공시일	2017-10-16
기준일	2017-10-13

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	2017-10-16
기준일	2017-10-13

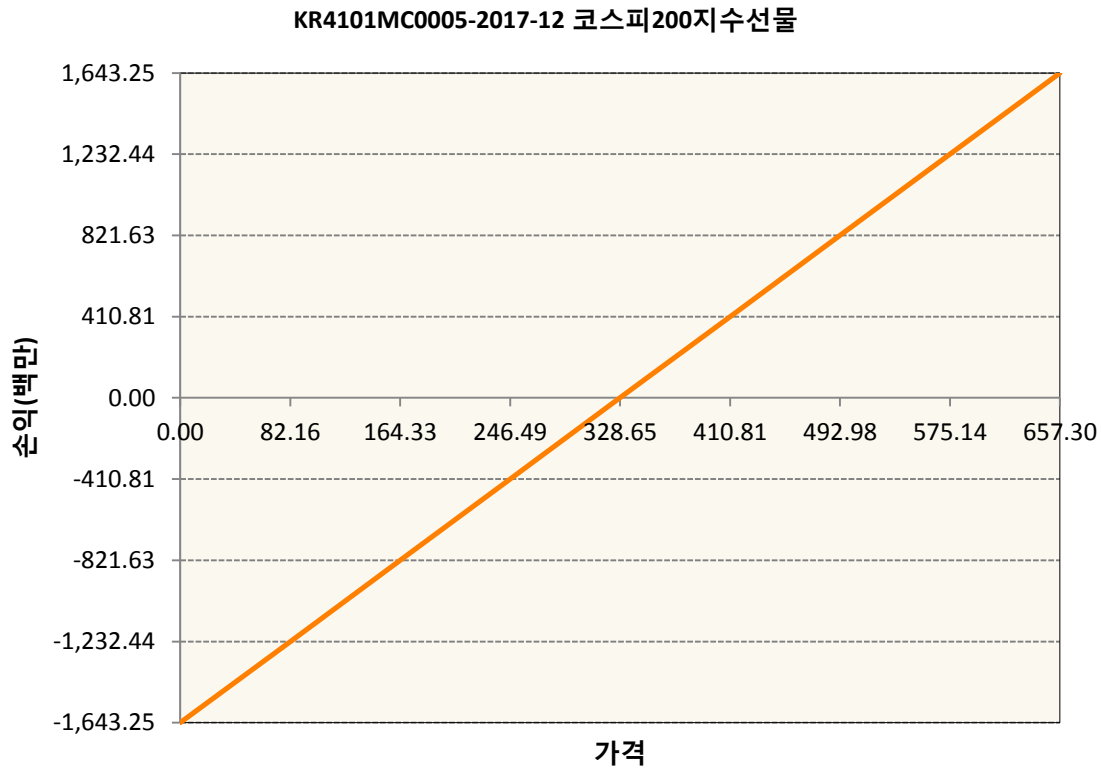
스마트인덱스모

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	411	-411	장내
누계	유가증권	선물	1,643	0	1,643	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101MC0(2017-12 코스피200지수선물							131
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-131	-131	-131	-131	-131	-131	-131
-5.33%	-87	-87	-87	-87	-87	-87	-87
-2.67%	-44	-44	-44	-44	-44	-44	-44
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	44	44	44	44	44	44	44
5.33%	87	87	87	87	87	87	87

8.00%	131	131	131	131	131	131	131

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

80

공시일	2017-10-16
기준일	2017-10-13

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	2017-10-16
기준일	2017-10-13

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	429

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

372

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-10-16
기준일	2017-10-13

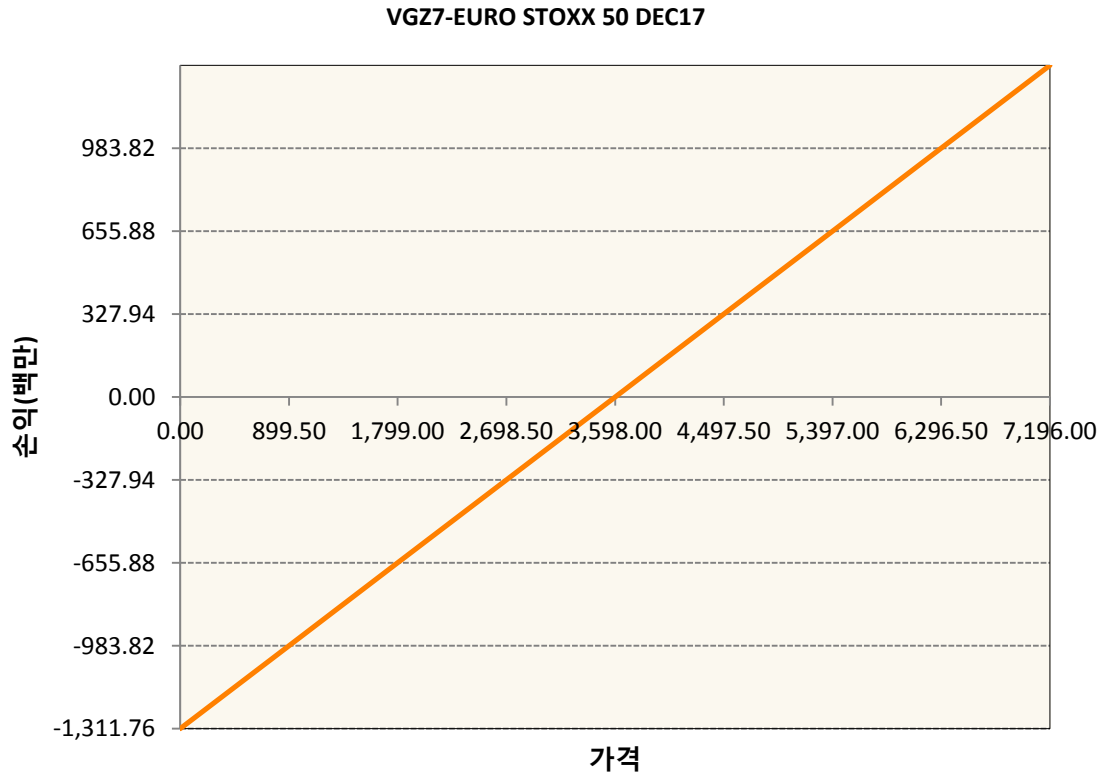
유로인덱스모(주식-파생형)

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	2017-10-16
기준일	2017-10-13

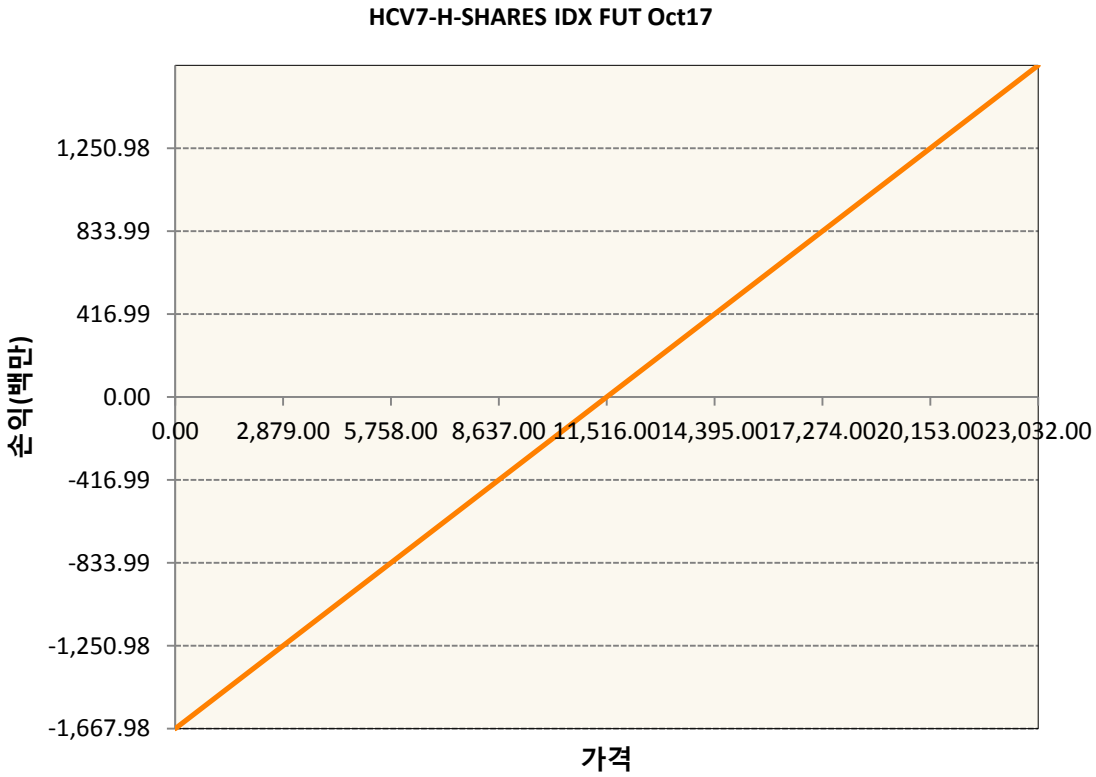
차이나인덱스모(주식-파생형)

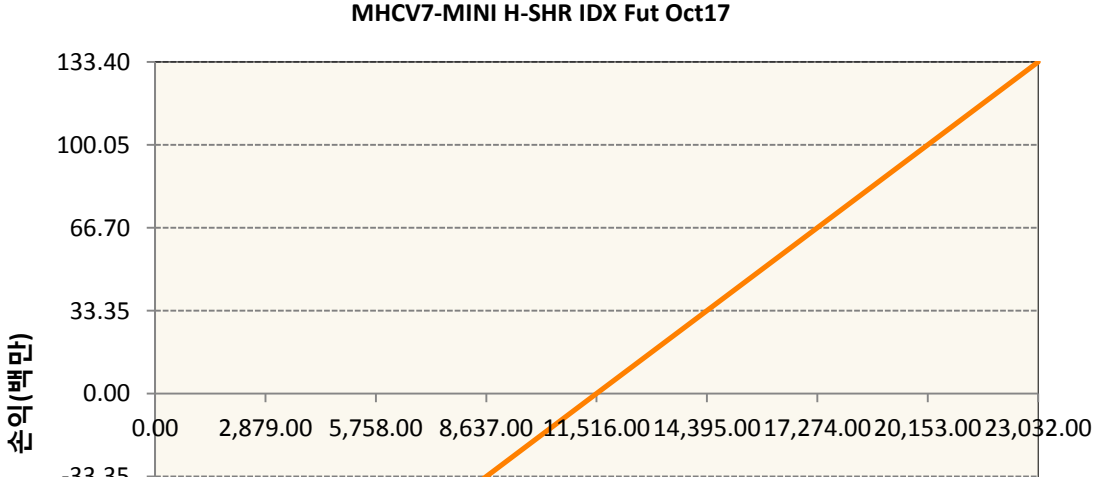
1. 계약금액

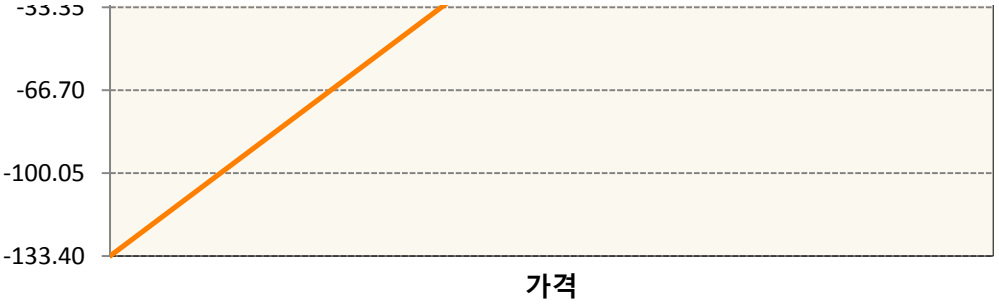
(단위:백만원)

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	2017-10-16
기준일	2017-10-13

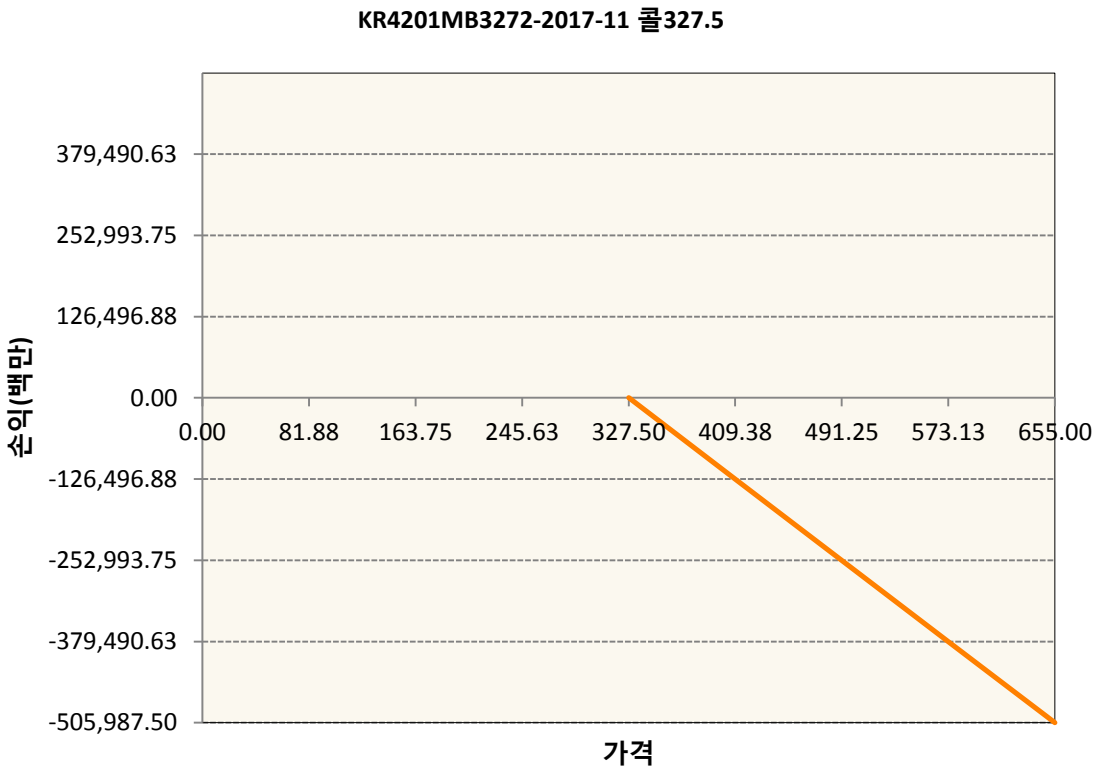
커버드콜모(주식혼합-파생형)

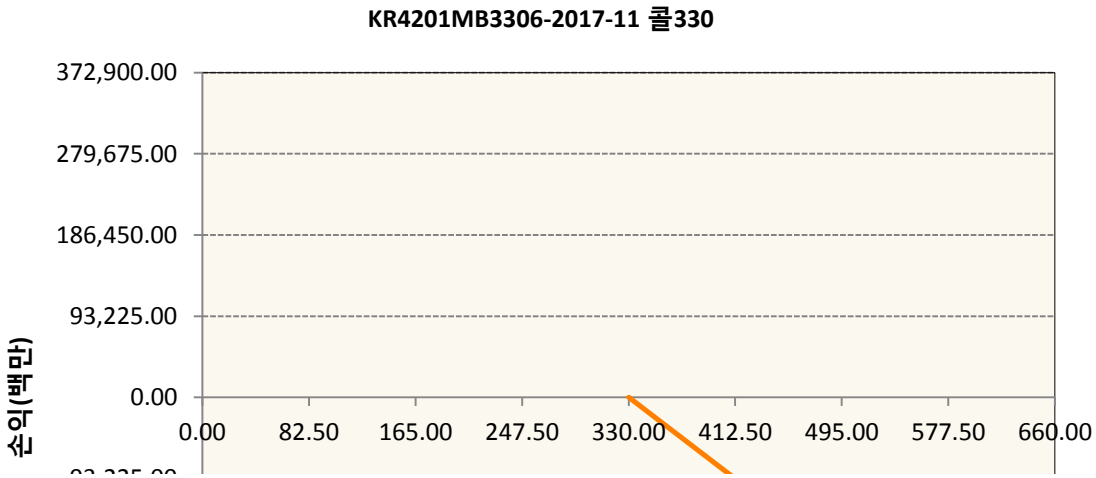
1. 계약금액

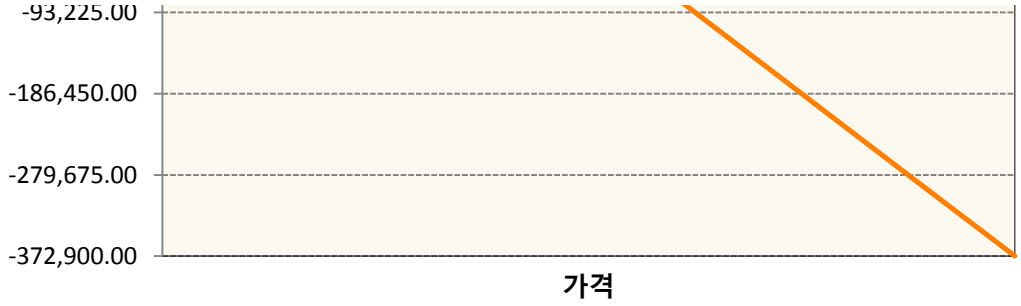
(단위:백만원)

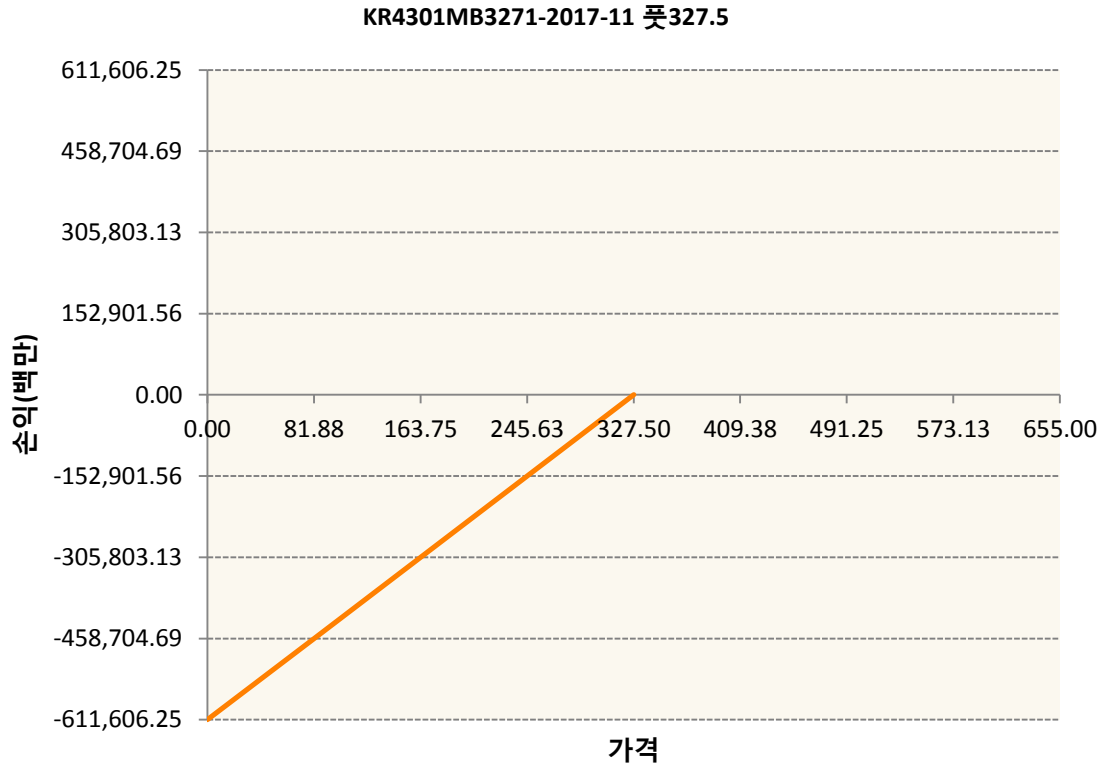
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	1,401,952	-1,401,952	장내
누계	유가증권	옵션	0	1,490,494	-1,490,494	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201MB3 2017-11 콜327.5							31,245
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	12,352	12,096	11,768	11,371	10,912	10,398	9,834
-5.33%	11,287	10,719	10,085	9,397	8,665	7,895	7,094
-2.67%	8,544	7,637	6,705	5,755	4,789	3,812	2,825
0%	3,198	2,132	1,066	0	-1,066	-2,132	-3,198
2.67%	-5,081	-6,026	-6,994	-7,979	-8,979	-9,989	-11,009
5.33%	-15,816	-16,461	-17,171	-17,934	-18,740	-19,582	-20,454
8.00%	-28,111	-28,457	-28,884	-29,385	-29,951	-30,573	-31,245
KR4201MB3 2017-11 콜330							21,869
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	7,821	7,676	7,482	7,238	6,949	6,618	6,248
-5.33%	7,246	6,896	6,494	6,047	5,561	5,044	4,499
-2.67%	5,650	5,043	4,410	3,755	3,084	2,399	1,703
0%	2,324	1,551	776	0	-777	-1,555	-2,333
2.67%	-3,126	-3,868	-4,618	-5,376	-6,139	-6,906	-7,676
5.33%	-10,510	-11,057	-11,643	-12,261	-12,905	-13,569	-14,249
8.00%	-19,228	-19,544	-19,919	-20,346	-20,818	-21,327	-21,869
KR4301MB3: 2017-11 풋327.5							40,996

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-40,789	-40,794	-40,805	-40,827	-40,864	-40,919	-40,996
-5.33%	-24,577	-24,653	-24,766	-24,918	-25,108	-25,335	-25,596
-2.67%	-9,281	-9,675	-10,109	-10,575	-11,069	-11,584	-12,118
0%	2,040	1,360	680	0	-680	-1,360	-2,040
2.67%	7,047	6,621	6,156	5,660	5,138	4,595	4,035
5.33%	8,143	8,038	7,890	7,699	7,465	7,192	6,883
8.00%	8,253	8,241	8,218	8,177	8,114	8,024	7,906

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

97,806

공시일	2017-10-16
기준일	2017-10-13

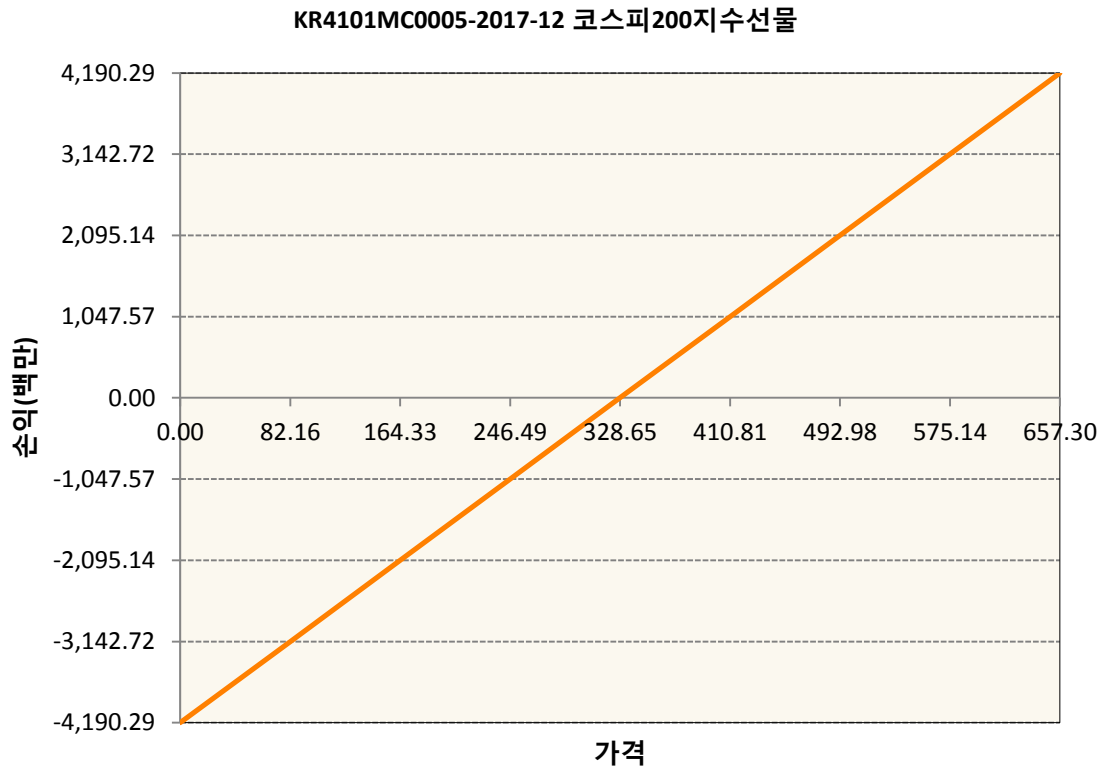
ETF스마트레버리지목표전환형7호

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	821	-821	장내
누계	유가증권	선물	4,190	0	4,190	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101MC0(2017-12 코스피200지수선물							334
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-334	-334	-334	-334	-334	-334	-334
-5.33%	-223	-223	-223	-223	-223	-223	-223
-2.67%	-111	-111	-111	-111	-111	-111	-111
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	111	111	111	111	111	111	111
5.33%	223	223	223	223	223	223	223

8.00%	334	334	334	334	334	334	334

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

204

공시일	2017-10-16
기준일	2017-10-13

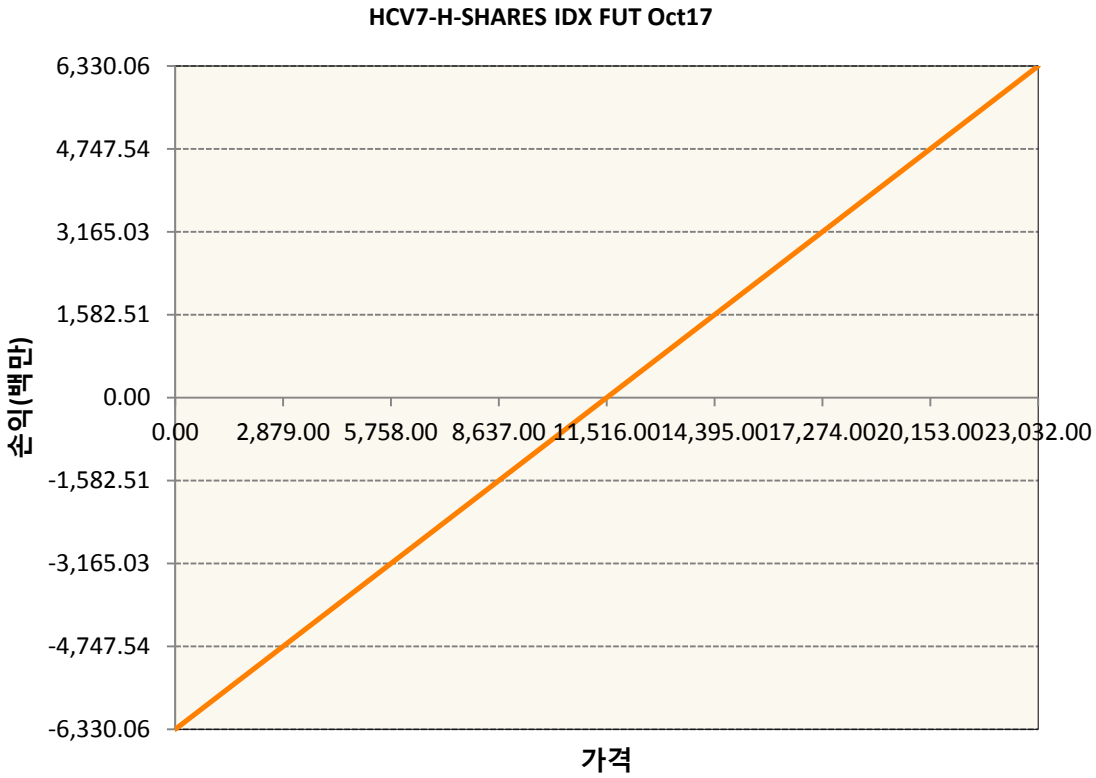
홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생

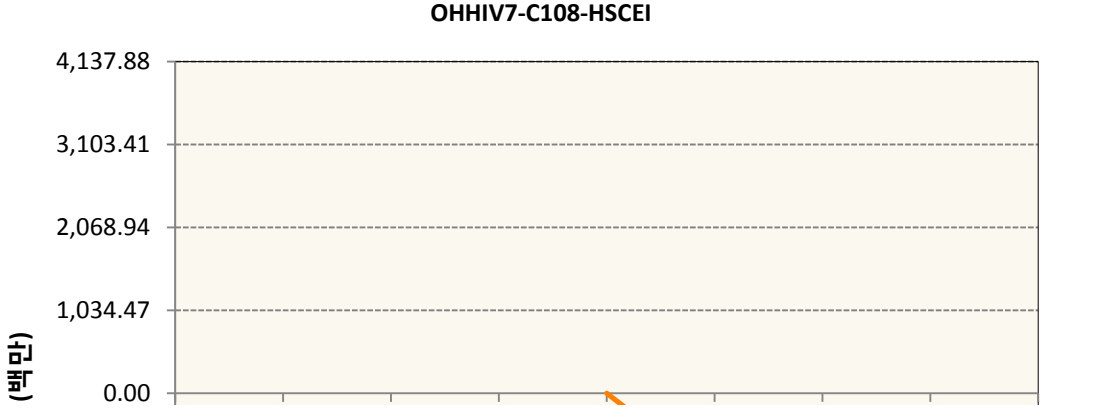
1. 계약금액

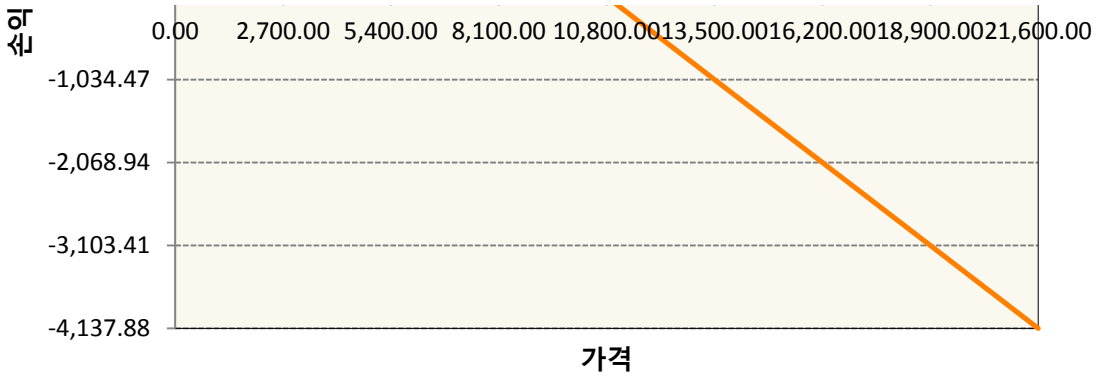
(단위:백만원)

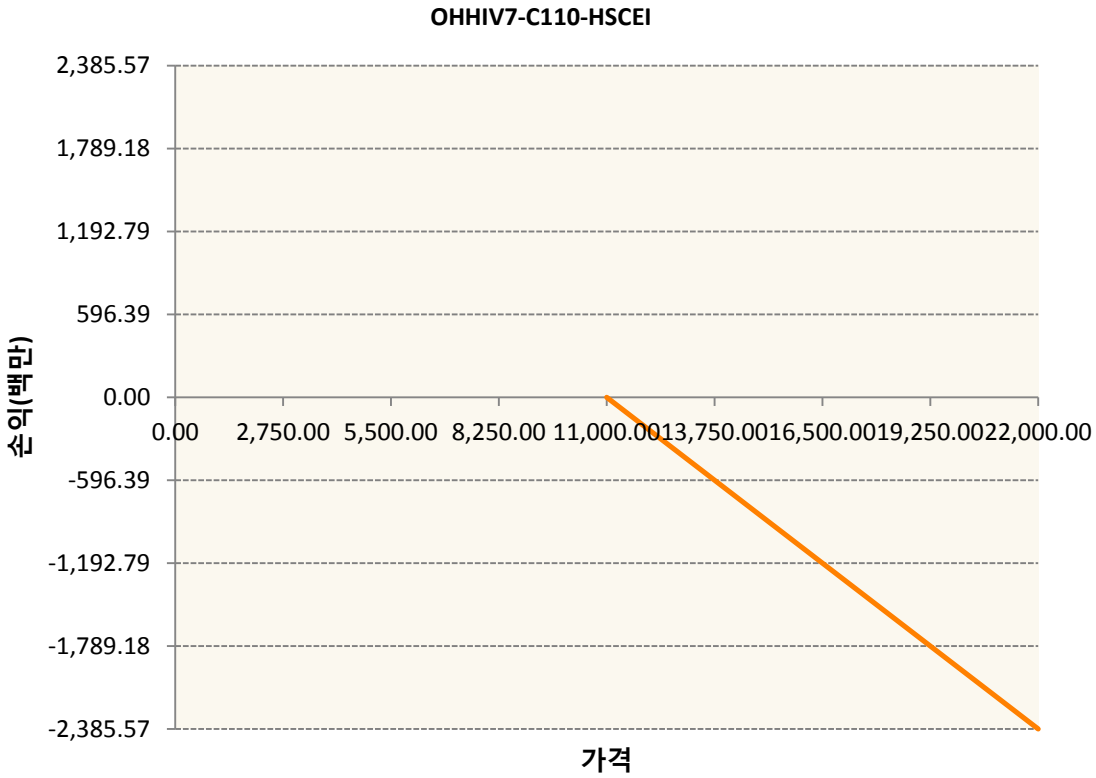
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	6,330	0	6,330	장내
누계	유가증권	옵션	0	13,047	-13,047	장내

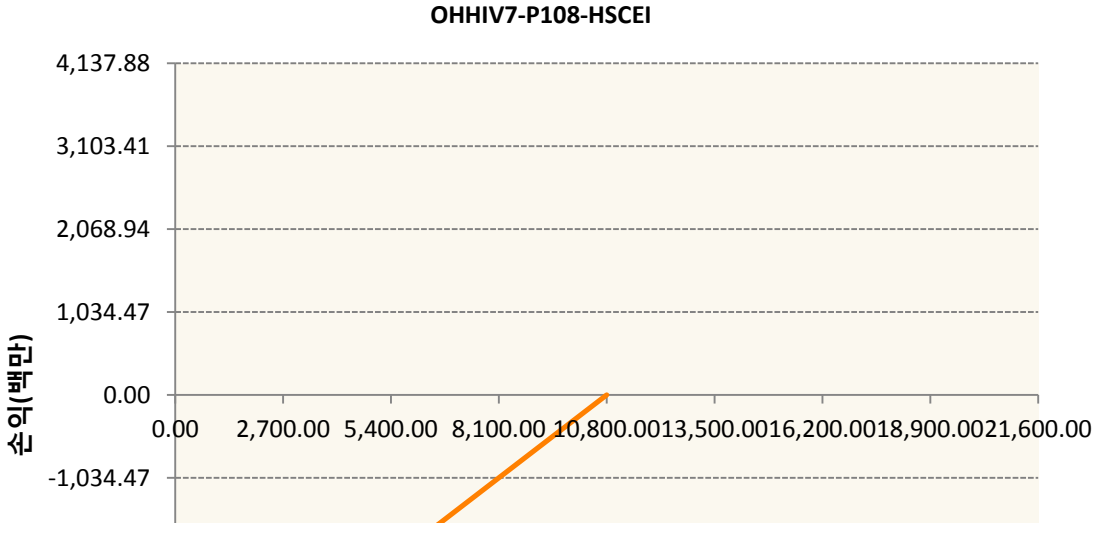
2. 만기시점의 손익구조

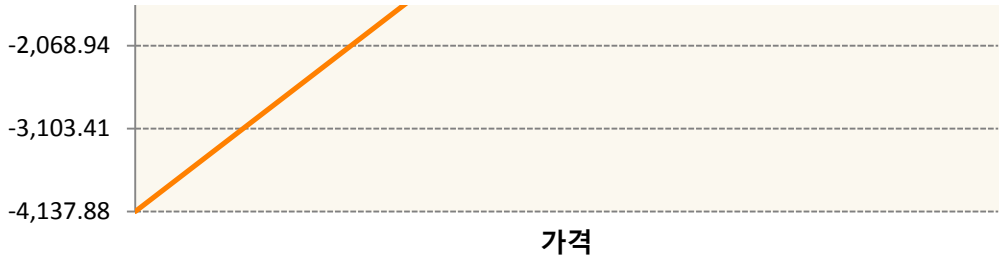


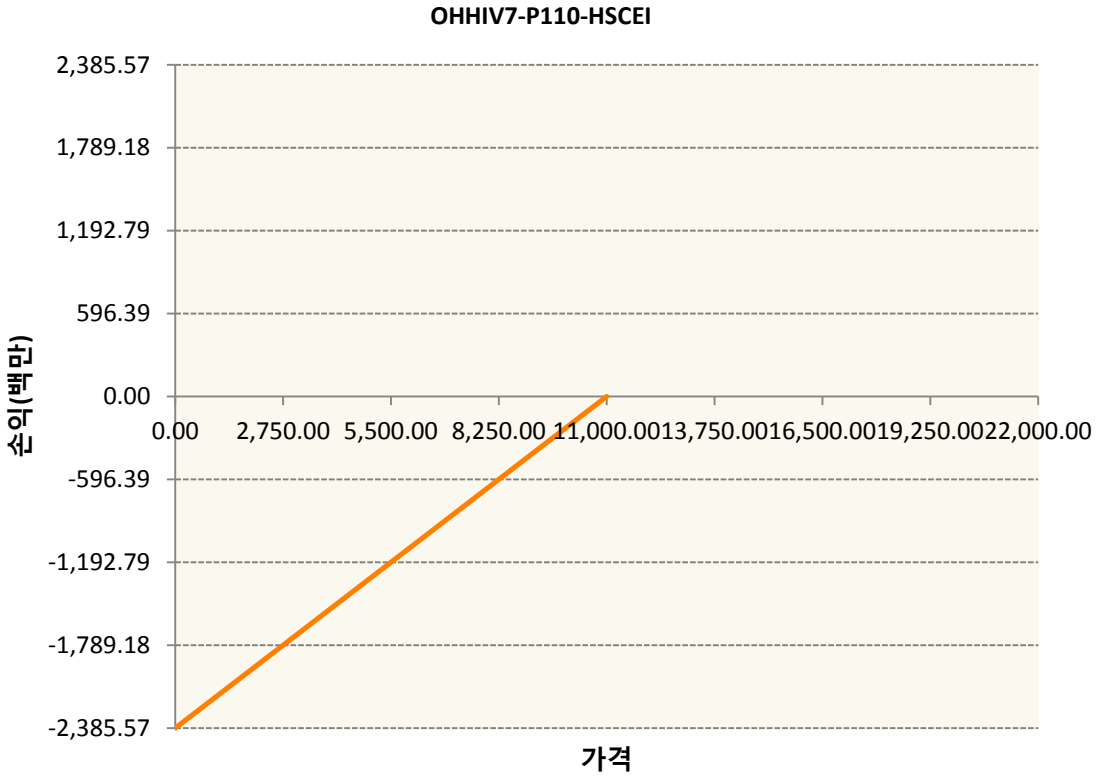



손익
0.00
2,700.00
5,400.00
8,100.00
10,800.00
13,500.00
16,200.00
18,900.00
21,600.00
-1,034.47
-2,068.94
-3,103.41
-4,137.88
가격


OHHIV7-C110-HSCEI
2,385.57
1,789.18
1,192.79
596.39
0.00
-596.39
-1,192.79
-1,789.18
-2,385.57
손익(백만)
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
가격


OHHIV7-P108-HSCEI
4,137.88
3,103.41
2,068.94
1,034.47
0.00
-1,034.47
손익(백만)
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





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

HCV7	H-SHARES IDX FUT Oct17	506
OHHIV7-C10	HSCEI	331
OHHIV7-C11	HSCEI	191
OHHIV7-P10	HSCEI	331
OHHIV7-P11	HSCEI	191

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

1,268

공시일	2017-10-16
기준일	2017-10-13

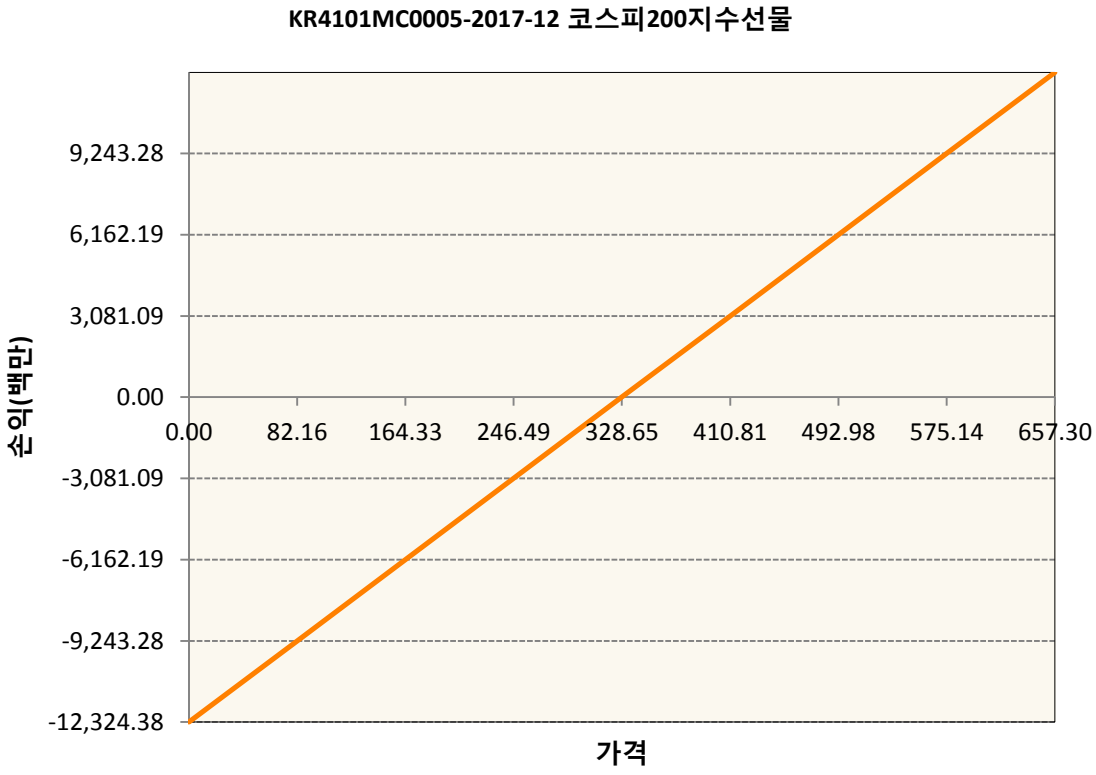
코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼

1. 계약금액

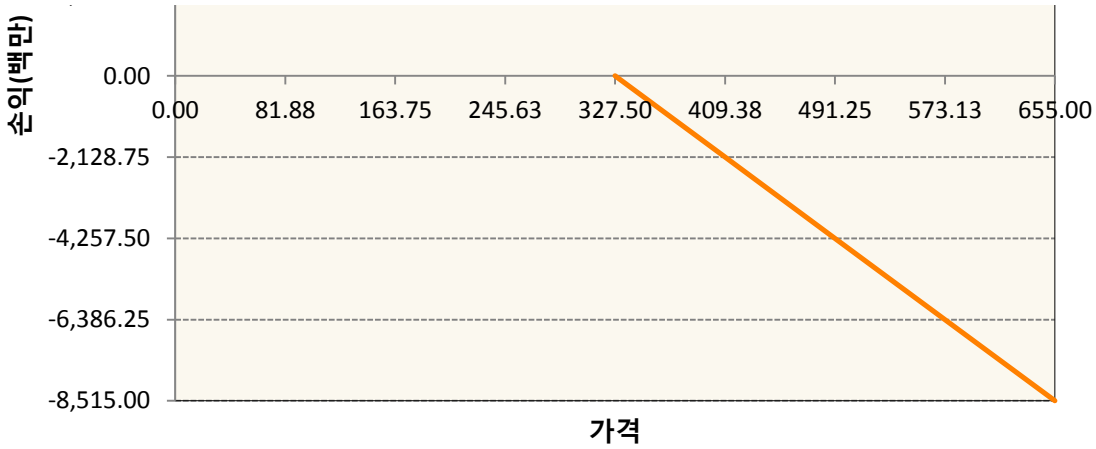
(단위:백만원)

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	27,343	-27,343	장내
누계	유가증권	선물	12,324	0	12,324	장내
누계	유가증권	스왑	29,500	0	29,500	장외
누계	유가증권	옵션	0	27,069	-27,069	장내

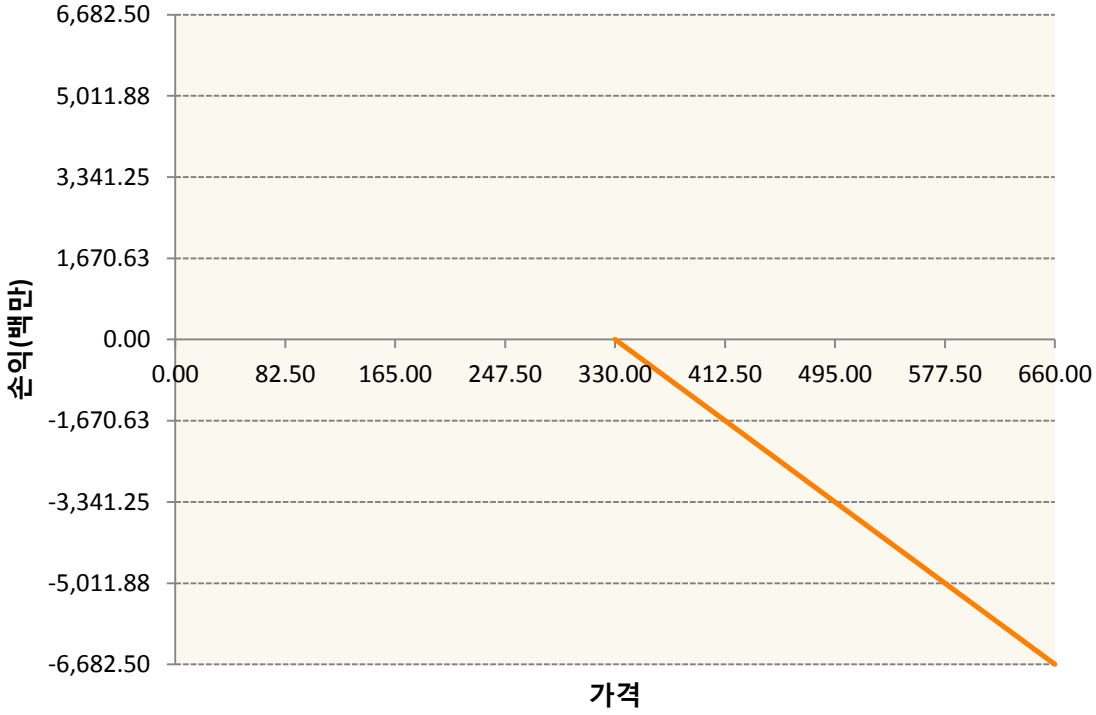
2. 만기시점의 손익구조



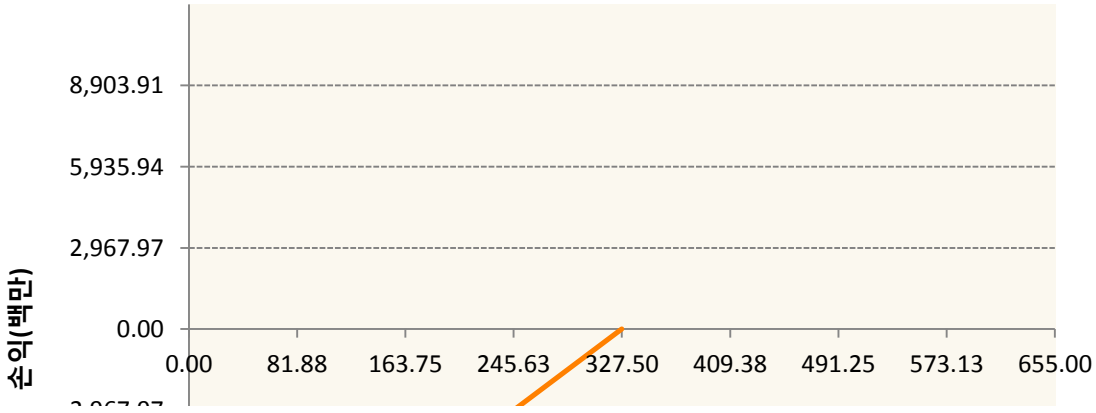




KR4201MB3306-2017-11 콜330



KR4301MB3271-2017-11 풋327.5





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				982

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-982	-982	-982	-982	-982	-982	-982
-5.33%	-655	-655	-655	-655	-655	-655	-655
-2.67%	-327	-327	-327	-327	-327	-327	-327
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	327	327	327	327	327	327	327
5.33%	655	655	655	655	655	655	655
8.00%	982	982	982	982	982	982	982
	KR4201MB3(	2017-11	콜327.5				526

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	208	204	198	191	184	175	165
-5.33%	190	180	170	158	146	133	119
-2.67%	144	129	113	97	81	64	48
0%	54	36	18	0	-18	-36	-54
2.67%	-86	-101	-118	-134	-151	-168	-185
5.33%	-266	-277	-289	-302	-315	-330	-344
8.00%	-473	-479	-486	-495	-504	-514	-526
	KR4201MB3(	2017-11	콜330				392

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	140	138	134	130	125	119	112
-5.33%	130	124	116	108	100	90	81

-2.67%	101	90	79	67	55	43	31
0%	42	28	14	0	-14	-28	-42
2.67%	-56	-69	-83	-96	-110	-124	-138
5.33%	-188	-198	-209	-220	-231	-243	-255
8.00%	-345	-350	-357	-365	-373	-382	-392
	KR4301MB3: 2017-11 풋327.5						796
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-792	-792	-792	-792	-793	-794	-796
-5.33%	-477	-479	-481	-484	-487	-492	-497
-2.67%	-180	-188	-196	-205	-215	-225	-235
0%	40	26	13	0	-13	-26	-40
2.67%	137	129	119	110	100	89	78
5.33%	158	156	153	149	145	140	134
8.00%	160	160	160	159	157	156	153

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

4,783

공시일	2017-10-16
기준일	2017-10-13

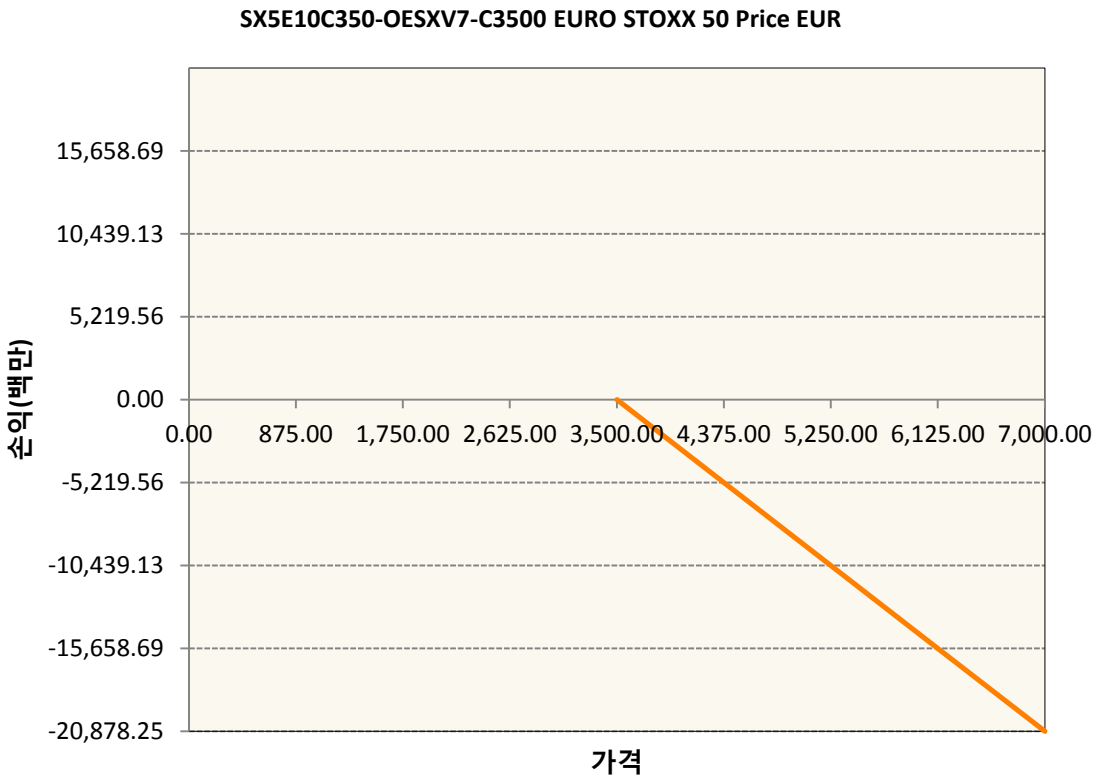
유로커버드콜모(주식혼합-파생형

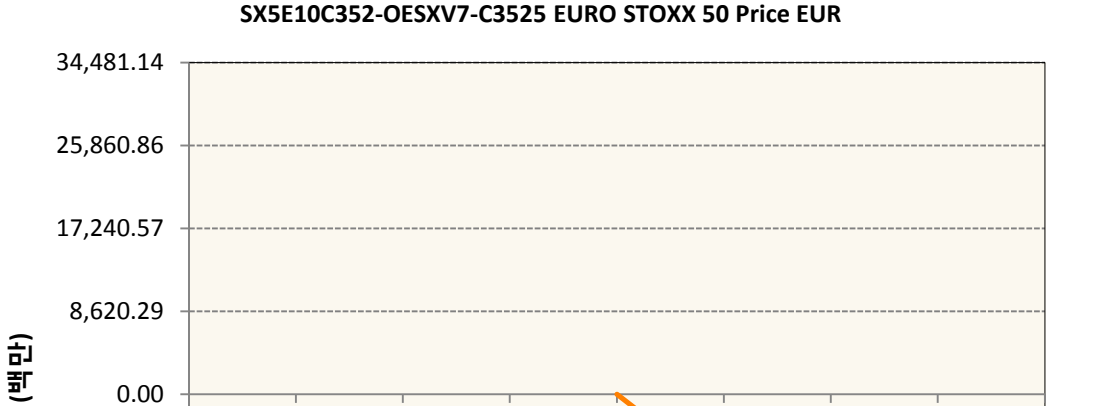
1. 계약금액

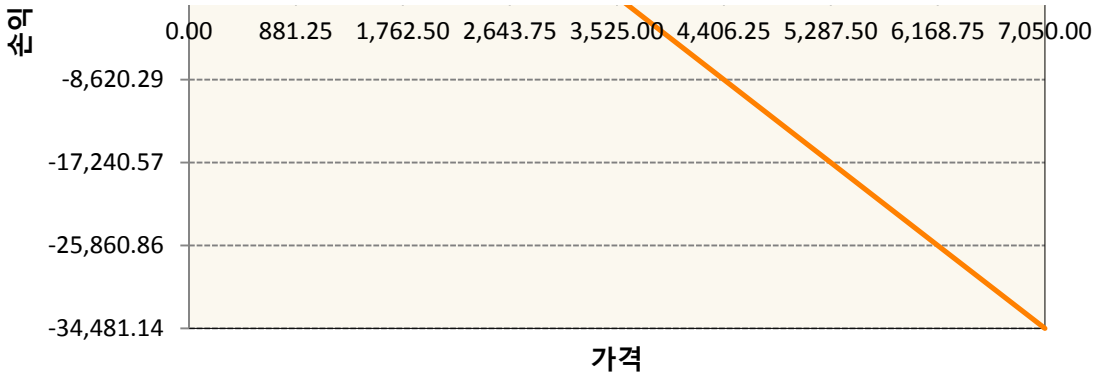
(단위:백만원)

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	52,904	0	52,904	
누계	유가증권	옵션	0	110,719	-110,719	장외

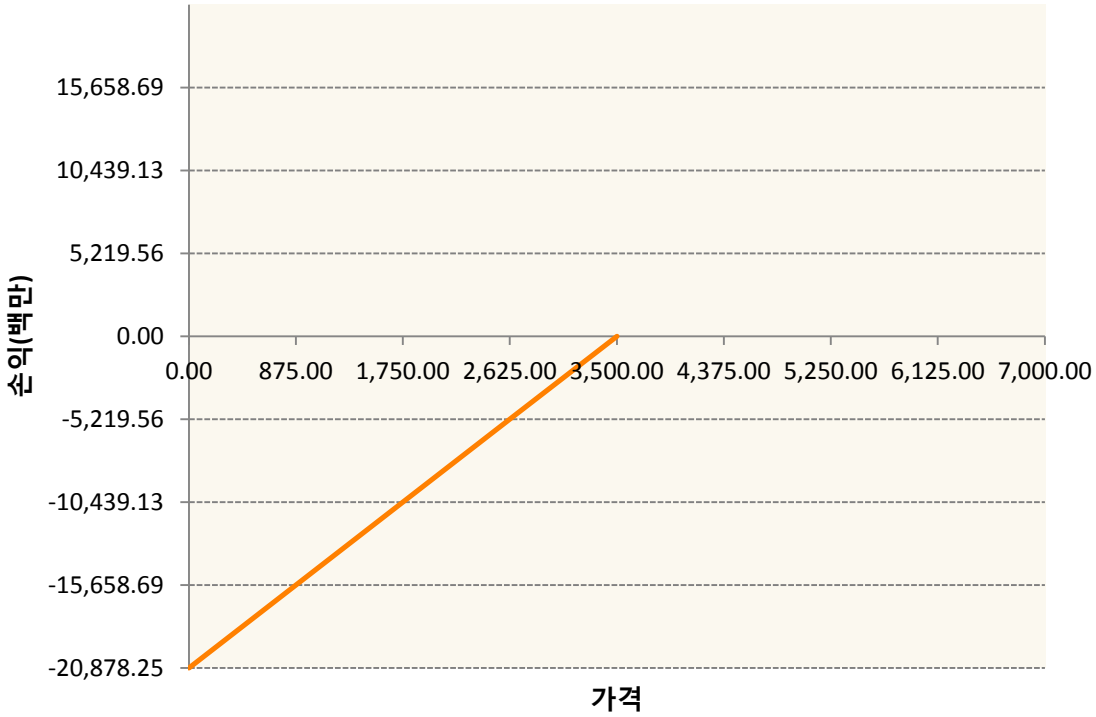
2. 만기시점의 손익구조



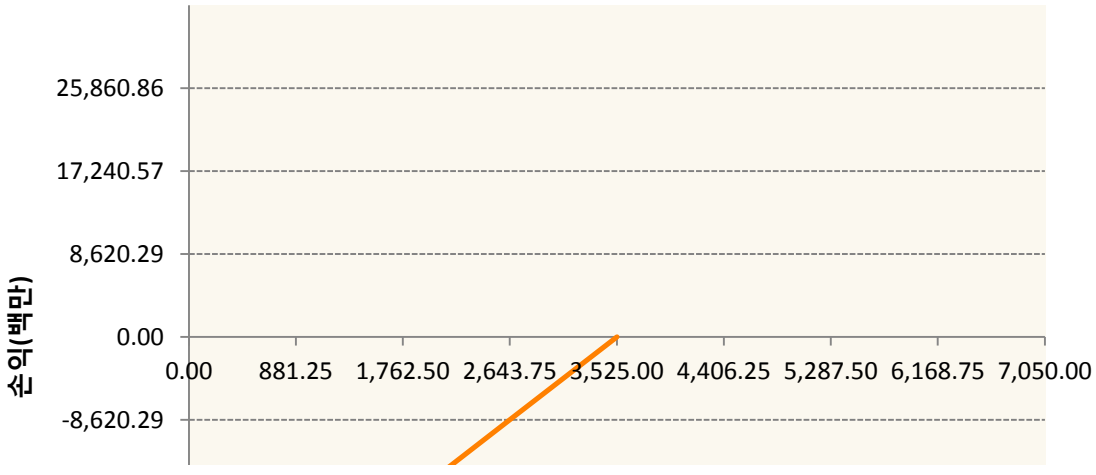


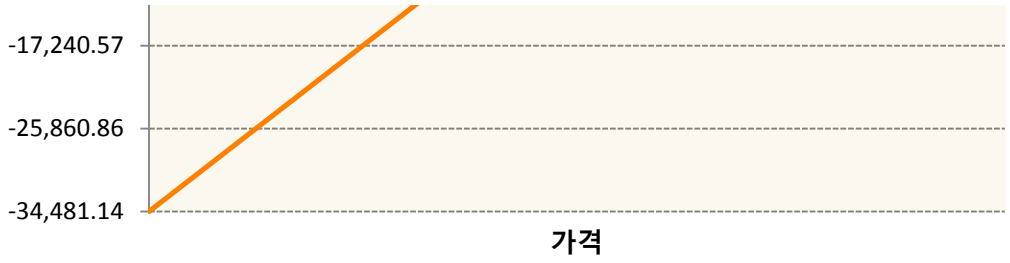


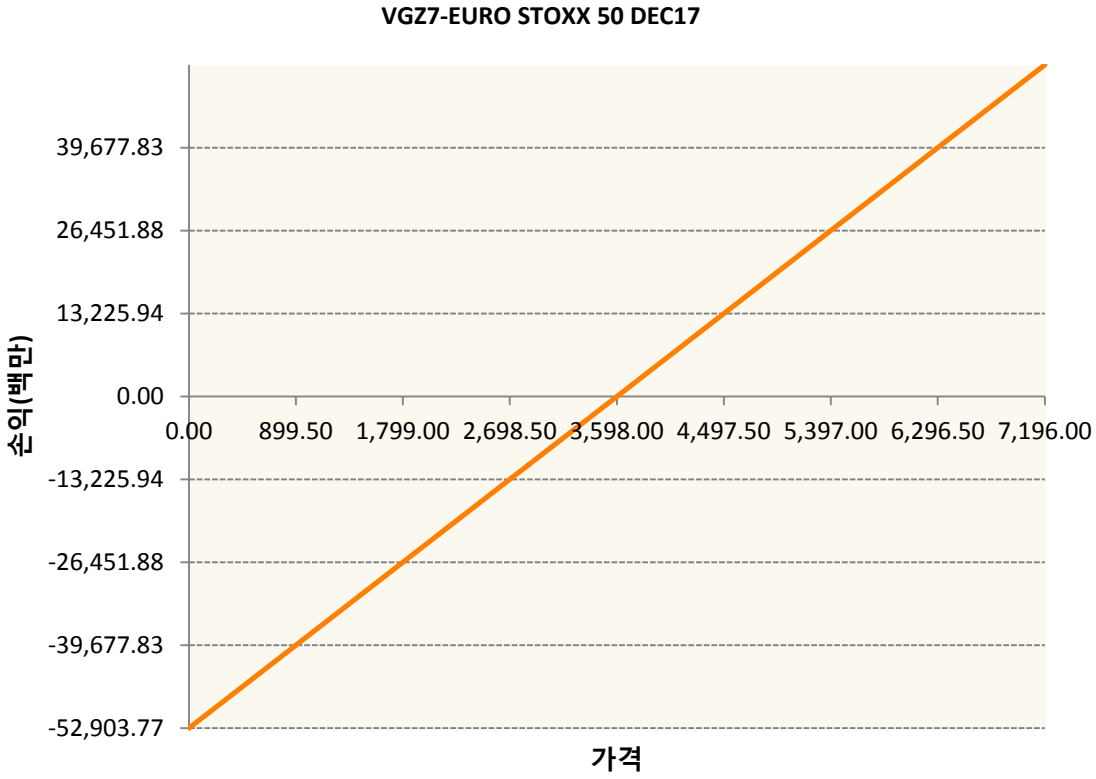
SX5E10P350-OESXV7-P3500 EURO STOXX 50 Price EUR



SX5E10P352-OESXV7-P3525 EURO STOXX 50 Price EUR







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

SX5E10C350 OESXV7-C3500 EURO STOXX 50 Price EUR	1,670
SX5E10C352 OESXV7-C3525 EURO STOXX 50 Price EUR	2,759
SX5E10P350 OESXV7-P3500 EURO STOXX 50 Price EUR	1,670
SX5E10P352 OESXV7-P3525 EURO STOXX 50 Price EUR	2,759
VGZ7 EURO STOXX 50 DEC17	4,232

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

10,052

공시일	2017-10-16
기준일	2017-10-13

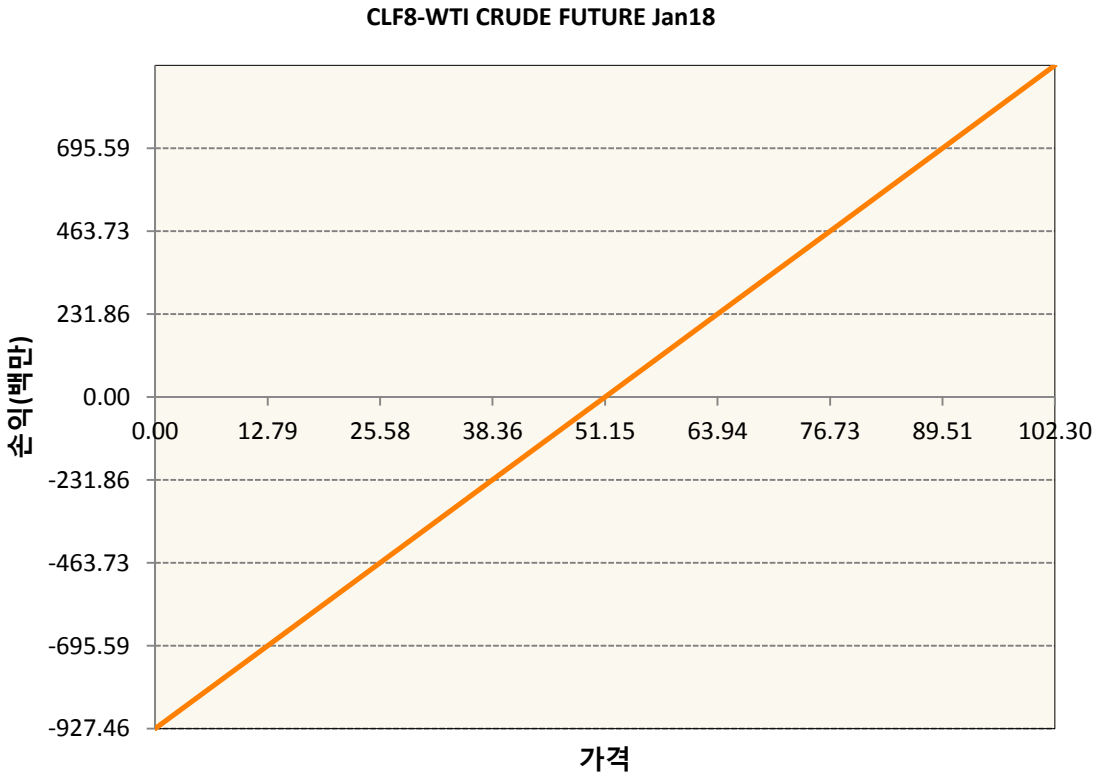
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

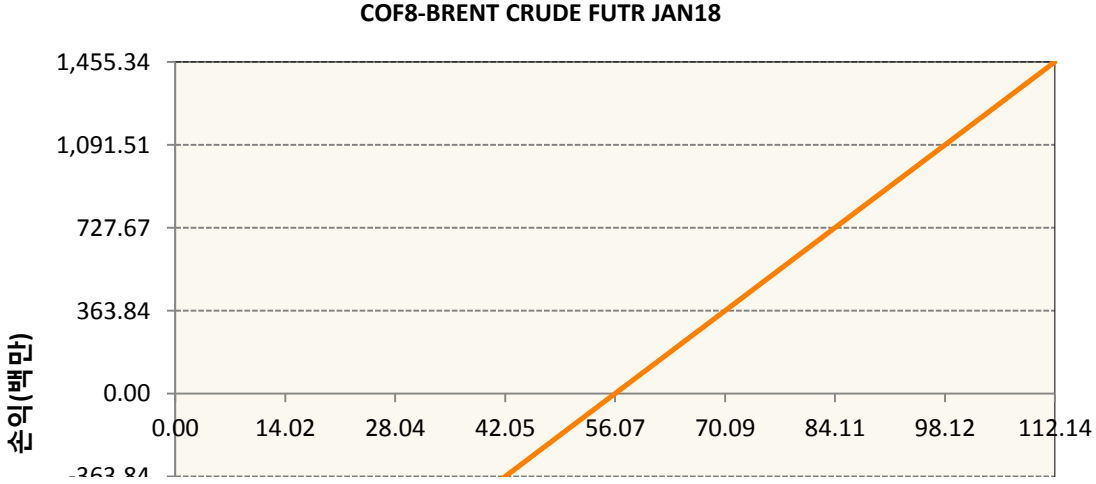
1. 계약금액

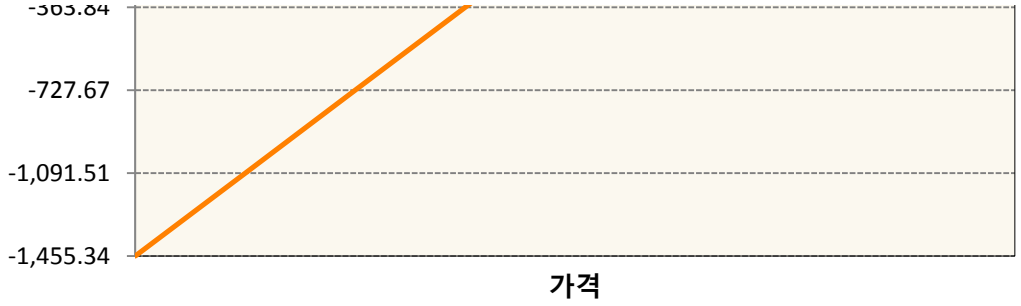
(단위:백만원)

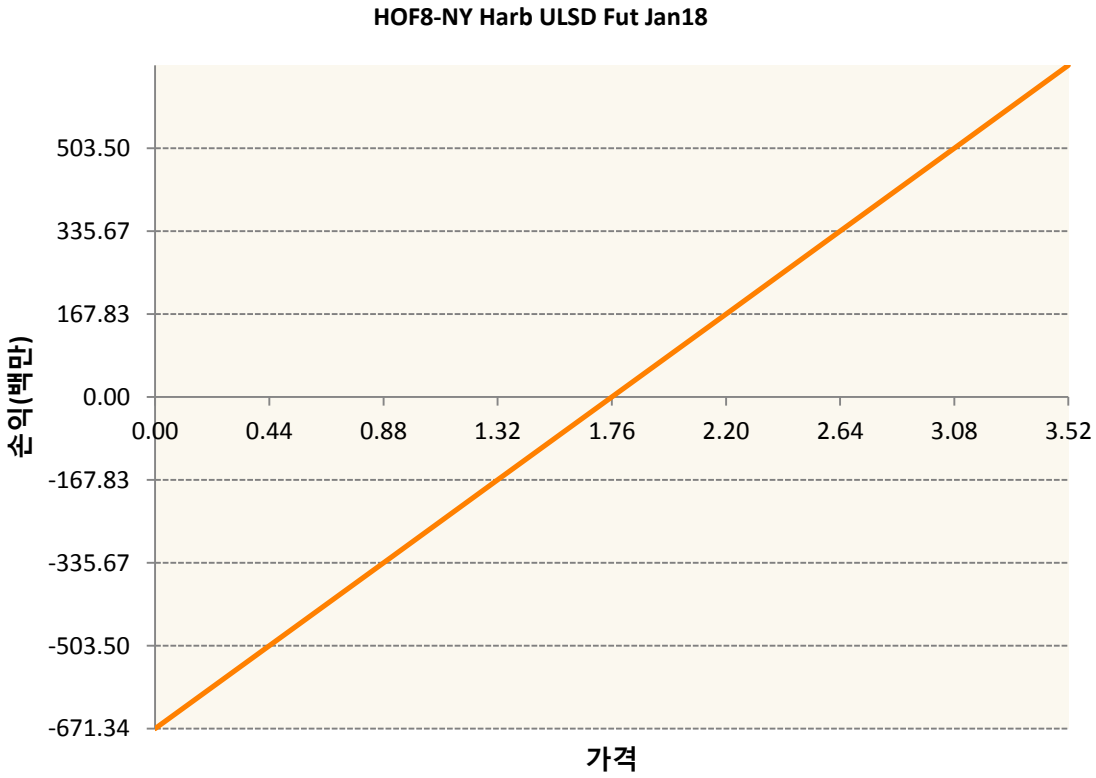
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	5,194	903	4,291	

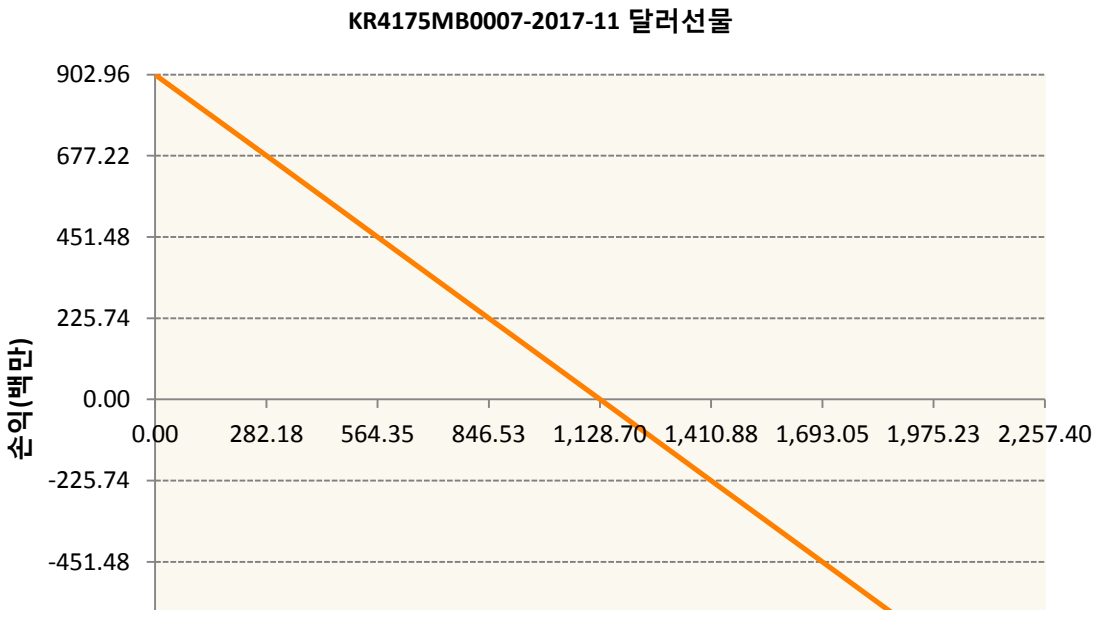
2. 만기시점의 손익구조

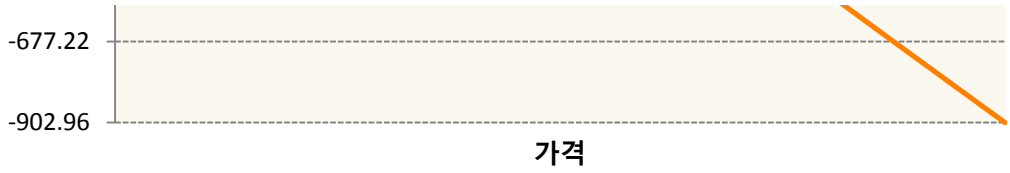


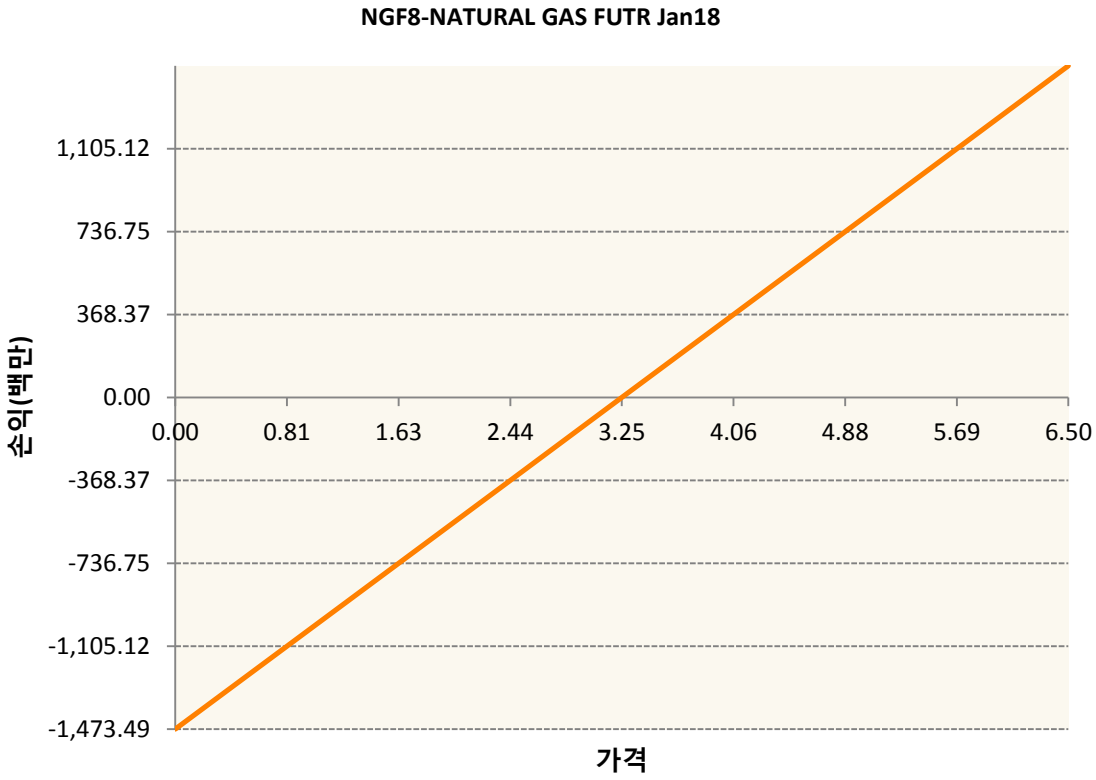


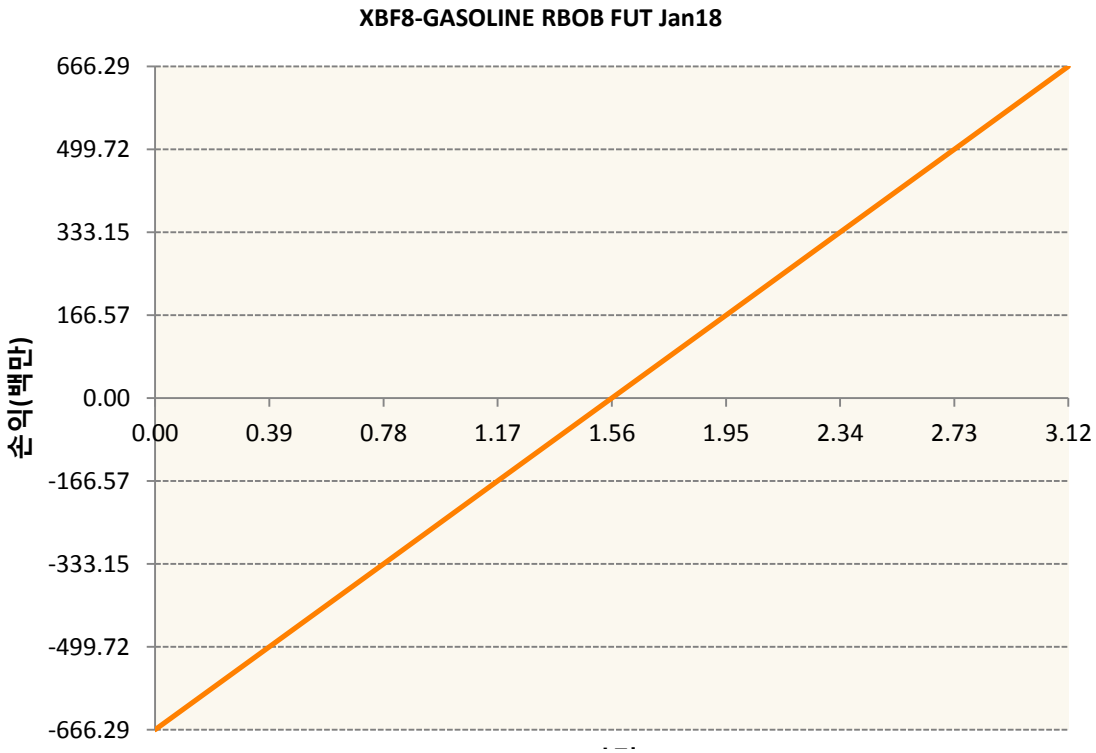

-727.67
-1,091.51
-1,455.34
가격


HOF8-NY Harb ULSD Fut Jan18
503.50
335.67
167.83
0.00
-167.83
-335.67
-503.50
-671.34
0.00
0.44
0.88
1.32
1.76
2.20
2.64
3.08
3.52
손익(백만)
가격


KR4175MB0007-2017-11 달러선물
902.96
677.22
451.48
225.74
0.00
-225.74
-451.48
0.00
282.18
564.35
846.53
1,128.70
1,410.88
1,693.05
1,975.23
2,257.40
손익(백만)


-677.22
-902.96
가격


NGF8-NATURAL GAS FUTR Jan18
1,105.12
736.75
368.37
0.00
-368.37
-736.75
-1,105.12
-1,473.49
0.00
0.81
1.63
2.44
3.25
4.06
4.88
5.69
6.50
손익(백만)
가격


XBF8-GASOLINE RBOB FUT Jan18
666.29
499.72
333.15
166.57
0.00
-166.57
-333.15
-499.72
-666.29
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)

CLF8	WTI CRUDE FUTURE Jan18	74
COF8	BRENT CRUDE FUTR JAN18	116
HOF8	NY Harb ULSD Fut Jan18	54
KR4175MB0(	2017-11 달러선물	72
NGF8	NATURAL GAS FUTR Jan18	118
XBF8	GASOLINE RBOB FUT Jan18	53

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

746

공시일	2017-10-16
기준일	2017-10-13

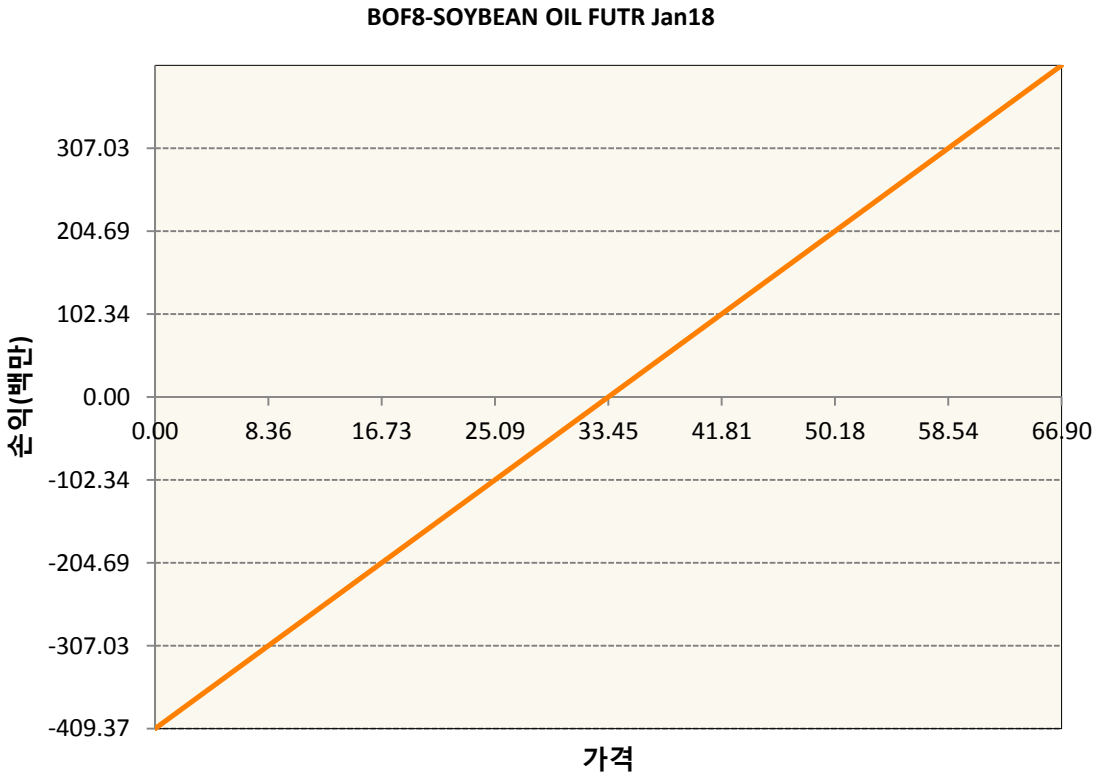
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

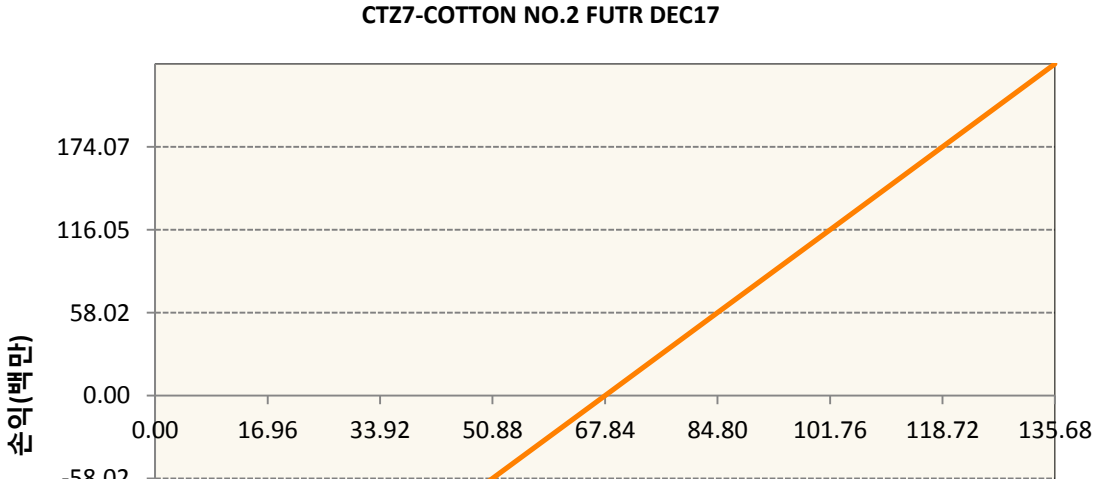
1. 계약금액

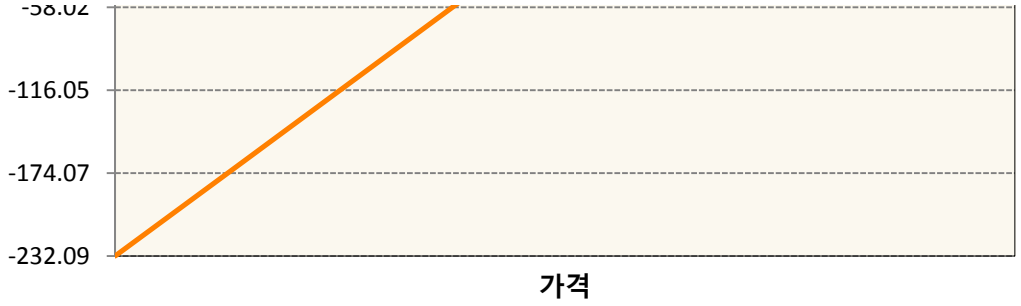
(단위:백만원)

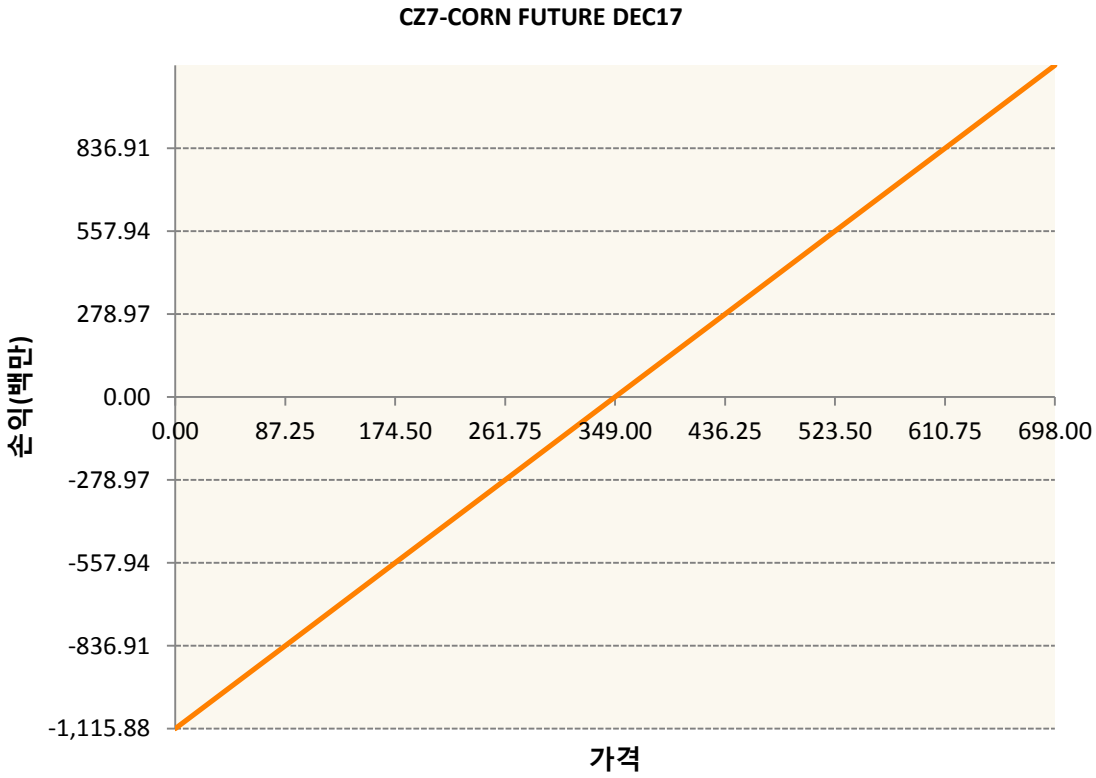
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	4,571	339	4,232	

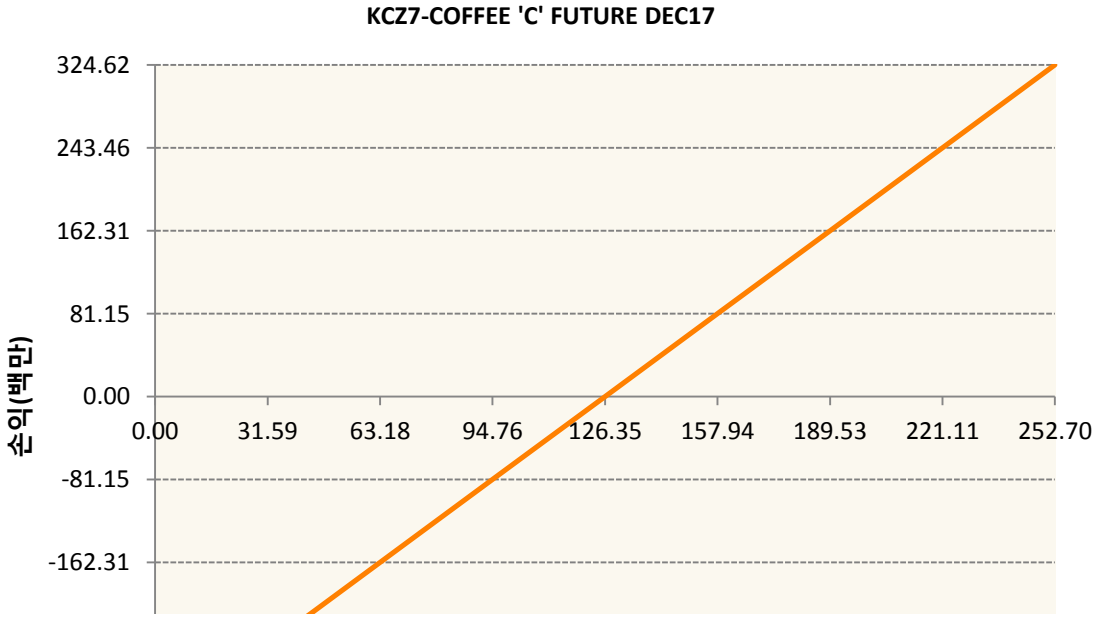
2. 만기시점의 손익구조

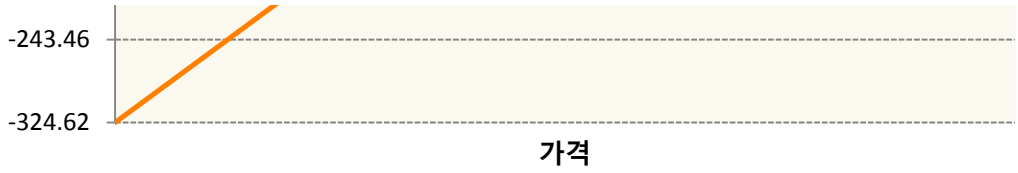


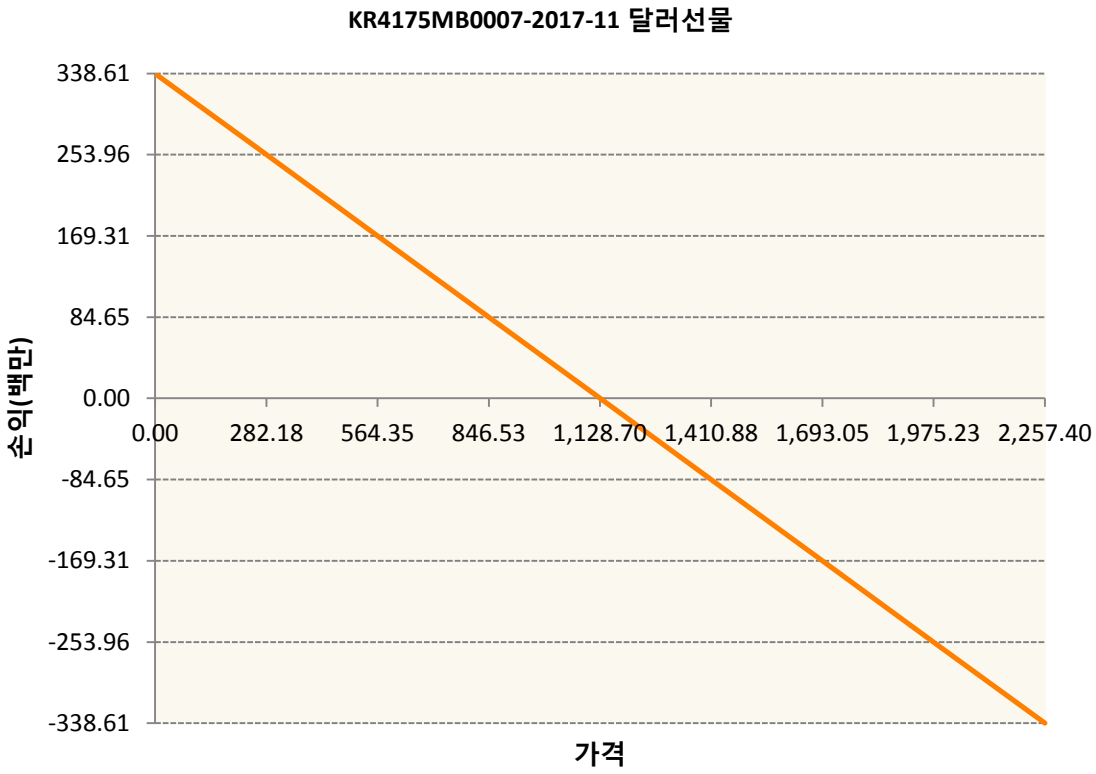


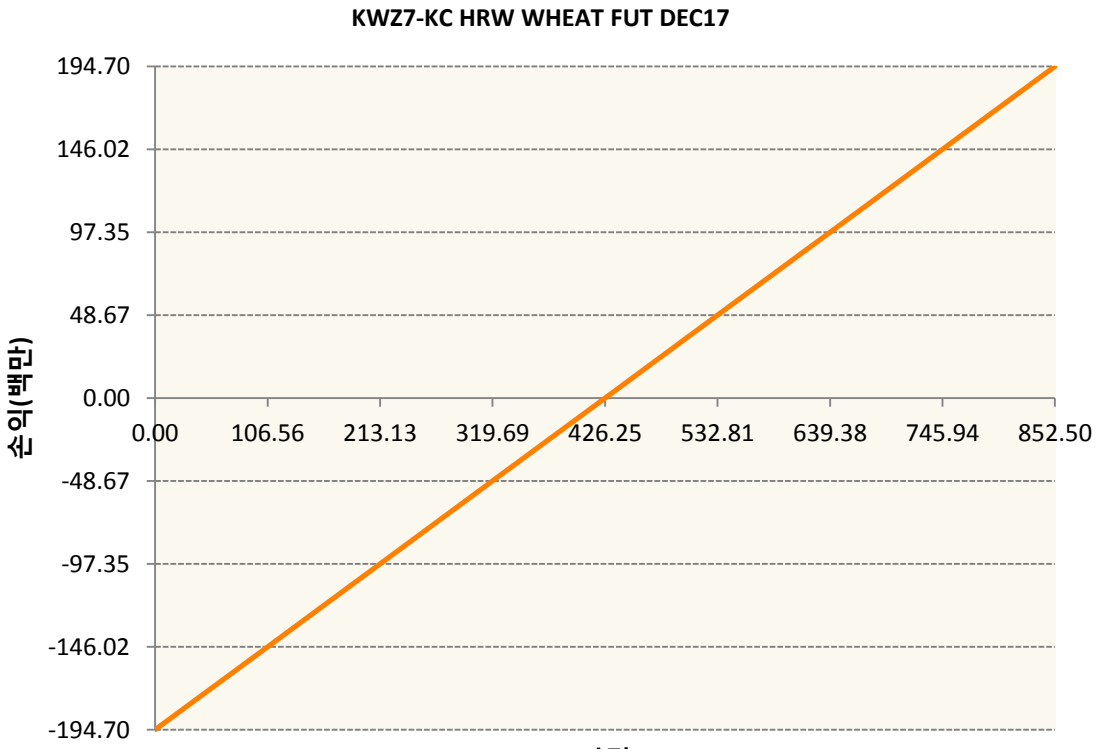

-116.05
-174.07
-232.09
가격


CZ7-CORN FUTURE DEC17
836.91
557.94
278.97
0.00
-278.97
-557.94
-836.91
-1,115.88
0.00
87.25
174.50
261.75
349.00
436.25
523.50
610.75
698.00
손익(백만)
가격

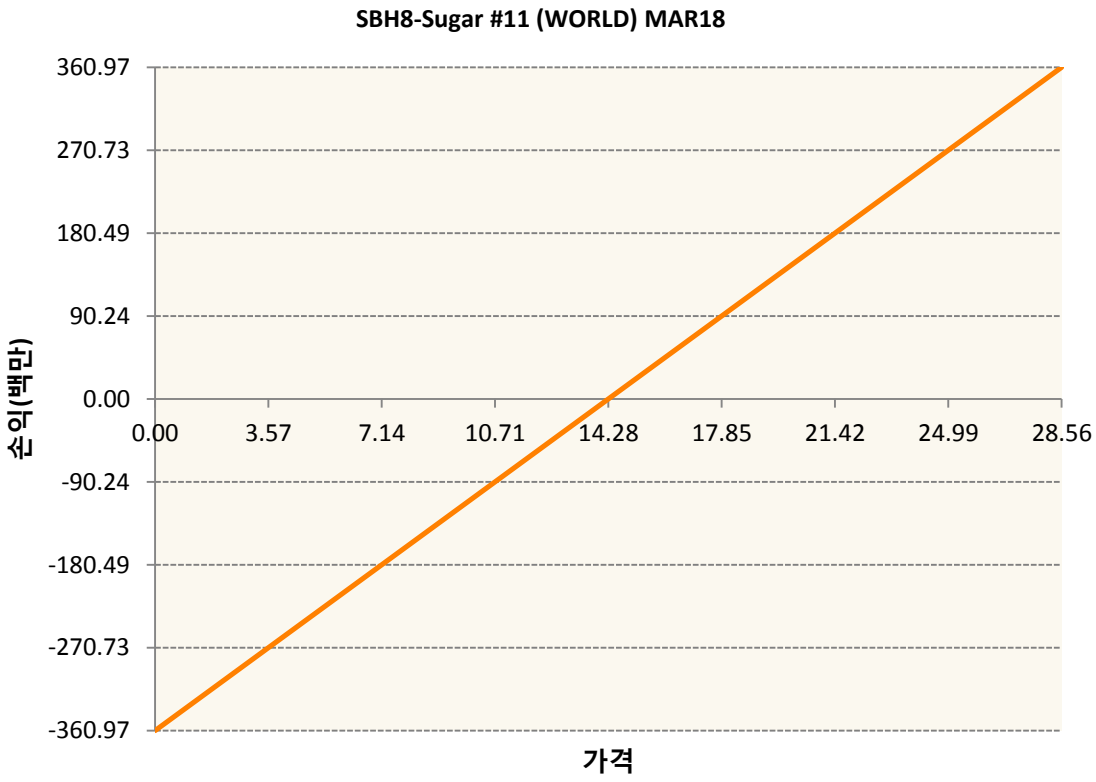

KCZ7-COFFEE 'C' FUTURE DEC17
324.62
243.46
162.31
81.15
0.00
-81.15
-162.31
0.00
31.59
63.18
94.76
126.35
157.94
189.53
221.11
252.70
손익(백만)

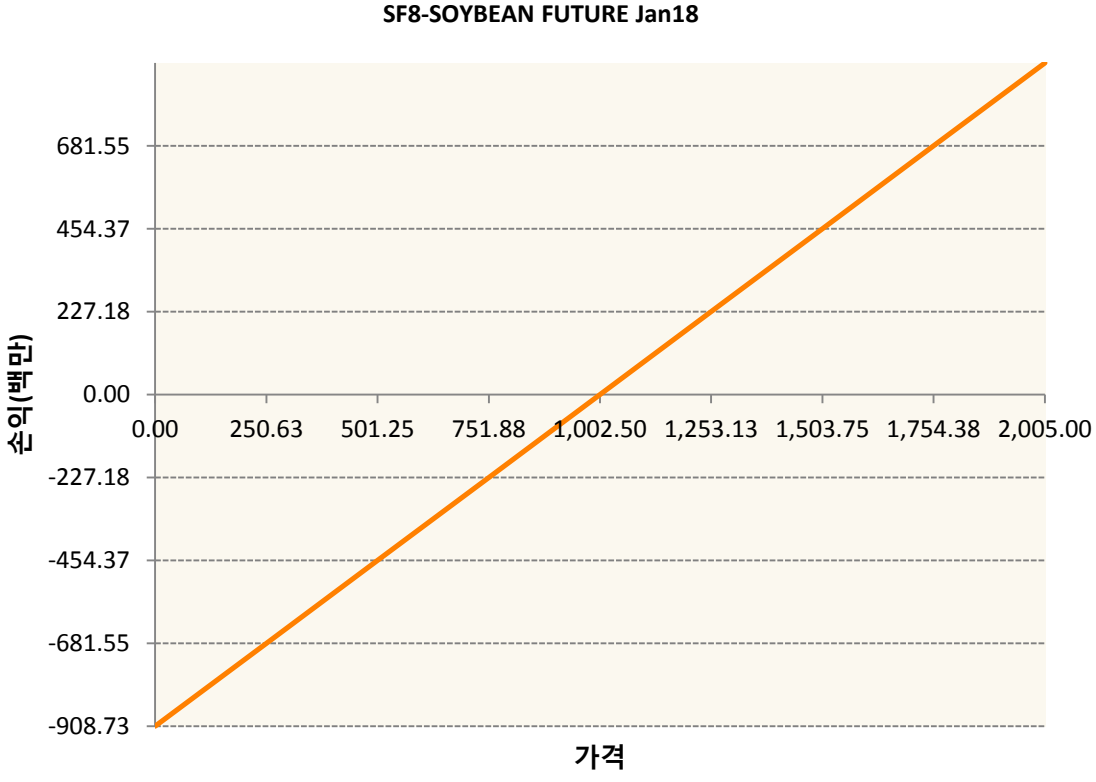

-243.46
-324.62
가격

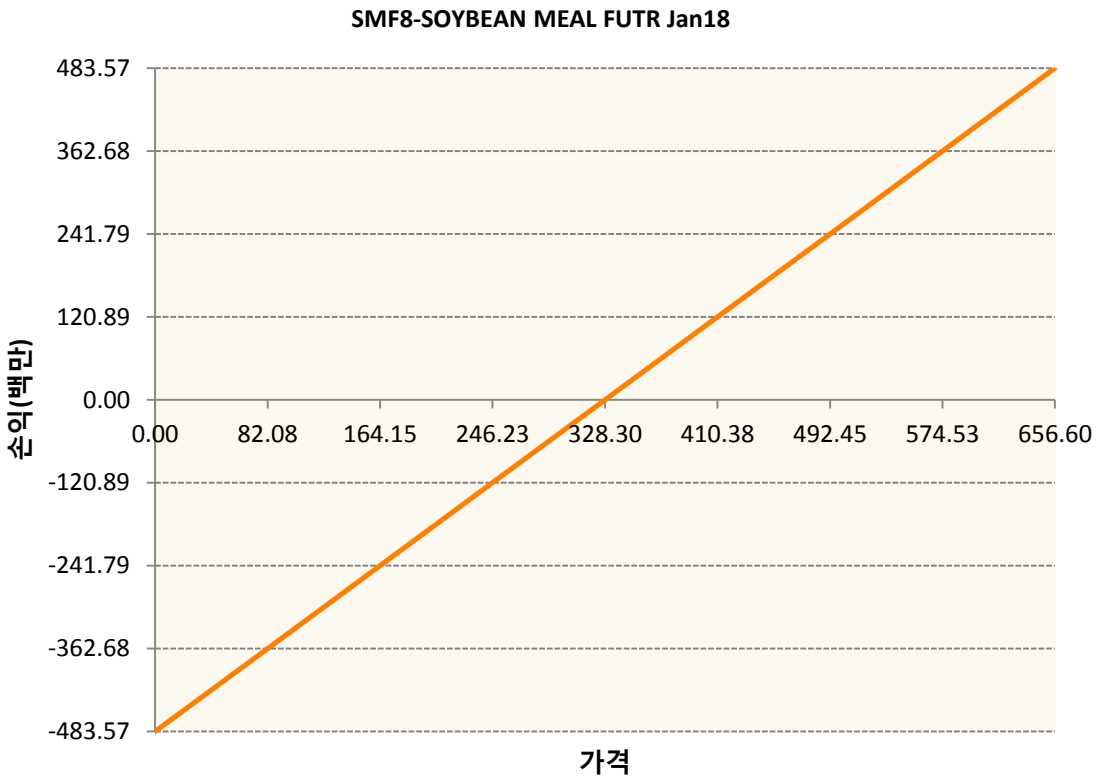

KR4175MB0007-2017-11 달러선물
338.61
253.96
169.31
84.65
0.00
-84.65
-169.31
-253.96
-338.61
0.00
282.18
564.35
846.53
1,128.70
1,410.88
1,693.05
1,975.23
2,257.40
손익(백만)
가격

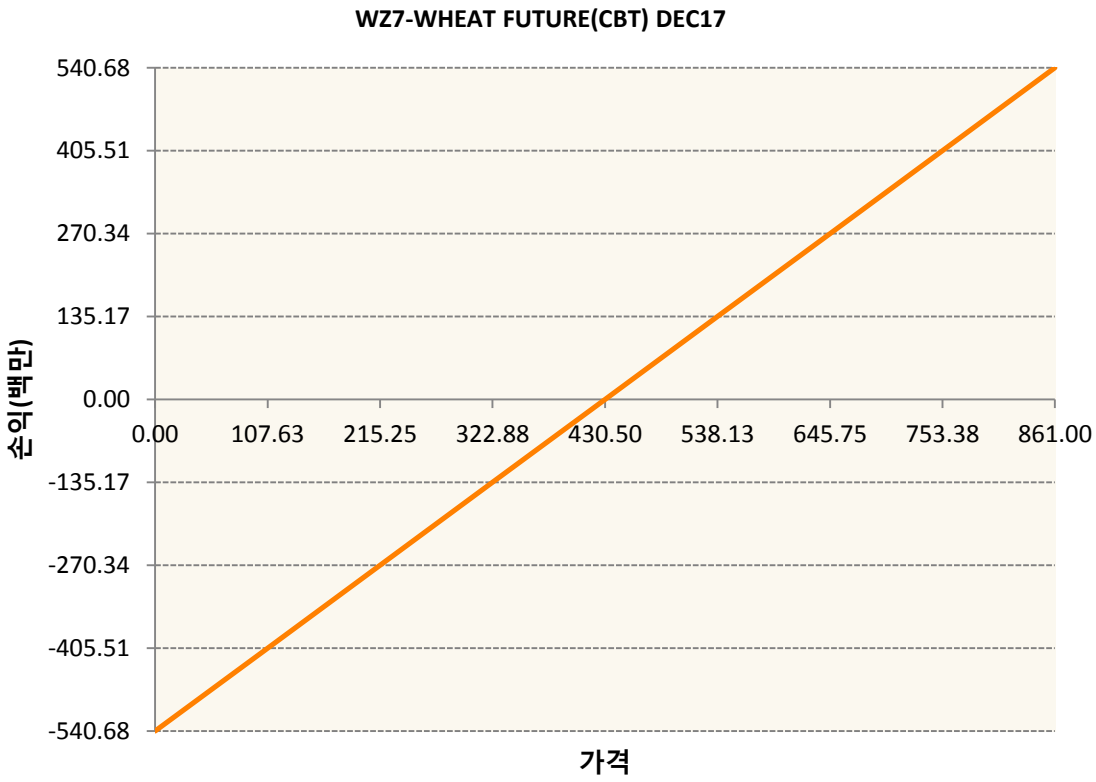

KWZ7-KC HRW WHEAT FUT DEC17
194.70
146.02
97.35
48.67
0.00
-48.67
-97.35
-146.02
-194.70
0.00
106.56
213.13
319.69
426.25
532.81
639.38
745.94
852.50
손익(백만)

가격


SBH8-Sugar #11 (WORLD) MAR18
360.97
270.73
180.49
90.24
0.00
-90.24
-180.49
-270.73
-360.97
손익(백만)
0.00
3.57
7.14
10.71
14.28
17.85
21.42
24.99
28.56
가격


SF8-SOYBEAN FUTURE Jan18
681.55
454.37
227.18
0.00
-227.18
-454.37
-681.55
-908.73
손익(백만)
0.00
250.63
501.25
751.88
1,002.50
1,253.13
1,503.75
1,754.38
2,005.00
가격





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

CTZ7	COTTON NO.2 FUTR DEC17	19
CZ7	CORN FUTURE DEC17	89
KCZ7	COFFEE 'C' FUTURE DEC17	26
KR4175MB0(	2017-11 달러선물	27
KWZ7	KC HRW WHEAT FUT DEC17	16
SBH8	Sugar #11 (WORLD) MAR18	29
SF8	SOYBEAN FUTURE Jan18	73
SMF8	SOYBEAN MEAL FUTR Jan18	39
WZ7	WHEAT FUTURE(CBT) DEC17	43

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

421