공시일	2017-09-19
기준일	2017-09-18

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	2017-09-19
기준일	2017-09-18

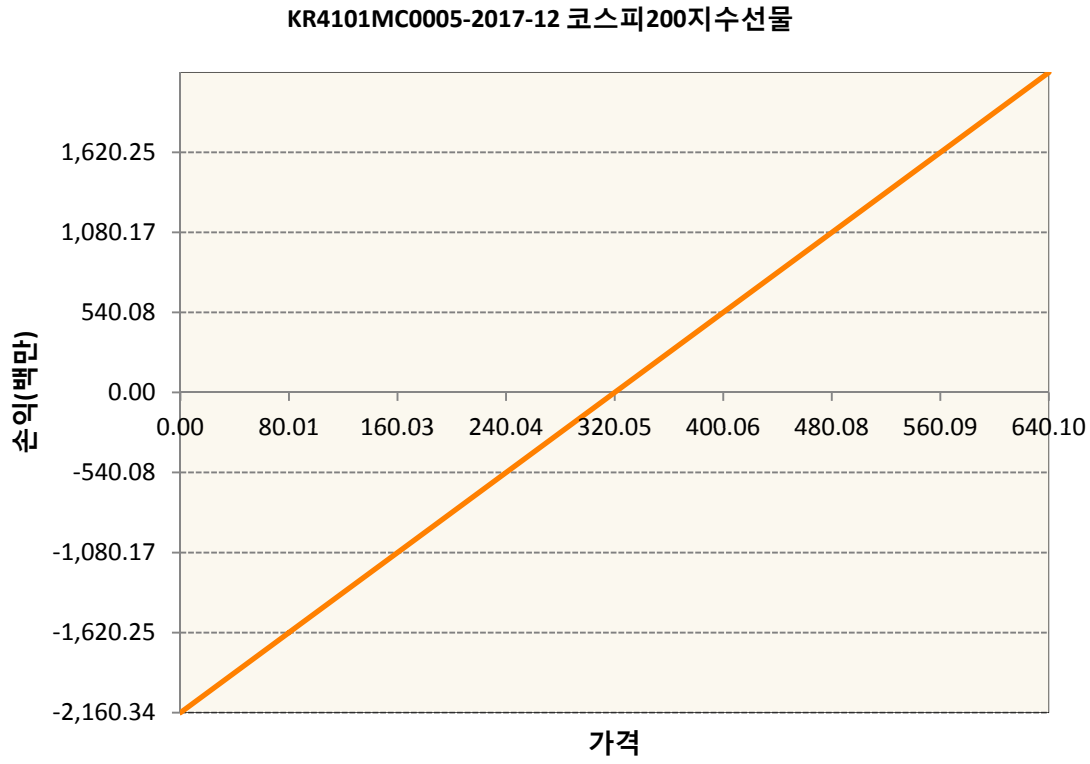
스마트인덱스모

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	160	-160	장내
누계	유가증권	선물	2,160	0	2,160	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101MC0	2017-12 코스피200지수선물						172
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-172	-172	-172	-172	-172	-172	-172
-5.33%	-115	-115	-115	-115	-115	-115	-115
-2.67%	-57	-57	-57	-57	-57	-57	-57
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	57	57	57	57	57	57	57
5.33%	115	115	115	115	115	115	115
8.00%	172	172	172	172	172	172	172

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

105

공시일	2017-09-19
기준일	2017-09-18

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	1,038

* 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	2017-09-19
기준일	2017-09-18

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	429

* 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	2017-09-19
기준일	2017-09-18

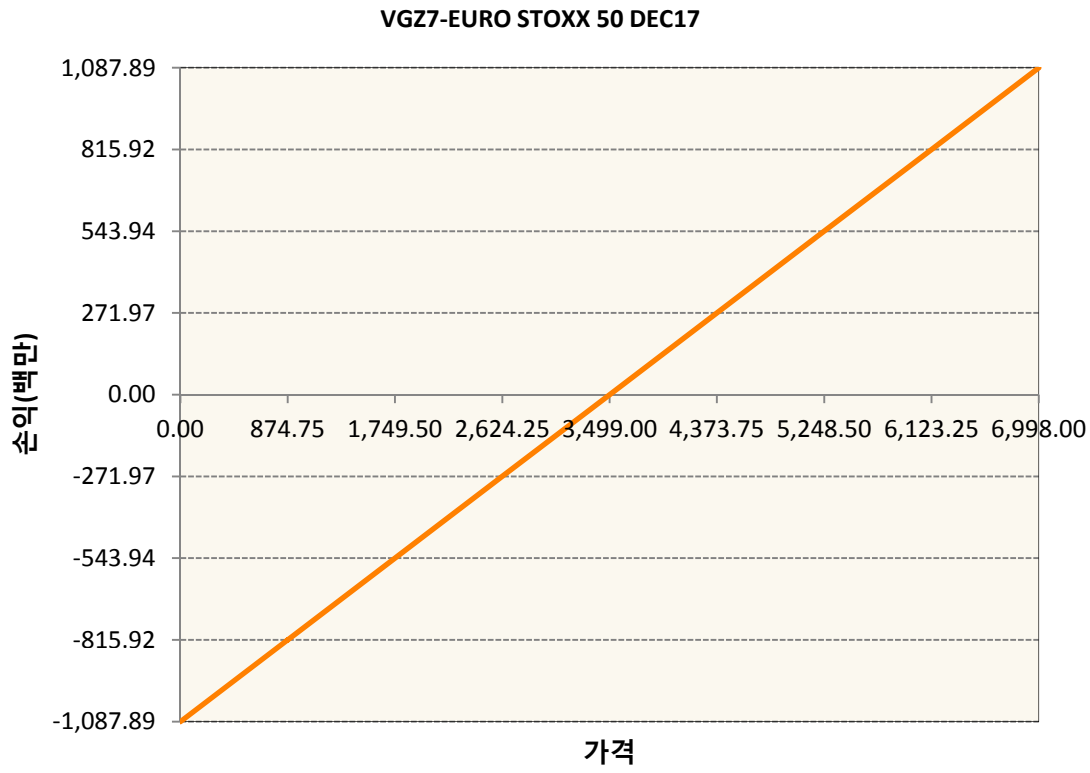
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,088	0	1,088	

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	2017-09-19
기준일	2017-09-18

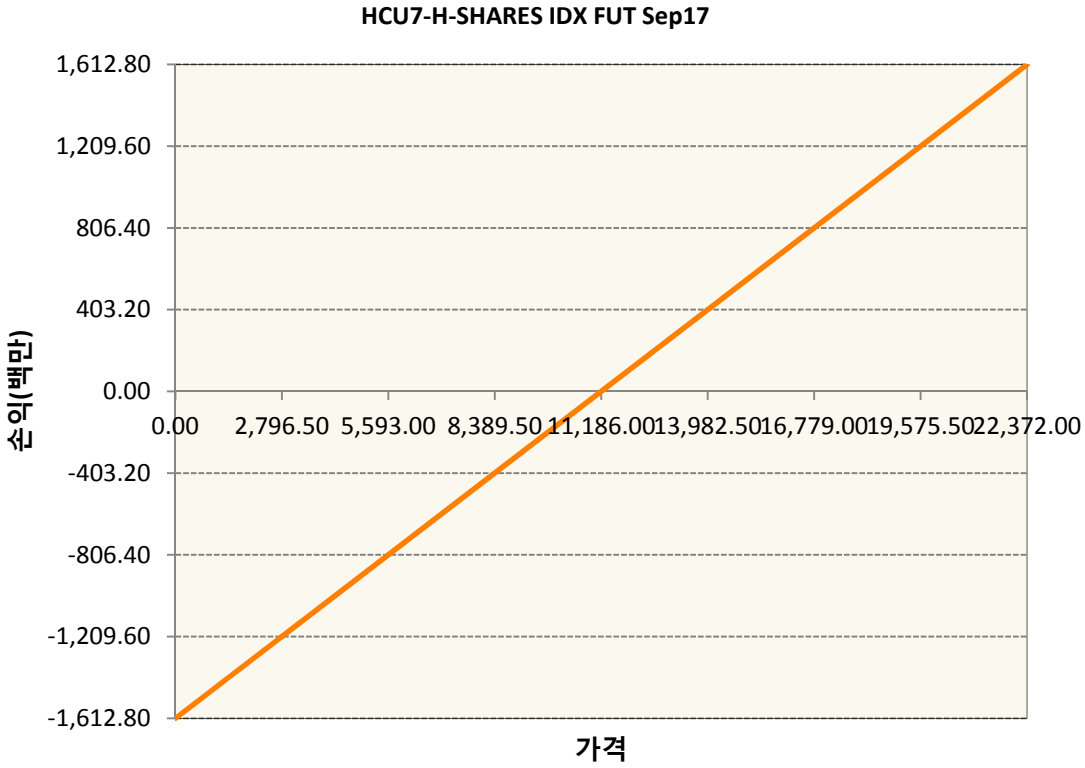
차이나인덱스모(주식-파생형)

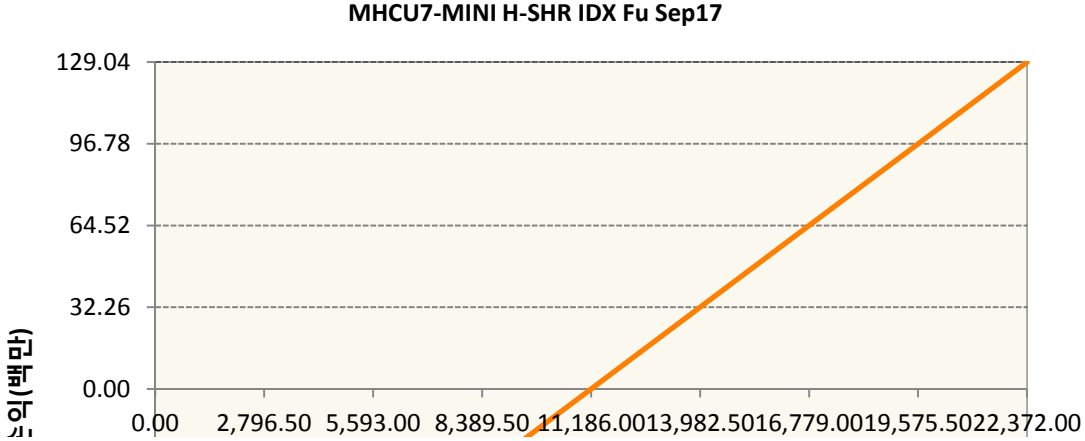
1. 계약금액

(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	129	0	129	
누계	유가증권	선물	1,613	0	1,613	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCU7	H-SHARES IDX FUT Sep17	129
MHCU7	MINI H-SHR IDX Fu Sep17	10

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	118

공시일	2017-09-19
기준일	2017-09-18

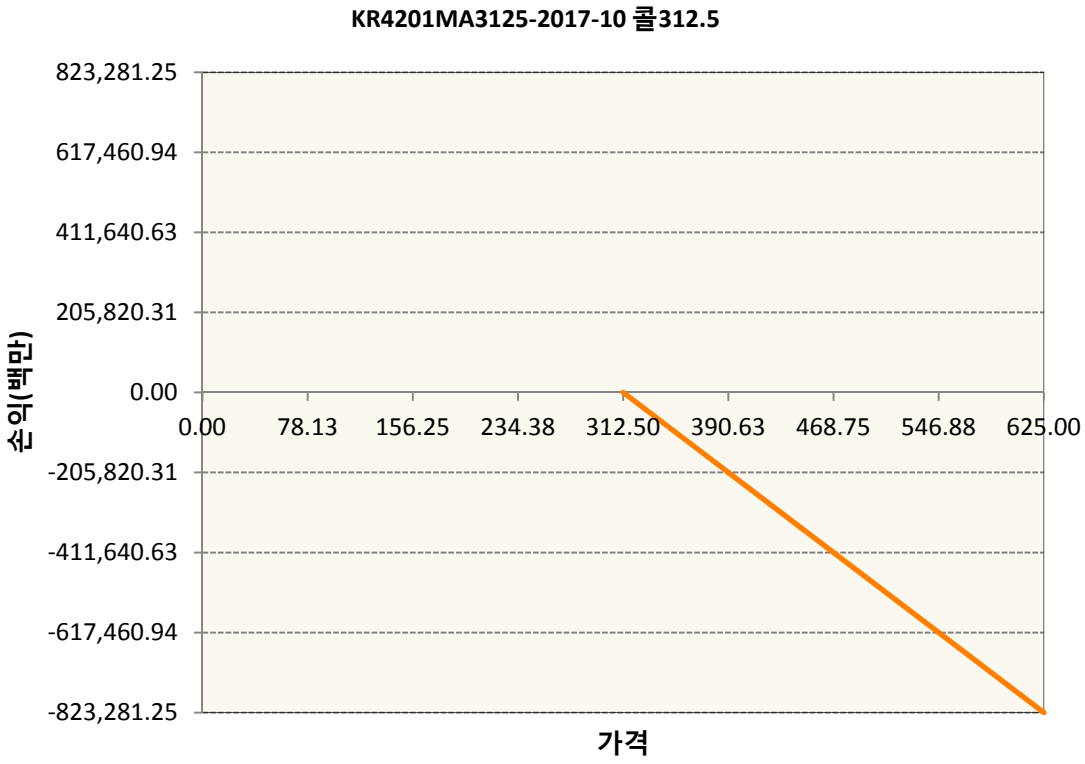
커버드콜모(주식혼합-파생형)

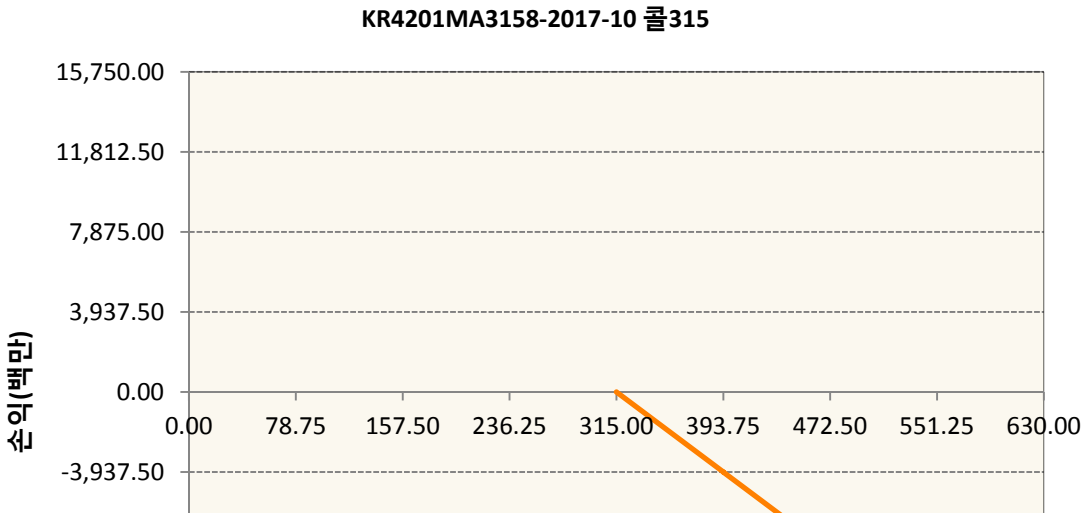
1. 계약금액

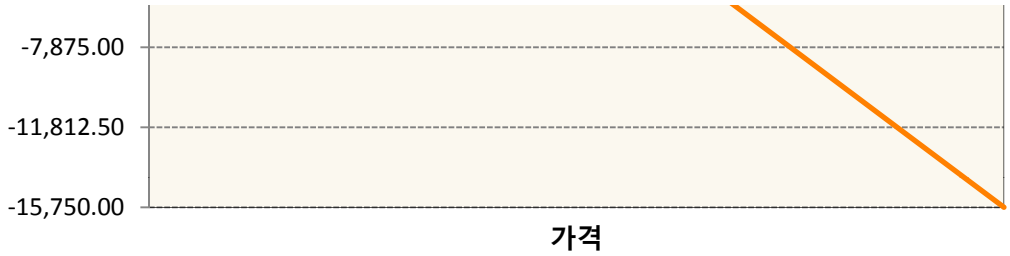
(단위:백만원)

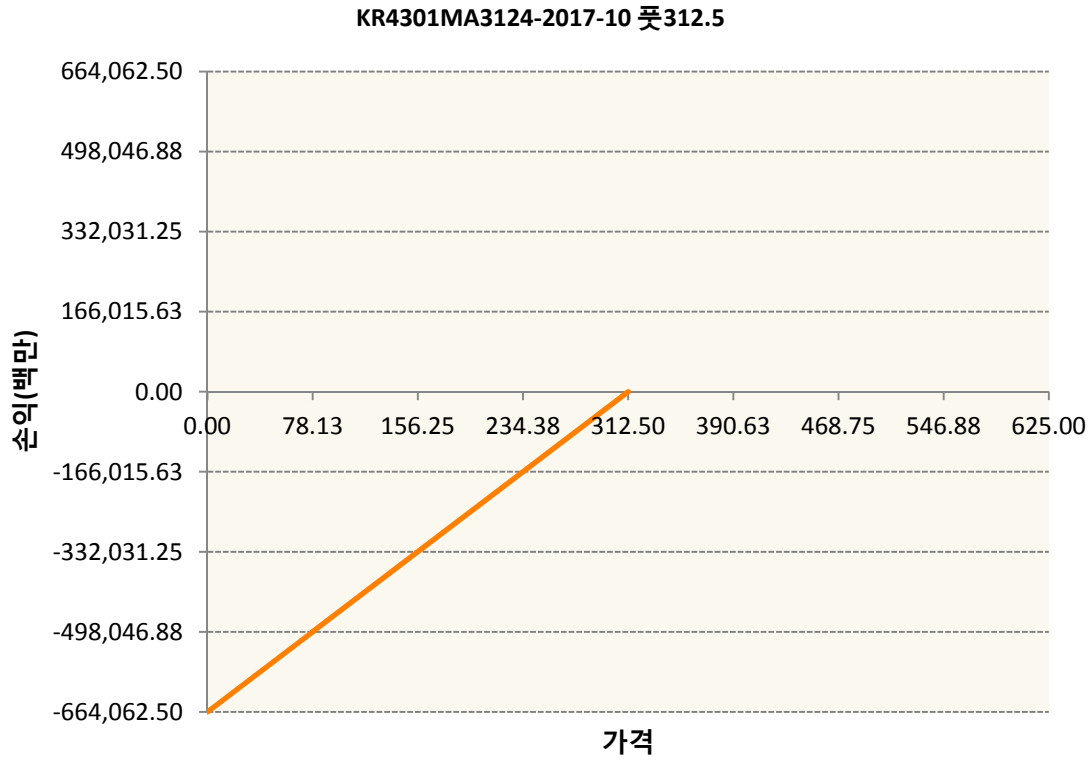
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	38,897	26,964	11,933	장내
누계	유가증권	옵션	0	1,503,094	-1,503,094	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201MA3 2017-10 콜312.5							57,751
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	27,829	27,216	26,490	25,667	24,761	23,782	22,741
-5.33%	24,636	23,445	22,192	20,891	19,552	18,183	16,788
-2.67%	17,232	15,655	14,075	12,492	10,909	9,324	7,738
0%	4,470	3,004	1,512	0	-1,527	-3,066	-4,615
2.67%	-13,014	-13,998	-15,076	-16,233	-17,453	-18,724	-20,040
5.33%	-33,454	-33,943	-34,553	-35,274	-36,093	-36,998	-37,979
8.00%	-55,239	-55,424	-55,699	-56,071	-56,540	-57,102	-57,751
KR4201MA3 2017-10 콜315							1,059
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	461	452	441	427	412	396	378

-5.33%	416	396	375	352	329	305	280
-2.67%	302	273	244	214	185	155	125
0%	90	60	30	0	-30	-60	-91
2.67%	-218	-240	-264	-288	-314	-340	-367
5.33%	-593	-605	-619	-635	-653	-673	-694
8.00%	-1,001	-1,005	-1,012	-1,021	-1,032	-1,045	-1,059
KR4301MA3 2017-10 풋312.5							35,822

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-31,719	-32,213	-32,798	-33,462	-34,194	-34,983	-35,822
-5.33%	-16,239	-17,200	-18,210	-19,259	-20,339	-21,444	-22,570
-2.67%	-4,156	-5,428	-6,703	-7,979	-9,256	-10,535	-11,814
0%	3,605	2,423	1,219	0	-1,232	-2,473	-3,723
2.67%	7,558	6,765	5,895	4,962	3,978	2,952	1,891
5.33%	9,127	8,732	8,240	7,659	6,998	6,268	5,476
8.00%	9,610	9,460	9,238	8,938	8,561	8,107	7,583

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

93,949

공시일	2017-09-19
기준일	2017-09-18

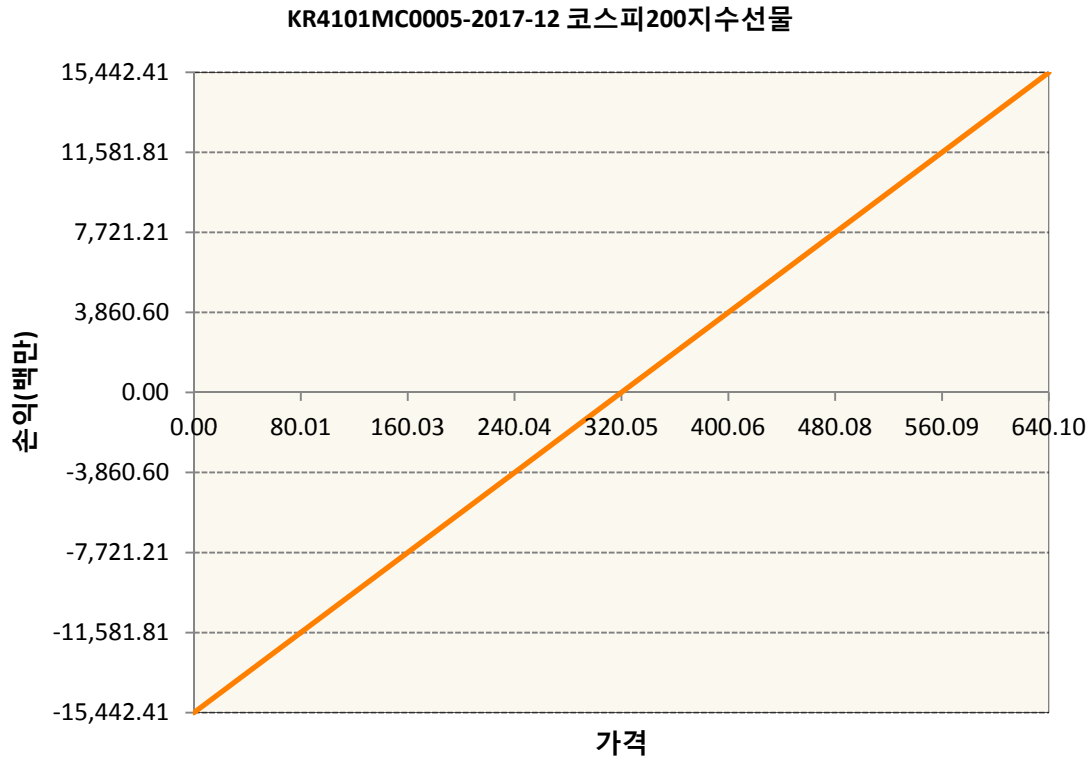
ETF스마트레버리지목표전환형6호

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	15,442	0	15,442	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101MC0	2017-12 코스피200지수선물						1,231
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,231	-1,231	-1,231	-1,231	-1,231	-1,231	-1,231
-5.33%	-821	-821	-821	-821	-821	-821	-821
-2.67%	-410	-410	-410	-410	-410	-410	-410
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	410	410	410	410	410	410	410
5.33%	821	821	821	821	821	821	821
8.00%	1,231	1,231	1,231	1,231	1,231	1,231	1,231

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

748

공시일	2017-09-19
기준일	2017-09-18

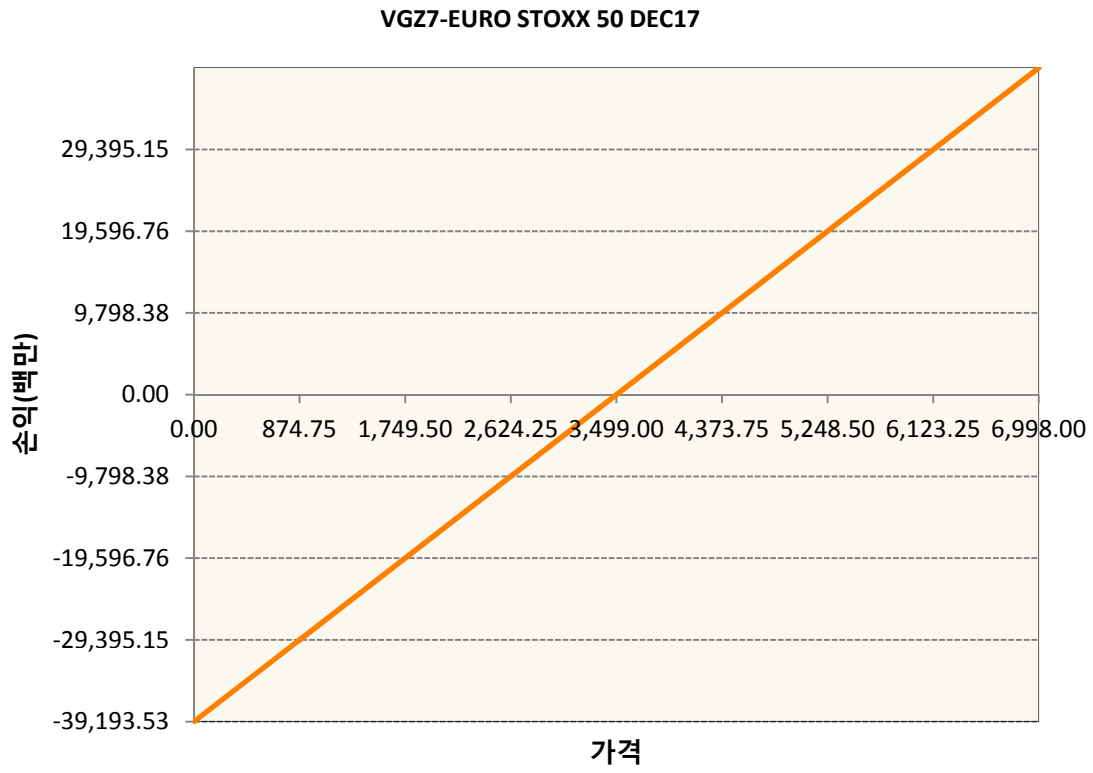
유로커버드콜(주식혼합-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	3	0	3	
누계	유가증권	선물	39,194	0	39,194	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGZ7	EURO STOXX 50 DEC17	3,136

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

(단위:백만원)

2,470

공시일	2017-09-19
기준일	2017-09-18

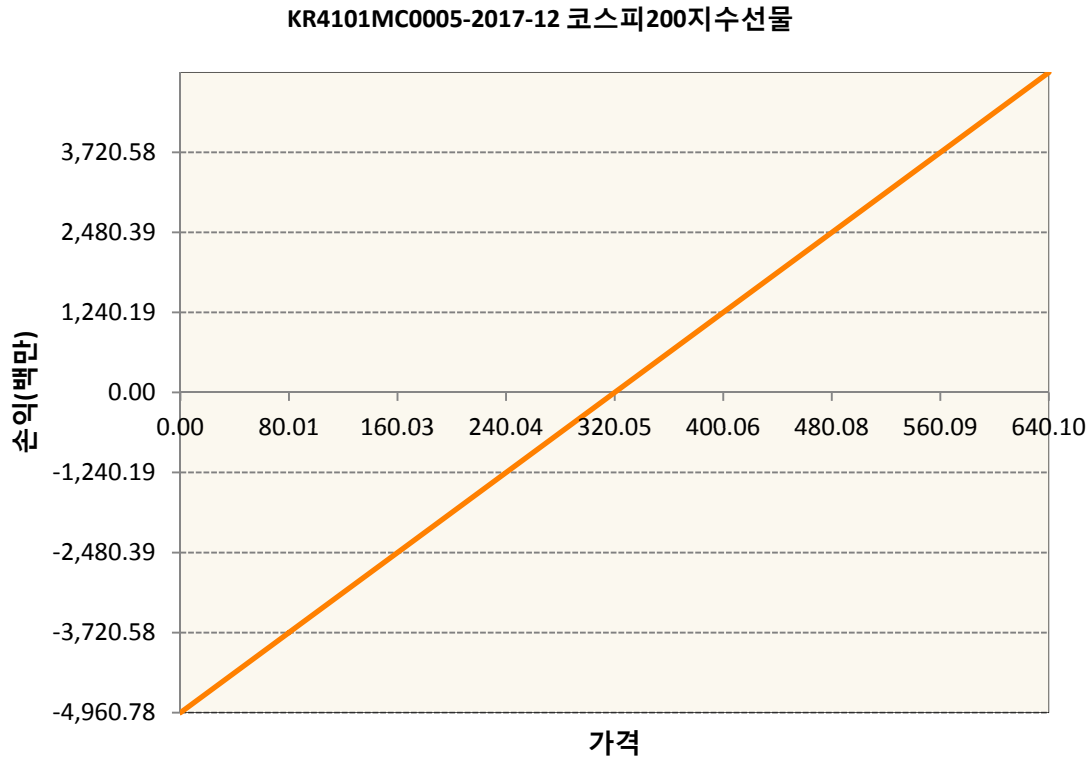
ETF스마트레버리지목표전환형7호

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	4,961	0	4,961	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101MC0	2017-12 코스피200지수선물	395

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-395	-395	-395	-395	-395	-395	-395
-5.33%	-264	-264	-264	-264	-264	-264	-264
-2.67%	-132	-132	-132	-132	-132	-132	-132
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	132	132	132	132	132	132	132
5.33%	264	264	264	264	264	264	264
8.00%	395	395	395	395	395	395	395

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

240

공시일	2017-09-19
기준일	2017-09-18

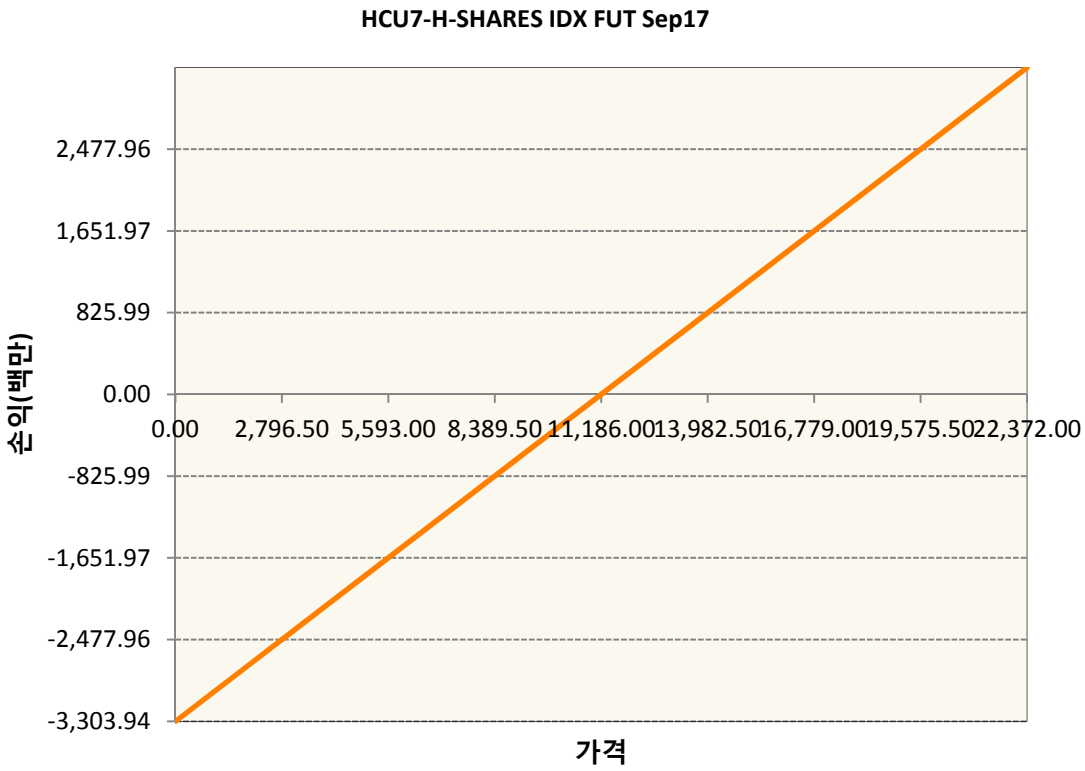
홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생

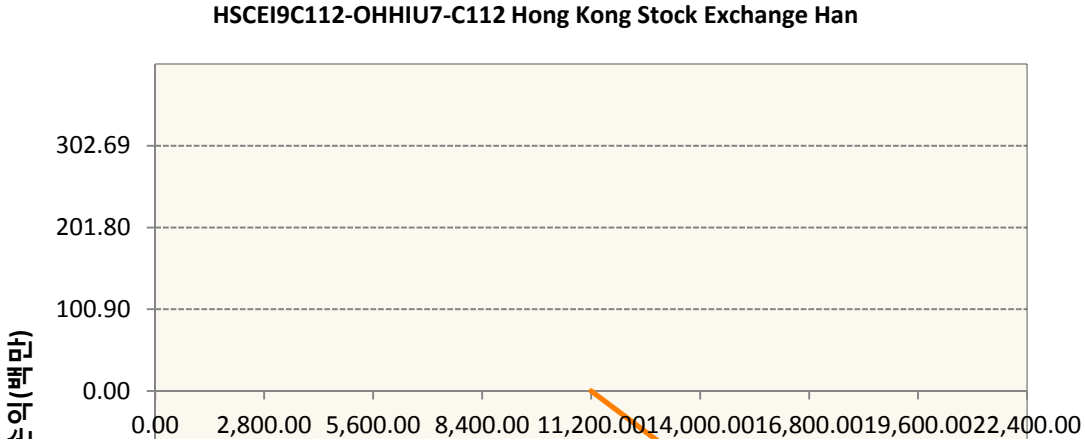
1. 계약금액

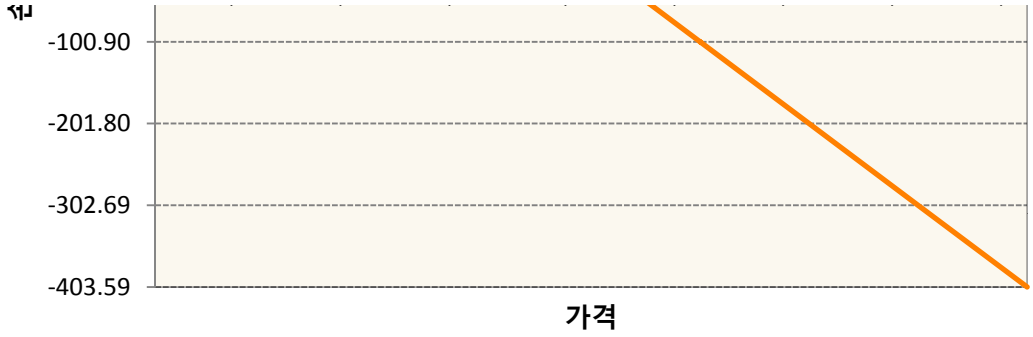
(단위:백만원)

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	3,304	0	3,304	장내
누계	유가증권	옵션	0	8,037	-8,037	장내

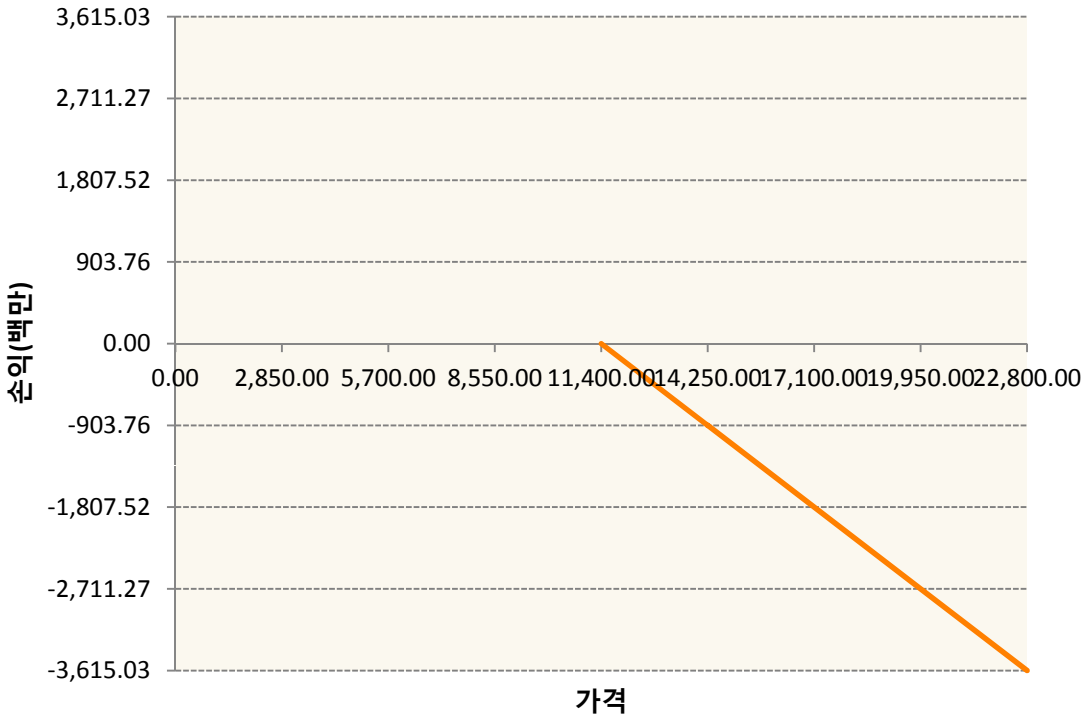
2. 만기시점의 손익구조



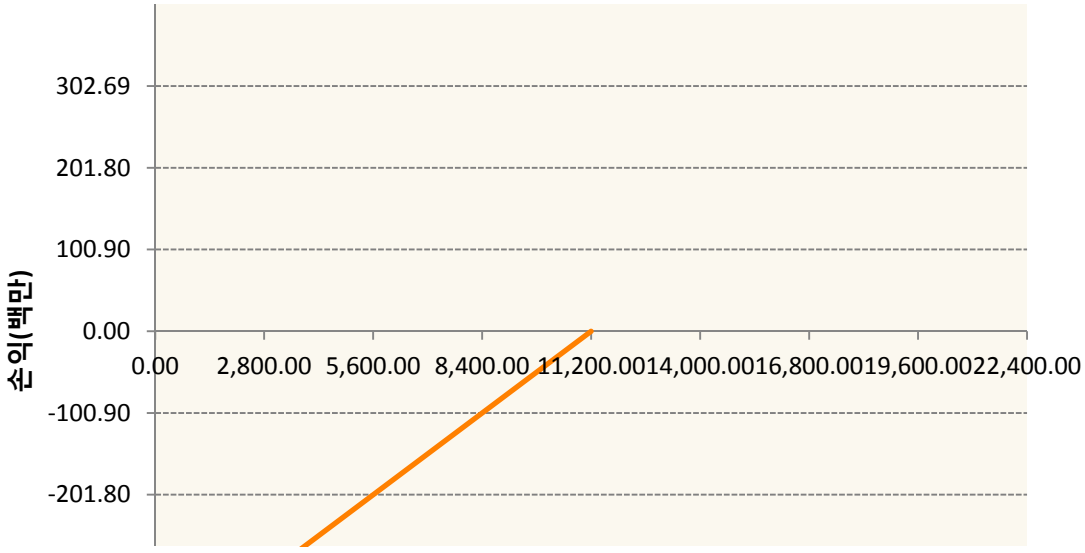


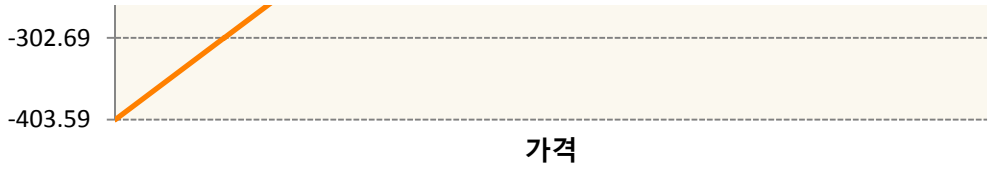


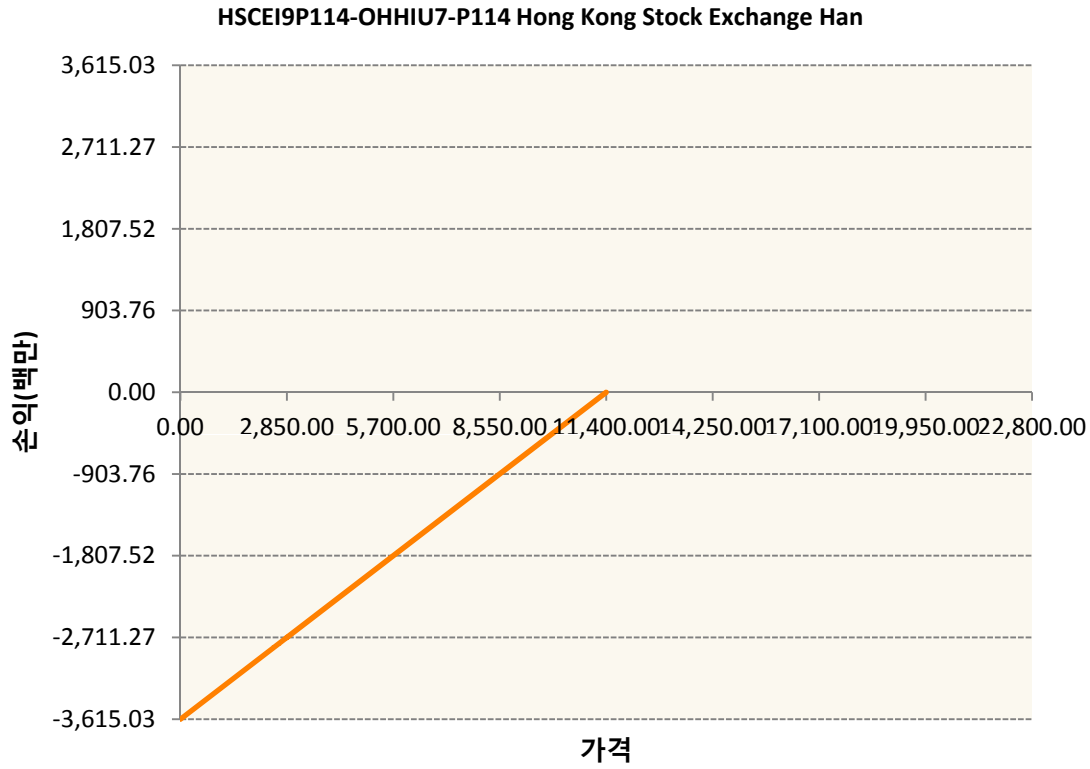
HSCEI9C114-OHHIU7-C114 Hong Kong Stock Exchange Han



HSCEI9P112-OHHIU7-P112 Hong Kong Stock Exchange Han







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

HCU7	H-SHARES IDX FUT Sep17	264
HSCEI9C112	OHHIU7-C112 Hong Kong Stock Exchange Han	32
HSCEI9C114	OHHIU7-C114 Hong Kong Stock Exchange Han	289
HSCEI9P112	OHHIU7-P112 Hong Kong Stock Exchange Han	32
HSCEI9P114	OHHIU7-P114 Hong Kong Stock Exchange Han	289

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

768

공시일	2017-09-19
기준일	2017-09-18

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼

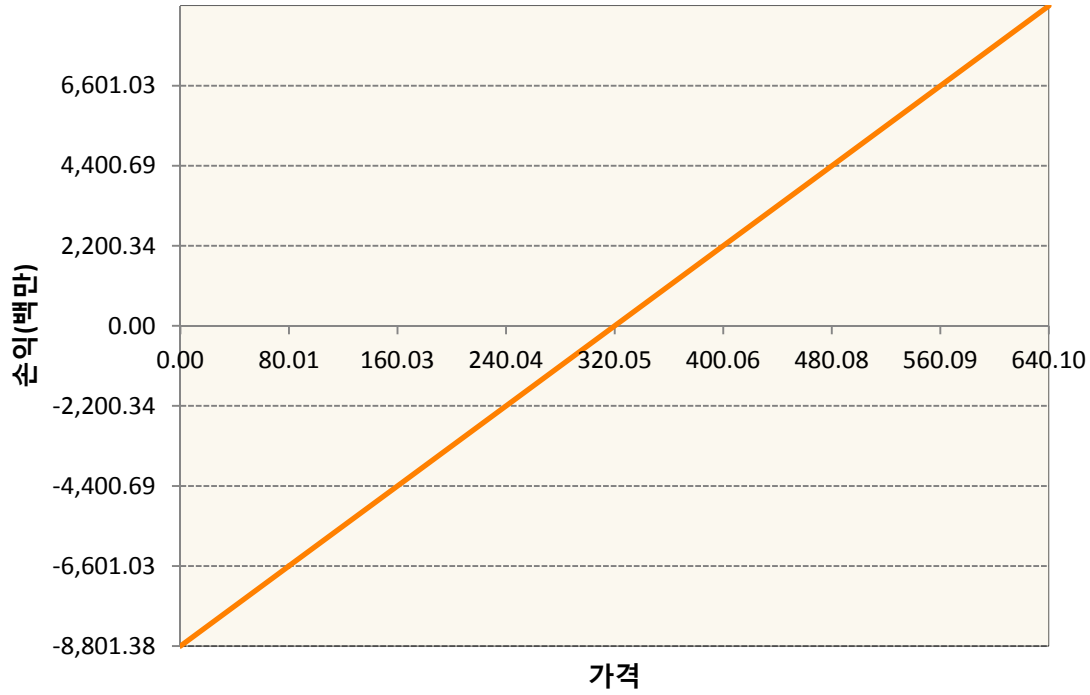
1. 계약금액

(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	8,801	0	8,801	장내
누계	유가증권	스왑	22,000	0	22,000	장외
누계	유가증권	옵션	0	22,656	-22,656	장내

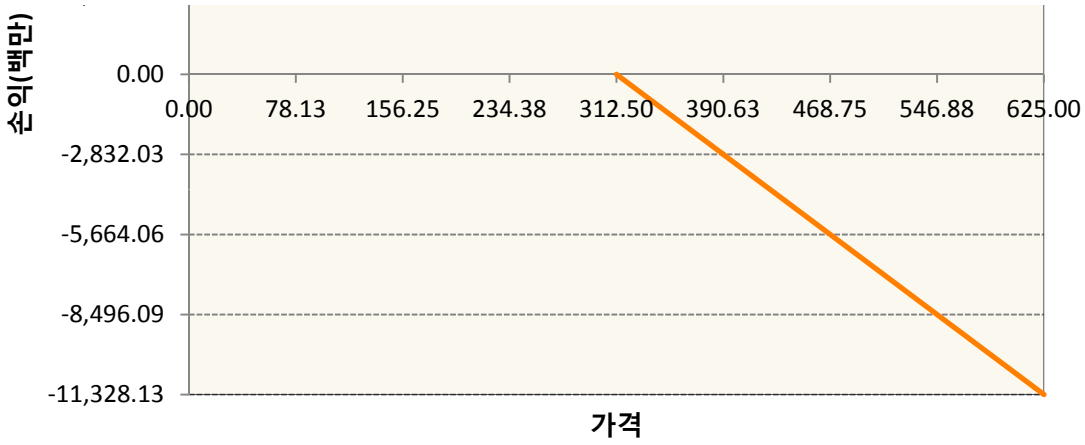
2. 만기시점의 손익구조

KR4101MC0005-2017-12 코스피200지수선물

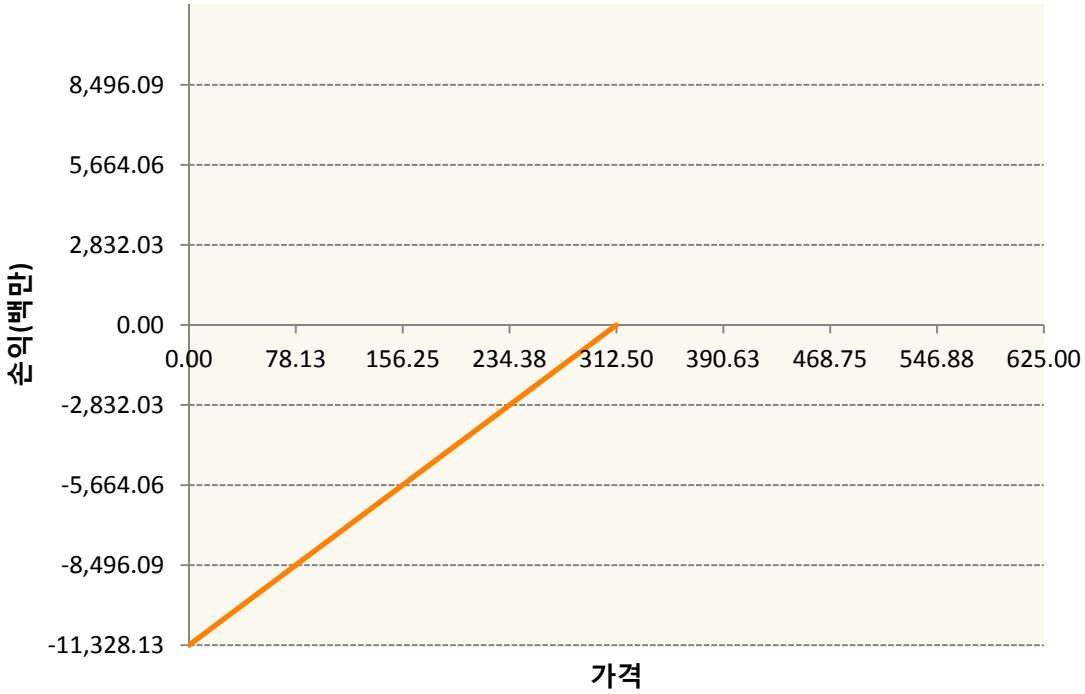


KR4201MA3125-2017-10 콜312.5





KR4301MA3124-2017-10 풋312.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_2							1,483
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,483	-1,483	-1,483	-1,483	-1,483	-1,483	-1,483
-5.33%	-988	-988	-988	-988	-988	-988	-988
-2.67%	-494	-494	-494	-494	-494	-494	-494
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	494	494	494	494	494	494	494
5.33%	988	988	988	988	988	988	988
8.00%	1,483	1,483	1,483	1,483	1,483	1,483	1,483

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						702
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-702	-702	-702	-702	-702	-702	-702
-5.33%	-468	-468	-468	-468	-468	-468	-468
-2.67%	-234	-234	-234	-234	-234	-234	-234
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	234	234	234	234	234	234	234
5.33%	468	468	468	468	468	468	468
8.00%	702	702	702	702	702	702	702
KR4201MA3 2017-10 콜312.5							795
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	383	374	365	353	341	327	313
-5.33%	339	323	305	287	269	250	231
-2.67%	237	215	194	172	150	128	106
0%	62	41	21	0	-21	-42	-64
2.67%	-179	-193	-207	-223	-240	-258	-276
5.33%	-460	-467	-475	-485	-497	-509	-523
8.00%	-760	-763	-766	-772	-778	-786	-795
KR4301MA3 2017-10 풋312.5							611
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-541	-550	-560	-571	-583	-597	-611
-5.33%	-277	-293	-311	-329	-347	-366	-385
-2.67%	-71	-93	-114	-136	-158	-180	-202
0%	62	41	21	0	-21	-42	-64
2.67%	129	115	101	85	68	50	32
5.33%	156	149	141	131	119	107	93
8.00%	164	161	158	152	146	138	129

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

3,577

공시일	2017-09-19
기준일	2017-09-18

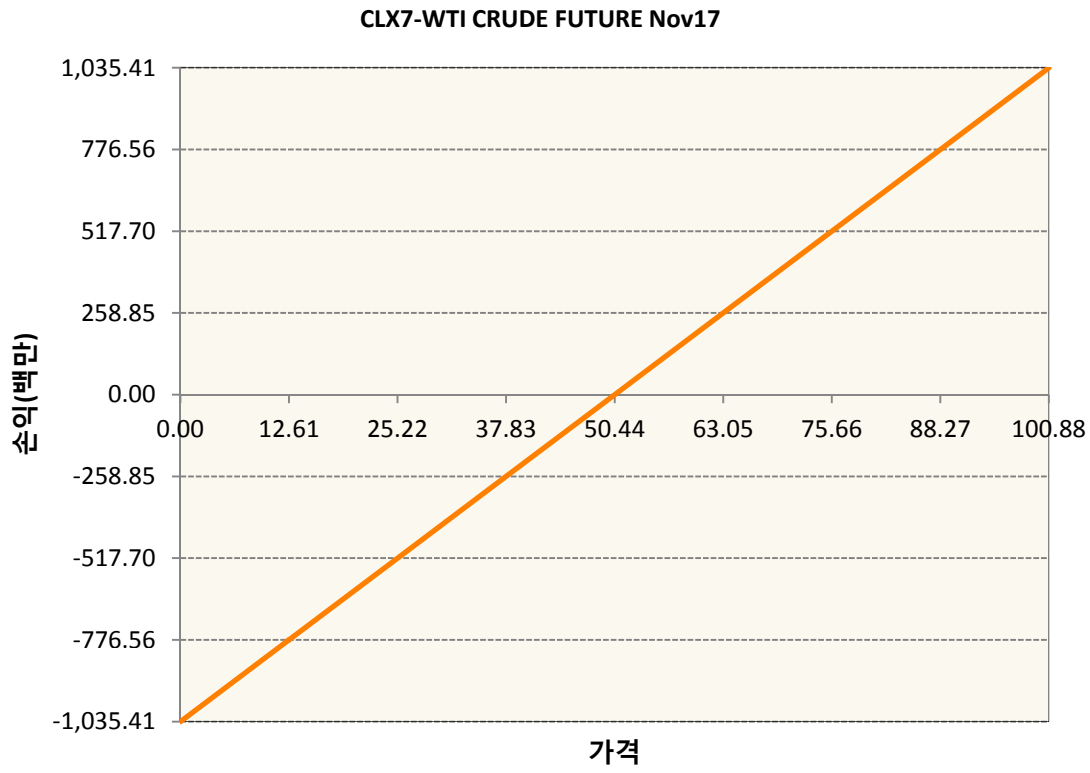
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

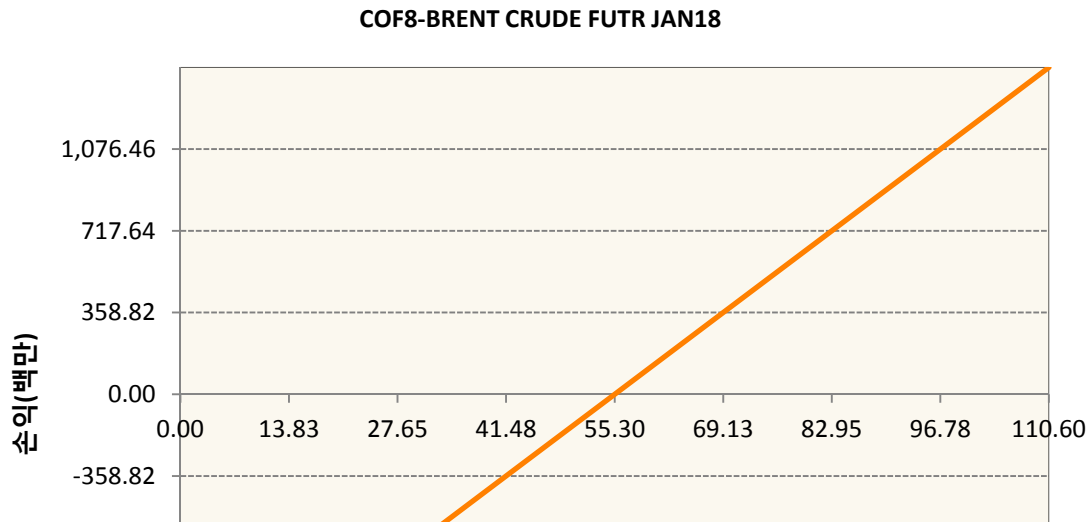
1. 계약금액

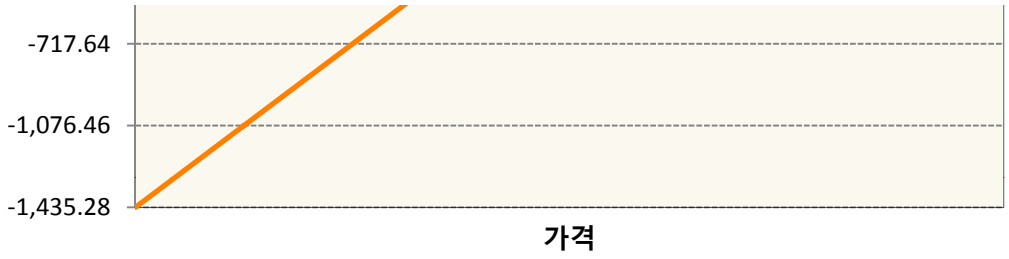
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	5,334	619	4,714	

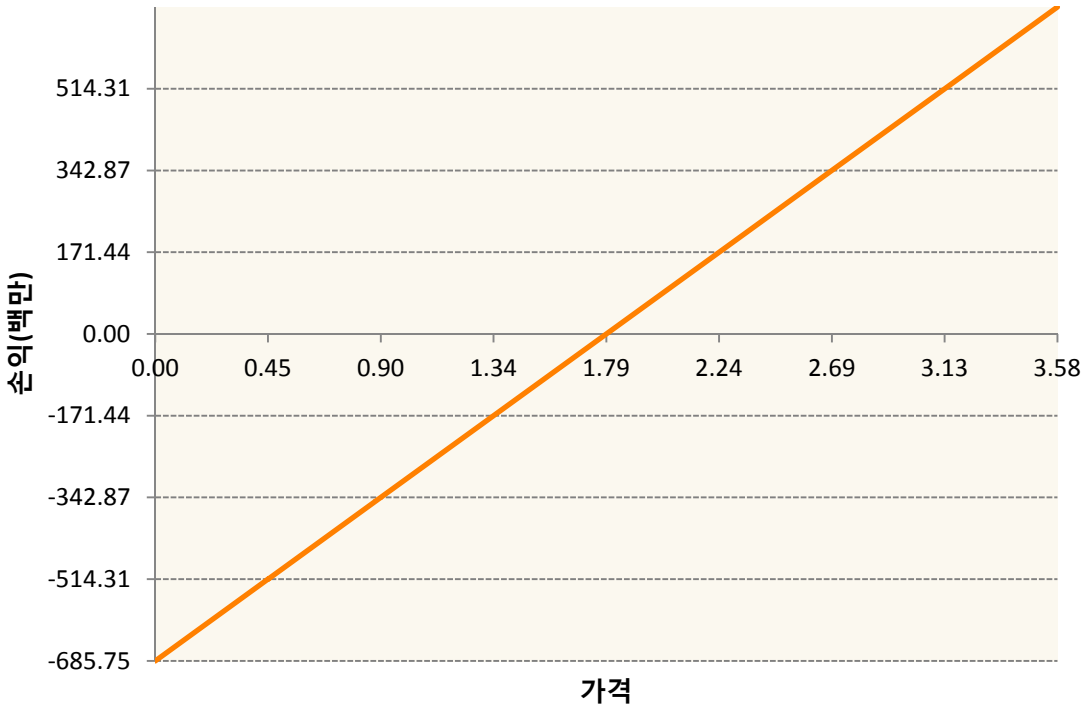
2. 만기시점의 손익구조



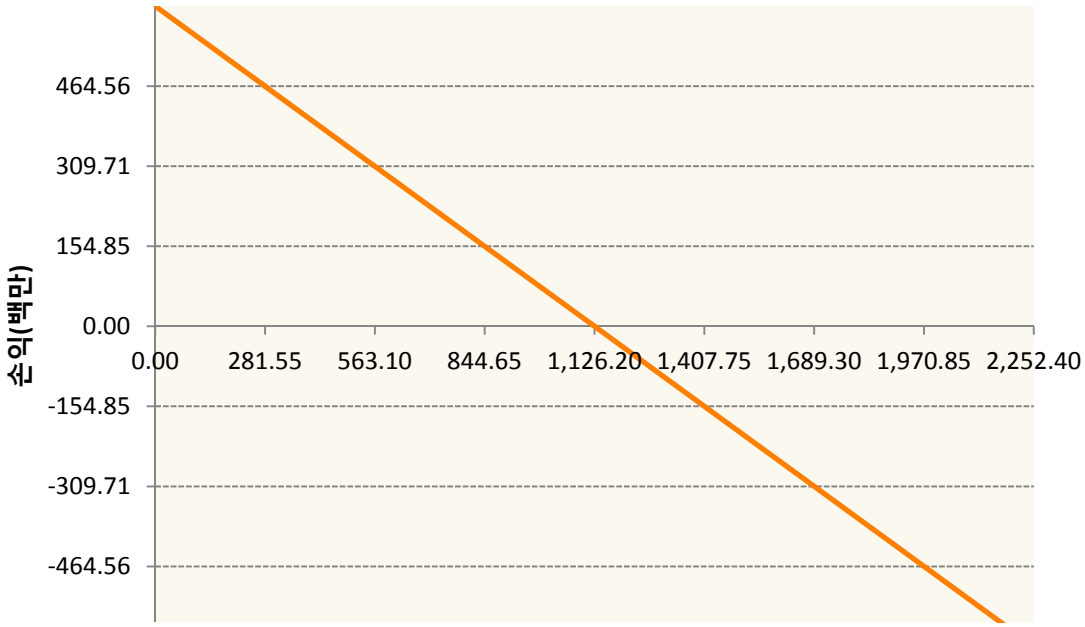


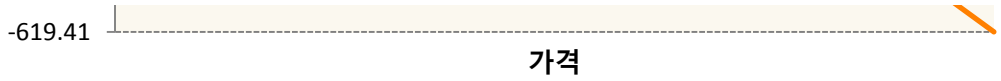


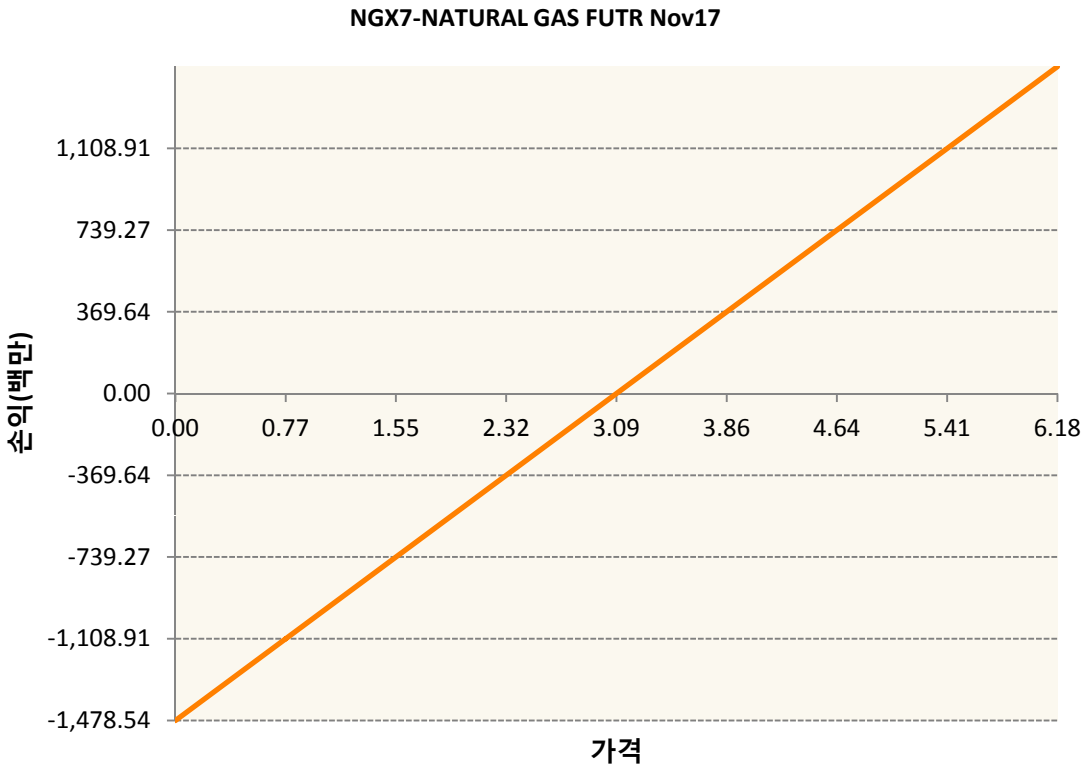
HOX7-NY Harb ULSD Fut Nov17

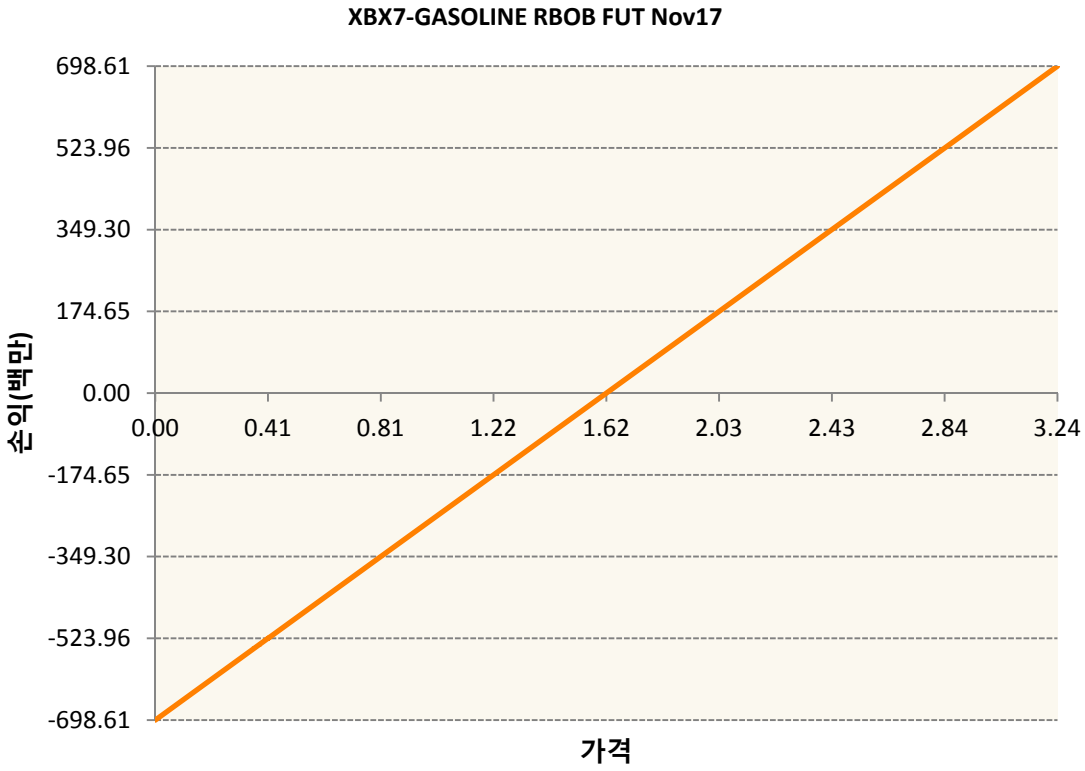


KR4175MA0008-2017-10 달러선물




-619.41
가격


NGX7-NATURAL GAS FUTR Nov17
1,108.91
739.27
369.64
0.00
-369.64
-739.27
-1,108.91
-1,478.54
0.00
0.77
1.55
2.32
3.09
3.86
4.64
5.41
6.18
손익(백만)
가격


XBX7-GASOLINE RBOB FUT Nov17
698.61
523.96
349.30
174.65
0.00
-174.65
-349.30
-523.96
-698.61
0.00
0.41
0.81
1.22
1.62
2.03
2.43
2.84
3.24
손익(백만)
가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLX7	WTI CRUDE FUTURE Nov17	83
COF8	BRENT CRUDE FUTR JAN18	115
HOX7	NY Harb ULSD Fut Nov17	55
KR4175MA0	2017-10 달러선물	50
NGX7	NATURAL GAS FUTR Nov17	118
XBX7	GASOLINE RBOB FUT Nov17	56

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

771

공시일	2017-09-19
기준일	2017-09-18

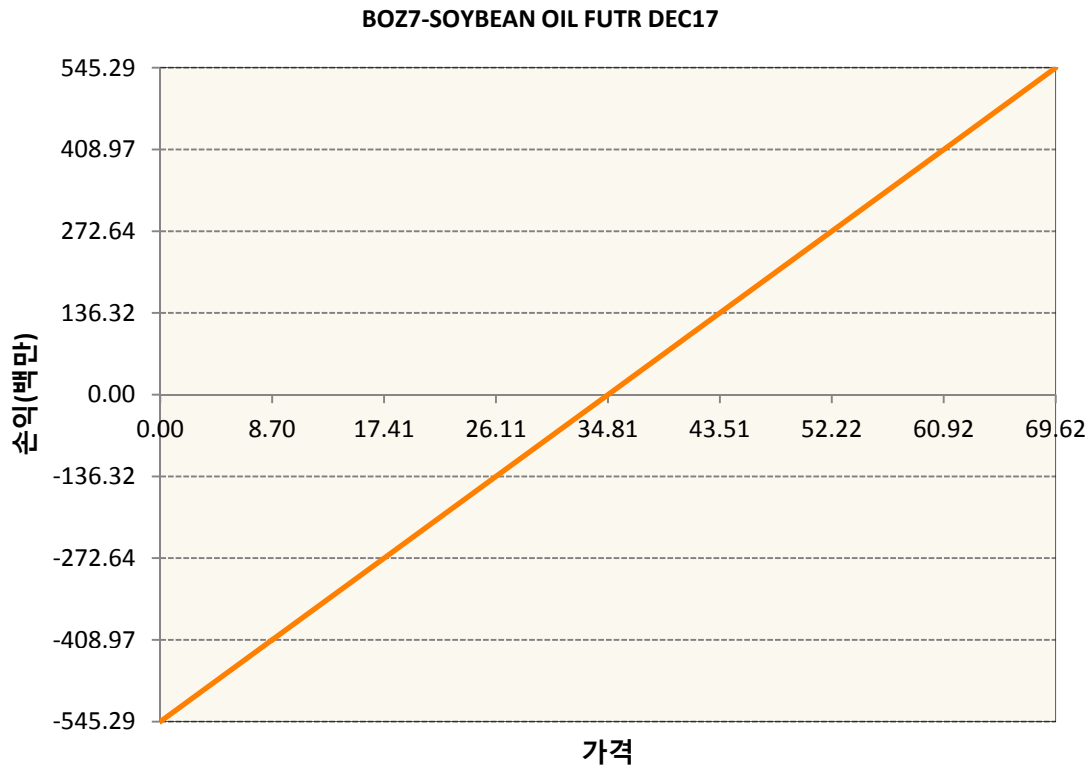
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

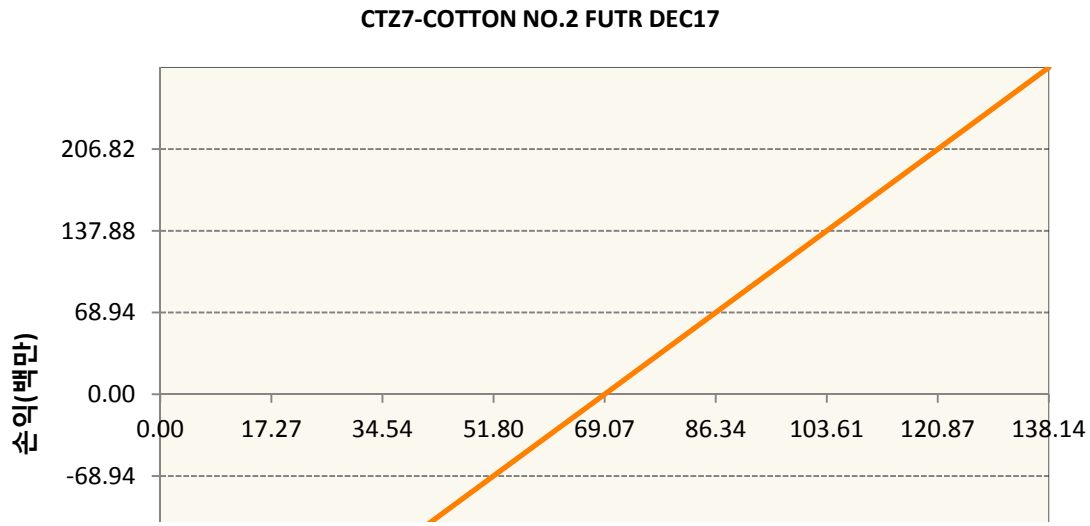
1. 계약금액

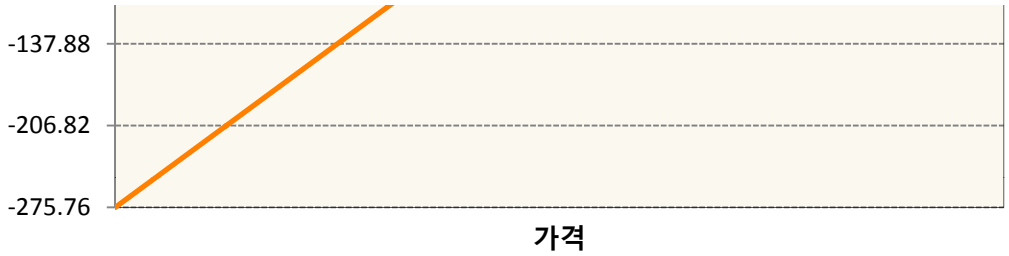
(단위:백만원)

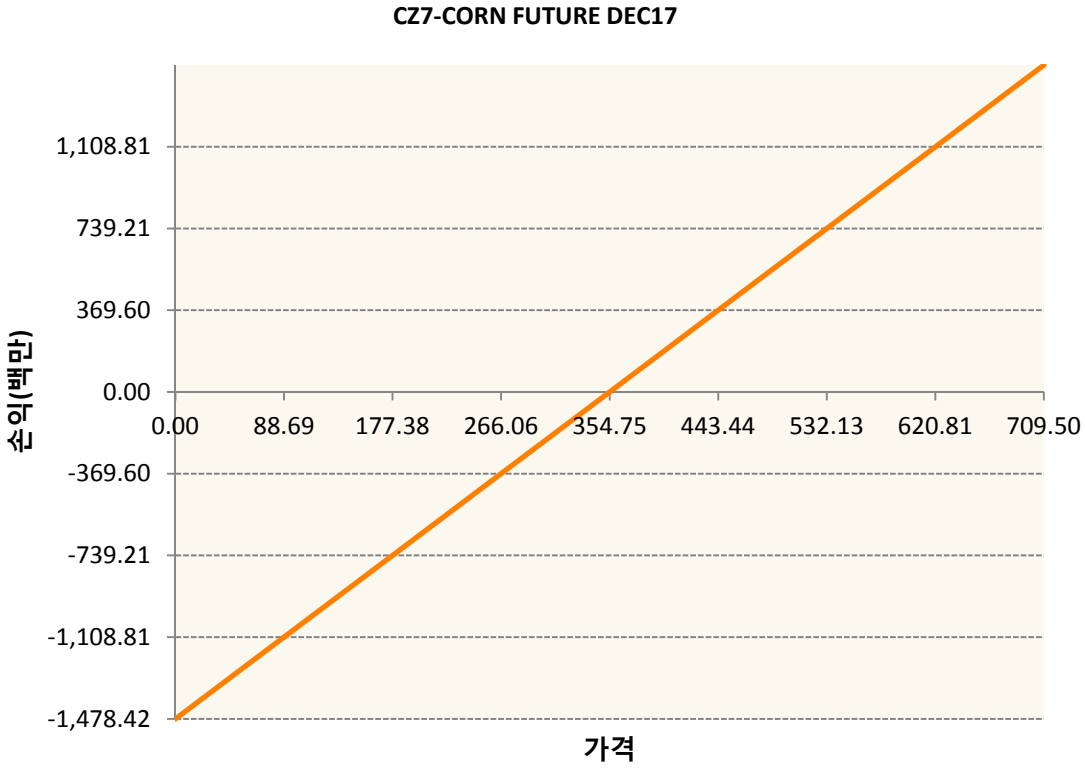
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	5,877	338	5,539	

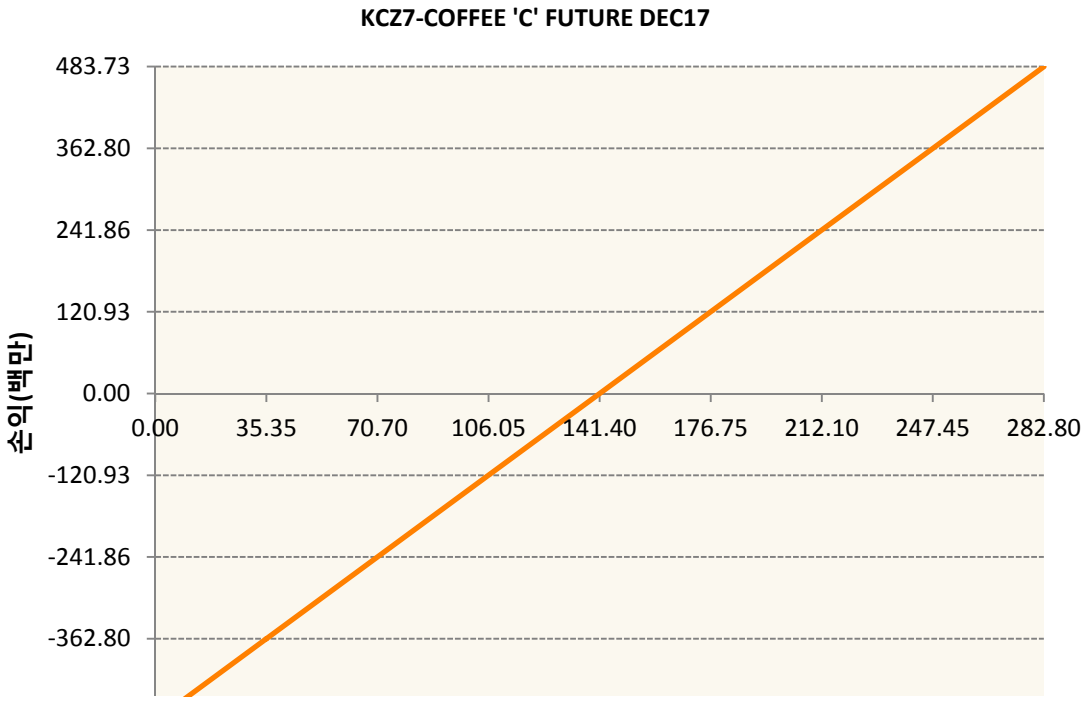
2. 만기시점의 손익구조

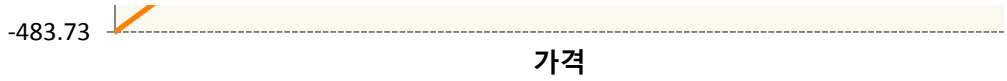


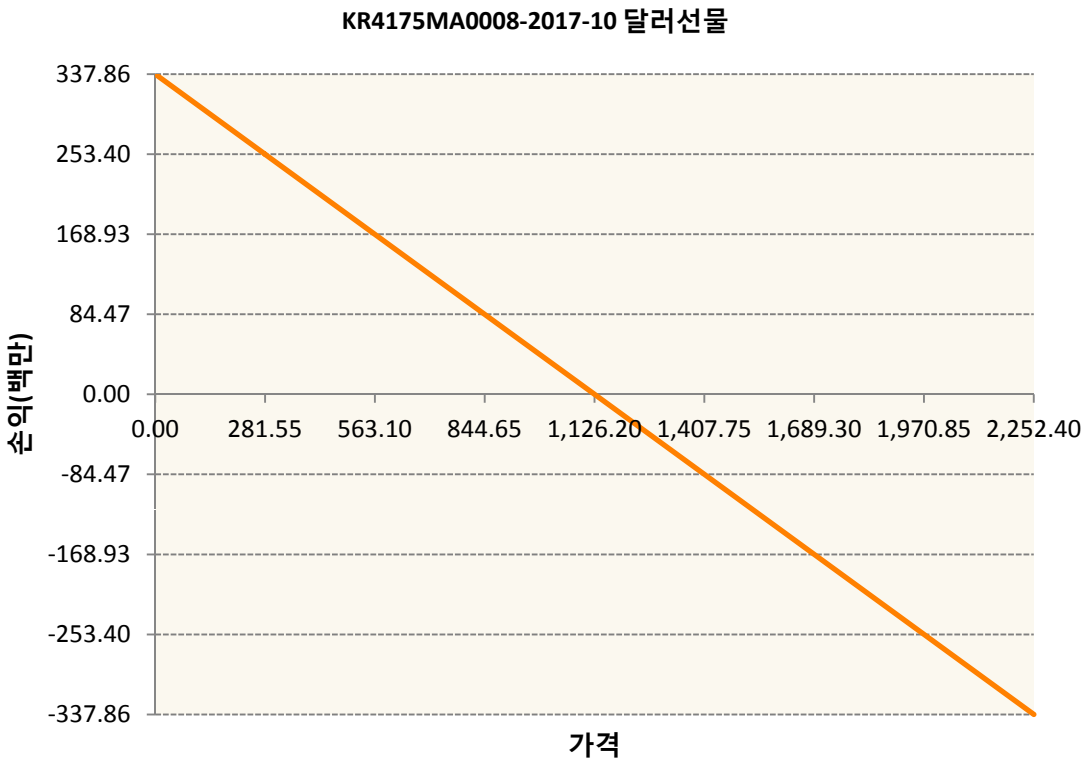


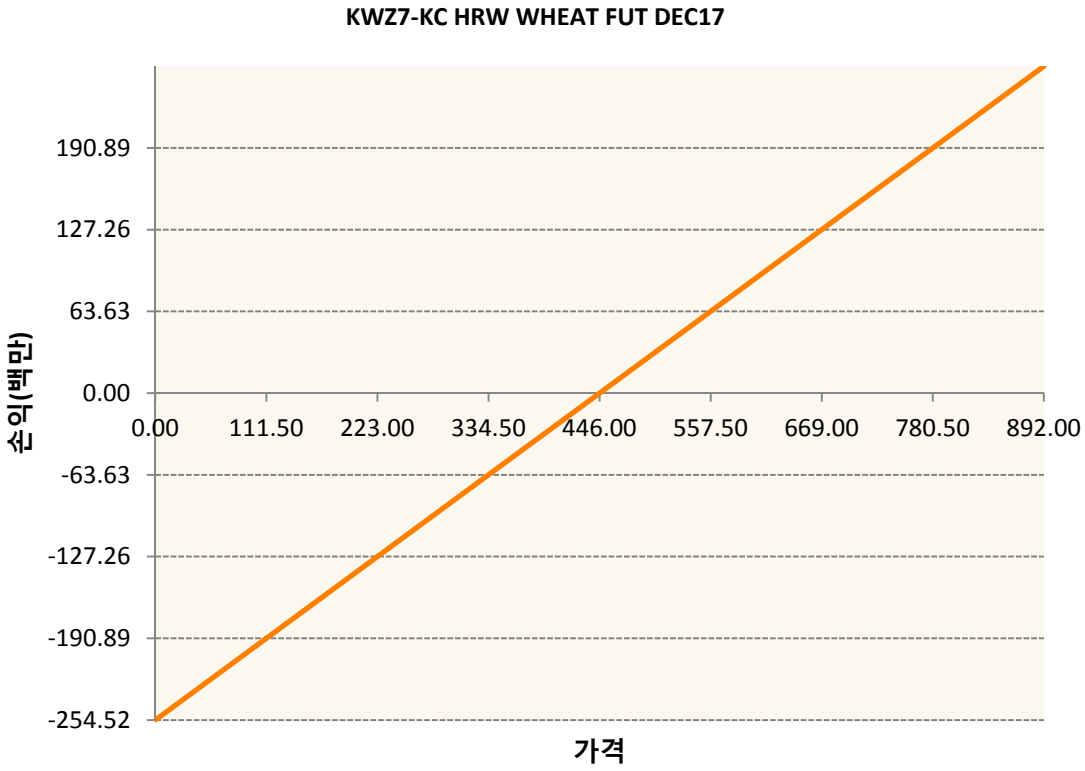

-137.88
-206.82
-275.76
가격


CZ7-CORN FUTURE DEC17
1,108.81
739.21
369.60
0.00
-369.60
-739.21
-1,108.81
-1,478.42
0.00
88.69
177.38
266.06
354.75
443.44
532.13
620.81
709.50
손익(백만)
가격

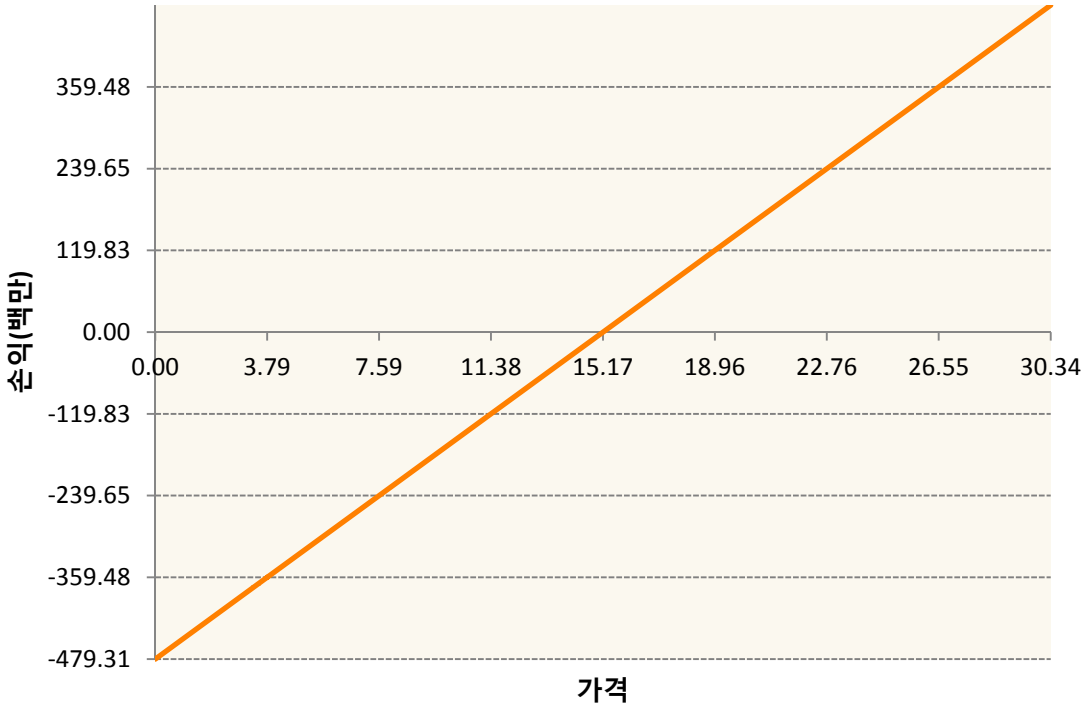

KCZ7-COFFEE 'C' FUTURE DEC17
483.73
362.80
241.86
120.93
0.00
-120.93
-241.86
-362.80
0.00
35.35
70.70
106.05
141.40
176.75
212.10
247.45
282.80
손익(백만)


-483.73
가격

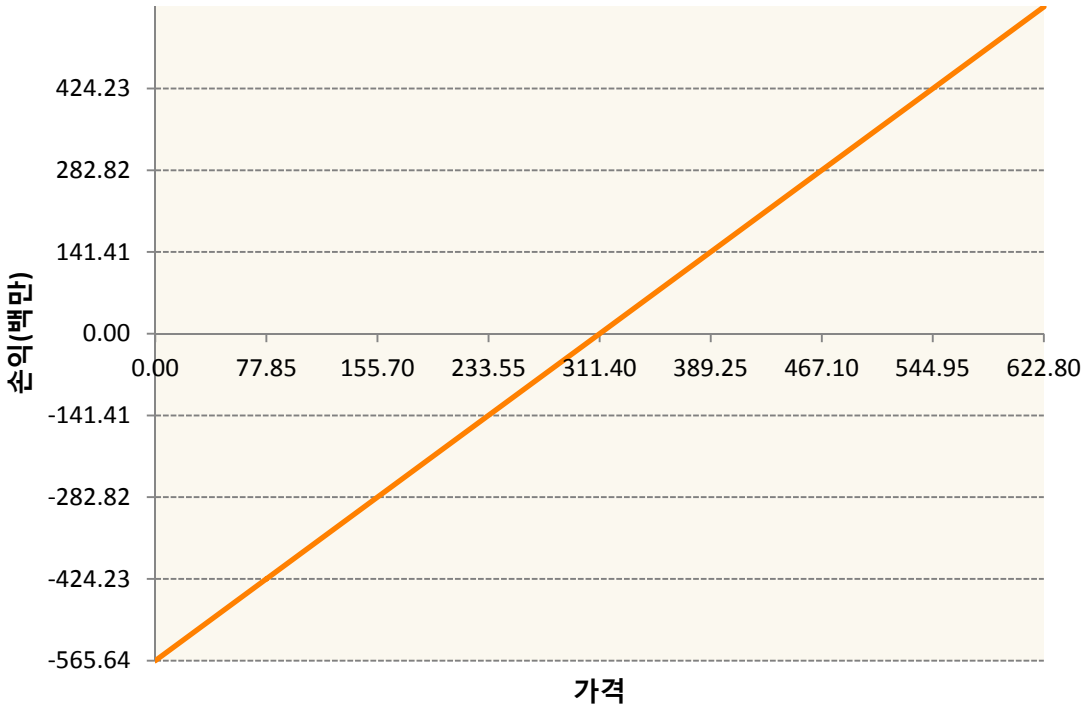

KR4175MA0008-2017-10 달러선물
337.86
253.40
168.93
84.47
0.00
-84.47
-168.93
-253.40
-337.86
0.00
281.55
563.10
844.65
1,126.20
1,407.75
1,689.30
1,970.85
2,252.40
손익(백만)
가격


KWZ7-KC HRW WHEAT FUT DEC17
190.89
127.26
63.63
0.00
-63.63
-127.26
-190.89
-254.52
0.00
111.50
223.00
334.50
446.00
557.50
669.00
780.50
892.00
손익(백만)
가격

SBH8-Sugar #11 (WORLD) MAR18

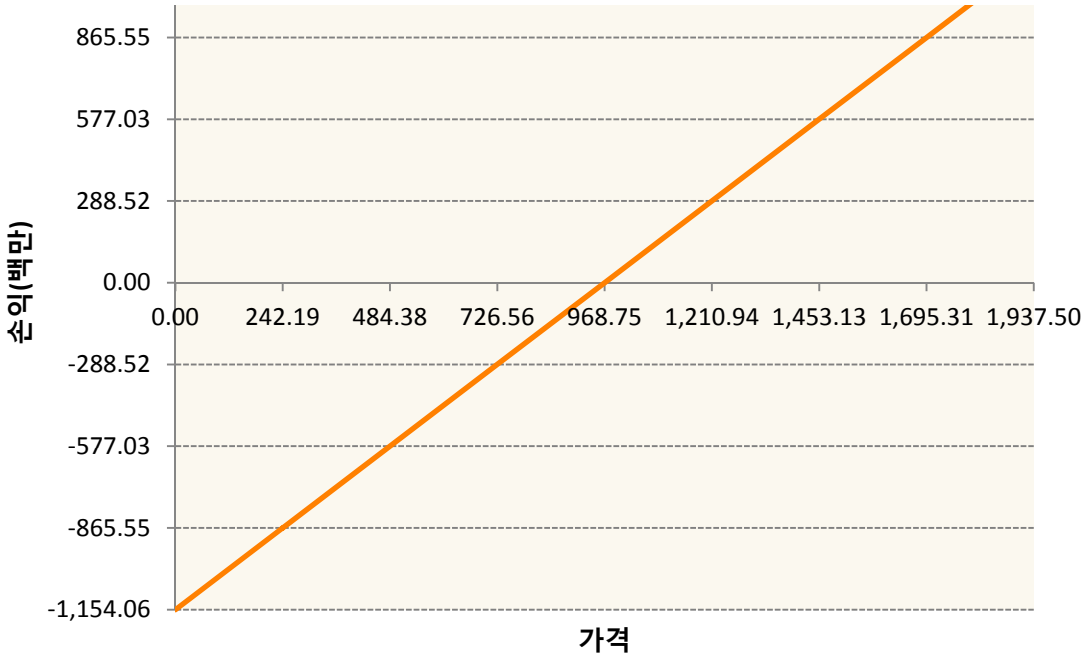


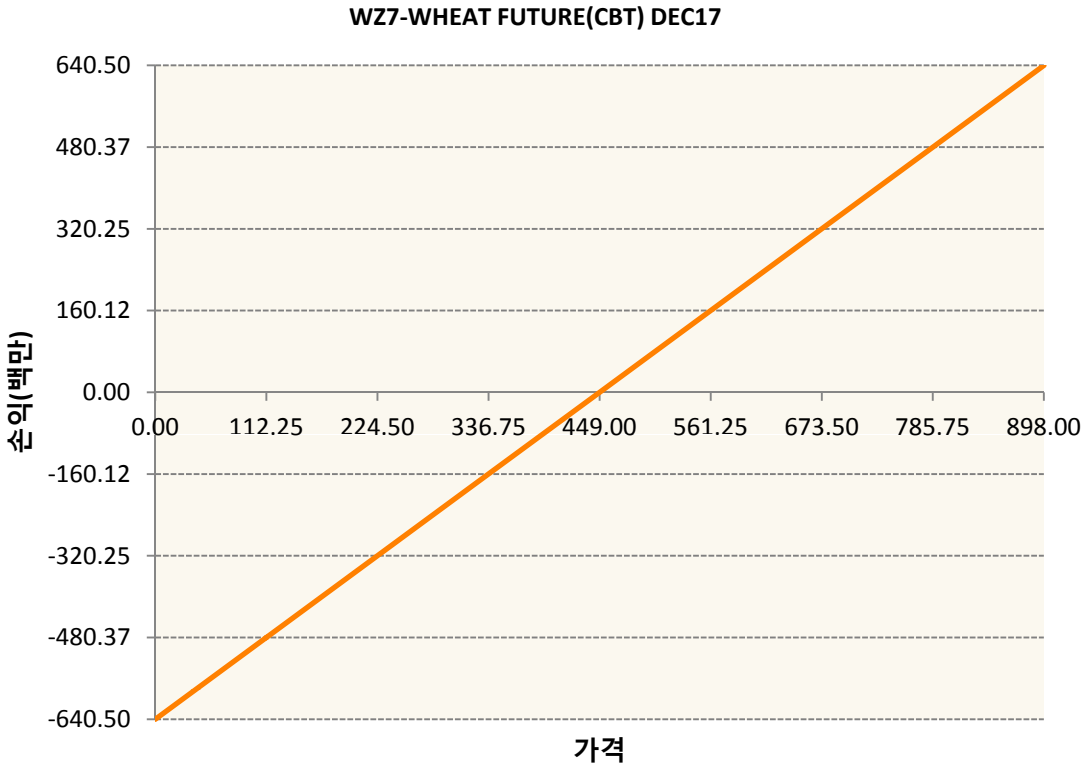
SMZ7-SOYBEAN MEAL FUTR DEC17



SX7-SOYBEAN FUTURE NOV17







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

BOZ7	SOYBEAN OIL FUTR DEC17	44
CTZ7	COTTON NO.2 FUTR DEC17	22
CZ7	CORN FUTURE DEC17	118
KCZ7	COFFEE 'C' FUTURE DEC17	39
KR4175MA0	2017-10 달러선물	27

KWZ7	KC HRW WHEAT FUT DEC17	20
SBH8	Sugar #11 (WORLD) MAR18	38
SMZ7	SOYBEAN MEAL FUTR DEC17	45
SX7	SOYBEAN FUTURE NOV17	92
WZ7	WHEAT FUTURE(CBT) DEC17	51

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

555