공시일	2017-08-25
기준일	2017-08-24

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	2017-08-25
기준일	2017-08-24

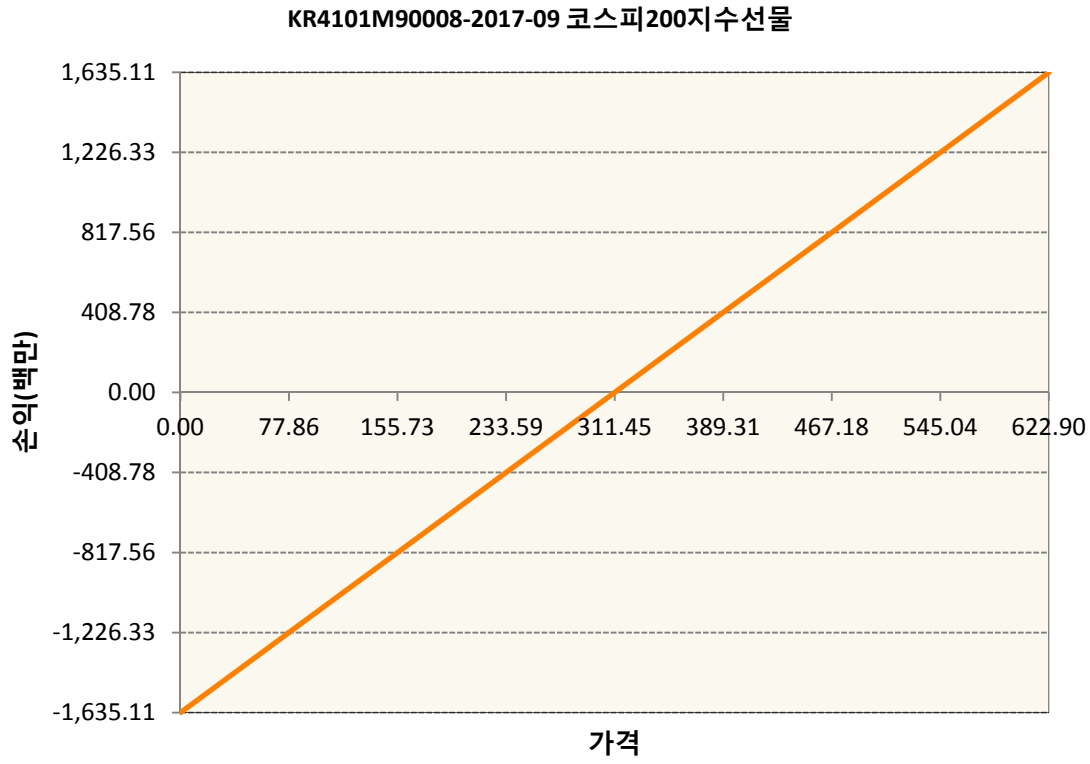
스마트인덱스모

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	78	-78	장내
누계	유가증권	선물	1,635	0	1,635	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101M90(2017-09 코스피200지수선물							131
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-131	-131	-131	-131	-131	-131	-131
-5.33%	-87	-87	-87	-87	-87	-87	-87
-2.67%	-44	-44	-44	-44	-44	-44	-44
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	44	44	44	44	44	44	44
5.33%	87	87	87	87	87	87	87
8.00%	131	131	131	131	131	131	131

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

81

공시일	2017-08-25
기준일	2017-08-24

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	1,013

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

463

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-08-25
기준일	2017-08-24

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	397

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

338

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-08-25
기준일	2017-08-24

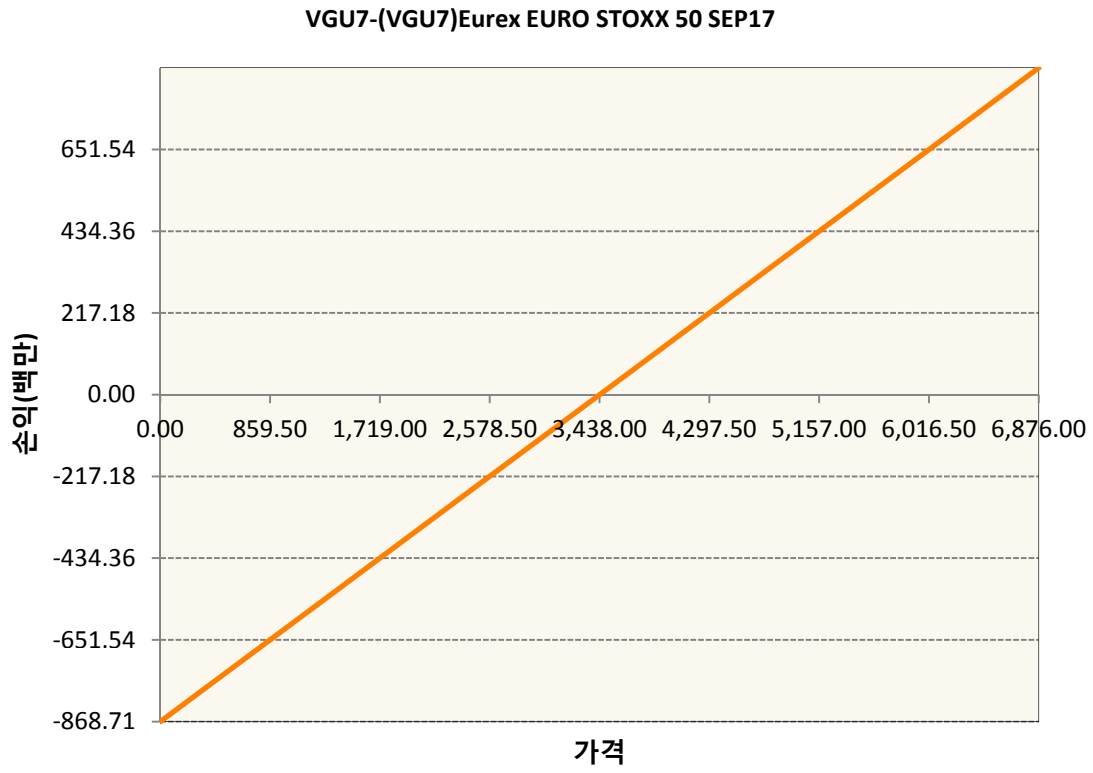
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	869	0	869	

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	2017-08-25
기준일	2017-08-24

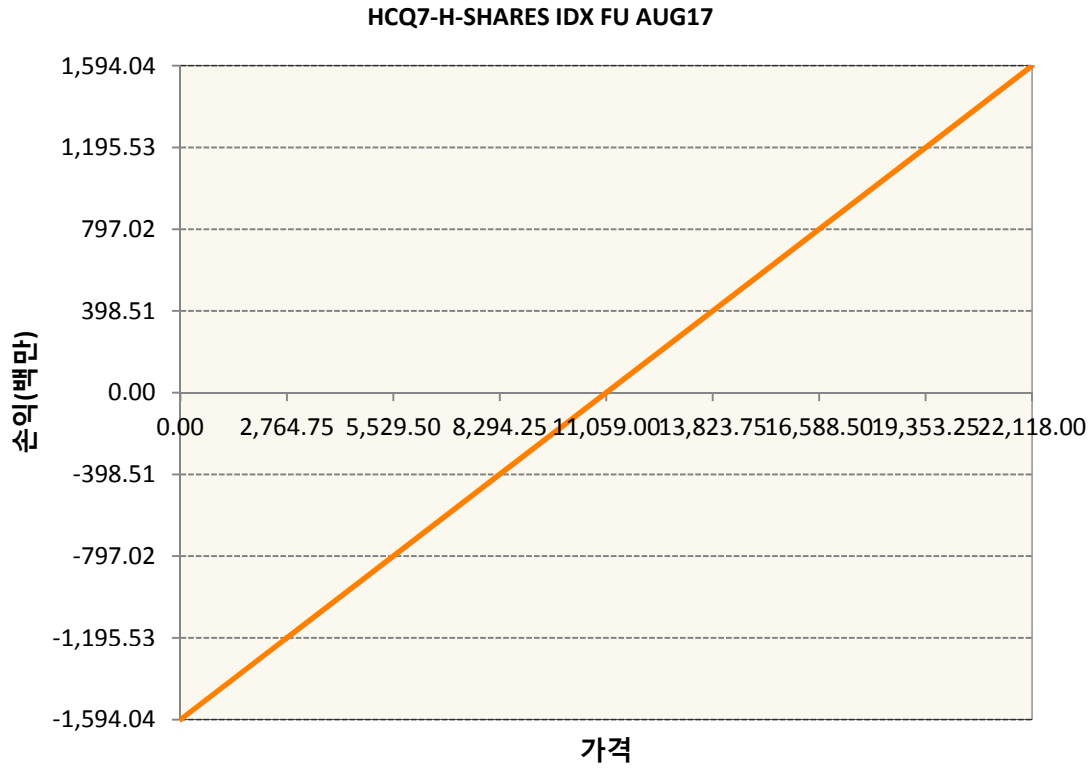
차이나인덱스모(주식-파생형)

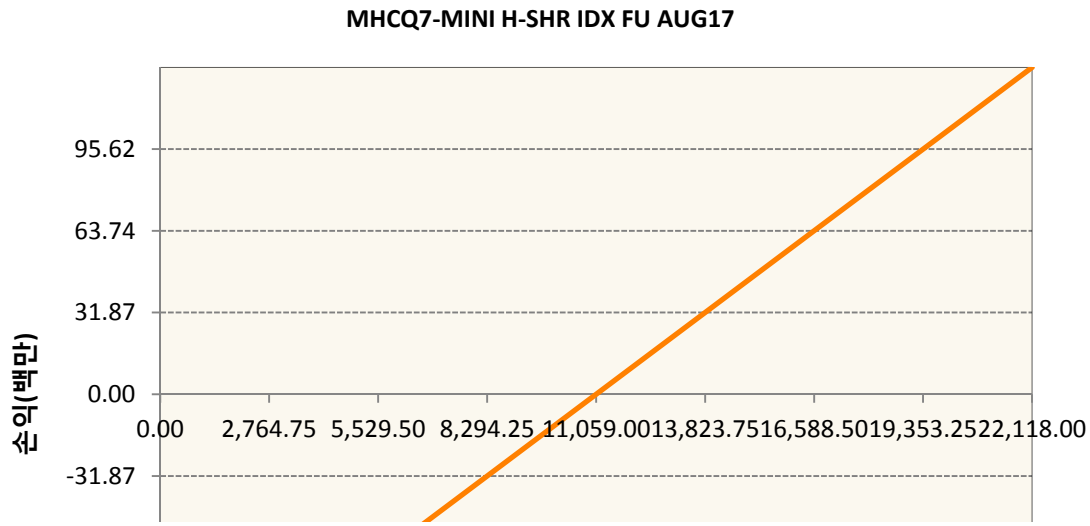
1. 계약금액

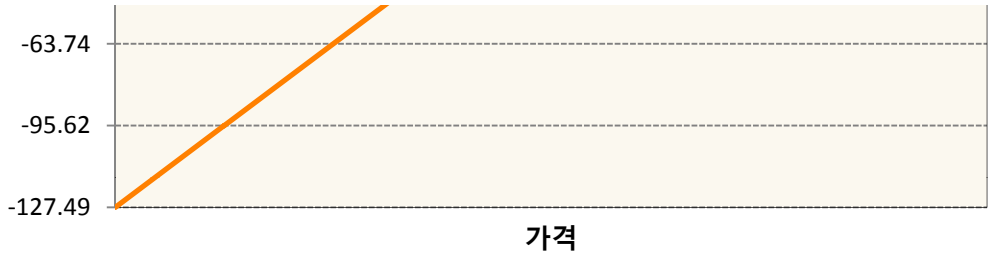
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,722	0	1,722	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCQ7	H-SHARES IDX FU AUG17	128
MHCQ7	MINI H-SHR IDX FU AUG17	10

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	119

공시일	2017-08-25
기준일	2017-08-24

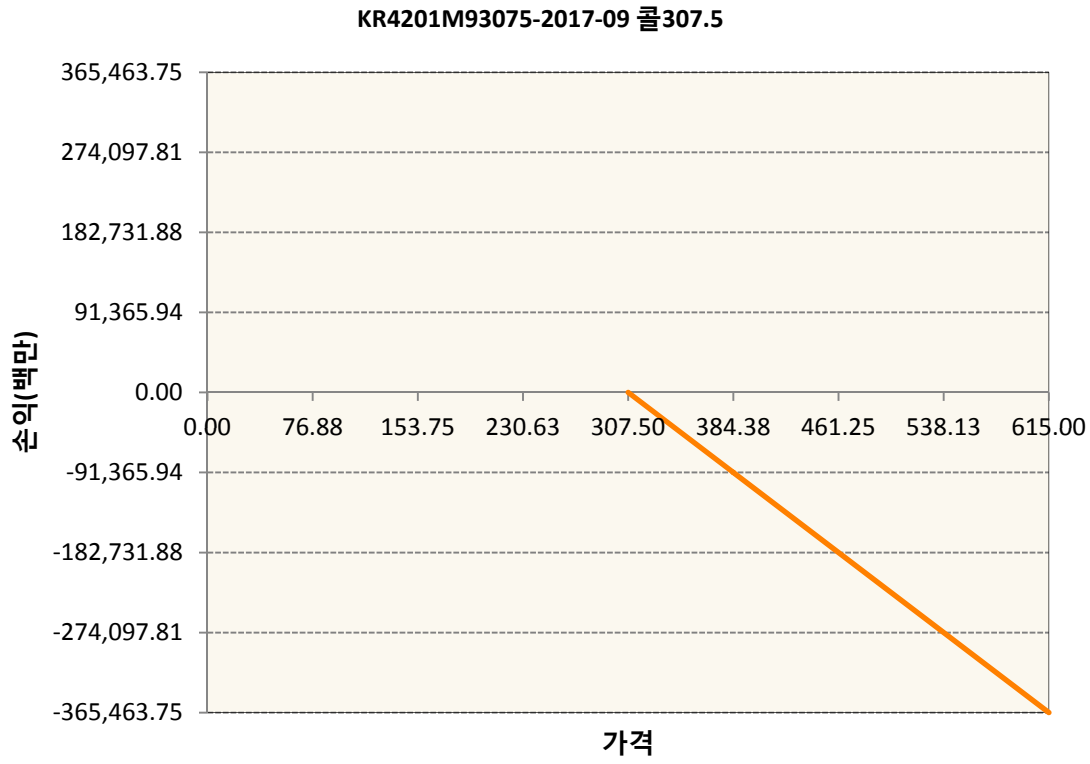
커버드콜모(주식혼합-파생형)

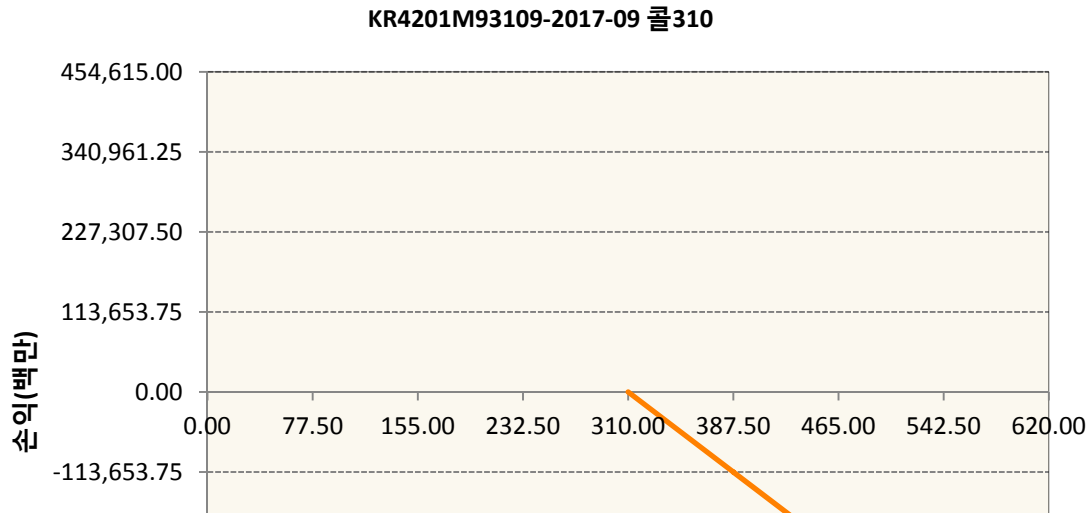
1. 계약금액

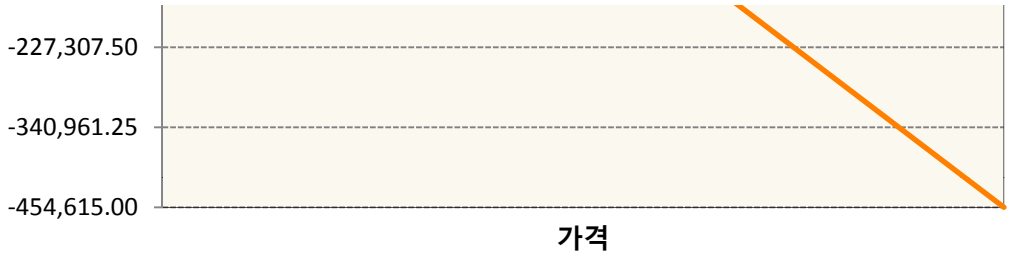
(단위:백만원)

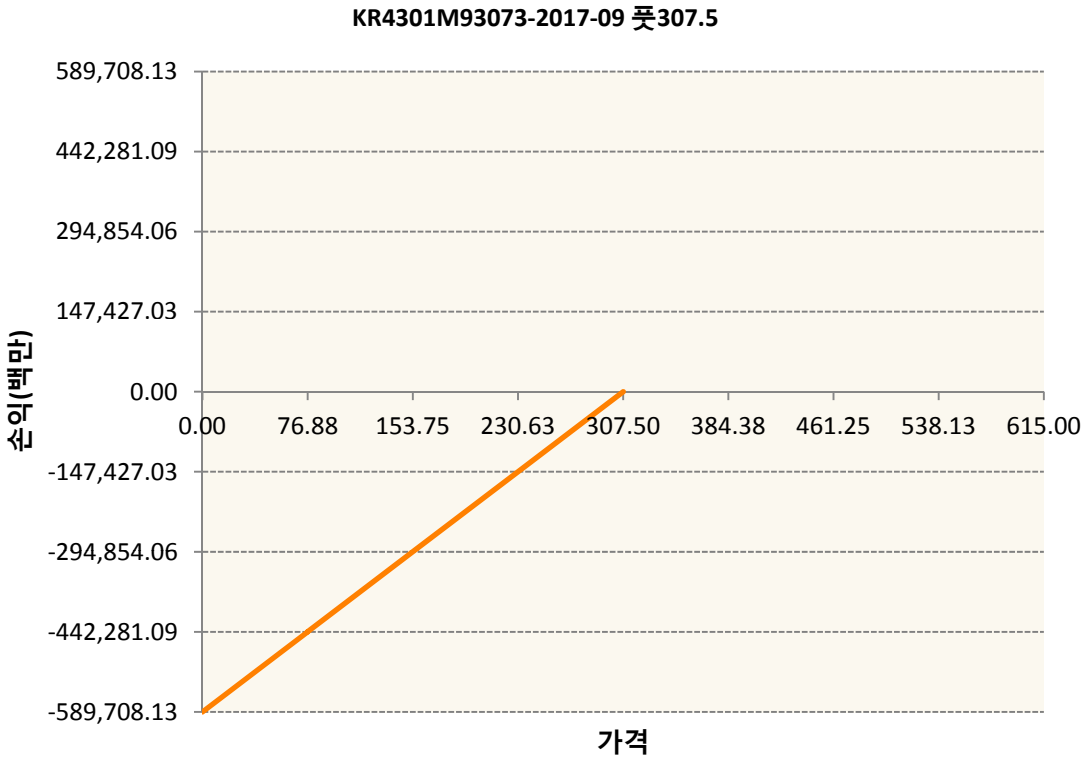
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	1,466,284	-1,466,284	장내

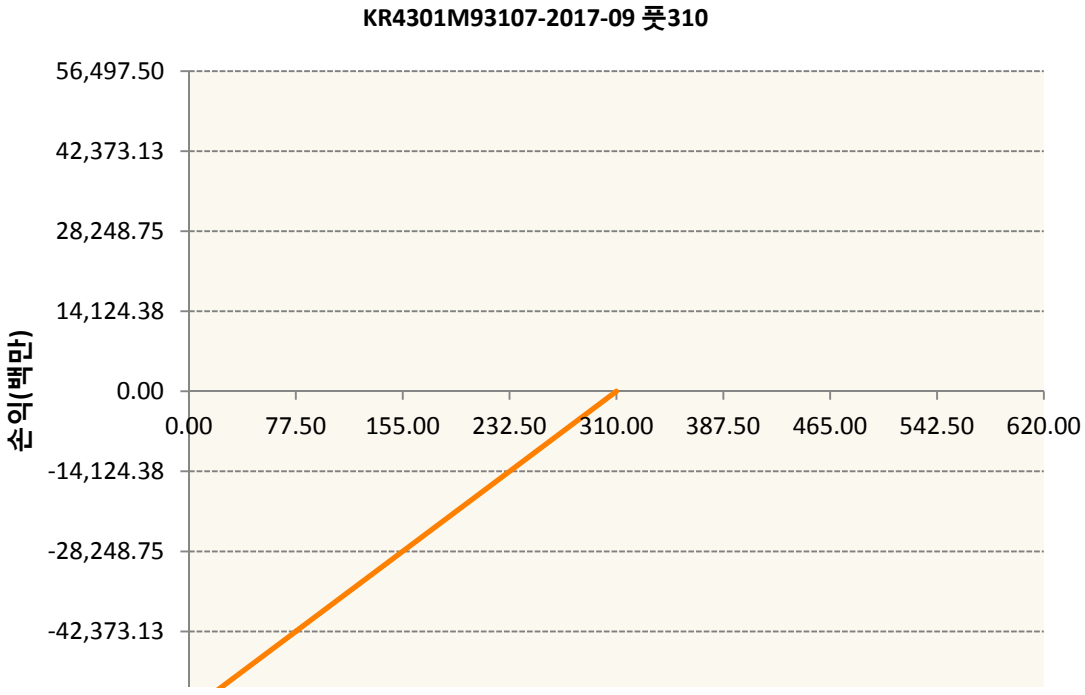
2. 만기시점의 손익구조

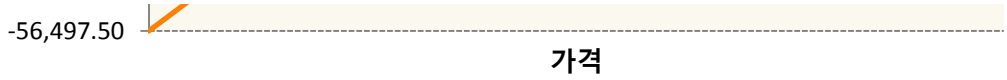





-227,307.50
-340,961.25
-454,615.00
가격


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							24,593
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	9,713	9,570	9,384	9,156	8,889	8,588	8,256
-5.33%	8,932	8,564	8,158	7,721	7,258	6,773	6,271
-2.67%	6,620	6,023	5,417	4,805	4,189	3,568	2,945
0%	1,911	1,277	640	0	-642	-1,285	-1,930
2.67%	-5,225	-5,679	-6,165	-6,677	-7,210	-7,759	-8,323
5.33%	-13,997	-14,224	-14,500	-14,820	-15,179	-15,570	-15,991
8.00%	-23,525	-23,606	-23,725	-23,885	-24,084	-24,320	-24,593
KR4201M93: 2017-09 콜310							29,063
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	10,116	9,991	9,817	9,594	9,324	9,009	8,655
-5.33%	9,459	9,093	8,673	8,206	7,700	7,161	6,595
-2.67%	7,290	6,616	5,921	5,209	4,486	3,751	3,009
0%	2,425	1,617	809	0	-809	-1,617	-2,426
2.67%	-5,534	-6,186	-6,866	-7,568	-8,286	-9,018	-9,762
5.33%	-15,854	-16,220	-16,644	-17,118	-17,635	-18,188	-18,772
8.00%	-27,404	-27,551	-27,752	-28,006	-28,312	-28,666	-29,063
KR4301M93(2017-09 풋307.5							34,308
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-31,958	-32,188	-32,489	-32,857	-33,287	-33,773	-34,308
-5.33%	-17,342	-17,935	-18,590	-19,295	-20,043	-20,824	-21,635
-2.67%	-5,196	-6,159	-7,136	-8,123	-9,118	-10,119	-11,125
0%	3,084	2,061	1,033	0	-1,036	-2,074	-3,115
2.67%	7,447	6,714	5,929	5,102	4,243	3,356	2,448
5.33%	9,168	8,802	8,357	7,840	7,262	6,629	5,950
8.00%	9,672	9,540	9,348	9,091	8,770	8,387	7,948
KR4301M93: 2017-09 풋310							3,451
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-3,269	-3,285	-3,306	-3,334	-3,368	-3,407	-3,451
-5.33%	-1,842	-1,888	-1,940	-1,998	-2,061	-2,128	-2,198
-2.67%	-603	-687	-773	-861	-951	-1,043	-1,135
0%	301	201	100	0	-101	-201	-302
2.67%	821	740	656	568	479	388	296

5.33%	1,047	1,002	949	890	826	757	685
8.00%	1,121	1,103	1,078	1,046	1,008	964	915

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

92,231

공시일	2017-08-25
기준일	2017-08-24

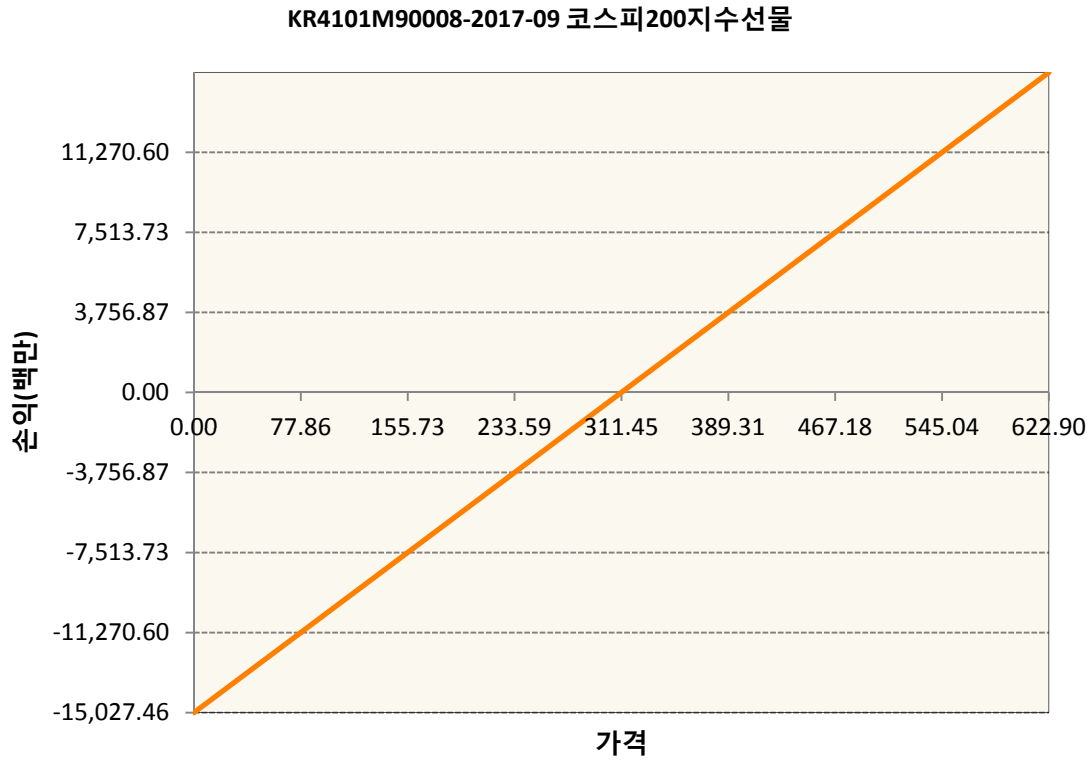
ETF스마트레버리지목표전환형6호

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	15,027	0	15,027	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101M90(2017-09 코스피200지수선물							1,199
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,199	-1,199	-1,199	-1,199	-1,199	-1,199	-1,199
-5.33%	-800	-800	-800	-800	-800	-800	-800
-2.67%	-400	-400	-400	-400	-400	-400	-400
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	400	400	400	400	400	400	400
5.33%	800	800	800	800	800	800	800
8.00%	1,199	1,199	1,199	1,199	1,199	1,199	1,199

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

747

공시일	2017-08-25
기준일	2017-08-24

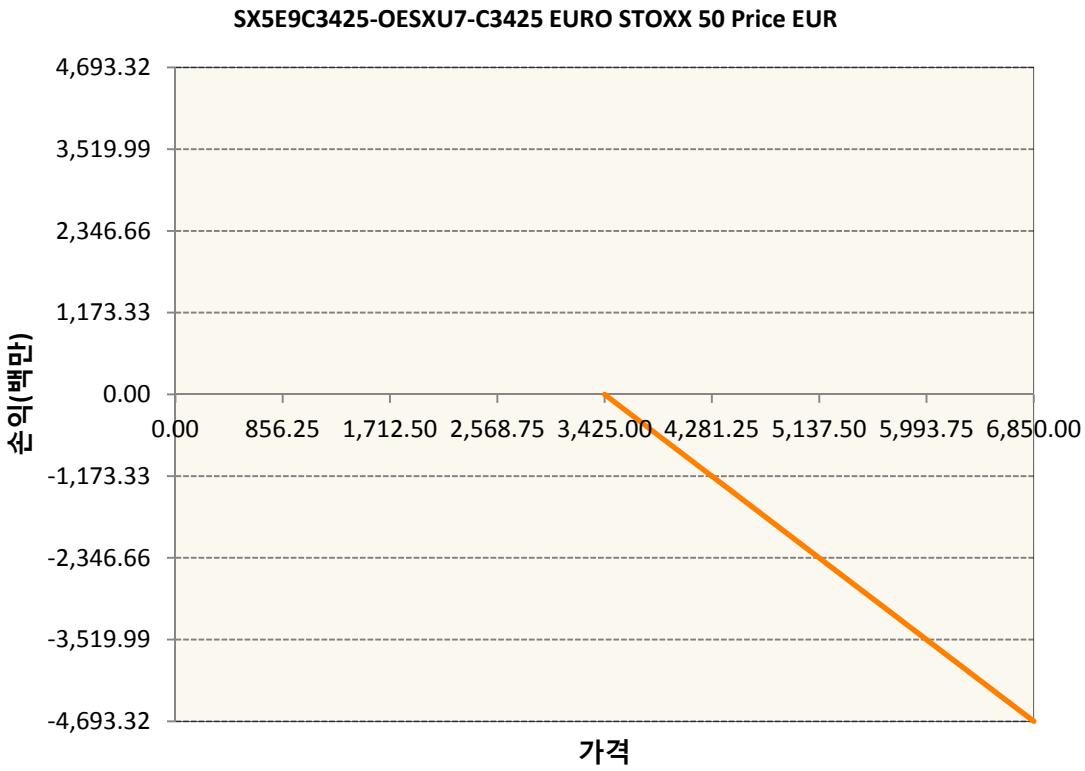
유로커버드콜(주식혼합-파생형)

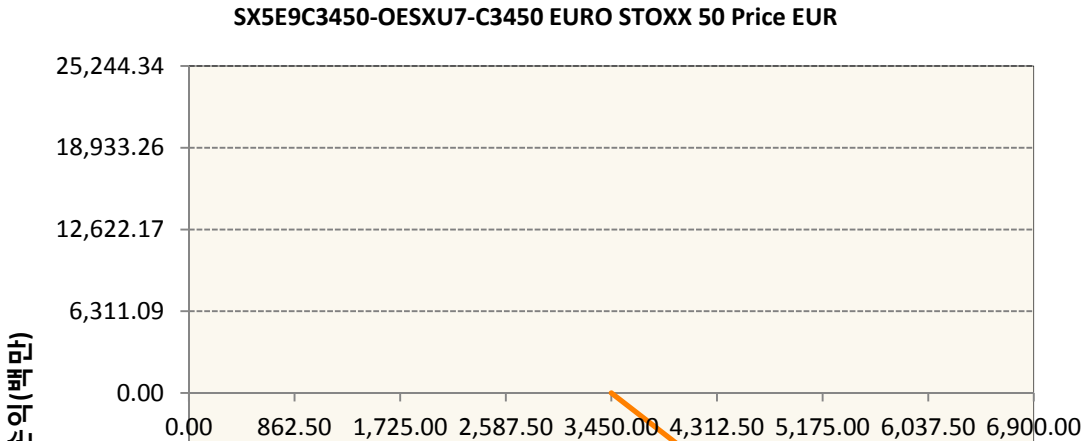
1. 계약금액

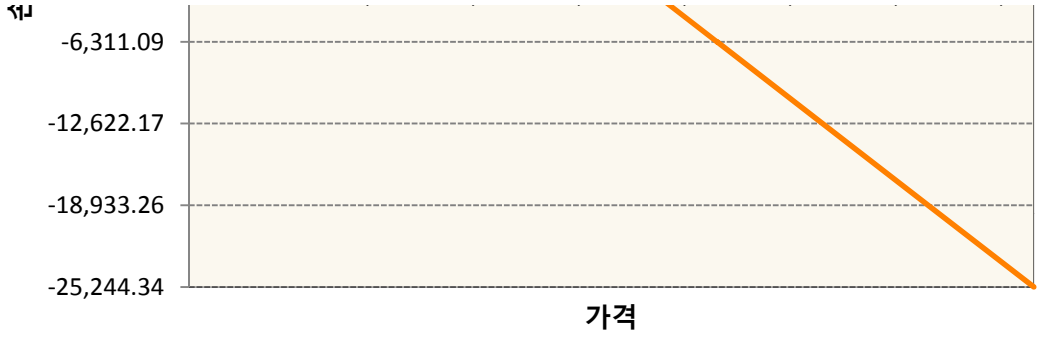
(단위:백만원)

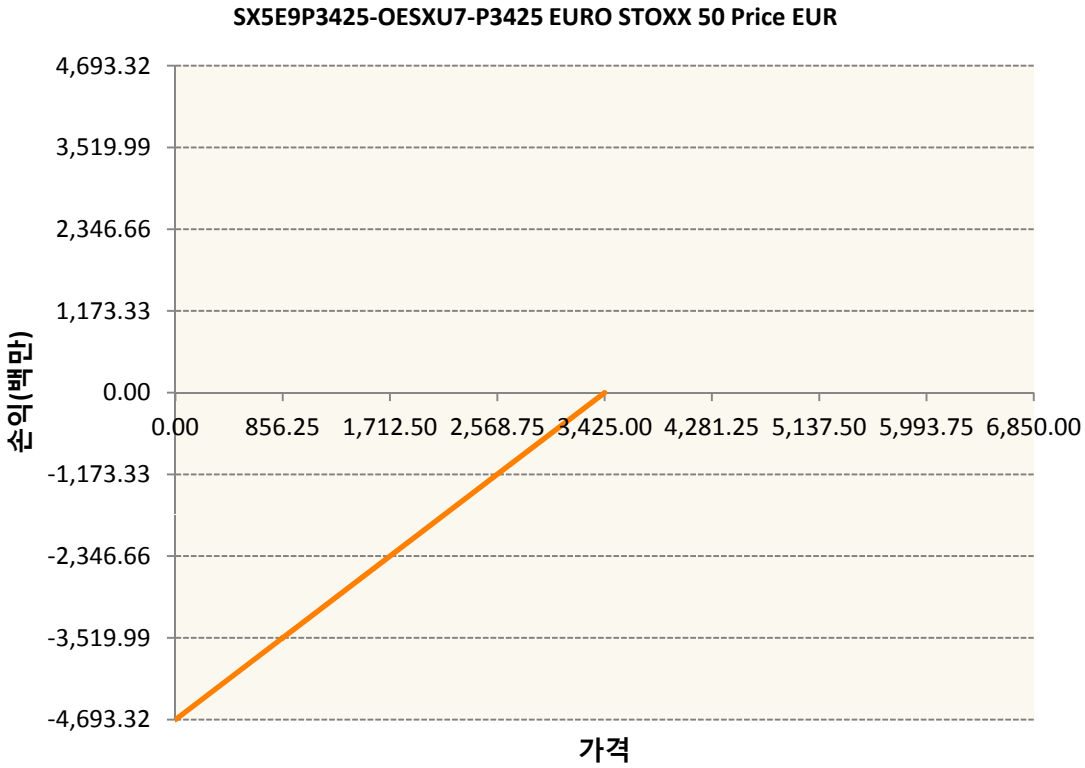
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	25,822	0	25,822	
누계	유가증권	옵션	0	59,875	-59,875	장내

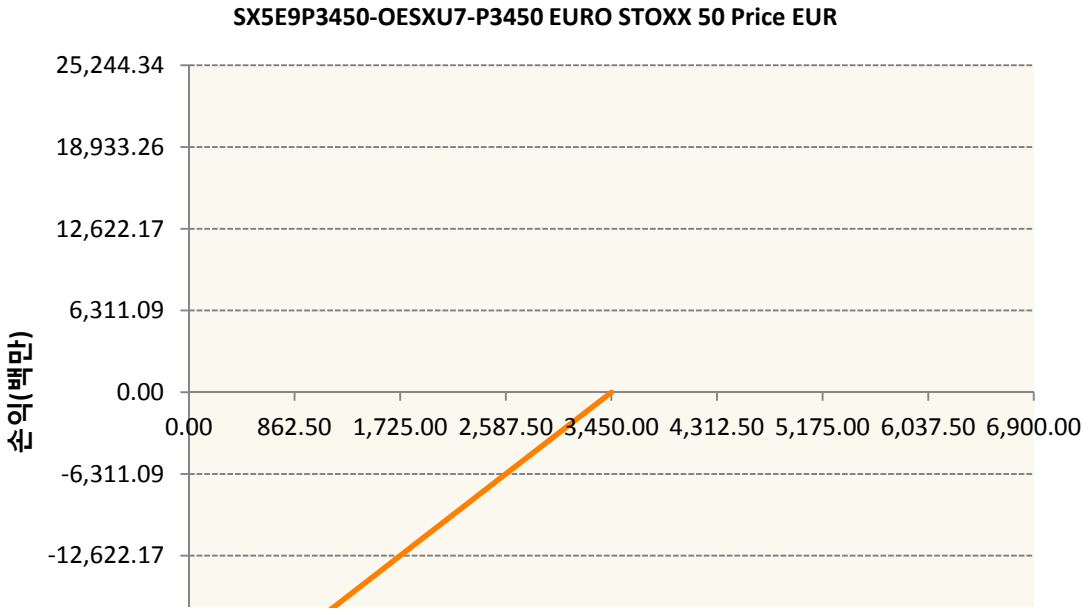
2. 만기시점의 손익구조

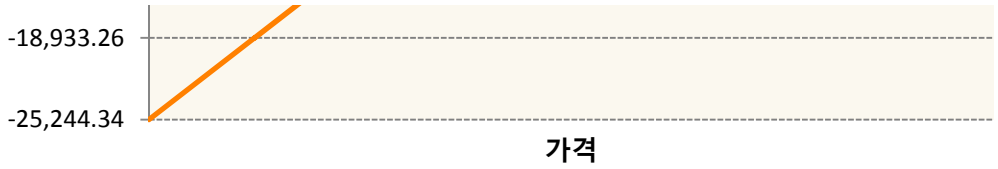


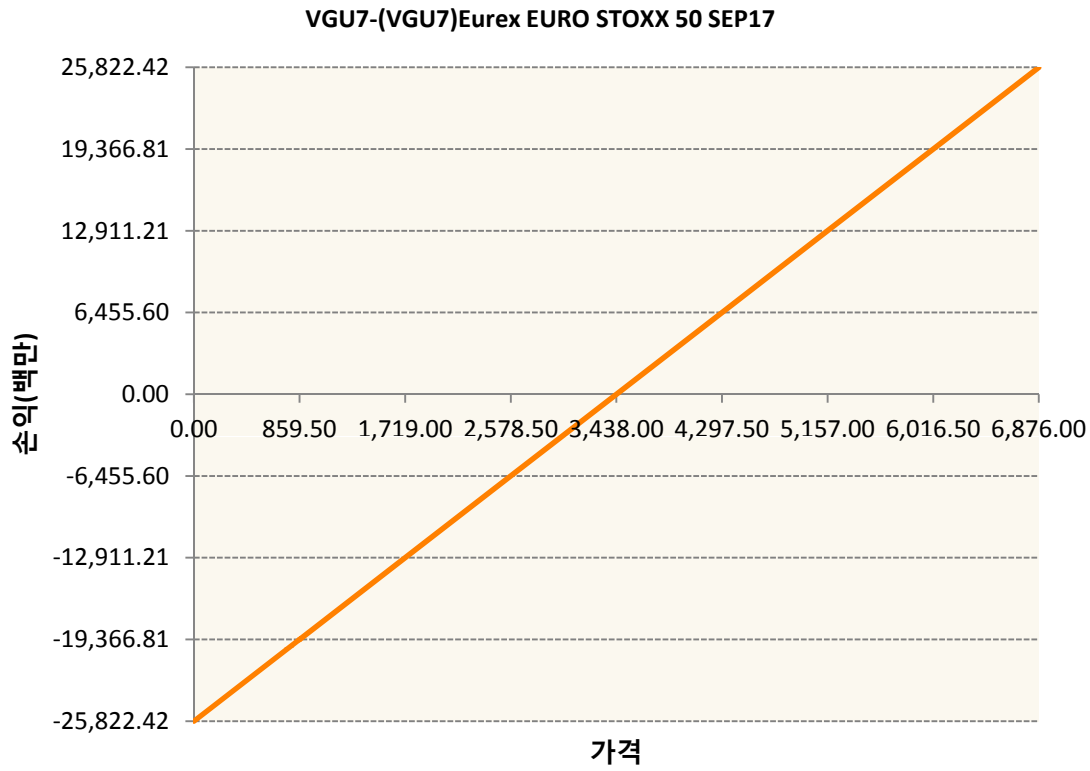



-6,311.09
-12,622.17
-18,933.26
-25,244.34
가격


SX5E9P3425-OESXU7-P3425 EURO STOXX 50 Price EUR
4,693.32
3,519.99
2,346.66
1,173.33
0.00
-1,173.33
-2,346.66
-3,519.99
-4,693.32
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
25,244.34
18,933.26
12,622.17
6,311.09
0.00
-6,311.09
-12,622.17
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	375
SX5E9C3450	OESXU7-C3450 EURO STOXX 50 Price EUR	2,019
SX5E9P3425	OESXU7-P3425 EURO STOXX 50 Price EUR	375
SX5E9P3450	OESXU7-P3450 EURO STOXX 50 Price EUR	2,019
VGU7	(VGU7)Eurex EURO STOXX 50 SEP17	2,066

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	5,544

공시일	2017-08-25
기준일	2017-08-24

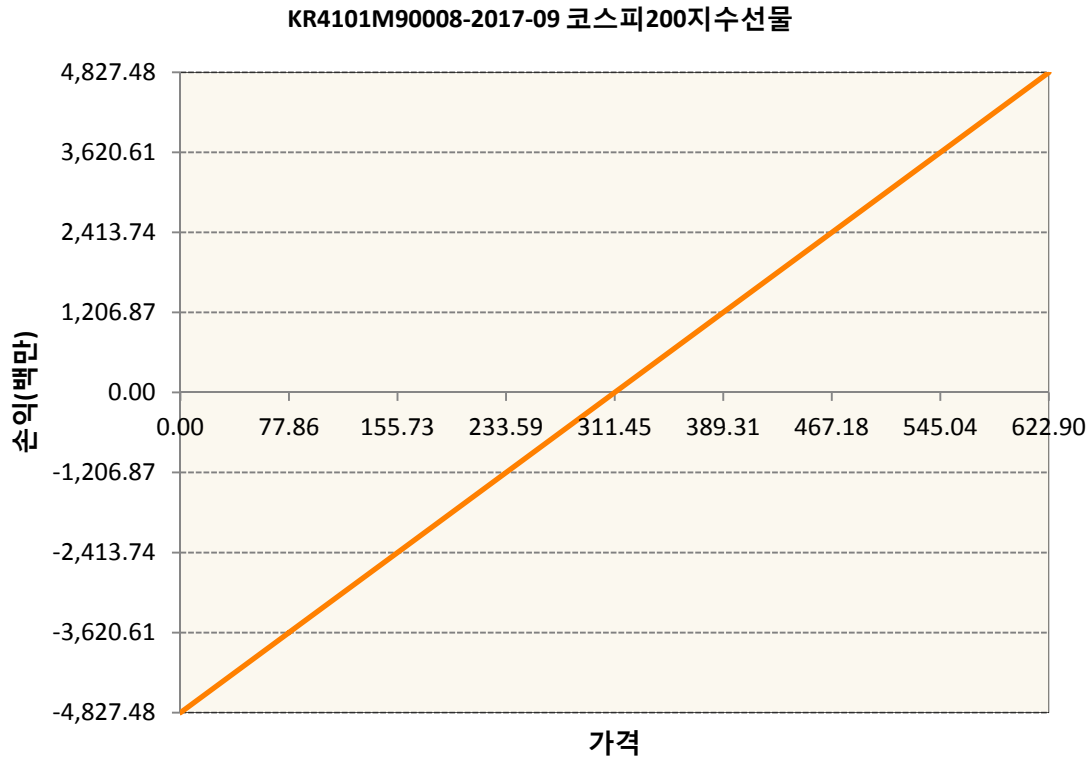
ETF스마트레버리지목표전환형7호

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	4,827	0	4,827	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101M90(2017-09 코스피200지수선물							385
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-385	-385	-385	-385	-385	-385	-385
-5.33%	-257	-257	-257	-257	-257	-257	-257
-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%	257	257	257	257	257	257	257
8.00%	385	385	385	385	385	385	385

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

240

공시일	2017-08-25
기준일	2017-08-24

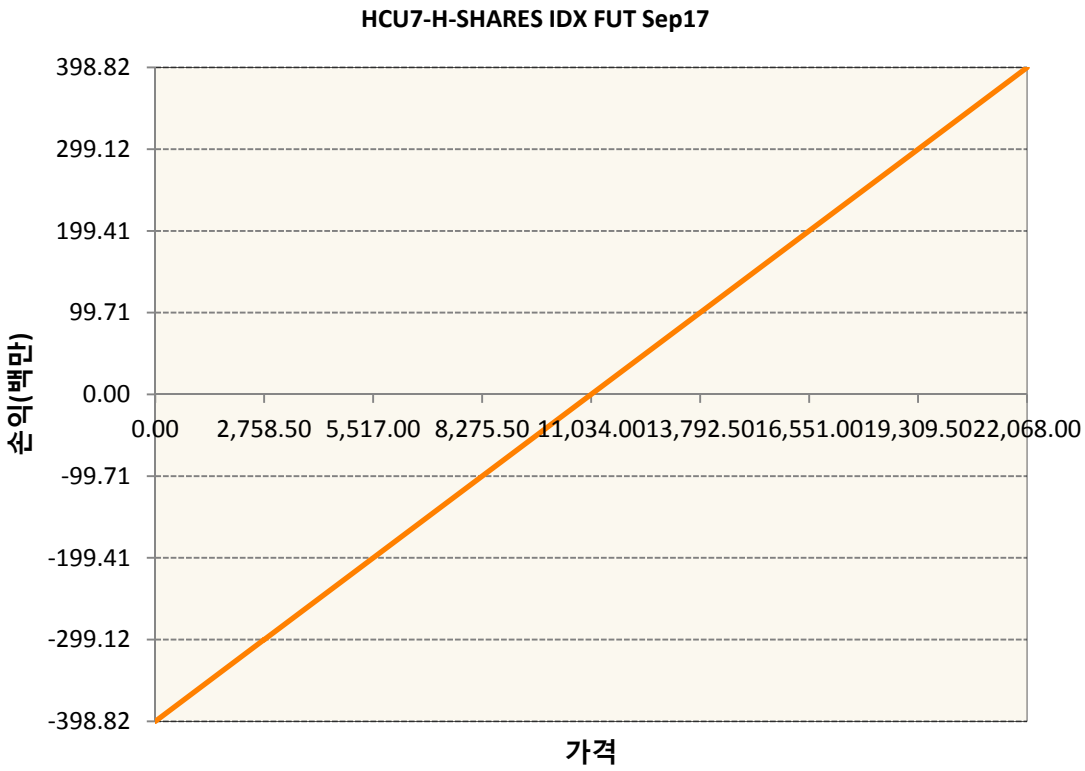
홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생

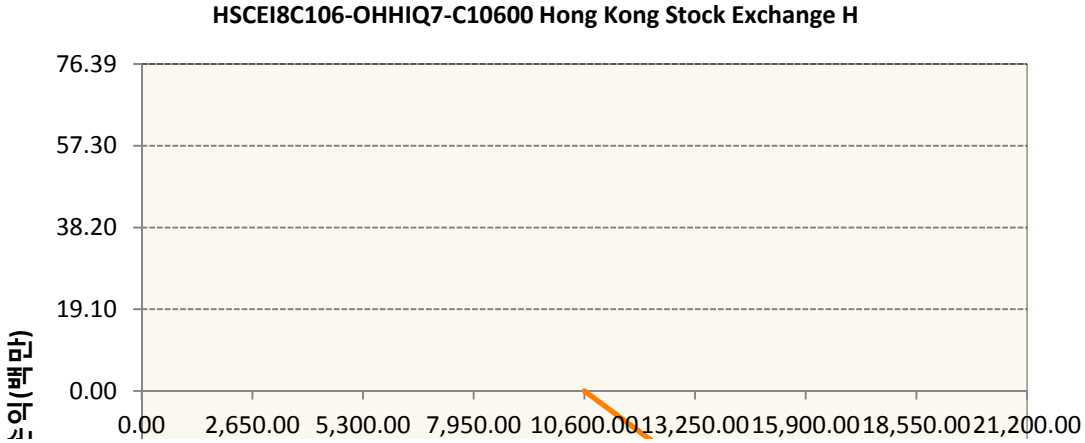
1. 계약금액

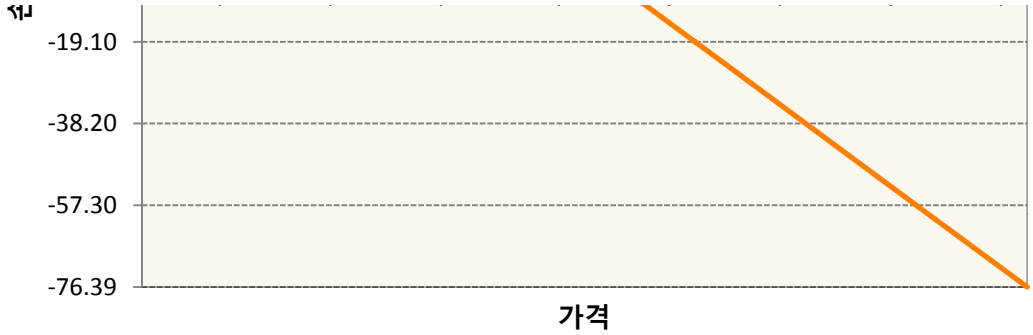
(단위:백만원)

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	399	0	399	장내
누계	유가증권	옵션	0	775	-775	장내

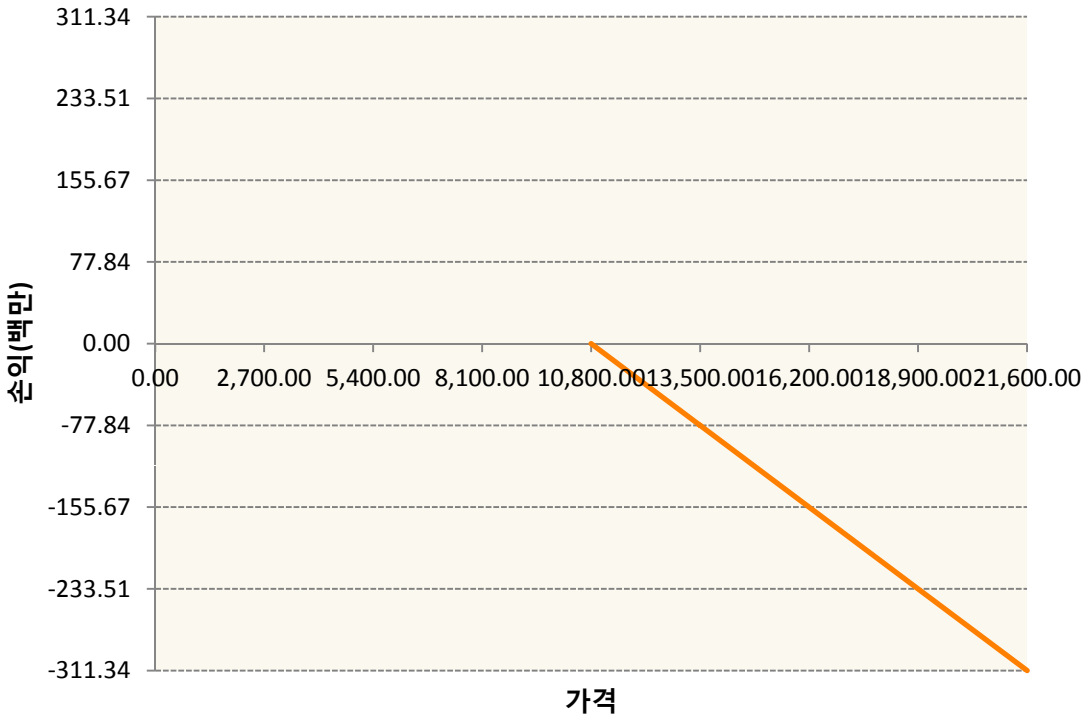
2. 만기시점의 손익구조



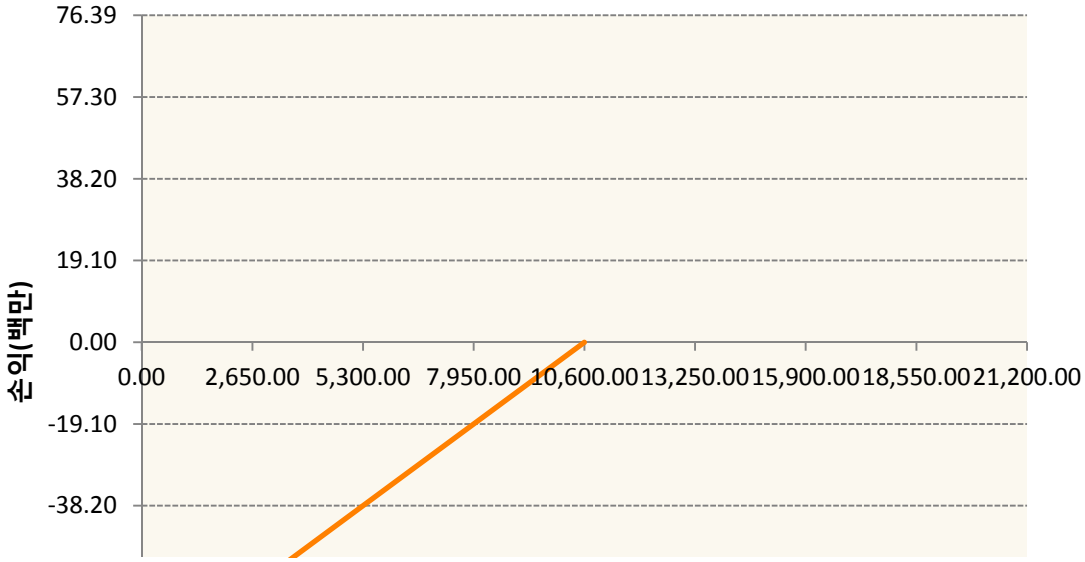


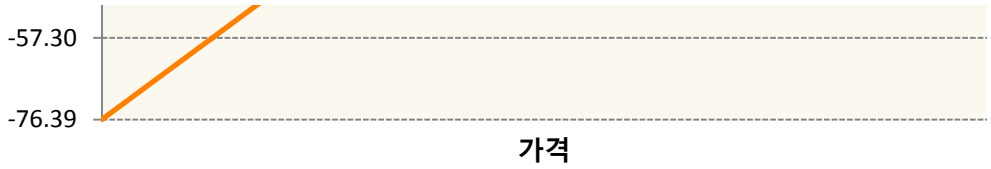


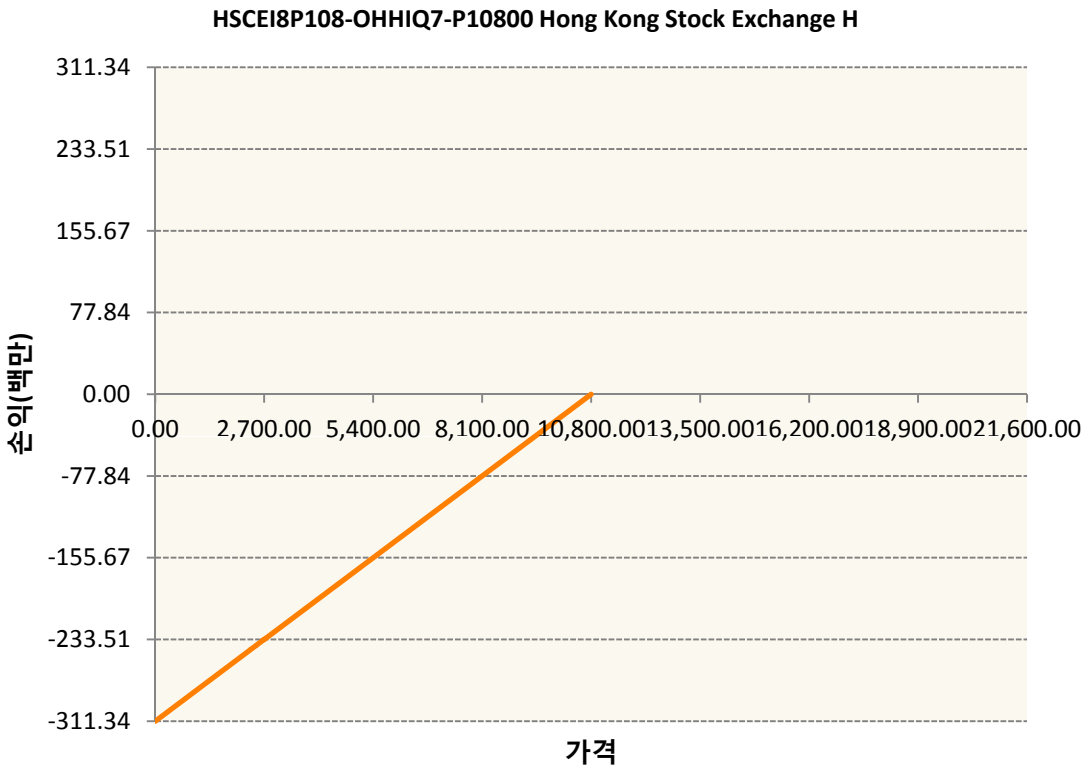
HSCEI8C108-OHHIQ7-C10800 Hong Kong Stock Exchange H



HSCEI8P106-OHHIQ7-P10600 Hong Kong Stock Exchange H







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)	(단위:백만원)
HCU7 H-SHARES IDX FUT Sep17	32
HSCEI8C106 OHHIQ7-C10600 Hong Kong Stock Exchange H	6
HSCEI8C108 OHHIQ7-C10800 Hong Kong Stock Exchange H	25
HSCEI8P106 OHHIQ7-P10600 Hong Kong Stock Exchange H	6
HSCEI8P108 OHHIQ7-P10800 Hong Kong Stock Exchange H	25

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	81

공시일	2017-08-25
기준일	2017-08-24

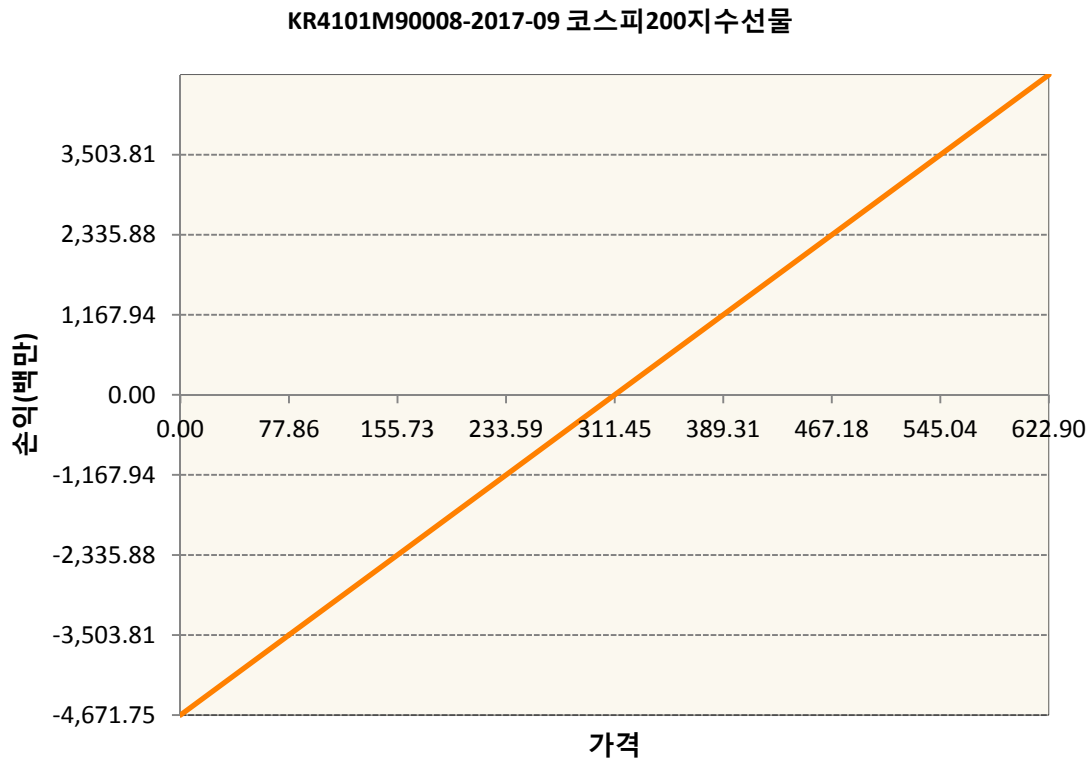
코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼

1. 계약금액

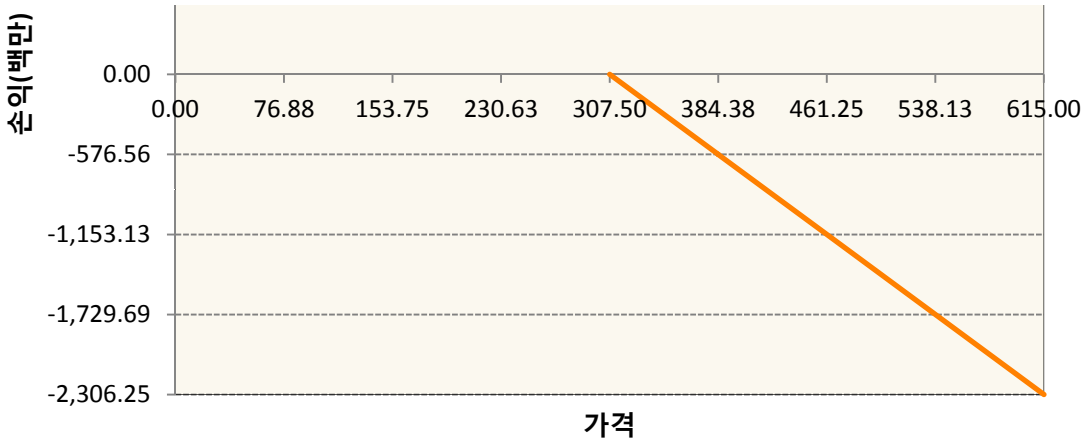
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	4,672	0	4,672	장내
누계	유가증권	스왑	15,000	0	15,000	장외
누계	유가증권	옵션	0	14,647	-14,647	장내

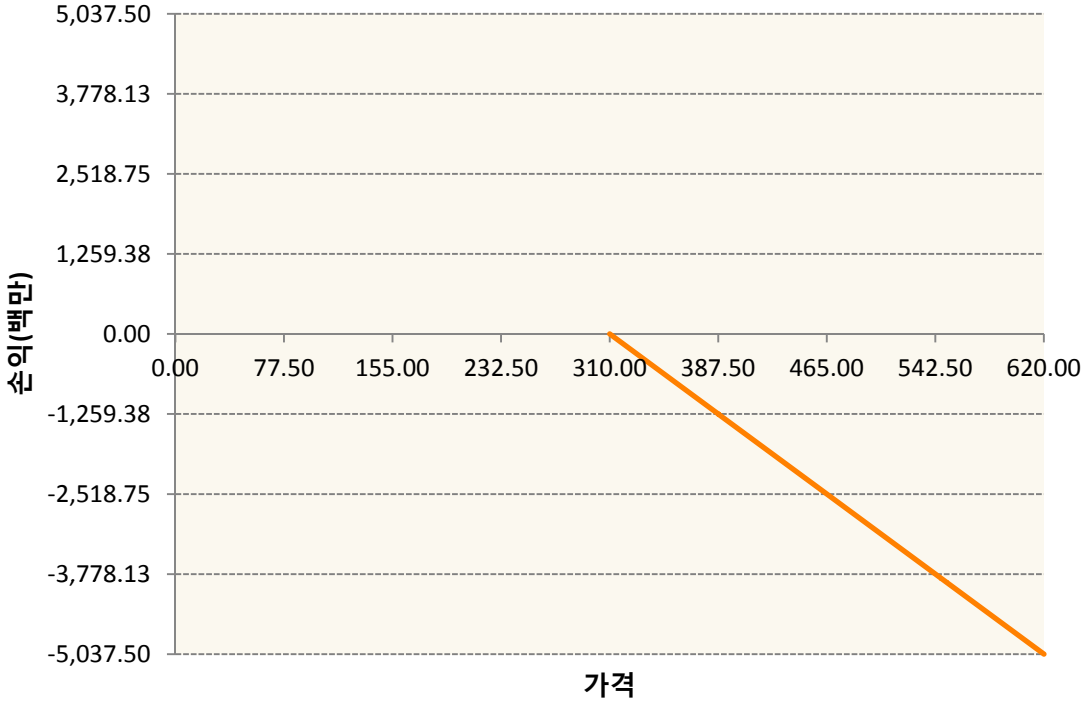
2. 만기시점의 손익구조



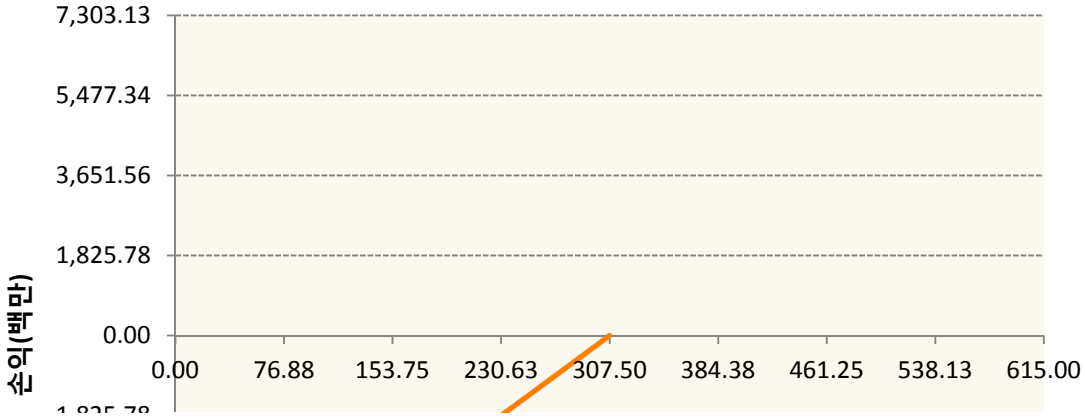




KR4201M93109-2017-09 콜310



KR4301M93073-2017-09 풋307.5





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

	KR4101M90(2017-09 코스피200지수선물						373
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-373	-373	-373	-373	-373	-373	-373
-5.33%	-249	-249	-249	-249	-249	-249	-249
-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%	249	249	249	249	249	249	249
8.00%	373	373	373	373	373	373	373
	KR4201M93(2017-09 콜307.5						155
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	61	60	59	58	56	54	52
-5.33%	56	54	51	49	46	43	40
-2.67%	42	38	34	30	26	23	19
0%	12	8	4	0	-4	-8	-12
2.67%	-33	-36	-39	-42	-45	-49	-53
5.33%	-88	-90	-92	-94	-96	-98	-101
8.00%	-148	-149	-150	-151	-152	-153	-155
	KR4201M93: 2017-09 콜310						322
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	112	111	109	106	103	100	96
-5.33%	105	101	96	91	85	79	73
-2.67%	81	73	66	58	50	42	33
0%	27	18	9	0	-9	-18	-27
2.67%	-61	-69	-76	-84	-92	-100	-108
5.33%	-176	-180	-184	-190	-195	-202	-208
8.00%	-304	-305	-308	-310	-314	-318	-322
	KR4301M93(2017-09 풋307.5						425
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-396	-399	-402	-407	-412	-418	-425
-5.33%	-215	-222	-230	-239	-248	-258	-268
-2.67%	-64	-76	-88	-101	-113	-125	-138
0%	38	26	13	0	-13	-26	-39
2.67%	92	83	73	63	53	42	30
5.33%	114	109	103	97	90	82	74
8.00%	120	118	116	113	109	104	98

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

1,137

공시일	2017-08-25
기준일	2017-08-24

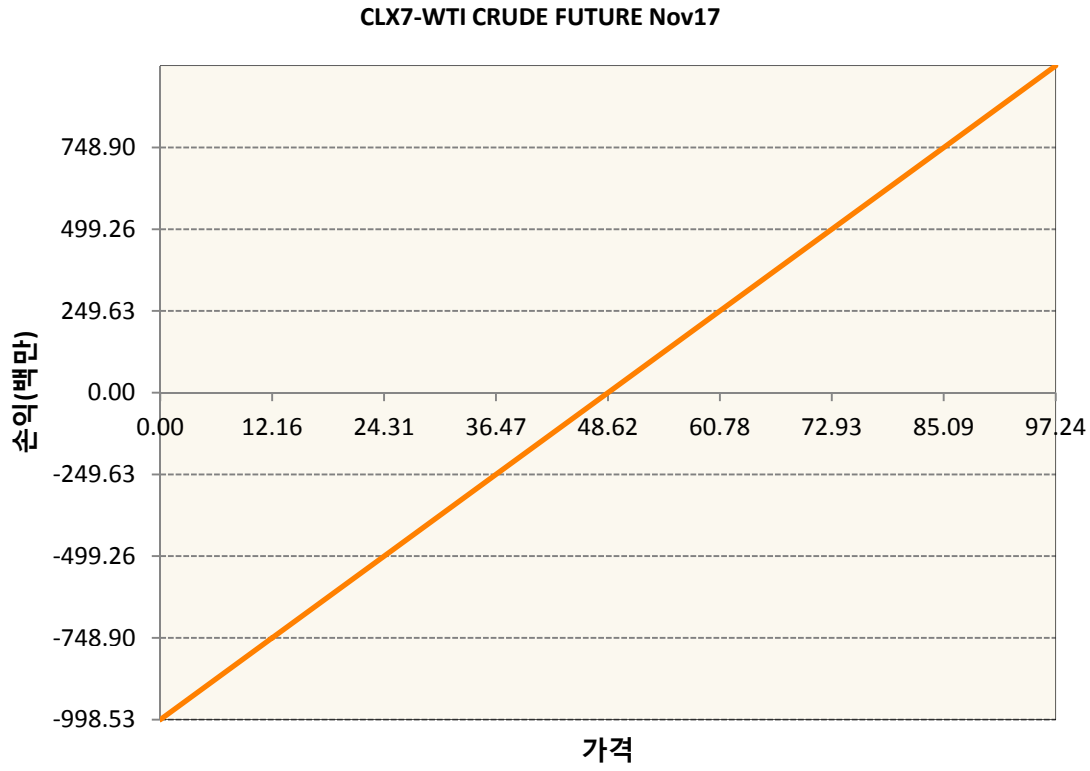
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

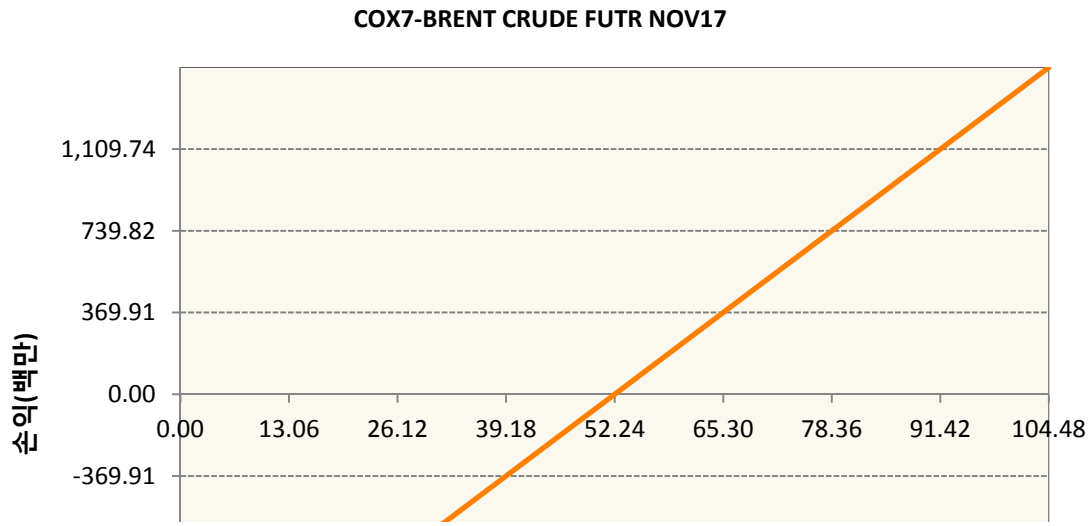
1. 계약금액

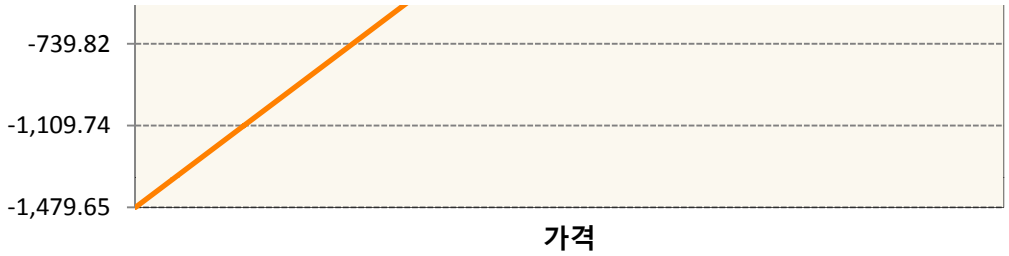
(단위:백만원)

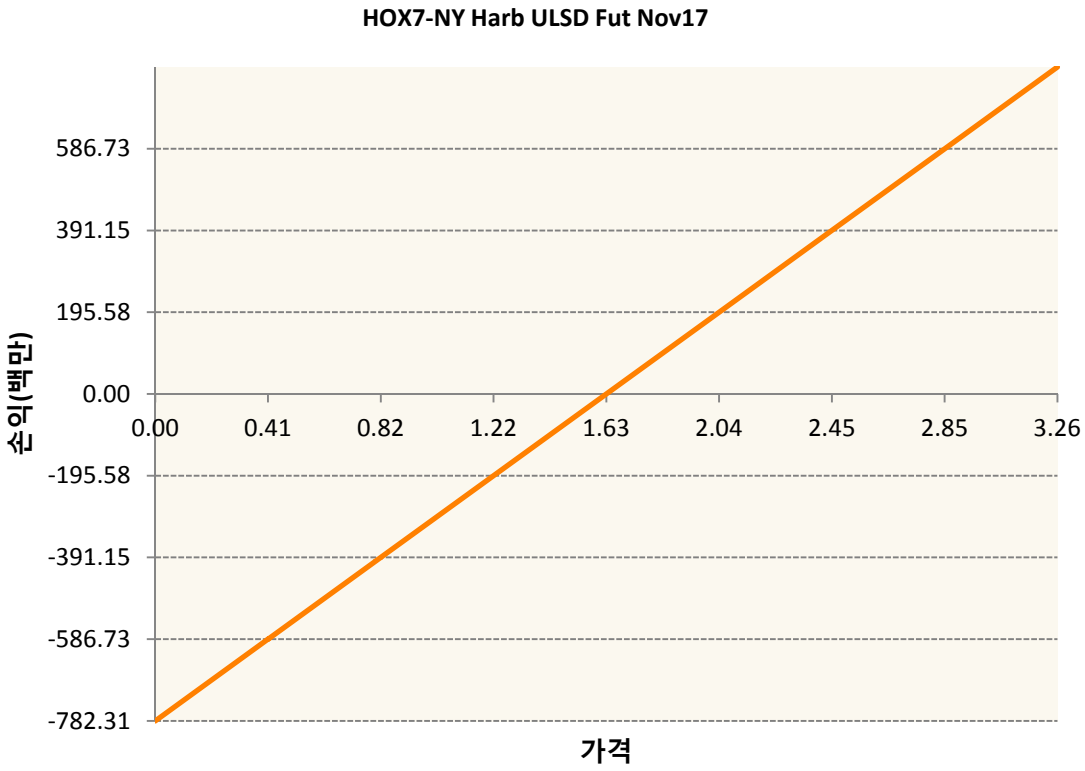
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	5,431	508	4,923	

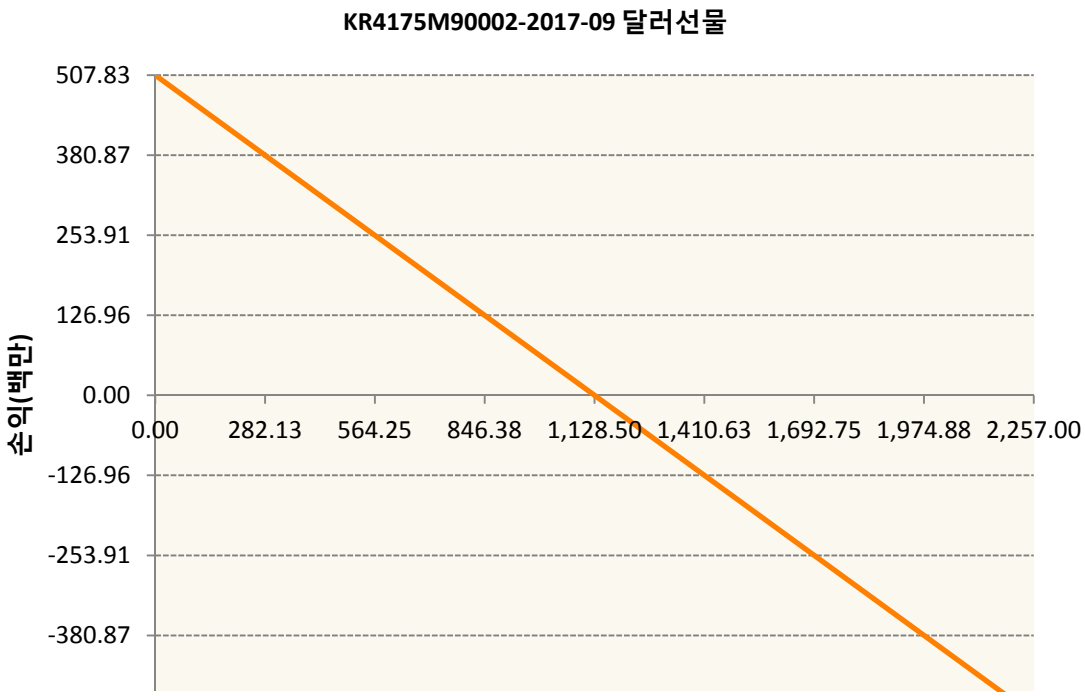
2. 만기시점의 손익구조

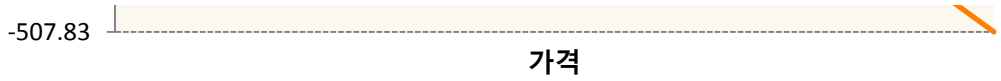


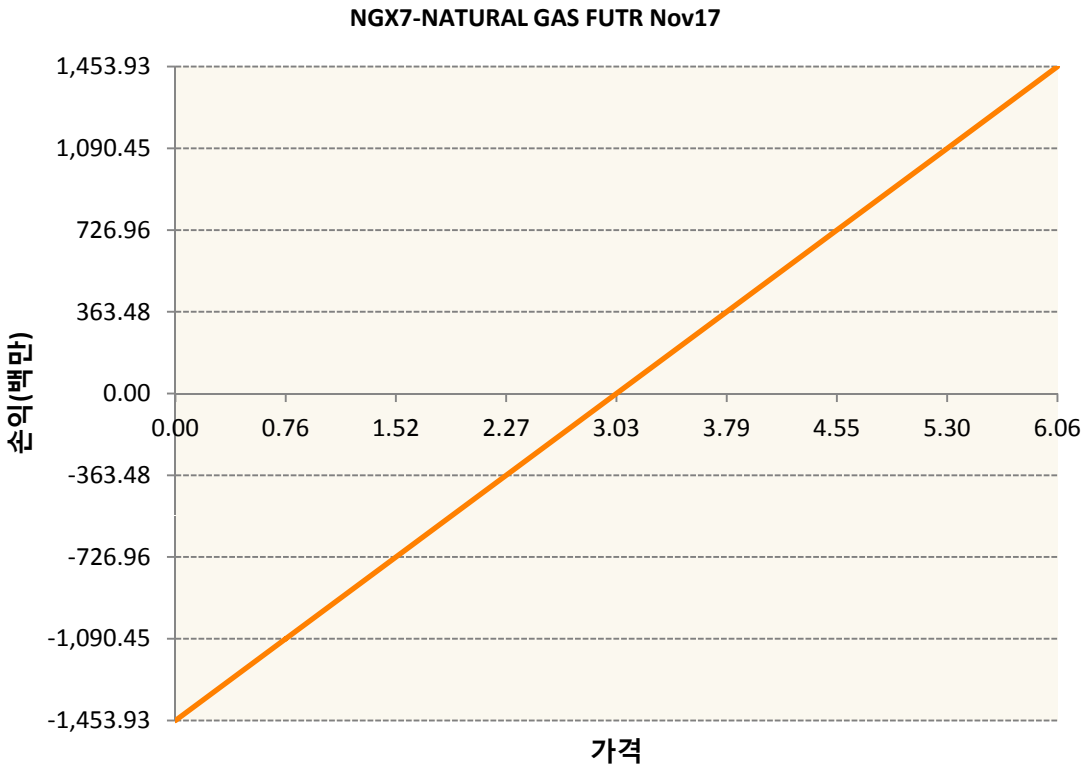


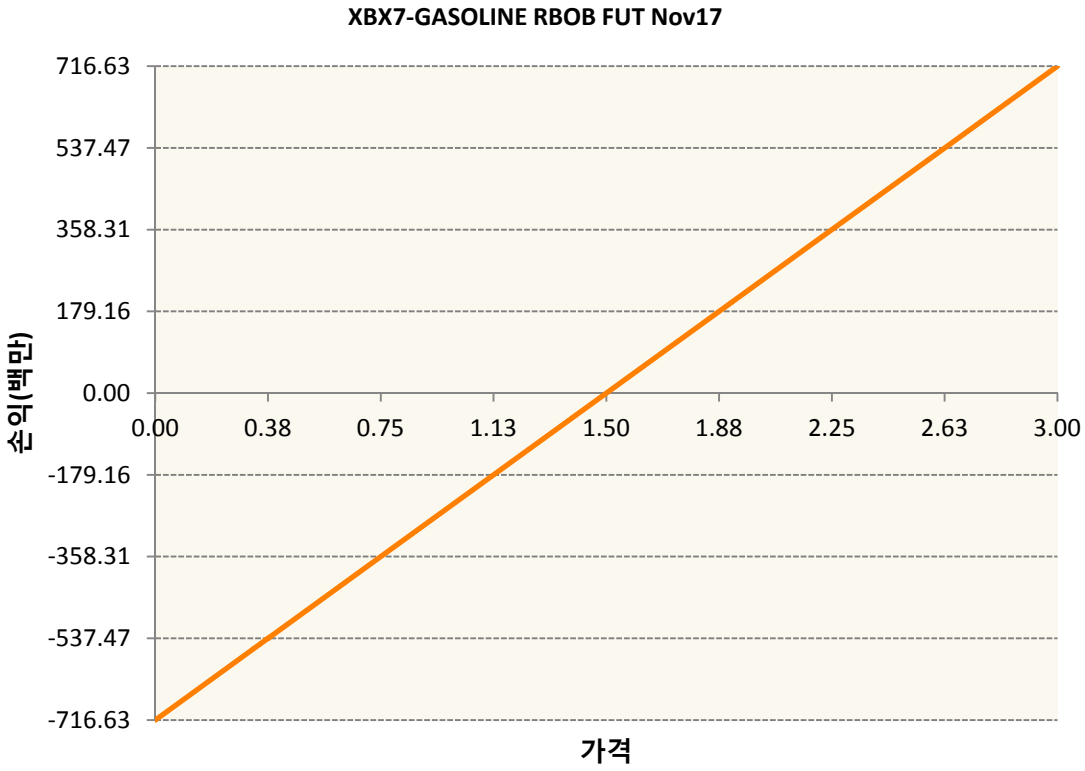

-739.82
-1,109.74
-1,479.65
가격


HOX7-NY Harb ULSD Fut Nov17
586.73
391.15
195.58
0.00
-195.58
-391.15
-586.73
-782.31
0.00
0.41
0.82
1.22
1.63
2.04
2.45
2.85
3.26
손익(백만)
가격


KR4175M90002-2017-09 달러선물
507.83
380.87
253.91
126.96
0.00
-126.96
-253.91
-380.87
0.00
282.13
564.25
846.38
1,128.50
1,410.63
1,692.75
1,974.88
2,257.00
손익(백만)


-507.83
가격


NGX7-NATURAL GAS FUTR Nov17
1,453.93
1,090.45
726.96
363.48
0.00
-363.48
-726.96
-1,090.45
-1,453.93
0.00
0.76
1.52
2.27
3.03
3.79
4.55
5.30
6.06
손익(백만)
가격


XBX7-GASOLINE RBOB FUT Nov17
716.63
537.47
358.31
179.16
0.00
-179.16
-358.31
-537.47
-716.63
0.00
0.38
0.75
1.13
1.50
1.88
2.25
2.63
3.00
손익(백만)
가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLX7	WTI CRUDE FUTURE Nov17	80
COX7	BRENT CRUDE FUTR NOV17	118
HOX7	NY Harb ULSD Fut Nov17	63
KR4175M90(	2017-09 달러선물	41
NGX7	NATURAL GAS FUTR Nov17	116
XBX7	GASOLINE RBOB FUT Nov17	57

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

783

공시일	2017-08-25
기준일	2017-08-24

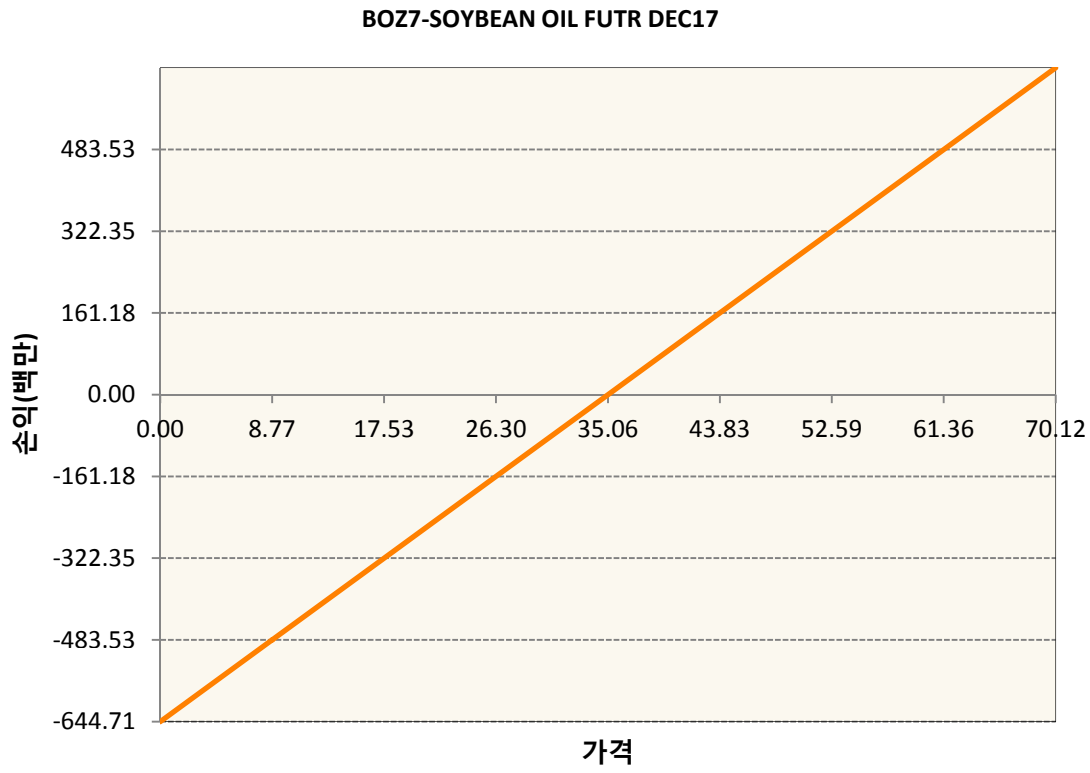
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

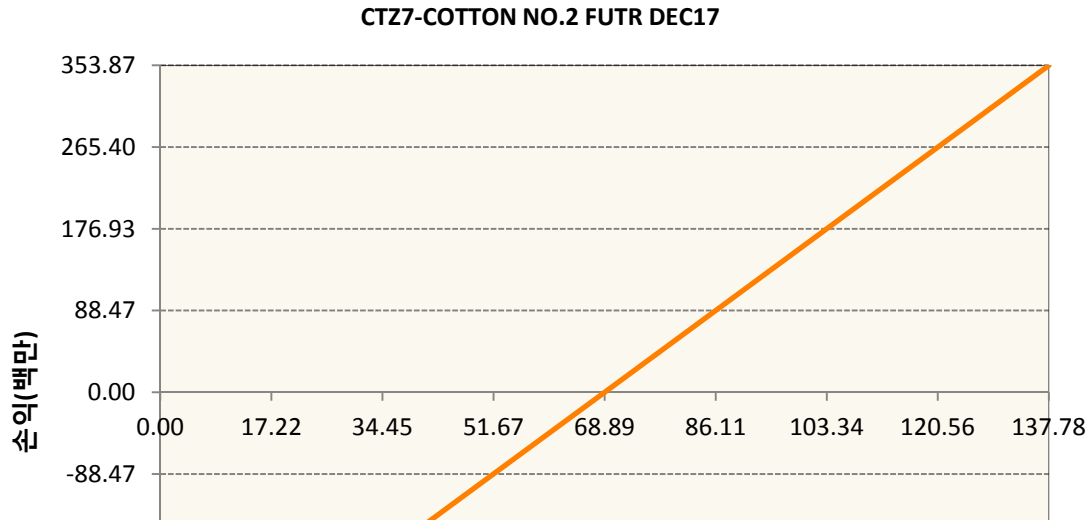
1. 계약금액

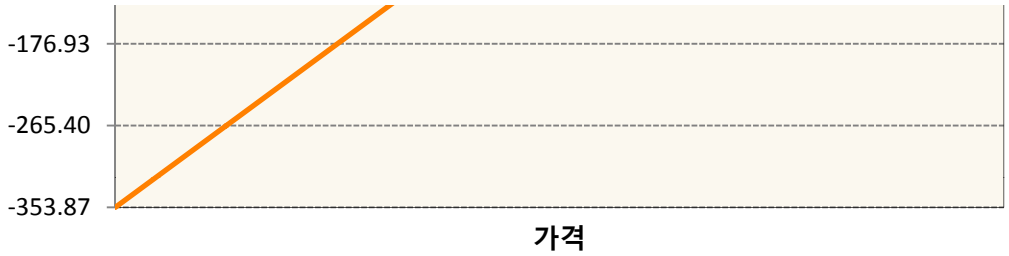
(단위:백만원)

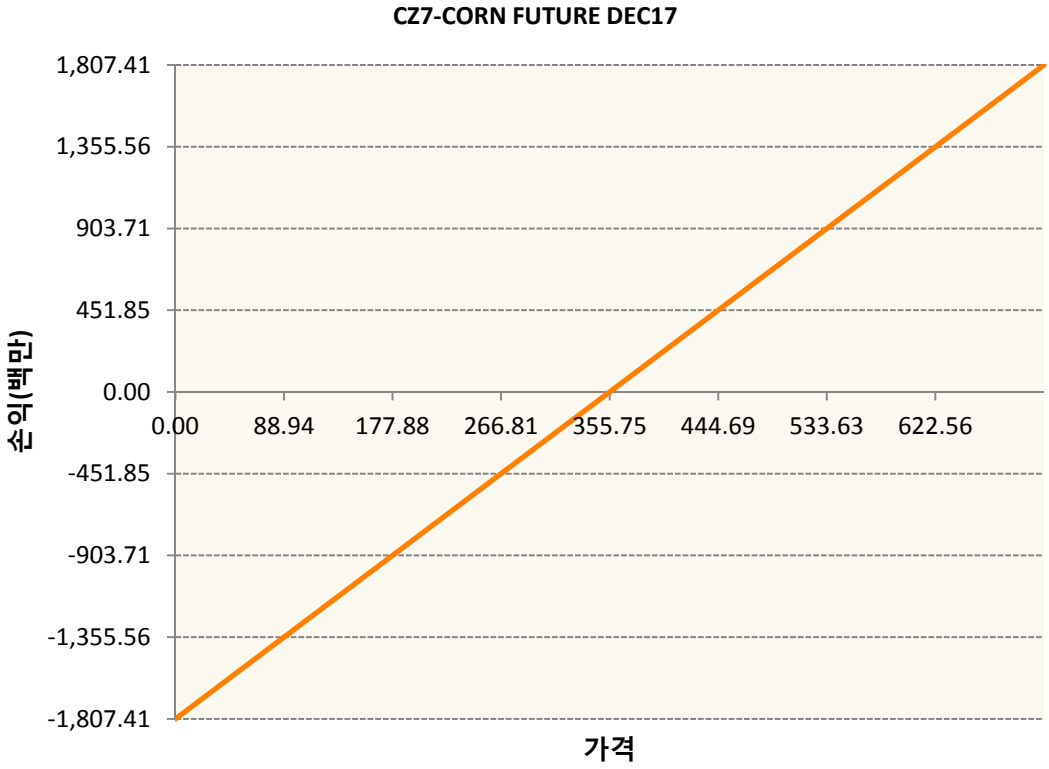
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	6,875	339	6,537	

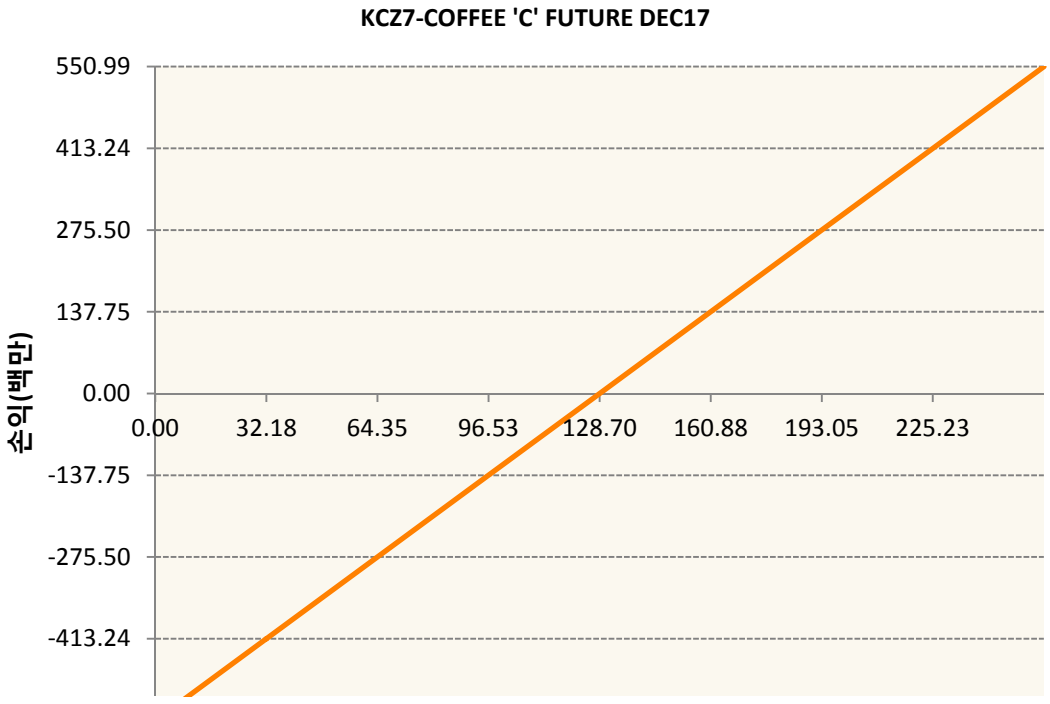
2. 만기시점의 손익구조

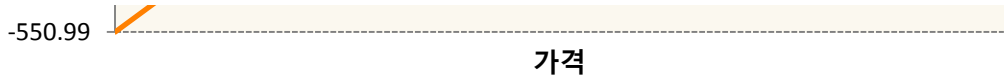


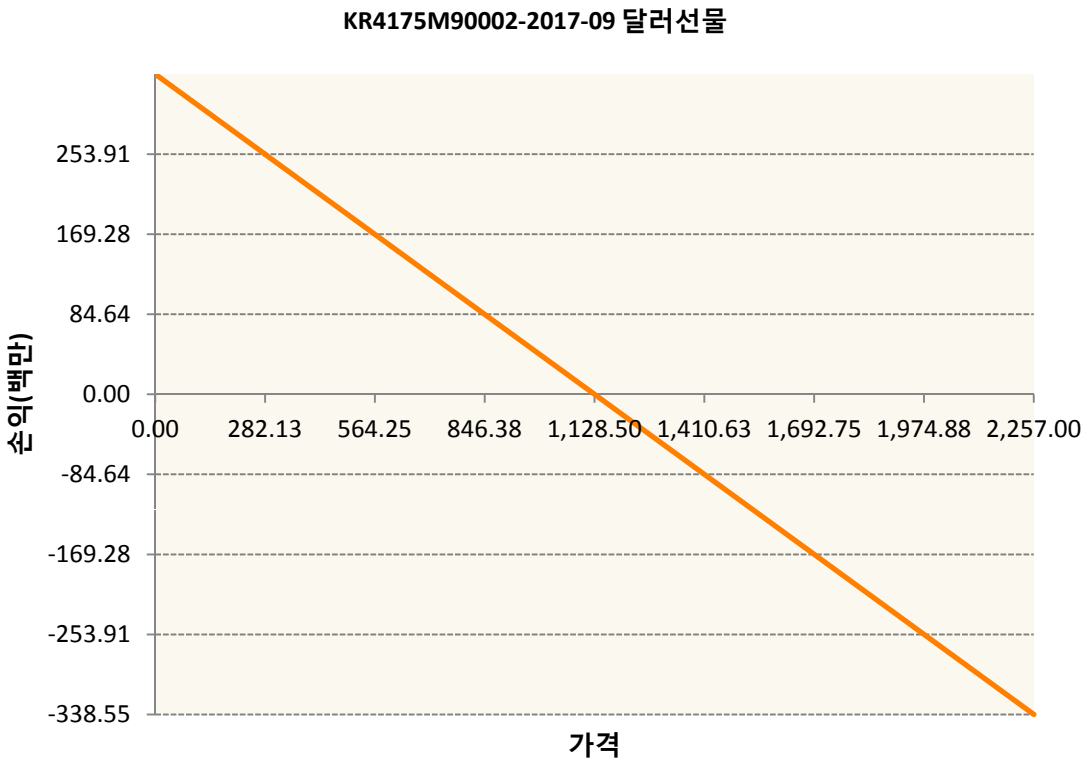


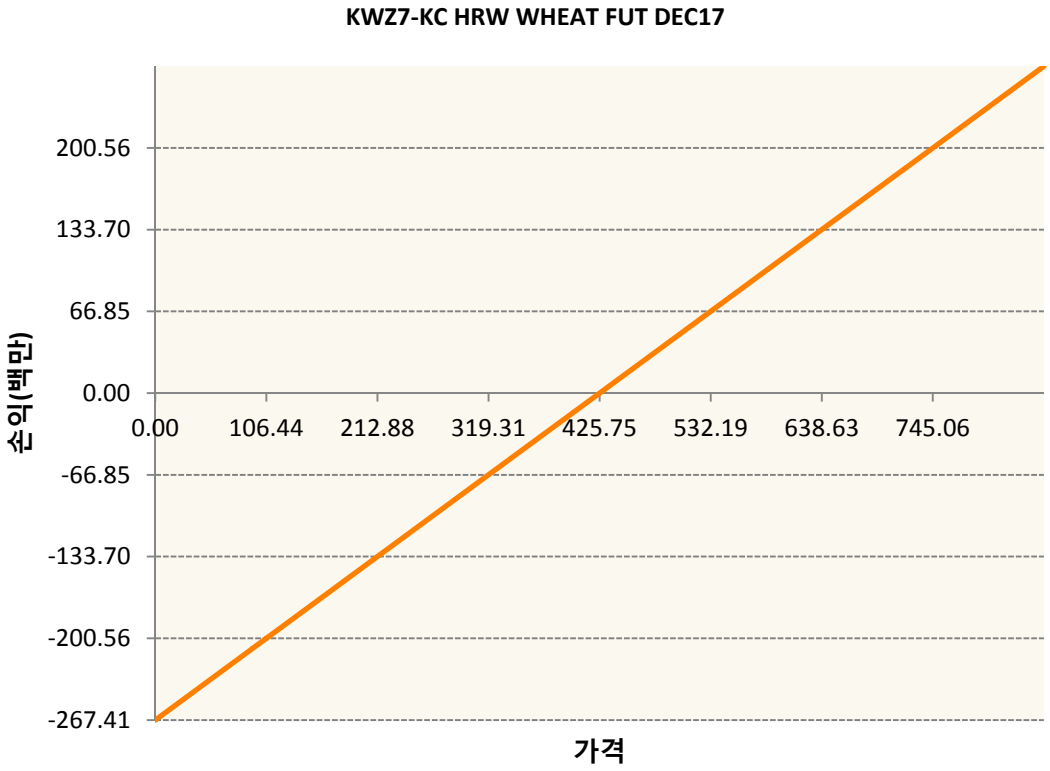

-176.93
-265.40
-353.87
가격

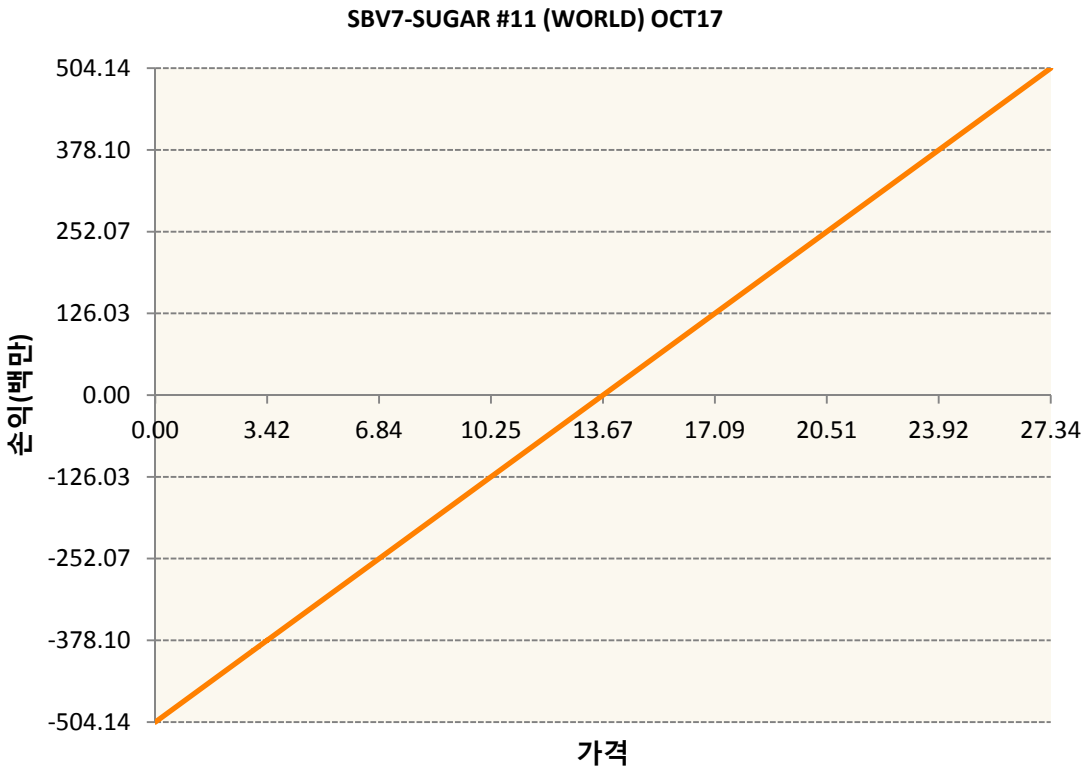

CZ7-CORN FUTURE DEC17
1,807.41
1,355.56
903.71
451.85
0.00
-451.85
-903.71
-1,355.56
-1,807.41
0.00
88.94
177.88
266.81
355.75
444.69
533.63
622.56
손익(백만)
가격

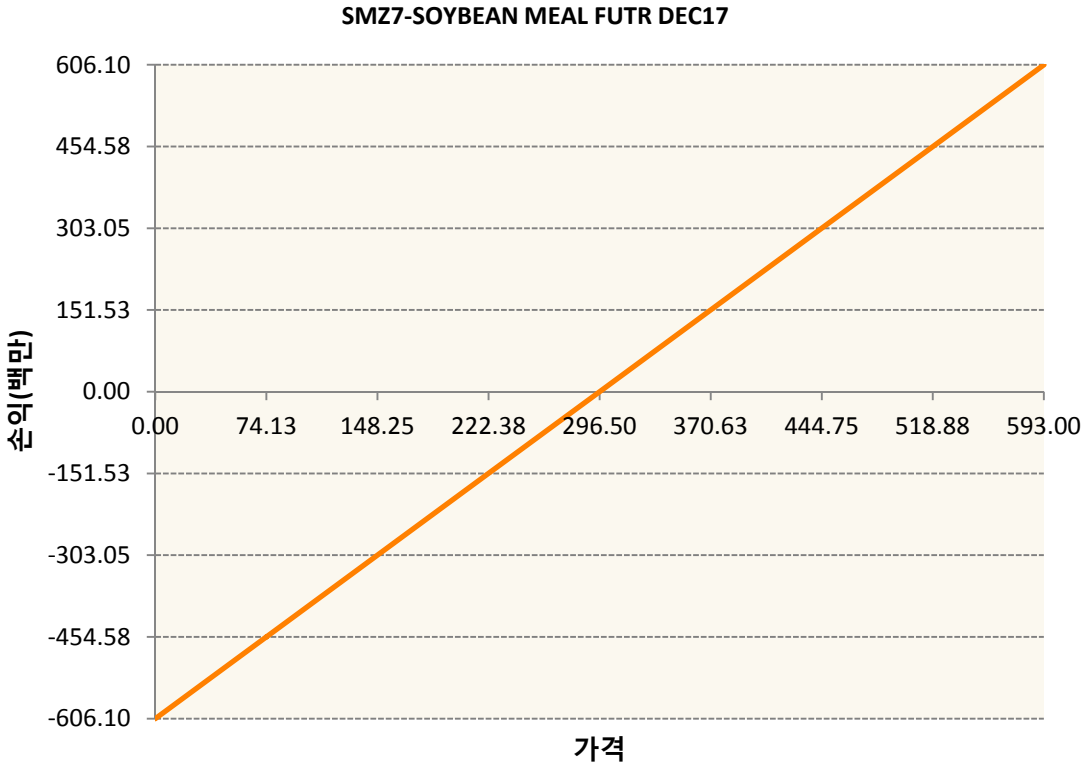

KCZ7-COFFEE 'C' FUTURE DEC17
550.99
413.24
275.50
137.75
0.00
-137.75
-275.50
-413.24
0.00
32.18
64.35
96.53
128.70
160.88
193.05
225.23
손익(백만)

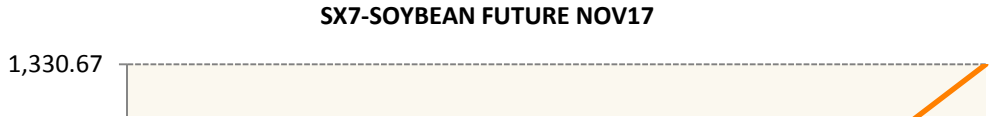

-550.99
가격

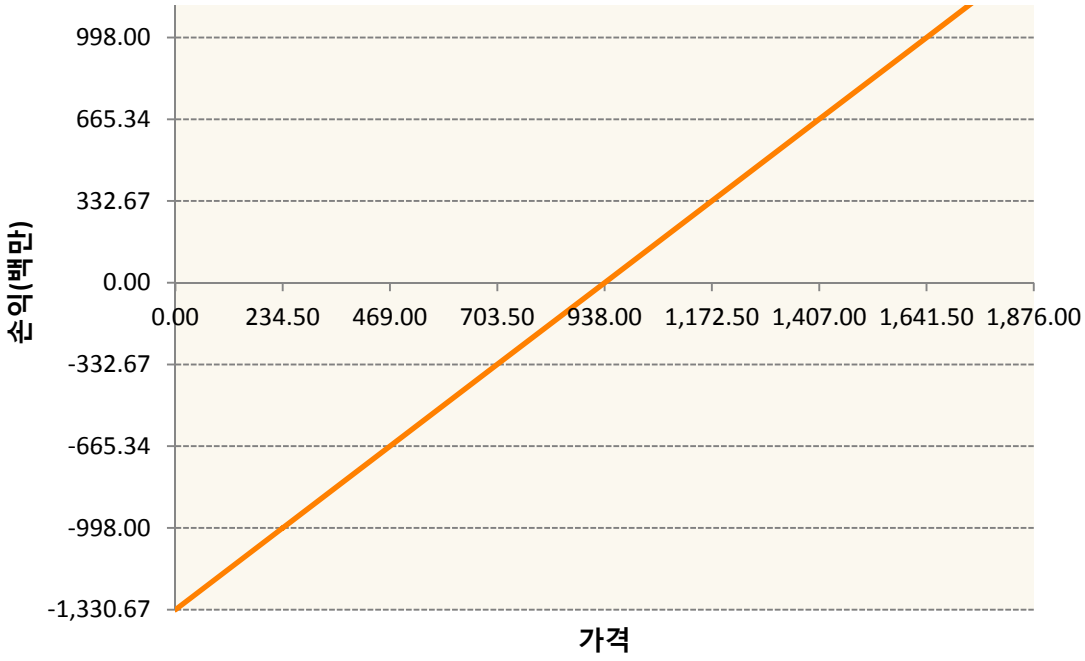

KR4175M90002-2017-09 달러선물
253.91
169.28
84.64
0.00
-84.64
-169.28
-253.91
-338.55
0.00
282.13
564.25
846.38
1,128.50
1,410.63
1,692.75
1,974.88
2,257.00
손익(백만)
가격

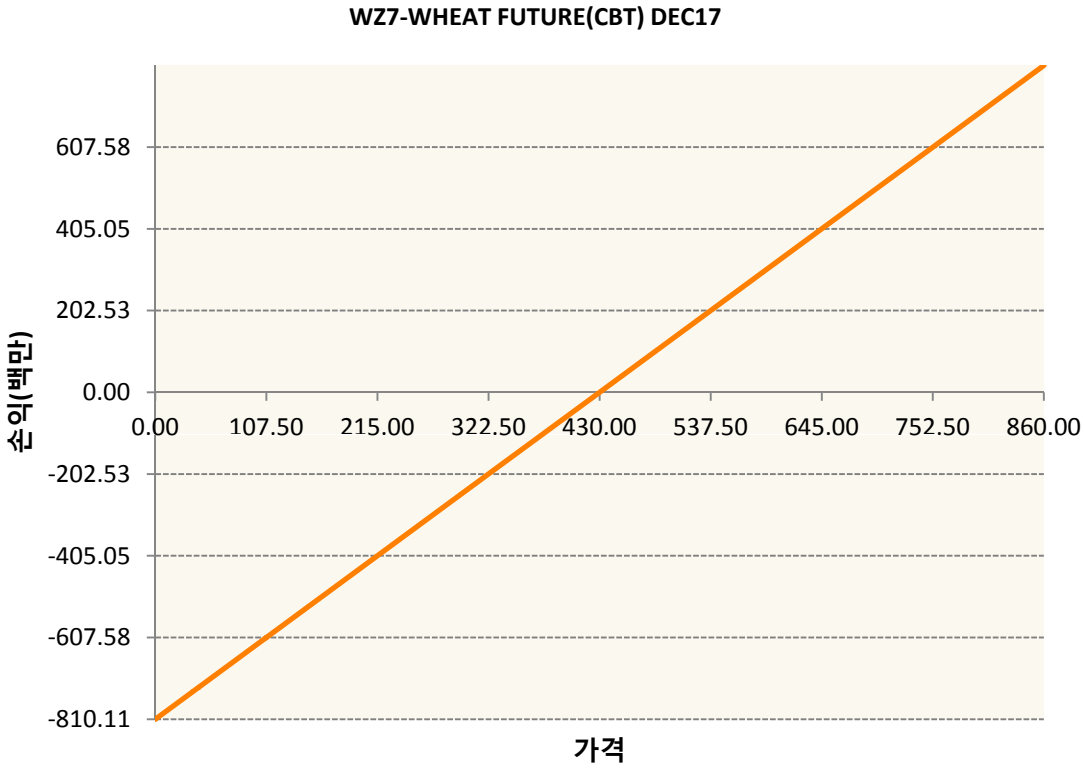

KWZ7-KC HRW WHEAT FUT DEC17
200.56
133.70
66.85
0.00
-66.85
-133.70
-200.56
-267.41
0.00
106.44
212.88
319.31
425.75
532.19
638.63
745.06
손익(백만)
가격


SBV7-SUGAR #11 (WORLD) OCT17
504.14
378.10
252.07
126.03
0.00
-126.03
-252.07
-378.10
-504.14
0.00
3.42
6.84
10.25
13.67
17.09
20.51
23.92
27.34
손익(백만)
가격


SMZ7-SOYBEAN MEAL FUTR DEC17
606.10
454.58
303.05
151.53
0.00
-151.53
-303.05
-454.58
-606.10
0.00
74.13
148.25
222.38
296.50
370.63
444.75
518.88
593.00
손익(백만)
가격


SX7-SOYBEAN FUTURE NOV17
1,330.67





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
BOZ7	SOYBEAN OIL FUTR DEC17	52
CTZ7	COTTON NO.2 FUTR DEC17	28
CZ7	CORN FUTURE DEC17	145
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	48
SX7	SOYBEAN FUTURE NOV17	106
WZ7	WHEAT FUTURE(CBT) DEC17	65

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

649