공시일	2018-02-08
기준일	2018-02-07

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	2018-02-08
기준일	2018-02-07

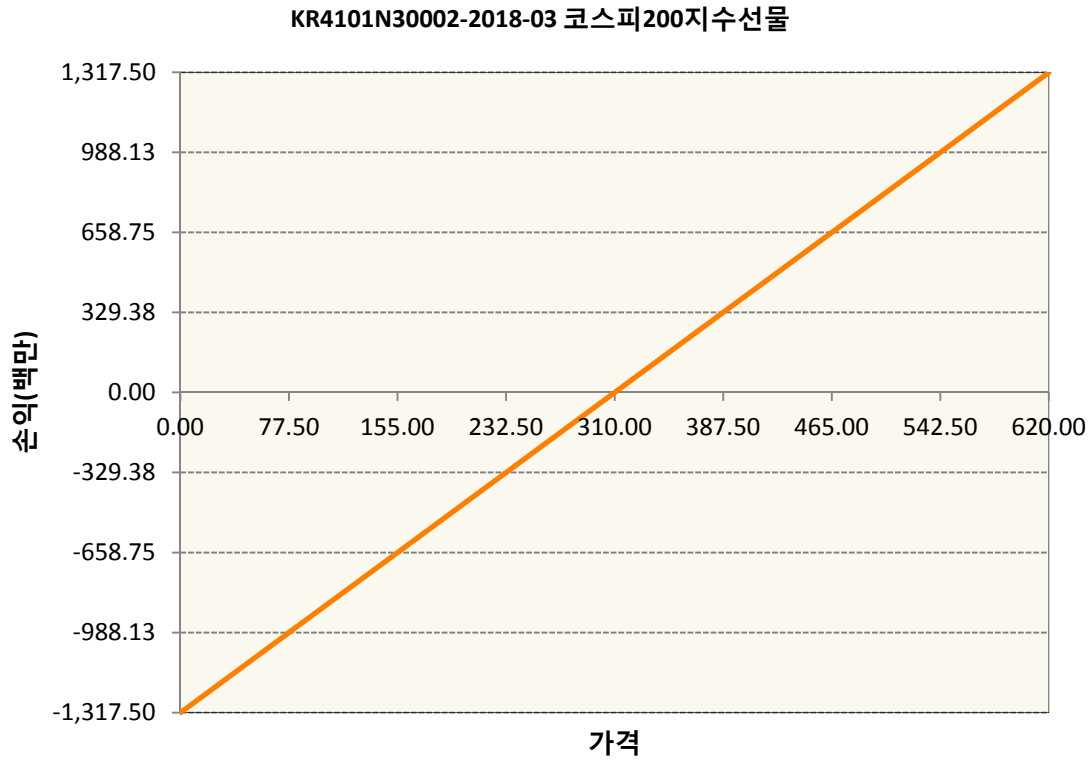
스마트인덱스모

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	1,318	0	1,318	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101N30(2018-03 코스피200지수선물							106
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-106	-106	-106	-106	-106	-106	-106
-5.33%	-70	-70	-70	-70	-70	-70	-70
-2.67%	-35	-35	-35	-35	-35	-35	-35
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	35	35	35	35	35	35	35
5.33%	70	70	70	70	70	70	70
8.00%	106	106	106	106	106	106	106

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

68

공시일	2018-02-08
기준일	2018-02-07

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	1,099

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

376

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2018-02-08
기준일	2018-02-07

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	386

* 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	2018-02-08
기준일	2018-02-07

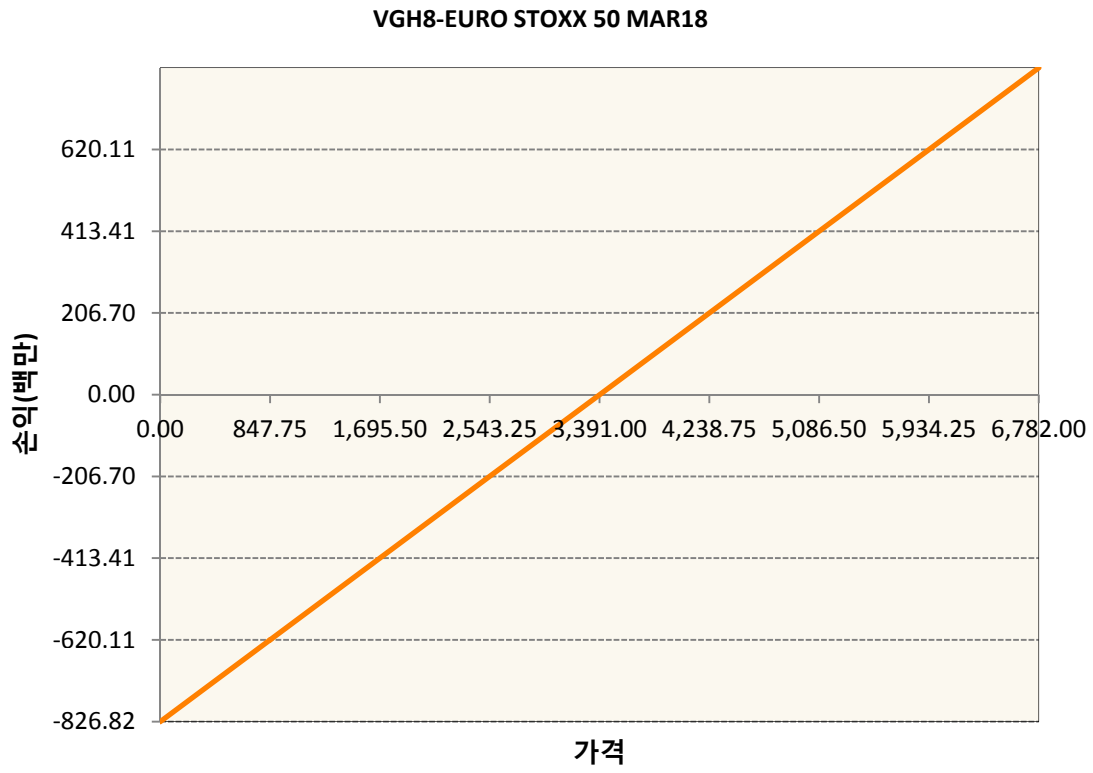
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	827	0	827	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGH8	EURO STOXX 50 MAR18	66

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

(단위:백만원)

37

공시일	2018-02-08
기준일	2018-02-07

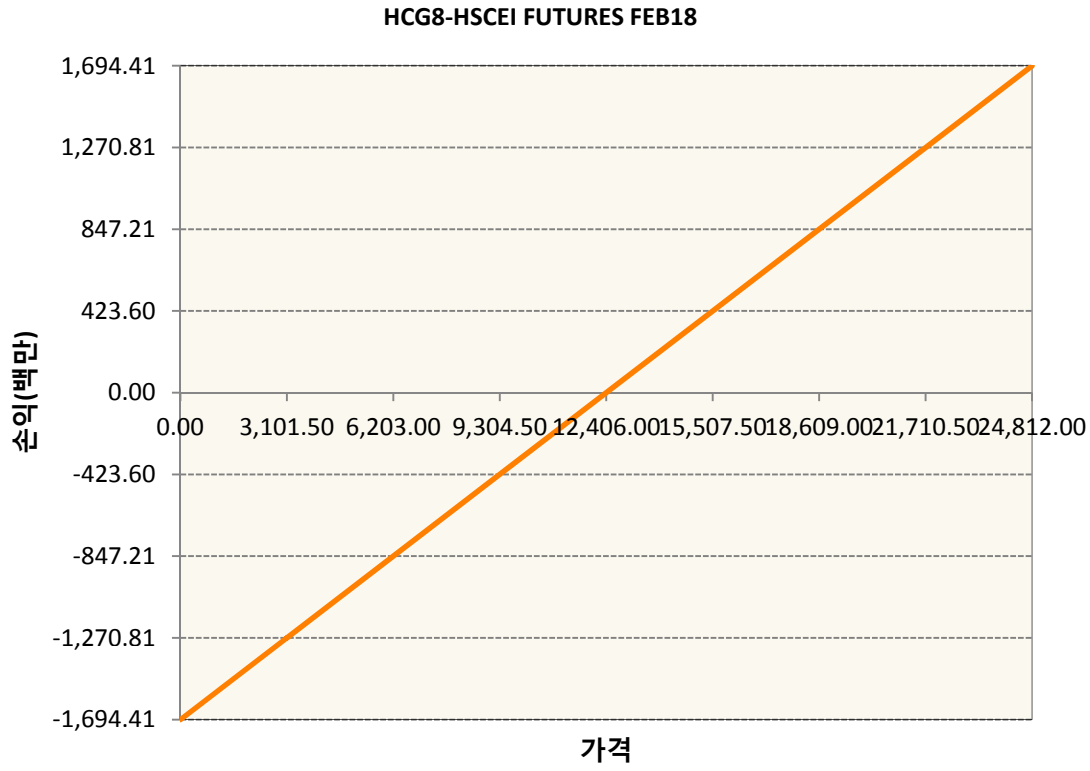
차이나인덱스모(주식-파생형)

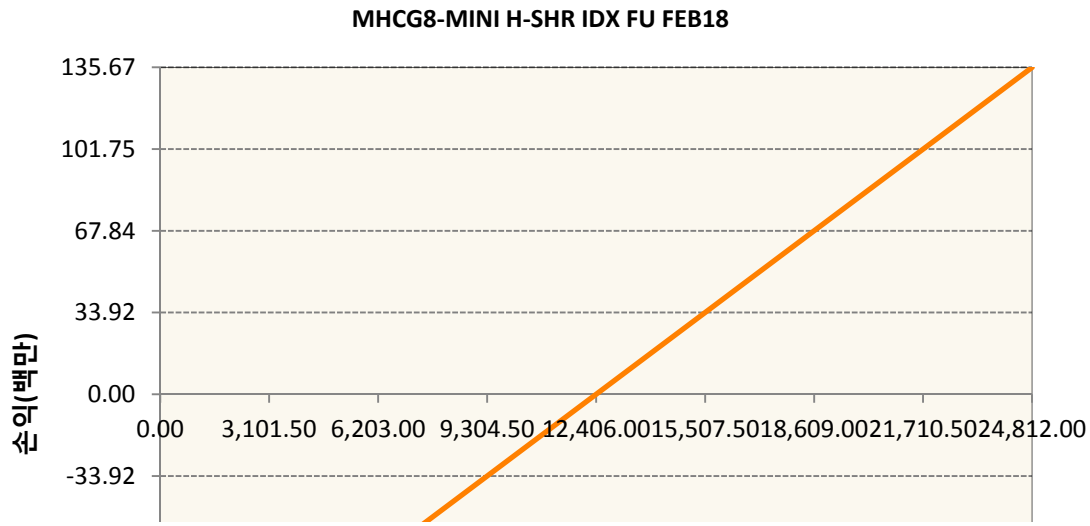
1. 계약금액

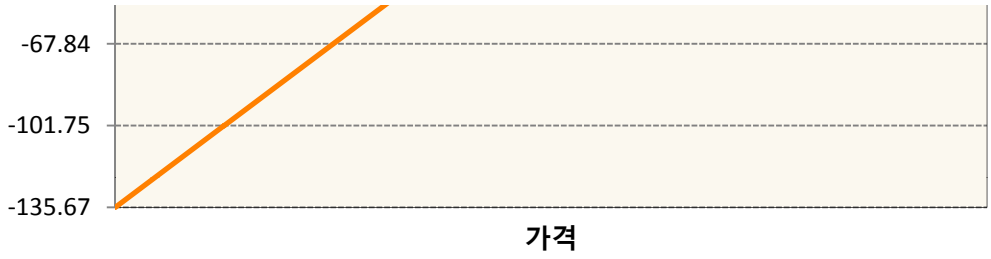
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,830	0	1,830	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCG8	HSCEI FUTURES FEB18	136
MHCG8	MINI H-SHR IDX FU FEB18	11

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	121

공시일	2018-02-08
기준일	2018-02-07

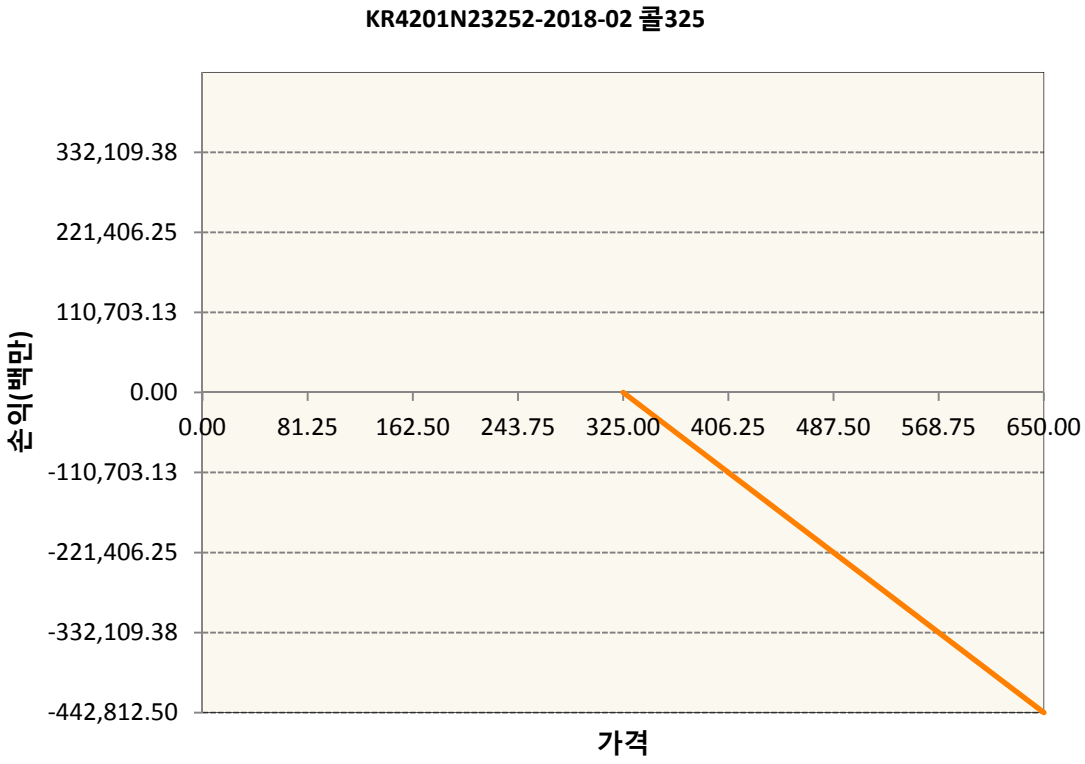
커버드콜모(주식혼합-파생형)

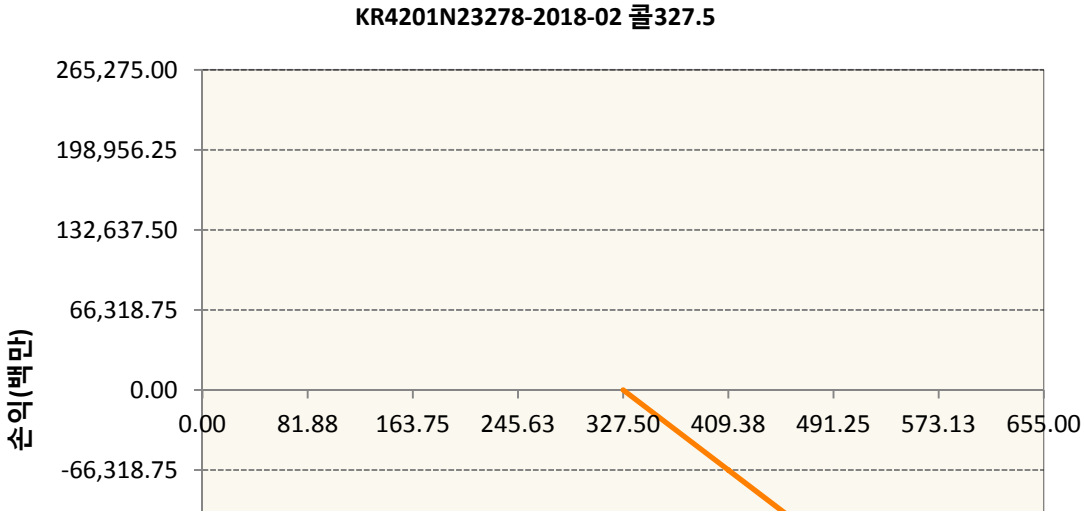
1. 계약금액

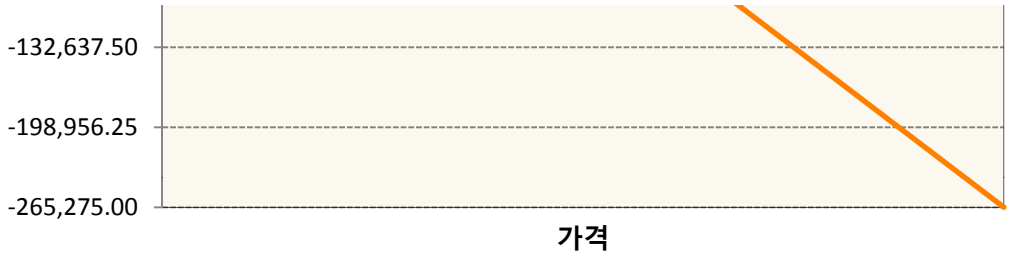
(단위:백만원)

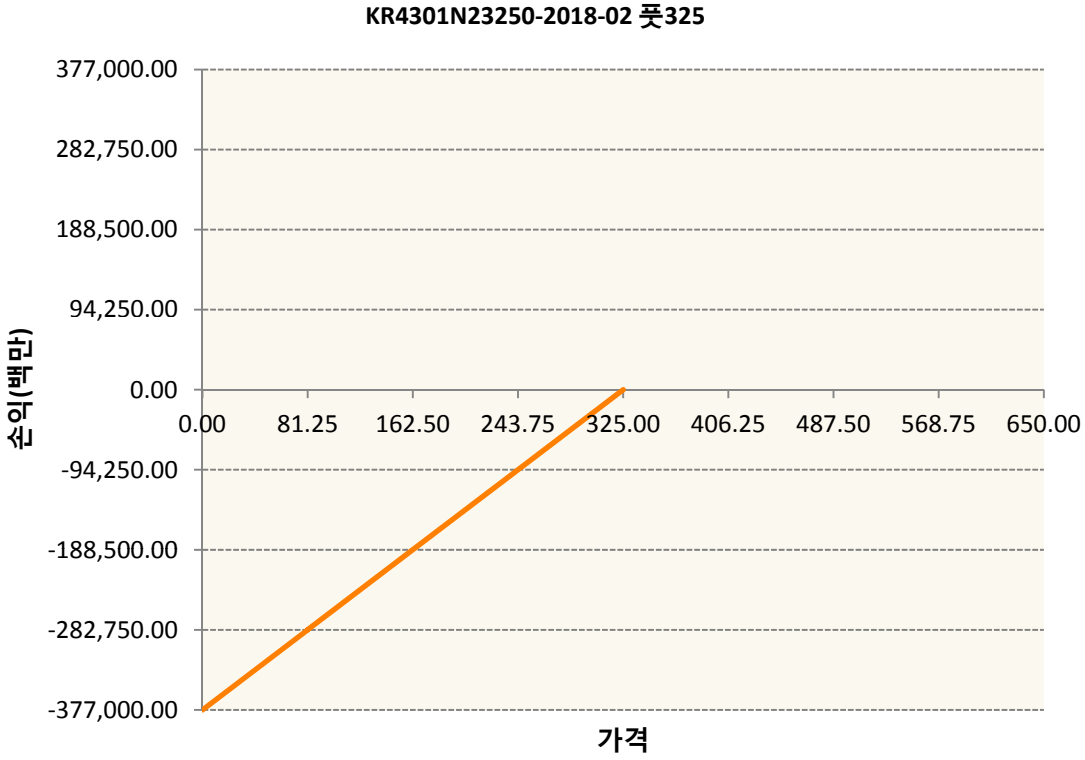
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	1,199,713	-1,199,713	장내

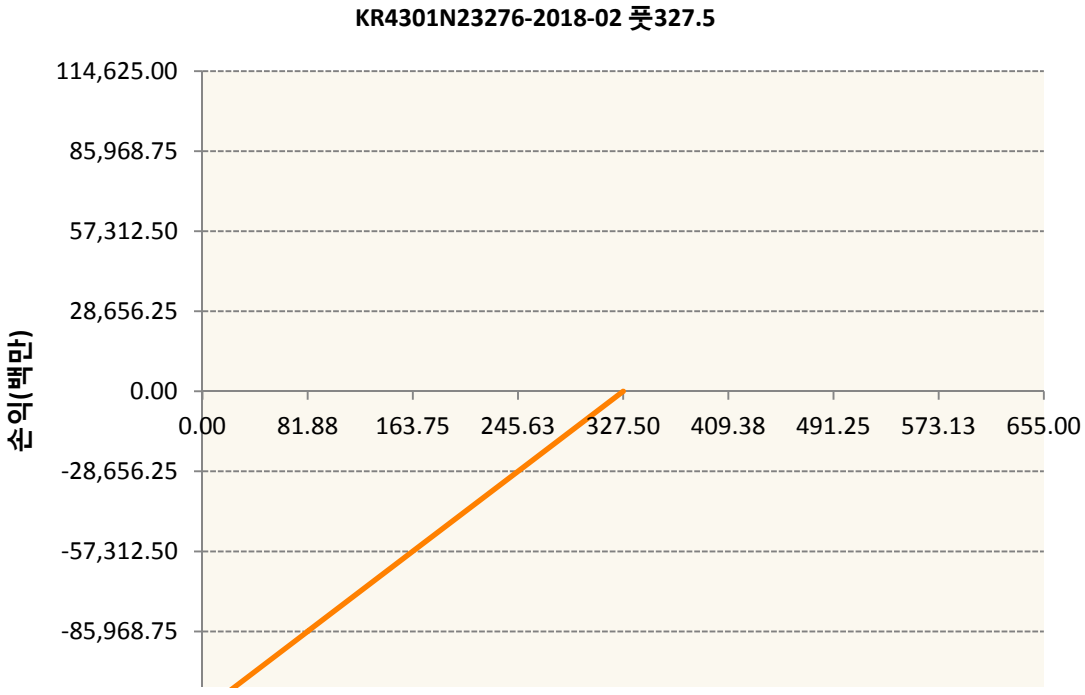
2. 만기시점의 손익구조






-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
114,625.00
85,968.75
57,312.50
28,656.25
0.00
-28,656.25
-57,312.50
-85,968.75
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							14,185
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1	1	1	1	1	1	1
-5.33%	1	1	1	1	1	1	1
-2.67%	1	1	1	1	1	1	1
0%	1	1	1	0	-2	-5	-10
2.67%	-60	-106	-166	-239	-325	-423	-530
5.33%	-3,586	-3,763	-3,946	-4,133	-4,323	-4,516	-4,710
8.00%	-14,067	-14,071	-14,079	-14,094	-14,116	-14,146	-14,185
KR4201N232 2018-02 콜327.5							6,535
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	0	0	0	0	0	0	0
-5.33%	0	0	0	0	0	0	0
-2.67%	0	0	0	0	0	0	0
0%	0	0	0	0	0	-1	-2
2.67%	-5	-11	-22	-39	-61	-90	-125
5.33%	-943	-1,067	-1,190	-1,314	-1,437	-1,561	-1,685
8.00%	-6,350	-6,363	-6,383	-6,411	-6,445	-6,487	-6,535
KR4301N232 2018-02 풋325							28,812
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-28,812	-28,812	-28,812	-28,812	-28,812	-28,812	-28,812
-5.33%	-19,208	-19,208	-19,208	-19,208	-19,208	-19,208	-19,208
-2.67%	-9,604	-9,604	-9,604	-9,604	-9,604	-9,604	-9,604
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	9,599	9,592	9,581	9,564	9,541	9,512	9,476
5.33%	16,509	16,415	16,317	16,214	16,108	15,999	15,887
8.00%	16,836	16,836	16,836	16,835	16,834	16,831	16,826
KR4301N232 2018-02 풋327.5							8,693
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-8,693	-8,693	-8,693	-8,693	-8,693	-8,693	-8,693
-5.33%	-5,795	-5,795	-5,795	-5,795	-5,795	-5,795	-5,795
-2.67%	-2,898	-2,898	-2,898	-2,898	-2,898	-2,898	-2,898
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	2,898	2,898	2,897	2,896	2,895	2,893	2,889

5.33%	5,523	5,485	5,447	5,409	5,371	5,333	5,295
8.00%	5,955	5,954	5,953	5,951	5,948	5,943	5,937

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

39,945

공시일	2018-02-08
기준일	2018-02-07

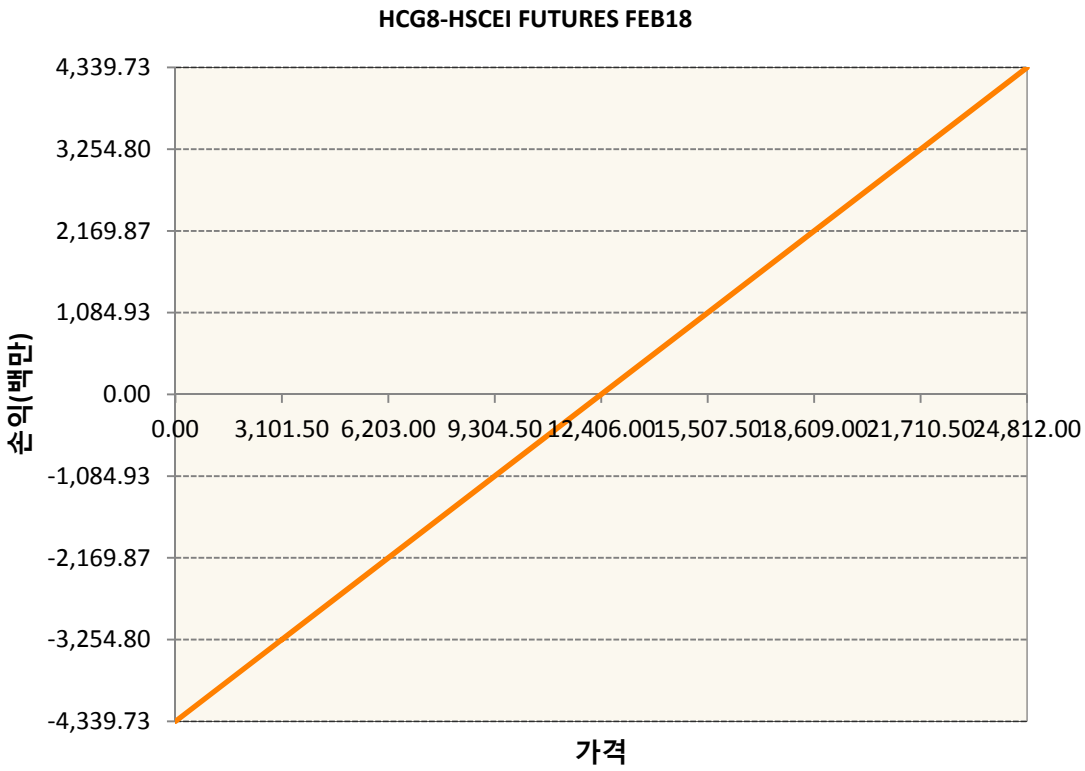
홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생

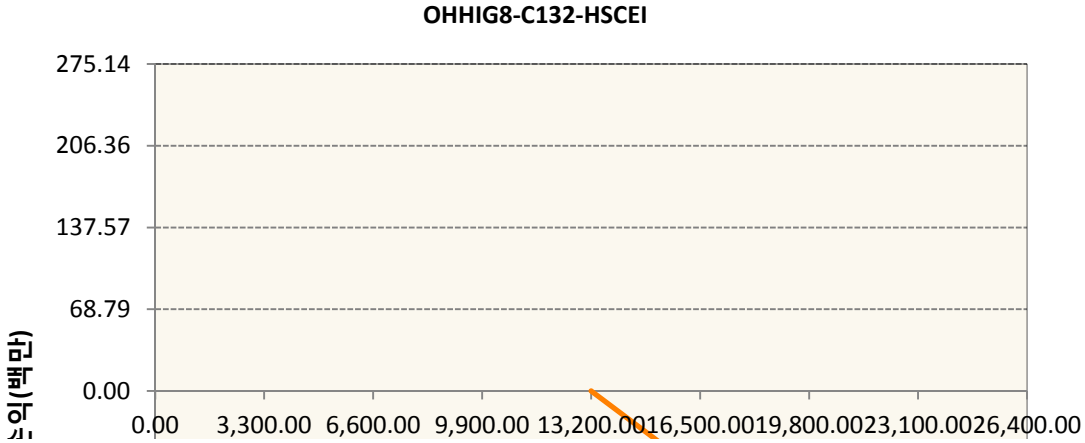
1. 계약금액

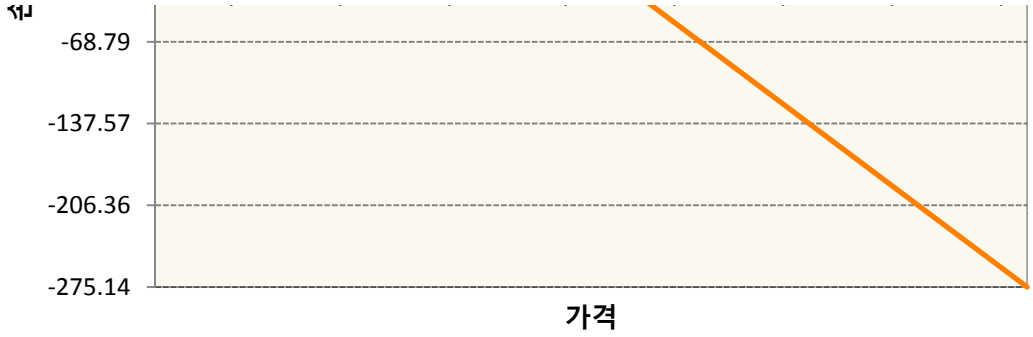
(단위:백만원)

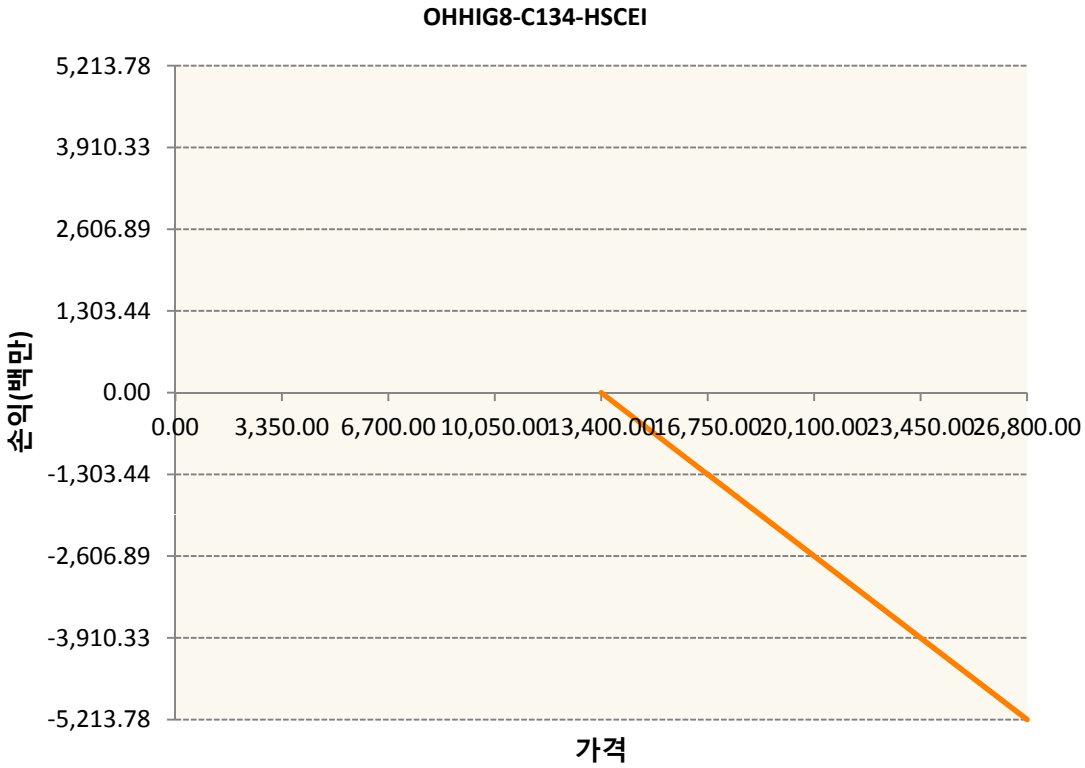
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	4,340	0	4,340	장내
누계	유가증권	옵션	0	10,978	-10,978	장내

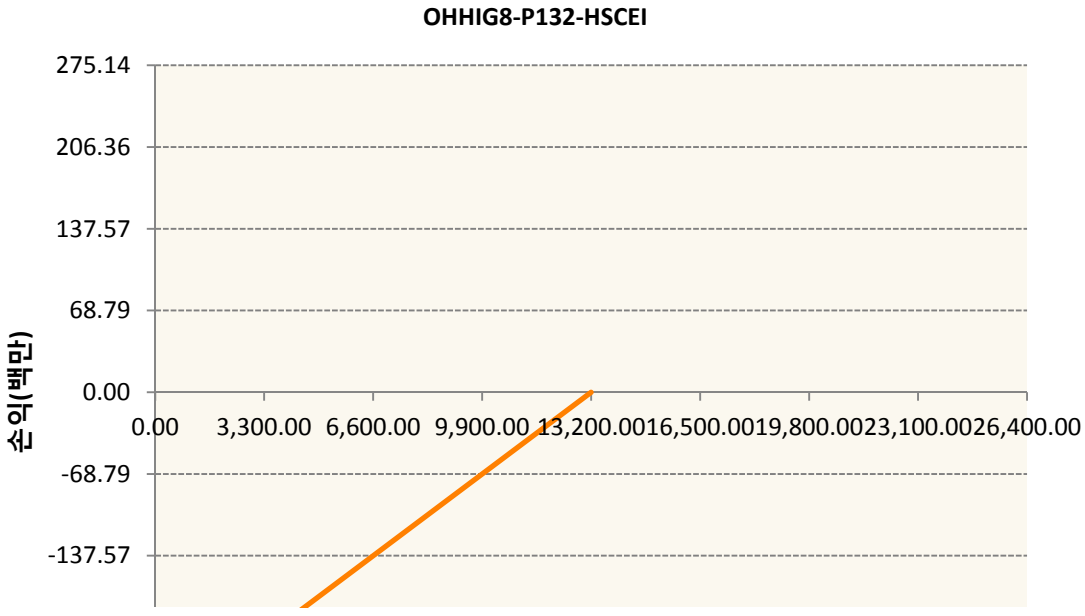
2. 만기시점의 손익구조

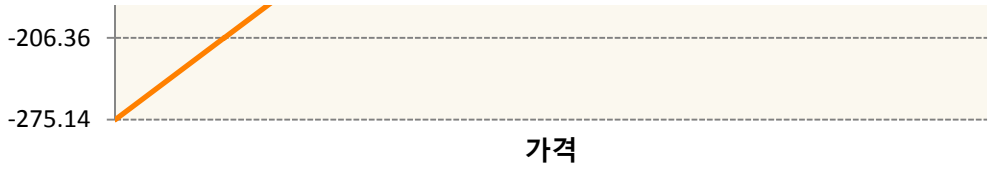


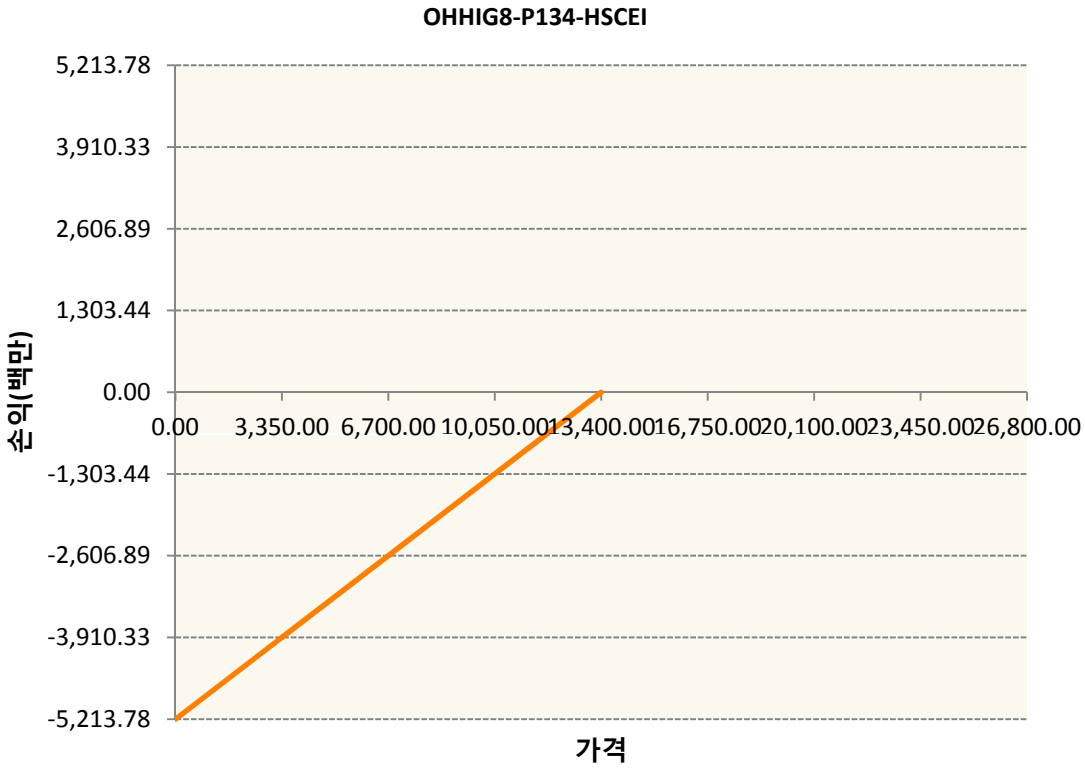



-68.79
-137.57
-206.36
-275.14
가격


OHHIG8-C134-HSCEI
5,213.78
3,910.33
2,606.89
1,303.44
0.00
-1,303.44
-2,606.89
-3,910.33
-5,213.78
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
275.14
206.36
137.57
68.79
0.00
-68.79
-137.57
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	347
OHHIG8-C1	HSCEI	22
OHHIG8-C1	HSCEI	417
OHHIG8-P1	HSCEI	22
OHHIG8-P1	HSCEI	417

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,018

공시일	2018-02-08
기준일	2018-02-07

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼

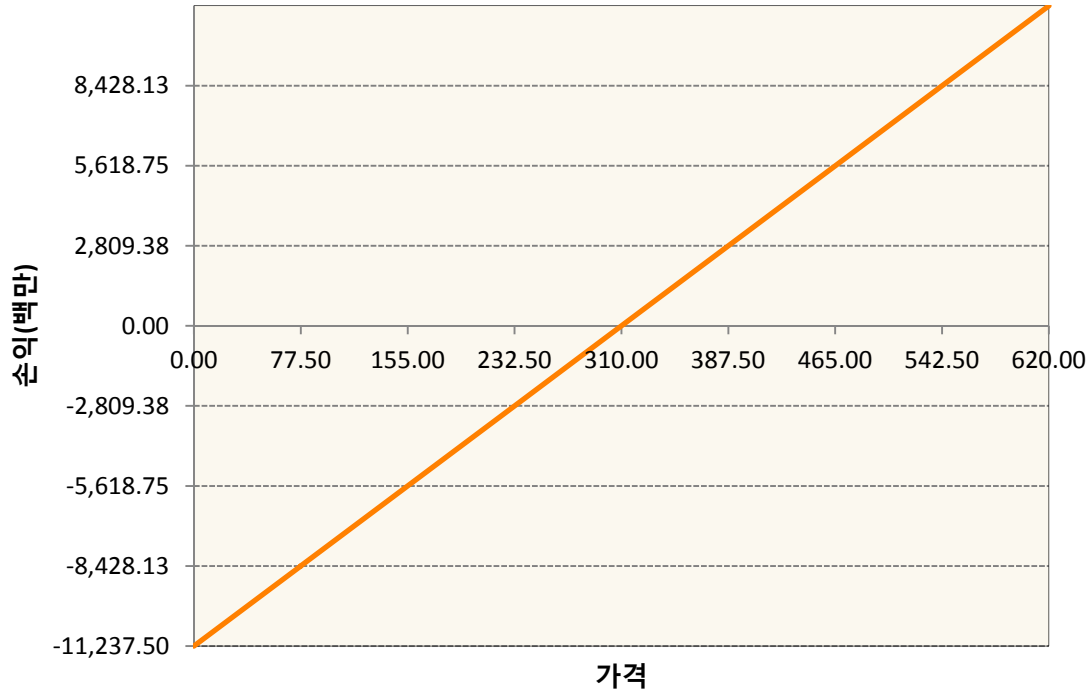
1. 계약금액

(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	11,238	0	11,238	장내
누계	유가증권	스왑	60,200	0	60,200	장외
누계	유가증권	옵션	0	60,250	-60,250	장내

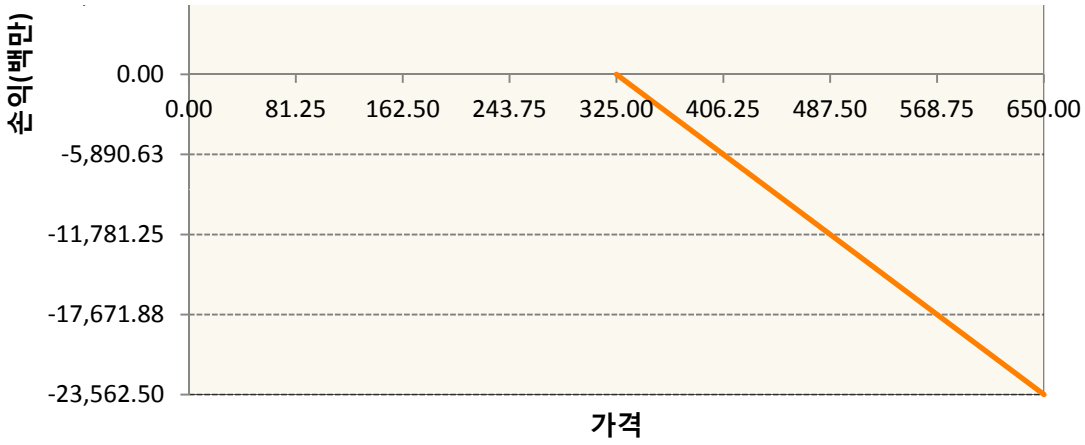
2. 만기시점의 손익구조

KR4101N30002-2018-03 코스피200지수선물

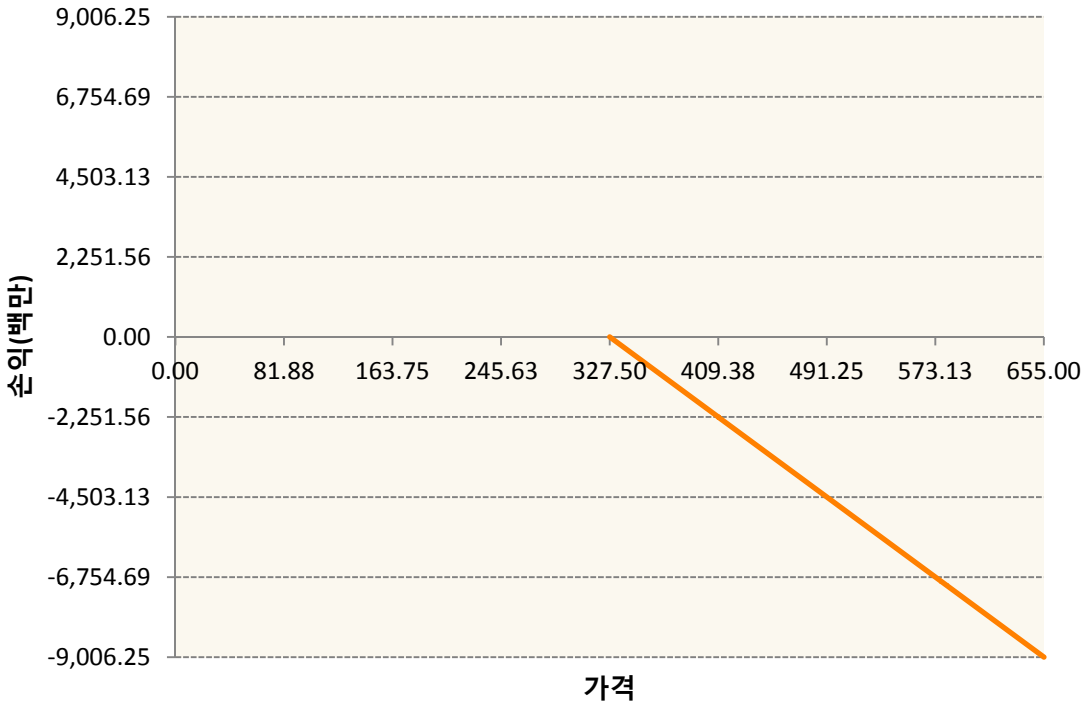


KR4201N23252-2018-02 콜325

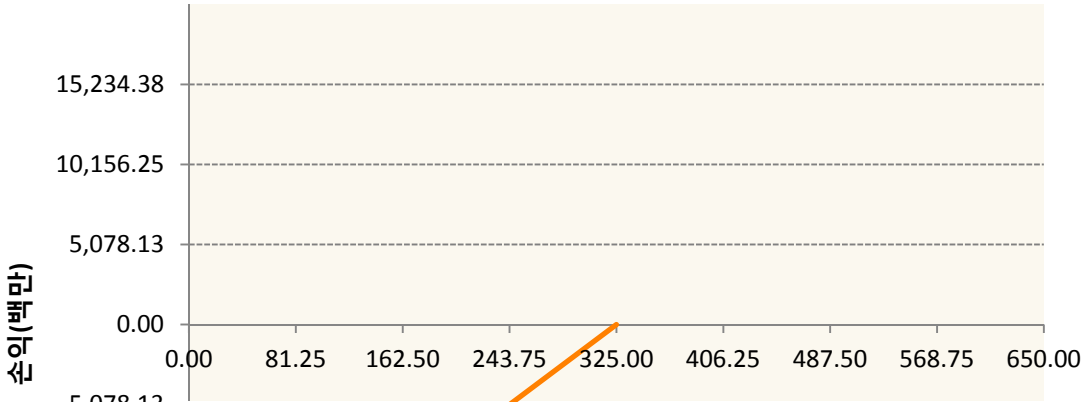




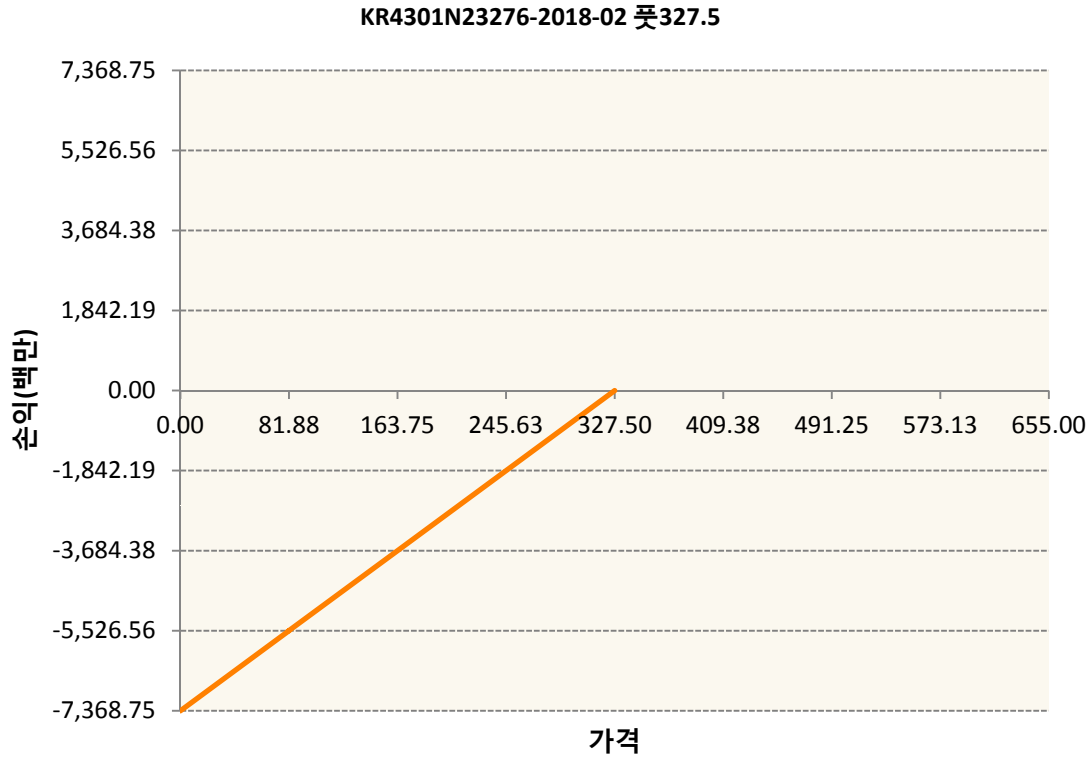
KR4201N23278-2018-02 콜327.5



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%	-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%	1,456	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				900

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-900	-900	-900	-900	-900	-900	-900
-5.33%	-600	-600	-600	-600	-600	-600	-600
-2.67%	-300	-300	-300	-300	-300	-300	-300
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	300	300	300	300	300	300	300
5.33%	600	600	600	600	600	600	600
8.00%	900	900	900	900	900	900	900
	KR4201N23:	2018-02	콜325				755

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	0	0	0	0	0	0	0
-5.33%	0	0	0	0	0	0	0
-2.67%	0	0	0	0	0	0	0
0%	0	0	0	0	0	0	-1
2.67%	-3	-6	-9	-13	-17	-22	-28
5.33%	-191	-200	-210	-220	-230	-240	-251
8.00%	-749	-749	-749	-750	-751	-753	-755
	KR4201N23:	2018-02	콜327.5				222

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	0	0	0	0	0	0	0
-5.33%	0	0	0	0	0	0	0
-2.67%	0	0	0	0	0	0	0
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	0	0	-1	-1	-2	-3	-4
5.33%	-32	-36	-40	-45	-49	-53	-57
8.00%	-216	-216	-217	-218	-219	-220	-222
	KR4301N23:	2018-02	풋325				1,552

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,552	-1,552	-1,552	-1,552	-1,552	-1,552	-1,552
-5.33%	-1,035	-1,035	-1,035	-1,035	-1,035	-1,035	-1,035

-2.67%	-517	-517	-517	-517	-517	-517	-517
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	517	517	516	515	514	512	511
5.33%	889	884	879	874	868	862	856
8.00%	907	907	907	907	907	907	907
	KR4301N232 2018-02 풋327.5						559
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-559	-559	-559	-559	-559	-559	-559
-5.33%	-373	-373	-373	-373	-373	-373	-373
-2.67%	-186	-186	-186	-186	-186	-186	-186
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	186	186	186	186	186	186	186
5.33%	355	353	350	348	345	343	340
8.00%	383	383	383	383	382	382	382

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

7,540

공시일	2018-02-08
기준일	2018-02-07

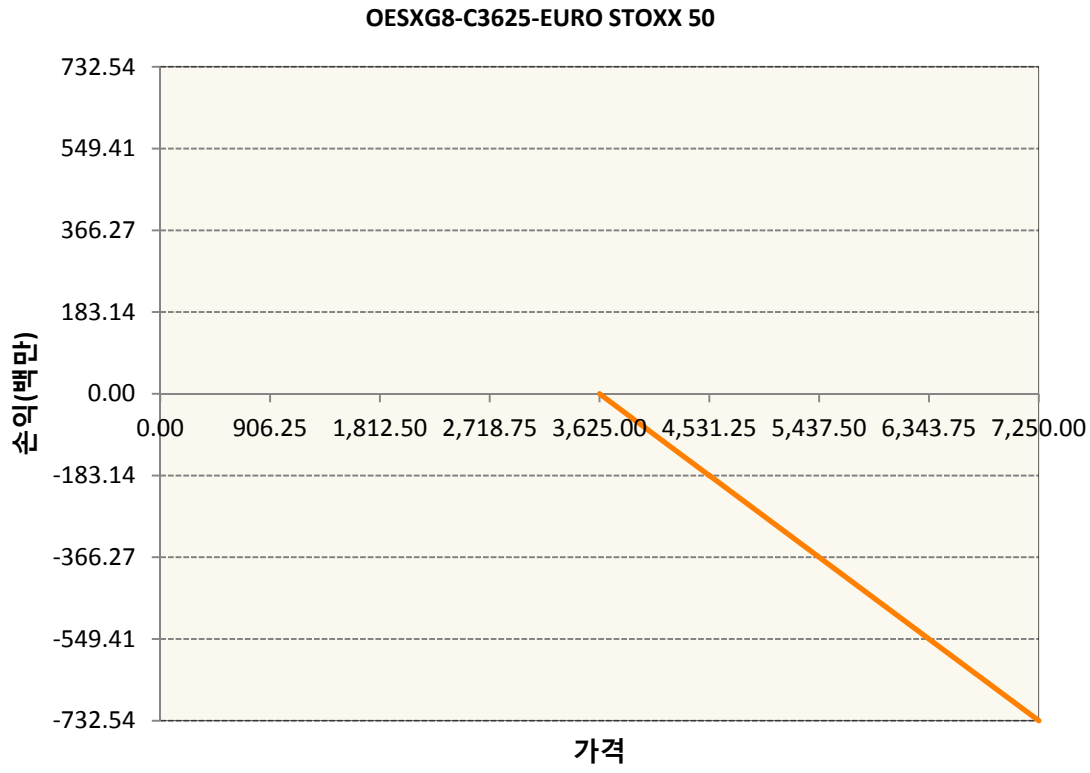
유로커버드콜모(주식혼합-파생형

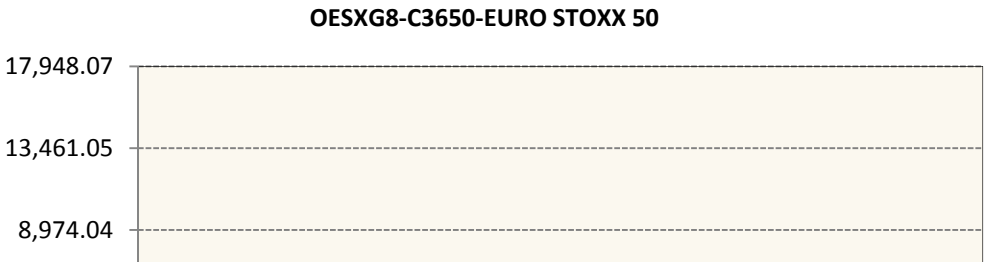
1. 계약금액

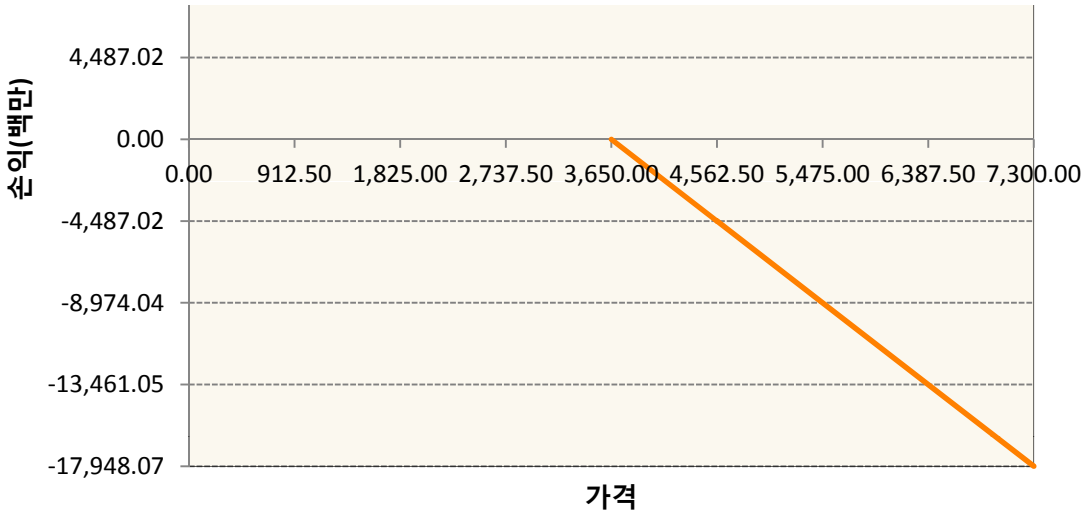
(단위:백만원)

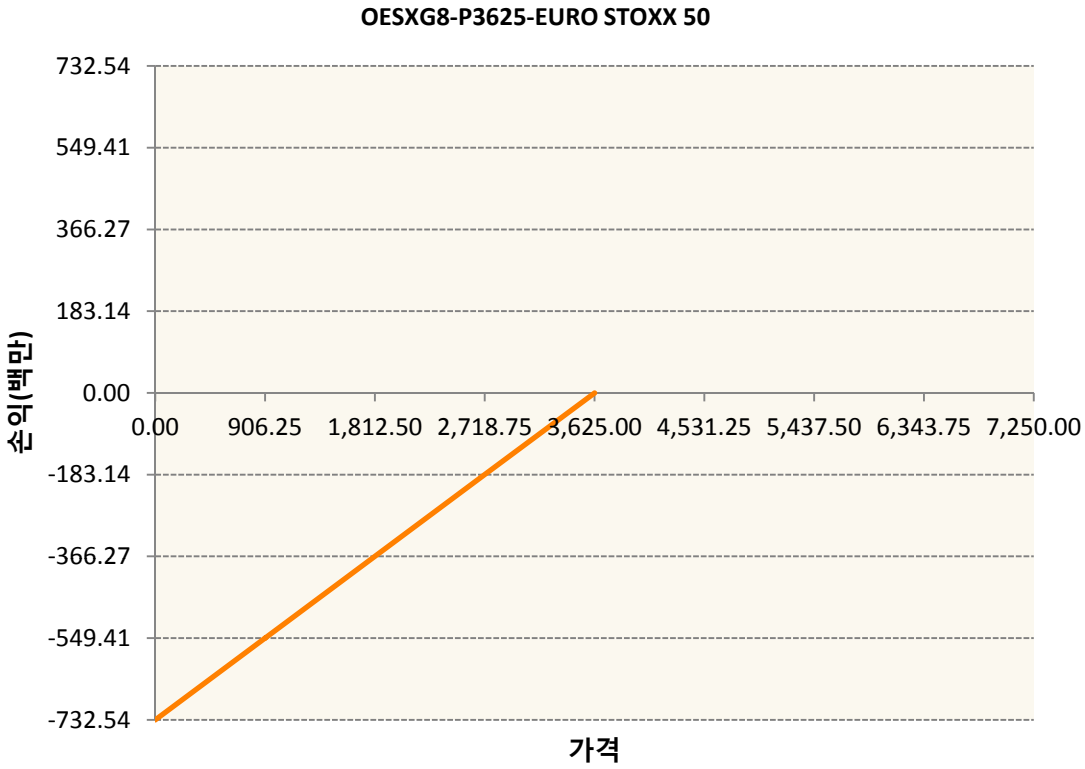
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	8,795	0	8,795	
누계	유가증권	스왑	101,042	0	101,042	장외
누계	유가증권	옵션	0	37,361	-37,361	장내
누계	지수	스왑	53,890	0	53,890	장외

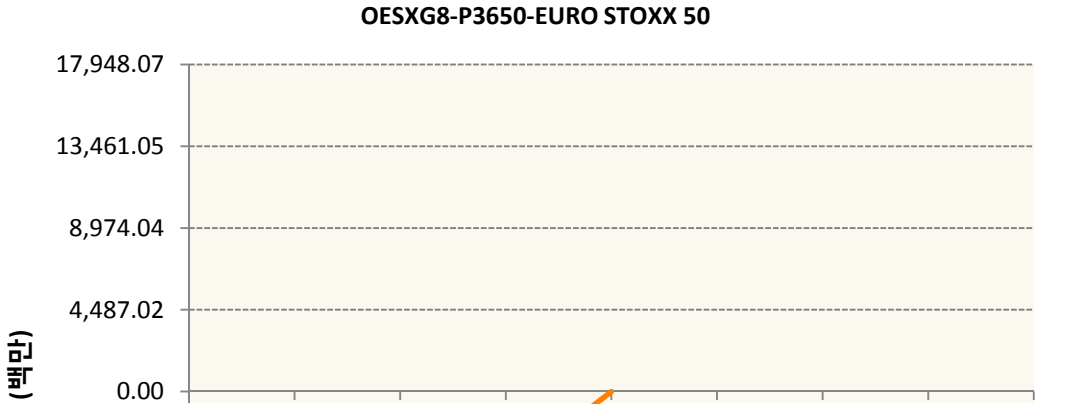
2. 만기시점의 손익구조

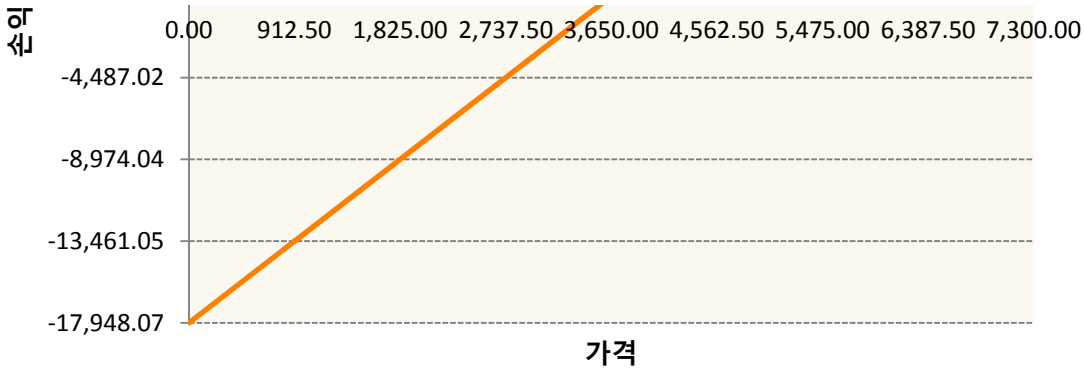


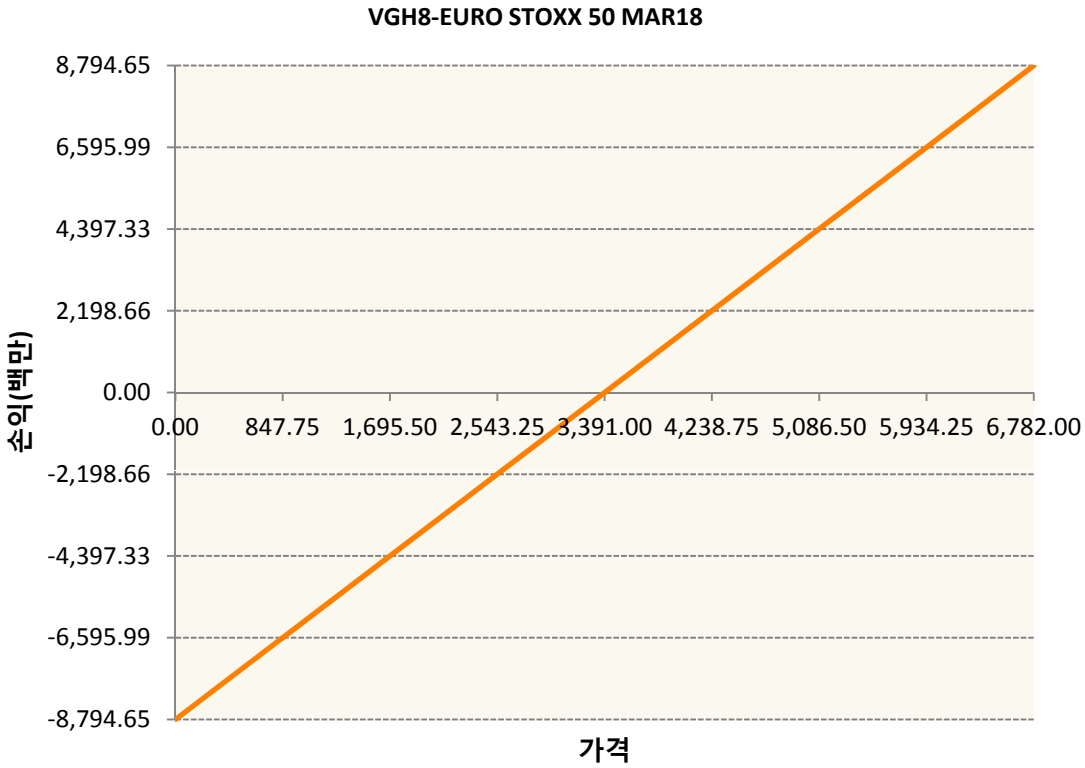



4,487.02
0.00
-4,487.02
-8,974.04
-13,461.05
-17,948.07
0.00
912.50
1,825.00
2,737.50
3,650.00
4,562.50
5,475.00
6,387.50
7,300.00
손익(백만)
가격


OESXG8-P3625-EURO STOXX 50
732.54
549.41
366.27
183.14
0.00
-183.14
-366.27
-549.41
-732.54
0.00
906.25
1,812.50
2,718.75
3,625.00
4,531.25
5,437.50
6,343.75
7,250.00
손익(백만)
가격


OESXG8-P3650-EURO STOXX 50
17,948.07
13,461.05
8,974.04
4,487.02
0.00
(백만)





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)	(단위:백만원)
260105SGPX SG EURO Covered CALL STRATEGY - 994.569	258
260105SQPX SG EURO Covered CALL STRATEGY	485
OESXG8-C3(EURO STOXX 50	59
OESXG8-C3(EURO STOXX 50	1,436
OESXG8-P3(EURO STOXX 50	59
OESXG8-P3(EURO STOXX 50	1,436
VGH8 EURO STOXX 50 MAR18	704

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

2,542

공시일	2018-02-08
기준일	2018-02-07

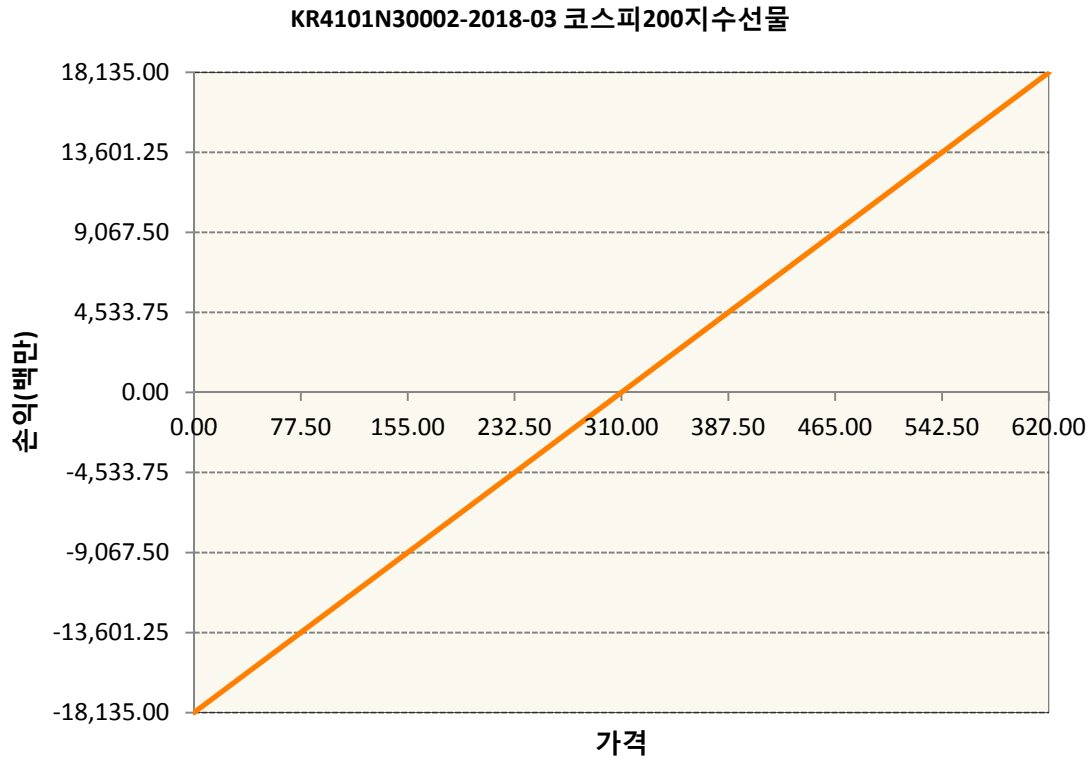
ETF스마트레버리지목표전환형8호

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	18,135	0	18,135	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101N30(2018-03 코스피200지수선물							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

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

930

공시일	2018-02-08
기준일	2018-02-07

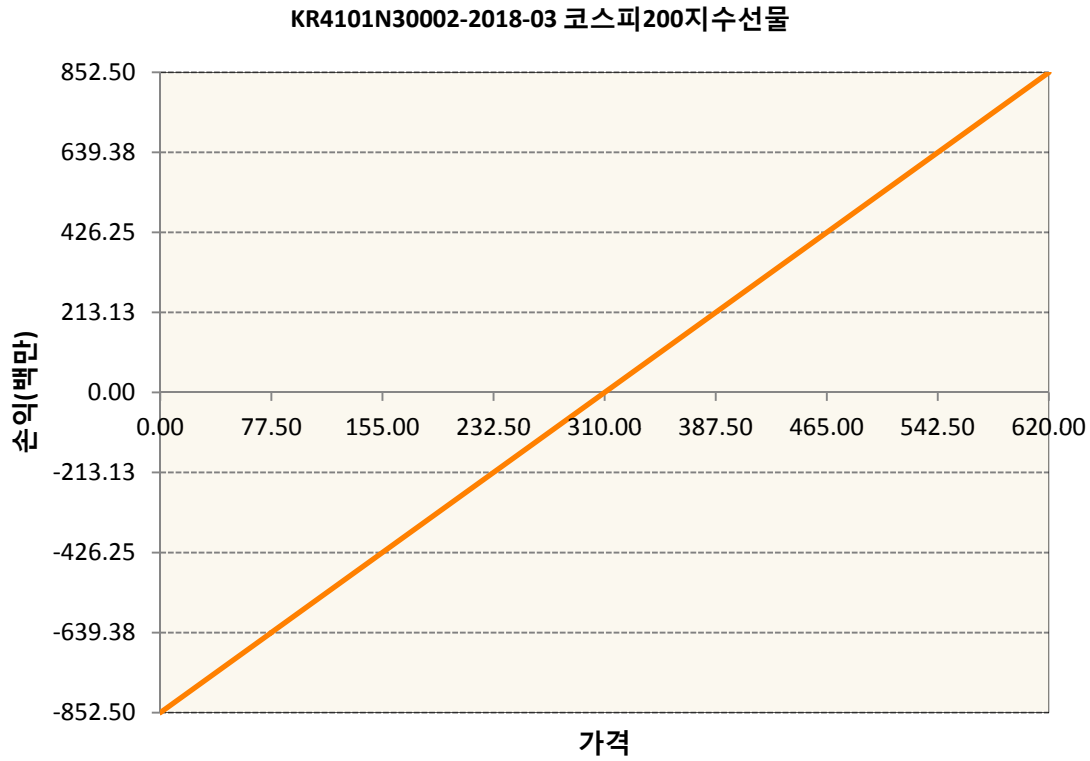
ETF스마트레버리지목표전환형9호

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	310	0	310	장내
누계	유가증권	선물	853	0	853	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101N30(2018-03 코스피200지수선물							68
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-68	-68	-68	-68	-68	-68	-68
-5.33%	-46	-46	-46	-46	-46	-46	-46
-2.67%	-23	-23	-23	-23	-23	-23	-23
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	23	23	23	23	23	23	23
5.33%	46	46	46	46	46	46	46
8.00%	68	68	68	68	68	68	68

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

44

공시일	2018-02-08
기준일	2018-02-07

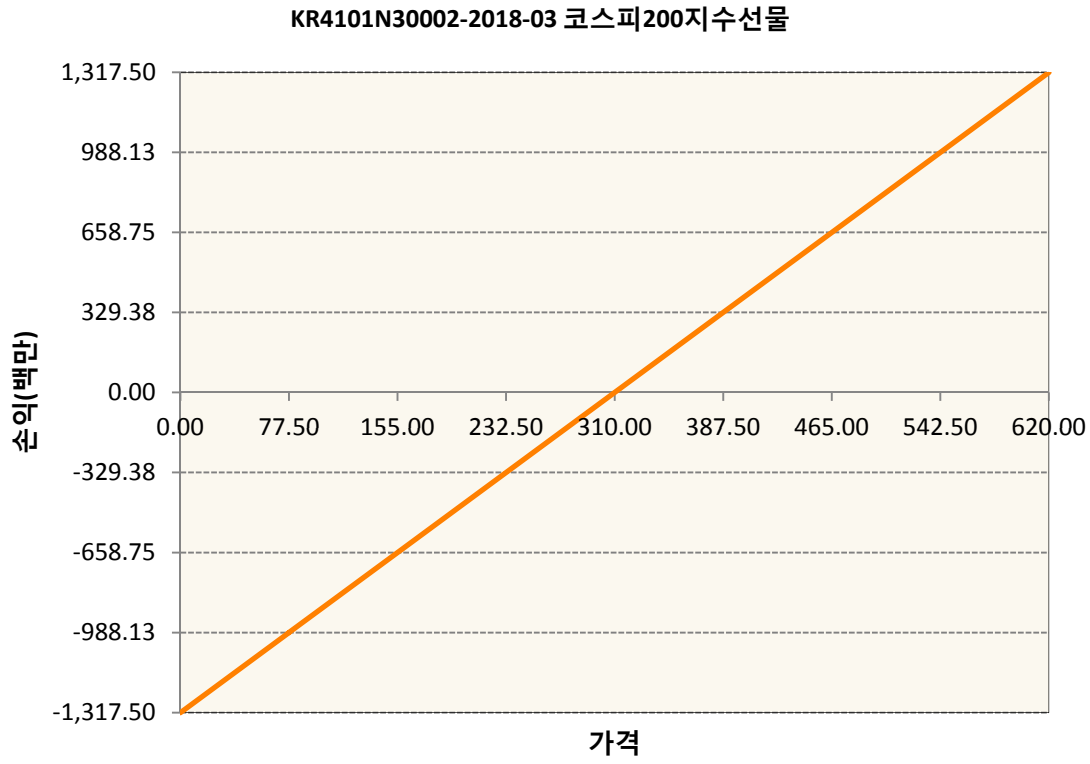
ETF스마트레버리지목표전환형10

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	233	0	233	장내
누계	유가증권	선물	1,318	0	1,318	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101N30(2018-03 코스피200지수선물							106
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-106	-106	-106	-106	-106	-106	-106
-5.33%	-70	-70	-70	-70	-70	-70	-70
-2.67%	-35	-35	-35	-35	-35	-35	-35
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	35	35	35	35	35	35	35
5.33%	70	70	70	70	70	70	70
8.00%	106	106	106	106	106	106	106

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

68

공시일	2018-02-08
기준일	2018-02-07

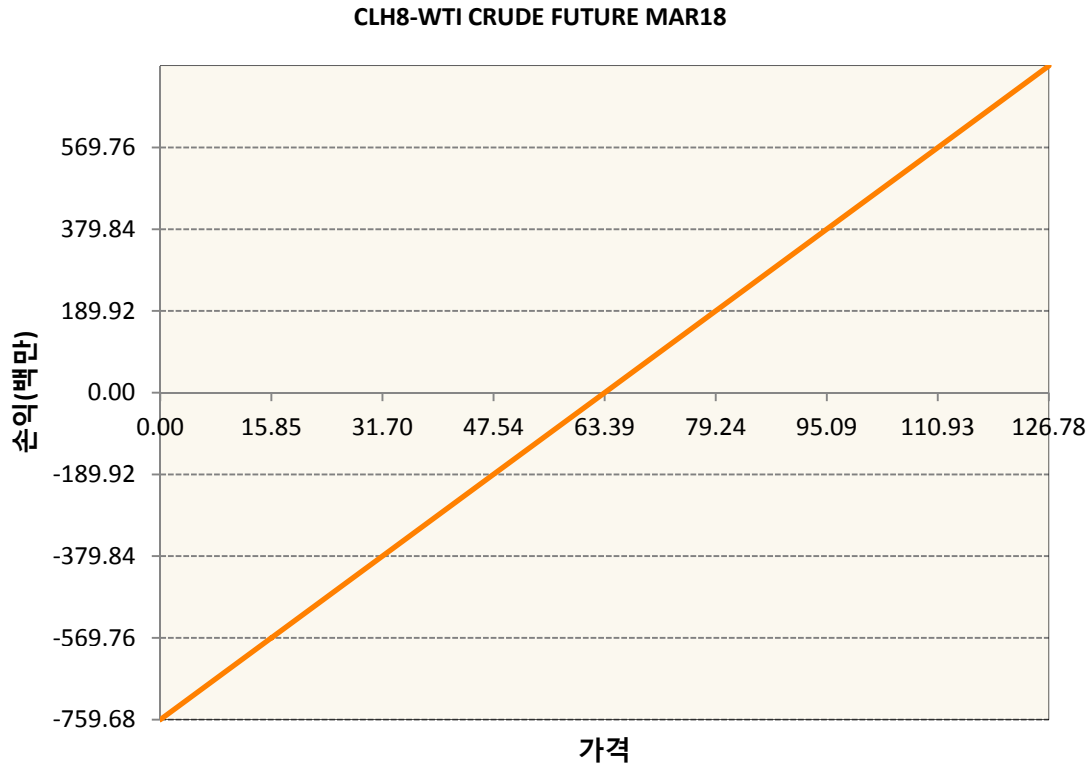
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

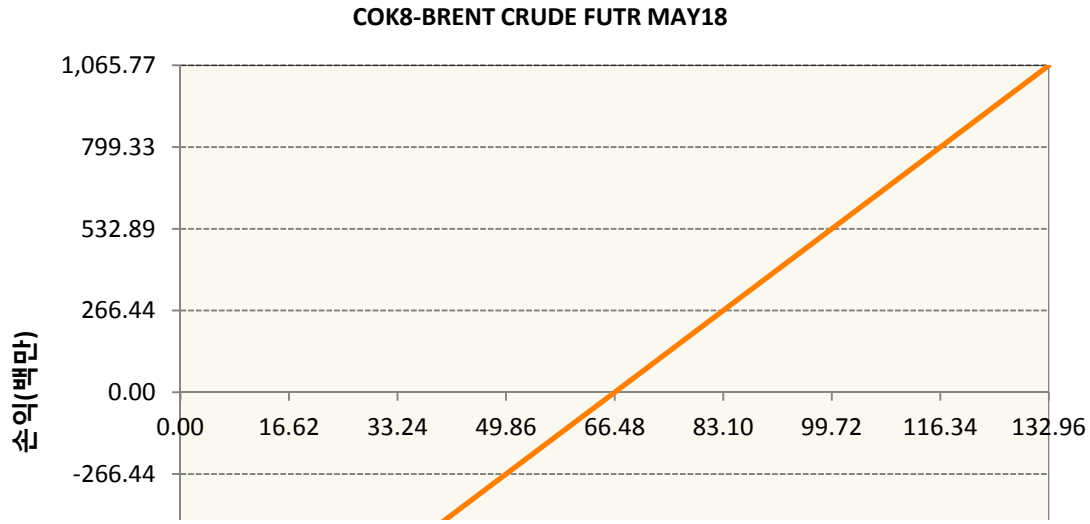
1. 계약금액

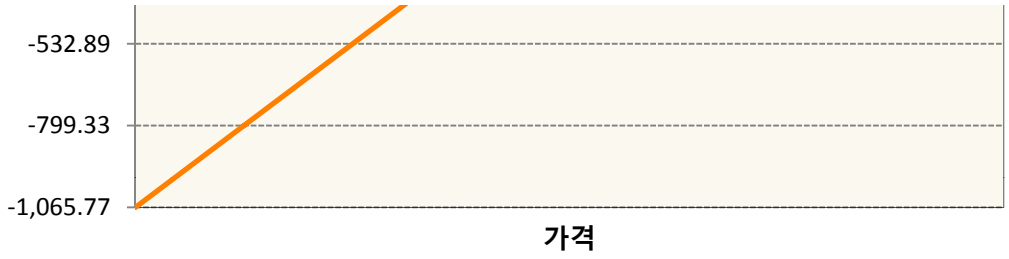
(단위:백만원)

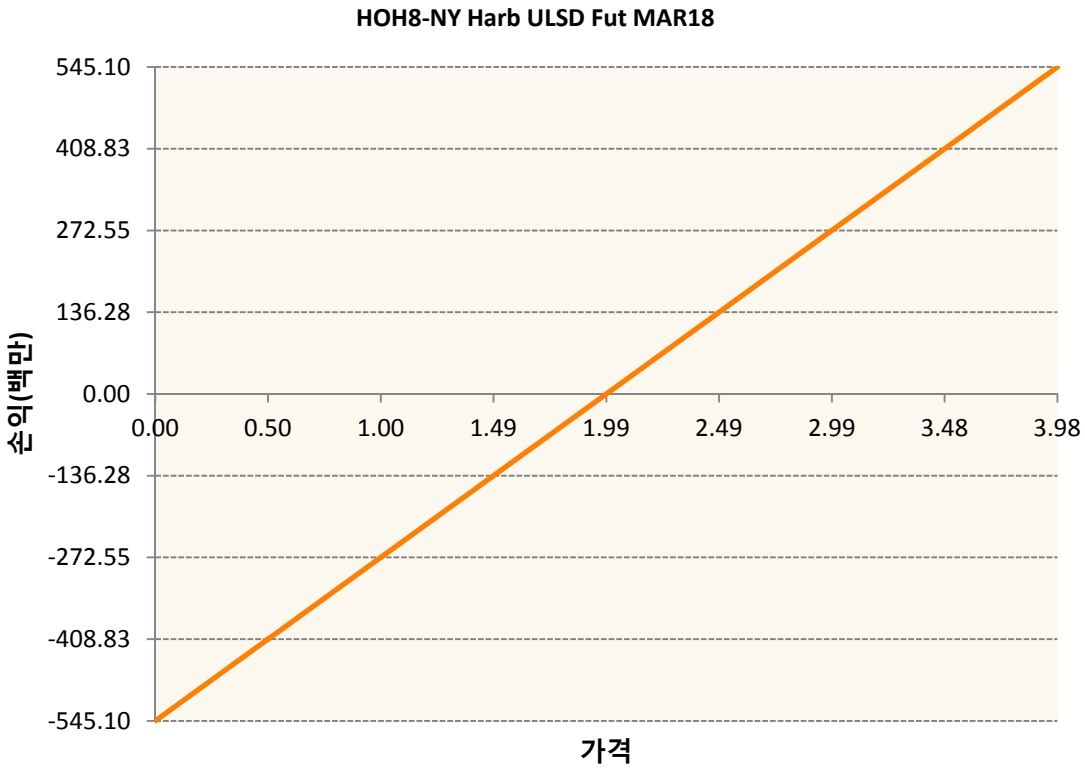
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	4,027	868	3,159	

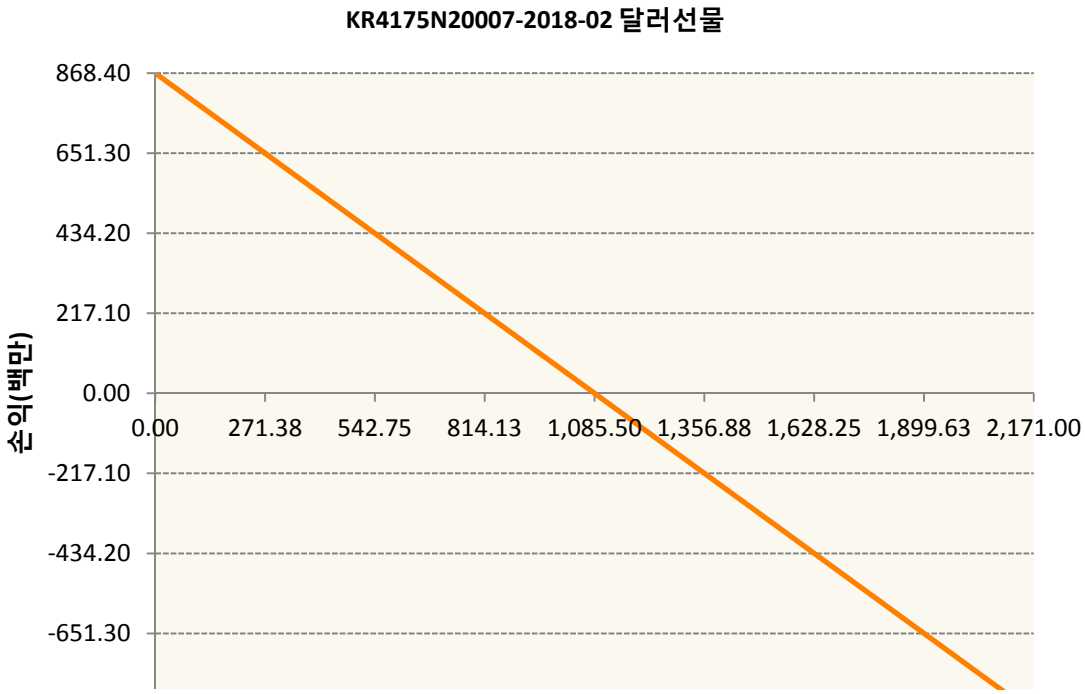
2. 만기시점의 손익구조

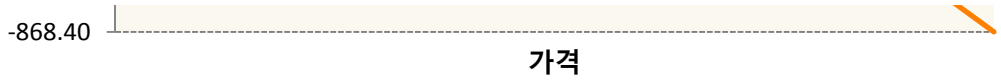


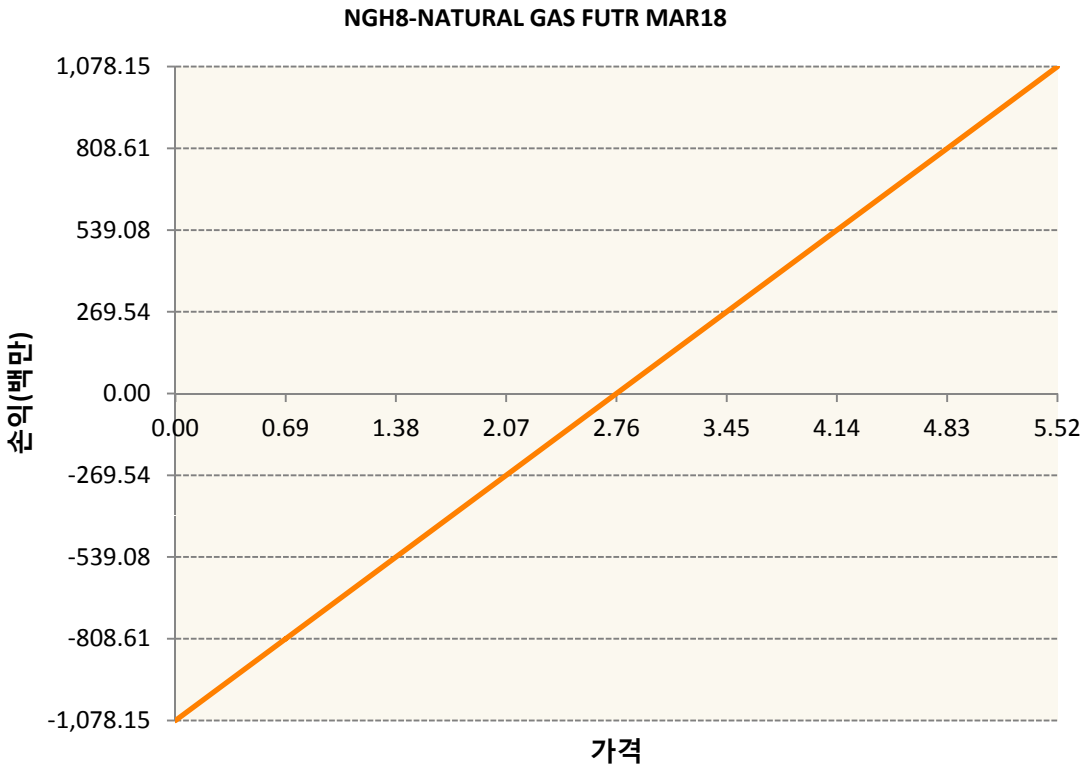


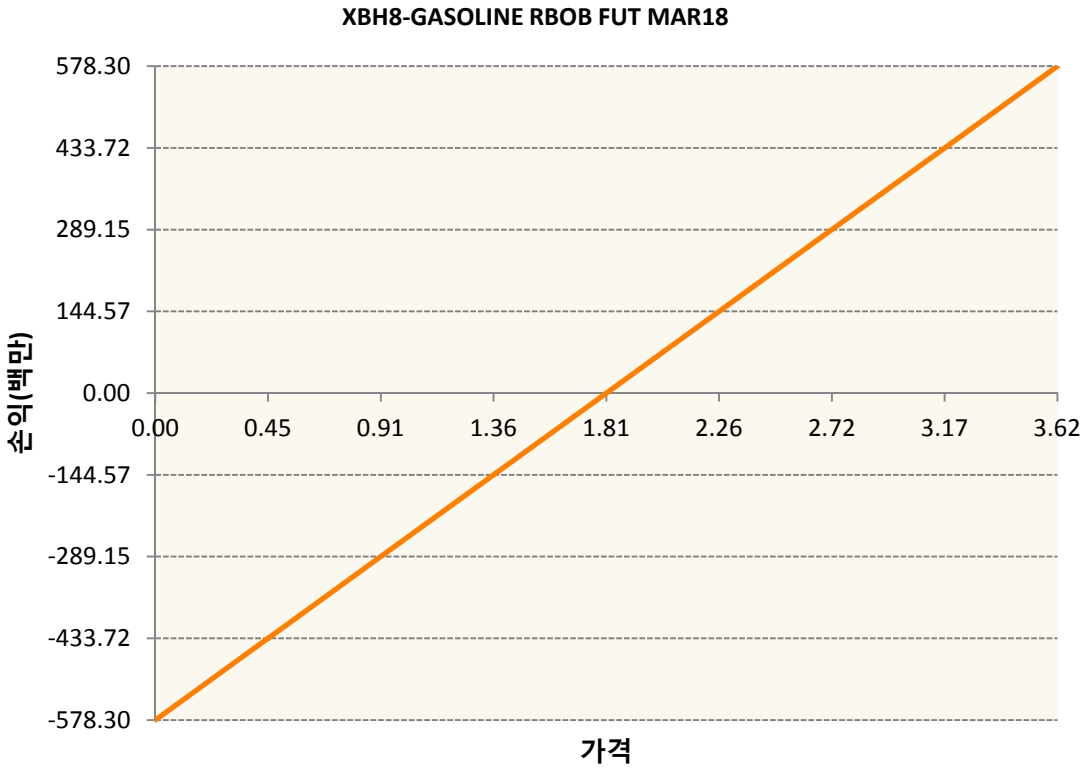

-532.89
-799.33
-1,065.77
가격


HOH8-NY Harb ULSD Fut MAR18
545.10
408.83
272.55
136.28
0.00
-136.28
-272.55
-408.83
-545.10
0.00
0.50
1.00
1.49
1.99
2.49
2.99
3.48
3.98
손익(백만)
가격


KR4175N20007-2018-02 달러선물
868.40
651.30
434.20
217.10
0.00
-217.10
-434.20
-651.30
0.00
271.38
542.75
814.13
1,085.50
1,356.88
1,628.25
1,899.63
2,171.00
손익(백만)


-868.40
가격


NGH8-NATURAL GAS FUTR MAR18
1,078.15
808.61
539.08
269.54
0.00
-269.54
-539.08
-808.61
-1,078.15
0.00
0.69
1.38
2.07
2.76
3.45
4.14
4.83
5.52
손익(백만)
가격


XBH8-GASOLINE RBOB FUT MAR18
578.30
433.72
289.15
144.57
0.00
-144.57
-289.15
-433.72
-578.30
0.00
0.45
0.91
1.36
1.81
2.26
2.72
3.17
3.62
손익(백만)
가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLH8	WTI CRUDE FUTURE MAR18	61
COK8	BRENT CRUDE FUTR MAY18	85
HOH8	NY Harb ULSD Fut MAR18	44
KR4175N20(	2018-02 달러선물	69
NGH8	NATURAL GAS FUTR MAR18	86
XBH8	GASOLINE RBOB FUT MAR18	46

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

548

공시일	2018-02-08
기준일	2018-02-07

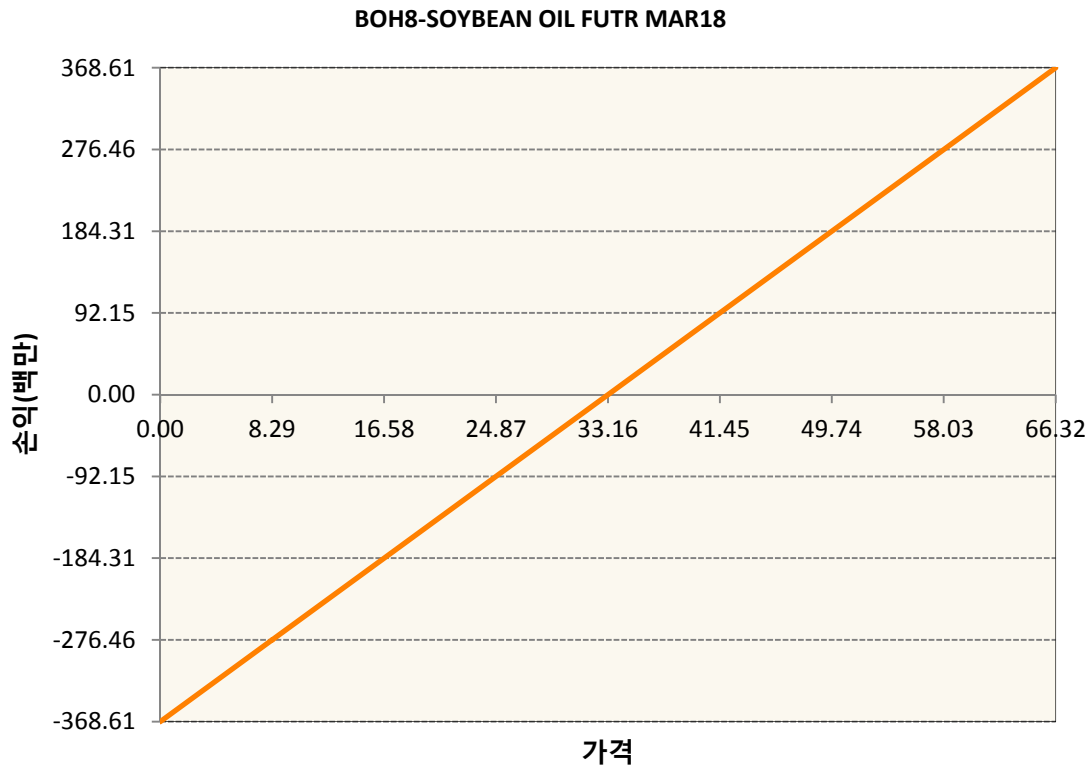
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

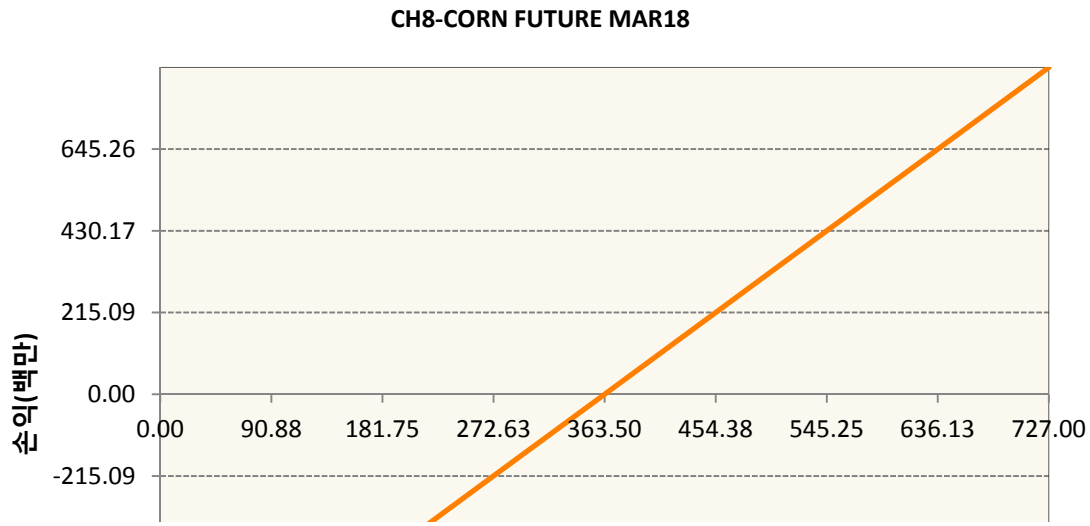
1. 계약금액

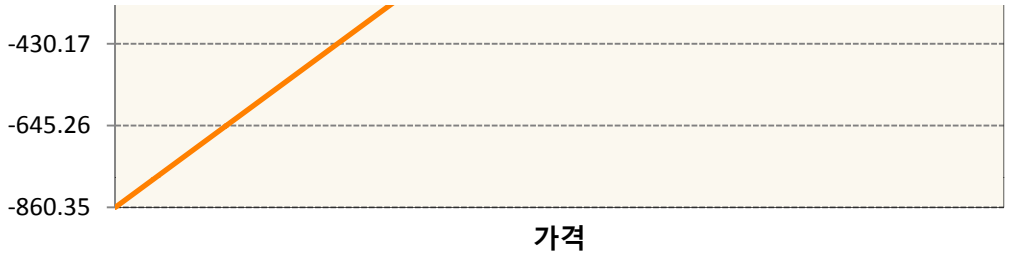
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	4,072	326	3,747	

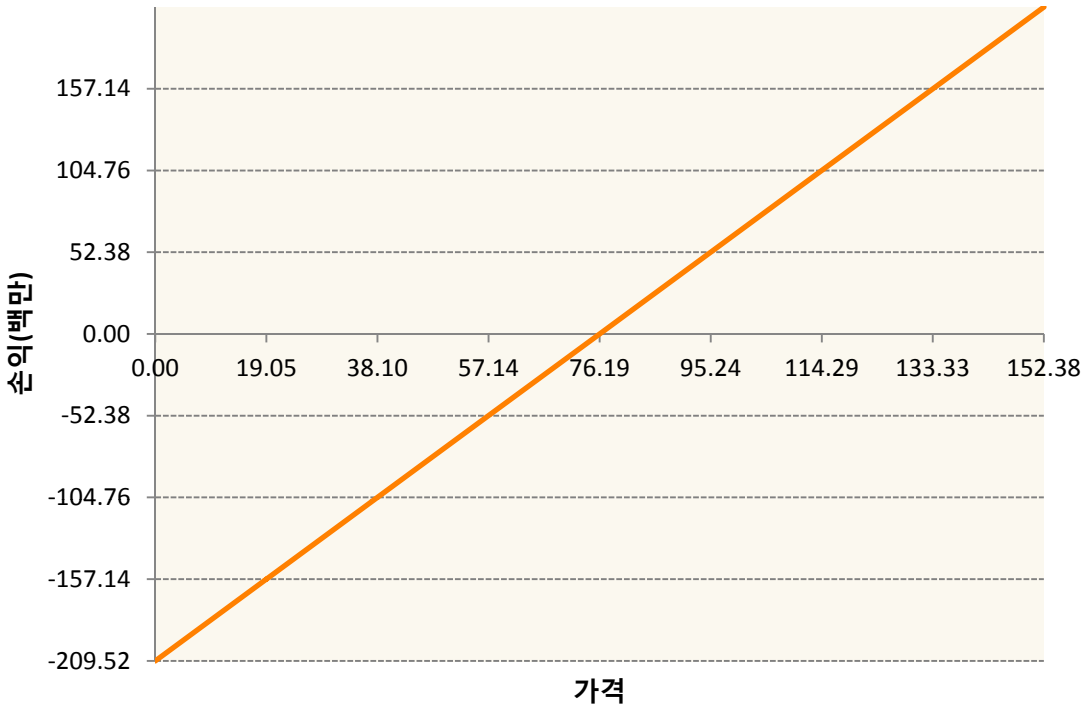
2. 만기시점의 손익구조



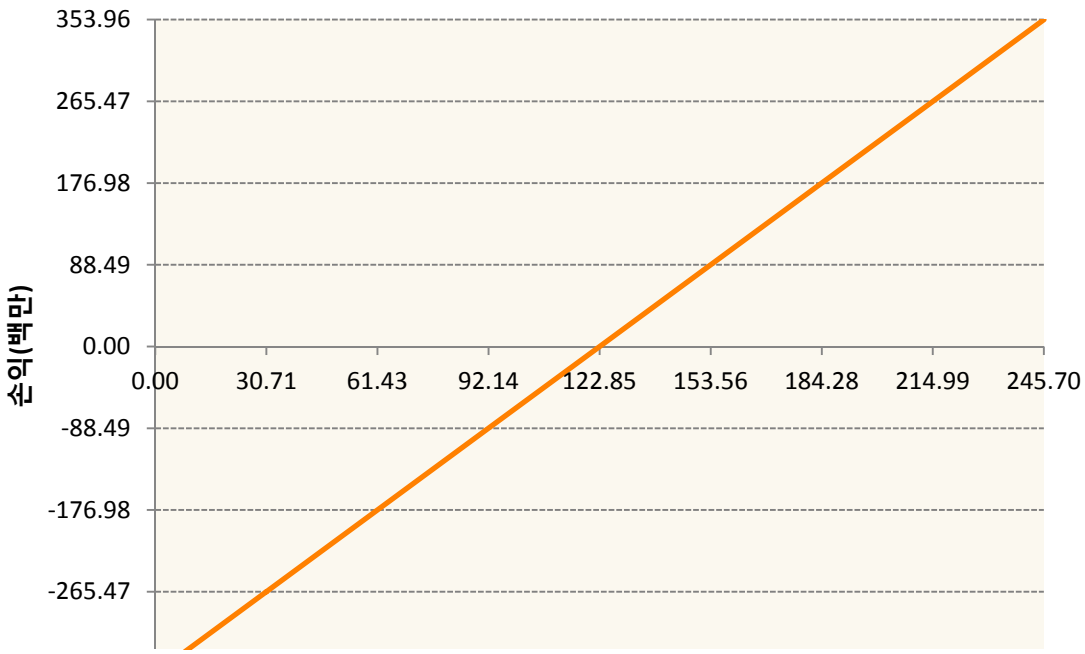


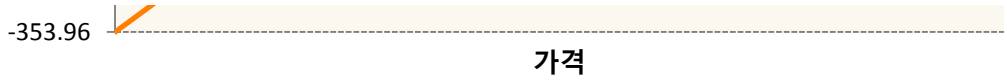


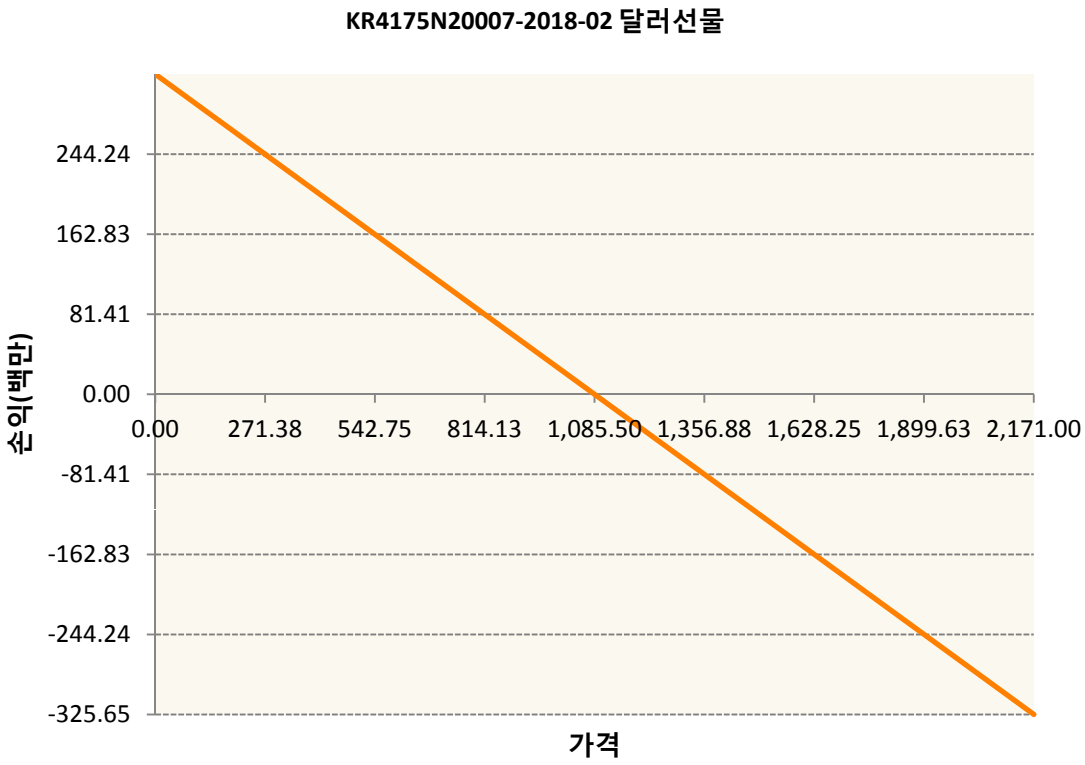
CTH8-COTTON NO.2 FUTR MAR18

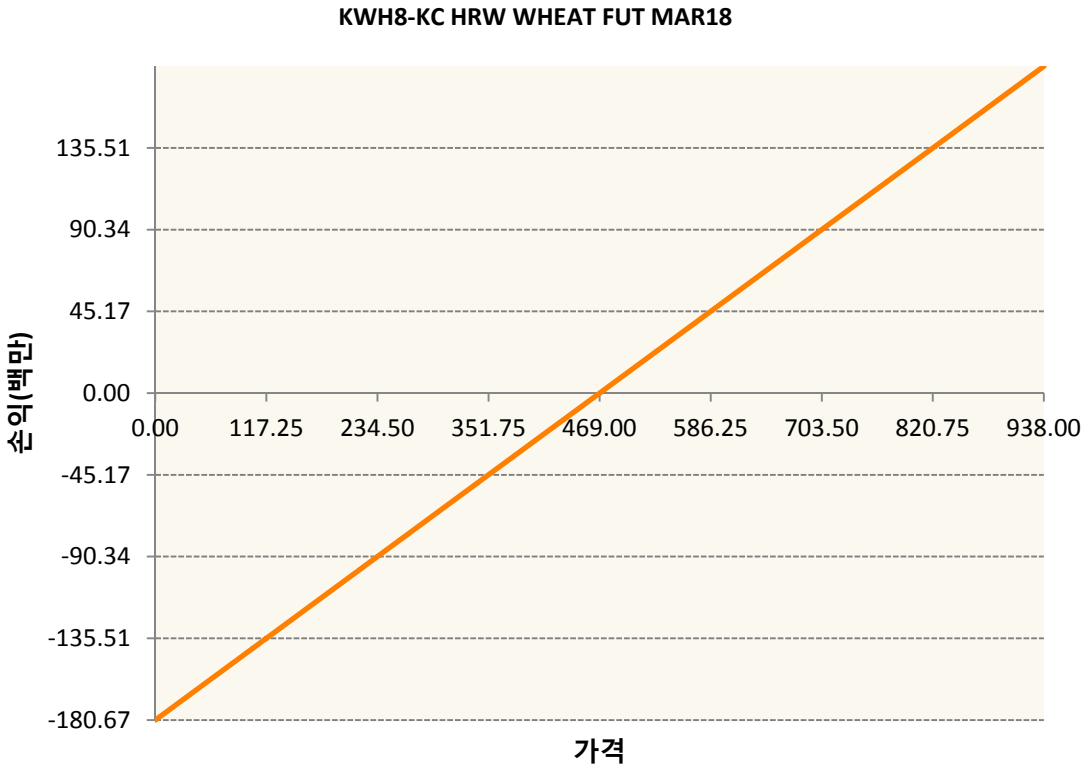


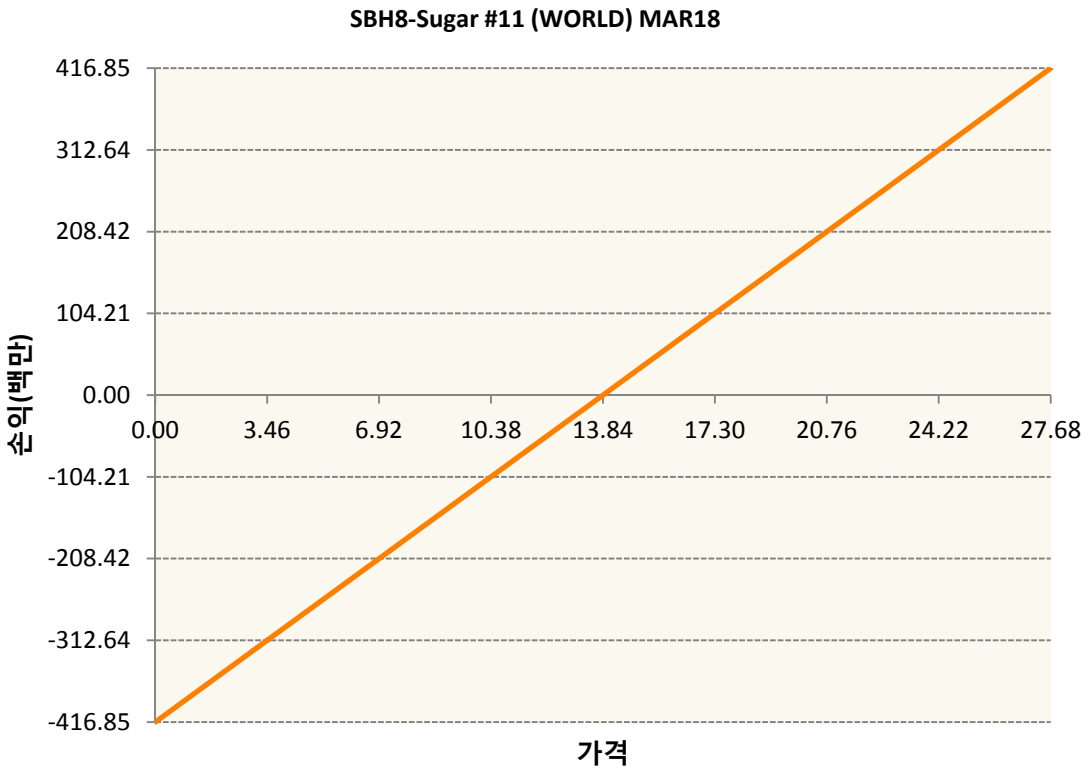
KCH8-COFFEE "C" FUTURE MAR18

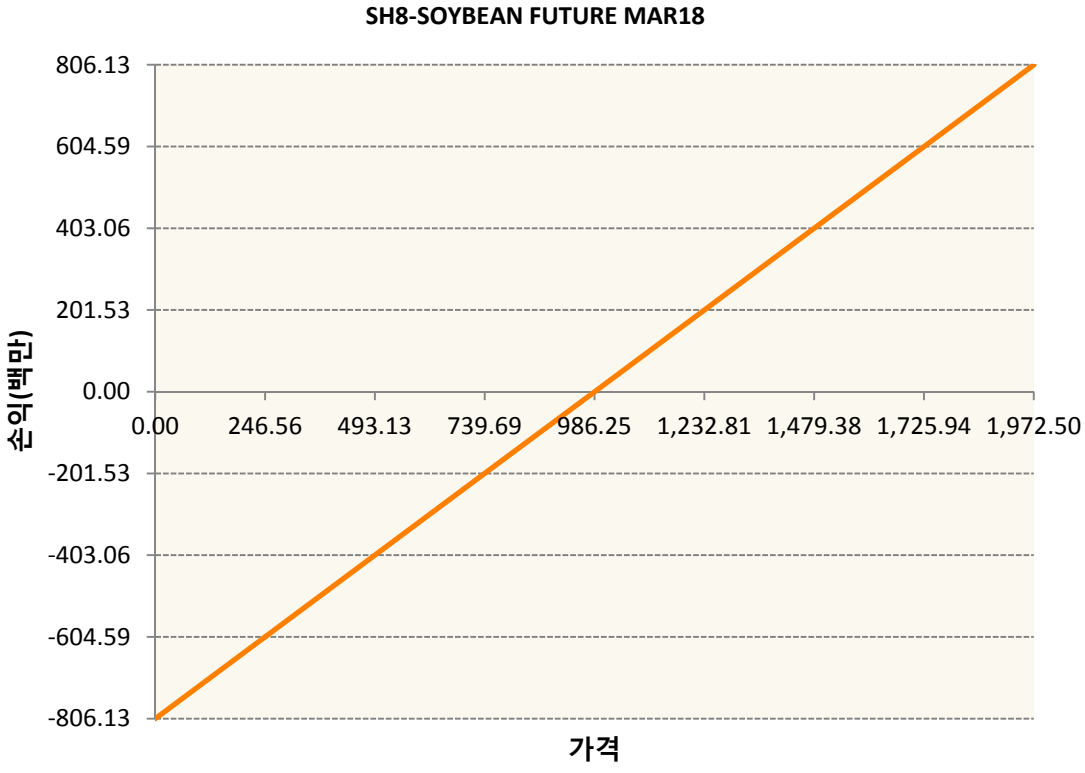



-353.96
가격

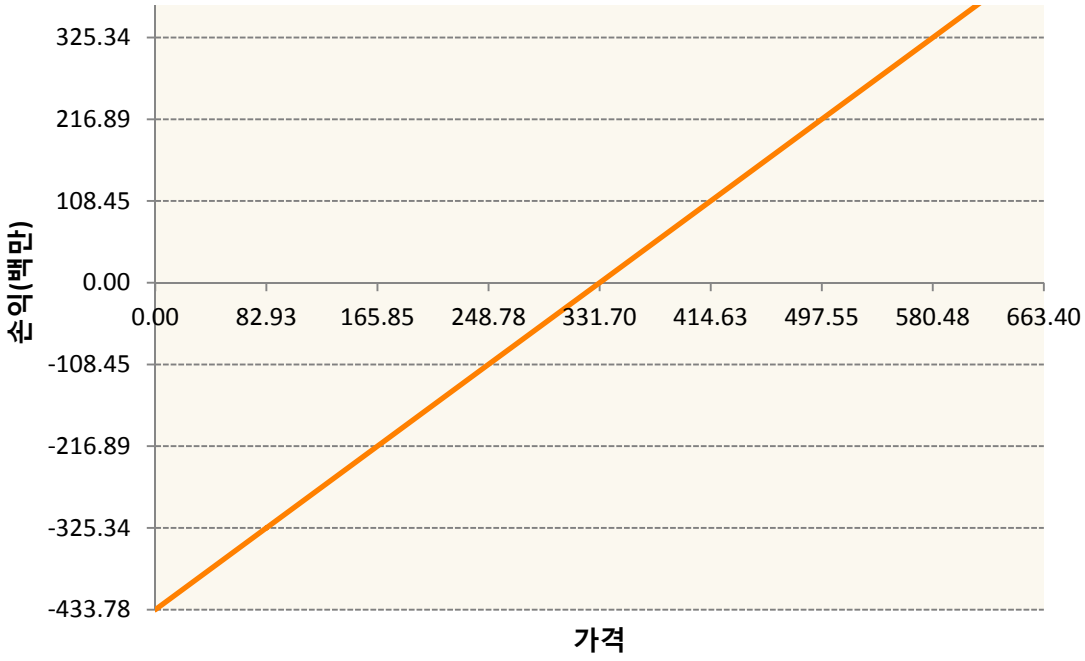

KR4175N20007-2018-02 달러선물
244.24
162.83
81.41
0.00
-81.41
-162.83
-244.24
-325.65
0.00
271.38
542.75
814.13
1,085.50
1,356.88
1,628.25
1,899.63
2,171.00
손익(백만)
가격


KWH8-KC HRW WHEAT FUT MAR18
135.51
90.34
45.17
0.00
-45.17
-90.34
-135.51
-180.67
0.00
117.25
234.50
351.75
469.00
586.25
703.50
820.75
938.00
손익(백만)
가격

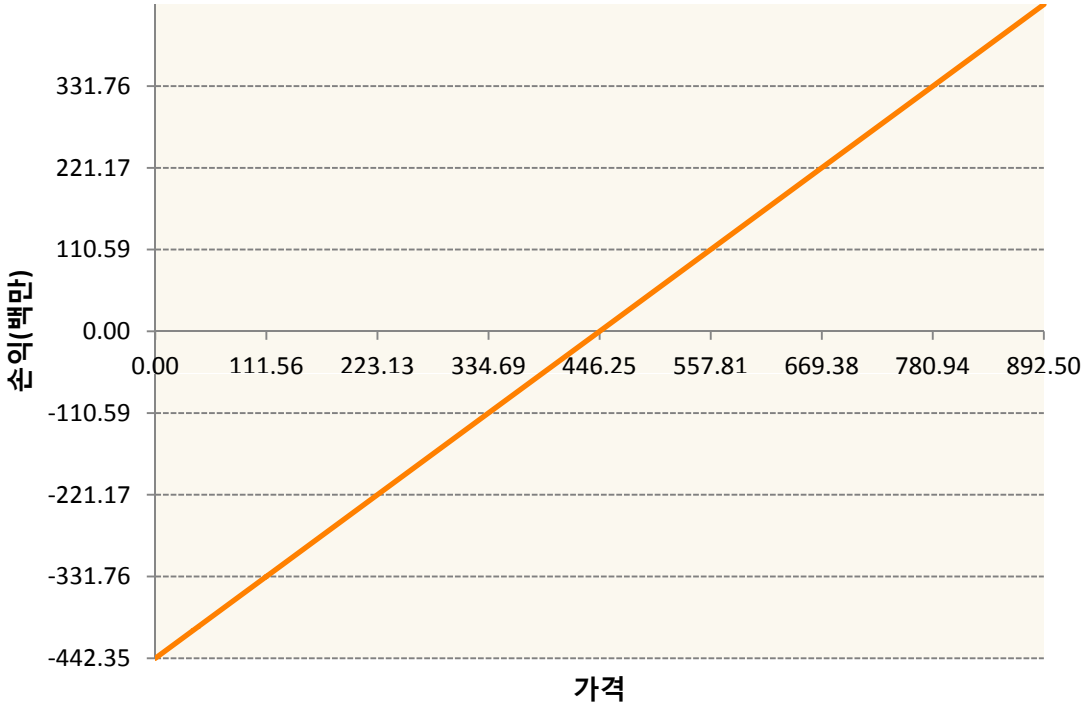

SBH8-Sugar #11 (WORLD) MAR18
416.85
312.64
208.42
104.21
0.00
-104.21
-208.42
-312.64
-416.85
손익(백만)
0.00
3.46
6.92
10.38
13.84
17.30
20.76
24.22
27.68
가격


SH8-SOYBEAN FUTURE MAR18
806.13
604.59
403.06
201.53
0.00
-201.53
-403.06
-604.59
-806.13
손익(백만)
0.00
246.56
493.13
739.69
986.25
1,232.81
1,479.38
1,725.94
1,972.50
가격


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	69
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)

338