공시일	2017-10-20
기준일	2017-10-19

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	2017-10-20
기준일	2017-10-19

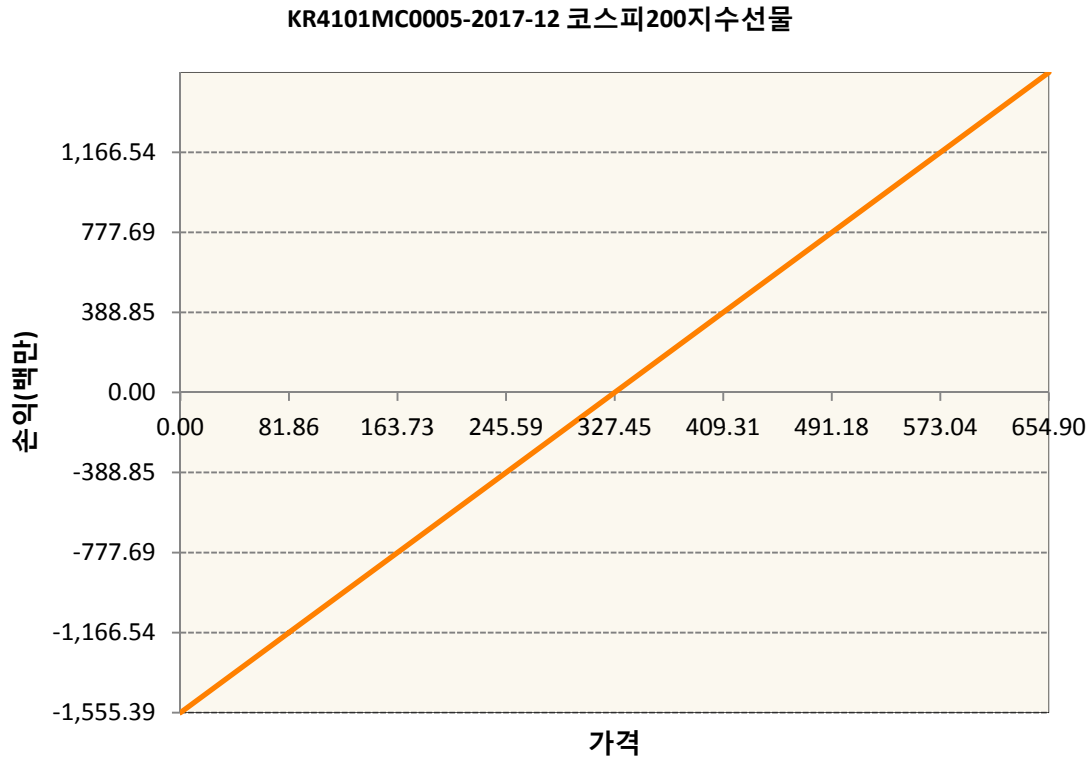
스마트인덱스모

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	82	-82	장내
누계	유가증권	선물	1,555	0	1,555	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101MC0	2017-12 코스피200지수선물						124
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-124	-124	-124	-124	-124	-124	-124
-5.33%	-83	-83	-83	-83	-83	-83	-83
-2.67%	-41	-41	-41	-41	-41	-41	-41
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	41	41	41	41	41	41	41
5.33%	83	83	83	83	83	83	83
8.00%	124	124	124	124	124	124	124

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

75

공시일	2017-10-20
기준일	2017-10-19

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	1,062

* 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	2017-10-20
기준일	2017-10-19

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	414

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

360

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-10-20
기준일	2017-10-19

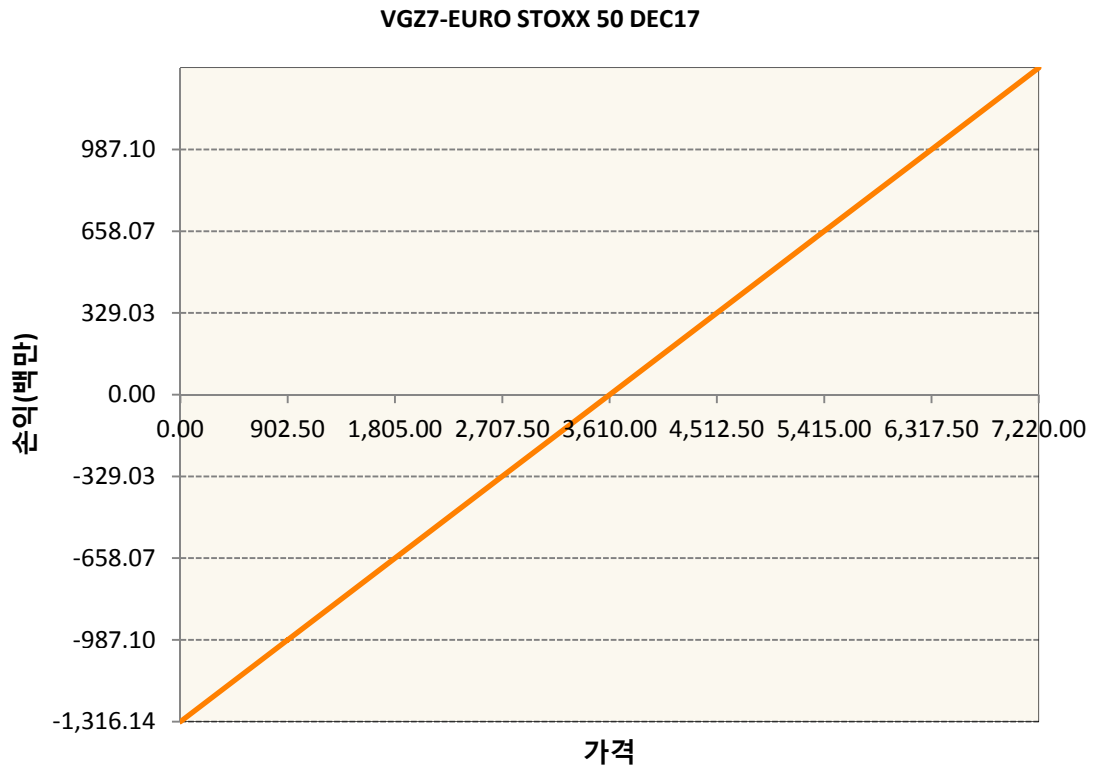
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,316	0	1,316	

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	2017-10-20
기준일	2017-10-19

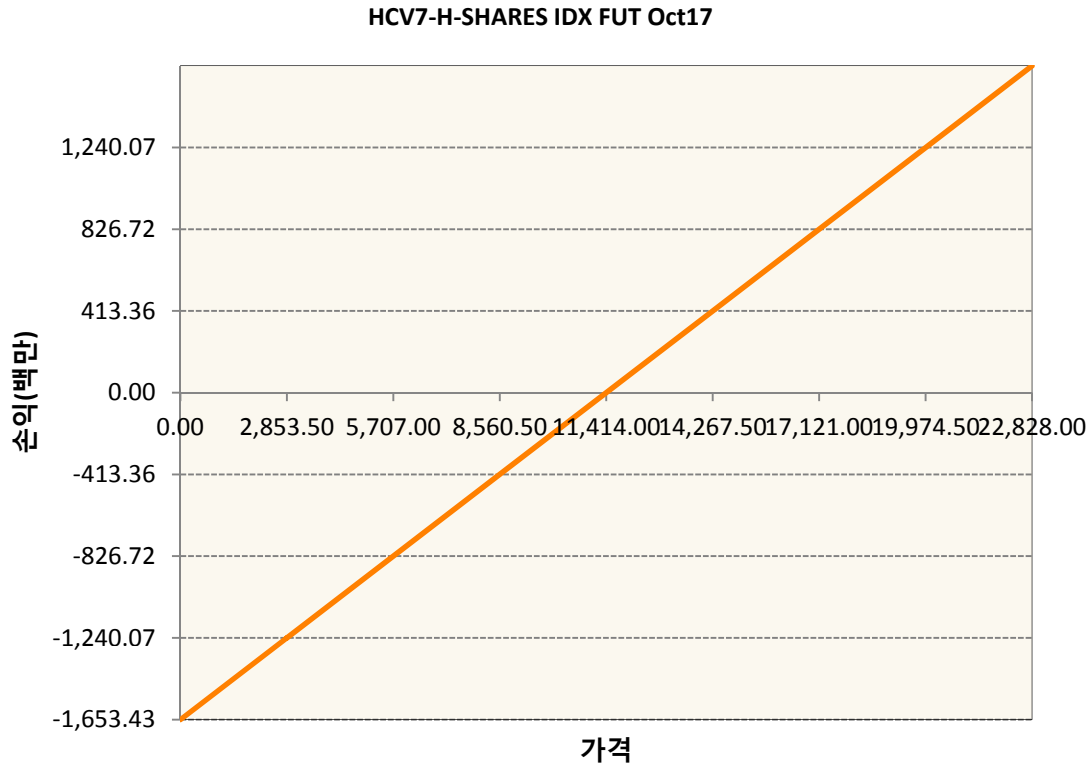
차이나인덱스모(주식-파생형)

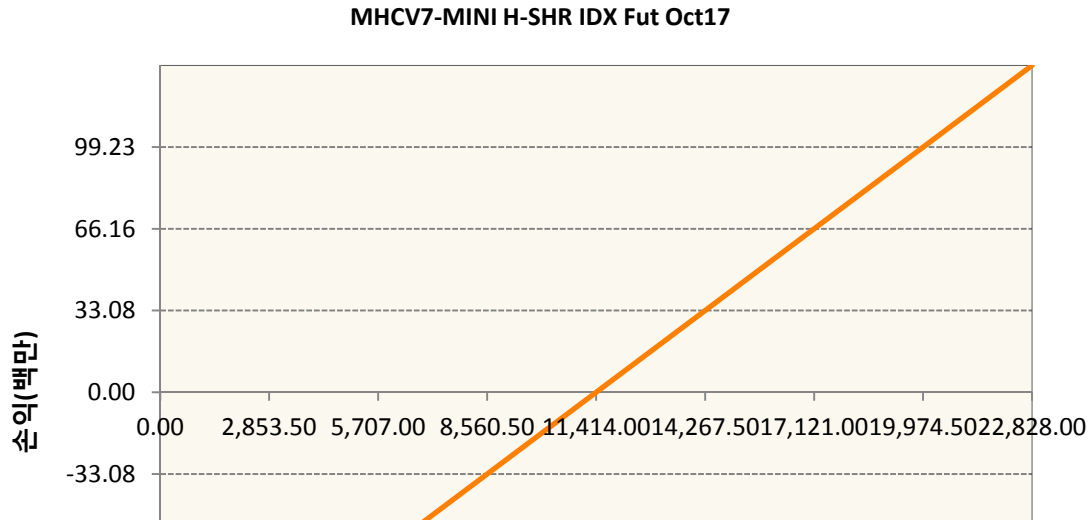
1. 계약금액

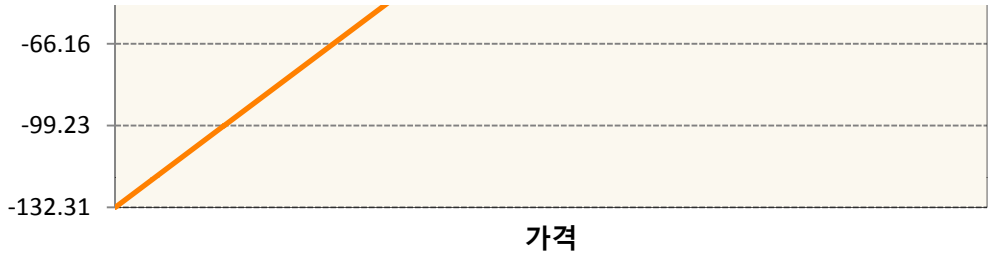
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,786	0	1,786	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCV7	H-SHARES IDX FUT Oct17	132
MHCV7	MINI H-SHR IDX Fut Oct17	11

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	116

공시일	2017-10-20
기준일	2017-10-19

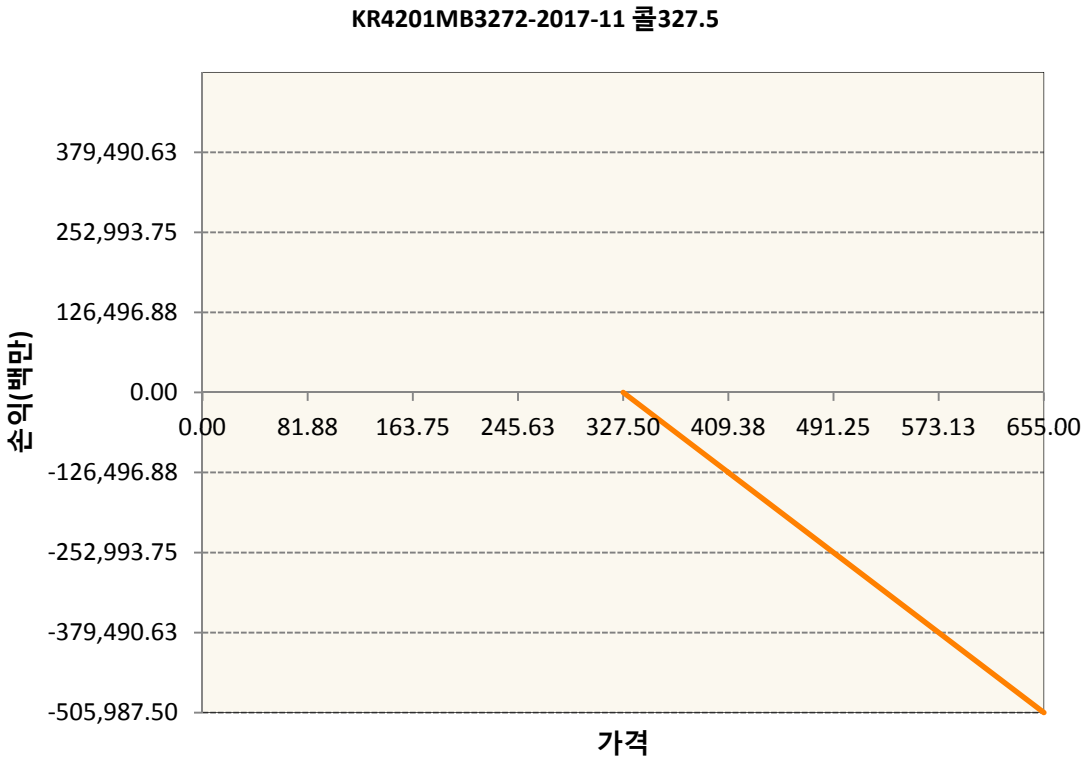
커버드콜모(주식혼합-파생형)

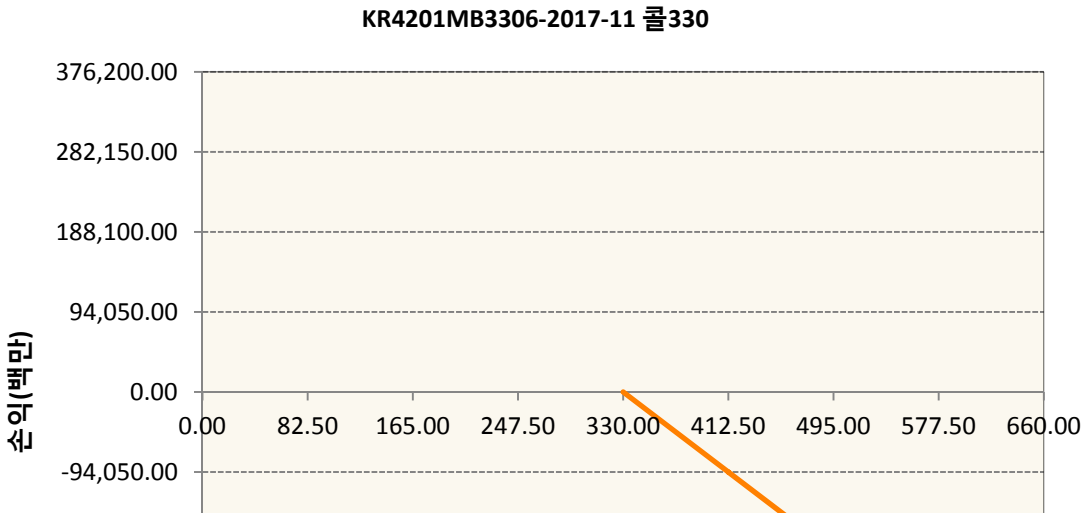
1. 계약금액

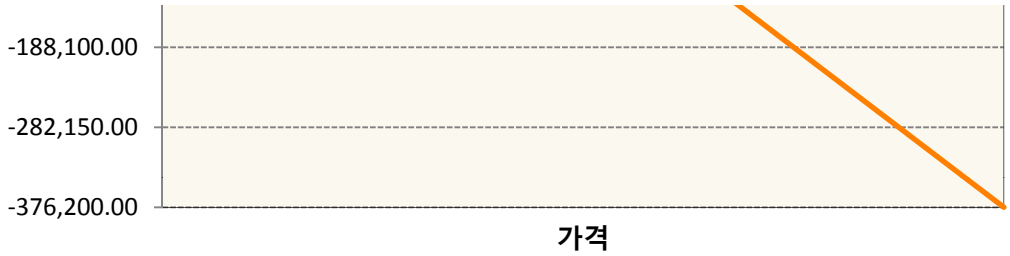
(단위:백만원)

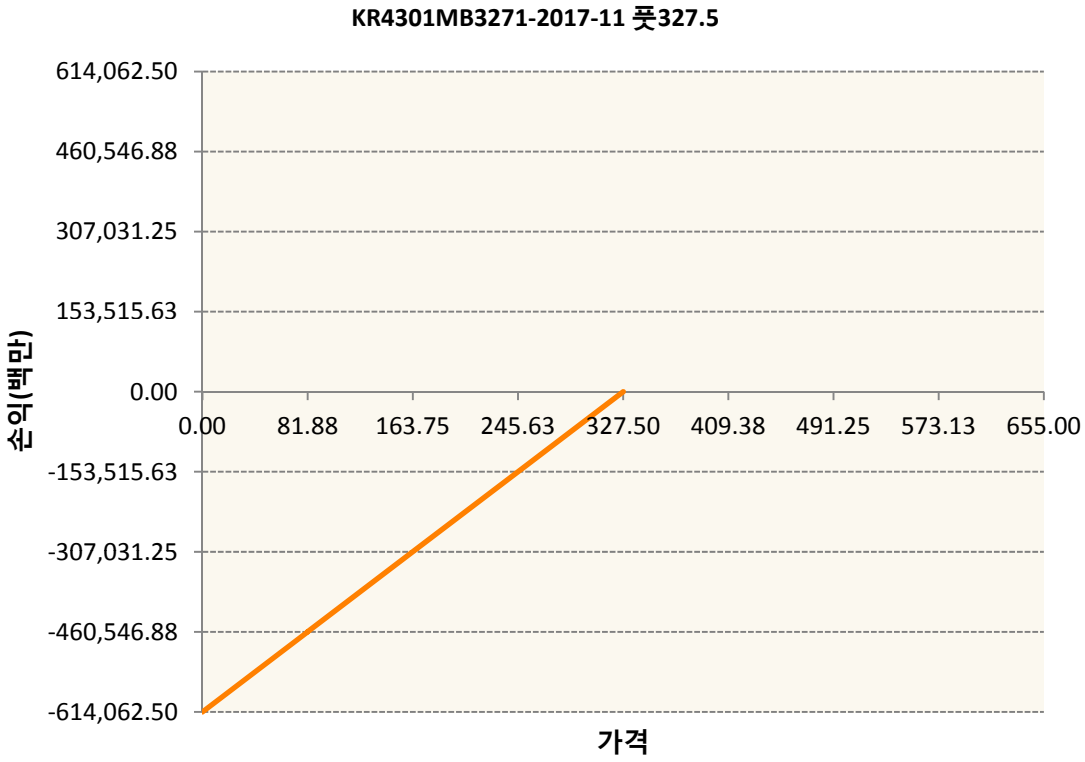
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	1,496,250	-1,496,250	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201MB3: 2017-11 콜327.5							30,980
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	10,527	10,383	10,182	9,923	9,609	9,244	8,831
-5.33%	9,848	9,444	8,974	8,448	7,874	7,259	6,610
-2.67%	7,687	6,936	6,154	5,348	4,523	3,682	2,829
0%	2,850	1,901	950	0	-951	-1,901	-2,852
2.67%	-5,236	-6,079	-6,942	-7,822	-8,713	-9,615	-10,525
5.33%	-16,054	-16,593	-17,193	-17,843	-18,536	-19,263	-20,020
8.00%	-28,499	-28,754	-29,079	-29,471	-29,923	-30,428	-30,980
KR4201MB3: 2017-11 콜330							21,753
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	6,557	6,481	6,369	6,217	6,026	5,797	5,533

-5.33%	6,213	5,976	5,688	5,355	4,983	4,578	4,143
-2.67%	5,007	4,517	3,995	3,448	2,880	2,296	1,698
0%	2,067	1,381	692	0	-694	-1,389	-2,085
2.67%	-3,215	-3,887	-4,566	-5,251	-5,941	-6,633	-7,329
5.33%	-10,680	-11,153	-11,664	-12,206	-12,772	-13,358	-13,961
8.00%	-19,586	-19,831	-20,131	-20,478	-20,868	-21,294	-21,753
KR4301MB3: 2017-11 풋327.5							42,661
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-42,590	-42,591	-42,593	-42,598	-42,610	-42,630	-42,661
-5.33%	-26,298	-26,326	-26,374	-26,447	-26,548	-26,676	-26,834
-2.67%	-10,511	-10,771	-11,073	-11,411	-11,780	-12,174	-12,590
0%	1,792	1,195	598	0	-598	-1,197	-1,797
2.67%	7,132	6,762	6,357	5,924	5,467	4,991	4,500
5.33%	8,099	8,030	7,927	7,789	7,616	7,408	7,167
8.00%	8,163	8,159	8,148	8,128	8,093	8,040	7,967

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

102,297

공시일	2017-10-20
기준일	2017-10-19

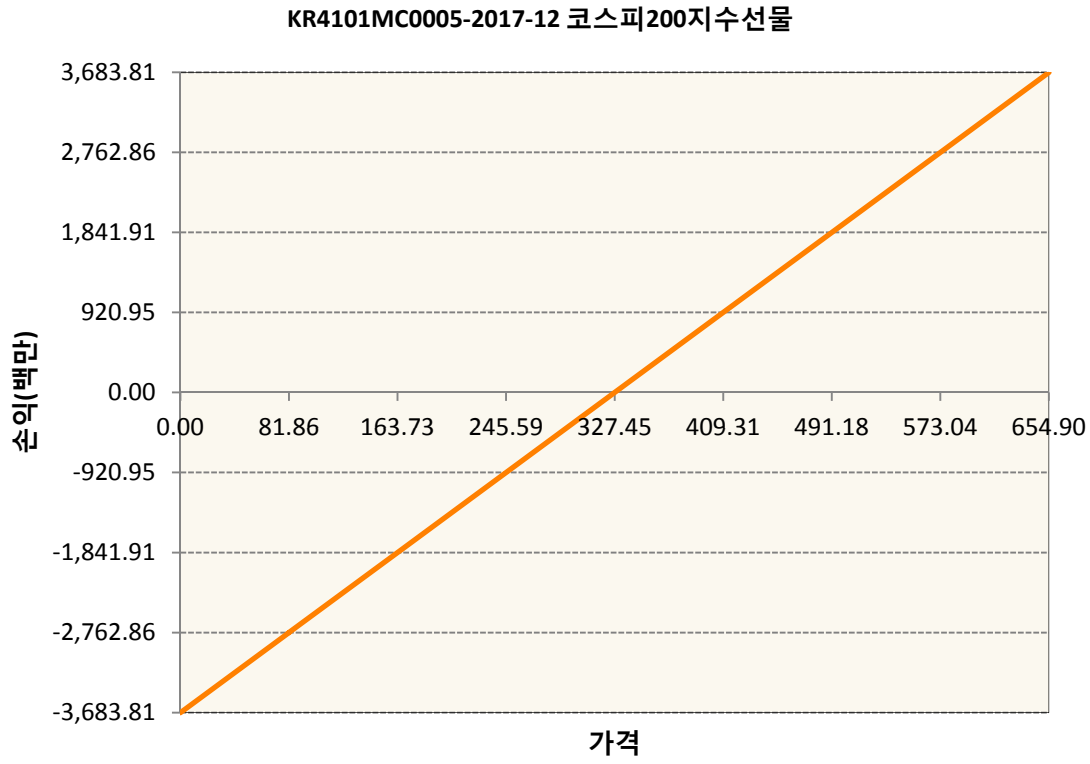
ETF스마트레버리지목표전환형7호

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	3,684	0	3,684	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101MC0	2017-12 코스피200지수선물						294
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-294	-294	-294	-294	-294	-294	-294
-5.33%	-196	-196	-196	-196	-196	-196	-196
-2.67%	-98	-98	-98	-98	-98	-98	-98
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	98	98	98	98	98	98	98
5.33%	196	196	196	196	196	196	196
8.00%	294	294	294	294	294	294	294

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

177

공시일	2017-10-20
기준일	2017-10-19

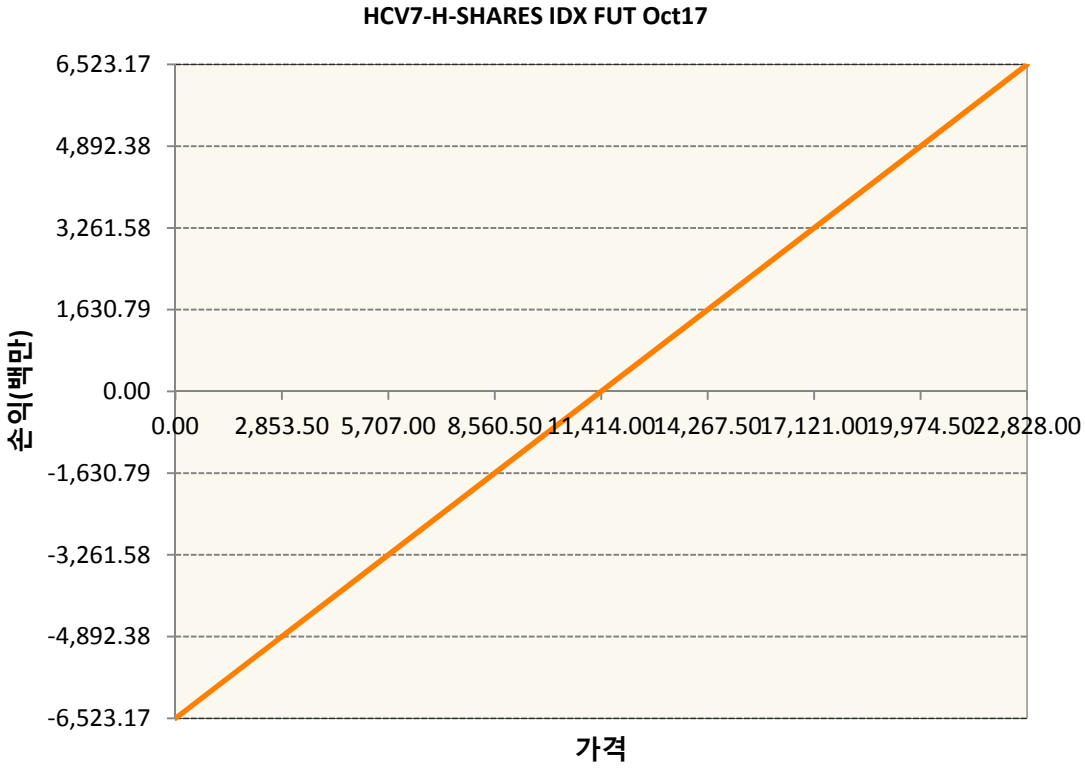
홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생

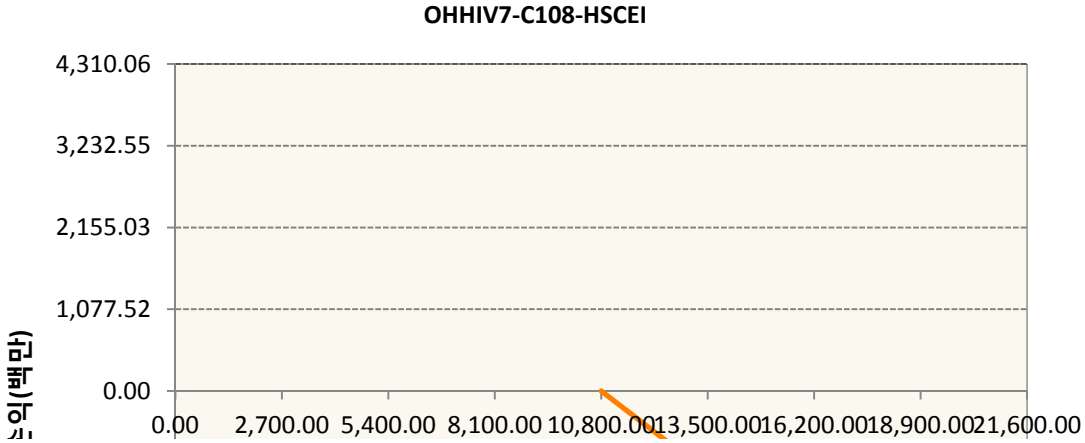
1. 계약금액

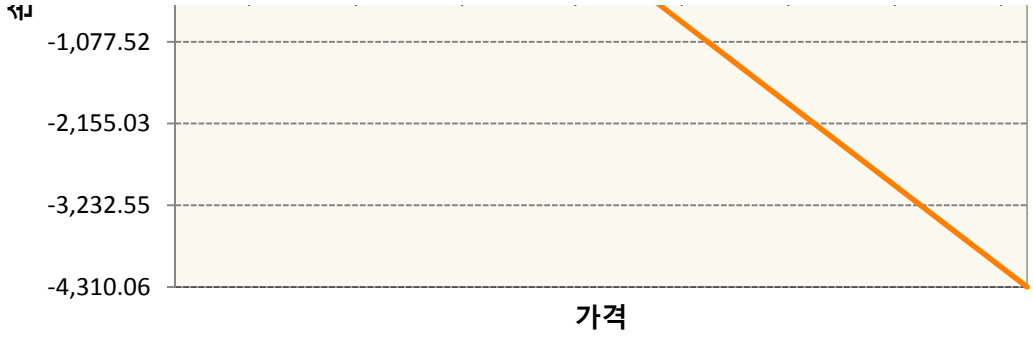
(단위:백만원)

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	6,523	0	6,523	장내
누계	유가증권	옵션	0	13,569	-13,569	장내

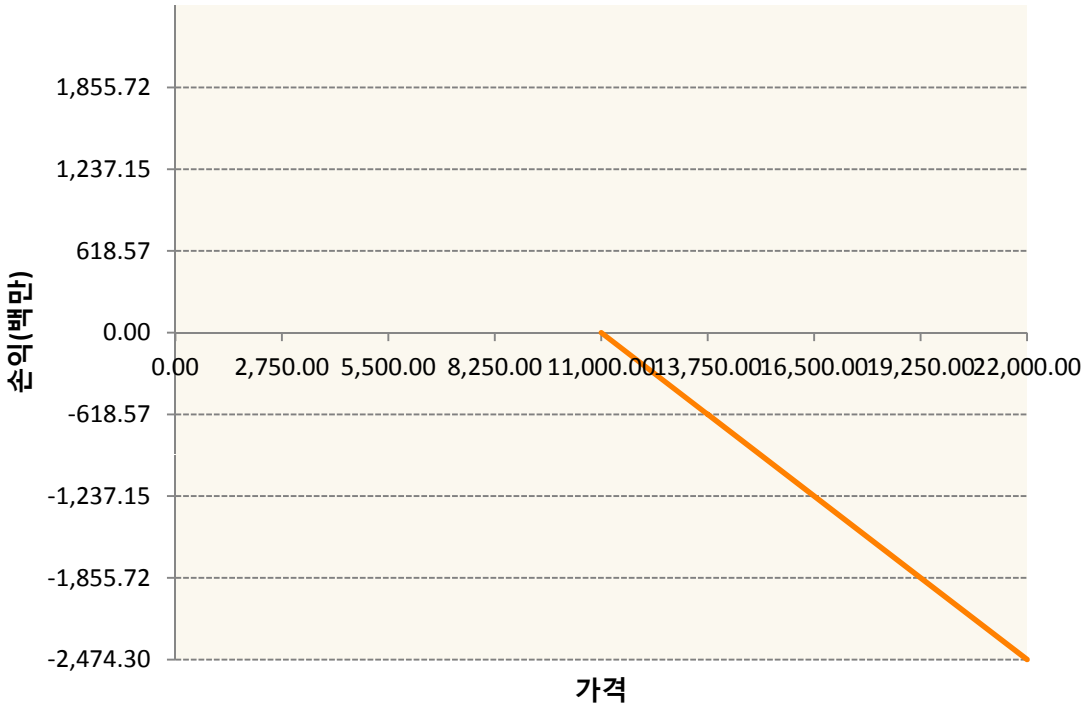
2. 만기시점의 손익구조



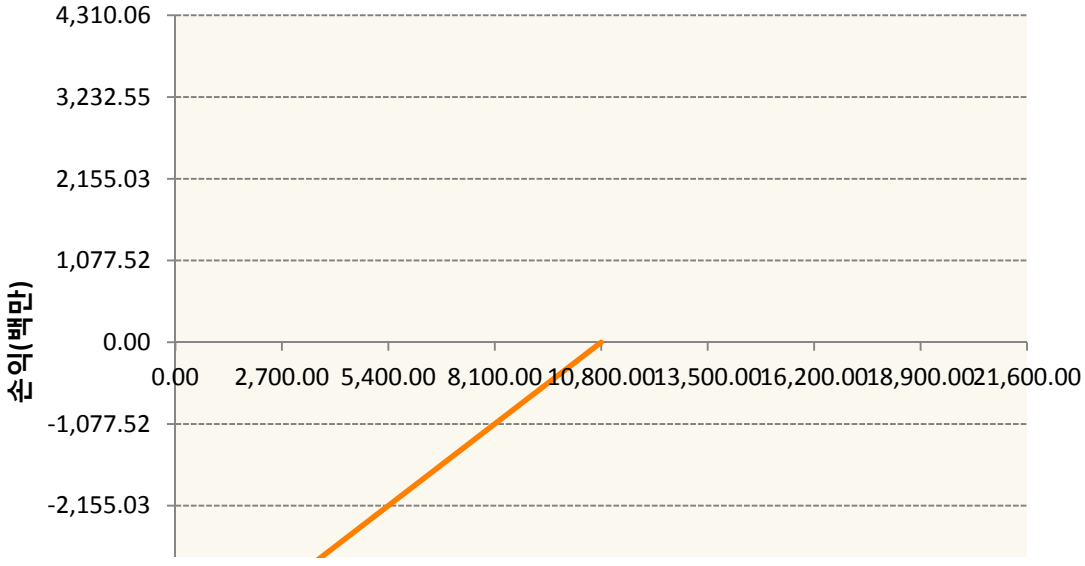


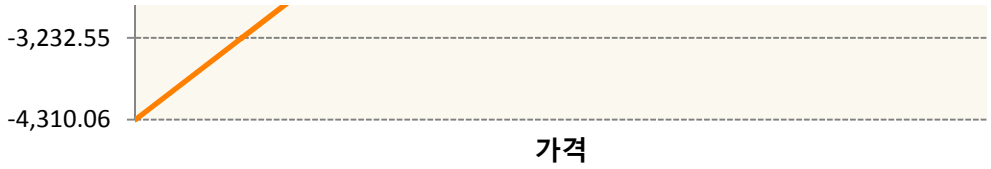


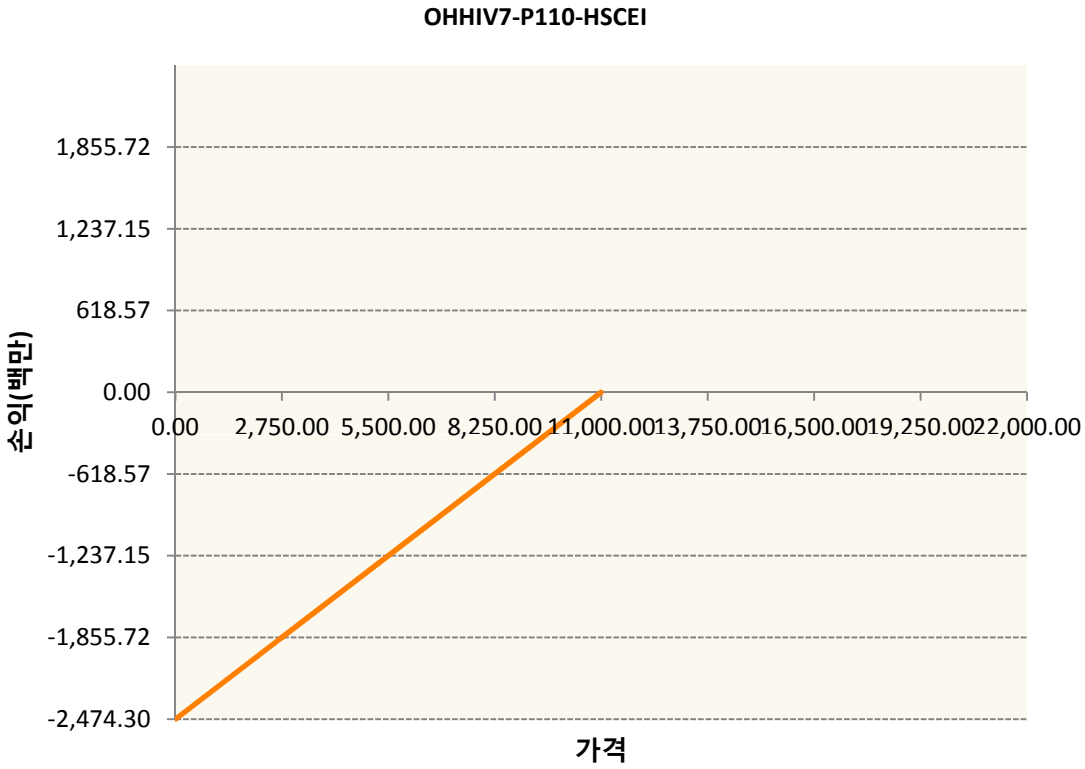
OHHIV7-C110-HSCEI



OHHIV7-P108-HSCEI







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCV7	H-SHARES IDX FUT Oct17	522
OHHIV7-C1(	HSCEI	345
OHHIV7-C11	HSCEI	198
OHHIV7-P1(	HSCEI	345
OHHIV7-P11	HSCEI	198

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,311

공시일	2017-10-20
기준일	2017-10-19

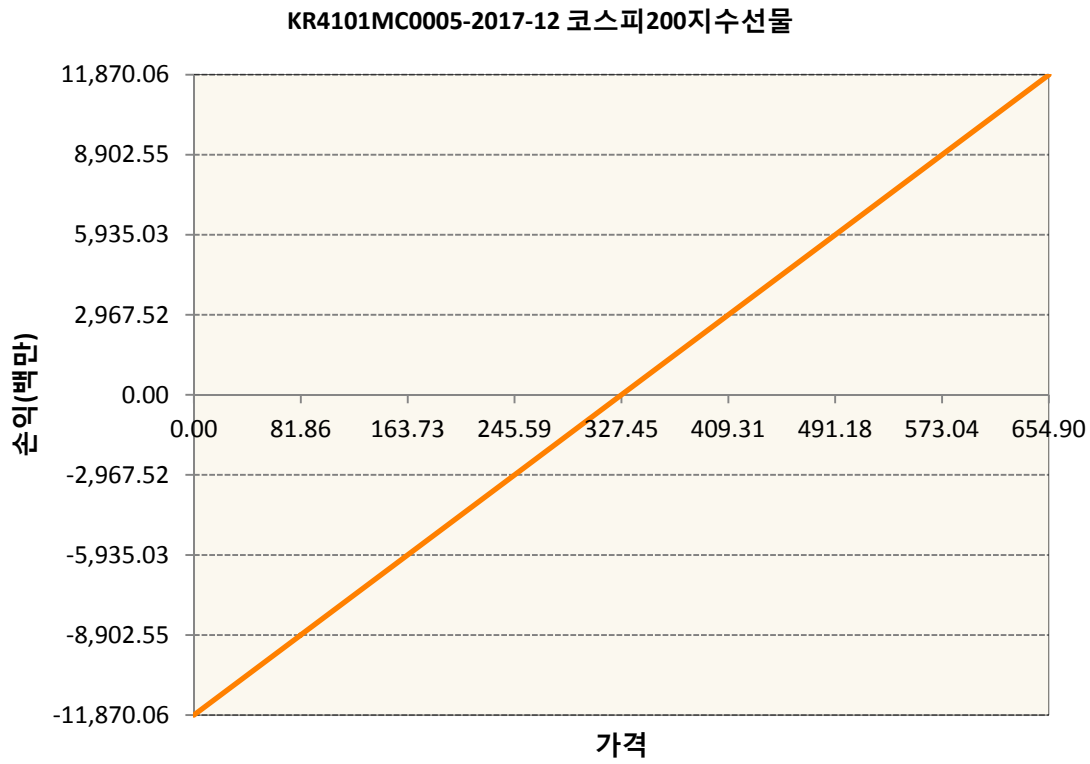
코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼

1. 계약금액

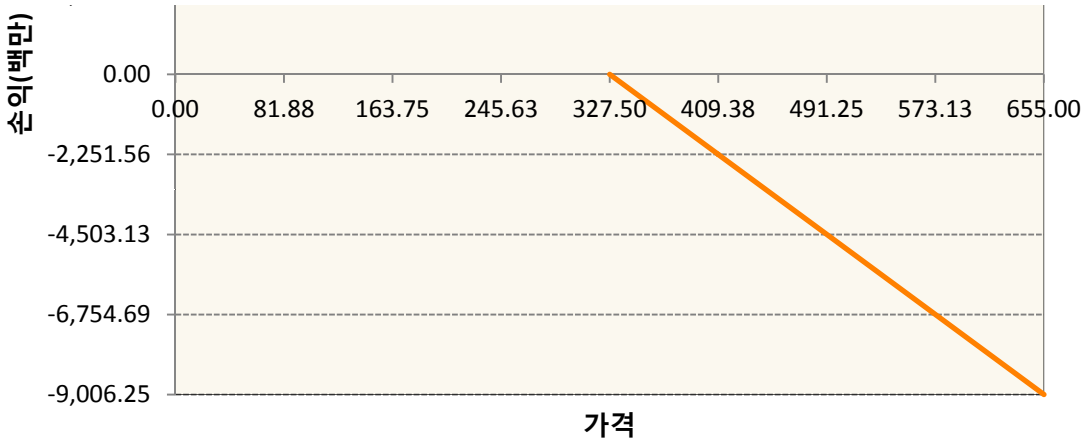
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	2,472	-2,472	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	11,870	0	11,870	장내
누계	유가증권	스왑	32,700	0	32,700	장외
누계	유가증권	옵션	0	31,584	-31,584	장내

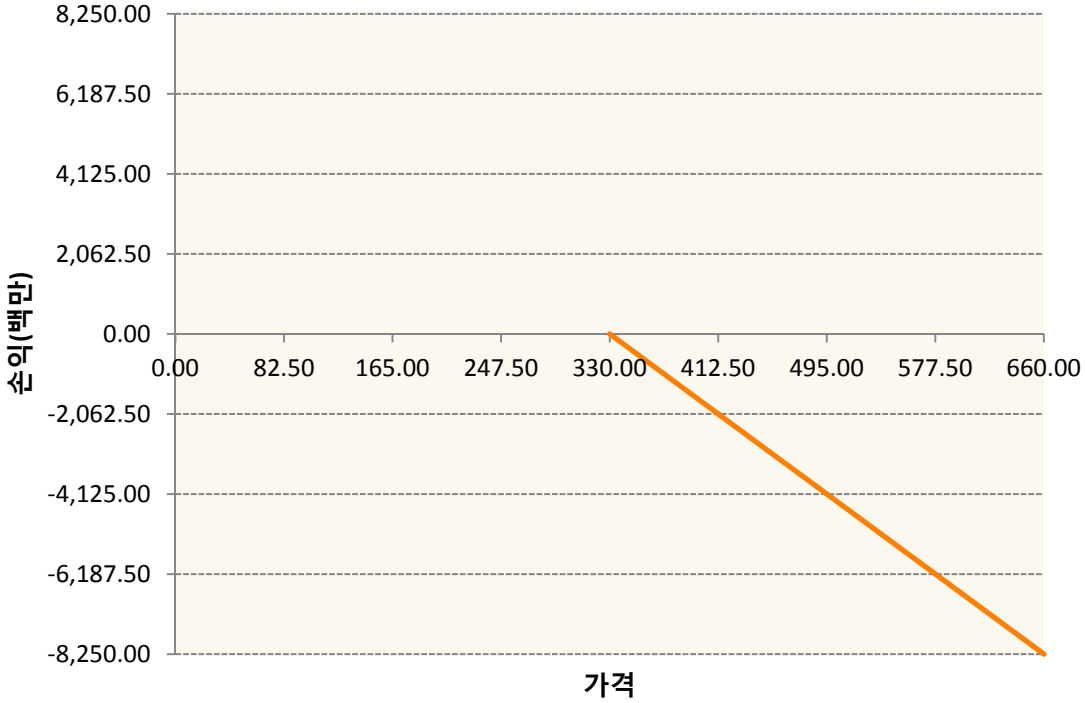
2. 만기시점의 손익구조



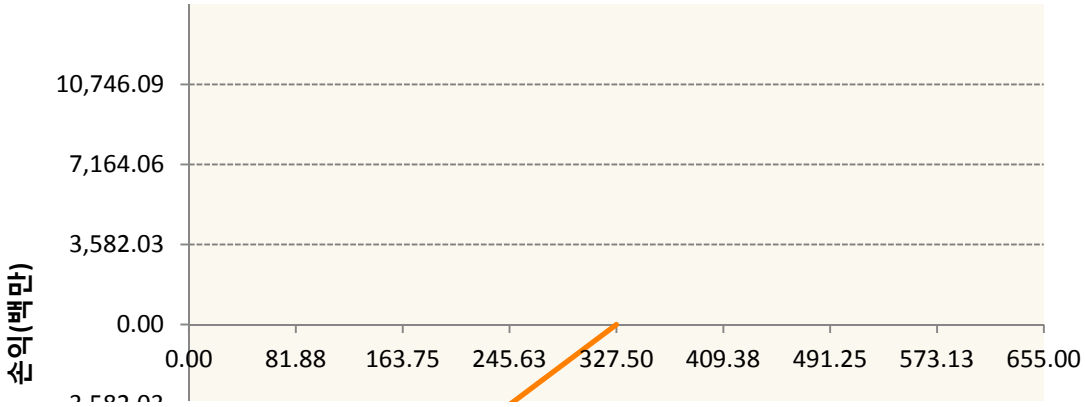




KR4201MB3306-2017-11 콜330



KR4301MB3271-2017-11 풋327.5





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_2							1,502
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,502	-1,502	-1,502	-1,502	-1,502	-1,502	-1,502
-5.33%	-1,001	-1,001	-1,001	-1,001	-1,001	-1,001	-1,001
-2.67%	-501	-501	-501	-501	-501	-501	-501
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	501	501	501	501	501	501	501
5.33%	1,001	1,001	1,001	1,001	1,001	1,001	1,001
8.00%	1,502	1,502	1,502	1,502	1,502	1,502	1,502
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							244
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%

-8.00%	-244	-244	-244	-244	-244	-244	-244
-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%	244	244	244	244	244	244	244
	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					260
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-260	-260	-260	-260	-260	-260	-260
-5.33%	-173	-173	-173	-173	-173	-173	-173
-2.67%	-87	-87	-87	-87	-87	-87	-87
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	87	87	87	87	87	87	87
5.33%	173	173	173	173	173	173	173
8.00%	260	260	260	260	260	260	260
	KR4101MC0	2017-12 코스피200지수선물					947
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-947	-947	-947	-947	-947	-947	-947
-5.33%	-631	-631	-631	-631	-631	-631	-631
-2.67%	-316	-316	-316	-316	-316	-316	-316
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	316	316	316	316	316	316	316
5.33%	631	631	631	631	631	631	631
8.00%	947	947	947	947	947	947	947
	KR4201MB3	2017-11 콜327.5					551
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	187	185	181	177	171	165	157
-5.33%	175	168	160	150	140	129	118
-2.67%	137	123	110	95	80	66	50
0%	51	34	17	0	-17	-34	-51

2.67%	-93	-108	-124	-139	-155	-171	-187
5.33%	-286	-295	-306	-318	-330	-343	-356
8.00%	-507	-512	-518	-525	-533	-542	-551
	KR4201MB3: 2017-11 콜330						477
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	144	142	140	136	132	127	121
-5.33%	136	131	125	117	109	100	91
-2.67%	110	99	88	76	63	50	37
0%	45	30	15	0	-15	-30	-46
2.67%	-71	-85	-100	-115	-130	-145	-161
5.33%	-234	-245	-256	-268	-280	-293	-306
8.00%	-430	-435	-441	-449	-458	-467	-477
	KR4301MB3: 2017-11 풋327.5						995
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-994	-994	-994	-994	-994	-995	-995
-5.33%	-614	-614	-615	-617	-619	-622	-626
-2.67%	-245	-251	-258	-266	-275	-284	-294
0%	42	28	14	0	-14	-28	-42
2.67%	166	158	148	138	128	116	105
5.33%	189	187	185	182	178	173	167
8.00%	190	190	190	190	189	188	186

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

5,411

공시일	2017-10-20
기준일	2017-10-19

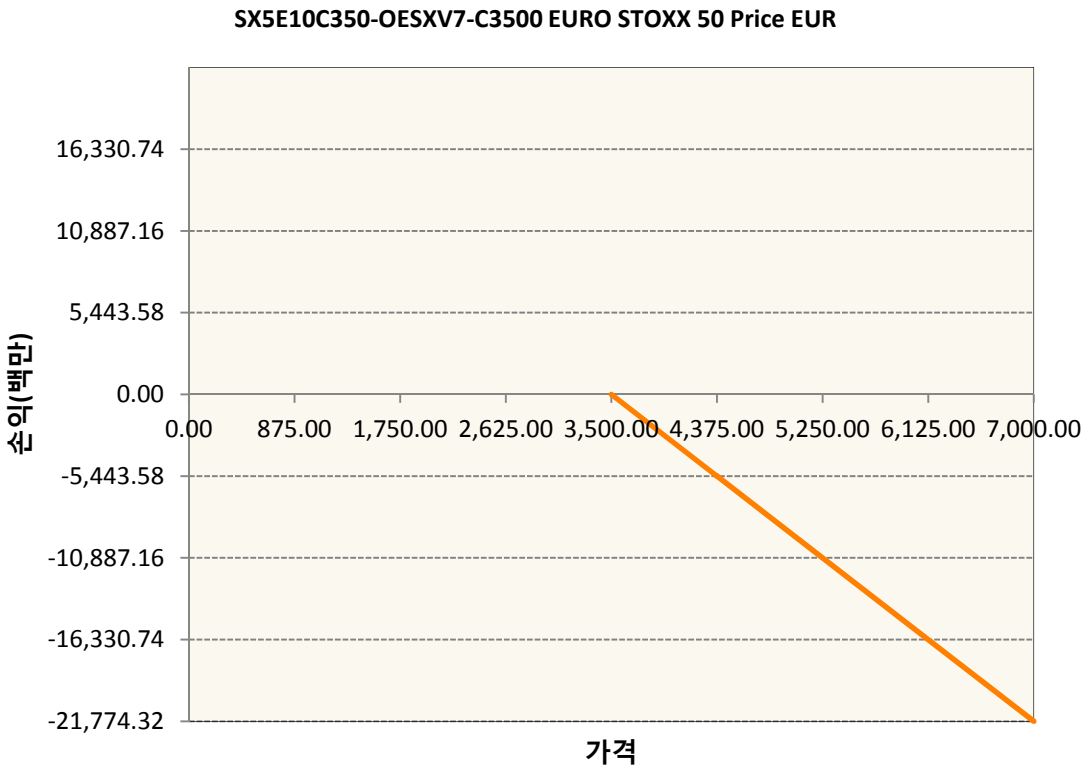
유로커버드콜모(주식혼합-파생형

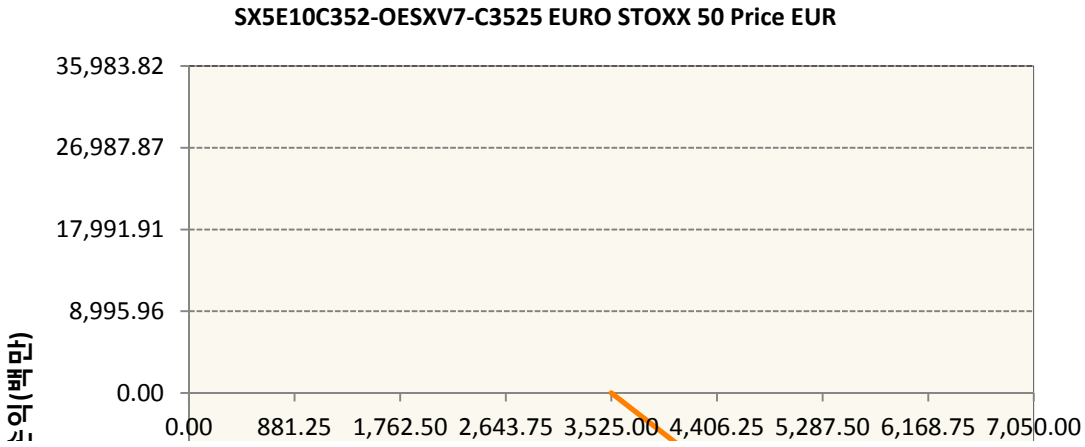
1. 계약금액

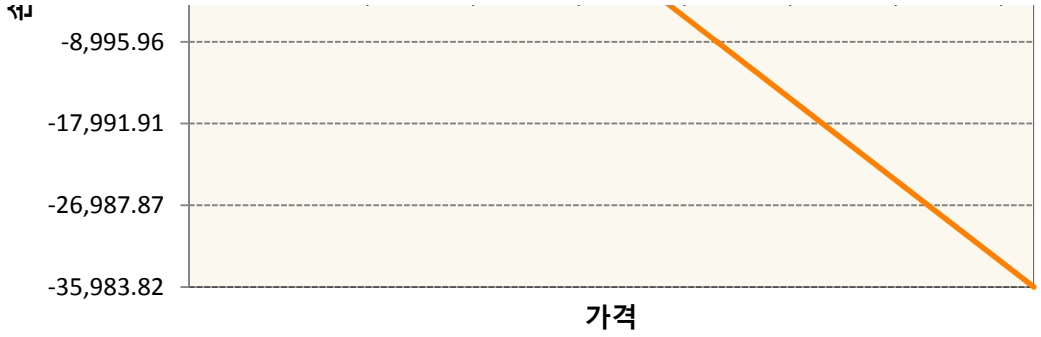
(단위:백만원)

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	55,386	0	55,386	
누계	유가증권	ELS	0	115,516	-115,516	장외

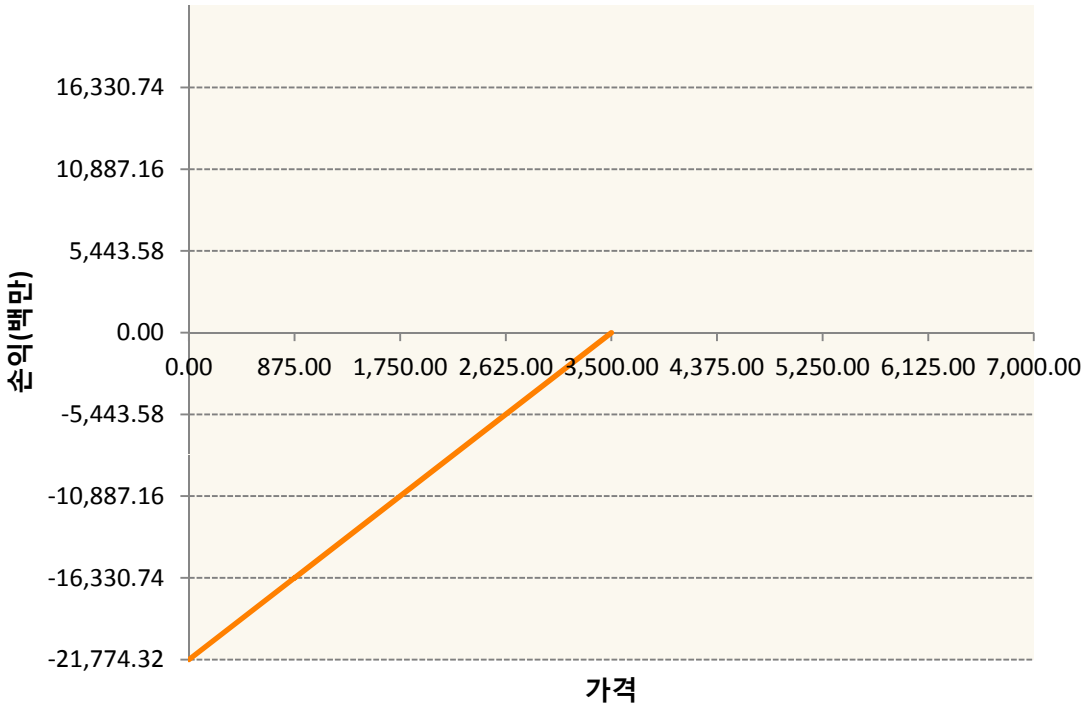
2. 만기시점의 손익구조



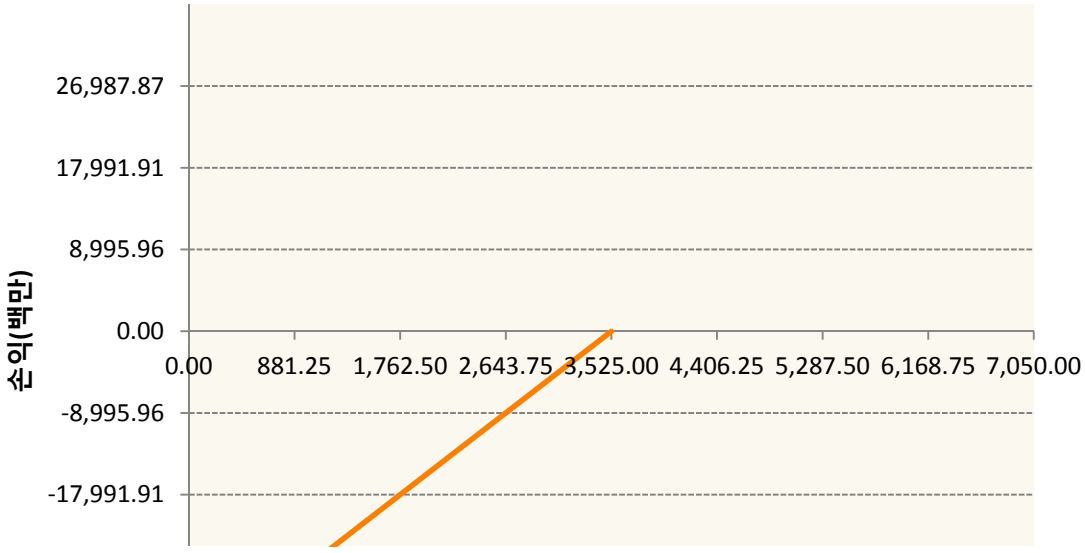


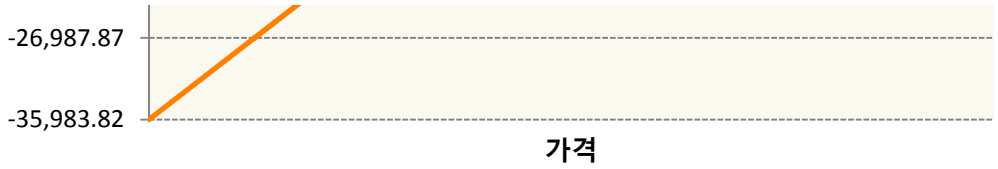


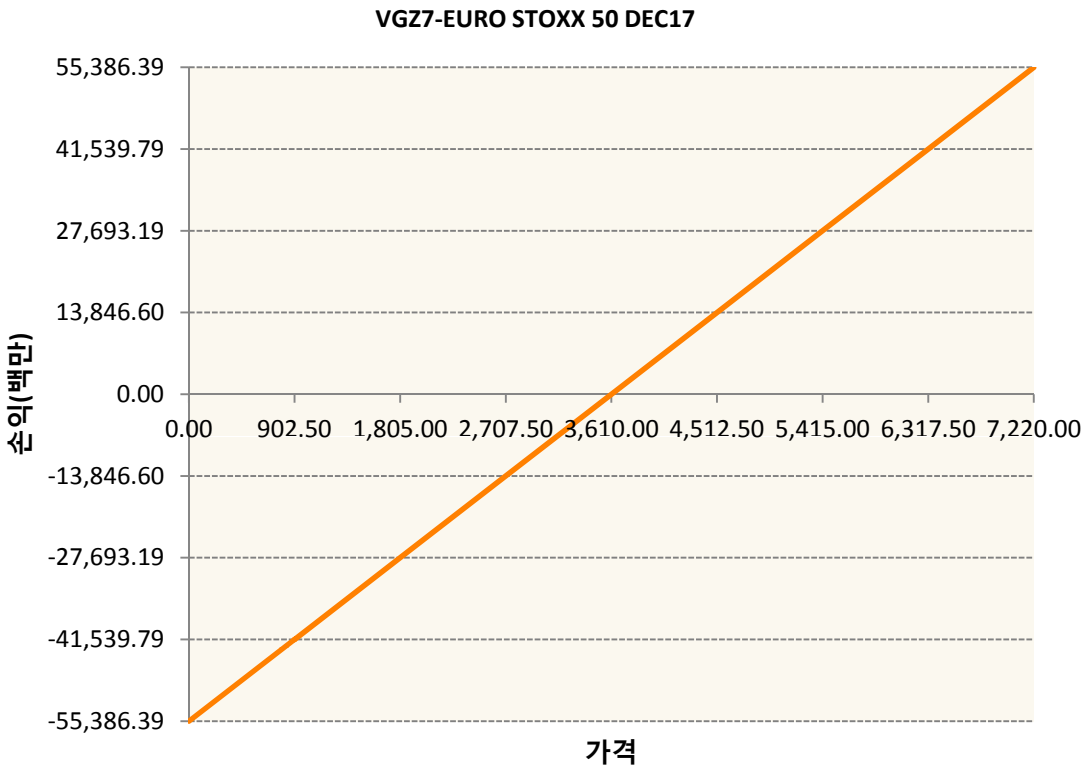
SX5E10P350-OESXV7-P3500 EURO STOXX 50 Price EUR



SX5E10P352-OESXV7-P3525 EURO STOXX 50 Price EUR







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

SX5E10C350 OESXV7-C3500 EURO STOXX 50 Price EUR	1,742
SX5E10C352 OESXV7-C3525 EURO STOXX 50 Price EUR	2,879
SX5E10P350 OESXV7-P3500 EURO STOXX 50 Price EUR	1,742
SX5E10P352 OESXV7-P3525 EURO STOXX 50 Price EUR	2,879
VGZ7 EURO STOXX 50 DEC17	4,431

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

10,366

공시일	2017-10-20
기준일	2017-10-19

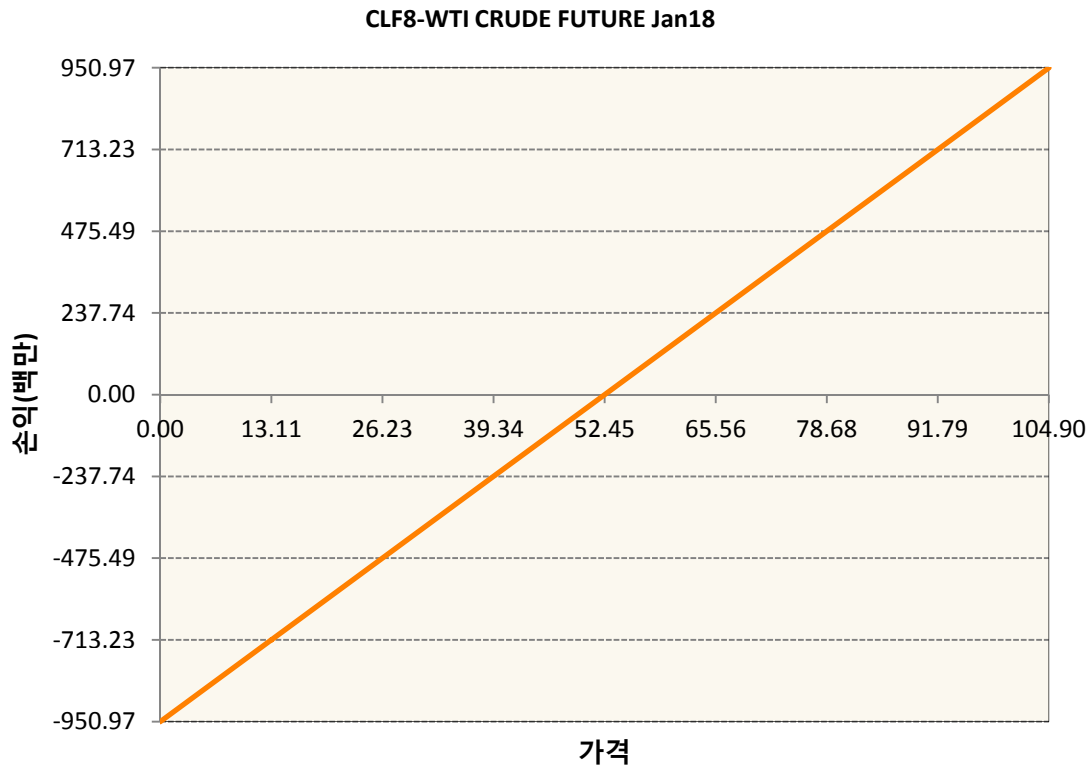
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

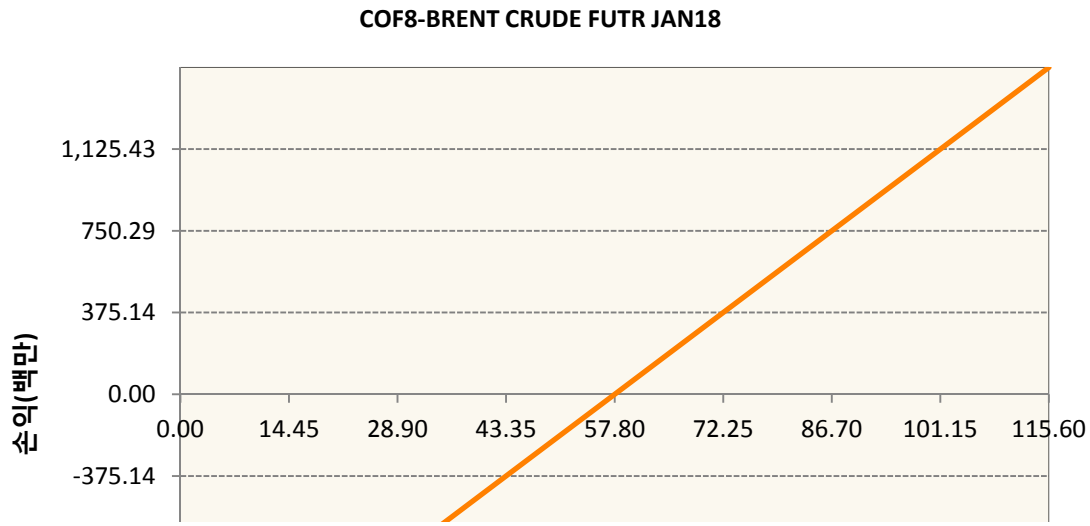
1. 계약금액

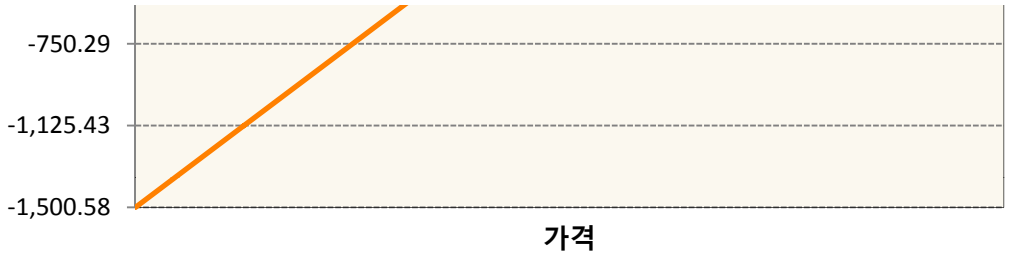
(단위:백만원)

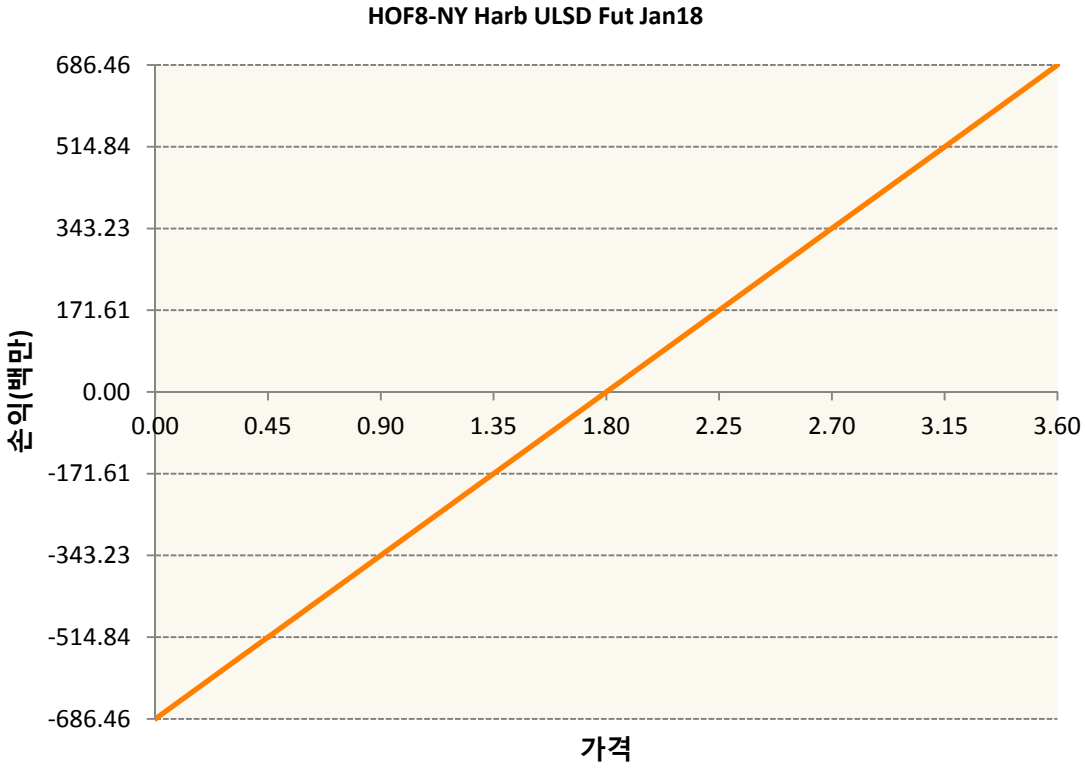
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	5,274	905	4,369	

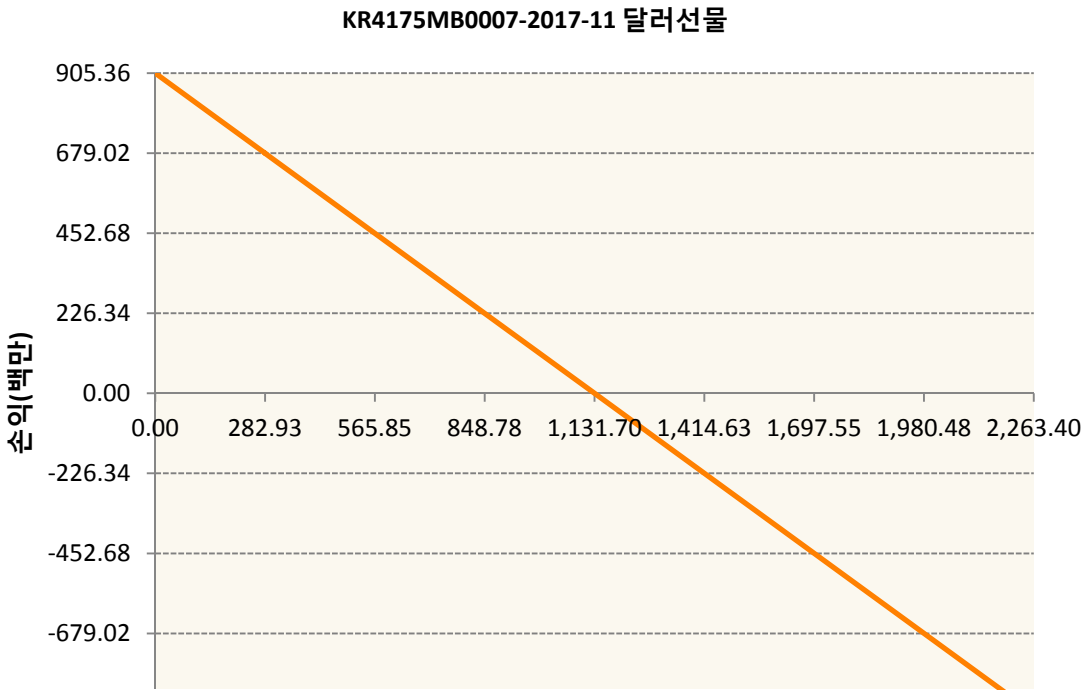
2. 만기시점의 손익구조

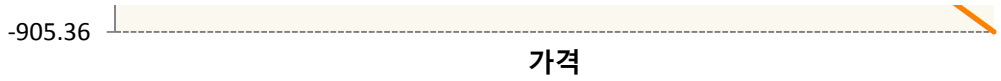


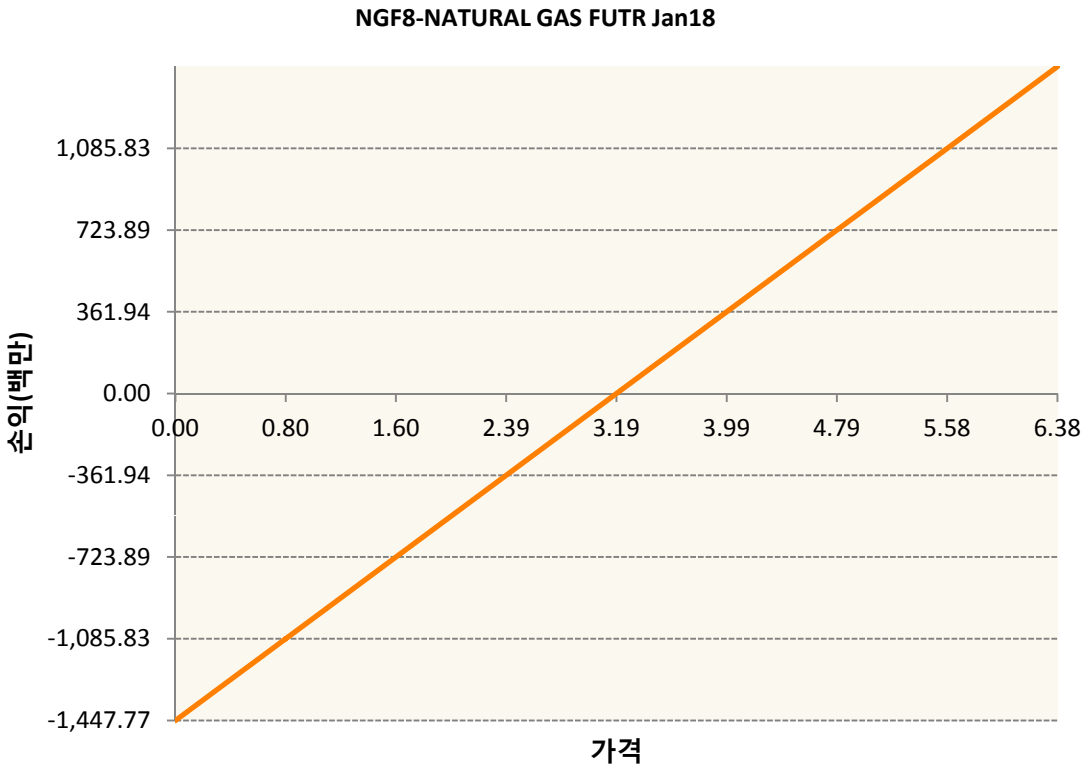


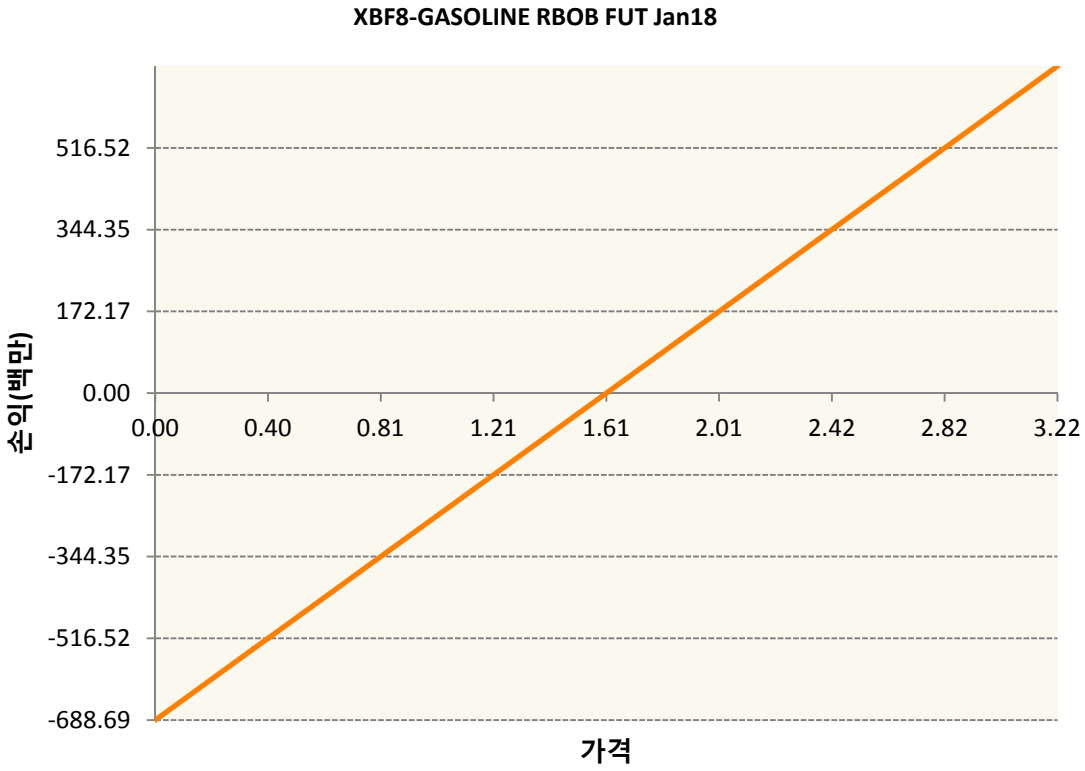

-750.29
-1,125.43
-1,500.58
가격


HOF8-NY Harb ULSD Fut Jan18
686.46
514.84
343.23
171.61
0.00
-171.61
-343.23
-514.84
-686.46
0.00
0.45
0.90
1.35
1.80
2.25
2.70
3.15
3.60
손익(백만)
가격


KR4175MB0007-2017-11 달러선물
905.36
679.02
452.68
226.34
0.00
-226.34
-452.68
-679.02
0.00
282.93
565.85
848.78
1,131.70
1,414.63
1,697.55
1,980.48
2,263.40
손익(백만)


-905.36
가격


NGF8-NATURAL GAS FUTR Jan18
손익(백만)
1,085.83
723.89
361.94
0.00
-361.94
-723.89
-1,085.83
-1,447.77
0.00
0.80
1.60
2.39
3.19
3.99
4.79
5.58
6.38
가격


XBF8-GASOLINE RBOB FUT Jan18
손익(백만)
516.52
344.35
172.17
0.00
-172.17
-344.35
-516.52
-688.69
0.00
0.40
0.81
1.21
1.61
2.01
2.42
2.82
3.22
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	116
XBF8	GASOLINE RBOB FUT Jan18	55

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

755

공시일	2017-10-20
기준일	2017-10-19

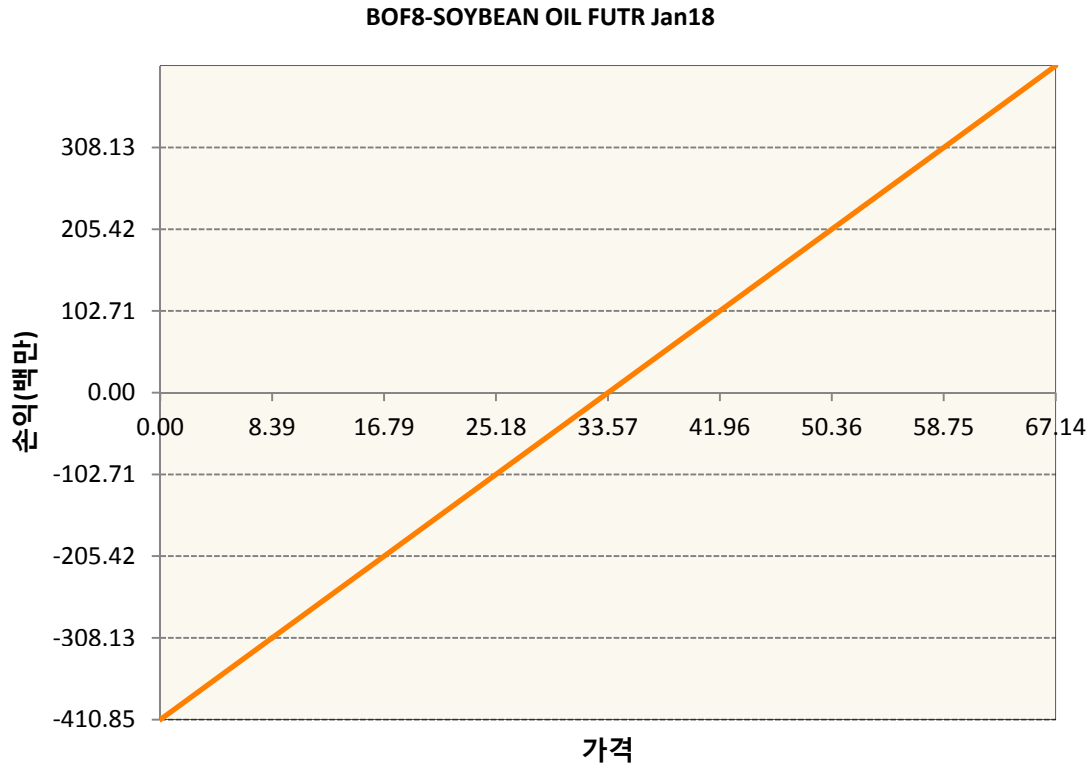
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

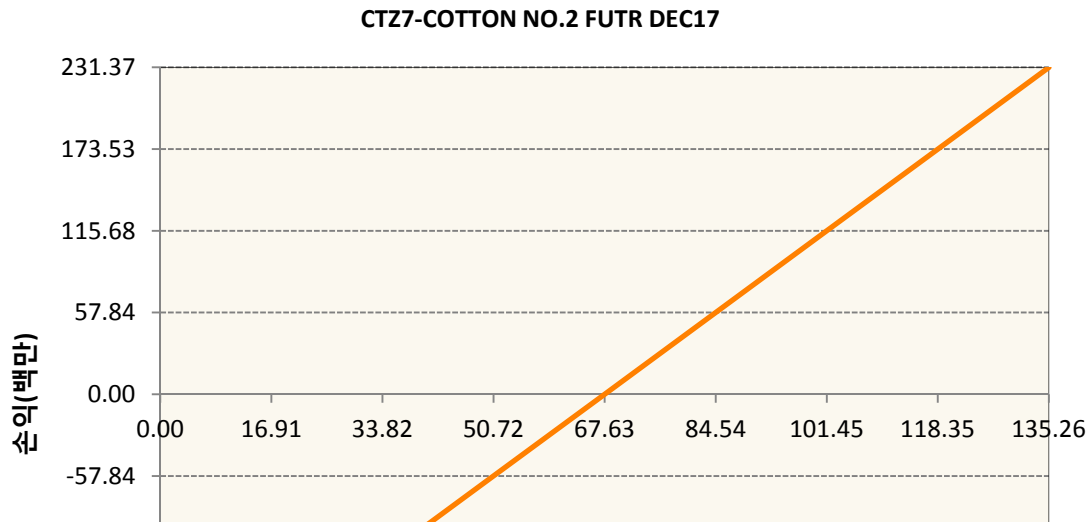
1. 계약금액

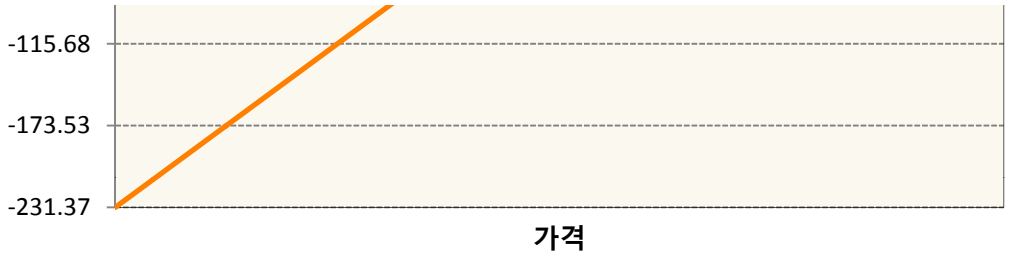
(단위:백만원)

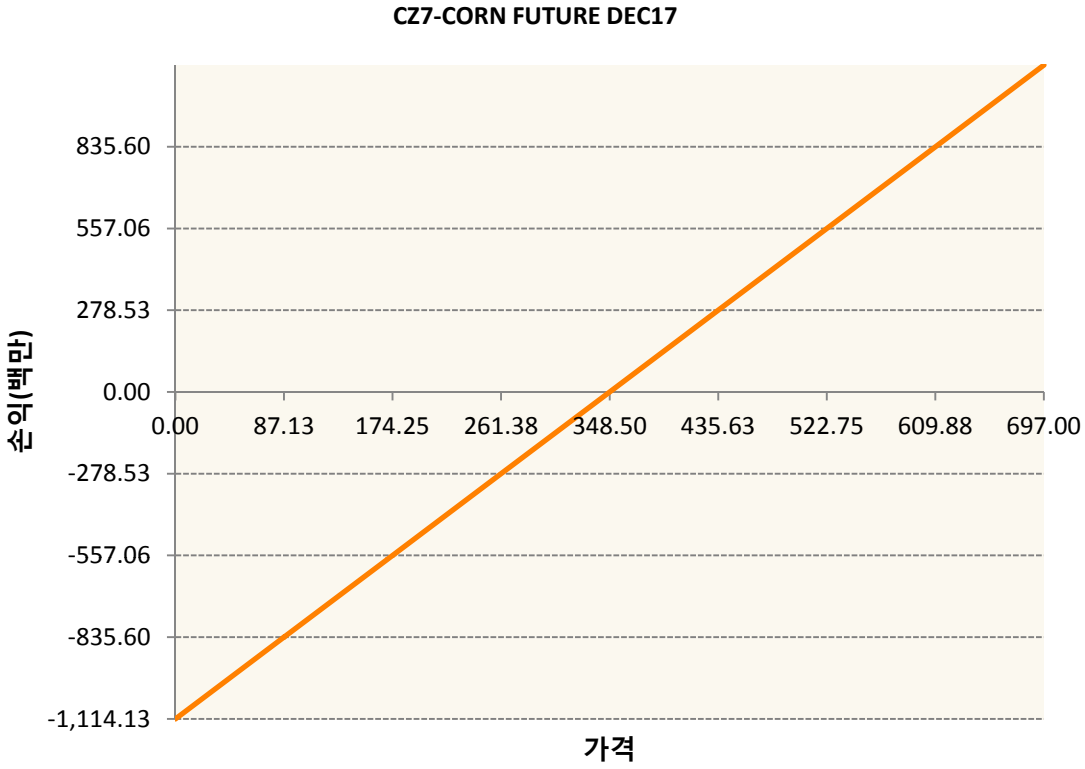
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	4,546	340	4,207	

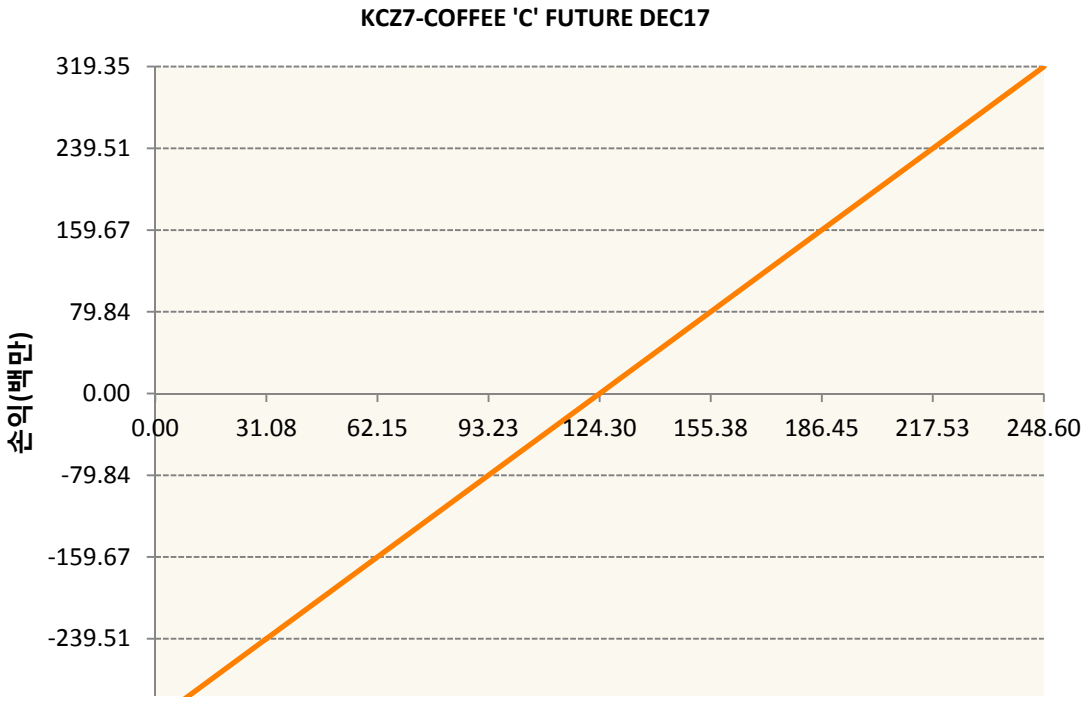
2. 만기시점의 손익구조

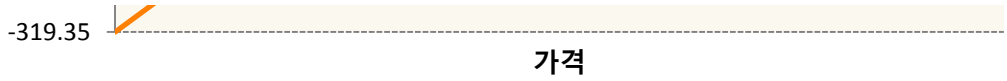


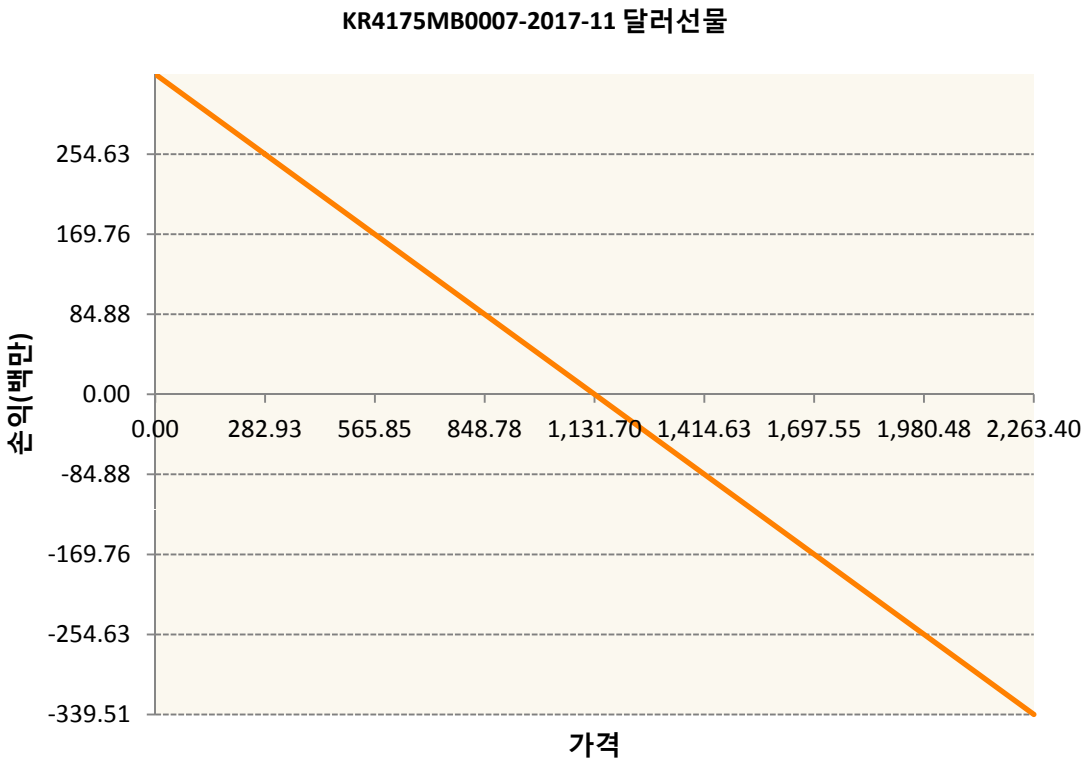


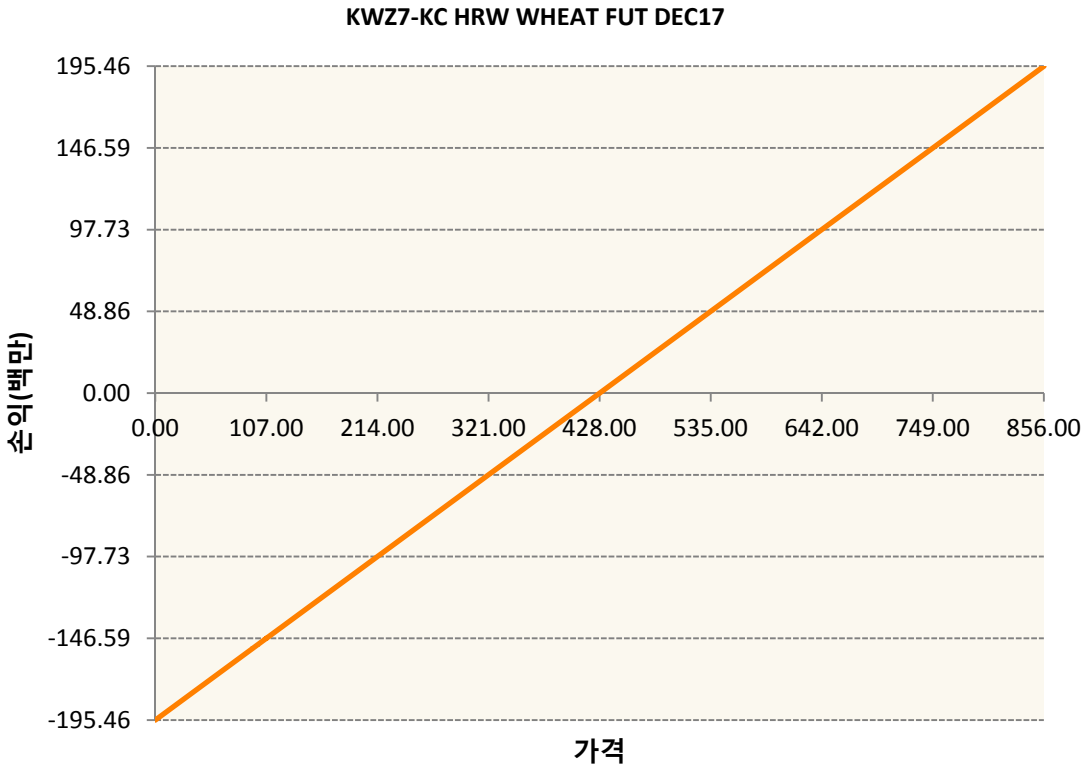

-115.68
-173.53
-231.37
가격


CZ7-CORN FUTURE DEC17
835.60
557.06
278.53
0.00
-278.53
-557.06
-835.60
-1,114.13
0.00
87.13
174.25
261.38
348.50
435.63
522.75
609.88
697.00
손익(백만)
가격

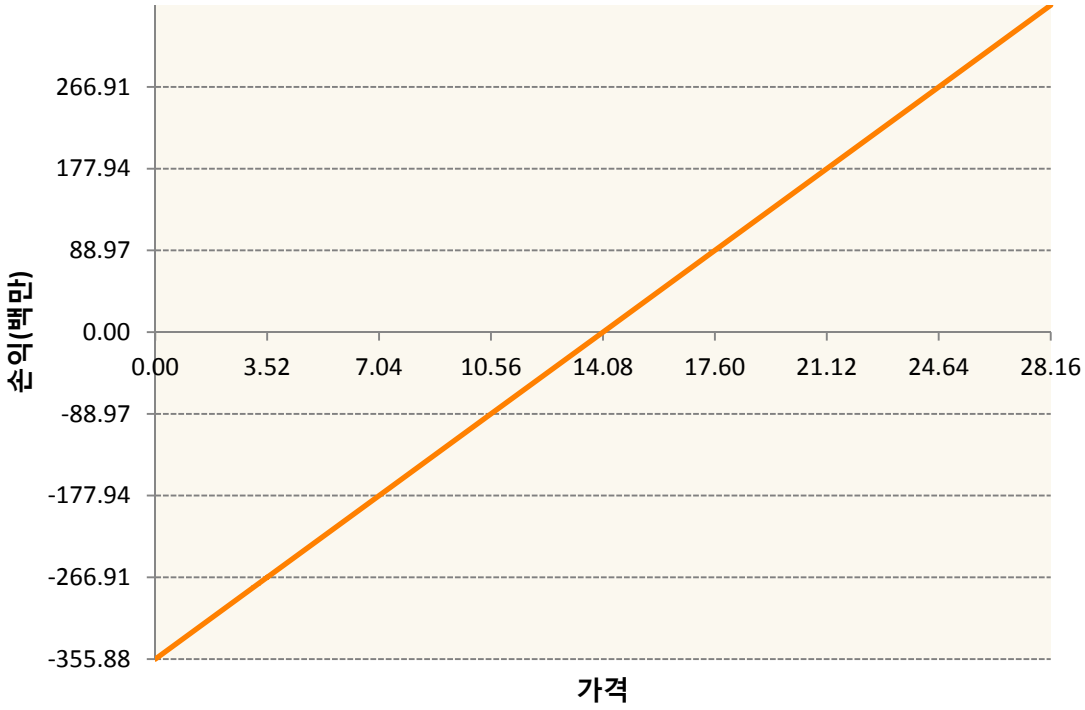

KCZ7-COFFEE 'C' FUTURE DEC17
319.35
239.51
159.67
79.84
0.00
-79.84
-159.67
-239.51
0.00
31.08
62.15
93.23
124.30
155.38
186.45
217.53
248.60
손익(백만)


-319.35
가격

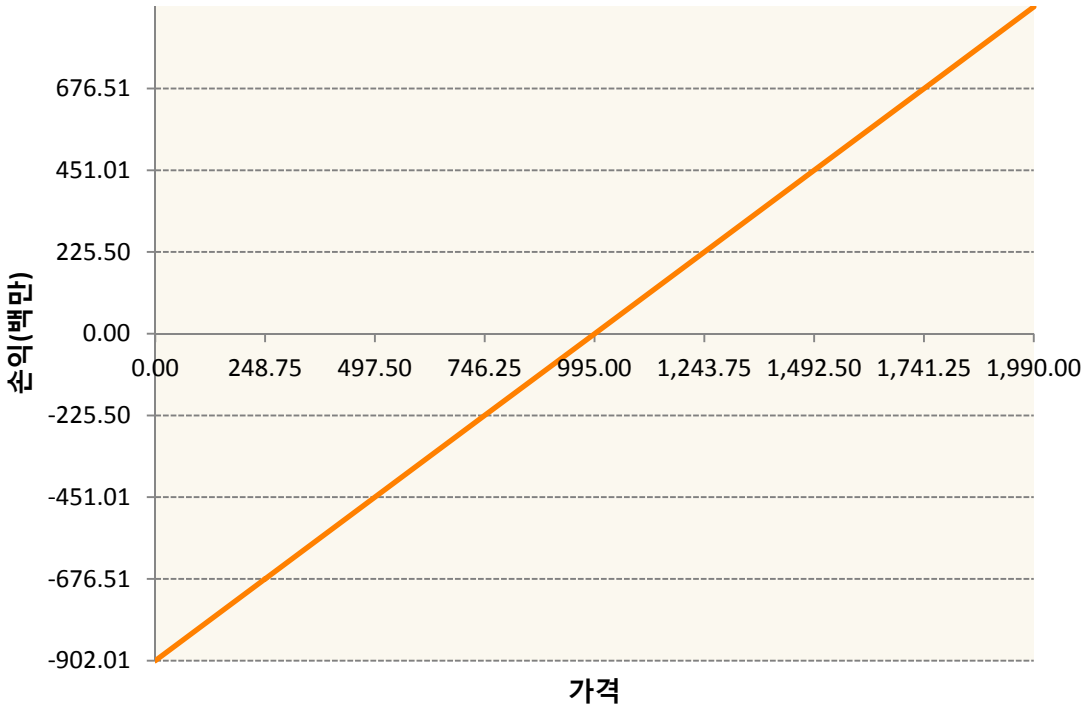

KR4175MB0007-2017-11 달러선물
254.63
169.76
84.88
0.00
-84.88
-169.76
-254.63
-339.51
0.00
282.93
565.85
848.78
1,131.70
1,414.63
1,697.55
1,980.48
2,263.40
손익(백만)
가격


KWZ7-KC HRW WHEAT FUT DEC17
195.46
146.59
97.73
48.86
0.00
-48.86
-97.73
-146.59
-195.46
0.00
107.00
214.00
321.00
428.00
535.00
642.00
749.00
856.00
손익(백만)
가격

SBH8-Sugar #11 (WORLD) MAR18

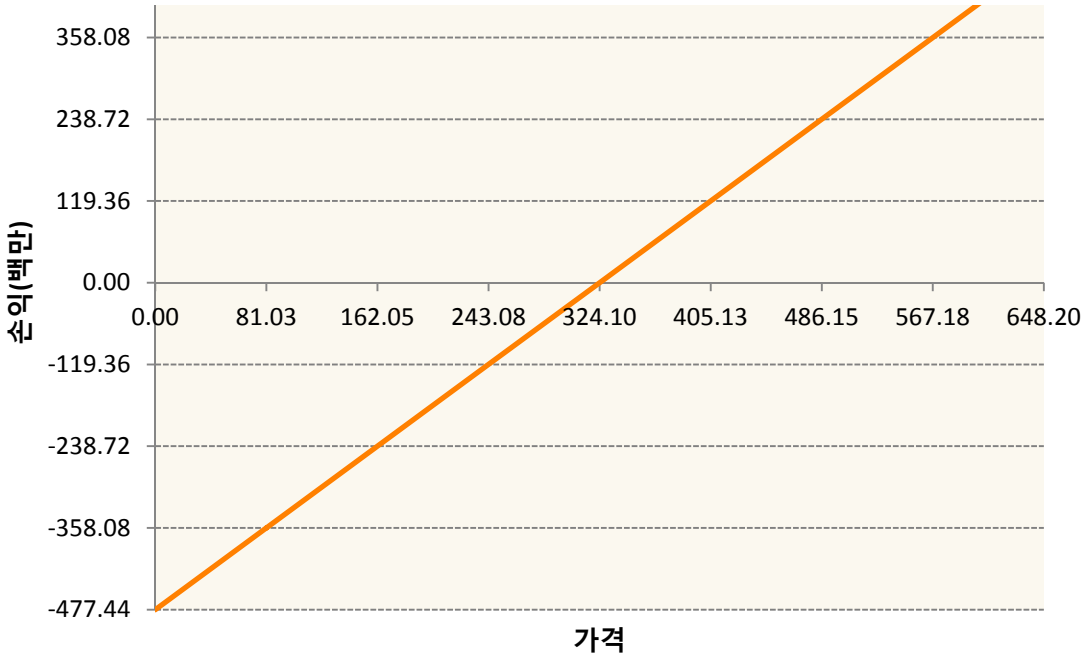


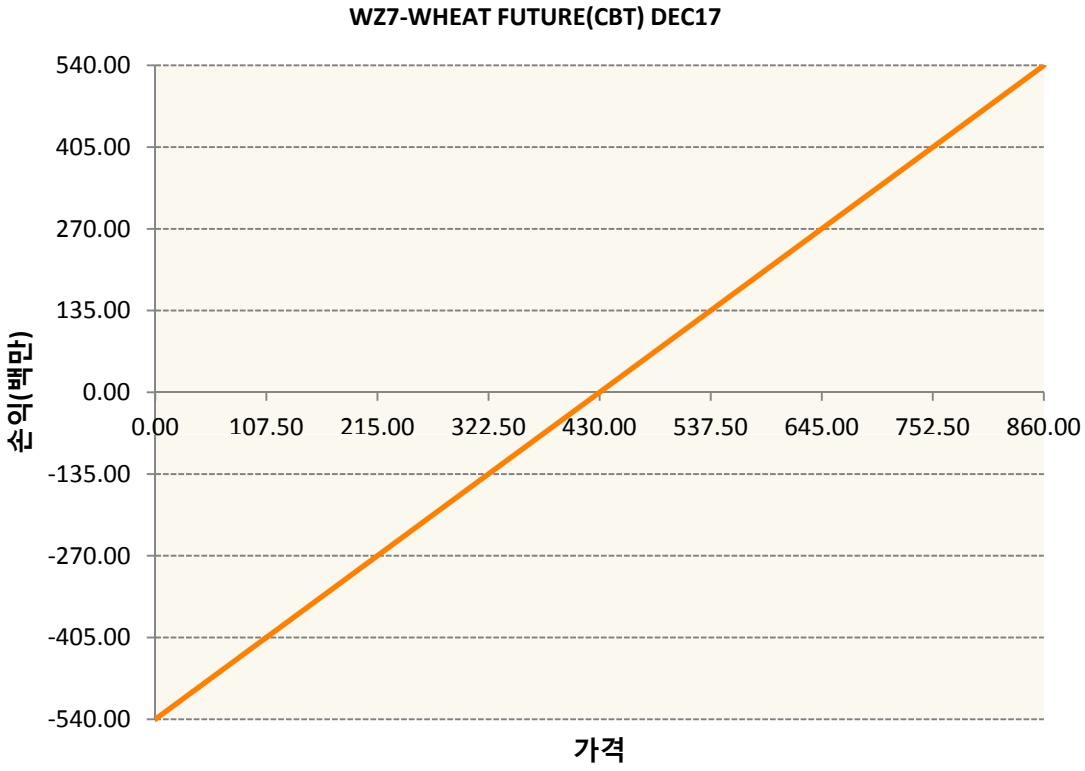
SF8-SOYBEAN FUTURE Jan18



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	89
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	43

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

416