공시일	2018-02-06
기준일	2018-02-05

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	2018-02-06
기준일	2018-02-05

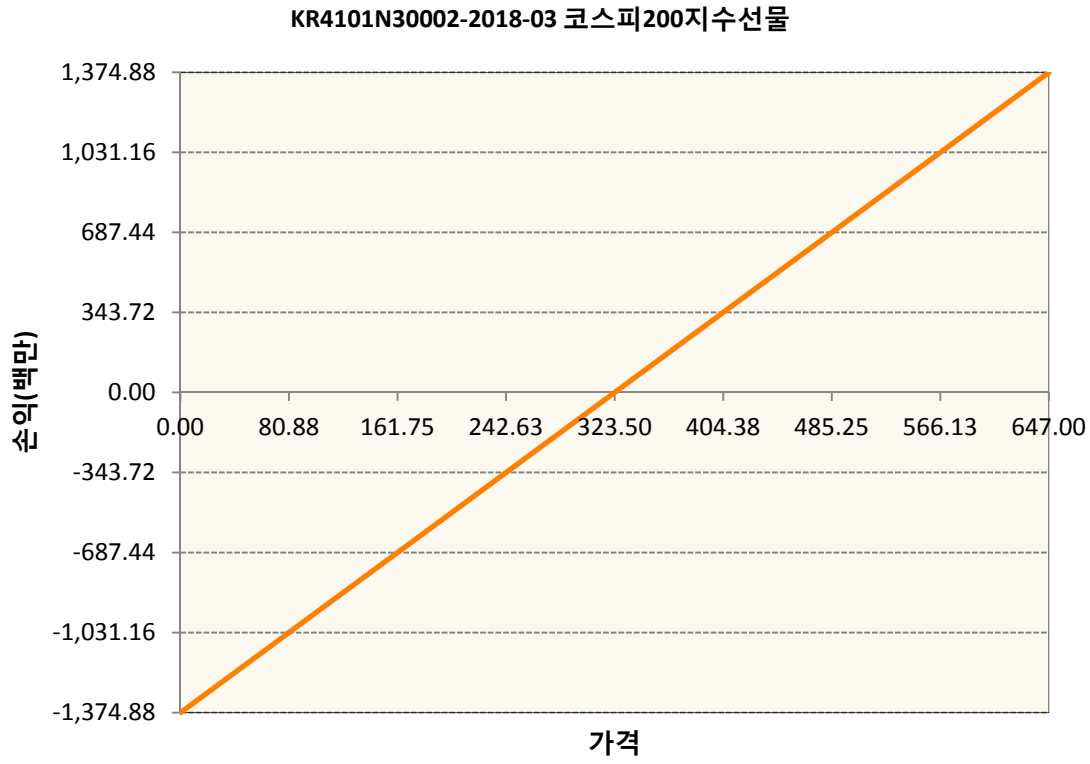
스마트인덱스모

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	1,375	0	1,375	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101N30(2018-03 코스피200지수선물							110
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-110	-110	-110	-110	-110	-110	-110
-5.33%	-73	-73	-73	-73	-73	-73	-73
-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%	73	73	73	73	73	73	73
8.00%	110	110	110	110	110	110	110

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

68

공시일	2018-02-06
기준일	2018-02-05

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	1,137

* 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	2018-02-06
기준일	2018-02-05

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	2018-02-06
기준일	2018-02-05

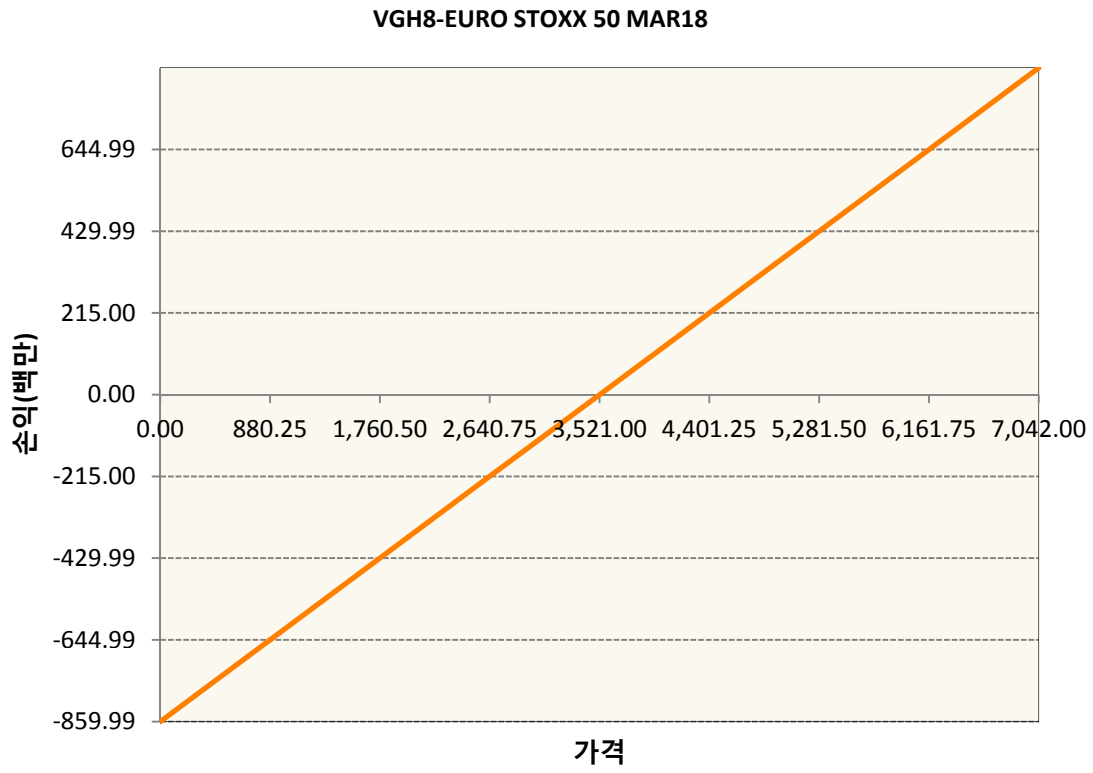
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	860	0	860	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGH8	EURO STOXX 50 MAR18	69

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

(단위:백만원)

38

공시일	2018-02-06
기준일	2018-02-05

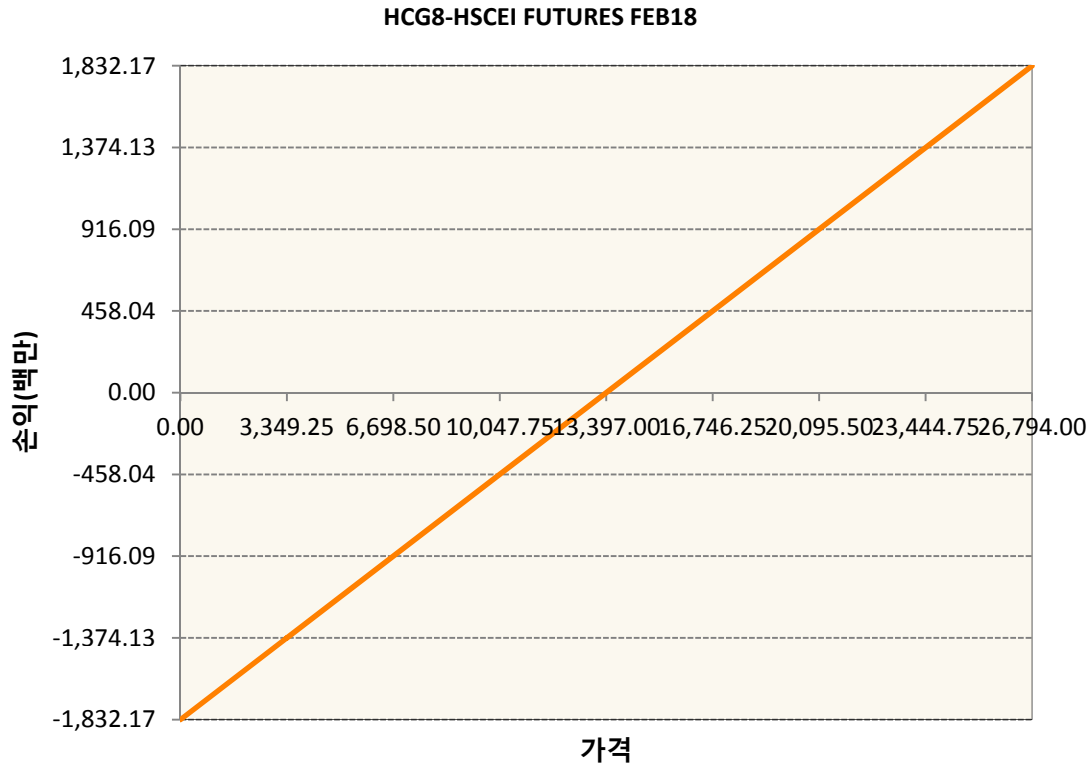
차이나인덱스모(주식-파생형)

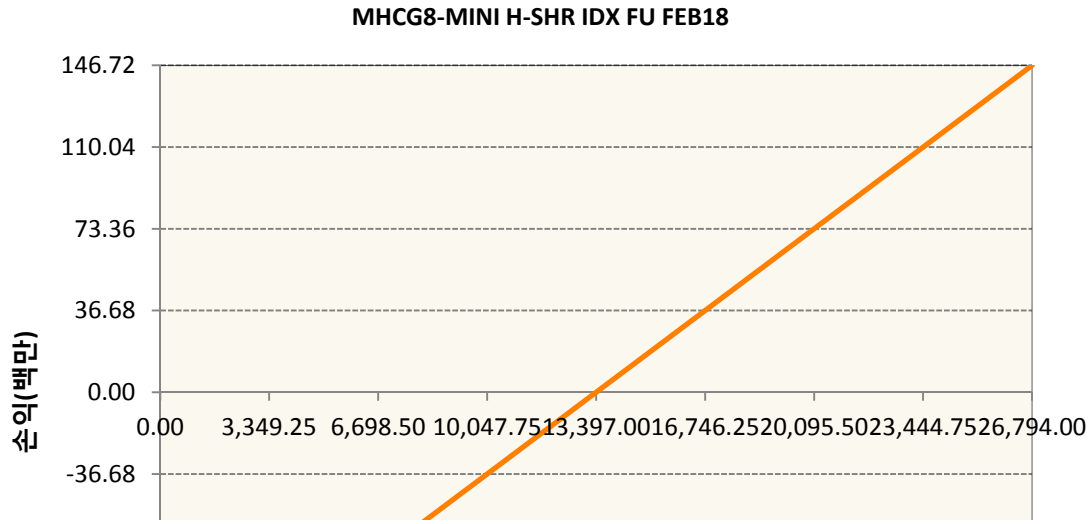
1. 계약금액

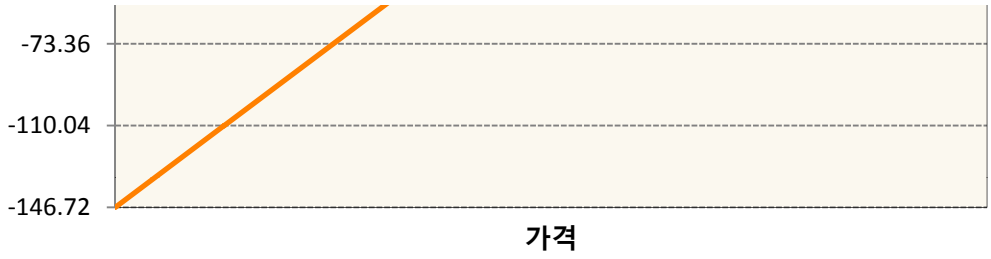
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,979	0	1,979	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)
	128

공시일	2018-02-06
기준일	2018-02-05

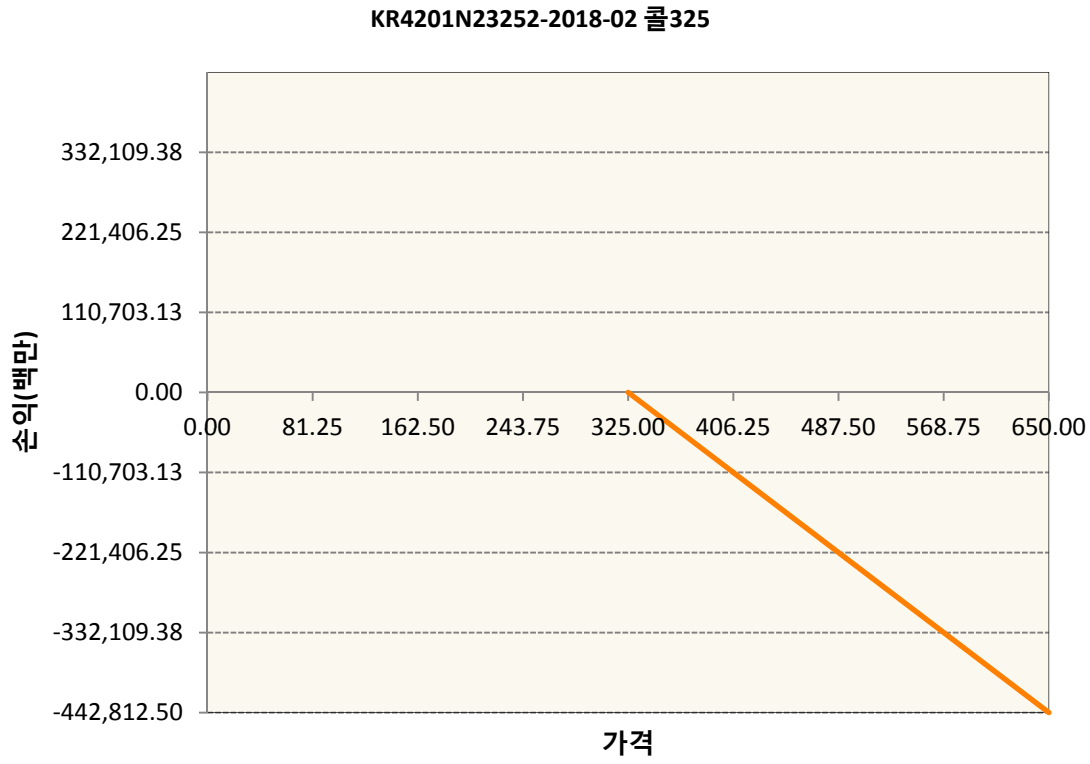
커버드콜모(주식혼합-파생형)

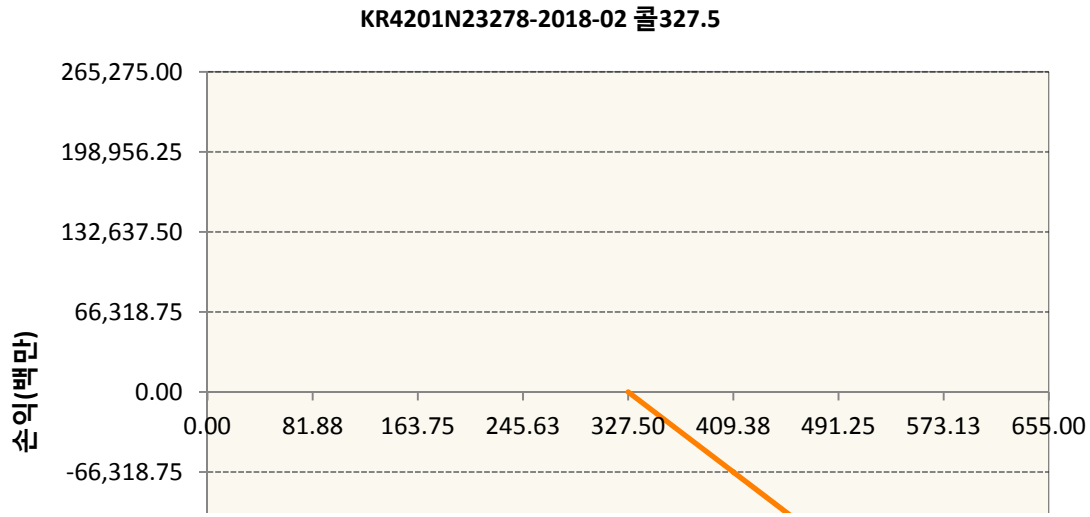
1. 계약금액

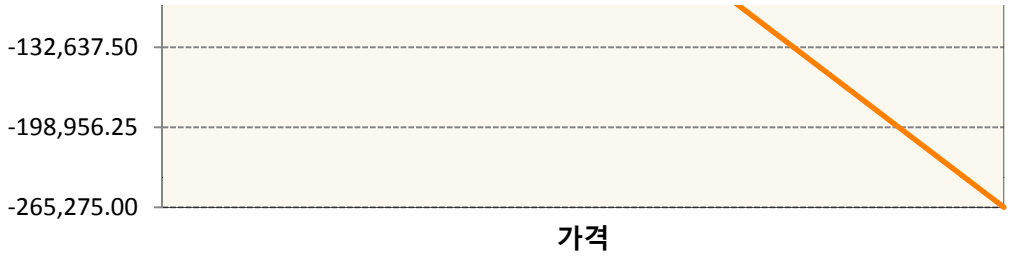
(단위:백만원)

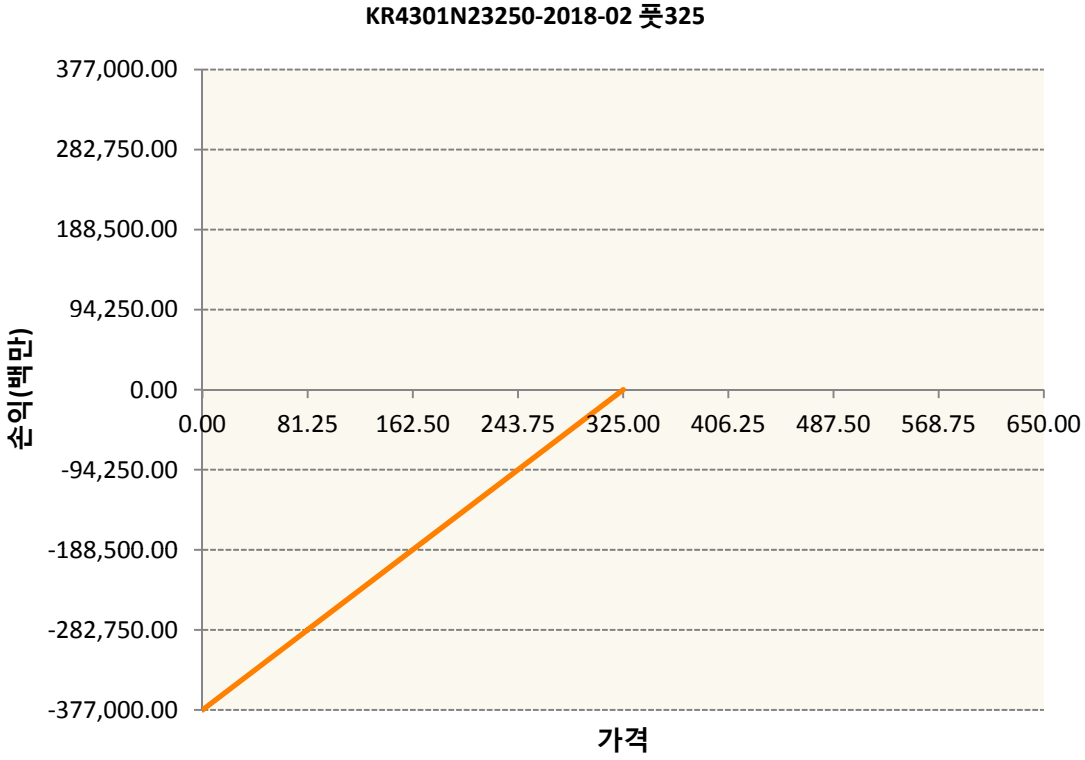
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	1,209,374	-1,209,374	장내

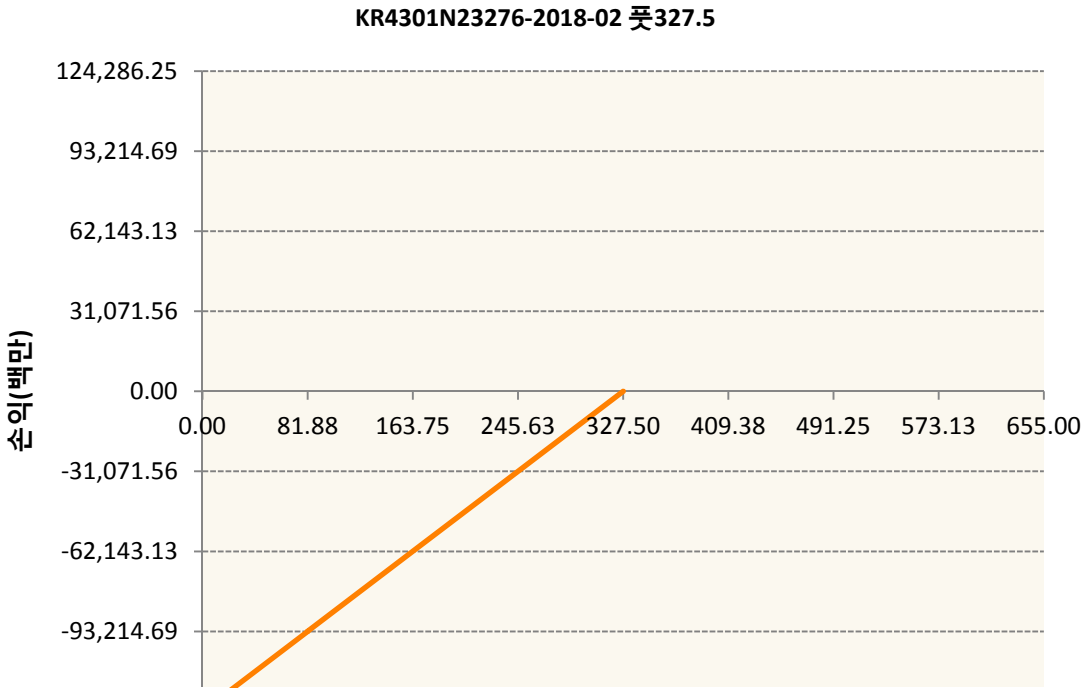
2. 만기시점의 손익구조






-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							29,989
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	2,958	2,958	2,958	2,958	2,957	2,956	2,955
-5.33%	2,957	2,956	2,952	2,945	2,932	2,911	2,881
-2.67%	2,874	2,807	2,719	2,608	2,478	2,329	2,164
0%	967	647	324	0	-326	-653	-981
2.67%	-6,873	-7,043	-7,236	-7,448	-7,676	-7,917	-8,169
5.33%	-18,227	-18,239	-18,260	-18,295	-18,344	-18,409	-18,490
8.00%	-29,964	-29,964	-29,965	-29,966	-29,970	-29,977	-29,989
KR4201N232 2018-02 콜327.5							16,513
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,067	1,067	1,067	1,067	1,067	1,067	1,066
-5.33%	1,067	1,067	1,066	1,064	1,061	1,055	1,046
-2.67%	1,052	1,035	1,009	972	925	866	798
0%	483	329	167	0	-172	-347	-526
2.67%	-3,077	-3,230	-3,391	-3,558	-3,730	-3,906	-4,085
5.33%	-9,516	-9,535	-9,565	-9,606	-9,659	-9,723	-9,797
8.00%	-16,480	-16,481	-16,482	-16,485	-16,490	-16,499	-16,513
KR4301N232 2018-02 풋325							28,712
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-28,712	-28,712	-28,712	-28,712	-28,712	-28,712	-28,712
-5.33%	-18,712	-18,712	-18,712	-18,712	-18,712	-18,712	-18,713
-2.67%	-8,714	-8,717	-8,723	-8,734	-8,750	-8,773	-8,802
0%	486	327	165	0	-166	-334	-504
2.67%	3,219	3,188	3,146	3,092	3,027	2,952	2,868
5.33%	3,255	3,255	3,255	3,255	3,253	3,251	3,246
8.00%	3,255	3,255	3,255	3,255	3,255	3,255	3,255
KR4301N232 2018-02 풋327.5							9,641
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-9,641	-9,641	-9,641	-9,641	-9,641	-9,641	-9,641
-5.33%	-6,370	-6,370	-6,370	-6,370	-6,370	-6,370	-6,370
-2.67%	-3,099	-3,099	-3,099	-3,100	-3,101	-3,104	-3,108
0%	101	71	37	0	-40	-82	-126
2.67%	1,700	1,671	1,638	1,602	1,563	1,521	1,478

5.33%	1,766	1,765	1,765	1,764	1,762	1,759	1,755
8.00%	1,766	1,766	1,766	1,766	1,766	1,766	1,766

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

110,022

공시일	2018-02-06
기준일	2018-02-05

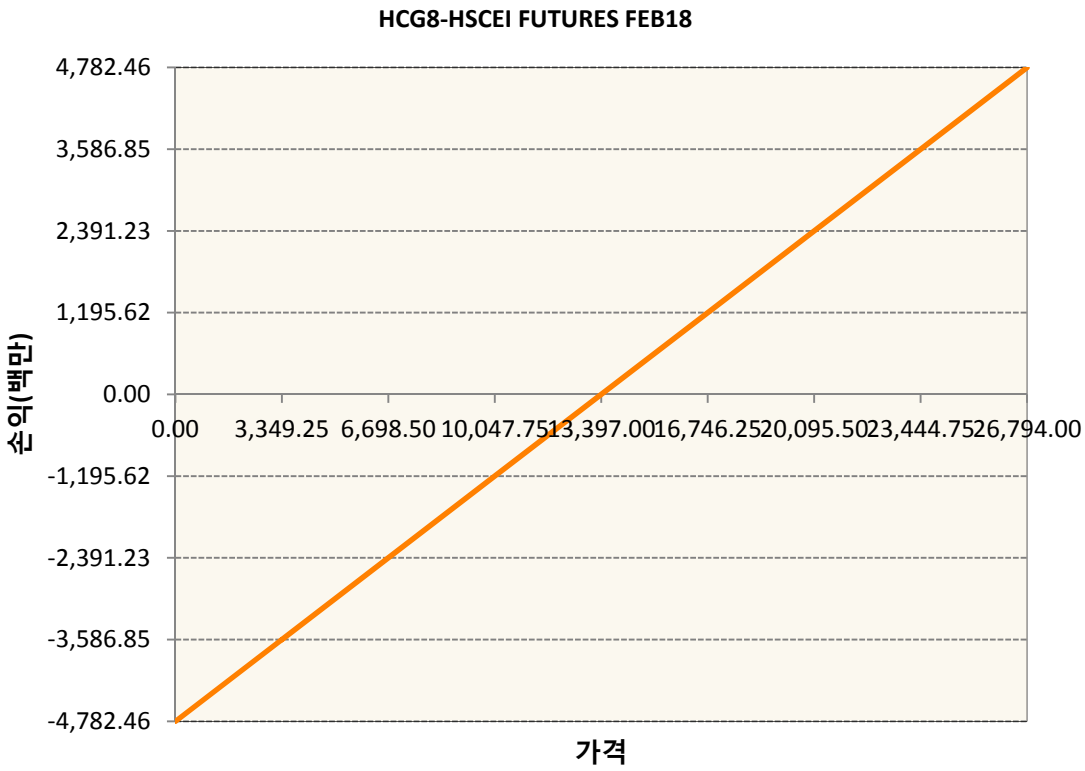
홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생

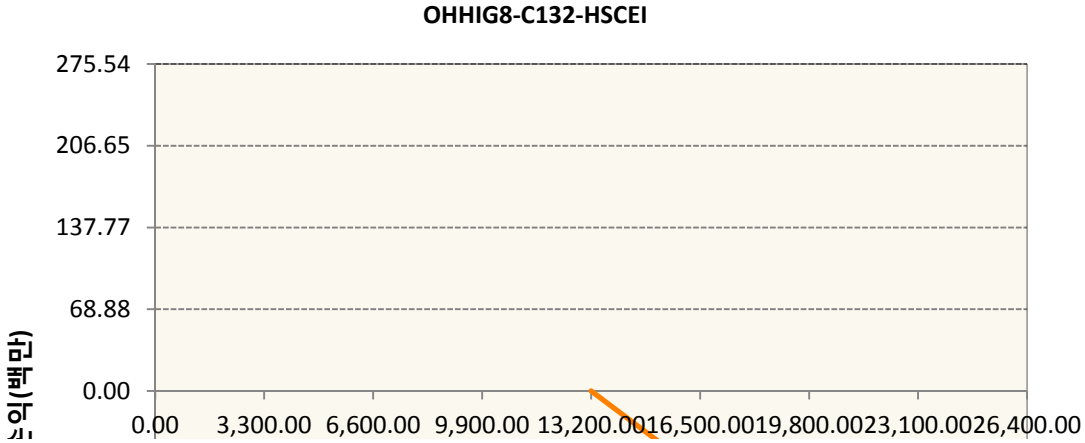
1. 계약금액

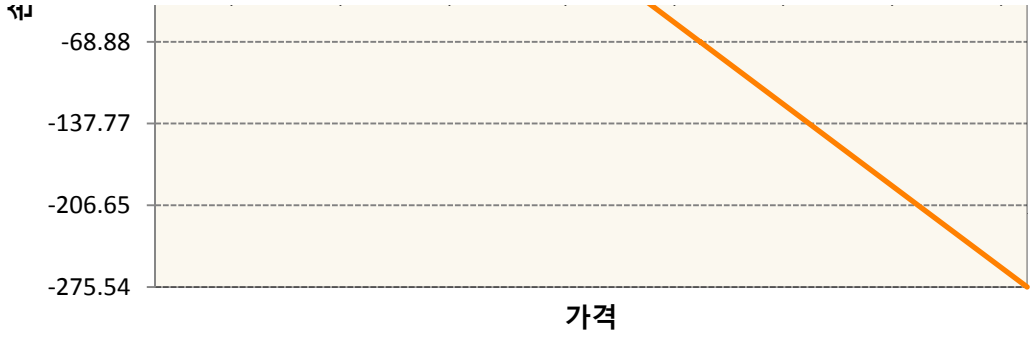
(단위:백만원)

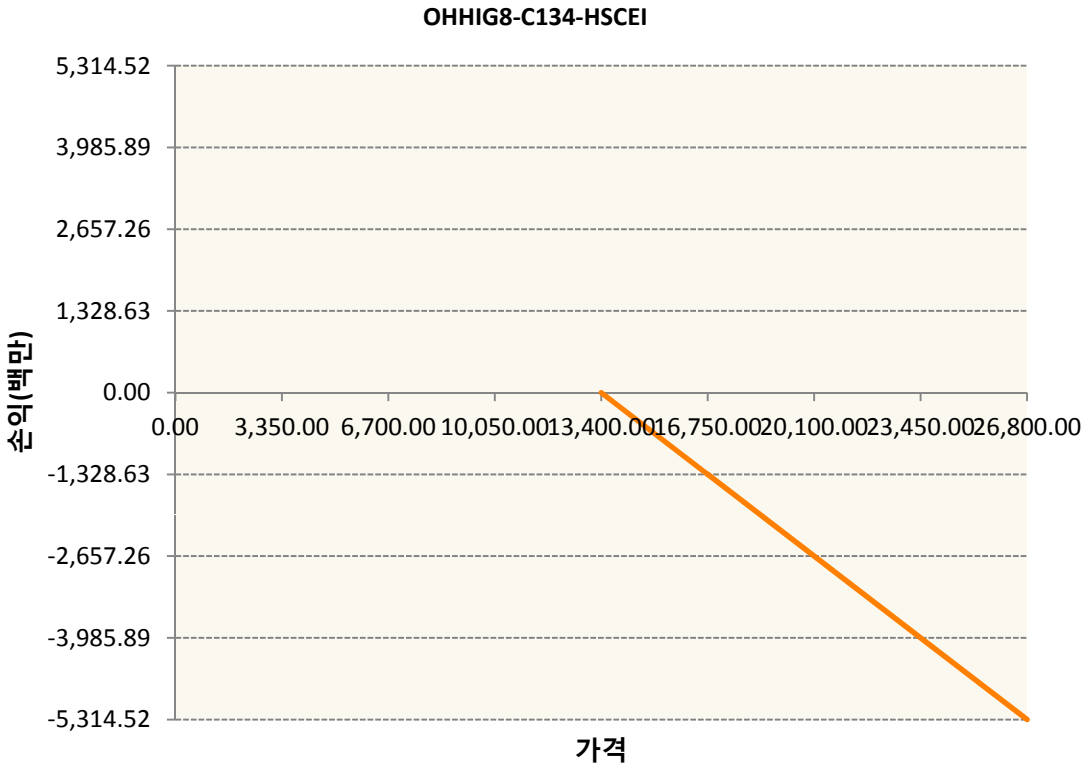
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	4,782	0	4,782	장내
누계	유가증권	옵션	0	11,180	-11,180	장내

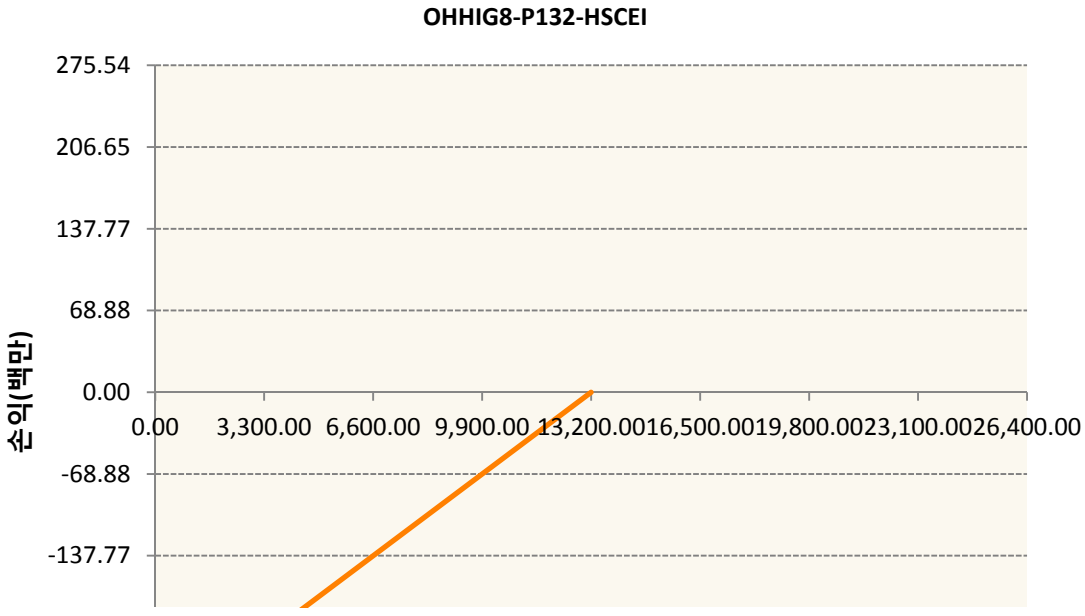
2. 만기시점의 손익구조

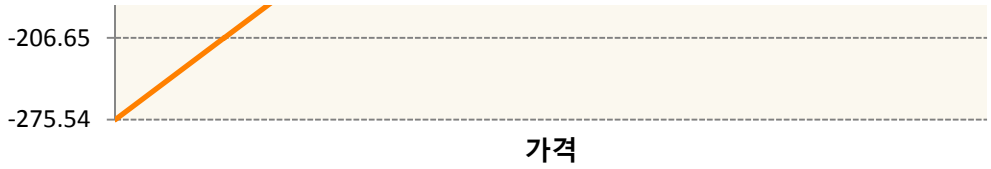


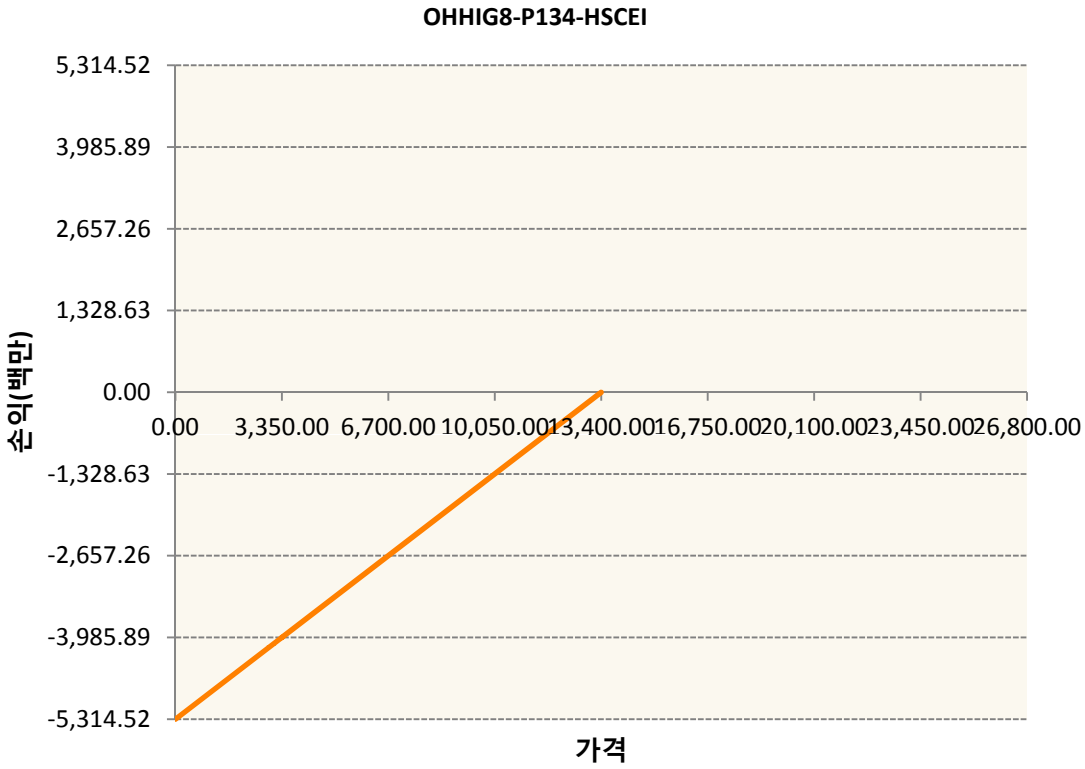



-68.88
-137.77
-206.65
-275.54
가격


OHHIG8-C134-HSCEI
5,314.52
3,985.89
2,657.26
1,328.63
0.00
-1,328.63
-2,657.26
-3,985.89
-5,314.52
0.00
3,350.00
6,700.00
10,050.00
13,400.00
16,750.00
20,100.00
23,450.00
26,800.00
손익(백만)
가격


OHHIG8-P132-HSCEI
275.54
206.65
137.77
68.88
0.00
-68.88
-137.77
0.00
3,300.00
6,600.00
9,900.00
13,200.00
16,500.00
19,800.00
23,100.00
26,400.00
손익(백만)





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCG8	HSCEI FUTURES FEB18	383
OHHIG8-C1	HSCEI	22
OHHIG8-C1	HSCEI	425
OHHIG8-P1	HSCEI	22
OHHIG8-P1	HSCEI	425

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,033

공시일	2018-02-06
기준일	2018-02-05

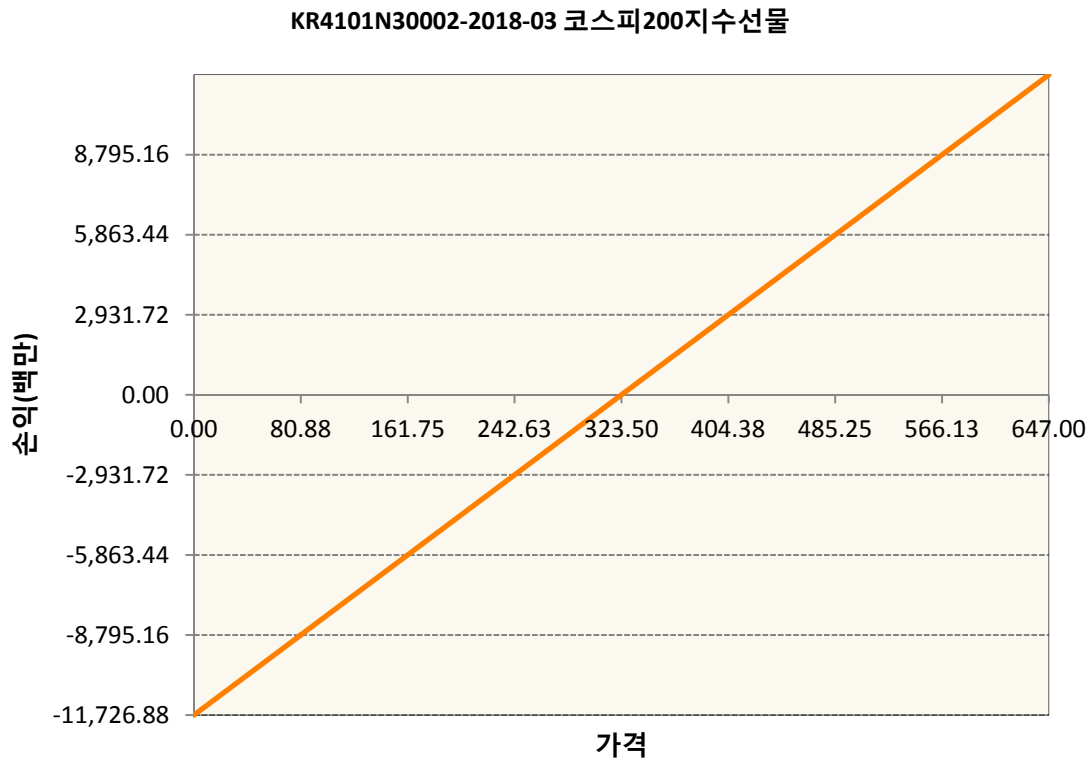
코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼

1. 계약금액

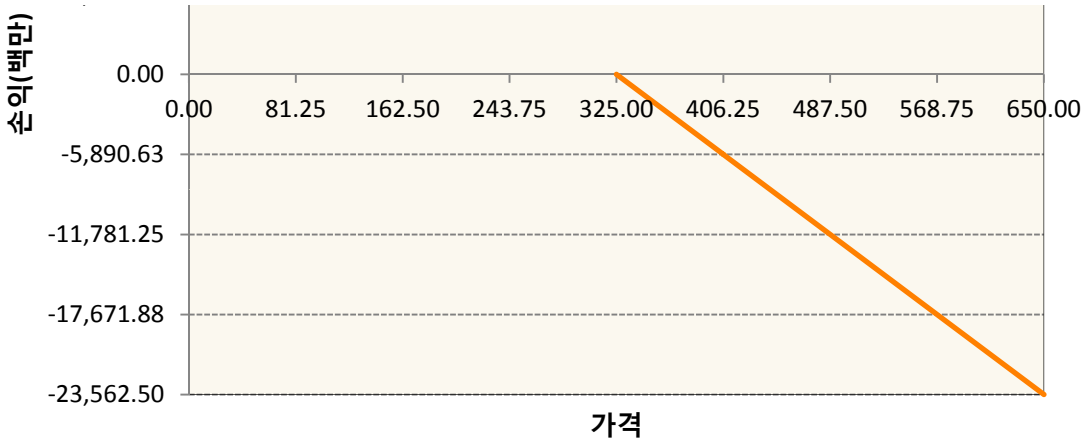
(단위:백만원)

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	11,727	0	11,727	장내
누계	유가증권	스왑	60,200	0	60,200	장외
누계	유가증권	옵션	0	60,250	-60,250	장내

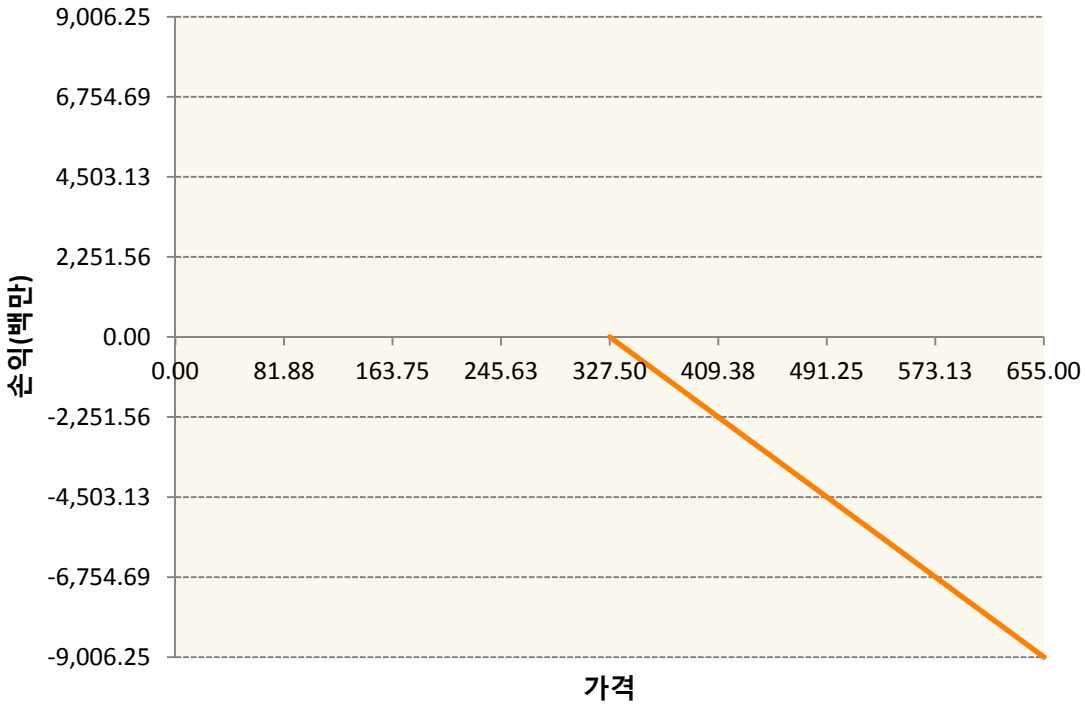
2. 만기시점의 손익구조



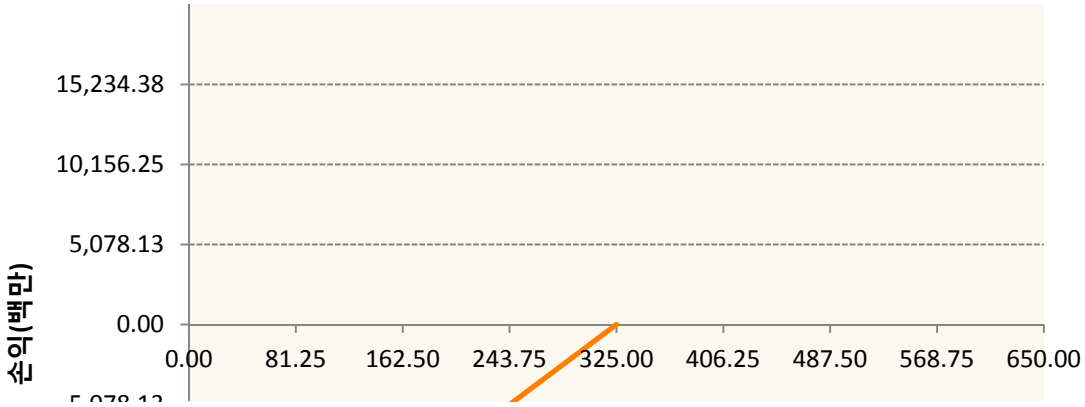




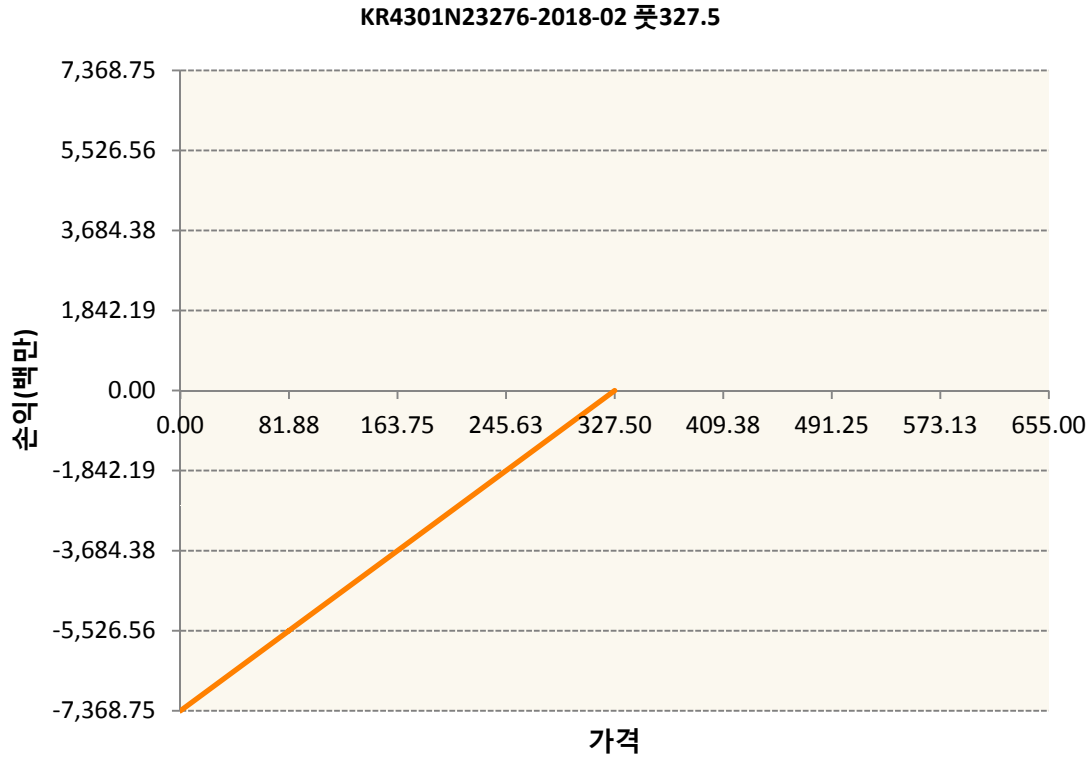
KR4201N23278-2018-02 콜327.5



KR4301N23250-2018-02 풋325







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_2							1,456
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,456	-1,456	-1,456	-1,456	-1,456	-1,456	-1,456
-5.33%	-971	-971	-971	-971	-971	-971	-971
-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%	971	971	971	971	971	971	971
8.00%	1,456	1,456	1,456	1,456	1,456	1,456	1,456
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%	-184	-184	-184	-184	-184	-184	-184
-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%	184	184	184	184	184	184	184
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						466
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-466	-466	-466	-466	-466	-466	-466
-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%	466	466	466	466	466	466	466
	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%	-184	-184	-184	-184	-184	-184	-184
-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%	184	184	184	184	184	184	184
8.00%	275	275	275	275	275	275	275
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_11						630
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-630	-630	-630	-630	-630	-630	-630
-5.33%	-420	-420	-420	-420	-420	-420	-420
-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%	420	420	420	420	420	420	420
8.00%	630	630	630	630	630	630	630
	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				938

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-938	-938	-938	-938	-938	-938	-938
-5.33%	-625	-625	-625	-625	-625	-625	-625
-2.67%	-313	-313	-313	-313	-313	-313	-313
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	313	313	313	313	313	313	313
5.33%	625	625	625	625	625	625	625
8.00%	938	938	938	938	938	938	938
	KR4201N23(	2018-02	콜325				1,596

	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%	157	157	157	157	156	155	153
-2.67%	153	149	145	139	132	124	115
0%	51	34	17	0	-17	-35	-52
2.67%	-366	-375	-385	-396	-408	-421	-435
5.33%	-970	-970	-972	-973	-976	-980	-984
8.00%	-1,594	-1,594	-1,594	-1,595	-1,595	-1,595	-1,596
	KR4201N23(	2018-02	콜327.5				561

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	36	36	36	36	36	36	36
-5.33%	36	36	36	36	36	36	36
-2.67%	36	35	34	33	31	29	27
0%	16	11	6	0	-6	-12	-18
2.67%	-104	-110	-115	-121	-127	-133	-139
5.33%	-323	-324	-325	-326	-328	-330	-333
8.00%	-560	-560	-560	-560	-560	-560	-561
	KR4301N23(	2018-02	풋325				1,547

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,547	-1,547	-1,547	-1,547	-1,547	-1,547	-1,547
-5.33%	-1,008	-1,008	-1,008	-1,008	-1,008	-1,008	-1,008

-2.67%	-470	-470	-470	-471	-471	-473	-474
0%	26	18	9	0	-9	-18	-27
2.67%	173	172	169	167	163	159	155
5.33%	175	175	175	175	175	175	175
8.00%	175	175	175	175	175	175	175
	KR4301N232 2018-02 풋327.5						572
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-572	-572	-572	-572	-572	-572	-572
-5.33%	-378	-378	-378	-378	-378	-378	-378
-2.67%	-184	-184	-184	-184	-184	-184	-184
0%	6	4	2	0	-2	-5	-7
2.67%	101	99	97	95	93	90	88
5.33%	105	105	105	105	104	104	104
8.00%	105	105	105	105	105	105	105

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

10,920

공시일	2018-02-06
기준일	2018-02-05

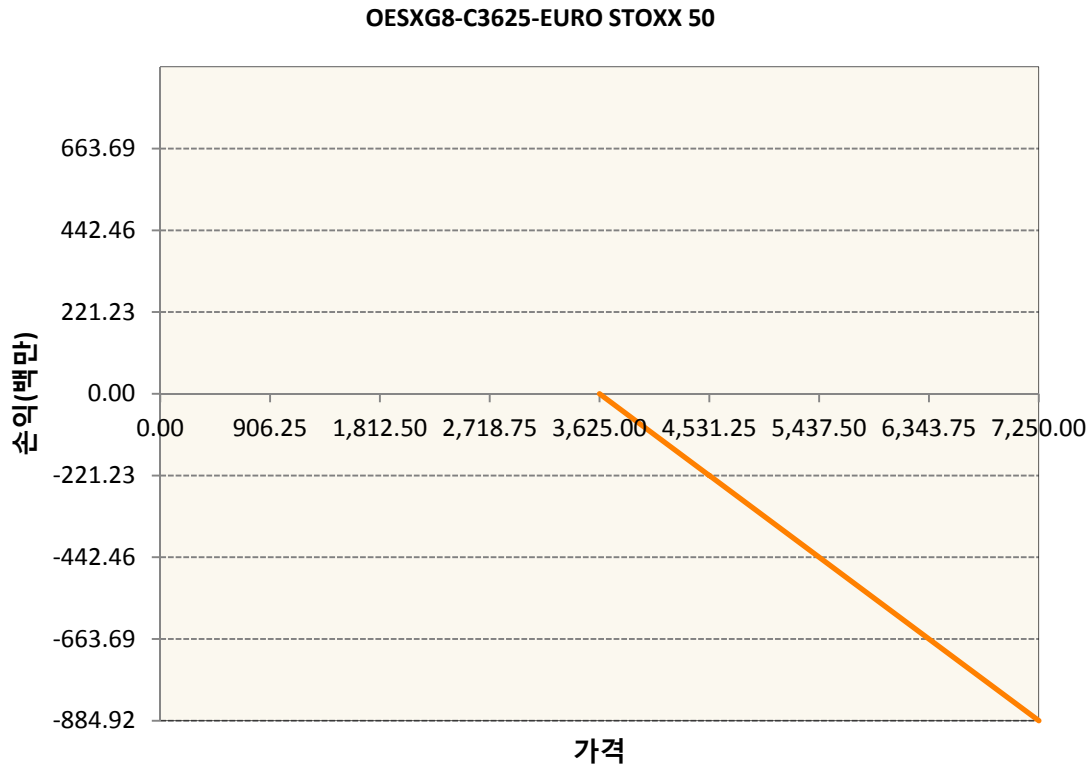
유로커버드콜모(주식혼합-파생형

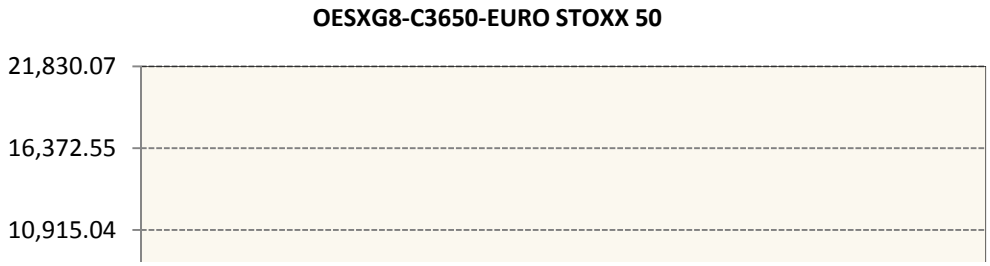
1. 계약금액

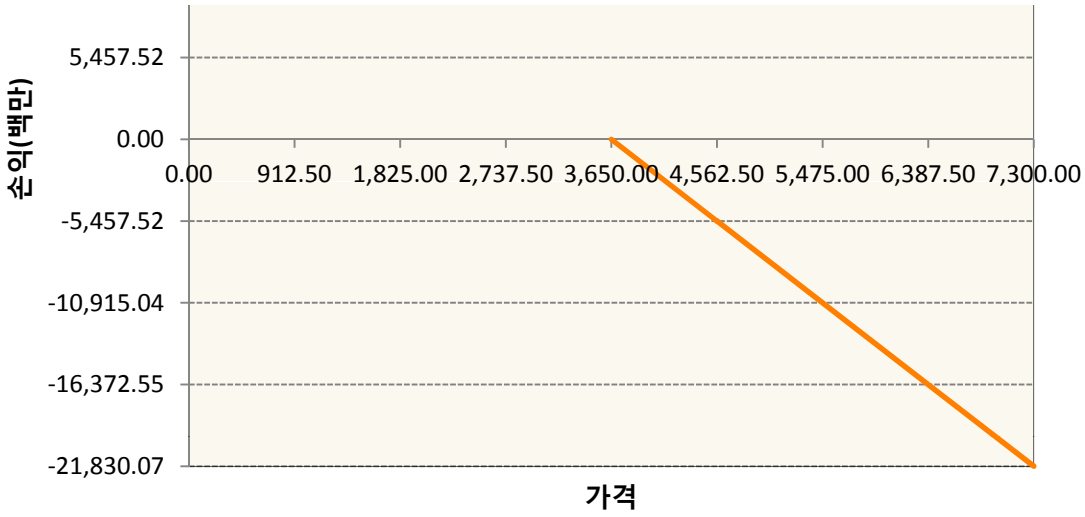
(단위:백만원)

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	12,711	0	12,711	
누계	유가증권	스왑	101,712	0	101,712	장외
누계	유가증권	옵션	0	45,430	-45,430	장내
누계	지수	스왑	54,247	0	54,247	장외

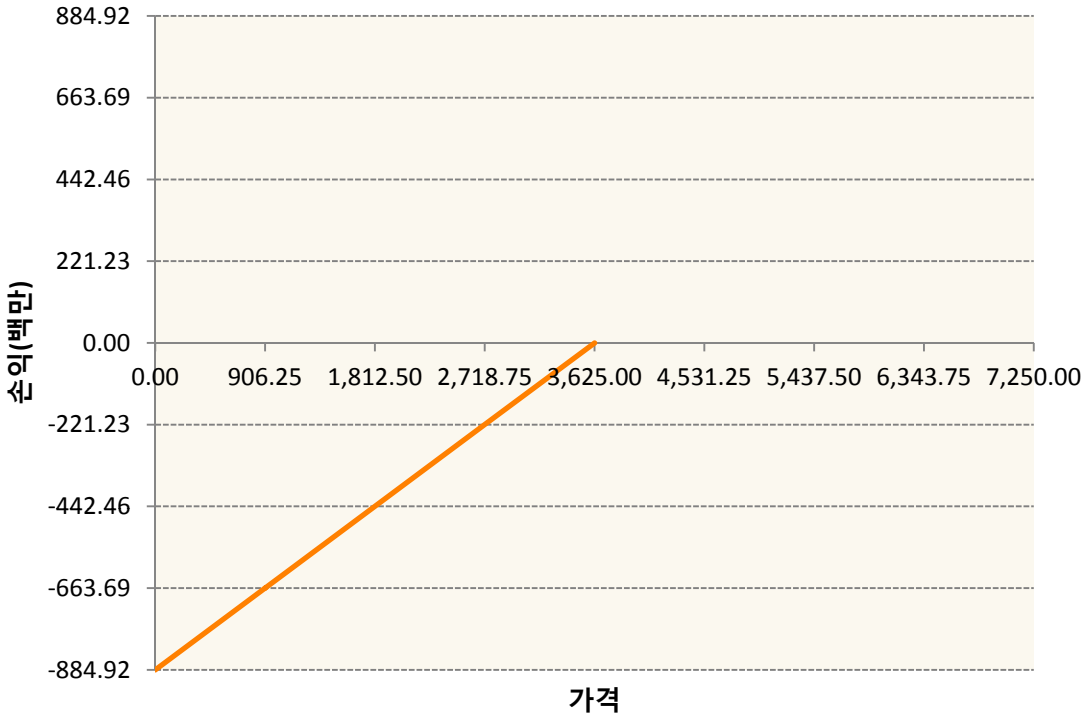
2. 만기시점의 손익구조



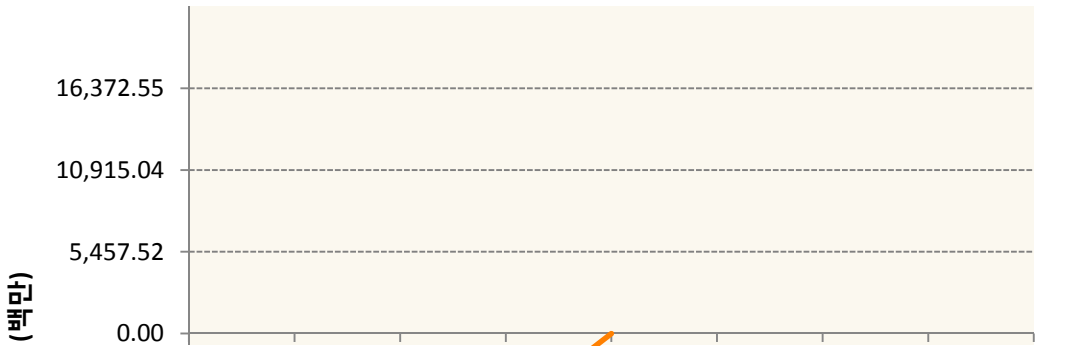


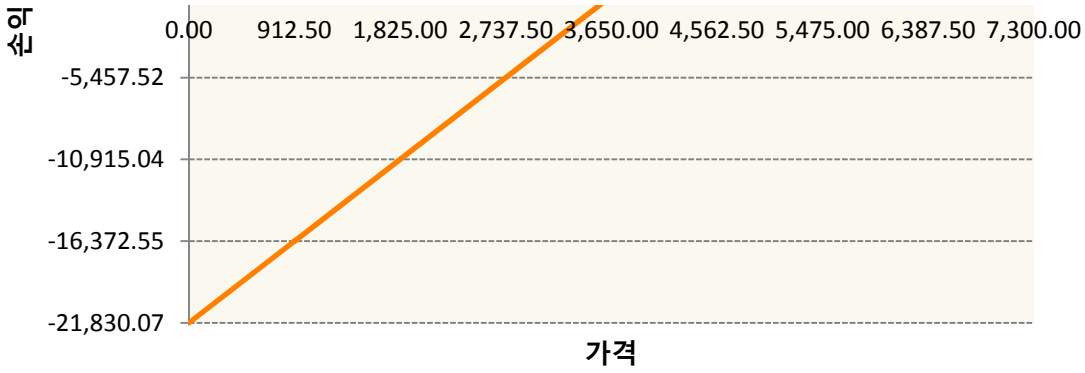


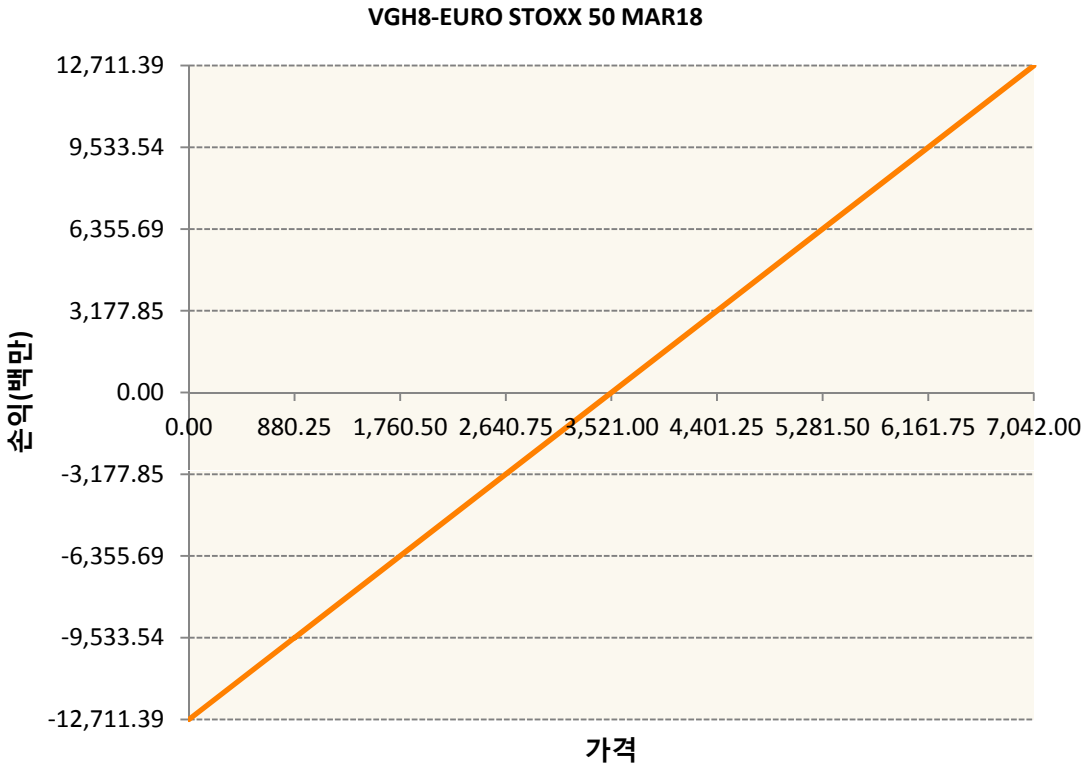
OESXG8-P3625-EURO STOXX 50



OESXG8-P3650-EURO STOXX 50







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)	(단위:백만원)
260105SGPX SG EURO Covered CALL STRATEGY - 994.569	109
260105SQPX SG EURO Covered CALL STRATEGY	204
OESXG8-C3(EURO STOXX 50	71
OESXG8-C3(EURO STOXX 50	1,746
OESXG8-P3(EURO STOXX 50	71
OESXG8-P3(EURO STOXX 50	1,746
VGH8 EURO STOXX 50 MAR18	1,017

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

2,759

공시일	2018-02-06
기준일	2018-02-05

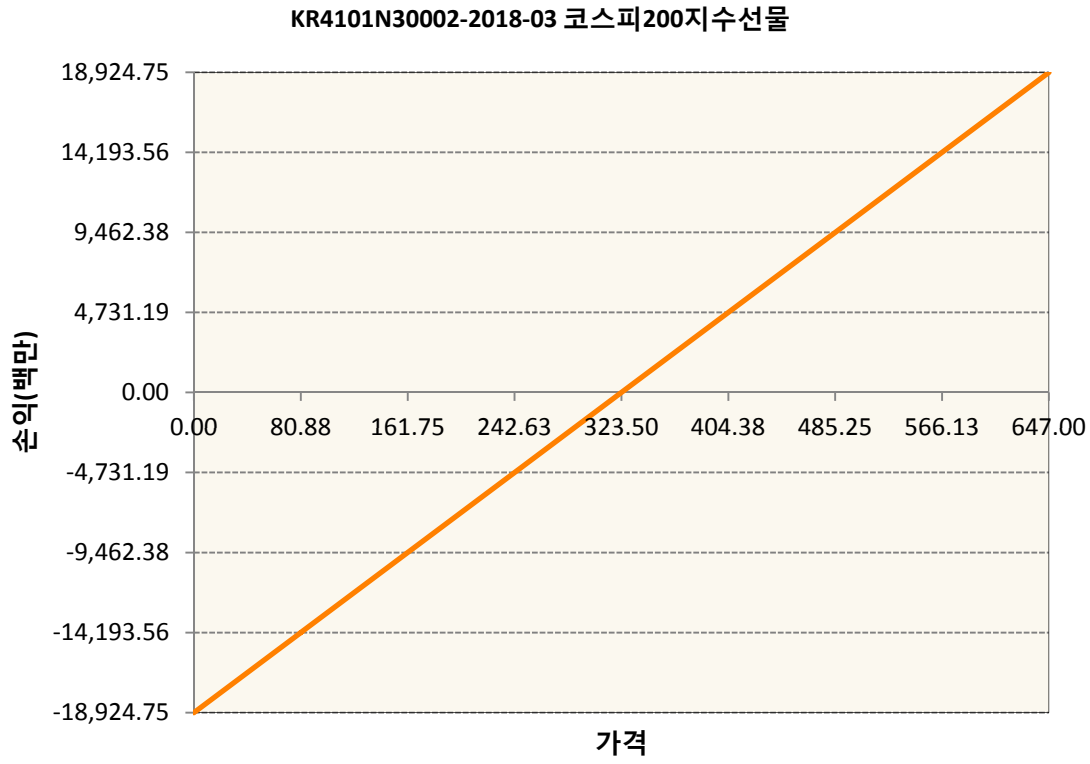
ETF스마트레버리지목표전환형8호

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	18,925	0	18,925	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101N30(2018-03 코스피200지수선물							1,513
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,513	-1,513	-1,513	-1,513	-1,513	-1,513	-1,513
-5.33%	-1,009	-1,009	-1,009	-1,009	-1,009	-1,009	-1,009
-2.67%	-504	-504	-504	-504	-504	-504	-504
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	504	504	504	504	504	504	504
5.33%	1,009	1,009	1,009	1,009	1,009	1,009	1,009
8.00%	1,513	1,513	1,513	1,513	1,513	1,513	1,513

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

937

공시일	2018-02-06
기준일	2018-02-05

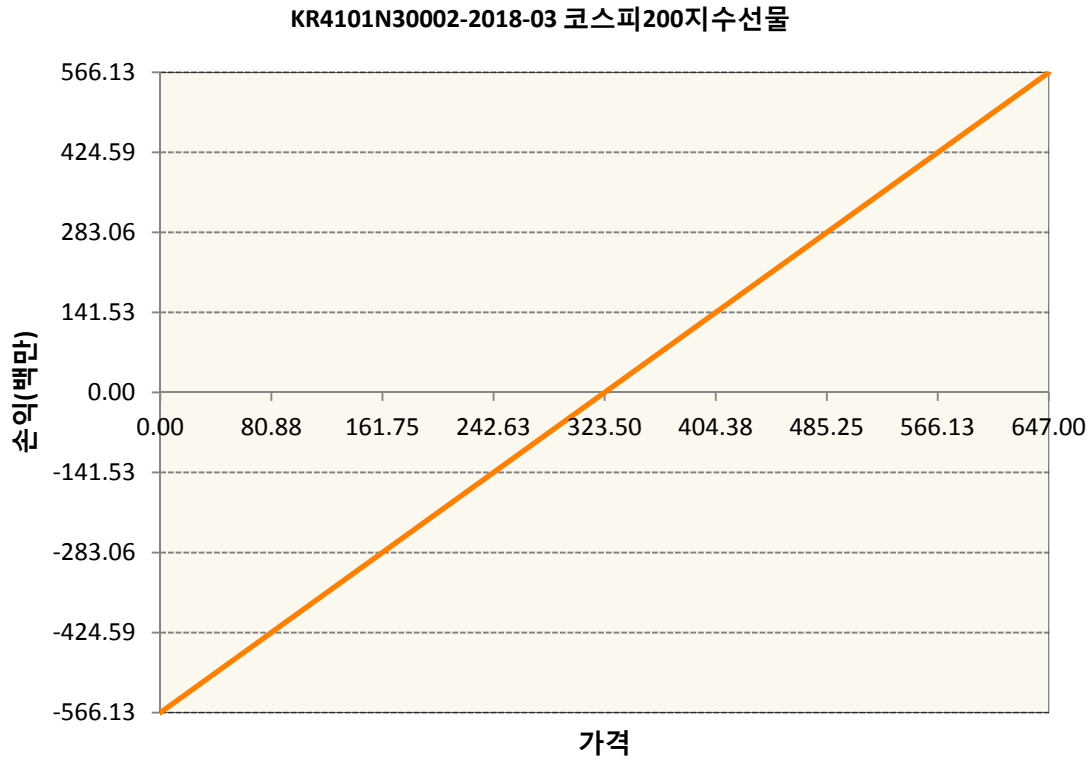
ETF스마트레버리지목표전환형9호

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	566	0	566	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101N30(2018-03 코스피200지수선물							45
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-45	-45	-45	-45	-45	-45	-45
-5.33%	-30	-30	-30	-30	-30	-30	-30
-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%	30	30	30	30	30	30	30
8.00%	45	45	45	45	45	45	45

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

28

공시일	2018-02-06
기준일	2018-02-05

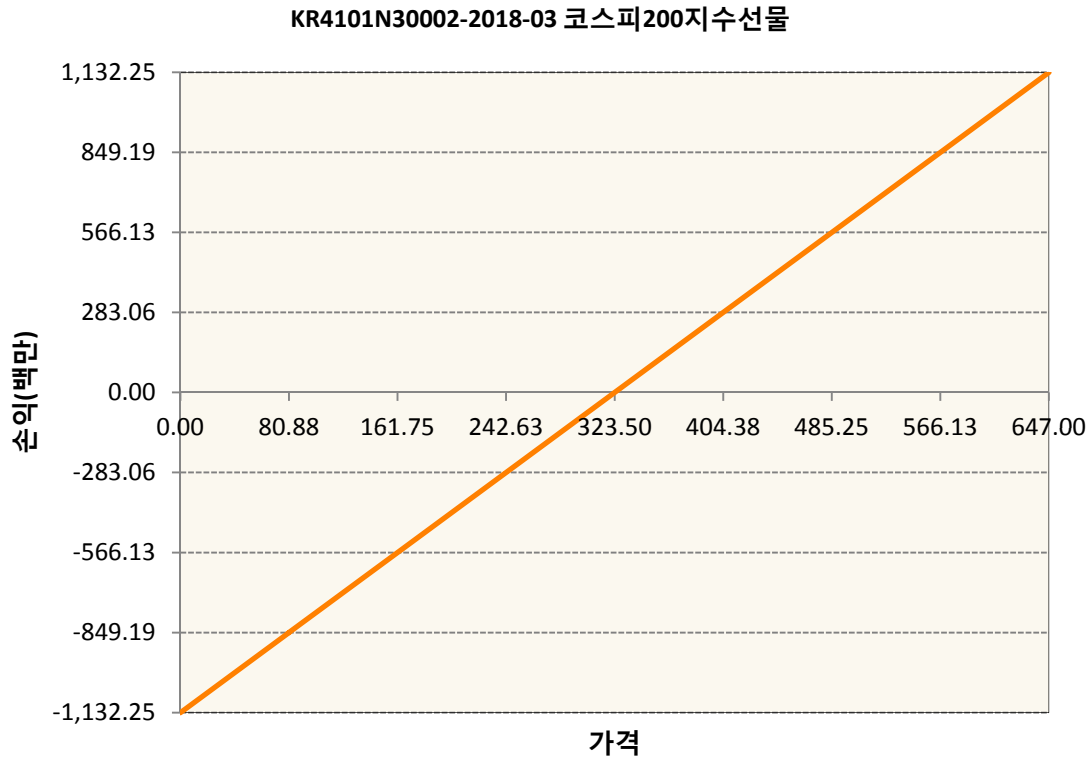
ETF스마트레버리지목표전환형10

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	1,132	0	1,132	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101N30(2018-03 코스피200지수선물							91
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-91	-91	-91	-91	-91	-91	-91
-5.33%	-60	-60	-60	-60	-60	-60	-60
-2.67%	-30	-30	-30	-30	-30	-30	-30
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	30	30	30	30	30	30	30
5.33%	60	60	60	60	60	60	60
8.00%	91	91	91	91	91	91	91

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

56

공시일	2018-02-06
기준일	2018-02-05

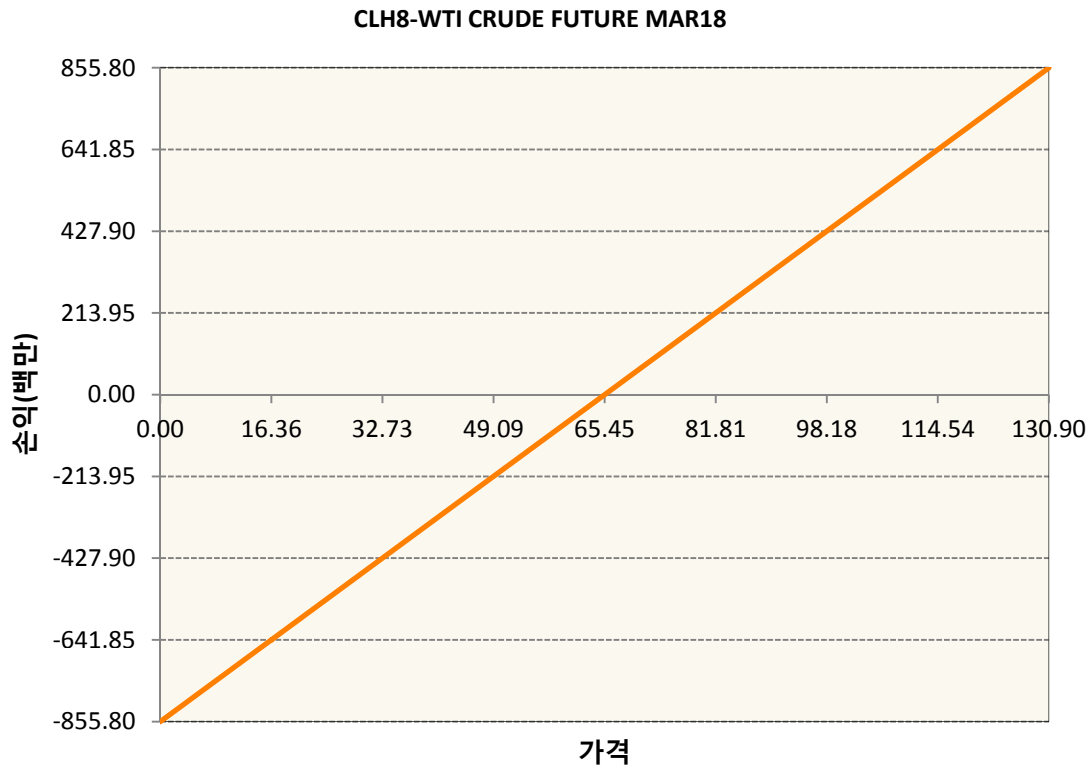
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

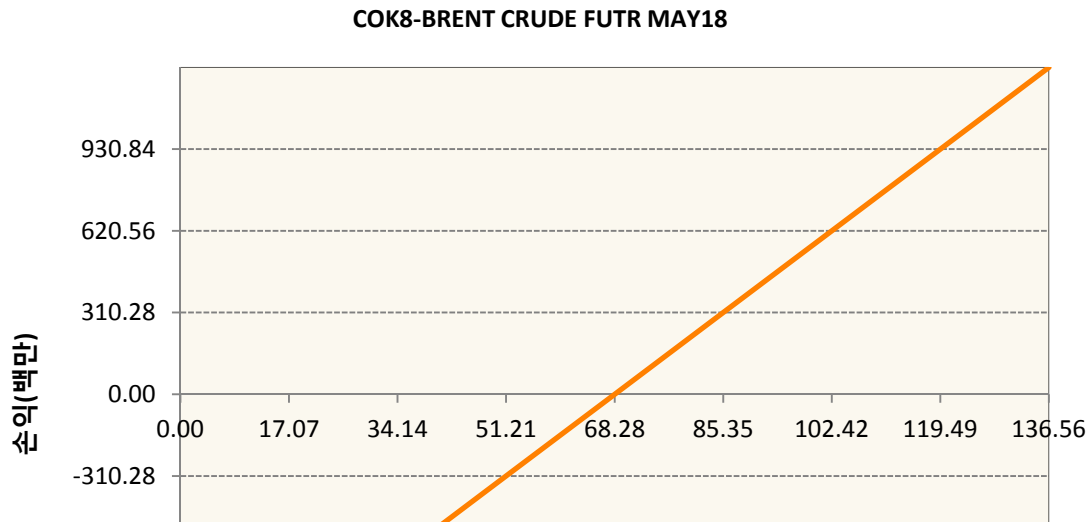
1. 계약금액

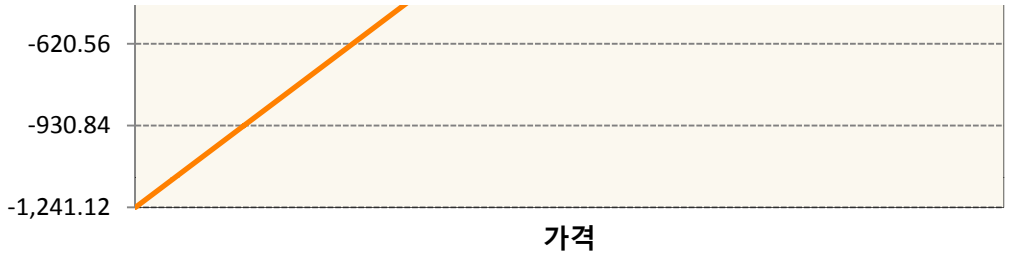
(단위:백만원)

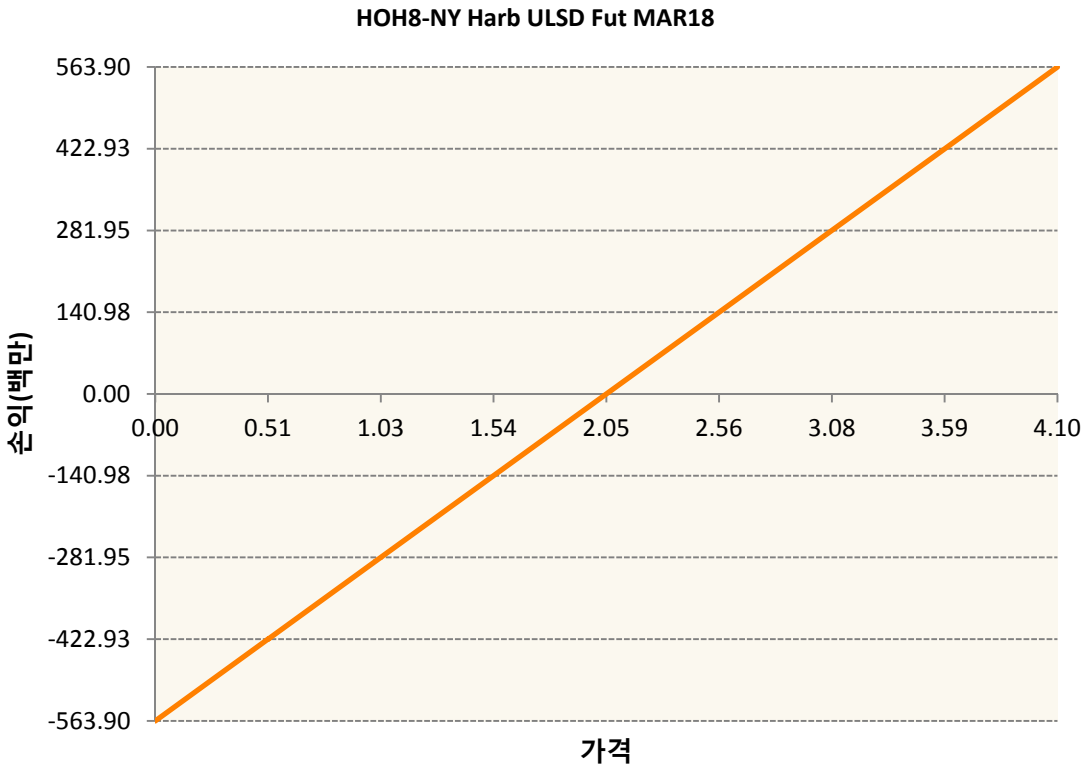
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	4,435	872	3,563	

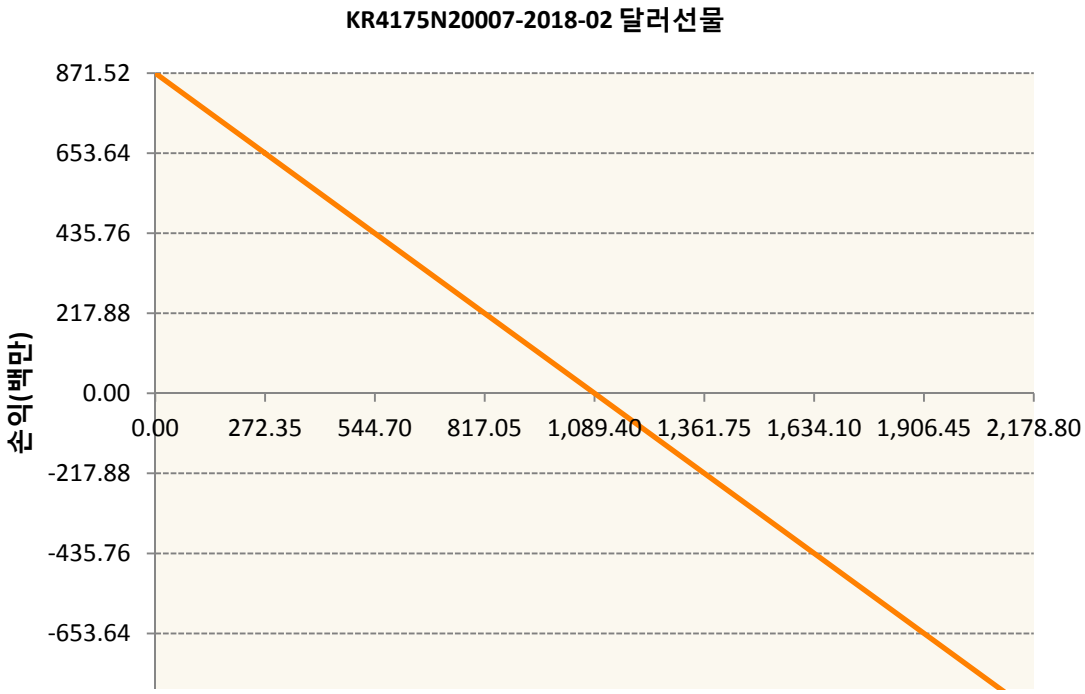
2. 만기시점의 손익구조

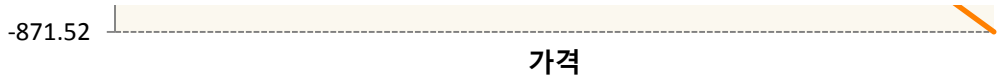


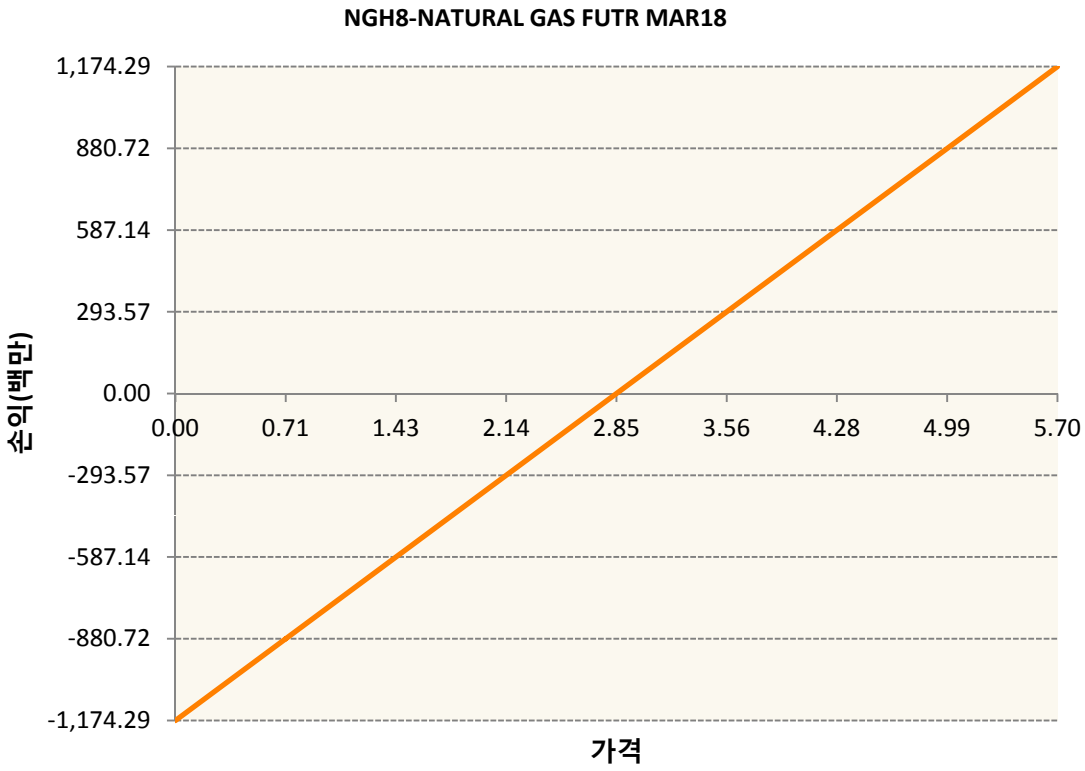


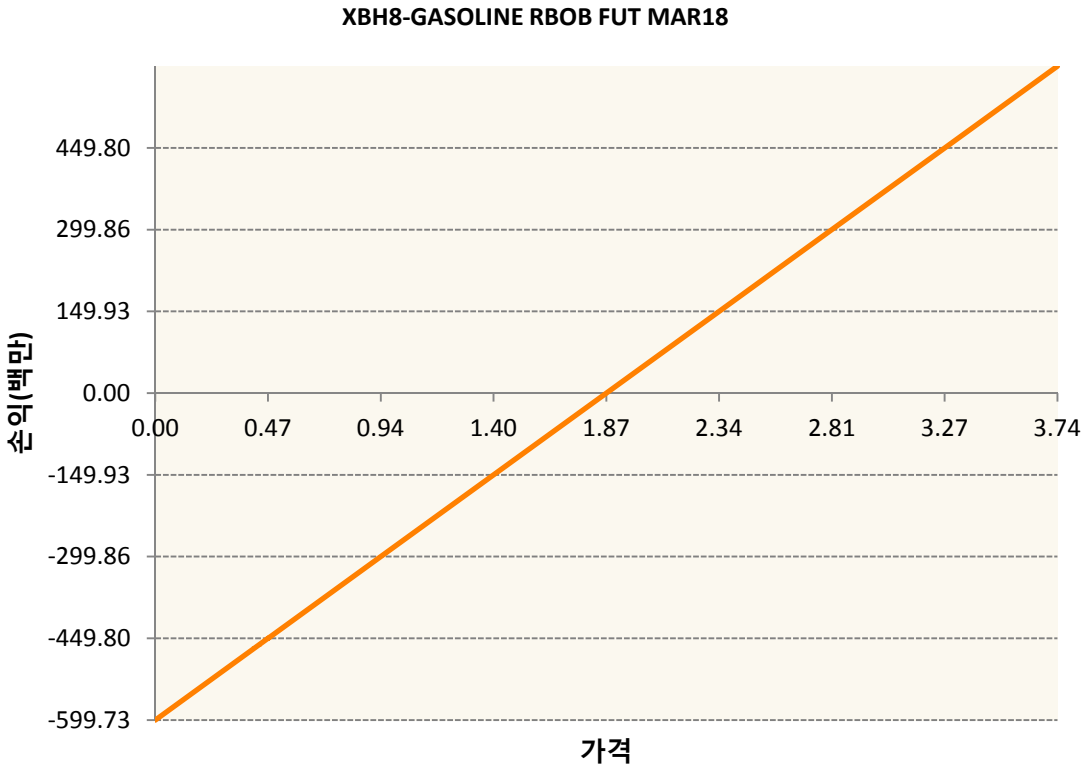

-620.56
-930.84
-1,241.12
가격


HOH8-NY Harb ULSD Fut MAR18
563.90
422.93
281.95
140.98
0.00
-140.98
-281.95
-422.93
-563.90
0.00
0.51
1.03
1.54
2.05
2.56
3.08
3.59
4.10
손익(백만)
가격


KR4175N20007-2018-02 달러선물
871.52
653.64
435.76
217.88
0.00
-217.88
-435.76
-653.64
0.00
272.35
544.70
817.05
1,089.40
1,361.75
1,634.10
1,906.45
2,178.80
손익(백만)


-871.52
가격


NGH8-NATURAL GAS FUTR MAR18
1,174.29
880.72
587.14
293.57
0.00
-293.57
-587.14
-880.72
-1,174.29
손익(백만)
0.00
0.71
1.43
2.14
2.85
3.56
4.28
4.99
5.70
가격


XBH8-GASOLINE RBOB FUT MAR18
449.80
299.86
149.93
0.00
-149.93
-299.86
-449.80
-599.73
손익(백만)
0.00
0.47
0.94
1.40
1.87
2.34
2.81
3.27
3.74
가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLH8	WTI CRUDE FUTURE MAR18	68
COK8	BRENT CRUDE FUTR MAY18	99
HOH8	NY Harb ULSD Fut MAR18	45
KR4175N20(	2018-02 달러선물	70
NGH8	NATURAL GAS FUTR MAR18	94
XBH8	GASOLINE RBOB FUT MAR18	48

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

603

공시일	2018-02-06
기준일	2018-02-05

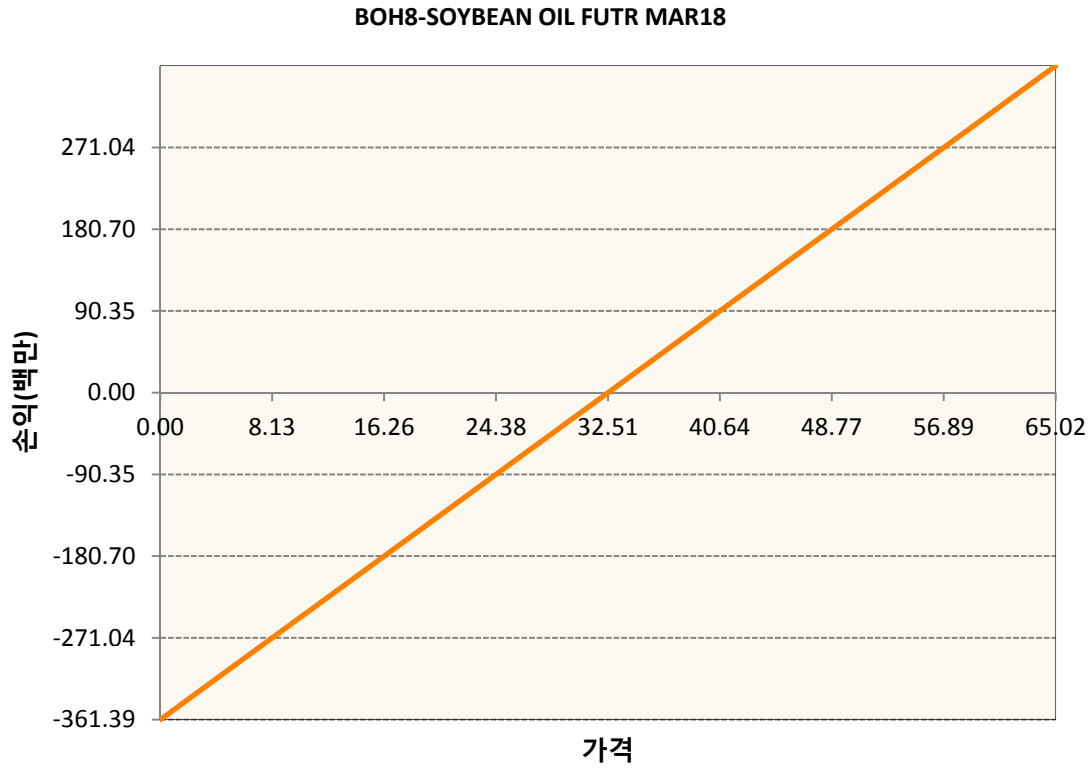
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

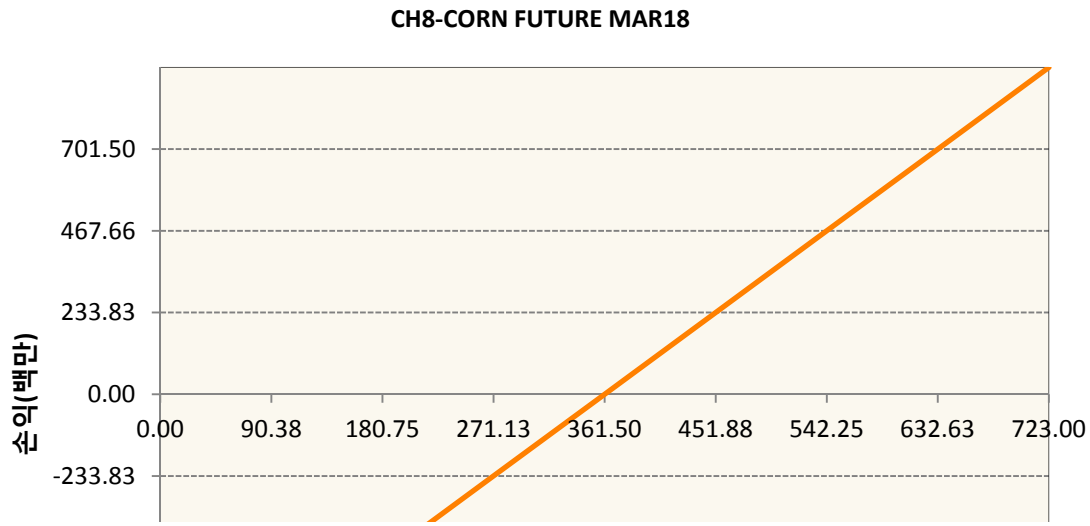
1. 계약금액

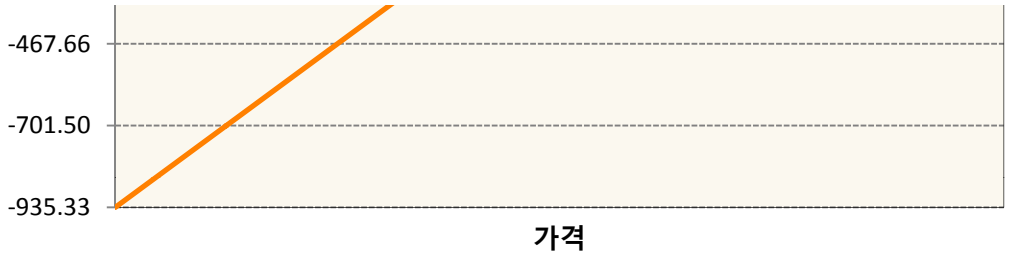
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	4,122	327	3,795	

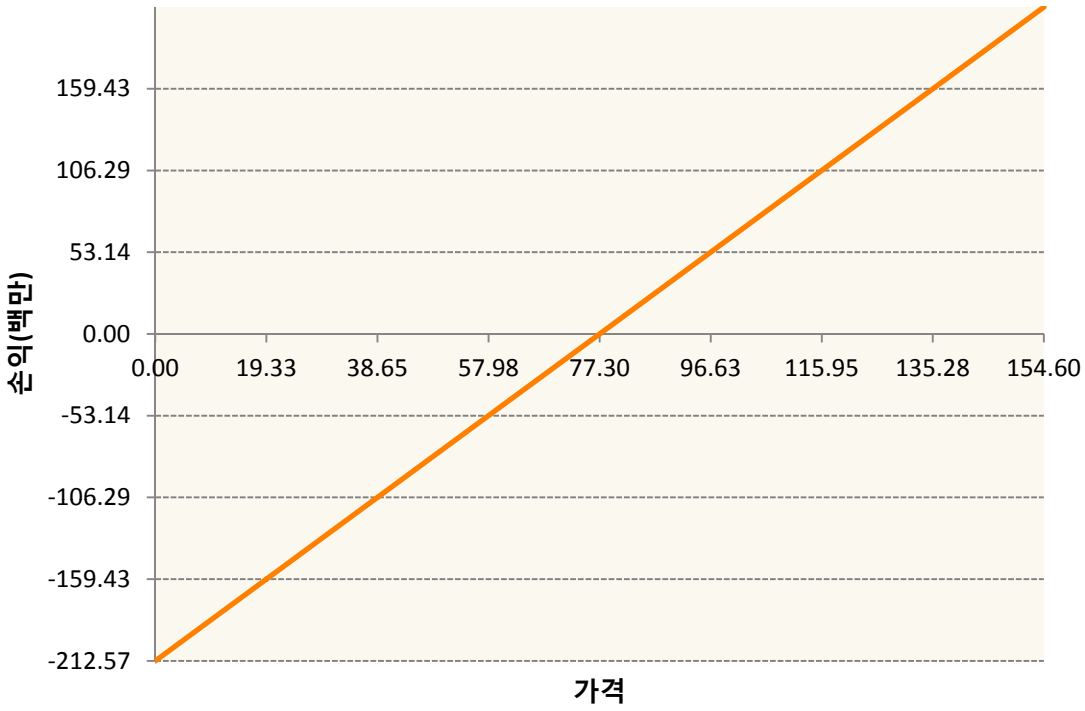
2. 만기시점의 손익구조



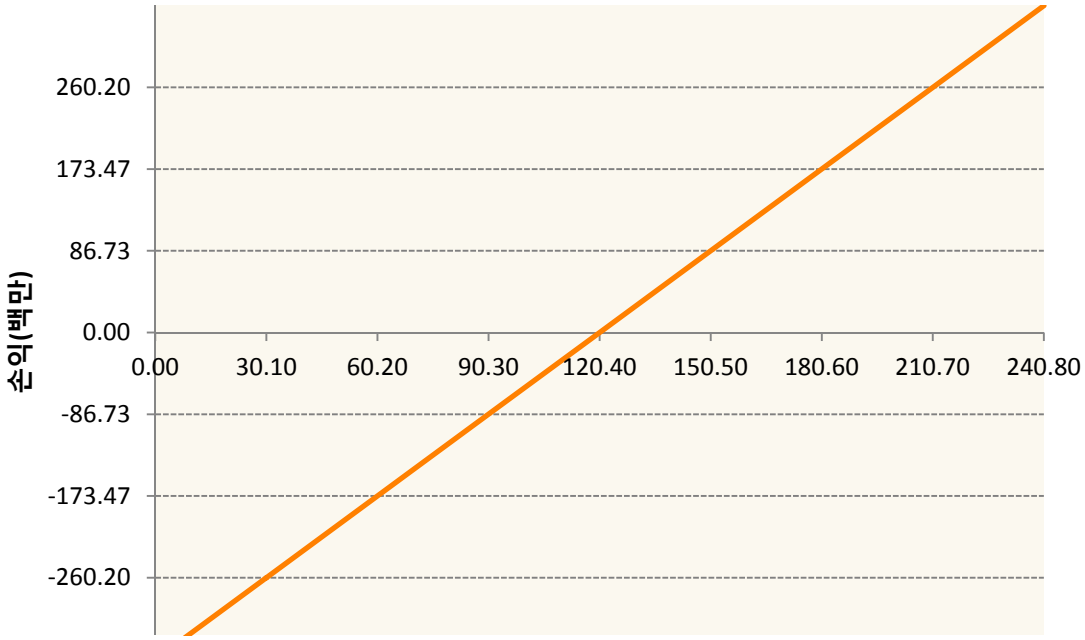


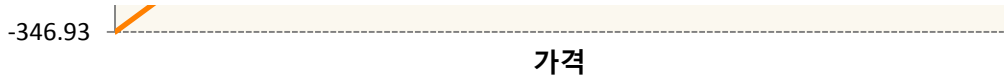


CTH8-COTTON NO.2 FUTR MAR18



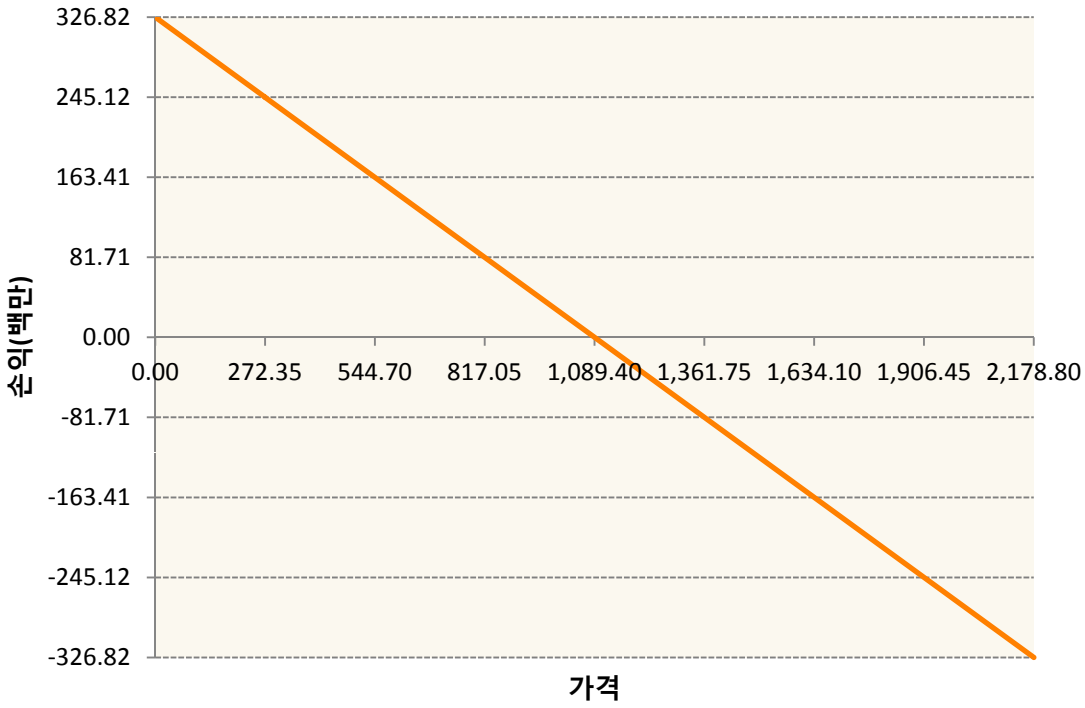
KCH8-COFFEE "C" FUTURE MAR18





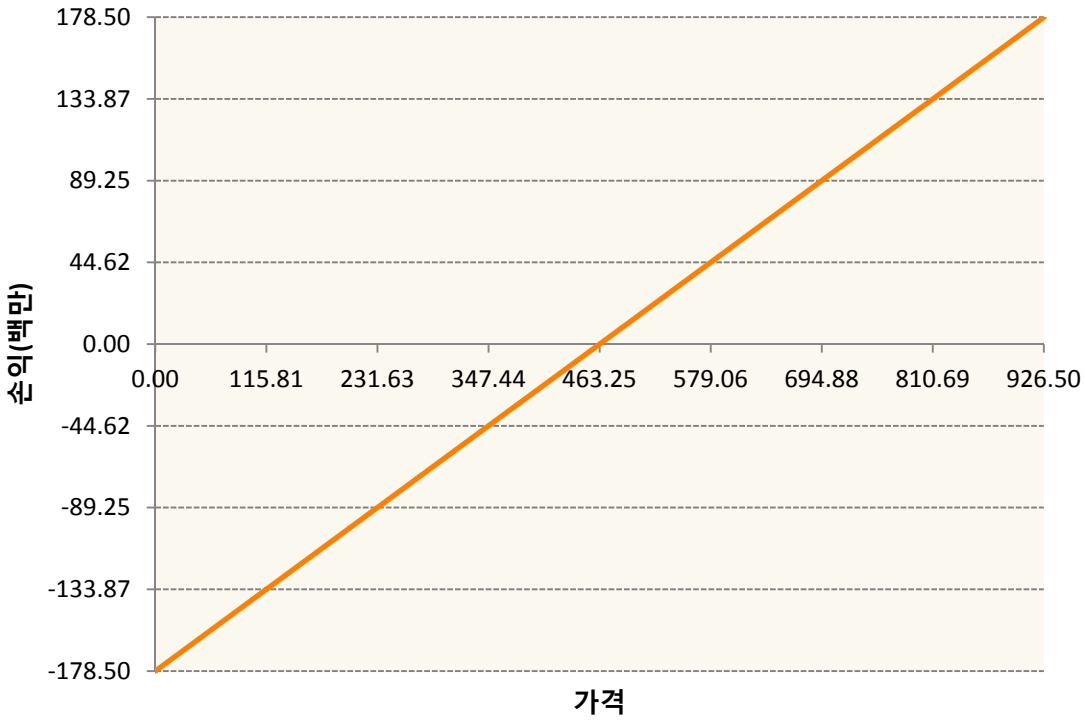
가격

KR4175N20007-2018-02 달러선물



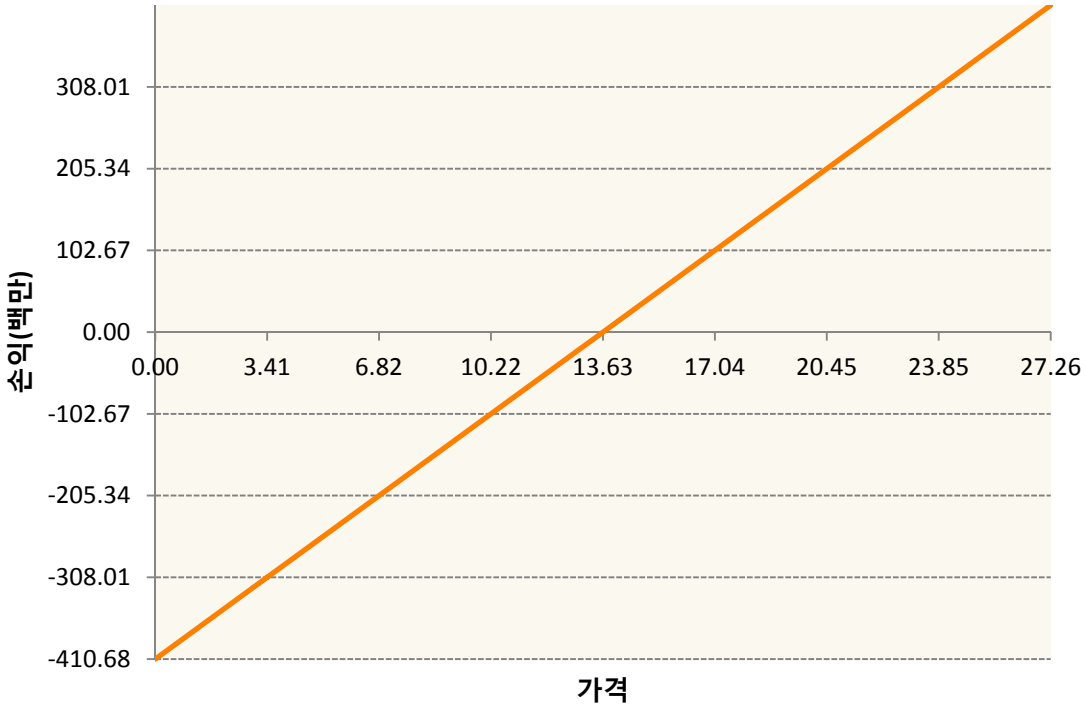
가격

KWH8-KC HRW WHEAT FUT MAR18

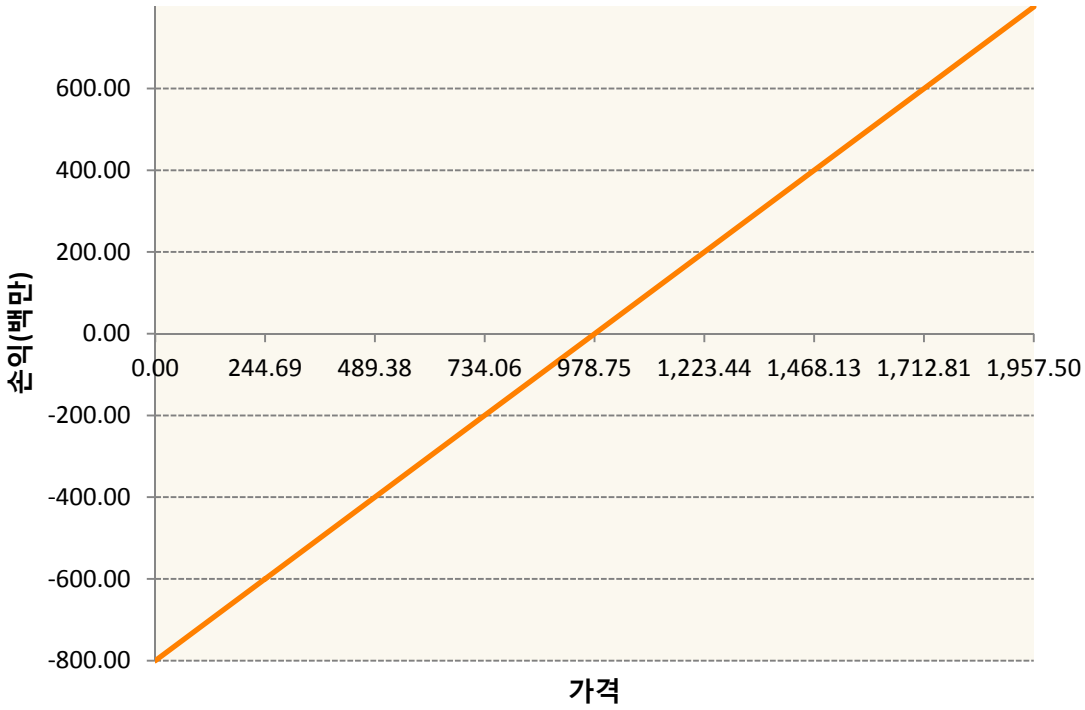


가격

SBH8-Sugar #11 (WORLD) MAR18

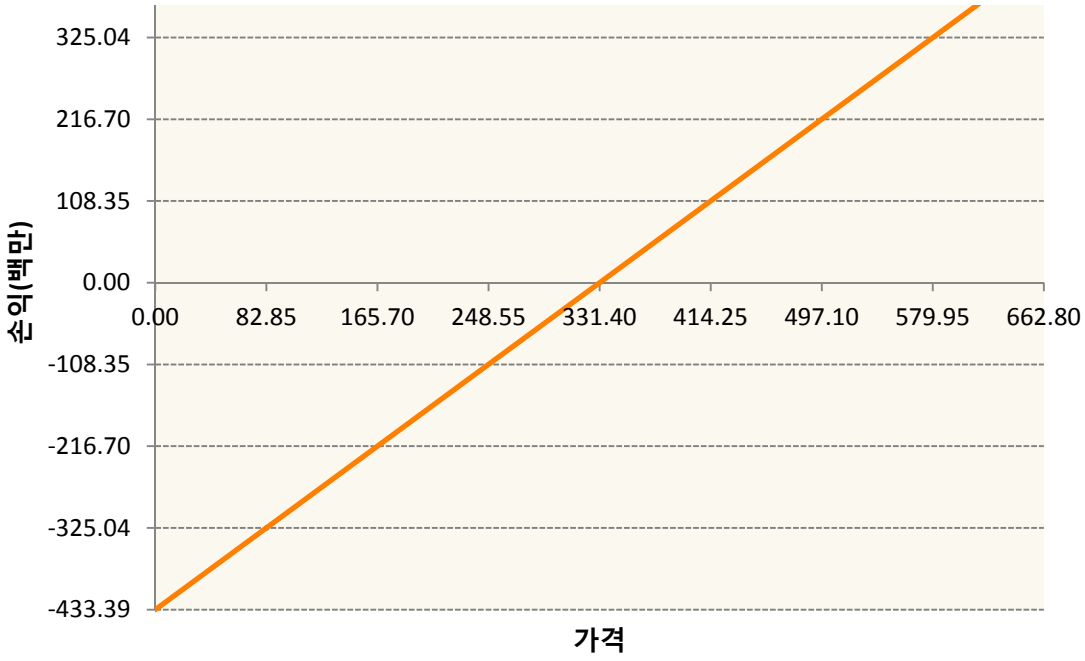


SH8-SOYBEAN FUTURE MAR18

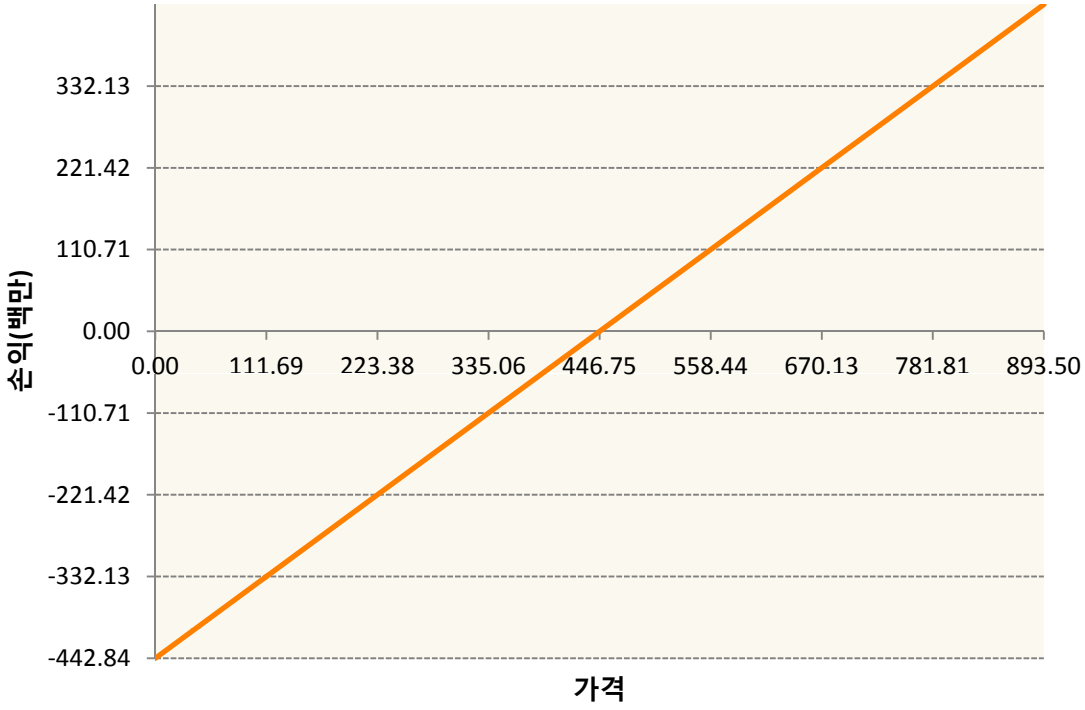


SMH8-SOYBEAN MEAL FUTR MAR18





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	33
SH8	SOYBEAN FUTURE MAR18	64
SMH8	SOYBEAN MEAL FUTR MAR18	35
WH8	WHEAT FUTURE(CBT) MAR18	35

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

342