공시일	2017-10-31
기준일	2017-10-30

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	2017-10-31
기준일	2017-10-30

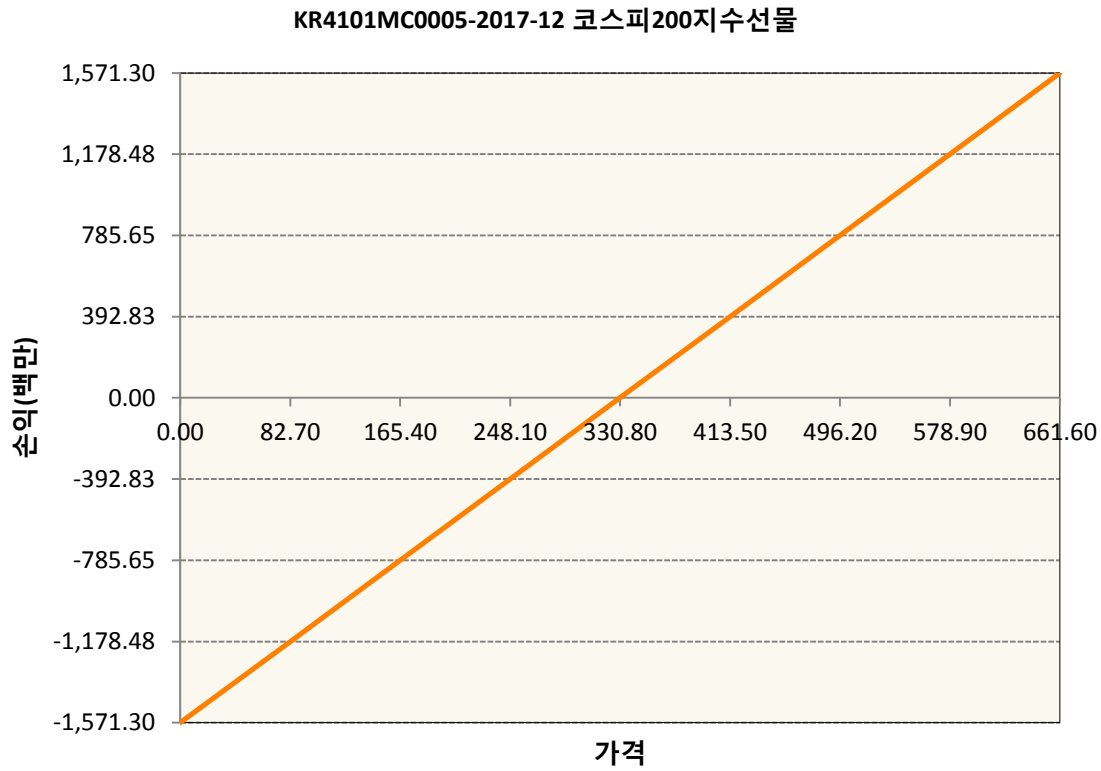
스마트인덱스모

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	1,571	0	1,571	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101MC0(2017-12 코스피200지수선물							126
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-126	-126	-126	-126	-126	-126	-126
-5.33%	-84	-84	-84	-84	-84	-84	-84
-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%	84	84	84	84	84	84	84

8.00%	126	126	126	126	126	126	126

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

76

공시일	2017-10-31
기준일	2017-10-30

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)

457

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-10-31
기준일	2017-10-30

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	413

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

359

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-10-31
기준일	2017-10-30

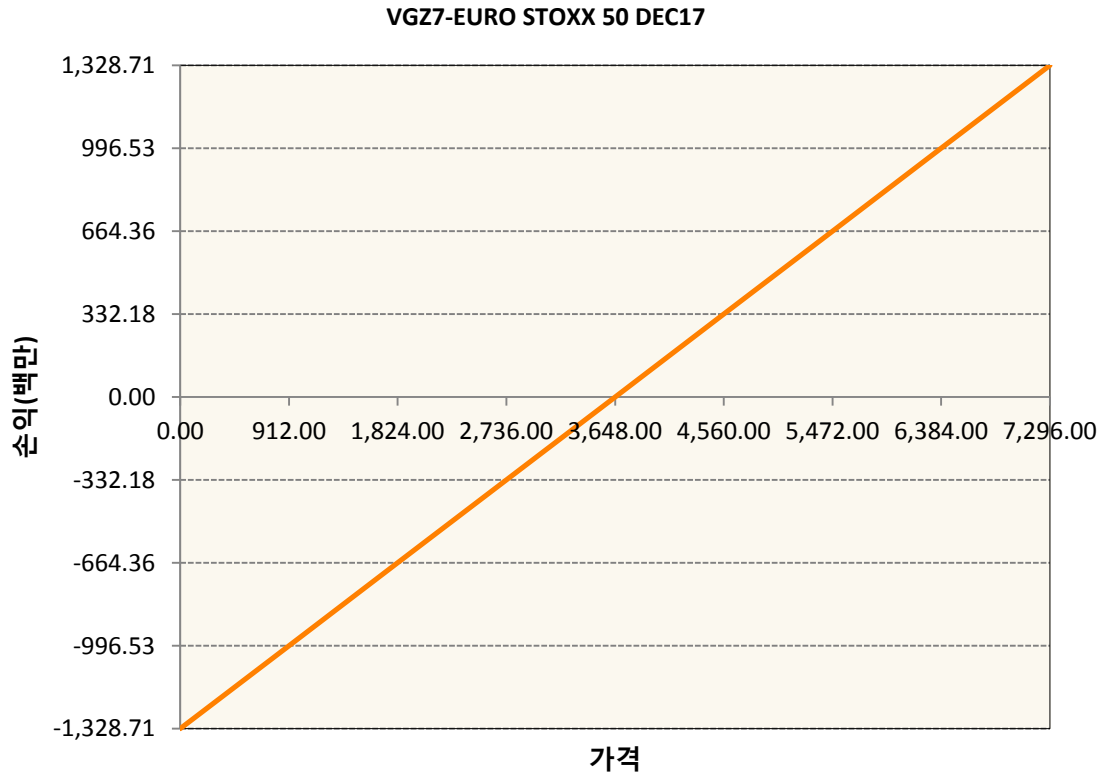
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,329	0	1,329	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGZ7	EURO STOXX 50 DEC17	106

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

(단위:백만원)

80

공시일	2017-10-31
기준일	2017-10-30

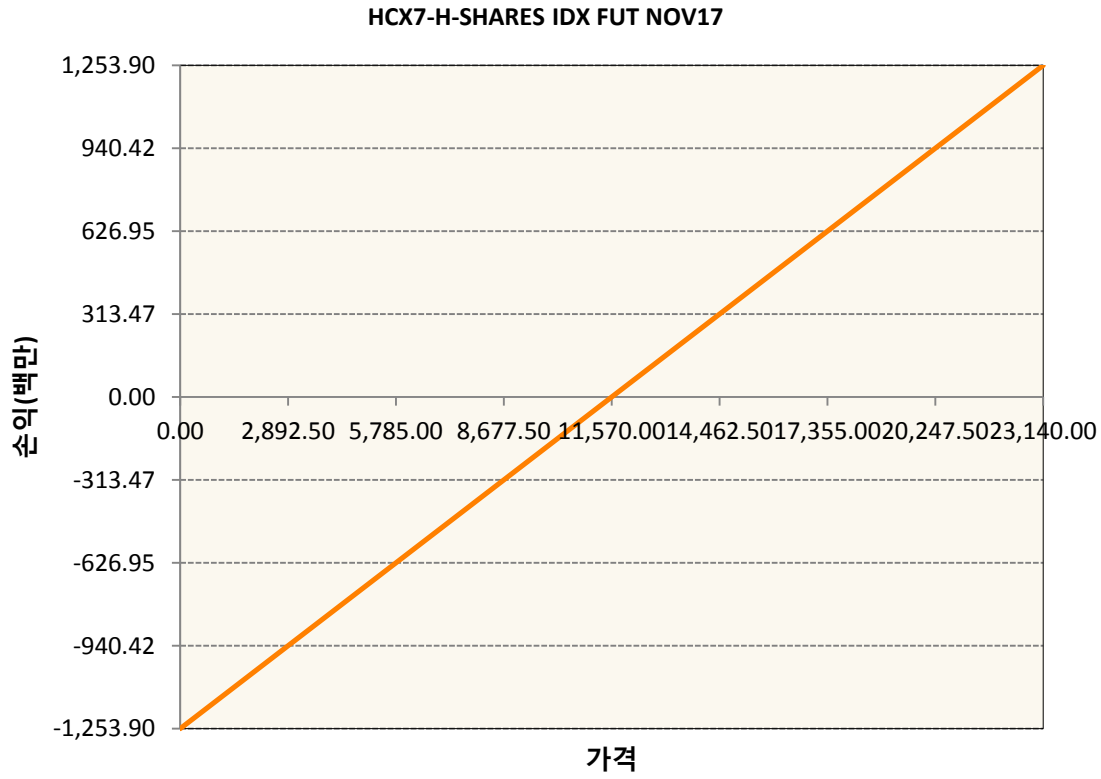
차이나인덱스모(주식-파생형)

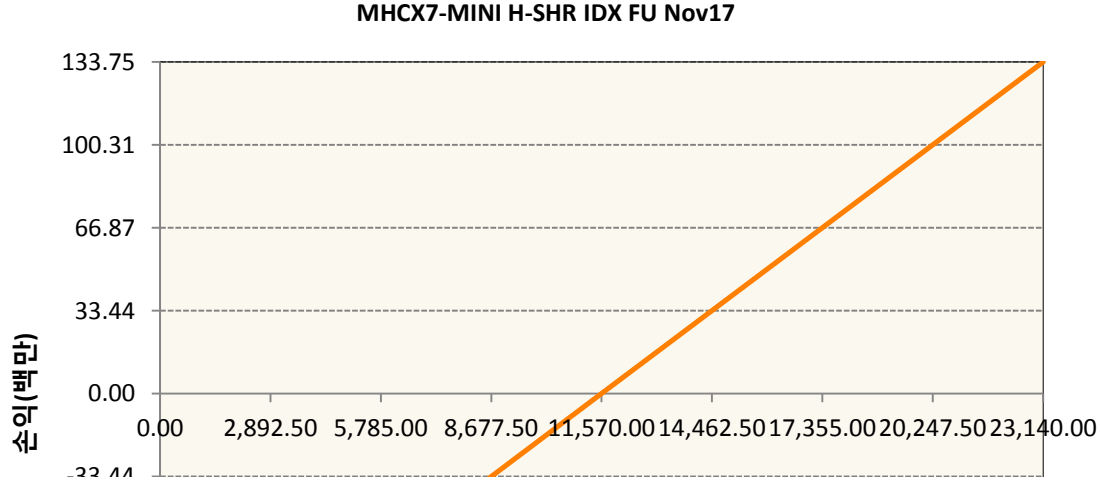
1. 계약금액

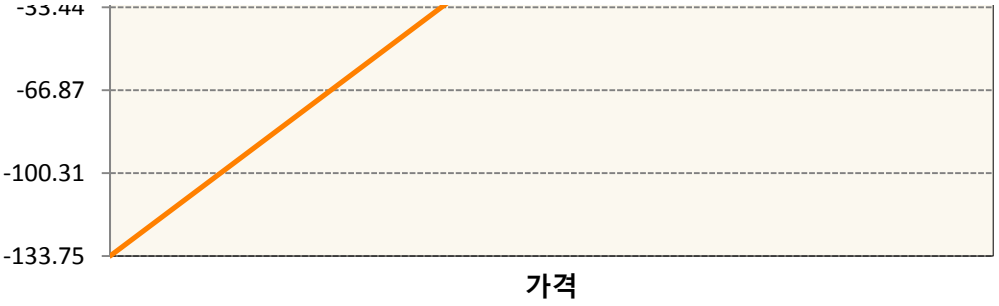
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,388	0	1,388	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCX7	H-SHARES IDX FUT NOV17	100
MHCX7	MINI H-SHR IDX FU Nov17	11

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	91

공시일	2017-10-31
기준일	2017-10-30

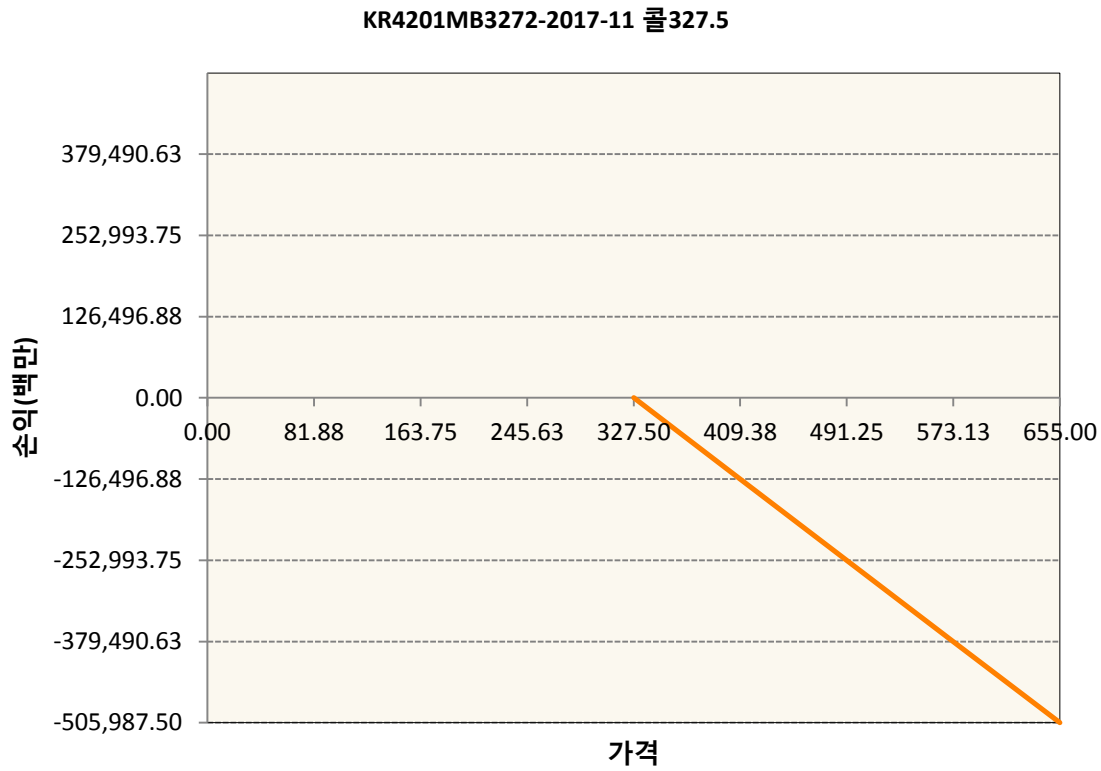
커버드콜모(주식혼합-파생형)

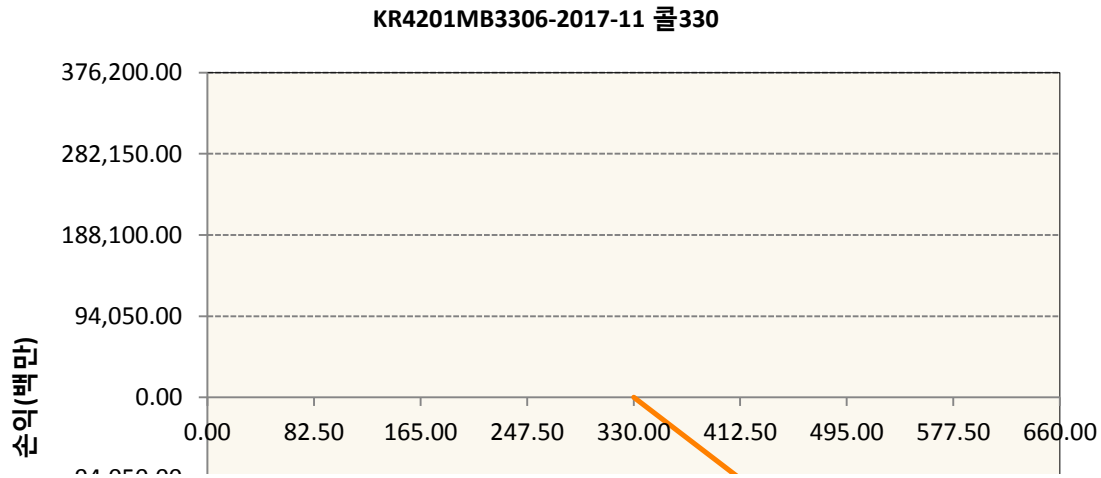
1. 계약금액

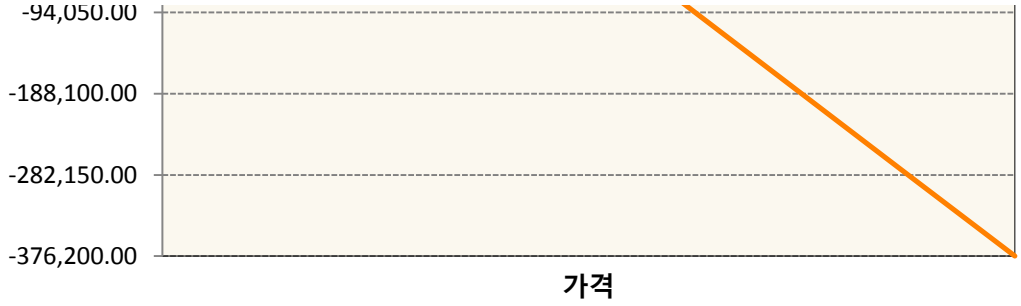
(단위:백만원)

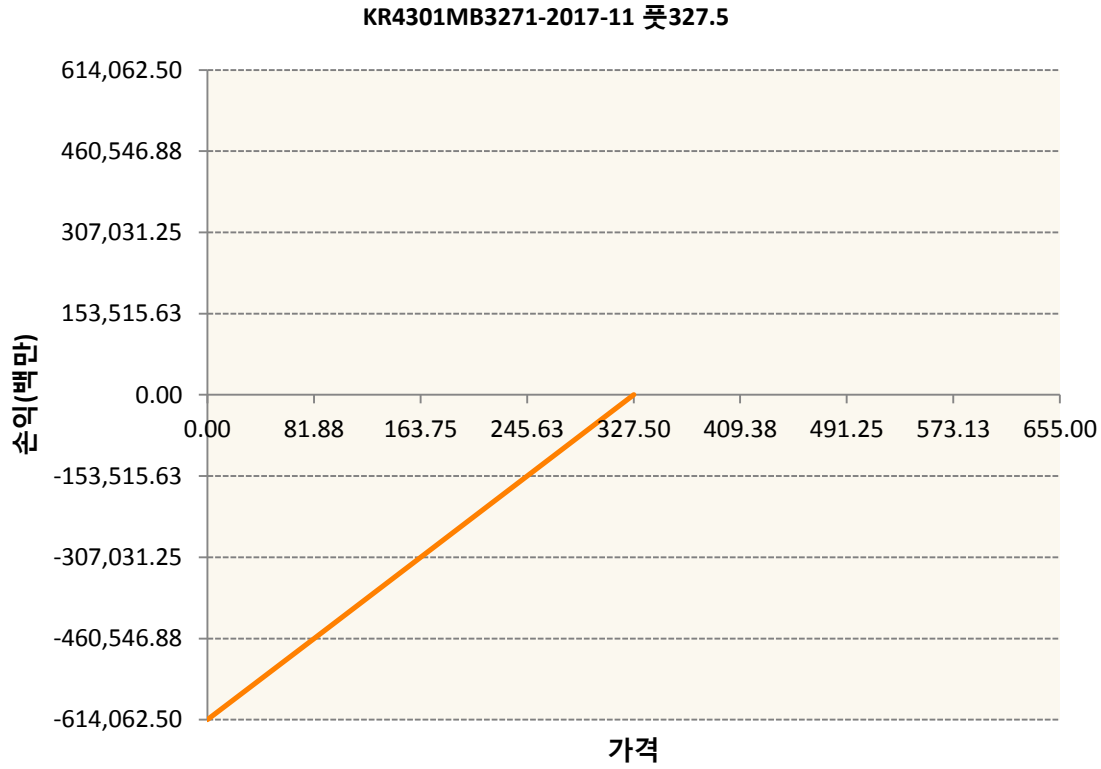
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	1,496,250	-1,496,250	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201MB3	2017-11 콜327.5						35,244
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	10,533	10,492	10,425	10,327	10,196	10,032	9,835
-5.33%	10,159	9,930	9,653	9,333	8,975	8,585	8,167
-2.67%	8,048	7,483	6,900	6,305	5,700	5,086	4,465
0%	1,959	1,310	657	0	-660	-1,321	-1,985
2.67%	-8,480	-8,848	-9,259	-9,707	-10,185	-10,688	-11,212
5.33%	-21,298	-21,407	-21,560	-21,756	-21,994	-22,271	-22,583
8.00%	-34,793	-34,811	-34,845	-34,902	-34,986	-35,099	-35,244
KR4201MB3	2017-11 콜330						24,854
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	6,238	6,222	6,191	6,142	6,074	5,983	5,870
-5.33%	6,086	5,969	5,818	5,635	5,422	5,183	4,919
-2.67%	5,042	4,688	4,312	3,918	3,511	3,092	2,664
0%	1,499	999	500	0	-500	-999	-1,499
2.67%	-5,386	-5,732	-6,103	-6,493	-6,899	-7,319	-7,749
5.33%	-14,498	-14,622	-14,783	-14,978	-15,204	-15,459	-15,738
8.00%	-24,379	-24,404	-24,447	-24,511	-24,600	-24,714	-24,854
KR4301MB3	2017-11	풋327.5					41,215

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-41,205	-41,205	-41,205	-41,206	-41,207	-41,210	-41,215
-5.33%	-24,696	-24,705	-24,723	-24,753	-24,797	-24,859	-24,938
-2.67%	-8,759	-8,989	-9,246	-9,526	-9,823	-10,136	-10,461
0%	1,135	766	387	0	-393	-790	-1,191
2.67%	2,801	2,756	2,689	2,598	2,482	2,342	2,179
5.33%	2,842	2,841	2,840	2,835	2,827	2,811	2,788
8.00%	2,842	2,842	2,842	2,842	2,842	2,841	2,840

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

115,210

공시일	2017-10-31
기준일	2017-10-30

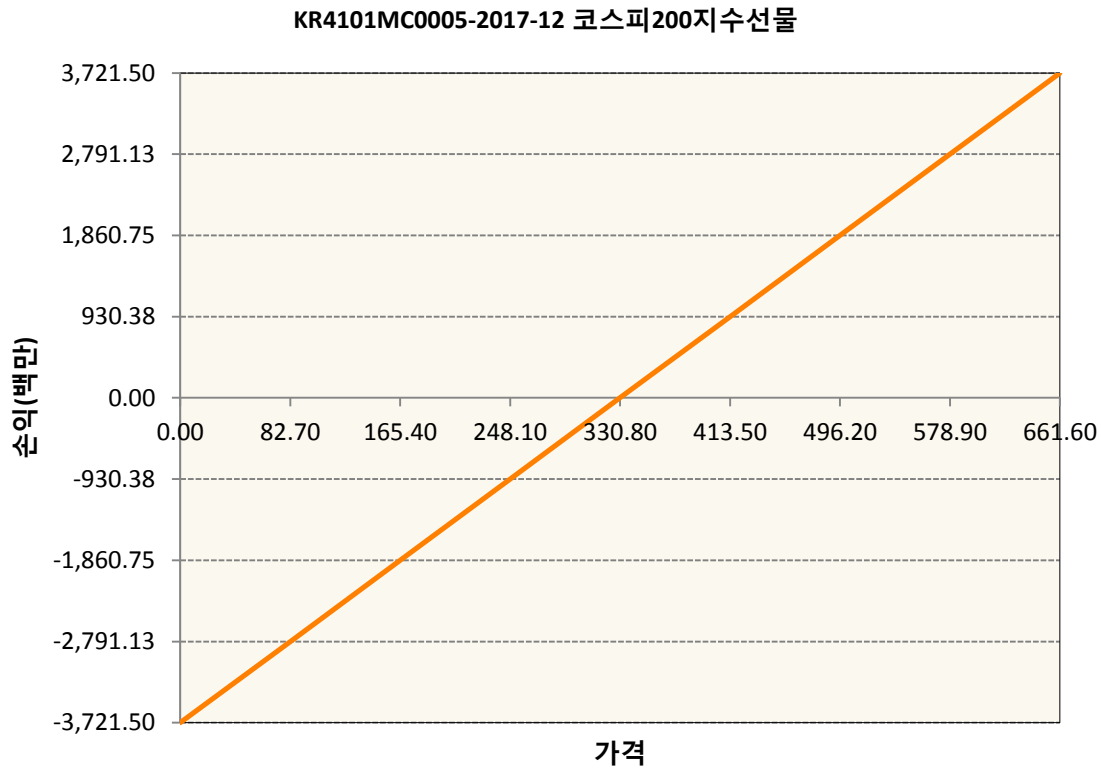
ETF스마트레버리지목표전환형7호

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	3,722	0	3,722	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	2017-10-31
기준일	2017-10-30

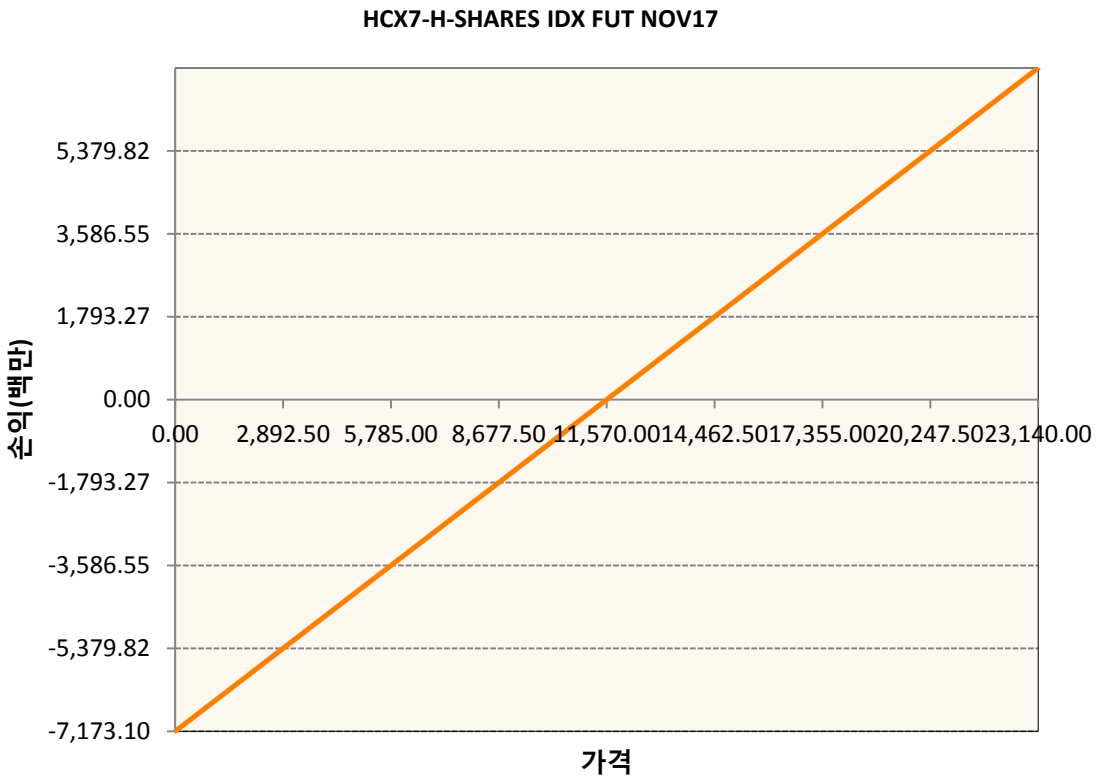
홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생

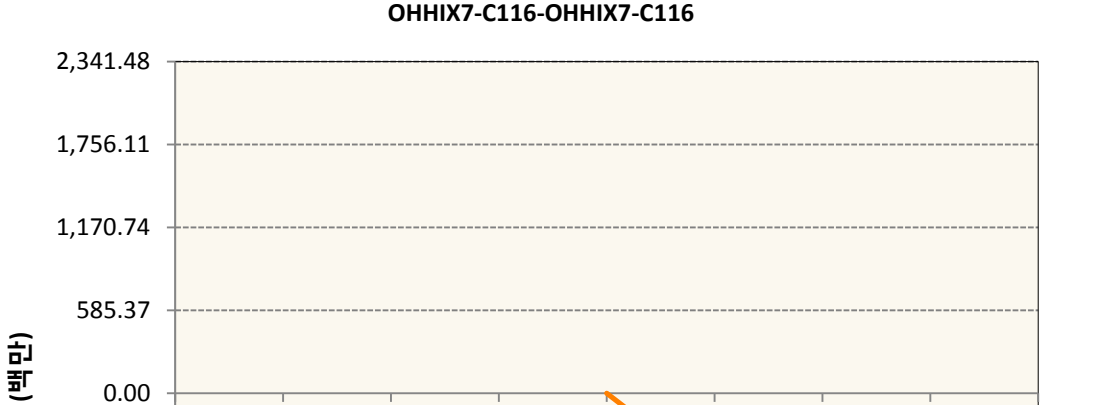
1. 계약금액

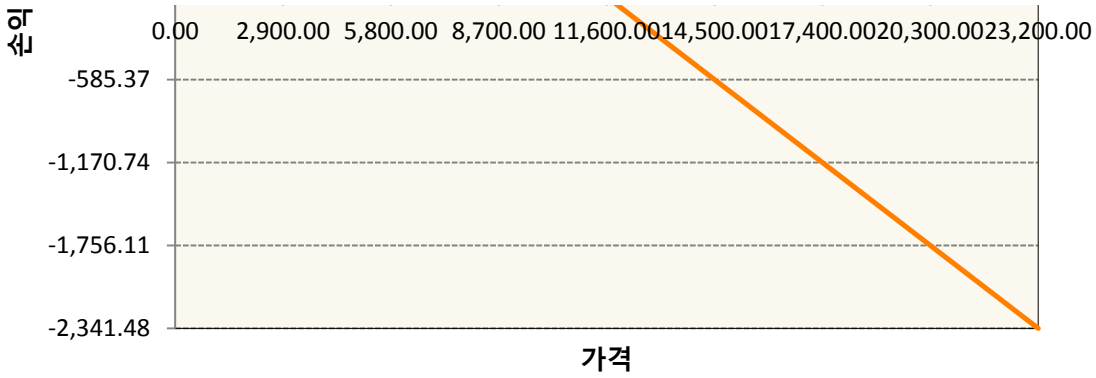
(단위:백만원)

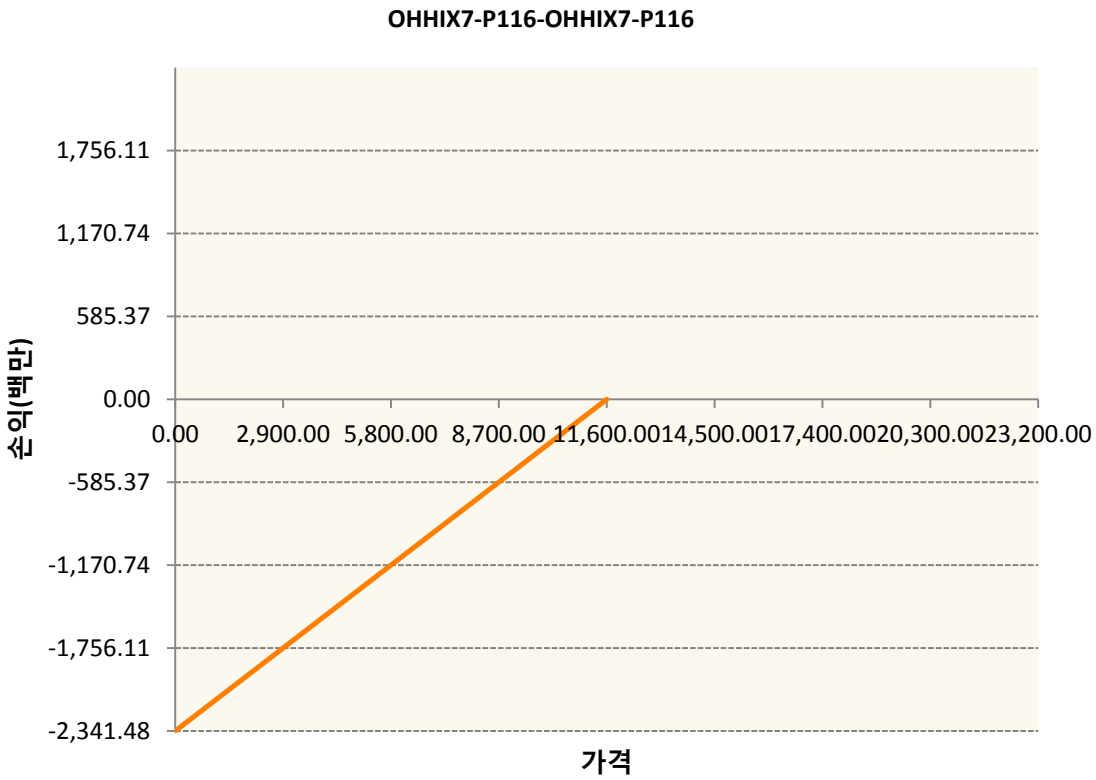
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	1	0	1	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	7,173	0	7,173	장내
누계	유가증권	옵션	0	4,683	-4,683	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCX7	H-SHARES IDX FUT NOV17	574
OHHIX7-C11	OHHIX7-C116	187
OHHIX7-P11	OHHIX7-P116	187

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

(단위:백만원)

775

공시일	2017-10-31
기준일	2017-10-30

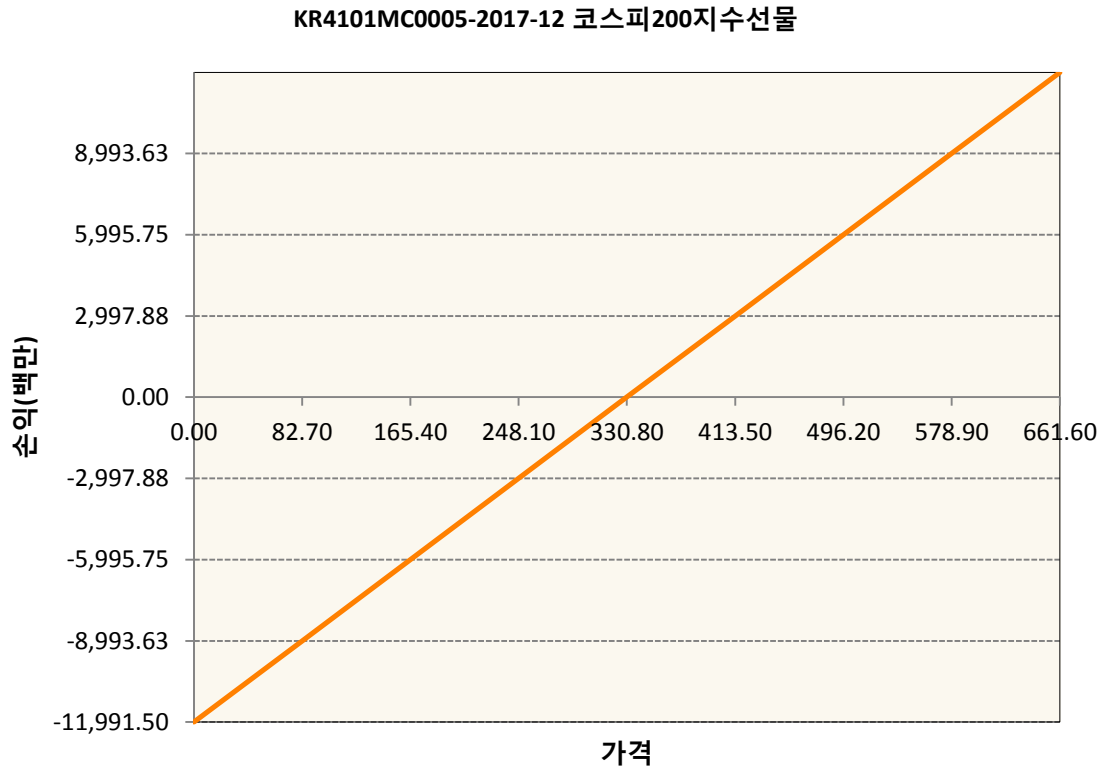
코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼

1. 계약금액

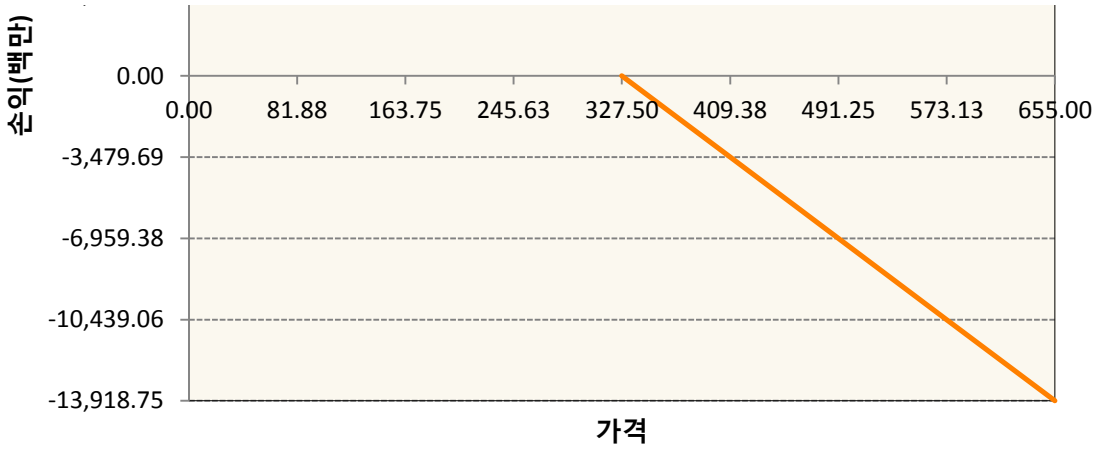
(단위:백만원)

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	11,992	0	11,992	장내
누계	유가증권	옵션	0	37,322	-37,322	장내
누계	유가증권	스왑	38,700	0	38,700	장외

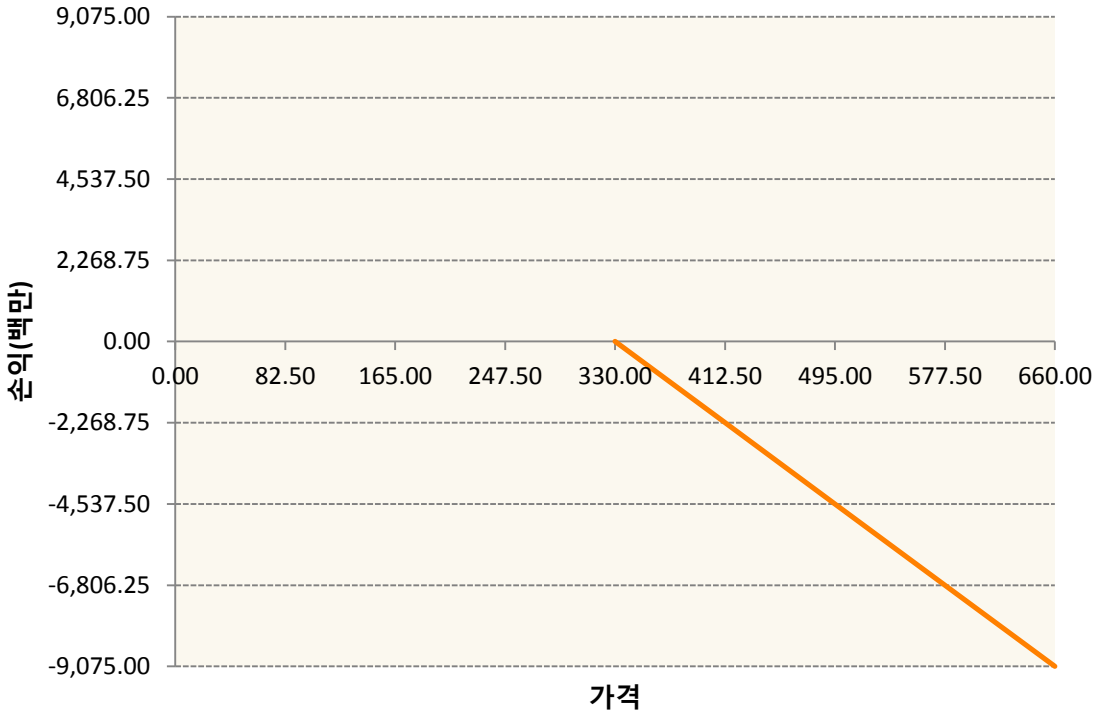
2. 만기시점의 손익구조



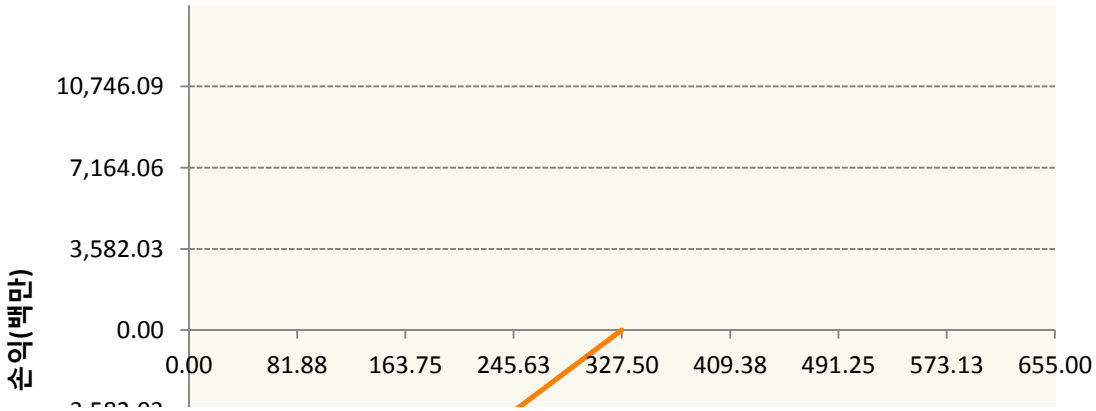




KR4201MB3306-2017-11 콜330



KR4301MB3271-2017-11 풋327.5





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

	2.5287E+11 UBCSFXC1 INDEX_2						1,498
	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%	-320	-320	-320	-320	-320	-320	-320
-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%	320	320	320	320	320	320	320
8.00%	479	479	479	479	479	479	479
	KR4101MC0(	2017-12 코스피200지수선물					958
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-958	-958	-958	-958	-958	-958	-958
-5.33%	-639	-639	-639	-639	-639	-639	-639

-2.67%	-319	-319	-319	-319	-319	-319	-319
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	319	319	319	319	319	319	319
5.33%	639	639	639	639	639	639	639
8.00%	958	958	958	958	958	958	958
	KR4201MB3: 2017-11 콜327.5						969
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	290	289	287	284	280	276	271
-5.33%	279	273	266	257	247	236	225
-2.67%	221	206	190	173	157	140	123
0%	54	36	18	0	-18	-36	-55
2.67%	-233	-243	-255	-267	-280	-294	-308
5.33%	-586	-589	-593	-598	-605	-613	-621
8.00%	-957	-958	-959	-960	-962	-966	-969
	KR4201MB3: 2017-11 콜330						600
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	150	150	149	148	147	144	142
-5.33%	147	144	140	136	131	125	119
-2.67%	122	113	104	95	85	75	64
0%	36	24	12	0	-12	-24	-36
2.67%	-130	-138	-147	-157	-166	-177	-187
5.33%	-350	-353	-357	-361	-367	-373	-380
8.00%	-588	-589	-590	-591	-593	-596	-600
	KR4301MB3: 2017-11 풋327.5						962
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-961	-961	-961	-961	-961	-962	-962
-5.33%	-576	-576	-577	-578	-579	-580	-582
-2.67%	-204	-210	-216	-222	-229	-236	-244
0%	26	18	9	0	-9	-18	-28
2.67%	65	64	63	61	58	55	51
5.33%	66	66	66	66	66	66	65
8.00%	66	66	66	66	66	66	66

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

6,579

공시일	2017-10-31
기준일	2017-10-30

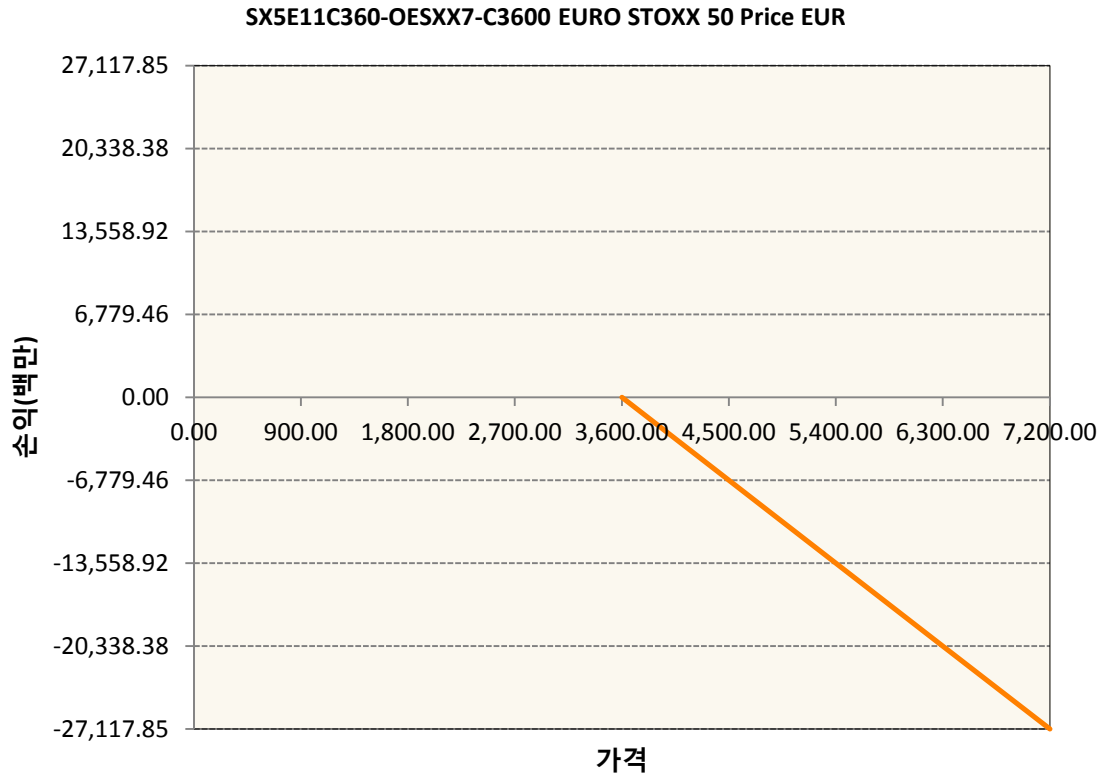
유로커버드콜모(주식혼합-파생형

1. 계약금액

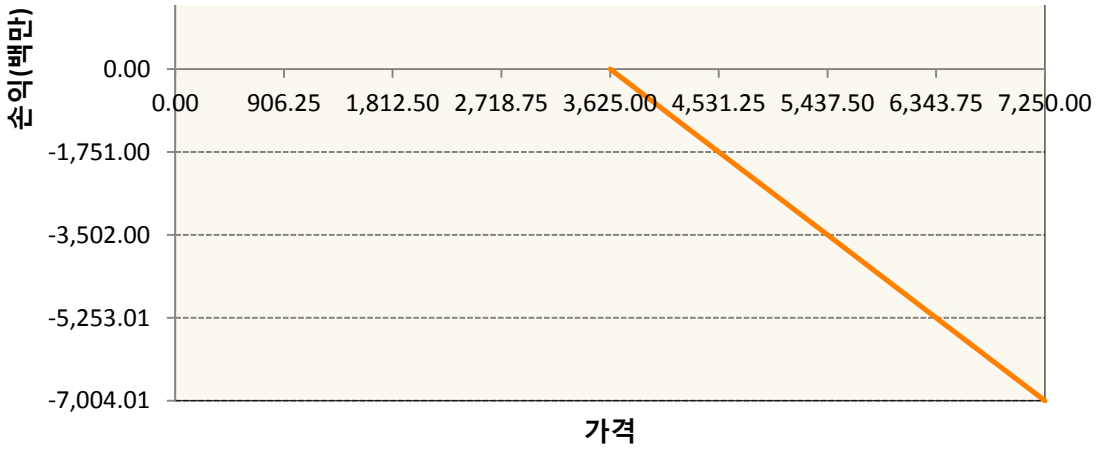
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	31,118	0	31,118	
누계	유가증권	옵션	0	68,244	-68,244	장내
누계	유가증권	스왑	97,912	0	97,912	장외

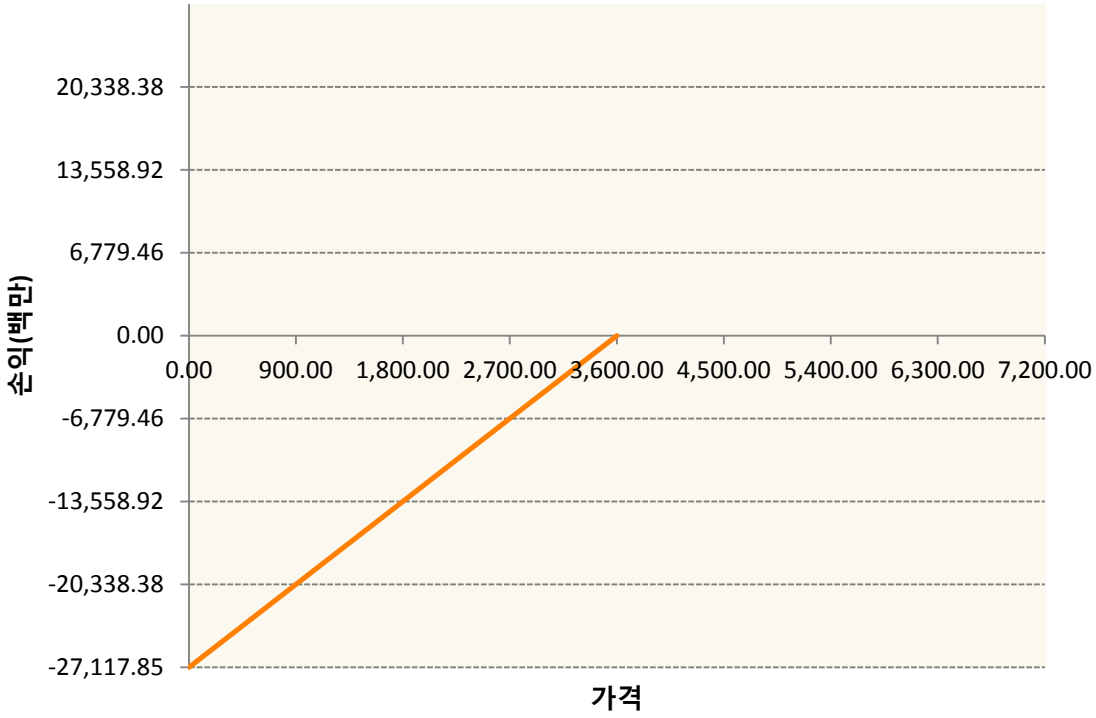
2. 만기시점의 손익구조



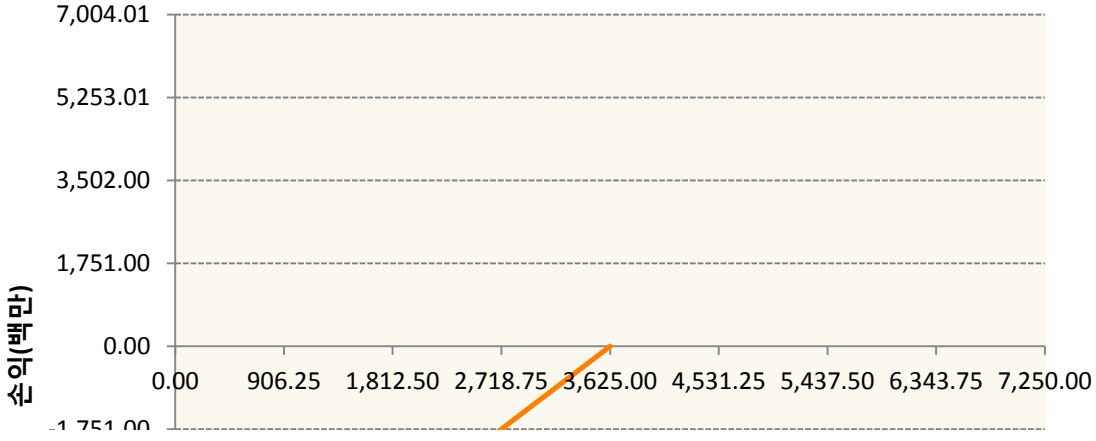




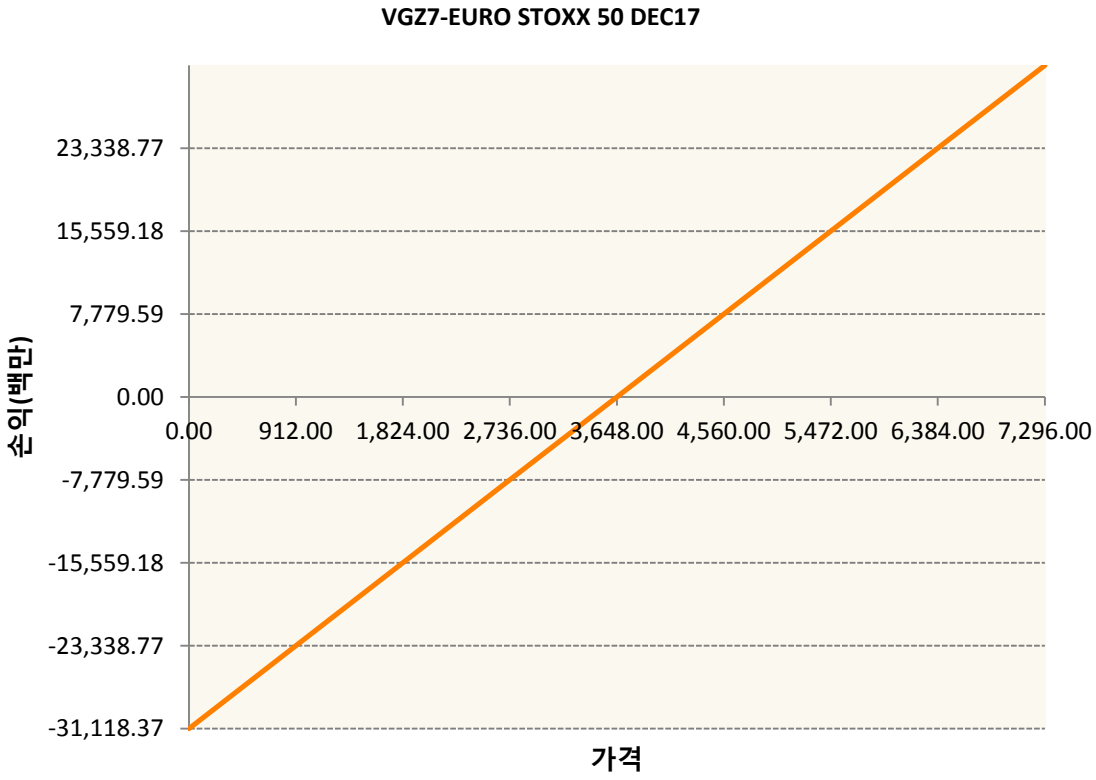
SX5E11P360-OESXX7-P3600 EURO STOXX 50 Price EUR



SX5E11P362-OESXX7-P3625 EURO STOXX 50 Price EUR







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

260105SQPX SG EURO Covered CALL STRATEGY	42
SX5E11C360 OESXX7-C3600 EURO STOXX 50 Price EUR	2,169
SX5E11C362 OESXX7-C3625 EURO STOXX 50 Price EUR	560
SX5E11P360 OESXX7-P3600 EURO STOXX 50 Price EUR	2,169
SX5E11P362 OESXX7-P3625 EURO STOXX 50 Price EUR	560
VGZ7 EURO STOXX 50 DEC17	2,489

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

6,031

공시일	2017-10-31
기준일	2017-10-30

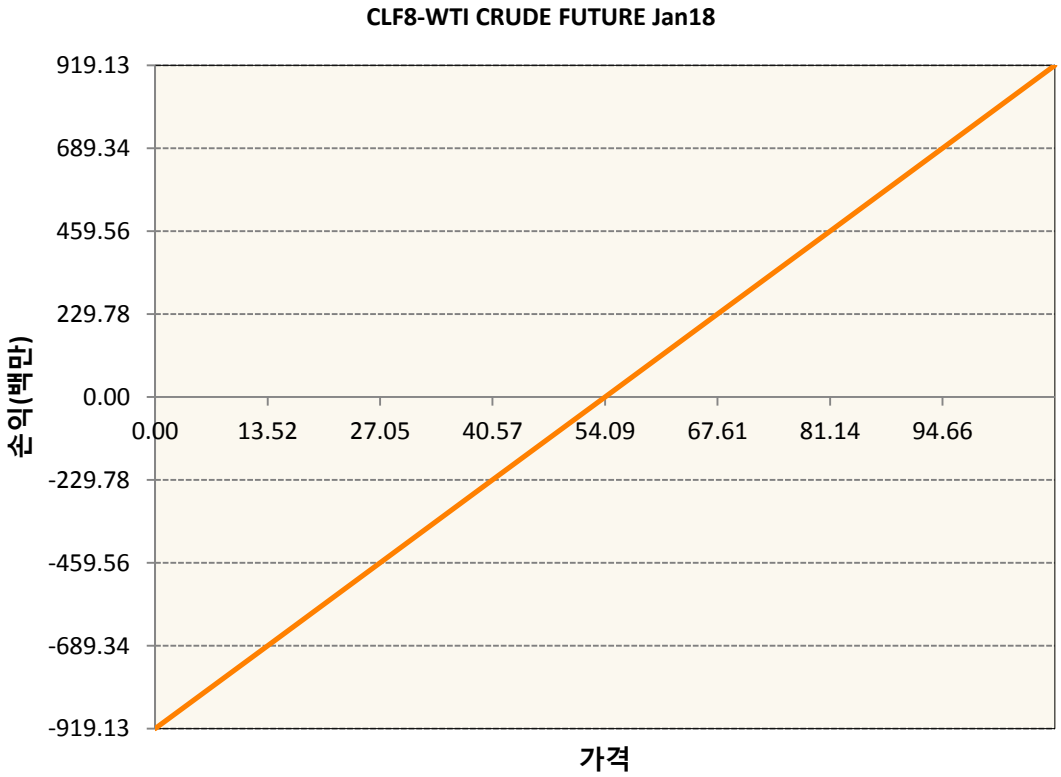
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

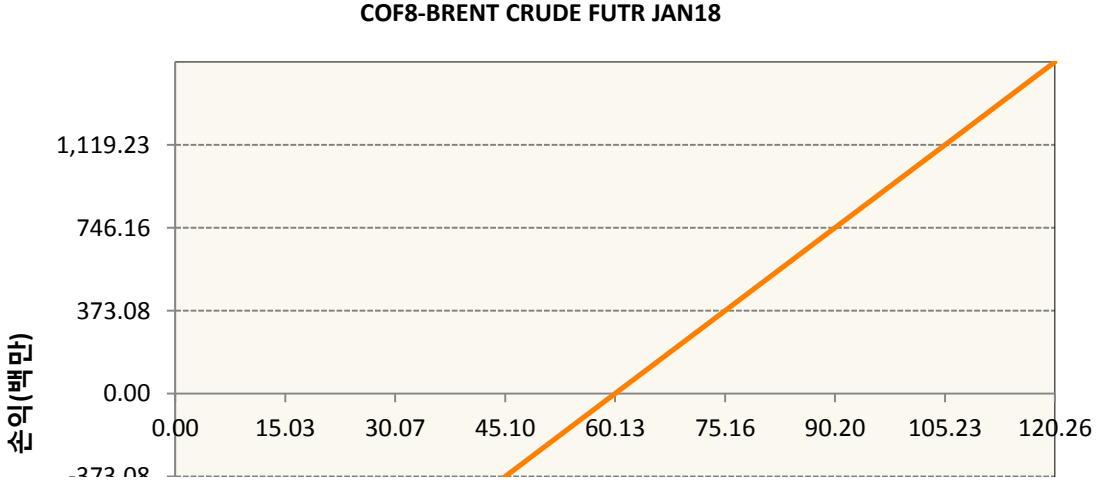
1. 계약금액

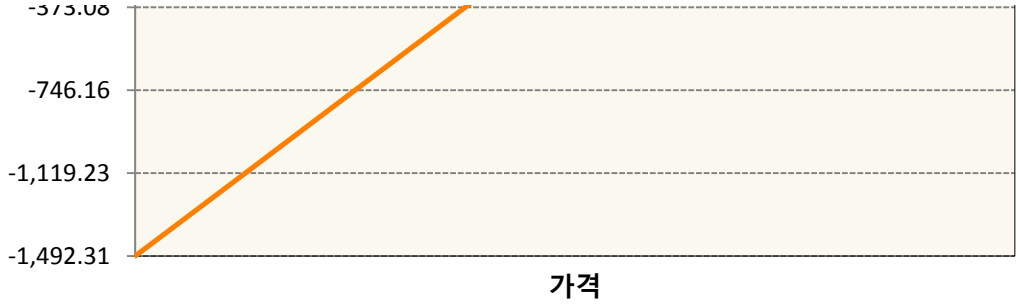
(단위:백만원)

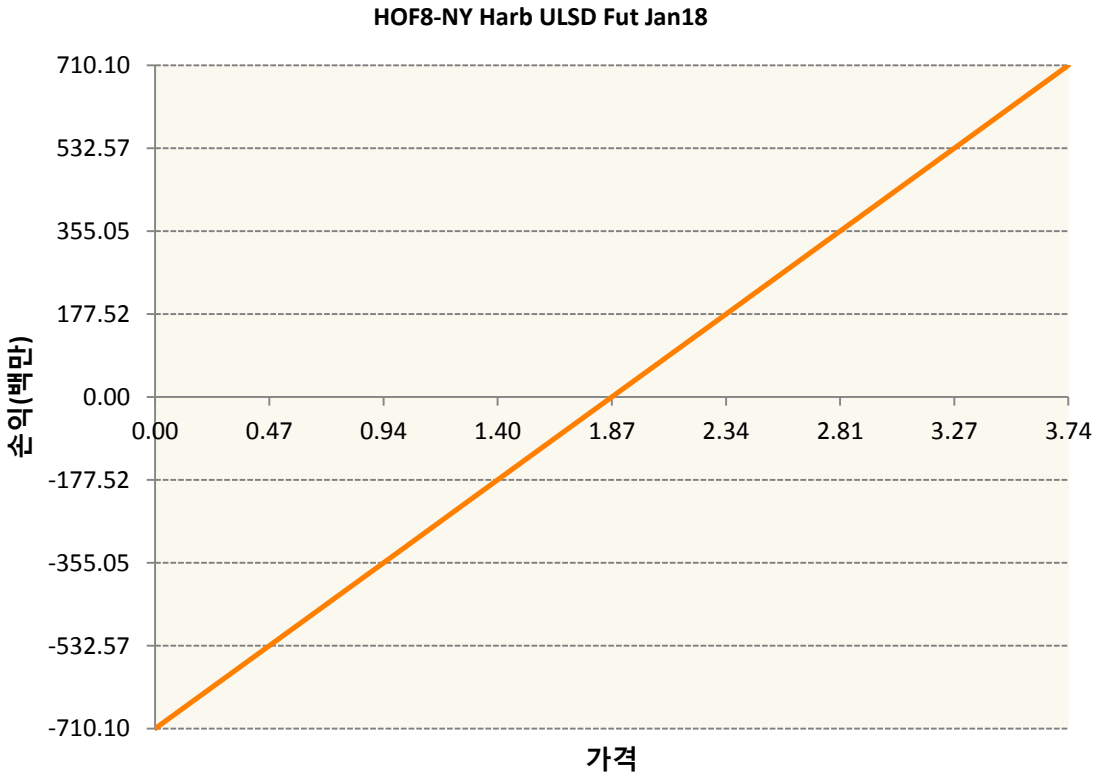
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	5,182	899	4,283	

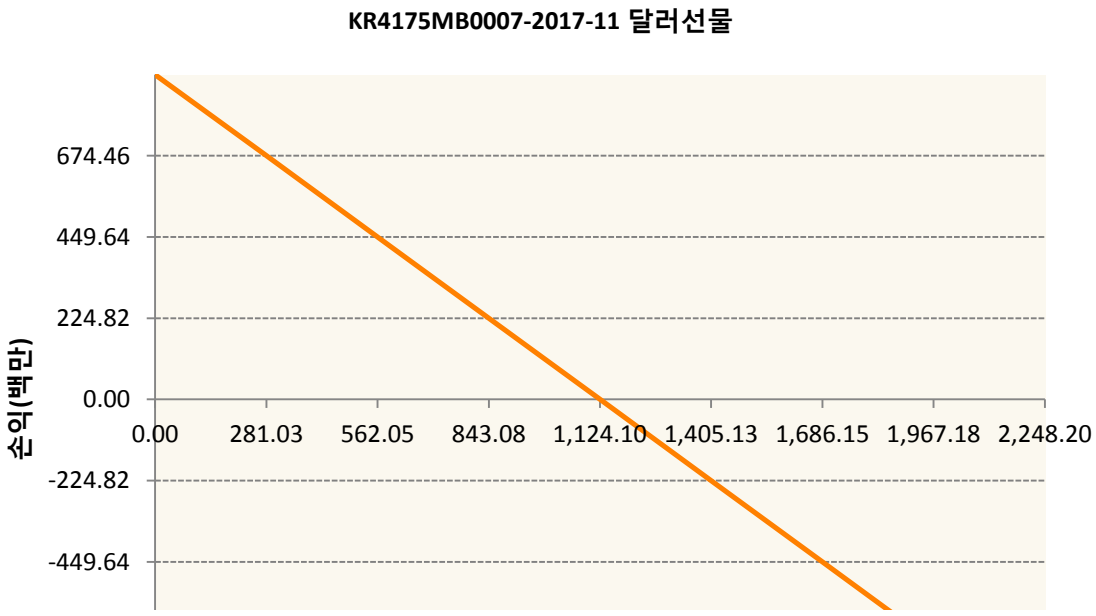
2. 만기시점의 손익구조

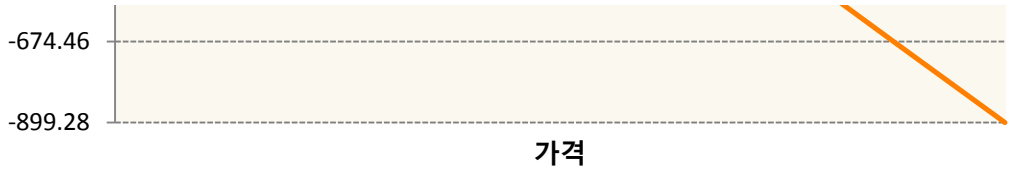


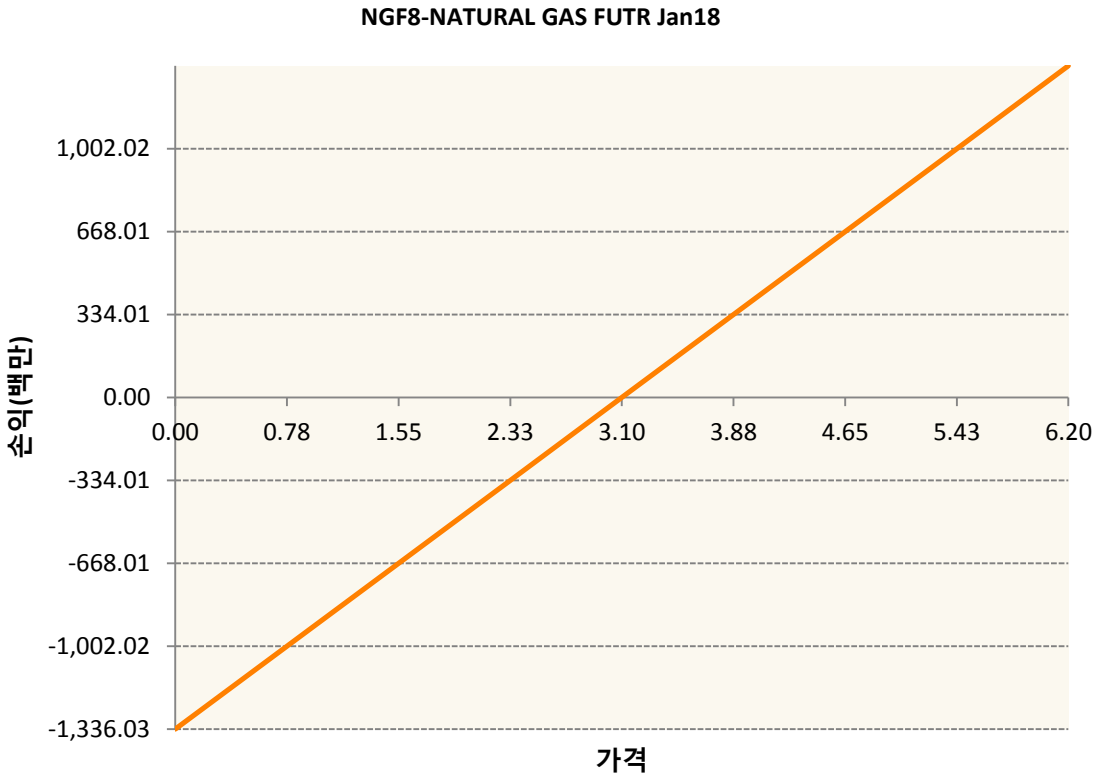


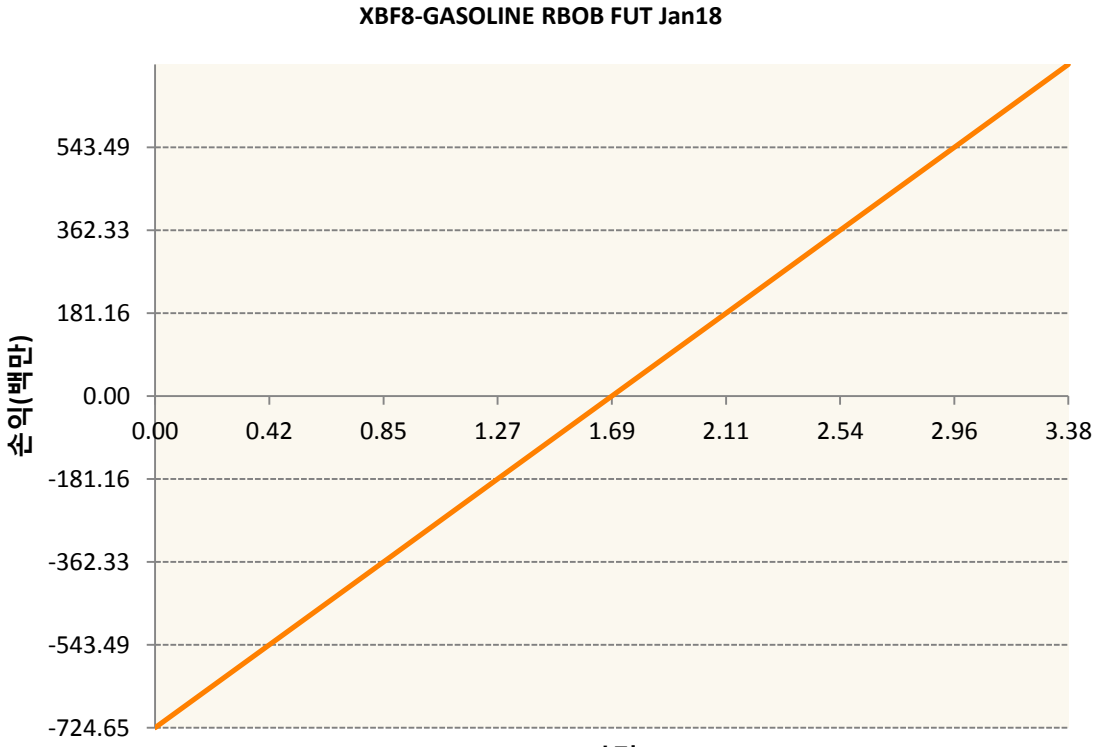

-373.08
-746.16
-1,119.23
-1,492.31
가격


HOF8-NY Harb ULSD Fut Jan18
710.10
532.57
355.05
177.52
0.00
-177.52
-355.05
-532.57
-710.10
손익(백만)
0.00
0.47
0.94
1.40
1.87
2.34
2.81
3.27
3.74
가격


KR4175MB0007-2017-11 달러선물
674.46
449.64
224.82
0.00
-224.82
-449.64
손익(백만)
0.00
281.03
562.05
843.08
1,124.10
1,405.13
1,686.15
1,967.18
2,248.20


-674.46
-899.28
가격


NGF8-NATURAL GAS FUTR Jan18
1,002.02
668.01
334.01
0.00
-334.01
-668.01
-1,002.02
-1,336.03
0.00
0.78
1.55
2.33
3.10
3.88
4.65
5.43
6.20
손익(백만)
가격


XBF8-GASOLINE RBOB FUT Jan18
543.49
362.33
181.16
0.00
-181.16
-362.33
-543.49
-724.65
0.00
0.42
0.85
1.27
1.69
2.11
2.54
2.96
3.38
손익(백만)

가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLF8	WTI CRUDE FUTURE Jan18	74
COF8	BRENT CRUDE FUTR JAN18	119
HOF8	NY Harb ULSD Fut Jan18	57
KR4175MB0(	2017-11 달러선물	72
NGF8	NATURAL GAS FUTR Jan18	107
XBF8	GASOLINE RBOB FUT Jan18	58

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

740

공시일	2017-10-31
기준일	2017-10-30

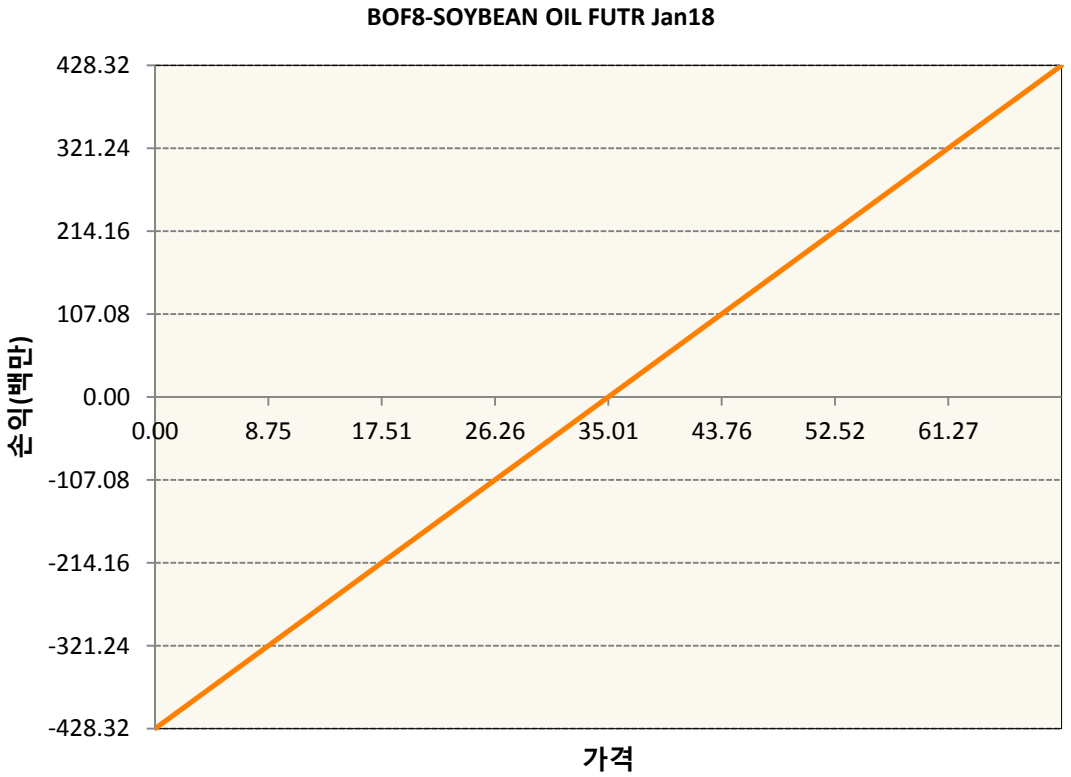
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

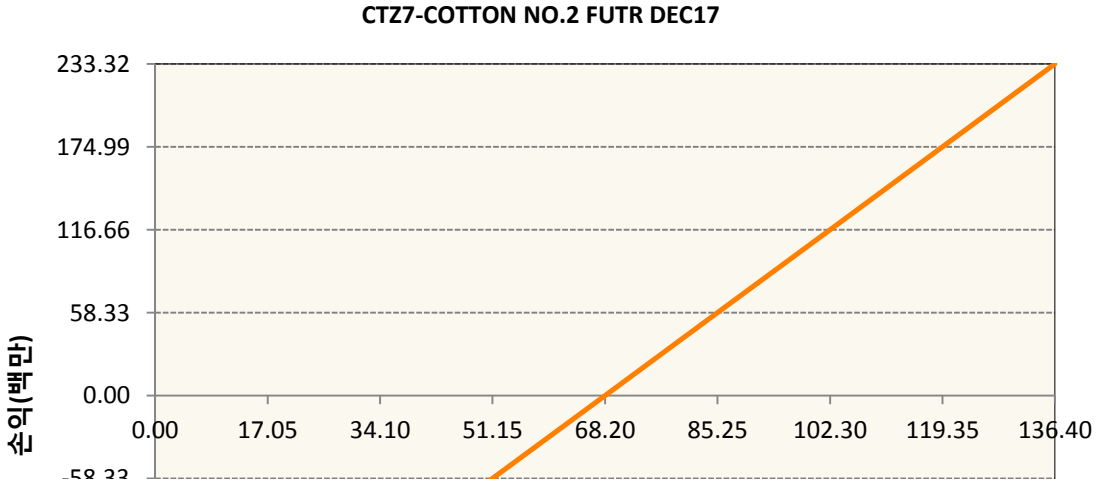
1. 계약금액

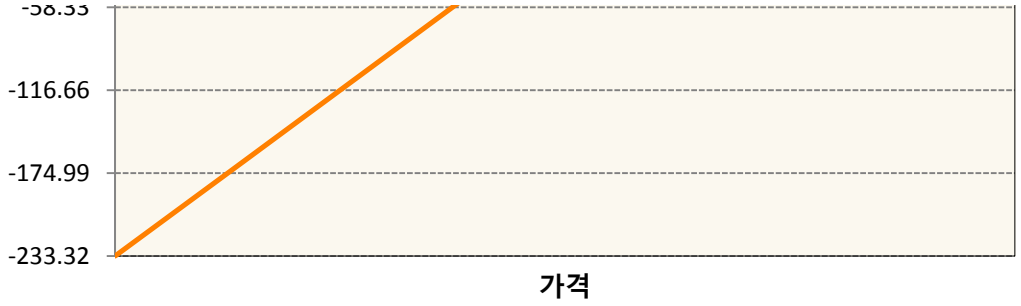
(단위:백만원)

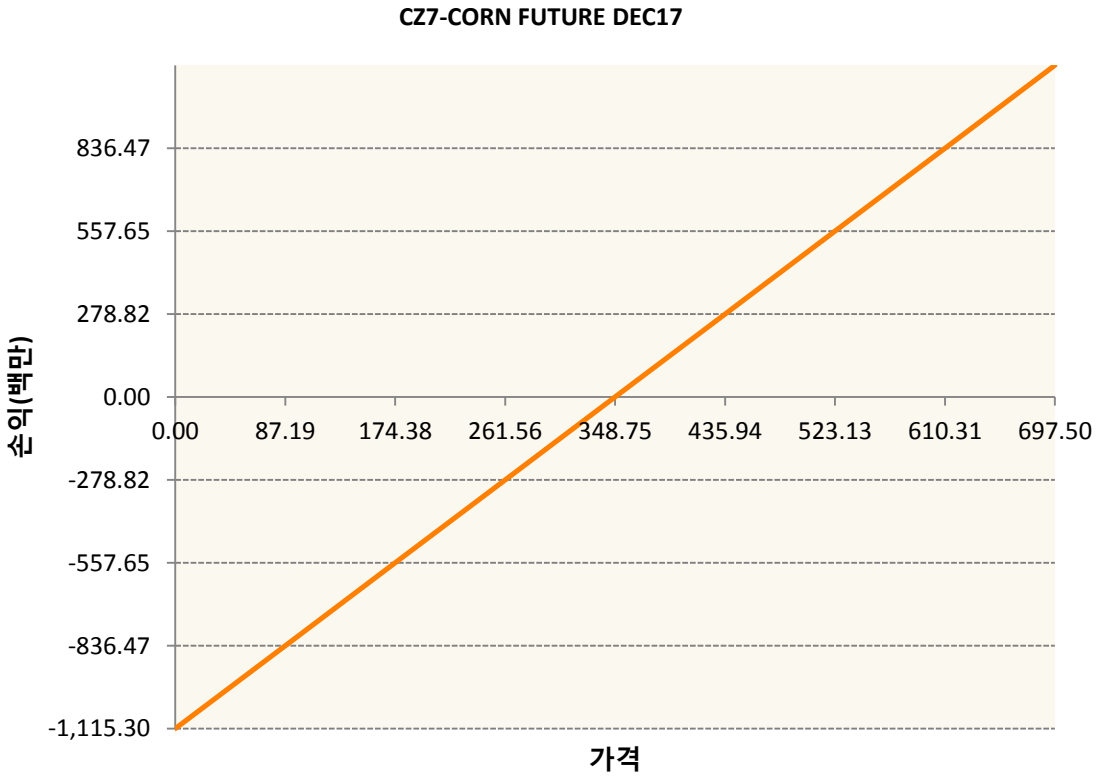
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	4,560	337	4,223	

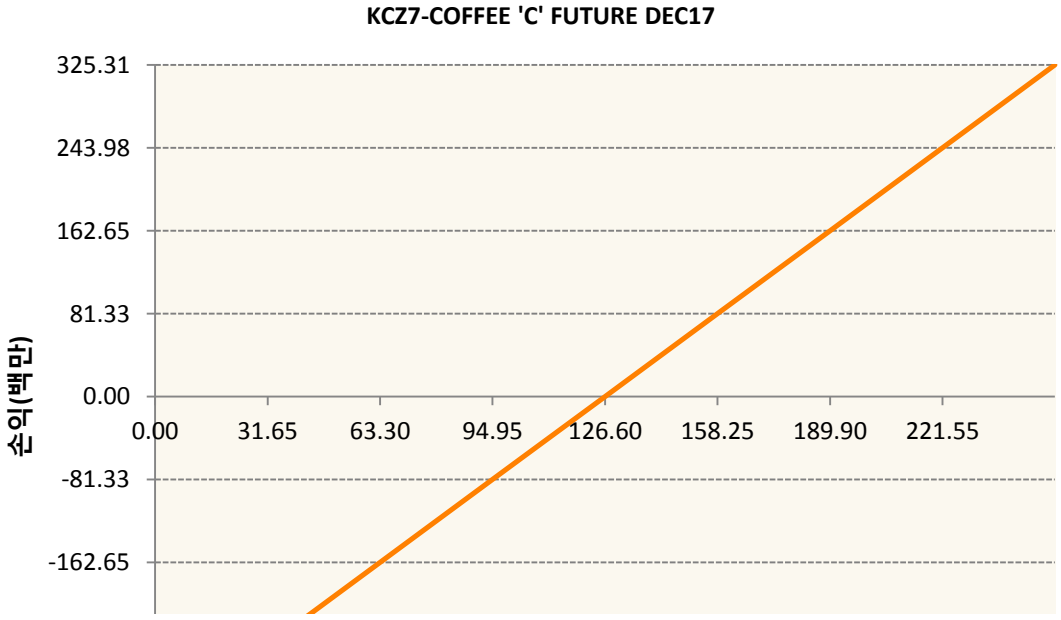
2. 만기시점의 손익구조

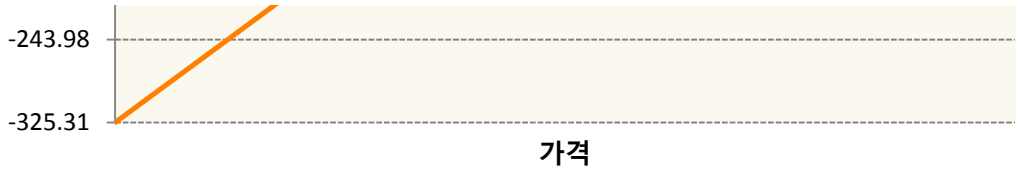


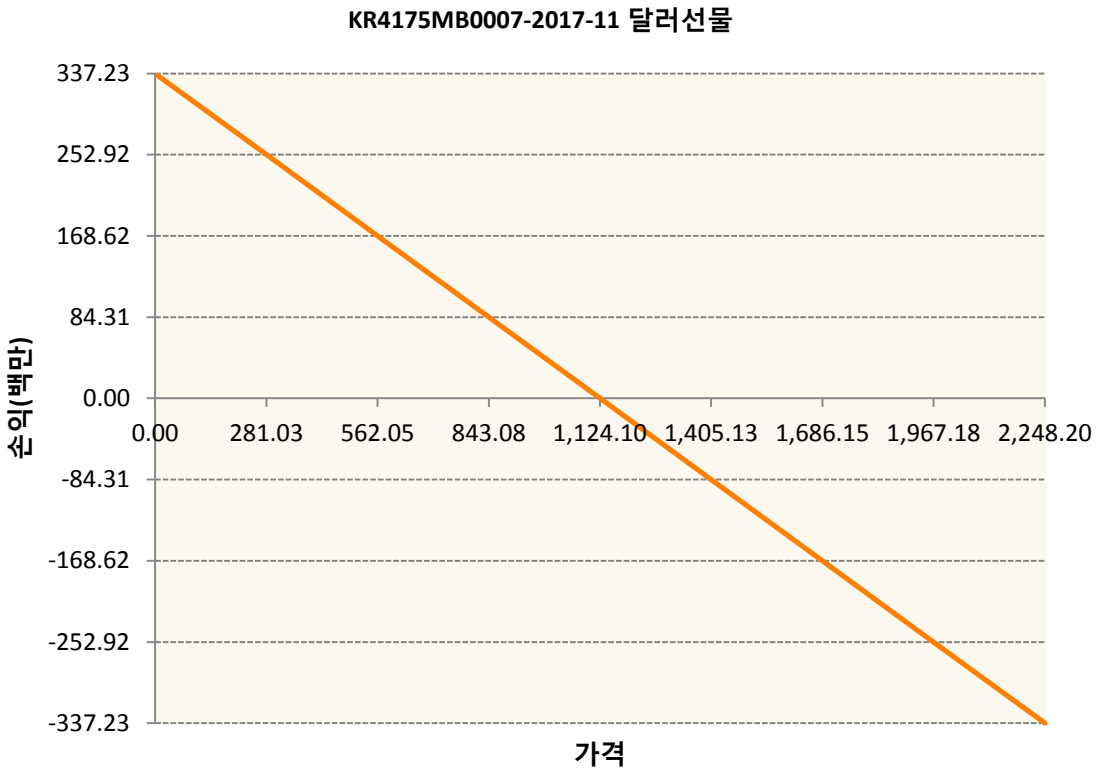


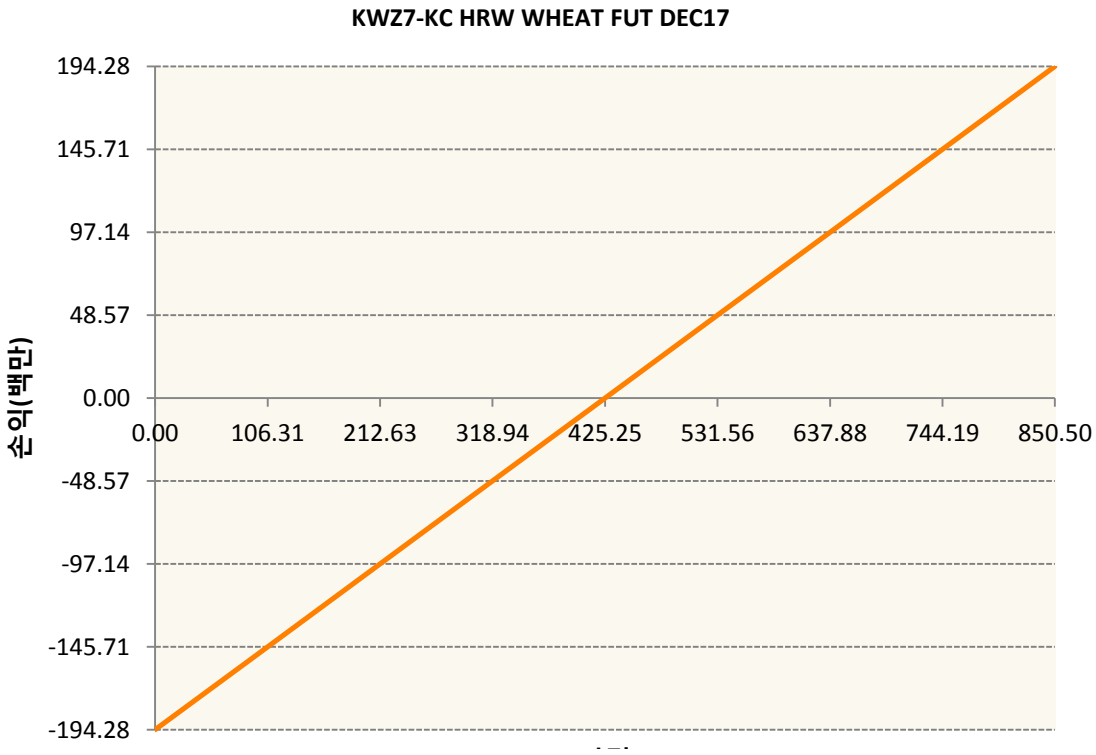

-116.66
-174.99
-233.32
가격


CZ7-CORN FUTURE DEC17
836.47
557.65
278.82
0.00
-278.82
-557.65
-836.47
-1,115.30
0.00
87.19
174.38
261.56
348.75
435.94
523.13
610.31
697.50
손익(백만)
가격

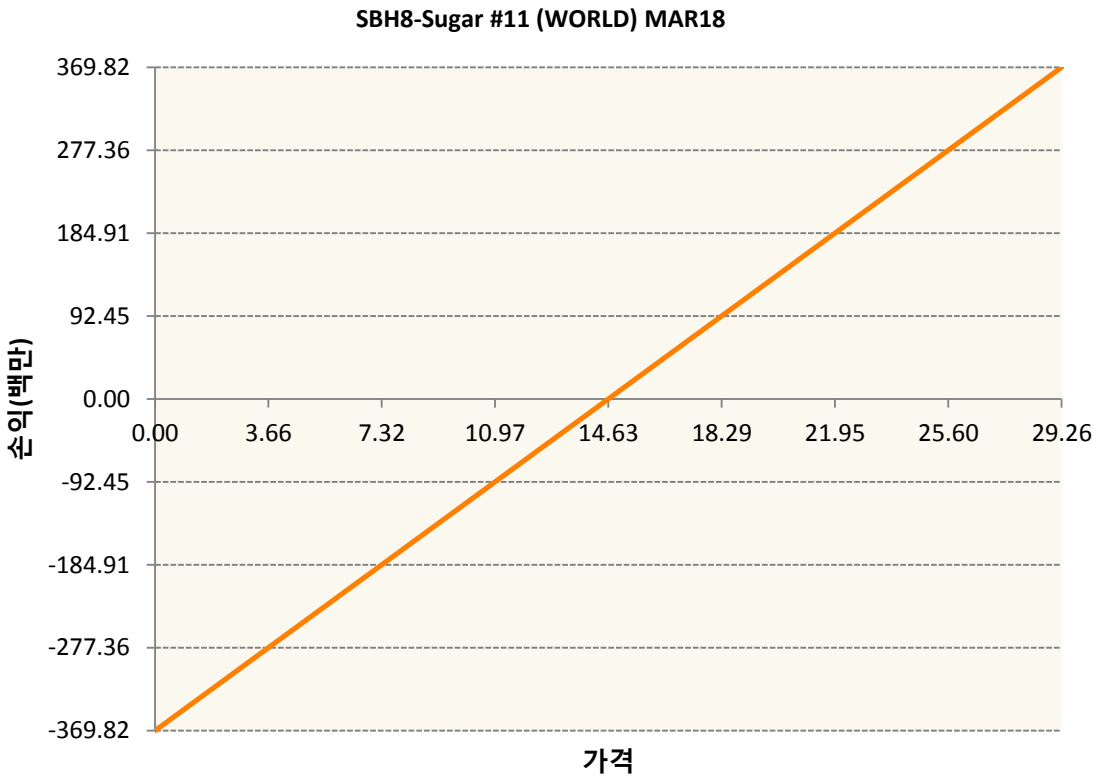

KCZ7-COFFEE 'C' FUTURE DEC17
325.31
243.98
162.65
81.33
0.00
-81.33
-162.65
0.00
31.65
63.30
94.95
126.60
158.25
189.90
221.55
손익(백만)

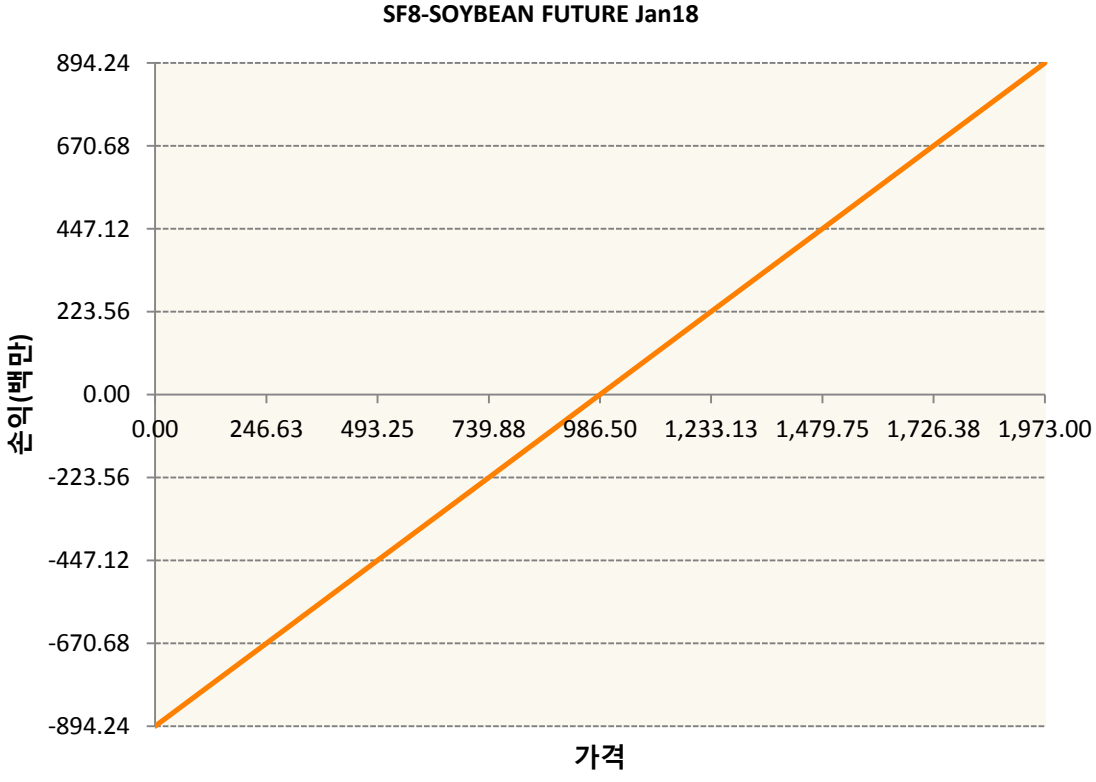

-243.98
-325.31
가격

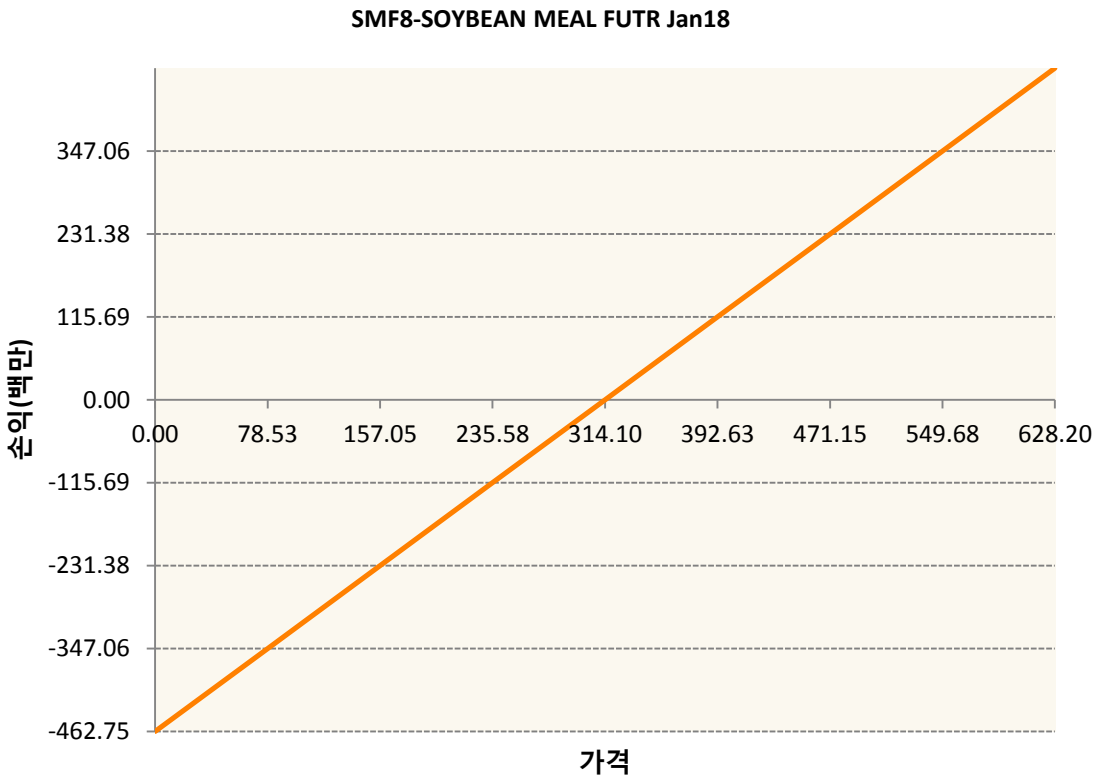

KR4175MB0007-2017-11 달러선물
337.23
252.92
168.62
84.31
0.00
-84.31
-168.62
-252.92
-337.23
0.00
281.03
562.05
843.08
1,124.10
1,405.13
1,686.15
1,967.18
2,248.20
손익(백만)
가격

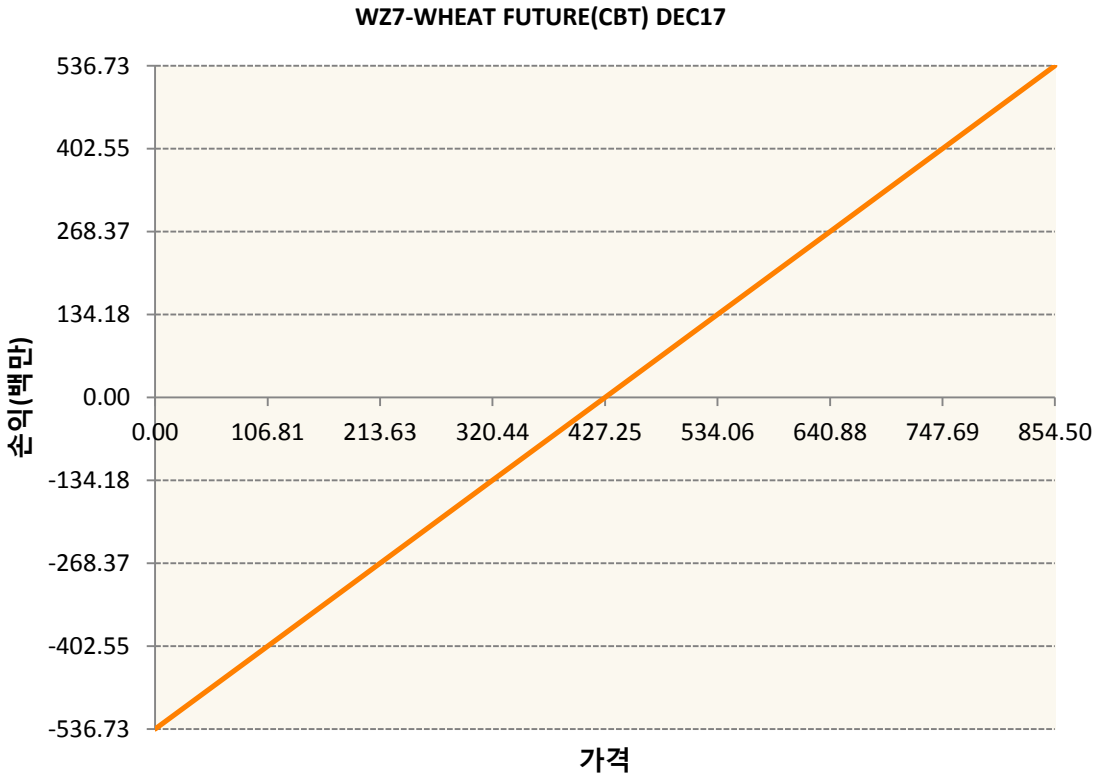

KWZ7-KC HRW WHEAT FUT DEC17
194.28
145.71
97.14
48.57
0.00
-48.57
-97.14
-145.71
-194.28
0.00
106.31
212.63
318.94
425.25
531.56
637.88
744.19
850.50
손익(백만)

가격


SBH8-Sugar #11 (WORLD) MAR18
369.82
277.36
184.91
92.45
0.00
-92.45
-184.91
-277.36
-369.82
0.00
3.66
7.32
10.97
14.63
18.29
21.95
25.60
29.26
손익(백만)
가격


SF8-SOYBEAN FUTURE Jan18
894.24
670.68
447.12
223.56
0.00
-223.56
-447.12
-670.68
-894.24
0.00
246.63
493.25
739.88
986.50
1,233.13
1,479.75
1,726.38
1,973.00
손익(백만)
가격





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

BOF8	SOYBEAN OIL FUTR Jan18	34

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	30
SF8	SOYBEAN FUTURE Jan18	72
SMF8	SOYBEAN MEAL FUTR Jan18	37
WZ7	WHEAT FUTURE(CBT) DEC17	43

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

417