공시일	2017-11-10
기준일	2017-11-09

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	2017-11-10
기준일	2017-11-09

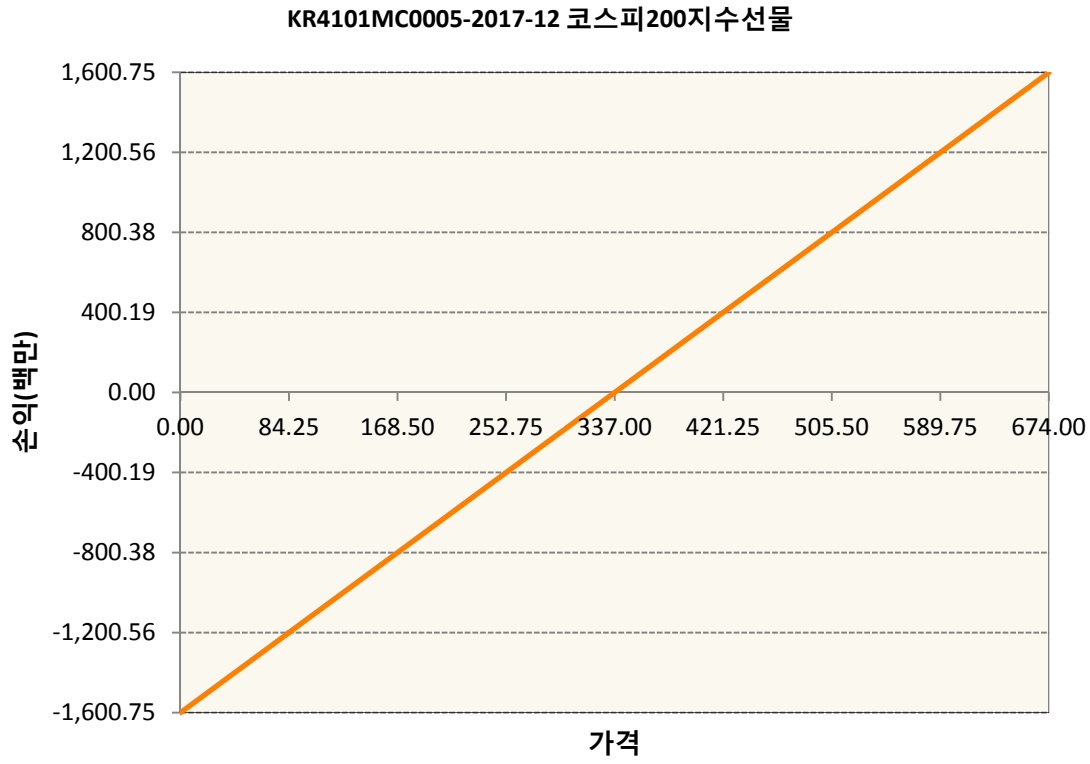
스마트인덱스모

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	1,601	0	1,601	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101MC0	2017-12 코스피200지수선물						128
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-128	-128	-128	-128	-128	-128	-128
-5.33%	-85	-85	-85	-85	-85	-85	-85
-2.67%	-43	-43	-43	-43	-43	-43	-43
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	43	43	43	43	43	43	43
5.33%	85	85	85	85	85	85	85
8.00%	128	128	128	128	128	128	128

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

77

공시일	2017-11-10
기준일	2017-11-09

SMART합성-MSCI선진국증권상장지

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	12,592	0	12,592	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWMXWO0(신한MXWO 미래S170822	1,072

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

447

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-11-10
기준일	2017-11-09

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	419

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

369

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-11-10
기준일	2017-11-09

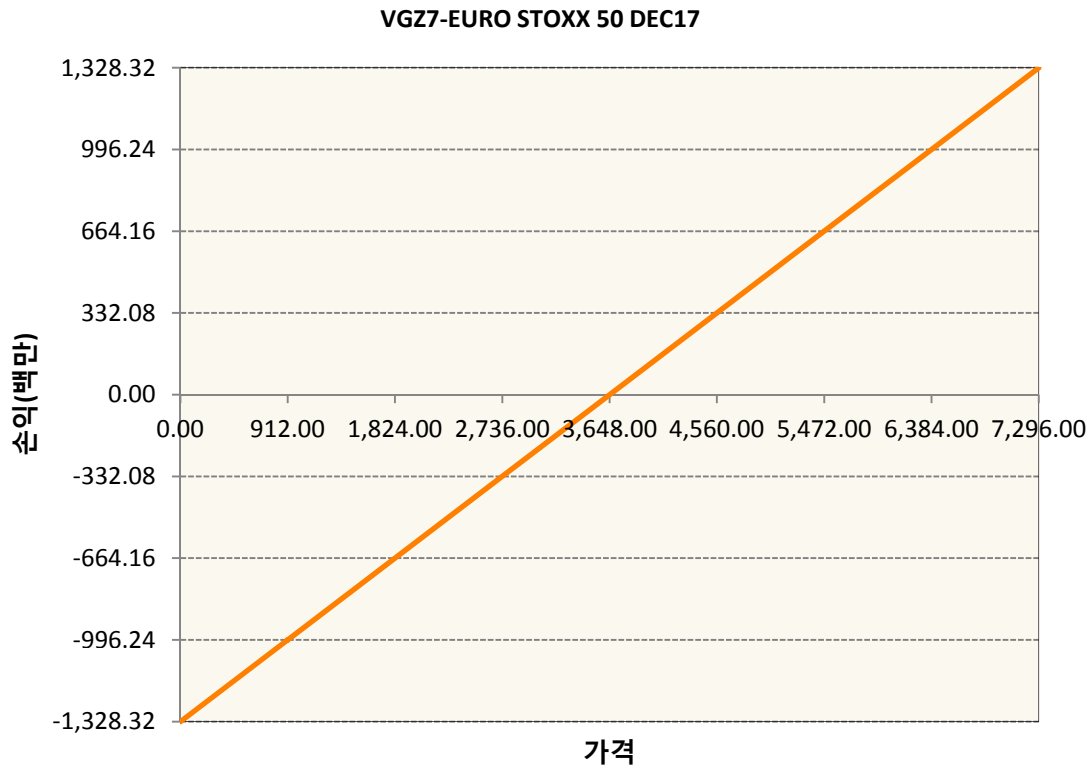
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,328	0	1,328	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGZ7	EURO STOXX 50 DEC17	106

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

(단위:백만원)

78

공시일	2017-11-10
기준일	2017-11-09

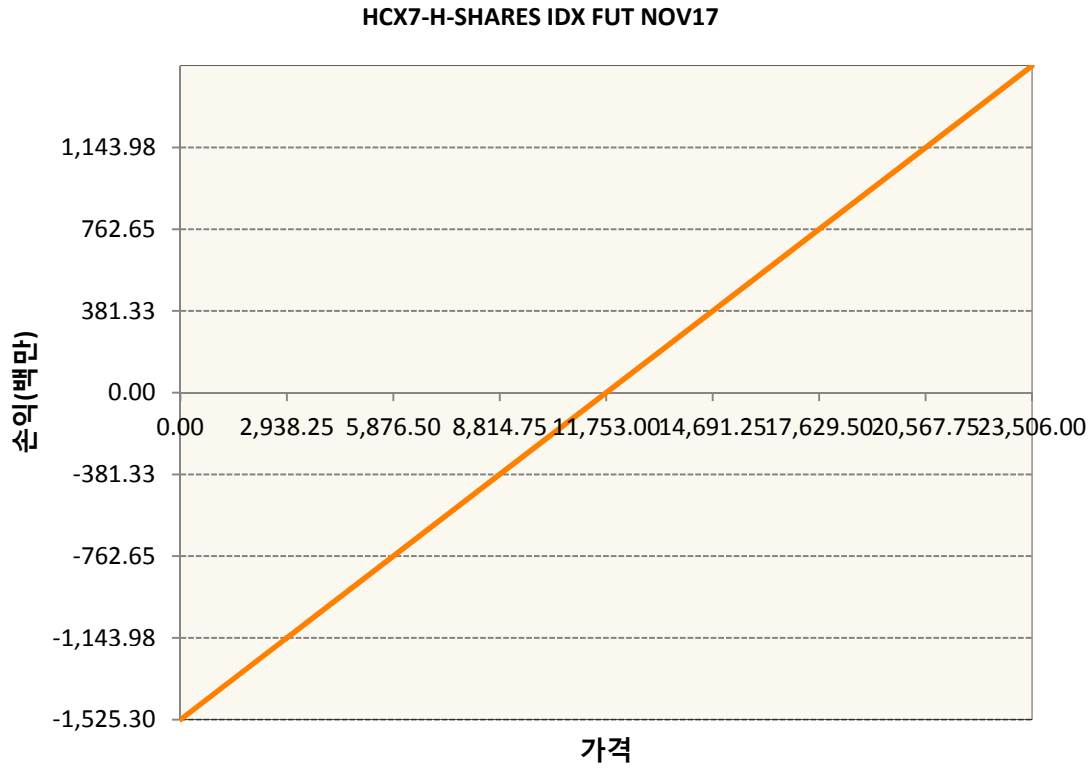
차이나인덱스모(주식-파생형)

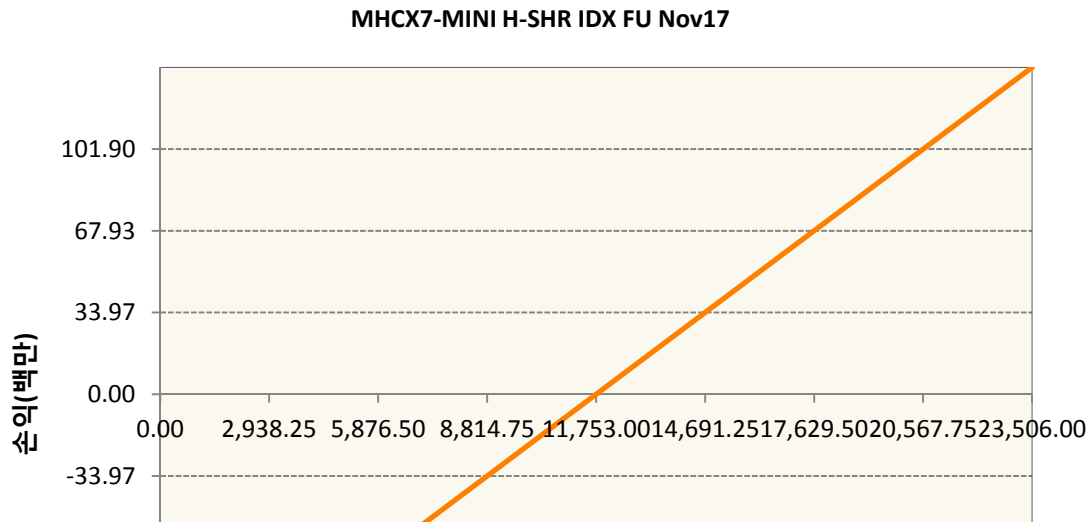
1. 계약금액

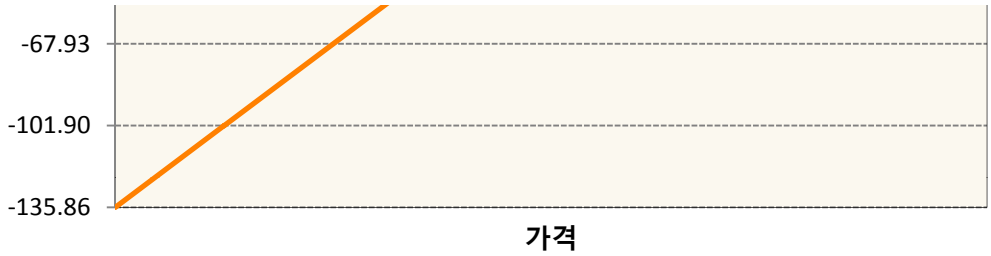
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,661	0	1,661	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCX7	H-SHARES IDX FUT NOV17	122
MHCX7	MINI H-SHR IDX FU Nov17	11

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	107

공시일	2017-11-10
기준일	2017-11-09

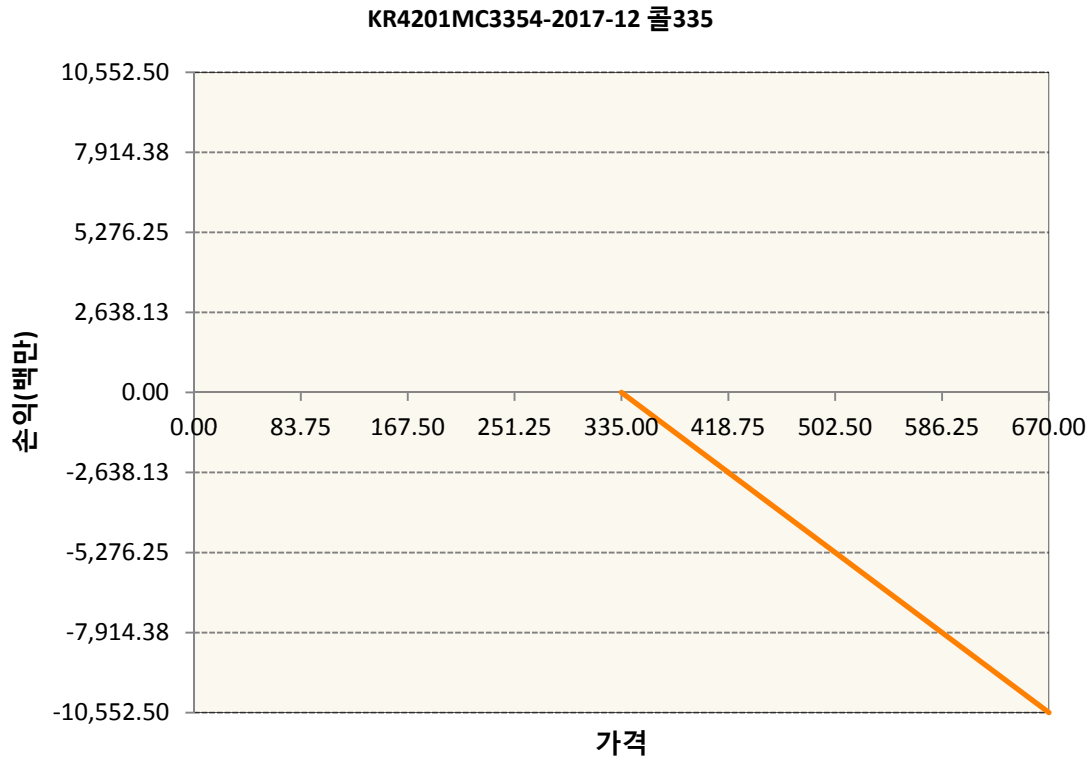
커버드콜모(주식혼합-파생형)

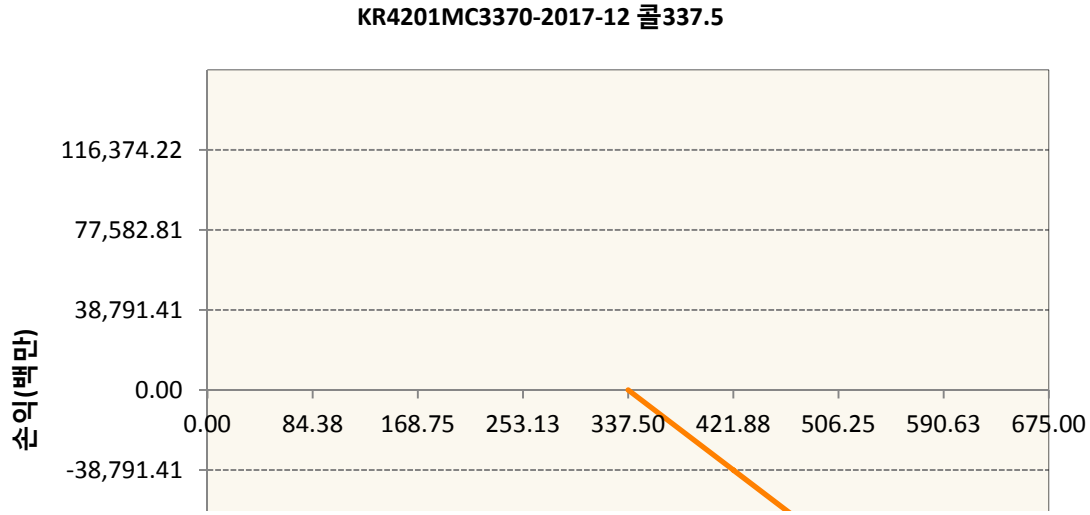
1. 계약금액

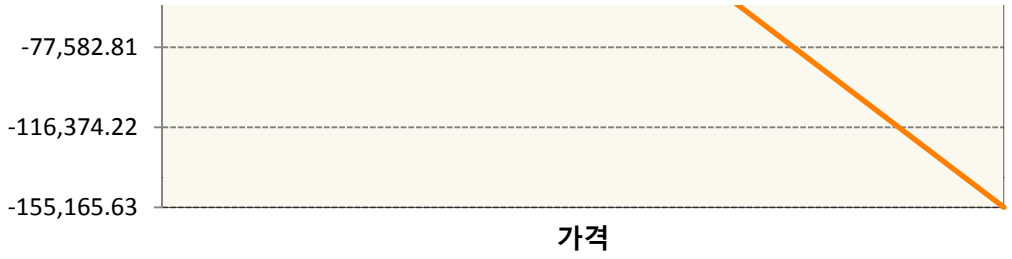
(단위:백만원)

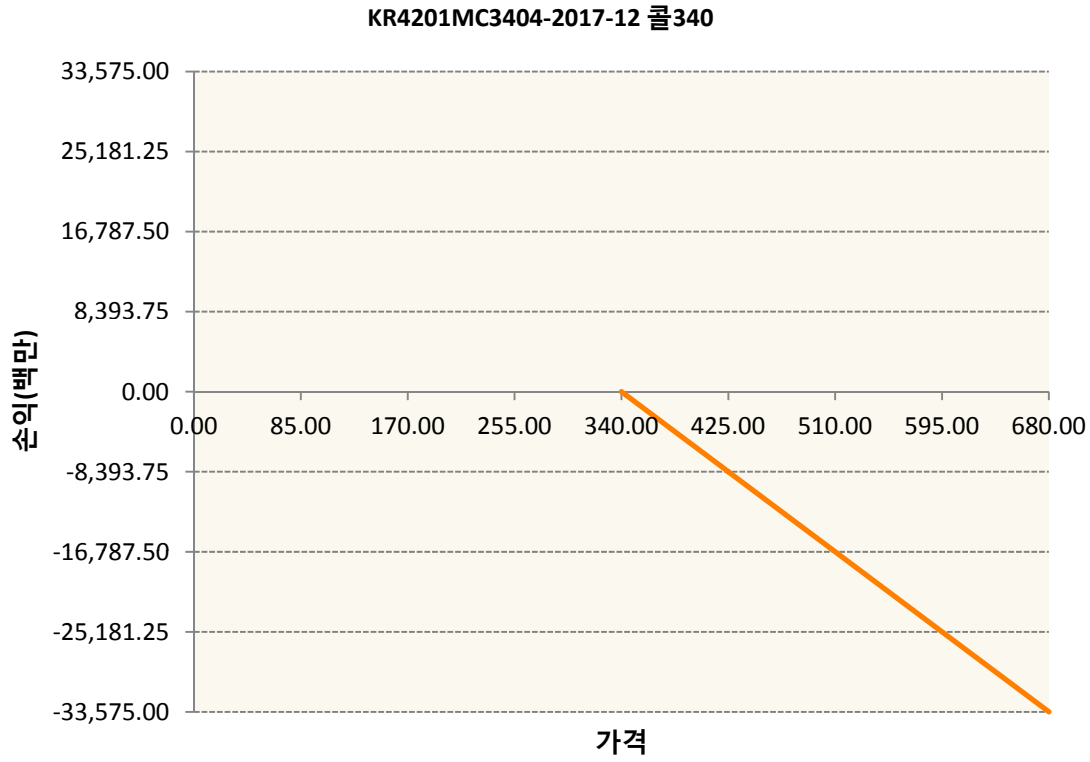
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	133,603	-133,603	장내
누계	유가증권	옵션	0	199,293	-199,293	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201MC3. 2017-12 콜335							670
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	337	325	311	296	280	262	244
-5.33%	294	275	255	233	211	189	166
-2.67%	213	187	162	136	110	84	58
0%	81	54	27	0	-27	-54	-81
2.67%	-102	-125	-150	-174	-200	-225	-251
5.33%	-326	-343	-362	-383	-404	-426	-449
8.00%	-579	-590	-603	-618	-634	-652	-670
KR4201MC3. 2017-12 콜337.5							9,461
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	4,429	4,282	4,107	3,908	3,689	3,451	3,199

-5.33%	3,925	3,671	3,396	3,105	2,801	2,487	2,164
-2.67%	2,904	2,552	2,192	1,828	1,459	1,088	714
0%	1,189	793	396	0	-396	-793	-1,189
2.67%	-1,273	-1,640	-2,014	-2,392	-2,774	-3,158	-3,544
5.33%	-4,389	-4,674	-4,979	-5,298	-5,630	-5,971	-6,320
8.00%	-7,979	-8,167	-8,384	-8,626	-8,888	-9,167	-9,461
KR4201MC3 2017-12 콜340							1,959

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	852	826	793	755	712	665	615
-5.33%	765	716	663	605	544	480	414
-2.67%	580	508	435	360	283	205	127
0%	255	170	85	0	-85	-170	-255
2.67%	-230	-313	-396	-480	-565	-649	-734
5.33%	-863	-930	-1,001	-1,075	-1,150	-1,227	-1,306
8.00%	-1,608	-1,655	-1,708	-1,765	-1,827	-1,891	-1,959

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

11,315

공시일	2017-11-10
기준일	2017-11-09

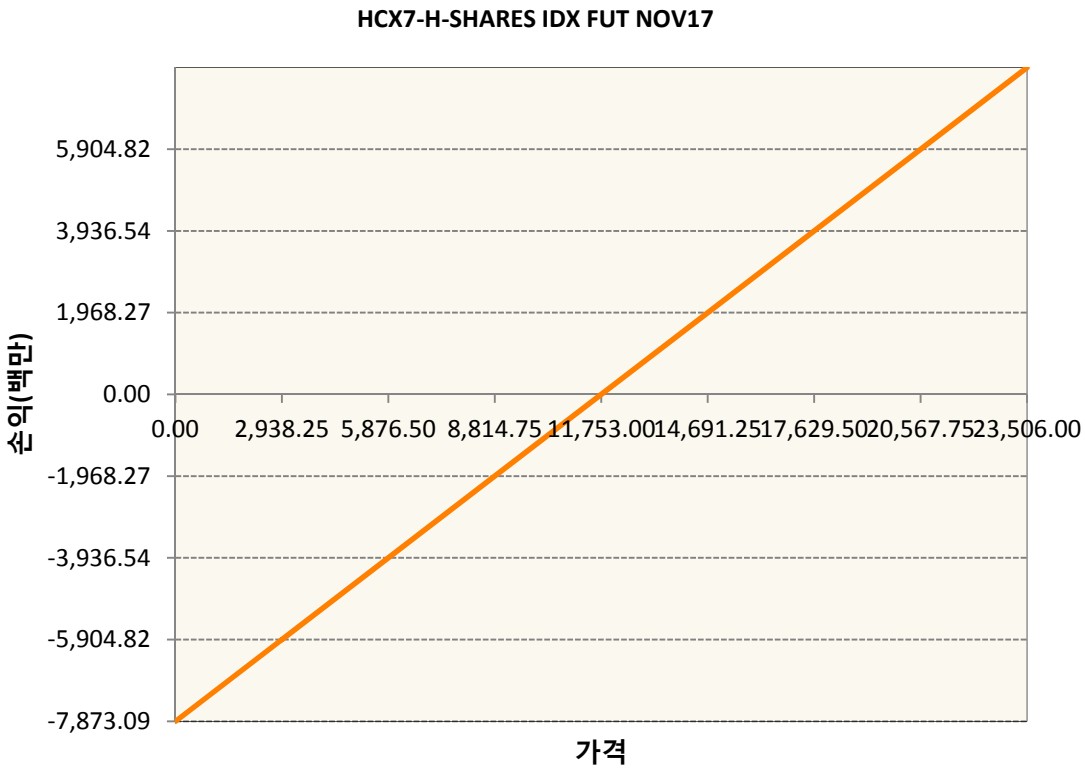
홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생

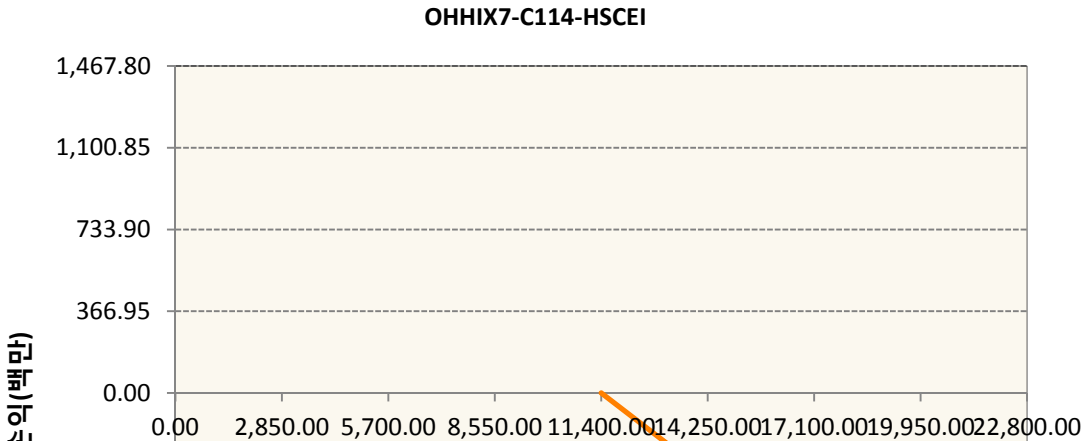
1. 계약금액

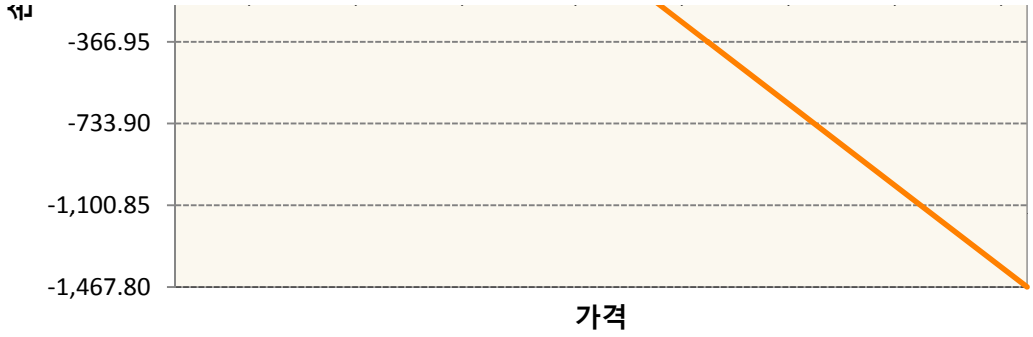
(단위:백만원)

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	7,873	0	7,873	장내
누계	유가증권	옵션	0	16,709	-16,709	장내

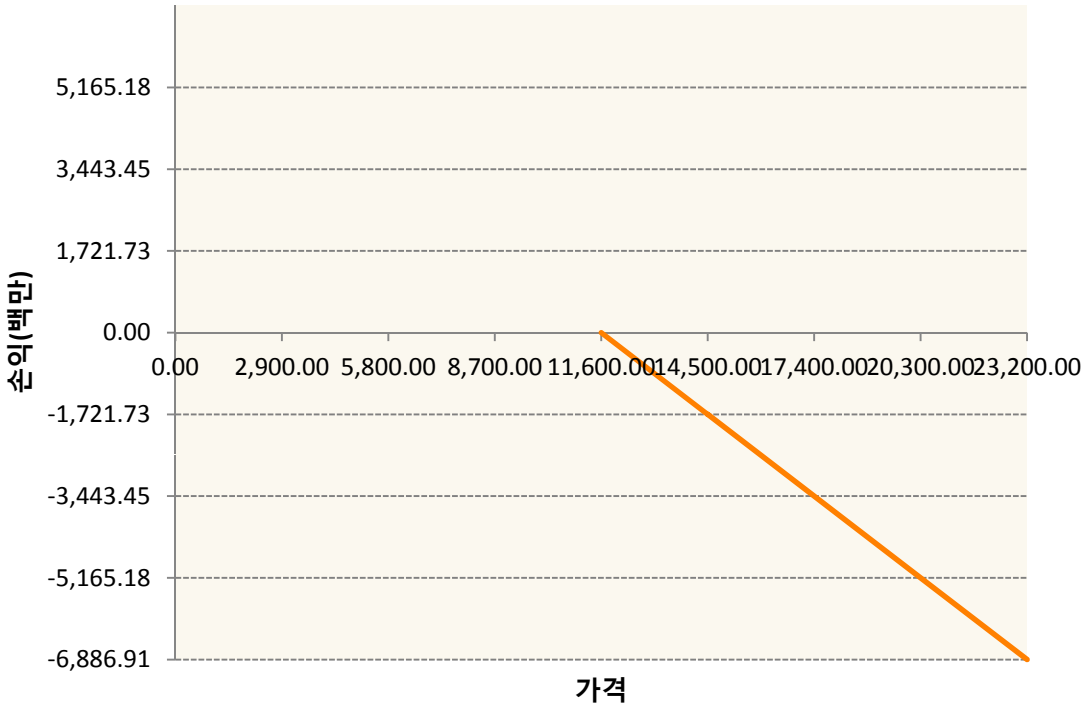
2. 만기시점의 손익구조



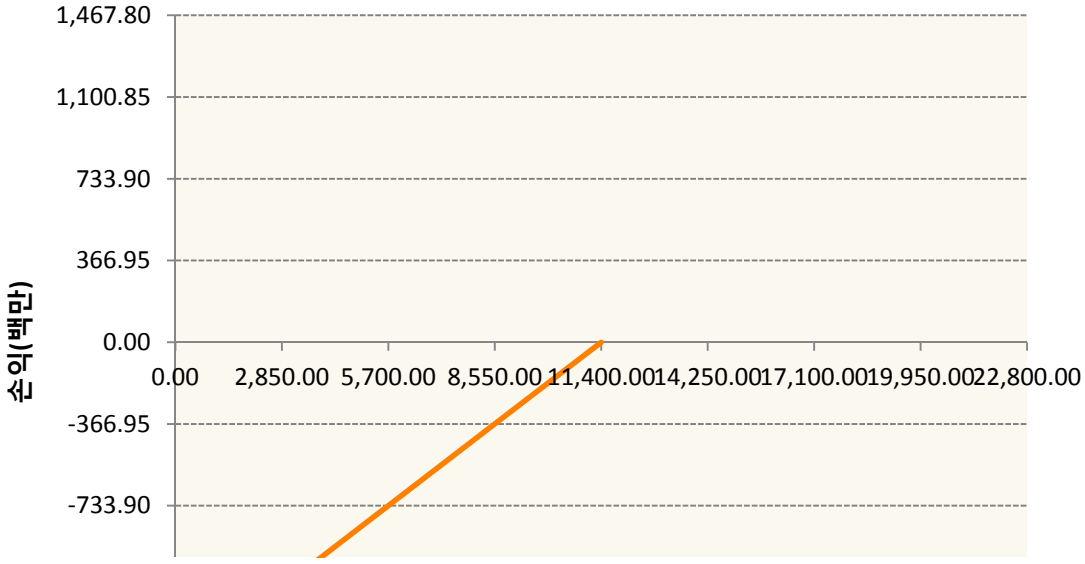


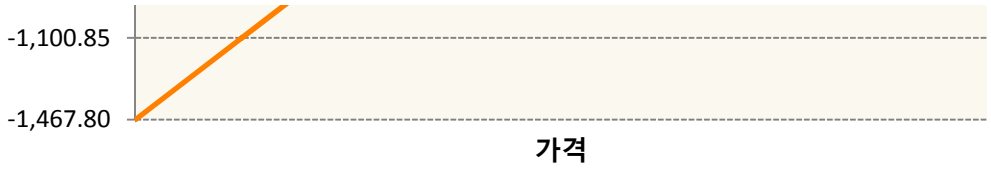


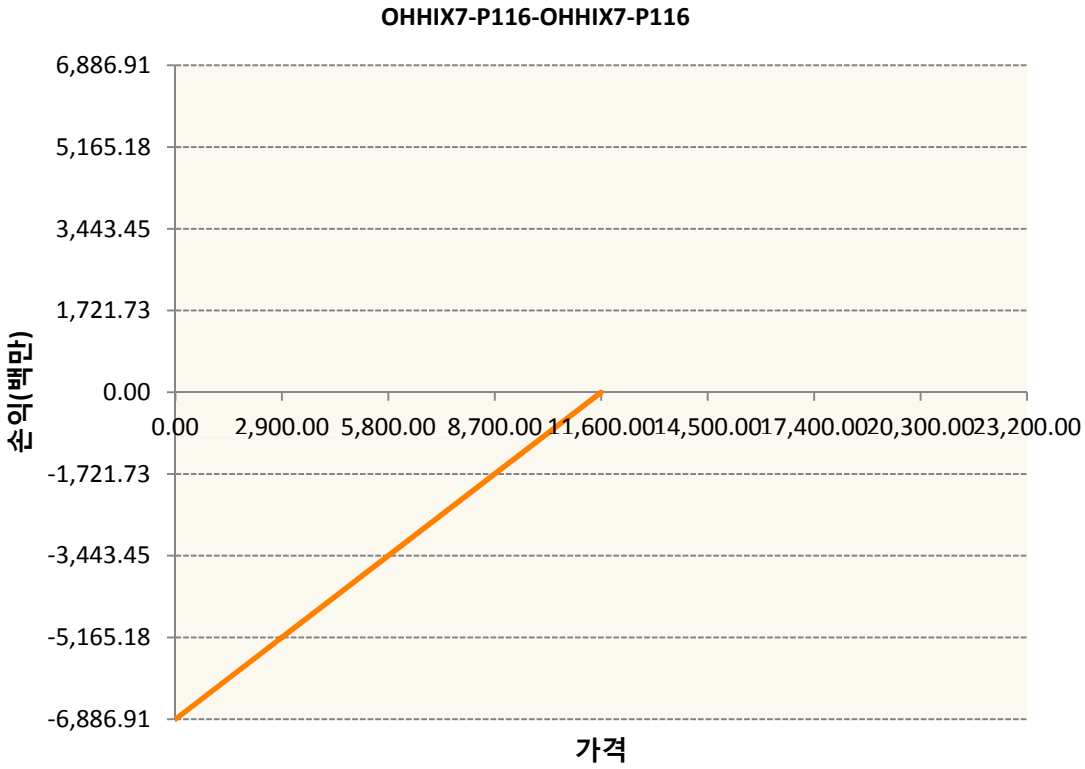
OHHIX7-C116-OHHIX7-C116



OHHIX7-P114-HSCEI







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCX7	H-SHARES IDX FUT NOV17	630
OHHIX7-C11	HSCEI	117
OHHIX7-C11	OHHIX7-C116	551
OHHIX7-P11	HSCEI	117
OHHIX7-P11	OHHIX7-P116	551

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,587

공시일	2017-11-10
기준일	2017-11-09

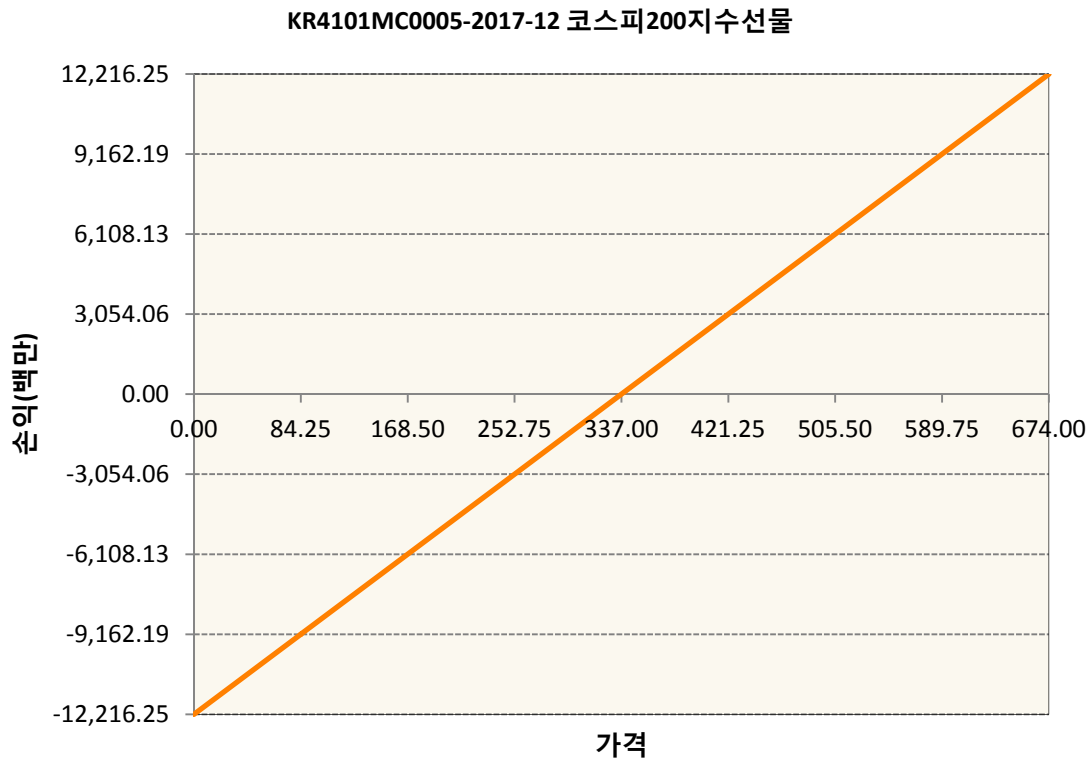
코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	3,500	0	3,500	장외
누계	유가증권	선물	12,216	0	12,216	장내
누계	유가증권	스왑	46,200	0	46,200	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_2							1,489
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,489	-1,489	-1,489	-1,489	-1,489	-1,489	-1,489
-5.33%	-992	-992	-992	-992	-992	-992	-992
-2.67%	-496	-496	-496	-496	-496	-496	-496
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	496	496	496	496	496	496	496

5.33%	992	992	992	992	992	992	992
8.00%	1,489	1,489	1,489	1,489	1,489	1,489	1,489
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_3						282
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-282	-282	-282	-282	-282	-282	-282
-5.33%	-188	-188	-188	-188	-188	-188	-188
-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%	188	188	188	188	188	188	188
8.00%	282	282	282	282	282	282	282
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_4						161
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-161	-161	-161	-161	-161	-161	-161
-5.33%	-107	-107	-107	-107	-107	-107	-107
-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%	107	107	107	107	107	107	107
8.00%	161	161	161	161	161	161	161
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_5						241
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-241	-241	-241	-241	-241	-241	-241
-5.33%	-161	-161	-161	-161	-161	-161	-161
-2.67%	-80	-80	-80	-80	-80	-80	-80
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	80	80	80	80	80	80	80
5.33%	161	161	161	161	161	161	161
8.00%	241	241	241	241	241	241	241
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_6						201
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-201	-201	-201	-201	-201	-201	-201
-5.33%	-134	-134	-134	-134	-134	-134	-134
-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%	134	134	134	134	134	134	134
8.00%	201	201	201	201	201	201	201
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_7						257
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-257	-257	-257	-257	-257	-257	-257
-5.33%	-172	-172	-172	-172	-172	-172	-172
-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%	172	172	172	172	172	172	172
8.00%	257	257	257	257	257	257	257
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_8						476
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-476	-476	-476	-476	-476	-476	-476
-5.33%	-317	-317	-317	-317	-317	-317	-317
-2.67%	-159	-159	-159	-159	-159	-159	-159
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	159	159	159	159	159	159	159
5.33%	317	317	317	317	317	317	317
8.00%	476	476	476	476	476	476	476
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_9						317
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-317	-317	-317	-317	-317	-317	-317
-5.33%	-212	-212	-212	-212	-212	-212	-212
-2.67%	-106	-106	-106	-106	-106	-106	-106
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	106	106	106	106	106	106	106
5.33%	212	212	212	212	212	212	212
8.00%	317	317	317	317	317	317	317
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_10						282
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-282	-282	-282	-282	-282	-282	-282
-5.33%	-188	-188	-188	-188	-188	-188	-188
-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%	188	188	188	188	188	188	188
8.00%	282	282	282	282	282	282	282
	KR4101MC0	2017-12 코스피200지수선물					978
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-978	-978	-978	-978	-978	-978	-978
-5.33%	-652	-652	-652	-652	-652	-652	-652
-2.67%	-326	-326	-326	-326	-326	-326	-326

0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	326	326	326	326	326	326	326
5.33%	652	652	652	652	652	652	652
8.00%	978	978	978	978	978	978	978

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

4,296

공시일	2017-11-10
기준일	2017-11-09

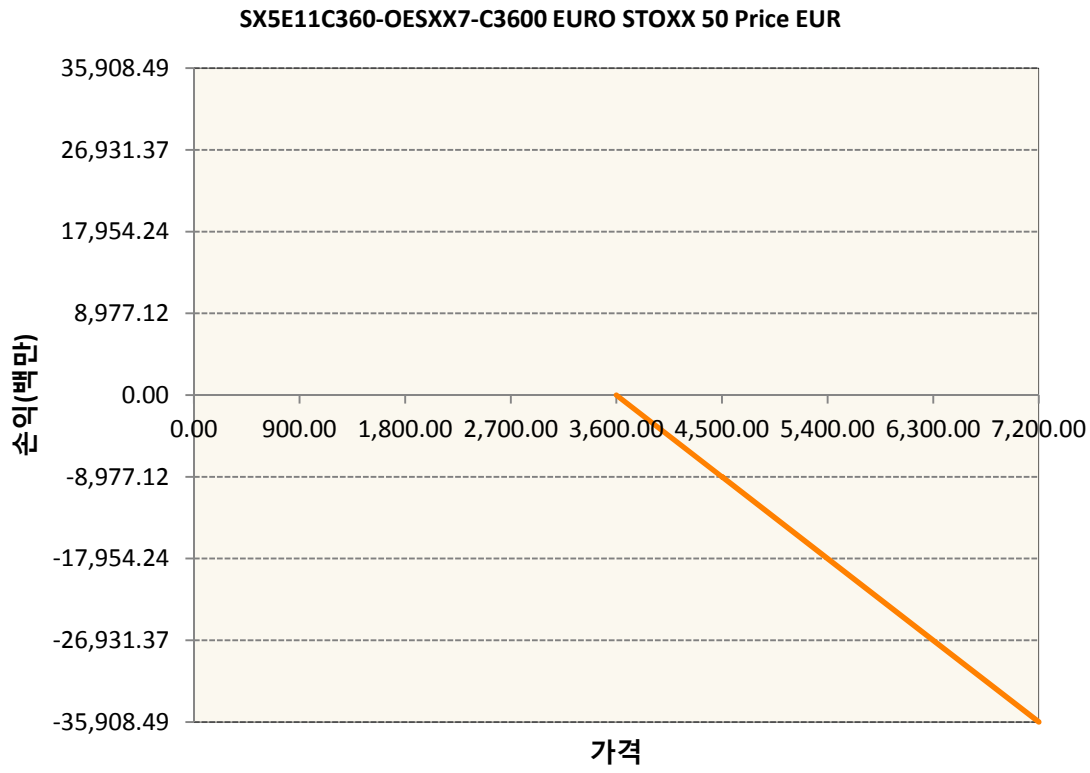
유로커버드콜모(주식혼합-파생형

1. 계약금액

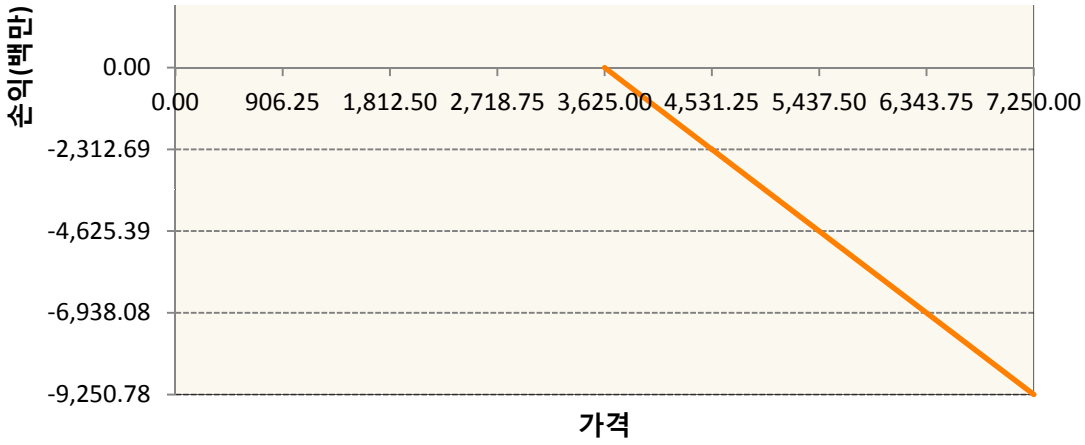
(단위:백만원)

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	ELS	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	38,741	0	38,741	
누계	유가증권	옵션	0	90,319	-90,319	장내
누계	유가증권	ELS	97,153	0	97,153	장외

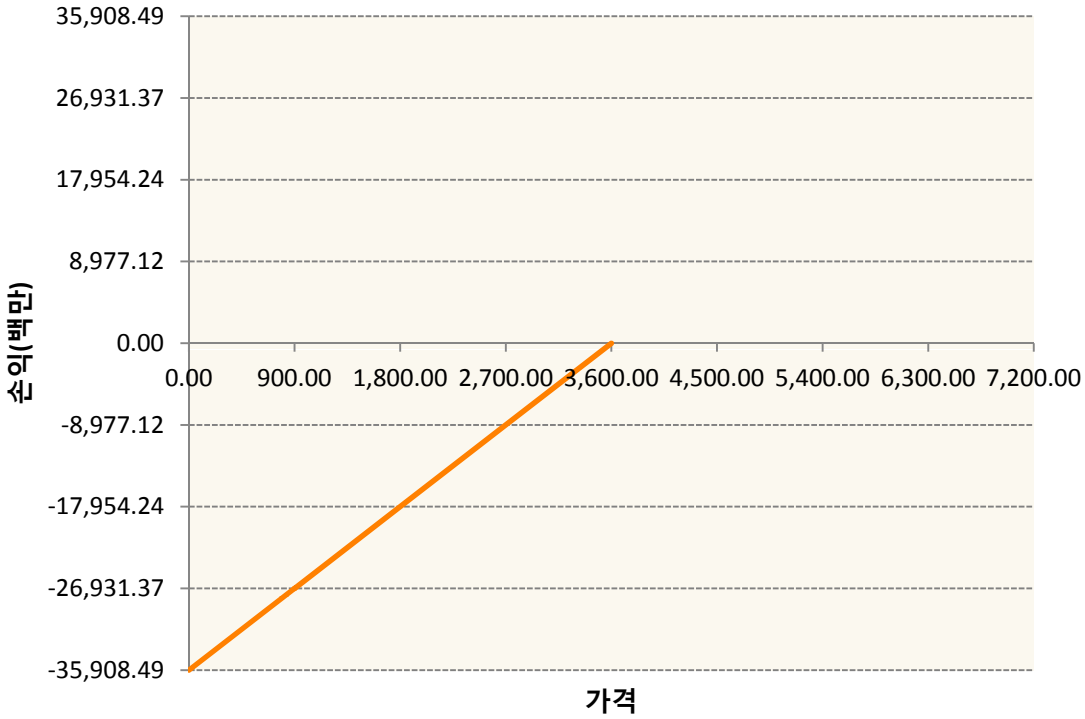
2. 만기시점의 손익구조



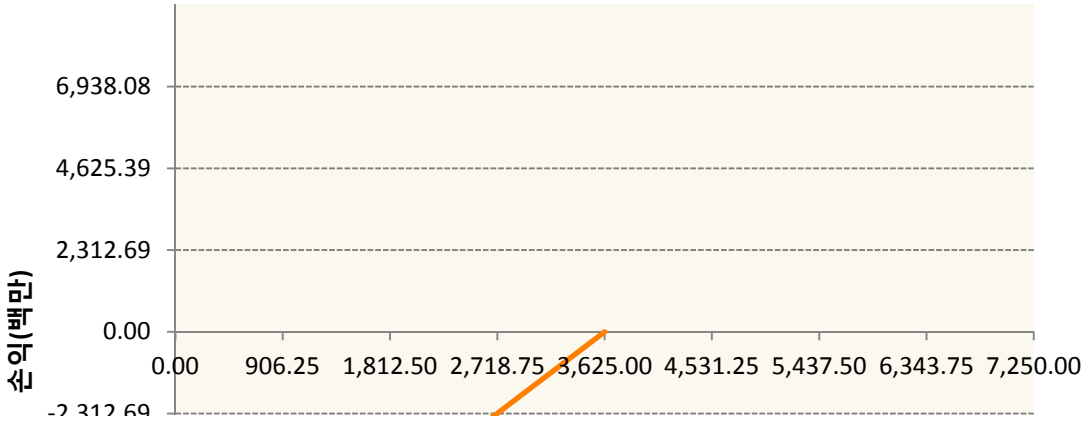


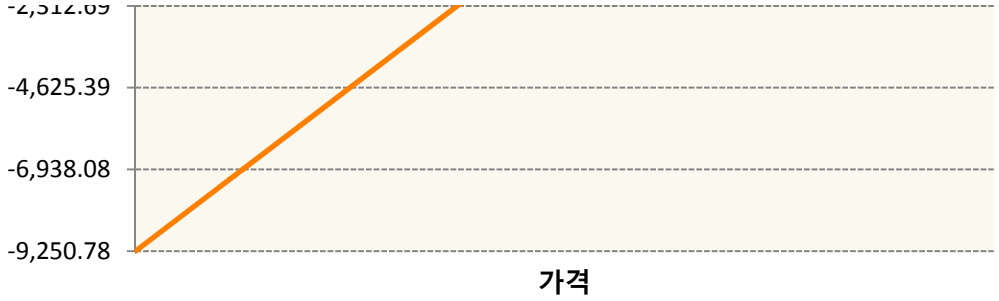


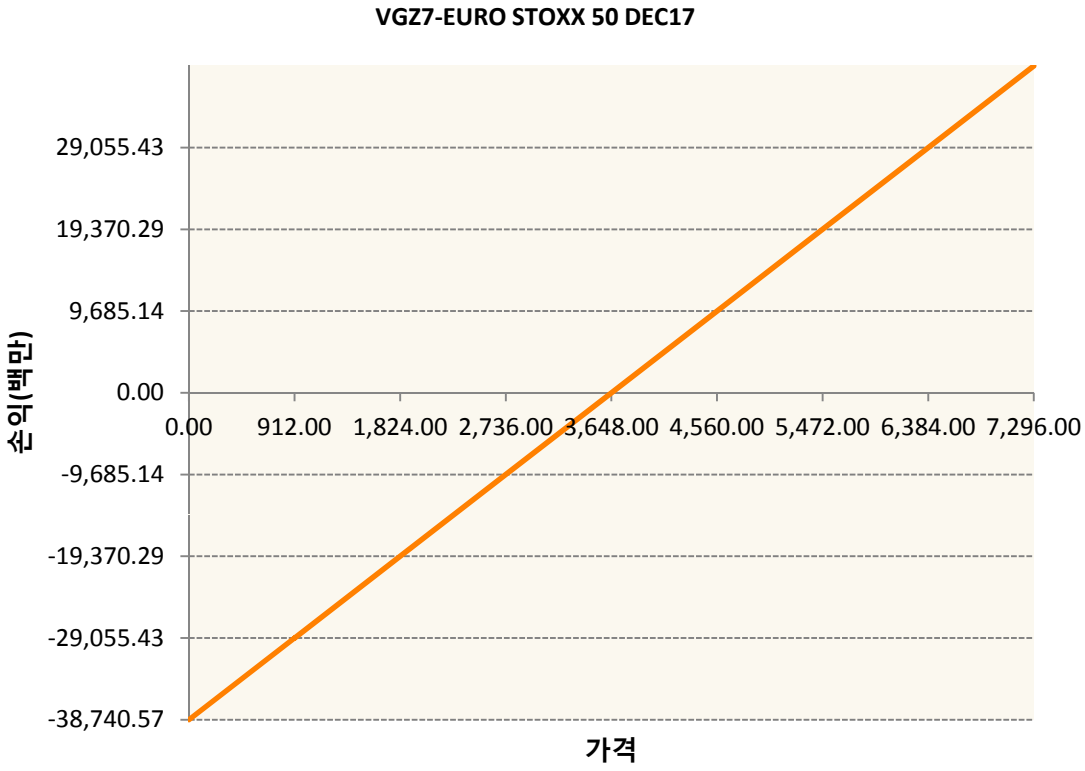
SX5E11P360-OESXX7-P3600 EURO STOXX 50 Price EUR



SX5E11P362-OESXX7-P3625 EURO STOXX 50 Price EUR







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

260105SQPX	SG EURO Covered CALL STRATEGY	64
SX5E11C360	OESXX7-C3600 EURO STOXX 50 Price EUR	2,873
SX5E11C362	OESXX7-C3625 EURO STOXX 50 Price EUR	740
SX5E11P360	OESXX7-P3600 EURO STOXX 50 Price EUR	2,873
SX5E11P362	OESXX7-P3625 EURO STOXX 50 Price EUR	740
VGZ7	EURO STOXX 50 DEC17	3,099

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

7,604

공시일	2017-11-10
기준일	2017-11-09

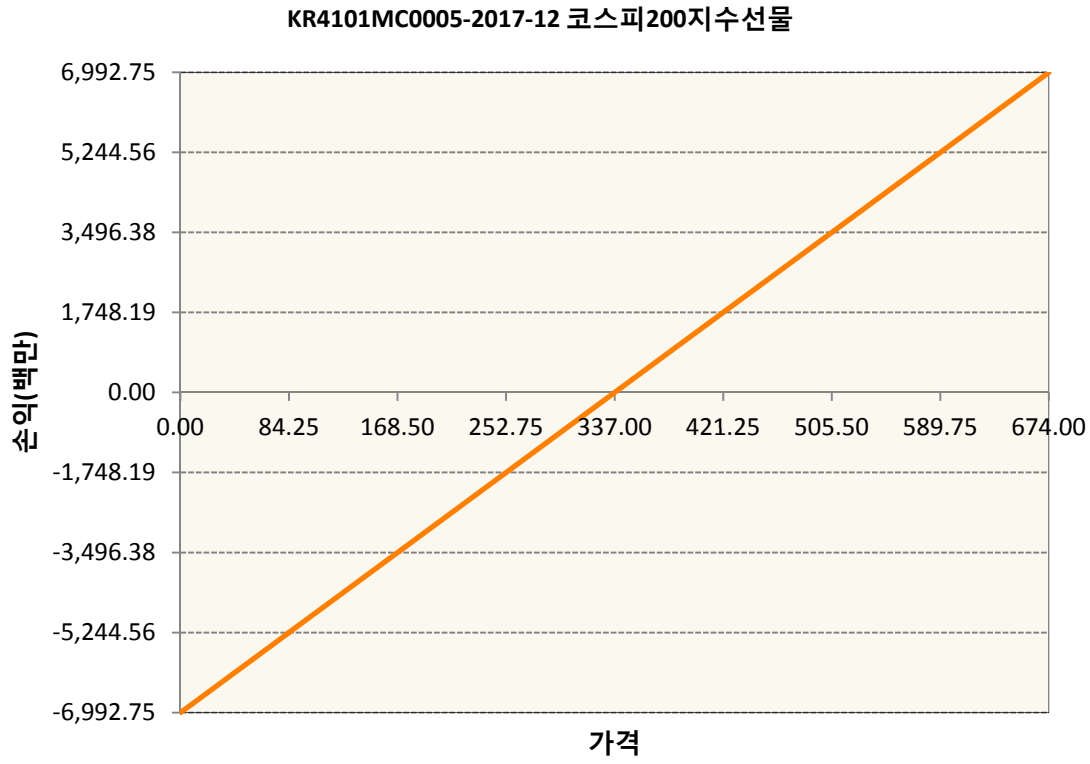
ETF스마트레버리지목표전환형8호

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	6,993	0	6,993	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101MC0	2017-12 코스피200지수선물	560

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-560	-560	-560	-560	-560	-560	-560
-5.33%	-373	-373	-373	-373	-373	-373	-373
-2.67%	-187	-187	-187	-187	-187	-187	-187
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	187	187	187	187	187	187	187
5.33%	373	373	373	373	373	373	373
8.00%	560	560	560	560	560	560	560

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

337

공시일	2017-11-10
기준일	2017-11-09

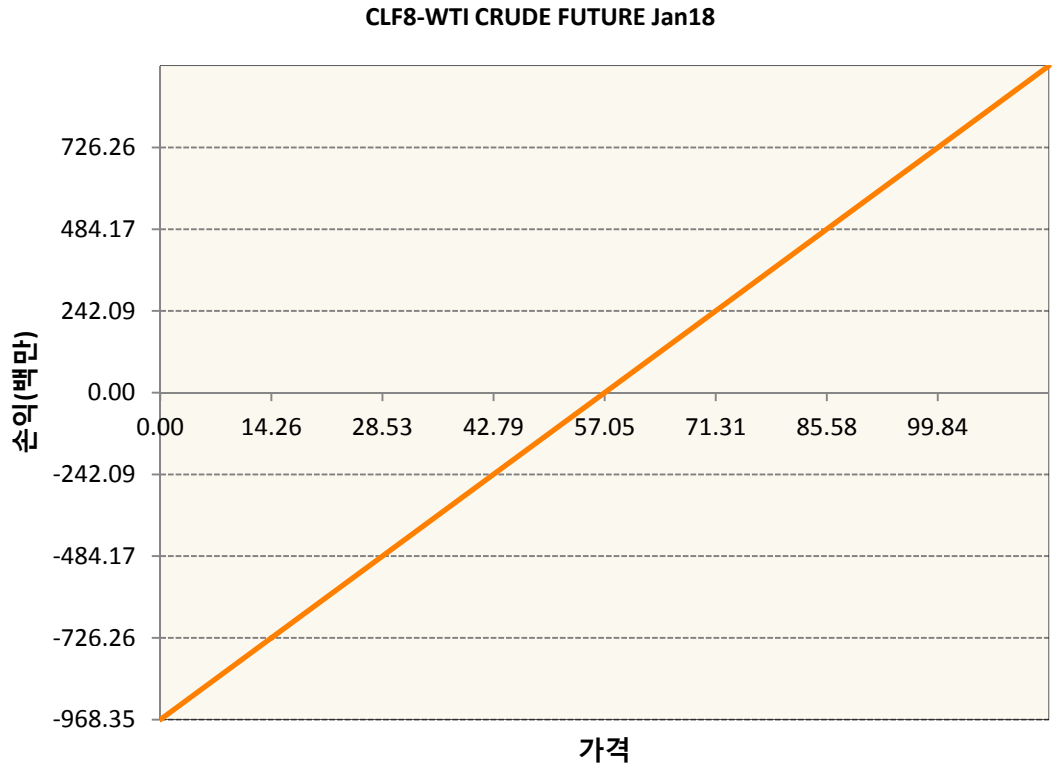
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

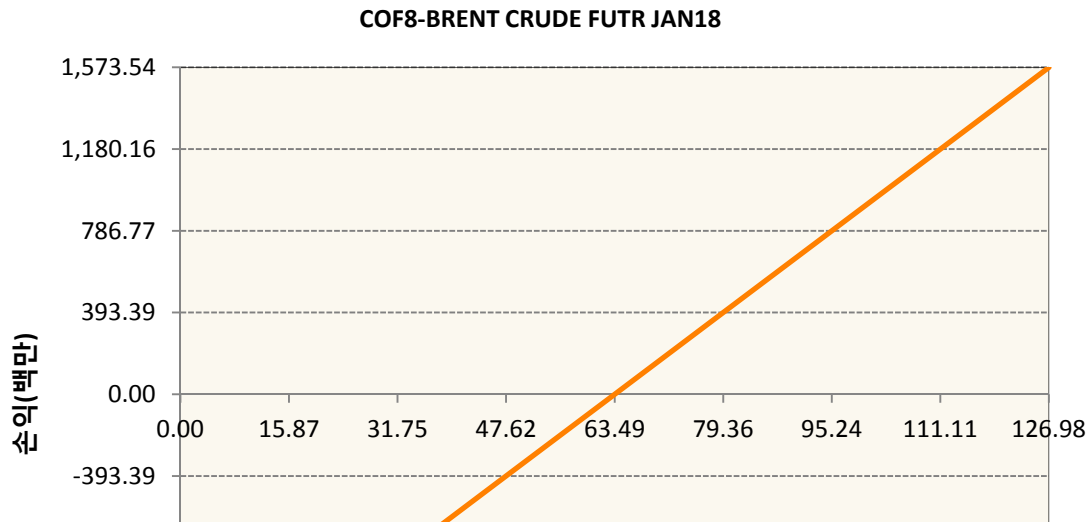
1. 계약금액

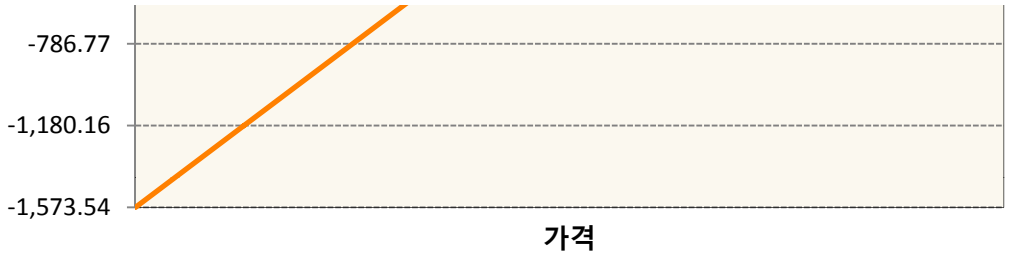
(단위:백만원)

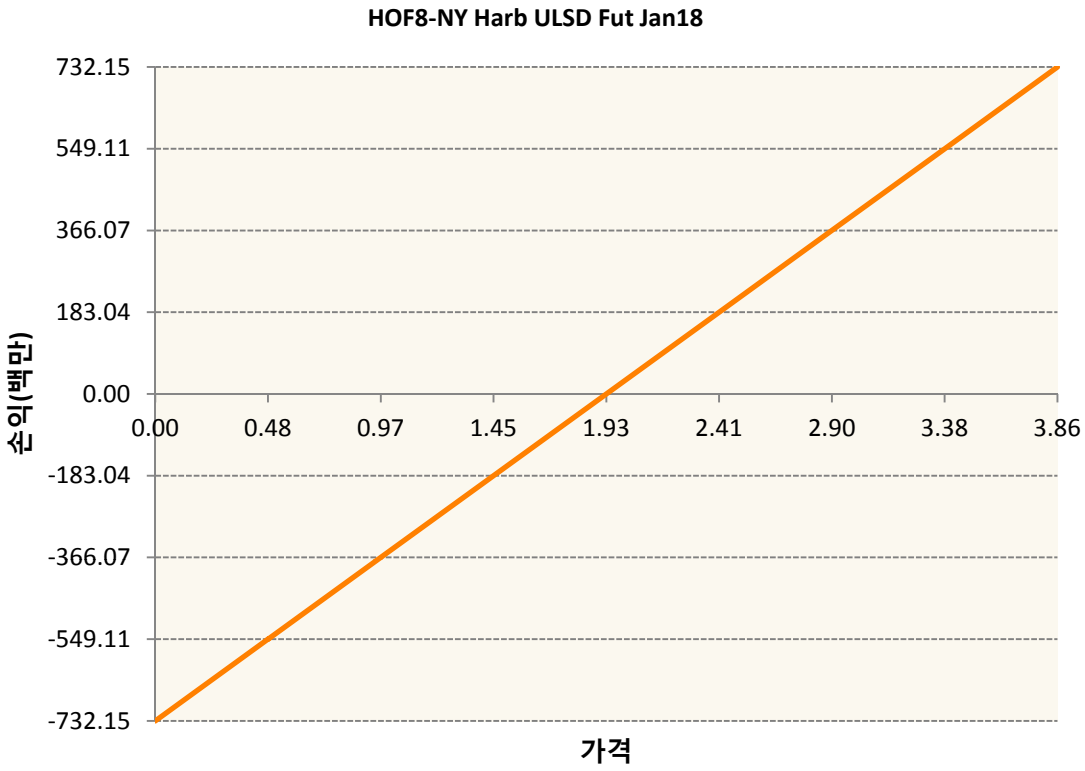
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	5,451	892	4,559	

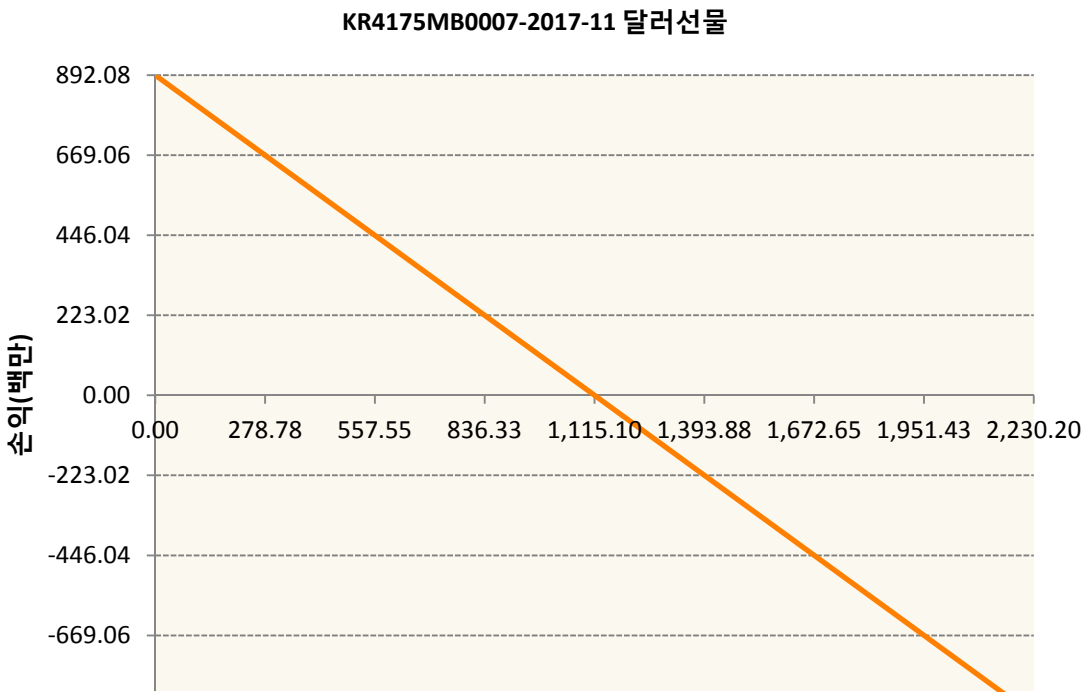
2. 만기시점의 손익구조

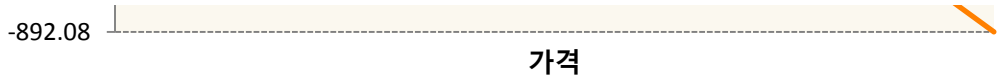


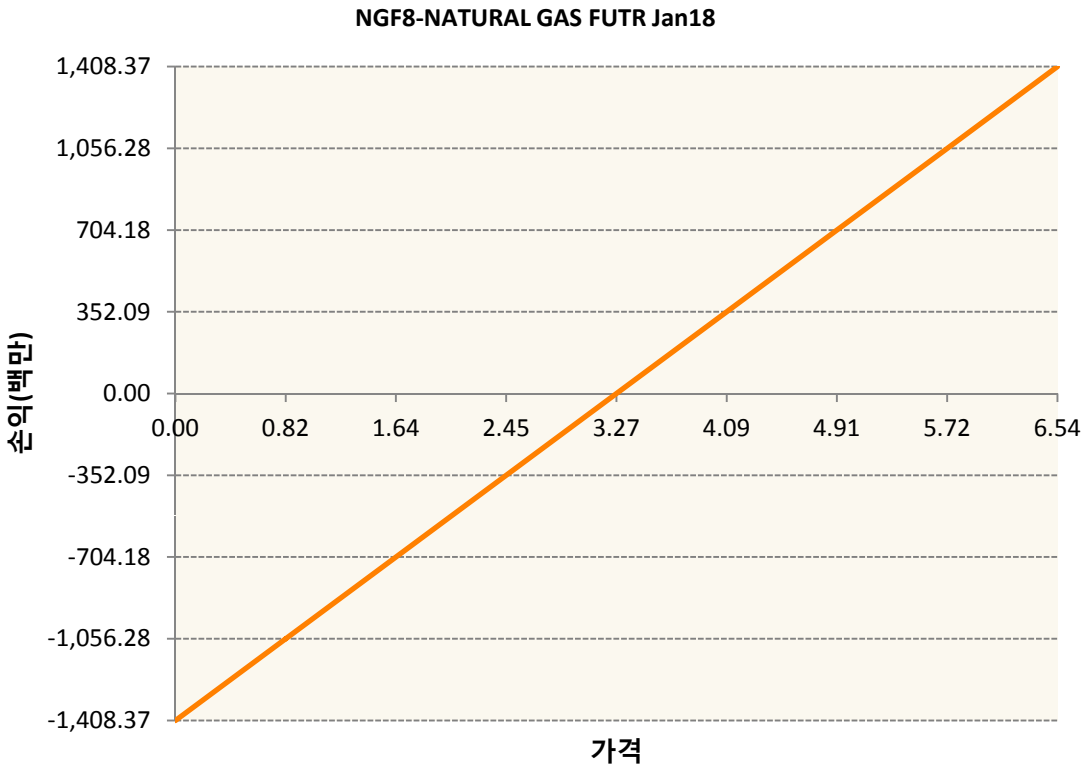


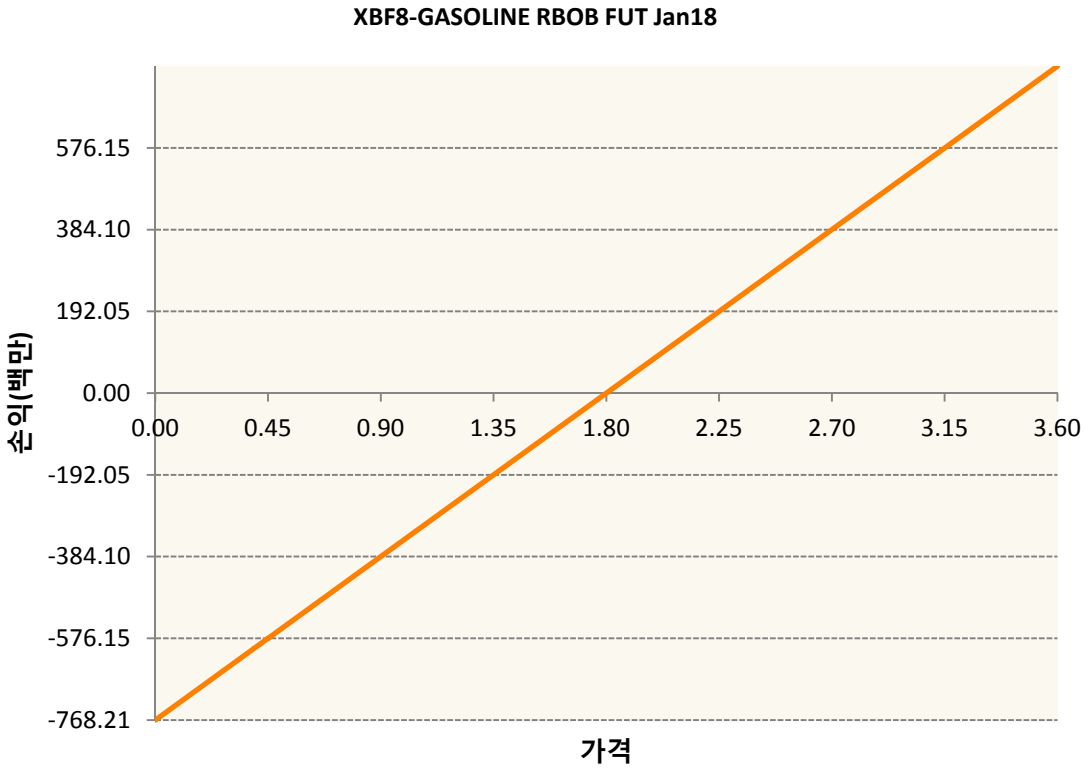

-786.77
-1,180.16
-1,573.54
가격


HOF8-NY Harb ULSD Fut Jan18
732.15
549.11
366.07
183.04
0.00
-183.04
-366.07
-549.11
-732.15
0.00
0.48
0.97
1.45
1.93
2.41
2.90
3.38
3.86
손익(백만)
가격


KR4175MB0007-2017-11 달러선물
892.08
669.06
446.04
223.02
0.00
-223.02
-446.04
-669.06
0.00
278.78
557.55
836.33
1,115.10
1,393.88
1,672.65
1,951.43
2,230.20
손익(백만)


-892.08
가격


NGF8-NATURAL GAS FUTR Jan18
1,408.37
1,056.28
704.18
352.09
0.00
-352.09
-704.18
-1,056.28
-1,408.37
0.00
0.82
1.64
2.45
3.27
4.09
4.91
5.72
6.54
손익(백만)
가격


XBF8-GASOLINE RBOB FUT Jan18
576.15
384.10
192.05
0.00
-192.05
-384.10
-576.15
-768.21
0.00
0.45
0.90
1.35
1.80
2.25
2.70
3.15
3.60
손익(백만)
가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLF8	WTI CRUDE FUTURE Jan18	77
COF8	BRENT CRUDE FUTR JAN18	126
HOF8	NY Harb ULSD Fut Jan18	59
KR4175MB0(	2017-11 달러선물	71
NGF8	NATURAL GAS FUTR Jan18	113
XBF8	GASOLINE RBOB FUT Jan18	61

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

772

공시일	2017-11-10
기준일	2017-11-09

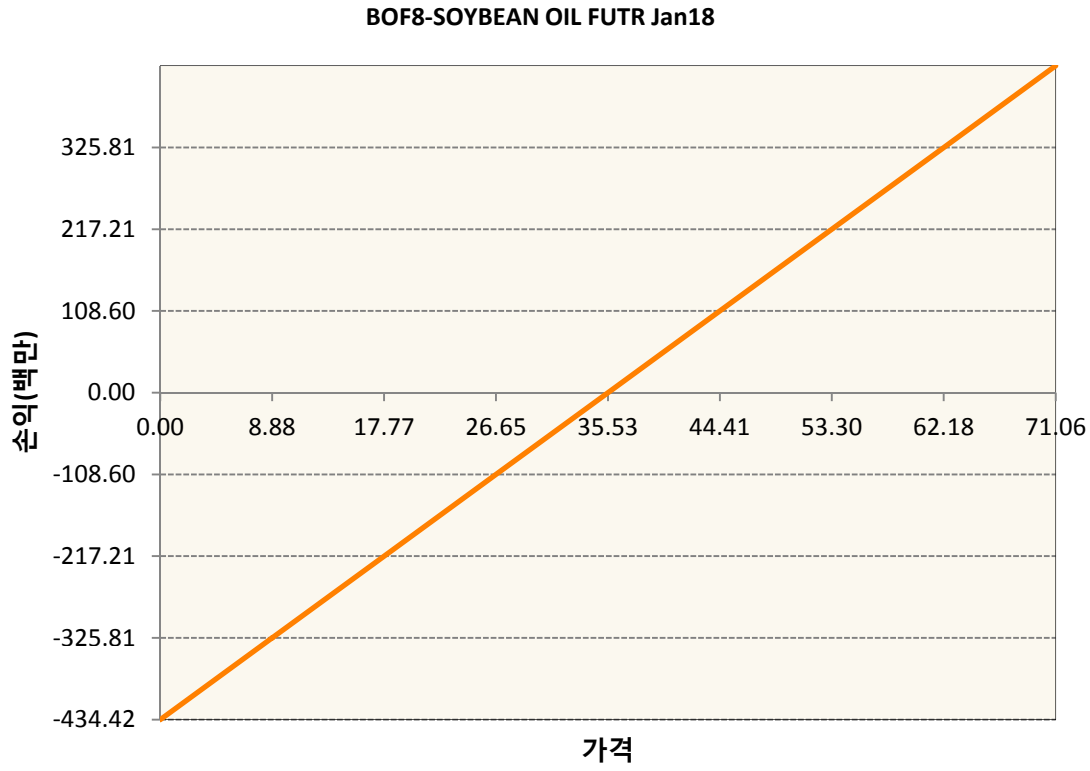
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

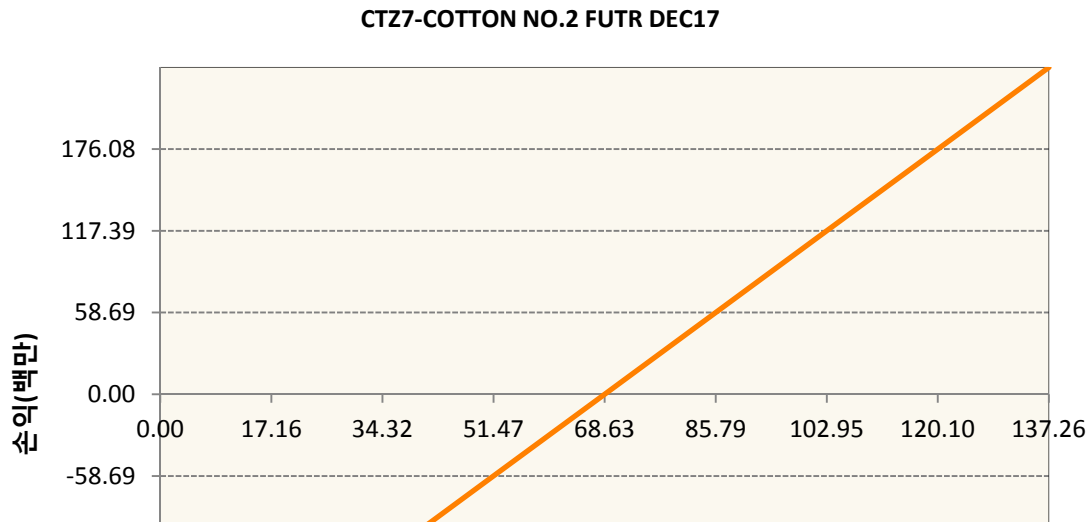
1. 계약금액

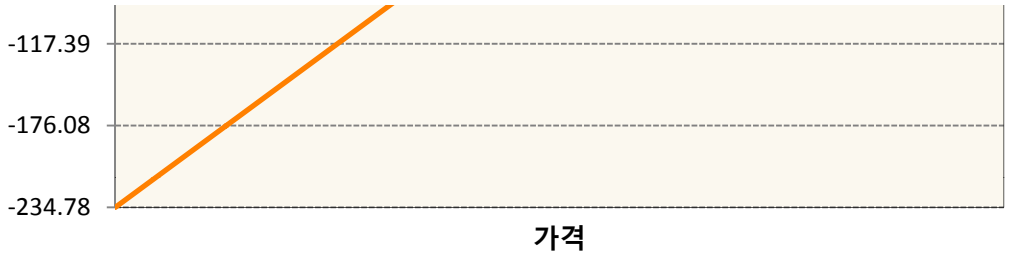
(단위:백만원)

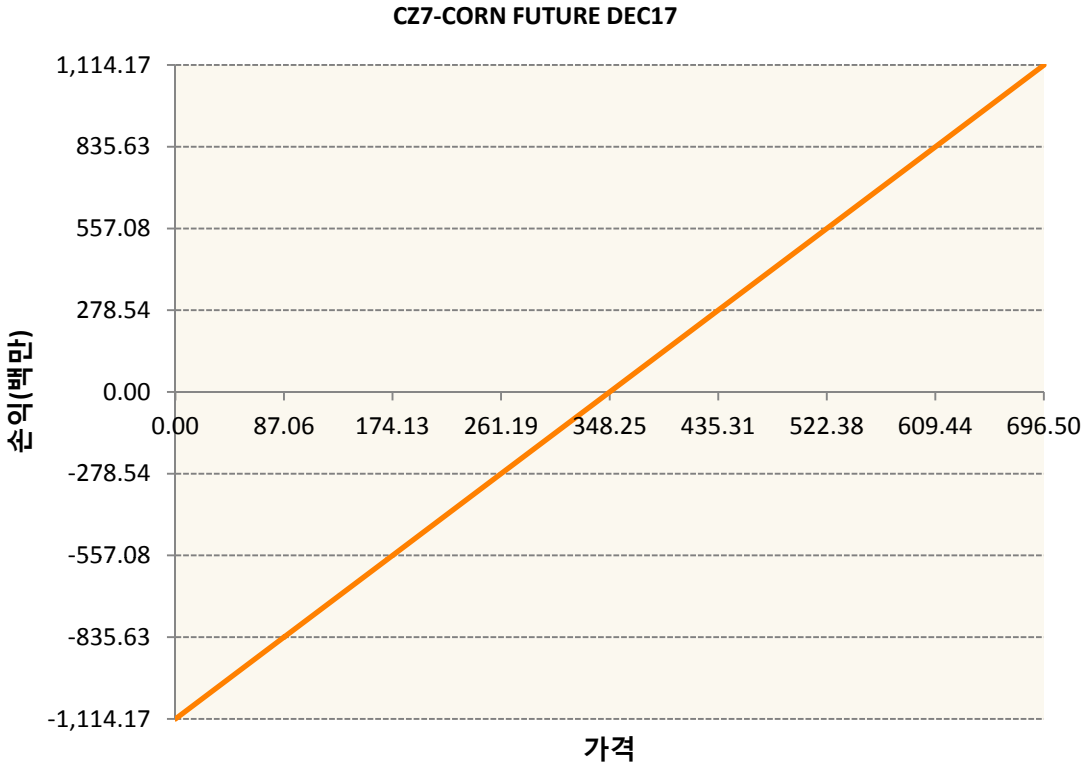
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	4,586	335	4,251	

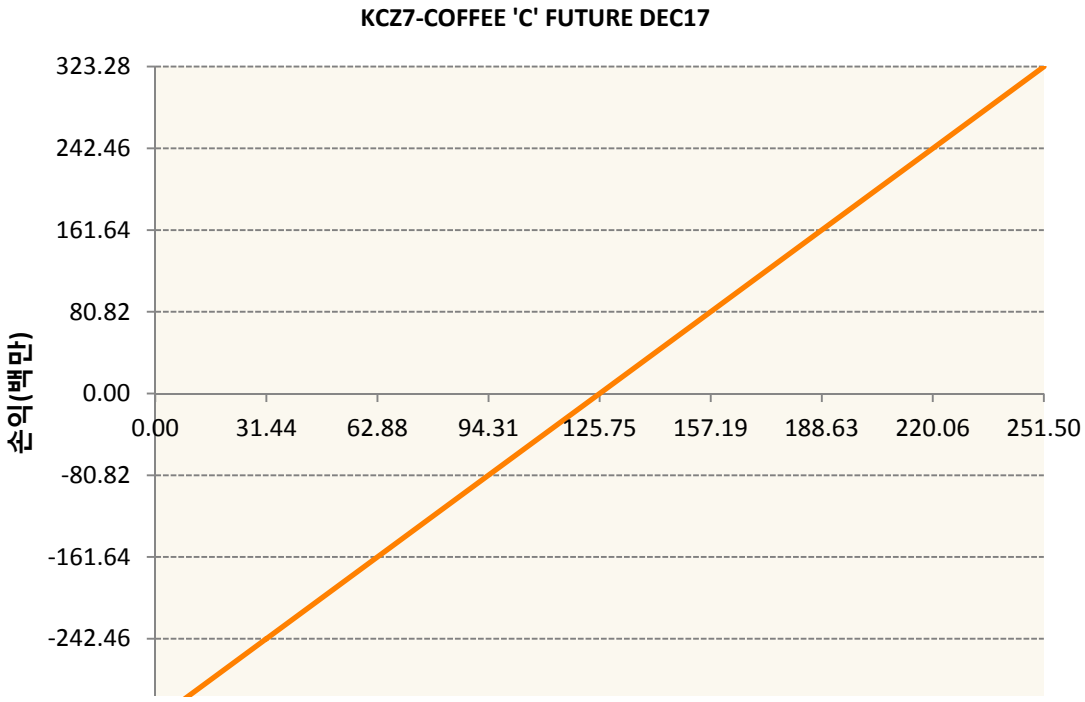
2. 만기시점의 손익구조

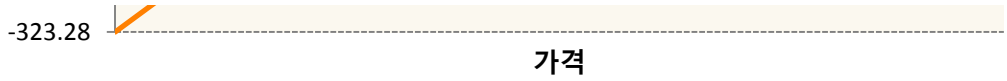


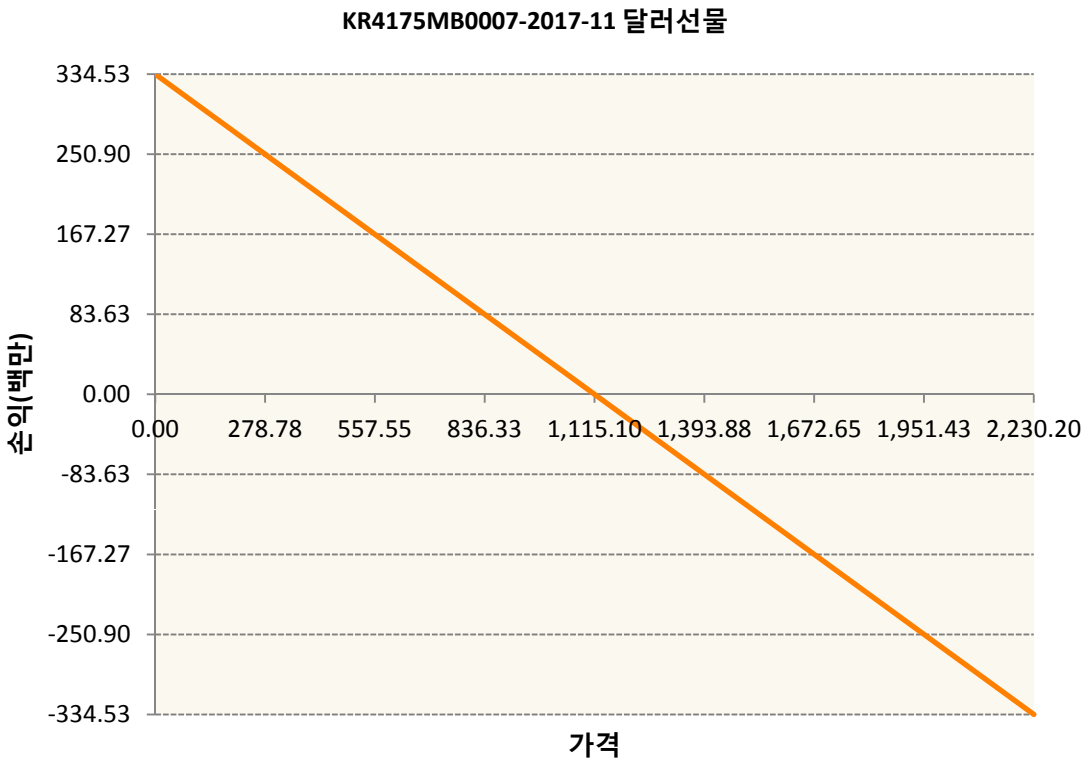


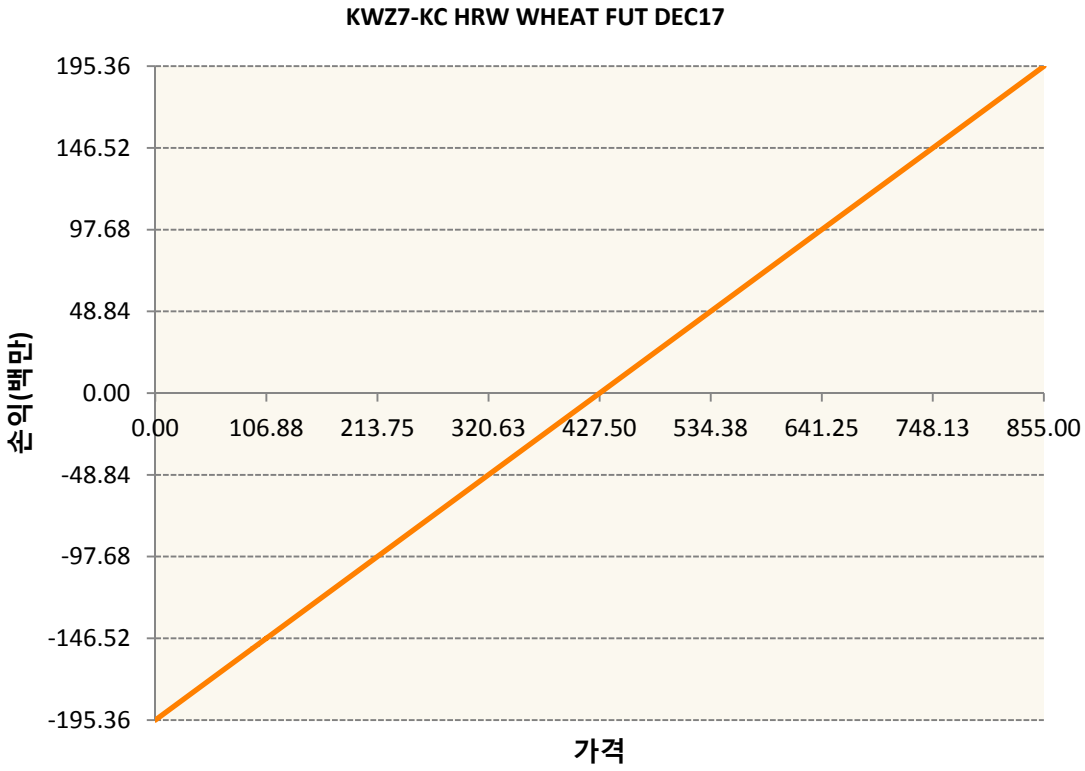

-117.39
-176.08
-234.78
가격


CZ7-CORN FUTURE DEC17
1,114.17
835.63
557.08
278.54
0.00
-278.54
-557.08
-835.63
-1,114.17
0.00
87.06
174.13
261.19
348.25
435.31
522.38
609.44
696.50
손익(백만)
가격

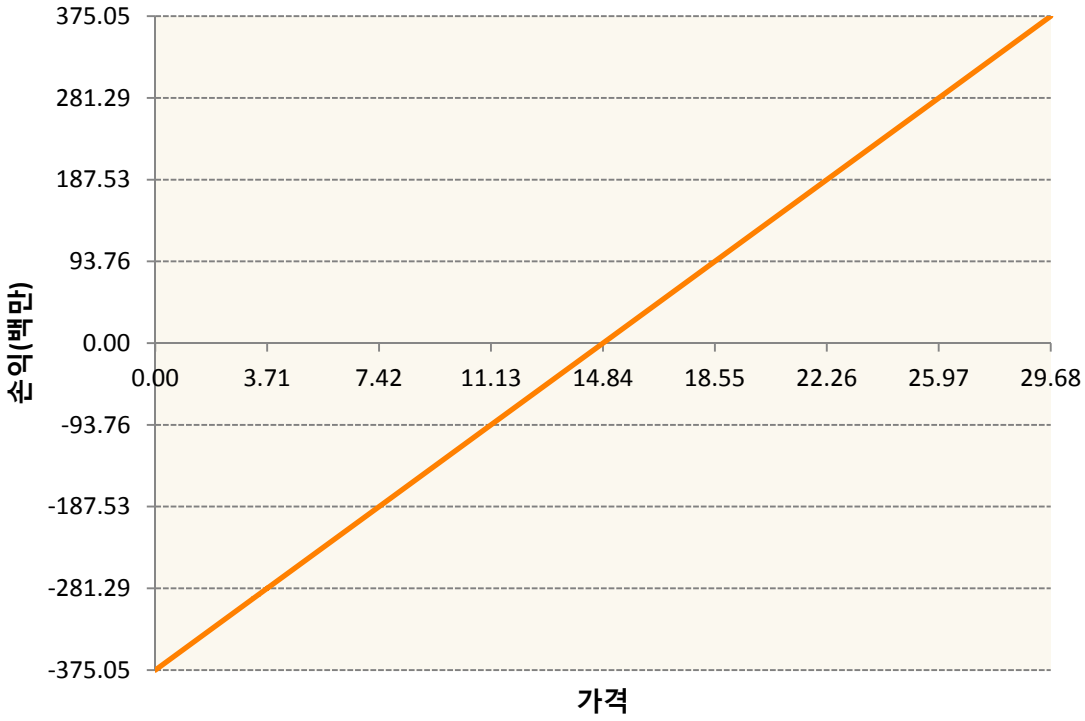

KCZ7-COFFEE 'C' FUTURE DEC17
323.28
242.46
161.64
80.82
0.00
-80.82
-161.64
-242.46
0.00
31.44
62.88
94.31
125.75
157.19
188.63
220.06
251.50
손익(백만)


-323.28
가격

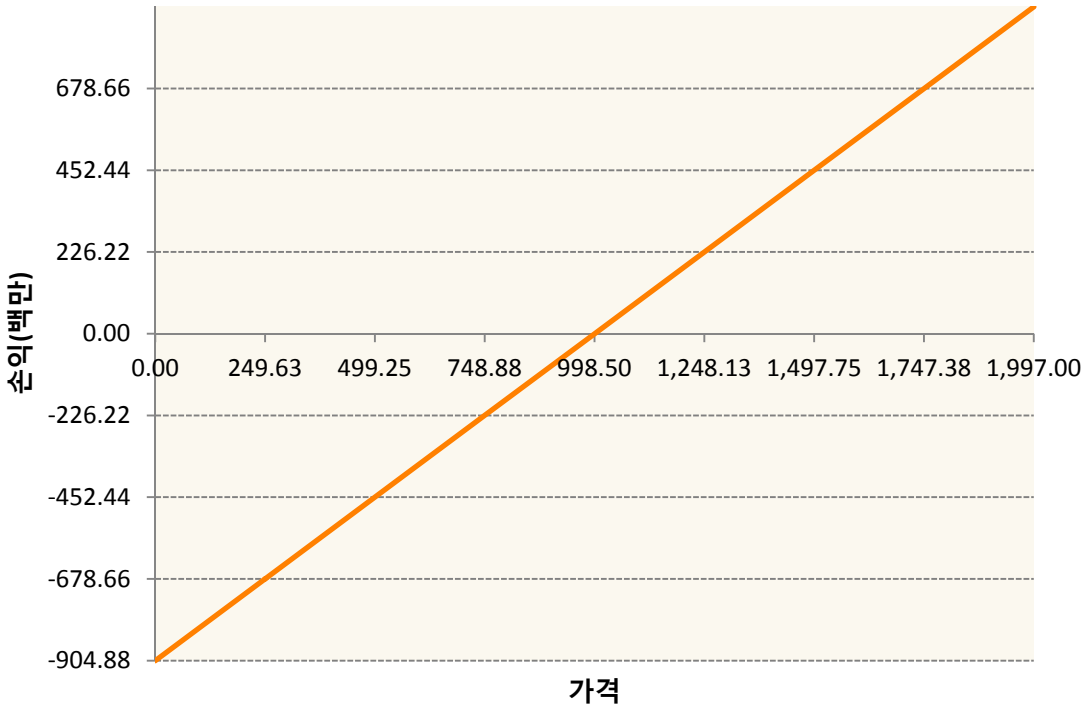

KR4175MB0007-2017-11 달러선물
334.53
250.90
167.27
83.63
0.00
-83.63
-167.27
-250.90
-334.53
0.00
278.78
557.55
836.33
1,115.10
1,393.88
1,672.65
1,951.43
2,230.20
손익(백만)
가격


KWZ7-KC HRW WHEAT FUT DEC17
195.36
146.52
97.68
48.84
0.00
-48.84
-97.68
-146.52
-195.36
0.00
106.88
213.75
320.63
427.50
534.38
641.25
748.13
855.00
손익(백만)
가격

SBH8-Sugar #11 (WORLD) MAR18

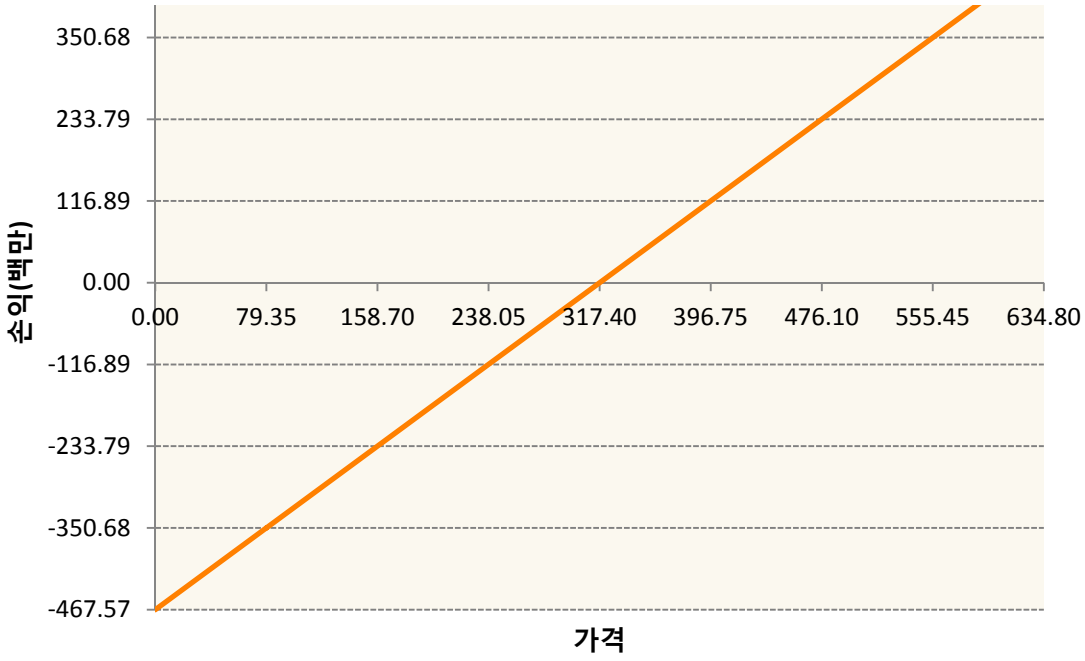


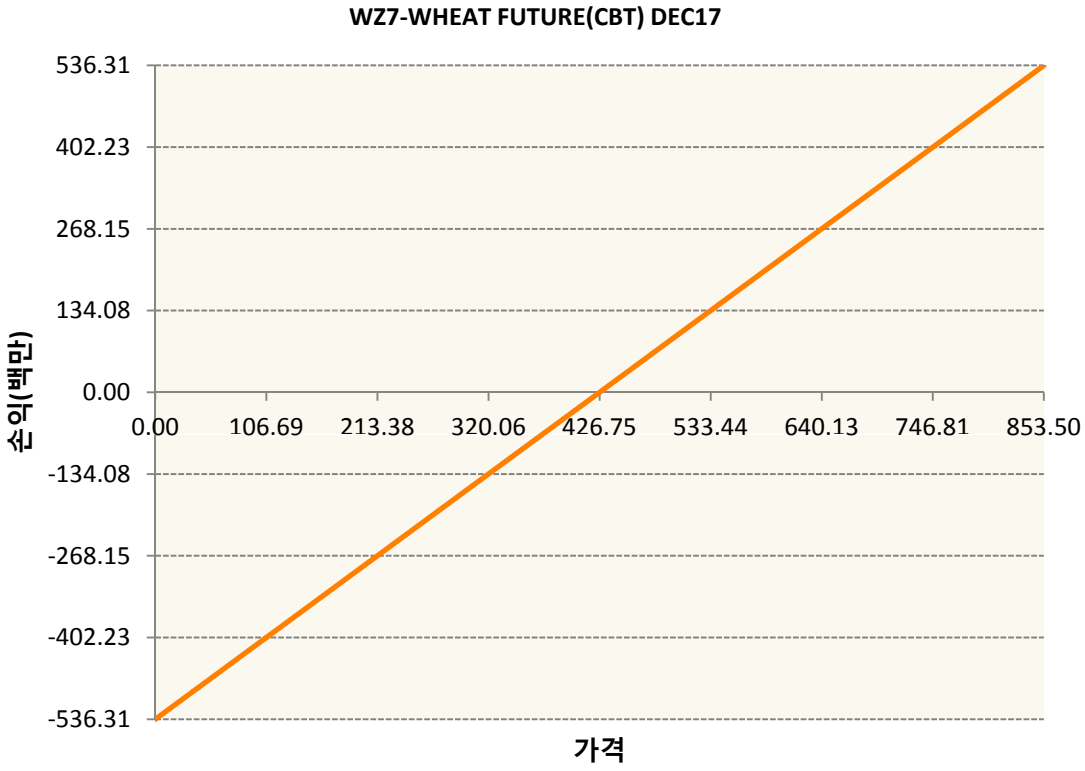
SF8-SOYBEAN FUTURE Jan18



SMF8-SOYBEAN MEAL FUTR Jan18







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

BOF8	SOYBEAN OIL FUTR Jan18	35
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)

413