공시일	2017-09-18
기준일	2017-09-15

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	2017-09-18
기준일	2017-09-15

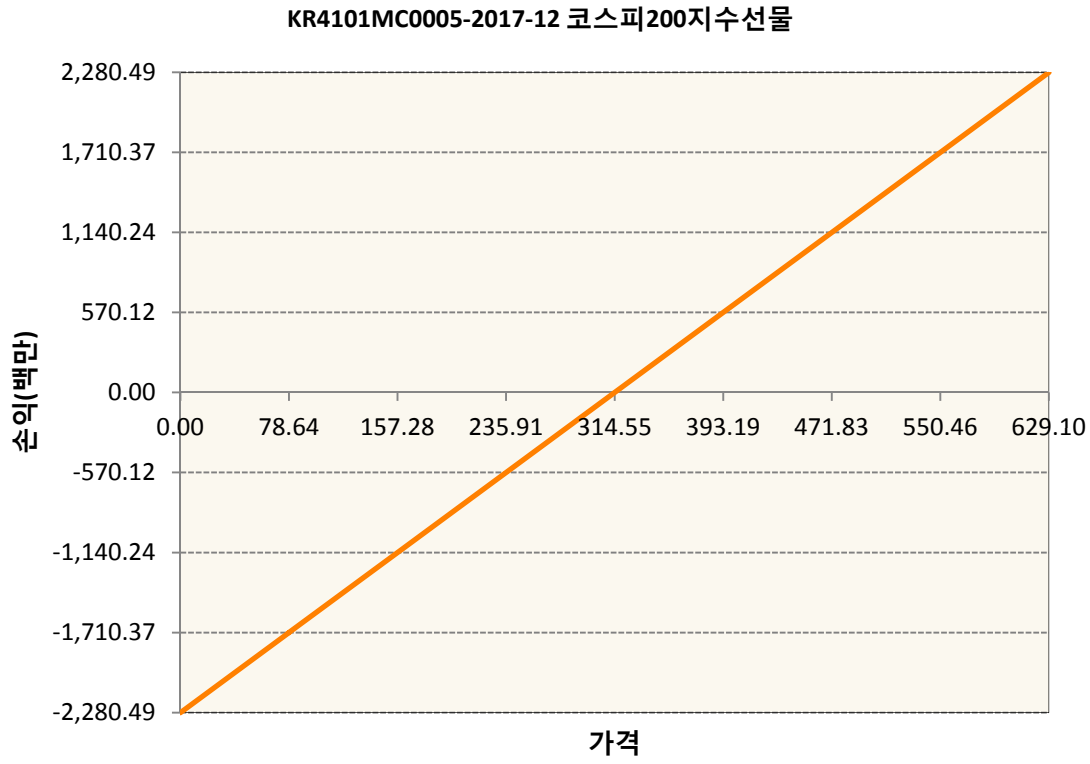
스마트인덱스모

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	79	-79	장내
누계	유가증권	선물	2,280	0	2,280	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101MC0	2017-12 코스피200지수선물						182
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-182	-182	-182	-182	-182	-182	-182
-5.33%	-121	-121	-121	-121	-121	-121	-121
-2.67%	-61	-61	-61	-61	-61	-61	-61
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	61	61	61	61	61	61	61
5.33%	121	121	121	121	121	121	121
8.00%	182	182	182	182	182	182	182

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

110

공시일	2017-09-18
기준일	2017-09-15

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	1,035

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

468

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-09-18
기준일	2017-09-15

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	427

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

361

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-09-18
기준일	2017-09-15

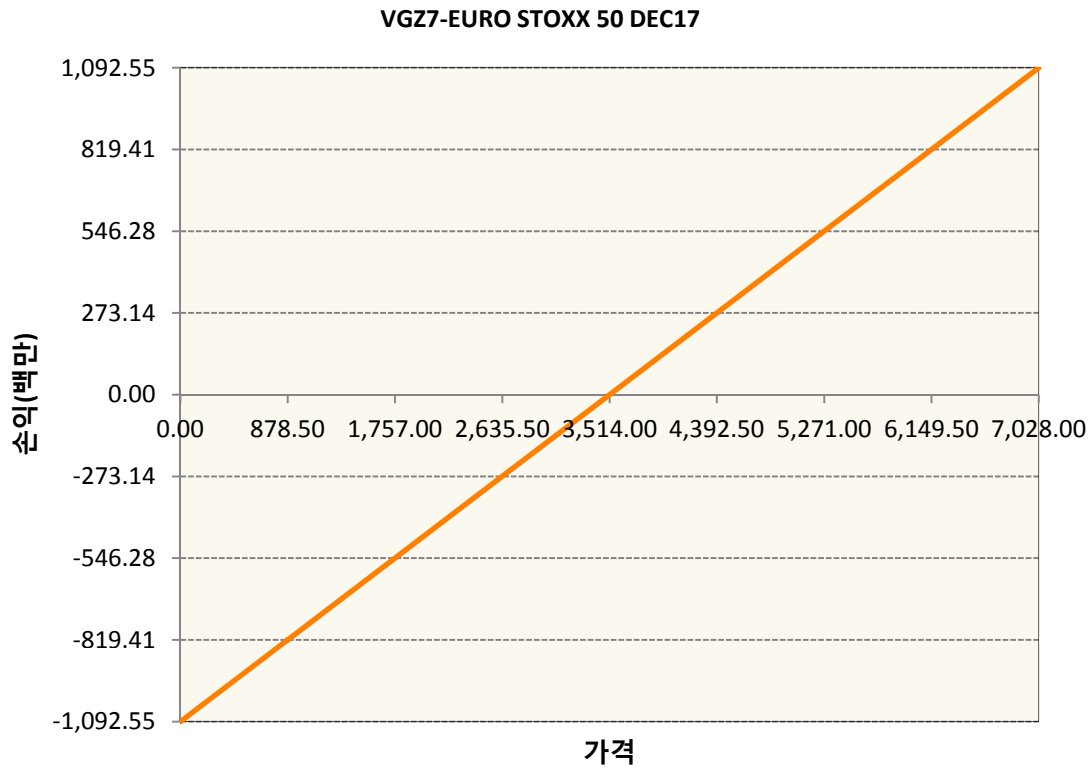
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,093	0	1,093	

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	2017-09-18
기준일	2017-09-15

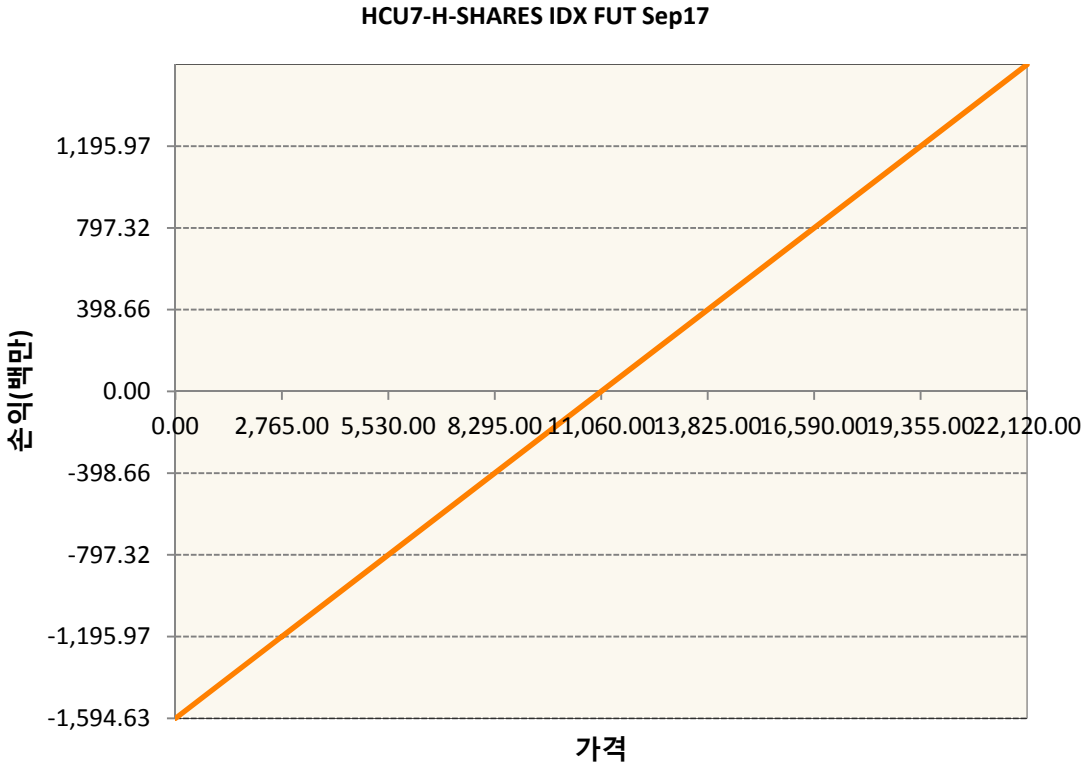
차이나인덱스모(주식-파생형)

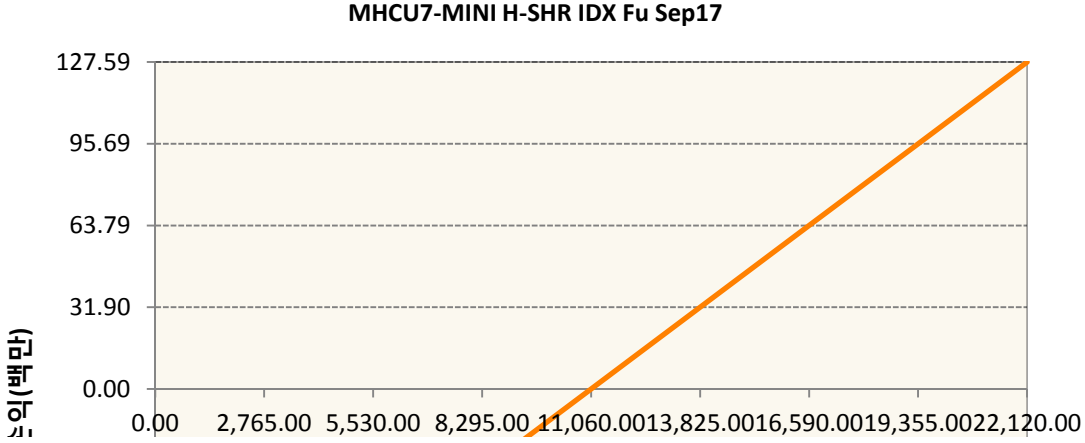
1. 계약금액

(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	1,595	0	1,595	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)
	116

공시일	2017-09-18
기준일	2017-09-15

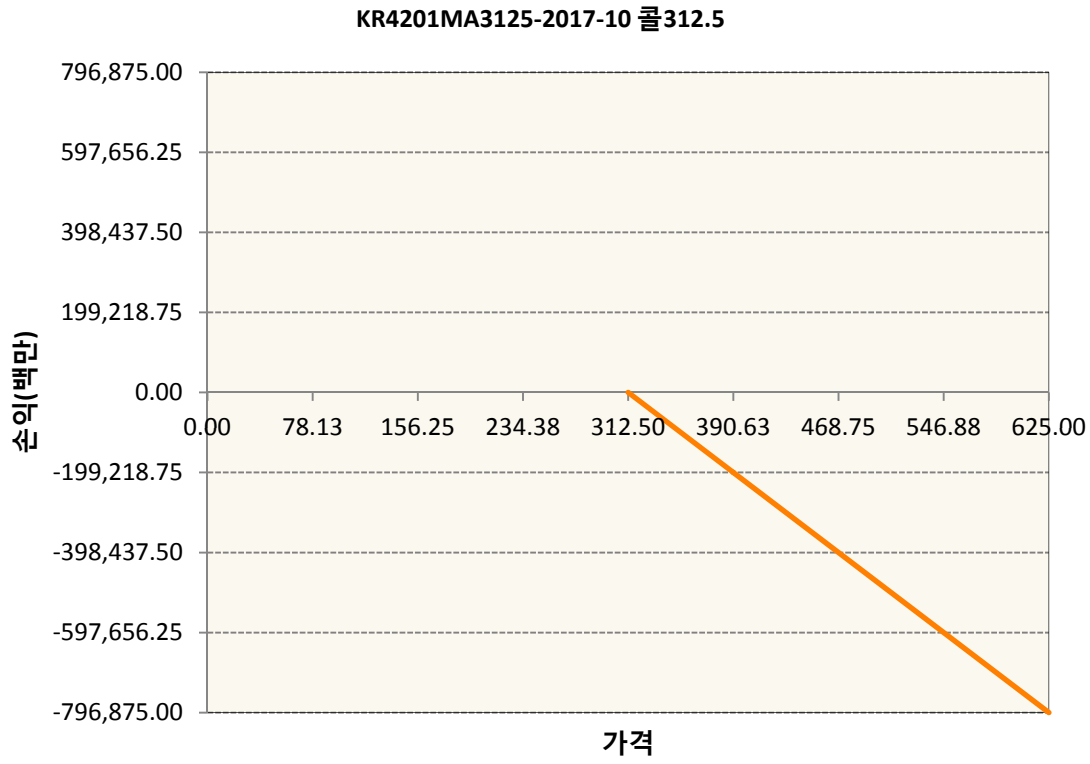
커버드콜모(주식혼합-파생형)

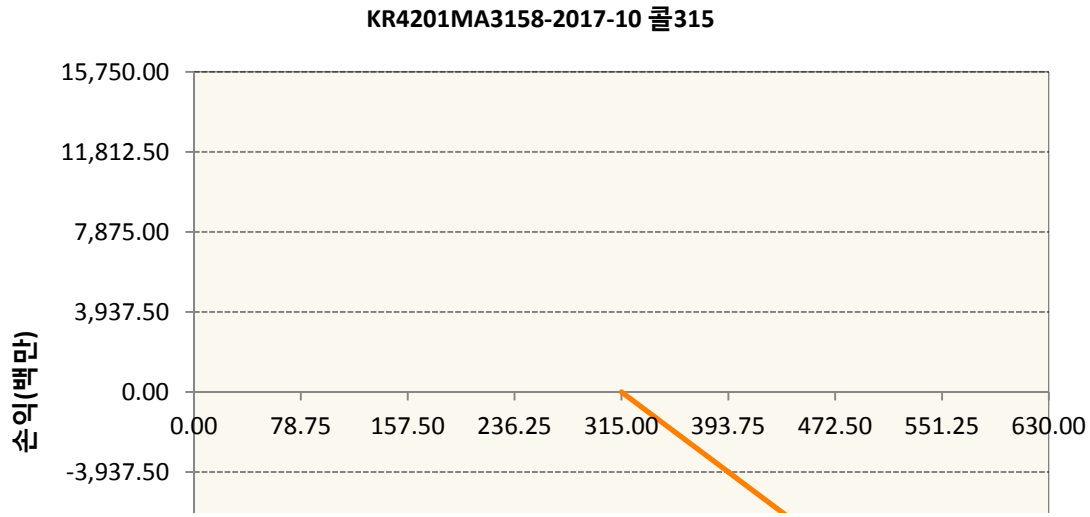
1. 계약금액

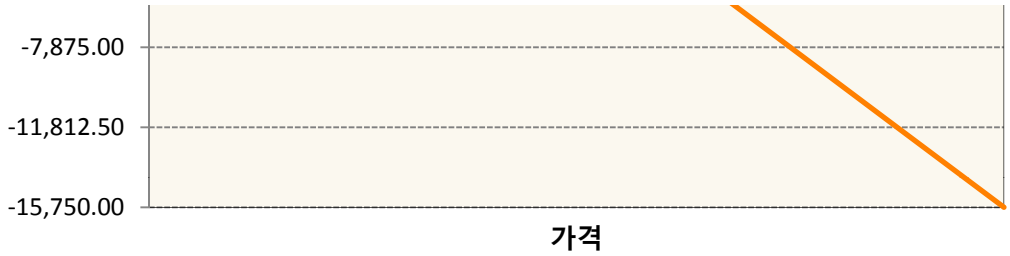
(단위:백만원)

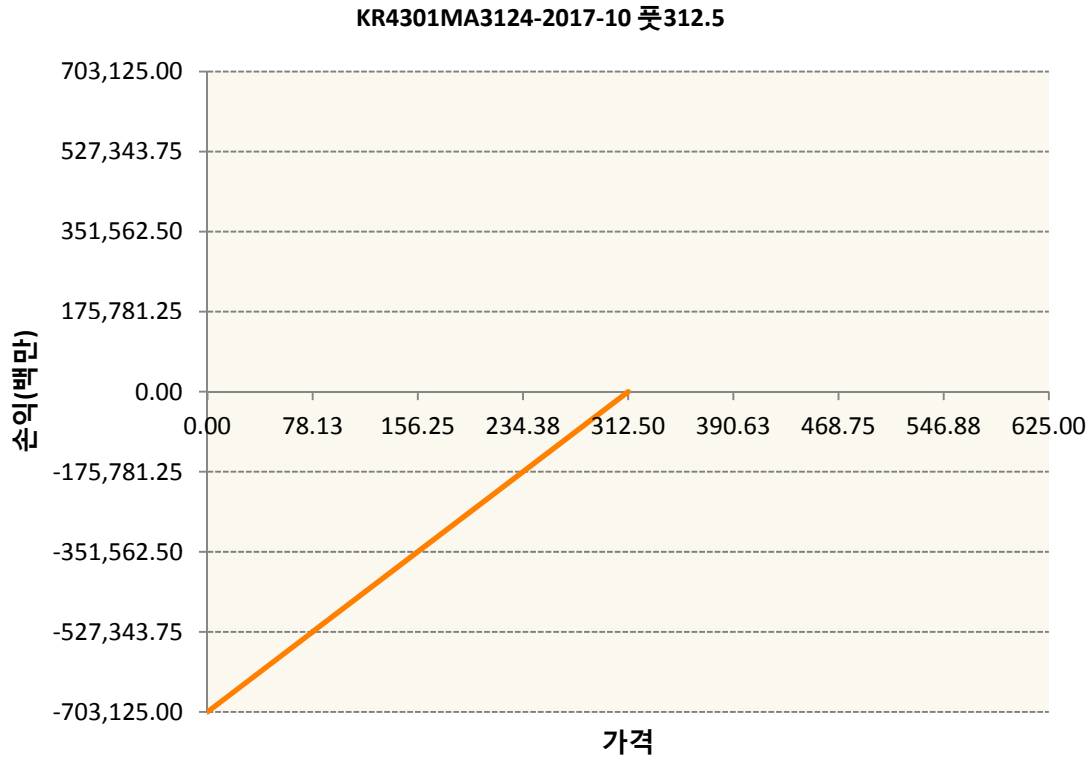
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	1,531,110	-1,531,110	장내
누계	유가증권	옵션	0	1,515,750	-1,515,750	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201MA3 2017-10 콜312.5							50,596
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	20,640	20,216	19,679	19,035	18,297	17,475	16,578
-5.33%	18,782	17,850	16,822	15,716	14,545	13,321	12,052
-2.67%	14,033	12,583	11,103	9,600	8,080	6,545	5,000
0%	4,922	3,282	1,641	0	-1,642	-3,284	-4,926
2.67%	-8,908	-10,290	-11,719	-13,185	-14,680	-16,198	-17,735
5.33%	-26,486	-27,372	-28,368	-29,456	-30,619	-31,846	-33,126
8.00%	-46,292	-46,735	-47,301	-47,980	-48,764	-49,639	-50,596
KR4201MA3 2017-10 콜315							949
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	348	342	334	323	311	297	281

-5.33%	322	307	289	270	249	227	204
-2.67%	248	222	195	167	139	110	81
0%	97	65	32	0	-32	-65	-97
2.67%	-147	-177	-207	-238	-269	-300	-331
5.33%	-472	-493	-516	-540	-565	-591	-618
8.00%	-850	-861	-875	-891	-909	-928	-949
KR4301MA3 2017-10 풋312.5							41,774

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-38,189	-38,563	-39,038	-39,606	-40,257	-40,983	-41,774
-5.33%	-21,029	-21,851	-22,758	-23,734	-24,767	-25,847	-26,966
-2.67%	-6,419	-7,698	-9,004	-10,330	-11,671	-13,025	-14,389
0%	4,343	2,896	1,448	0	-1,448	-2,897	-4,346
2.67%	10,940	9,721	8,461	7,167	5,848	4,508	3,152
5.33%	14,231	13,449	12,570	11,611	10,584	9,502	8,372
8.00%	15,556	15,165	14,666	14,066	13,375	12,603	11,758

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

91,682

공시일	2017-09-18
기준일	2017-09-15

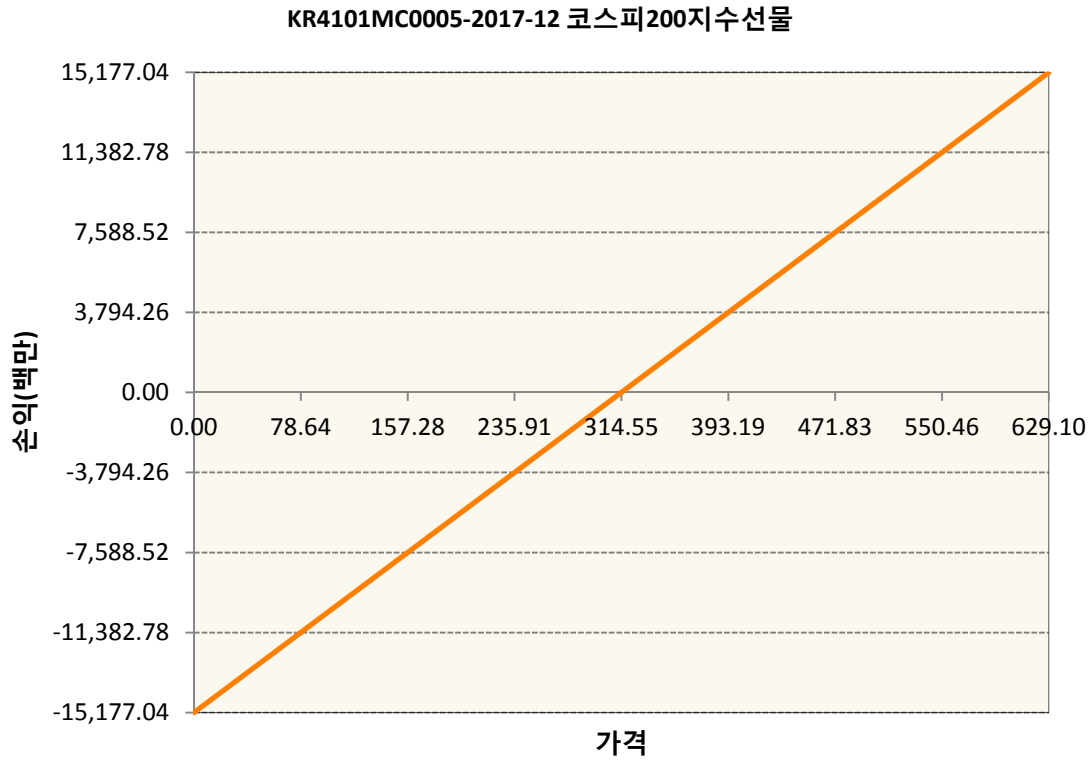
ETF스마트레버리지목표전환형6호

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	15,177	0	15,177	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101MC0	2017-12 코스피200지수선물						1,211
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,211	-1,211	-1,211	-1,211	-1,211	-1,211	-1,211
-5.33%	-807	-807	-807	-807	-807	-807	-807
-2.67%	-404	-404	-404	-404	-404	-404	-404
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	404	404	404	404	404	404	404
5.33%	807	807	807	807	807	807	807
8.00%	1,211	1,211	1,211	1,211	1,211	1,211	1,211

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

729

공시일	2017-09-18
기준일	2017-09-15

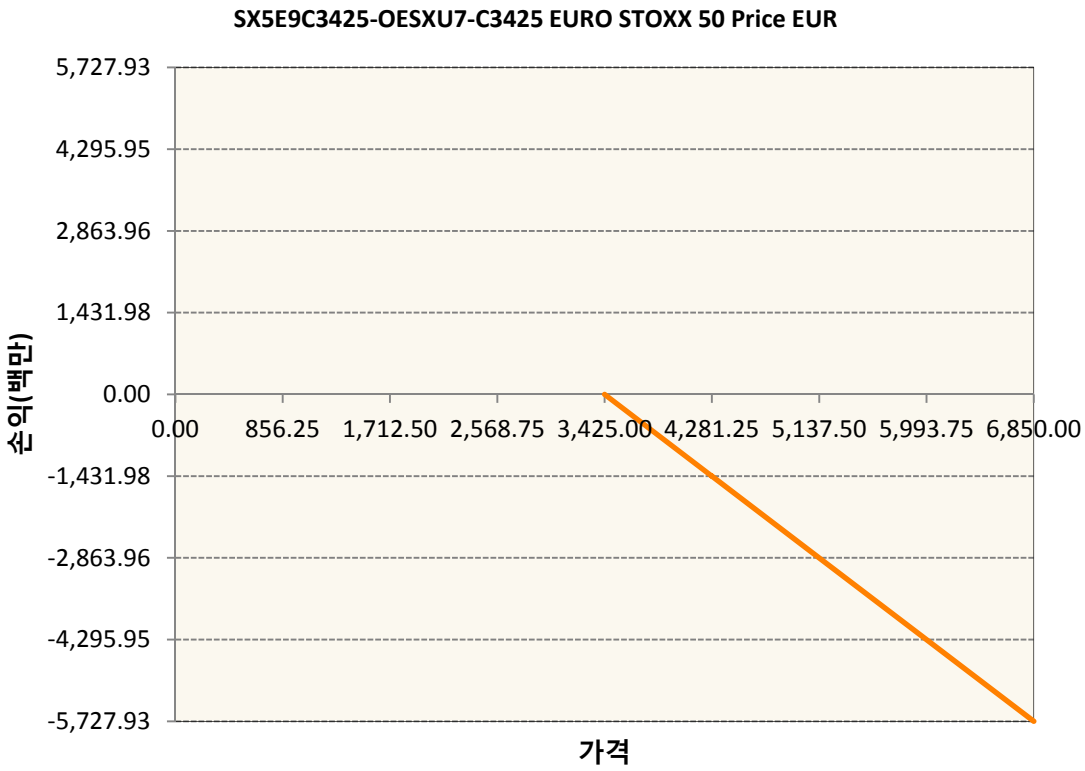
유로커버드콜(주식혼합-파생형)

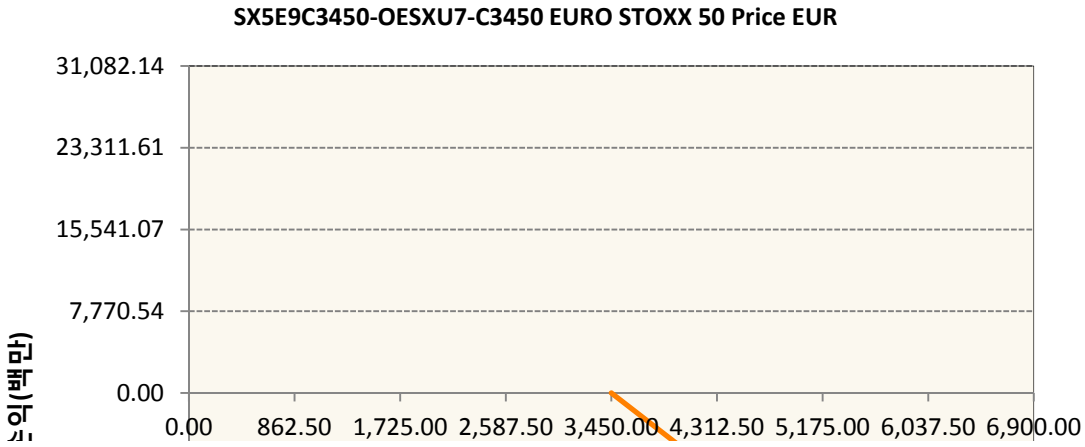
1. 계약금액

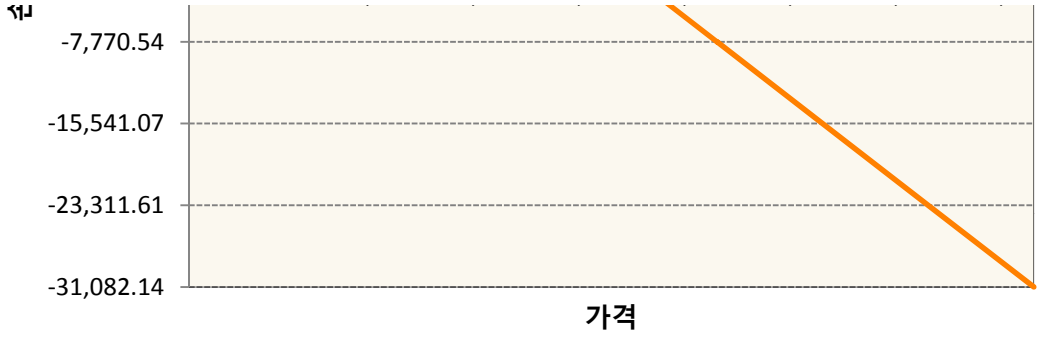
(단위:백만원)

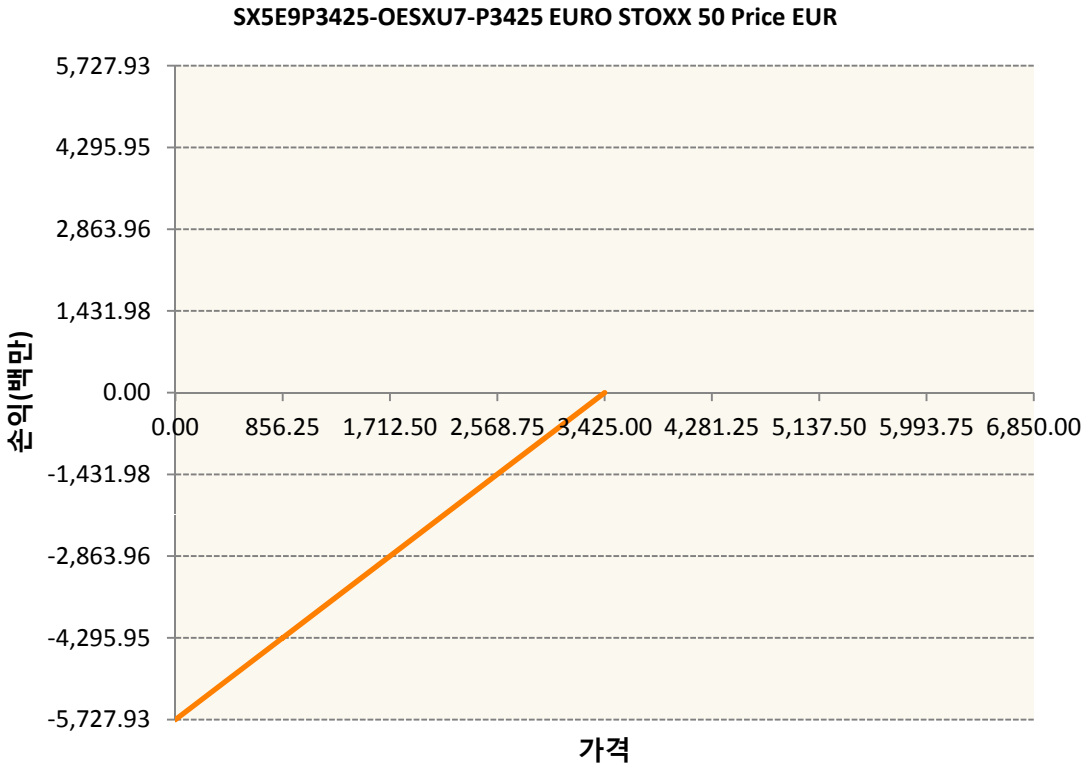
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	33,141	0	33,141	
누계	유가증권	옵션	0	73,620	-73,620	장내

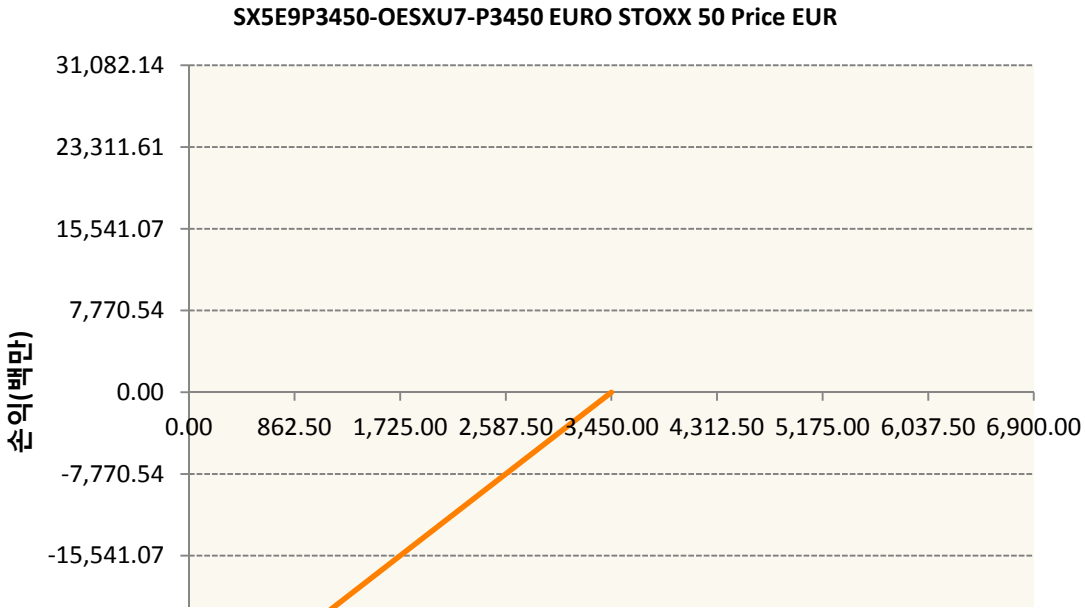
2. 만기시점의 손익구조

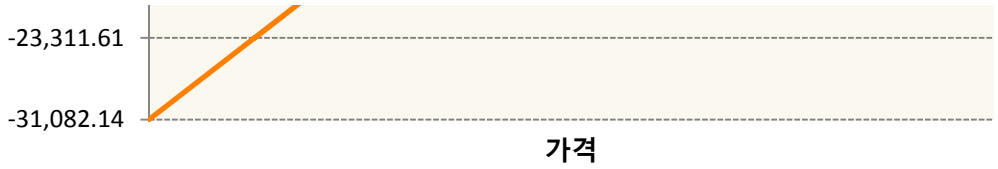


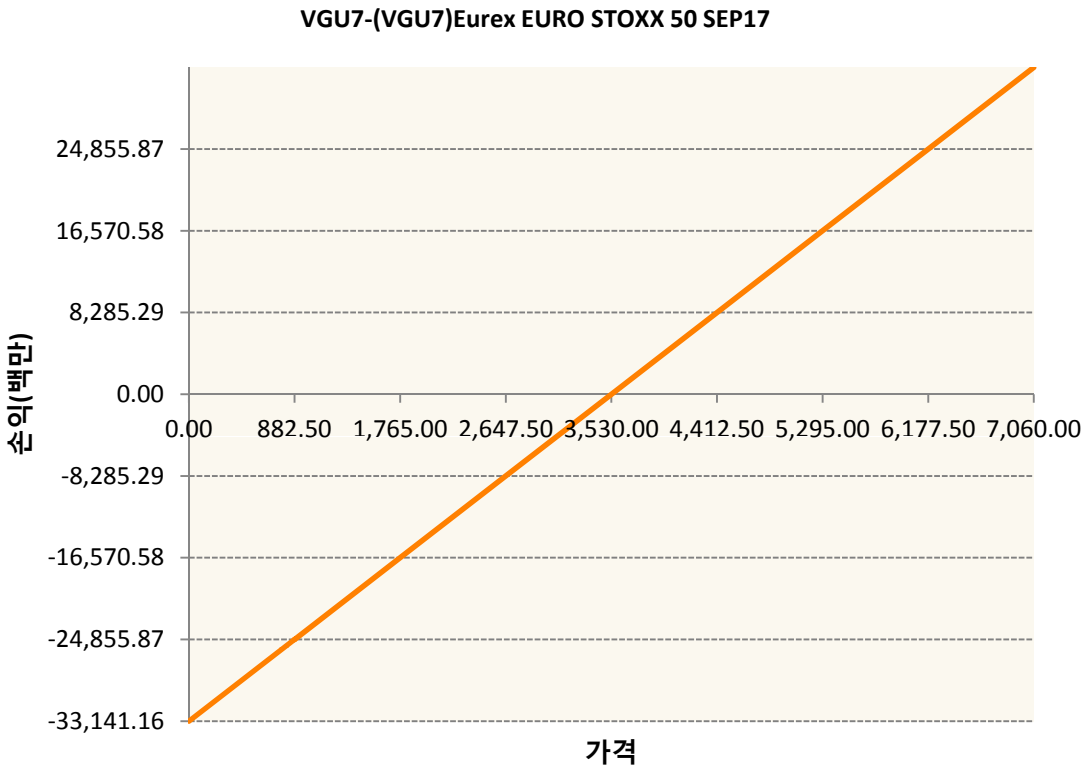



-7,770.54
-15,541.07
-23,311.61
-31,082.14
가격


SX5E9P3425-OESXU7-P3425 EURO STOXX 50 Price EUR
5,727.93
4,295.95
2,863.96
1,431.98
0.00
-1,431.98
-2,863.96
-4,295.95
-5,727.93
손익(백만)
0.00
856.25
1,712.50
2,568.75
3,425.00
4,281.25
5,137.50
5,993.75
6,850.00
가격


SX5E9P3450-OESXU7-P3450 EURO STOXX 50 Price EUR
31,082.14
23,311.61
15,541.07
7,770.54
0.00
-7,770.54
-15,541.07
손익(백만)
0.00
862.50
1,725.00
2,587.50
3,450.00
4,312.50
5,175.00
6,037.50
6,900.00





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
SX5E9C3425	OESXU7-C3425 EURO STOXX 50 Price EUR	458
SX5E9C3450	OESXU7-C3450 EURO STOXX 50 Price EUR	2,487
SX5E9P3425	OESXU7-P3425 EURO STOXX 50 Price EUR	458
SX5E9P3450	OESXU7-P3450 EURO STOXX 50 Price EUR	2,487
VGU7	(VGU7)Eurex EURO STOXX 50 SEP17	2,651

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	6,729

공시일	2017-09-18
기준일	2017-09-15

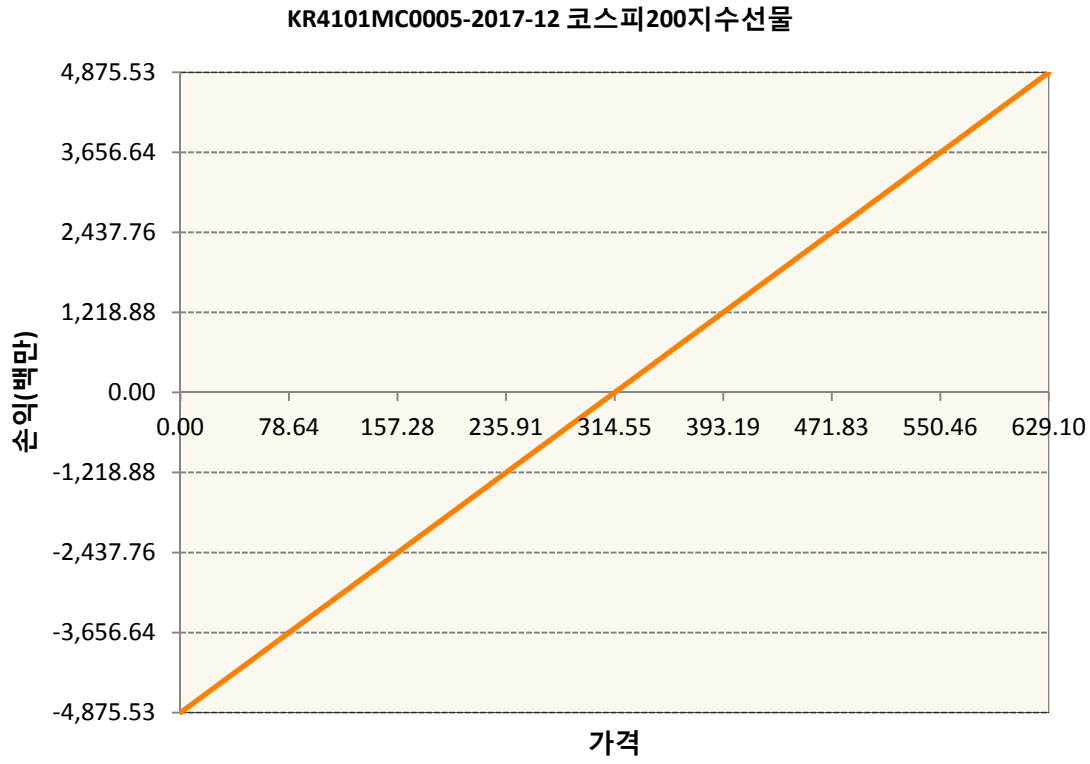
ETF스마트레버리지목표전환형7호

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	4,876	0	4,876	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101MC0	2017-12 코스피200지수선물						389
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-389	-389	-389	-389	-389	-389	-389
-5.33%	-259	-259	-259	-259	-259	-259	-259
-2.67%	-130	-130	-130	-130	-130	-130	-130
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	130	130	130	130	130	130	130
5.33%	259	259	259	259	259	259	259
8.00%	389	389	389	389	389	389	389

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

234

공시일	2017-09-18
기준일	2017-09-15

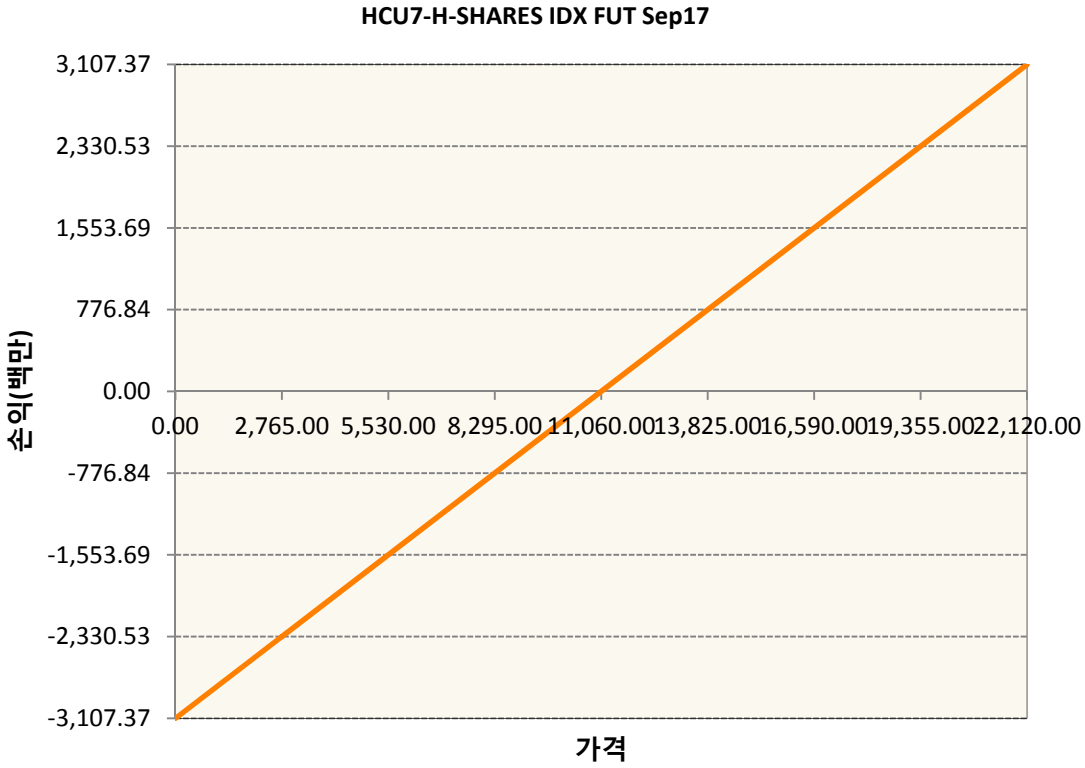
홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생

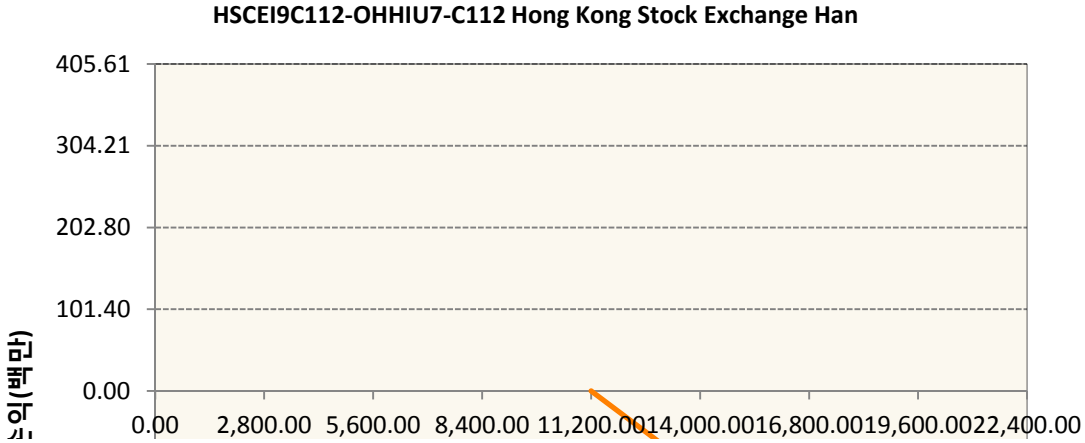
1. 계약금액

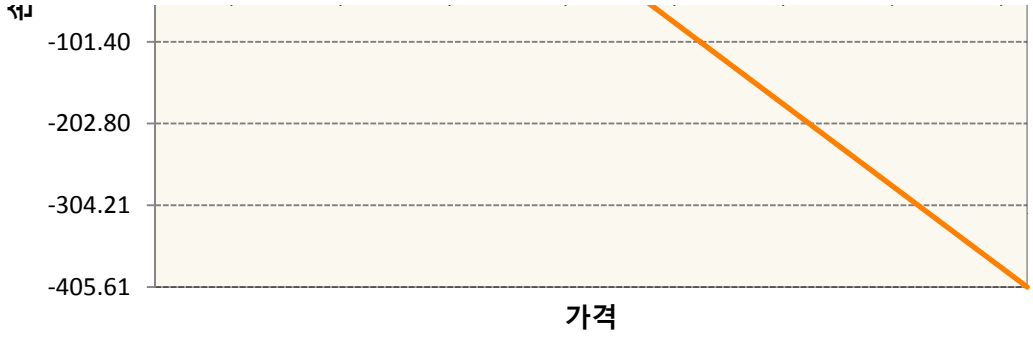
(단위:백만원)

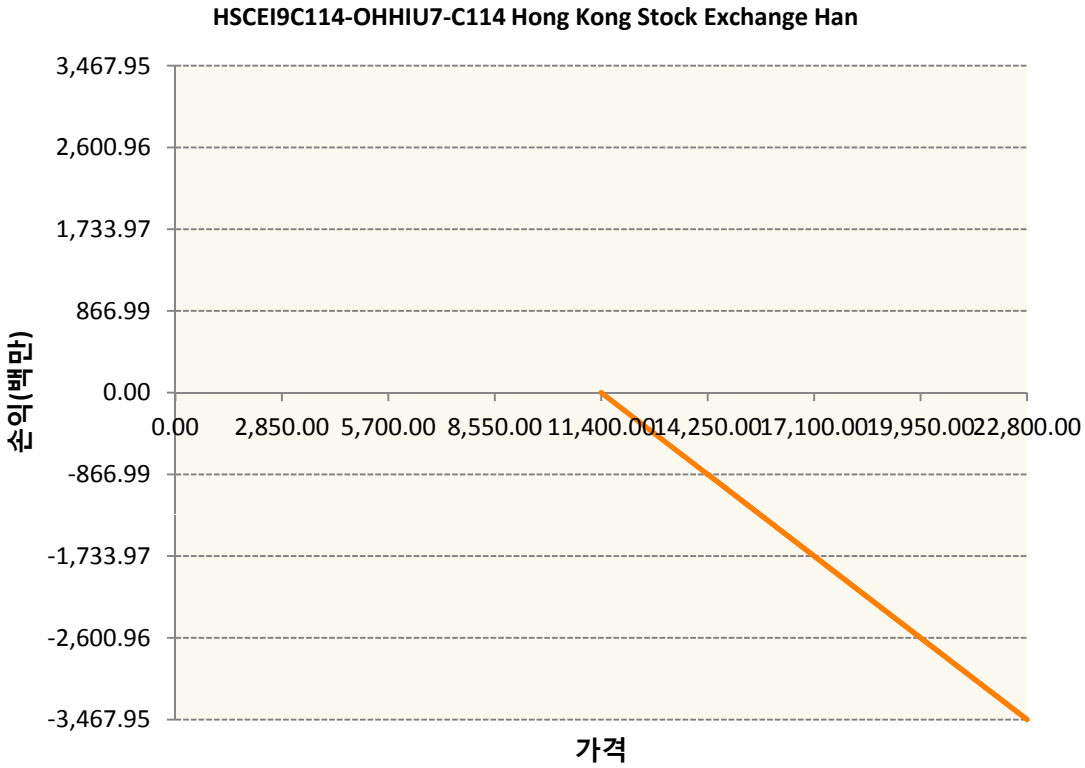
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	3,107	0	3,107	장내
누계	유가증권	옵션	0	7,747	-7,747	장내

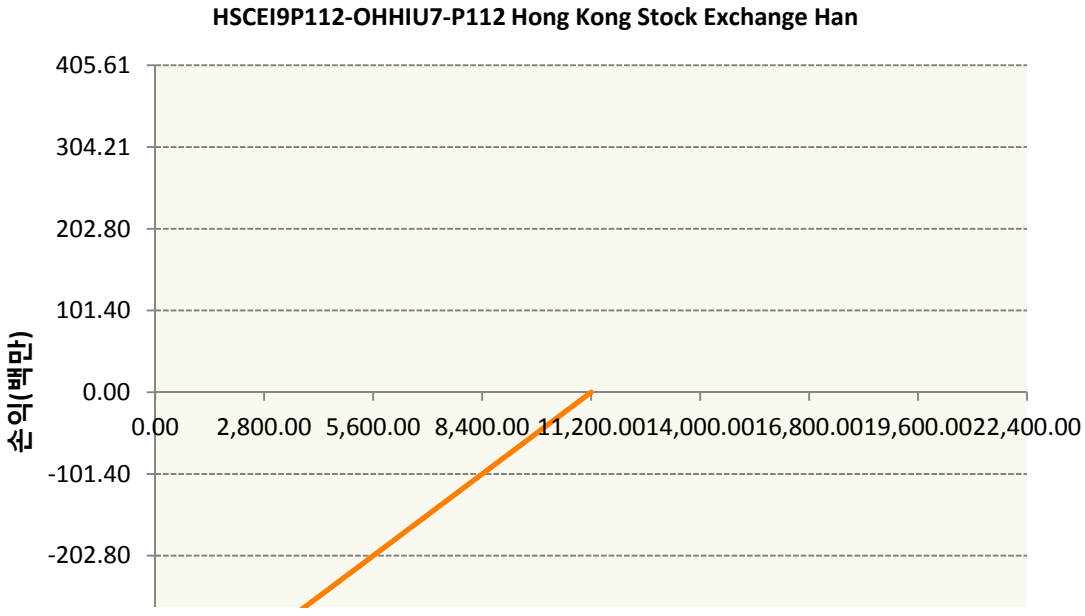
2. 만기시점의 손익구조

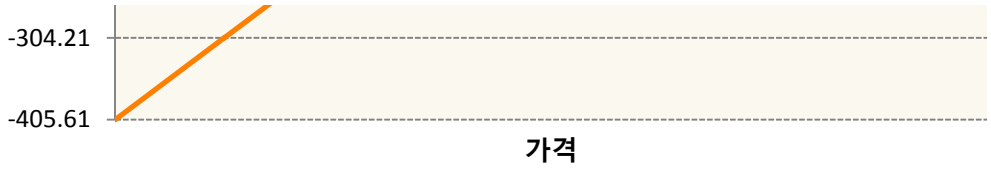


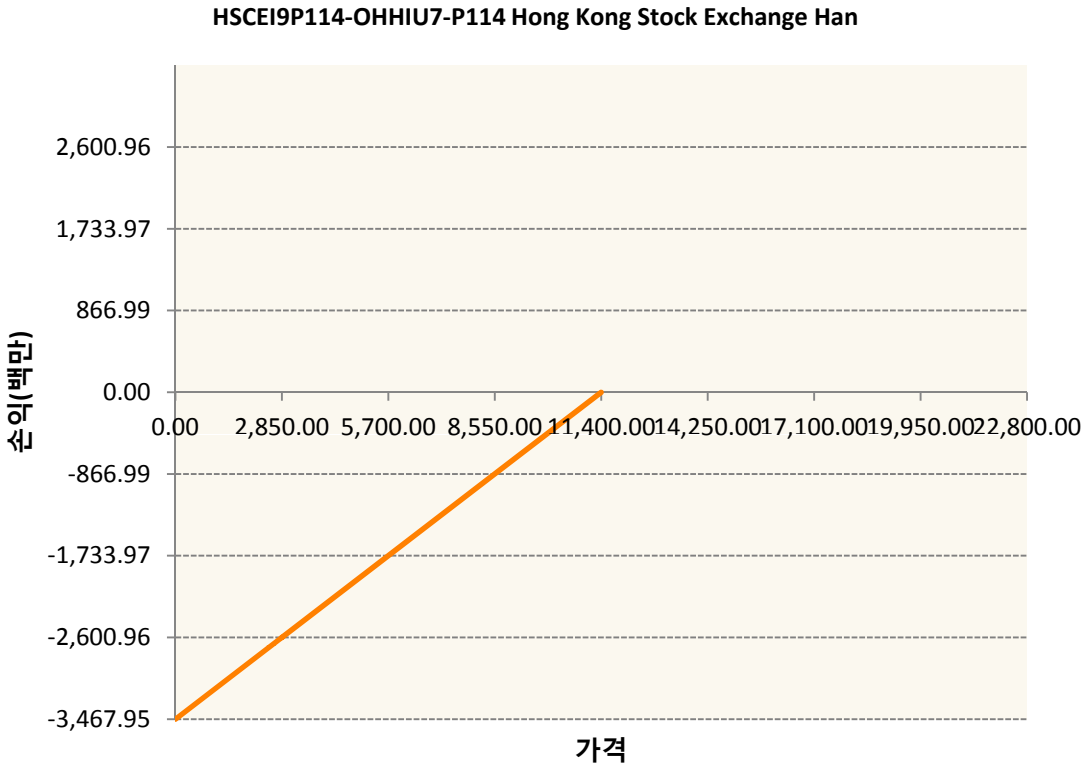



-101.40
-202.80
-304.21
-405.61
가격


HSCEI9C114-OHHIU7-C114 Hong Kong Stock Exchange Han
3,467.95
2,600.96
1,733.97
866.99
0.00
-866.99
-1,733.97
-2,600.96
-3,467.95
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
405.61
304.21
202.80
101.40
0.00
-101.40
-202.80
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	32
HSCEI9C114 OHHIU7-C114 Hong Kong Stock Exchange Han	277
HSCEI9P112 OHHIU7-P112 Hong Kong Stock Exchange Han	32
HSCEI9P114 OHHIU7-P114 Hong Kong Stock Exchange Han	277

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	735

공시일	2017-09-18
기준일	2017-09-15

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼

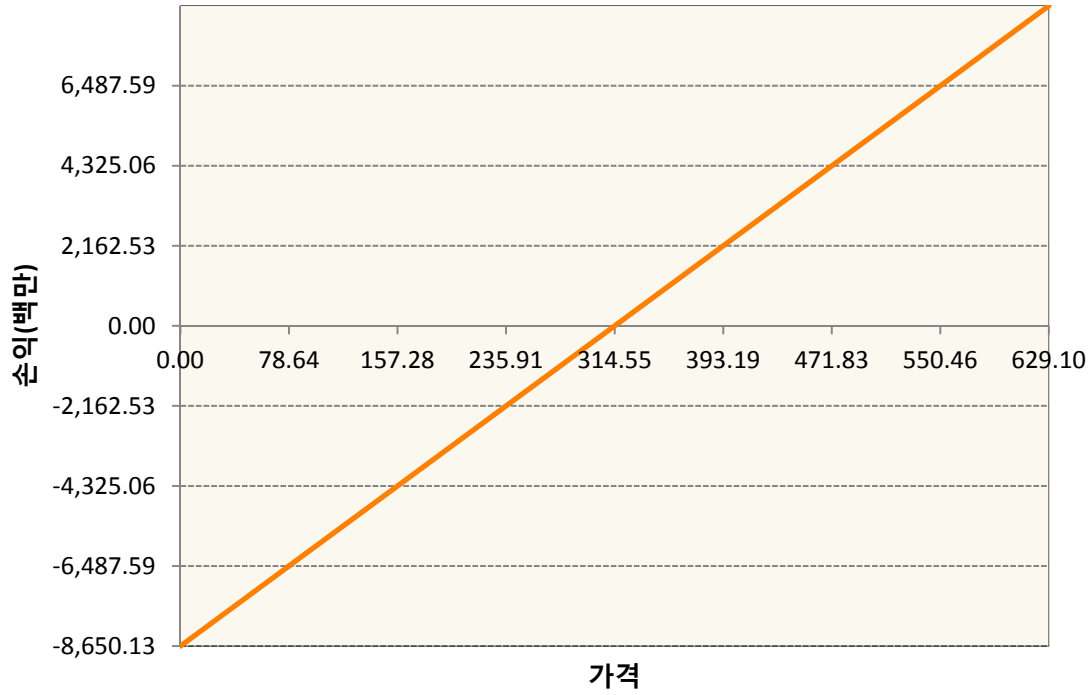
1. 계약금액

(단위:백만원)

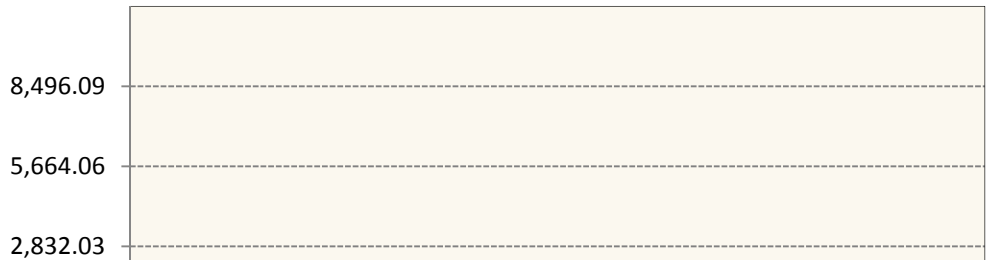
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	391	0	391	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	22,887	-22,887	장내
누계	유가증권	선물	8,650	0	8,650	장내
누계	유가증권	스왑	22,000	0	22,000	장외
누계	유가증권	옵션	0	22,656	-22,656	장내

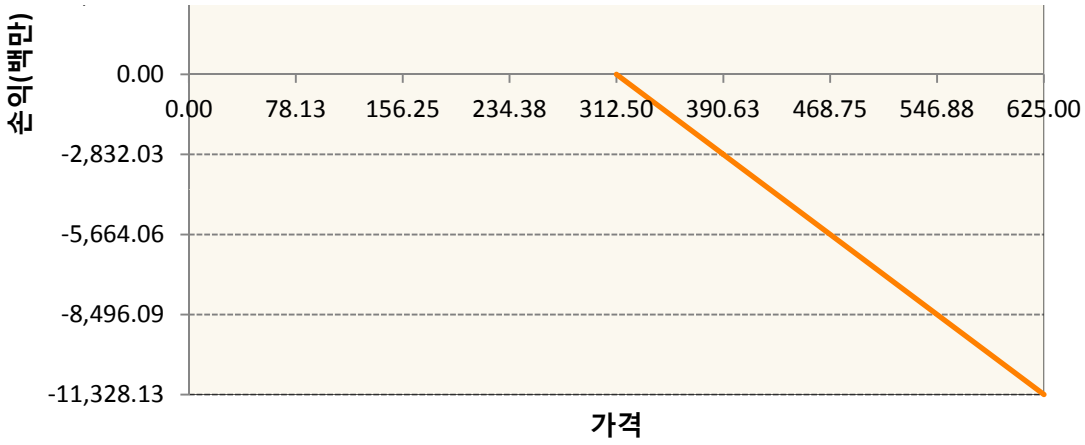
2. 만기시점의 손익구조

KR4101MC0005-2017-12 코스피200지수선물

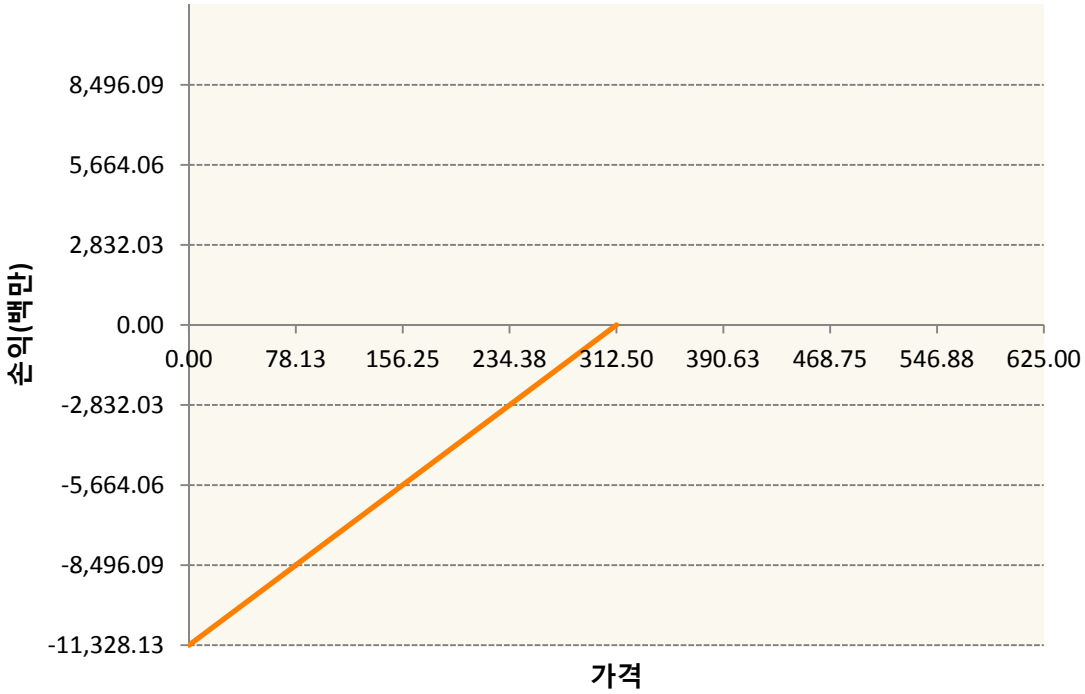


KR4201MA3125-2017-10 콜312.5





KR4301MA3124-2017-10 풋312.5



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						690
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-690	-690	-690	-690	-690	-690	-690
-5.33%	-460	-460	-460	-460	-460	-460	-460
-2.67%	-230	-230	-230	-230	-230	-230	-230
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	230	230	230	230	230	230	230
5.33%	460	460	460	460	460	460	460
8.00%	690	690	690	690	690	690	690
KR4201MA3 2017-10 콜312.5							719
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	293	287	280	271	260	248	236
-5.33%	267	254	239	223	207	189	171
-2.67%	199	179	158	136	115	93	71
0%	70	47	23	0	-23	-47	-70
2.67%	-127	-146	-167	-187	-209	-230	-252
5.33%	-377	-389	-403	-419	-435	-453	-471
8.00%	-658	-664	-672	-682	-693	-706	-719
KR4301MA3 2017-10 풋312.5							673
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-615	-621	-629	-638	-649	-660	-673
-5.33%	-339	-352	-367	-382	-399	-416	-434
-2.67%	-103	-124	-145	-166	-188	-210	-232
0%	70	47	23	0	-23	-47	-70
2.67%	176	157	136	115	94	73	51
5.33%	229	217	203	187	171	153	135
8.00%	251	244	236	227	215	203	189

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	3,550

공시일	2017-09-18
기준일	2017-09-15

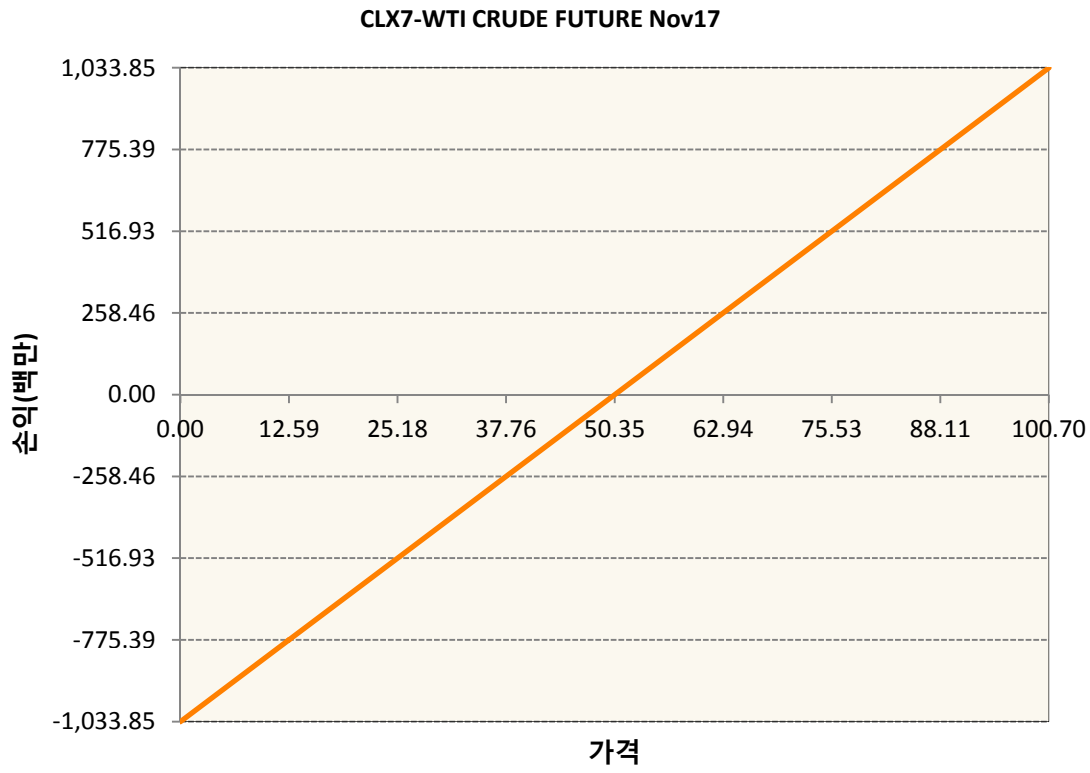
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

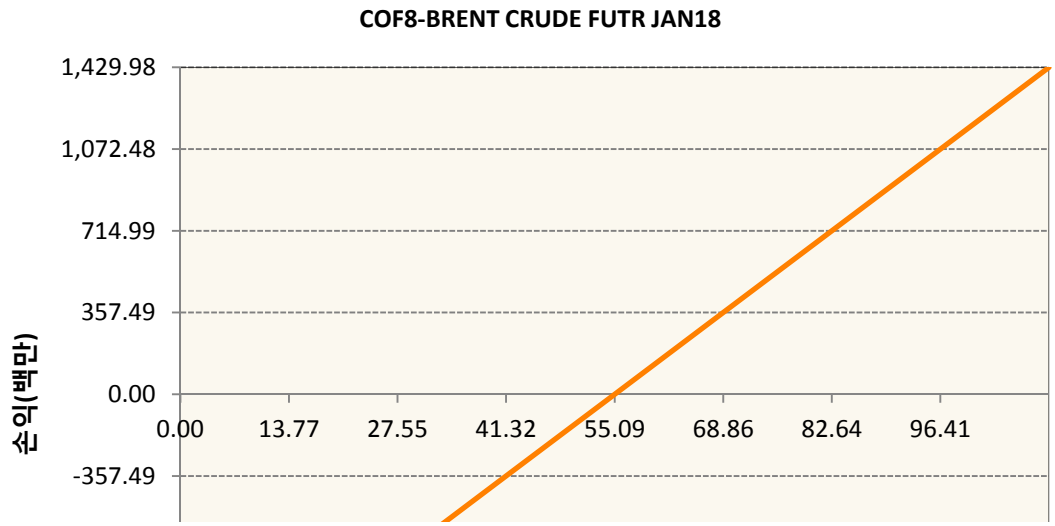
1. 계약금액

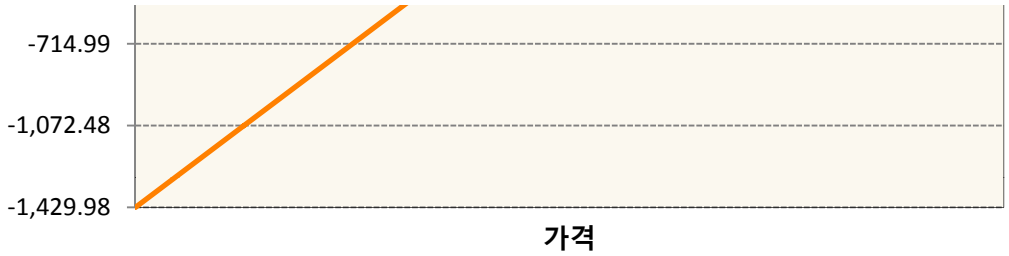
(단위:백만원)

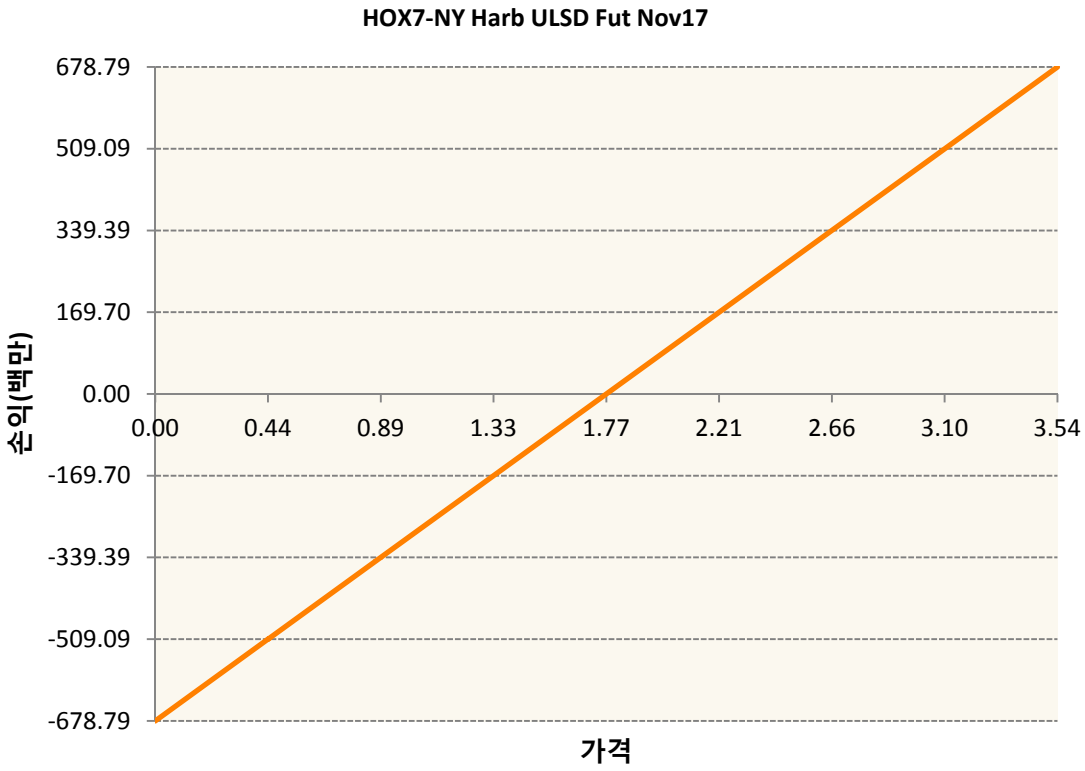
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	5,330	622	4,708	

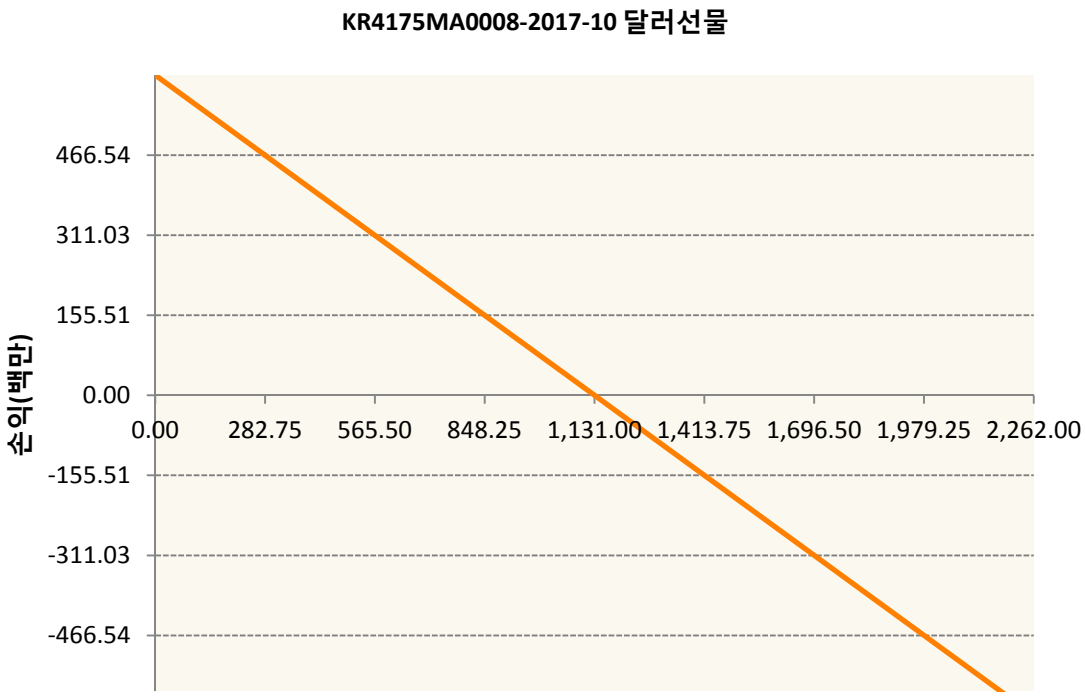
2. 만기시점의 손익구조

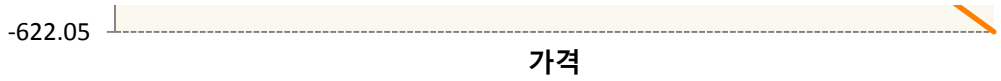


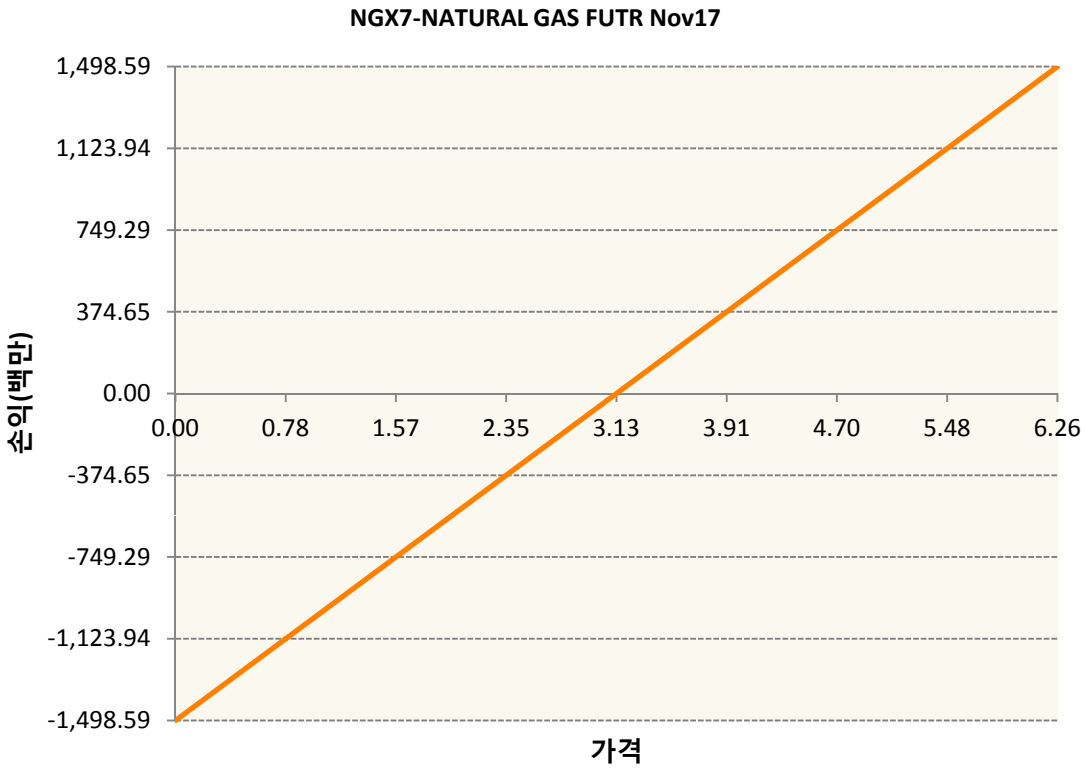


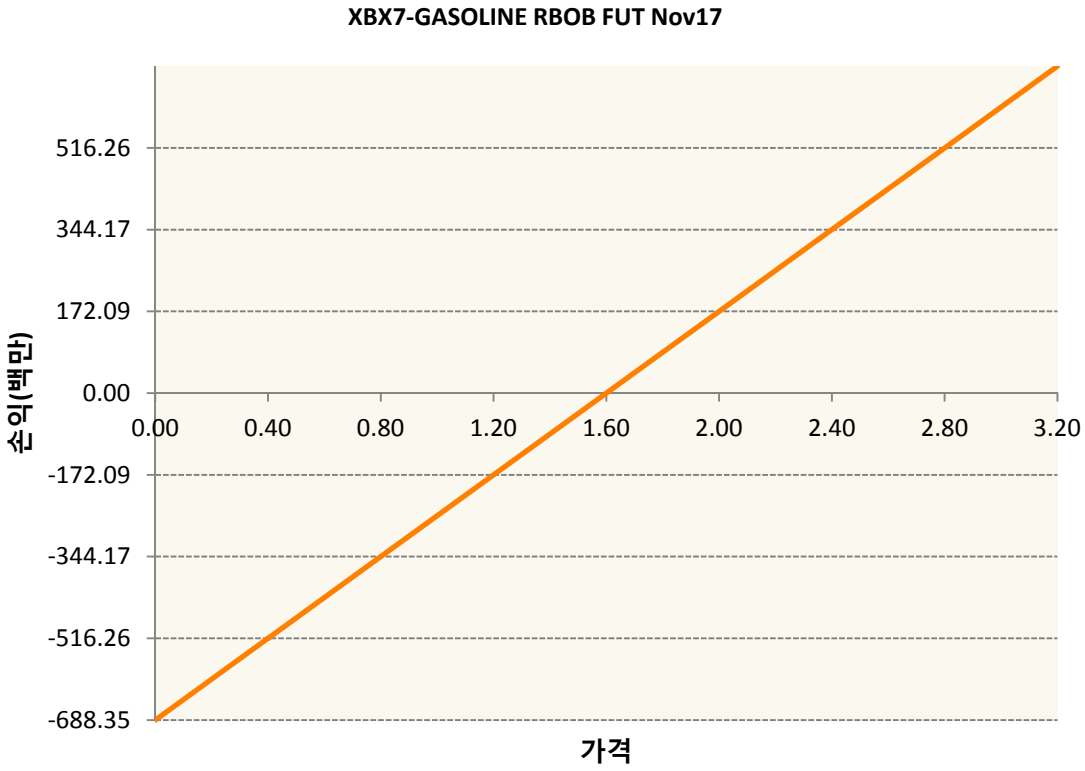

-714.99
-1,072.48
-1,429.98
가격


HOX7-NY Harb ULSD Fut Nov17
678.79
509.09
339.39
169.70
0.00
-169.70
-339.39
-509.09
-678.79
0.00
0.44
0.89
1.33
1.77
2.21
2.66
3.10
3.54
손익(백만)
가격


KR4175MA0008-2017-10 달러선물
466.54
311.03
155.51
0.00
-155.51
-311.03
-466.54
0.00
282.75
565.50
848.25
1,131.00
1,413.75
1,696.50
1,979.25
2,262.00
손익(백만)


-622.05
가격


NGX7-NATURAL GAS FUTR Nov17
1,498.59
1,123.94
749.29
374.65
0.00
-374.65
-749.29
-1,123.94
-1,498.59
0.00
0.78
1.57
2.35
3.13
3.91
4.70
5.48
6.26
손익(백만)
가격


XBX7-GASOLINE RBOB FUT Nov17
516.26
344.17
172.09
0.00
-172.09
-344.17
-516.26
-688.35
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	83
COF8	BRENT CRUDE FUTR JAN18	114
HOX7	NY Harb ULSD Fut Nov17	54
KR4175MA0	2017-10 달러선물	50
NGX7	NATURAL GAS FUTR Nov17	120
XBX7	GASOLINE RBOB FUT Nov17	55

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

772

공시일	2017-09-18
기준일	2017-09-15

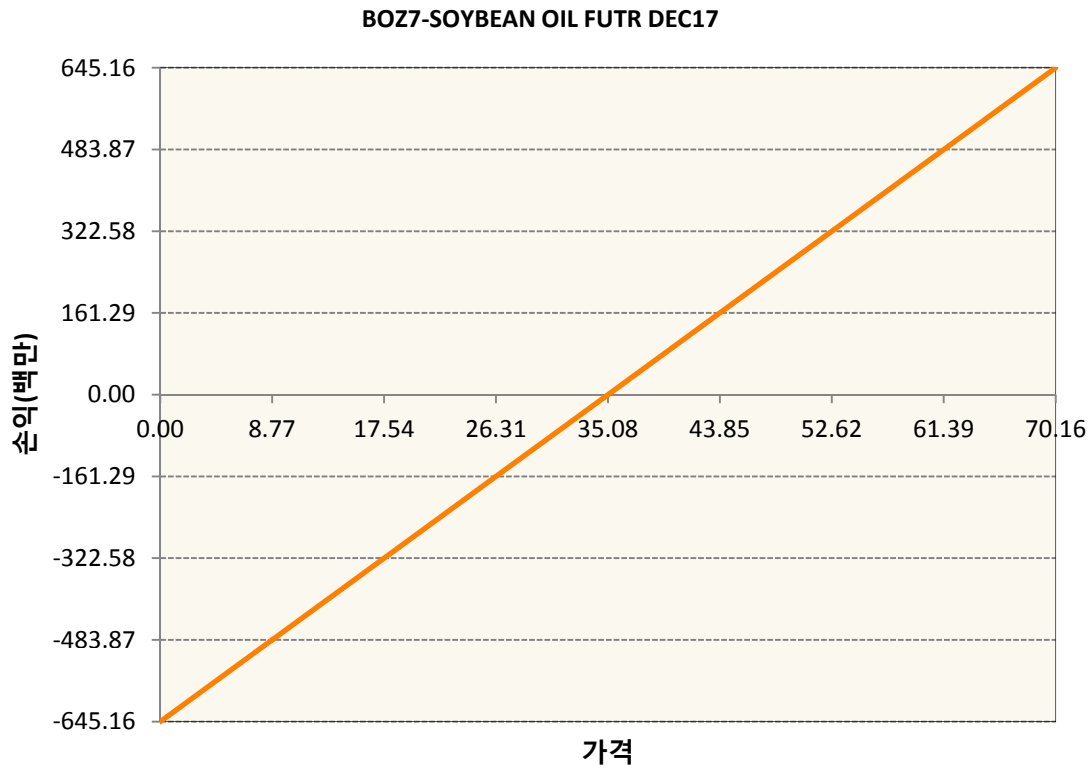
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

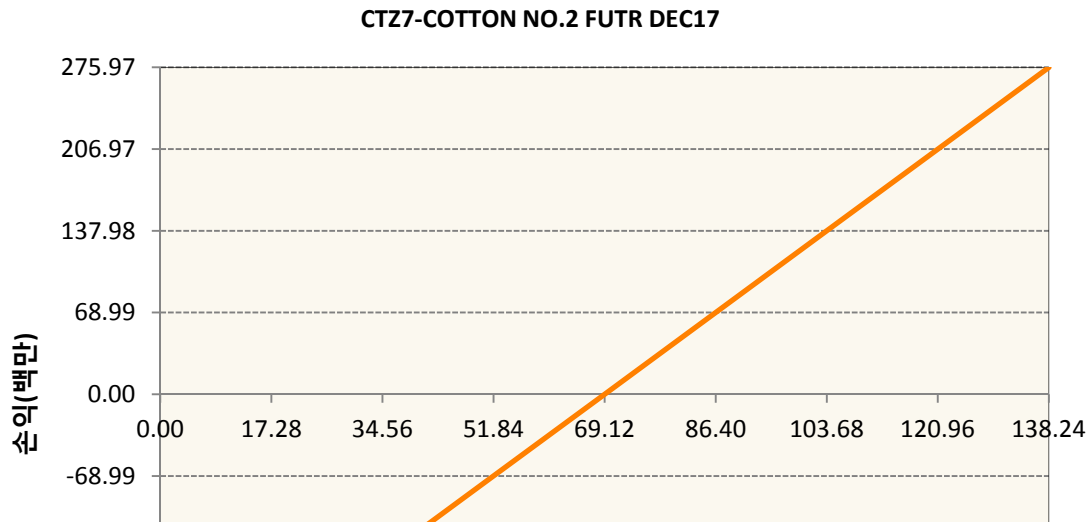
1. 계약금액

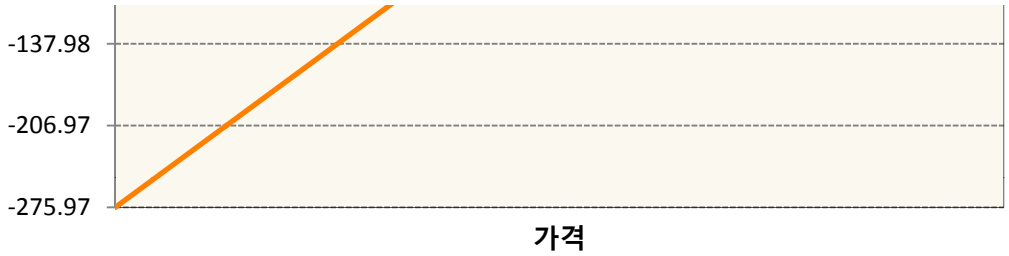
(단위:백만원)

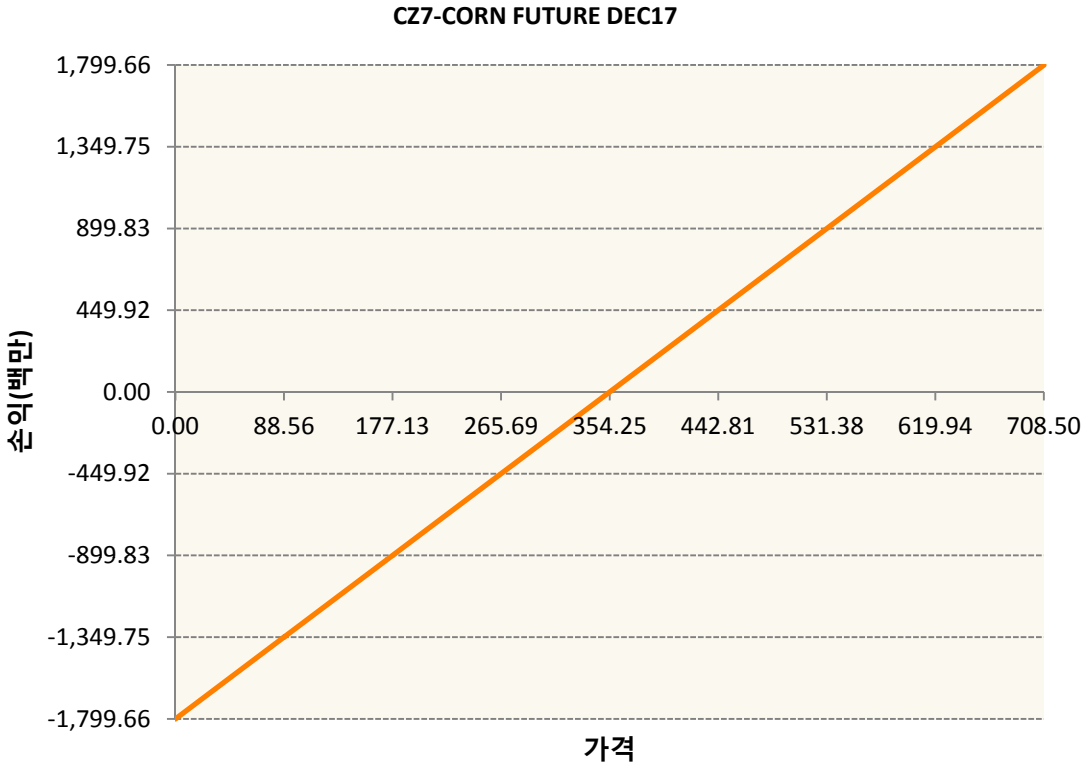
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	6,906	339	6,567	

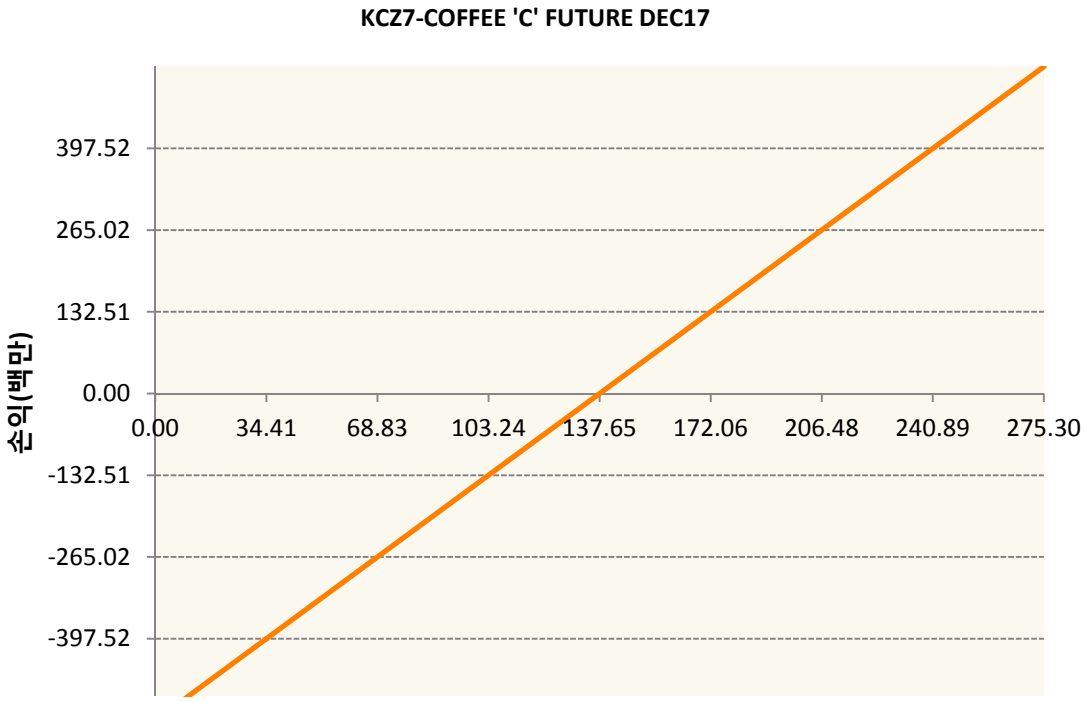
2. 만기시점의 손익구조

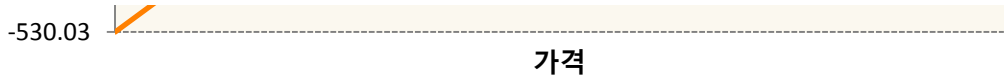


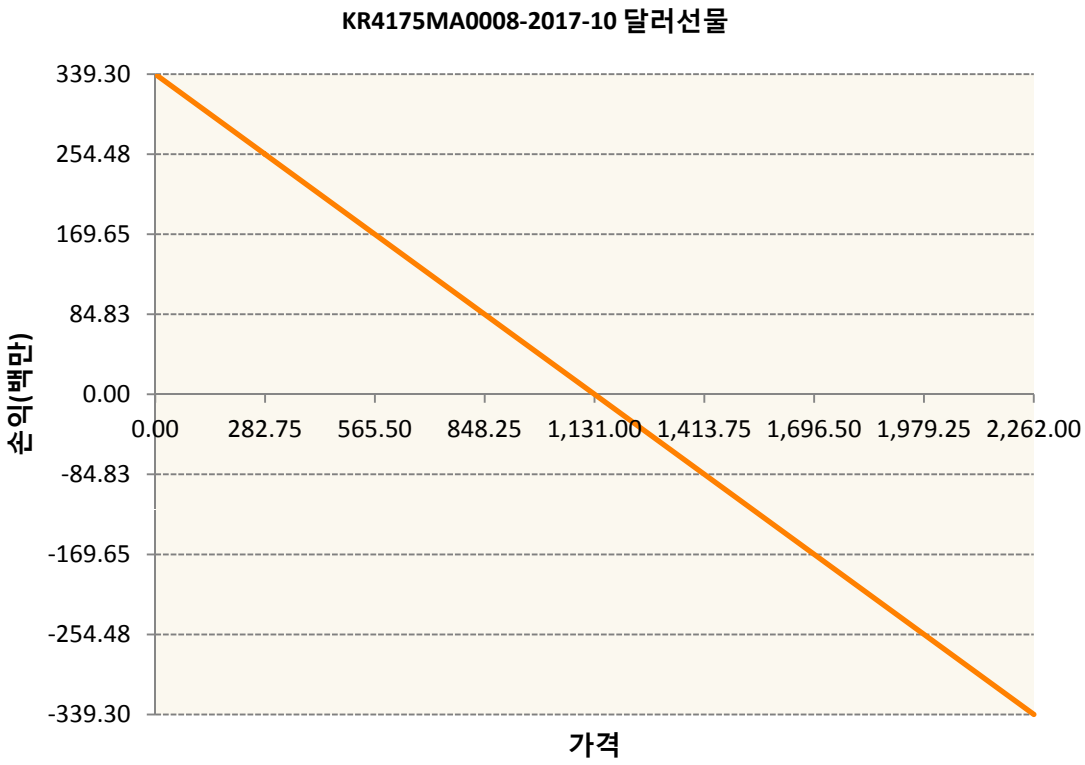


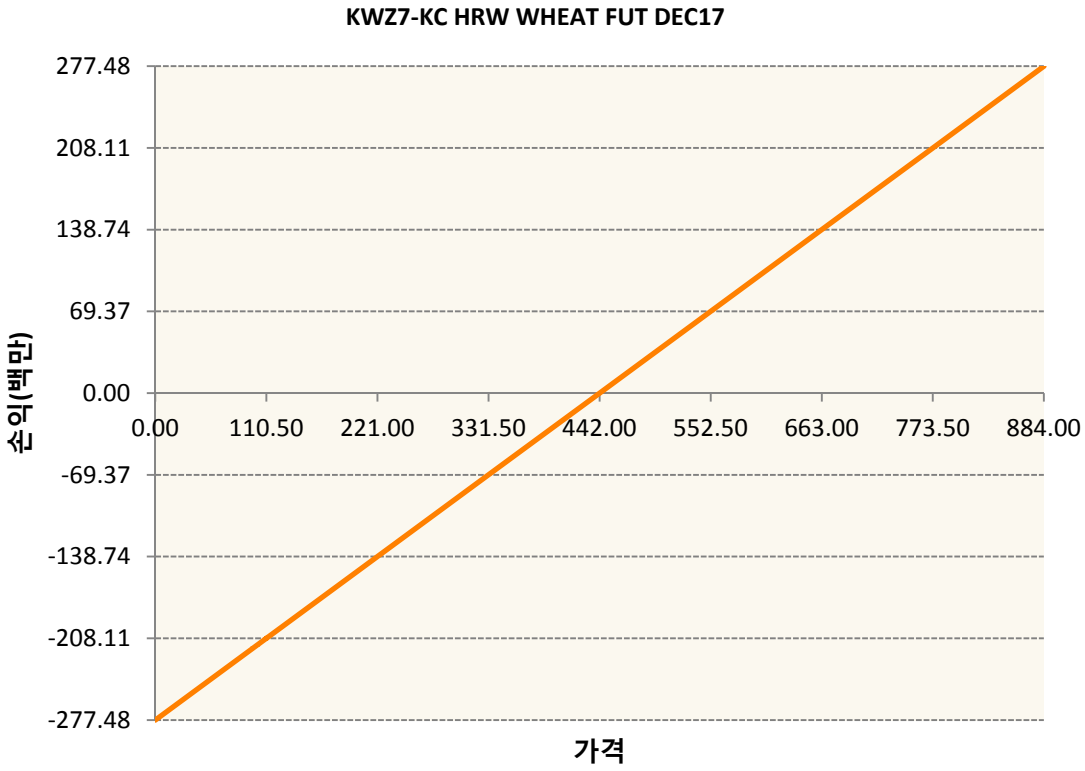

-137.98
-206.97
-275.97
가격


CZ7-CORN FUTURE DEC17
1,799.66
1,349.75
899.83
449.92
0.00
-449.92
-899.83
-1,349.75
-1,799.66
0.00
88.56
177.13
265.69
354.25
442.81
531.38
619.94
708.50
손익(백만)
가격

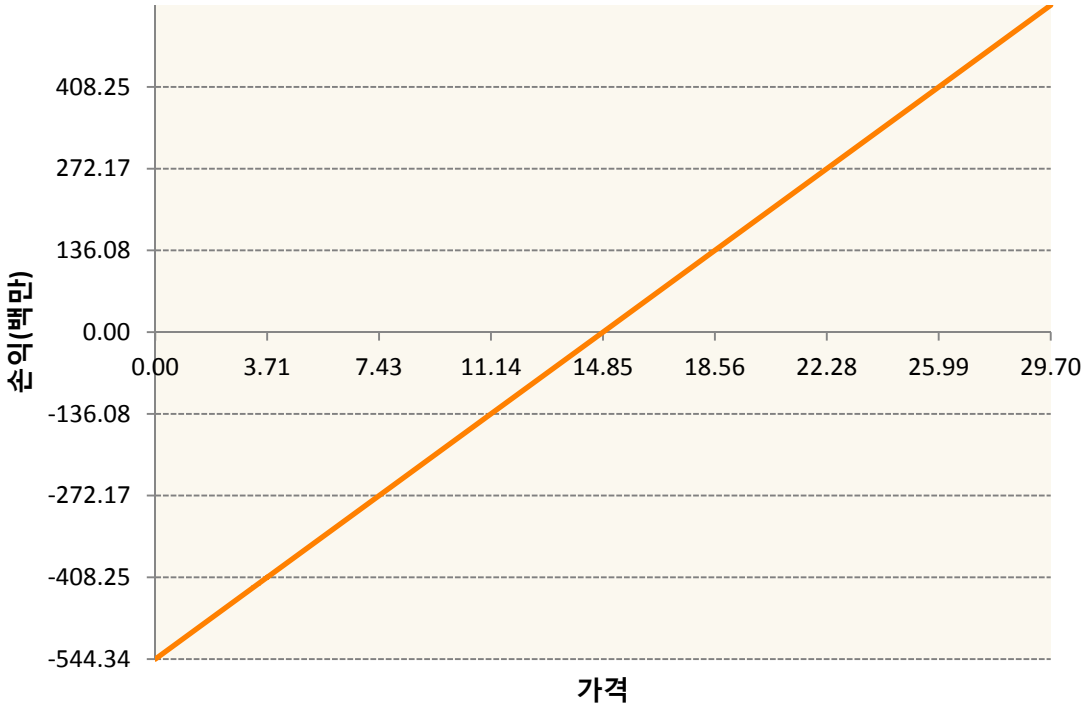

KCZ7-COFFEE 'C' FUTURE DEC17
397.52
265.02
132.51
0.00
-132.51
-265.02
-397.52
0.00
34.41
68.83
103.24
137.65
172.06
206.48
240.89
275.30
손익(백만)


-530.03
가격

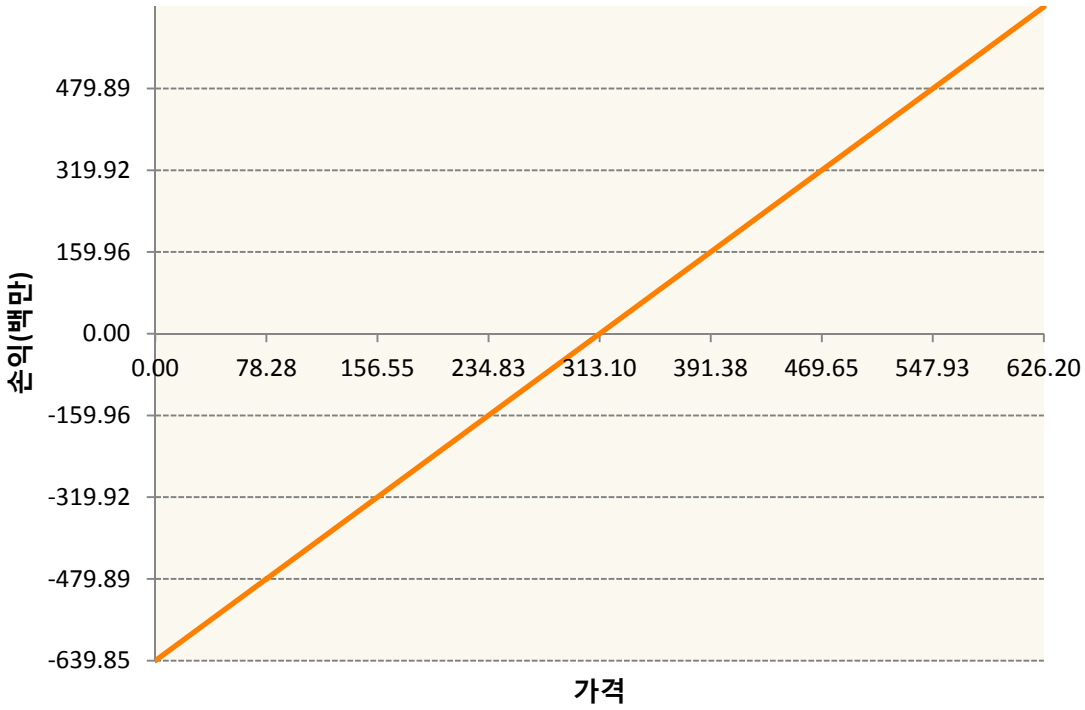

KR4175MA0008-2017-10 달러선물
339.30
254.48
169.65
84.83
0.00
-84.83
-169.65
-254.48
-339.30
0.00
282.75
565.50
848.25
1,131.00
1,413.75
1,696.50
1,979.25
2,262.00
손익(백만)
가격


KWZ7-KC HRW WHEAT FUT DEC17
277.48
208.11
138.74
69.37
0.00
-69.37
-138.74
-208.11
-277.48
0.00
110.50
221.00
331.50
442.00
552.50
663.00
773.50
884.00
손익(백만)
가격

SBH8-Sugar #11 (WORLD) MAR18

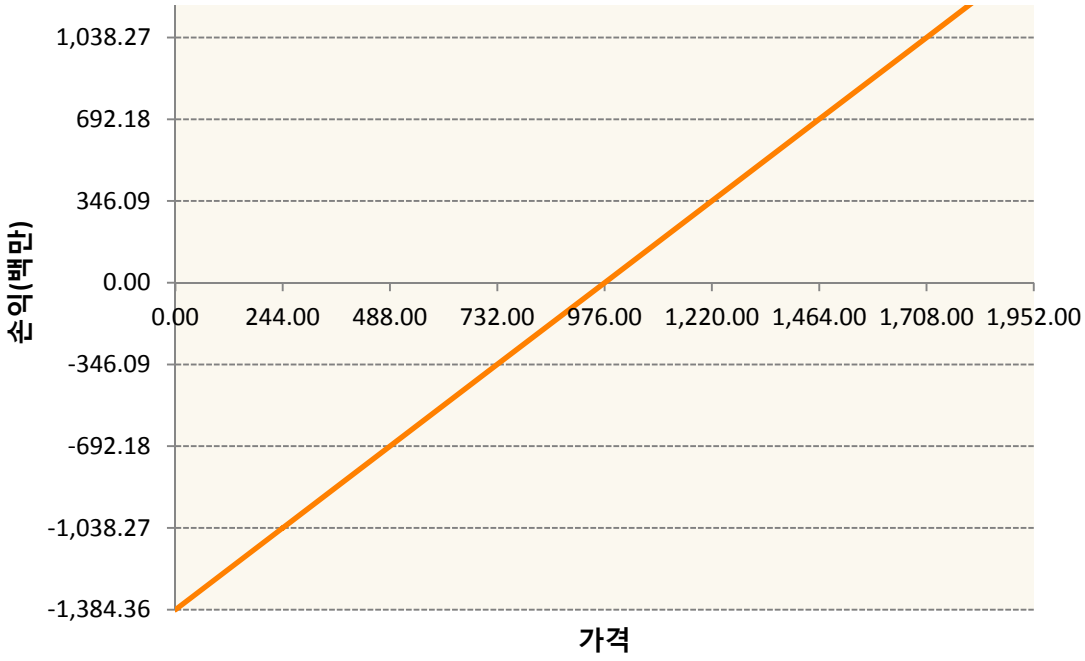


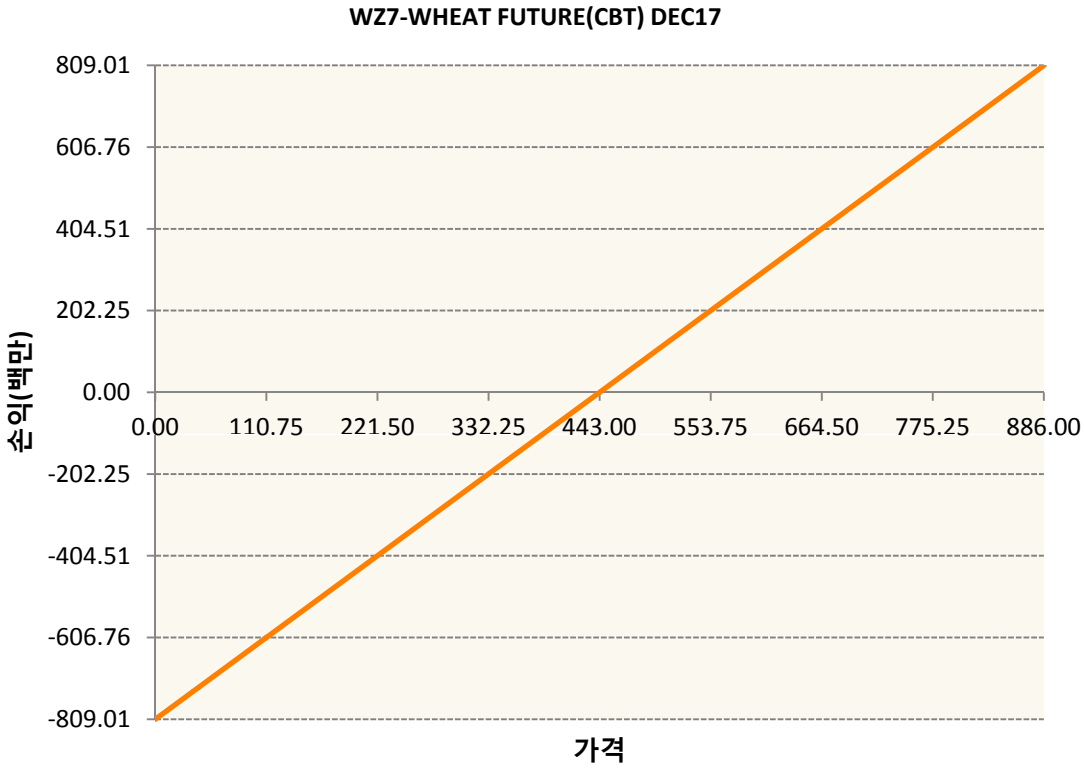
SMZ7-SOYBEAN MEAL FUTR DEC17



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	144
KCZ7	COFFEE 'C' FUTURE DEC17	42
KR4175MA0	2017-10 달러선물	27

KWZ7	KC HRW WHEAT FUT DEC17	22
SBH8	Sugar #11 (WORLD) MAR18	44
SMZ7	SOYBEAN MEAL FUTR DEC17	51
SX7	SOYBEAN FUTURE NOV17	111
WZ7	WHEAT FUTURE(CBT) DEC17	65

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

648