공시일	2018-02-12
기준일	2018-02-09

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	2018-02-12
기준일	2018-02-09

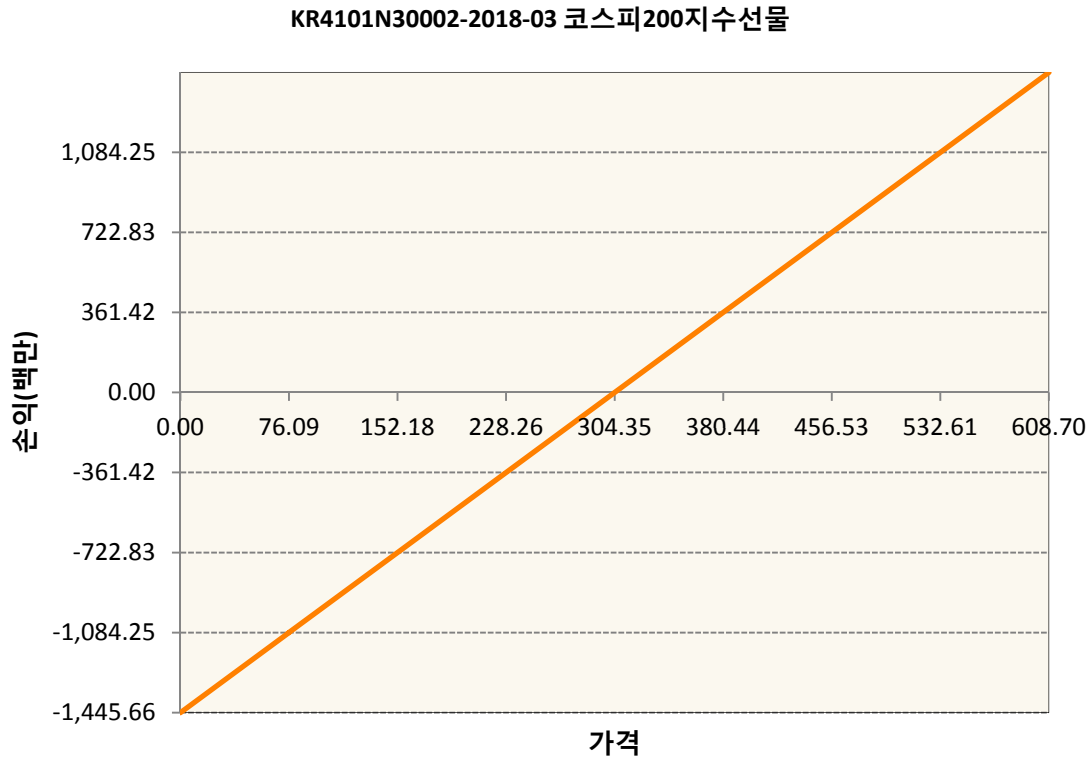
스마트인덱스모

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	153	0	153	장내
누계	유가증권	선물	1,446	0	1,446	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101N30(2018-03 코스피200지수선물							116
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-116	-116	-116	-116	-116	-116	-116
-5.33%	-77	-77	-77	-77	-77	-77	-77
-2.67%	-39	-39	-39	-39	-39	-39	-39
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	39	39	39	39	39	39	39
5.33%	77	77	77	77	77	77	77
8.00%	116	116	116	116	116	116	116

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

76

공시일	2018-02-12
기준일	2018-02-09

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	1,072

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

382

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2018-02-12
기준일	2018-02-09

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	372

* 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	2018-02-12
기준일	2018-02-09

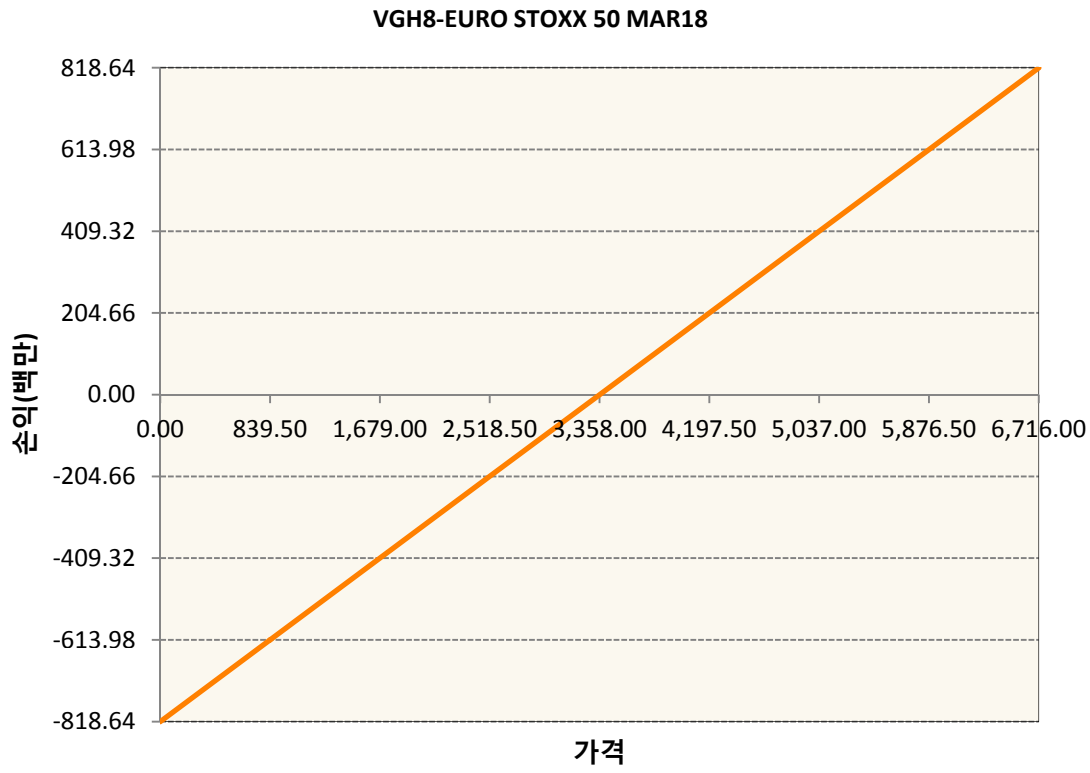
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	819	0	819	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGH8	EURO STOXX 50 MAR18	65

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

(단위:백만원)

38

공시일	2018-02-12
기준일	2018-02-09

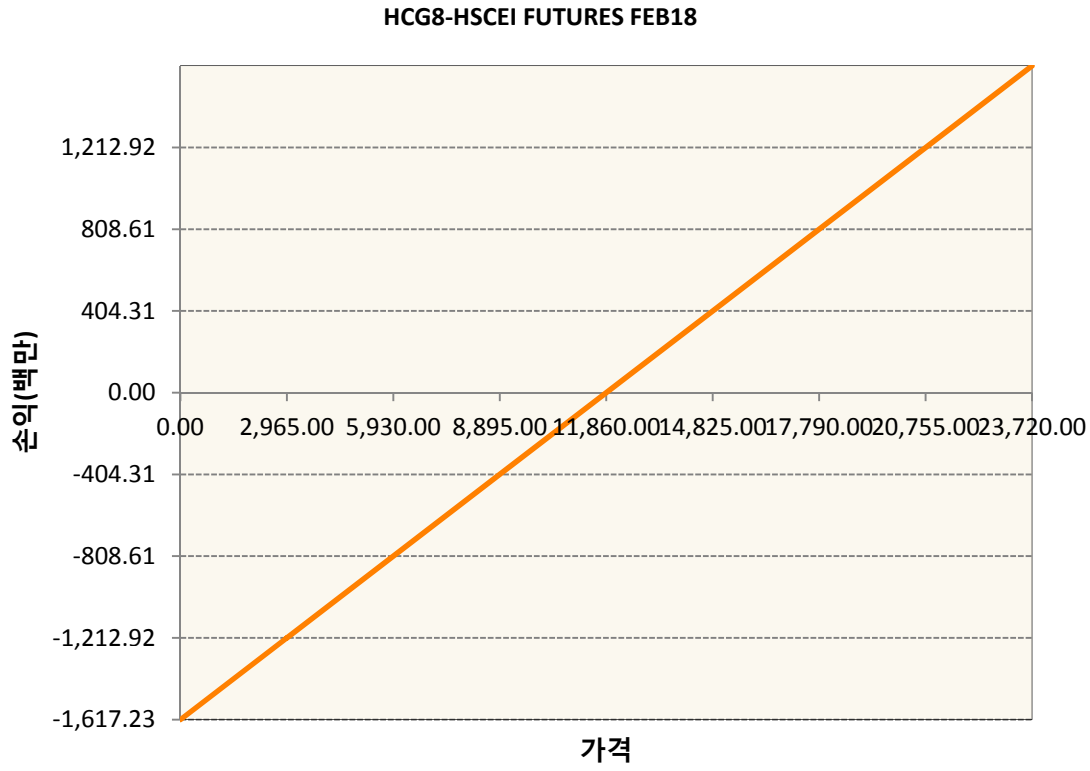
차이나인덱스모(주식-파생형)

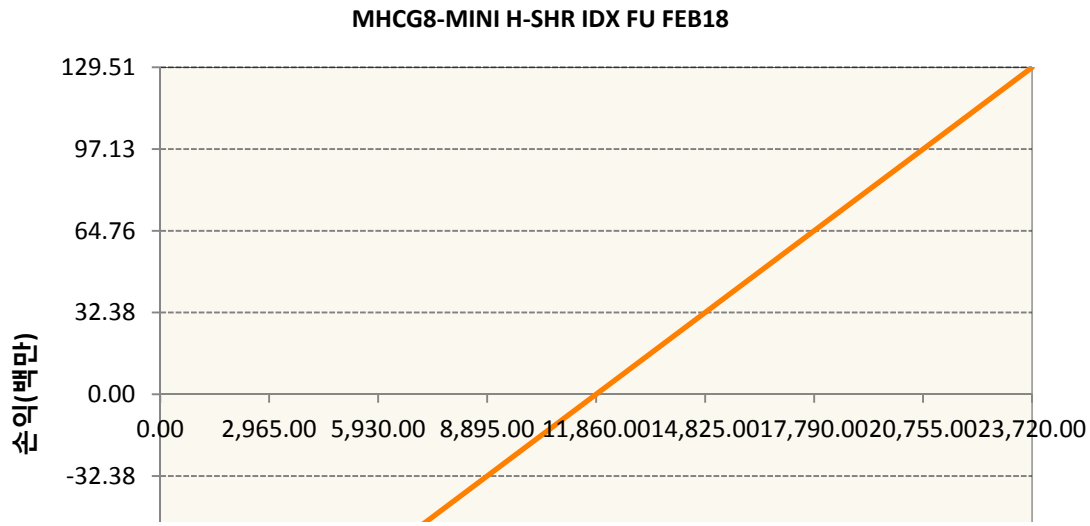
1. 계약금액

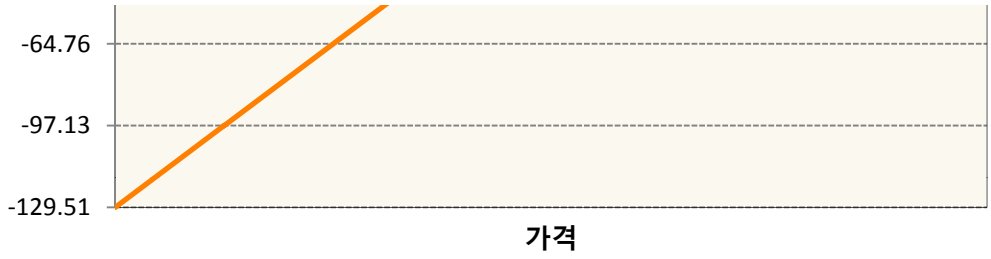
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,747	0	1,747	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCG8	HSCEI FUTURES FEB18	129
MHCG8	MINI H-SHR IDX FU FEB18	10

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	117

공시일	2018-02-12
기준일	2018-02-09

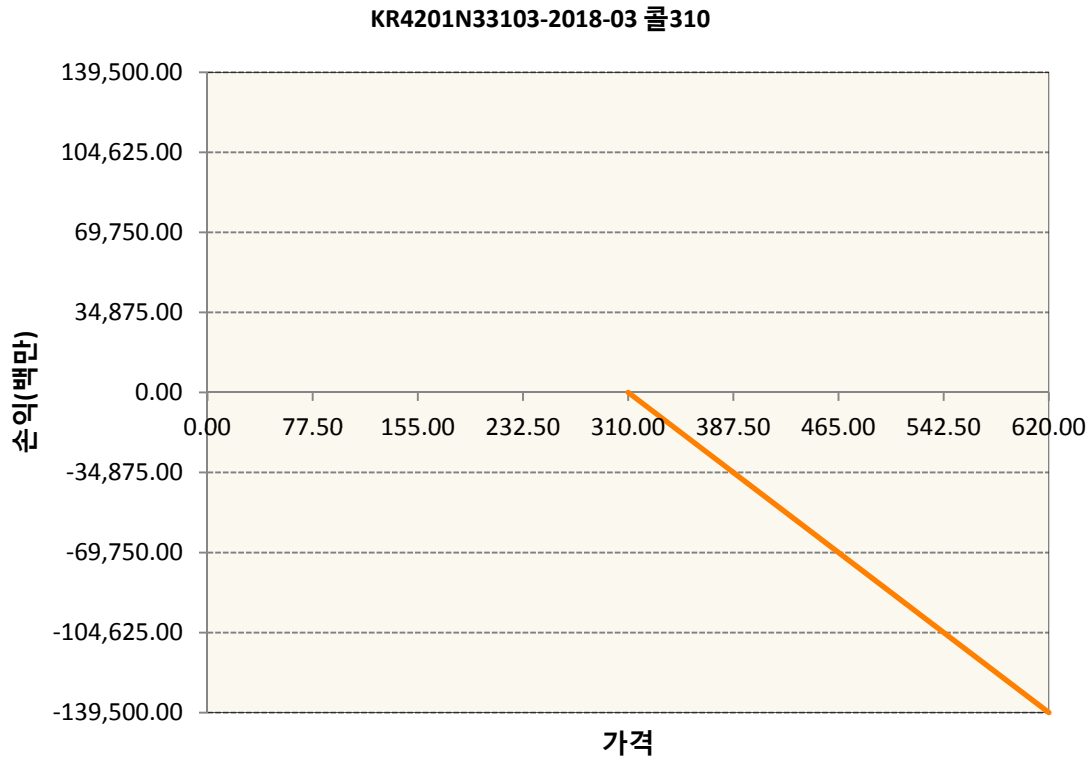
커버드콜모(주식혼합-파생형)

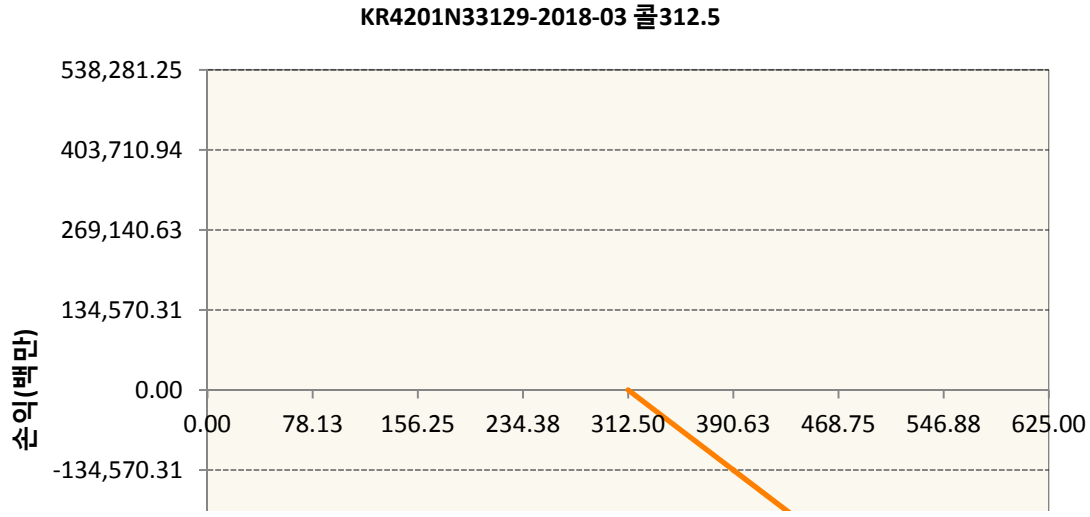
1. 계약금액

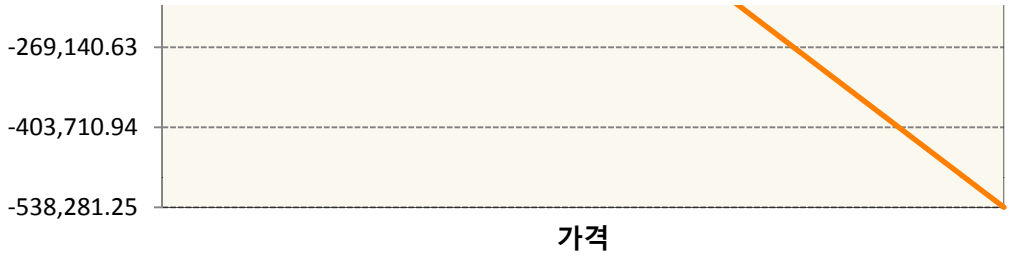
(단위:백만원)

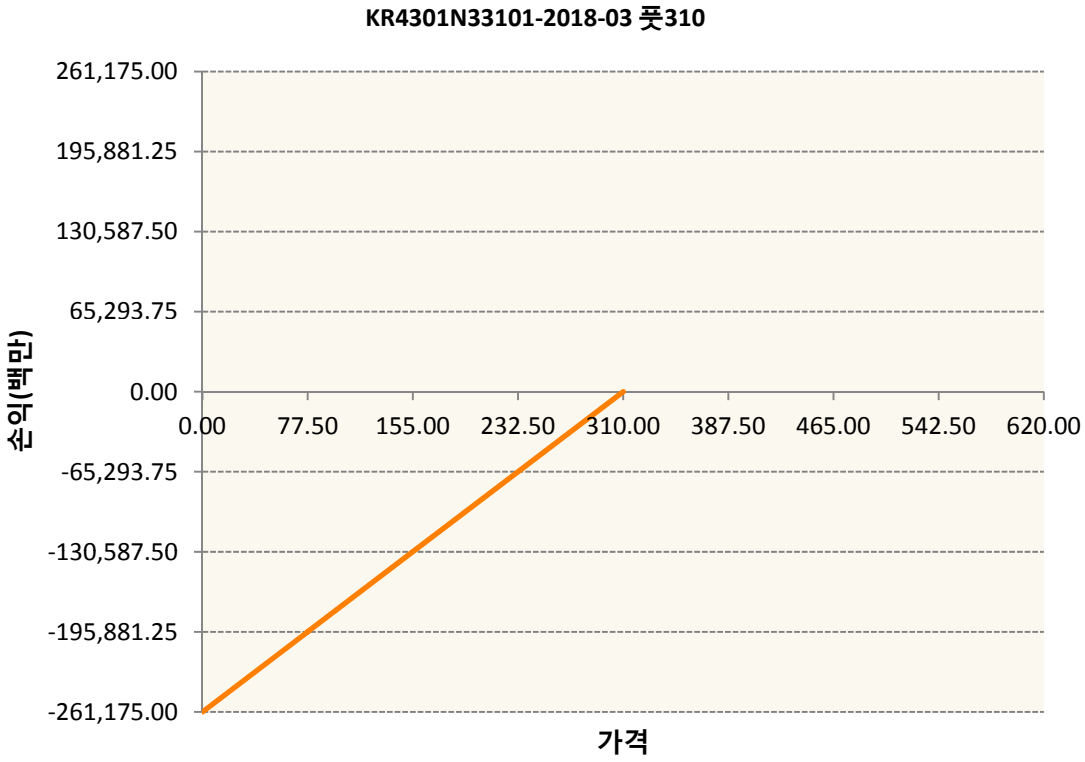
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	1,095,236	-1,095,236	장내
누계	유가증권	옵션	0	1,144,425	-1,144,425	장내

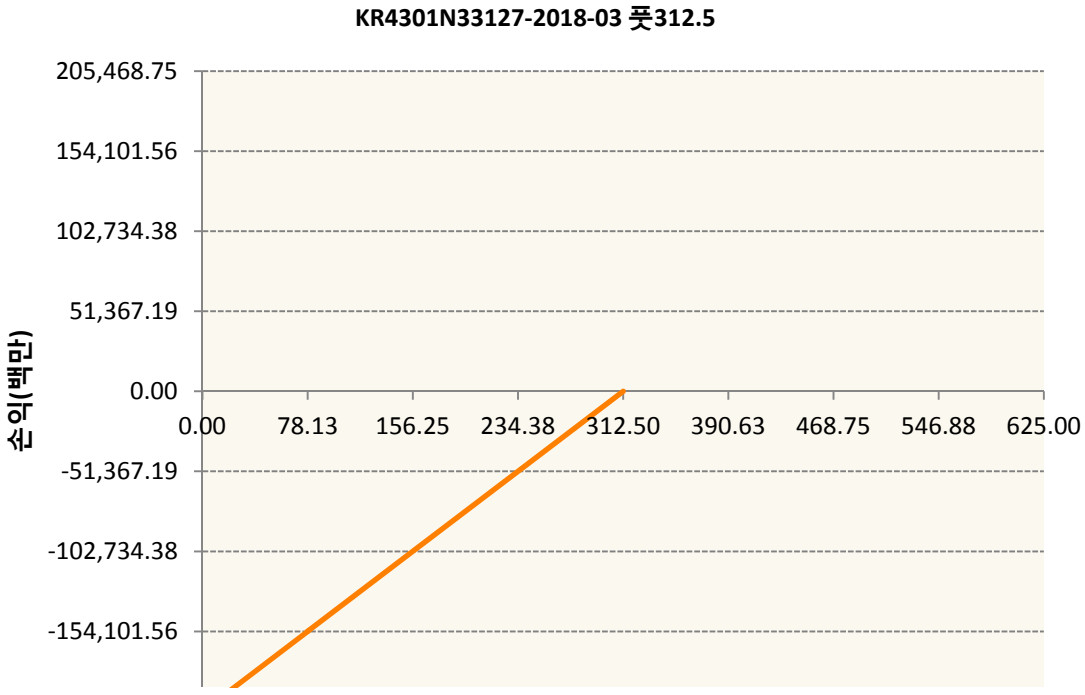
2. 만기시점의 손익구조






-269,140.63
-403,710.94
-538,281.25
가격


KR4301N33101-2018-03 풋310
261,175.00
195,881.25
130,587.50
65,293.75
0.00
-65,293.75
-130,587.50
-195,881.25
-261,175.00
0.00
77.50
155.00
232.50
310.00
387.50
465.00
542.50
620.00
손익(백만)
가격


KR4301N33127-2018-03 풋312.5
205,468.75
154,101.56
102,734.38
51,367.19
0.00
-51,367.19
-102,734.38
-154,101.56
0.00
78.13
156.25
234.38
312.50
390.63
468.75
546.88
625.00
손익(백만)



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201N3312018-03 콜310							7,702
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	3,014	2,931	2,824	2,695	2,545	2,377	2,194
-5.33%	2,751	2,585	2,395	2,187	1,962	1,724	1,474
-2.67%	2,146	1,882	1,606	1,320	1,025	724	418
0%	1,011	676	339	0	-340	-681	-1,023
2.67%	-775	-1,122	-1,471	-1,820	-2,169	-2,519	-2,869
5.33%	-3,203	-3,503	-3,812	-4,128	-4,450	-4,777	-5,108
8.00%	-6,153	-6,370	-6,607	-6,863	-7,132	-7,412	-7,702
KR4201N3312018-03 콜312.5							28,065
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	10,045	9,791	9,451	9,026	8,524	7,950	7,311
-5.33%	9,281	8,740	8,105	7,390	6,607	5,765	4,873
-2.67%	7,418	6,507	5,534	4,510	3,446	2,349	1,225
0%	3,738	2,509	1,262	0	-1,273	-2,554	-3,842
2.67%	-2,318	-3,671	-5,025	-6,378	-7,731	-9,084	-10,436
5.33%	-10,879	-12,114	-13,372	-14,648	-15,938	-17,239	-18,549
8.00%	-21,599	-22,545	-23,559	-24,628	-25,740	-26,888	-28,065
KR4301N3312018-03 풋310							17,131
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-16,484	-16,529	-16,597	-16,691	-16,812	-16,959	-17,131
-5.33%	-9,833	-9,977	-10,156	-10,368	-10,608	-10,873	-11,161
-2.67%	-3,680	-3,992	-4,331	-4,692	-5,070	-5,462	-5,866
0%	1,414	947	476	0	-479	-961	-1,444
2.67%	4,977	4,485	3,991	3,495	2,997	2,499	2,001
5.33%	6,998	6,621	6,222	5,806	5,377	4,937	4,489
8.00%	7,906	7,691	7,438	7,153	6,841	6,506	6,150
KR4301N3312018-03 풋312.5							13,829
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-13,427	-13,451	-13,490	-13,546	-13,621	-13,716	-13,829
-5.33%	-8,185	-8,269	-8,380	-8,516	-8,676	-8,856	-9,055
-2.67%	-3,231	-3,435	-3,663	-3,913	-4,179	-4,460	-4,753
0%	1,037	700	353	0	-359	-722	-1,088
2.67%	4,203	3,808	3,413	3,019	2,624	2,230	1,835

5.33%	6,131	5,797	5,452	5,098	4,738	4,372	4,002
8.00%	7,071	6,861	6,624	6,365	6,088	5,796	5,491

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

63,776

공시일	2018-02-12
기준일	2018-02-09

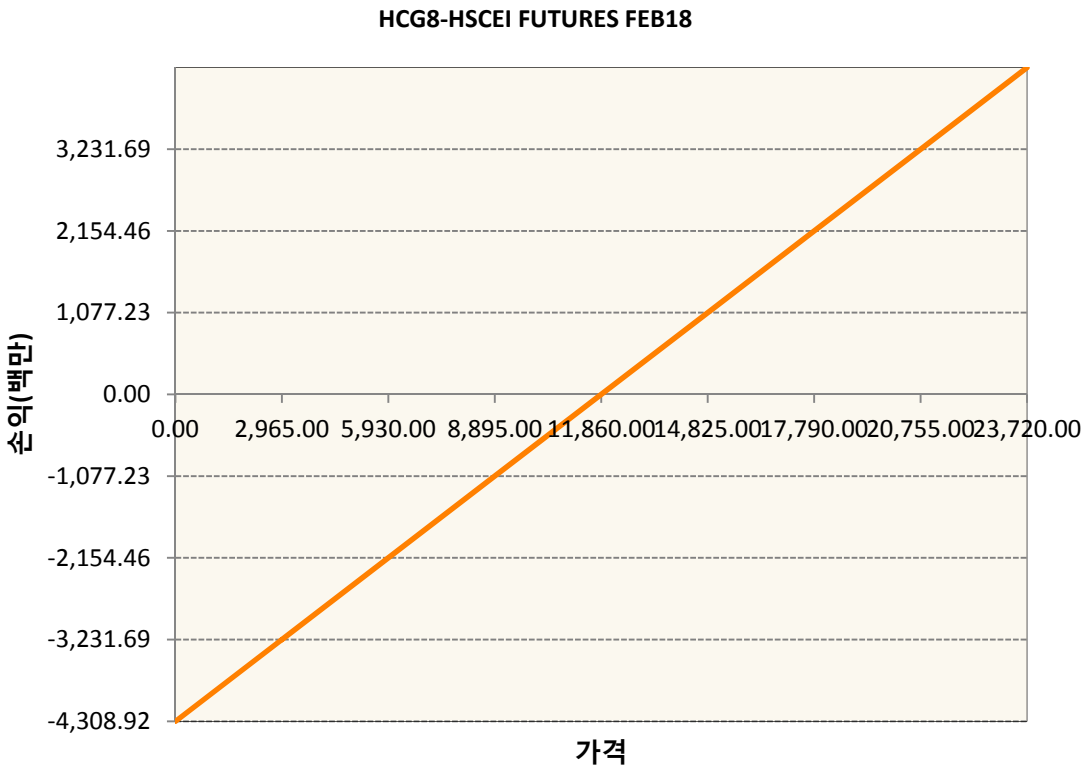
홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생

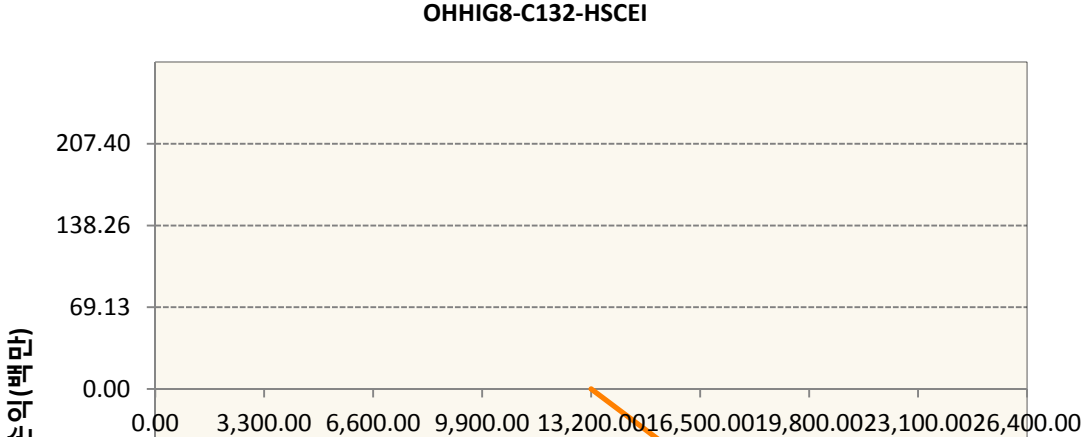
1. 계약금액

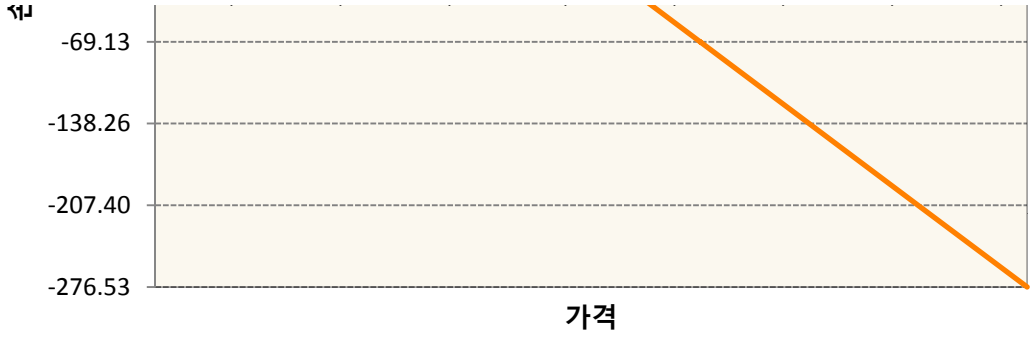
(단위:백만원)

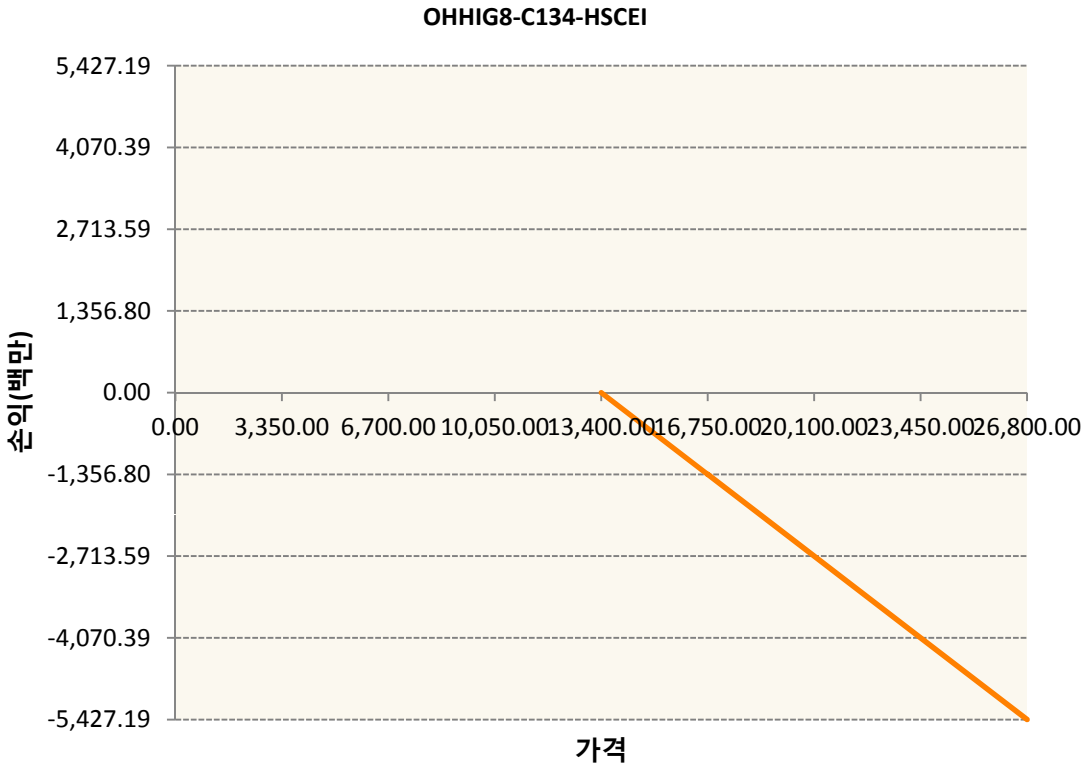
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	4,309	0	4,309	장내
누계	유가증권	옵션	0	11,407	-11,407	장내

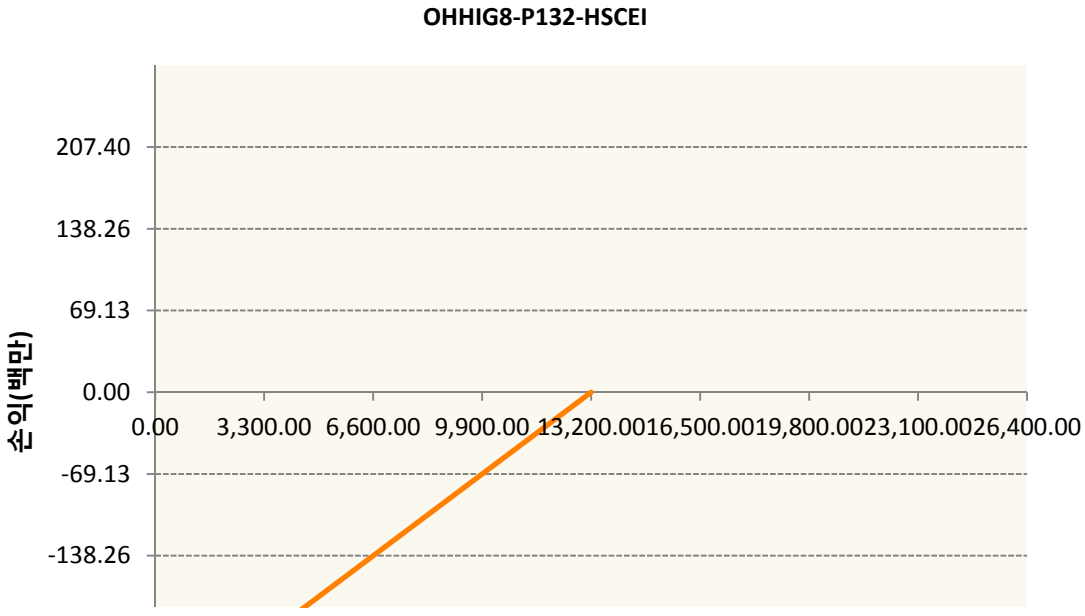
2. 만기시점의 손익구조

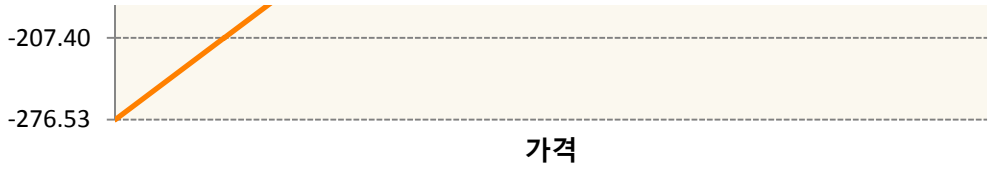


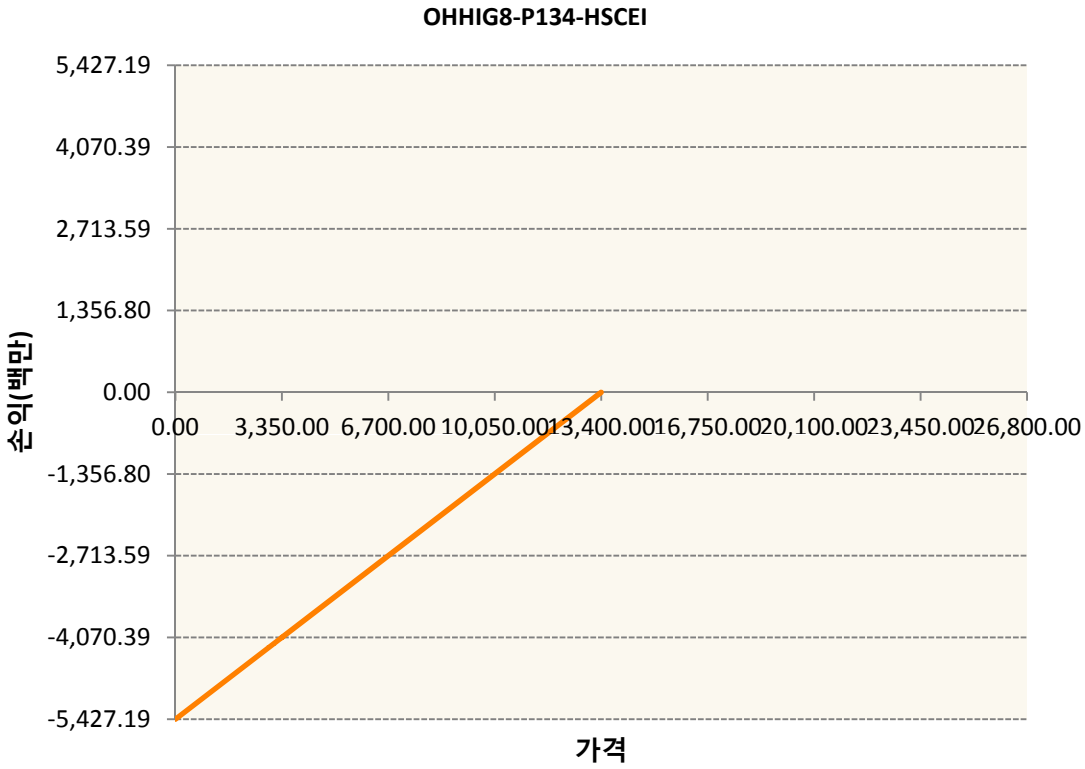



-69.13
-138.26
-207.40
-276.53
가격


OHHIG8-C134-HSCEI
5,427.19
4,070.39
2,713.59
1,356.80
0.00
-1,356.80
-2,713.59
-4,070.39
-5,427.19
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
207.40
138.26
69.13
0.00
-69.13
-138.26
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	345
OHHIG8-C1	HSCEI	22
OHHIG8-C1	HSCEI	434
OHHIG8-P1	HSCEI	22
OHHIG8-P1	HSCEI	434

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,058

공시일	2018-02-12
기준일	2018-02-09

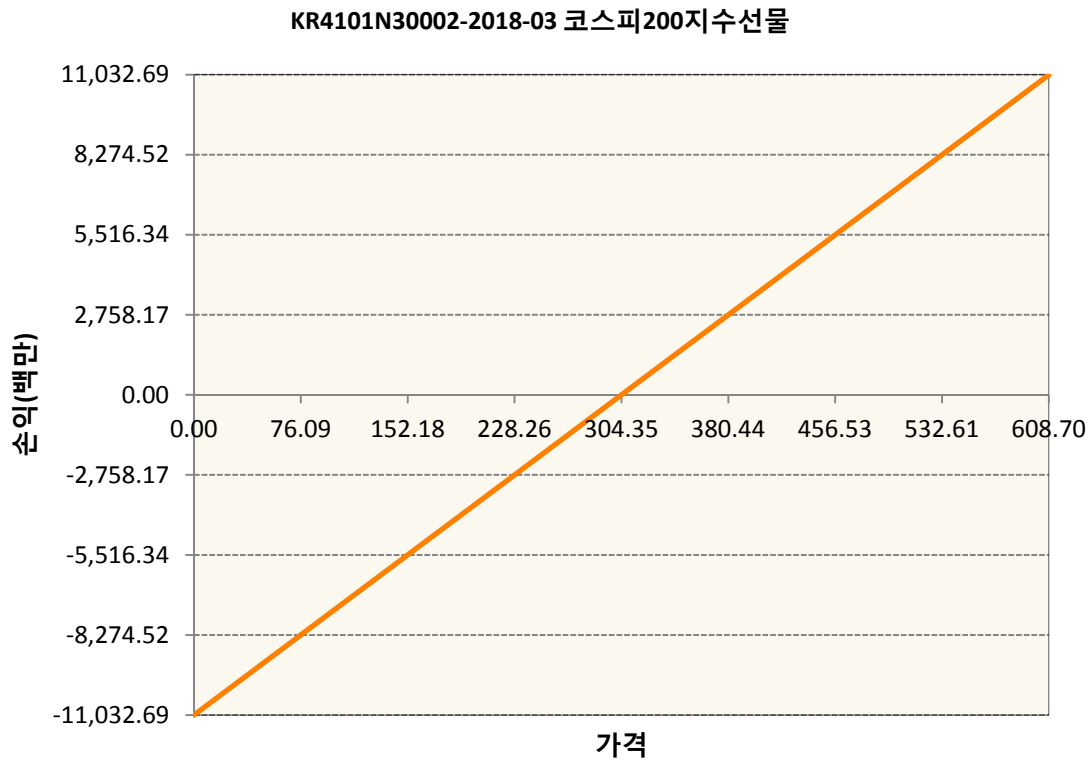
코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼

1. 계약금액

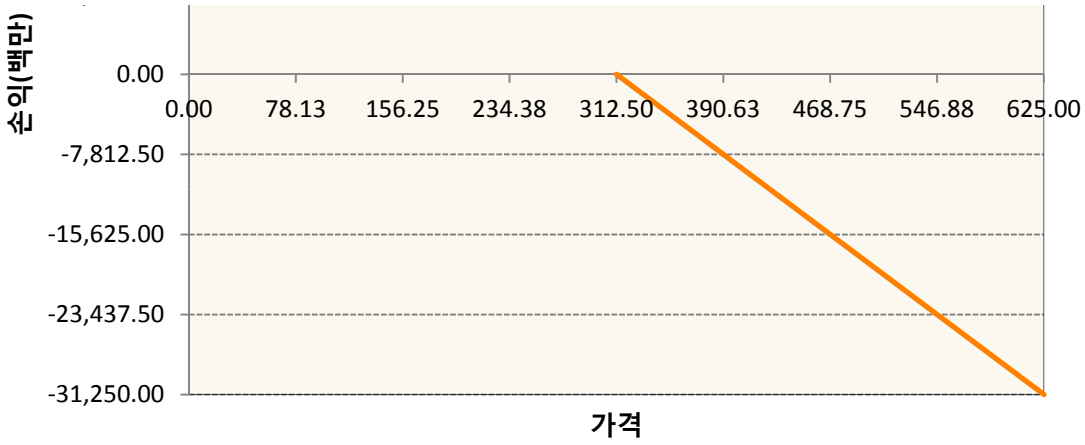
(단위:백만원)

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	57,159	-57,159	장내
누계	유가증권	선물	11,033	0	11,033	장내
누계	유가증권	스왑	60,200	0	60,200	장외
누계	유가증권	옵션	0	56,094	-56,094	장내

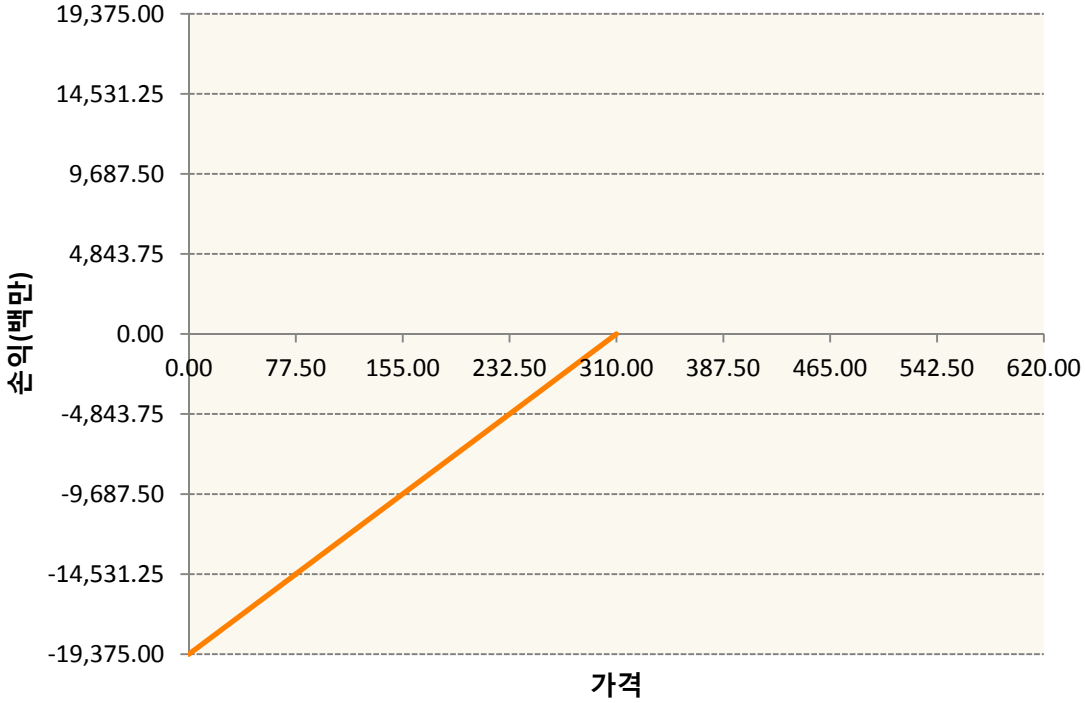
2. 만기시점의 손익구조



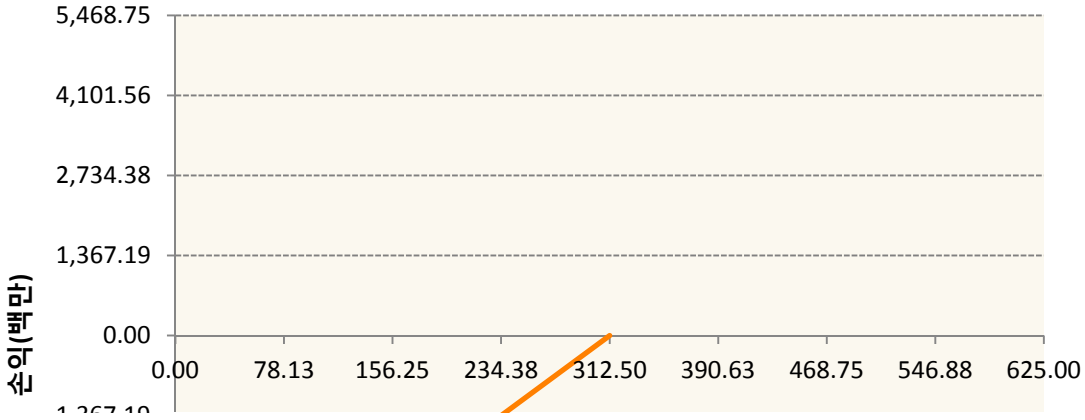




KR4301N33101-2018-03 풋310



KR4301N33127-2018-03 풋312.5





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_2							1,459
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,459	-1,459	-1,459	-1,459	-1,459	-1,459	-1,459
-5.33%	-973	-973	-973	-973	-973	-973	-973
-2.67%	-486	-486	-486	-486	-486	-486	-486
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	486	486	486	486	486	486	486
5.33%	973	973	973	973	973	973	973
8.00%	1,459	1,459	1,459	1,459	1,459	1,459	1,459
2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_3							276
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-276	-276	-276	-276	-276	-276	-276
-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%	276	276	276	276	276	276	276
2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_4							158
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-158	-158	-158	-158	-158	-158	-158
-5.33%	-105	-105	-105	-105	-105	-105	-105
-2.67%	-53	-53	-53	-53	-53	-53	-53
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	53	53	53	53	53	53	53
5.33%	105	105	105	105	105	105	105
8.00%	158	158	158	158	158	158	158
2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_5							237
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%

-8.00%	-237	-237	-237	-237	-237	-237	-237
-5.33%	-158	-158	-158	-158	-158	-158	-158
-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%	158	158	158	158	158	158	158
8.00%	237	237	237	237	237	237	237
	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						467
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-467	-467	-467	-467	-467	-467	-467
-5.33%	-311	-311	-311	-311	-311	-311	-311
-2.67%	-156	-156	-156	-156	-156	-156	-156
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	156	156	156	156	156	156	156
5.33%	311	311	311	311	311	311	311
8.00%	467	467	467	467	467	467	467
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_9						311
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-311	-311	-311	-311	-311	-311	-311
-5.33%	-207	-207	-207	-207	-207	-207	-207
-2.67%	-104	-104	-104	-104	-104	-104	-104
0%	0	0	0	0	0	0	0

2.67%	104	104	104	104	104	104	104
5.33%	207	207	207	207	207	207	207
8.00%	311	311	311	311	311	311	311
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_10						276
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-276	-276	-276	-276	-276	-276	-276
-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%	276	276	276	276	276	276	276
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_11						631
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-631	-631	-631	-631	-631	-631	-631
-5.33%	-421	-421	-421	-421	-421	-421	-421
-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%	421	421	421	421	421	421	421
8.00%	631	631	631	631	631	631	631
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_12						473
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-473	-473	-473	-473	-473	-473	-473
-5.33%	-316	-316	-316	-316	-316	-316	-316
-2.67%	-158	-158	-158	-158	-158	-158	-158
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	158	158	158	158	158	158	158
5.33%	316	316	316	316	316	316	316
8.00%	473	473	473	473	473	473	473
	KR4101N30(	2018-03 코스피200지수선물					884
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-884	-884	-884	-884	-884	-884	-884
-5.33%	-589	-589	-589	-589	-589	-589	-589
-2.67%	-295	-295	-295	-295	-295	-295	-295
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	295	295	295	295	295	295	295
5.33%	589	589	589	589	589	589	589
8.00%	884	884	884	884	884	884	884
	KR4201N331	2018-03 콜312.5					1,629

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	583	568	549	524	495	462	424
-5.33%	539	507	471	429	384	335	283
-2.67%	431	378	321	262	200	136	71
0%	217	146	73	0	-74	-148	-223
2.67%	-135	-213	-292	-370	-449	-527	-606
5.33%	-632	-703	-776	-850	-925	-1,001	-1,077
8.00%	-1,254	-1,309	-1,368	-1,430	-1,494	-1,561	-1,629
KR4301N3312018-03 풋310							1,271

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,223	-1,226	-1,231	-1,238	-1,247	-1,258	-1,271
-5.33%	-729	-740	-753	-769	-787	-807	-828
-2.67%	-273	-296	-321	-348	-376	-405	-435
0%	105	70	35	0	-36	-71	-107
2.67%	369	333	296	259	222	185	148
5.33%	519	491	462	431	399	366	333
8.00%	587	571	552	531	507	483	456
KR4301N3312018-03 풋312.5							368

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-357	-358	-359	-361	-363	-365	-368
-5.33%	-218	-220	-223	-227	-231	-236	-241
-2.67%	-86	-91	-98	-104	-111	-119	-127
0%	28	19	9	0	-10	-19	-29
2.67%	112	101	91	80	70	59	49
5.33%	163	154	145	136	126	116	107
8.00%	188	183	176	169	162	154	146

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

8,448

공시일	2018-02-12
기준일	2018-02-09

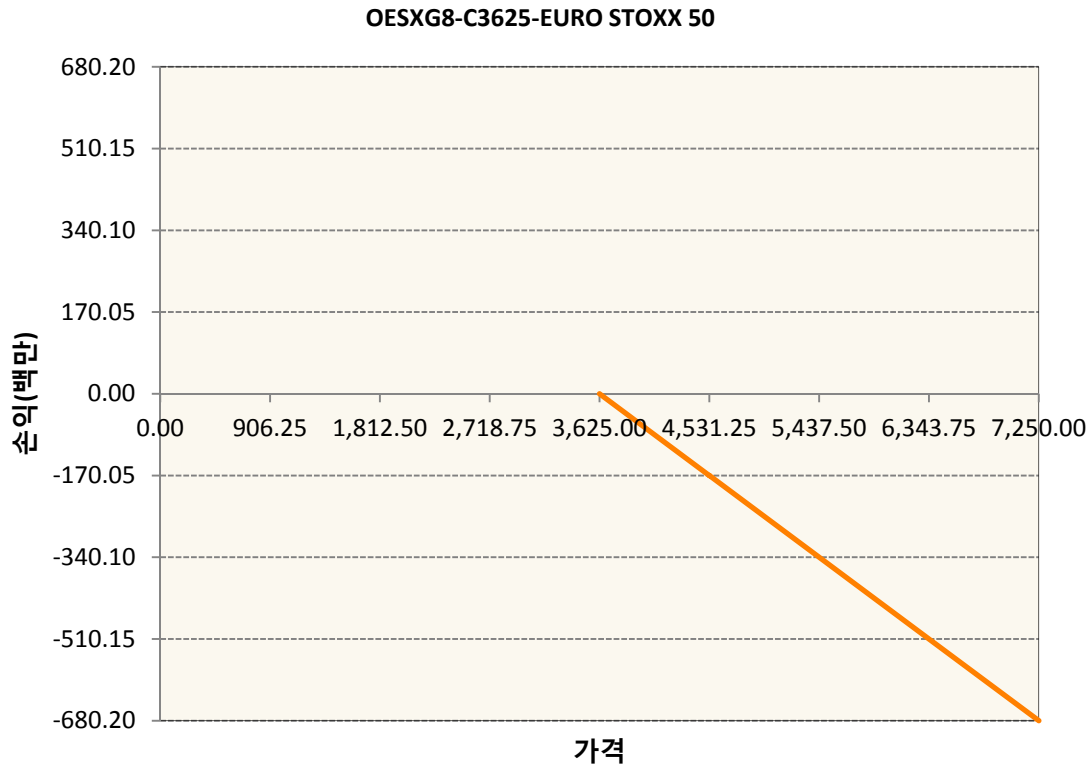
유로커버드콜모(주식혼합-파생형

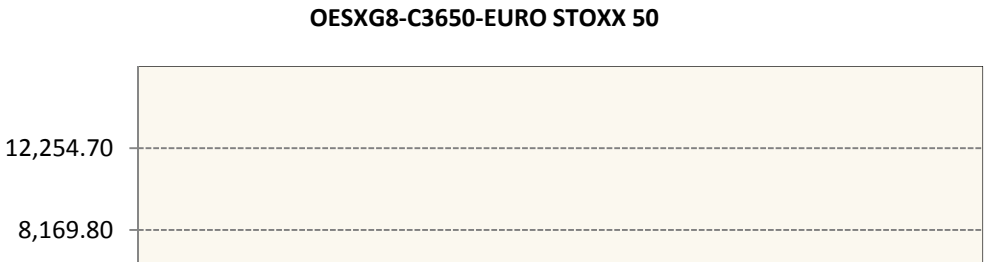
1. 계약금액

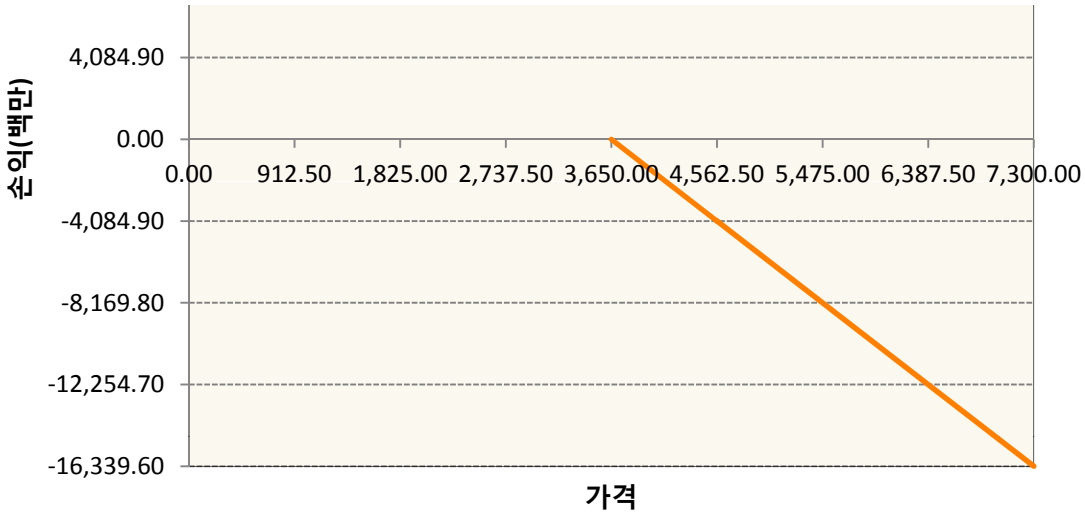
(단위:백만원)

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	7,334	0	7,334	
누계	유가증권	스왑	100,525	0	100,525	장외
누계	유가증권	옵션	0	34,040	-34,040	장내
누계	지수	스왑	53,614	0	53,614	장외

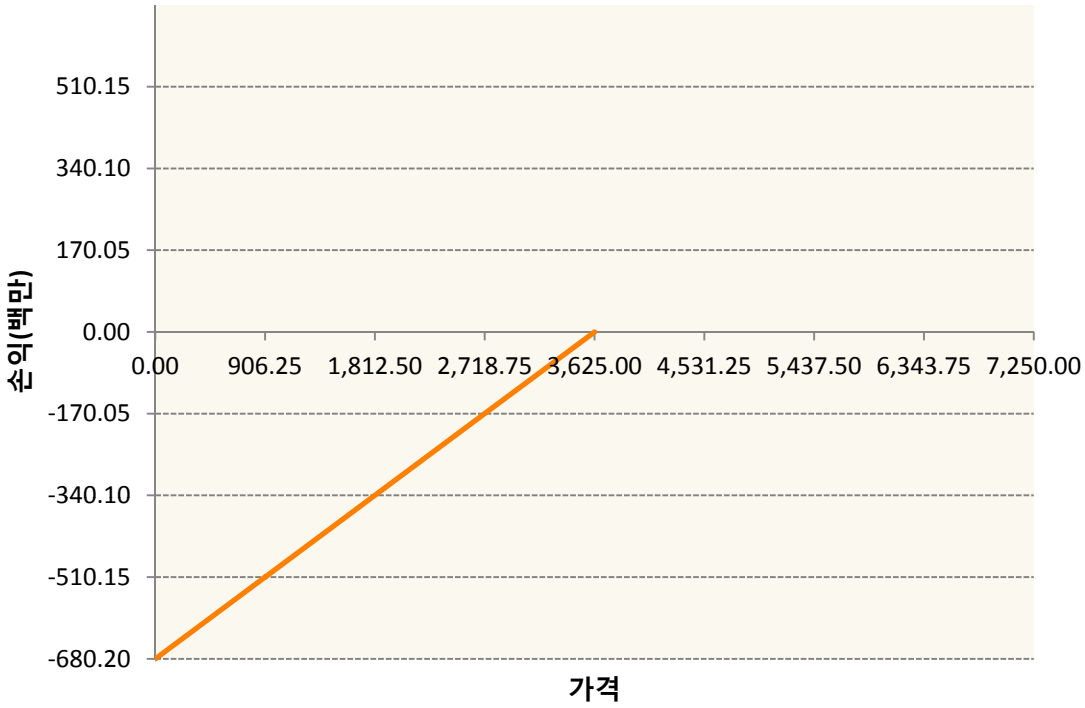
2. 만기시점의 손익구조



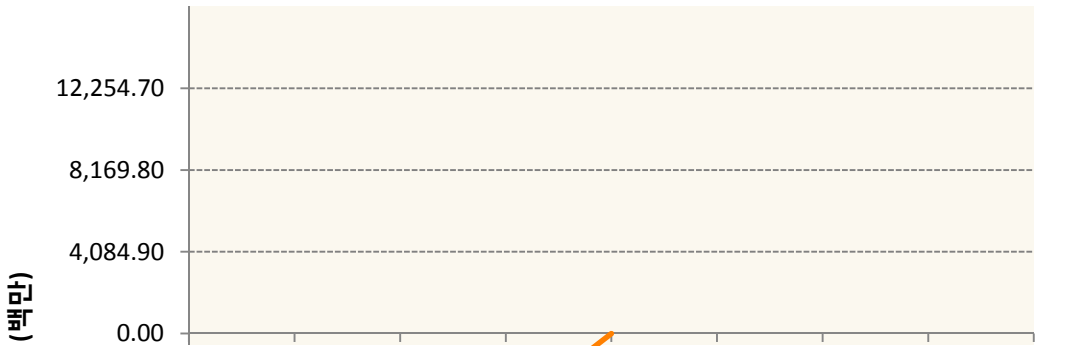


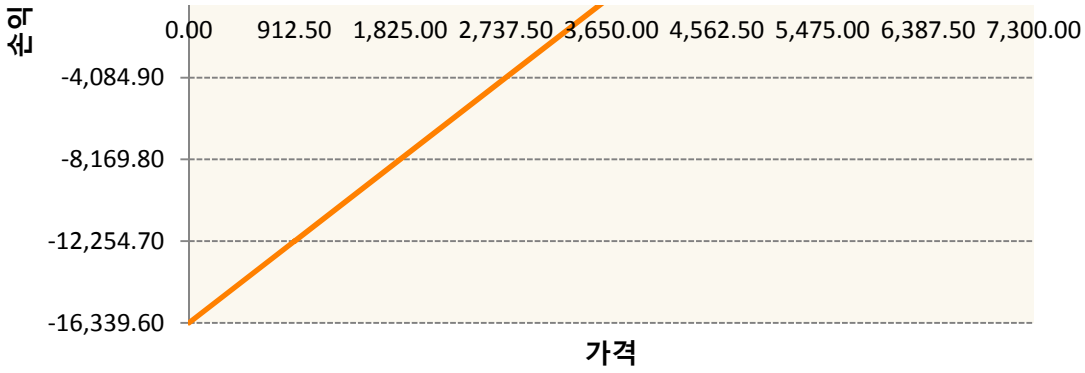


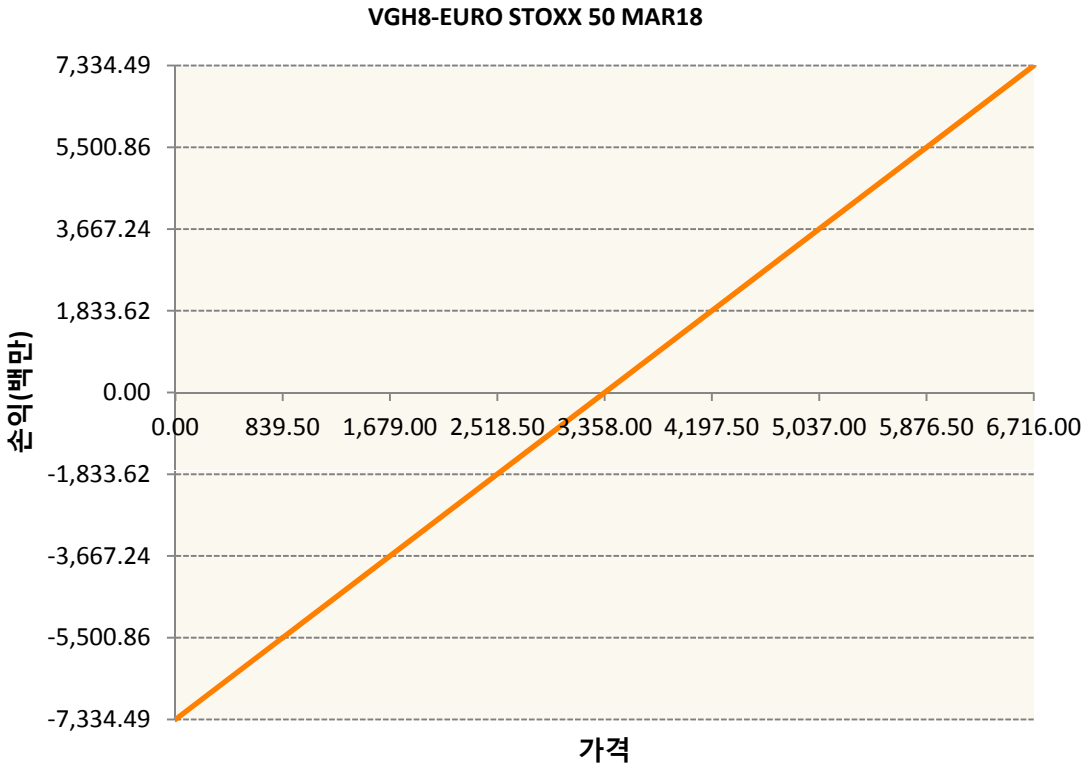
OESXG8-P3625-EURO STOXX 50



OESXG8-P3650-EURO STOXX 50







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
260105SGPX	SG EURO Covered CALL STRATEGY - 994.569	278
260105SQPX	SG EURO Covered CALL STRATEGY	521
OESXG8-C3(	EURO STOXX 50	54
OESXG8-C3(	EURO STOXX 50	1,307
OESXG8-P3(	EURO STOXX 50	54
OESXG8-P3(	EURO STOXX 50	1,307
VGH8	EURO STOXX 50 MAR18	587

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

2,409

공시일	2018-02-12
기준일	2018-02-09

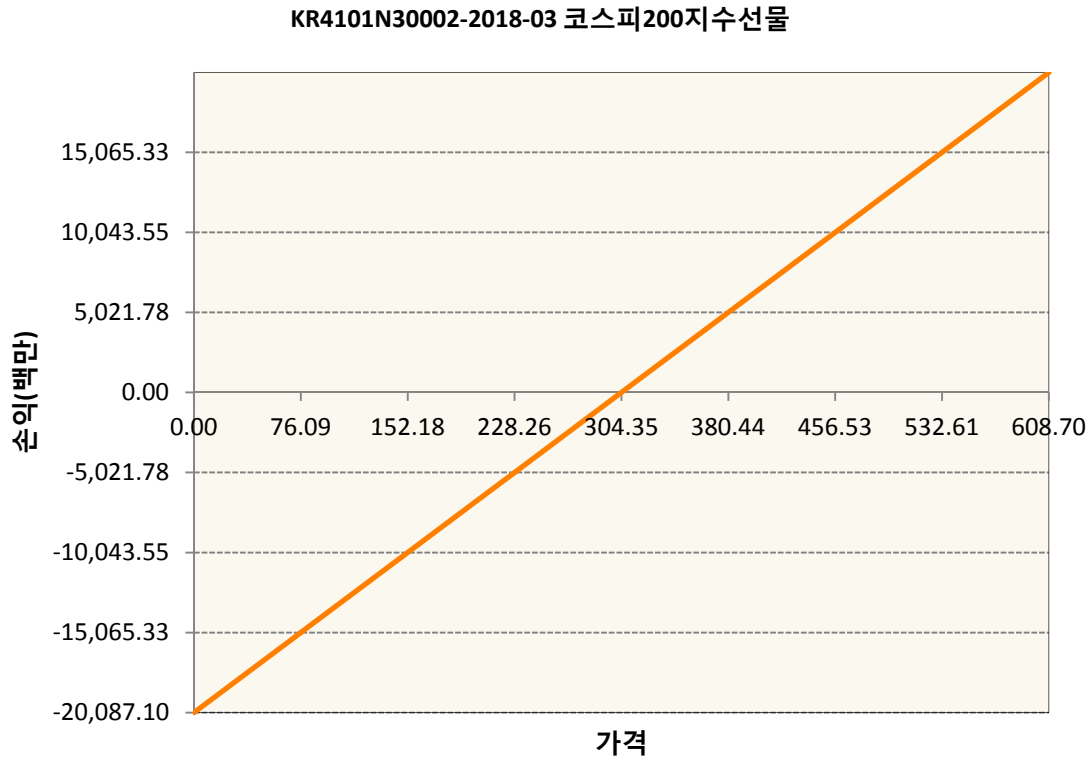
ETF스마트레버리지목표전환형8호

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	2,293	0	2,293	장내
누계	유가증권	선물	20,087	0	20,087	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101N30(2018-03 코스피200지수선물							1,610
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,610	-1,610	-1,610	-1,610	-1,610	-1,610	-1,610
-5.33%	-1,073	-1,073	-1,073	-1,073	-1,073	-1,073	-1,073
-2.67%	-537	-537	-537	-537	-537	-537	-537
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	537	537	537	537	537	537	537
5.33%	1,073	1,073	1,073	1,073	1,073	1,073	1,073
8.00%	1,610	1,610	1,610	1,610	1,610	1,610	1,610

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

1,051

공시일	2018-02-12
기준일	2018-02-09

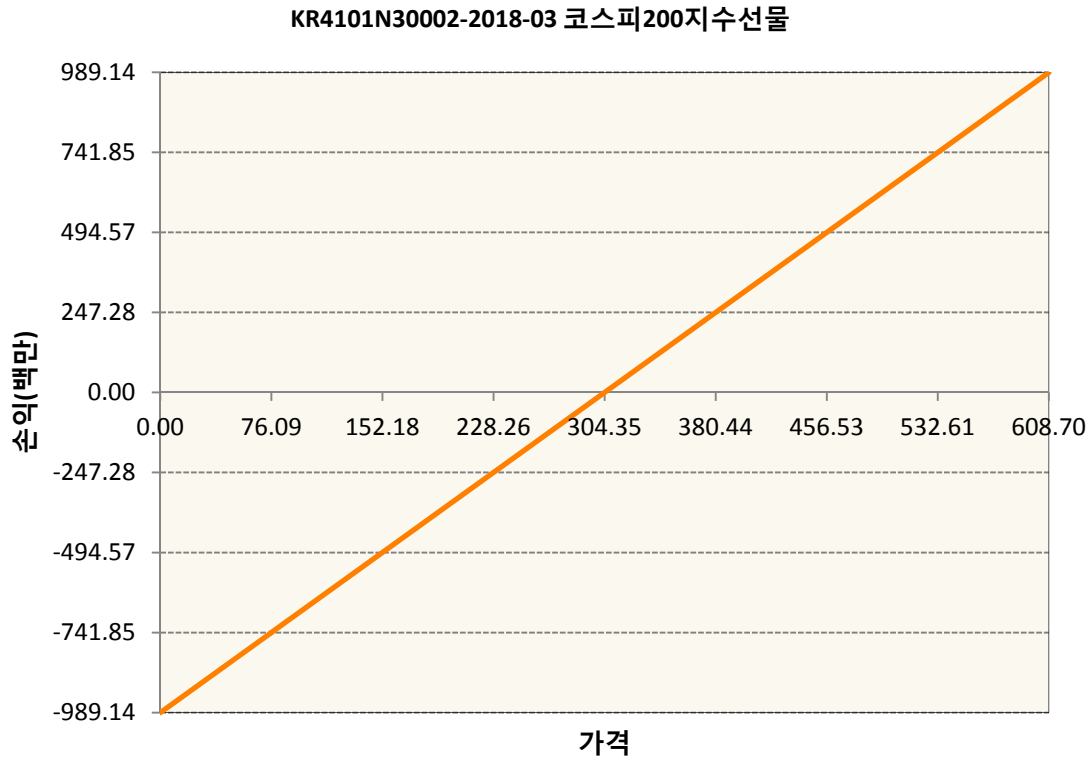
ETF스마트레버리지목표전환형9호

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	153	0	153	장내
누계	유가증권	선물	989	0	989	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101N30(2018-03 코스피200지수선물							79
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-79	-79	-79	-79	-79	-79	-79
-5.33%	-53	-53	-53	-53	-53	-53	-53
-2.67%	-26	-26	-26	-26	-26	-26	-26
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	26	26	26	26	26	26	26
5.33%	53	53	53	53	53	53	53
8.00%	79	79	79	79	79	79	79

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

52

공시일	2018-02-12
기준일	2018-02-09

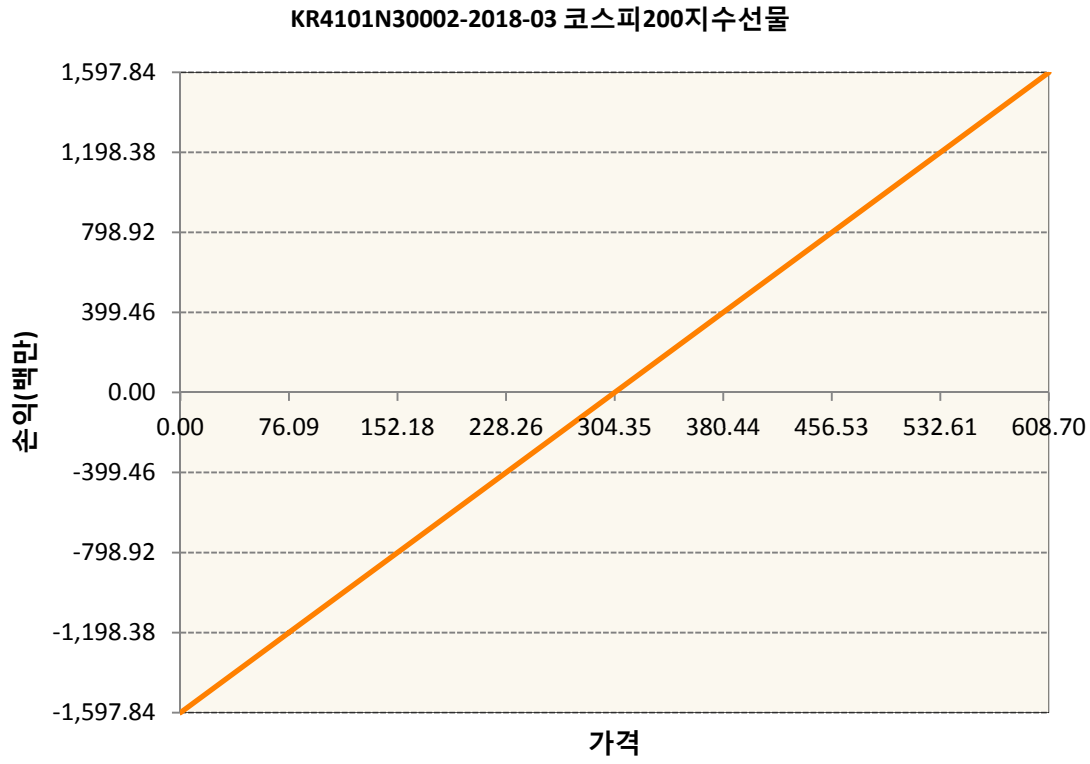
ETF스마트레버리지목표전환형10

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	305	0	305	장내
누계	유가증권	선물	1,598	0	1,598	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101N30(2018-03 코스피200지수선물							128
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-128	-128	-128	-128	-128	-128	-128
-5.33%	-85	-85	-85	-85	-85	-85	-85
-2.67%	-43	-43	-43	-43	-43	-43	-43
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	43	43	43	43	43	43	43
5.33%	85	85	85	85	85	85	85
8.00%	128	128	128	128	128	128	128

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

84

공시일	2018-02-12
기준일	2018-02-09

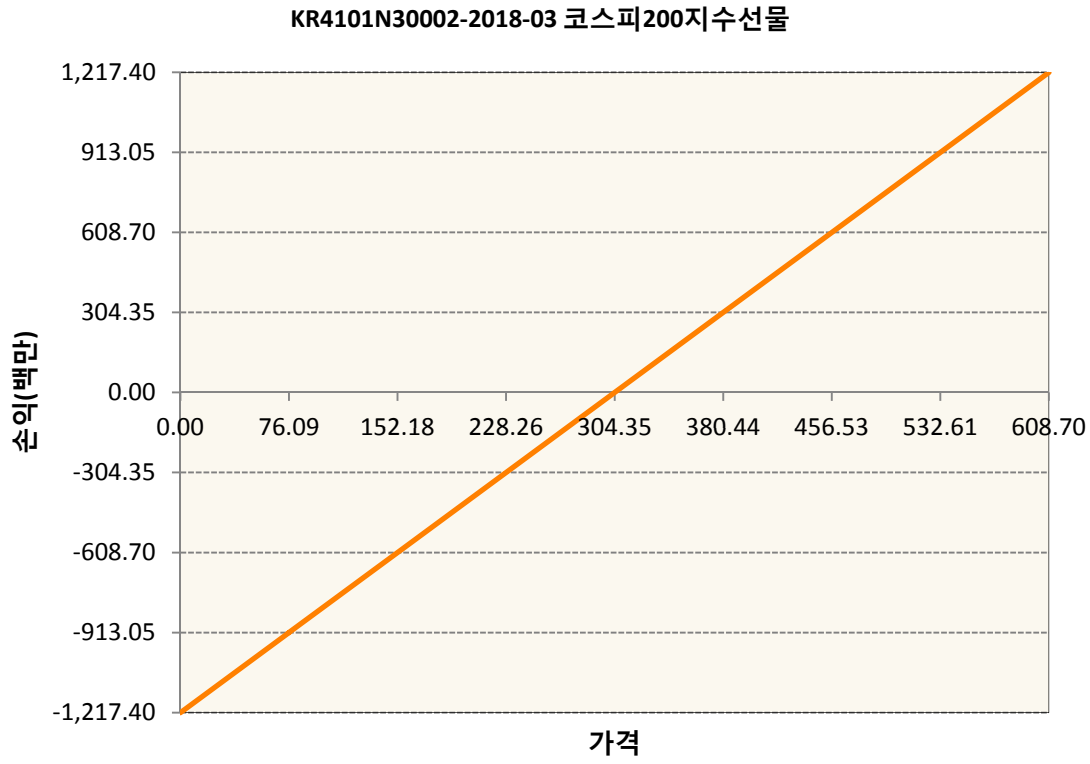
스마트KRX300인덱스1호(주식-파

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	1,217	0	1,217	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101N30(2018-03 코스피200지수선물							98
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-98	-98	-98	-98	-98	-98	-98
-5.33%	-65	-65	-65	-65	-65	-65	-65
-2.67%	-33	-33	-33	-33	-33	-33	-33
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	33	33	33	33	33	33	33
5.33%	65	65	65	65	65	65	65
8.00%	98	98	98	98	98	98	98

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

64

공시일	2018-02-12
기준일	2018-02-09

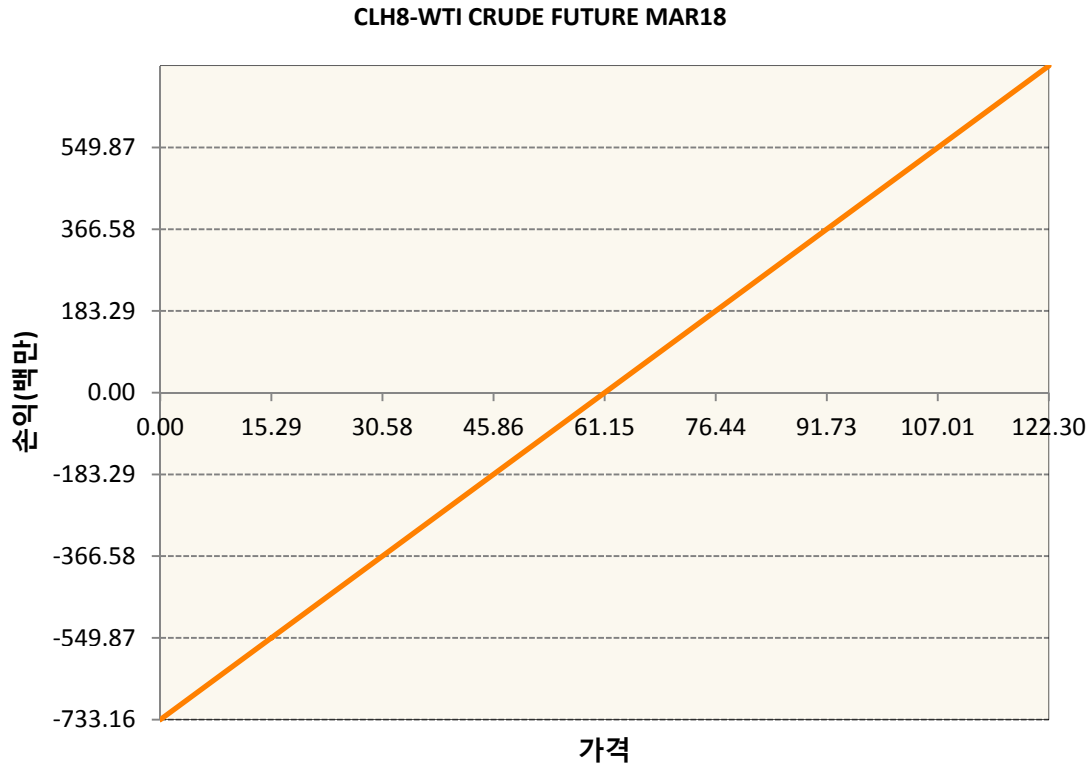
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

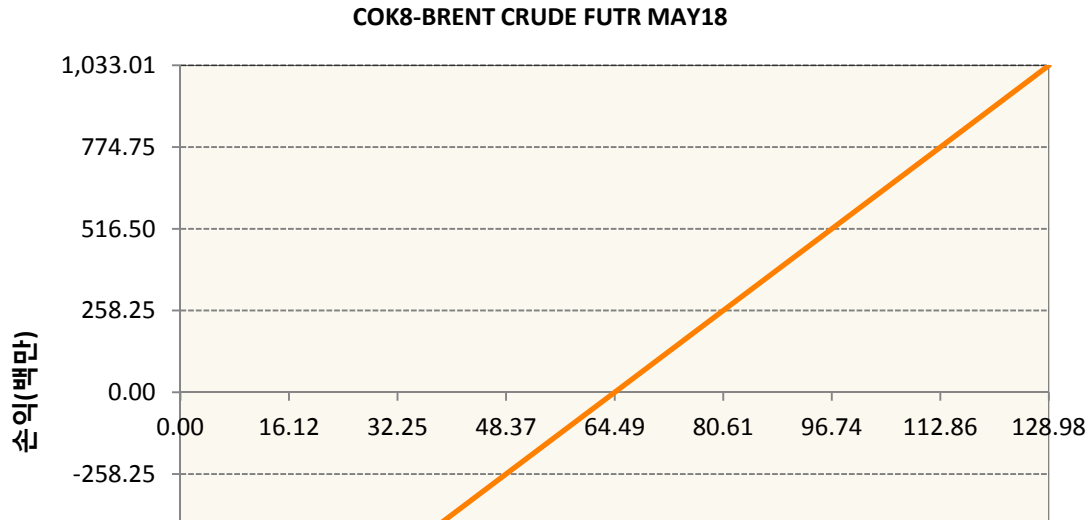
1. 계약금액

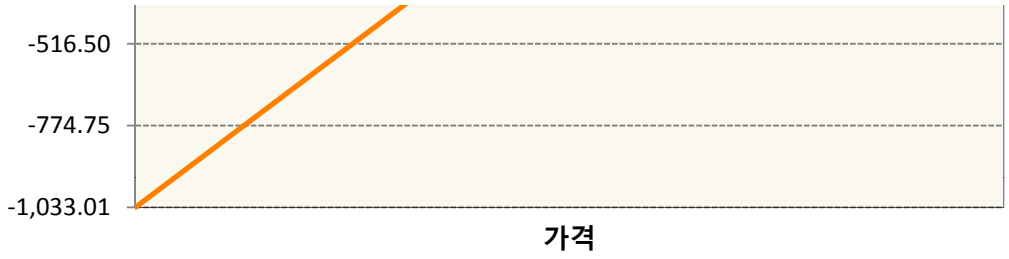
(단위:백만원)

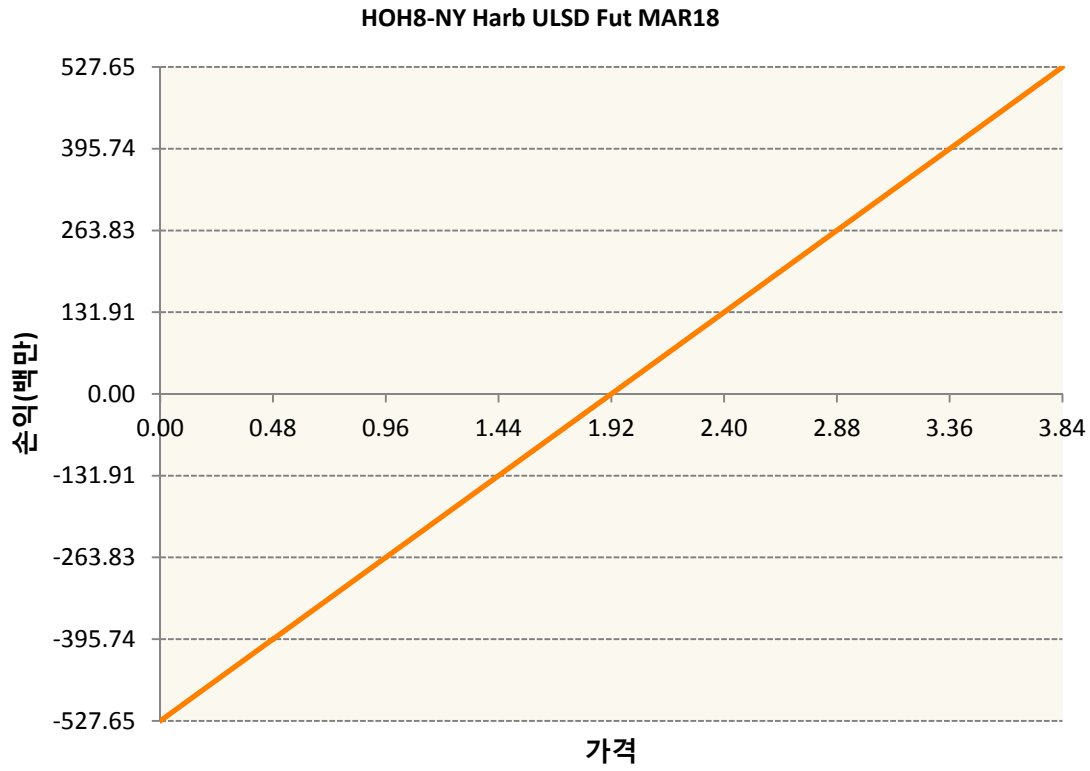
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,913	873	3,040	

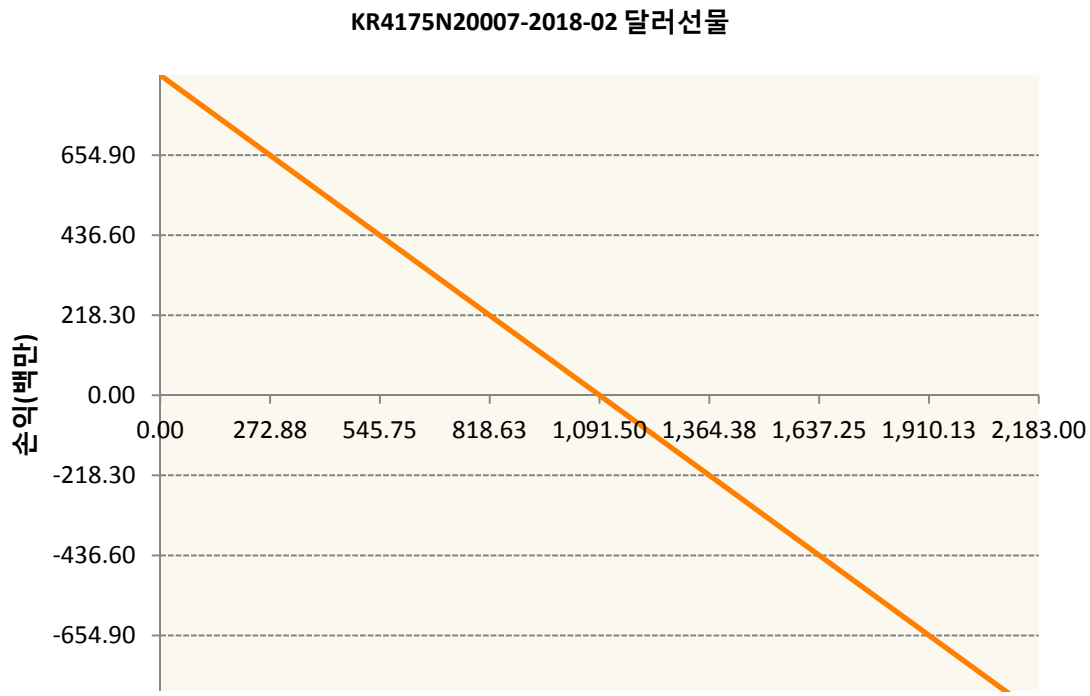
2. 만기시점의 손익구조

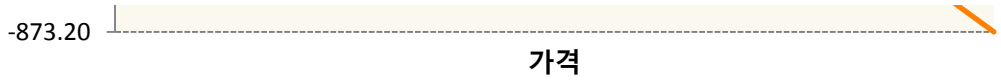


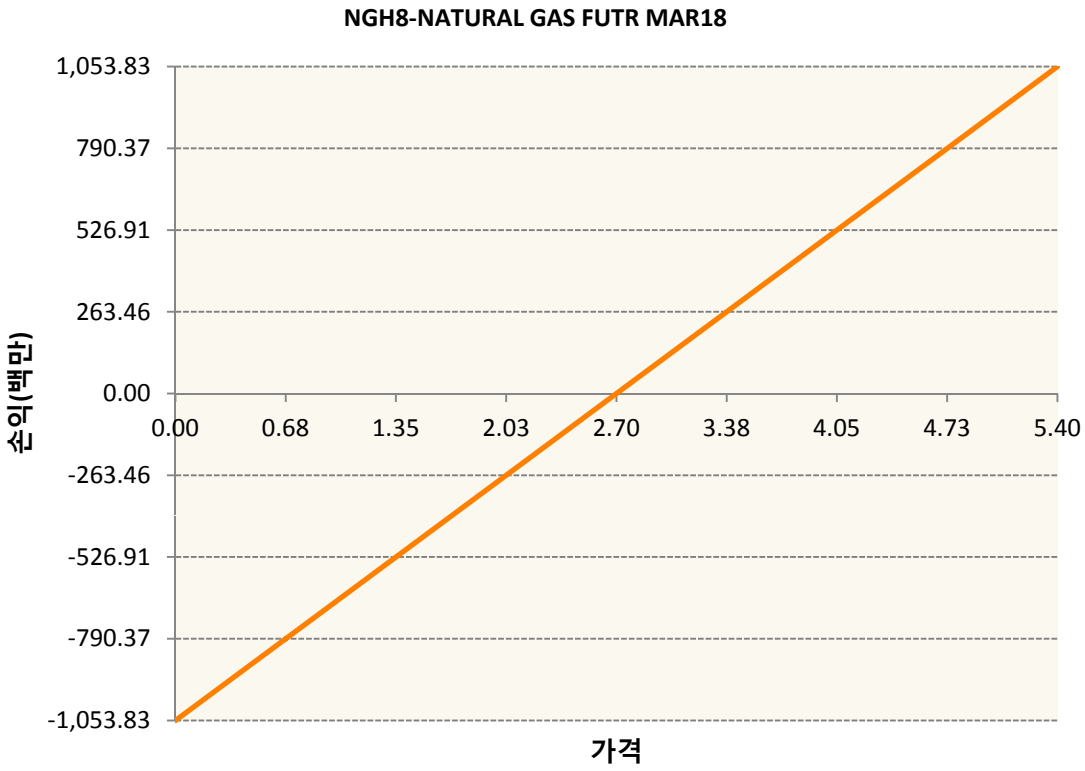


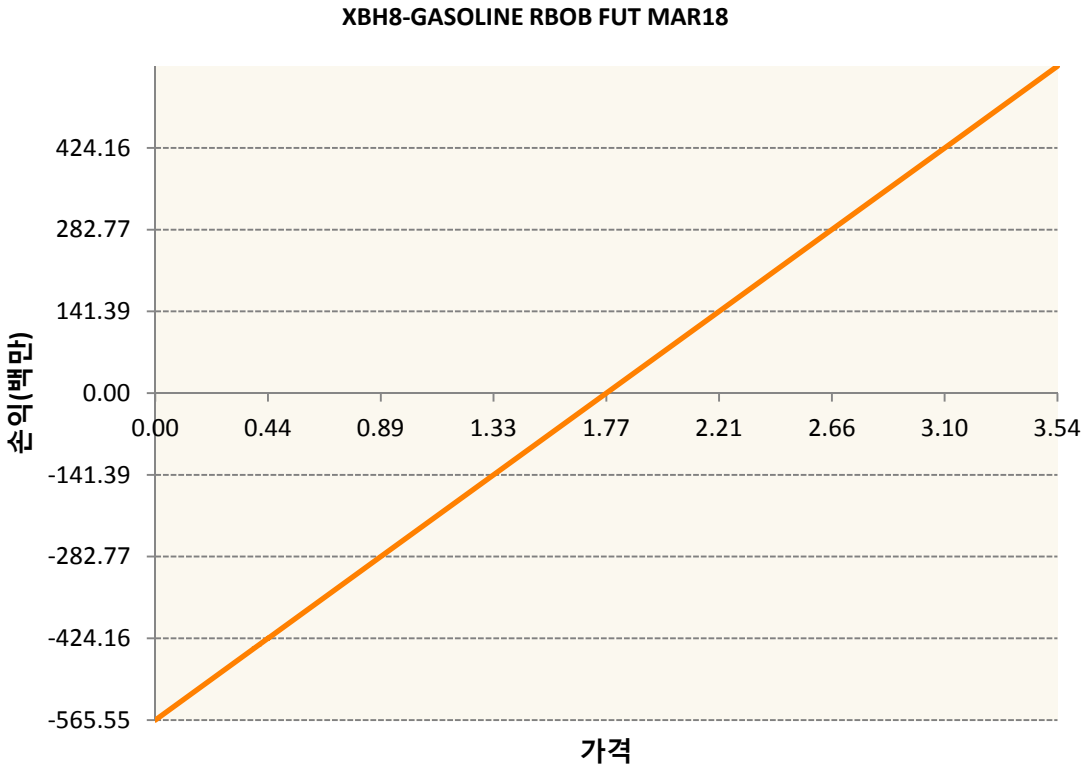

-516.50
-774.75
-1,033.01
가격


HOH8-NY Harb ULSD Fut MAR18
527.65
395.74
263.83
131.91
0.00
-131.91
-263.83
-395.74
-527.65
0.00
0.48
0.96
1.44
1.92
2.40
2.88
3.36
3.84
손익(백만)
가격


KR4175N20007-2018-02 달러선물
654.90
436.60
218.30
0.00
-218.30
-436.60
-654.90
0.00
272.88
545.75
818.63
1,091.50
1,364.38
1,637.25
1,910.13
2,183.00
손익(백만)


-873.20
가격


NGH8-NATURAL GAS FUTR MAR18
1,053.83
790.37
526.91
263.46
0.00
-263.46
-526.91
-790.37
-1,053.83
0.00
0.68
1.35
2.03
2.70
3.38
4.05
4.73
5.40
손익(백만)
가격


XBH8-GASOLINE RBOB FUT MAR18
424.16
282.77
141.39
0.00
-141.39
-282.77
-424.16
-565.55
0.00
0.44
0.89
1.33
1.77
2.21
2.66
3.10
3.54
손익(백만)
가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLH8	WTI CRUDE FUTURE MAR18	59
COK8	BRENT CRUDE FUTR MAY18	83
HOH8	NY Harb ULSD Fut MAR18	42
KR4175N20(	2018-02 달러선물	70
NGH8	NATURAL GAS FUTR MAR18	84
XBH8	GASOLINE RBOB FUT MAR18	45

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

534

공시일	2018-02-12
기준일	2018-02-09

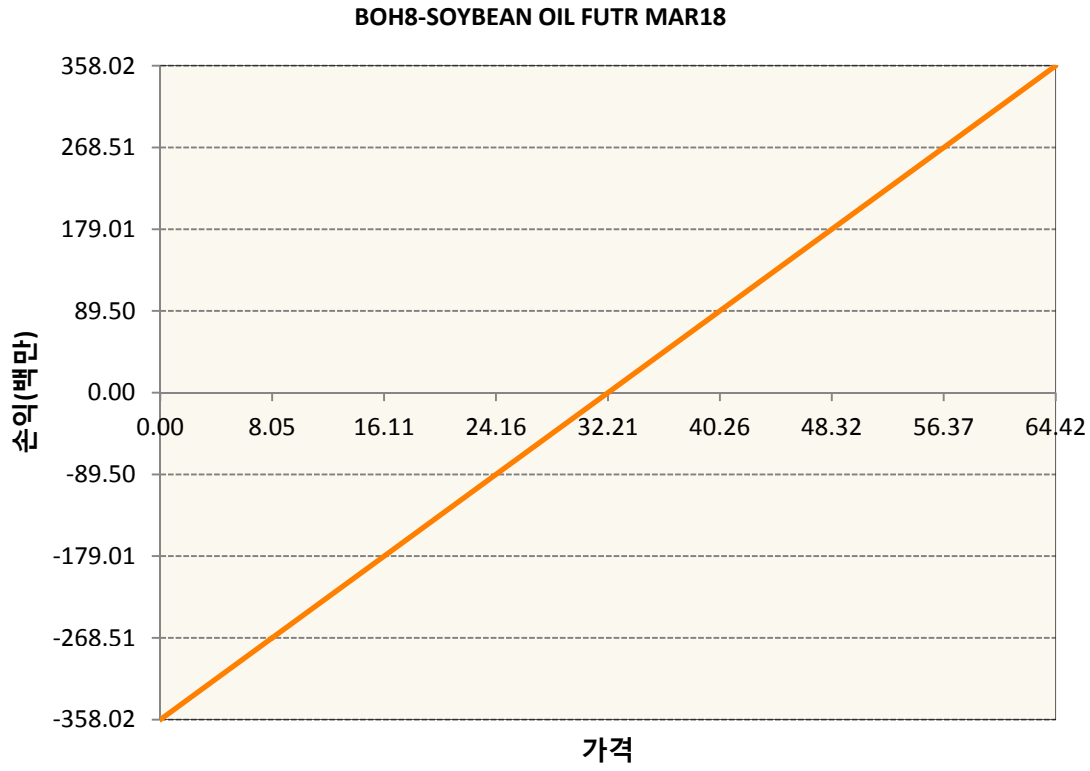
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

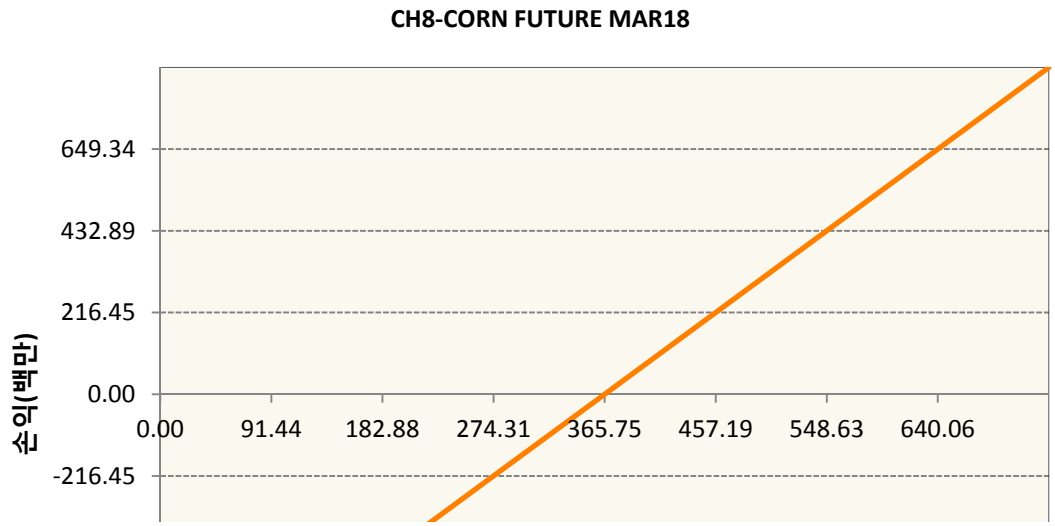
1. 계약금액

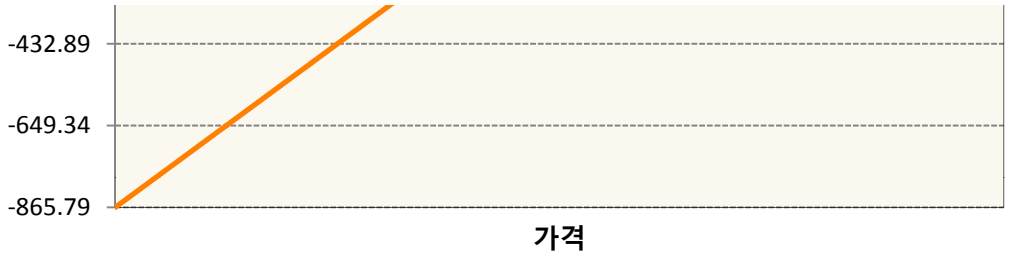
(단위:백만원)

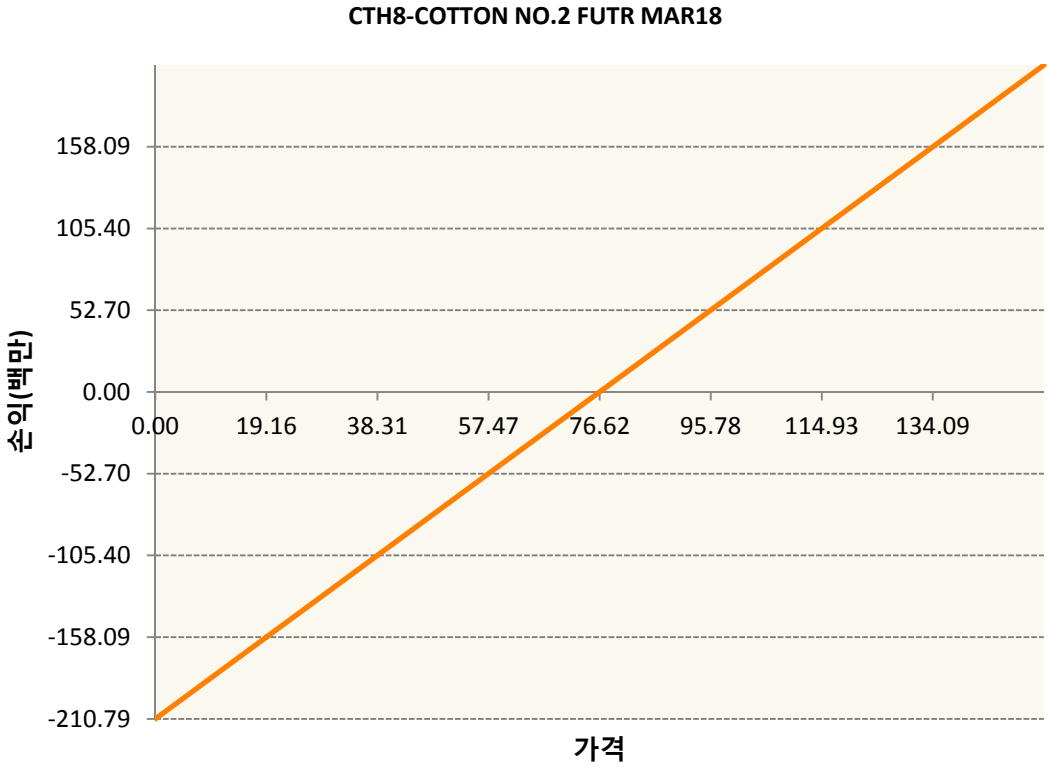
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	4,087	327	3,759	

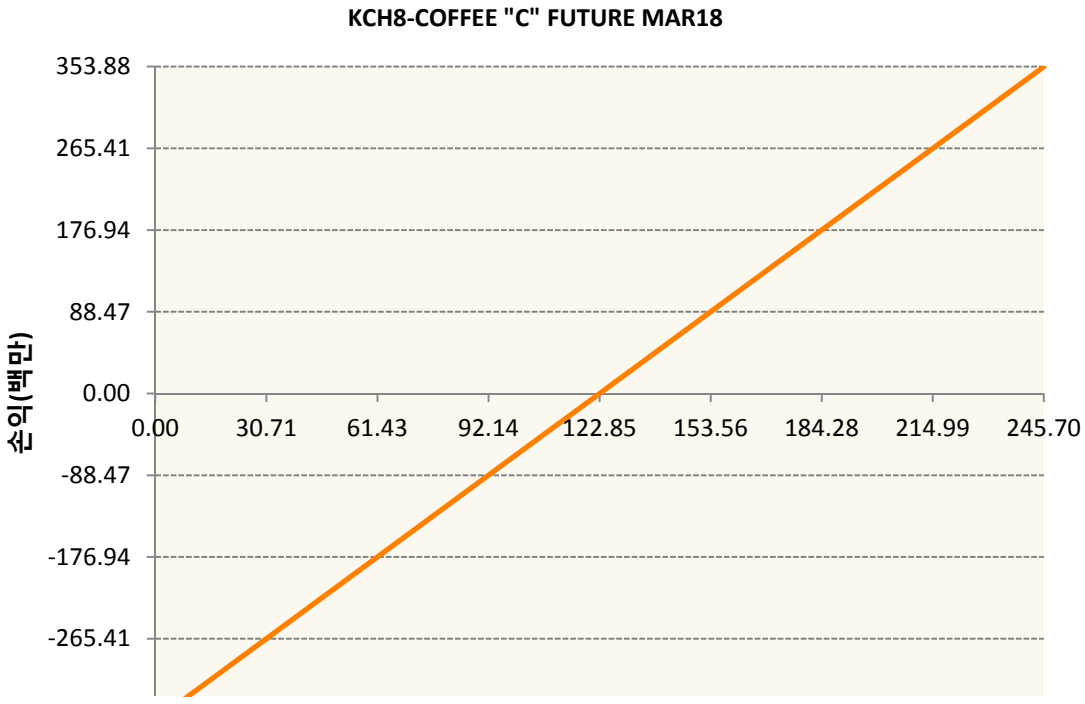
2. 만기시점의 손익구조

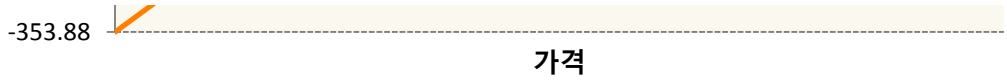


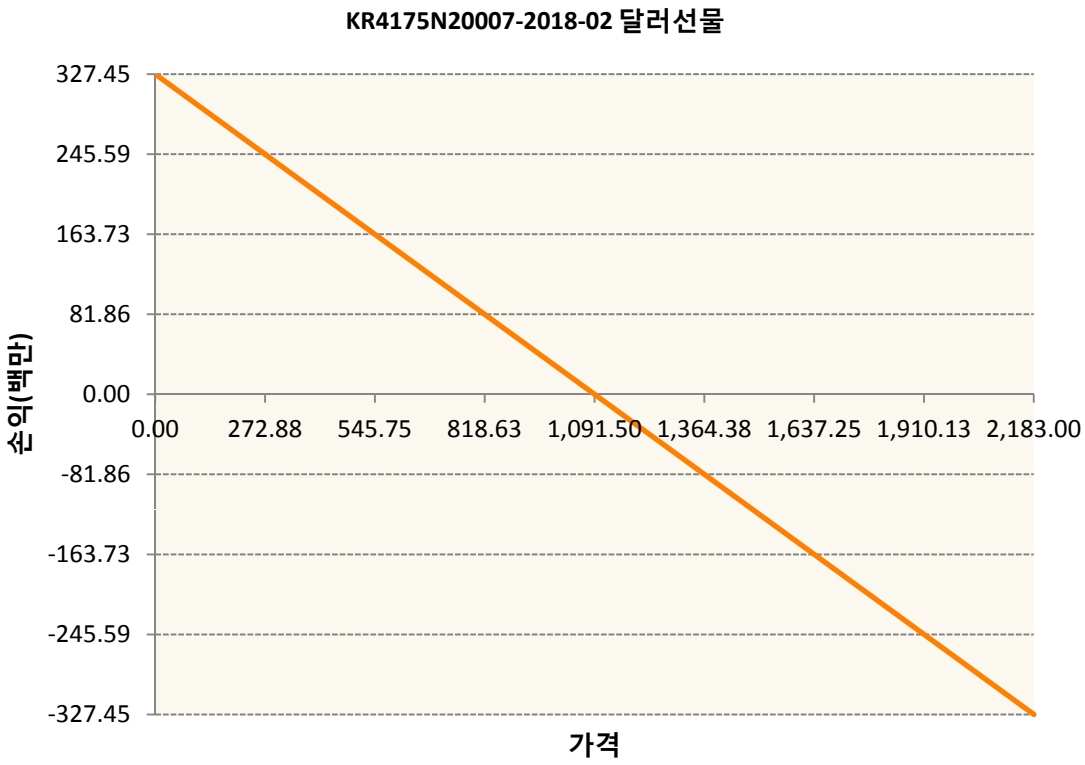


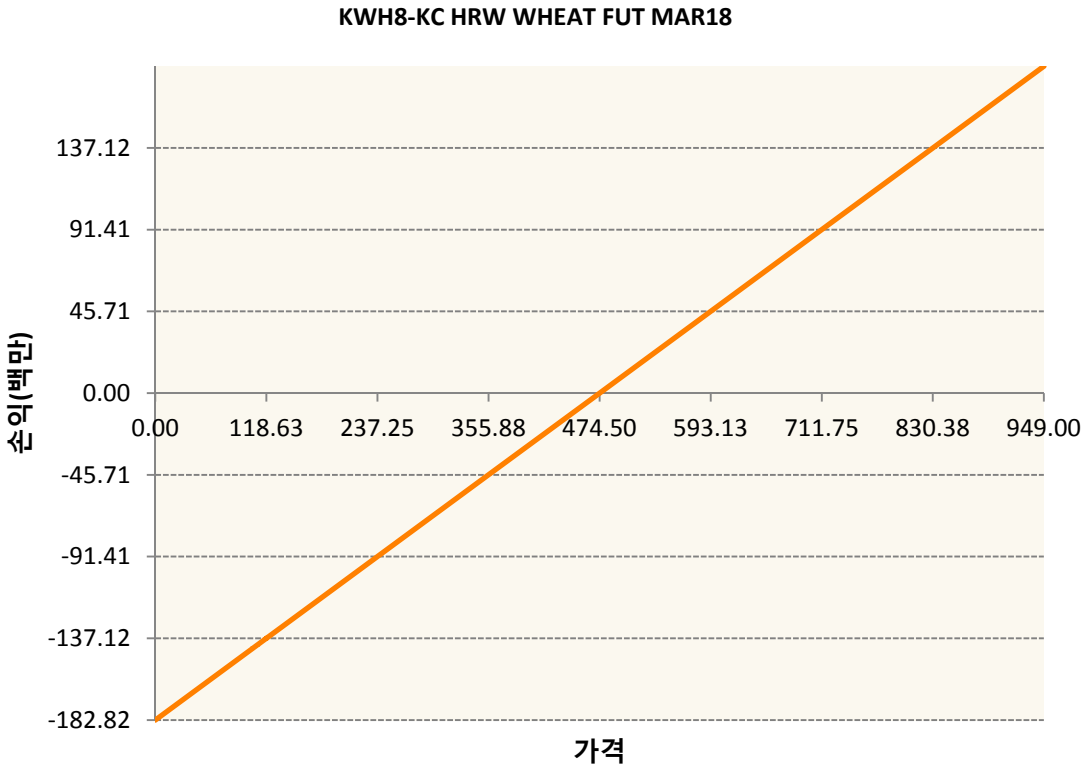

-432.89
-649.34
-865.79
가격

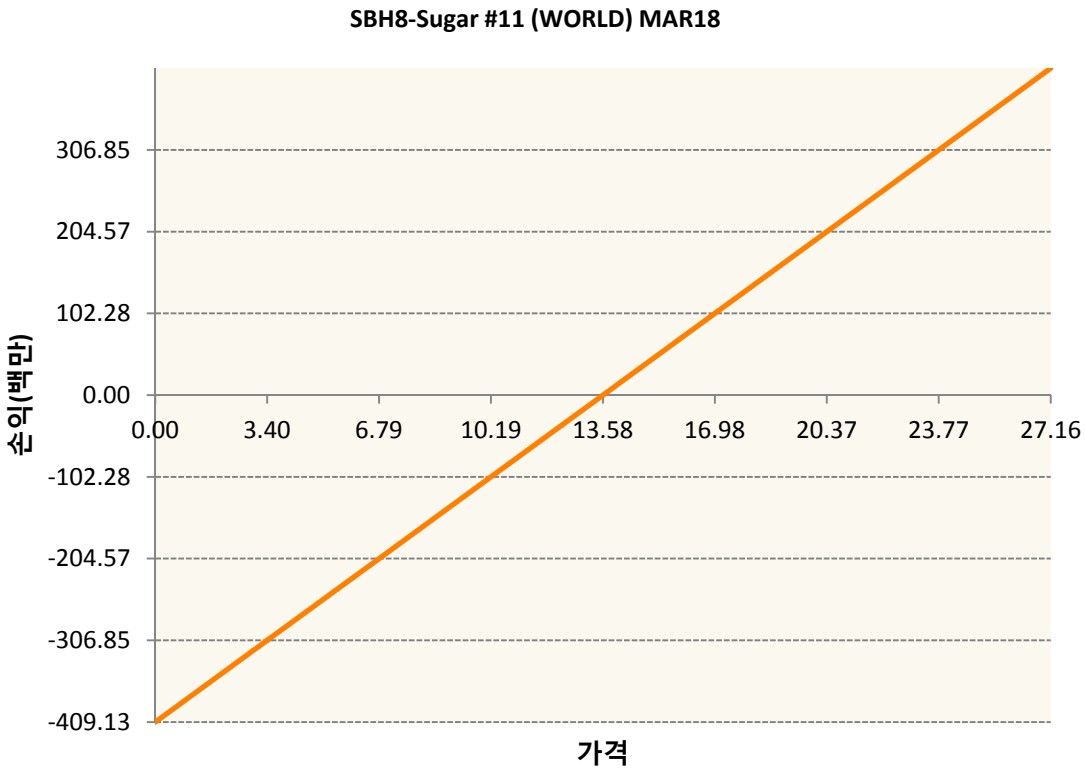

CTH8-COTTON NO.2 FUTR MAR18
158.09
105.40
52.70
0.00
-52.70
-105.40
-158.09
-210.79
0.00
19.16
38.31
57.47
76.62
95.78
114.93
134.09
손익(백만)
가격

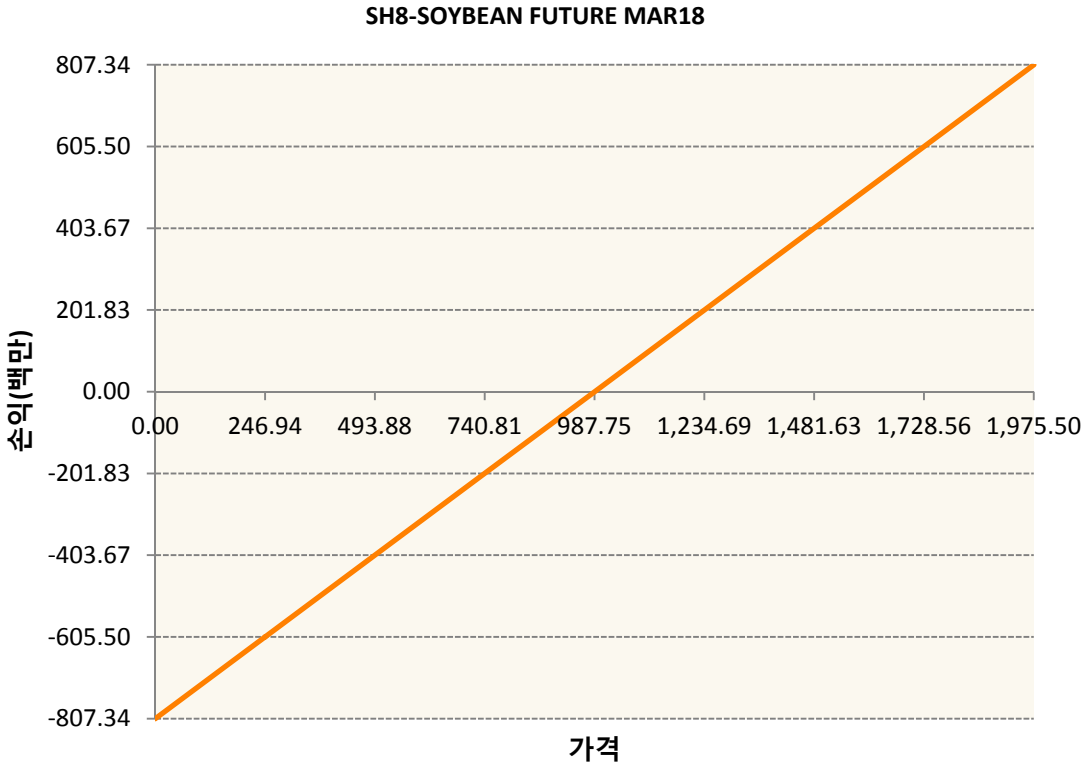

KCH8-COFFEE "C" FUTURE MAR18
353.88
265.41
176.94
88.47
0.00
-88.47
-176.94
-265.41
0.00
30.71
61.43
92.14
122.85
153.56
184.28
214.99
245.70
손익(백만)


-353.88
가격

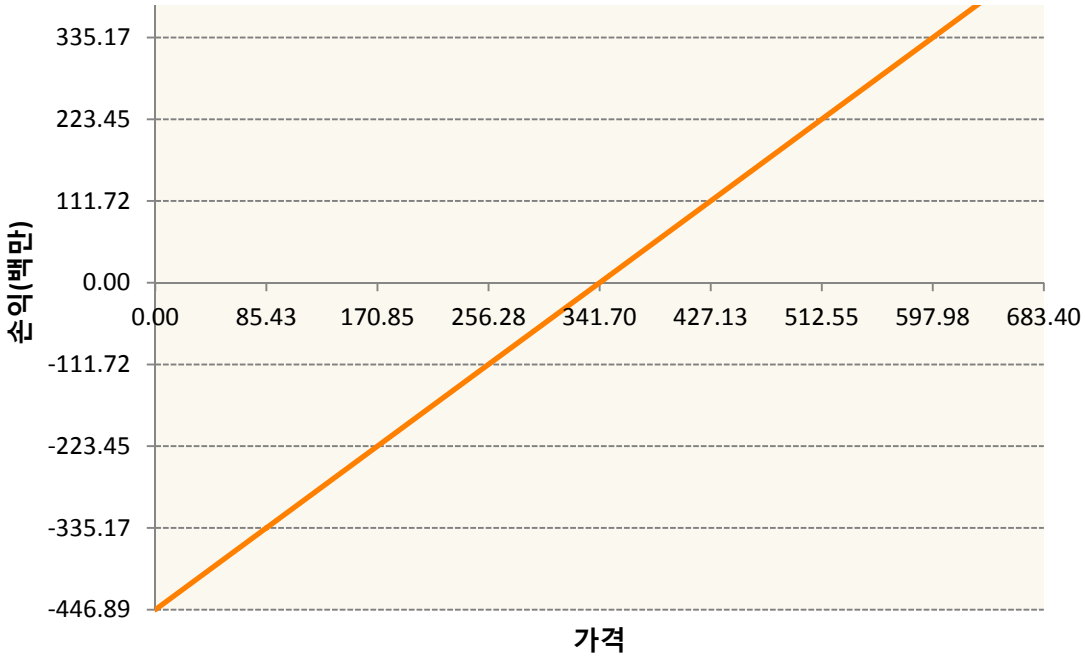

KR4175N20007-2018-02 달러선물
327.45
245.59
163.73
81.86
0.00
-81.86
-163.73
-245.59
-327.45
0.00
272.88
545.75
818.63
1,091.50
1,364.38
1,637.25
1,910.13
2,183.00
손익(백만)
가격


KWH8-KC HRW WHEAT FUT MAR18
137.12
91.41
45.71
0.00
-45.71
-91.41
-137.12
-182.82
0.00
118.63
237.25
355.88
474.50
593.13
711.75
830.38
949.00
손익(백만)
가격

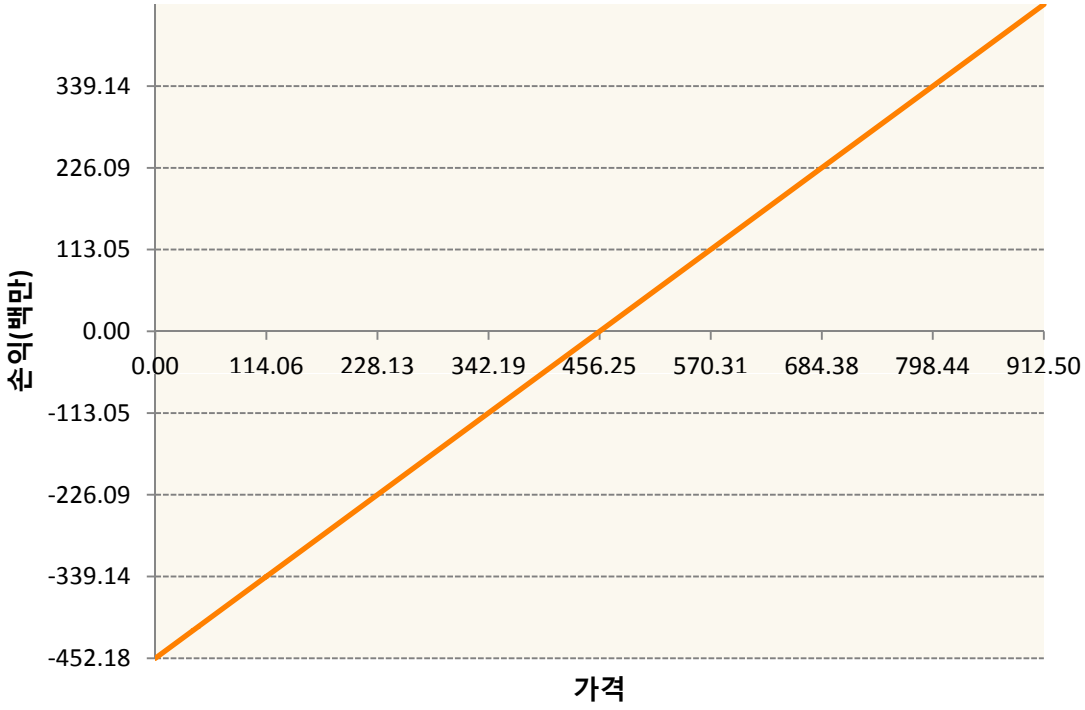

SBH8-Sugar #11 (WORLD) MAR18
306.85
204.57
102.28
0.00
-102.28
-204.57
-306.85
-409.13
손익(백만)
0.00
3.40
6.79
10.19
13.58
16.98
20.37
23.77
27.16
가격


SH8-SOYBEAN FUTURE MAR18
807.34
605.50
403.67
201.83
0.00
-201.83
-403.67
-605.50
-807.34
손익(백만)
0.00
246.94
493.88
740.81
987.75
1,234.69
1,481.63
1,728.56
1,975.50
가격


SMH8-SOYBEAN MEAL FUTR MAR18
446.89



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	15
SBH8	Sugar #11 (WORLD) MAR18	33
SH8	SOYBEAN FUTURE MAR18	65
SMH8	SOYBEAN MEAL FUTR MAR18	36
WH8	WHEAT FUTURE(CBT) MAR18	36

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

339