공시일	2017-10-18
기준일	2017-10-17

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	2017-10-18
기준일	2017-10-17

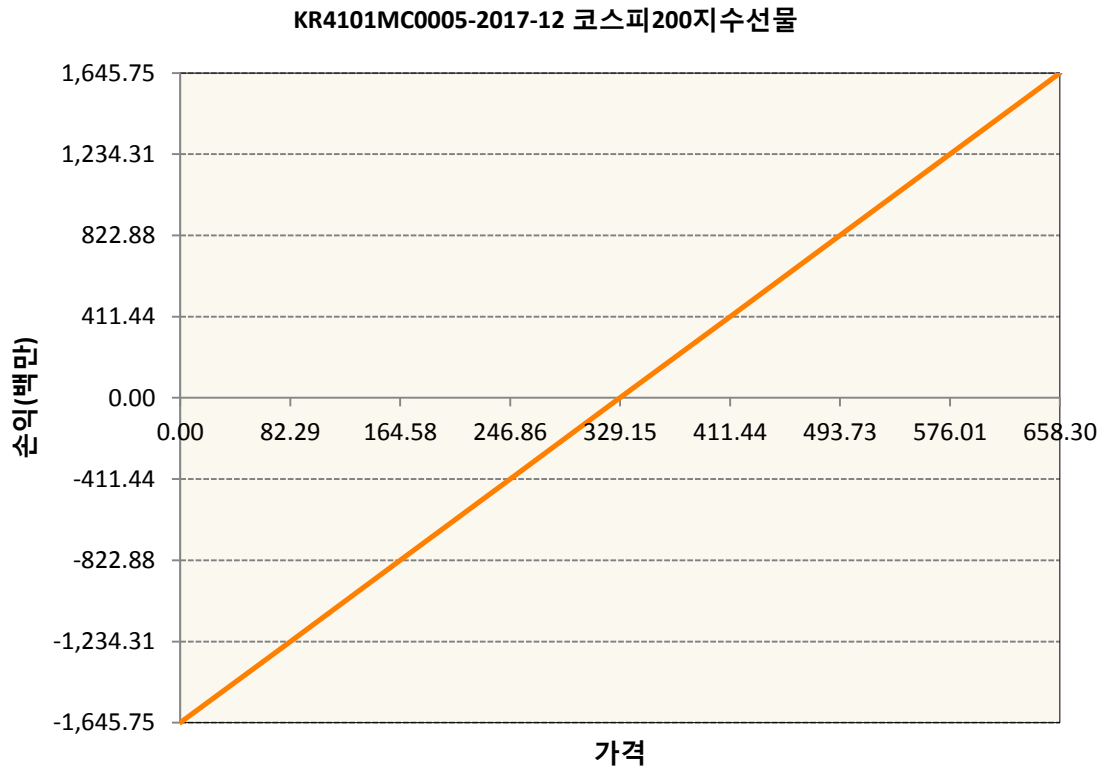
스마트인덱스모

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	1,646	0	1,646	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%	-88	-88	-88	-88	-88	-88	-88
-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%	88	88	88	88	88	88	88

8.00%	131	131	131	131	131	131	131

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

79

공시일	2017-10-18
기준일	2017-10-17

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	1,061

* 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	2017-10-18
기준일	2017-10-17

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	422

* 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	2017-10-18
기준일	2017-10-17

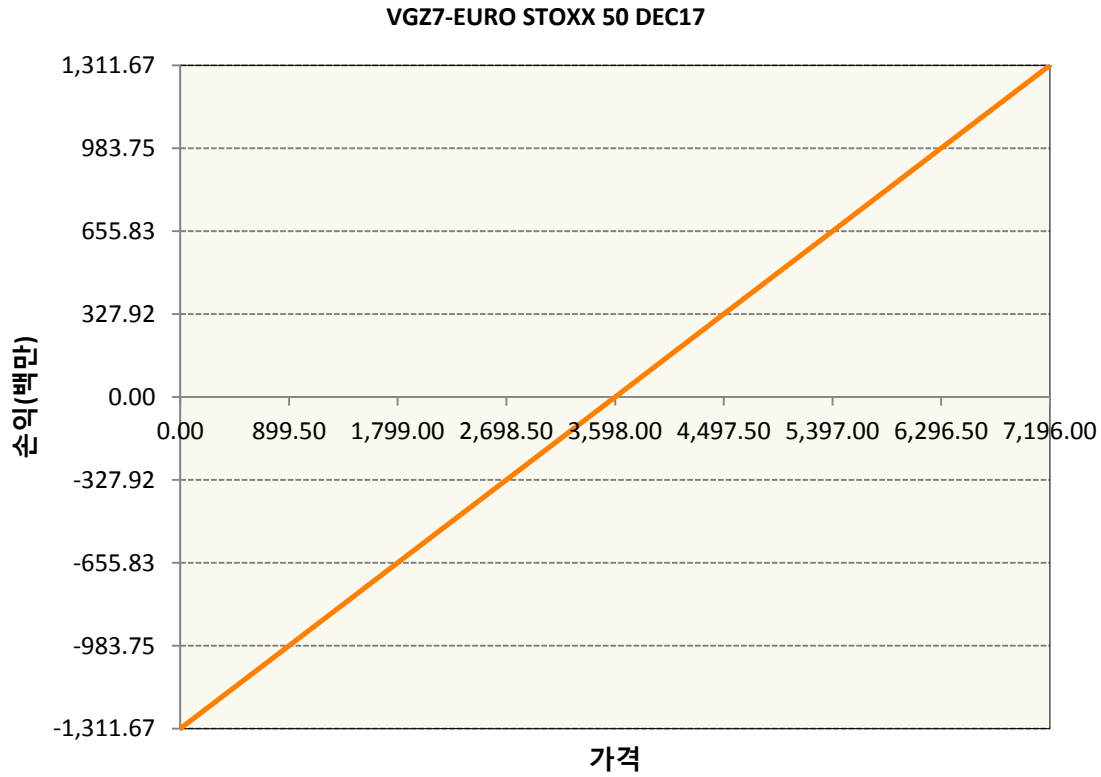
유로인덱스모(주식-파생형)

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	2017-10-18
기준일	2017-10-17

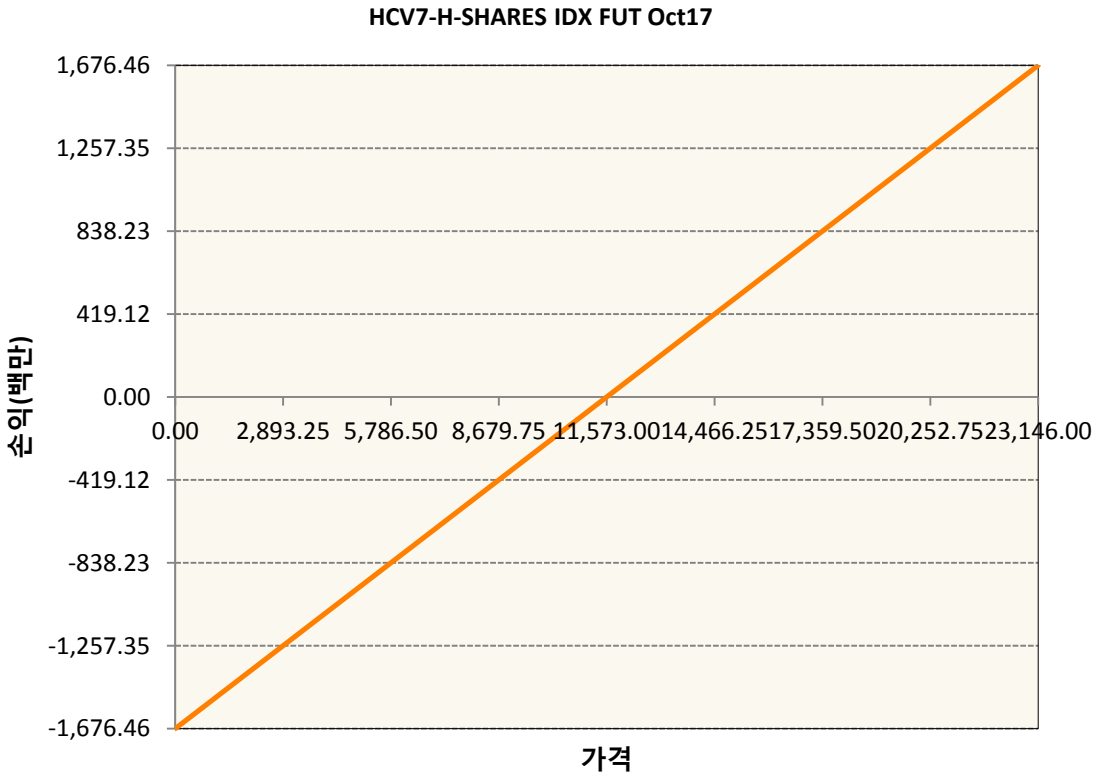
차이나인덱스모(주식-파생형)

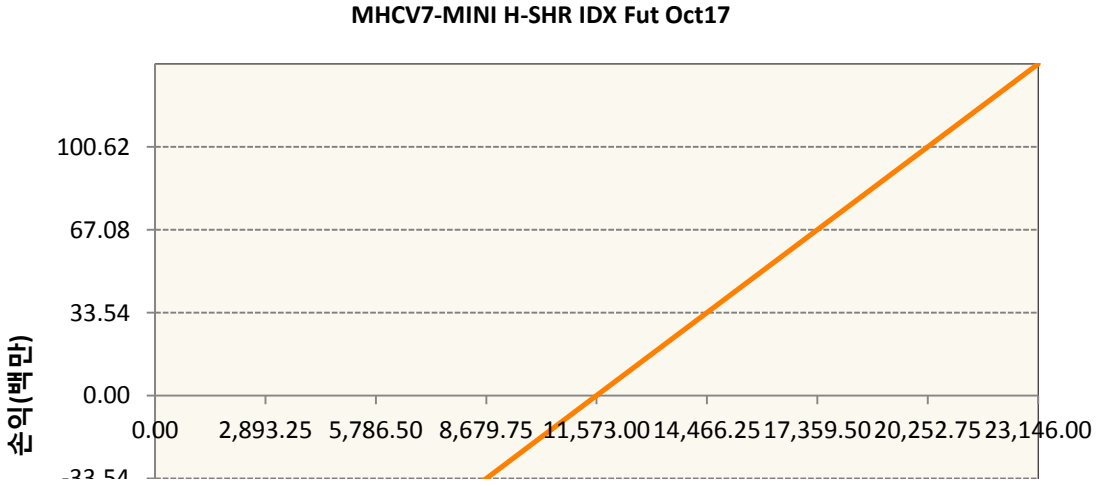
1. 계약금액

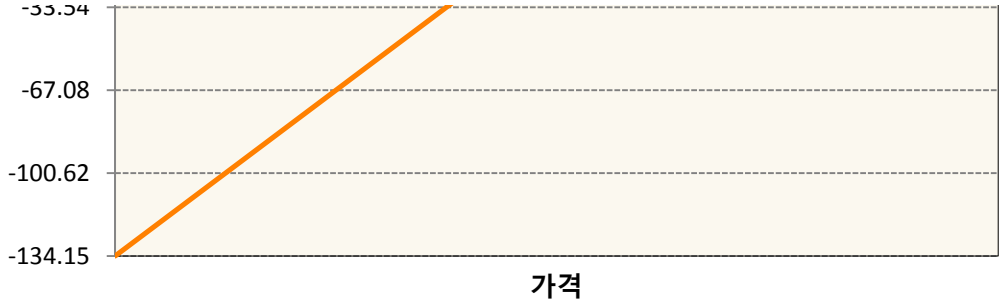
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,811	0	1,811	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)

118

공시일	2017-10-18
기준일	2017-10-17

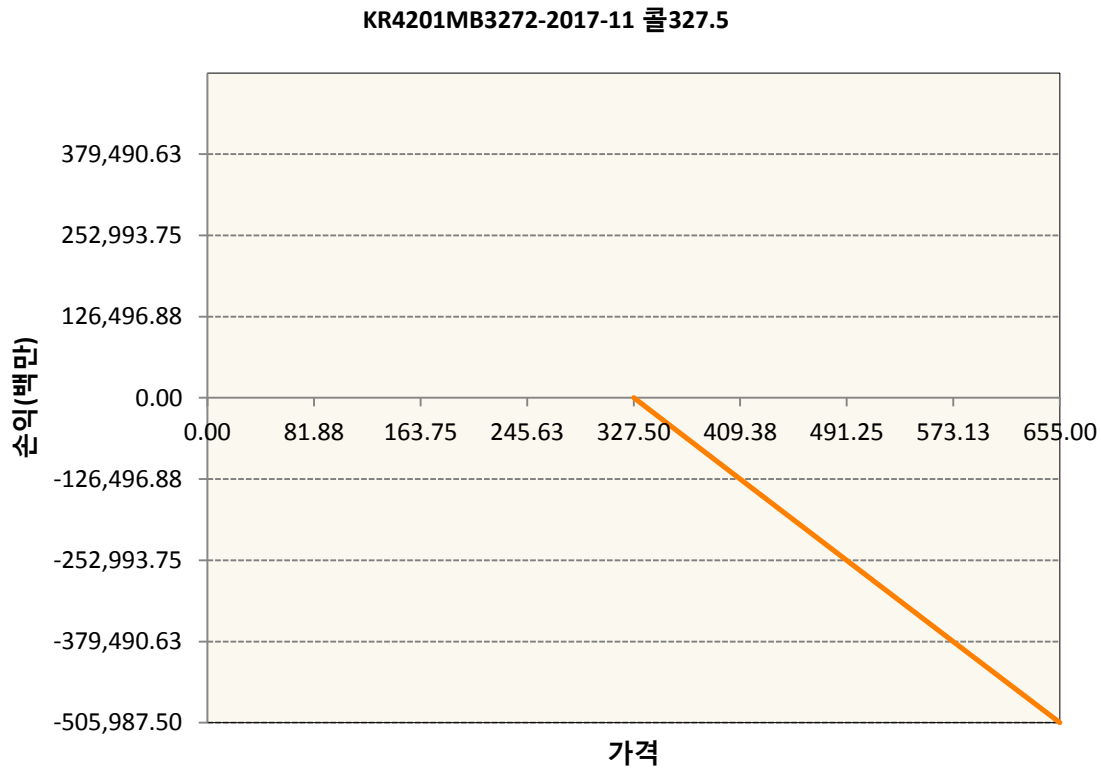
커버드콜모(주식혼합-파생형)

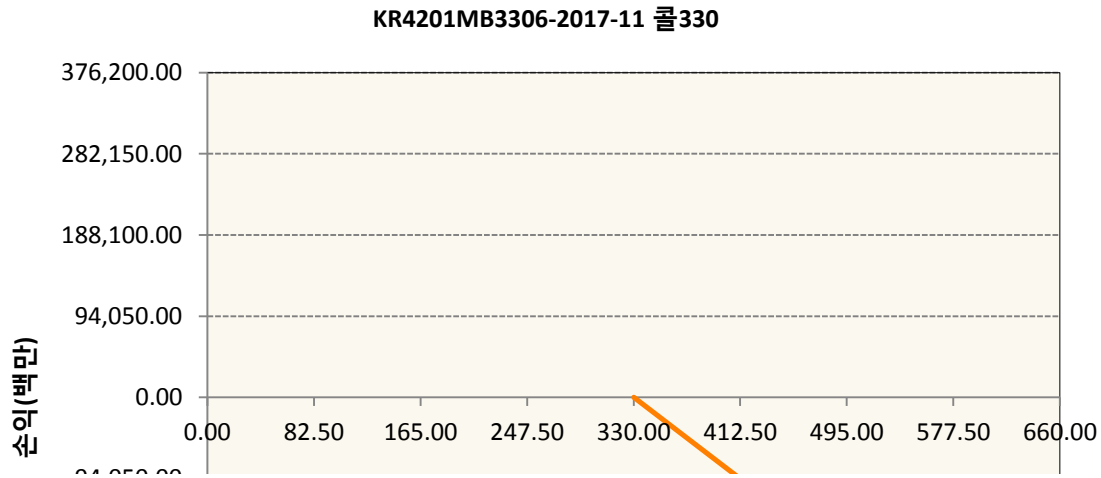
1. 계약금액

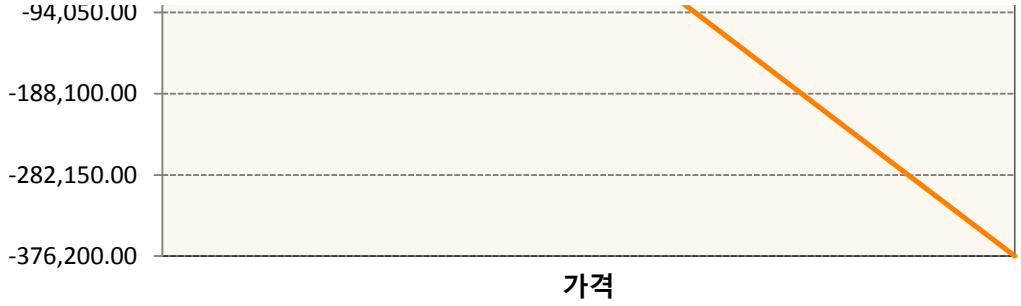
(단위:백만원)

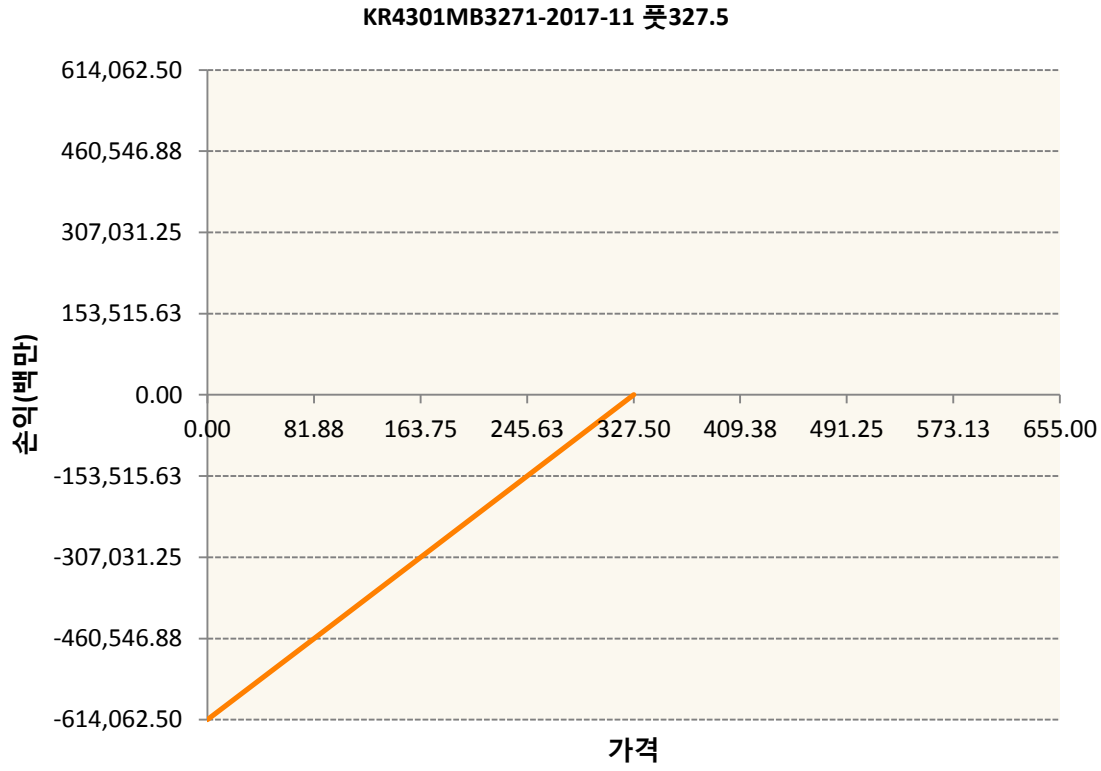
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	1,496,250	-1,496,250	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

	KR4201MB3: 2017-11 콜327.5						32,223
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	12,321	12,113	11,840	11,505	11,113	10,668	10,177
-5.33%	11,342	10,833	10,262	9,640	8,976	8,276	7,547
-2.67%	8,577	7,730	6,864	5,981	5,085	4,180	3,267
0%	2,935	1,957	979	0	-979	-1,958	-2,937
2.67%	-5,889	-6,698	-7,537	-8,400	-9,282	-10,179	-11,089
5.33%	-17,195	-17,687	-18,246	-18,863	-19,528	-20,233	-20,973
8.00%	-29,900	-30,125	-30,421	-30,784	-31,209	-31,691	-32,223
	KR4201MB3: 2017-11 콜330						22,751
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	7,786	7,672	7,514	7,312	7,067	6,783	6,464
-5.33%	7,272	6,962	6,602	6,200	5,761	5,292	4,796
-2.67%	5,681	5,113	4,521	3,909	3,283	2,645	1,997
0%	2,170	1,447	724	0	-724	-1,448	-2,173
2.67%	-3,690	-4,347	-5,018	-5,699	-6,388	-7,083	-7,783
5.33%	-11,574	-12,012	-12,493	-13,011	-13,559	-14,131	-14,724
8.00%	-20,715	-20,934	-21,207	-21,531	-21,900	-22,308	-22,751
KR4301MB3: 2017-11 풋327.5							40,930

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-40,795	-40,797	-40,803	-40,816	-40,840	-40,876	-40,930
-5.33%	-24,437	-24,495	-24,585	-24,708	-24,865	-25,055	-25,276
-2.67%	-9,011	-9,382	-9,788	-10,222	-10,679	-11,155	-11,648
0%	1,838	1,226	613	0	-614	-1,228	-1,843
2.67%	5,822	5,530	5,195	4,824	4,421	3,993	3,542
5.33%	6,425	6,380	6,308	6,205	6,069	5,899	5,697
8.00%	6,459	6,456	6,450	6,436	6,411	6,371	6,313

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

101,456

공시일	2017-10-18
기준일	2017-10-17

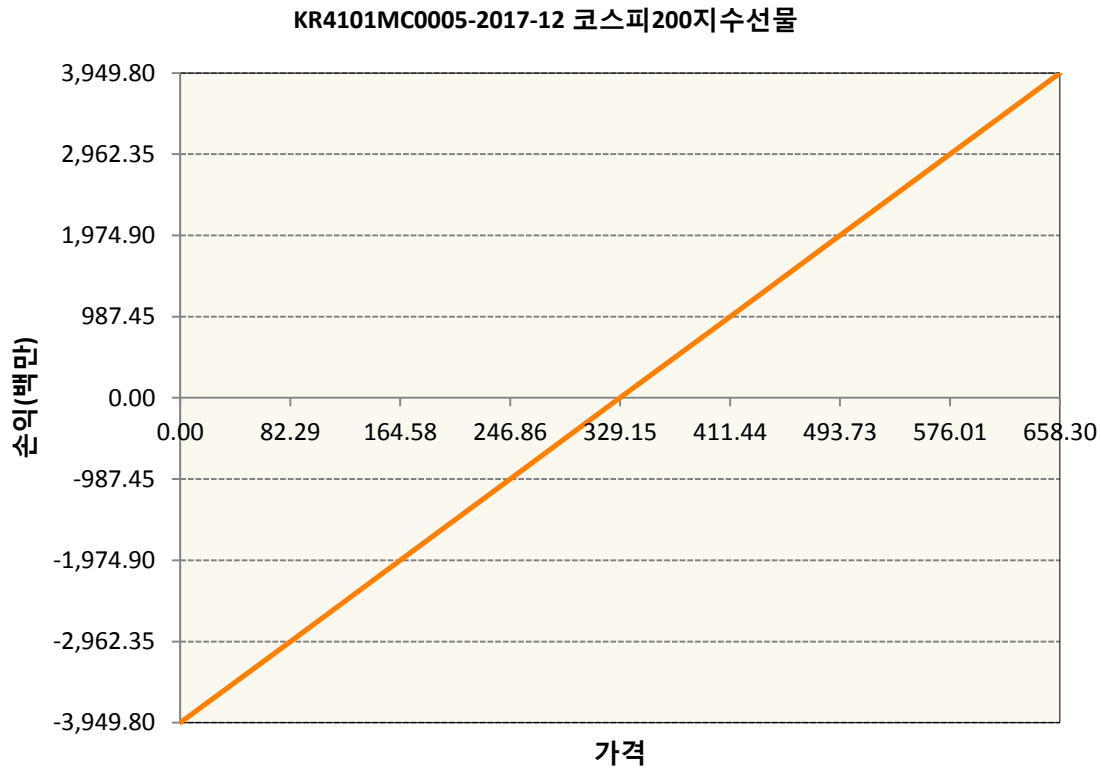
ETF스마트레버리지목표전환형7호

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	247	-247	장내
누계	유가증권	선물	3,950	0	3,950	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101MC0(2017-12 코스피200지수선물							315
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-315	-315	-315	-315	-315	-315	-315
-5.33%	-210	-210	-210	-210	-210	-210	-210
-2.67%	-105	-105	-105	-105	-105	-105	-105
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	105	105	105	105	105	105	105
5.33%	210	210	210	210	210	210	210

8.00%	315	315	315	315	315	315	315

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

190

공시일	2017-10-18
기준일	2017-10-17

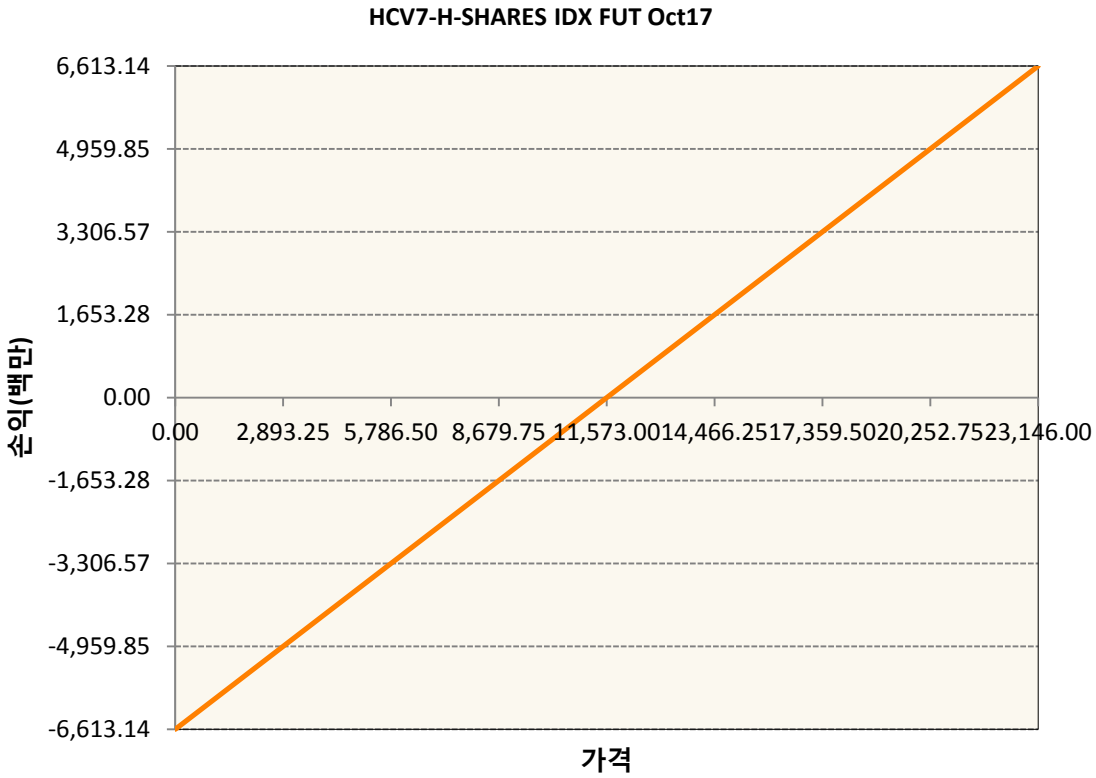
홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생

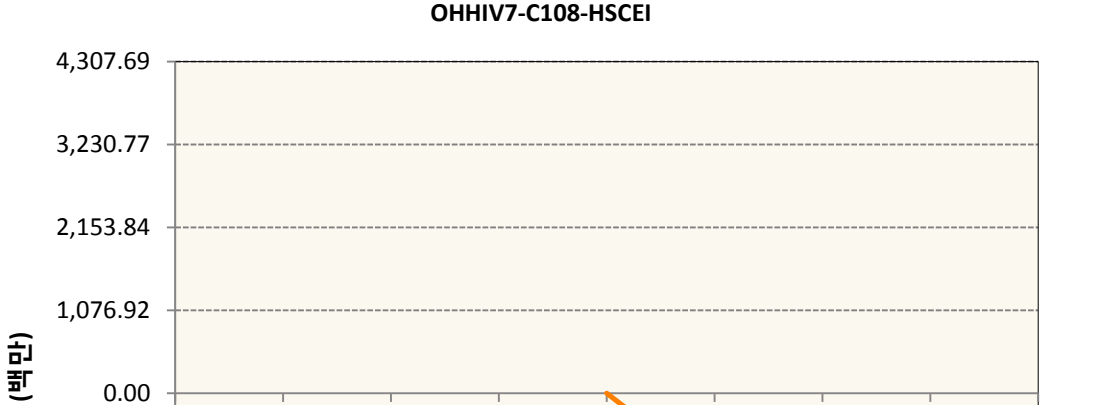
1. 계약금액

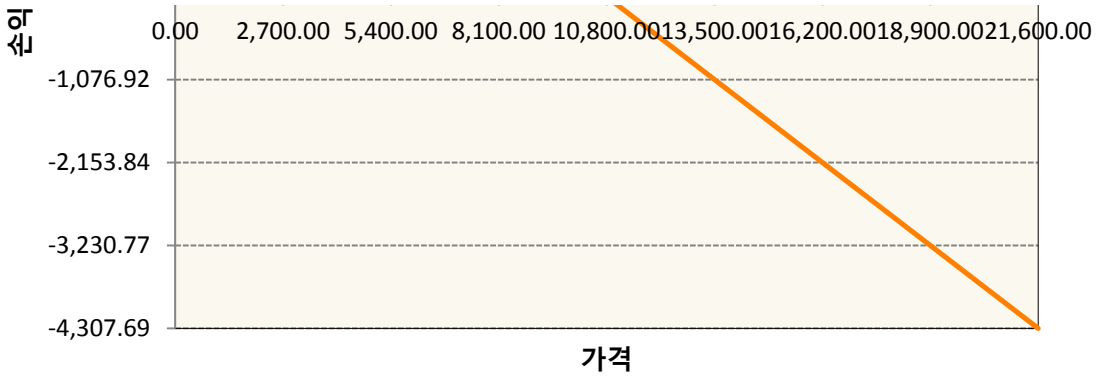
(단위:백만원)

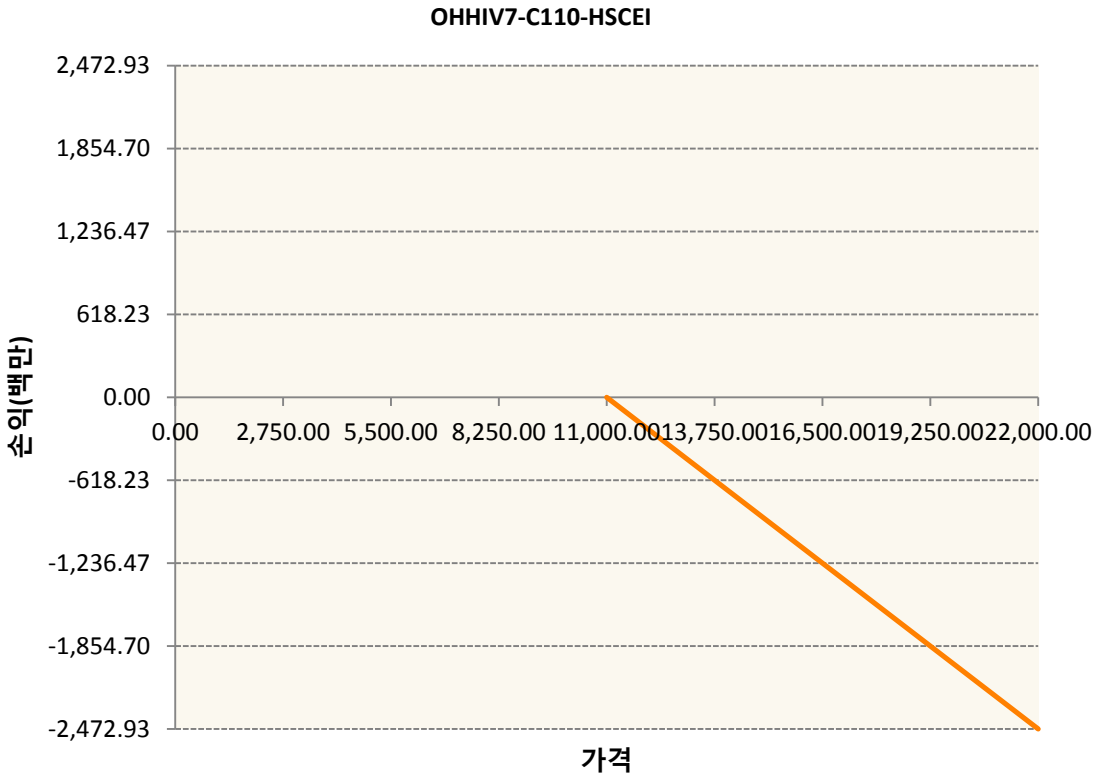
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	6,613	0	6,613	장내
누계	유가증권	옵션	0	13,561	-13,561	장내

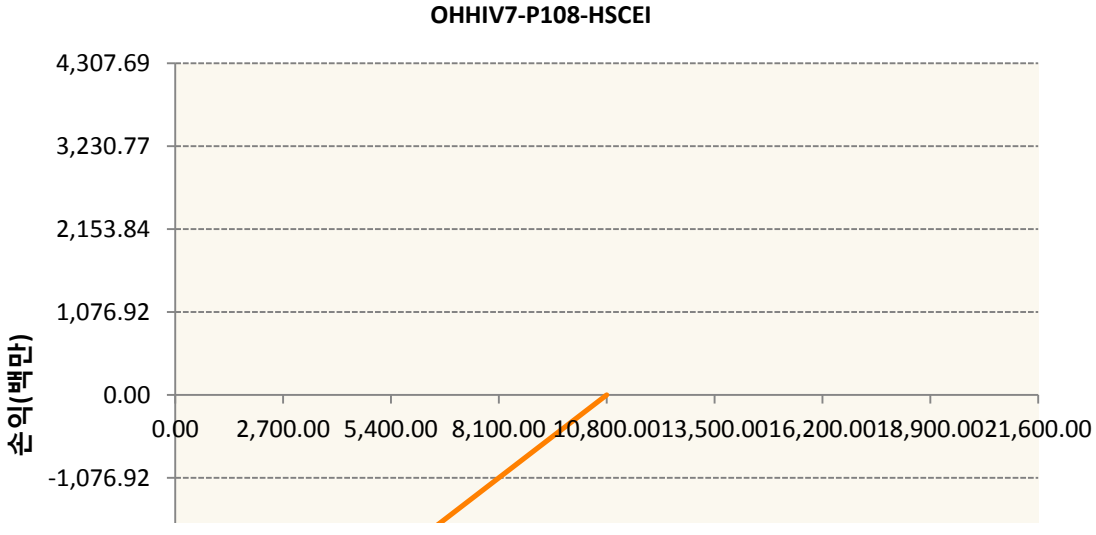
2. 만기시점의 손익구조

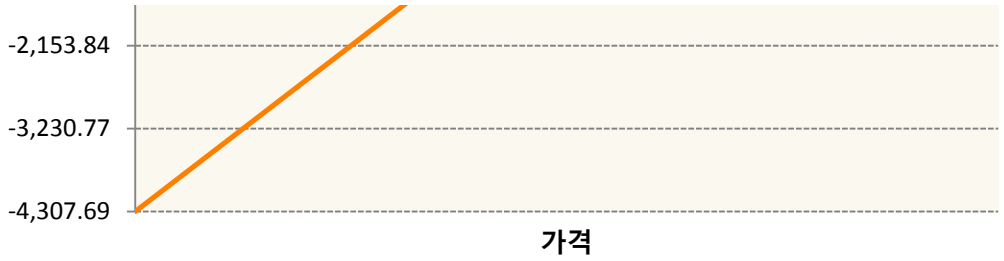


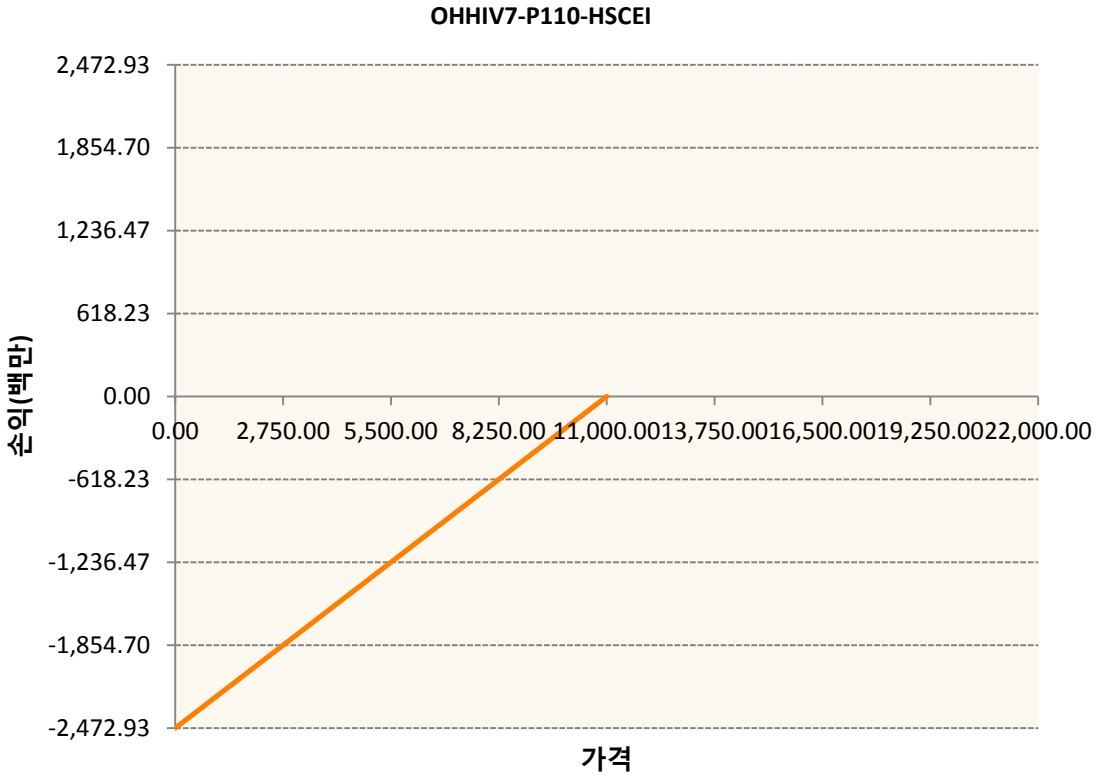



손익
0.00
2,700.00
5,400.00
8,100.00
10,800.00
13,500.00
16,200.00
18,900.00
21,600.00
-1,076.92
-2,153.84
-3,230.77
-4,307.69
가격


OHHIV7-C110-HSCEI
2,472.93
1,854.70
1,236.47
618.23
0.00
-618.23
-1,236.47
-1,854.70
-2,472.93
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
4,307.69
3,230.77
2,153.84
1,076.92
0.00
-1,076.92
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	529
OHHIV7-C10	HSCEI	345
OHHIV7-C11	HSCEI	198
OHHIV7-P10	HSCEI	345
OHHIV7-P11	HSCEI	198

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

1,316

공시일	2017-10-18
기준일	2017-10-17

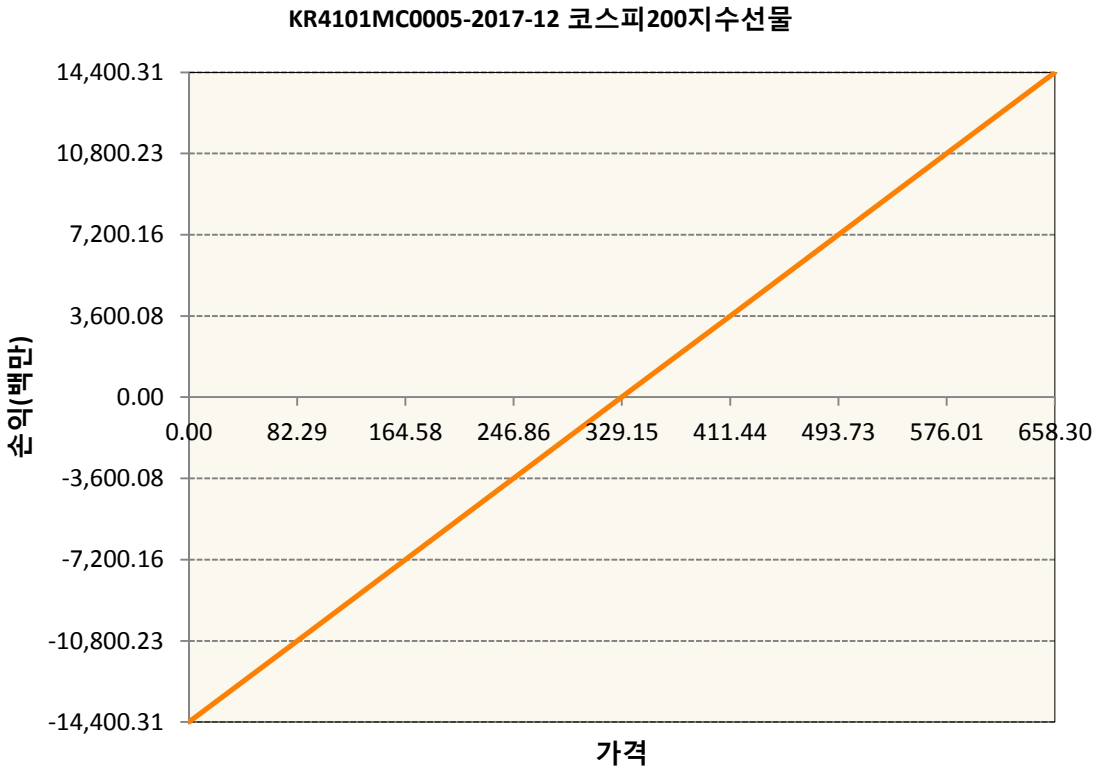
코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼

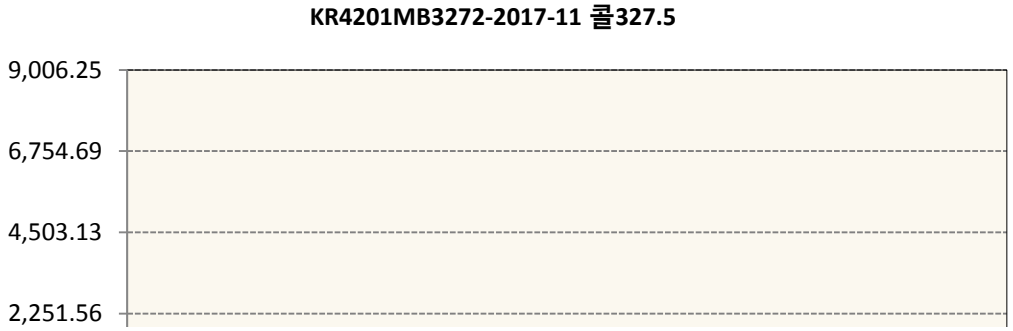
1. 계약금액

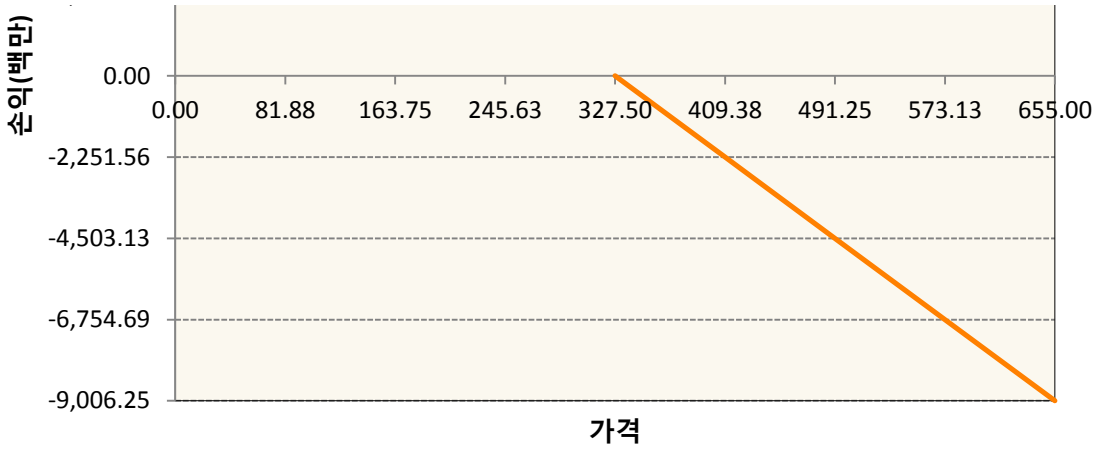
(단위:백만원)

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	2,477	-2,477	장내
누계	유가증권	선물	14,400	0	14,400	장내
누계	유가증권	스왑	29,500	0	29,500	장외
누계	유가증권	옵션	0	31,584	-31,584	장내

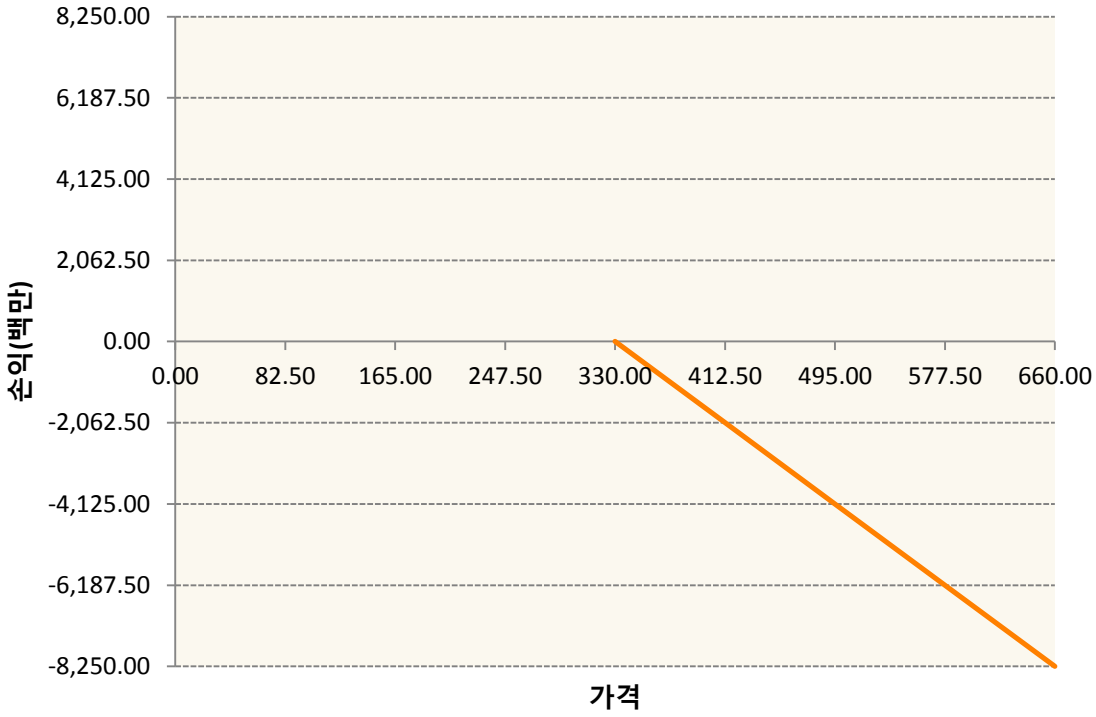
2. 만기시점의 손익구조



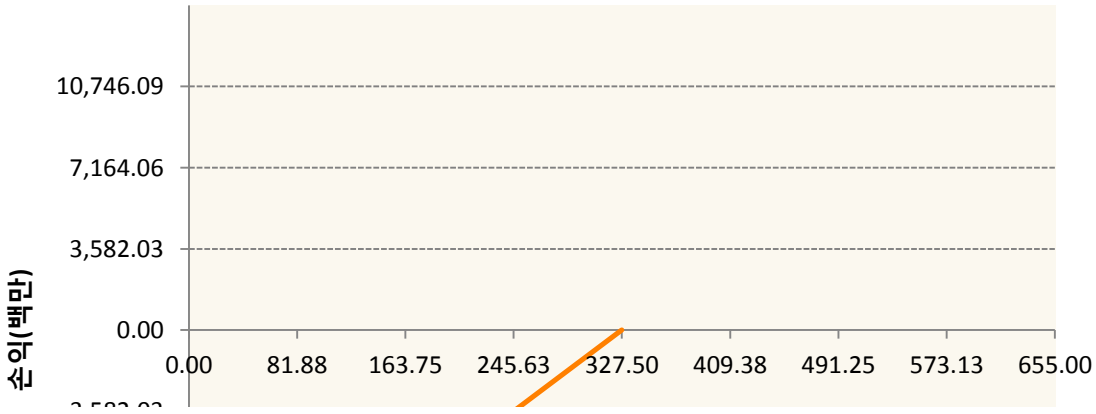




KR4201MB3306-2017-11 콜330



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%	-1,000	-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%	1,501	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				1,150
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,150	-1,150	-1,150	-1,150	-1,150	-1,150	-1,150
-5.33%	-767	-767	-767	-767	-767	-767	-767
-2.67%	-383	-383	-383	-383	-383	-383	-383
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	383	383	383	383	383	383	383
5.33%	767	767	767	767	767	767	767
8.00%	1,150	1,150	1,150	1,150	1,150	1,150	1,150
	KR4201MB3(	2017-11	콜327.5				574
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	219	216	211	205	198	190	181
-5.33%	202	193	183	172	160	147	134
-2.67%	153	138	122	106	91	74	58
0%	52	35	17	0	-17	-35	-52
2.67%	-105	-119	-134	-150	-165	-181	-197
5.33%	-306	-315	-325	-336	-348	-360	-373
8.00%	-532	-536	-541	-548	-555	-564	-574
	KR4201MB3(	2017-11	콜330				499
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	171	168	165	160	155	149	142
-5.33%	159	153	145	136	126	116	105

-2.67%	125	112	99	86	72	58	44
0%	48	32	16	0	-16	-32	-48
2.67%	-81	-95	-110	-125	-140	-155	-171
5.33%	-254	-263	-274	-285	-297	-310	-323
8.00%	-454	-459	-465	-472	-480	-489	-499
	KR4301MB3	2017-11	풋327.5				955
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-952	-952	-952	-952	-953	-954	-955
-5.33%	-570	-572	-574	-577	-580	-585	-590
-2.67%	-210	-219	-228	-239	-249	-260	-272
0%	43	29	14	0	-14	-29	-43
2.67%	136	129	121	113	103	93	83
5.33%	150	149	147	145	142	138	133
8.00%	151	151	150	150	150	149	147

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

5,244

공시일	2017-10-18
기준일	2017-10-17

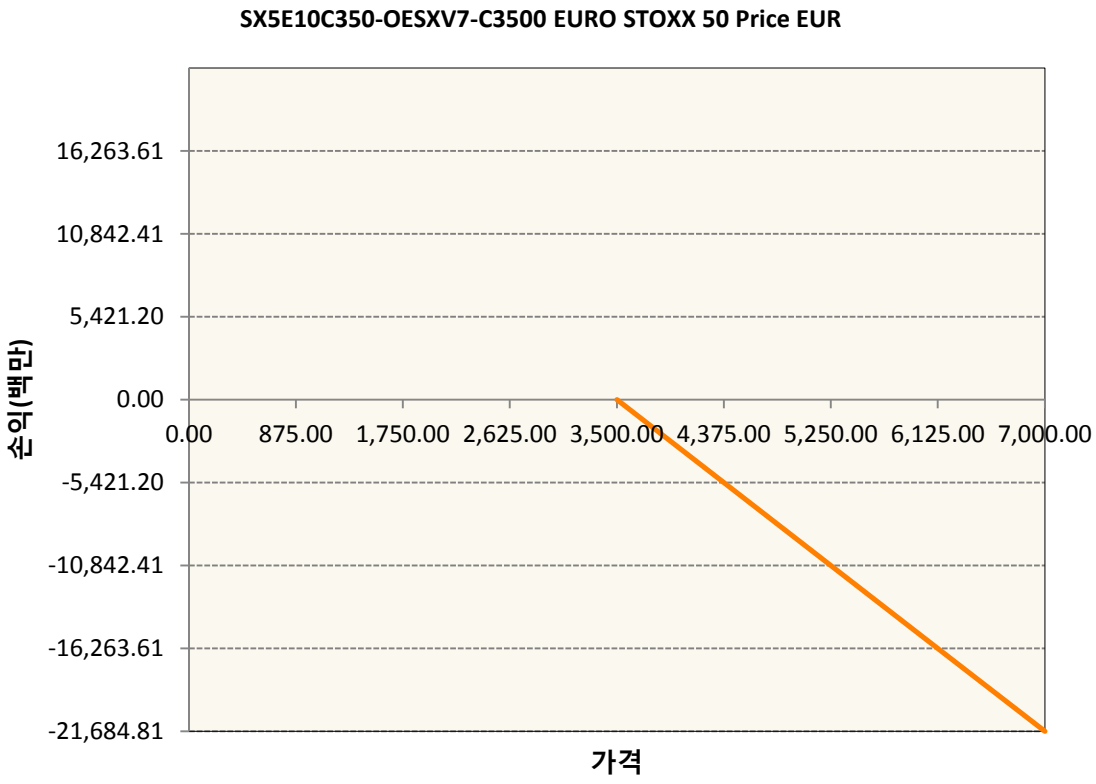
유로커버드콜모(주식혼합-파생형

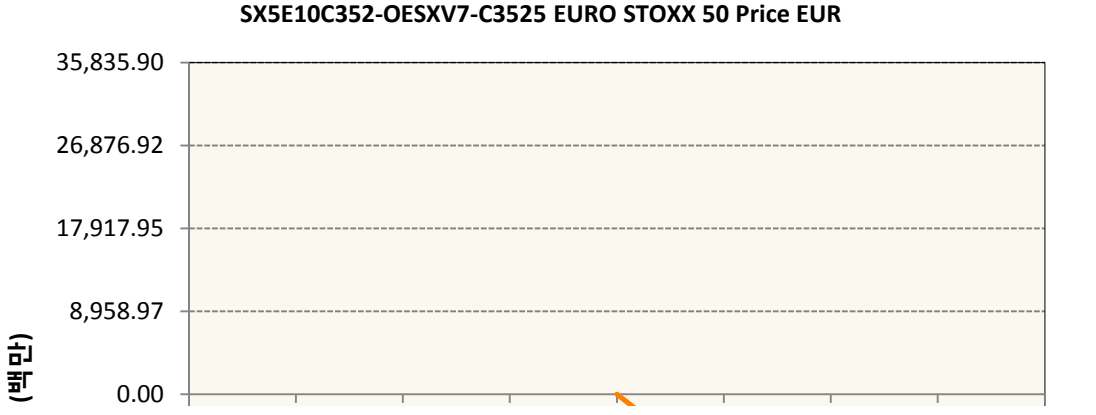
1. 계약금액

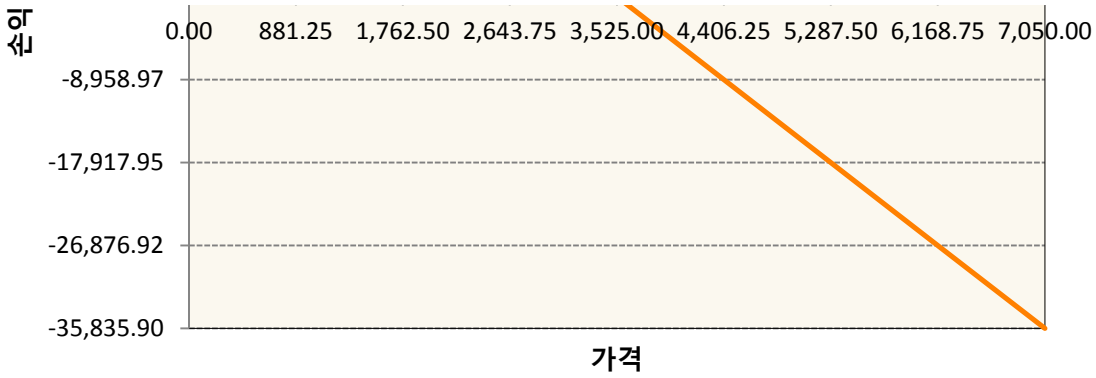
(단위:백만원)

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	55,198	0	55,198	
누계	유가증권	옵션	0	115,041	-115,041	장외

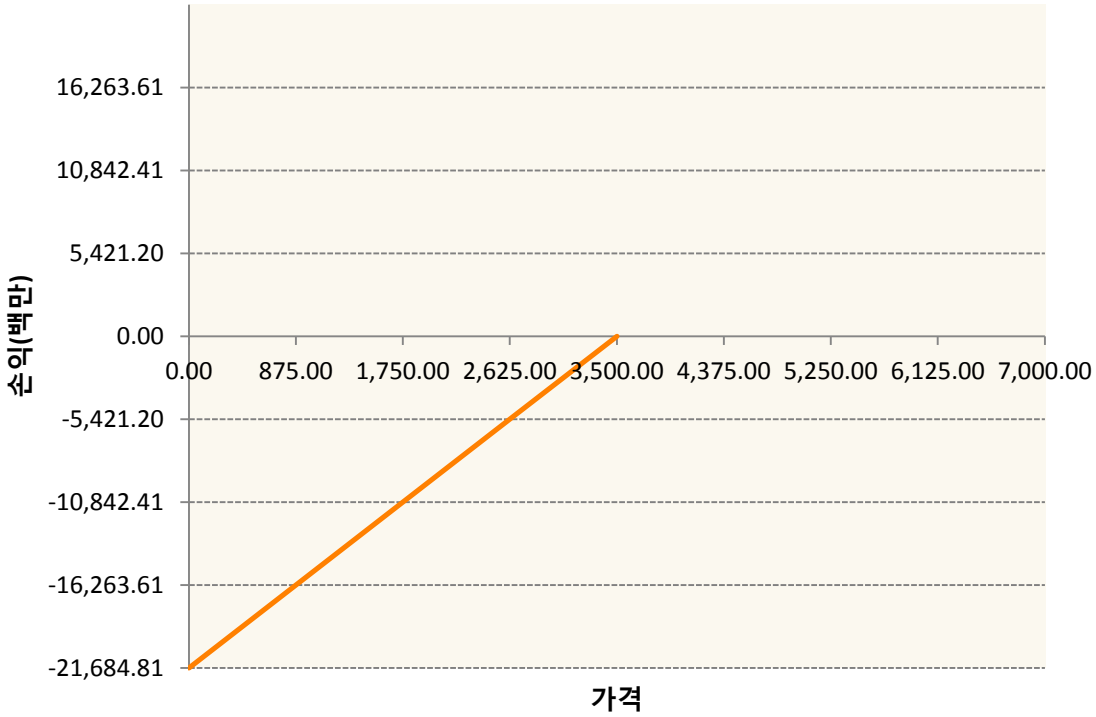
2. 만기시점의 손익구조



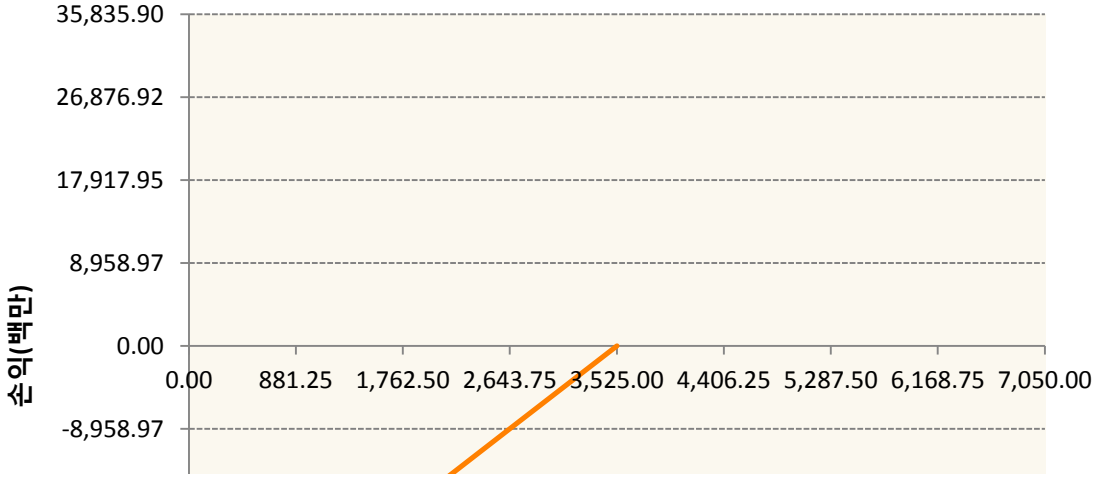


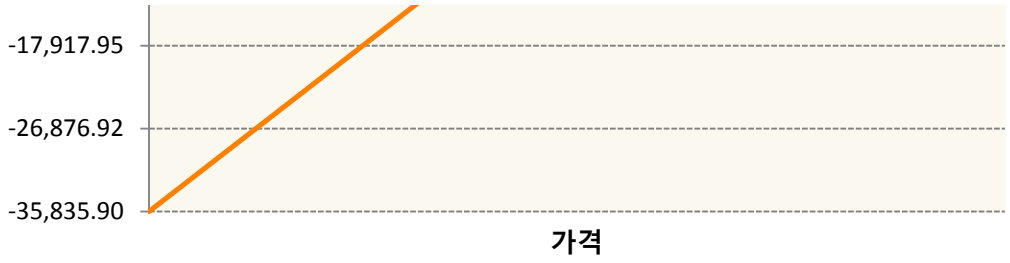


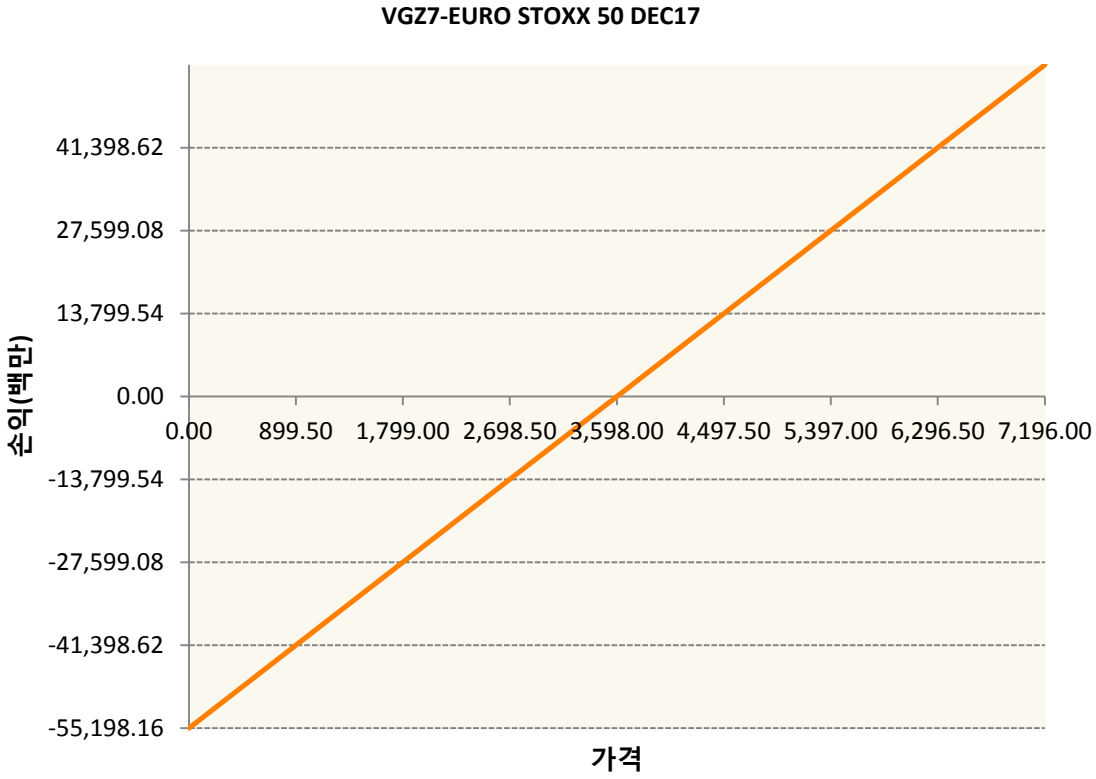
SX5E10P350-OESXV7-P3500 EURO STOXX 50 Price EUR



SX5E10P352-OESXV7-P3525 EURO STOXX 50 Price EUR







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

SX5E10C350 OESXV7-C3500 EURO STOXX 50 Price EUR	1,735
SX5E10C352 OESXV7-C3525 EURO STOXX 50 Price EUR	2,867
SX5E10P350 OESXV7-P3500 EURO STOXX 50 Price EUR	1,735
SX5E10P352 OESXV7-P3525 EURO STOXX 50 Price EUR	2,867
VGZ7 EURO STOXX 50 DEC17	4,416

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

10,326

공시일	2017-10-18
기준일	2017-10-17

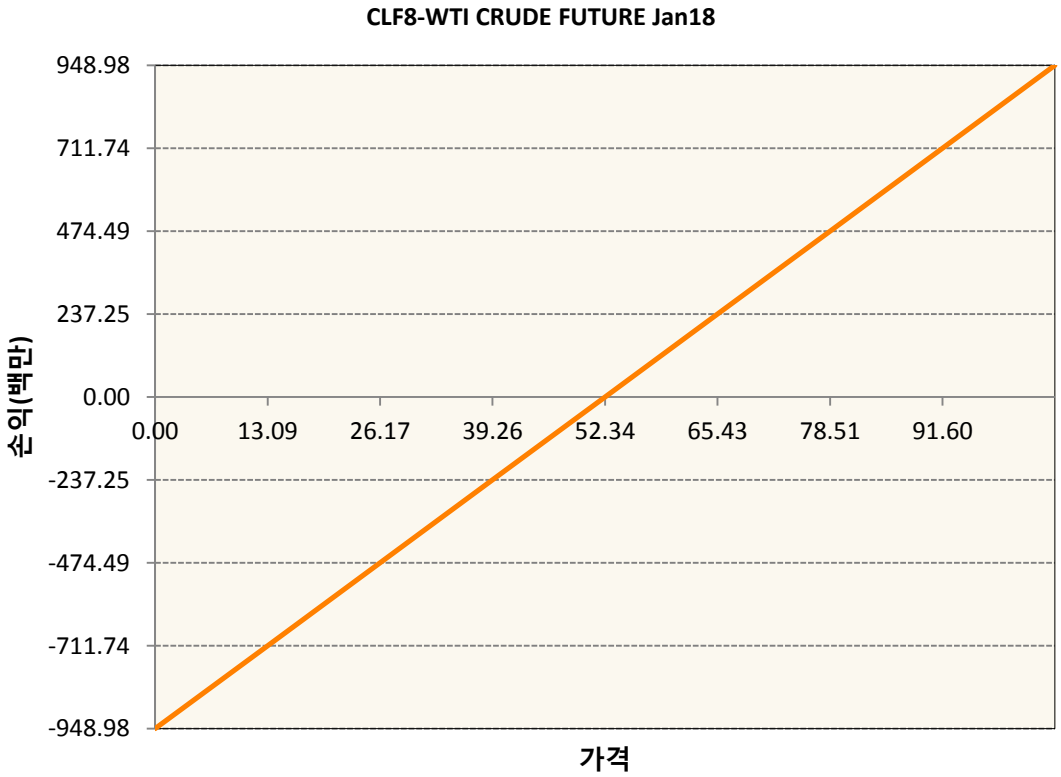
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

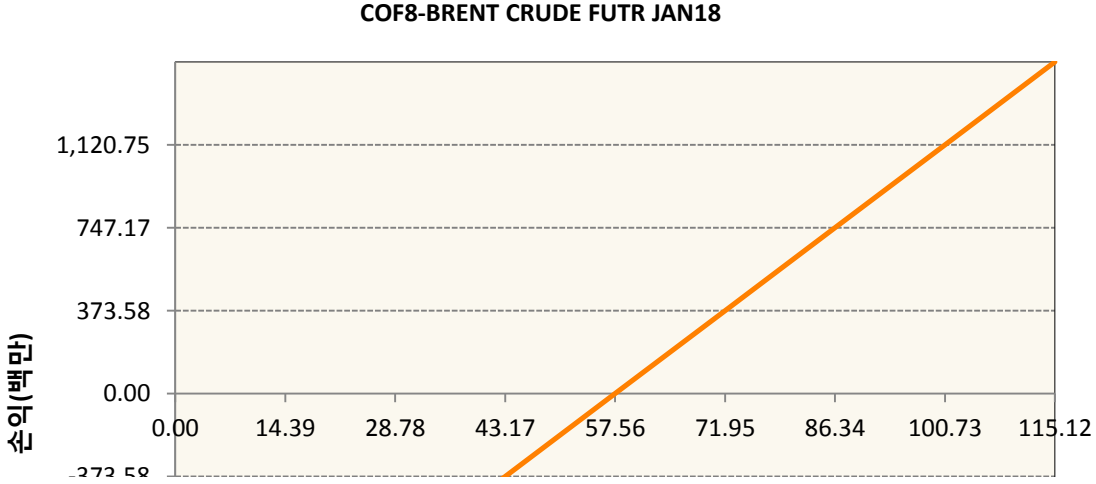
1. 계약금액

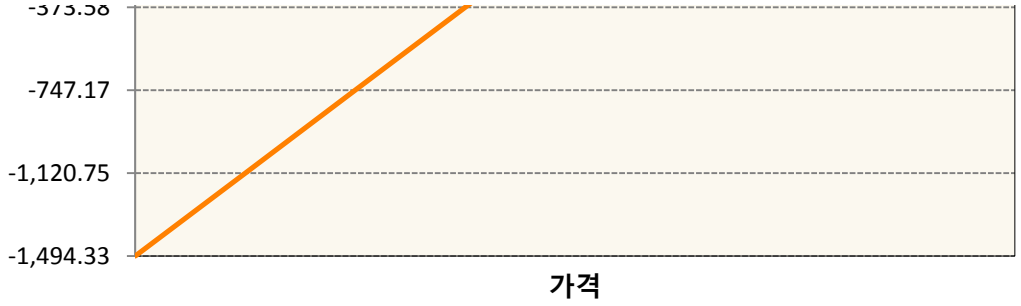
(단위:백만원)

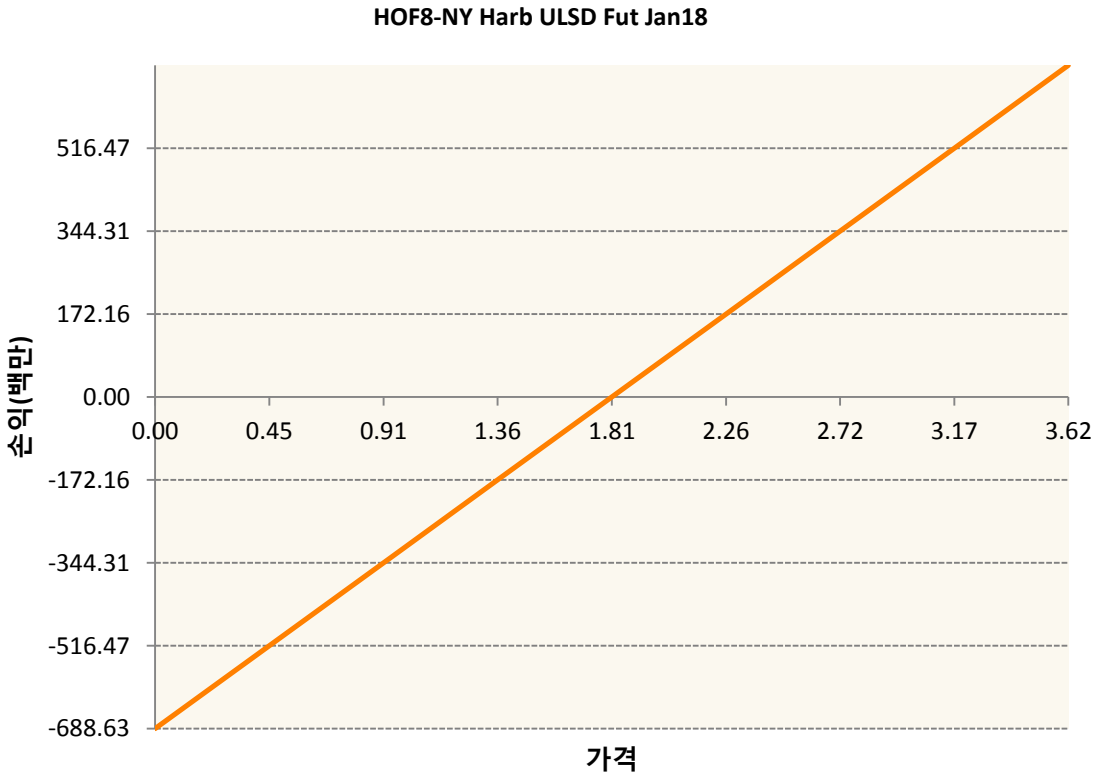
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	5,276	905	4,371	

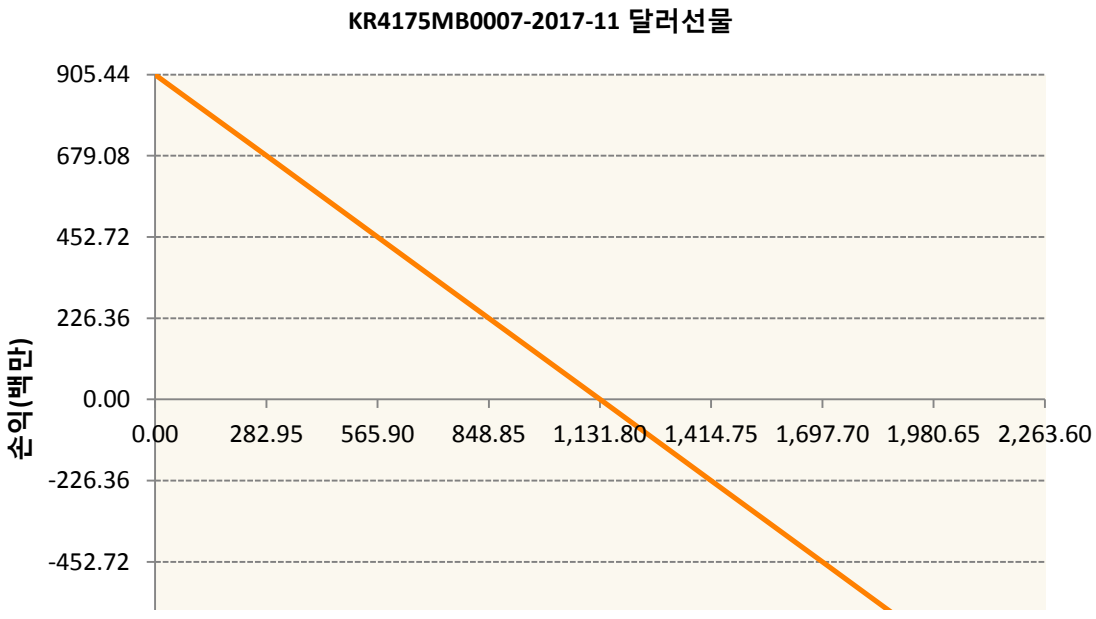
2. 만기시점의 손익구조

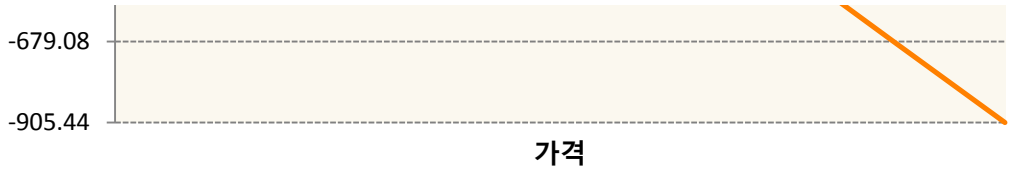


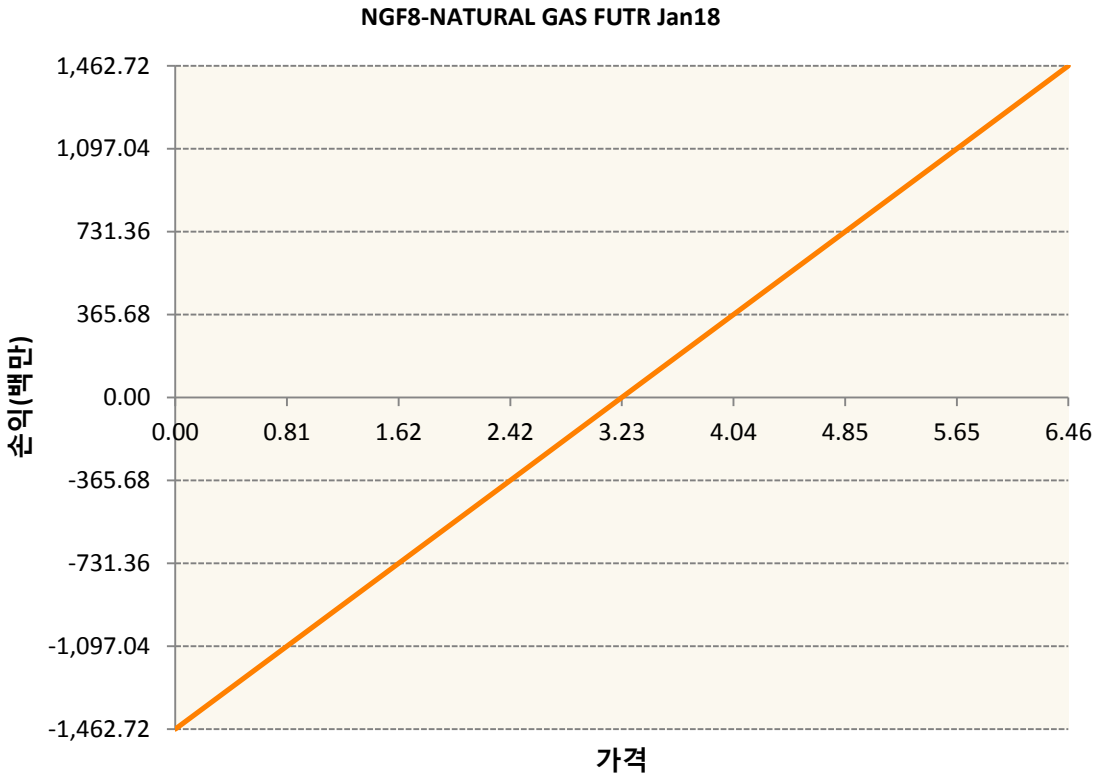


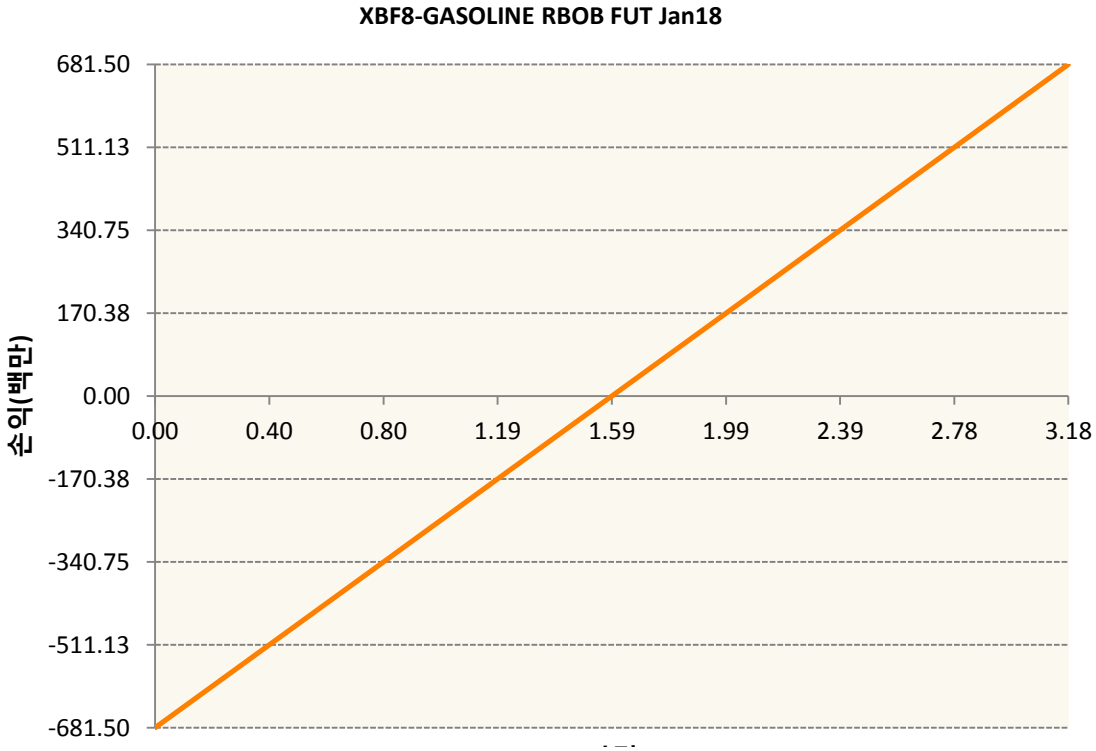

-747.17
-1,120.75
-1,494.33
가격


HOF8-NY Harb ULSD Fut Jan18
516.47
344.31
172.16
0.00
-172.16
-344.31
-516.47
-688.63
0.00
0.45
0.91
1.36
1.81
2.26
2.72
3.17
3.62
손익(백만)
가격


KR4175MB0007-2017-11 달러선물
905.44
679.08
452.72
226.36
0.00
-226.36
-452.72
0.00
282.95
565.90
848.85
1,131.80
1,414.75
1,697.70
1,980.65
2,263.60
손익(백만)


-679.08
-905.44
가격


NGF8-NATURAL GAS FUTR Jan18
1,462.72
1,097.04
731.36
365.68
0.00
-365.68
-731.36
-1,097.04
-1,462.72
0.00
0.81
1.62
2.42
3.23
4.04
4.85
5.65
6.46
손익(백만)
가격


XBF8-GASOLINE RBOB FUT Jan18
681.50
511.13
340.75
170.38
0.00
-170.38
-340.75
-511.13
-681.50
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	76
COF8	BRENT CRUDE FUTR JAN18	120
HOF8	NY Harb ULSD Fut Jan18	55
KR4175MB0(	2017-11 달러선물	72
NGF8	NATURAL GAS FUTR Jan18	117
XBF8	GASOLINE RBOB FUT Jan18	55

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

756

공시일	2017-10-18
기준일	2017-10-17

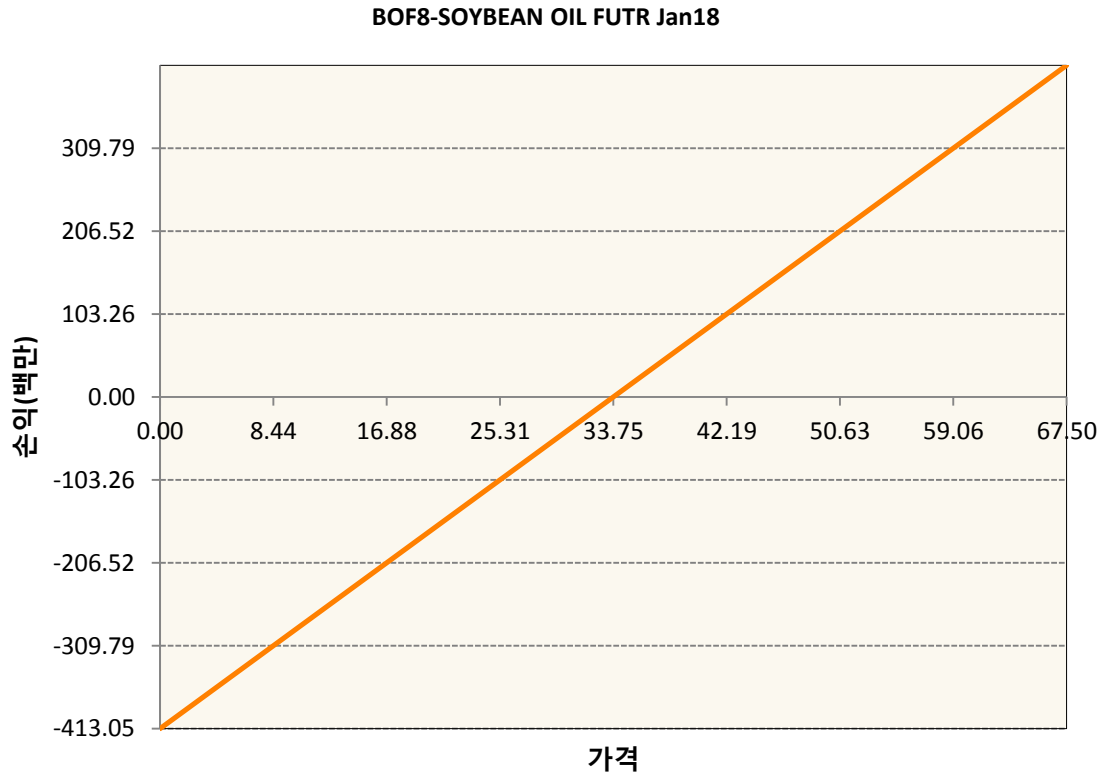
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

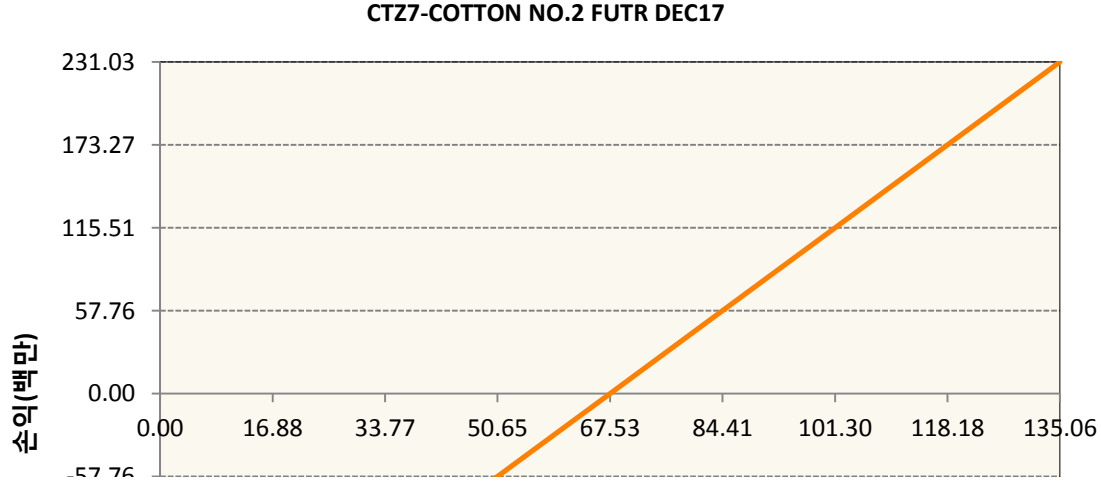
1. 계약금액

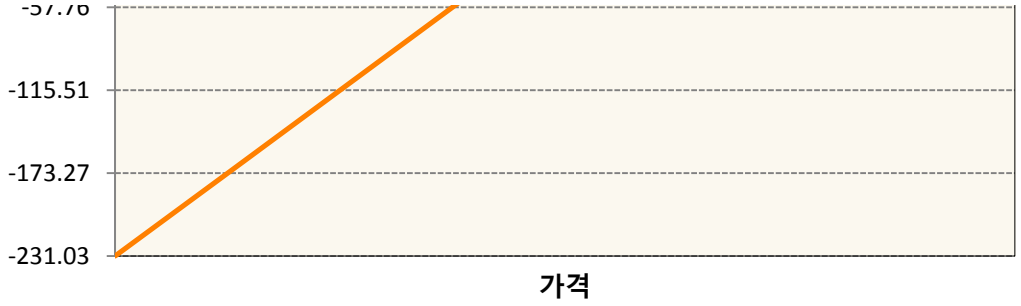
(단위:백만원)

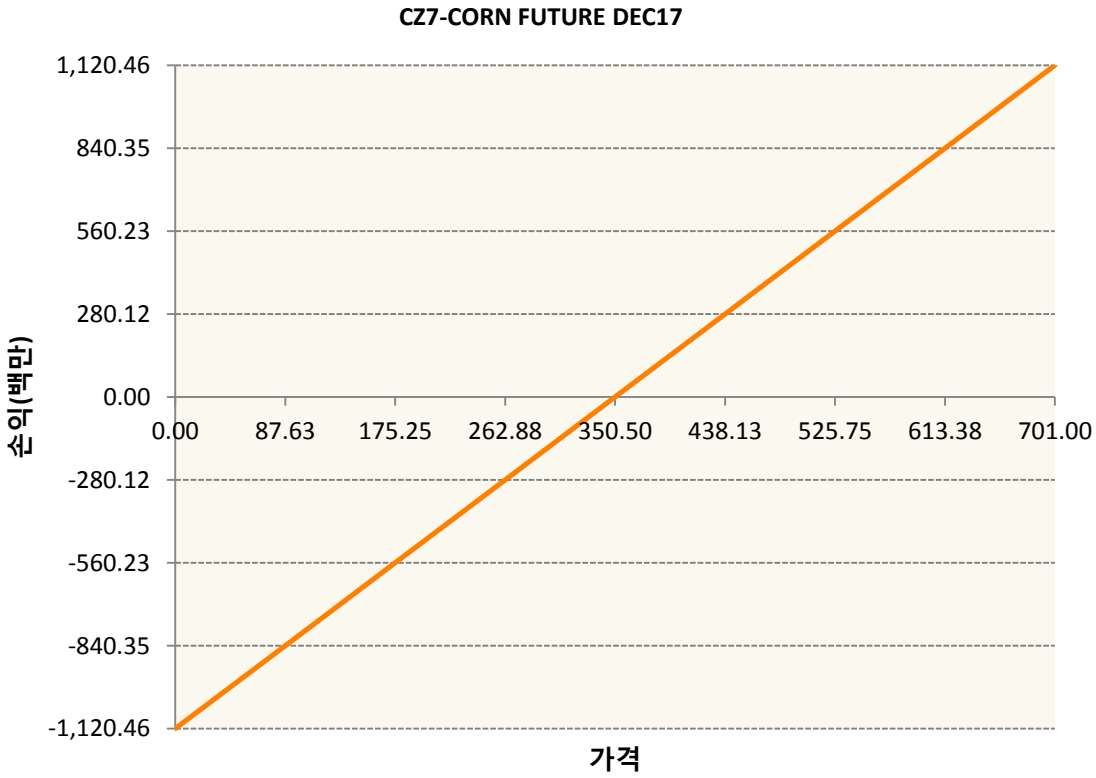
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	4,576	340	4,237	

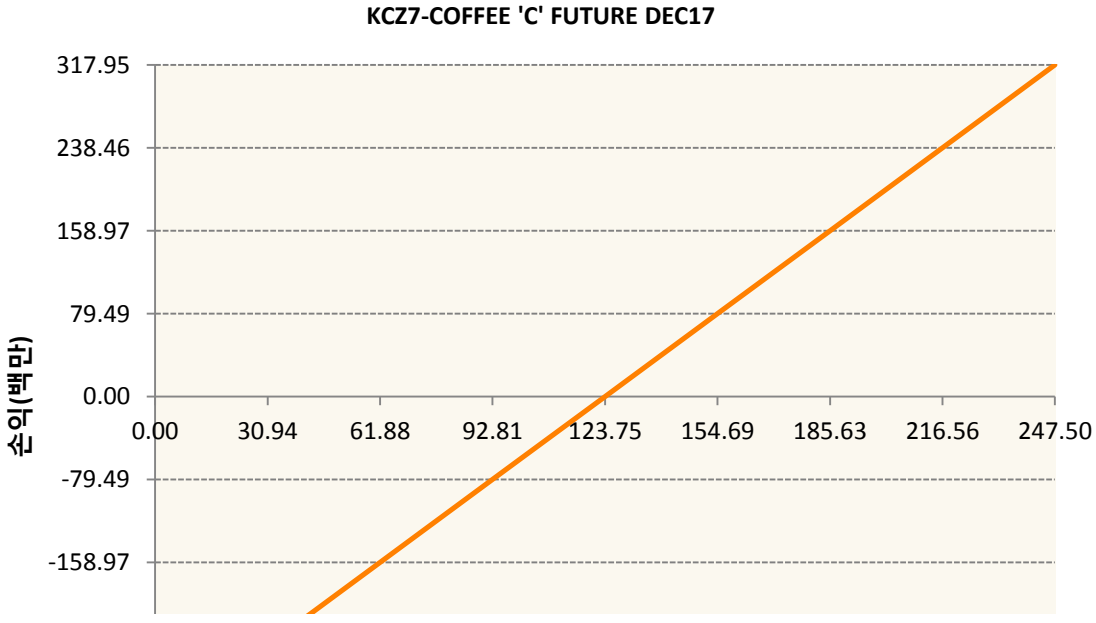
2. 만기시점의 손익구조

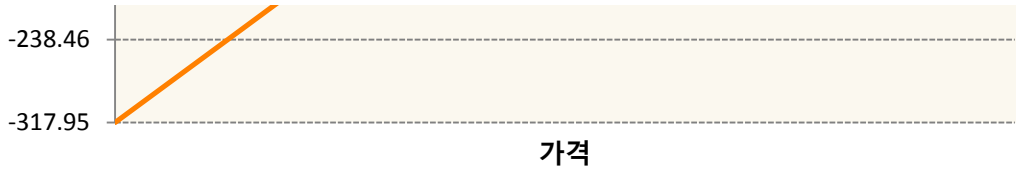


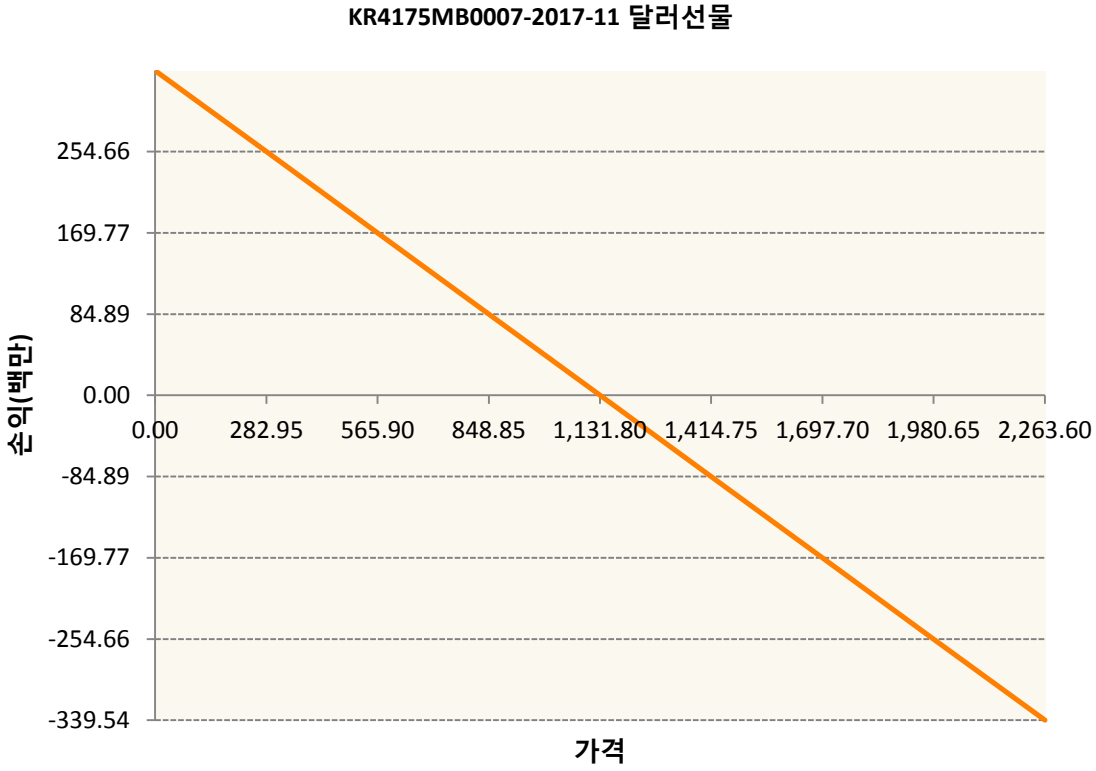


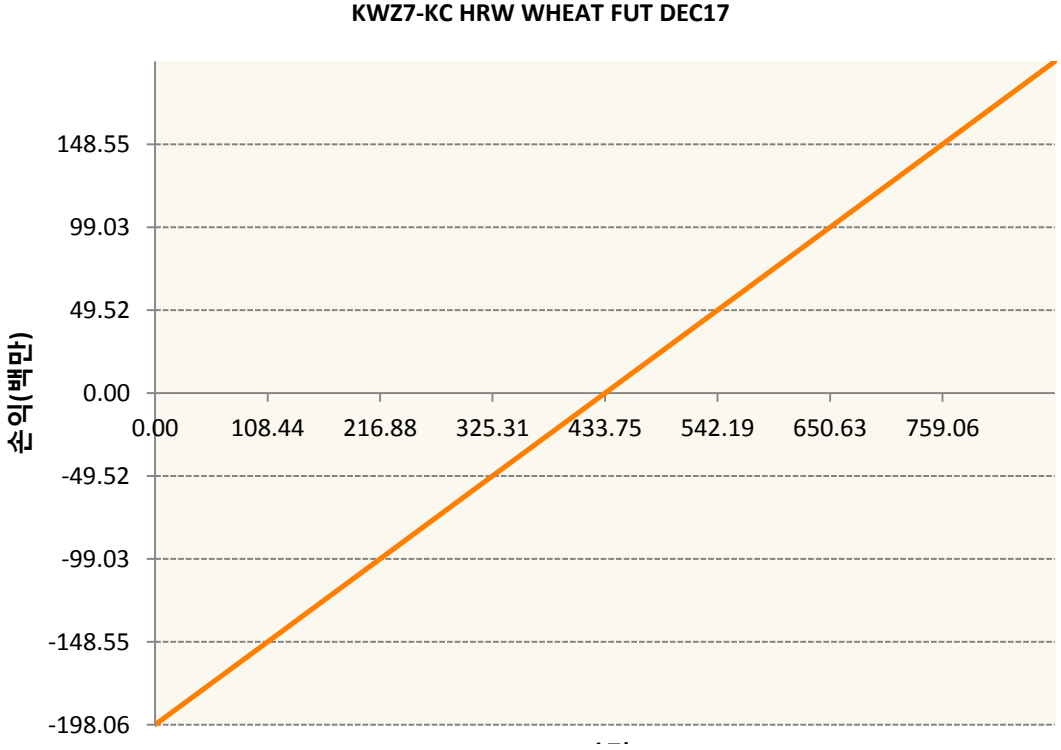

-115.51
-173.27
-231.03
가격


CZ7-CORN FUTURE DEC17
1,120.46
840.35
560.23
280.12
0.00
0.00
87.63
175.25
262.88
350.50
438.13
525.75
613.38
701.00
-280.12
-560.23
-840.35
-1,120.46
손익(백만)
가격

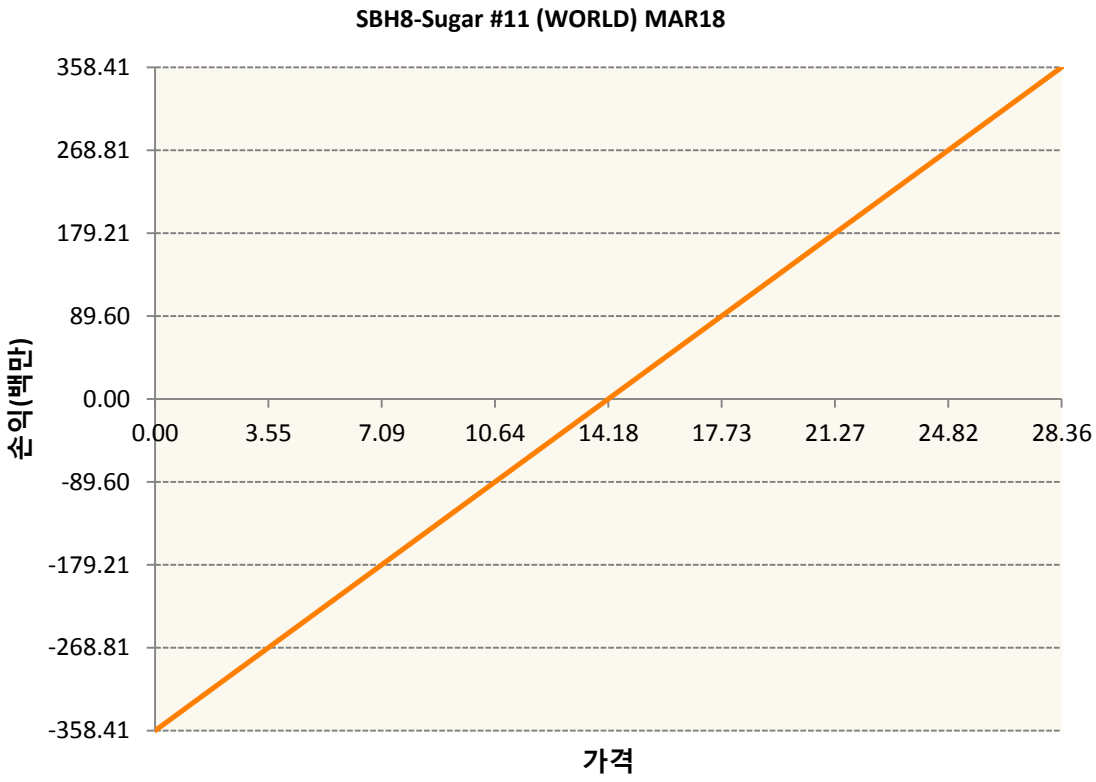

KCZ7-COFFEE 'C' FUTURE DEC17
317.95
238.46
158.97
79.49
0.00
0.00
30.94
61.88
92.81
123.75
154.69
185.63
216.56
247.50
-79.49
-158.97
손익(백만)

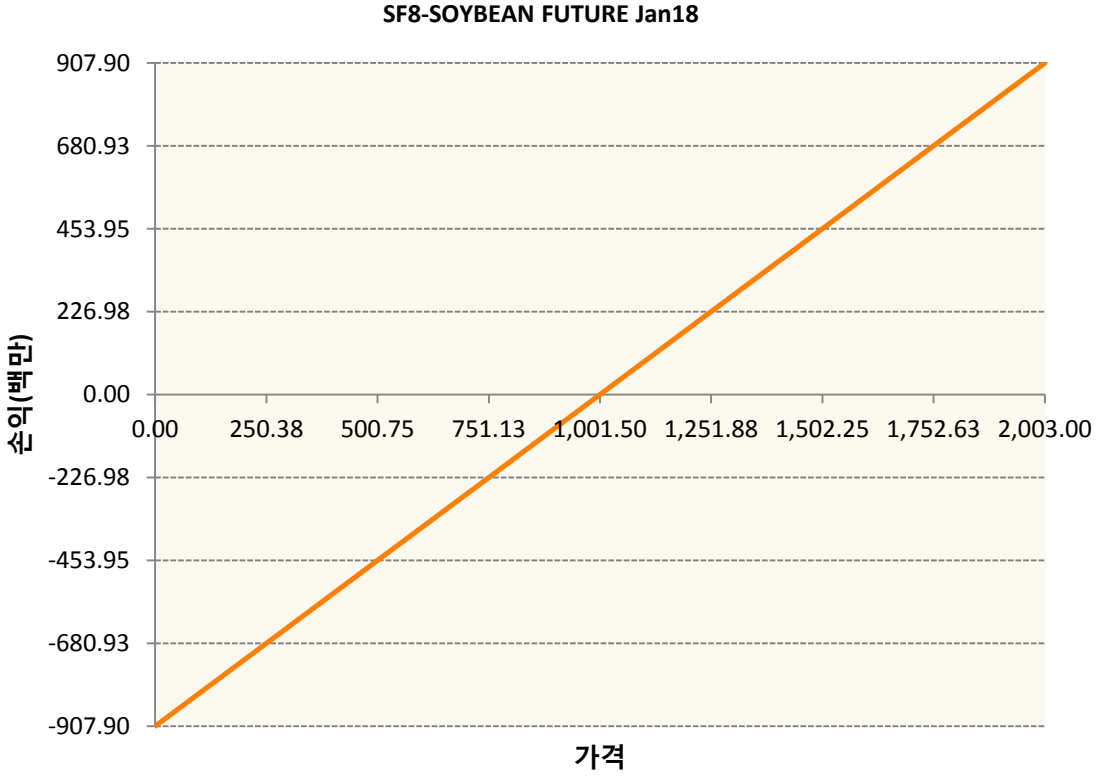

-238.46
-317.95
가격

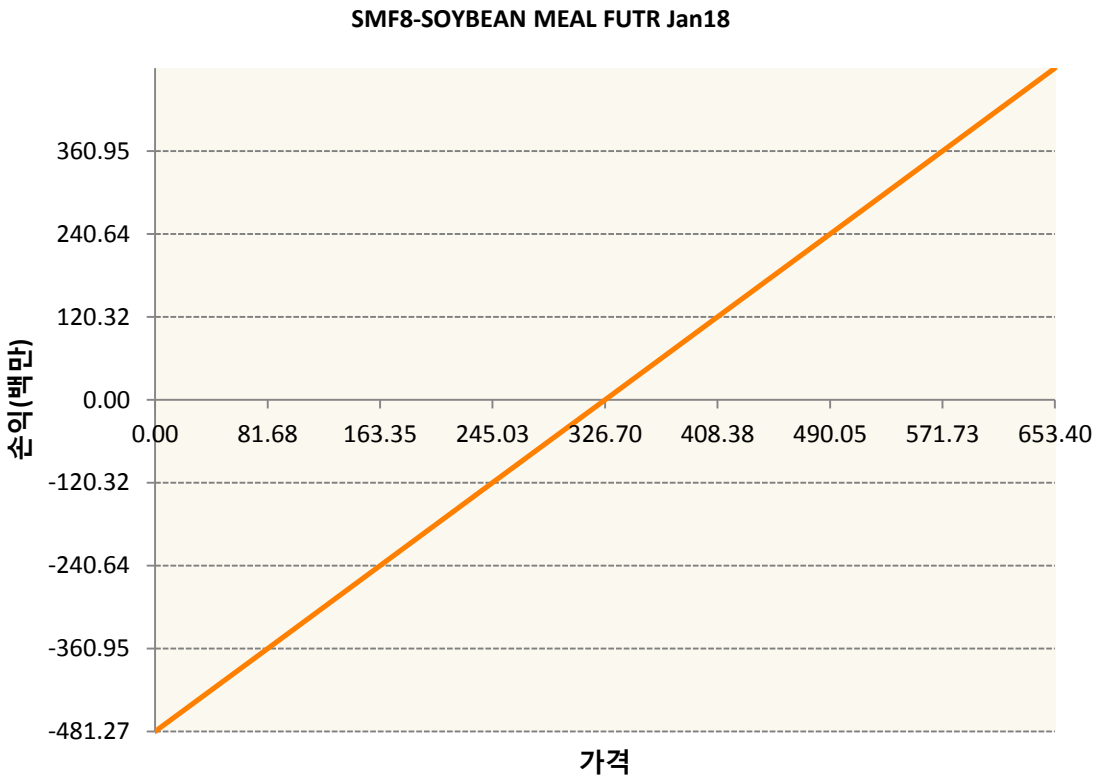

KR4175MB0007-2017-11 달러선물
254.66
169.77
84.89
0.00
-84.89
-169.77
-254.66
-339.54
0.00
282.95
565.90
848.85
1,131.80
1,414.75
1,697.70
1,980.65
2,263.60
손익(백만)
가격

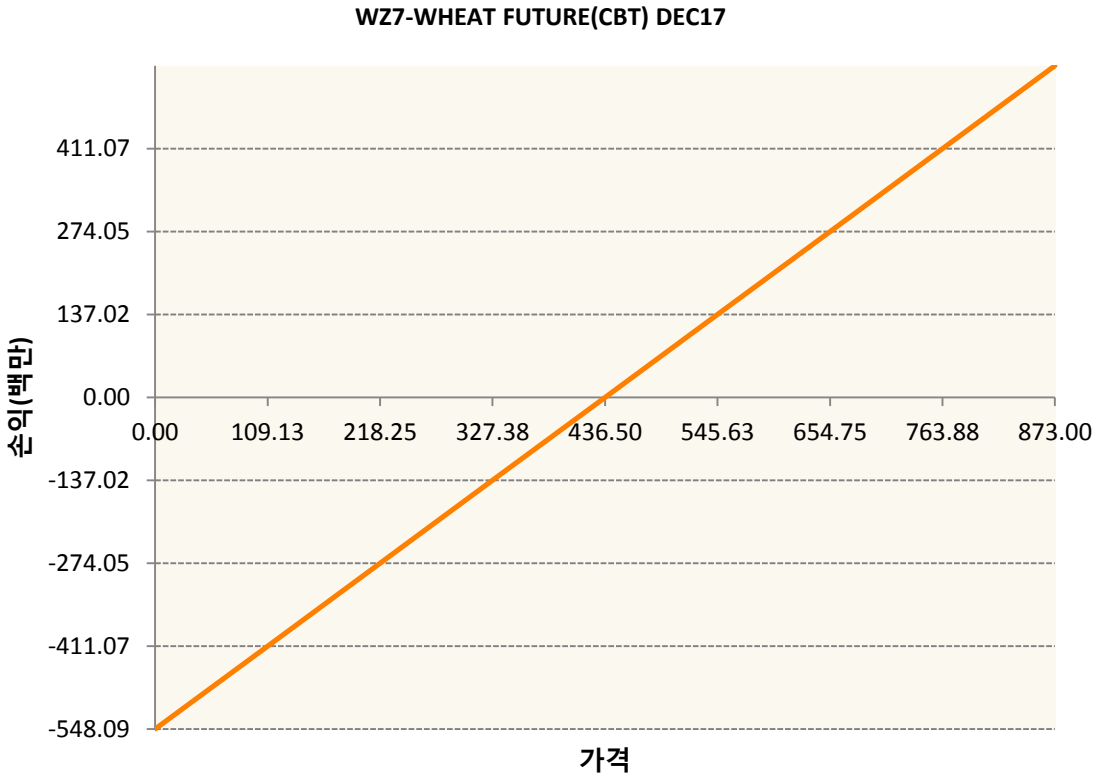

KWZ7-KC HRW WHEAT FUT DEC17
148.55
99.03
49.52
0.00
-49.52
-99.03
-148.55
-198.06
0.00
108.44
216.88
325.31
433.75
542.19
650.63
759.06
손익(백만)

가격


SBH8-Sugar #11 (WORLD) MAR18
358.41
268.81
179.21
89.60
0.00
-89.60
-179.21
-268.81
-358.41
손익(백만)
0.00
3.55
7.09
10.64
14.18
17.73
21.27
24.82
28.36
가격


SF8-SOYBEAN FUTURE Jan18
907.90
680.93
453.95
226.98
0.00
-226.98
-453.95
-680.93
-907.90
손익(백만)
0.00
250.38
500.75
751.13
1,001.50
1,251.88
1,502.25
1,752.63
2,003.00
가격





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

CTZ7	COTTON NO.2 FUTR DEC17	18
CZ7	CORN FUTURE DEC17	90
KCZ7	COFFEE 'C' FUTURE DEC17	25
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)

421