공시일	2017-10-13
기준일	2017-10-12

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	2017-10-13
기준일	2017-10-12

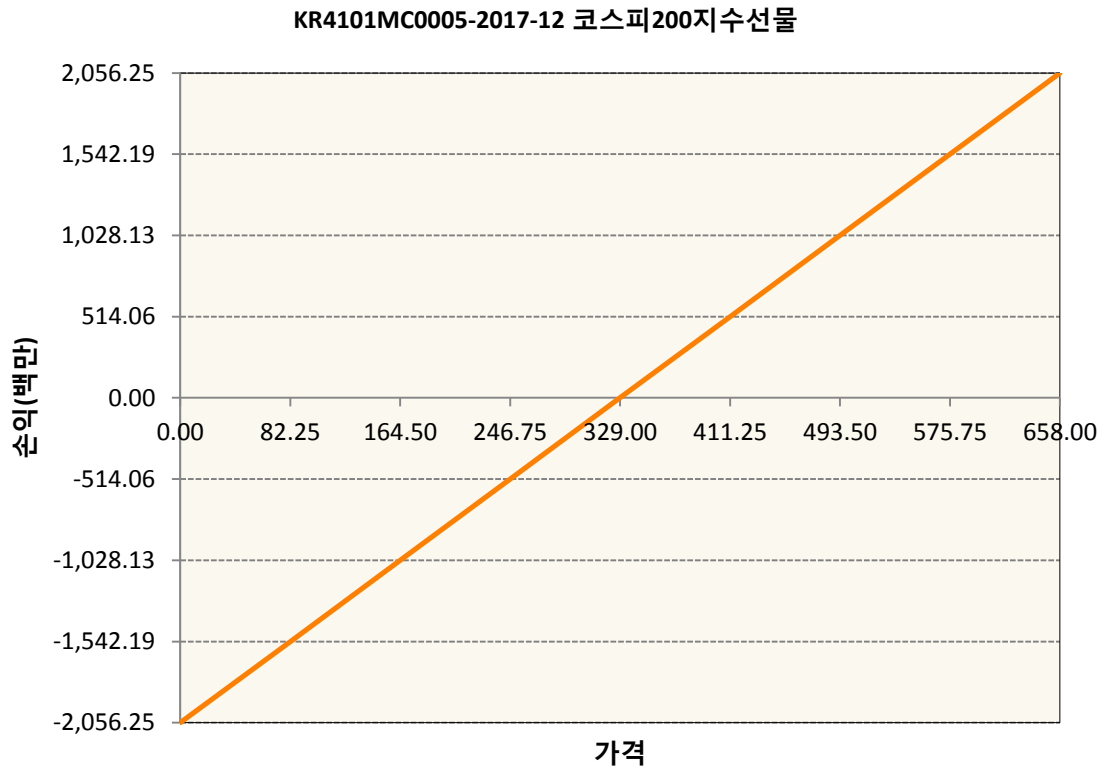
스마트인덱스모

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	2,056	0	2,056	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101MC0(2017-12 코스피200지수선물							164
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-164	-164	-164	-164	-164	-164	-164
-5.33%	-109	-109	-109	-109	-109	-109	-109
-2.67%	-55	-55	-55	-55	-55	-55	-55
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	55	55	55	55	55	55	55
5.33%	109	109	109	109	109	109	109

8.00%	164	164	164	164	164	164	164

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

100

공시일	2017-10-13
기준일	2017-10-12

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	1,058

* 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	2017-10-13
기준일	2017-10-12

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	427

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

370

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-10-13
기준일	2017-10-12

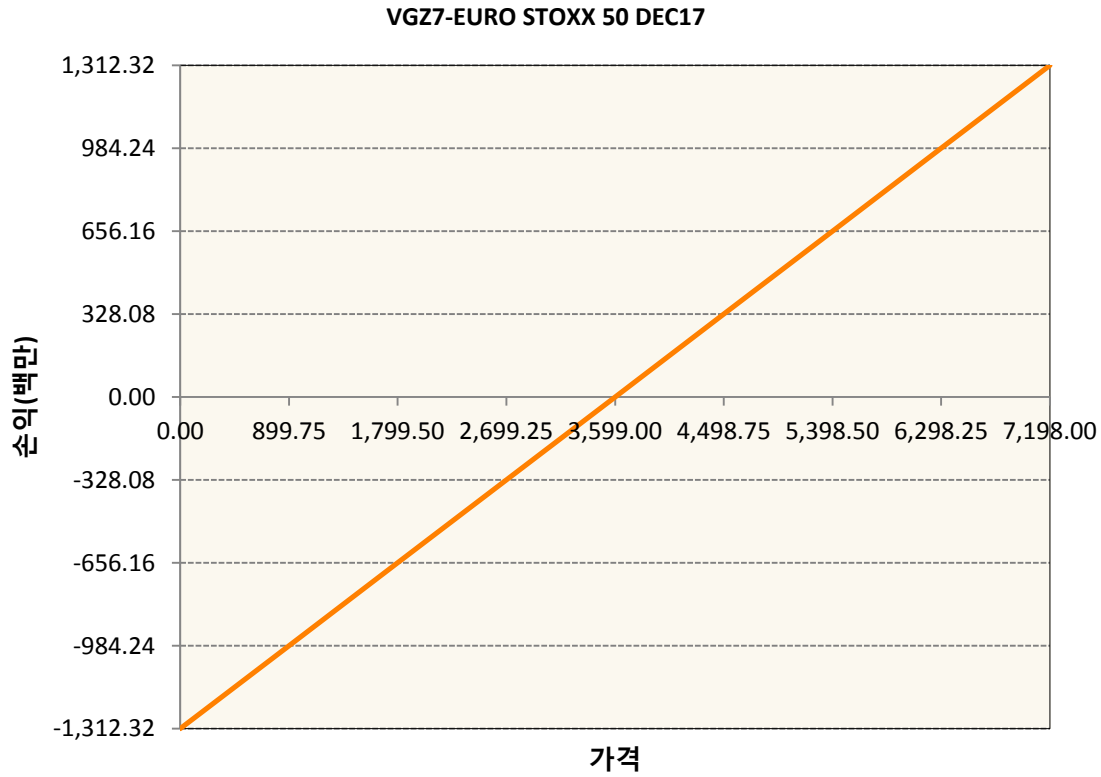
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,312	0	1,312	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGZ7	EURO STOXX 50 DEC17	105

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

(단위:백만원)

81

공시일	2017-10-13
기준일	2017-10-12

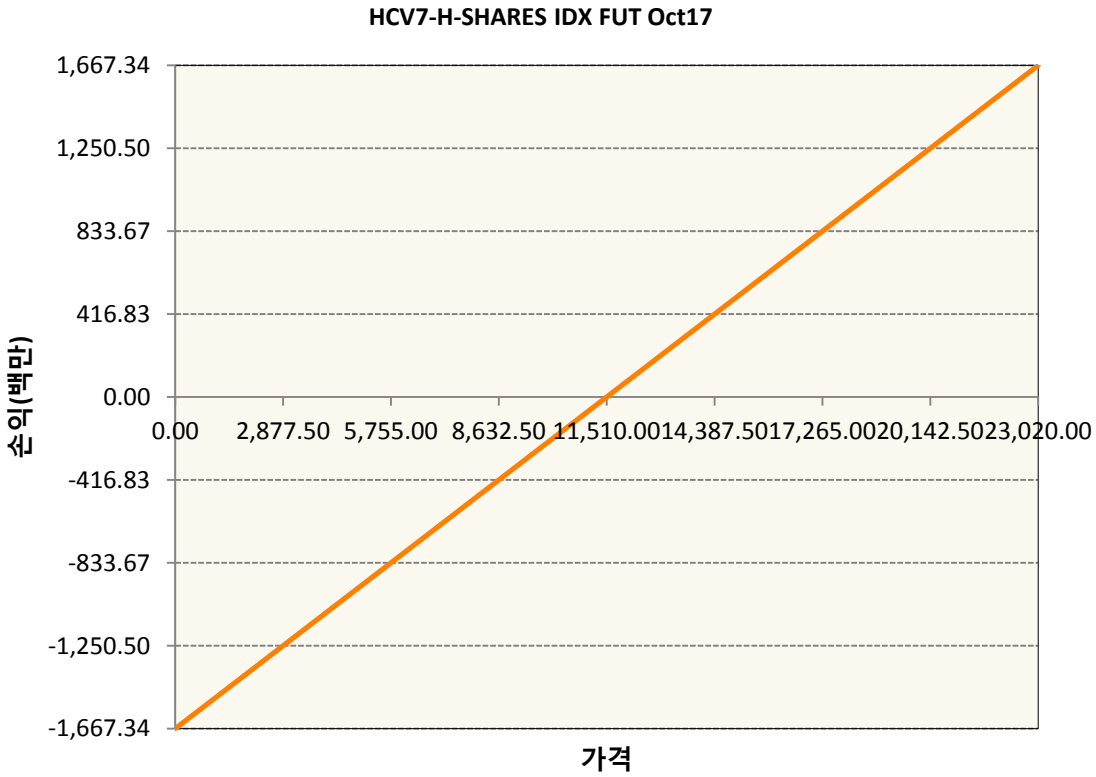
차이나인덱스모(주식-파생형)

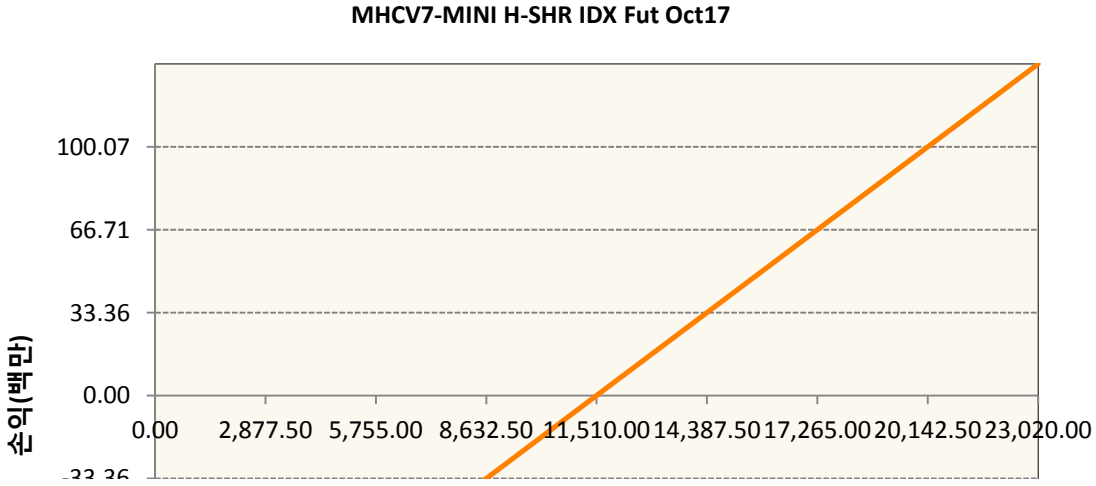
1. 계약금액

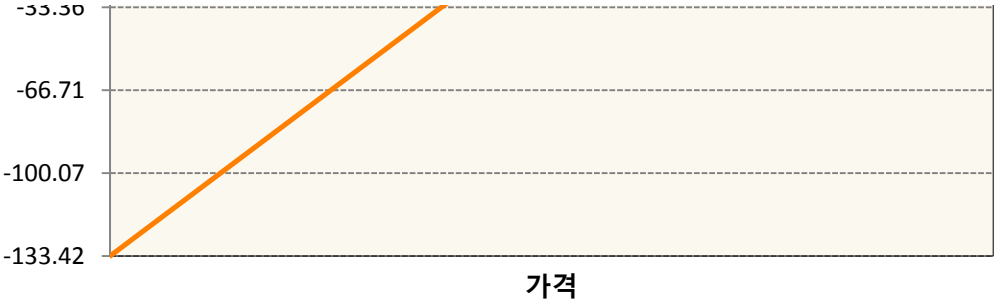
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,801	0	1,801	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

HCV7	H-SHARES IDX FUT Oct17	133
MHCV7	MINI H-SHR IDX Fut Oct17	11

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

118

공시일	2017-10-13
기준일	2017-10-12

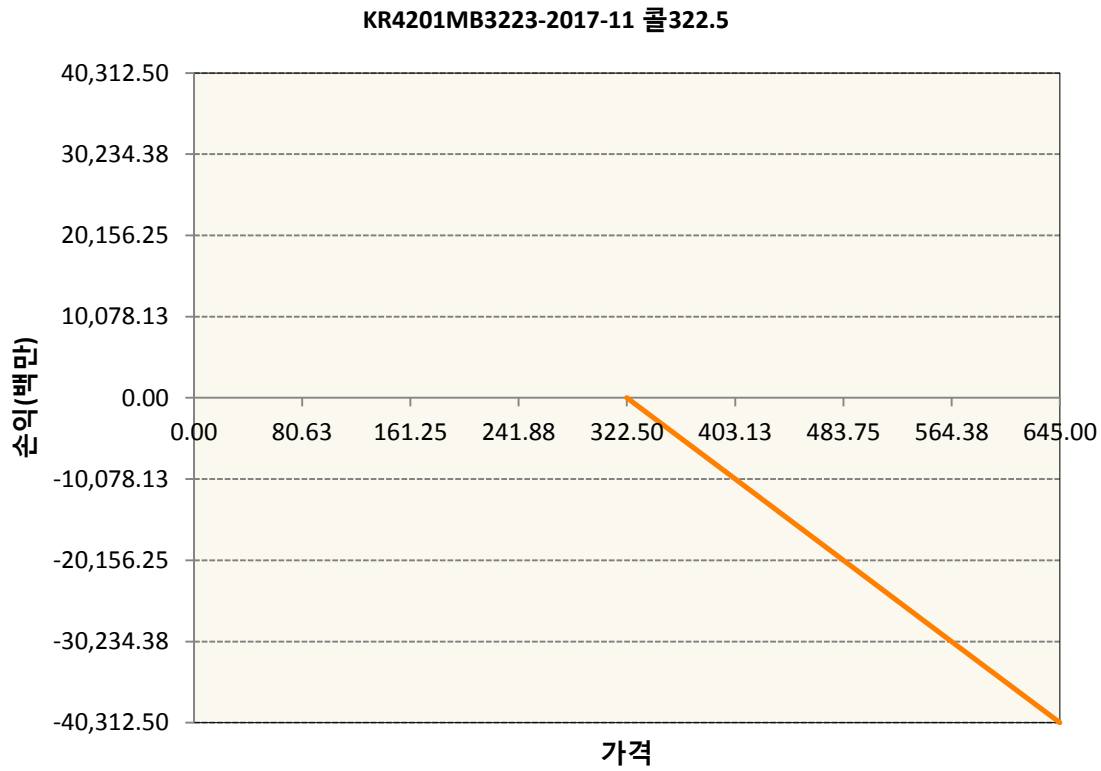
커버드콜모(주식혼합-파생형)

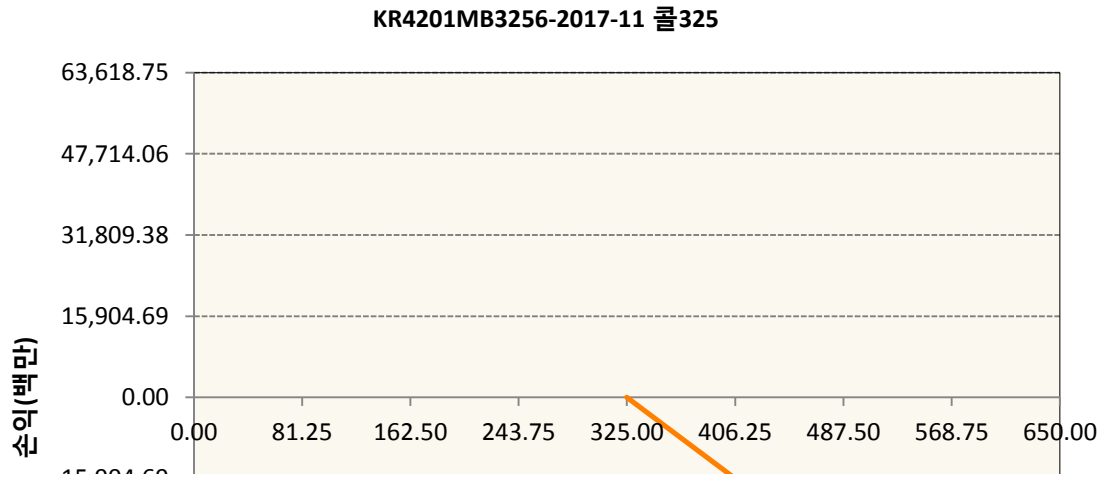
1. 계약금액

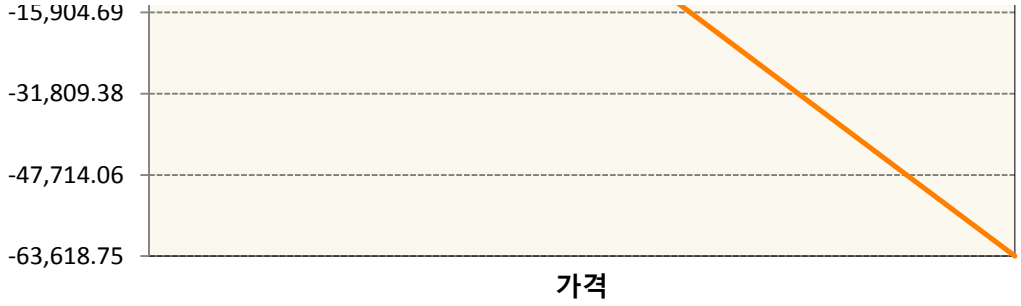
(단위:백만원)

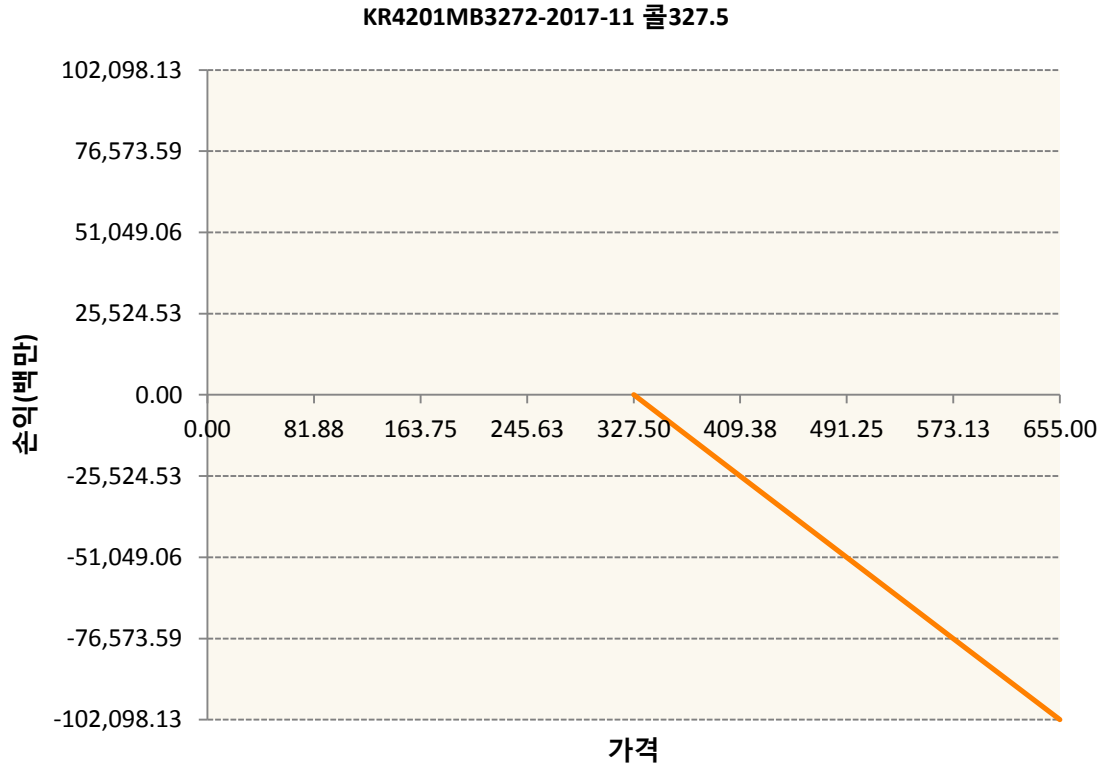
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	167,896	-167,896	장내
누계	유가증권	옵션	0	206,029	-206,029	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201MB3 2017-11 콜322.5							2,749
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,364	1,328	1,285	1,237	1,185	1,130	1,071
-5.33%	1,197	1,132	1,064	993	920	845	769
-2.67%	842	757	672	587	501	416	330
0%	250	167	84	0	-85	-170	-255
2.67%	-560	-621	-687	-756	-828	-902	-978
5.33%	-1,521	-1,557	-1,599	-1,647	-1,700	-1,757	-1,818
8.00%	-2,564	-2,581	-2,603	-2,632	-2,666	-2,705	-2,749
KR4201MB3 2017-11 콜325							4,164
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,893	1,846	1,790	1,724	1,652	1,573	1,488
-5.33%	1,690	1,599	1,502	1,399	1,292	1,182	1,068
-2.67%	1,226	1,098	968	838	707	575	443
0%	406	271	136	0	-136	-272	-409
2.67%	-770	-879	-993	-1,111	-1,231	-1,355	-1,480
5.33%	-2,217	-2,286	-2,364	-2,450	-2,543	-2,641	-2,745
8.00%	-3,821	-3,855	-3,900	-3,954	-4,016	-4,087	-4,164
KR4201MB3	2017-11 콜327.5						6,388

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	2,649	2,589	2,514	2,425	2,323	2,210	2,087
-5.33%	2,401	2,276	2,137	1,988	1,831	1,667	1,497
-2.67%	1,796	1,604	1,407	1,207	1,005	801	595
0%	659	439	220	0	-220	-439	-659
2.67%	-1,059	-1,251	-1,447	-1,648	-1,851	-2,058	-2,266
5.33%	-3,255	-3,384	-3,528	-3,682	-3,846	-4,017	-4,195
8.00%	-5,751	-5,820	-5,907	-6,008	-6,123	-6,250	-6,388

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

13,181

공시일	2017-10-13
기준일	2017-10-12

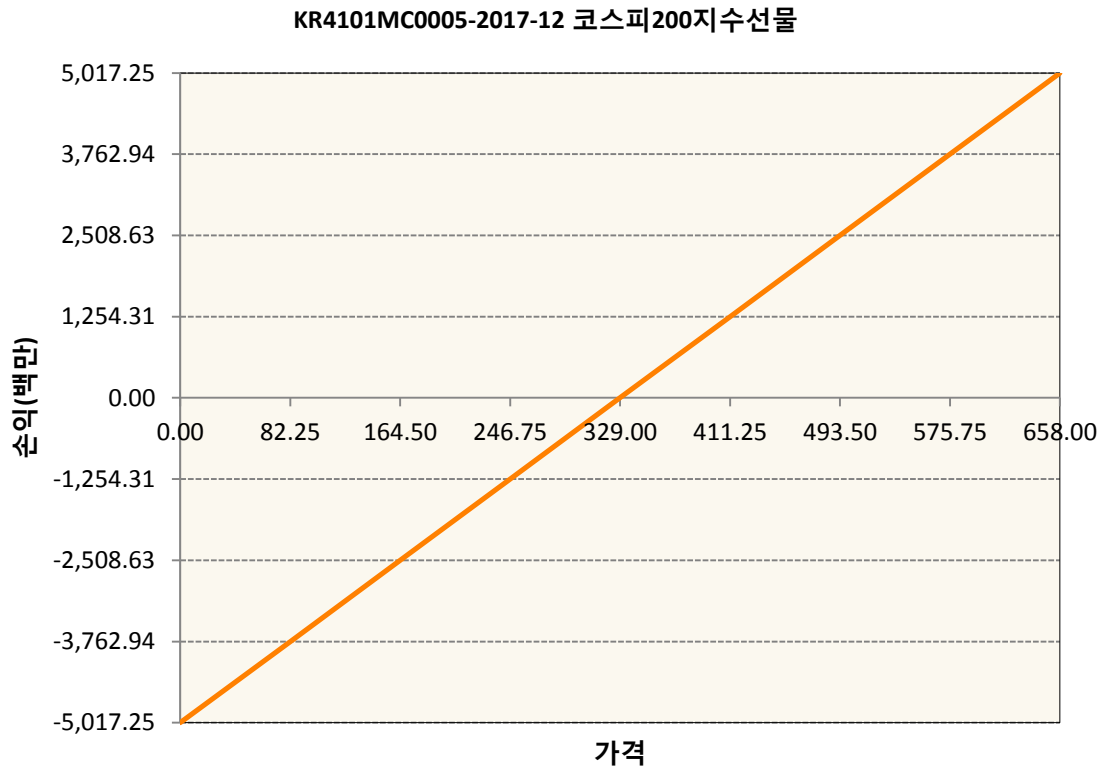
ETF스마트레버리지목표전환형7호

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	5,017	0	5,017	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)

245

공시일	2017-10-13
기준일	2017-10-12

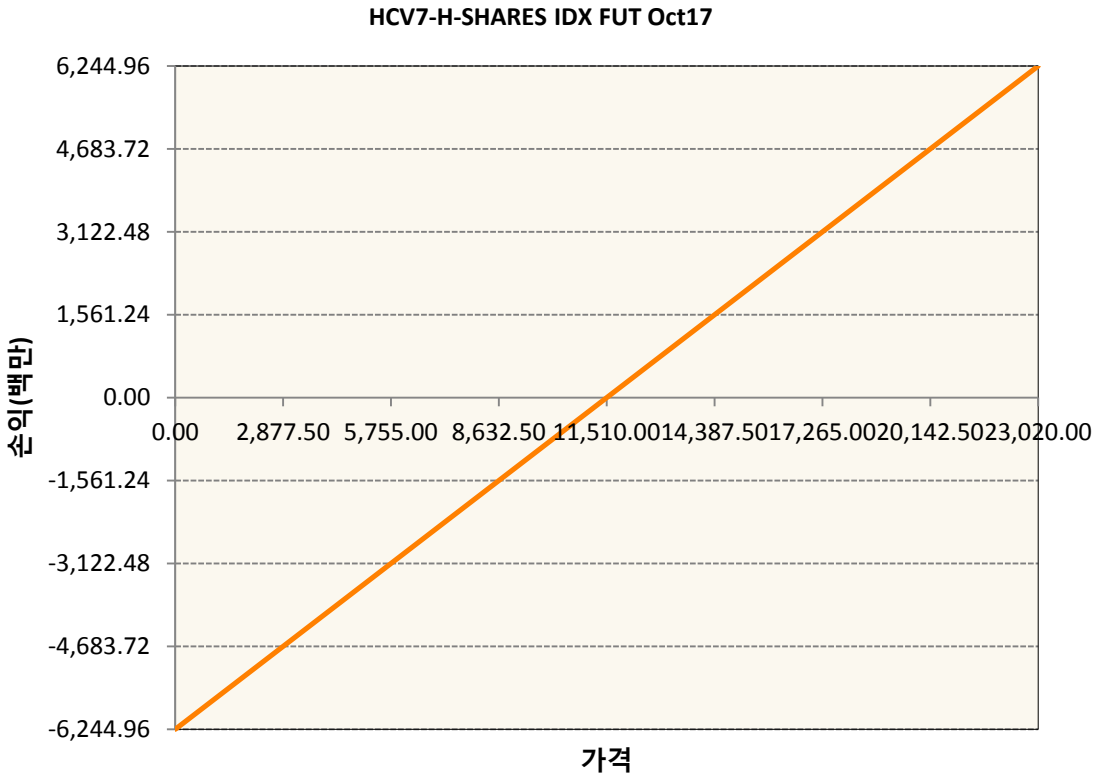
홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생

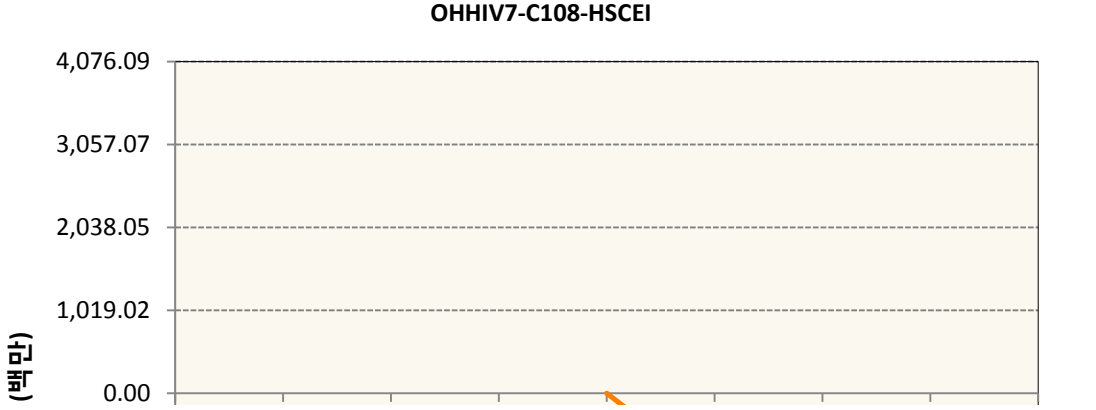
1. 계약금액

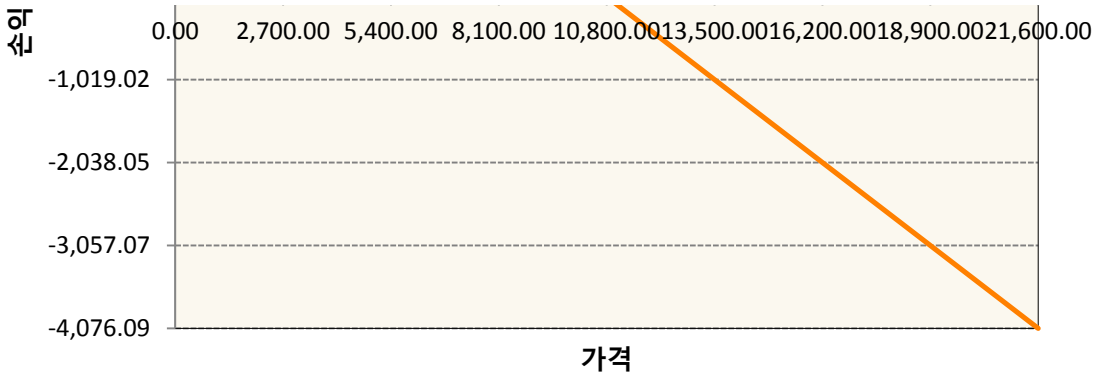
(단위:백만원)

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	6,245	0	6,245	장내
누계	유가증권	옵션	0	12,942	-12,942	장내

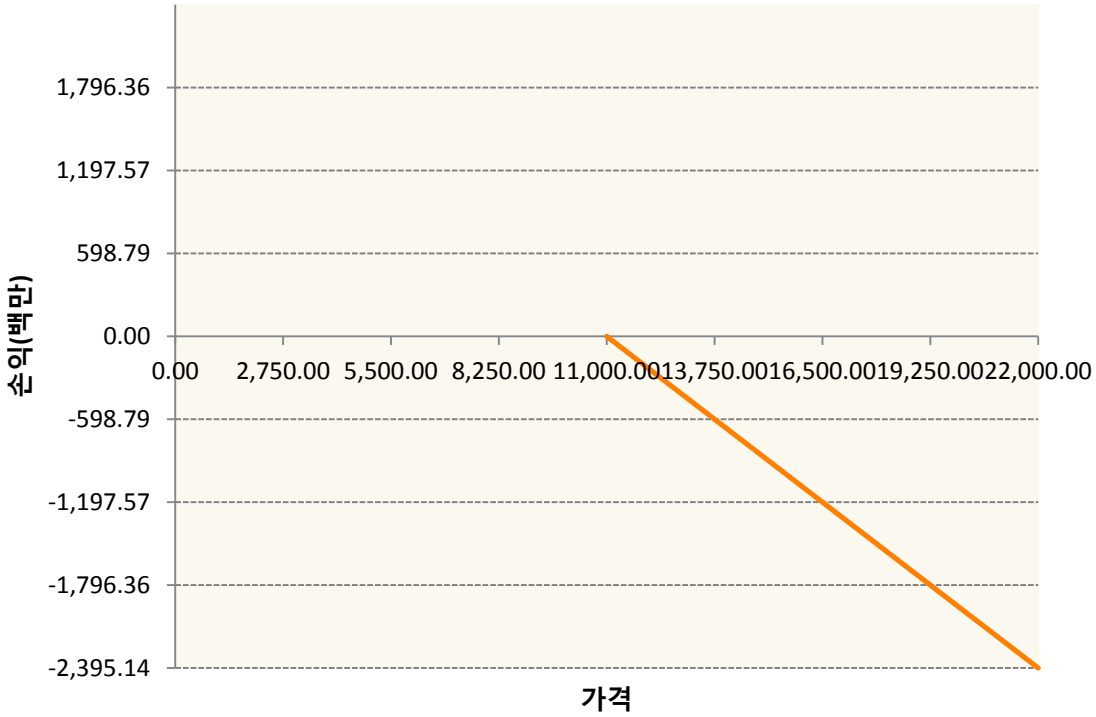
2. 만기시점의 손익구조



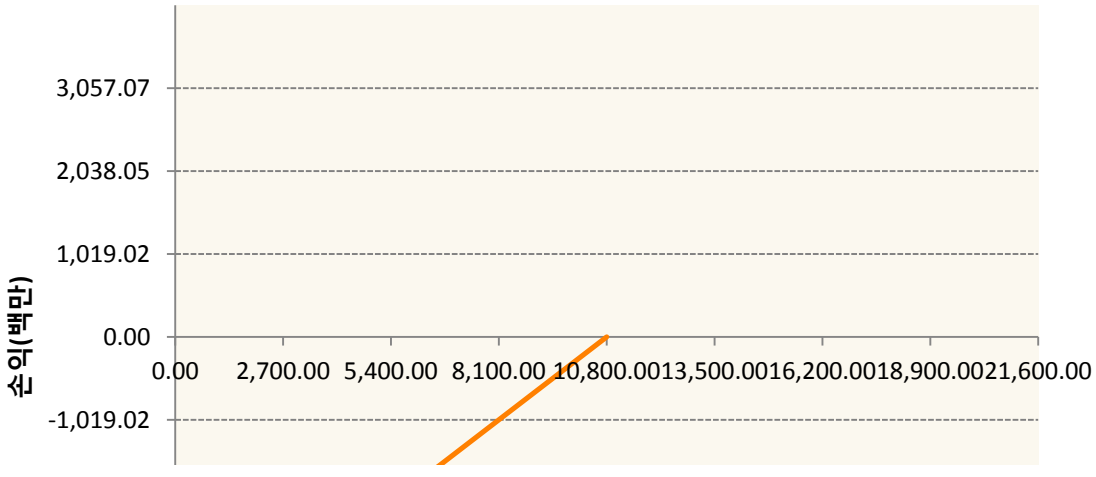


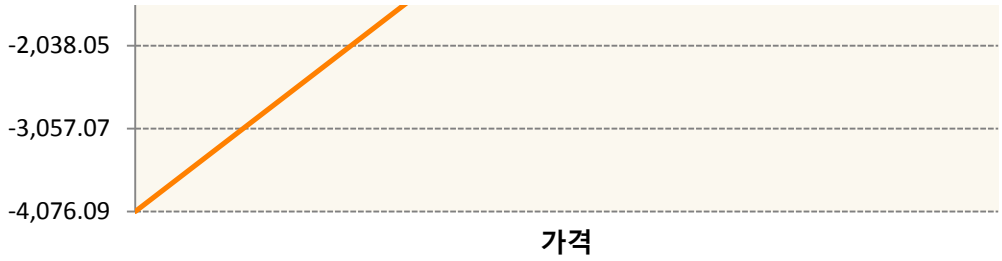


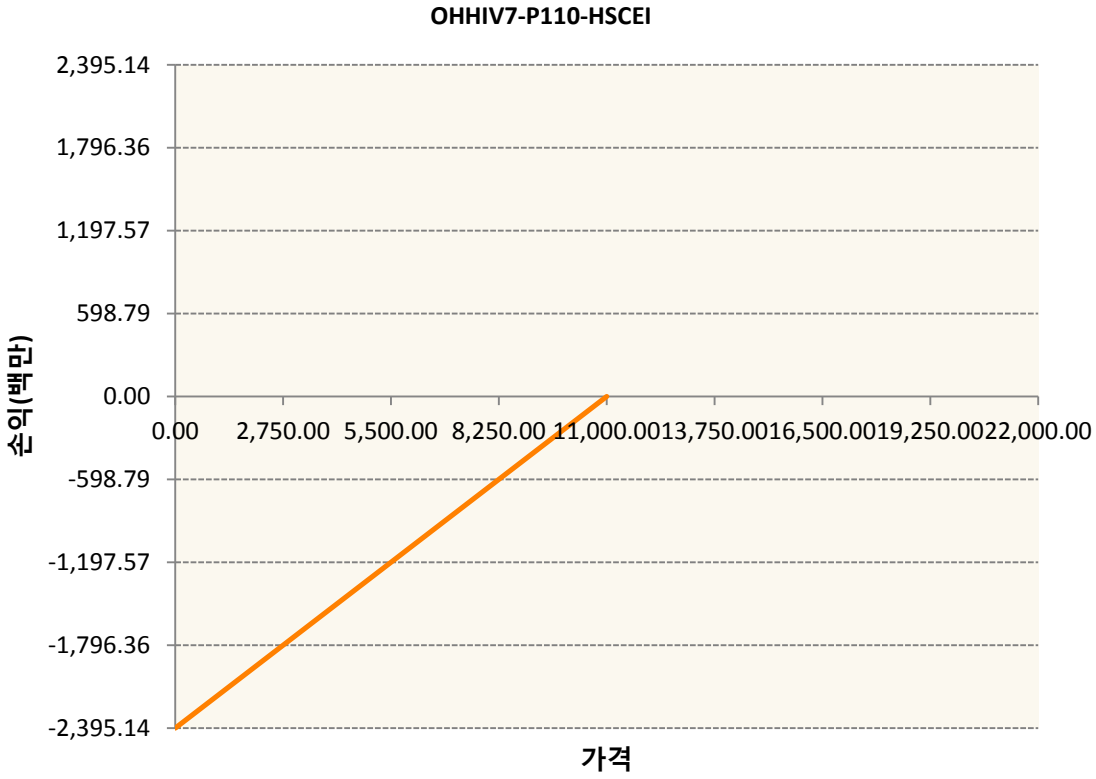
OHHIV7-C110-HSCEI



OHHIV7-P108-HSCEI







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

HCV7	H-SHARES IDX FUT Oct17	500
OHHIV7-C10	HSCEI	326
OHHIV7-C11	HSCEI	192
OHHIV7-P10	HSCEI	326
OHHIV7-P11	HSCEI	192

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

1,257

공시일	2017-10-13
기준일	2017-10-12

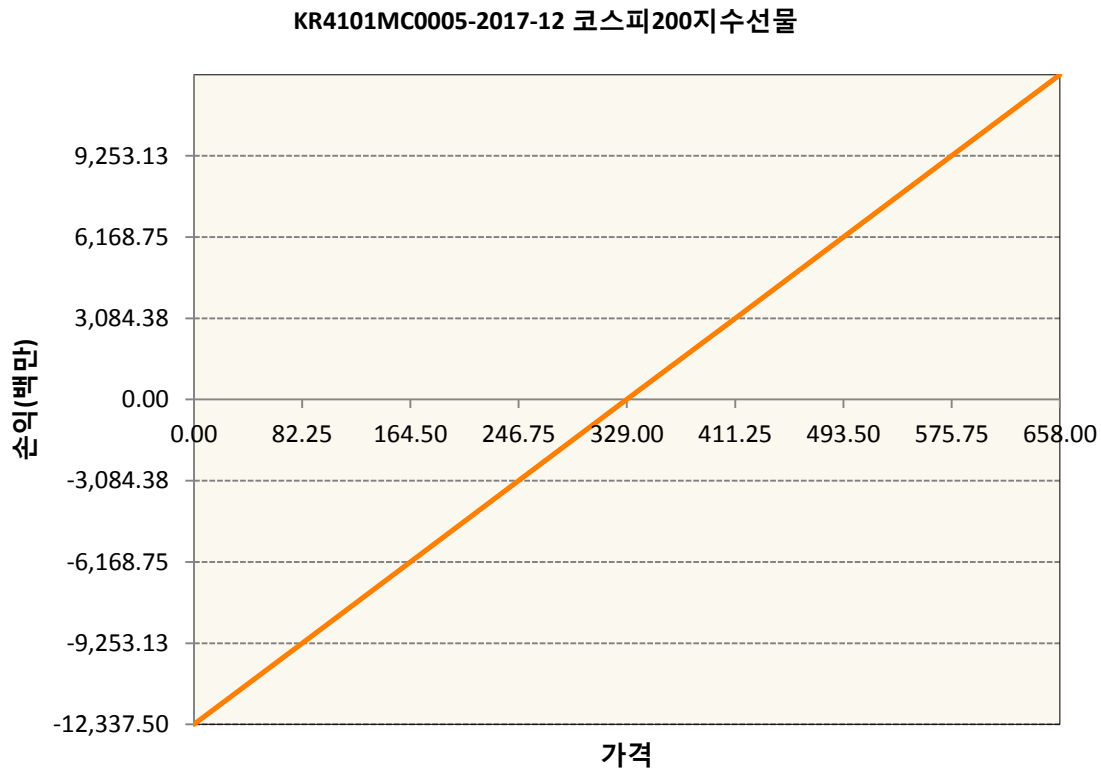
코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼

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	2,500	0	2,500	장외
누계	유가증권	선물	12,338	0	12,338	장내
누계	유가증권	스왑	29,500	0	29,500	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

2.5287E+11 UBCSFXC1 INDEX_2							1,501
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,501	-1,501	-1,501	-1,501	-1,501	-1,501	-1,501
-5.33%	-1,001	-1,001	-1,001	-1,001	-1,001	-1,001	-1,001
-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%	1,001	1,001	1,001	1,001	1,001	1,001	1,001
8.00%	1,501	1,501	1,501	1,501	1,501	1,501	1,501
	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
	2.5287E+11 UBCSFXC1 INDEX_6						203
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-203	-203	-203	-203	-203	-203	-203
-5.33%	-135	-135	-135	-135	-135	-135	-135
-2.67%	-68	-68	-68	-68	-68	-68	-68
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	68	68	68	68	68	68	68
5.33%	135	135	135	135	135	135	135
8.00%	203	203	203	203	203	203	203
	KR4101MC0(2017-12 코스피200지수선물						984

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-984	-984	-984	-984	-984	-984	-984
-5.33%	-656	-656	-656	-656	-656	-656	-656
-2.67%	-328	-328	-328	-328	-328	-328	-328
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	328	328	328	328	328	328	328
5.33%	656	656	656	656	656	656	656
8.00%	984	984	984	984	984	984	984

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

2,997

공시일	2017-10-13
기준일	2017-10-12

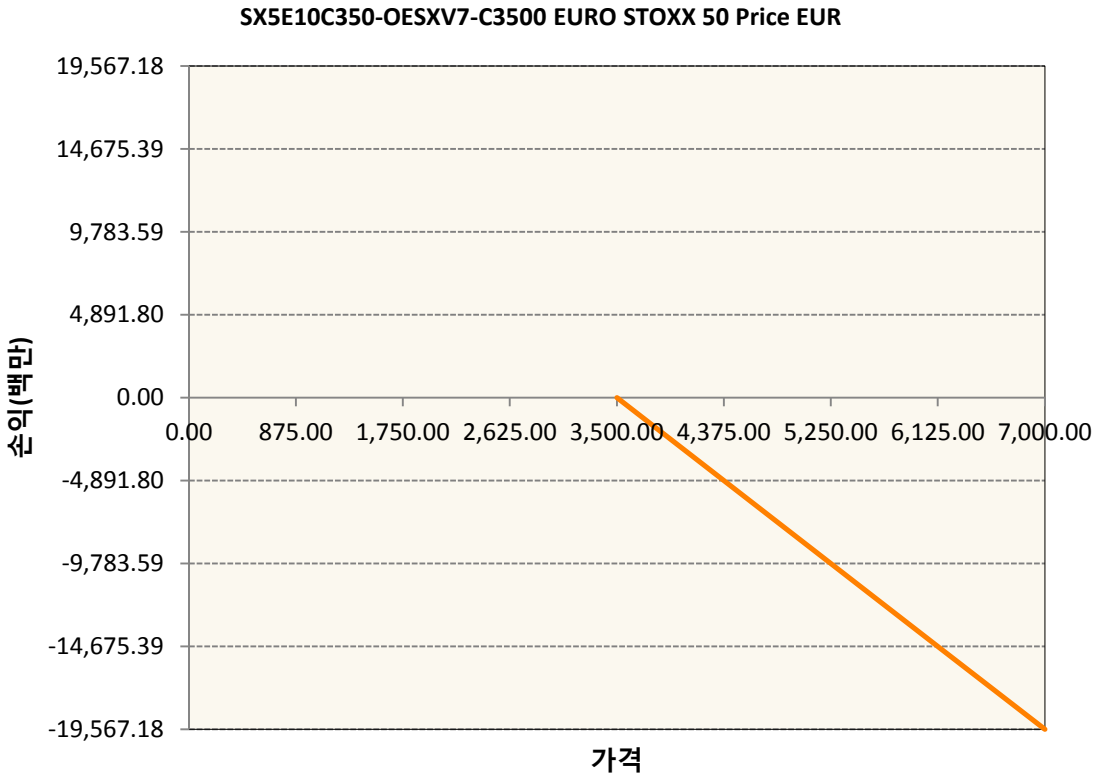
유로커버드콜모(주식혼합-파생형

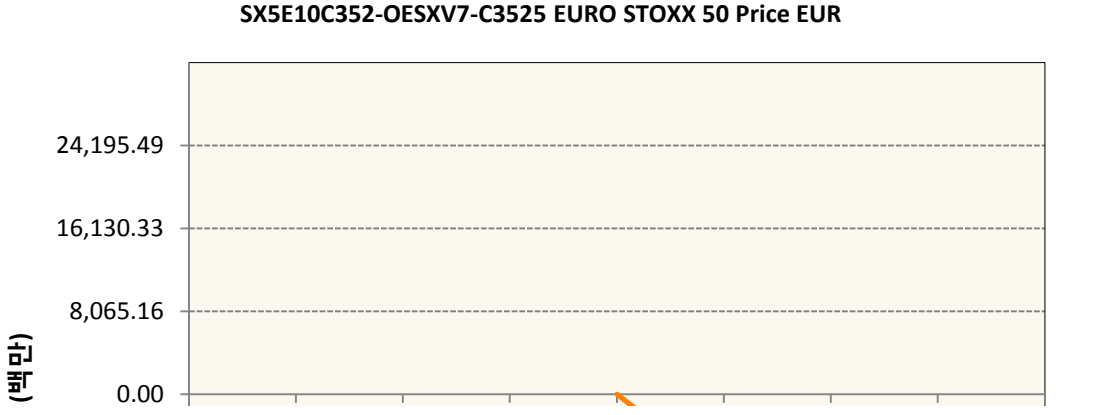
1. 계약금액

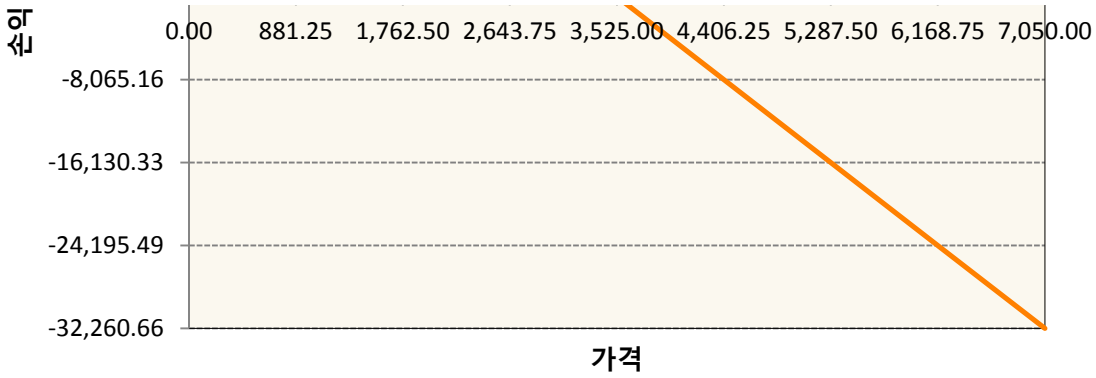
(단위:백만원)

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	48,940	0	48,940	
누계	유가증권	옵션	0	103,656	-103,656	장외

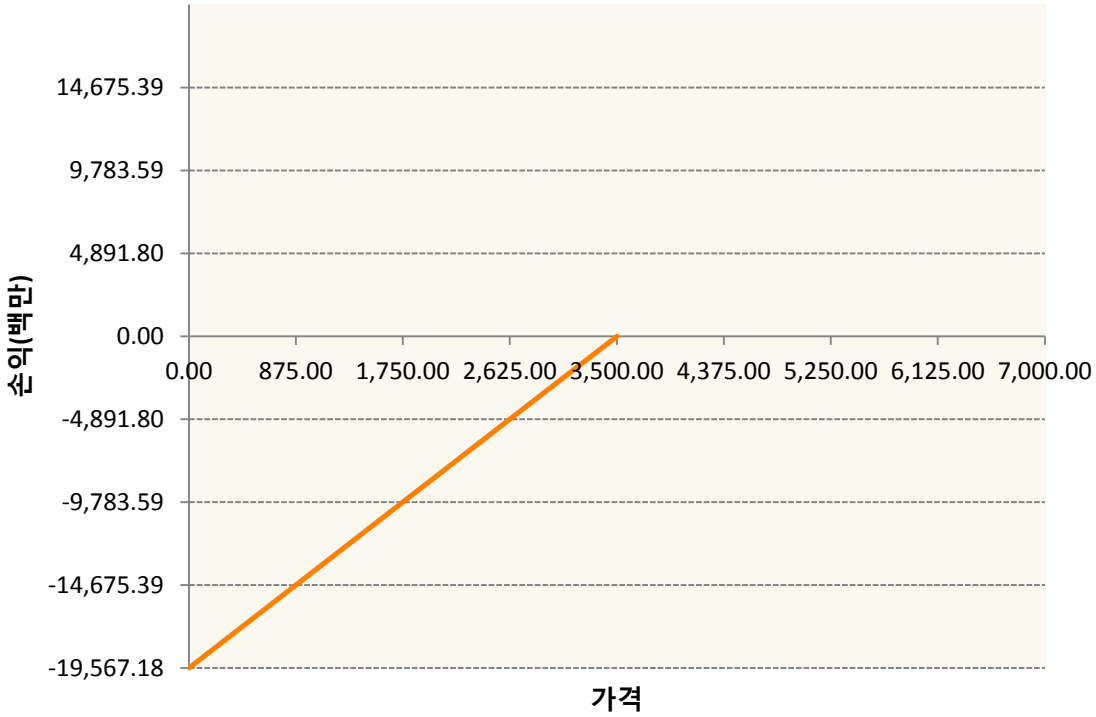
2. 만기시점의 손익구조



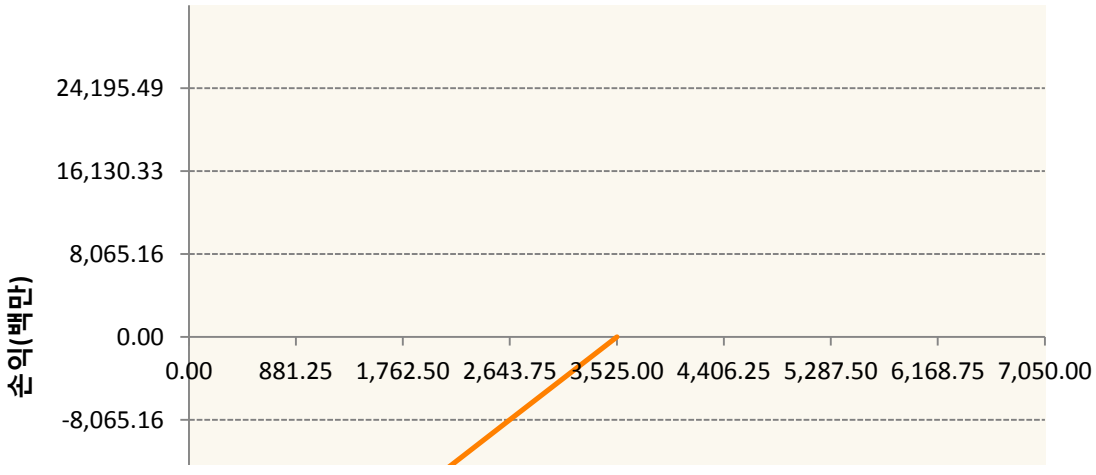


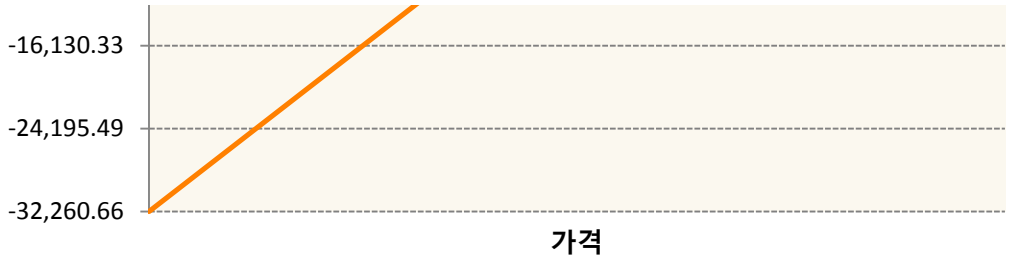


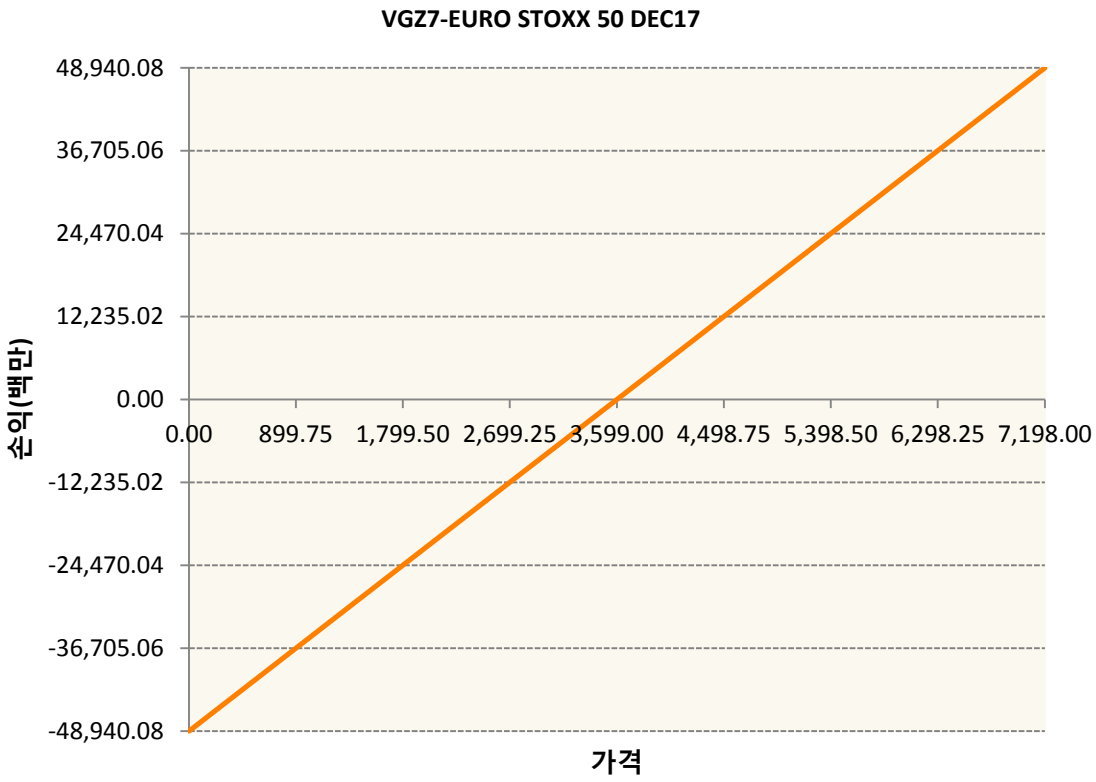
SX5E10P350-OESXV7-P3500 EURO STOXX 50 Price EUR



SX5E10P352-OESXV7-P3525 EURO STOXX 50 Price EUR







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

SX5E10C350 OESXV7-C3500 EURO STOXX 50 Price EUR	1,565
SX5E10C352 OESXV7-C3525 EURO STOXX 50 Price EUR	2,581
SX5E10P350 OESXV7-P3500 EURO STOXX 50 Price EUR	1,565
SX5E10P352 OESXV7-P3525 EURO STOXX 50 Price EUR	2,581
VGZ7 EURO STOXX 50 DEC17	3,915

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

9,375

공시일	2017-10-13
기준일	2017-10-12

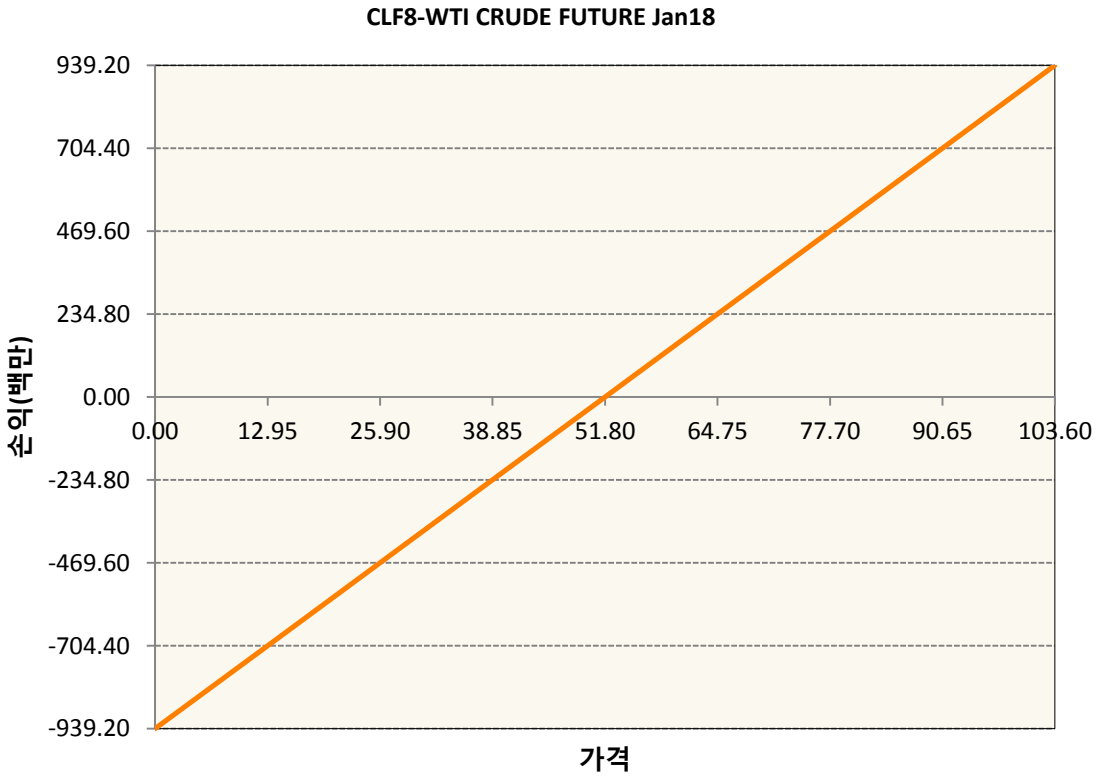
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

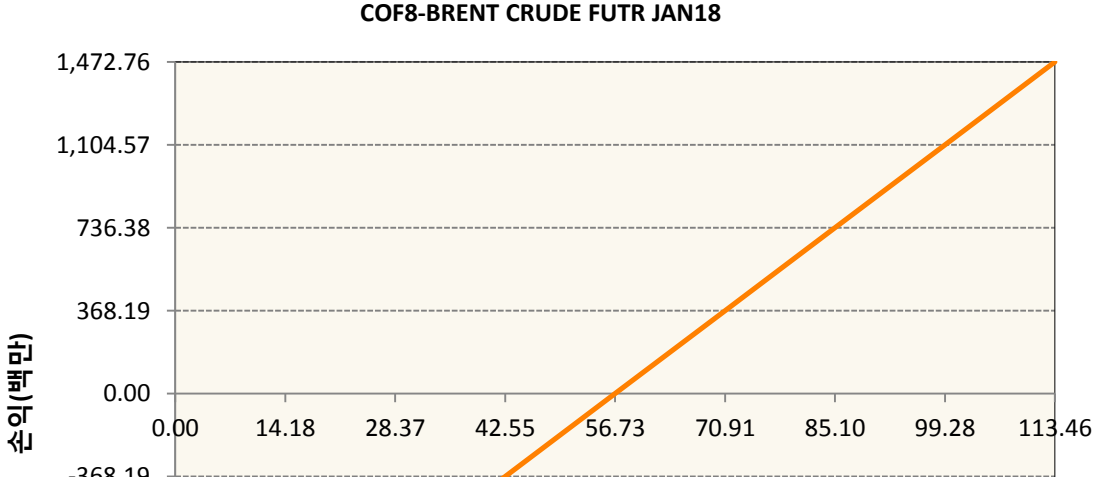
1. 계약금액

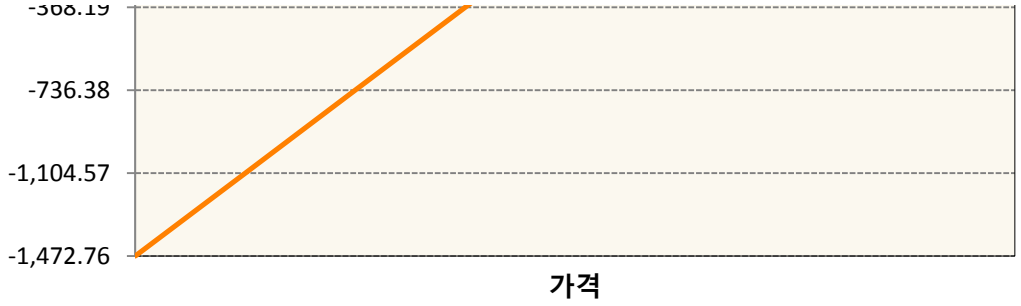
(단위:백만원)

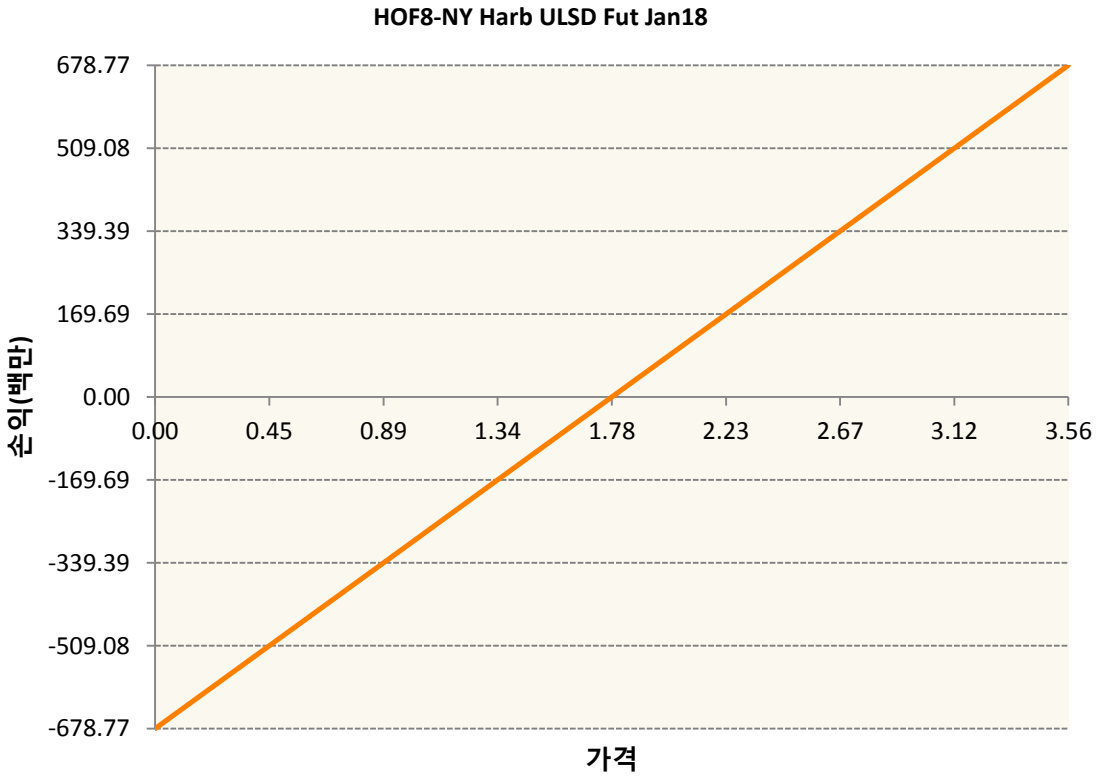
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	5,209	907	4,302	

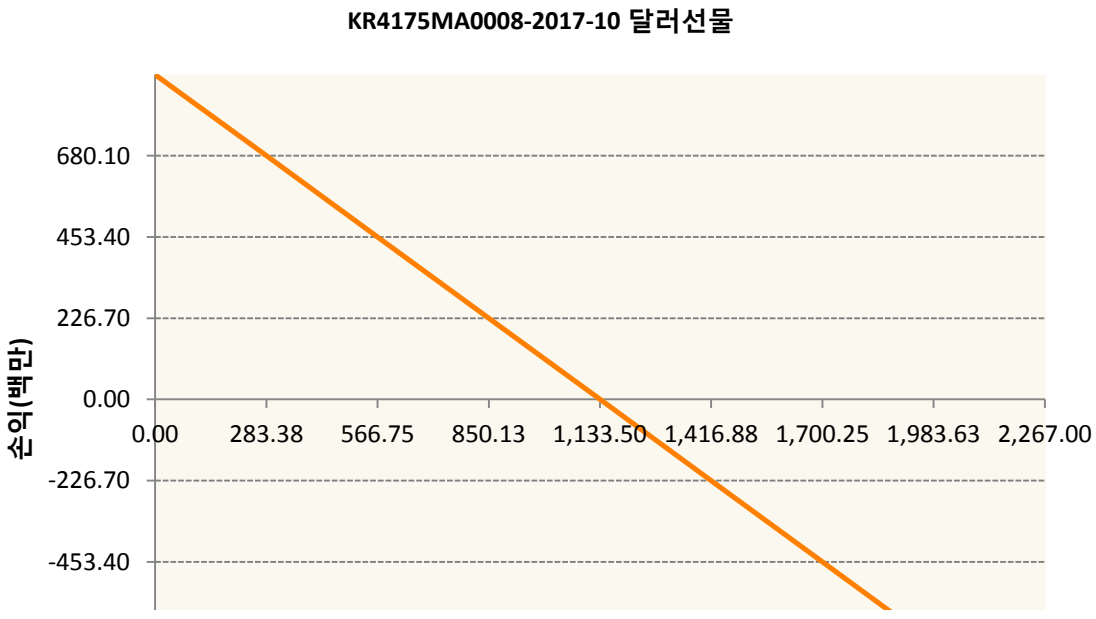
2. 만기시점의 손익구조

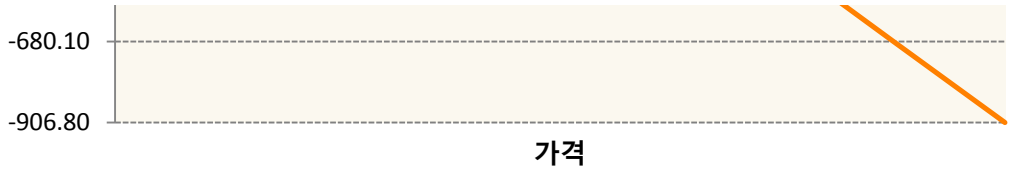


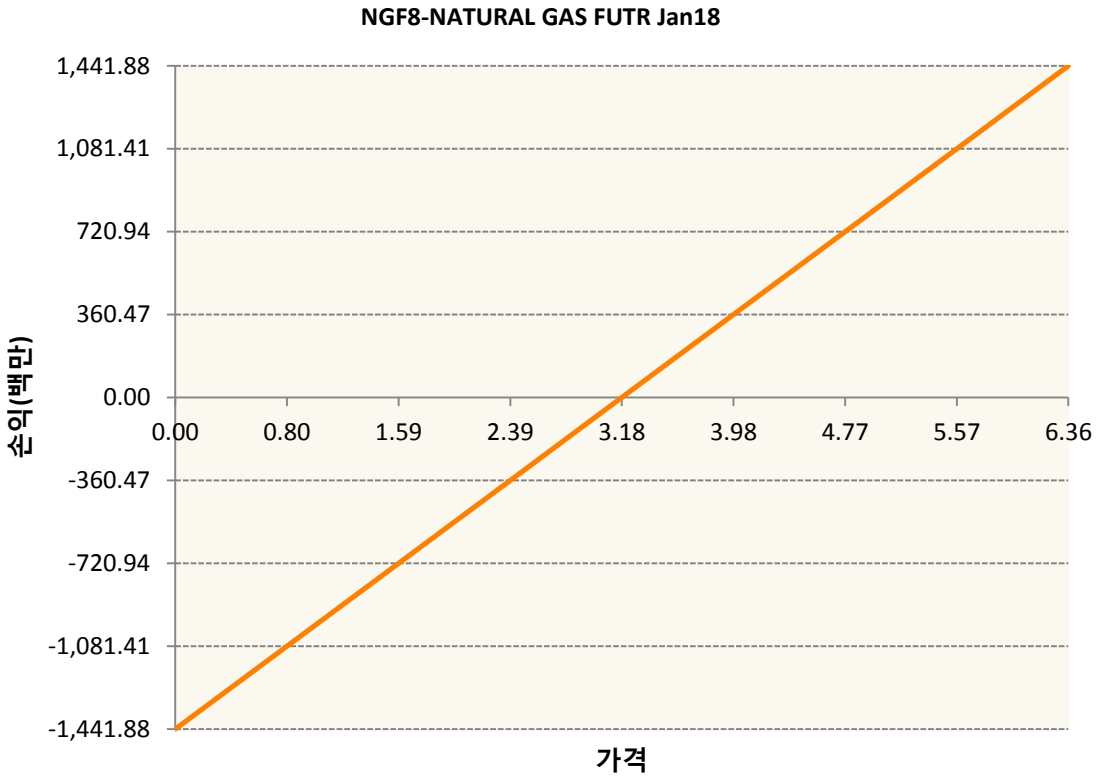


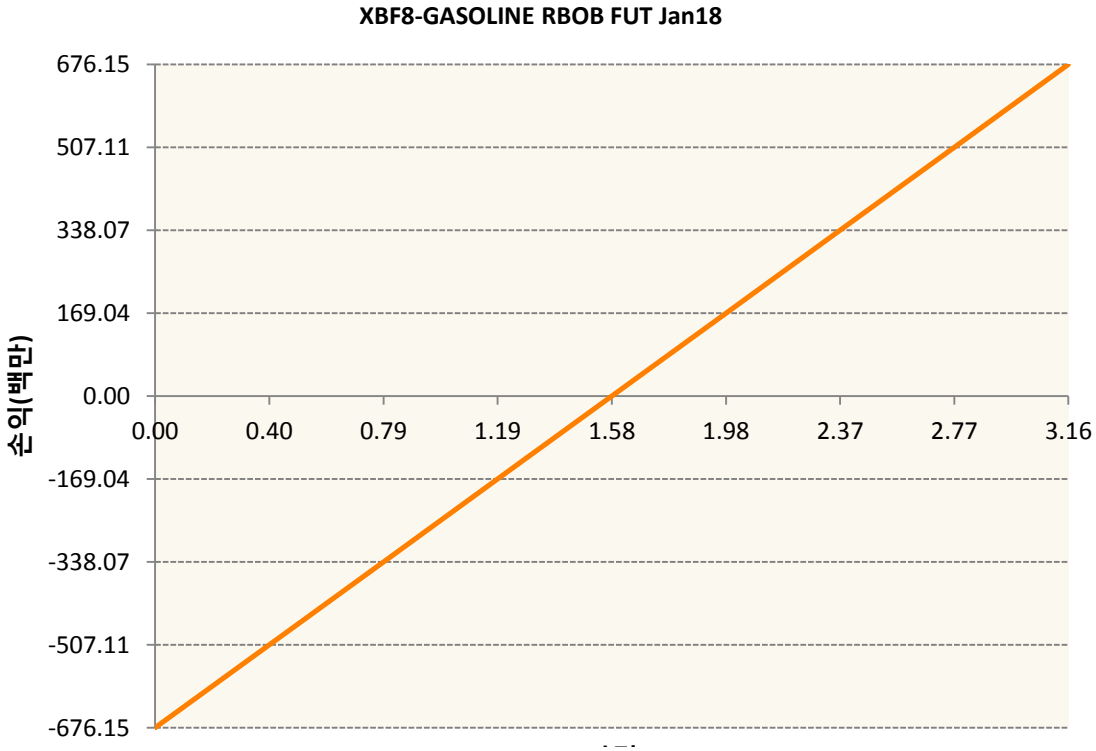

-736.38
-1,104.57
-1,472.76
가격


HOF8-NY Harb ULSD Fut Jan18
678.77
509.08
339.39
169.69
0.00
-169.69
-339.39
-509.08
-678.77
0.00
0.45
0.89
1.34
1.78
2.23
2.67
3.12
3.56
손익(백만)
가격


KR4175MA0008-2017-10 달러선물
680.10
453.40
226.70
0.00
-226.70
-453.40
0.00
283.38
566.75
850.13
1,133.50
1,416.88
1,700.25
1,983.63
2,267.00
손익(백만)


-680.10
-906.80
가격


NGF8-NATURAL GAS FUTR Jan18
1,441.88
1,081.41
720.94
360.47
0.00
-360.47
-720.94
-1,081.41
-1,441.88
0.00
0.80
1.59
2.39
3.18
3.98
4.77
5.57
6.36
손익(백만)
가격


XBF8-GASOLINE RBOB FUT Jan18
676.15
507.11
338.07
169.04
0.00
-169.04
-338.07
-507.11
-676.15
0.00
0.40
0.79
1.19
1.58
1.98
2.37
2.77
3.16
손익(백만)

가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLF8	WTI CRUDE FUTURE Jan18	75
COF8	BRENT CRUDE FUTR JAN18	118
HOF8	NY Harb ULSD Fut Jan18	54
KR4175MA0(	2017-10 달러선물	73
NGF8	NATURAL GAS FUTR Jan18	115
XBF8	GASOLINE RBOB FUT Jan18	54

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

748

공시일	2017-10-13
기준일	2017-10-12

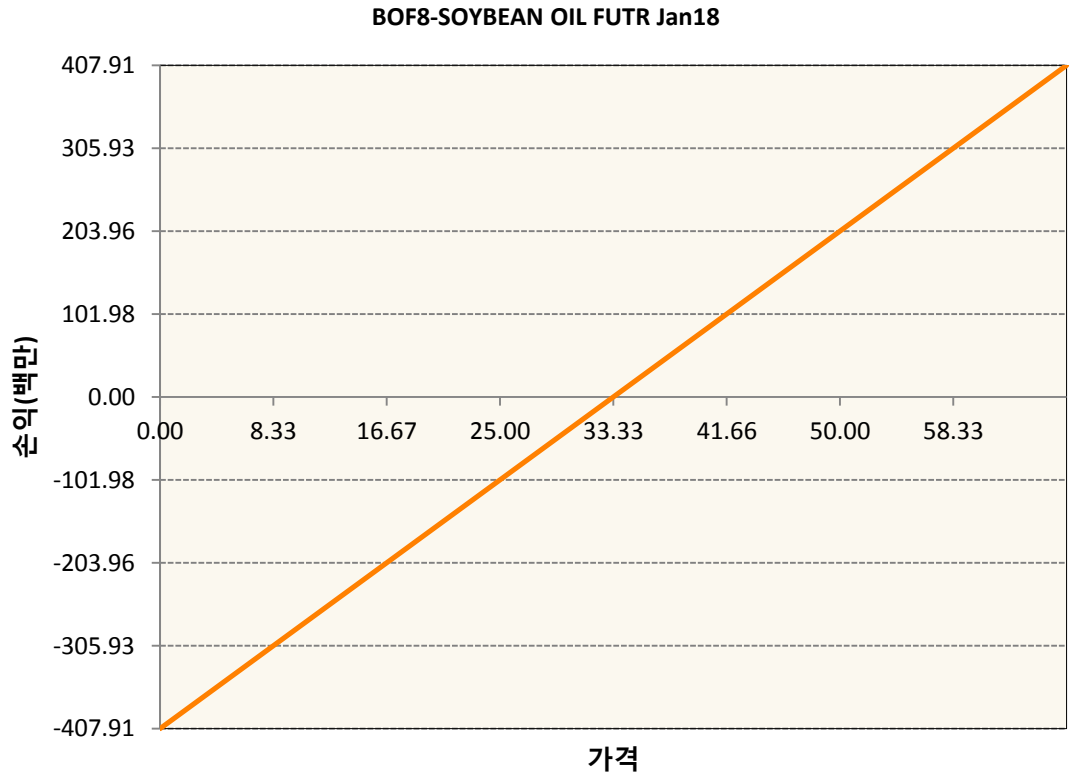
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

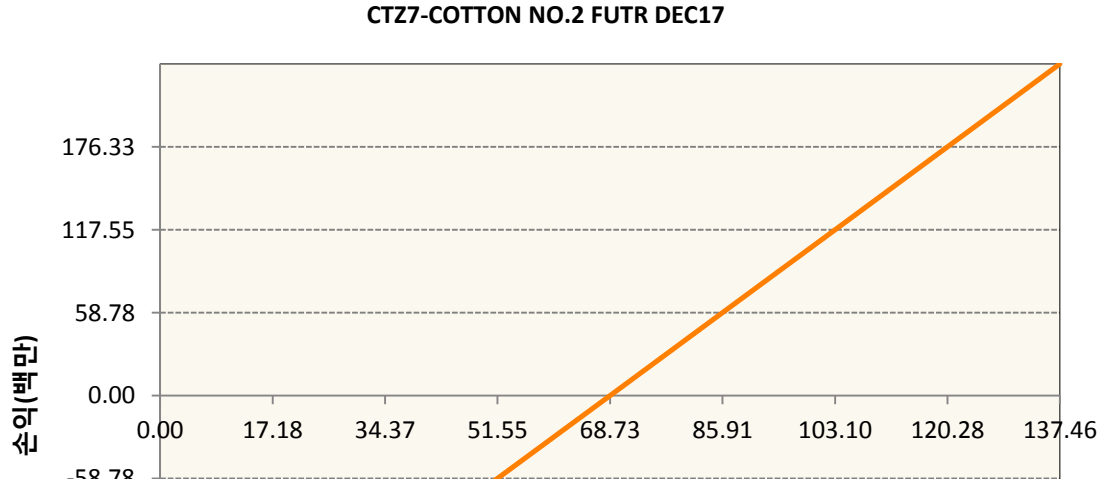
1. 계약금액

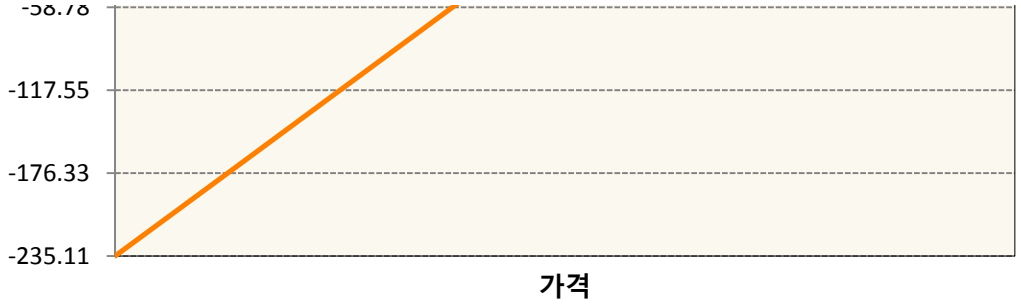
(단위:백만원)

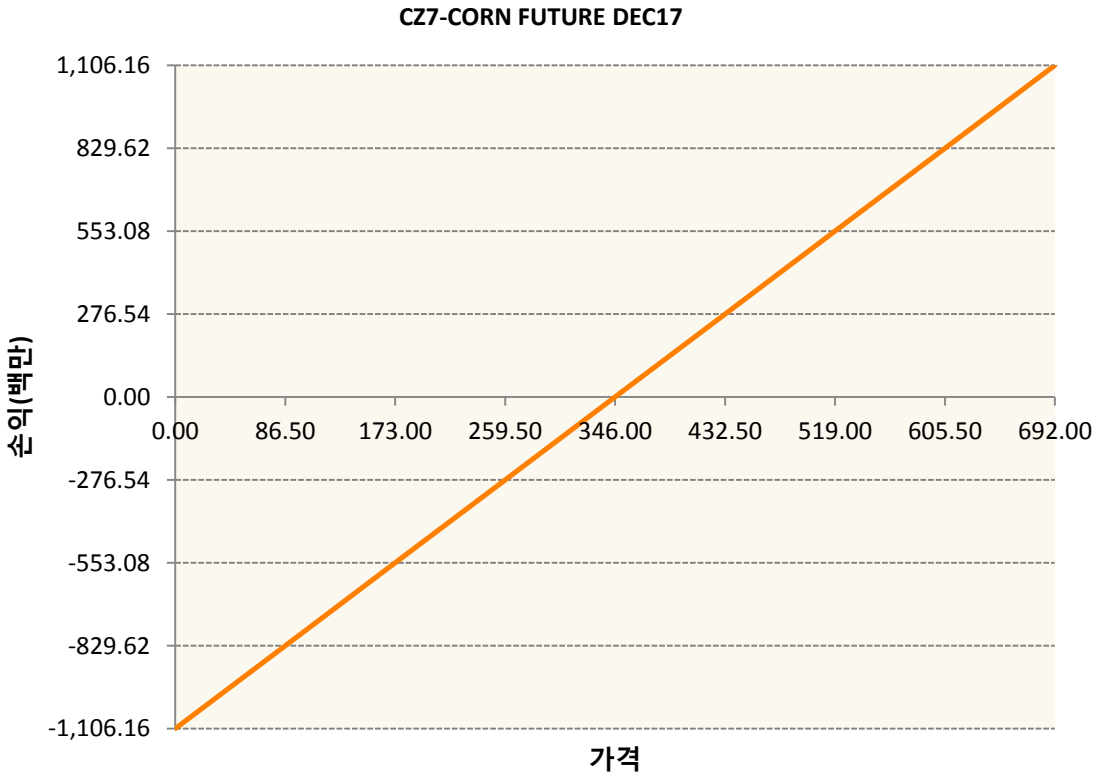
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	4,528	340	4,188	

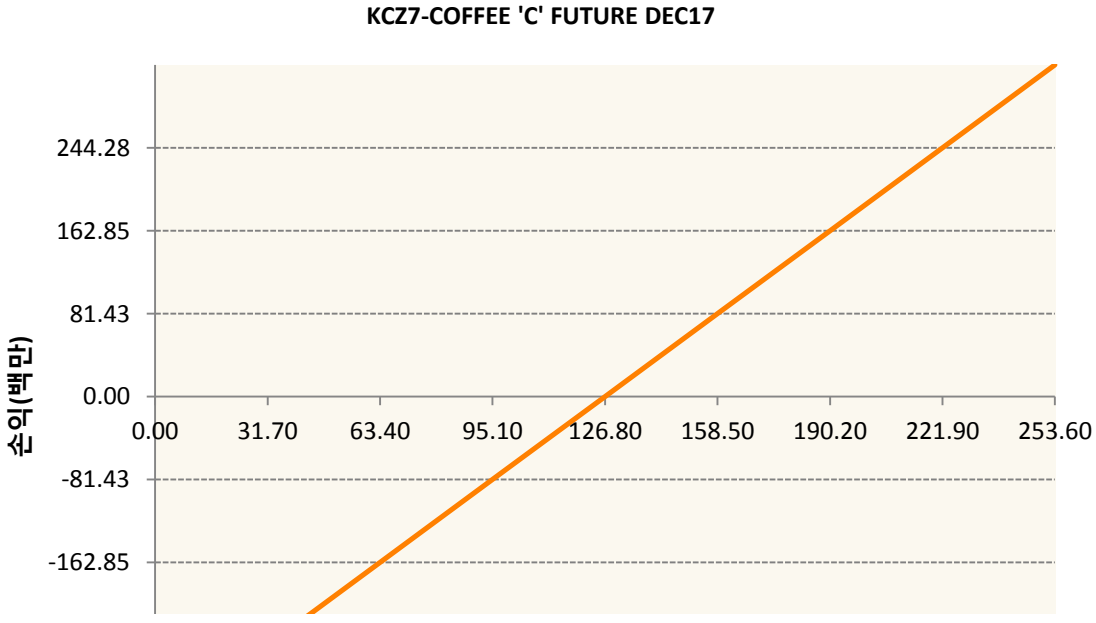
2. 만기시점의 손익구조

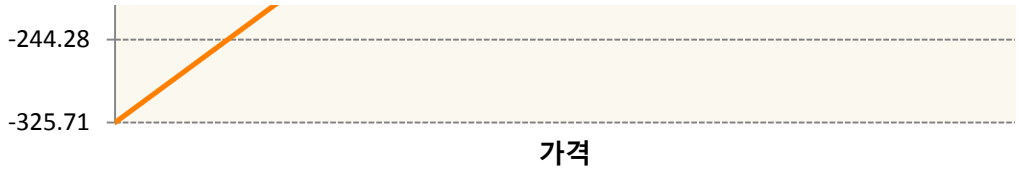


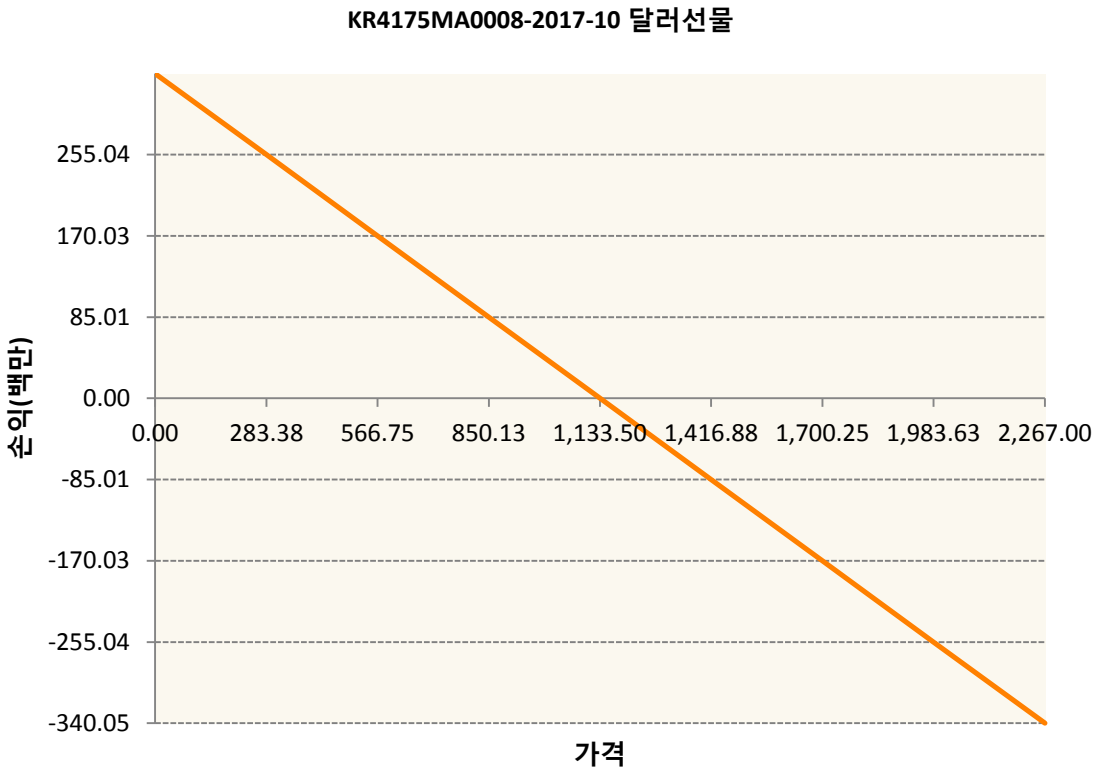


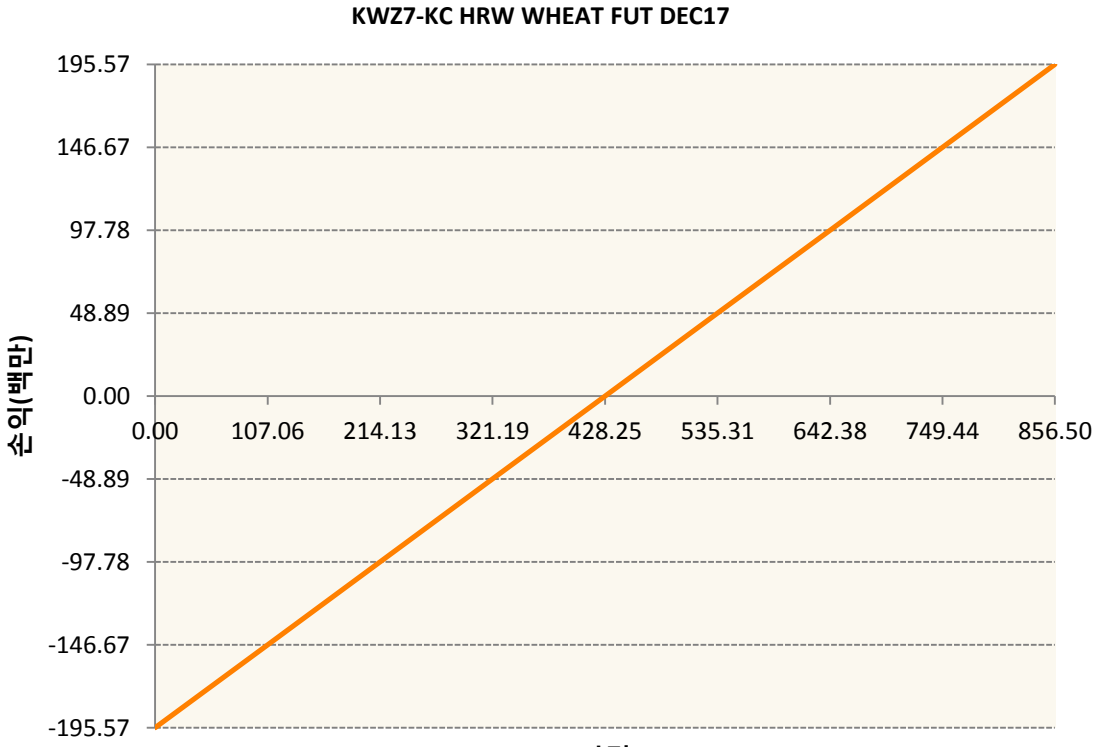

-117.55
-176.33
-235.11
가격


CZ7-CORN FUTURE DEC17
1,106.16
829.62
553.08
276.54
0.00
-276.54
-553.08
-829.62
-1,106.16
0.00
86.50
173.00
259.50
346.00
432.50
519.00
605.50
692.00
손익(백만)
가격


KCZ7-COFFEE 'C' FUTURE DEC17
244.28
162.85
81.43
0.00
-81.43
-162.85
0.00
31.70
63.40
95.10
126.80
158.50
190.20
221.90
253.60
손익(백만)

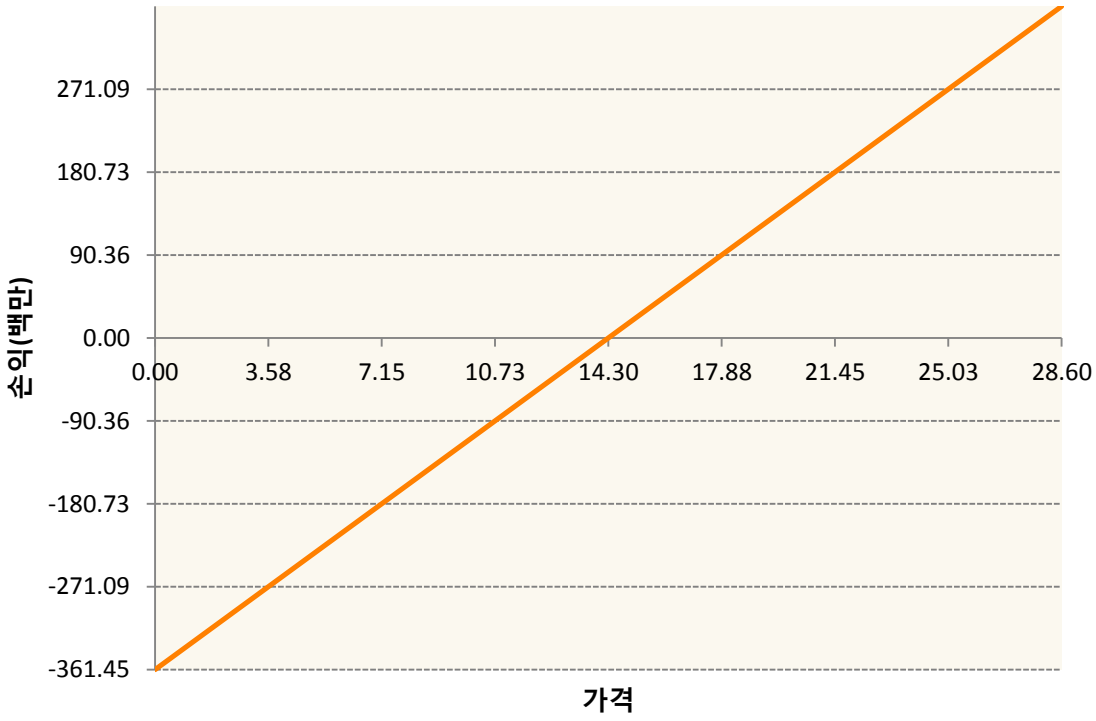

-244.28
-325.71
가격


KR4175MA0008-2017-10 달러선물
255.04
170.03
85.01
0.00
-85.01
-170.03
-255.04
-340.05
0.00
283.38
566.75
850.13
1,133.50
1,416.88
1,700.25
1,983.63
2,267.00
손익(백만)
가격

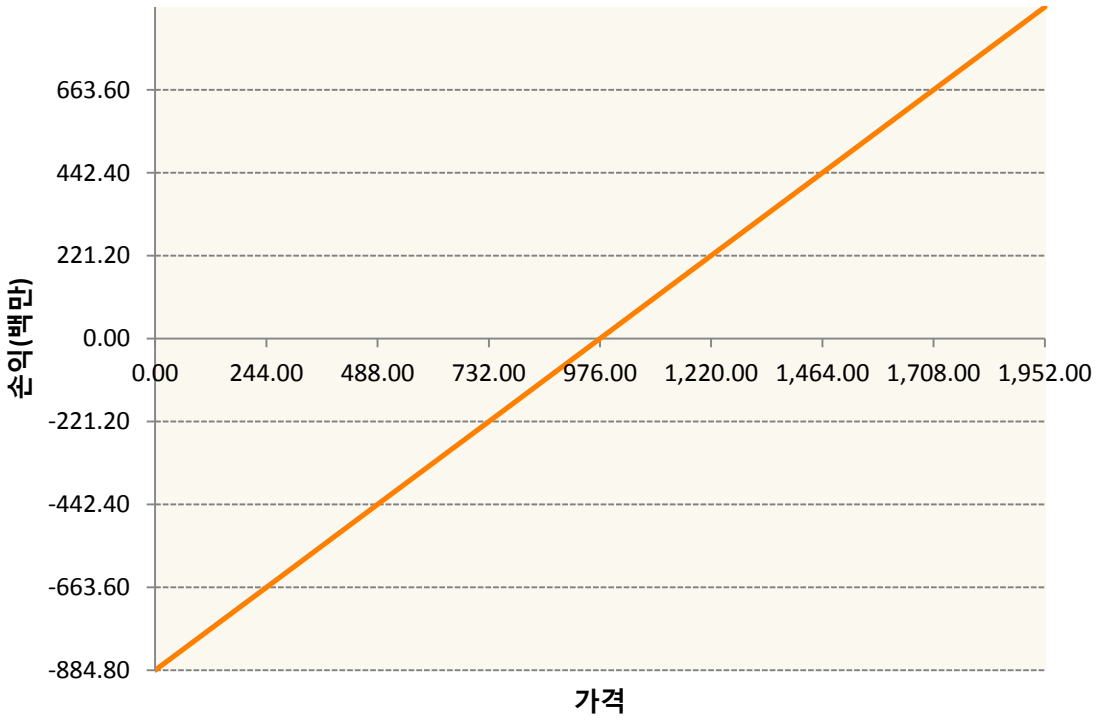

KWZ7-KC HRW WHEAT FUT DEC17
195.57
146.67
97.78
48.89
0.00
-48.89
-97.78
-146.67
-195.57
0.00
107.06
214.13
321.19
428.25
535.31
642.38
749.44
856.50
손익(백만)

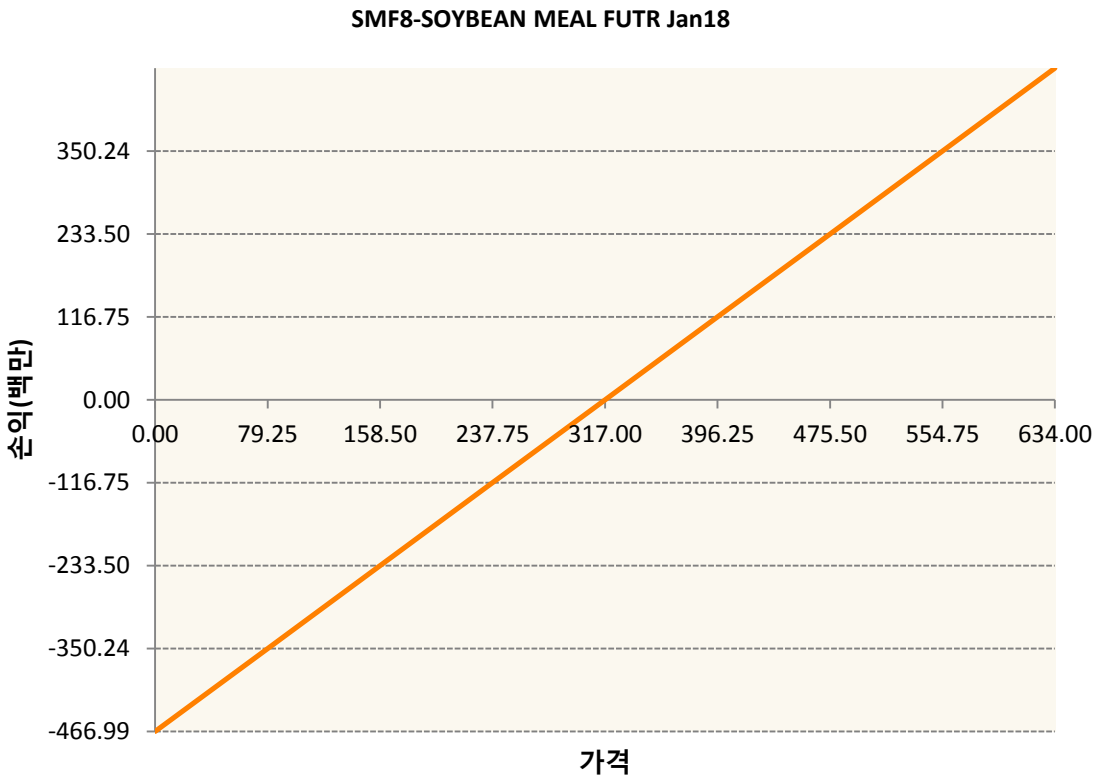
가격

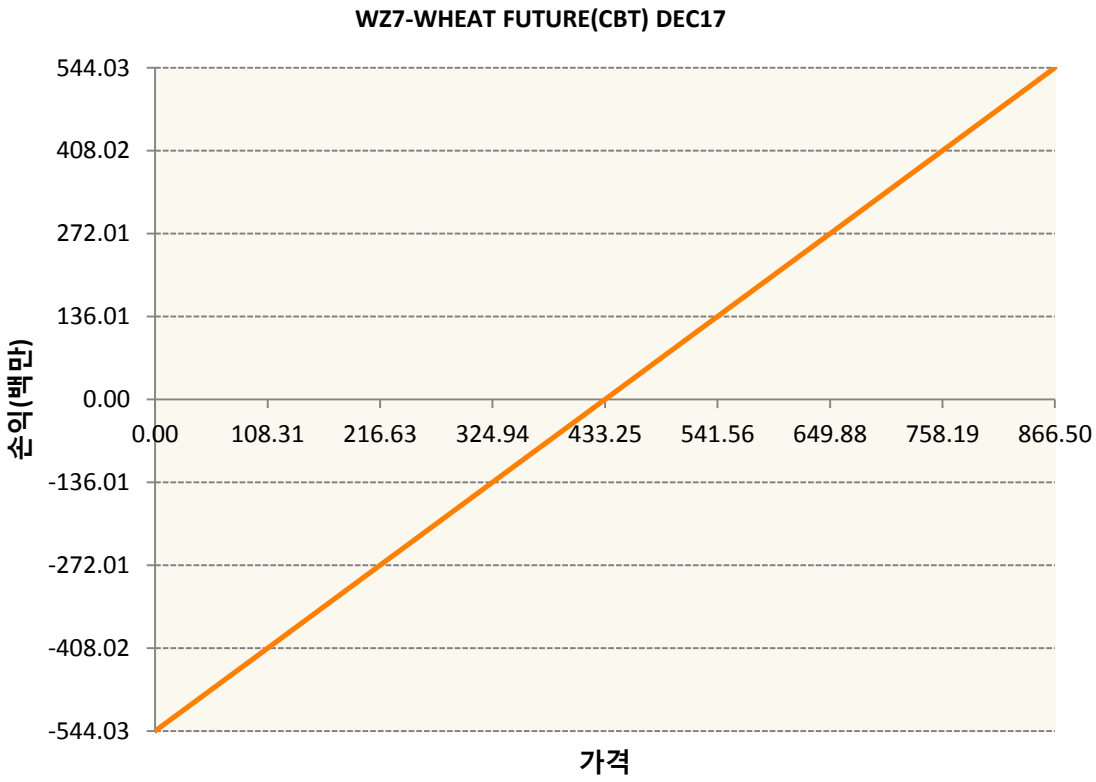
SBH8-Sugar #11 (WORLD) MAR18



SF8-SOYBEAN FUTURE Jan18







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
BOF8	SOYBEAN OIL FUTR Jan18	33

CTZ7	COTTON NO.2 FUTR DEC17	19
CZ7	CORN FUTURE DEC17	88
KCZ7	COFFEE 'C' FUTURE DEC17	26
KR4175MA0(	2017-10 달러선물	27
KWZ7	KC HRW WHEAT FUT DEC17	16
SBH8	Sugar #11 (WORLD) MAR18	29
SF8	SOYBEAN FUTURE Jan18	71
SMF8	SOYBEAN MEAL FUTR Jan18	37
WZ7	WHEAT FUTURE(CBT) DEC17	44

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

418