공시일	2017-08-24
기준일	2017-08-23

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	2017-08-24
기준일	2017-08-23

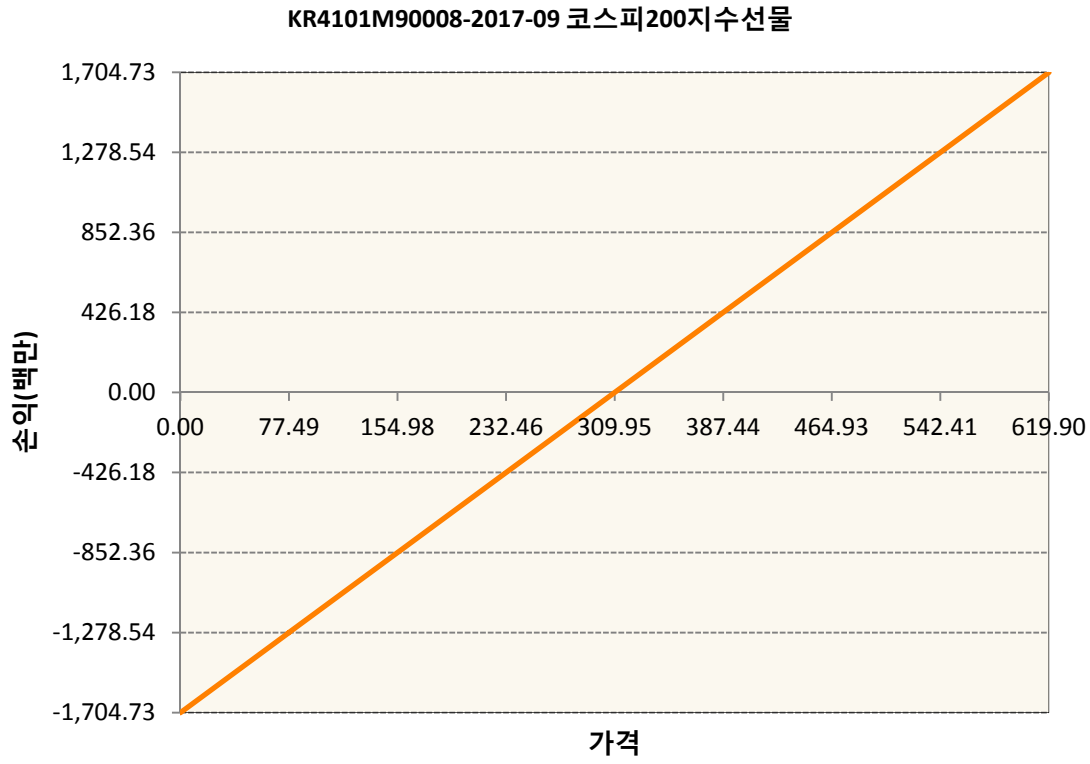
스마트인덱스모

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	2017-08-24
기준일	2017-08-23

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	1,014

* 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	2017-08-24
기준일	2017-08-23

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	400

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

342

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-08-24
기준일	2017-08-23

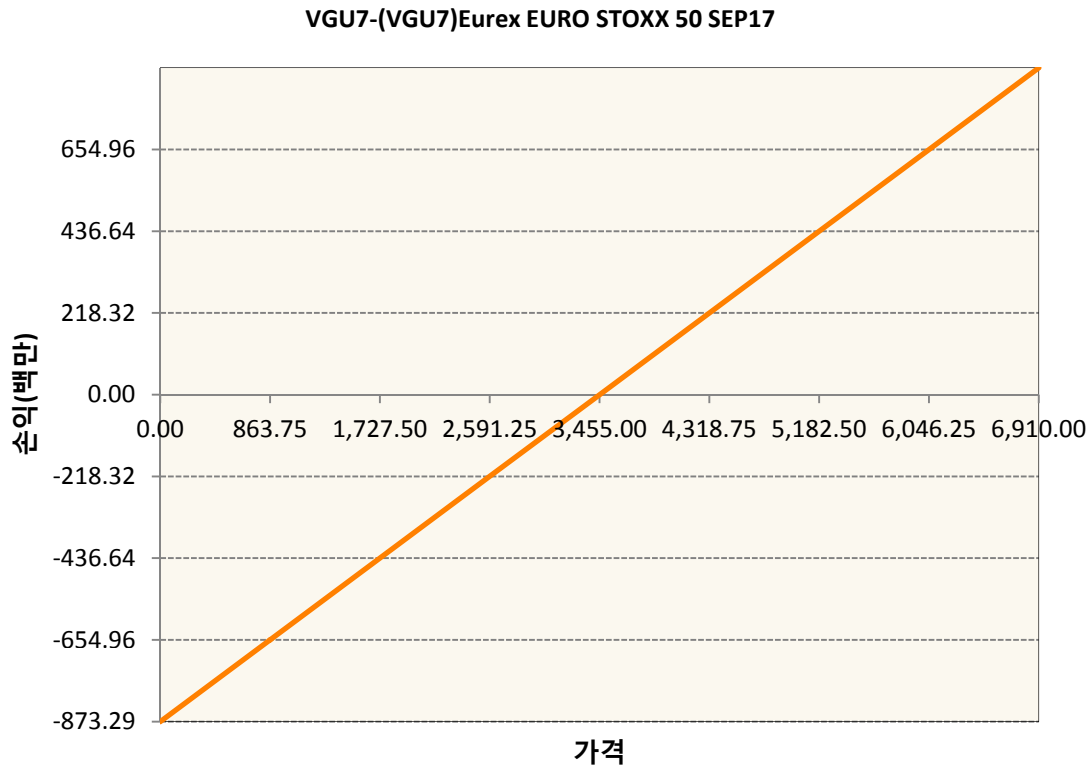
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	873	0	873	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGU7	(VGU7)Eurex EURO STOXX 50 SEP17	70

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

(단위:백만원)

57

공시일	2017-08-24
기준일	2017-08-23

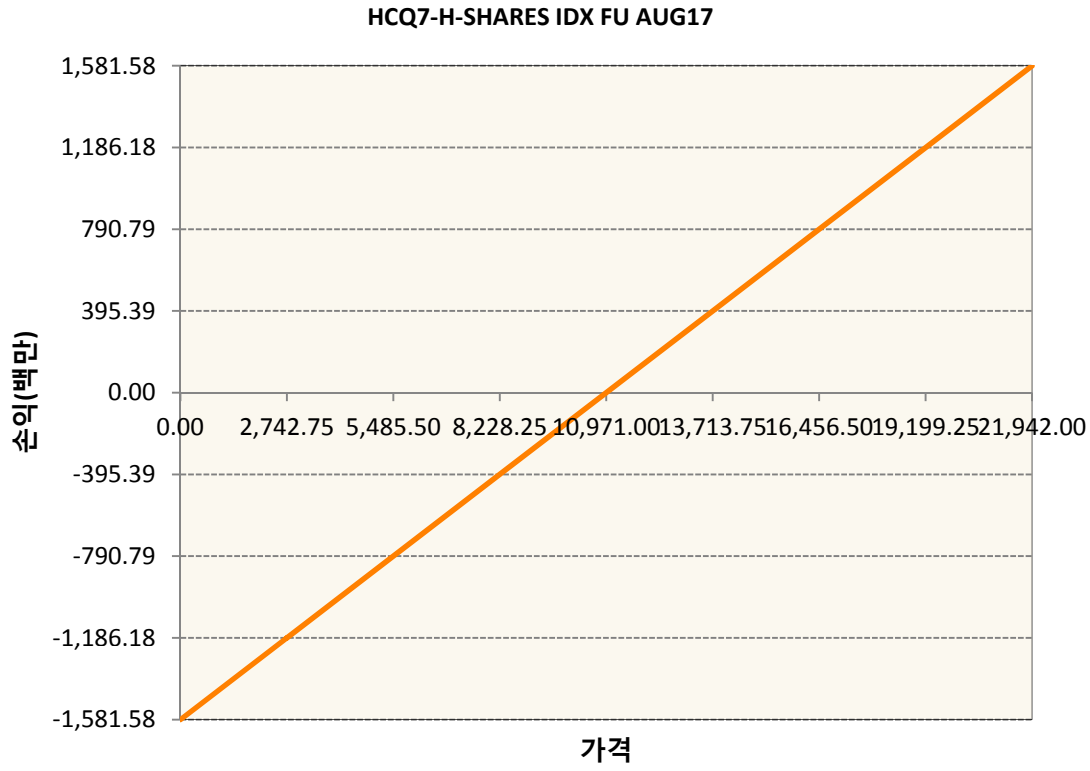
차이나인덱스모(주식-파생형)

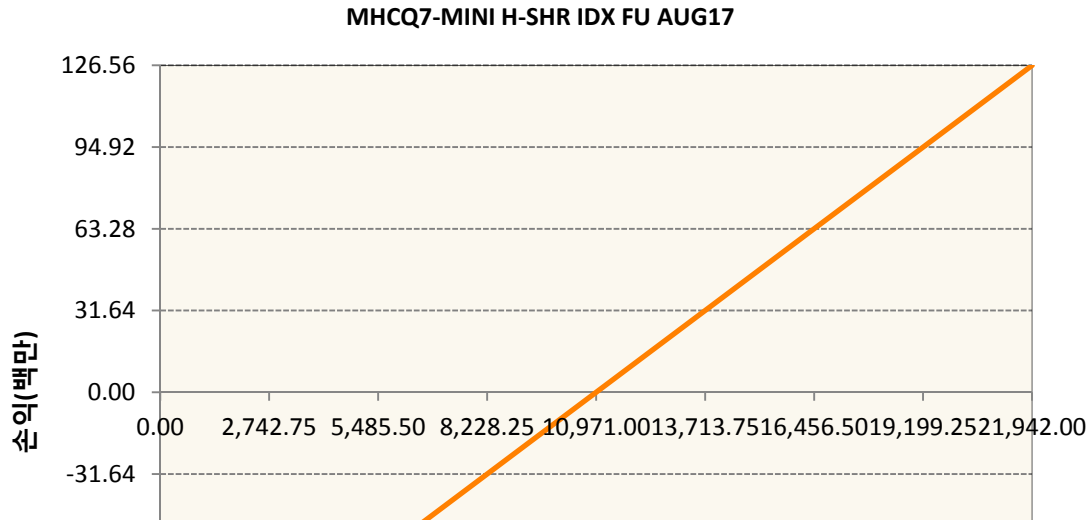
1. 계약금액

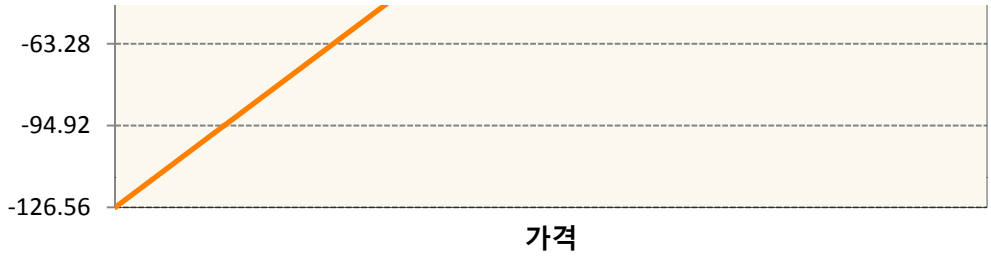
(단위:백만원)

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	2017-08-24
기준일	2017-08-23

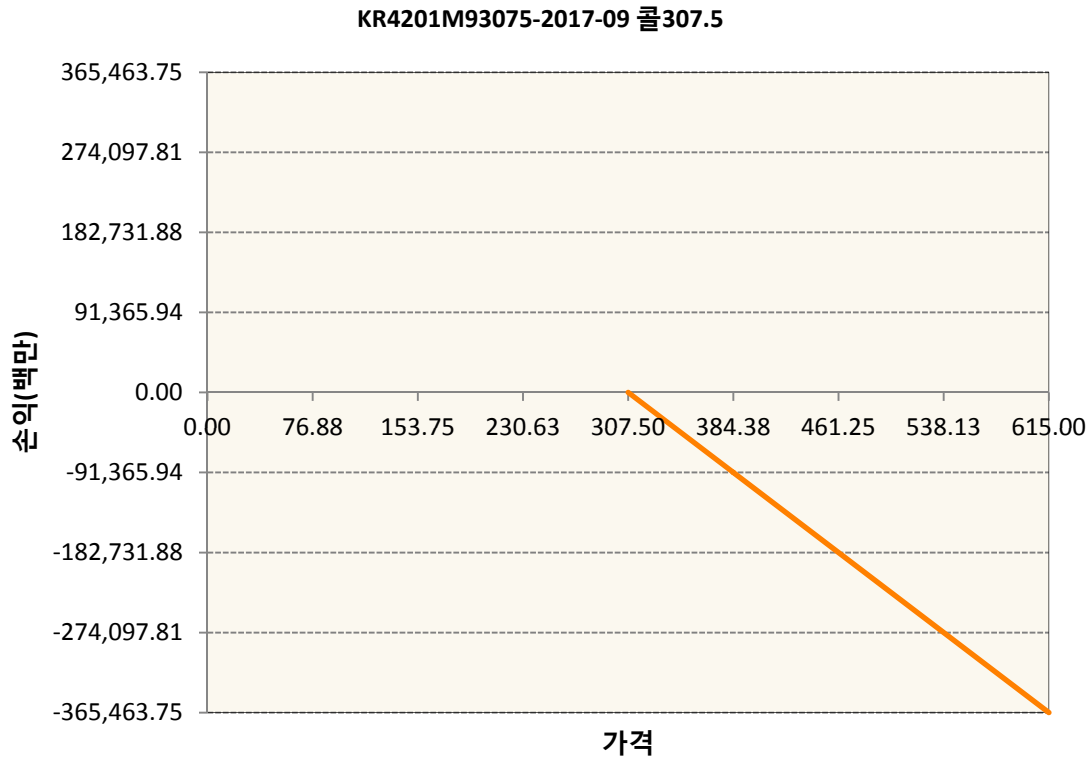
커버드콜모(주식혼합-파생형)

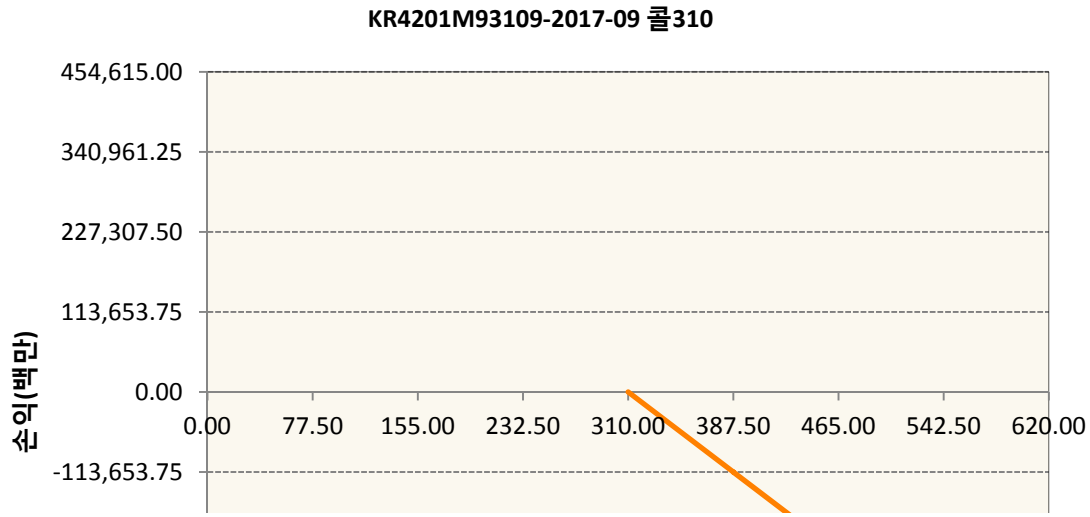
1. 계약금액

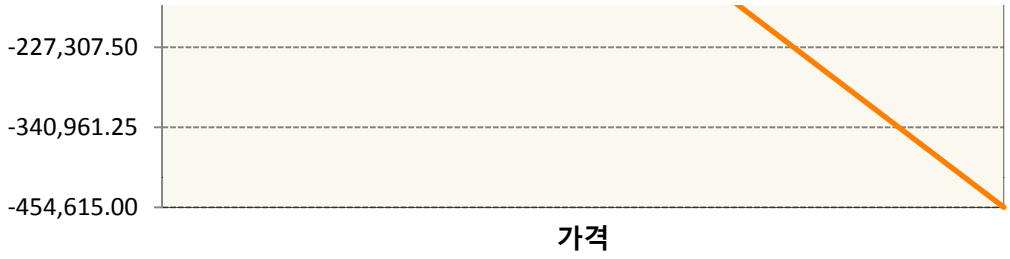
(단위:백만원)

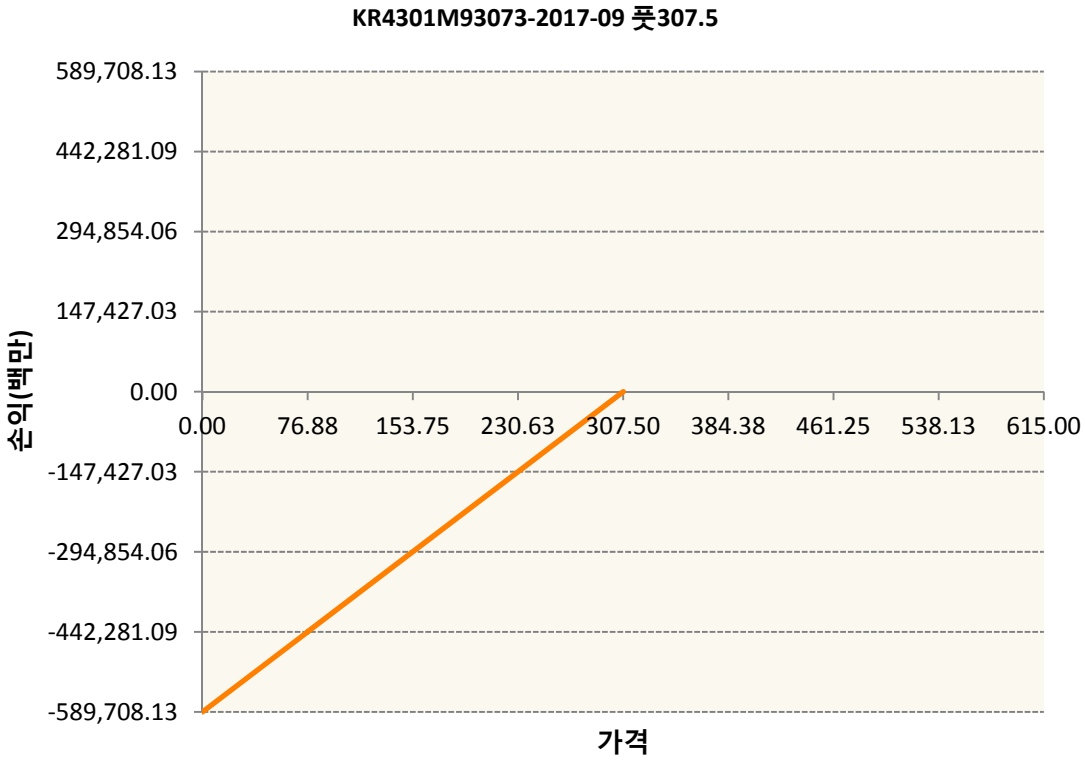
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	15,495	-15,495	장내
누계	유가증권	옵션	0	1,466,284	-1,466,284	장내

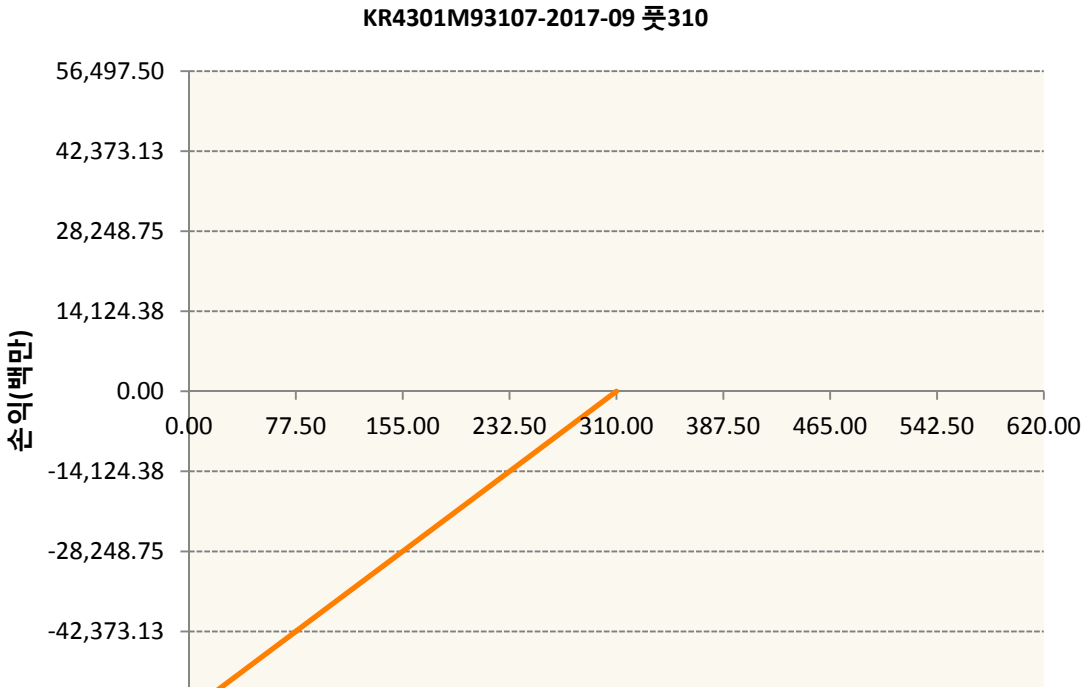
2. 만기시점의 손익구조

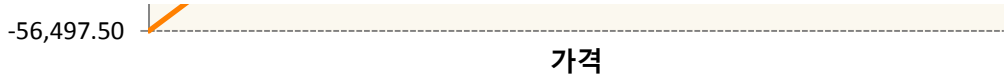





-227,307.50
-340,961.25
-454,615.00
가격


KR4301M93073-2017-09 풋307.5
589,708.13
442,281.09
294,854.06
147,427.03
0.00
-147,427.03
-294,854.06
-442,281.09
-589,708.13
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							24,011
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	9,258	9,118	8,932	8,704	8,437	8,133	7,798
-5.33%	8,531	8,171	7,769	7,334	6,870	6,383	5,877
-2.67%	6,393	5,795	5,186	4,568	3,944	3,314	2,680
0%	1,994	1,331	666	0	-667	-1,335	-2,003
2.67%	-4,801	-5,309	-5,844	-6,402	-6,976	-7,565	-8,166
5.33%	-13,325	-13,601	-13,927	-14,296	-14,702	-15,140	-15,606
8.00%	-22,718	-22,827	-22,981	-23,178	-23,417	-23,696	-24,011
KR4201M93: 2017-09 콜310							28,315
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	9,643	9,519	9,345	9,121	8,849	8,531	8,172
-5.33%	9,029	8,670	8,254	7,790	7,284	6,743	6,172
-2.67%	7,023	6,354	5,659	4,945	4,215	3,473	2,721
0%	2,498	1,665	833	0	-833	-1,665	-2,498
2.67%	-5,034	-5,746	-6,481	-7,233	-7,998	-8,774	-9,559
5.33%	-15,001	-15,433	-15,922	-16,459	-17,035	-17,645	-18,282
8.00%	-26,344	-26,535	-26,785	-27,093	-27,454	-27,863	-28,315
KR4301M93(2017-09 풋307.5							34,889
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-32,533	-32,760	-33,059	-33,427	-33,859	-34,348	-34,889
-5.33%	-17,882	-18,464	-19,112	-19,815	-20,563	-21,349	-22,166
-2.67%	-5,508	-6,473	-7,456	-8,453	-9,461	-10,477	-11,500
0%	3,218	2,148	1,075	0	-1,076	-2,153	-3,232
2.67%	8,077	7,258	6,394	5,494	4,567	3,617	2,648
5.33%	10,148	9,702	9,176	8,581	7,925	7,218	6,466
8.00%	10,815	10,638	10,391	10,073	9,686	9,236	8,728
KR4301M93: 2017-09 풋310							3,496
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-3,313	-3,328	-3,350	-3,378	-3,412	-3,451	-3,496
-5.33%	-1,886	-1,930	-1,982	-2,040	-2,102	-2,170	-2,241
-2.67%	-631	-714	-801	-889	-980	-1,072	-1,166
0%	310	207	103	0	-103	-207	-310
2.67%	878	790	698	605	510	413	316

5.33%	1,143	1,090	1,029	962	891	815	736
8.00%	1,238	1,214	1,183	1,144	1,100	1,049	993

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

90,952

공시일	2017-08-24
기준일	2017-08-23

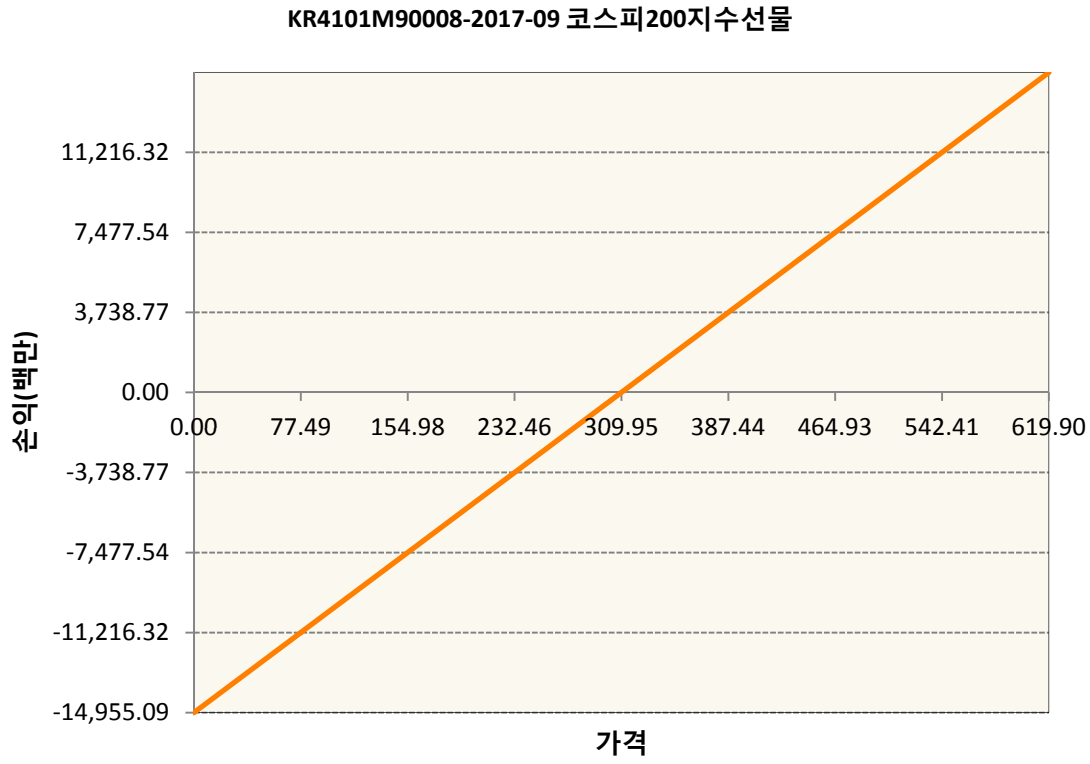
ETF스마트레버리지목표전환형6호

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	14,955	0	14,955	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101M90(2017-09 코스피200지수선물							1,195
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,195	-1,195	-1,195	-1,195	-1,195	-1,195	-1,195
-5.33%	-797	-797	-797	-797	-797	-797	-797
-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%	797	797	797	797	797	797	797
8.00%	1,195	1,195	1,195	1,195	1,195	1,195	1,195

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

745

공시일	2017-08-24
기준일	2017-08-23

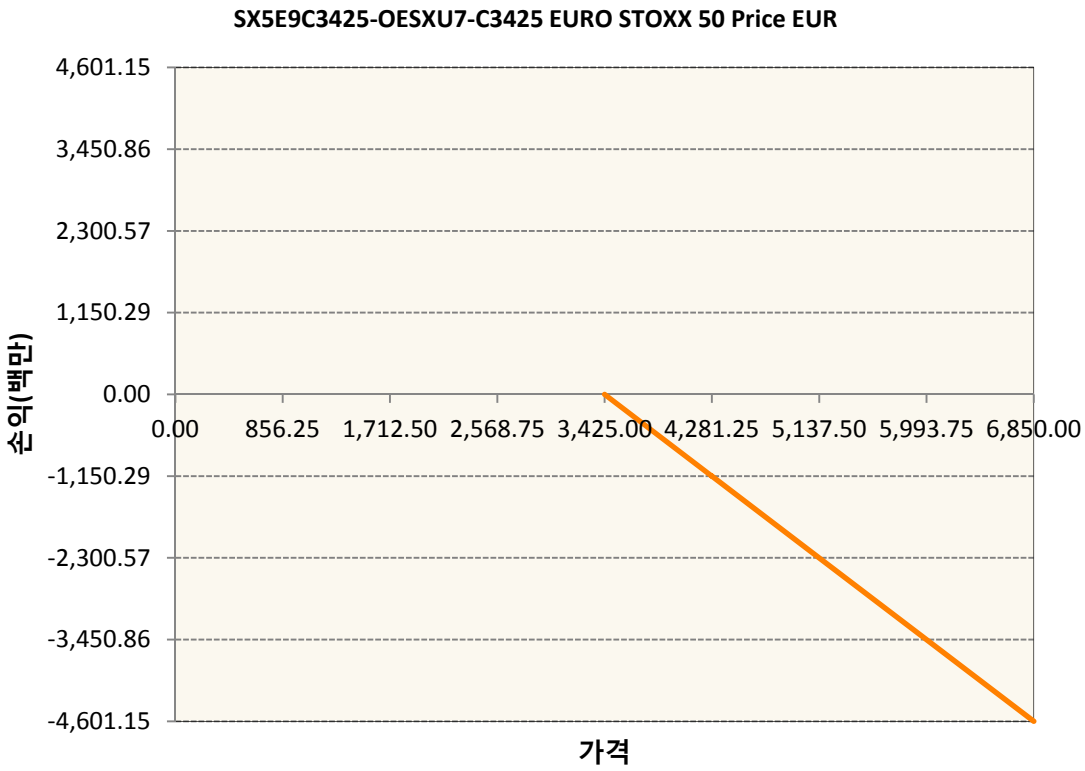
유로커버드콜(주식혼합-파생형)

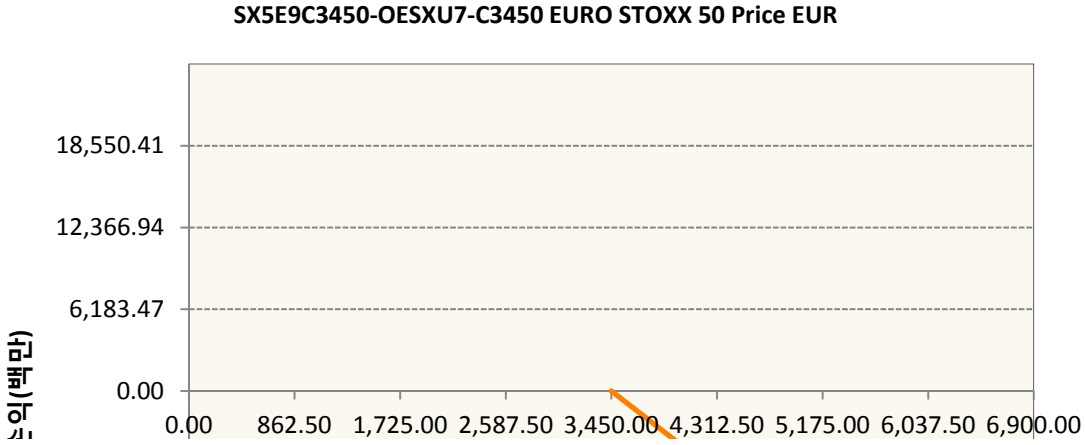
1. 계약금액

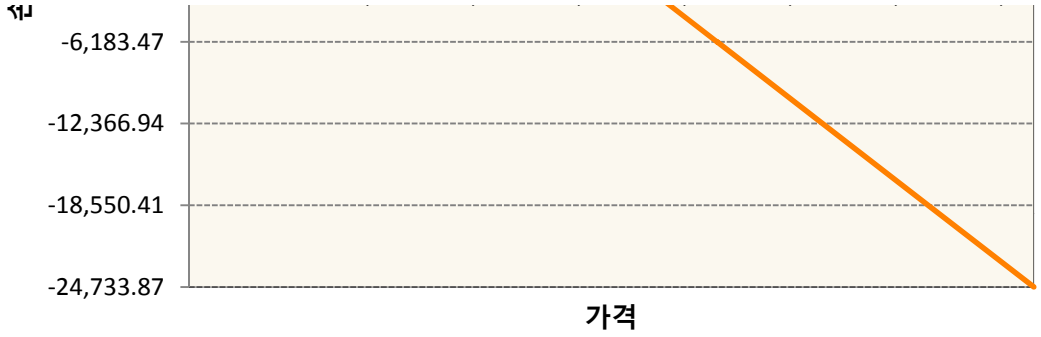
(단위:백만원)

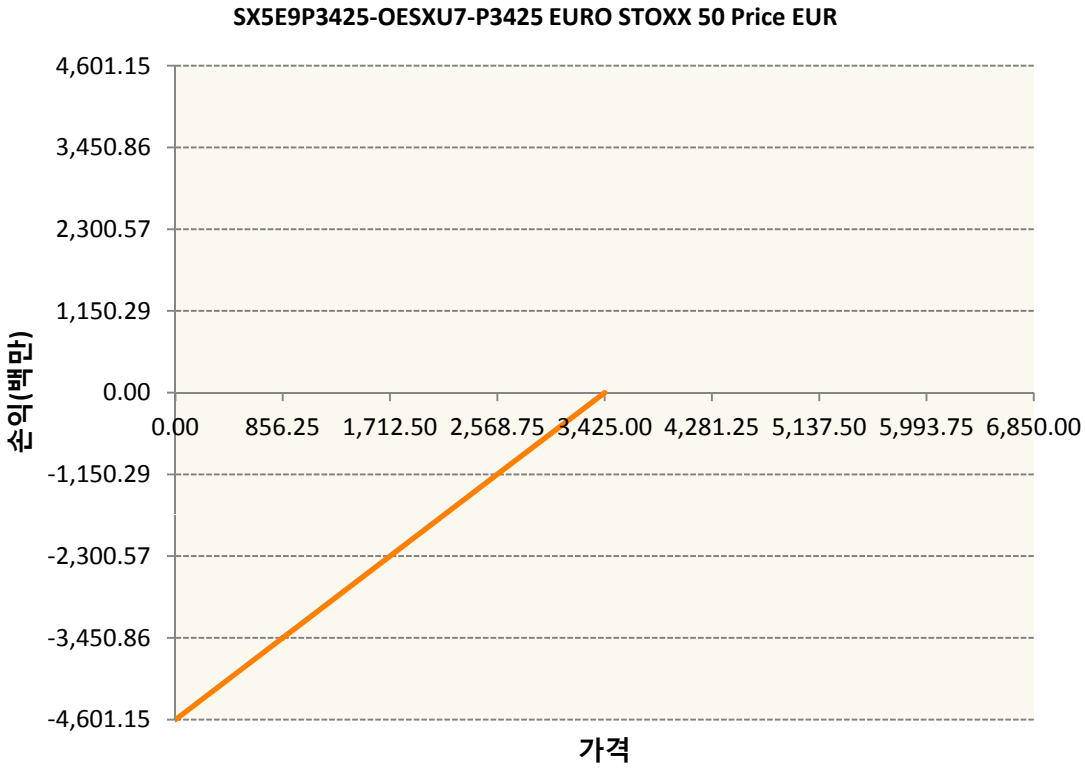
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	25,356	0	25,356	
누계	유가증권	옵션	0	58,670	-58,670	장내

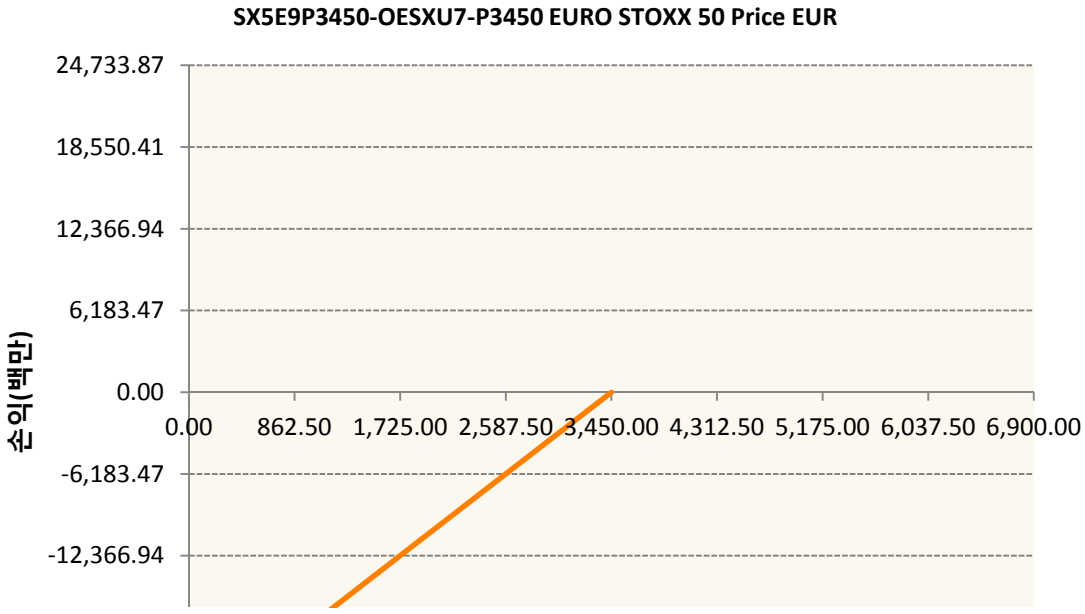
2. 만기시점의 손익구조

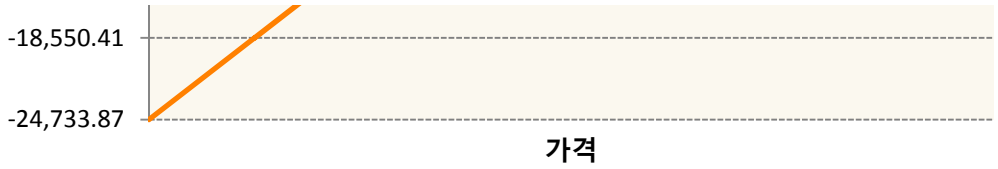


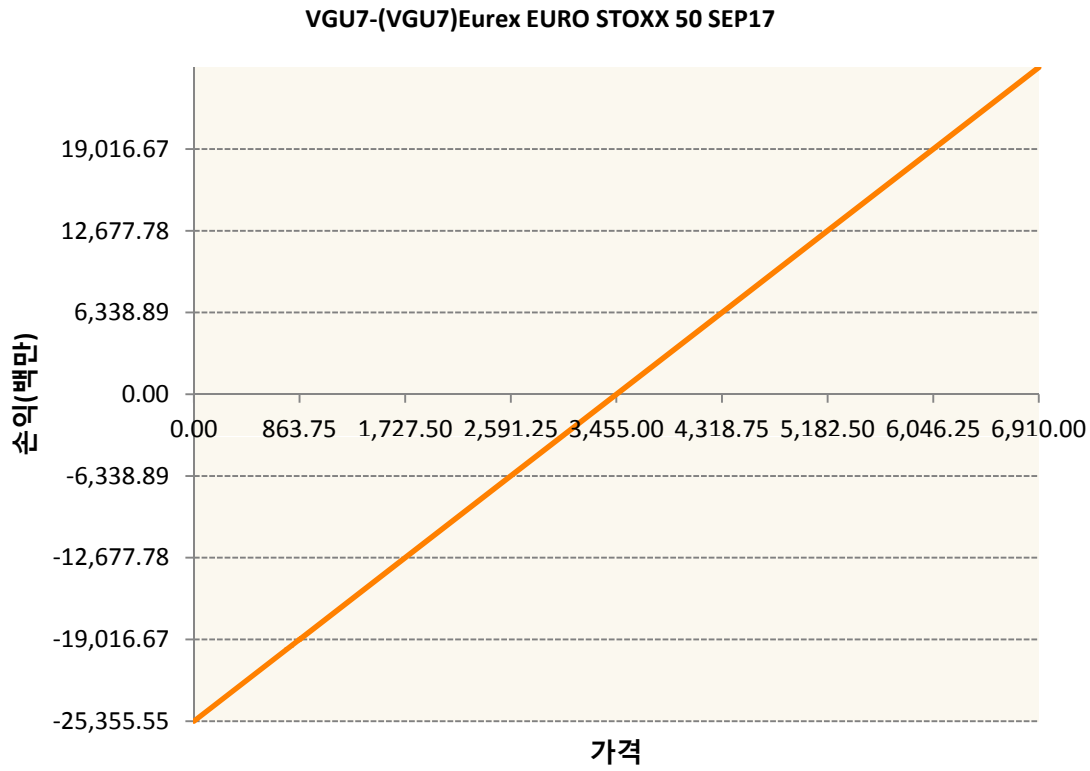



-6,183.47
-12,366.94
-18,550.41
-24,733.87
가격


SX5E9P3425-OESXU7-P3425 EURO STOXX 50 Price EUR
4,601.15
3,450.86
2,300.57
1,150.29
0.00
-1,150.29
-2,300.57
-3,450.86
-4,601.15
0.00
856.25
1,712.50
2,568.75
3,425.00
4,281.25
5,137.50
5,993.75
6,850.00
손익(백만)
가격


SX5E9P3450-OESXU7-P3450 EURO STOXX 50 Price EUR
24,733.87
18,550.41
12,366.94
6,183.47
0.00
-6,183.47
-12,366.94
0.00
862.50
1,725.00
2,587.50
3,450.00
4,312.50
5,175.00
6,037.50
6,900.00
손익(백만)





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
SX5E9C3425	OESXU7-C3425 EURO STOXX 50 Price EUR	368
SX5E9C3450	OESXU7-C3450 EURO STOXX 50 Price EUR	1,979
SX5E9P3425	OESXU7-P3425 EURO STOXX 50 Price EUR	368
SX5E9P3450	OESXU7-P3450 EURO STOXX 50 Price EUR	1,979
VGU7	(VGU7)Eurex EURO STOXX 50 SEP17	2,028

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	5,459

공시일	2017-08-24
기준일	2017-08-23

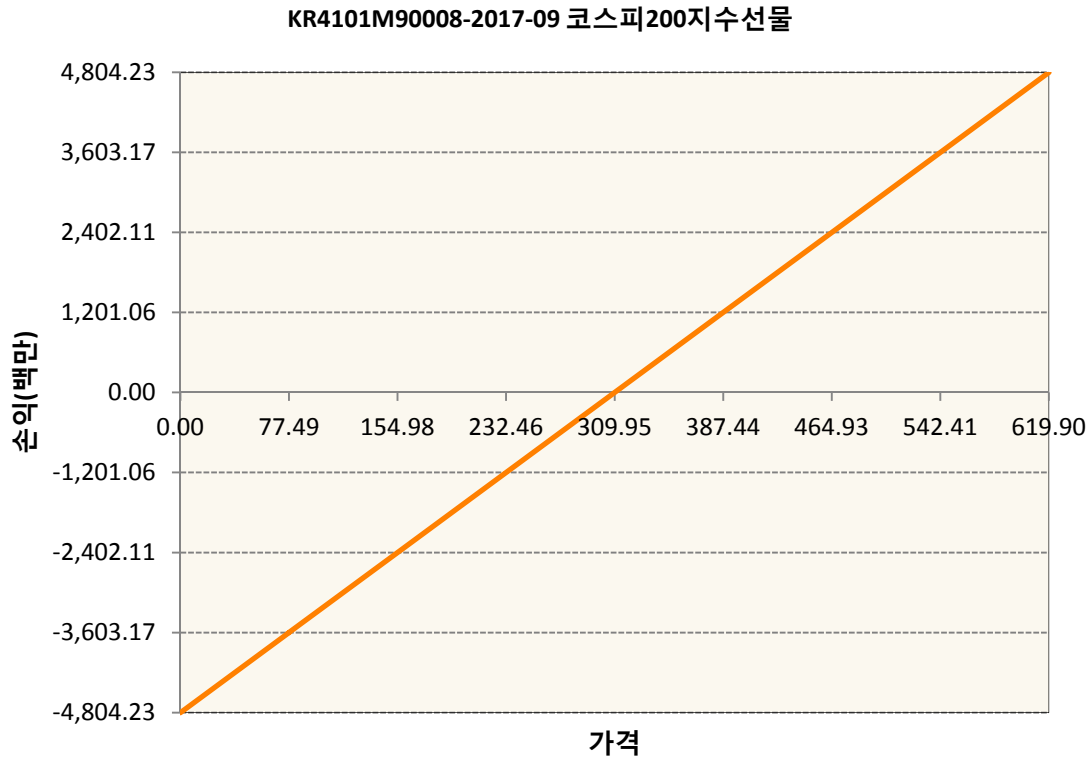
ETF스마트레버리지목표전환형7호

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	4,804	0	4,804	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	2017-08-24
기준일	2017-08-23

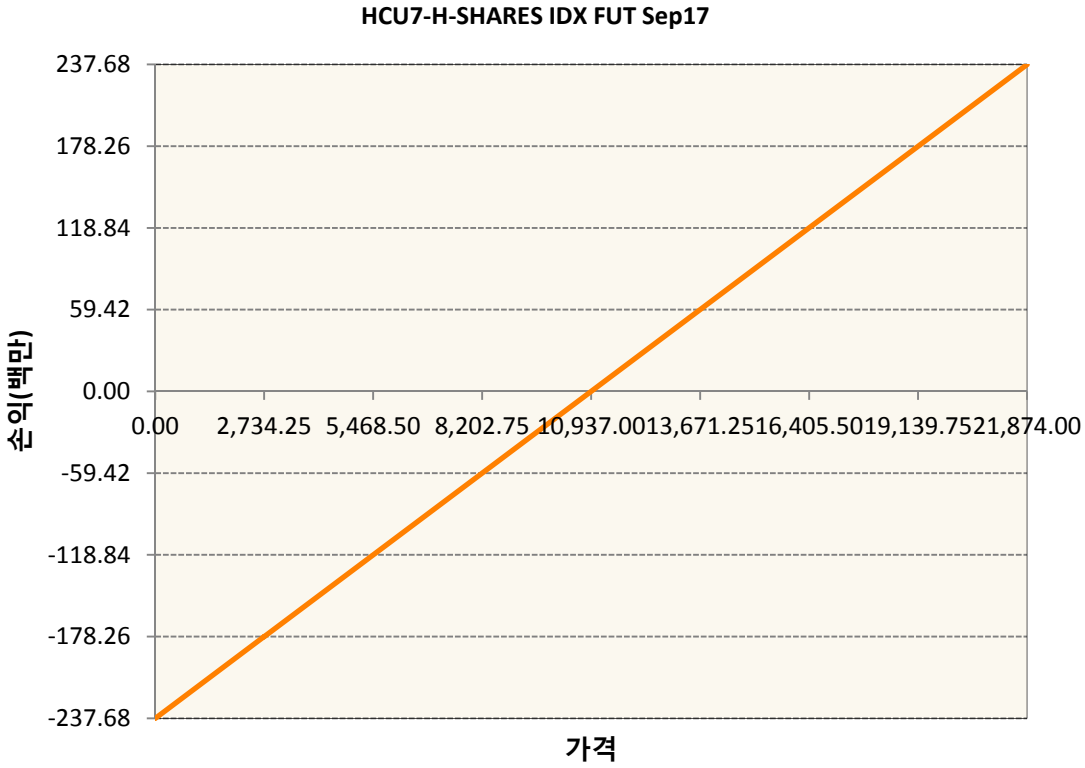
홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생

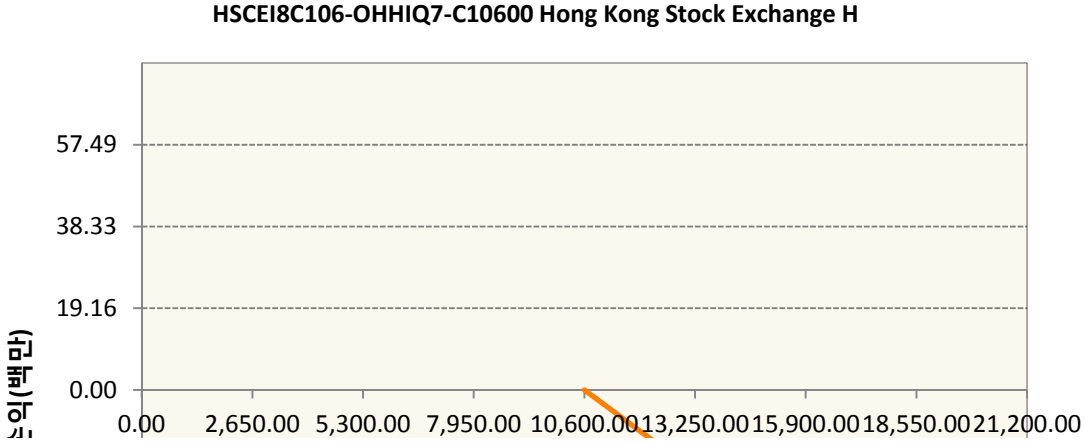
1. 계약금액

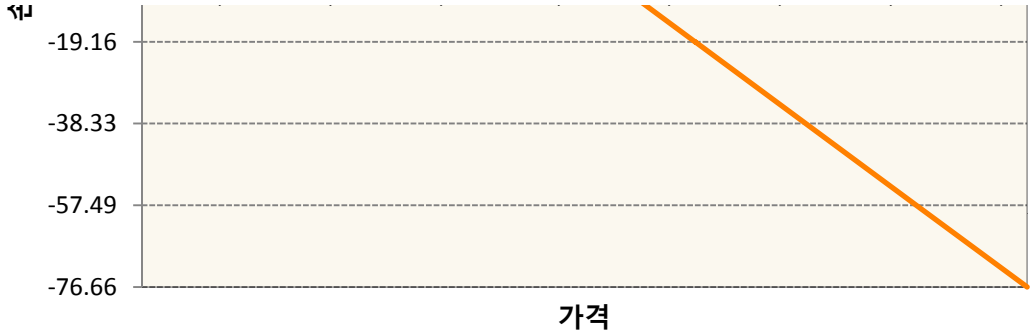
(단위:백만원)

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	238	0	238	장내
누계	유가증권	옵션	0	466	-466	장내

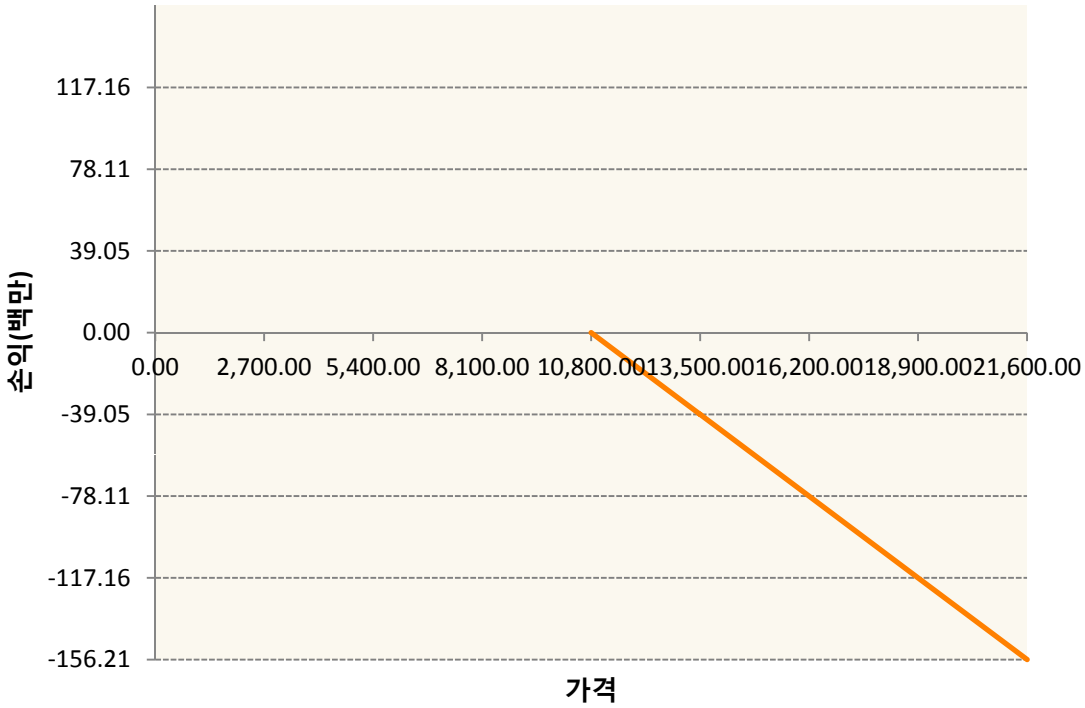
2. 만기시점의 손익구조



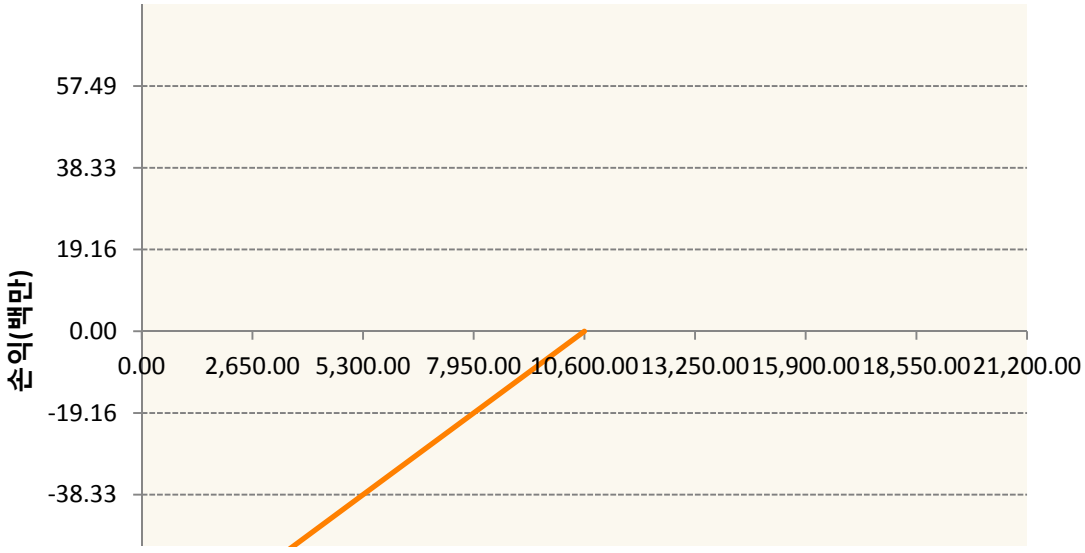


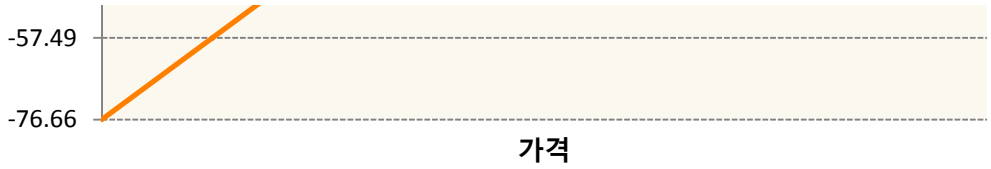


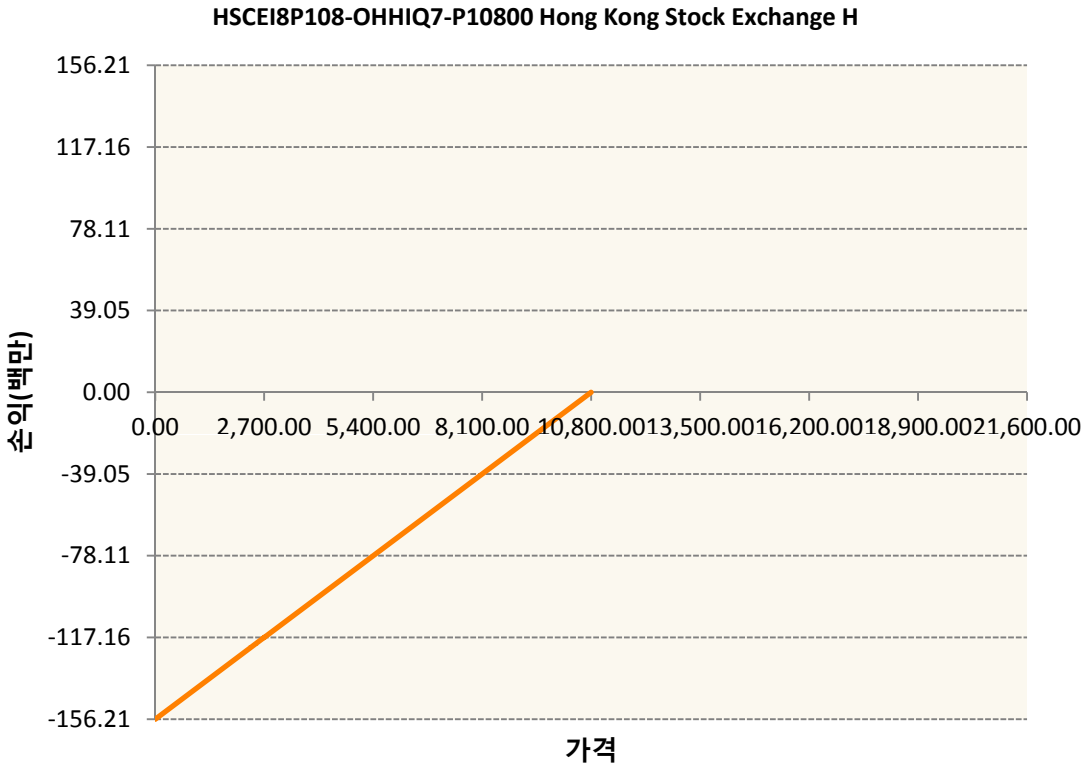
HSCEI8C108-OHHIQ7-C10800 Hong Kong Stock Exchange H



HSCEI8P106-OHHIQ7-P10600 Hong Kong Stock Exchange H







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)	(단위:백만원)
HCU7 H-SHARES IDX FUT Sep17	19
HSCEI8C106 OHHIQ7-C10600 Hong Kong Stock Exchange H	6
HSCEI8C108 OHHIQ7-C10800 Hong Kong Stock Exchange H	12
HSCEI8P106 OHHIQ7-P10600 Hong Kong Stock Exchange H	6
HSCEI8P108 OHHIQ7-P10800 Hong Kong Stock Exchange H	12

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	49

공시일	2017-08-24
기준일	2017-08-23

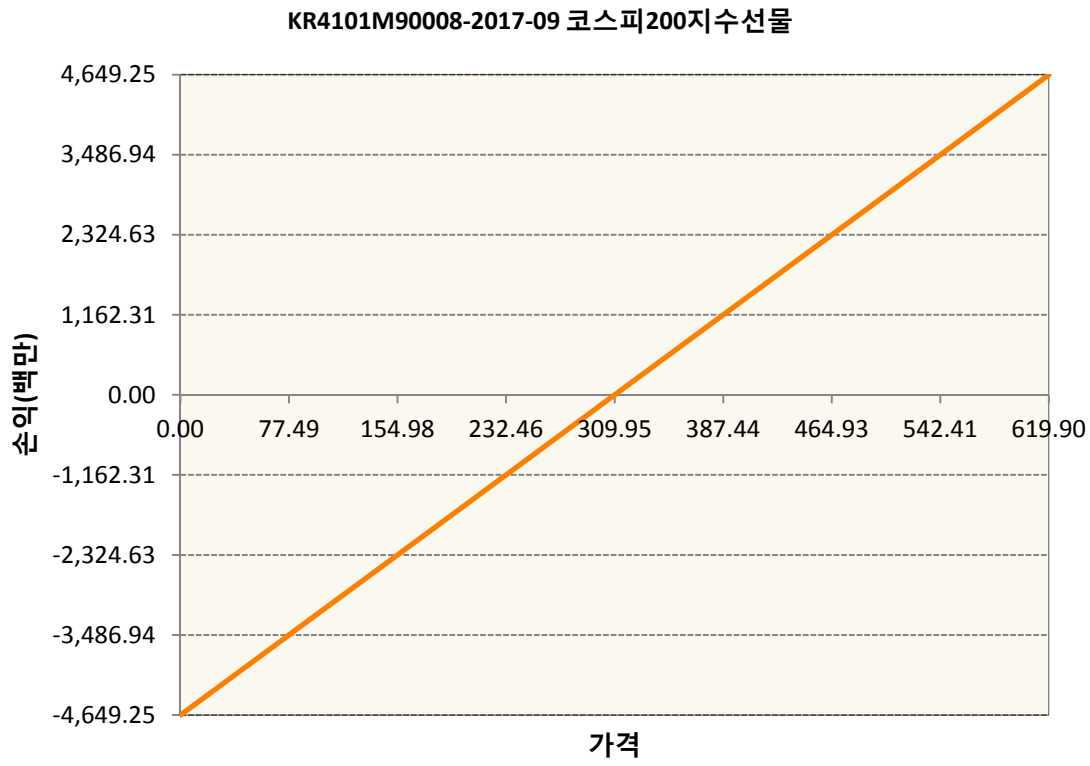
코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼

1. 계약금액

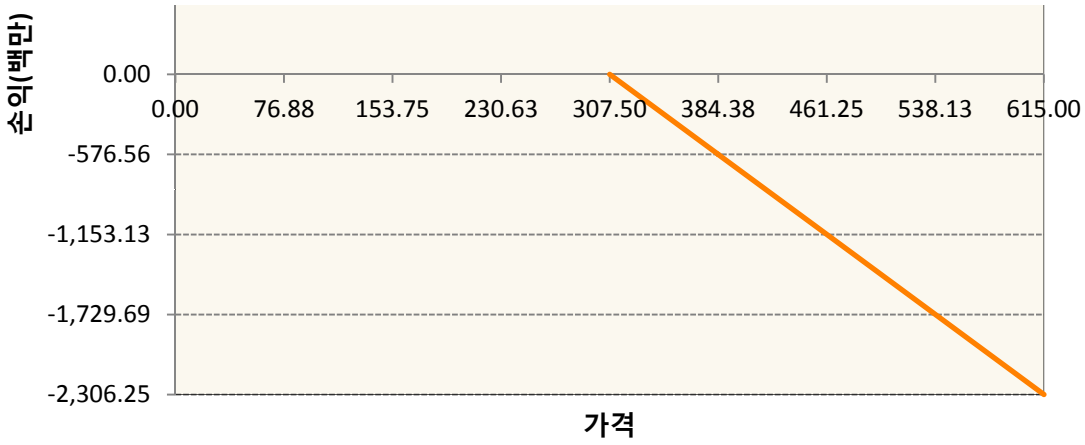
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	15,000	0	15,000	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	4,649	0	4,649	장내
누계	유가증권	스왑	15,000	0	15,000	장외
누계	유가증권	옵션	0	14,647	-14,647	장내

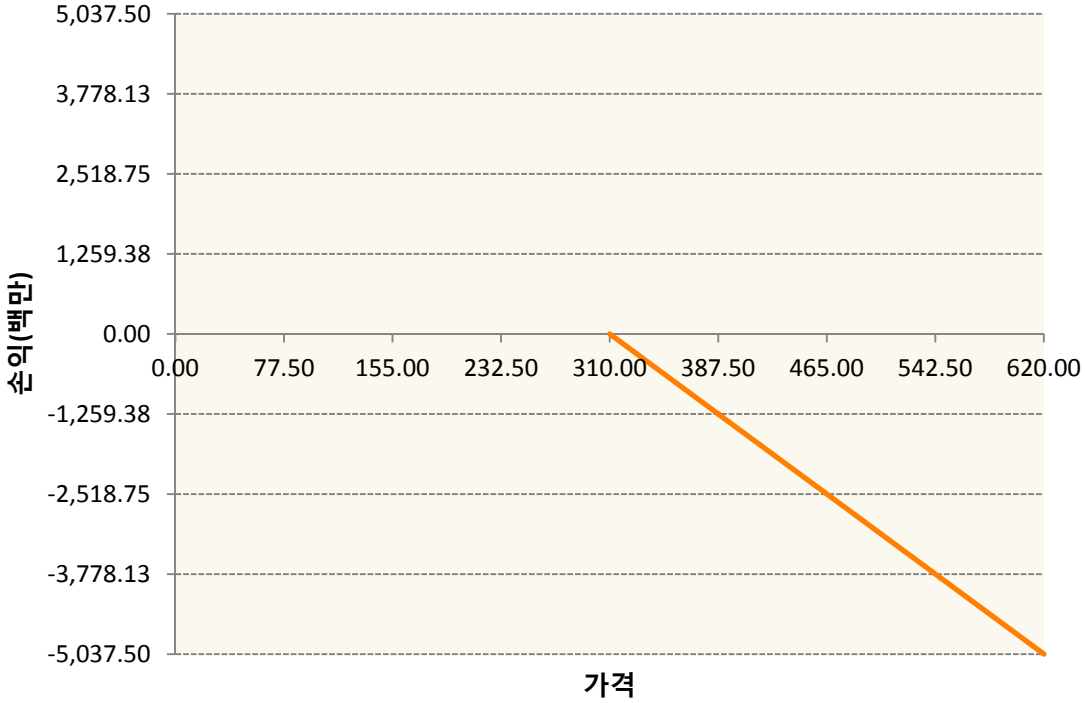
2. 만기시점의 손익구조



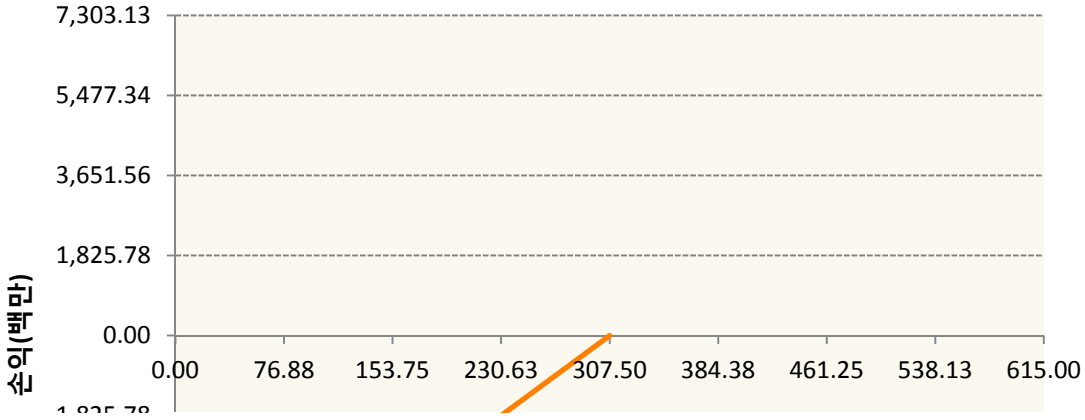




KR4201M93109-2017-09 콜310



KR4301M93073-2017-09 풋307.5





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

	KR4101M90(2017-09 코스피200지수선물						372
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-372	-372	-372	-372	-372	-372	-372
-5.33%	-248	-248	-248	-248	-248	-248	-248
-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%	248	248	248	248	248	248	248
8.00%	372	372	372	372	372	372	372
	KR4201M93(2017-09 콜307.5						152
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	58	58	56	55	53	51	49
-5.33%	54	52	49	46	43	40	37
-2.67%	40	37	33	29	25	21	17
0%	13	8	4	0	-4	-8	-13
2.67%	-30	-34	-37	-40	-44	-48	-52
5.33%	-84	-86	-88	-90	-93	-96	-98
8.00%	-143	-144	-145	-146	-148	-150	-152
	KR4201M93: 2017-09 콜310						314
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	107	105	104	101	98	95	91
-5.33%	100	96	91	86	81	75	68
-2.67%	78	70	63	55	47	38	30
0%	28	18	9	0	-9	-18	-28
2.67%	-56	-64	-72	-80	-89	-97	-106
5.33%	-166	-171	-176	-182	-189	-196	-203
8.00%	-292	-294	-297	-300	-304	-309	-314
	KR4301M93(2017-09 풋307.5						432
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-403	-406	-409	-414	-419	-425	-432
-5.33%	-221	-229	-237	-245	-255	-264	-275
-2.67%	-68	-80	-92	-105	-117	-130	-142
0%	40	27	13	0	-13	-27	-40
2.67%	100	90	79	68	57	45	33
5.33%	126	120	114	106	98	89	80
8.00%	134	132	129	125	120	114	108

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

1,127

공시일	2017-08-24
기준일	2017-08-23

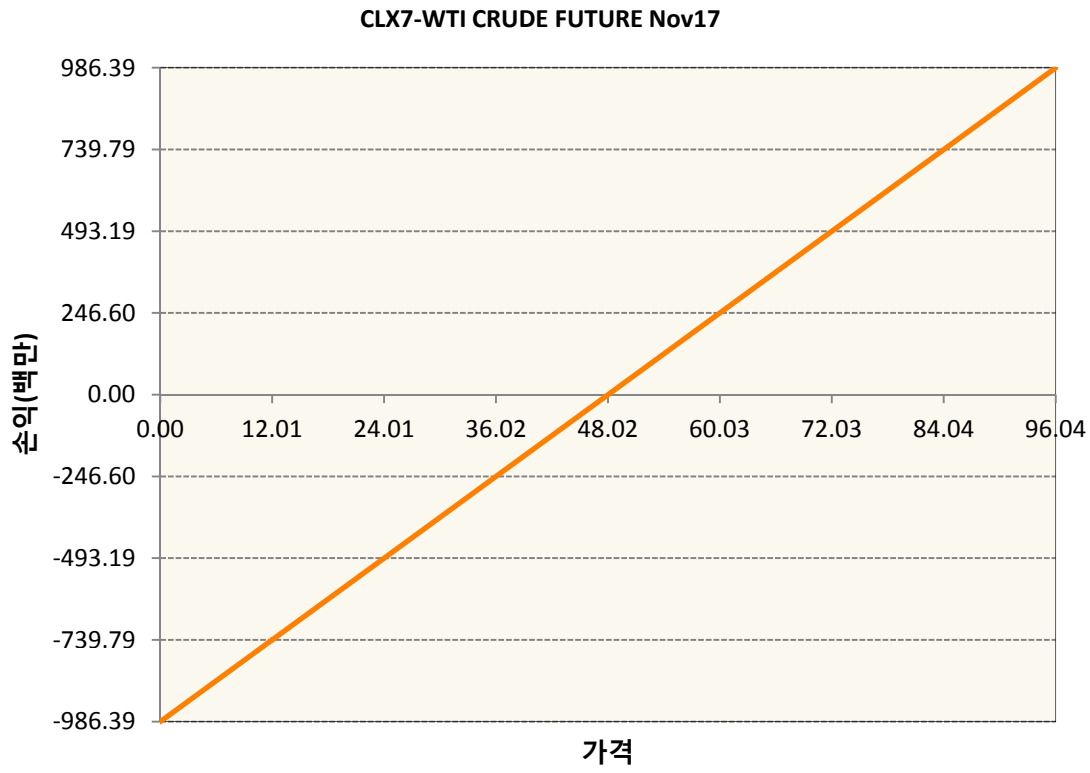
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

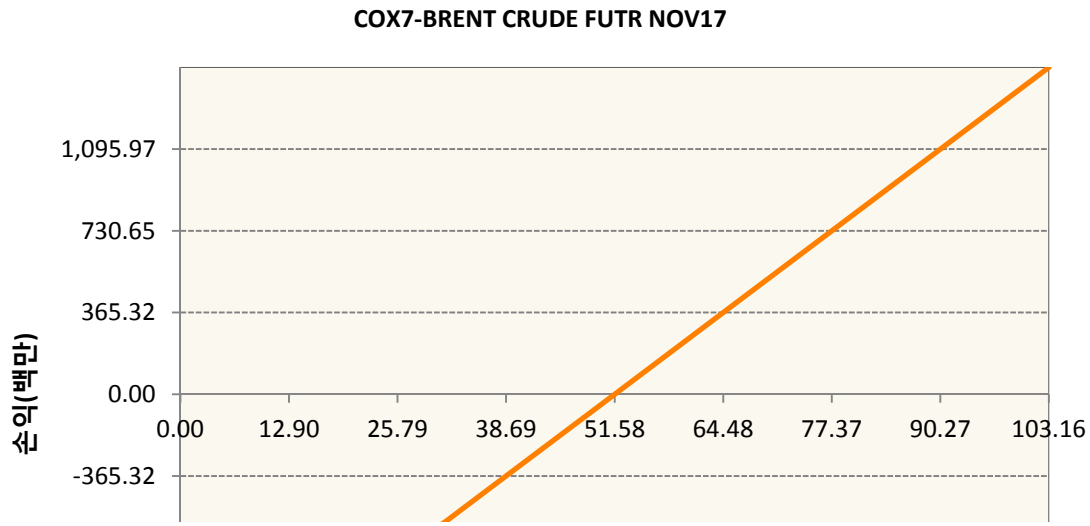
1. 계약금액

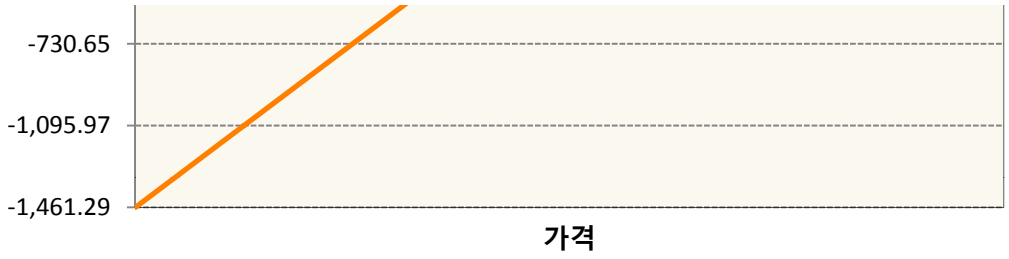
(단위:백만원)

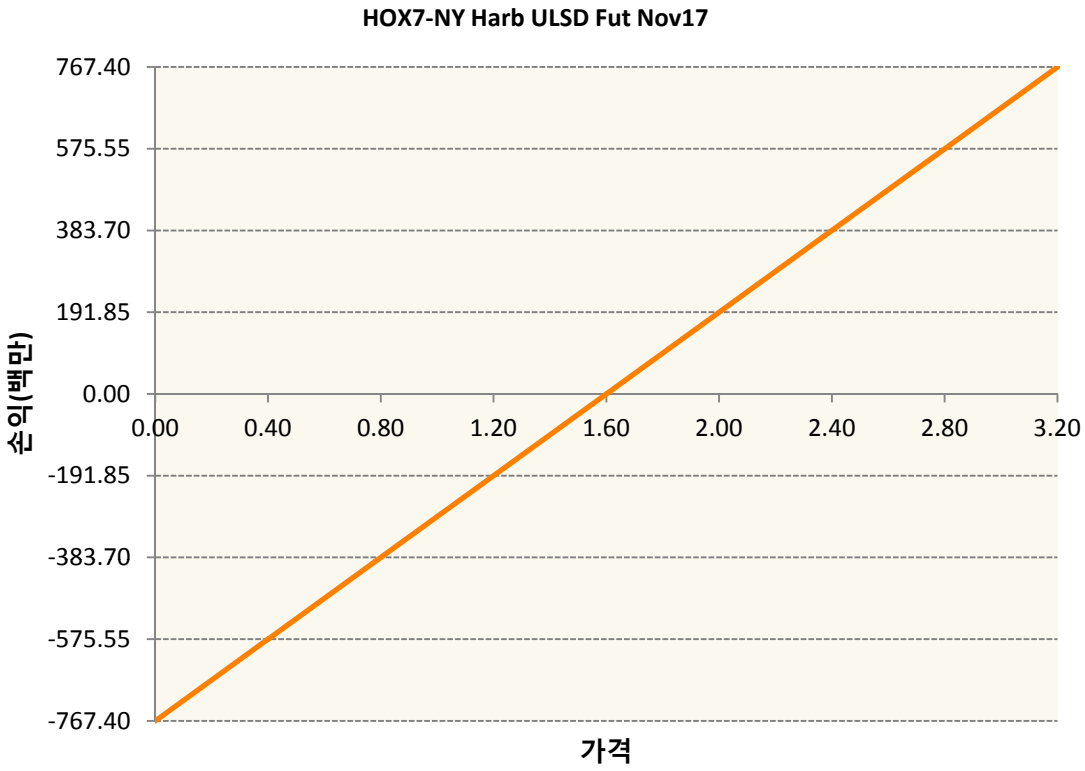
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	5,376	509	4,867	

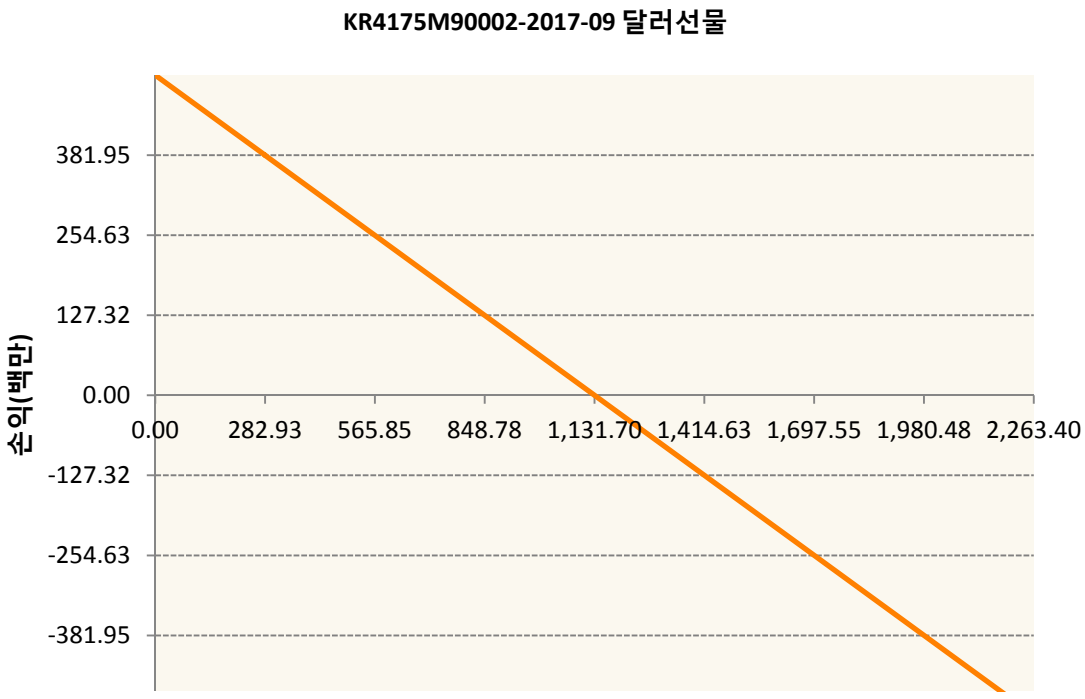
2. 만기시점의 손익구조

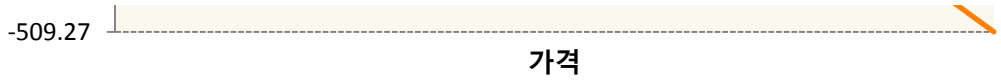


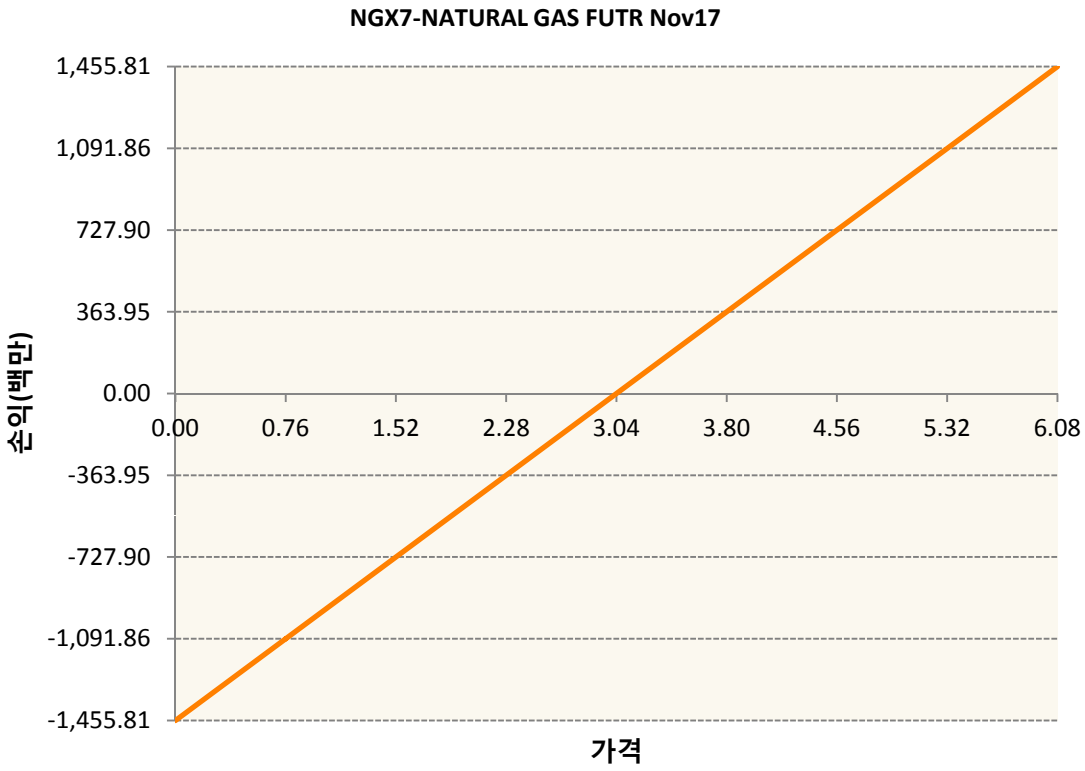


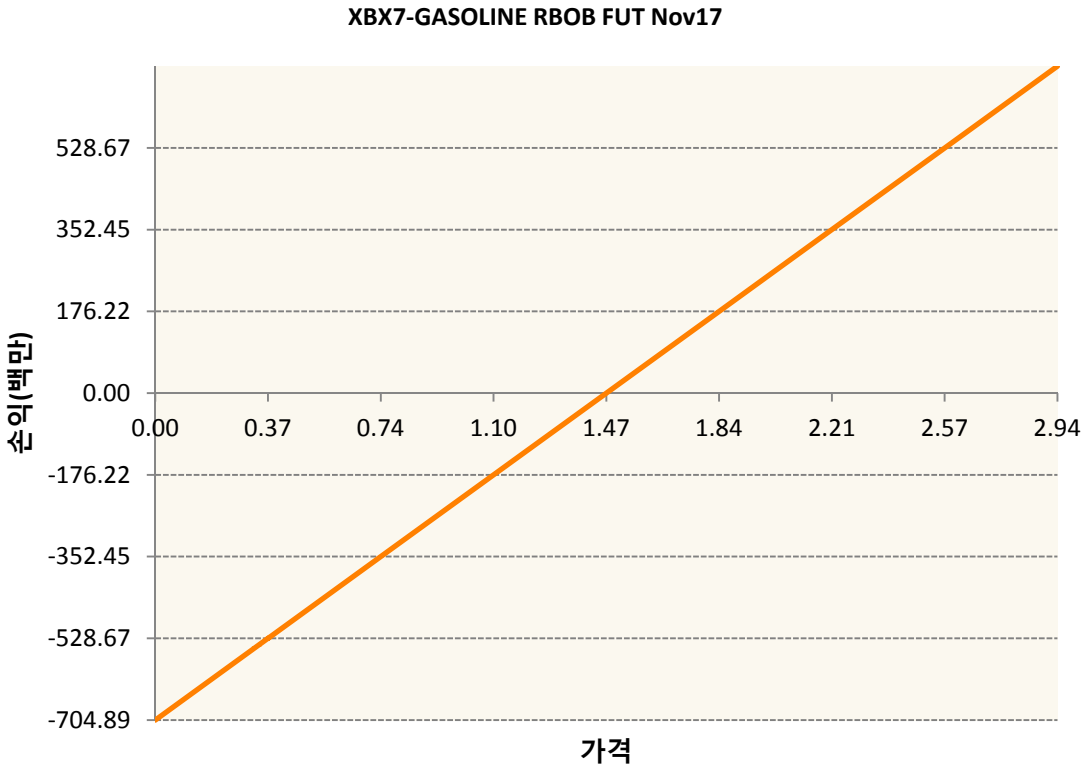

-730.65
-1,095.97
-1,461.29
가격


HOX7-NY Harb ULSD Fut Nov17
767.40
575.55
383.70
191.85
0.00
-191.85
-383.70
-575.55
-767.40
0.00
0.40
0.80
1.20
1.60
2.00
2.40
2.80
3.20
손익(백만)
가격


KR4175M90002-2017-09 달러선물
381.95
254.63
127.32
0.00
-127.32
-254.63
-381.95
0.00
282.93
565.85
848.78
1,131.70
1,414.63
1,697.55
1,980.48
2,263.40
손익(백만)


-509.27
가격


NGX7-NATURAL GAS FUTR Nov17
1,455.81
1,091.86
727.90
363.95
0.00
-363.95
-727.90
-1,091.86
-1,455.81
0.00
0.76
1.52
2.28
3.04
3.80
4.56
5.32
6.08
손익(백만)
가격


XBX7-GASOLINE RBOB FUT Nov17
528.67
352.45
176.22
0.00
-176.22
-352.45
-528.67
-704.89
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	79
COX7	BRENT CRUDE FUTR NOV17	117
HOX7	NY Harb ULSD Fut Nov17	61
KR4175M90(	2017-09 달러선물	41
NGX7	NATURAL GAS FUTR Nov17	116
XBX7	GASOLINE RBOB FUT Nov17	56

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

776

공시일	2017-08-24
기준일	2017-08-23

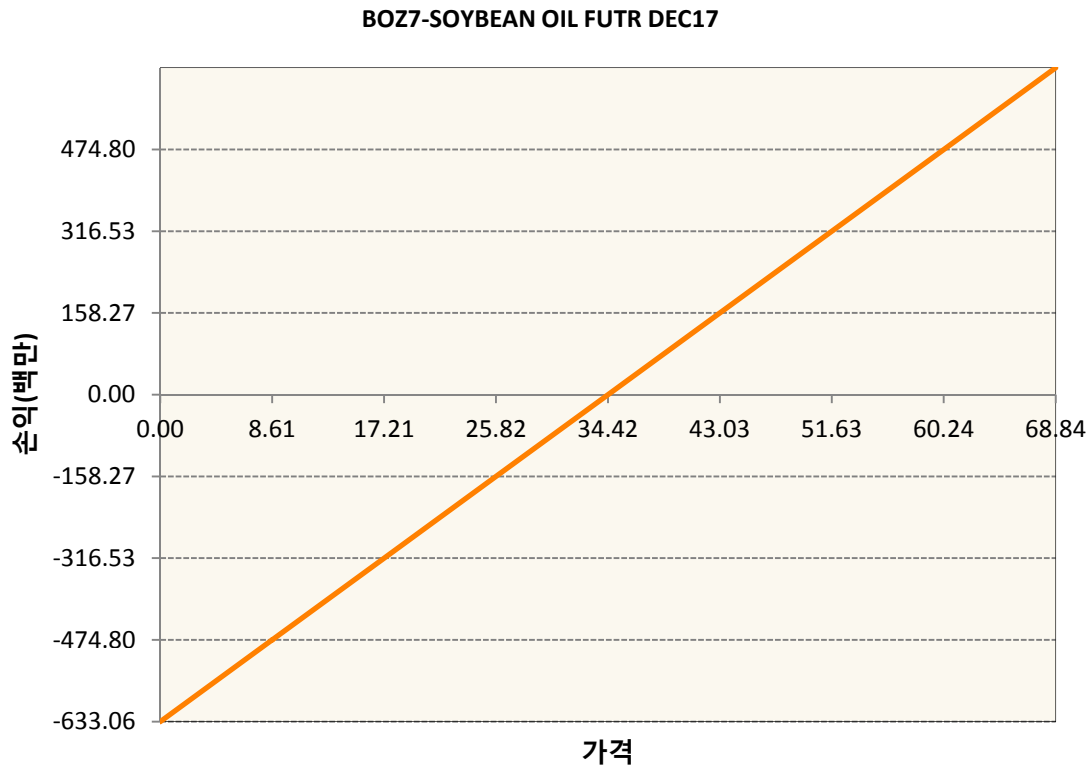
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

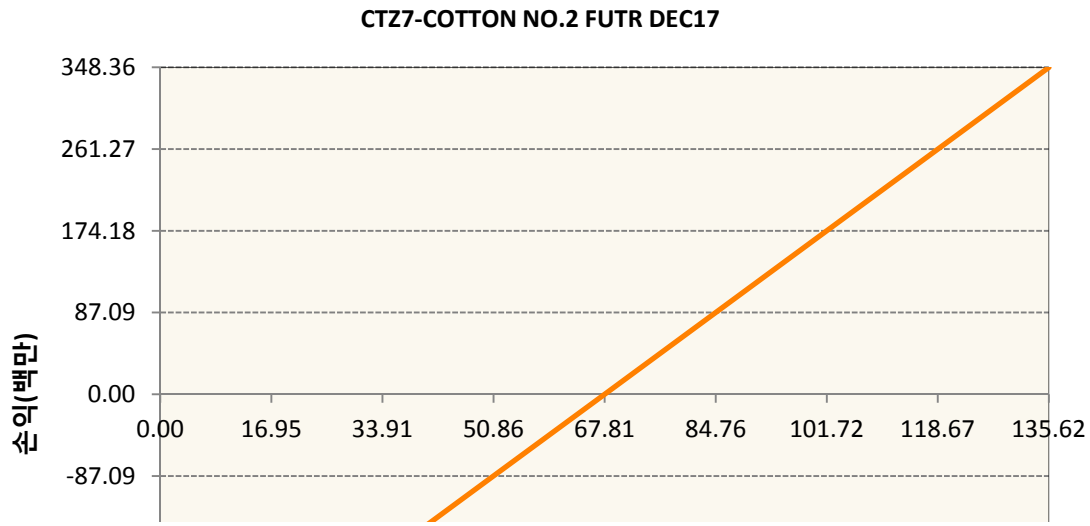
1. 계약금액

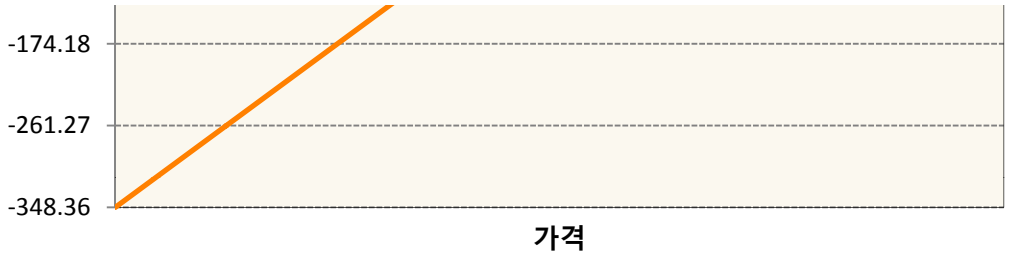
(단위:백만원)

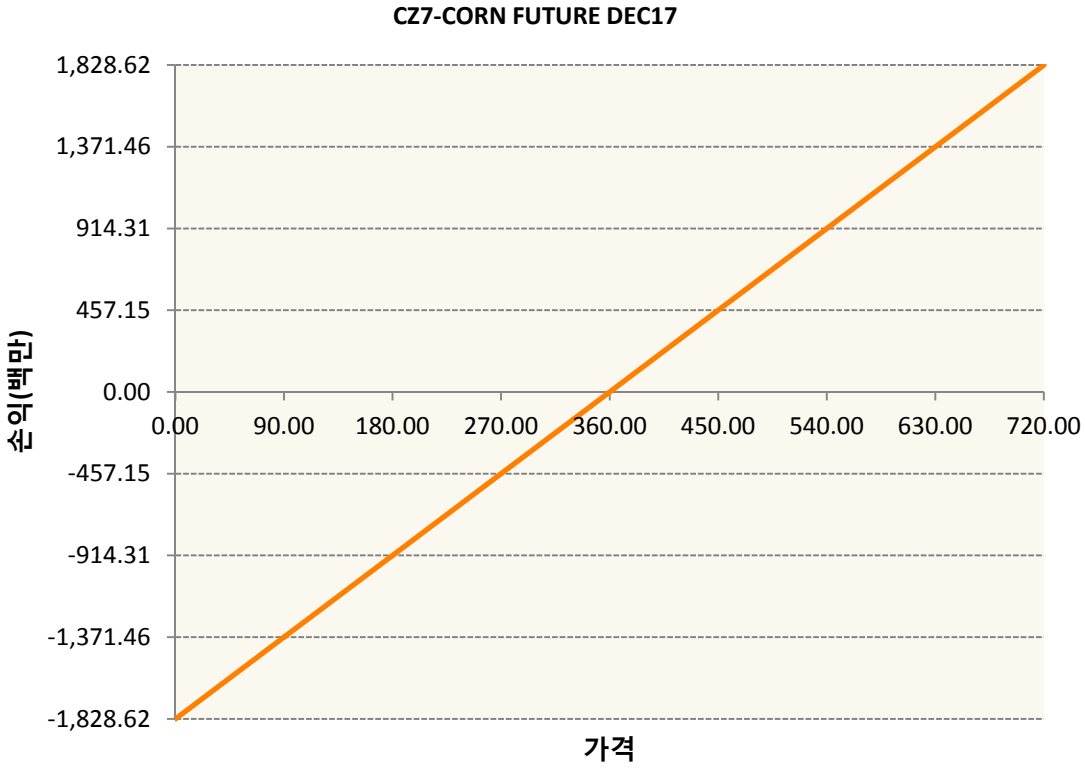
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	6,878	340	6,538	

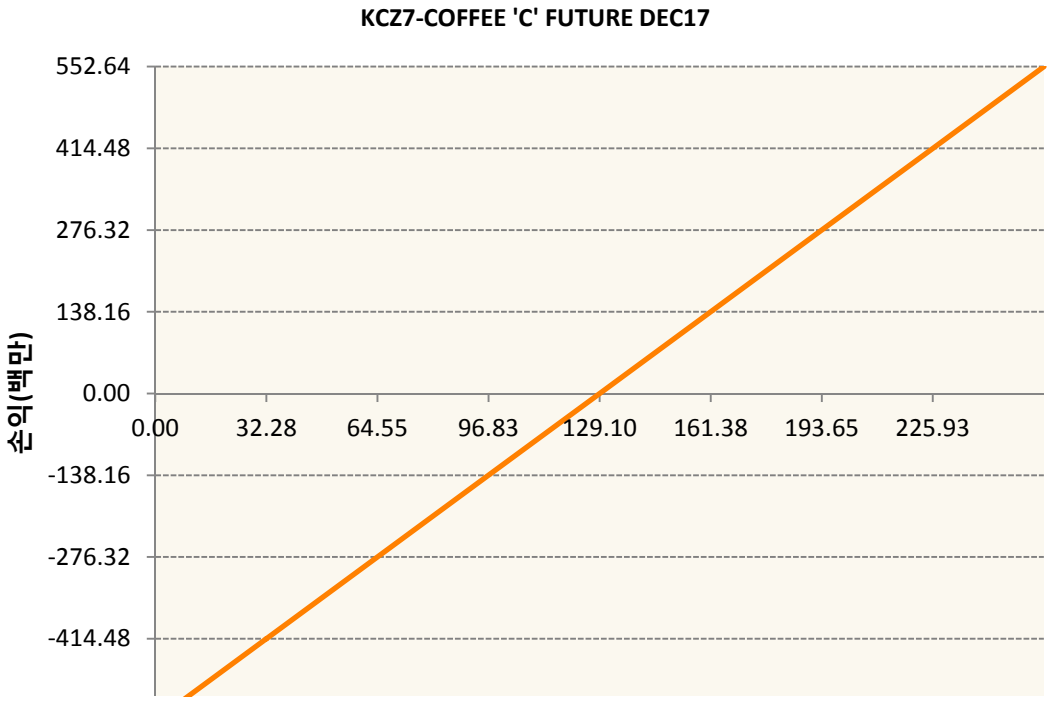
2. 만기시점의 손익구조

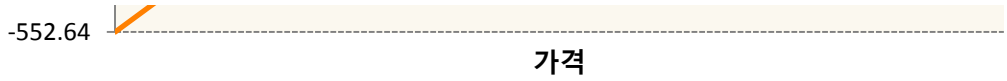


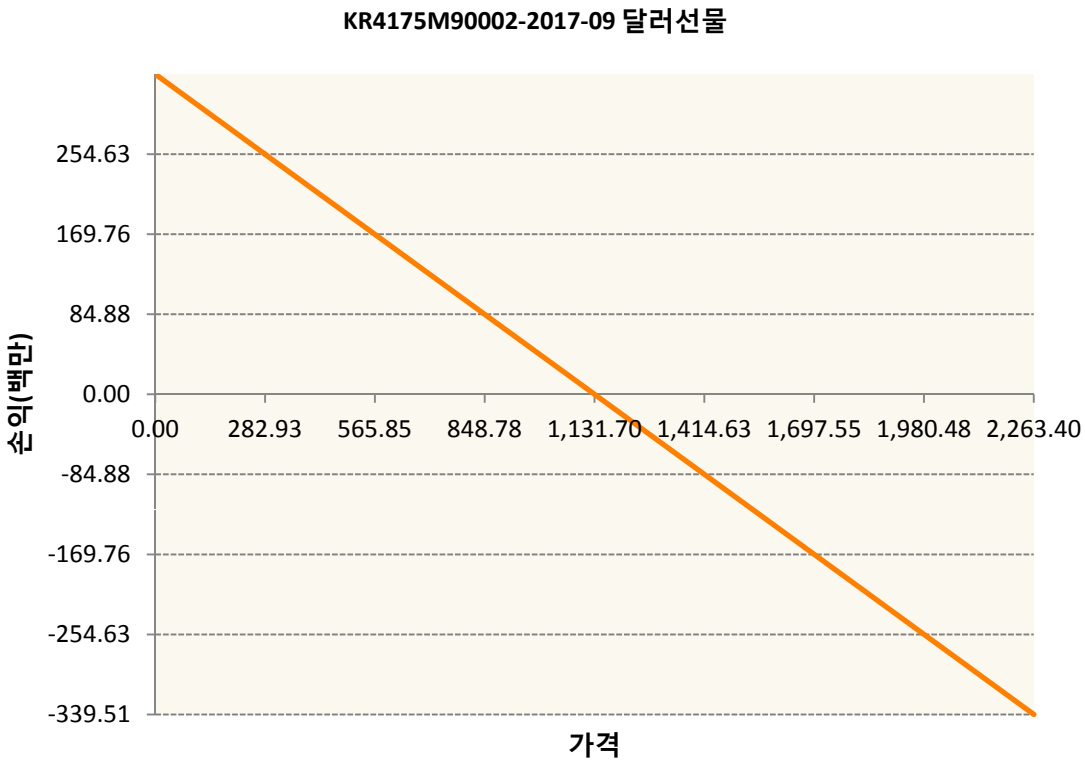


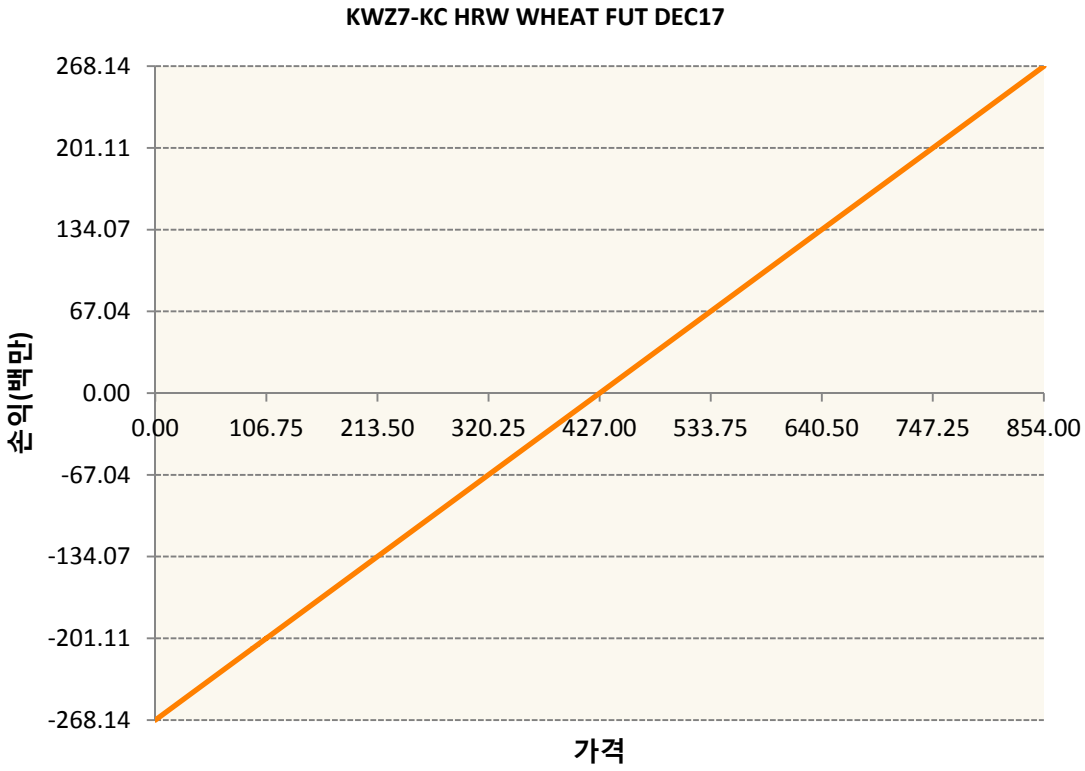

-174.18
-261.27
-348.36
가격


CZ7-CORN FUTURE DEC17
1,828.62
1,371.46
914.31
457.15
0.00
-457.15
-914.31
-1,371.46
-1,828.62
0.00
90.00
180.00
270.00
360.00
450.00
540.00
630.00
720.00
손익(백만)
가격

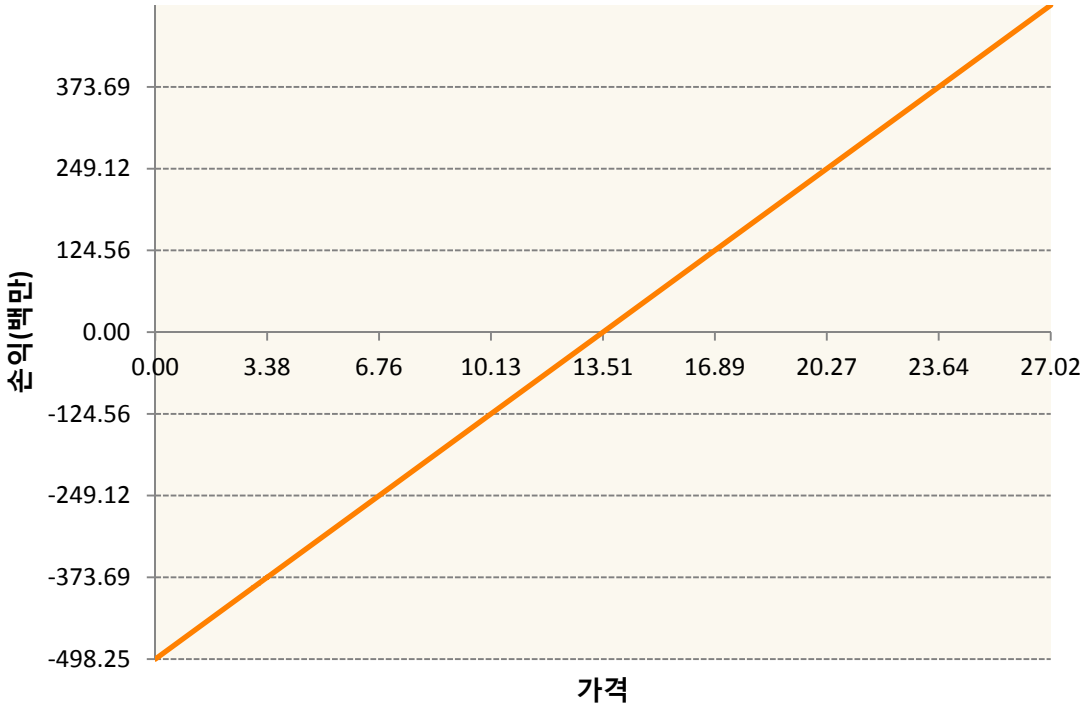

KCZ7-COFFEE 'C' FUTURE DEC17
552.64
414.48
276.32
138.16
0.00
-138.16
-276.32
-414.48
0.00
32.28
64.55
96.83
129.10
161.38
193.65
225.93
손익(백만)


-552.64
가격

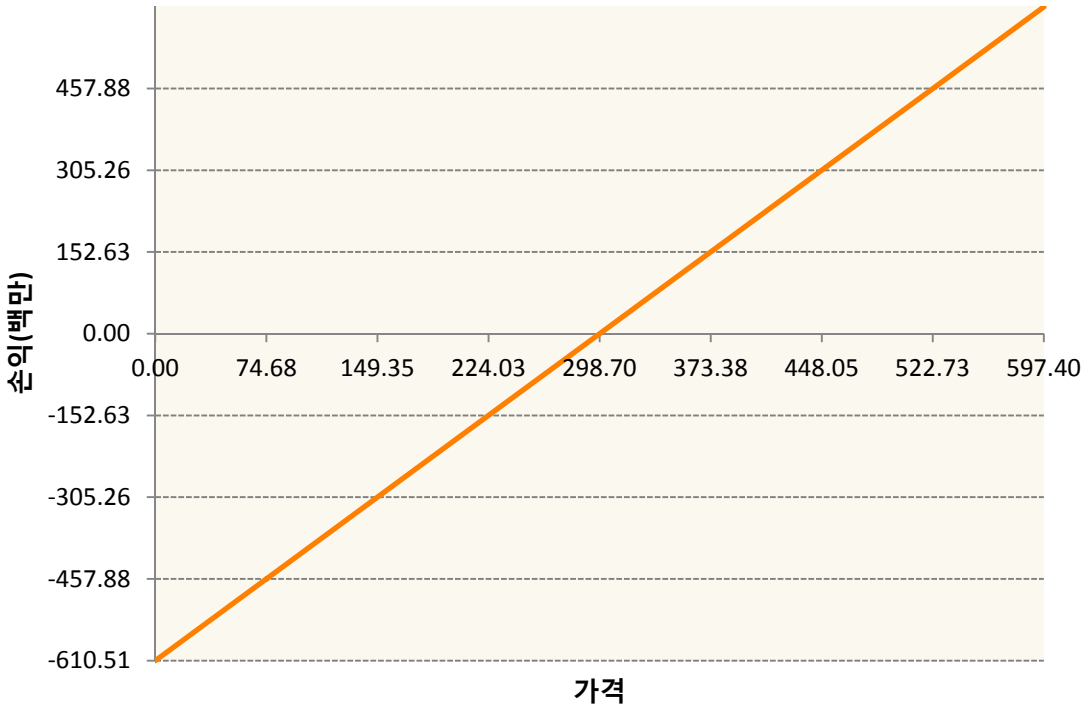

KR4175M90002-2017-09 달러선물
254.63
169.76
84.88
0.00
-84.88
-169.76
-254.63
-339.51
0.00
282.93
565.85
848.78
1,131.70
1,414.63
1,697.55
1,980.48
2,263.40
손익(백만)
가격


KWZ7-KC HRW WHEAT FUT DEC17
268.14
201.11
134.07
67.04
0.00
-67.04
-134.07
-201.11
-268.14
0.00
106.75
213.50
320.25
427.00
533.75
640.50
747.25
854.00
손익(백만)
가격

SBV7-SUGAR #11 (WORLD) OCT17

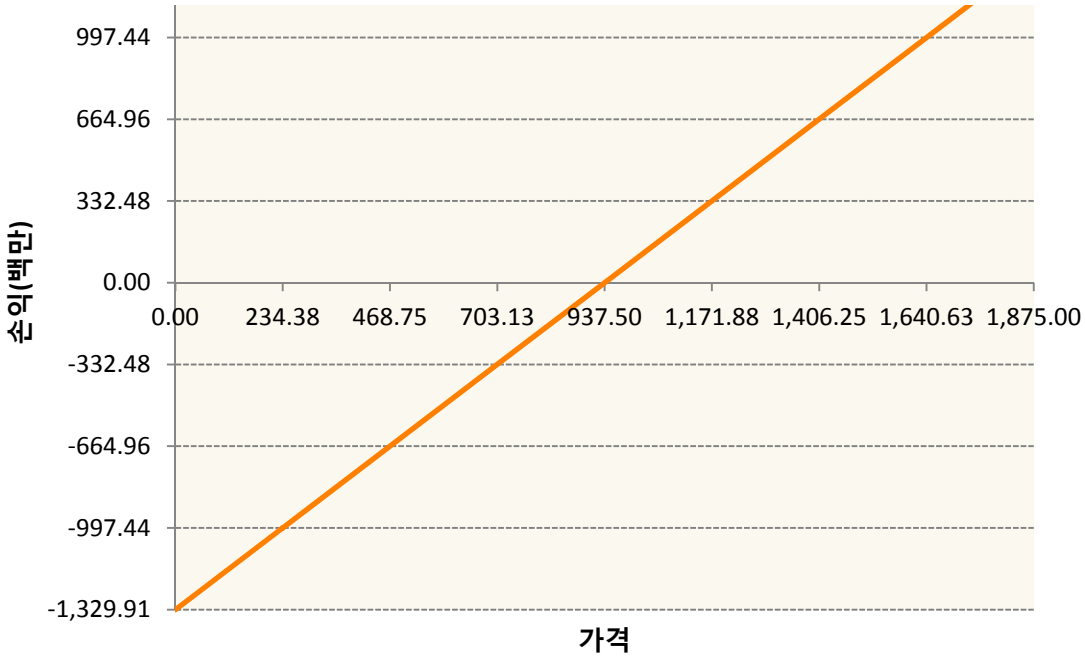


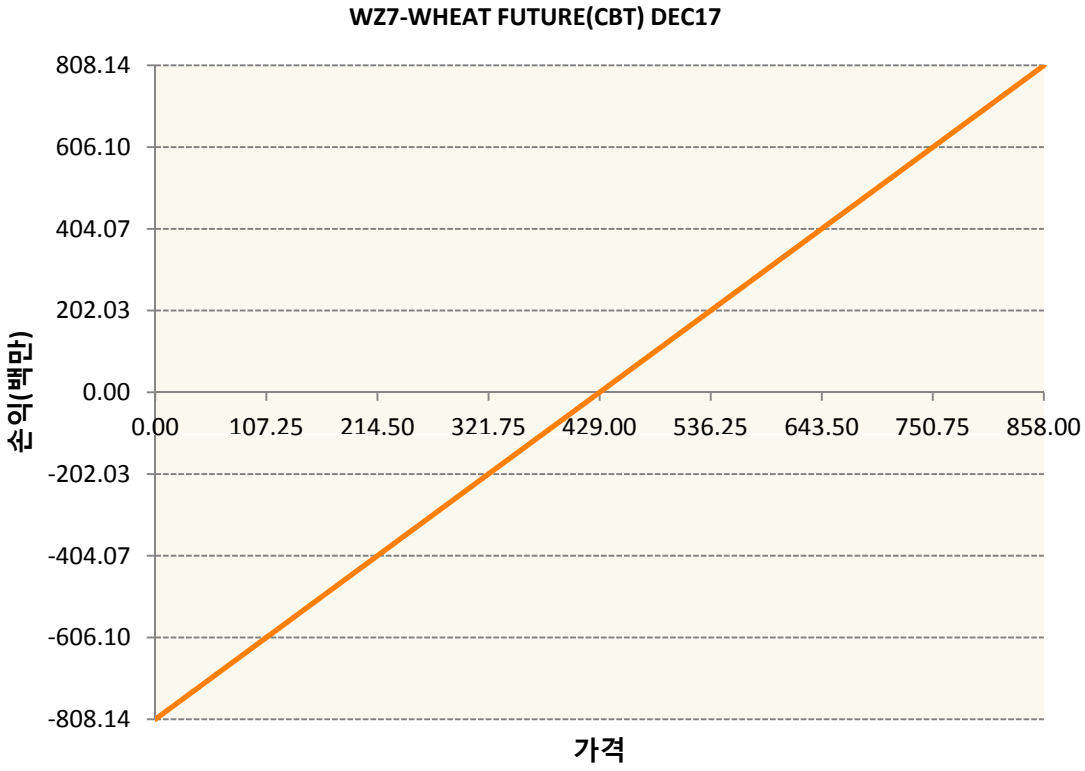
SMZ7-SOYBEAN MEAL FUTR DEC17



SX7-SOYBEAN FUTURE NOV17







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

BOZ7	SOYBEAN OIL FUTR DEC17	51
CTZ7	COTTON NO.2 FUTR DEC17	28
CZ7	CORN FUTURE DEC17	146
KCZ7	COFFEE 'C' FUTURE DEC17	44
KR4175M90(	2017-09 달러선물	27

KWZ7	KC HRW WHEAT FUT DEC17	21
SBV7	SUGAR #11 (WORLD) OCT17	40
SMZ7	SOYBEAN MEAL FUTR DEC17	49
SX7	SOYBEAN FUTURE NOV17	106
WZ7	WHEAT FUTURE(CBT) DEC17	65

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

649