공시일	2017-10-17
기준일	2017-10-16

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	2017-10-17
기준일	2017-10-16

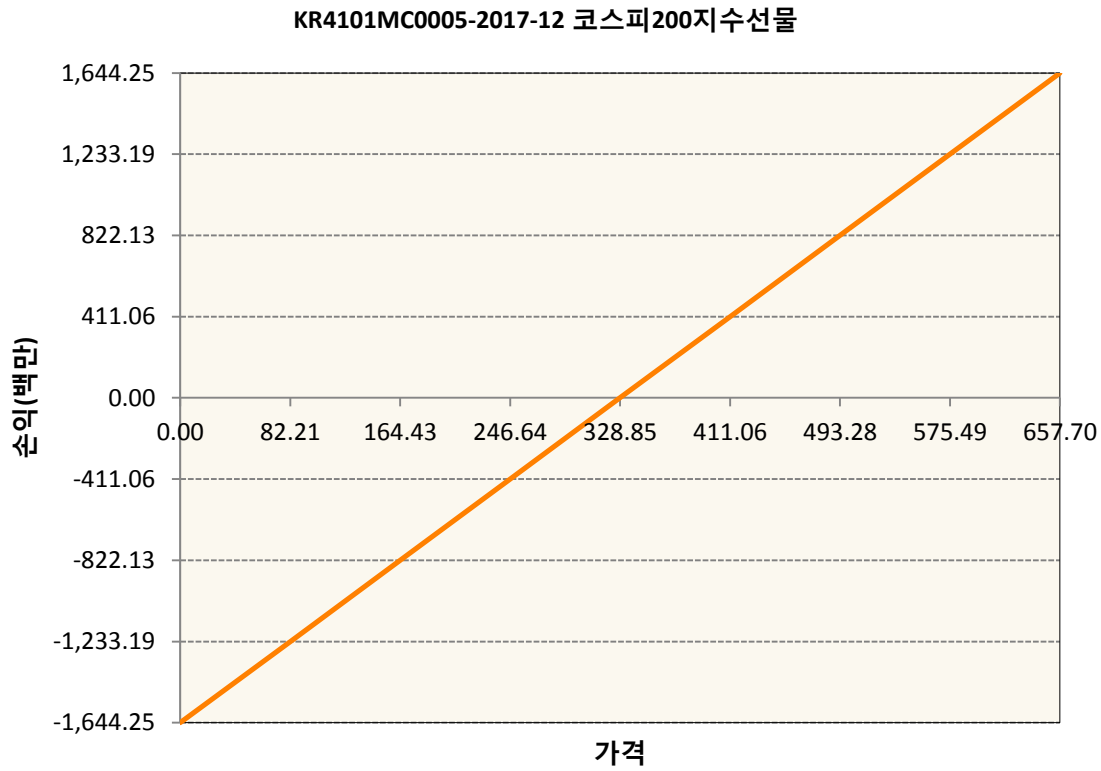
스마트인덱스모

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	1,644	0	1,644	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	2017-10-17
기준일	2017-10-16

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	1,060

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

464

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-10-17
기준일	2017-10-16

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	423

* 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	2017-10-17
기준일	2017-10-16

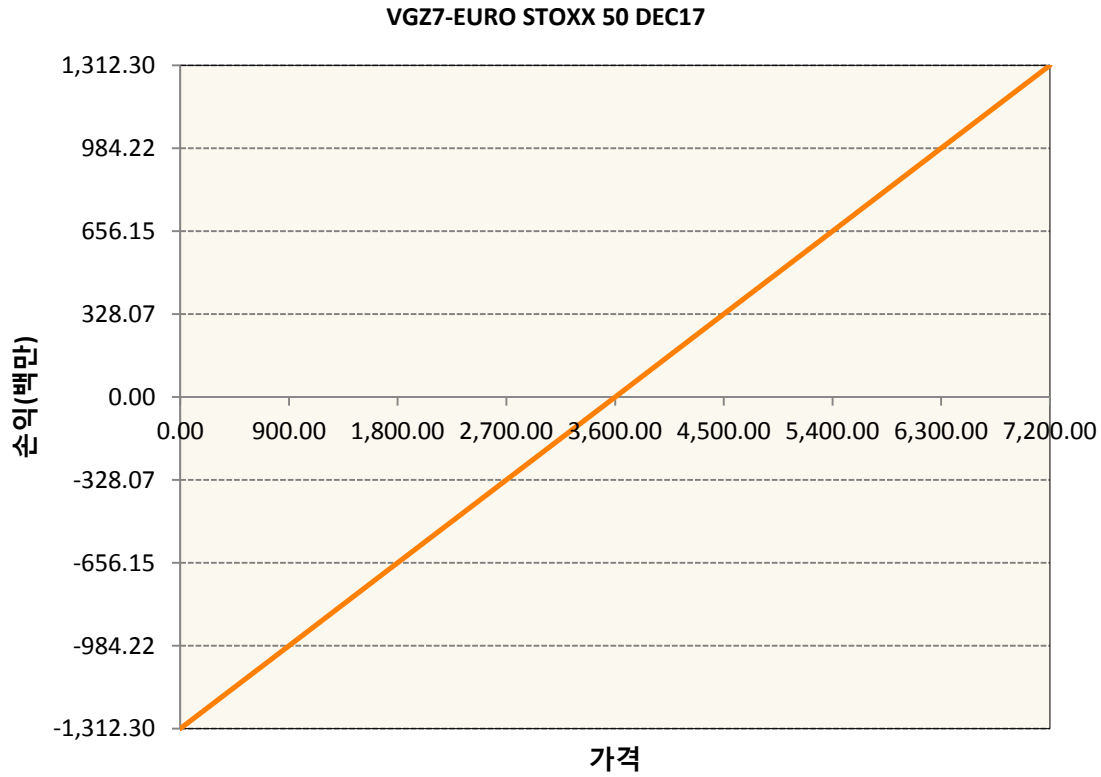
유로인덱스모(주식-파생형)

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)

80

공시일	2017-10-17
기준일	2017-10-16

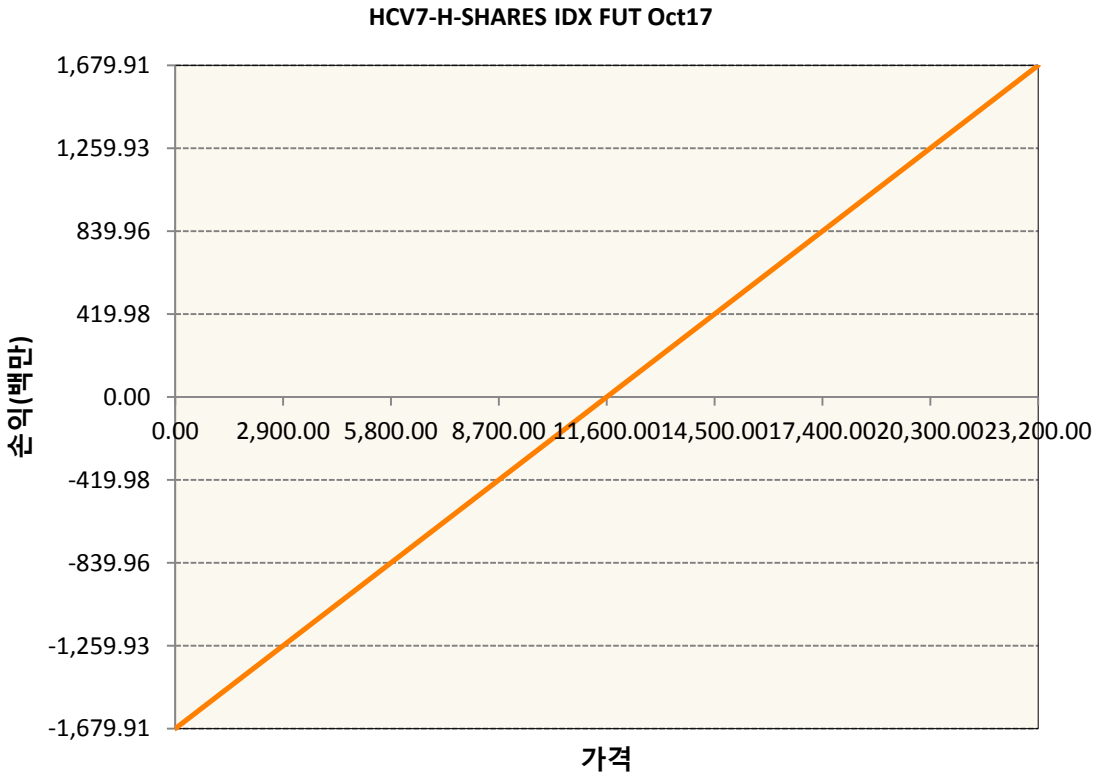
차이나인덱스모(주식-파생형)

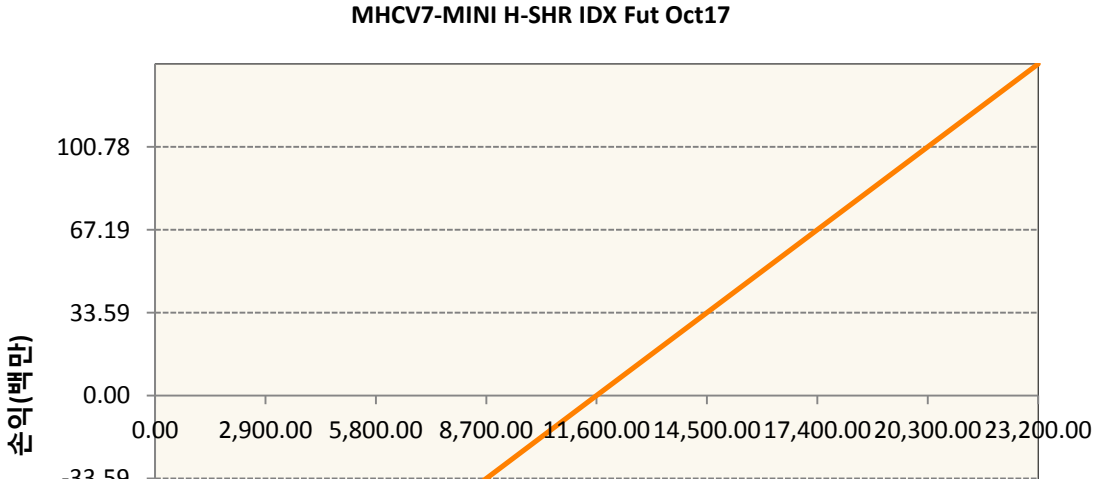
1. 계약금액

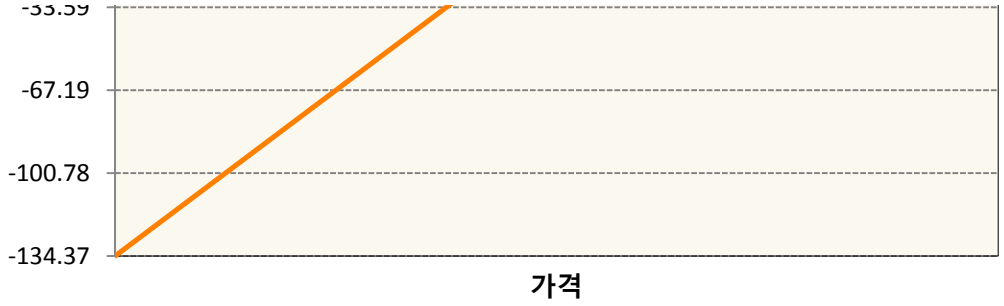
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,814	0	1,814	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

HCV7	H-SHARES IDX FUT Oct17	134
MHCV7	MINI H-SHR IDX Fut Oct17	11

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

119

공시일	2017-10-17
기준일	2017-10-16

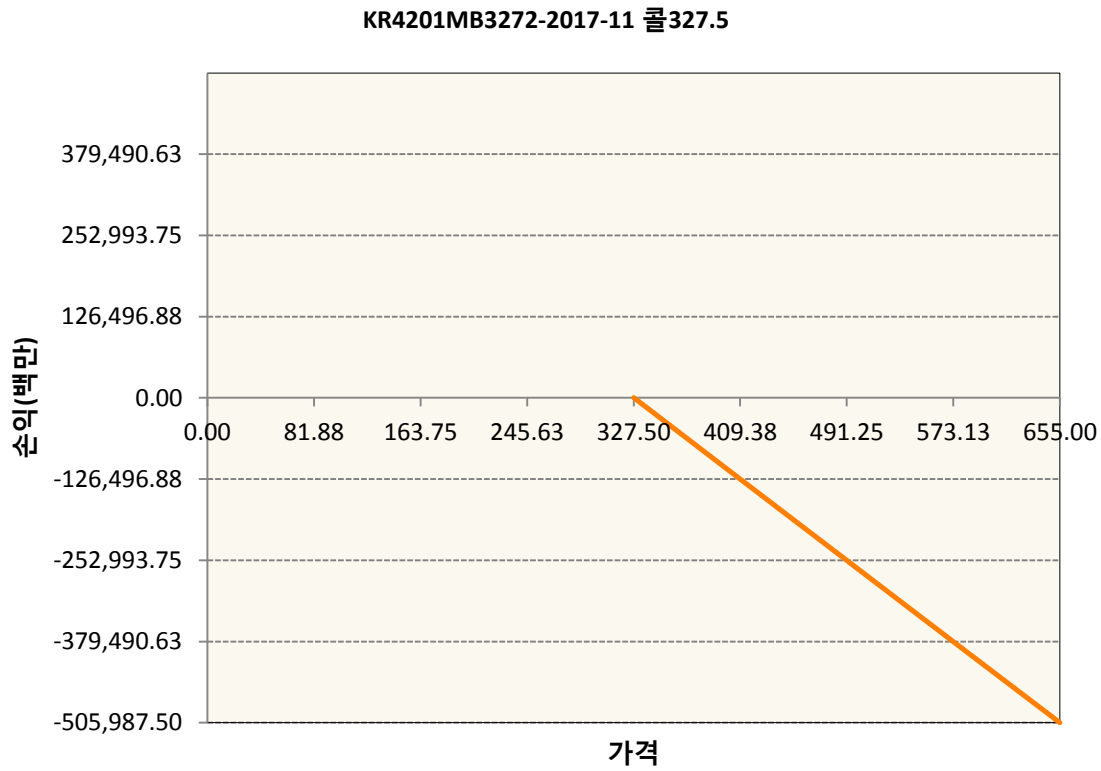
커버드콜모(주식혼합-파생형)

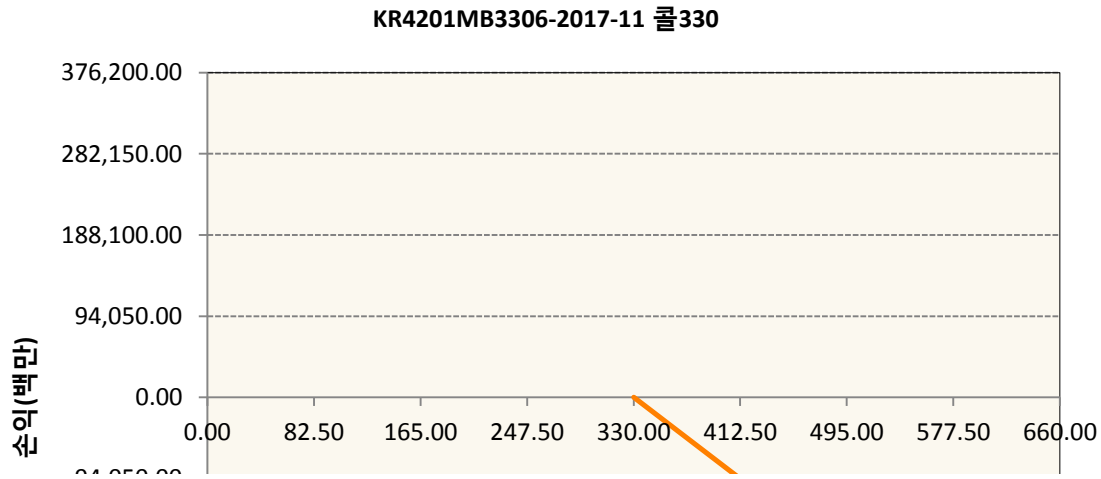
1. 계약금액

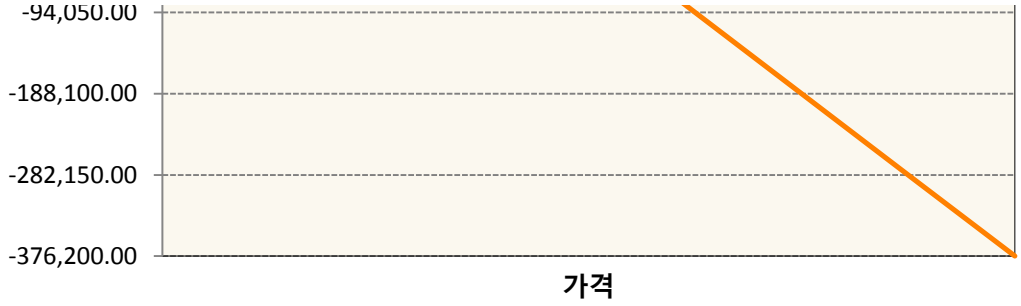
(단위:백만원)

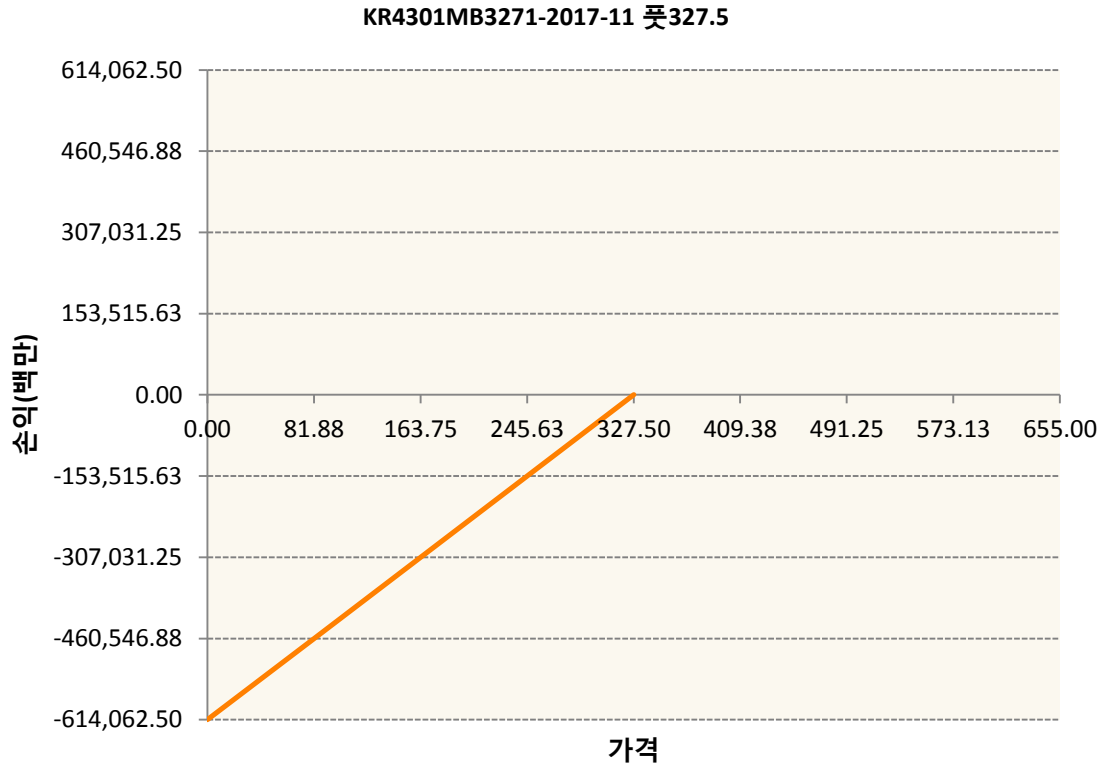
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	5,804	-5,804	장내
누계	유가증권	옵션	0	1,496,250	-1,496,250	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201MB3 2017-11 콜327.5							31,721
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	12,002	11,794	11,520	11,182	10,786	10,337	9,840
-5.33%	11,057	10,551	9,981	9,358	8,690	7,986	7,252
-2.67%	8,409	7,562	6,692	5,803	4,900	3,986	3,063
0%	2,997	1,998	999	0	-999	-1,998	-2,996
2.67%	-5,541	-6,395	-7,275	-8,176	-9,094	-10,024	-10,965
5.33%	-16,601	-17,143	-17,752	-18,416	-19,125	-19,873	-20,653
8.00%	-29,149	-29,411	-29,747	-30,153	-30,621	-31,146	-31,721
KR4201MB3 2017-11 콜330							22,375
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	7,590	7,475	7,316	7,111	6,864	6,576	6,252
-5.33%	7,091	6,783	6,424	6,020	5,579	5,107	4,607
-2.67%	5,566	5,000	4,407	3,793	3,162	2,519	1,864
0%	2,202	1,469	735	0	-736	-1,472	-2,209
2.67%	-3,451	-4,137	-4,834	-5,540	-6,252	-6,969	-7,691
5.33%	-11,139	-11,614	-12,132	-12,684	-13,264	-13,866	-14,487
8.00%	-20,143	-20,393	-20,700	-21,058	-21,460	-21,901	-22,375
KR4301MB3: 2017-11 풋327.5							41,431

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-41,308	-41,310	-41,315	-41,326	-41,348	-41,381	-41,431
-5.33%	-24,975	-25,027	-25,107	-25,219	-25,365	-25,543	-25,753
-2.67%	-9,448	-9,793	-10,176	-10,591	-11,031	-11,493	-11,973
0%	1,866	1,244	622	0	-622	-1,244	-1,866
2.67%	6,331	6,001	5,629	5,223	4,789	4,331	3,853
5.33%	7,081	7,024	6,935	6,812	6,654	6,461	6,234
8.00%	7,130	7,126	7,117	7,099	7,067	7,018	6,949

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

101,037

공시일	2017-10-17
기준일	2017-10-16

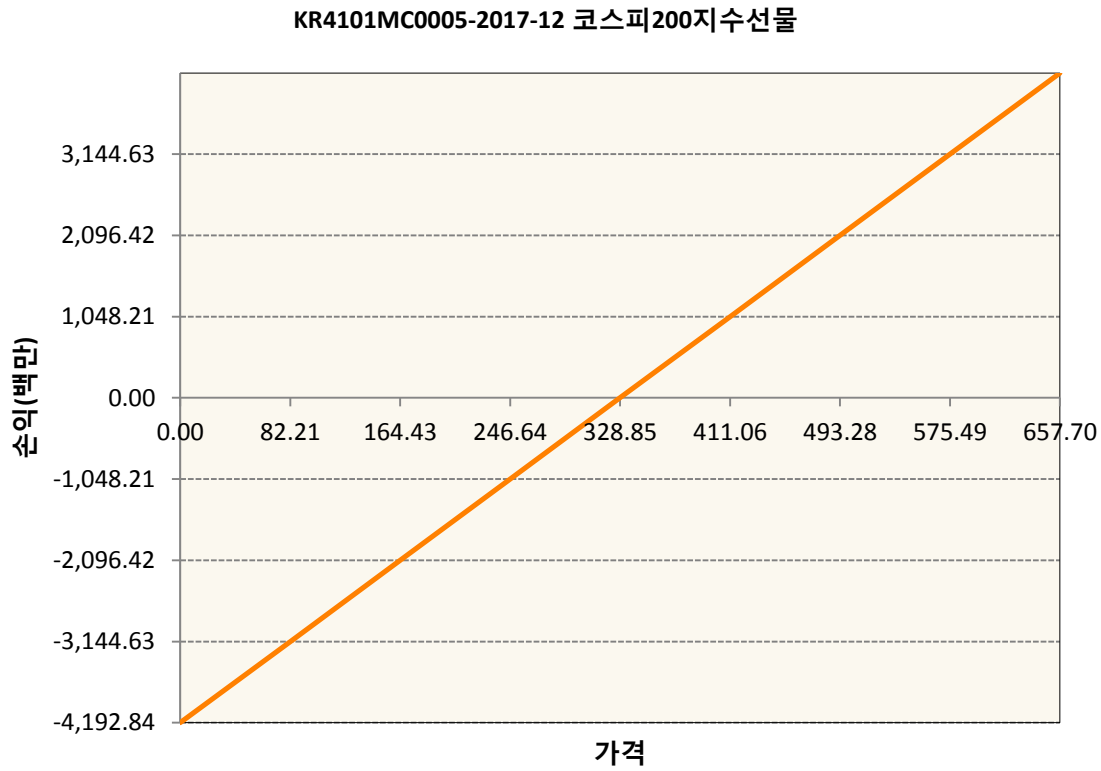
ETF스마트레버리지목표전환형7호

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	4,193	0	4,193	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)

205

공시일	2017-10-17
기준일	2017-10-16

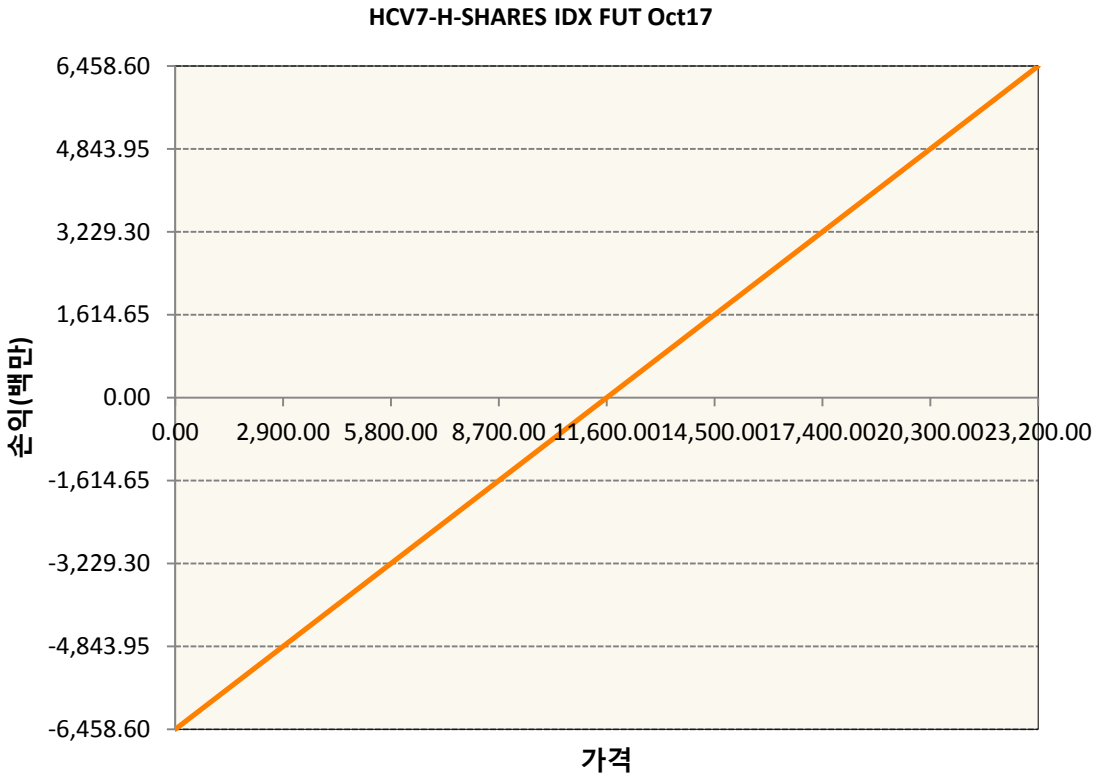
홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생

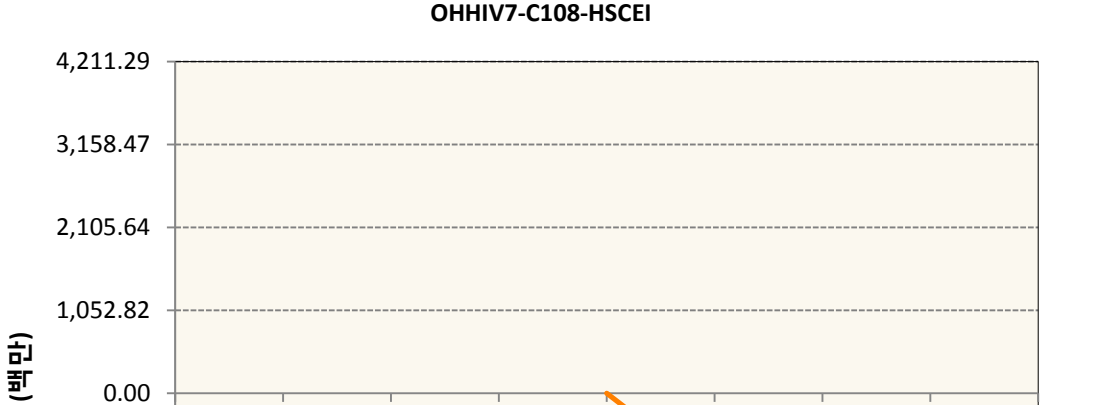
1. 계약금액

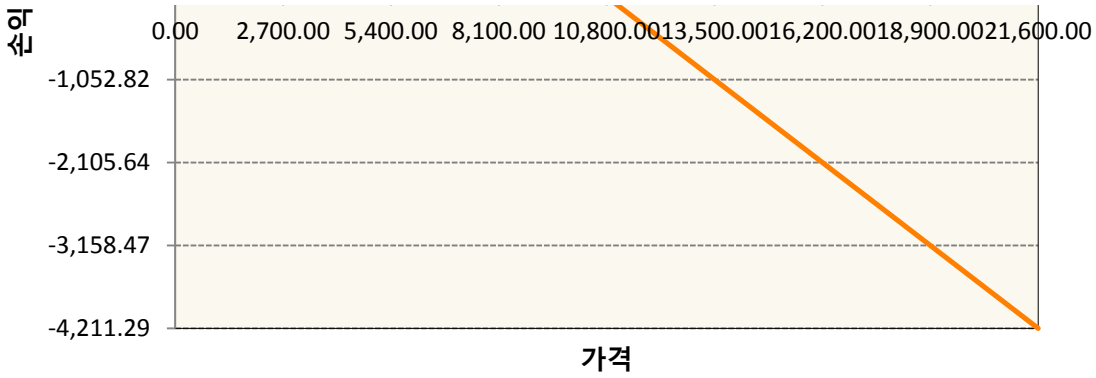
(단위:백만원)

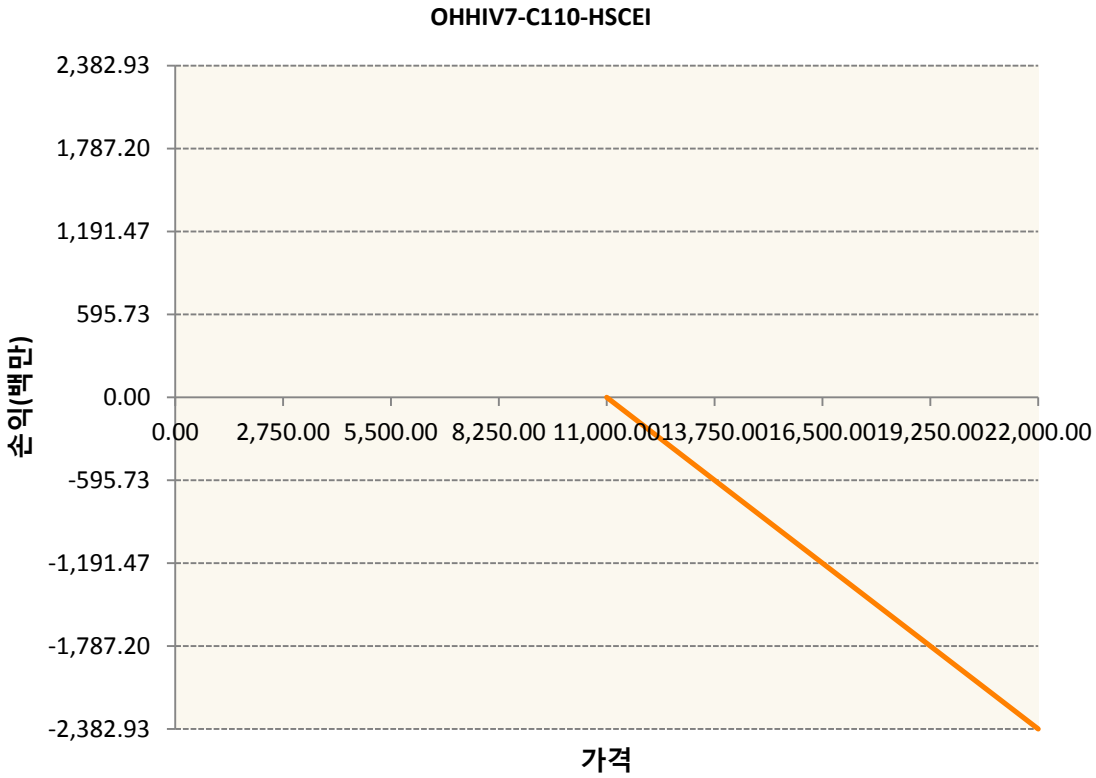
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	6,459	0	6,459	장내
누계	유가증권	옵션	0	13,188	-13,188	장내

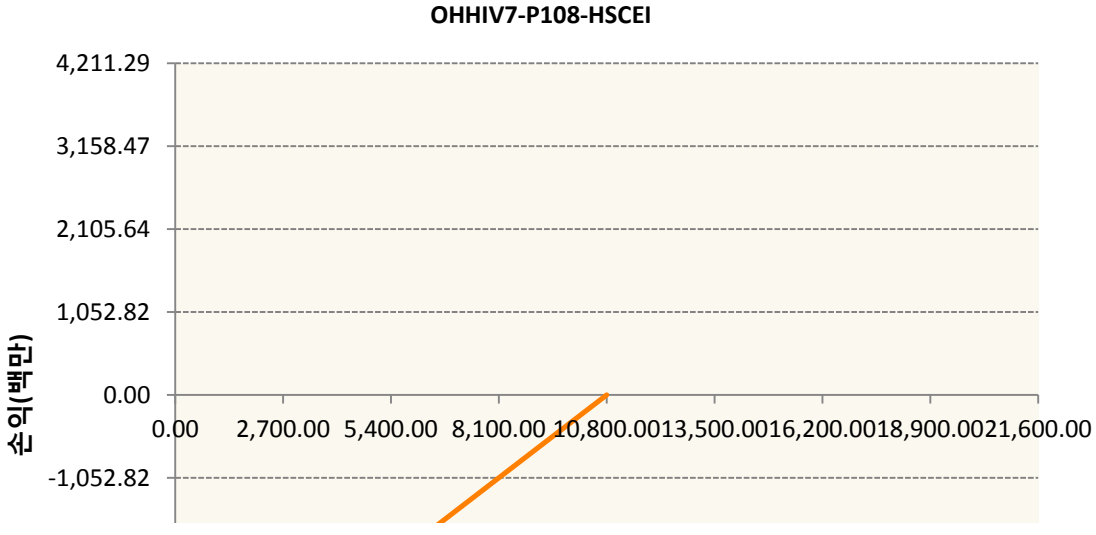
2. 만기시점의 손익구조

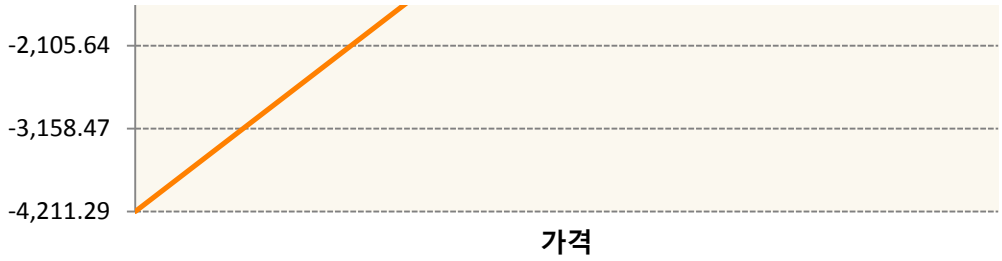


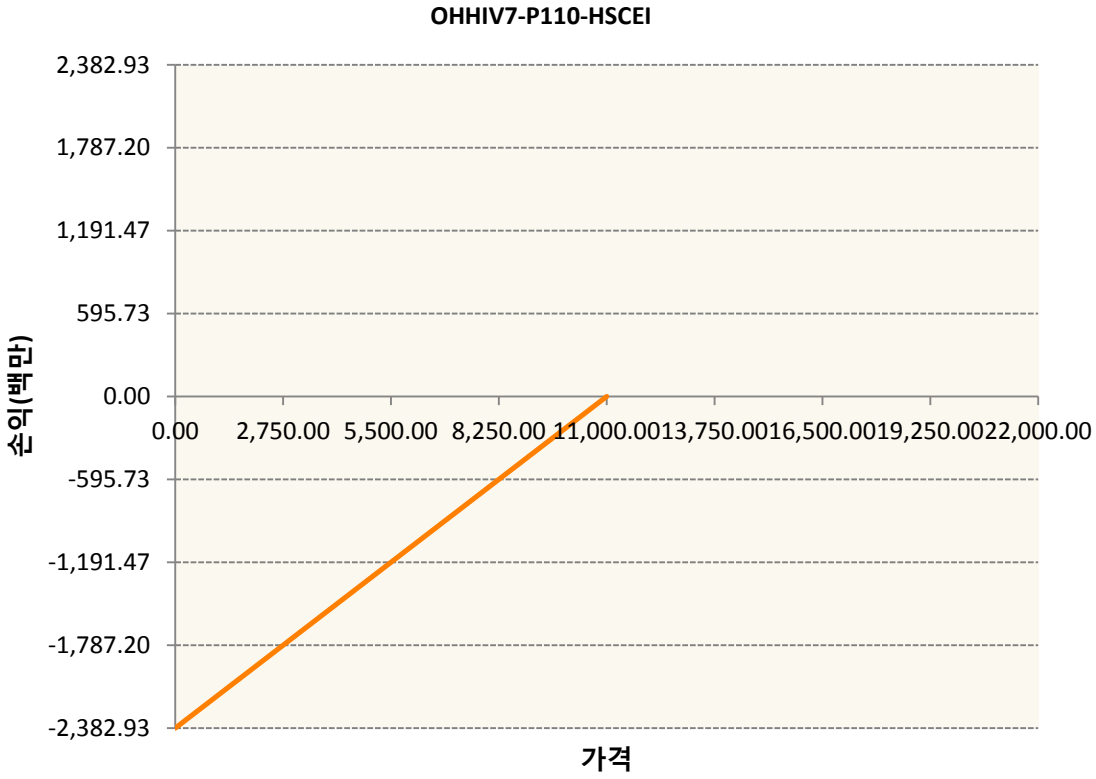



손익
0.00
2,700.00
5,400.00
8,100.00
10,800.00
13,500.00
16,200.00
18,900.00
21,600.00
-1,052.82
-2,105.64
-3,158.47
-4,211.29
가격


OHHIV7-C110-HSCEI
2,382.93
1,787.20
1,191.47
595.73
0.00
-595.73
-1,191.47
-1,787.20
-2,382.93
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
4,211.29
3,158.47
2,105.64
1,052.82
0.00
-1,052.82
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	517
OHHIV7-C10 HSCEI	337
OHHIV7-C11 HSCEI	191
OHHIV7-P10 HSCEI	337
OHHIV7-P11 HSCEI	191

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

1,286

공시일	2017-10-17
기준일	2017-10-16

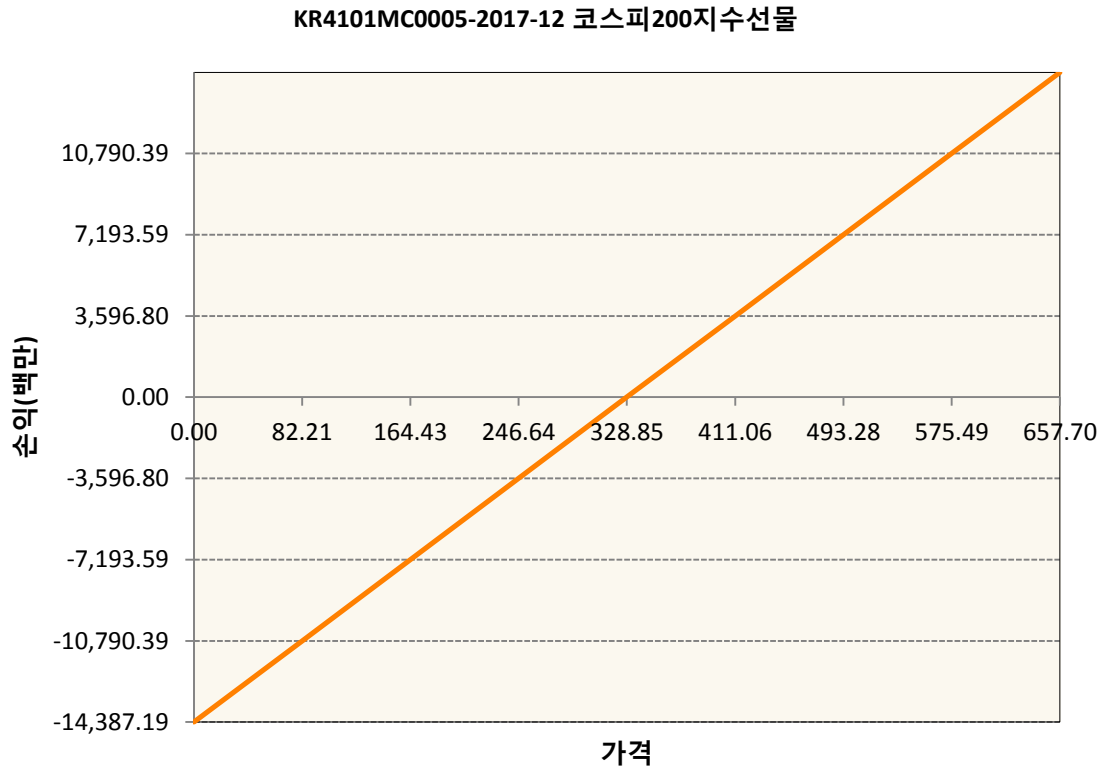
코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼

1. 계약금액

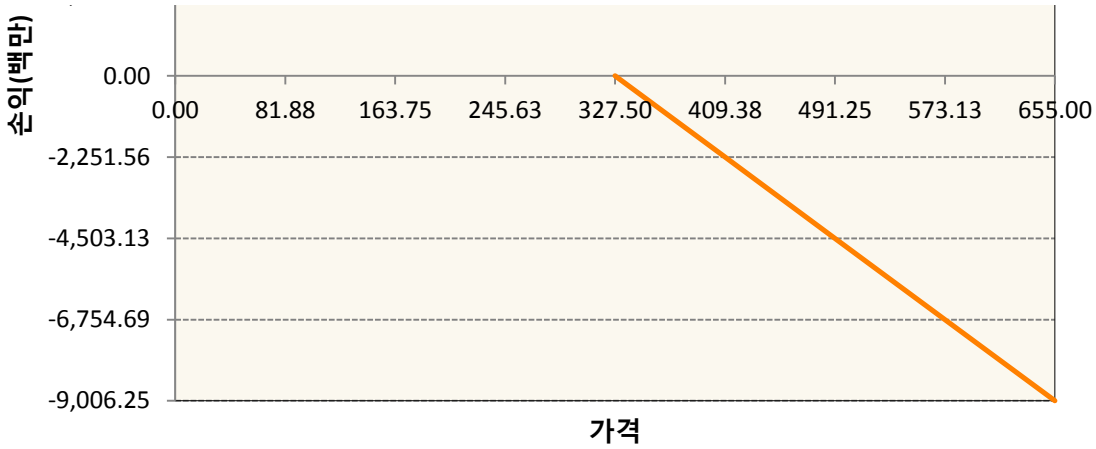
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	2,058	0	2,058	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	2,077	-2,077	장내
누계	유가증권	선물	14,387	0	14,387	장내
누계	유가증권	스왑	29,500	0	29,500	장외
누계	유가증권	옵션	0	29,128	-29,128	장내

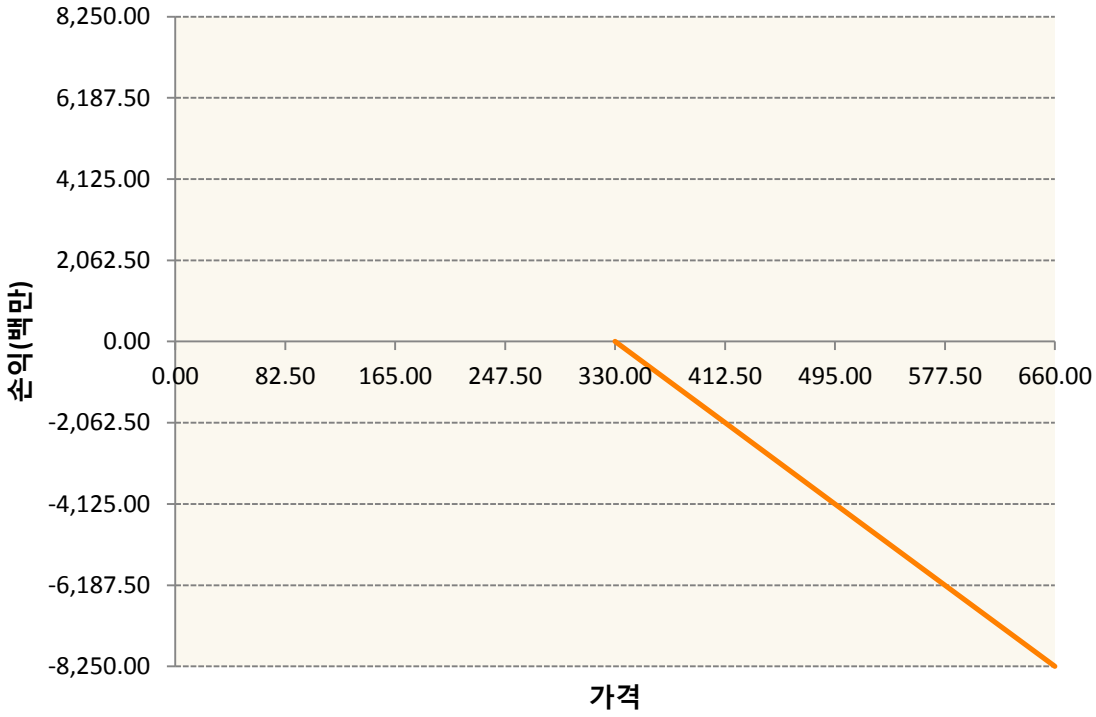
2. 만기시점의 손익구조



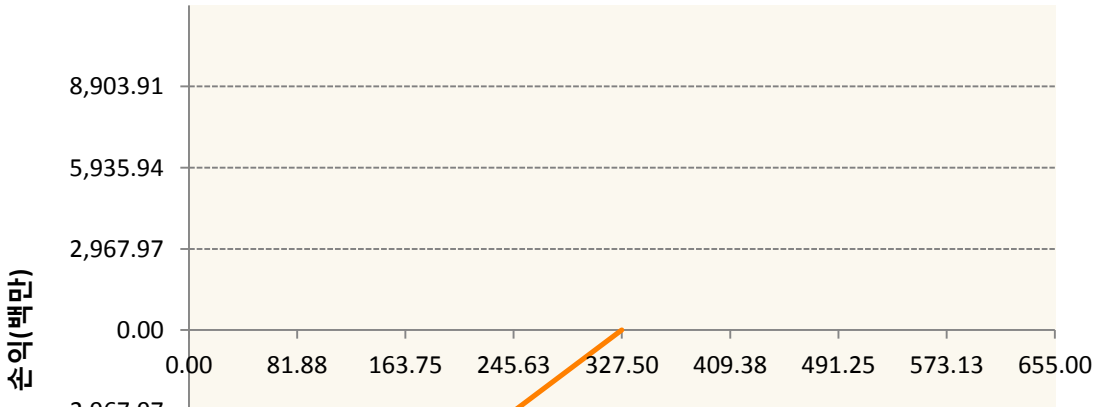




KR4201MB3306-2017-11 콜330



KR4301MB3271-2017-11 풋327.5





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

	2.5287E+11 UBCSFXC1 INDEX_2						1,500
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,500	-1,500	-1,500	-1,500	-1,500	-1,500	-1,500
-5.33%	-1,000	-1,000	-1,000	-1,000	-1,000	-1,000	-1,000
-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%	1,000	1,000	1,000	1,000	1,000	1,000	1,000
8.00%	1,500	1,500	1,500	1,500	1,500	1,500	1,500
	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				1,147

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,147	-1,147	-1,147	-1,147	-1,147	-1,147	-1,147
-5.33%	-765	-765	-765	-765	-765	-765	-765
-2.67%	-382	-382	-382	-382	-382	-382	-382
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	382	382	382	382	382	382	382
5.33%	765	765	765	765	765	765	765
8.00%	1,147	1,147	1,147	1,147	1,147	1,147	1,147
	KR4201MB3(	2017-11	콜327.5				565

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	214	210	205	199	192	184	175
-5.33%	197	188	178	167	155	142	129
-2.67%	150	135	119	103	87	71	55
0%	53	36	18	0	-18	-36	-53
2.67%	-99	-114	-129	-146	-162	-178	-195
5.33%	-295	-305	-316	-328	-340	-354	-368
8.00%	-519	-523	-529	-537	-545	-554	-565
	KR4201MB3(	2017-11	콜330				491

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	166	164	160	156	151	144	137
-5.33%	156	149	141	132	122	112	101

-2.67%	122	110	97	83	69	55	41
0%	48	32	16	0	-16	-32	-48
2.67%	-76	-91	-106	-121	-137	-153	-169
5.33%	-244	-255	-266	-278	-291	-304	-318
8.00%	-442	-447	-454	-462	-471	-480	-491
	KR4301MB3: 2017-11 풋327.5						801
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-799	-799	-799	-799	-799	-800	-801
-5.33%	-483	-484	-485	-488	-490	-494	-498
-2.67%	-183	-189	-197	-205	-213	-222	-231
0%	36	24	12	0	-12	-24	-36
2.67%	122	116	109	101	93	84	74
5.33%	137	136	134	132	129	125	121
8.00%	138	138	138	137	137	136	134

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

5,056

공시일	2017-10-17
기준일	2017-10-16

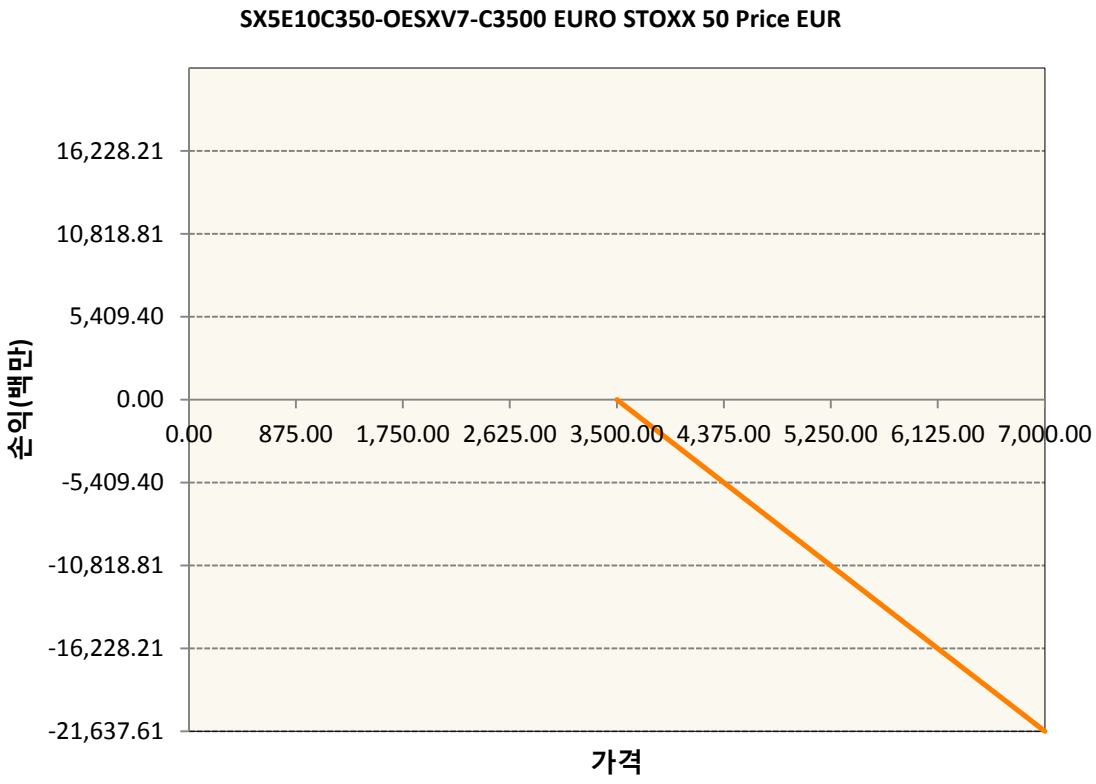
유로커버드콜모(주식혼합-파생형

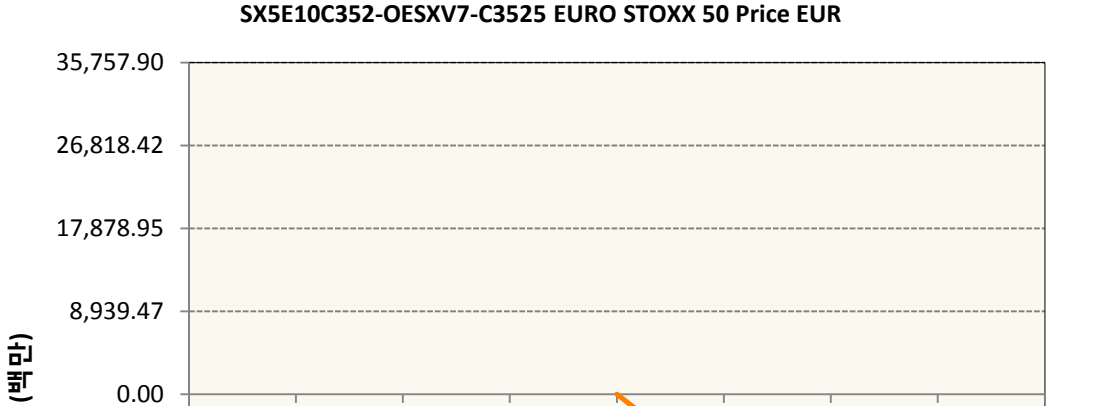
1. 계약금액

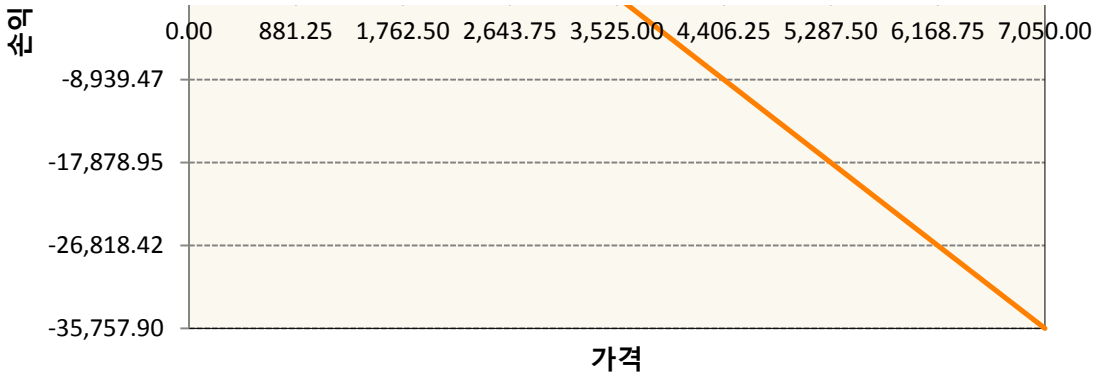
(단위:백만원)

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	55,225	0	55,225	
누계	유가증권	옵션	0	114,791	-114,791	장외

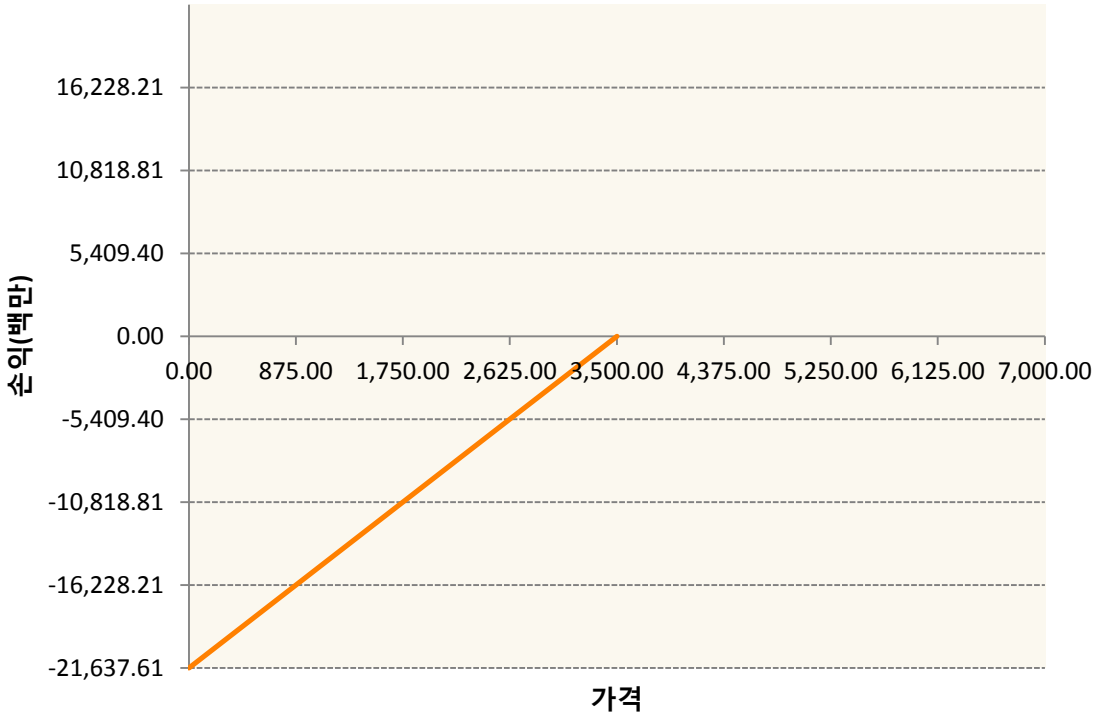
2. 만기시점의 손익구조



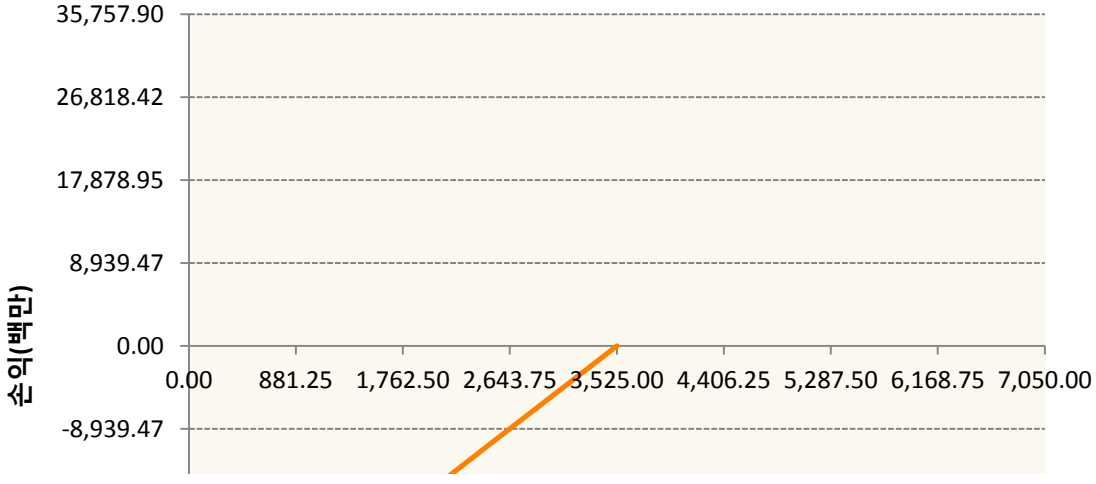


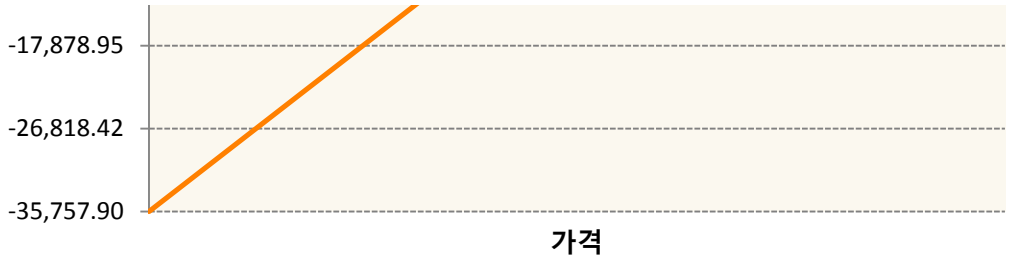


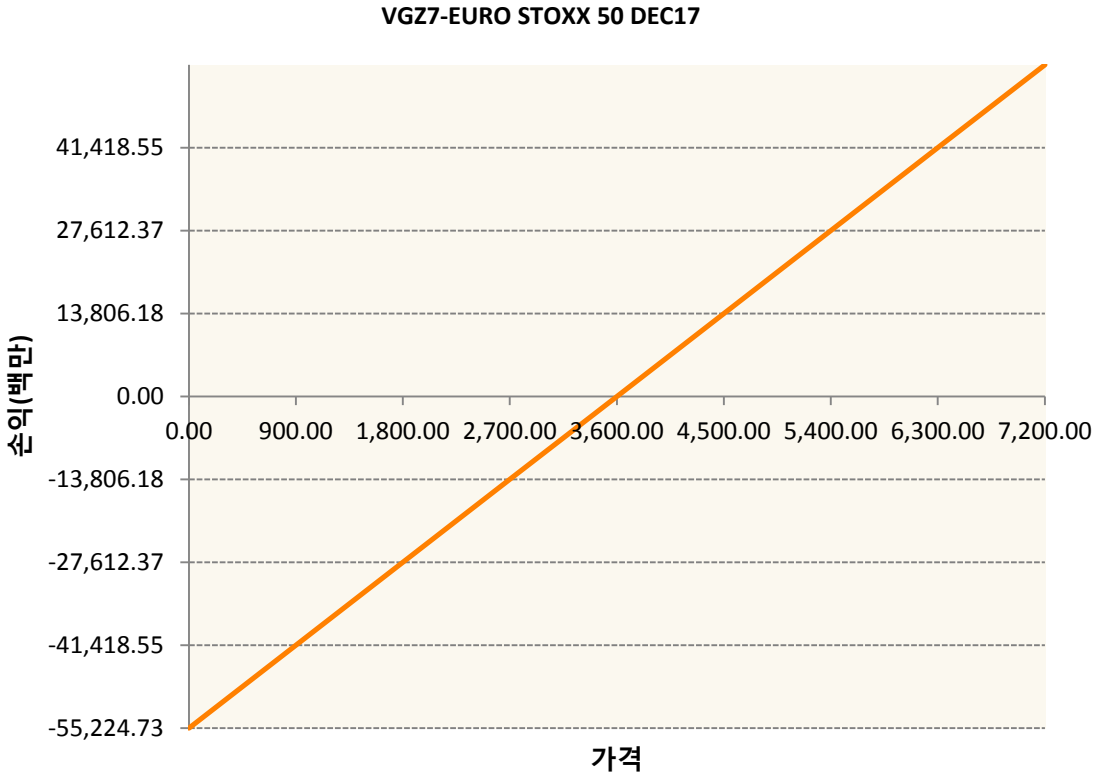
SX5E10P350-OESXV7-P3500 EURO STOXX 50 Price EUR



SX5E10P352-OESXV7-P3525 EURO STOXX 50 Price EUR







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

SX5E10C350 OESXV7-C3500 EURO STOXX 50 Price EUR	1,731
SX5E10C352 OESXV7-C3525 EURO STOXX 50 Price EUR	2,861
SX5E10P350 OESXV7-P3500 EURO STOXX 50 Price EUR	1,731
SX5E10P352 OESXV7-P3525 EURO STOXX 50 Price EUR	2,861
VGZ7 EURO STOXX 50 DEC17	4,418

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

10,352

공시일	2017-10-17
기준일	2017-10-16

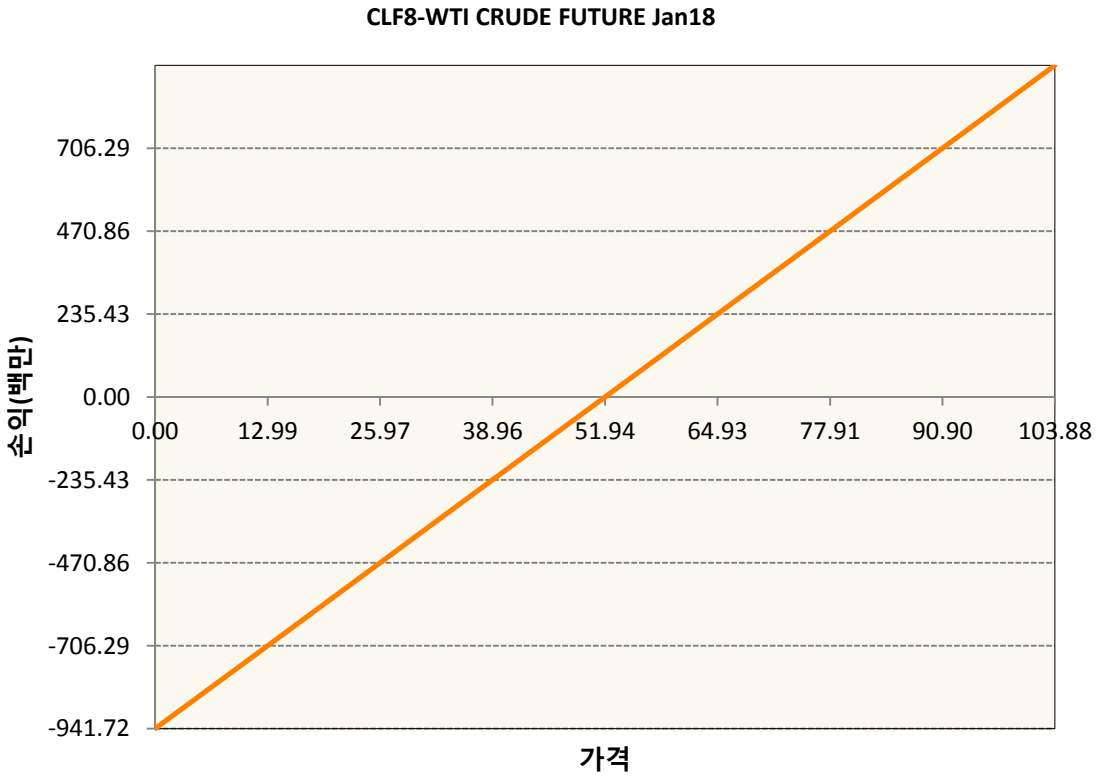
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

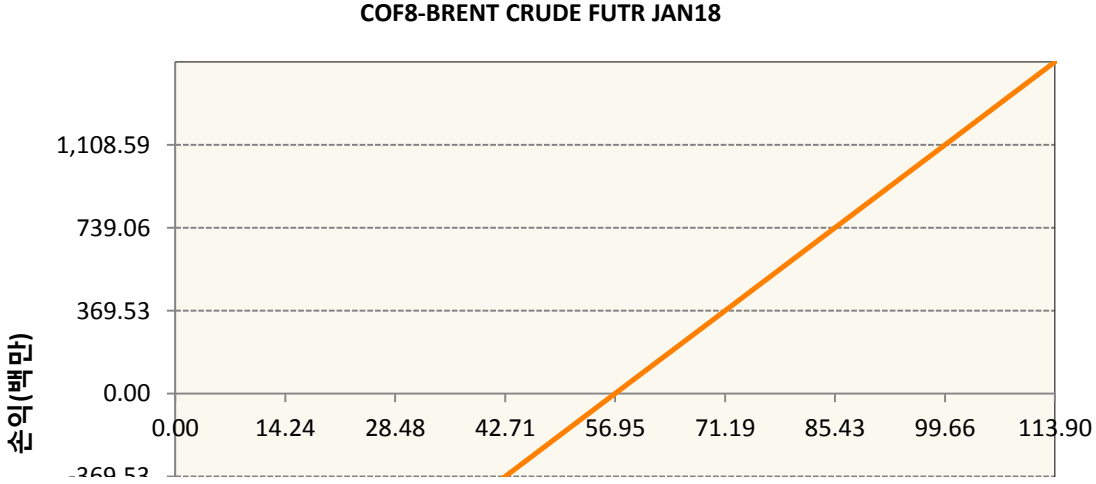
1. 계약금액

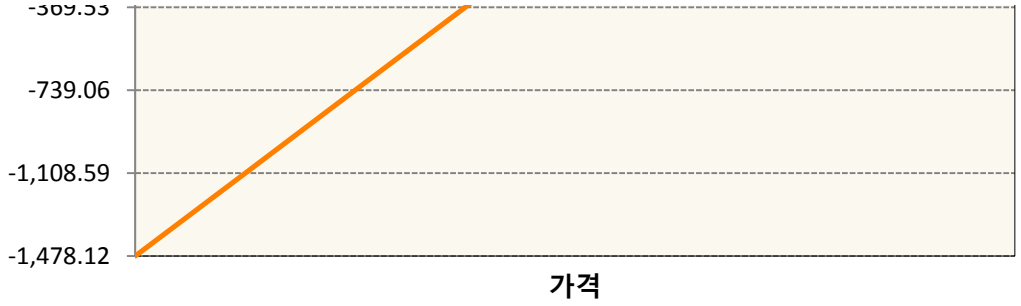
(단위:백만원)

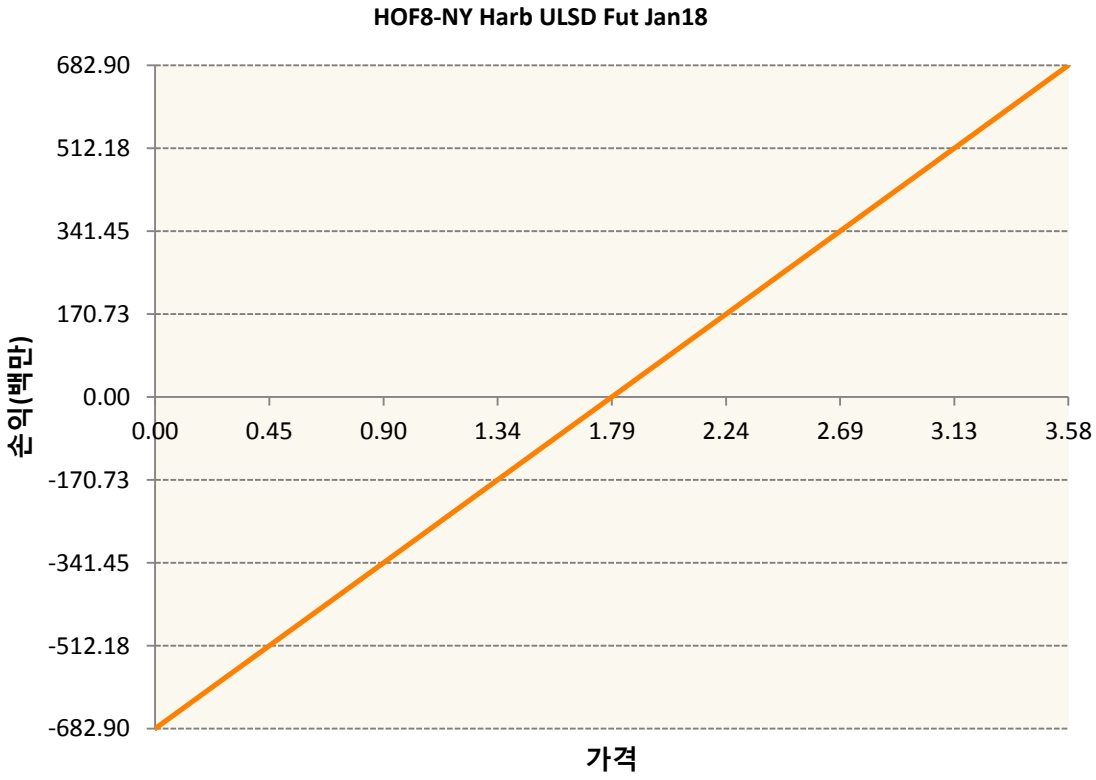
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	5,266	902	4,364	

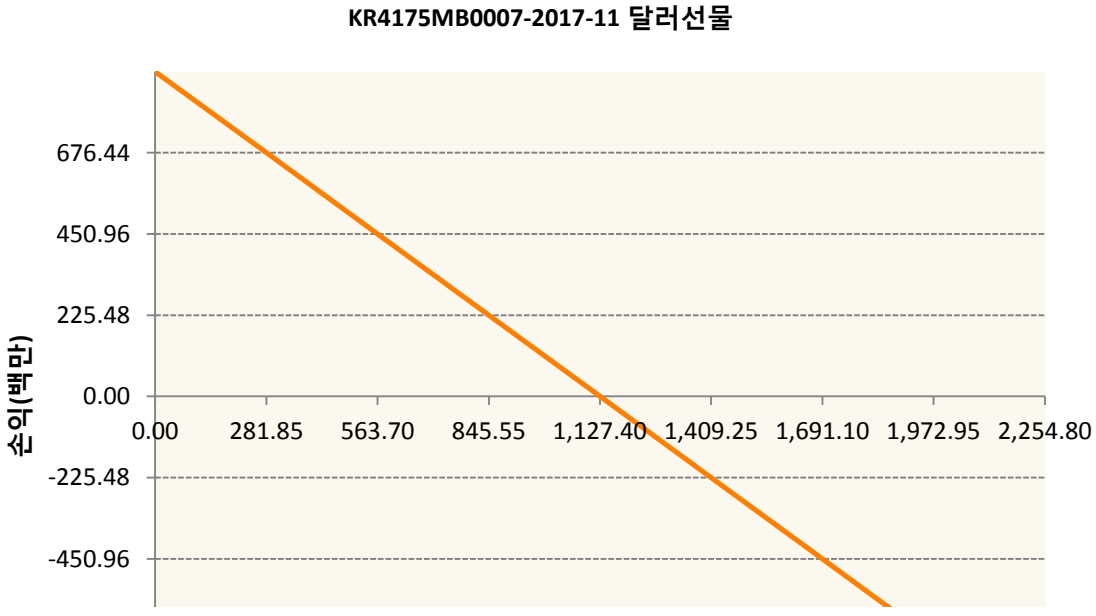
2. 만기시점의 손익구조

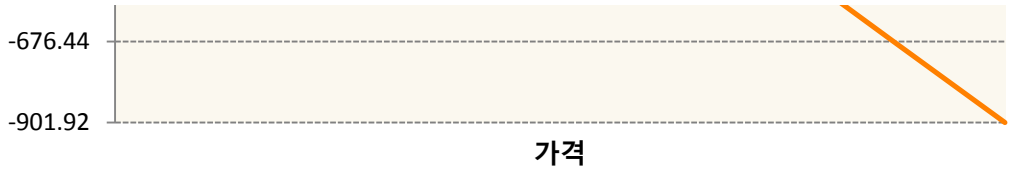


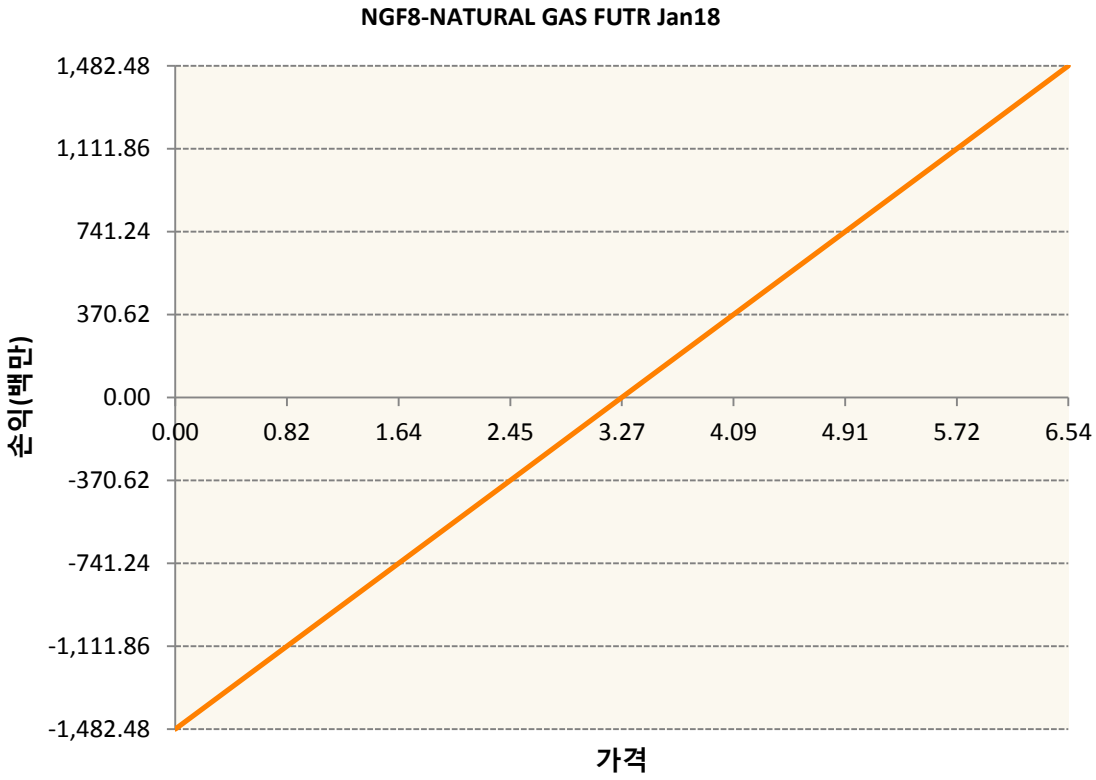


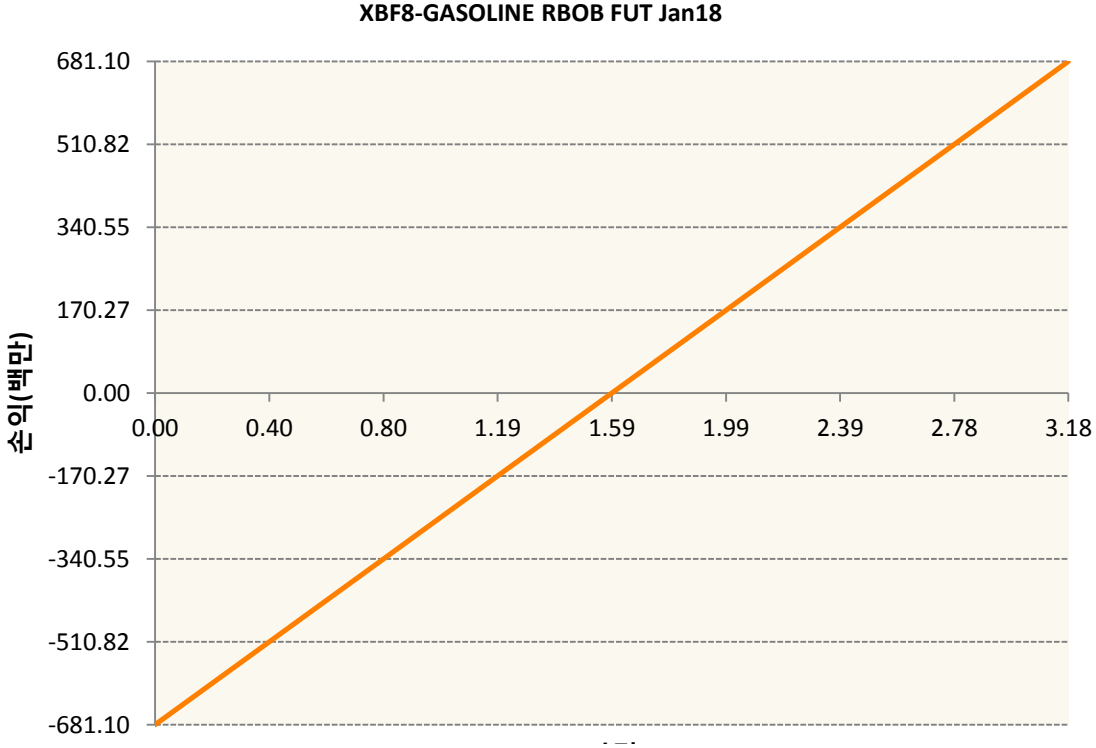

-739.06
-1,108.59
-1,478.12
가격


HOF8-NY Harb ULSD Fut Jan18
682.90
512.18
341.45
170.73
0.00
-170.73
-341.45
-512.18
-682.90
0.00
0.45
0.90
1.34
1.79
2.24
2.69
3.13
3.58
손익(백만)
가격


KR4175MB0007-2017-11 달러선물
676.44
450.96
225.48
0.00
-225.48
-450.96
0.00
281.85
563.70
845.55
1,127.40
1,409.25
1,691.10
1,972.95
2,254.80
손익(백만)


-676.44
-901.92
가격


NGF8-NATURAL GAS FUTR Jan18
1,482.48
1,111.86
741.24
370.62
0.00
-370.62
-741.24
-1,111.86
-1,482.48
0.00
0.82
1.64
2.45
3.27
4.09
4.91
5.72
6.54
손익(백만)
가격


XBF8-GASOLINE RBOB FUT Jan18
681.10
510.82
340.55
170.27
0.00
-170.27
-340.55
-510.82
-681.10
0.00
0.40
0.80
1.19
1.59
1.99
2.39
2.78
3.18
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	55
KR4175MB0(	2017-11 달러선물	72
NGF8	NATURAL GAS FUTR Jan18	119
XBF8	GASOLINE RBOB FUT Jan18	54

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

756

공시일	2017-10-17
기준일	2017-10-16

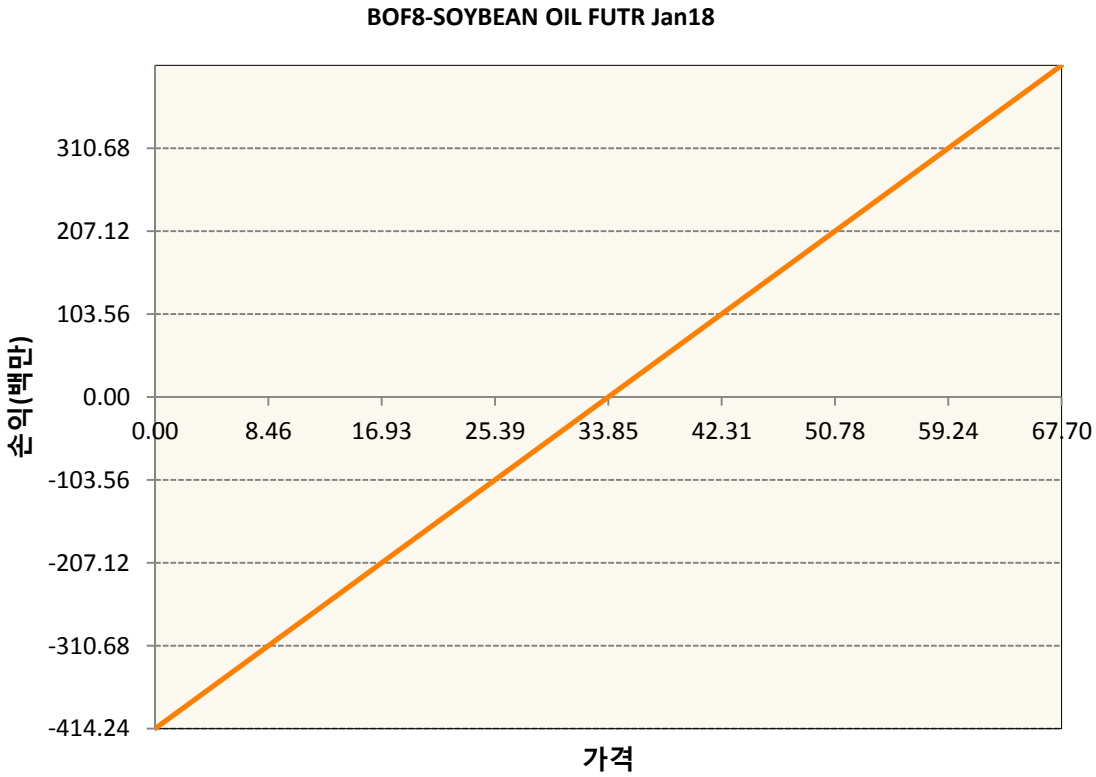
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

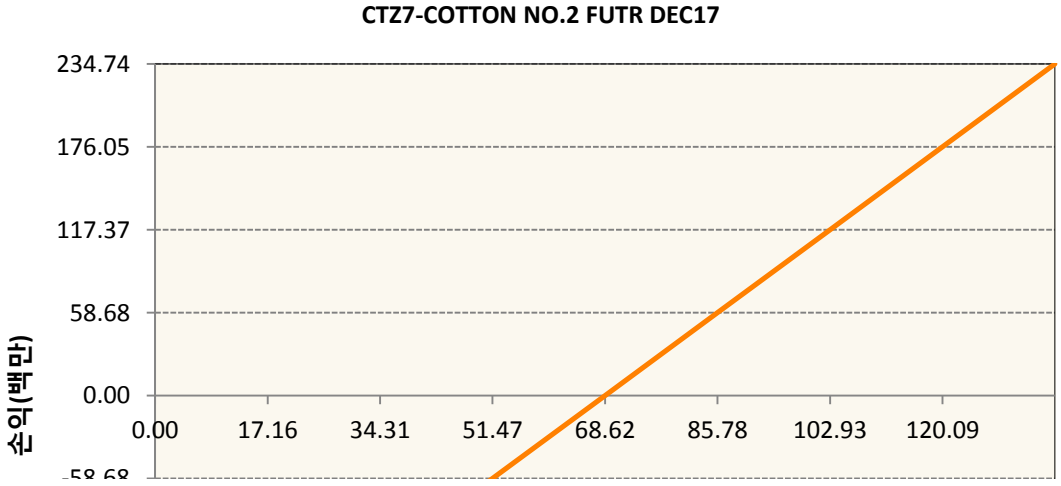
1. 계약금액

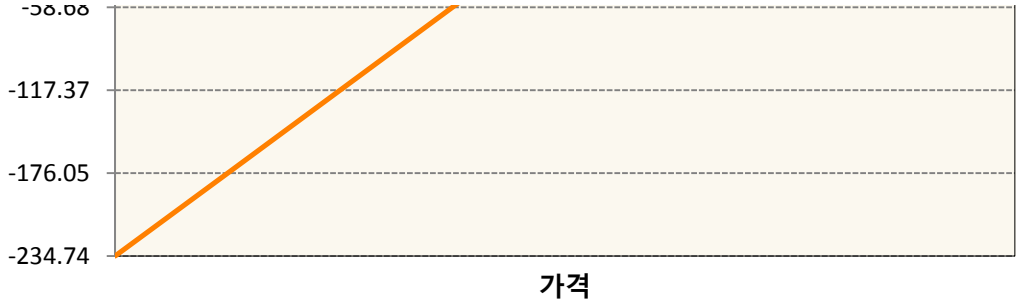
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	4,620	338	4,282	

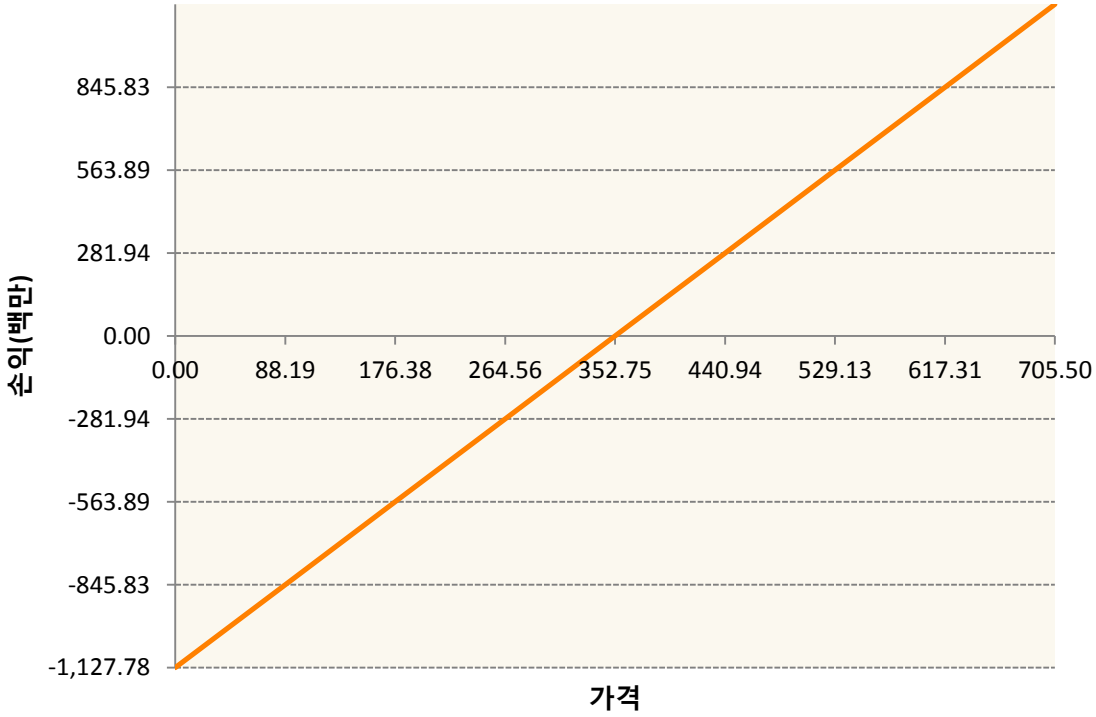
2. 만기시점의 손익구조



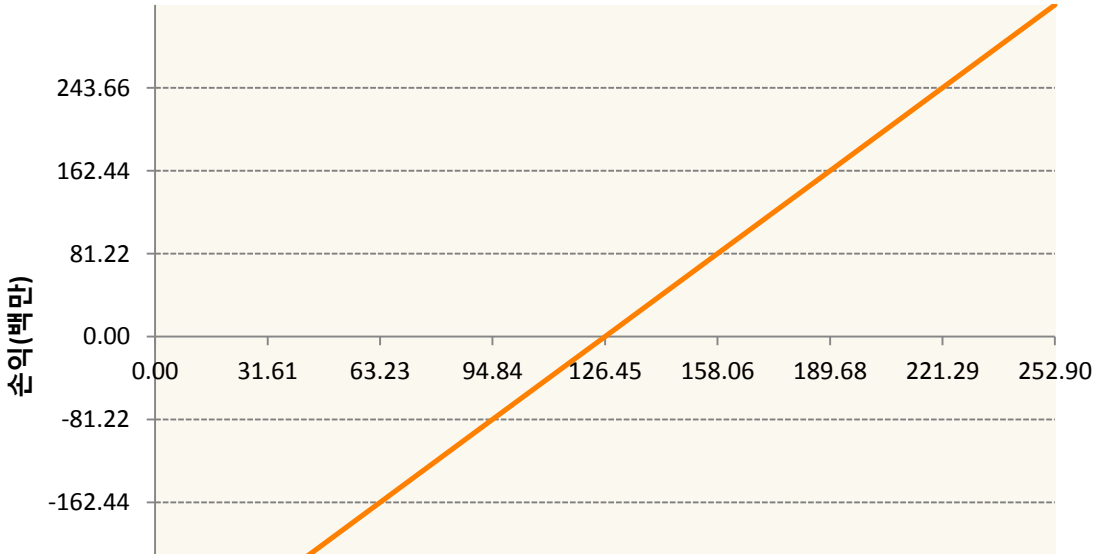


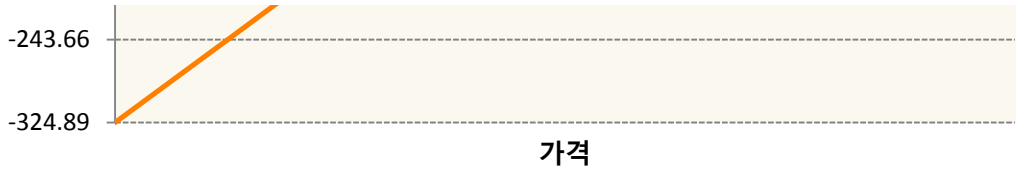


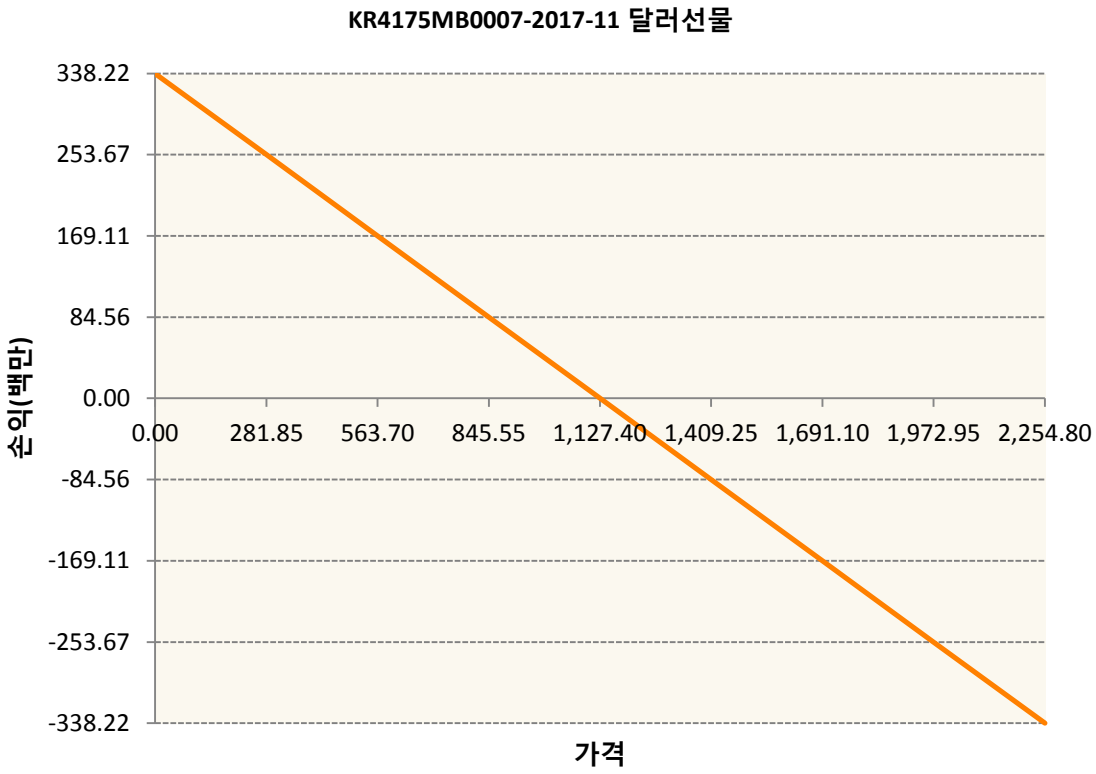
CZ7-CORN FUTURE DEC17

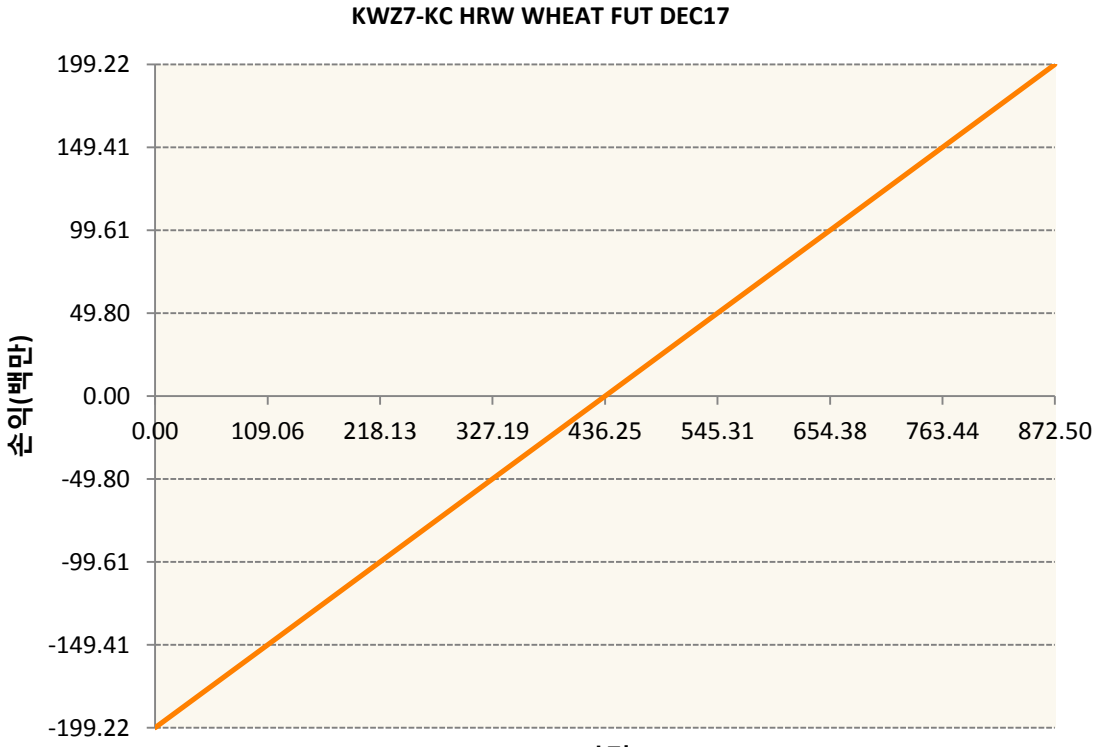


KCZ7-COFFEE 'C' FUTURE DEC17

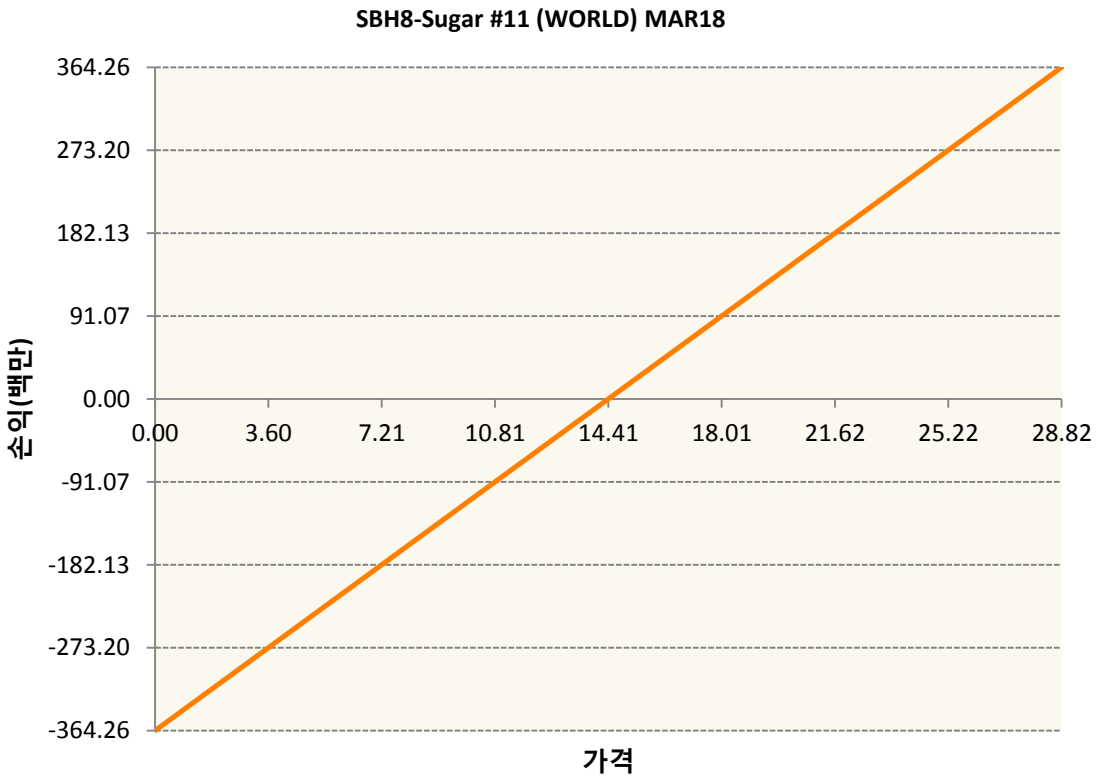


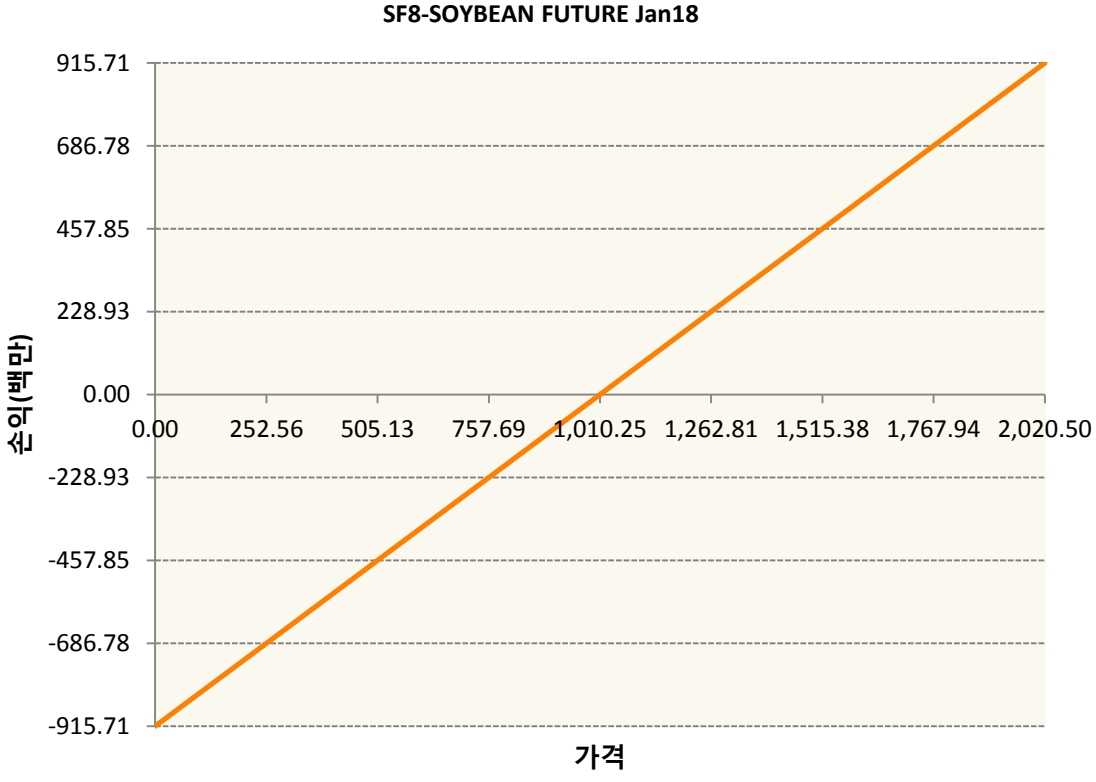

-243.66
-324.89
가격

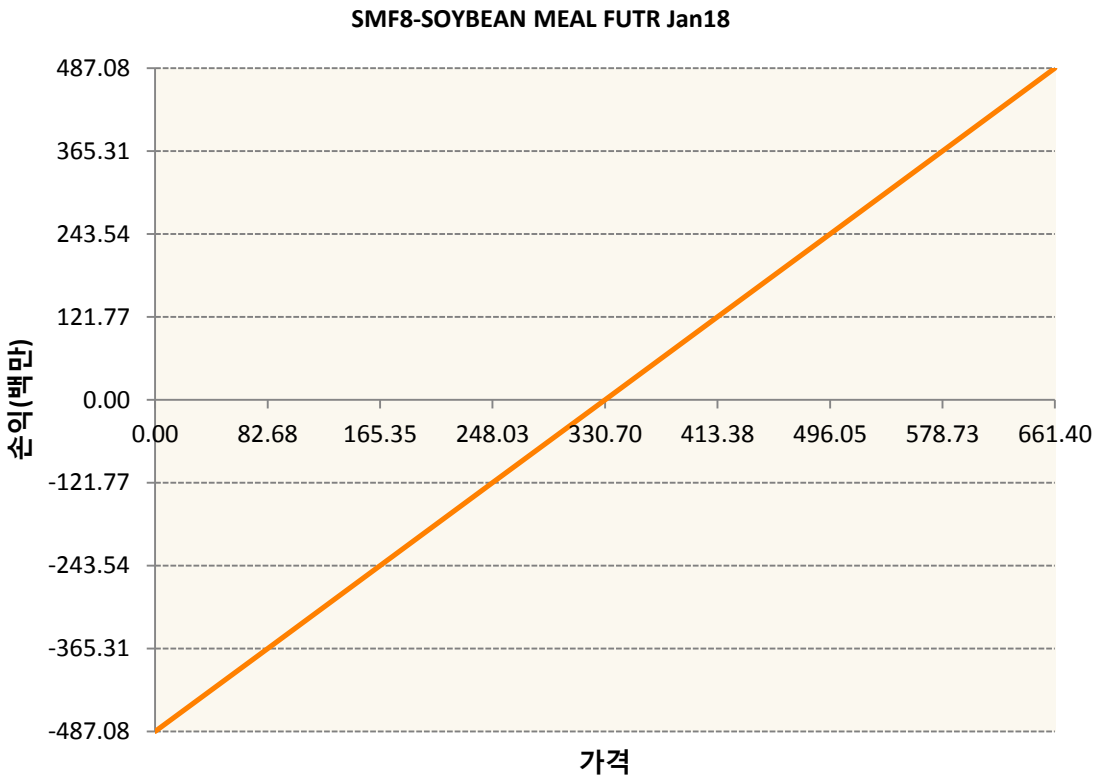

KR4175MB0007-2017-11 달러선물
338.22
253.67
169.11
84.56
0.00
-84.56
-169.11
-253.67
-338.22
0.00
281.85
563.70
845.55
1,127.40
1,409.25
1,691.10
1,972.95
2,254.80
손익(백만)
가격

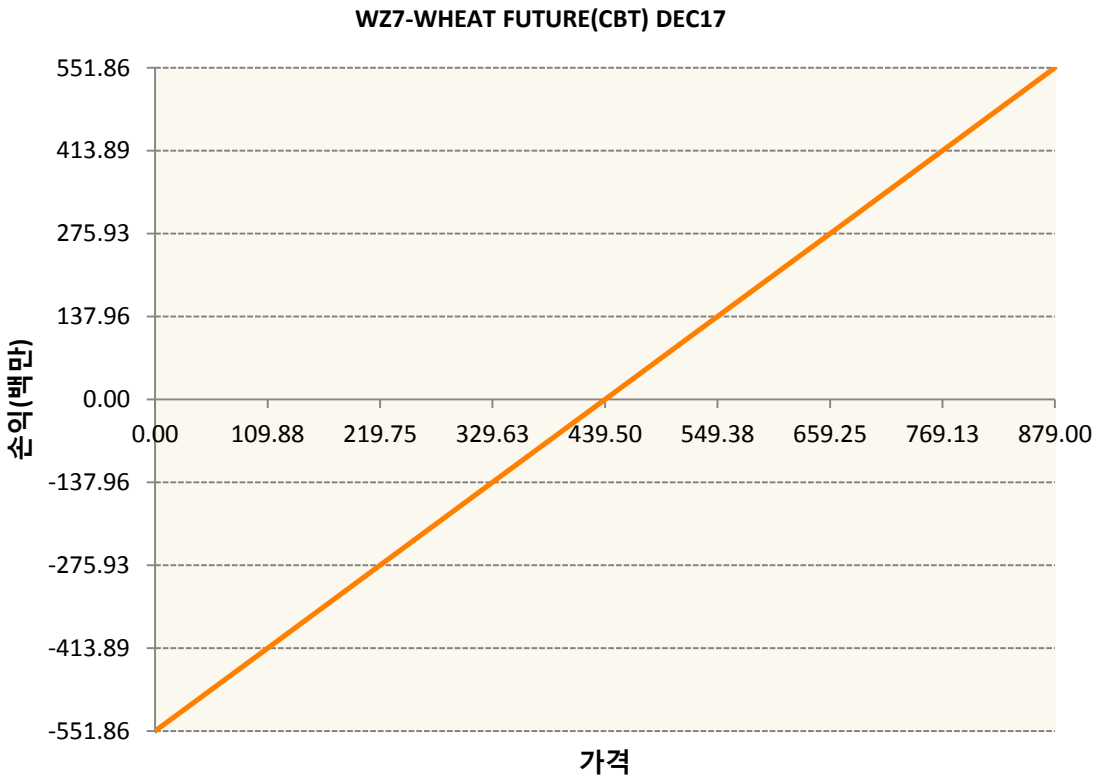

KWZ7-KC HRW WHEAT FUT DEC17
199.22
149.41
99.61
49.80
0.00
-49.80
-99.61
-149.41
-199.22
0.00
109.06
218.13
327.19
436.25
545.31
654.38
763.44
872.50
손익(백만)

가격


SBH8-Sugar #11 (WORLD) MAR18
364.26
273.20
182.13
91.07
0.00
-91.07
-182.13
-273.20
-364.26
0.00
3.60
7.21
10.81
14.41
18.01
21.62
25.22
28.82
손익(백만)
가격


SF8-SOYBEAN FUTURE Jan18
915.71
686.78
457.85
228.93
0.00
-228.93
-457.85
-686.78
-915.71
0.00
252.56
505.13
757.69
1,010.25
1,262.81
1,515.38
1,767.94
2,020.50
손익(백만)
가격





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

BOF8	SOYBEAN OIL FUTR Jan18	33

CTZ7	COTTON NO.2 FUTR DEC17	19
CZ7	CORN FUTURE DEC17	90
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	44

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

424