공시일	2017-09-25
기준일	2017-09-22

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	2017-09-25
기준일	2017-09-22

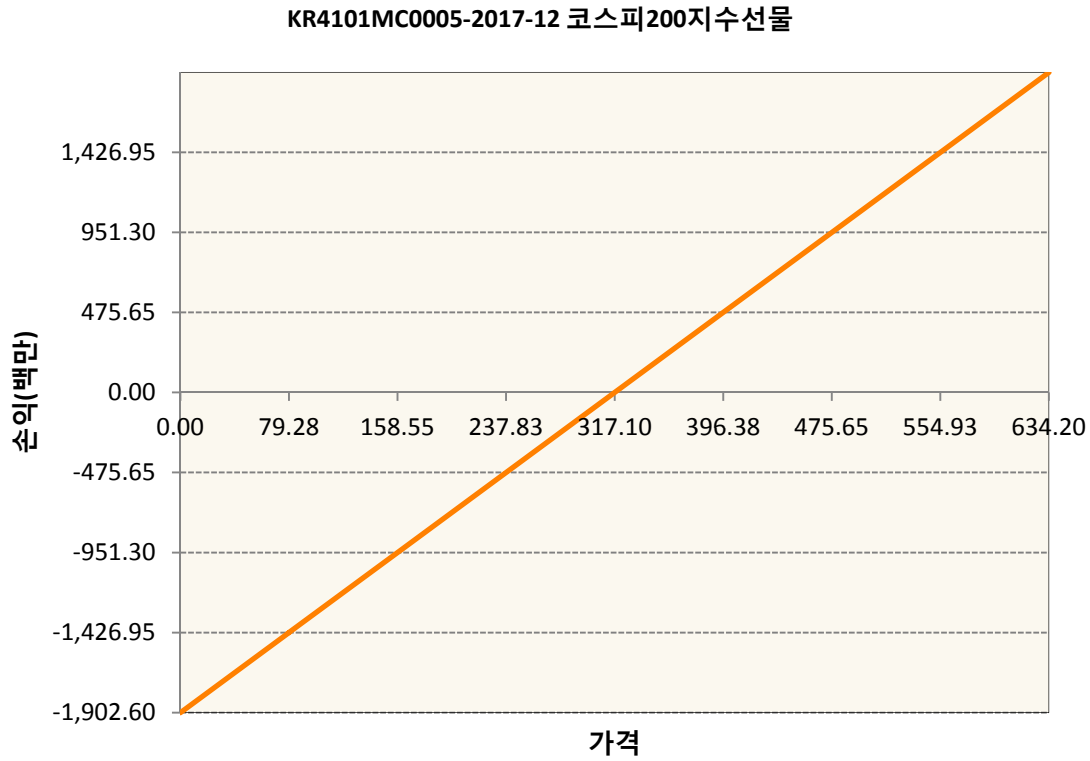
스마트인덱스모

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	79	-79	장내
누계	유가증권	선물	1,903	0	1,903	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101MC0	2017-12 코스피200지수선물						152
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-152	-152	-152	-152	-152	-152	-152
-5.33%	-101	-101	-101	-101	-101	-101	-101
-2.67%	-51	-51	-51	-51	-51	-51	-51
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	51	51	51	51	51	51	51
5.33%	101	101	101	101	101	101	101
8.00%	152	152	152	152	152	152	152

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

92

공시일	2017-09-25
기준일	2017-09-22

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)

466

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-09-25
기준일	2017-09-22

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	420

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

359

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-09-25
기준일	2017-09-22

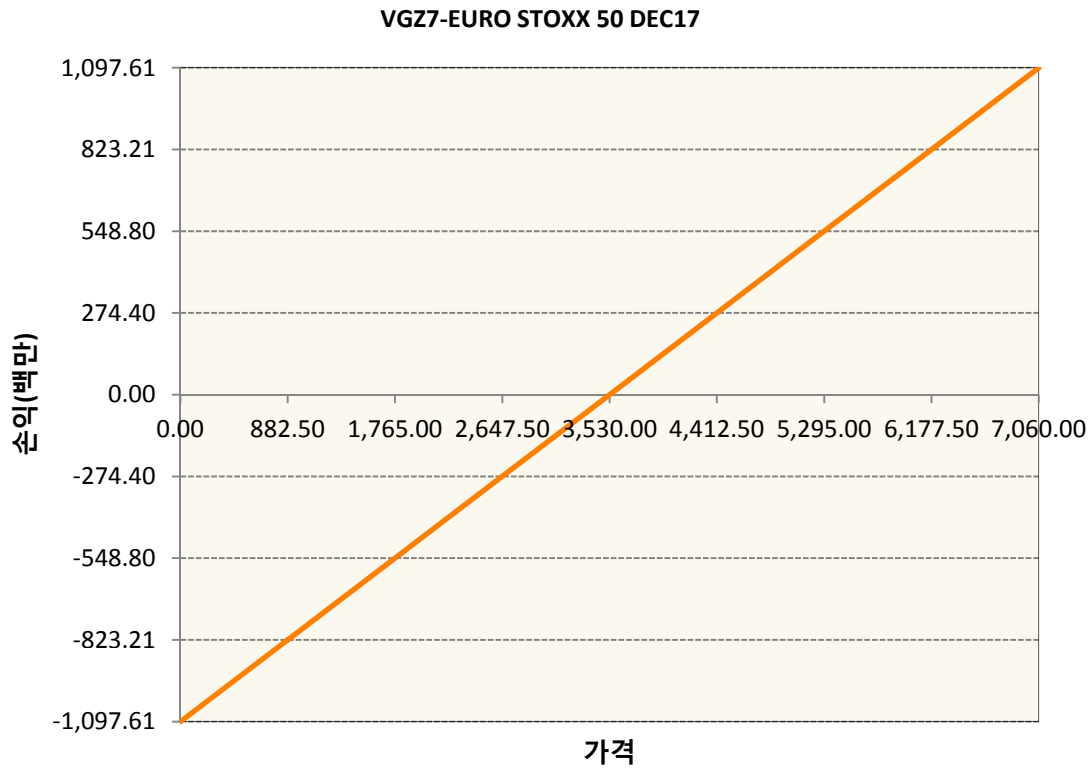
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,098	0	1,098	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGZ7	EURO STOXX 50 DEC17	88

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

(단위:백만원)

68

공시일	2017-09-25
기준일	2017-09-22

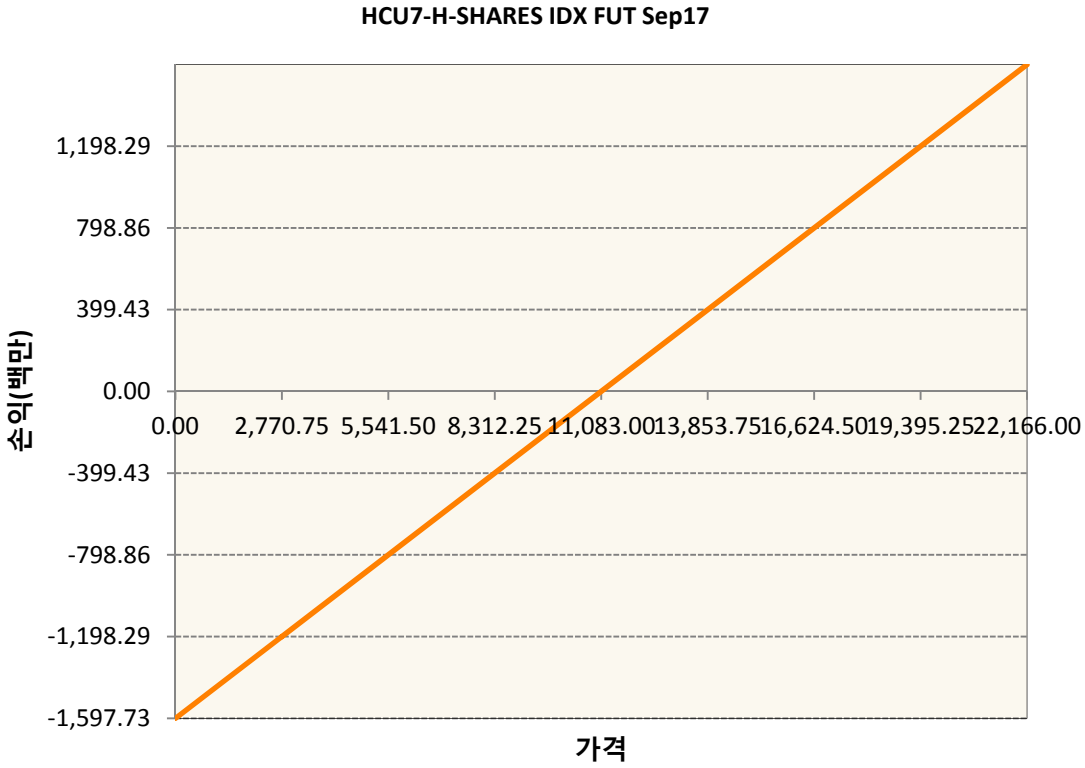
차이나인덱스모(주식-파생형)

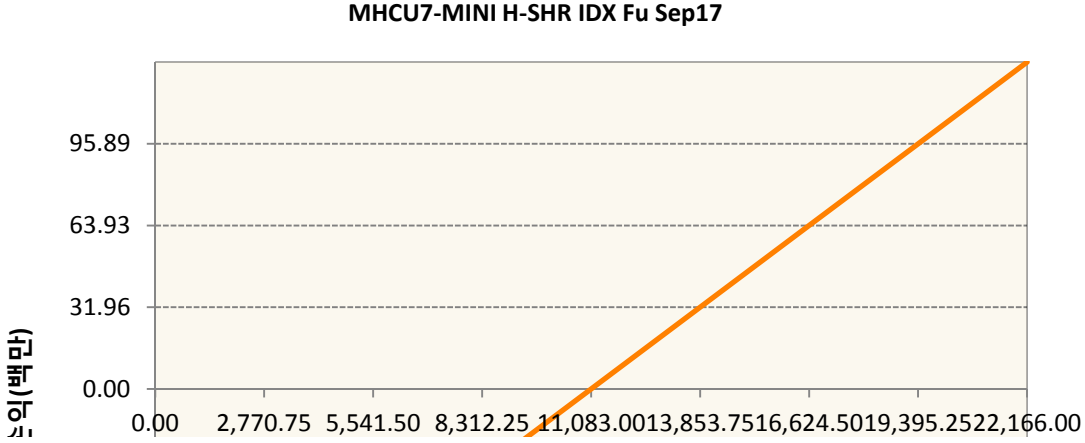
1. 계약금액

(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	1,598	0	1,598	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)
	114

공시일	2017-09-25
기준일	2017-09-22

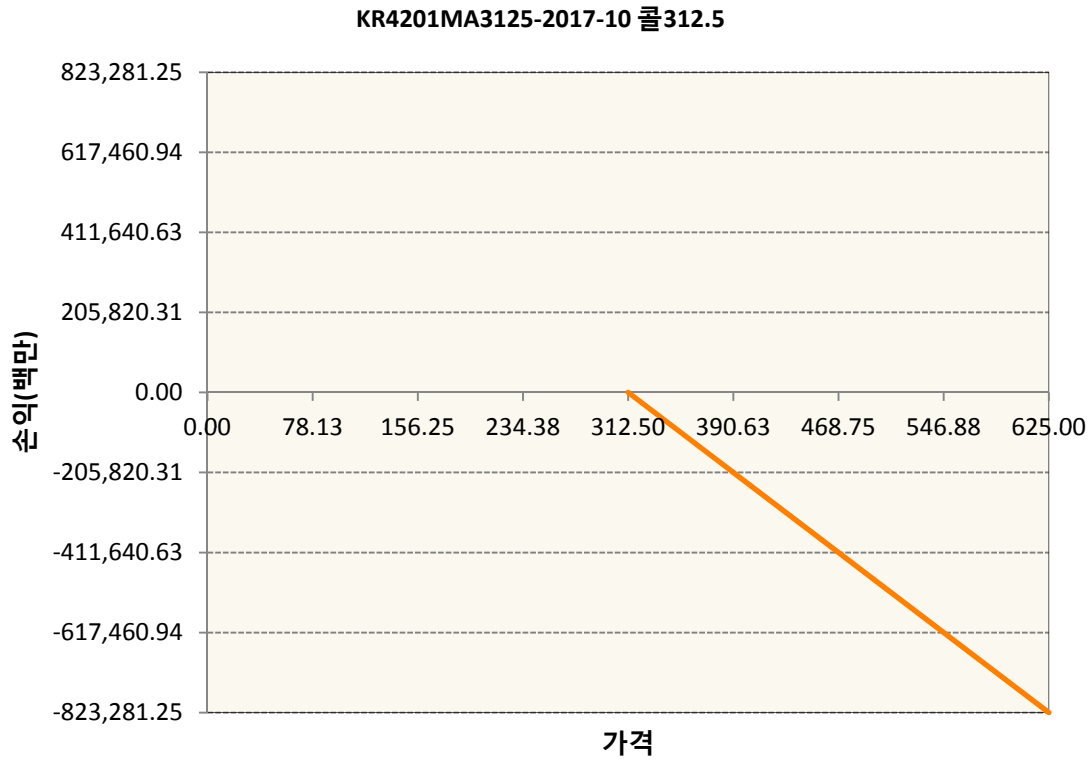
커버드콜모(주식혼합-파생형)

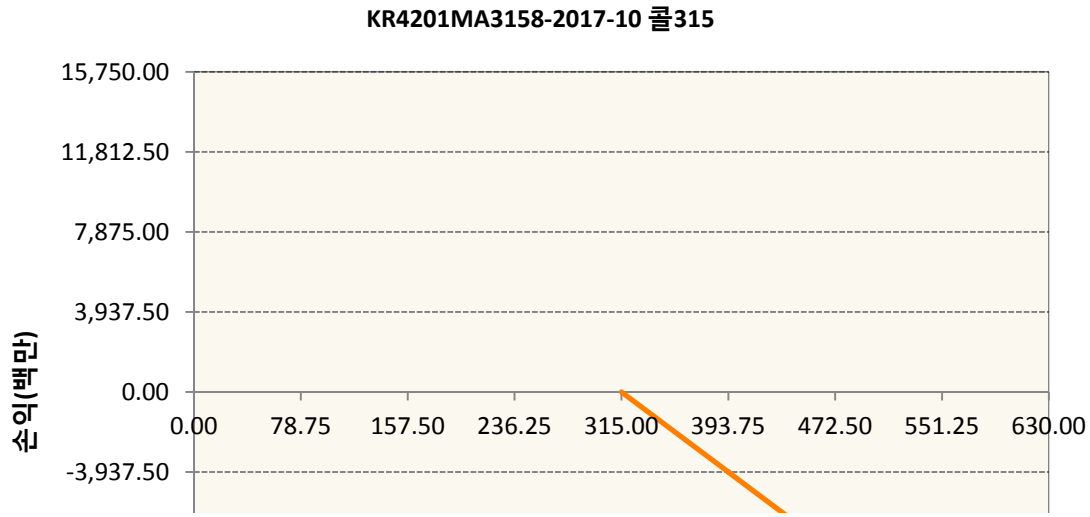
1. 계약금액

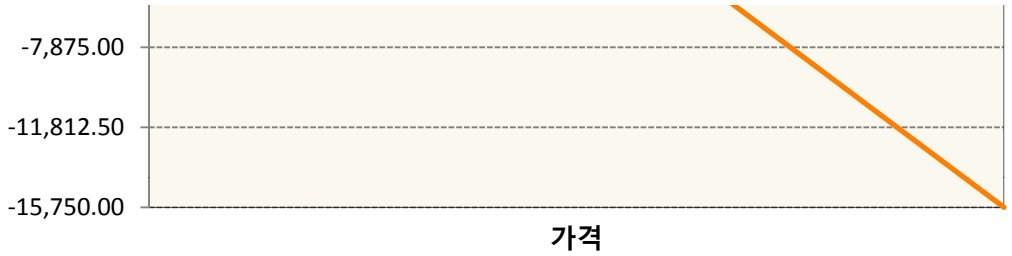
(단위:백만원)

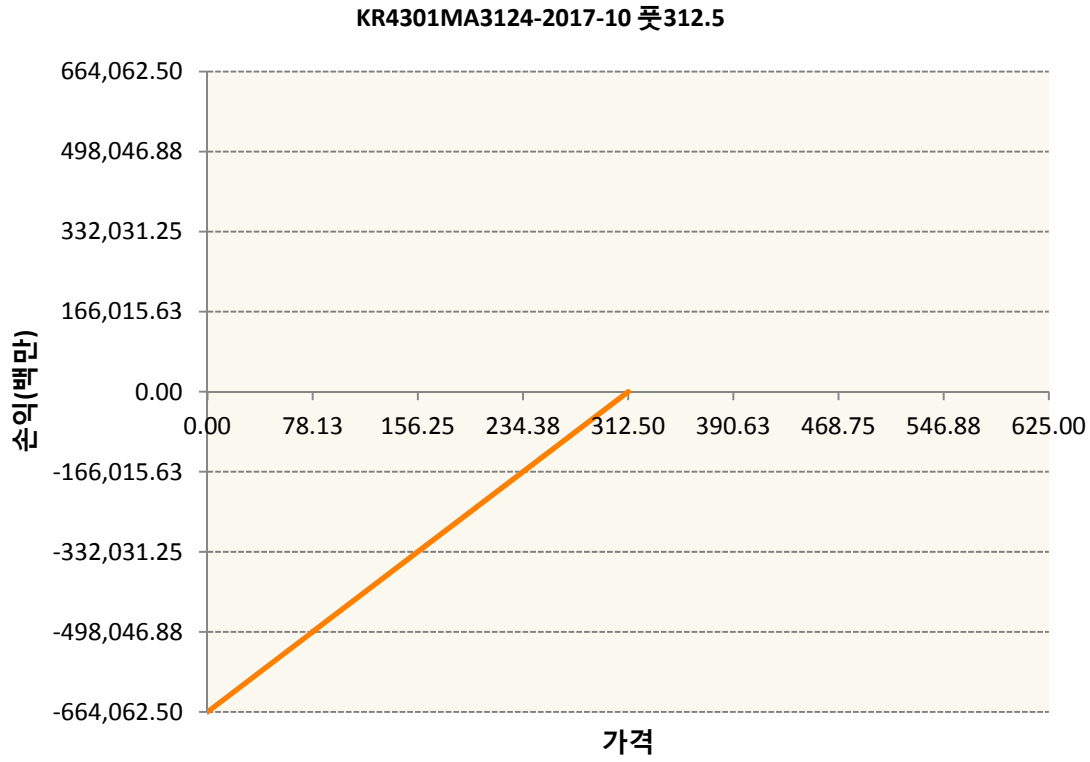
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	1,503,094	-1,503,094	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201MA3 2017-10 콜312.5							56,297
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	23,357	22,985	22,512	21,943	21,289	20,557	19,758
-5.33%	21,310	20,408	19,426	18,380	17,280	16,136	14,957
-2.67%	15,551	14,159	12,755	11,341	9,919	8,491	7,059
0%	4,274	2,861	1,435	0	-1,443	-2,891	-4,344
2.67%	-12,339	-13,315	-14,370	-15,489	-16,661	-17,874	-19,123
5.33%	-32,413	-32,885	-33,468	-34,153	-34,927	-35,780	-36,701
8.00%	-54,029	-54,194	-54,441	-54,776	-55,199	-55,708	-56,297
KR4201MA3 2017-10 콜315							1,027
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	378	372	366	357	346	335	321

-5.33%	351	336	321	303	284	265	244
-2.67%	266	241	216	191	165	139	112
0%	84	56	28	0	-28	-56	-85
2.67%	-203	-225	-248	-272	-296	-321	-347
5.33%	-568	-580	-594	-610	-627	-646	-665
8.00%	-972	-977	-983	-992	-1,002	-1,013	-1,027
KR4301MA3 2017-10 풋312.5							40,970

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-40,721	-40,728	-40,743	-40,771	-40,816	-40,882	-40,970
-5.33%	-22,950	-23,079	-23,250	-23,464	-23,716	-24,003	-24,322
-2.67%	-7,215	-7,755	-8,312	-8,882	-9,463	-10,052	-10,649
0%	1,700	1,149	581	0	-591	-1,190	-1,796
2.67%	3,933	3,780	3,581	3,338	3,055	2,736	2,384
5.33%	4,136	4,123	4,096	4,052	3,984	3,890	3,768
8.00%	4,142	4,141	4,140	4,136	4,127	4,112	4,085

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

103,096

공시일	2017-09-25
기준일	2017-09-22

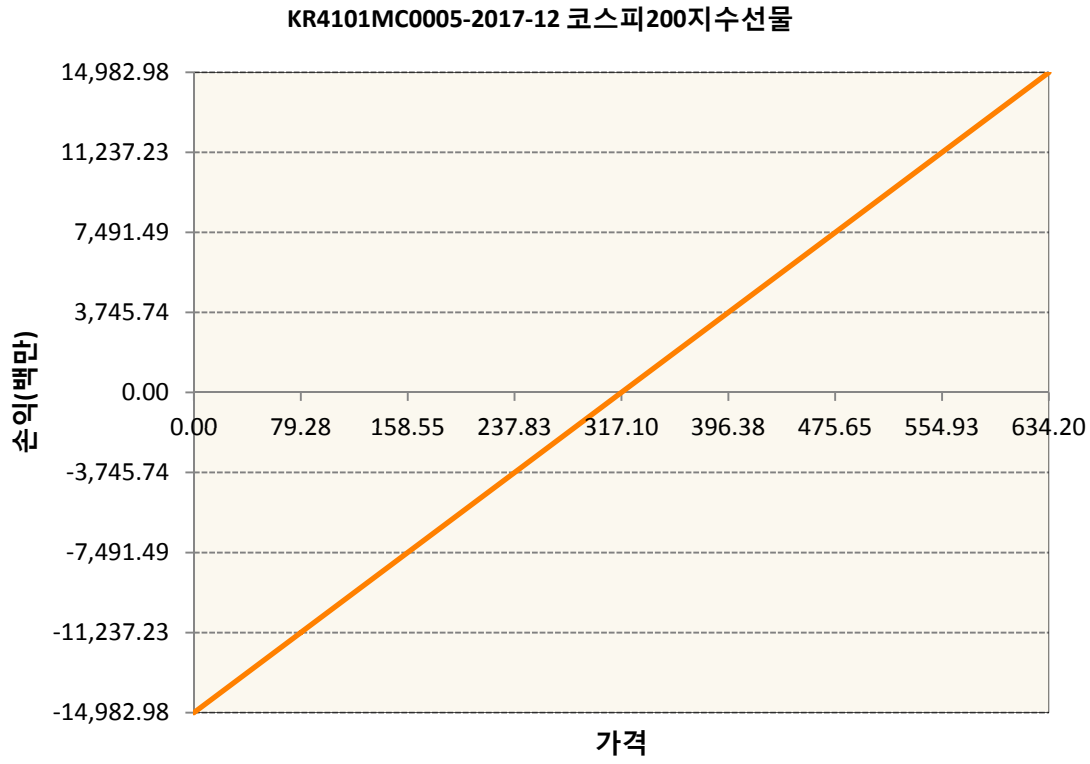
ETF스마트레버리지목표전환형6호

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	14,983	0	14,983	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101MC0	2017-12 코스피200지수선물						1,197
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,197	-1,197	-1,197	-1,197	-1,197	-1,197	-1,197
-5.33%	-798	-798	-798	-798	-798	-798	-798
-2.67%	-399	-399	-399	-399	-399	-399	-399
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	399	399	399	399	399	399	399
5.33%	798	798	798	798	798	798	798
8.00%	1,197	1,197	1,197	1,197	1,197	1,197	1,197

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

726

공시일	2017-09-25
기준일	2017-09-22

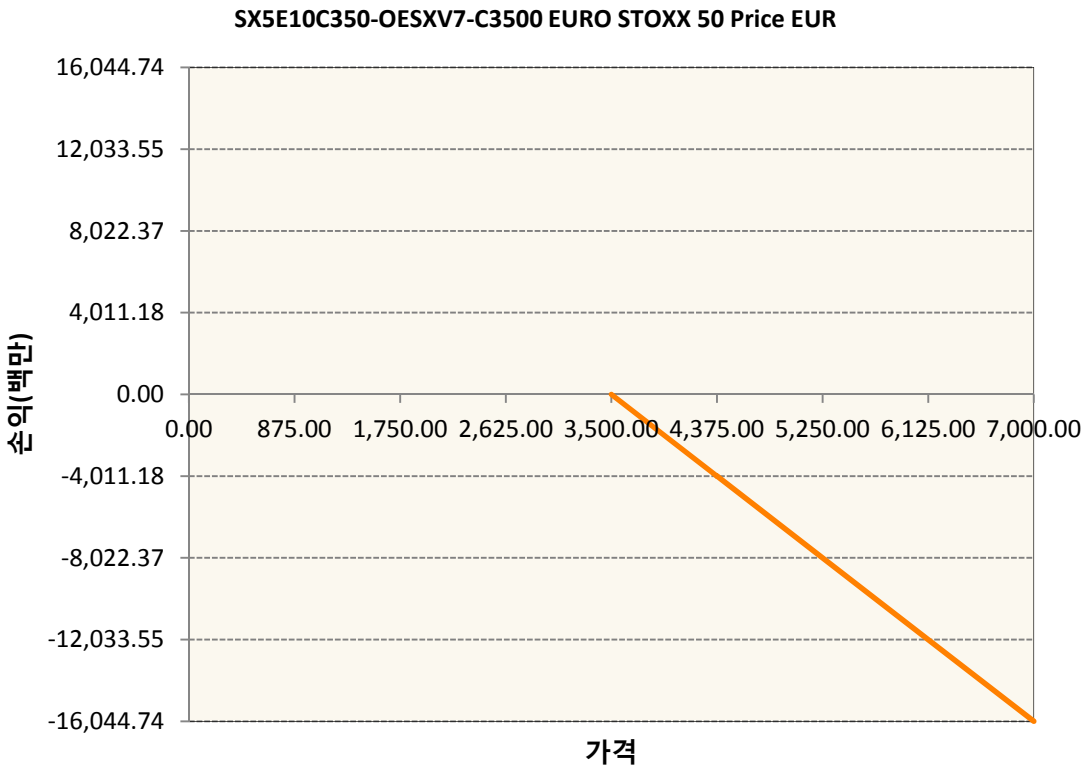
유로커버드콜(주식혼합-파생형)

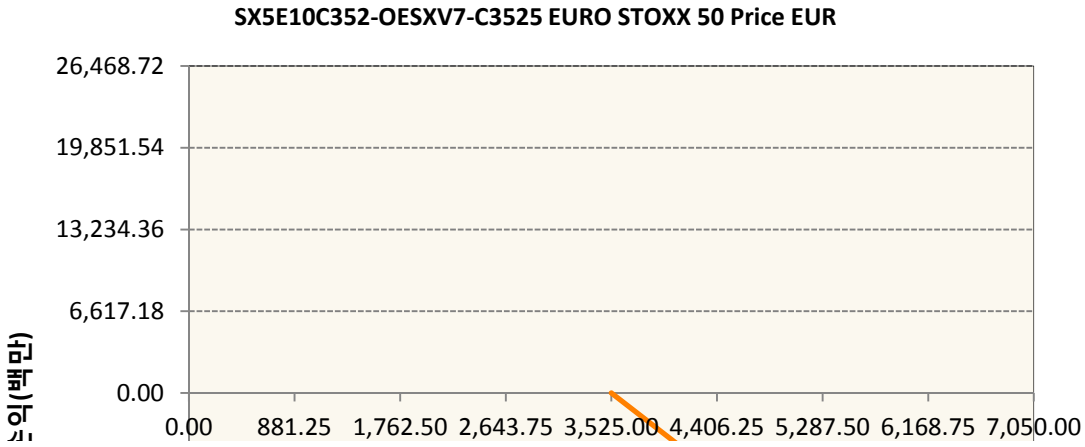
1. 계약금액

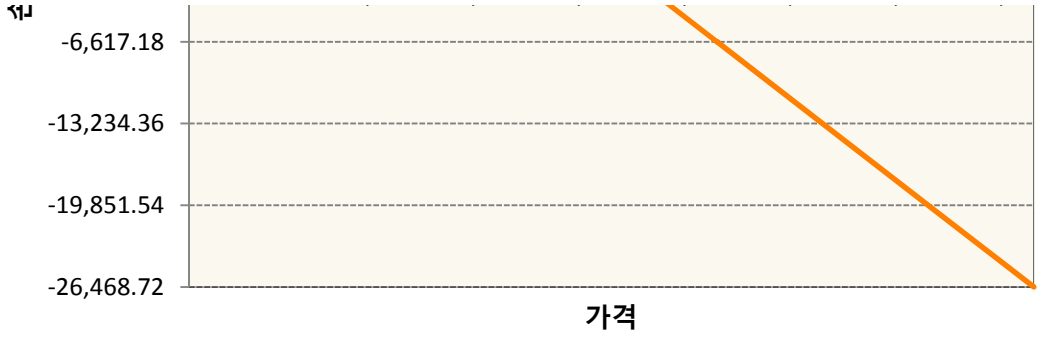
(단위:백만원)

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	37,555	0	37,555	
누계	유가증권	옵션	0	85,027	-85,027	장내

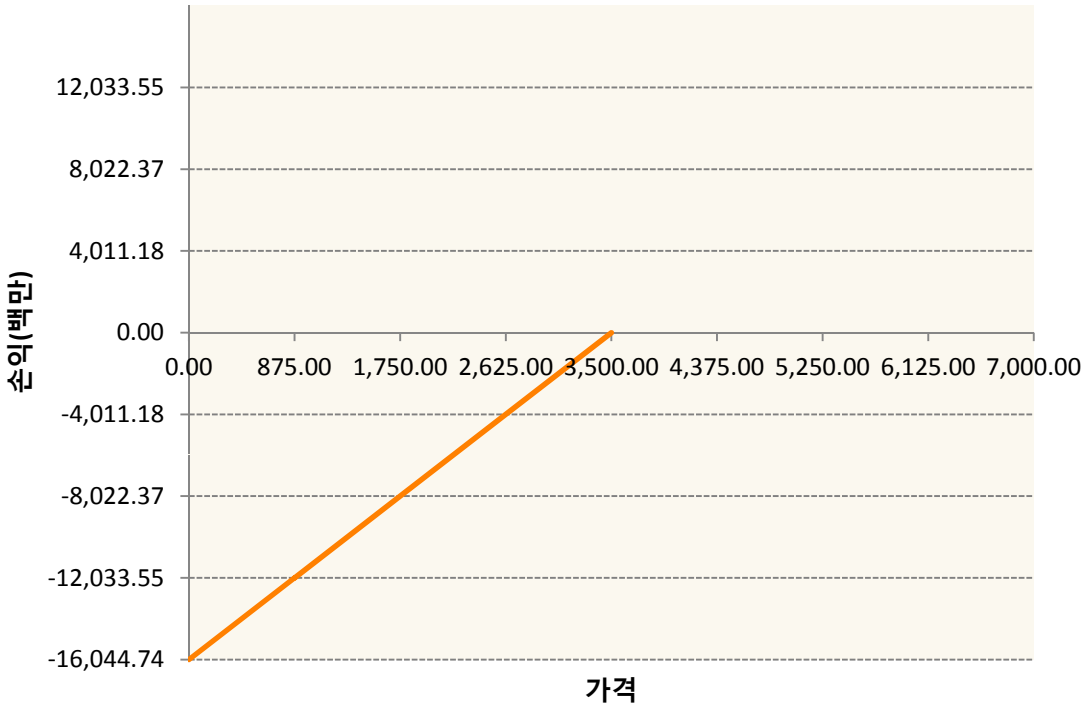
2. 만기시점의 손익구조



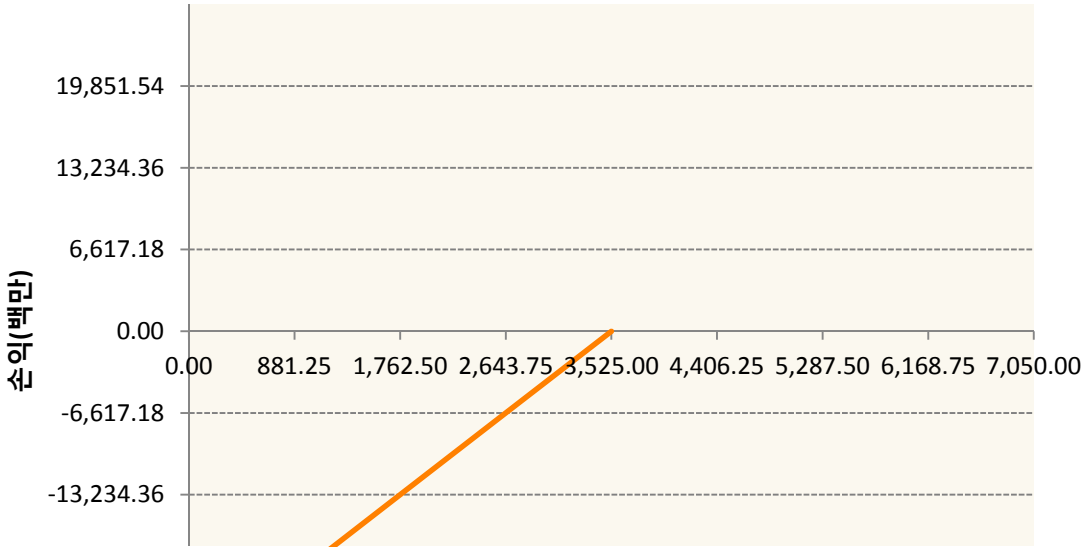


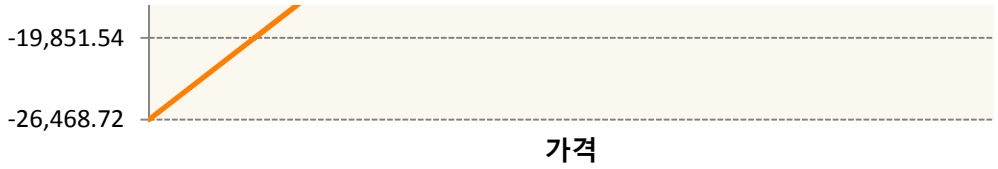


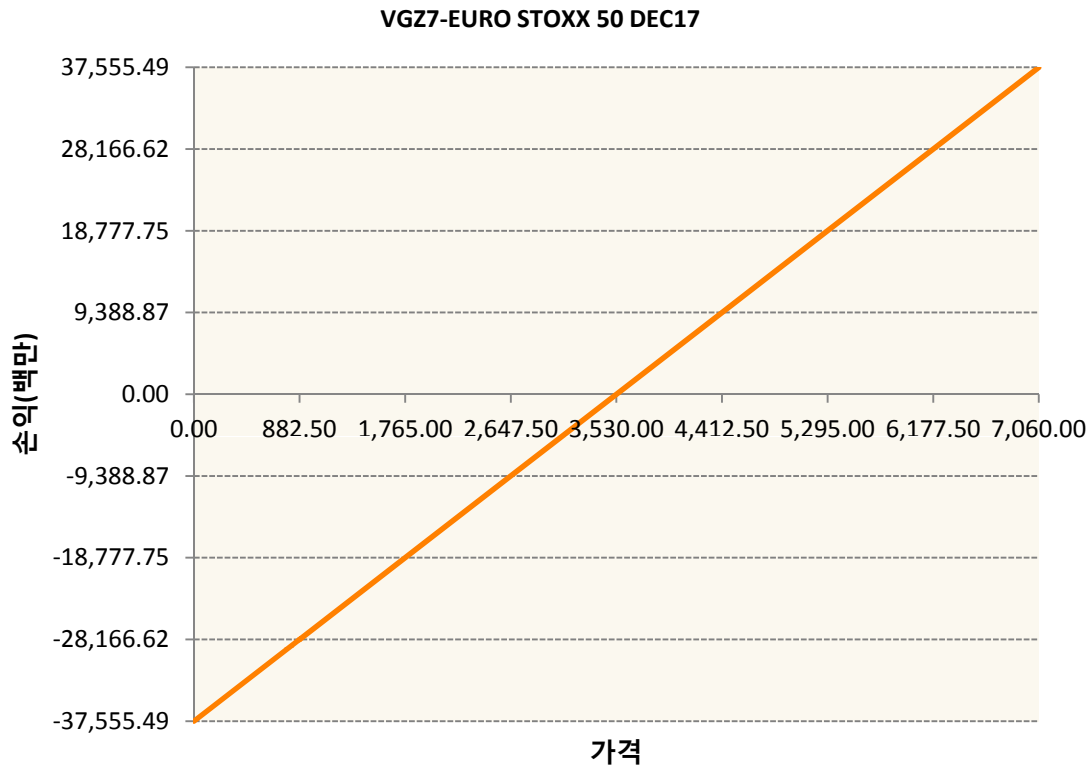
SX5E10P350-OESXV7-P3500 EURO STOXX 50 Price EUR



SX5E10P352-OESXV7-P3525 EURO STOXX 50 Price EUR







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

SX5E10C350 OESXV7-C3500 EURO STOXX 50 Price EUR	1,284
SX5E10C352 OESXV7-C3525 EURO STOXX 50 Price EUR	2,117
SX5E10P350 OESXV7-P3500 EURO STOXX 50 Price EUR	1,284
SX5E10P352 OESXV7-P3525 EURO STOXX 50 Price EUR	2,117
VGZ7 EURO STOXX 50 DEC17	3,005

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

7,645

공시일	2017-09-25
기준일	2017-09-22

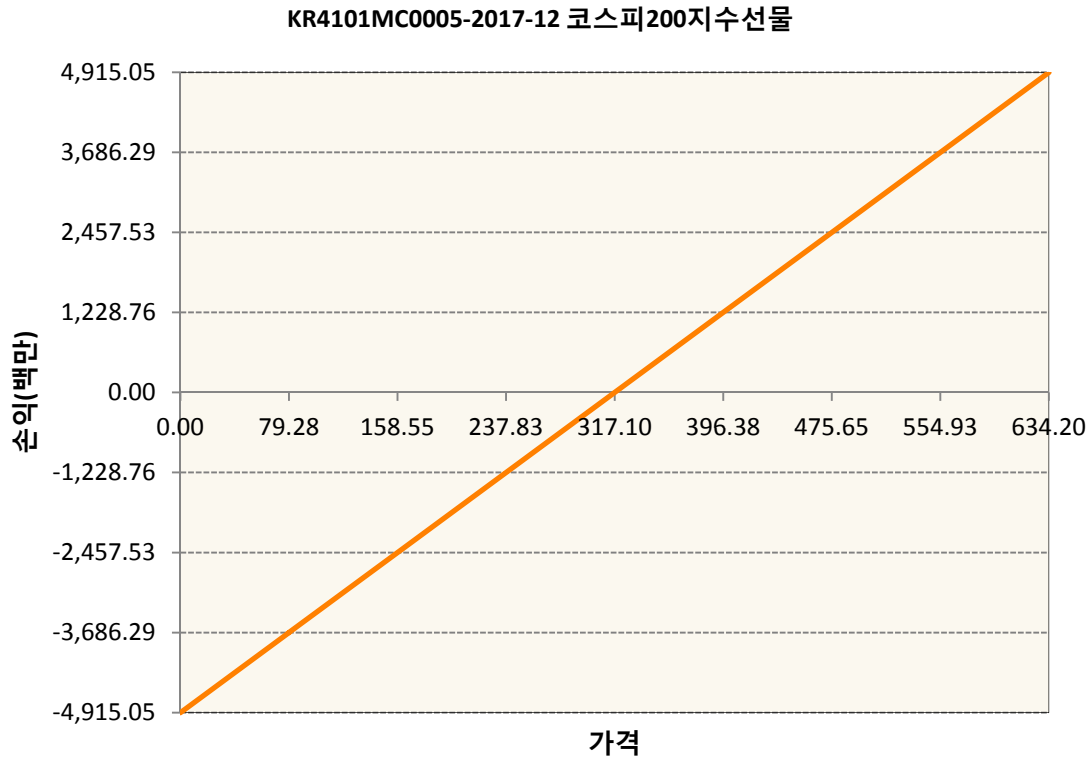
ETF스마트레버리지목표전환형7호

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	4,915	0	4,915	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101MC0	2017-12 코스피200지수선물						393
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-393	-393	-393	-393	-393	-393	-393
-5.33%	-262	-262	-262	-262	-262	-262	-262
-2.67%	-131	-131	-131	-131	-131	-131	-131
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	131	131	131	131	131	131	131
5.33%	262	262	262	262	262	262	262
8.00%	393	393	393	393	393	393	393

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

238

공시일	2017-09-25
기준일	2017-09-22

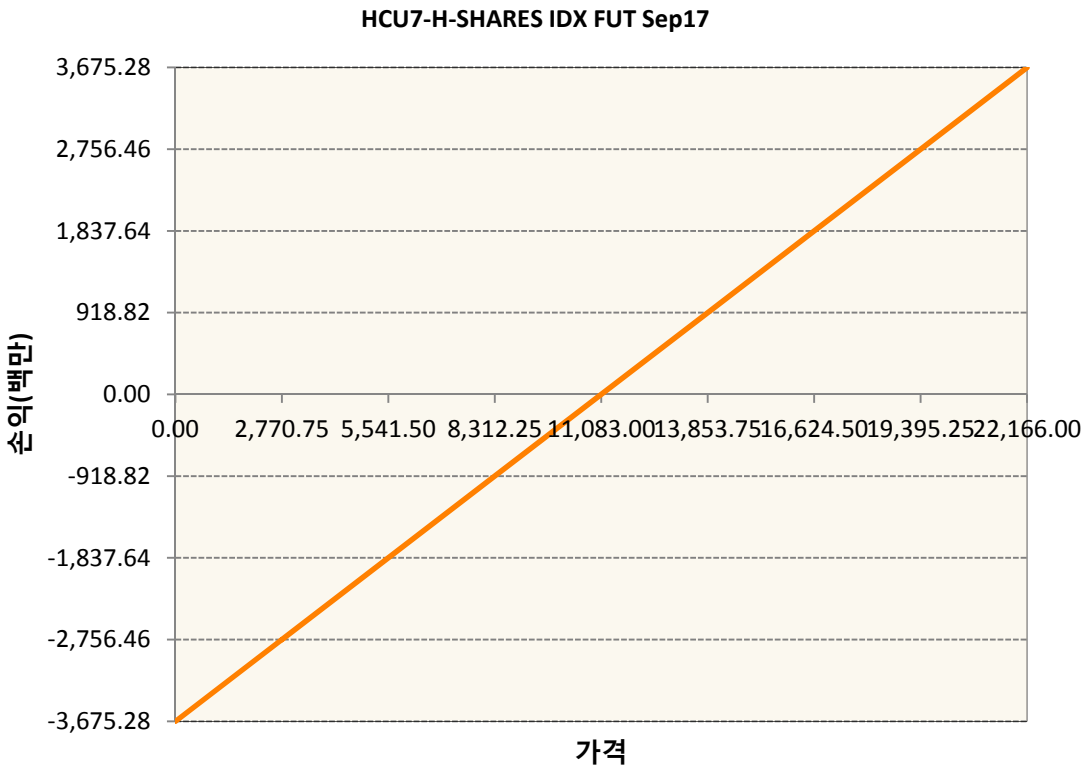
홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생

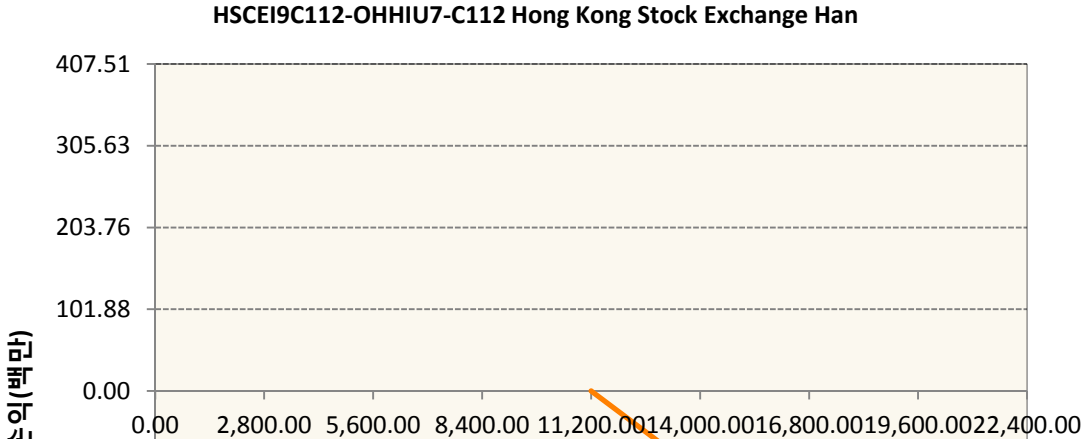
1. 계약금액

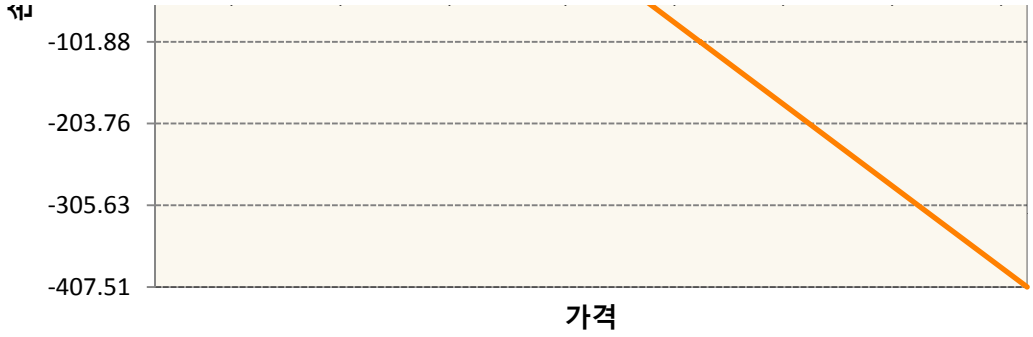
(단위:백만원)

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	3,675	0	3,675	장내
누계	유가증권	옵션	0	8,945	-8,945	장내

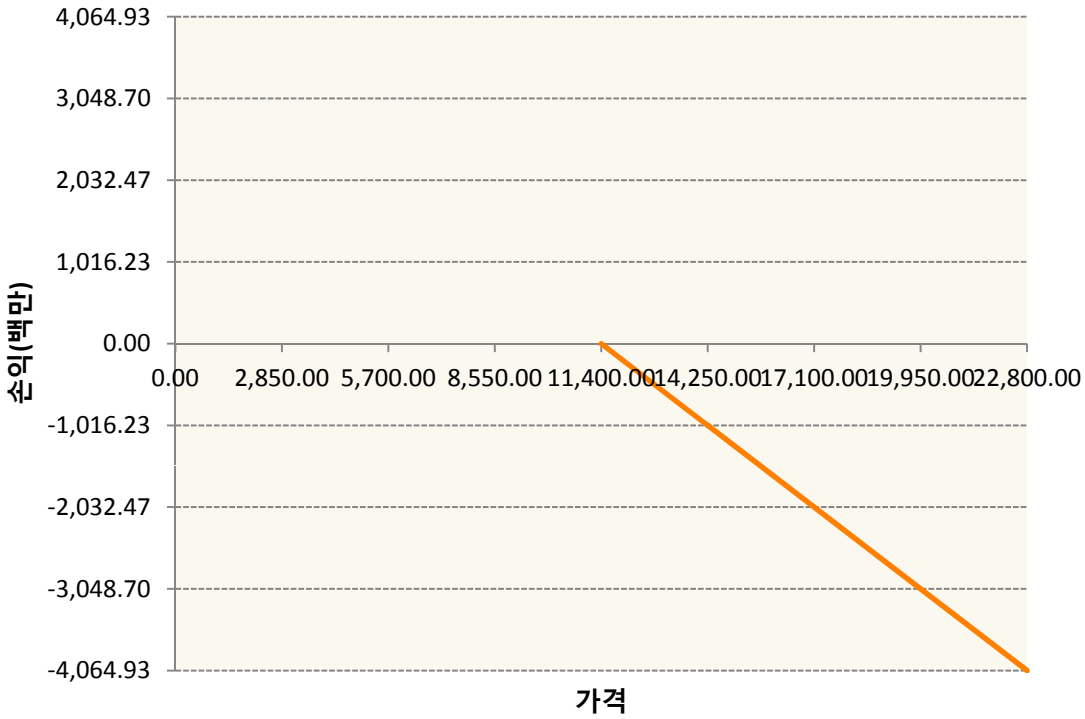
2. 만기시점의 손익구조



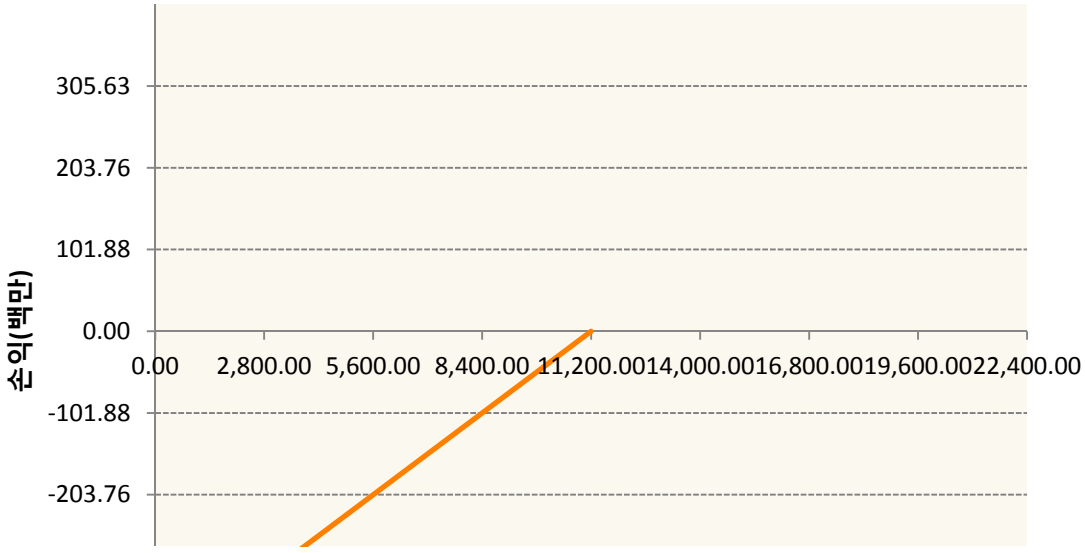


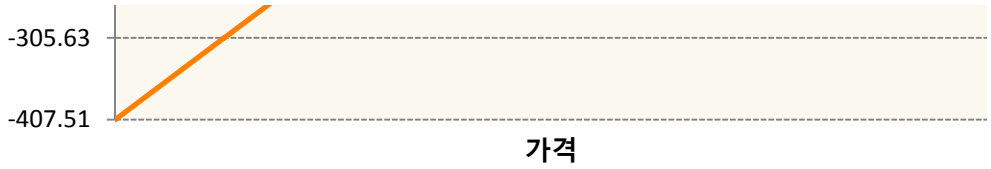


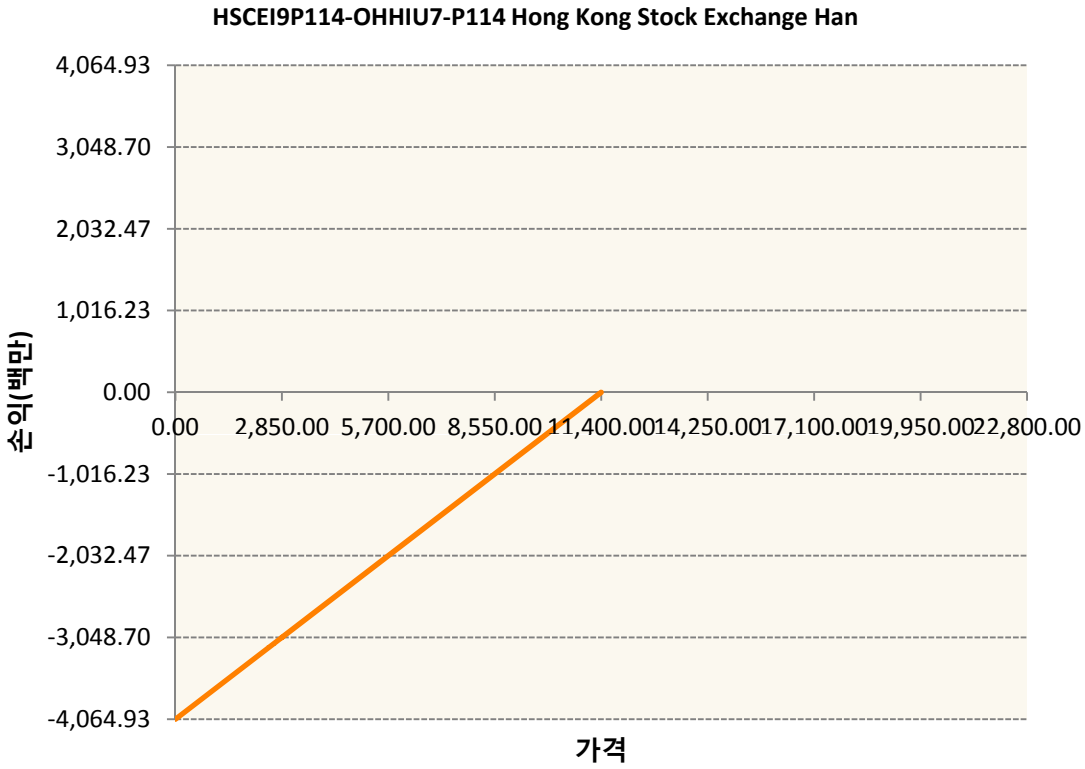
HSCEI9C114-OHHIU7-C114 Hong Kong Stock Exchange Han



HSCEI9P112-OHHIU7-P112 Hong Kong Stock Exchange Han







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

HCU7	H-SHARES IDX FUT Sep17	294
HSCEI9C112	OHHIU7-C112 Hong Kong Stock Exchange Han	33
HSCEI9C114	OHHIU7-C114 Hong Kong Stock Exchange Han	325
HSCEI9P112	OHHIU7-P112 Hong Kong Stock Exchange Han	33
HSCEI9P114	OHHIU7-P114 Hong Kong Stock Exchange Han	325

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

833

공시일	2017-09-25
기준일	2017-09-22

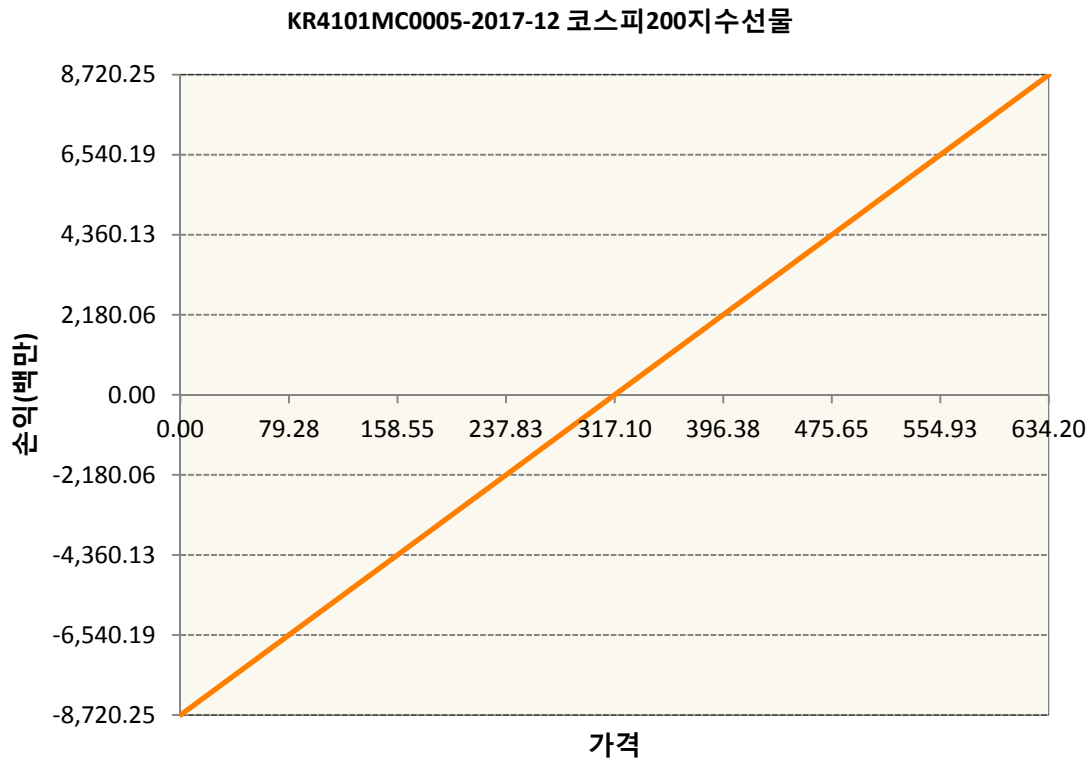
코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼

1. 계약금액

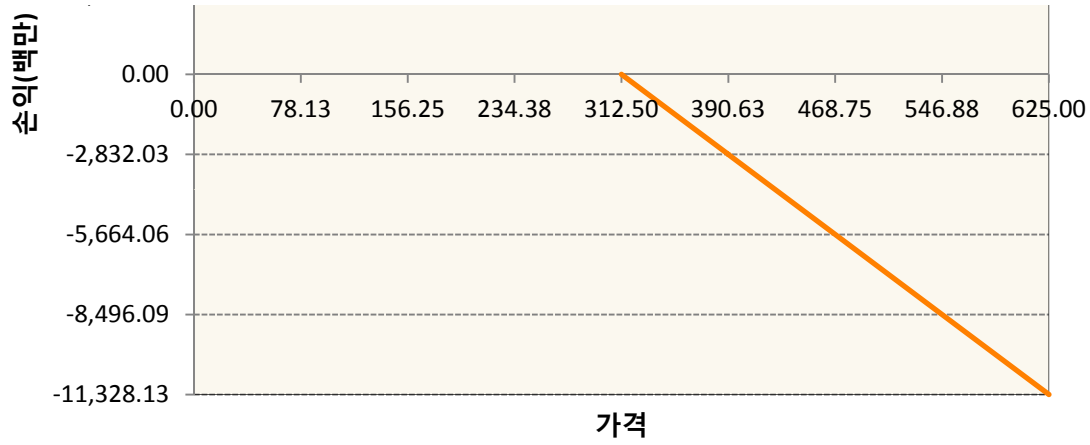
(단위:백만원)

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	8,720	0	8,720	장내
누계	유가증권	스왑	24,000	0	24,000	장외
누계	유가증권	옵션	0	22,656	-22,656	장내

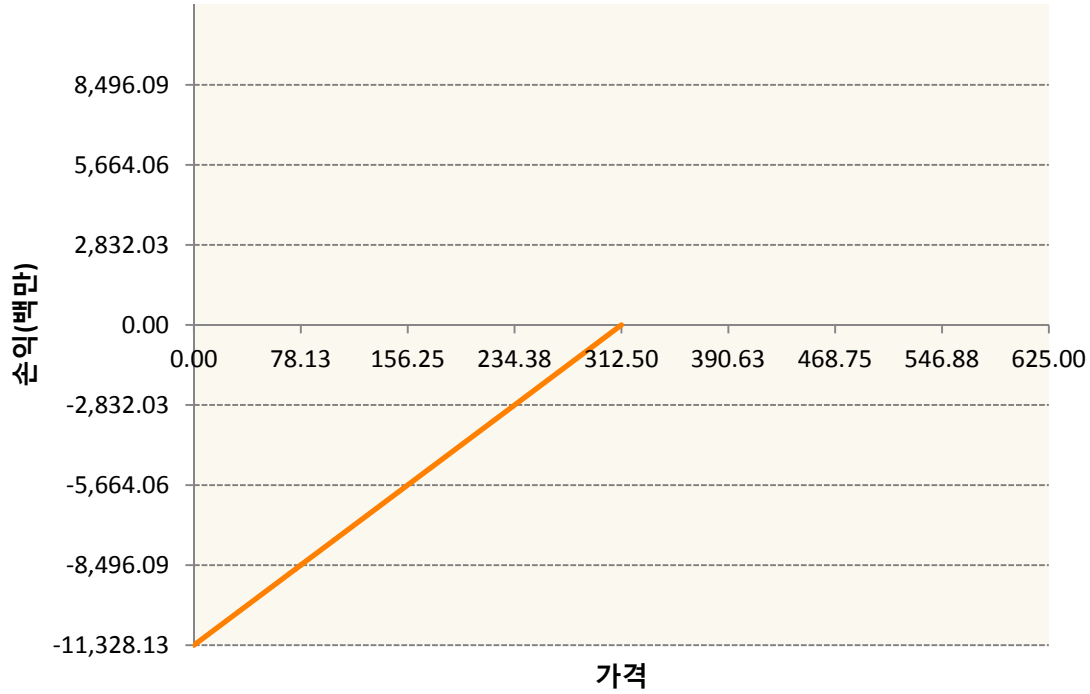
2. 만기시점의 손익구조







KR4301MA3124-2017-10 풋312.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_2							1,492
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,492	-1,492	-1,492	-1,492	-1,492	-1,492	-1,492
-5.33%	-995	-995	-995	-995	-995	-995	-995
-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%	995	995	995	995	995	995	995
8.00%	1,492	1,492	1,492	1,492	1,492	1,492	1,492

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%	-108	-108	-108	-108	-108	-108	-108
-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%	108	108	108	108	108	108	108
8.00%	161	161	161	161	161	161	161
KR4101MC0	2017-12 코스피200지수선물						697
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-697	-697	-697	-697	-697	-697	-697
-5.33%	-465	-465	-465	-465	-465	-465	-465
-2.67%	-232	-232	-232	-232	-232	-232	-232
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	232	232	232	232	232	232	232
5.33%	465	465	465	465	465	465	465
8.00%	697	697	697	697	697	697	697
KR4201MA3 2017-10 콜312.5							775
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	321	316	310	302	293	283	272
-5.33%	293	281	267	253	238	222	206
-2.67%	214	195	176	156	136	117	97
0%	59	39	20	0	-20	-40	-60
2.67%	-170	-183	-198	-213	-229	-246	-263
5.33%	-446	-452	-461	-470	-481	-492	-505
8.00%	-743	-746	-749	-754	-760	-767	-775
KR4301MA3 2017-10 풋312.5							699
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-695	-695	-695	-696	-696	-697	-699

-5.33%	-392	-394	-397	-400	-405	-409	-415
-2.67%	-123	-132	-142	-152	-161	-171	-182
0%	29	20	10	0	-10	-20	-31
2.67%	67	64	61	57	52	47	41
5.33%	71	70	70	69	68	66	64
8.00%	71	71	71	71	70	70	70

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

3,905

공시일	2017-09-25
기준일	2017-09-22

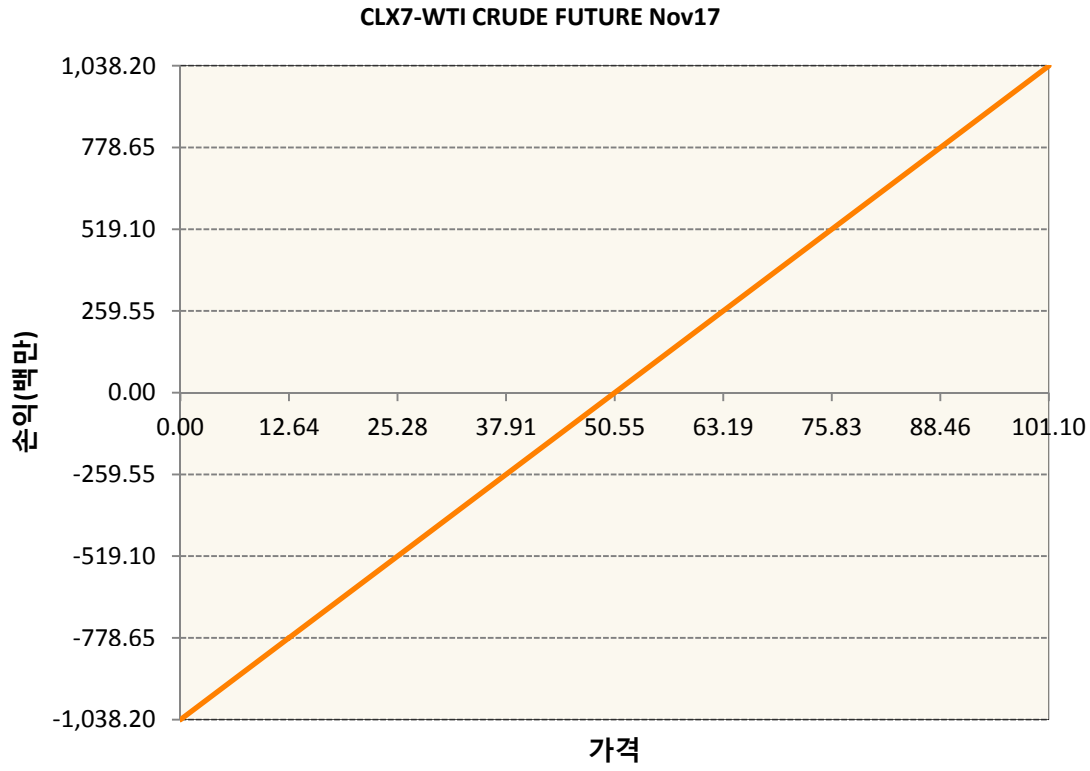
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

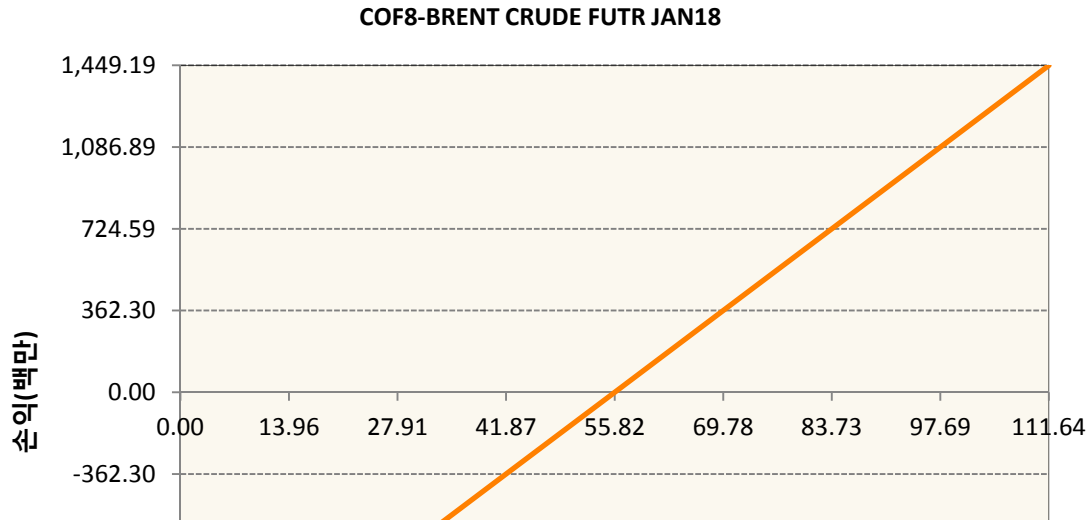
1. 계약금액

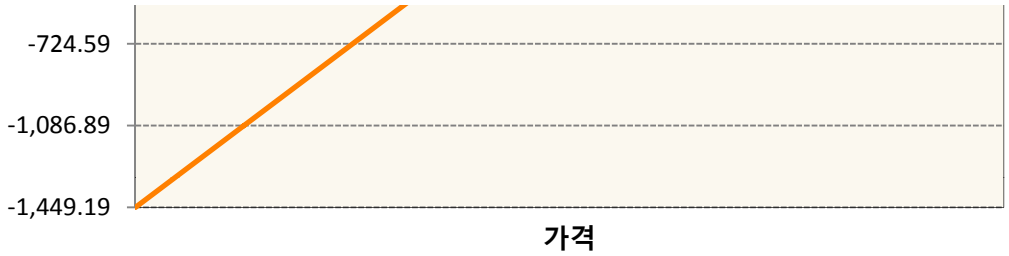
(단위:백만원)

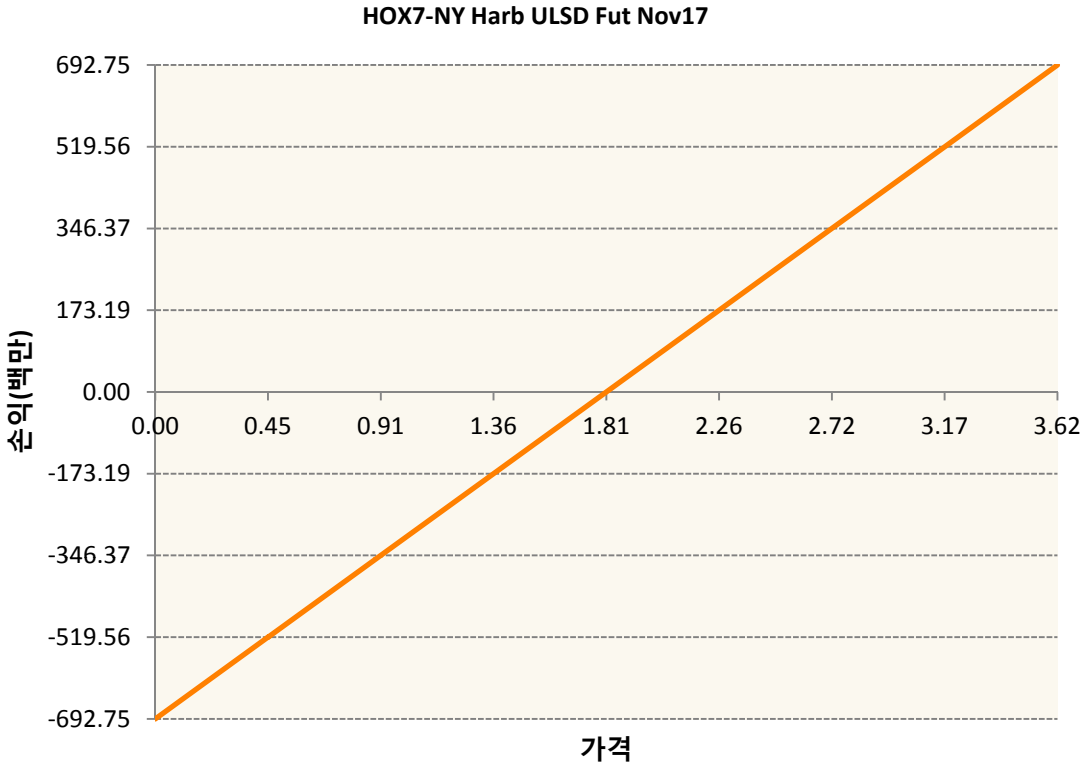
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	5,314	738	4,576	

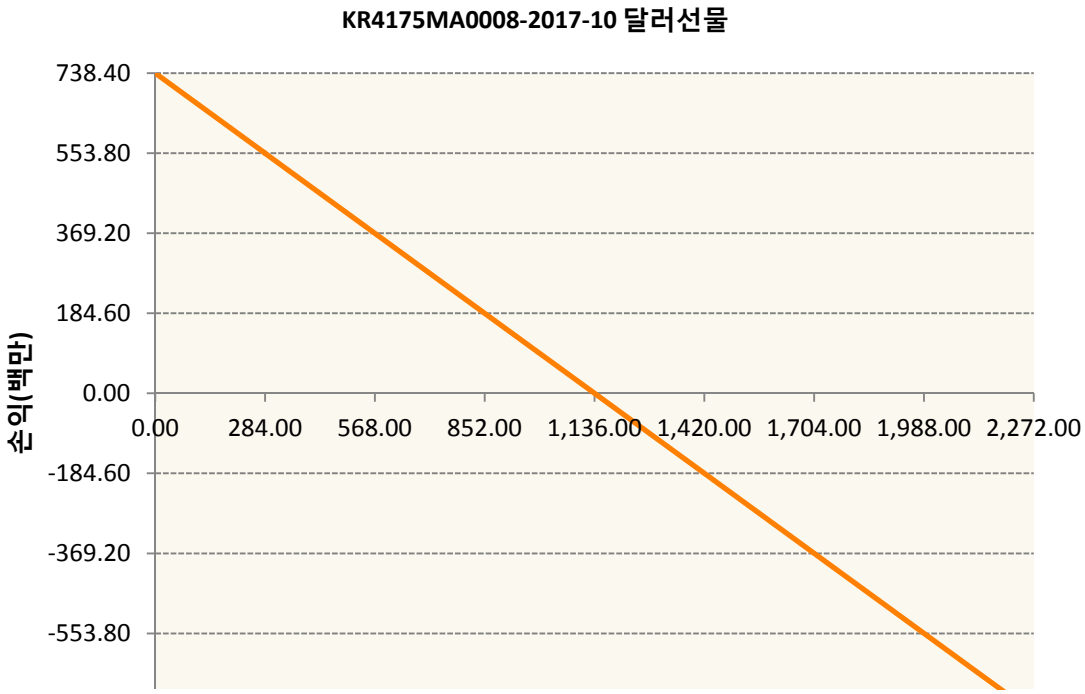
2. 만기시점의 손익구조

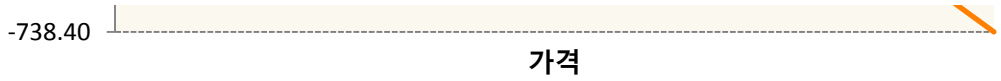


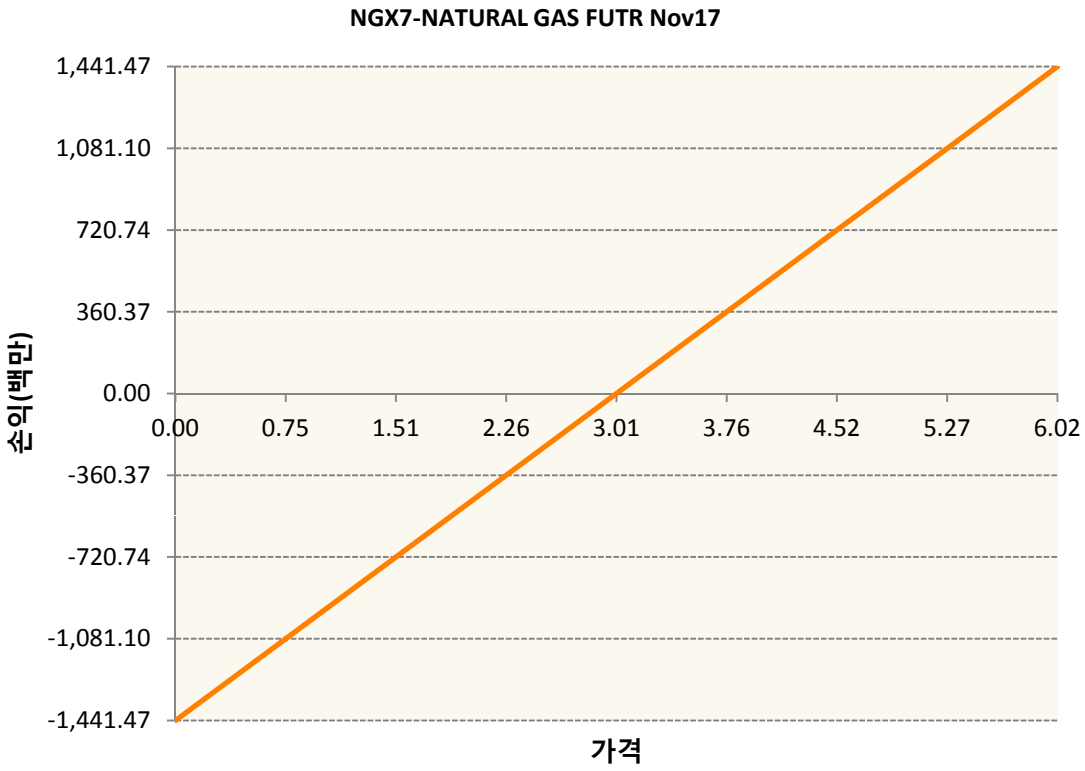


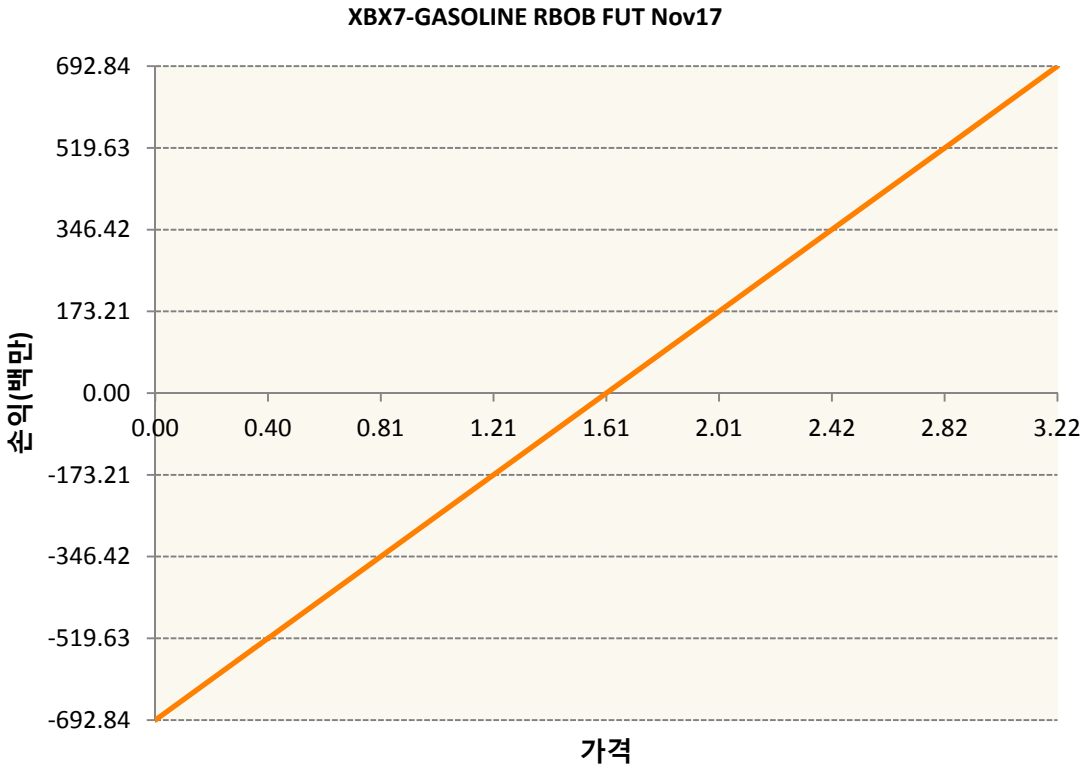

-724.59
-1,086.89
-1,449.19
가격


HOX7-NY Harb ULSD Fut Nov17
692.75
519.56
346.37
173.19
0.00
-173.19
-346.37
-519.56
-692.75
0.00
0.45
0.91
1.36
1.81
2.26
2.72
3.17
3.62
손익(만)
가격


KR4175MA0008-2017-10 달러선물
738.40
553.80
369.20
184.60
0.00
-184.60
-369.20
-553.80
0.00
284.00
568.00
852.00
1,136.00
1,420.00
1,704.00
1,988.00
2,272.00
손익(만)


-738.40
가격


NGX7-NATURAL GAS FUTR Nov17
1,441.47
1,081.10
720.74
360.37
0.00
-360.37
-720.74
-1,081.10
-1,441.47
0.00
0.75
1.51
2.26
3.01
3.76
4.52
5.27
6.02
손익(백만)
가격


XBX7-GASOLINE RBOB FUT Nov17
692.84
519.63
346.42
173.21
0.00
-173.21
-346.42
-519.63
-692.84
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	83
COF8	BRENT CRUDE FUTR JAN18	116
HOX7	NY Harb ULSD Fut Nov17	55
KR4175MA0	2017-10 달러선물	59
NGX7	NATURAL GAS FUTR Nov17	115
XBX7	GASOLINE RBOB FUT Nov17	55

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

766

공시일	2017-09-25
기준일	2017-09-22

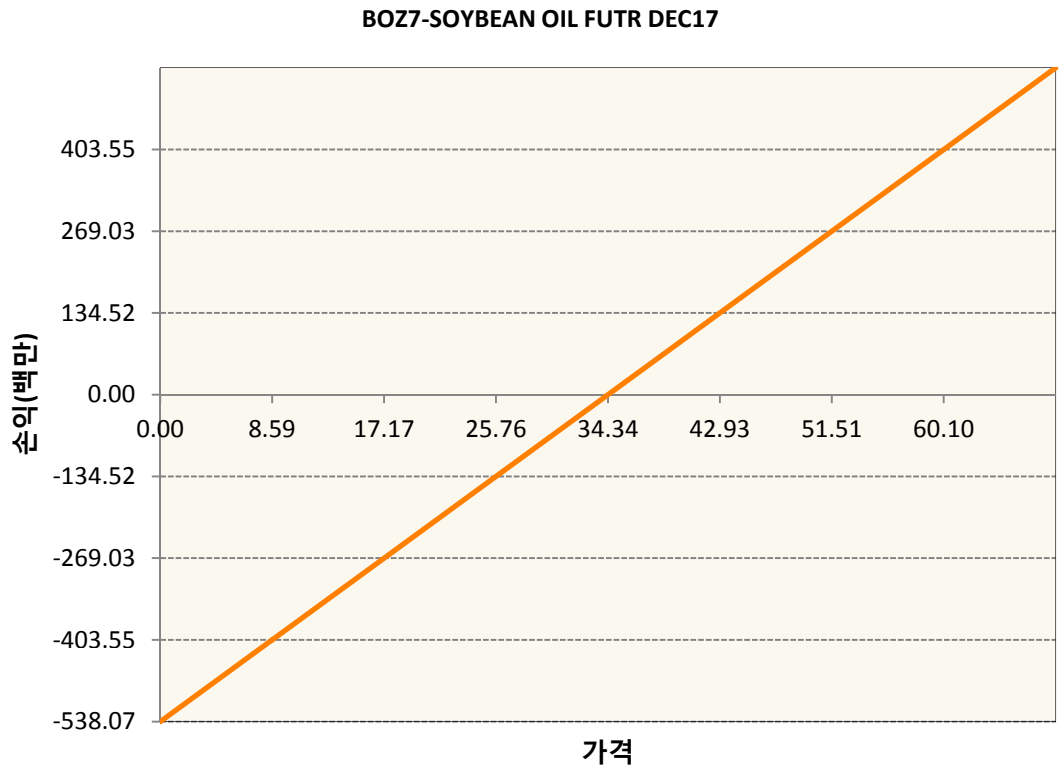
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

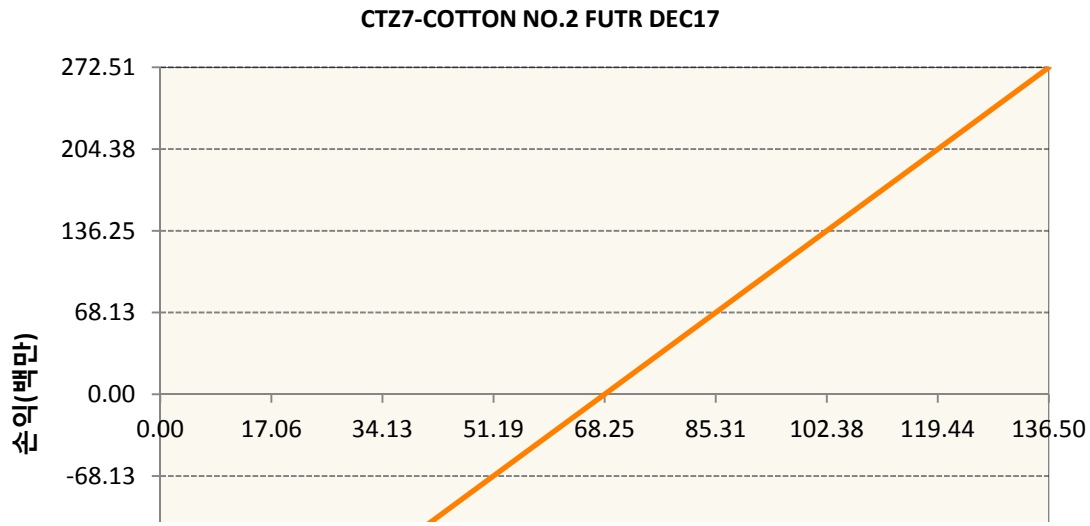
1. 계약금액

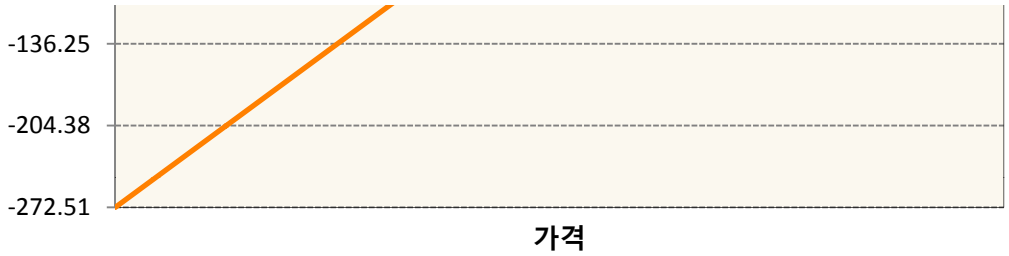
(단위:백만원)

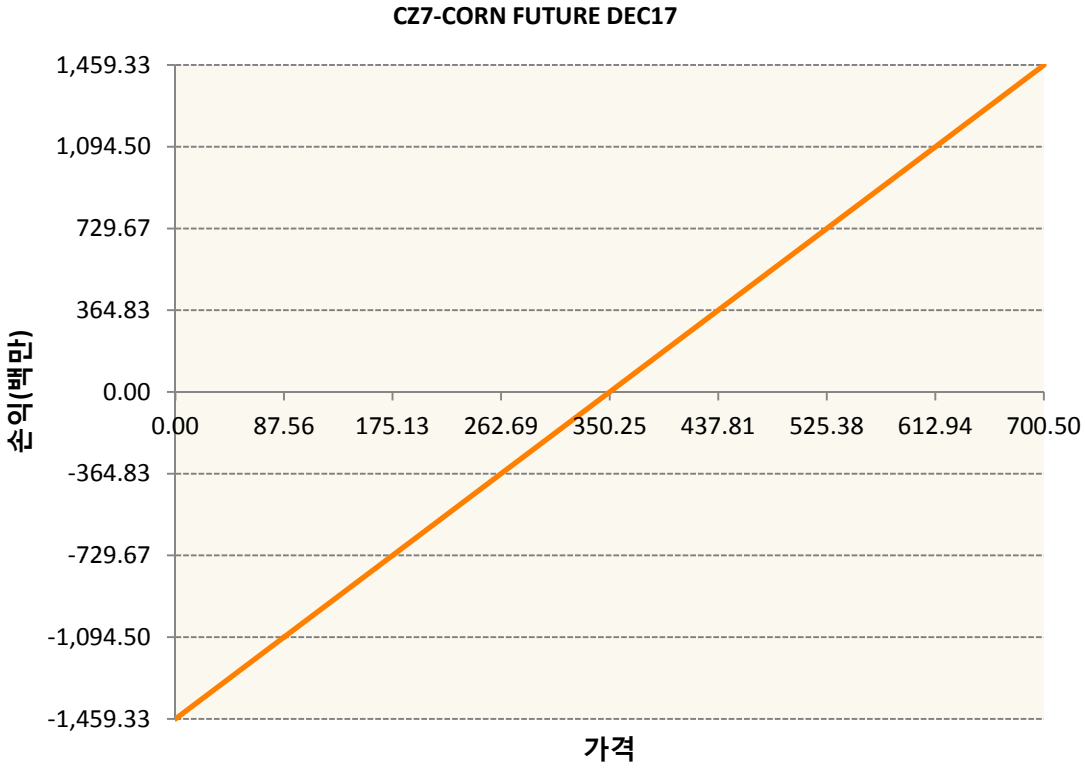
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	5,825	341	5,484	

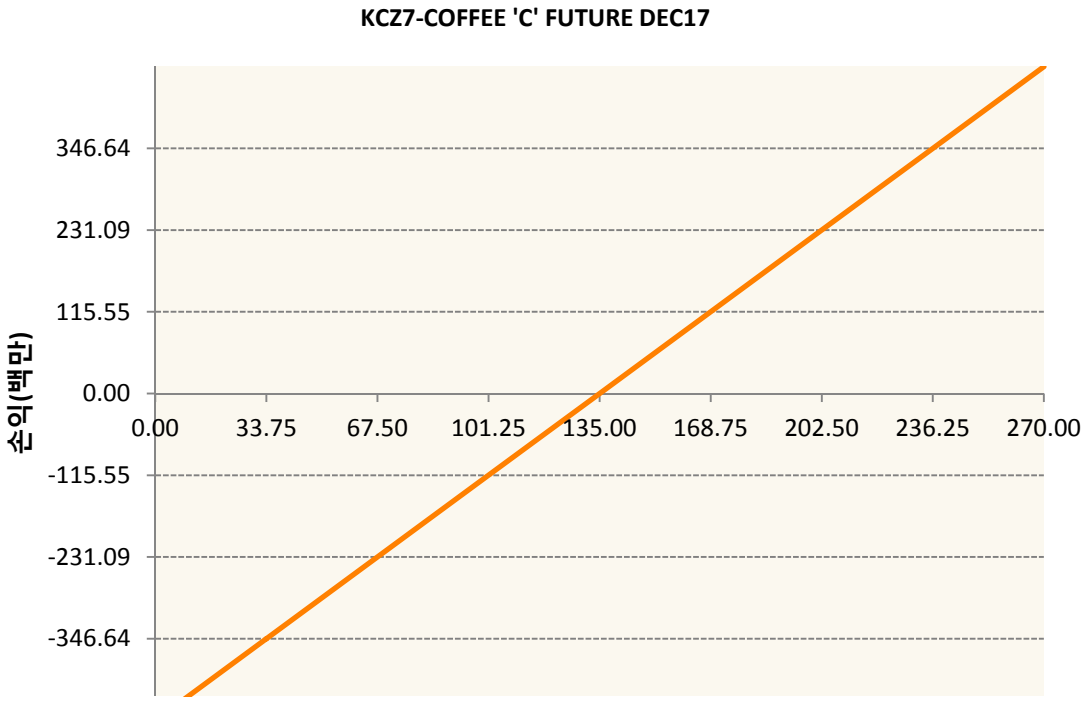
2. 만기시점의 손익구조

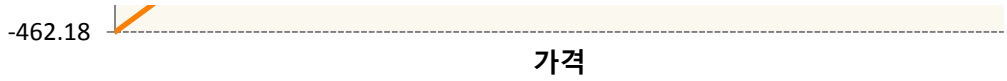


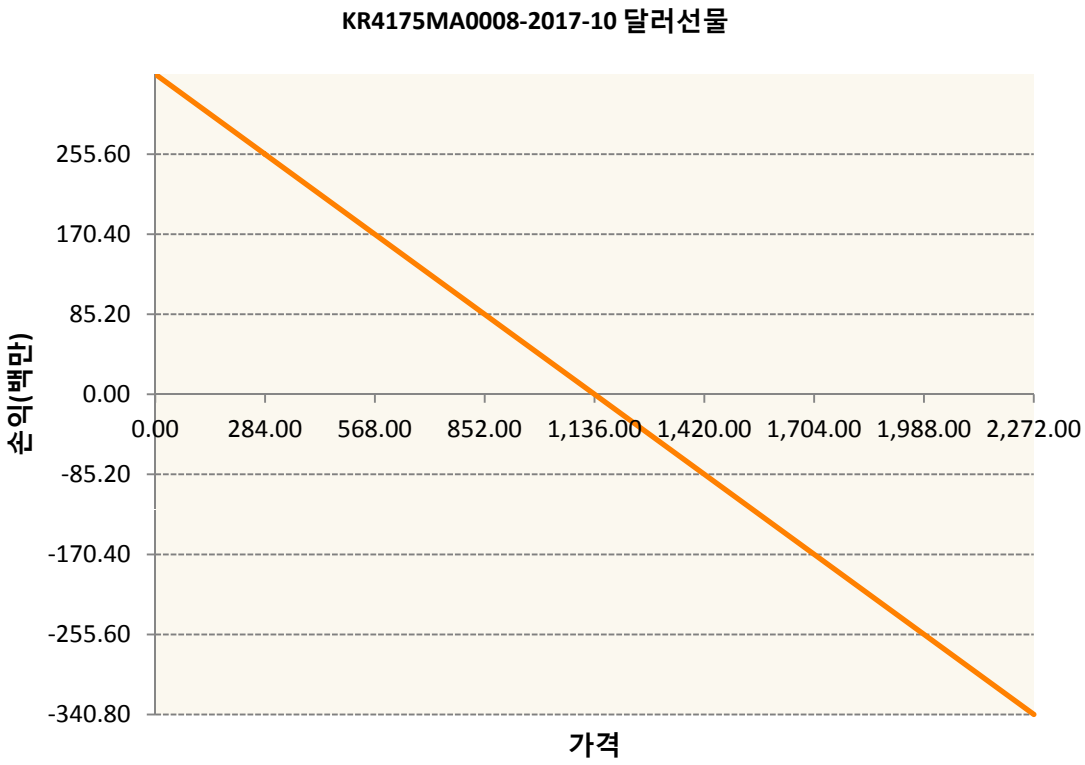


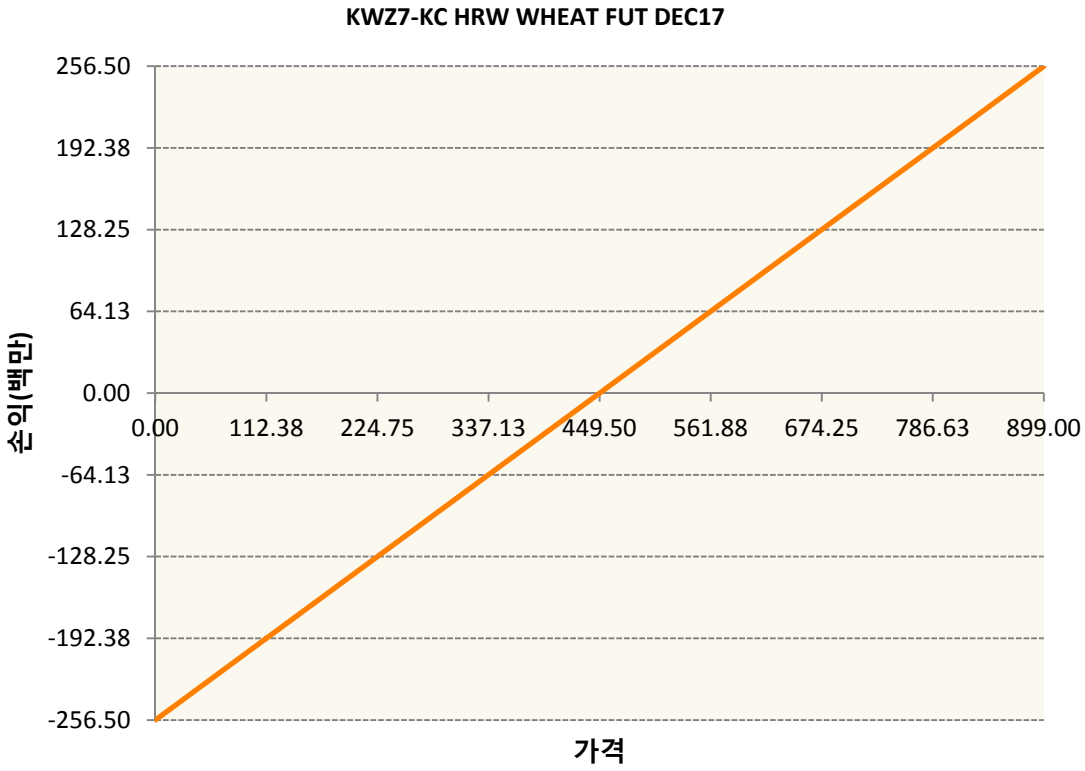

-136.25
-204.38
-272.51
가격

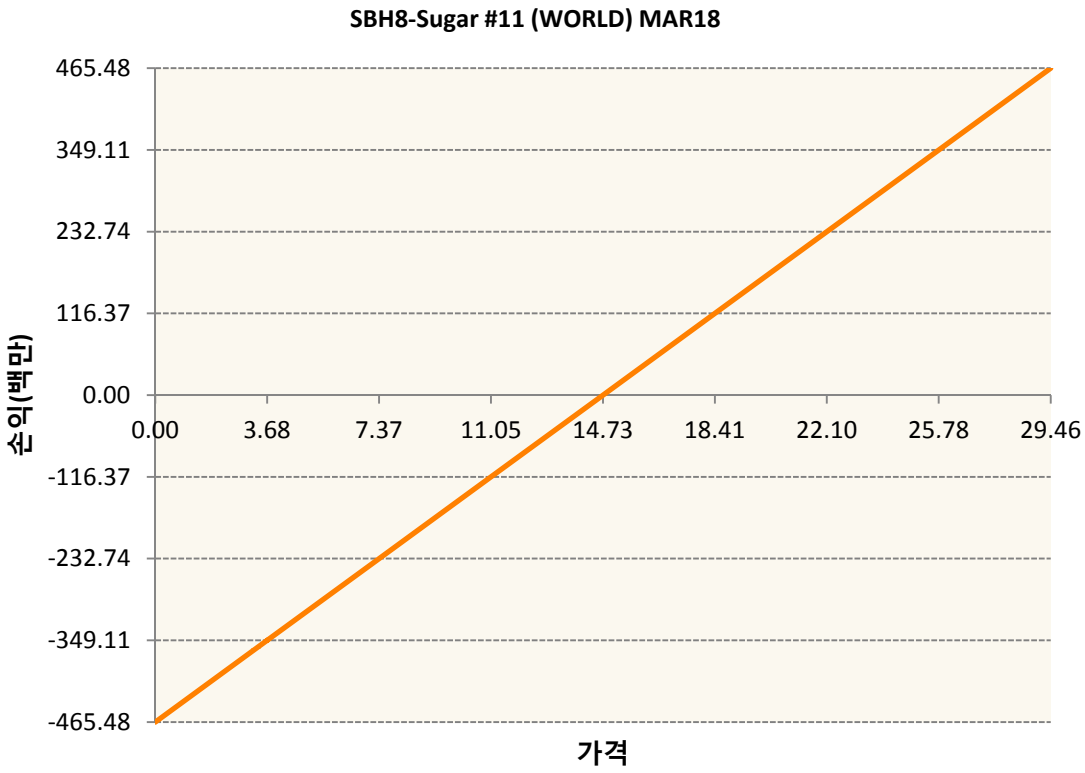

CZ7-CORN FUTURE DEC17
1,459.33
1,094.50
729.67
364.83
0.00
-364.83
-729.67
-1,094.50
-1,459.33
0.00
87.56
175.13
262.69
350.25
437.81
525.38
612.94
700.50
손익(백만)
가격

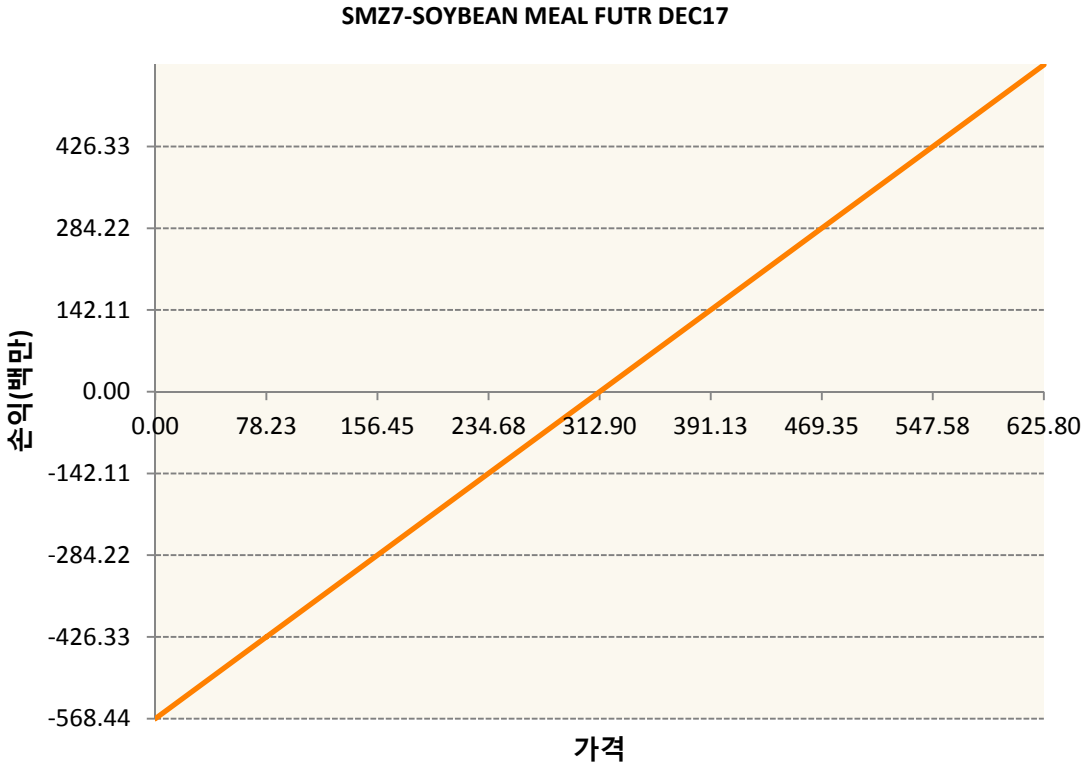

KCZ7-COFFEE 'C' FUTURE DEC17
346.64
231.09
115.55
0.00
-115.55
-231.09
-346.64
0.00
33.75
67.50
101.25
135.00
168.75
202.50
236.25
270.00
손익(백만)

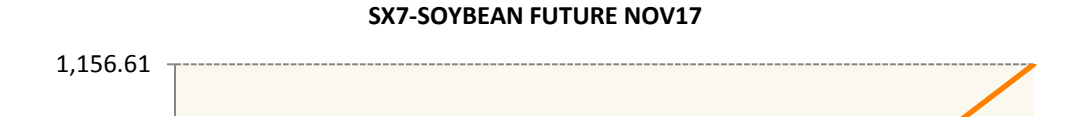

-462.18
가격

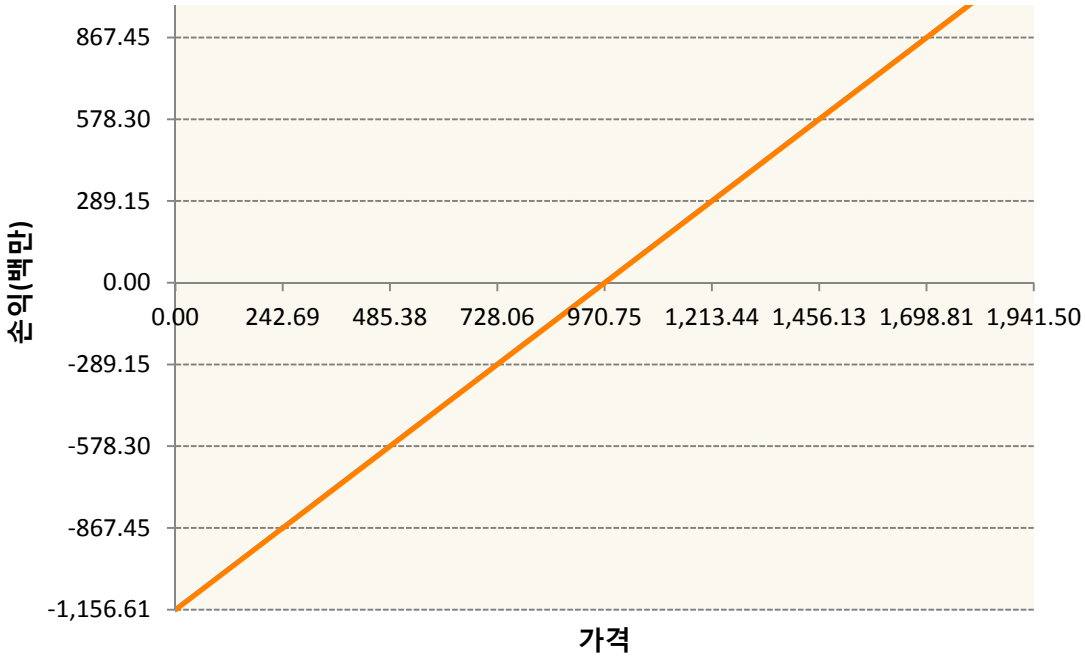

KR4175MA0008-2017-10 달러선물
255.60
170.40
85.20
0.00
-85.20
-170.40
-255.60
-340.80
0.00
284.00
568.00
852.00
1,136.00
1,420.00
1,704.00
1,988.00
2,272.00
손익(백만)
가격

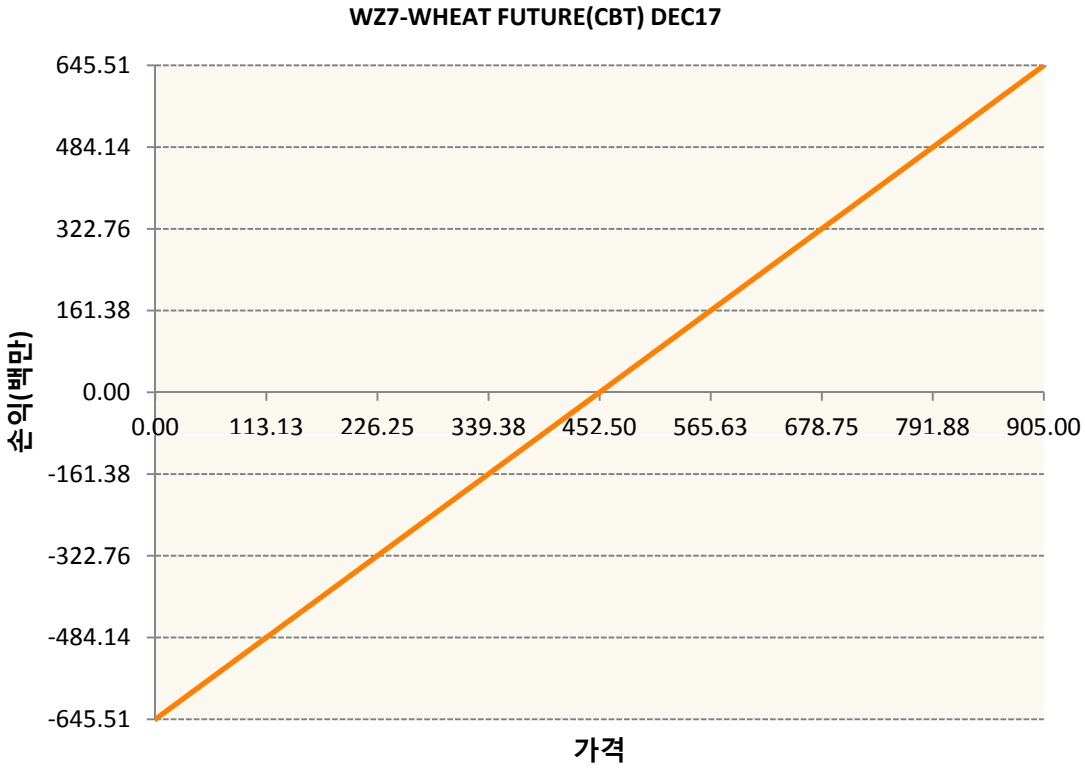

KWZ7-KC HRW WHEAT FUT DEC17
256.50
192.38
128.25
64.13
0.00
-64.13
-128.25
-192.38
-256.50
0.00
112.38
224.75
337.13
449.50
561.88
674.25
786.63
899.00
손익(백만)
가격


SBH8-Sugar #11 (WORLD) MAR18
465.48
349.11
232.74
116.37
0.00
-116.37
-232.74
-349.11
-465.48
0.00
3.68
7.37
11.05
14.73
18.41
22.10
25.78
29.46
손익(백만)
가격


SMZ7-SOYBEAN MEAL FUTR DEC17
426.33
284.22
142.11
0.00
-142.11
-284.22
-426.33
-568.44
0.00
78.23
156.45
234.68
312.90
391.13
469.35
547.58
625.80
손익(백만)
가격


SX7-SOYBEAN FUTURE NOV17
1,156.61





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	37
KR4175MA0	2017-10 달러선물	27

KWZ7	KC HRW WHEAT FUT DEC17	21
SBH8	Sugar #11 (WORLD) MAR18	37
SMZ7	SOYBEAN MEAL FUTR DEC17	45
SX7	SOYBEAN FUTURE NOV17	93
WZ7	WHEAT FUTURE(CBT) DEC17	52

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

546