공시일	2017-09-29
기준일	2017-09-28

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	2017-09-29
기준일	2017-09-28

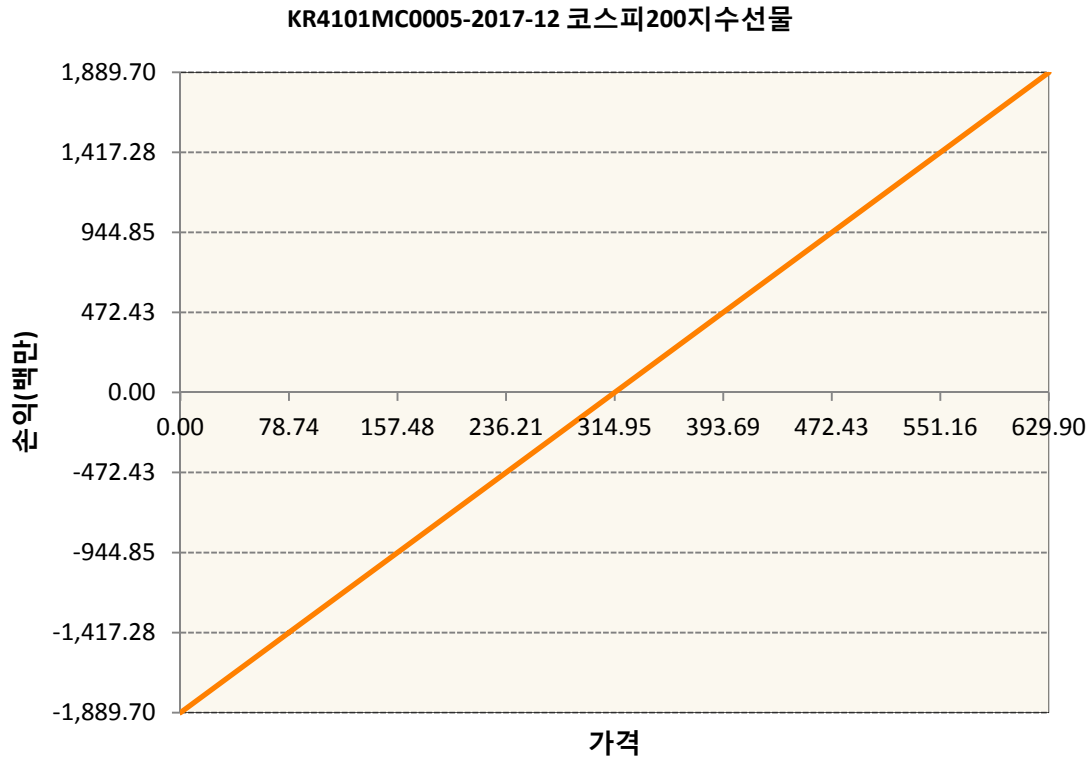
스마트인덱스모

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	1,890	0	1,890	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	2017-09-29
기준일	2017-09-28

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	2017-09-29
기준일	2017-09-28

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)

354

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-09-29
기준일	2017-09-28

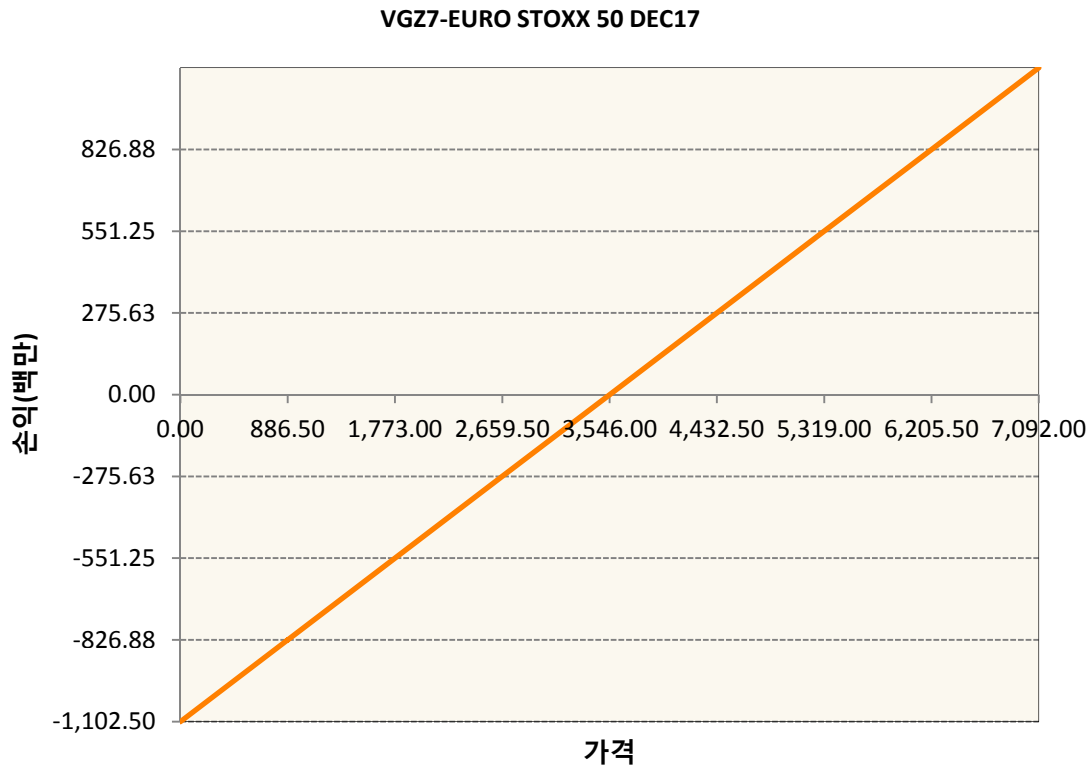
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,103	0	1,103	

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	2017-09-29
기준일	2017-09-28

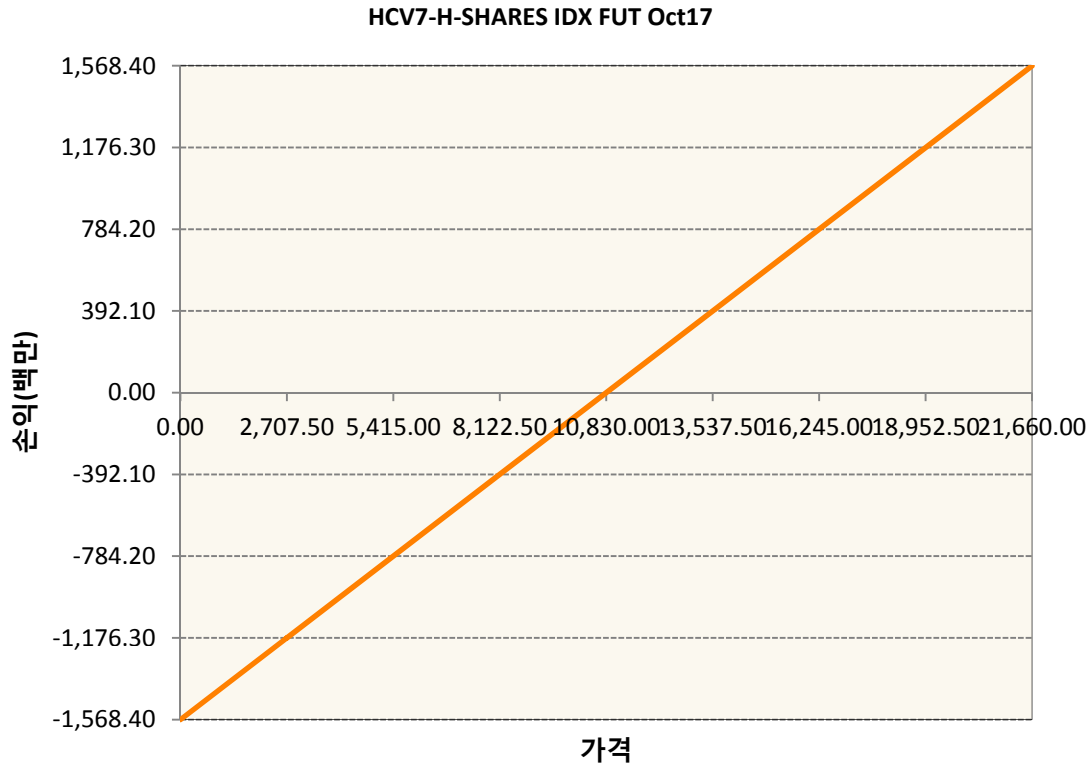
차이나인덱스모(주식-파생형)

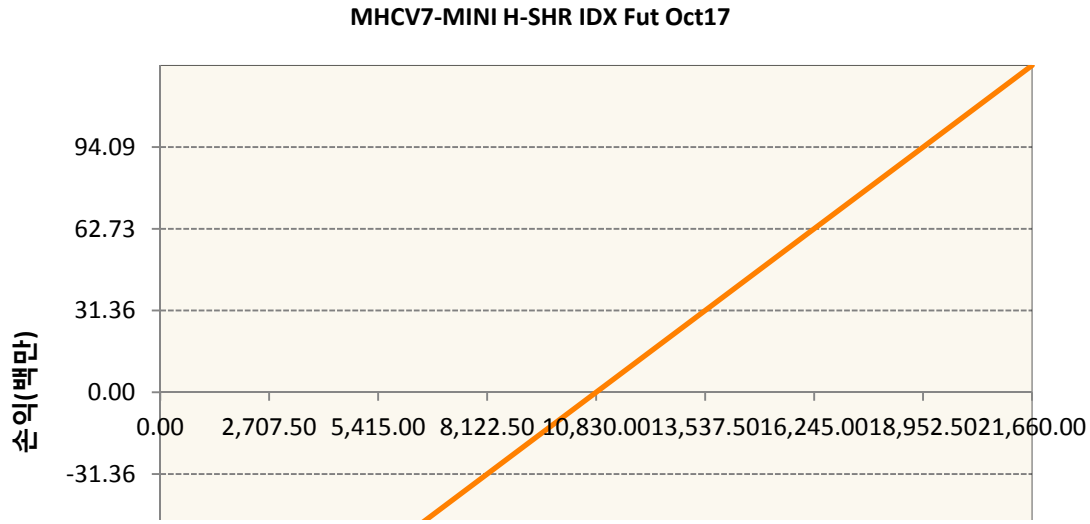
1. 계약금액

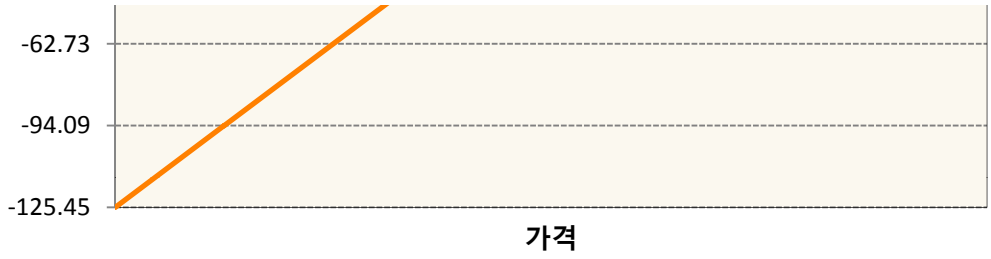
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,694	0	1,694	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCV7	H-SHARES IDX FUT Oct17	125
MHCV7	MINI H-SHR IDX Fut Oct17	10

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	111

공시일	2017-09-29
기준일	2017-09-28

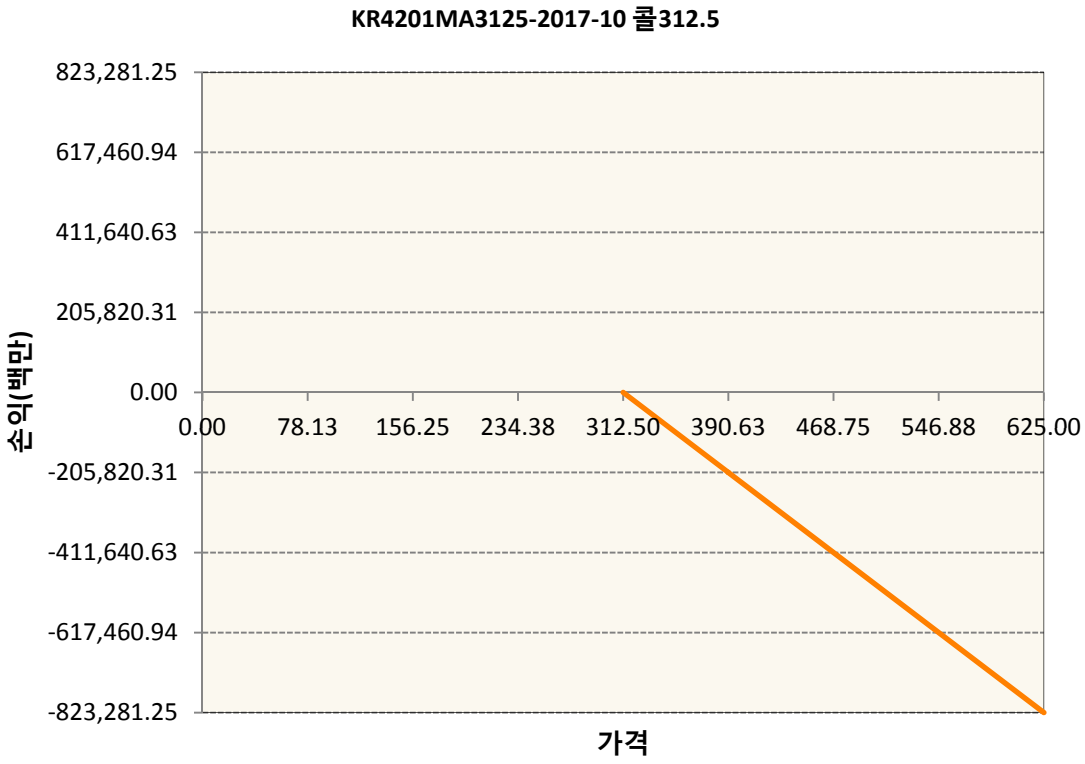
커버드콜모(주식혼합-파생형)

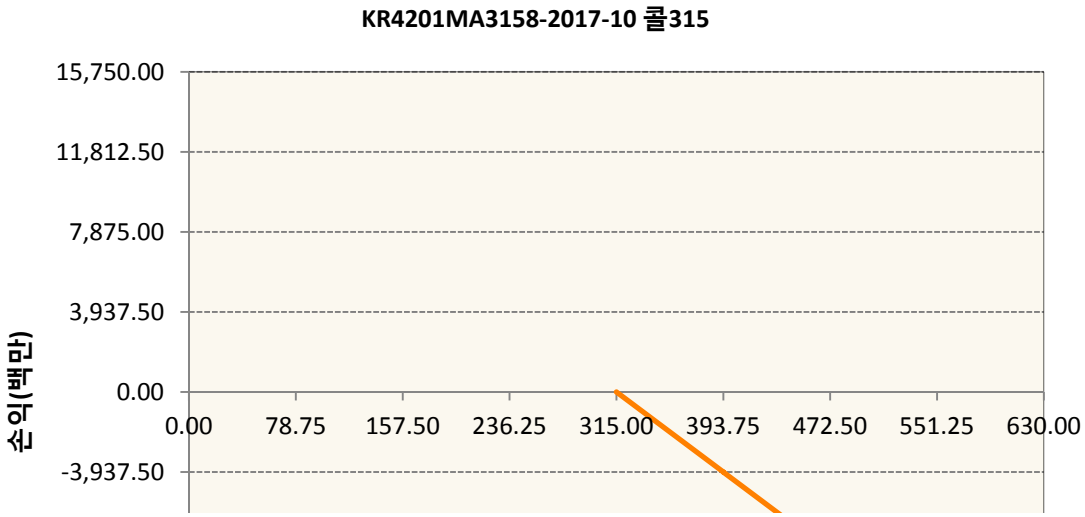
1. 계약금액

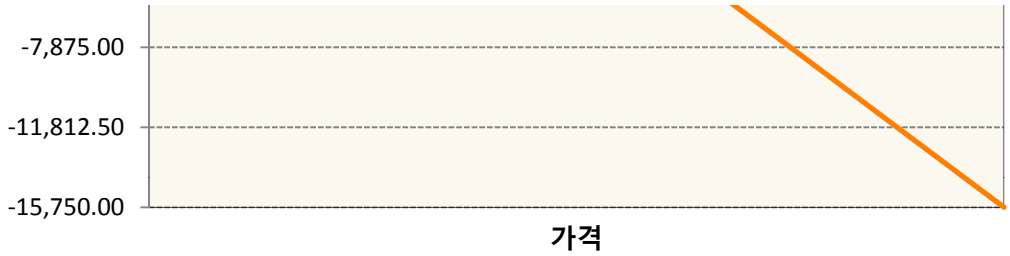
(단위:백만원)

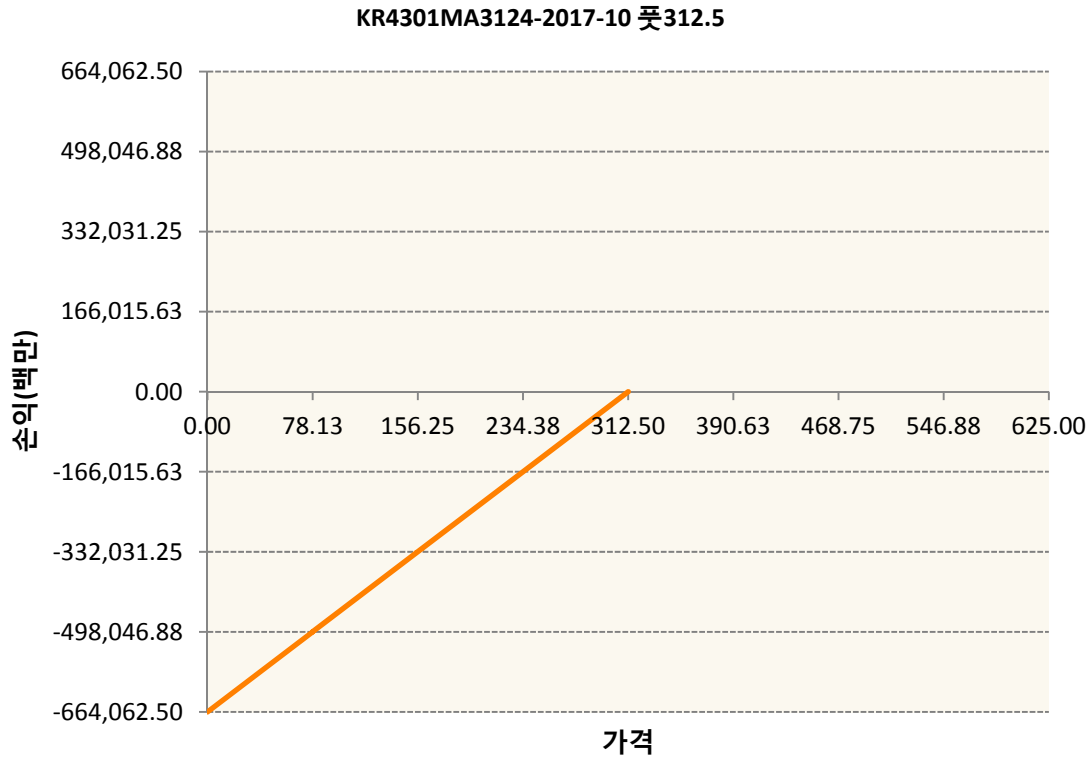
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	1,503,094	-1,503,094	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201MA3 2017-10 콜312.5							54,576
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	16,653	16,548	16,386	16,159	15,868	15,511	15,092
-5.33%	15,921	15,474	14,938	14,325	13,645	12,907	12,119
-2.67%	12,583	11,582	10,544	9,477	8,387	7,279	6,156
0%	3,699	2,468	1,234	0	-1,235	-2,471	-3,708
2.67%	-11,698	-12,570	-13,501	-14,480	-15,498	-16,546	-17,620
5.33%	-31,482	-31,853	-32,316	-32,864	-33,489	-34,179	-34,929
8.00%	-53,017	-53,116	-53,274	-53,496	-53,788	-54,149	-54,576
KR4201MA3 2017-10 콜315							984
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	255	254	252	249	245	240	233

-5.33%	247	241	233	224	213	201	188
-2.67%	204	187	170	152	133	114	94
0%	71	47	24	0	-24	-47	-71
2.67%	-187	-206	-226	-247	-269	-290	-312
5.33%	-542	-552	-564	-577	-591	-606	-623
8.00%	-945	-948	-952	-958	-965	-974	-984
KR4301MA3 2017-10 풋312.5							45,290

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-45,259	-45,259	-45,260	-45,262	-45,266	-45,275	-45,290
-5.33%	-27,495	-27,514	-27,548	-27,601	-27,677	-27,777	-27,902
-2.67%	-10,346	-10,618	-10,925	-11,262	-11,624	-12,007	-12,407
0%	1,598	1,067	535	0	-536	-1,073	-1,611
2.67%	4,935	4,776	4,576	4,340	4,071	3,773	3,450
5.33%	5,180	5,172	5,153	5,121	5,071	5,001	4,908
8.00%	5,184	5,184	5,184	5,182	5,179	5,171	5,157

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

113,356

공시일	2017-09-29
기준일	2017-09-28

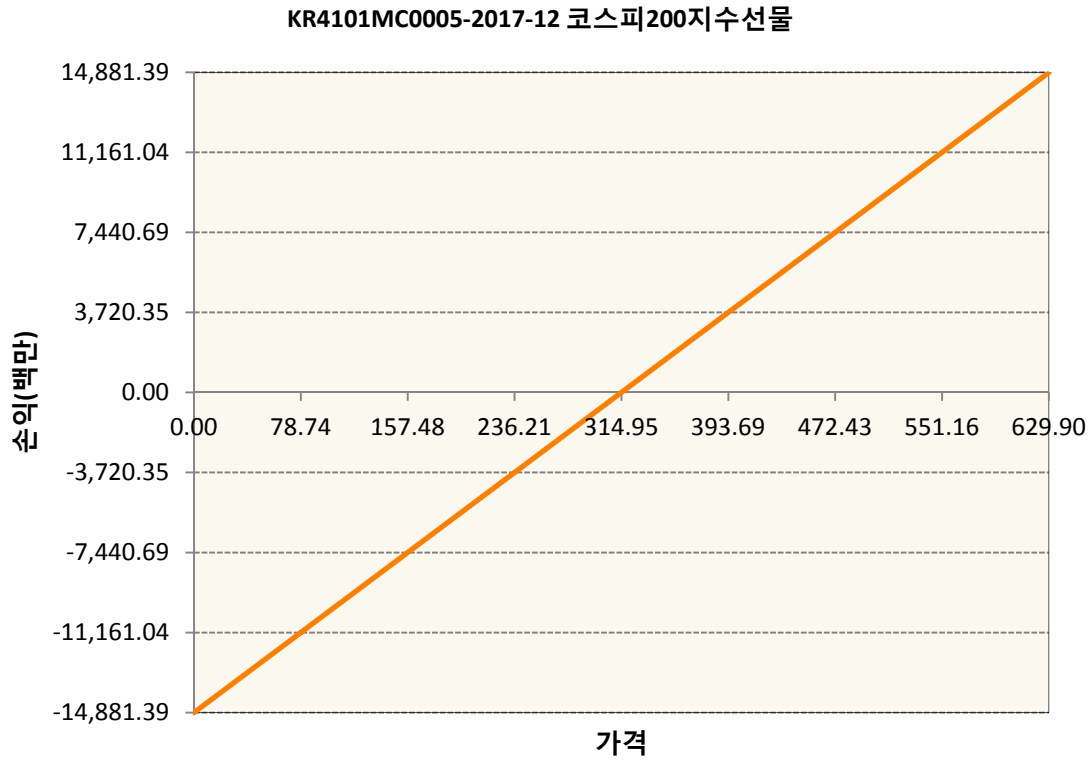
ETF스마트레버리지목표전환형6호

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	14,881	0	14,881	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)

716

공시일	2017-09-29
기준일	2017-09-28

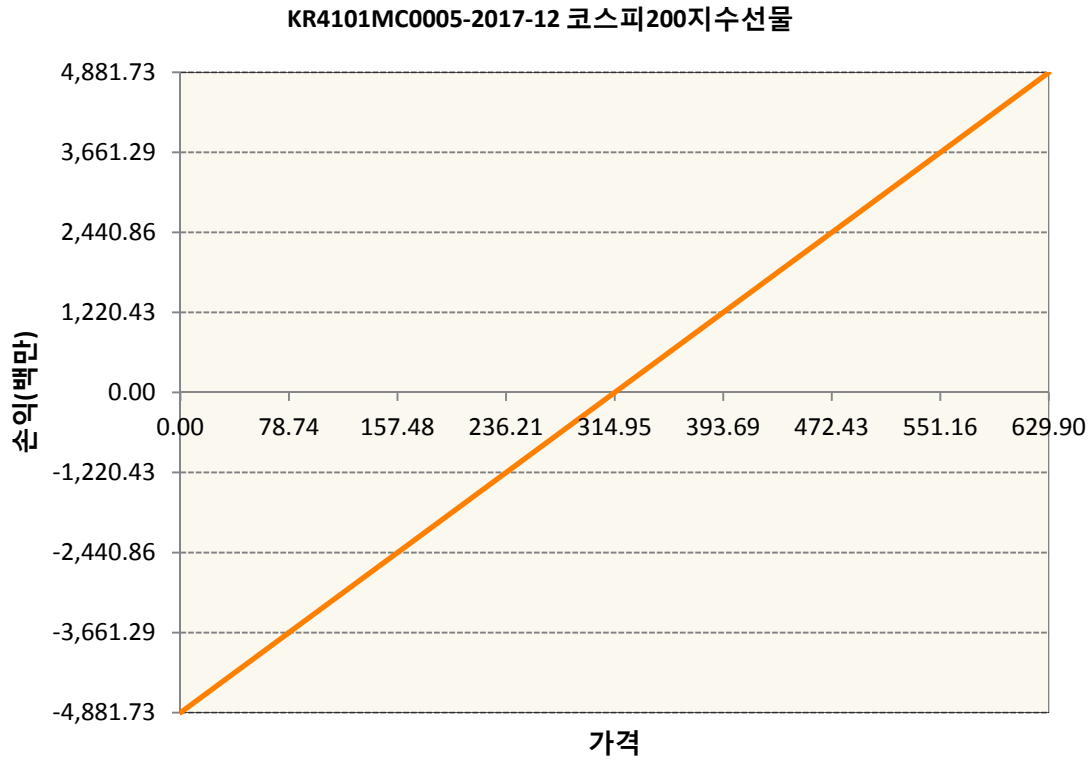
ETF스마트레버리지목표전환형7호

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	4,882	0	4,882	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)

235

공시일	2017-09-29
기준일	2017-09-28

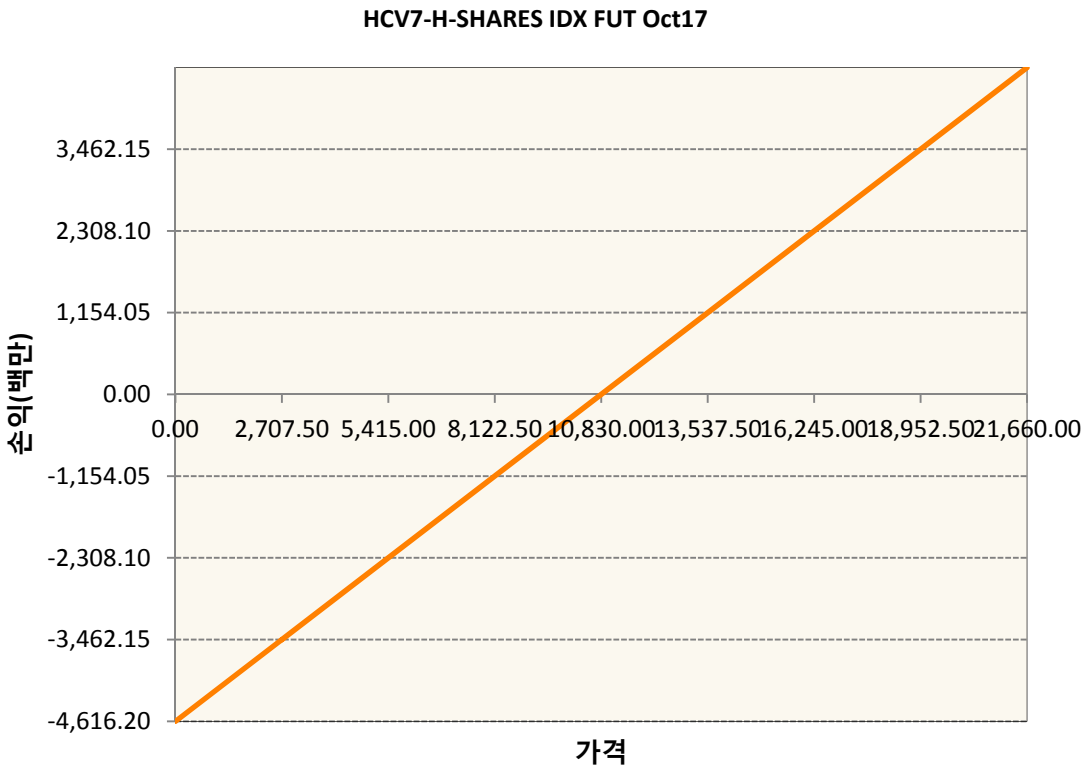
홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생

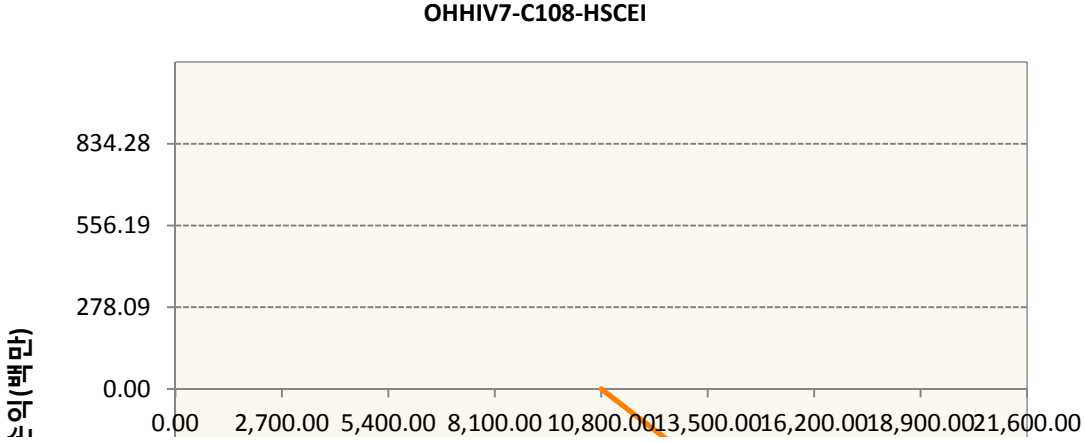
1. 계약금액

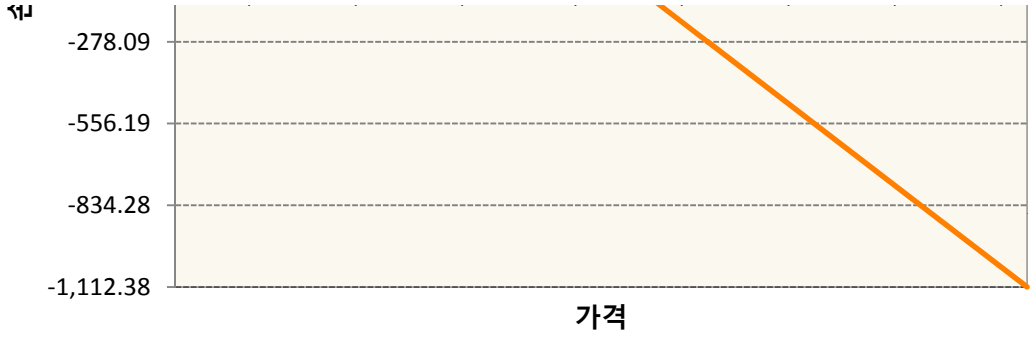
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	1	0	1	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	4,616	0	4,616	장내
누계	유가증권	옵션	0	4,491	-4,491	장내

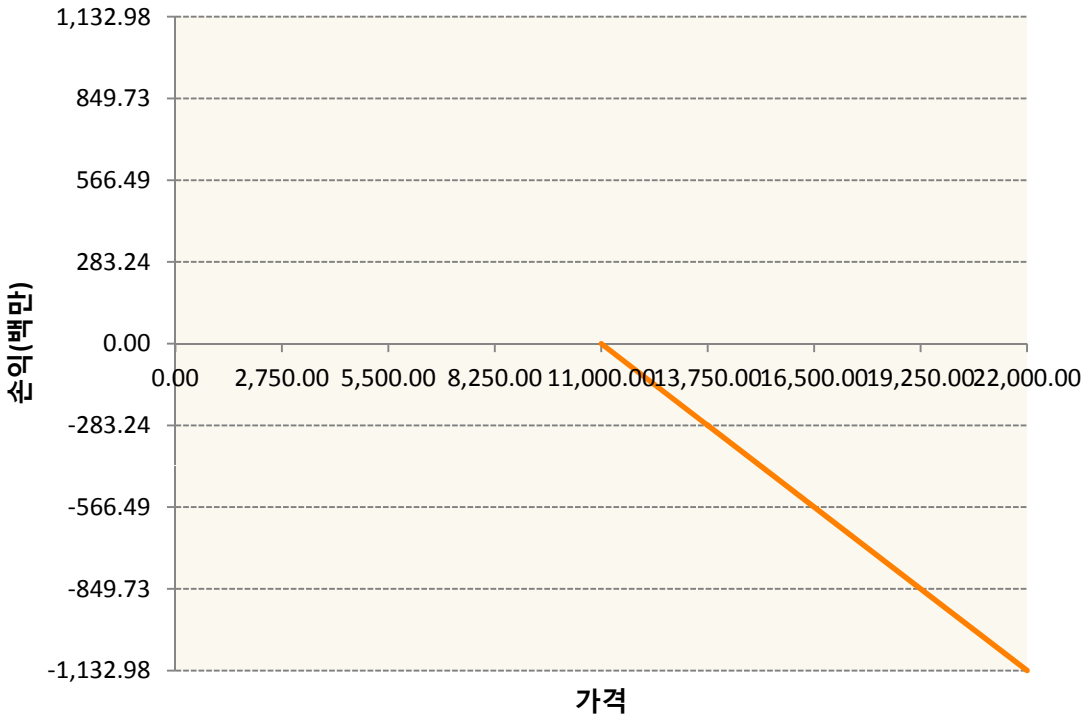
2. 만기시점의 손익구조



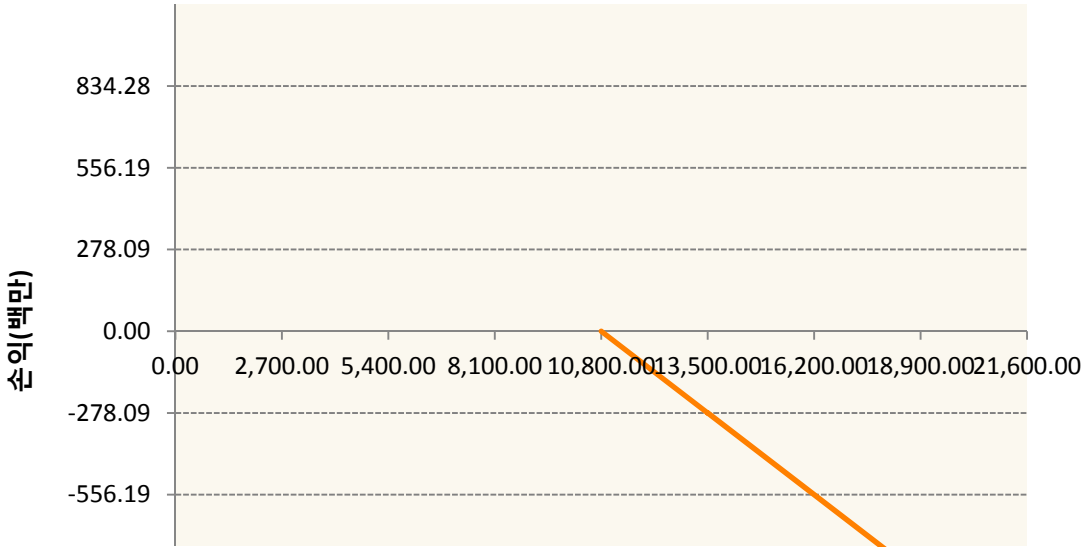


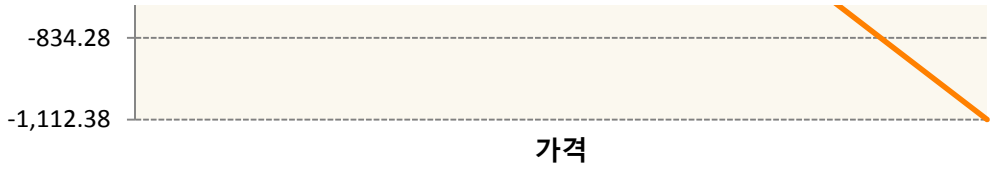


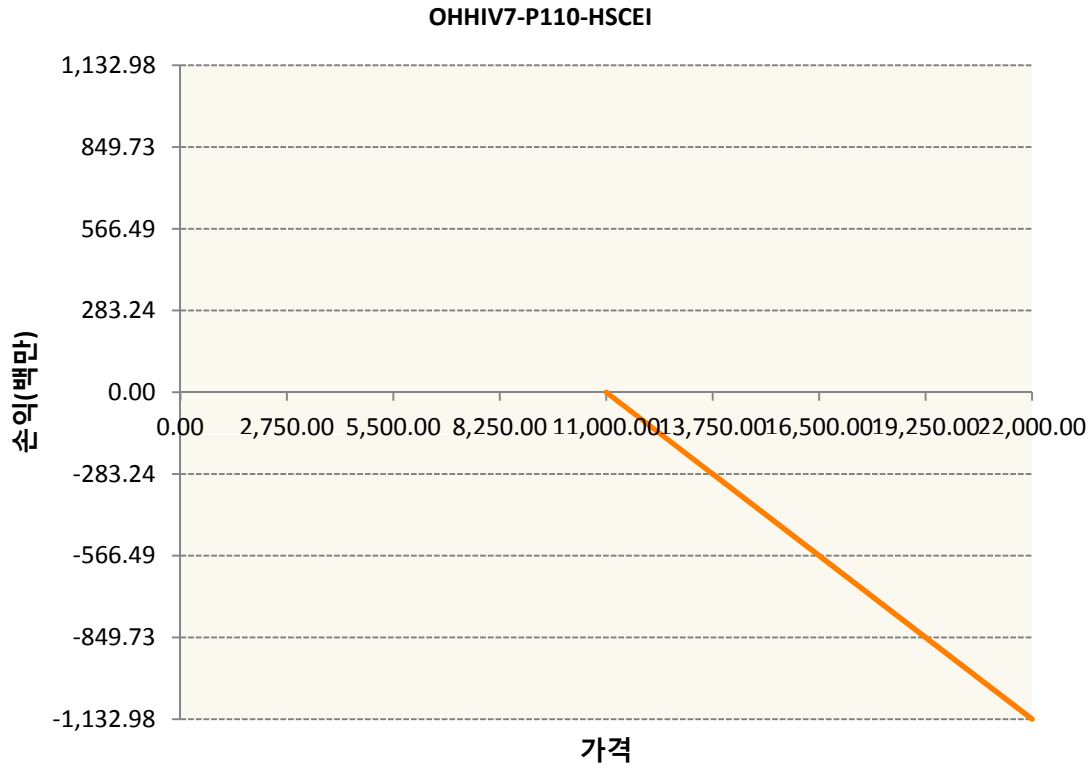
OHHIV7-C110-HSCEI



OHHIV7-P108-HSCEI







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCV7	H-SHARES IDX FUT Oct17	369
OHHIV7-C1(	HSCEI	89
OHHIV7-C11	HSCEI	91
OHHIV7-P1(	HSCEI	89
OHHIV7-P11	HSCEI	91

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	598

공시일	2017-09-29
기준일	2017-09-28

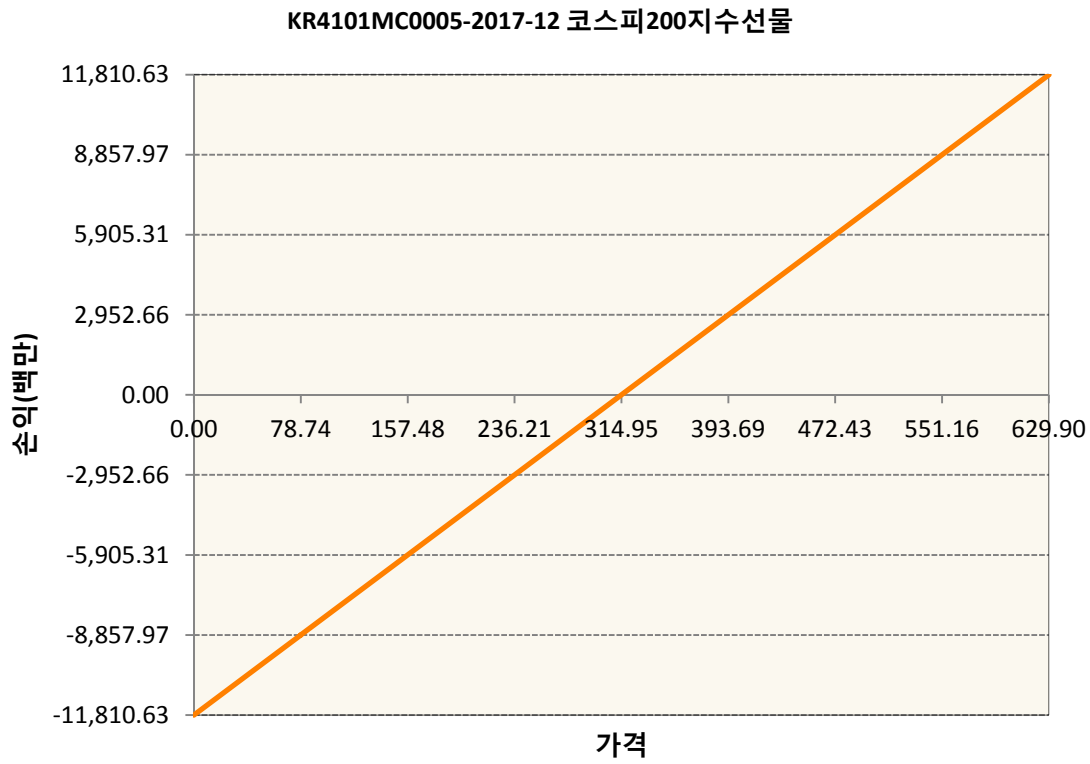
코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼

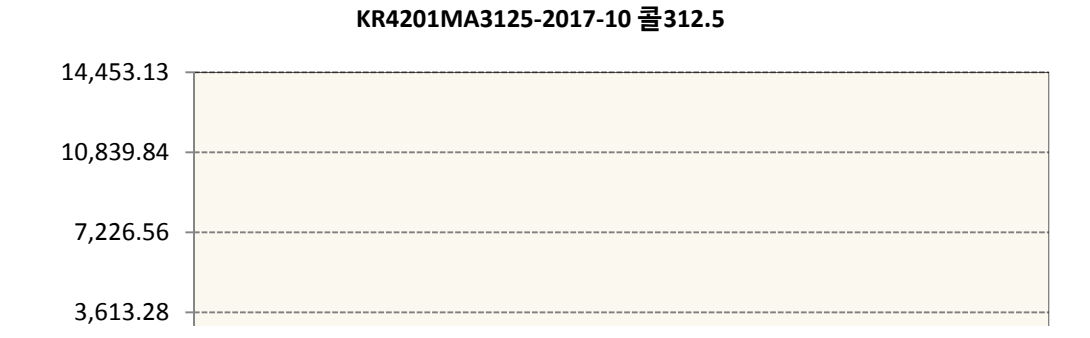
1. 계약금액

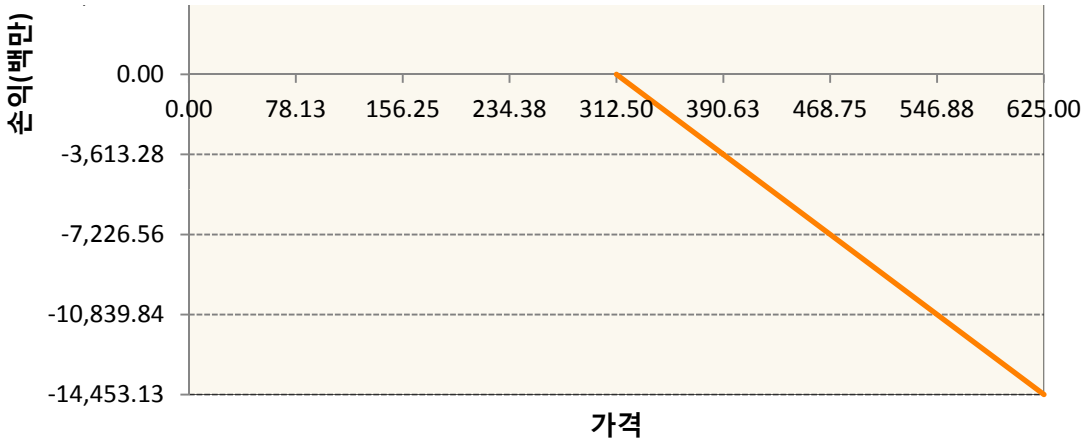
(단위:백만원)

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	11,811	0	11,811	장내
누계	유가증권	스왑	27,000	0	27,000	장외
누계	유가증권	옵션	0	25,781	-25,781	장내

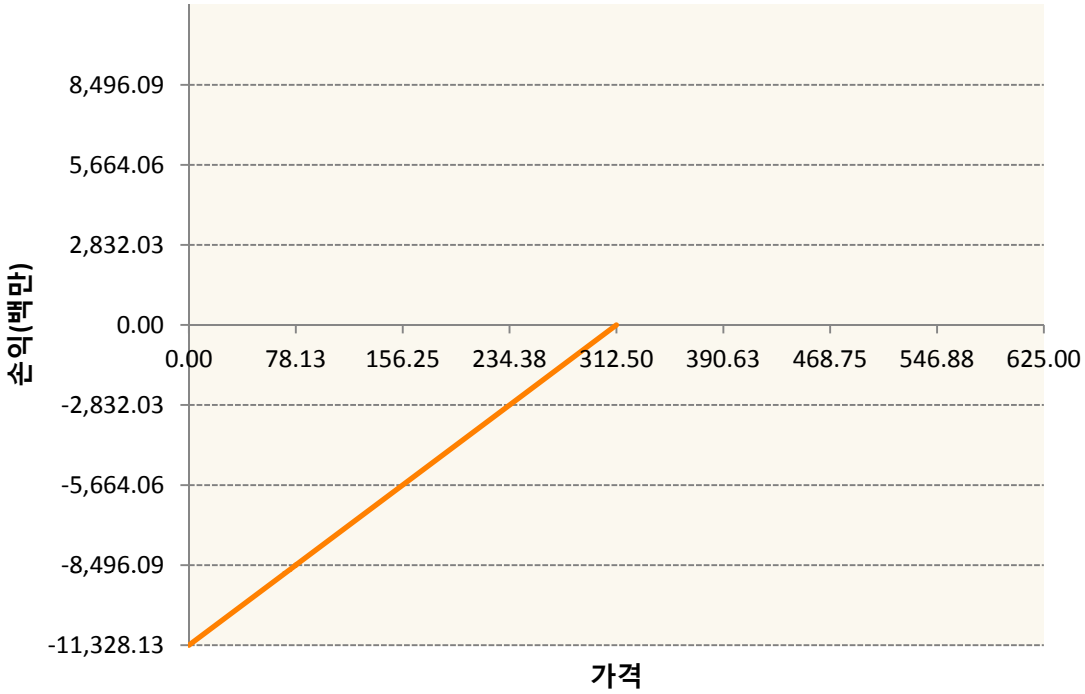
2. 만기시점의 손익구조







KR4301MA3124-2017-10 풋312.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_2							1,499
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,499	-1,499	-1,499	-1,499	-1,499	-1,499	-1,499
-5.33%	-999	-999	-999	-999	-999	-999	-999
-2.67%	-500	-500	-500	-500	-500	-500	-500
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	500	500	500	500	500	500	500
5.33%	999	999	999	999	999	999	999
8.00%	1,499	1,499	1,499	1,499	1,499	1,499	1,499

2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_3							284
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-284	-284	-284	-284	-284	-284	-284
-5.33%	-189	-189	-189	-189	-189	-189	-189
-2.67%	-95	-95	-95	-95	-95	-95	-95
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	95	95	95	95	95	95	95
5.33%	189	189	189	189	189	189	189
8.00%	284	284	284	284	284	284	284
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							243
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-243	-243	-243	-243	-243	-243	-243
-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%	243	243	243	243	243	243	243
KR4101MC0(2017-12 코스피200지수선물							942
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-942	-942	-942	-942	-942	-942	-942
-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%	942	942	942	942	942	942	942
KR4201MA3 2017-10 콜312.5							958
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	292	291	288	284	279	272	265

-5.33%	280	272	262	251	240	227	213
-2.67%	221	203	185	166	147	128	108
0%	65	43	22	0	-22	-43	-65
2.67%	-205	-221	-237	-254	-272	-290	-309
5.33%	-553	-559	-567	-577	-588	-600	-613
8.00%	-931	-932	-935	-939	-944	-951	-958
KR4301MA3 2017-10 풋312.5							773

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-772	-772	-772	-772	-772	-772	-773
-5.33%	-469	-469	-470	-471	-472	-474	-476
-2.67%	-176	-181	-186	-192	-198	-205	-212
0%	27	18	9	0	-9	-18	-27
2.67%	84	81	78	74	69	64	59
5.33%	88	88	88	87	87	85	84
8.00%	88	88	88	88	88	88	88

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

4,701

공시일	2017-09-29
기준일	2017-09-28

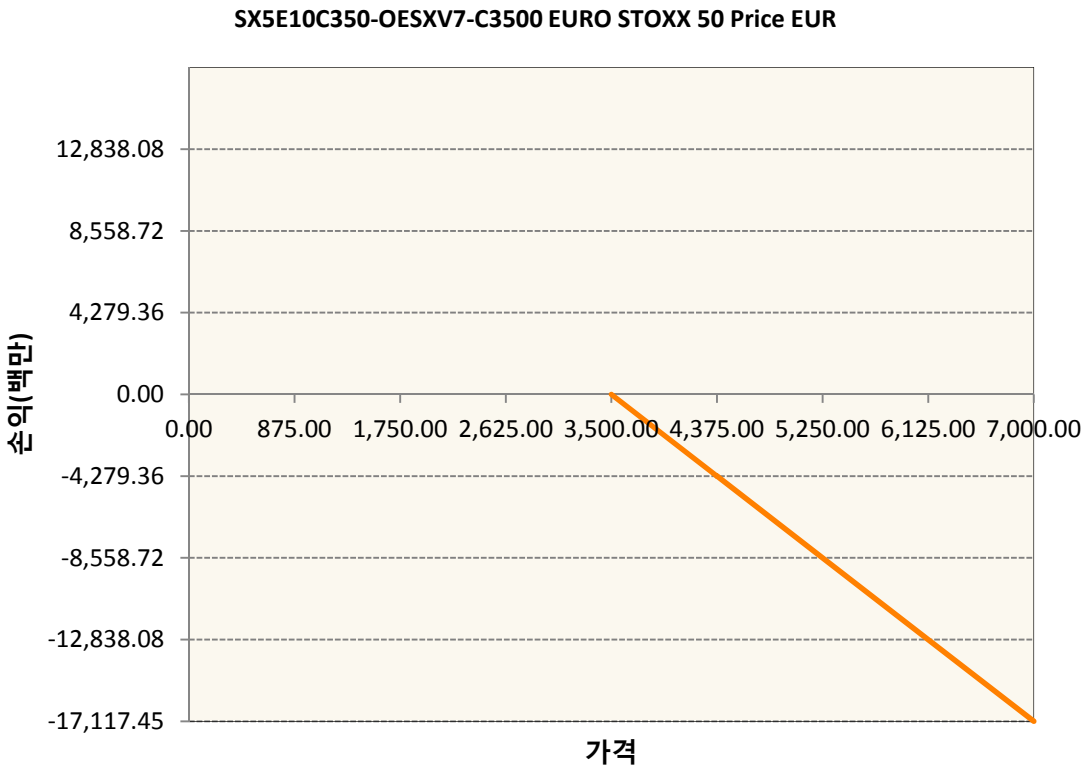
유로커버드콜모(주식혼합-파생형

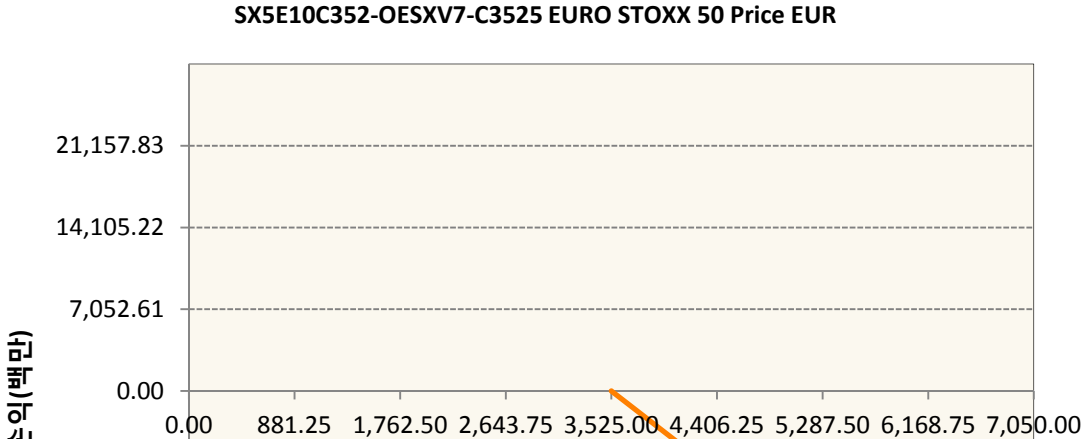
1. 계약금액

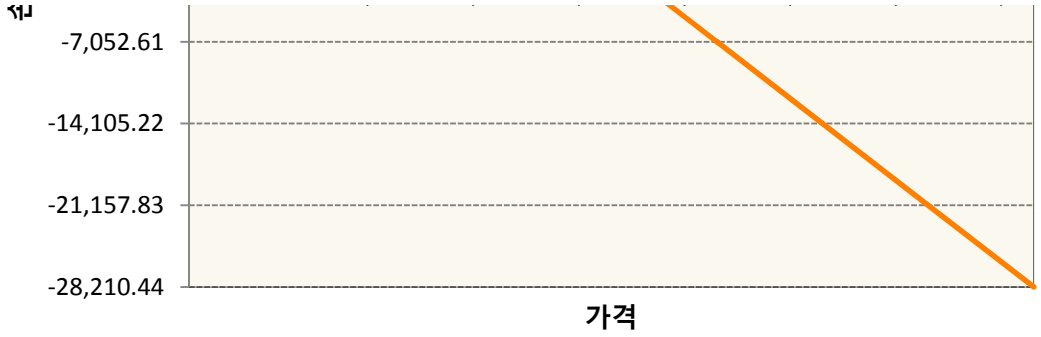
(단위:백만원)

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	41,586	0	41,586	
누계	유가증권	옵션	0	90,656	-90,656	장내

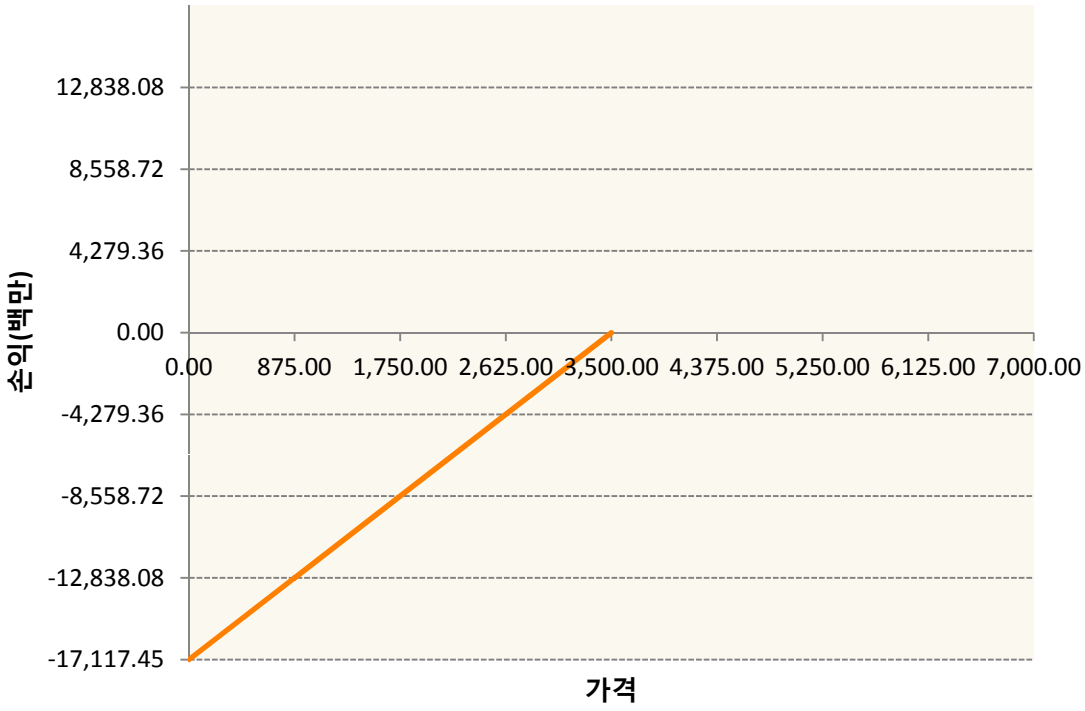
2. 만기시점의 손익구조



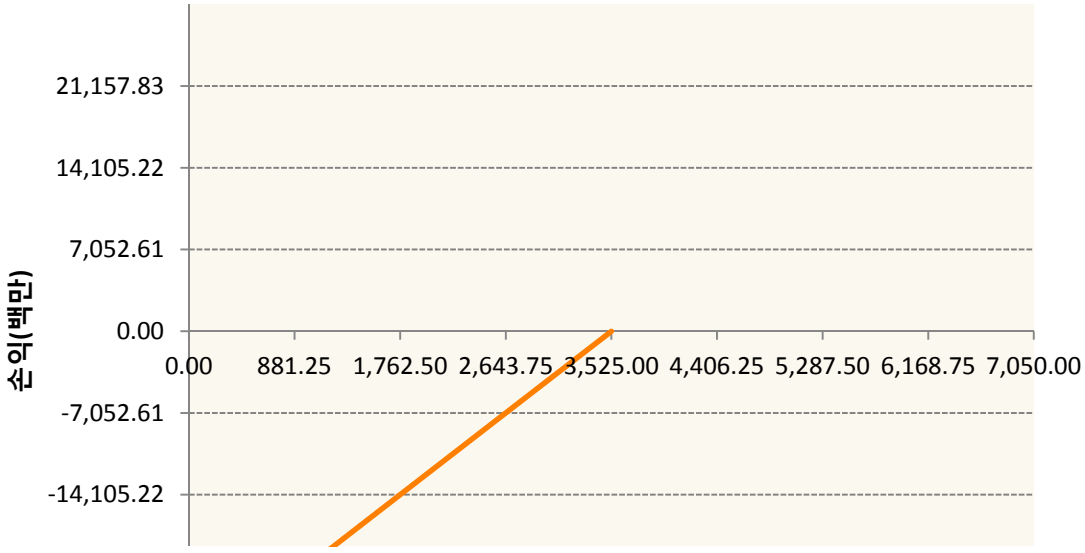


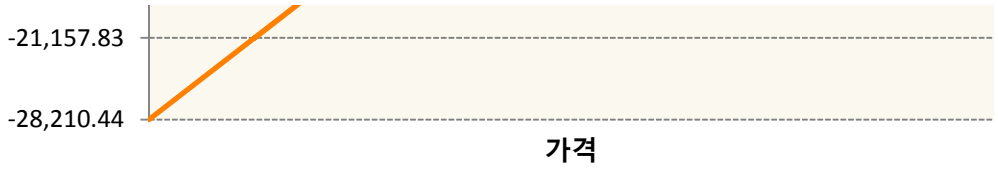


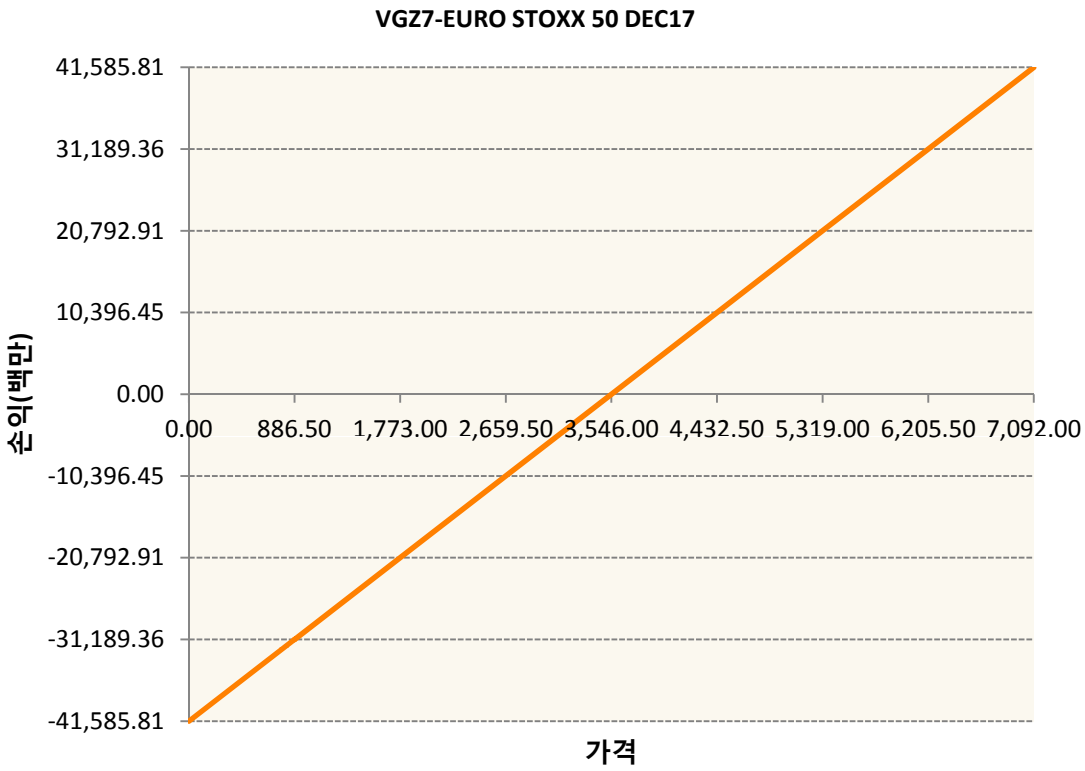
SX5E10P350-OESXV7-P3500 EURO STOXX 50 Price EUR



SX5E10P352-OESXV7-P3525 EURO STOXX 50 Price EUR







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
SX5E10C350	OESXV7-C3500 EURO STOXX 50 Price EUR	1,369
SX5E10C352	OESXV7-C3525 EURO STOXX 50 Price EUR	2,257
SX5E10P350	OESXV7-P3500 EURO STOXX 50 Price EUR	1,369
SX5E10P352	OESXV7-P3525 EURO STOXX 50 Price EUR	2,257
VGZ7	EURO STOXX 50 DEC17	3,327

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	8,191

공시일	2017-09-29
기준일	2017-09-28

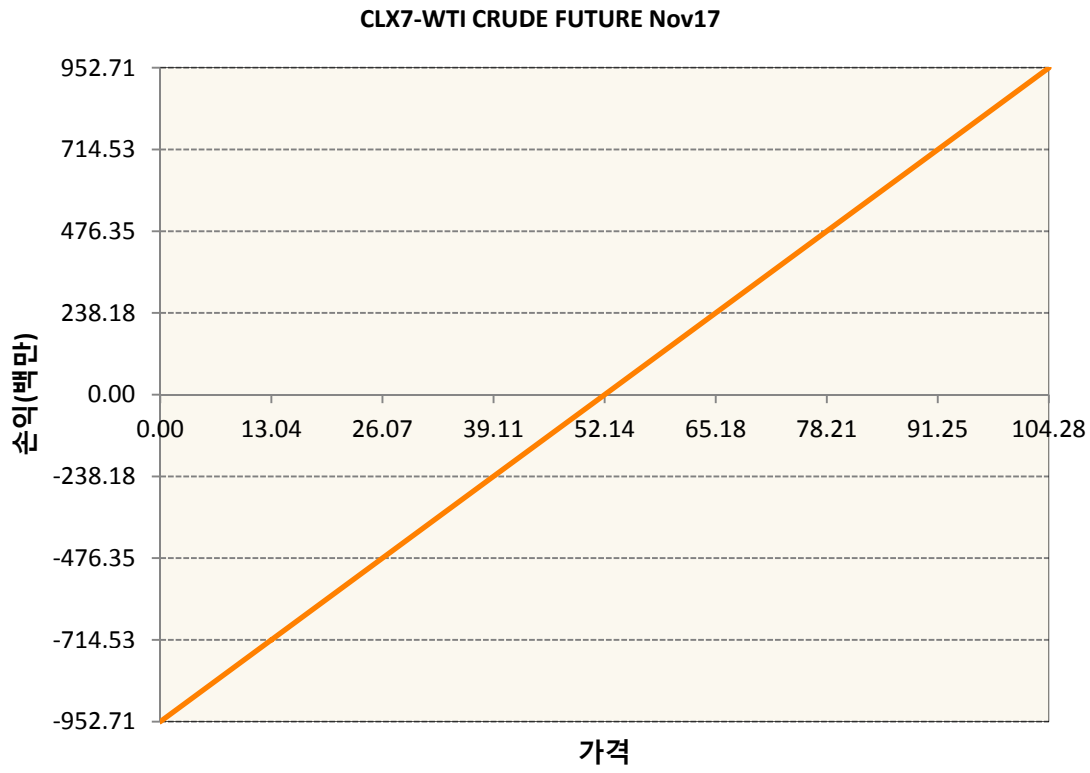
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

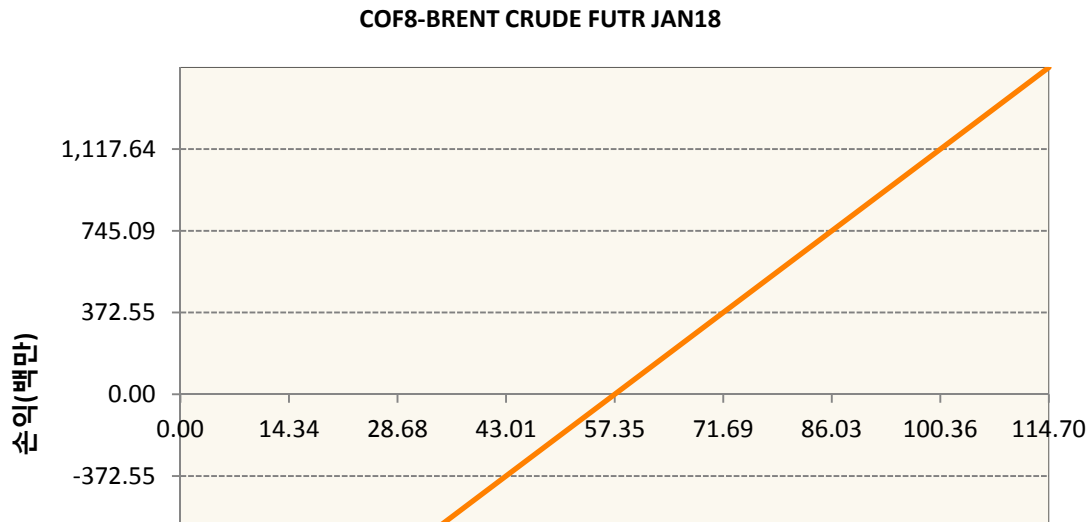
1. 계약금액

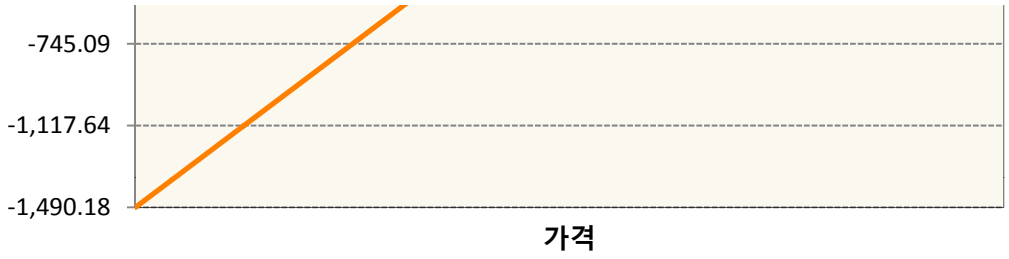
(단위:백만원)

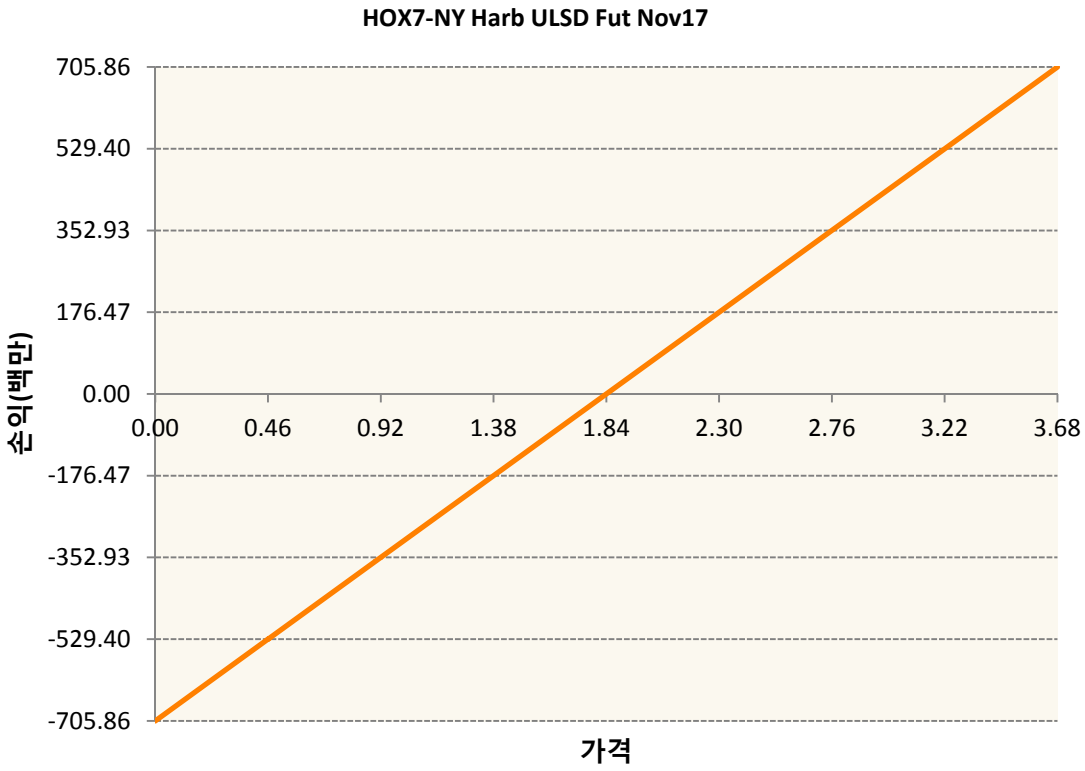
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	5,246	920	4,327	

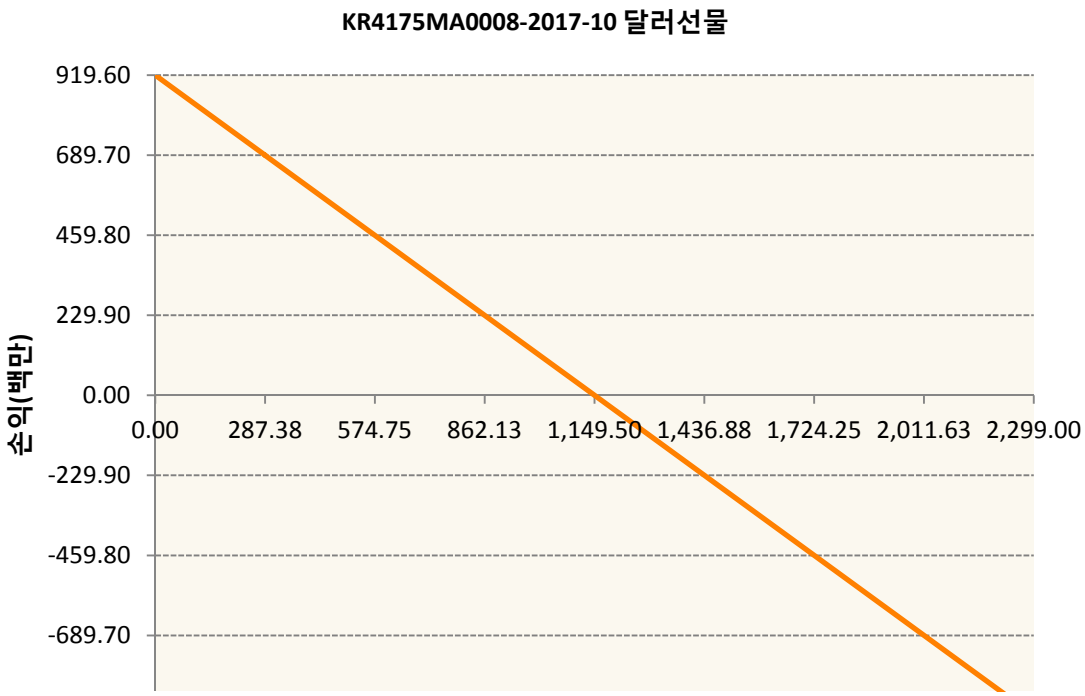
2. 만기시점의 손익구조

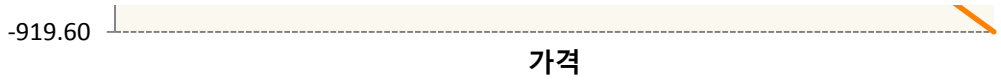


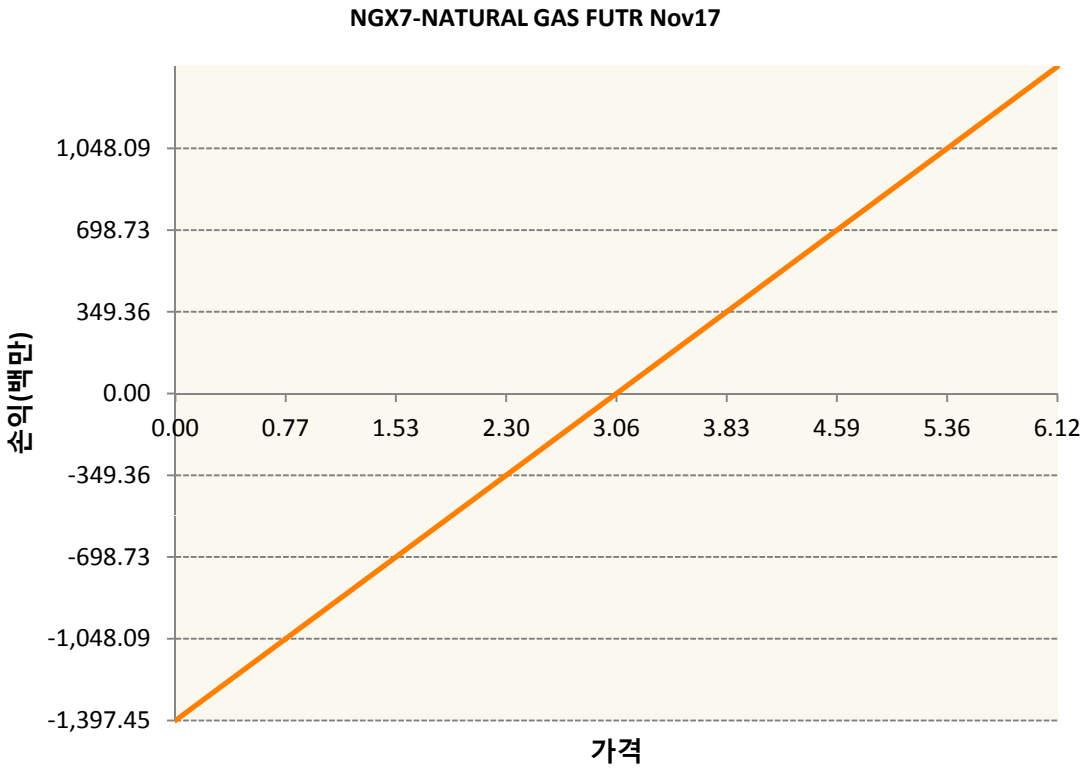


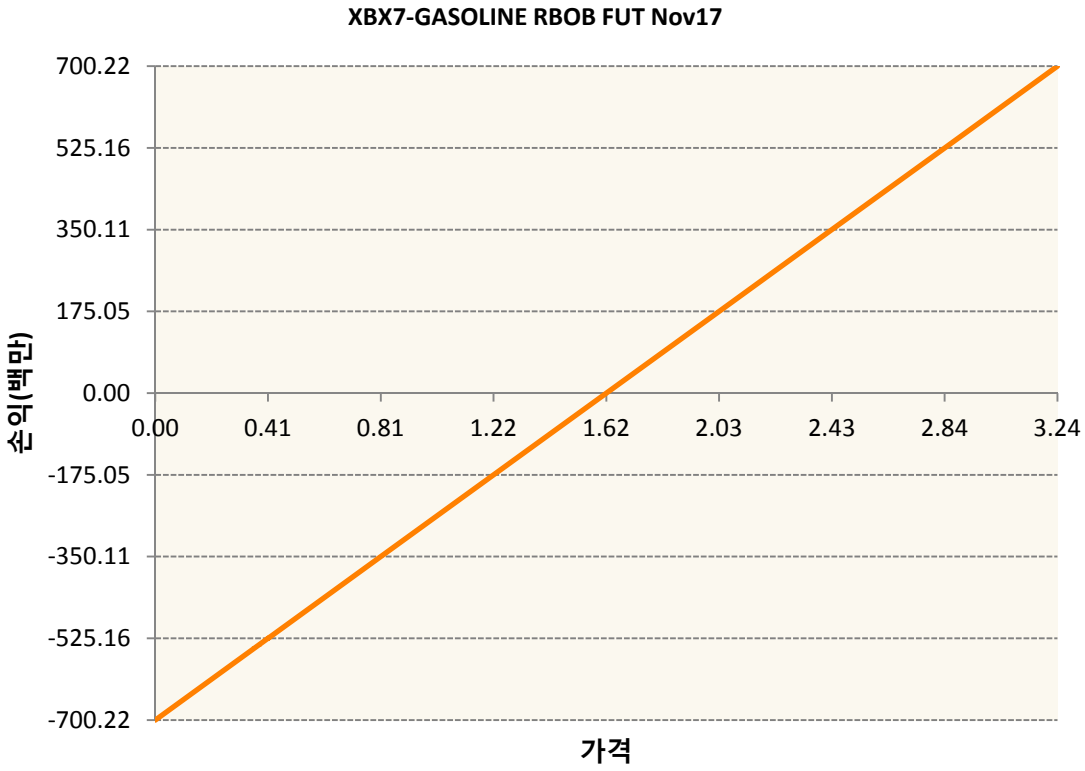

-745.09
-1,117.64
-1,490.18
가격


HOX7-NY Harb ULSD Fut Nov17
705.86
529.40
352.93
176.47
0.00
-176.47
-352.93
-529.40
-705.86
0.00
0.46
0.92
1.38
1.84
2.30
2.76
3.22
3.68
손익(만)
가격


KR4175MA0008-2017-10 달러선물
919.60
689.70
459.80
229.90
0.00
-229.90
-459.80
-689.70
0.00
287.38
574.75
862.13
1,149.50
1,436.88
1,724.25
2,011.63
2,299.00
손익(만)


-919.60
가격


NGX7-NATURAL GAS FUTR Nov17
1,048.09
698.73
349.36
0.00
-349.36
-698.73
-1,048.09
-1,397.45
0.00
0.77
1.53
2.30
3.06
3.83
4.59
5.36
6.12
손익(백만)
가격


XBX7-GASOLINE RBOB FUT Nov17
700.22
525.16
350.11
175.05
0.00
-175.05
-350.11
-525.16
-700.22
0.00
0.41
0.81
1.22
1.62
2.03
2.43
2.84
3.24
손익(백만)
가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLX7	WTI CRUDE FUTURE Nov17	76
COF8	BRENT CRUDE FUTR JAN18	119
HOX7	NY Harb ULSD Fut Nov17	56
KR4175MA0	2017-10 달러선물	74
NGX7	NATURAL GAS FUTR Nov17	112
XBX7	GASOLINE RBOB FUT Nov17	56

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

758

공시일	2017-09-29
기준일	2017-09-28

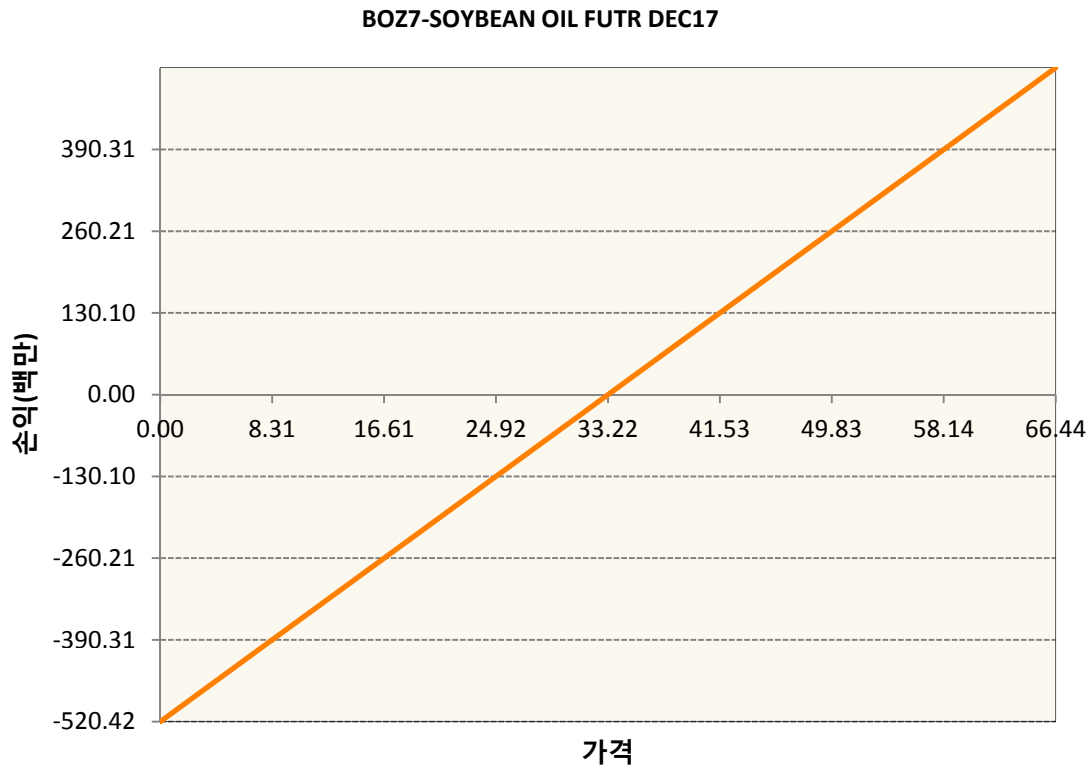
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

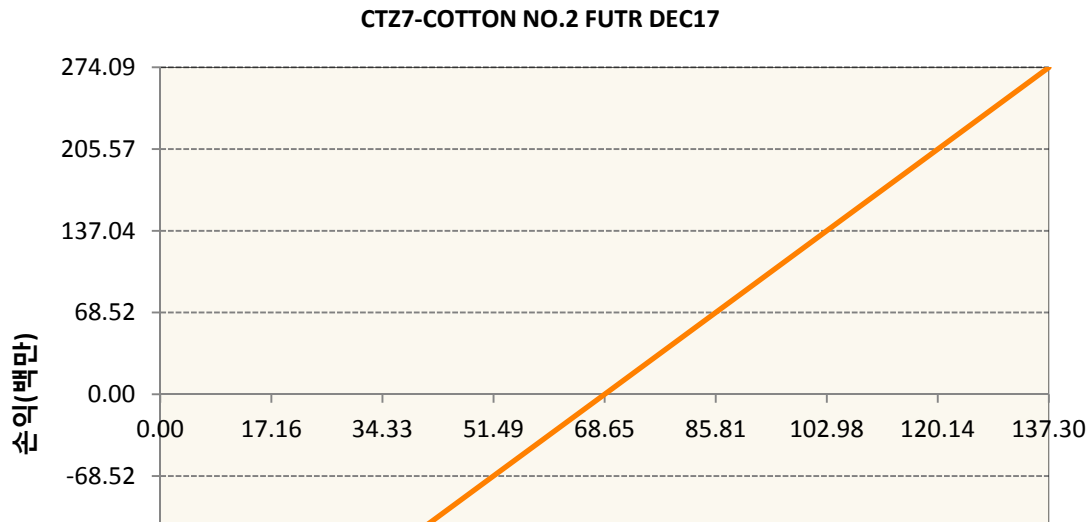
1. 계약금액

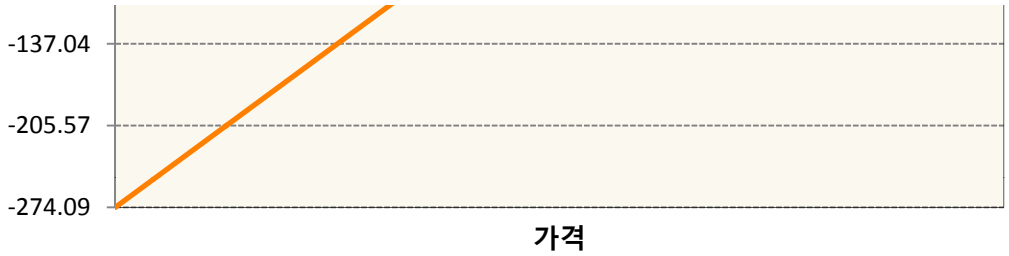
(단위:백만원)

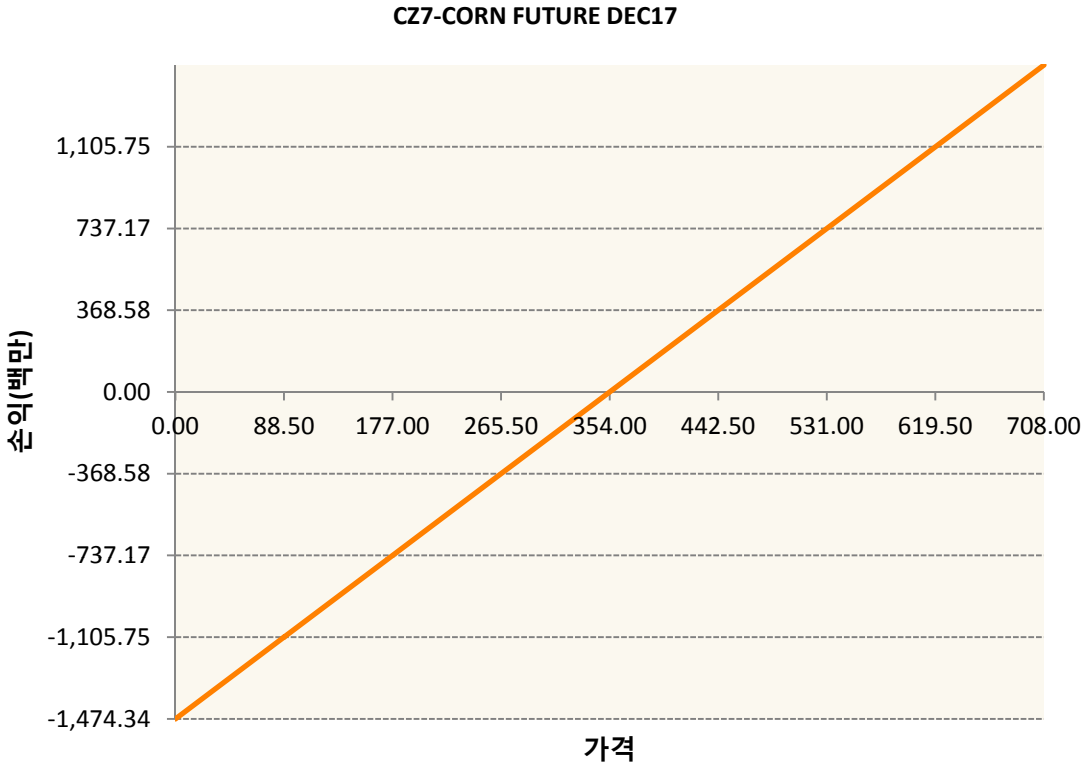
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	5,635	345	5,290	

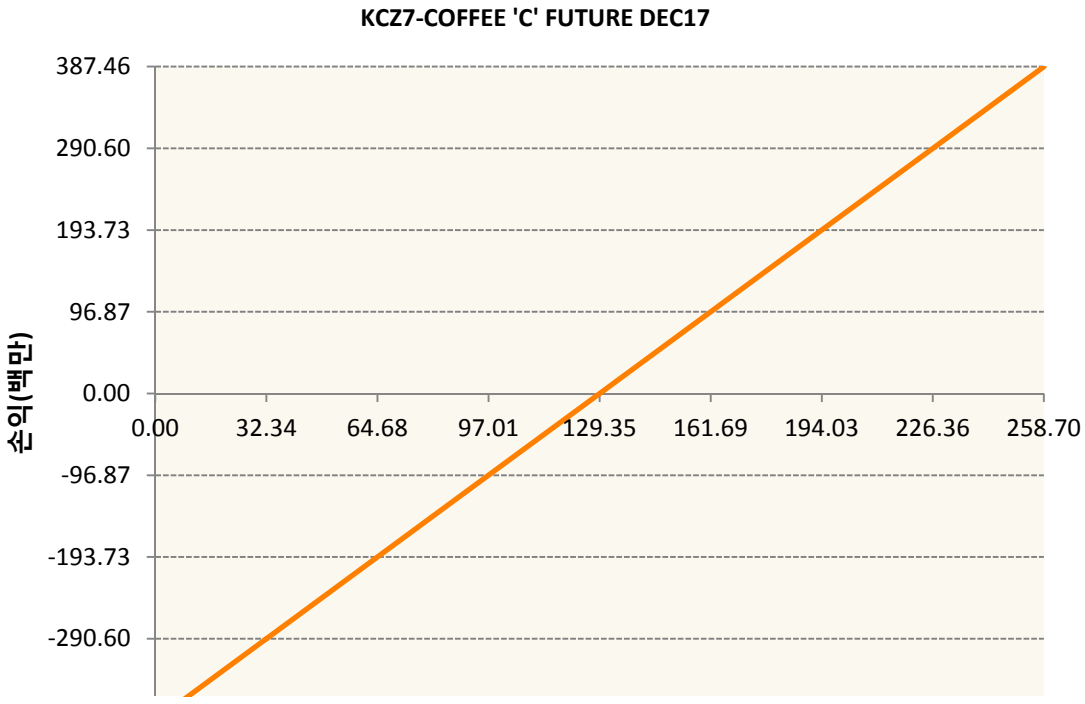
2. 만기시점의 손익구조

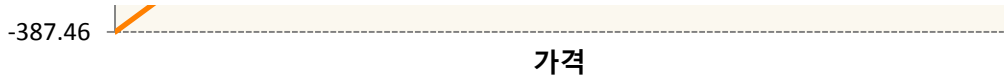


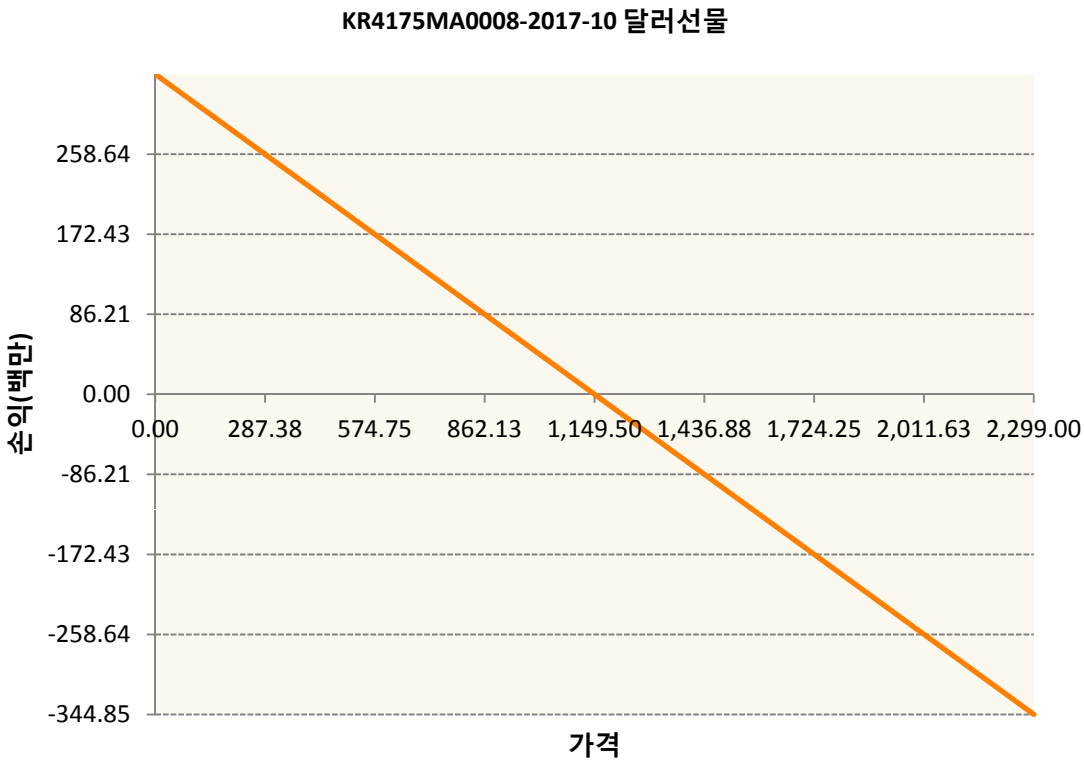


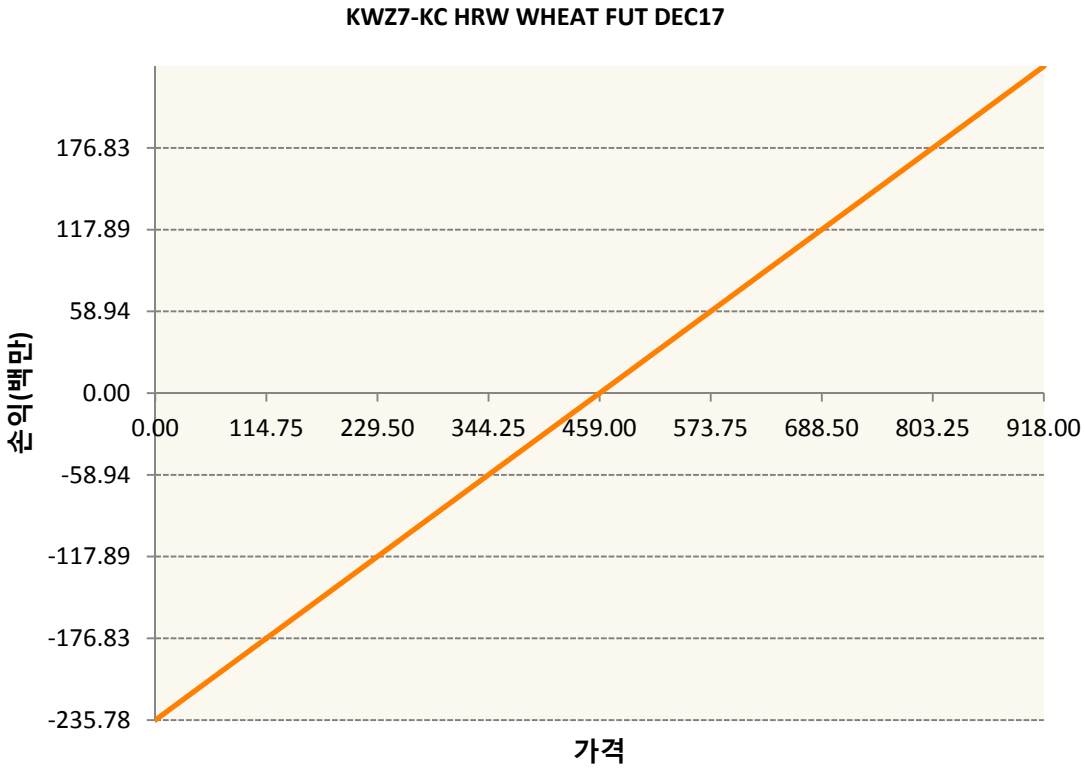

-137.04
-205.57
-274.09
가격

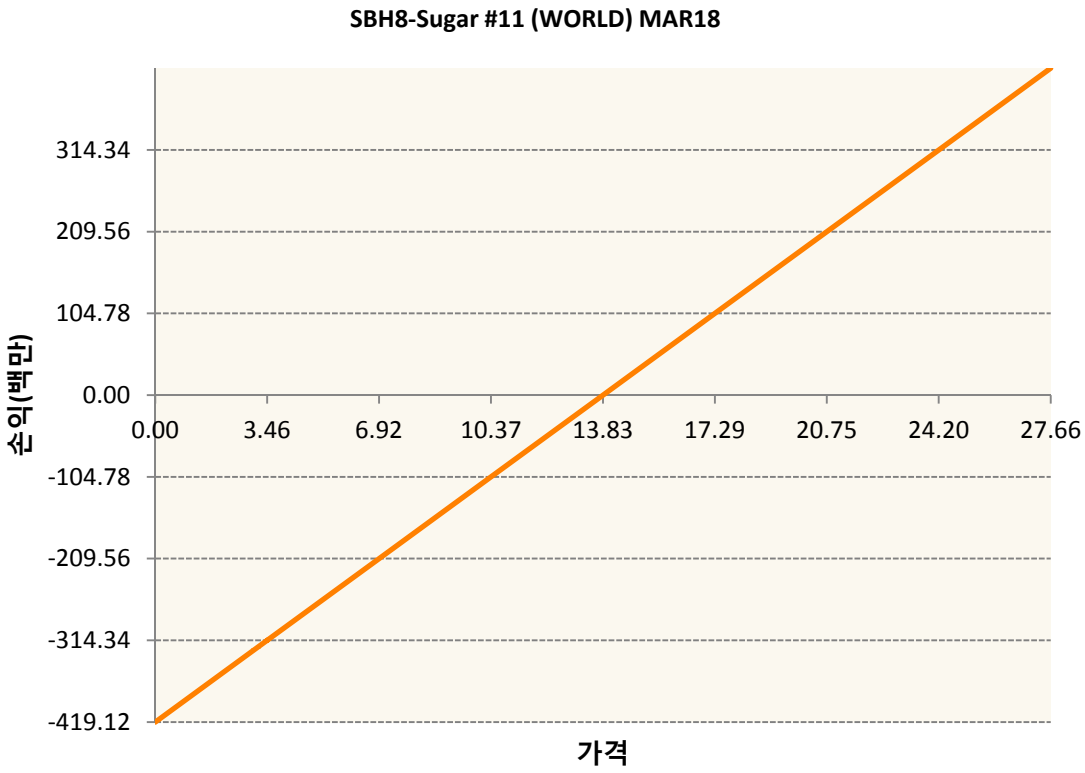

CZ7-CORN FUTURE DEC17
1,105.75
737.17
368.58
0.00
-368.58
-737.17
-1,105.75
-1,474.34
0.00
88.50
177.00
265.50
354.00
442.50
531.00
619.50
708.00
손익(백만)
가격

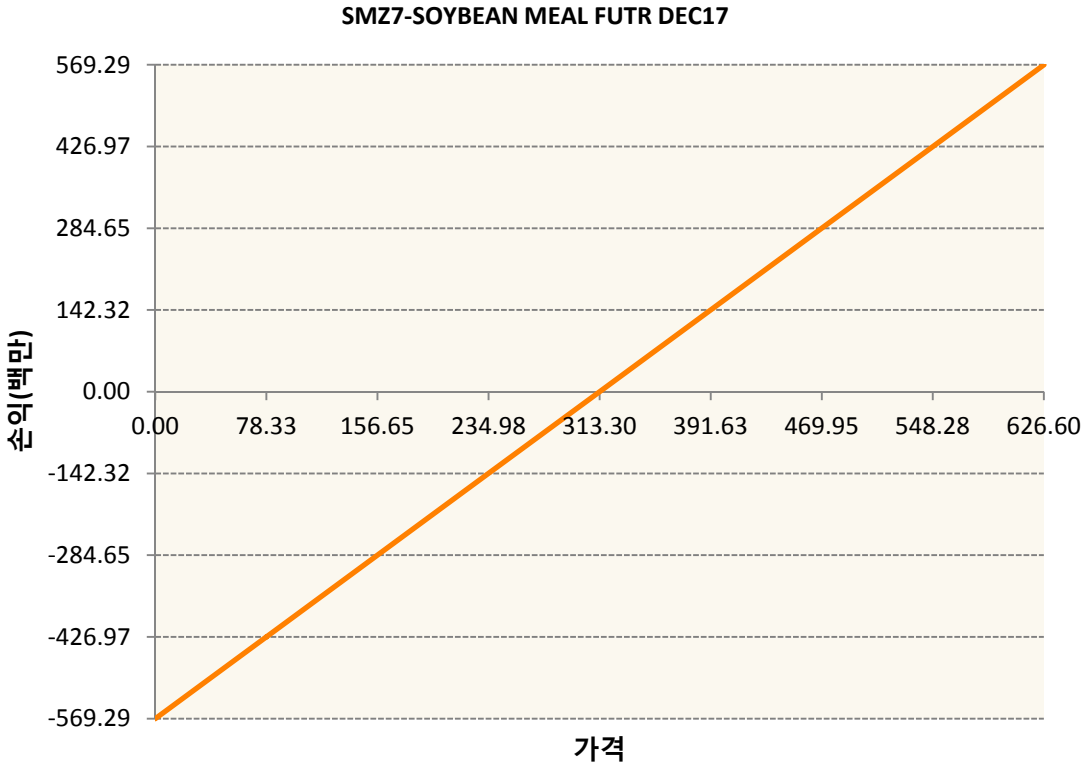

KCZ7-COFFEE 'C' FUTURE DEC17
387.46
290.60
193.73
96.87
0.00
-96.87
-193.73
-290.60
0.00
32.34
64.68
97.01
129.35
161.69
194.03
226.36
258.70
손익(백만)

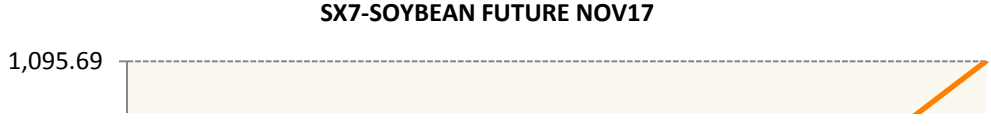

-387.46
가격

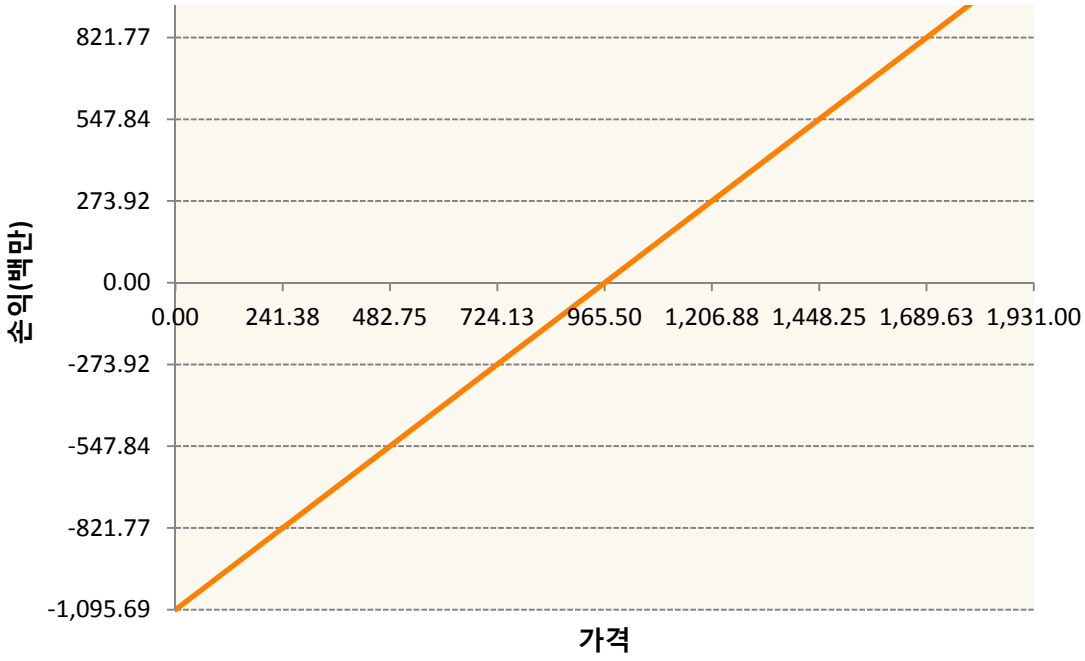

KR4175MA0008-2017-10 달러선물
258.64
172.43
86.21
0.00
-86.21
-172.43
-258.64
-344.85
0.00
287.38
574.75
862.13
1,149.50
1,436.88
1,724.25
2,011.63
2,299.00
손익(백만)
가격

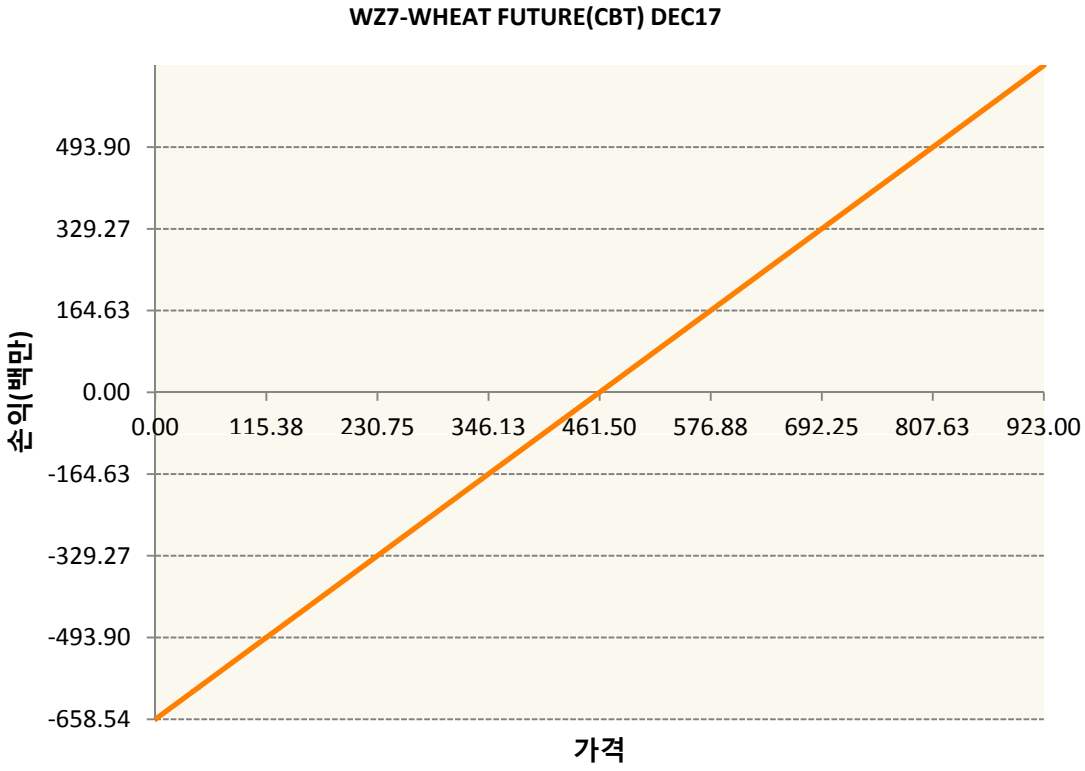

KWZ7-KC HRW WHEAT FUT DEC17
176.83
117.89
58.94
0.00
-58.94
-117.89
-176.83
-235.78
0.00
114.75
229.50
344.25
459.00
573.75
688.50
803.25
918.00
손익(백만)
가격


SBH8-Sugar #11 (WORLD) MAR18
314.34
209.56
104.78
0.00
-104.78
-209.56
-314.34
-419.12
0.00
3.46
6.92
10.37
13.83
17.29
20.75
24.20
27.66
손익(백만)
가격


SMZ7-SOYBEAN MEAL FUTR DEC17
569.29
426.97
284.65
142.32
0.00
-142.32
-284.65
-426.97
-569.29
0.00
78.33
156.65
234.98
313.30
391.63
469.95
548.28
626.60
손익(백만)
가격


SX7-SOYBEAN FUTURE NOV17
1,095.69





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
BOZ7	SOYBEAN OIL FUTR DEC17	42
CTZ7	COTTON NO.2 FUTR DEC17	22
CZ7	CORN FUTURE DEC17	118
KCZ7	COFFEE 'C' FUTURE DEC17	31
KR4175MA0	2017-10 달러선물	28

KWZ7	KC HRW WHEAT FUT DEC17	19
SBH8	Sugar #11 (WORLD) MAR18	34
SMZ7	SOYBEAN MEAL FUTR DEC17	46
SX7	SOYBEAN FUTURE NOV17	88
WZ7	WHEAT FUTURE(CBT) DEC17	53

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

523