공시일	2017-09-26
기준일	2017-09-25

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	2017-09-26
기준일	2017-09-25

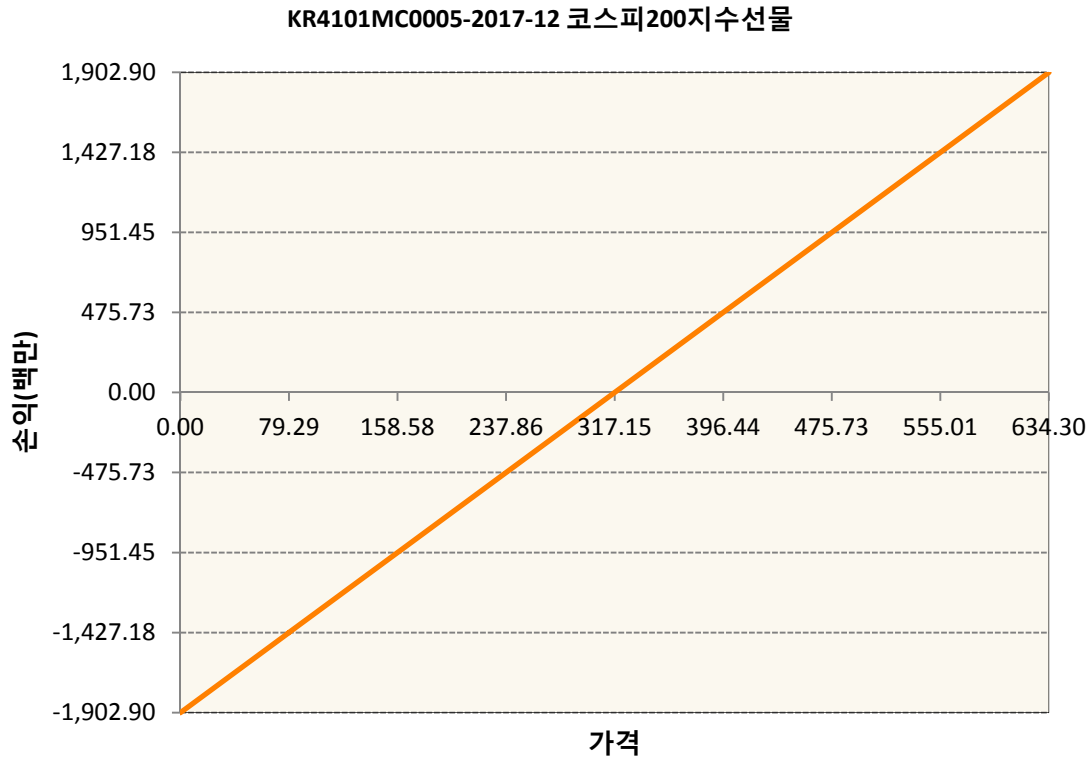
스마트인덱스모

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	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	2017-09-26
기준일	2017-09-25

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	1,041

* 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	2017-09-26
기준일	2017-09-25

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	413

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

350

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-09-26
기준일	2017-09-25

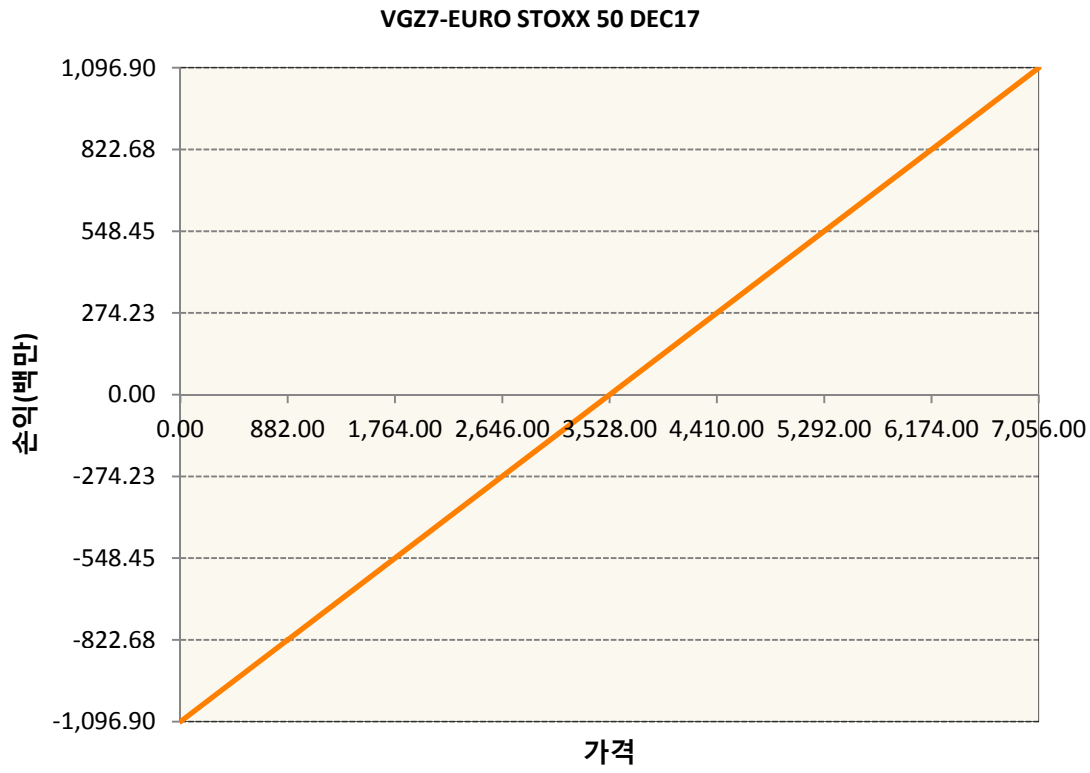
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,097	0	1,097	

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	2017-09-26
기준일	2017-09-25

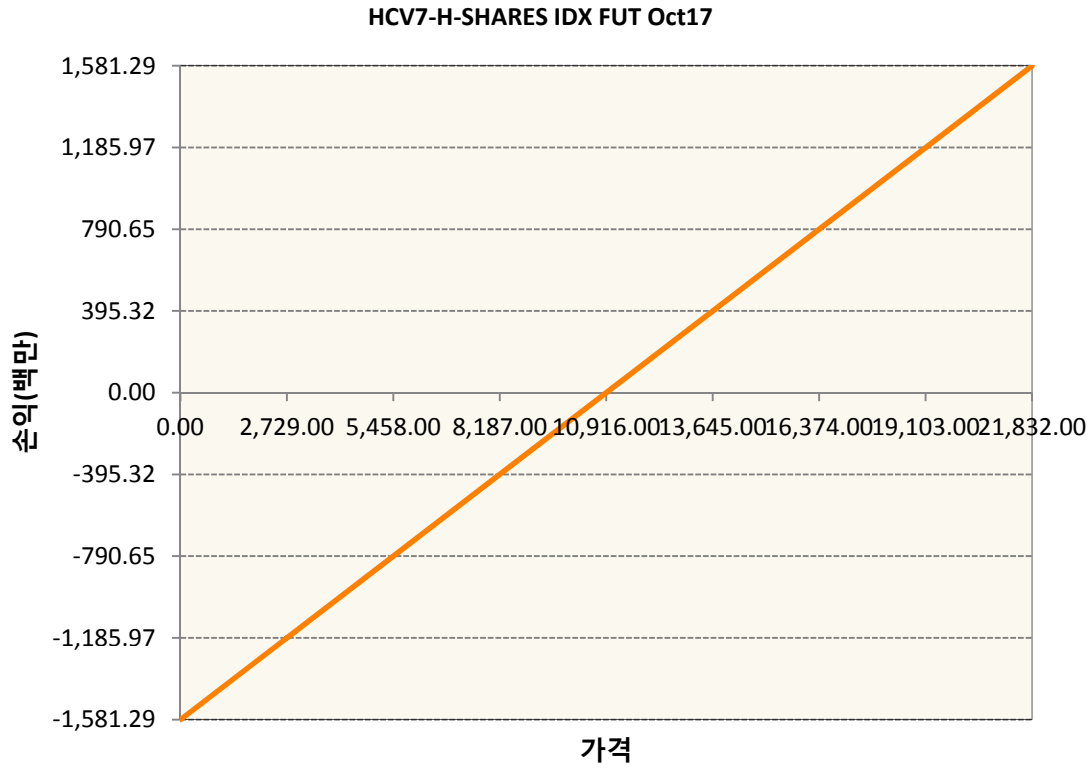
차이나인덱스모(주식-파생형)

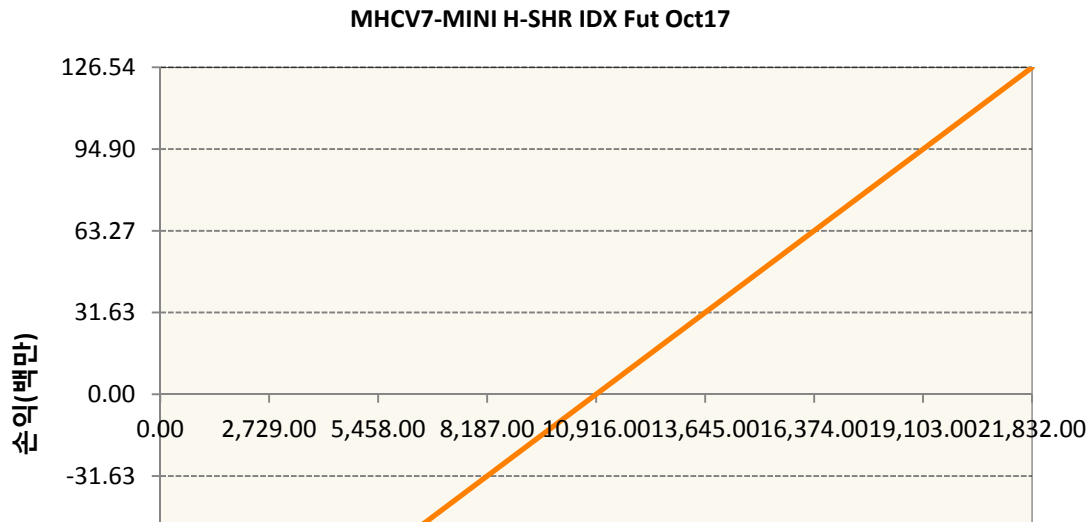
1. 계약금액

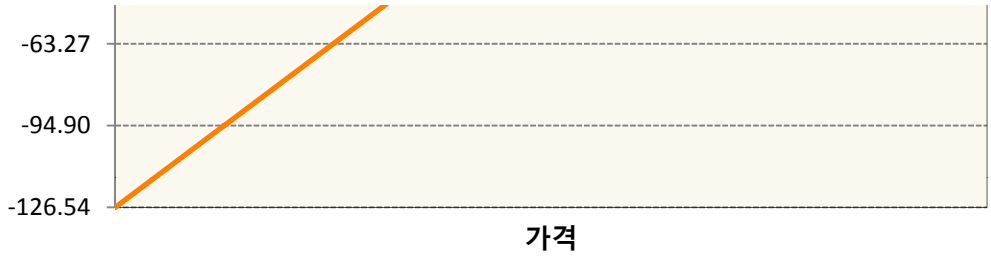
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,708	0	1,708	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCV7	H-SHARES IDX FUT Oct17	126
MHCV7	MINI H-SHR IDX Fut Oct17	10

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	113

공시일	2017-09-26
기준일	2017-09-25

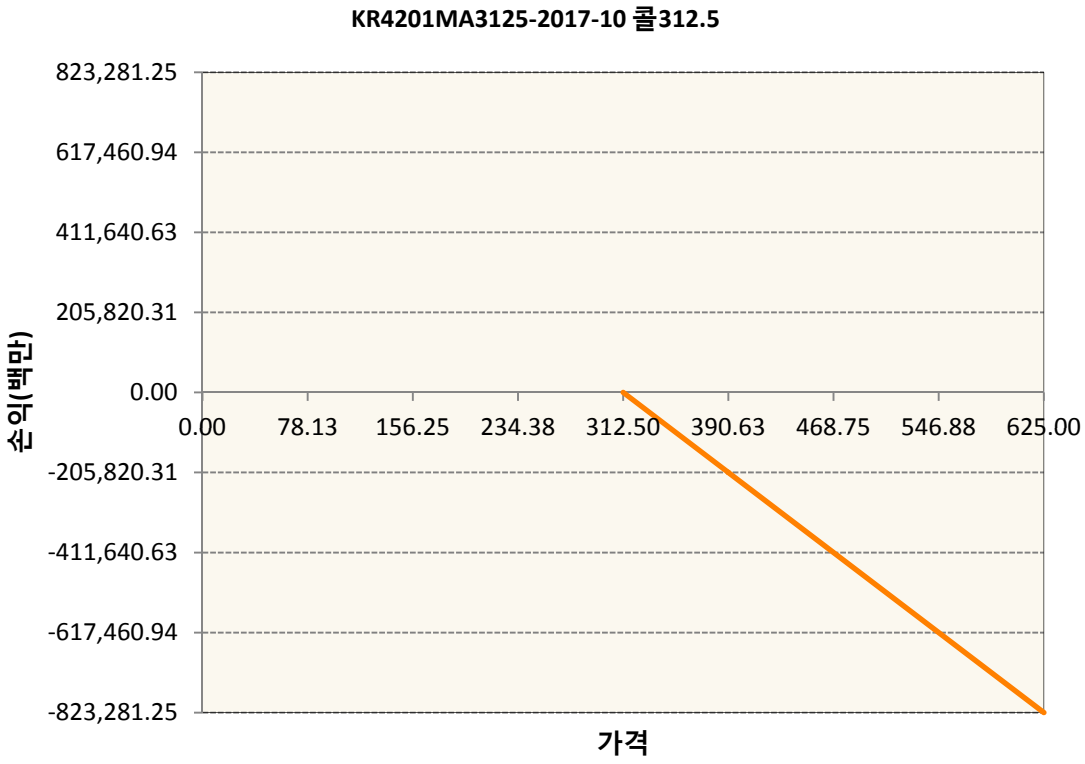
커버드콜모(주식혼합-파생형)

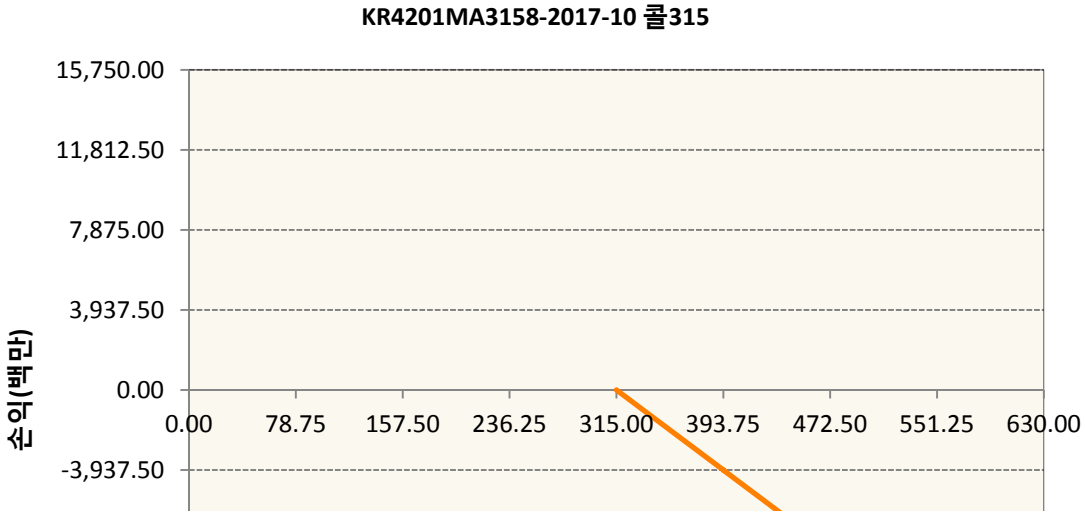
1. 계약금액

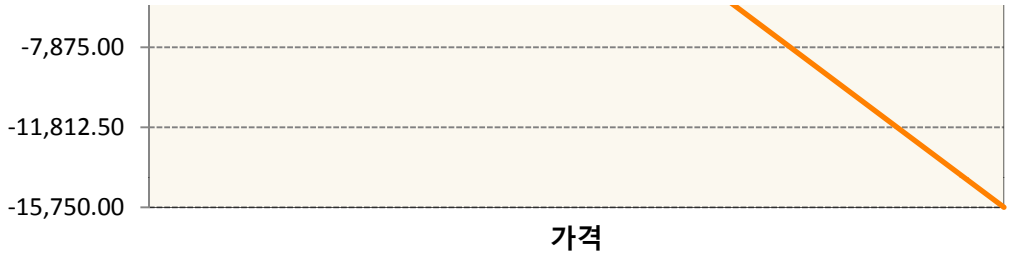
(단위:백만원)

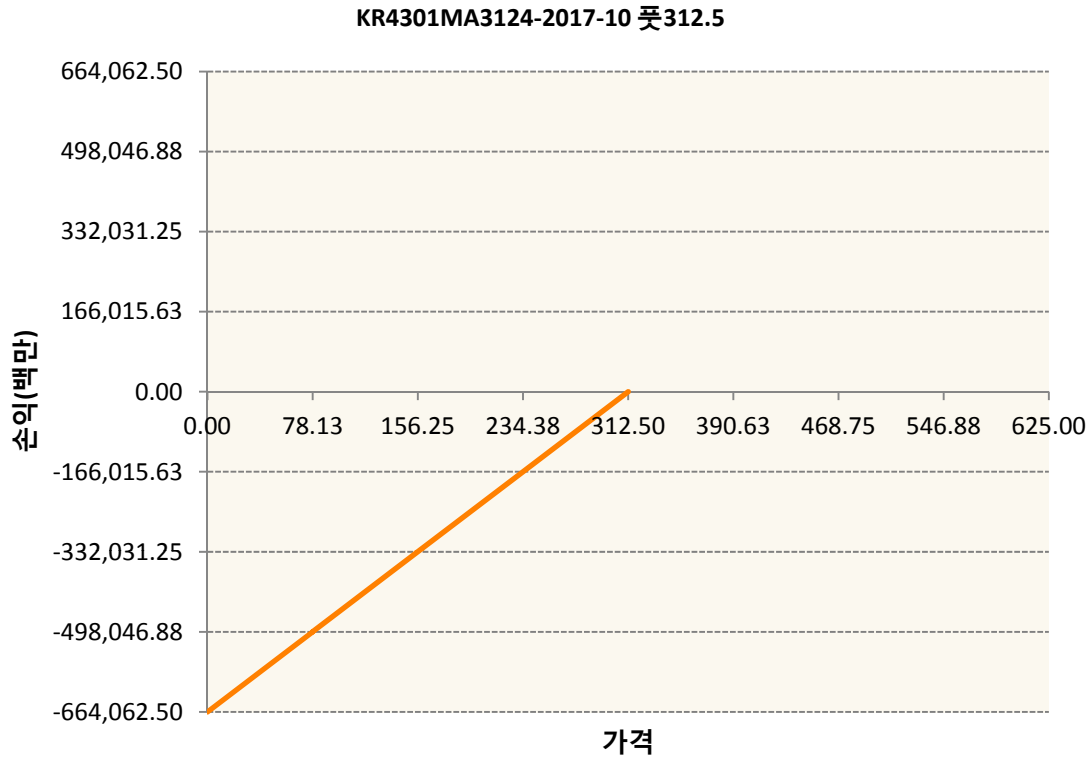
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	1,503,094	-1,503,094	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201MA3 2017-10 콜312.5							56,525
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	21,939	21,664	21,299	20,846	20,312	19,703	19,028
-5.33%	20,286	19,518	18,667	17,749	16,774	15,753	14,693
-2.67%	15,029	13,748	12,452	11,144	9,827	8,502	7,172
0%	4,000	2,677	1,343	0	-1,350	-2,705	-4,064
2.67%	-12,713	-13,592	-14,549	-15,569	-16,641	-17,755	-18,904
5.33%	-32,983	-33,372	-33,864	-34,451	-35,124	-35,872	-36,688
8.00%	-54,709	-54,828	-55,014	-55,275	-55,615	-56,033	-56,525
KR4201MA3 2017-10 콜315							1,029
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	350	346	341	334	326	317	306

-5.33%	329	317	304	289	273	255	237
-2.67%	254	232	209	185	162	137	113
0%	79	53	26	0	-26	-53	-79
2.67%	-209	-229	-250	-272	-294	-317	-341
5.33%	-578	-588	-600	-614	-629	-645	-663
8.00%	-984	-988	-993	-1,000	-1,008	-1,018	-1,029
KR4301MA3 2017-10 풋312.5							41,858

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-41,728	-41,730	-41,736	-41,748	-41,771	-41,806	-41,858
-5.33%	-23,892	-23,970	-24,082	-24,230	-24,412	-24,627	-24,872
-2.67%	-7,694	-8,156	-8,638	-9,137	-9,648	-10,169	-10,698
0%	1,546	1,046	529	0	-538	-1,085	-1,637
2.67%	3,606	3,492	3,338	3,145	2,916	2,652	2,358
5.33%	3,743	3,737	3,723	3,696	3,653	3,591	3,507
8.00%	3,746	3,746	3,745	3,744	3,740	3,732	3,718

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

106,203

공시일	2017-09-26
기준일	2017-09-25

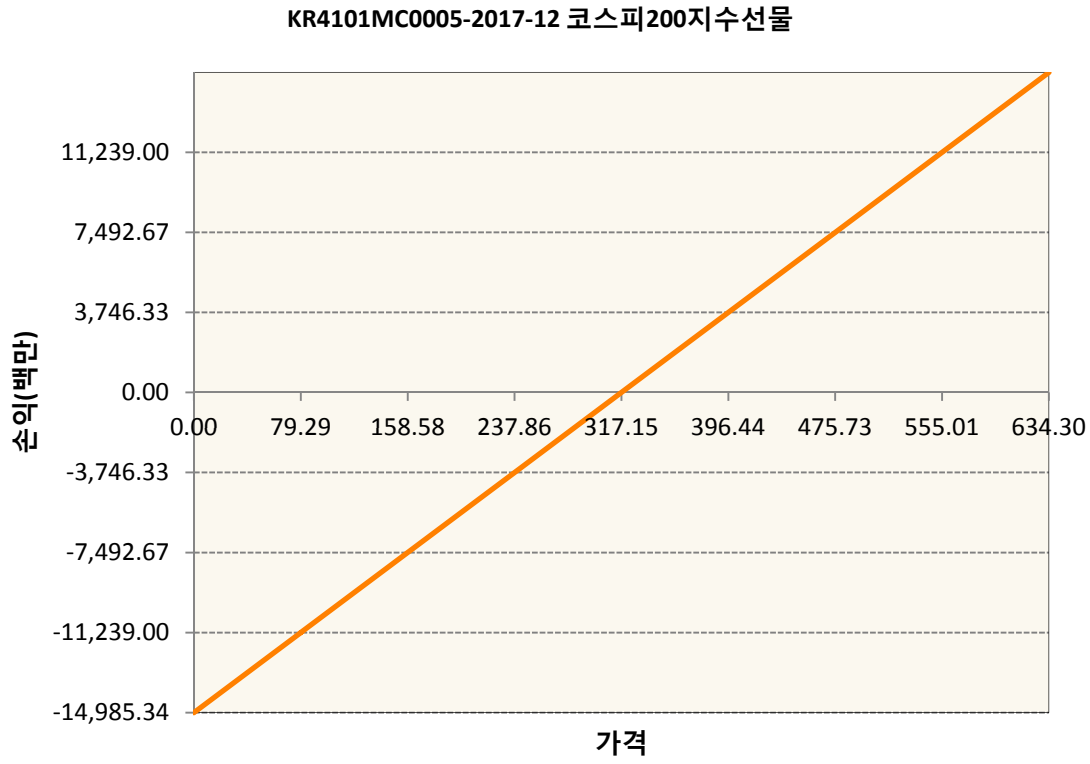
ETF스마트레버리지목표전환형6호

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	14,985	0	14,985	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101MC0	2017-12 코스피200지수선물						1,196
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,196	-1,196	-1,196	-1,196	-1,196	-1,196	-1,196
-5.33%	-797	-797	-797	-797	-797	-797	-797
-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%	797	797	797	797	797	797	797
8.00%	1,196	1,196	1,196	1,196	1,196	1,196	1,196

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

725

공시일	2017-09-26
기준일	2017-09-25

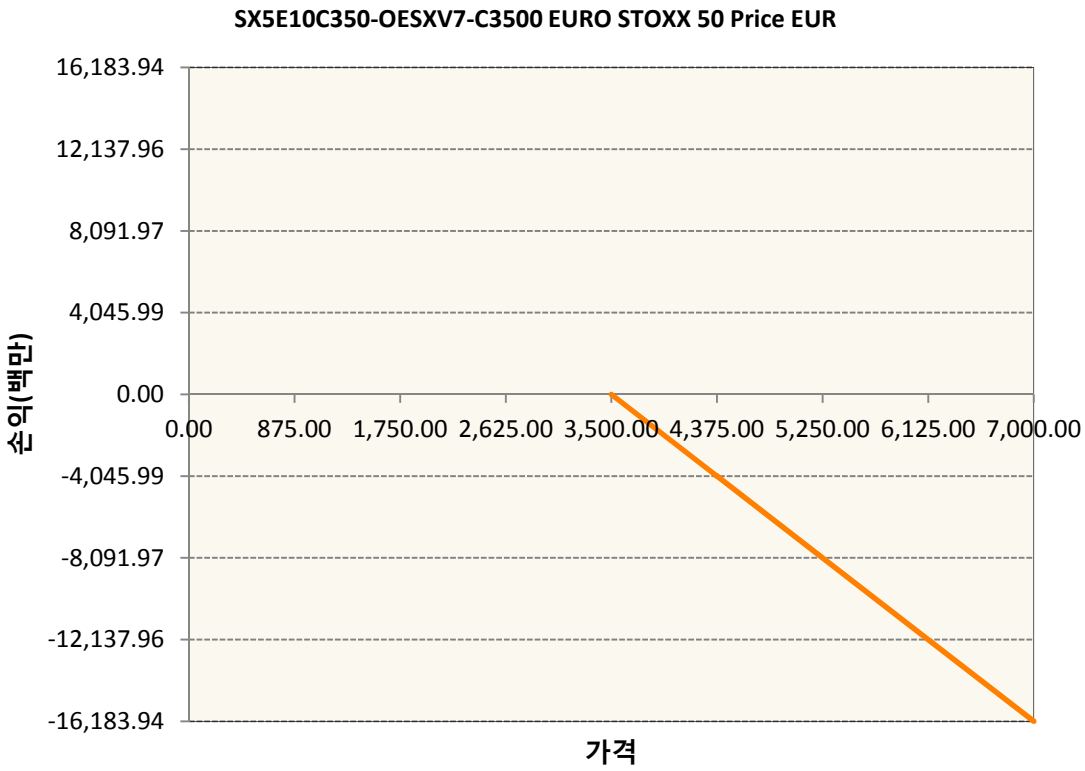
유로커버드콜(주식혼합-파생형)

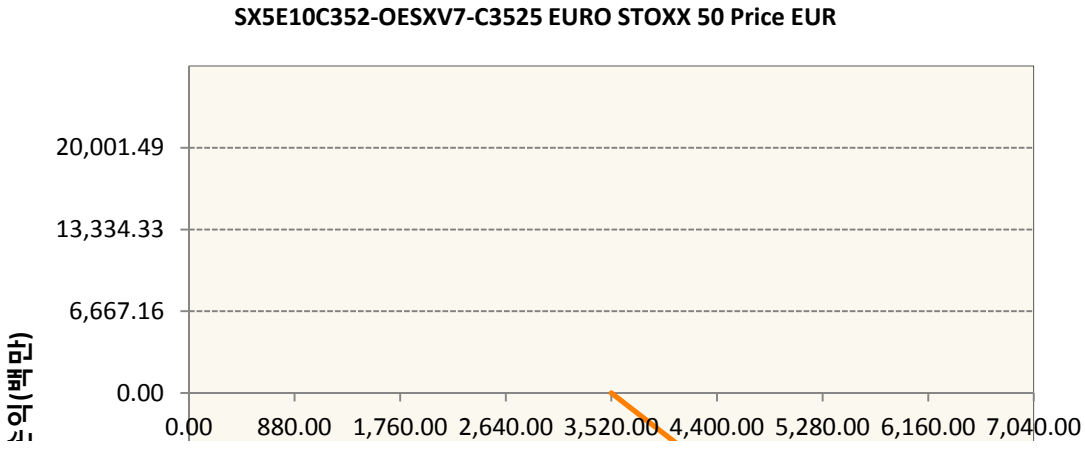
1. 계약금액

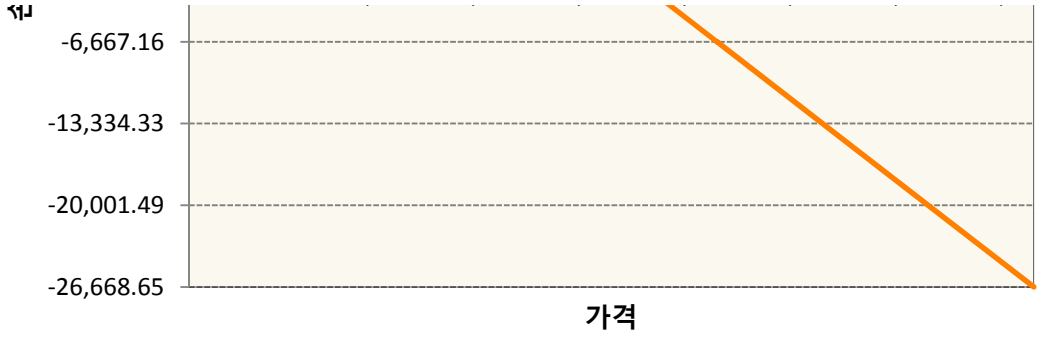
(단위:백만원)

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	38,910	0	38,910	
누계	유가증권	옵션	0	85,705	-85,705	장내

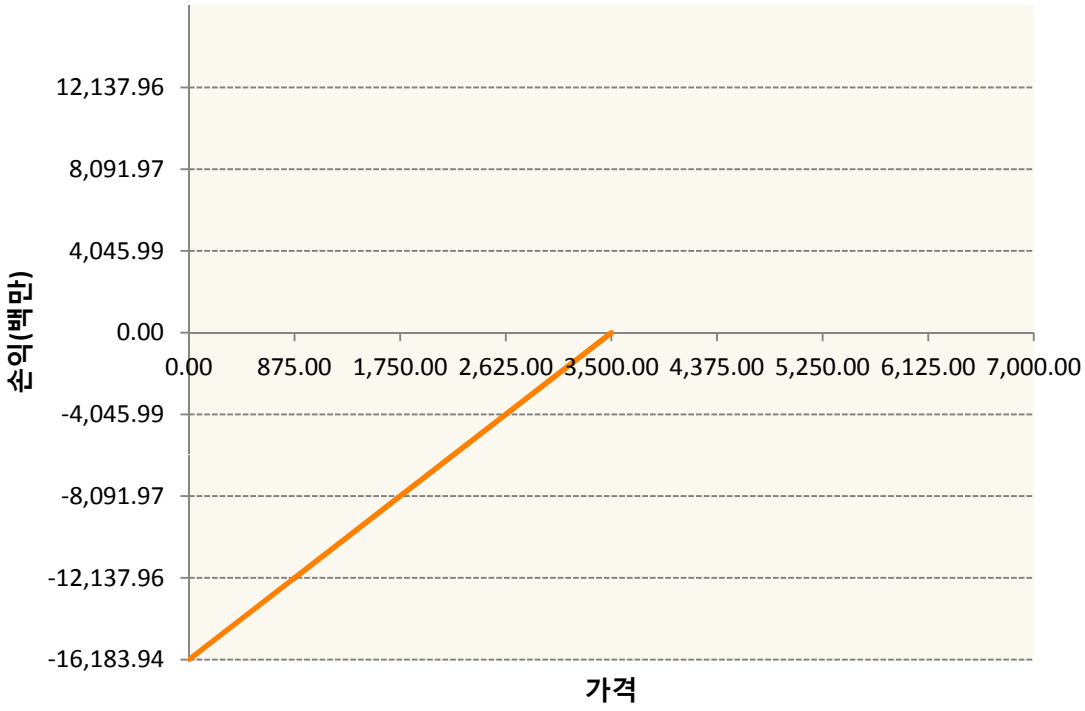
2. 만기시점의 손익구조



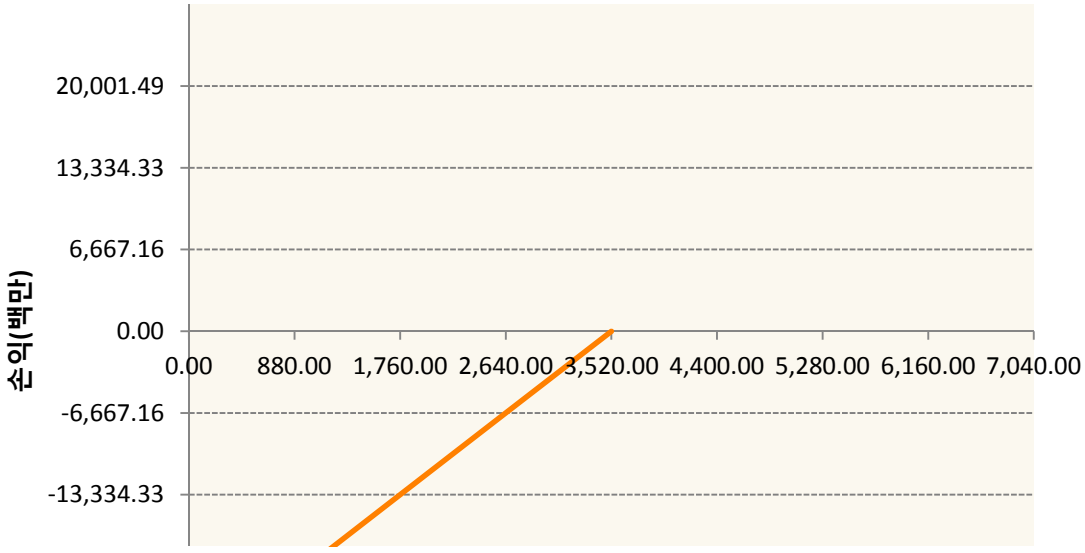


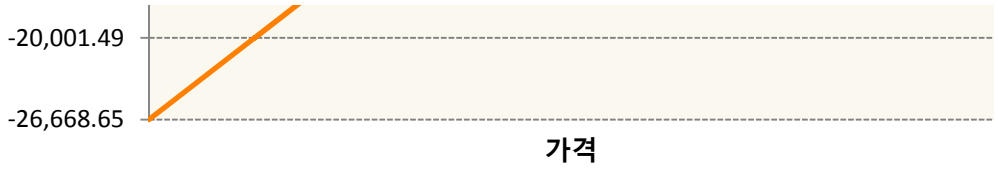


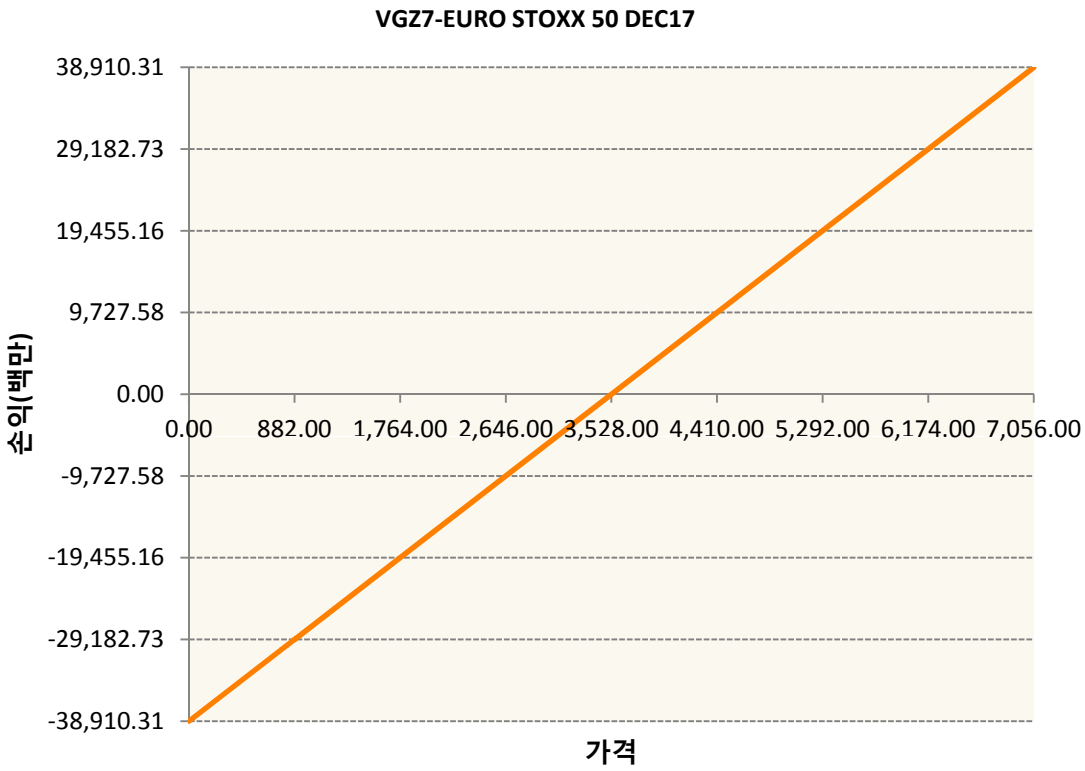
SX5E10P350-OESXV7-P3500 EURO STOXX 50 Price EUR



SX5E10P352-OESXV7-P3525 EURO STOXX 50 Price EUR







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
SX5E10C350	OESXV7-C3500 EURO STOXX 50 Price EUR	1,295
SX5E10C352	OESXV7-C3525 EURO STOXX 50 Price EUR	2,133
SX5E10P350	OESXV7-P3500 EURO STOXX 50 Price EUR	1,295
SX5E10P352	OESXV7-P3525 EURO STOXX 50 Price EUR	2,133
VGZ7	EURO STOXX 50 DEC17	3,113

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	7,743

공시일	2017-09-26
기준일	2017-09-25

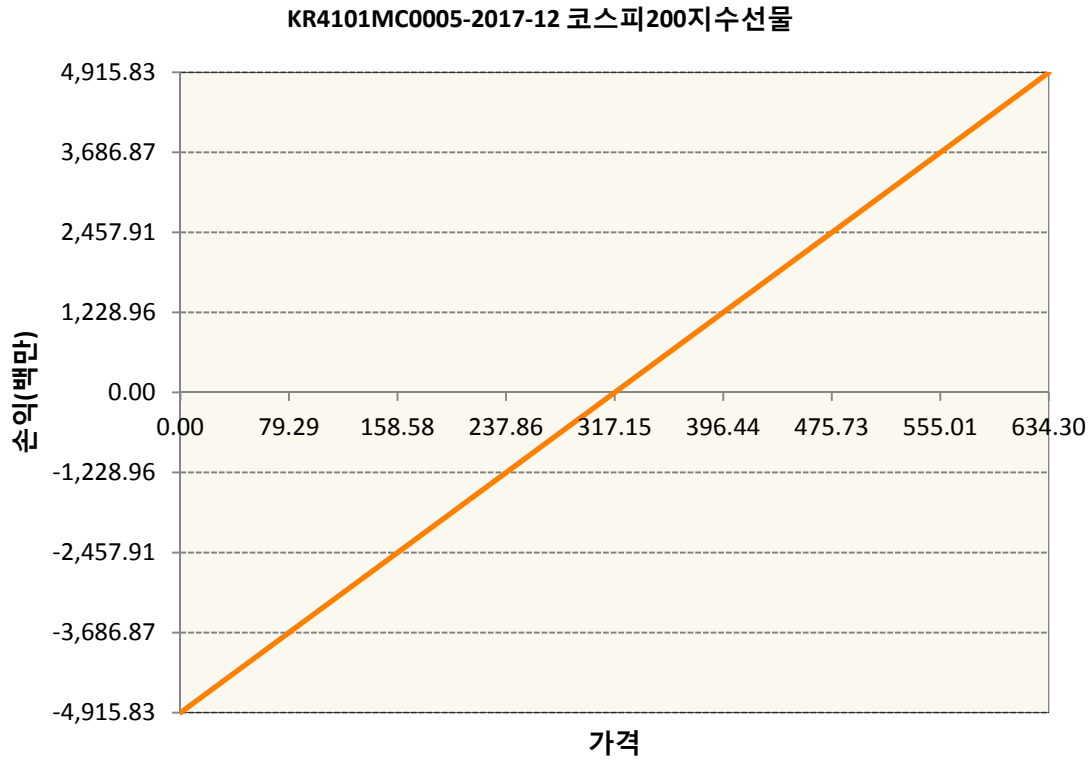
ETF스마트레버리지목표전환형7호

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	4,916	0	4,916	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101MC0	2017-12 코스피200지수선물						392
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-392	-392	-392	-392	-392	-392	-392
-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%	392	392	392	392	392	392	392

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

238

공시일	2017-09-26
기준일	2017-09-25

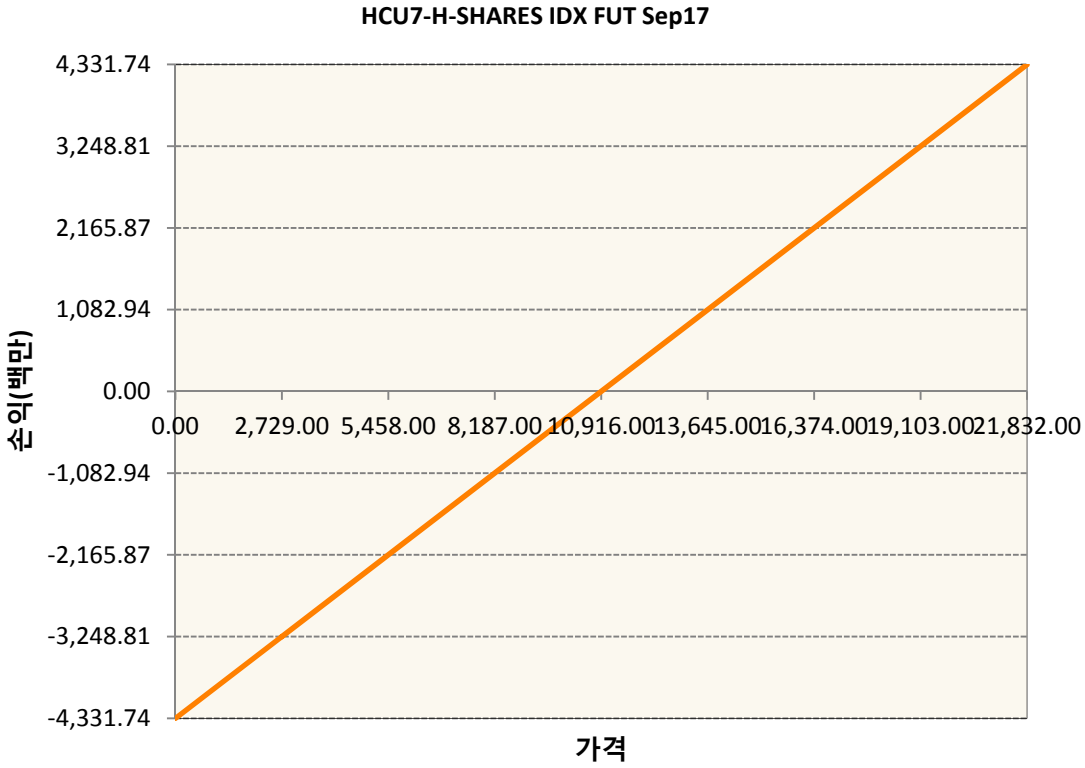
홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생

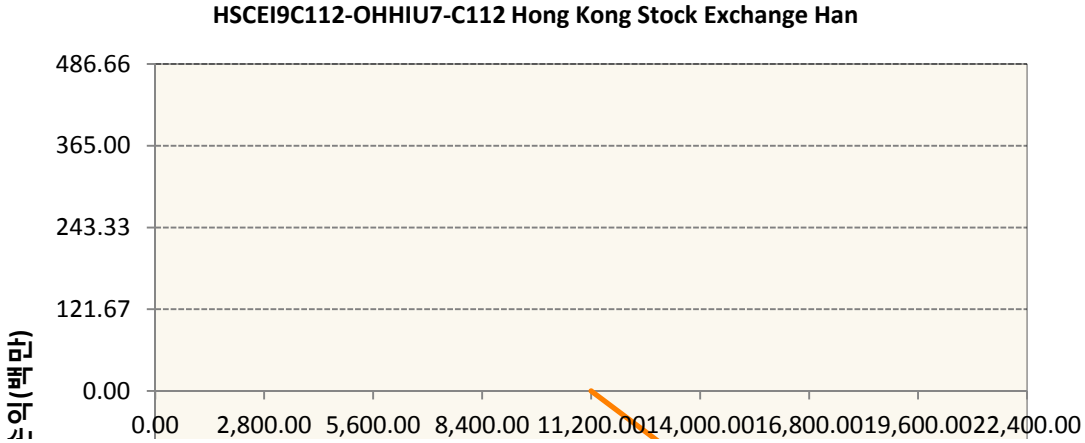
1. 계약금액

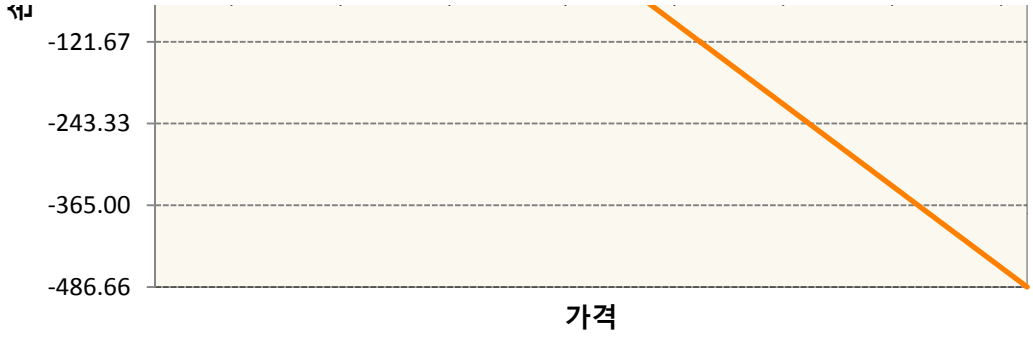
(단위:백만원)

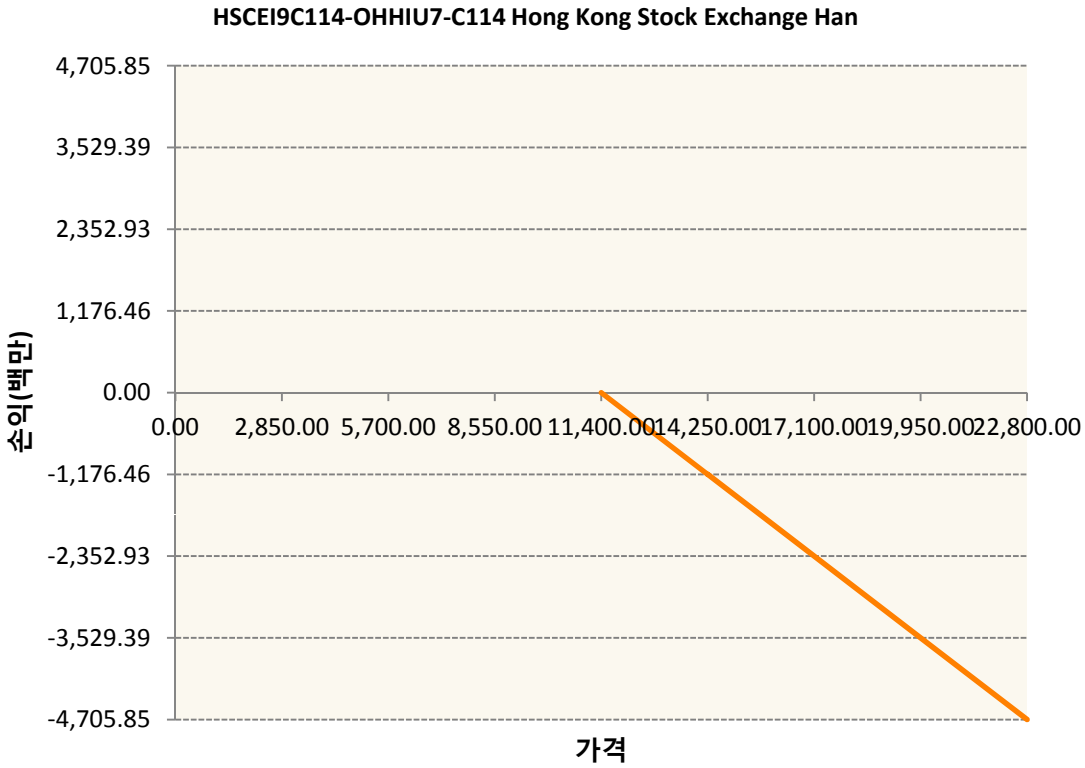
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	4,332	0	4,332	장내
누계	유가증권	옵션	0	10,385	-10,385	장내

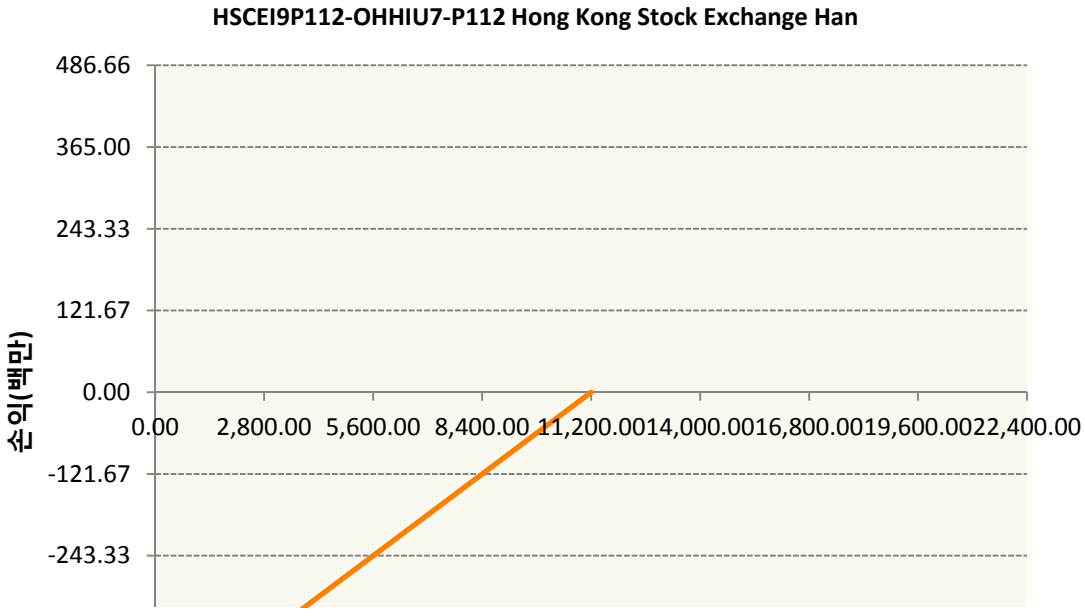
2. 만기시점의 손익구조

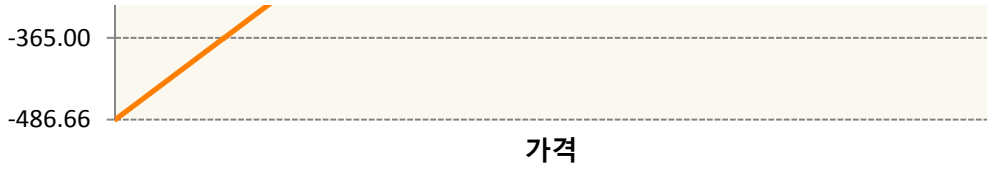


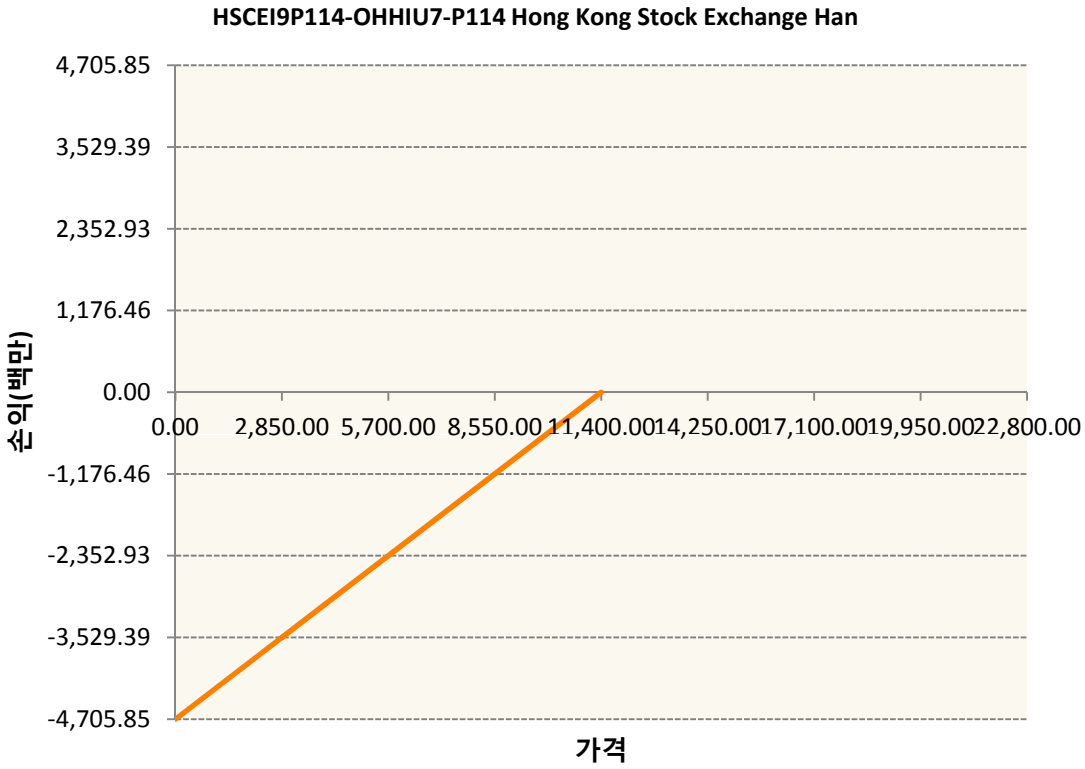



-121.67
-243.33
-365.00
-486.66
가격


HSCEI9C114-OHHIU7-C114 Hong Kong Stock Exchange Han
4,705.85
3,529.39
2,352.93
1,176.46
0.00
-1,176.46
-2,352.93
-3,529.39
-4,705.85
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
486.66
365.00
243.33
121.67
0.00
-121.67
-243.33
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	347
HSCEI9C112 OHHIU7-C112 Hong Kong Stock Exchange Han	39
HSCEI9C114 OHHIU7-C114 Hong Kong Stock Exchange Han	376
HSCEI9P112 OHHIU7-P112 Hong Kong Stock Exchange Han	39
HSCEI9P114 OHHIU7-P114 Hong Kong Stock Exchange Han	376

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

973

공시일	2017-09-26
기준일	2017-09-25

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼

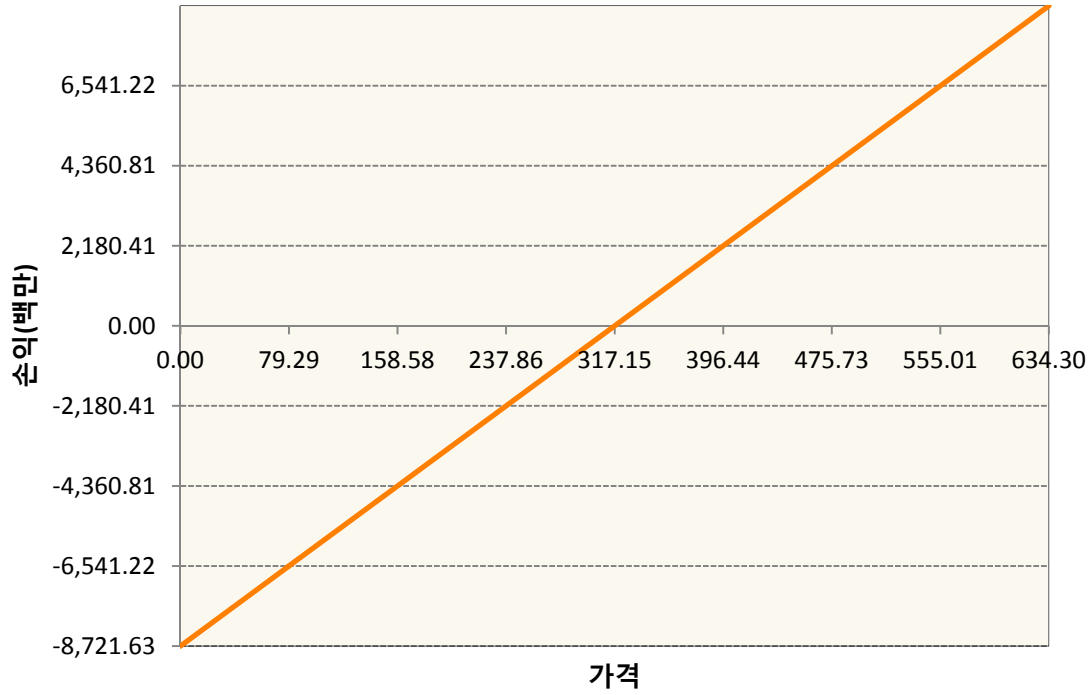
1. 계약금액

(단위:백만원)

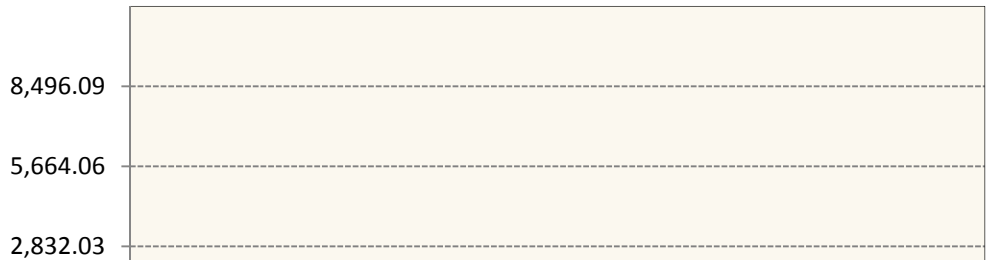
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	8,722	0	8,722	장내
누계	유가증권	스왑	24,000	0	24,000	장외
누계	유가증권	옵션	0	22,656	-22,656	장내

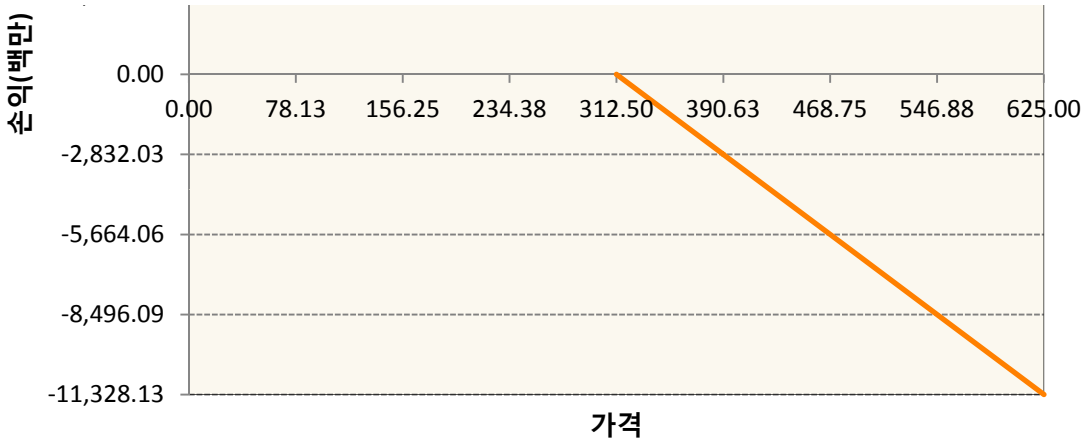
2. 만기시점의 손익구조

KR4101MC0005-2017-12 코스피200지수선물

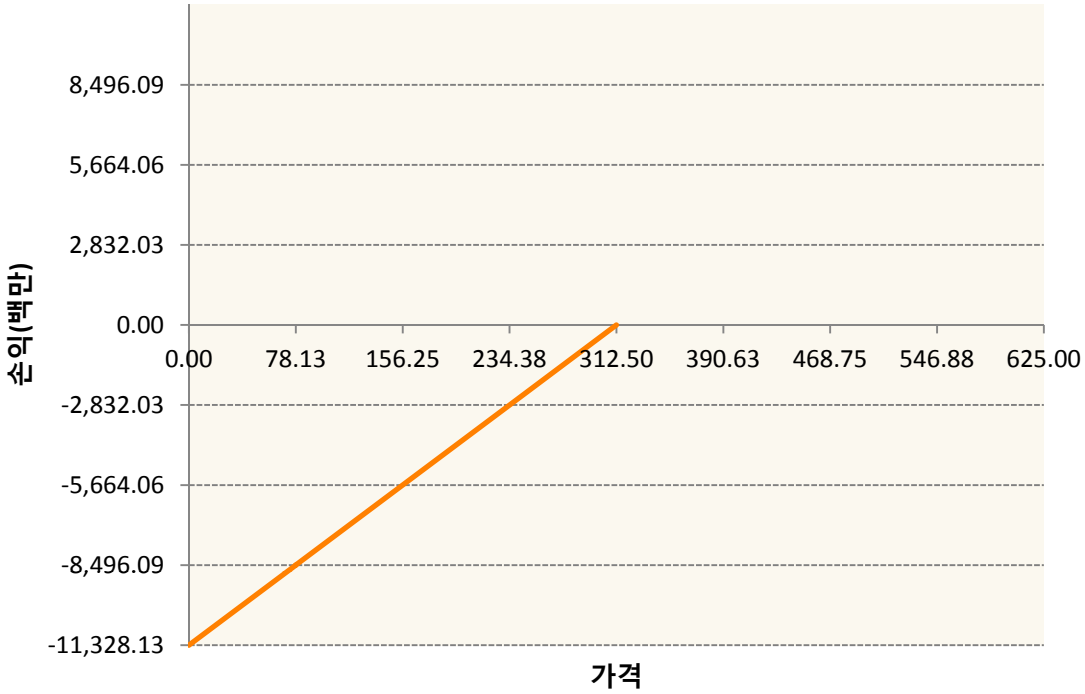


KR4201MA3125-2017-10 콜312.5





KR4301MA3124-2017-10 풋312.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_2							1,489
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,489	-1,489	-1,489	-1,489	-1,489	-1,489	-1,489
-5.33%	-992	-992	-992	-992	-992	-992	-992
-2.67%	-496	-496	-496	-496	-496	-496	-496
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	496	496	496	496	496	496	496
5.33%	992	992	992	992	992	992	992
8.00%	1,489	1,489	1,489	1,489	1,489	1,489	1,489

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						696
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-696	-696	-696	-696	-696	-696	-696
-5.33%	-464	-464	-464	-464	-464	-464	-464
-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%	464	464	464	464	464	464	464
8.00%	696	696	696	696	696	696	696
KR4201MA3 2017-10 콜312.5							778
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	302	298	293	287	279	271	262
-5.33%	279	269	257	244	231	217	202
-2.67%	207	189	171	153	135	117	99
0%	55	37	18	0	-19	-37	-56
2.67%	-175	-187	-200	-214	-229	-244	-260
5.33%	-454	-459	-466	-474	-483	-494	-505
8.00%	-753	-754	-757	-761	-765	-771	-778
KR4301MA3 2017-10 풋312.5							714
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-712	-712	-712	-712	-713	-713	-714

-5.33%	-408	-409	-411	-413	-416	-420	-424
-2.67%	-131	-139	-147	-156	-165	-173	-182
0%	26	18	9	0	-9	-19	-28
2.67%	62	60	57	54	50	45	40
5.33%	64	64	64	63	62	61	60
8.00%	64	64	64	64	64	64	63

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

3,950

공시일	2017-09-26
기준일	2017-09-25

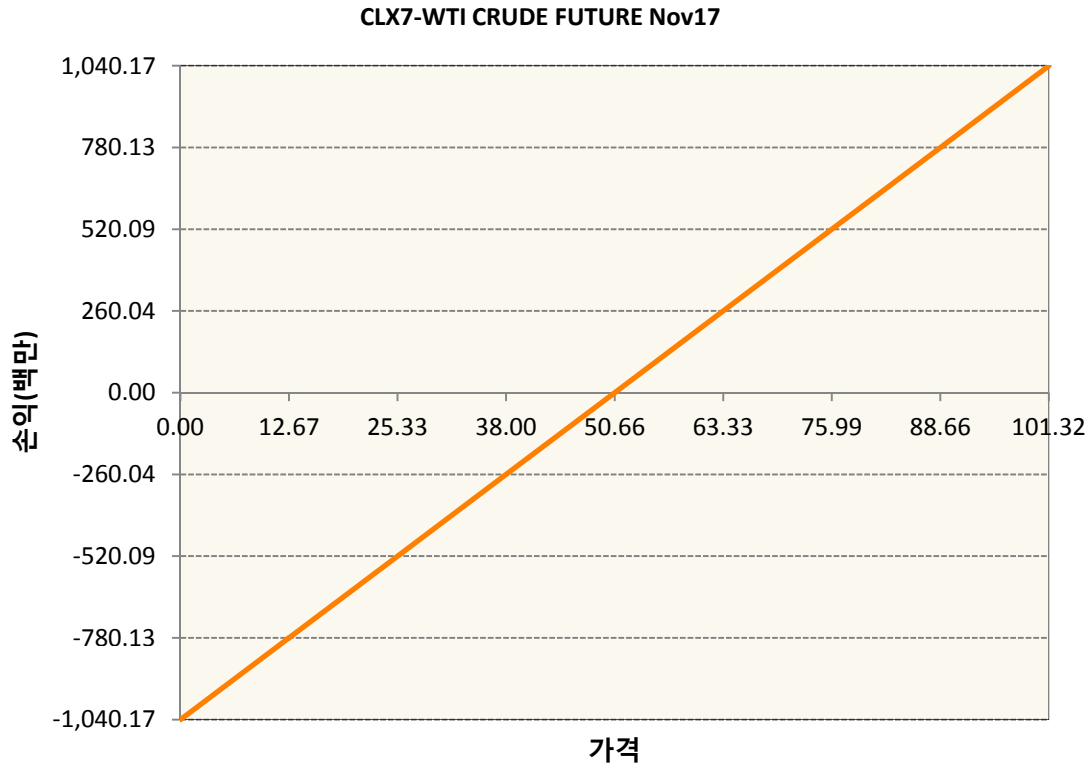
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

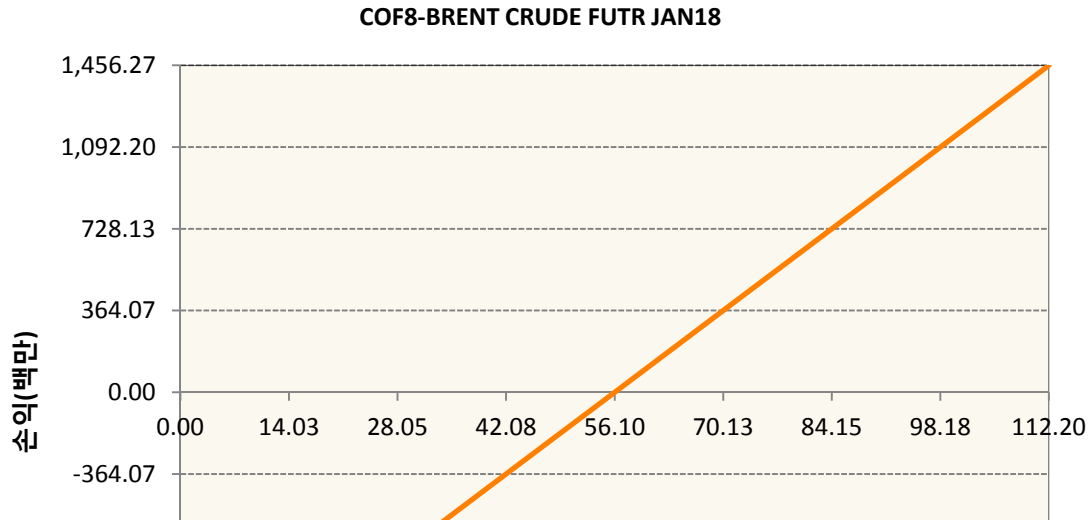
1. 계약금액

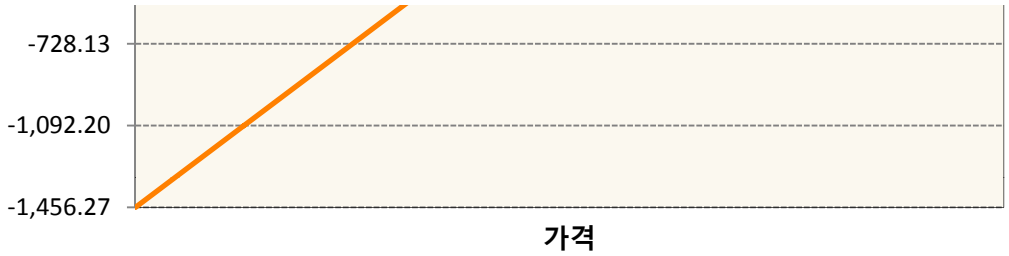
(단위:백만원)

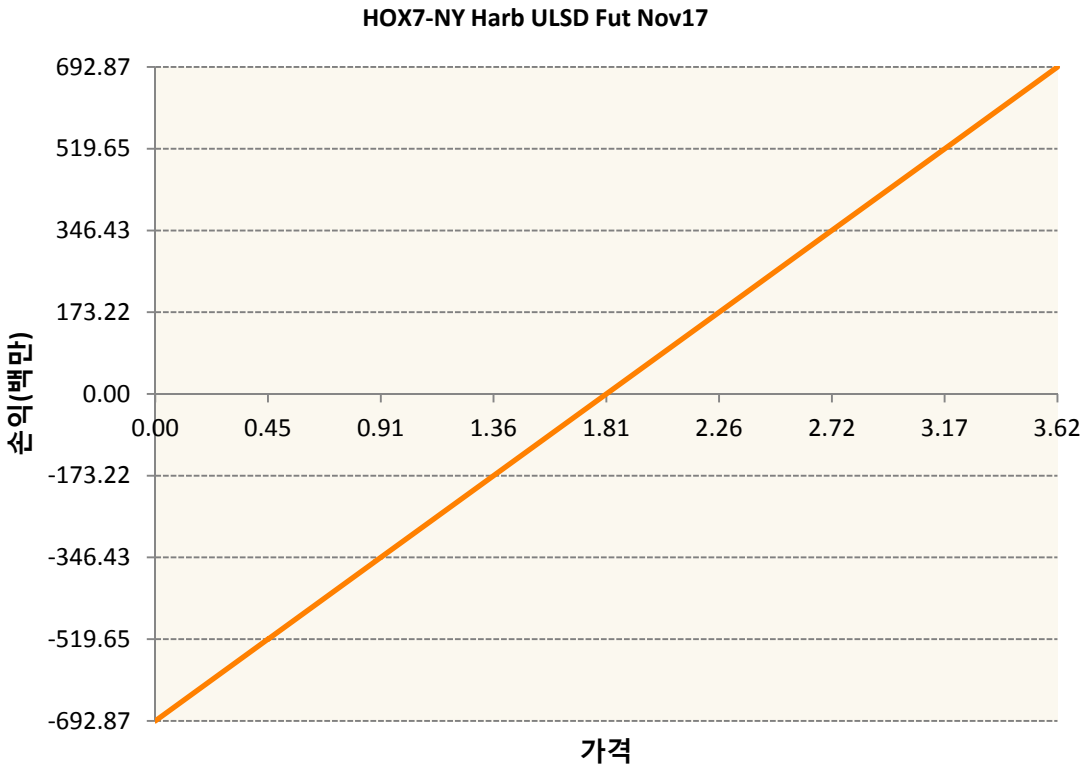
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	5,338	736	4,603	

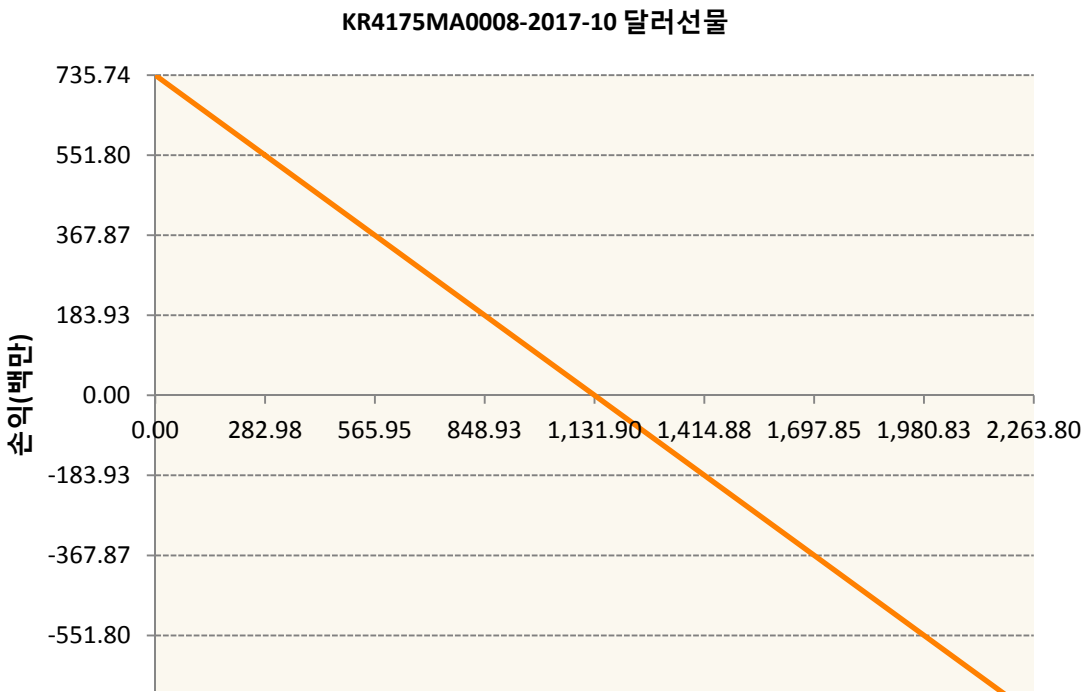
2. 만기시점의 손익구조

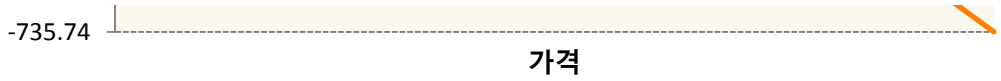


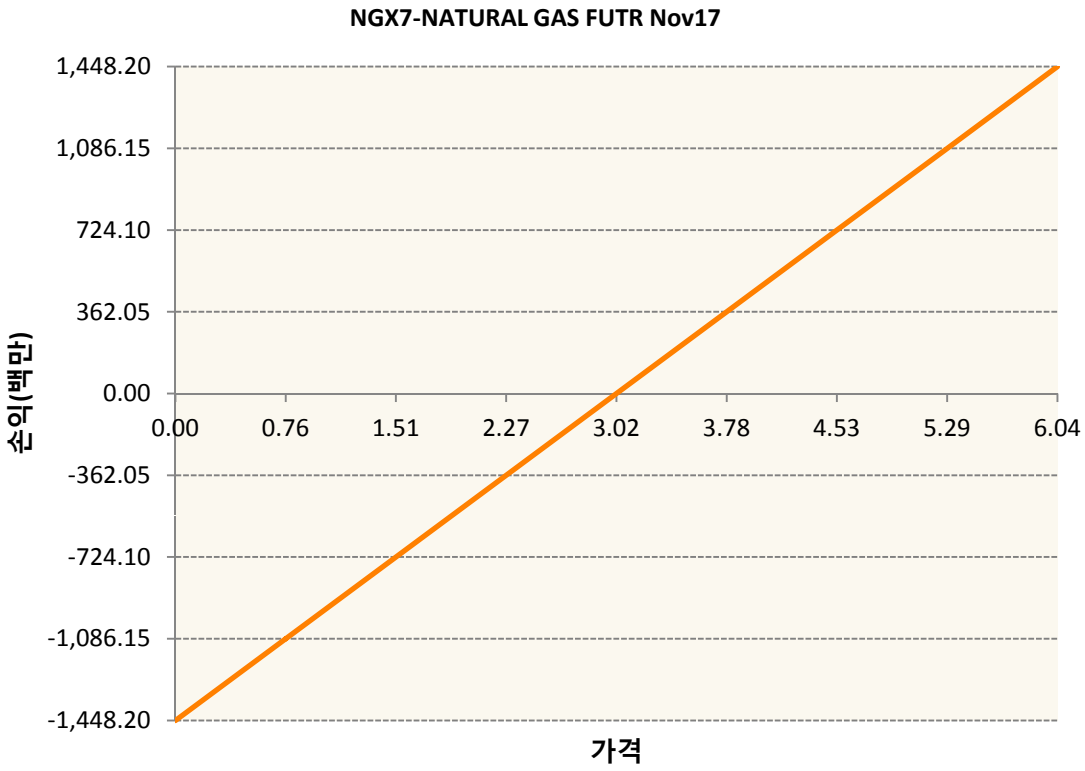


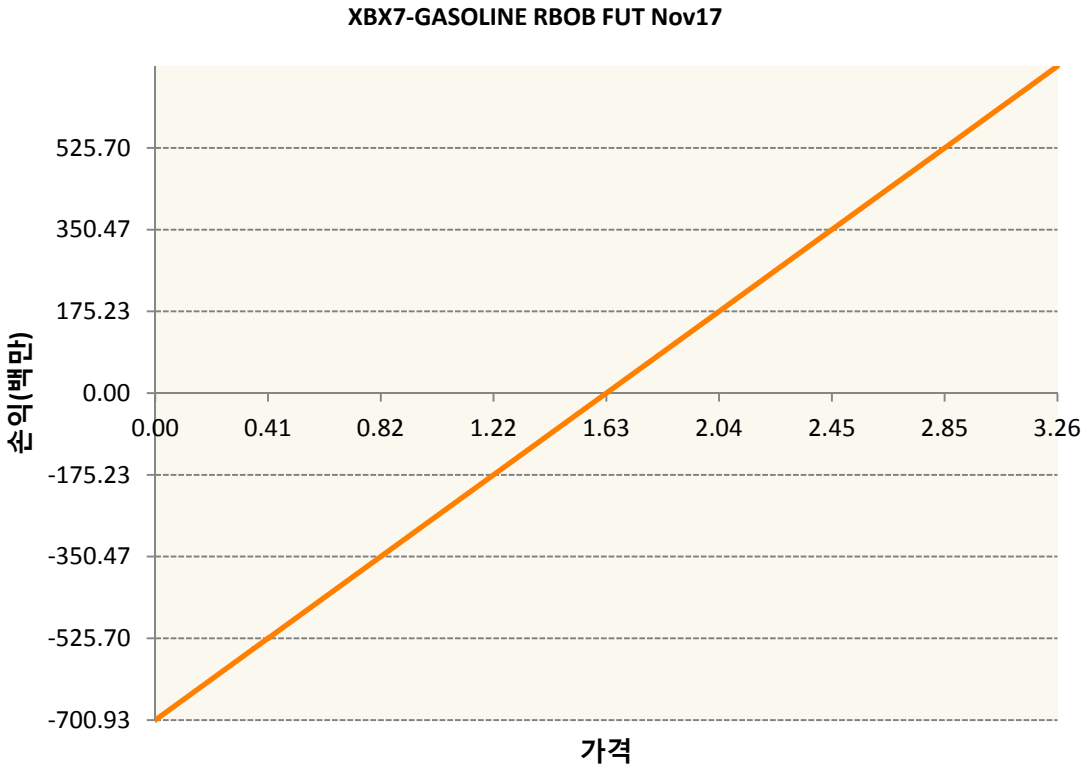

-728.13
-1,092.20
-1,456.27
가격


HOX7-NY Harb ULSD Fut Nov17
692.87
519.65
346.43
173.22
0.00
-173.22
-346.43
-519.65
-692.87
0.00
0.45
0.91
1.36
1.81
2.26
2.72
3.17
3.62
손익(백만)
가격


KR4175MA0008-2017-10 달러선물
735.74
551.80
367.87
183.93
0.00
-183.93
-367.87
-551.80
0.00
282.98
565.95
848.93
1,131.90
1,414.88
1,697.85
1,980.83
2,263.80
손익(백만)


-735.74
가격


NGX7-NATURAL GAS FUTR Nov17
1,448.20
1,086.15
724.10
362.05
0.00
-362.05
-724.10
-1,086.15
-1,448.20
0.00
0.76
1.51
2.27
3.02
3.78
4.53
5.29
6.04
손익(백만)
가격


XBX7-GASOLINE RBOB FUT Nov17
525.70
350.47
175.23
0.00
-175.23
-350.47
-525.70
-700.93
0.00
0.41
0.82
1.22
1.63
2.04
2.45
2.85
3.26
손익(백만)
가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLX7	WTI CRUDE FUTURE Nov17	83
COF8	BRENT CRUDE FUTR JAN18	117
HOX7	NY Harb ULSD Fut Nov17	55
KR4175MA0	2017-10 달러선물	59
NGX7	NATURAL GAS FUTR Nov17	116
XBX7	GASOLINE RBOB FUT Nov17	56

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

769

공시일	2017-09-26
기준일	2017-09-25

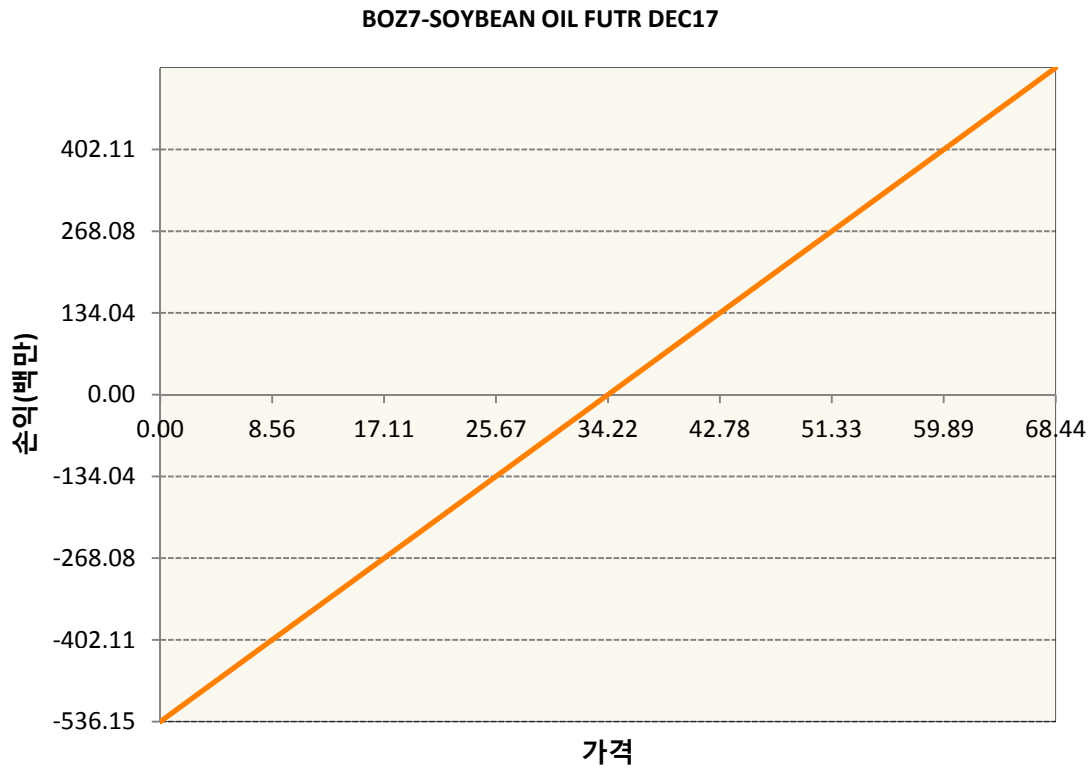
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

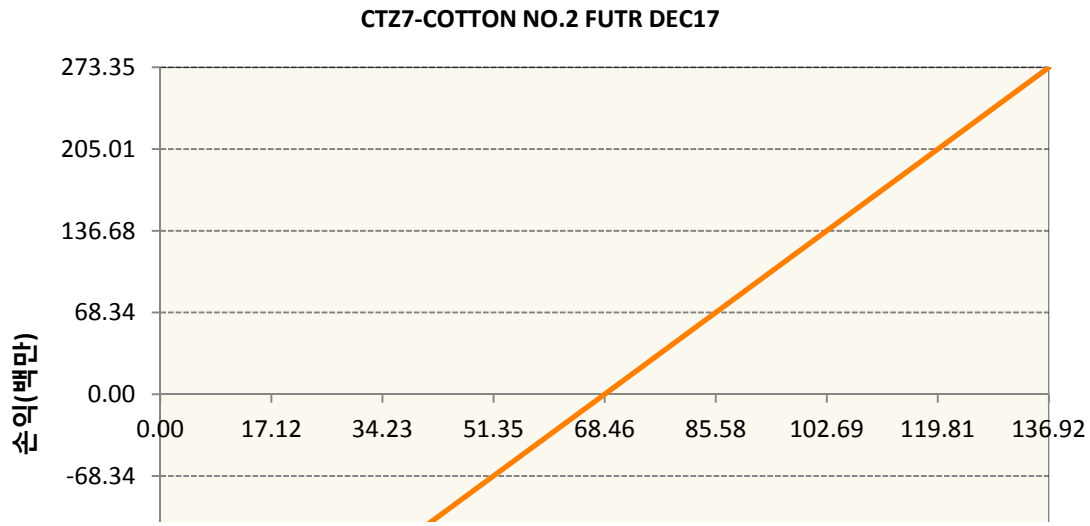
1. 계약금액

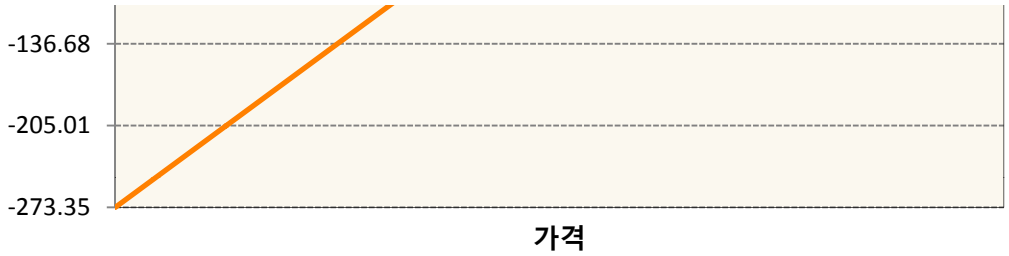
(단위:백만원)

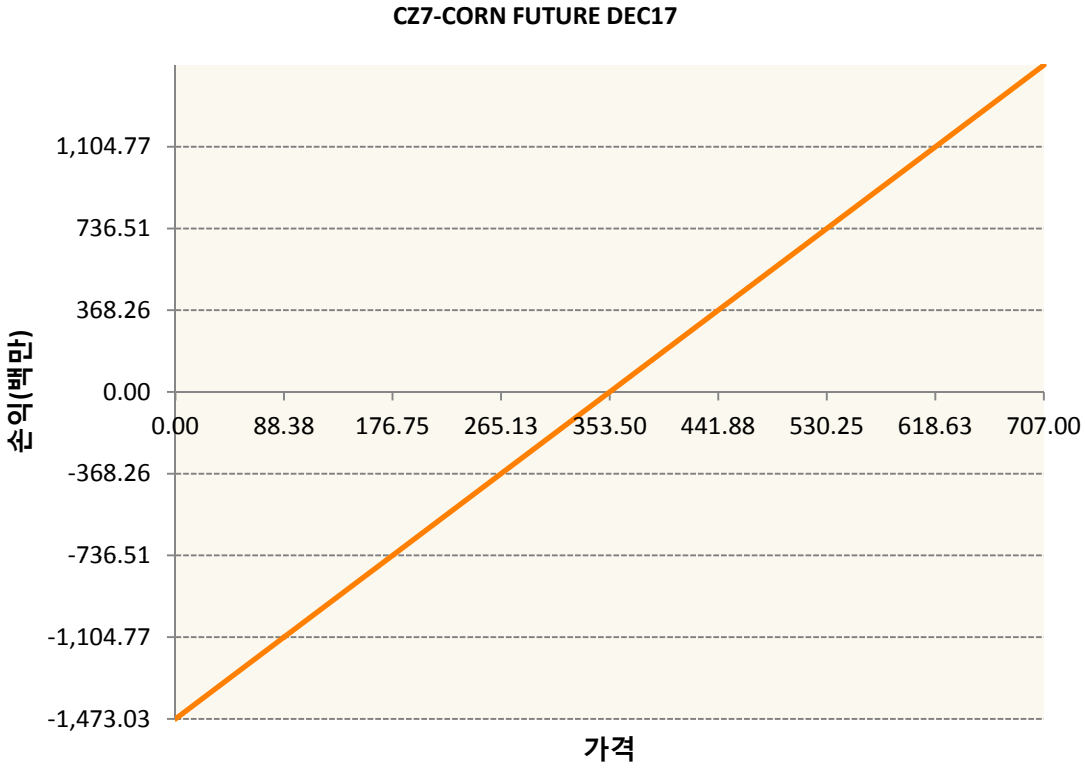
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	5,856	340	5,516	

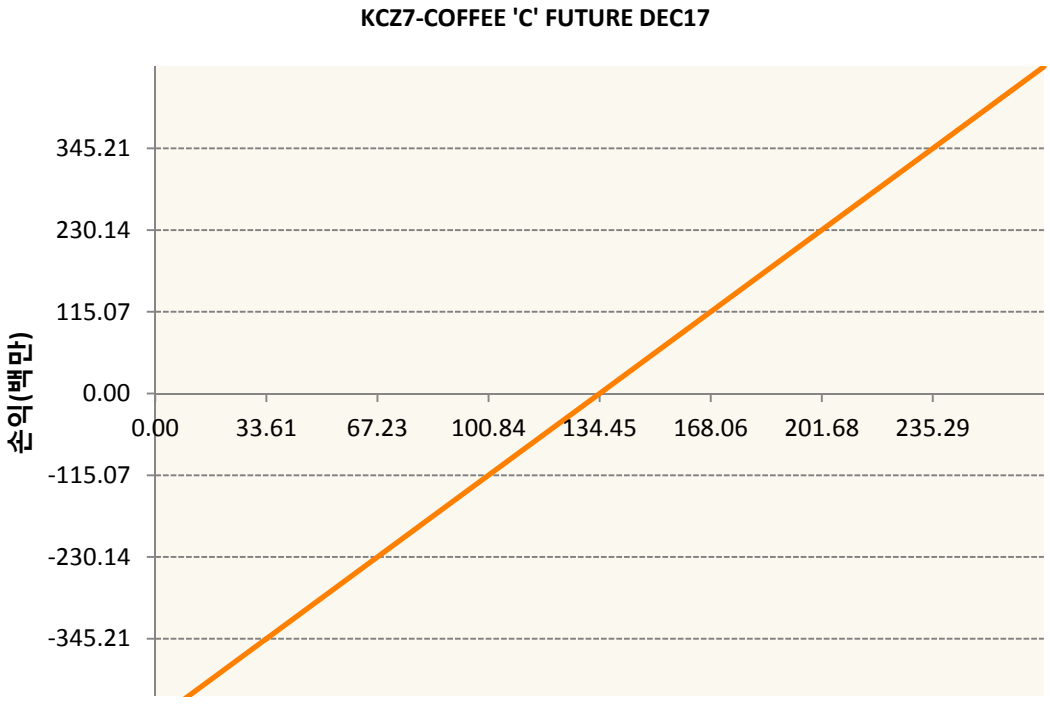
2. 만기시점의 손익구조

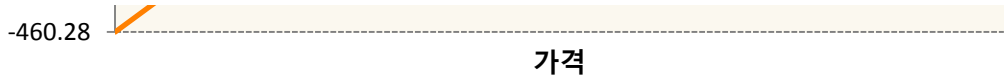


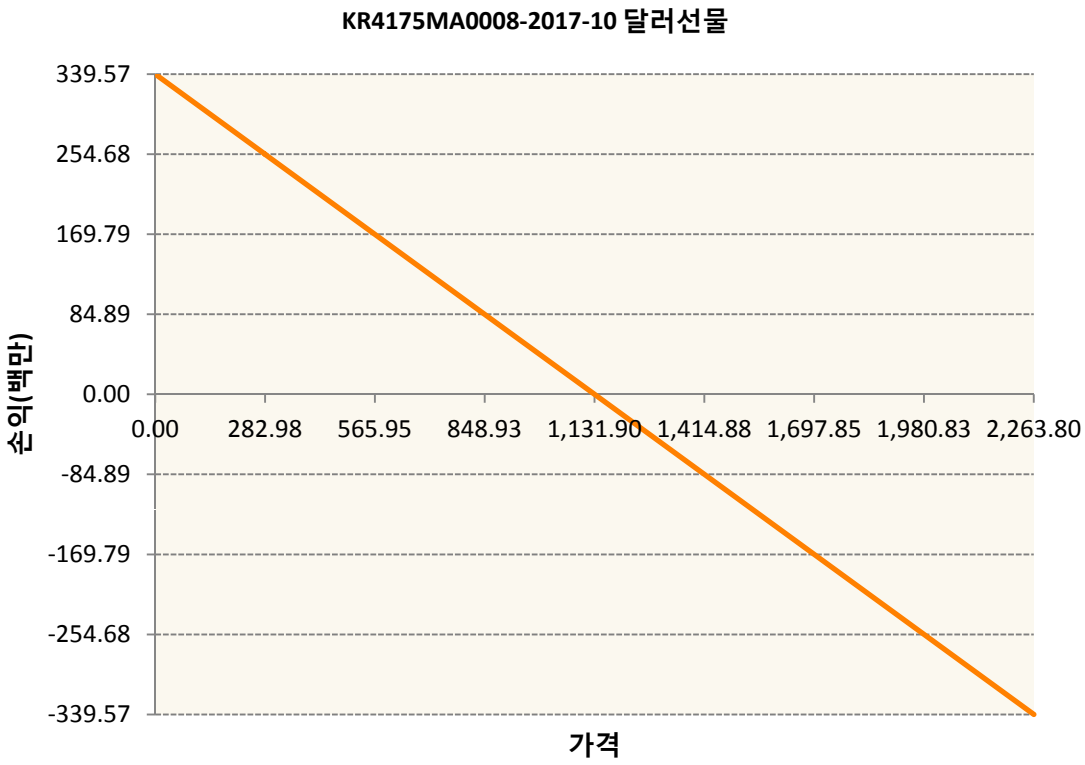


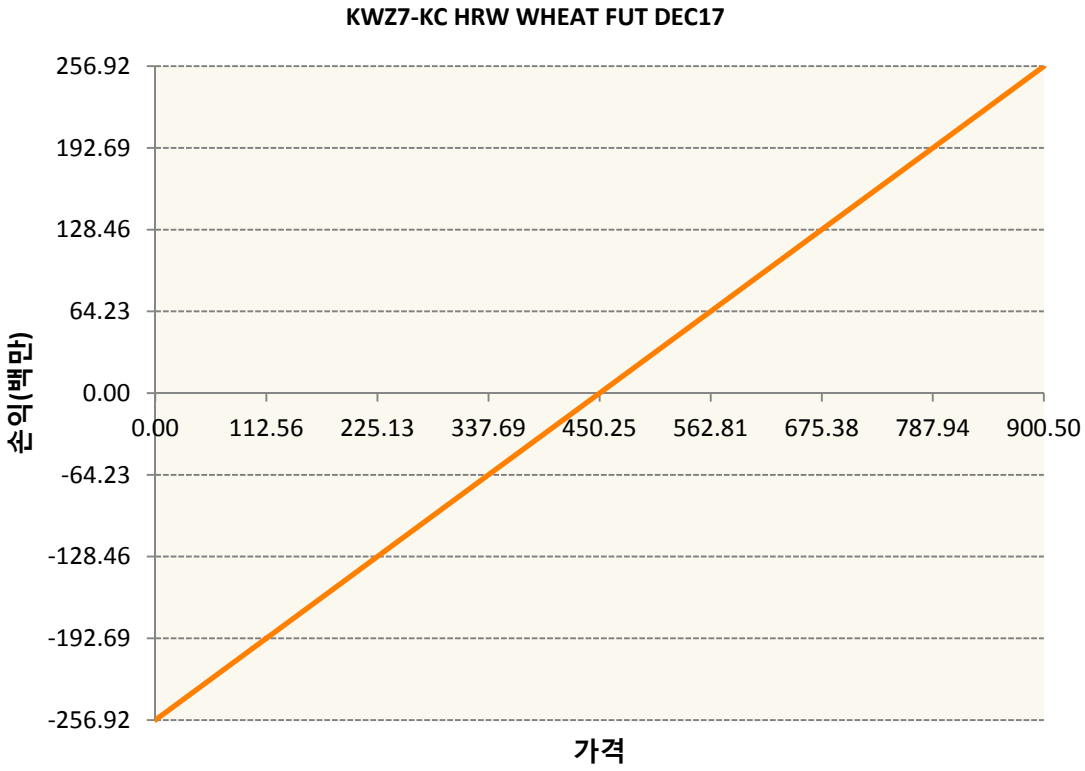

-136.68
-205.01
-273.35
가격

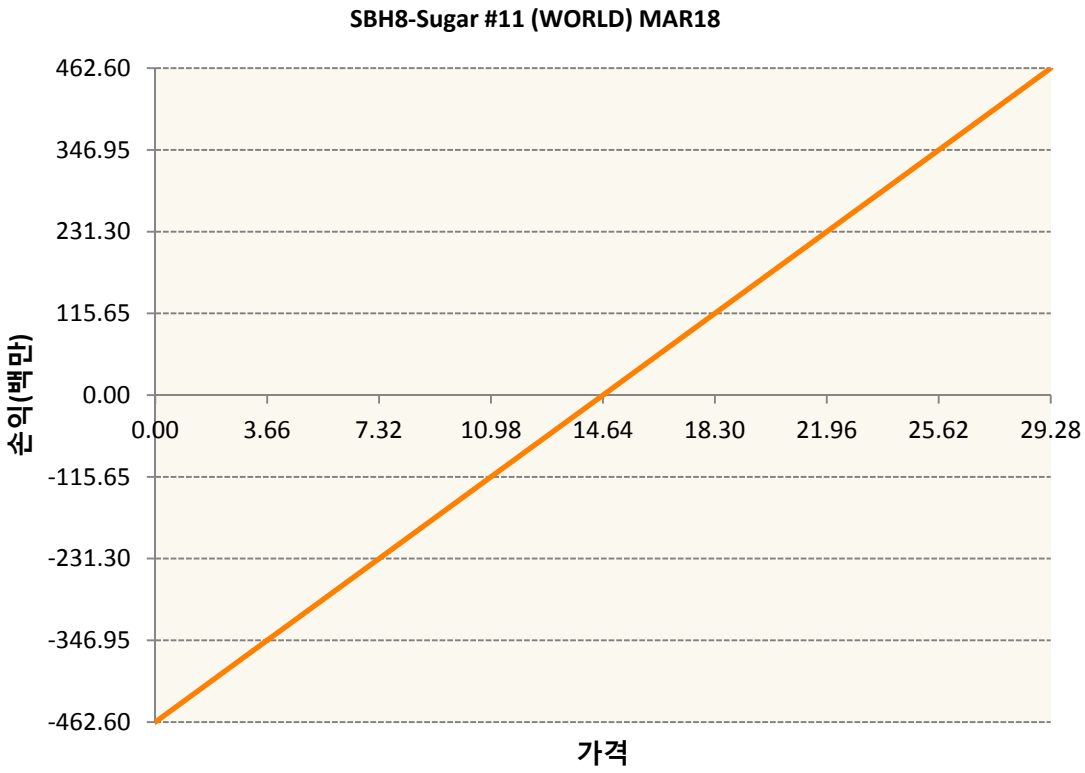

CZ7-CORN FUTURE DEC17
1,104.77
736.51
368.26
0.00
-368.26
-736.51
-1,104.77
-1,473.03
0.00
88.38
176.75
265.13
353.50
441.88
530.25
618.63
707.00
손익(백만)
가격

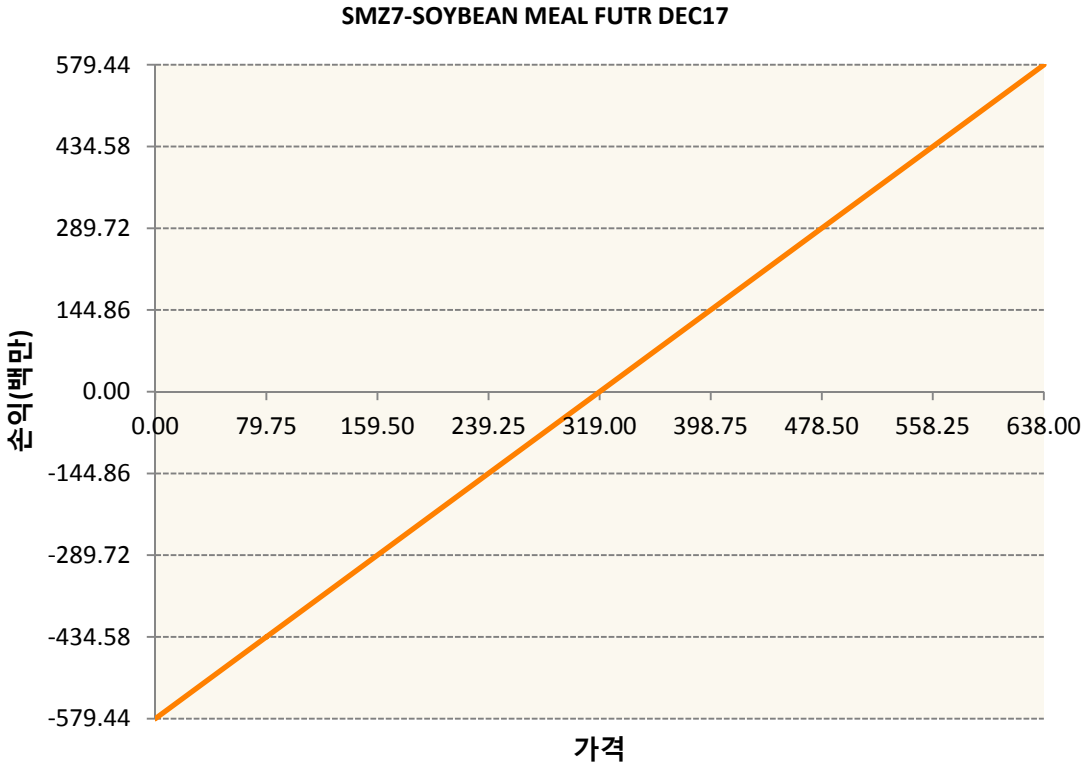

KCZ7-COFFEE 'C' FUTURE DEC17
345.21
230.14
115.07
0.00
-115.07
-230.14
-345.21
0.00
33.61
67.23
100.84
134.45
168.06
201.68
235.29
손익(백만)

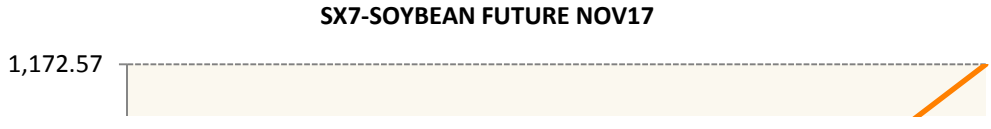

-460.28
가격

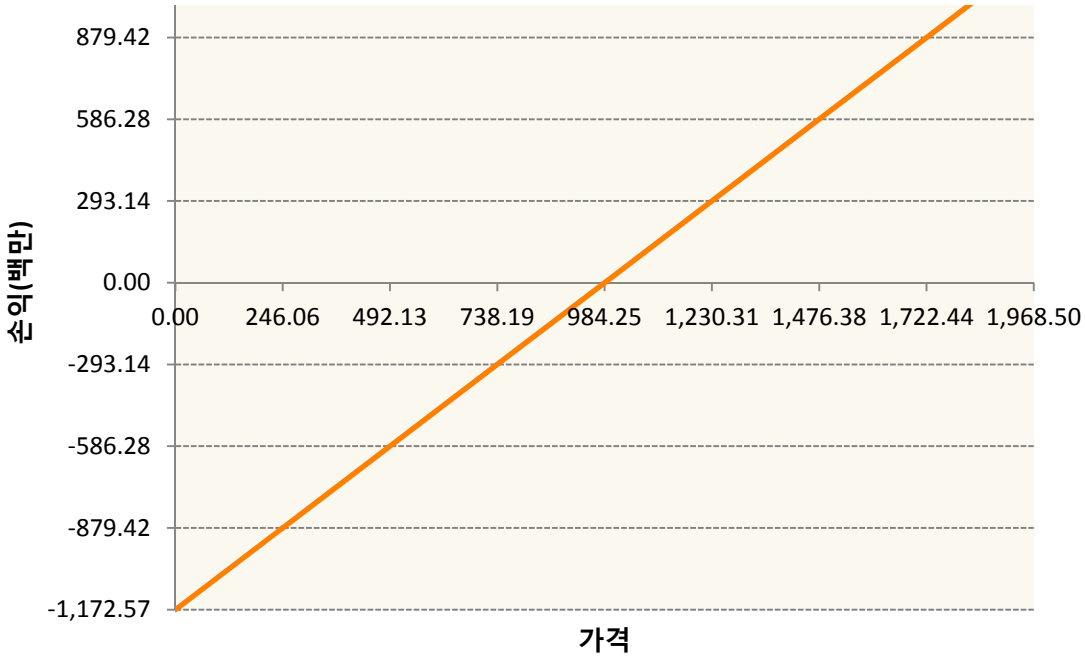

KR4175MA0008-2017-10 달러선물
339.57
254.68
169.79
84.89
0.00
-84.89
-169.79
-254.68
-339.57
0.00
282.98
565.95
848.93
1,131.90
1,414.88
1,697.85
1,980.83
2,263.80
손익(백만)
가격

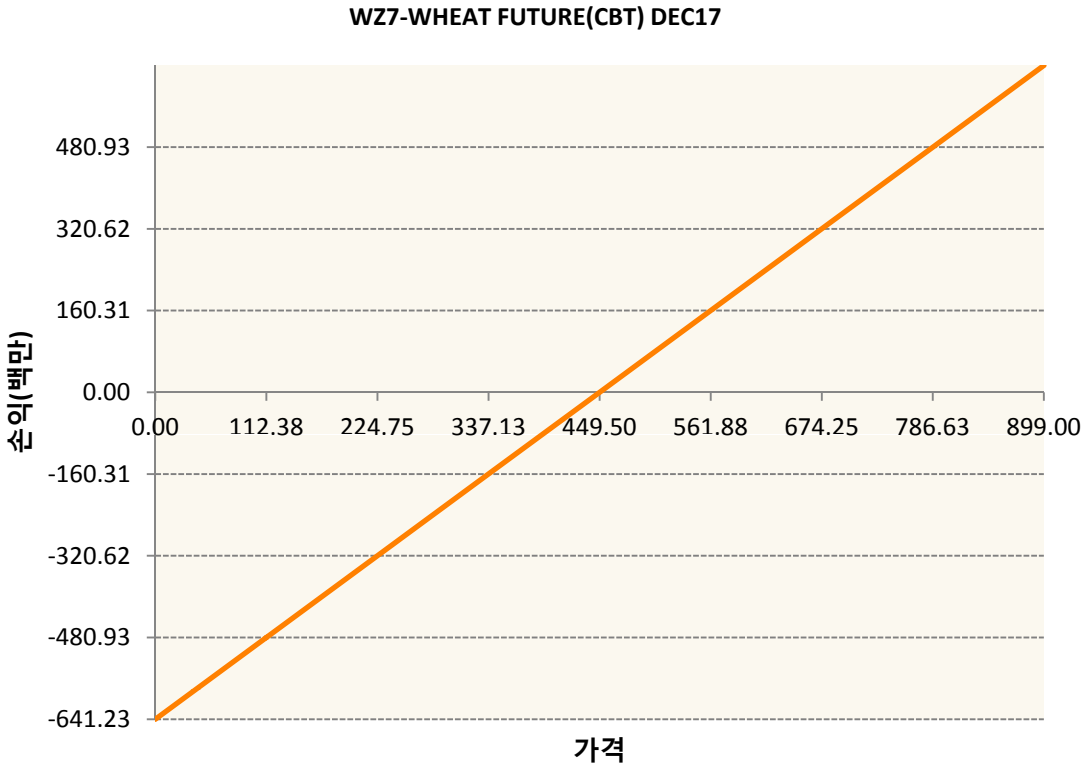

KWZ7-KC HRW WHEAT FUT DEC17
256.92
192.69
128.46
64.23
0.00
-64.23
-128.46
-192.69
-256.92
0.00
112.56
225.13
337.69
450.25
562.81
675.38
787.94
900.50
손익(백만)
가격


SBH8-Sugar #11 (WORLD) MAR18
462.60
346.95
231.30
115.65
0.00
-115.65
-231.30
-346.95
-462.60
0.00
3.66
7.32
10.98
14.64
18.30
21.96
25.62
29.28
손익(백만)
가격


SMZ7-SOYBEAN MEAL FUTR DEC17
579.44
434.58
289.72
144.86
0.00
-144.86
-289.72
-434.58
-579.44
0.00
79.75
159.50
239.25
319.00
398.75
478.50
558.25
638.00
손익(백만)
가격


SX7-SOYBEAN FUTURE NOV17
1,172.57





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
BOZ7	SOYBEAN OIL FUTR DEC17	43
CTZ7	COTTON NO.2 FUTR DEC17	22
CZ7	CORN FUTURE DEC17	118
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	46
SX7	SOYBEAN FUTURE NOV17	94
WZ7	WHEAT FUTURE(CBT) DEC17	51

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

547