공시일	2017-09-27
기준일	2017-09-26

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	2017-09-27
기준일	2017-09-26

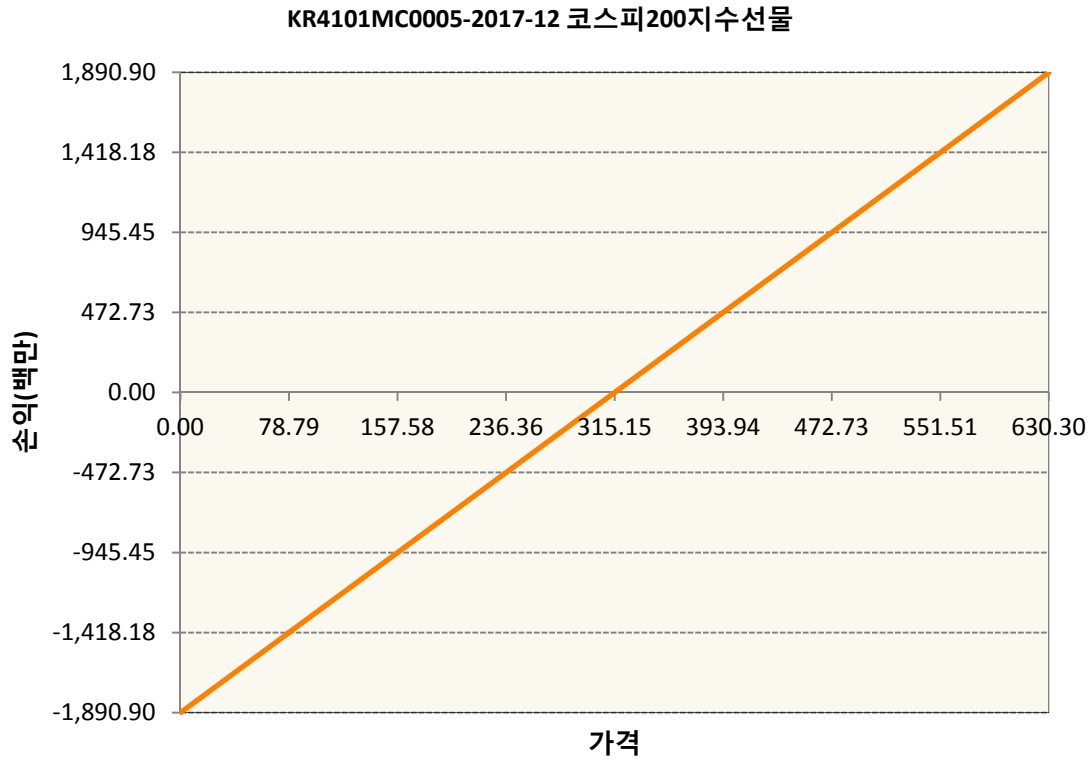
스마트인덱스모

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	1,891	0	1,891	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101MC0	2017-12 코스피200지수선물						151
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-151	-151	-151	-151	-151	-151	-151
-5.33%	-101	-101	-101	-101	-101	-101	-101
-2.67%	-50	-50	-50	-50	-50	-50	-50
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	50	50	50	50	50	50	50
5.33%	101	101	101	101	101	101	101
8.00%	151	151	151	151	151	151	151

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

91

공시일	2017-09-27
기준일	2017-09-26

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)

463

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-09-27
기준일	2017-09-26

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	415

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

353

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-09-27
기준일	2017-09-26

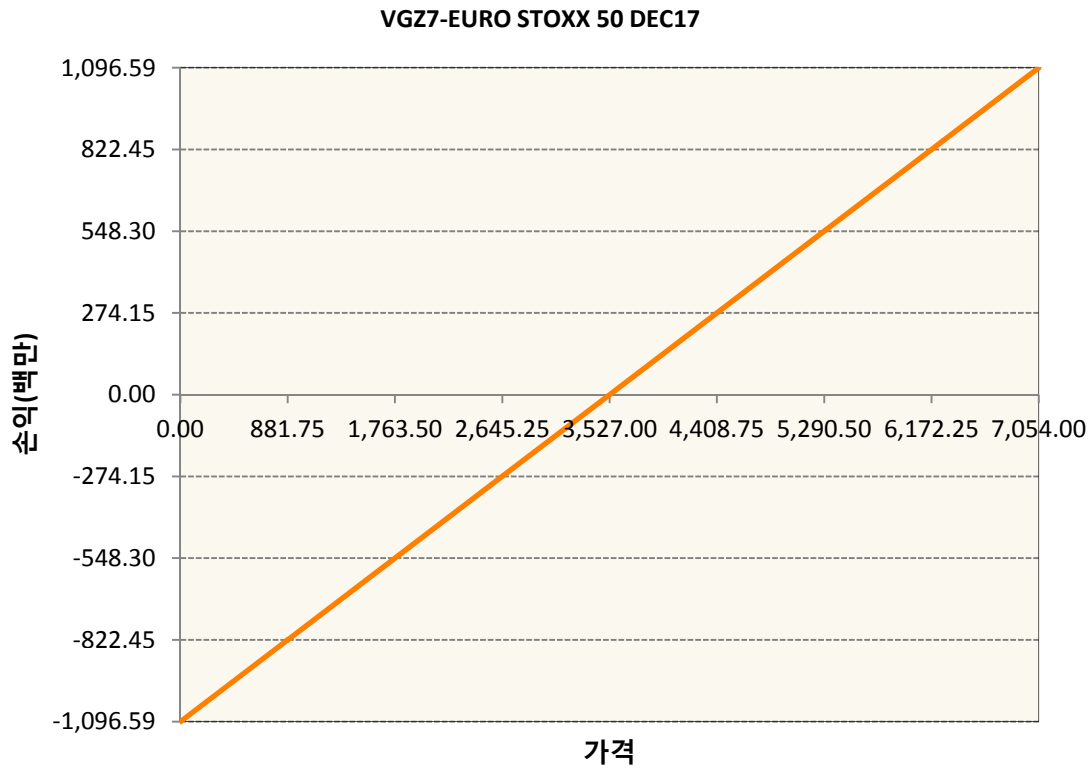
유로인덱스모(주식-파생형)

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	2017-09-27
기준일	2017-09-26

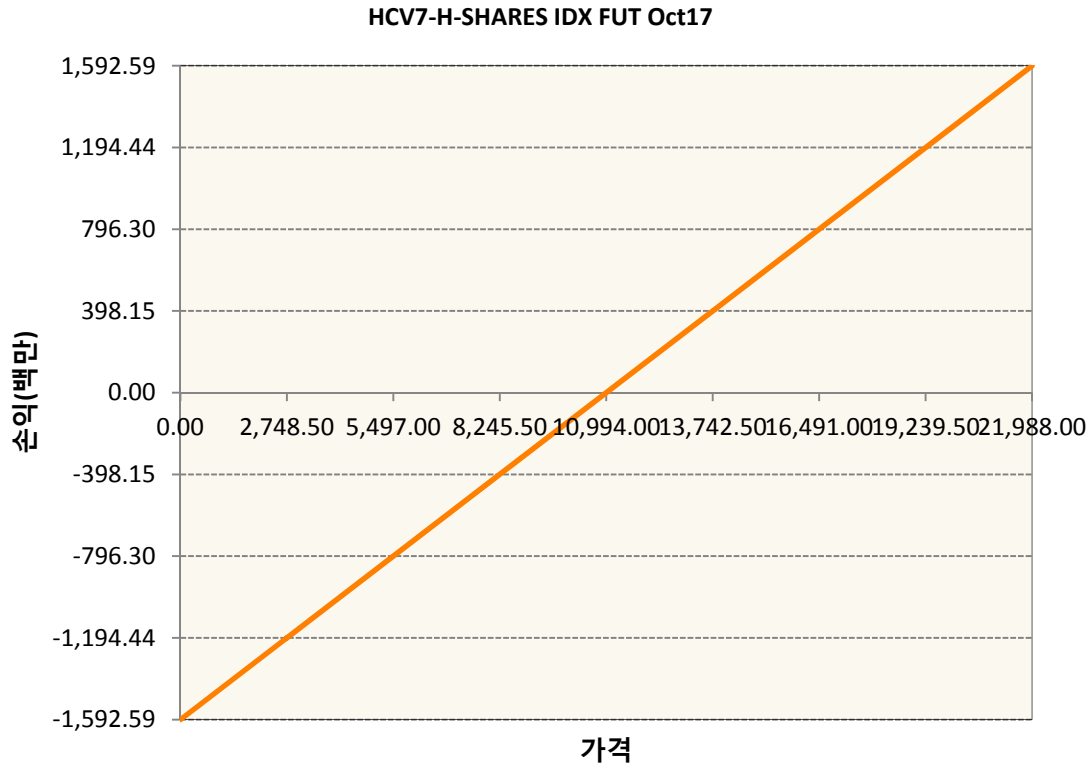
차이나인덱스모(주식-파생형)

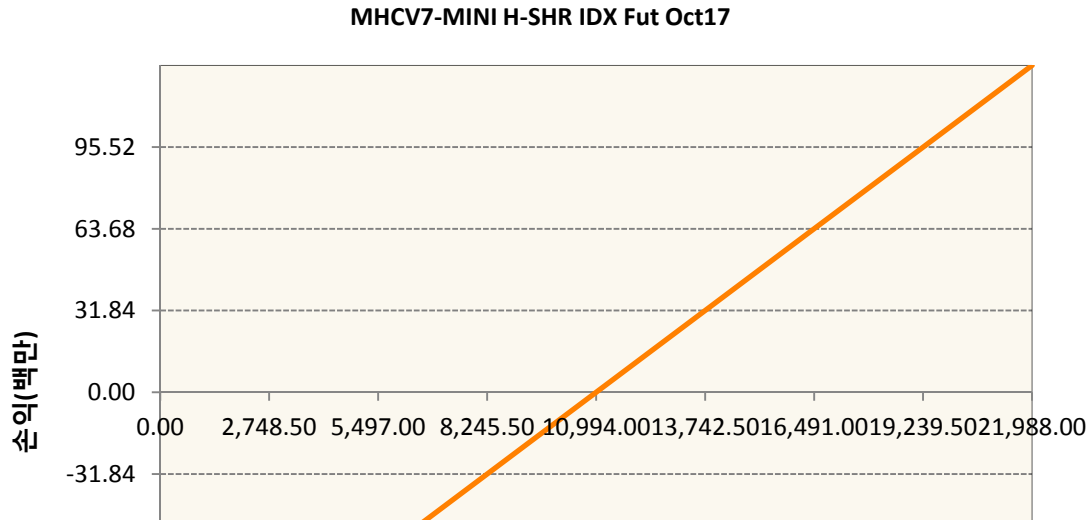
1. 계약금액

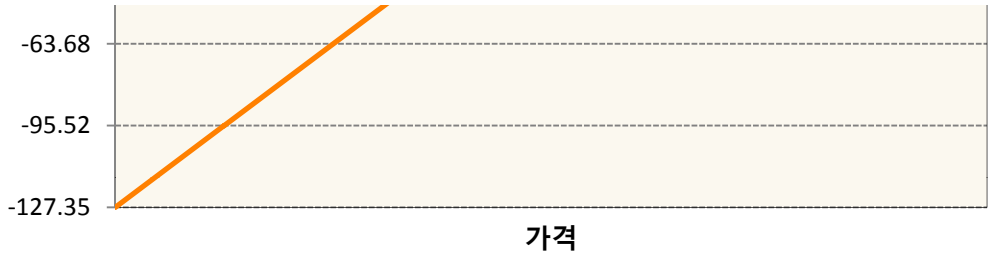
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,720	0	1,720	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCV7	H-SHARES IDX FUT Oct17	127
MHCV7	MINI H-SHR IDX Fut Oct17	10

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	114

공시일	2017-09-27
기준일	2017-09-26

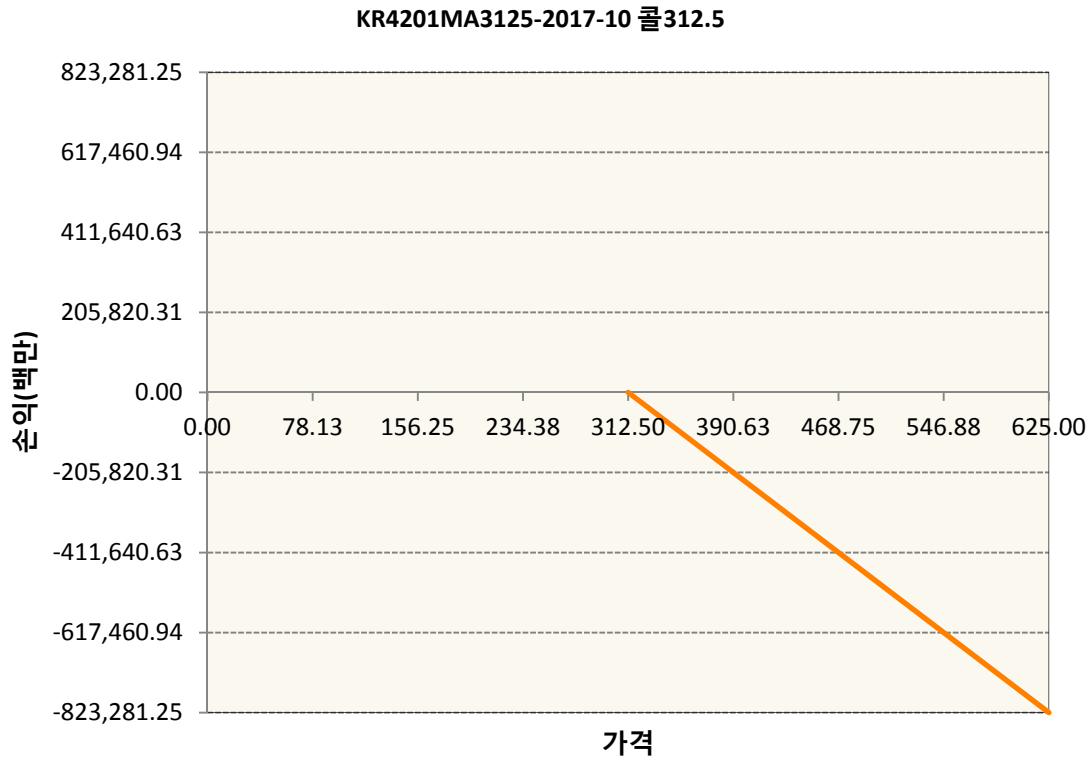
커버드콜모(주식혼합-파생형)

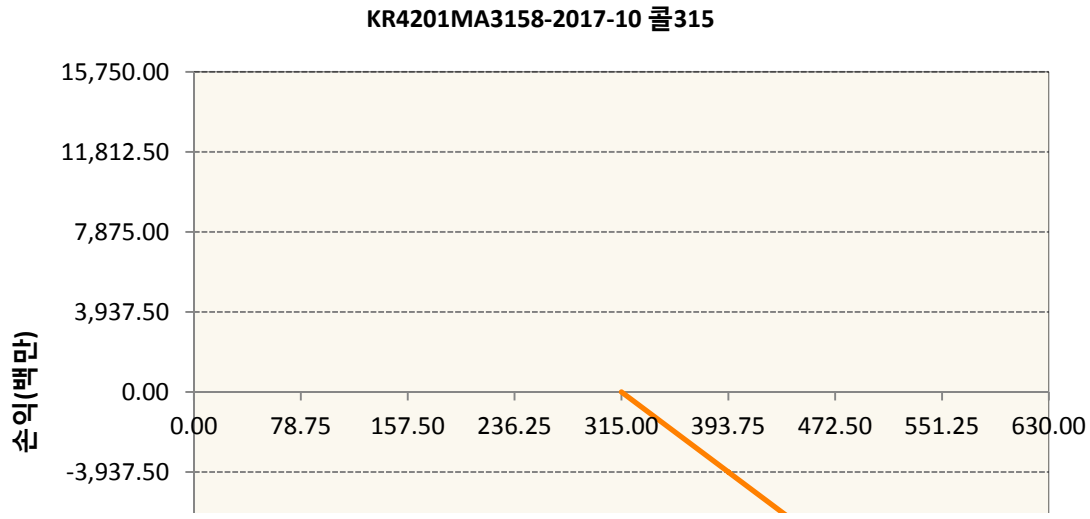
1. 계약금액

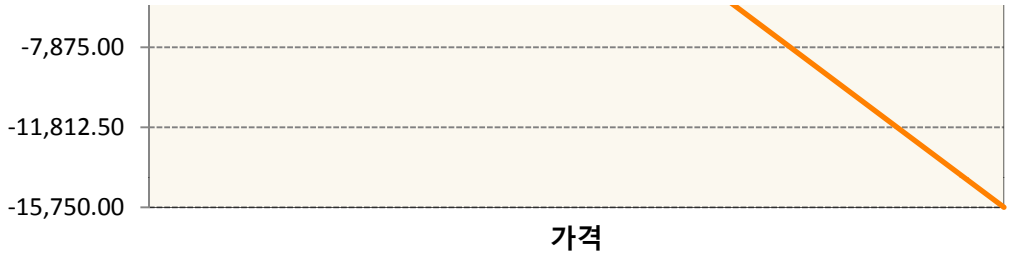
(단위:백만원)

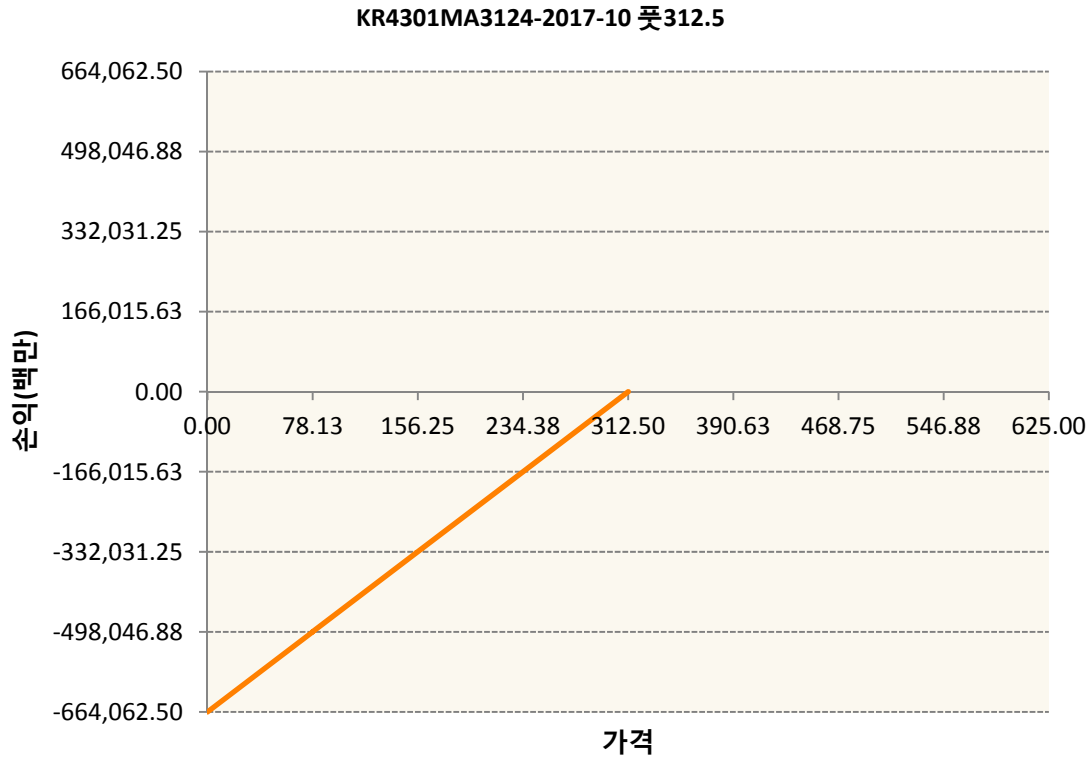
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	1,503,094	-1,503,094	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201MA3 2017-10 콜312.5							54,409
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	18,516	18,336	18,079	17,742	17,327	16,840	16,284
-5.33%	17,429	16,831	16,142	15,374	14,540	13,650	12,712
-2.67%	13,424	12,274	11,092	9,886	8,661	7,421	6,169
0%	4,024	2,685	1,344	0	-1,345	-2,691	-4,038
2.67%	-11,379	-12,358	-13,399	-14,489	-15,619	-16,779	-17,966
5.33%	-30,938	-31,405	-31,974	-32,634	-33,373	-34,183	-35,053
8.00%	-52,340	-52,491	-52,716	-53,021	-53,407	-53,871	-54,409
KR4201MA3 2017-10 콜315							984
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	290	288	284	280	273	266	257

-5.33%	277	268	258	246	232	217	202
-2.67%	222	203	183	162	140	118	95
0%	77	52	26	0	-26	-52	-77
2.67%	-183	-204	-227	-250	-273	-297	-321
5.33%	-535	-547	-560	-575	-592	-610	-628
8.00%	-934	-938	-944	-952	-961	-972	-984
KR4301MA3 2017-10 풋312.5							44,279

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-44,204	-44,205	-44,207	-44,214	-44,226	-44,247	-44,279
-5.33%	-26,438	-26,478	-26,543	-26,637	-26,761	-26,915	-27,099
-2.67%	-9,592	-9,947	-10,335	-10,750	-11,189	-11,646	-12,118
0%	1,730	1,157	580	0	-582	-1,166	-1,751
2.67%	5,068	4,875	4,637	4,360	4,047	3,704	3,334
5.33%	5,383	5,368	5,337	5,288	5,215	5,116	4,990
8.00%	5,392	5,391	5,390	5,386	5,378	5,364	5,339

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

109,236

공시일	2017-09-27
기준일	2017-09-26

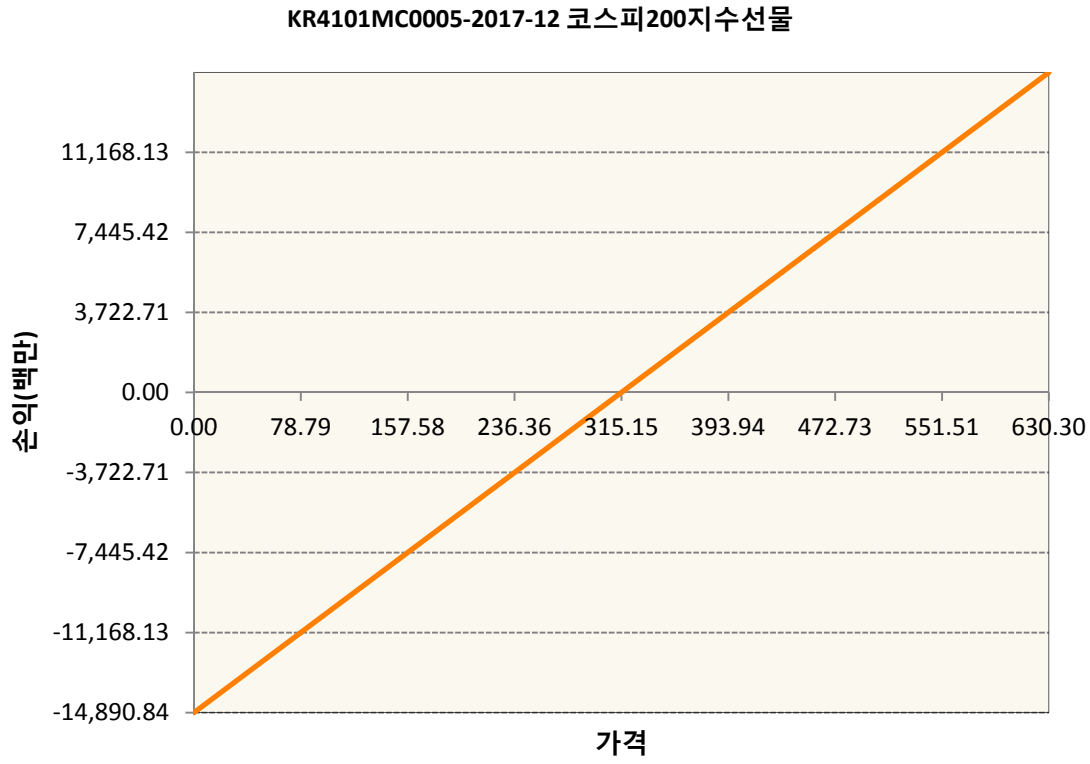
ETF스마트레버리지목표전환형6호

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	14,891	0	14,891	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101MC0	2017-12 코스피200지수선물						1,188
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,188	-1,188	-1,188	-1,188	-1,188	-1,188	-1,188
-5.33%	-792	-792	-792	-792	-792	-792	-792
-2.67%	-396	-396	-396	-396	-396	-396	-396
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	396	396	396	396	396	396	396
5.33%	792	792	792	792	792	792	792
8.00%	1,188	1,188	1,188	1,188	1,188	1,188	1,188

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

720

공시일	2017-09-27
기준일	2017-09-26

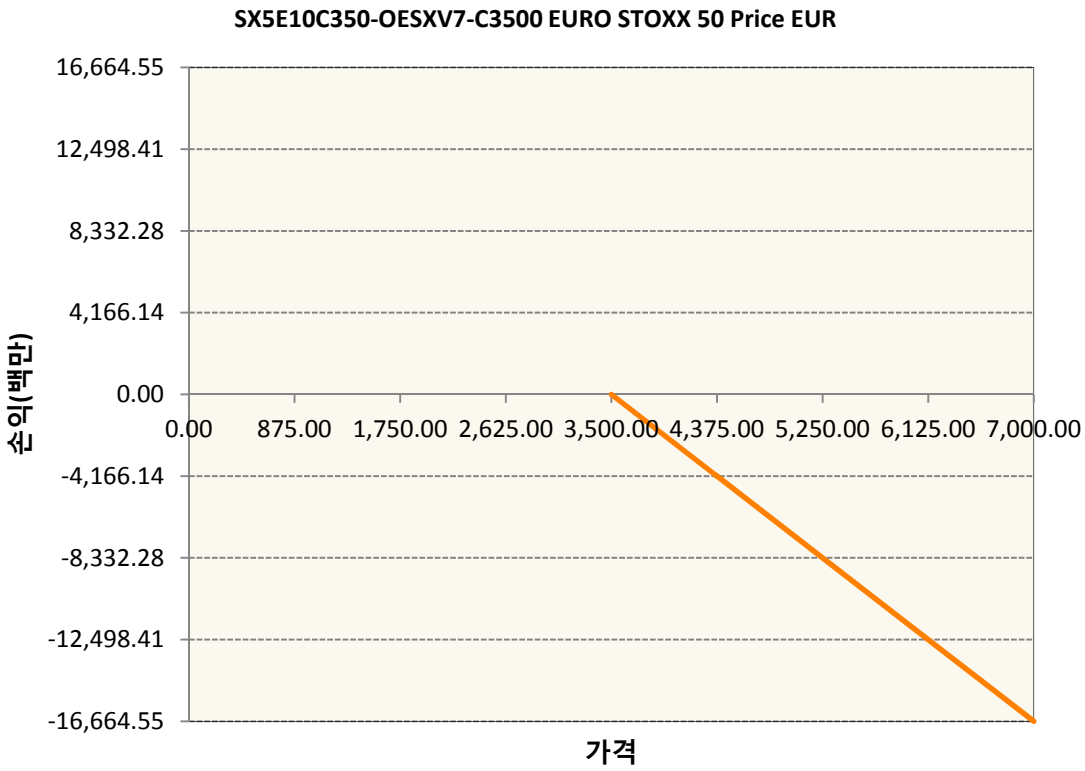
유로커버드콜(주식혼합-파생형)

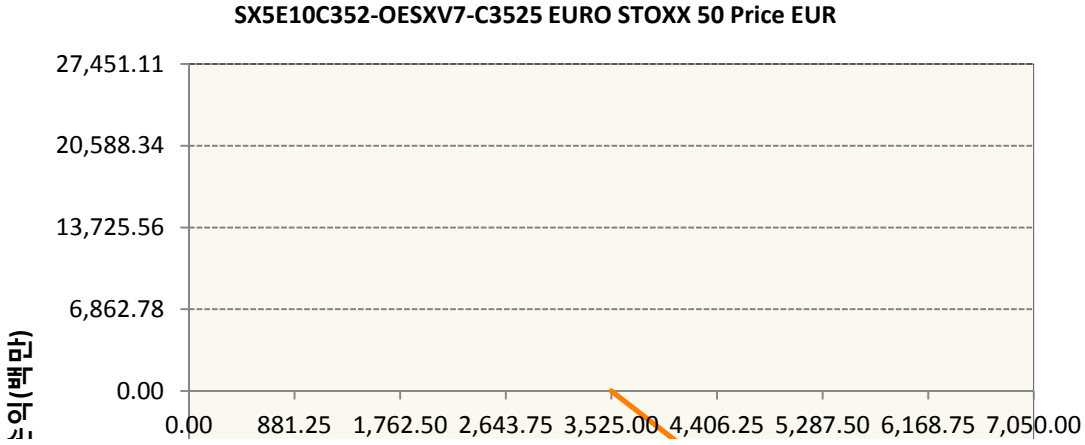
1. 계약금액

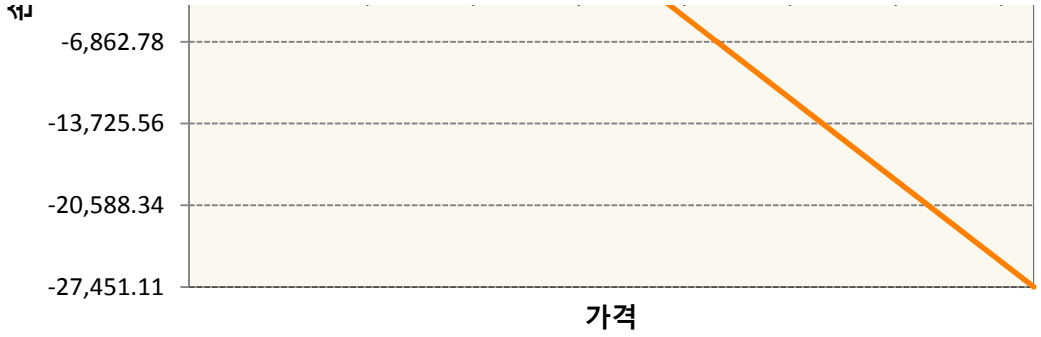
(단위:백만원)

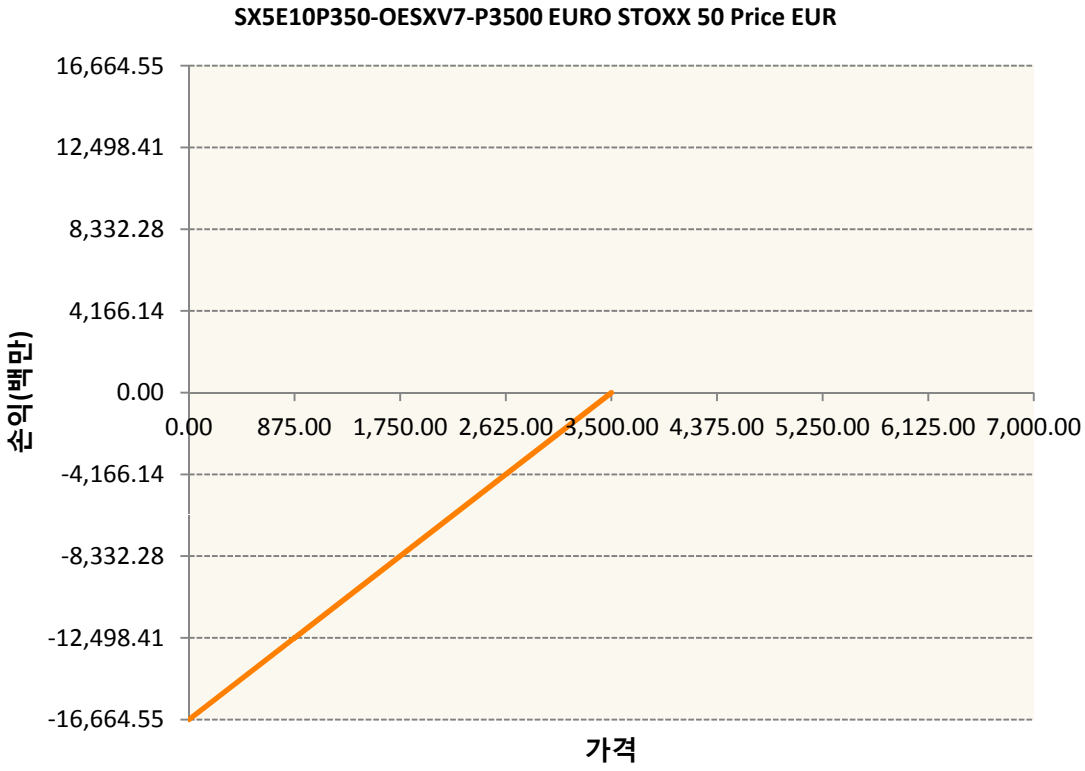
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	40,228	0	40,228	
누계	유가증권	옵션	0	88,231	-88,231	장내

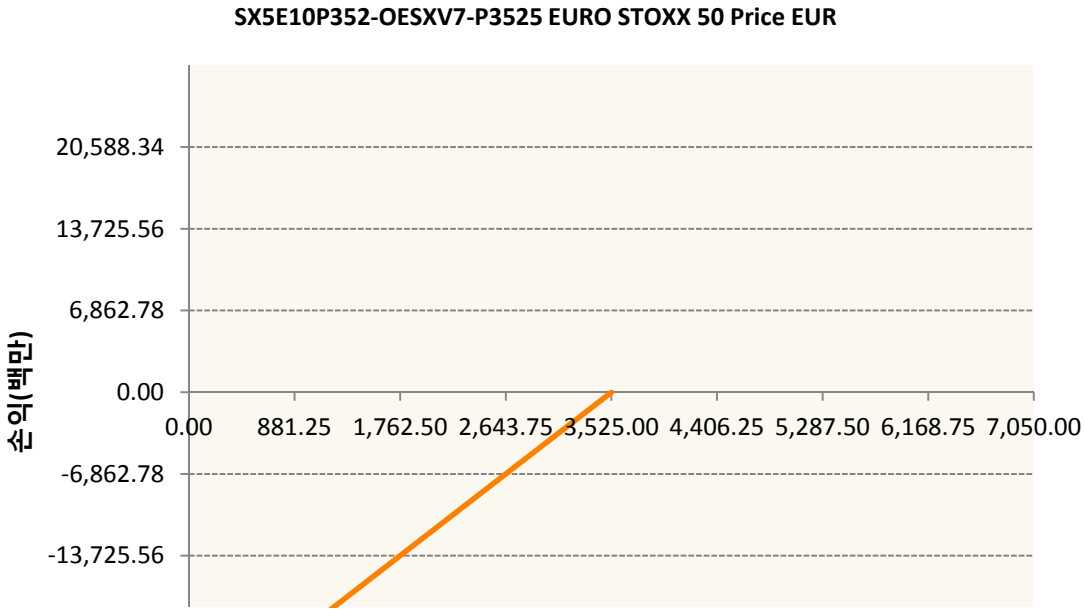
2. 만기시점의 손익구조

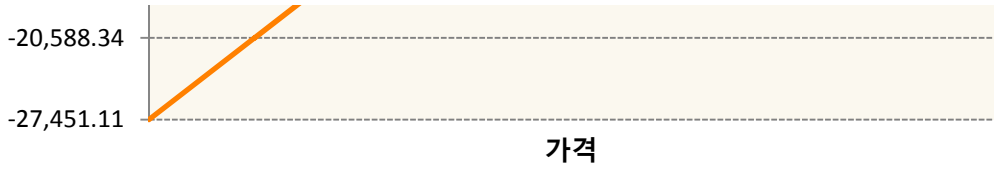


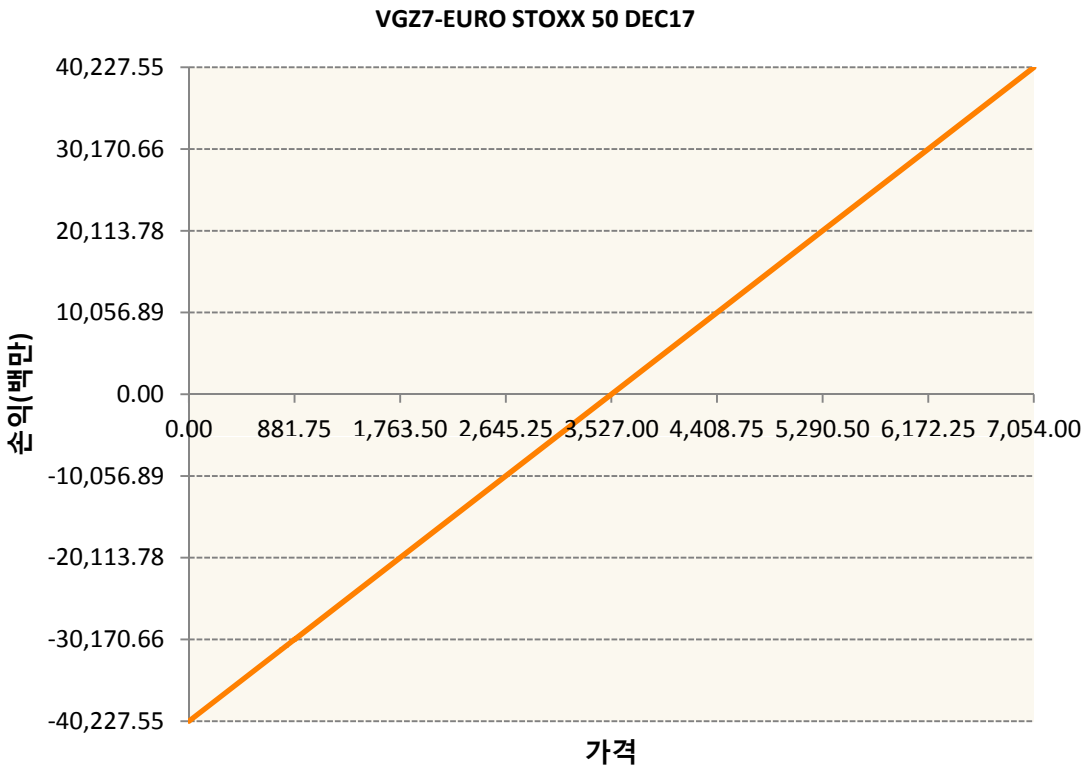



-6,862.78
-13,725.56
-20,588.34
-27,451.11
가격


SX5E10P350-OESXV7-P3500 EURO STOXX 50 Price EUR
16,664.55
12,498.41
8,332.28
4,166.14
0.00
-4,166.14
-8,332.28
-12,498.41
-16,664.55
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
20,588.34
13,725.56
6,862.78
0.00
-6,862.78
-13,725.56
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	1,333
SX5E10C352 OESXV7-C3525 EURO STOXX 50 Price EUR	2,196
SX5E10P350 OESXV7-P3500 EURO STOXX 50 Price EUR	1,333
SX5E10P352 OESXV7-P3525 EURO STOXX 50 Price EUR	2,196
VGZ7 EURO STOXX 50 DEC17	3,218

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

7,952

공시일	2017-09-27
기준일	2017-09-26

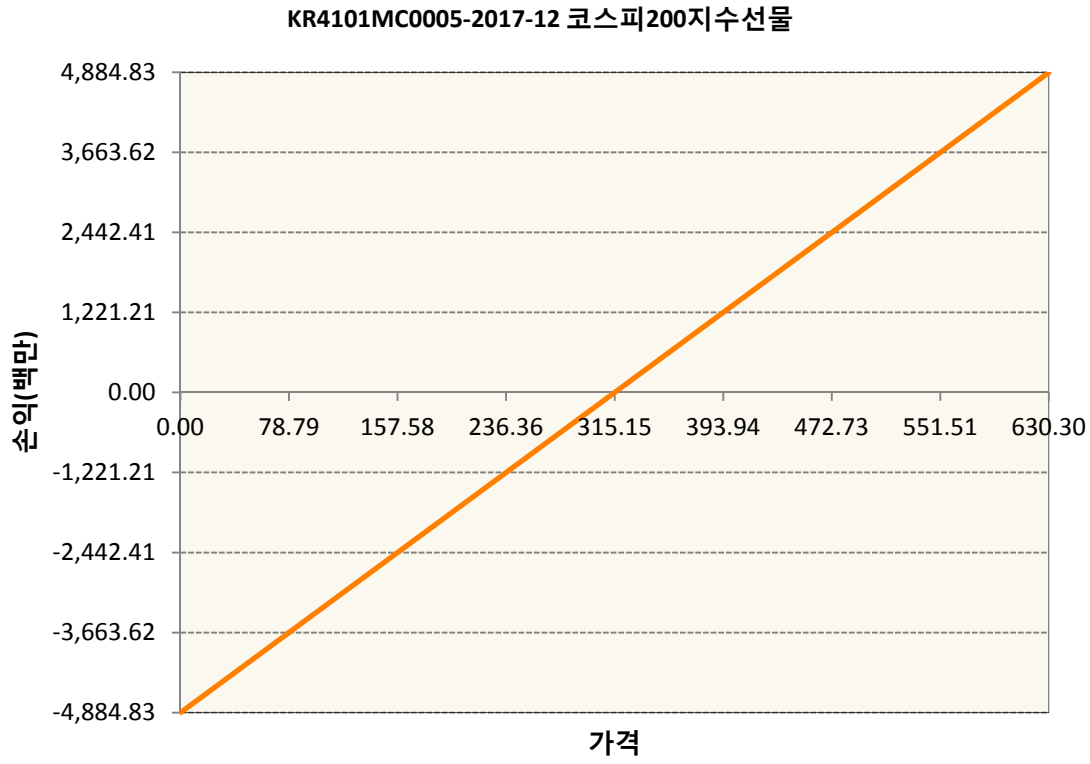
ETF스마트레버리지목표전환형7호

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	4,885	0	4,885	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101MC0 2017-12 코스피200지수선물							390
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-390	-390	-390	-390	-390	-390	-390
-5.33%	-260	-260	-260	-260	-260	-260	-260
-2.67%	-130	-130	-130	-130	-130	-130	-130
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	130	130	130	130	130	130	130
5.33%	260	260	260	260	260	260	260
8.00%	390	390	390	390	390	390	390

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

236

공시일	2017-09-27
기준일	2017-09-26

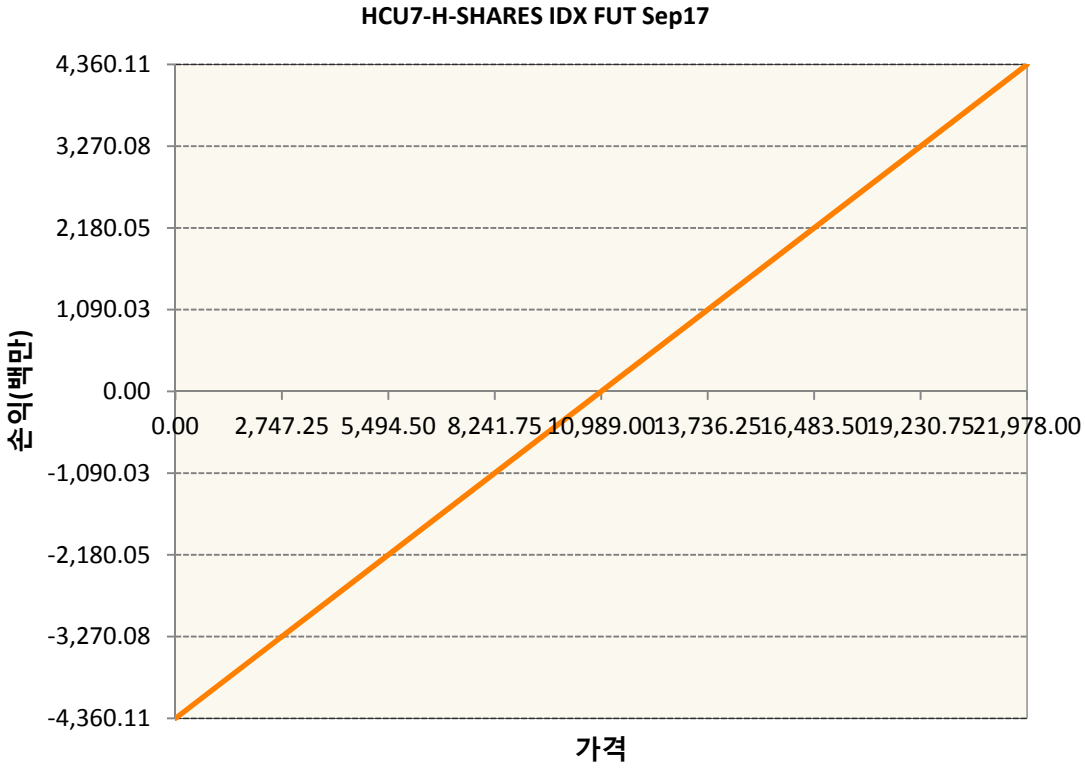
홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생

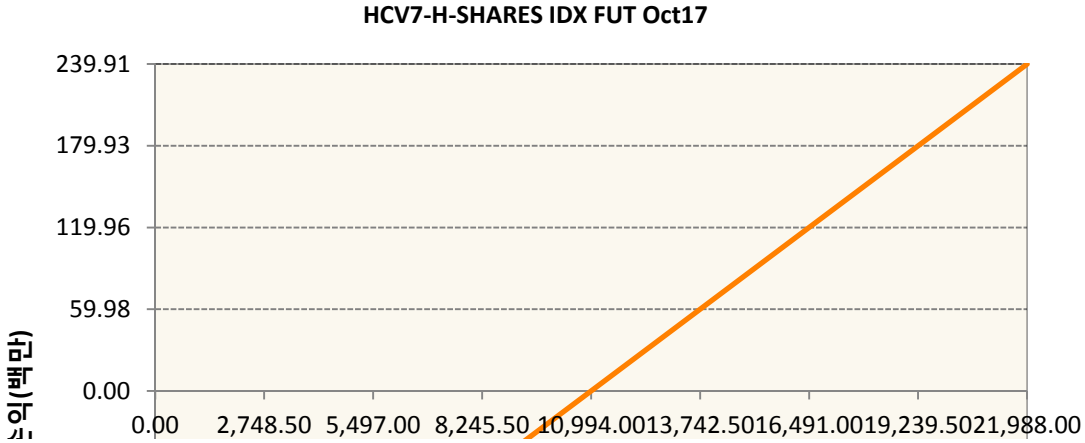
1. 계약금액

(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	4,600	0	4,600	장내
누계	유가증권	옵션	0	10,431	-10,431	장내

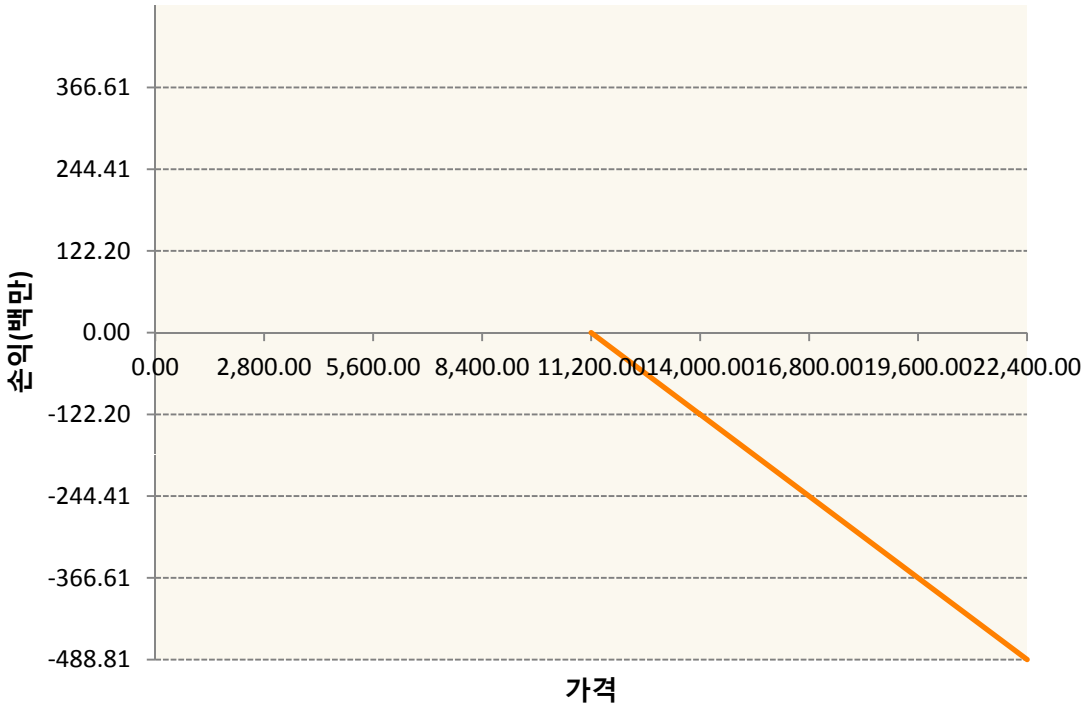
2. 만기시점의 손익구조



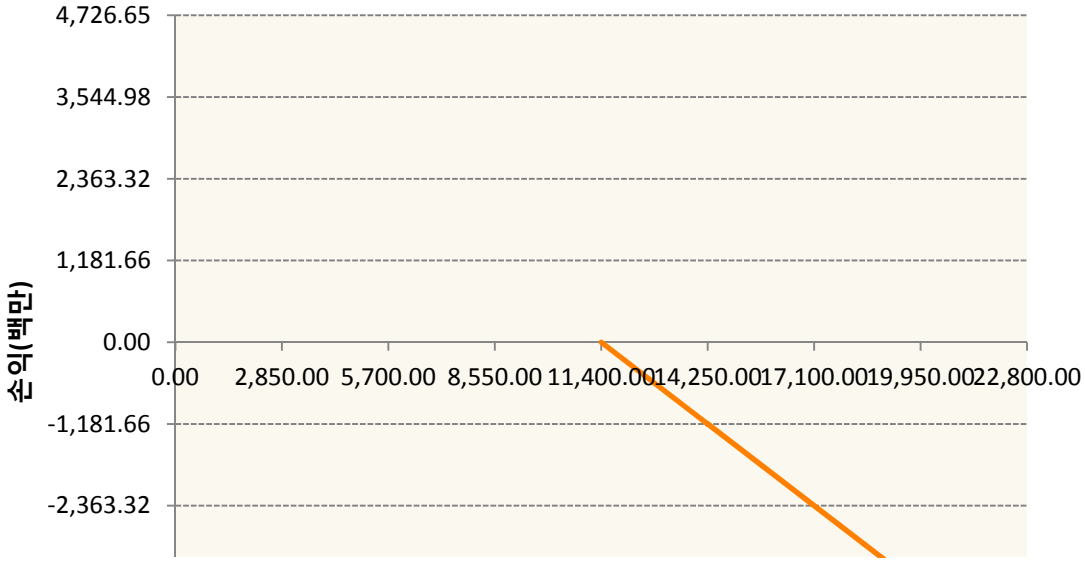


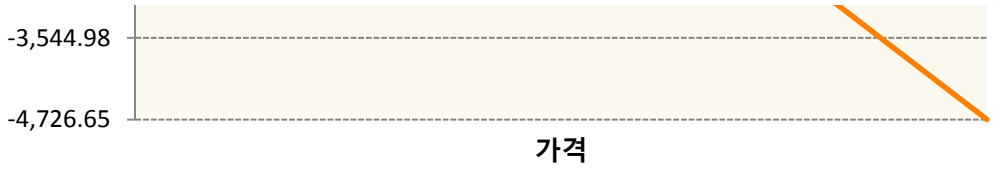


HSCEI9C112-OHHIU7-C112 Hong Kong Stock Exchange Han

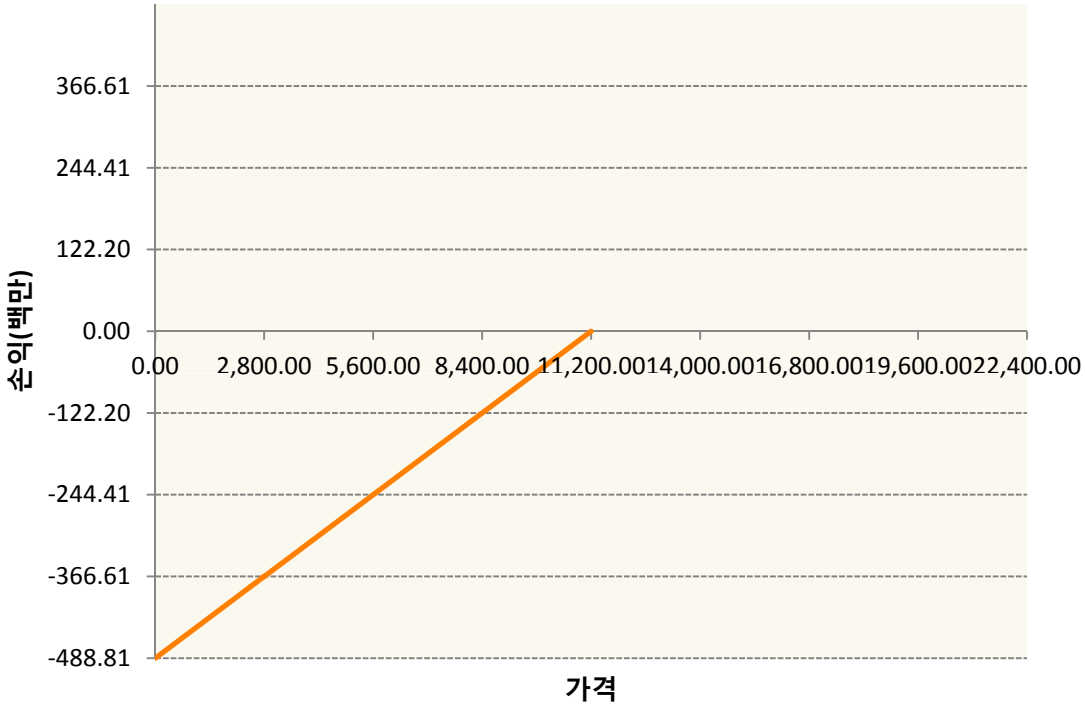


HSCEI9C114-OHHIU7-C114 Hong Kong Stock Exchange Han

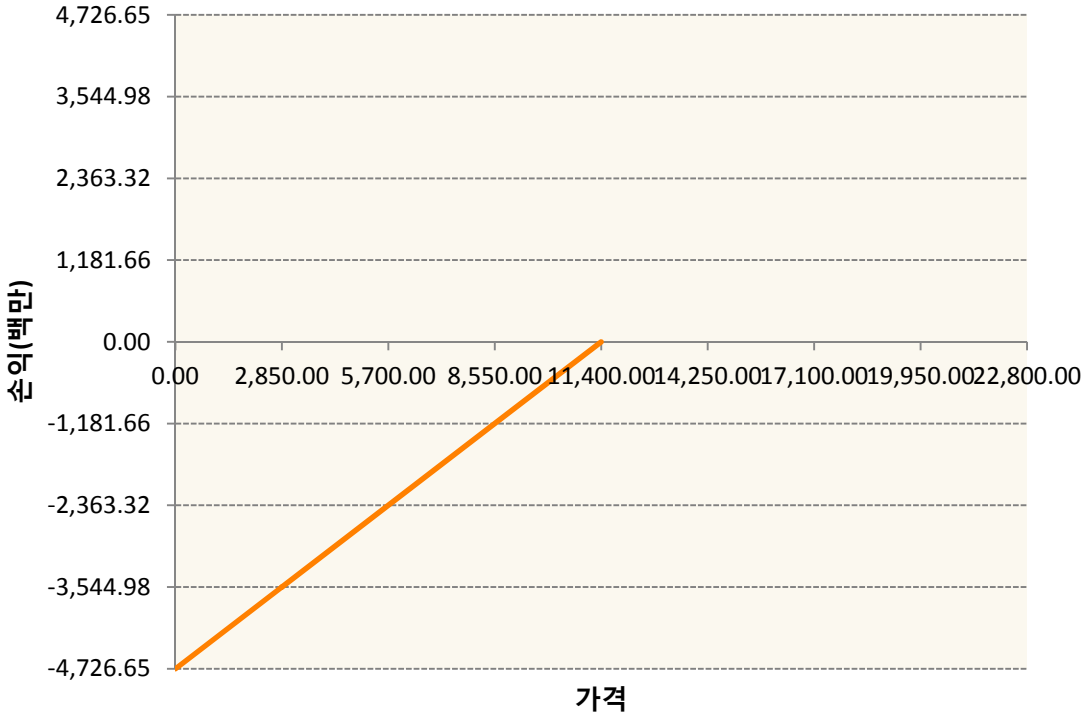




HSCEI9P112-OHHIU7-P112 Hong Kong Stock Exchange Han



HSCEI9P114-OHHIU7-P114 Hong Kong Stock Exchange Han



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

HCU7	H-SHARES IDX FUT Sep17	349
HCV7	H-SHARES IDX FUT Oct17	19
HSCEI9C112	OHHIU7-C112 Hong Kong Stock Exchange Han	39
HSCEI9C114	OHHIU7-C114 Hong Kong Stock Exchange Han	378
HSCEI9P112	OHHIU7-P112 Hong Kong Stock Exchange Han	39
HSCEI9P114	OHHIU7-P114 Hong Kong Stock Exchange Han	378

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

994

공시일	2017-09-27
기준일	2017-09-26

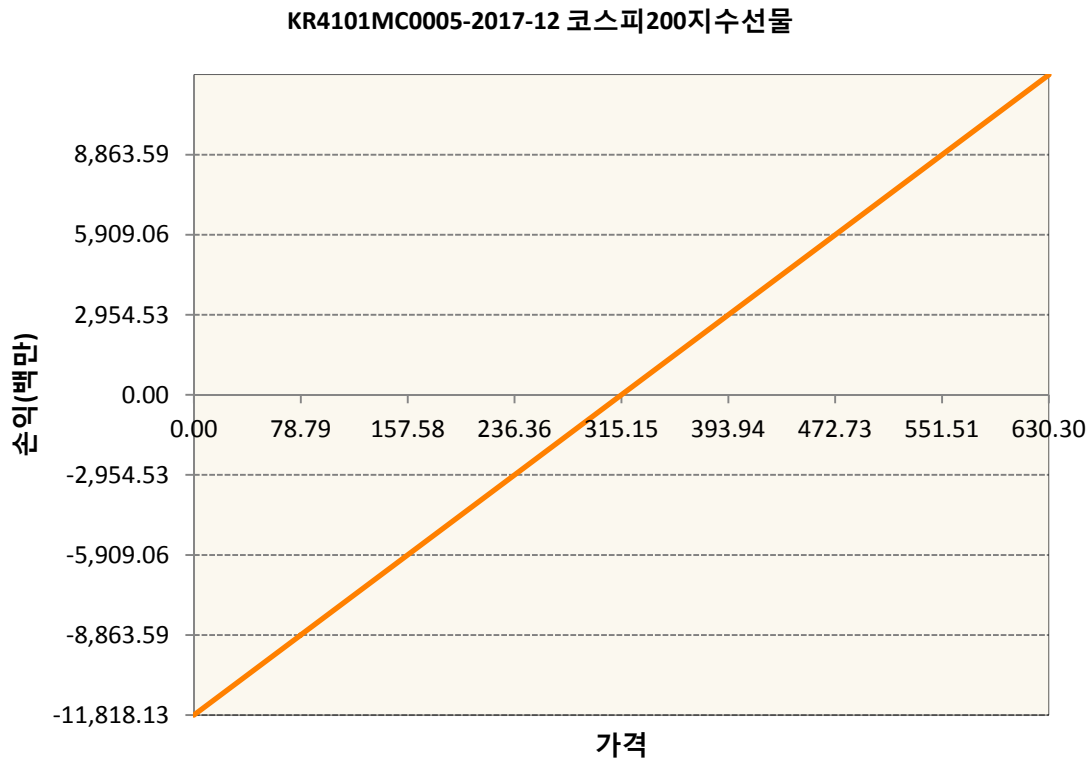
코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼

1. 계약금액

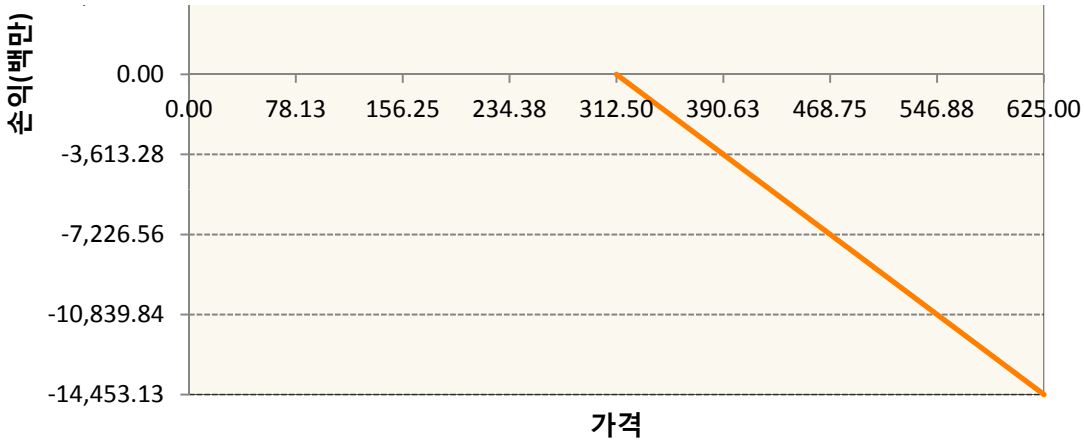
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	3,156	0	3,156	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	3,163	-3,163	장내
누계	유가증권	선물	11,818	0	11,818	장내
누계	유가증권	스왑	24,000	0	24,000	장외
누계	유가증권	옵션	0	25,781	-25,781	장내

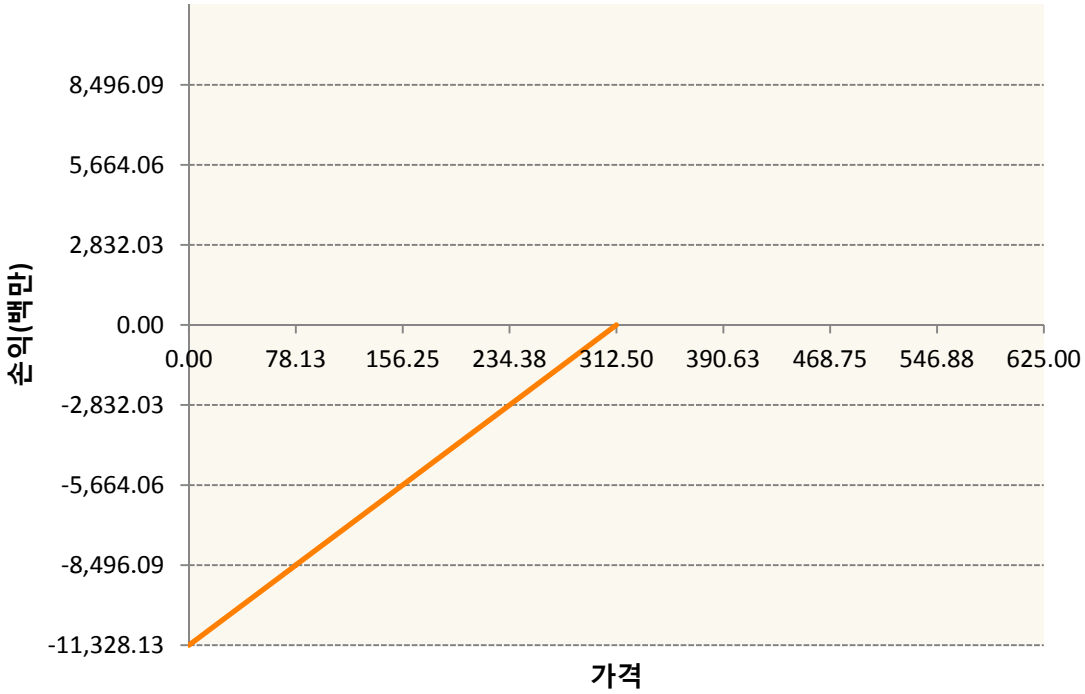
2. 만기시점의 손익구조







KR4301MA3124-2017-10 풋312.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_2							1,493
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,493	-1,493	-1,493	-1,493	-1,493	-1,493	-1,493
-5.33%	-996	-996	-996	-996	-996	-996	-996
-2.67%	-498	-498	-498	-498	-498	-498	-498
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	498	498	498	498	498	498	498
5.33%	996	996	996	996	996	996	996
8.00%	1,493	1,493	1,493	1,493	1,493	1,493	1,493

	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_3						283
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-283	-283	-283	-283	-283	-283	-283
-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%	283	283	283	283	283	283	283
	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					943
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-943	-943	-943	-943	-943	-943	-943
-5.33%	-629	-629	-629	-629	-629	-629	-629
-2.67%	-314	-314	-314	-314	-314	-314	-314
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	314	314	314	314	314	314	314
5.33%	629	629	629	629	629	629	629
8.00%	943	943	943	943	943	943	943
	KR4201MA3 2017-10 콜312.5						955
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	325	322	317	311	304	296	286
-5.33%	306	295	283	270	255	240	223
-2.67%	236	215	195	174	152	130	108
0%	71	47	24	0	-24	-47	-71
2.67%	-200	-217	-235	-254	-274	-295	-315
5.33%	-543	-551	-561	-573	-586	-600	-615
8.00%	-919	-922	-925	-931	-938	-946	-955
	KR4301MA3 2017-10 풋312.5						755
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-754	-754	-754	-754	-754	-755	-755

-5.33%	-451	-452	-453	-454	-457	-459	-462
-2.67%	-164	-170	-176	-183	-191	-199	-207
0%	30	20	10	0	-10	-20	-30
2.67%	86	83	79	74	69	63	57
5.33%	92	92	91	90	89	87	85
8.00%	92	92	92	92	92	91	91

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

4,384

공시일	2017-09-27
기준일	2017-09-26

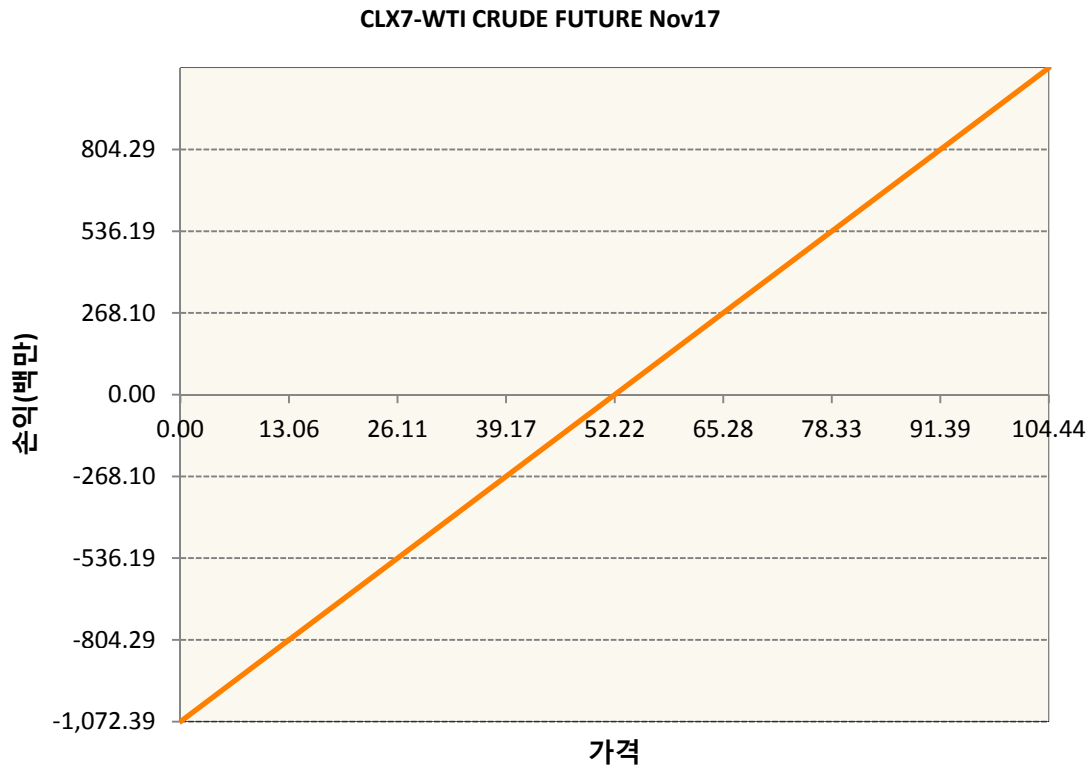
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

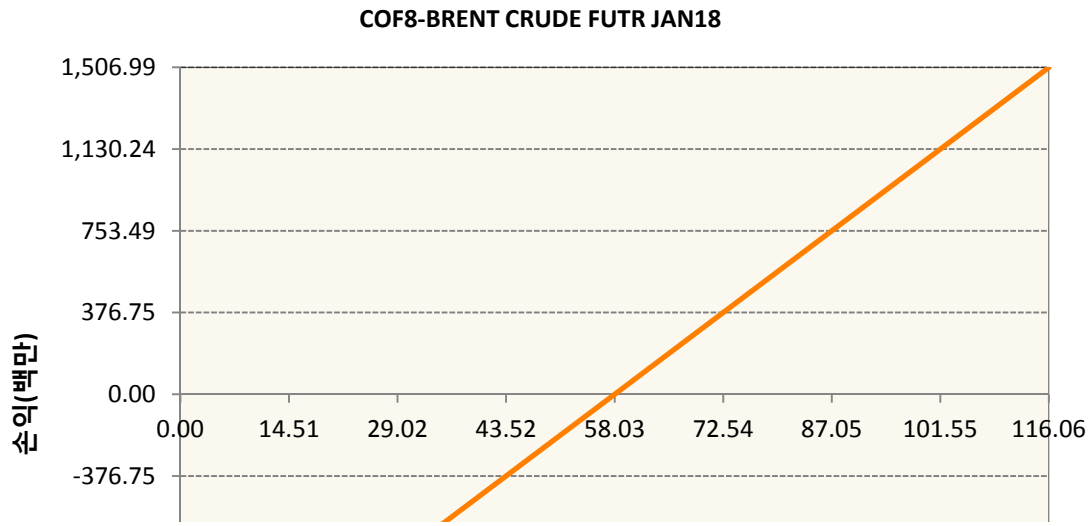
1. 계약금액

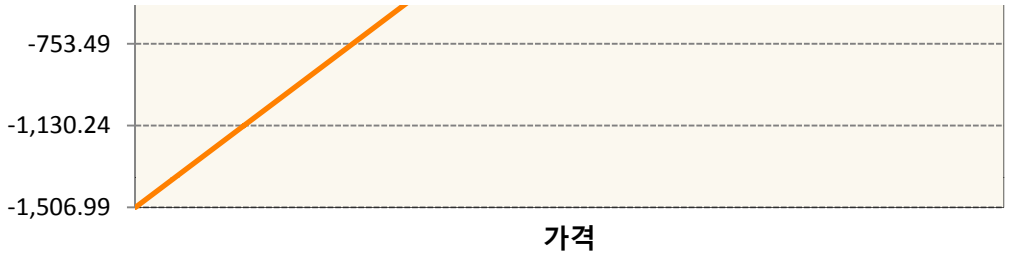
(단위:백만원)

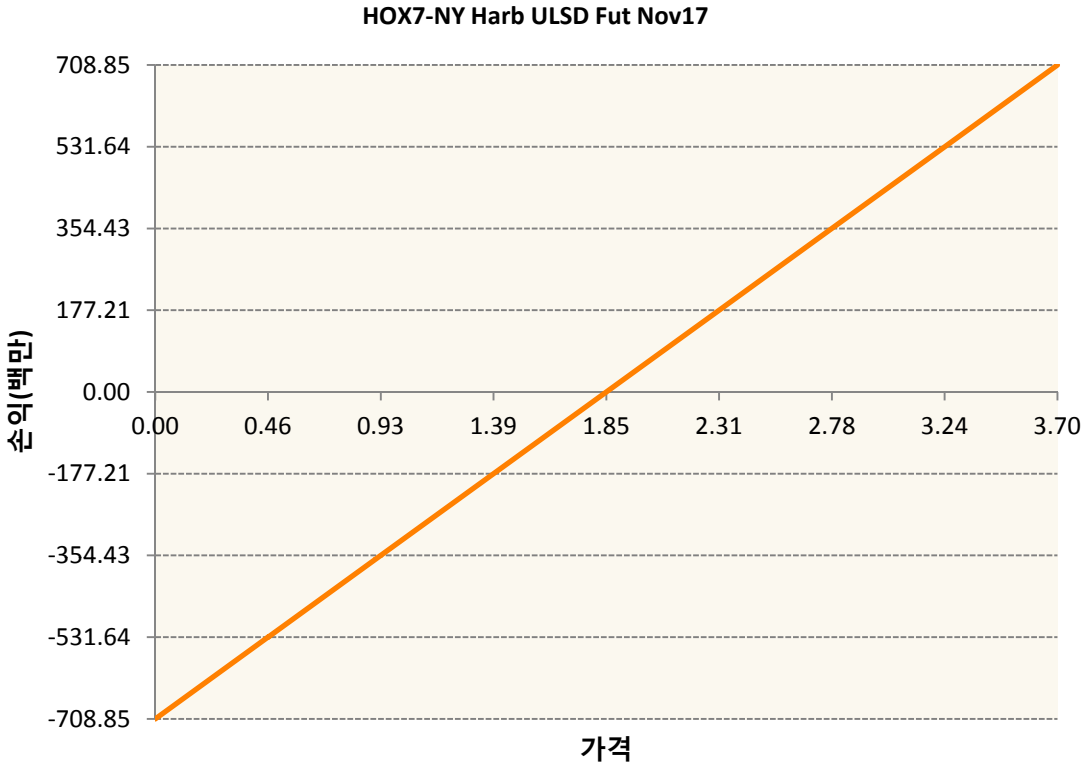
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	5,440	739	4,700	

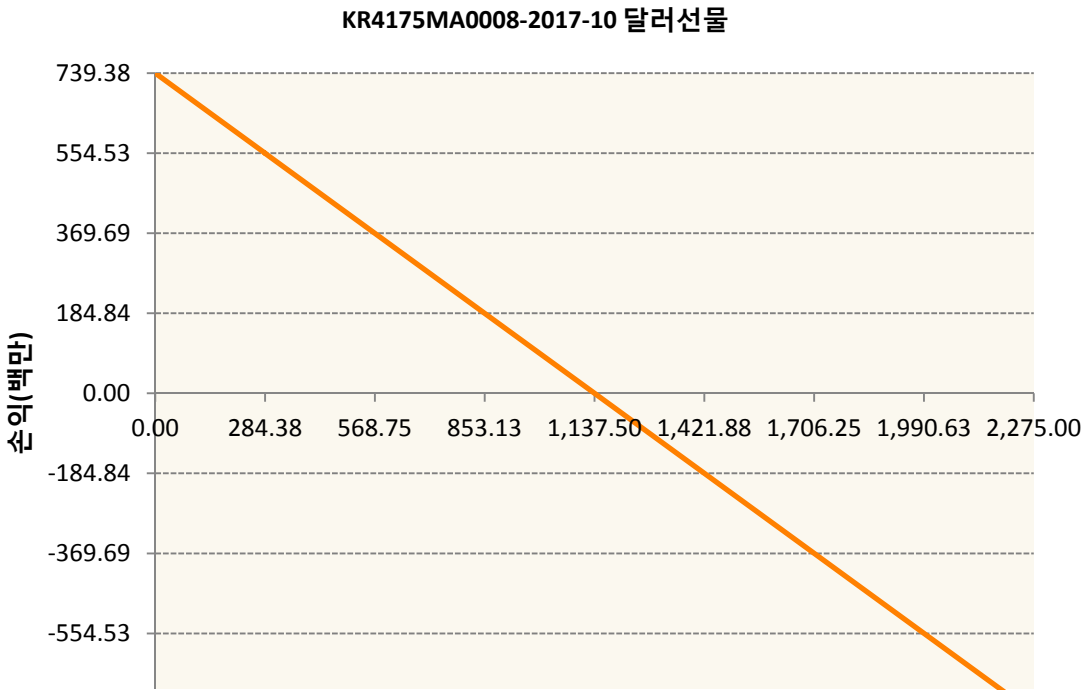
2. 만기시점의 손익구조

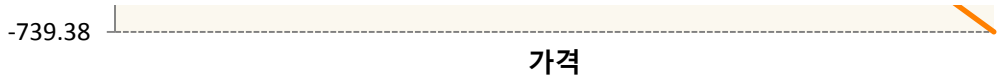


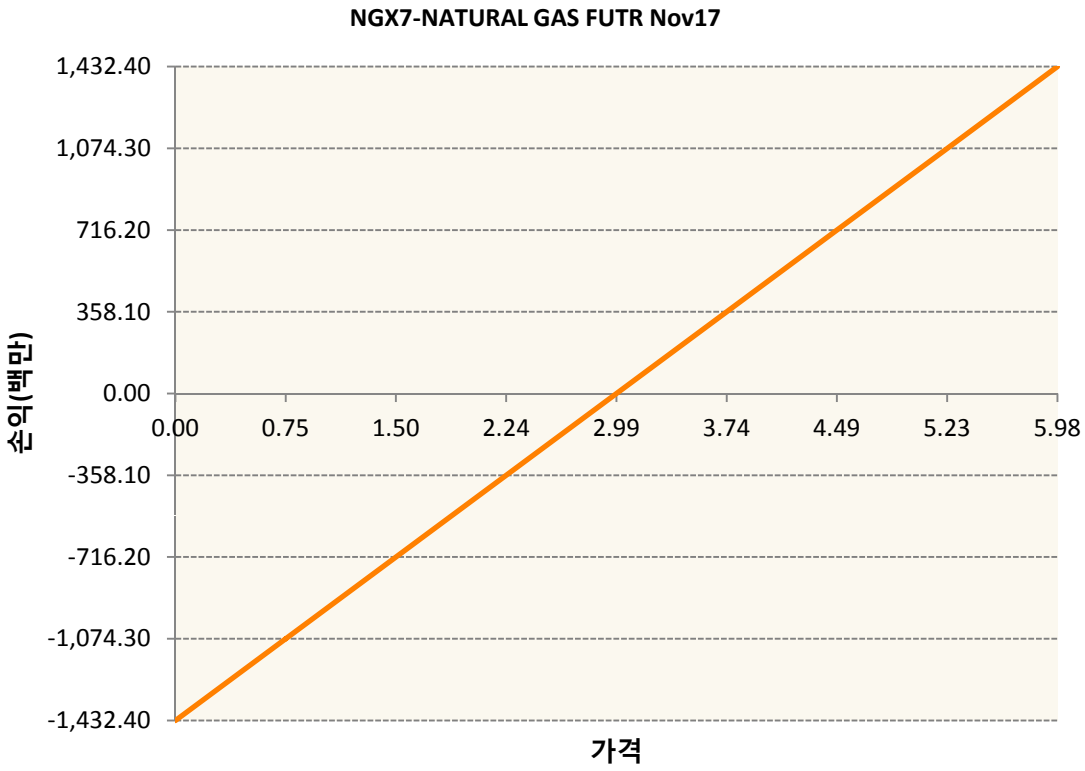


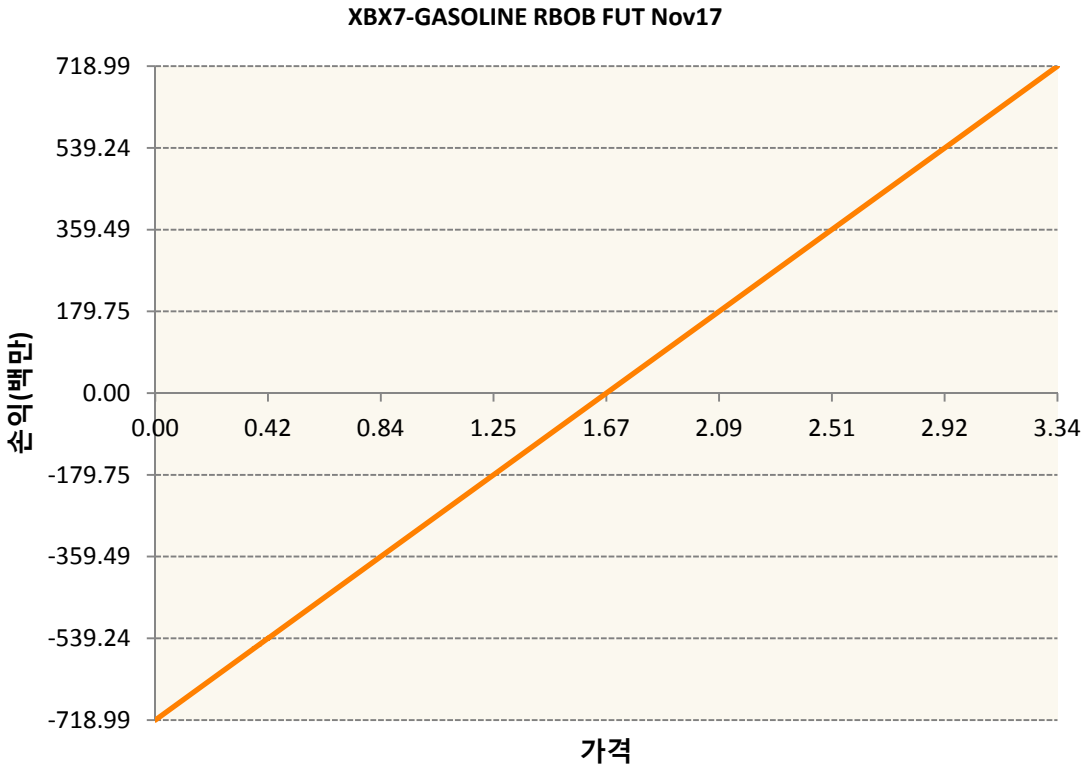

-753.49
-1,130.24
-1,506.99
가격


HOX7-NY Harb ULSD Fut Nov17
708.85
531.64
354.43
177.21
0.00
-177.21
-354.43
-531.64
-708.85
0.00
0.46
0.93
1.39
1.85
2.31
2.78
3.24
3.70
손익(백만)
가격


KR4175MA0008-2017-10 달러선물
739.38
554.53
369.69
184.84
0.00
-184.84
-369.69
-554.53
0.00
284.38
568.75
853.13
1,137.50
1,421.88
1,706.25
1,990.63
2,275.00
손익(백만)


-739.38
가격


NGX7-NATURAL GAS FUTR Nov17
1,432.40
1,074.30
716.20
358.10
0.00
-358.10
-716.20
-1,074.30
-1,432.40
0.00
0.75
1.50
2.24
2.99
3.74
4.49
5.23
5.98
손익(백만)
가격


XBX7-GASOLINE RBOB FUT Nov17
718.99
539.24
359.49
179.75
0.00
-179.75
-359.49
-539.24
-718.99
0.00
0.42
0.84
1.25
1.67
2.09
2.51
2.92
3.34
손익(백만)
가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLX7	WTI CRUDE FUTURE Nov17	86
COF8	BRENT CRUDE FUTR JAN18	121
HOX7	NY Harb ULSD Fut Nov17	57
KR4175MA0	2017-10 달러선물	59
NGX7	NATURAL GAS FUTR Nov17	115
XBX7	GASOLINE RBOB FUT Nov17	58

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

782

공시일	2017-09-27
기준일	2017-09-26

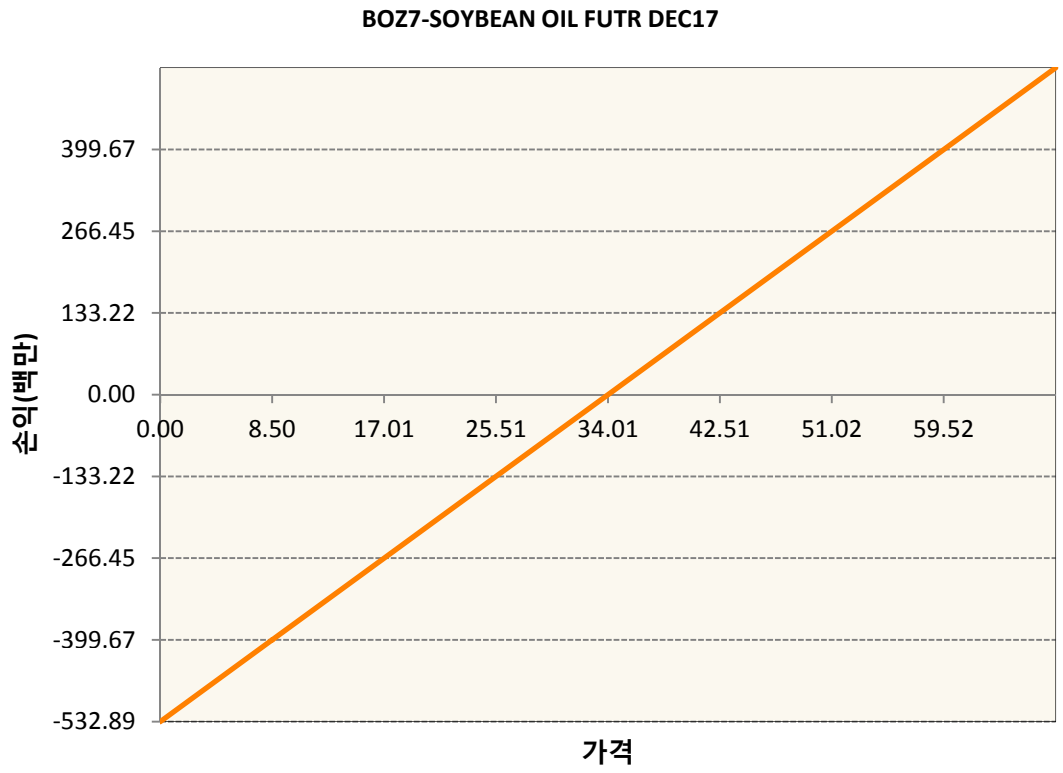
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

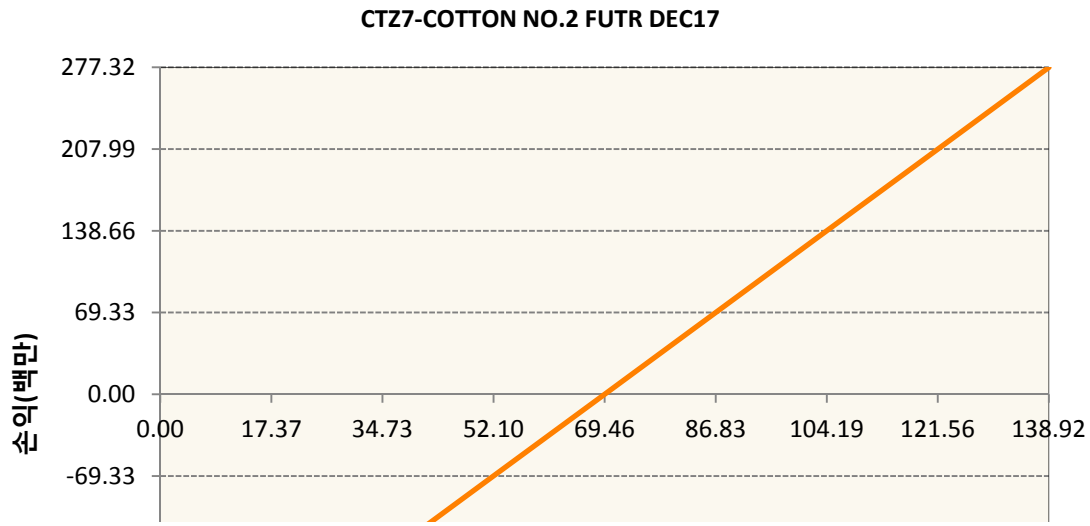
1. 계약금액

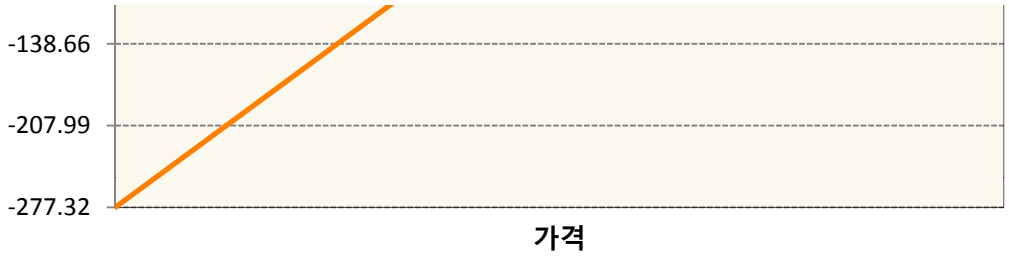
(단위:백만원)

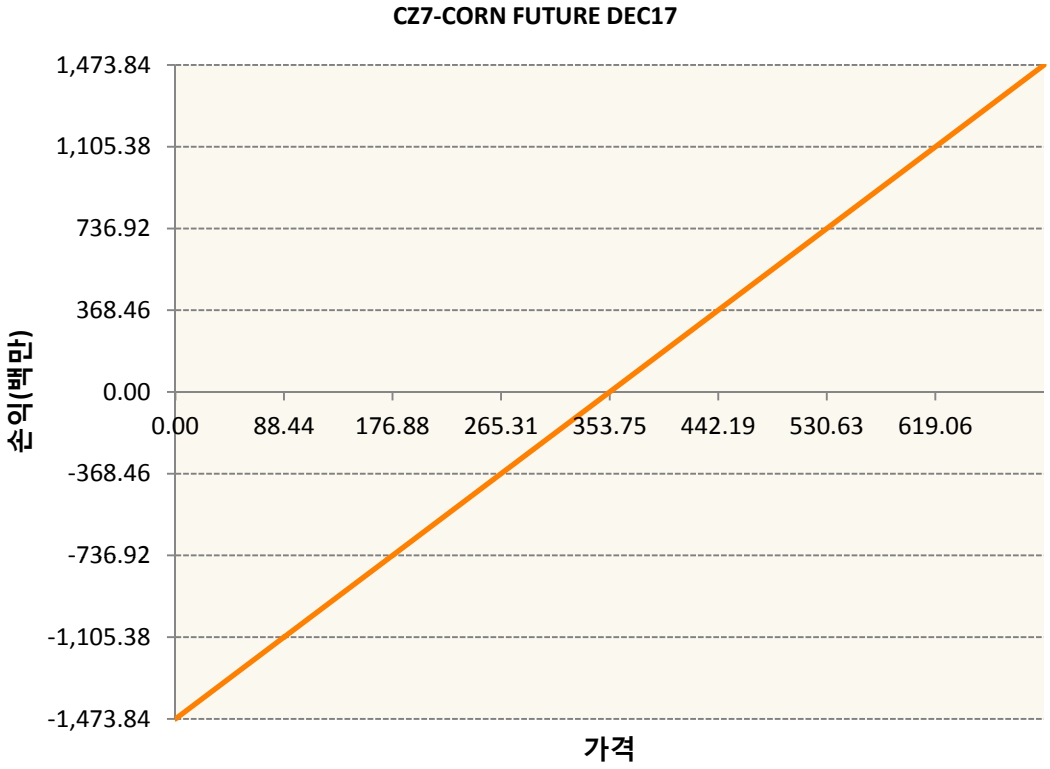
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	5,823	341	5,482	

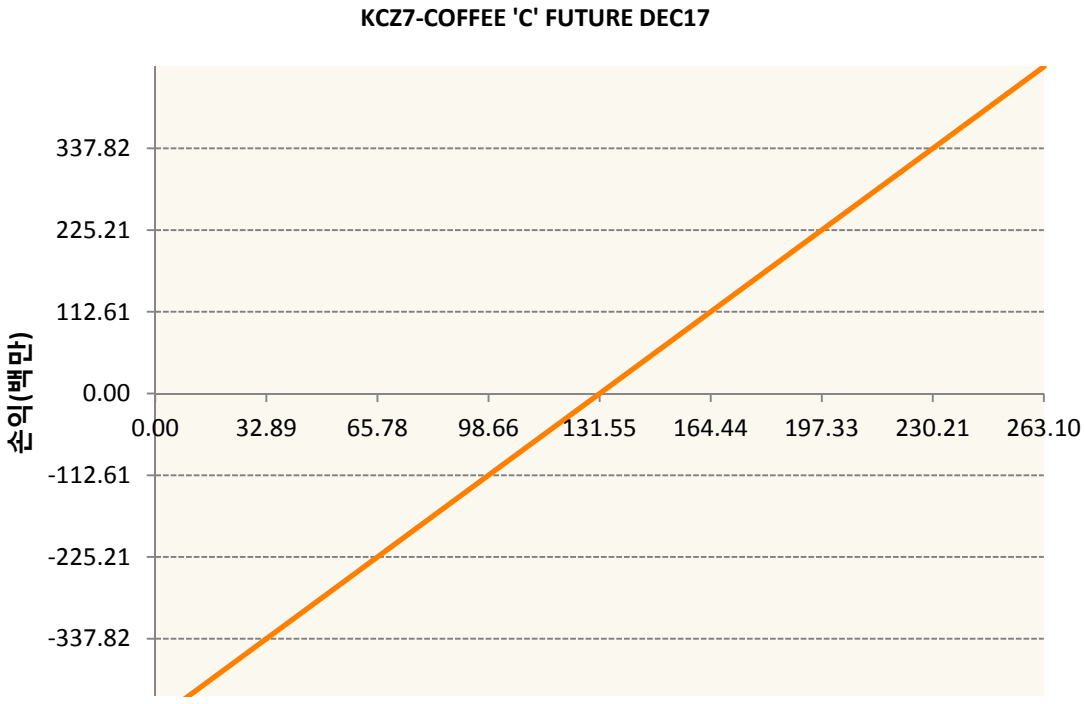
2. 만기시점의 손익구조

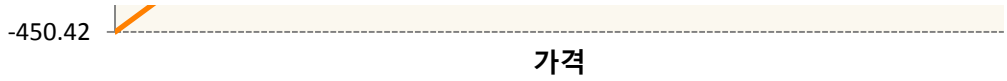


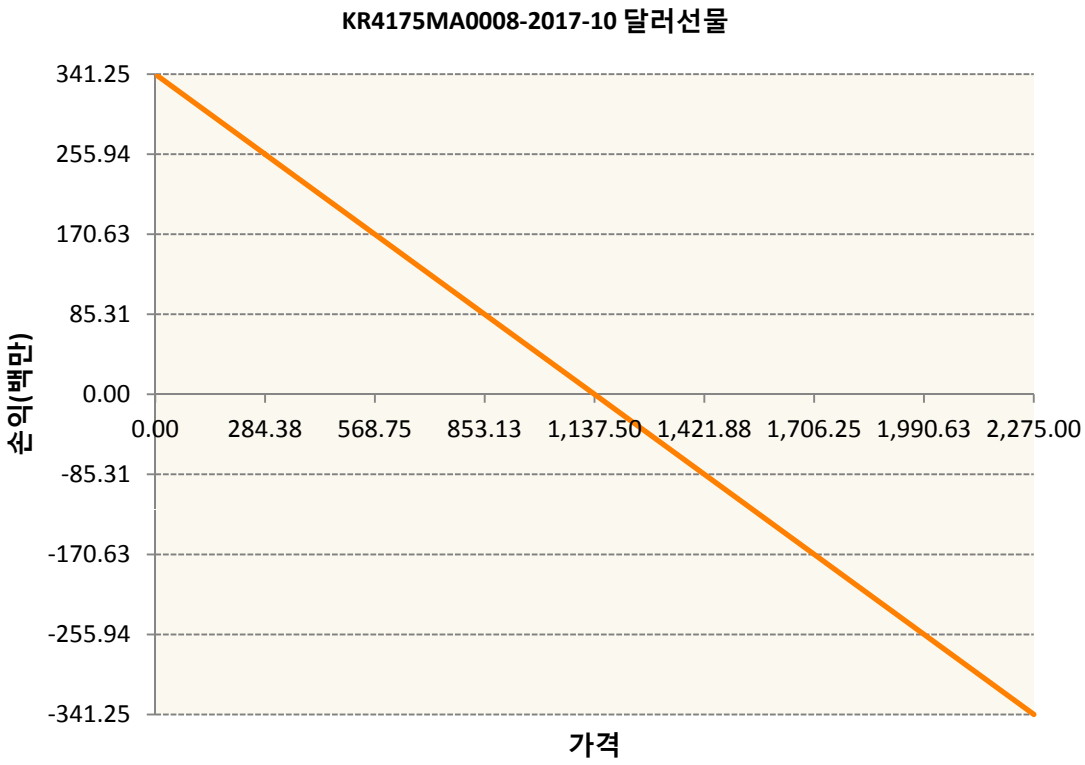


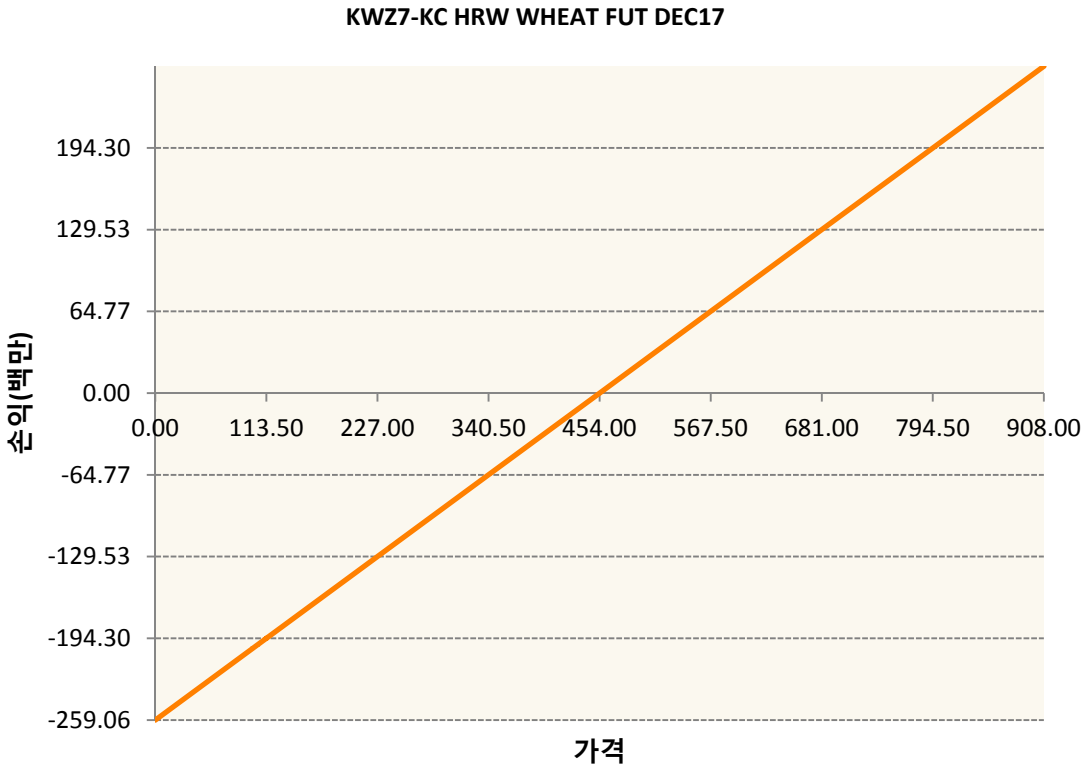

-138.66
-207.99
-277.32
가격


CZ7-CORN FUTURE DEC17
1,473.84
1,105.38
736.92
368.46
0.00
-368.46
-736.92
-1,105.38
-1,473.84
0.00
88.44
176.88
265.31
353.75
442.19
530.63
619.06
손익(백만)
가격

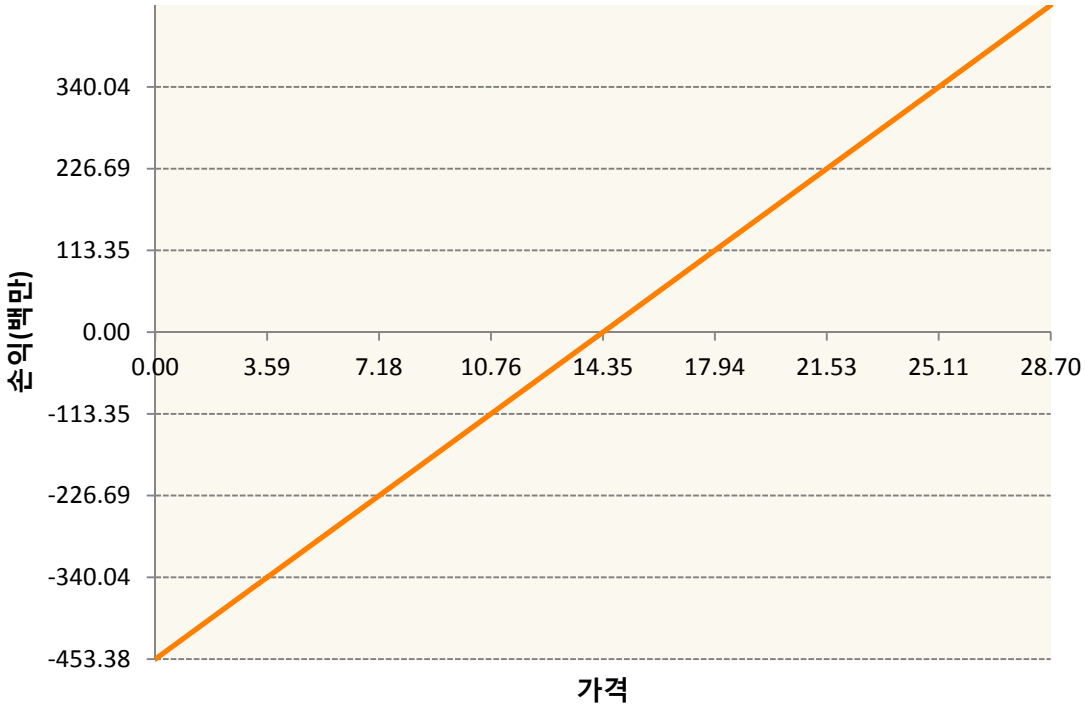

KCZ7-COFFEE 'C' FUTURE DEC17
337.82
225.21
112.61
0.00
-112.61
-225.21
-337.82
0.00
32.89
65.78
98.66
131.55
164.44
197.33
230.21
263.10
손익(백만)


-450.42
가격

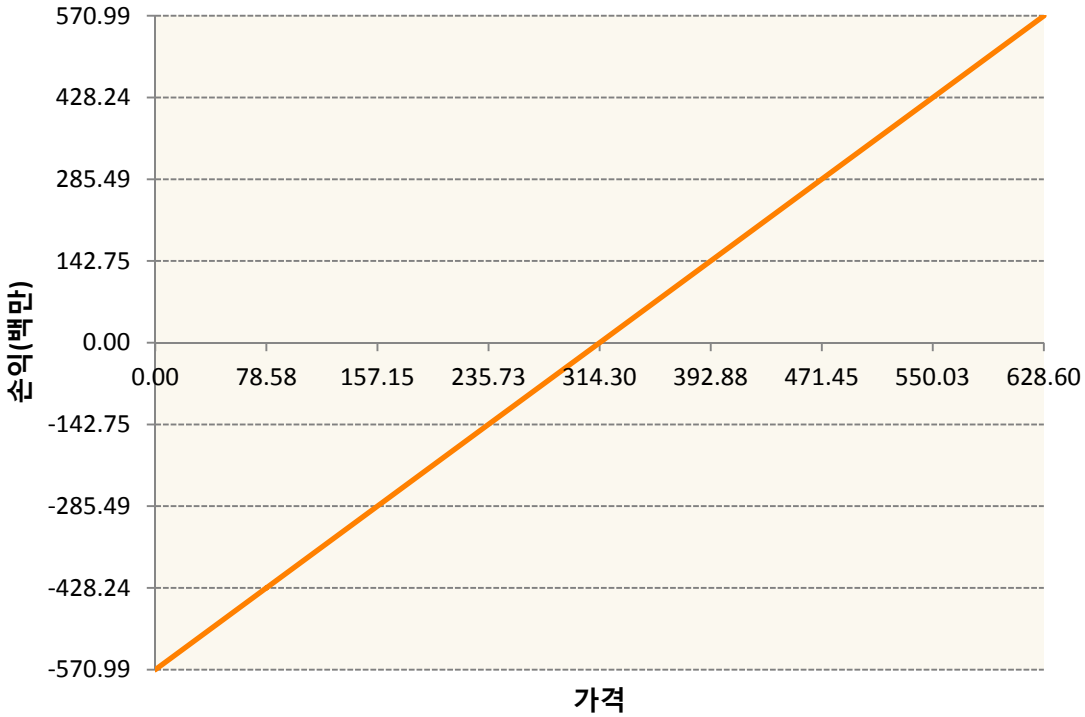

KR4175MA0008-2017-10 달러선물
341.25
255.94
170.63
85.31
0.00
-85.31
-170.63
-255.94
-341.25
0.00
284.38
568.75
853.13
1,137.50
1,421.88
1,706.25
1,990.63
2,275.00
손익(백만)
가격


KWZ7-KC HRW WHEAT FUT DEC17
194.30
129.53
64.77
0.00
-64.77
-129.53
-194.30
-259.06
0.00
113.50
227.00
340.50
454.00
567.50
681.00
794.50
908.00
손익(백만)
가격

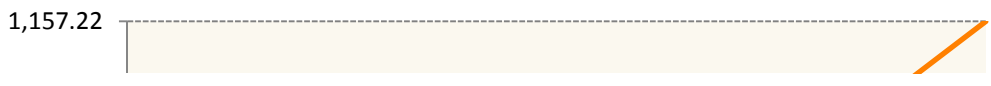
SBH8-Sugar #11 (WORLD) MAR18

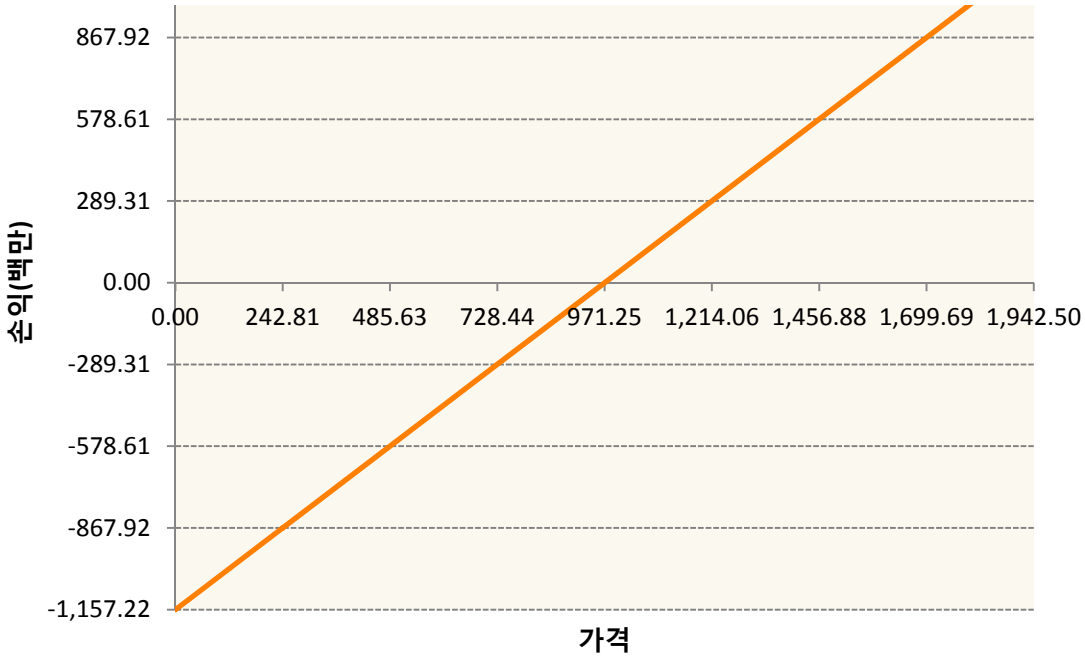


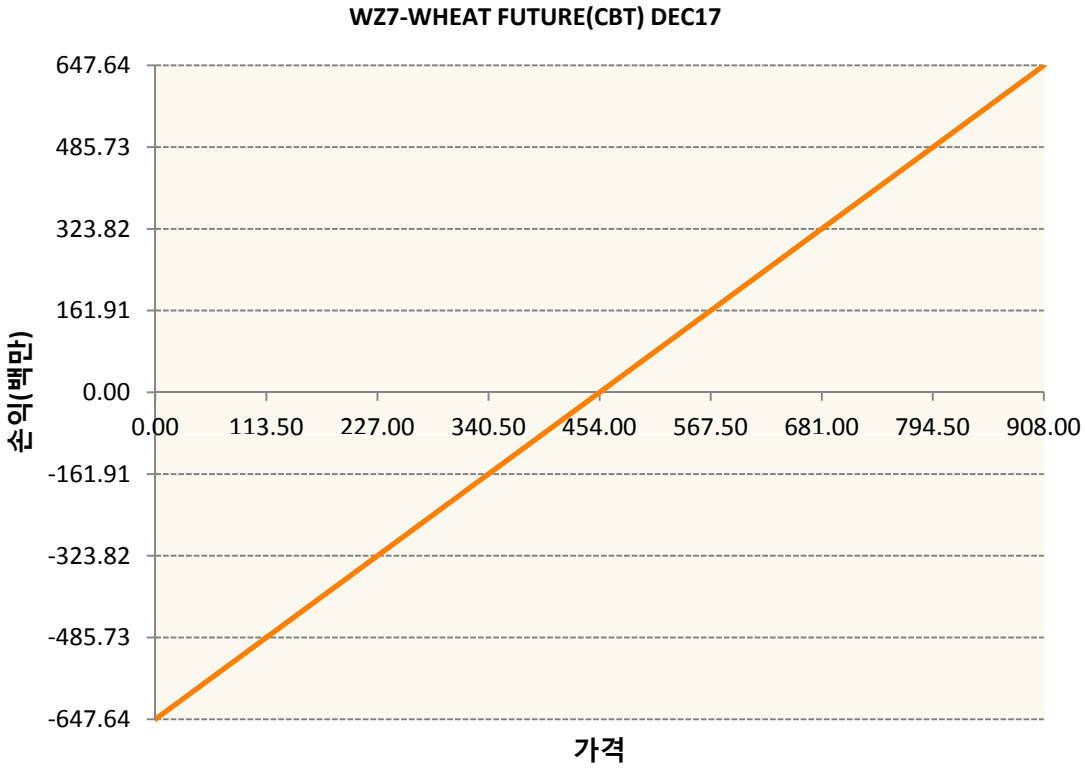
SMZ7-SOYBEAN MEAL FUTR DEC17



SX7-SOYBEAN FUTURE NOV17







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
BOZ7	SOYBEAN OIL FUTR DEC17	43
CTZ7	COTTON NO.2 FUTR DEC17	22
CZ7	CORN FUTURE DEC17	118
KCZ7	COFFEE 'C' FUTURE DEC17	36
KR4175MA0	2017-10 달러선물	27

KWZ7	KC HRW WHEAT FUT DEC17	21
SBH8	Sugar #11 (WORLD) MAR18	36
SMZ7	SOYBEAN MEAL FUTR DEC17	46
SX7	SOYBEAN FUTURE NOV17	93
WZ7	WHEAT FUTURE(CBT) DEC17	52

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

542