공시일	2017-10-11
기준일	2017-10-10

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	2017-10-11
기준일	2017-10-10

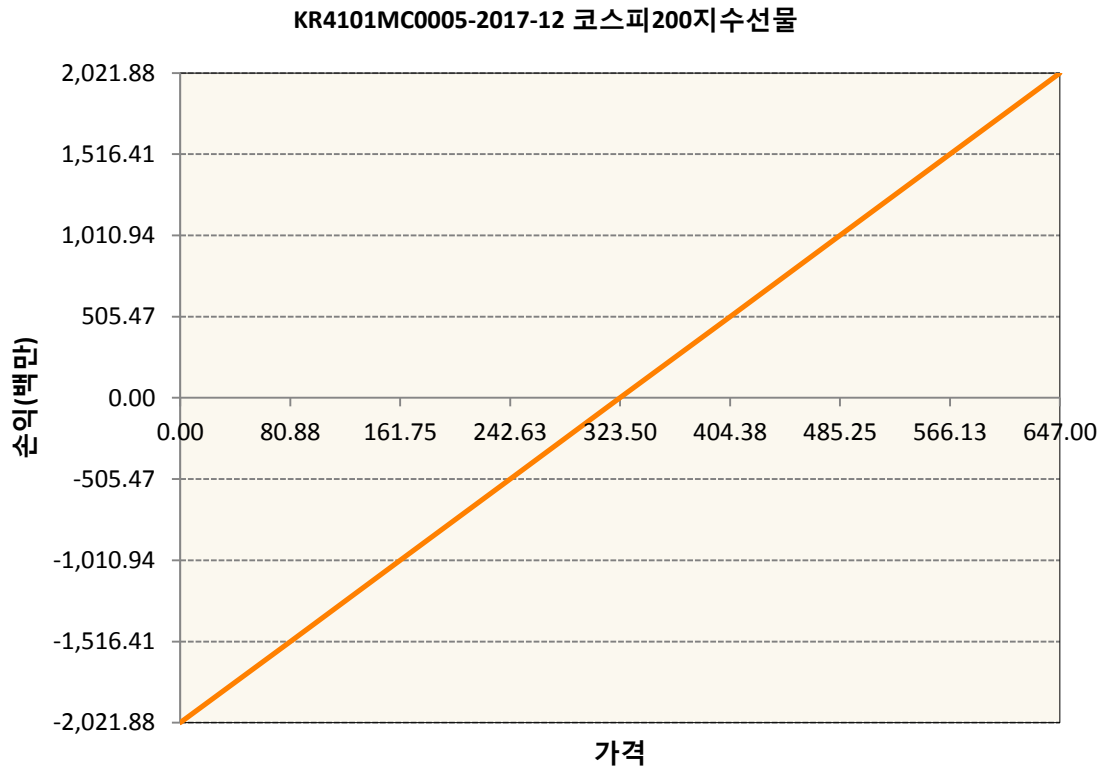
스마트인덱스모

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	2,022	0	2,022	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101MC0(2017-12 코스피200지수선물							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

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

98

공시일	2017-10-11
기준일	2017-10-10

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)

SWMXWO0C 신한MXWO 미래S170822	1,053

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

461

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-10-11
기준일	2017-10-10

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	428

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

366

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-10-11
기준일	2017-10-10

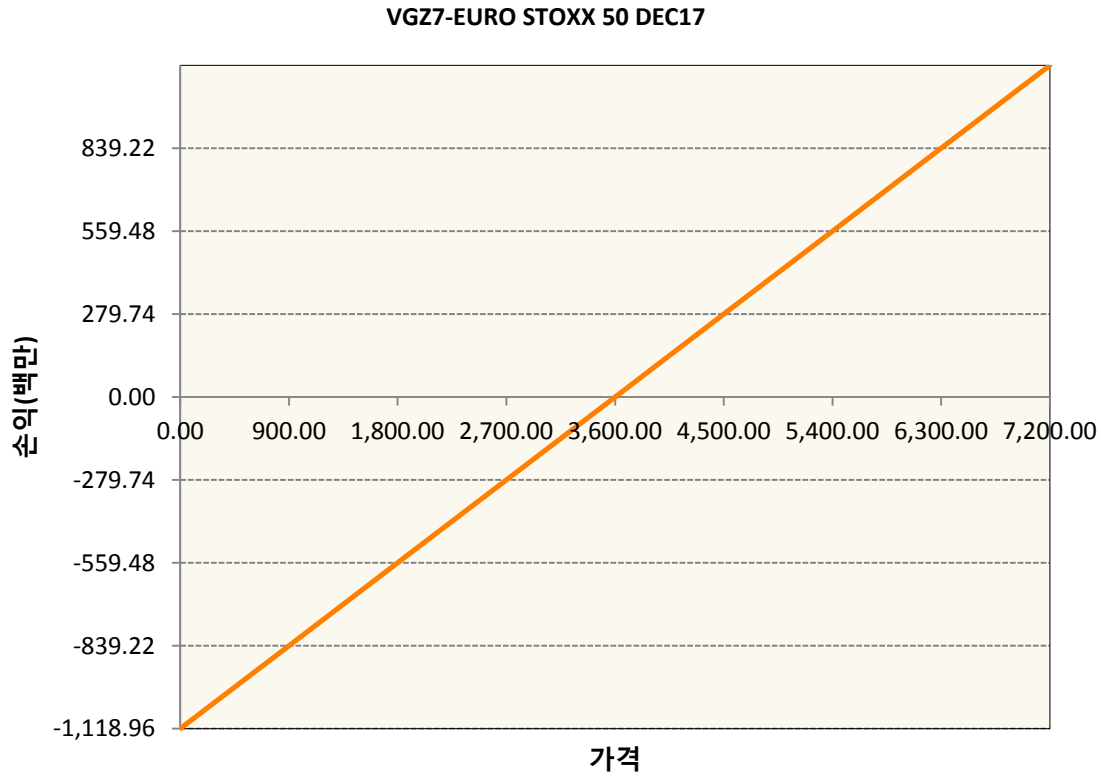
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,119	0	1,119	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGZ7	EURO STOXX 50 DEC17	90

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

(단위:백만원)

69

공시일	2017-10-11
기준일	2017-10-10

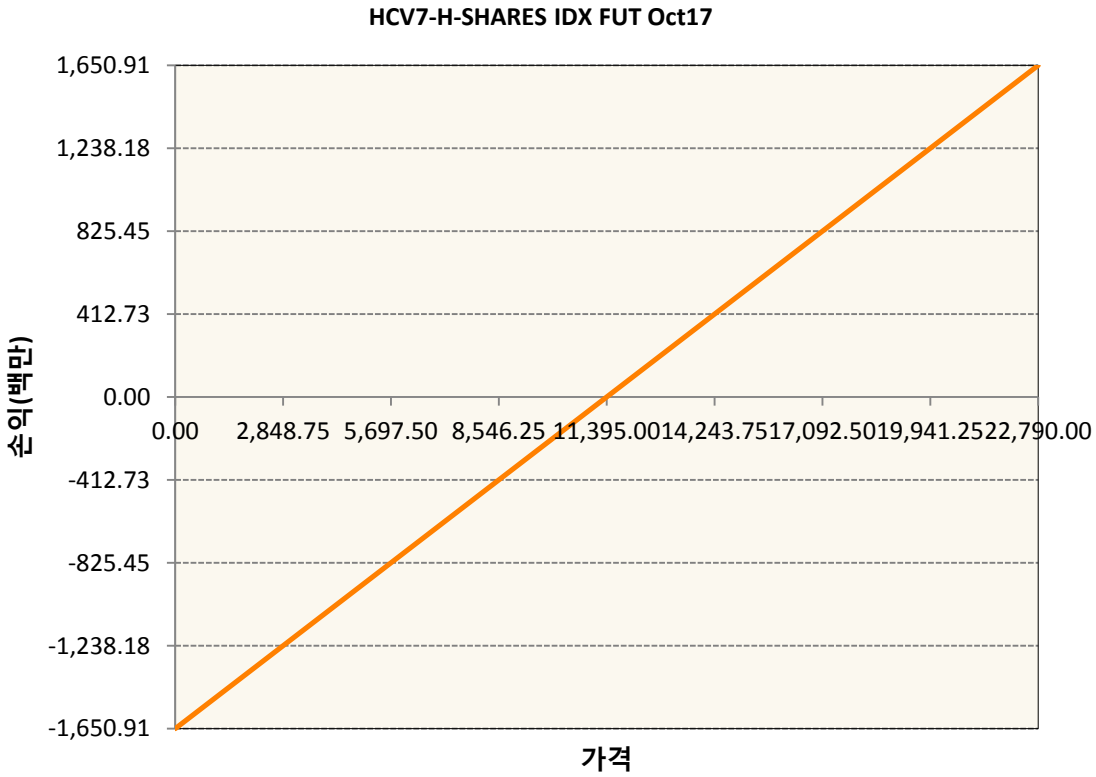
차이나인덱스모(주식-파생형)

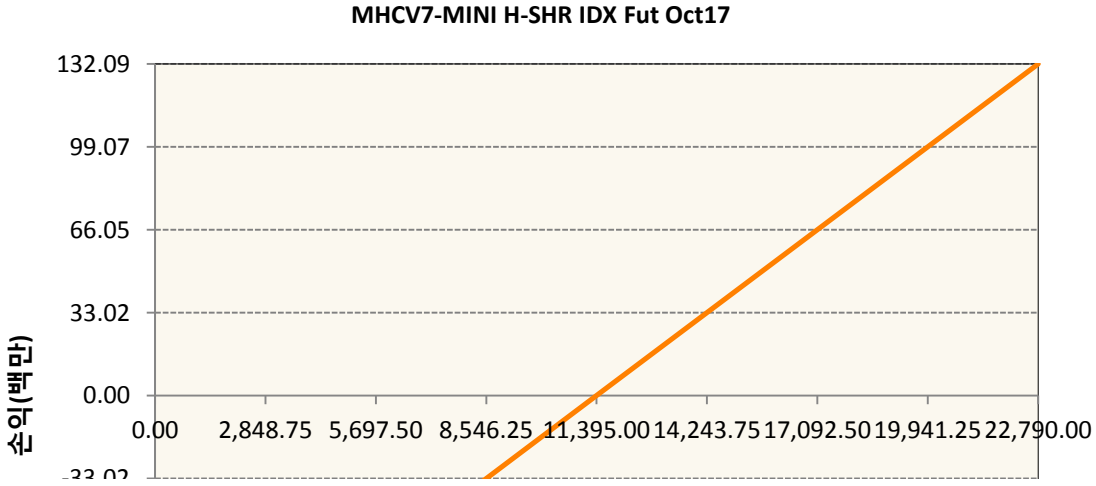
1. 계약금액

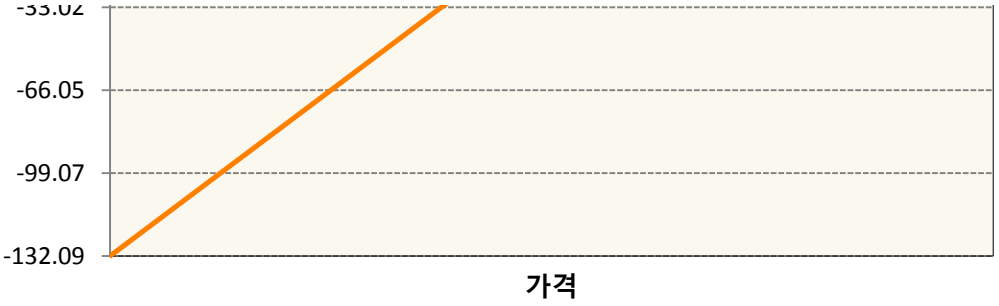
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,783	0	1,783	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

HCV7	H-SHARES IDX FUT Oct17	132
MHCV7	MINI H-SHR IDX Fut Oct17	11

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

118

공시일	2017-10-11
기준일	2017-10-10

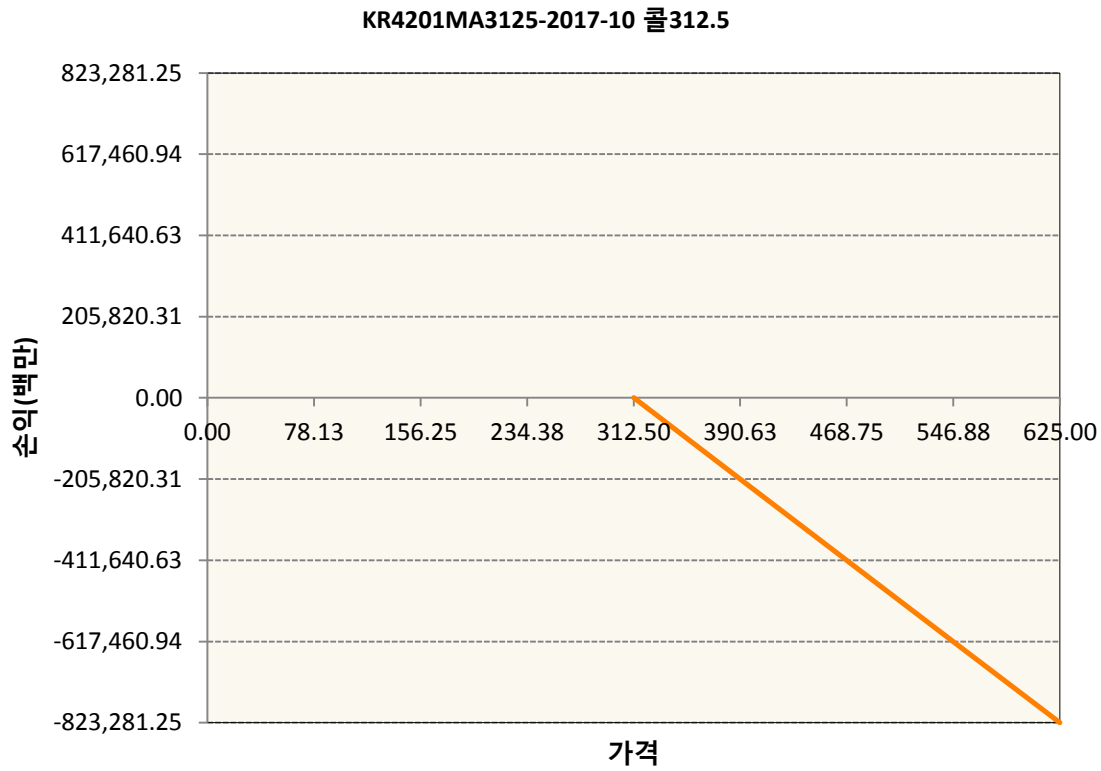
커버드콜모(주식혼합-파생형)

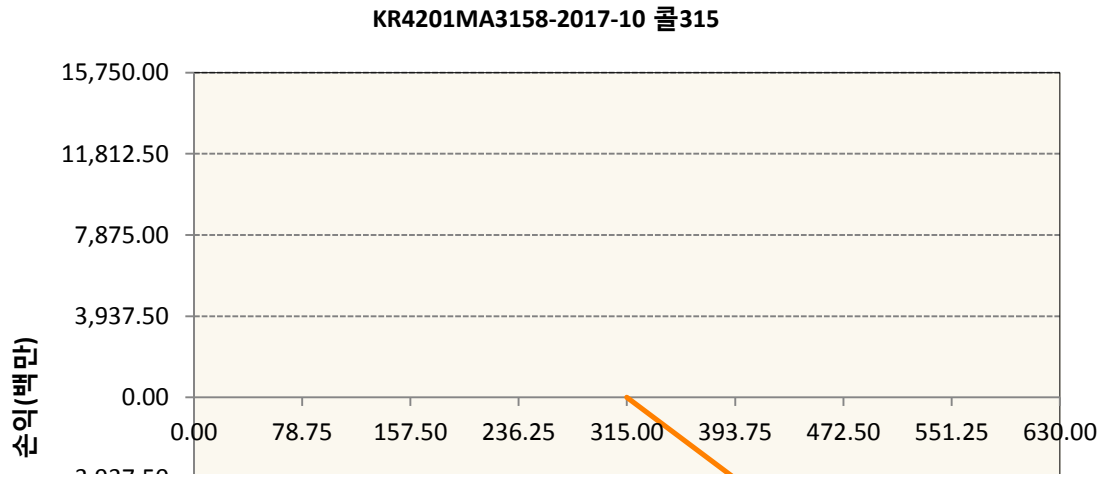
1. 계약금액

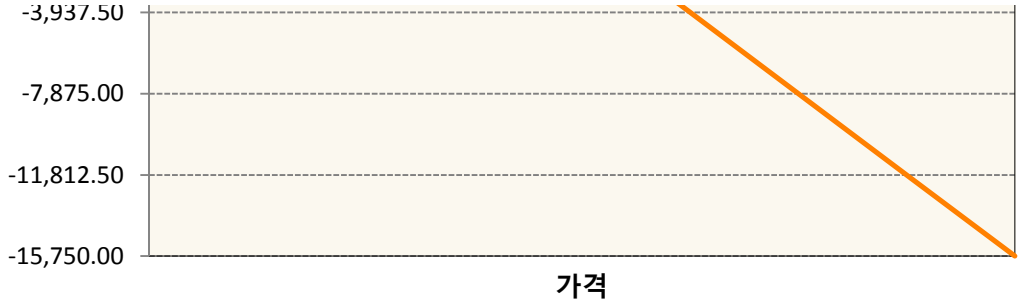
(단위:백만원)

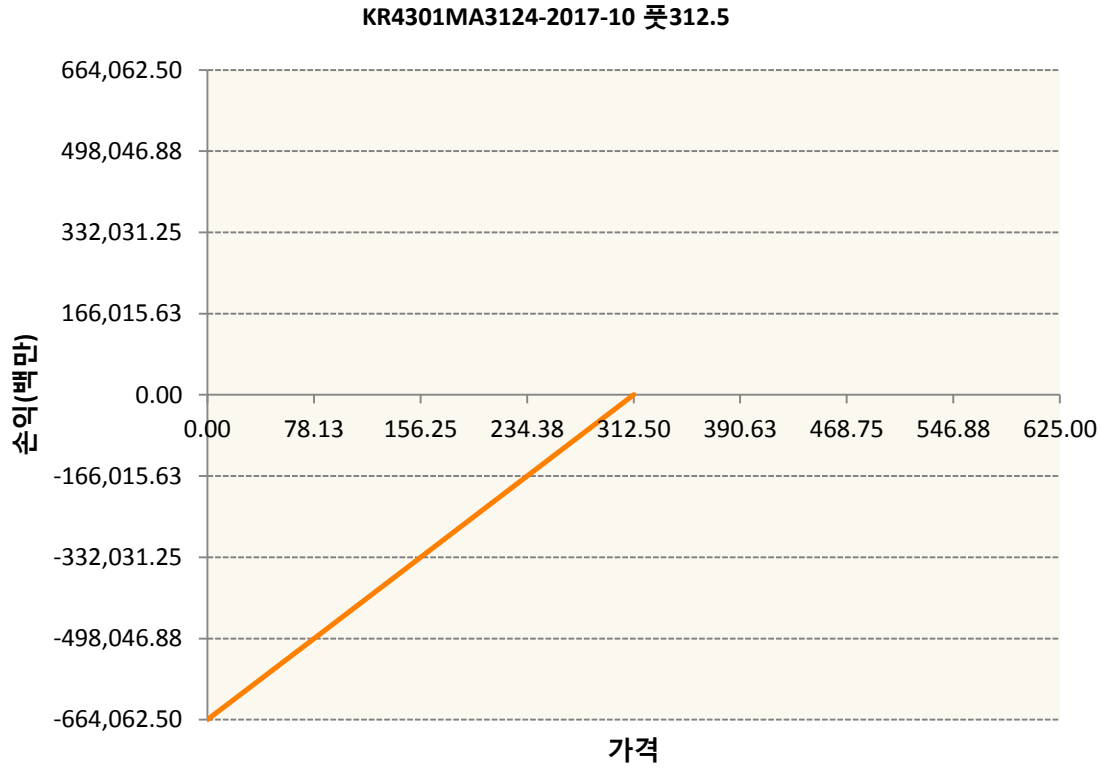
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	1,503,094	-1,503,094	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201MA3: 2017-10 콜312.5							67,759
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	26,525	26,525	26,523	26,519	26,512	26,498	26,475
-5.33%	26,368	26,256	26,110	25,933	25,728	25,496	25,242
-2.67%	20,147	19,693	19,236	18,775	18,312	17,846	17,379
0%	175	139	82	0	-107	-241	-399
2.67%	-22,450	-22,450	-22,451	-22,452	-22,455	-22,461	-22,473
5.33%	-45,104	-45,104	-45,104	-45,104	-45,104	-45,104	-45,105
8.00%	-67,759	-67,759	-67,759	-67,759	-67,759	-67,759	-67,759
KR4201MA3: 2017-10 콜315							1,279
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	386	386	386	386	386	386	386
-5.33%	385	385	384	382	380	378	375
-2.67%	329	320	311	302	293	284	275
0%	8	6	3	0	-4	-8	-13
2.67%	-419	-419	-419	-419	-419	-419	-420
5.33%	-849	-849	-849	-849	-849	-849	-849
8.00%	-1,279	-1,279	-1,279	-1,279	-1,279	-1,279	-1,279
KR4301MA3: 2017-10 풋312.5							33,586

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-33,586	-33,586	-33,586	-33,586	-33,586	-33,586	-33,586
-5.33%	-15,315	-15,318	-15,324	-15,336	-15,355	-15,381	-15,416
-2.67%	-860	-1,051	-1,246	-1,446	-1,650	-1,856	-2,064
0%	2	2	1	0	-3	-7	-15
2.67%	2	2	2	2	2	2	2
5.33%	2	2	2	2	2	2	2
8.00%	2	2	2	2	2	2	2

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

91,359

공시일	2017-10-11
기준일	2017-10-10

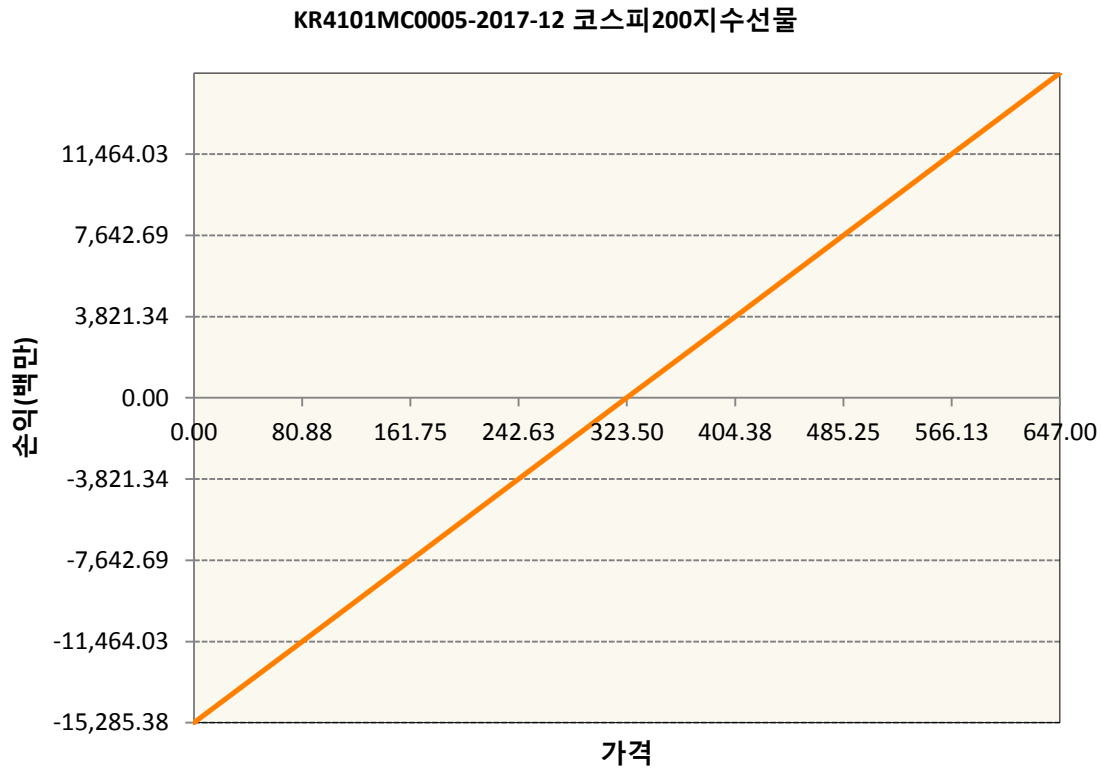
ETF스마트레버리지목표전환형6호

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	15,285	0	15,285	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101MC0(2017-12 코스피200지수선물							1,219
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,219	-1,219	-1,219	-1,219	-1,219	-1,219	-1,219
-5.33%	-813	-813	-813	-813	-813	-813	-813
-2.67%	-406	-406	-406	-406	-406	-406	-406
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	406	406	406	406	406	406	406
5.33%	813	813	813	813	813	813	813

8.00%	1,219	1,219	1,219	1,219	1,219	1,219	1,219

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

744

공시일	2017-10-11
기준일	2017-10-10

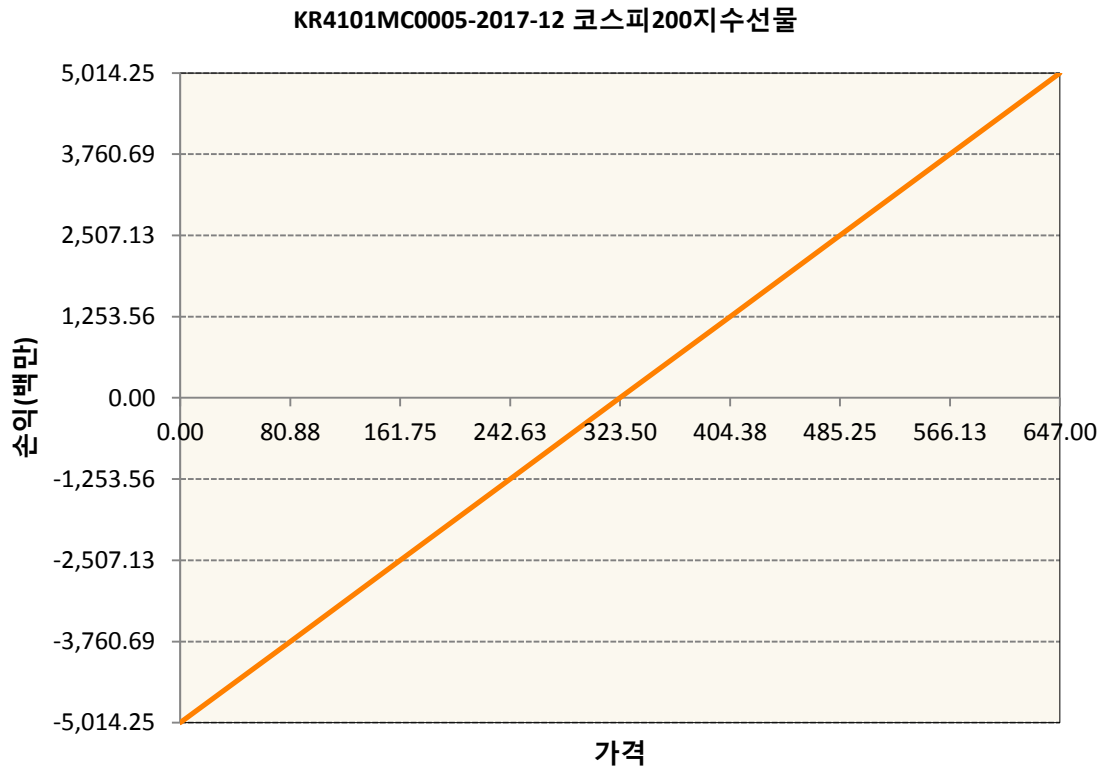
ETF스마트레버리지목표전환형7호

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	5,014	0	5,014	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101MC0(2017-12 코스피200지수선물							400
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-400	-400	-400	-400	-400	-400	-400
-5.33%	-267	-267	-267	-267	-267	-267	-267
-2.67%	-133	-133	-133	-133	-133	-133	-133
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	133	133	133	133	133	133	133
5.33%	267	267	267	267	267	267	267

8.00%	400	400	400	400	400	400	400

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

244

공시일	2017-10-11
기준일	2017-10-10

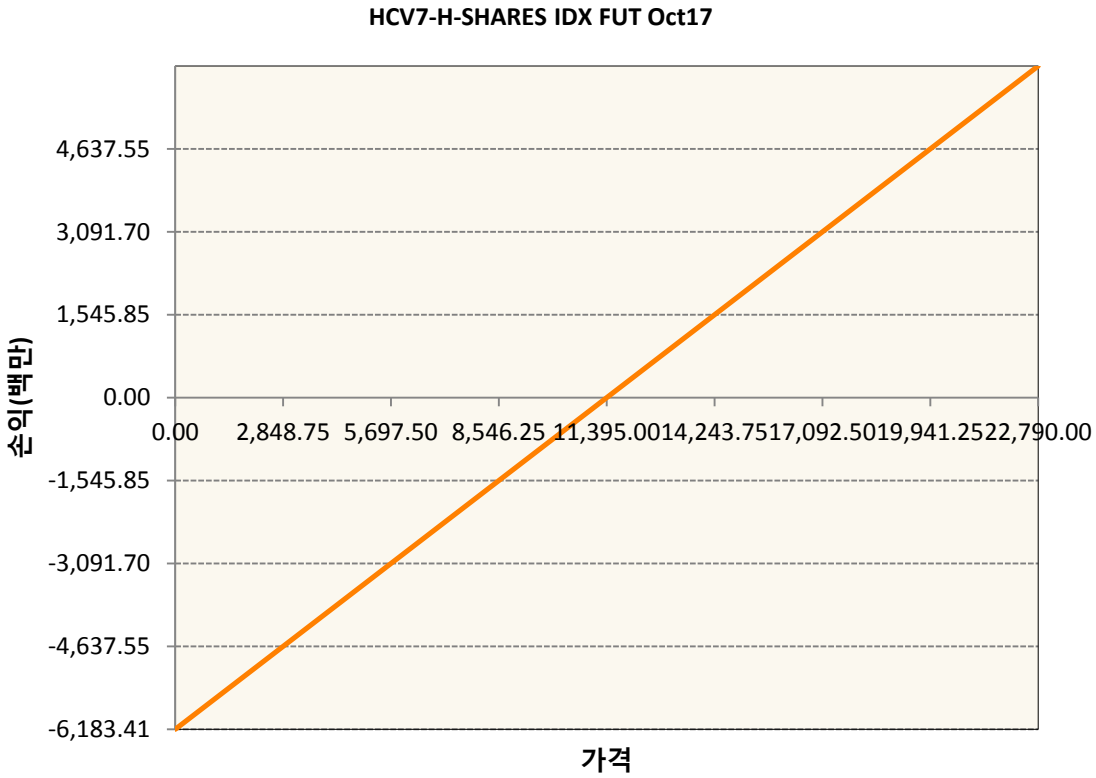
홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생

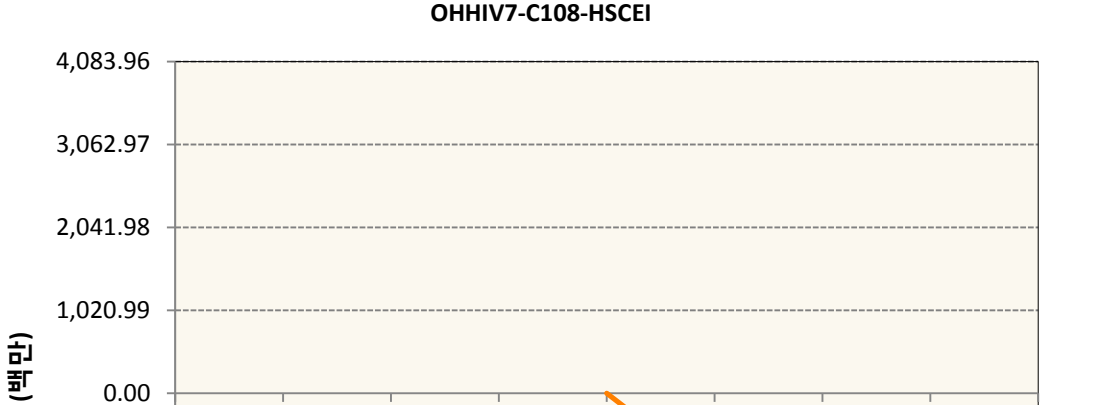
1. 계약금액

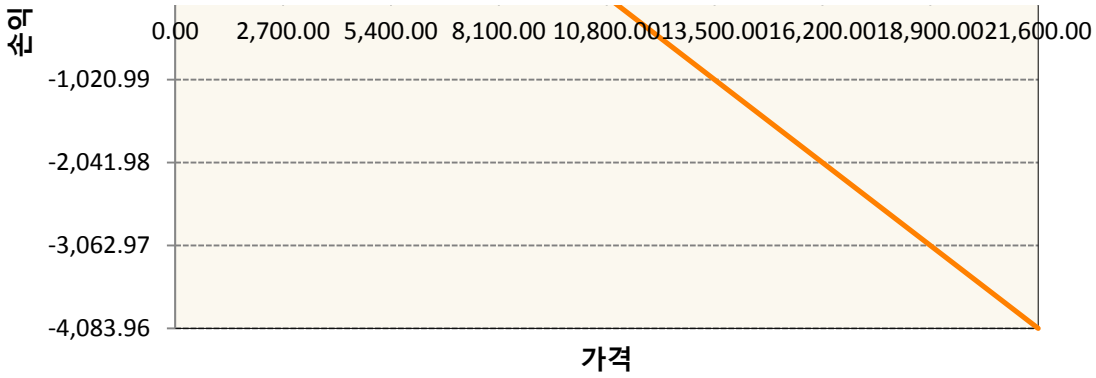
(단위:백만원)

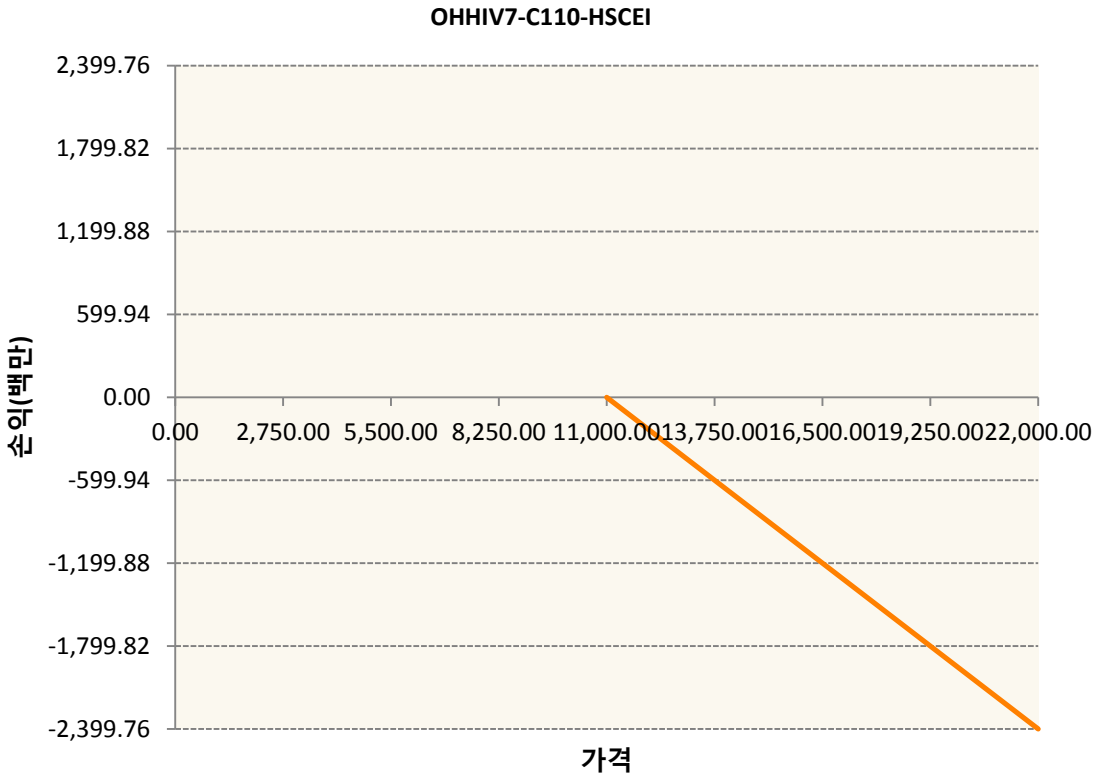
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	6,183	0	6,183	장내
누계	유가증권	옵션	0	12,967	-12,967	장내

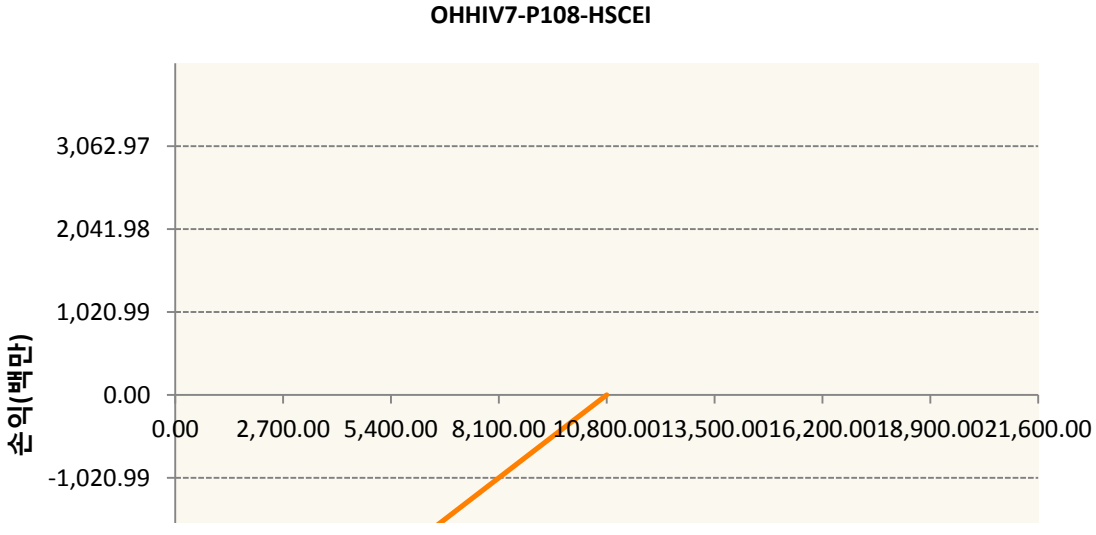
2. 만기시점의 손익구조

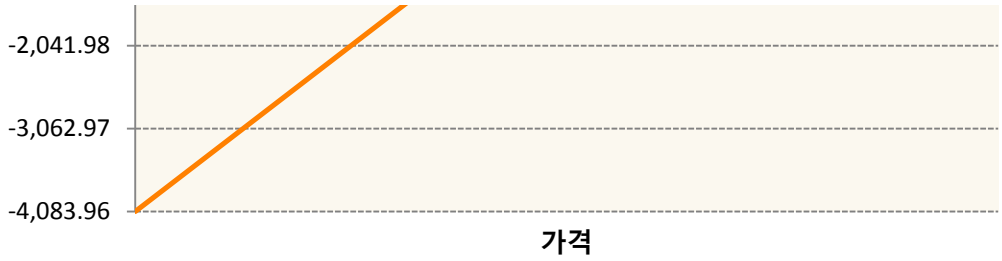


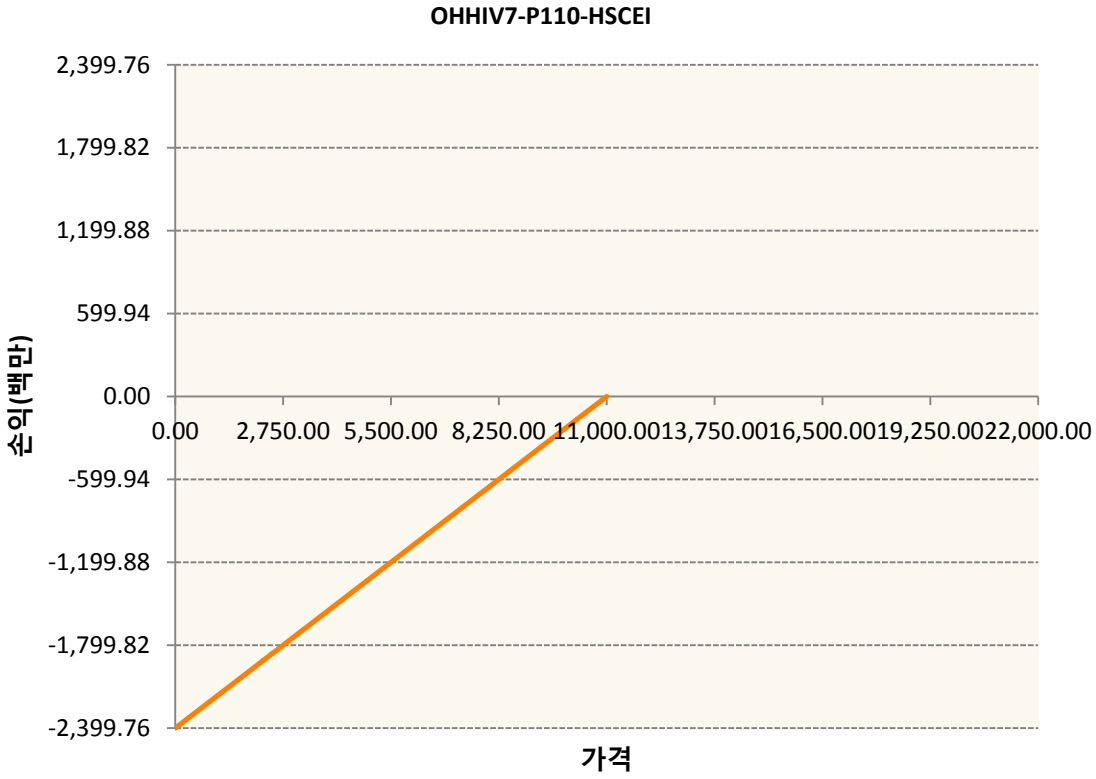



손익
0.00
2,700.00
5,400.00
8,100.00
10,800.00
13,500.00
16,200.00
18,900.00
21,600.00
-1,020.99
-2,041.98
-3,062.97
-4,083.96
가격


OHHIV7-C110-HSCEI
2,399.76
1,799.82
1,199.88
599.94
0.00
-599.94
-1,199.88
-1,799.82
-2,399.76
0.00
2,750.00
5,500.00
8,250.00
11,000.00
13,750.00
16,500.00
19,250.00
22,000.00
손익(백만)
가격


OHHIV7-P108-HSCEI
3,062.97
2,041.98
1,020.99
0.00
-1,020.99
0.00
2,700.00
5,400.00
8,100.00
10,800.00
13,500.00
16,200.00
18,900.00
21,600.00
손익(백만)





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

HCV7	H-SHARES IDX FUT Oct17	495
OHHIV7-C10	HSCEI	327
OHHIV7-C11	HSCEI	192
OHHIV7-P10	HSCEI	327
OHHIV7-P11	HSCEI	192

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

1,268

공시일	2017-10-11
기준일	2017-10-10

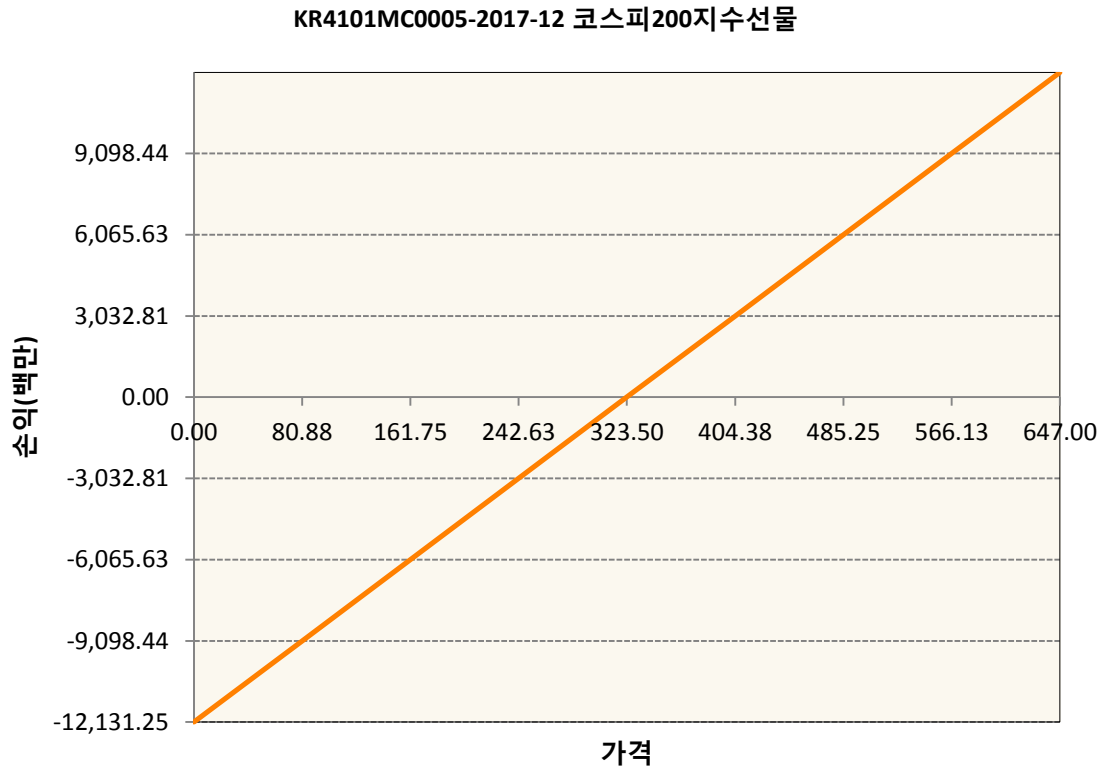
코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼

1. 계약금액

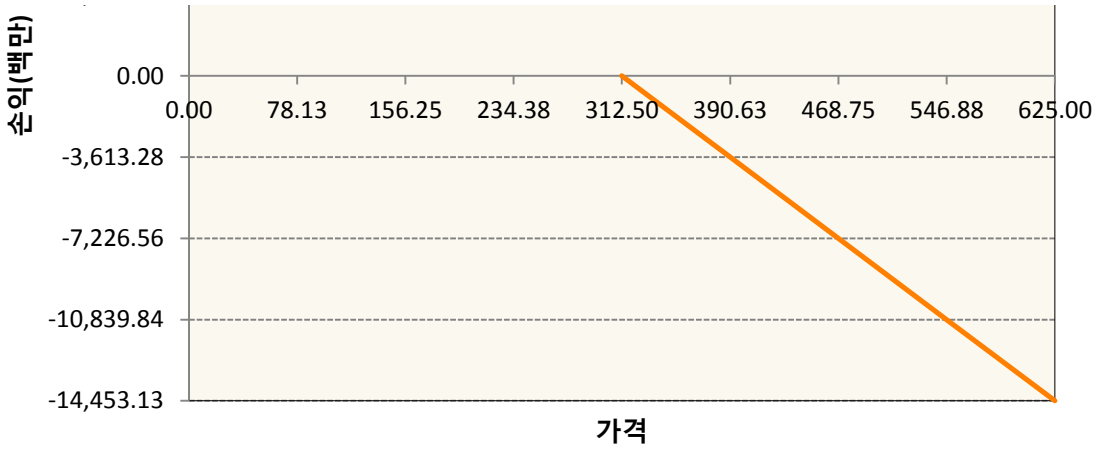
(단위:백만원)

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	12,131	0	12,131	장내
누계	유가증권	스왑	27,000	0	27,000	장외
누계	유가증권	옵션	0	25,781	-25,781	장내

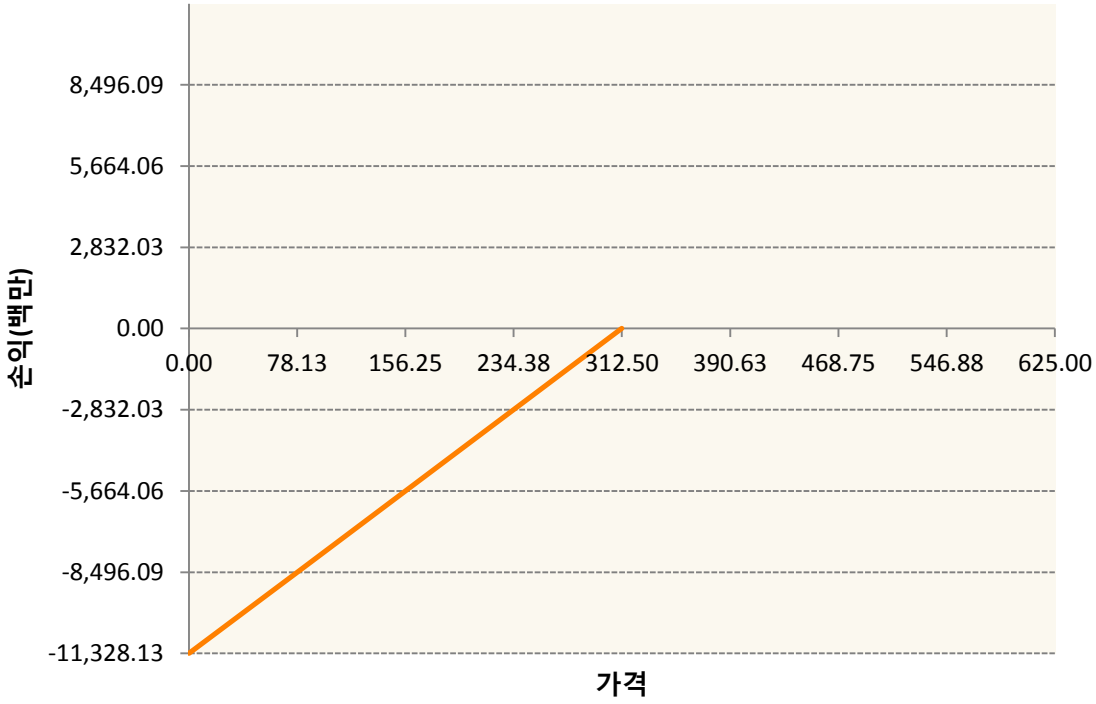
2. 만기시점의 손익구조







KR4301MA3124-2017-10 풋312.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.5287E+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
	2.5287E+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
	2.5287E+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
	2.5287E+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						967
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-967	-967	-967	-967	-967	-967	-967
-5.33%	-645	-645	-645	-645	-645	-645	-645
-2.67%	-322	-322	-322	-322	-322	-322	-322
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	322	322	322	322	322	322	322
5.33%	645	645	645	645	645	645	645
8.00%	967	967	967	967	967	967	967
	KR4201MA3: 2017-10 콜312.5						1,190
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	466	466	466	466	465	465	465
-5.33%	463	461	458	455	452	448	443
-2.67%	354	346	338	330	321	313	305
0%	3	2	1	0	-2	-4	-7
2.67%	-394	-394	-394	-394	-394	-394	-395
5.33%	-792	-792	-792	-792	-792	-792	-792
8.00%	-1,190	-1,190	-1,190	-1,190	-1,190	-1,190	-1,190
KR4301MA3: 2017-10 풋312.5							573

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-573	-573	-573	-573	-573	-573	-573
-5.33%	-261	-261	-261	-262	-262	-262	-263
-2.67%	-15	-18	-21	-25	-28	-32	-35
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	0	0	0	0	0	0	0
5.33%	0	0	0	0	0	0	0
8.00%	0	0	0	0	0	0	0

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

4,348

공시일	2017-10-11
기준일	2017-10-10

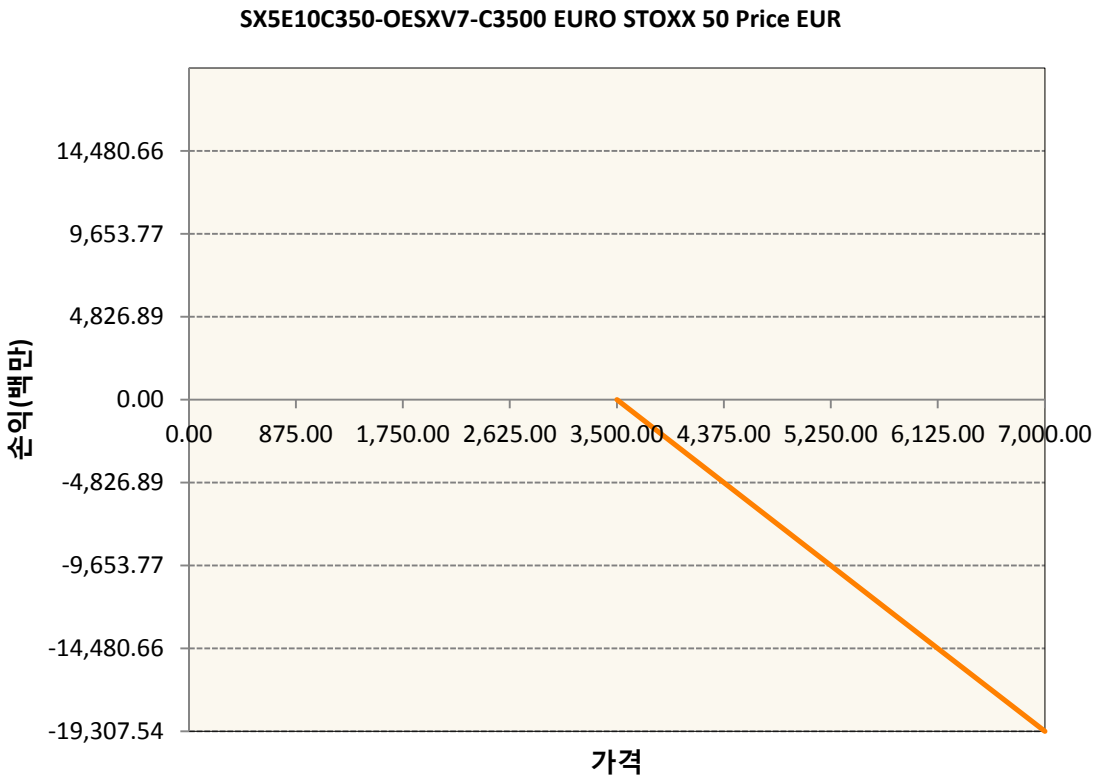
유로커버드콜모(주식혼합-파생형

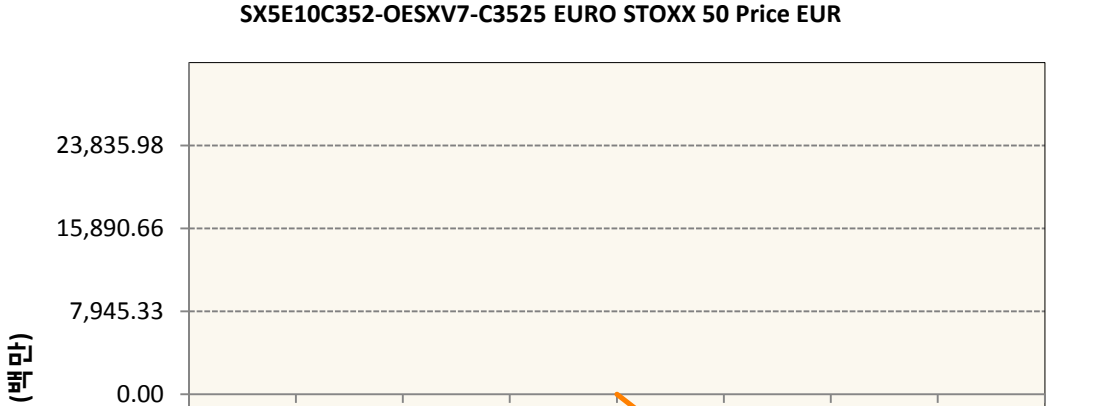
1. 계약금액

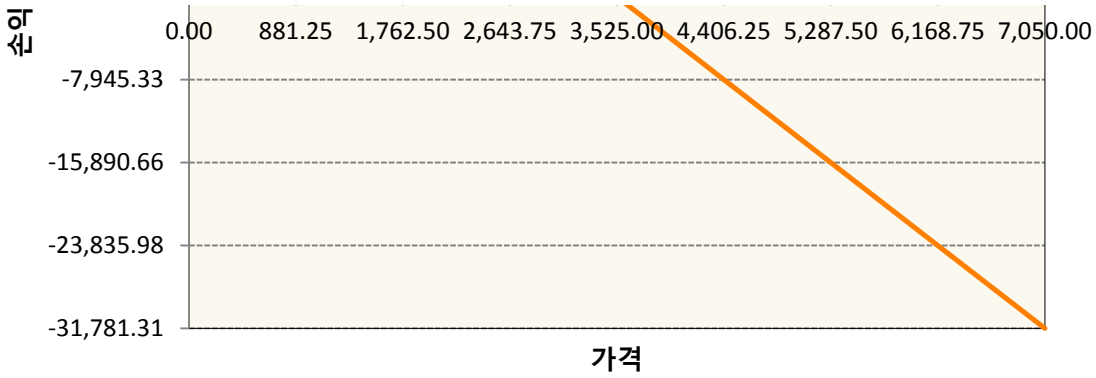
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	48,511	0	48,511	
누계	유가증권	옵션	0	102,178	-102,178	장외

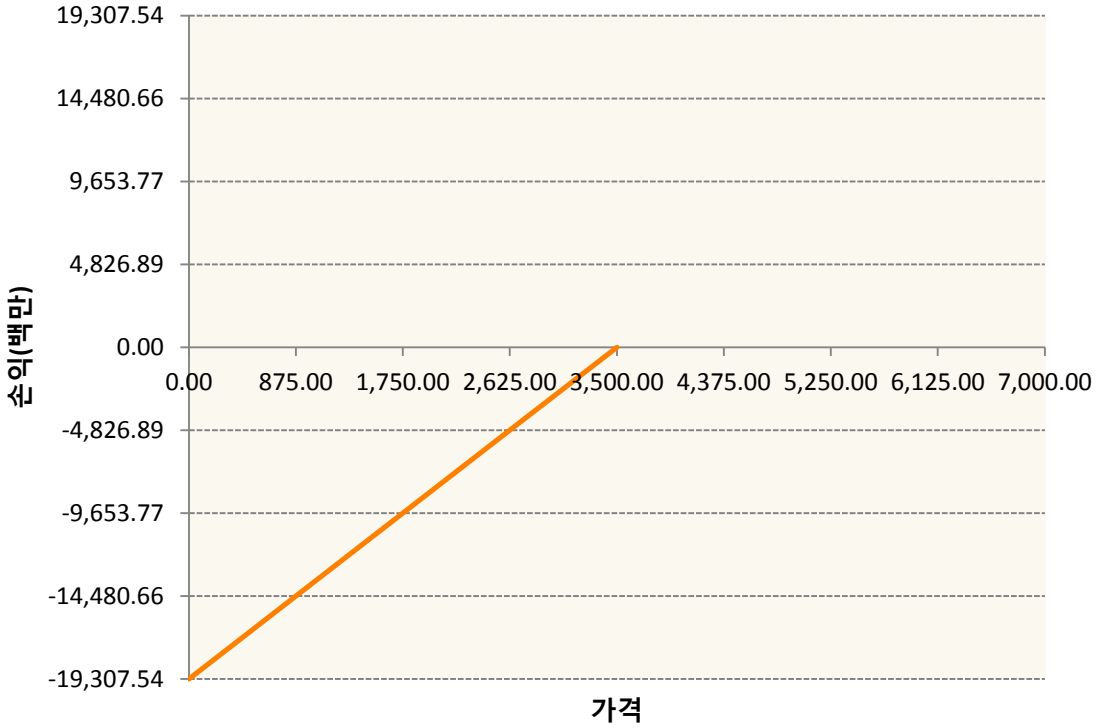
2. 만기시점의 손익구조



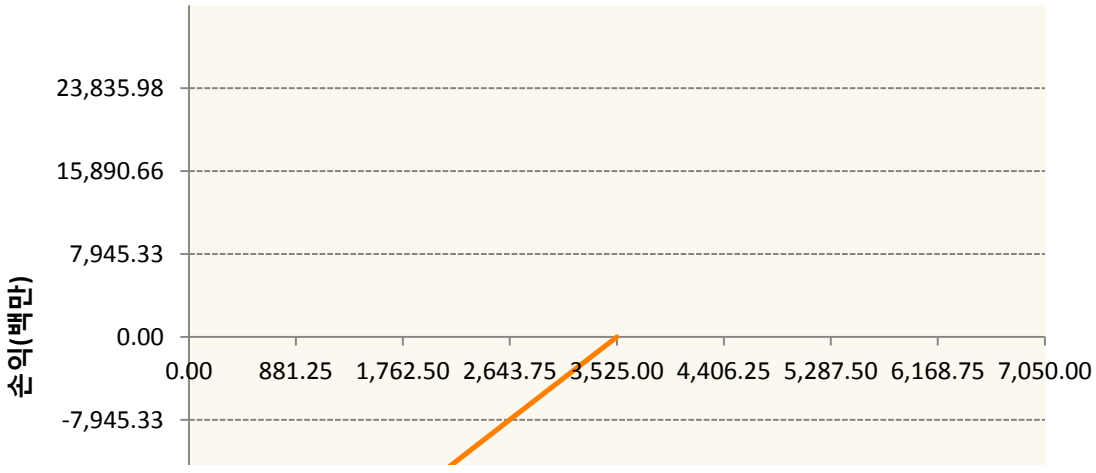


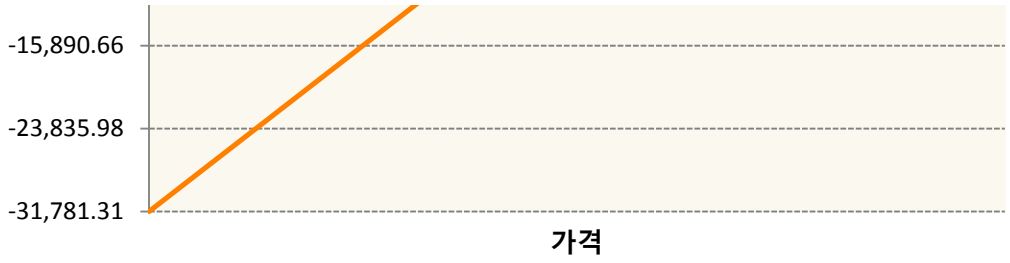


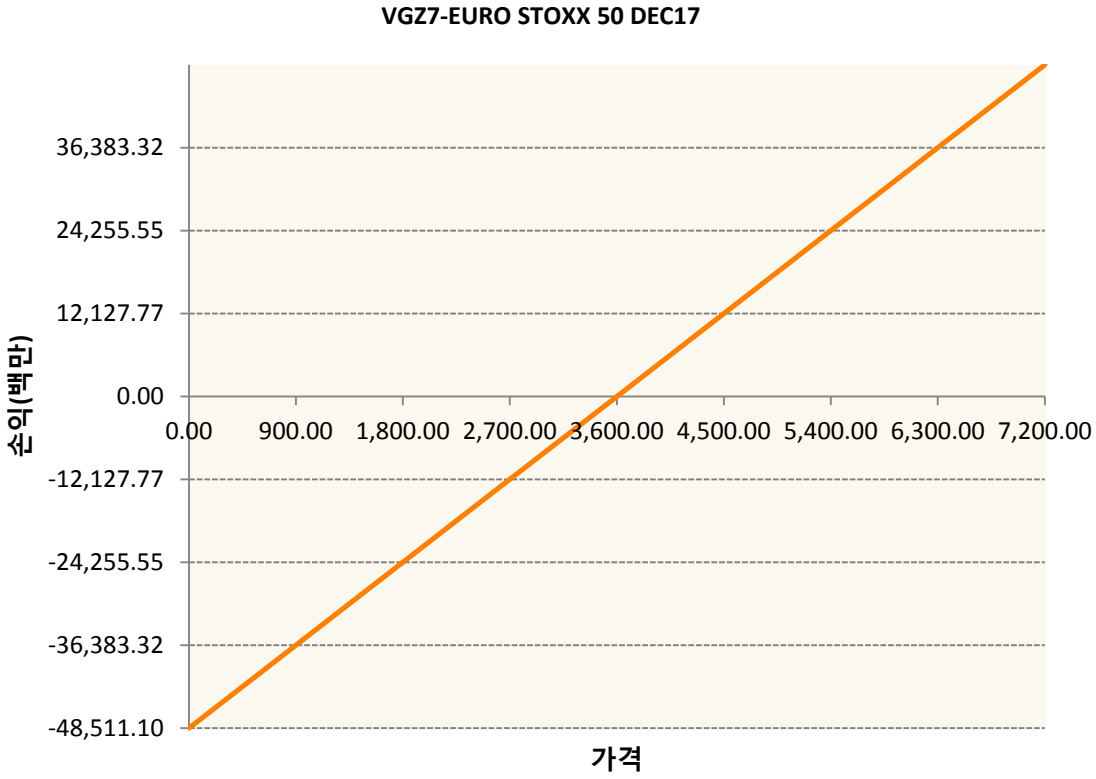
SX5E10P350-OESXV7-P3500 EURO STOXX 50 Price EUR



SX5E10P352-OESXV7-P3525 EURO STOXX 50 Price EUR







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)	(단위:백만원)
SX5E10C350 OESXV7-C3500 EURO STOXX 50 Price EUR	1,545
SX5E10C352 OESXV7-C3525 EURO STOXX 50 Price EUR	2,543
SX5E10P350 OESXV7-P3500 EURO STOXX 50 Price EUR	1,545
SX5E10P352 OESXV7-P3525 EURO STOXX 50 Price EUR	2,543
VGZ7 EURO STOXX 50 DEC17	3,881

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	9,298

공시일	2017-10-11
기준일	2017-10-10

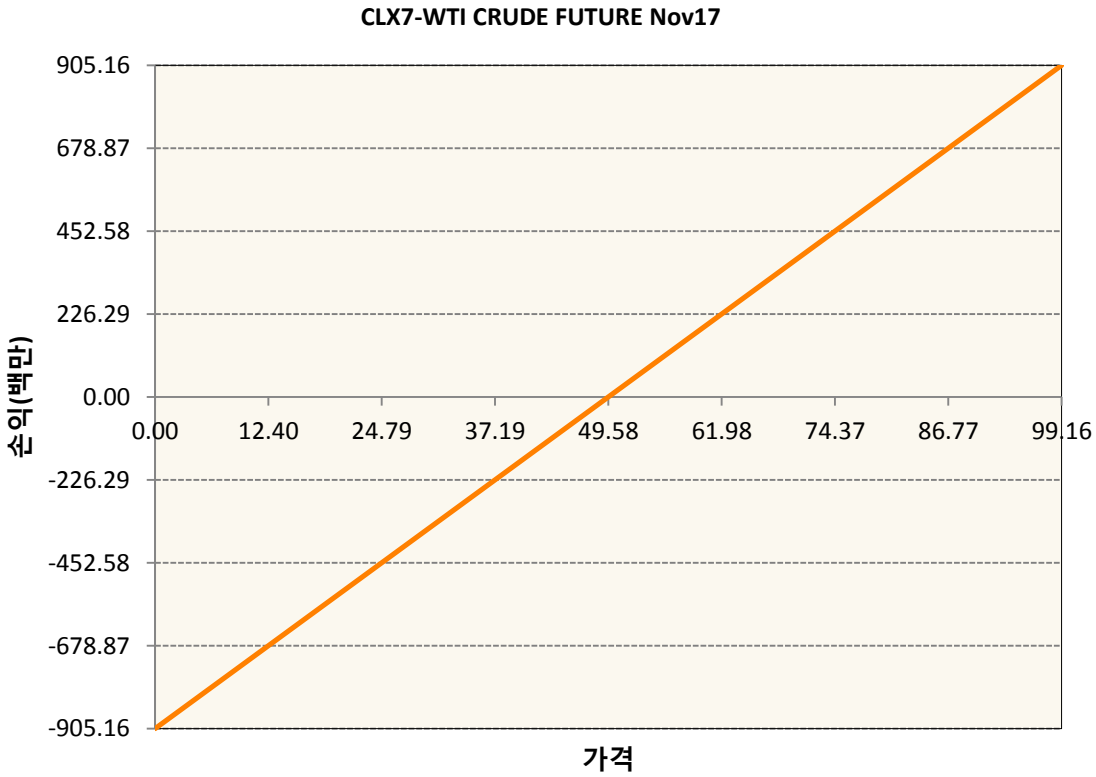
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

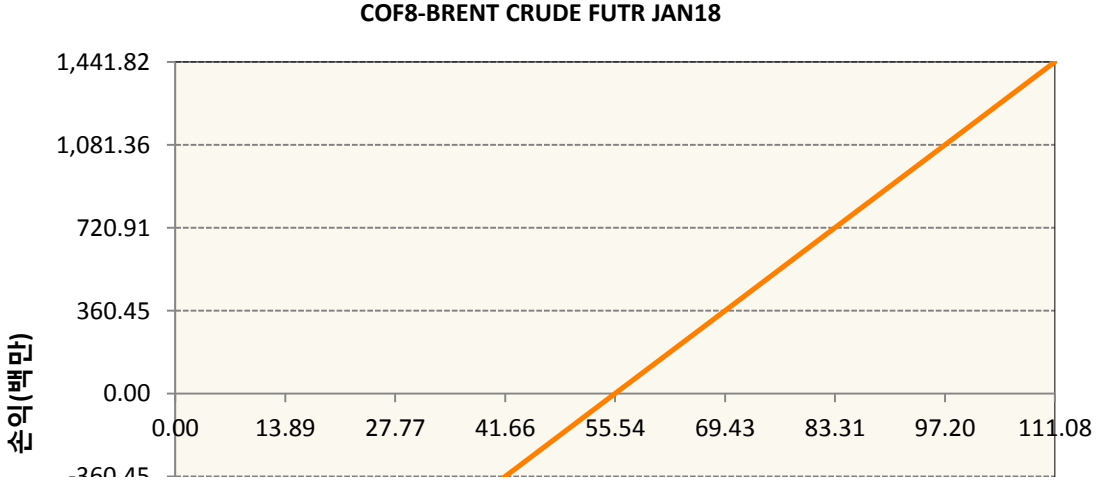
1. 계약금액

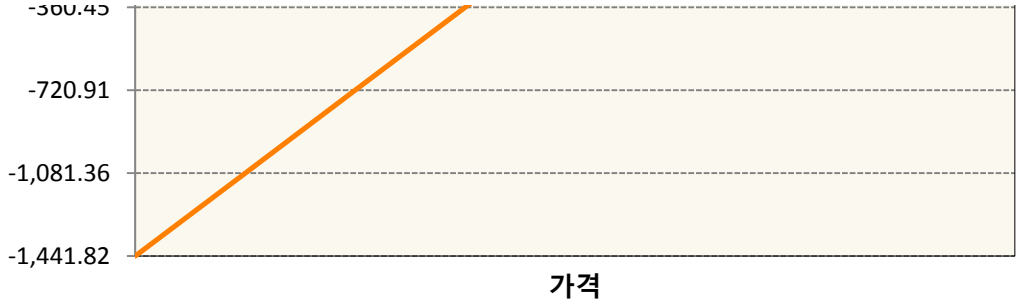
(단위:백만원)

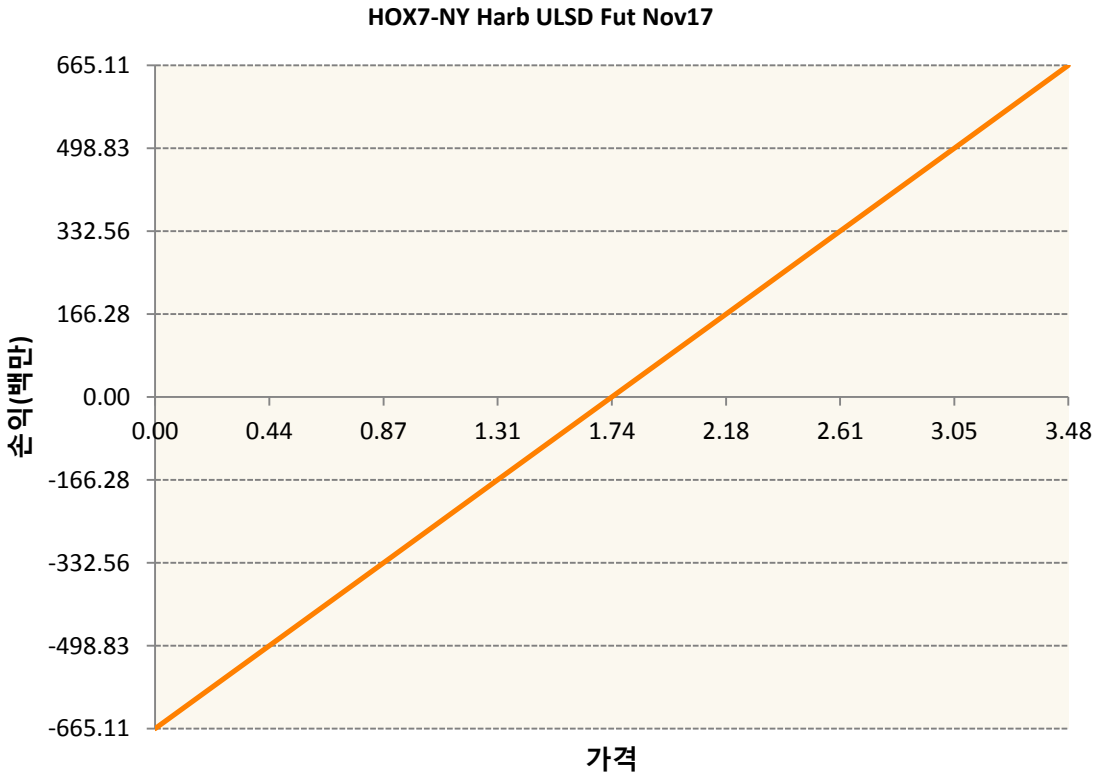
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	4,978	909	4,070	

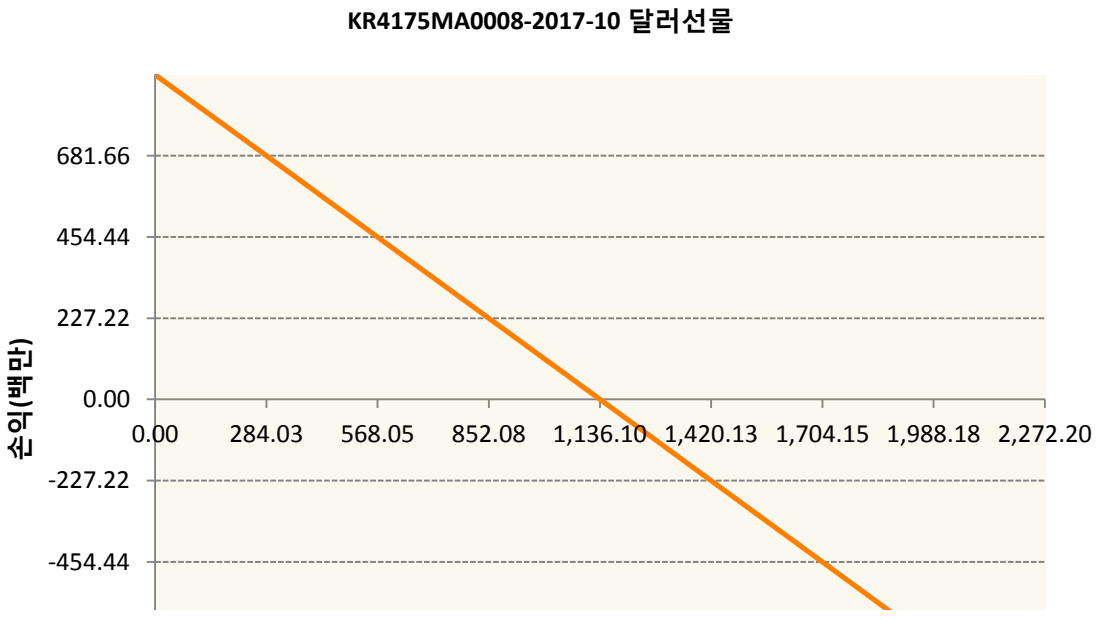
2. 만기시점의 손익구조

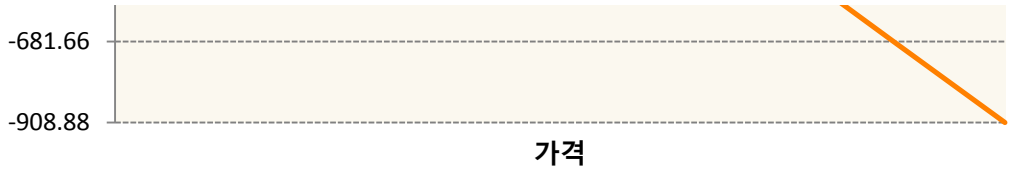


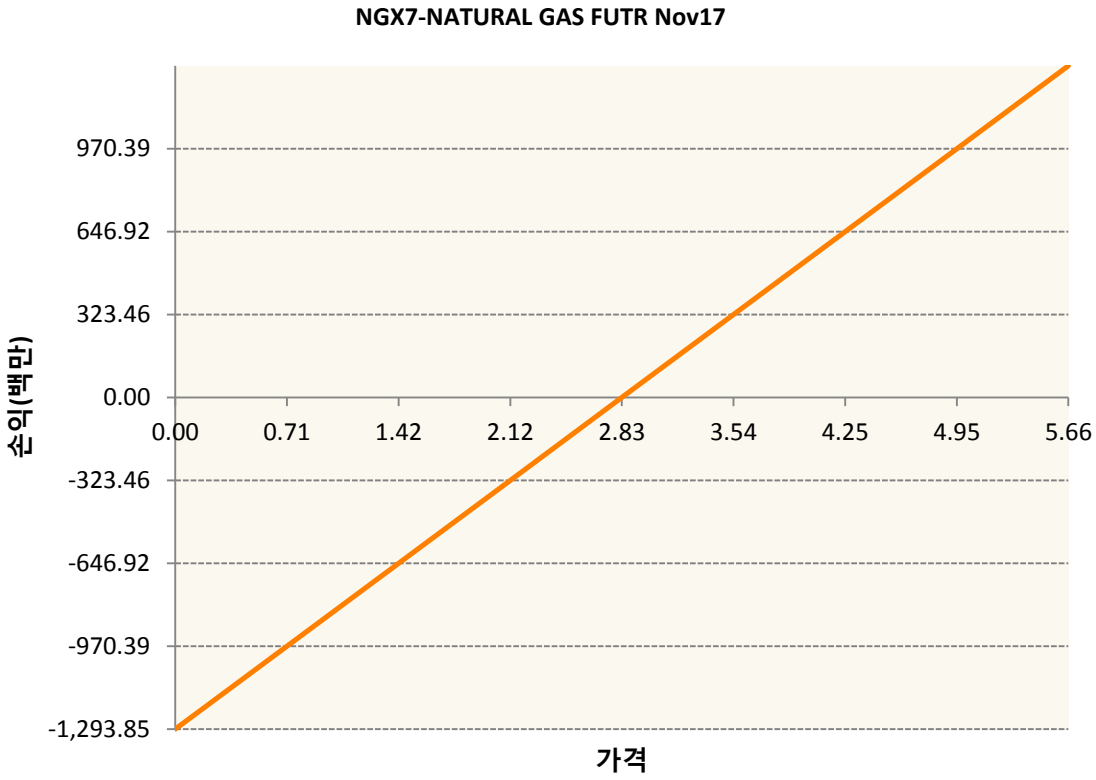


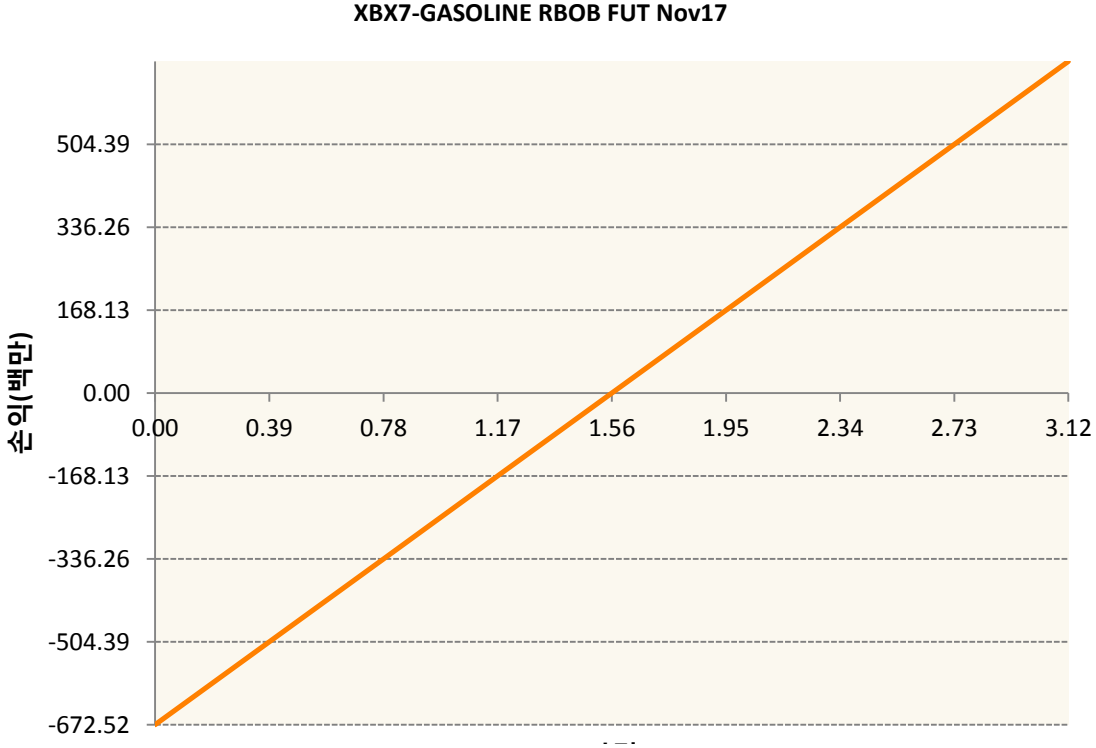

-360.45
-720.91
-1,081.36
-1,441.82
가격


HOX7-NY Harb ULSD Fut Nov17
665.11
498.83
332.56
166.28
0.00
-166.28
-332.56
-498.83
-665.11
손익(백만)
0.00
0.44
0.87
1.31
1.74
2.18
2.61
3.05
3.48
가격


KR4175MA0008-2017-10 달러선물
681.66
454.44
227.22
0.00
-227.22
-454.44
손익(백만)
0.00
284.03
568.05
852.08
1,136.10
1,420.13
1,704.15
1,988.18
2,272.20


-681.66
-908.88
가격


NGX7-NATURAL GAS FUTR Nov17
970.39
646.92
323.46
0.00
-323.46
-646.92
-970.39
-1,293.85
0.00
0.71
1.42
2.12
2.83
3.54
4.25
4.95
5.66
손익(백만)
가격


XBX7-GASOLINE RBOB FUT Nov17
504.39
336.26
168.13
0.00
-168.13
-336.26
-504.39
-672.52
0.00
0.39
0.78
1.17
1.56
1.95
2.34
2.73
3.12
손익(백만)

가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLX7	WTI CRUDE FUTURE Nov17	72
COF8	BRENT CRUDE FUTR JAN18	115
HOX7	NY Harb ULSD Fut Nov17	53
KR4175MA0(	2017-10 달러선물	73
NGX7	NATURAL GAS FUTR Nov17	104
XBX7	GASOLINE RBOB FUT Nov17	54

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

715

공시일	2017-10-11
기준일	2017-10-10

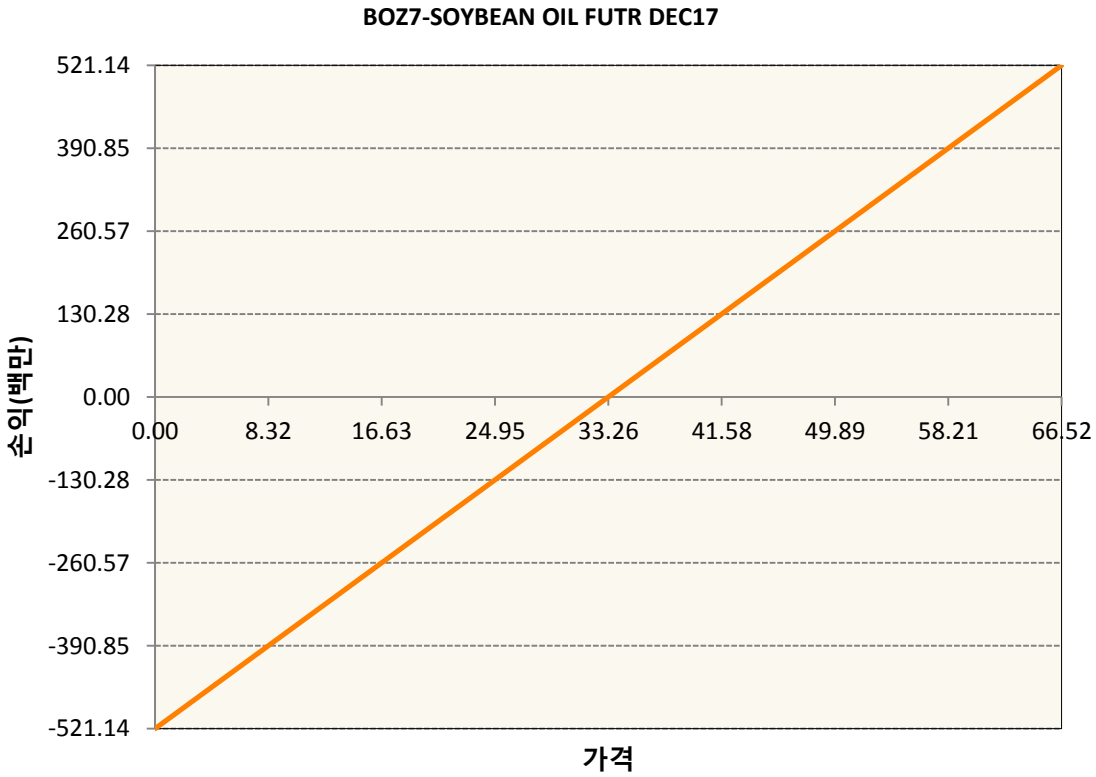
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

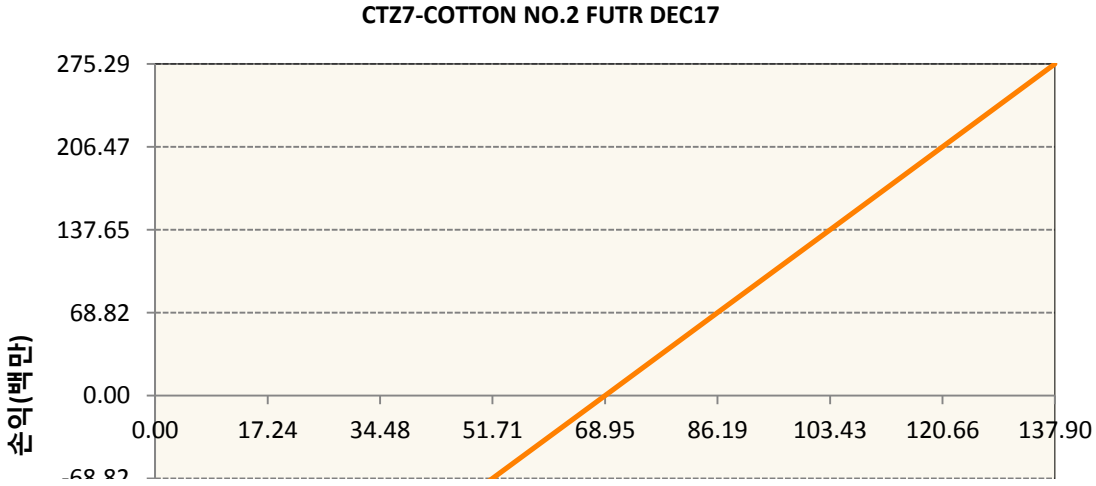
1. 계약금액

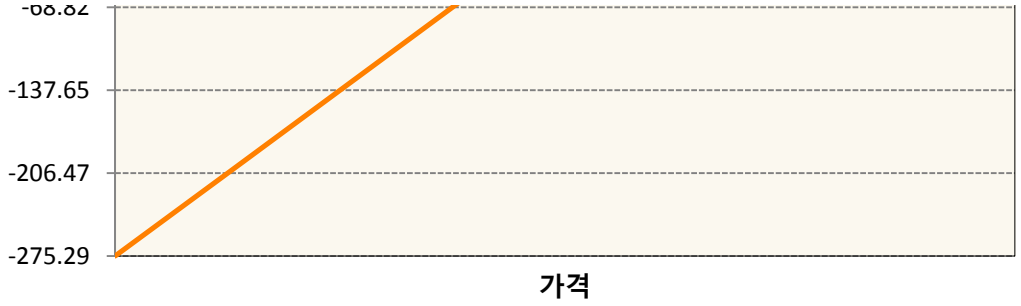
(단위:백만원)

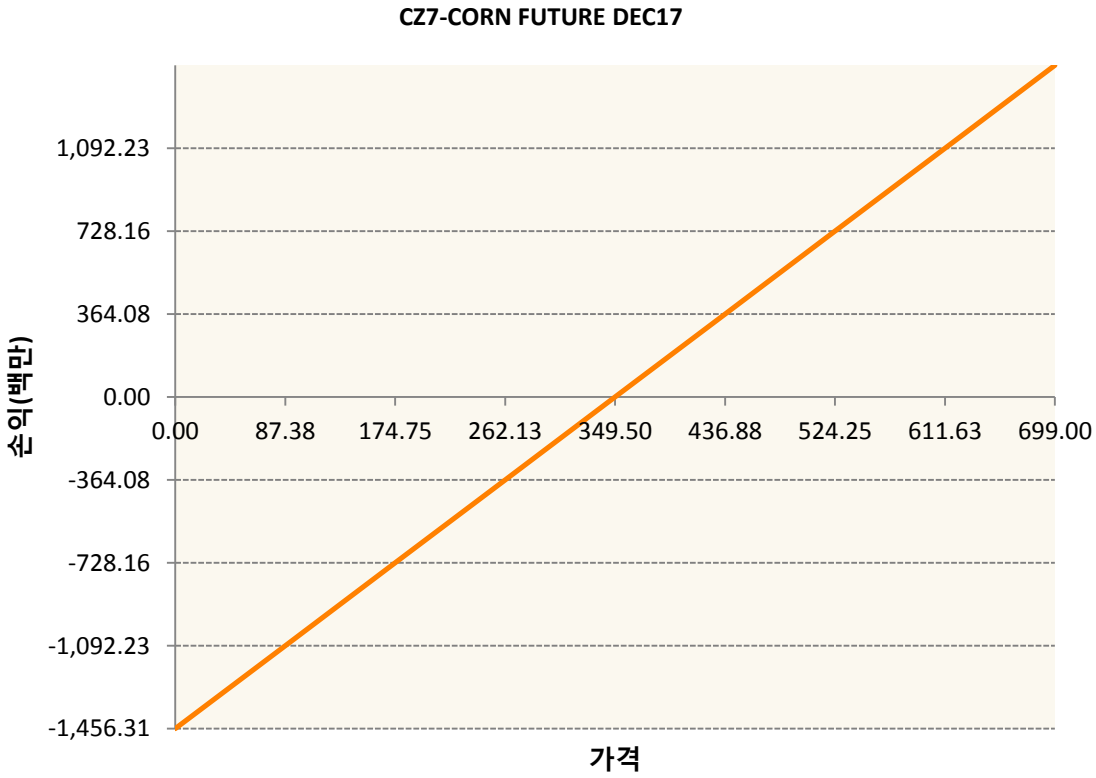
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	5,583	341	5,242	

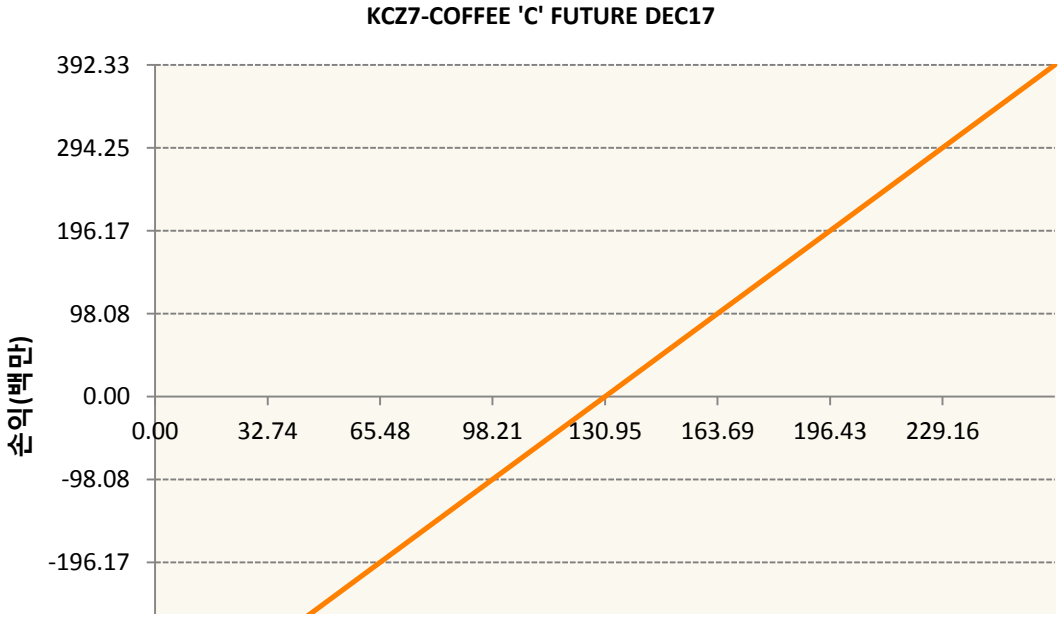
2. 만기시점의 손익구조

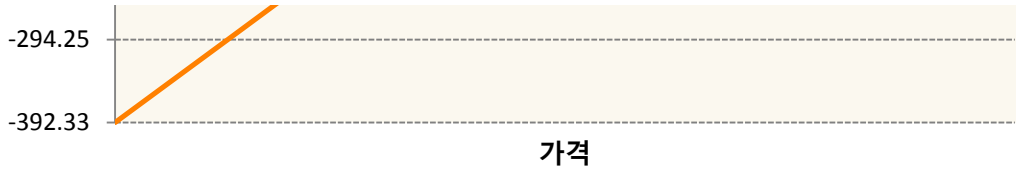


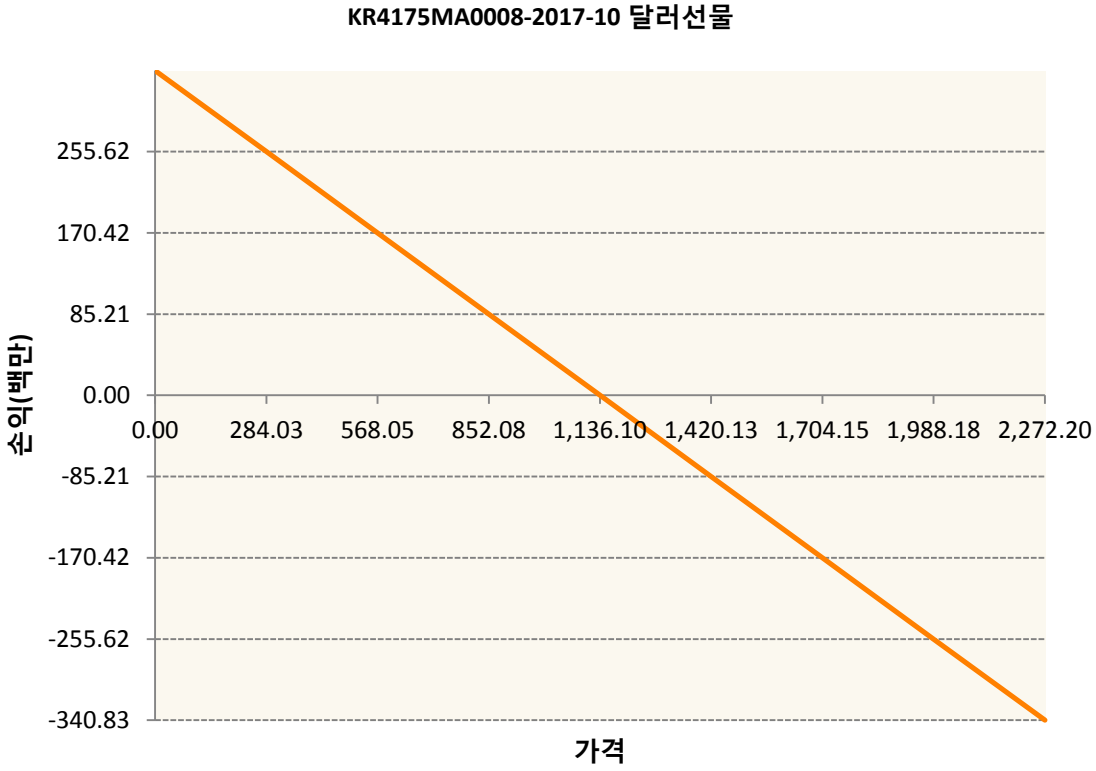


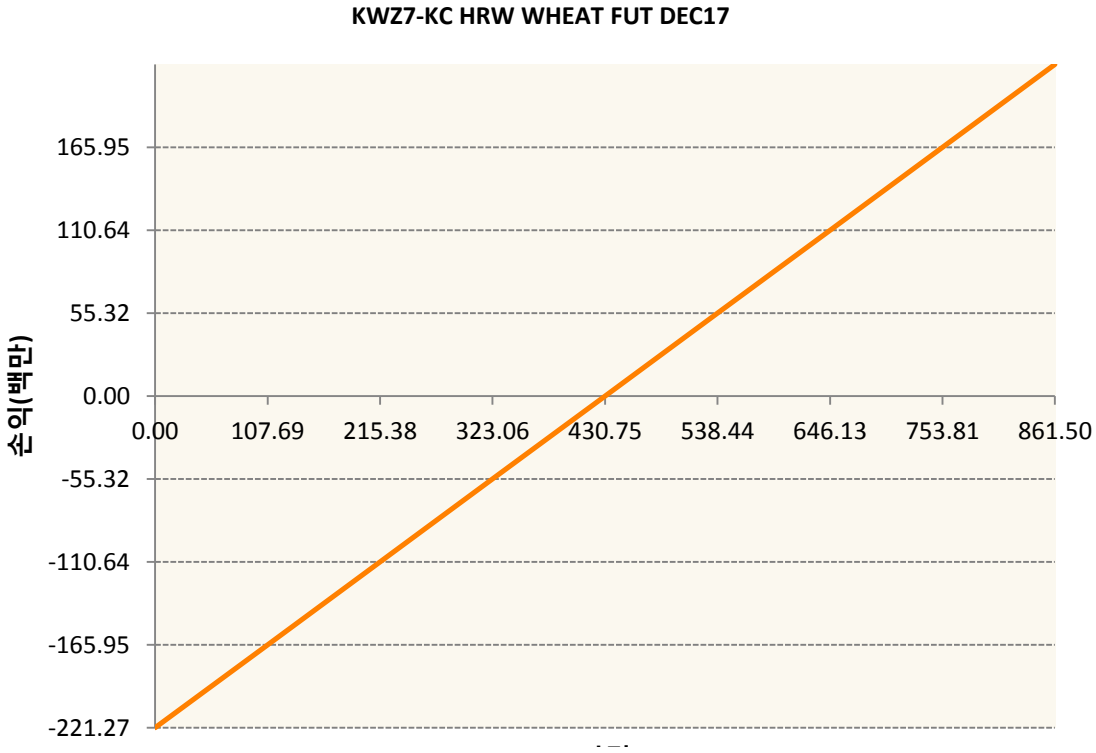

-137.65
-206.47
-275.29
가격


CZ7-CORN FUTURE DEC17
1,092.23
728.16
364.08
0.00
-364.08
-728.16
-1,092.23
-1,456.31
0.00
87.38
174.75
262.13
349.50
436.88
524.25
611.63
699.00
손익(백만)
가격

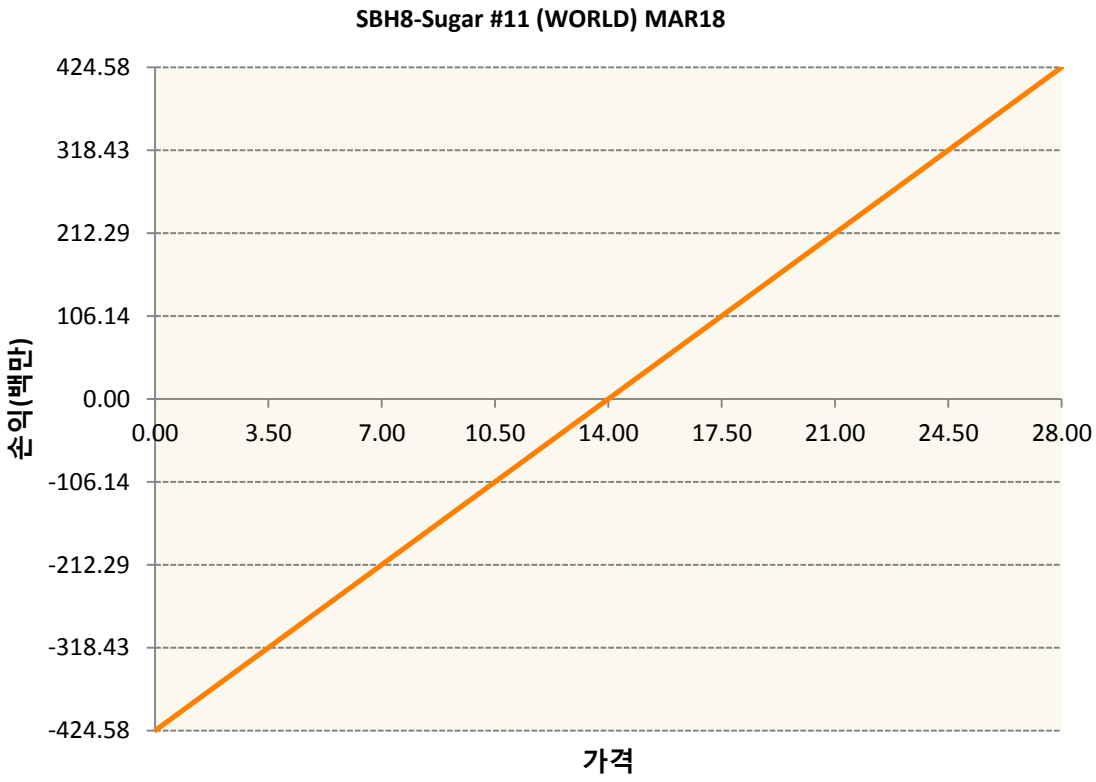

KCZ7-COFFEE 'C' FUTURE DEC17
392.33
294.25
196.17
98.08
0.00
-98.08
-196.17
0.00
32.74
65.48
98.21
130.95
163.69
196.43
229.16
손익(백만)

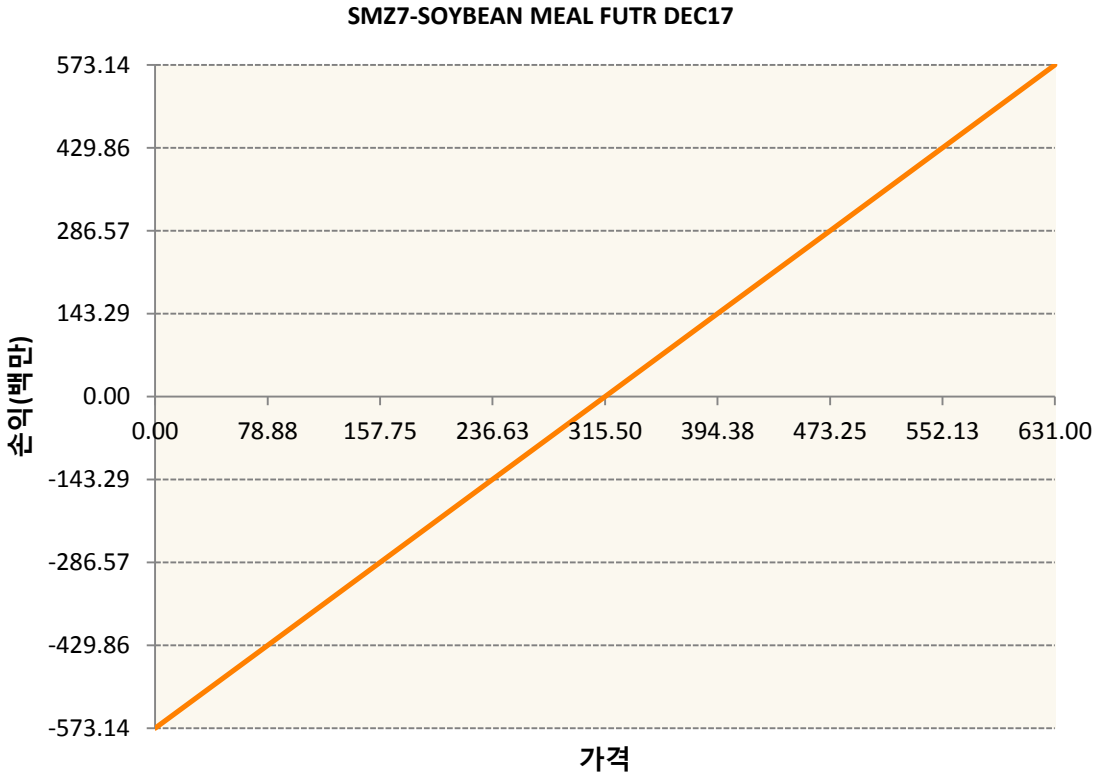

-294.25
-392.33
가격

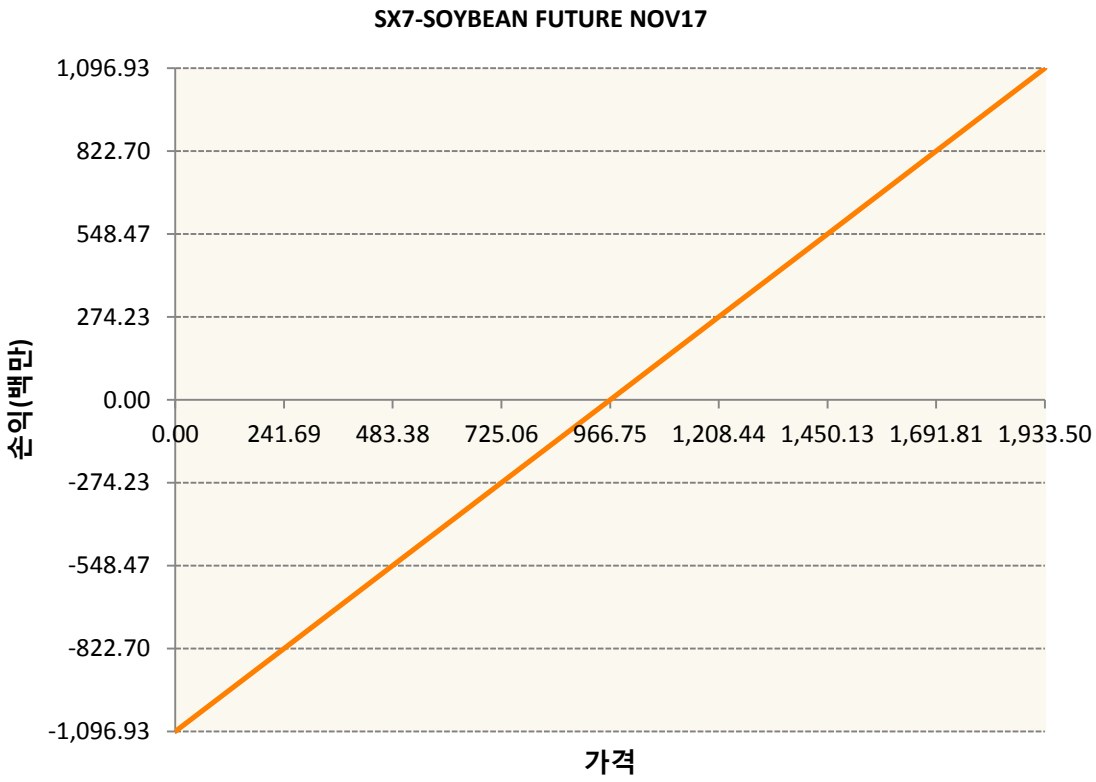

KR4175MA0008-2017-10 달러선물
255.62
170.42
85.21
0.00
-85.21
-170.42
-255.62
-340.83
0.00
284.03
568.05
852.08
1,136.10
1,420.13
1,704.15
1,988.18
2,272.20
손익(백만)
가격

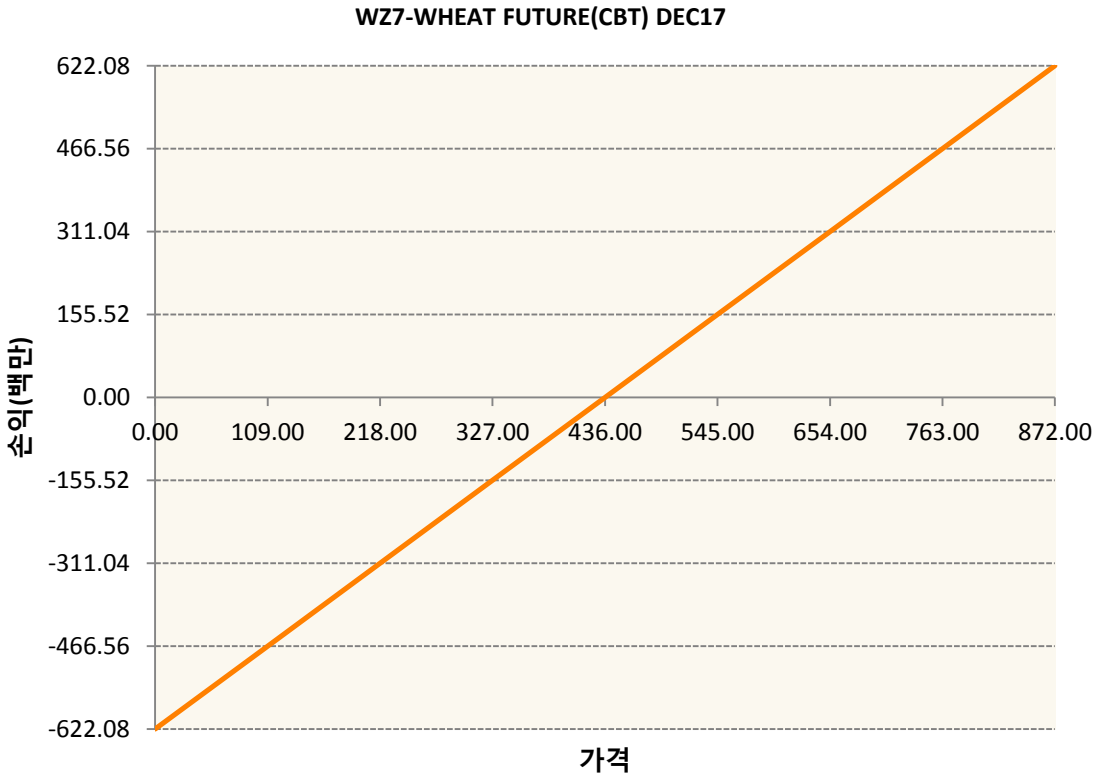

KWZ7-KC HRW WHEAT FUT DEC17
165.95
110.64
55.32
0.00
-55.32
-110.64
-165.95
-221.27
0.00
107.69
215.38
323.06
430.75
538.44
646.13
753.81
861.50
손익(백만)

가격


SBH8-Sugar #11 (WORLD) MAR18
424.58
318.43
212.29
106.14
0.00
-106.14
-212.29
-318.43
-424.58
0.00
3.50
7.00
10.50
14.00
17.50
21.00
24.50
28.00
손익(백만)
가격


SMZ7-SOYBEAN MEAL FUTR DEC17
573.14
429.86
286.57
143.29
0.00
-143.29
-286.57
-429.86
-573.14
0.00
78.88
157.75
236.63
315.50
394.38
473.25
552.13
631.00
손익(백만)
가격





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	31
KR4175MA0(	2017-10 달러선물	27
KWZ7	KC HRW WHEAT FUT DEC17	18
SBH8	Sugar #11 (WORLD) MAR18	34
SMZ7	SOYBEAN MEAL FUTR DEC17	46
SX7	SOYBEAN FUTURE NOV17	88
WZ7	WHEAT FUTURE(CBT) DEC17	50

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

514