공시일	2017-10-24
기준일	2017-10-23

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	2017-10-24
기준일	2017-10-23

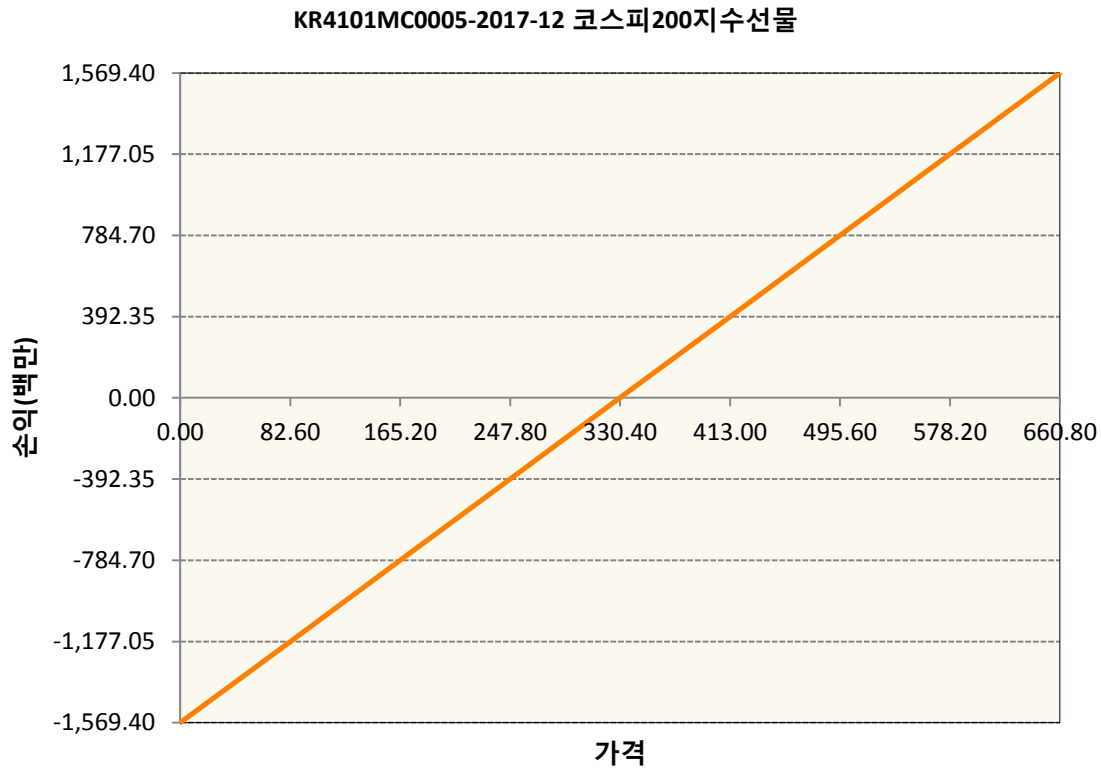
스마트인덱스모

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	1,569	0	1,569	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101MC0(2017-12 코스피200지수선물							125
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-125	-125	-125	-125	-125	-125	-125
-5.33%	-83	-83	-83	-83	-83	-83	-83
-2.67%	-42	-42	-42	-42	-42	-42	-42
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	42	42	42	42	42	42	42
5.33%	83	83	83	83	83	83	83

8.00%	125	125	125	125	125	125	125

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

75

공시일	2017-10-24
기준일	2017-10-23

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	1,064

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

465

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-10-24
기준일	2017-10-23

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	420

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

367

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-10-24
기준일	2017-10-23

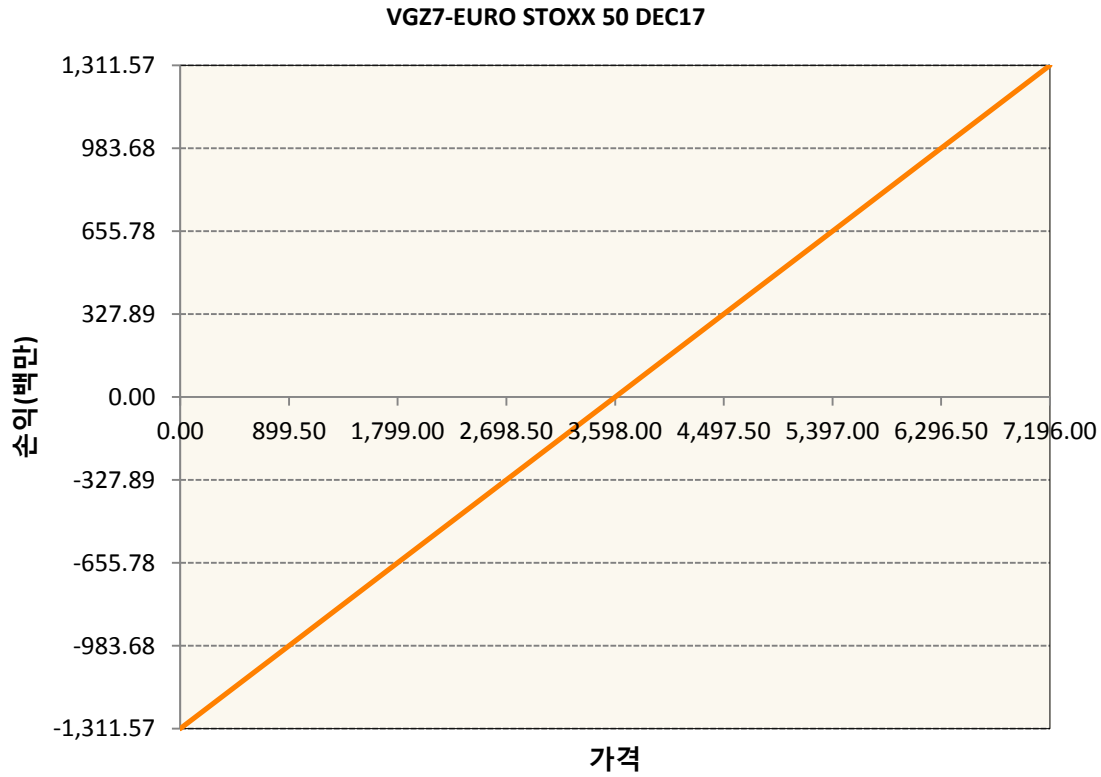
유로인덱스모(주식-파생형)

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)

79

공시일	2017-10-24
기준일	2017-10-23

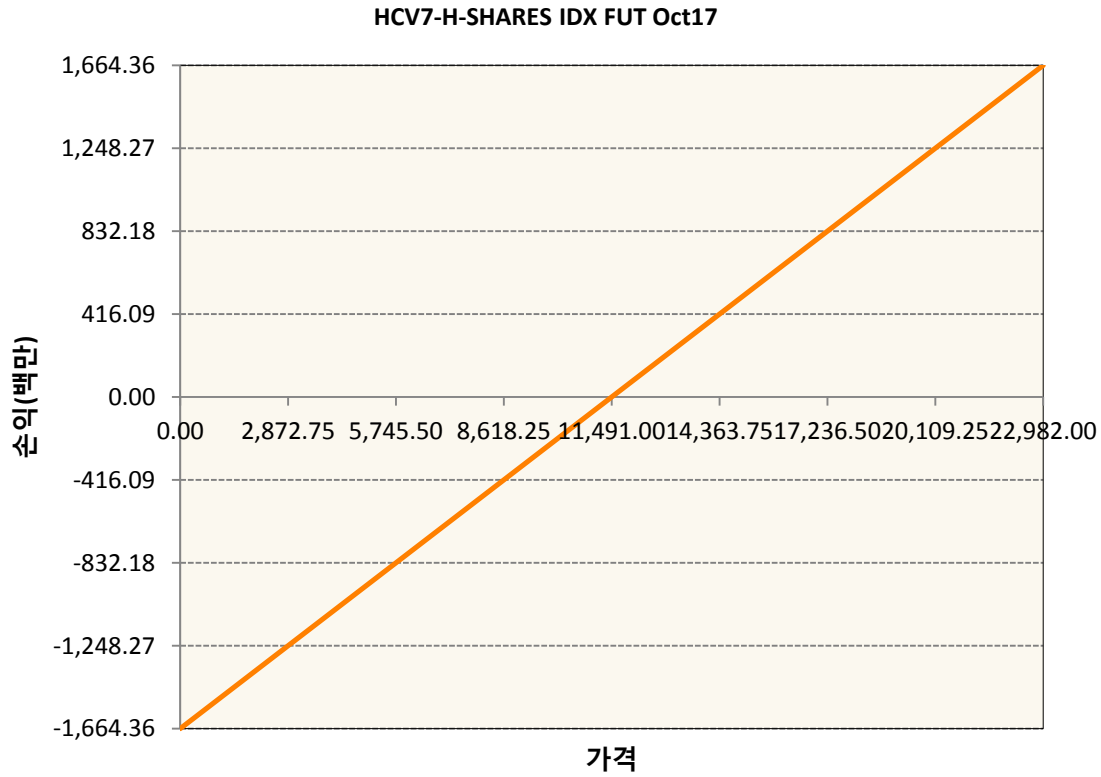
차이나인덱스모(주식-파생형)

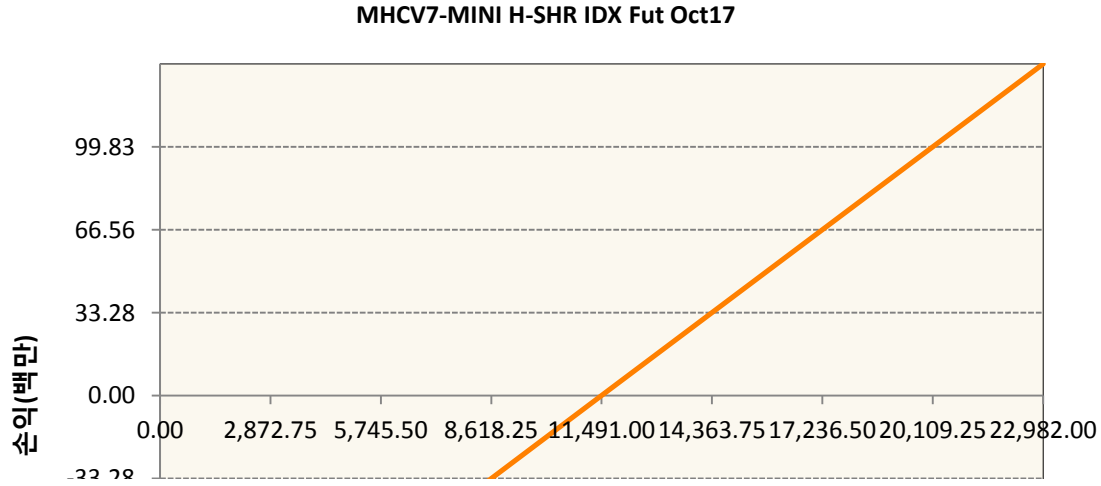
1. 계약금액

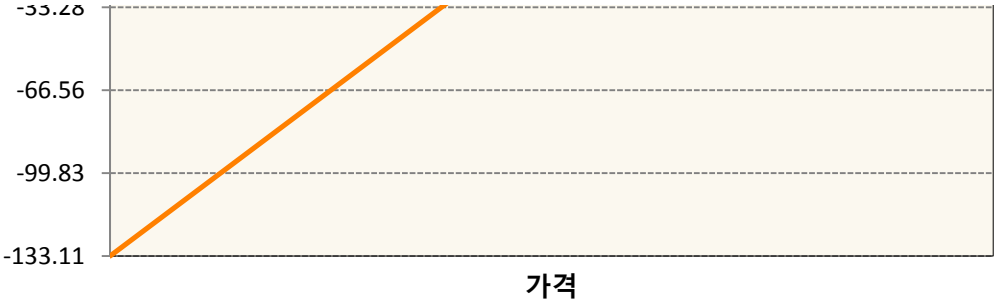
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,797	0	1,797	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCV7	H-SHARES IDX FUT Oct17	133
MHCV7	MINI H-SHR IDX Fut Oct17	11

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	118

공시일	2017-10-24
기준일	2017-10-23

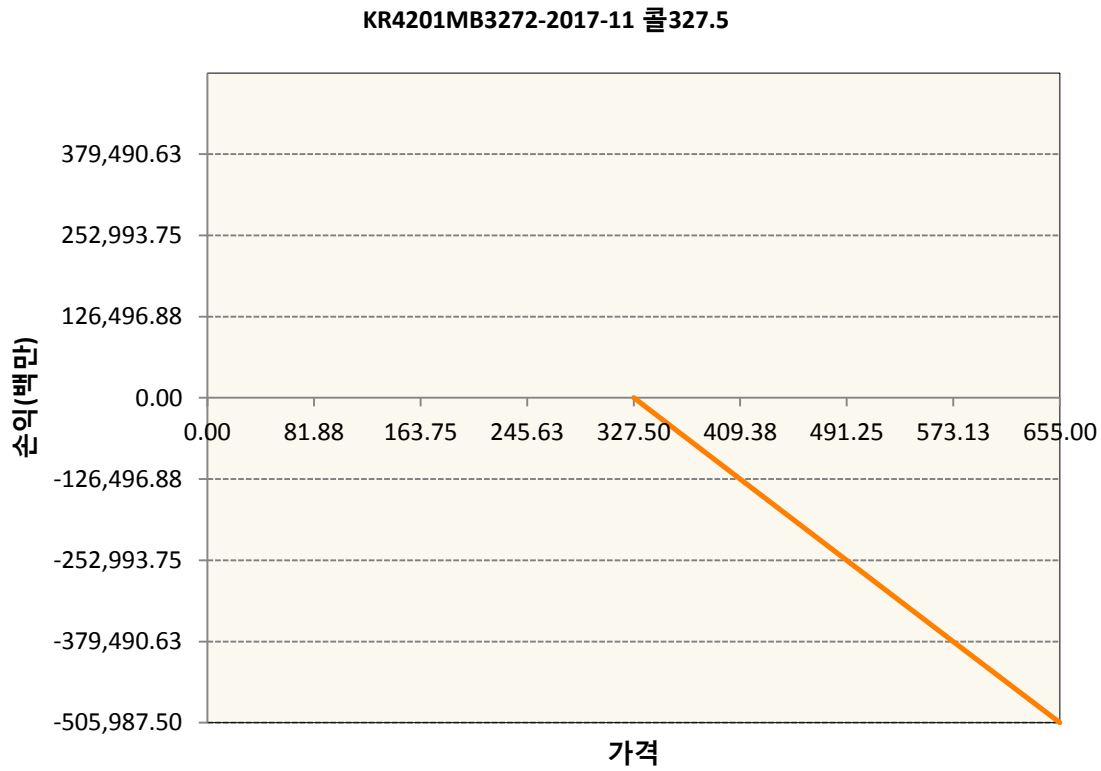
커버드콜모(주식혼합-파생형)

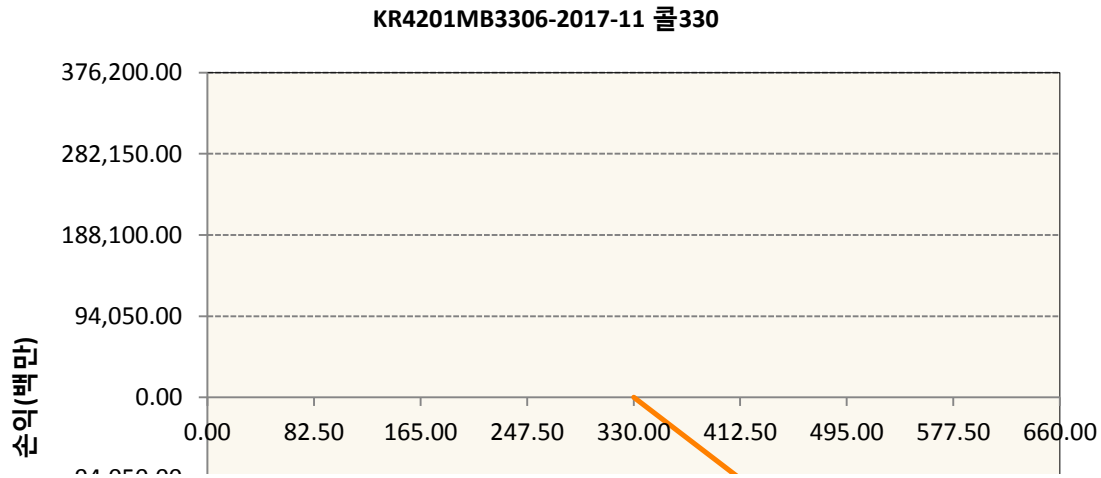
1. 계약금액

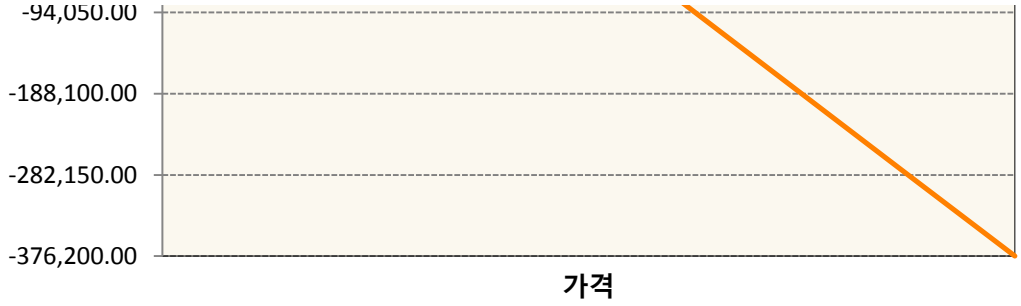
(단위:백만원)

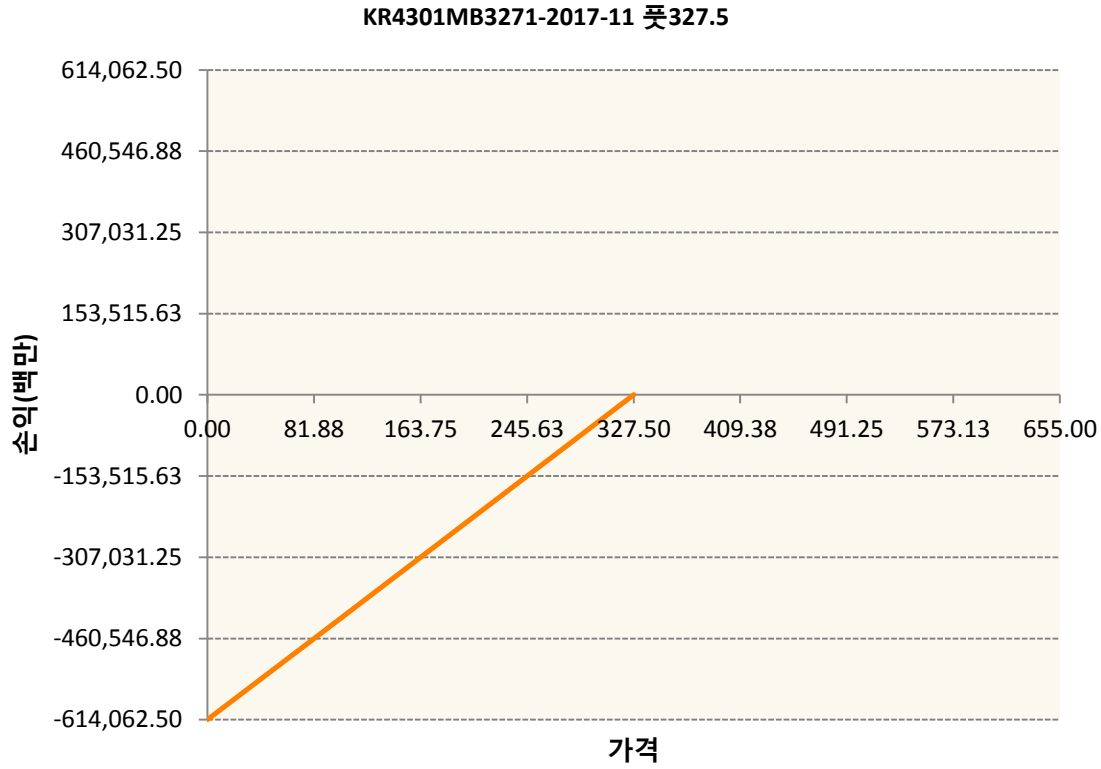
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	1,496,250	-1,496,250	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201MB3: 2017-11 콜327.5							33,341
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	11,890	11,752	11,560	11,316	11,021	10,679	10,295
-5.33%	11,106	10,693	10,222	9,703	9,144	8,551	7,930
-2.67%	8,465	7,715	6,946	6,164	5,370	4,568	3,759
0%	2,578	1,720	861	0	-862	-1,724	-2,588
2.67%	-6,855	-7,495	-8,173	-8,880	-9,612	-10,363	-11,129
5.33%	-18,786	-19,108	-19,495	-19,940	-20,434	-20,972	-21,547
8.00%	-31,884	-31,997	-32,161	-32,379	-32,650	-32,972	-33,341
KR4201MB3: 2017-11 콜330							23,527
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	7,376	7,305	7,200	7,060	6,884	6,673	6,430
-5.33%	6,989	6,748	6,462	6,135	5,775	5,385	4,970
-2.67%	5,527	5,031	4,512	3,975	3,425	2,863	2,293
0%	1,927	1,285	642	0	-642	-1,285	-1,927
2.67%	-4,327	-4,867	-5,426	-5,999	-6,584	-7,177	-7,778
5.33%	-12,697	-13,002	-13,354	-13,744	-14,167	-14,618	-15,092
8.00%	-22,185	-22,305	-22,468	-22,675	-22,923	-23,208	-23,527
KR4301MB3	2017-11	풋327.5					40,915

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-40,853	-40,853	-40,855	-40,860	-40,870	-40,887	-40,915
-5.33%	-24,416	-24,451	-24,508	-24,589	-24,698	-24,834	-24,997
-2.67%	-8,822	-9,144	-9,496	-9,874	-10,271	-10,686	-11,114
0%	1,558	1,042	523	0	-525	-1,052	-1,581
2.67%	4,487	4,325	4,124	3,885	3,615	3,316	2,992
5.33%	4,739	4,727	4,704	4,665	4,607	4,526	4,422
8.00%	4,745	4,744	4,744	4,741	4,735	4,724	4,706

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

106,017

공시일	2017-10-24
기준일	2017-10-23

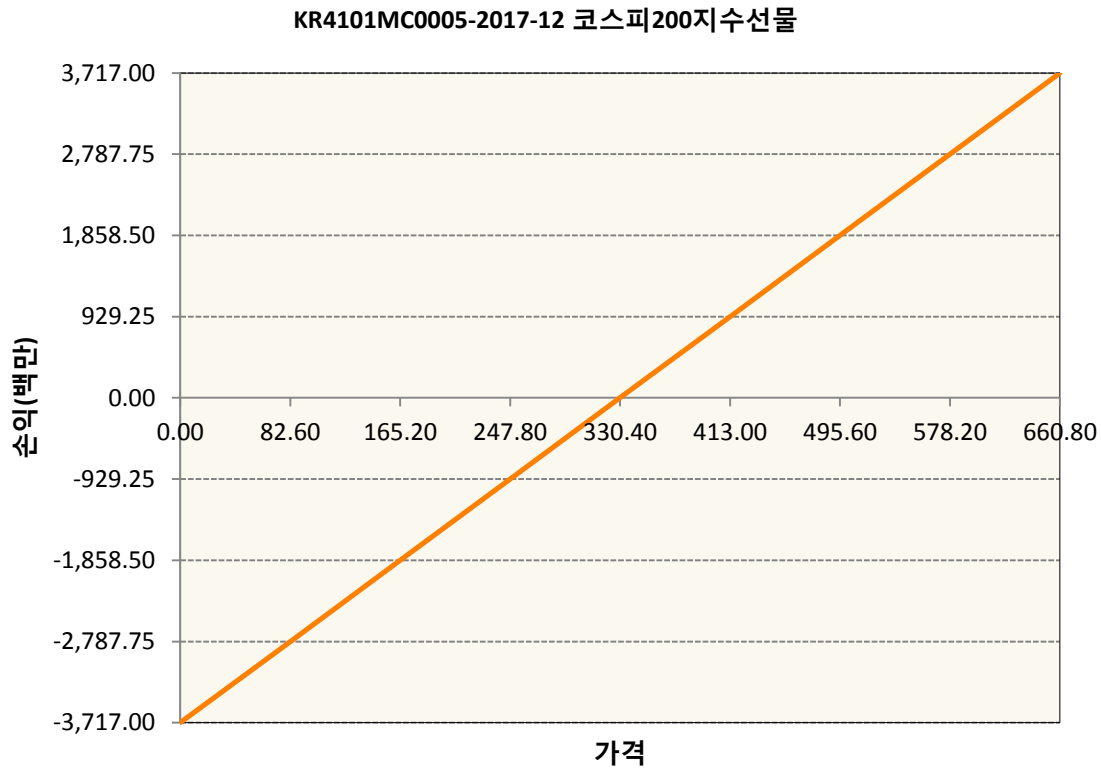
ETF스마트레버리지목표전환형7호

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	3,717	0	3,717	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101MC0(2017-12 코스피200지수선물							297
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-297	-297	-297	-297	-297	-297	-297
-5.33%	-198	-198	-198	-198	-198	-198	-198
-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%	198	198	198	198	198	198	198

8.00%	297	297	297	297	297	297	297

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

179

공시일	2017-10-24
기준일	2017-10-23

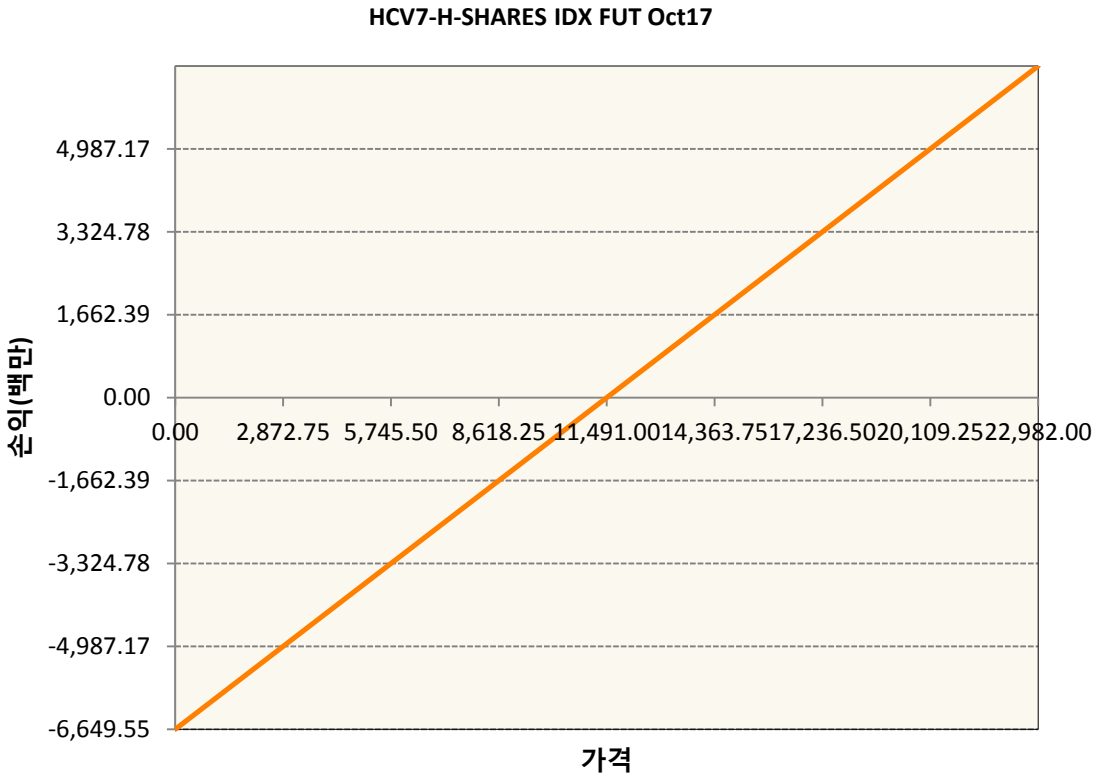
홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생

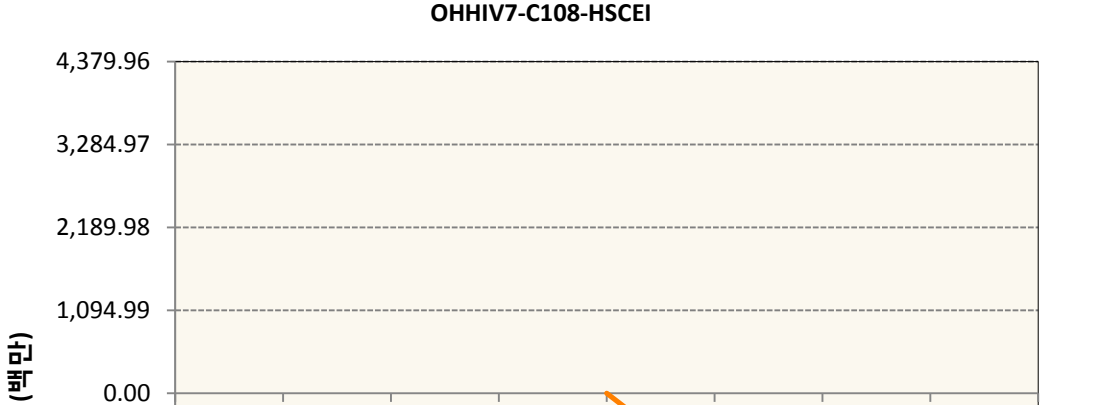
1. 계약금액

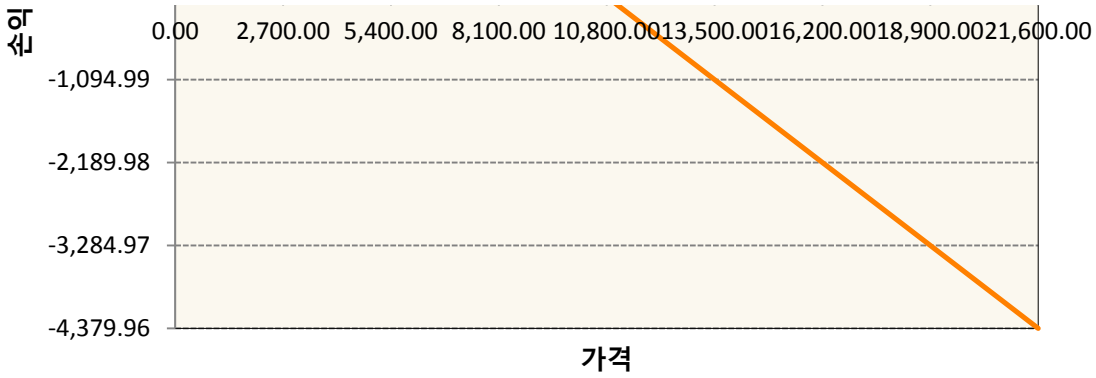
(단위:백만원)

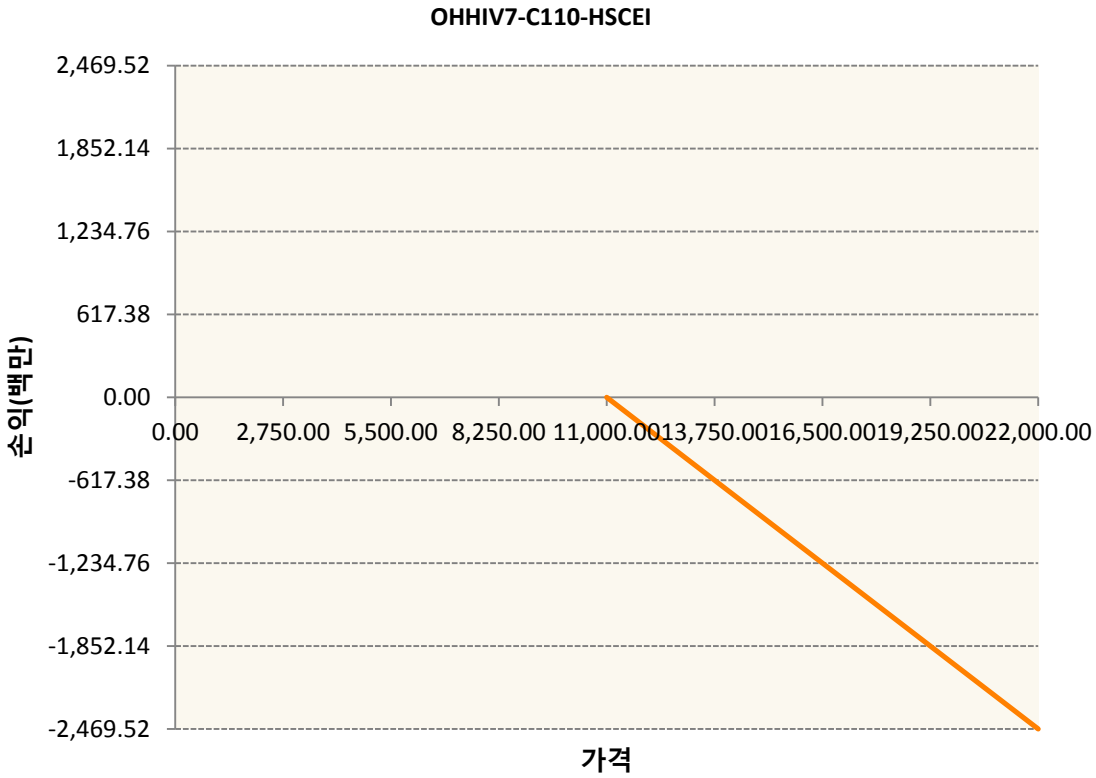
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	6,650	0	6,650	장내
누계	유가증권	옵션	0	13,699	-13,699	장내

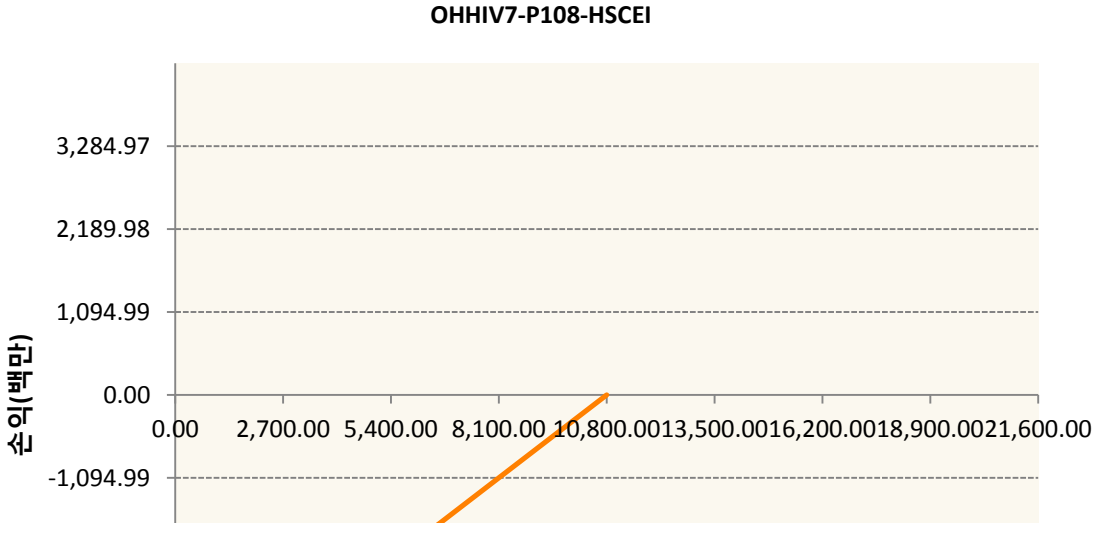
2. 만기시점의 손익구조

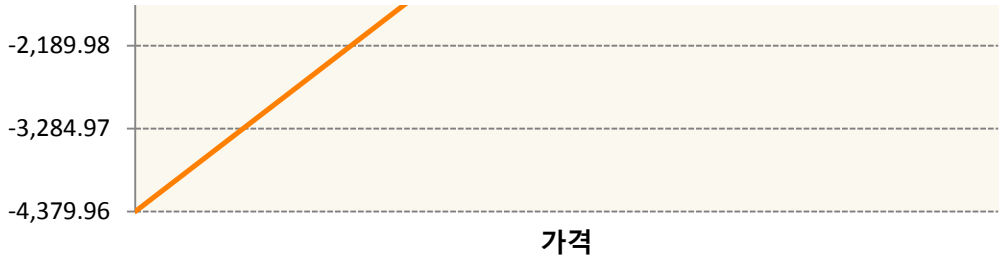


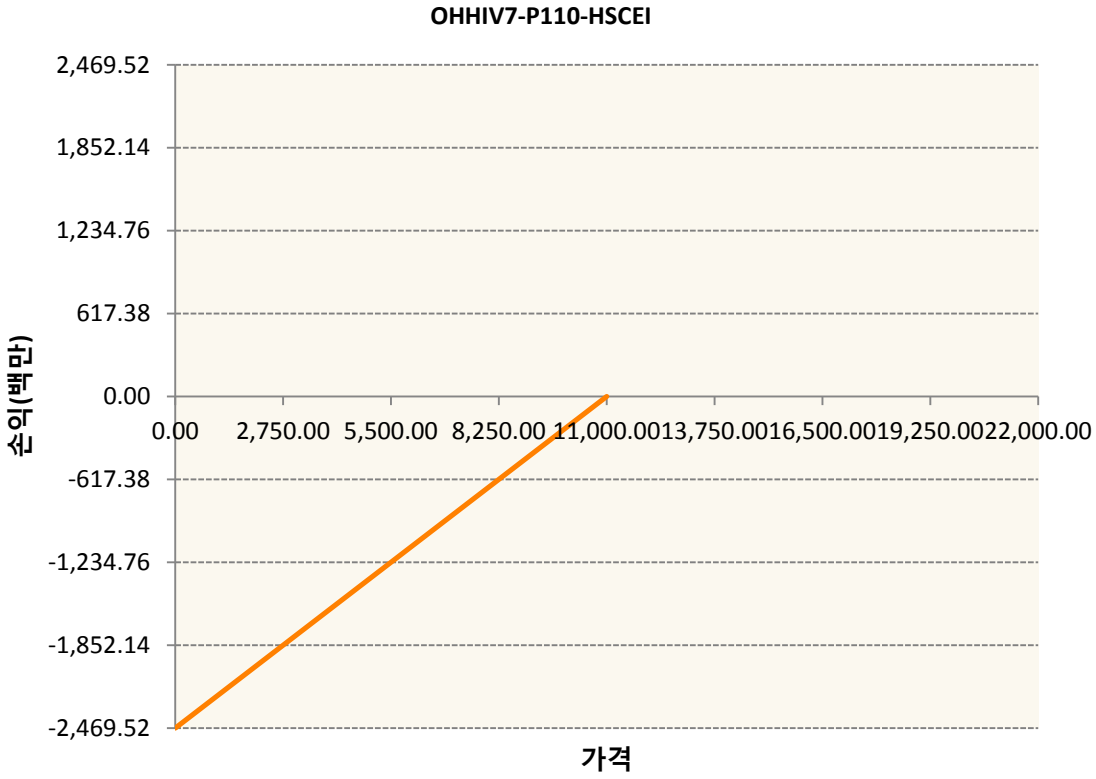



손익
0.00
2,700.00
5,400.00
8,100.00
10,800.00
13,500.00
16,200.00
18,900.00
21,600.00
-1,094.99
-2,189.98
-3,284.97
-4,379.96
가격


OHHIV7-C110-HSCEI
2,469.52
1,852.14
1,234.76
617.38
0.00
-617.38
-1,234.76
-1,852.14
-2,469.52
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
3,284.97
2,189.98
1,094.99
0.00
-1,094.99
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	532
OHHIV7-C10	HSCEI	350
OHHIV7-C11	HSCEI	198
OHHIV7-P10	HSCEI	350
OHHIV7-P11	HSCEI	198

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

1,335

공시일	2017-10-24
기준일	2017-10-23

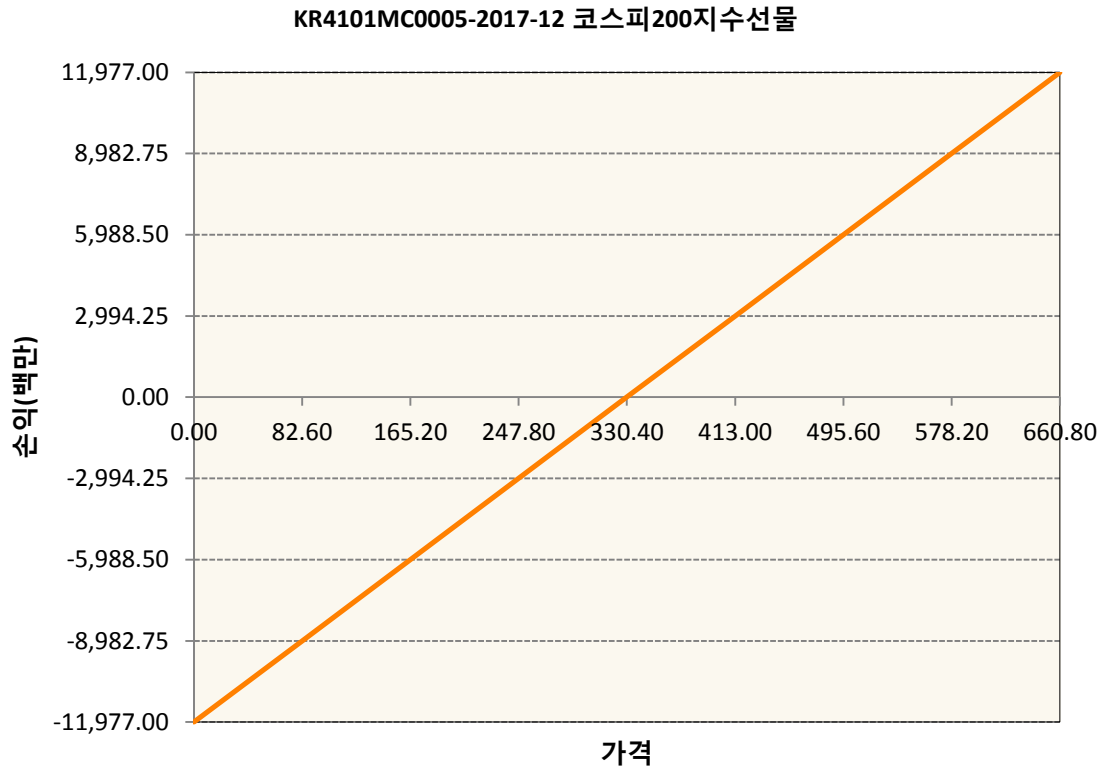
코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼

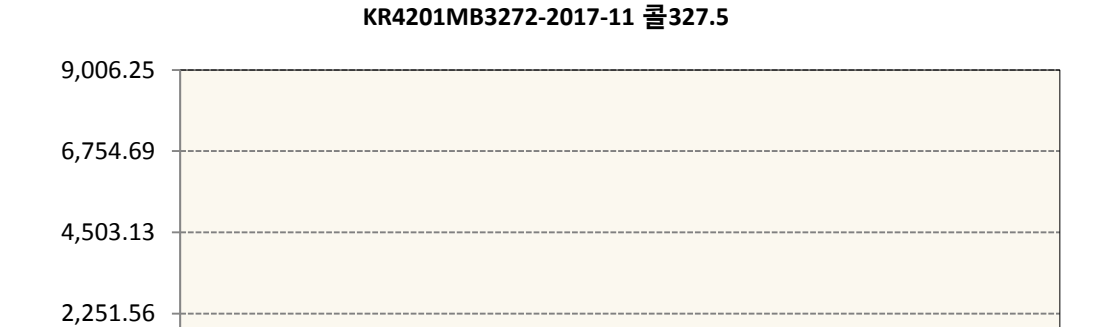
1. 계약금액

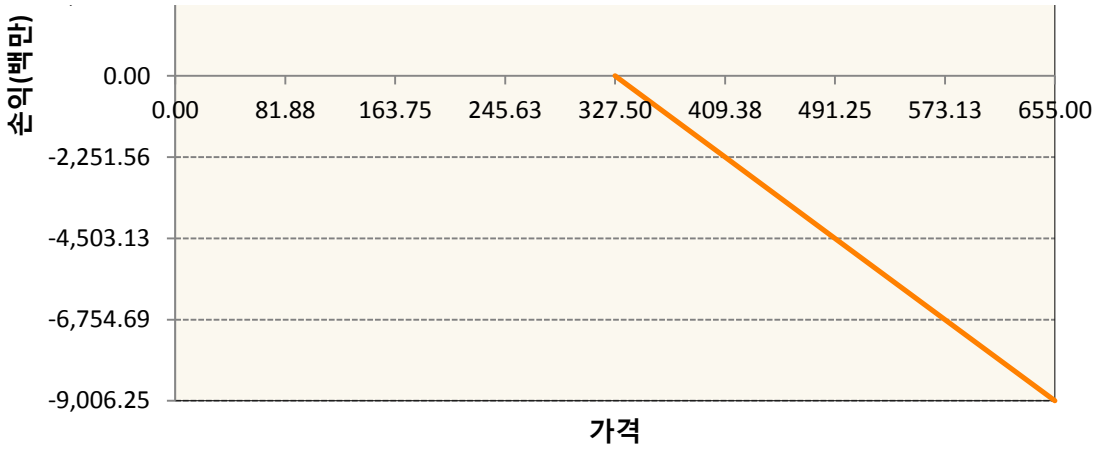
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	11,977	0	11,977	장내
누계	유가증권	옵션	0	31,584	-31,584	장내
누계	유가증권	스왑	32,700	0	32,700	장외

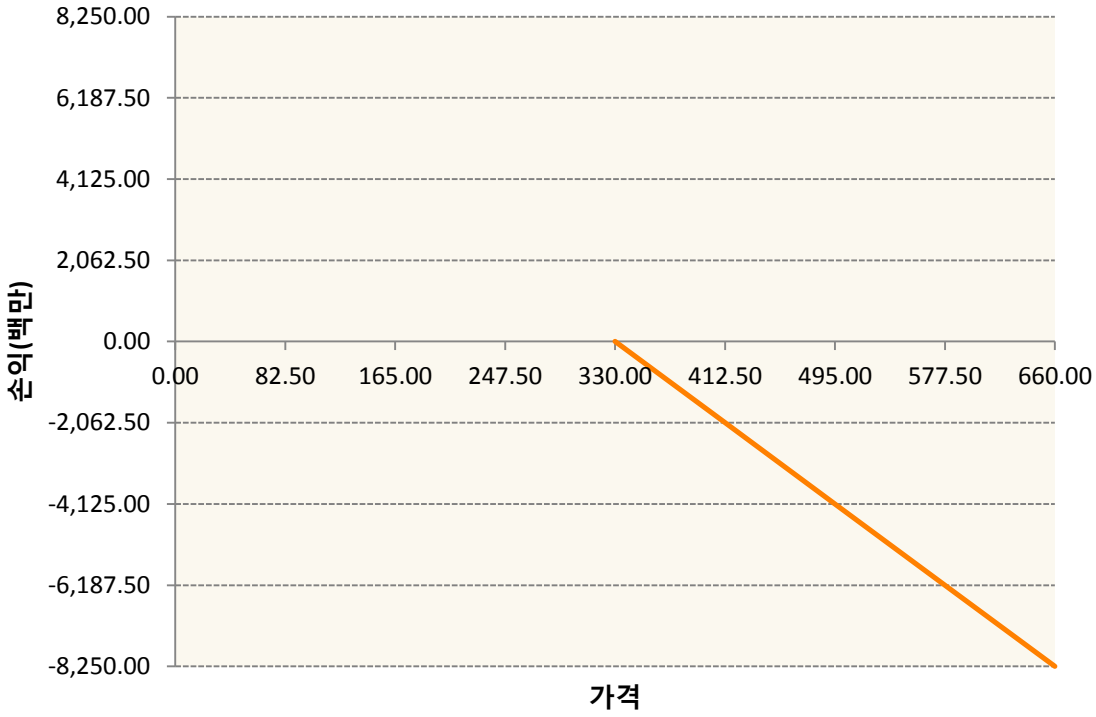
2. 만기시점의 손익구조



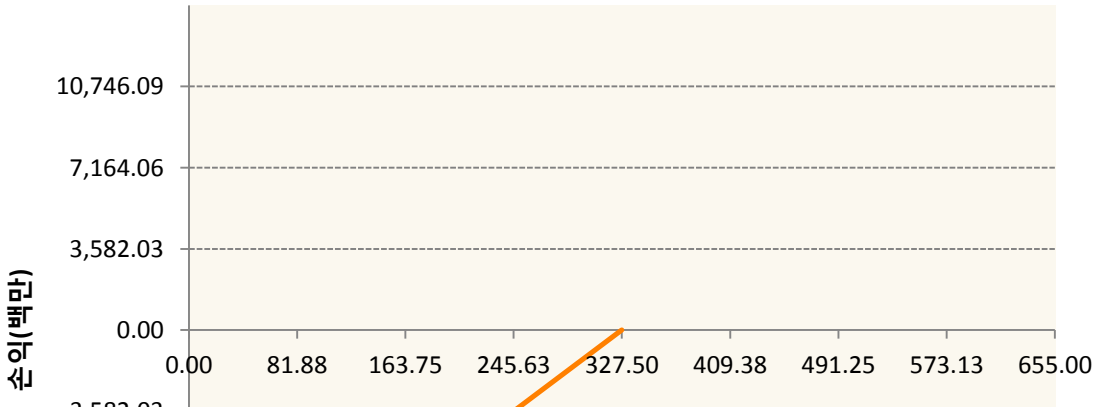




KR4201MB3306-2017-11 콜330



KR4301MB3271-2017-11 풋327.5





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.5287E+11 UBCSFXC1 INDEX_2							1,502
	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%	-1,002	-1,002	-1,002	-1,002	-1,002	-1,002	-1,002
-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%	1,002	1,002	1,002	1,002	1,002	1,002	1,002
8.00%	1,502	1,502	1,502	1,502	1,502	1,502	1,502
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%	-190	-190	-190	-190	-190	-190	-190
-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%	190	190	190	190	190	190	190
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							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
	2.5287E+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
	2.5287E+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						955

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-955	-955	-955	-955	-955	-955	-955
-5.33%	-637	-637	-637	-637	-637	-637	-637
-2.67%	-318	-318	-318	-318	-318	-318	-318
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	318	318	318	318	318	318	318
5.33%	637	637	637	637	637	637	637
8.00%	955	955	955	955	955	955	955
	KR4201MB3(2017-11 콜327.5						593

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	212	209	206	201	196	190	183
-5.33%	198	190	182	173	163	152	141

-2.67%	151	137	124	110	96	81	67
0%	46	31	15	0	-15	-31	-46
2.67%	-122	-133	-145	-158	-171	-184	-198
5.33%	-334	-340	-347	-355	-364	-373	-384
8.00%	-568	-570	-572	-576	-581	-587	-593
	KR4201MB3: 2017-11 콜330						516
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	162	160	158	155	151	146	141
-5.33%	153	148	142	135	127	118	109
-2.67%	121	110	99	87	75	63	50
0%	42	28	14	0	-14	-28	-42
2.67%	-95	-107	-119	-132	-144	-157	-171
5.33%	-278	-285	-293	-301	-311	-321	-331
8.00%	-487	-489	-493	-497	-503	-509	-516
	KR4301MB3: 2017-11 풋327.5						955
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-953	-953	-953	-953	-954	-954	-955
-5.33%	-570	-571	-572	-574	-576	-579	-583
-2.67%	-206	-213	-222	-230	-240	-249	-259
0%	36	24	12	0	-12	-25	-37
2.67%	105	101	96	91	84	77	70
5.33%	111	110	110	109	107	106	103
8.00%	111	111	111	111	110	110	110

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

5,480

공시일	2017-10-24
기준일	2017-10-23

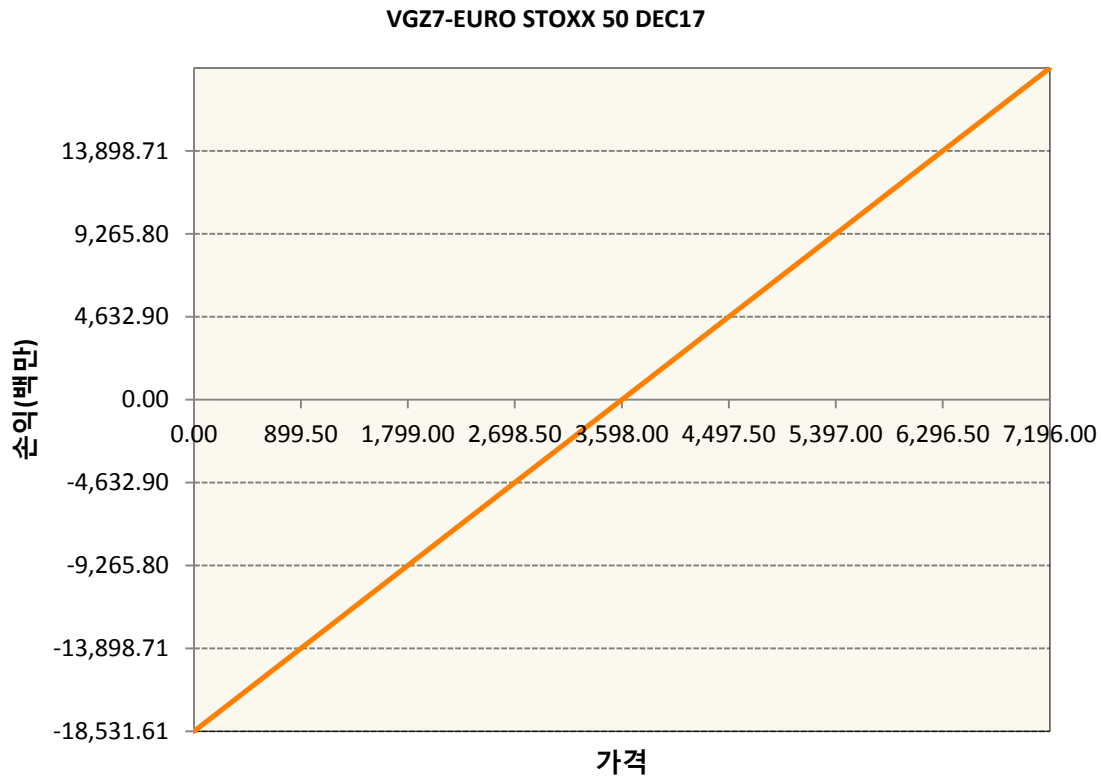
유로커버드콜모(주식혼합-파생형

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	3	-3	
신규	유가증권	스왑	75	0	75	장외
누계	유가증권	선물	18,532	0	18,532	
누계	유가증권	스왑	99,641	0	99,641	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

260105SQPX SG EURO Covered CALL STRATEGY	0.1
VGZ7 EURO STOXX 50 DEC17	1,482

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

(단위:백만원)

1,123

공시일	2017-10-24
기준일	2017-10-23

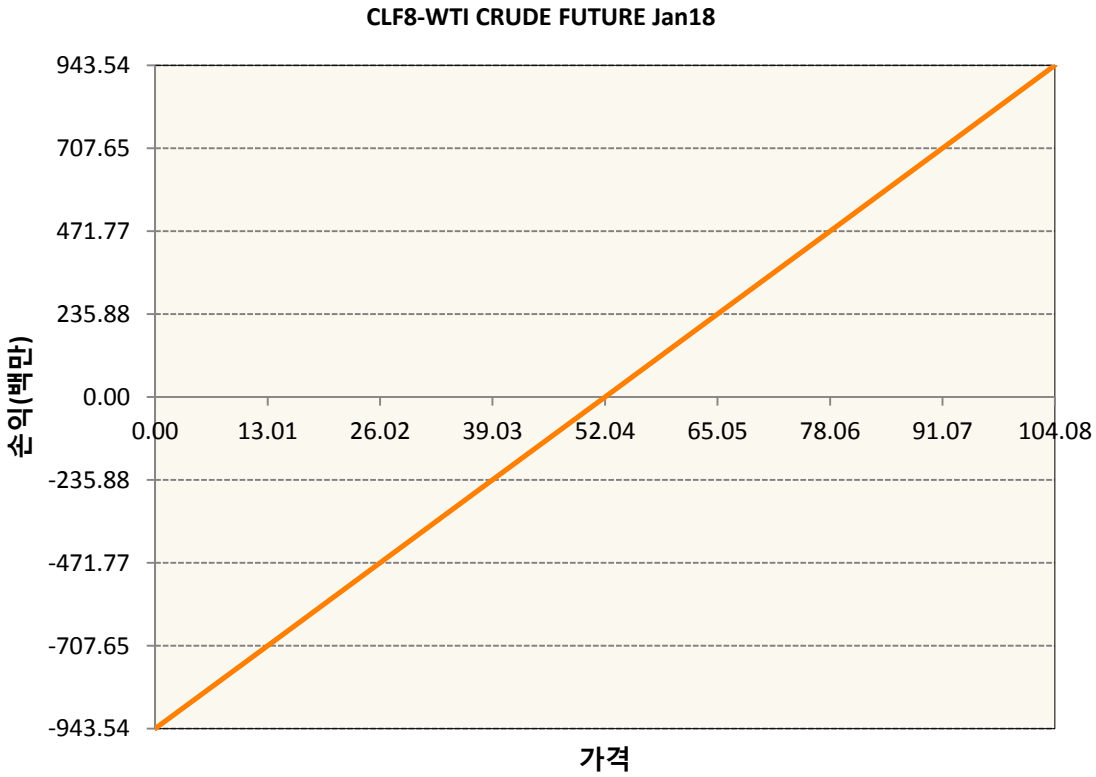
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

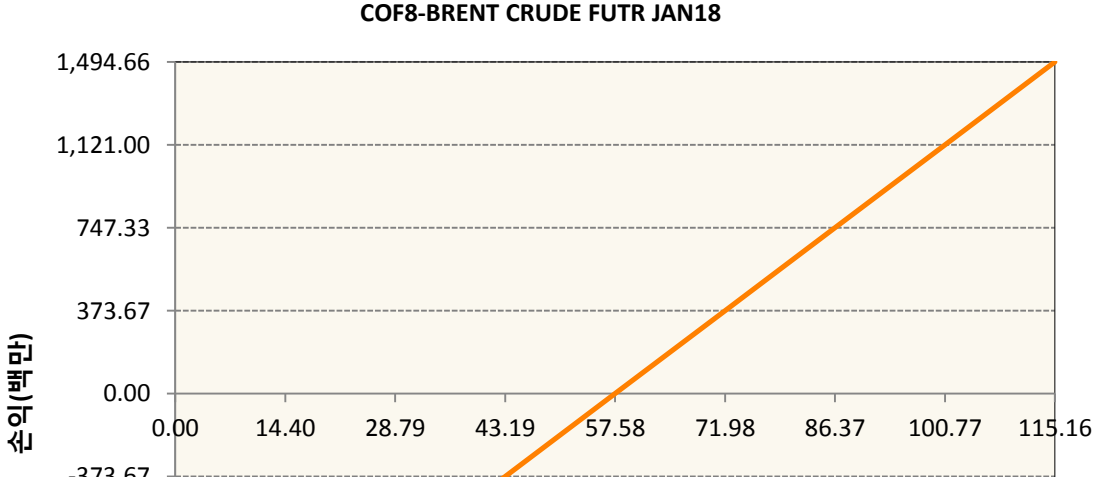
1. 계약금액

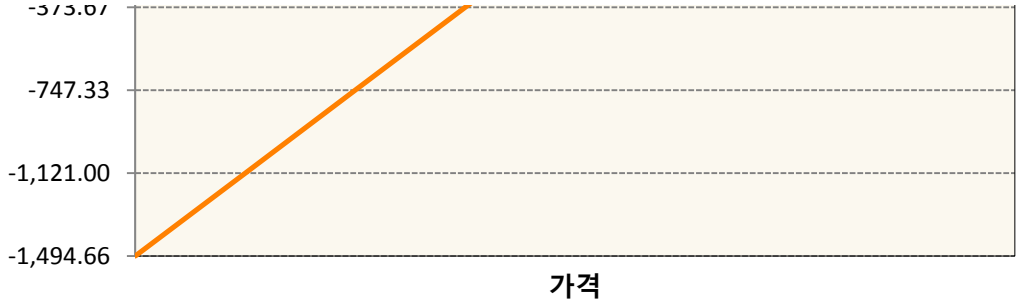
(단위:백만원)

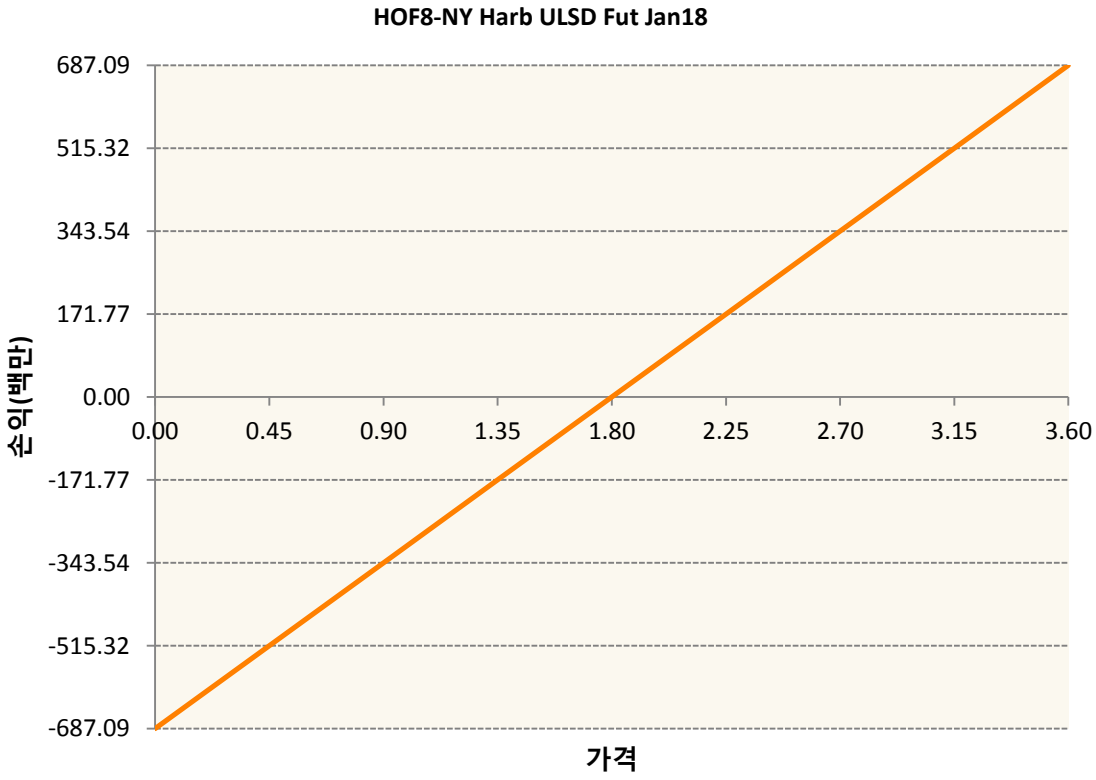
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	5,292	904	4,388	

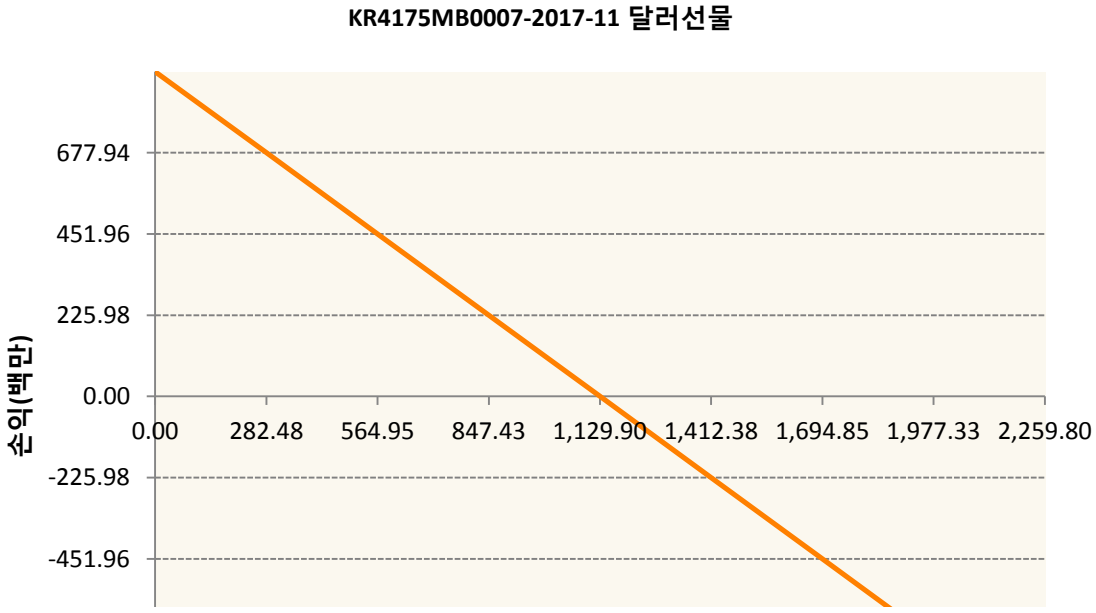
2. 만기시점의 손익구조

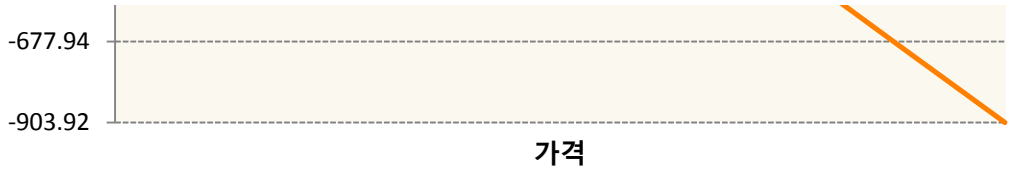


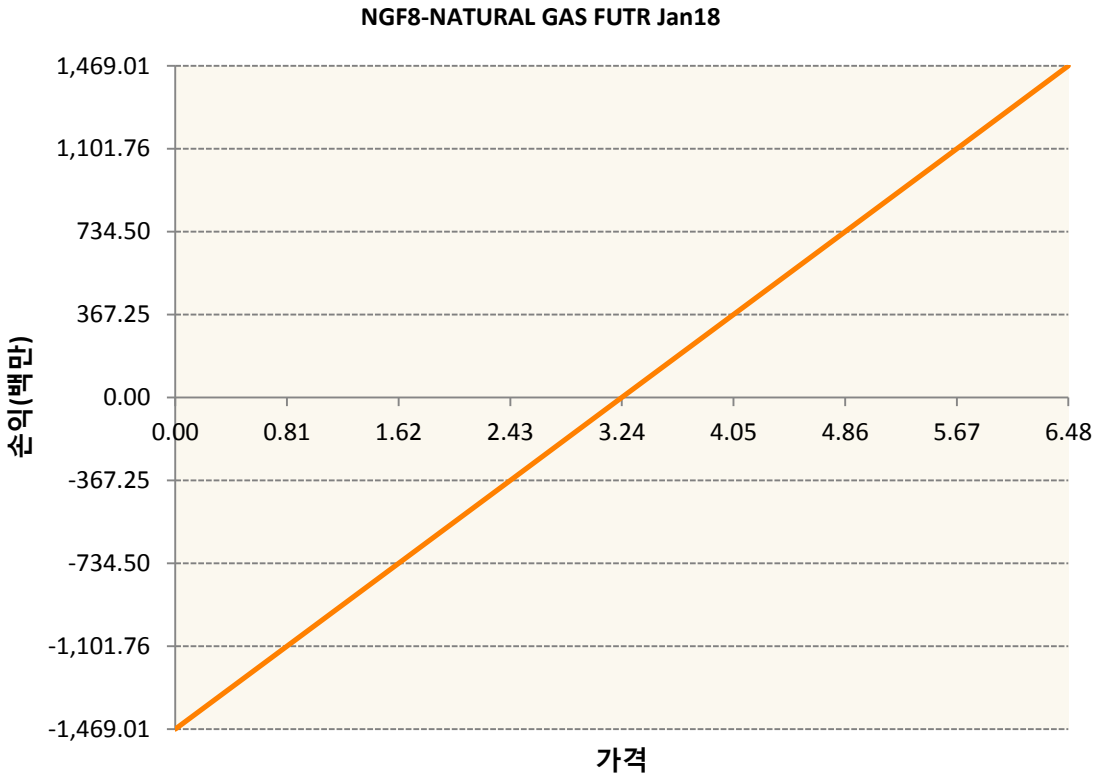


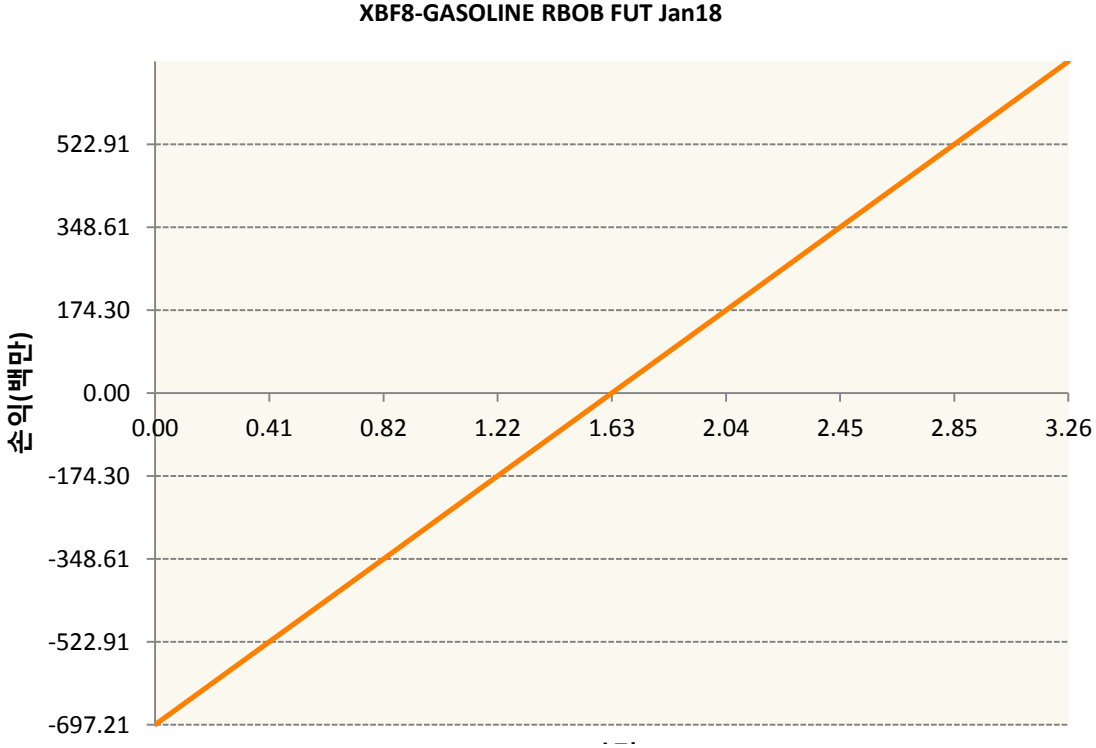

-747.33
-1,121.00
-1,494.66
가격


HOF8-NY Harb ULSD Fut Jan18
687.09
515.32
343.54
171.77
0.00
-171.77
-343.54
-515.32
-687.09
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
677.94
451.96
225.98
0.00
-225.98
-451.96
0.00
282.48
564.95
847.43
1,129.90
1,412.38
1,694.85
1,977.33
2,259.80
손익(백만)


-677.94
-903.92
가격


NGF8-NATURAL GAS FUTR Jan18
1,469.01
1,101.76
734.50
367.25
0.00
-367.25
-734.50
-1,101.76
-1,469.01
0.00
0.81
1.62
2.43
3.24
4.05
4.86
5.67
6.48
손익(백만)
가격


XBF8-GASOLINE RBOB FUT Jan18
522.91
348.61
174.30
0.00
-174.30
-348.61
-522.91
-697.21
0.00
0.41
0.82
1.22
1.63
2.04
2.45
2.85
3.26
손익(백만)

가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLF8	WTI CRUDE FUTURE Jan18	75
COF8	BRENT CRUDE FUTR JAN18	120
HOF8	NY Harb ULSD Fut Jan18	55
KR4175MB0(	2017-11 달러선물	72
NGF8	NATURAL GAS FUTR Jan18	118
XBF8	GASOLINE RBOB FUT Jan18	56

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

758

공시일	2017-10-24
기준일	2017-10-23

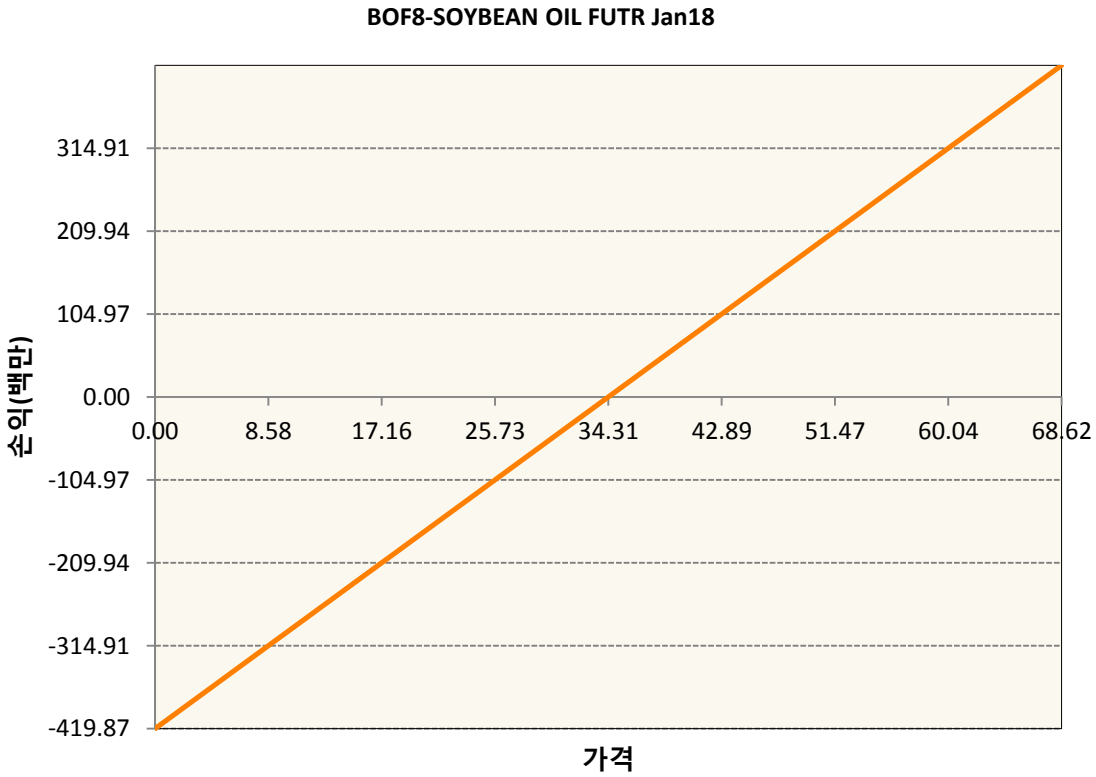
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

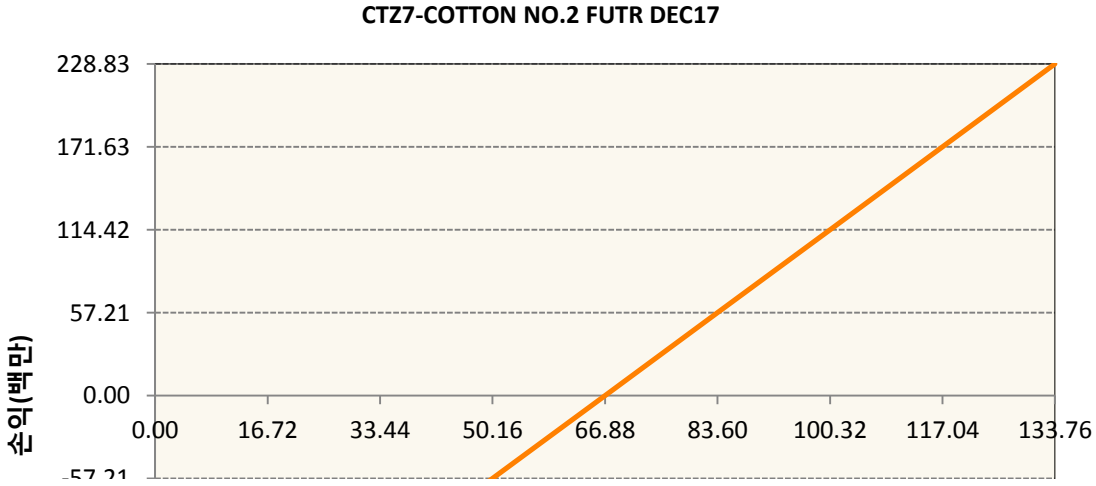
1. 계약금액

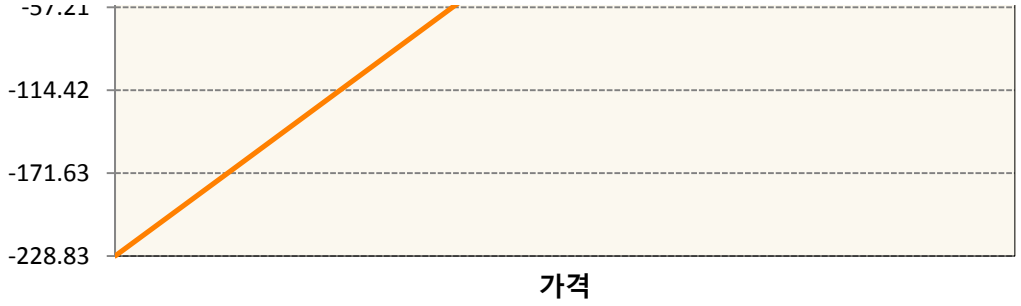
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	4,521	339	4,182	

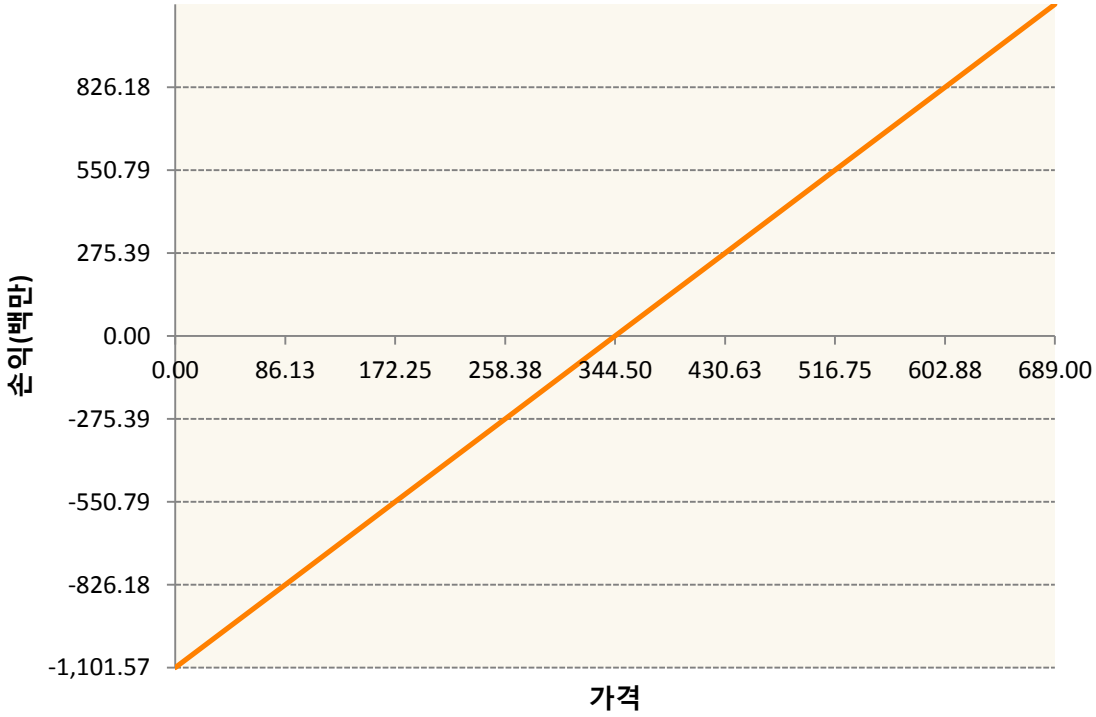
2. 만기시점의 손익구조



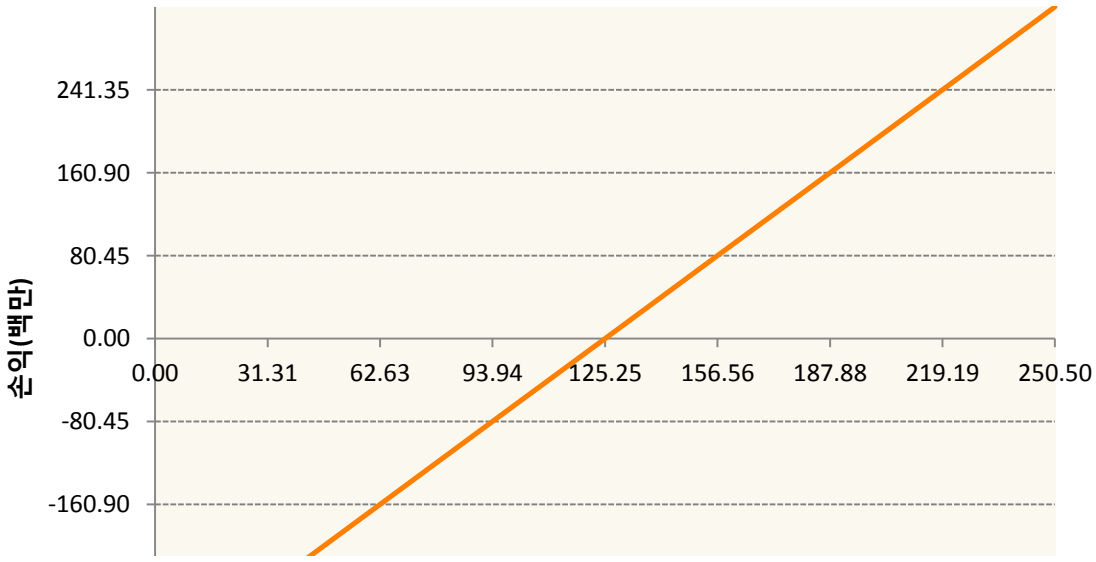


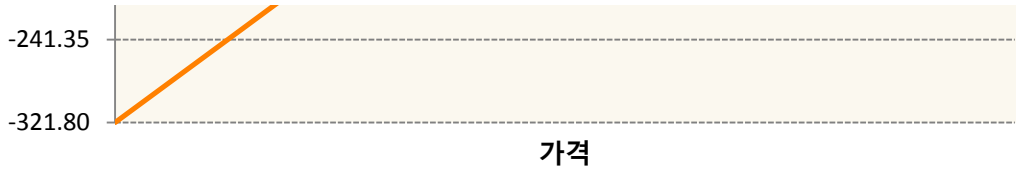


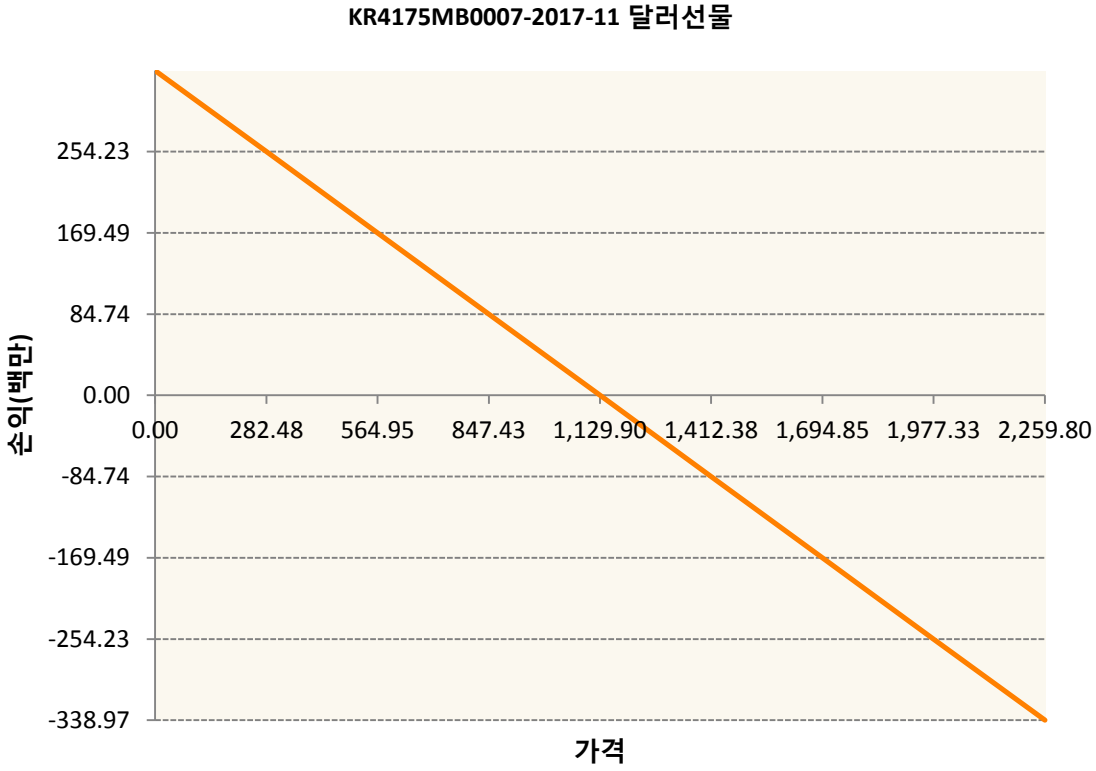
CZ7-CORN FUTURE DEC17

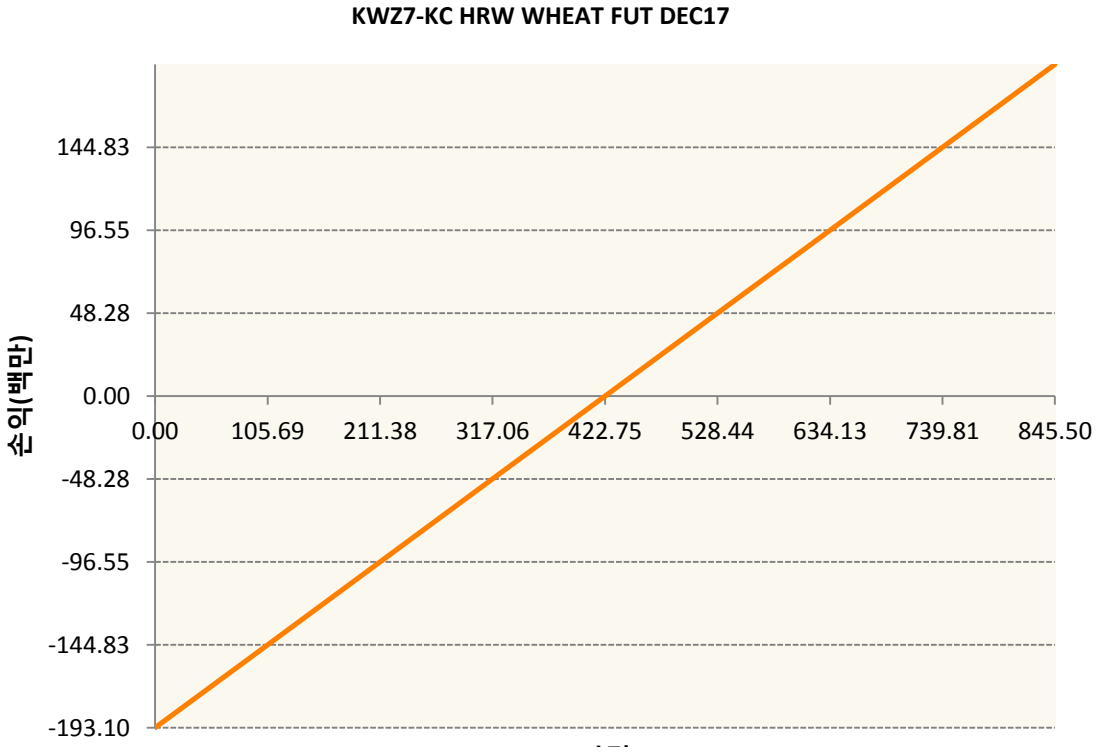


KCZ7-COFFEE 'C' FUTURE DEC17

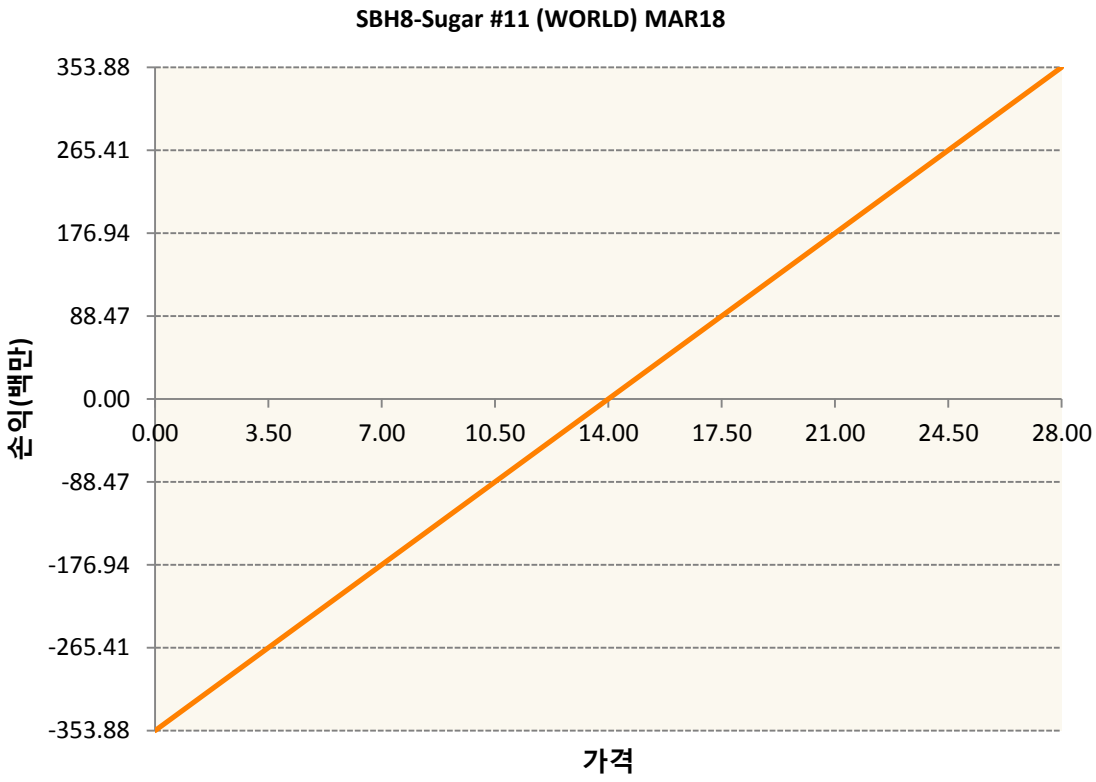


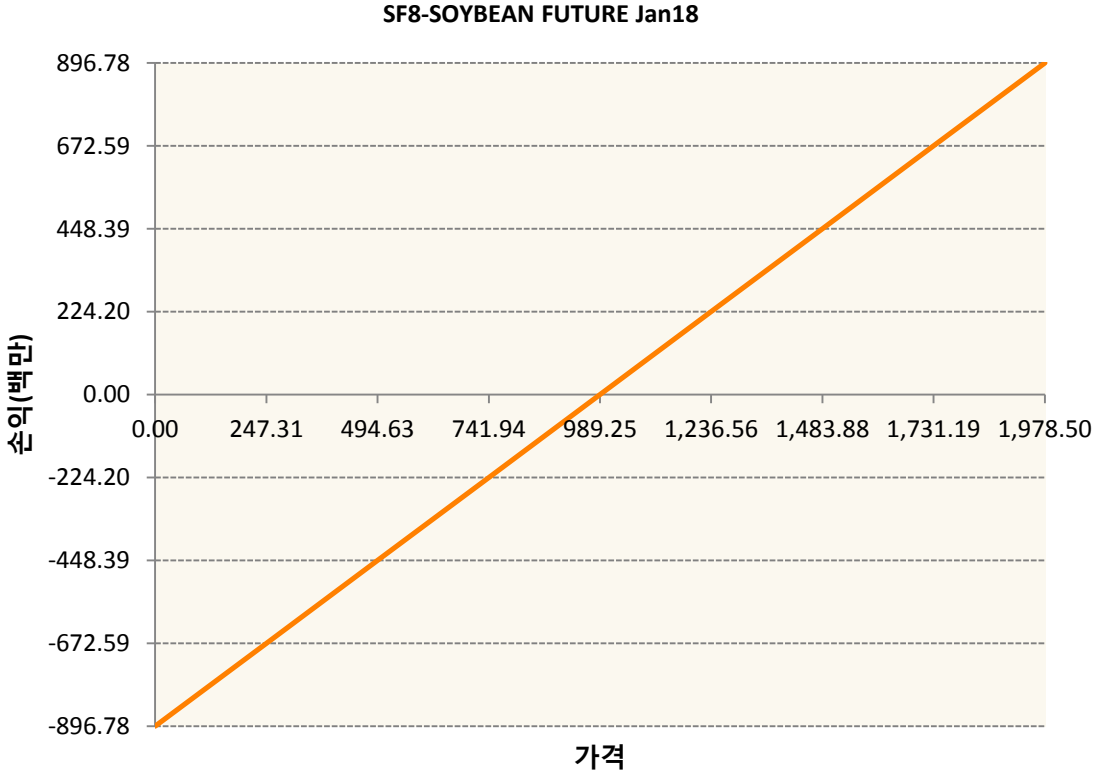

-241.35
-321.80
가격

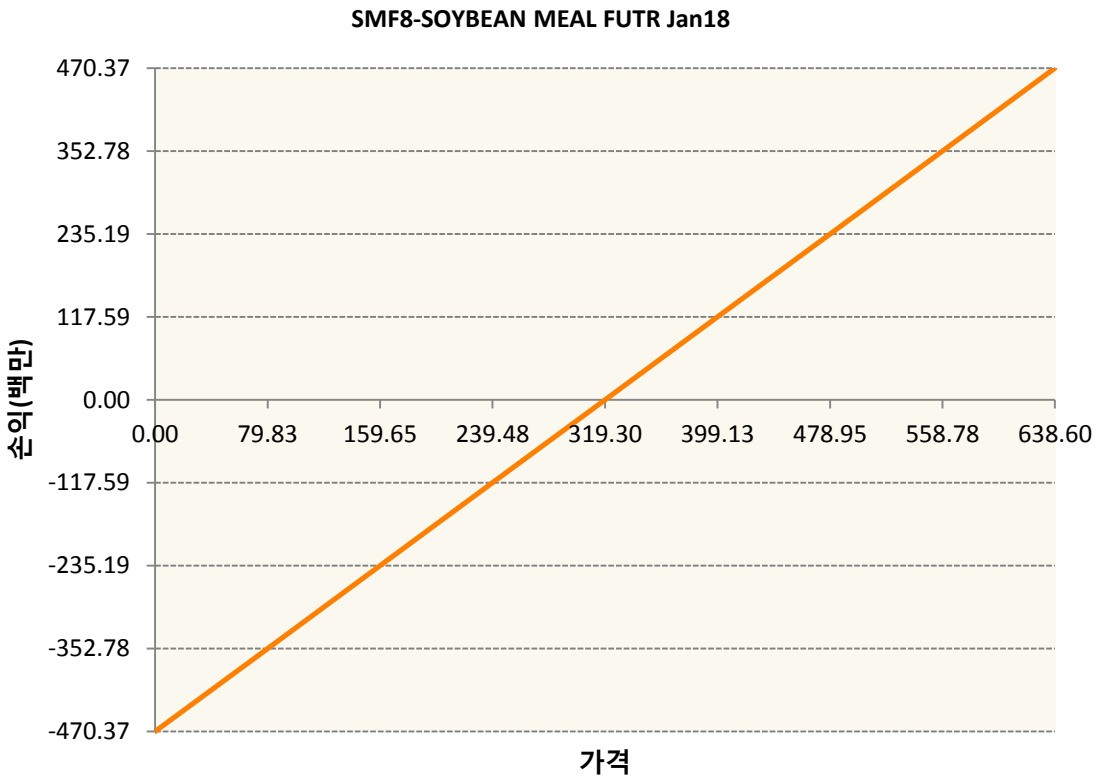

KR4175MB0007-2017-11 달러선물
254.23
169.49
84.74
0.00
-84.74
-169.49
-254.23
-338.97
0.00
282.48
564.95
847.43
1,129.90
1,412.38
1,694.85
1,977.33
2,259.80
손익(백만)
가격

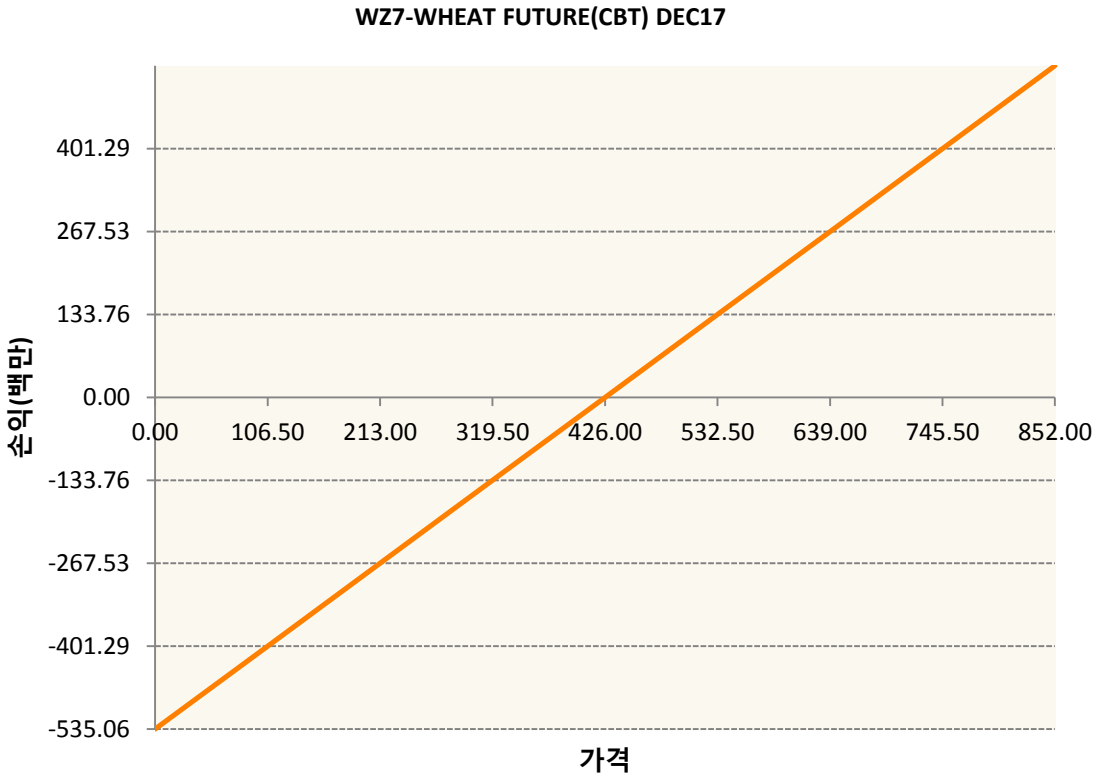

KWZ7-KC HRW WHEAT FUT DEC17
144.83
96.55
48.28
0.00
-48.28
-96.55
-144.83
-193.10
0.00
105.69
211.38
317.06
422.75
528.44
634.13
739.81
845.50
손익(백만)

가격


SBH8-Sugar #11 (WORLD) MAR18
353.88
265.41
176.94
88.47
0.00
-88.47
-176.94
-265.41
-353.88
손익(백만)
0.00
3.50
7.00
10.50
14.00
17.50
21.00
24.50
28.00
가격


SF8-SOYBEAN FUTURE Jan18
896.78
672.59
448.39
224.20
0.00
-224.20
-448.39
-672.59
-896.78
손익(백만)
0.00
247.31
494.63
741.94
989.25
1,236.56
1,483.88
1,731.19
1,978.50
가격





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
BOF8	SOYBEAN OIL FUTR Jan18	34

CTZ7	COTTON NO.2 FUTR DEC17	18
CZ7	CORN FUTURE DEC17	88
KCZ7	COFFEE 'C' FUTURE DEC17	26
KR4175MB0(	2017-11 달러선물	27
KWZ7	KC HRW WHEAT FUT DEC17	15
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)

414