공시일	2017-09-22
기준일	2017-09-21

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	2017-09-22
기준일	2017-09-21

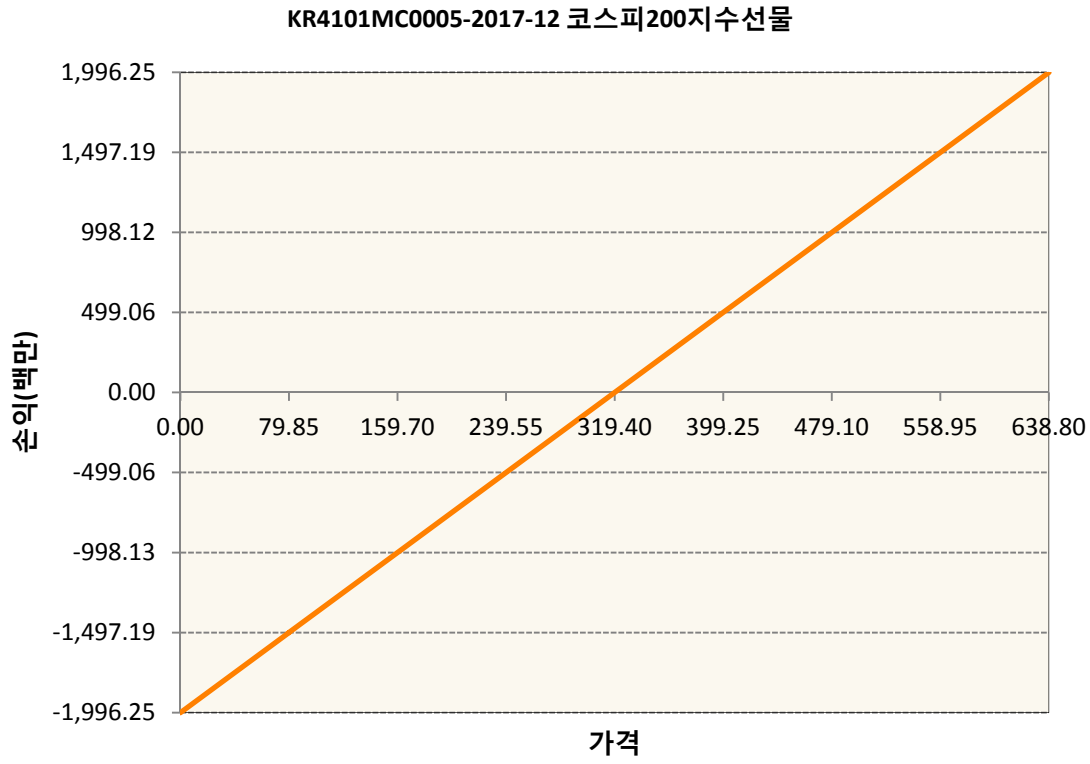
스마트인덱스모

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	1,996	0	1,996	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101MC0	2017-12 코스피200지수선물						159
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-159	-159	-159	-159	-159	-159	-159
-5.33%	-106	-106	-106	-106	-106	-106	-106
-2.67%	-53	-53	-53	-53	-53	-53	-53
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	53	53	53	53	53	53	53
5.33%	106	106	106	106	106	106	106
8.00%	159	159	159	159	159	159	159

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

96

공시일	2017-09-22
기준일	2017-09-21

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	1,044

* 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	2017-09-22
기준일	2017-09-21

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	423

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

360

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-09-22
기준일	2017-09-21

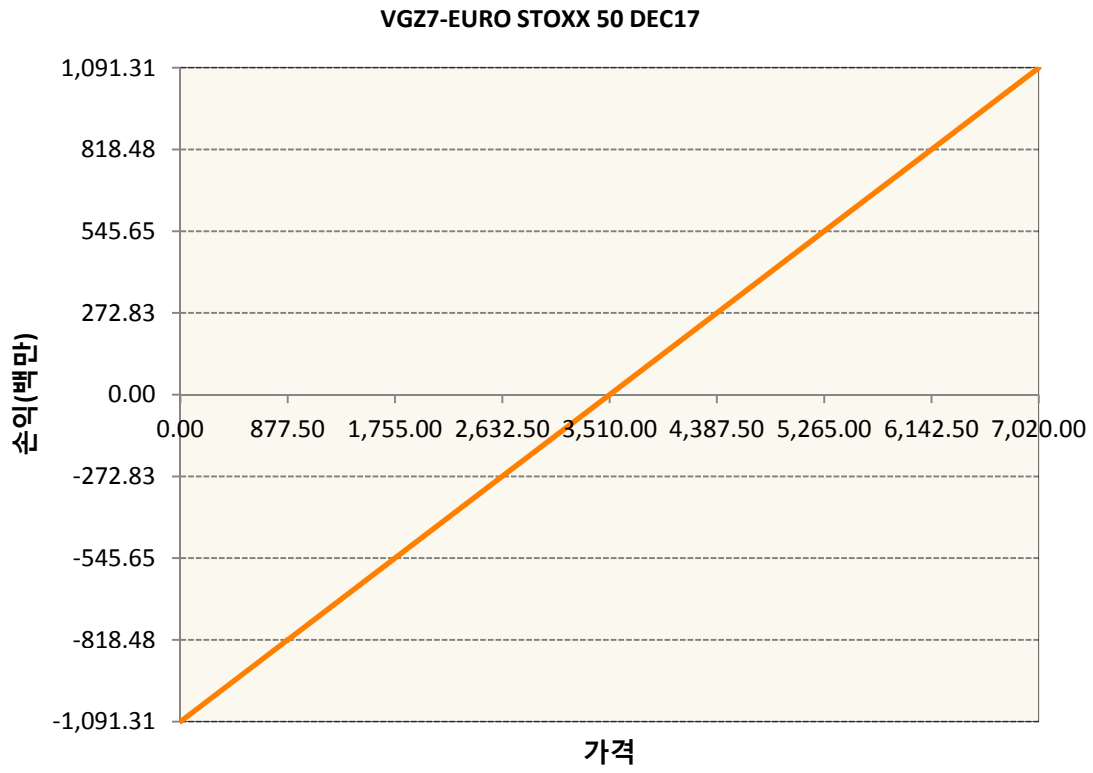
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,091	0	1,091	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGZ7	EURO STOXX 50 DEC17	87

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

(단위:백만원)

68

공시일	2017-09-22
기준일	2017-09-21

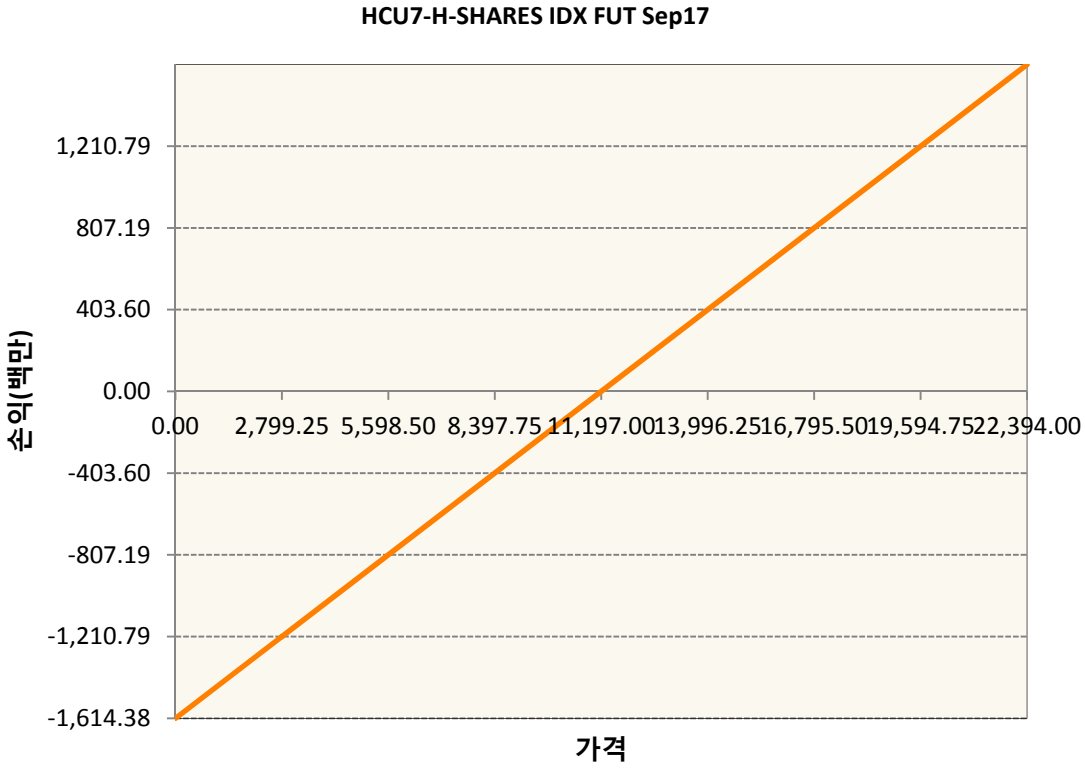
차이나인덱스모(주식-파생형)

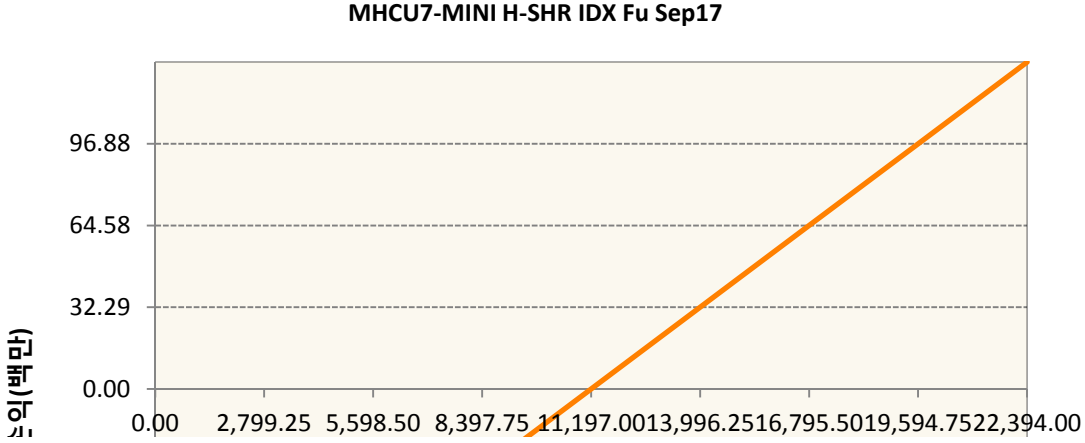
1. 계약금액

(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	1,614	0	1,614	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)
	115

공시일	2017-09-22
기준일	2017-09-21

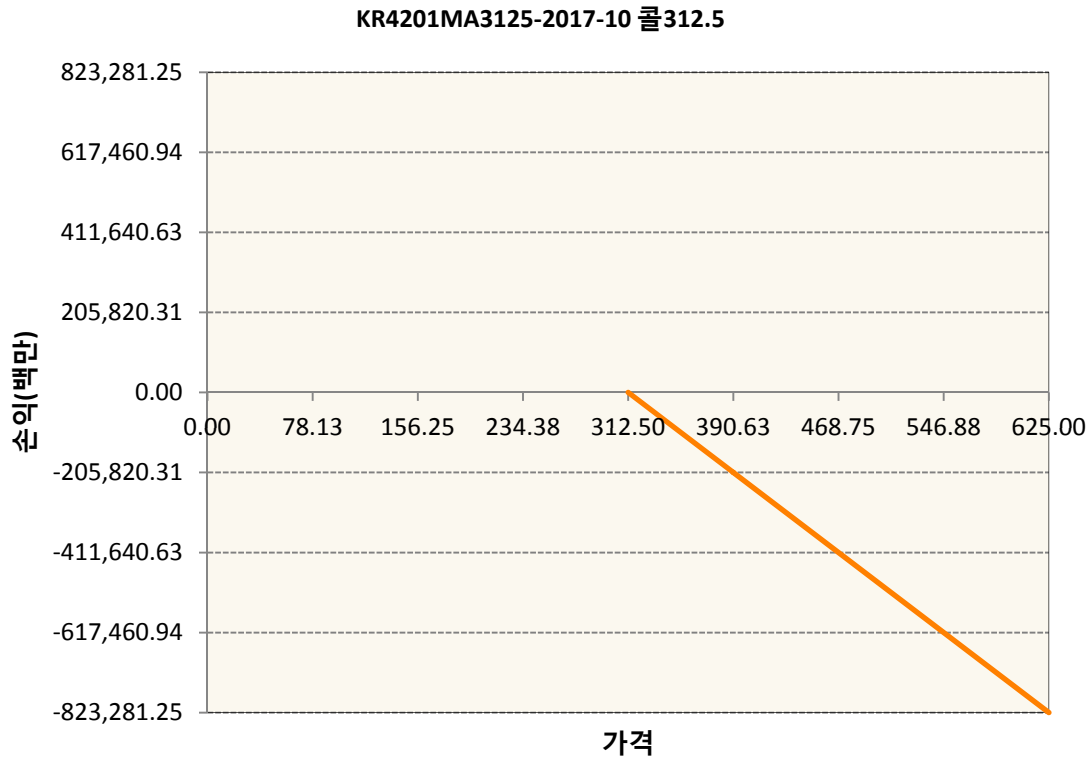
커버드콜모(주식혼합-파생형)

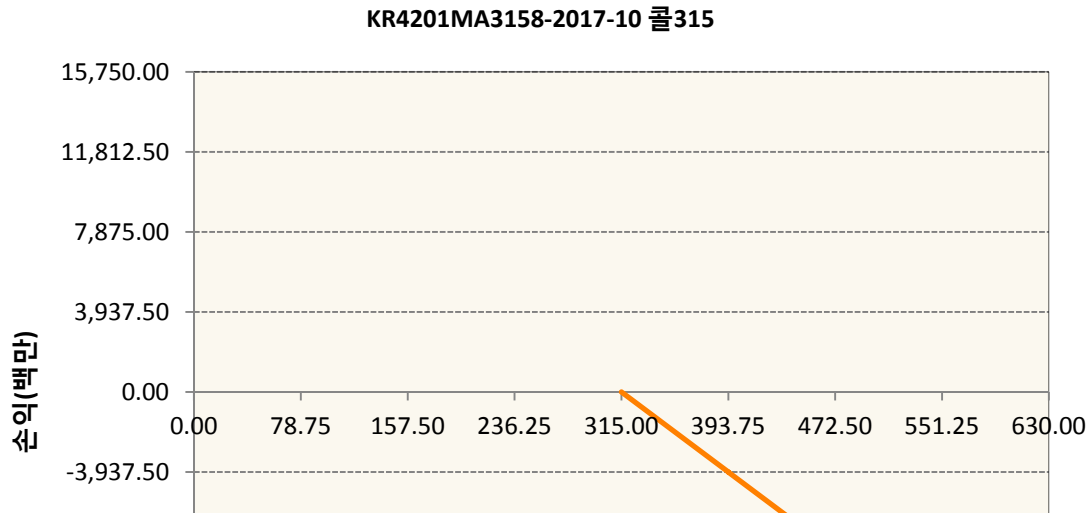
1. 계약금액

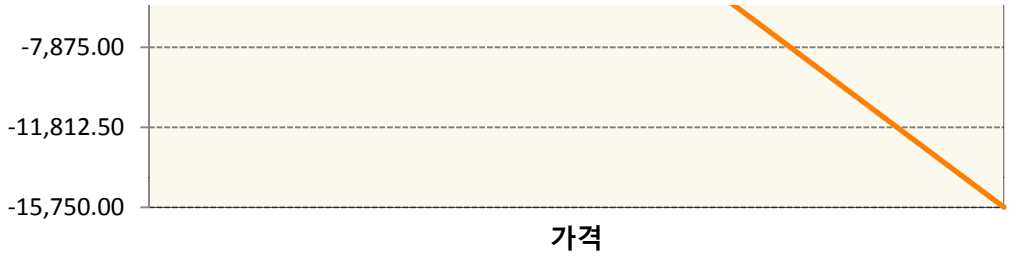
(단위:백만원)

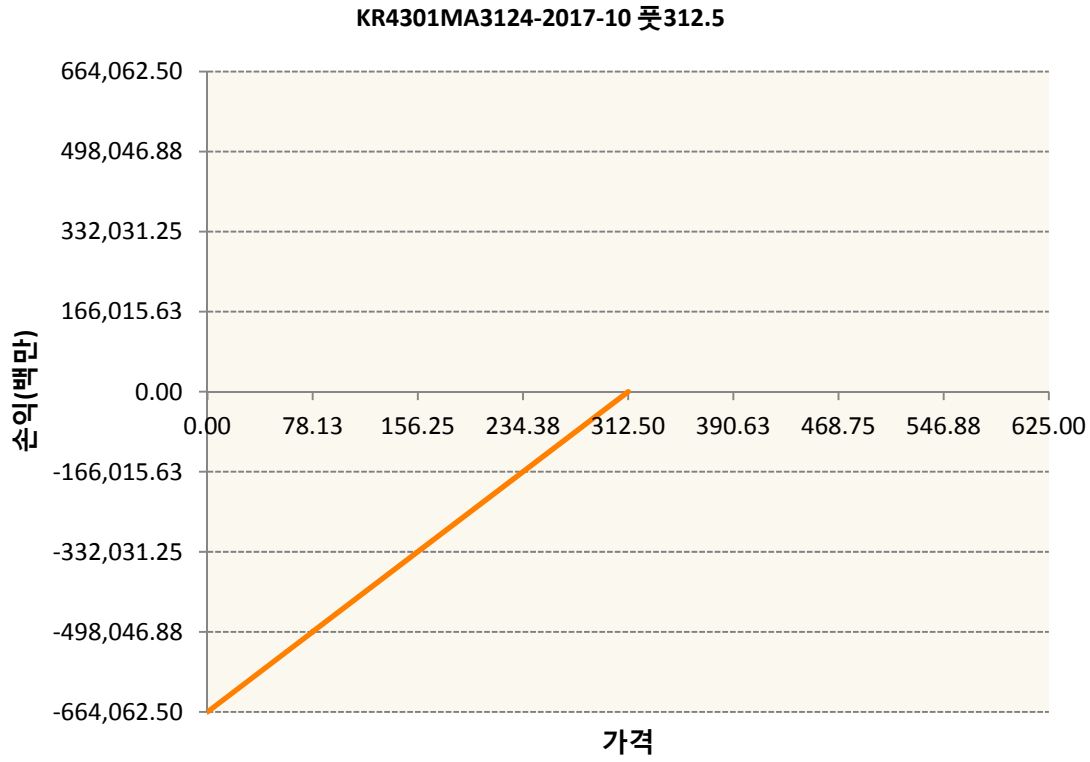
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	1,503,094	-1,503,094	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201MA3 2017-10 콜312.5							57,720
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	25,829	25,370	24,806	24,147	23,403	22,587	21,706
-5.33%	23,257	22,239	21,152	20,011	18,825	17,604	16,353
-2.67%	16,550	15,099	13,643	12,183	10,720	9,255	7,787
0%	4,179	2,807	1,412	0	-1,425	-2,861	-4,305
2.67%	-13,282	-14,172	-15,153	-16,209	-17,325	-18,491	-19,700
5.33%	-33,834	-34,242	-34,761	-35,383	-36,098	-36,896	-37,766
8.00%	-55,685	-55,821	-56,033	-56,327	-56,708	-57,173	-57,720
KR4201MA3 2017-10 콜315							1,057
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	422	415	407	396	384	371	356

-5.33%	387	371	353	333	313	291	269
-2.67%	286	260	234	207	180	153	125
0%	84	56	28	0	-28	-56	-85
2.67%	-222	-242	-264	-286	-310	-334	-359
5.33%	-598	-608	-621	-635	-651	-669	-688
8.00%	-1,008	-1,011	-1,017	-1,024	-1,033	-1,044	-1,057
KR4301MA3 2017-10 풋312.5							39,230

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-38,964	-38,972	-38,989	-39,020	-39,069	-39,138	-39,230
-5.33%	-21,164	-21,317	-21,513	-21,750	-22,024	-22,330	-22,665
-2.67%	-6,013	-6,579	-7,153	-7,733	-8,318	-8,907	-9,499
0%	1,402	961	492	0	-510	-1,034	-1,570
2.67%	2,799	2,716	2,598	2,441	2,247	2,017	1,755
5.33%	2,882	2,878	2,867	2,847	2,812	2,760	2,687
8.00%	2,883	2,883	2,883	2,882	2,879	2,872	2,860

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

100,884

공시일	2017-09-22
기준일	2017-09-21

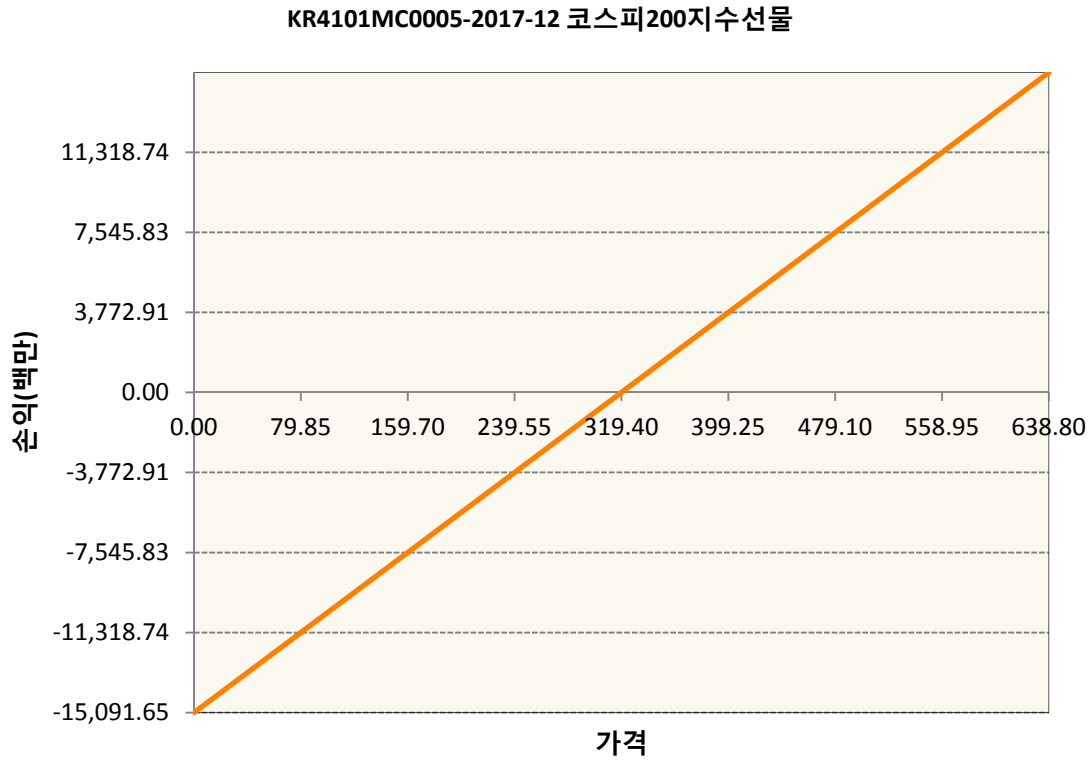
ETF스마트레버리지목표전환형6호

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	15,092	0	15,092	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101MC0	2017-12 코스피200지수선물						1,203
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,203	-1,203	-1,203	-1,203	-1,203	-1,203	-1,203
-5.33%	-802	-802	-802	-802	-802	-802	-802
-2.67%	-401	-401	-401	-401	-401	-401	-401
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	401	401	401	401	401	401	401
5.33%	802	802	802	802	802	802	802
8.00%	1,203	1,203	1,203	1,203	1,203	1,203	1,203

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

729

공시일	2017-09-22
기준일	2017-09-21

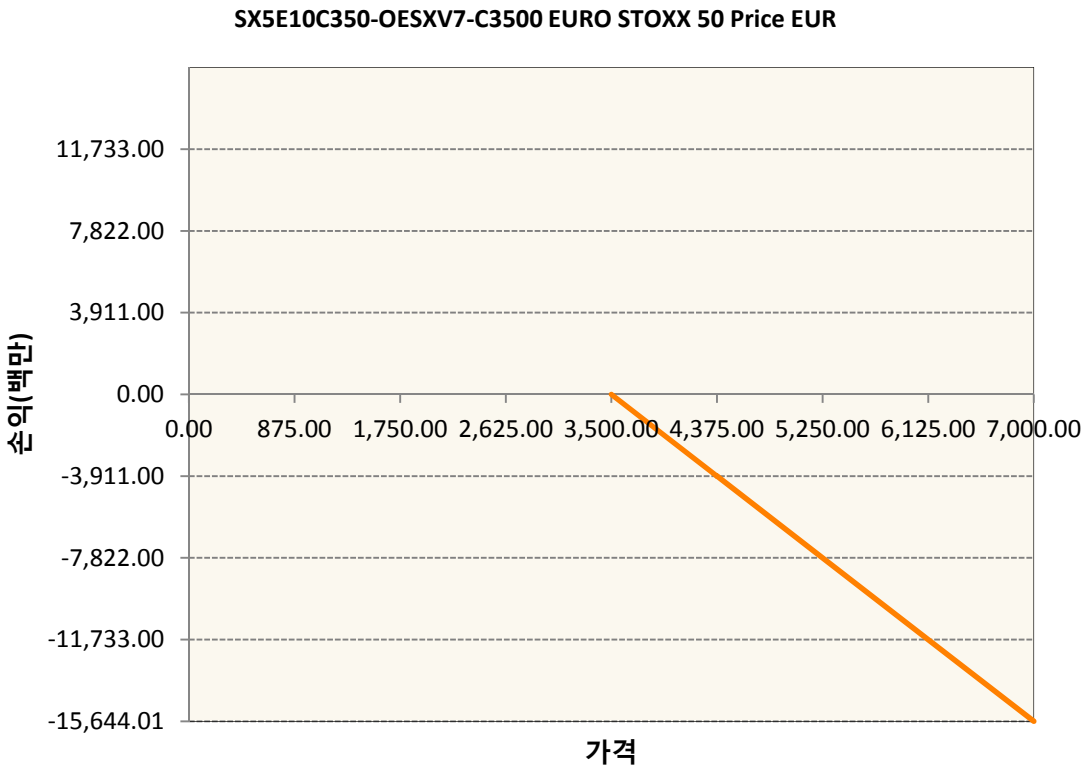
유로커버드콜(주식혼합-파생형)

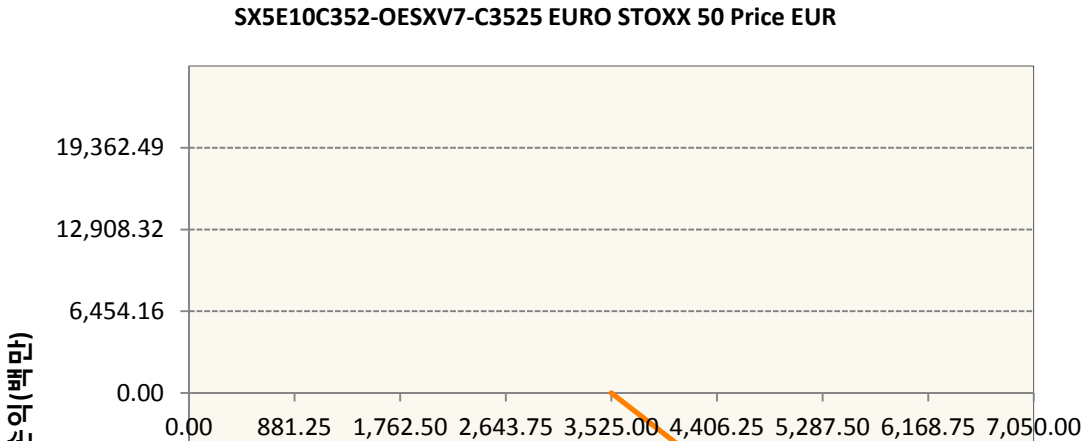
1. 계약금액

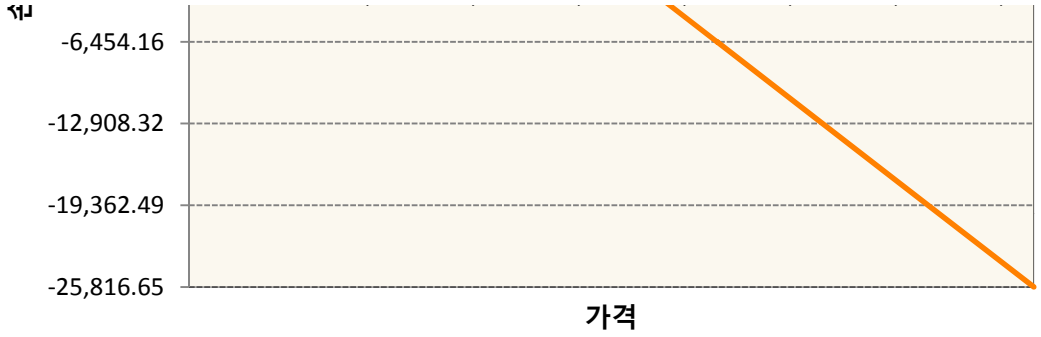
(단위:백만원)

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	37,340	0	37,340	
누계	유가증권	옵션	0	82,921	-82,921	장내

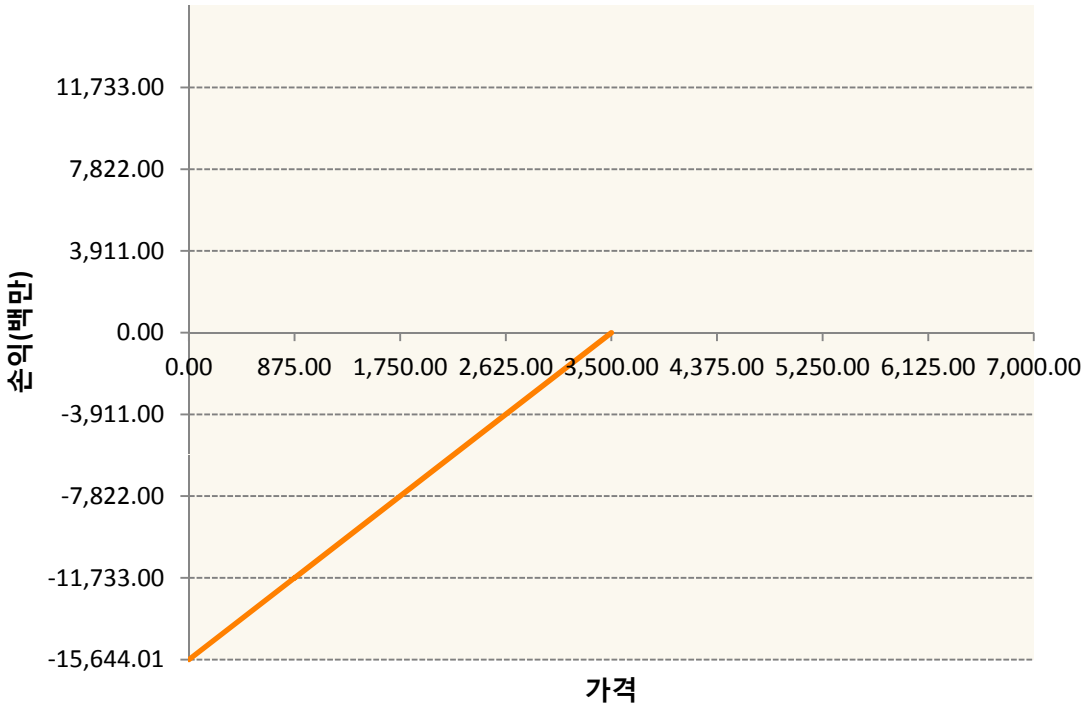
2. 만기시점의 손익구조



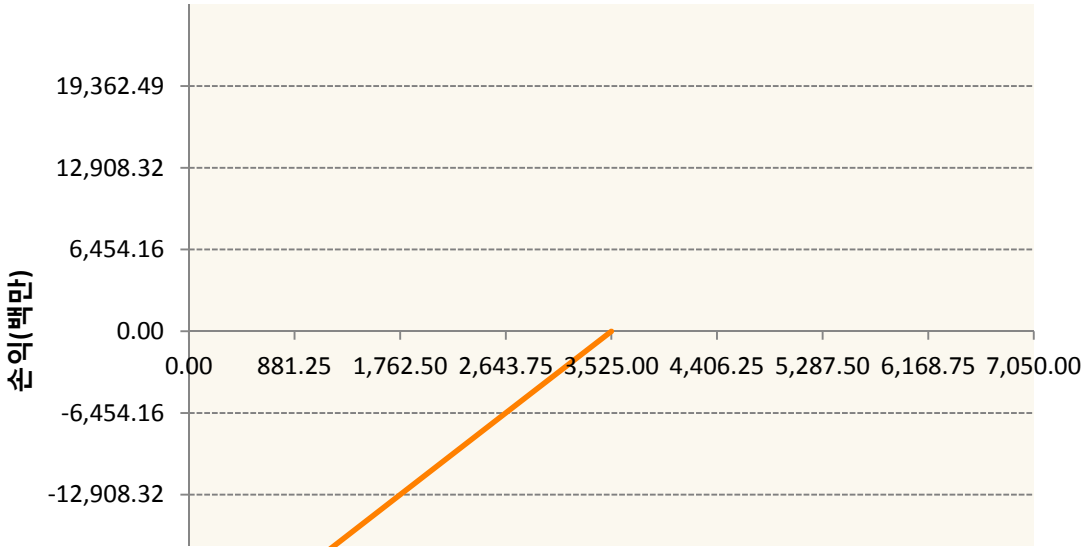


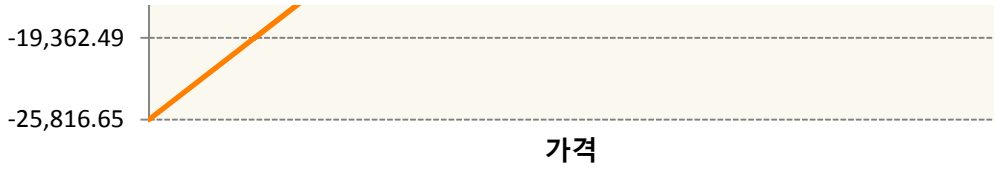


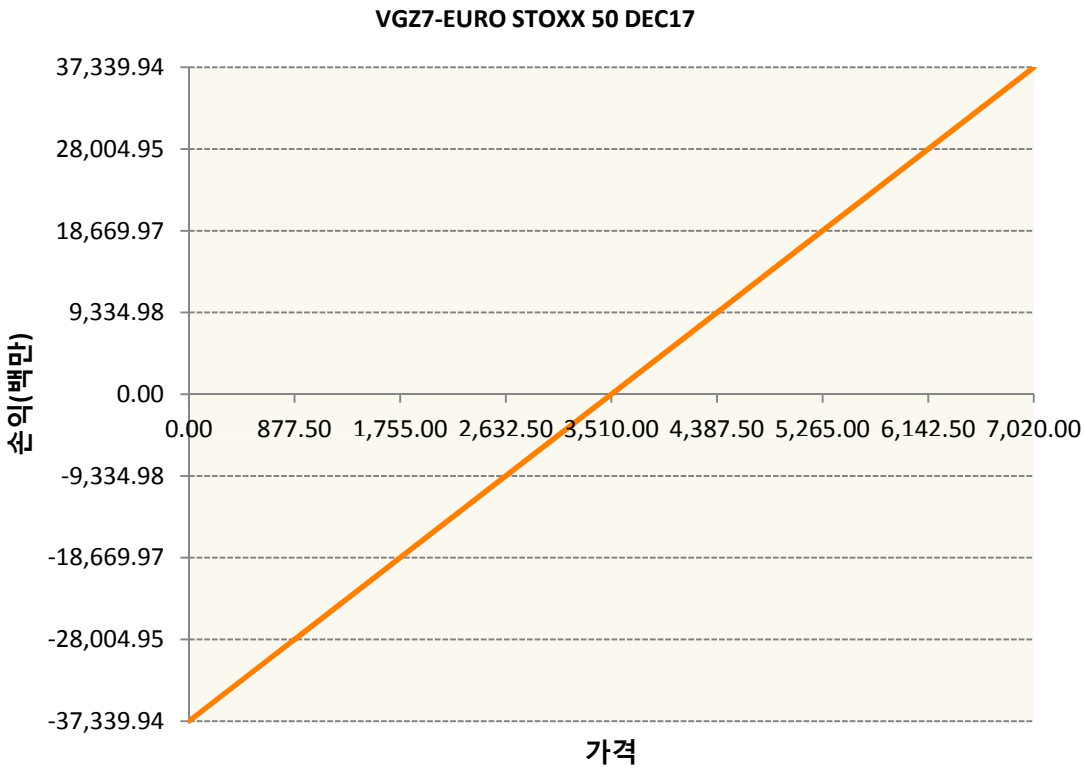
SX5E10P350-OESXV7-P3500 EURO STOXX 50 Price EUR



SX5E10P352-OESXV7-P3525 EURO STOXX 50 Price EUR







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)	(단위:백만원)
SX5E10C350 OESXV7-C3500 EURO STOXX 50 Price EUR	1,251
SX5E10C352 OESXV7-C3525 EURO STOXX 50 Price EUR	2,065
SX5E10P350 OESXV7-P3500 EURO STOXX 50 Price EUR	1,251
SX5E10P352 OESXV7-P3525 EURO STOXX 50 Price EUR	2,065
VGZ7 EURO STOXX 50 DEC17	2,987

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	7,500

공시일	2017-09-22
기준일	2017-09-21

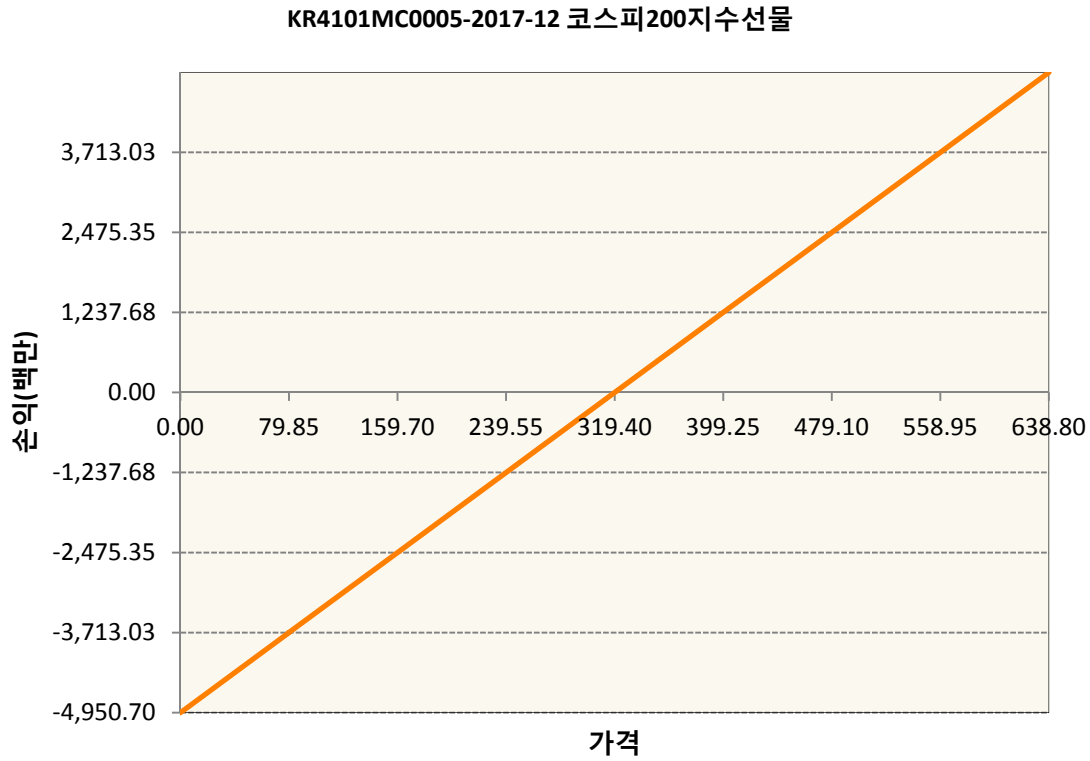
ETF스마트레버리지목표전환형7호

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)

239

공시일	2017-09-22
기준일	2017-09-21

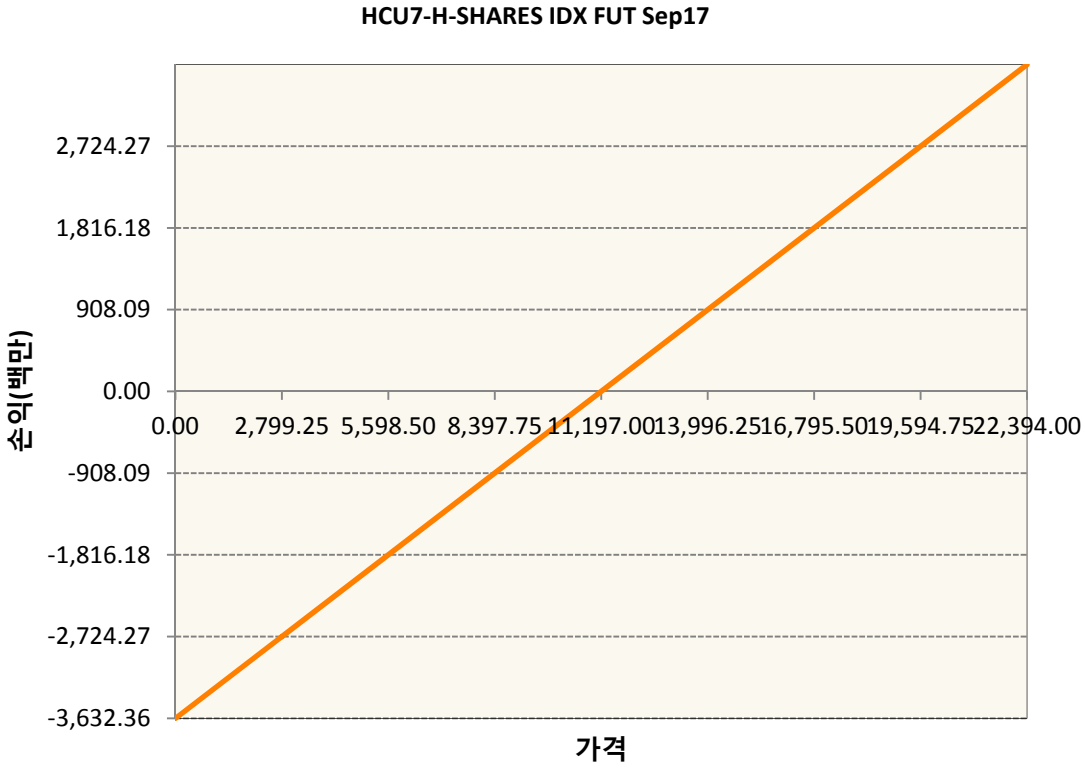
홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생

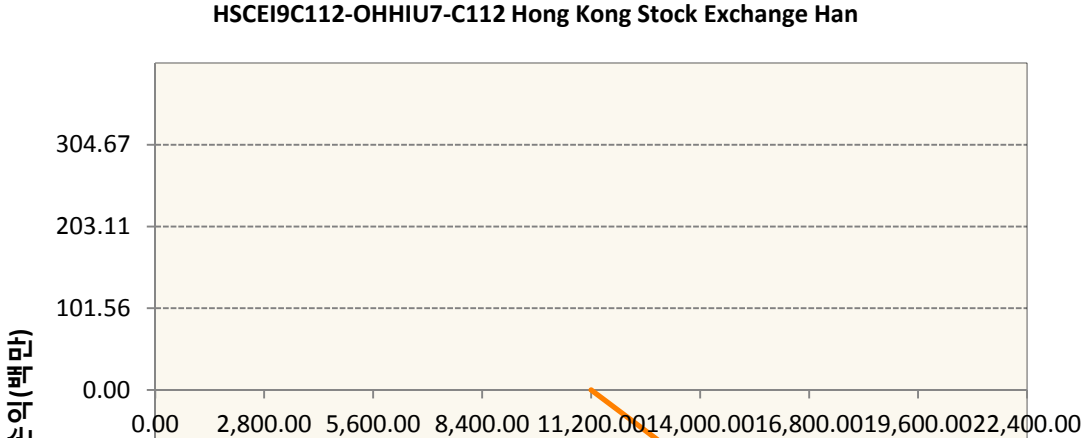
1. 계약금액

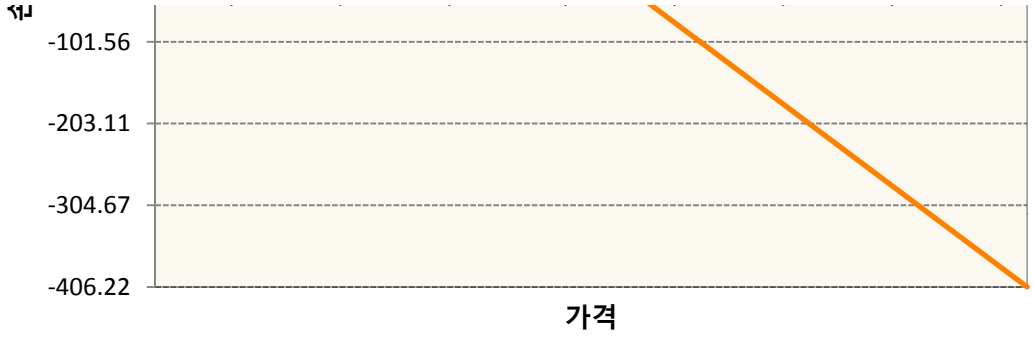
(단위:백만원)

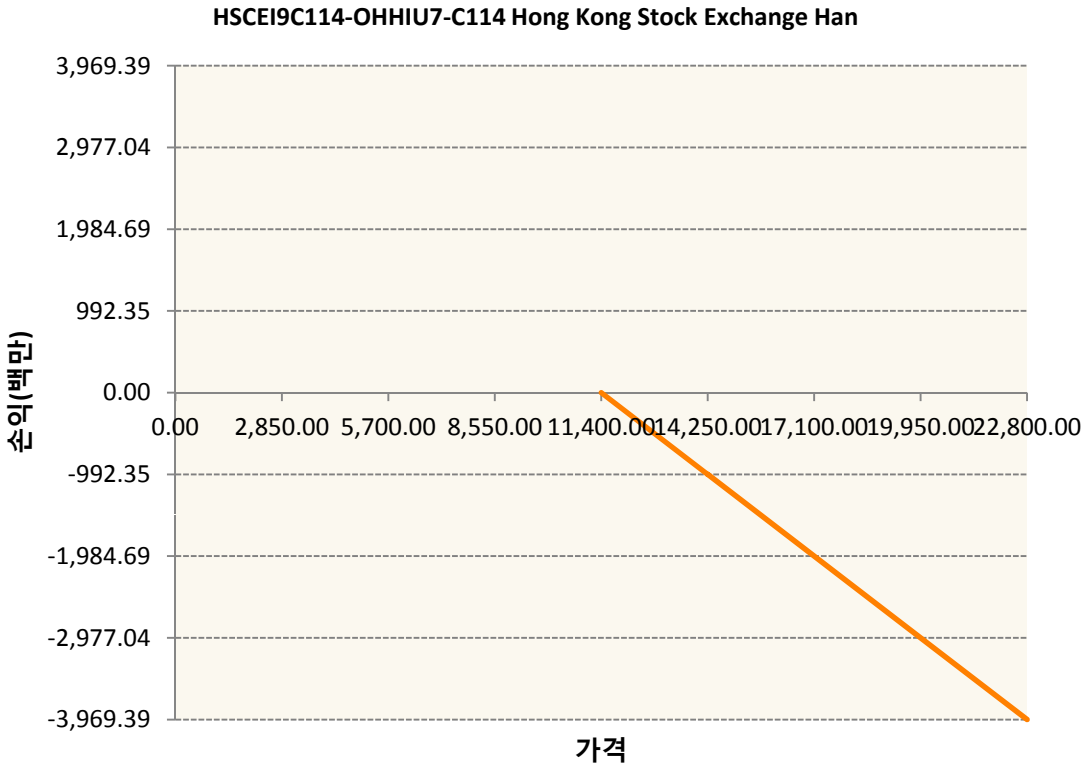
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	3,632	0	3,632	장내
누계	유가증권	옵션	0	8,751	-8,751	장내

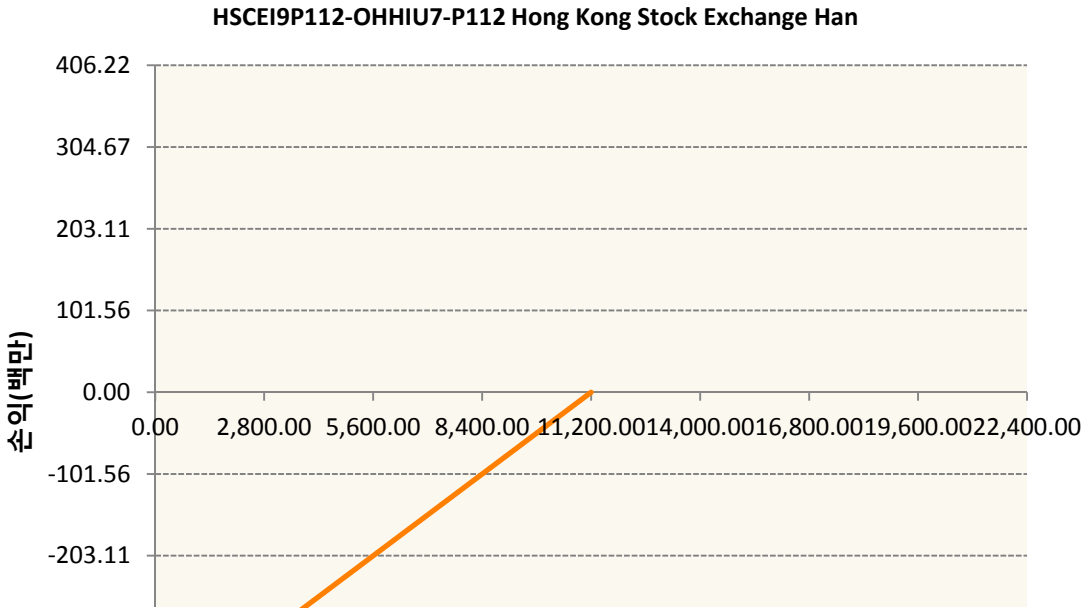
2. 만기시점의 손익구조

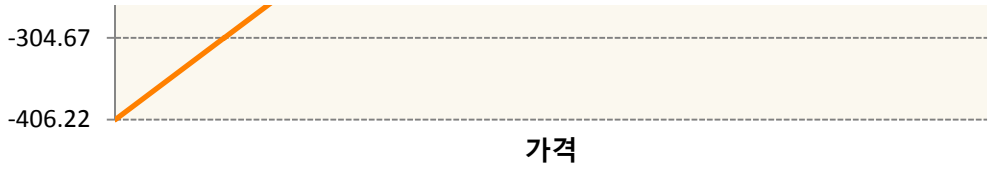


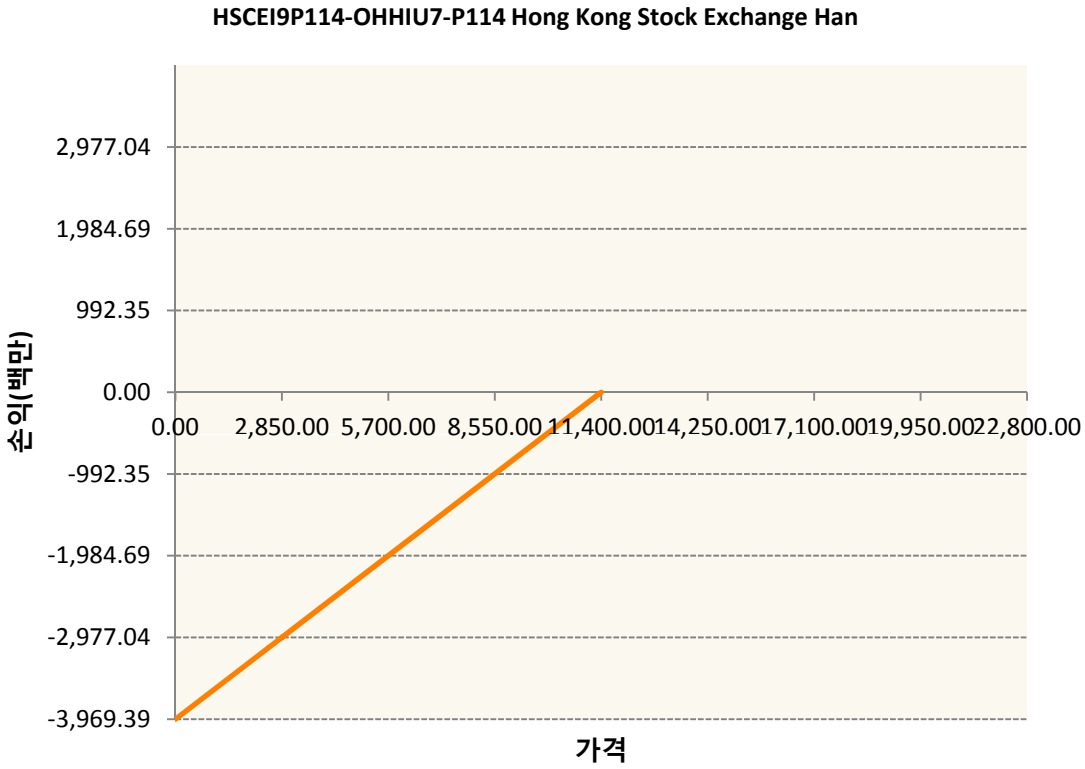



-101.56
-203.11
-304.67
-406.22
가격


HSCEI9C114-OHHIU7-C114 Hong Kong Stock Exchange Han
3,969.39
2,977.04
1,984.69
992.35
0.00
-992.35
-1,984.69
-2,977.04
-3,969.39
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
406.22
304.67
203.11
101.56
0.00
-101.56
-203.11
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	291
HSCEI9C112 OHHIU7-C112 Hong Kong Stock Exchange Han	32
HSCEI9C114 OHHIU7-C114 Hong Kong Stock Exchange Han	318
HSCEI9P112 OHHIU7-P112 Hong Kong Stock Exchange Han	32
HSCEI9P114 OHHIU7-P114 Hong Kong Stock Exchange Han	318

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	818

공시일	2017-09-22
기준일	2017-09-21

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼

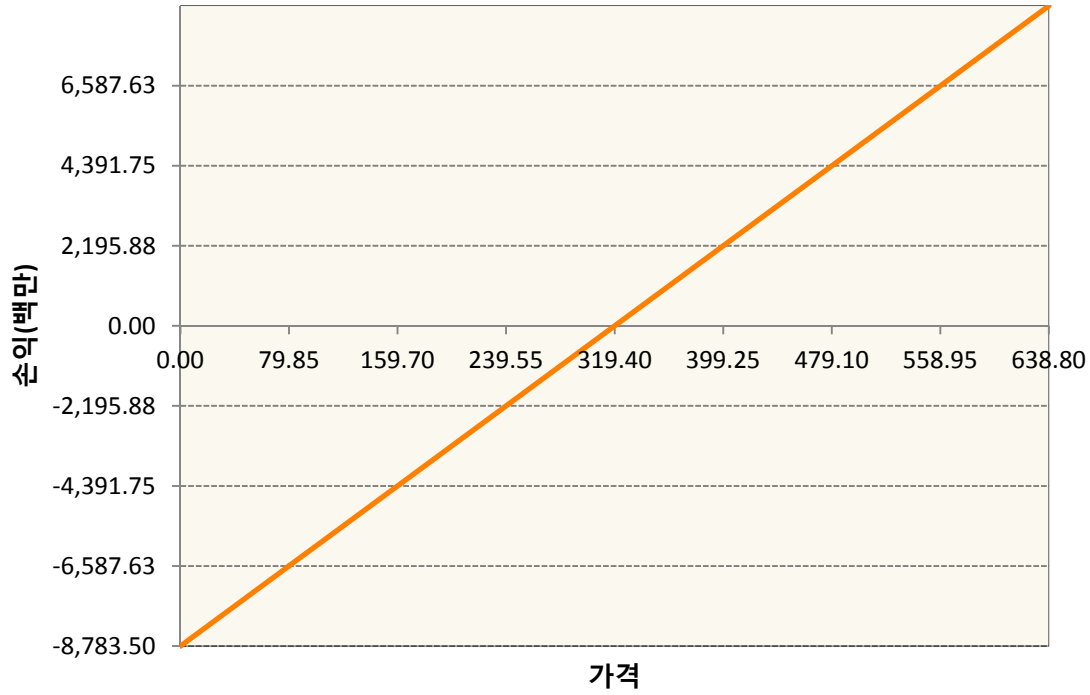
1. 계약금액

(단위:백만원)

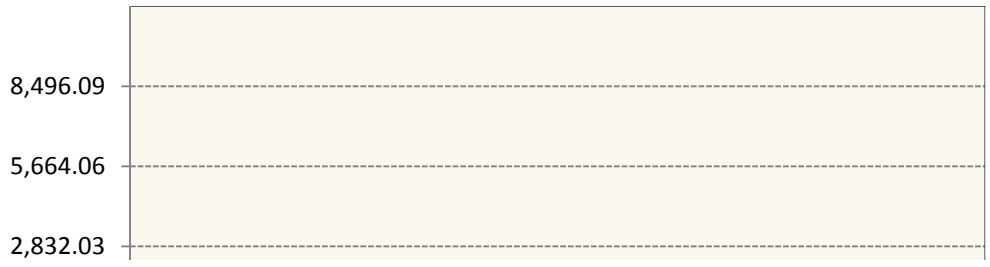
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	8,784	0	8,784	장내
누계	유가증권	스왑	24,000	0	24,000	장외
누계	유가증권	옵션	0	22,656	-22,656	장내

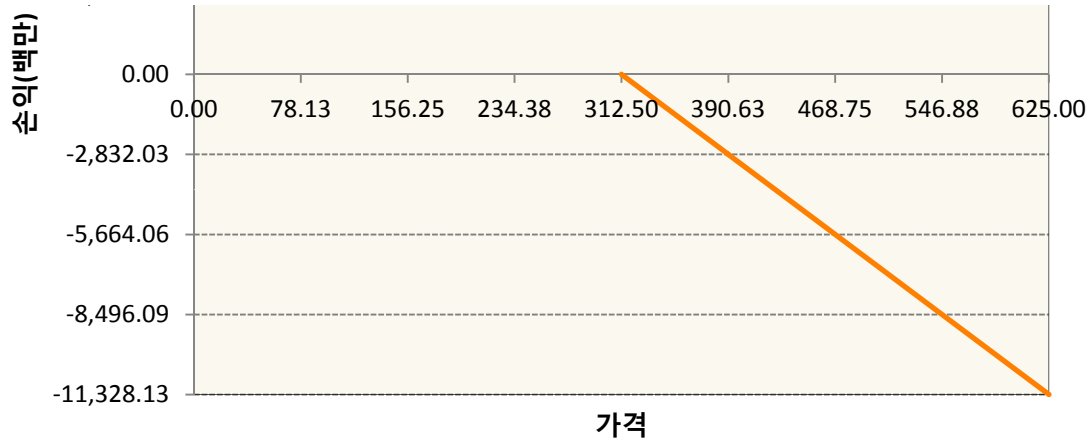
2. 만기시점의 손익구조

KR4101MC0005-2017-12 코스피200지수선물

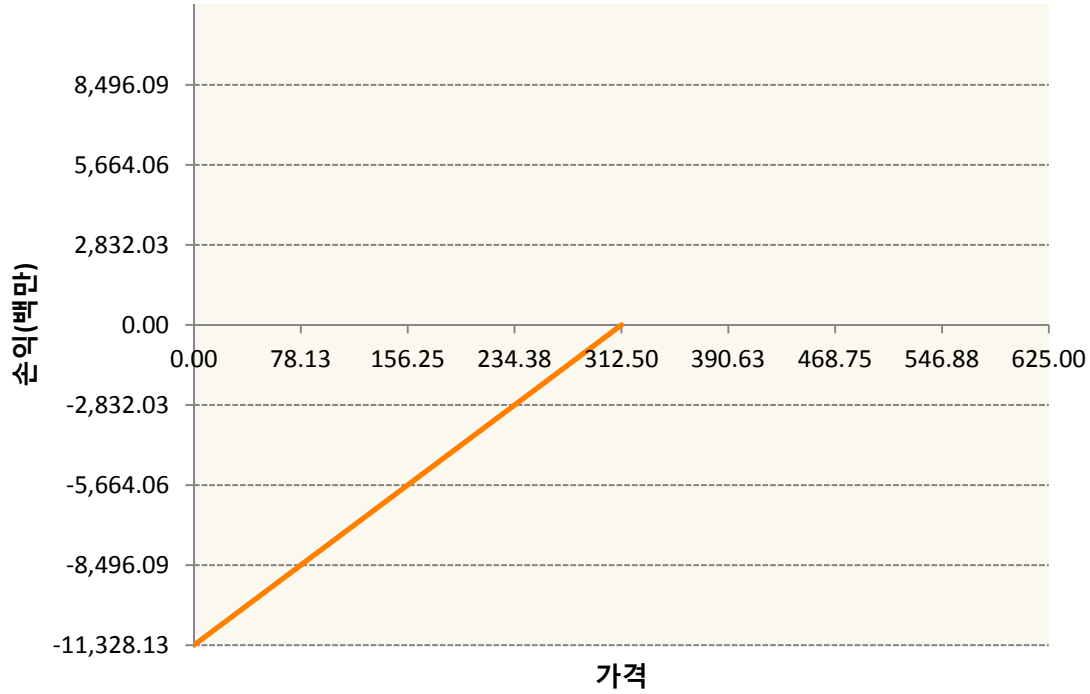


KR4201MA3125-2017-10 콜312.5





KR4301MA3124-2017-10 풋312.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_2							1,490
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,490	-1,490	-1,490	-1,490	-1,490	-1,490	-1,490
-5.33%	-993	-993	-993	-993	-993	-993	-993
-2.67%	-497	-497	-497	-497	-497	-497	-497
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	497	497	497	497	497	497	497
5.33%	993	993	993	993	993	993	993
8.00%	1,490	1,490	1,490	1,490	1,490	1,490	1,490

2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_3							282
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-282	-282	-282	-282	-282	-282	-282
-5.33%	-188	-188	-188	-188	-188	-188	-188
-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%	188	188	188	188	188	188	188
8.00%	282	282	282	282	282	282	282
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						700
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-700	-700	-700	-700	-700	-700	-700
-5.33%	-467	-467	-467	-467	-467	-467	-467
-2.67%	-233	-233	-233	-233	-233	-233	-233
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	233	233	233	233	233	233	233
5.33%	467	467	467	467	467	467	467
8.00%	700	700	700	700	700	700	700
KR4201MA3 2017-10 콜312.5							794
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	355	349	341	332	322	311	299
-5.33%	320	306	291	275	259	242	225
-2.67%	228	208	188	168	148	127	107
0%	57	39	19	0	-20	-39	-59
2.67%	-183	-195	-209	-223	-238	-254	-271
5.33%	-466	-471	-478	-487	-497	-508	-520
8.00%	-766	-768	-771	-775	-780	-787	-794
KR4301MA3 2017-10 풋312.5							669
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-665	-665	-665	-666	-666	-668	-669

-5.33%	-361	-364	-367	-371	-376	-381	-387
-2.67%	-103	-112	-122	-132	-142	-152	-162
0%	24	16	8	0	-9	-18	-27
2.67%	48	46	44	42	38	34	30
5.33%	49	49	49	49	48	47	46
8.00%	49	49	49	49	49	49	49

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

3,859

공시일	2017-09-22
기준일	2017-09-21

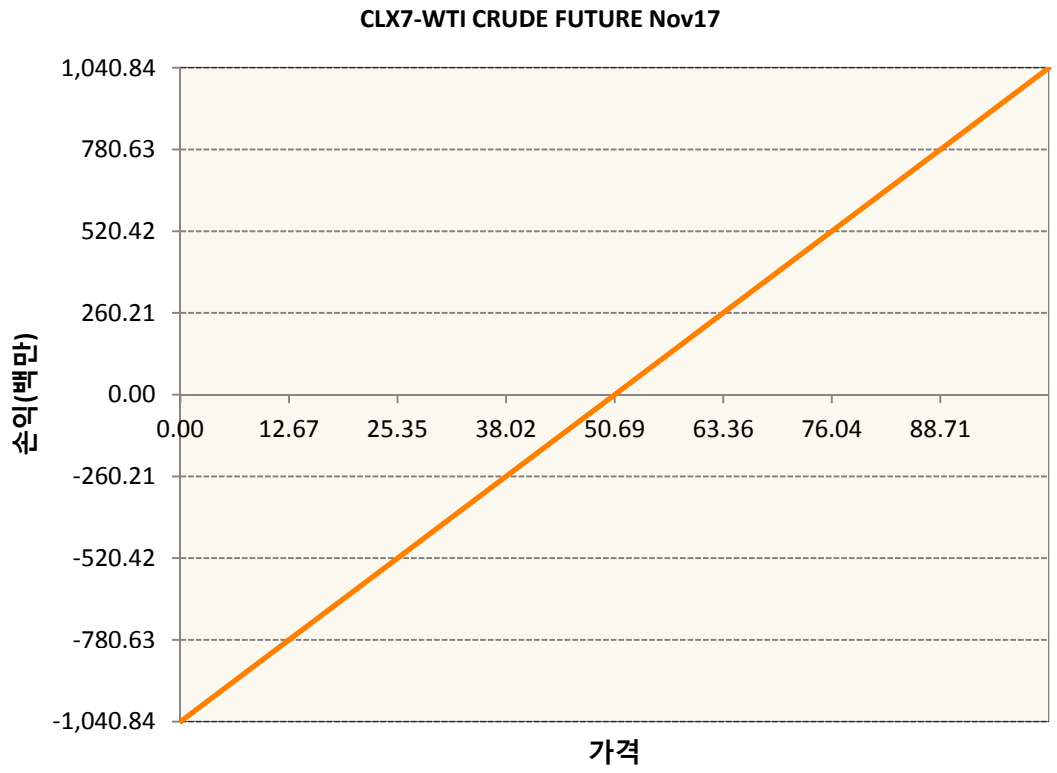
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

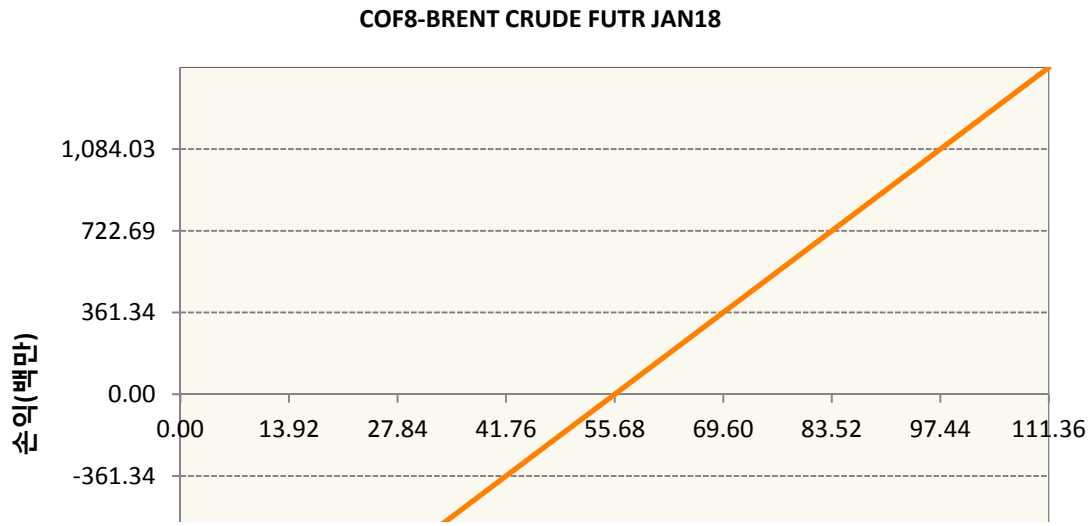
1. 계약금액

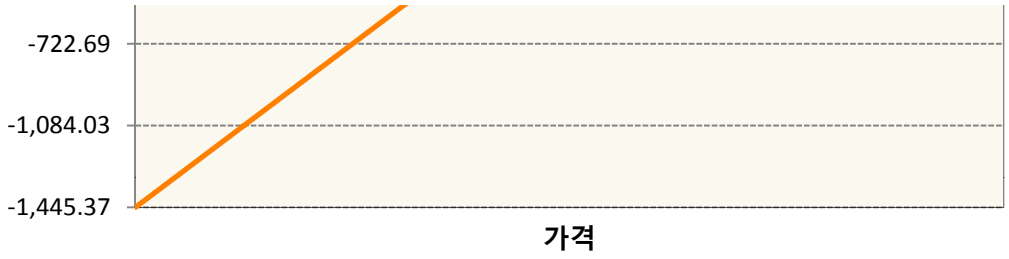
(단위:백만원)

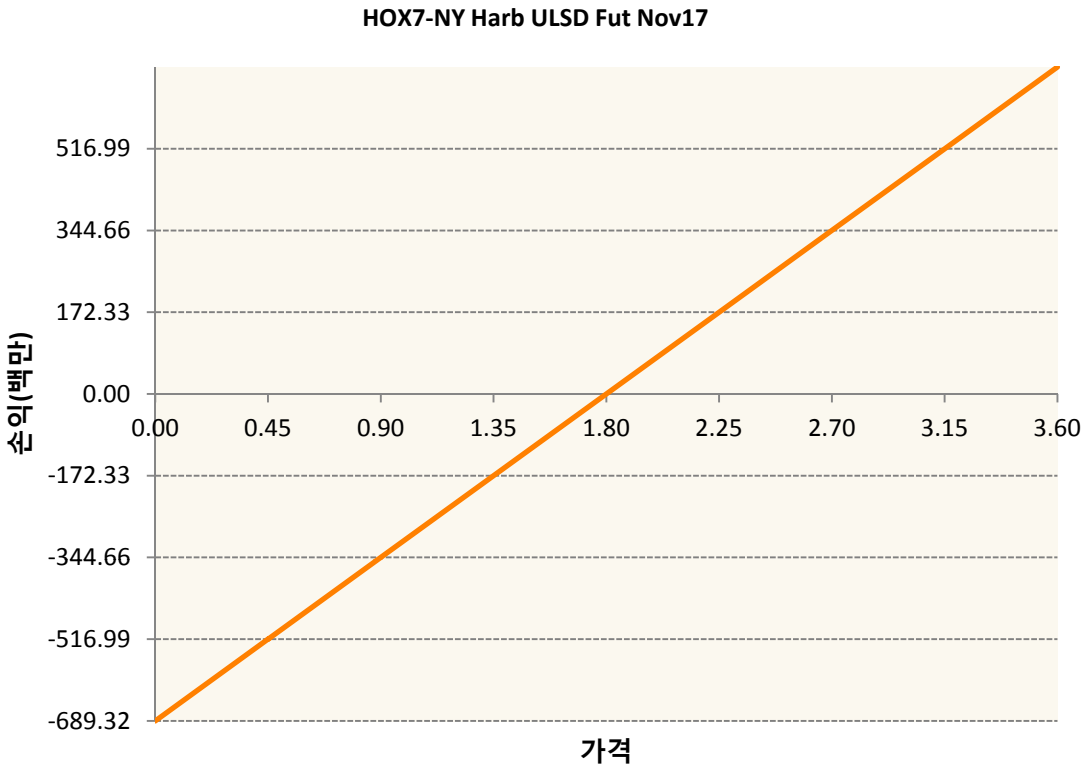
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	5,381	736	4,645	

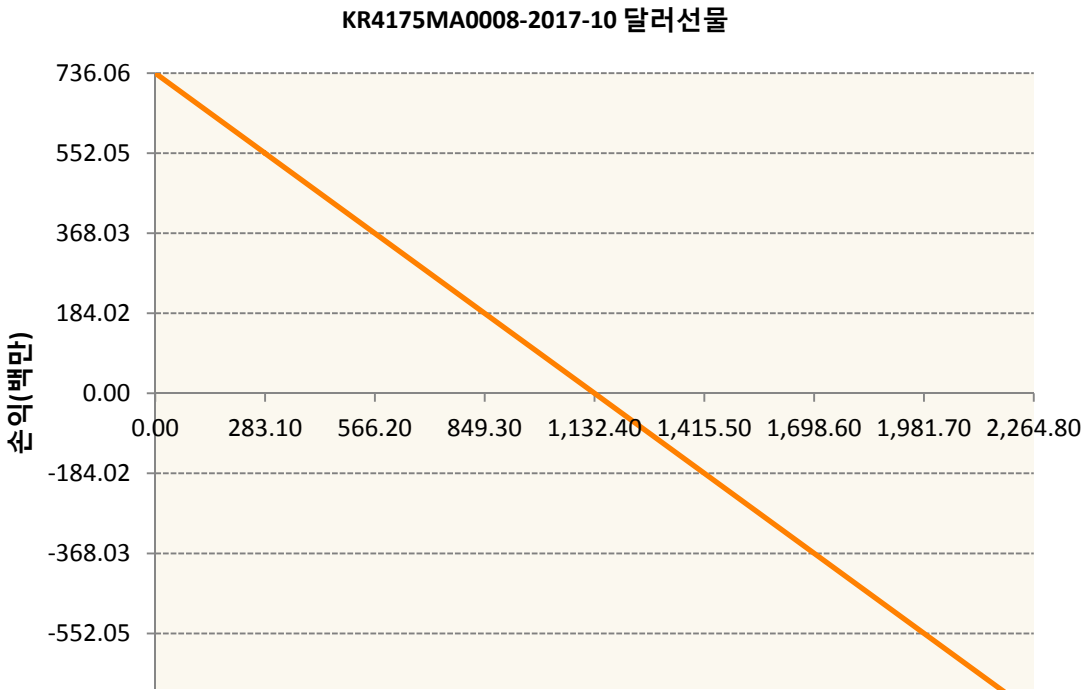
2. 만기시점의 손익구조

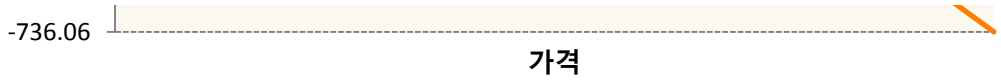


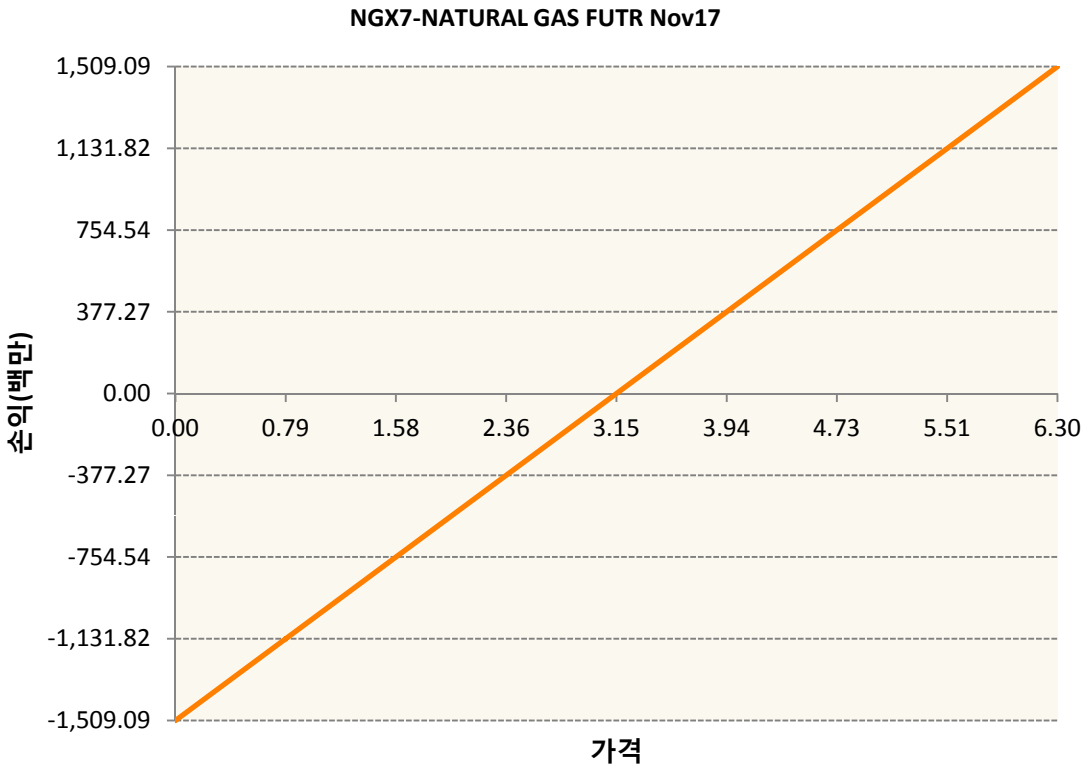


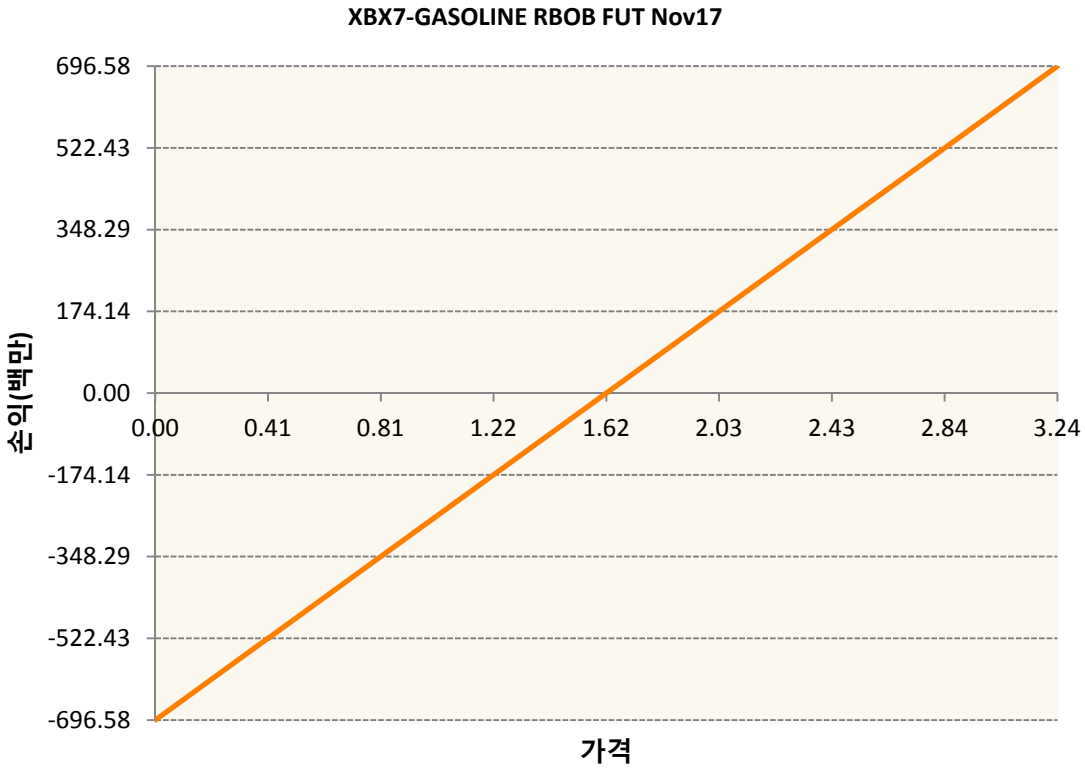

-722.69
-1,084.03
-1,445.37
가격


HOX7-NY Harb ULSD Fut Nov17
516.99
344.66
172.33
0.00
-172.33
-344.66
-516.99
-689.32
0.00
0.45
0.90
1.35
1.80
2.25
2.70
3.15
3.60
손익(백만)
가격


KR4175MA0008-2017-10 달러선물
736.06
552.05
368.03
184.02
0.00
-184.02
-368.03
-552.05
0.00
283.10
566.20
849.30
1,132.40
1,415.50
1,698.60
1,981.70
2,264.80
손익(백만)


-736.06
가격


NGX7-NATURAL GAS FUTR Nov17
1,509.09
1,131.82
754.54
377.27
0.00
-377.27
-754.54
-1,131.82
-1,509.09
0.00
0.79
1.58
2.36
3.15
3.94
4.73
5.51
6.30
손익(백만)
가격


XBX7-GASOLINE RBOB FUT Nov17
696.58
522.43
348.29
174.14
0.00
-174.14
-348.29
-522.43
-696.58
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	116
HOX7	NY Harb ULSD Fut Nov17	55
KR4175MA0	2017-10 달러선물	59
NGX7	NATURAL GAS FUTR Nov17	121
XBX7	GASOLINE RBOB FUT Nov17	56

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

778

공시일	2017-09-22
기준일	2017-09-21

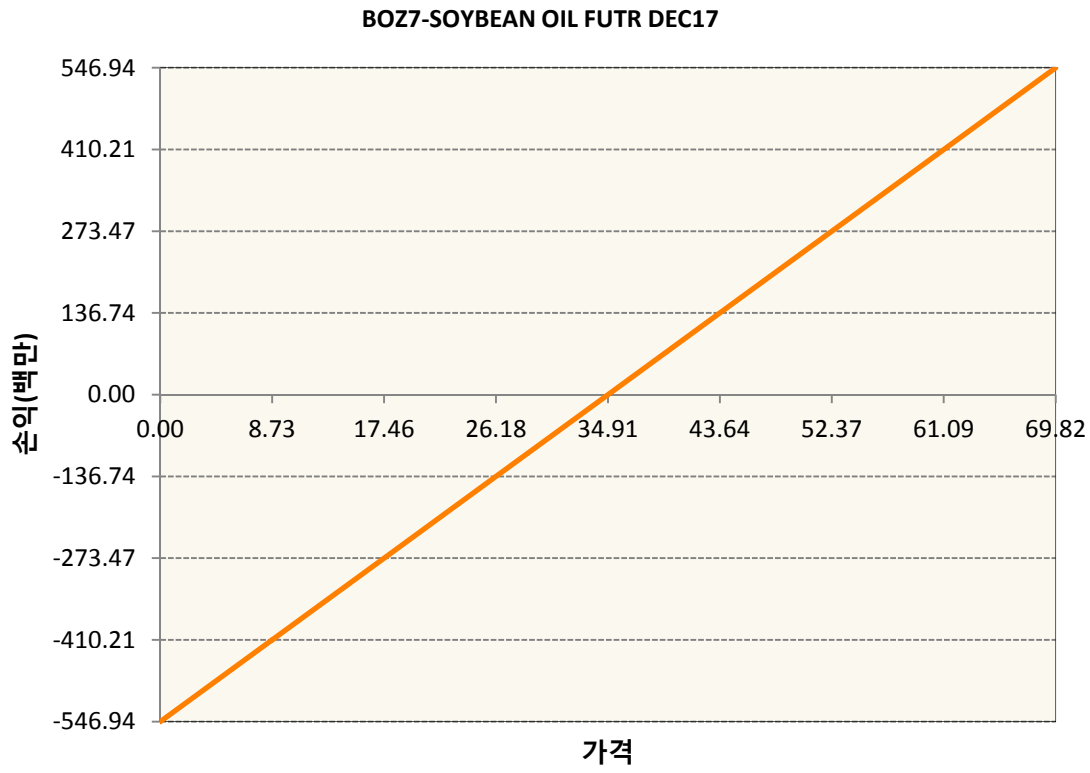
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

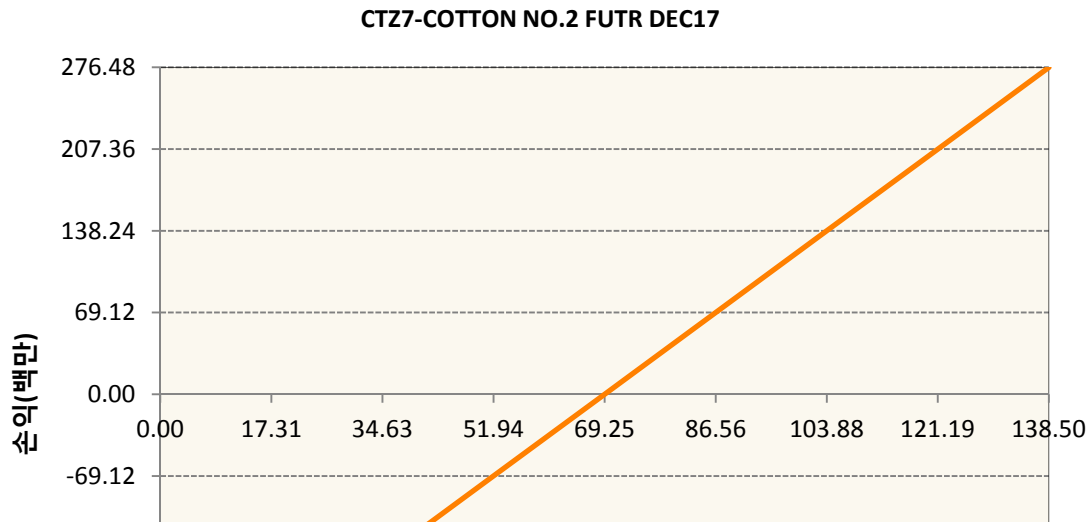
1. 계약금액

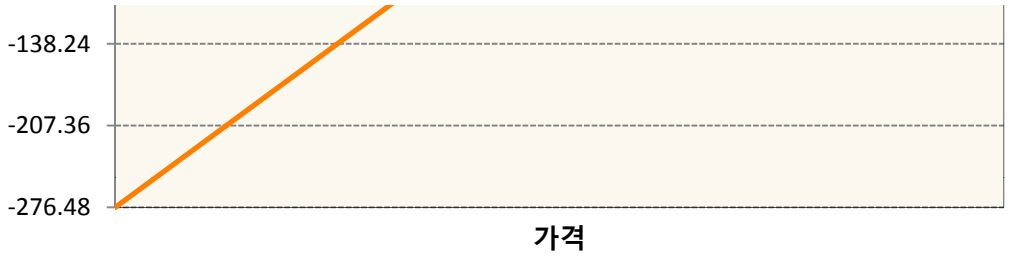
(단위:백만원)

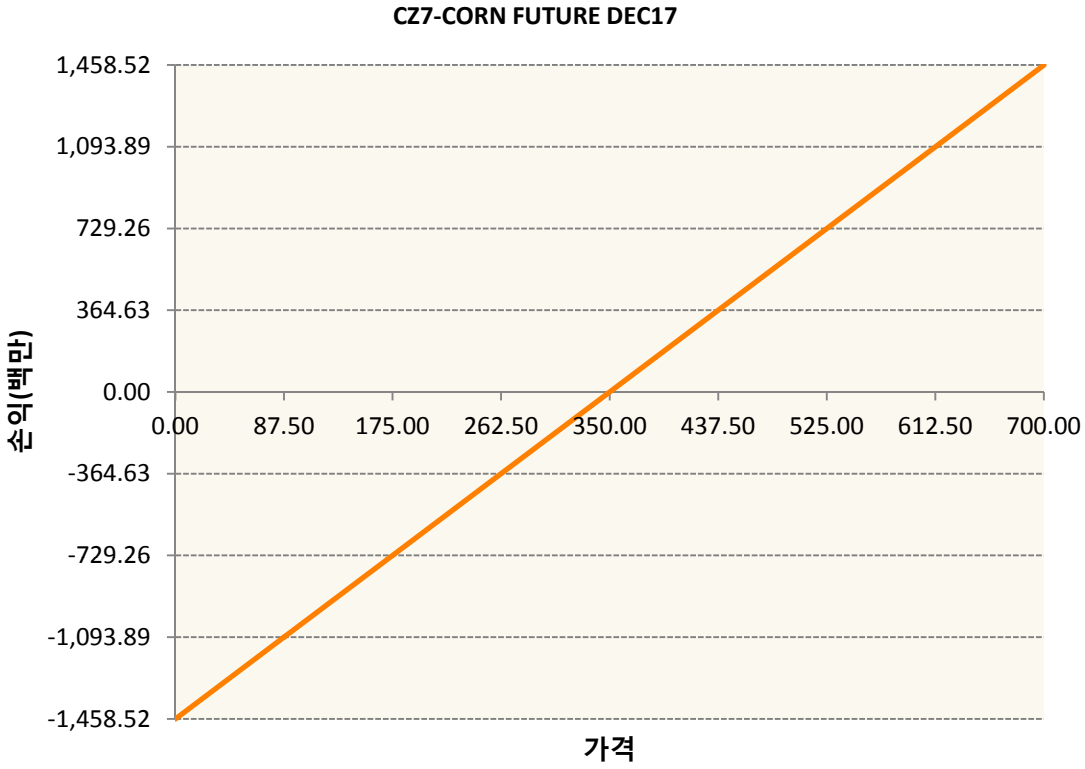
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	5,830	340	5,490	

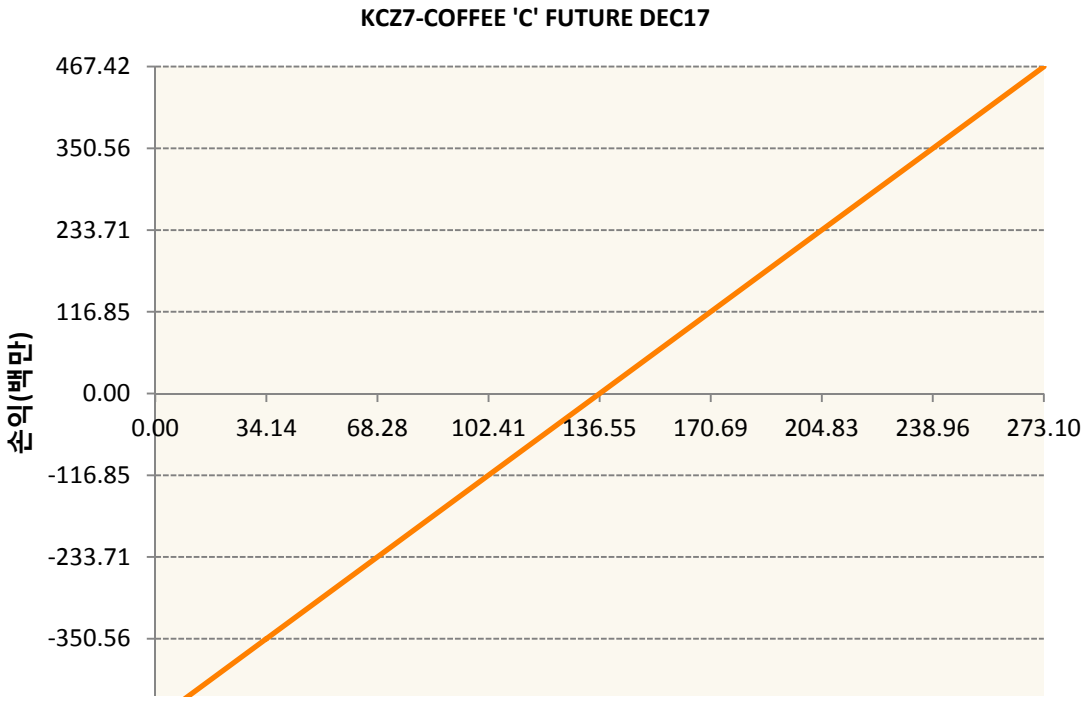
2. 만기시점의 손익구조

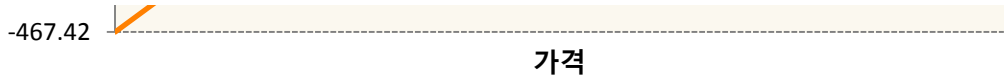


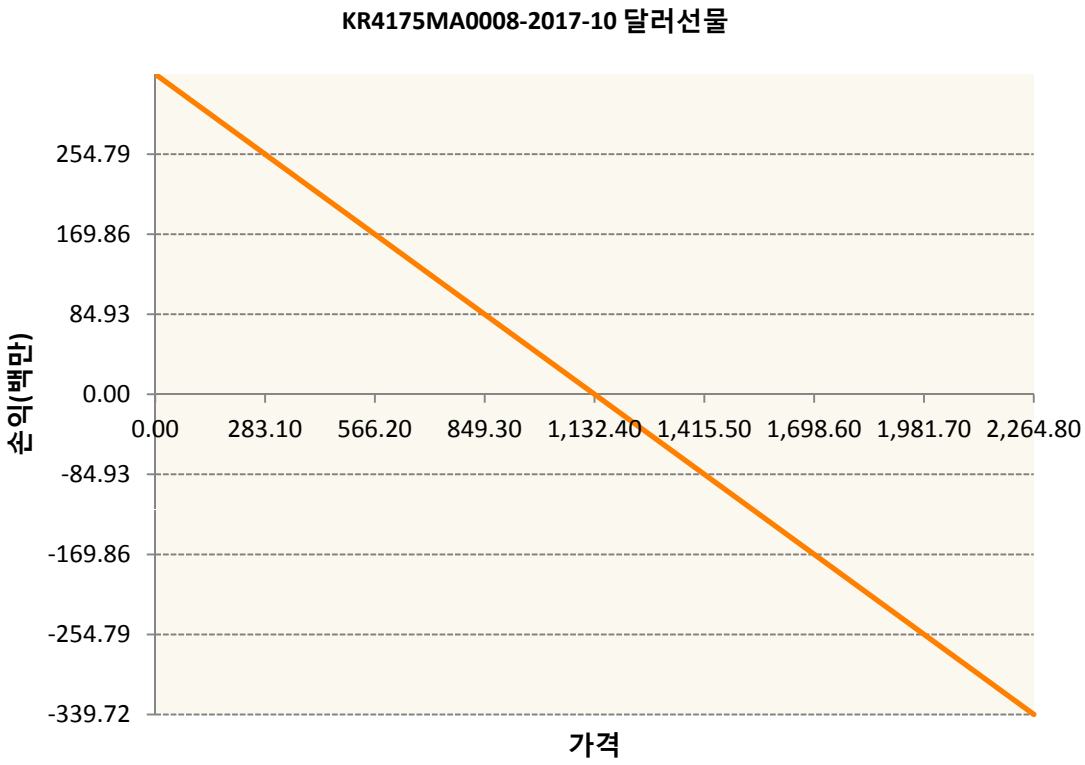


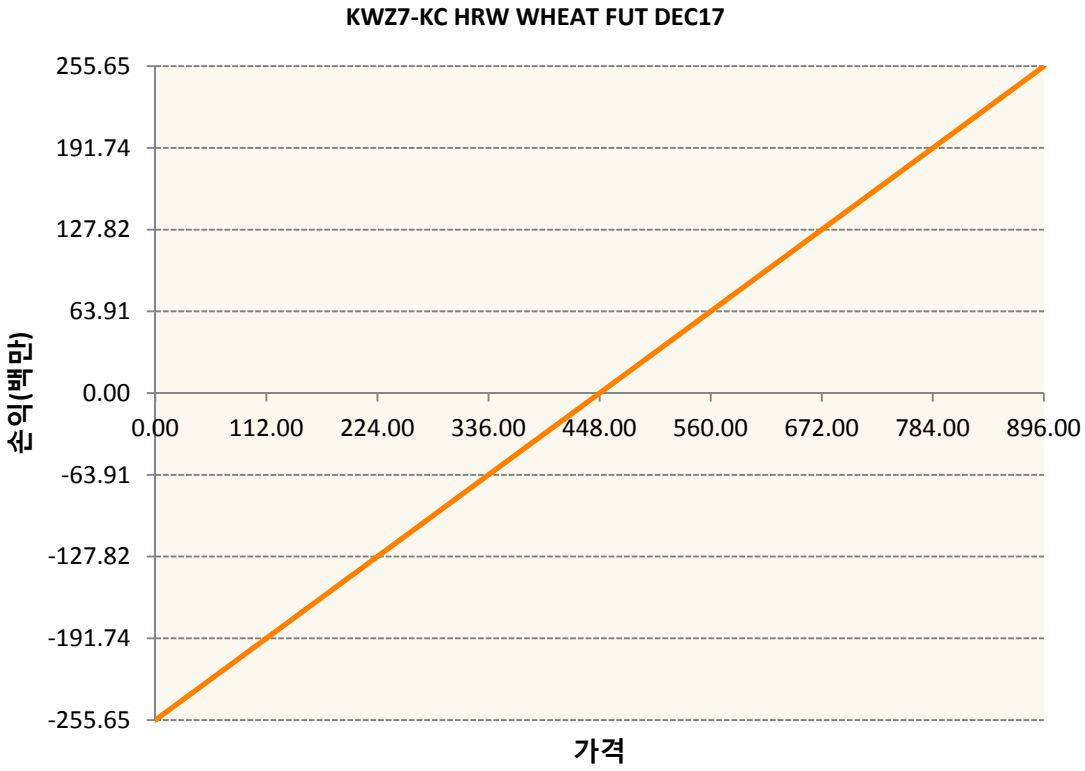

-138.24
-207.36
-276.48
가격


CZ7-CORN FUTURE DEC17
1,458.52
1,093.89
729.26
364.63
0.00
0.00
87.50
175.00
262.50
350.00
437.50
525.00
612.50
700.00
-364.63
-729.26
-1,093.89
-1,458.52
손익(백만)
가격

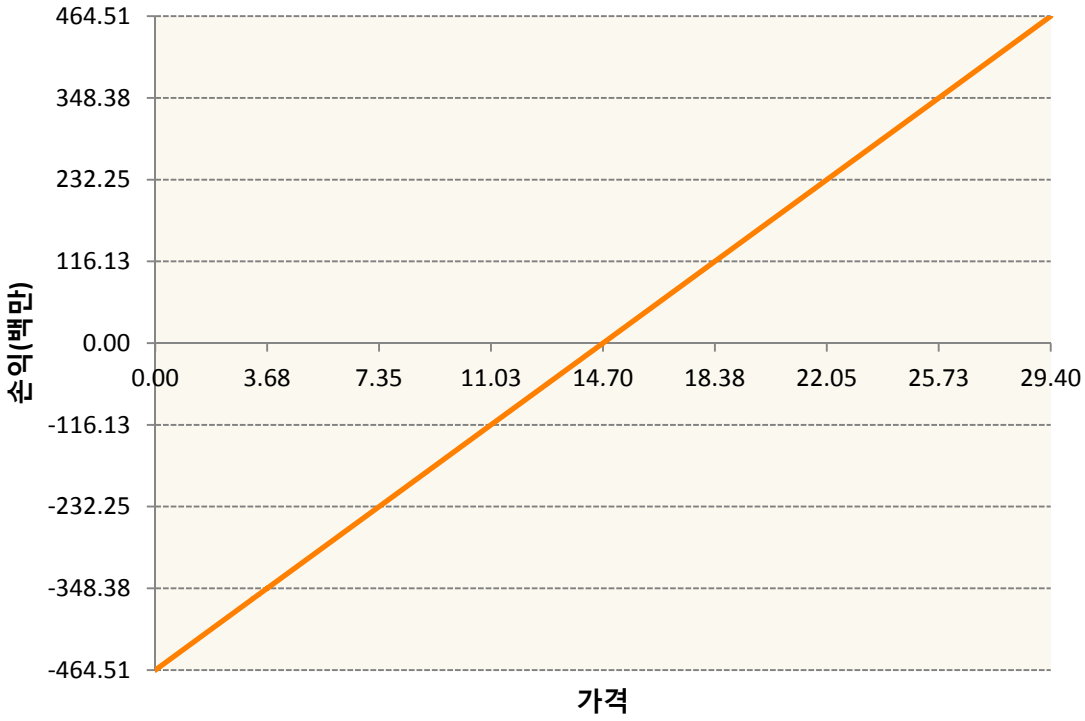

KCZ7-COFFEE 'C' FUTURE DEC17
467.42
350.56
233.71
116.85
0.00
0.00
34.14
68.28
102.41
136.55
170.69
204.83
238.96
273.10
-116.85
-233.71
-350.56
손익(백만)


-467.42
가격

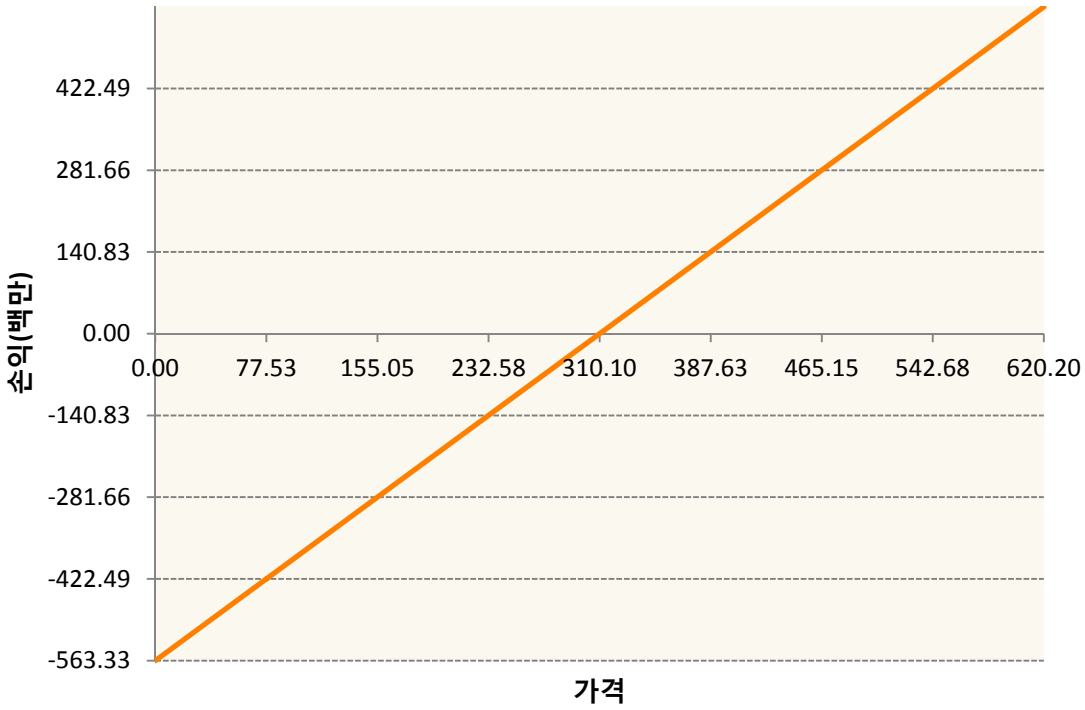

KR4175MA0008-2017-10 달러선물
254.79
169.86
84.93
0.00
-84.93
-169.86
-254.79
-339.72
0.00
283.10
566.20
849.30
1,132.40
1,415.50
1,698.60
1,981.70
2,264.80
손익(백만)
가격


KWZ7-KC HRW WHEAT FUT DEC17
255.65
191.74
127.82
63.91
0.00
-63.91
-127.82
-191.74
-255.65
0.00
112.00
224.00
336.00
448.00
560.00
672.00
784.00
896.00
손익(백만)
가격

SBH8-Sugar #11 (WORLD) MAR18

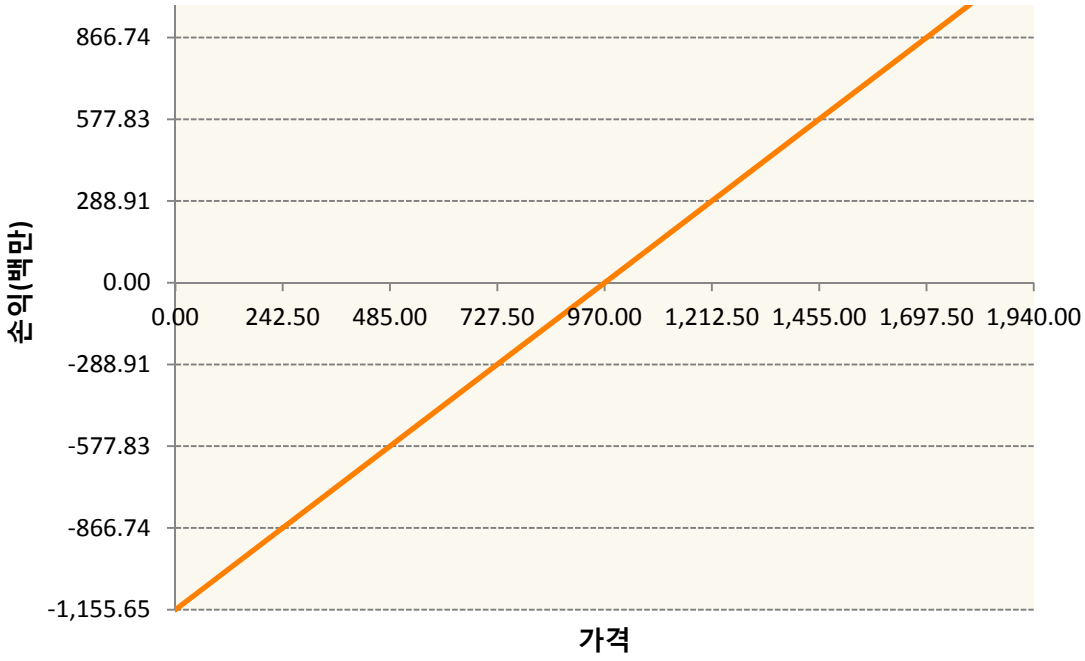


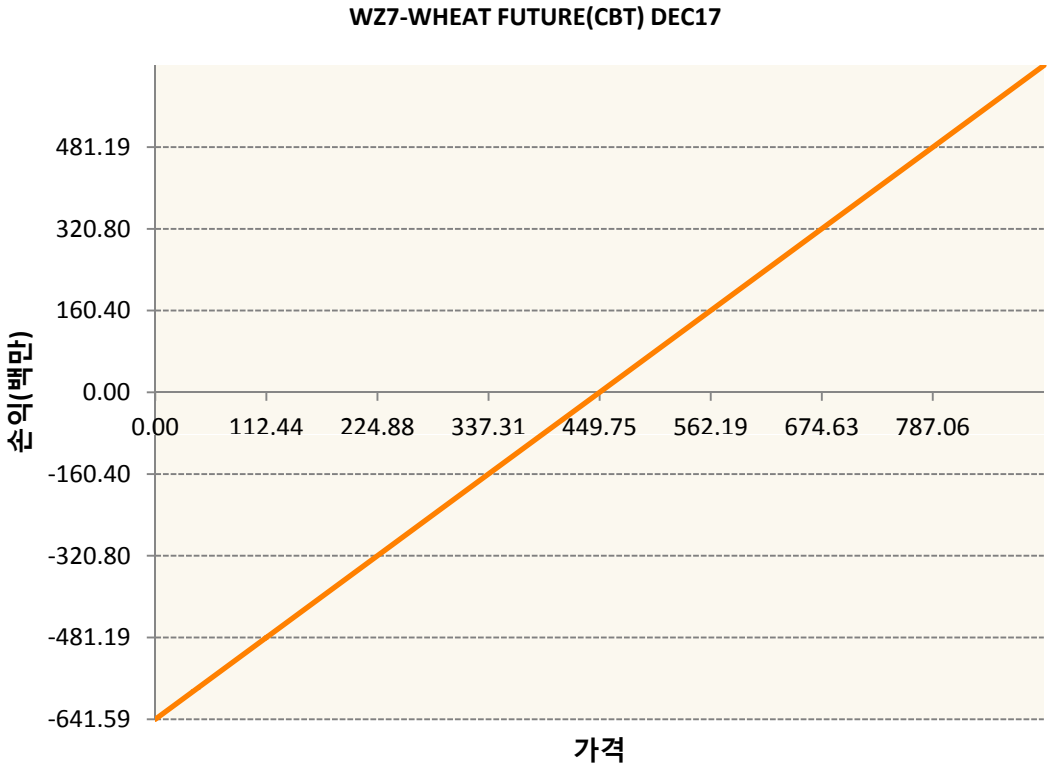
SMZ7-SOYBEAN MEAL FUTR DEC17



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	117
KCZ7	COFFEE 'C' FUTURE DEC17	37
KR4175MA0	2017-10 달러선물	27

KWZ7	KC HRW WHEAT FUT DEC17	20
SBH8	Sugar #11 (WORLD) MAR18	37
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)

548