공시일	2017-10-27
기준일	2017-10-26

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	2017-10-27
기준일	2017-10-26

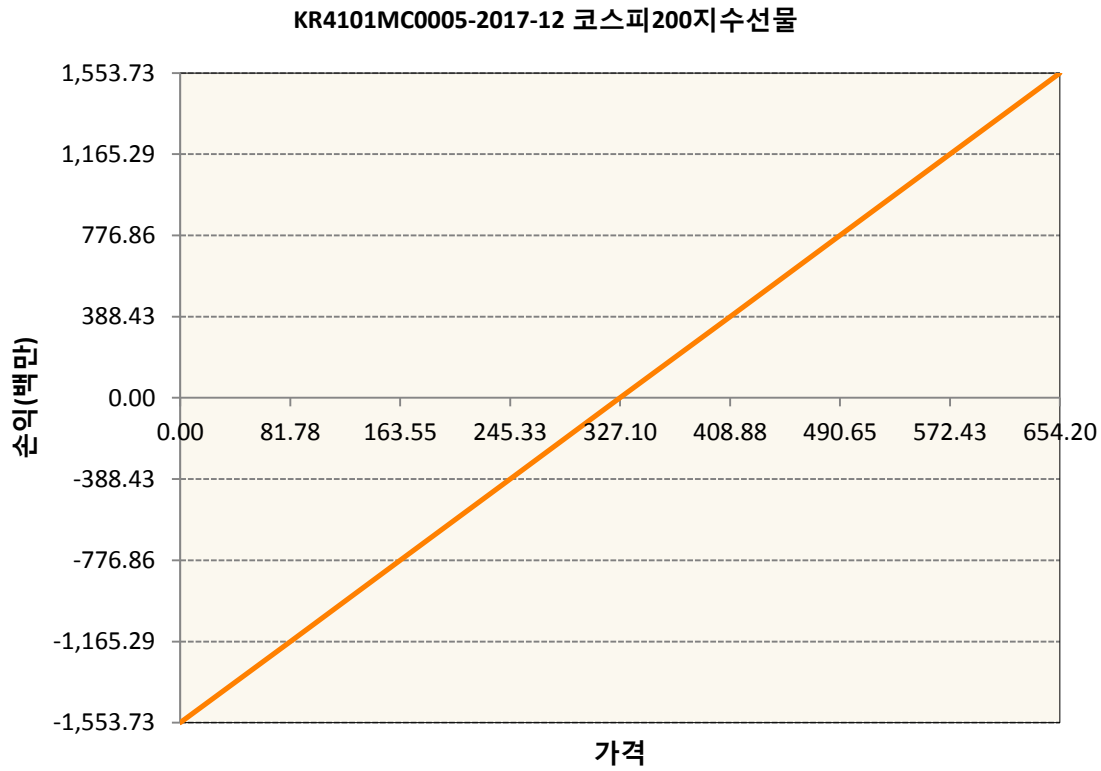
스마트인덱스모

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	1,554	0	1,554	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	2017-10-27
기준일	2017-10-26

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	1,058

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

462

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-10-27
기준일	2017-10-26

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	424

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

368

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-10-27
기준일	2017-10-26

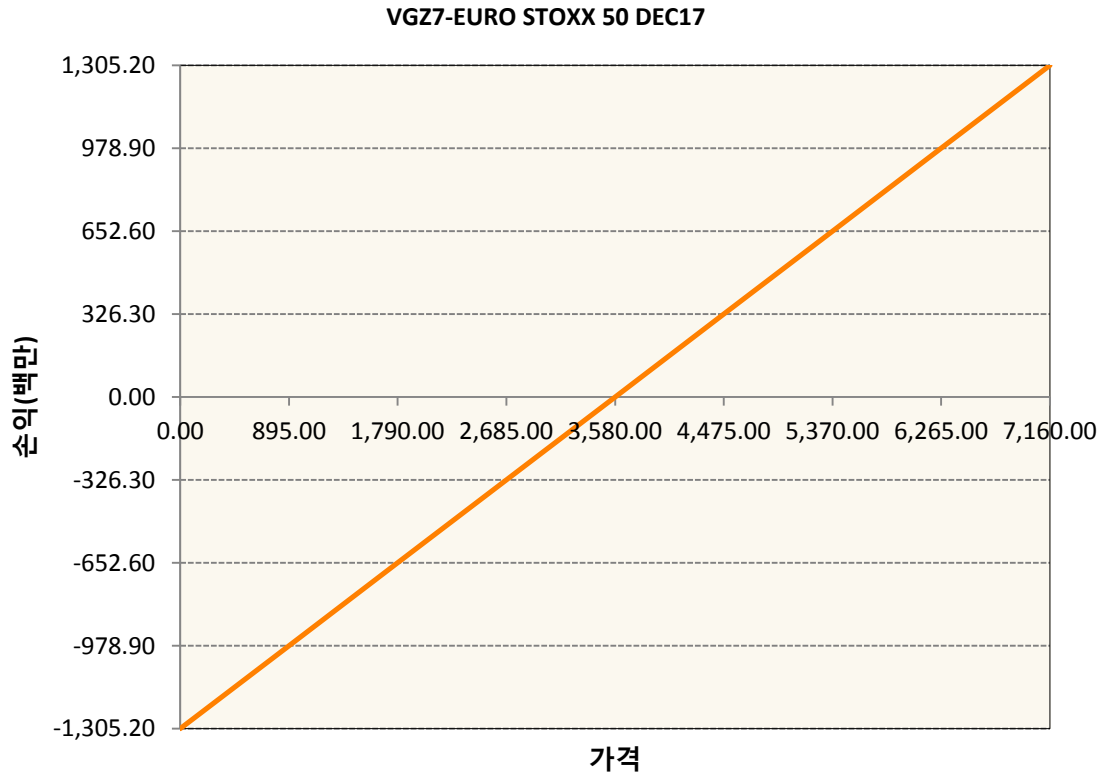
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,305	0	1,305	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGZ7	EURO STOXX 50 DEC17	104

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

(단위:백만원)

79

공시일	2017-10-27
기준일	2017-10-26

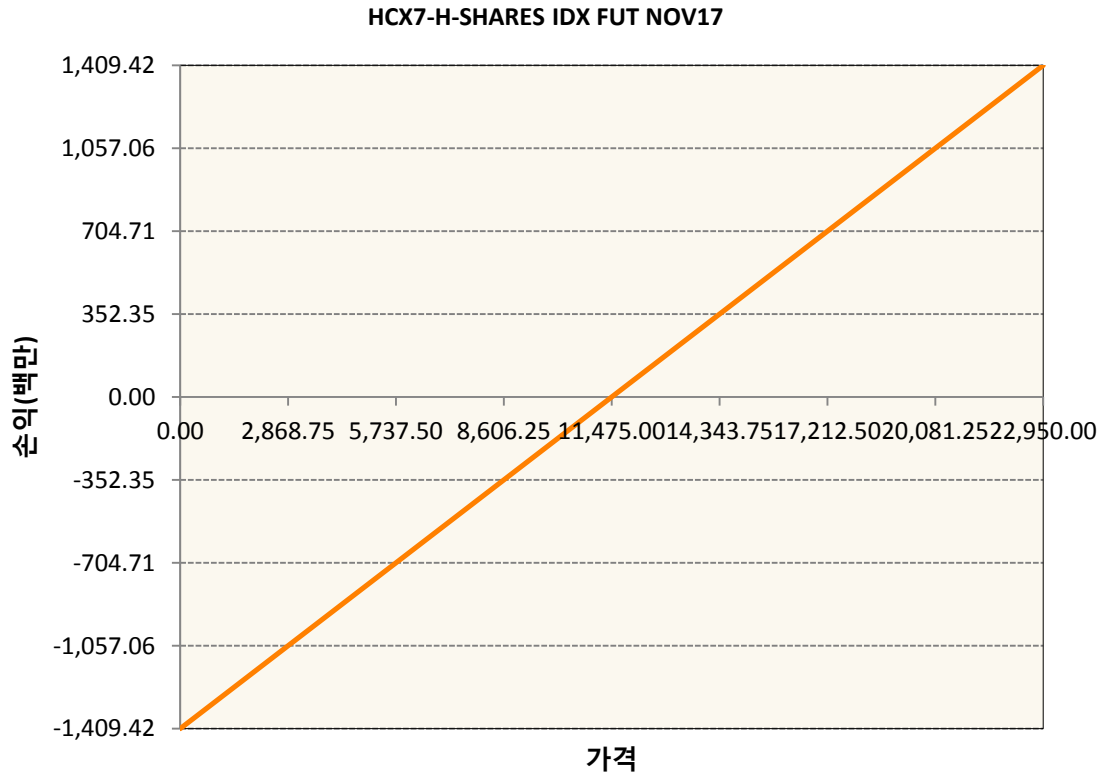
차이나인덱스모(주식-파생형)

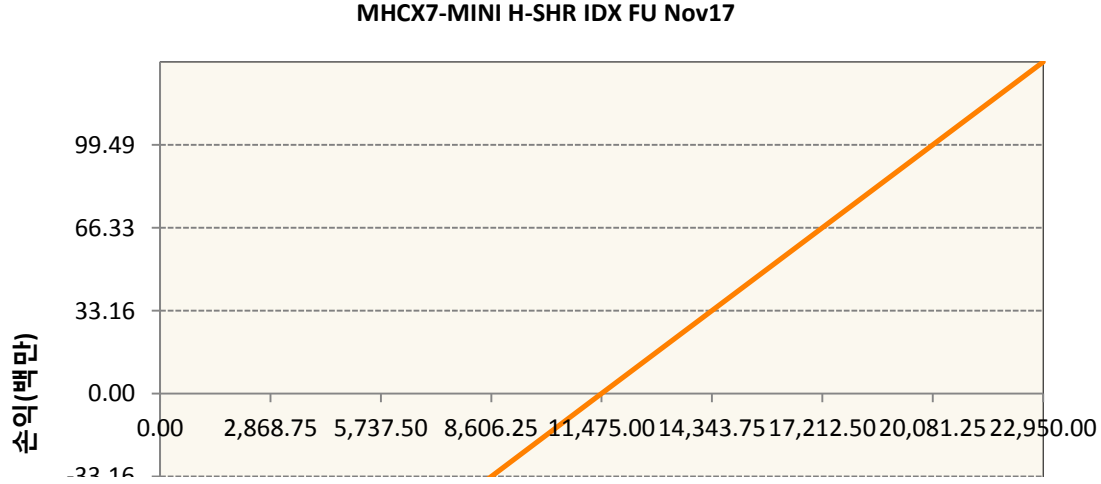
1. 계약금액

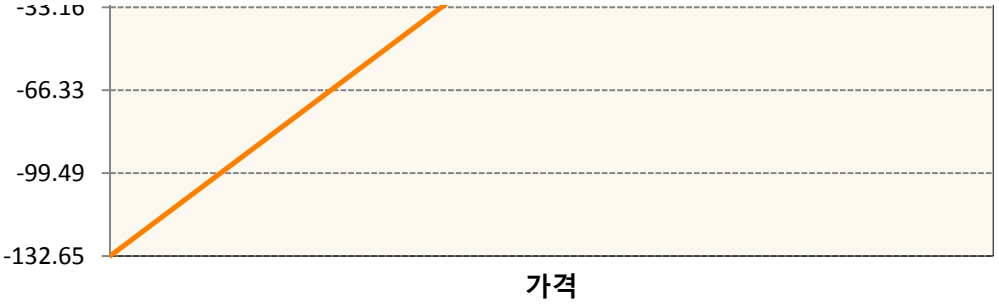
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,542	0	1,542	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

HCX7	H-SHARES IDX FUT NOV17	113
MHCX7	MINI H-SHR IDX FU Nov17	11

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

101

공시일	2017-10-27
기준일	2017-10-26

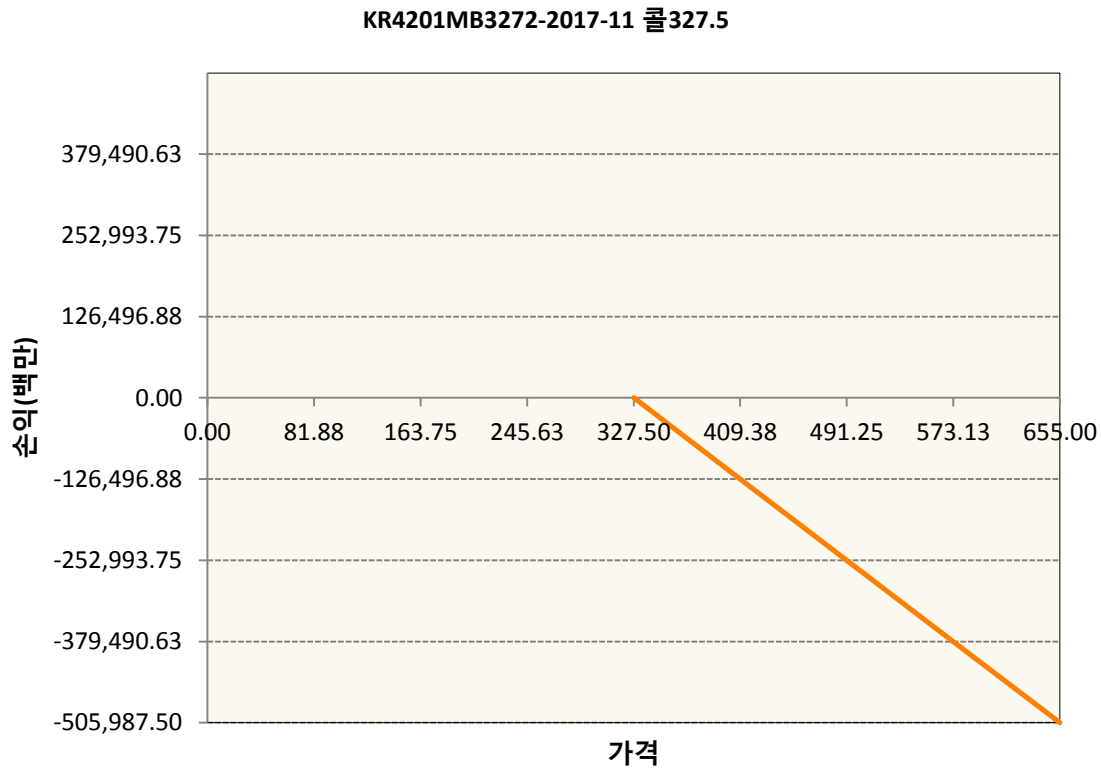
커버드콜모(주식혼합-파생형)

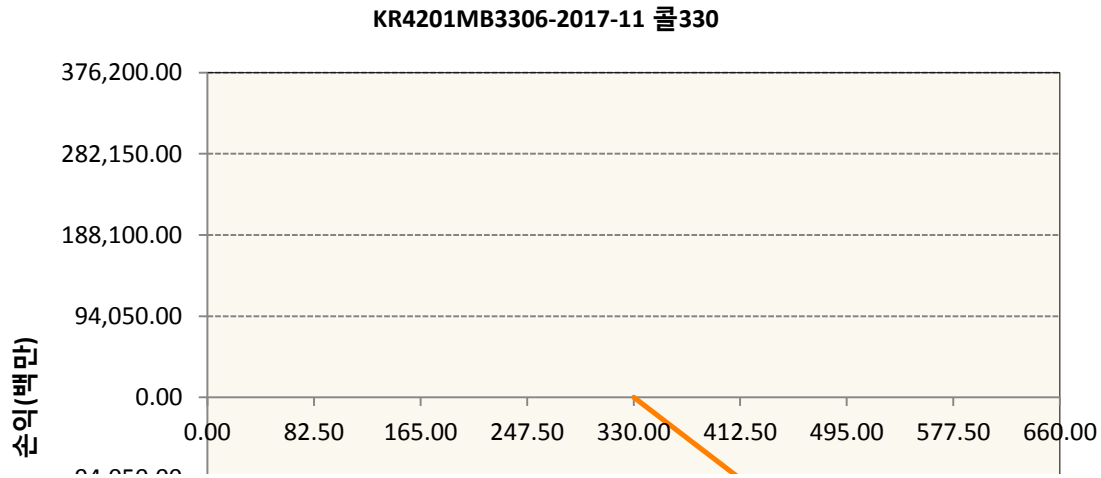
1. 계약금액

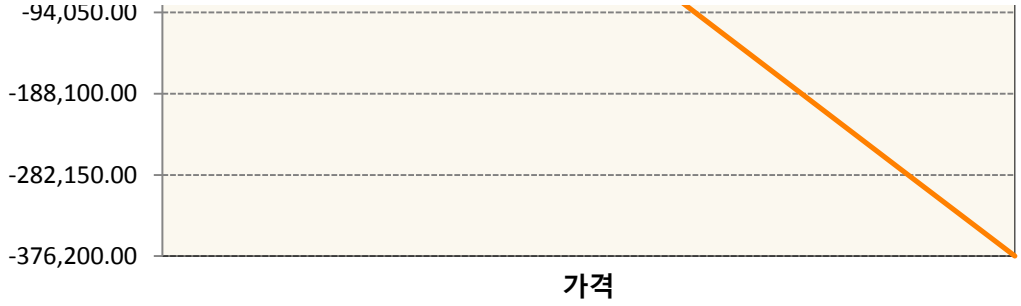
(단위:백만원)

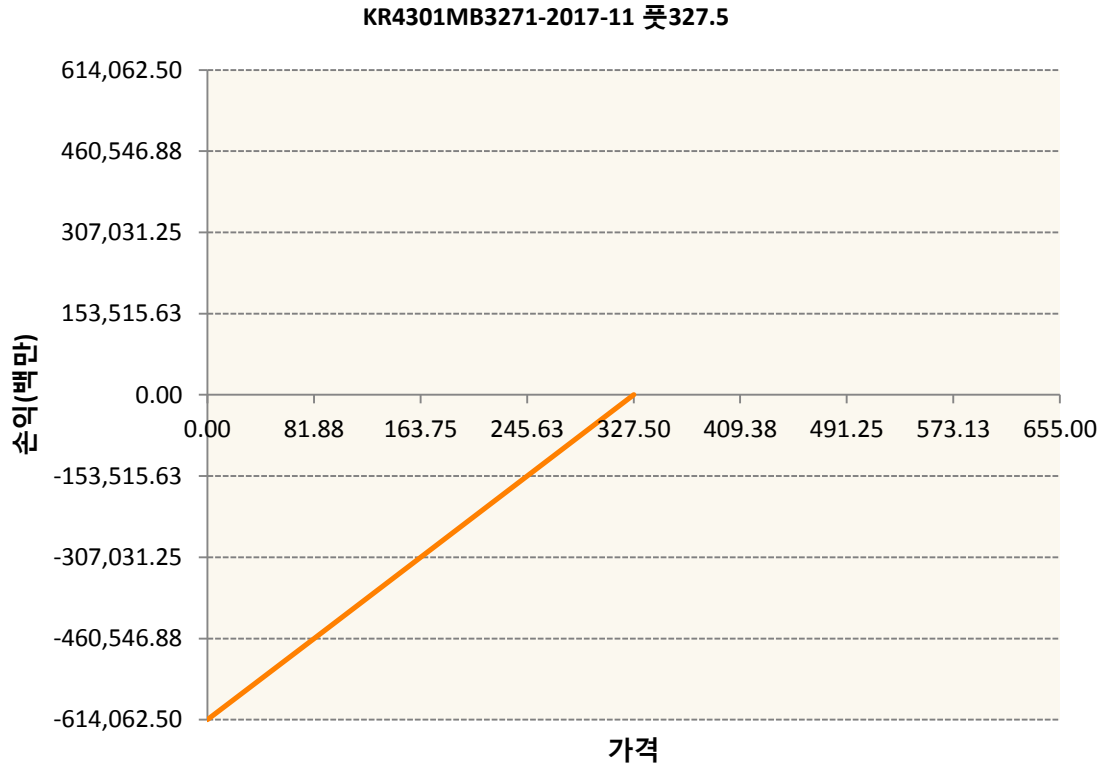
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	1,496,250	-1,496,250	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4201MB3 2017-11 콜327.5							32,005
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	9,122	9,064	8,971	8,840	8,668	8,456	8,205
-5.33%	8,753	8,505	8,199	7,843	7,443	7,003	6,529
-2.67%	7,058	6,473	5,856	5,215	4,554	3,876	3,186
0%	2,375	1,584	792	0	-792	-1,584	-2,375
2.67%	-6,175	-6,816	-7,485	-8,174	-8,879	-9,597	-10,326
5.33%	-17,706	-18,030	-18,413	-18,847	-19,325	-19,841	-20,389
8.00%	-30,651	-30,757	-30,911	-31,114	-31,366	-31,664	-32,005
KR4201MB3 2017-11 콜330							22,376
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	5,474	5,447	5,401	5,331	5,235	5,111	4,960
-5.33%	5,309	5,177	5,004	4,793	4,547	4,270	3,965
-2.67%	4,439	4,076	3,680	3,259	2,816	2,357	1,882
0%	1,718	1,148	575	0	-577	-1,155	-1,735
2.67%	-3,783	-4,316	-4,860	-5,412	-5,971	-6,534	-7,102
5.33%	-11,764	-12,074	-12,424	-12,807	-13,217	-13,651	-14,104
8.00%	-21,105	-21,221	-21,378	-21,575	-21,809	-22,077	-22,376
KR4301MB3: 2017-11 풋327.5							43,351

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-43,332	-43,332	-43,333	-43,334	-43,336	-43,341	-43,351
-5.33%	-26,995	-27,004	-27,022	-27,053	-27,101	-27,168	-27,255
-2.67%	-10,967	-11,146	-11,360	-11,608	-11,883	-12,184	-12,505
0%	1,522	1,015	507	0	-507	-1,015	-1,523
2.67%	6,032	5,801	5,534	5,236	4,911	4,565	4,200
5.33%	6,510	6,491	6,455	6,400	6,322	6,219	6,092
8.00%	6,523	6,522	6,521	6,517	6,510	6,495	6,473

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

109,310

공시일	2017-10-27
기준일	2017-10-26

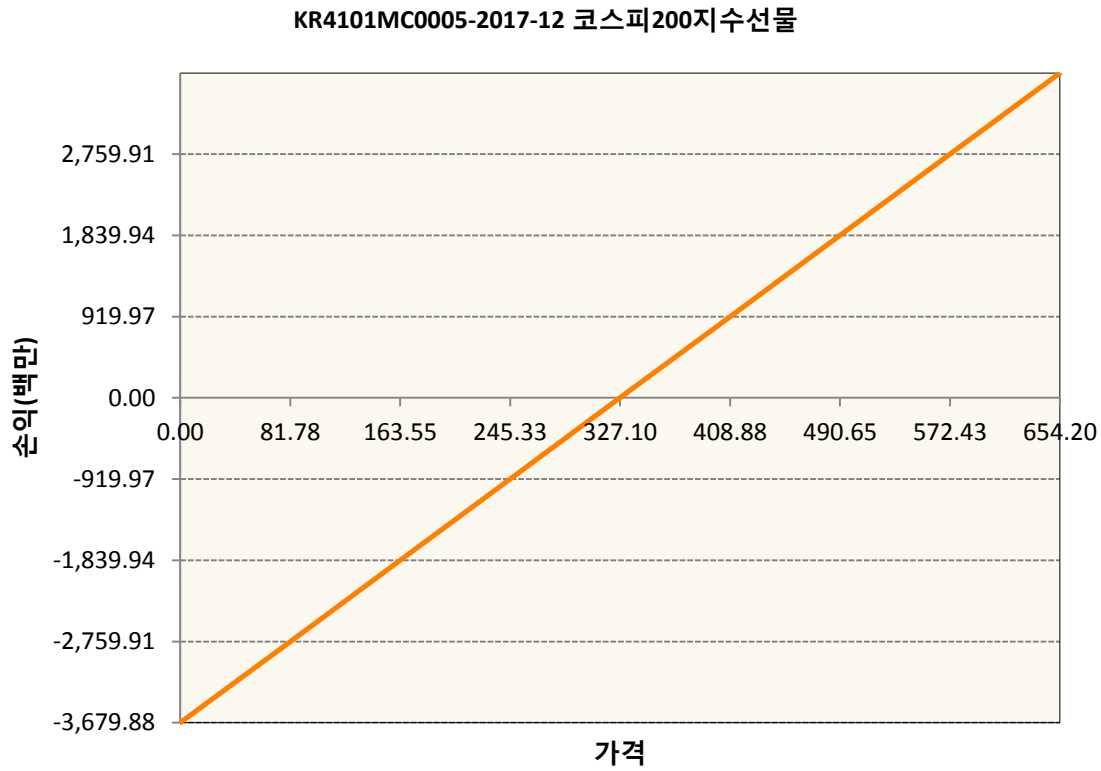
ETF스마트레버리지목표전환형7호

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	3,680	0	3,680	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)

178

공시일	2017-10-27
기준일	2017-10-26

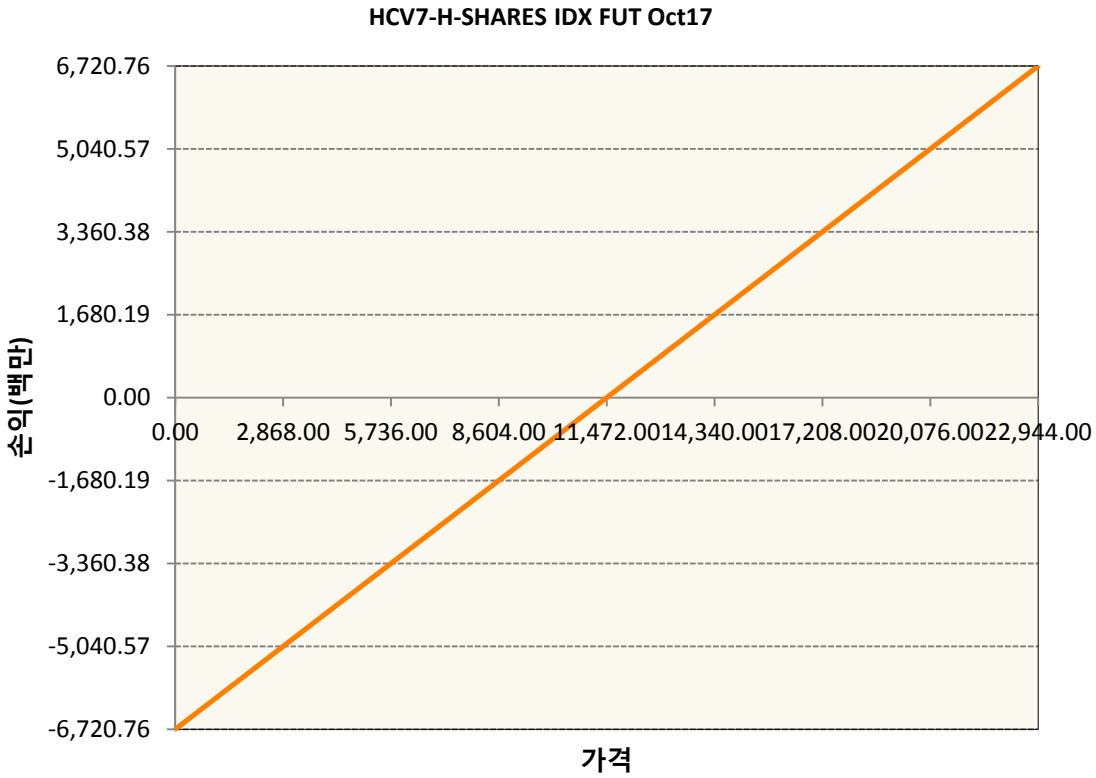
홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생

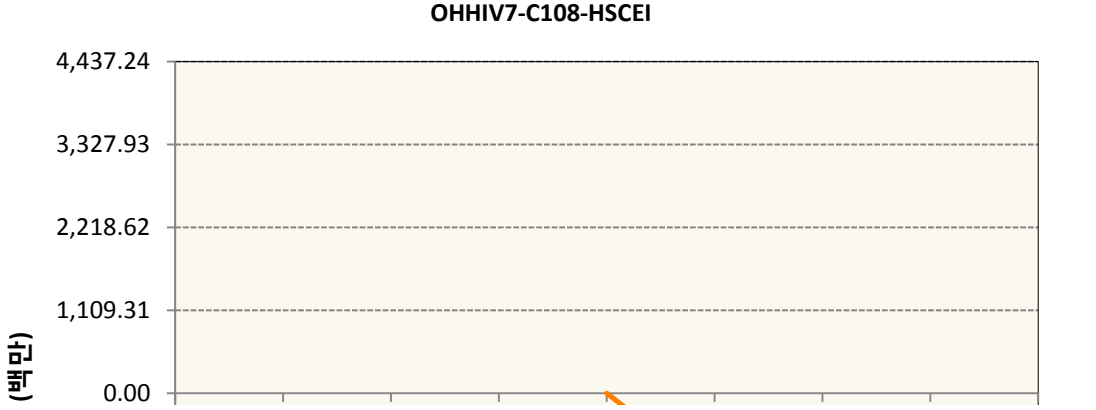
1. 계약금액

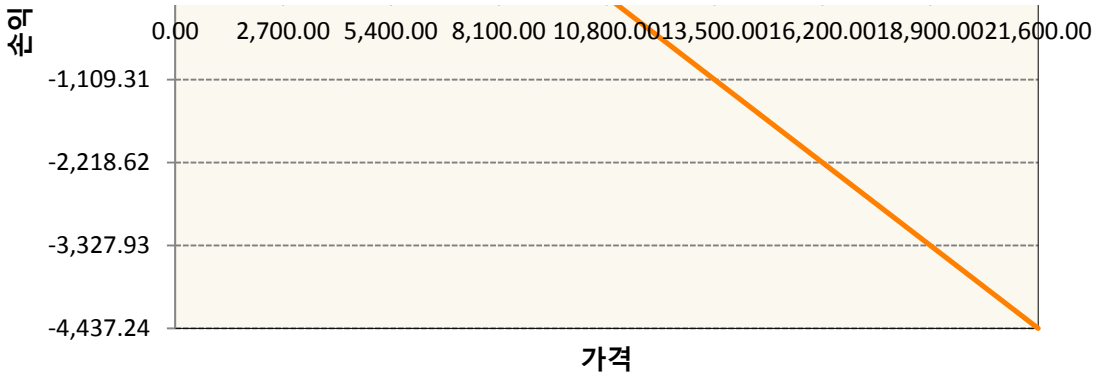
(단위:백만원)

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	6,721	0	6,721	장내
누계	유가증권	옵션	0	13,790	-13,790	장내

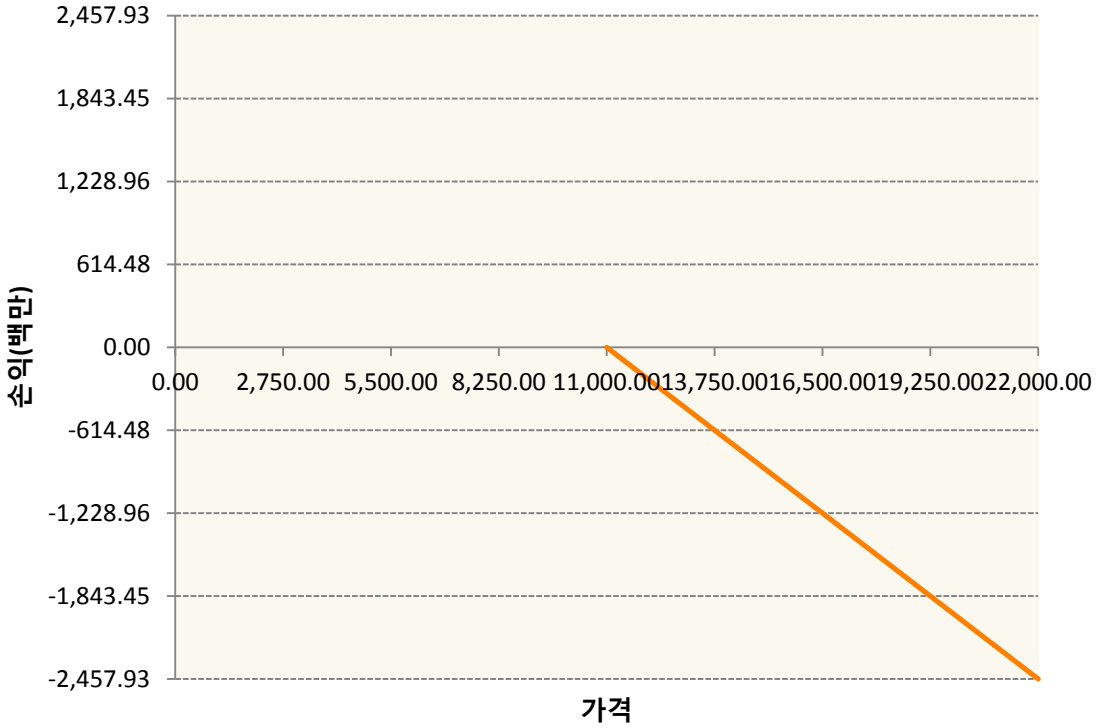
2. 만기시점의 손익구조



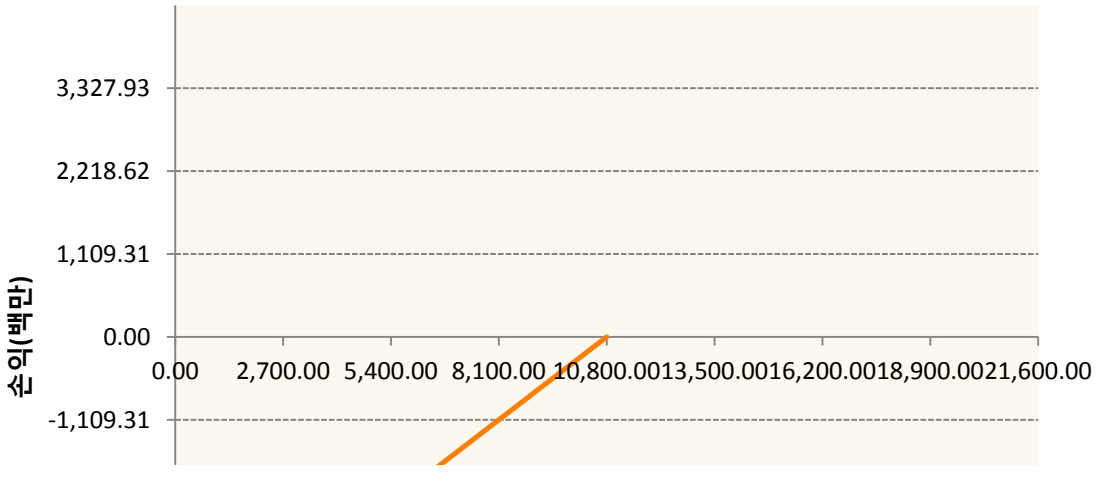


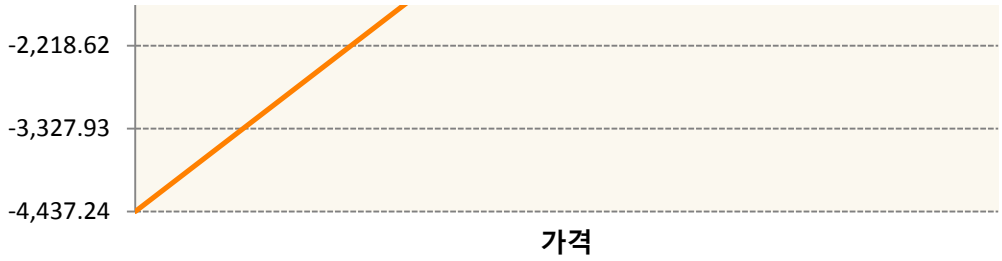


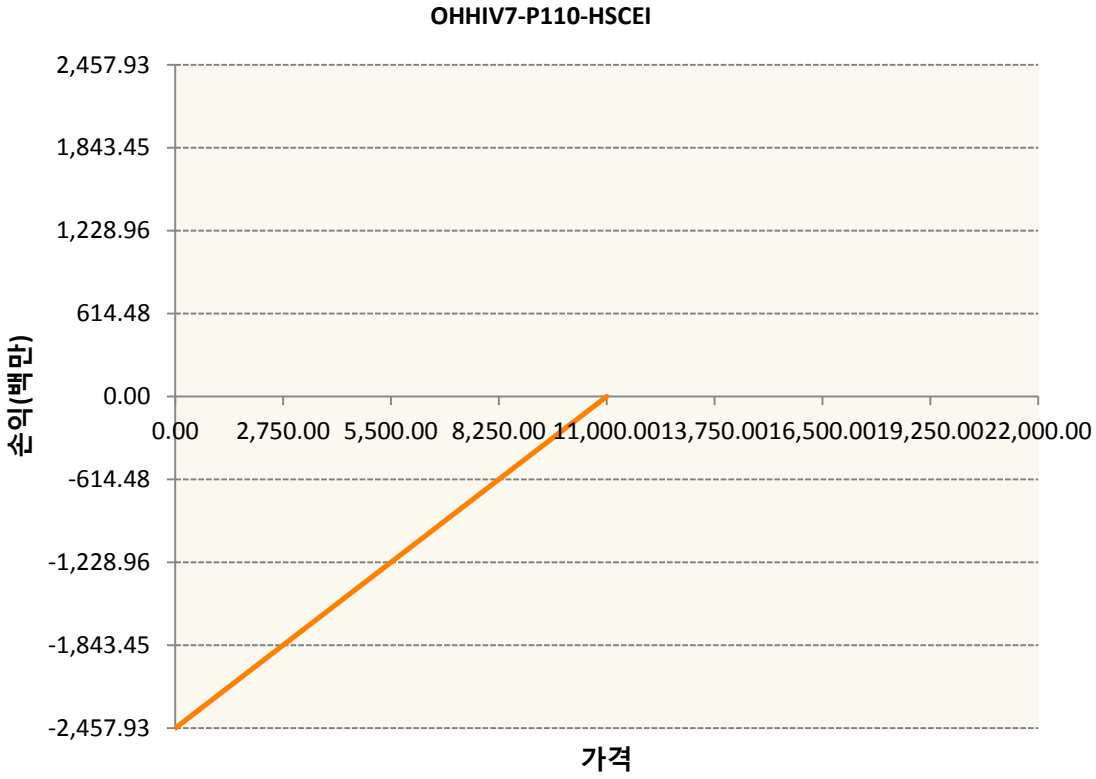
OHHIV7-C110-HSCEI



OHHIV7-P108-HSCEI







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

HCV7	H-SHARES IDX FUT Oct17	538
OHHIV7-C10	HSCEI	355
OHHIV7-C11	HSCEI	197
OHHIV7-P10	HSCEI	355
OHHIV7-P11	HSCEI	197

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

1,341

공시일	2017-10-27
기준일	2017-10-26

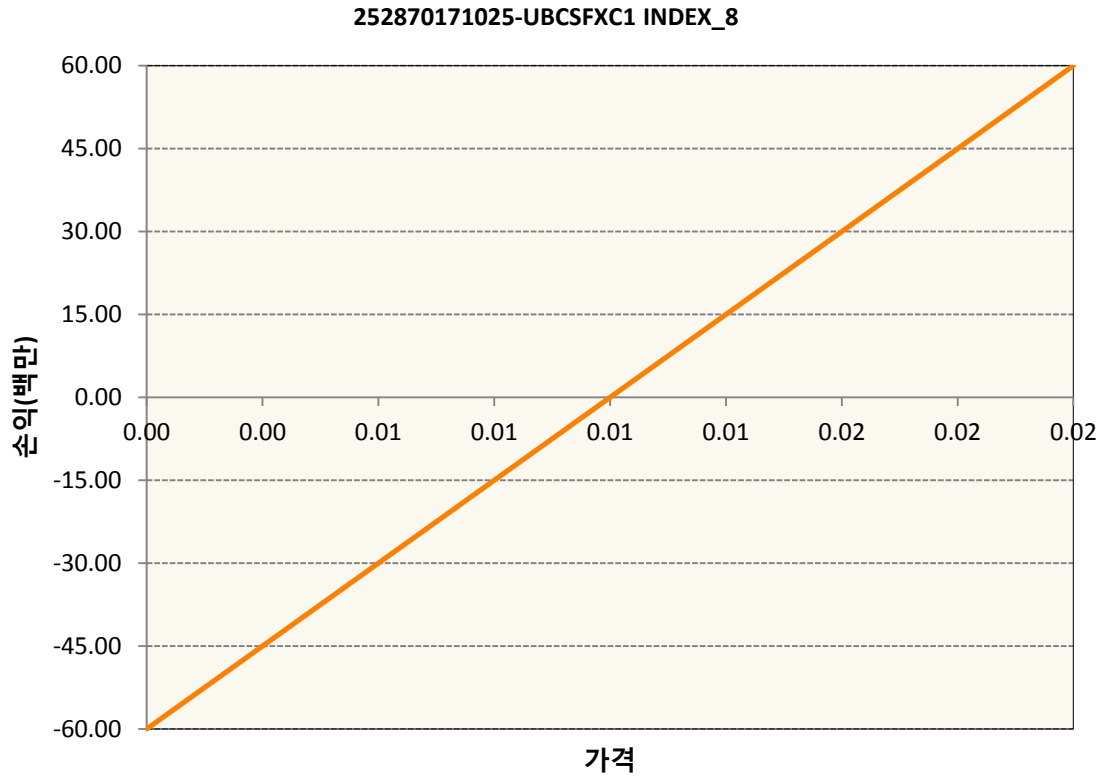
코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼

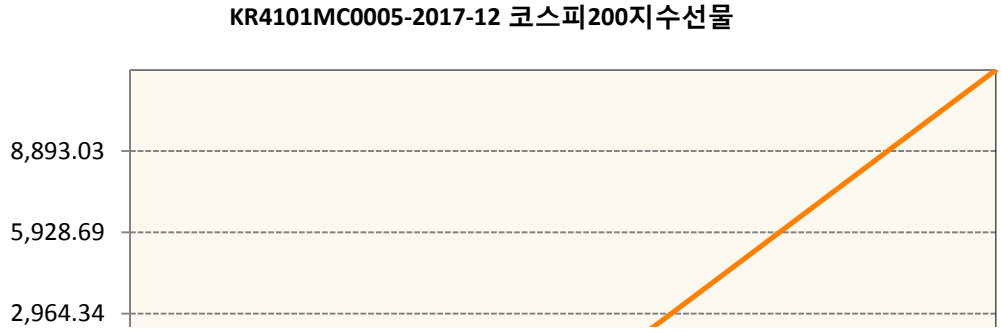
1. 계약금액

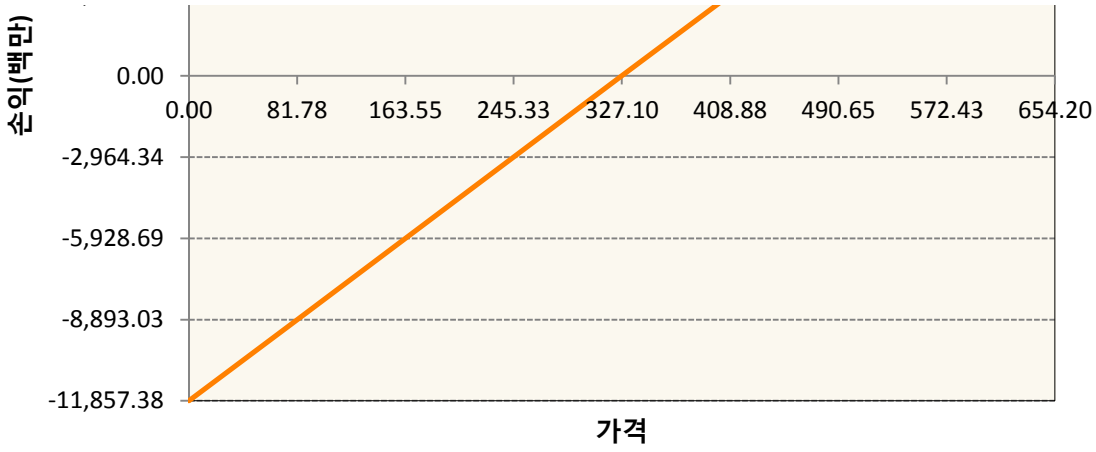
(단위:백만원)

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	11,857	0	11,857	장내
누계	유가증권	옵션	0	37,322	-37,322	장내
누계	유가증권	스왑	32,760	0	32,760	장외

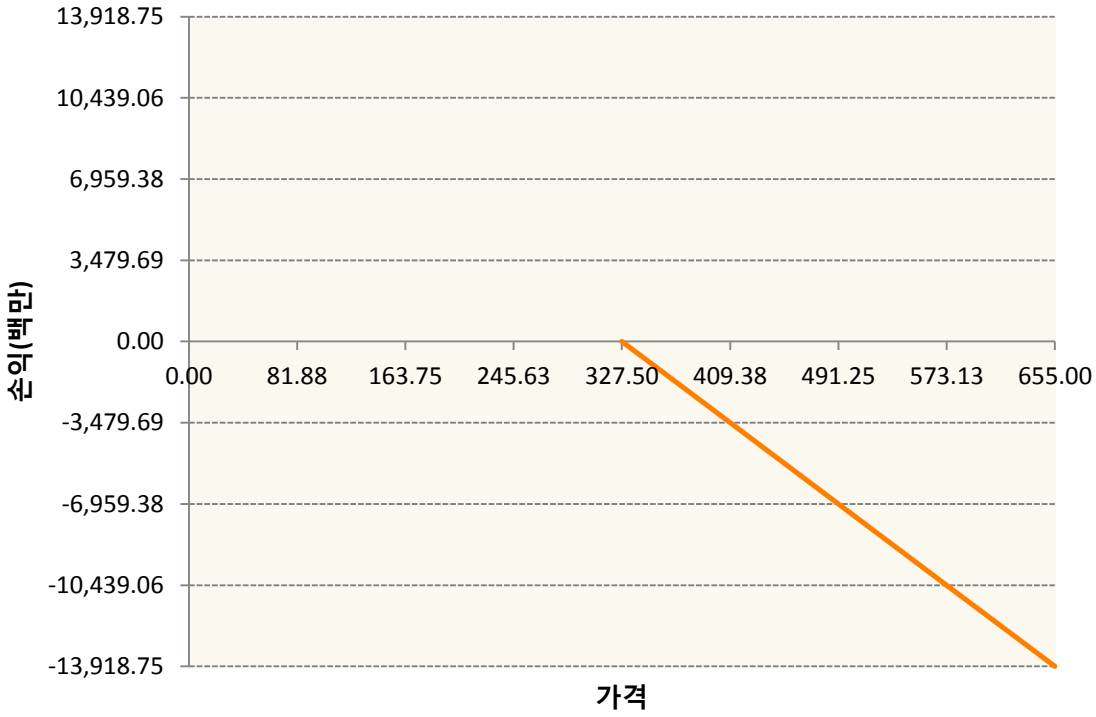
2. 만기시점의 손익구조



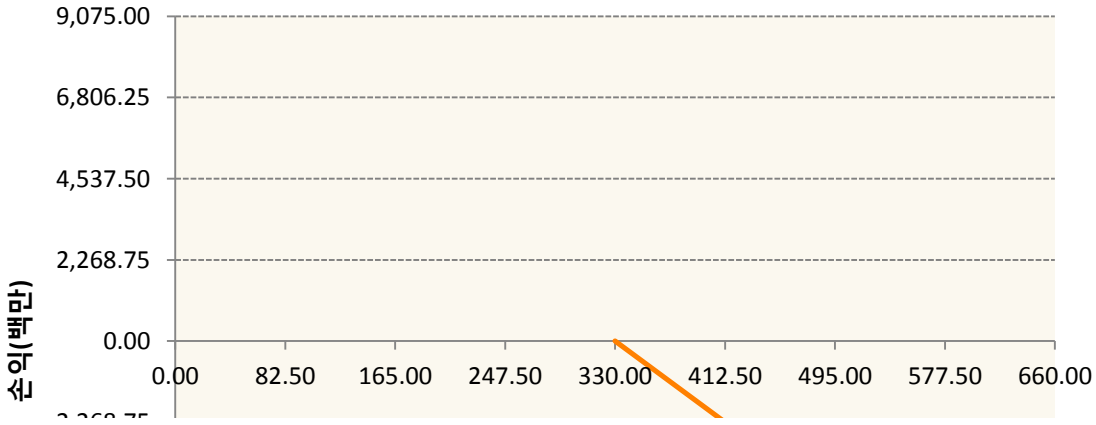


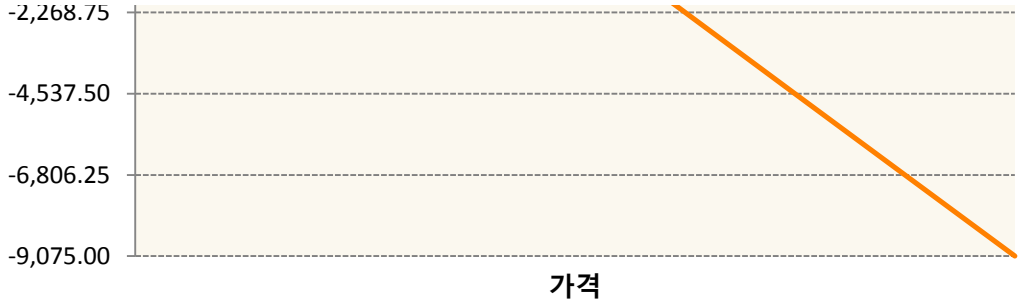


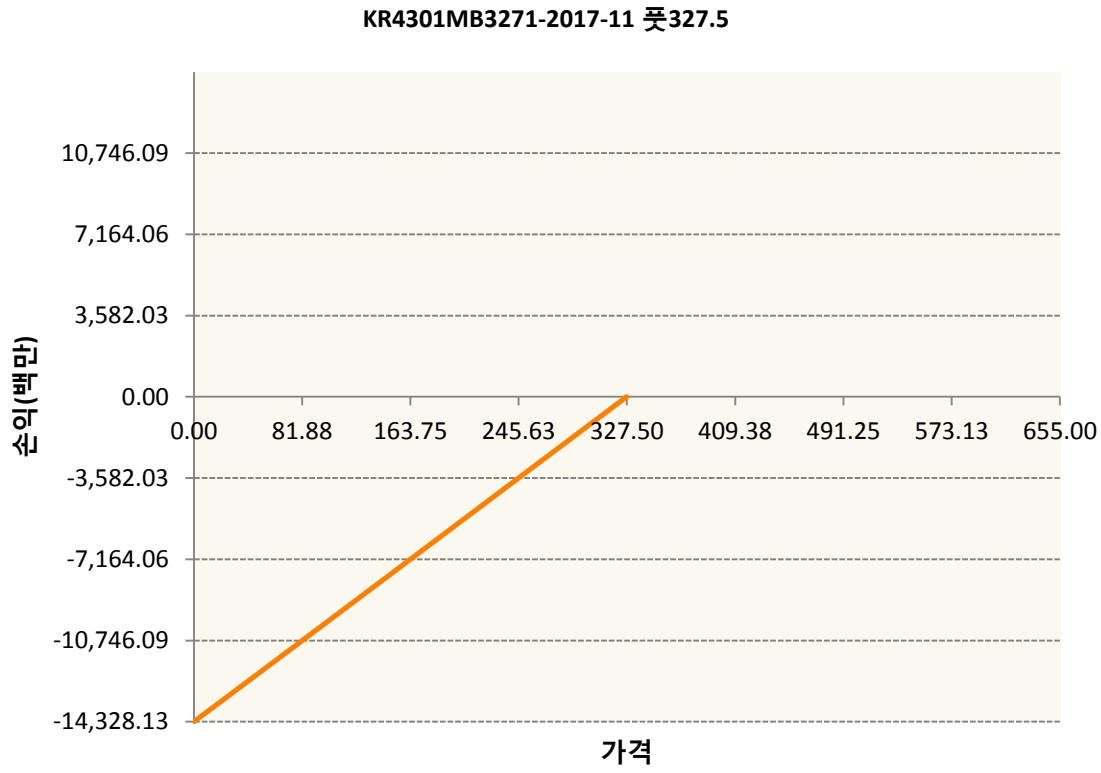
KR4201MB3272-2017-11 콜327.5



KR4201MB3306-2017-11 콜330







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.5287E+11 UBCSFXC1 INDEX_2							1,498
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,498	-1,498	-1,498	-1,498	-1,498	-1,498	-1,498
-5.33%	-999	-999	-999	-999	-999	-999	-999
-2.67%	-499	-499	-499	-499	-499	-499	-499
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	499	499	499	499	499	499	499
5.33%	999	999	999	999	999	999	999
8.00%	1,498	1,498	1,498	1,498	1,498	1,498	1,498
2.5287E+11 UBCSFXC1 INDEX_3							283
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-283	-283	-283	-283	-283	-283	-283
-5.33%	-189	-189	-189	-189	-189	-189	-189
-2.67%	-94	-94	-94	-94	-94	-94	-94
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	94	94	94	94	94	94	94
5.33%	189	189	189	189	189	189	189
8.00%	283	283	283	283	283	283	283
	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						202

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-202	-202	-202	-202	-202	-202	-202
-5.33%	-135	-135	-135	-135	-135	-135	-135
-2.67%	-67	-67	-67	-67	-67	-67	-67
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	67	67	67	67	67	67	67
5.33%	135	135	135	135	135	135	135
8.00%	202	202	202	202	202	202	202
	2.5287E+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
	2.5287E+11	UBCSFXC1 INDEX_8					479
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-479	-479	-479	-479	-479	-479	-479
-5.33%	-319	-319	-319	-319	-319	-319	-319
-2.67%	-160	-160	-160	-160	-160	-160	-160
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	160	160	160	160	160	160	160
5.33%	319	319	319	319	319	319	319
8.00%	479	479	479	479	479	479	479
	KR4101MC0(	2017-12	코스피200지수선물				948
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-948	-948	-948	-948	-948	-948	-948
-5.33%	-632	-632	-632	-632	-632	-632	-632
-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%	632	632	632	632	632	632	632
8.00%	948	948	948	948	948	948	948
	KR4201MB3(	2017-11	콜327.5				880
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	251	249	247	243	238	233	226
-5.33%	241	234	226	216	205	193	180
-2.67%	194	178	161	143	125	107	88
0%	65	44	22	0	-22	-44	-65
2.67%	-170	-188	-206	-225	-244	-264	-284
5.33%	-487	-496	-507	-518	-532	-546	-561
8.00%	-843	-846	-850	-856	-863	-871	-880
	KR4201MB3(	2017-11	콜330				540
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	132	131	130	129	126	123	120
-5.33%	128	125	121	116	110	103	96
-2.67%	107	98	89	79	68	57	45
0%	41	28	14	0	-14	-28	-42
2.67%	-91	-104	-117	-131	-144	-158	-171

5.33%	-284	-291	-300	-309	-319	-329	-340
8.00%	-509	-512	-516	-520	-526	-533	-540
	KR4301MB3	2017-11	풋327.5				1,012

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,011	-1,011	-1,011	-1,011	-1,011	-1,011	-1,012
-5.33%	-630	-630	-631	-631	-632	-634	-636
-2.67%	-256	-260	-265	-271	-277	-284	-292
0%	36	24	12	0	-12	-24	-36
2.67%	141	135	129	122	115	107	98
5.33%	152	151	151	149	148	145	142
8.00%	152	152	152	152	152	152	151

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

6,407

공시일	2017-10-27
기준일	2017-10-26

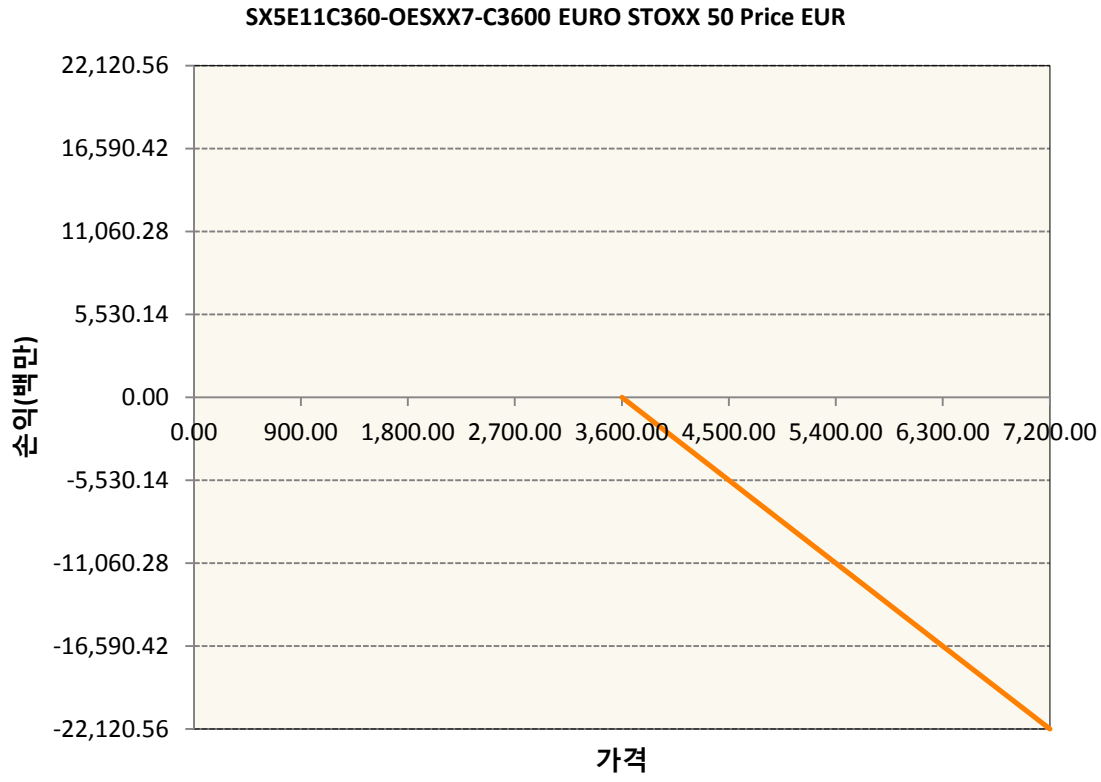
유로커버드콜모(주식혼합-파생형

1. 계약금액

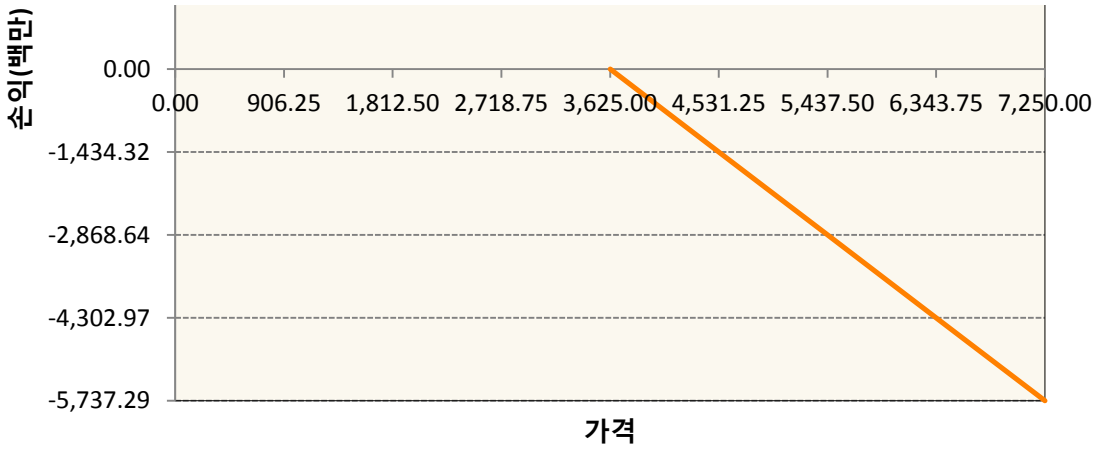
(단위:백만원)

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	23,806	0	23,806	
누계	유가증권	옵션	0	55,716	-55,716	
누계	유가증권	스왑	99,751	0	99,751	장외

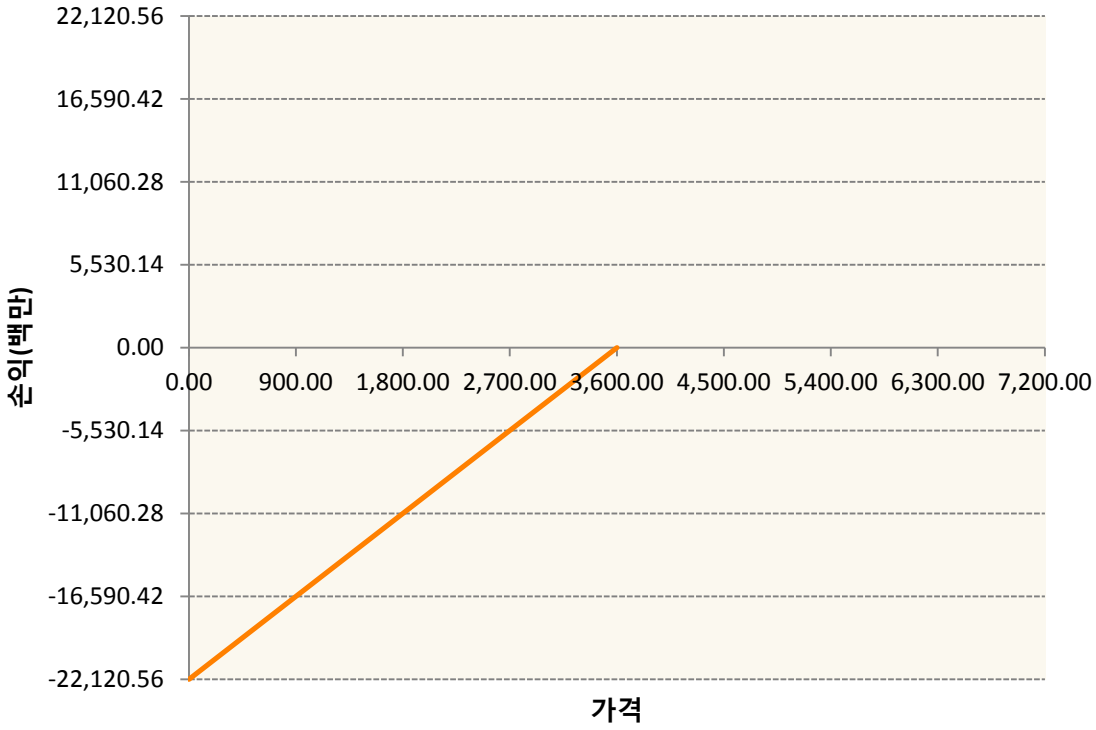
2. 만기시점의 손익구조



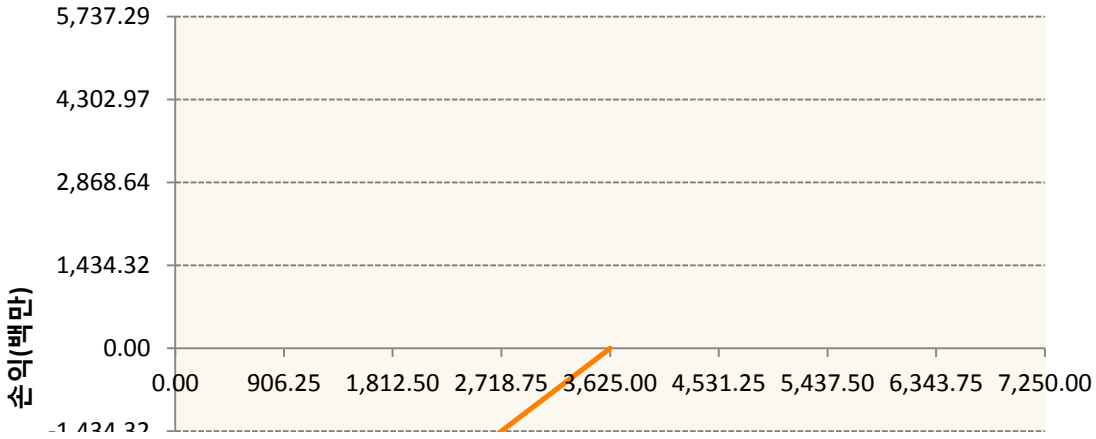




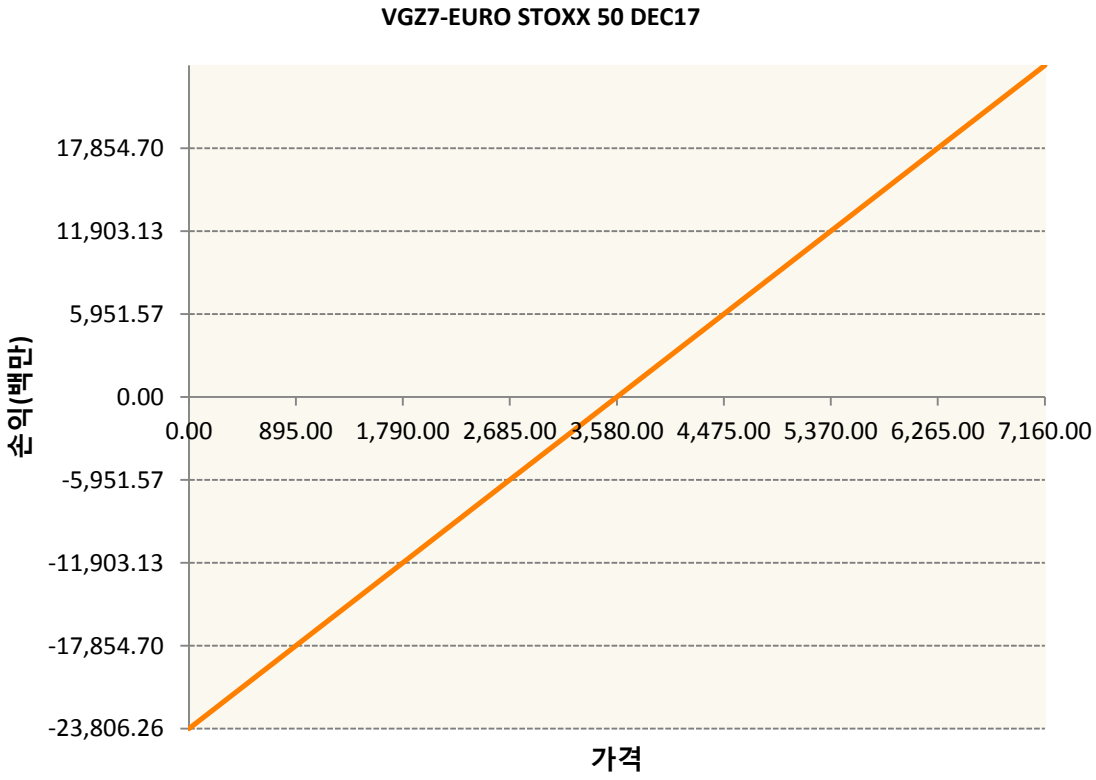
SX5E11P360-OESXX7-P3600 EURO STOXX 50 Price EUR



SX5E11P362-OESXX7-P3625 EURO STOXX 50 Price EUR







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

260105SQPX SG EURO Covered CALL STRATEGY	25
SX5E11C360 OESXX7-C3600 EURO STOXX 50 Price EUR	1,770
SX5E11C362 OESXX7-C3625 EURO STOXX 50 Price EUR	459
SX5E11P360 OESXX7-P3600 EURO STOXX 50 Price EUR	1,770
SX5E11P362 OESXX7-P3625 EURO STOXX 50 Price EUR	459
VGZ7 EURO STOXX 50 DEC17	1,905

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

4,817

공시일	2017-10-27
기준일	2017-10-26

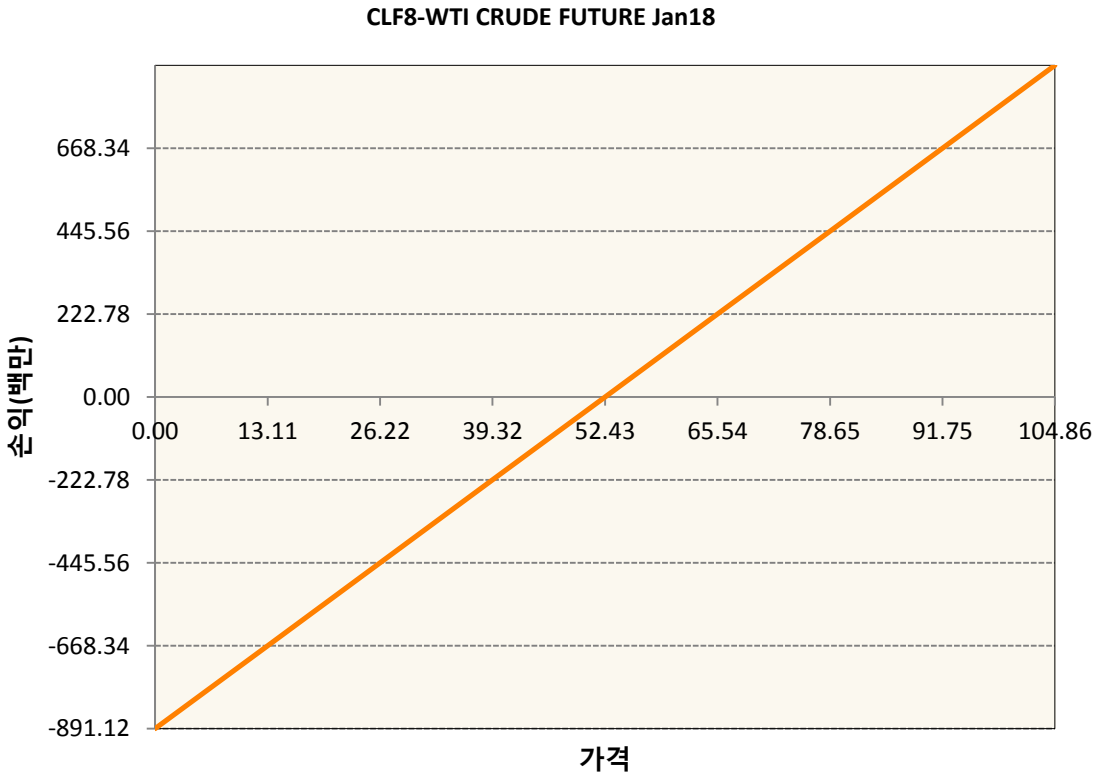
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

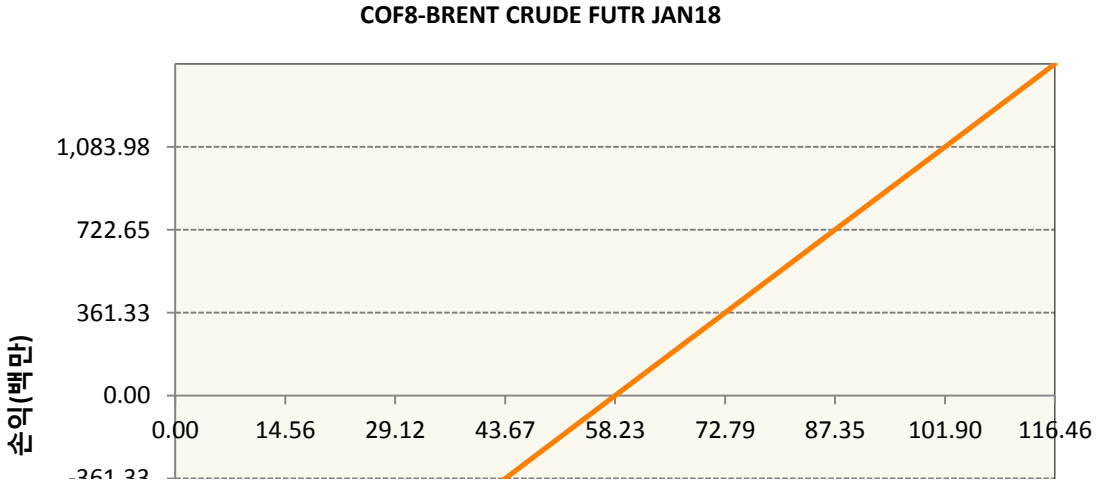
1. 계약금액

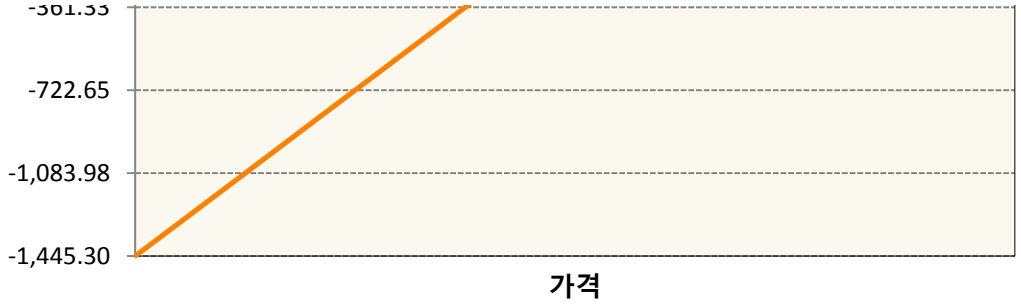
(단위:백만원)

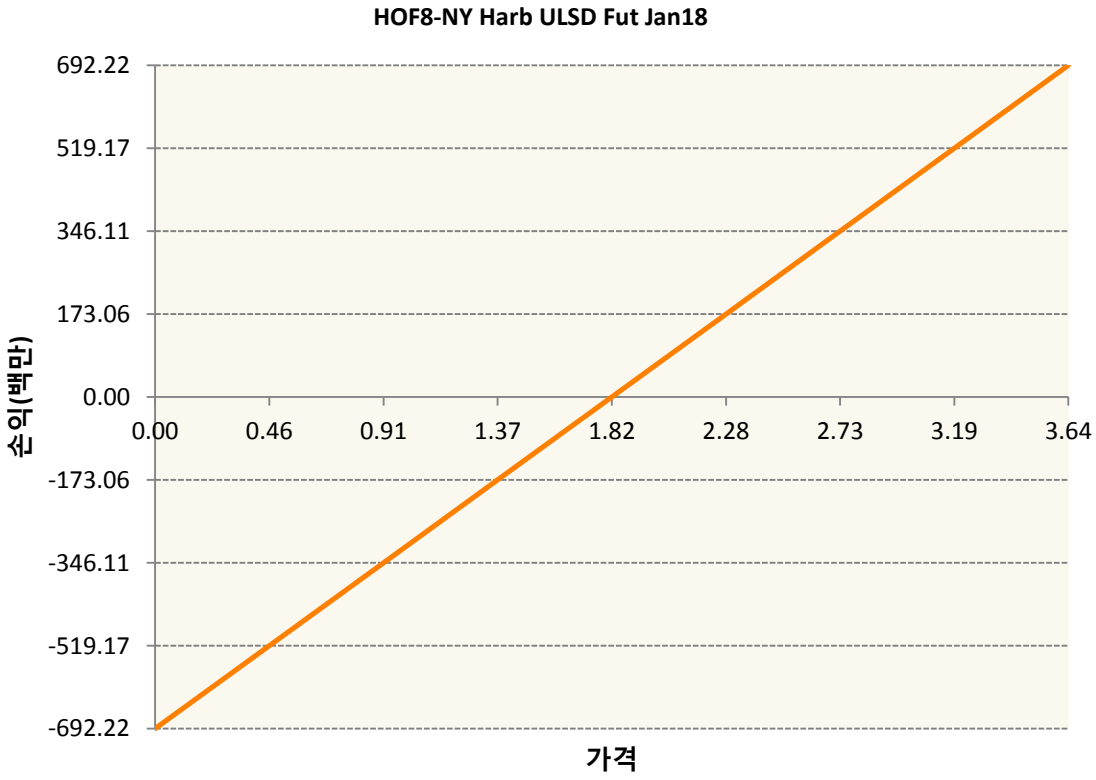
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	5,118	899	4,218	

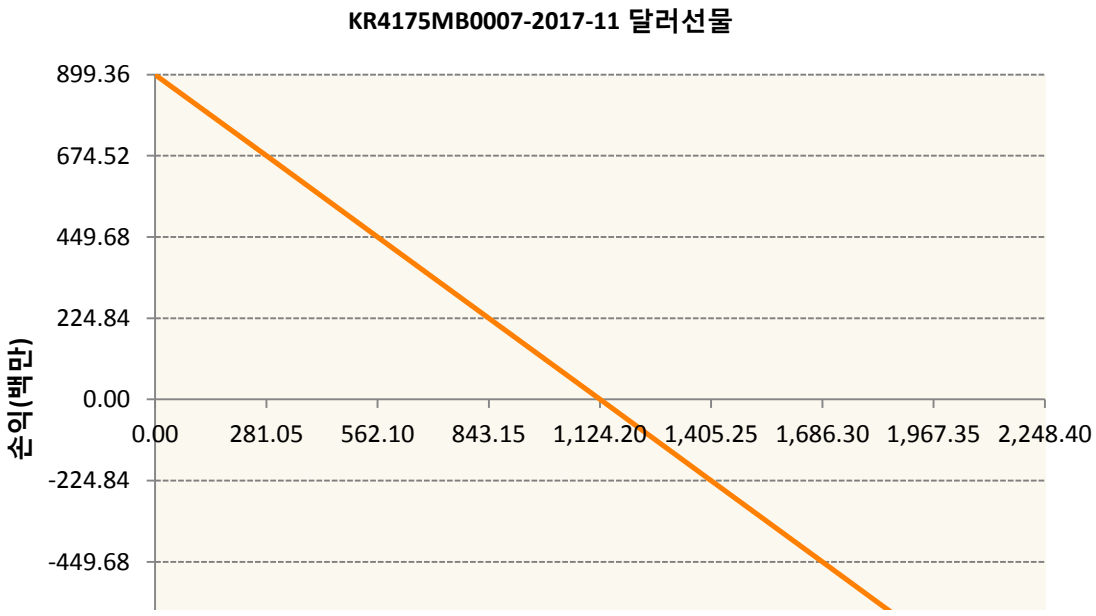
2. 만기시점의 손익구조

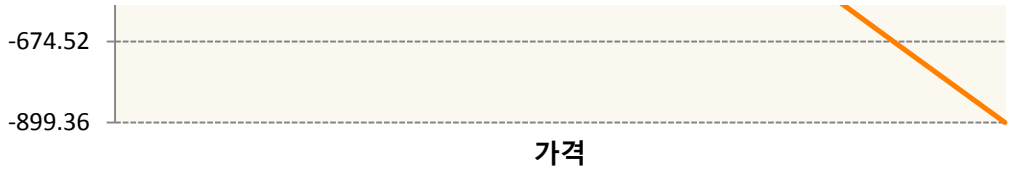


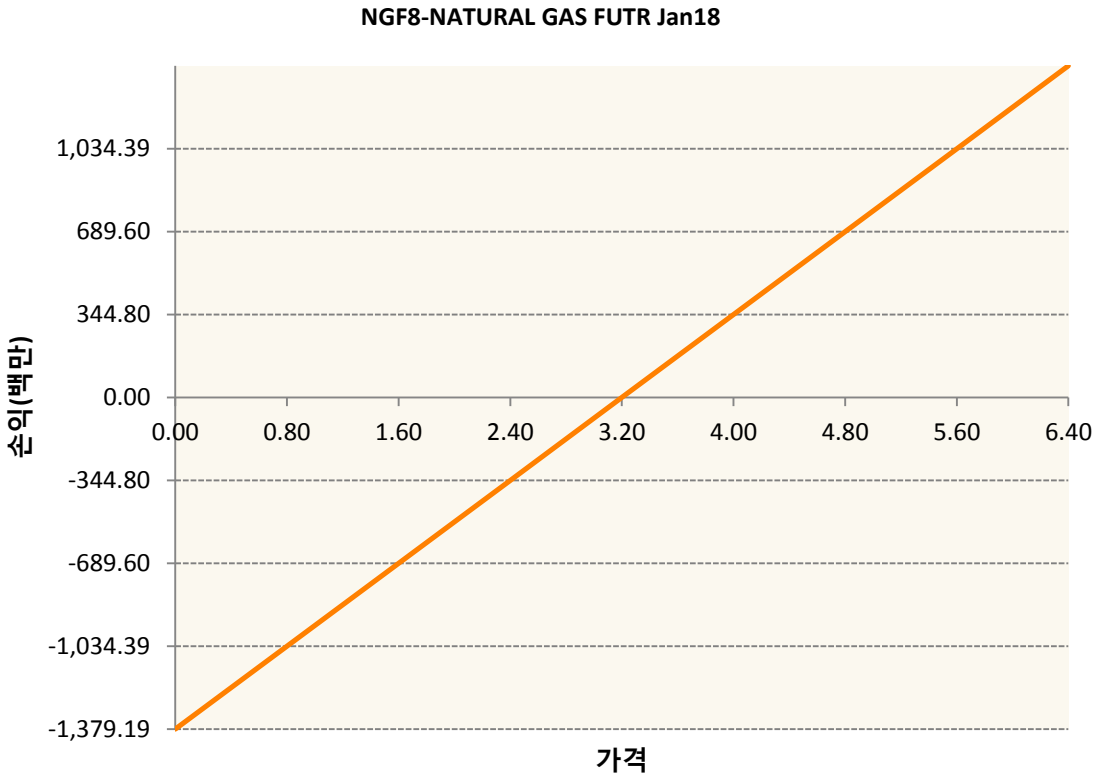


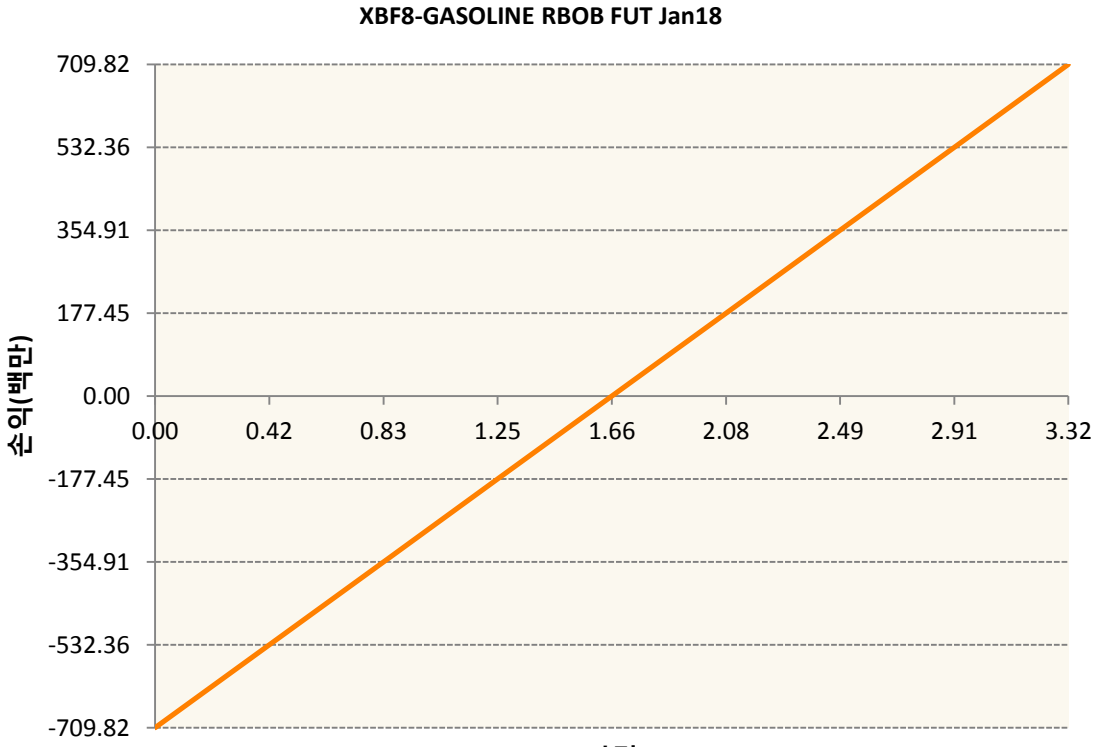

-361.33
-722.65
-1,083.98
-1,445.30
가격


HOF8-NY Harb ULSD Fut Jan18
692.22
519.17
346.11
173.06
0.00
-173.06
-346.11
-519.17
-692.22
0.00
0.46
0.91
1.37
1.82
2.28
2.73
3.19
3.64
손익(백만)
가격


KR4175MB0007-2017-11 달러선물
899.36
674.52
449.68
224.84
0.00
-224.84
-449.68
0.00
281.05
562.10
843.15
1,124.20
1,405.25
1,686.30
1,967.35
2,248.40
손익(백만)


-674.52
-899.36
가격


NGF8-NATURAL GAS FUTR Jan18
1,034.39
689.60
344.80
0.00
-344.80
-689.60
-1,034.39
-1,379.19
0.00
0.80
1.60
2.40
3.20
4.00
4.80
5.60
6.40
손익(백만)
가격


XBF8-GASOLINE RBOB FUT Jan18
709.82
532.36
354.91
177.45
0.00
-177.45
-354.91
-532.36
-709.82
0.00
0.42
0.83
1.25
1.66
2.08
2.49
2.91
3.32
손익(백만)

가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLF8	WTI CRUDE FUTURE Jan18	71
COF8	BRENT CRUDE FUTR JAN18	116
HOF8	NY Harb ULSD Fut Jan18	55
KR4175MB0(	2017-11 달러선물	72
NGF8	NATURAL GAS FUTR Jan18	110
XBF8	GASOLINE RBOB FUT Jan18	57

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

732

공시일	2017-10-27
기준일	2017-10-26

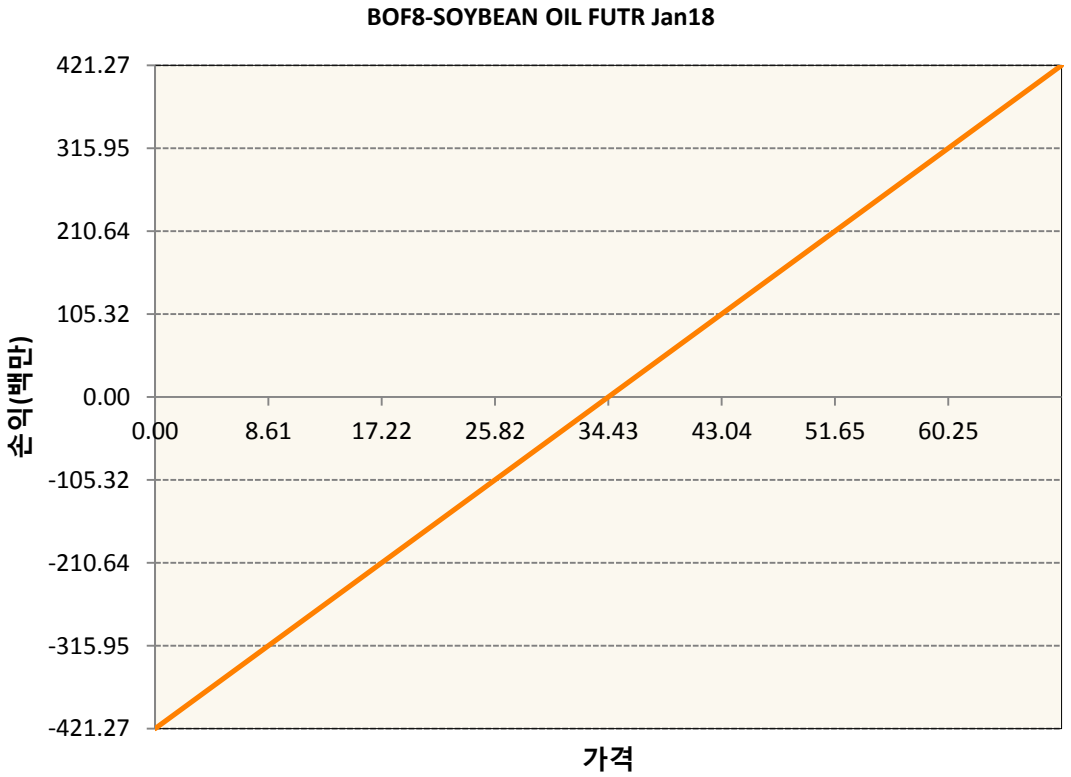
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

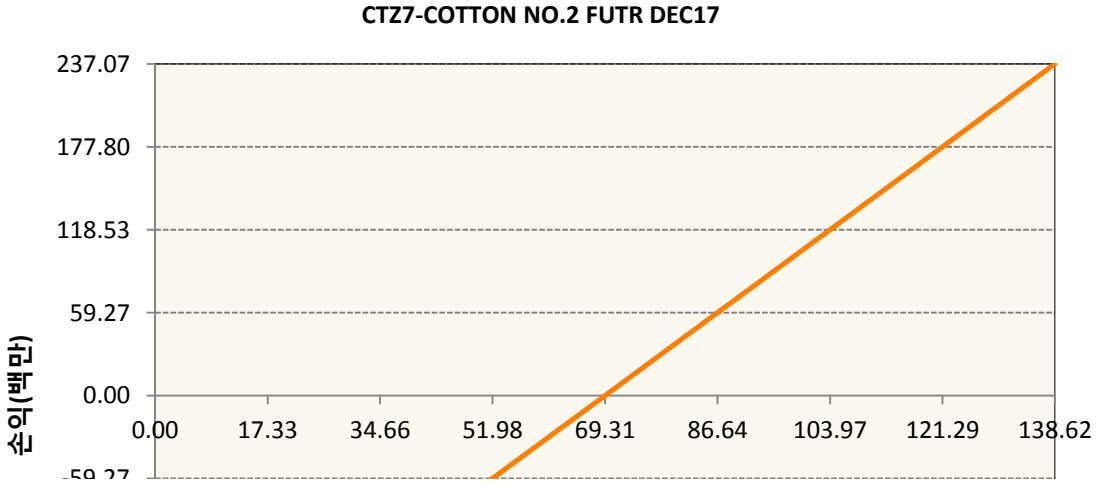
1. 계약금액

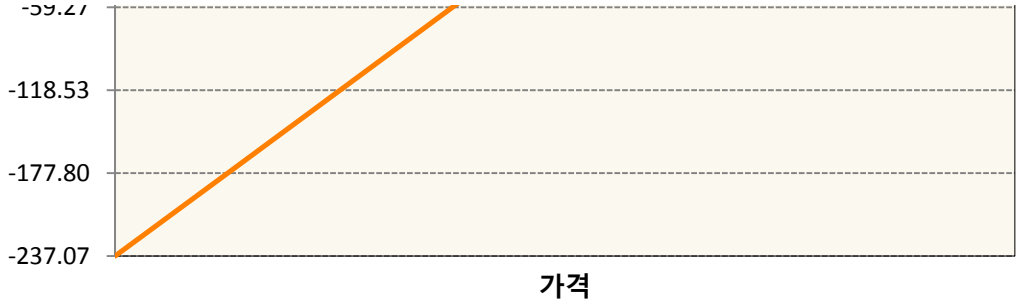
(단위:백만원)

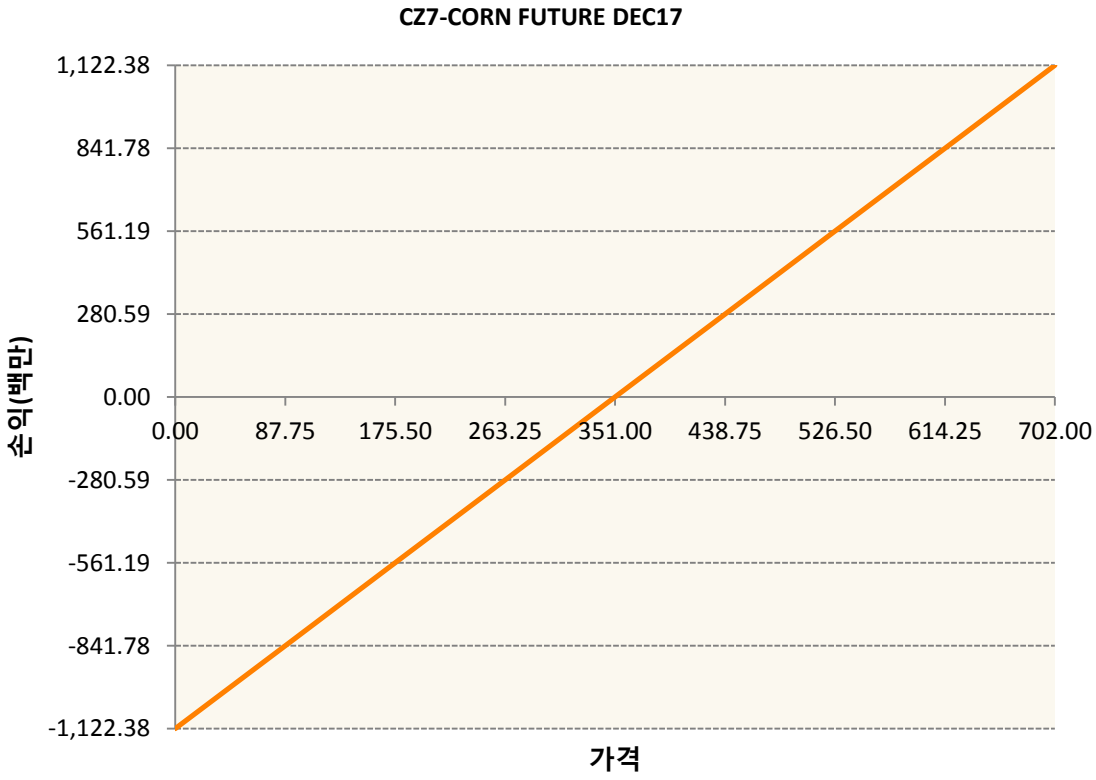
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	4,565	337	4,228	

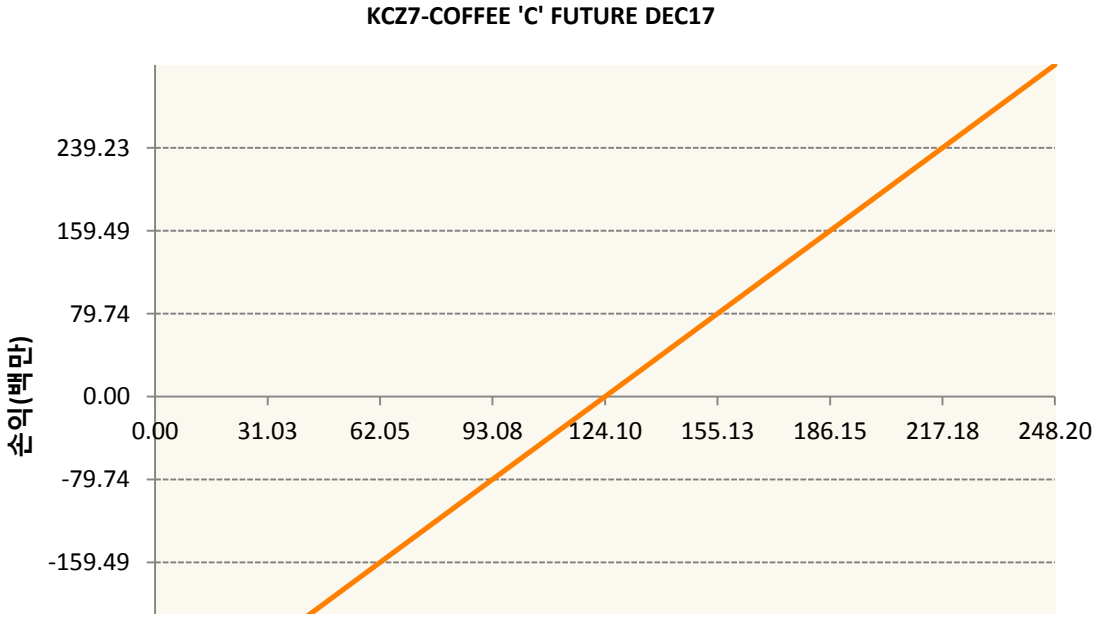
2. 만기시점의 손익구조

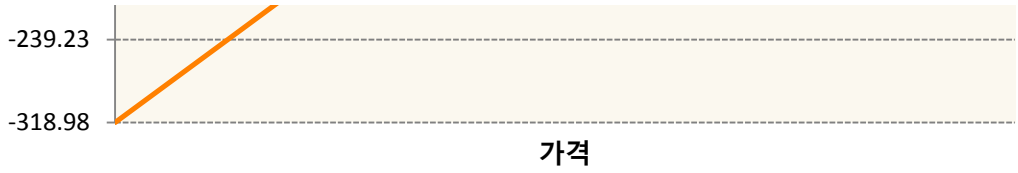


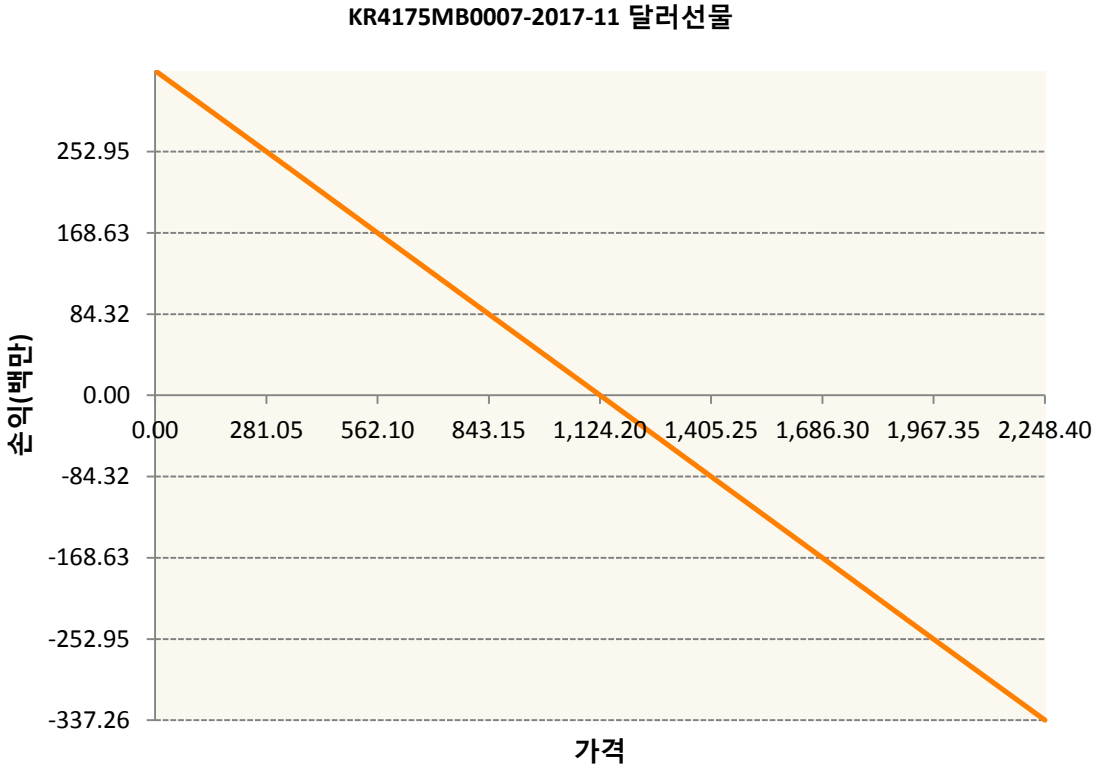


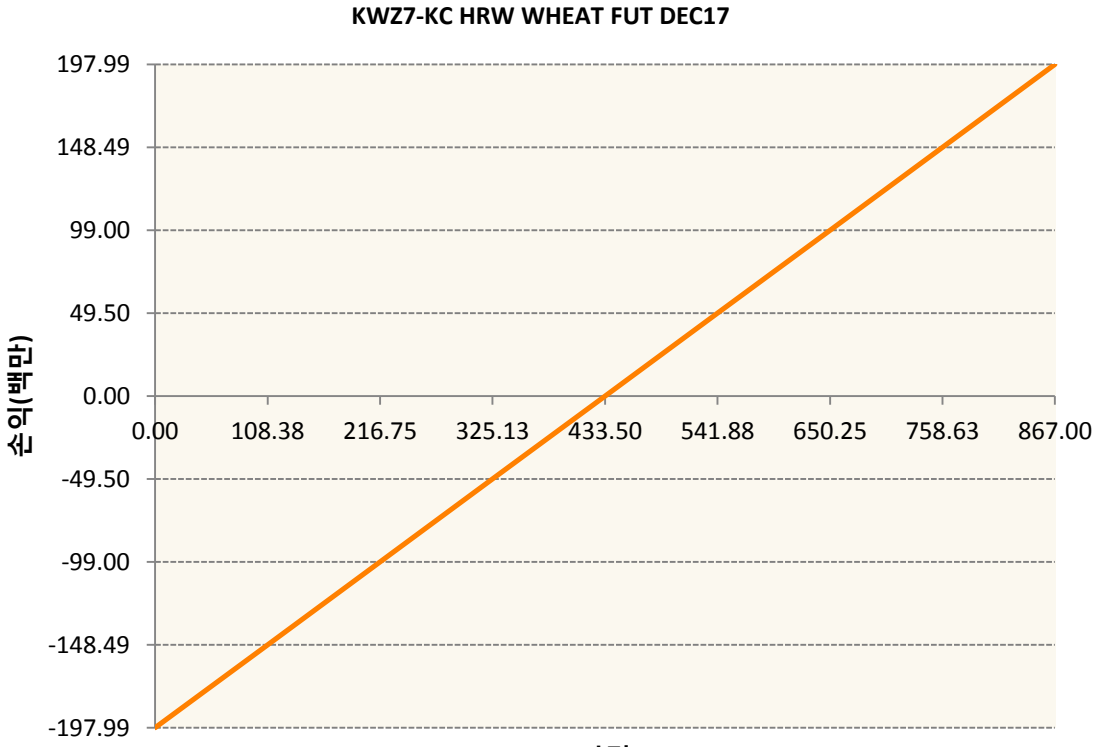

-118.53
-177.80
-237.07
가격


CZ7-CORN FUTURE DEC17
1,122.38
841.78
561.19
280.59
0.00
-280.59
-561.19
-841.78
-1,122.38
0.00
87.75
175.50
263.25
351.00
438.75
526.50
614.25
702.00
손익(백만)
가격


KCZ7-COFFEE 'C' FUTURE DEC17
239.23
159.49
79.74
0.00
-79.74
-159.49
0.00
31.03
62.05
93.08
124.10
155.13
186.15
217.18
248.20
손익(백만)

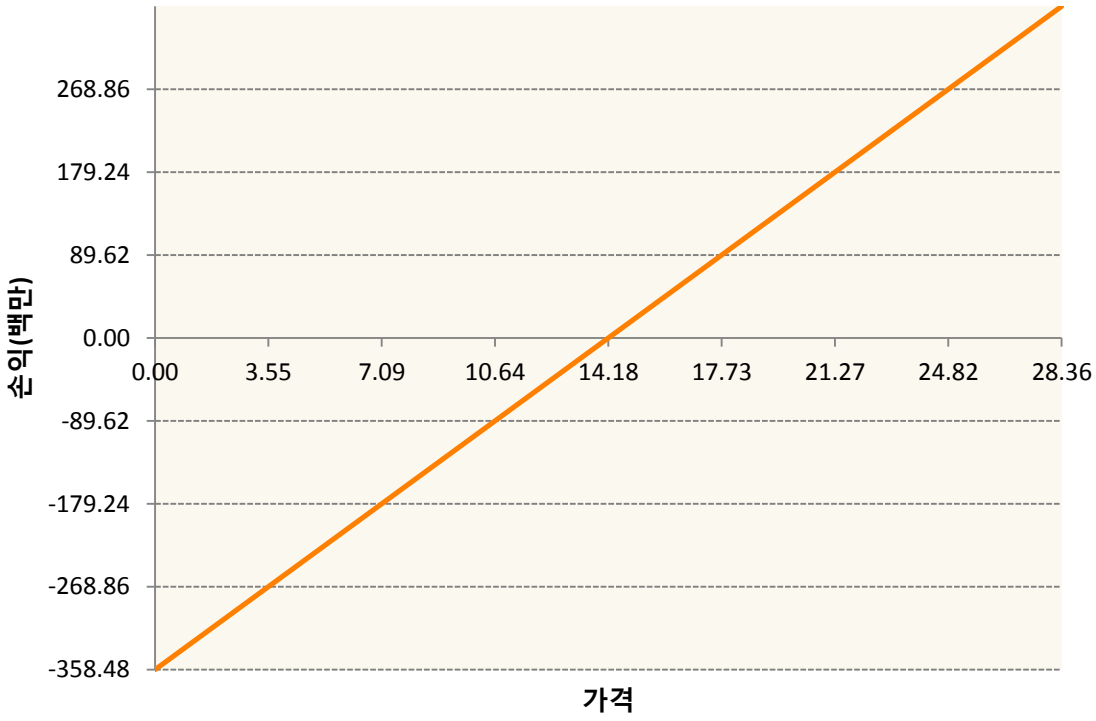

-239.23
-318.98
가격


KR4175MB0007-2017-11 달러선물
252.95
168.63
84.32
0.00
-84.32
-168.63
-252.95
-337.26
0.00
281.05
562.10
843.15
1,124.20
1,405.25
1,686.30
1,967.35
2,248.40
손익(백만)
가격

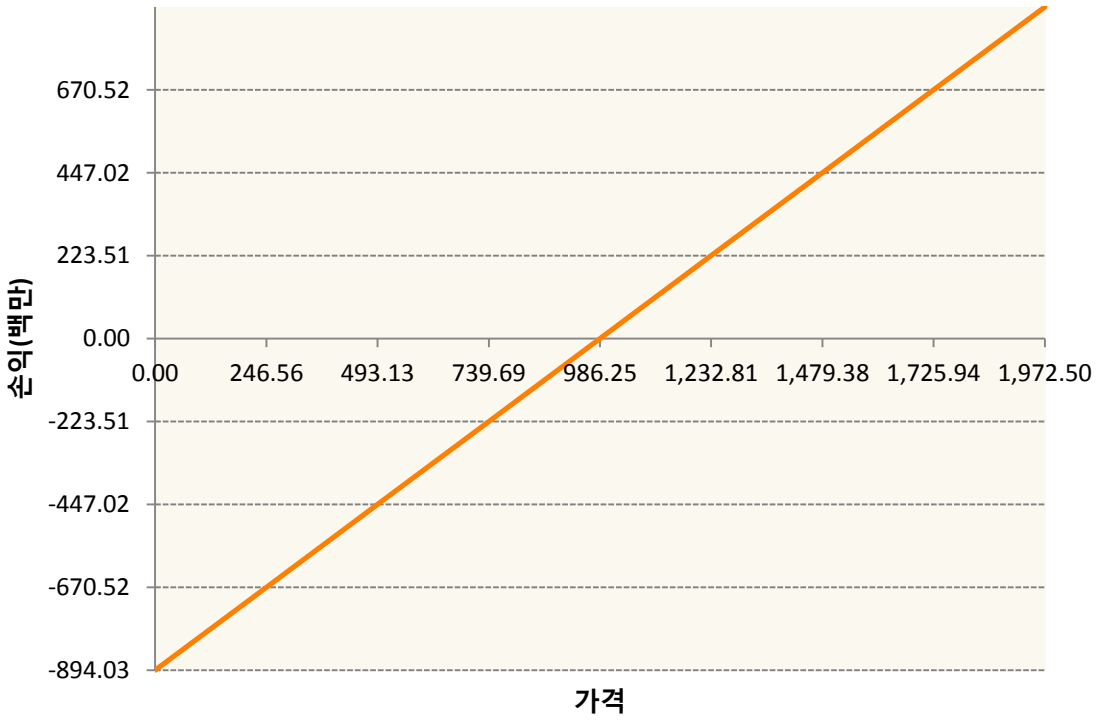

KWZ7-KC HRW WHEAT FUT DEC17
197.99
148.49
99.00
49.50
0.00
-49.50
-99.00
-148.49
-197.99
0.00
108.38
216.75
325.13
433.50
541.88
650.25
758.63
867.00
손익(백만)

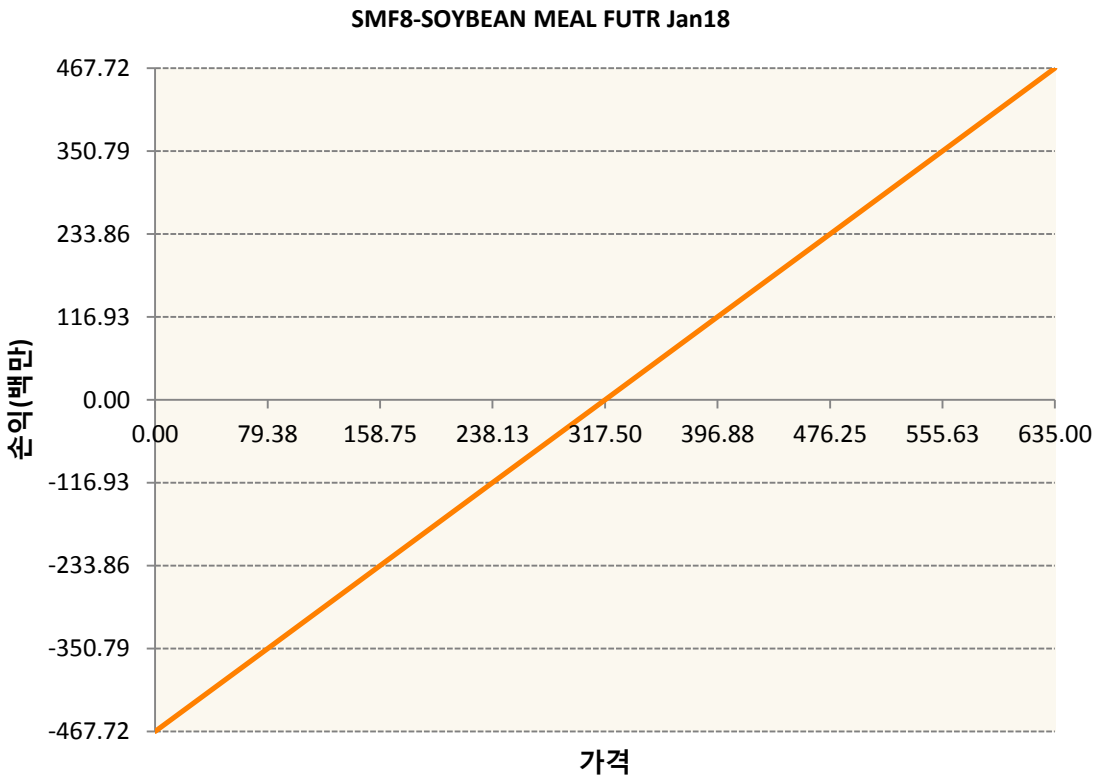
가격

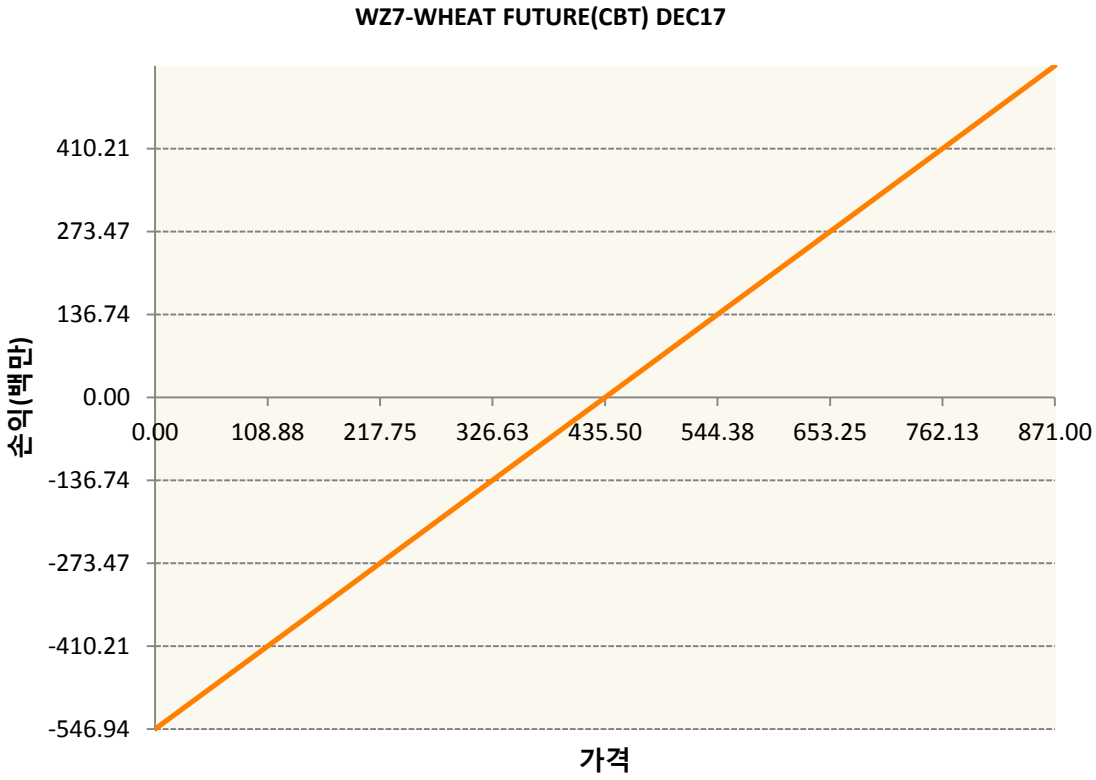
SBH8-Sugar #11 (WORLD) MAR18



SF8-SOYBEAN FUTURE 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	29
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)

418