공시일	2017-09-15
기준일	2017-09-14

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	2017-09-15
기준일	2017-09-14

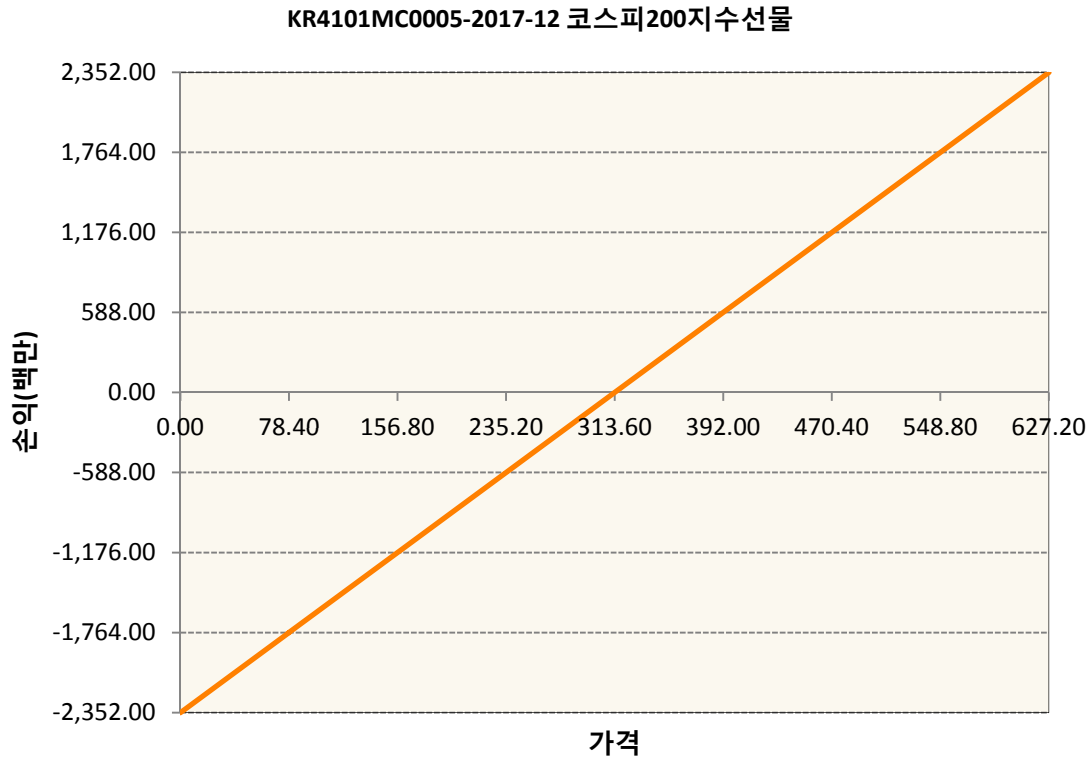
스마트인덱스모

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	1,168	0	1,168	장내
누계	유가증권	선물	2,352	0	2,352	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101MC0	2017-12 코스피200지수선물						188
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-188	-188	-188	-188	-188	-188	-188
-5.33%	-125	-125	-125	-125	-125	-125	-125
-2.67%	-63	-63	-63	-63	-63	-63	-63
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	63	63	63	63	63	63	63
5.33%	125	125	125	125	125	125	125
8.00%	188	188	188	188	188	188	188

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

113

공시일	2017-09-15
기준일	2017-09-14

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	12,592	0	12,592	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWMXWO0(신한MXWO 미래S170822	1,037

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

469

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-09-15
기준일	2017-09-14

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	5,301	0	5,301	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI50000 신한CSI500미래S170908	430

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

363

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-09-15
기준일	2017-09-14

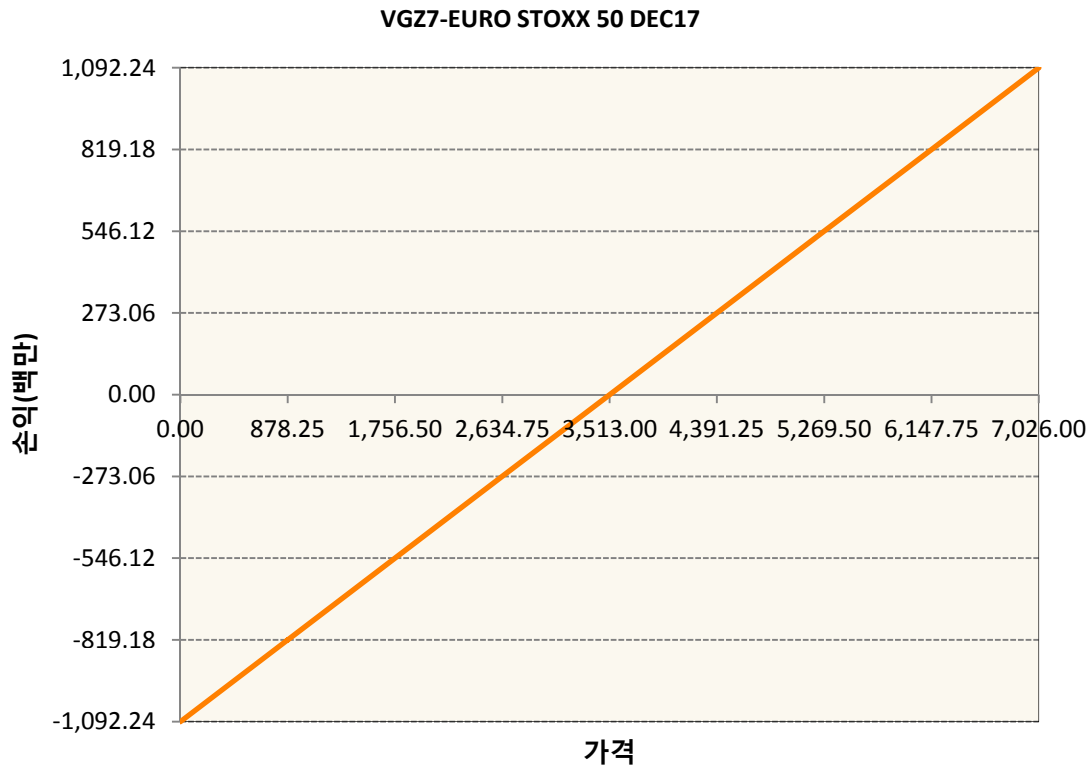
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,092	0	1,092	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGZ7	EURO STOXX 50 DEC17	87

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

(단위:백만원)

69

공시일	2017-09-15
기준일	2017-09-14

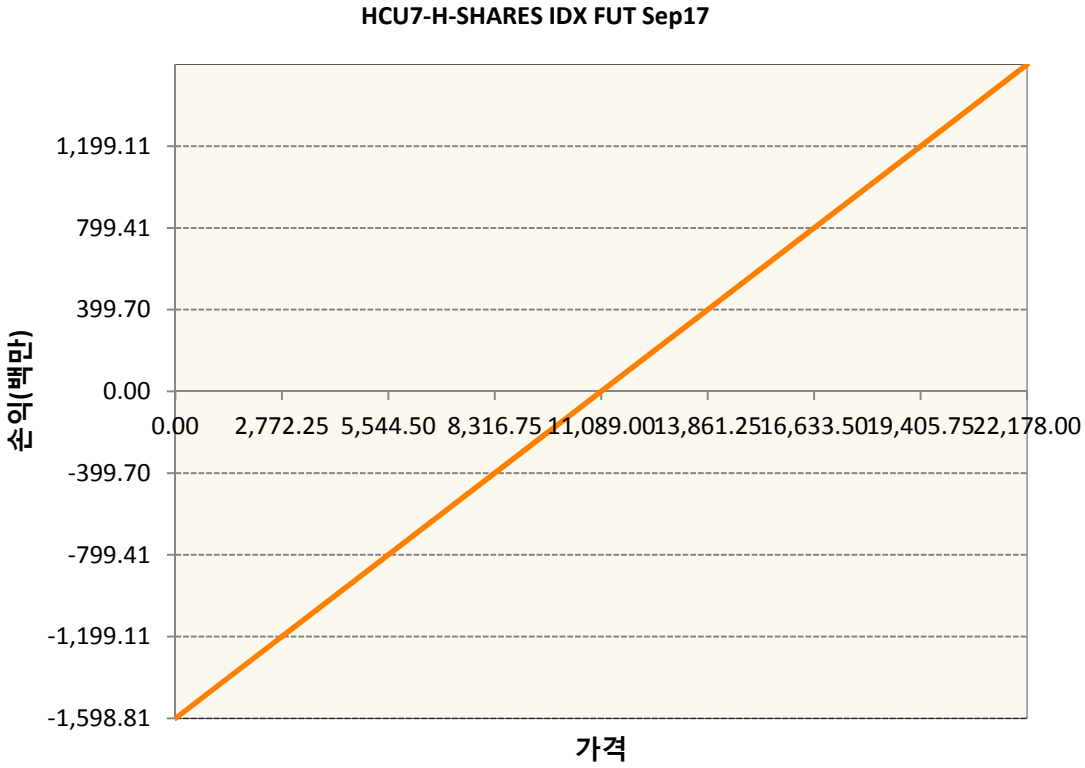
차이나인덱스모(주식-파생형)

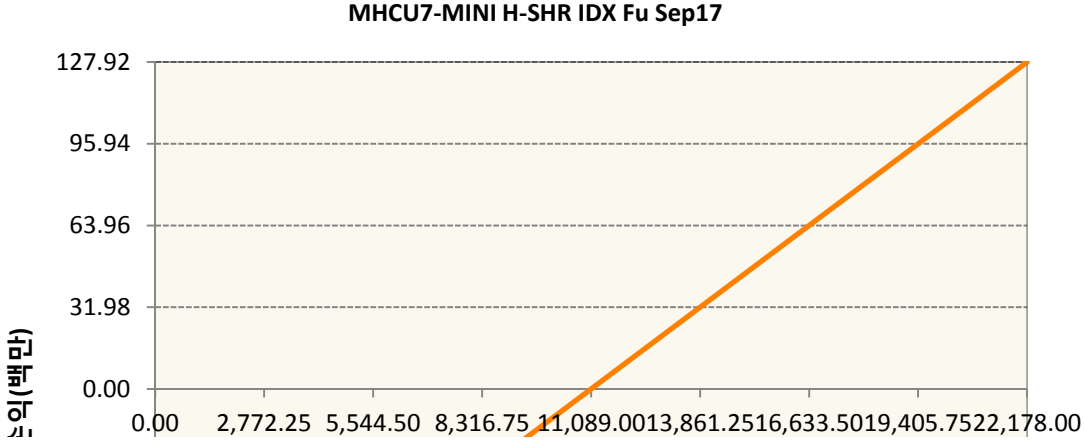
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	128	0	128	
누계	유가증권	선물	1,599	0	1,599	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCU7	H-SHARES IDX FUT Sep17	128
MHCU7	MINI H-SHR IDX Fu Sep17	10

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

공시일	2017-09-15
기준일	2017-09-14

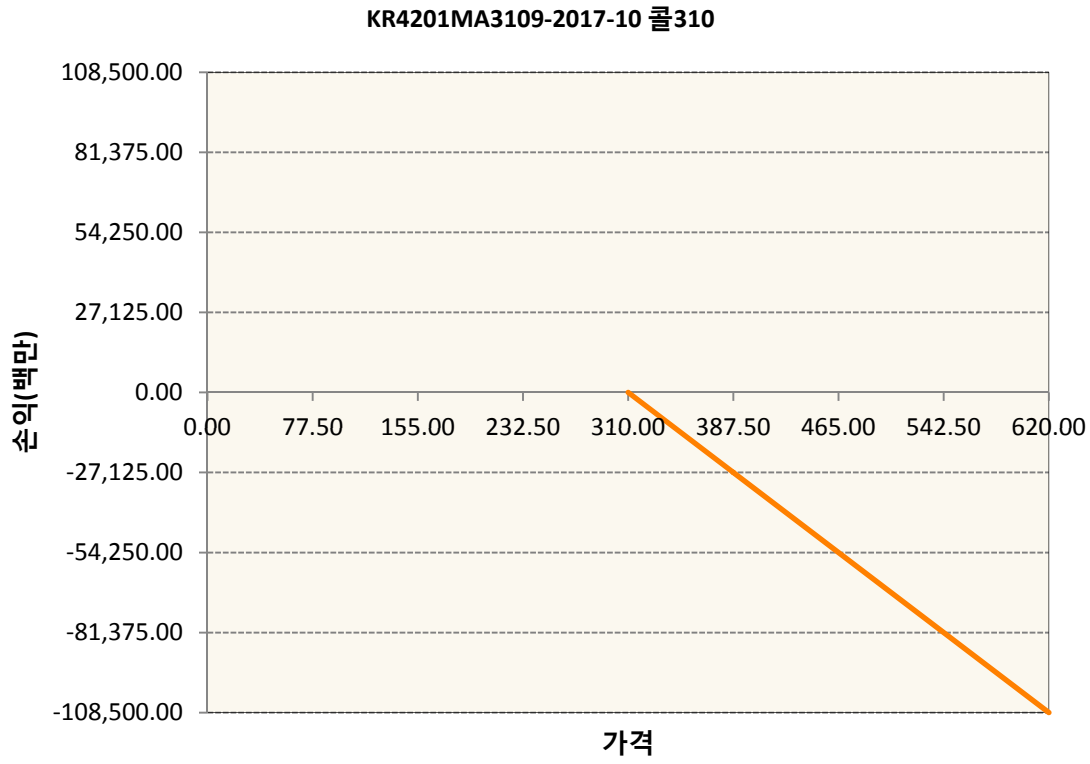
커버드콜모(주식혼합-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	78,458	-78,458	장내
누계	유가증권	옵션	0	108,500	-108,500	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4201MA3 2017-10 콜310 7,047

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	3,110	3,037	2,948	2,844	2,727	2,599	2,461
-5.33%	2,792	2,645	2,486	2,318	2,142	1,960	1,773
-2.67%	2,041	1,829	1,613	1,396	1,177	957	736
0%	686	458	229	0	-230	-459	-689
2.67%	-1,288	-1,474	-1,668	-1,868	-2,073	-2,282	-2,494
5.33%	-3,737	-3,855	-3,988	-4,135	-4,293	-4,461	-4,636
8.00%	-6,464	-6,522	-6,598	-6,690	-6,796	-6,916	-7,047

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

7,016

공시일	2017-09-15
기준일	2017-09-14

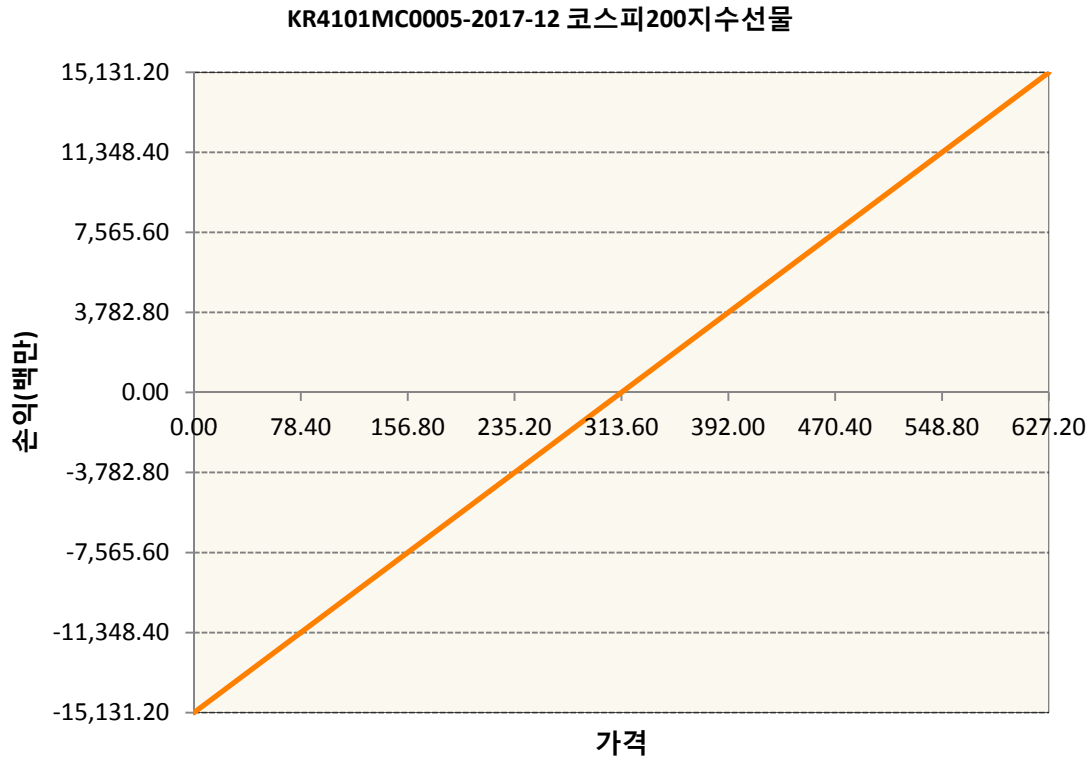
ETF스마트레버리지목표전환형6호

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	7,552	0	7,552	장내
누계	유가증권	선물	15,131	0	15,131	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101MC0	2017-12 코스피200지수선물						1,206
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,206	-1,206	-1,206	-1,206	-1,206	-1,206	-1,206
-5.33%	-804	-804	-804	-804	-804	-804	-804
-2.67%	-402	-402	-402	-402	-402	-402	-402
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	402	402	402	402	402	402	402
5.33%	804	804	804	804	804	804	804
8.00%	1,206	1,206	1,206	1,206	1,206	1,206	1,206

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

727

공시일	2017-09-15
기준일	2017-09-14

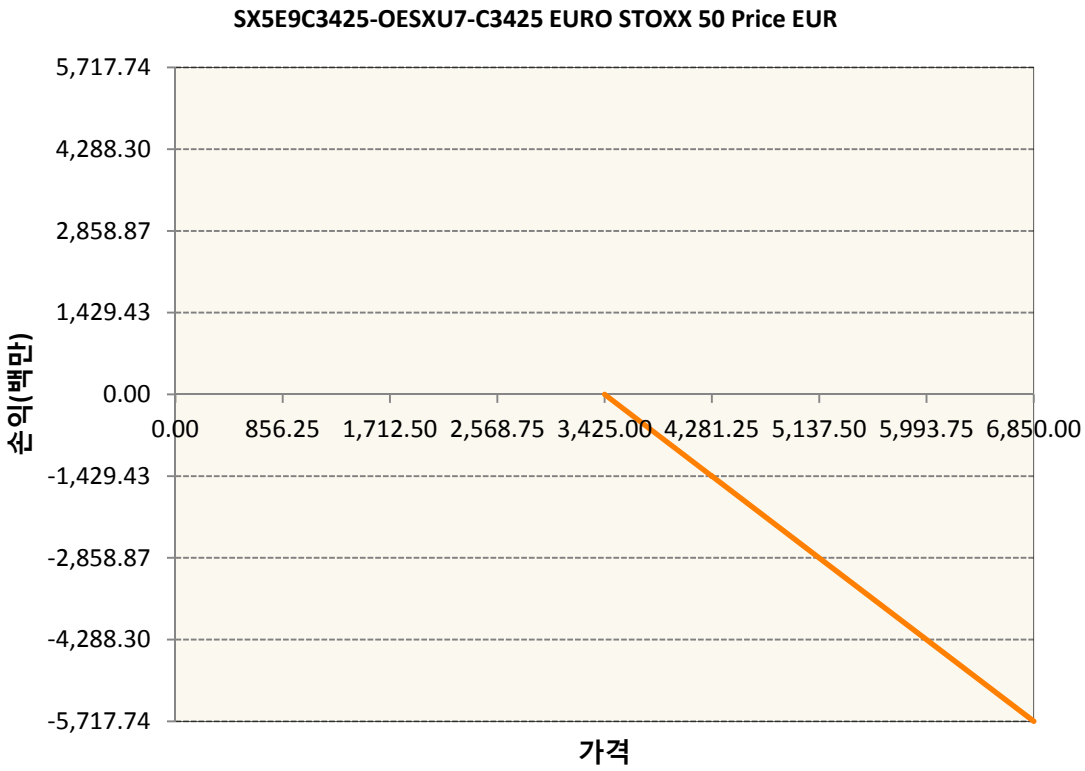
유로커버드콜(주식혼합-파생형)

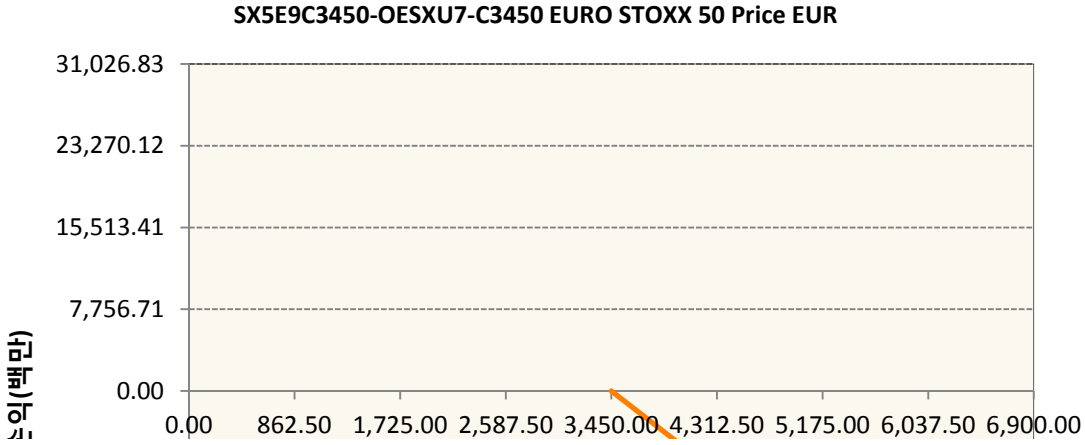
1. 계약금액

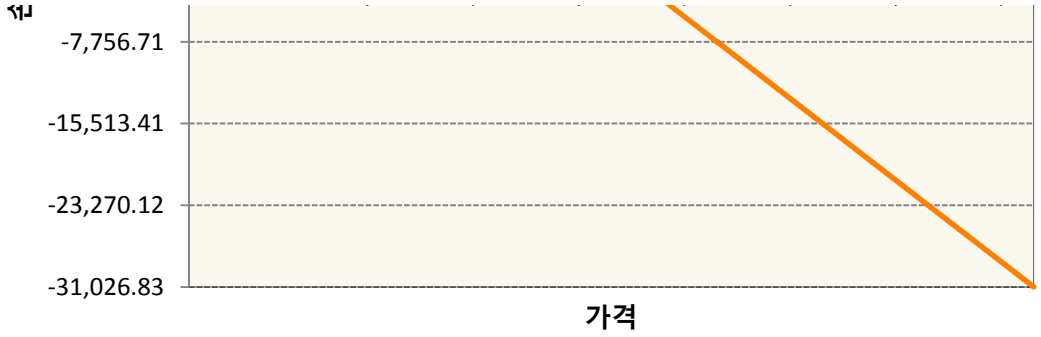
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	33,110	0	33,110	
누계	유가증권	옵션	0	73,489	-73,489	장내

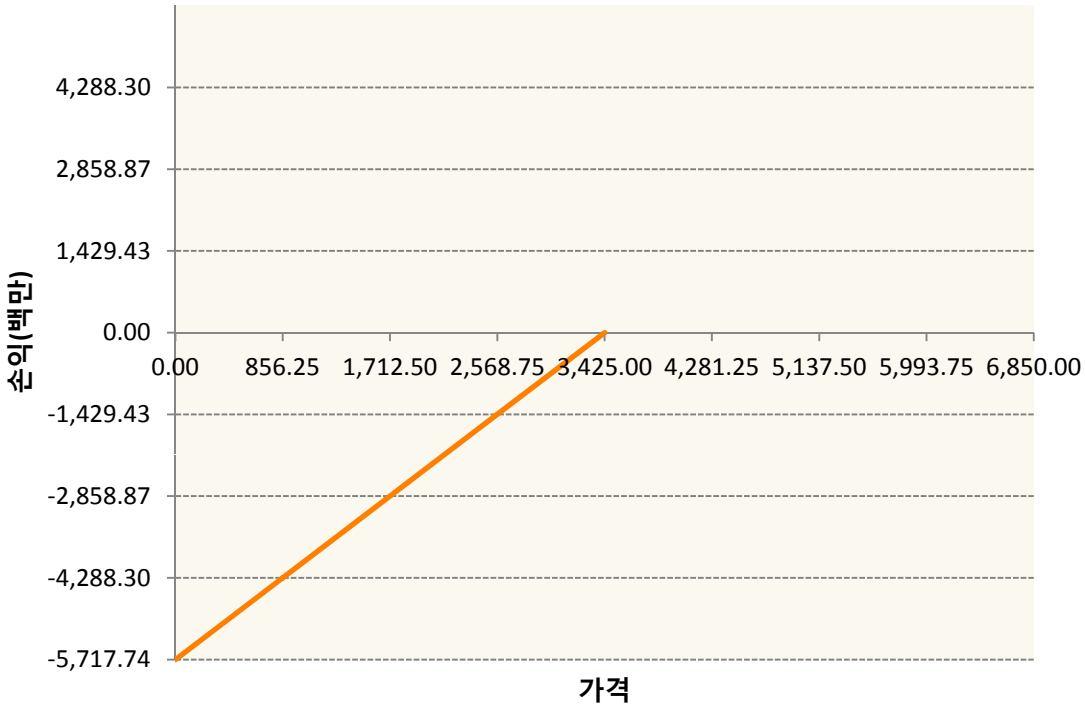
2. 만기시점의 손익구조



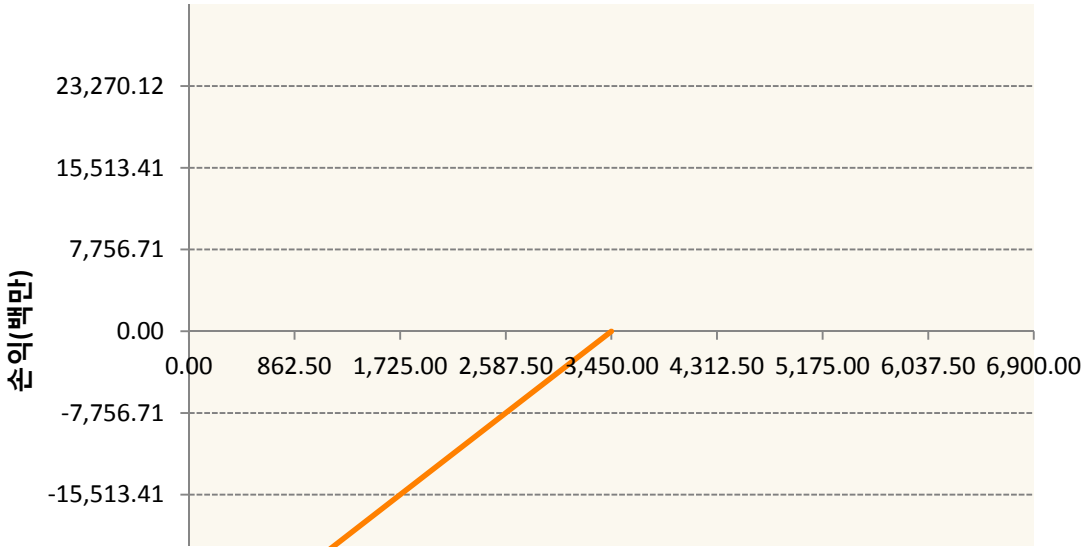


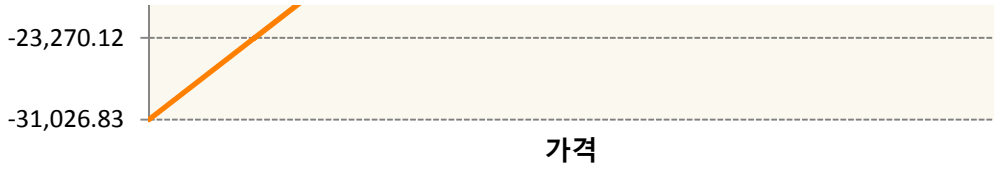


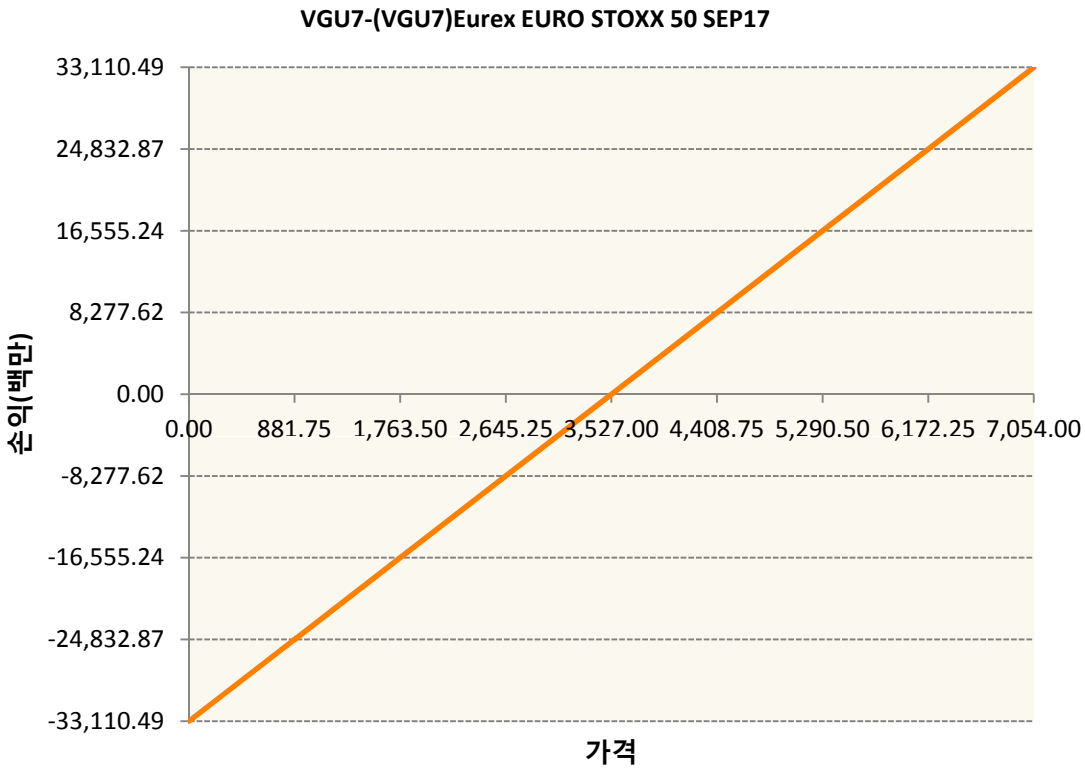
SX5E9P3425-OESXU7-P3425 EURO STOXX 50 Price EUR



SX5E9P3450-OESXU7-P3450 EURO STOXX 50 Price EUR







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

SX5E9C3425	OESXU7-C3425 EURO STOXX 50 Price EUR	457
SX5E9C3450	OESXU7-C3450 EURO STOXX 50 Price EUR	2,482
SX5E9P3425	OESXU7-P3425 EURO STOXX 50 Price EUR	457
SX5E9P3450	OESXU7-P3450 EURO STOXX 50 Price EUR	2,482
VGU7	(VGU7)Eurex EURO STOXX 50 SEP17	2,649

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

6,723

공시일	2017-09-15
기준일	2017-09-14

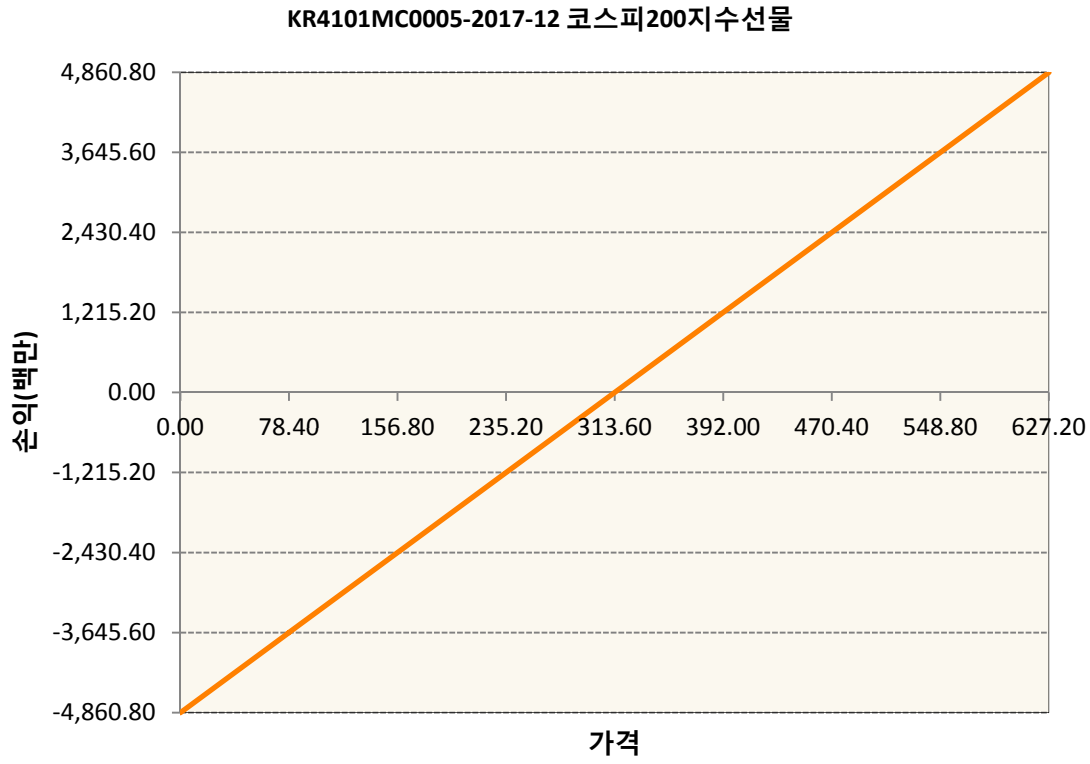
ETF스마트레버리지목표전환형7호

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	2,414	0	2,414	장내
누계	유가증권	선물	4,861	0	4,861	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101MC0	2017-12 코스피200지수선물	388

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-388	-388	-388	-388	-388	-388	-388
-5.33%	-258	-258	-258	-258	-258	-258	-258
-2.67%	-129	-129	-129	-129	-129	-129	-129
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	129	129	129	129	129	129	129
5.33%	258	258	258	258	258	258	258
8.00%	388	388	388	388	388	388	388

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

234

공시일	2017-09-15
기준일	2017-09-14

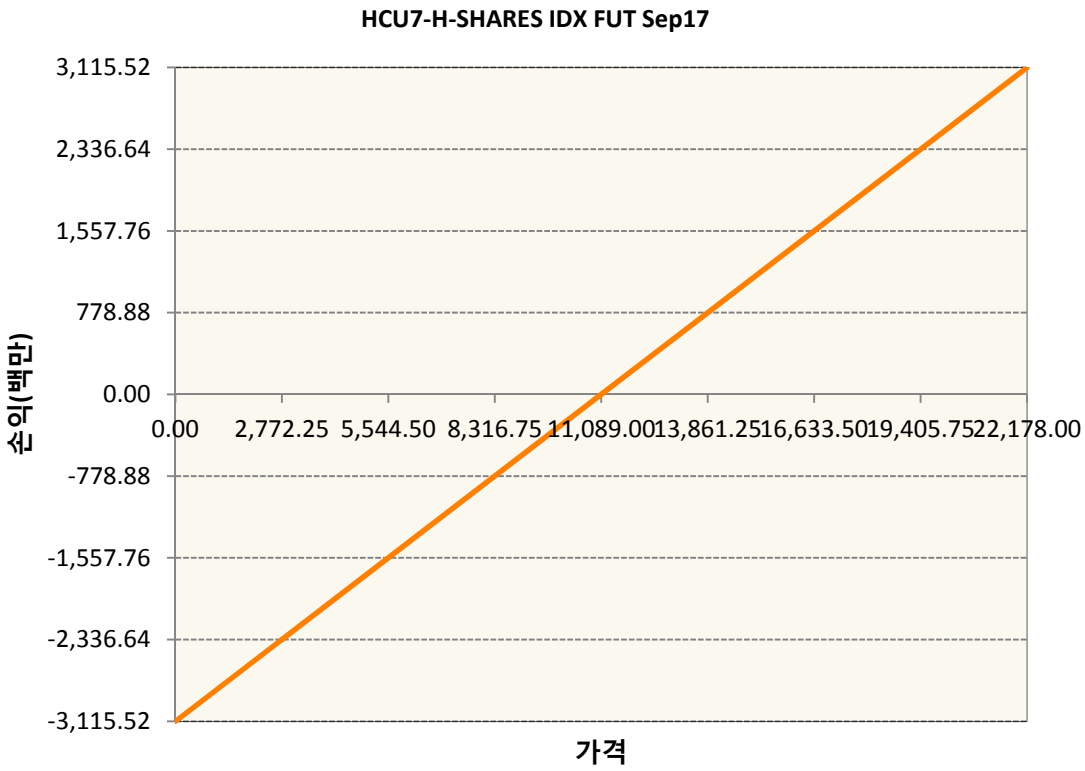
홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생

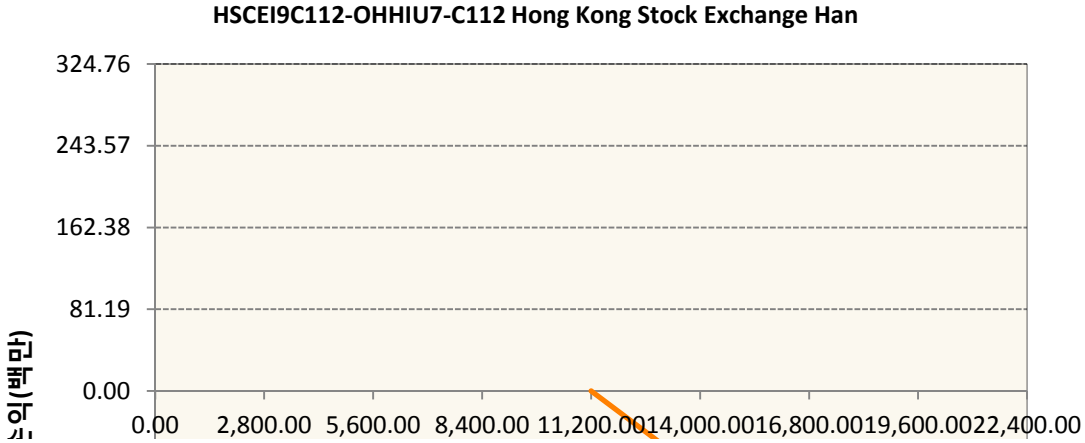
1. 계약금액

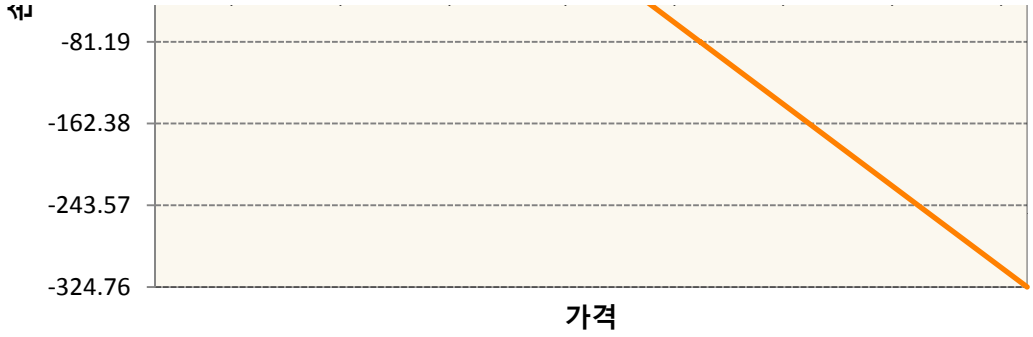
(단위:백만원)

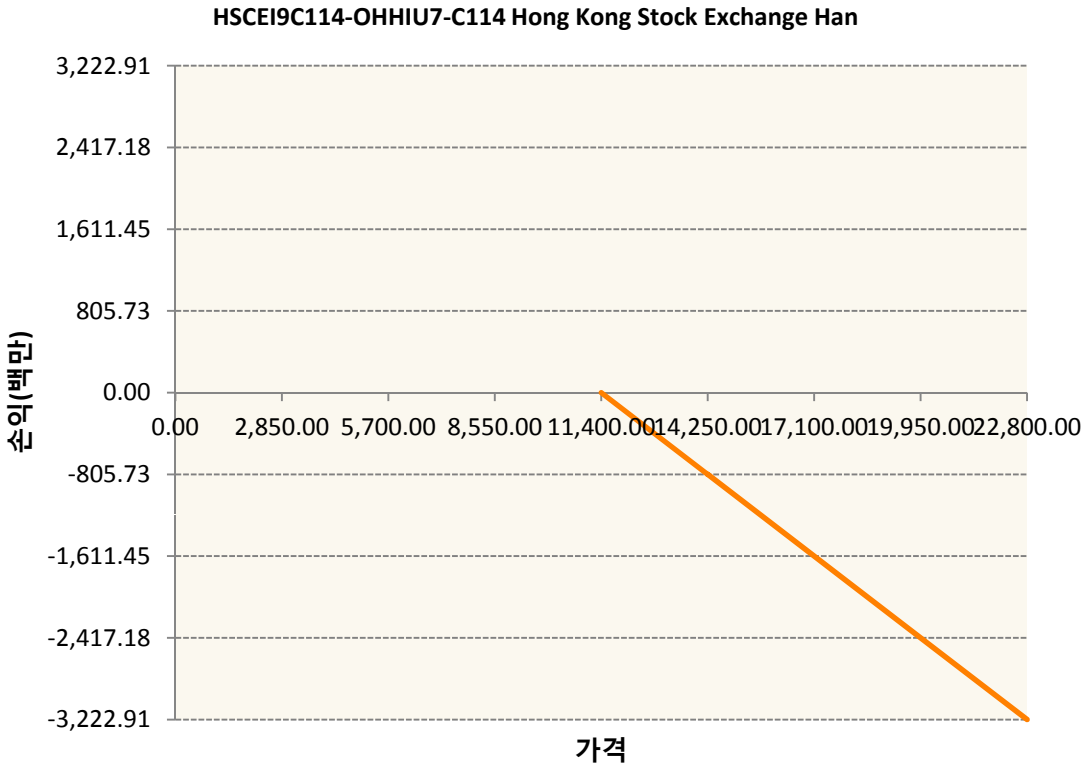
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	3,116	0	3,116	장내
누계	유가증권	옵션	0	7,095	-7,095	장내

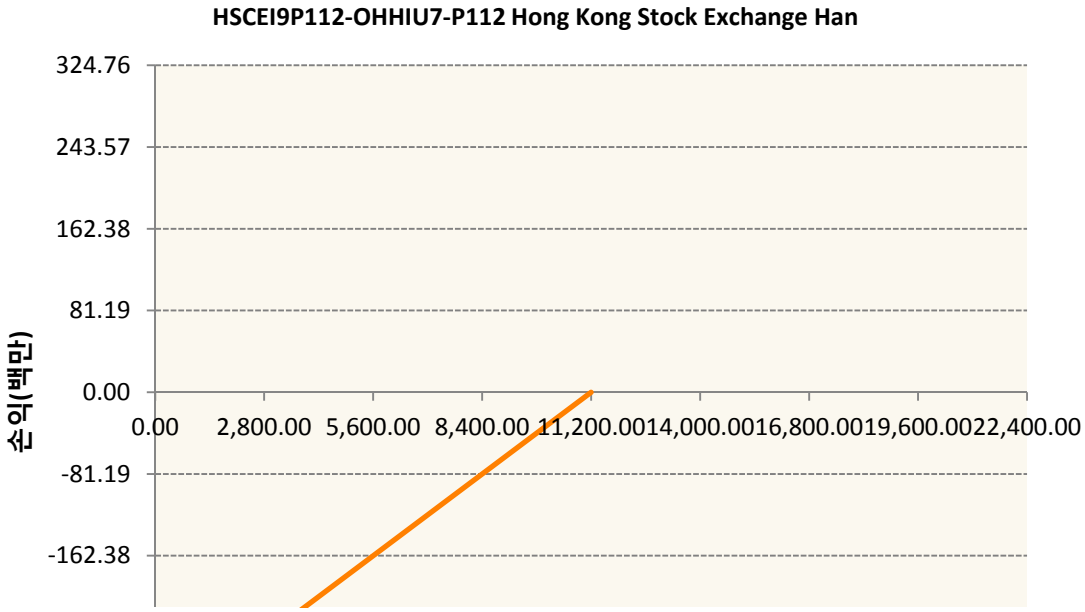
2. 만기시점의 손익구조

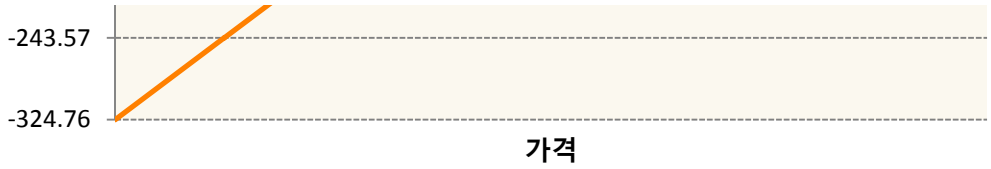


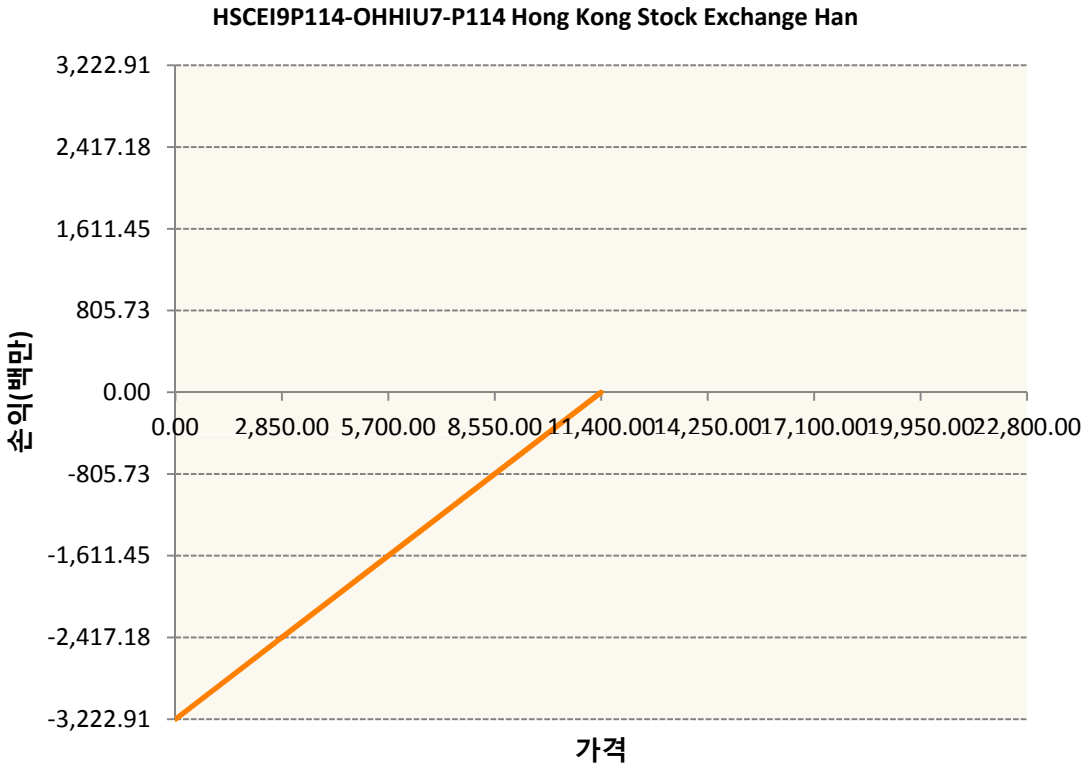



-81.19
-162.38
-243.57
-324.76
가격


HSCEI9C114-OHHIU7-C114 Hong Kong Stock Exchange Han
3,222.91
2,417.18
1,611.45
805.73
0.00
-805.73
-1,611.45
-2,417.18
-3,222.91
0.00
2,850.00
5,700.00
8,550.00
11,400.00
14,250.00
17,100.00
19,950.00
22,800.00
손익(백만)
가격


HSCEI9P112-OHHIU7-P112 Hong Kong Stock Exchange Han
324.76
243.57
162.38
81.19
0.00
-81.19
-162.38
0.00
2,800.00
5,600.00
8,400.00
11,200.00
14,000.00
16,800.00
19,600.00
22,400.00
손익(백만)





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCU7	H-SHARES IDX FUT Sep17	249
HSCEI9C112	OHHIU7-C112 Hong Kong Stock Exchange Han	26
HSCEI9C114	OHHIU7-C114 Hong Kong Stock Exchange Han	258
HSCEI9P112	OHHIU7-P112 Hong Kong Stock Exchange Han	26
HSCEI9P114	OHHIU7-P114 Hong Kong Stock Exchange Han	258

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	691

공시일	2017-09-15
기준일	2017-09-14

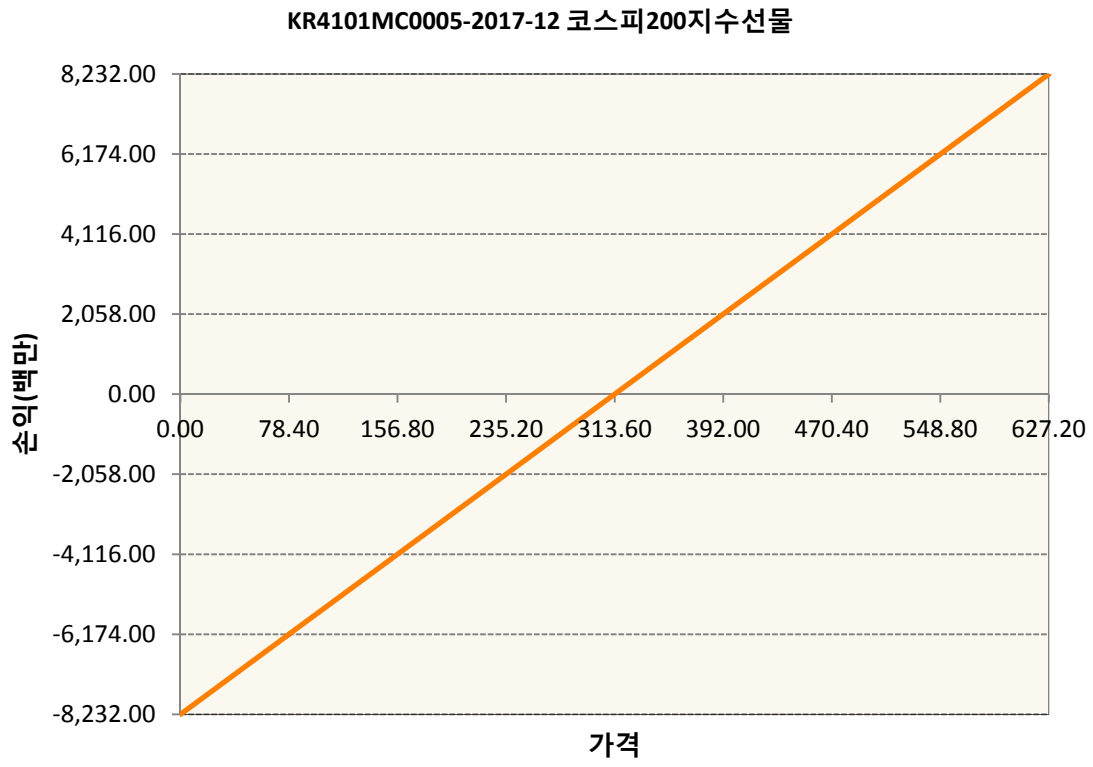
코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	4,127	0	4,127	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	8,232	0	8,232	장내
누계	유가증권	스왑	22,000	0	22,000	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_2							1,486
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,486	-1,486	-1,486	-1,486	-1,486	-1,486	-1,486
-5.33%	-991	-991	-991	-991	-991	-991	-991
-2.67%	-495	-495	-495	-495	-495	-495	-495
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	495	495	495	495	495	495	495

5.33%	991	991	991	991	991	991	991
8.00%	1,486	1,486	1,486	1,486	1,486	1,486	1,486
2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_3							281
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-281	-281	-281	-281	-281	-281	-281
-5.33%	-187	-187	-187	-187	-187	-187	-187
-2.67%	-94	-94	-94	-94	-94	-94	-94
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	94	94	94	94	94	94	94
5.33%	187	187	187	187	187	187	187
8.00%	281	281	281	281	281	281	281
KR4101MC0	2017-12 코스피200지수선물						656
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-656	-656	-656	-656	-656	-656	-656
-5.33%	-438	-438	-438	-438	-438	-438	-438
-2.67%	-219	-219	-219	-219	-219	-219	-219
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	219	219	219	219	219	219	219
5.33%	438	438	438	438	438	438	438
8.00%	656	656	656	656	656	656	656

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

2,163

공시일	2017-09-15
기준일	2017-09-14

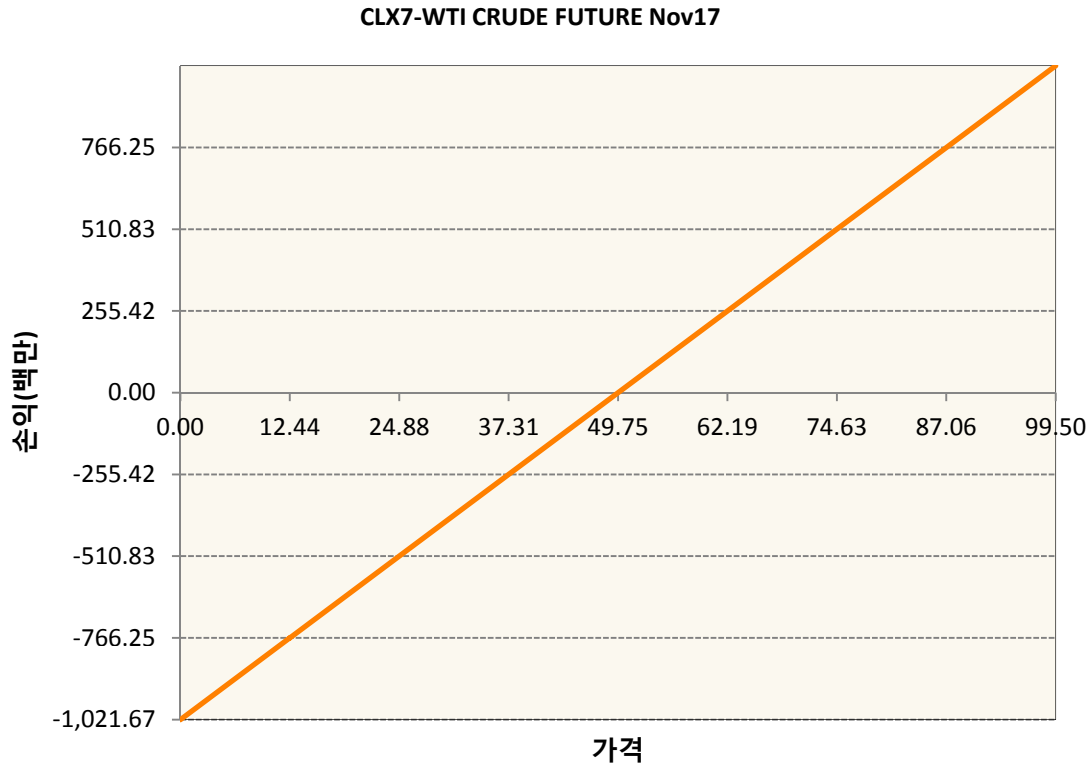
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

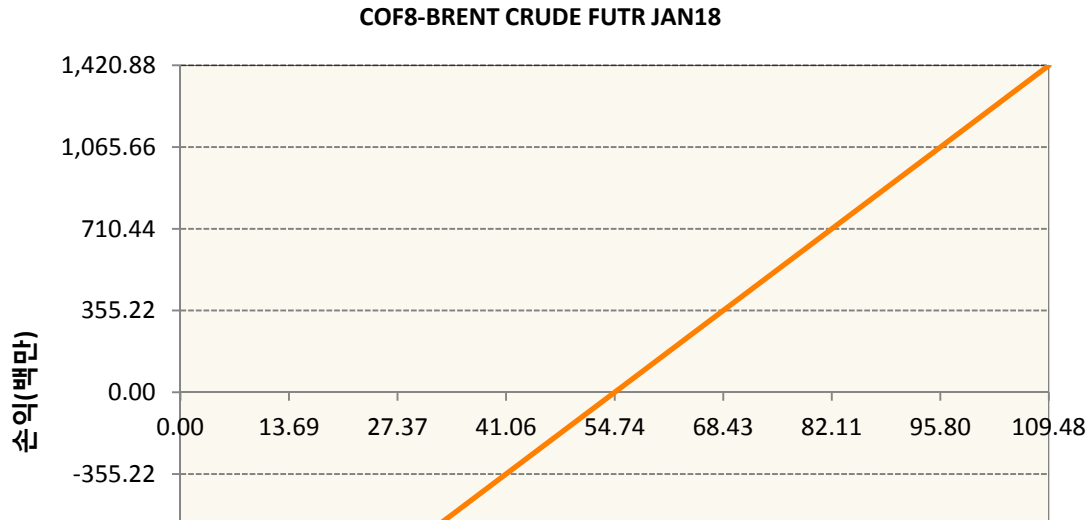
1. 계약금액

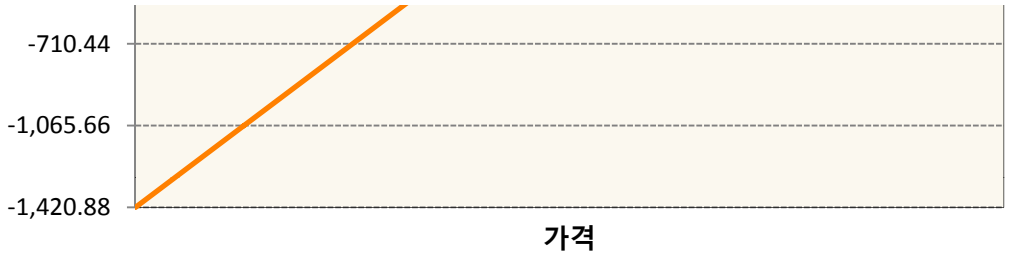
(단위:백만원)

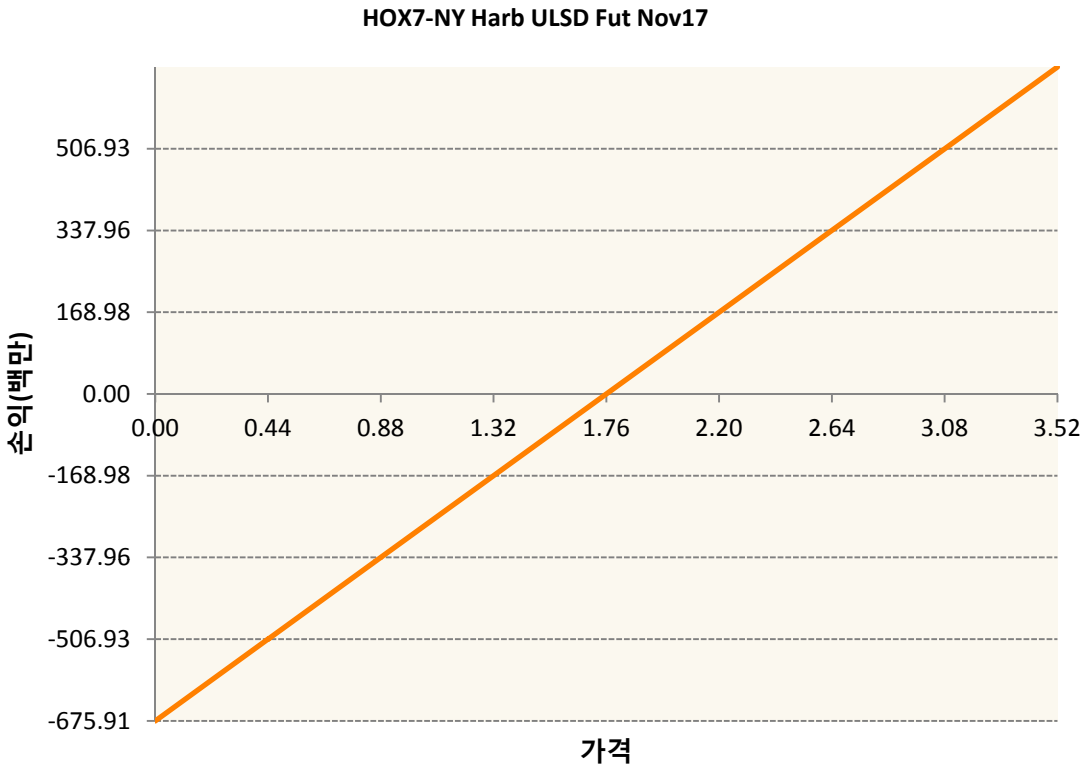
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	5,303	623	4,680	

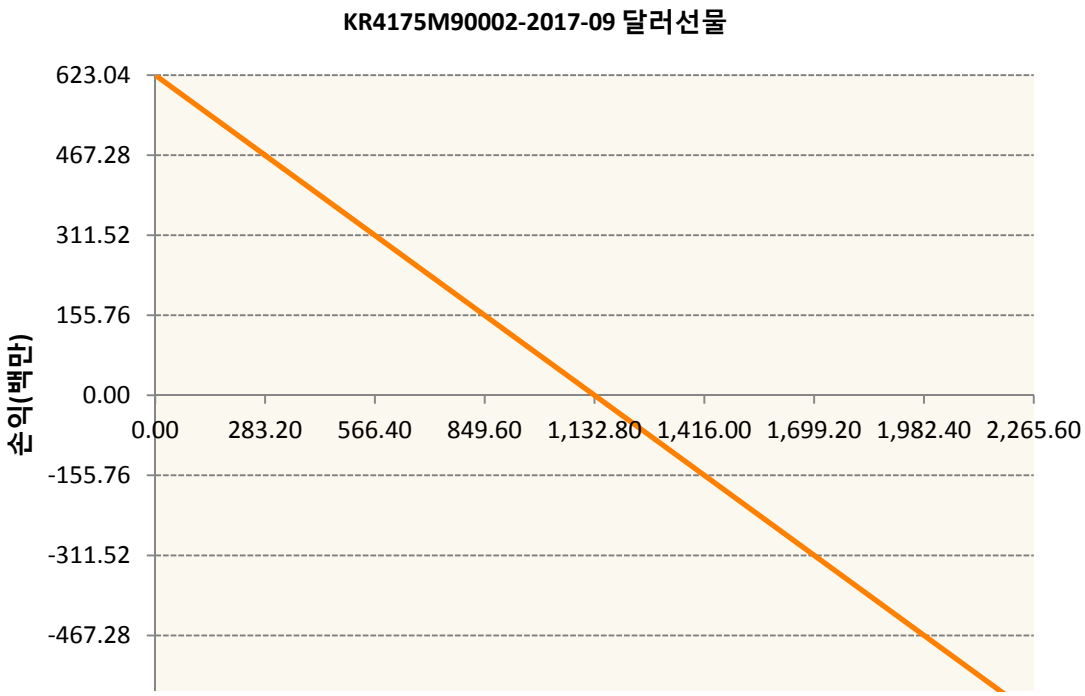
2. 만기시점의 손익구조

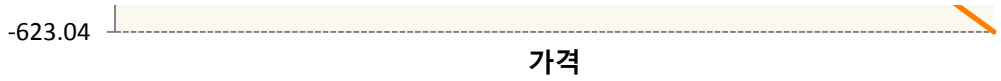


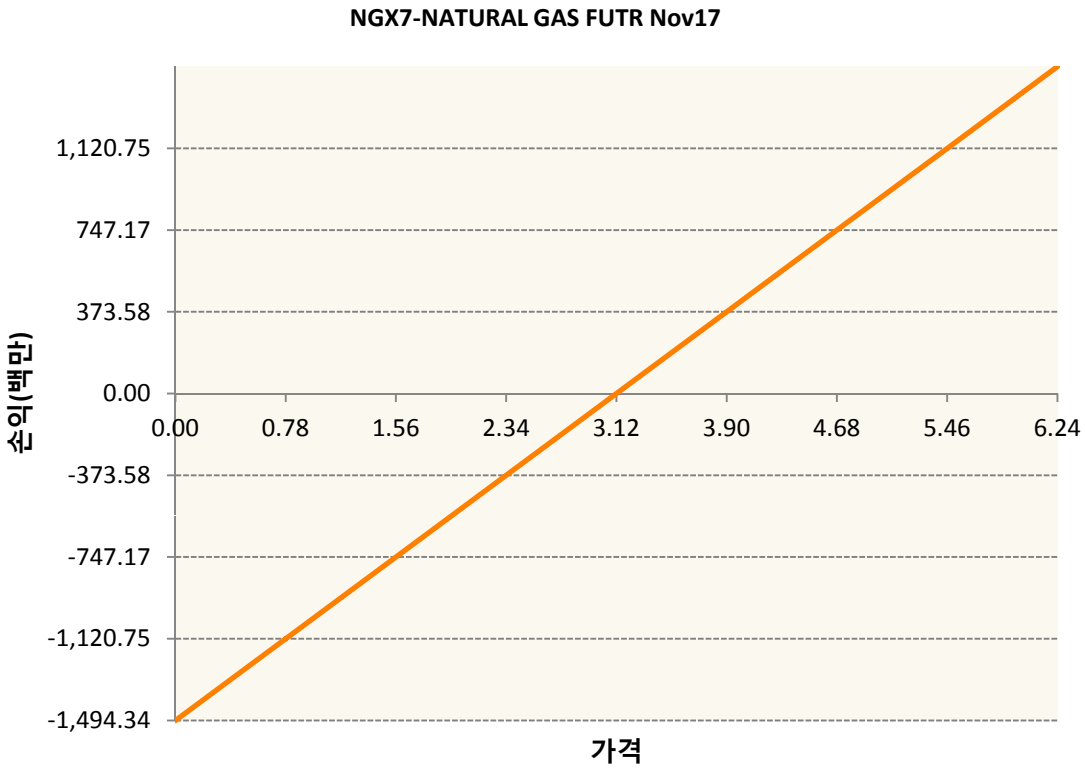


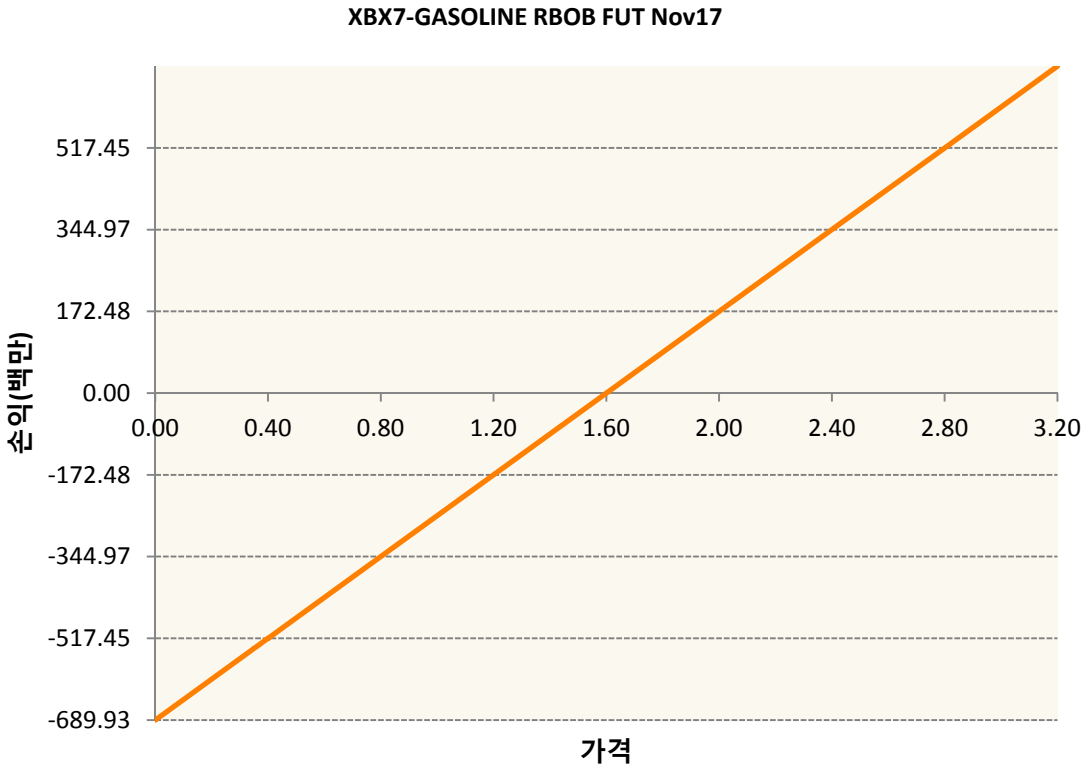

-710.44
-1,065.66
-1,420.88
가격


HOX7-NY Harb ULSD Fut Nov17
506.93
337.96
168.98
0.00
-168.98
-337.96
-506.93
-675.91
0.00
0.44
0.88
1.32
1.76
2.20
2.64
3.08
3.52
손익(백만)
가격


KR4175M90002-2017-09 달러선물
623.04
467.28
311.52
155.76
0.00
-155.76
-311.52
-467.28
0.00
283.20
566.40
849.60
1,132.80
1,416.00
1,699.20
1,982.40
2,265.60
손익(백만)


-623.04
가격


NGX7-NATURAL GAS FUTR Nov17
1,120.75
747.17
373.58
0.00
-373.58
-747.17
-1,120.75
-1,494.34
0.00
0.78
1.56
2.34
3.12
3.90
4.68
5.46
6.24
손익(백만)
가격


XBX7-GASOLINE RBOB FUT Nov17
517.45
344.97
172.48
0.00
-172.48
-344.97
-517.45
-689.93
0.00
0.40
0.80
1.20
1.60
2.00
2.40
2.80
3.20
손익(백만)
가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLX7	WTI CRUDE FUTURE Nov17	82
COF8	BRENT CRUDE FUTR JAN18	114
HOX7	NY Harb ULSD Fut Nov17	54
KR4175M90(	2017-09 달러선물	50
NGX7	NATURAL GAS FUTR Nov17	120
XBX7	GASOLINE RBOB FUT Nov17	55

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

770

공시일	2017-09-15
기준일	2017-09-14

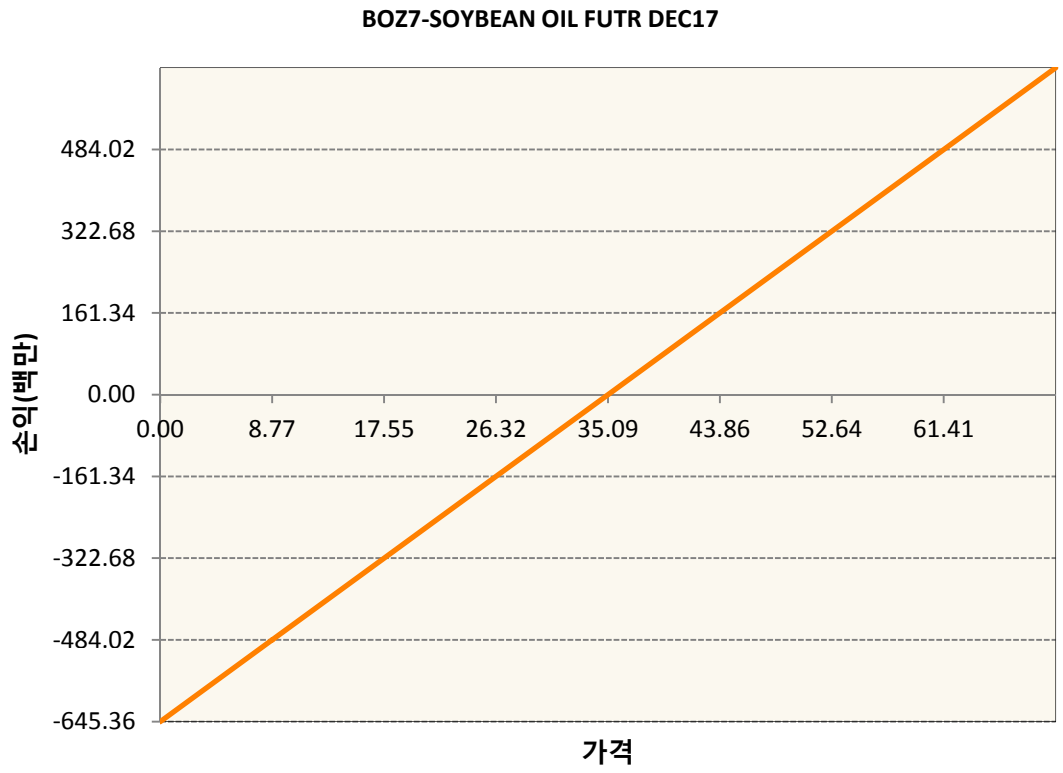
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

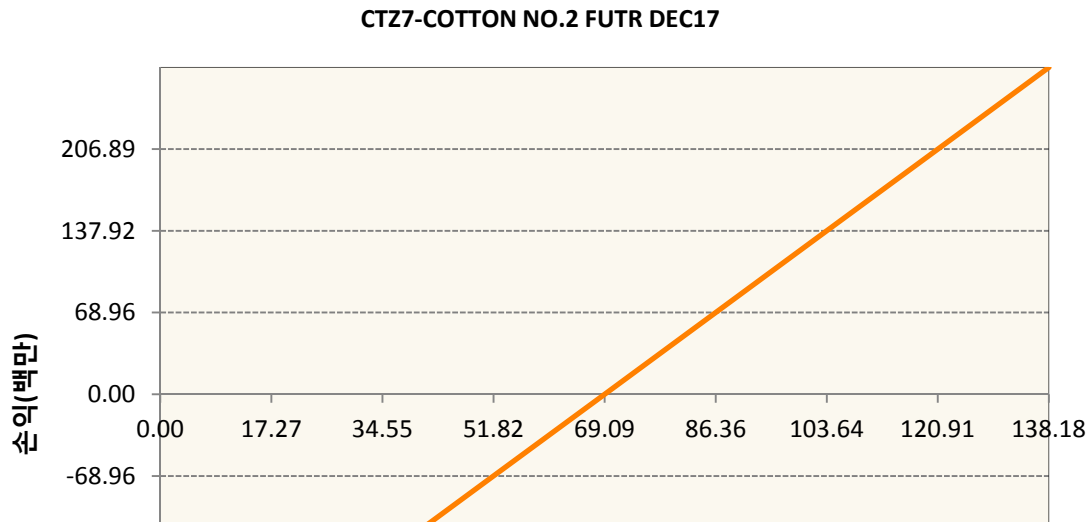
1. 계약금액

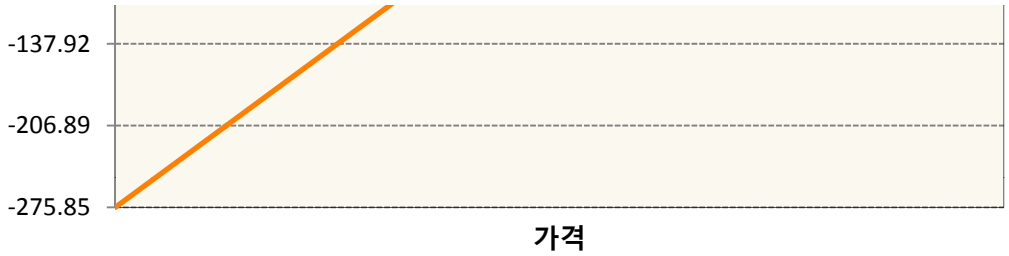
(단위:백만원)

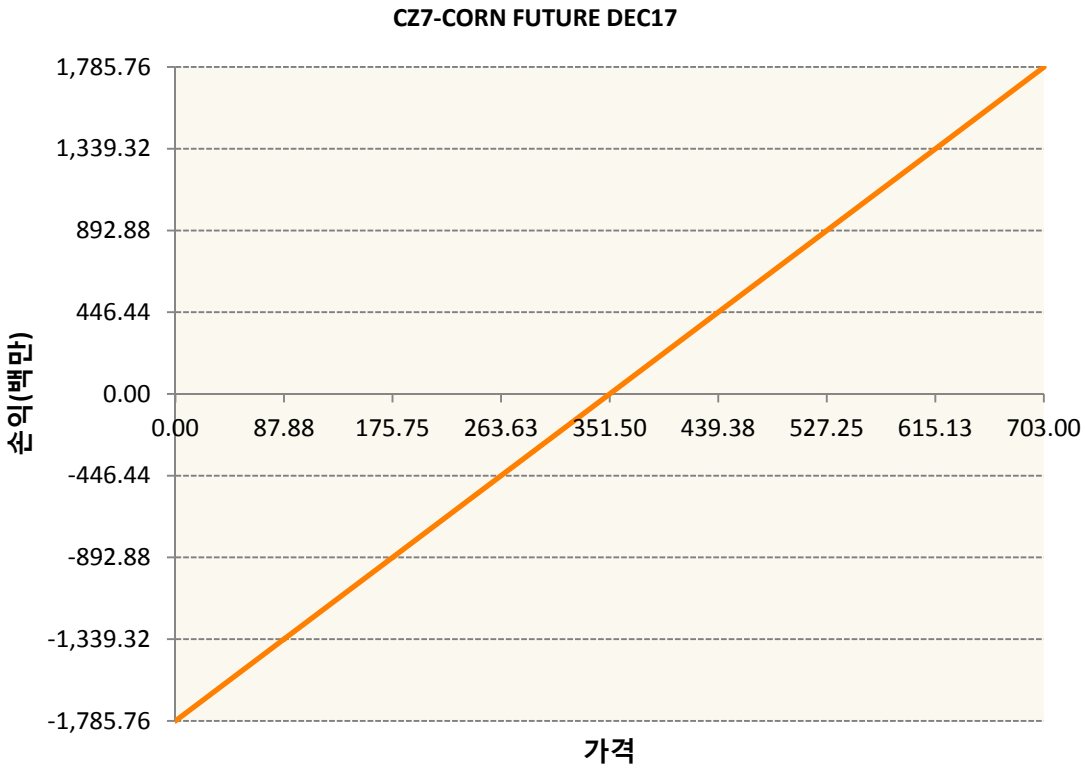
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	6,855	340	6,515	

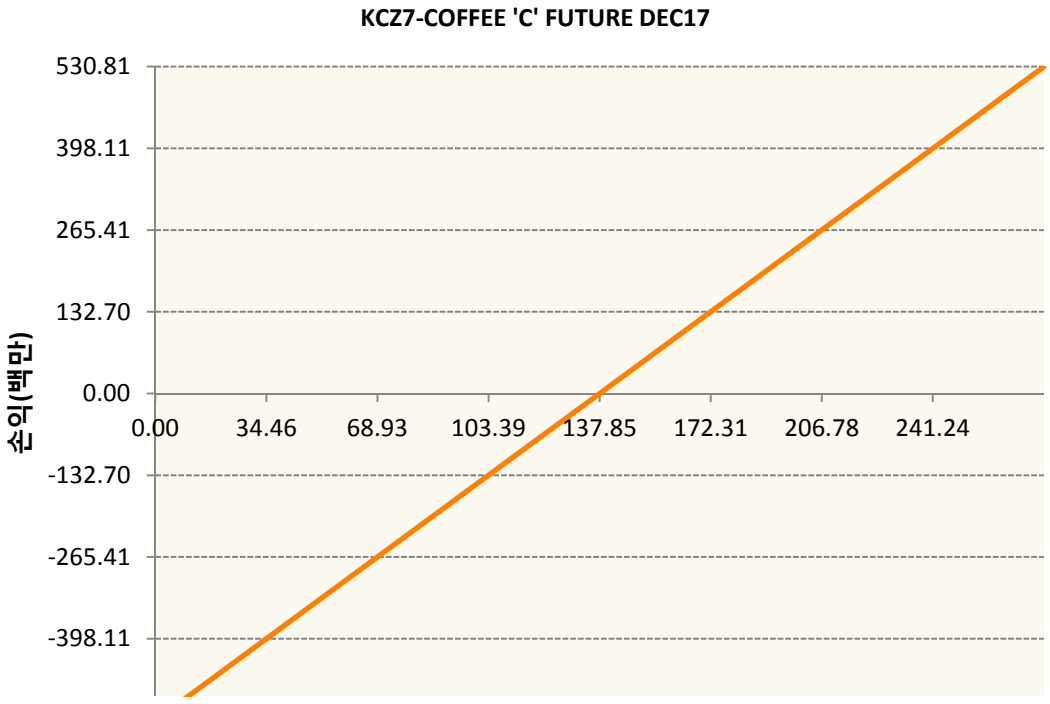
2. 만기시점의 손익구조

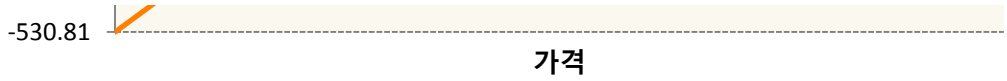


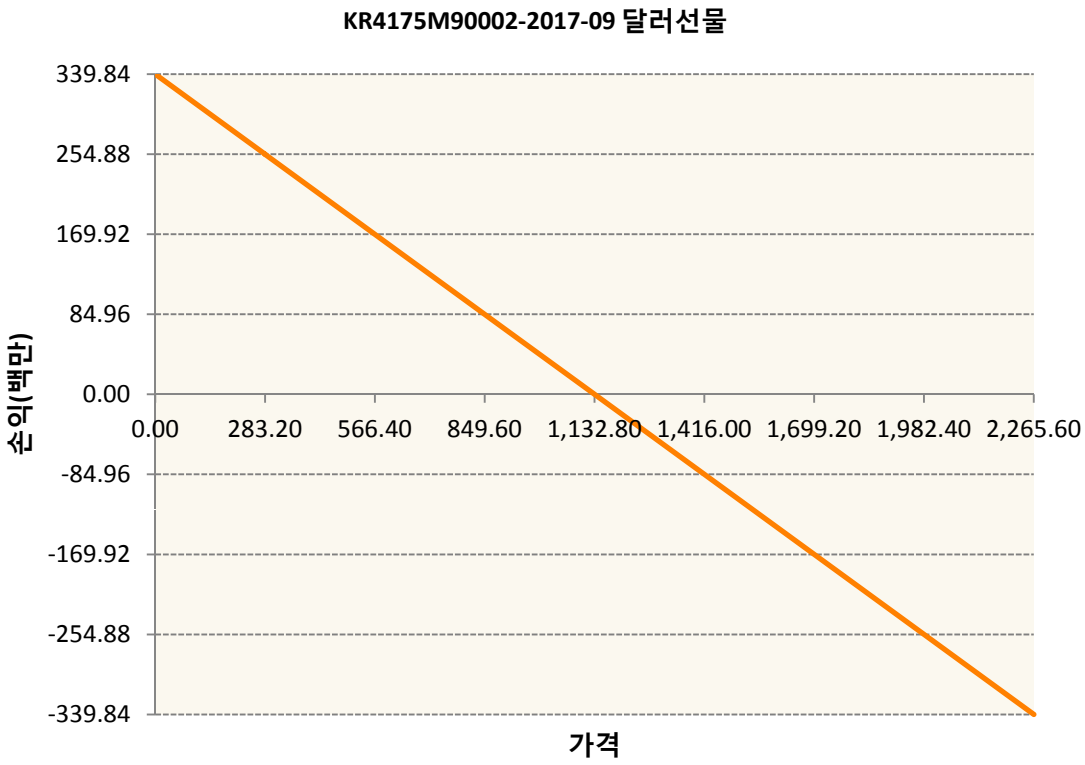


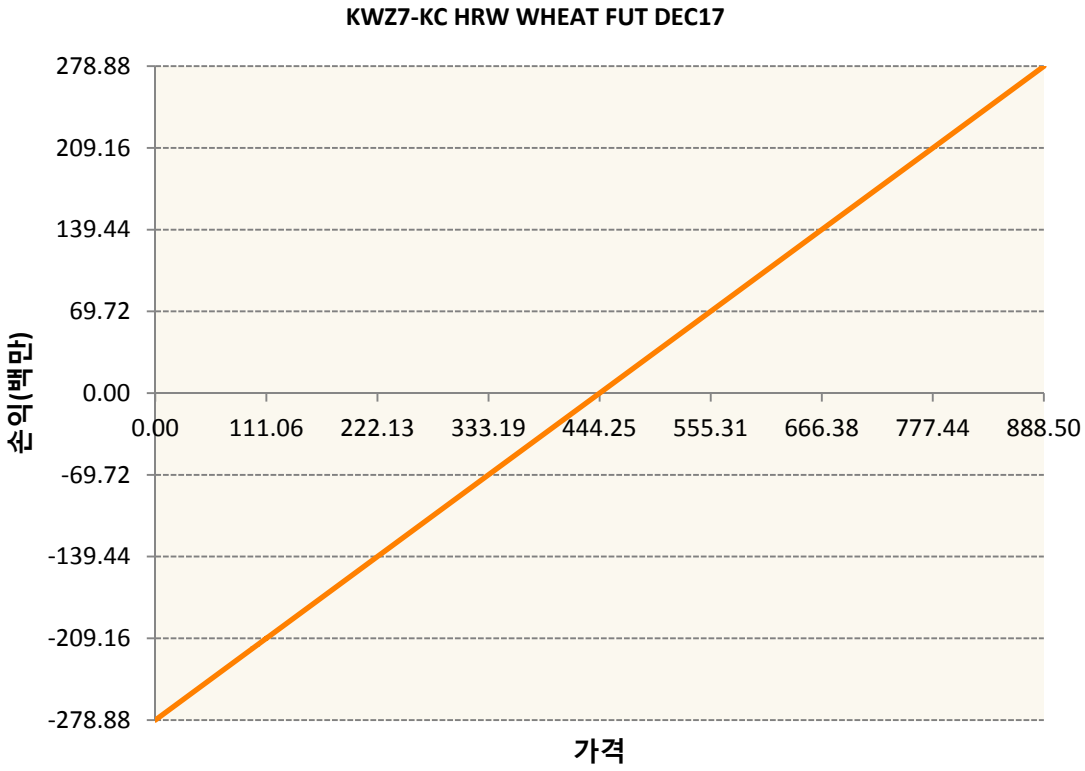

-137.92
-206.89
-275.85
가격


CZ7-CORN FUTURE DEC17
1,785.76
1,339.32
892.88
446.44
0.00
-446.44
-892.88
-1,339.32
-1,785.76
0.00
87.88
175.75
263.63
351.50
439.38
527.25
615.13
703.00
손익(백만)
가격

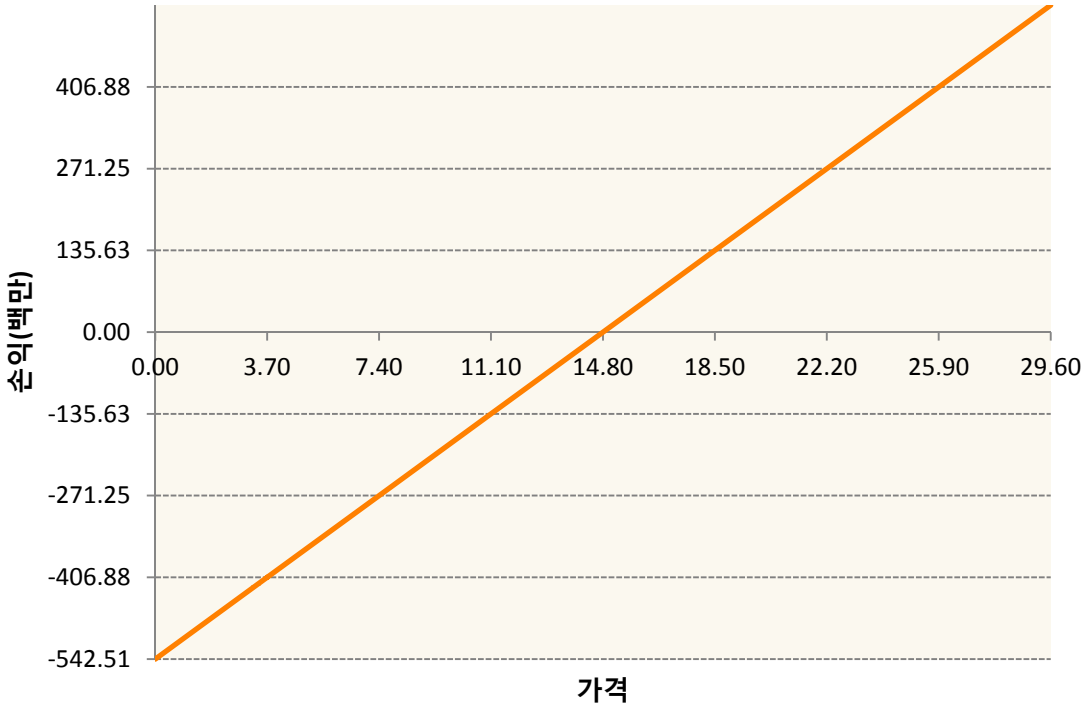

KCZ7-COFFEE 'C' FUTURE DEC17
530.81
398.11
265.41
132.70
0.00
-132.70
-265.41
-398.11
0.00
34.46
68.93
103.39
137.85
172.31
206.78
241.24
손익(백만)


-530.81
가격

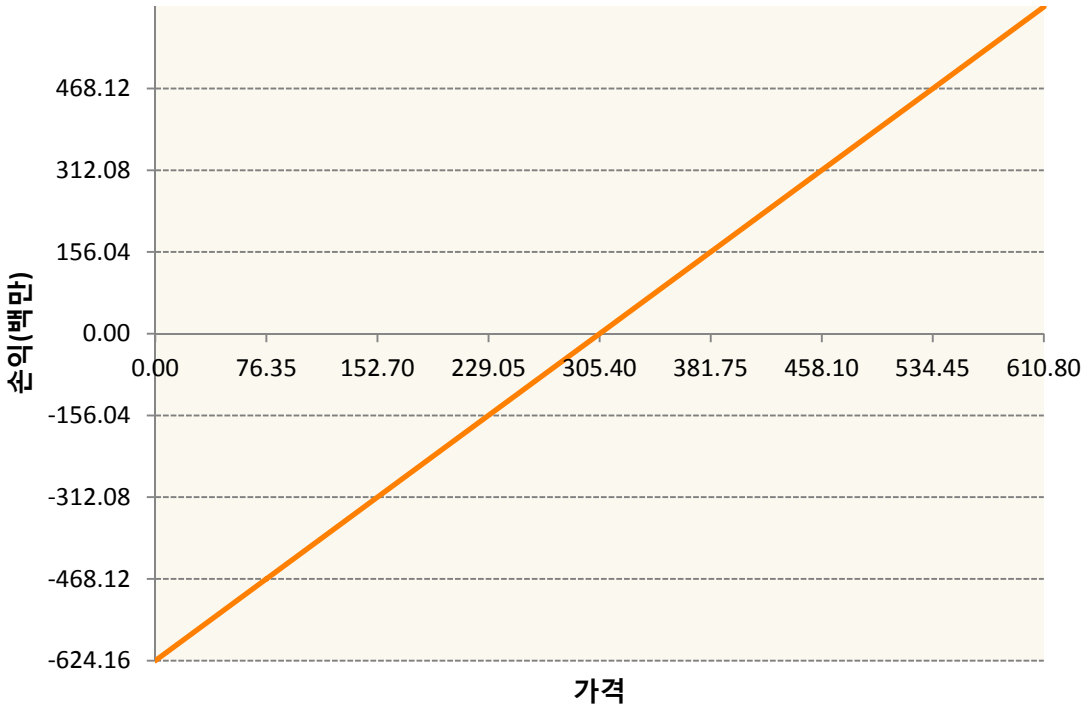

KR4175M90002-2017-09 달러선물
339.84
254.88
169.92
84.96
0.00
-84.96
-169.92
-254.88
-339.84
0.00
283.20
566.40
849.60
1,132.80
1,416.00
1,699.20
1,982.40
2,265.60
손익(백만)
가격


KWZ7-KC HRW WHEAT FUT DEC17
278.88
209.16
139.44
69.72
0.00
-69.72
-139.44
-209.16
-278.88
0.00
111.06
222.13
333.19
444.25
555.31
666.38
777.44
888.50
손익(백만)
가격

SBH8-Sugar #11 (WORLD) MAR18

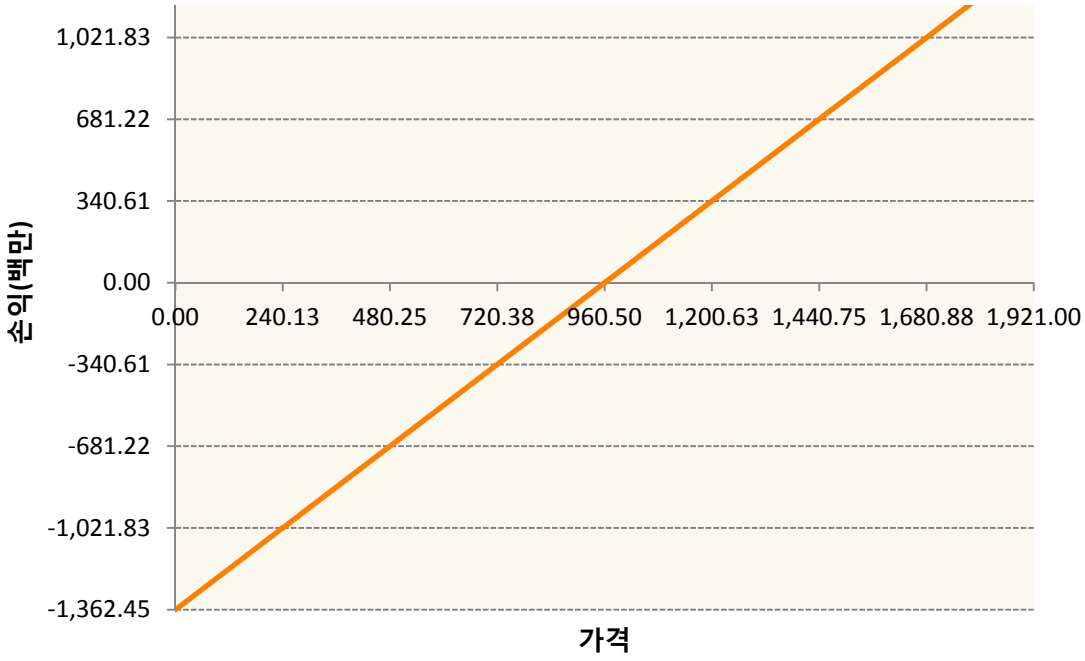


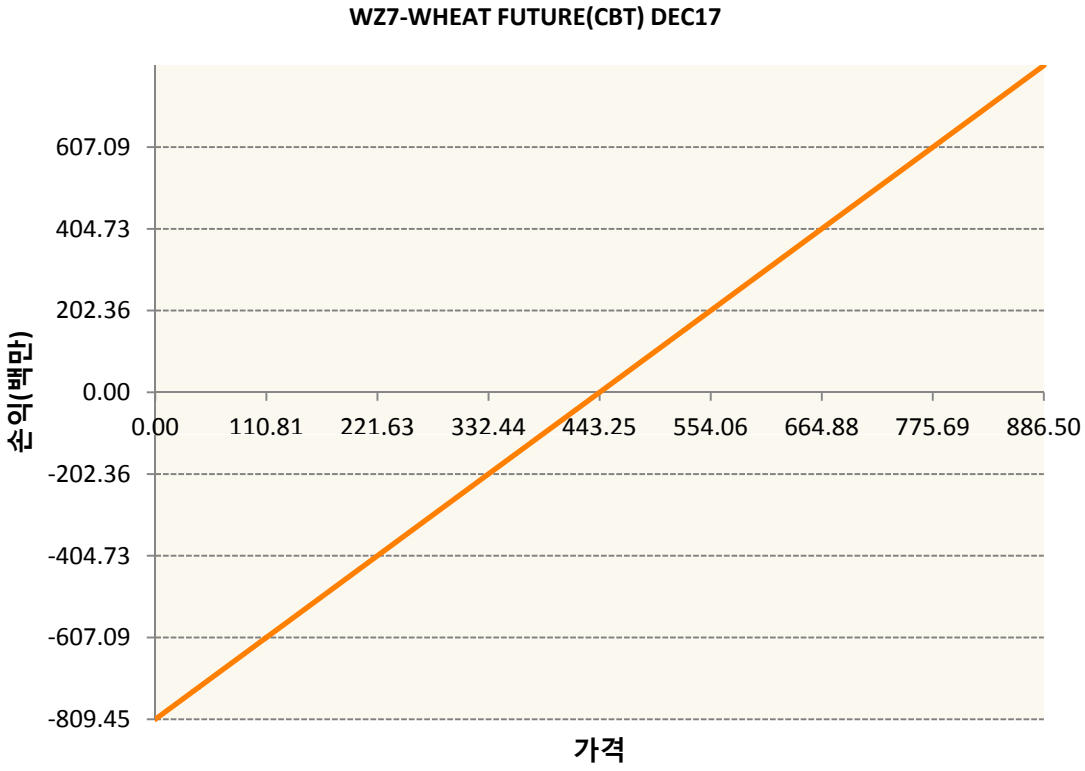
SMZ7-SOYBEAN MEAL FUTR DEC17



SX7-SOYBEAN FUTURE NOV17







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
BOZ7	SOYBEAN OIL FUTR DEC17	52
CTZ7	COTTON NO.2 FUTR DEC17	22
CZ7	CORN FUTURE DEC17	143
KCZ7	COFFEE 'C' FUTURE DEC17	42
KR4175M90(	2017-09 달러선물	27

KWZ7	KC HRW WHEAT FUT DEC17	22
SBH8	Sugar #11 (WORLD) MAR18	43
SMZ7	SOYBEAN MEAL FUTR DEC17	50
SX7	SOYBEAN FUTURE NOV17	109
WZ7	WHEAT FUTURE(CBT) DEC17	65

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

646