공시일	2017-09-21
기준일	2017-09-20

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	2017-09-21
기준일	2017-09-20

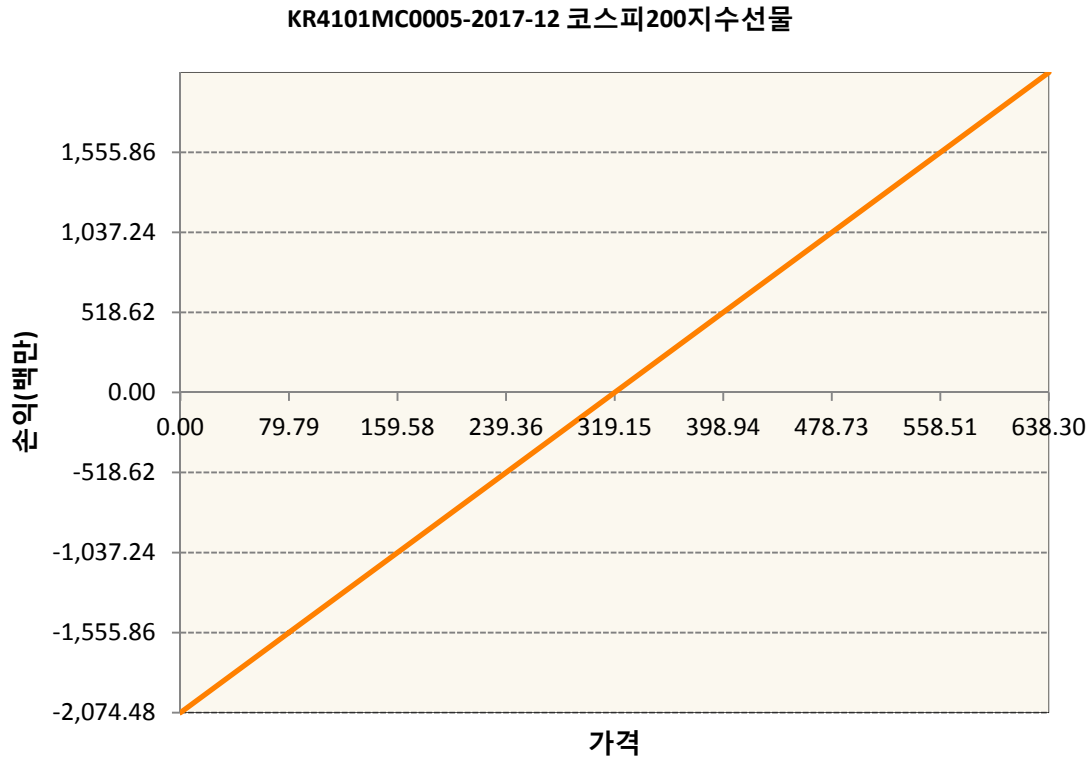
스마트인덱스모

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	80	-80	장내
누계	유가증권	선물	2,074	0	2,074	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101MC0	2017-12 코스피200지수선물						166
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-166	-166	-166	-166	-166	-166	-166
-5.33%	-110	-110	-110	-110	-110	-110	-110
-2.67%	-55	-55	-55	-55	-55	-55	-55
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	55	55	55	55	55	55	55
5.33%	110	110	110	110	110	110	110
8.00%	166	166	166	166	166	166	166

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

100

공시일	2017-09-21
기준일	2017-09-20

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	1,042

* 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	2017-09-21
기준일	2017-09-20

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)

364

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-09-21
기준일	2017-09-20

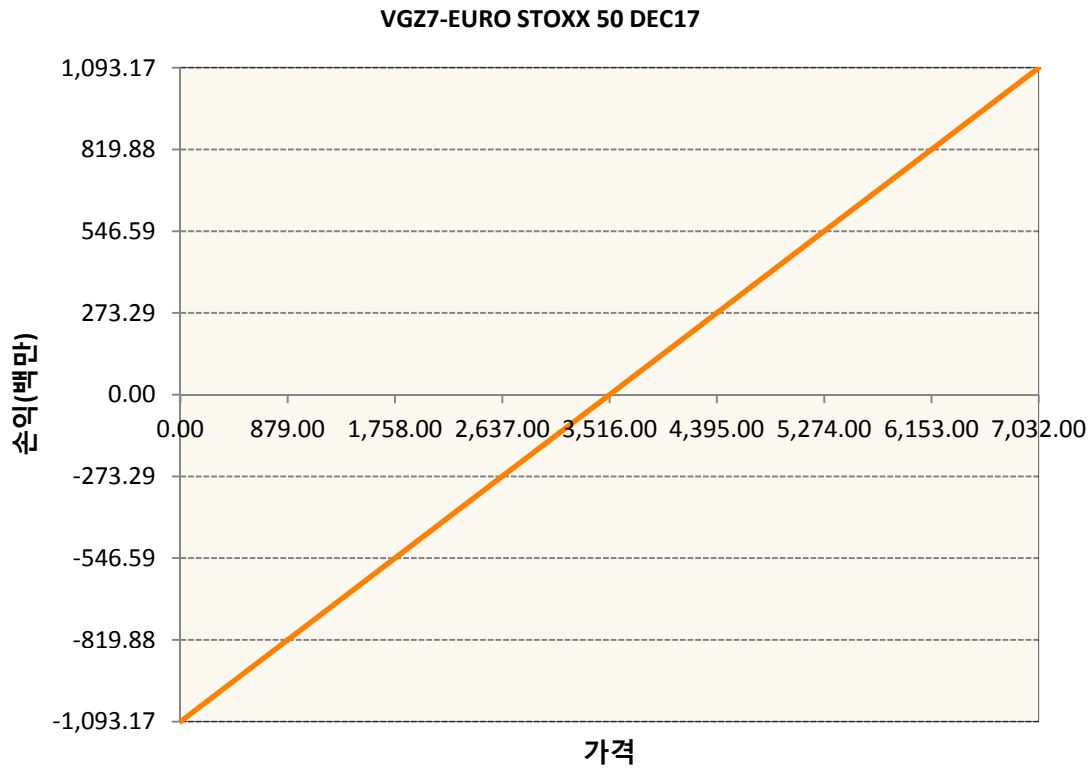
유로인덱스모(주식-파생형)

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	2017-09-21
기준일	2017-09-20

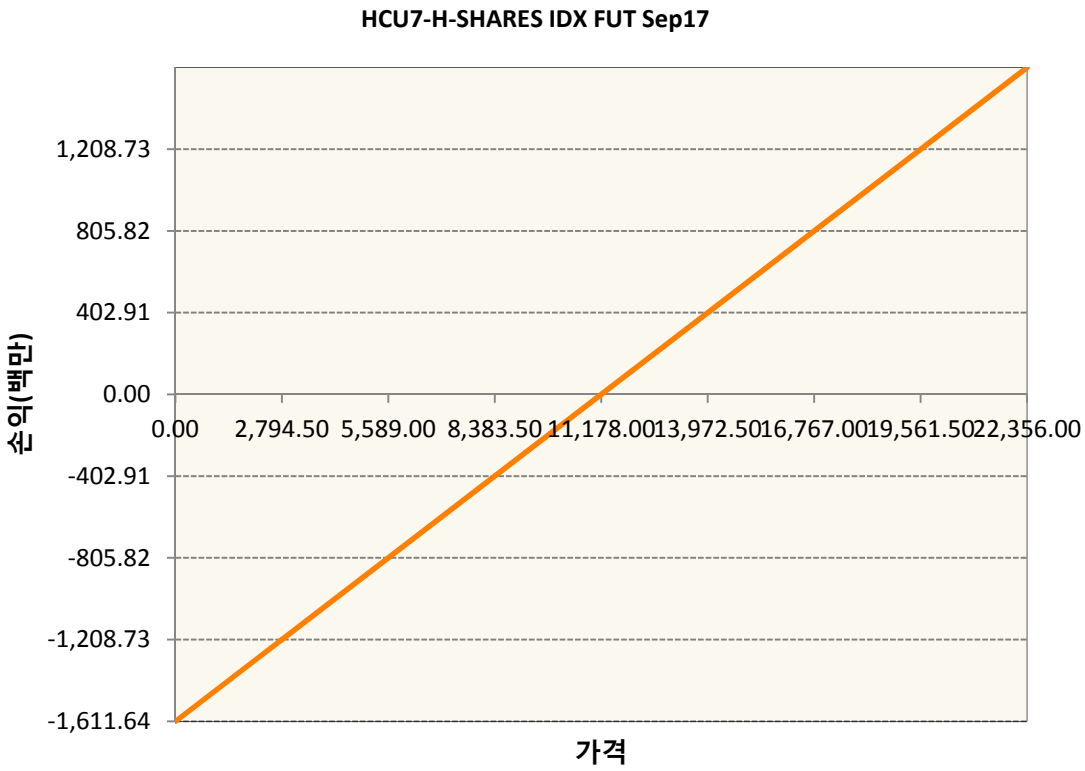
차이나인덱스모(주식-파생형)

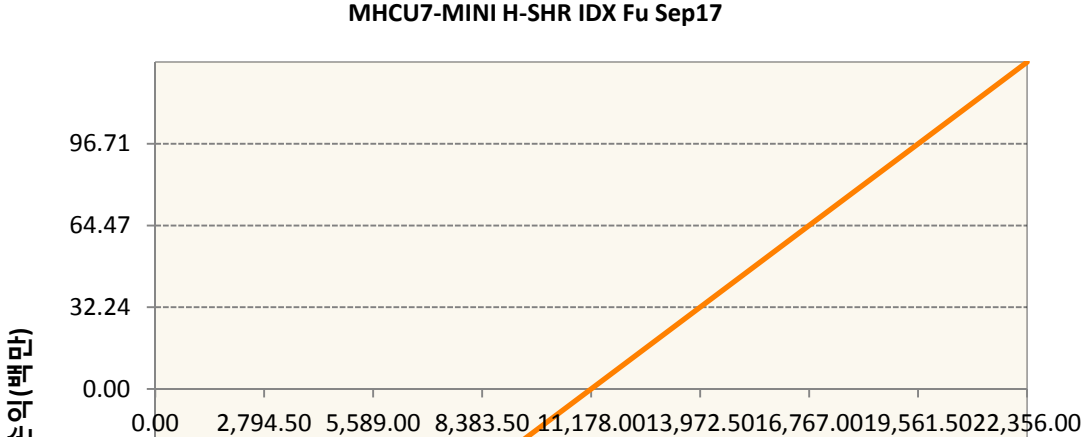
1. 계약금액

(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	1,612	0	1,612	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)
	117

공시일	2017-09-21
기준일	2017-09-20

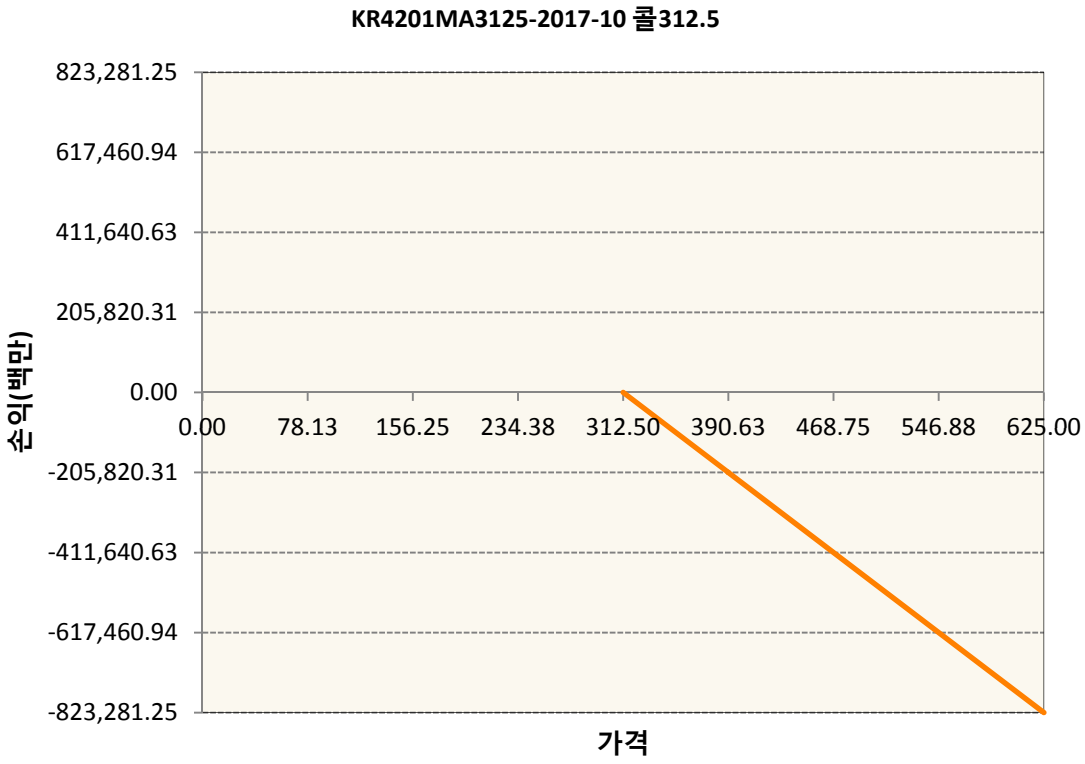
커버드콜모(주식혼합-파생형)

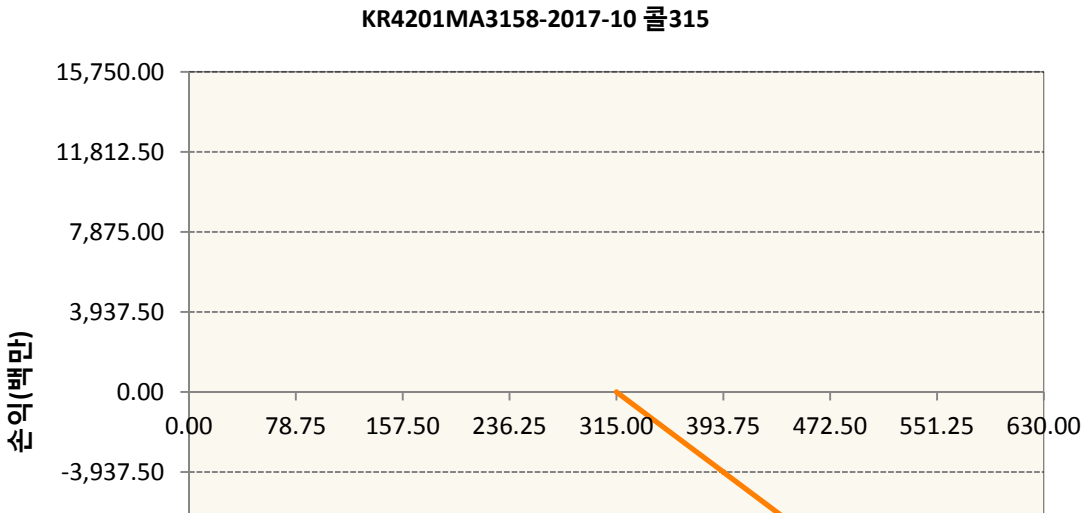
1. 계약금액

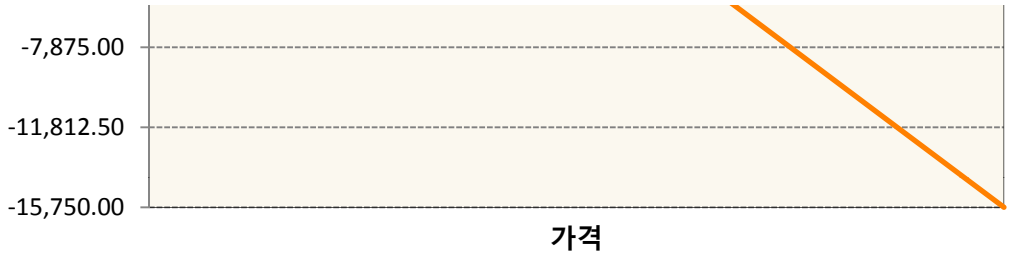
(단위:백만원)

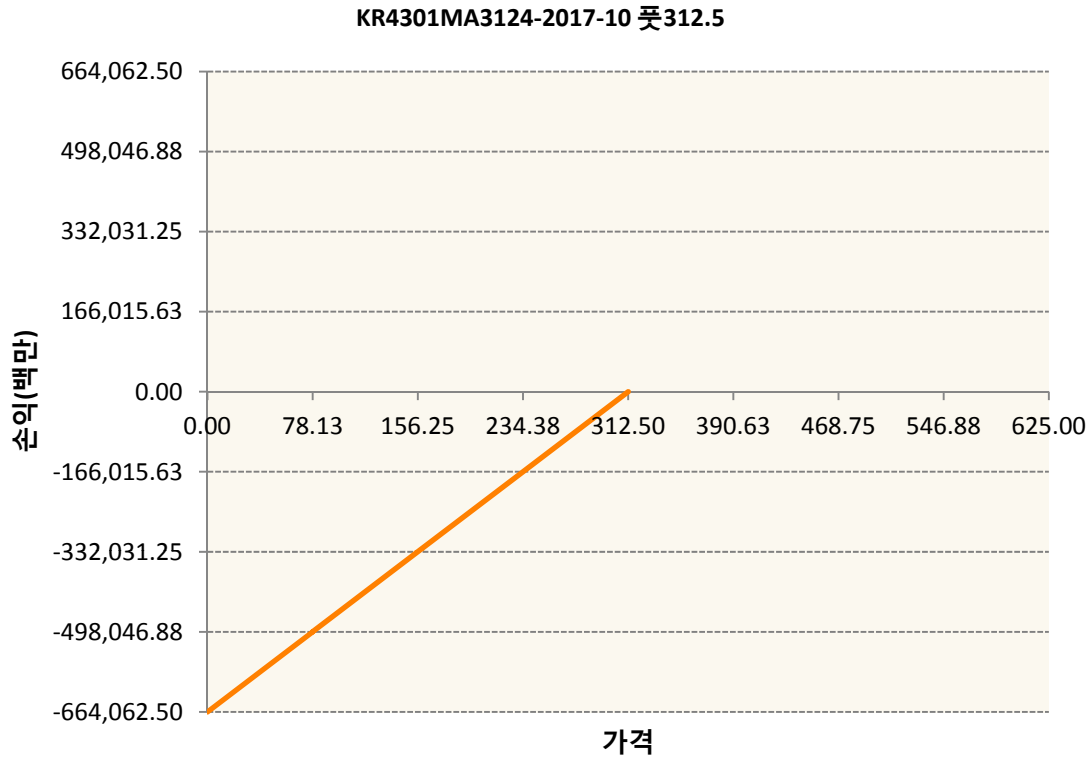
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	1,503,094	-1,503,094	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201MA3 2017-10 콜312.5							57,723
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	26,522	26,012	25,393	24,679	23,880	23,008	22,072
-5.33%	23,739	22,662	21,517	20,321	19,082	17,809	16,509
-2.67%	16,788	15,293	13,794	12,292	10,787	9,280	7,772
0%	4,279	2,874	1,446	0	-1,460	-2,931	-4,412
2.67%	-13,188	-14,110	-15,125	-16,215	-17,367	-18,570	-19,815
5.33%	-33,699	-34,134	-34,685	-35,340	-36,091	-36,926	-37,835
8.00%	-55,527	-55,679	-55,912	-56,233	-56,643	-57,141	-57,723
KR4201MA3 2017-10 콜315							1,057
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	435	428	418	407	394	380	364

-5.33%	397	379	360	340	319	296	273
-2.67%	292	265	237	209	182	154	125
0%	86	57	29	0	-29	-58	-87
2.67%	-221	-241	-264	-287	-311	-336	-362
5.33%	-596	-607	-620	-635	-652	-670	-690
8.00%	-1,005	-1,009	-1,015	-1,023	-1,033	-1,044	-1,057
KR4301MA3 2017-10 풋312.5							36,290

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-32,701	-33,112	-33,611	-34,188	-34,832	-35,536	-36,290
-5.33%	-16,914	-17,784	-18,706	-19,672	-20,671	-21,697	-22,746
-2.67%	-4,490	-5,696	-6,905	-8,116	-9,330	-10,546	-11,762
0%	3,451	2,319	1,167	0	-1,178	-2,365	-3,558
2.67%	7,394	6,650	5,831	4,952	4,023	3,053	2,048
5.33%	8,881	8,529	8,086	7,557	6,951	6,278	5,545
8.00%	9,305	9,182	8,995	8,736	8,405	8,003	7,534

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

95,283

공시일	2017-09-21
기준일	2017-09-20

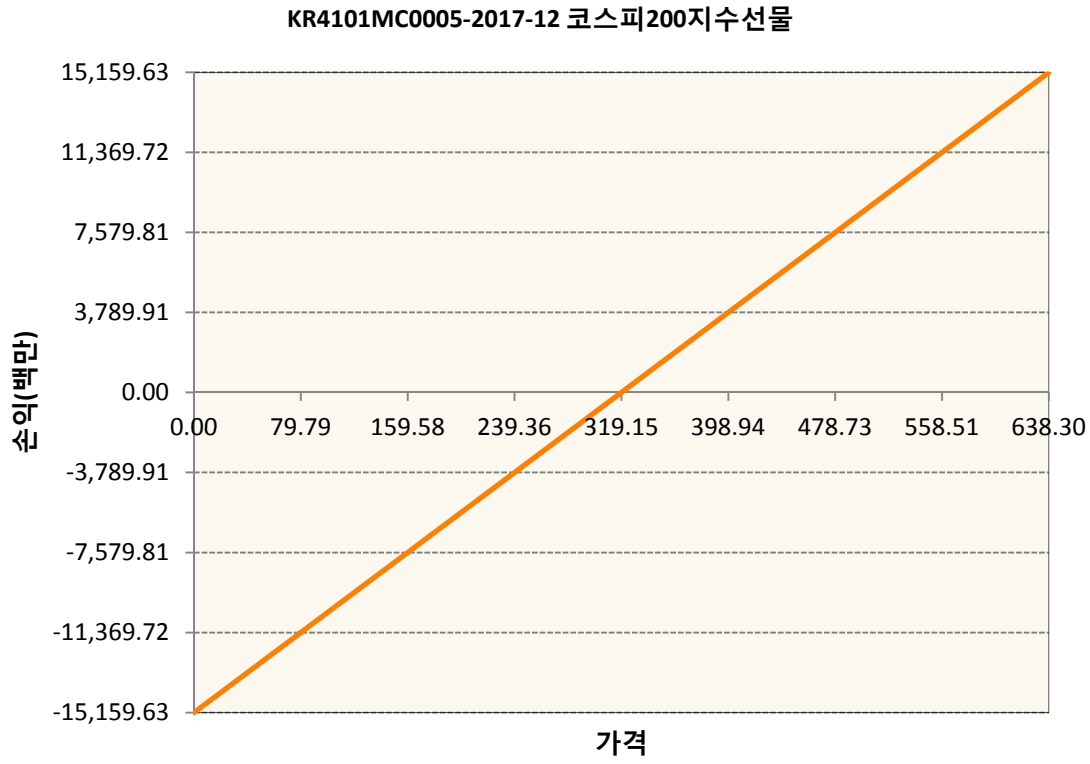
ETF스마트레버리지목표전환형6호

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	240	-240	장내
누계	유가증권	선물	15,160	0	15,160	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101MC0	2017-12 코스피200지수선물						1,210
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,210	-1,210	-1,210	-1,210	-1,210	-1,210	-1,210
-5.33%	-807	-807	-807	-807	-807	-807	-807
-2.67%	-403	-403	-403	-403	-403	-403	-403
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	403	403	403	403	403	403	403
5.33%	807	807	807	807	807	807	807
8.00%	1,210	1,210	1,210	1,210	1,210	1,210	1,210

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

734

공시일	2017-09-21
기준일	2017-09-20

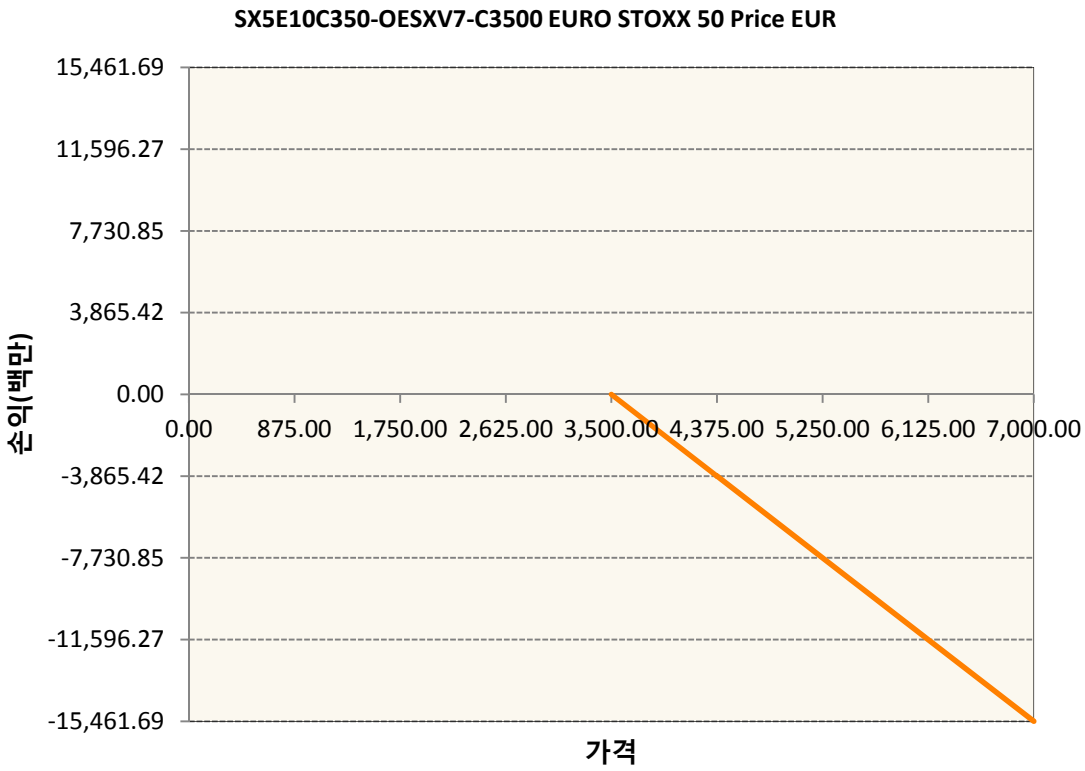
유로커버드콜(주식혼합-파생형)

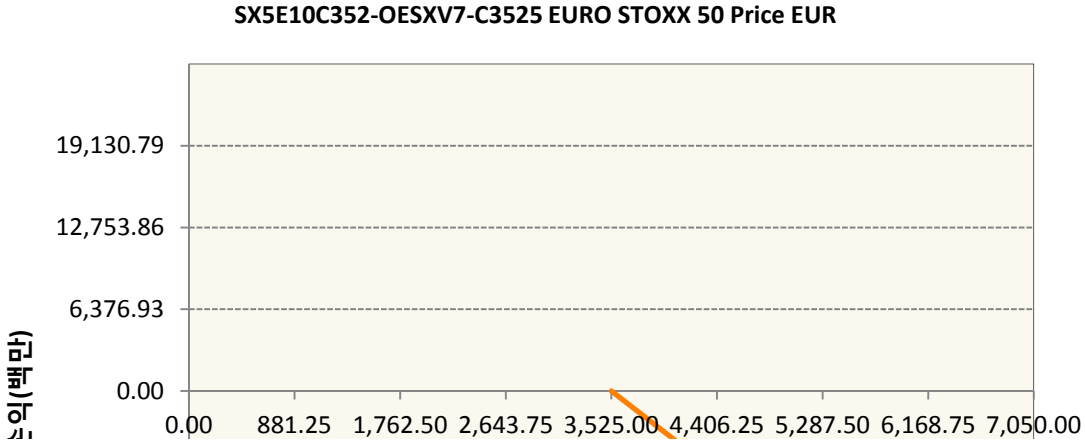
1. 계약금액

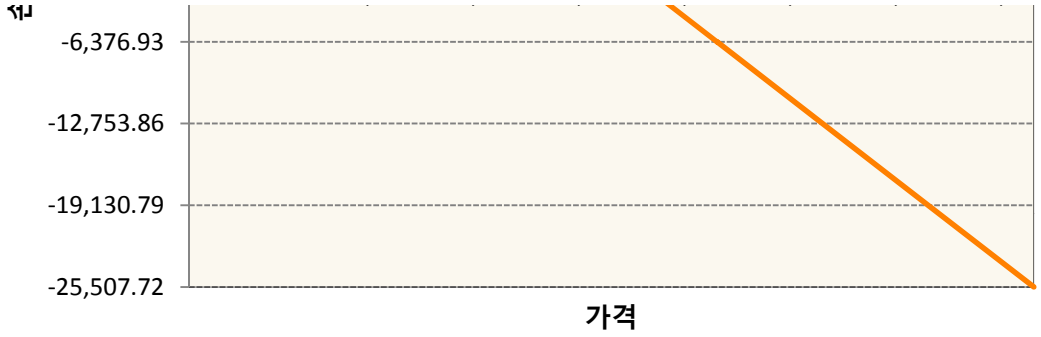
(단위:백만원)

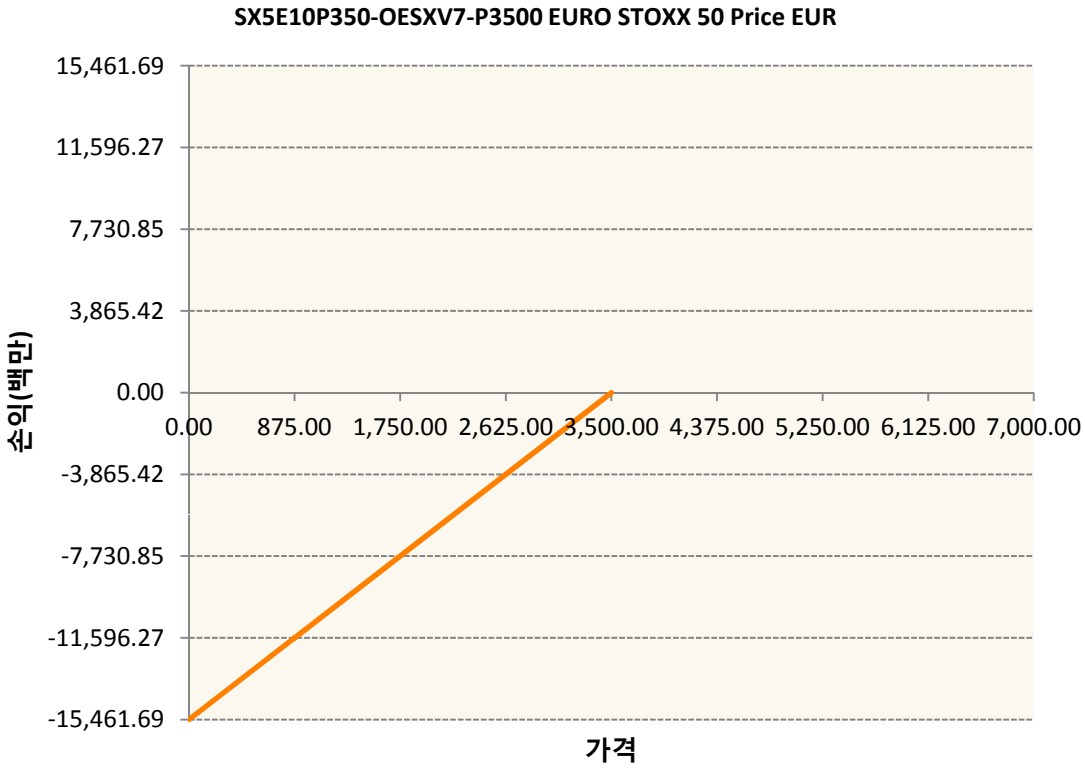
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	39,957	0	39,957	
누계	유가증권	옵션	0	81,939	-81,939	장내

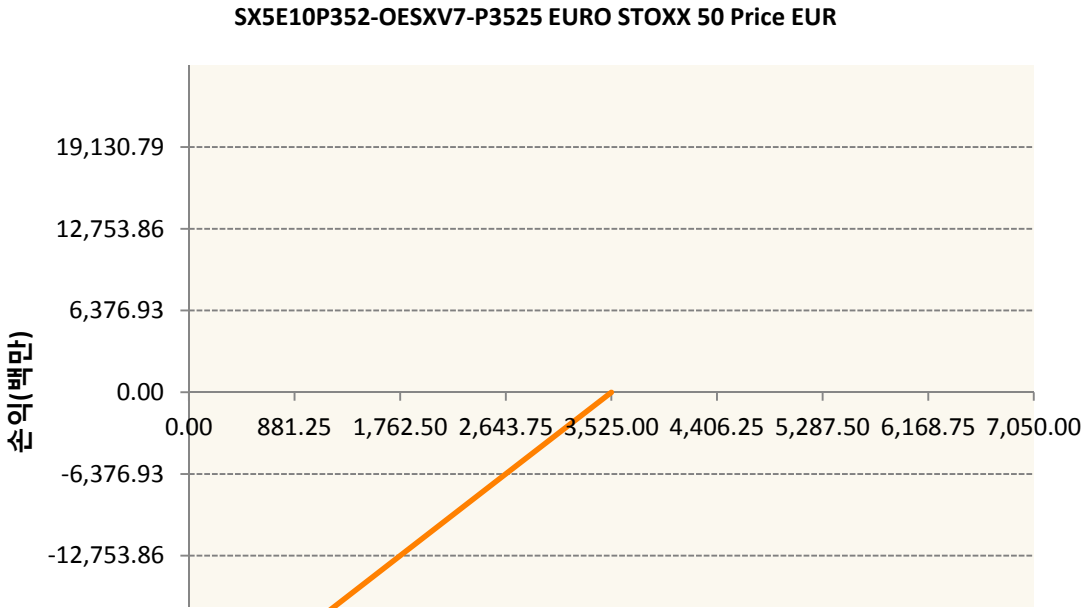
2. 만기시점의 손익구조

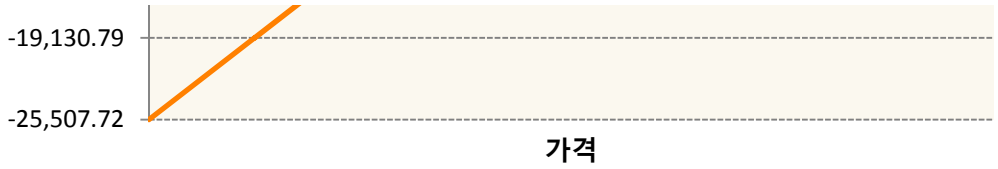


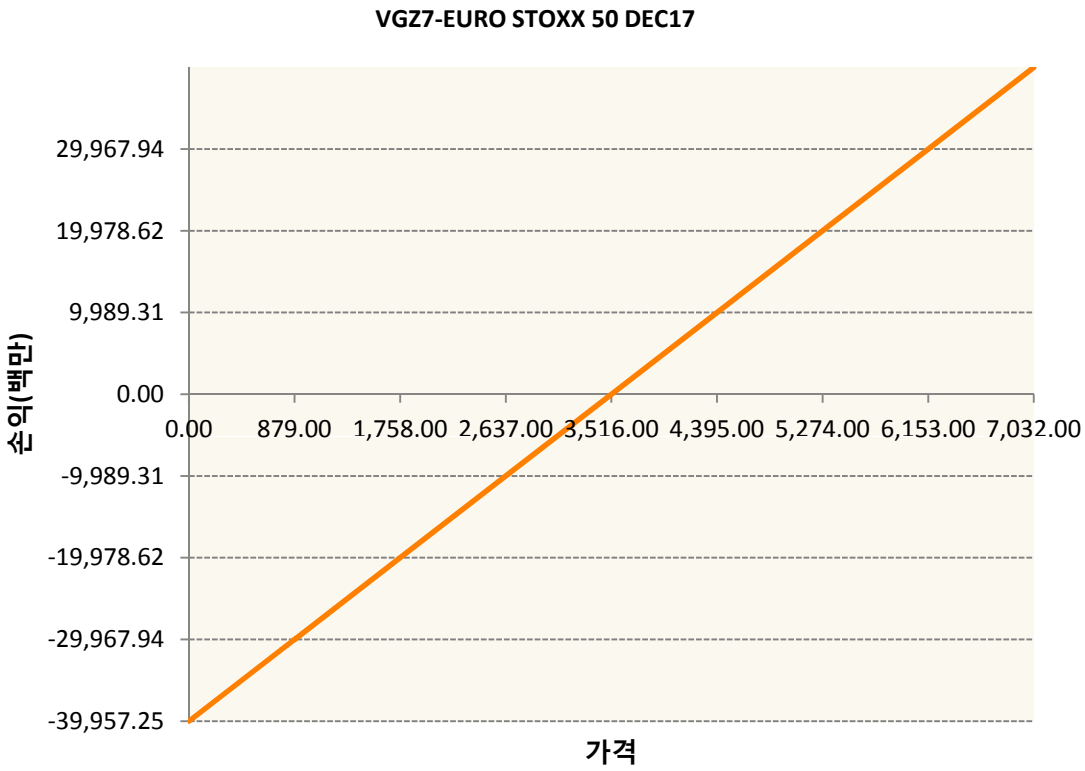



-6,376.93
-12,753.86
-19,130.79
-25,507.72
가격


SX5E10P350-OESXV7-P3500 EURO STOXX 50 Price EUR
15,461.69
11,596.27
7,730.85
3,865.42
0.00
-3,865.42
-7,730.85
-11,596.27
-15,461.69
0.00
875.00
1,750.00
2,625.00
3,500.00
4,375.00
5,250.00
6,125.00
7,000.00
손익(백만)
가격


SX5E10P352-OESXV7-P3525 EURO STOXX 50 Price EUR
19,130.79
12,753.86
6,376.93
0.00
-6,376.93
-12,753.86
0.00
881.25
1,762.50
2,643.75
3,525.00
4,406.25
5,287.50
6,168.75
7,050.00
손익(백만)





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
SX5E10C350	OESXV7-C3500 EURO STOXX 50 Price EUR	1,237
SX5E10C352	OESXV7-C3525 EURO STOXX 50 Price EUR	2,041
SX5E10P350	OESXV7-P3500 EURO STOXX 50 Price EUR	1,237
SX5E10P352	OESXV7-P3525 EURO STOXX 50 Price EUR	2,041
VGZ7	EURO STOXX 50 DEC17	3,197

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	7,683

공시일	2017-09-21
기준일	2017-09-20

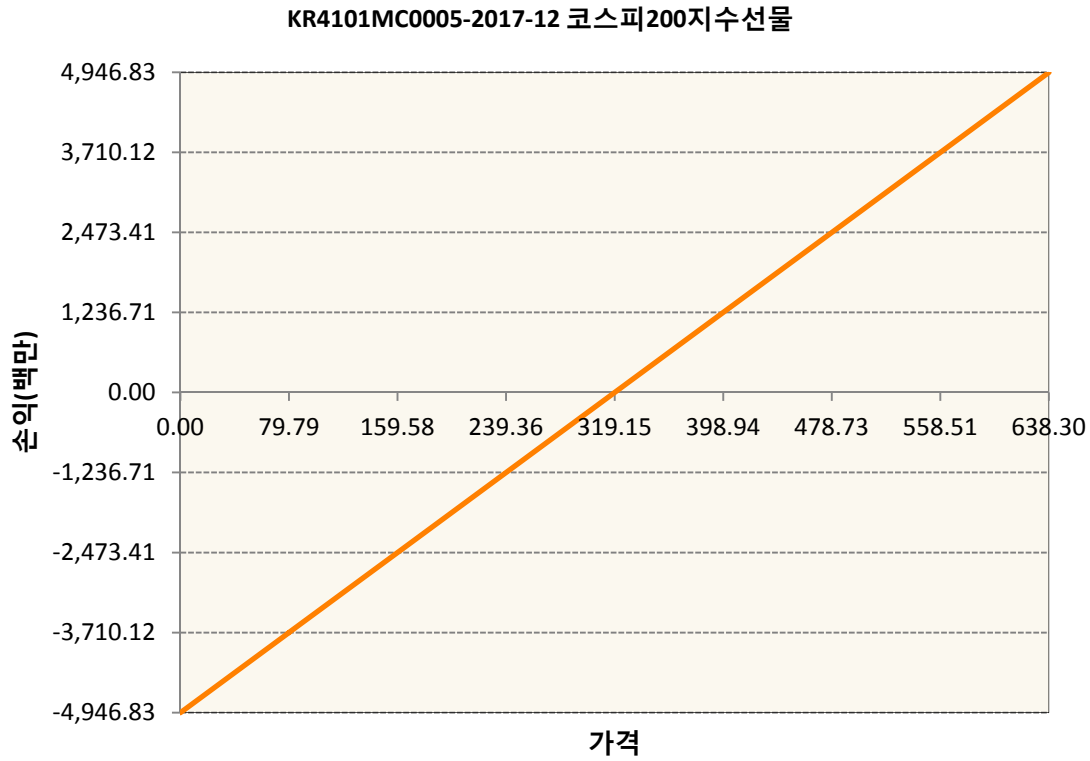
ETF스마트레버리지목표전환형7호

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	4,947	0	4,947	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	2017-09-21
기준일	2017-09-20

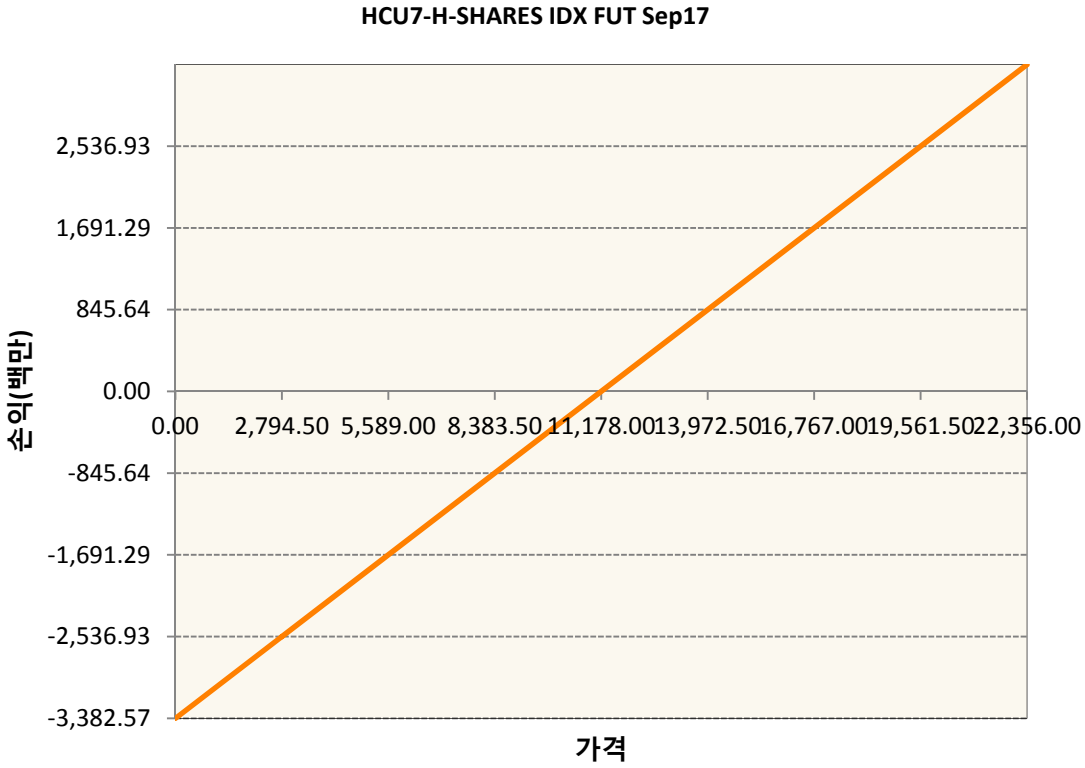
홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생

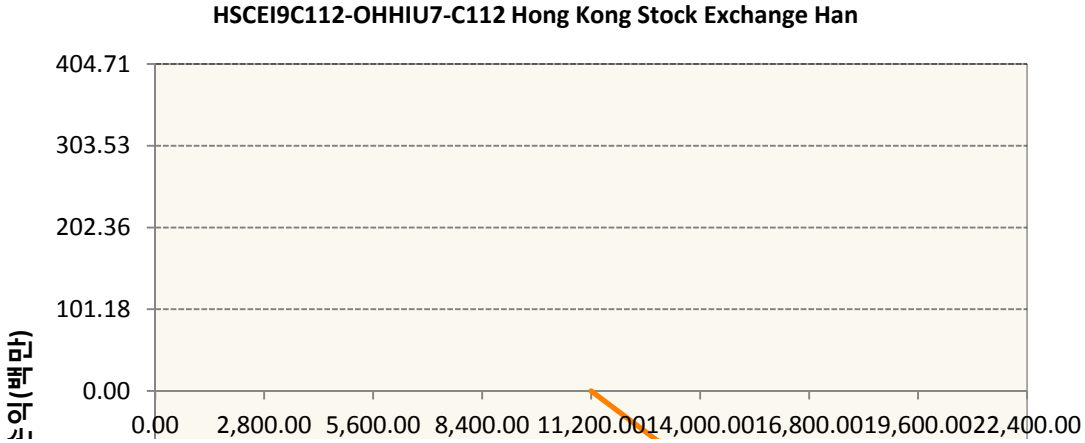
1. 계약금액

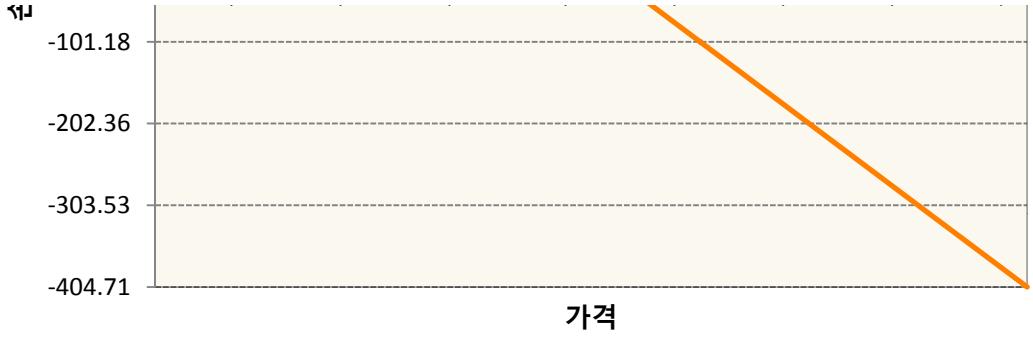
(단위:백만원)

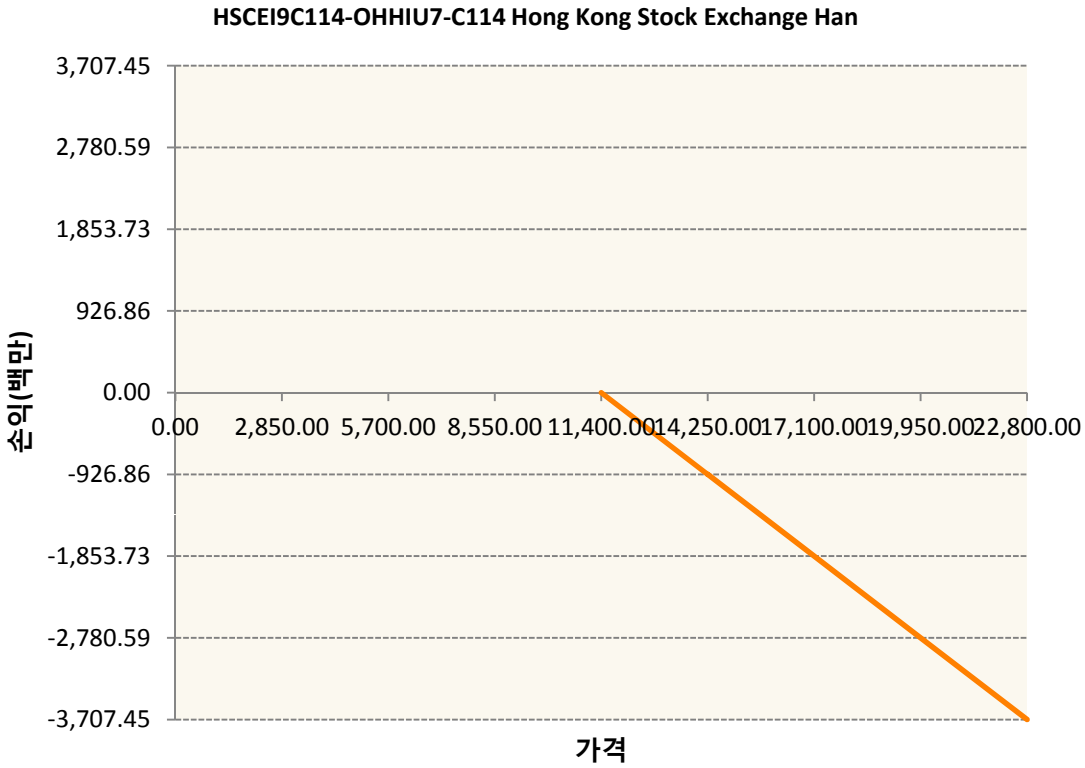
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	3,383	0	3,383	장내
누계	유가증권	옵션	0	8,224	-8,224	장내

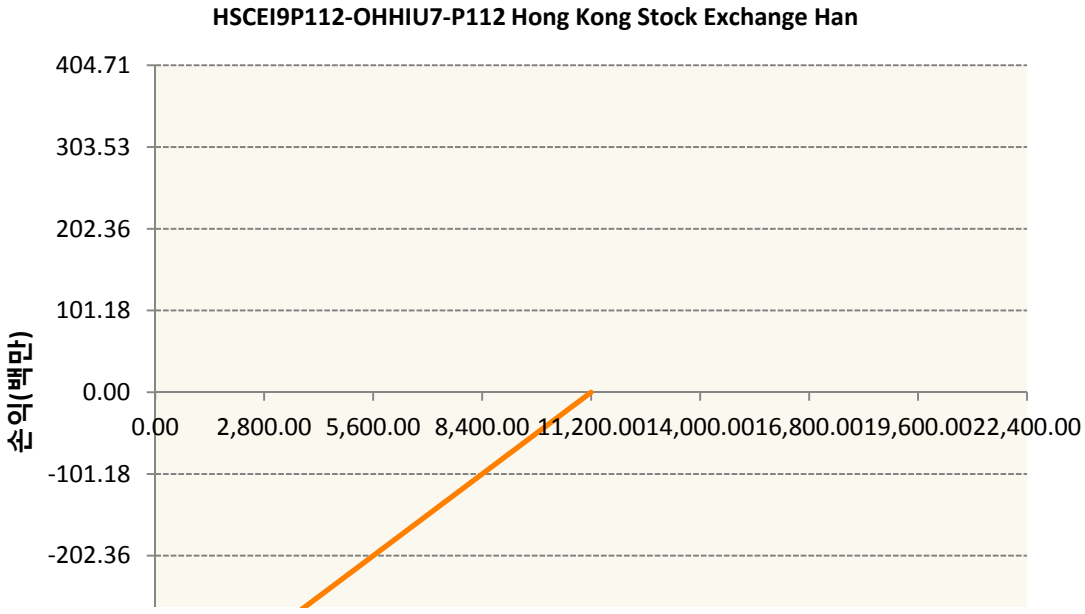
2. 만기시점의 손익구조

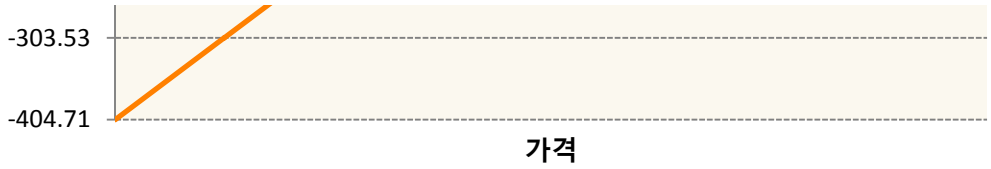


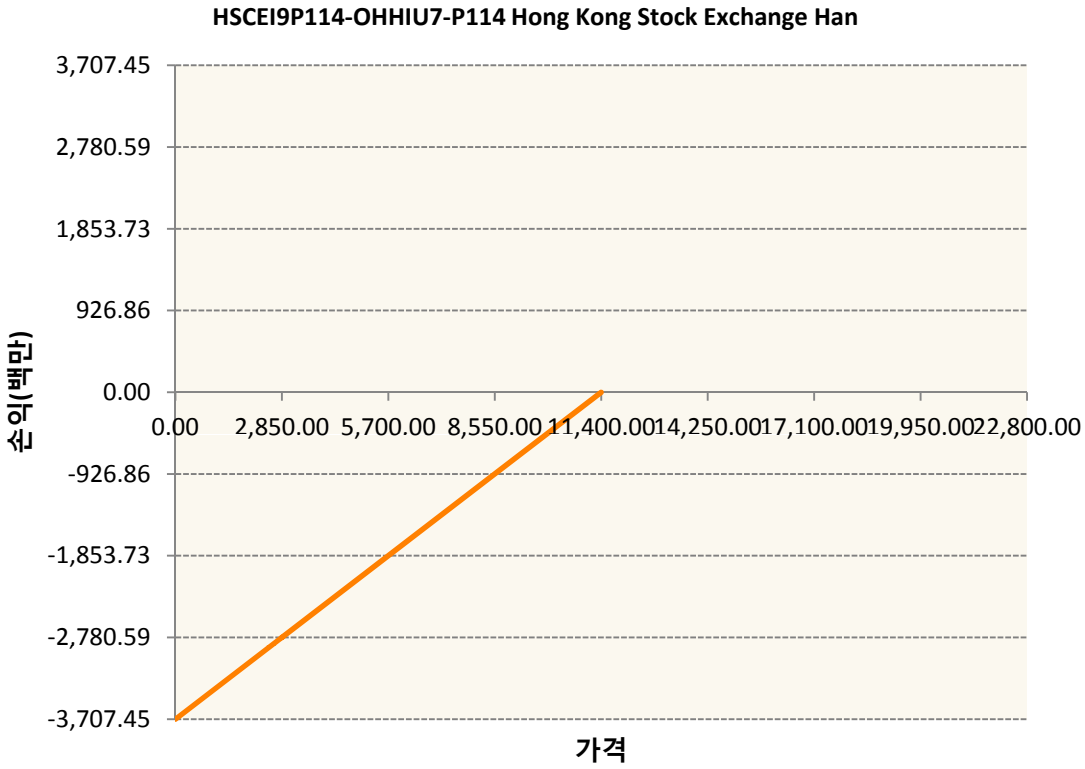



-101.18
-202.36
-303.53
-404.71
가격


HSCEI9C114-OHHIU7-C114 Hong Kong Stock Exchange Han
3,707.45
2,780.59
1,853.73
926.86
0.00
-926.86
-1,853.73
-2,780.59
-3,707.45
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
404.71
303.53
202.36
101.18
0.00
-101.18
-202.36
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	271
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	2017-09-21
기준일	2017-09-20

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼

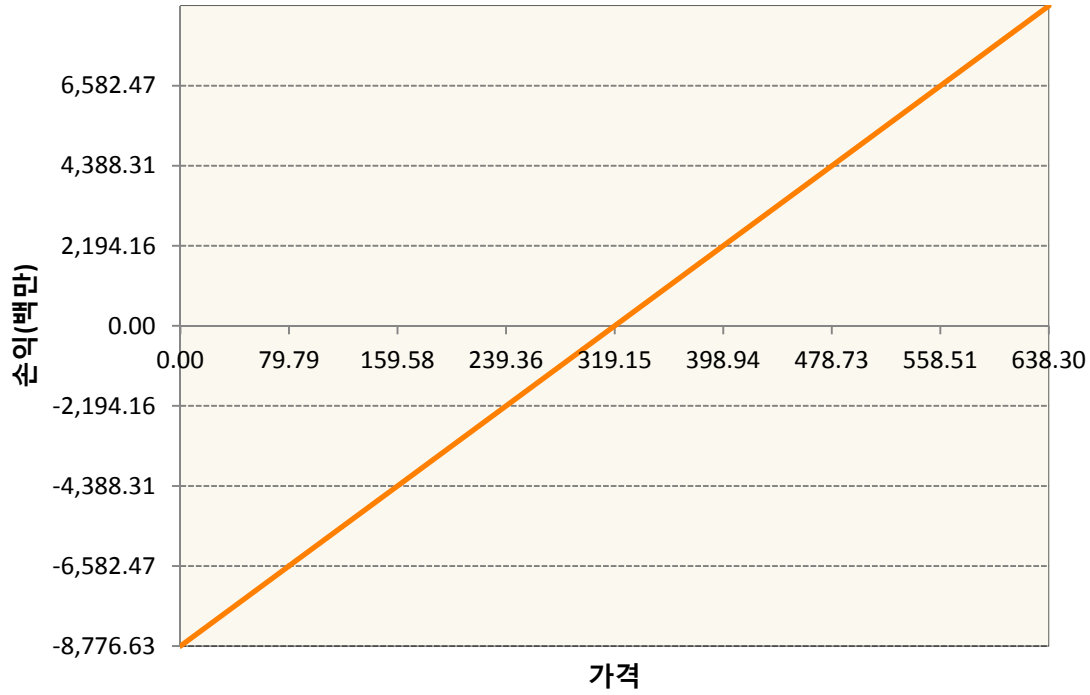
1. 계약금액

(단위:백만원)

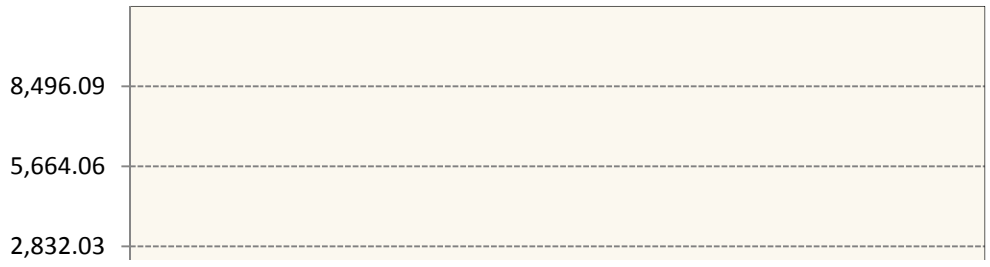
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	2,000	0	2,000	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	8,777	0	8,777	장내
누계	유가증권	스왑	24,000	0	24,000	장외
누계	유가증권	옵션	0	22,656	-22,656	장내

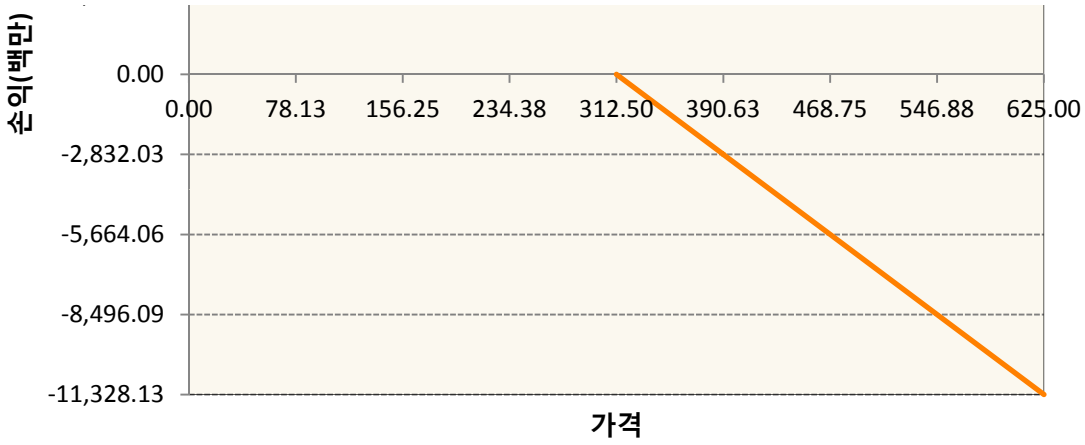
2. 만기시점의 손익구조

KR4101MC0005-2017-12 코스피200지수선물

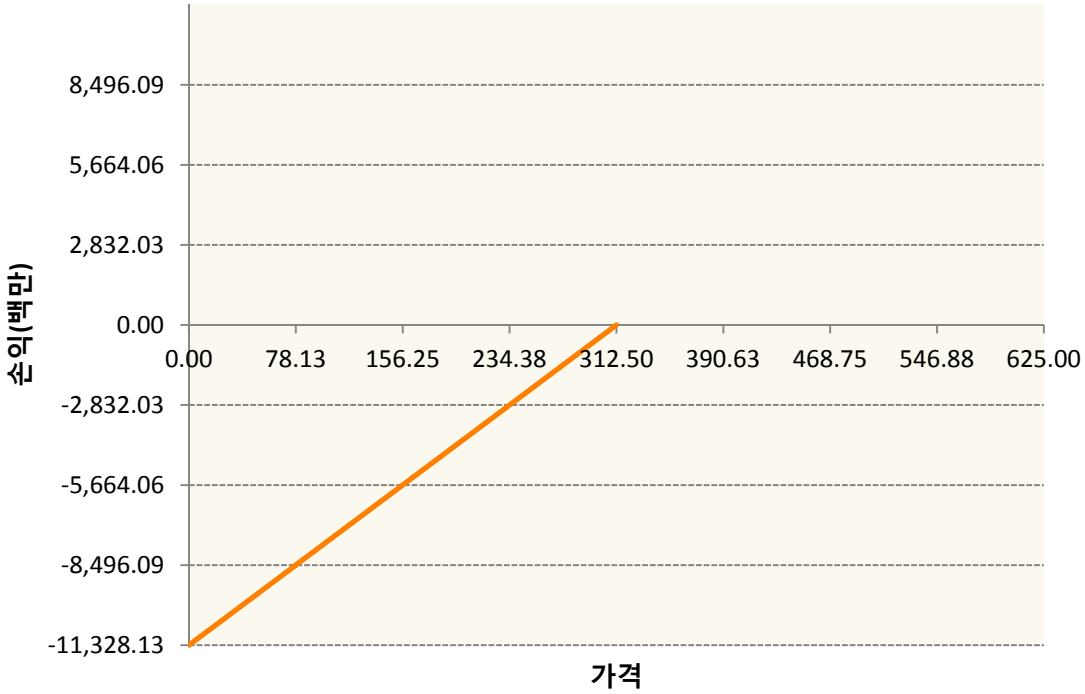


KR4201MA3125-2017-10 콜312.5





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
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_3						161
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-161	-161	-161	-161	-161	-161	-161
-5.33%	-107	-107	-107	-107	-107	-107	-107
-2.67%	-54	-54	-54	-54	-54	-54	-54
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	54	54	54	54	54	54	54
5.33%	107	107	107	107	107	107	107
8.00%	161	161	161	161	161	161	161
	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						794
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	365	358	349	340	329	317	304
-5.33%	327	312	296	280	263	245	227
-2.67%	231	210	190	169	148	128	107
0%	59	40	20	0	-20	-40	-61
2.67%	-181	-194	-208	-223	-239	-256	-273
5.33%	-464	-470	-477	-486	-497	-508	-521
8.00%	-764	-766	-769	-774	-779	-786	-794
	KR4301MA3 2017-10 풋312.5						619
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-558	-565	-573	-583	-594	-606	-619

-5.33%	-289	-303	-319	-336	-353	-370	-388
-2.67%	-77	-97	-118	-138	-159	-180	-201
0%	59	40	20	0	-20	-40	-61
2.67%	126	113	99	84	69	52	35
5.33%	151	146	138	129	119	107	95
8.00%	159	157	153	149	143	137	129

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

3,761

공시일	2017-09-21
기준일	2017-09-20

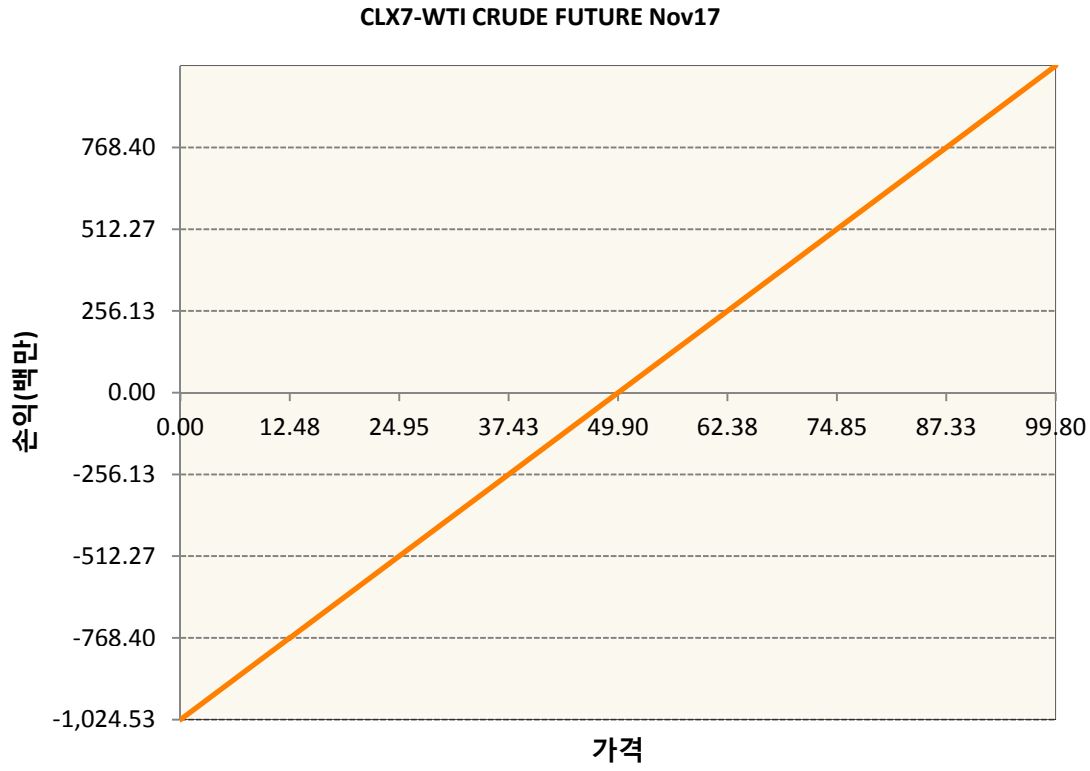
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

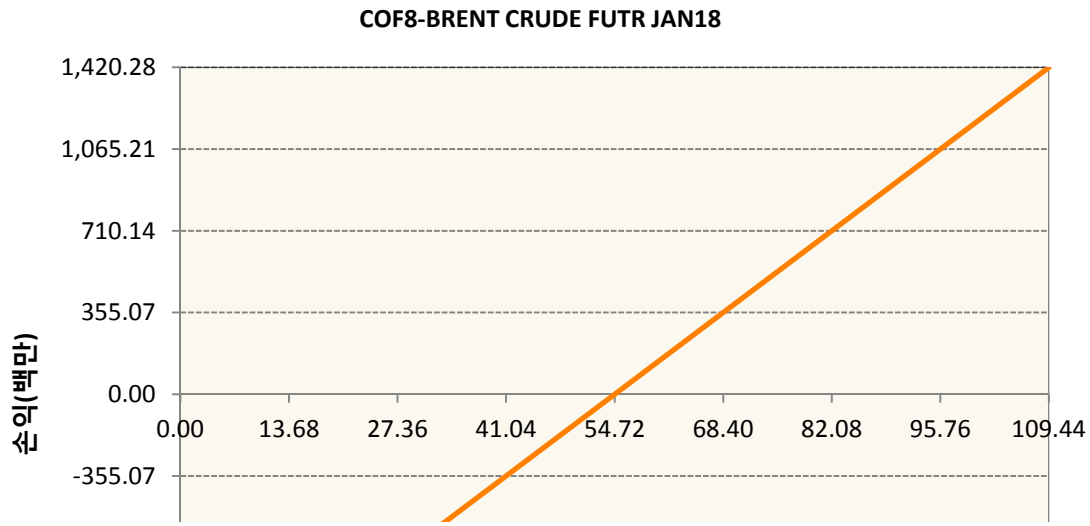
1. 계약금액

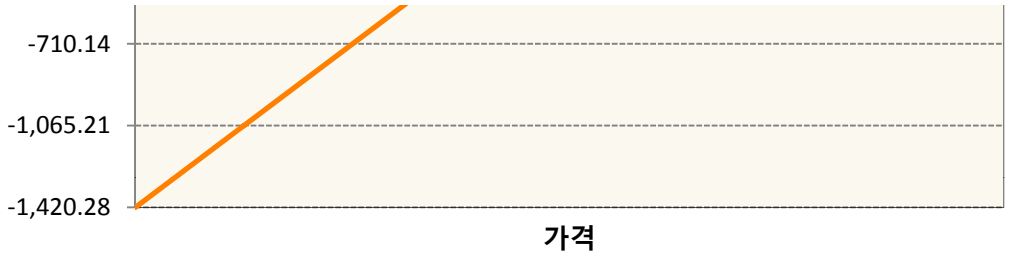
(단위:백만원)

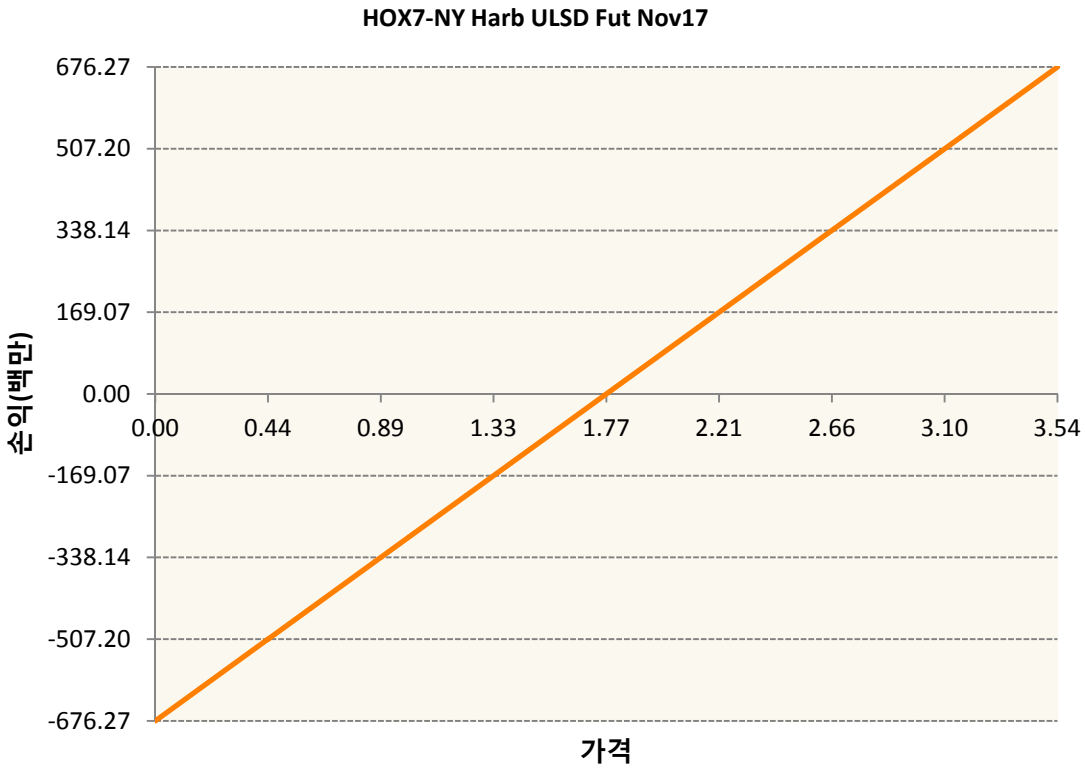
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	5,334	733	4,601	

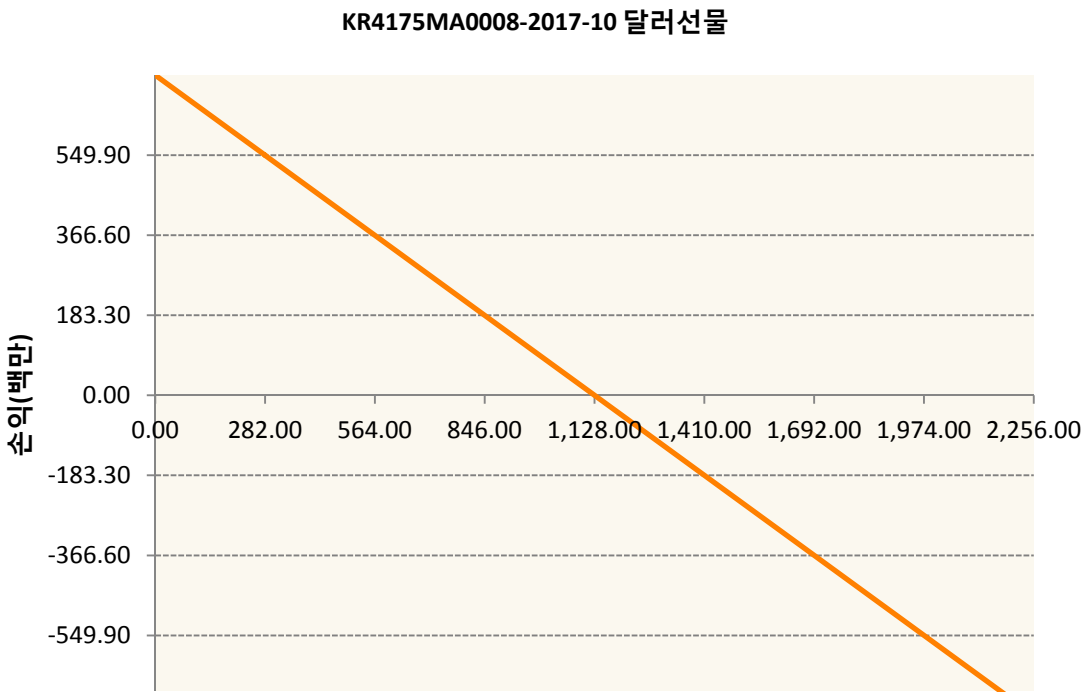
2. 만기시점의 손익구조

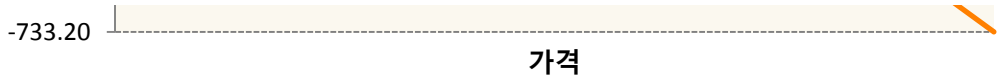


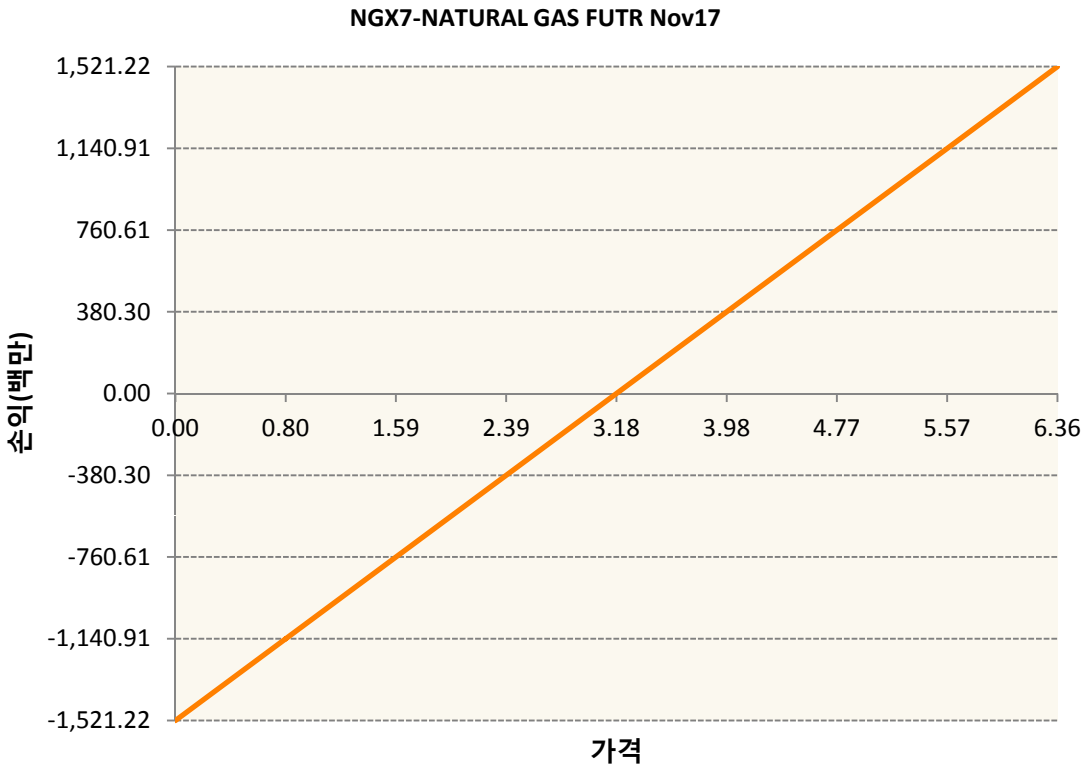


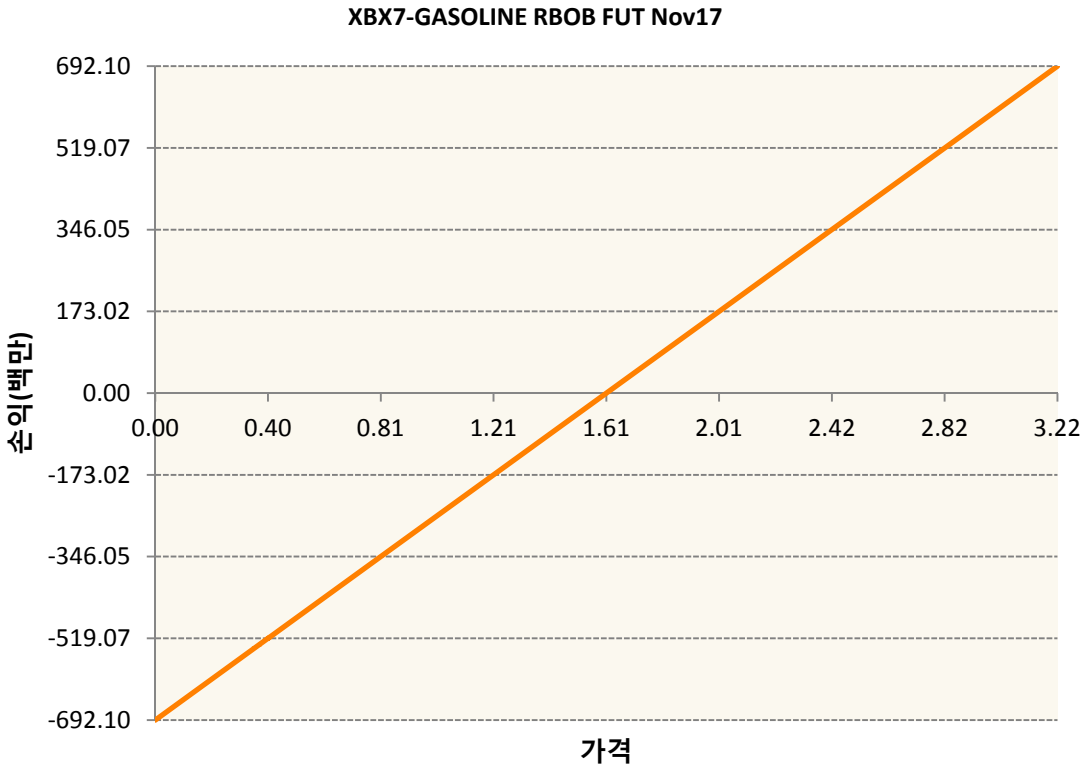

-710.14
-1,065.21
-1,420.28
가격


HOX7-NY Harb ULSD Fut Nov17
676.27
507.20
338.14
169.07
0.00
-169.07
-338.14
-507.20
-676.27
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
549.90
366.60
183.30
0.00
-183.30
-366.60
-549.90
0.00
282.00
564.00
846.00
1,128.00
1,410.00
1,692.00
1,974.00
2,256.00
손익(백만)


-733.20
가격


NGX7-NATURAL GAS FUTR Nov17
1,521.22
1,140.91
760.61
380.30
0.00
-380.30
-760.61
-1,140.91
-1,521.22
0.00
0.80
1.59
2.39
3.18
3.98
4.77
5.57
6.36
손익(백만)
가격


XBX7-GASOLINE RBOB FUT Nov17
692.10
519.07
346.05
173.02
0.00
-173.02
-346.05
-519.07
-692.10
0.00
0.40
0.81
1.21
1.61
2.01
2.42
2.82
3.22
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
KR4175MA0	2017-10 달러선물	59
NGX7	NATURAL GAS FUTR Nov17	122
XBX7	GASOLINE RBOB FUT Nov17	55

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

775

공시일	2017-09-21
기준일	2017-09-20

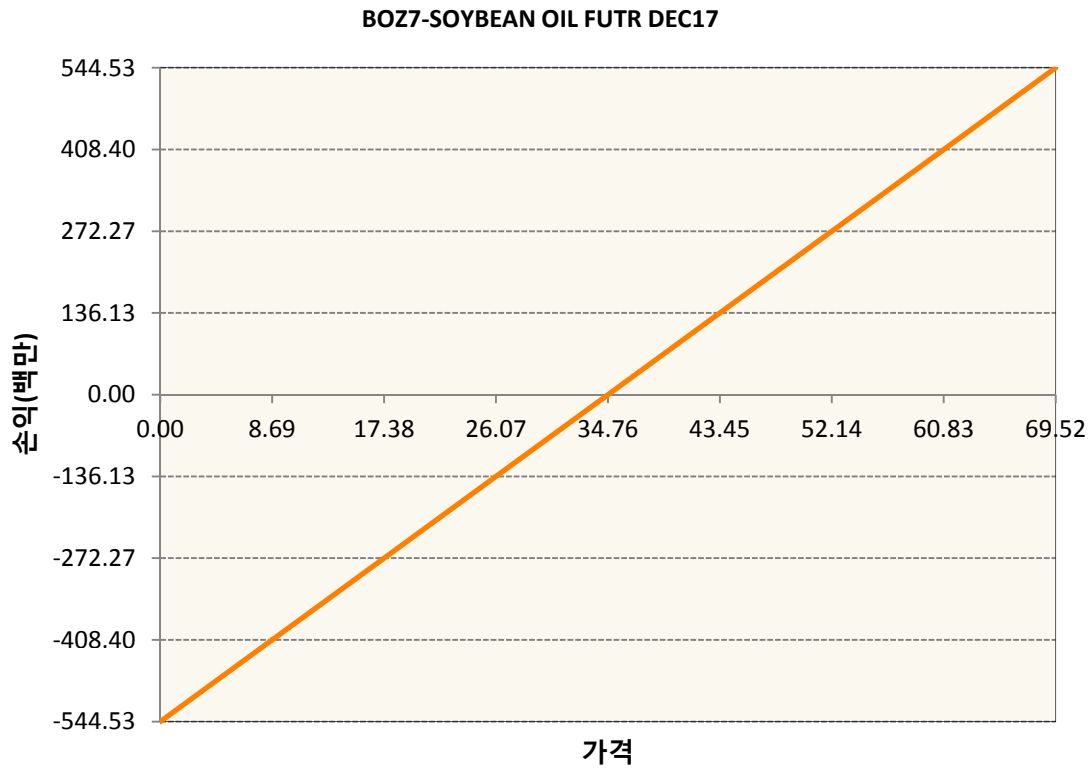
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

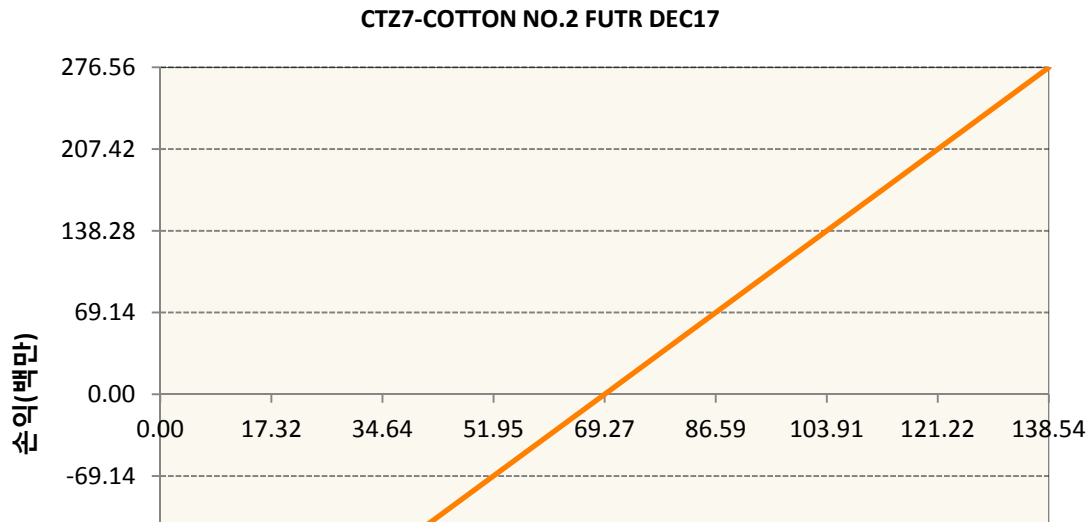
1. 계약금액

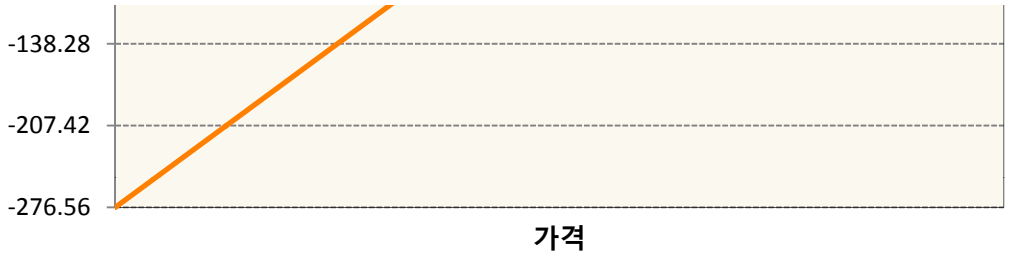
(단위:백만원)

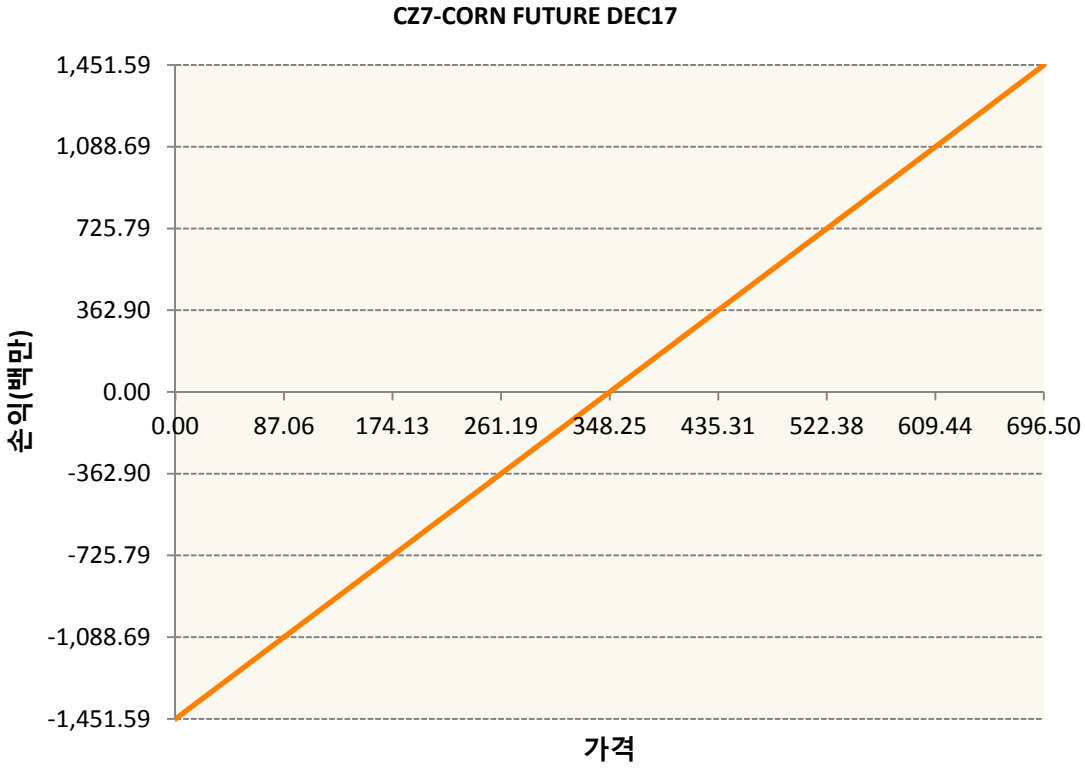
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	5,785	338	5,447	

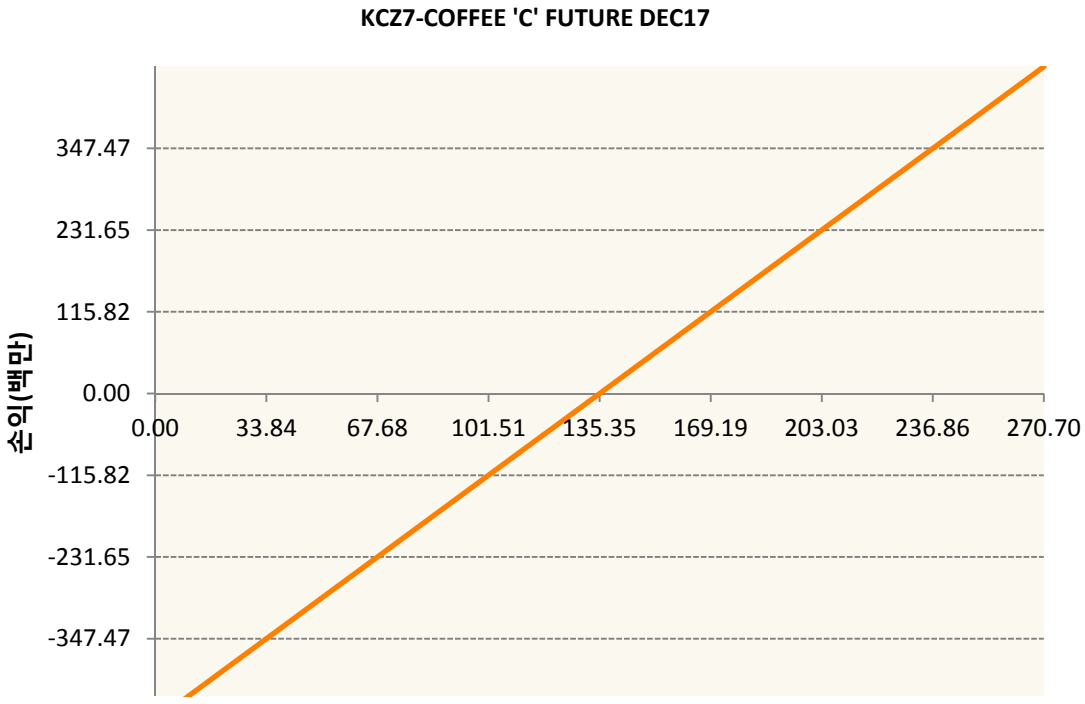
2. 만기시점의 손익구조

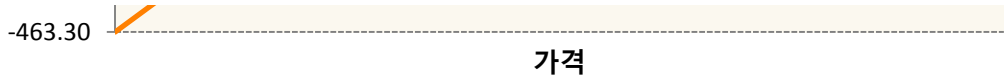


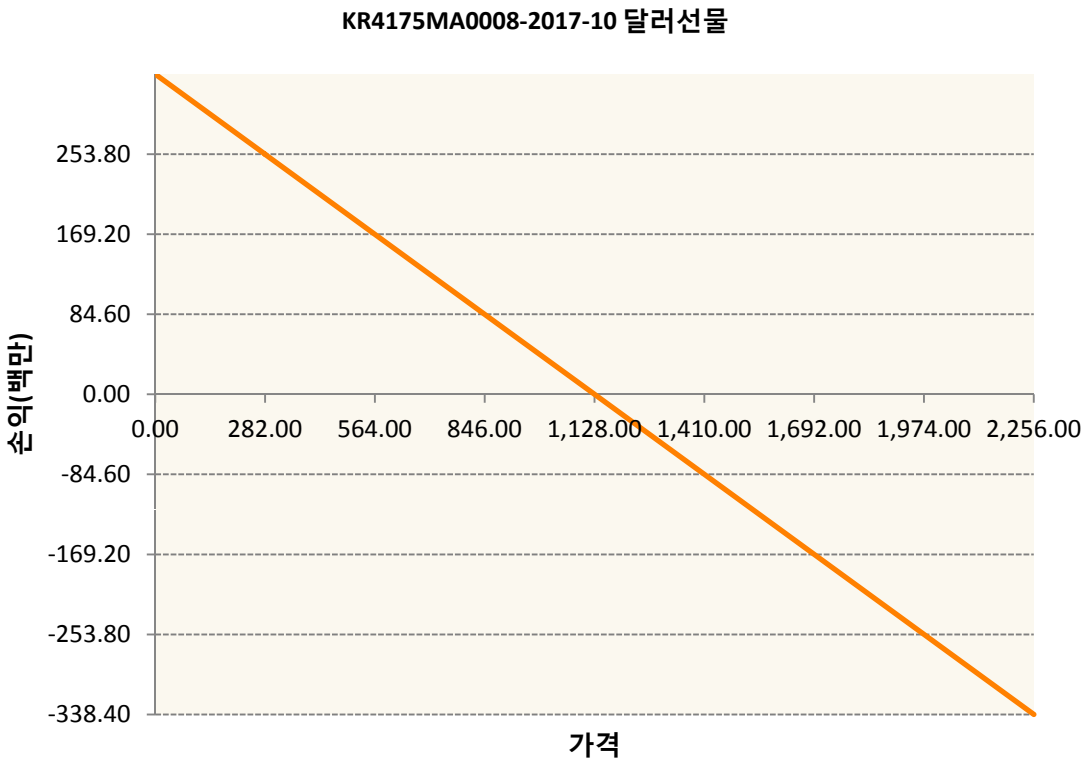


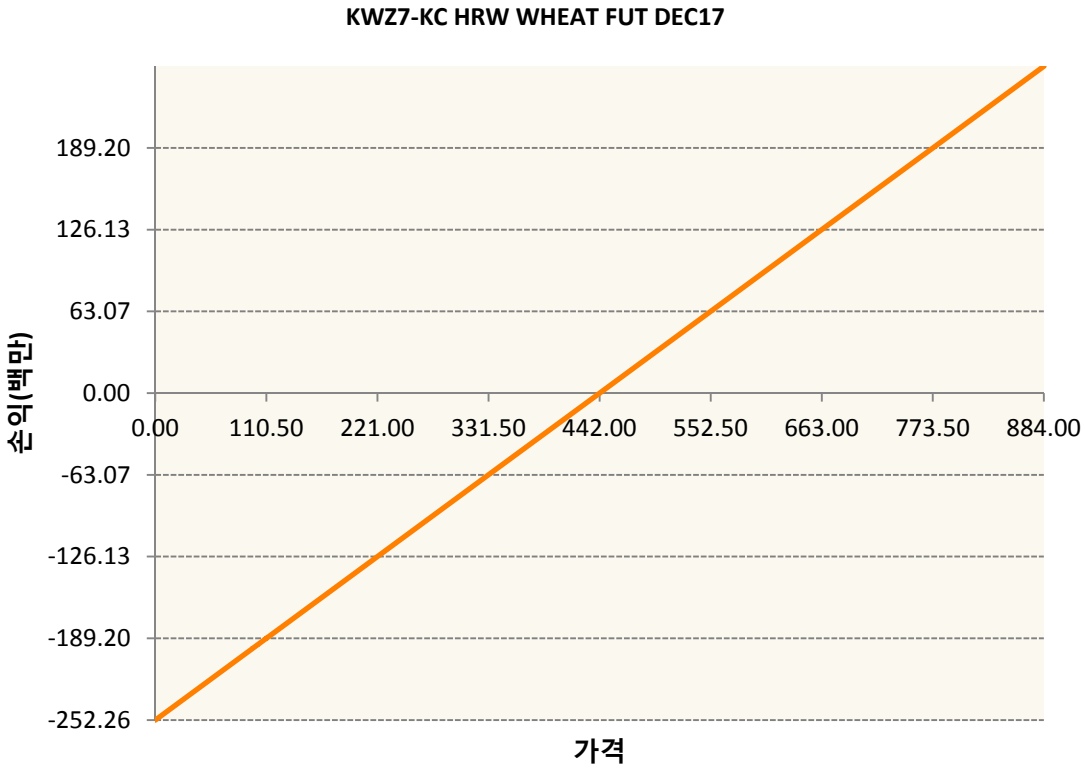

-138.28
-207.42
-276.56
가격

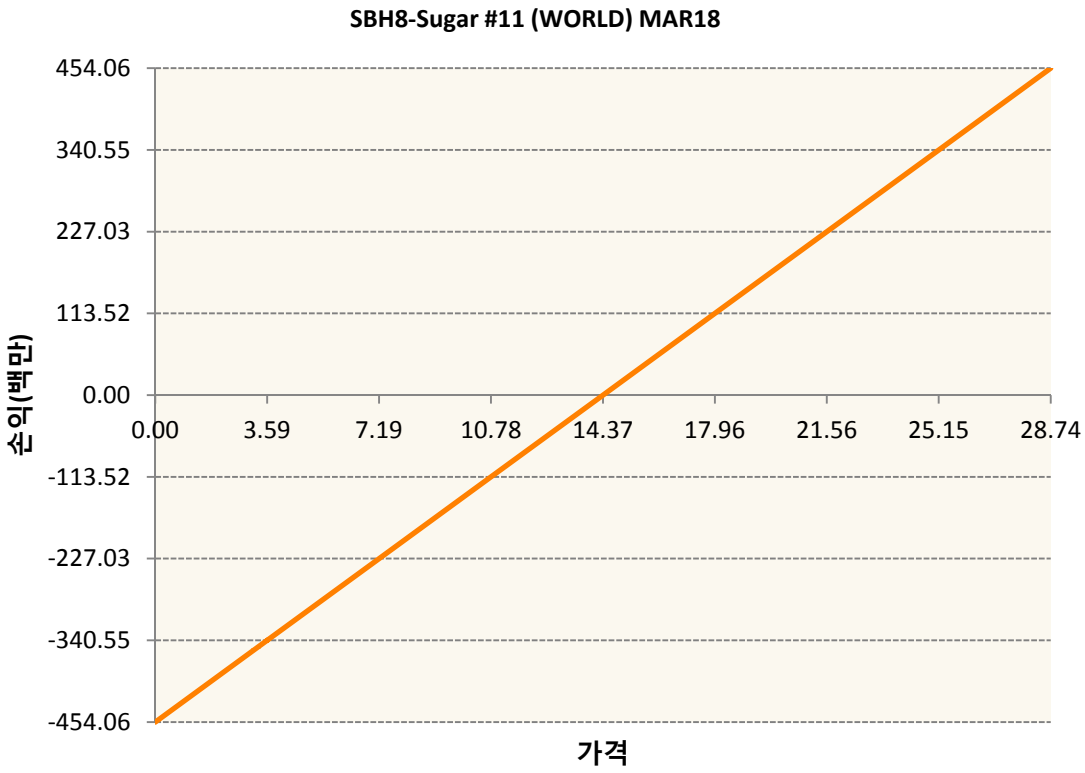

CZ7-CORN FUTURE DEC17
1,451.59
1,088.69
725.79
362.90
0.00
-362.90
-725.79
-1,088.69
-1,451.59
0.00
87.06
174.13
261.19
348.25
435.31
522.38
609.44
696.50
손익(백만)
가격

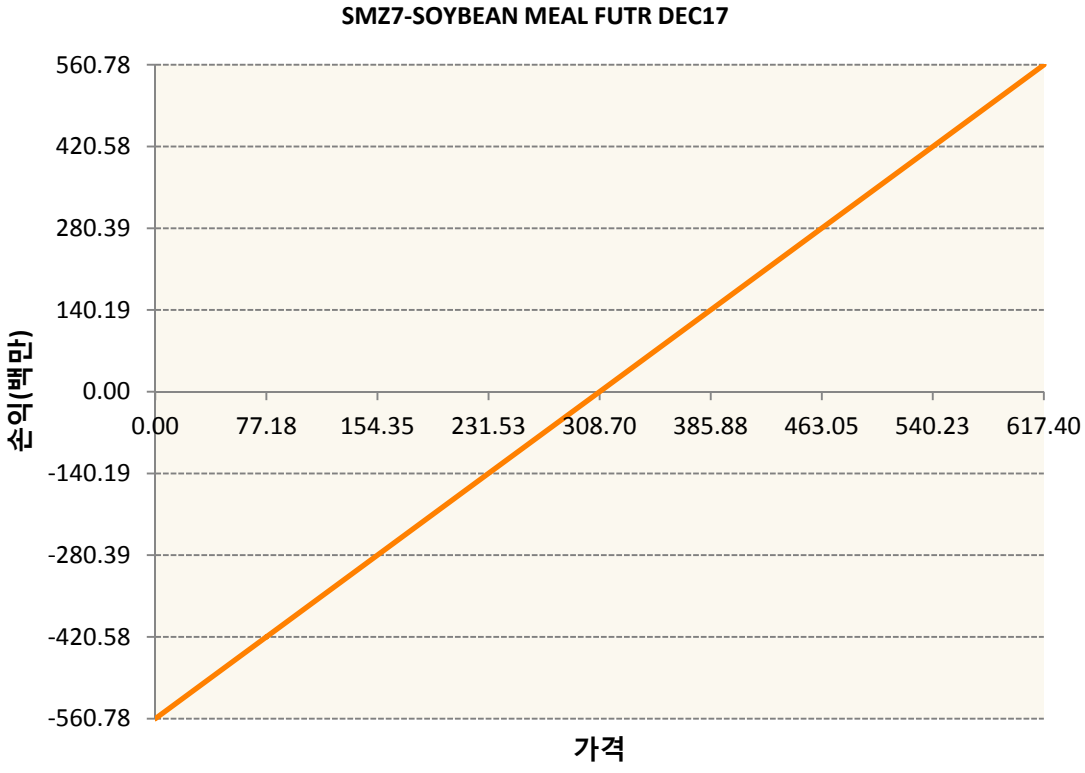

KCZ7-COFFEE 'C' FUTURE DEC17
347.47
231.65
115.82
0.00
-115.82
-231.65
-347.47
0.00
33.84
67.68
101.51
135.35
169.19
203.03
236.86
270.70
손익(백만)

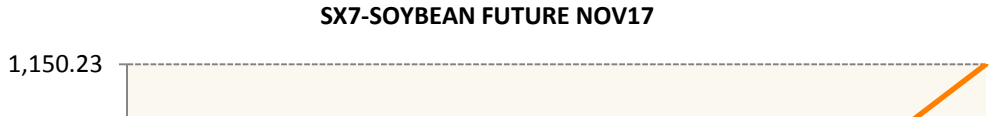

-463.30
가격

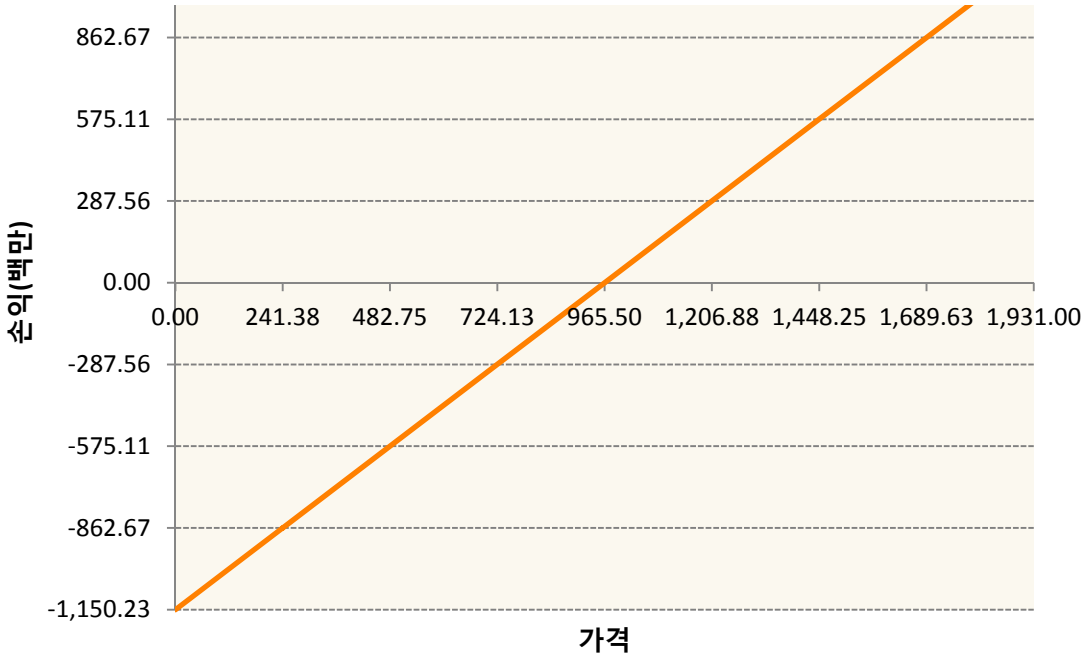

KR4175MA0008-2017-10 달러선물
253.80
169.20
84.60
0.00
-84.60
-169.20
-253.80
-338.40
0.00
282.00
564.00
846.00
1,128.00
1,410.00
1,692.00
1,974.00
2,256.00
손익(백만)
가격

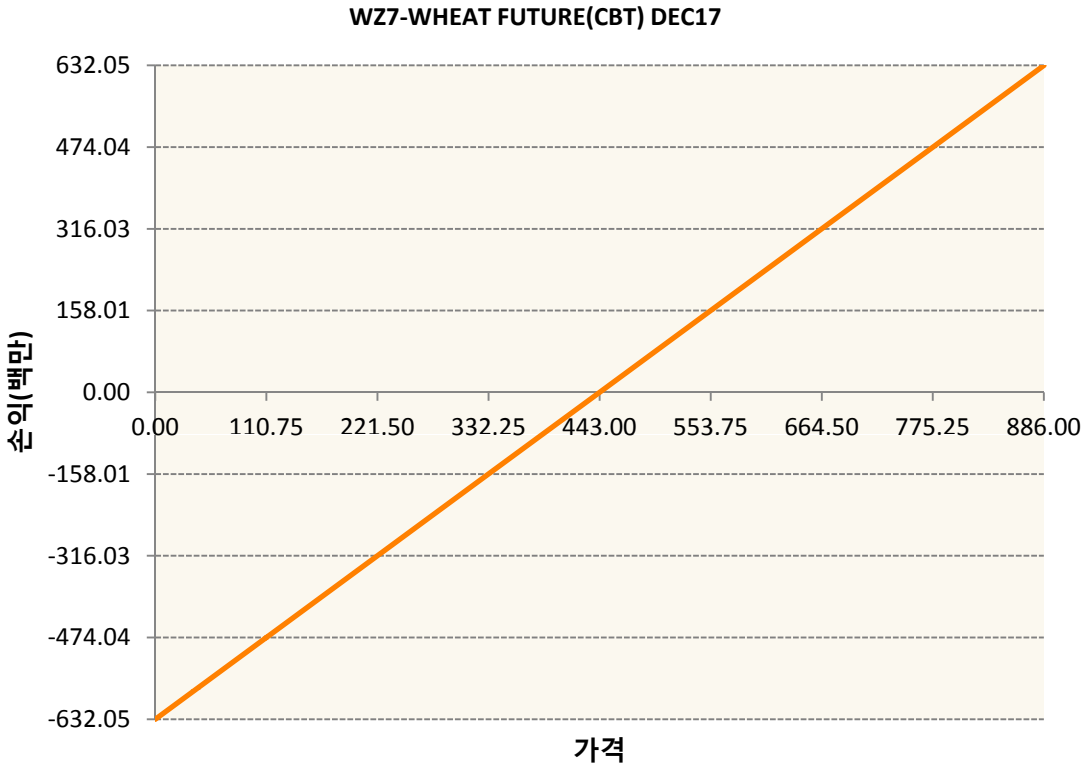

KWZ7-KC HRW WHEAT FUT DEC17
189.20
126.13
63.07
0.00
-63.07
-126.13
-189.20
-252.26
0.00
110.50
221.00
331.50
442.00
552.50
663.00
773.50
884.00
손익(백만)
가격


SBH8-Sugar #11 (WORLD) MAR18
454.06
340.55
227.03
113.52
0.00
-113.52
-227.03
-340.55
-454.06
0.00
3.59
7.19
10.78
14.37
17.96
21.56
25.15
28.74
손익(백만)
가격


SMZ7-SOYBEAN MEAL FUTR DEC17
560.78
420.58
280.39
140.19
0.00
-140.19
-280.39
-420.58
-560.78
0.00
77.18
154.35
231.53
308.70
385.88
463.05
540.23
617.40
손익(백만)
가격


SX7-SOYBEAN FUTURE NOV17
1,150.23





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
BOZ7	SOYBEAN OIL FUTR DEC17	44
CTZ7	COTTON NO.2 FUTR DEC17	22
CZ7	CORN FUTURE DEC17	116
KCZ7	COFFEE 'C' FUTURE DEC17	37
KR4175MA0	2017-10 달러선물	27

KWZ7	KC HRW WHEAT FUT DEC17	20
SBH8	Sugar #11 (WORLD) MAR18	36
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)

545