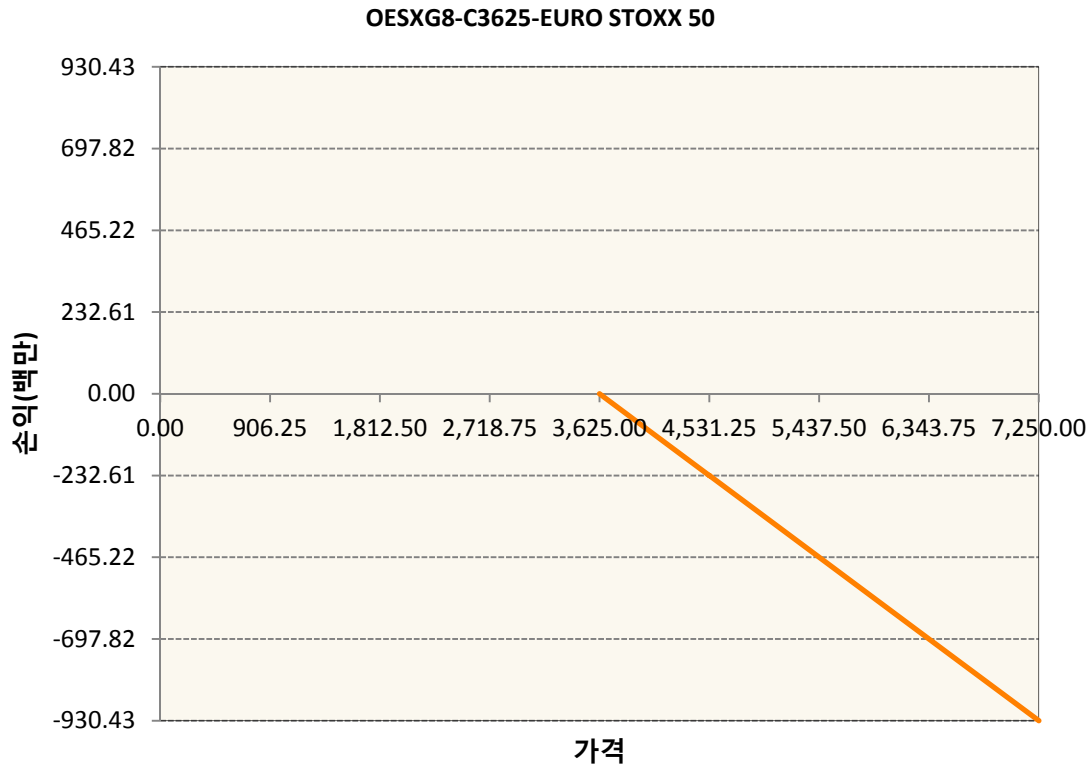
유로커버드콜모(주식혼합-파생형

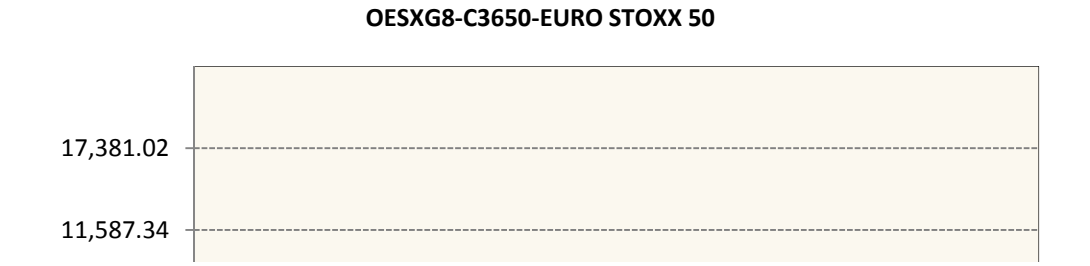
1. 계약금액

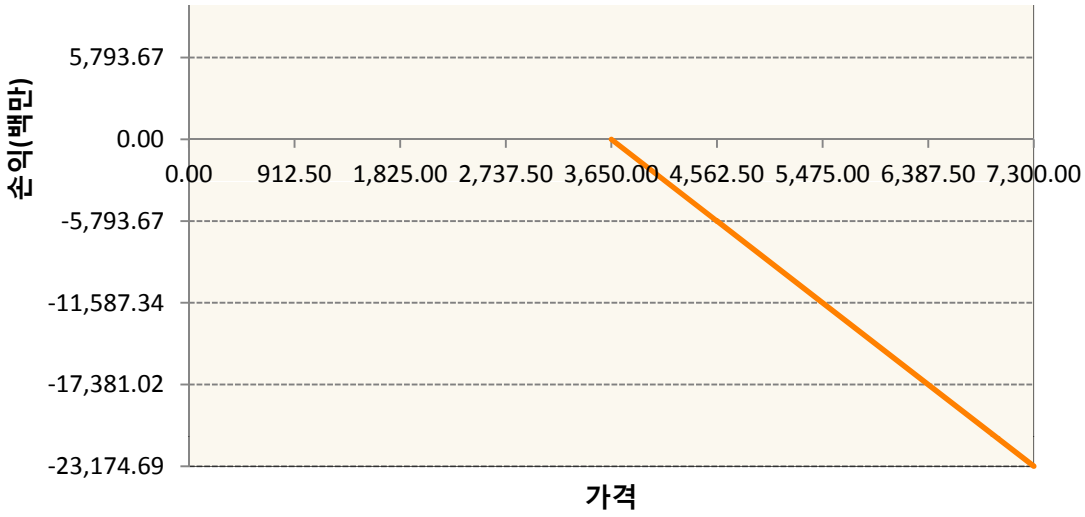
(단위:백만원)

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	14,257	0	14,257	
누계	유가증권	스왑	101,315	0	101,315	장외
누계	유가증권	옵션	0	48,210	-48,210	장내
누계	지수	스왑	54,035	0	54,035	장외

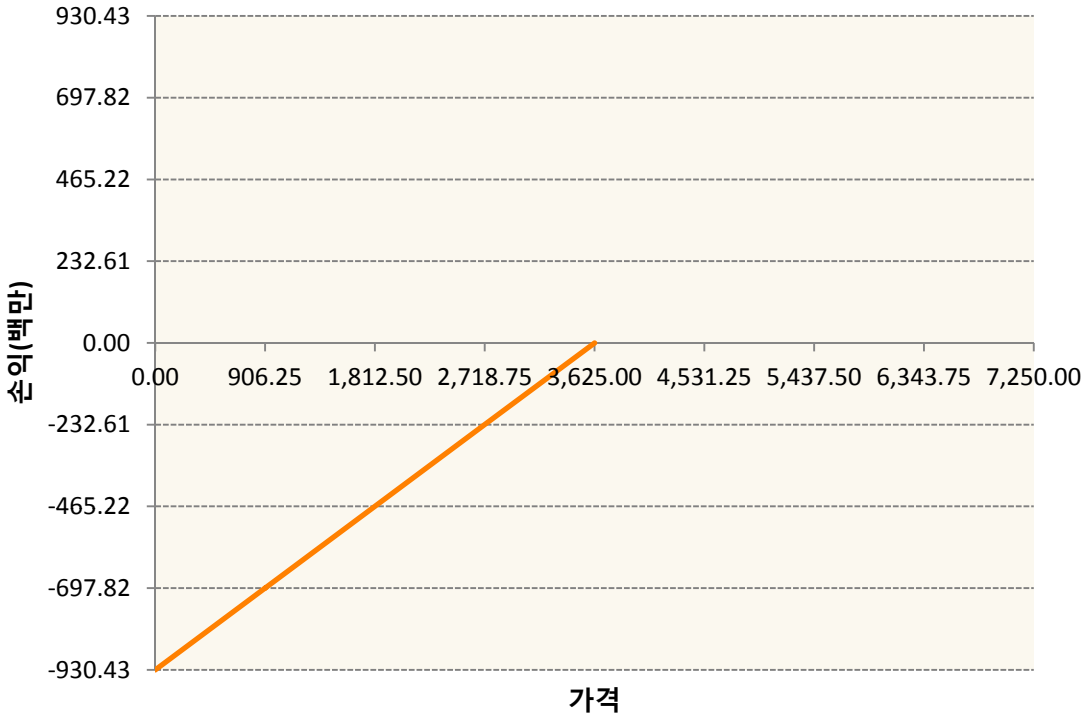
2. 만기시점의 손익구조



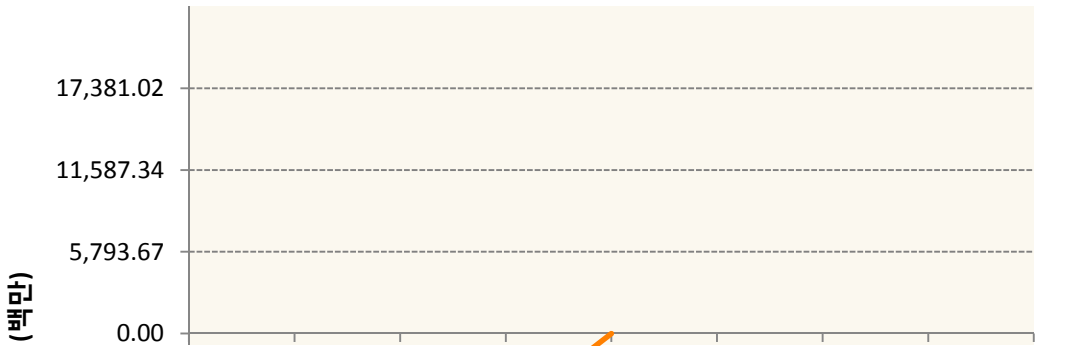


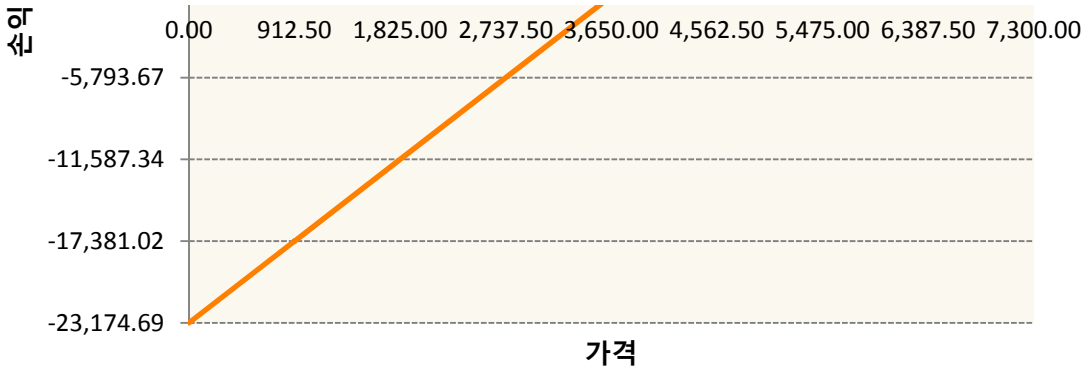


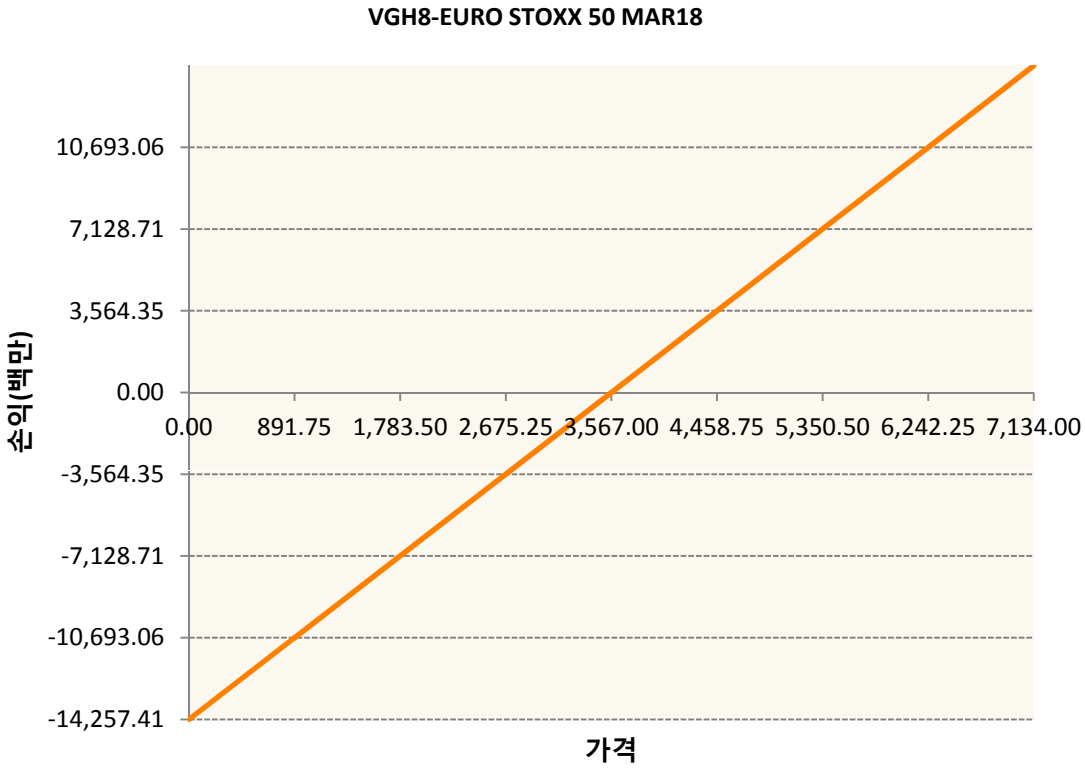
OESXG8-P3625-EURO STOXX 50



OESXG8-P3650-EURO STOXX 50







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)	(단위:백만원)
260105SGPX SG EURO Covered CALL STRATEGY - 994.569	51
260105SQPX SG EURO Covered CALL STRATEGY	96
OESXG8-C3(EURO STOXX 50	74
OESXG8-C3(EURO STOXX 50	1,854
OESXG8-P3(EURO STOXX 50	74
OESXG8-P3(EURO STOXX 50	1,854
VGH8 EURO STOXX 50 MAR18	1,141

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

2,838

공시일	2018-02-05
기준일	2018-02-02

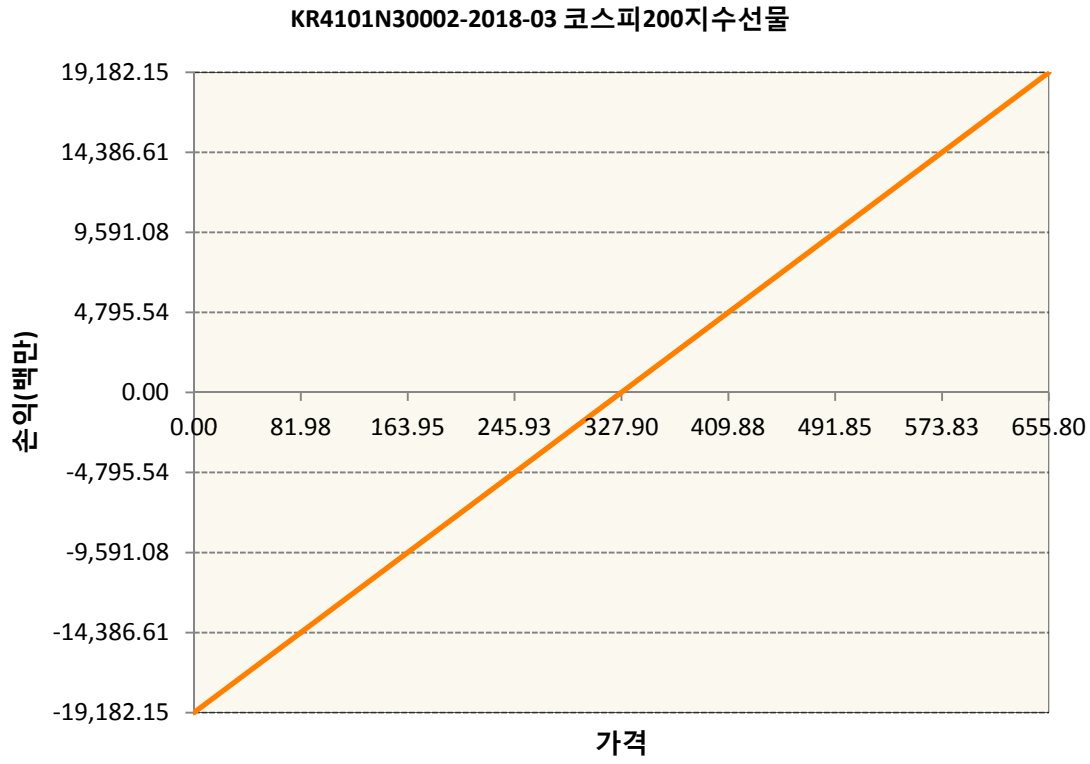
ETF스마트레버리지목표전환형8호

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	19,182	0	19,182	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101N30(2018-03 코스피200지수선물							1,530
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,530	-1,530	-1,530	-1,530	-1,530	-1,530	-1,530
-5.33%	-1,020	-1,020	-1,020	-1,020	-1,020	-1,020	-1,020
-2.67%	-510	-510	-510	-510	-510	-510	-510
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	510	510	510	510	510	510	510
5.33%	1,020	1,020	1,020	1,020	1,020	1,020	1,020
8.00%	1,530	1,530	1,530	1,530	1,530	1,530	1,530

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

944

공시일	2018-02-05
기준일	2018-02-02

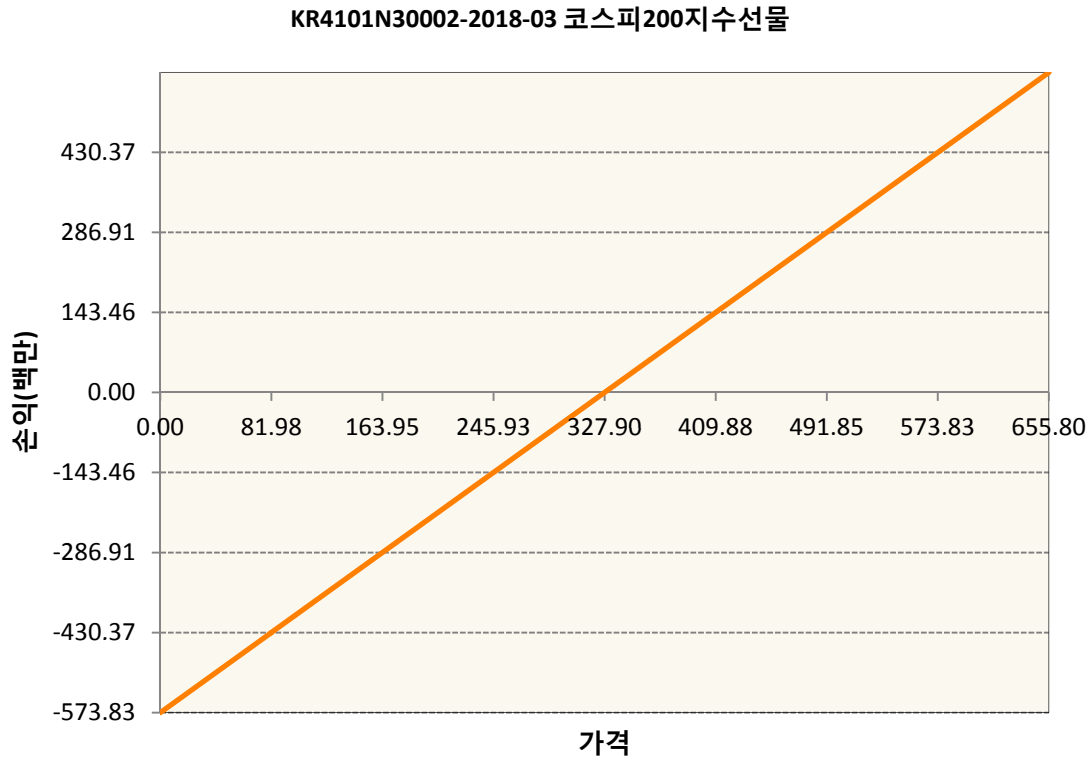
ETF스마트레버리지목표전환형9호

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	574	0	574	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	2018-02-05
기준일	2018-02-02

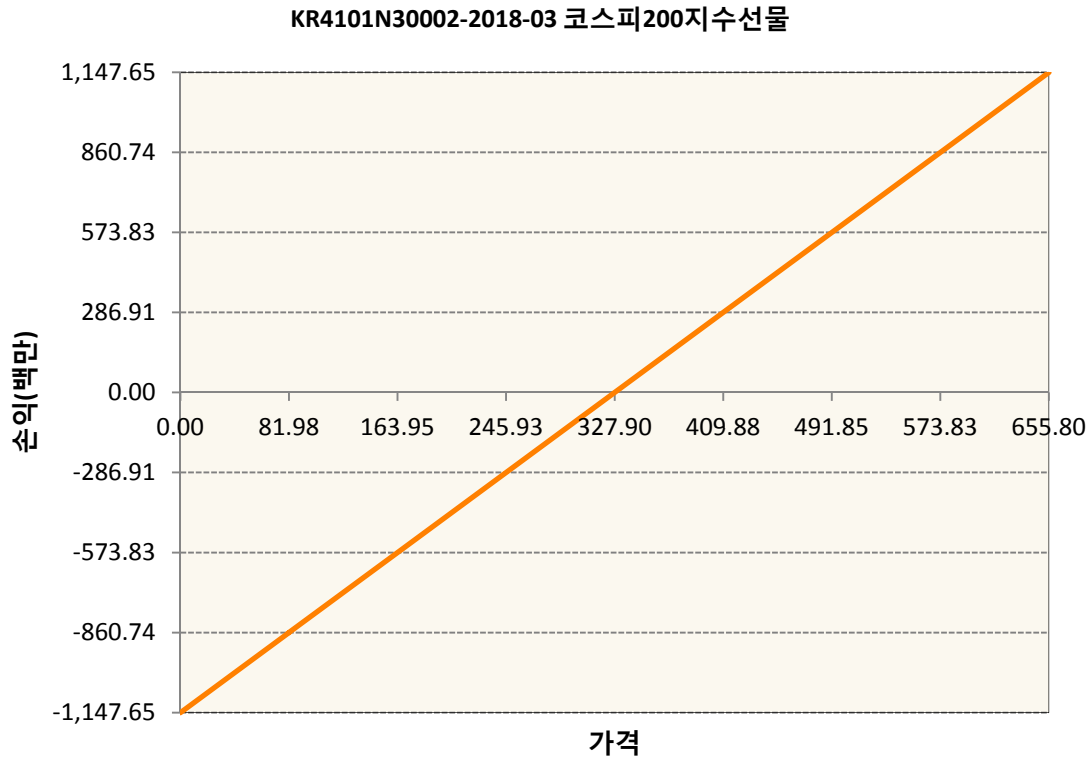
ETF스마트레버리지목표전환형10

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	1,148	0	1,148	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101N30(2018-03 코스피200지수선물							92
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-92	-92	-92	-92	-92	-92	-92
-5.33%	-61	-61	-61	-61	-61	-61	-61
-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%	61	61	61	61	61	61	61
8.00%	92	92	92	92	92	92	92

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

56

공시일	2018-02-05
기준일	2018-02-02

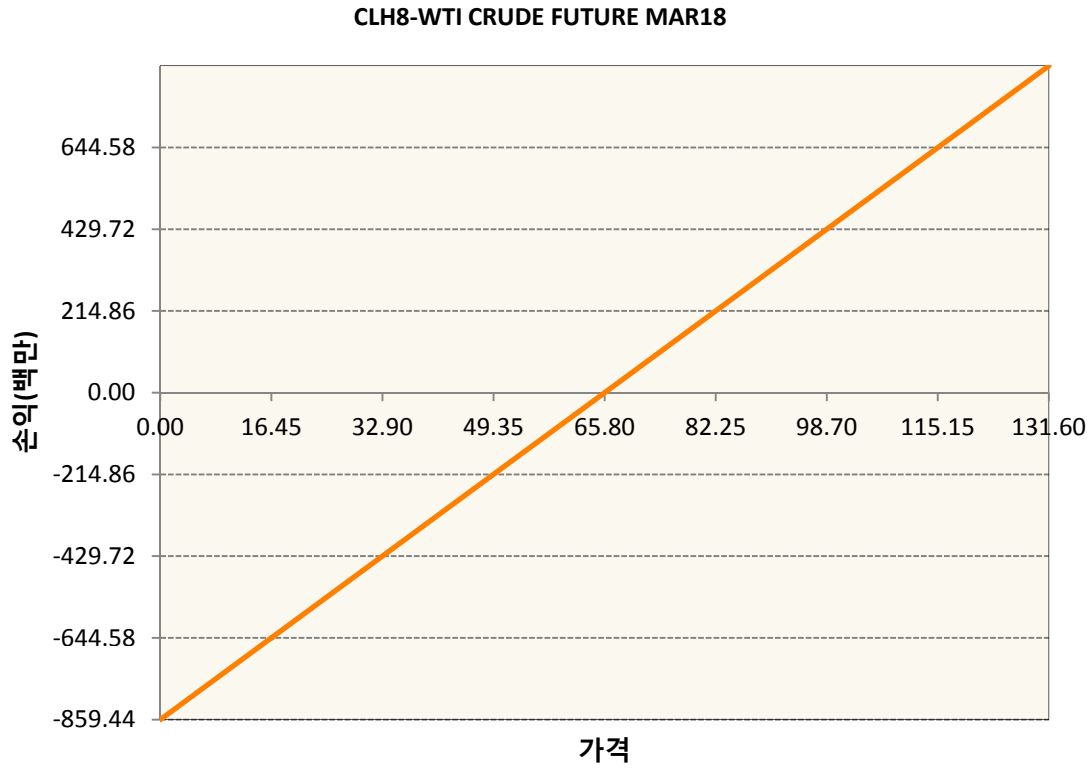
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

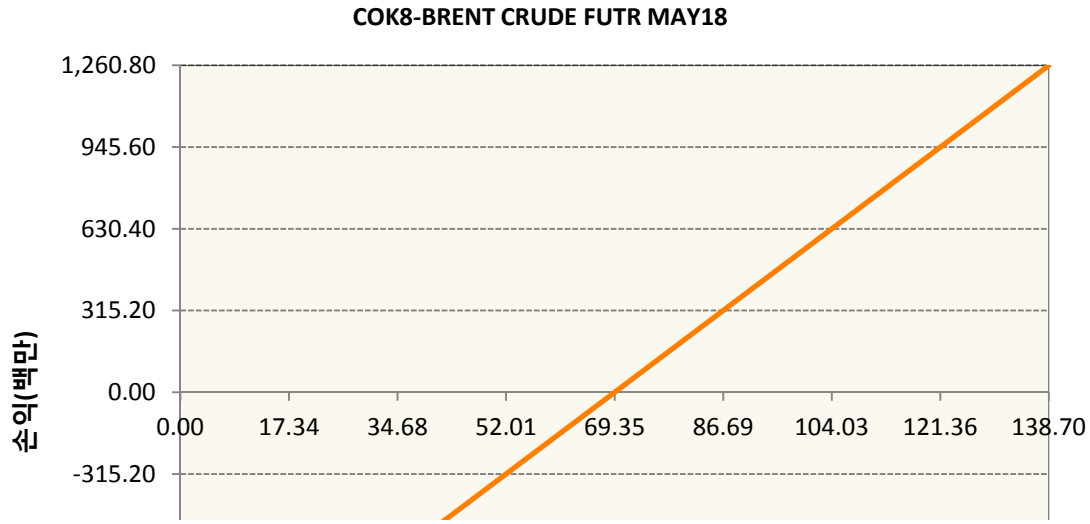
1. 계약금액

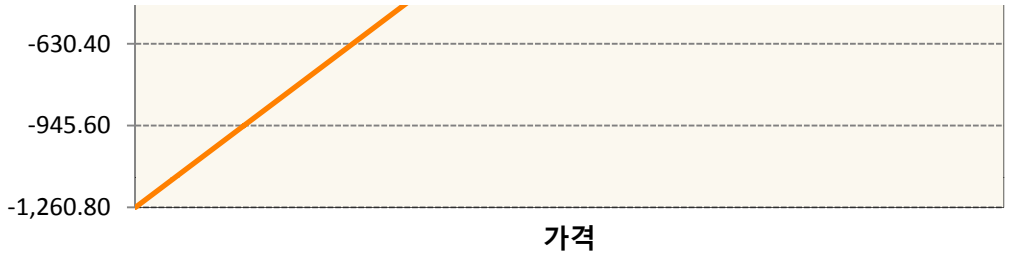
(단위:백만원)

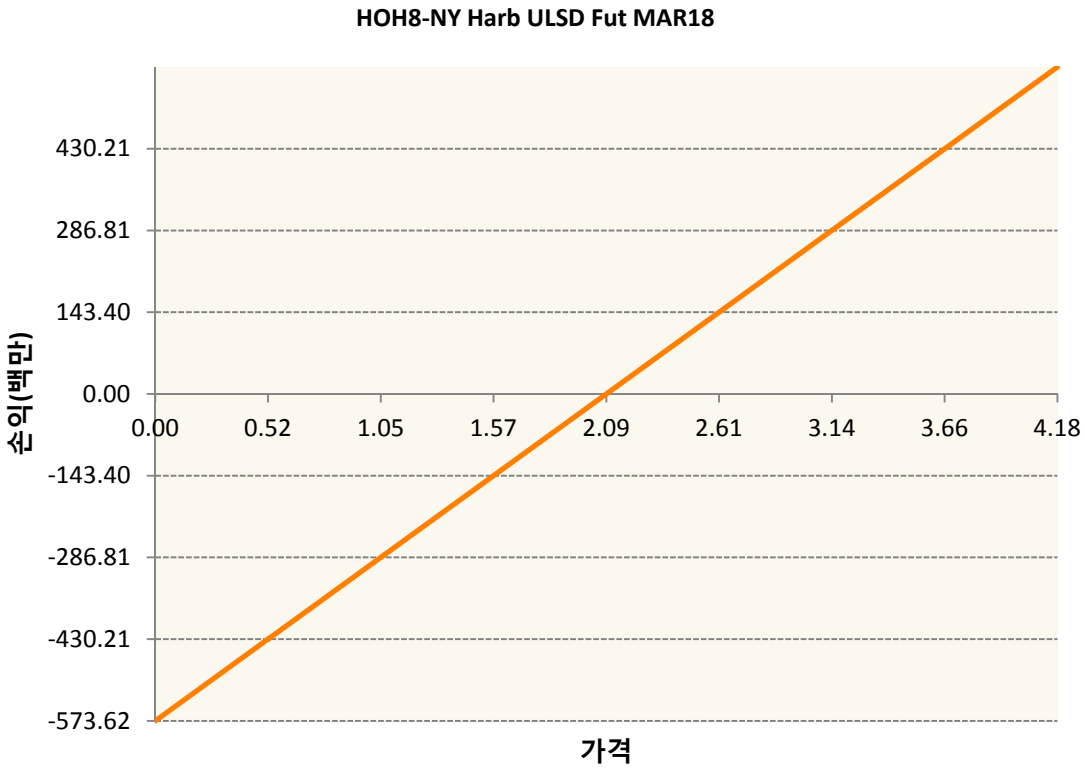
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	4,479	864	3,615	

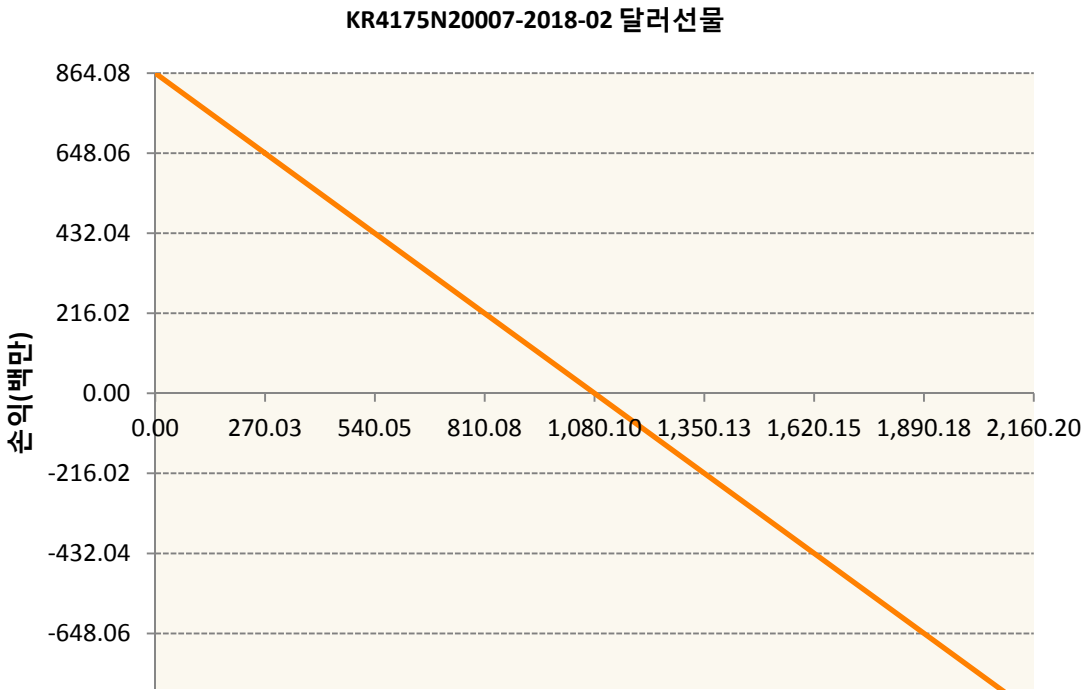
2. 만기시점의 손익구조

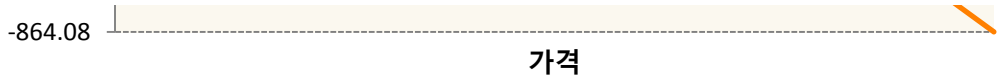


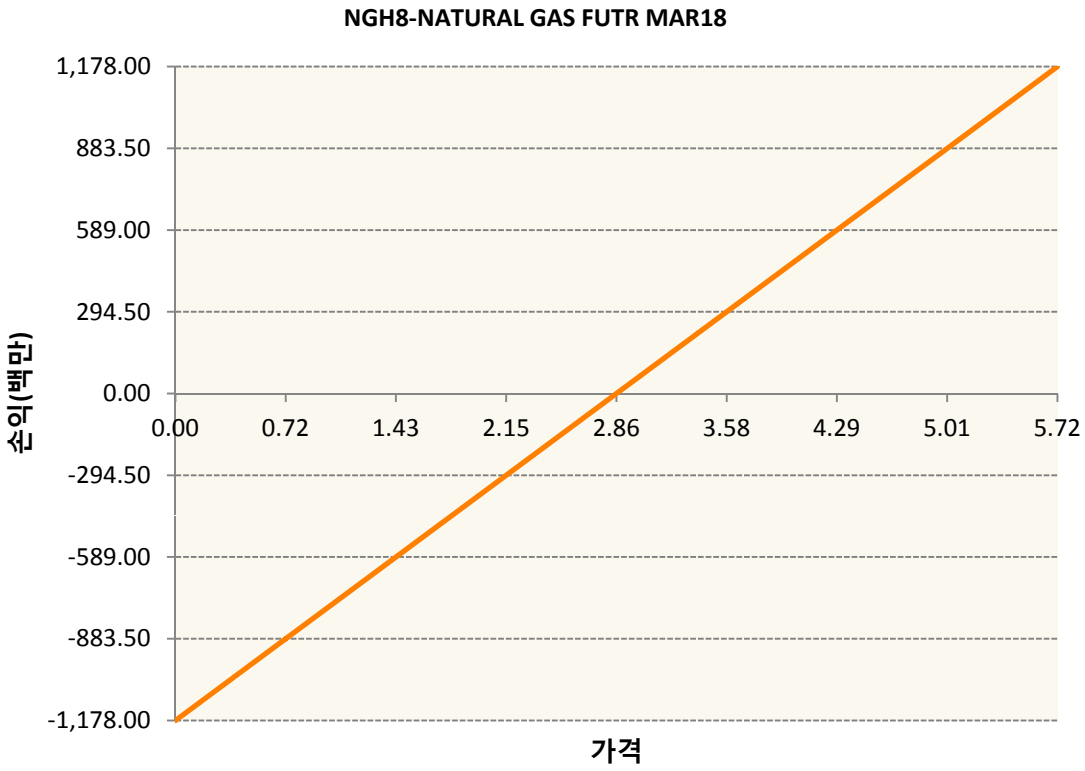


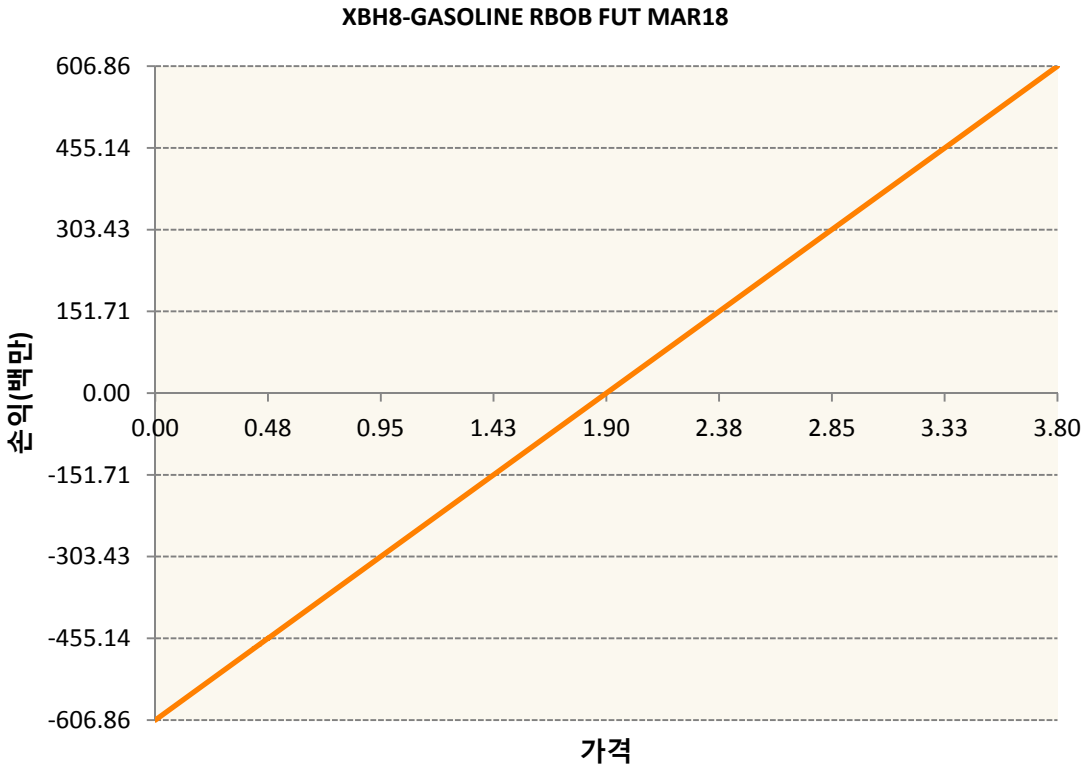

-630.40
-945.60
-1,260.80
가격


HOH8-NY Harb ULSD Fut MAR18
430.21
286.81
143.40
0.00
-143.40
-286.81
-430.21
-573.62
0.00
0.52
1.05
1.57
2.09
2.61
3.14
3.66
4.18
손익(백만)
가격


KR4175N20007-2018-02 달러선물
864.08
648.06
432.04
216.02
0.00
-216.02
-432.04
-648.06
0.00
270.03
540.05
810.08
1,080.10
1,350.13
1,620.15
1,890.18
2,160.20
손익(백만)


-864.08
가격


NGH8-NATURAL GAS FUTR MAR18
1,178.00
883.50
589.00
294.50
0.00
-294.50
-589.00
-883.50
-1,178.00
0.00
0.72
1.43
2.15
2.86
3.58
4.29
5.01
5.72
손익(백만)
가격


XBH8-GASOLINE RBOB FUT MAR18
606.86
455.14
303.43
151.71
0.00
-151.71
-303.43
-455.14
-606.86
0.00
0.48
0.95
1.43
1.90
2.38
2.85
3.33
3.80
손익(백만)
가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLH8	WTI CRUDE FUTURE MAR18	69
COK8	BRENT CRUDE FUTR MAY18	101
HOH8	NY Harb ULSD Fut MAR18	46
KR4175N20(	2018-02 달러선물	69
NGH8	NATURAL GAS FUTR MAR18	94
XBH8	GASOLINE RBOB FUT MAR18	49

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

608

공시일	2018-02-05
기준일	2018-02-02

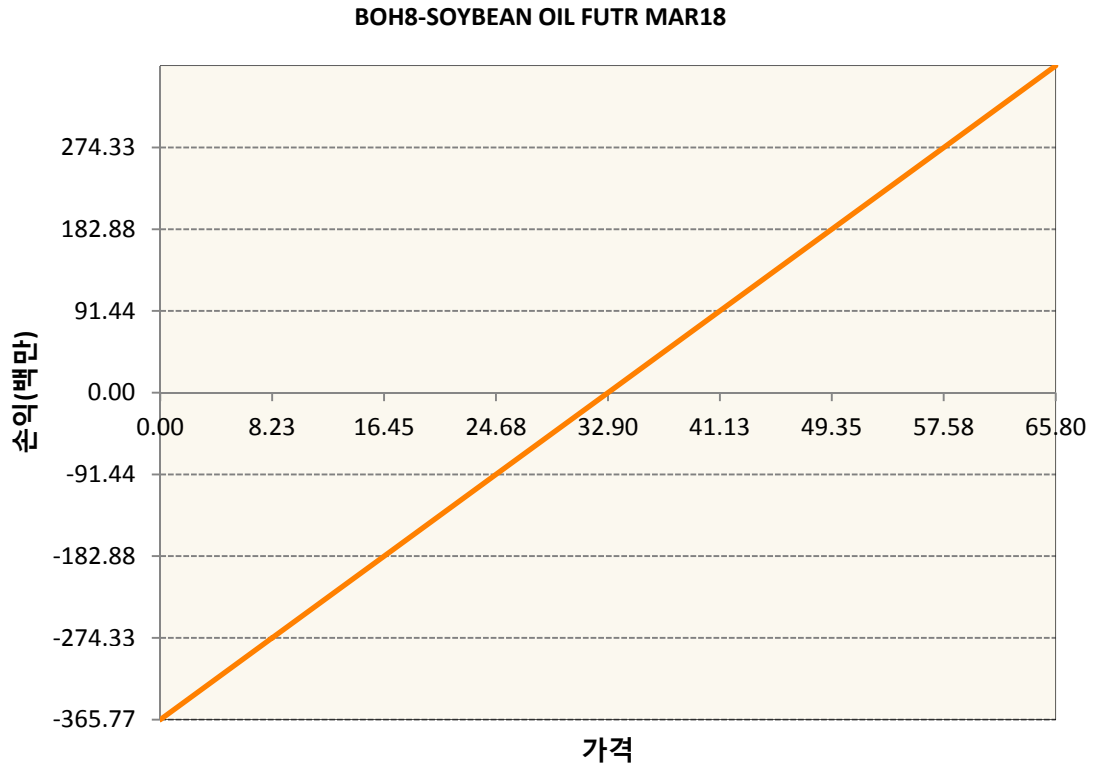
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

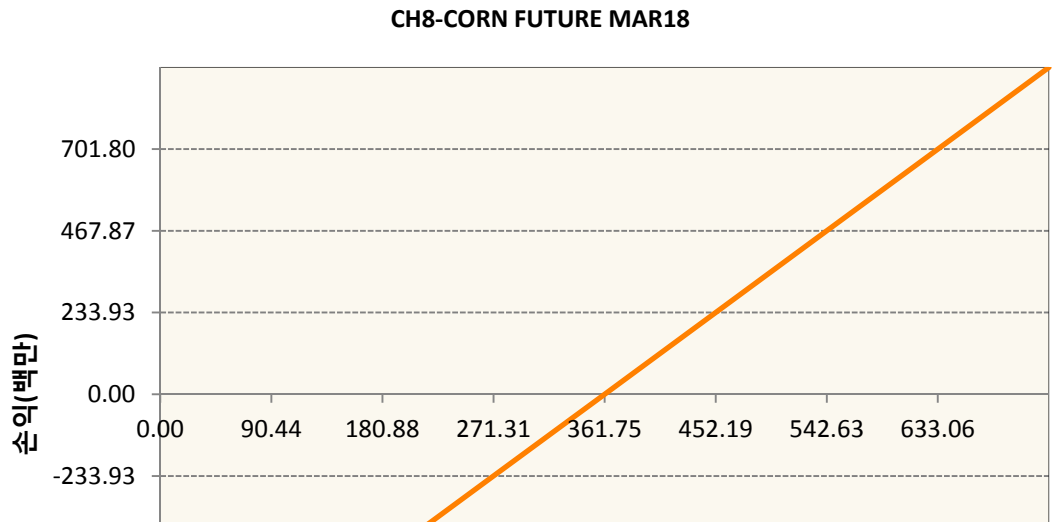
1. 계약금액

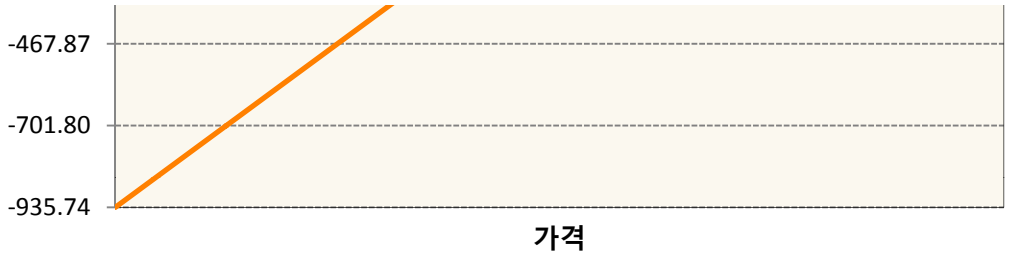
(단위:백만원)

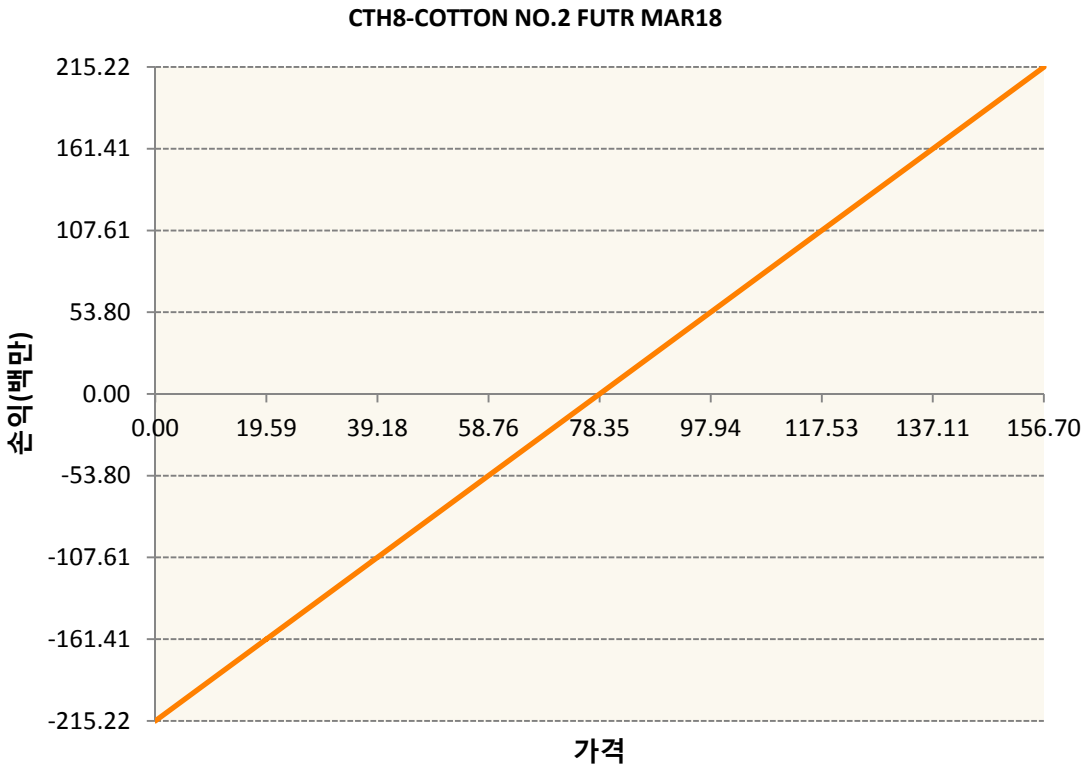
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	4,139	324	3,815	

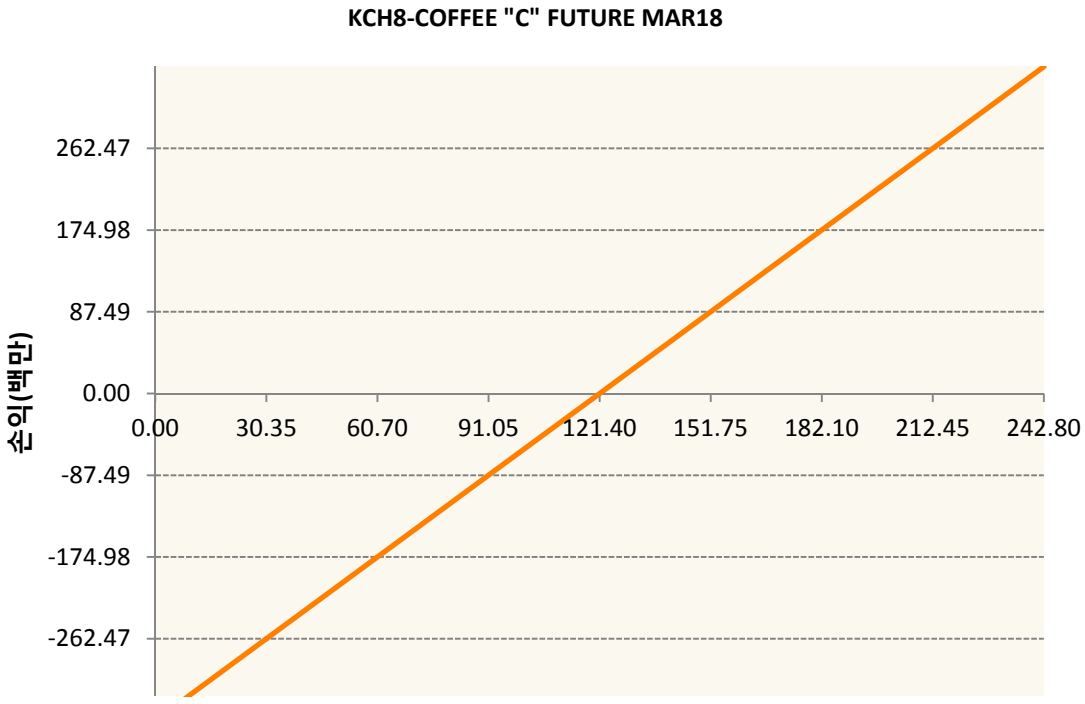
2. 만기시점의 손익구조

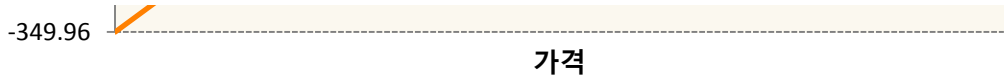


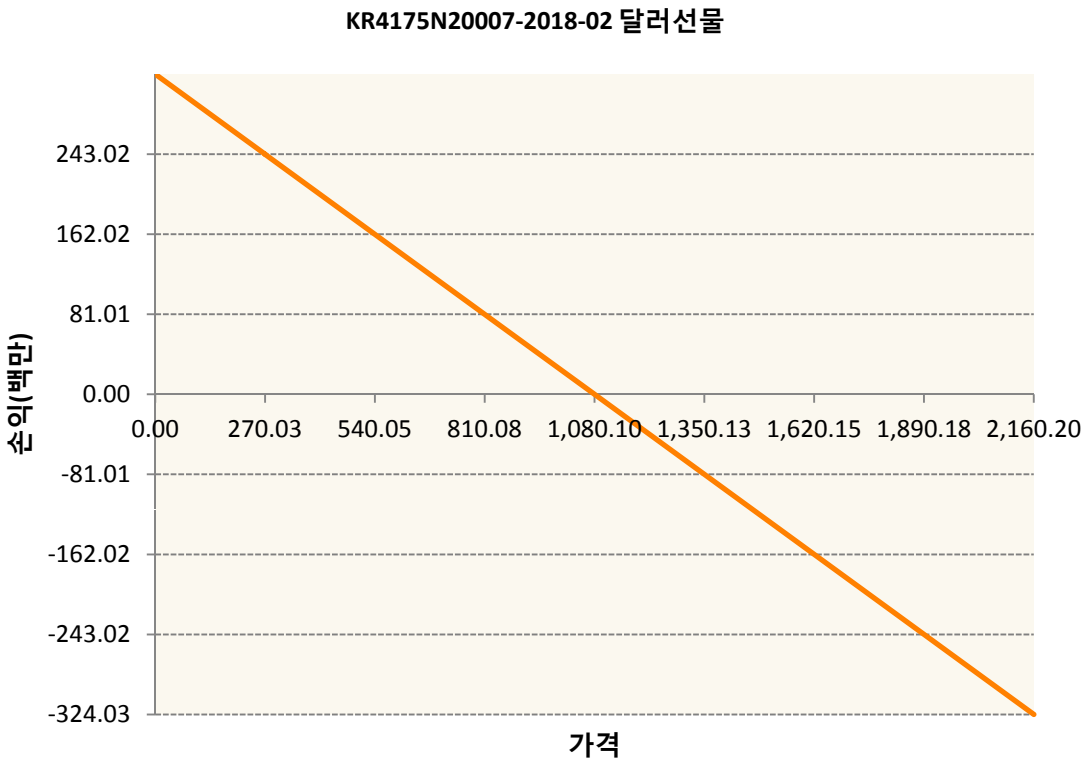


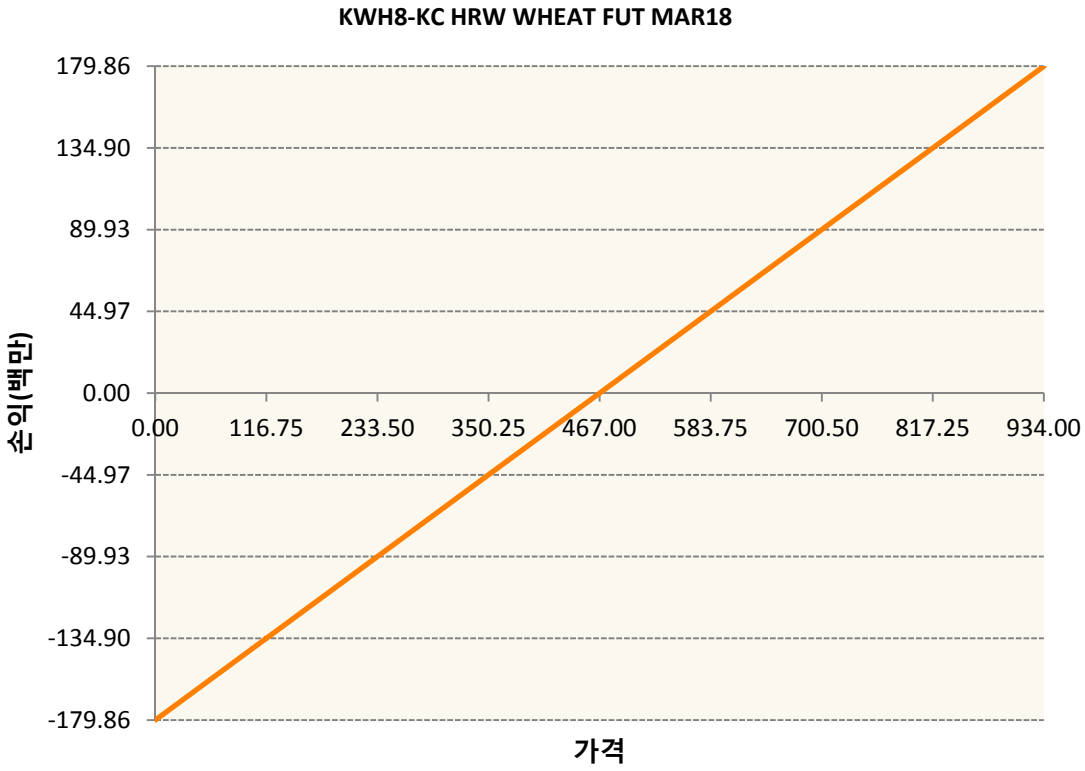

-467.87
-701.80
-935.74
가격

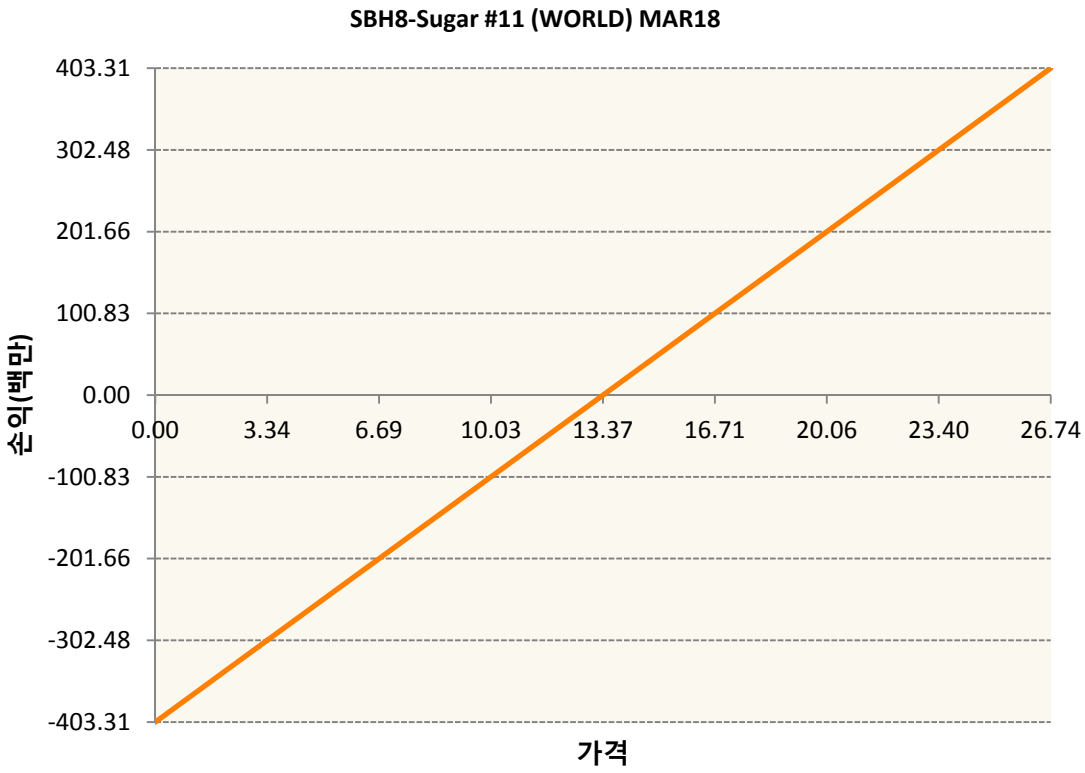

CTH8-COTTON NO.2 FUTR MAR18
215.22
161.41
107.61
53.80
0.00
-53.80
-107.61
-161.41
-215.22
0.00
19.59
39.18
58.76
78.35
97.94
117.53
137.11
156.70
손익(백만)
가격

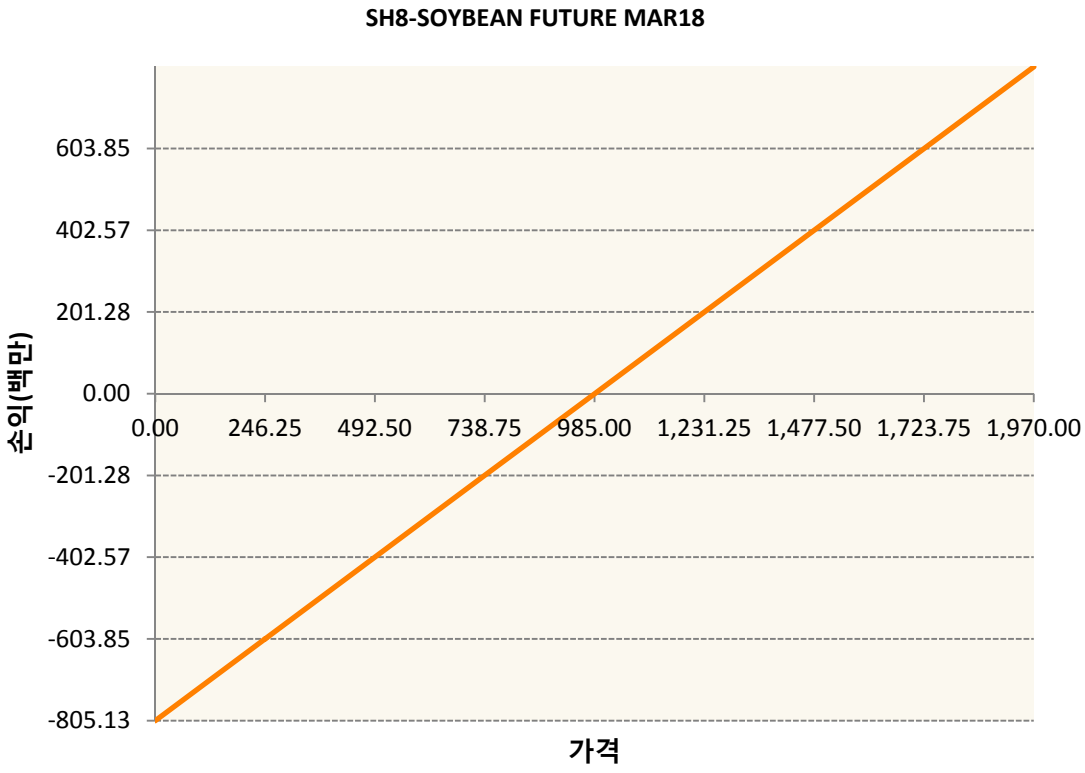

KCH8-COFFEE "C" FUTURE MAR18
262.47
174.98
87.49
0.00
-87.49
-174.98
-262.47
0.00
30.35
60.70
91.05
121.40
151.75
182.10
212.45
242.80
손익(백만)


-349.96
가격

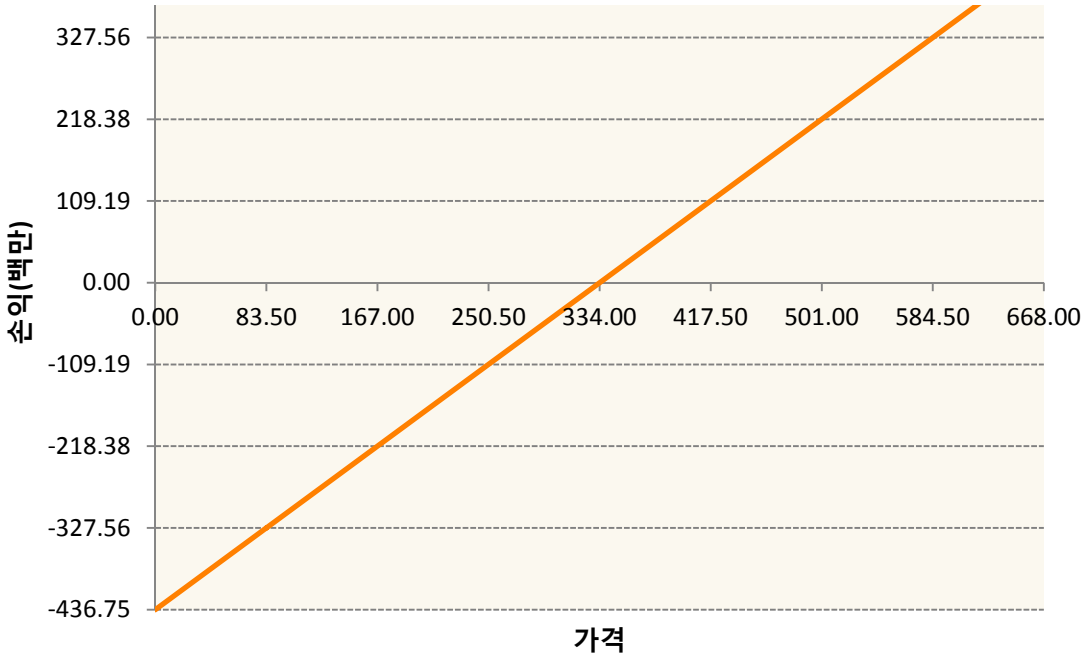

KR4175N20007-2018-02 달러선물
243.02
162.02
81.01
0.00
-81.01
-162.02
-243.02
-324.03
0.00
270.03
540.05
810.08
1,080.10
1,350.13
1,620.15
1,890.18
2,160.20
손익(백만)
가격

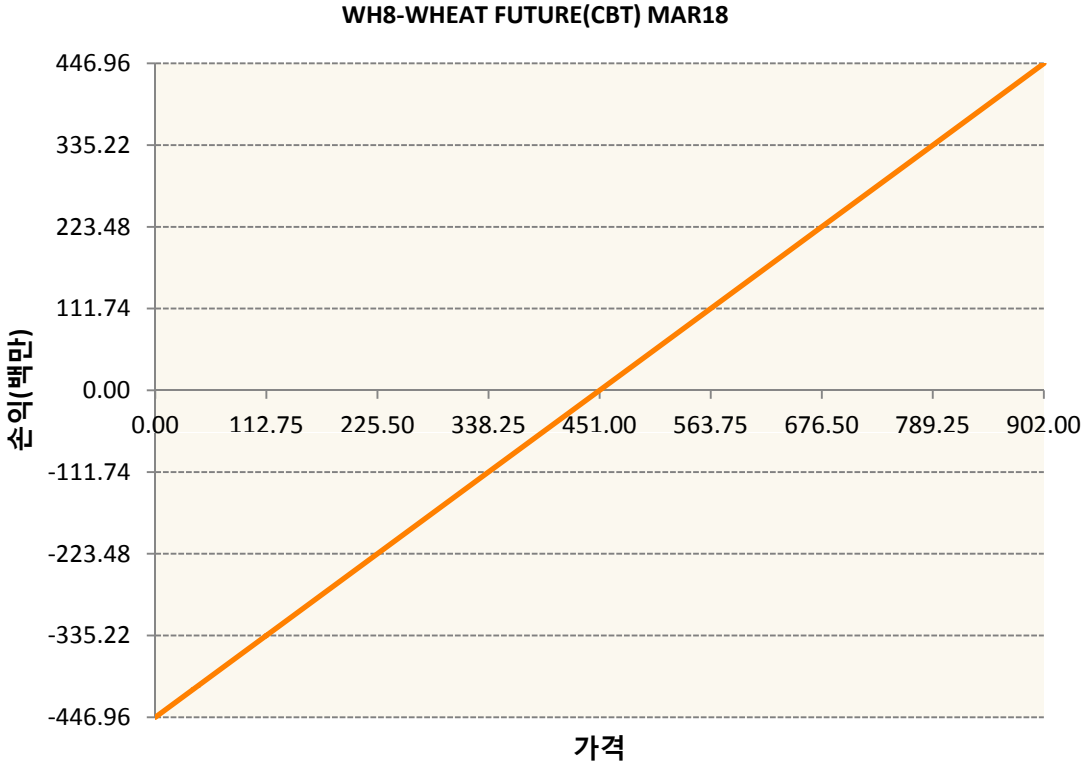

KWH8-KC HRW WHEAT FUT MAR18
179.86
134.90
89.93
44.97
0.00
-44.97
-89.93
-134.90
-179.86
0.00
116.75
233.50
350.25
467.00
583.75
700.50
817.25
934.00
손익(백만)
가격


SBH8-Sugar #11 (WORLD) MAR18
403.31
302.48
201.66
100.83
0.00
-100.83
-201.66
-302.48
-403.31
0.00
3.34
6.69
10.03
13.37
16.71
20.06
23.40
26.74
손익(백만)
가격


SH8-SOYBEAN FUTURE MAR18
603.85
402.57
201.28
0.00
-201.28
-402.57
-603.85
-805.13
0.00
246.25
492.50
738.75
985.00
1,231.25
1,477.50
1,723.75
1,970.00
손익(백만)
가격


SMH8-SOYBEAN MEAL FUTR 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	64
SMH8	SOYBEAN MEAL FUTR MAR18	35
WH8	WHEAT FUTURE(CBT) MAR18	36

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

343