공시일	2018-02-14
기준일	2018-02-13

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	2018-02-14
기준일	2018-02-13

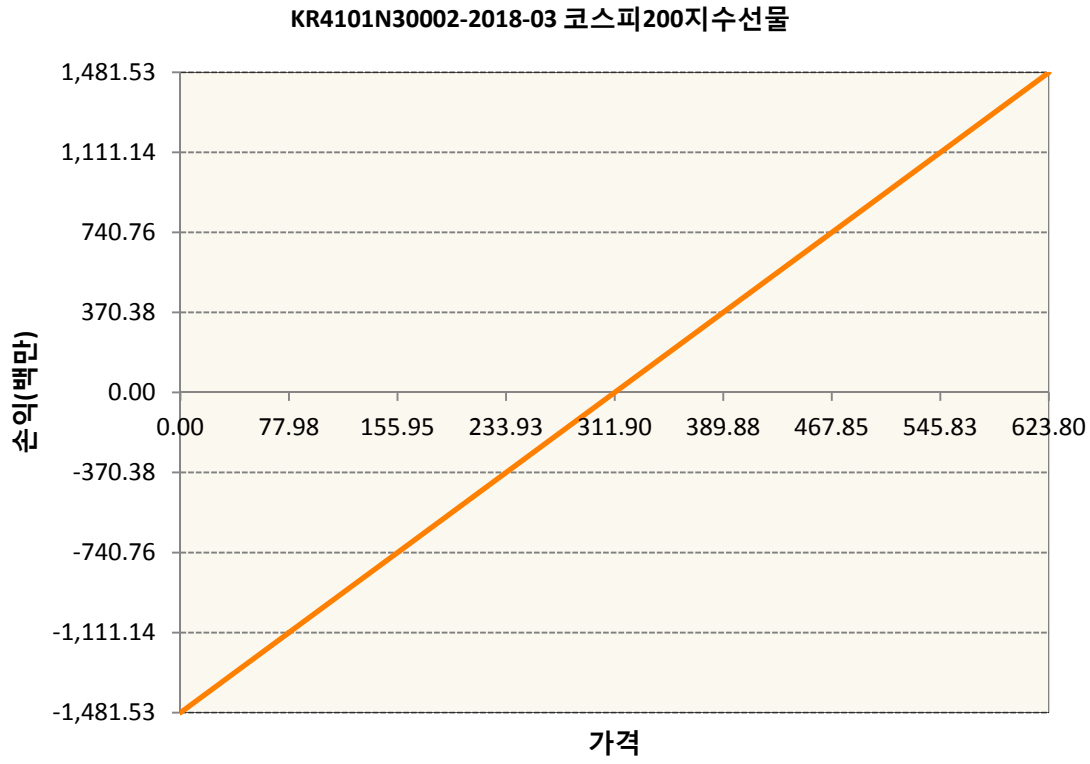
스마트인덱스모

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	1,482	0	1,482	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101N30(2018-03 코스피200지수선물							118
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-118	-118	-118	-118	-118	-118	-118
-5.33%	-79	-79	-79	-79	-79	-79	-79
-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%	79	79	79	79	79	79	79
8.00%	118	118	118	118	118	118	118

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

78

공시일	2018-02-14
기준일	2018-02-13

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	1,088

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

389

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2018-02-14
기준일	2018-02-13

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	384

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

379

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2018-02-14
기준일	2018-02-13

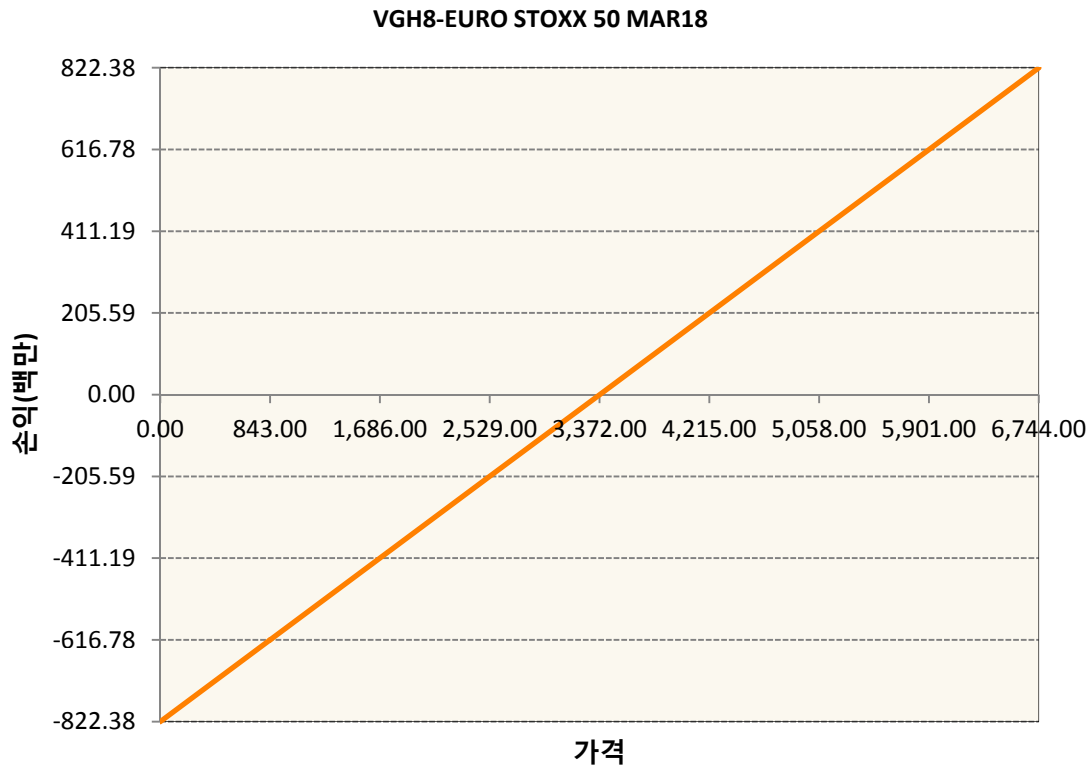
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	822	0	822	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGH8	EURO STOXX 50 MAR18	66

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

(단위:백만원)

38

공시일	2018-02-14
기준일	2018-02-13

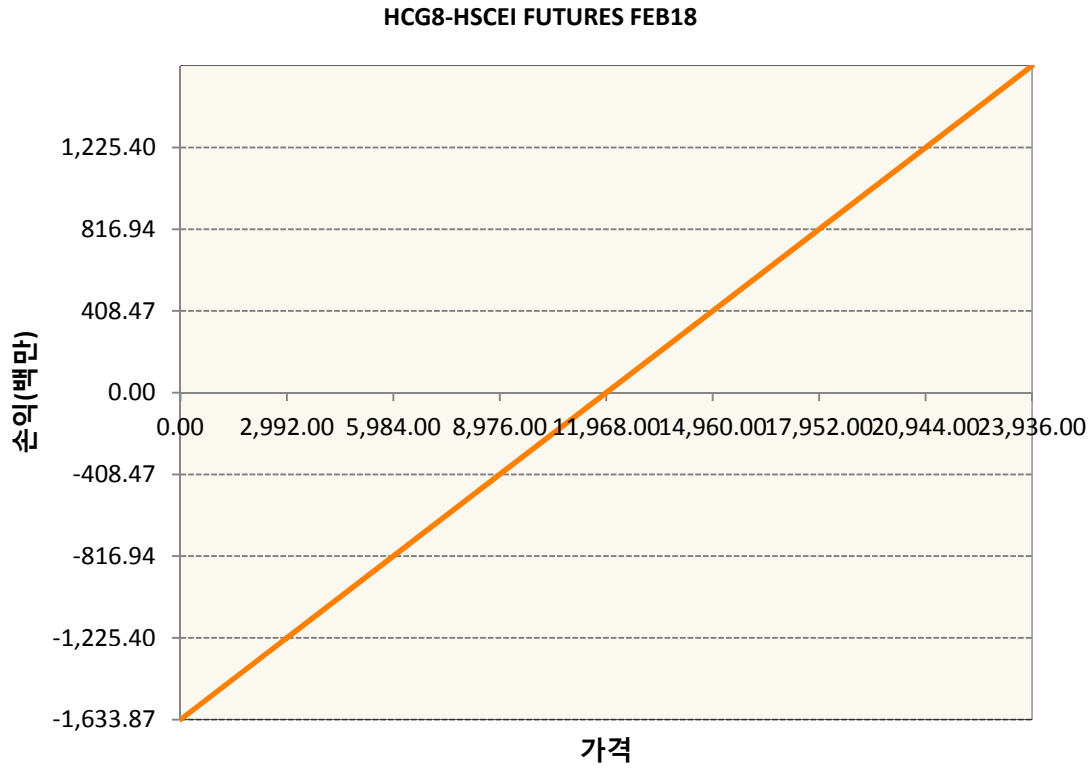
차이나인덱스모(주식-파생형)

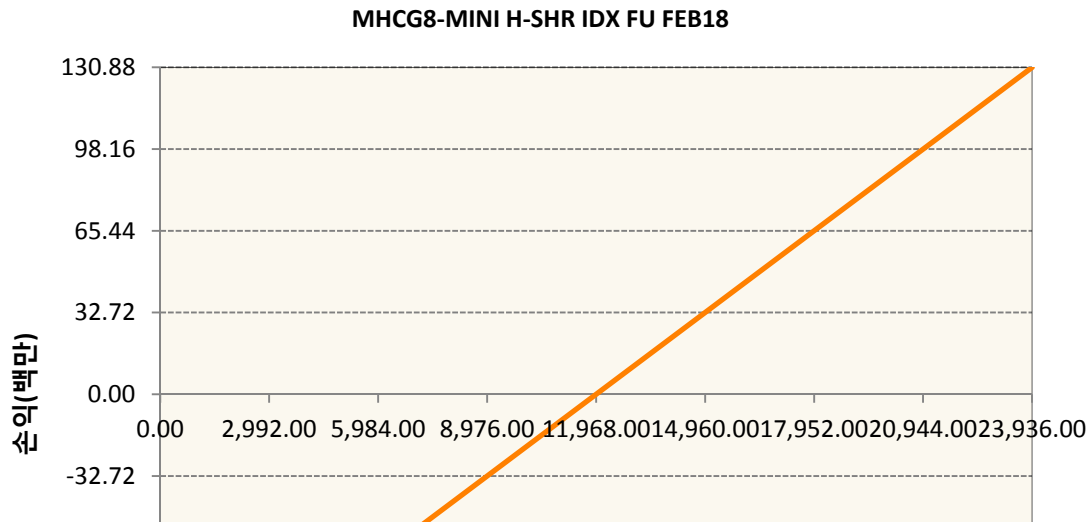
1. 계약금액

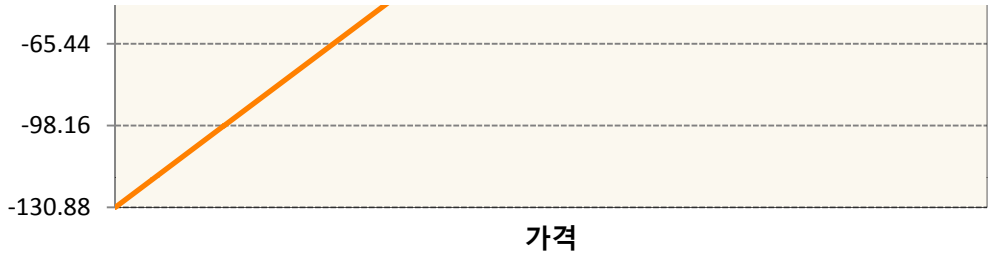
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,765	0	1,765	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCG8	HSCEI FUTURES FEB18	131
MHCG8	MINI H-SHR IDX FU FEB18	10

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

공시일	2018-02-14
기준일	2018-02-13

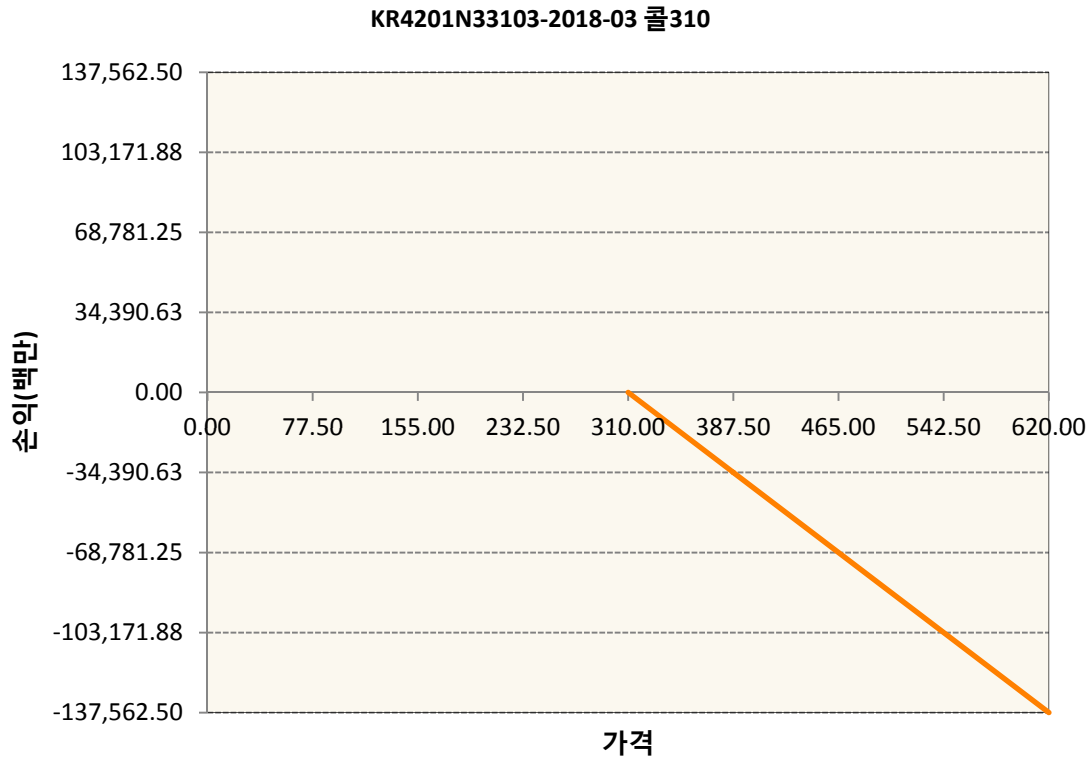
커버드콜모(주식혼합-파생형)

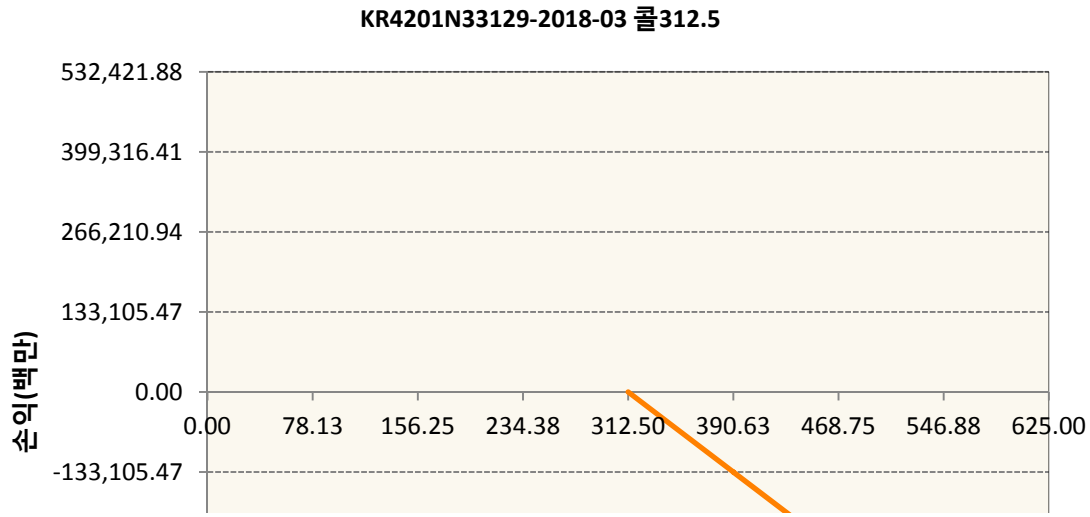
1. 계약금액

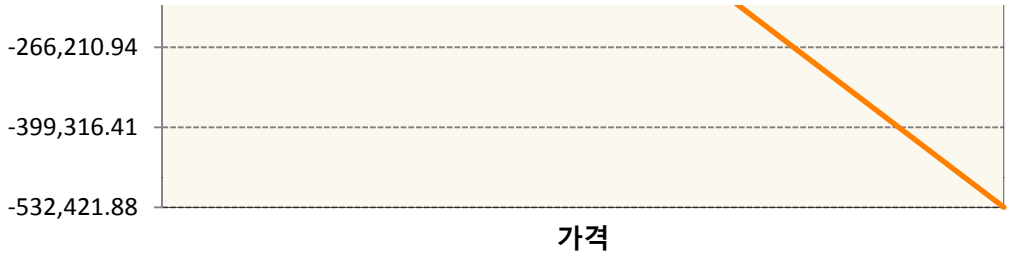
(단위:백만원)

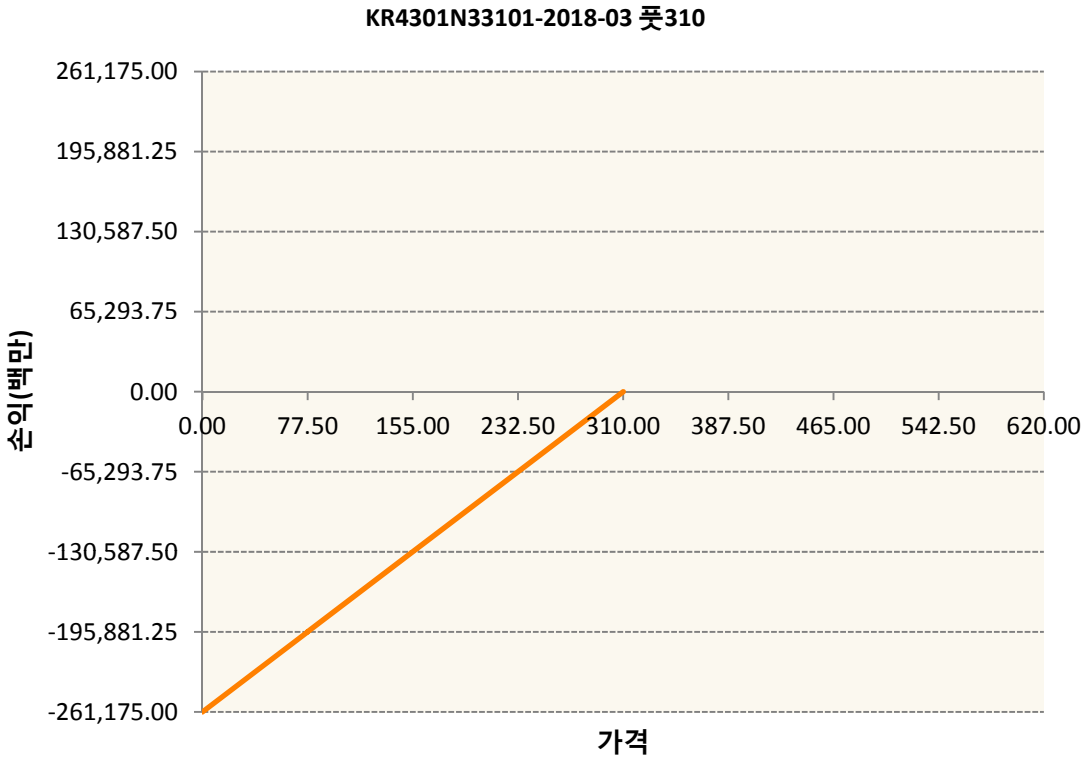
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	7,655	0	7,655	장내
누계	유가증권	옵션	0	1,136,628	-1,136,628	장내

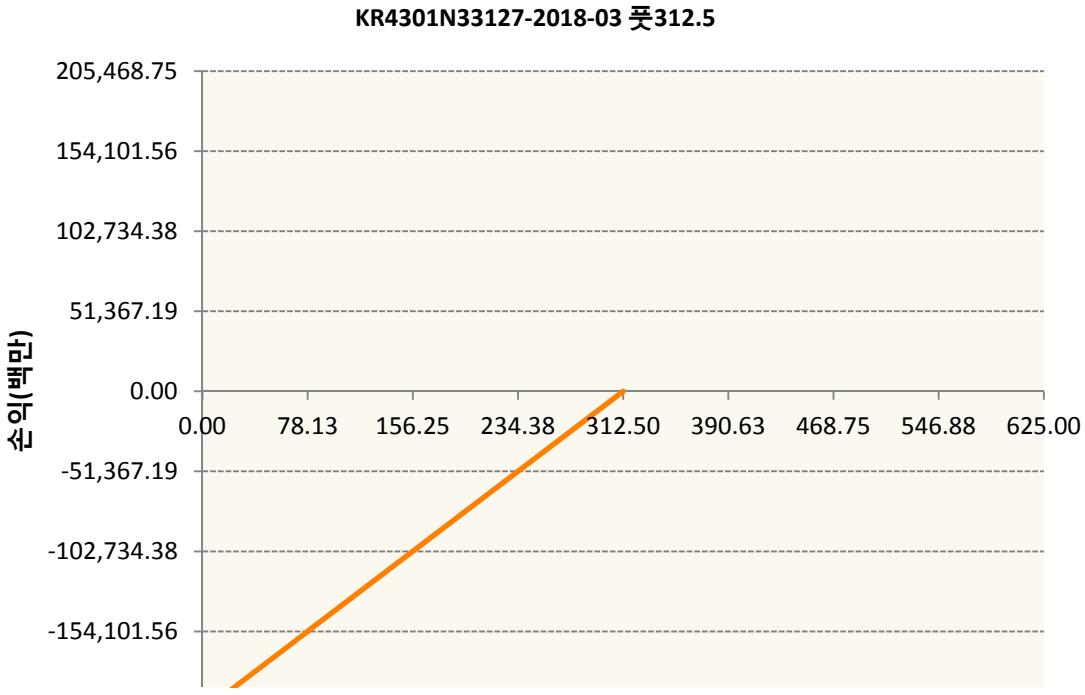
2. 만기시점의 손익구조






-266,210.94
-399,316.41
-532,421.88
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							8,609
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	3,868	3,760	3,630	3,479	3,312	3,129	2,933
-5.33%	3,455	3,253	3,035	2,803	2,561	2,310	2,051
-2.67%	2,549	2,261	1,968	1,672	1,372	1,070	767
0%	961	640	320	0	-320	-641	-961
2.67%	-1,354	-1,636	-1,926	-2,221	-2,521	-2,824	-3,130
5.33%	-4,272	-4,473	-4,693	-4,929	-5,176	-5,434	-5,701
8.00%	-7,590	-7,708	-7,850	-8,014	-8,197	-8,396	-8,609
KR4201N3312018-03 콜312.5							31,718
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	13,026	12,693	12,273	11,775	11,206	10,574	9,887
-5.33%	11,811	11,139	10,393	9,584	8,725	7,824	6,888
-2.67%	8,970	7,938	6,875	5,787	4,680	3,558	2,423
0%	3,695	2,464	1,232	0	-1,233	-2,466	-3,699
2.67%	-4,368	-5,531	-6,710	-7,901	-9,101	-10,308	-11,521
5.33%	-14,927	-15,814	-16,760	-17,753	-18,785	-19,847	-20,934
8.00%	-27,262	-27,816	-28,462	-29,185	-29,976	-30,823	-31,718
KR4301N3312018-03 풋310							16,137
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-15,532	-15,577	-15,643	-15,733	-15,846	-15,981	-16,137
-5.33%	-8,830	-8,993	-9,186	-9,405	-9,646	-9,906	-10,181
-2.67%	-2,958	-3,298	-3,651	-4,013	-4,383	-4,759	-5,139
0%	1,257	838	419	0	-419	-839	-1,258
2.67%	3,521	3,204	2,869	2,521	2,162	1,794	1,418
5.33%	4,384	4,230	4,045	3,831	3,594	3,335	3,058
8.00%	4,612	4,562	4,489	4,390	4,267	4,118	3,947
KR4301N3312018-03 풋312.5							13,258
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-12,897	-12,919	-12,955	-13,006	-13,074	-13,158	-13,258
-5.33%	-7,584	-7,678	-7,796	-7,935	-8,093	-8,268	-8,457
-2.67%	-2,747	-2,976	-3,219	-3,475	-3,740	-4,013	-4,292
0%	980	654	327	0	-327	-655	-983
2.67%	3,190	2,904	2,610	2,310	2,005	1,696	1,384

5.33%	4,135	3,976	3,793	3,591	3,372	3,139	2,895
8.00%	4,418	4,360	4,279	4,176	4,053	3,910	3,750

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

68,749

공시일	2018-02-14
기준일	2018-02-13

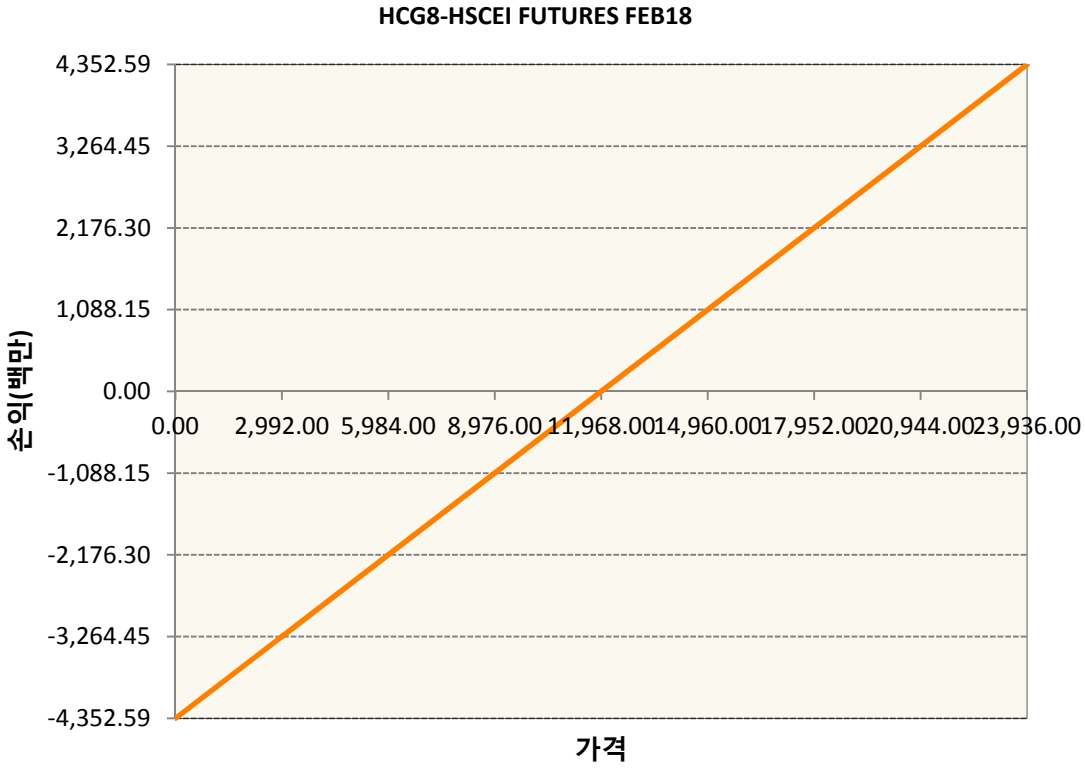
홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생

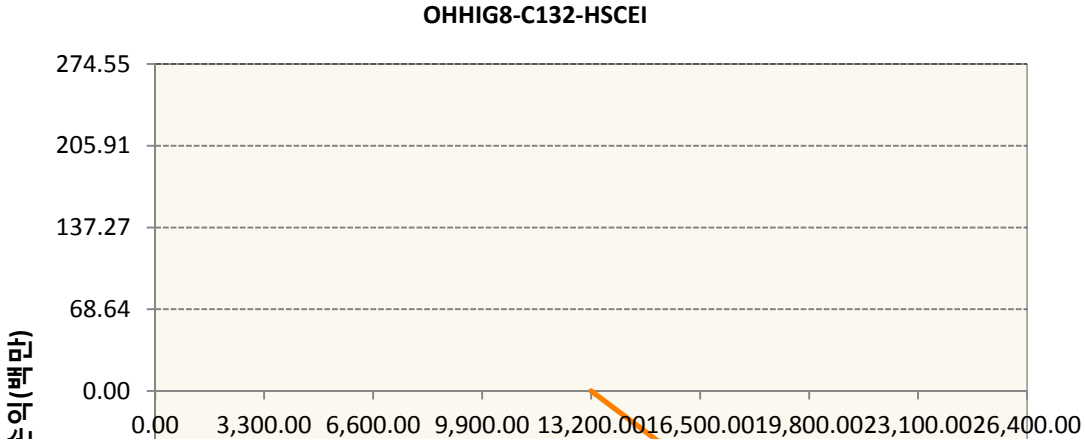
1. 계약금액

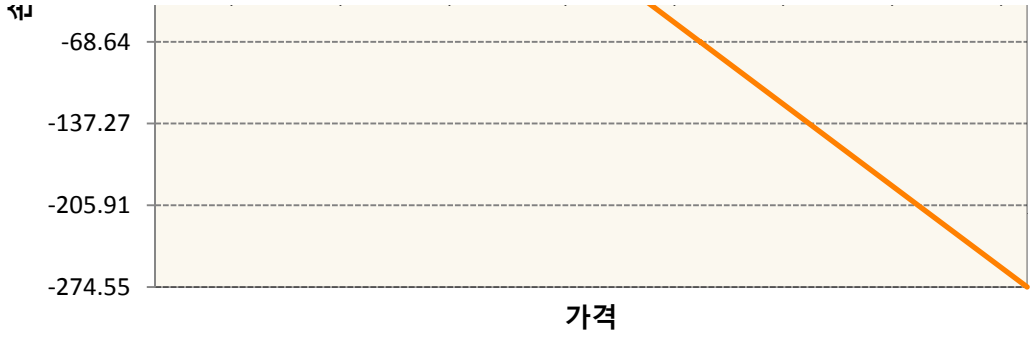
(단위:백만원)

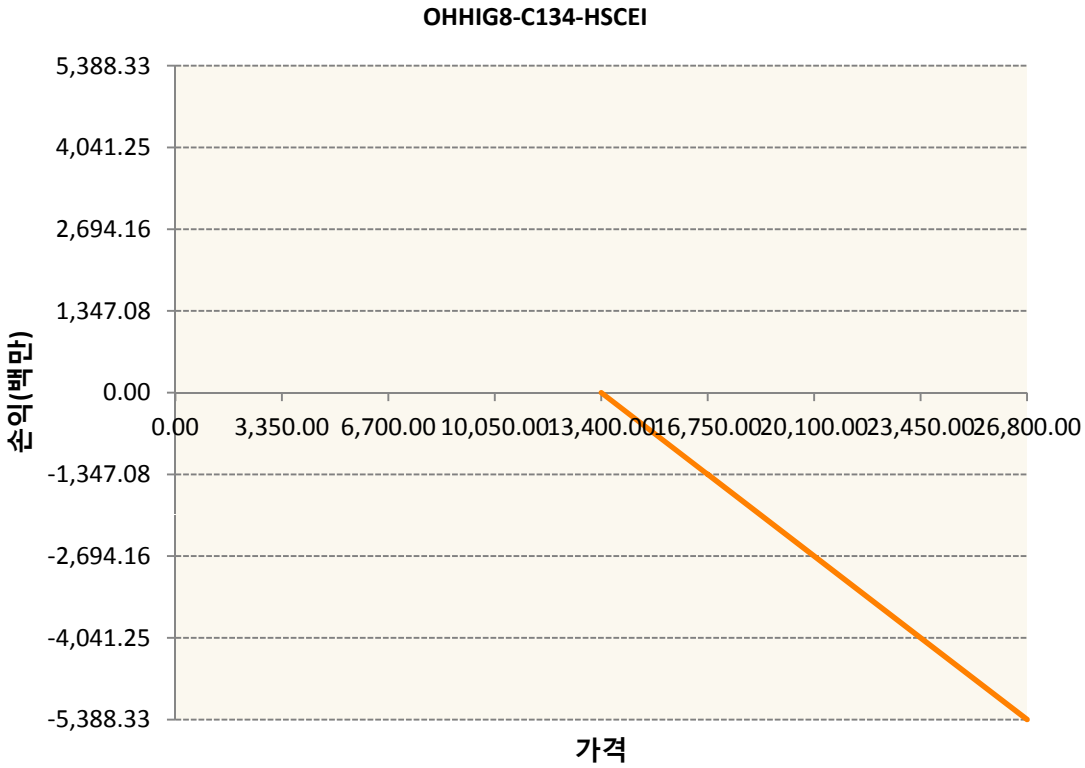
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	4,353	0	4,353	장내
누계	유가증권	옵션	0	11,326	-11,326	장내

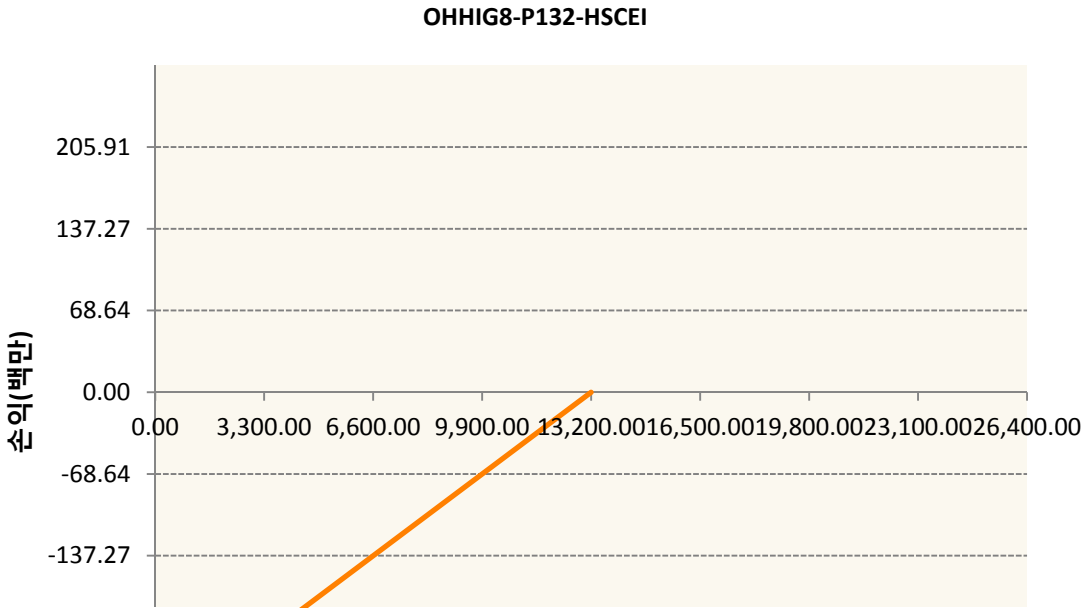
2. 만기시점의 손익구조

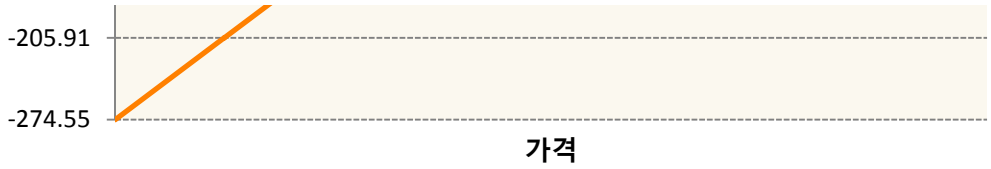


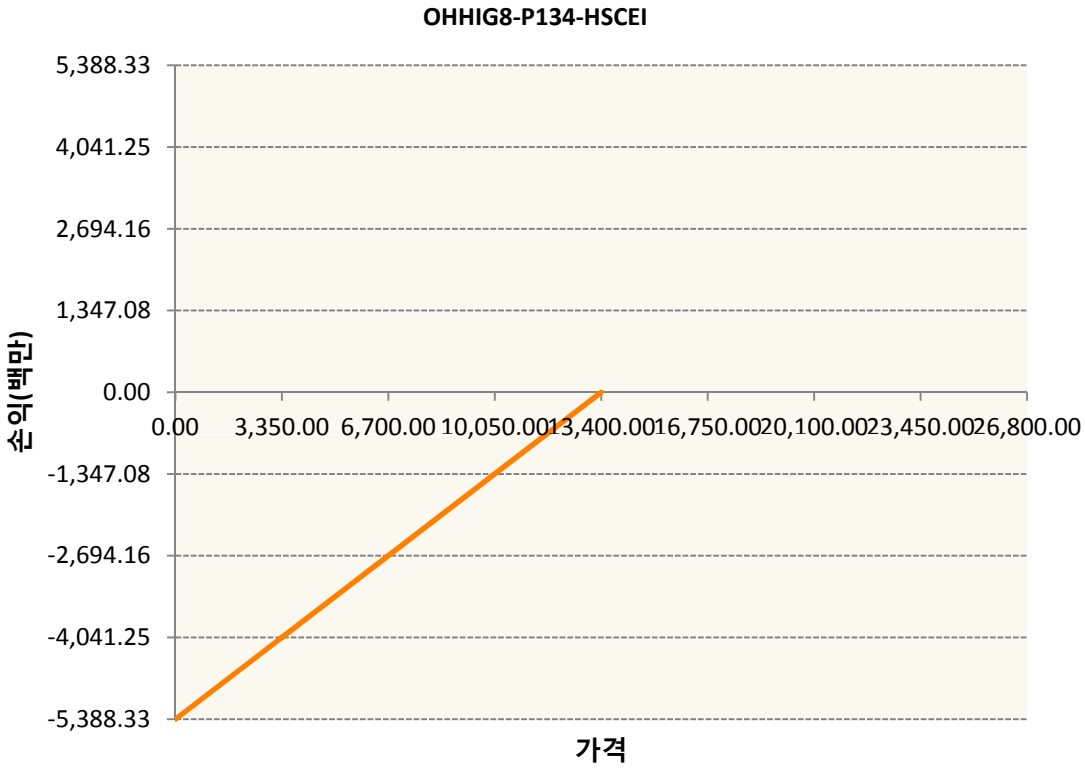



-68.64
-137.27
-205.91
-274.55
가격


OHHIG8-C134-HSCEI
5,388.33
4,041.25
2,694.16
1,347.08
0.00
-1,347.08
-2,694.16
-4,041.25
-5,388.33
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
205.91
137.27
68.64
0.00
-68.64
-137.27
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	348
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	2018-02-14
기준일	2018-02-13

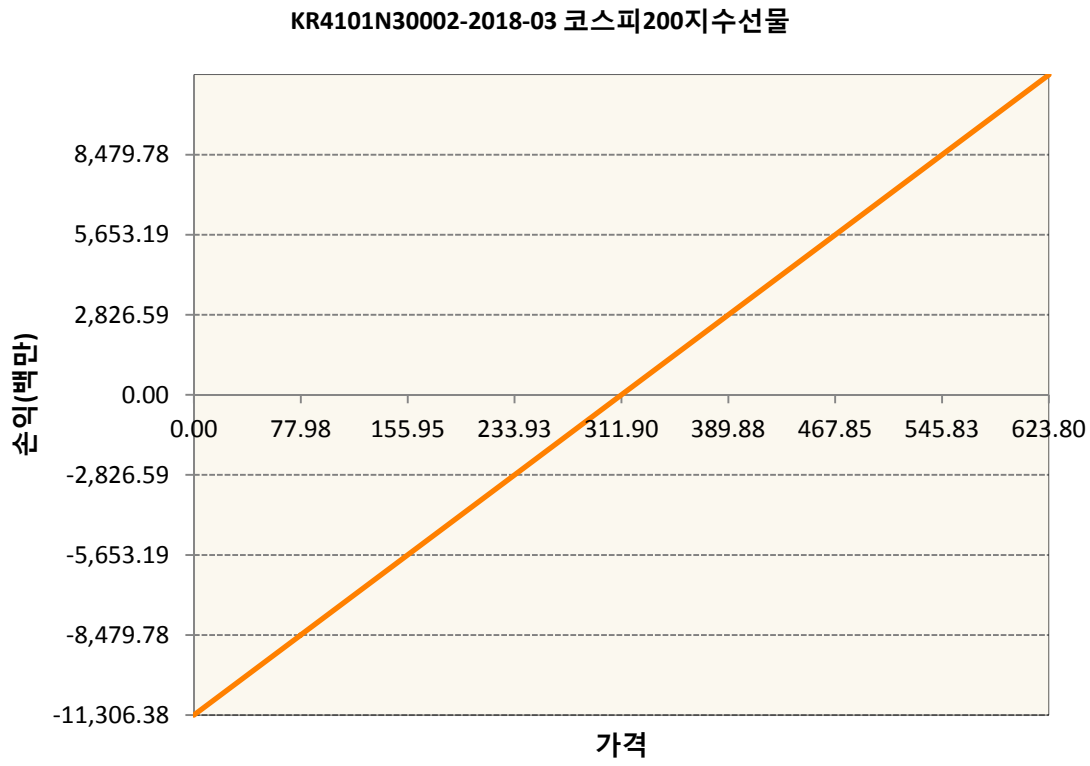
코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼

1. 계약금액

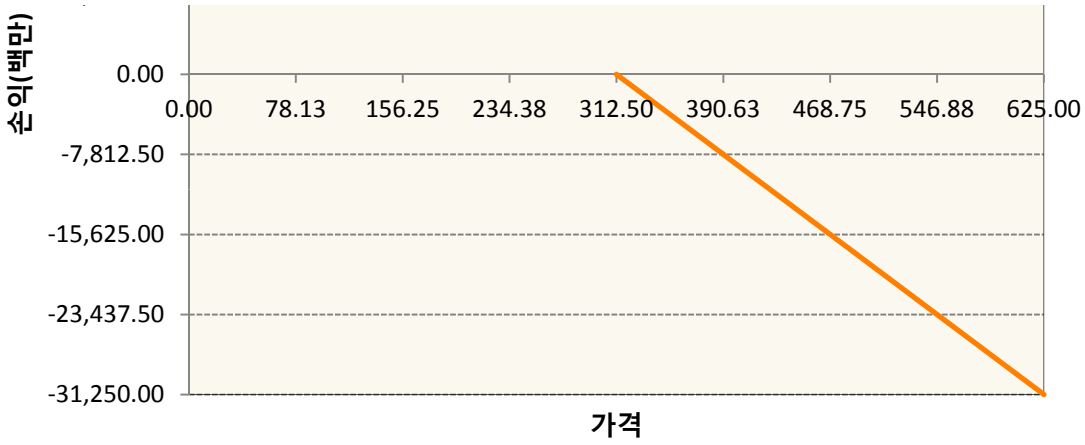
(단위:백만원)

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	11,306	0	11,306	장내
누계	유가증권	스왑	60,200	0	60,200	장외
누계	유가증권	옵션	0	56,094	-56,094	장내

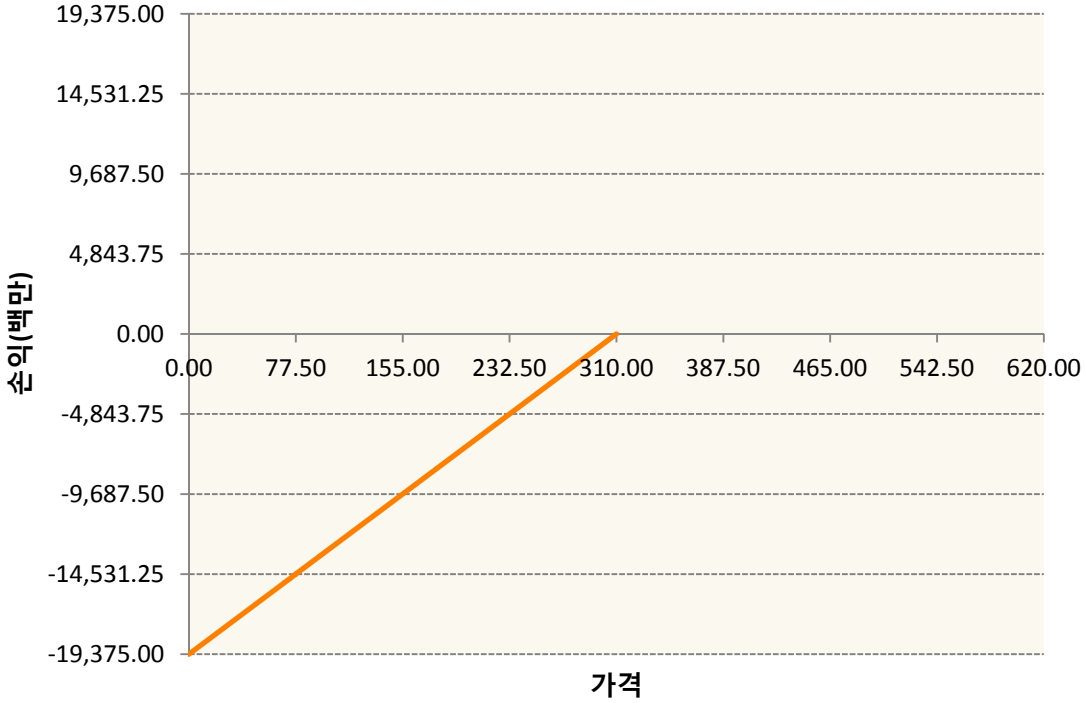
2. 만기시점의 손익구조



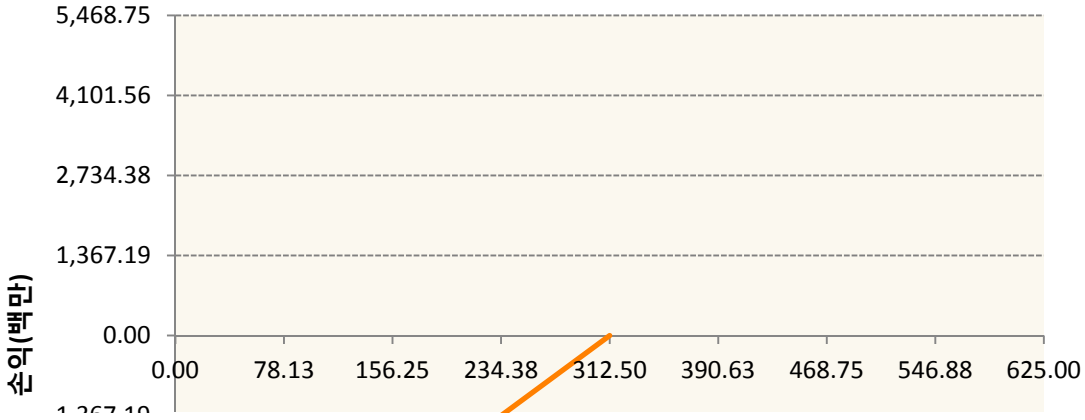




KR4301N33101-2018-03 풋310



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						471
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-471	-471	-471	-471	-471	-471	-471
-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%	471	471	471	471	471	471	471
	KR4101N30(	2018-03 코스피200지수선물					902
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-902	-902	-902	-902	-902	-902	-902
-5.33%	-601	-601	-601	-601	-601	-601	-601
-2.67%	-301	-301	-301	-301	-301	-301	-301
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	301	301	301	301	301	301	301
5.33%	601	601	601	601	601	601	601
8.00%	902	902	902	902	902	902	902
	KR4201N331	2018-03 콜312.5					1,862

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	765	745	720	691	658	621	580
-5.33%	693	654	610	563	512	459	404
-2.67%	526	466	403	340	275	209	142
0%	217	145	72	0	-72	-145	-217
2.67%	-256	-325	-394	-464	-534	-605	-676
5.33%	-876	-928	-984	-1,042	-1,103	-1,165	-1,229
8.00%	-1,600	-1,633	-1,671	-1,713	-1,759	-1,809	-1,862
KR4301N3312018-03 풋310							1,197

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,152	-1,156	-1,160	-1,167	-1,175	-1,186	-1,197
-5.33%	-655	-667	-681	-698	-716	-735	-755
-2.67%	-219	-245	-271	-298	-325	-353	-381
0%	93	62	31	0	-31	-62	-93
2.67%	261	238	213	187	160	133	105
5.33%	325	314	300	284	267	247	227
8.00%	342	338	333	326	317	306	293
KR4301N3312018-03 풋312.5							353

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-343	-344	-345	-346	-348	-350	-353
-5.33%	-202	-204	-207	-211	-215	-220	-225
-2.67%	-73	-79	-86	-92	-100	-107	-114
0%	26	17	9	0	-9	-17	-26
2.67%	85	77	69	61	53	45	37
5.33%	110	106	101	96	90	84	77
8.00%	118	116	114	111	108	104	100

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

8,672

공시일	2018-02-14
기준일	2018-02-13

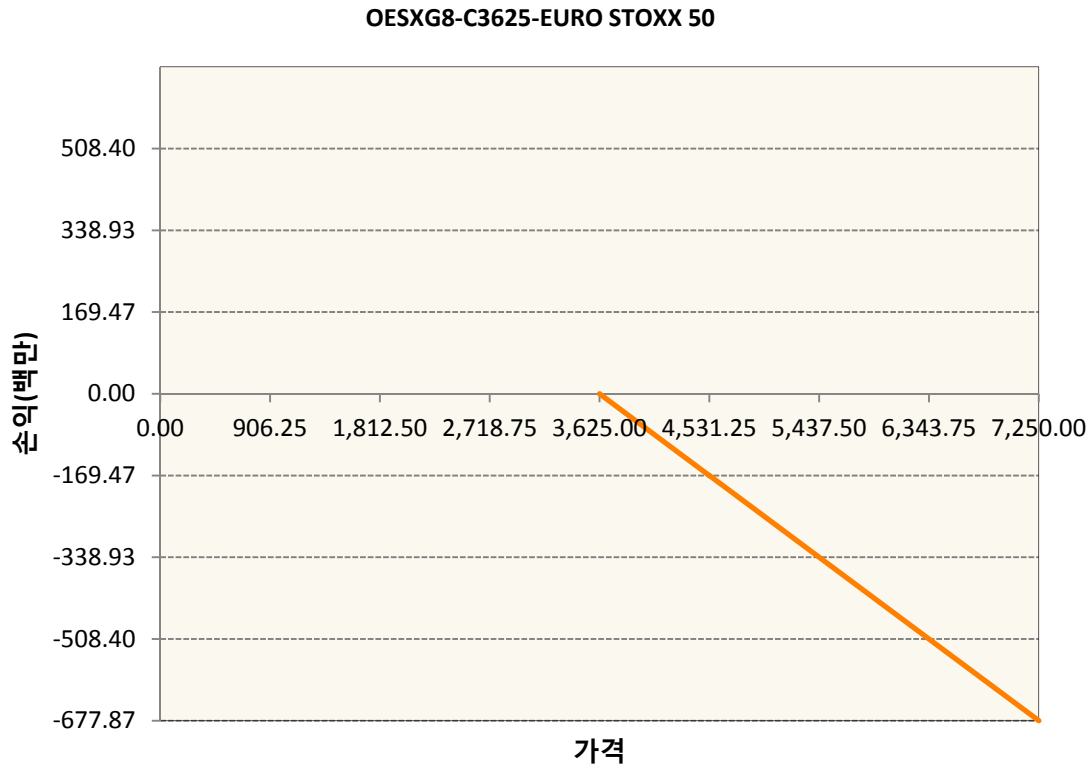
유로커버드콜모(주식혼합-파생형

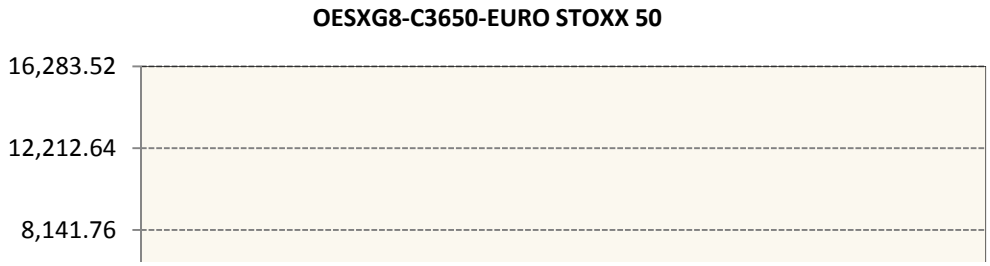
1. 계약금액

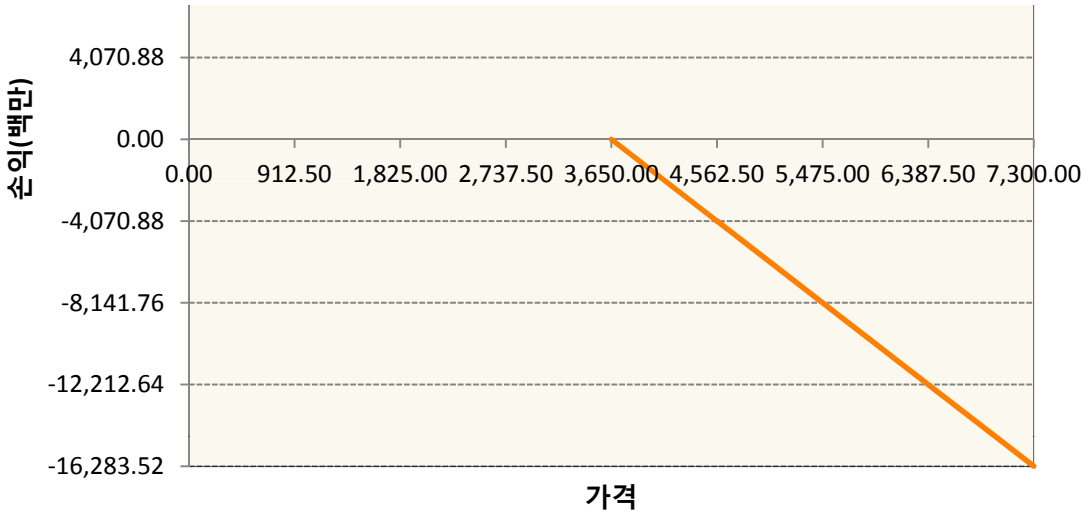
(단위:백만원)

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	7,368	0	7,368	
누계	유가증권	스왑	100,175	0	100,175	장외
누계	유가증권	옵션	0	33,923	-33,923	장내
누계	지수	스왑	53,428	0	53,428	장외

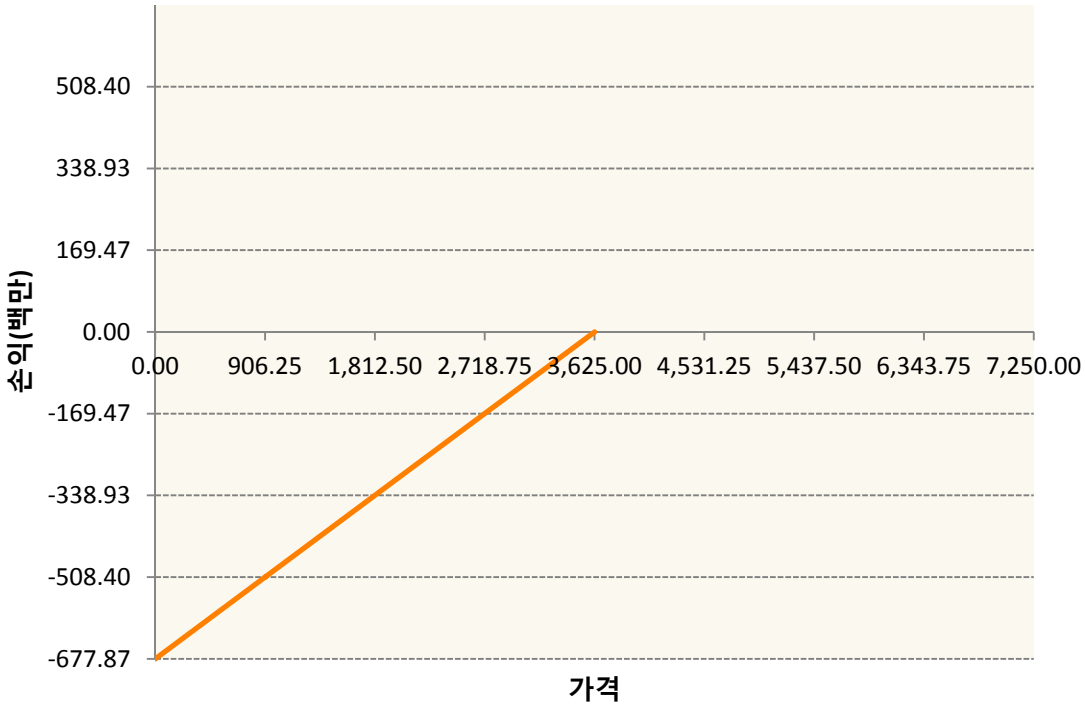
2. 만기시점의 손익구조



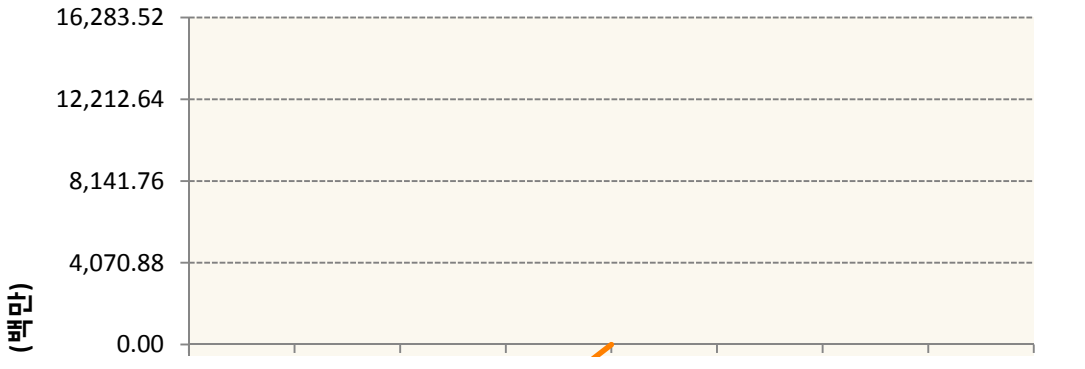


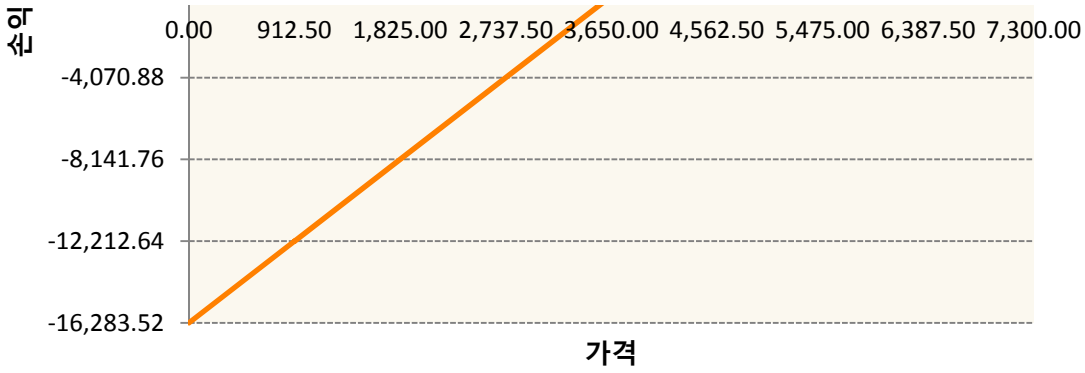


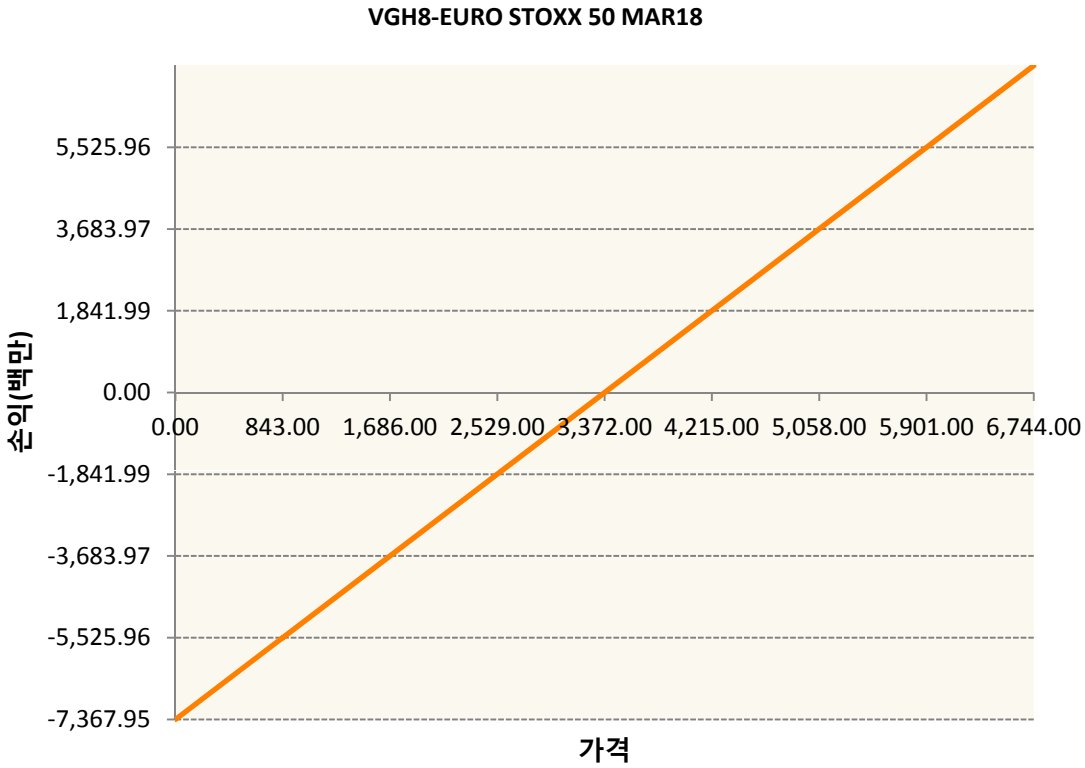
OESXG8-P3625-EURO STOXX 50



OESXG8-P3650-EURO STOXX 50







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)	(단위:백만원)
260105SGPX SG EURO Covered CALL STRATEGY - 994.569	287
260105SQPX SG EURO Covered CALL STRATEGY	539
OESXG8-C3(EURO STOXX 50	54
OESXG8-C3(EURO STOXX 50	1,303
OESXG8-P3(EURO STOXX 50	54
OESXG8-P3(EURO STOXX 50	1,303
VGH8 EURO STOXX 50 MAR18	589

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

2,472

공시일	2018-02-14
기준일	2018-02-13

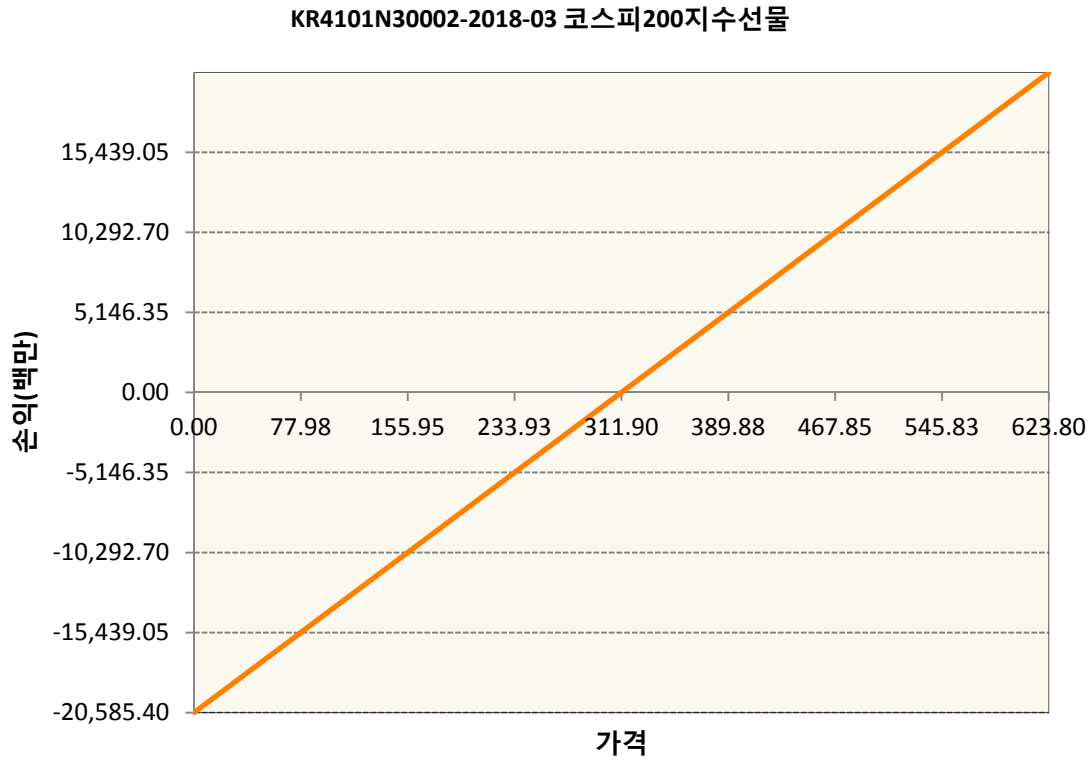
ETF스마트레버리지목표전환형8호

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	20,585	0	20,585	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101N30(2018-03 코스피200지수선물							1,641
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,641	-1,641	-1,641	-1,641	-1,641	-1,641	-1,641
-5.33%	-1,094	-1,094	-1,094	-1,094	-1,094	-1,094	-1,094
-2.67%	-547	-547	-547	-547	-547	-547	-547
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	547	547	547	547	547	547	547
5.33%	1,094	1,094	1,094	1,094	1,094	1,094	1,094
8.00%	1,641	1,641	1,641	1,641	1,641	1,641	1,641

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

1,079

공시일	2018-02-14
기준일	2018-02-13

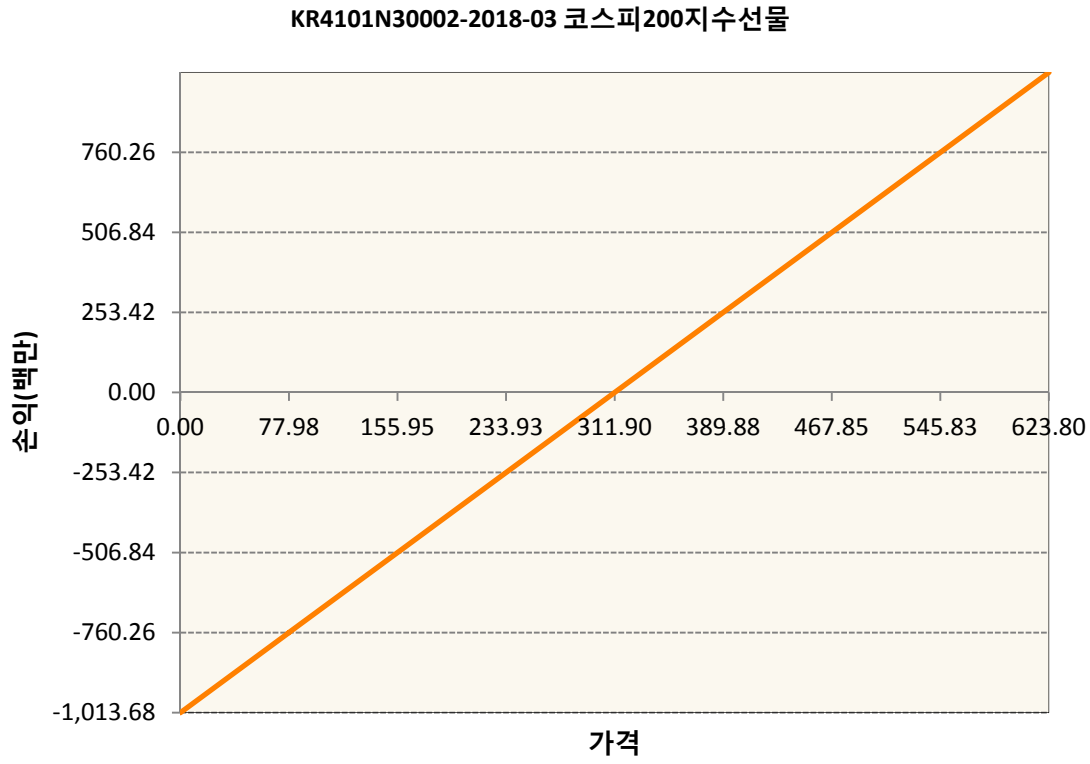
ETF스마트레버리지목표전환형9호

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	1,014	0	1,014	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101N30(2018-03 코스피200지수선물							81
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-81	-81	-81	-81	-81	-81	-81
-5.33%	-54	-54	-54	-54	-54	-54	-54
-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%	54	54	54	54	54	54	54
8.00%	81	81	81	81	81	81	81

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

53

공시일	2018-02-14
기준일	2018-02-13

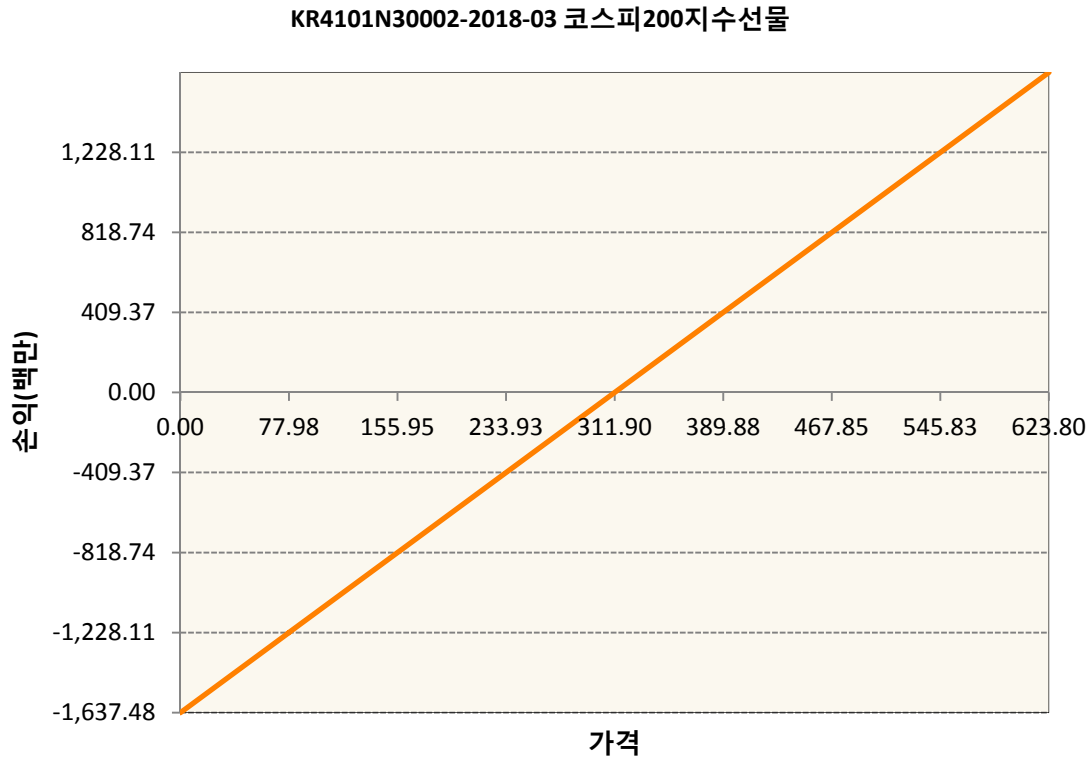
ETF스마트레버리지목표전환형10

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	1,637	0	1,637	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101N30(2018-03 코스피200지수선물							131
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-131	-131	-131	-131	-131	-131	-131
-5.33%	-87	-87	-87	-87	-87	-87	-87
-2.67%	-44	-44	-44	-44	-44	-44	-44
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	44	44	44	44	44	44	44
5.33%	87	87	87	87	87	87	87
8.00%	131	131	131	131	131	131	131

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

86

공시일	2018-02-14
기준일	2018-02-13

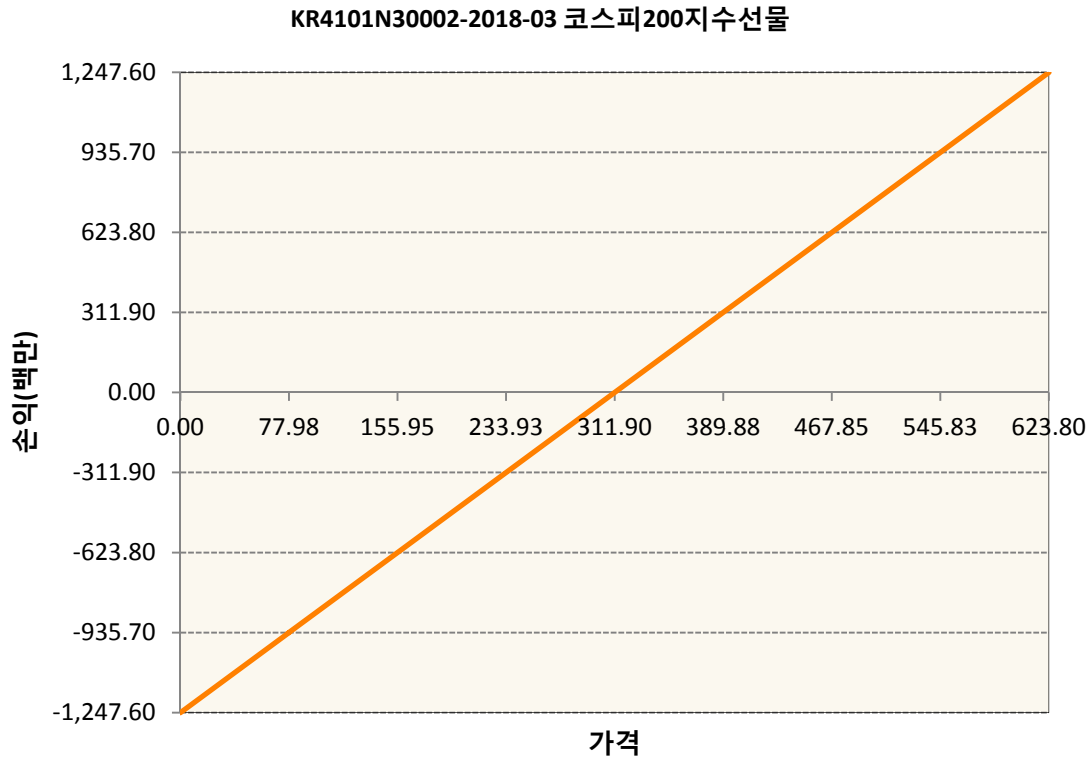
스마트KRX300인덱스1호(주식-파

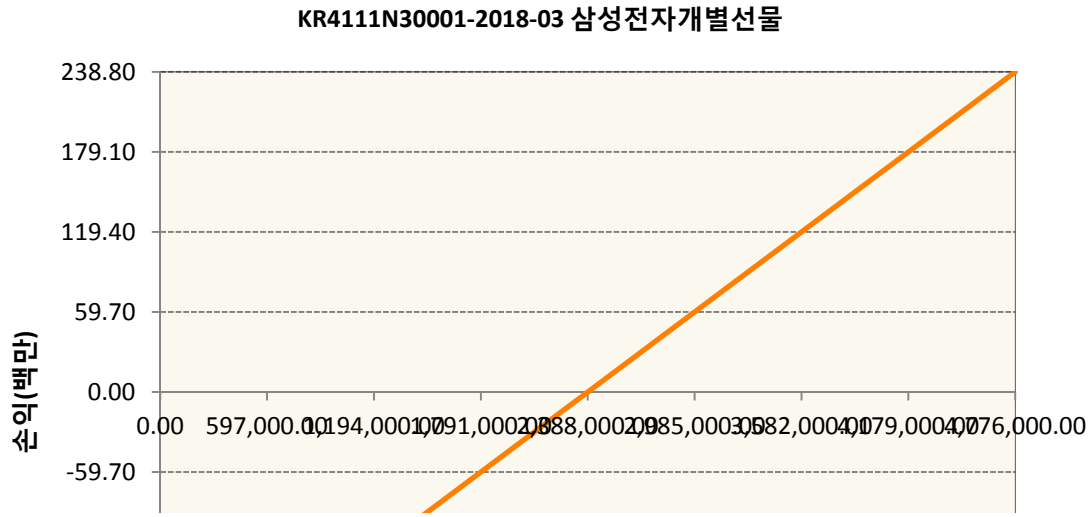
1. 계약금액

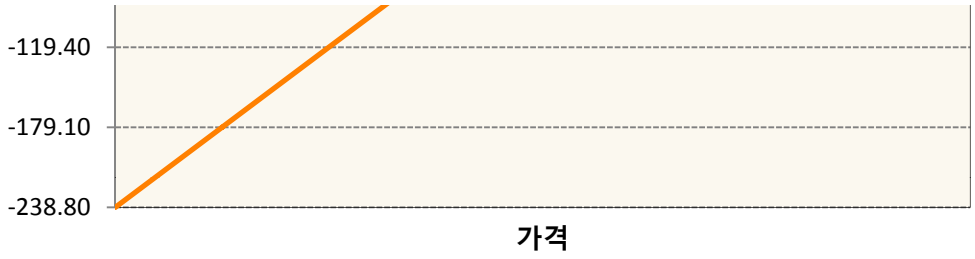
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	238	0	238	장내
누계	유가증권	선물	1,486	0	1,486	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

KR4111N30(2018-03 삼성전자개별선물							19
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-19	-19	-19	-19	-19	-19	-19
-5.33%	-13	-13	-13	-13	-13	-13	-13
-2.67%	-6	-6	-6	-6	-6	-6	-6
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	6	6	6	6	6	6	6
5.33%	13	13	13	13	13	13	13
8.00%	19	19	19	19	19	19	19

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

88

공시일	2018-02-14
기준일	2018-02-13

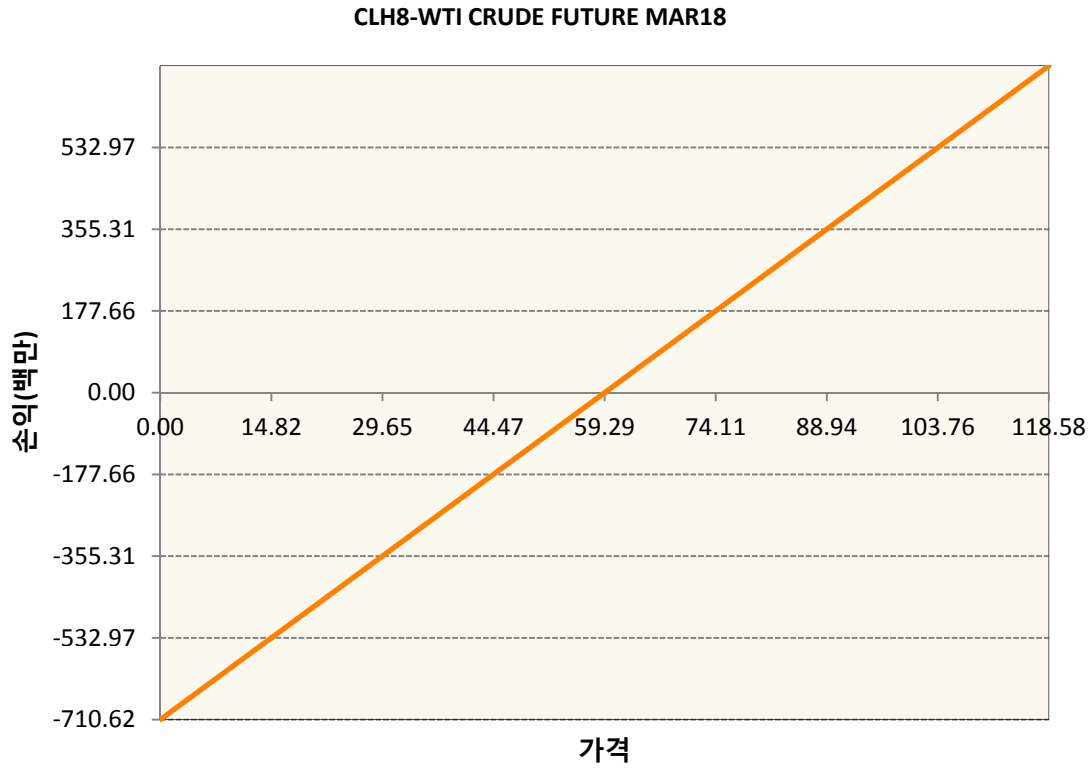
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

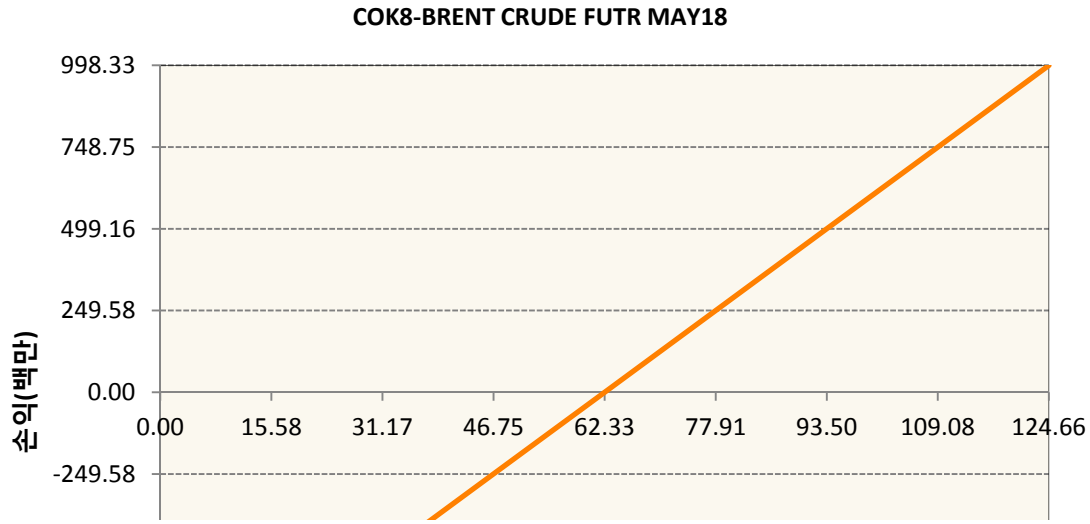
1. 계약금액

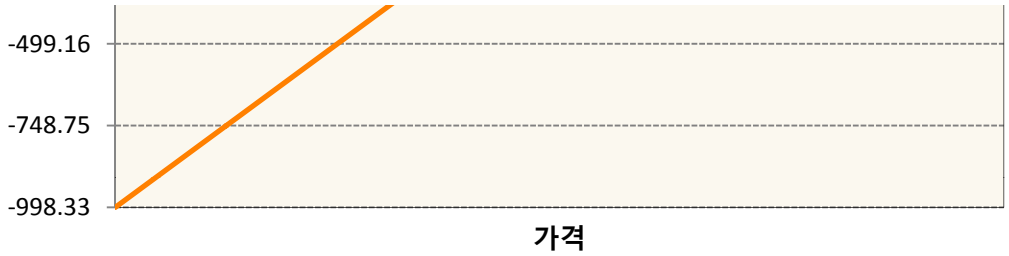
(단위:백만원)

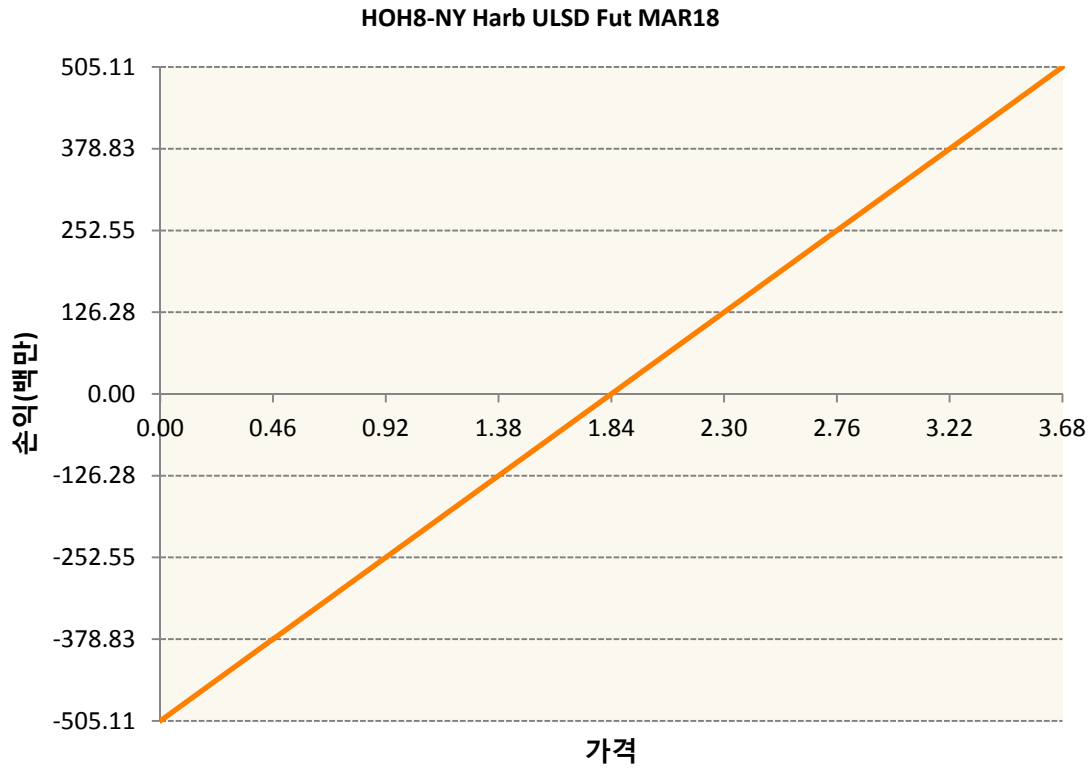
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,749	596	3,153	

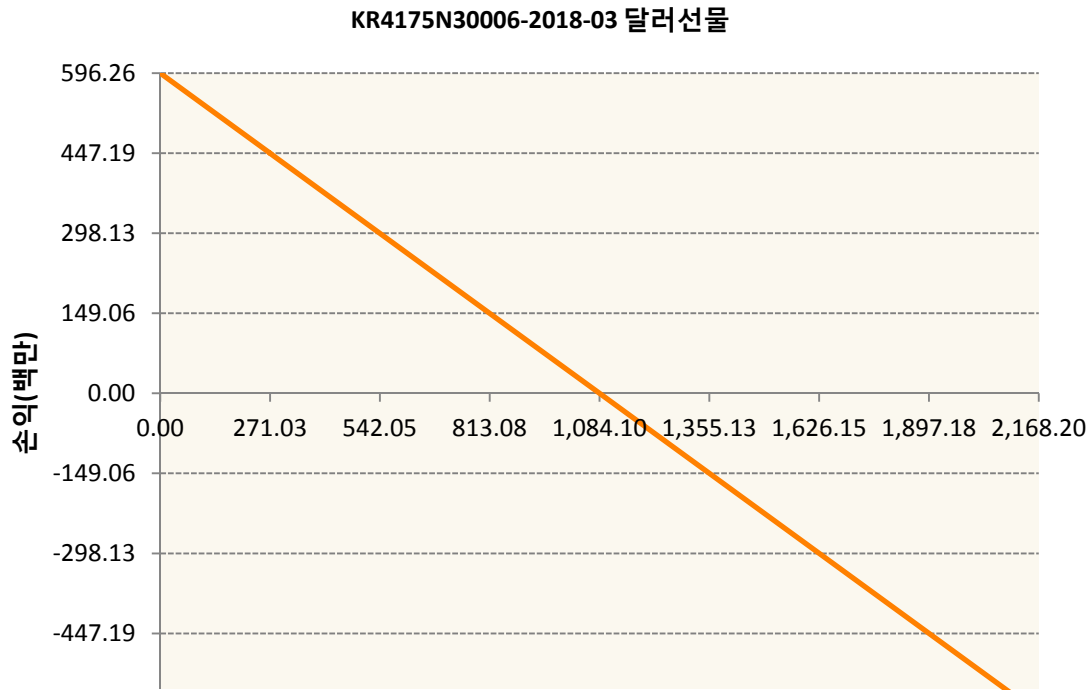
2. 만기시점의 손익구조

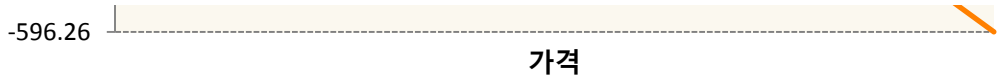


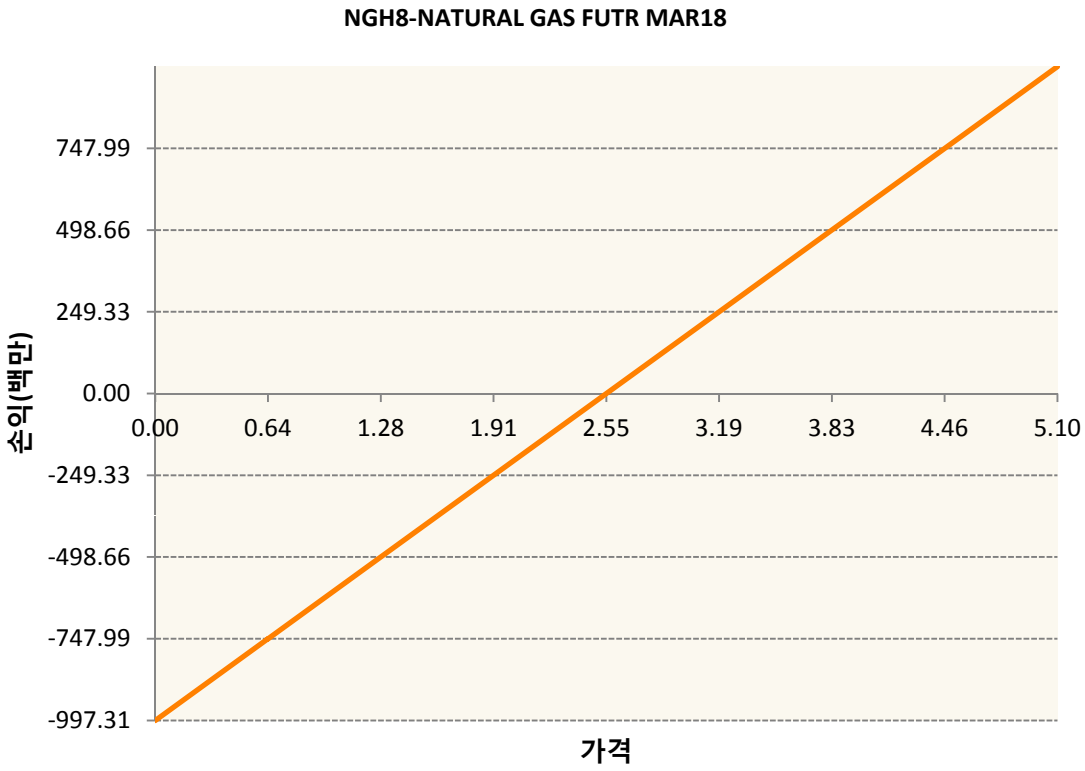


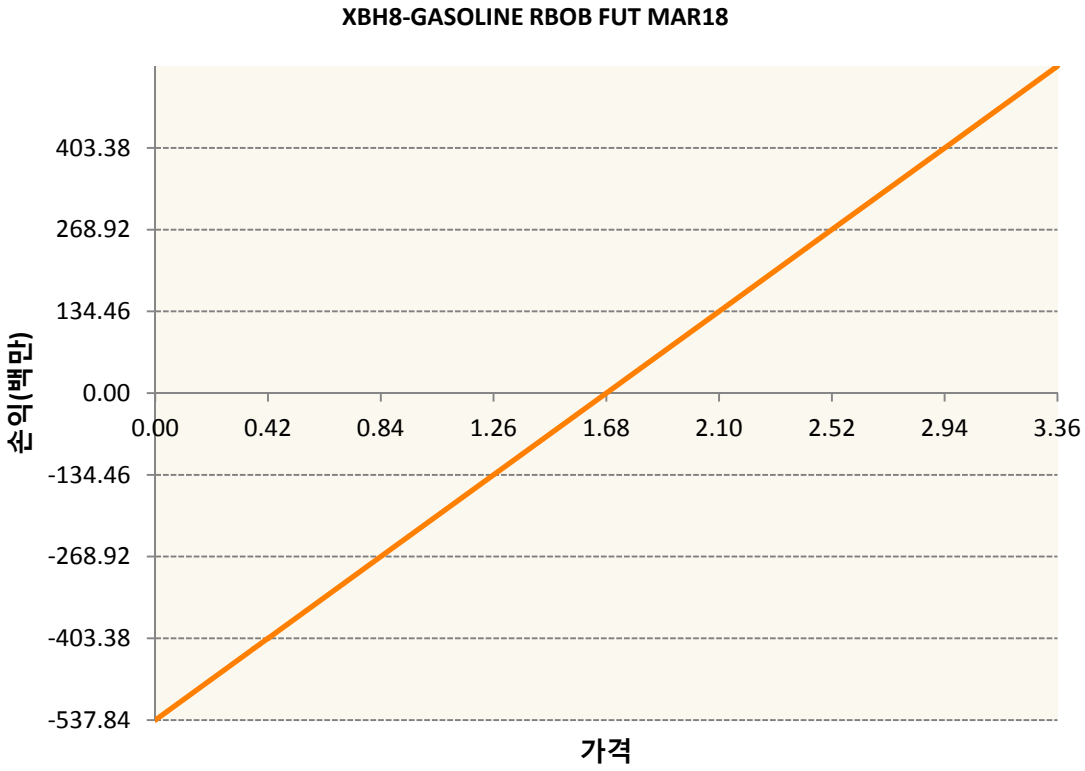

-499.16
-748.75
-998.33
가격


HOH8-NY Harb ULSD Fut MAR18
505.11
378.83
252.55
126.28
0.00
-126.28
-252.55
-378.83
-505.11
0.00
0.46
0.92
1.38
1.84
2.30
2.76
3.22
3.68
손익(백만)
가격


KR4175N30006-2018-03 달러선물
596.26
447.19
298.13
149.06
0.00
-149.06
-298.13
-447.19
0.00
271.03
542.05
813.08
1,084.10
1,355.13
1,626.15
1,897.18
2,168.20
손익(백만)


-596.26
가격


NGH8-NATURAL GAS FUTR MAR18
747.99
498.66
249.33
0.00
-249.33
-498.66
-747.99
-997.31
손익(백만)
0.00
0.64
1.28
1.91
2.55
3.19
3.83
4.46
5.10
가격


XBH8-GASOLINE RBOB FUT MAR18
403.38
268.92
134.46
0.00
-134.46
-268.92
-403.38
-537.84
손익(백만)
0.00
0.42
0.84
1.26
1.68
2.10
2.52
2.94
3.36
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	40
KR4175N30(	2018-03 달러선물	48
NGH8	NATURAL GAS FUTR MAR18	80
XBH8	GASOLINE RBOB FUT MAR18	43

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

502

공시일	2018-02-14
기준일	2018-02-13

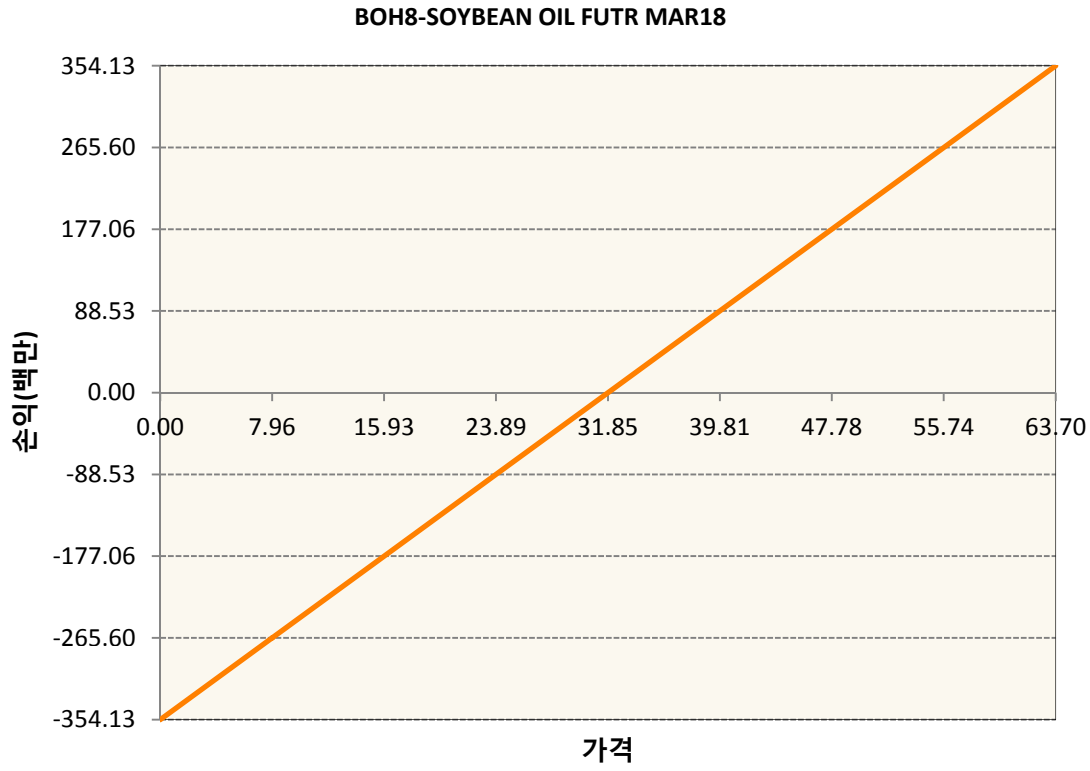
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

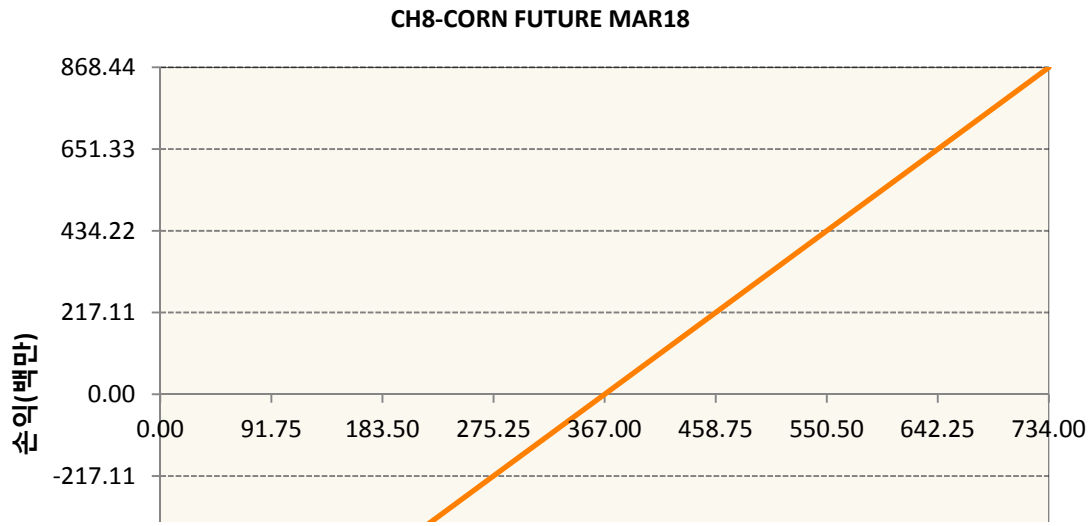
1. 계약금액

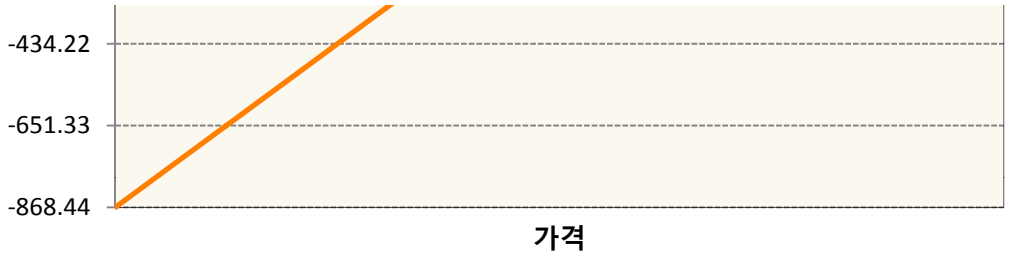
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	4,126	325	3,801	

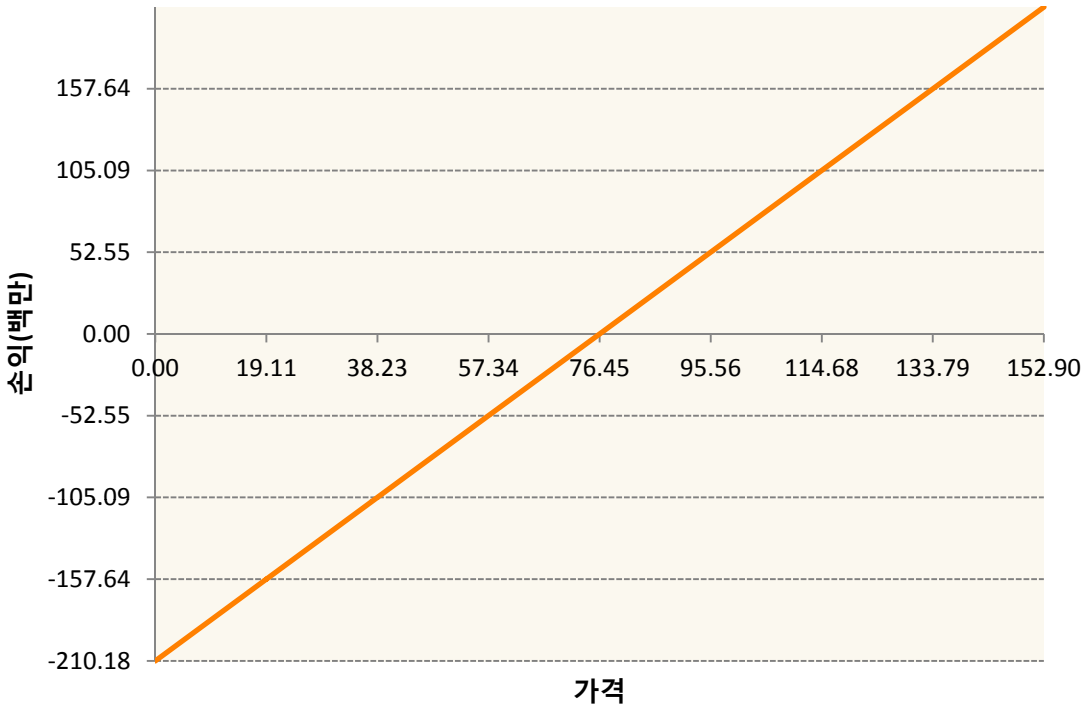
2. 만기시점의 손익구조



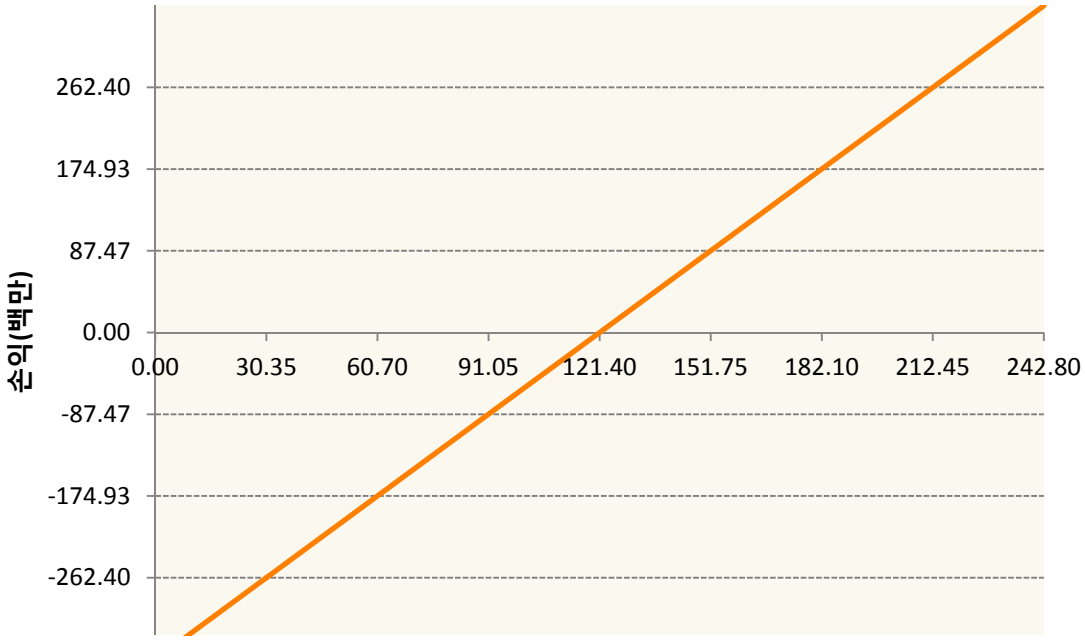


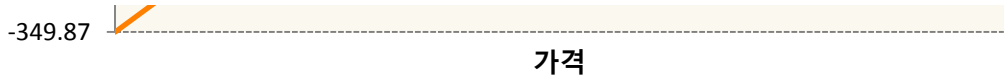


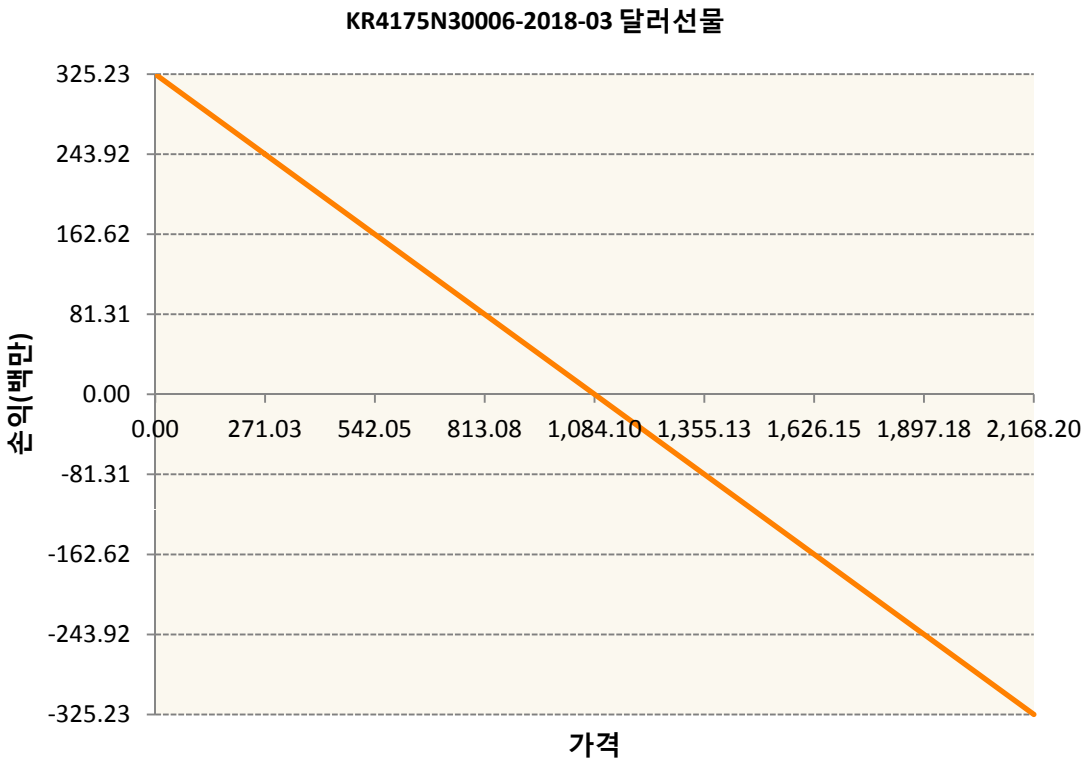
CTH8-COTTON NO.2 FUTR MAR18

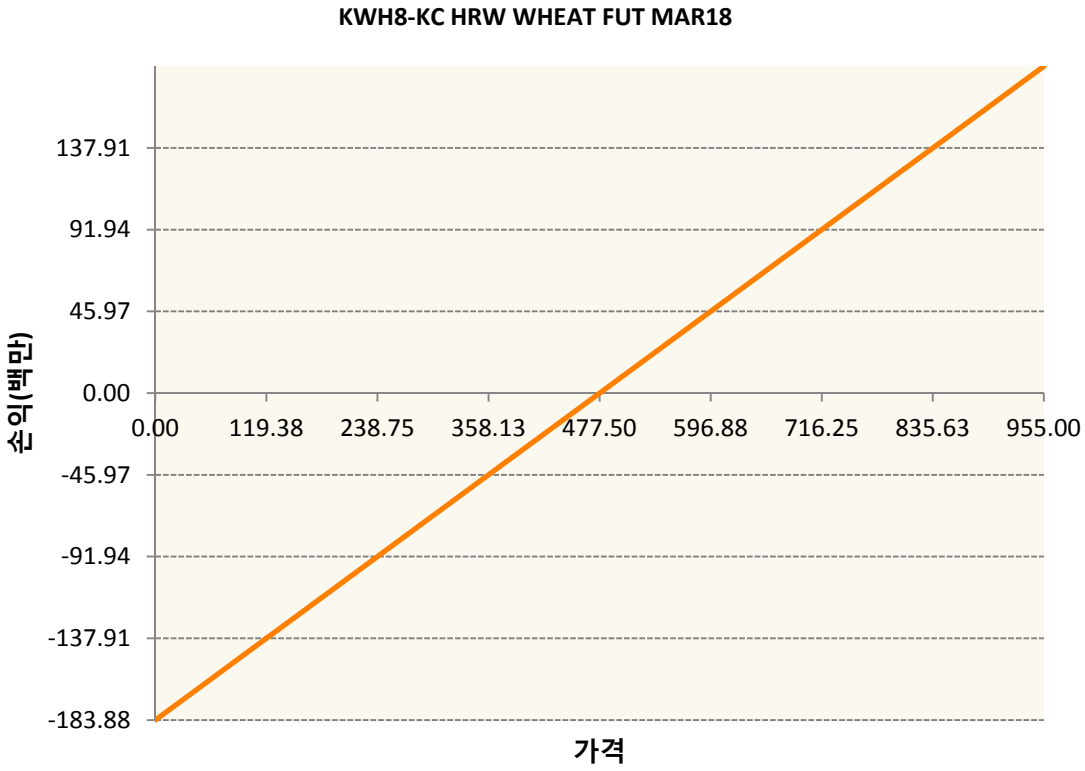


KCH8-COFFEE "C" FUTURE MAR18

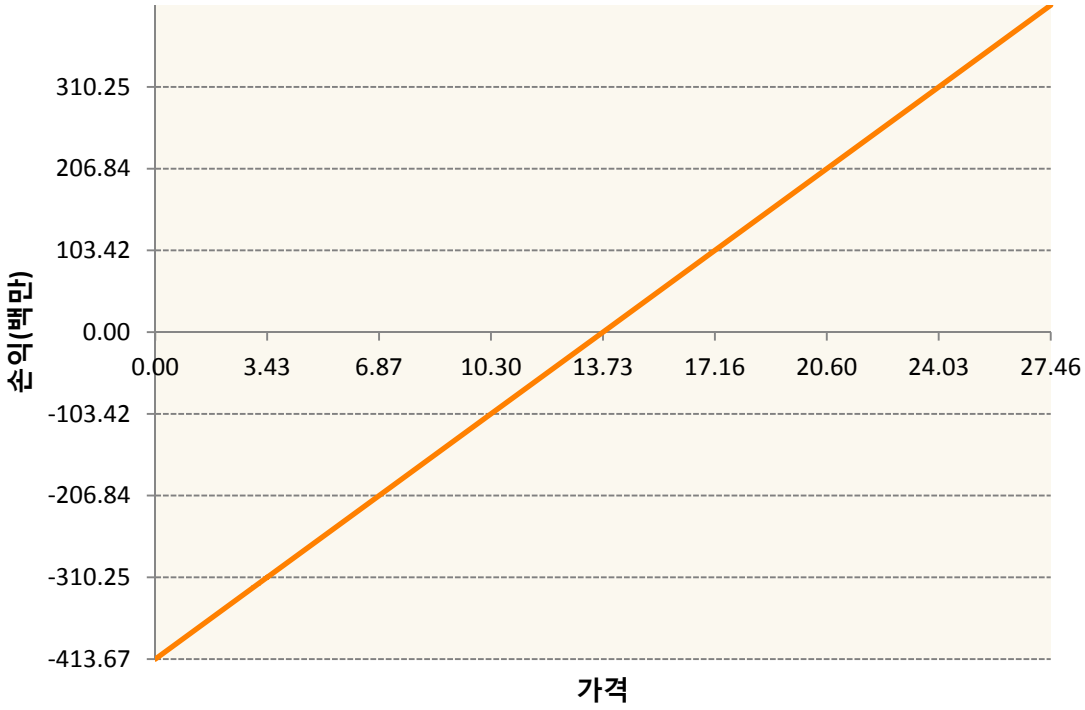



-349.87
가격

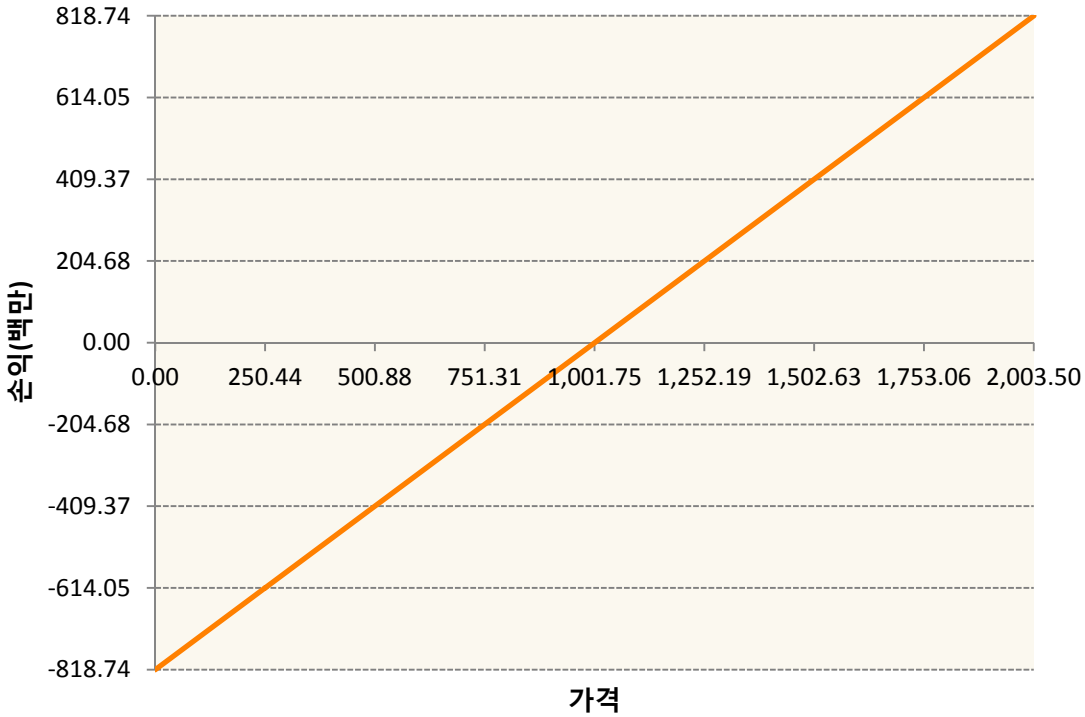

KR4175N30006-2018-03 달러선물
325.23
243.92
162.62
81.31
0.00
-81.31
-162.62
-243.92
-325.23
0.00
271.03
542.05
813.08
1,084.10
1,355.13
1,626.15
1,897.18
2,168.20
손익(백만)
가격


KWH8-KC HRW WHEAT FUT MAR18
137.91
91.94
45.97
0.00
-45.97
-91.94
-137.91
-183.88
0.00
119.38
238.75
358.13
477.50
596.88
716.25
835.63
955.00
손익(백만)
가격

SBH8-Sugar #11 (WORLD) MAR18

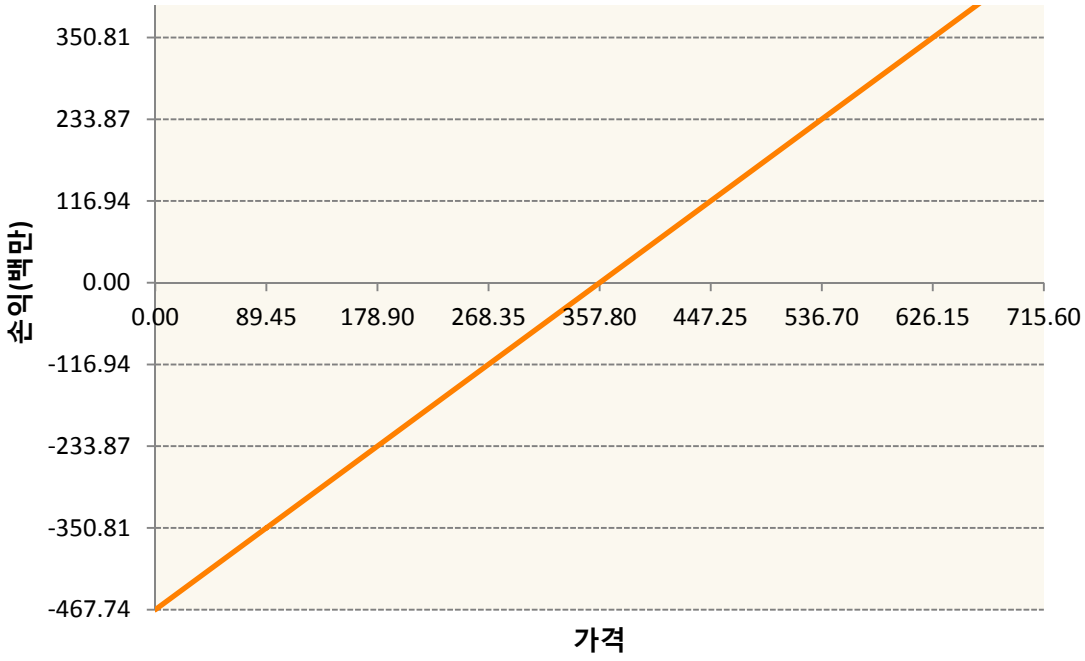


SH8-SOYBEAN FUTURE MAR18

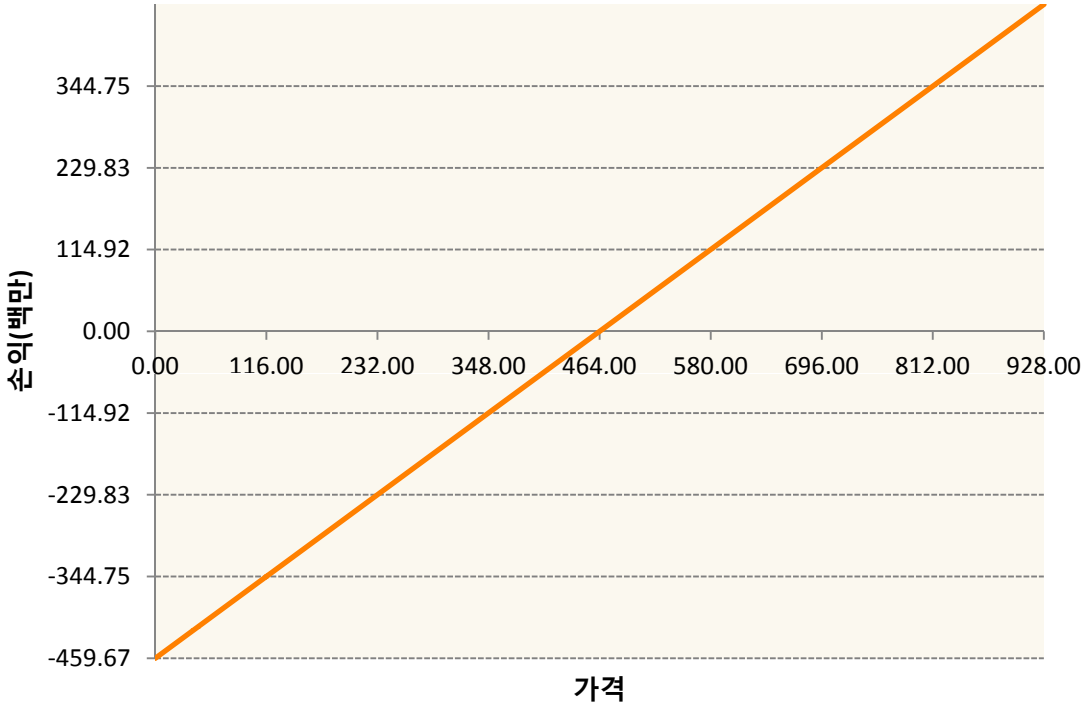


SMH8-SOYBEAN MEAL FUTR MAR18





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	15
SBH8	Sugar #11 (WORLD) MAR18	33
SH8	SOYBEAN FUTURE MAR18	65
SMH8	SOYBEAN MEAL FUTR MAR18	37
WH8	WHEAT FUTURE(CBT) MAR18	37

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

342