공시일	2017-10-25
기준일	2017-10-24

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	2017-10-25
기준일	2017-10-24

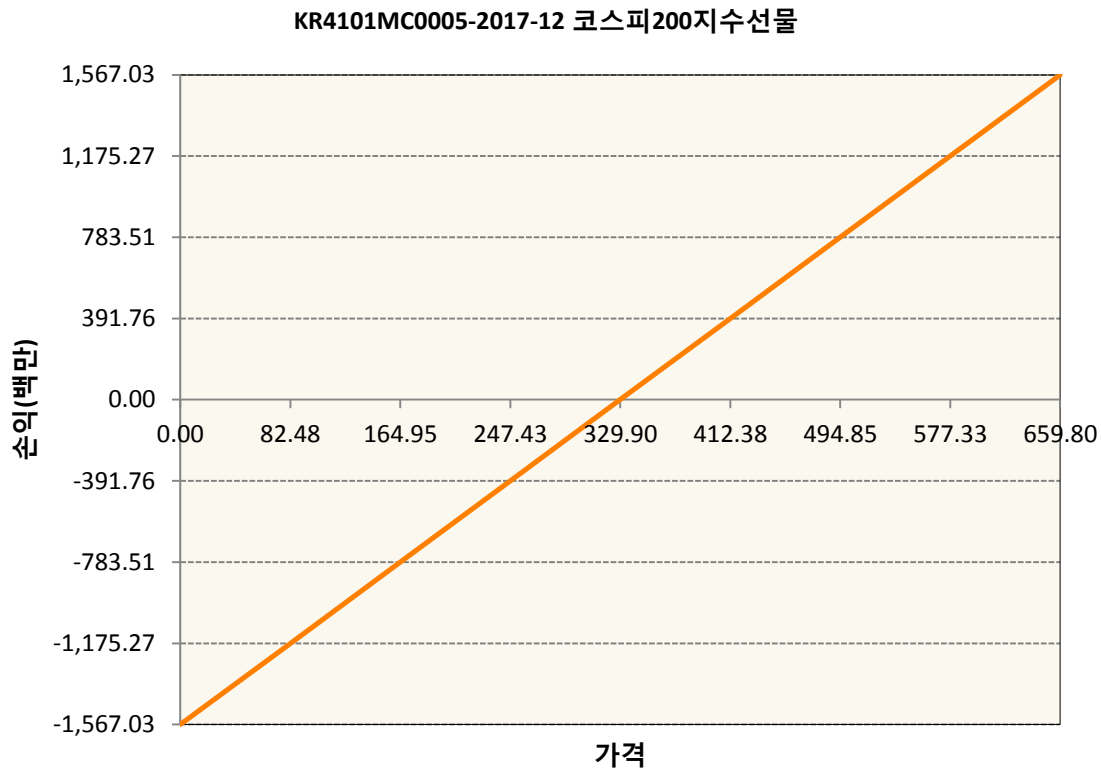
스마트인덱스모

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	1,567	0	1,567	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	2017-10-25
기준일	2017-10-24

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	2017-10-25
기준일	2017-10-24

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)

365

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-10-25
기준일	2017-10-24

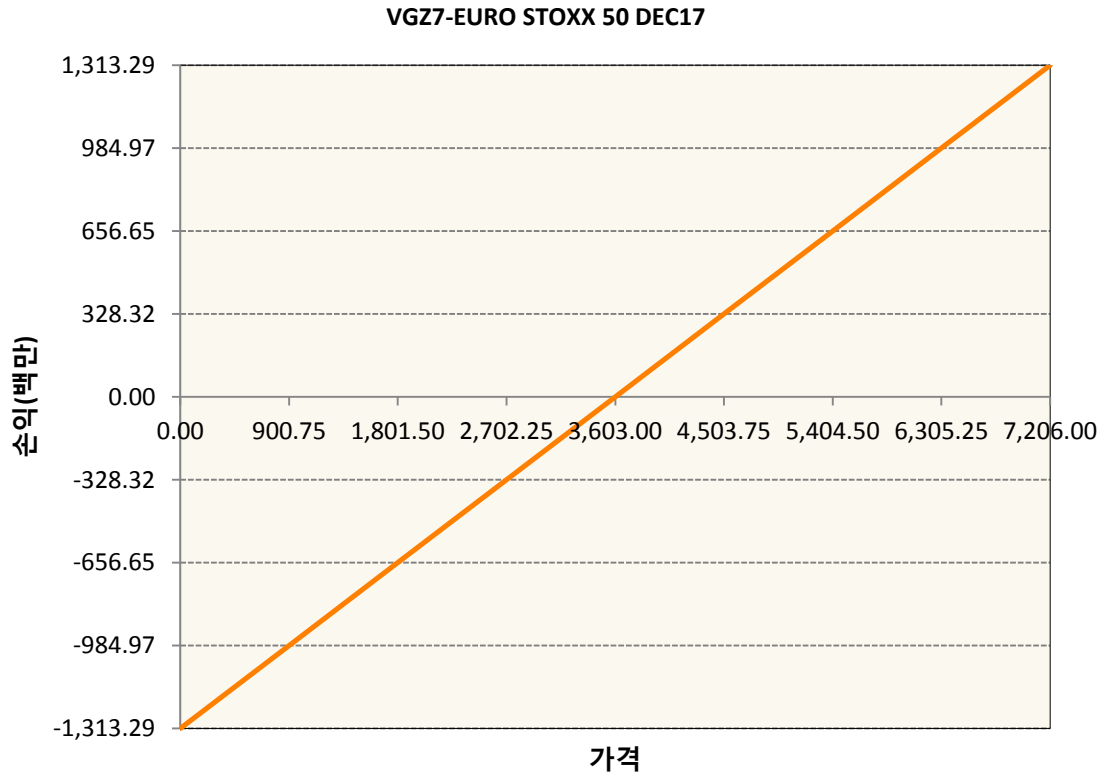
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,313	0	1,313	

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	2017-10-25
기준일	2017-10-24

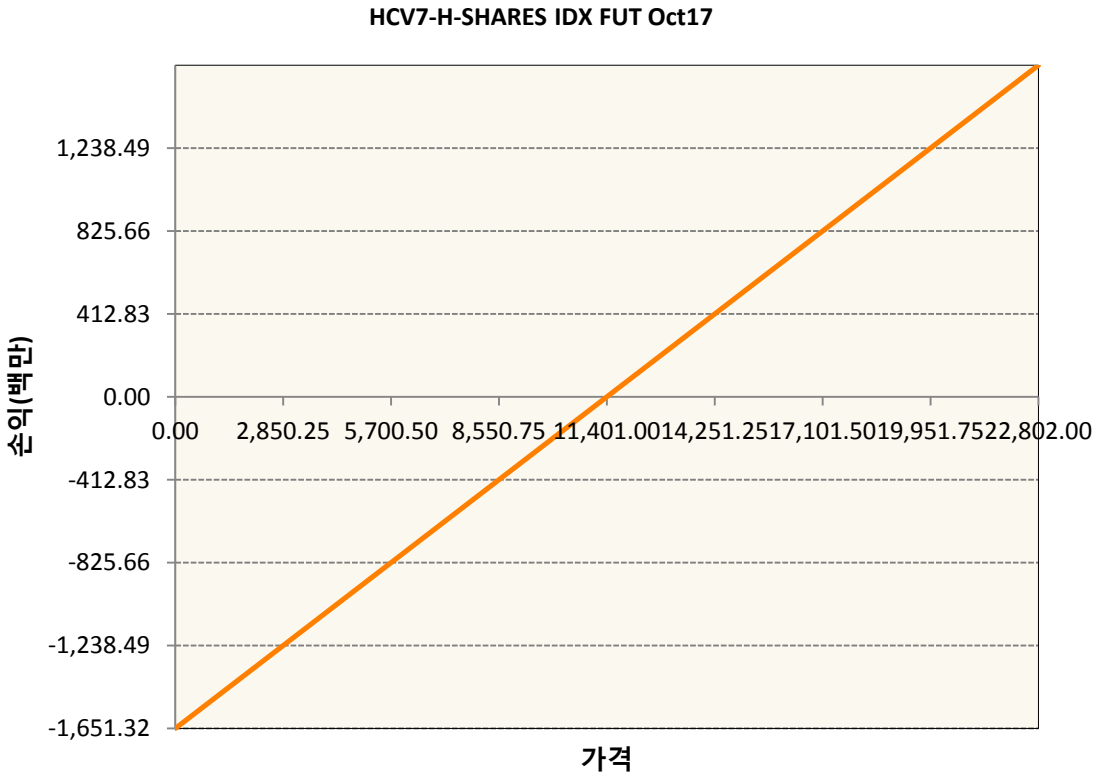
차이나인덱스모(주식-파생형)

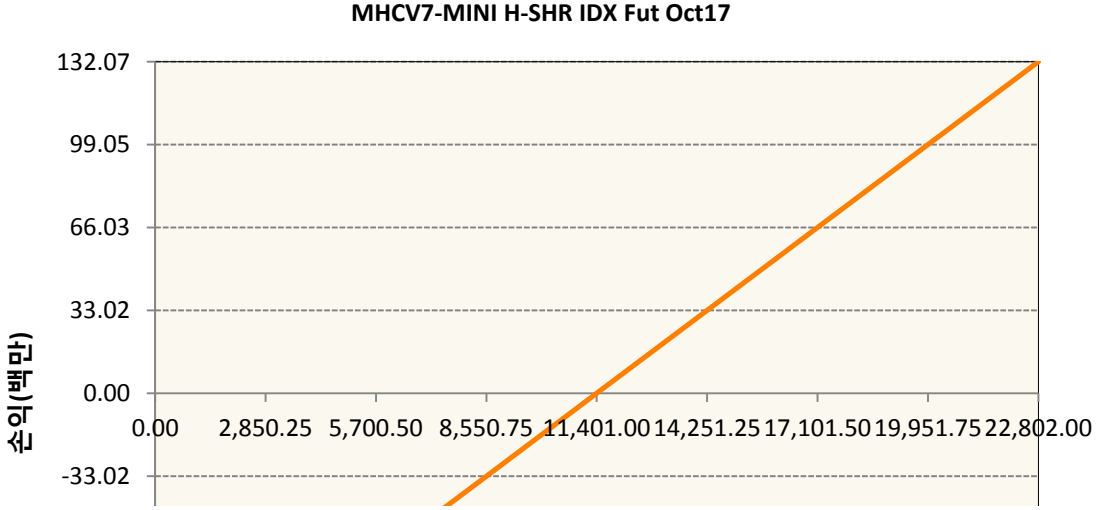
1. 계약금액

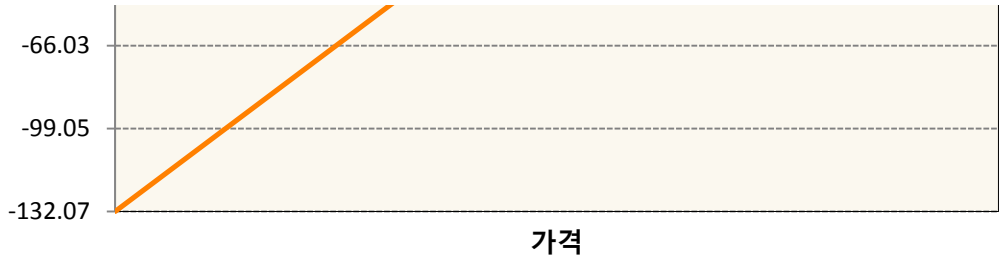
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,783	0	1,783	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)

117

공시일	2017-10-25
기준일	2017-10-24

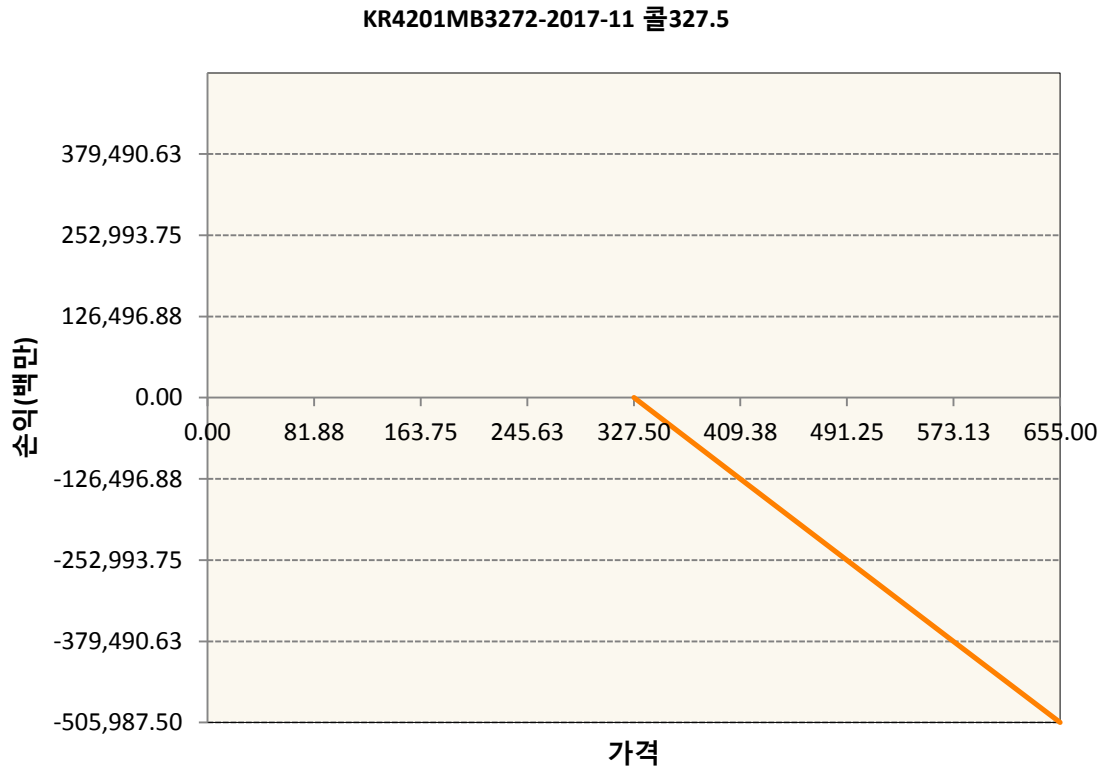
커버드콜모(주식혼합-파생형)

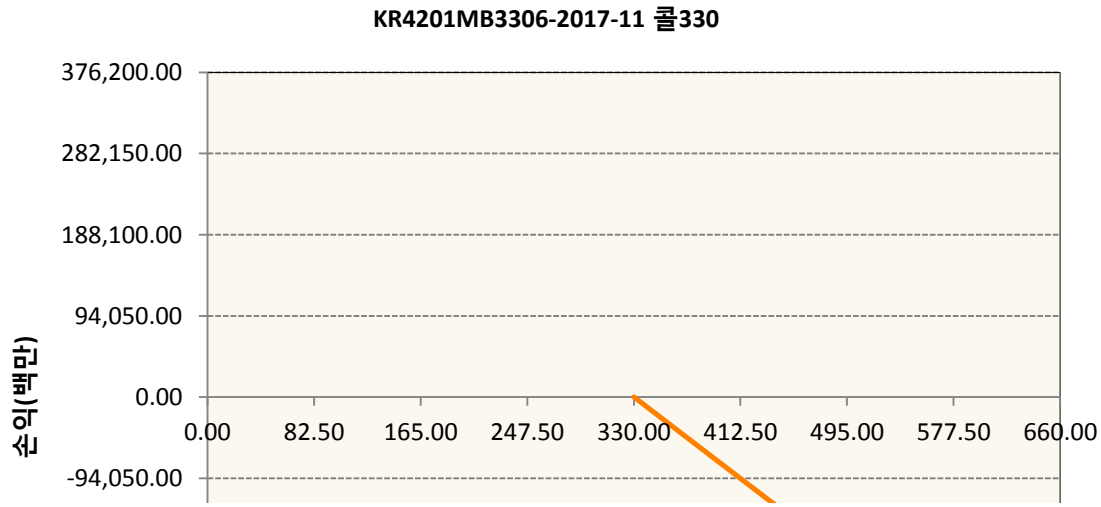
1. 계약금액

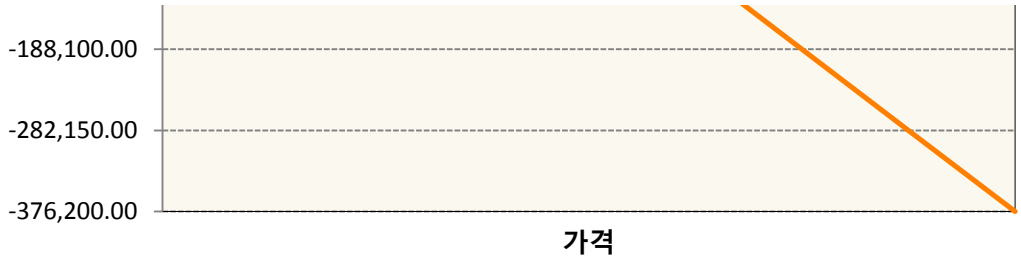
(단위:백만원)

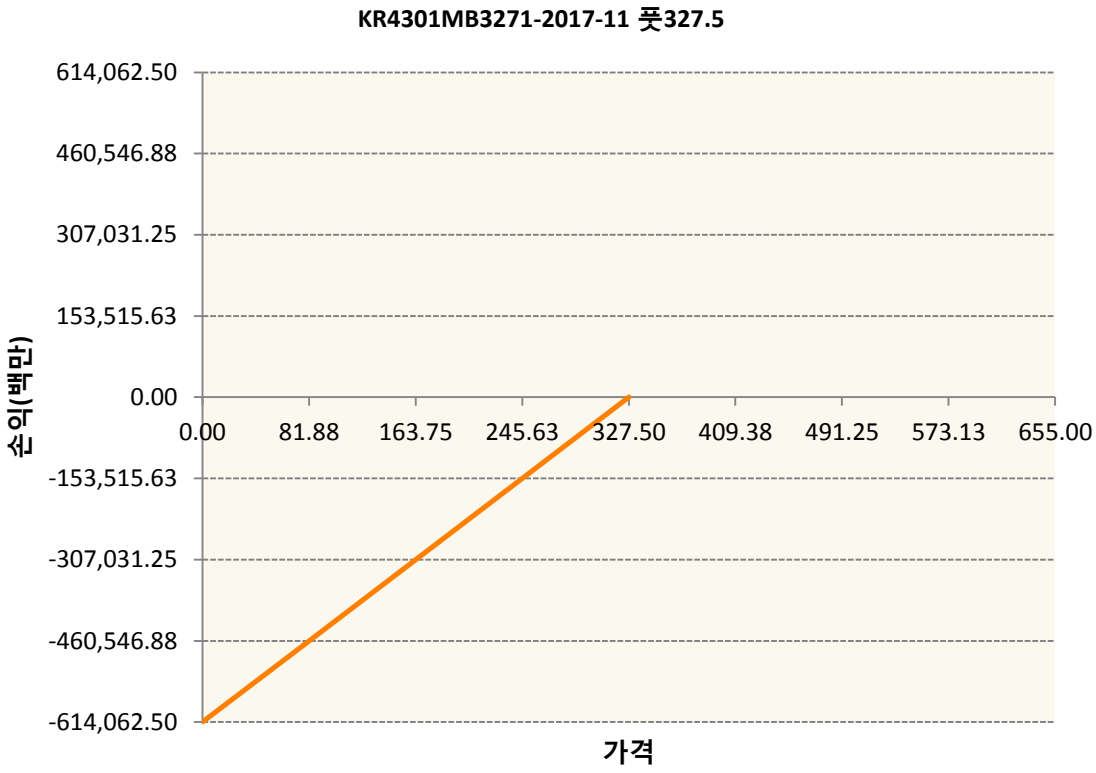
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	1,496,250	-1,496,250	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201MB3: 2017-11 콜327.5							33,124
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	11,256	11,141	10,978	10,765	10,504	10,196	9,847
-5.33%	10,587	10,216	9,787	9,309	8,789	8,234	7,649
-2.67%	8,169	7,457	6,724	5,975	5,213	4,442	3,662
0%	2,524	1,683	842	0	-843	-1,686	-2,529
2.67%	-6,763	-7,396	-8,064	-8,761	-9,480	-10,218	-10,970
5.33%	-18,644	-18,959	-19,337	-19,772	-20,255	-20,780	-21,342
8.00%	-31,726	-31,833	-31,990	-32,198	-32,459	-32,768	-33,124
KR4201MB3: 2017-11 콜330							23,332
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	6,930	6,873	6,785	6,665	6,511	6,324	6,105

-5.33%	6,607	6,395	6,138	5,841	5,510	5,149	4,761
-2.67%	5,291	4,826	4,336	3,827	3,303	2,766	2,219
0%	1,876	1,251	625	0	-626	-1,251	-1,877
2.67%	-4,245	-4,779	-5,330	-5,895	-6,469	-7,052	-7,641
5.33%	-12,562	-12,862	-13,207	-13,590	-14,005	-14,446	-14,910
8.00%	-22,034	-22,150	-22,307	-22,507	-22,746	-23,022	-23,332
	KR4301MB3: 2017-11 풋327.5						41,529

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-41,485	-41,486	-41,487	-41,490	-41,497	-41,509	-41,529
-5.33%	-25,063	-25,088	-25,130	-25,194	-25,282	-25,394	-25,532
-2.67%	-9,315	-9,597	-9,912	-10,254	-10,618	-11,001	-11,400
0%	1,540	1,029	515	0	-517	-1,035	-1,553
2.67%	4,695	4,528	4,323	4,083	3,812	3,513	3,190
5.33%	4,961	4,950	4,928	4,889	4,832	4,753	4,652
8.00%	4,967	4,967	4,966	4,964	4,959	4,949	4,931

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

107,290

공시일	2017-10-25
기준일	2017-10-24

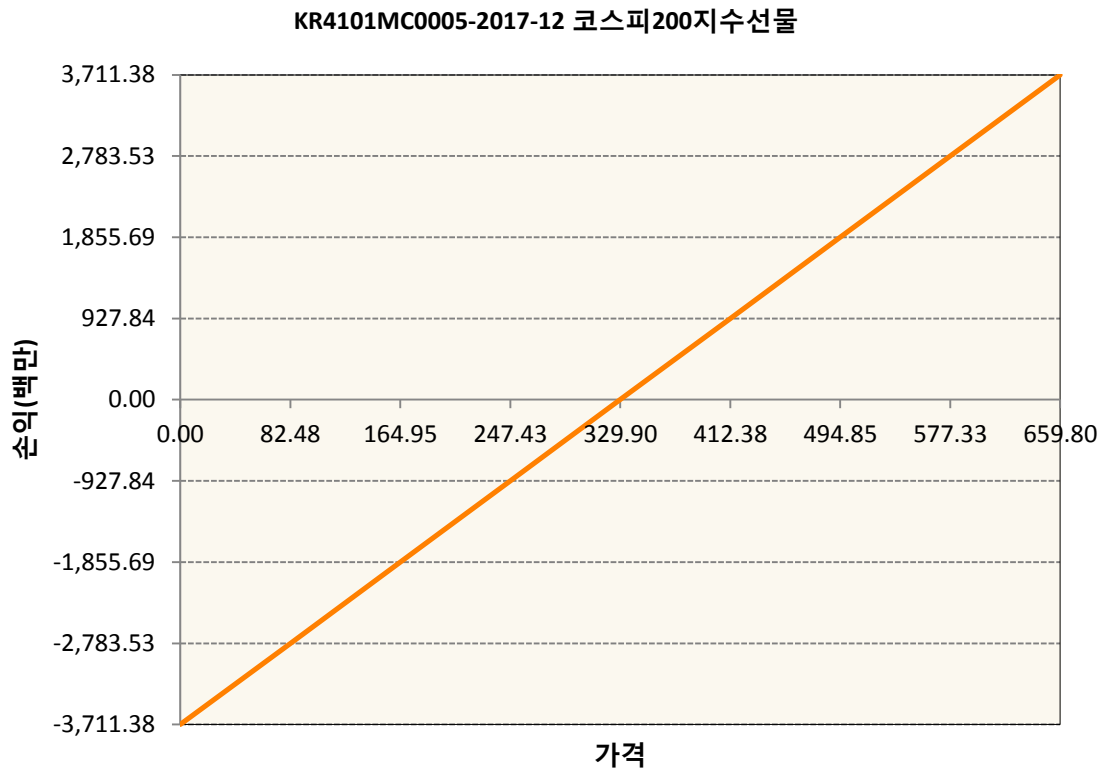
ETF스마트레버리지목표전환형7호

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	3,711	0	3,711	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	2017-10-25
기준일	2017-10-24

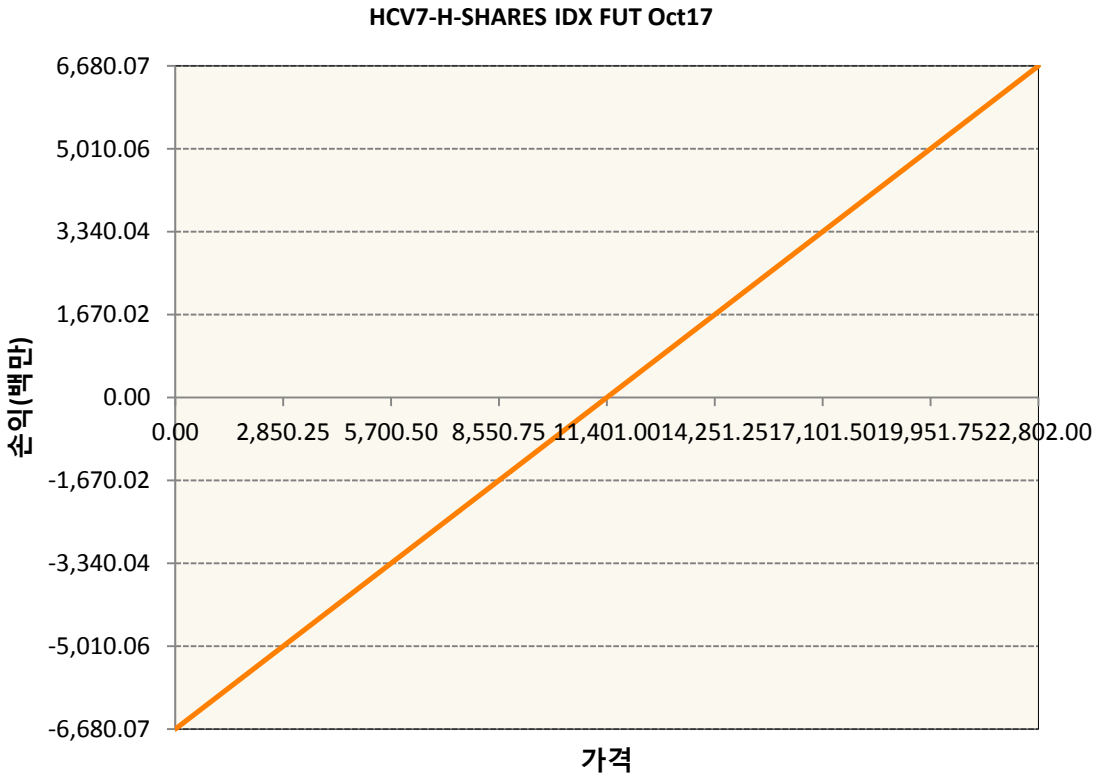
홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생

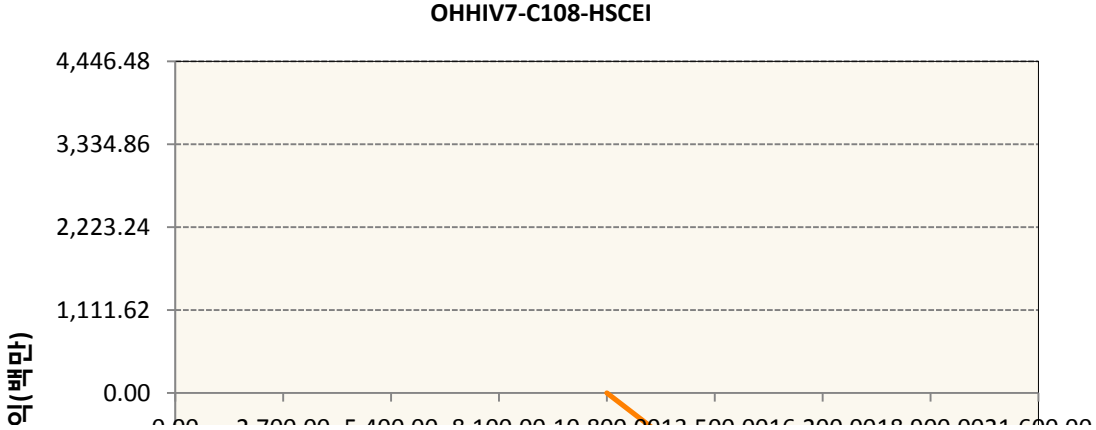
1. 계약금액

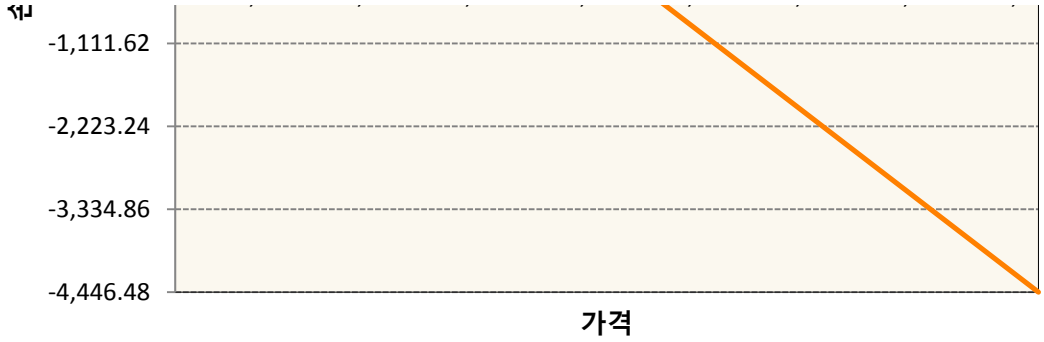
(단위:백만원)

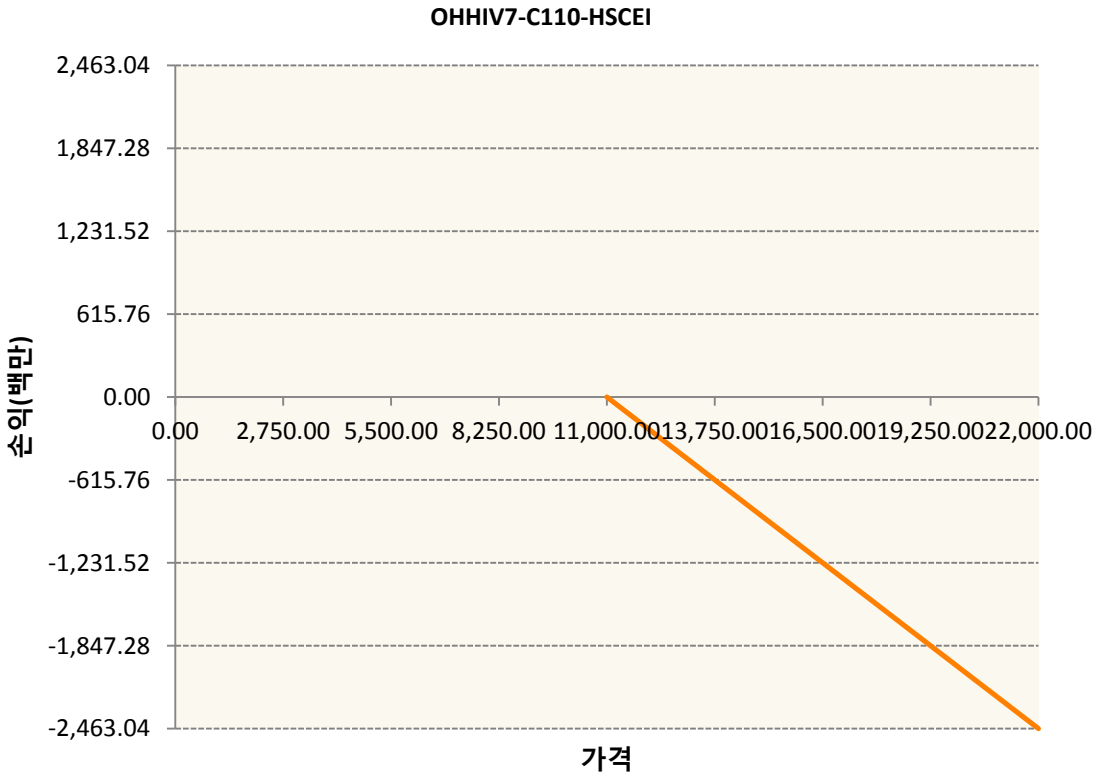
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	6,680	0	6,680	장내
누계	유가증권	옵션	0	13,819	-13,819	장내

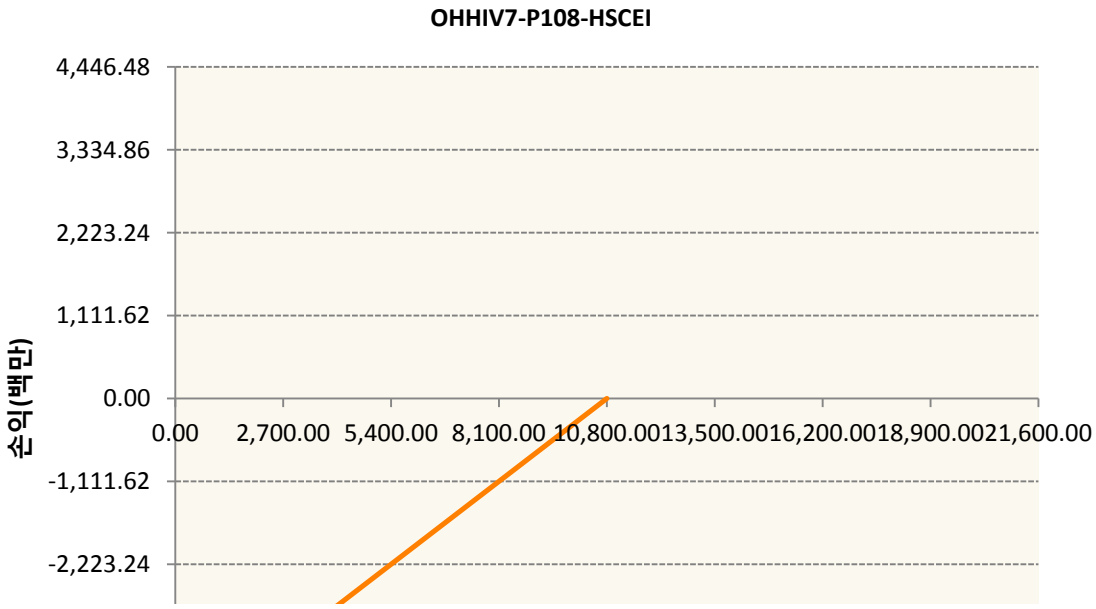
2. 만기시점의 손익구조

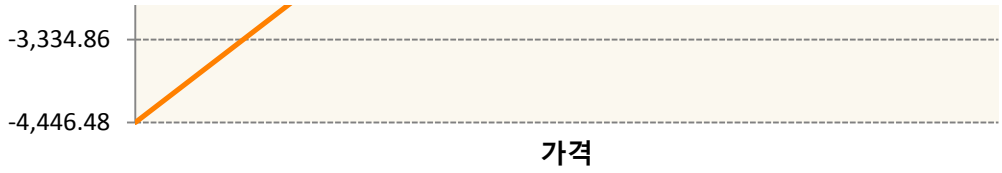


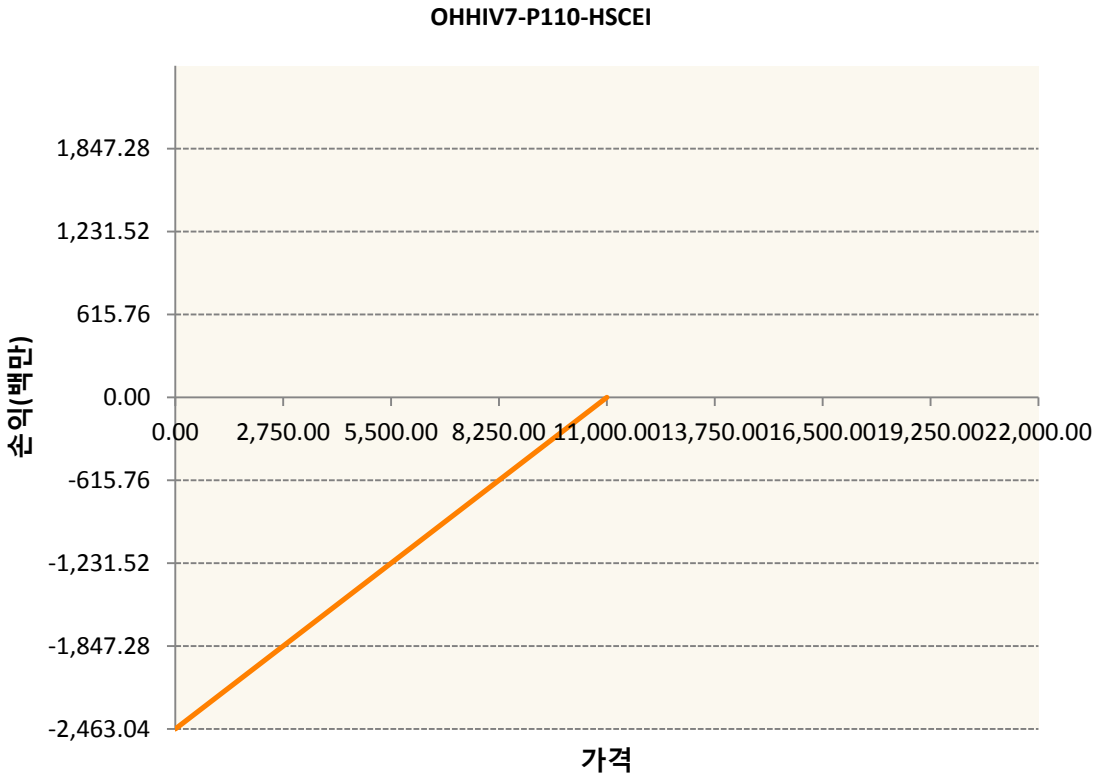



-1,111.62
-2,223.24
-3,334.86
-4,446.48
가격


OHHIV7-C110-HSCEI
2,463.04
1,847.28
1,231.52
615.76
0.00
-615.76
-1,231.52
-1,847.28
-2,463.04
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
4,446.48
3,334.86
2,223.24
1,111.62
0.00
-1,111.62
-2,223.24
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	534
OHHIV7-C10	HSCEI	356
OHHIV7-C11	HSCEI	197
OHHIV7-P10	HSCEI	356
OHHIV7-P11	HSCEI	197

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

1,340

공시일	2017-10-25
기준일	2017-10-24

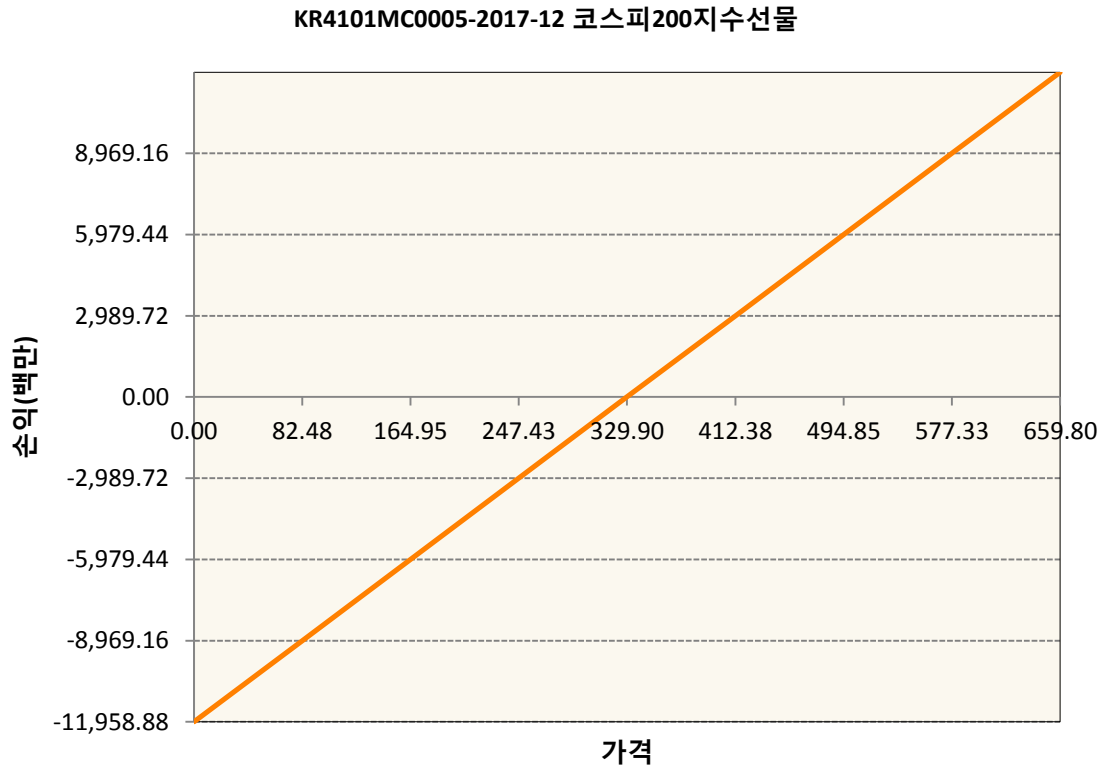
코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼

1. 계약금액

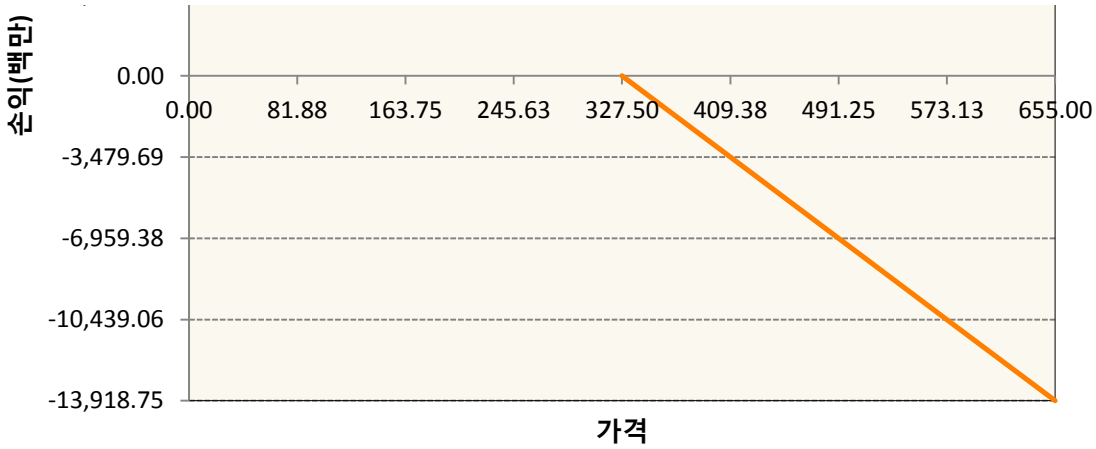
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	5,809	-5,809	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	11,959	0	11,959	장내
누계	유가증권	옵션	0	37,322	-37,322	장내
누계	유가증권	스왑	32,700	0	32,700	장외

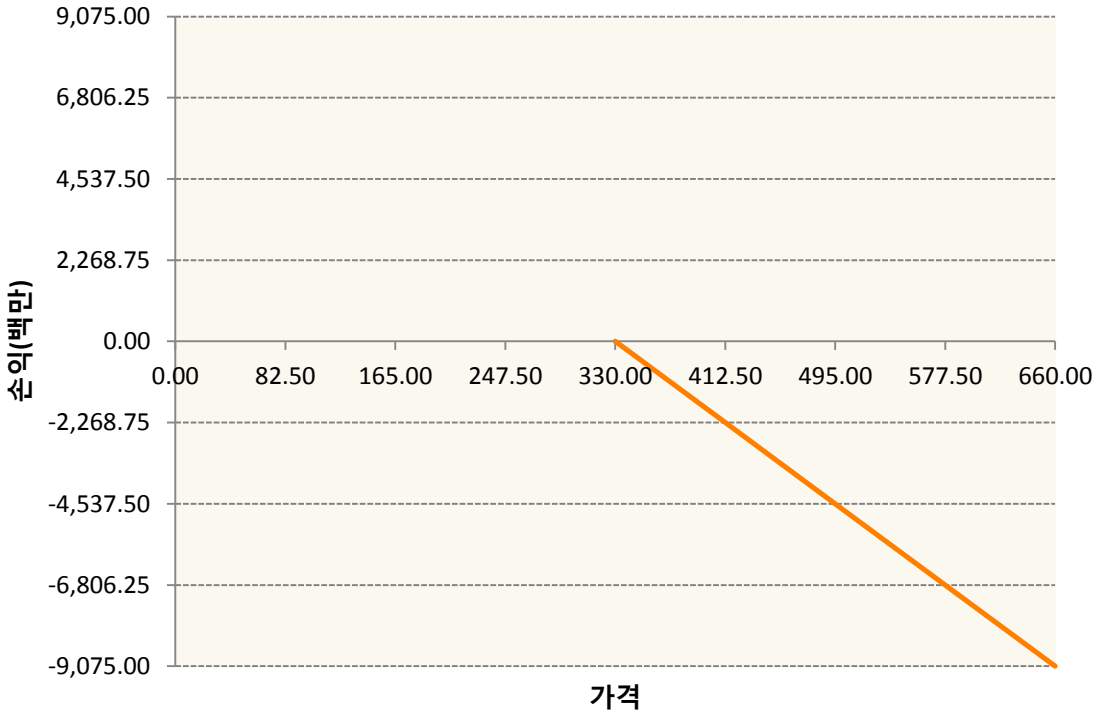
2. 만기시점의 손익구조



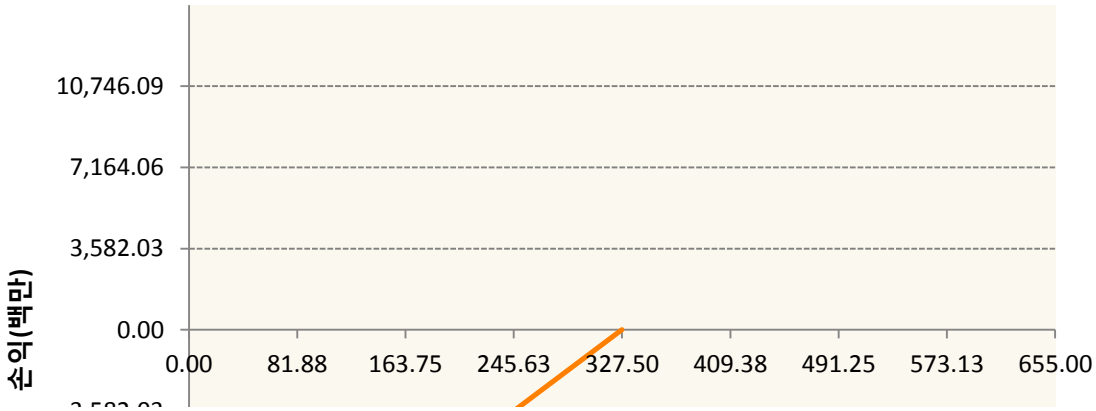




KR4201MB3306-2017-11 콜330



KR4301MB3271-2017-11 풋327.5





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.5287E+11 UBCSFXC1 INDEX_2							1,500
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,500	-1,500	-1,500	-1,500	-1,500	-1,500	-1,500
-5.33%	-1,000	-1,000	-1,000	-1,000	-1,000	-1,000	-1,000
-2.67%	-500	-500	-500	-500	-500	-500	-500
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	500	500	500	500	500	500	500
5.33%	1,000	1,000	1,000	1,000	1,000	1,000	1,000
8.00%	1,500	1,500	1,500	1,500	1,500	1,500	1,500
2.5287E+11 UBCSFXC1 INDEX_3							284
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-284	-284	-284	-284	-284	-284	-284
-5.33%	-189	-189	-189	-189	-189	-189	-189
-2.67%	-95	-95	-95	-95	-95	-95	-95
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	95	95	95	95	95	95	95
5.33%	189	189	189	189	189	189	189
8.00%	284	284	284	284	284	284	284
2.5287E+11 UBCSFXC1 INDEX_4							162
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-162	-162	-162	-162	-162	-162	-162
-5.33%	-108	-108	-108	-108	-108	-108	-108
-2.67%	-54	-54	-54	-54	-54	-54	-54
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	54	54	54	54	54	54	54
5.33%	108	108	108	108	108	108	108
8.00%	162	162	162	162	162	162	162
2.5287E+11 UBCSFXC1 INDEX_5							243
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%

-8.00%	-243	-243	-243	-243	-243	-243	-243
-5.33%	-162	-162	-162	-162	-162	-162	-162
-2.67%	-81	-81	-81	-81	-81	-81	-81
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	81	81	81	81	81	81	81
5.33%	162	162	162	162	162	162	162
8.00%	243	243	243	243	243	243	243
	2.5287E+11	UBCSFXC1 INDEX_6					203
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-203	-203	-203	-203	-203	-203	-203
-5.33%	-135	-135	-135	-135	-135	-135	-135
-2.67%	-68	-68	-68	-68	-68	-68	-68
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	68	68	68	68	68	68	68
5.33%	135	135	135	135	135	135	135
8.00%	203	203	203	203	203	203	203
	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				954
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-954	-954	-954	-954	-954	-954	-954
-5.33%	-636	-636	-636	-636	-636	-636	-636
-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%	636	636	636	636	636	636	636
8.00%	954	954	954	954	954	954	954
	KR4201MB3(	2017-11	콜327.5				911
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	310	306	302	296	289	280	271
-5.33%	291	281	269	256	242	227	210
-2.67%	225	205	185	164	143	122	101
0%	69	46	23	0	-23	-46	-70

2.67%	-186	-203	-222	-241	-261	-281	-302
5.33%	-513	-522	-532	-544	-557	-572	-587
8.00%	-873	-876	-880	-886	-893	-901	-911
	KR4201MB3: 2017-11 콜330						563
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	167	166	164	161	157	153	147
-5.33%	159	154	148	141	133	124	115
-2.67%	128	116	105	92	80	67	54
0%	45	30	15	0	-15	-30	-45
2.67%	-102	-115	-129	-142	-156	-170	-184
5.33%	-303	-310	-319	-328	-338	-348	-360
8.00%	-532	-534	-538	-543	-549	-555	-563
	KR4301MB3: 2017-11 풋327.5						969
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-968	-968	-968	-968	-968	-969	-969
-5.33%	-585	-585	-586	-588	-590	-593	-596
-2.67%	-217	-224	-231	-239	-248	-257	-266
0%	36	24	12	0	-12	-24	-36
2.67%	110	106	101	95	89	82	74
5.33%	116	116	115	114	113	111	109
8.00%	116	116	116	116	116	115	115

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

5,893

공시일	2017-10-25
기준일	2017-10-24

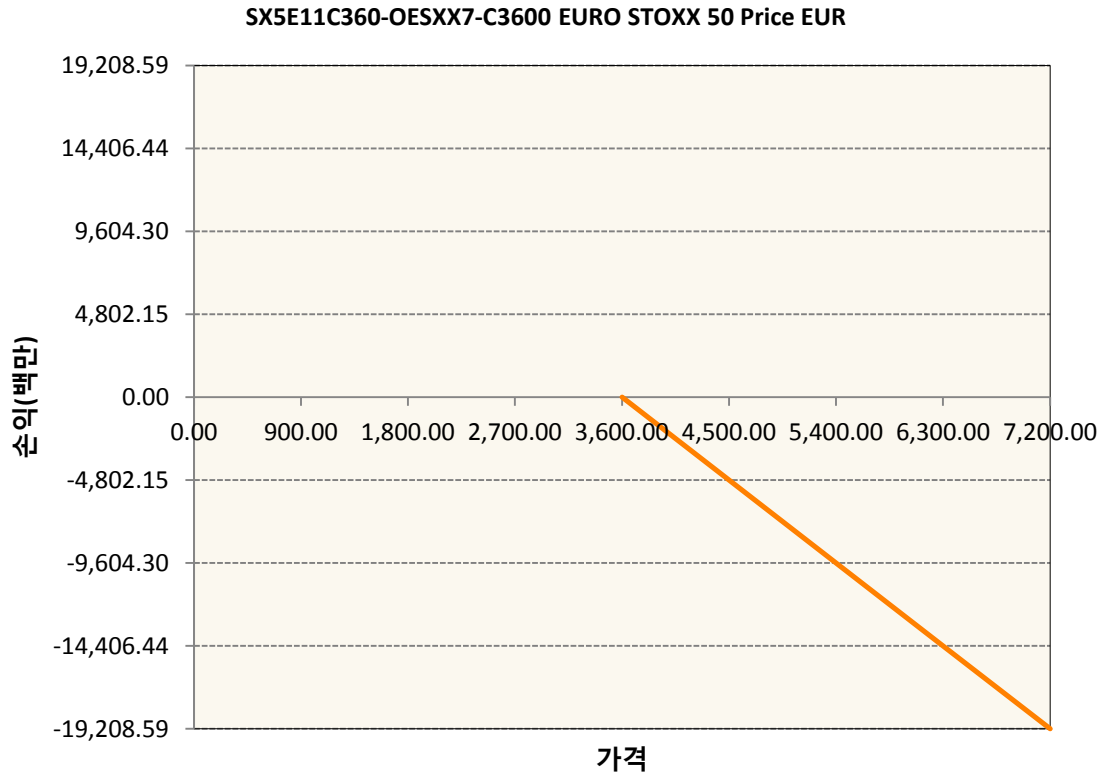
유로커버드콜모(주식혼합-파생형

1. 계약금액

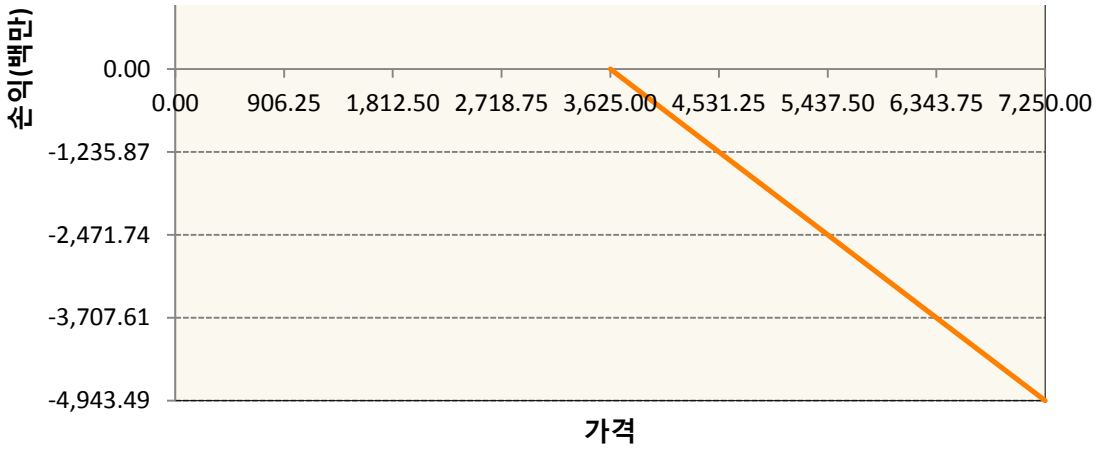
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	옵션	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	20,369	0	20,369	
누계	유가증권	옵션	0	48,304	-48,304	
누계	유가증권	스왑	99,301	0	99,301	장외

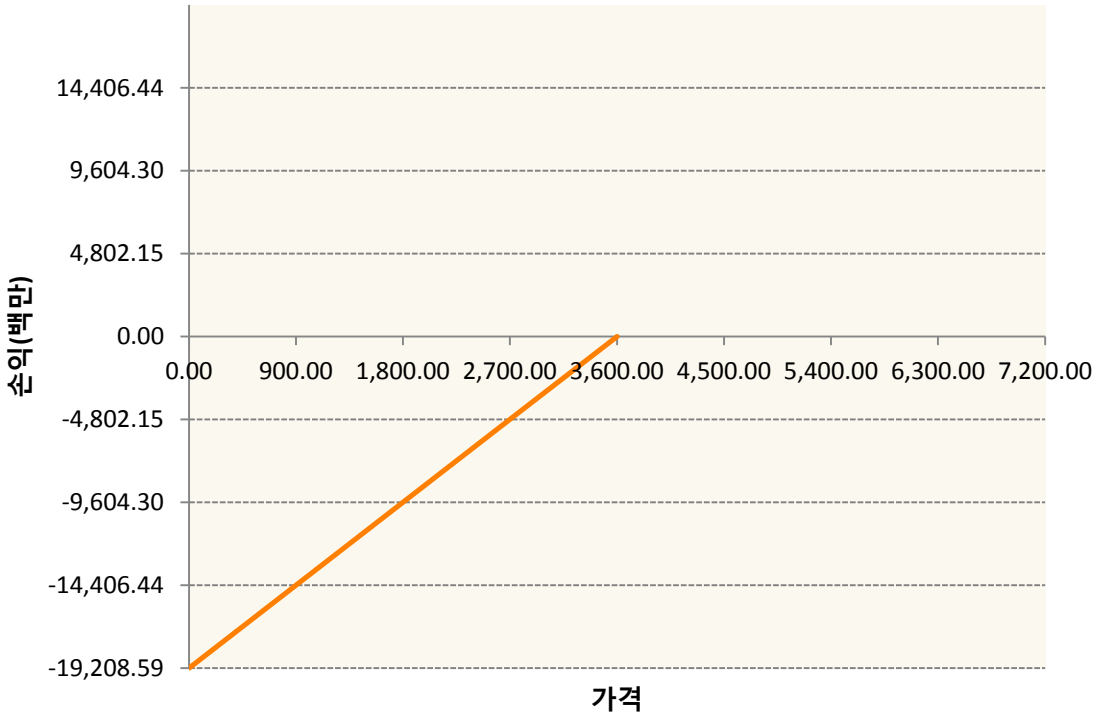
2. 만기시점의 손익구조



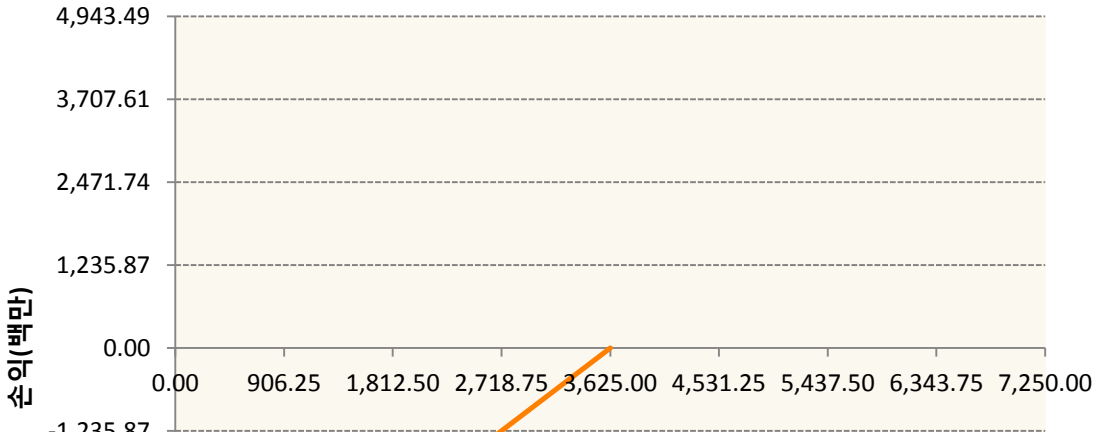




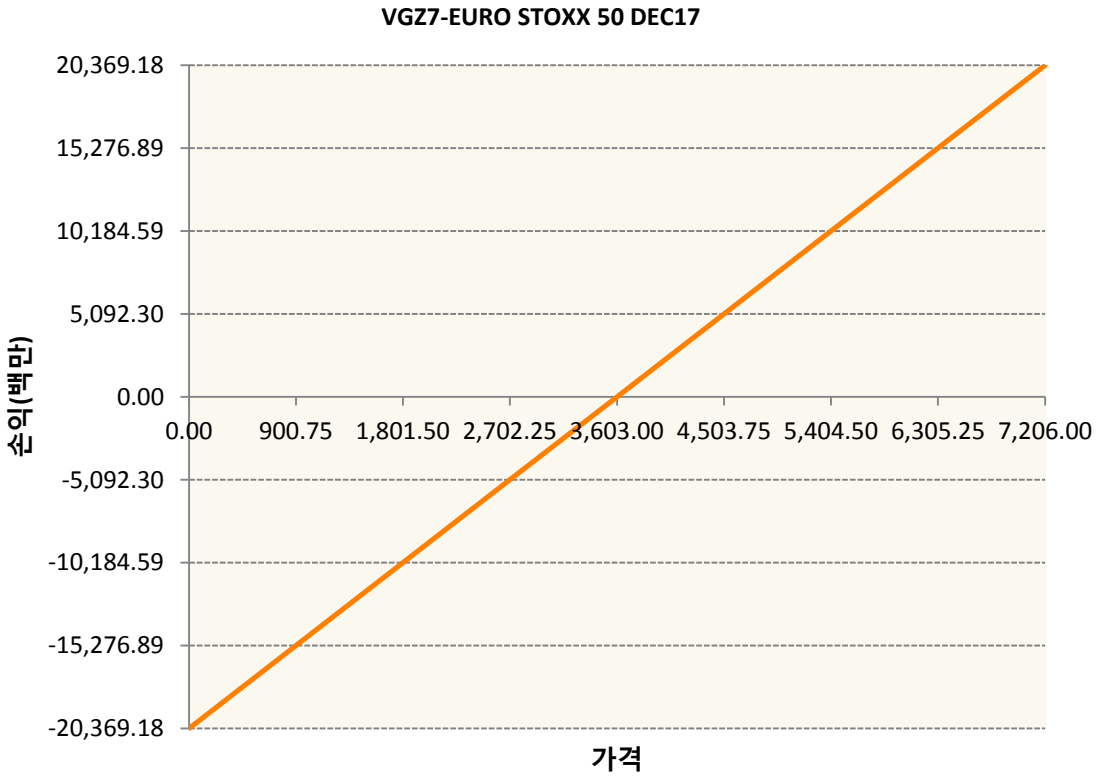
SX5E11P360-OESXX7-P3600 EURO STOXX 50 Price EUR



SX5E11P362-OESXX7-P3625 EURO STOXX 50 Price EUR







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

260105SQPX SG EURO Covered CALL STRATEGY	6
SX5E11C360 OESXX7-C3600 EURO STOXX 50 Price EUR	1,537
SX5E11C362 OESXX7-C3625 EURO STOXX 50 Price EUR	395
SX5E11P360 OESXX7-P3600 EURO STOXX 50 Price EUR	1,537
SX5E11P362 OESXX7-P3625 EURO STOXX 50 Price EUR	395
VGZ7 EURO STOXX 50 DEC17	1,630

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

4,155

공시일	2017-10-25
기준일	2017-10-24

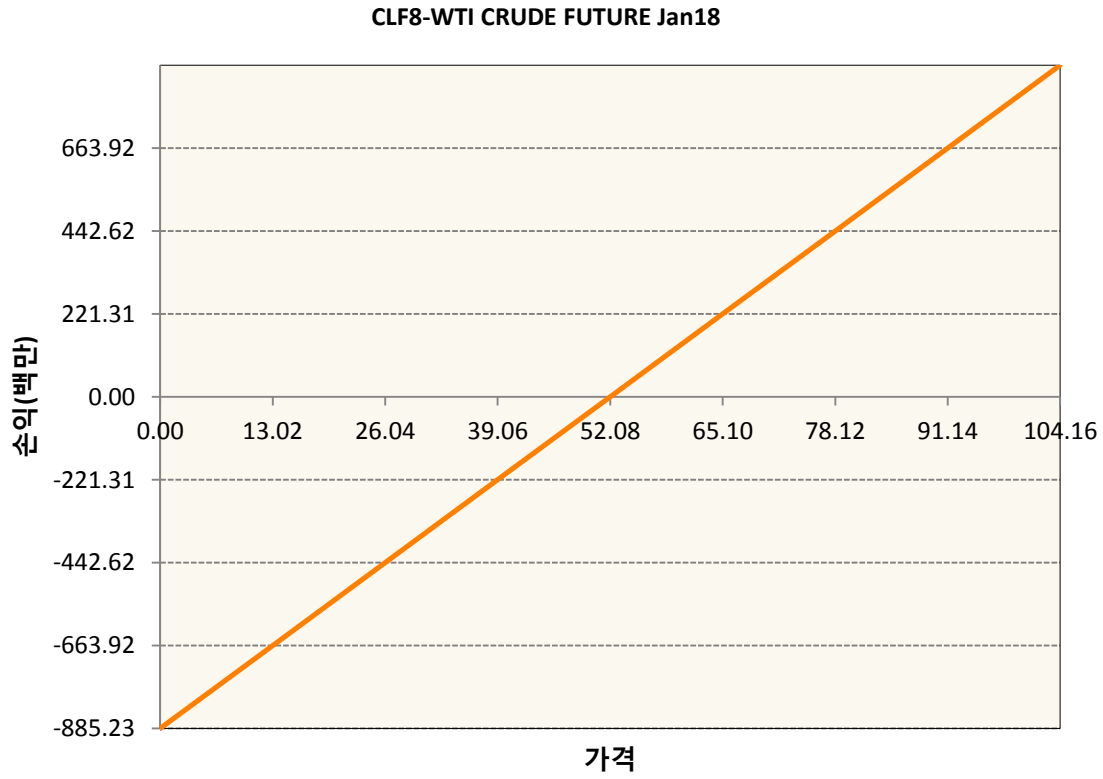
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

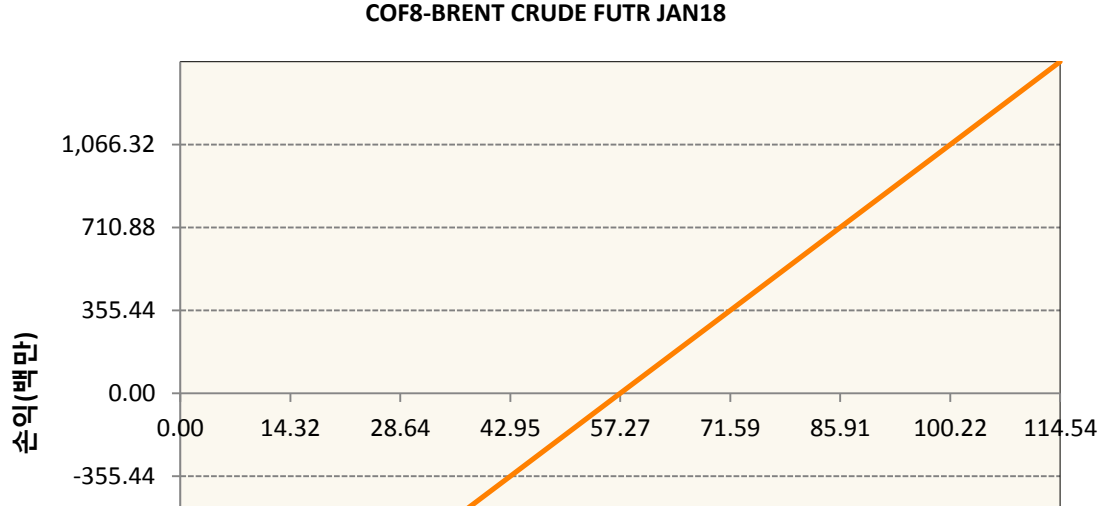
1. 계약금액

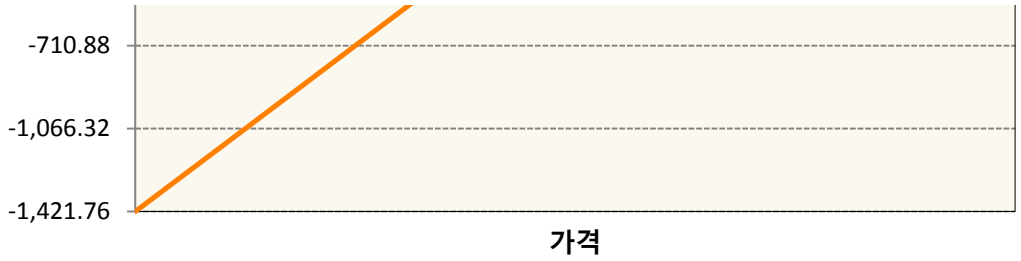
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	5,095	902	4,193	

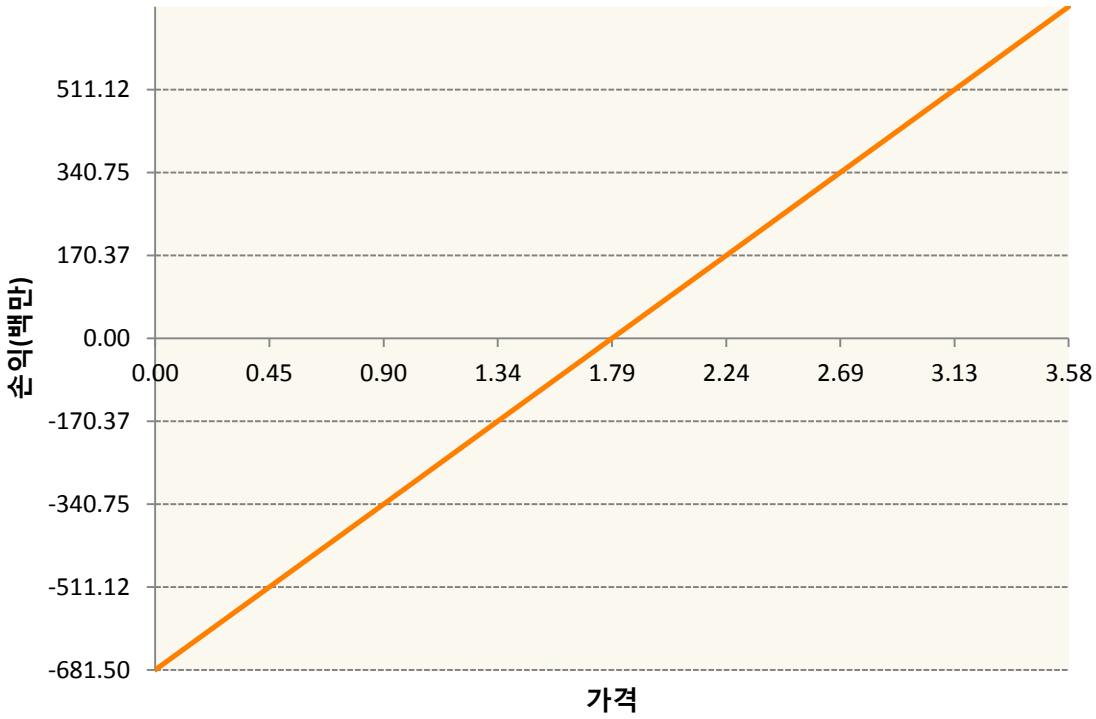
2. 만기시점의 손익구조



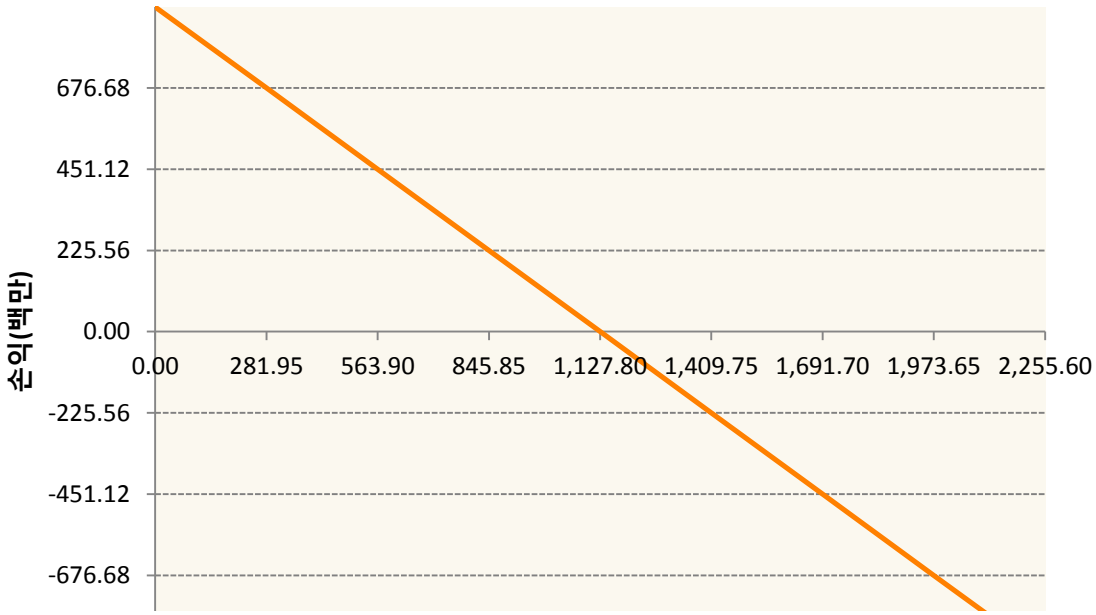


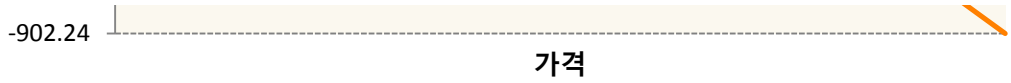


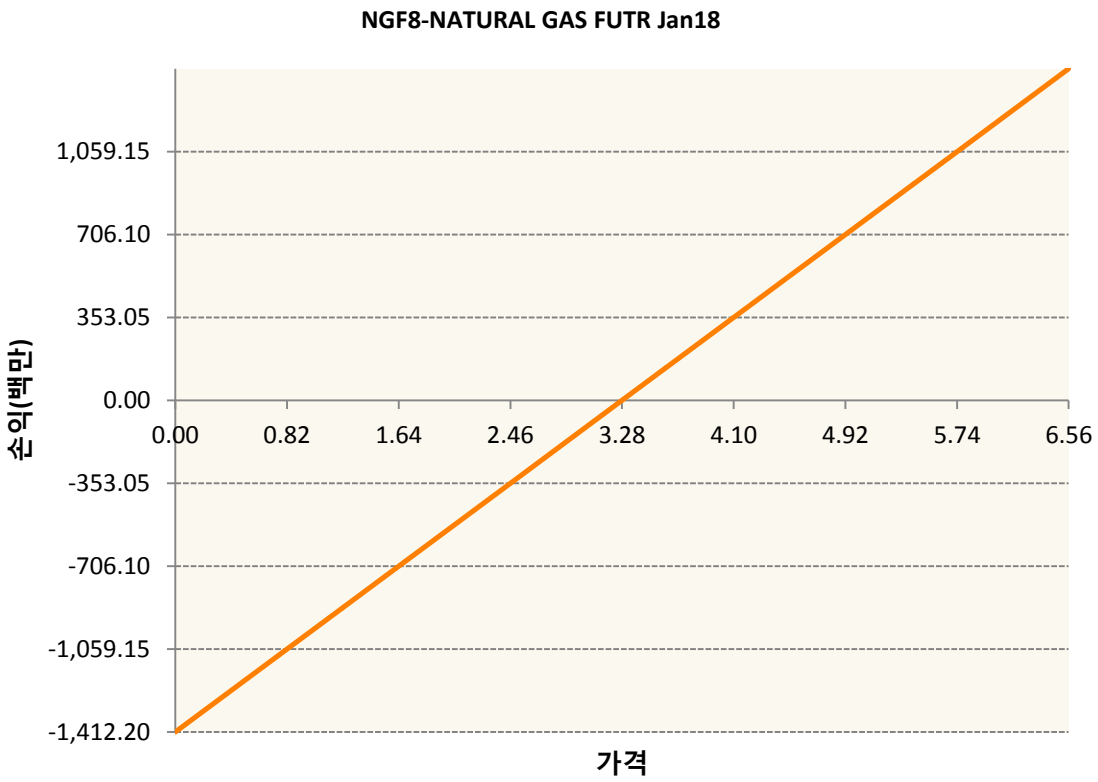
HOF8-NY Harb ULSD Fut Jan18

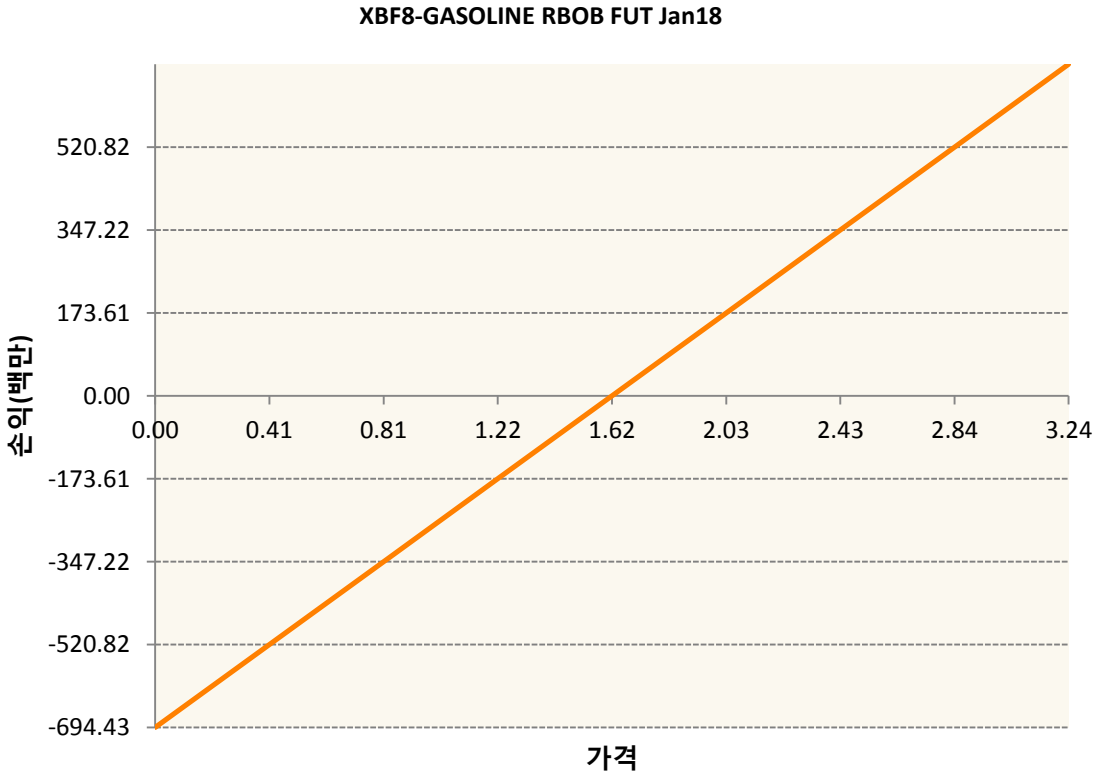


KR4175MB0007-2017-11 달러선물




-902.24
가격


NGF8-NATURAL GAS FUTR Jan18
1,059.15
706.10
353.05
0.00
-353.05
-706.10
-1,059.15
-1,412.20
0.00
0.82
1.64
2.46
3.28
4.10
4.92
5.74
6.56
손익(백만)
가격


XBF8-GASOLINE RBOB FUT Jan18
520.82
347.22
173.61
0.00
-173.61
-347.22
-520.82
-694.43
0.00
0.41
0.81
1.22
1.62
2.03
2.43
2.84
3.24
손익(백만)
가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLF8	WTI CRUDE FUTURE Jan18	71
COF8	BRENT CRUDE FUTR JAN18	114
HOF8	NY Harb ULSD Fut Jan18	55
KR4175MB0(	2017-11 달러선물	72
NGF8	NATURAL GAS FUTR Jan18	113
XBF8	GASOLINE RBOB FUT Jan18	56

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

731

공시일	2017-10-25
기준일	2017-10-24

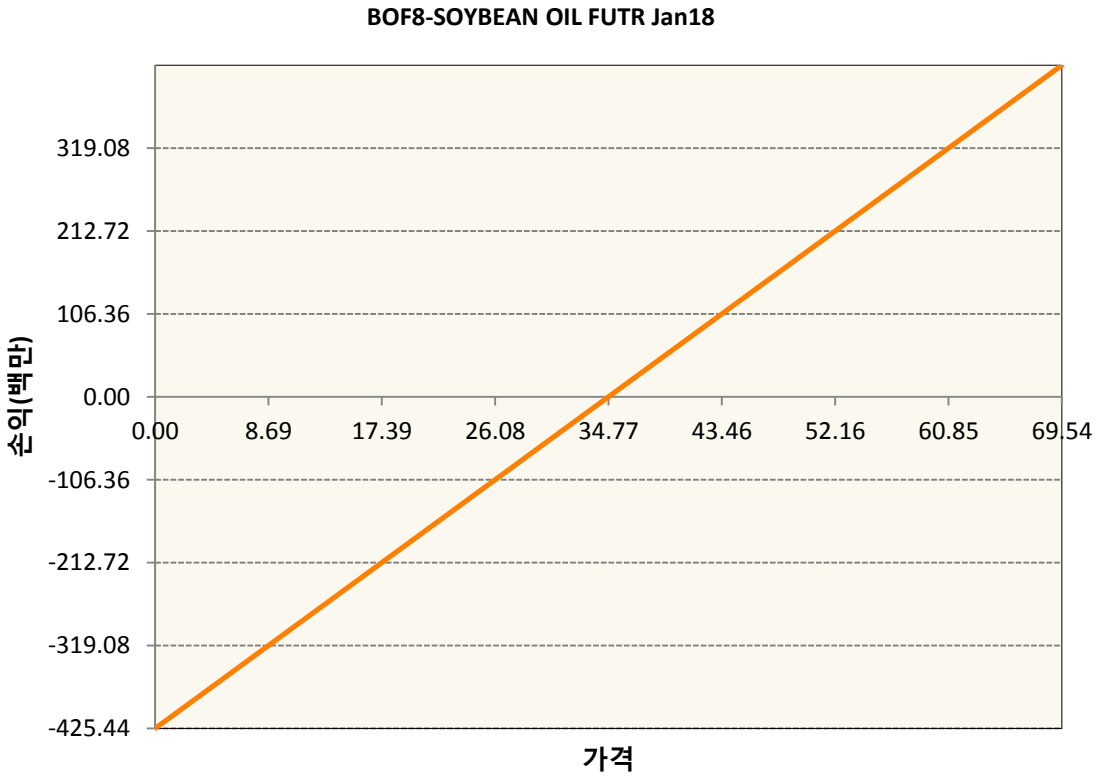
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

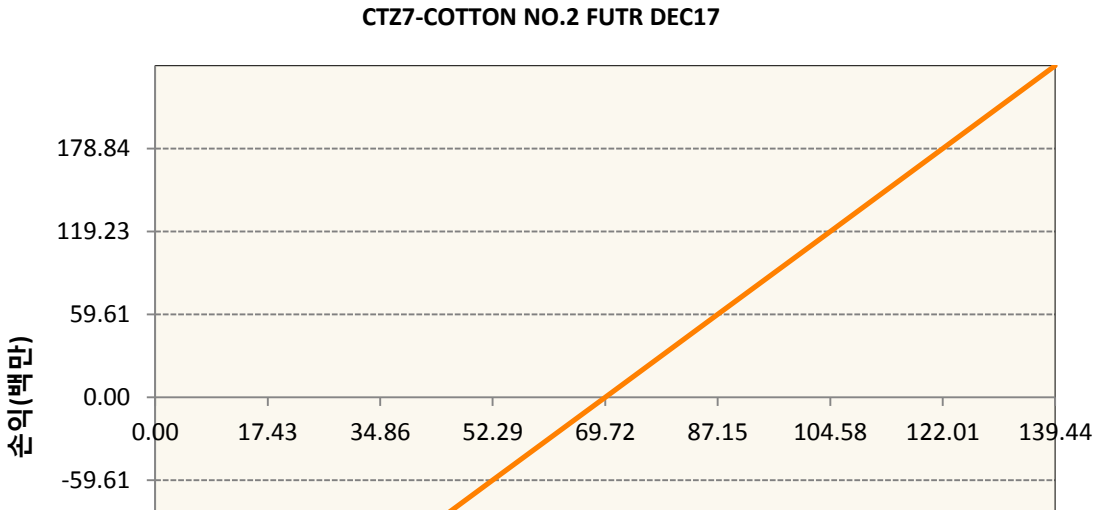
1. 계약금액

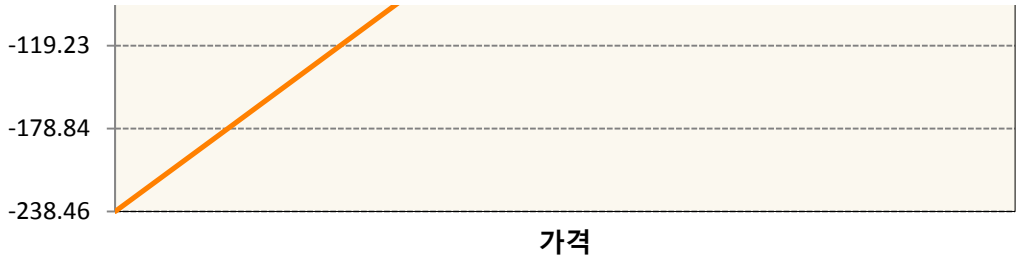
(단위:백만원)

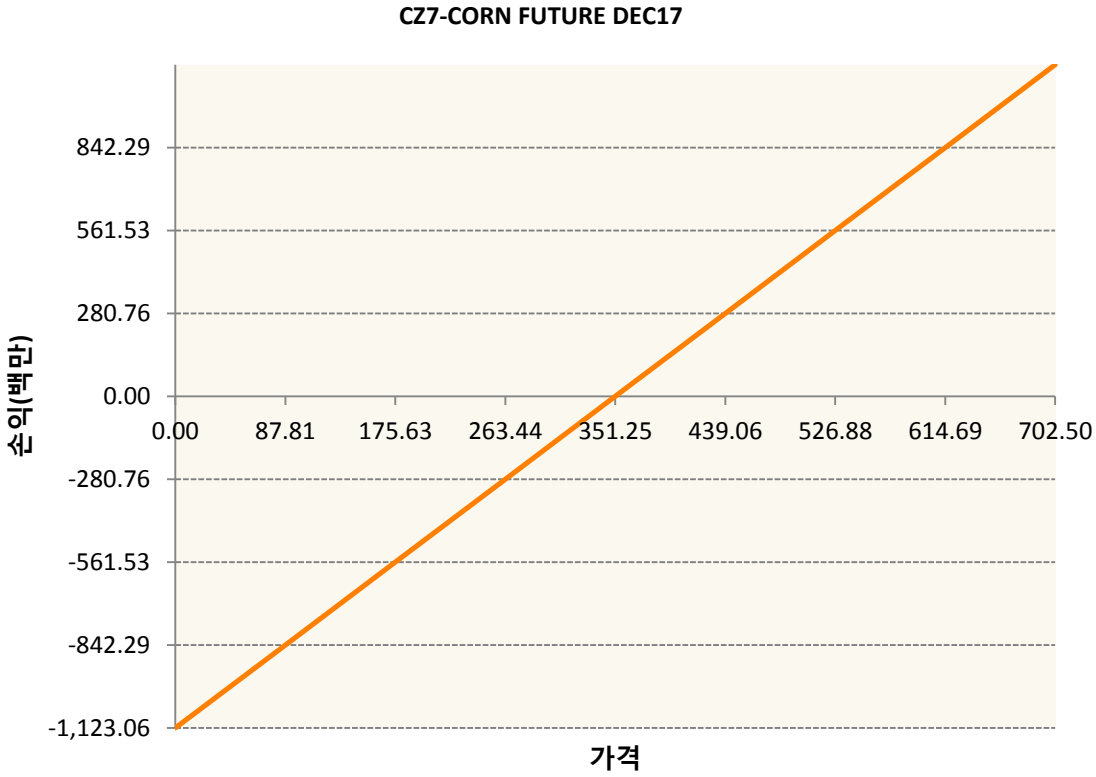
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	4,571	338	4,232	

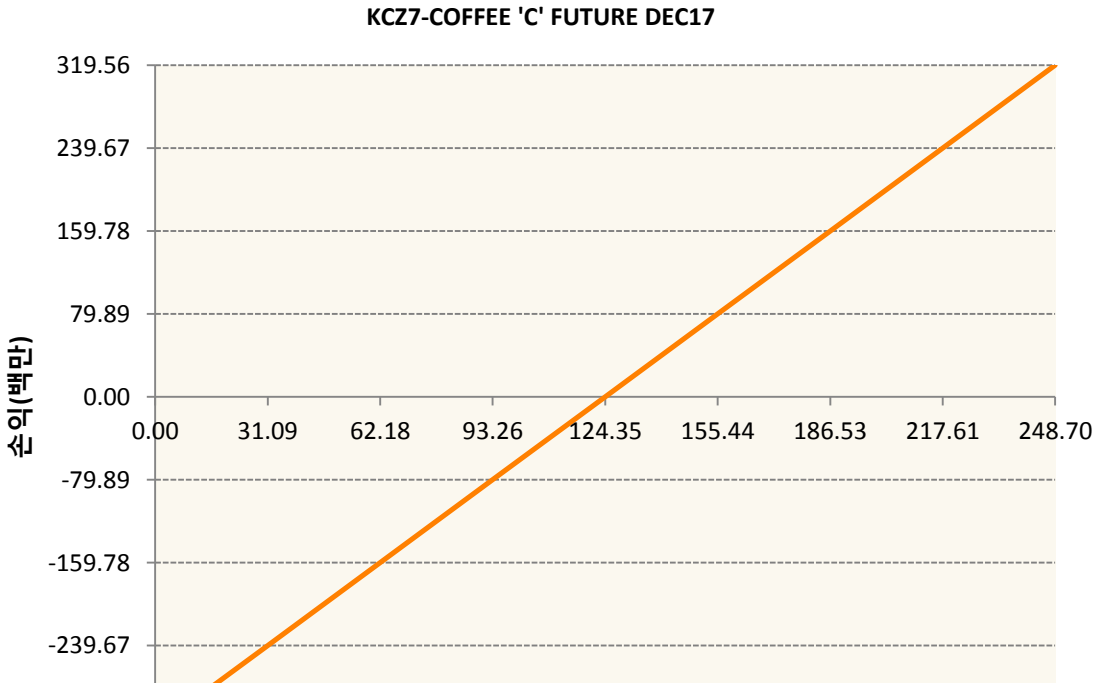
2. 만기시점의 손익구조

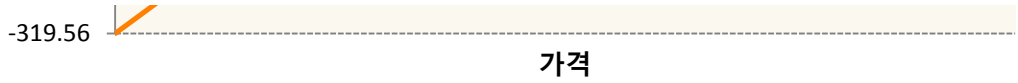


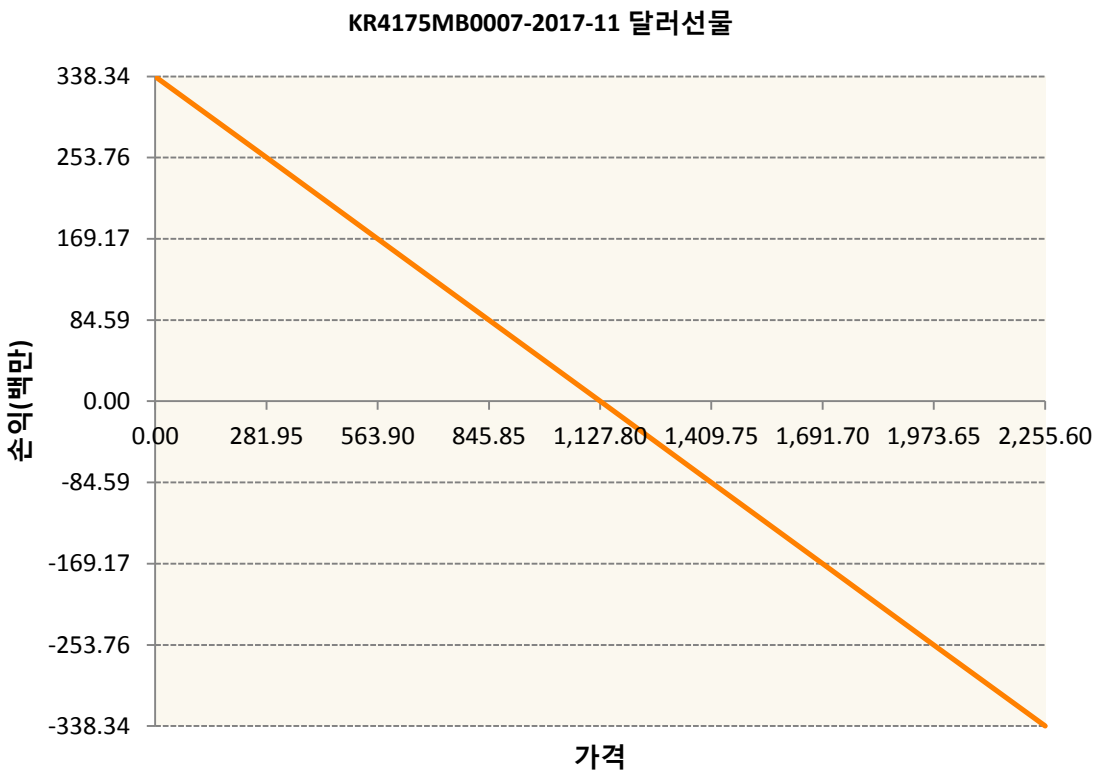


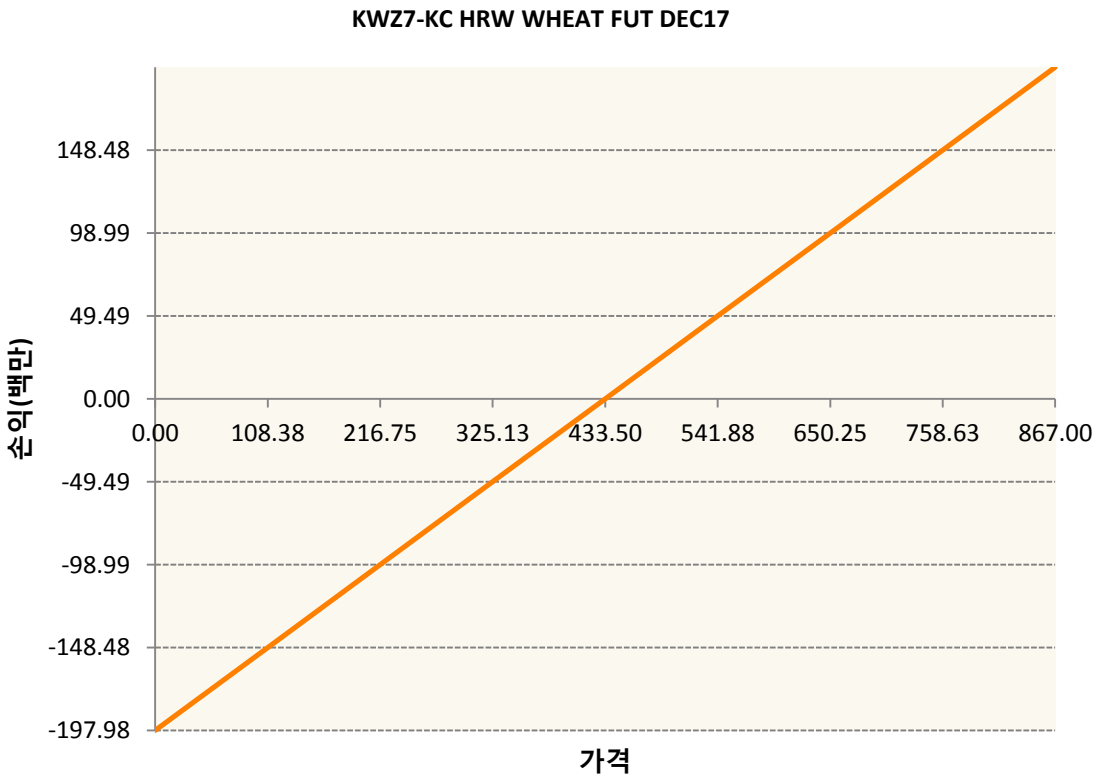

-119.23
-178.84
-238.46
가격


CZ7-CORN FUTURE DEC17
842.29
561.53
280.76
0.00
-280.76
-561.53
-842.29
-1,123.06
0.00
87.81
175.63
263.44
351.25
439.06
526.88
614.69
702.50
손익(백만)
가격

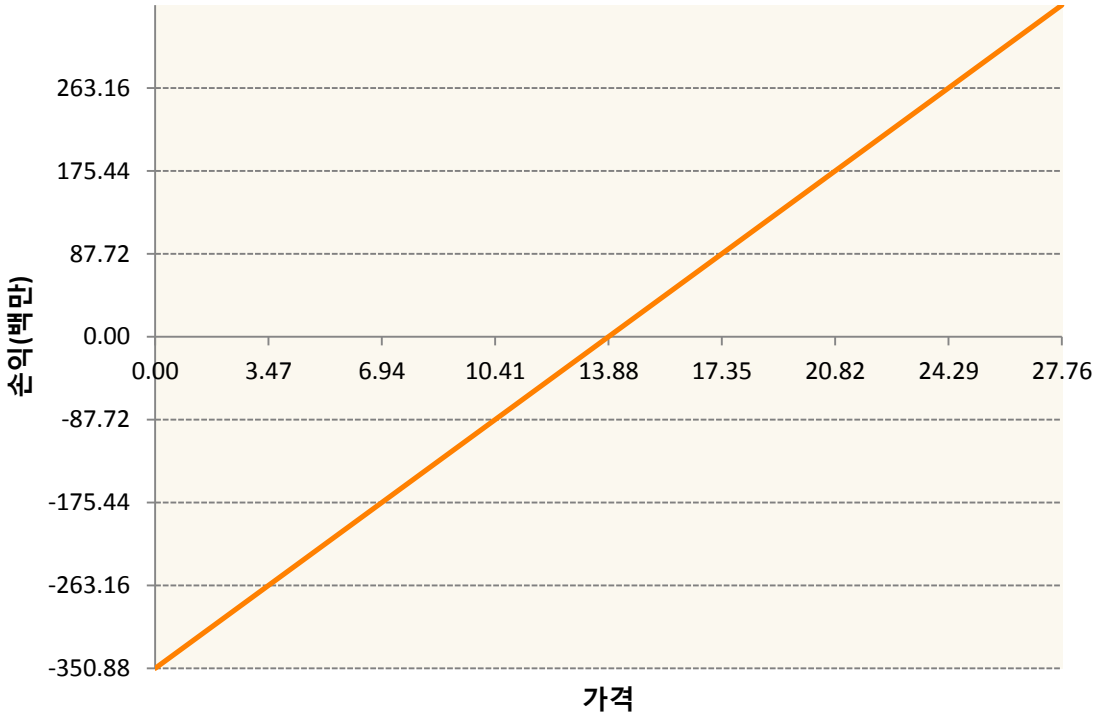

KCZ7-COFFEE 'C' FUTURE DEC17
319.56
239.67
159.78
79.89
0.00
-79.89
-159.78
-239.67
0.00
31.09
62.18
93.26
124.35
155.44
186.53
217.61
248.70
손익(백만)


-319.56
가격

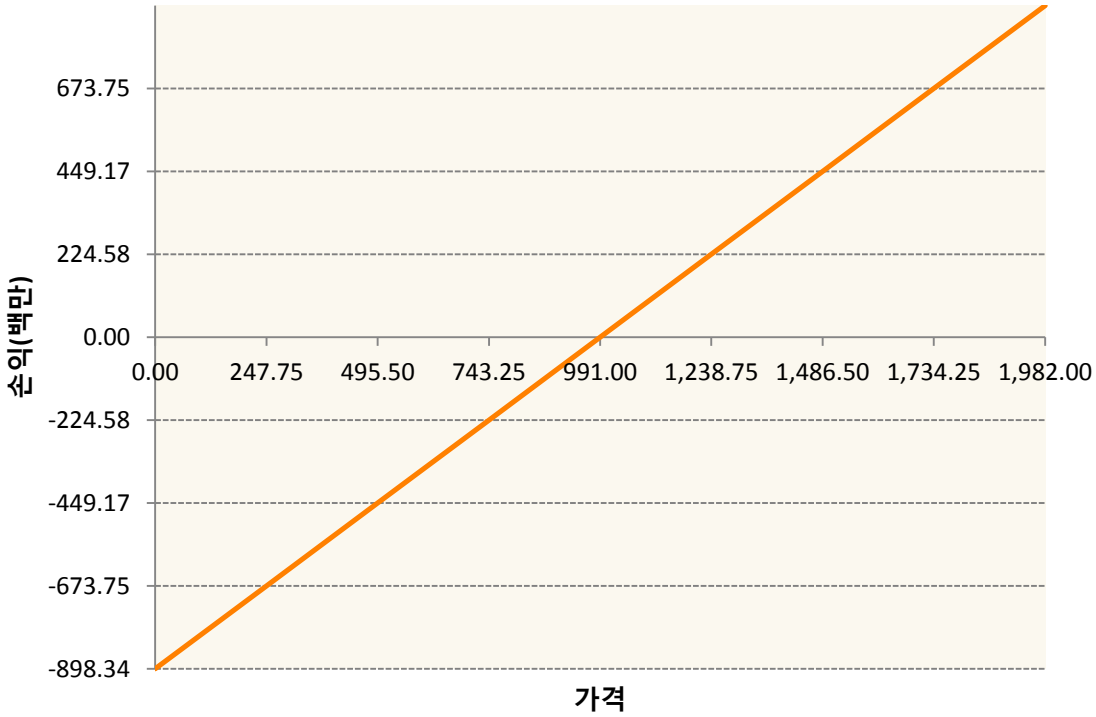

KR4175MB0007-2017-11 달러선물
338.34
253.76
169.17
84.59
0.00
-84.59
-169.17
-253.76
-338.34
손익(백만)
0.00
281.95
563.90
845.85
1,127.80
1,409.75
1,691.70
1,973.65
2,255.60
가격


KWZ7-KC HRW WHEAT FUT DEC17
148.48
98.99
49.49
0.00
-49.49
-98.99
-148.48
-197.98
손익(백만)
0.00
108.38
216.75
325.13
433.50
541.88
650.25
758.63
867.00
가격

SBH8-Sugar #11 (WORLD) MAR18

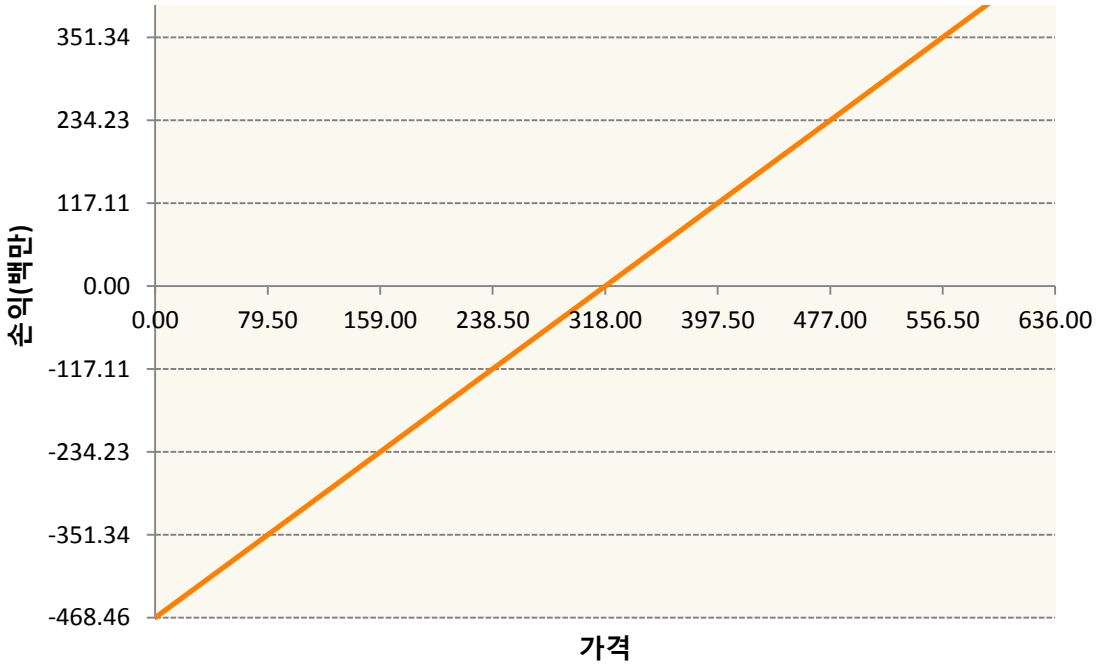


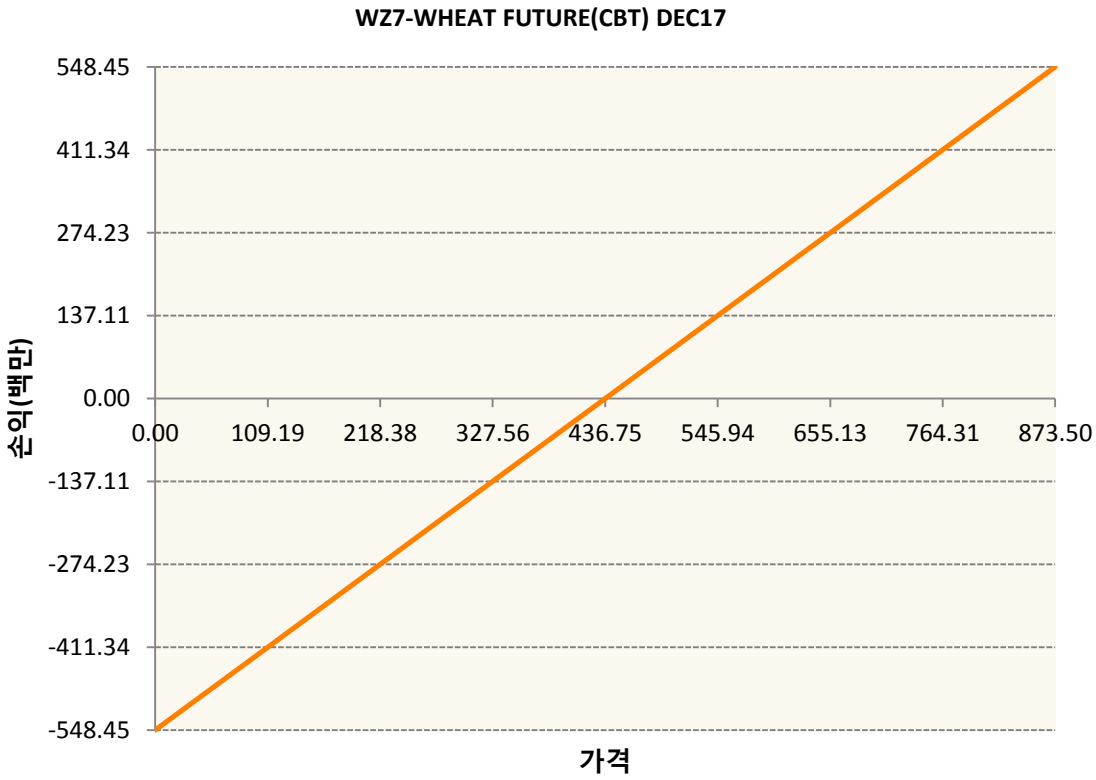
SF8-SOYBEAN FUTURE Jan18



SMF8-SOYBEAN MEAL FUTR Jan18







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

BOF8	SOYBEAN OIL FUTR Jan18	34
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	37
WZ7	WHEAT FUTURE(CBT) DEC17	44

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

419