공시일	2017-10-19
기준일	2017-10-18

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	2017-10-19
기준일	2017-10-18

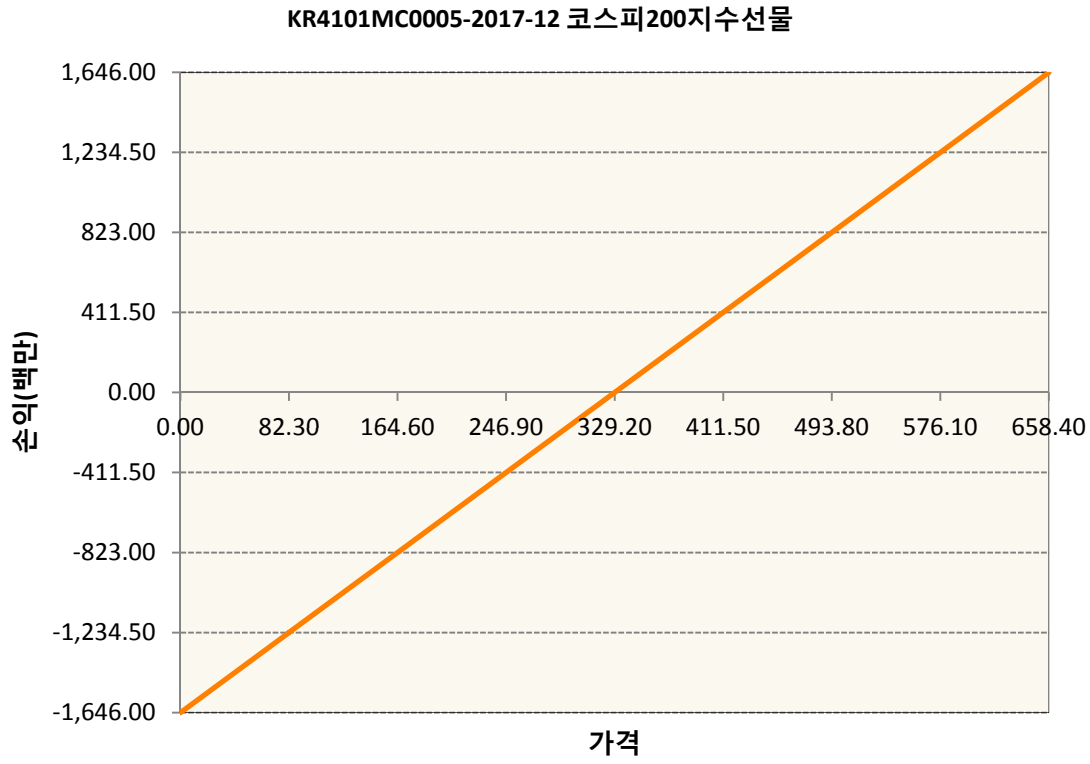
스마트인덱스모

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	2017-10-19
기준일	2017-10-18

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)

SWMXWO0(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	2017-10-19
기준일	2017-10-18

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	418

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

364

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-10-19
기준일	2017-10-18

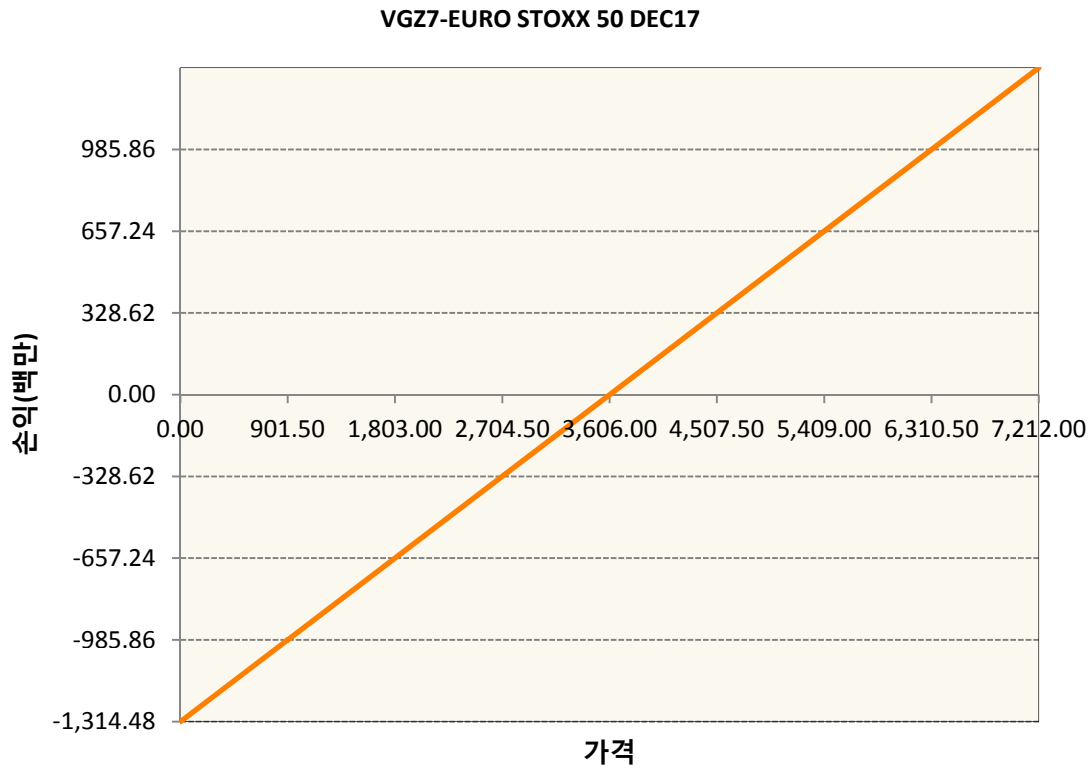
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,314	0	1,314	

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	2017-10-19
기준일	2017-10-18

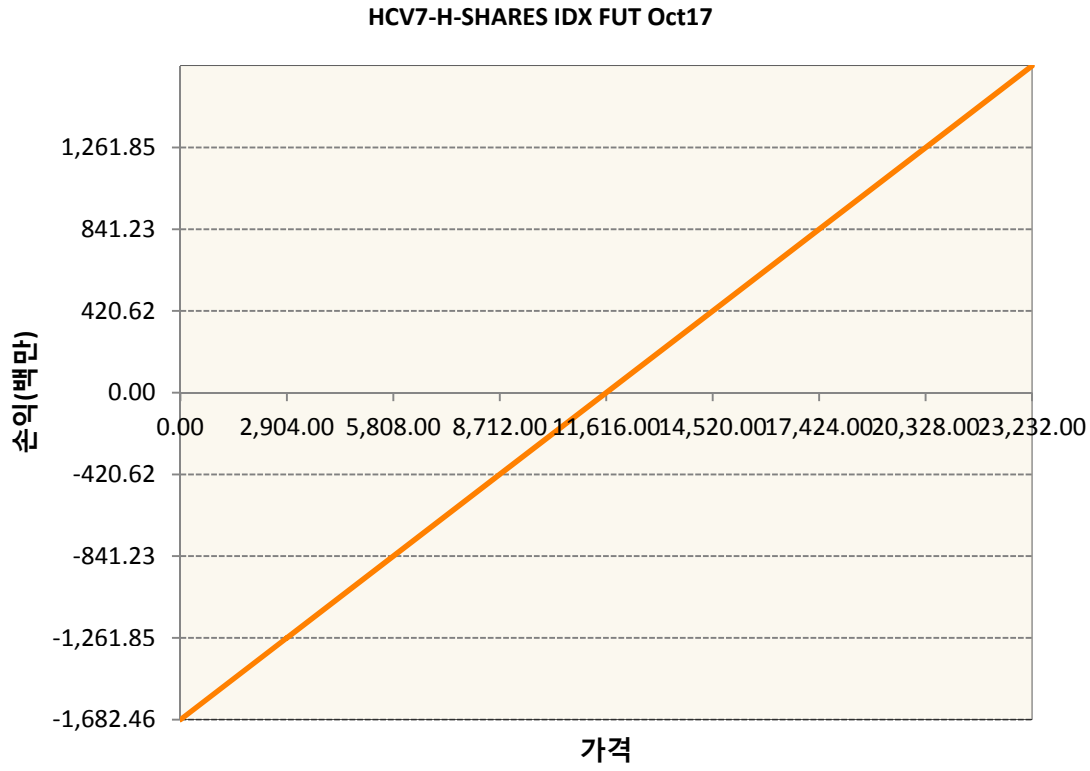
차이나인덱스모(주식-파생형)

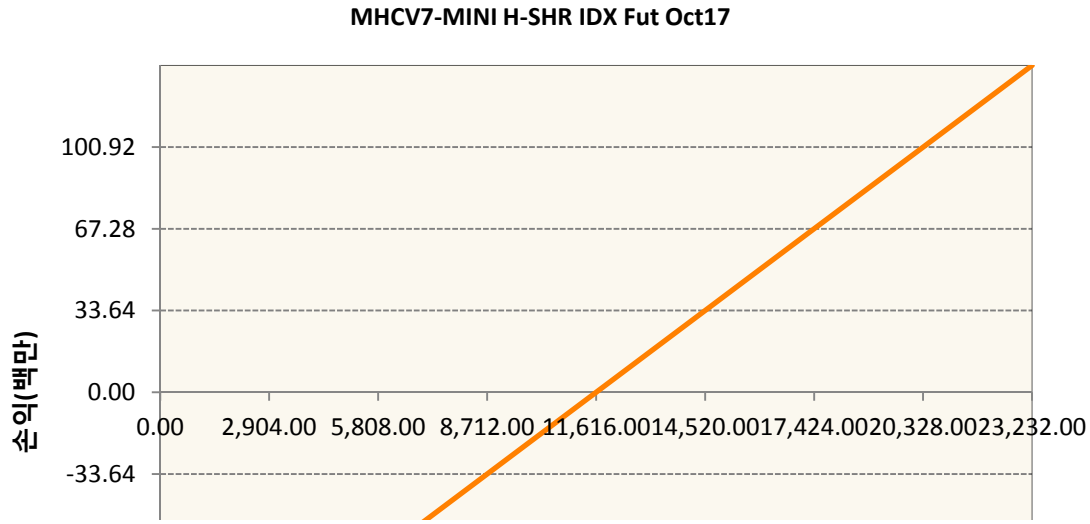
1. 계약금액

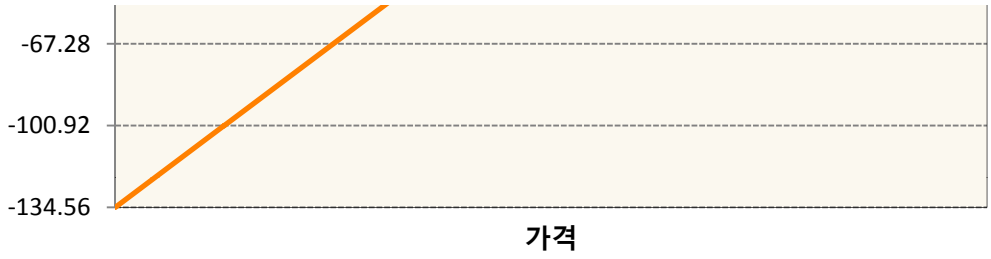
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,817	0	1,817	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCV7	H-SHARES IDX FUT Oct17	135
MHCV7	MINI H-SHR IDX Fut Oct17	11

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	119

공시일	2017-10-19
기준일	2017-10-18

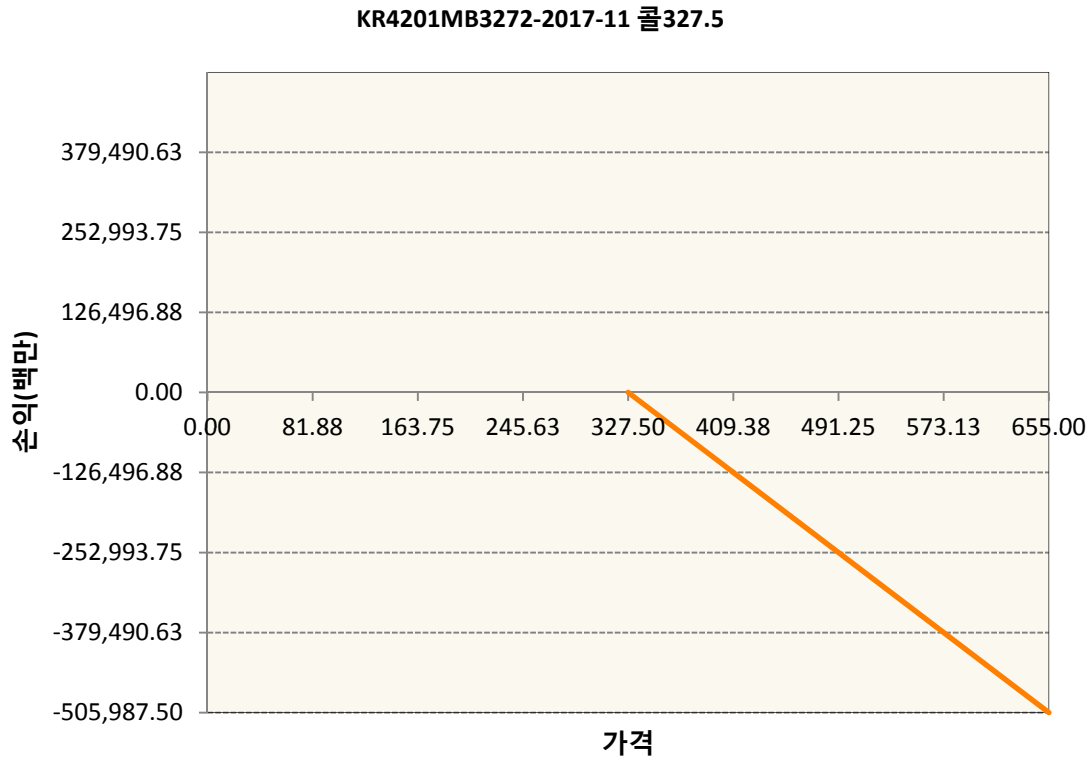
커버드콜모(주식혼합-파생형)

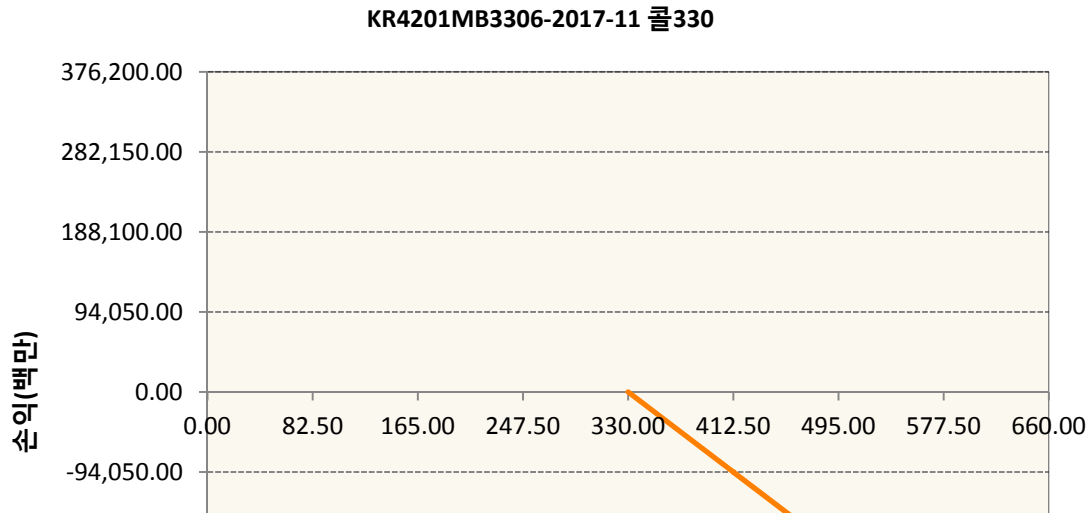
1. 계약금액

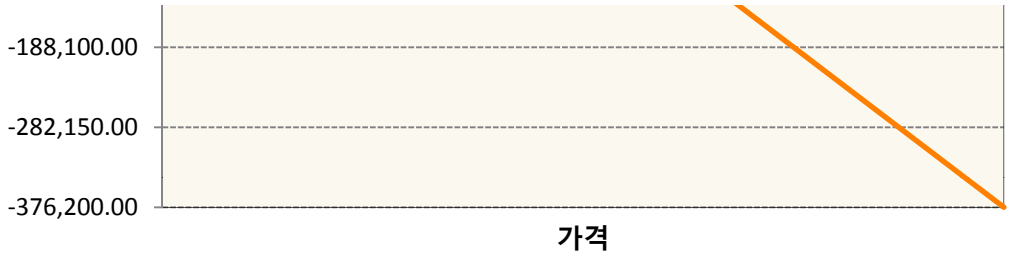
(단위:백만원)

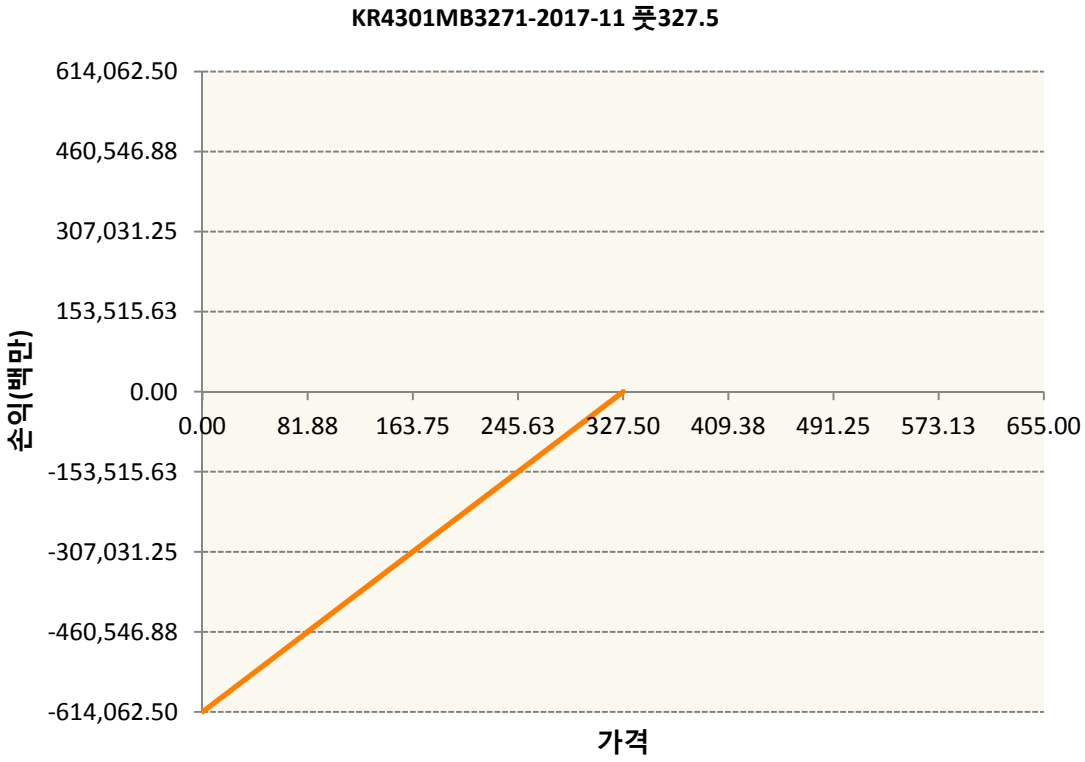
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	1,496,250	-1,496,250	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201MB3: 2017-11 콜327.5							32,202
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	12,093	11,899	11,642	11,324	10,949	10,523	10,050
-5.33%	11,166	10,676	10,125	9,523	8,878	8,198	7,487
-2.67%	8,476	7,648	6,798	5,933	5,054	4,165	3,268
0%	2,895	1,930	965	0	-965	-1,931	-2,896
2.67%	-5,912	-6,708	-7,535	-8,386	-9,255	-10,139	-11,035
5.33%	-17,232	-17,710	-18,257	-18,860	-19,512	-20,203	-20,929
8.00%	-29,954	-30,169	-30,453	-30,804	-31,216	-31,684	-32,202
KR4201MB3: 2017-11 콜330							22,722
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	7,619	7,513	7,366	7,175	6,943	6,672	6,365

-5.33%	7,135	6,840	6,495	6,107	5,683	5,227	4,745
-2.67%	5,597	5,044	4,466	3,868	3,255	2,629	1,993
0%	2,138	1,426	713	0	-714	-1,427	-2,141
2.67%	-3,700	-4,348	-5,009	-5,681	-6,360	-7,046	-7,736
5.33%	-11,589	-12,017	-12,490	-12,998	-13,535	-14,098	-14,680
8.00%	-20,744	-20,954	-21,219	-21,533	-21,892	-22,290	-22,722
KR4301MB3: 2017-11 풋327.5							41,098

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-40,976	-40,978	-40,983	-40,995	-41,016	-41,049	-41,098
-5.33%	-24,616	-24,670	-24,753	-24,867	-25,015	-25,195	-25,406
-2.67%	-9,138	-9,495	-9,888	-10,310	-10,755	-11,220	-11,701
0%	1,819	1,214	607	0	-608	-1,216	-1,824
2.67%	5,841	5,553	5,221	4,854	4,456	4,032	3,586
5.33%	6,439	6,396	6,326	6,226	6,094	5,928	5,730
8.00%	6,471	6,469	6,463	6,450	6,426	6,388	6,333

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

101,943

공시일	2017-10-19
기준일	2017-10-18

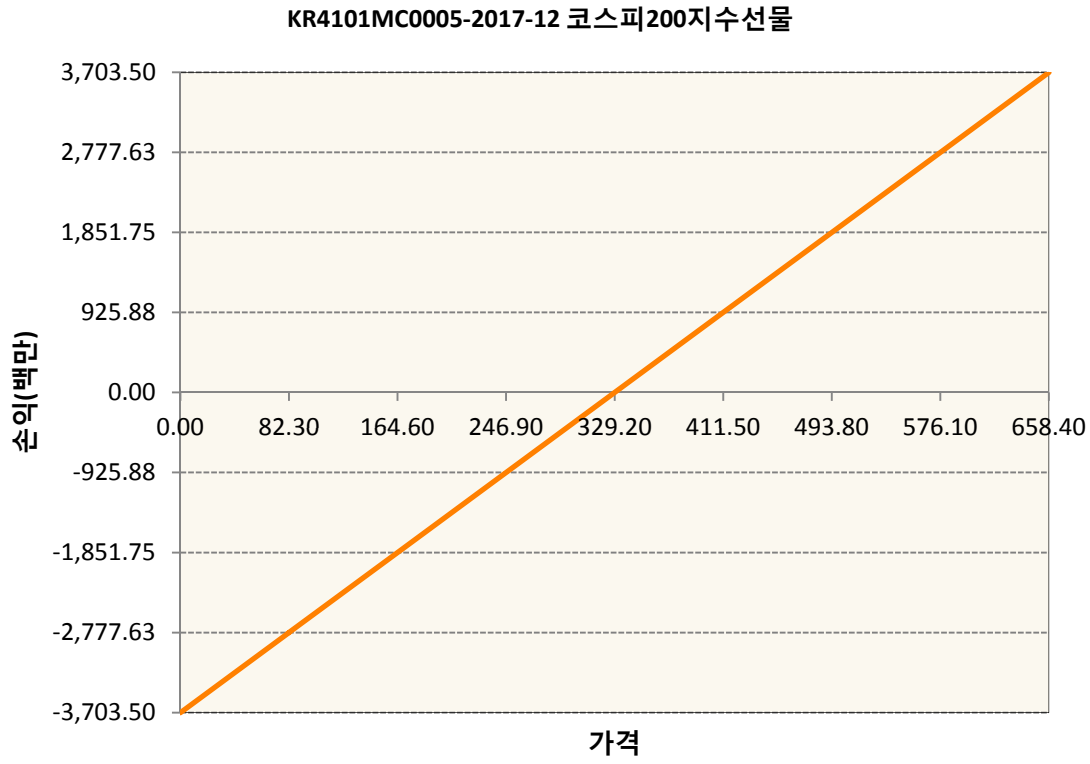
ETF스마트레버리지목표전환형7호

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	3,704	0	3,704	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101MC0	2017-12 코스피200지수선물						296
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-296	-296	-296	-296	-296	-296	-296
-5.33%	-197	-197	-197	-197	-197	-197	-197
-2.67%	-99	-99	-99	-99	-99	-99	-99
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	99	99	99	99	99	99	99
5.33%	197	197	197	197	197	197	197
8.00%	296	296	296	296	296	296	296

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

178

공시일	2017-10-19
기준일	2017-10-18

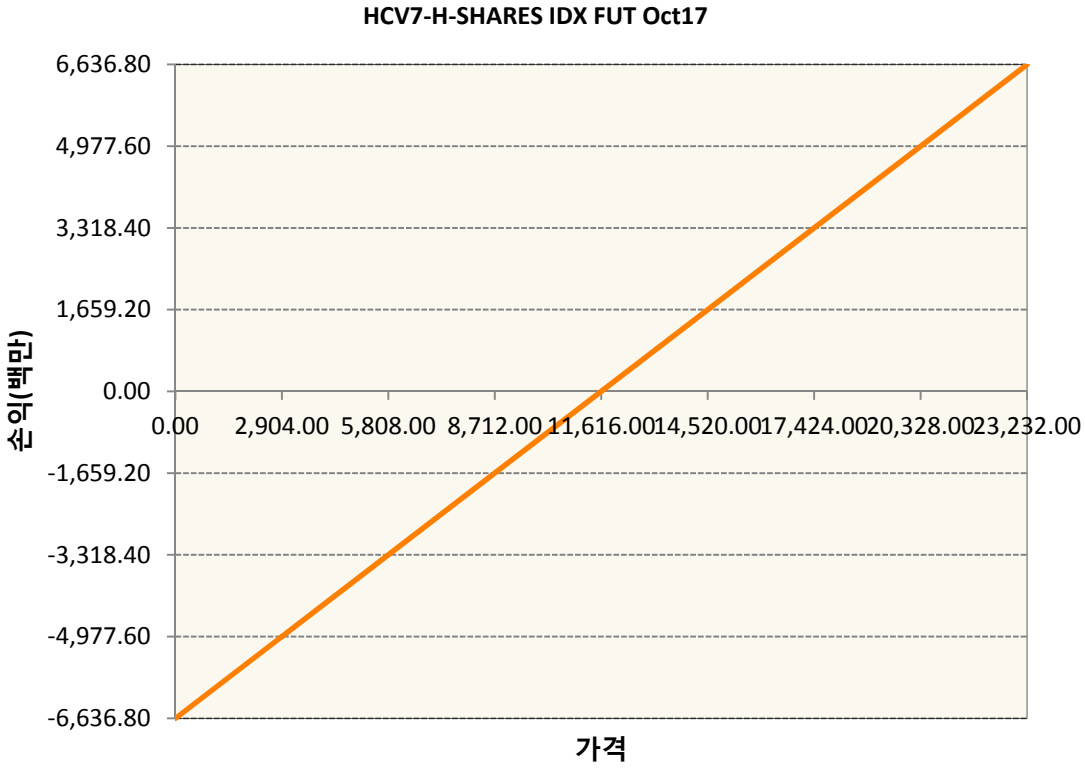
홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생

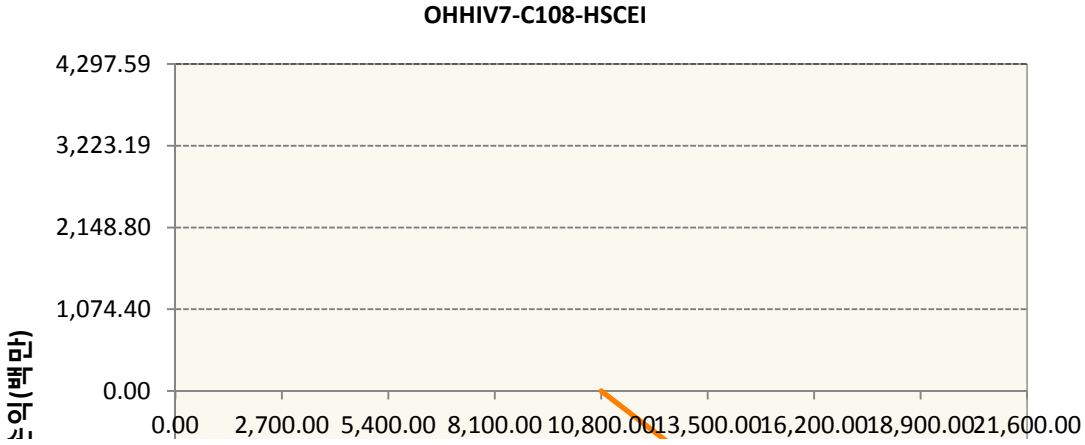
1. 계약금액

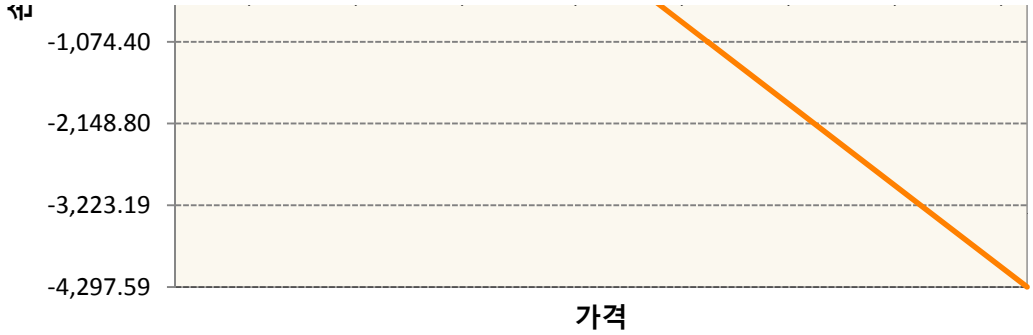
(단위:백만원)

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	6,637	0	6,637	장내
누계	유가증권	옵션	0	13,529	-13,529	장내

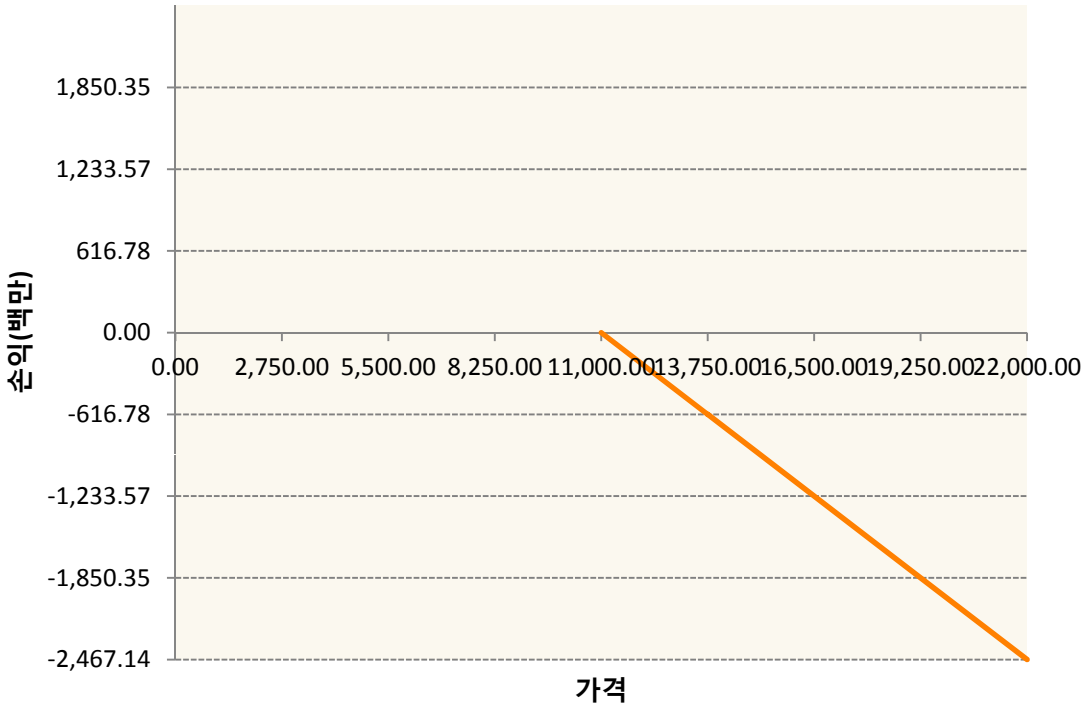
2. 만기시점의 손익구조



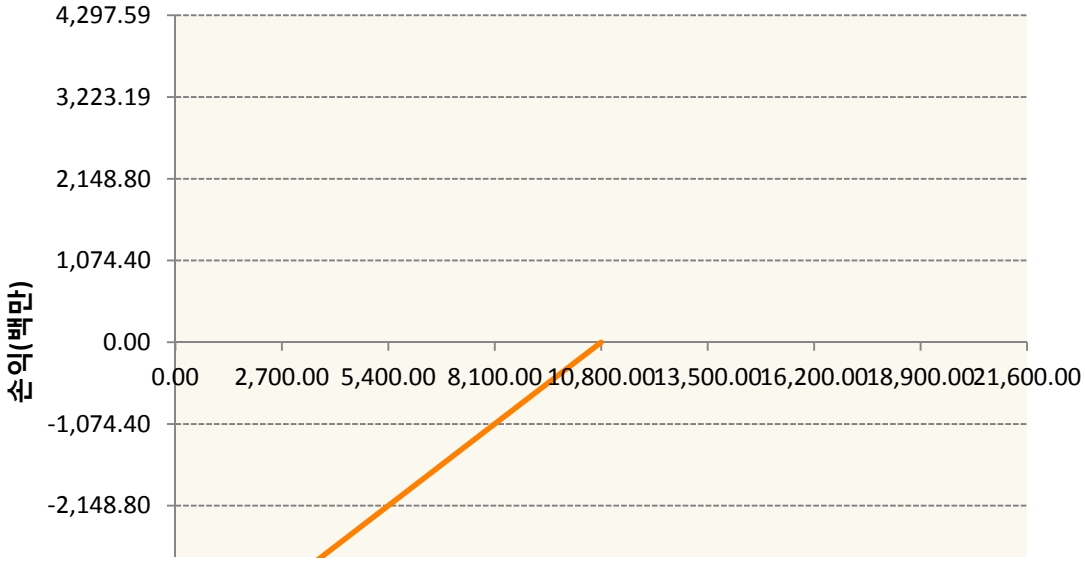


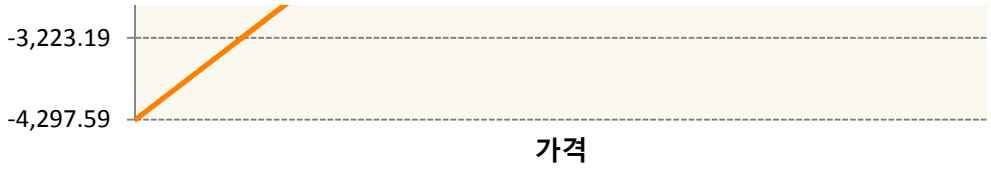


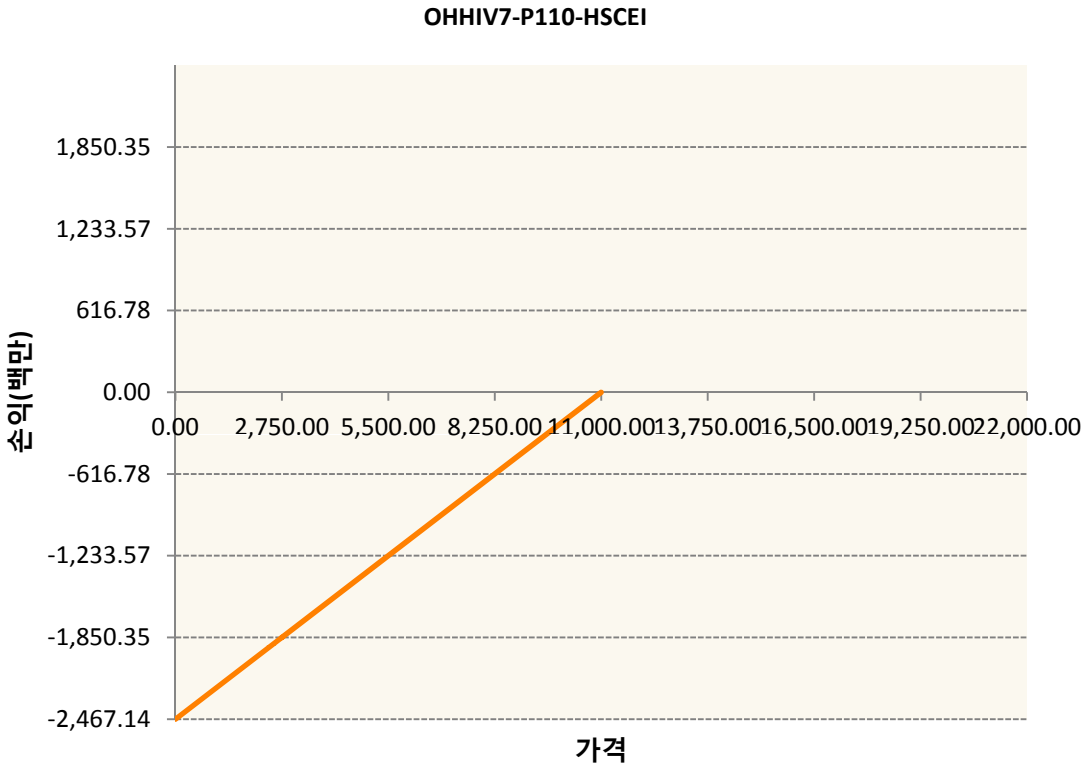
OHHIV7-C110-HSCEI



OHHIV7-P108-HSCEI







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

HCV7	H-SHARES IDX FUT Oct17	531
OHHIV7-C1(	HSCEI	344
OHHIV7-C11	HSCEI	197
OHHIV7-P1(	HSCEI	344
OHHIV7-P11	HSCEI	197

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

1,316

공시일	2017-10-19
기준일	2017-10-18

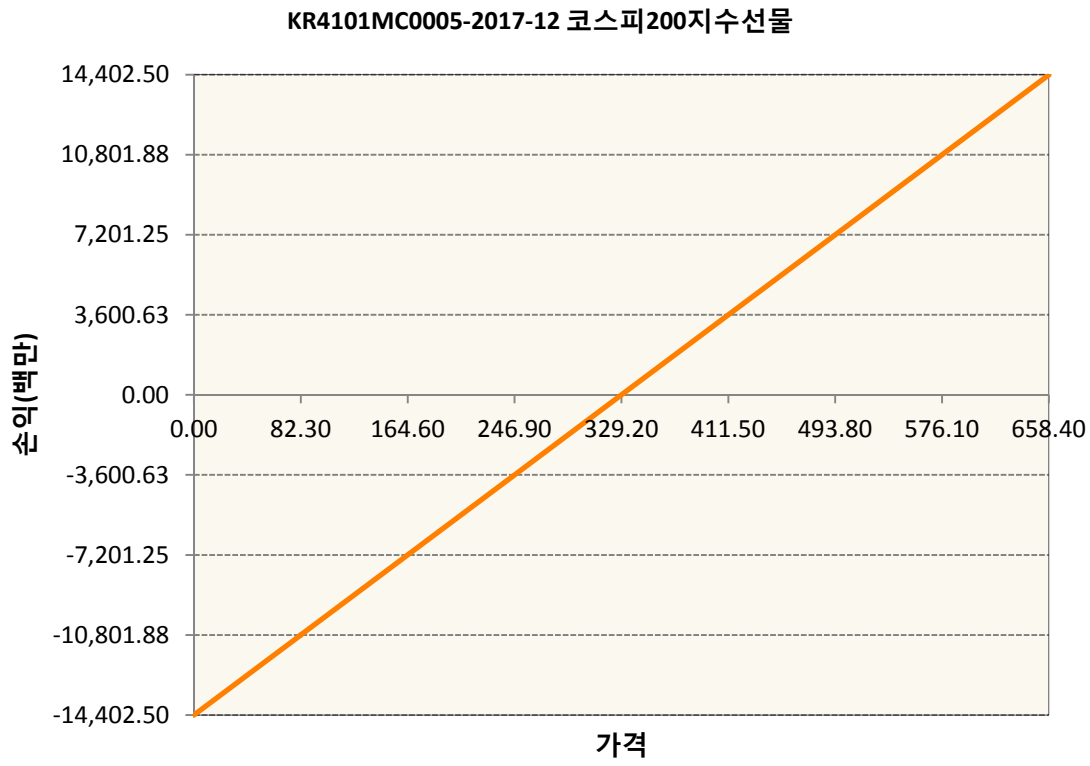
코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼

1. 계약금액

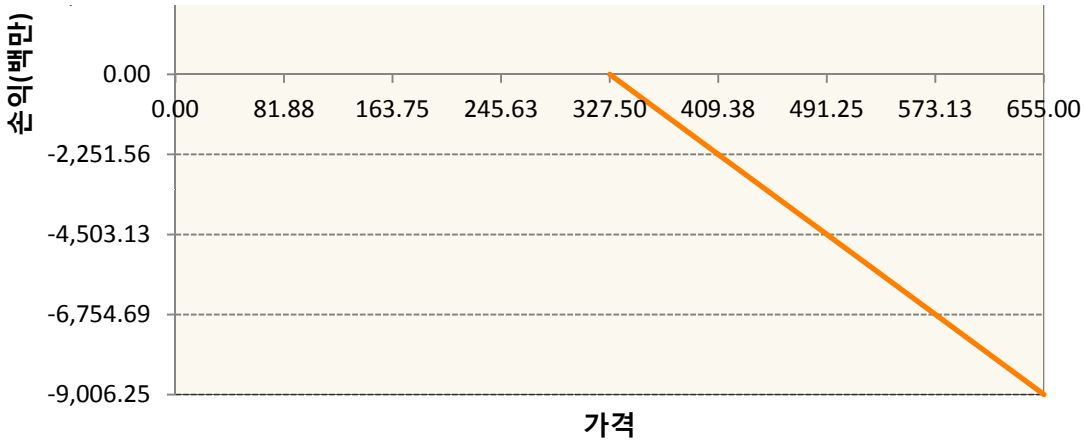
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	3,200	0	3,200	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	14,403	0	14,403	장내
누계	유가증권	스왑	32,700	0	32,700	장외
누계	유가증권	옵션	0	31,584	-31,584	장내

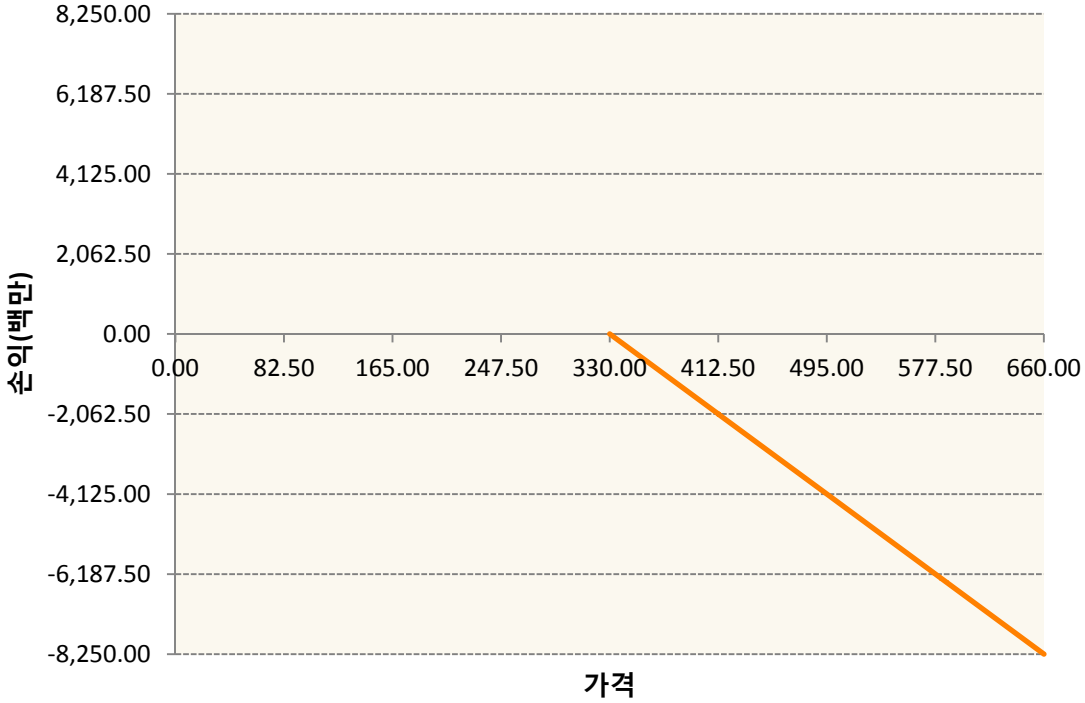
2. 만기시점의 손익구조



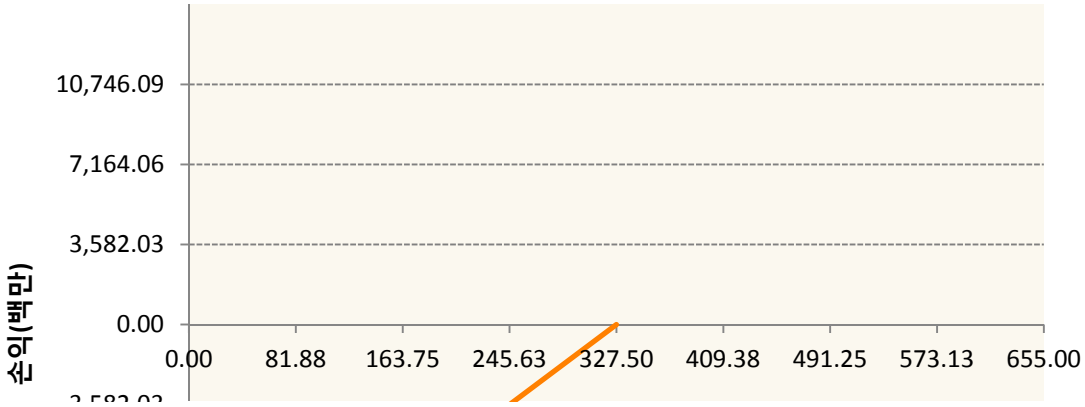




KR4201MB3306-2017-11 콜330



KR4301MB3271-2017-11 풋327.5





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+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
2.529E+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
2.529E+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
2.529E+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
	2.529E+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
	2.529E+11	UBCSFXC1 INDEX_7					259
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-259	-259	-259	-259	-259	-259	-259
-5.33%	-173	-173	-173	-173	-173	-173	-173
-2.67%	-86	-86	-86	-86	-86	-86	-86
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	86	86	86	86	86	86	86
5.33%	173	173	173	173	173	173	173
8.00%	259	259	259	259	259	259	259
	KR4101MC0	2017-12 코스피200지수선물					1,149
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,149	-1,149	-1,149	-1,149	-1,149	-1,149	-1,149
-5.33%	-766	-766	-766	-766	-766	-766	-766
-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%	766	766	766	766	766	766	766
8.00%	1,149	1,149	1,149	1,149	1,149	1,149	1,149
	KR4201MB3	2017-11 콜327.5					573
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	215	212	207	202	195	187	179
-5.33%	199	190	180	170	158	146	133
-2.67%	151	136	121	106	90	74	58
0%	52	34	17	0	-17	-34	-52

2.67%	-105	-119	-134	-149	-165	-180	-196
5.33%	-307	-315	-325	-336	-347	-360	-373
8.00%	-533	-537	-542	-548	-556	-564	-573
	KR4201MB3: 2017-11 콜330						498
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	167	165	162	157	152	146	140
-5.33%	156	150	142	134	125	115	104
-2.67%	123	111	98	85	71	58	44
0%	47	31	16	0	-16	-31	-47
2.67%	-81	-95	-110	-125	-139	-155	-170
5.33%	-254	-264	-274	-285	-297	-309	-322
8.00%	-455	-460	-465	-472	-480	-489	-498
	KR4301MB3: 2017-11 풋327.5						959
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-956	-956	-956	-957	-957	-958	-959
-5.33%	-574	-576	-578	-580	-584	-588	-593
-2.67%	-213	-222	-231	-241	-251	-262	-273
0%	42	28	14	0	-14	-28	-43
2.67%	136	130	122	113	104	94	84
5.33%	150	149	148	145	142	138	134
8.00%	151	151	151	150	150	149	148

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

5,513

공시일	2017-10-19
기준일	2017-10-18

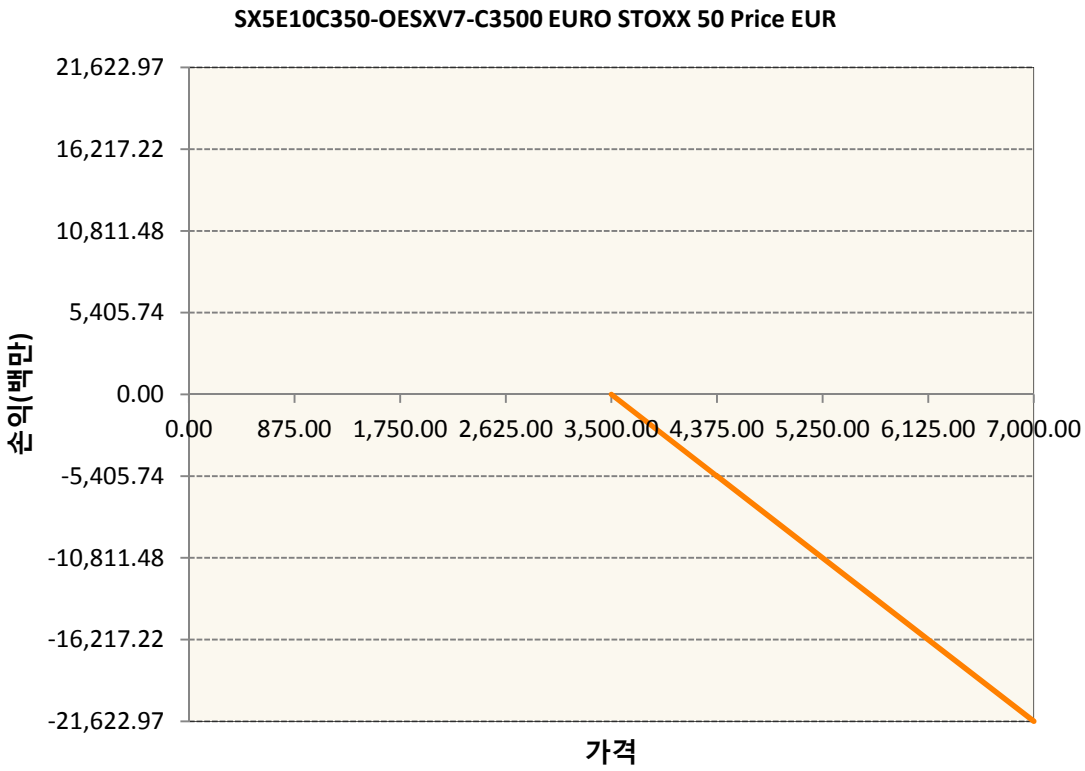
유로커버드콜모(주식혼합-파생형

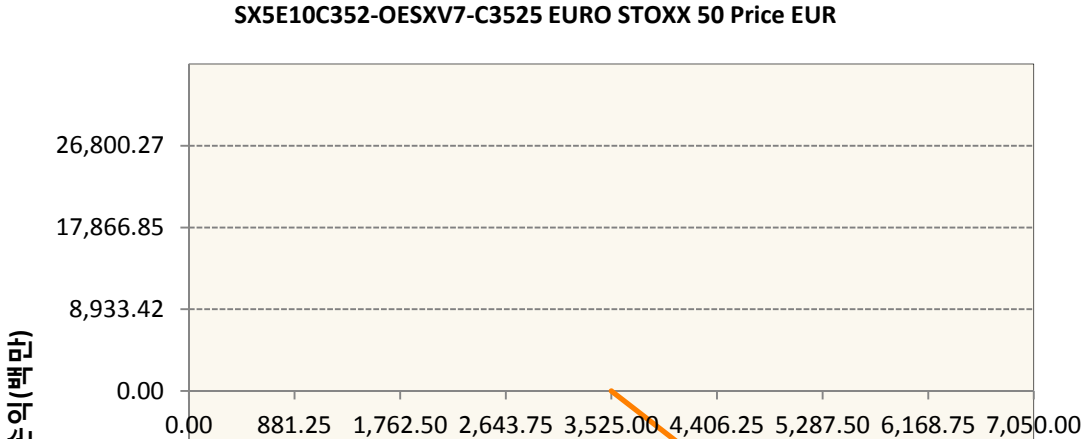
1. 계약금액

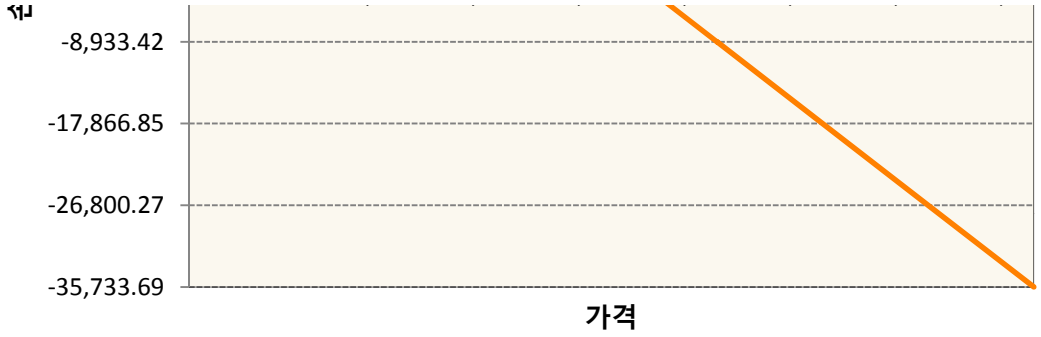
(단위:백만원)

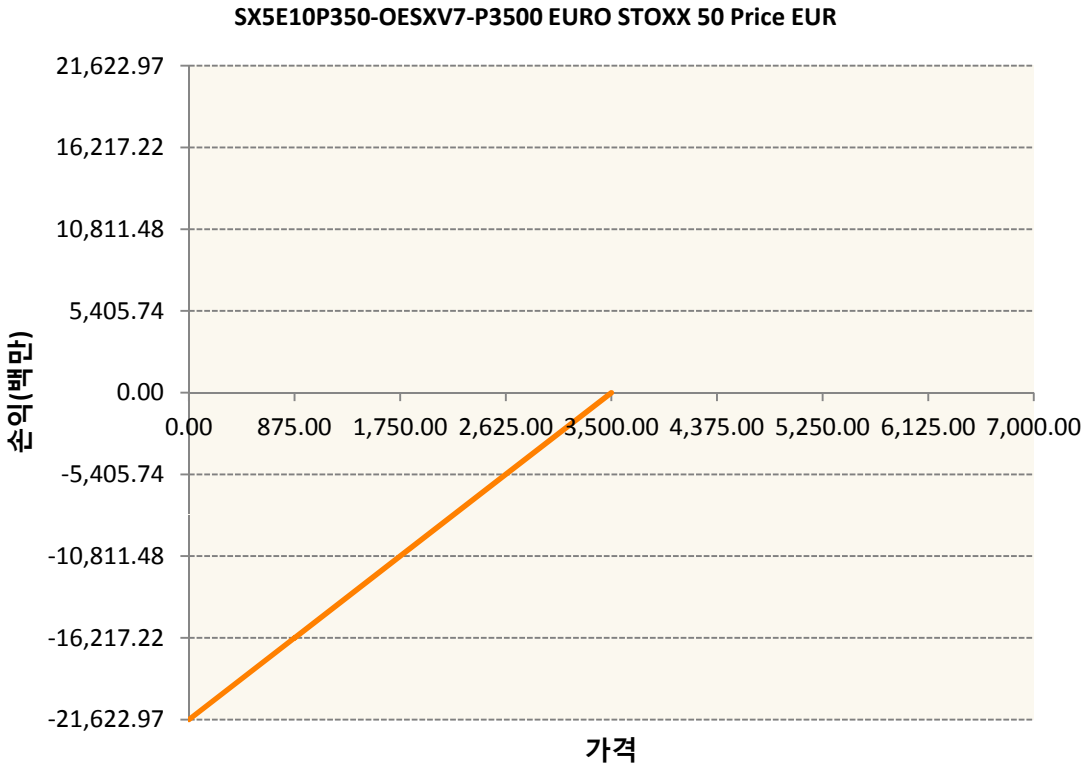
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	ELS	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	55,313	0	55,313	
누계	유가증권	ELS	0	114,713	-114,713	장외

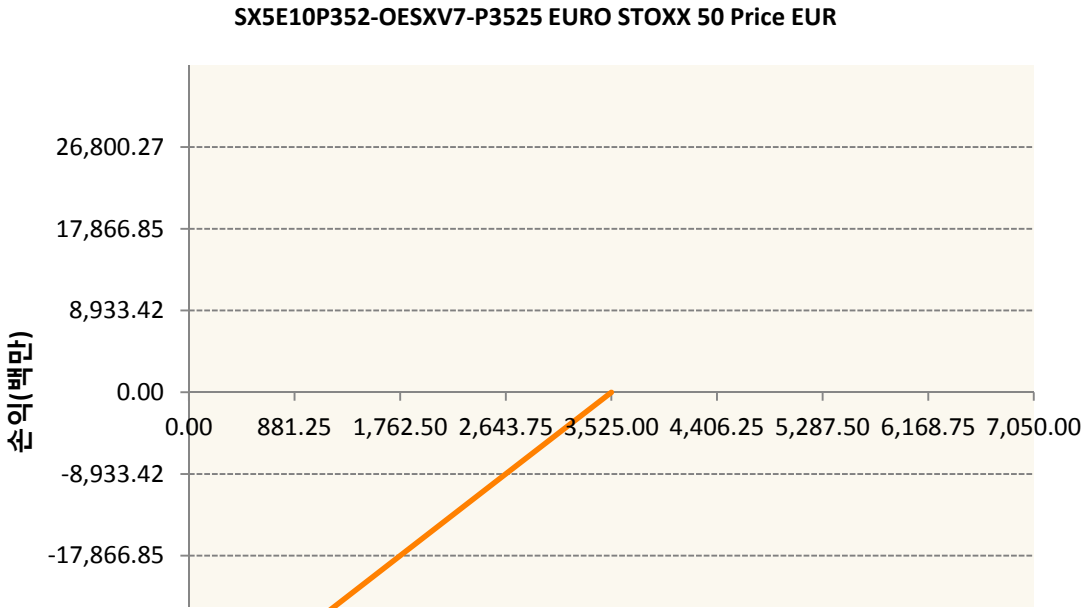
2. 만기시점의 손익구조

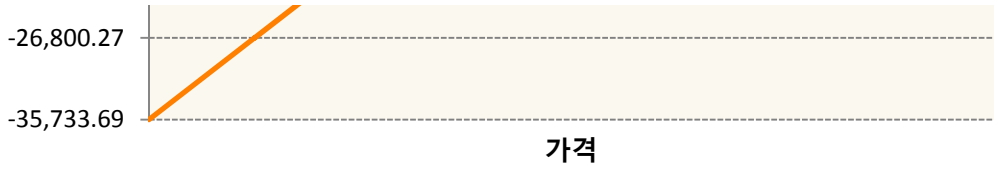


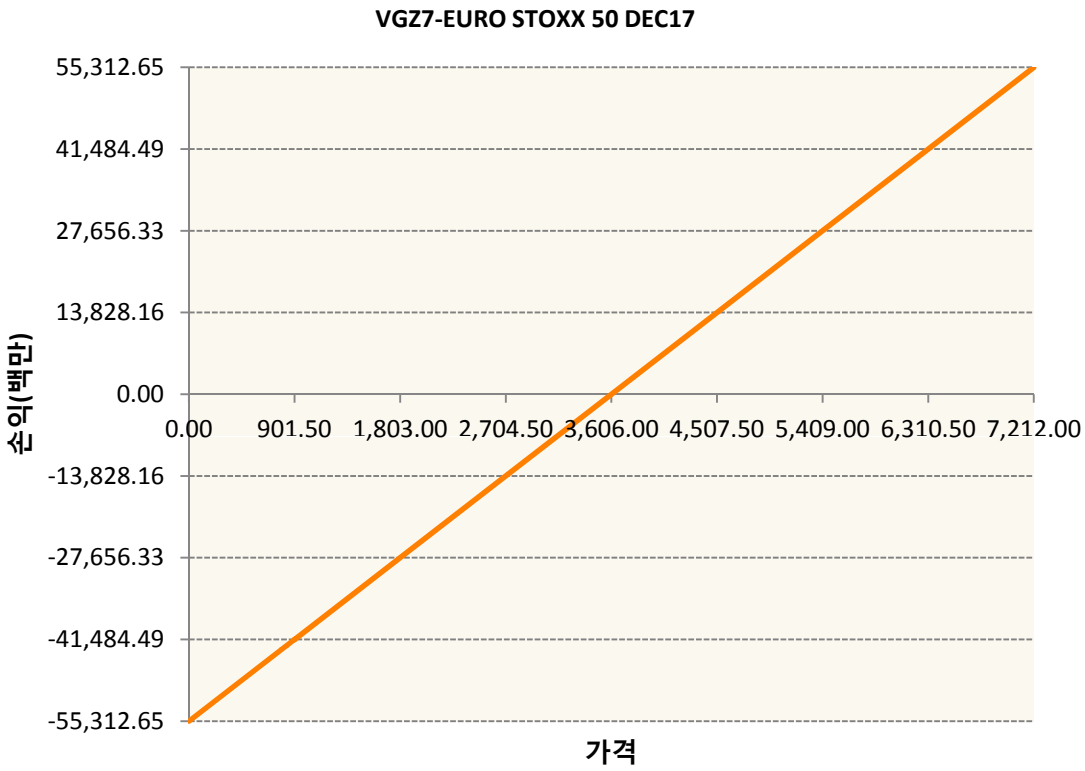



-8,933.42
-17,866.85
-26,800.27
-35,733.69
가격


SX5E10P350-OESXV7-P3500 EURO STOXX 50 Price EUR
21,622.97
16,217.22
10,811.48
5,405.74
0.00
-5,405.74
-10,811.48
-16,217.22
-21,622.97
손익(백만)
0.00
875.00
1,750.00
2,625.00
3,500.00
4,375.00
5,250.00
6,125.00
7,000.00
가격


SX5E10P352-OESXV7-P3525 EURO STOXX 50 Price EUR
26,800.27
17,866.85
8,933.42
0.00
-8,933.42
-17,866.85
손익(백만)
0.00
881.25
1,762.50
2,643.75
3,525.00
4,406.25
5,287.50
6,168.75
7,050.00





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)	(단위:백만원)
SX5E10C350 OESXV7-C3500 EURO STOXX 50 Price EUR	1,730
SX5E10C352 OESXV7-C3525 EURO STOXX 50 Price EUR	2,859
SX5E10P350 OESXV7-P3500 EURO STOXX 50 Price EUR	1,730
SX5E10P352 OESXV7-P3525 EURO STOXX 50 Price EUR	2,859
VGZ7 EURO STOXX 50 DEC17	4,425

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	10,314

공시일	2017-10-19
기준일	2017-10-18

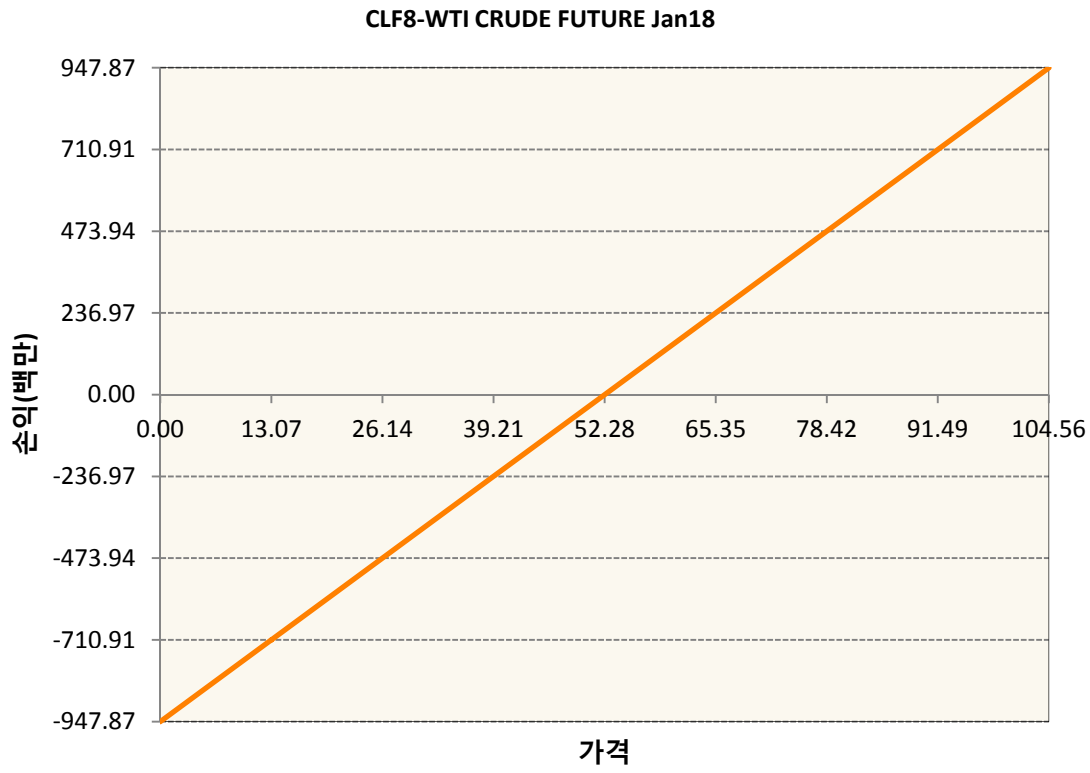
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

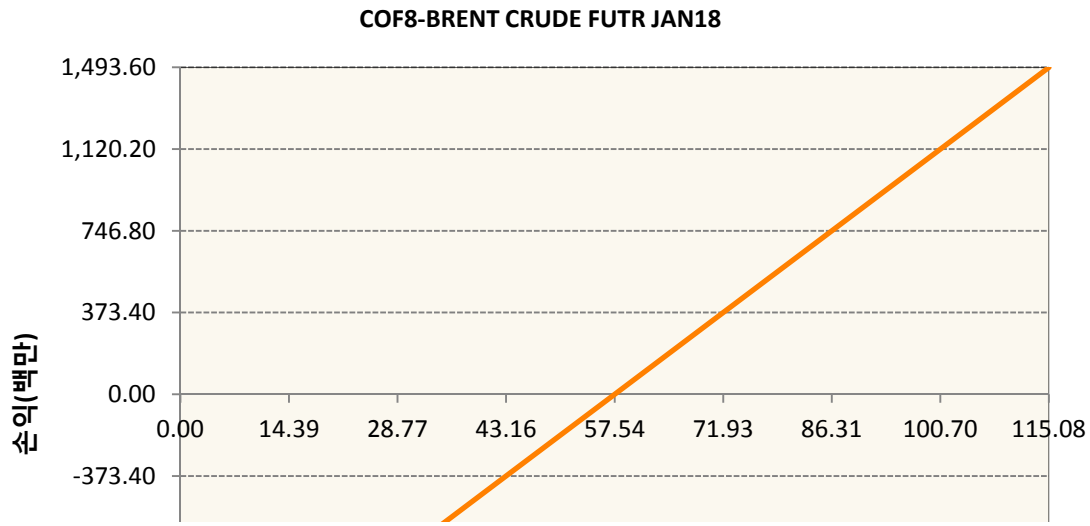
1. 계약금액

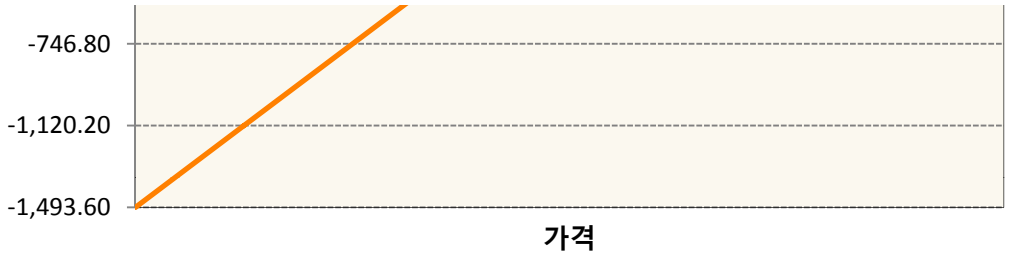
(단위:백만원)

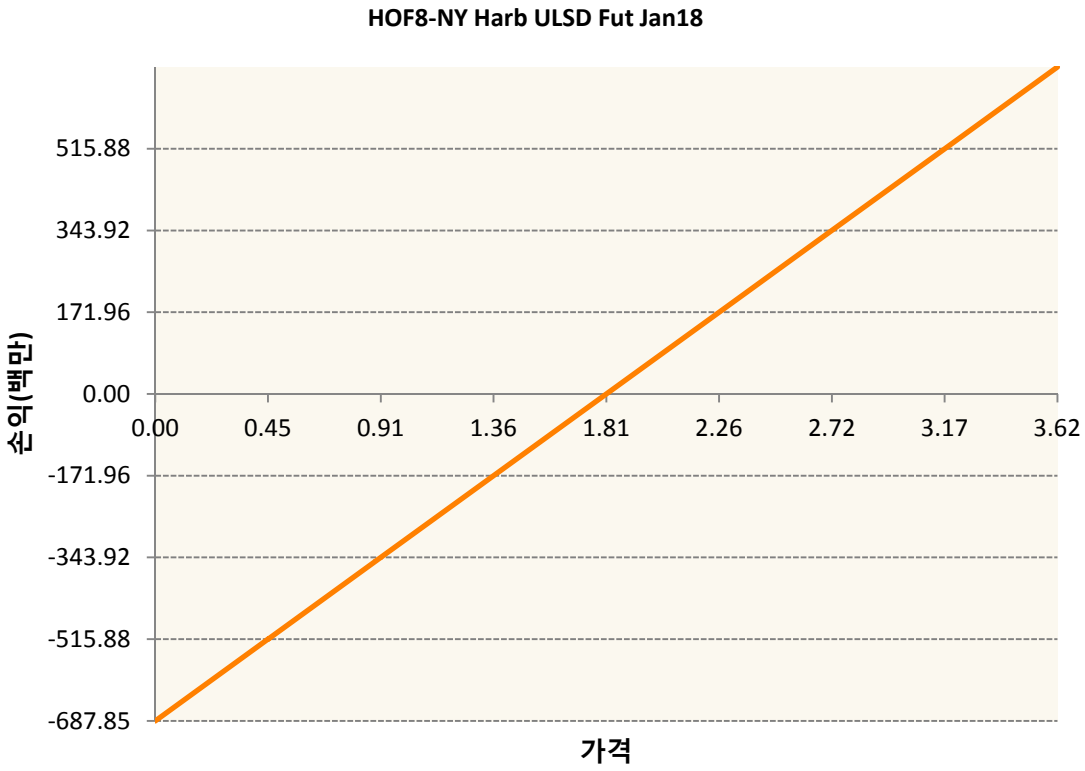
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	5,288	904	4,384	

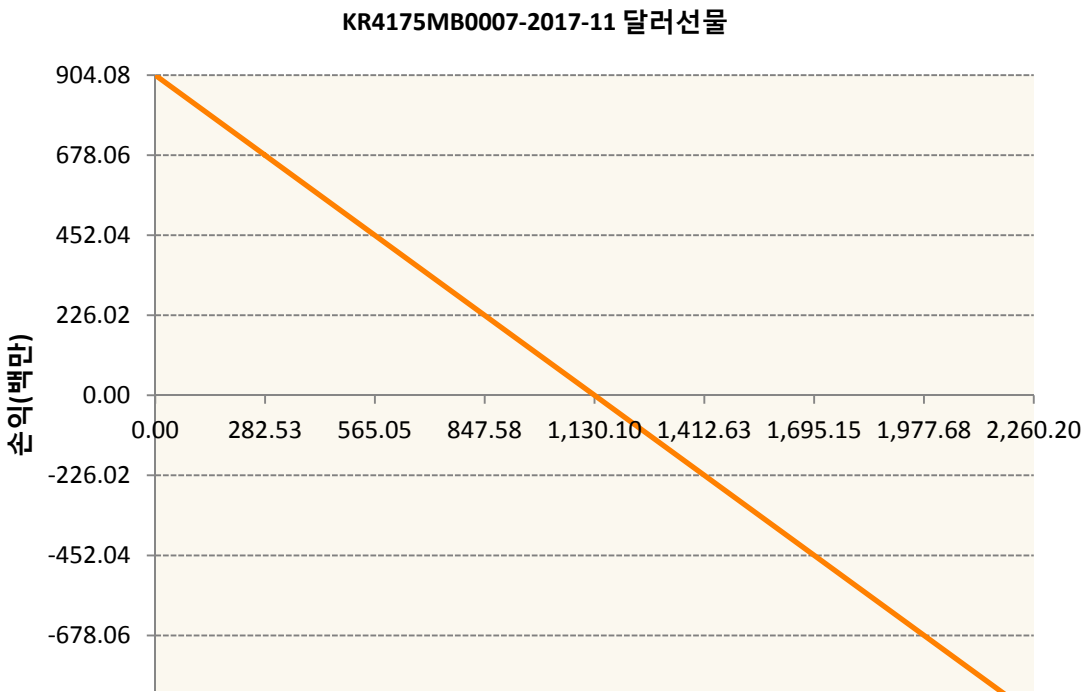
2. 만기시점의 손익구조

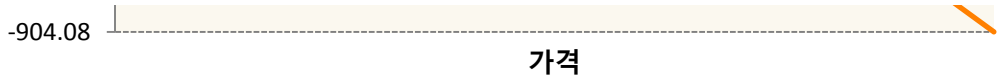


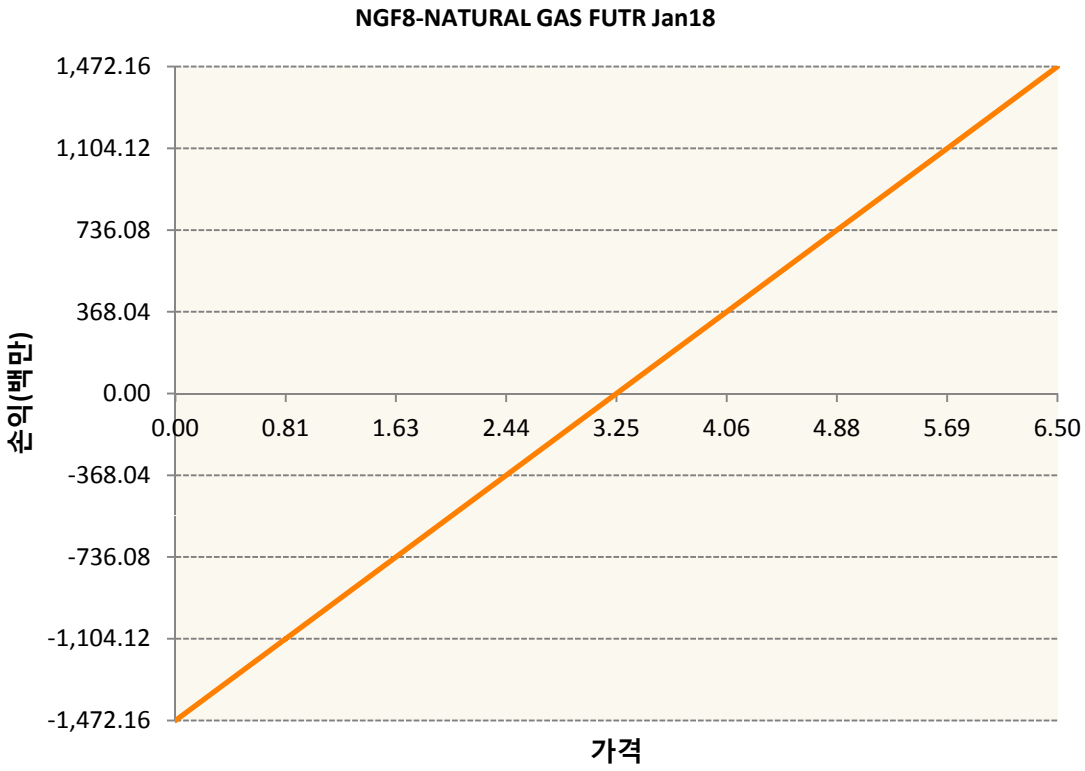


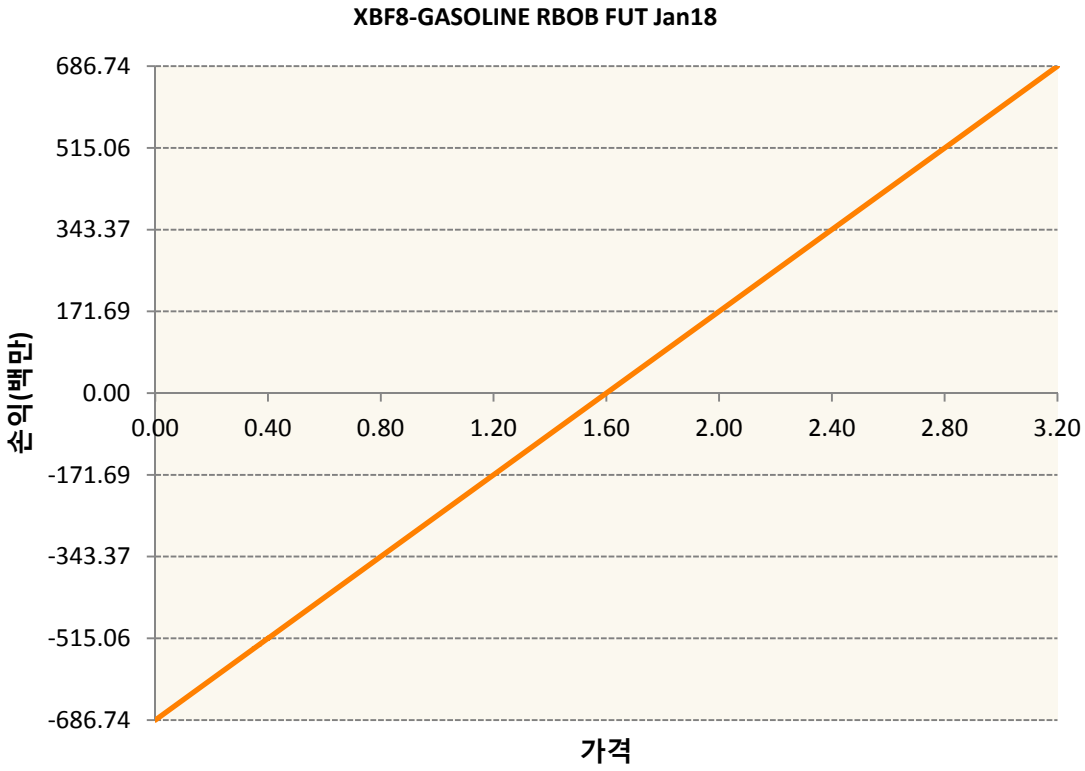

-746.80
-1,120.20
-1,493.60
가격


HOF8-NY Harb ULSD Fut Jan18
515.88
343.92
171.96
0.00
-171.96
-343.92
-515.88
-687.85
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
904.08
678.06
452.04
226.02
0.00
-226.02
-452.04
-678.06
0.00
282.53
565.05
847.58
1,130.10
1,412.63
1,695.15
1,977.68
2,260.20
손익(백만)


-904.08
가격


NGF8-NATURAL GAS FUTR Jan18
1,472.16
1,104.12
736.08
368.04
0.00
-368.04
-736.08
-1,104.12
-1,472.16
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
686.74
515.06
343.37
171.69
0.00
-171.69
-343.37
-515.06
-686.74
0.00
0.40
0.80
1.20
1.60
2.00
2.40
2.80
3.20
손익(백만)
가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLF8	WTI CRUDE FUTURE Jan18	76
COF8	BRENT CRUDE FUTR JAN18	119
HOF8	NY Harb ULSD Fut Jan18	55
KR4175MB0(	2017-11 달러선물	72
NGF8	NATURAL GAS FUTR Jan18	118
XBF8	GASOLINE RBOB FUT Jan18	55

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

757

공시일	2017-10-19
기준일	2017-10-18

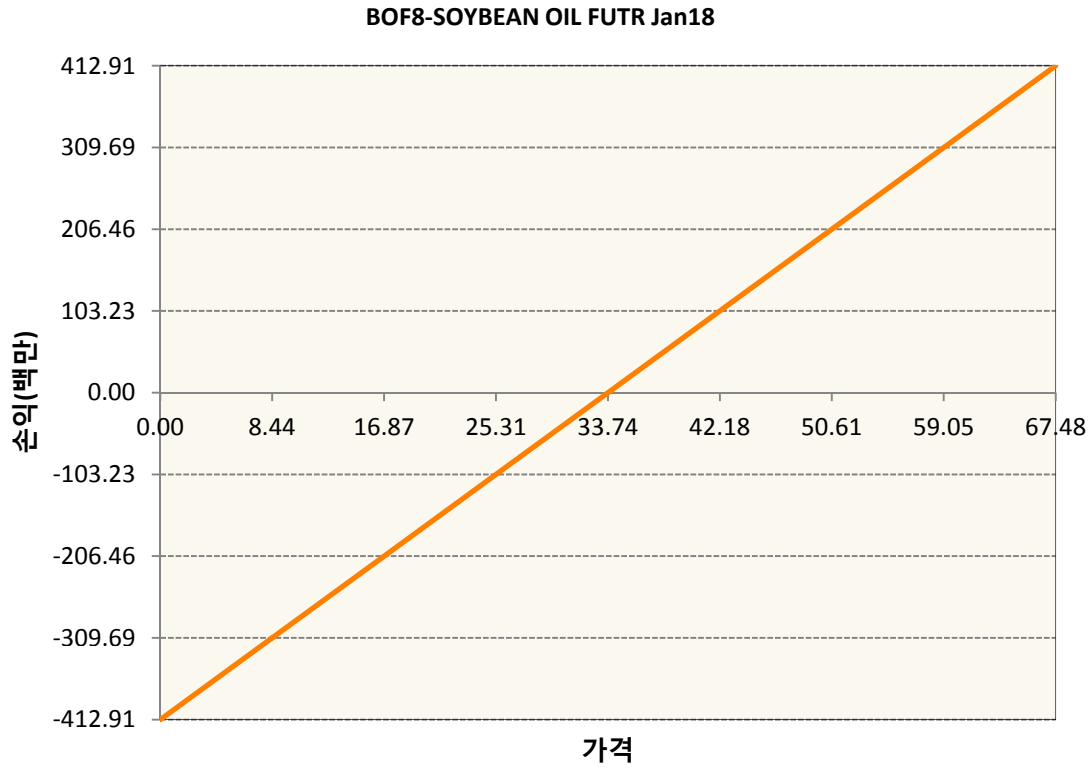
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

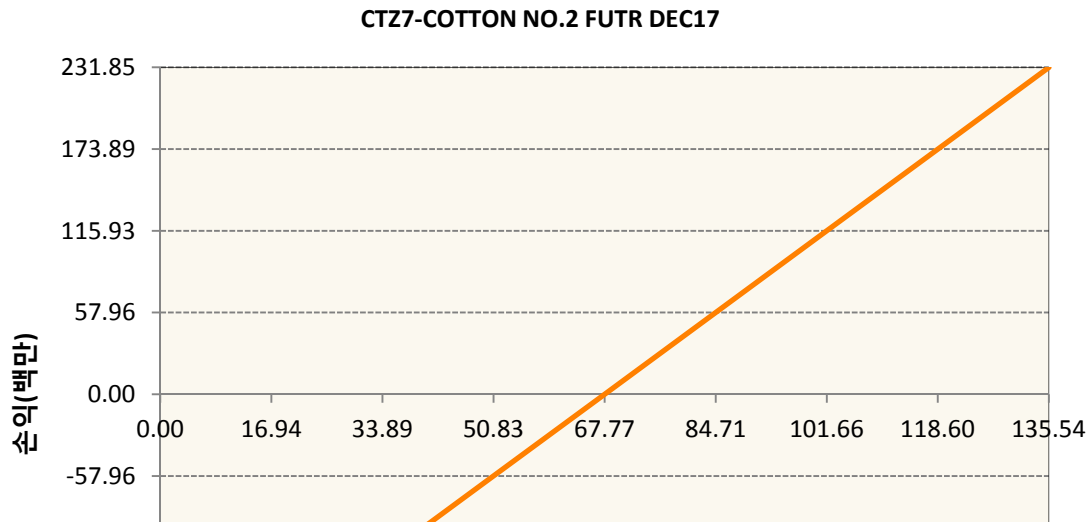
1. 계약금액

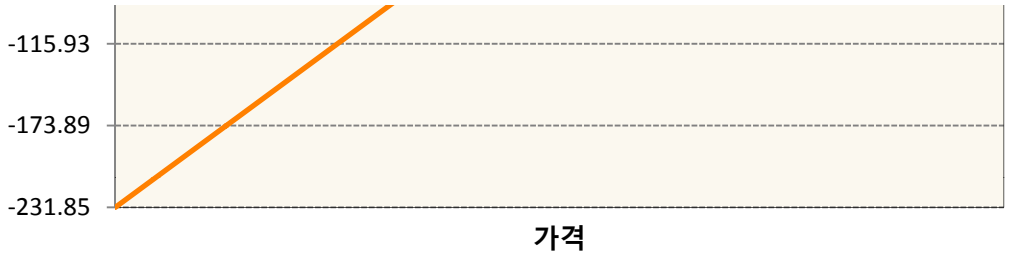
(단위:백만원)

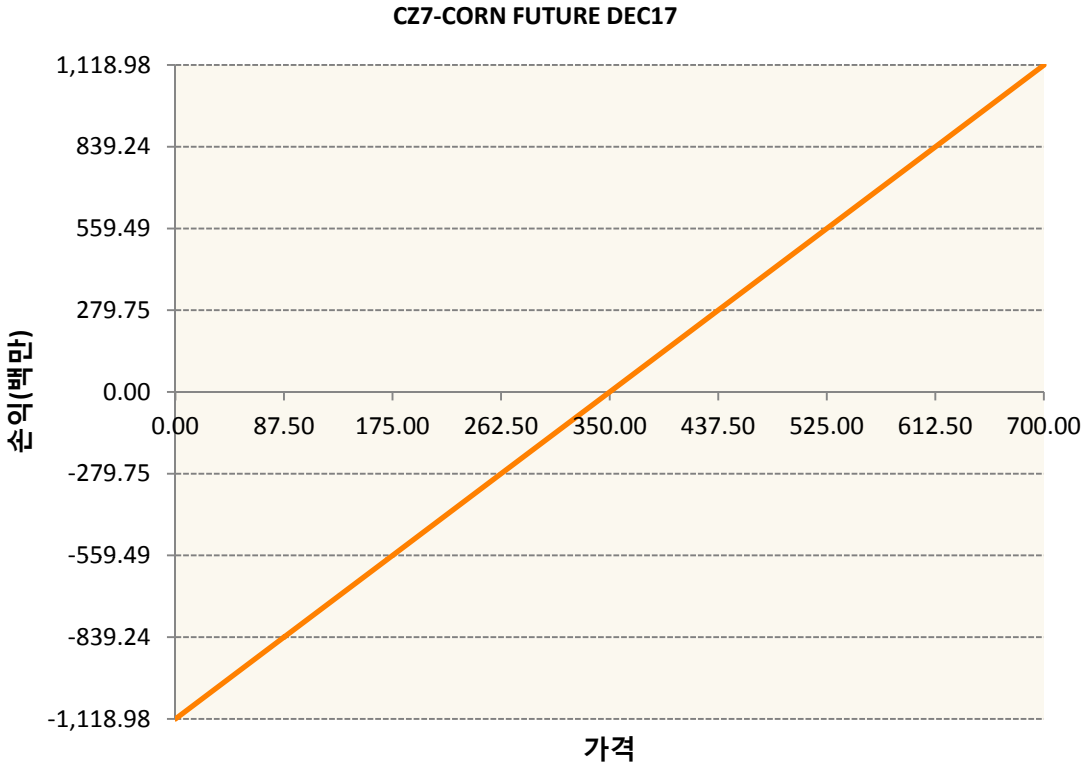
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	4,561	339	4,221	

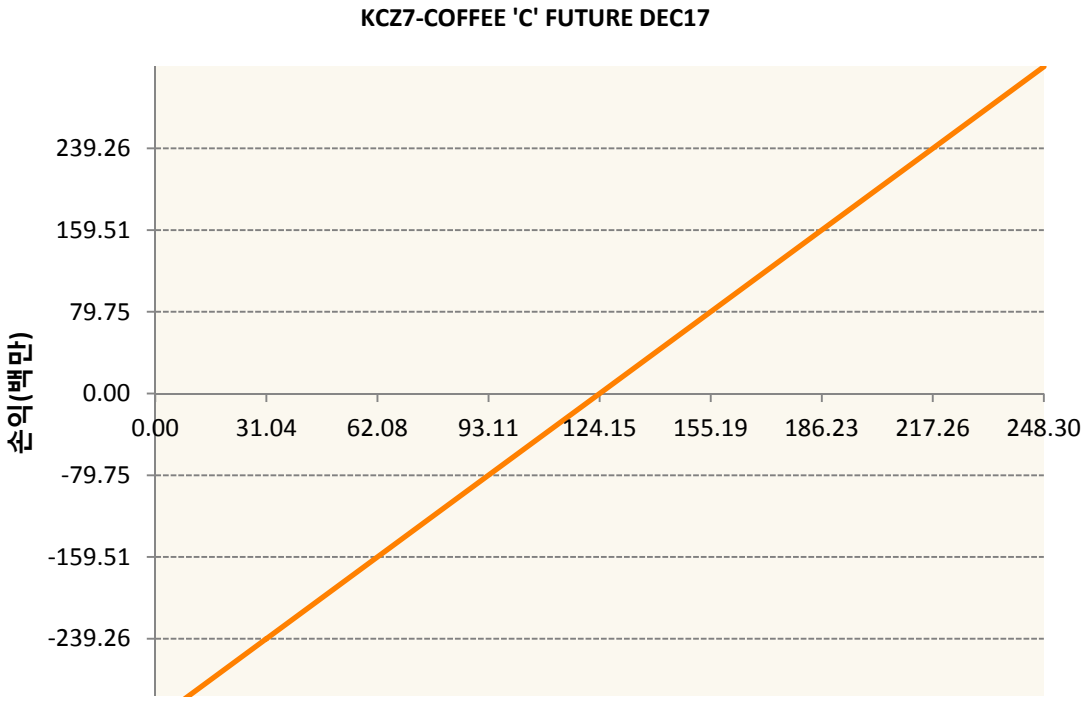
2. 만기시점의 손익구조

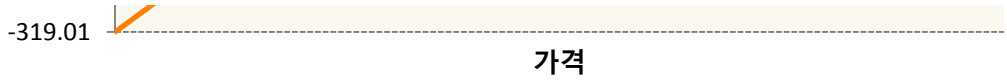


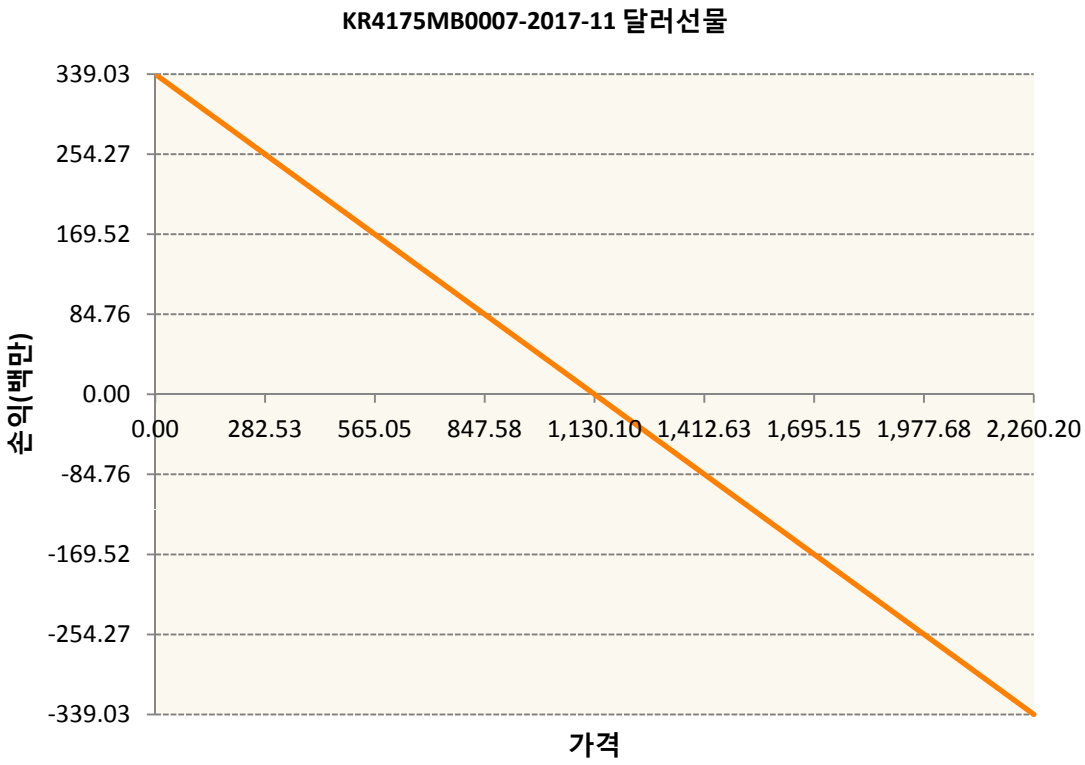


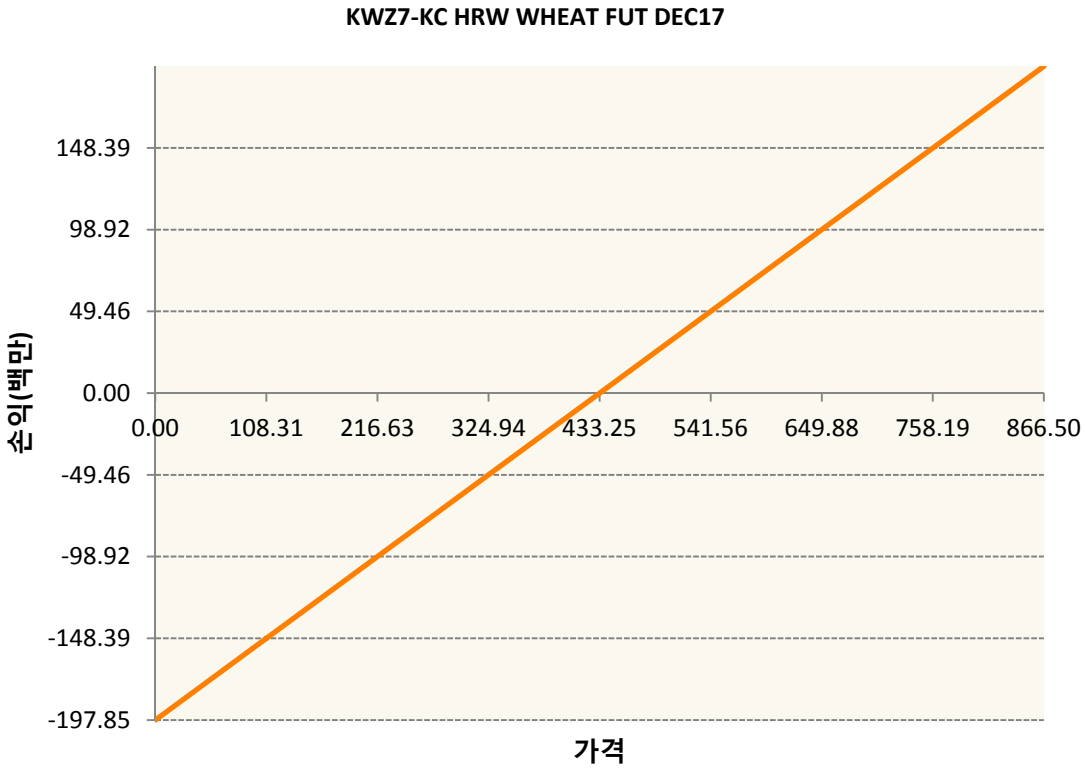

-115.93
-173.89
-231.85
가격


CZ7-CORN FUTURE DEC17
1,118.98
839.24
559.49
279.75
0.00
0.00
87.50
175.00
262.50
350.00
437.50
525.00
612.50
700.00
-279.75
-559.49
-839.24
-1,118.98
손익(백만)
가격

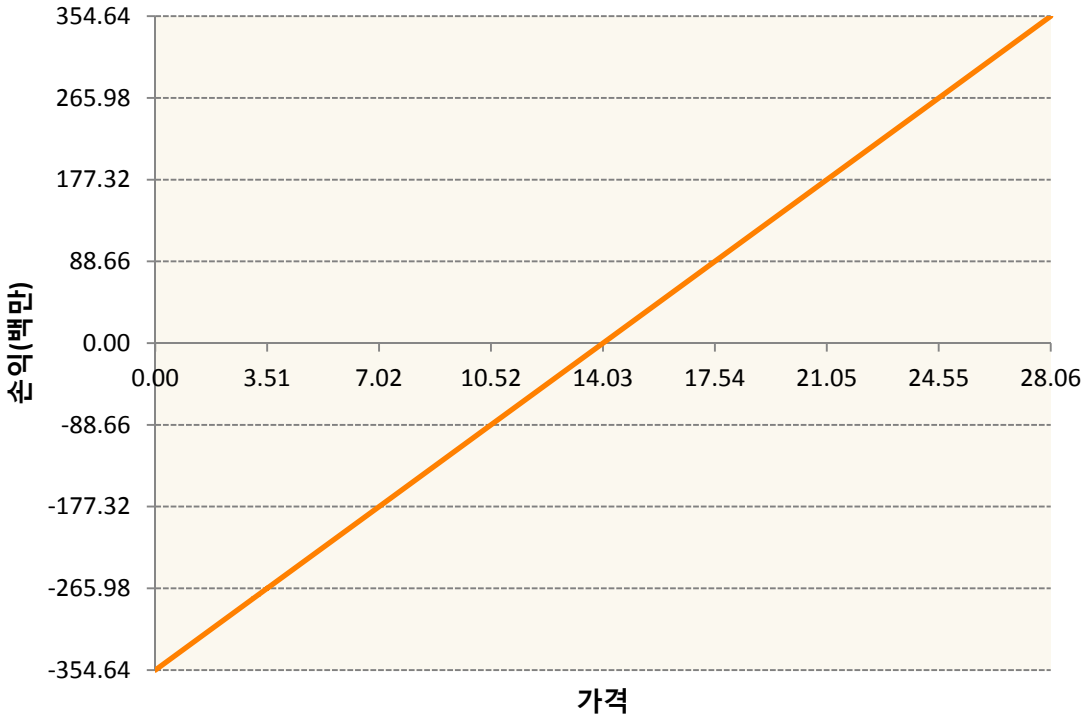

KCZ7-COFFEE 'C' FUTURE DEC17
239.26
159.51
79.75
0.00
0.00
31.04
62.08
93.11
124.15
155.19
186.23
217.26
248.30
-79.75
-159.51
-239.26
손익(백만)


-319.01
가격

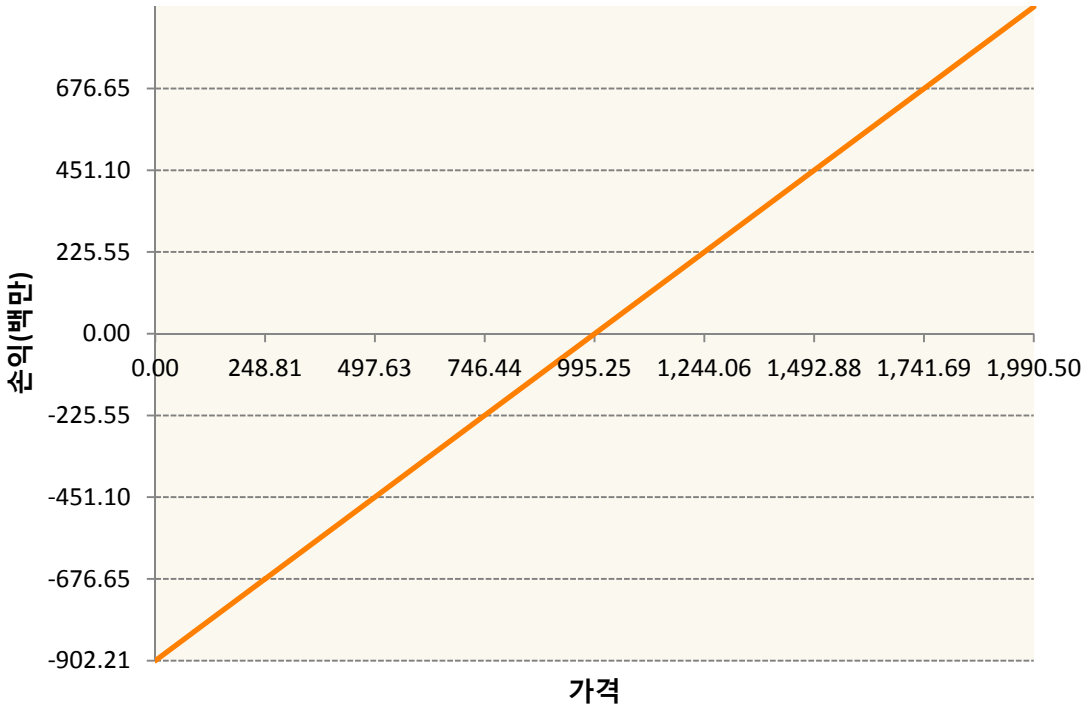

KR4175MB0007-2017-11 달러선물
339.03
254.27
169.52
84.76
0.00
-84.76
-169.52
-254.27
-339.03
0.00
282.53
565.05
847.58
1,130.10
1,412.63
1,695.15
1,977.68
2,260.20
손익(백만)
가격


KWZ7-KC HRW WHEAT FUT DEC17
148.39
98.92
49.46
0.00
-49.46
-98.92
-148.39
-197.85
0.00
108.31
216.63
324.94
433.25
541.56
649.88
758.19
866.50
손익(백만)
가격

SBH8-Sugar #11 (WORLD) MAR18

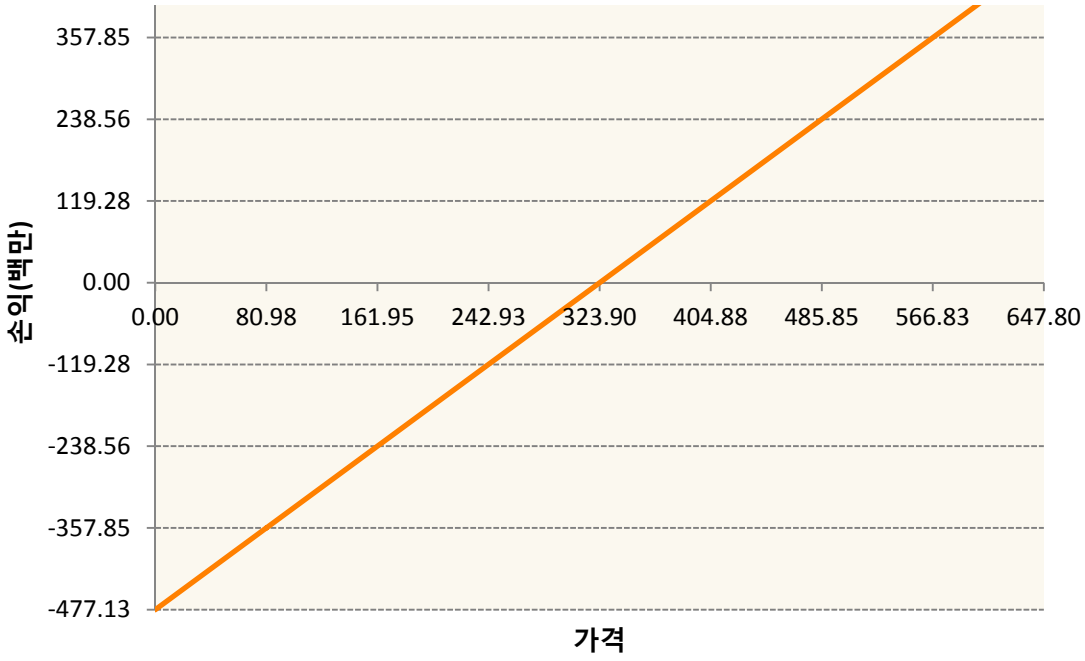


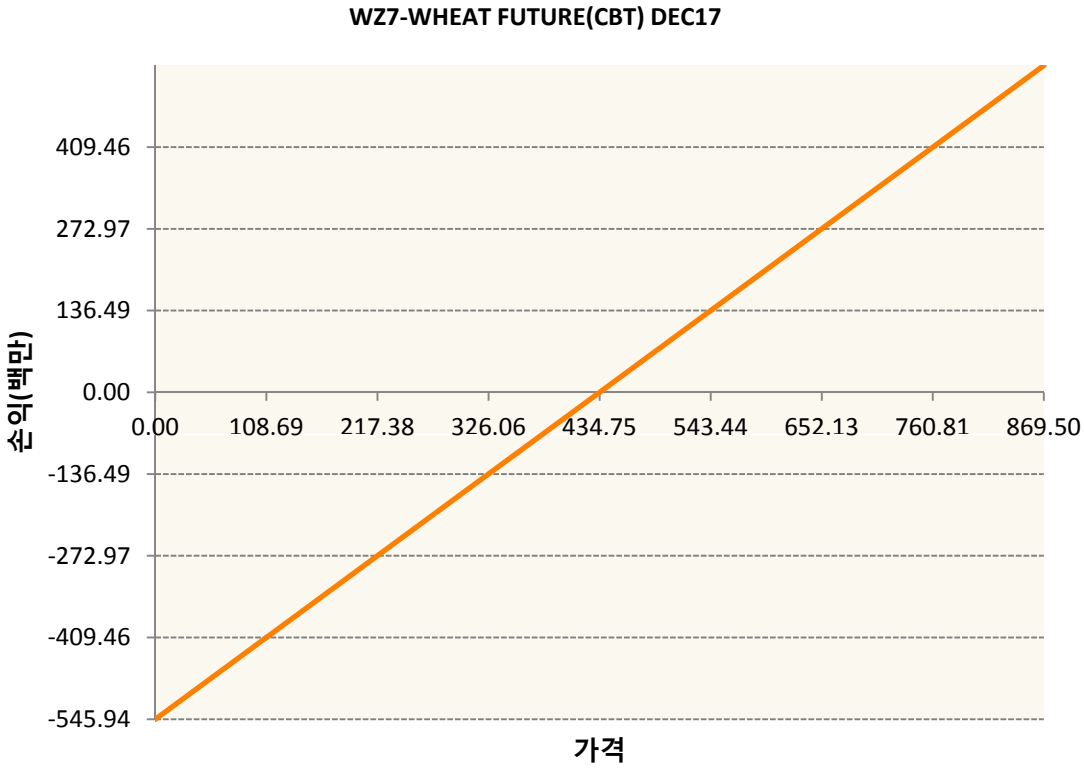
SF8-SOYBEAN FUTURE Jan18



SMF8-SOYBEAN MEAL FUTR Jan18







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	28
SF8	SOYBEAN FUTURE Jan18	72
SMF8	SOYBEAN MEAL FUTR Jan18	38
WZ7	WHEAT FUTURE(CBT) DEC17	44

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

418