공시일	2018-02-13
기준일	2018-02-12

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	2018-02-13
기준일	2018-02-12

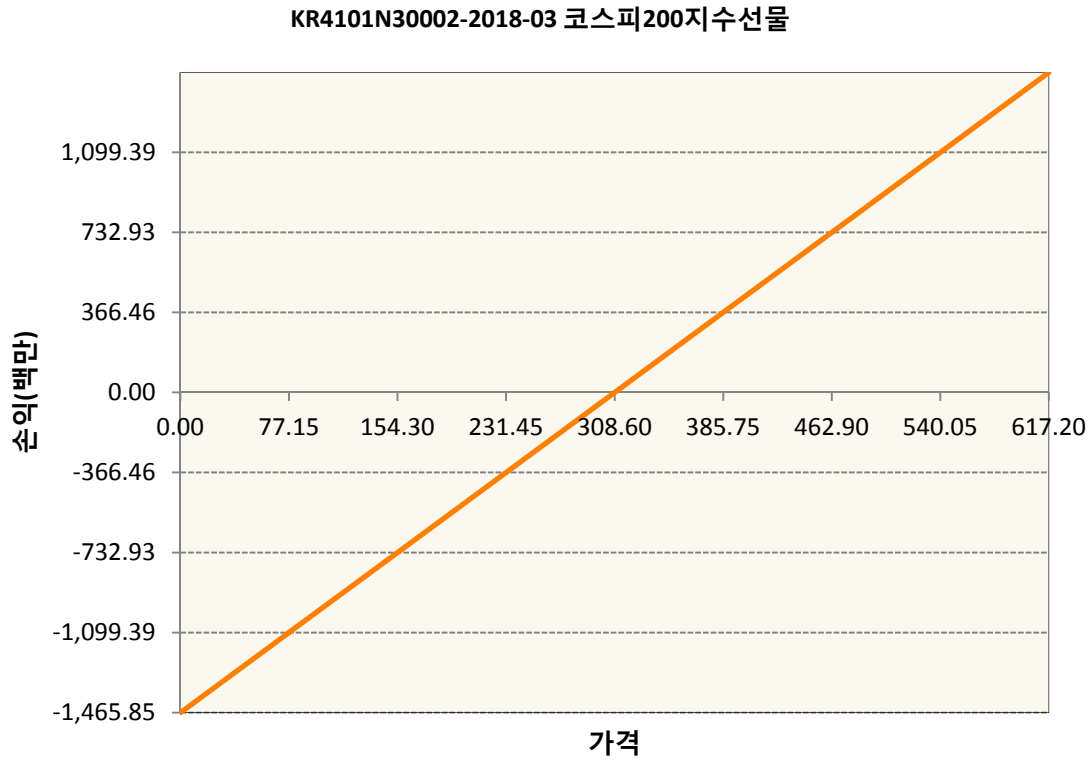
스마트인덱스모

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	1,466	0	1,466	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101N30(2018-03 코스피200지수선물							117
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-117	-117	-117	-117	-117	-117	-117
-5.33%	-78	-78	-78	-78	-78	-78	-78
-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%	78	78	78	78	78	78	78
8.00%	117	117	117	117	117	117	117

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

77

공시일	2018-02-13
기준일	2018-02-12

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	1,075

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

381

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2018-02-13
기준일	2018-02-12

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	380

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

370

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2018-02-13
기준일	2018-02-12

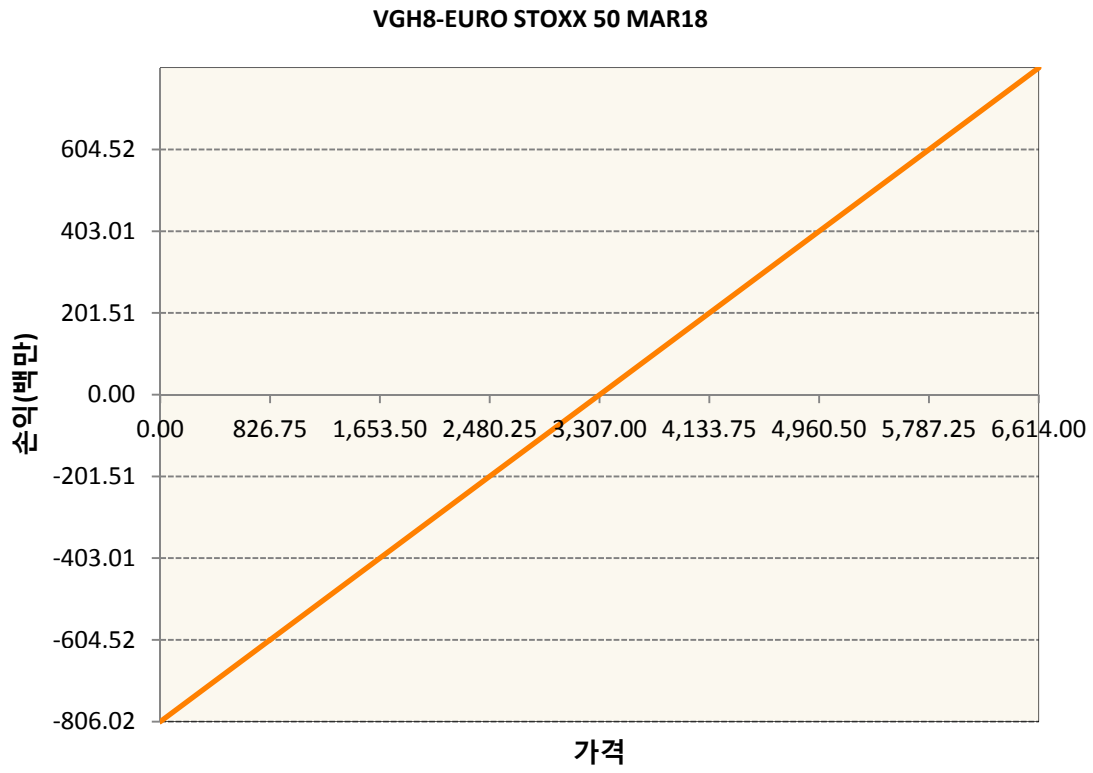
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	806	0	806	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGH8	EURO STOXX 50 MAR18	64

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

(단위:백만원)

37

공시일	2018-02-13
기준일	2018-02-12

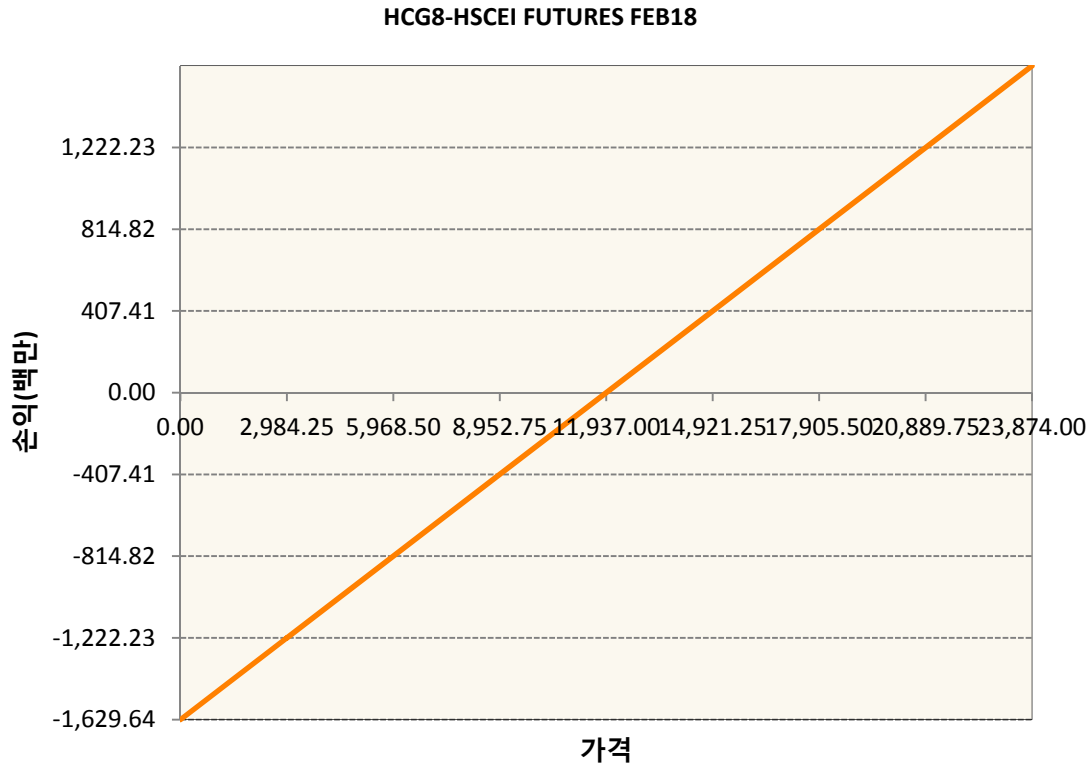
차이나인덱스모(주식-파생형)

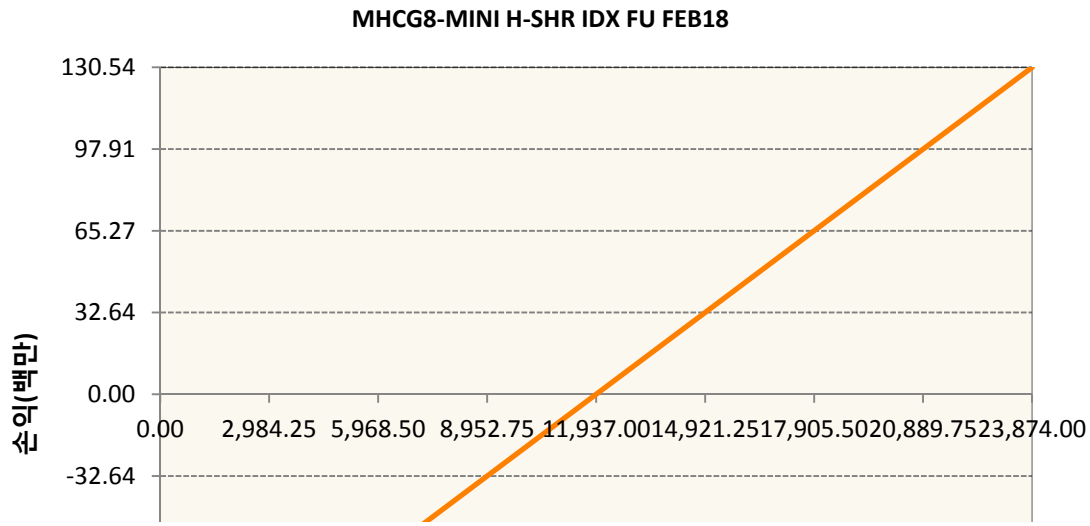
1. 계약금액

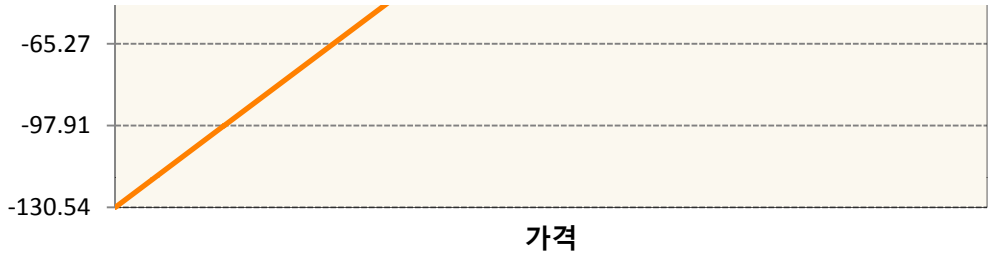
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,760	0	1,760	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCG8	HSCEI FUTURES FEB18	130
MHCG8	MINI H-SHR IDX FU FEB18	10

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

공시일	2018-02-13
기준일	2018-02-12

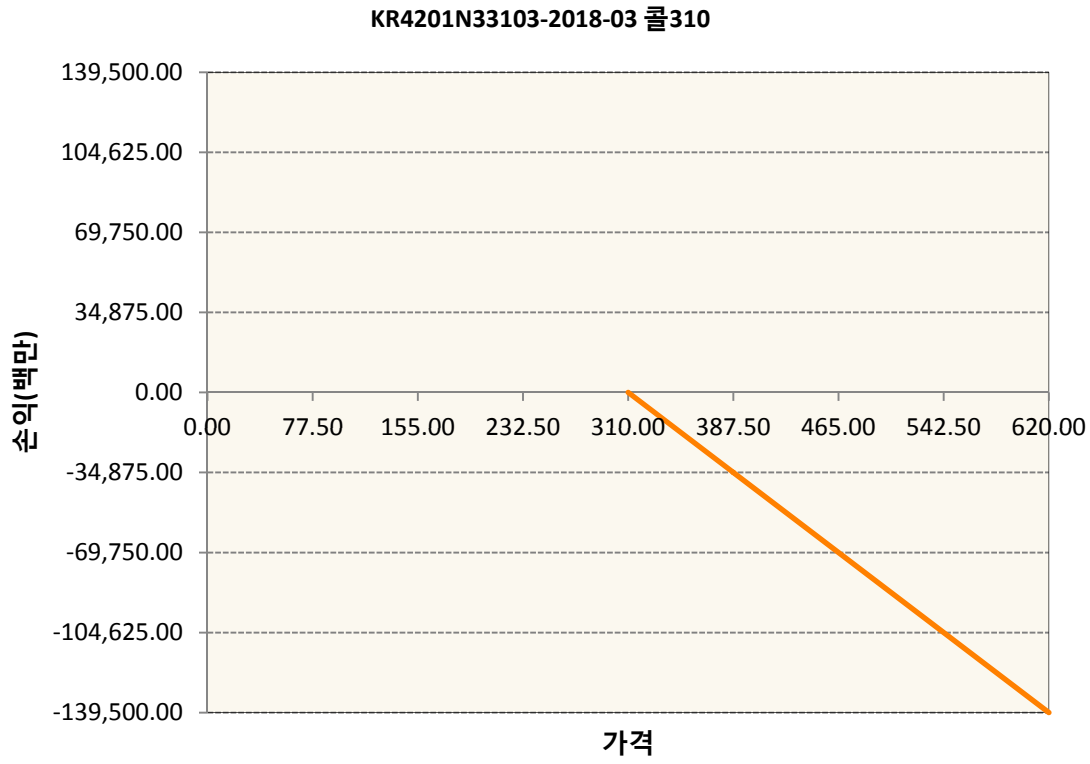
커버드콜모(주식혼합-파생형)

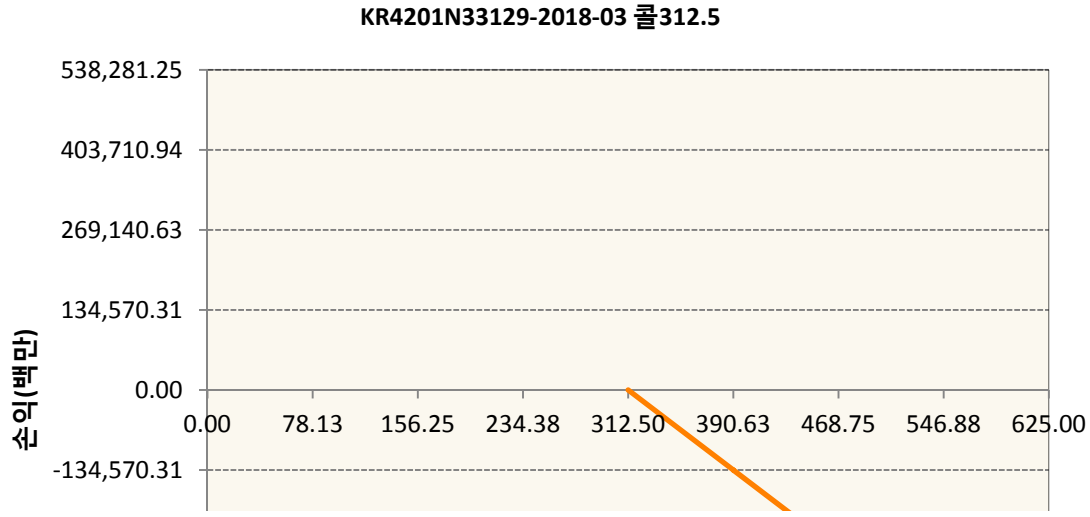
1. 계약금액

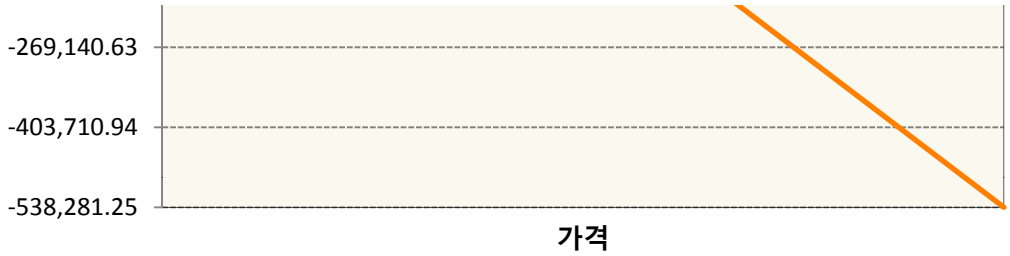
(단위:백만원)

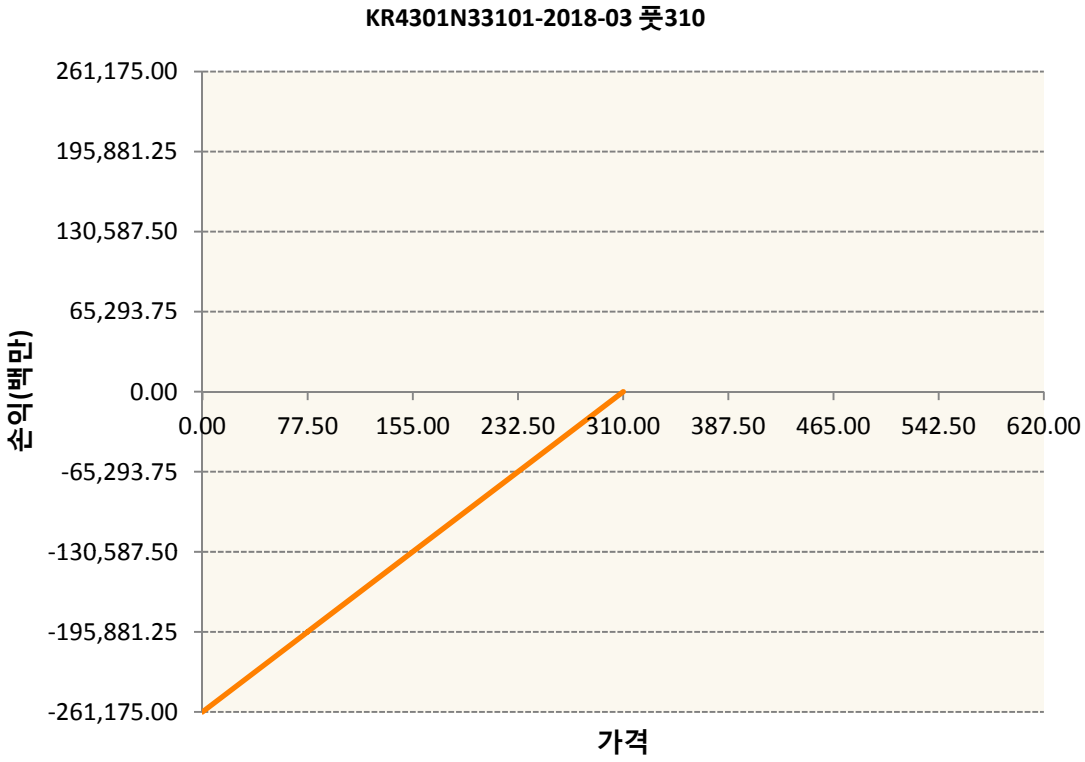
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	1,144,425	-1,144,425	장내

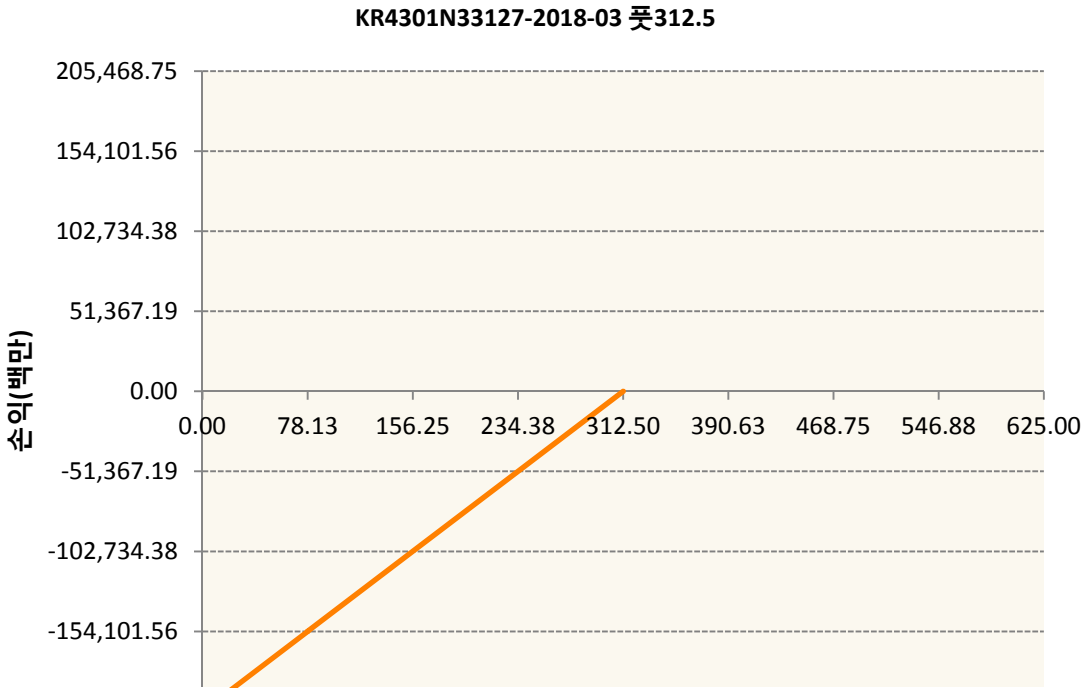
2. 만기시점의 손익구조






-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							8,267
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	3,363	3,277	3,170	3,041	2,894	2,731	2,553
-5.33%	3,054	2,881	2,688	2,478	2,255	2,021	1,778
-2.67%	2,326	2,058	1,781	1,498	1,210	917	622
0%	966	644	322	0	-322	-645	-968
2.67%	-1,122	-1,429	-1,739	-2,052	-2,367	-2,684	-3,002
5.33%	-3,869	-4,104	-4,354	-4,616	-4,888	-5,168	-5,454
8.00%	-7,086	-7,234	-7,406	-7,598	-7,807	-8,030	-8,267
KR4201N3312018-03 콜312.5							30,204
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	11,176	10,919	10,580	10,162	9,671	9,114	8,498
-5.33%	10,288	9,726	9,080	8,364	7,587	6,760	5,889
-2.67%	8,056	7,121	6,139	5,121	4,072	3,001	1,909
0%	3,634	2,429	1,217	0	-1,221	-2,445	-3,671
2.67%	-3,512	-4,741	-5,975	-7,213	-8,455	-9,699	-10,945
5.33%	-13,303	-14,311	-15,363	-16,449	-17,563	-18,698	-19,851
8.00%	-25,130	-25,807	-26,568	-27,398	-28,288	-29,225	-30,204
KR4301N3312018-03 풋310							15,967
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-14,451	-14,611	-14,812	-15,052	-15,328	-15,634	-15,967
-5.33%	-8,114	-8,438	-8,799	-9,191	-9,608	-10,046	-10,502
-2.67%	-2,561	-3,063	-3,580	-4,110	-4,650	-5,198	-5,752
0%	1,809	1,206	603	0	-604	-1,208	-1,812
2.67%	4,814	4,241	3,660	3,074	2,484	1,891	1,295
5.33%	6,588	6,148	5,680	5,189	4,680	4,156	3,620
8.00%	7,479	7,203	6,881	6,522	6,131	5,712	5,270
KR4301N3312018-03 풋312.5							12,947
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-11,925	-12,023	-12,153	-12,312	-12,499	-12,712	-12,947
-5.33%	-6,867	-7,081	-7,328	-7,601	-7,898	-8,214	-8,546
-2.67%	-2,322	-2,679	-3,053	-3,442	-3,842	-4,252	-4,668
0%	1,387	927	465	0	-466	-933	-1,401
2.67%	4,056	3,587	3,116	2,644	2,170	1,695	1,219

5.33%	5,716	5,331	4,930	4,515	4,090	3,657	3,217
8.00%	6,598	6,340	6,050	5,733	5,393	5,035	4,662

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

63,916

공시일	2018-02-13
기준일	2018-02-12

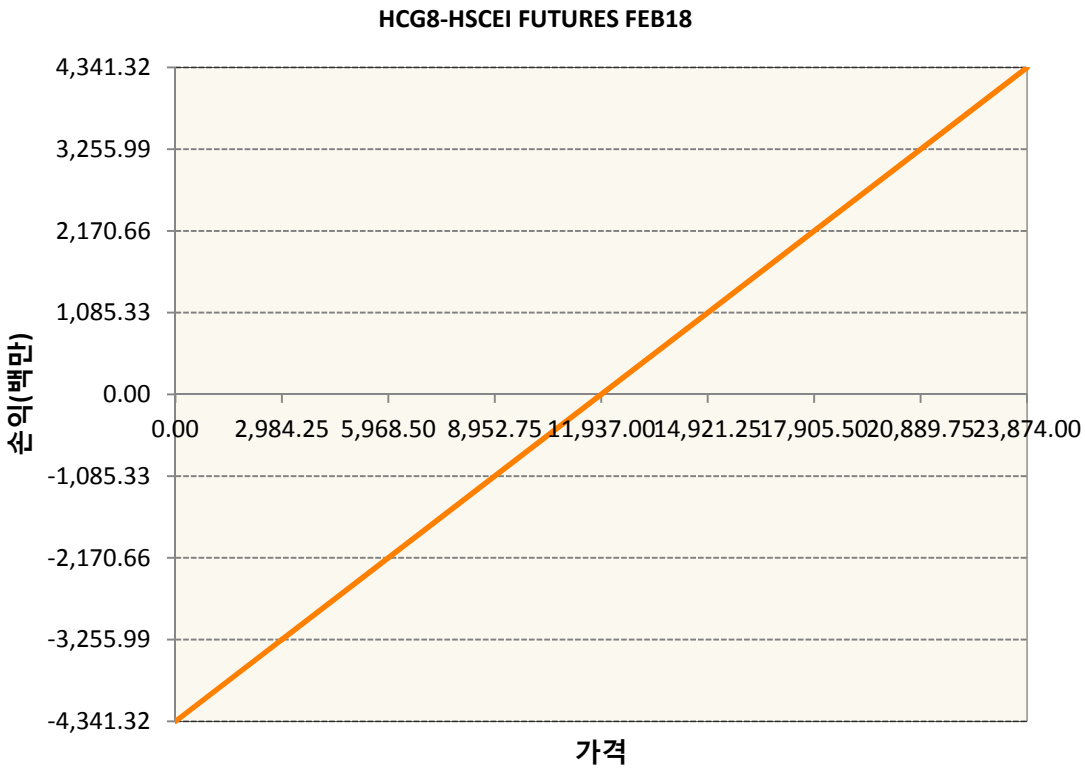
홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생

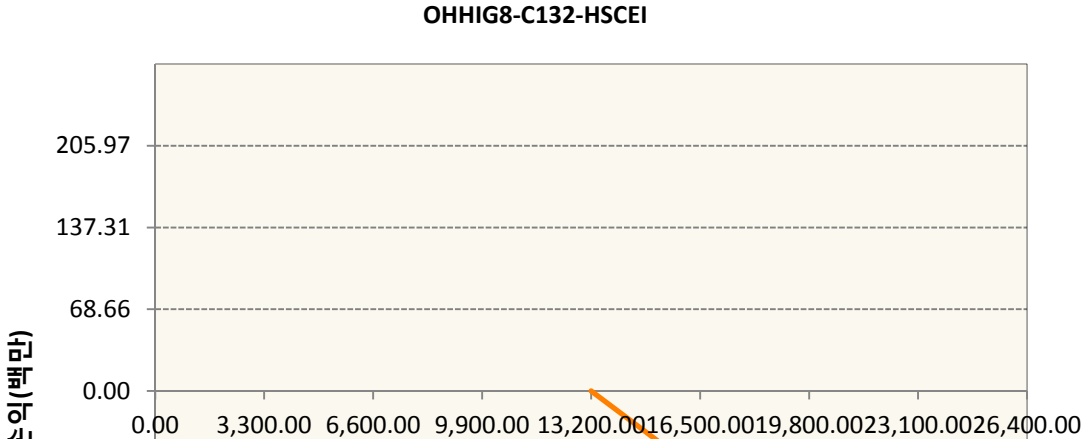
1. 계약금액

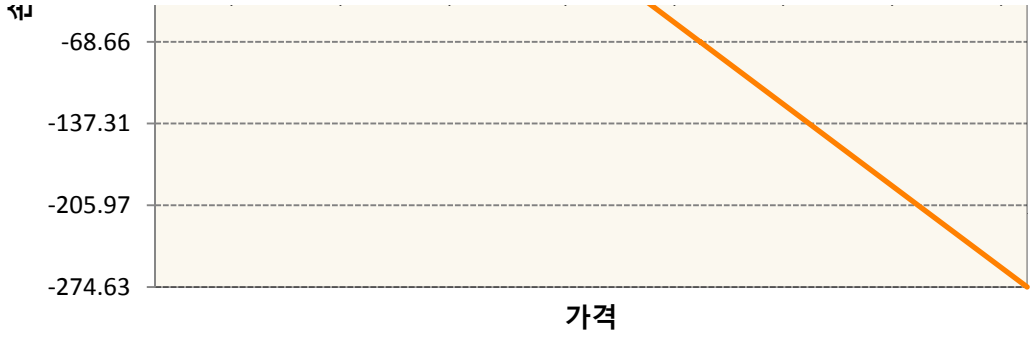
(단위:백만원)

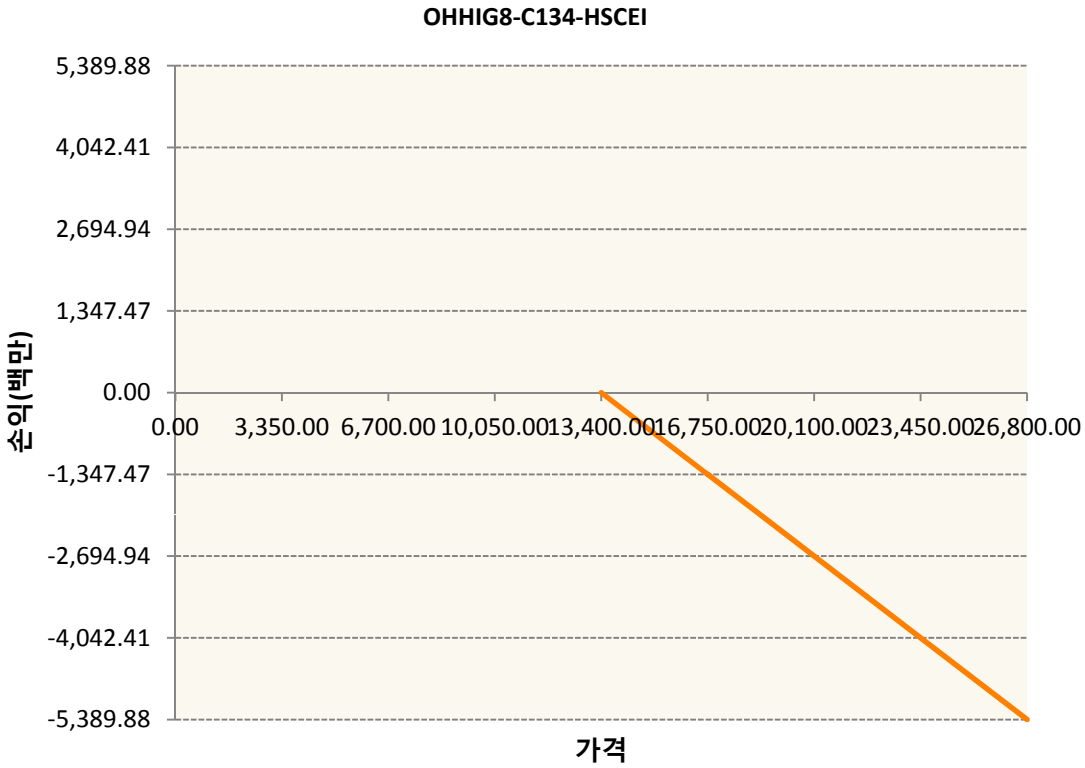
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	4,341	0	4,341	장내
누계	유가증권	옵션	0	11,329	-11,329	장내

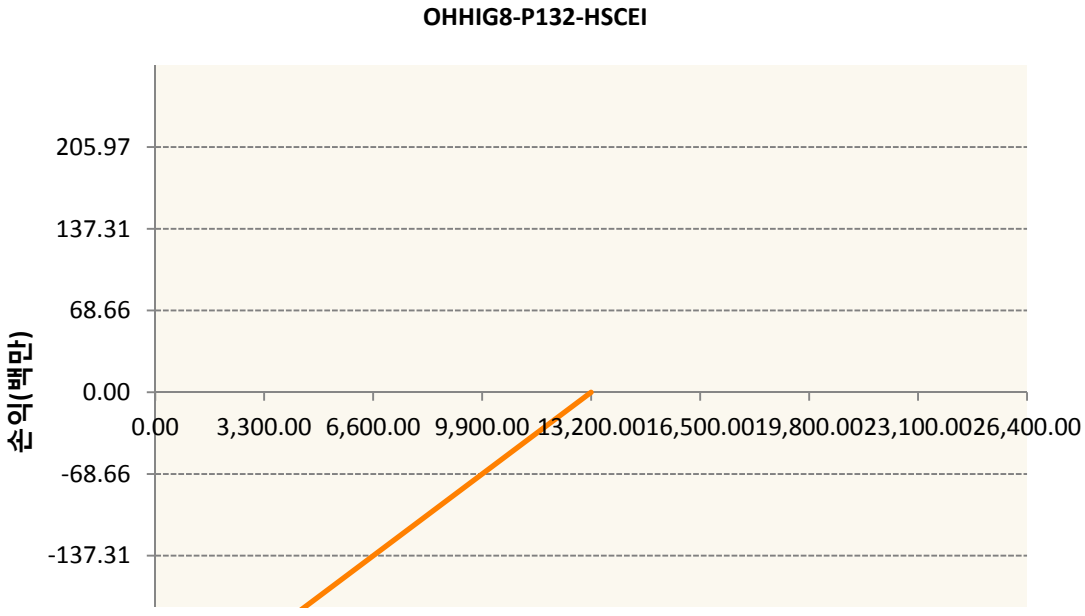
2. 만기시점의 손익구조

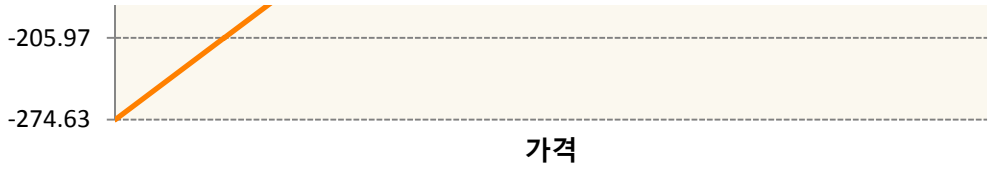


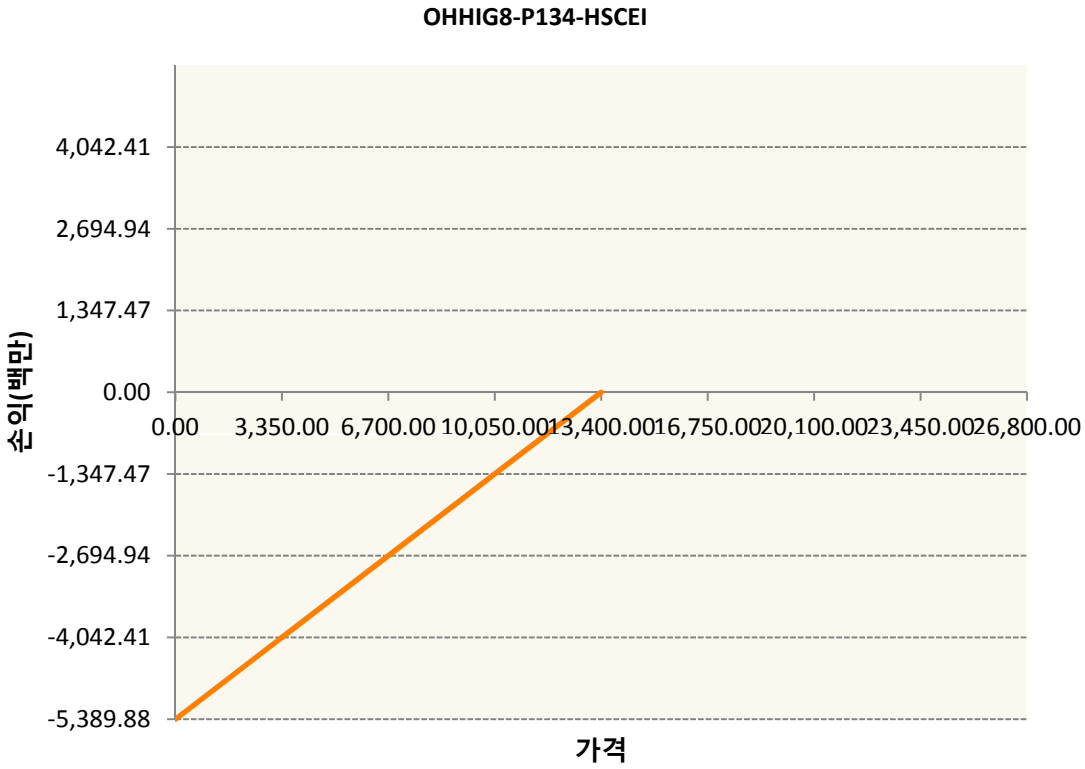



-68.66
-137.31
-205.97
-274.63
가격


OHHIG8-C134-HSCEI
5,389.88
4,042.41
2,694.94
1,347.47
0.00
-1,347.47
-2,694.94
-4,042.41
-5,389.88
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
205.97
137.31
68.66
0.00
-68.66
-137.31
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	431
OHHIG8-P1	HSCEI	22
OHHIG8-P1	HSCEI	431

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,080

공시일	2018-02-13
기준일	2018-02-12

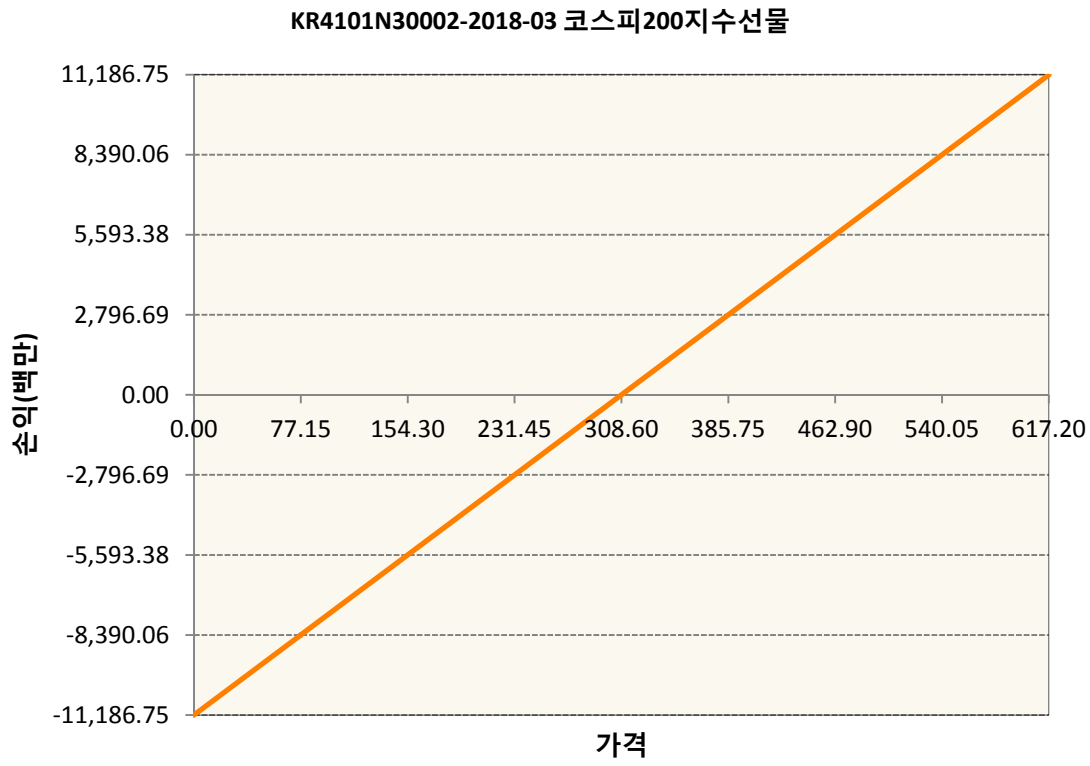
코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼

1. 계약금액

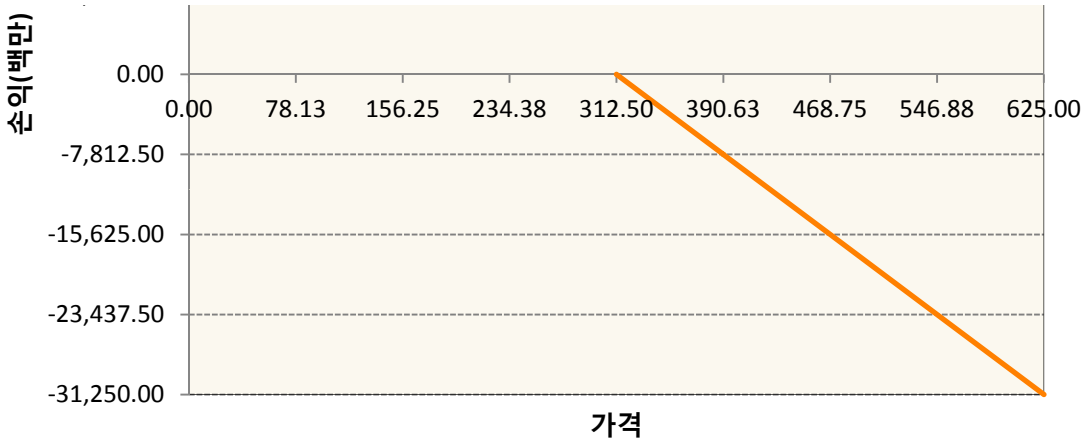
(단위:백만원)

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	11,187	0	11,187	장내
누계	유가증권	스왑	60,200	0	60,200	장외
누계	유가증권	옵션	0	56,094	-56,094	장내

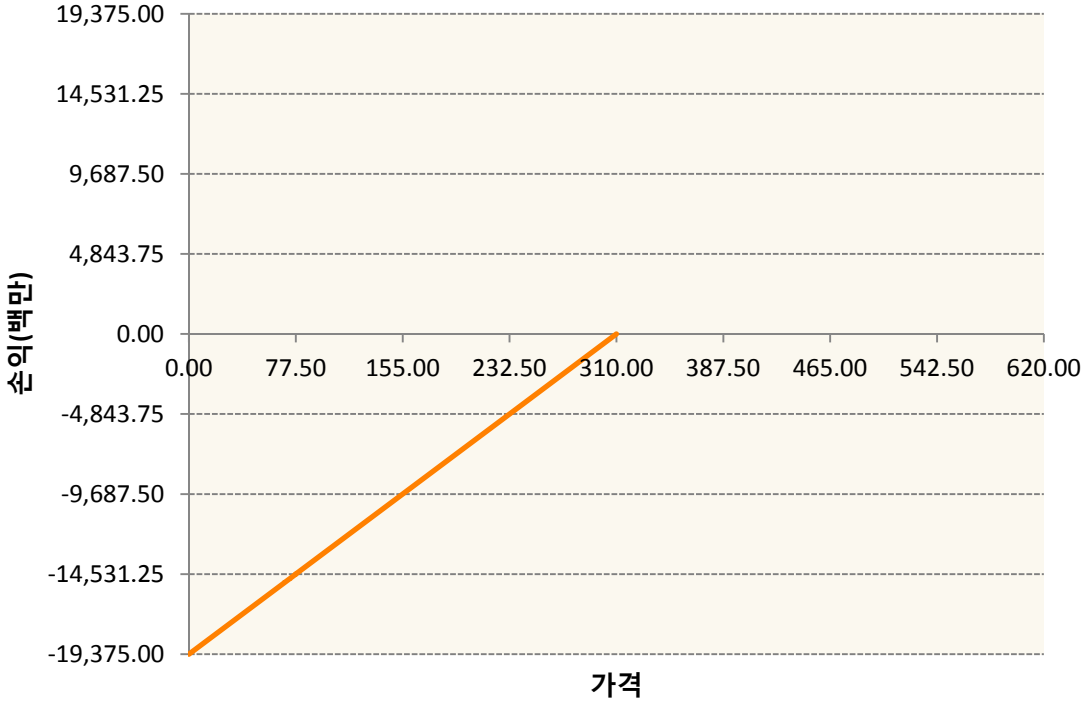
2. 만기시점의 손익구조



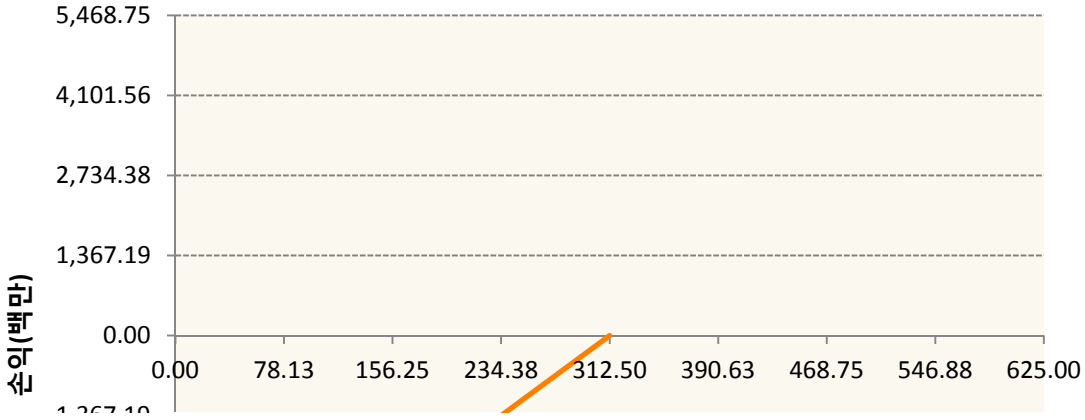




KR4301N33101-2018-03 풋310



KR4301N33127-2018-03 풋312.5





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_2							1,454
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,454	-1,454	-1,454	-1,454	-1,454	-1,454	-1,454
-5.33%	-969	-969	-969	-969	-969	-969	-969
-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%	969	969	969	969	969	969	969
8.00%	1,454	1,454	1,454	1,454	1,454	1,454	1,454
2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_3							275
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-275	-275	-275	-275	-275	-275	-275
-5.33%	-183	-183	-183	-183	-183	-183	-183
-2.67%	-92	-92	-92	-92	-92	-92	-92
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	92	92	92	92	92	92	92
5.33%	183	183	183	183	183	183	183
8.00%	275	275	275	275	275	275	275
2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_4							157
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-157	-157	-157	-157	-157	-157	-157
-5.33%	-105	-105	-105	-105	-105	-105	-105
-2.67%	-52	-52	-52	-52	-52	-52	-52
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	52	52	52	52	52	52	52
5.33%	105	105	105	105	105	105	105
8.00%	157	157	157	157	157	157	157
2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_5							236
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%

-8.00%	-236	-236	-236	-236	-236	-236	-236
-5.33%	-157	-157	-157	-157	-157	-157	-157
-2.67%	-79	-79	-79	-79	-79	-79	-79
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	79	79	79	79	79	79	79
5.33%	157	157	157	157	157	157	157
8.00%	236	236	236	236	236	236	236
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_6						196
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-196	-196	-196	-196	-196	-196	-196
-5.33%	-131	-131	-131	-131	-131	-131	-131
-2.67%	-65	-65	-65	-65	-65	-65	-65
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	65	65	65	65	65	65	65
5.33%	131	131	131	131	131	131	131
8.00%	196	196	196	196	196	196	196
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_7						251
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-251	-251	-251	-251	-251	-251	-251
-5.33%	-168	-168	-168	-168	-168	-168	-168
-2.67%	-84	-84	-84	-84	-84	-84	-84
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	84	84	84	84	84	84	84
5.33%	168	168	168	168	168	168	168
8.00%	251	251	251	251	251	251	251
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_8						465
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-465	-465	-465	-465	-465	-465	-465
-5.33%	-310	-310	-310	-310	-310	-310	-310
-2.67%	-155	-155	-155	-155	-155	-155	-155
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	155	155	155	155	155	155	155
5.33%	310	310	310	310	310	310	310
8.00%	465	465	465	465	465	465	465
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_9						310
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-310	-310	-310	-310	-310	-310	-310
-5.33%	-207	-207	-207	-207	-207	-207	-207
-2.67%	-103	-103	-103	-103	-103	-103	-103
0%	0	0	0	0	0	0	0

2.67%	103	103	103	103	103	103	103
5.33%	207	207	207	207	207	207	207
8.00%	310	310	310	310	310	310	310
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_10						275
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-275	-275	-275	-275	-275	-275	-275
-5.33%	-183	-183	-183	-183	-183	-183	-183
-2.67%	-92	-92	-92	-92	-92	-92	-92
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	92	92	92	92	92	92	92
5.33%	183	183	183	183	183	183	183
8.00%	275	275	275	275	275	275	275
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_11						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%	-314	-314	-314	-314	-314	-314	-314
-2.67%	-157	-157	-157	-157	-157	-157	-157
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	157	157	157	157	157	157	157
5.33%	314	314	314	314	314	314	314
8.00%	472	472	472	472	472	472	472
	KR4101N30(	2018-03 코스피200지수선물					894
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-894	-894	-894	-894	-894	-894	-894
-5.33%	-596	-596	-596	-596	-596	-596	-596
-2.67%	-298	-298	-298	-298	-298	-298	-298
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	298	298	298	298	298	298	298
5.33%	596	596	596	596	596	596	596
8.00%	894	894	894	894	894	894	894
	KR4201N331	2018-03 콜312.5					1,753

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	649	634	614	590	561	529	493
-5.33%	597	565	527	486	440	392	342
-2.67%	468	413	356	297	236	174	111
0%	211	141	71	0	-71	-142	-213
2.67%	-204	-275	-347	-419	-491	-563	-635
5.33%	-772	-831	-892	-955	-1,020	-1,086	-1,152
8.00%	-1,459	-1,498	-1,542	-1,591	-1,642	-1,697	-1,753
KR4301N3312018-03 풋310							1,184

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,072	-1,084	-1,099	-1,117	-1,137	-1,160	-1,184
-5.33%	-602	-626	-653	-682	-713	-745	-779
-2.67%	-190	-227	-266	-305	-345	-386	-427
0%	134	90	45	0	-45	-90	-134
2.67%	357	315	272	228	184	140	96
5.33%	489	456	421	385	347	308	269
8.00%	555	534	510	484	455	424	391
KR4301N3312018-03 풋312.5							345

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-317	-320	-323	-328	-333	-338	-345
-5.33%	-183	-188	-195	-202	-210	-219	-227
-2.67%	-62	-71	-81	-92	-102	-113	-124
0%	37	25	12	0	-12	-25	-37
2.67%	108	95	83	70	58	45	32
5.33%	152	142	131	120	109	97	86
8.00%	176	169	161	153	144	134	124

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

8,415

공시일	2018-02-13
기준일	2018-02-12

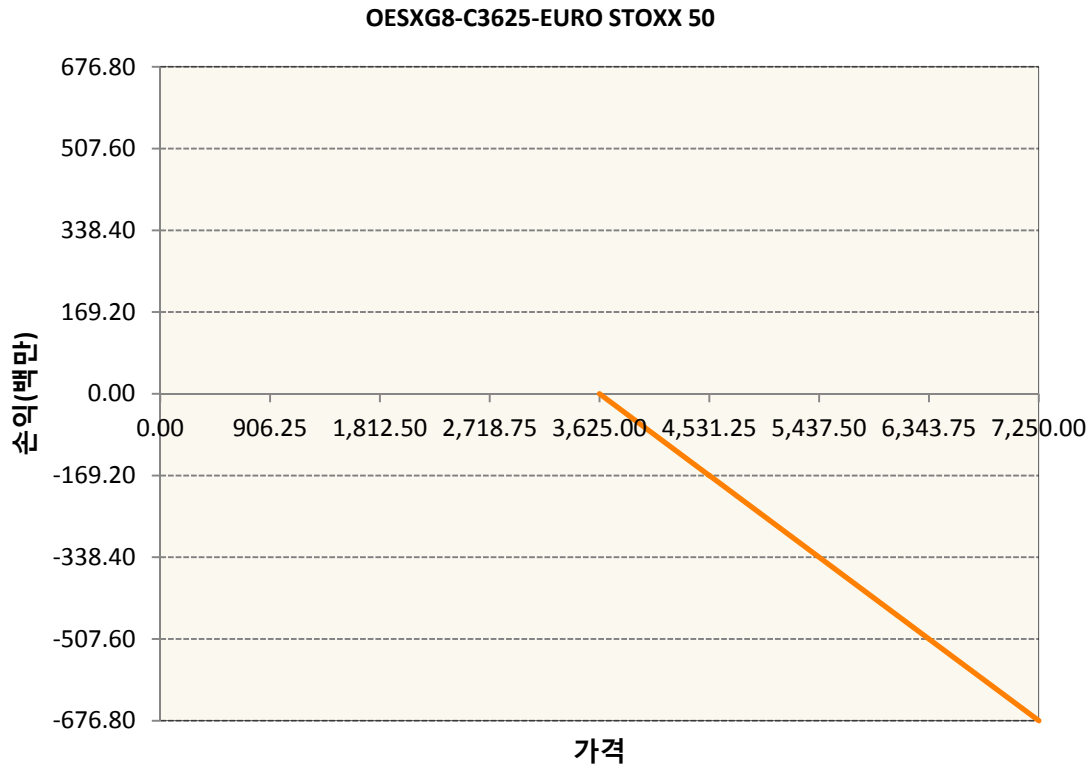
유로커버드콜모(주식혼합-파생형

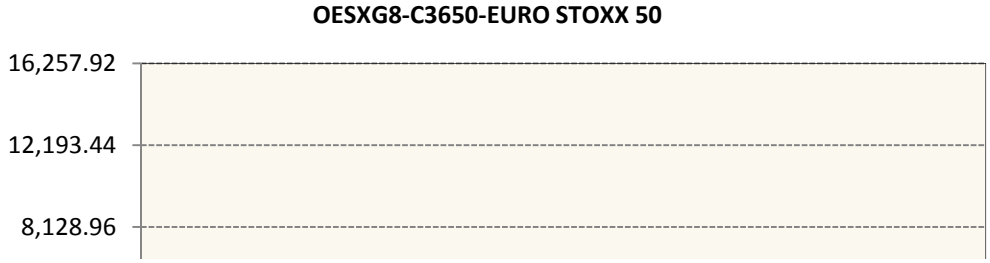
1. 계약금액

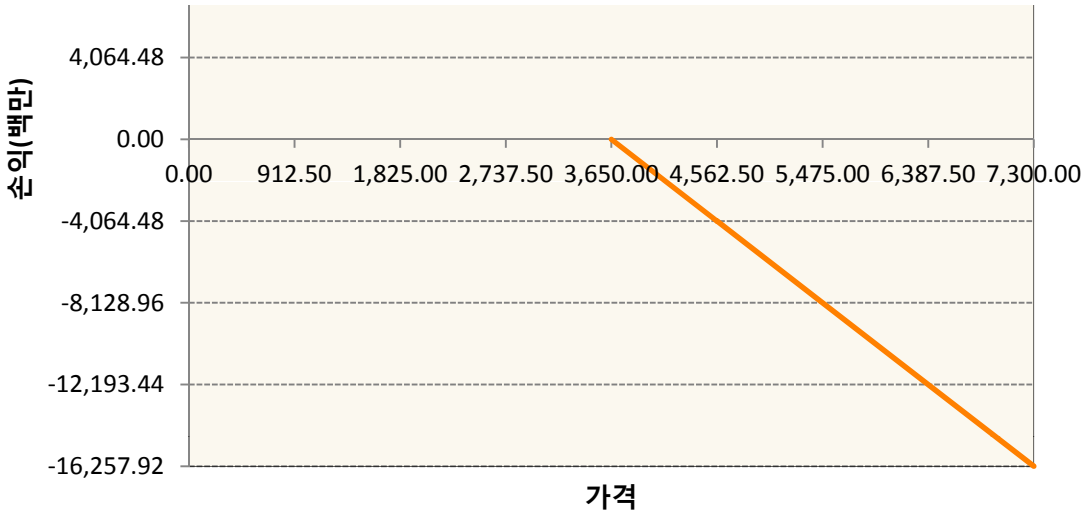
(단위:백만원)

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	7,220	0	7,220	
누계	유가증권	스왑	100,018	0	100,018	장외
누계	유가증권	옵션	0	33,869	-33,869	장내
누계	지수	스왑	53,344	0	53,344	장외

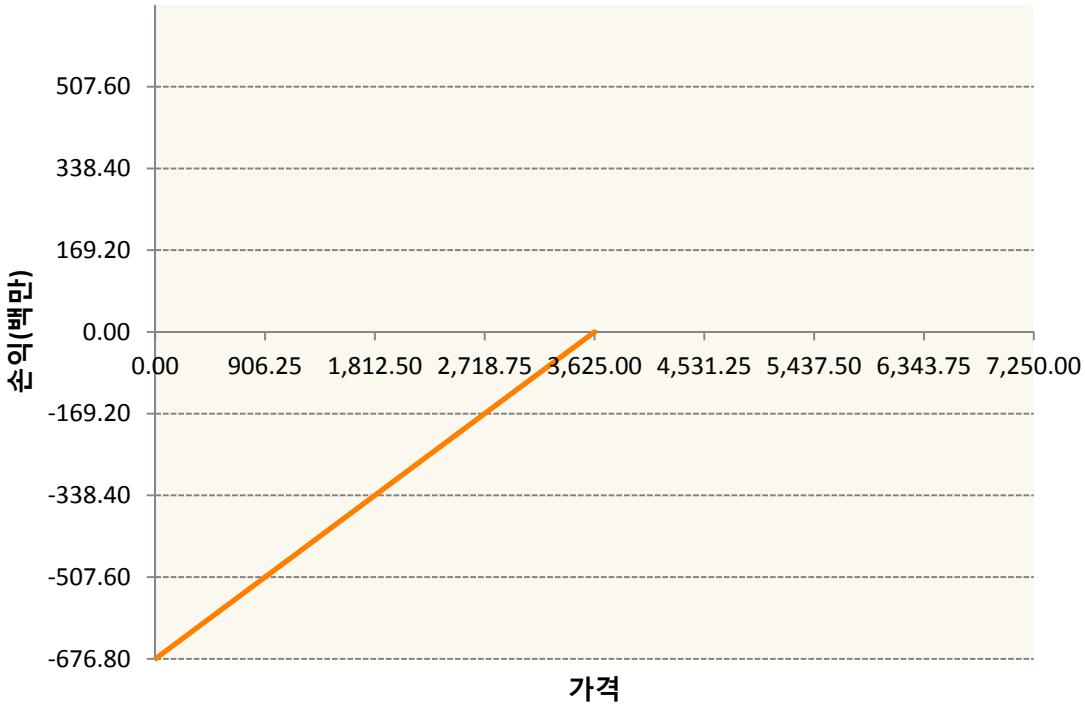
2. 만기시점의 손익구조



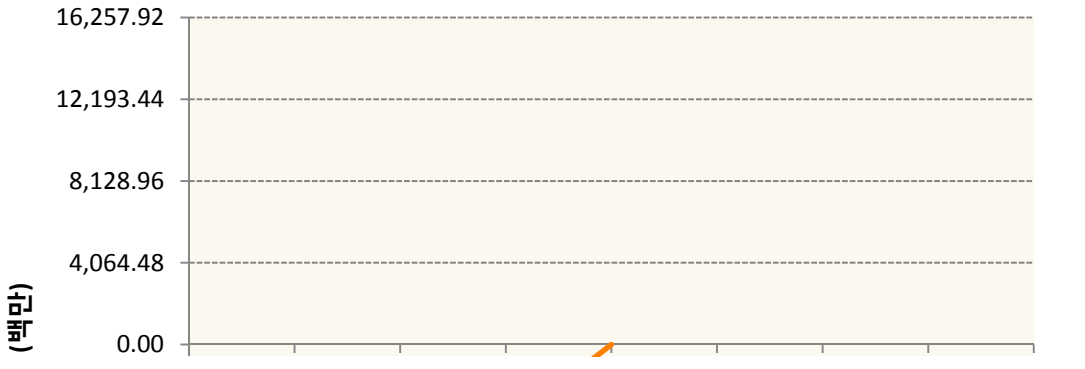


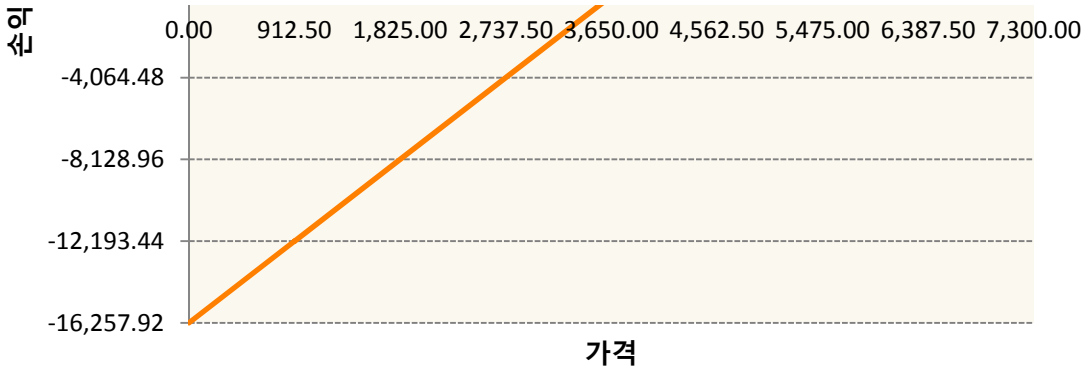


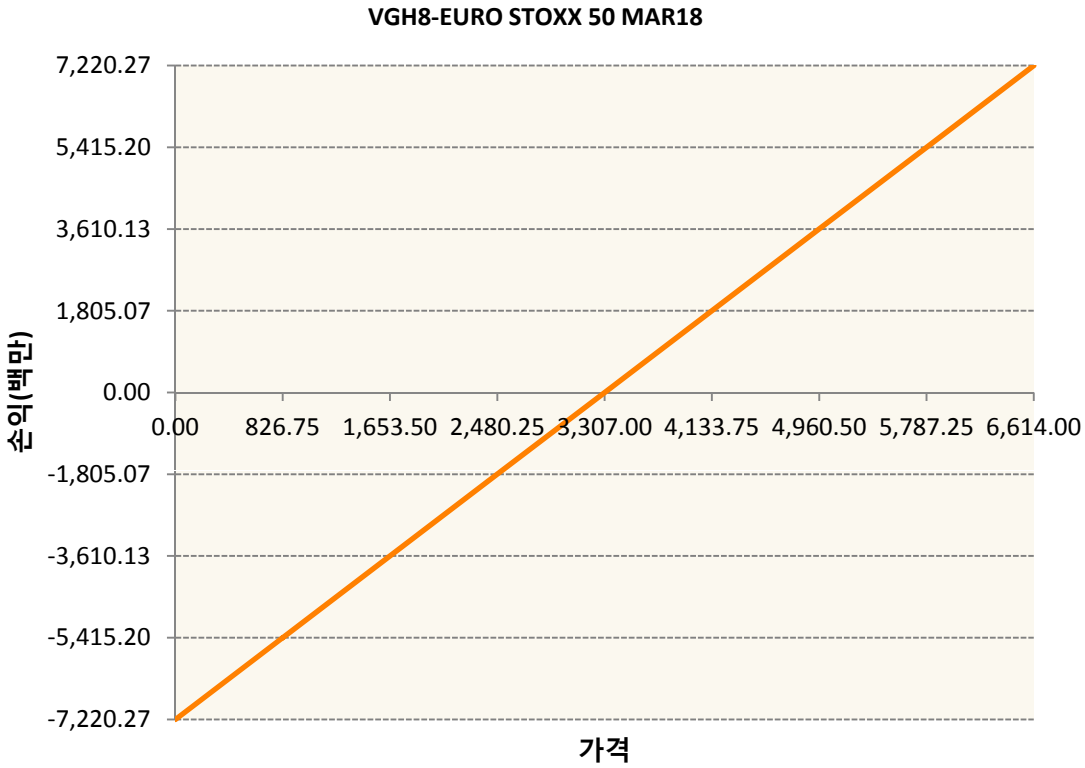
OESXG8-P3625-EURO STOXX 50



OESXG8-P3650-EURO STOXX 50







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)	(단위:백만원)
260105SGPX SG EURO Covered CALL STRATEGY - 994.569	337
260105SQPX SG EURO Covered CALL STRATEGY	632
OESXG8-C3(EURO STOXX 50	54
OESXG8-C3(EURO STOXX 50	1,301
OESXG8-P3(EURO STOXX 50	54
OESXG8-P3(EURO STOXX 50	1,301
VGH8 EURO STOXX 50 MAR18	578

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

2,528

공시일	2018-02-13
기준일	2018-02-12

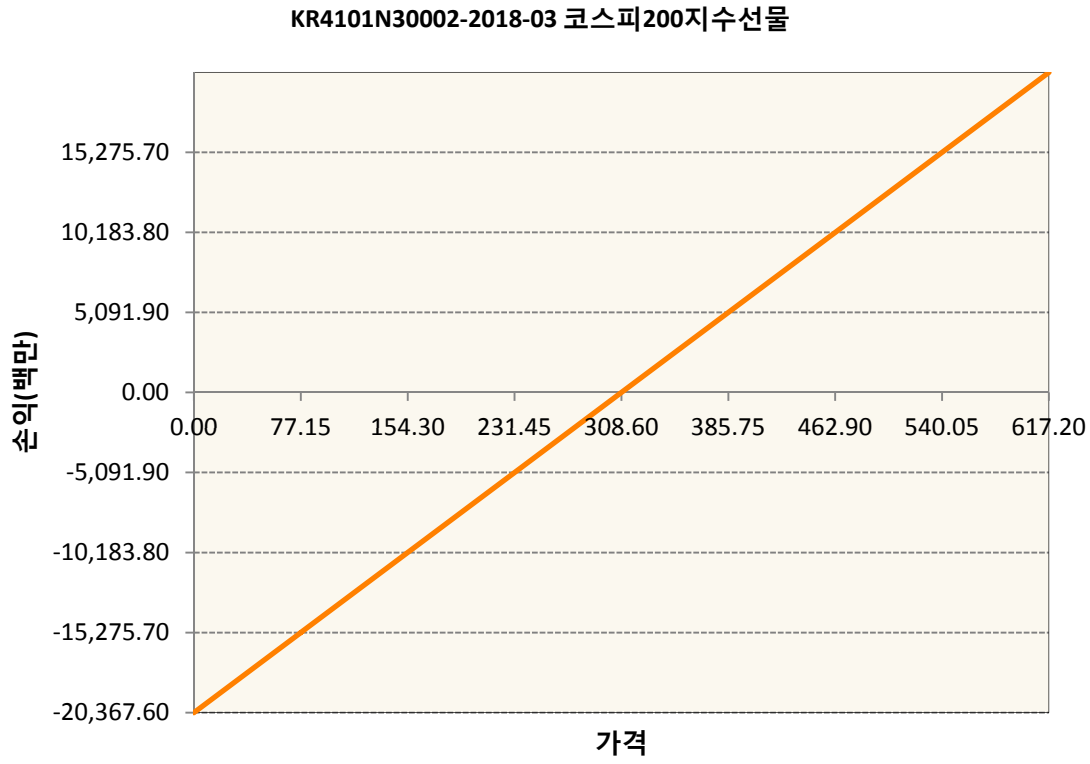
ETF스마트레버리지목표전환형8호

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	20,368	0	20,368	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101N30(2018-03 코스피200지수선물							1,627
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,627	-1,627	-1,627	-1,627	-1,627	-1,627	-1,627
-5.33%	-1,085	-1,085	-1,085	-1,085	-1,085	-1,085	-1,085
-2.67%	-542	-542	-542	-542	-542	-542	-542
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	542	542	542	542	542	542	542
5.33%	1,085	1,085	1,085	1,085	1,085	1,085	1,085
8.00%	1,627	1,627	1,627	1,627	1,627	1,627	1,627

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

1,067

공시일	2018-02-13
기준일	2018-02-12

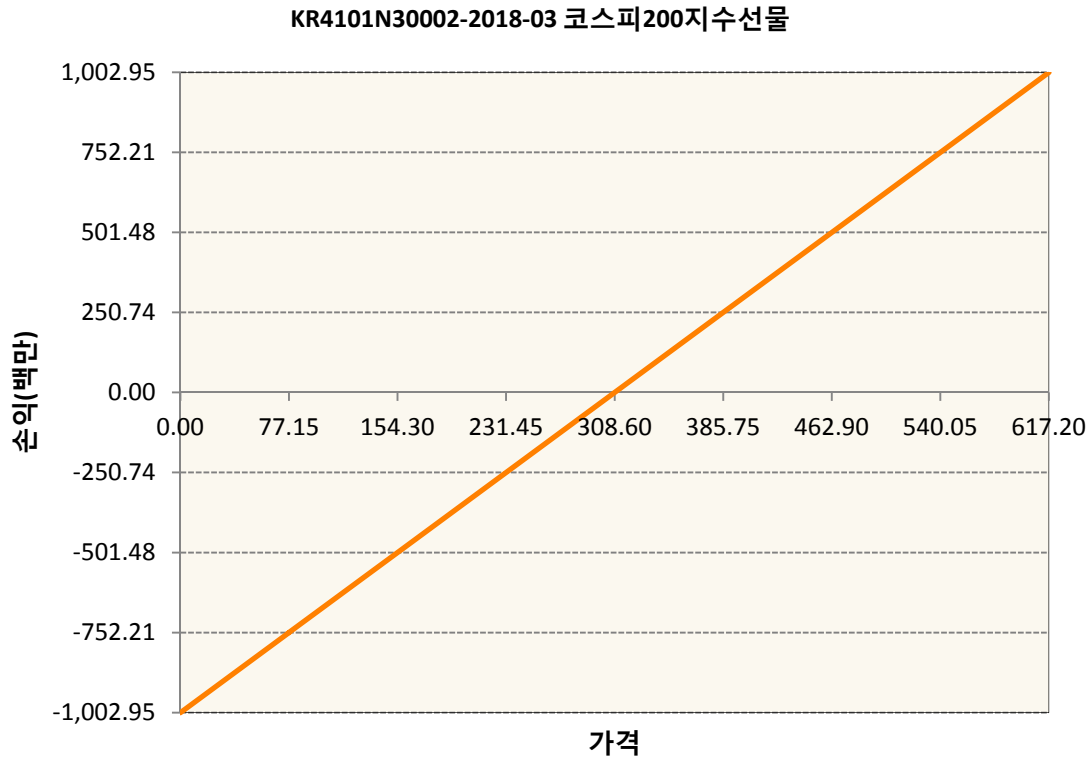
ETF스마트레버리지목표전환형9호

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	1,003	0	1,003	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101N30(2018-03 코스피200지수선물							80
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-80	-80	-80	-80	-80	-80	-80
-5.33%	-53	-53	-53	-53	-53	-53	-53
-2.67%	-27	-27	-27	-27	-27	-27	-27
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	27	27	27	27	27	27	27
5.33%	53	53	53	53	53	53	53
8.00%	80	80	80	80	80	80	80

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

53

공시일	2018-02-13
기준일	2018-02-12

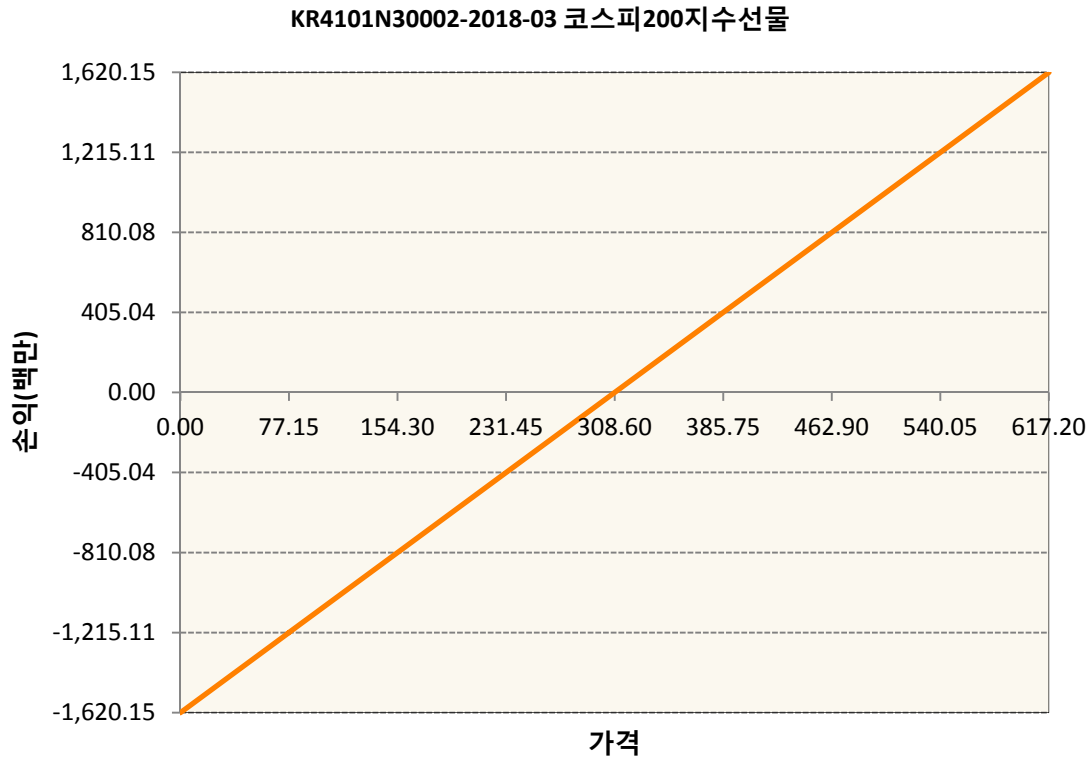
ETF스마트레버리지목표전환형10

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	1,620	0	1,620	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101N30(2018-03 코스피200지수선물							129
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-129	-129	-129	-129	-129	-129	-129
-5.33%	-86	-86	-86	-86	-86	-86	-86
-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%	86	86	86	86	86	86	86
8.00%	129	129	129	129	129	129	129

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

85

공시일	2018-02-13
기준일	2018-02-12

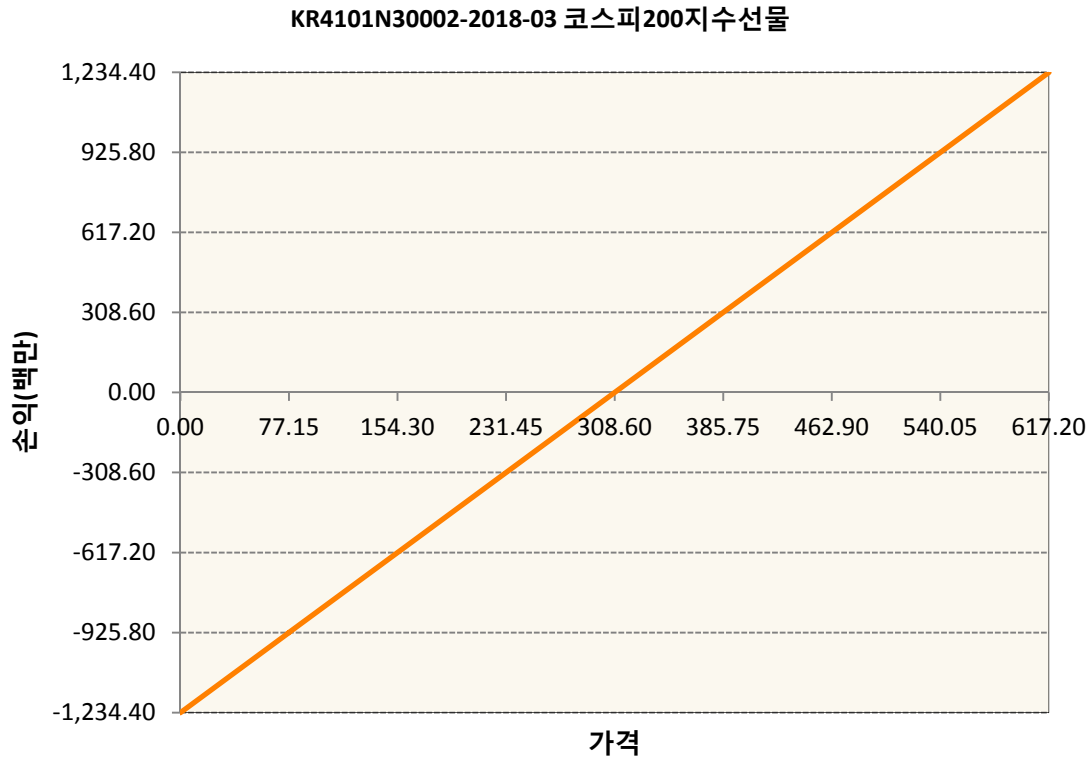
스마트KRX300인덱스1호(주식-파

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	1,234	0	1,234	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101N30(2018-03 코스피200지수선물							99
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-99	-99	-99	-99	-99	-99	-99
-5.33%	-66	-66	-66	-66	-66	-66	-66
-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%	66	66	66	66	66	66	66
8.00%	99	99	99	99	99	99	99

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

65

공시일	2018-02-13
기준일	2018-02-12

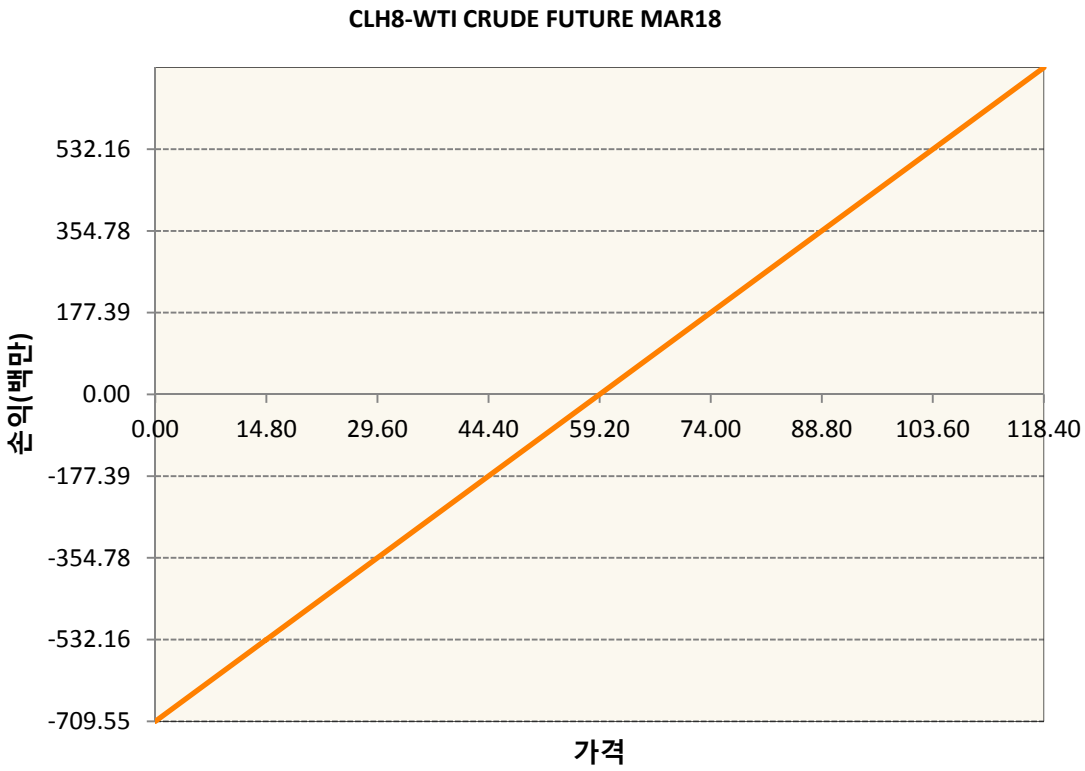
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

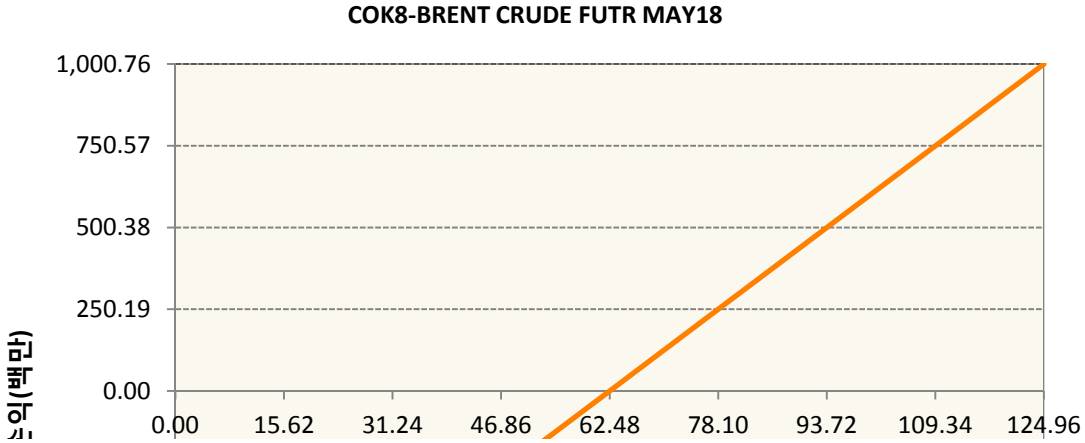
1. 계약금액

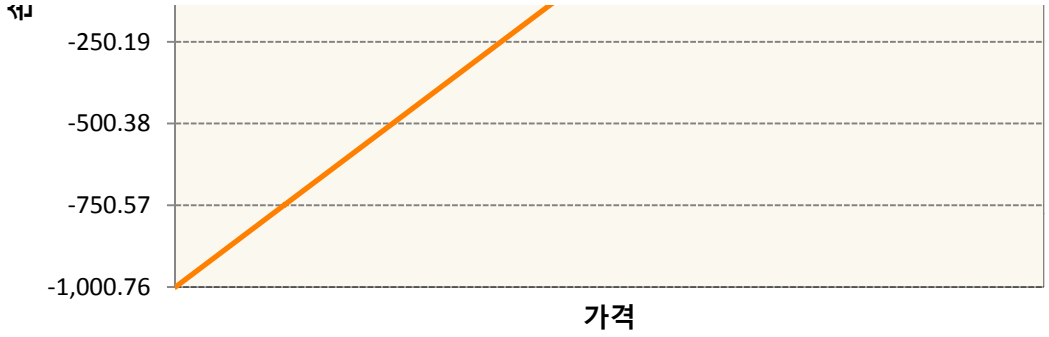
(단위:백만원)

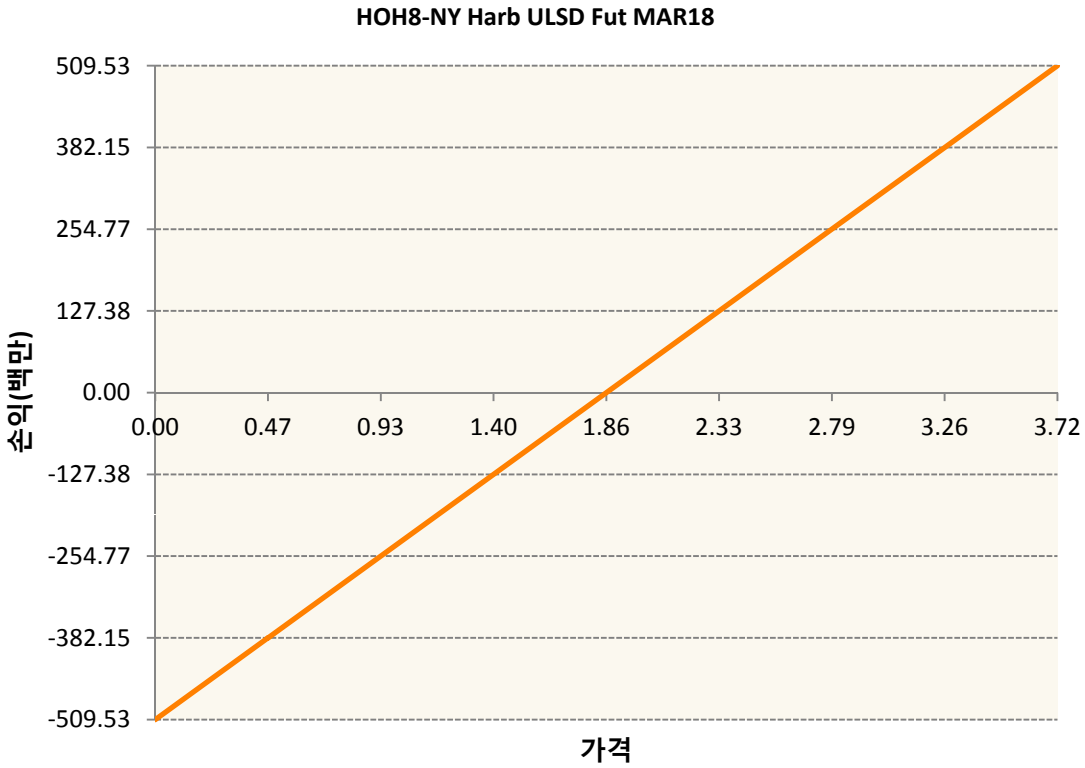
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	통화	선물	0	757	-757	장내
누계	유가증권	선물	3,774	0	3,774	
누계	통화	선물	0	759	-759	장내

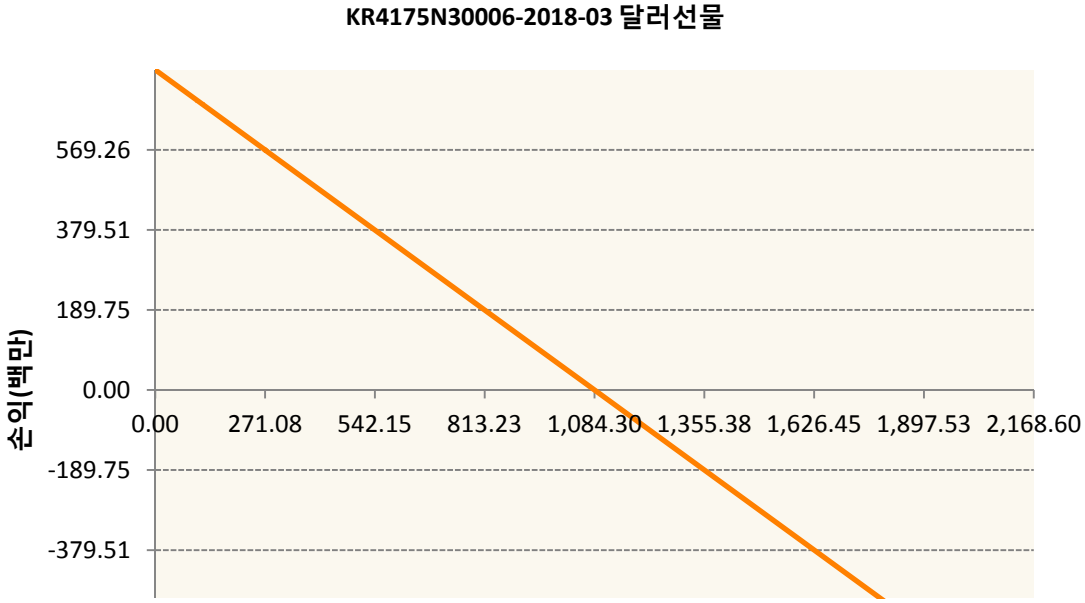
2. 만기시점의 손익구조

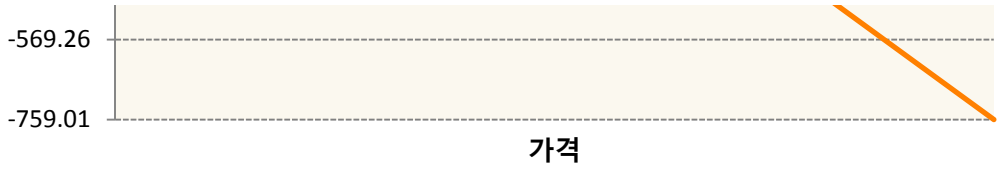


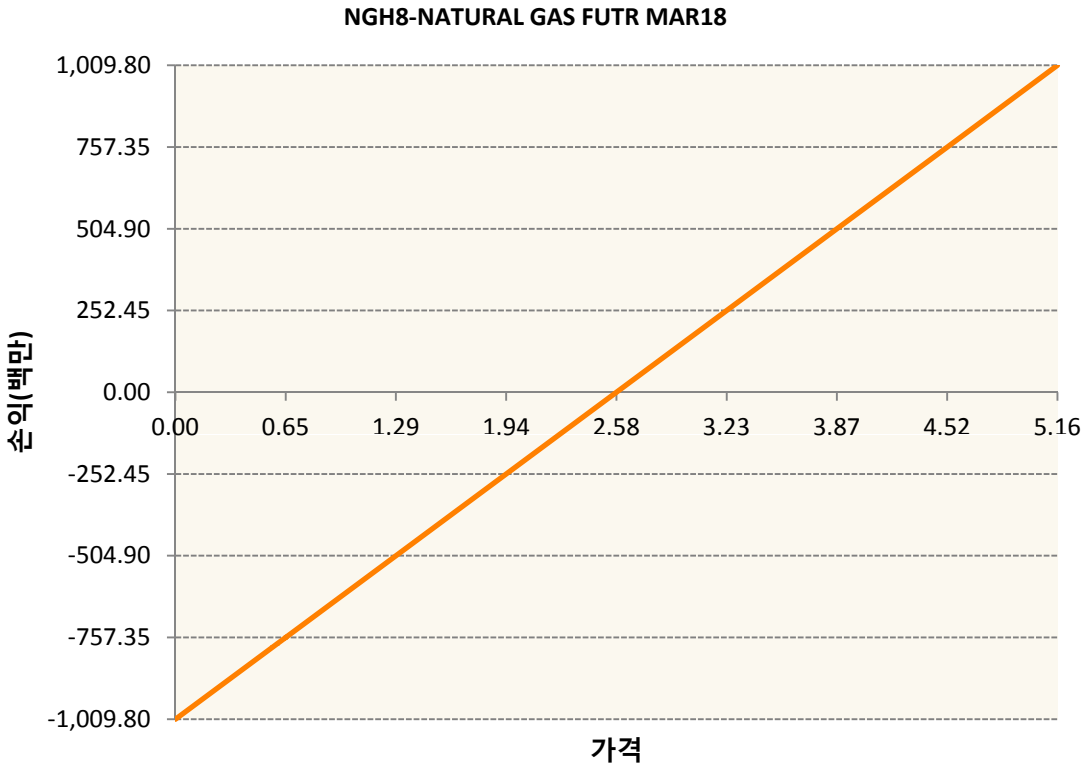


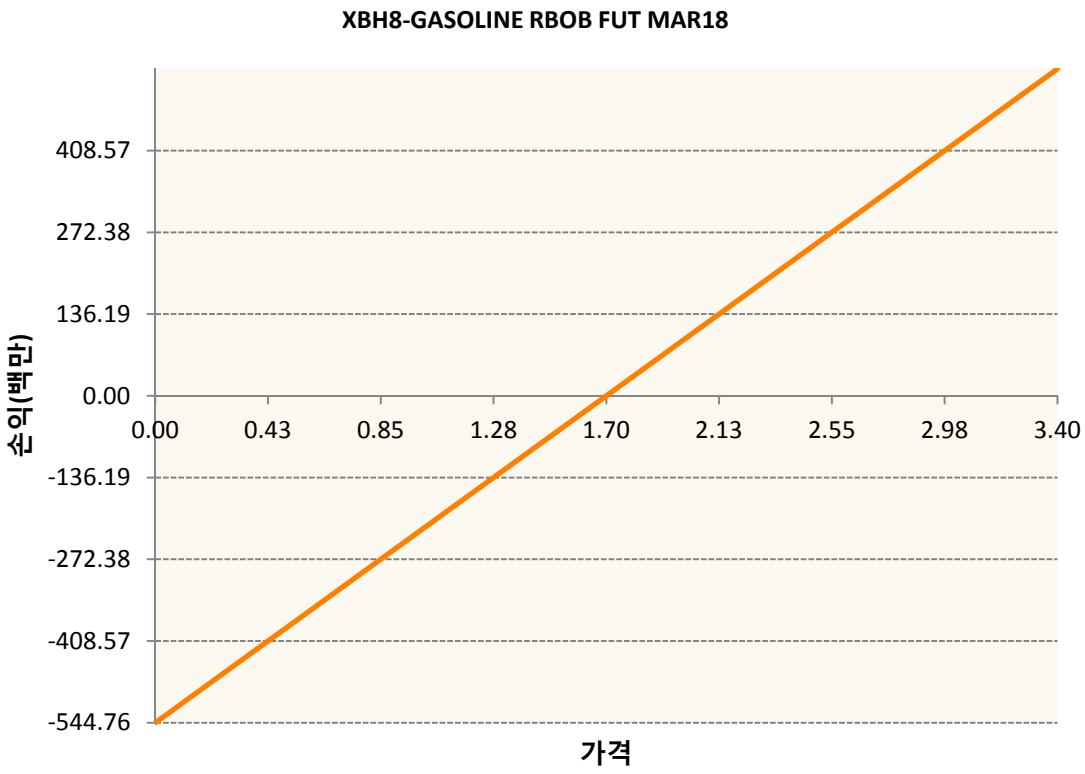

-250.19
-500.38
-750.57
-1,000.76
가격


HOH8-NY Harb ULSD Fut MAR18
509.53
382.15
254.77
127.38
0.00
-127.38
-254.77
-382.15
-509.53
0.00
0.47
0.93
1.40
1.86
2.33
2.79
3.26
3.72
손익(백만)
가격


KR4175N30006-2018-03 달러선물
569.26
379.51
189.75
0.00
-189.75
-379.51
0.00
271.08
542.15
813.23
1,084.30
1,355.38
1,626.45
1,897.53
2,168.60
손익(백만)


-569.26
-759.01
가격


NGH8-NATURAL GAS FUTR MAR18
1,009.80
757.35
504.90
252.45
0.00
-252.45
-504.90
-757.35
-1,009.80
0.00
0.65
1.29
1.94
2.58
3.23
3.87
4.52
5.16
손익(백만)
가격


XBH8-GASOLINE RBOB FUT MAR18
408.57
272.38
136.19
0.00
-136.19
-272.38
-408.57
-544.76
0.00
0.43
0.85
1.28
1.70
2.13
2.55
2.98
3.40
손익(백만)
가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLH8	WTI CRUDE FUTURE MAR18	57
COK8	BRENT CRUDE FUTR MAY18	80
HOH8	NY Harb ULSD Fut MAR18	41
KR4175N30(	2018-03 달러선물	61
NGH8	NATURAL GAS FUTR MAR18	81
XBH8	GASOLINE RBOB FUT MAR18	44

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

514

공시일	2018-02-13
기준일	2018-02-12

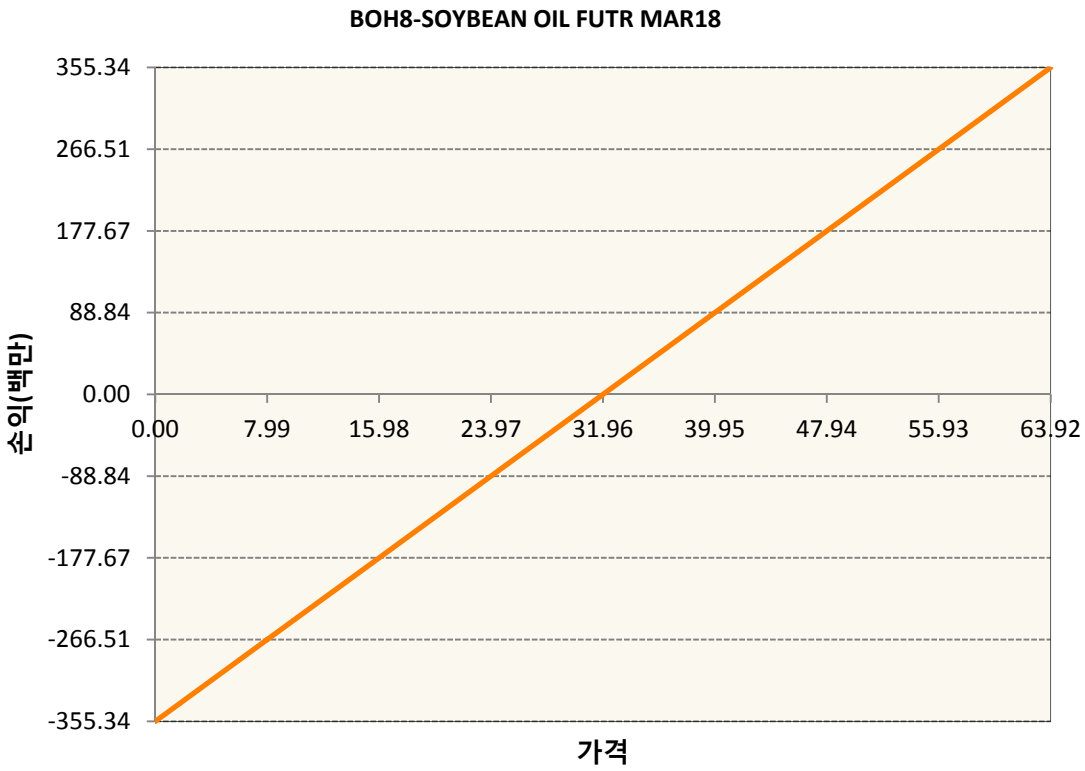
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

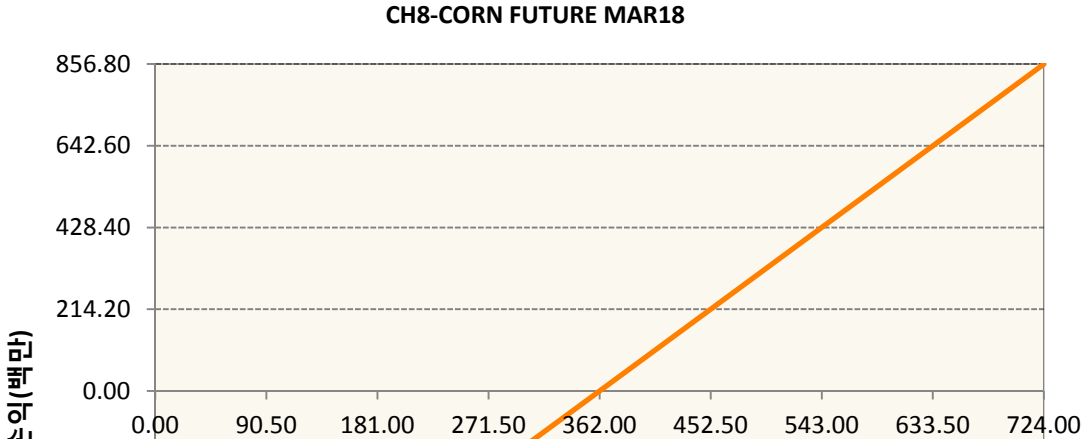
1. 계약금액

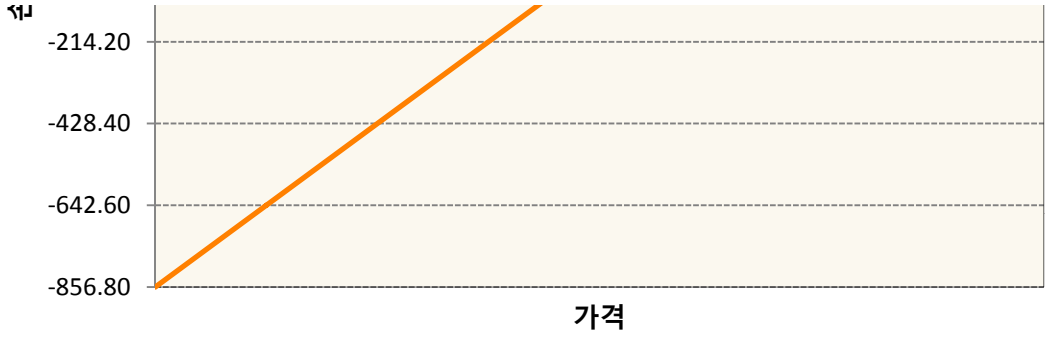
(단위:백만원)

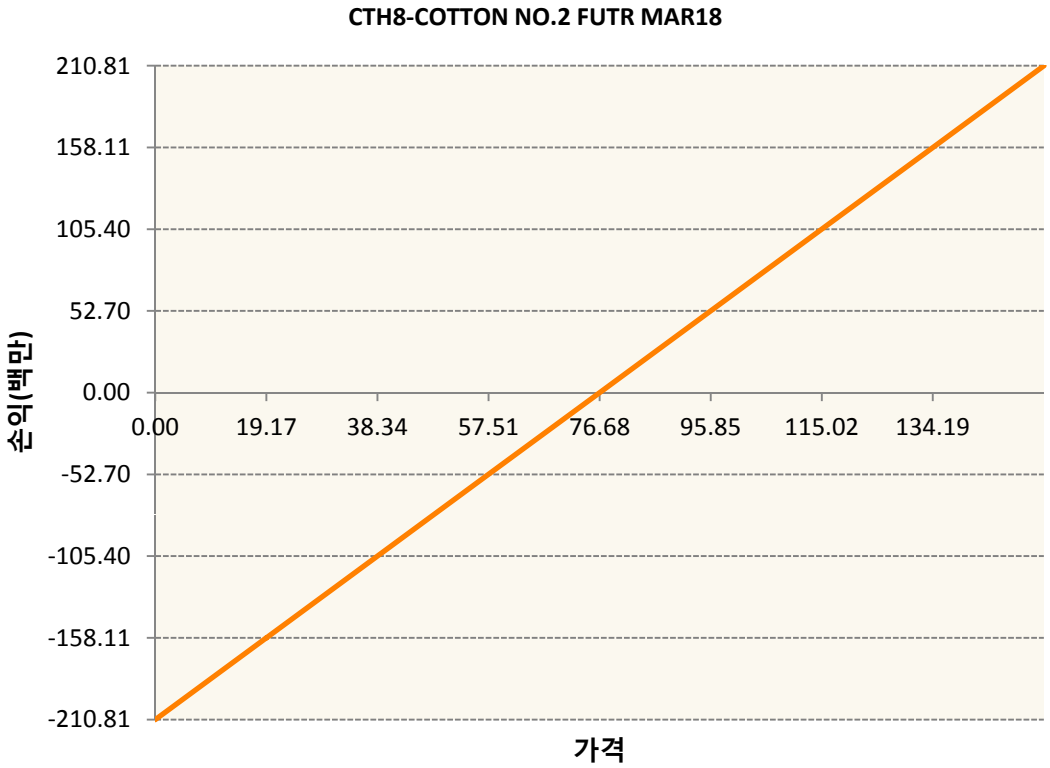
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	통화	선물	0	325	-325	장내
누계	유가증권	선물	4,063	0	4,063	
누계	통화	선물	0	325	-325	장내

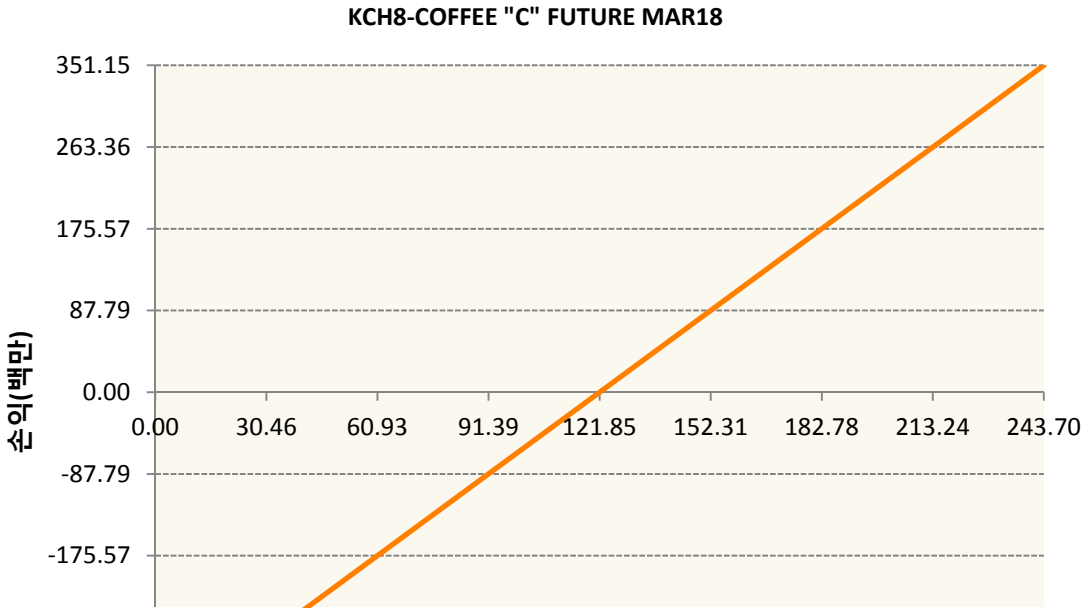
2. 만기시점의 손익구조

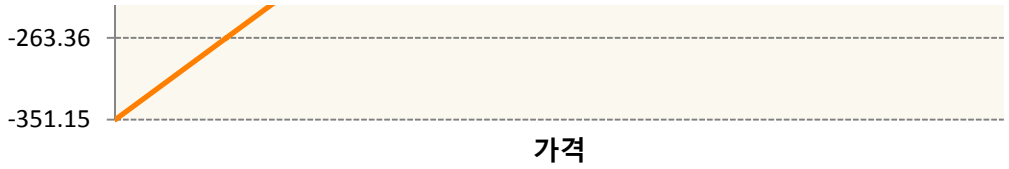


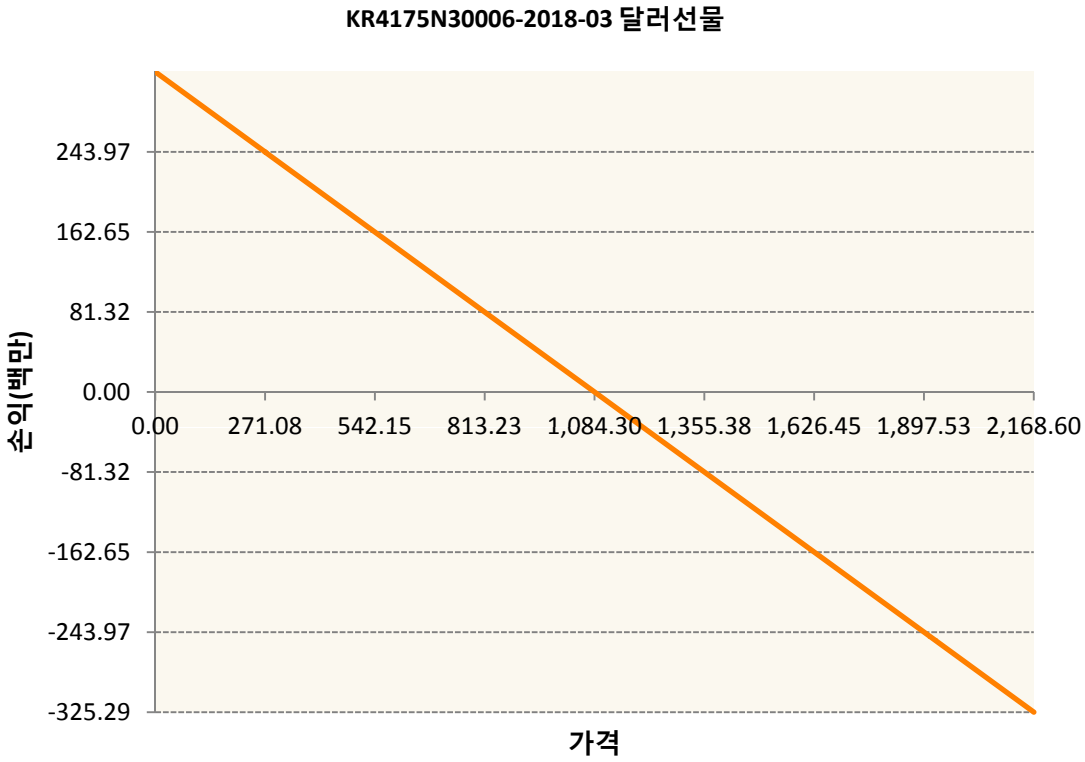


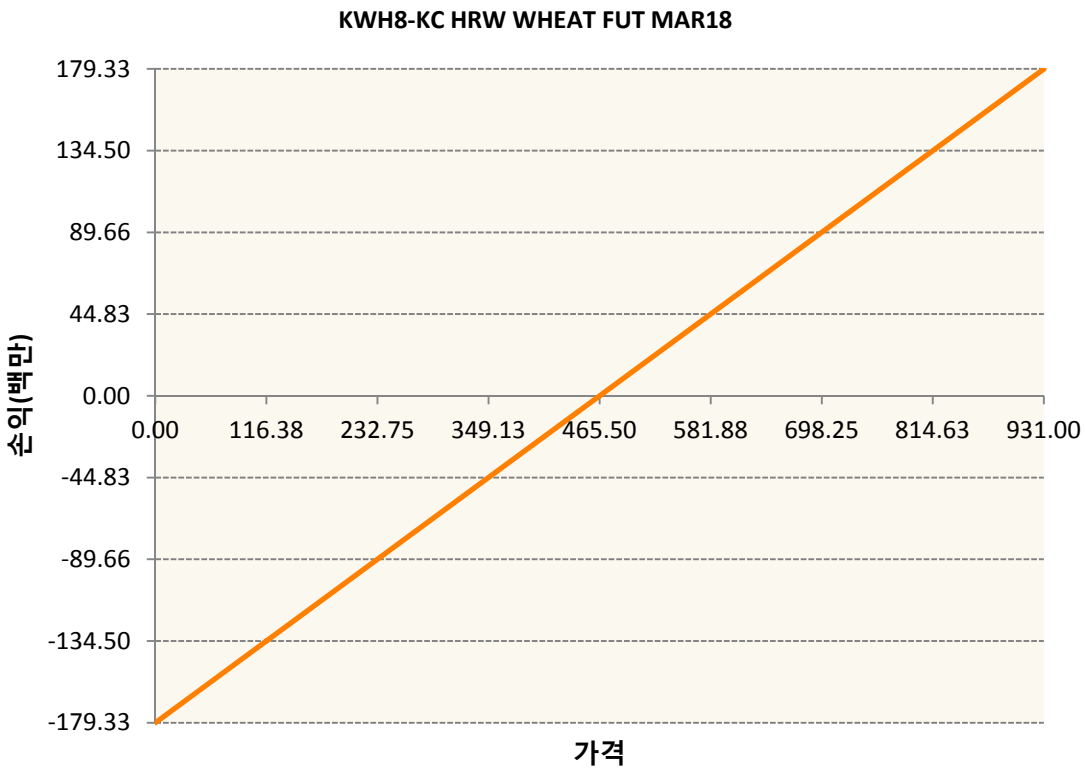

-214.20
-428.40
-642.60
-856.80
가격


CTH8-COTTON NO.2 FUTR MAR18
210.81
158.11
105.40
52.70
0.00
-52.70
-105.40
-158.11
-210.81
0.00
19.17
38.34
57.51
76.68
95.85
115.02
134.19
손익(백만)
가격

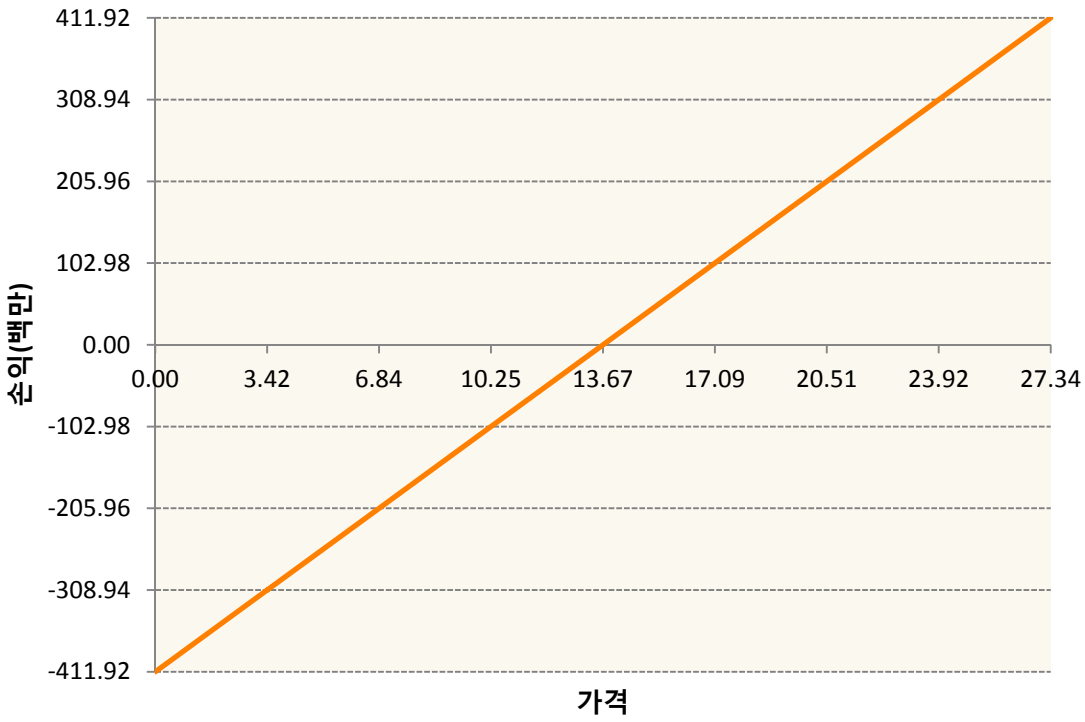

KCH8-COFFEE "C" FUTURE MAR18
351.15
263.36
175.57
87.79
0.00
-87.79
-175.57
0.00
30.46
60.93
91.39
121.85
152.31
182.78
213.24
243.70
손익(백만)


-263.36
-351.15
가격

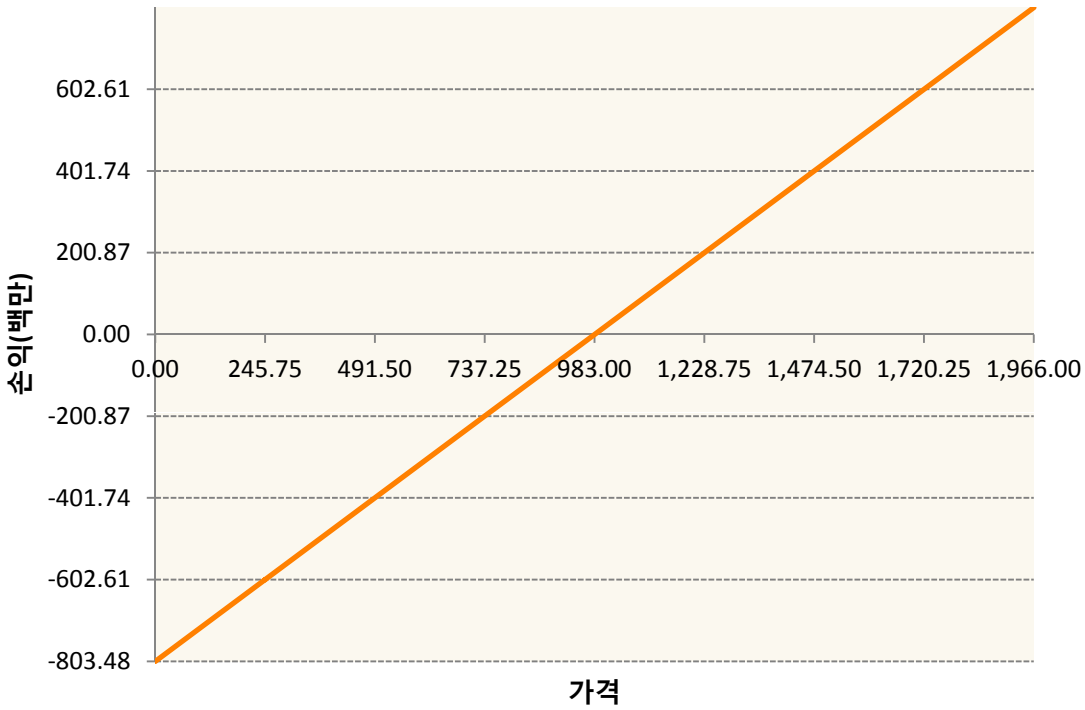

KR4175N30006-2018-03 달러선물
243.97
162.65
81.32
0.00
-81.32
-162.65
-243.97
-325.29
0.00
271.08
542.15
813.23
1,084.30
1,355.38
1,626.45
1,897.53
2,168.60
손익(백만)
가격


KWH8-KC HRW WHEAT FUT MAR18
179.33
134.50
89.66
44.83
0.00
-44.83
-89.66
-134.50
-179.33
0.00
116.38
232.75
349.13
465.50
581.88
698.25
814.63
931.00
손익(백만)
가격

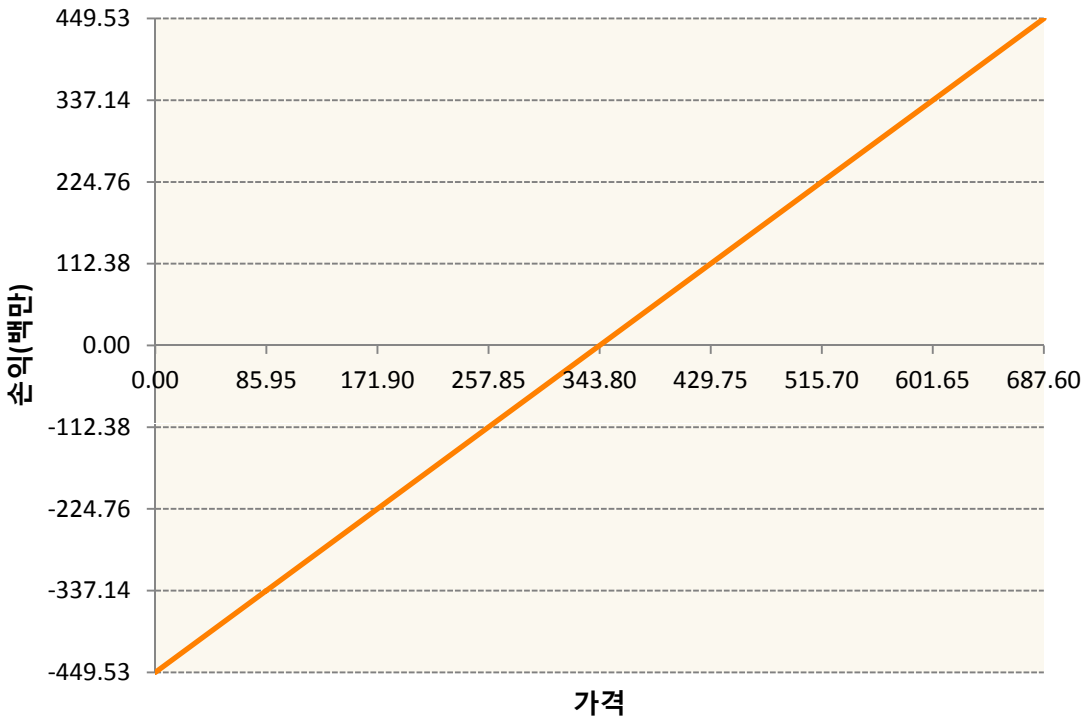
SBH8-Sugar #11 (WORLD) MAR18



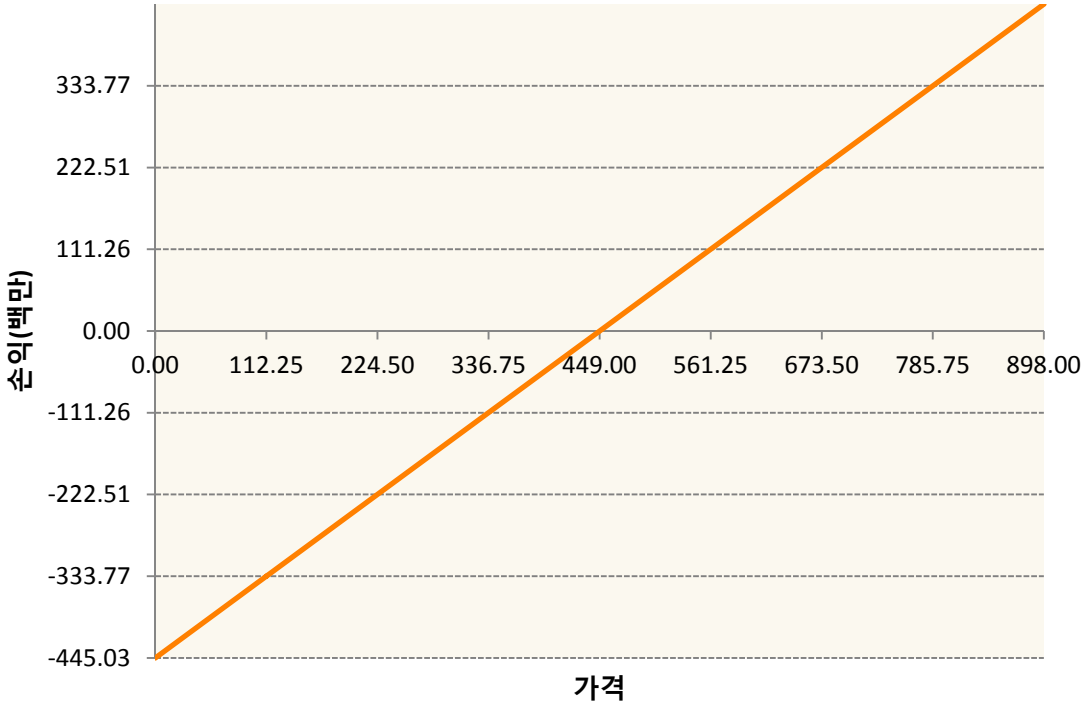
SH8-SOYBEAN FUTURE MAR18



SMH8-SOYBEAN MEAL FUTR MAR18



WH8-WHEAT FUTURE(CBT) MAR18



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

BOH8	SOYBEAN OIL FUTR MAR18	28
CH8	CORN FUTURE MAR18	69
CTH8	COTTON NO.2 FUTR MAR18	17

KCH8	COFFEE "C" FUTURE MAR18	28
KR4175N30(	2018-03 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	36
WH8	WHEAT FUTURE(CBT) MAR18	36

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

337