공시일	2017-08-23
기준일	2017-08-22

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	2017-08-23
기준일	2017-08-22

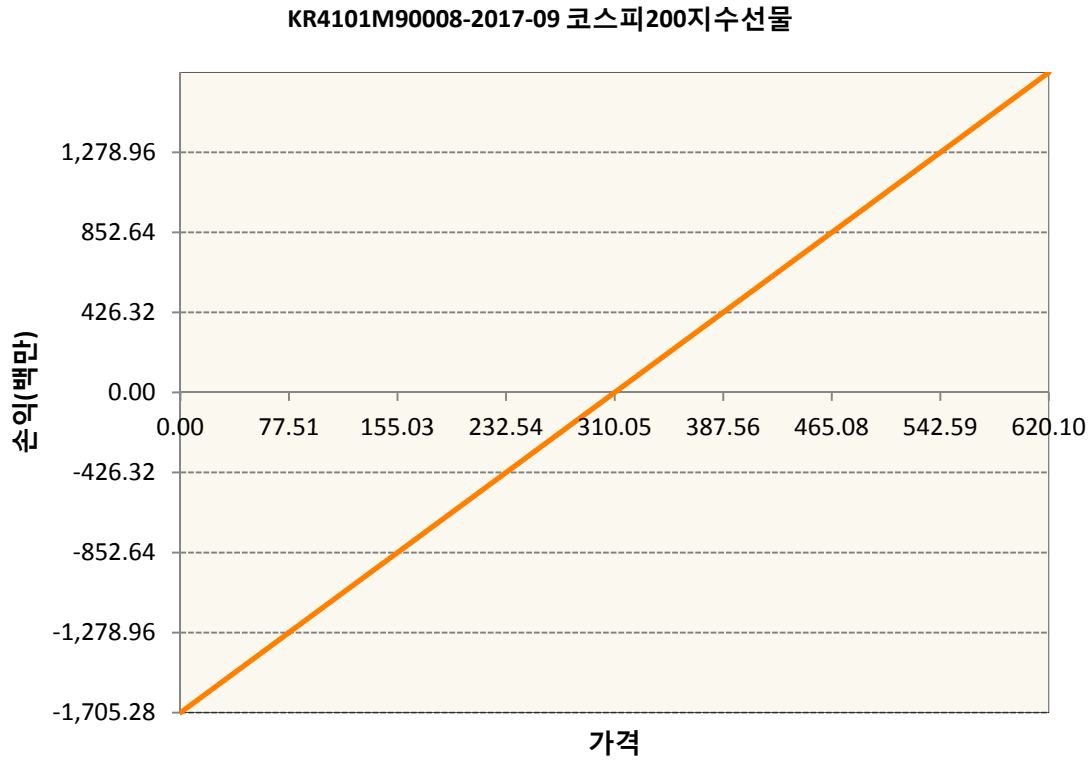
스마트인덱스모

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	1,705	0	1,705	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101M90(2017-09 코스피200지수선물							136
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-136	-136	-136	-136	-136	-136	-136
-5.33%	-91	-91	-91	-91	-91	-91	-91
-2.67%	-45	-45	-45	-45	-45	-45	-45
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	45	45	45	45	45	45	45
5.33%	91	91	91	91	91	91	91
8.00%	136	136	136	136	136	136	136

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

85

공시일	2017-08-23
기준일	2017-08-22

SMART합성-MSCI선진국증권상장지

1. 계약금액

(단위:백만원)

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

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWMXWO0(신한MXWO 미래S170822	1,007

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

466

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-08-23
기준일	2017-08-22

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	4,599	0	4,599	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI50000 신한CSI500미래S170608	403

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

345

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-08-23
기준일	2017-08-22

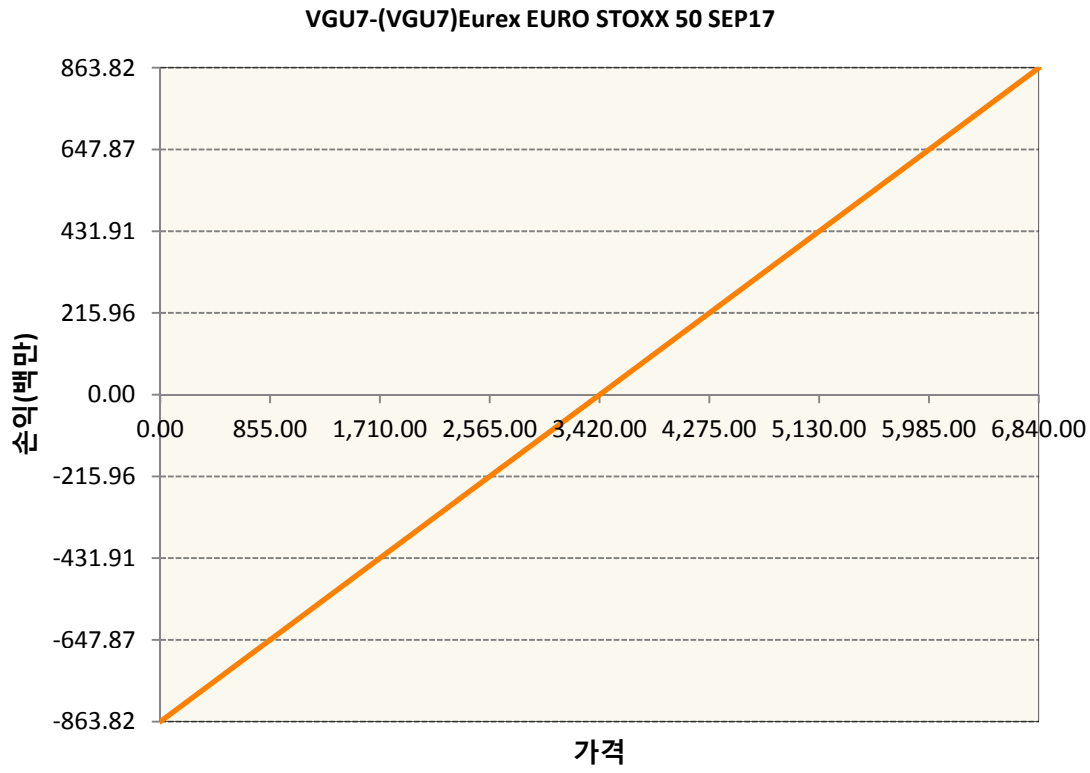
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	864	0	864	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGU7	(VGU7)Eurex EURO STOXX 50 SEP17	69

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

(단위:백만원)

56

공시일	2017-08-23
기준일	2017-08-22

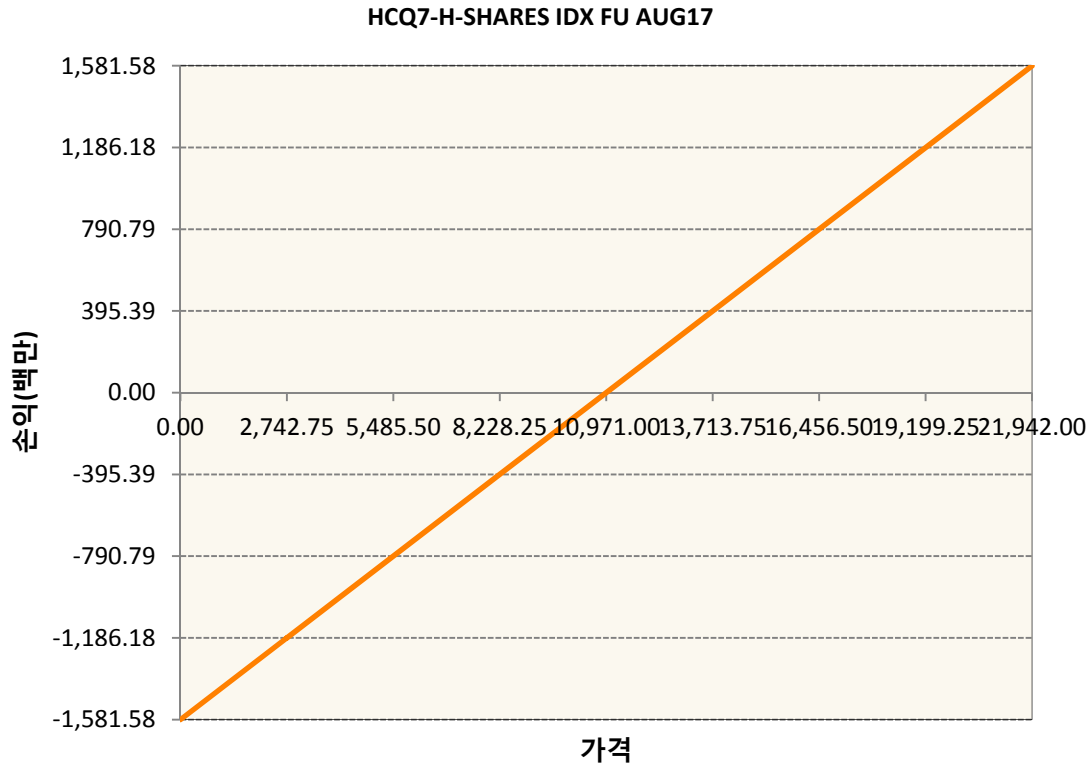
차이나인덱스모(주식-파생형)

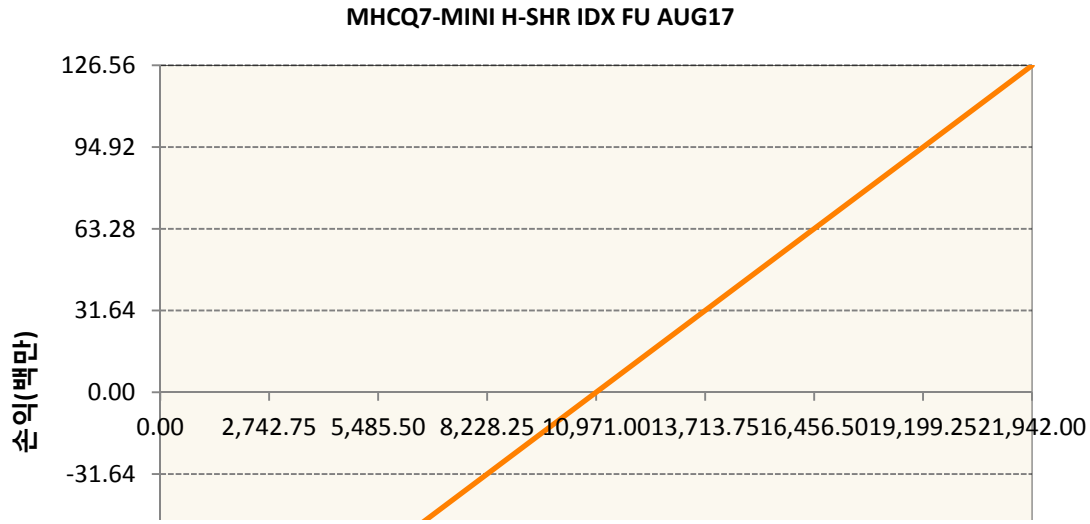
1. 계약금액

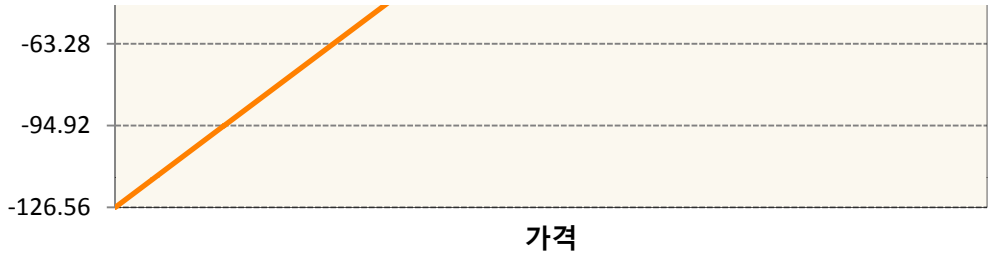
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,708	0	1,708	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCQ7	H-SHARES IDX FU AUG17	127
MHCQ7	MINI H-SHR IDX FU AUG17	10

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

공시일	2017-08-23
기준일	2017-08-22

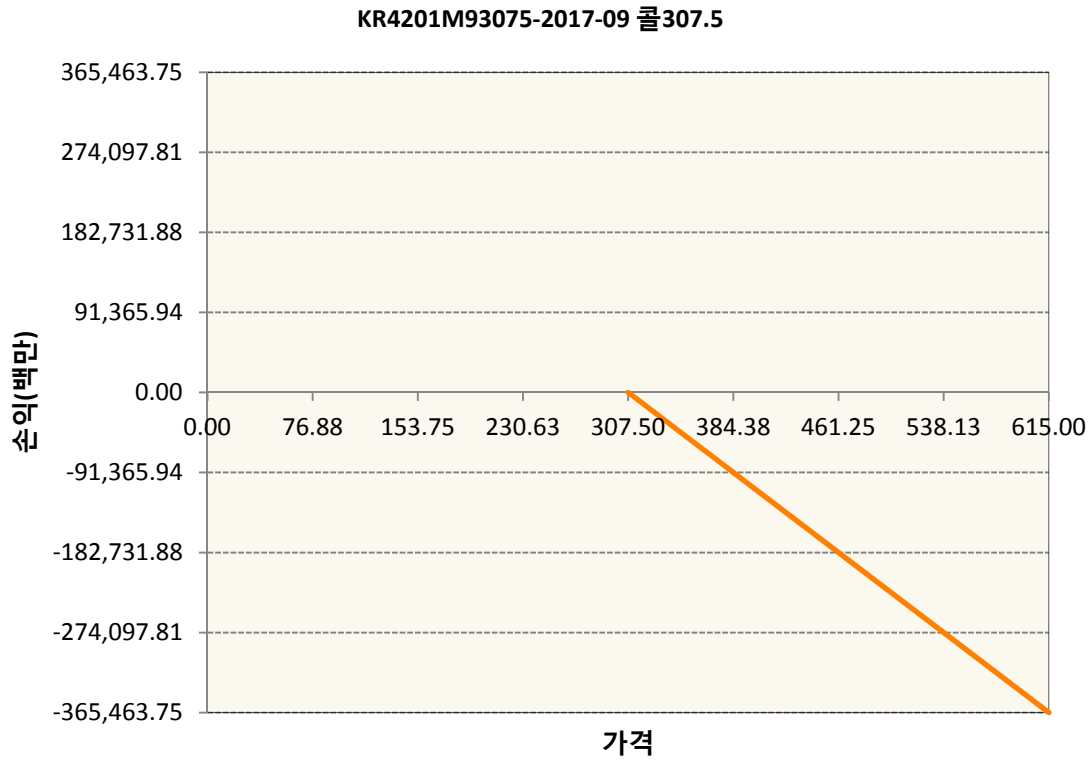
커버드콜모(주식혼합-파생형)

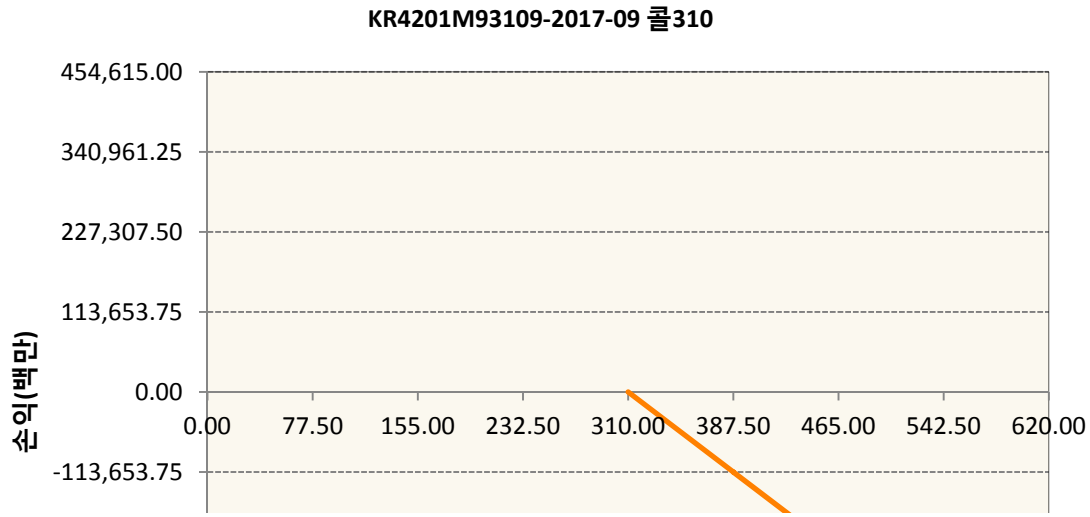
1. 계약금액

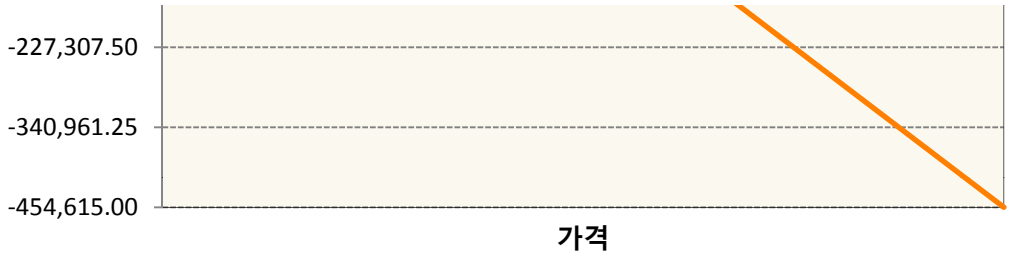
(단위:백만원)

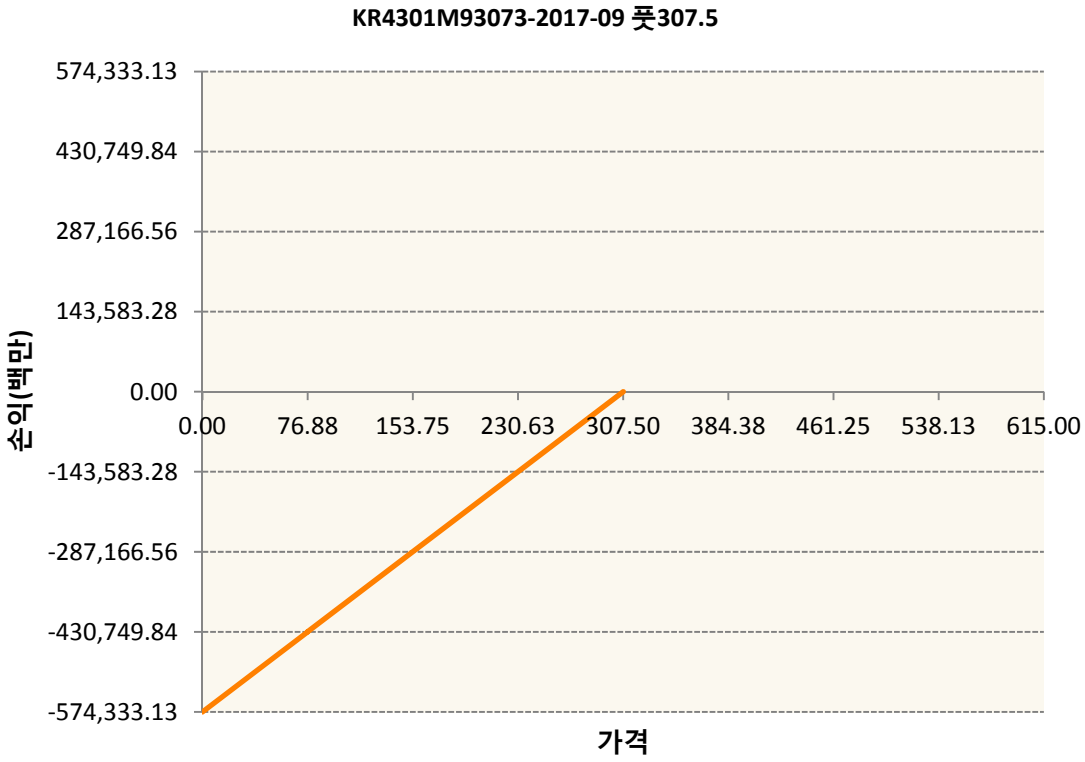
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	1,450,909	-1,450,909	장내

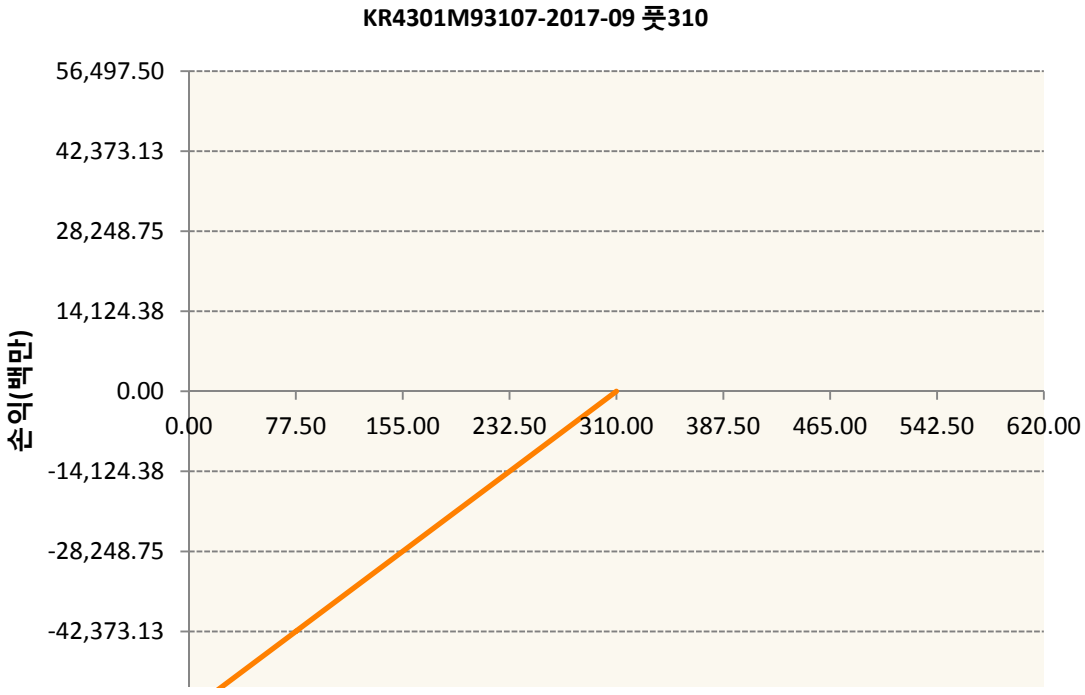
2. 만기시점의 손익구조

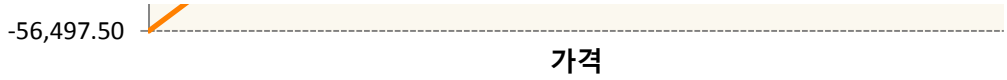





-227,307.50
-340,961.25
-454,615.00
가격


KR4301M93073-2017-09 풋307.5
574,333.13
430,749.84
287,166.56
143,583.28
0.00
-143,583.28
-287,166.56
-430,749.84
-574,333.13
0.00
76.88
153.75
230.63
307.50
384.38
461.25
538.13
615.00
손익(백만)
가격


KR4301M93107-2017-09 풋310
56,497.50
42,373.13
28,248.75
14,124.38
0.00
-14,124.38
-28,248.75
-42,373.13
0.00
77.50
155.00
232.50
310.00
387.50
465.00
542.50
620.00
손익(백만)



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4201M93(2017-09 콜307.5							23,713
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	9,321	9,163	8,957	8,706	8,415	8,086	7,725
-5.33%	8,551	8,168	7,742	7,282	6,794	6,281	5,749
-2.67%	6,400	5,780	5,147	4,505	3,855	3,200	2,540
0%	2,086	1,392	696	0	-697	-1,394	-2,092
2.67%	-4,542	-5,094	-5,672	-6,269	-6,883	-7,510	-8,147
5.33%	-12,903	-13,223	-13,594	-14,008	-14,458	-14,940	-15,447
8.00%	-22,194	-22,333	-22,521	-22,756	-23,035	-23,355	-23,713
KR4201M93: 2017-09 콜310							27,964
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	9,767	9,624	9,428	9,178	8,877	8,530	8,139
-5.33%	9,103	8,717	8,272	7,777	7,240	6,667	6,064
-2.67%	7,061	6,364	5,640	4,896	4,136	3,363	2,579
0%	2,601	1,734	867	0	-867	-1,734	-2,601
2.67%	-4,746	-5,509	-6,293	-7,091	-7,902	-8,722	-9,549
5.33%	-14,500	-14,989	-15,535	-16,127	-16,757	-17,419	-18,108
8.00%	-25,691	-25,925	-26,224	-26,583	-26,996	-27,459	-27,964
KR4301M93(2017-09 풋307.5							34,037
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-31,529	-31,778	-32,102	-32,495	-32,953	-33,469	-34,037
-5.33%	-17,347	-17,949	-18,618	-19,341	-20,108	-20,914	-21,750
-2.67%	-5,334	-6,310	-7,304	-8,313	-9,334	-10,364	-11,400
0%	3,279	2,187	1,094	0	-1,095	-2,191	-3,287
2.67%	8,255	7,387	6,479	5,540	4,575	3,591	2,590
5.33%	10,508	10,005	9,422	8,772	8,064	7,307	6,509
8.00%	11,299	11,080	10,786	10,416	9,977	9,474	8,912
KR4301M93: 2017-09 풋310							3,494
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-3,292	-3,310	-3,334	-3,365	-3,403	-3,446	-3,494
-5.33%	-1,873	-1,921	-1,976	-2,037	-2,104	-2,175	-2,250
-2.67%	-624	-711	-801	-893	-988	-1,084	-1,181
0%	323	215	108	0	-108	-216	-323
2.67%	912	817	720	621	520	418	315

5.33%	1,202	1,141	1,073	1,000	921	839	754
8.00%	1,313	1,284	1,247	1,202	1,151	1,093	1,031

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

88,670

공시일	2017-08-23
기준일	2017-08-22

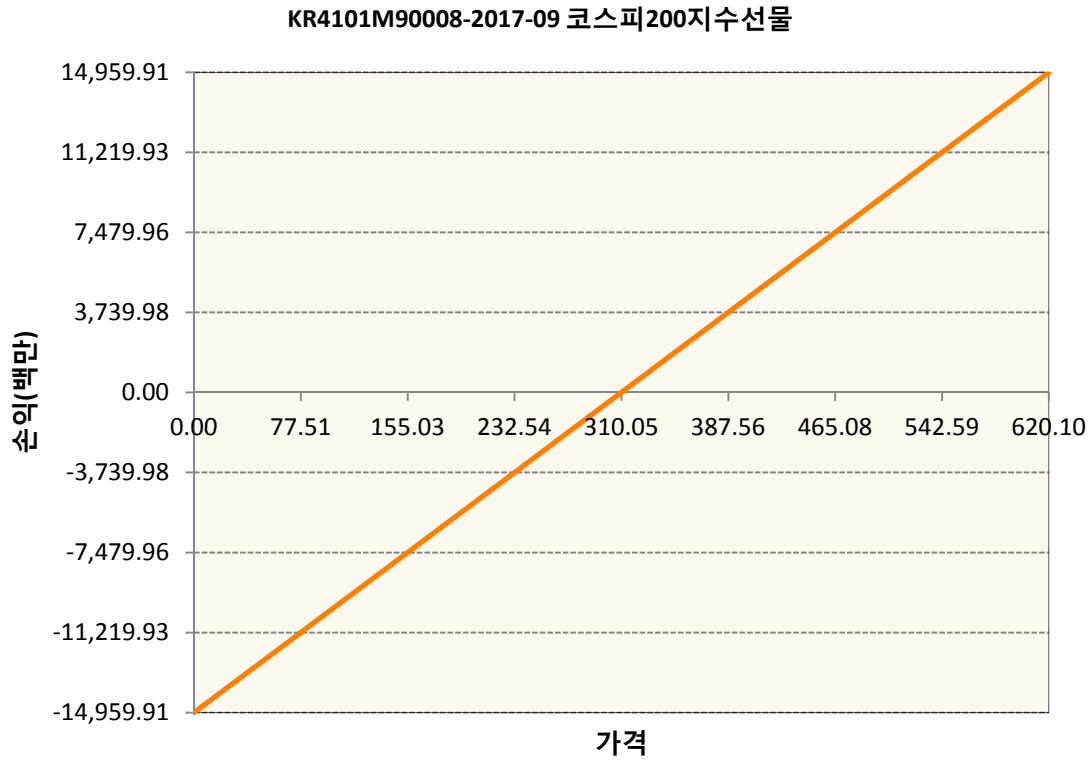
ETF스마트레버리지목표전환형6호

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	14,960	0	14,960	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101M90(2017-09 코스피200지수선물							1,194
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,194	-1,194	-1,194	-1,194	-1,194	-1,194	-1,194
-5.33%	-796	-796	-796	-796	-796	-796	-796
-2.67%	-398	-398	-398	-398	-398	-398	-398
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	398	398	398	398	398	398	398
5.33%	796	796	796	796	796	796	796
8.00%	1,194	1,194	1,194	1,194	1,194	1,194	1,194

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

744

공시일	2017-08-23
기준일	2017-08-22

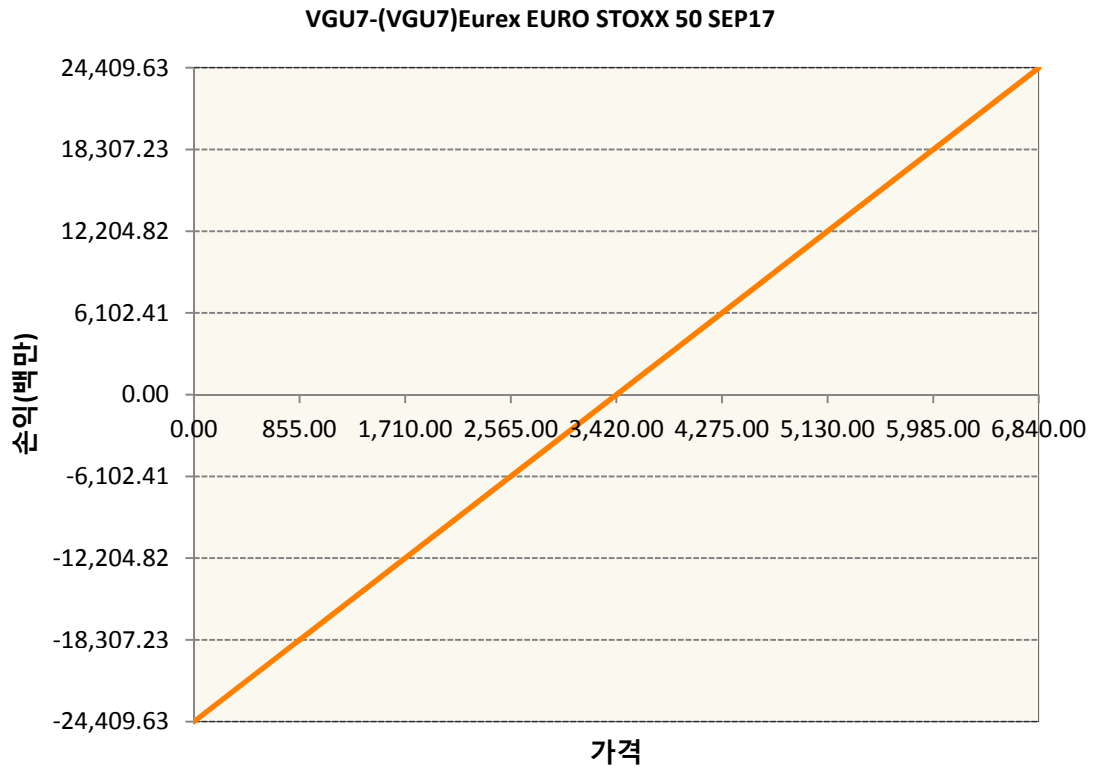
유로커버드콜(주식혼합-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	24,410	0	24,410	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGU7	(VGU7)Eurex EURO STOXX 50 SEP17	1,953

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

(단위:백만원)

1,590

공시일	2017-08-23
기준일	2017-08-22

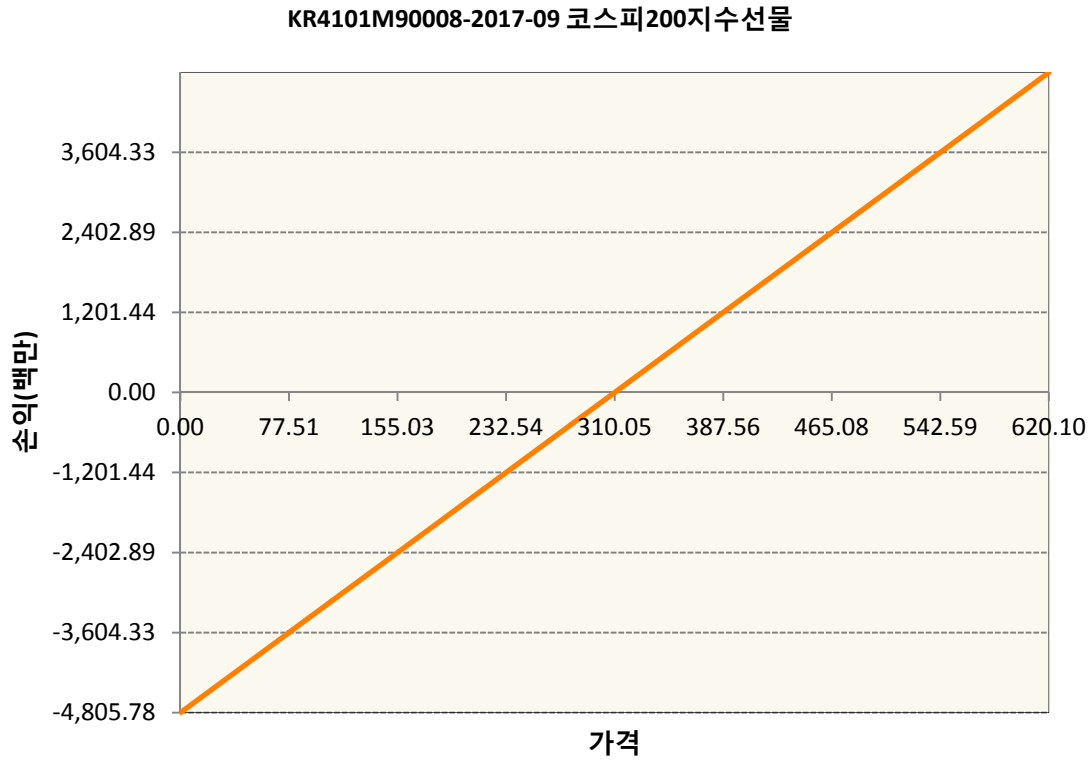
ETF스마트레버리지목표전환형7호

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	4,806	0	4,806	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101M90(2017-09 코스피200지수선물							384
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-384	-384	-384	-384	-384	-384	-384
-5.33%	-256	-256	-256	-256	-256	-256	-256
-2.67%	-128	-128	-128	-128	-128	-128	-128
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	128	128	128	128	128	128	128
5.33%	256	256	256	256	256	256	256
8.00%	384	384	384	384	384	384	384

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

239

공시일	2017-08-23
기준일	2017-08-22

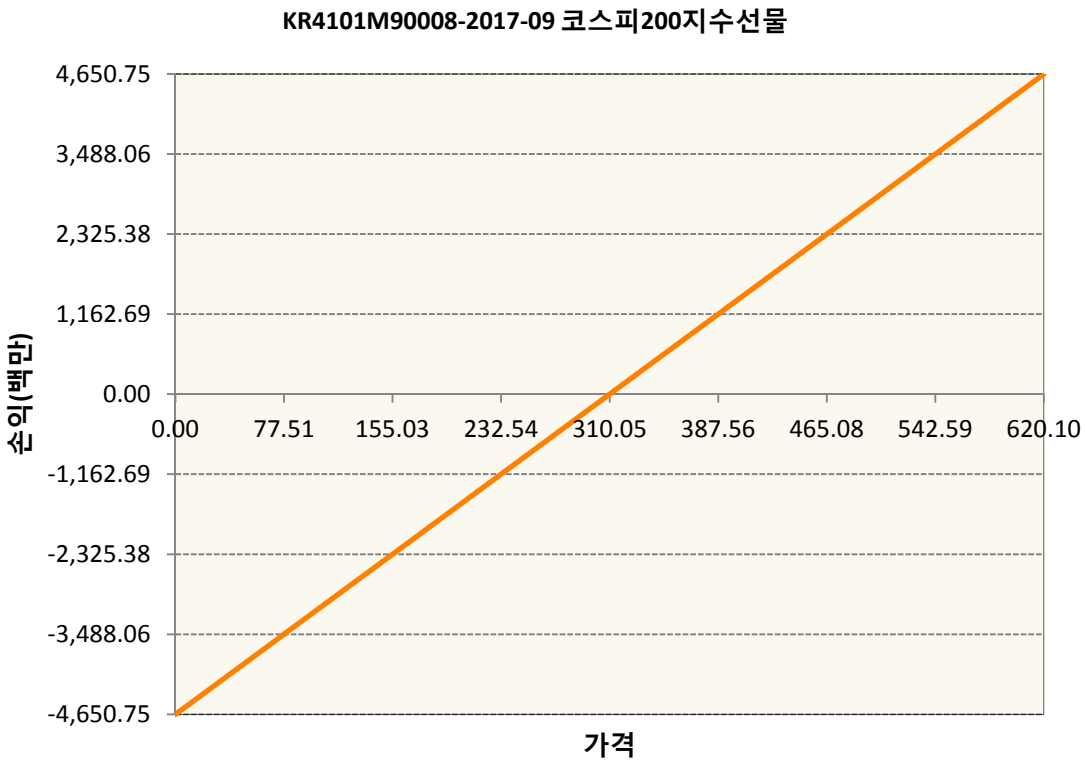
코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼

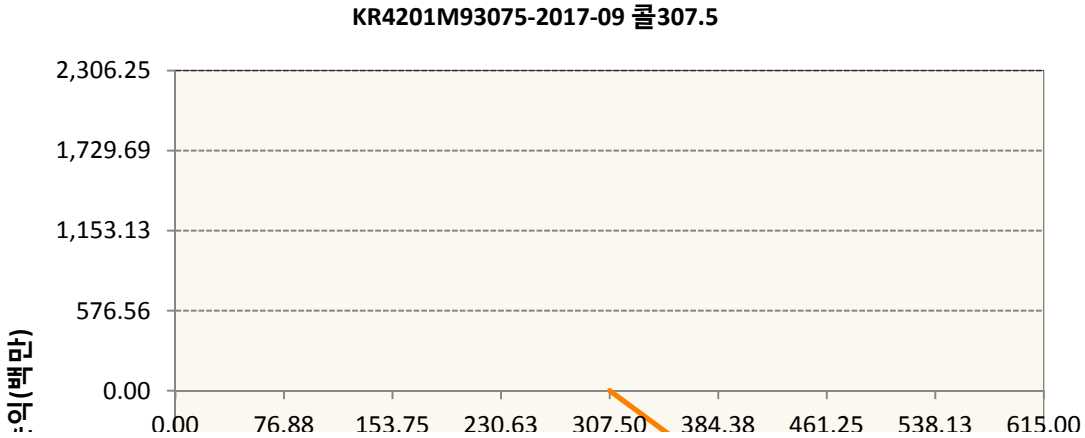
1. 계약금액

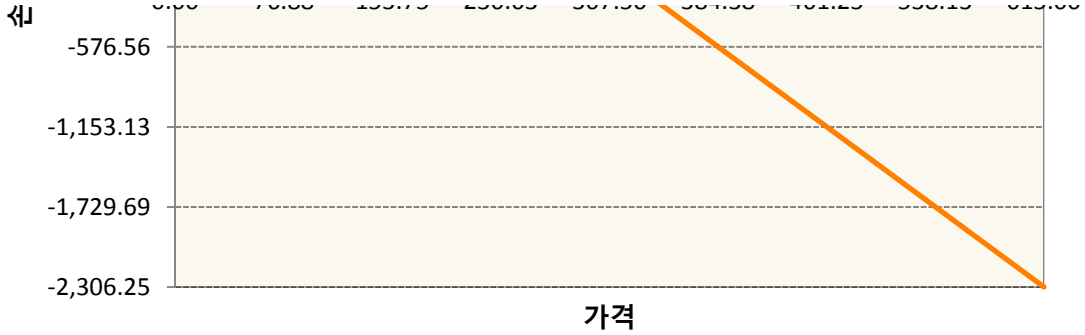
(단위:백만원)

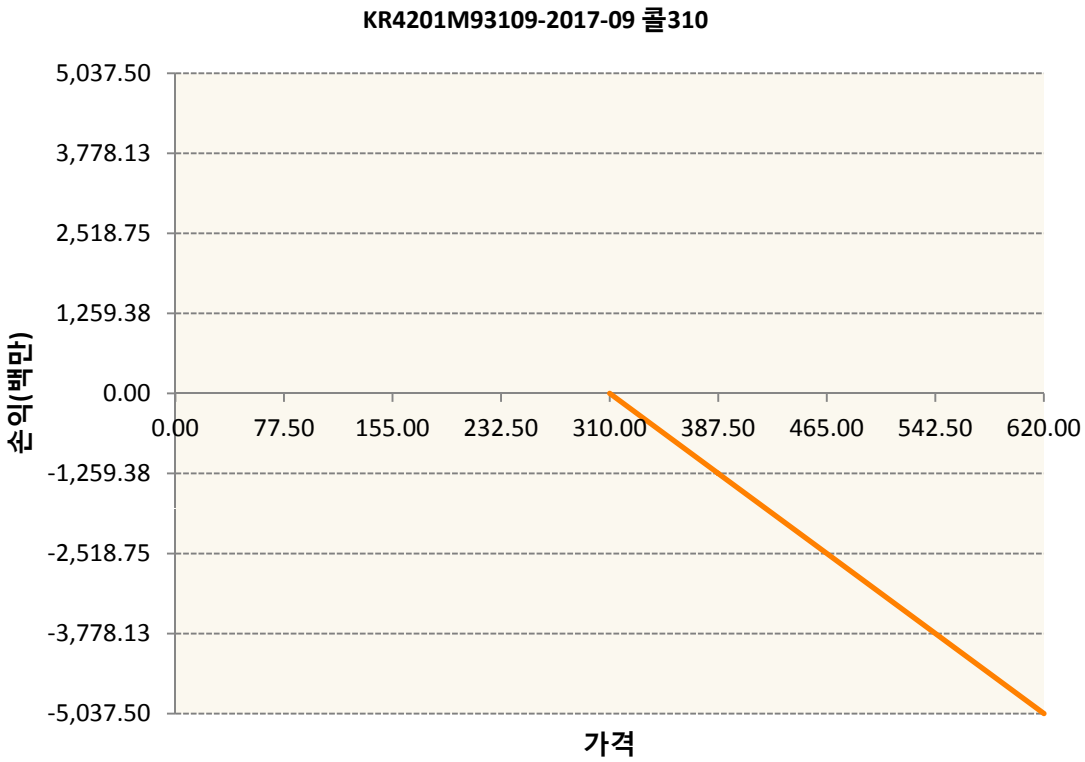
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	4,651	0	4,651	장내
누계	유가증권	옵션	0	14,647	-14,647	장내

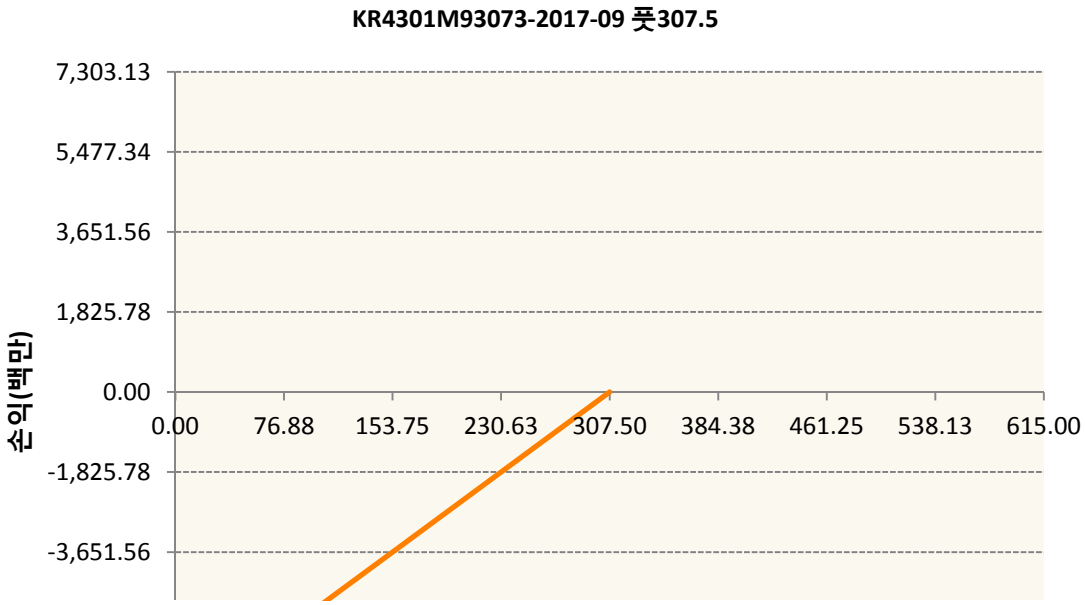
2. 만기시점의 손익구조

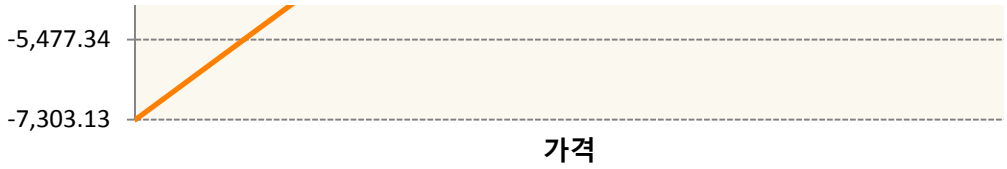





-576.56
-1,153.13
-1,729.69
-2,306.25
가격


KR4201M93109-2017-09 콜310
5,037.50
3,778.13
2,518.75
1,259.38
0.00
-1,259.38
-2,518.75
-3,778.13
-5,037.50
0.00
77.50
155.00
232.50
310.00
387.50
465.00
542.50
620.00
손익(백만)
가격


KR4301M93073-2017-09 풋307.5
7,303.13
5,477.34
3,651.56
1,825.78
0.00
-1,825.78
-3,651.56
0.00
76.88
153.75
230.63
307.50
384.38
461.25
538.13
615.00
손익(백만)



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101M90(2017-09 코스피200지수선물							371
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-371	-371	-371	-371	-371	-371	-371
-5.33%	-247	-247	-247	-247	-247	-247	-247
-2.67%	-124	-124	-124	-124	-124	-124	-124
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	124	124	124	124	124	124	124
5.33%	247	247	247	247	247	247	247
8.00%	371	371	371	371	371	371	371
KR4201M93(2017-09 콜307.5							150
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	59	58	57	55	53	51	49
-5.33%	54	52	49	46	43	40	36
-2.67%	40	36	32	28	24	20	16
0%	13	9	4	0	-4	-9	-13
2.67%	-29	-32	-36	-40	-43	-47	-51
5.33%	-81	-83	-86	-88	-91	-94	-97
8.00%	-140	-141	-142	-144	-145	-147	-150
KR4201M93: 2017-09 콜310							310
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	108	107	104	102	98	95	90
-5.33%	101	97	92	86	80	74	67
-2.67%	78	71	62	54	46	37	29
0%	29	19	10	0	-10	-19	-29
2.67%	-53	-61	-70	-79	-88	-97	-106
5.33%	-161	-166	-172	-179	-186	-193	-201
8.00%	-285	-287	-291	-295	-299	-304	-310
KR4301M93(2017-09 풋307.5							433
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-401	-404	-408	-413	-419	-426	-433
-5.33%	-221	-228	-237	-246	-256	-266	-277
-2.67%	-68	-80	-93	-106	-119	-132	-145

0%	42	28	14	0	-14	-28	-42
2.67%	105	94	82	70	58	46	33
5.33%	134	127	120	112	103	93	83
8.00%	144	141	137	132	127	120	113

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

1,115

공시일	2017-08-23
기준일	2017-08-22

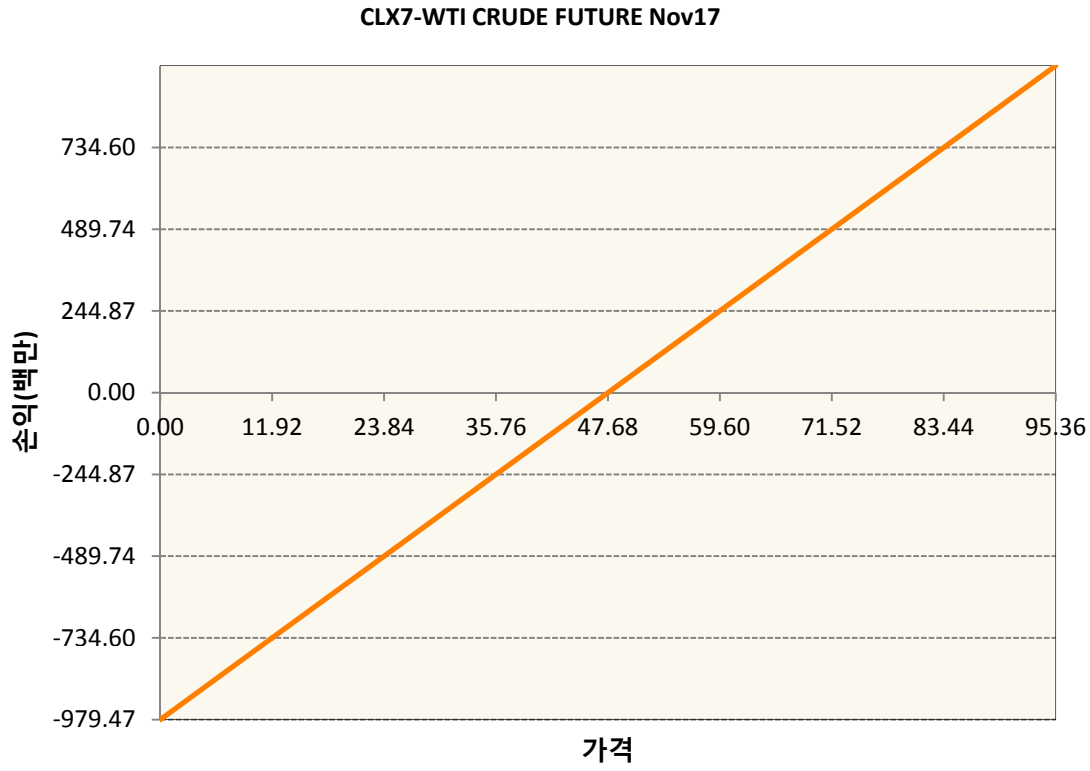
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

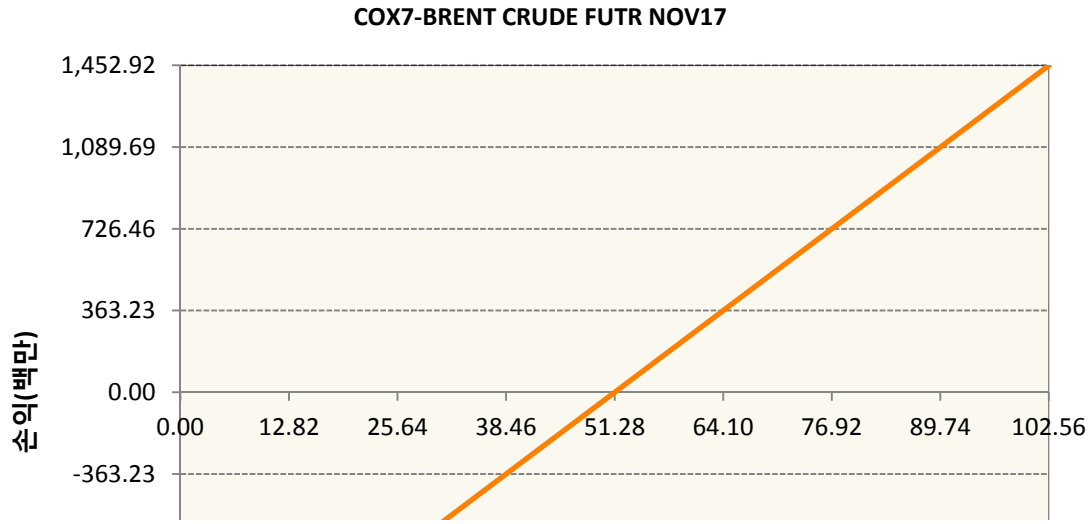
1. 계약금액

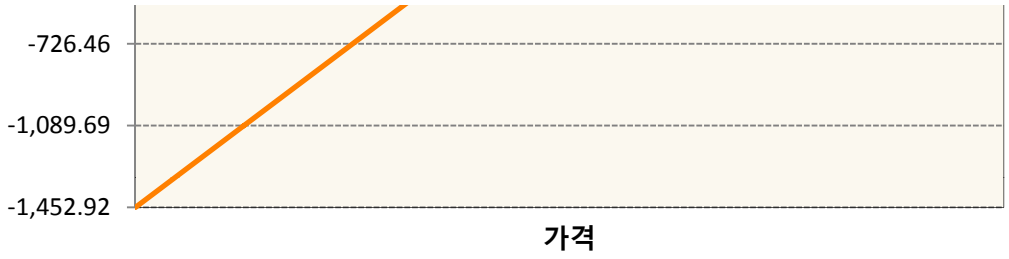
(단위:백만원)

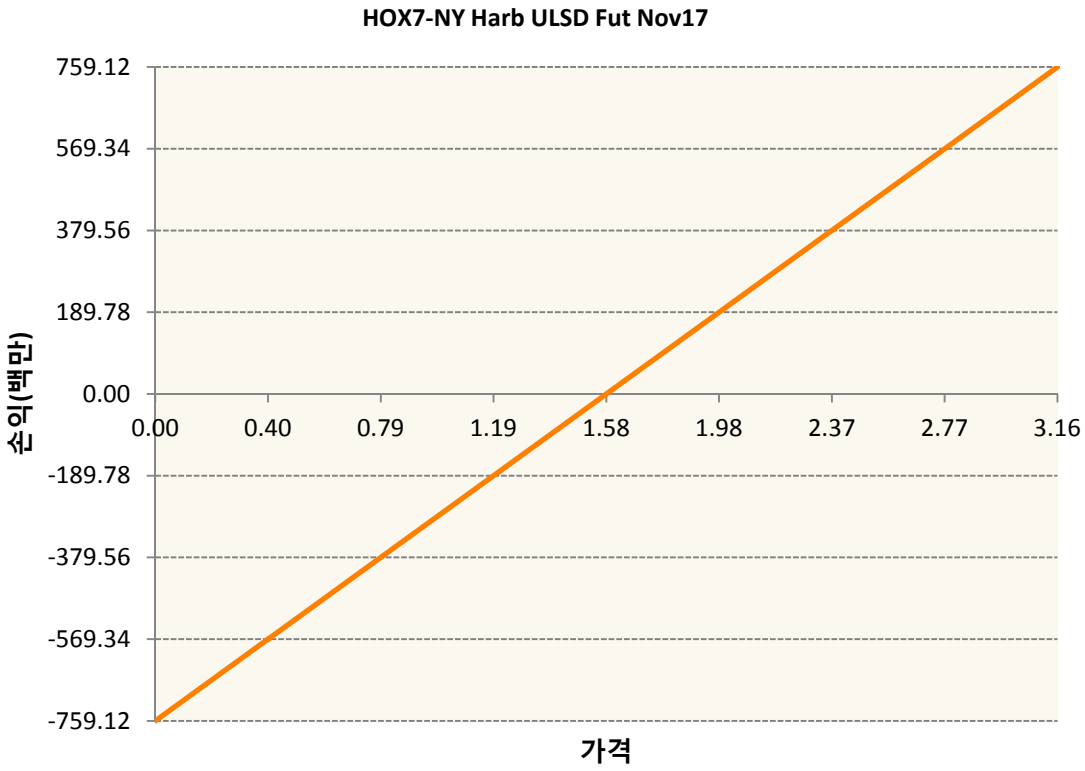
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	5,361	510	4,850	

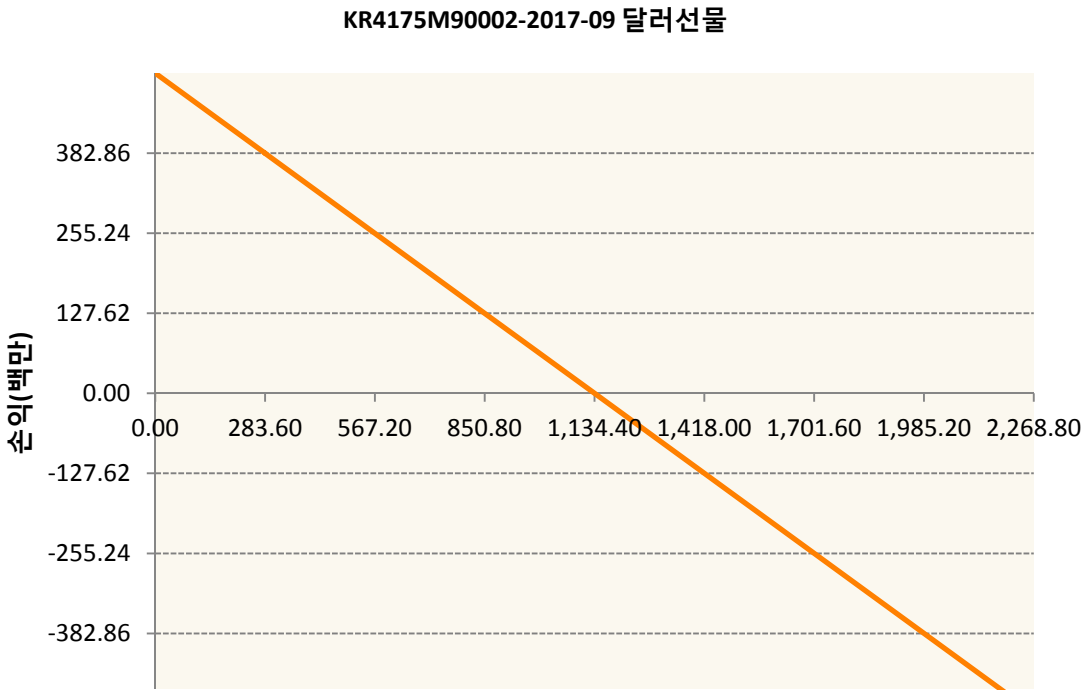
2. 만기시점의 손익구조

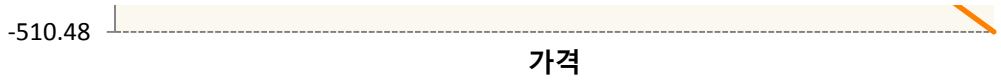


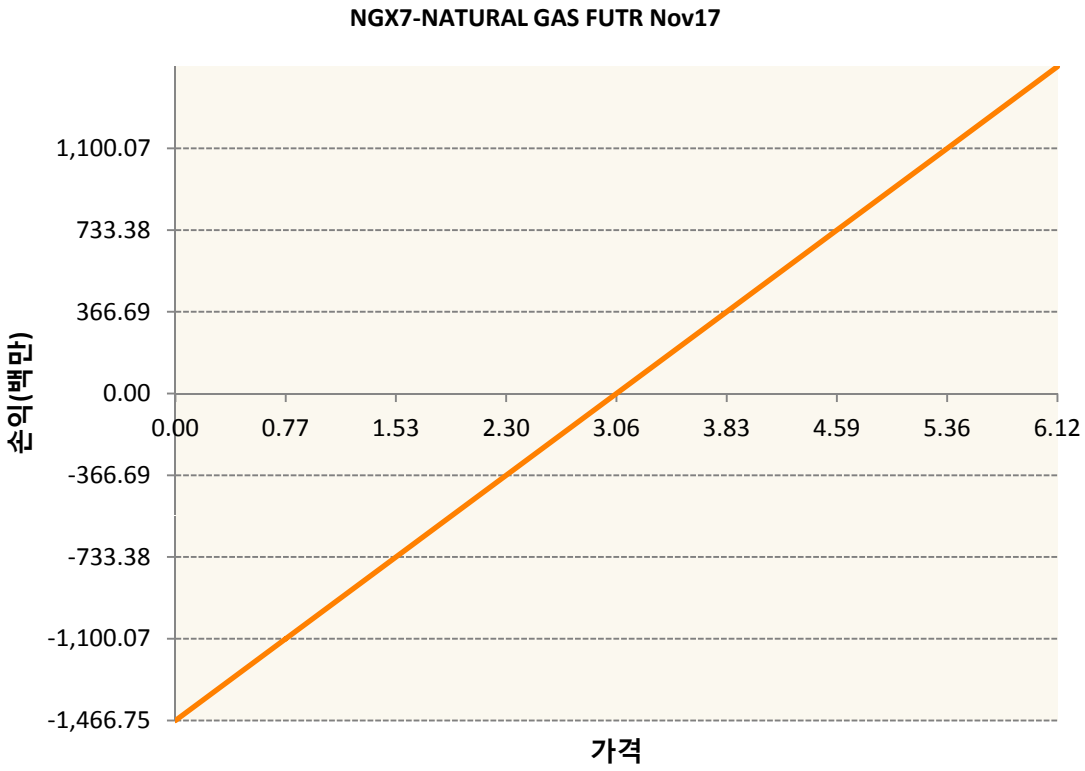


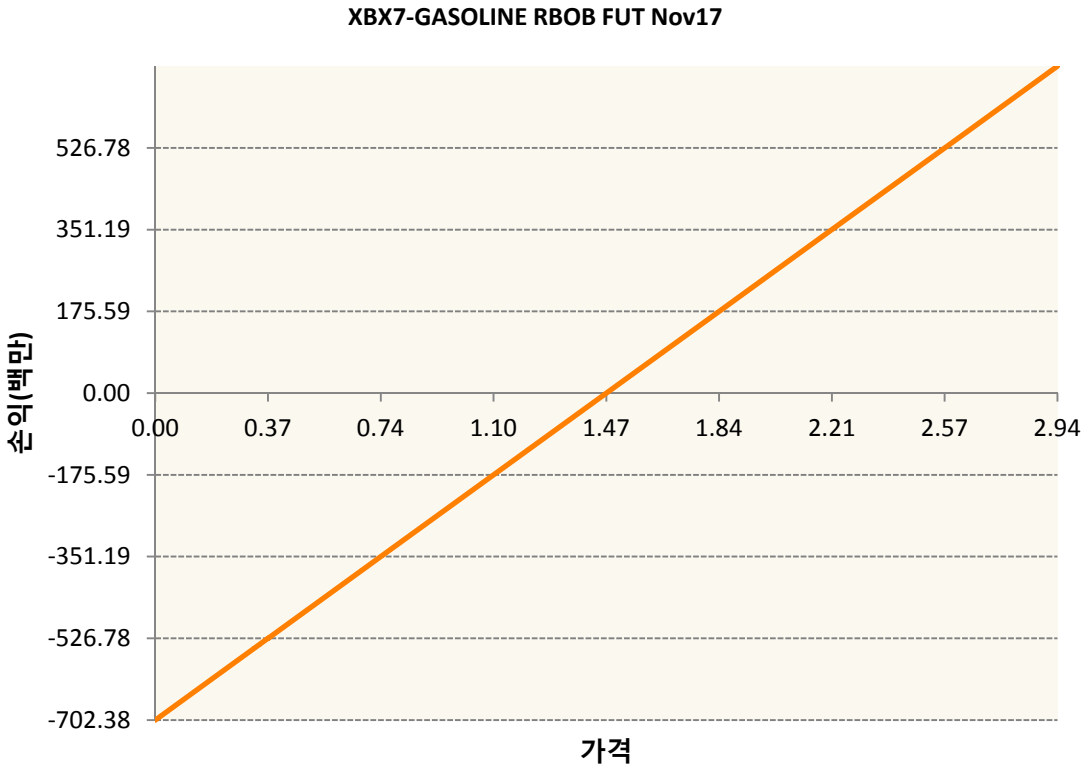

-726.46
-1,089.69
-1,452.92
가격


HOX7-NY Harb ULSD Fut Nov17
759.12
569.34
379.56
189.78
0.00
-189.78
-379.56
-569.34
-759.12
0.00
0.40
0.79
1.19
1.58
1.98
2.37
2.77
3.16
손익(백만)
가격


KR4175M90002-2017-09 달러선물
382.86
255.24
127.62
0.00
-127.62
-255.24
-382.86
0.00
283.60
567.20
850.80
1,134.40
1,418.00
1,701.60
1,985.20
2,268.80
손익(백만)


-510.48
가격


NGX7-NATURAL GAS FUTR Nov17
1,100.07
733.38
366.69
0.00
-366.69
-733.38
-1,100.07
-1,466.75
0.00
0.77
1.53
2.30
3.06
3.83
4.59
5.36
6.12
손익(백만)
가격


XBX7-GASOLINE RBOB FUT Nov17
526.78
351.19
175.59
0.00
-175.59
-351.19
-526.78
-702.38
0.00
0.37
0.74
1.10
1.47
1.84
2.21
2.57
2.94
손익(백만)
가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLX7	WTI CRUDE FUTURE Nov17	78
COX7	BRENT CRUDE FUTR NOV17	116
HOX7	NY Harb ULSD Fut Nov17	61
KR4175M90(	2017-09 달러선물	41
NGX7	NATURAL GAS FUTR Nov17	117
XBX7	GASOLINE RBOB FUT Nov17	56

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

776

공시일	2017-08-23
기준일	2017-08-22

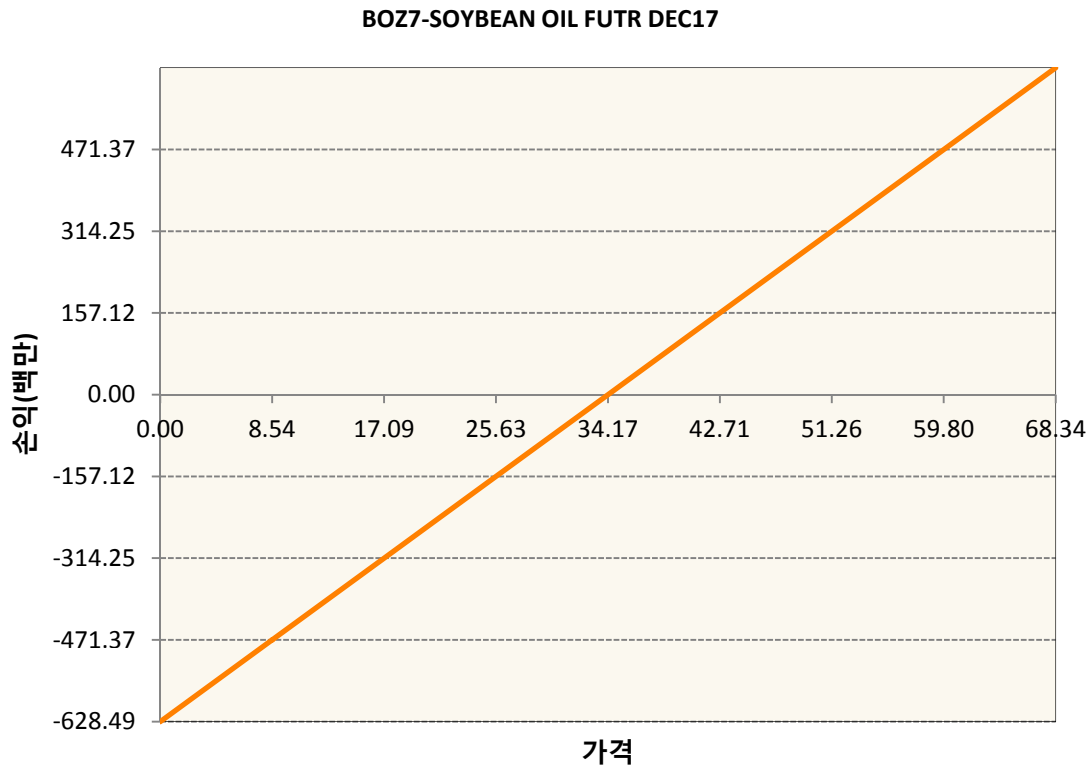
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

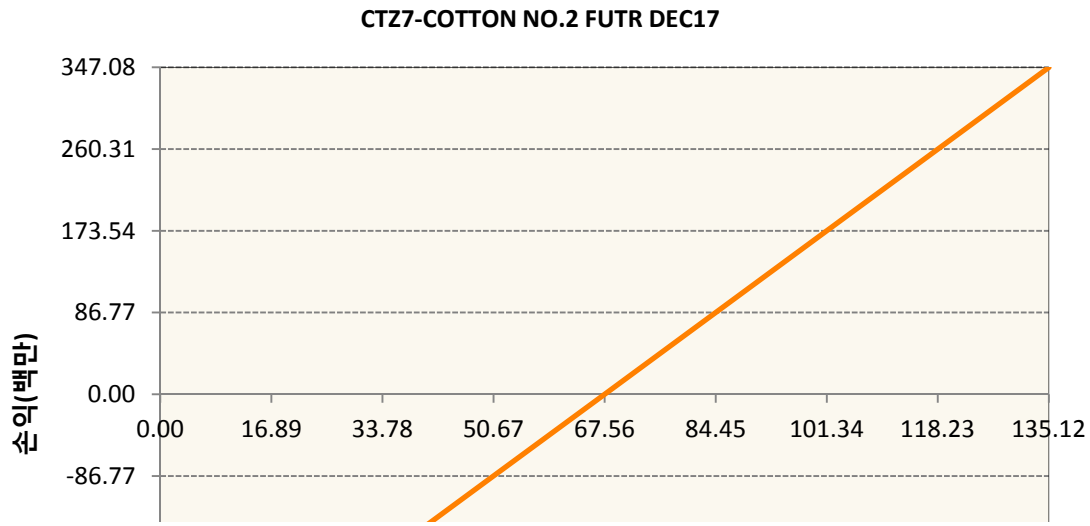
1. 계약금액

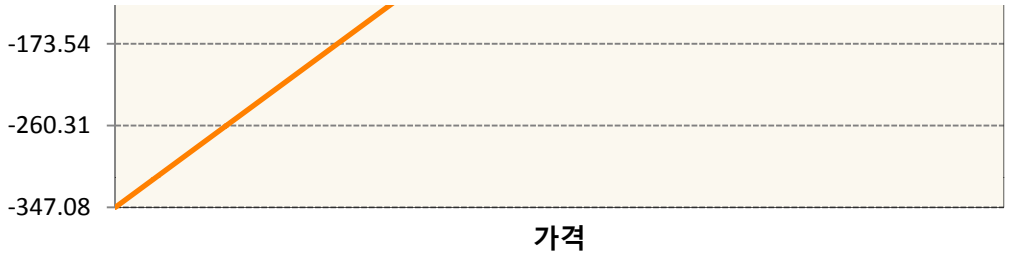
(단위:백만원)

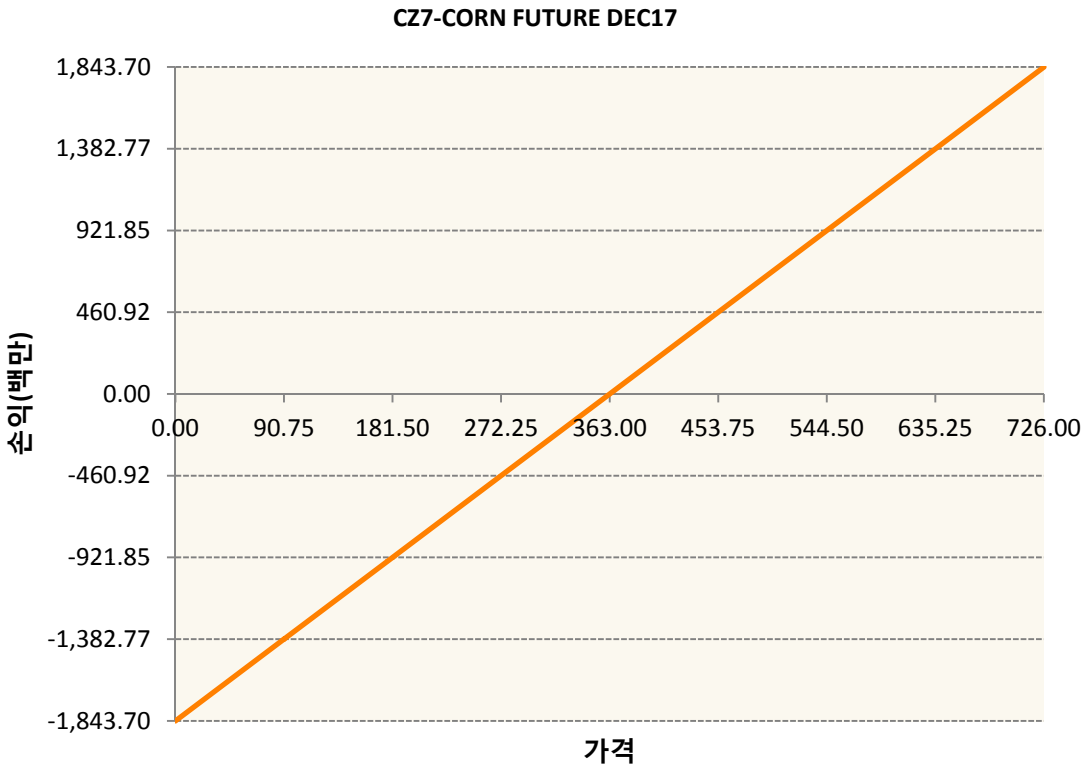
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	6,911	340	6,570	

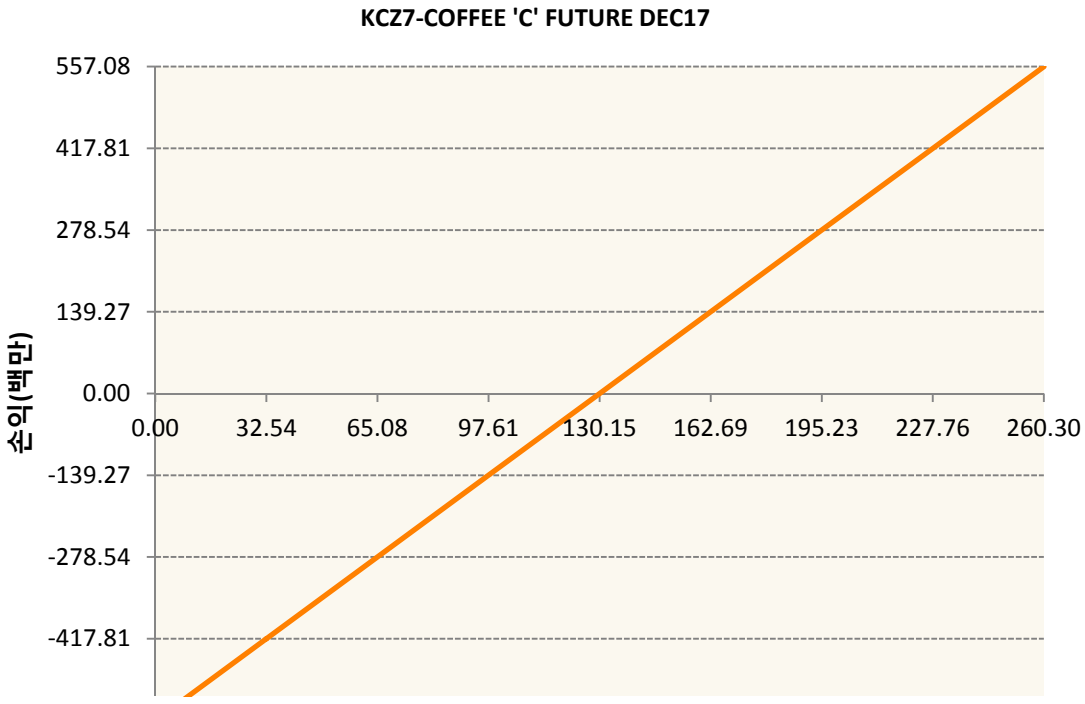
2. 만기시점의 손익구조

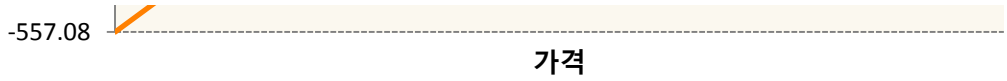


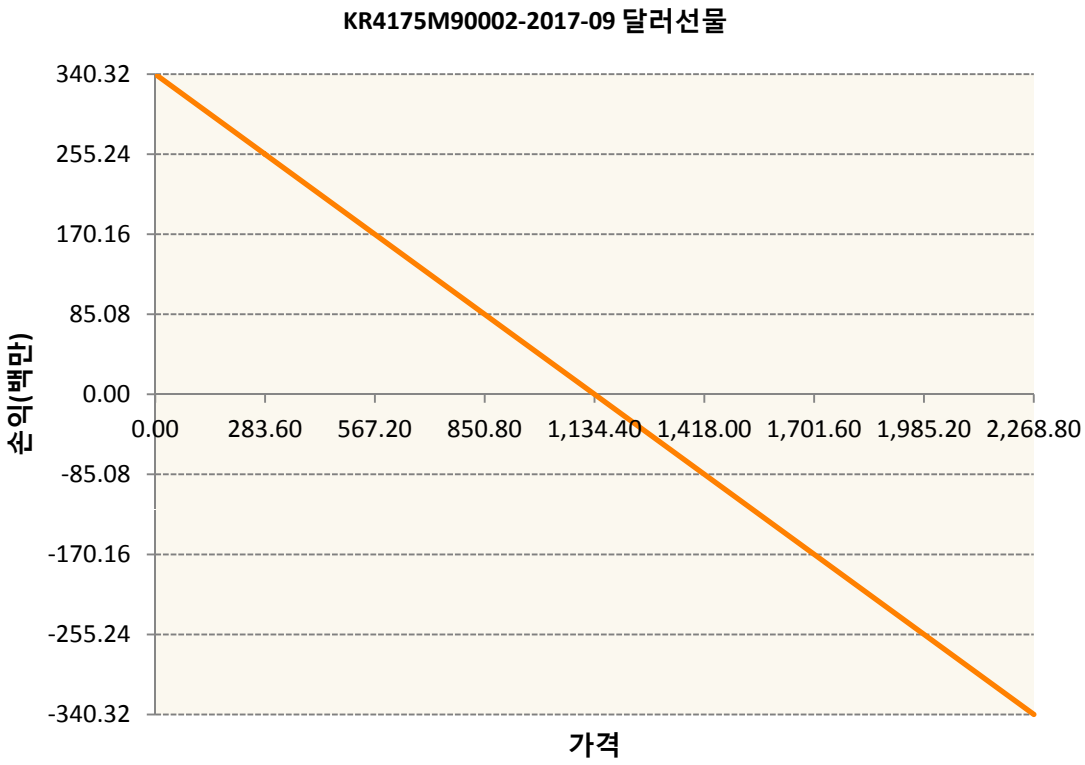


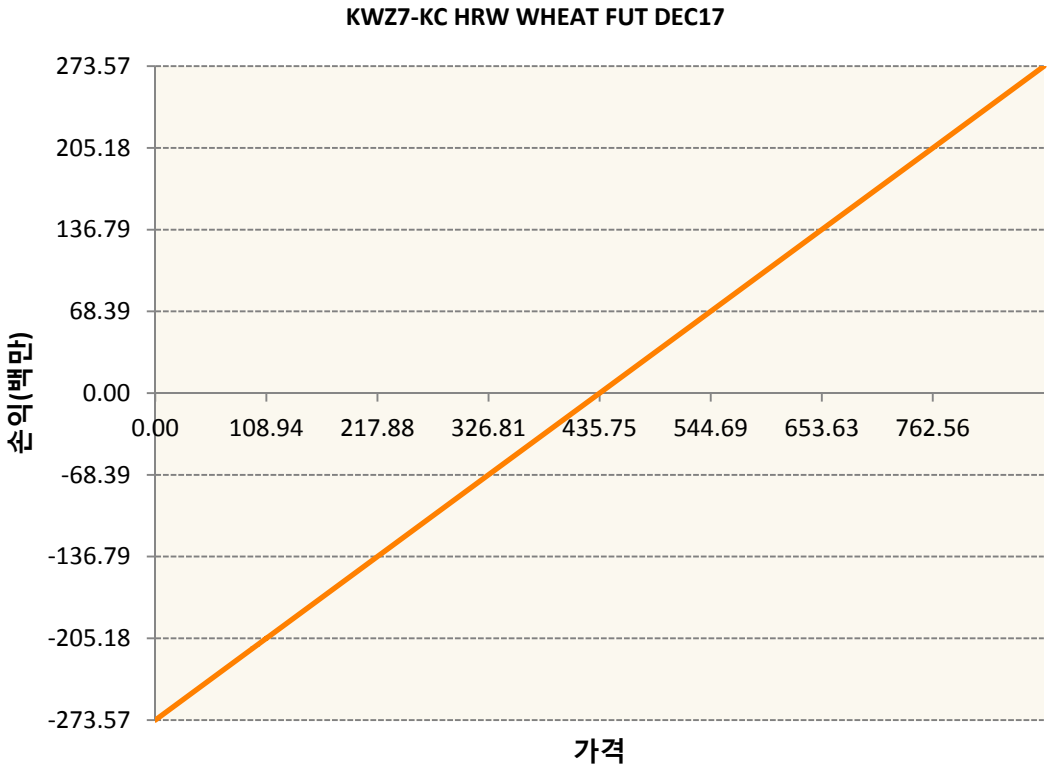

-173.54
-260.31
-347.08
가격

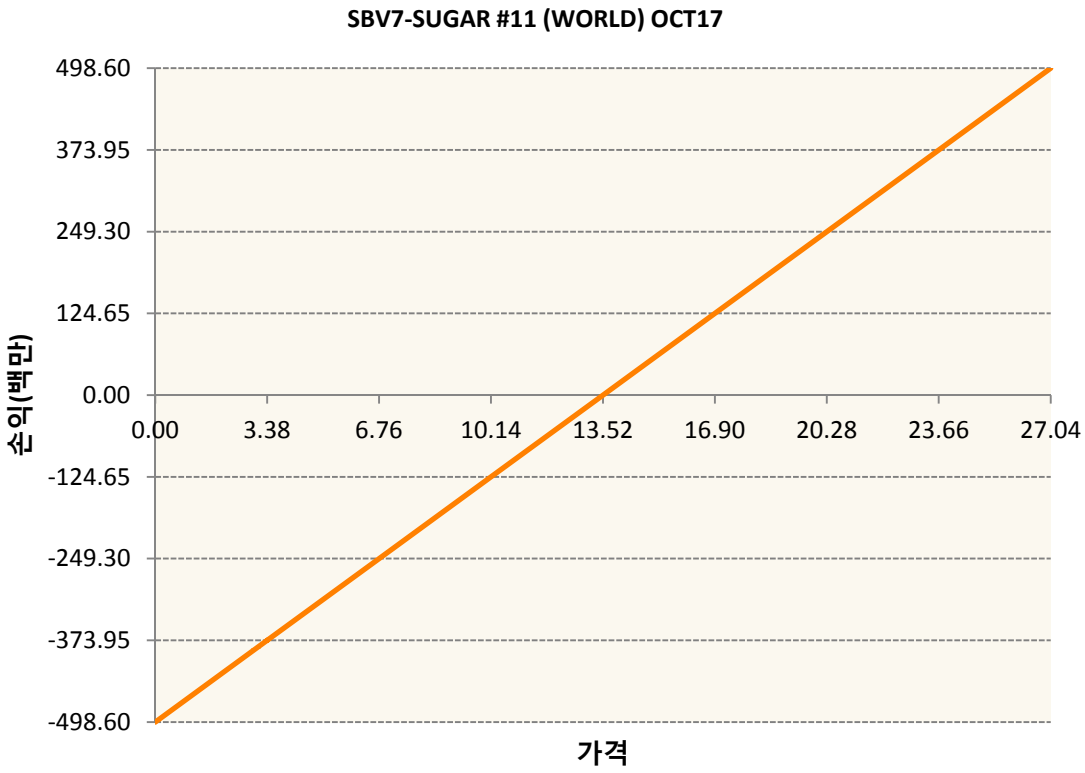

CZ7-CORN FUTURE DEC17
1,843.70
1,382.77
921.85
460.92
0.00
-460.92
-921.85
-1,382.77
-1,843.70
0.00
90.75
181.50
272.25
363.00
453.75
544.50
635.25
726.00
손익(백만)
가격

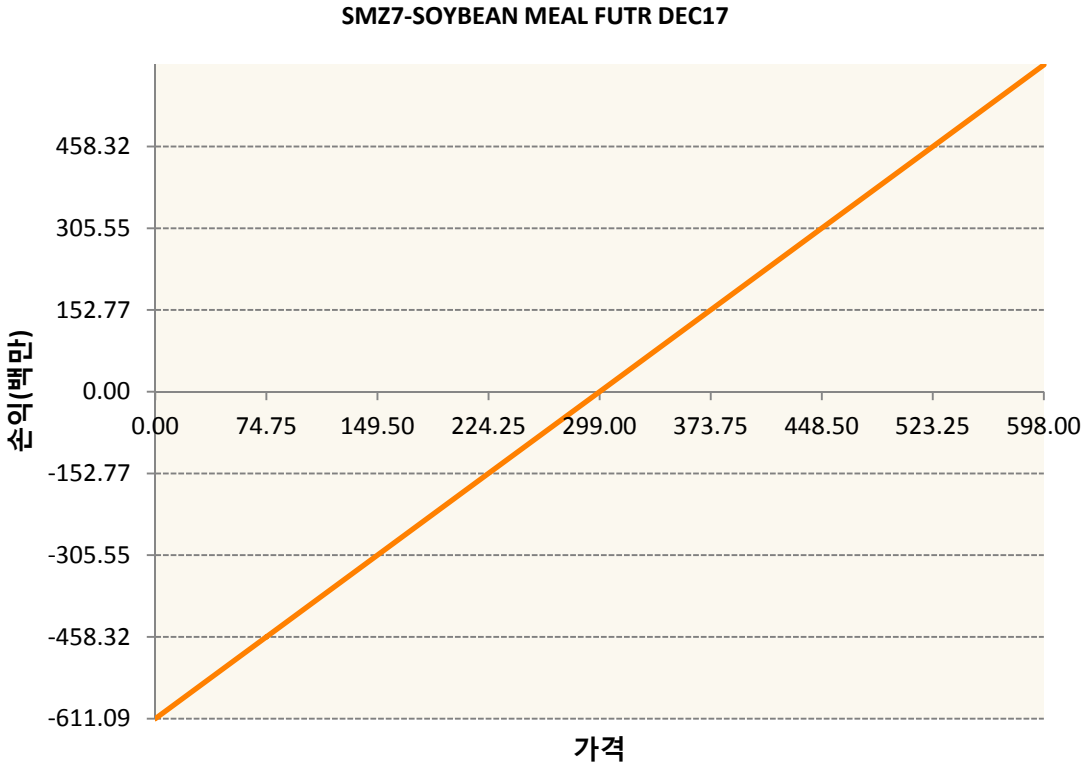

KCZ7-COFFEE 'C' FUTURE DEC17
557.08
417.81
278.54
139.27
0.00
-139.27
-278.54
-417.81
0.00
32.54
65.08
97.61
130.15
162.69
195.23
227.76
260.30
손익(백만)

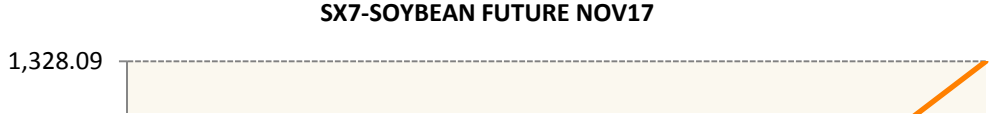

-557.08
가격

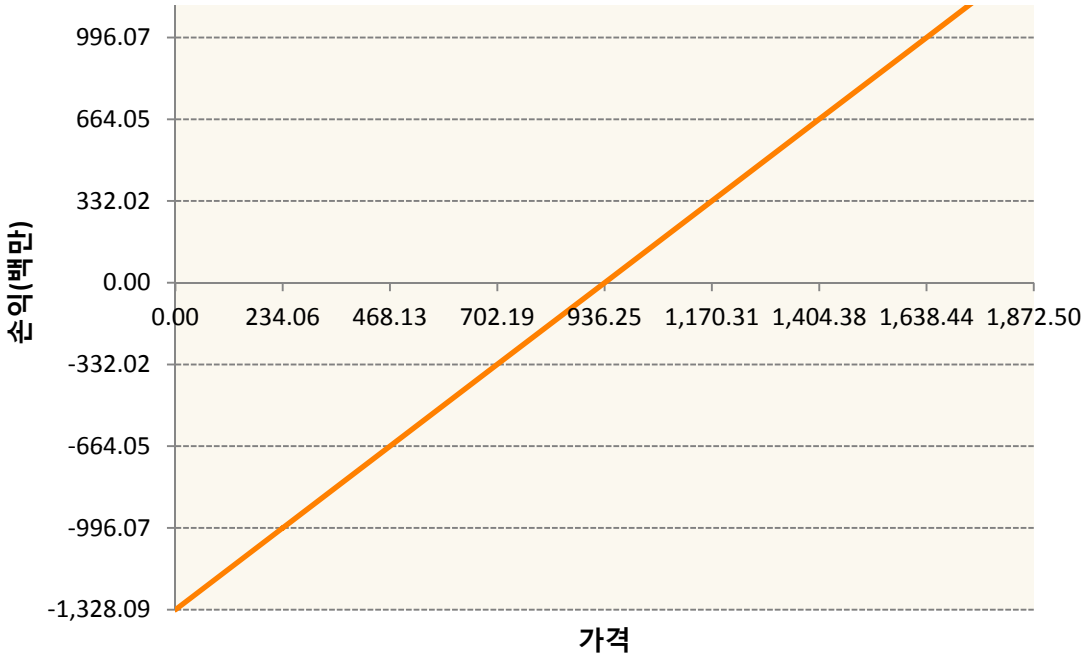

KR4175M90002-2017-09 달러선물
340.32
255.24
170.16
85.08
0.00
-85.08
-170.16
-255.24
-340.32
0.00
283.60
567.20
850.80
1,134.40
1,418.00
1,701.60
1,985.20
2,268.80
손익(백만)
가격

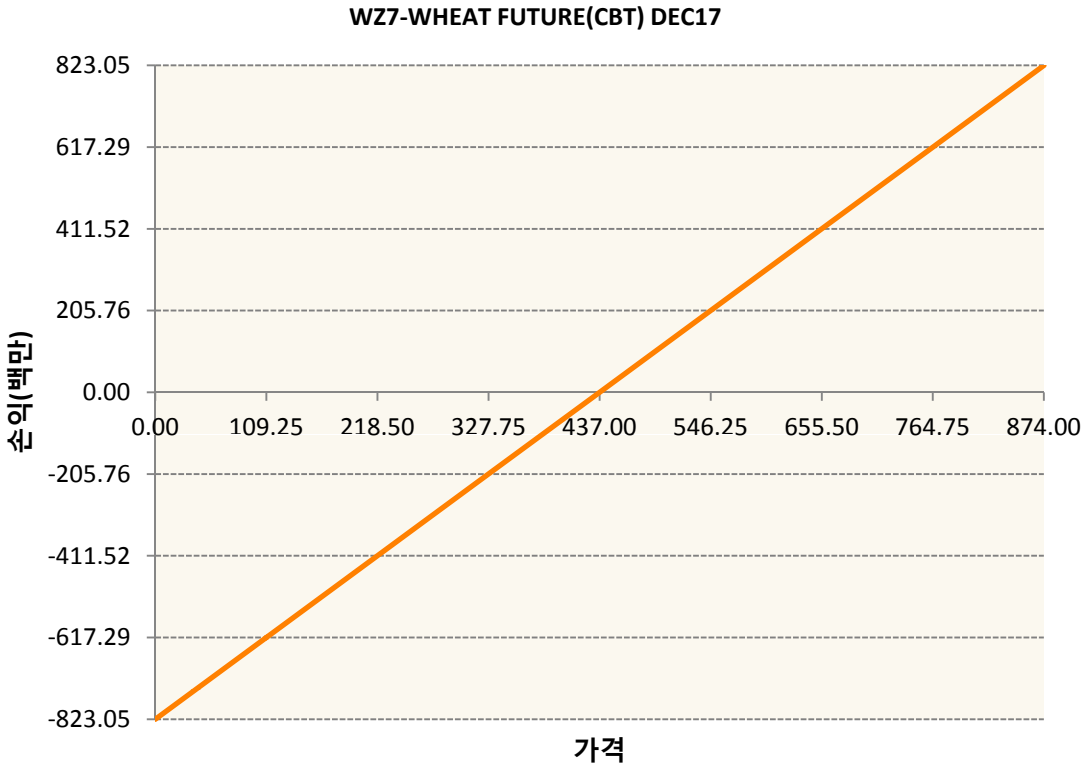

KWZ7-KC HRW WHEAT FUT DEC17
273.57
205.18
136.79
68.39
0.00
-68.39
-136.79
-205.18
-273.57
0.00
108.94
217.88
326.81
435.75
544.69
653.63
762.56
손익(백만)
가격


SBV7-SUGAR #11 (WORLD) OCT17
498.60
373.95
249.30
124.65
0.00
-124.65
-249.30
-373.95
-498.60
0.00
3.38
6.76
10.14
13.52
16.90
20.28
23.66
27.04
손익(백만)
가격


SMZ7-SOYBEAN MEAL FUTR DEC17
458.32
305.55
152.77
0.00
-152.77
-305.55
-458.32
-611.09
0.00
74.75
149.50
224.25
299.00
373.75
448.50
523.25
598.00
손익(백만)
가격


SX7-SOYBEAN FUTURE NOV17
1,328.09





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
BOZ7	SOYBEAN OIL FUTR DEC17	50
CTZ7	COTTON NO.2 FUTR DEC17	28
CZ7	CORN FUTURE DEC17	147
KCZ7	COFFEE 'C' FUTURE DEC17	45
KR4175M90(	2017-09 달러선물	27

KWZ7	KC HRW WHEAT FUT DEC17	22
SBV7	SUGAR #11 (WORLD) OCT17	40
SMZ7	SOYBEAN MEAL FUTR DEC17	49
SX7	SOYBEAN FUTURE NOV17	106
WZ7	WHEAT FUTURE(CBT) DEC17	66

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

652