공시일	2017-09-28
기준일	2017-09-27

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	2017-09-28
기준일	2017-09-27

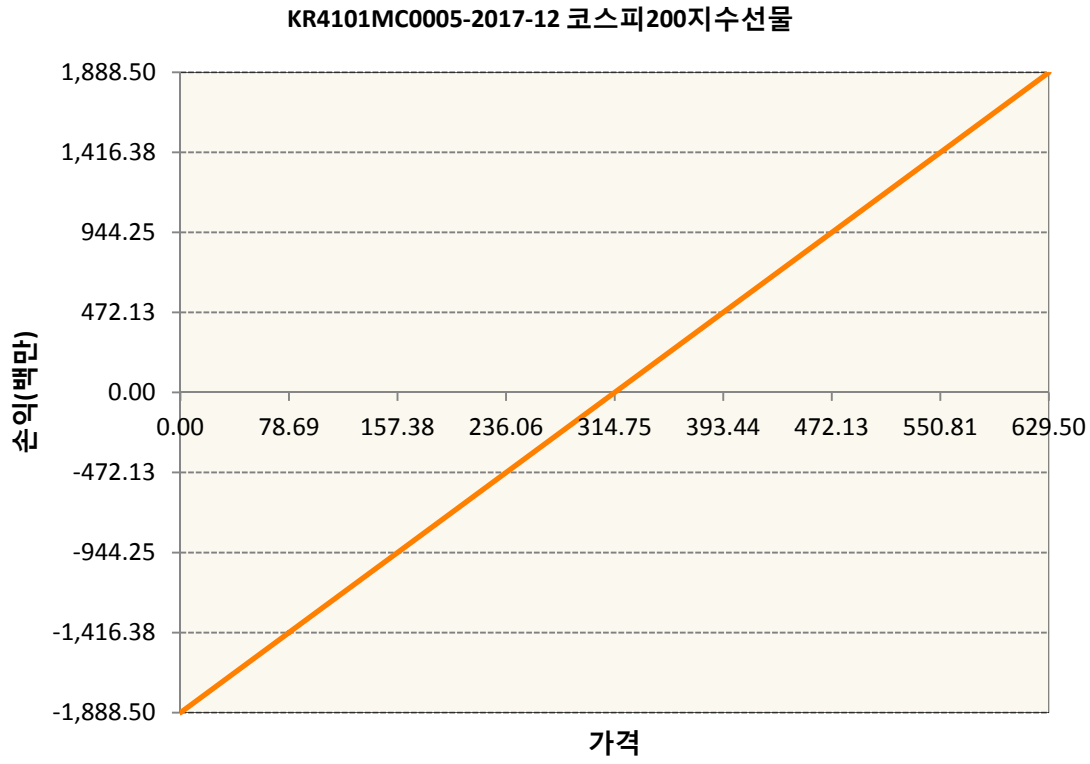
스마트인덱스모

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	1,889	0	1,889	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%	-100	-100	-100	-100	-100	-100	-100
-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%	100	100	100	100	100	100	100
8.00%	151	151	151	151	151	151	151

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

91

공시일	2017-09-28
기준일	2017-09-27

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	1,036

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

462

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-09-28
기준일	2017-09-27

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	419

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

357

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-09-28
기준일	2017-09-27

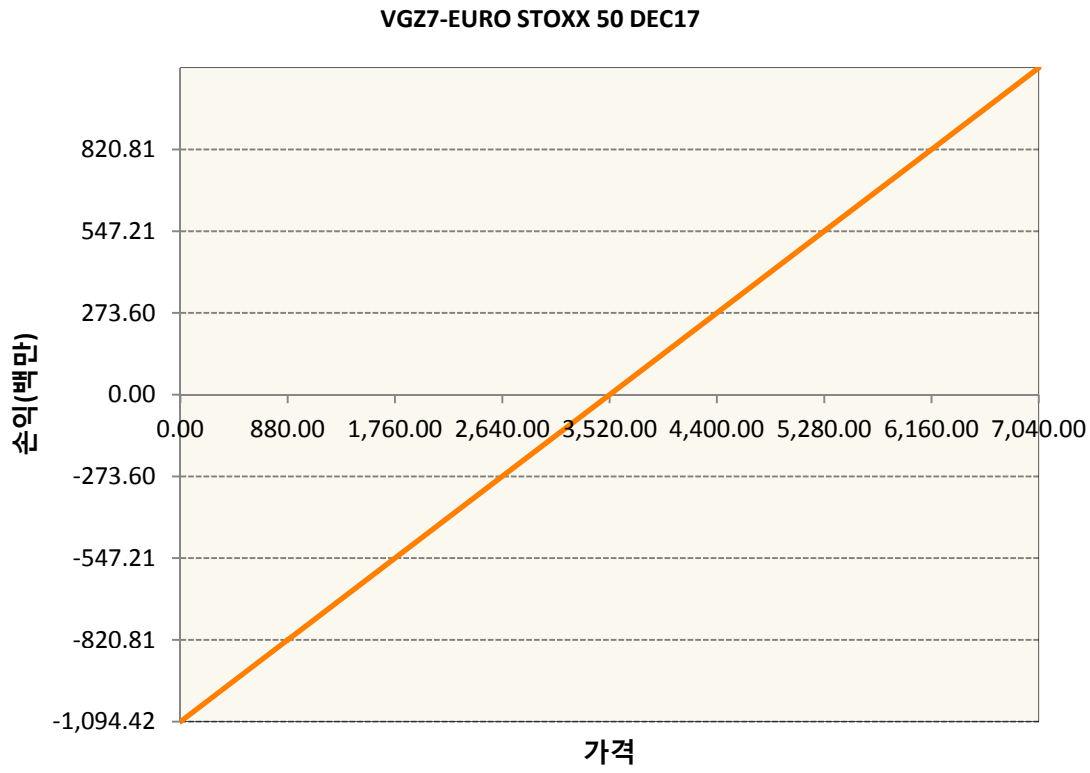
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

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

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	2017-09-28
기준일	2017-09-27

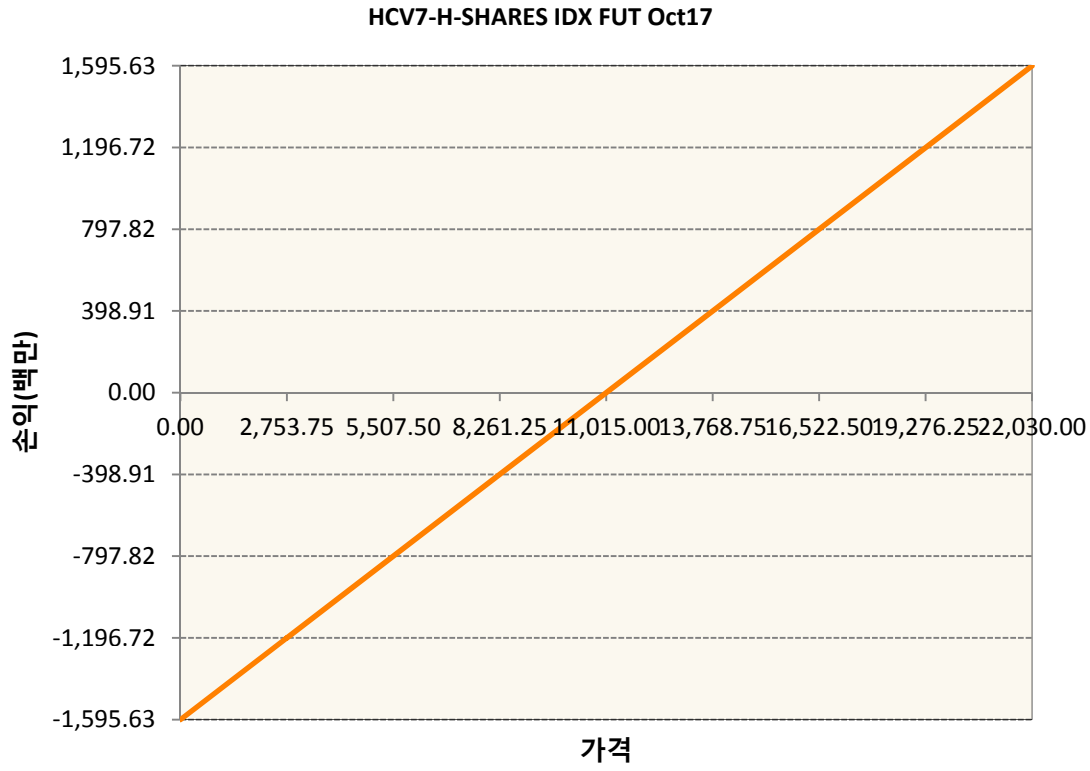
차이나인덱스모(주식-파생형)

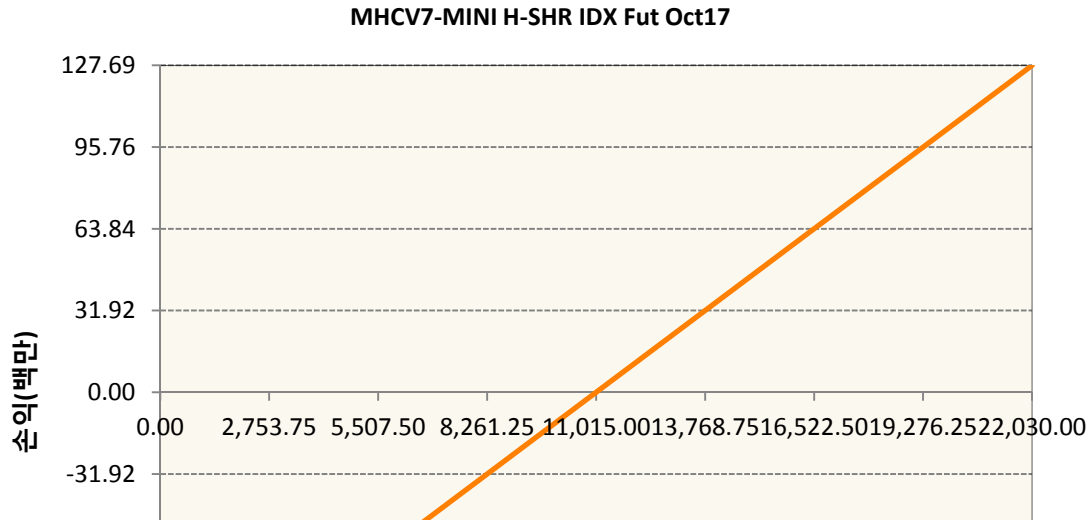
1. 계약금액

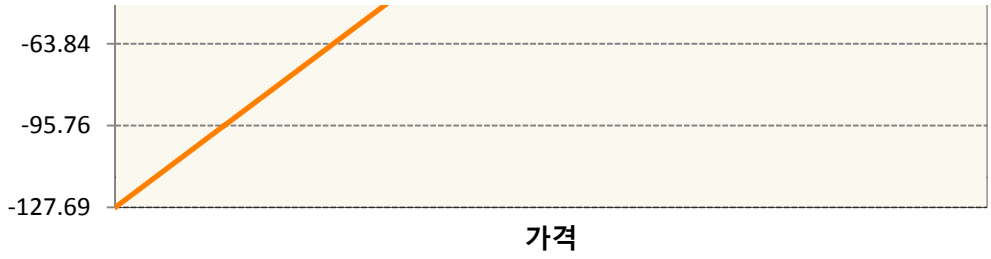
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,723	0	1,723	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCV7	H-SHARES IDX FUT Oct17	128
MHCV7	MINI H-SHR IDX Fut Oct17	10

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

공시일	2017-09-28
기준일	2017-09-27

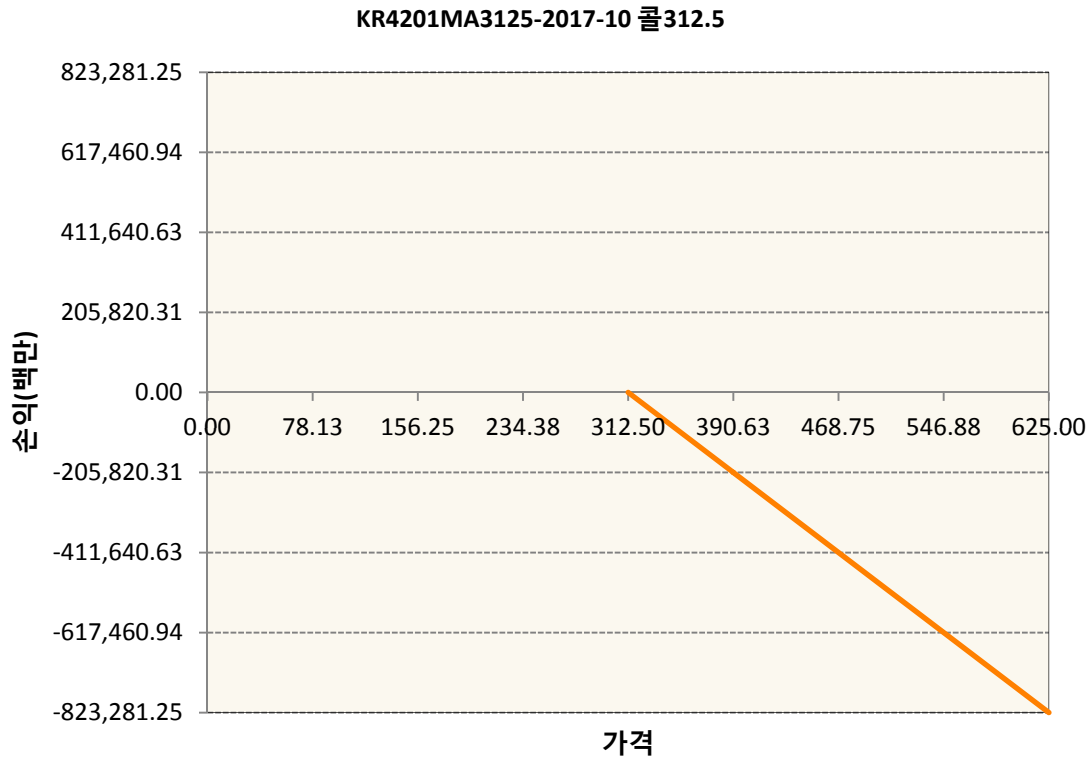
커버드콜모(주식혼합-파생형)

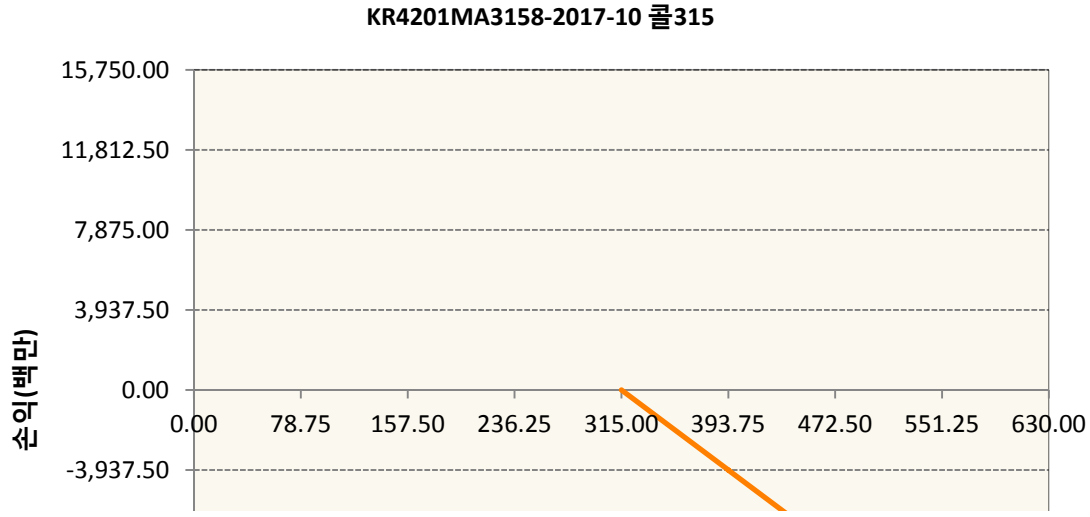
1. 계약금액

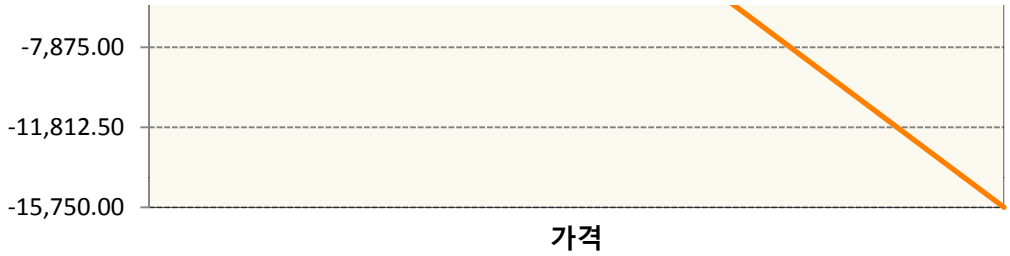
(단위:백만원)

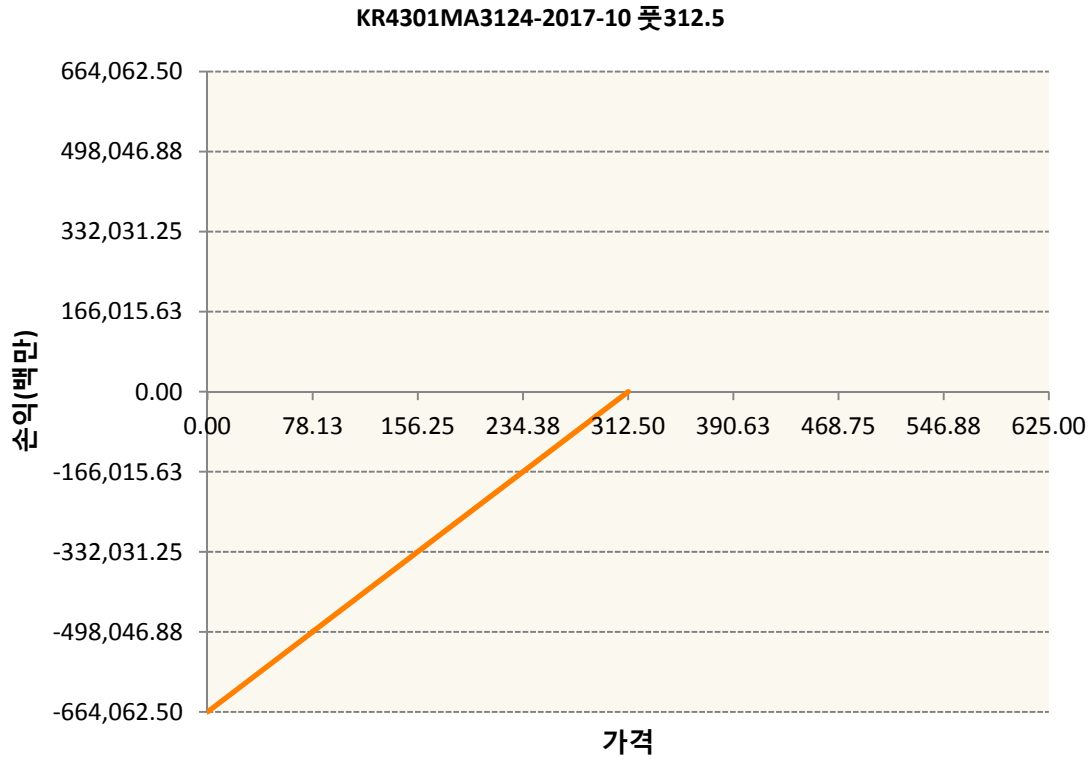
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	1,503,094	-1,503,094	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201MA3 2017-10 콜312.5							54,249
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	17,134	17,006	16,813	16,550	16,216	15,814	15,348
-5.33%	16,297	15,801	15,214	14,548	13,815	13,023	12,182
-2.67%	12,782	11,730	10,641	9,525	8,386	7,229	6,058
0%	3,840	2,562	1,281	0	-1,282	-2,565	-3,848
2.67%	-11,405	-12,335	-13,323	-14,359	-15,432	-16,535	-17,662
5.33%	-31,002	-31,423	-31,941	-32,547	-33,229	-33,979	-34,788
8.00%	-52,444	-52,567	-52,758	-53,021	-53,358	-53,768	-54,249
KR4201MA3 2017-10 콜315							979
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	265	263	261	257	252	246	239

-5.33%	255	248	240	229	218	205	191
-2.67%	208	191	173	154	134	114	93
0%	73	49	24	0	-24	-49	-73
2.67%	-182	-203	-224	-246	-268	-291	-314
5.33%	-534	-545	-557	-572	-587	-604	-621
8.00%	-934	-937	-943	-949	-958	-968	-979
KR4301MA3 2017-10 풋312.5							45,056

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-45,011	-45,011	-45,012	-45,016	-45,022	-45,035	-45,056
-5.33%	-27,255	-27,280	-27,324	-27,391	-27,483	-27,602	-27,748
-2.67%	-10,197	-10,495	-10,829	-11,193	-11,581	-11,991	-12,418
0%	1,671	1,116	559	0	-560	-1,121	-1,683
2.67%	5,182	4,997	4,769	4,504	4,205	3,877	3,523
5.33%	5,486	5,473	5,447	5,404	5,340	5,253	5,140
8.00%	5,492	5,492	5,491	5,489	5,483	5,471	5,452

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

111,633

공시일	2017-09-28
기준일	2017-09-27

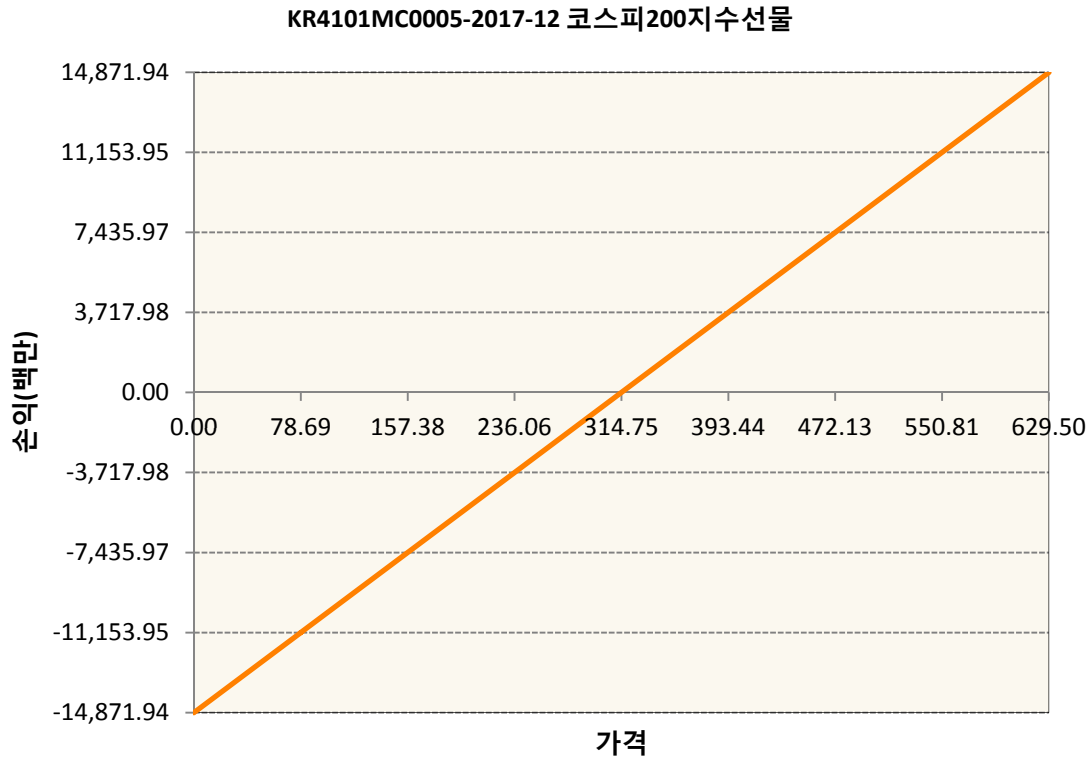
ETF스마트레버리지목표전환형6호

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	14,872	0	14,872	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101MC0	2017-12 코스피200지수선물						1,186
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,186	-1,186	-1,186	-1,186	-1,186	-1,186	-1,186
-5.33%	-791	-791	-791	-791	-791	-791	-791
-2.67%	-395	-395	-395	-395	-395	-395	-395
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	395	395	395	395	395	395	395
5.33%	791	791	791	791	791	791	791
8.00%	1,186	1,186	1,186	1,186	1,186	1,186	1,186

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

718

공시일	2017-09-28
기준일	2017-09-27

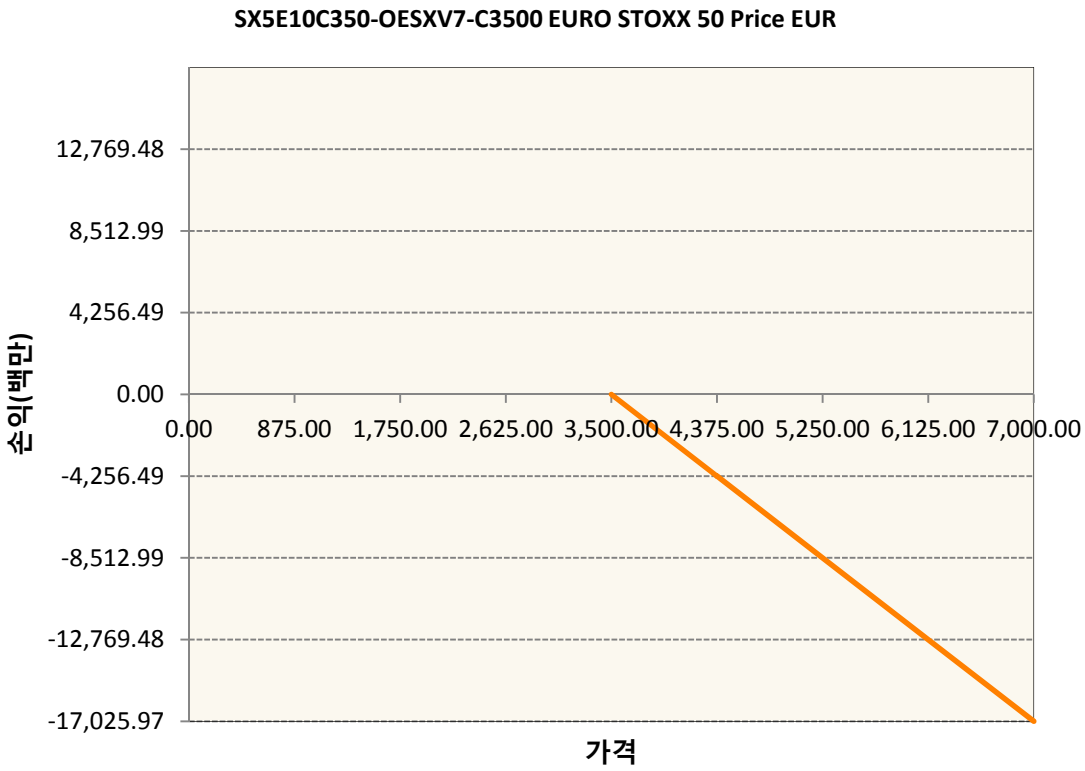
유로커버드콜(주식혼합-파생형)

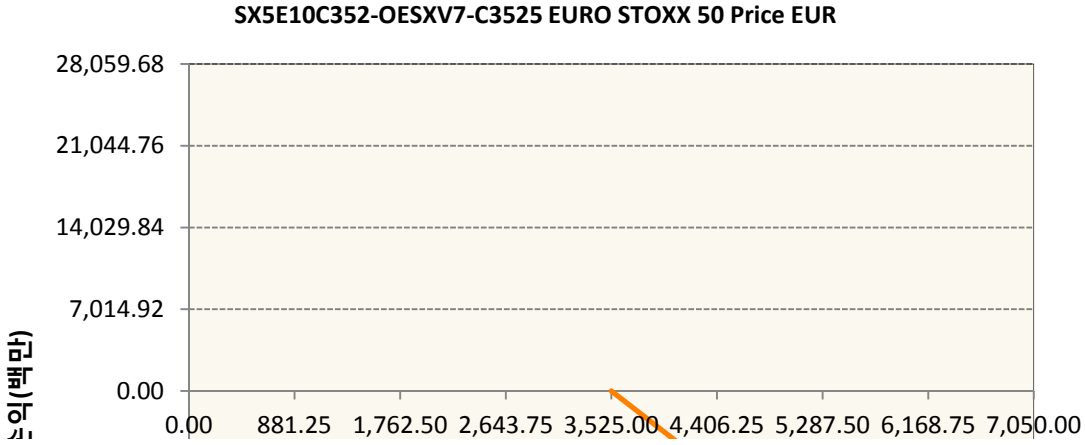
1. 계약금액

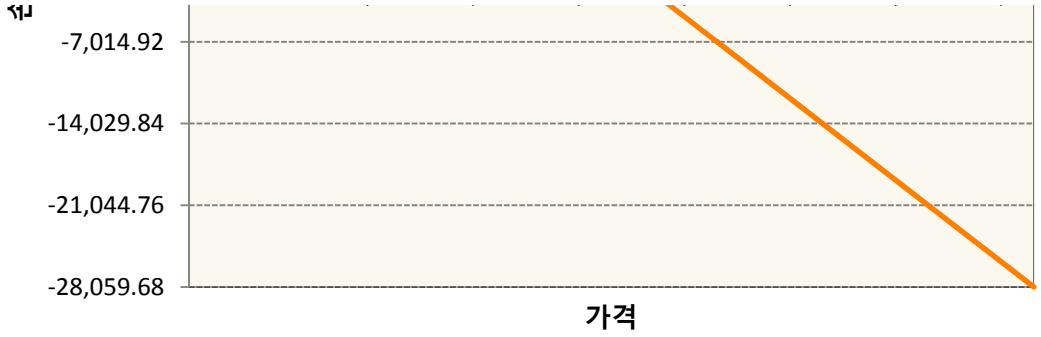
(단위:백만원)

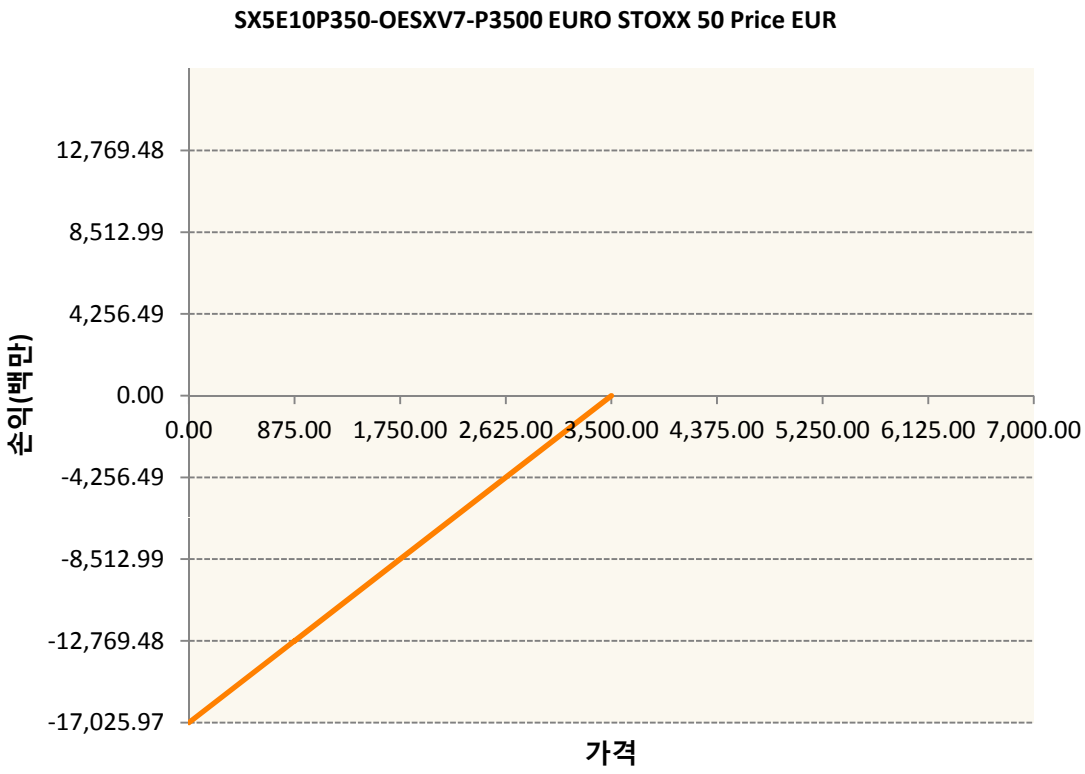
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	41,278	0	41,278	
누계	유가증권	옵션	0	90,171	-90,171	장내

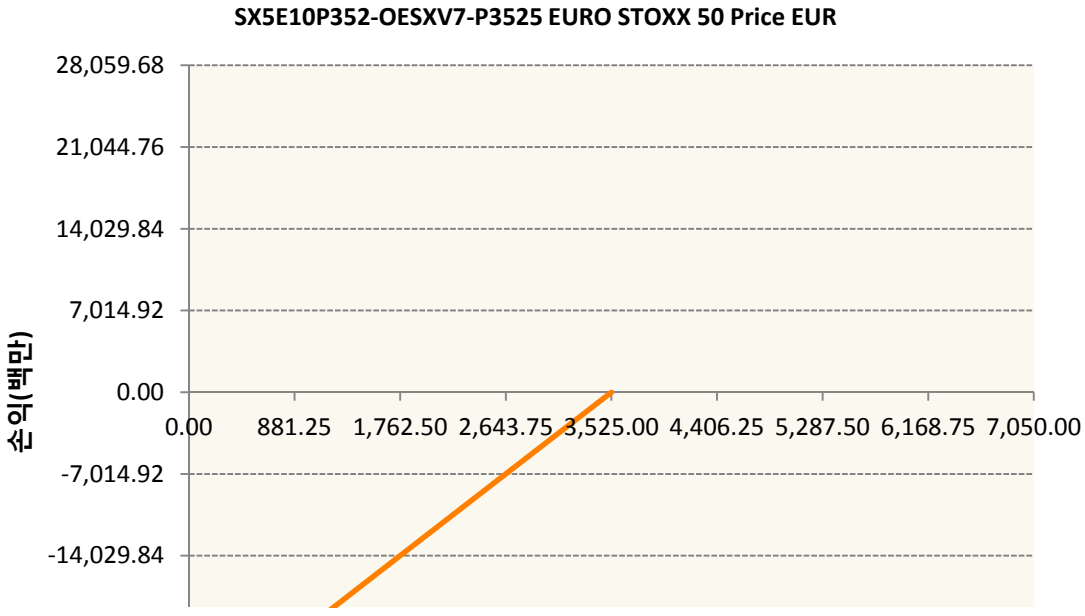
2. 만기시점의 손익구조

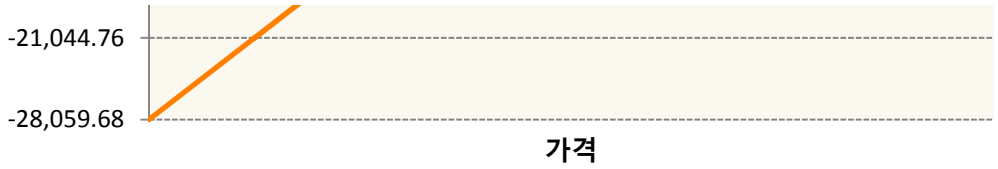


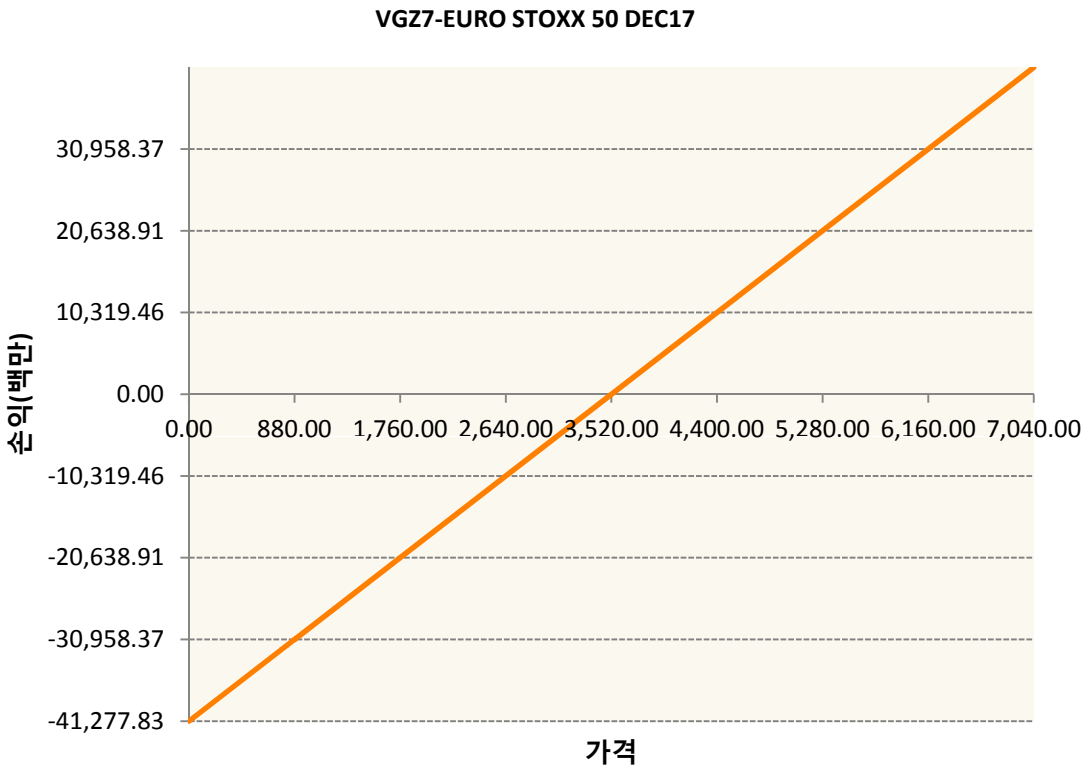



-7,014.92
-14,029.84
-21,044.76
-28,059.68
가격


SX5E10P350-OESXV7-P3500 EURO STOXX 50 Price EUR
12,769.48
8,512.99
4,256.49
0.00
-4,256.49
-8,512.99
-12,769.48
-17,025.97
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
28,059.68
21,044.76
14,029.84
7,014.92
0.00
-7,014.92
-14,029.84
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	1,362
SX5E10C352	OESXV7-C3525 EURO STOXX 50 Price EUR	2,245
SX5E10P350	OESXV7-P3500 EURO STOXX 50 Price EUR	1,362
SX5E10P352	OESXV7-P3525 EURO STOXX 50 Price EUR	2,245
VGZ7	EURO STOXX 50 DEC17	3,302

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	8,137

공시일	2017-09-28
기준일	2017-09-27

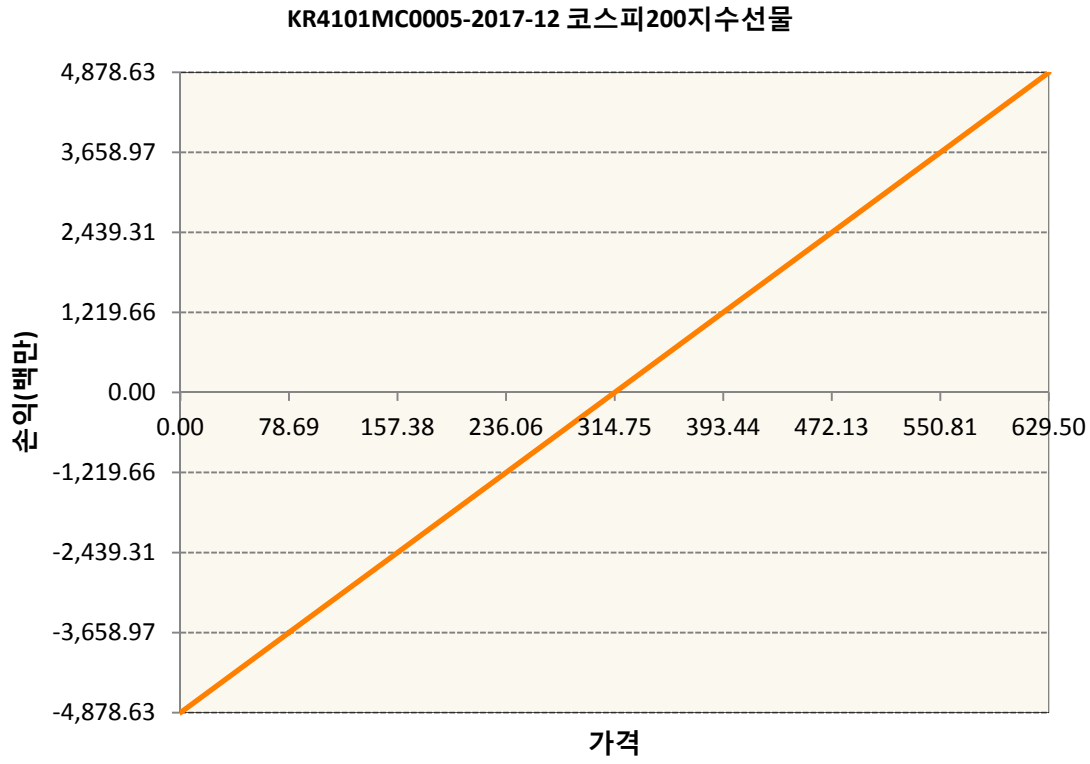
ETF스마트레버리지목표전환형7호

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	4,879	0	4,879	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101MC0	2017-12 코스피200지수선물						389
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-389	-389	-389	-389	-389	-389	-389
-5.33%	-259	-259	-259	-259	-259	-259	-259
-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%	259	259	259	259	259	259	259
8.00%	389	389	389	389	389	389	389

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

236

공시일	2017-09-28
기준일	2017-09-27

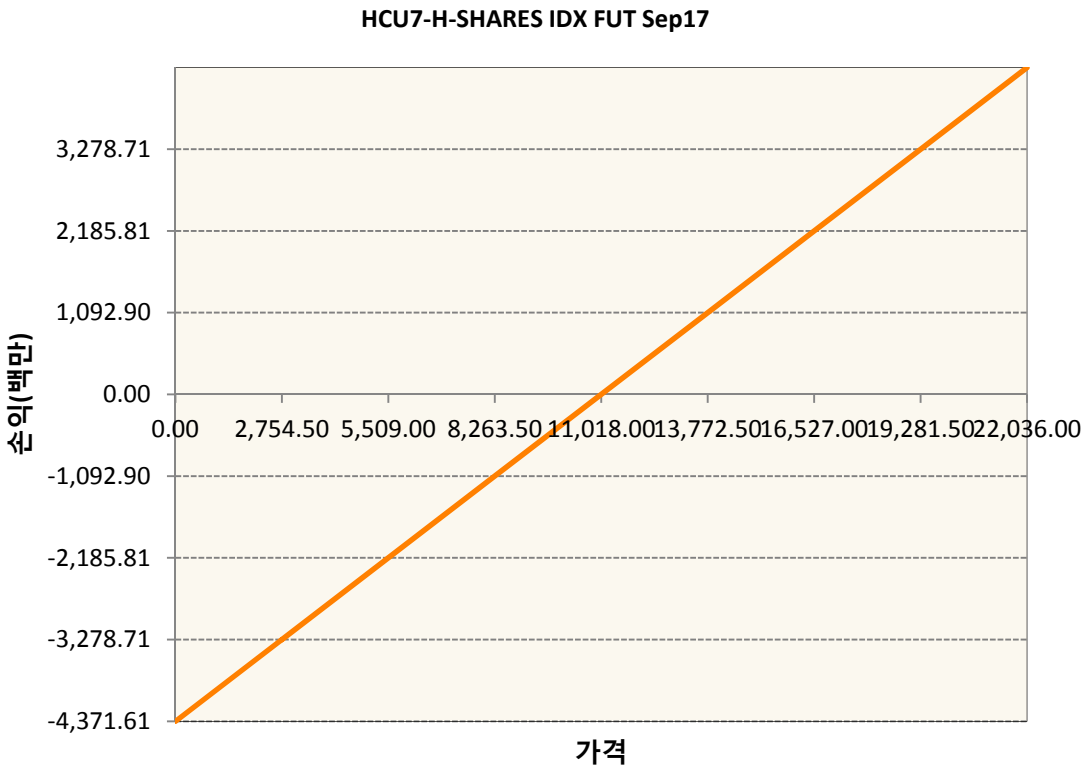
홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생

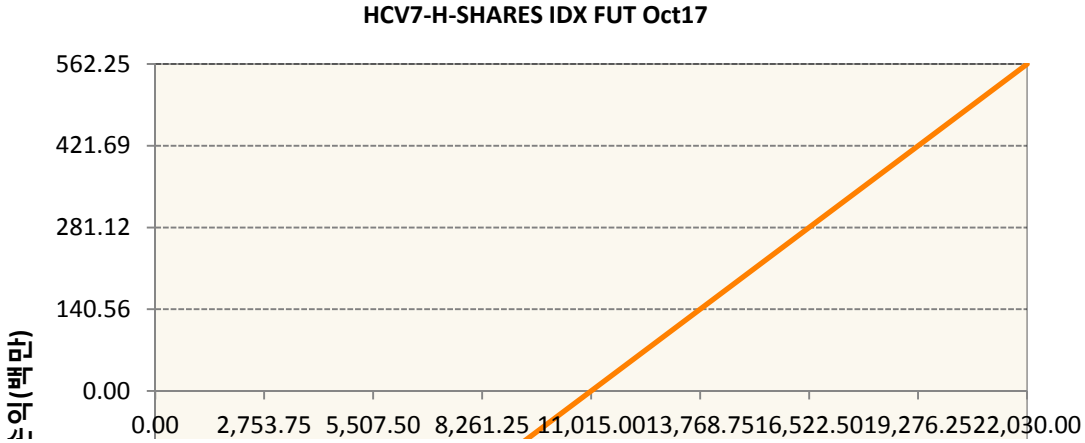
1. 계약금액

(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	4,934	0	4,934	장내
누계	유가증권	옵션	0	10,474	-10,474	장내

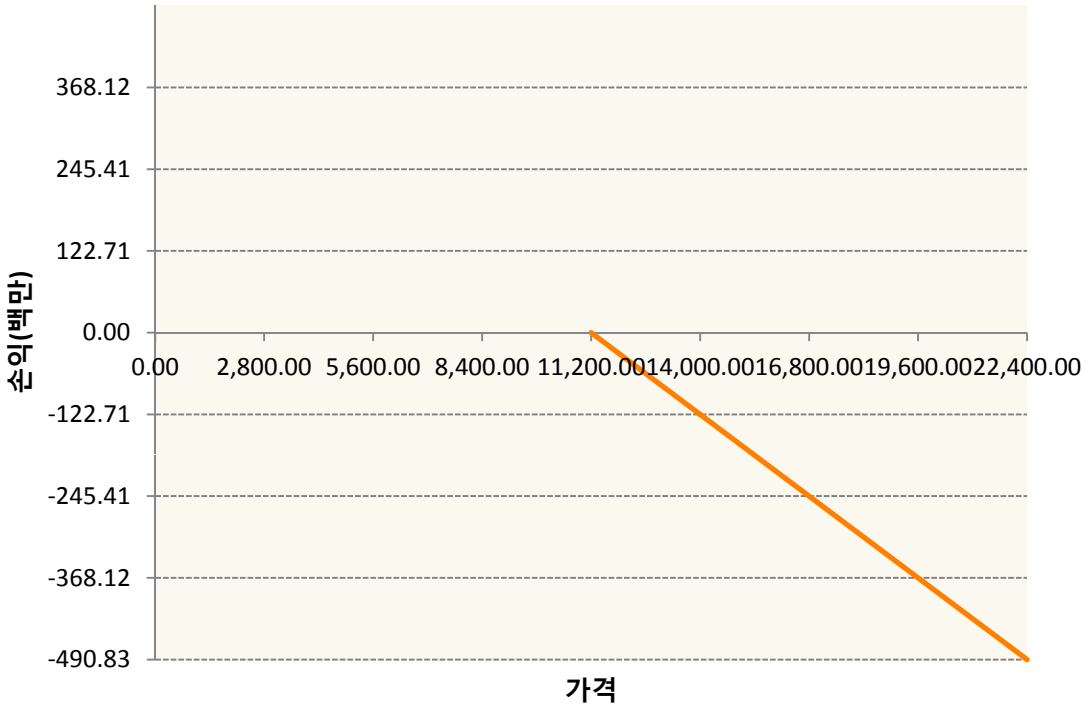
2. 만기시점의 손익구조



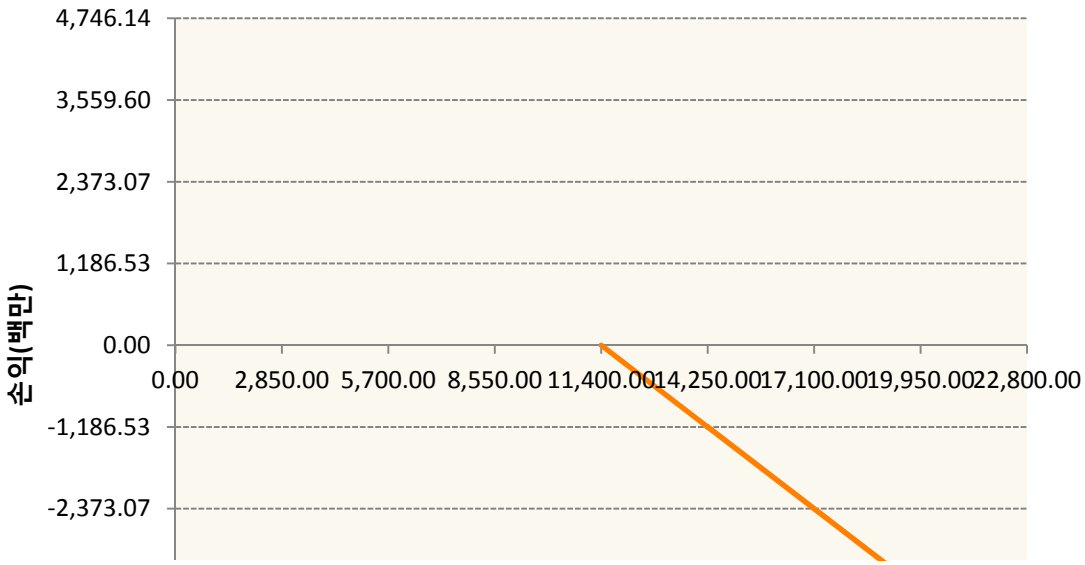


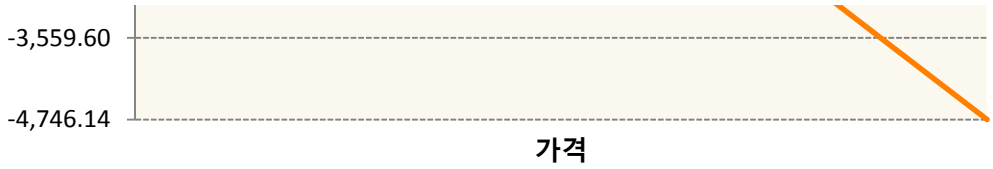


HSCEI9C112-OHHIU7-C112 Hong Kong Stock Exchange Han

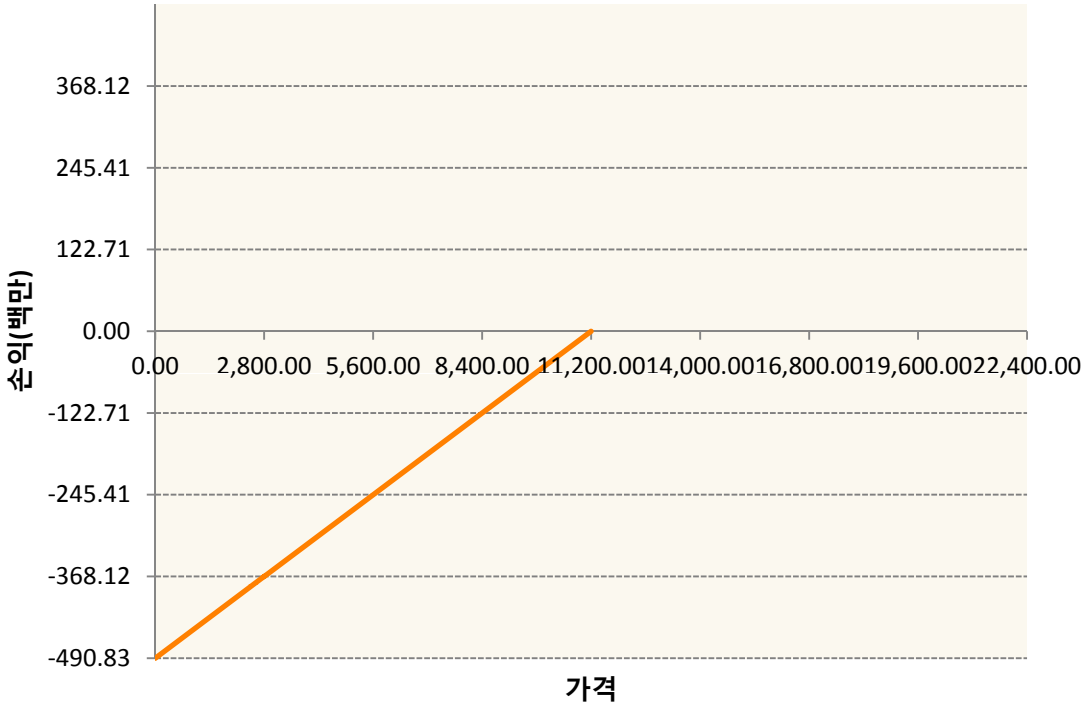


HSCEI9C114-OHHIU7-C114 Hong Kong Stock Exchange Han

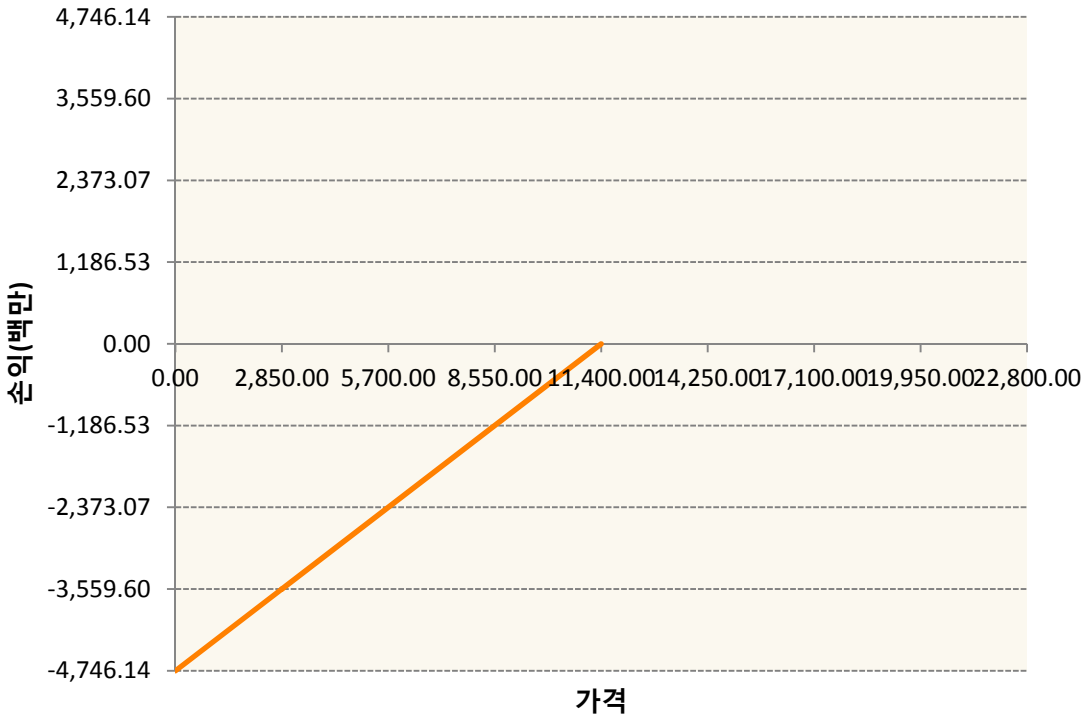




HSCEI9P112-OHHIU7-P112 Hong Kong Stock Exchange Han



HSCEI9P114-OHHIU7-P114 Hong Kong Stock Exchange Han



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

HCU7	H-SHARES IDX FUT Sep17	350
HCV7	H-SHARES IDX FUT Oct17	45
HSCEI9C112	OHHIU7-C112 Hong Kong Stock Exchange Han	39
HSCEI9C114	OHHIU7-C114 Hong Kong Stock Exchange Han	380
HSCEI9P112	OHHIU7-P112 Hong Kong Stock Exchange Han	39
HSCEI9P114	OHHIU7-P114 Hong Kong Stock Exchange Han	380

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

1,014

공시일	2017-09-28
기준일	2017-09-27

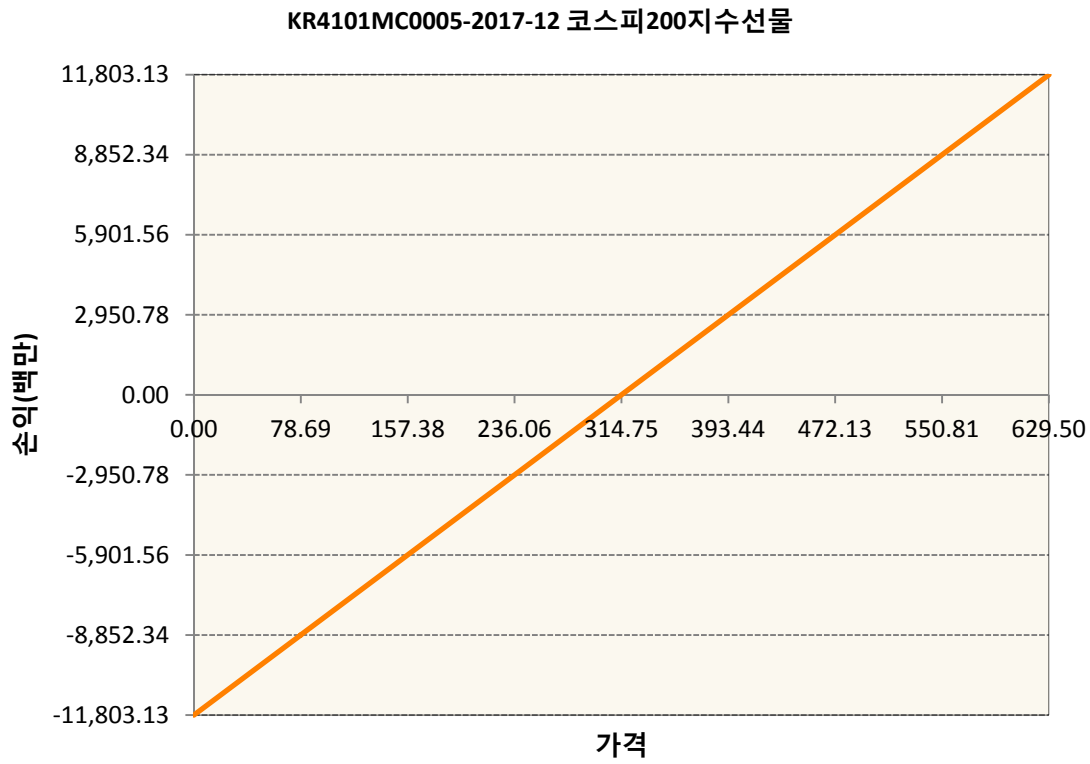
코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼

1. 계약금액

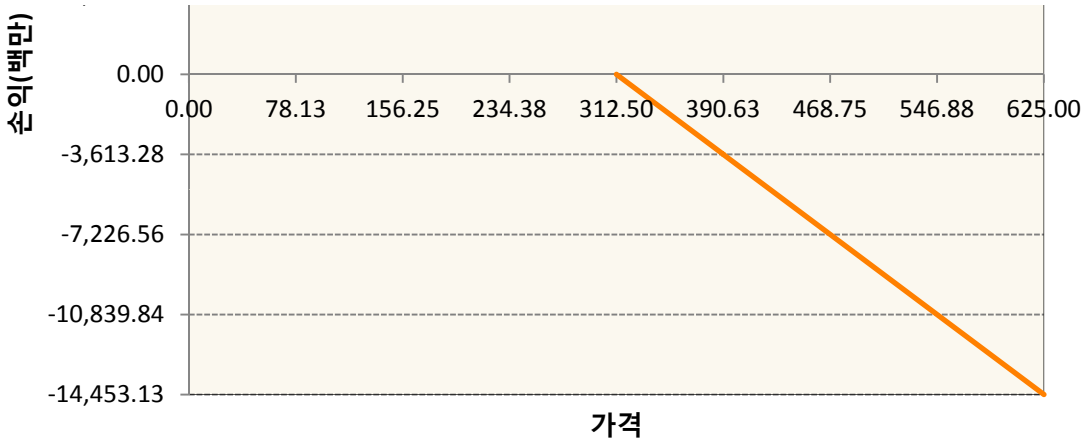
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	3,000	0	3,000	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	11,803	0	11,803	장내
누계	유가증권	스왑	27,000	0	27,000	장외
누계	유가증권	옵션	0	25,781	-25,781	장내

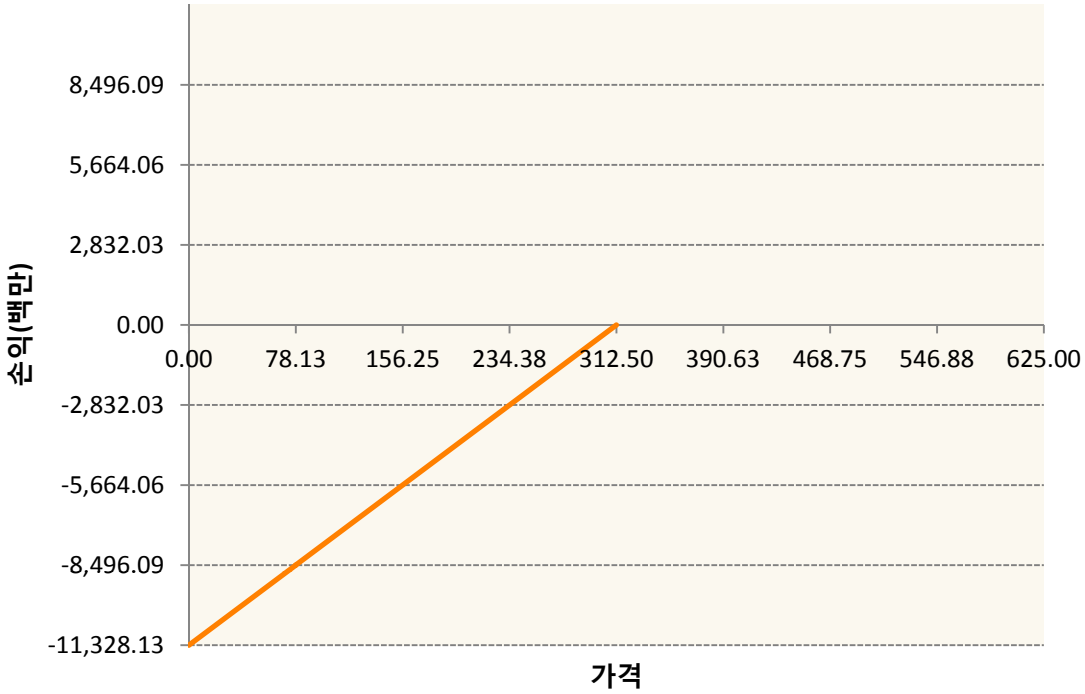
2. 만기시점의 손익구조







KR4301MA3124-2017-10 풋312.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_2							1,495
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,495	-1,495	-1,495	-1,495	-1,495	-1,495	-1,495
-5.33%	-997	-997	-997	-997	-997	-997	-997
-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%	997	997	997	997	997	997	997
8.00%	1,495	1,495	1,495	1,495	1,495	1,495	1,495

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%	-189	-189	-189	-189	-189	-189	-189
-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%	189	189	189	189	189	189	189
8.00%	283	283	283	283	283	283	283
2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_4							162
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-162	-162	-162	-162	-162	-162	-162
-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%	162	162	162	162	162	162	162
2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_5							242
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-242	-242	-242	-242	-242	-242	-242
-5.33%	-162	-162	-162	-162	-162	-162	-162
-2.67%	-81	-81	-81	-81	-81	-81	-81
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	81	81	81	81	81	81	81
5.33%	162	162	162	162	162	162	162
8.00%	242	242	242	242	242	242	242
KR4101MC0(2017-12 코스피200지수선물							941
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-941	-941	-941	-941	-941	-941	-941
-5.33%	-628	-628	-628	-628	-628	-628	-628
-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%	628	628	628	628	628	628	628
8.00%	941	941	941	941	941	941	941
KR4201MA3 2017-10 콜312.5							952
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	301	299	295	291	285	278	269

-5.33%	286	277	267	255	243	229	214
-2.67%	224	206	187	167	147	127	106
0%	67	45	22	0	-23	-45	-68
2.67%	-200	-217	-234	-252	-271	-290	-310
5.33%	-544	-552	-561	-571	-583	-597	-611
8.00%	-921	-923	-926	-931	-937	-944	-952
KR4301MA3 2017-10 풋312.5							769

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-768	-768	-768	-768	-768	-768	-769
-5.33%	-465	-465	-466	-467	-469	-471	-473
-2.67%	-174	-179	-185	-191	-198	-205	-212
0%	29	19	10	0	-10	-19	-29
2.67%	88	85	81	77	72	66	60
5.33%	94	93	93	92	91	90	88
8.00%	94	94	94	94	94	93	93

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

4,668

공시일	2017-09-28
기준일	2017-09-27

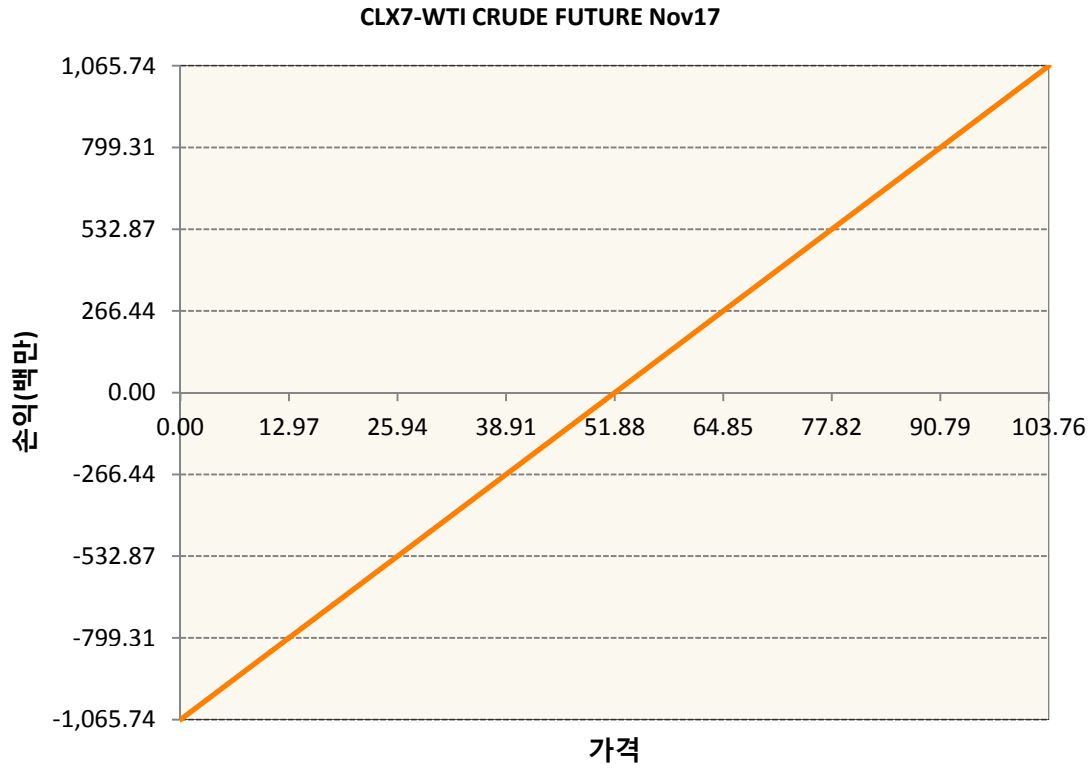
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

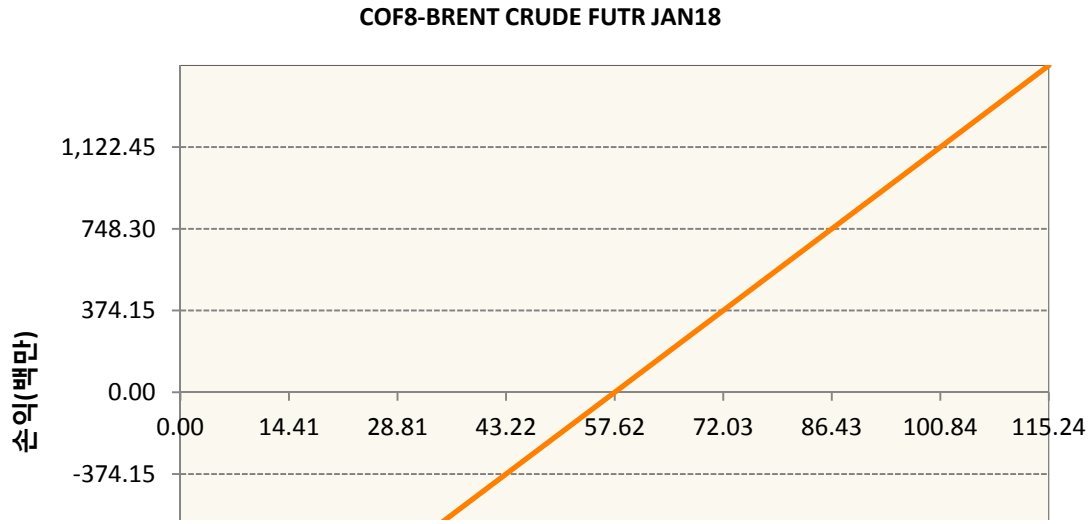
1. 계약금액

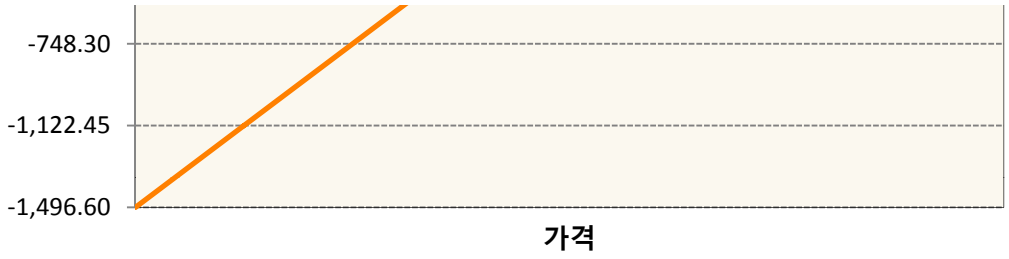
(단위:백만원)

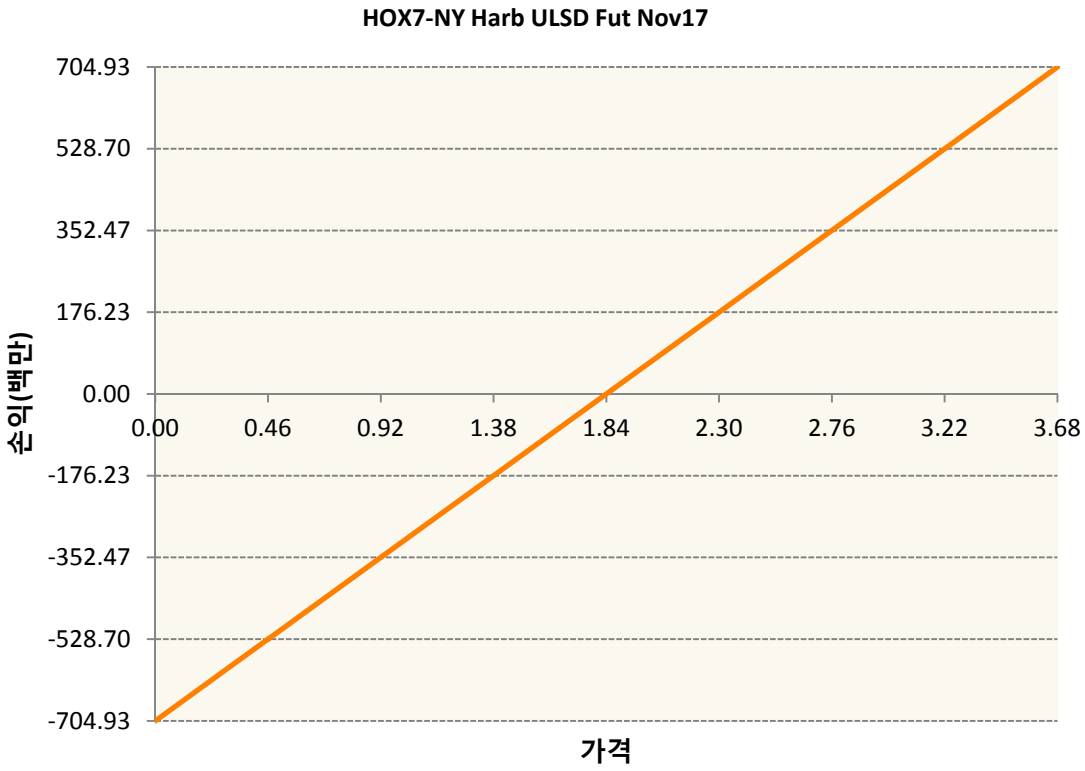
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	5,417	741	4,675	

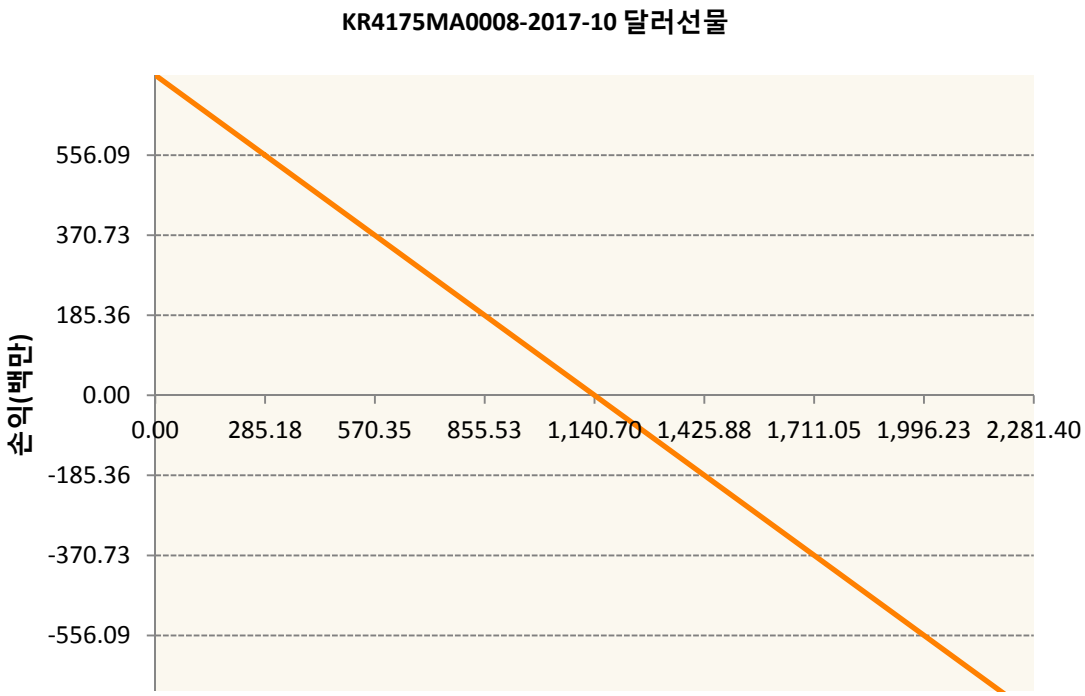
2. 만기시점의 손익구조

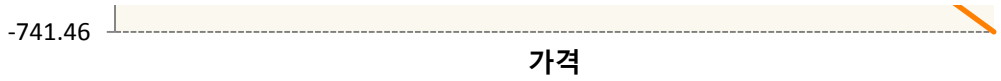


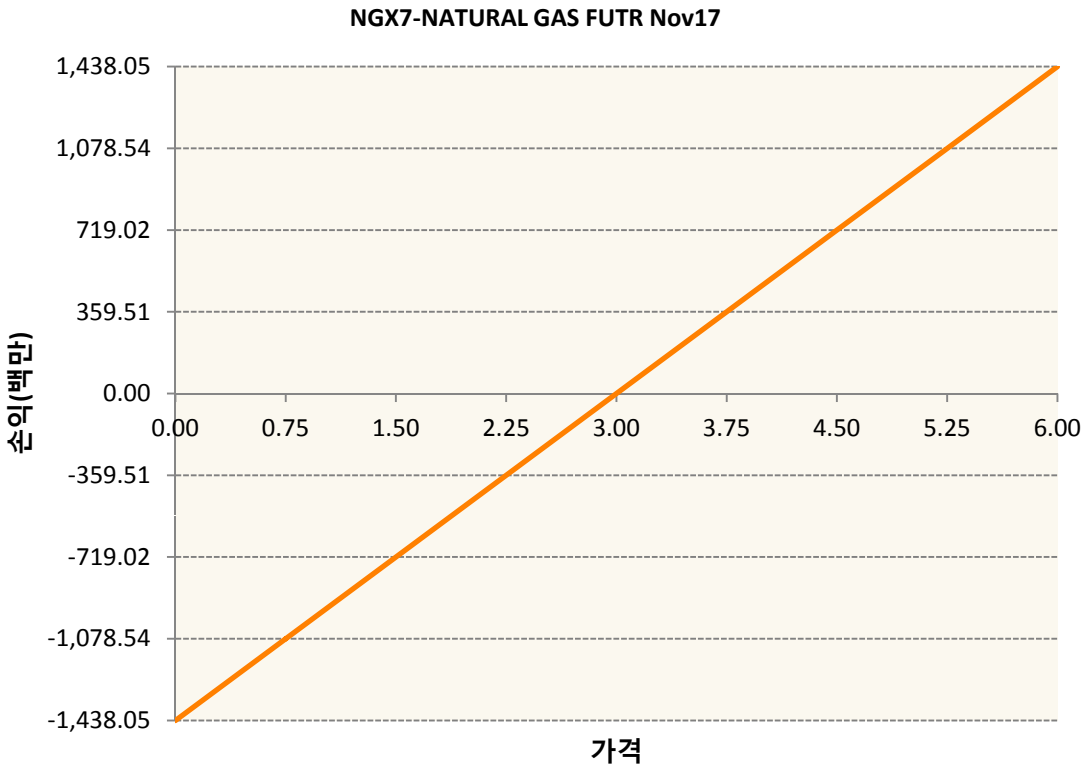


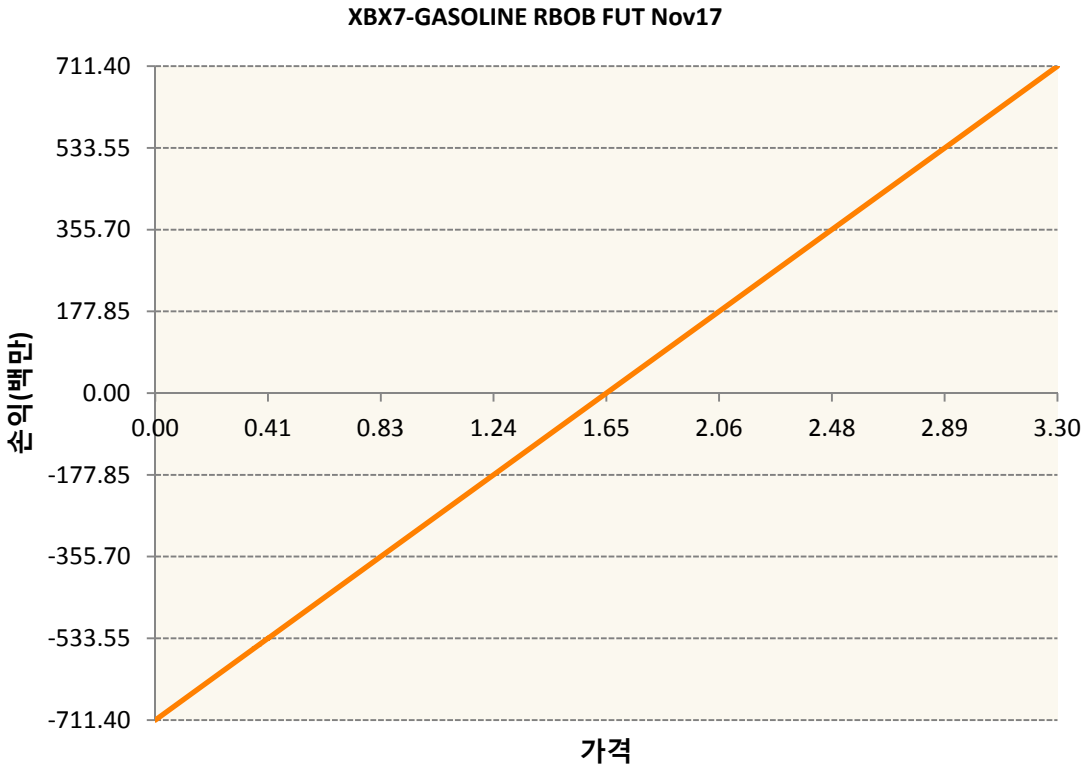

-748.30
-1,122.45
-1,496.60
가격


HOX7-NY Harb ULSD Fut Nov17
704.93
528.70
352.47
176.23
0.00
-176.23
-352.47
-528.70
-704.93
0.00
0.46
0.92
1.38
1.84
2.30
2.76
3.22
3.68
손익(백만)
가격


KR4175MA0008-2017-10 달러선물
556.09
370.73
185.36
0.00
-185.36
-370.73
-556.09
0.00
285.18
570.35
855.53
1,140.70
1,425.88
1,711.05
1,996.23
2,281.40
손익(백만)


-741.46
가격


NGX7-NATURAL GAS FUTR Nov17
1,438.05
1,078.54
719.02
359.51
0.00
-359.51
-719.02
-1,078.54
-1,438.05
0.00
0.75
1.50
2.25
3.00
3.75
4.50
5.25
6.00
손익(백만)
가격


XBX7-GASOLINE RBOB FUT Nov17
711.40
533.55
355.70
177.85
0.00
-177.85
-355.70
-533.55
-711.40
0.00
0.41
0.83
1.24
1.65
2.06
2.48
2.89
3.30
손익(백만)
가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLX7	WTI CRUDE FUTURE Nov17	85
COF8	BRENT CRUDE FUTR JAN18	120
HOX7	NY Harb ULSD Fut Nov17	56
KR4175MA0	2017-10 달러선물	59
NGX7	NATURAL GAS FUTR Nov17	115
XBX7	GASOLINE RBOB FUT Nov17	57

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

778

공시일	2017-09-28
기준일	2017-09-27

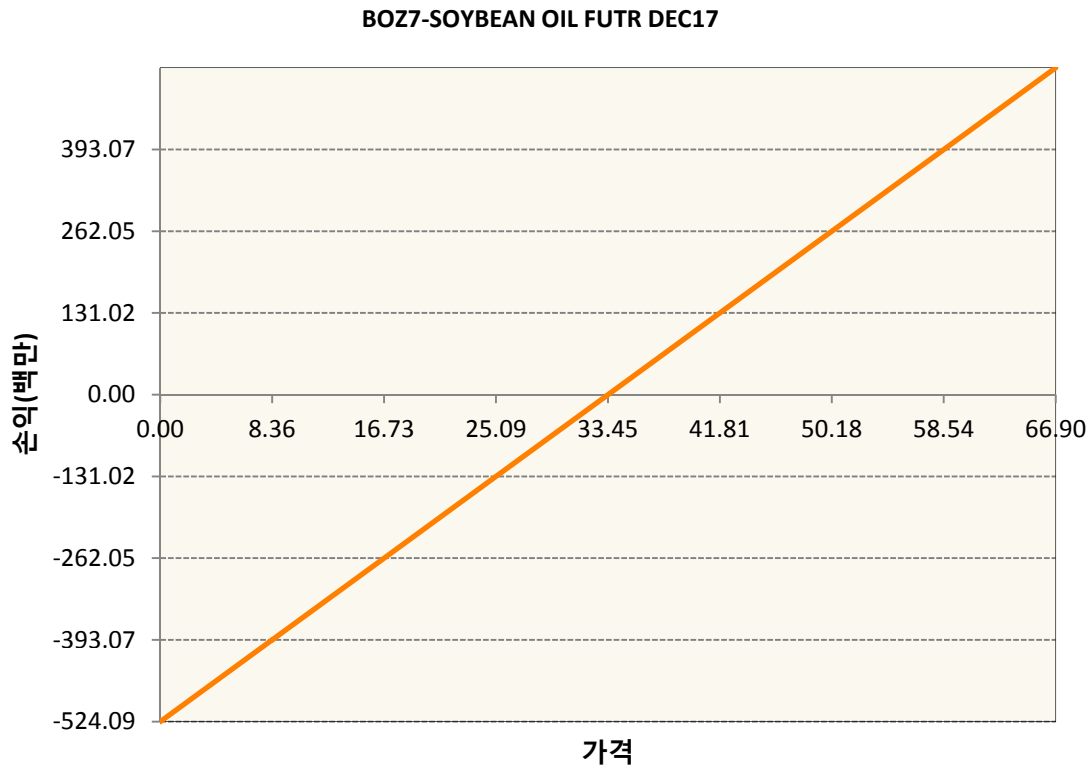
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

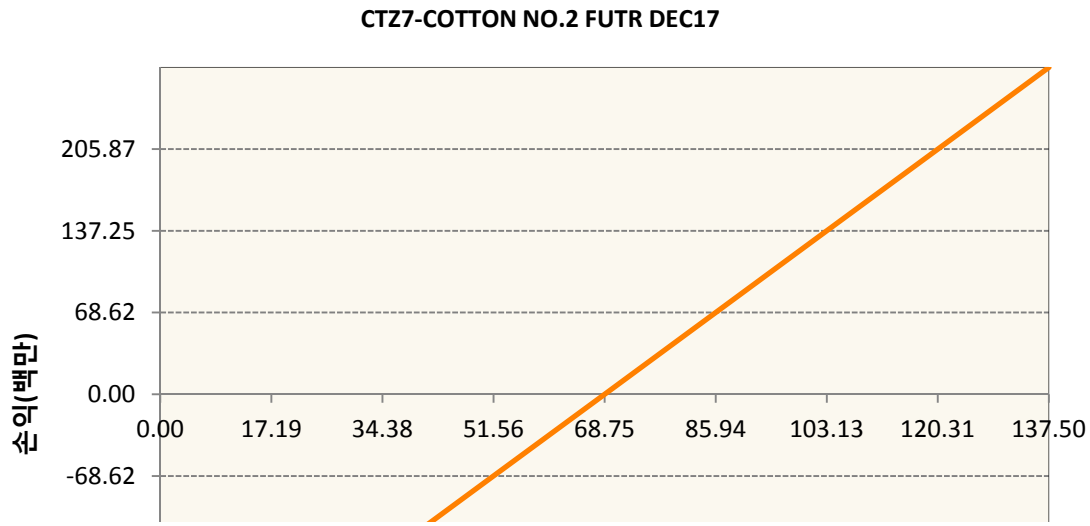
1. 계약금액

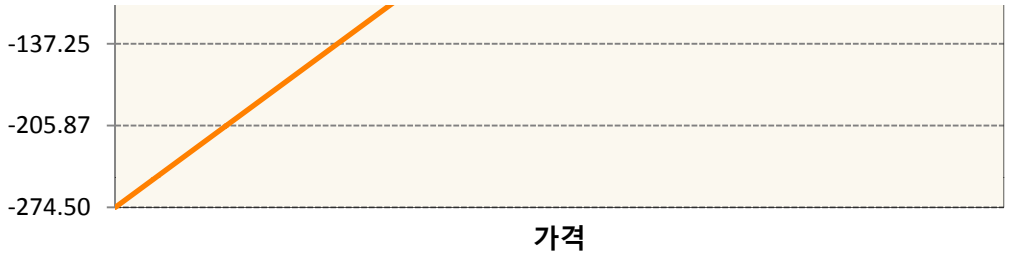
(단위:백만원)

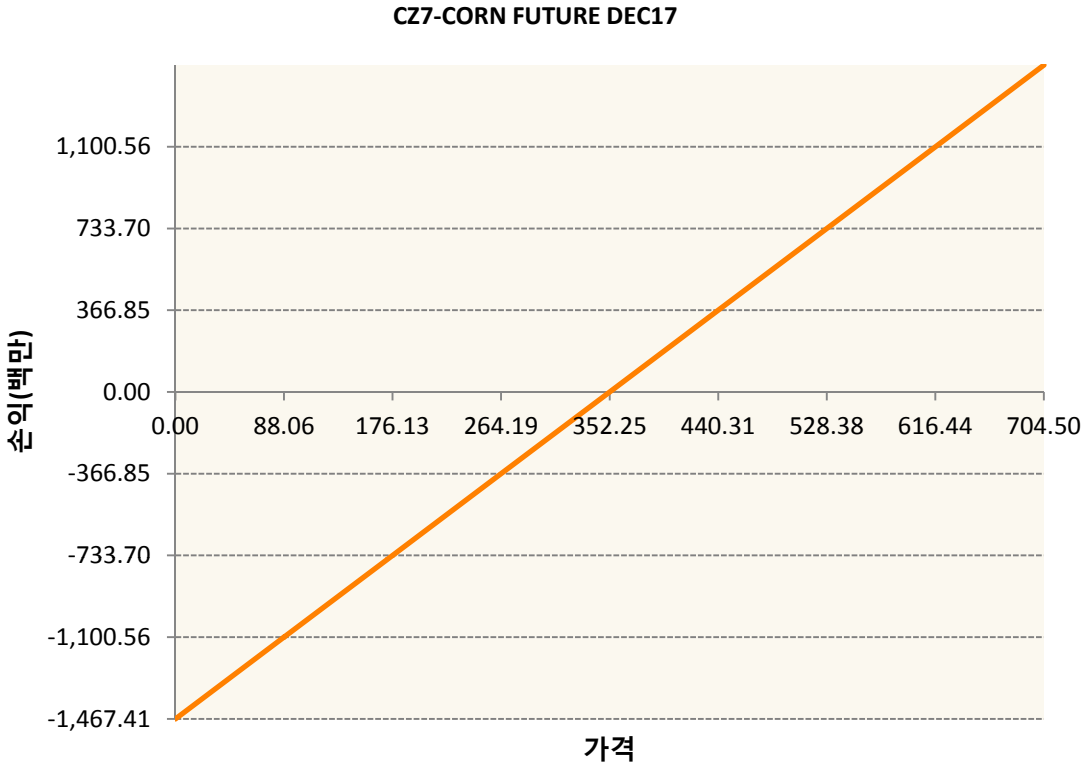
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	5,780	342	5,438	

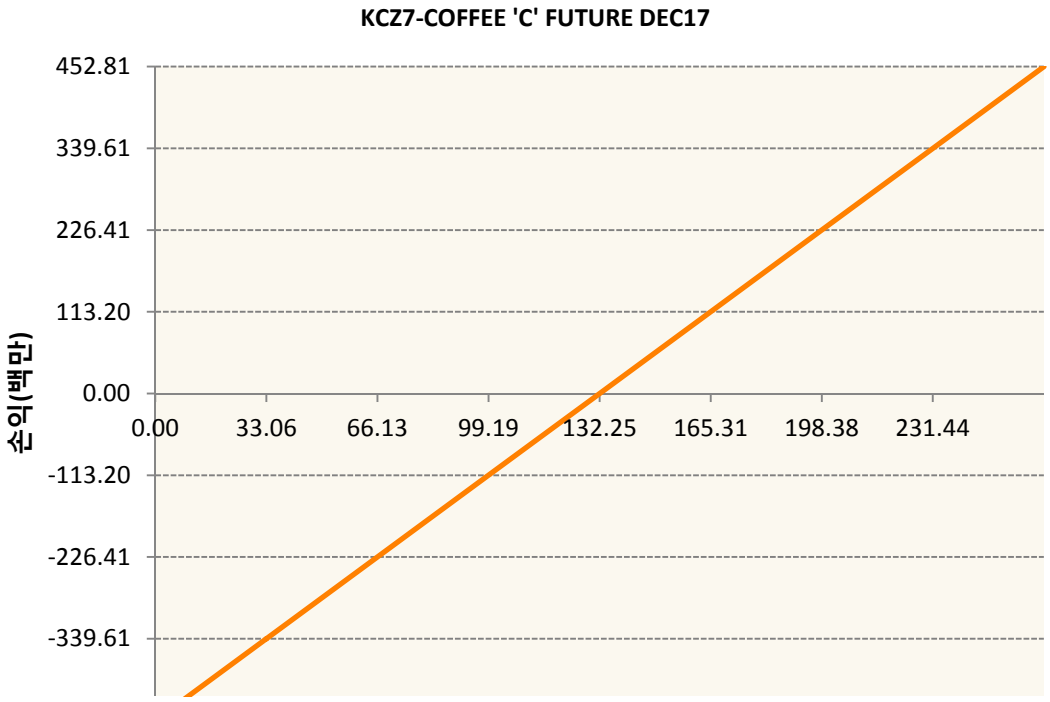
2. 만기시점의 손익구조

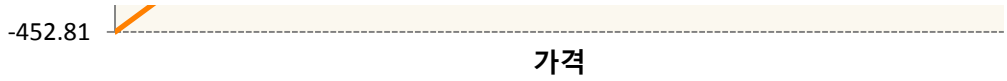


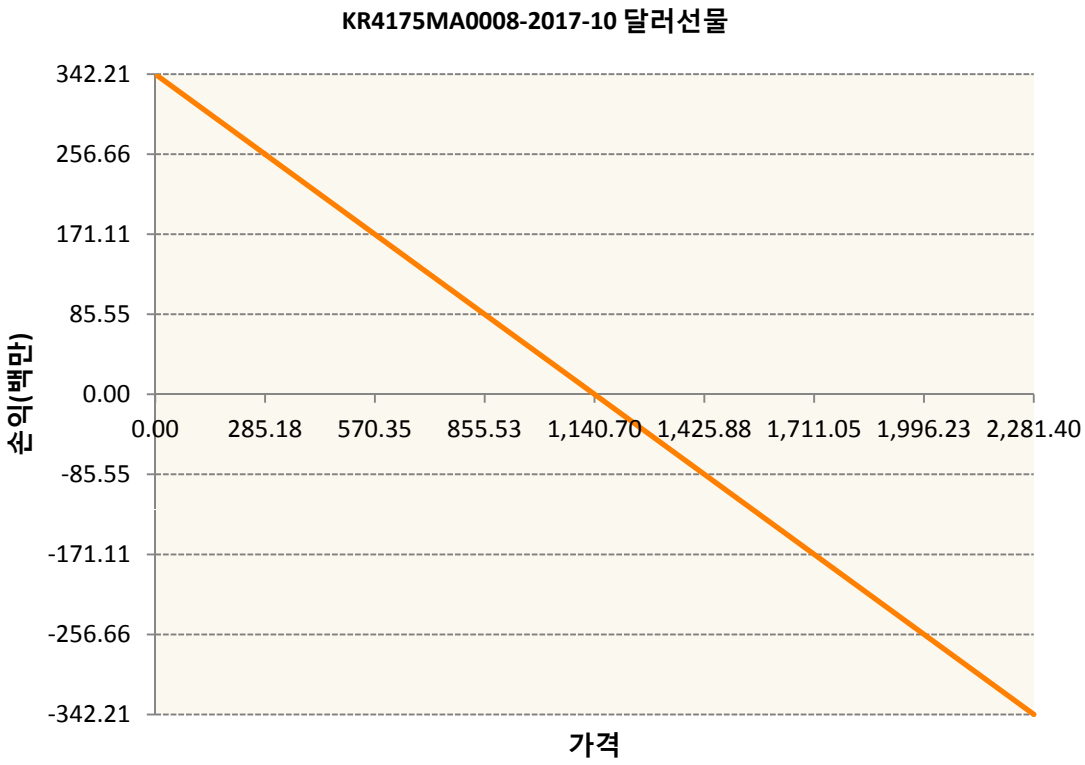


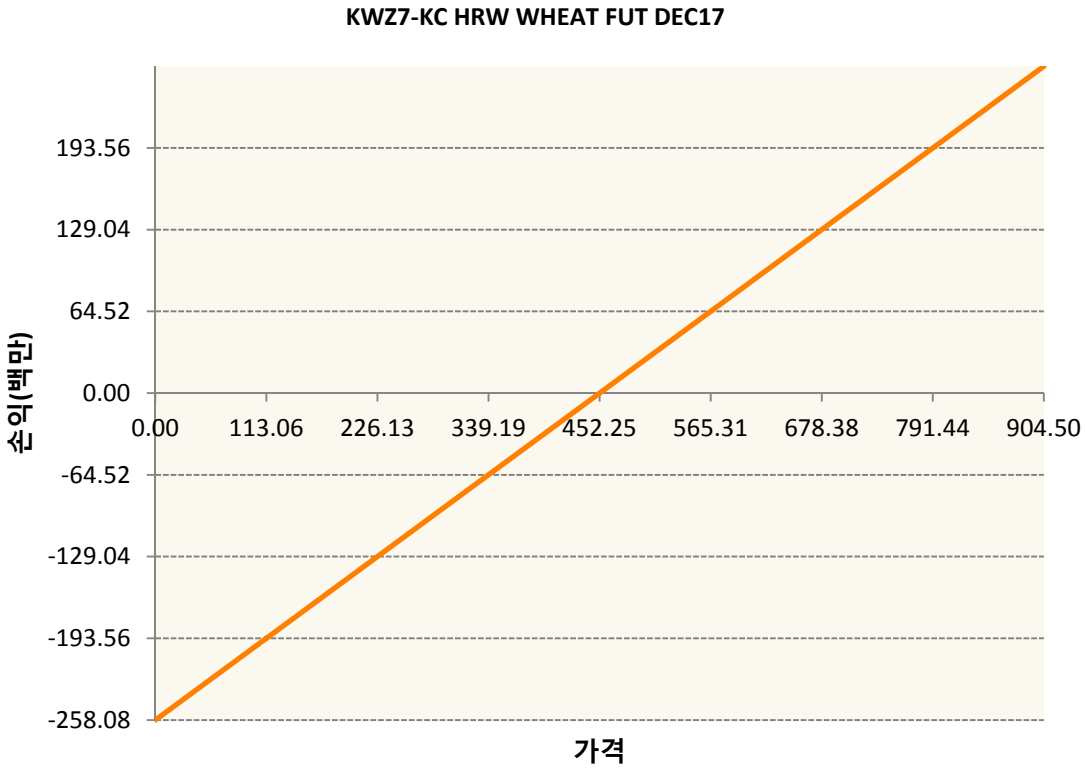

-137.25
-205.87
-274.50
가격


CZ7-CORN FUTURE DEC17
1,100.56
733.70
366.85
0.00
-366.85
-733.70
-1,100.56
-1,467.41
0.00
88.06
176.13
264.19
352.25
440.31
528.38
616.44
704.50
손익(백만)
가격

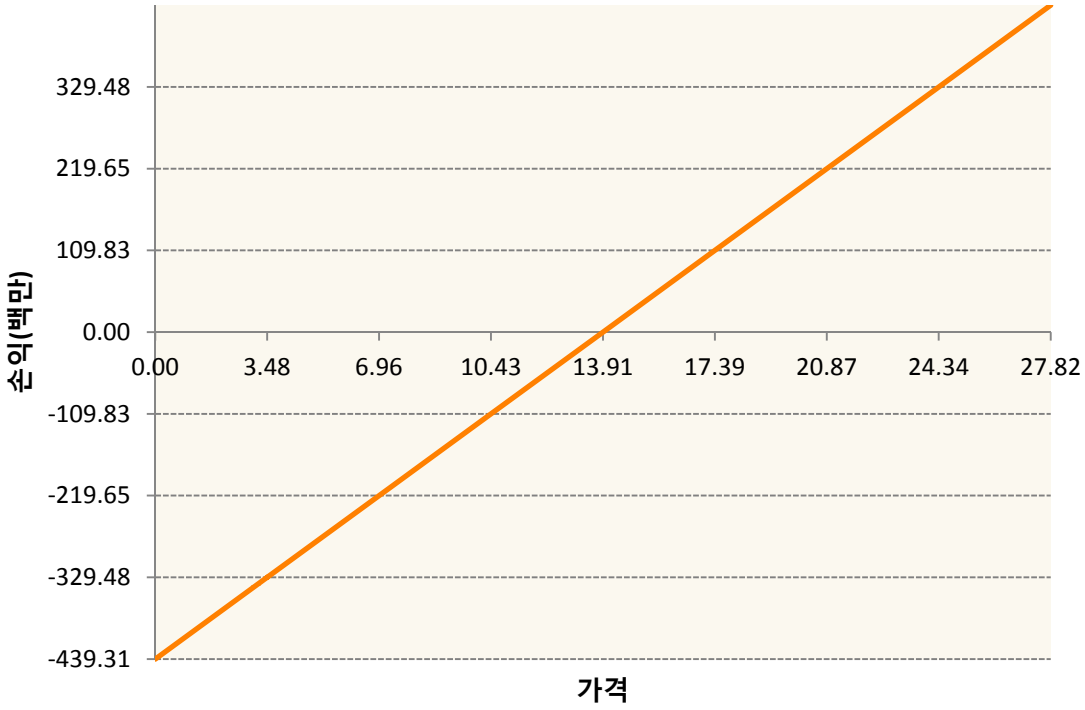

KCZ7-COFFEE 'C' FUTURE DEC17
452.81
339.61
226.41
113.20
0.00
-113.20
-226.41
-339.61
0.00
33.06
66.13
99.19
132.25
165.31
198.38
231.44
손익(백만)


-452.81
가격

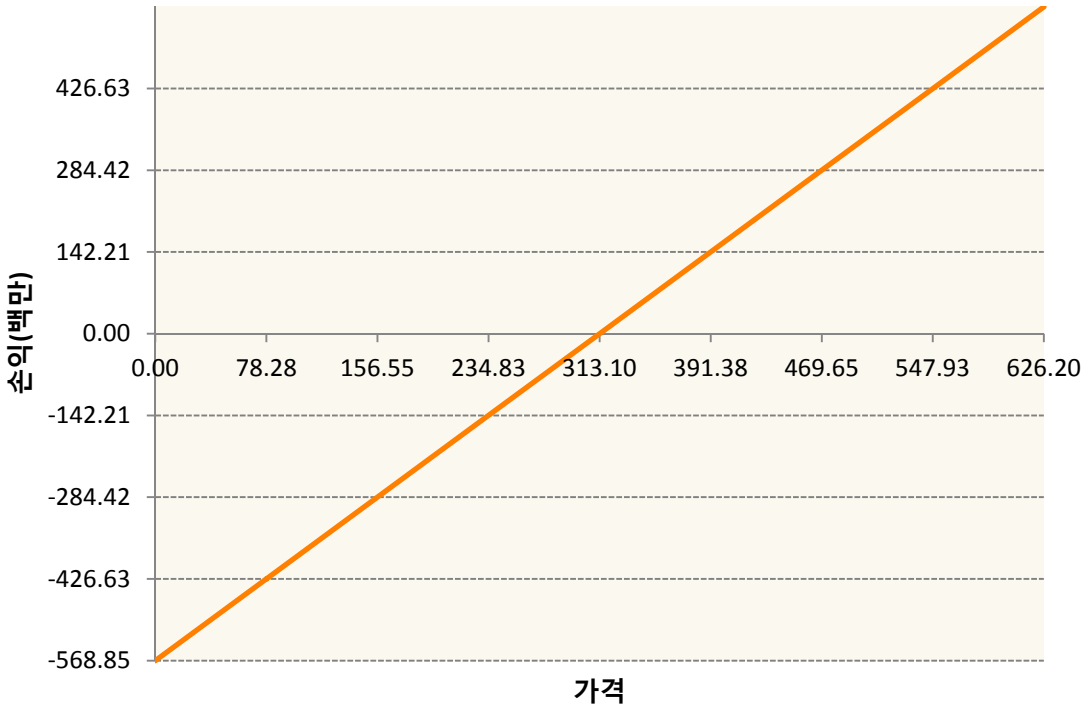

KR4175MA0008-2017-10 달러선물
342.21
256.66
171.11
85.55
0.00
-85.55
-171.11
-256.66
-342.21
0.00
285.18
570.35
855.53
1,140.70
1,425.88
1,711.05
1,996.23
2,281.40
손익(백만)
가격


KWZ7-KC HRW WHEAT FUT DEC17
193.56
129.04
64.52
0.00
-64.52
-129.04
-193.56
-258.08
0.00
113.06
226.13
339.19
452.25
565.31
678.38
791.44
904.50
손익(백만)
가격

SBH8-Sugar #11 (WORLD) MAR18

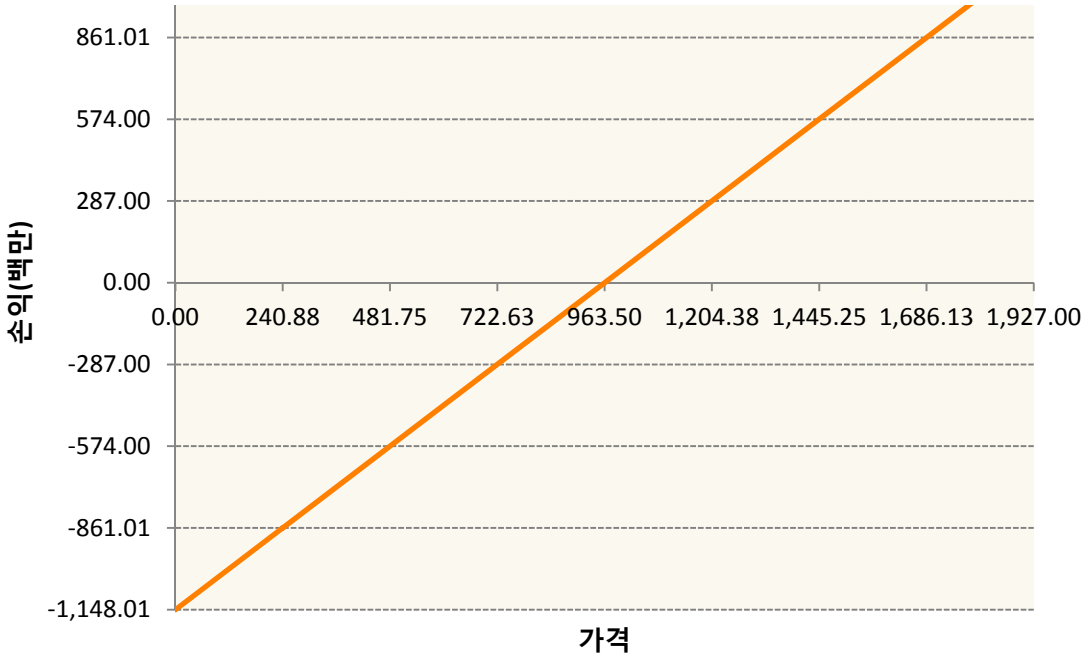


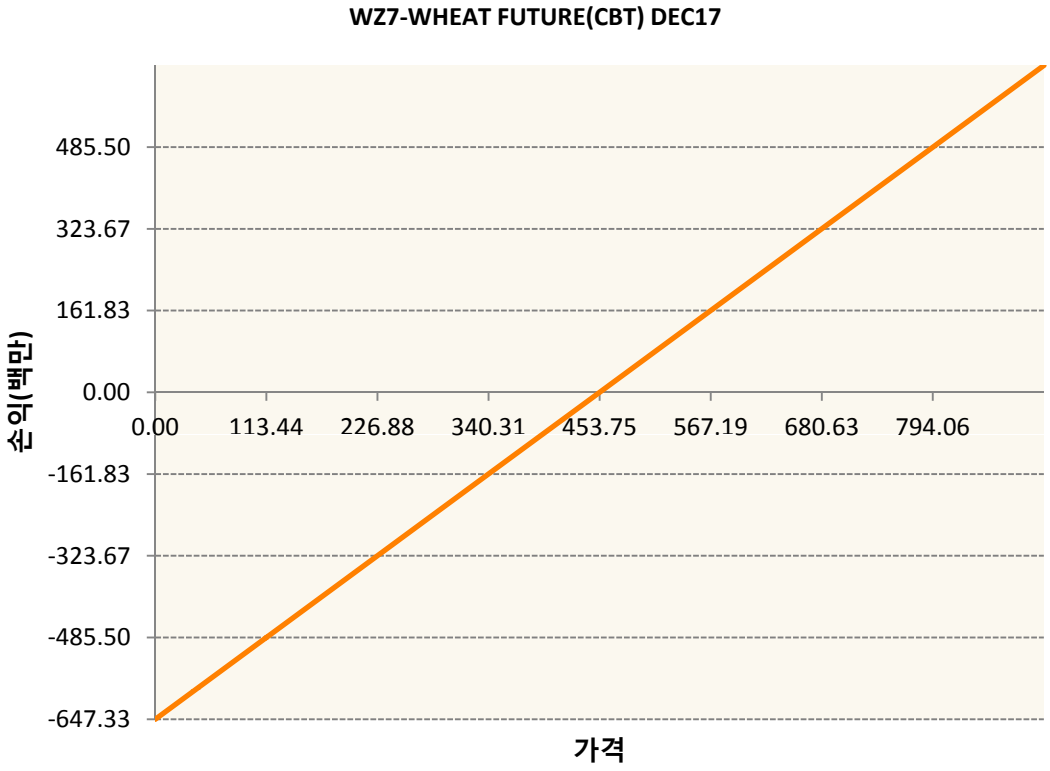
SMZ7-SOYBEAN MEAL FUTR DEC17



SX7-SOYBEAN FUTURE NOV17







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
BOZ7	SOYBEAN OIL FUTR DEC17	42
CTZ7	COTTON NO.2 FUTR DEC17	22
CZ7	CORN FUTURE DEC17	117
KCZ7	COFFEE 'C' FUTURE DEC17	36
KR4175MA0	2017-10 달러선물	27

KWZ7	KC HRW WHEAT FUT DEC17	21
SBH8	Sugar #11 (WORLD) MAR18	35
SMZ7	SOYBEAN MEAL FUTR DEC17	46
SX7	SOYBEAN FUTURE NOV17	92
WZ7	WHEAT FUTURE(CBT) DEC17	52

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

538