공시일	2017-09-20
기준일	2017-09-19

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	2017-09-20
기준일	2017-09-19

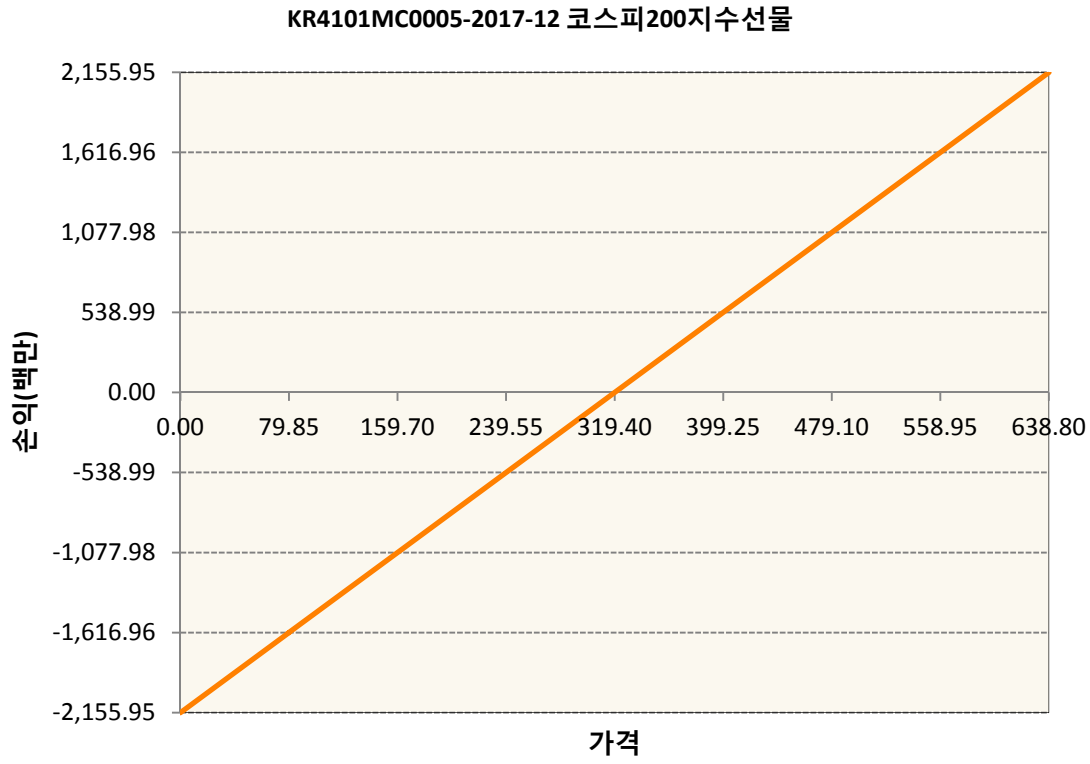
스마트인덱스모

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	2,156	0	2,156	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)

104

공시일	2017-09-20
기준일	2017-09-19

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	1,039

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

467

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-09-20
기준일	2017-09-19

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	426

* 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	2017-09-20
기준일	2017-09-19

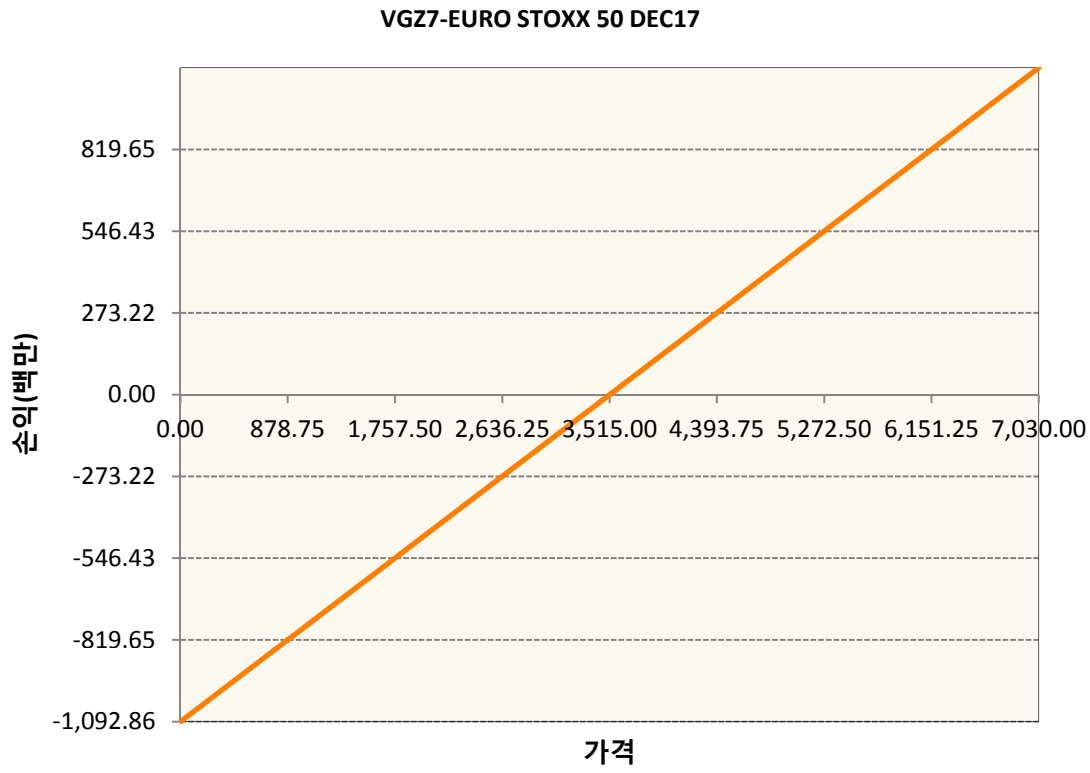
유로인덱스모(주식-파생형)

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	2017-09-20
기준일	2017-09-19

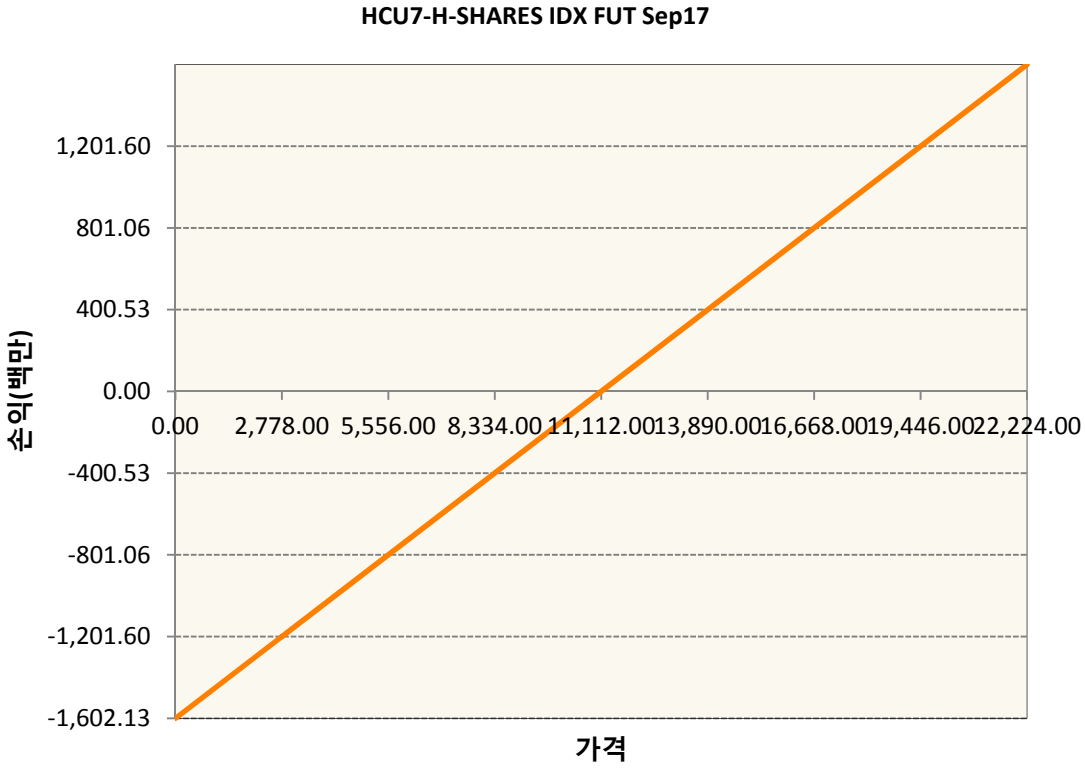
차이나인덱스모(주식-파생형)

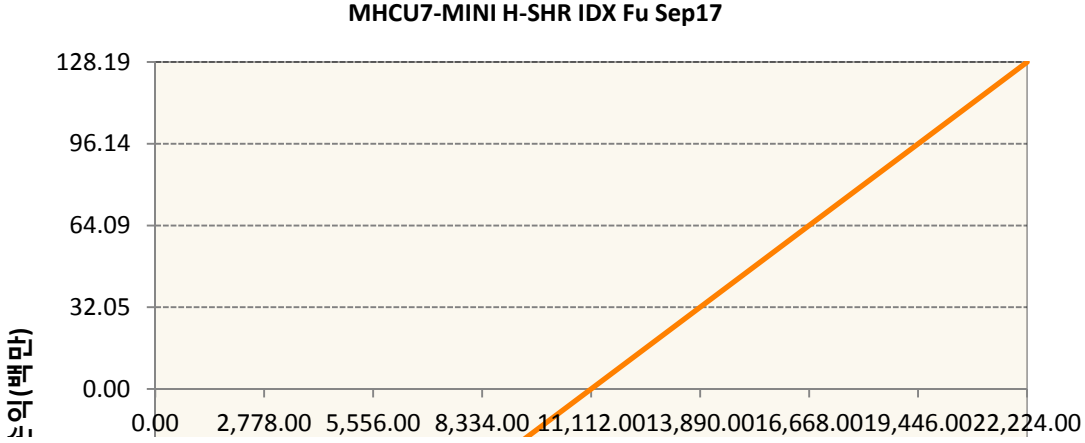
1. 계약금액

(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	1,602	0	1,602	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	2017-09-20
기준일	2017-09-19

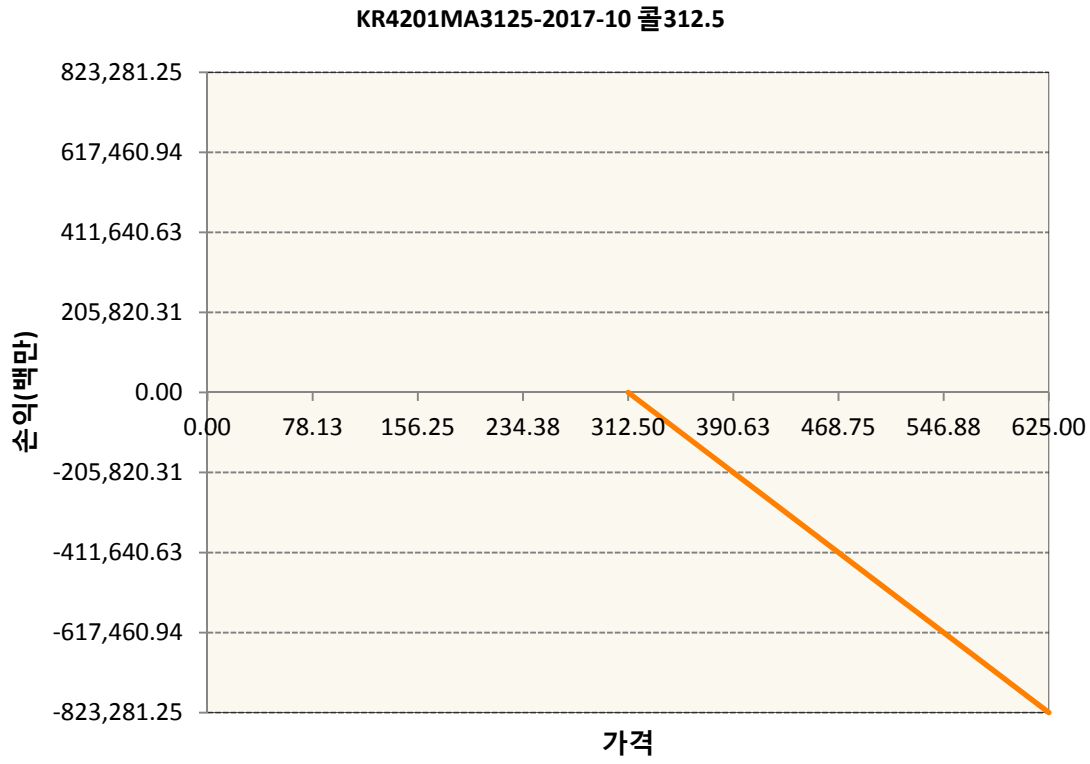
커버드콜모(주식혼합-파생형)

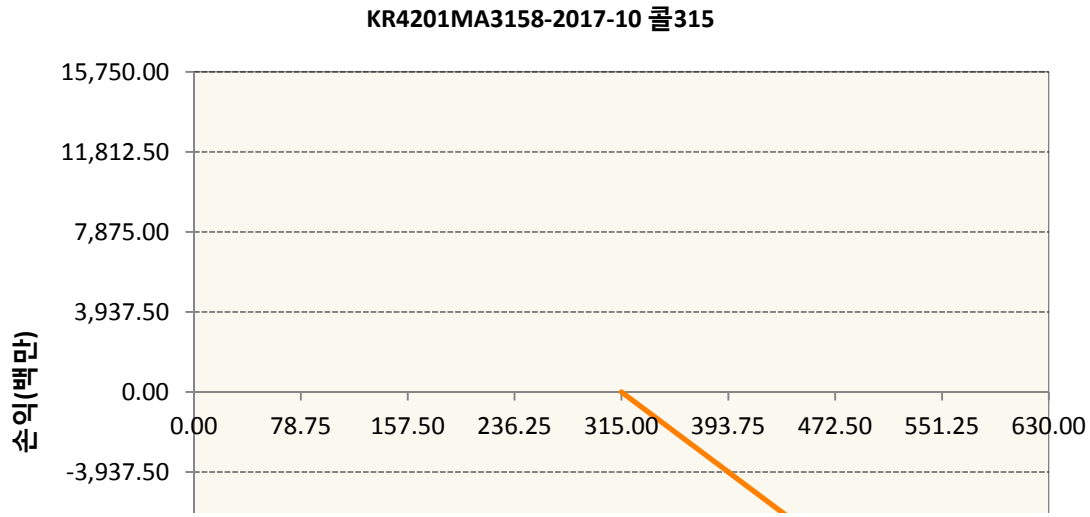
1. 계약금액

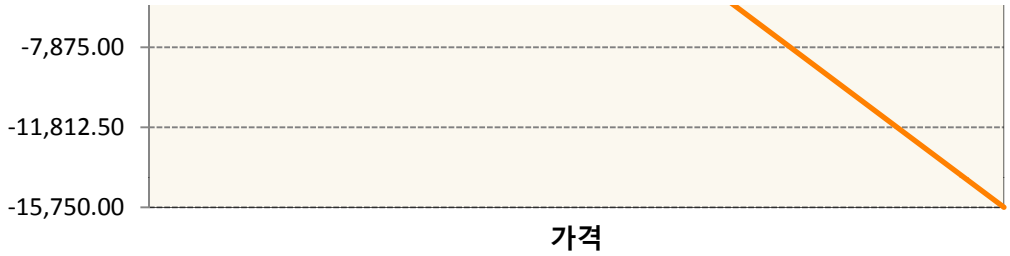
(단위:백만원)

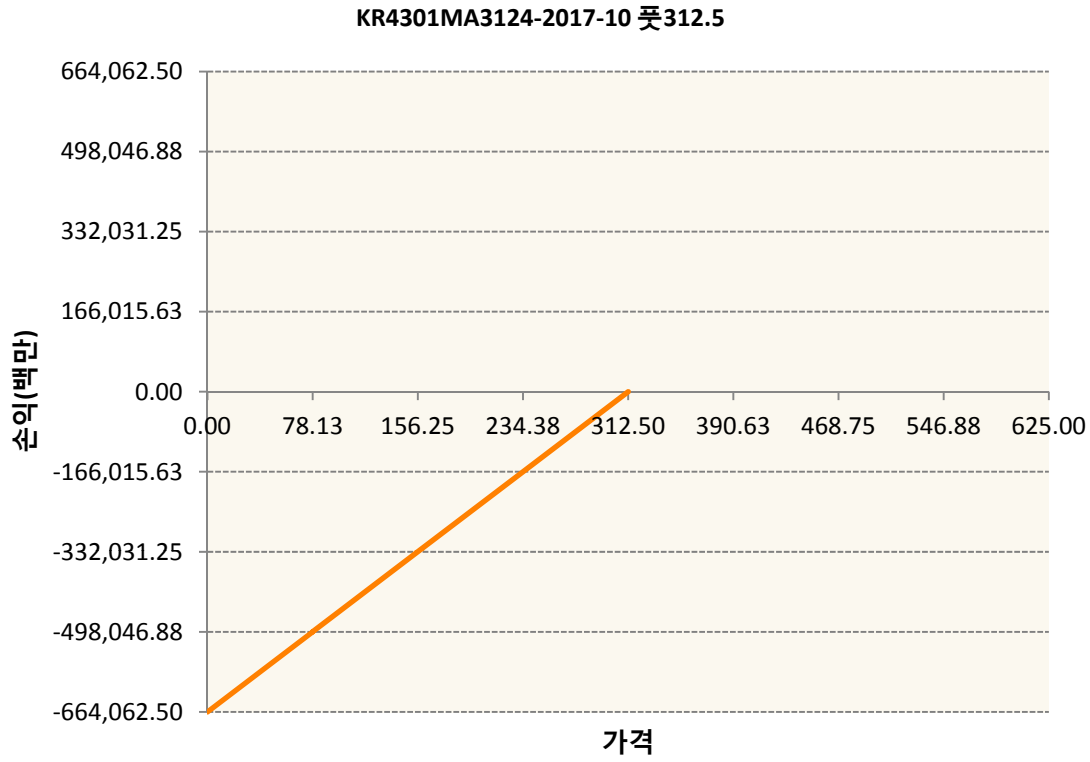
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	1,503,094	-1,503,094	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201MA3 2017-10 콜312.5							57,602
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	26,812	26,271	25,620	24,871	24,038	23,131	22,162
-5.33%	23,922	22,810	21,632	20,402	19,131	17,826	16,494
-2.67%	16,879	15,355	13,828	12,297	10,763	9,228	7,691
0%	4,366	2,933	1,475	0	-1,489	-2,989	-4,498
2.67%	-13,031	-13,986	-15,034	-16,157	-17,341	-18,576	-19,853
5.33%	-33,469	-33,932	-34,513	-35,200	-35,984	-36,852	-37,795
8.00%	-55,258	-55,426	-55,679	-56,024	-56,461	-56,989	-57,602
KR4201MA3 2017-10 콜315							1,055
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	441	433	423	412	398	383	366

-5.33%	401	383	363	342	320	297	273
-2.67%	294	266	238	210	181	153	124
0%	87	58	29	0	-29	-59	-88
2.67%	-218	-239	-262	-286	-311	-336	-363
5.33%	-592	-604	-617	-633	-650	-669	-689
8.00%	-1,000	-1,005	-1,011	-1,019	-1,030	-1,042	-1,055
KR4301MA3 2017-10 풋312.5							36,221

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-32,470	-32,906	-33,432	-34,035	-34,707	-35,439	-36,221
-5.33%	-16,769	-17,666	-18,616	-19,608	-20,633	-21,686	-22,761
-2.67%	-4,418	-5,646	-6,879	-8,114	-9,350	-10,589	-11,828
0%	3,522	2,365	1,190	0	-1,201	-2,411	-3,628
2.67%	7,521	6,751	5,906	5,000	4,045	3,049	2,018
5.33%	9,068	8,694	8,226	7,672	7,040	6,339	5,579
8.00%	9,525	9,390	9,186	8,908	8,555	8,129	7,635

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

94,758

공시일	2017-09-20
기준일	2017-09-19

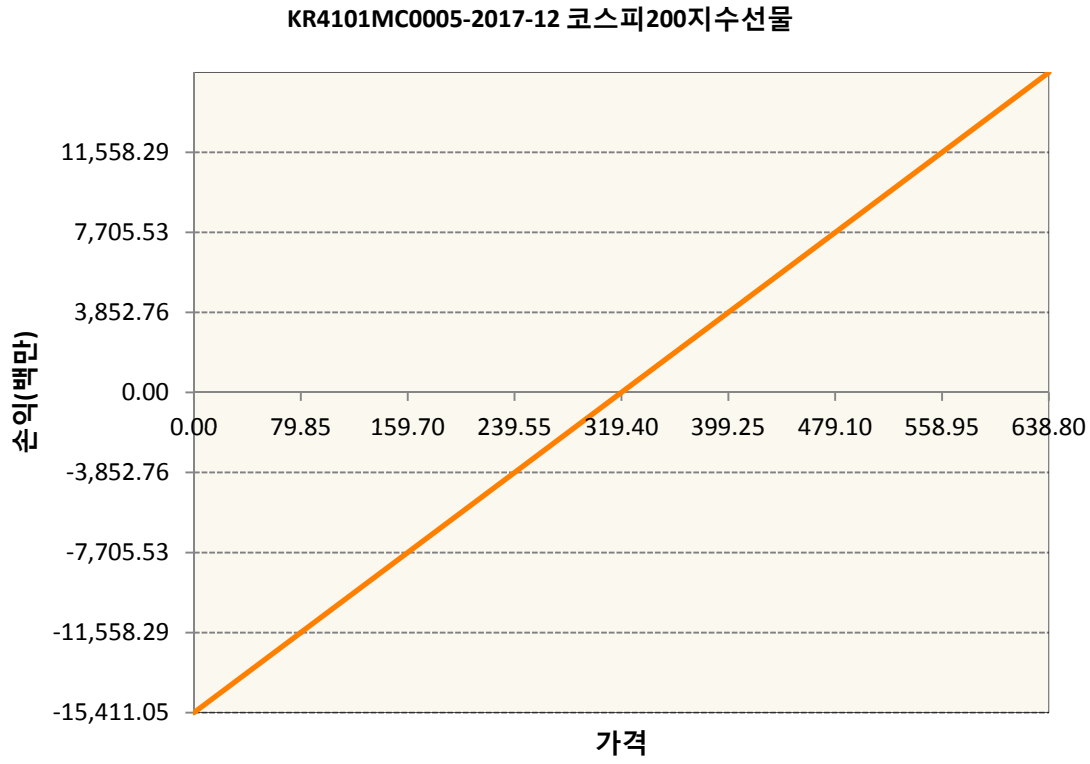
ETF스마트레버리지목표전환형6호

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	15,411	0	15,411	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101MC0	2017-12 코스피200지수선물						1,229
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,229	-1,229	-1,229	-1,229	-1,229	-1,229	-1,229
-5.33%	-820	-820	-820	-820	-820	-820	-820
-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%	820	820	820	820	820	820	820
8.00%	1,229	1,229	1,229	1,229	1,229	1,229	1,229

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

747

공시일	2017-09-20
기준일	2017-09-19

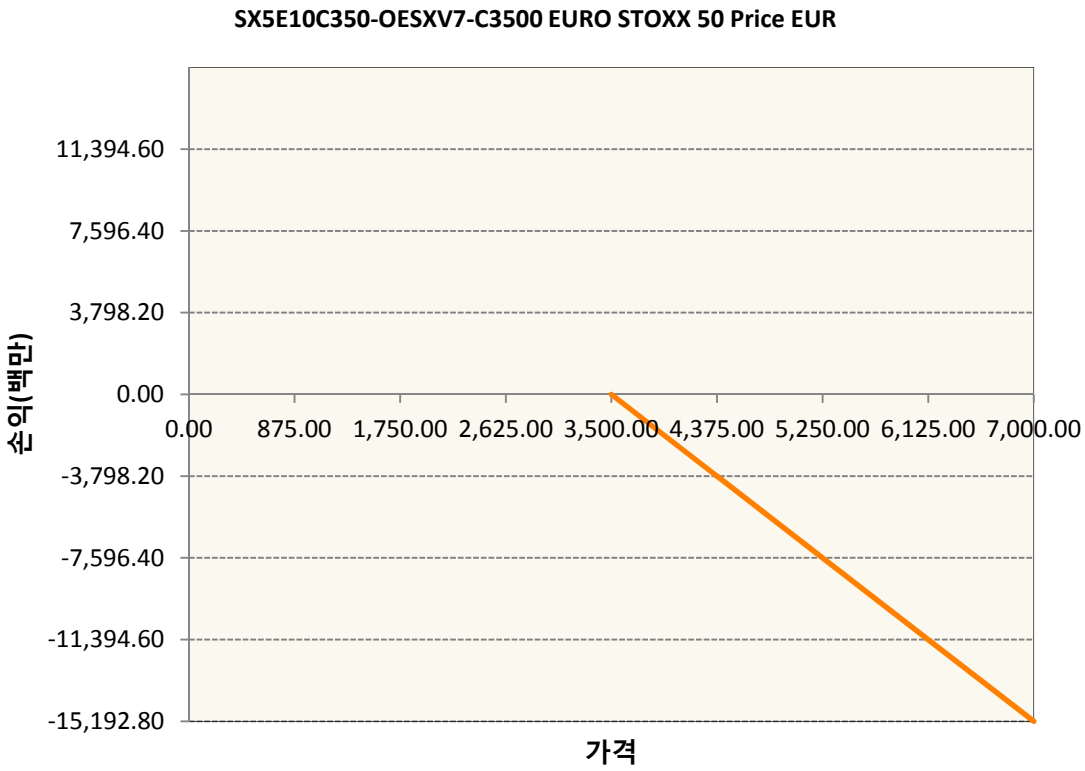
유로커버드콜(주식혼합-파생형)

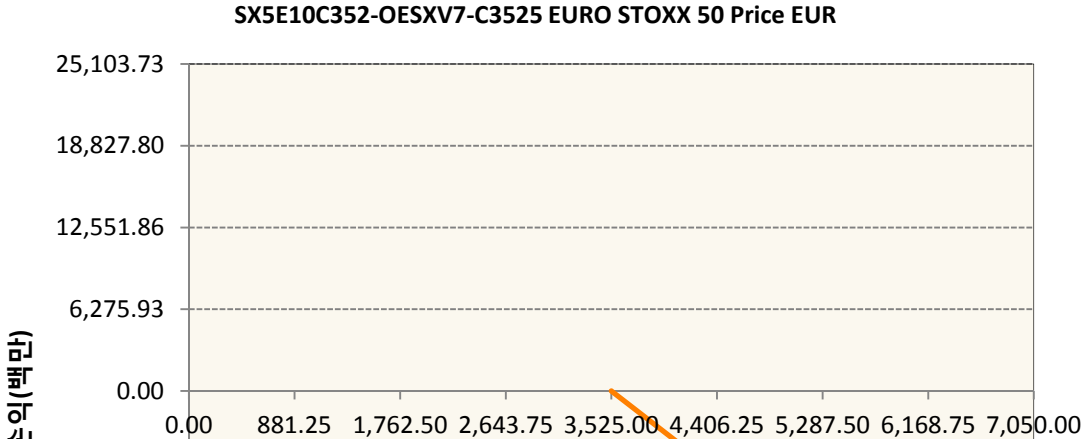
1. 계약금액

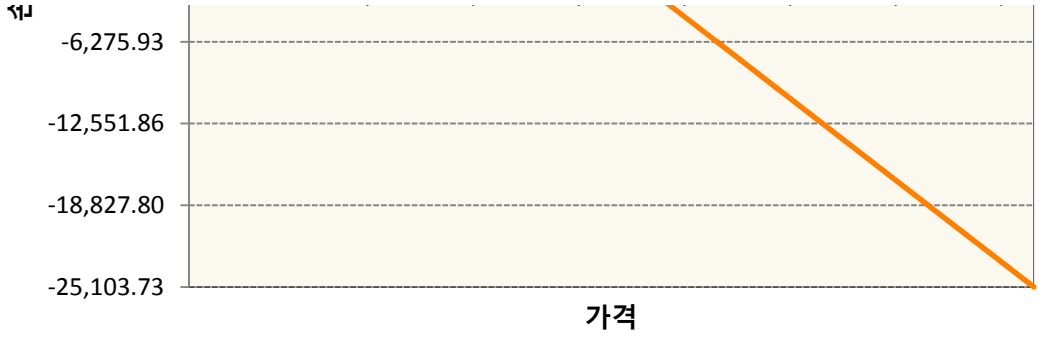
(단위:백만원)

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	39,946	0	39,946	
누계	유가증권	옵션	0	80,593	-80,593	장내

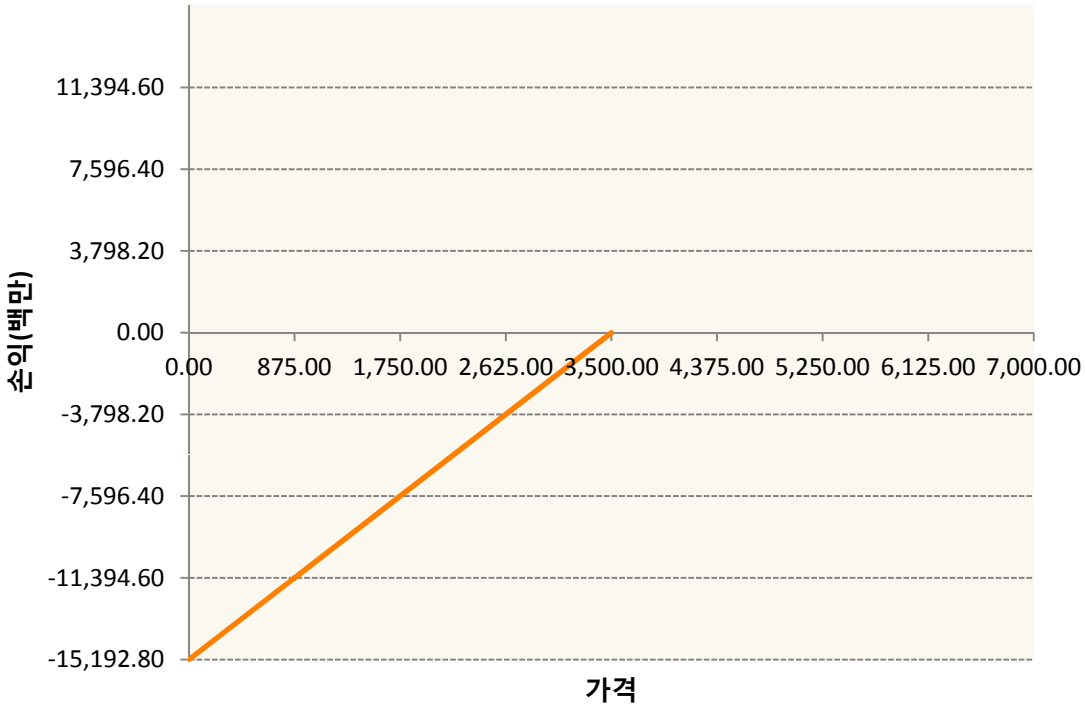
2. 만기시점의 손익구조



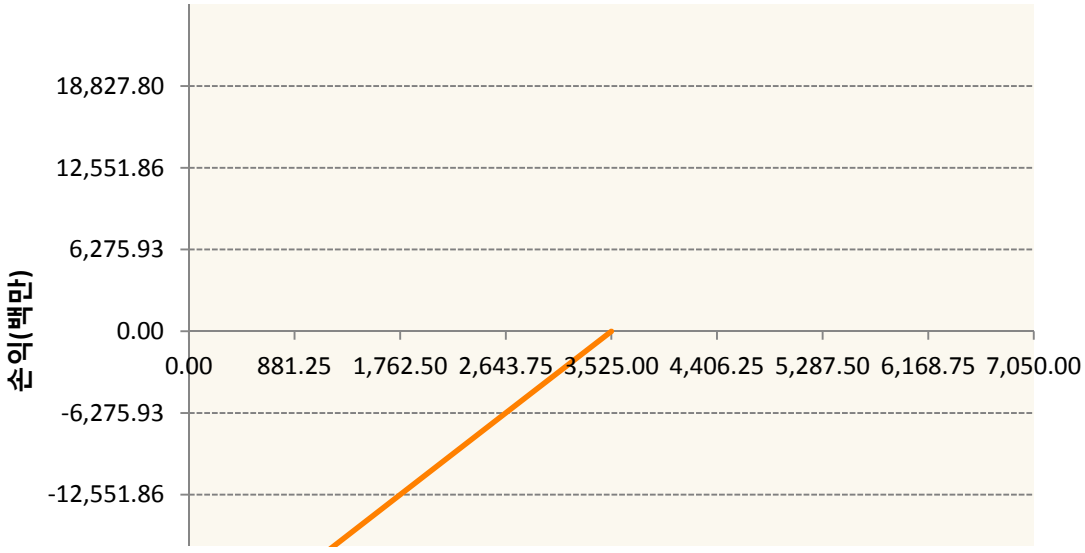


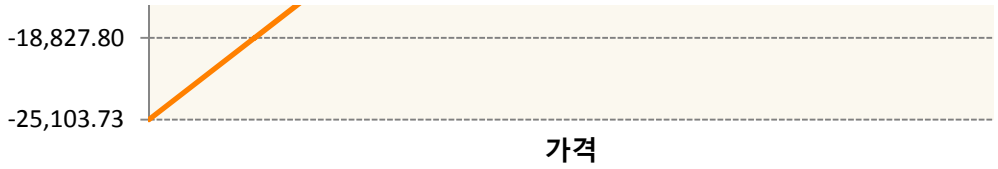


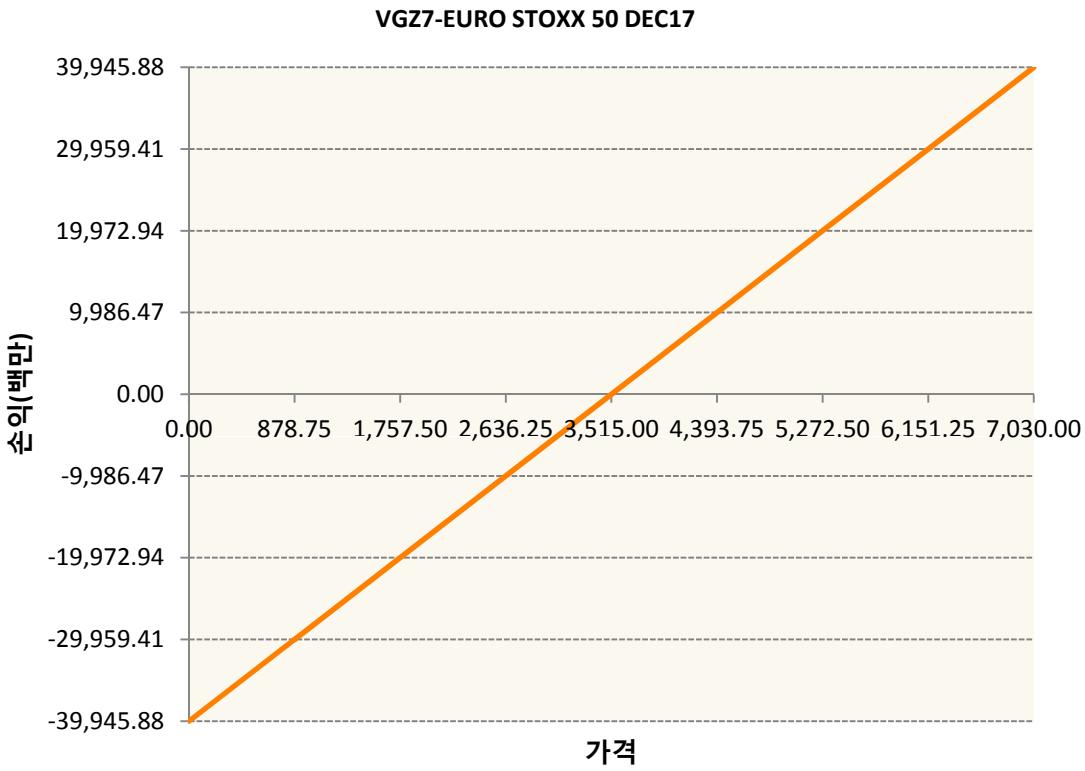
SX5E10P350-OESXV7-P3500 EURO STOXX 50 Price EUR



SX5E10P352-OESXV7-P3525 EURO STOXX 50 Price EUR







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)	(단위:백만원)
SX5E10C350 OESXV7-C3500 EURO STOXX 50 Price EUR	1,215
SX5E10C352 OESXV7-C3525 EURO STOXX 50 Price EUR	2,008
SX5E10P350 OESXV7-P3500 EURO STOXX 50 Price EUR	1,215
SX5E10P352 OESXV7-P3525 EURO STOXX 50 Price EUR	2,008
VGZ7 EURO STOXX 50 DEC17	3,196

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	7,597

공시일	2017-09-20
기준일	2017-09-19

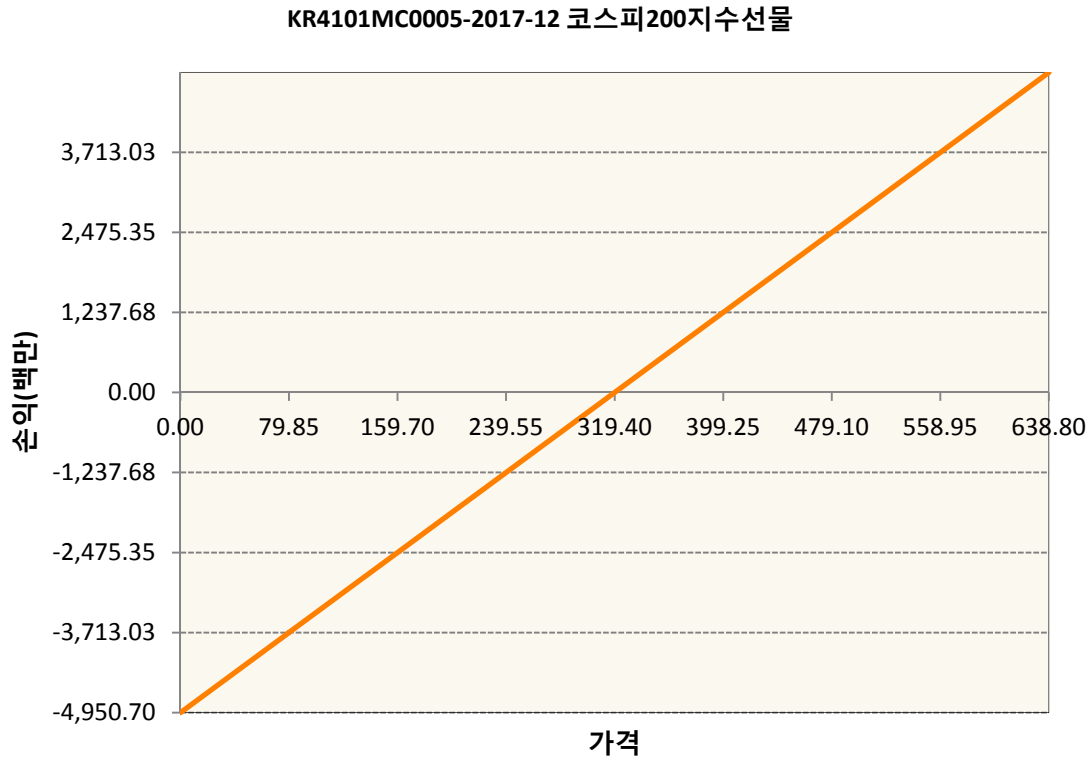
ETF스마트레버리지목표전환형7호

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	4,951	0	4,951	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%	-263	-263	-263	-263	-263	-263	-263
-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%	263	263	263	263	263	263	263
8.00%	395	395	395	395	395	395	395

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

240

공시일	2017-09-20
기준일	2017-09-19

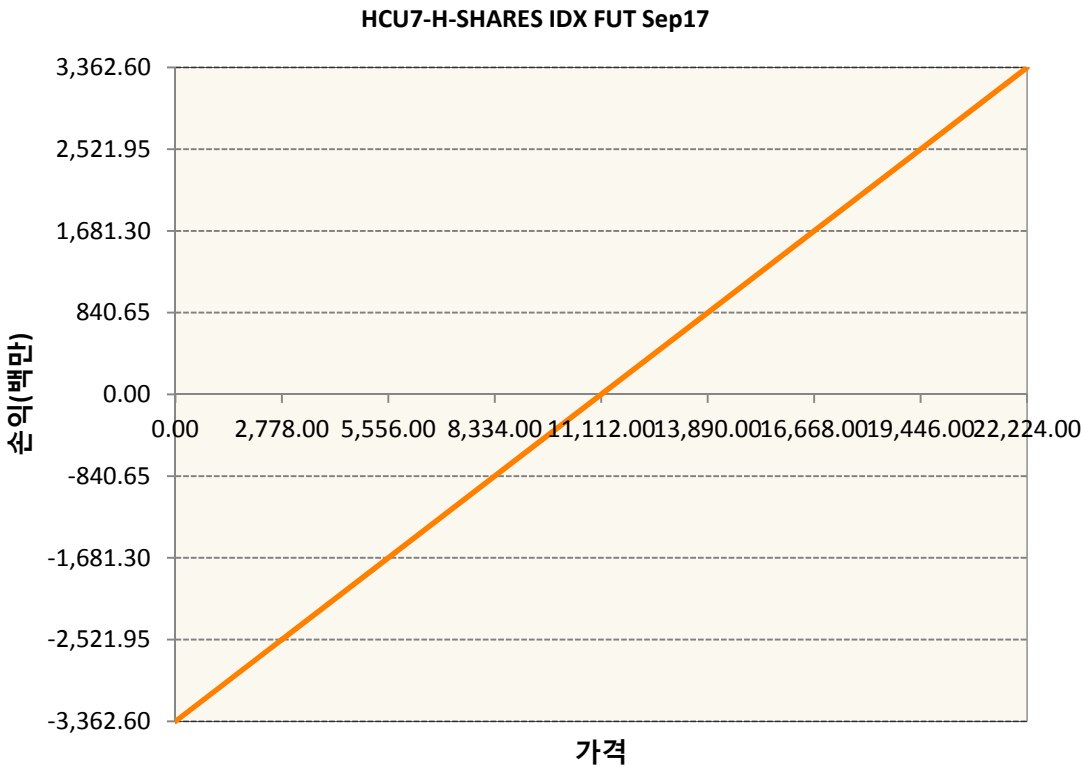
홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생

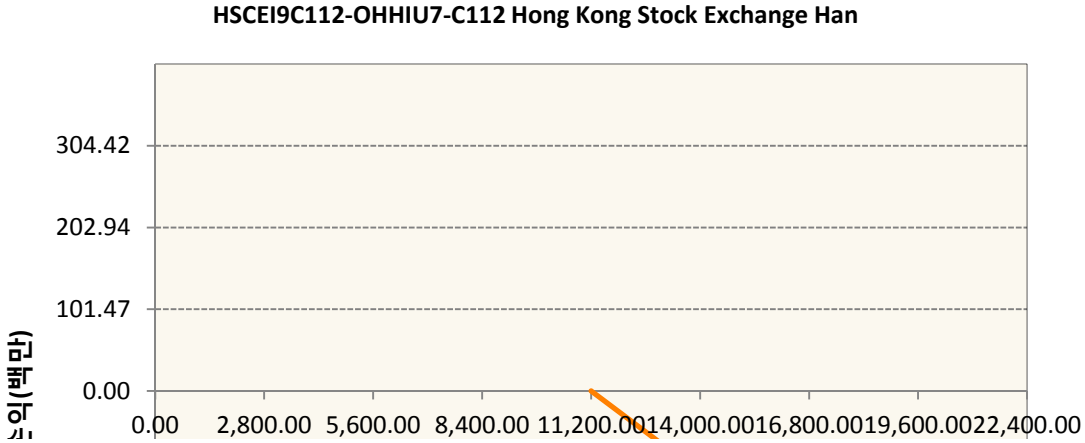
1. 계약금액

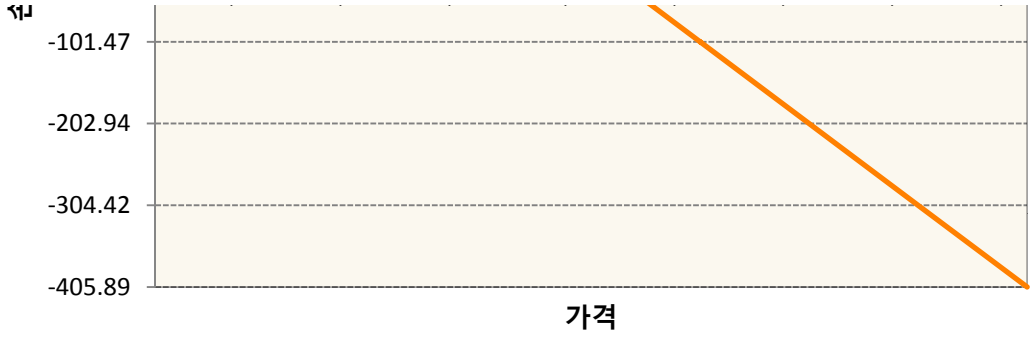
(단위:백만원)

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	3,363	0	3,363	장내
누계	유가증권	옵션	0	8,248	-8,248	장내

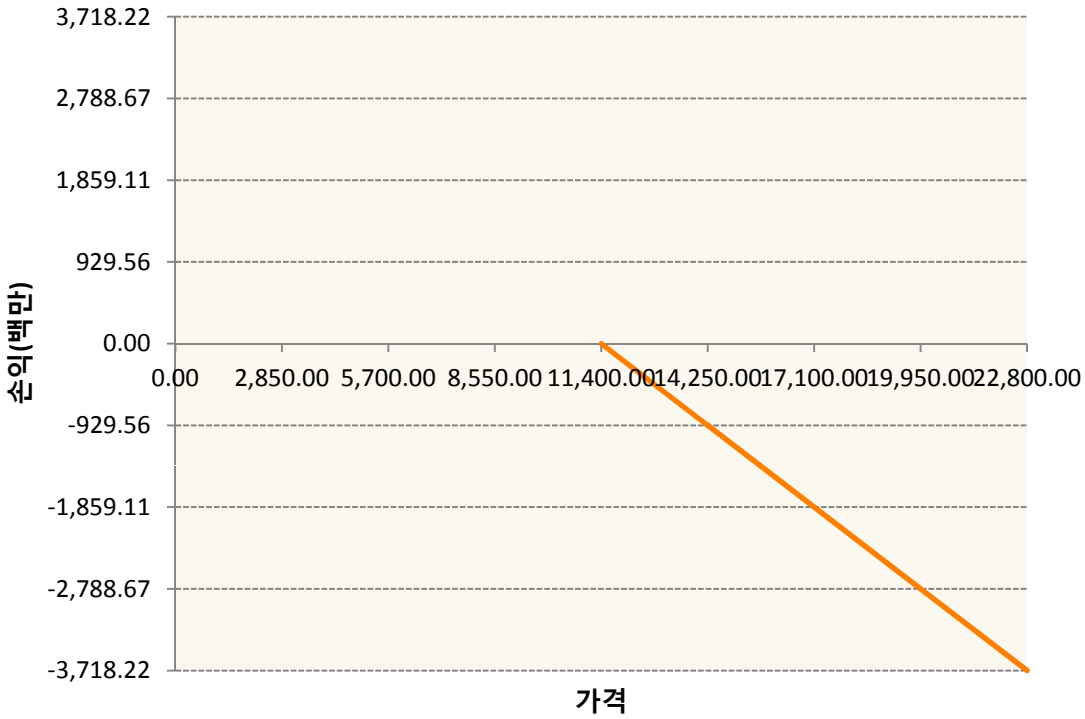
2. 만기시점의 손익구조



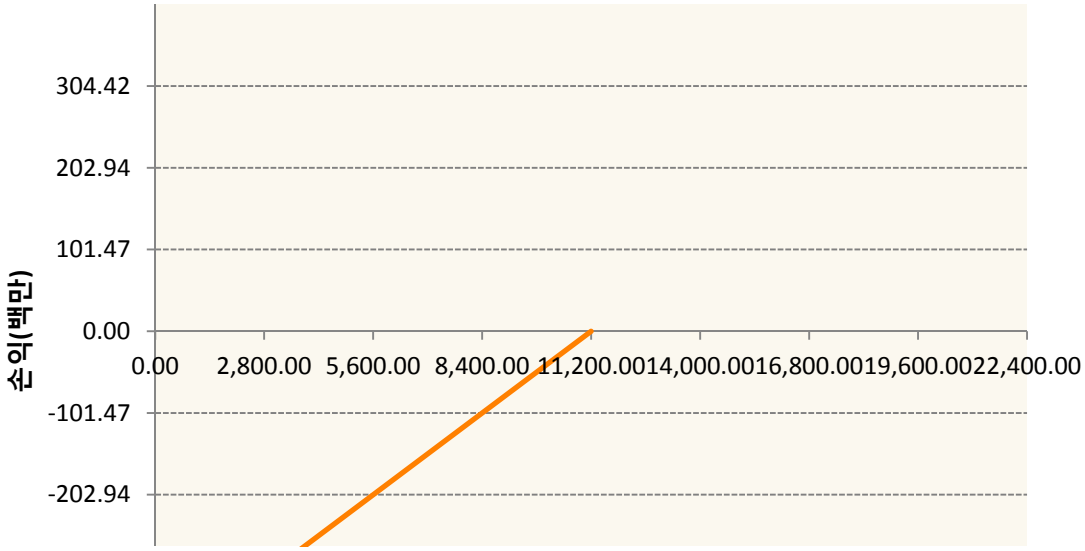


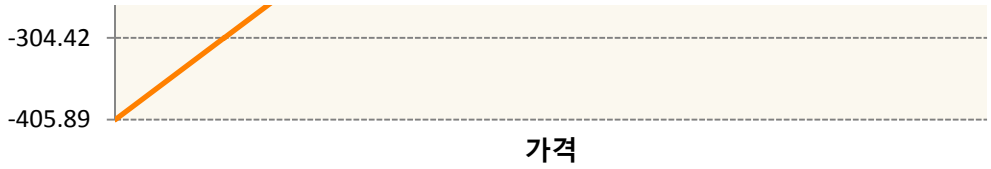


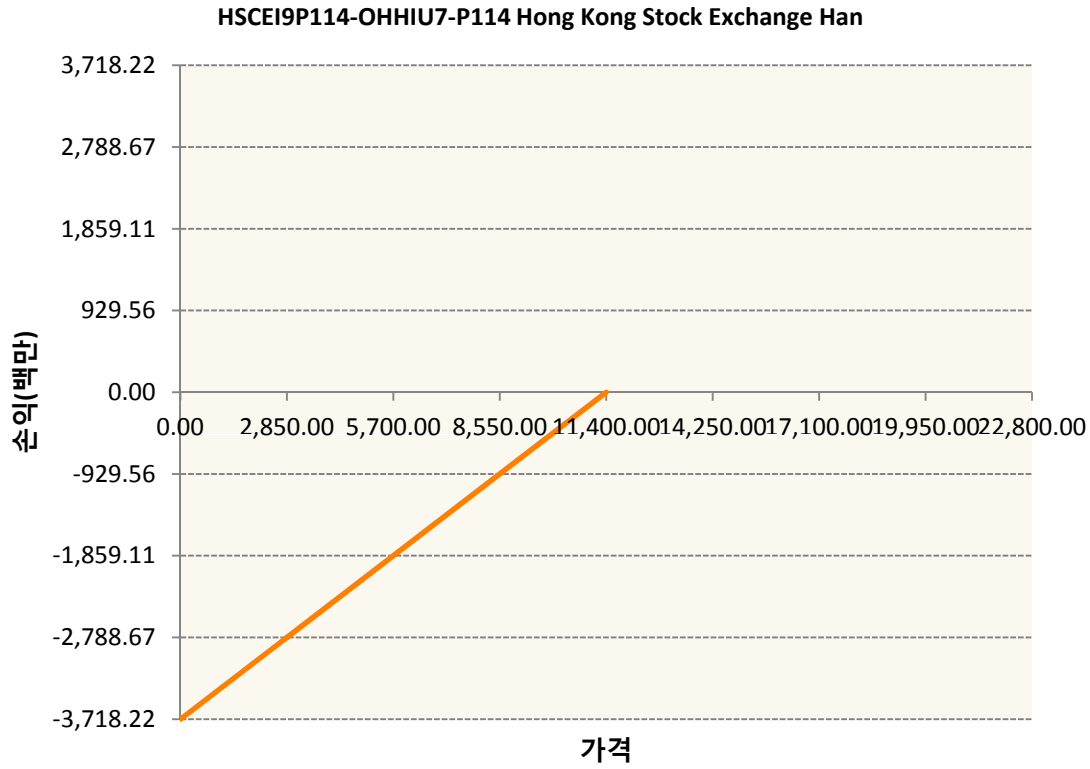
HSCEI9C114-OHHIU7-C114 Hong Kong Stock Exchange Han



HSCEI9P112-OHHIU7-P112 Hong Kong Stock Exchange Han







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCU7	H-SHARES IDX FUT Sep17	269
HSCEI9C112	OHHIU7-C112 Hong Kong Stock Exchange Han	32
HSCEI9C114	OHHIU7-C114 Hong Kong Stock Exchange Han	297
HSCEI9P112	OHHIU7-P112 Hong Kong Stock Exchange Han	32
HSCEI9P114	OHHIU7-P114 Hong Kong Stock Exchange Han	297

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	785

공시일	2017-09-20
기준일	2017-09-19

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼

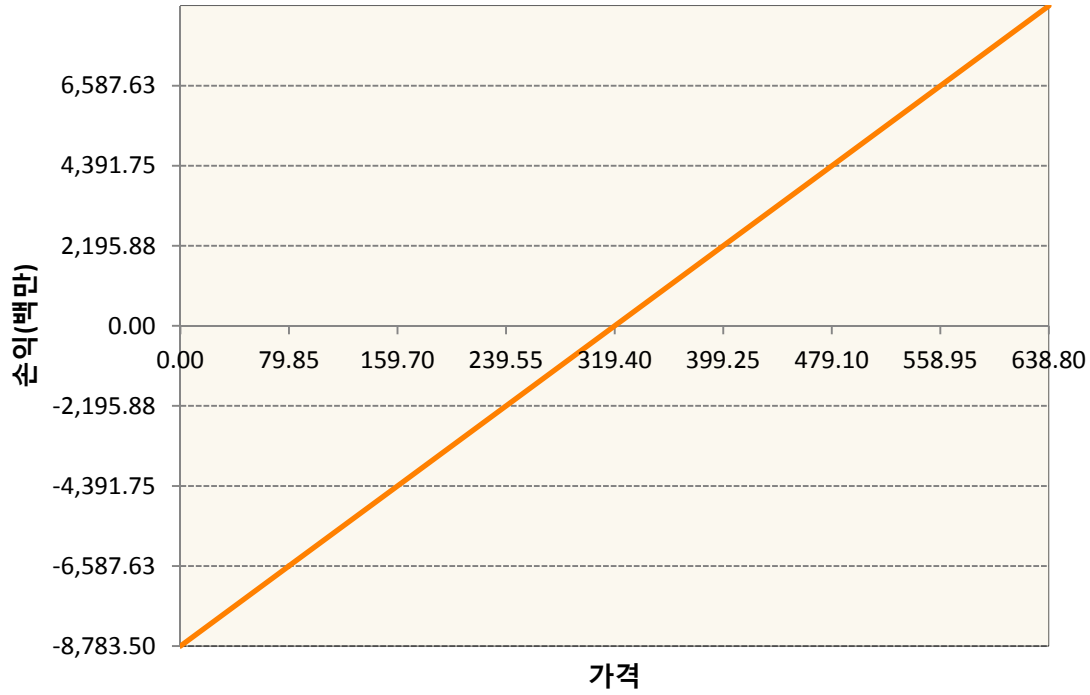
1. 계약금액

(단위:백만원)

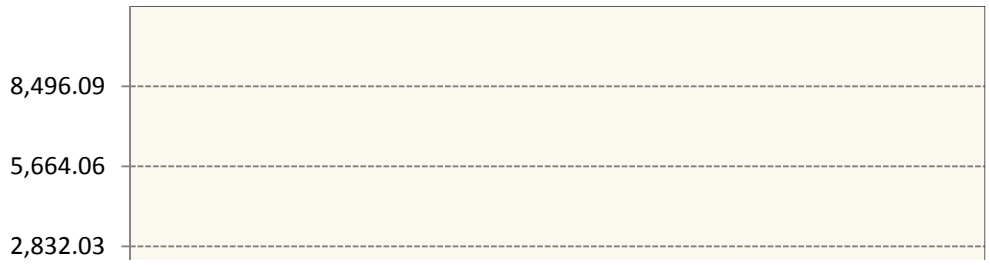
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	8,784	0	8,784	장내
누계	유가증권	스왑	22,000	0	22,000	장외
누계	유가증권	옵션	0	22,656	-22,656	장내

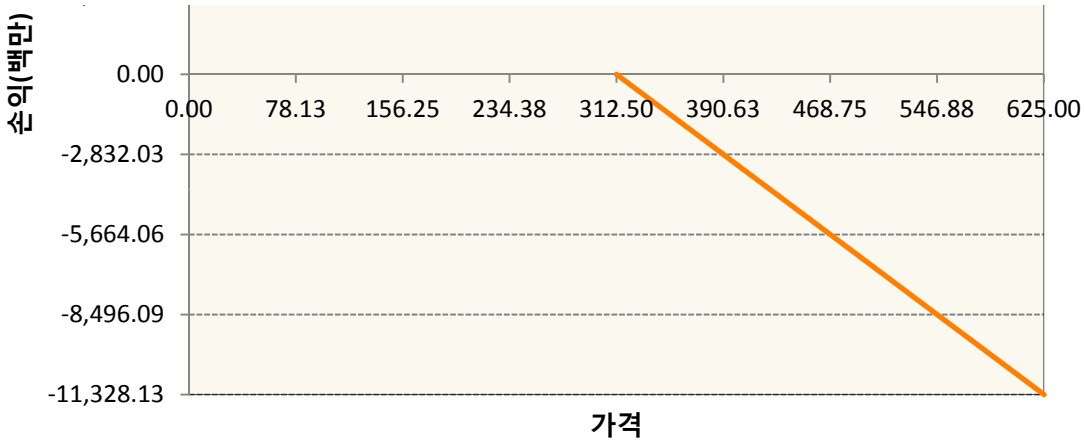
2. 만기시점의 손익구조

KR4101MC0005-2017-12 코스피200지수선물

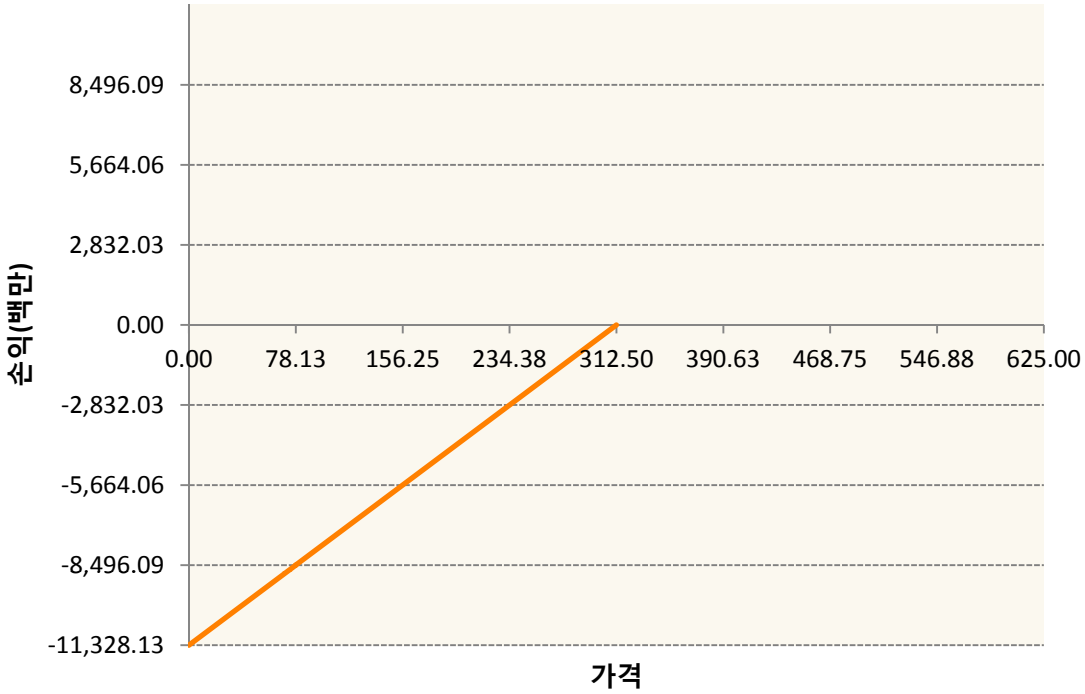


KR4201MA3125-2017-10 콜312.5





KR4301MA3124-2017-10 풋312.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_2							1,485
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,485	-1,485	-1,485	-1,485	-1,485	-1,485	-1,485
-5.33%	-990	-990	-990	-990	-990	-990	-990
-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%	990	990	990	990	990	990	990
8.00%	1,485	1,485	1,485	1,485	1,485	1,485	1,485

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						701
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-701	-701	-701	-701	-701	-701	-701
-5.33%	-467	-467	-467	-467	-467	-467	-467
-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%	467	467	467	467	467	467	467
8.00%	701	701	701	701	701	701	701
KR4201MA3 2017-10 콜312.5							793
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	369	361	353	342	331	318	305
-5.33%	329	314	298	281	263	245	227
-2.67%	232	211	190	169	148	127	106
0%	60	40	20	0	-20	-41	-62
2.67%	-179	-192	-207	-222	-239	-256	-273
5.33%	-461	-467	-475	-484	-495	-507	-520
8.00%	-760	-763	-766	-771	-777	-784	-793
KR4301MA3 2017-10 풋312.5							618
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-554	-561	-570	-581	-592	-605	-618
-5.33%	-286	-301	-318	-334	-352	-370	-388
-2.67%	-75	-96	-117	-138	-160	-181	-202
0%	60	40	20	0	-20	-41	-62
2.67%	128	115	101	85	69	52	34
5.33%	155	148	140	131	120	108	95
8.00%	162	160	157	152	146	139	130

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

3,592

공시일	2017-09-20
기준일	2017-09-19

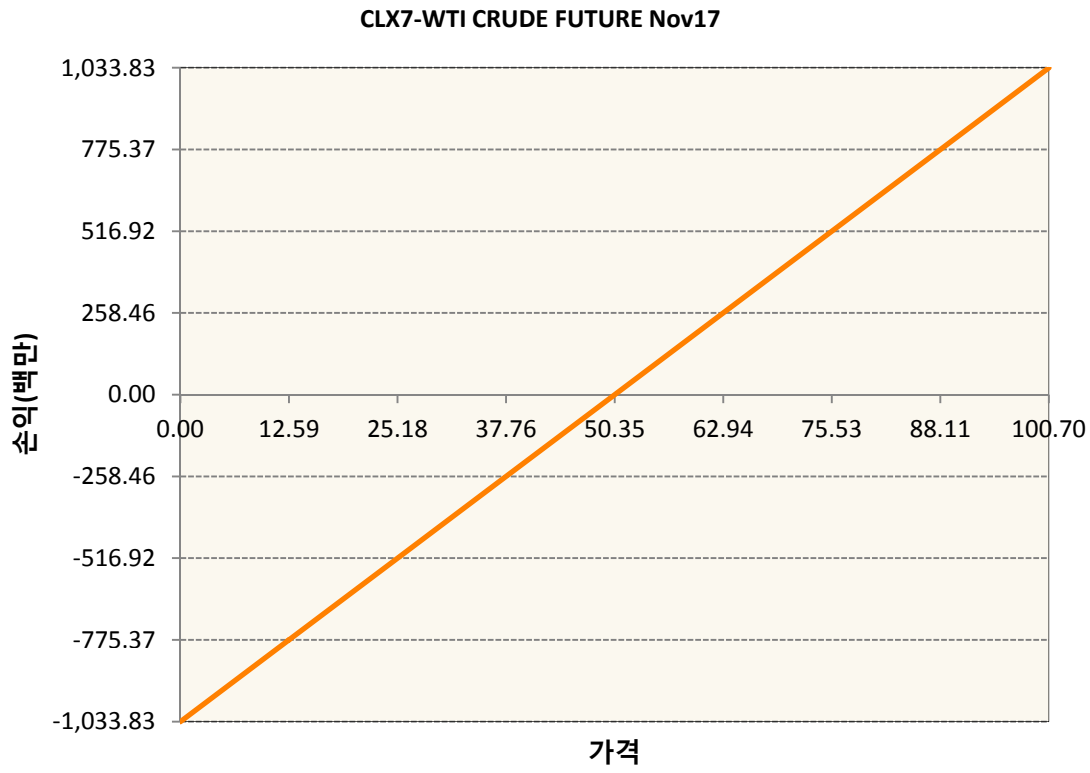
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

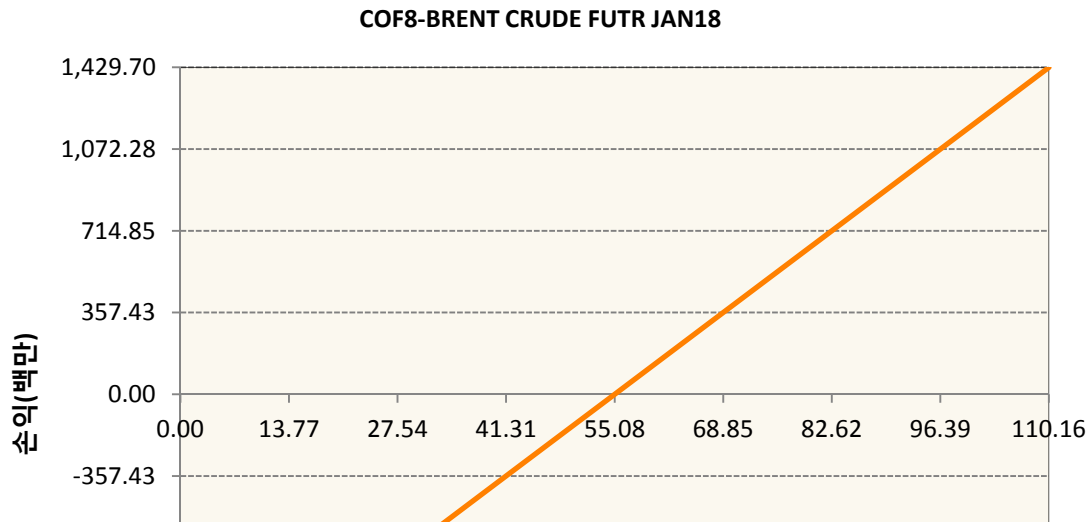
1. 계약금액

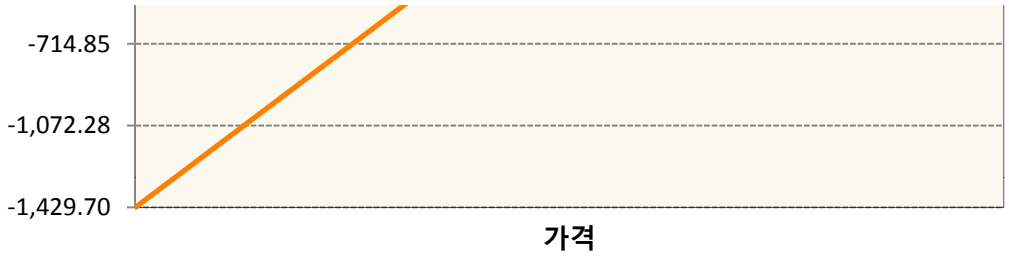
(단위:백만원)

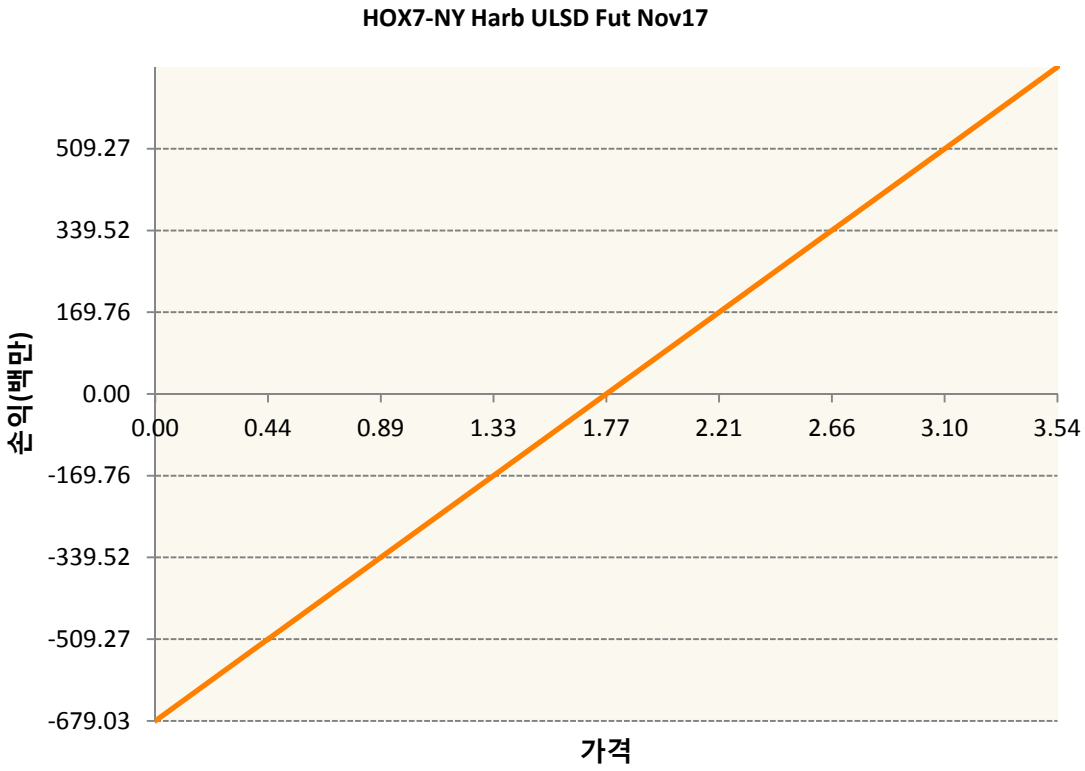
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	5,370	735	4,635	

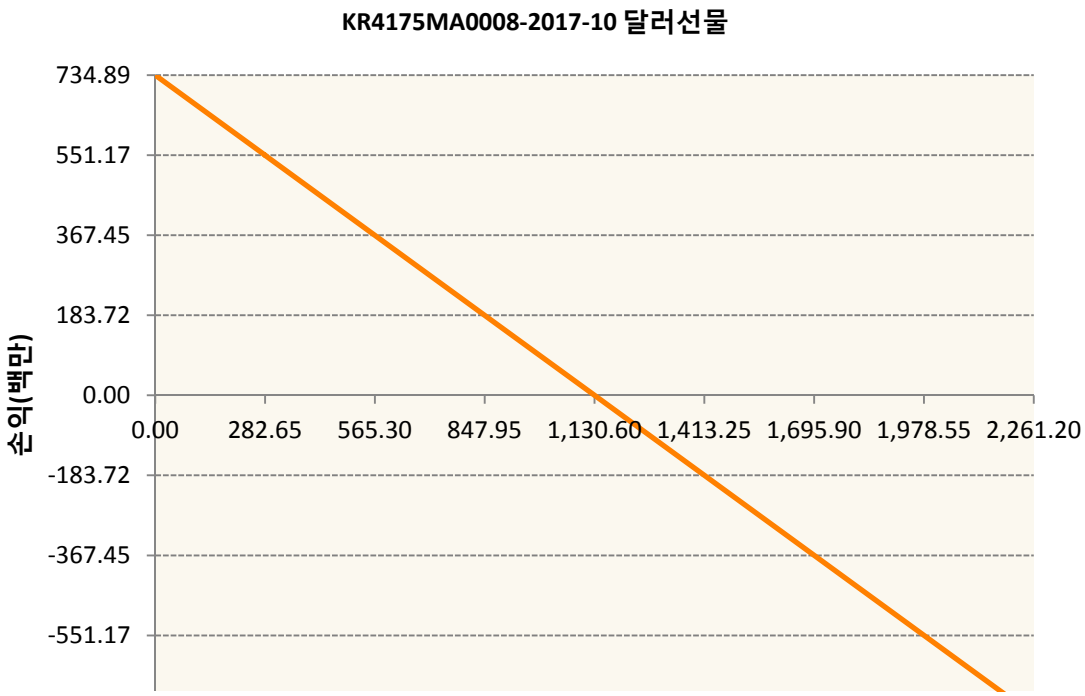
2. 만기시점의 손익구조

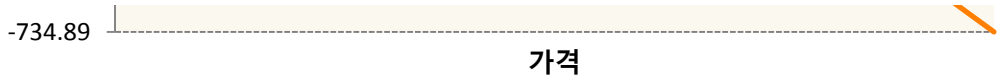


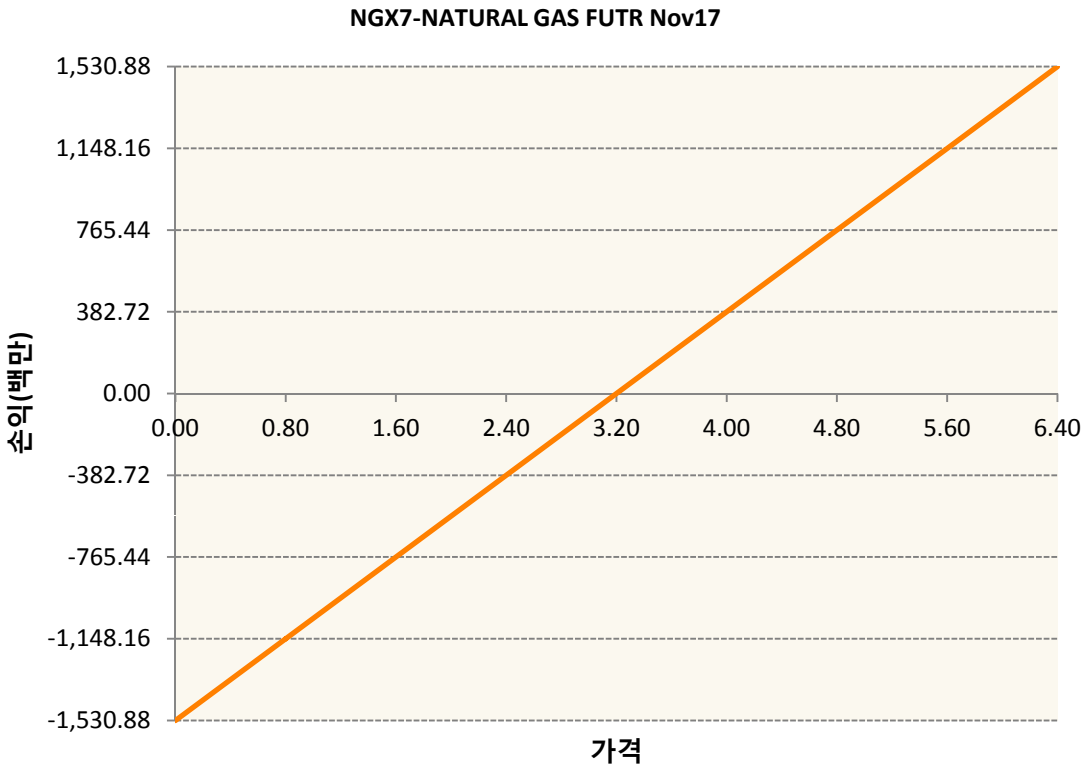


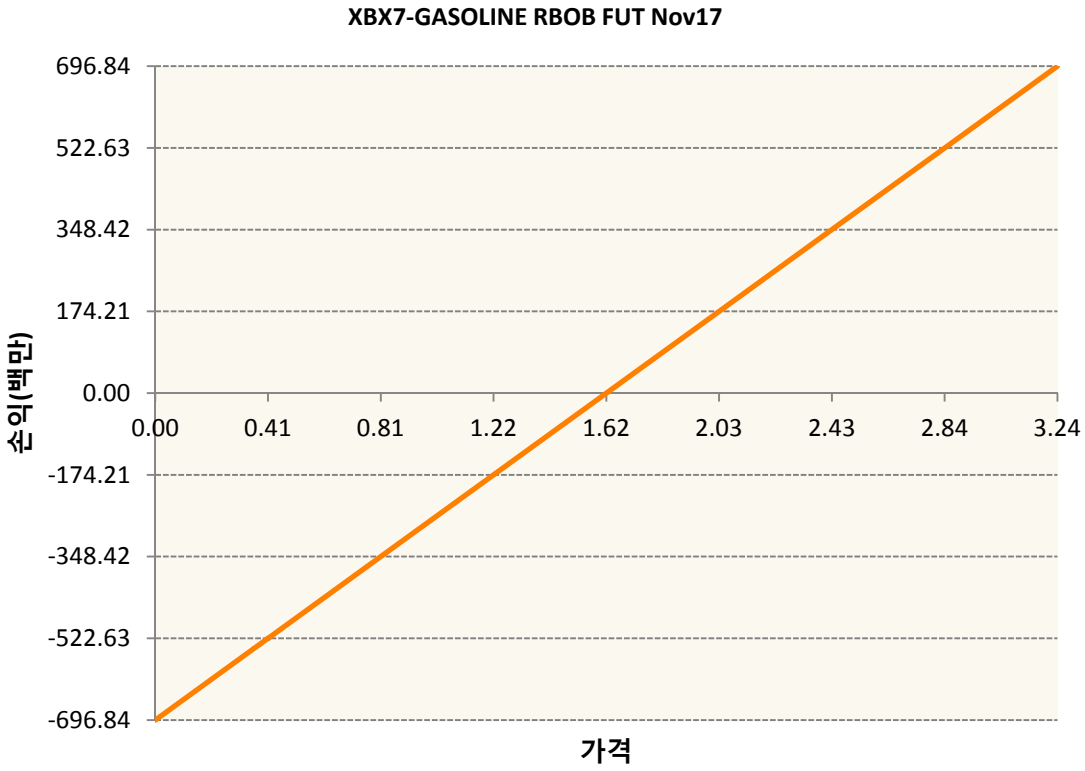

-714.85
-1,072.28
-1,429.70
가격


HOX7-NY Harb ULSD Fut Nov17
509.27
339.52
169.76
0.00
-169.76
-339.52
-509.27
-679.03
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
734.89
551.17
367.45
183.72
0.00
-183.72
-367.45
-551.17
0.00
282.65
565.30
847.95
1,130.60
1,413.25
1,695.90
1,978.55
2,261.20
손익(백만)


-734.89
가격


NGX7-NATURAL GAS FUTR Nov17
1,530.88
1,148.16
765.44
382.72
0.00
-382.72
-765.44
-1,148.16
-1,530.88
0.00
0.80
1.60
2.40
3.20
4.00
4.80
5.60
6.40
손익(백만)
가격


XBX7-GASOLINE RBOB FUT Nov17
696.84
522.63
348.42
174.21
0.00
-174.21
-348.42
-522.63
-696.84
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	114
HOX7	NY Harb ULSD Fut Nov17	54
KR4175MA0	2017-10 달러선물	59
NGX7	NATURAL GAS FUTR Nov17	122
XBX7	GASOLINE RBOB FUT Nov17	56

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

782

공시일	2017-09-20
기준일	2017-09-19

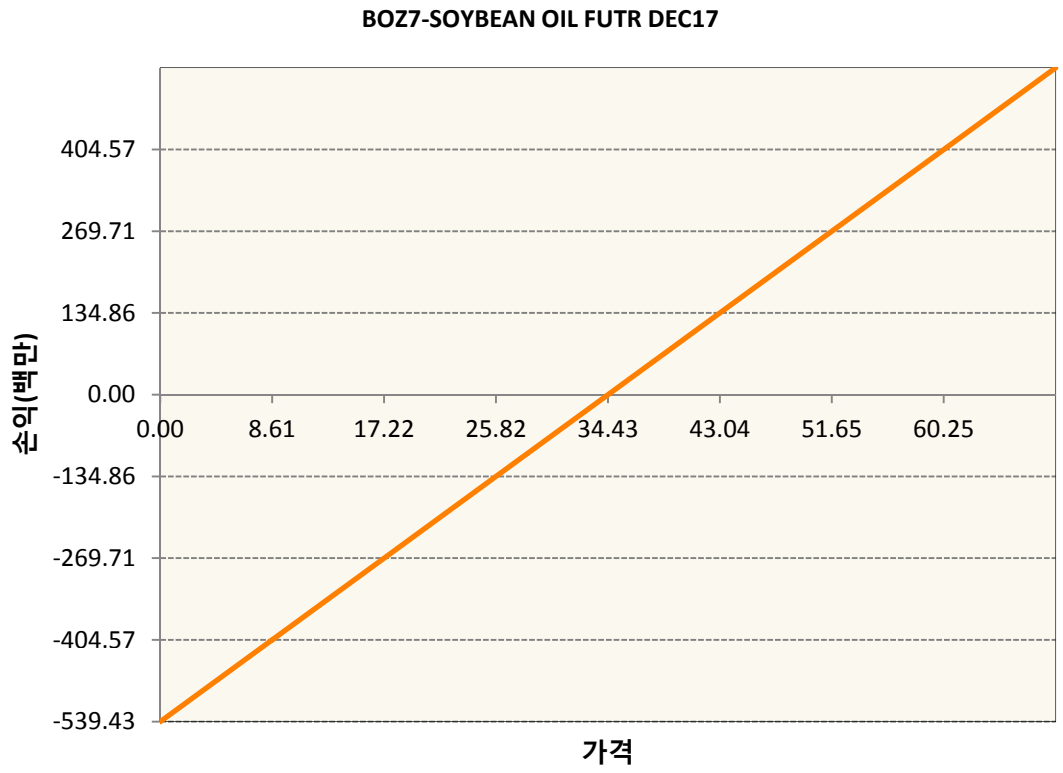
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

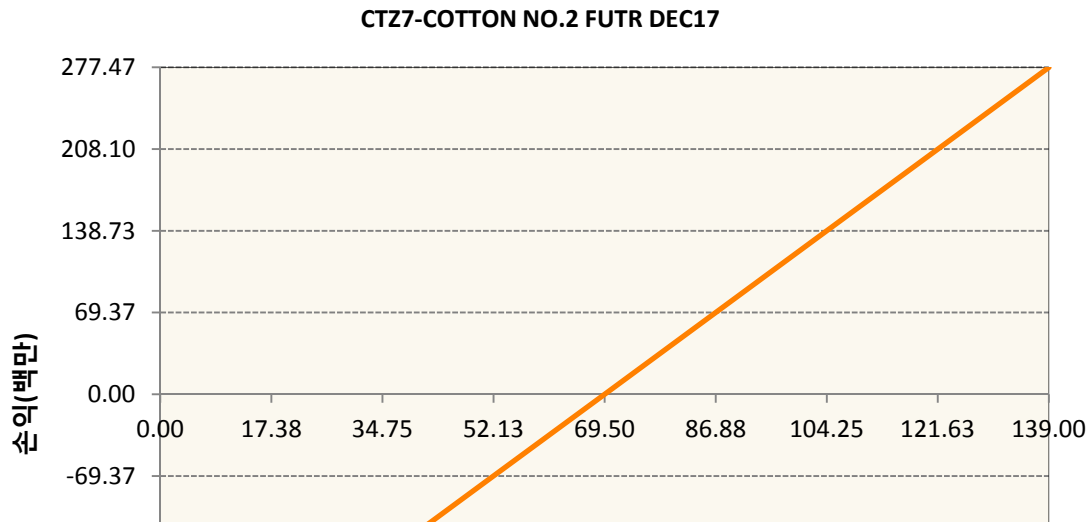
1. 계약금액

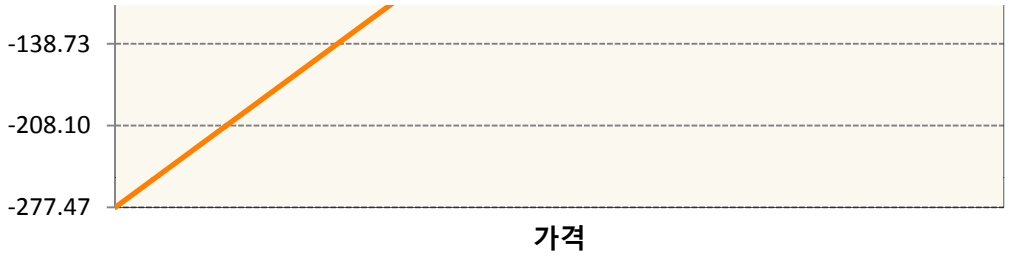
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	5,839	339	5,500	

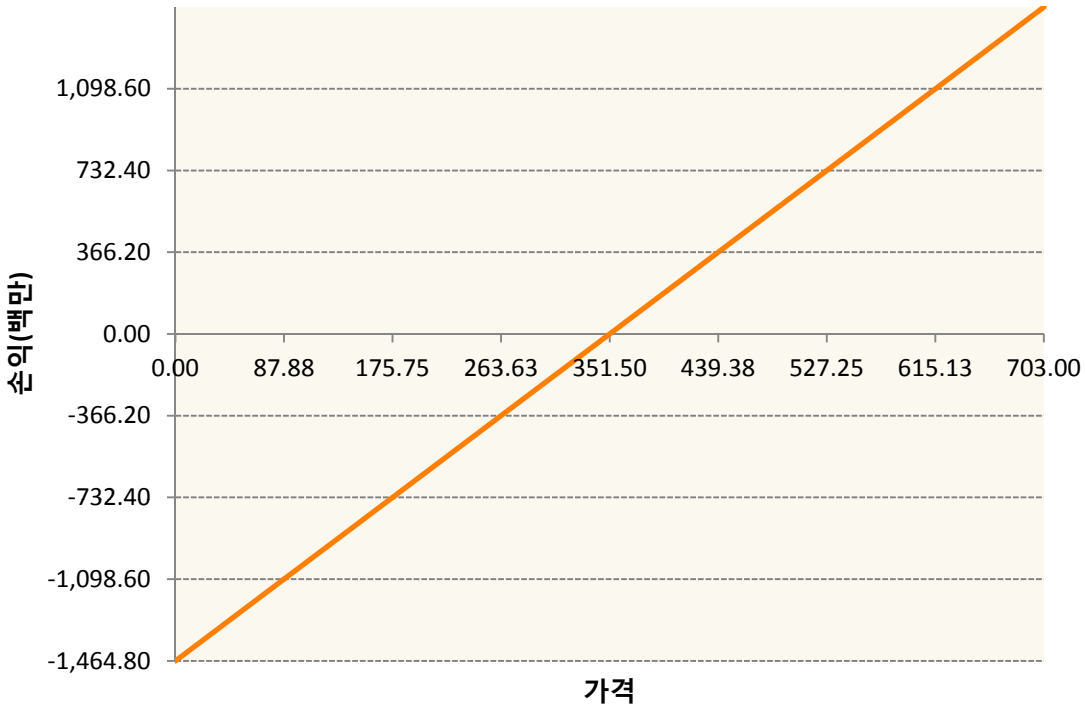
2. 만기시점의 손익구조



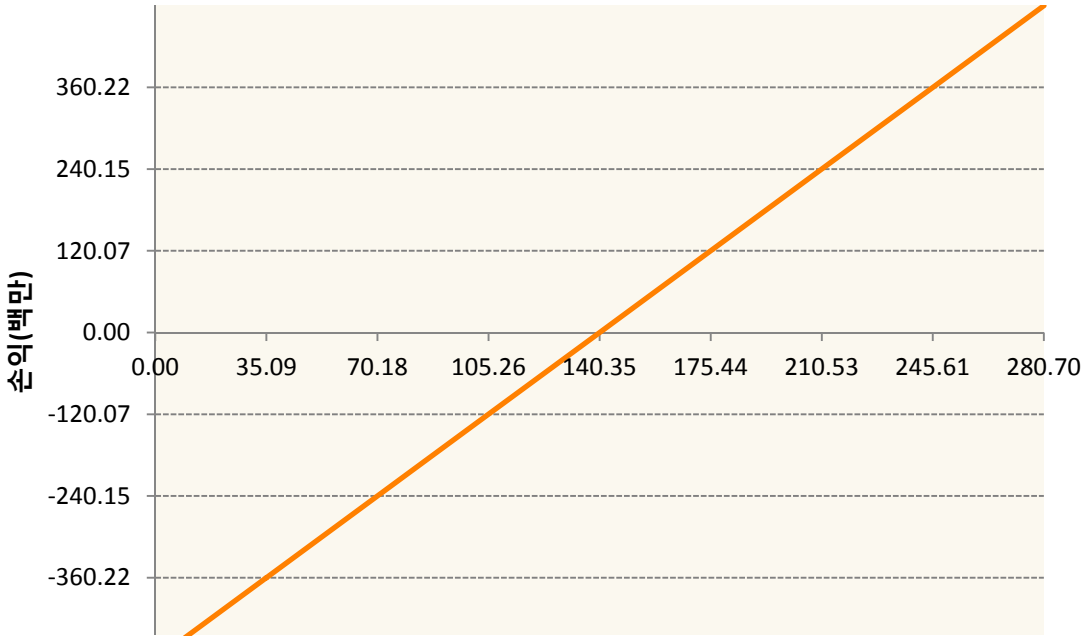


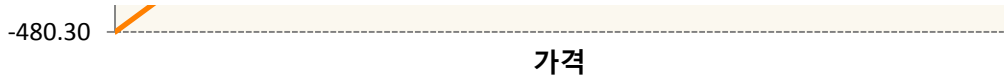


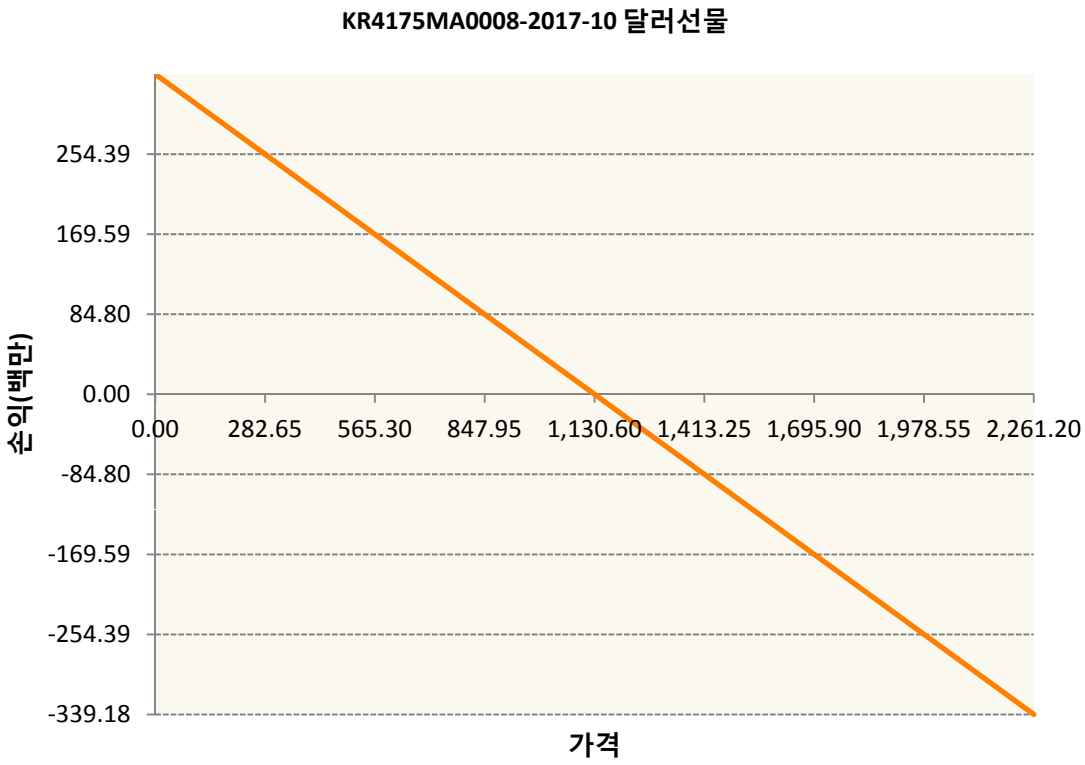
CZ7-CORN FUTURE DEC17

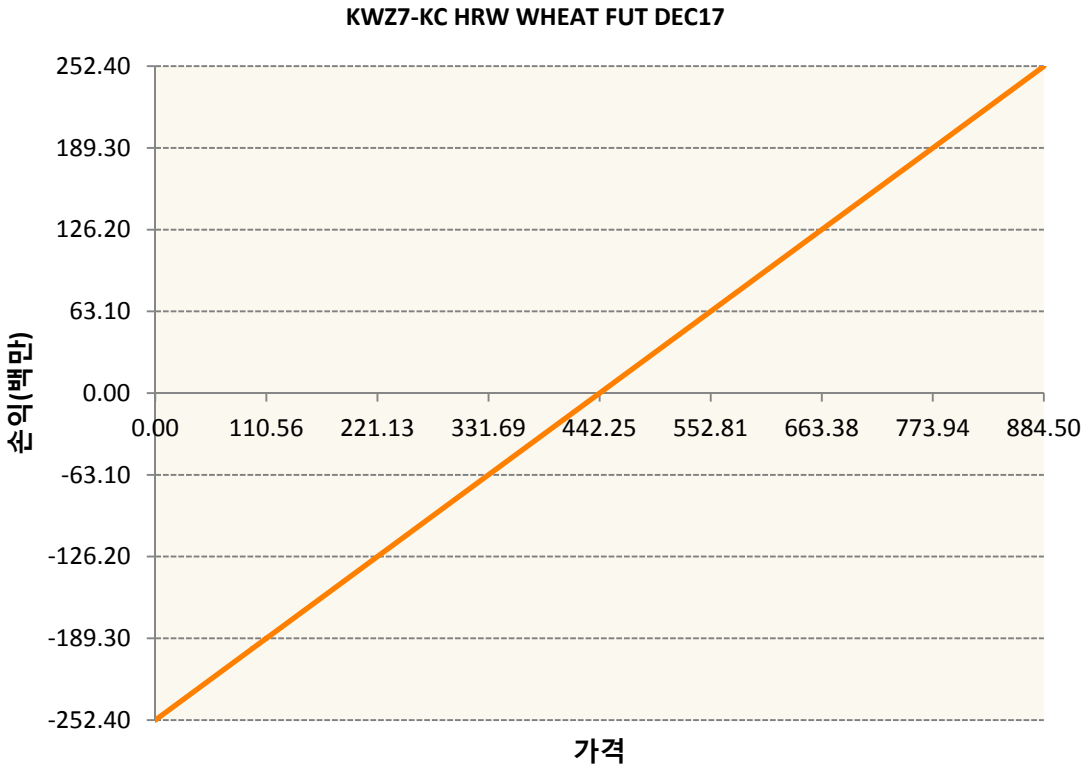


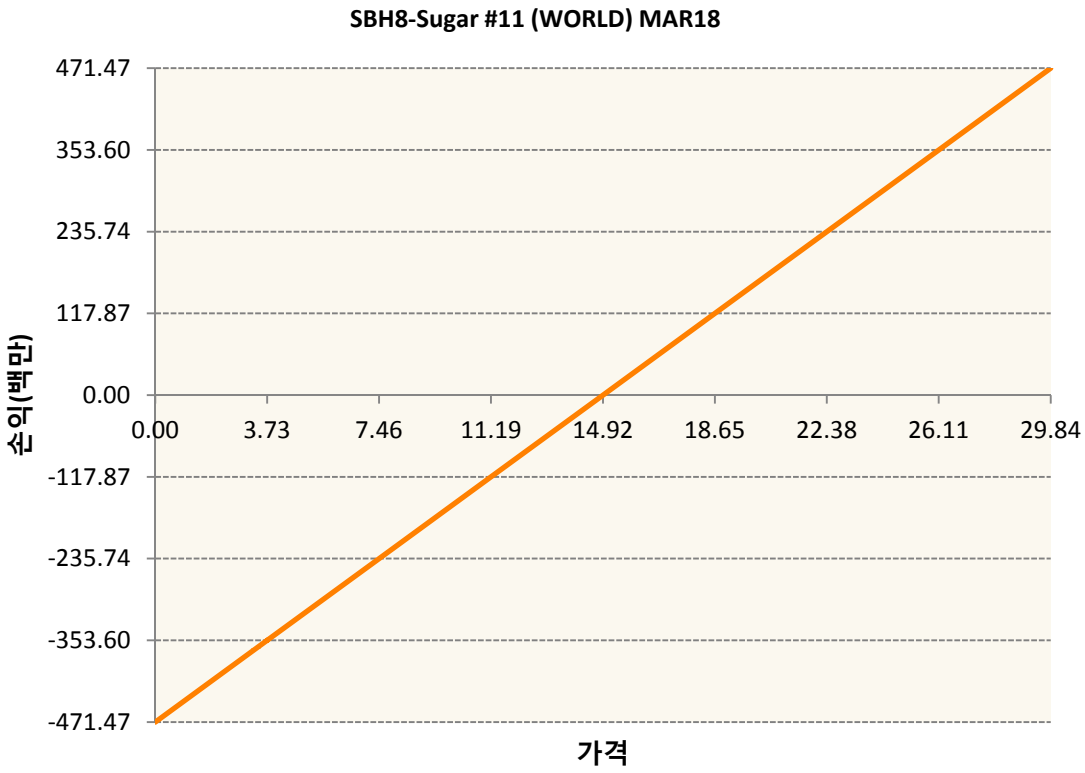
KCZ7-COFFEE 'C' FUTURE DEC17

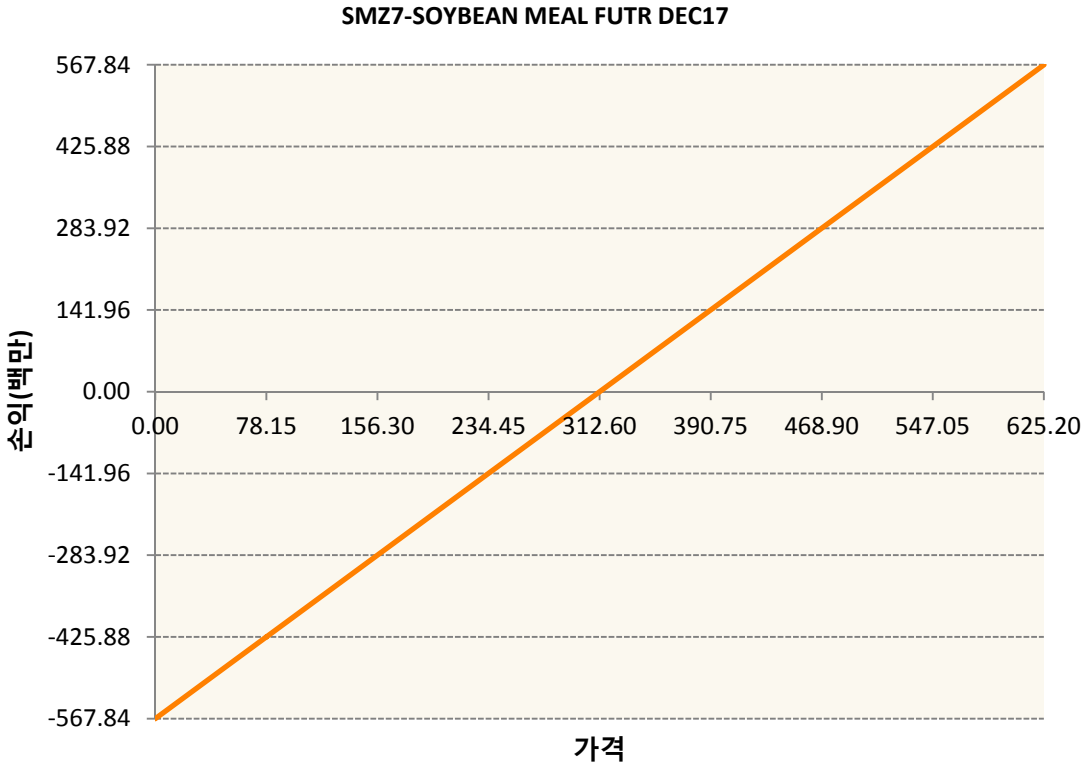


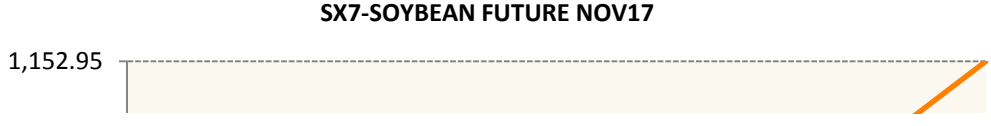

-480.30
가격

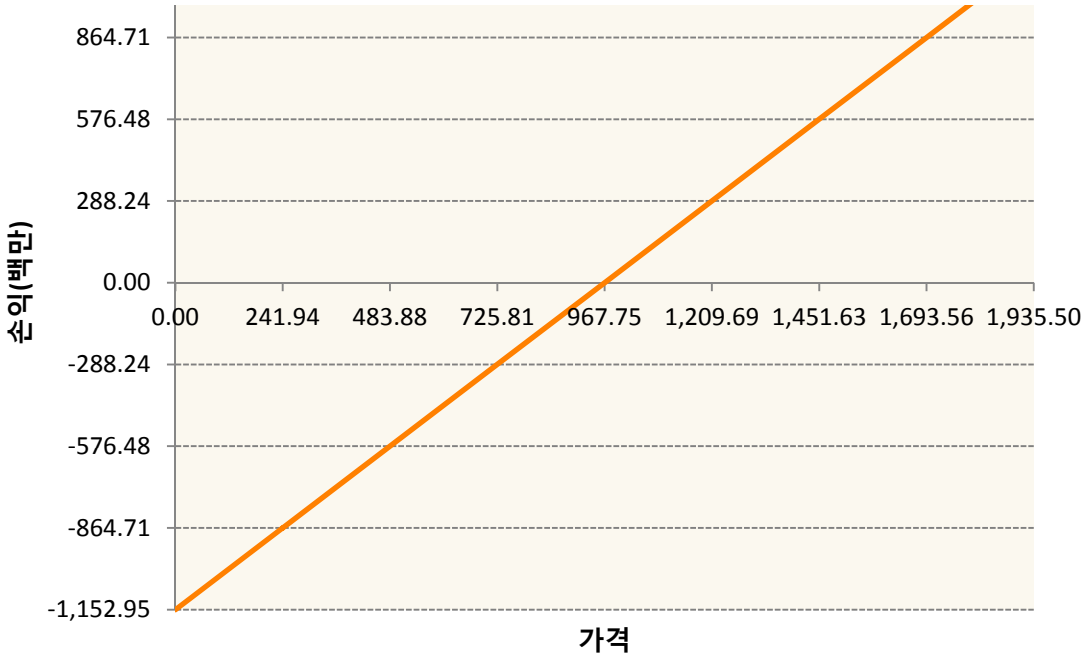

KR4175MA0008-2017-10 달러선물
254.39
169.59
84.80
0.00
-84.80
-169.59
-254.39
-339.18
0.00
282.65
565.30
847.95
1,130.60
1,413.25
1,695.90
1,978.55
2,261.20
손익(백만)
가격

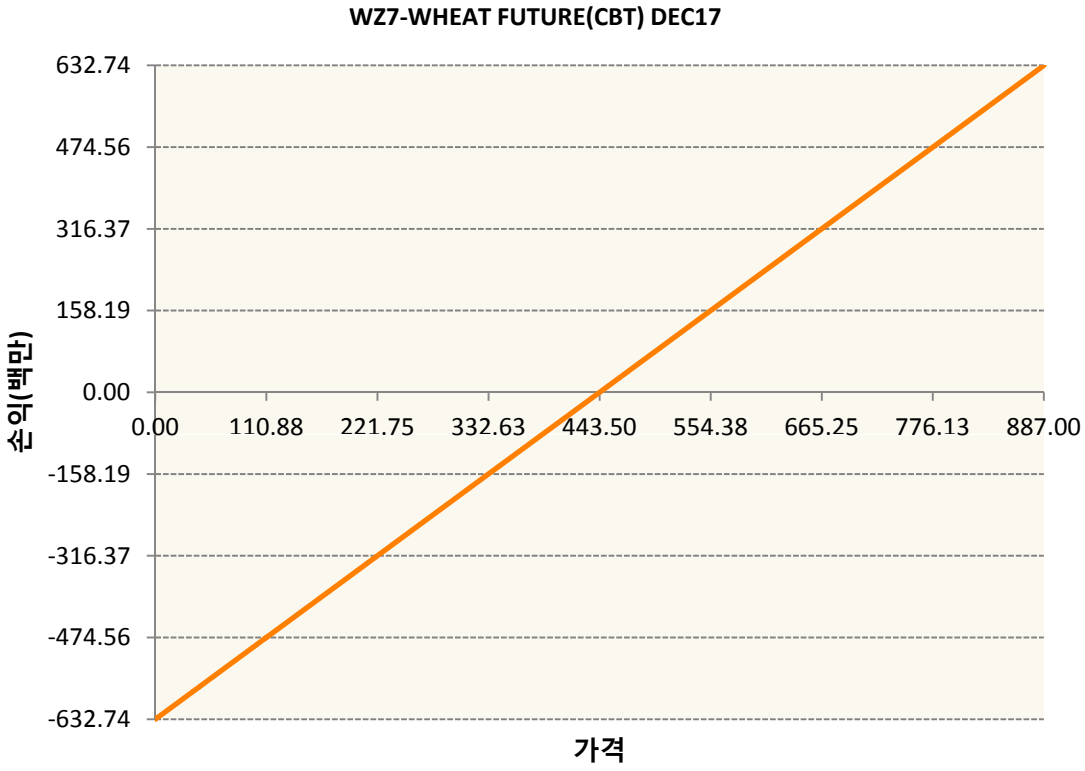

KWZ7-KC HRW WHEAT FUT DEC17
252.40
189.30
126.20
63.10
0.00
-63.10
-126.20
-189.30
-252.40
0.00
110.56
221.13
331.69
442.25
552.81
663.38
773.94
884.50
손익(백만)
가격


SBH8-Sugar #11 (WORLD) MAR18
471.47
353.60
235.74
117.87
0.00
-117.87
-235.74
-353.60
-471.47
0.00
3.73
7.46
11.19
14.92
18.65
22.38
26.11
29.84
손익(백만)
가격


SMZ7-SOYBEAN MEAL FUTR DEC17
567.84
425.88
283.92
141.96
0.00
-141.96
-283.92
-425.88
-567.84
0.00
78.15
156.30
234.45
312.60
390.75
468.90
547.05
625.20
손익(백만)
가격


SX7-SOYBEAN FUTURE NOV17
1,152.95





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
BOZ7	SOYBEAN OIL FUTR DEC17	43
CTZ7	COTTON NO.2 FUTR DEC17	22
CZ7	CORN FUTURE DEC17	117
KCZ7	COFFEE 'C' FUTURE DEC17	38
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)

550