공시일	2017-08-28
기준일	2017-08-25

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	2017-08-28
기준일	2017-08-25

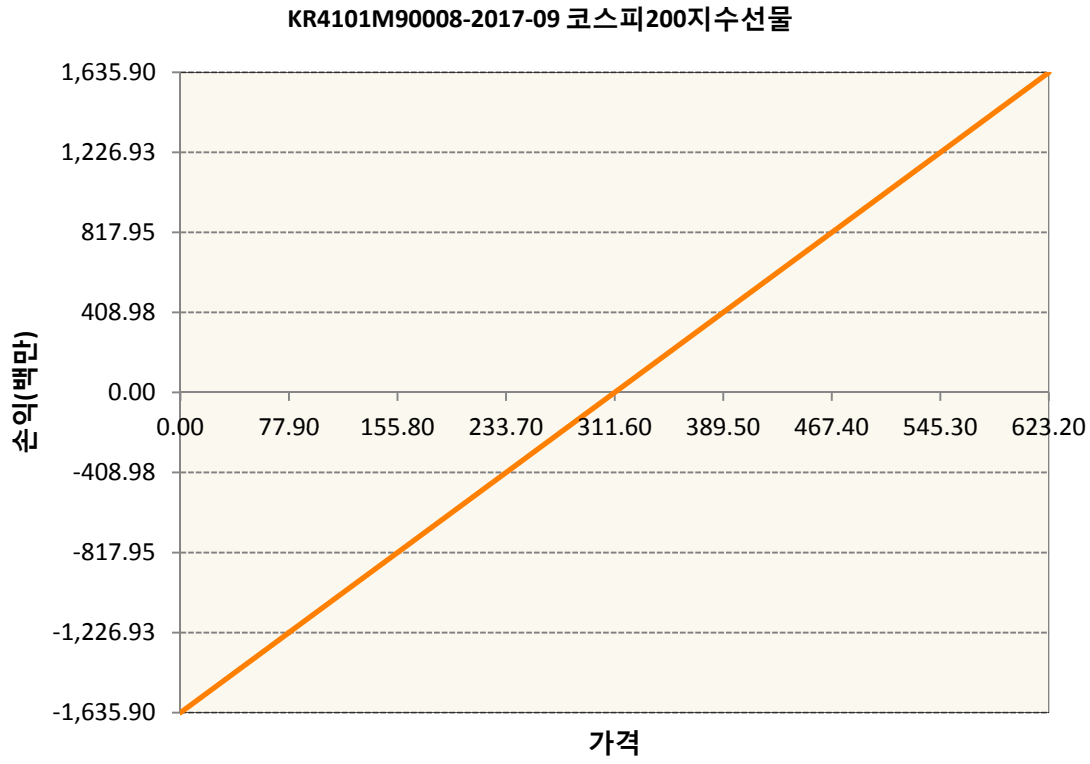
스마트인덱스모

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	1,636	0	1,636	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	2017-08-28
기준일	2017-08-25

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	1,011

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

462

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-08-28
기준일	2017-08-25

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	401

* 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	2017-08-28
기준일	2017-08-25

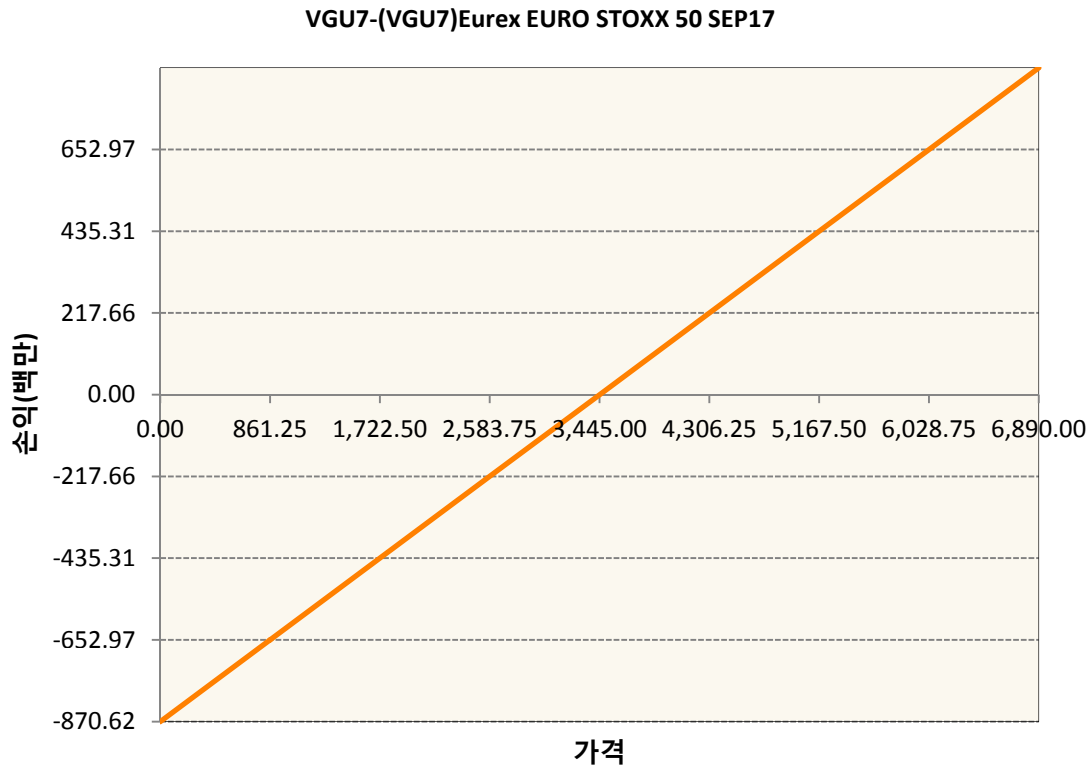
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	871	0	871	

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)

56

공시일	2017-08-28
기준일	2017-08-25

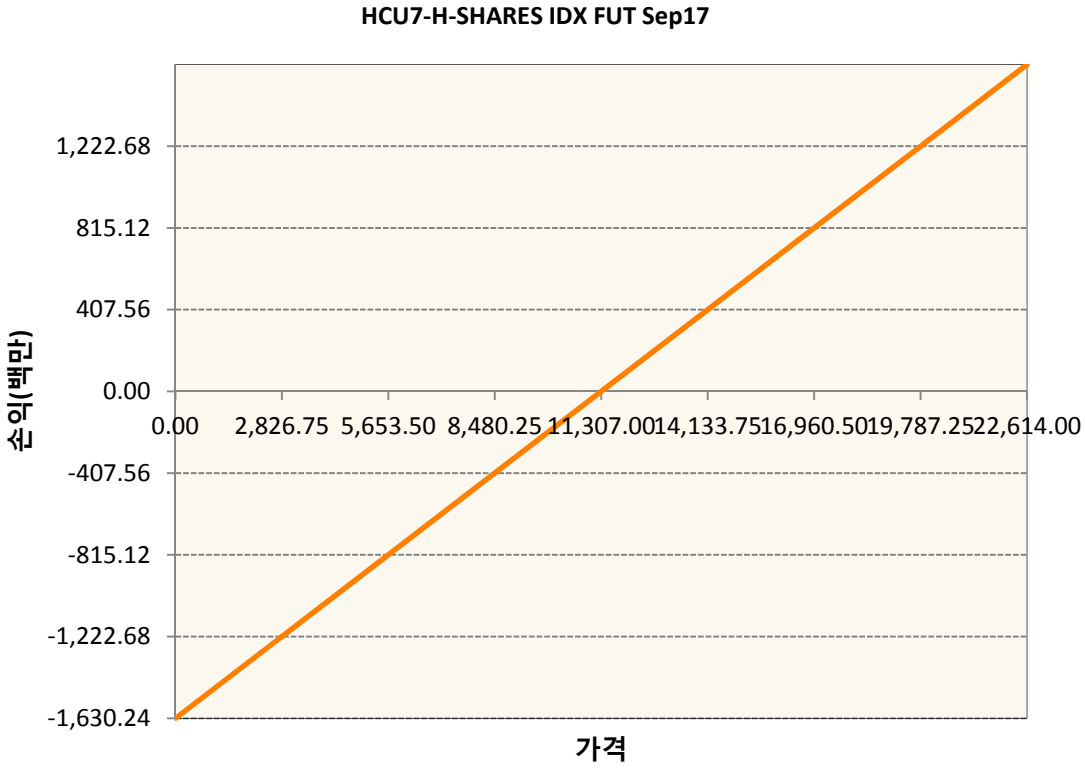
차이나인덱스모(주식-파생형)

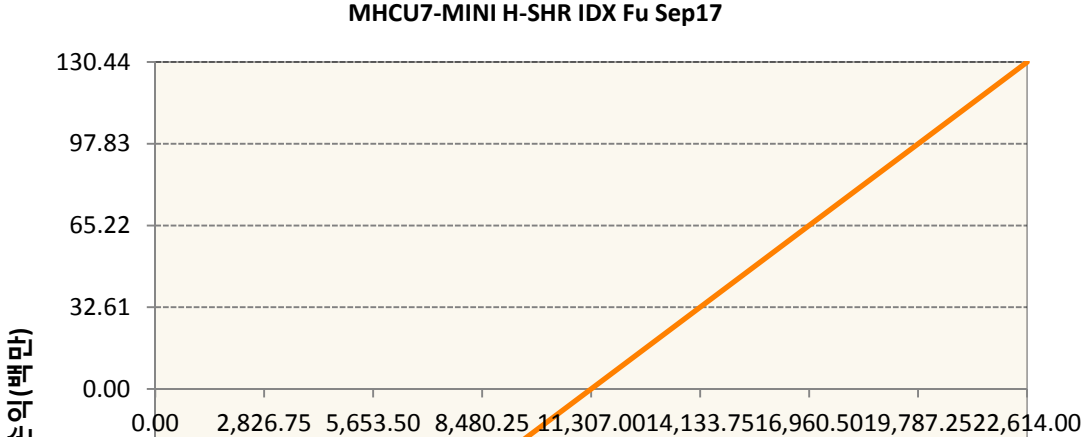
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	130	0	130	
누계	유가증권	선물	1,630	0	1,630	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCU7	H-SHARES IDX FUT Sep17	130
MHCU7	MINI H-SHR IDX Fu Sep17	10

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	121

공시일	2017-08-28
기준일	2017-08-25

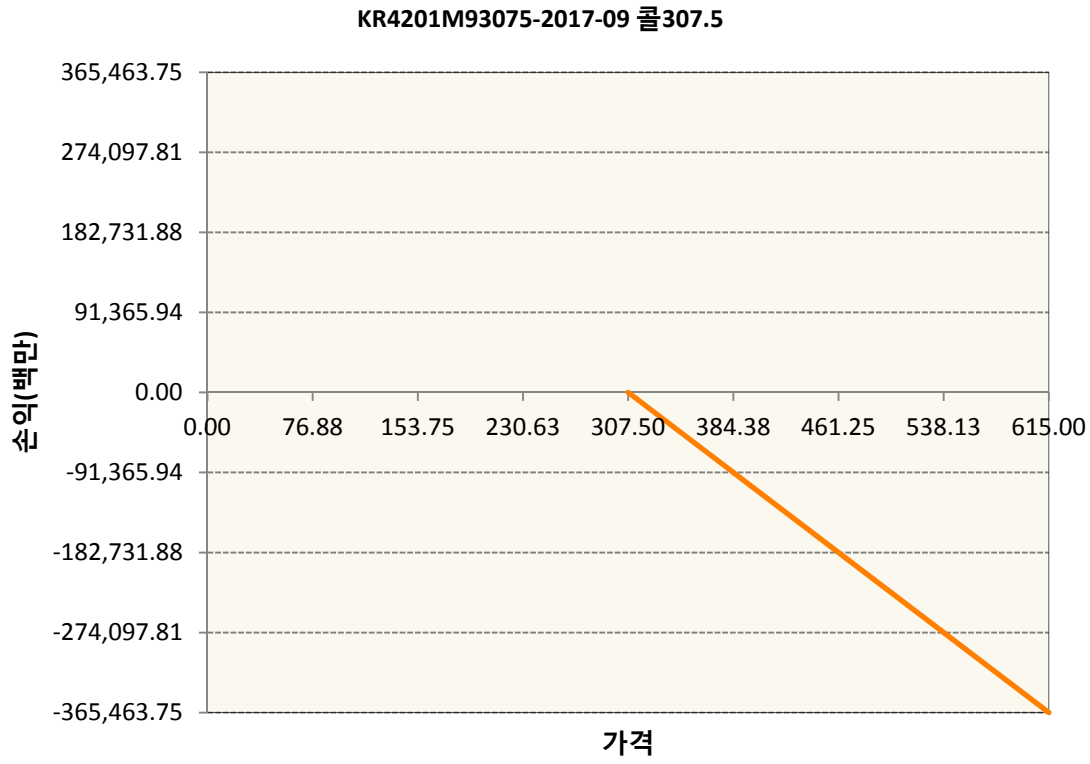
커버드콜모(주식혼합-파생형)

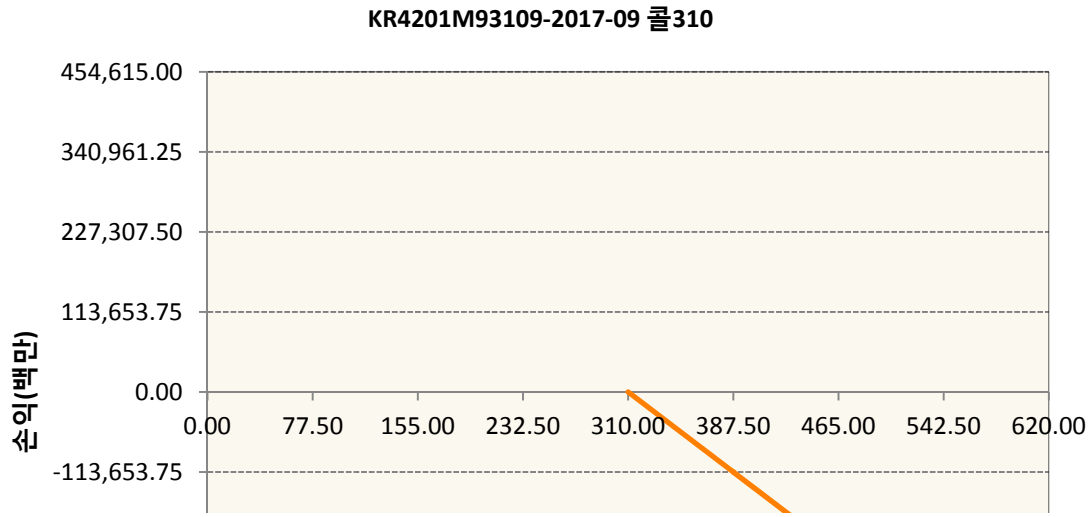
1. 계약금액

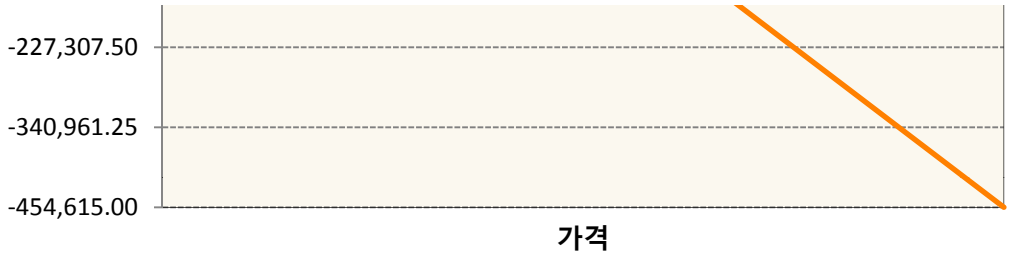
(단위:백만원)

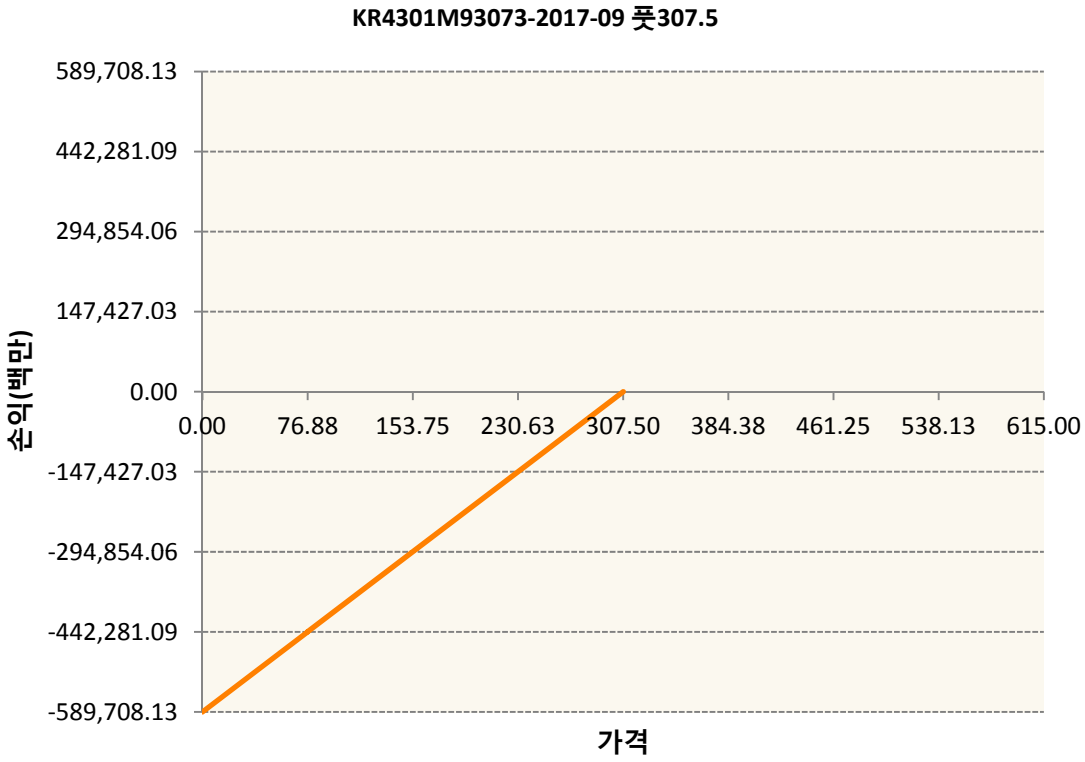
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	1,466,284	-1,466,284	장내

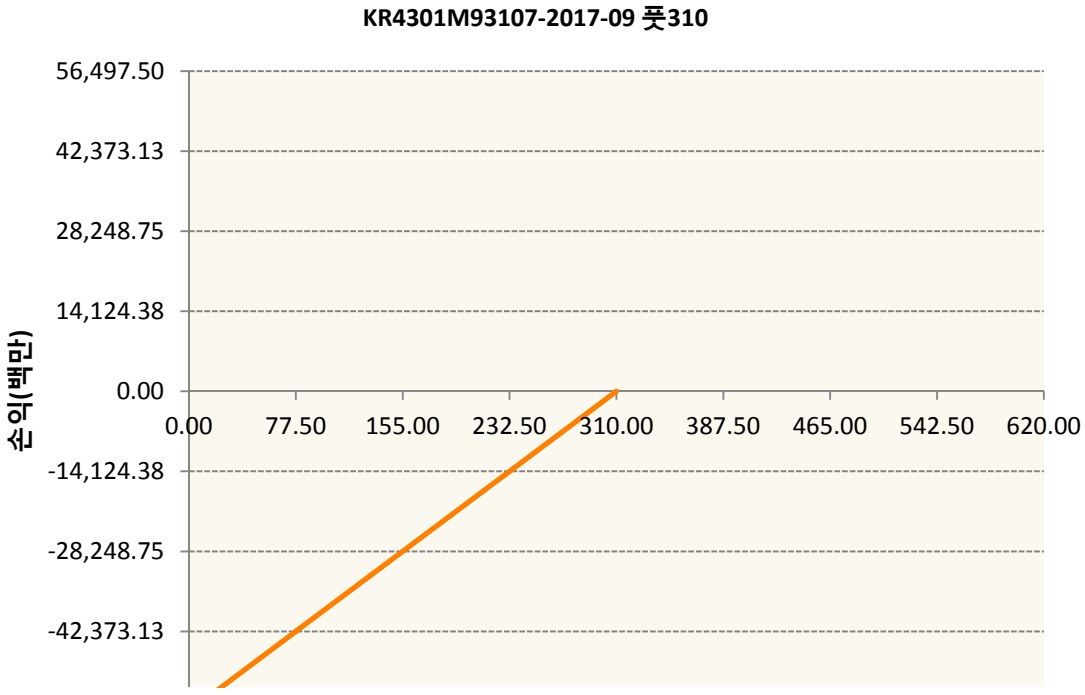
2. 만기시점의 손익구조

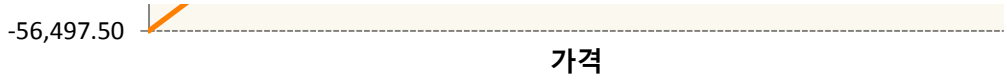





-227,307.50
-340,961.25
-454,615.00
가격


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							24,889
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	9,895	9,755	9,572	9,348	9,087	8,792	8,466
-5.33%	9,099	8,733	8,331	7,898	7,440	6,961	6,465
-2.67%	6,714	6,123	5,524	4,920	4,312	3,701	3,087
0%	1,855	1,241	622	0	-625	-1,252	-1,881
2.67%	-5,452	-5,876	-6,334	-6,819	-7,326	-7,852	-8,392
5.33%	-14,350	-14,550	-14,799	-15,092	-15,423	-15,788	-16,183
8.00%	-23,942	-24,009	-24,111	-24,250	-24,427	-24,640	-24,889
KR4201M93: 2017-09 콜310							29,440
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	10,293	10,171	10,001	9,784	9,520	9,213	8,867
-5.33%	9,629	9,265	8,849	8,387	7,888	7,356	6,797
-2.67%	7,396	6,726	6,037	5,333	4,618	3,893	3,161
0%	2,371	1,581	791	0	-791	-1,583	-2,374
2.67%	-5,803	-6,419	-7,067	-7,737	-8,427	-9,132	-9,849
5.33%	-16,301	-16,630	-17,018	-17,457	-17,940	-18,460	-19,012
8.00%	-27,952	-28,076	-28,251	-28,477	-28,753	-29,075	-29,440
KR4301M93(2017-09 풋307.5							34,045
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-31,740	-31,966	-32,261	-32,622	-33,044	-33,520	-34,045
-5.33%	-17,122	-17,712	-18,362	-19,061	-19,800	-20,572	-21,372
-2.67%	-5,068	-6,023	-6,988	-7,963	-8,944	-9,931	-10,922
0%	2,994	2,003	1,004	0	-1,009	-2,021	-3,035
2.67%	7,104	6,420	5,682	4,899	4,080	3,233	2,361
5.33%	8,650	8,326	7,924	7,453	6,918	6,329	5,692
8.00%	9,074	8,965	8,801	8,577	8,291	7,947	7,546
KR4301M93: 2017-09 풋310							3,432
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-3,255	-3,270	-3,291	-3,318	-3,351	-3,389	-3,432
-5.33%	-1,826	-1,871	-1,923	-1,980	-2,042	-2,108	-2,178
-2.67%	-592	-675	-761	-848	-937	-1,027	-1,118
0%	295	197	98	0	-98	-197	-295
2.67%	790	713	633	550	464	376	287

5.33%	997	956	907	853	793	728	660
8.00%	1,060	1,044	1,023	995	960	920	875

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

93,005

공시일	2017-08-28
기준일	2017-08-25

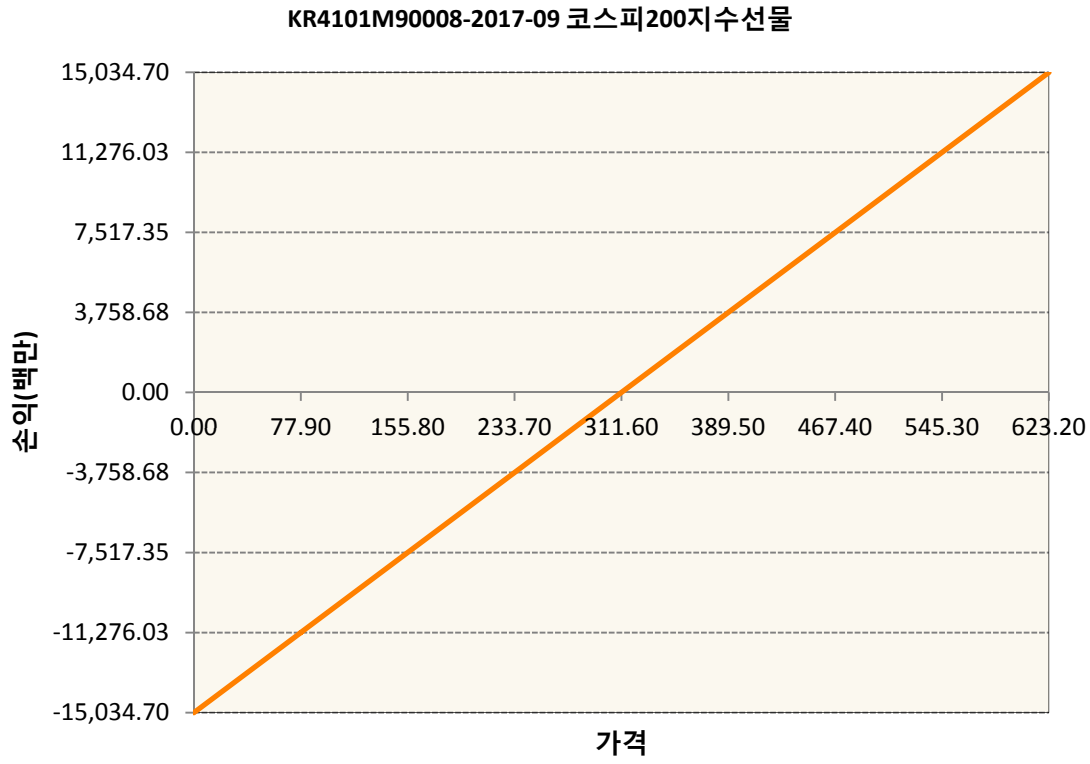
ETF스마트레버리지목표전환형6호

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	15,035	0	15,035	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101M90(2017-09 코스피200지수선물							1,201
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,201	-1,201	-1,201	-1,201	-1,201	-1,201	-1,201
-5.33%	-801	-801	-801	-801	-801	-801	-801
-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%	801	801	801	801	801	801	801
8.00%	1,201	1,201	1,201	1,201	1,201	1,201	1,201

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

747

공시일	2017-08-28
기준일	2017-08-25

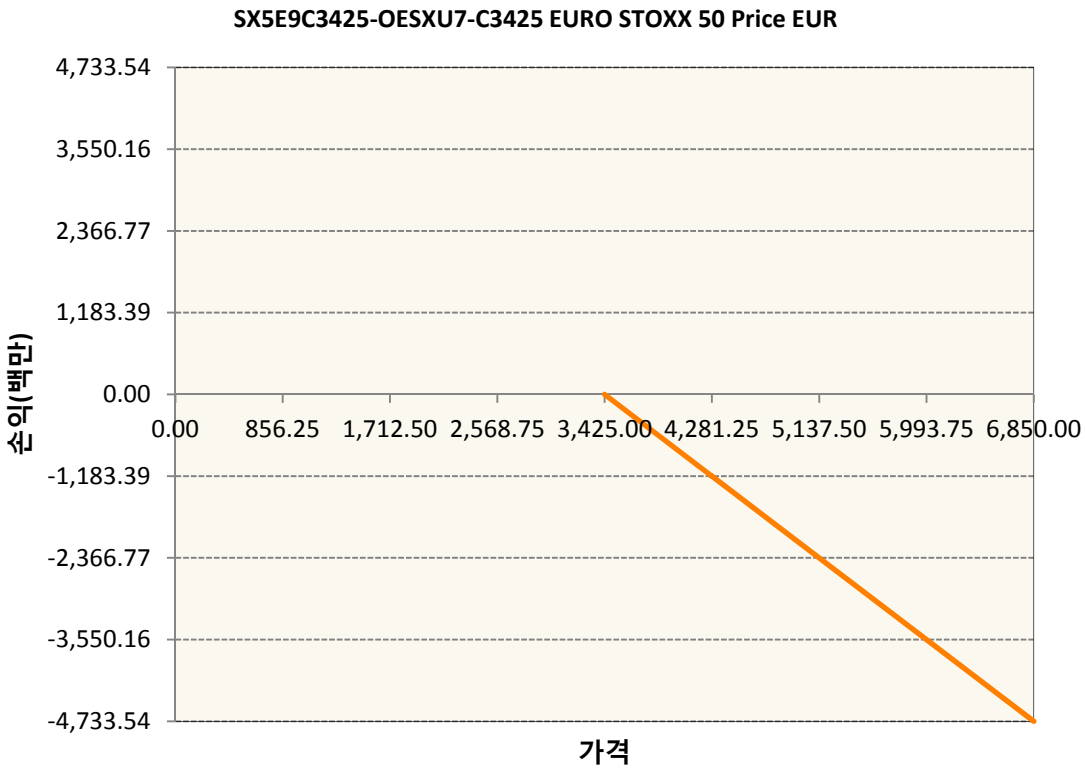
유로커버드콜(주식혼합-파생형)

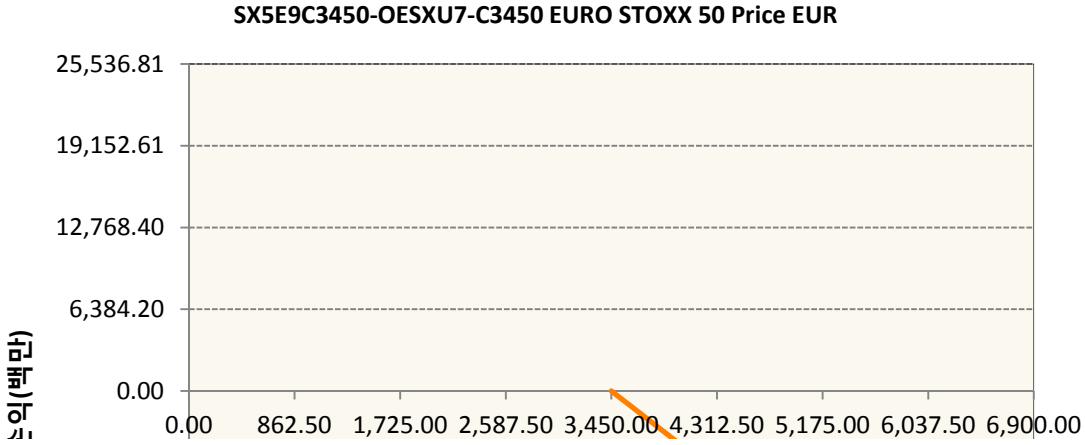
1. 계약금액

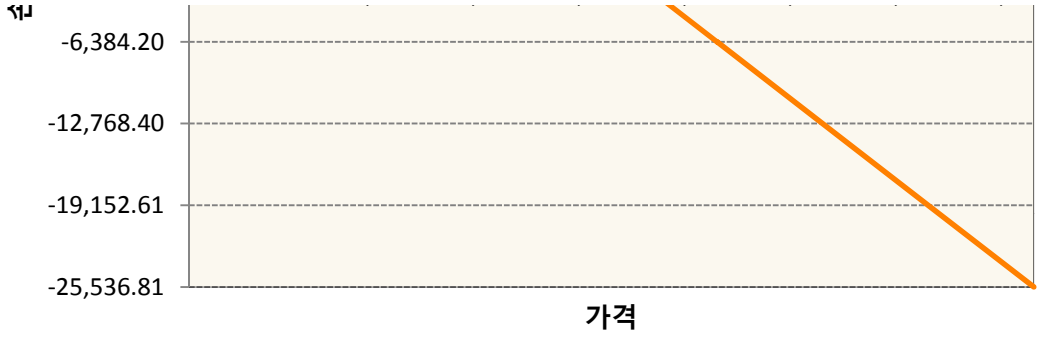
(단위:백만원)

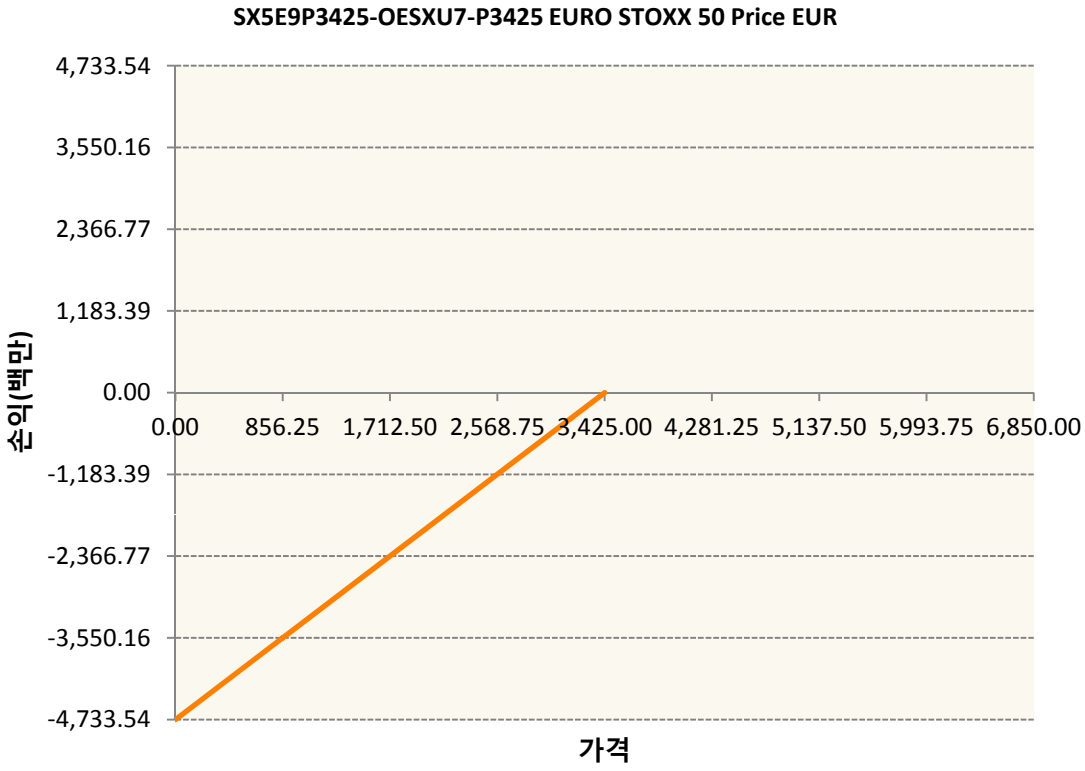
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	26,242	0	26,242	
누계	유가증권	옵션	0	60,541	-60,541	장내

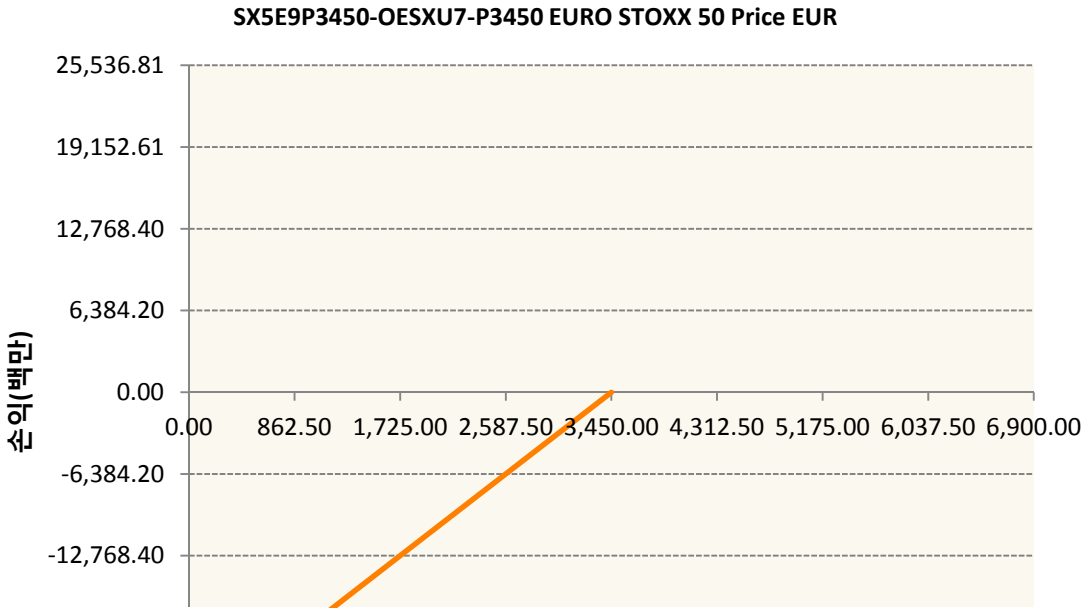
2. 만기시점의 손익구조

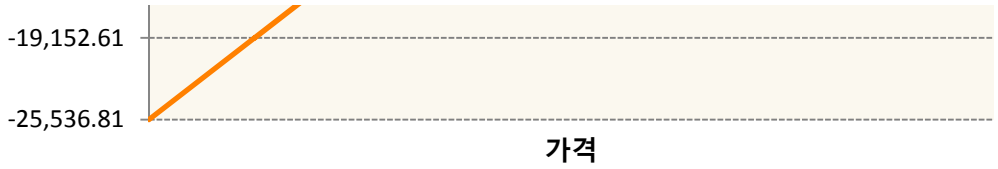


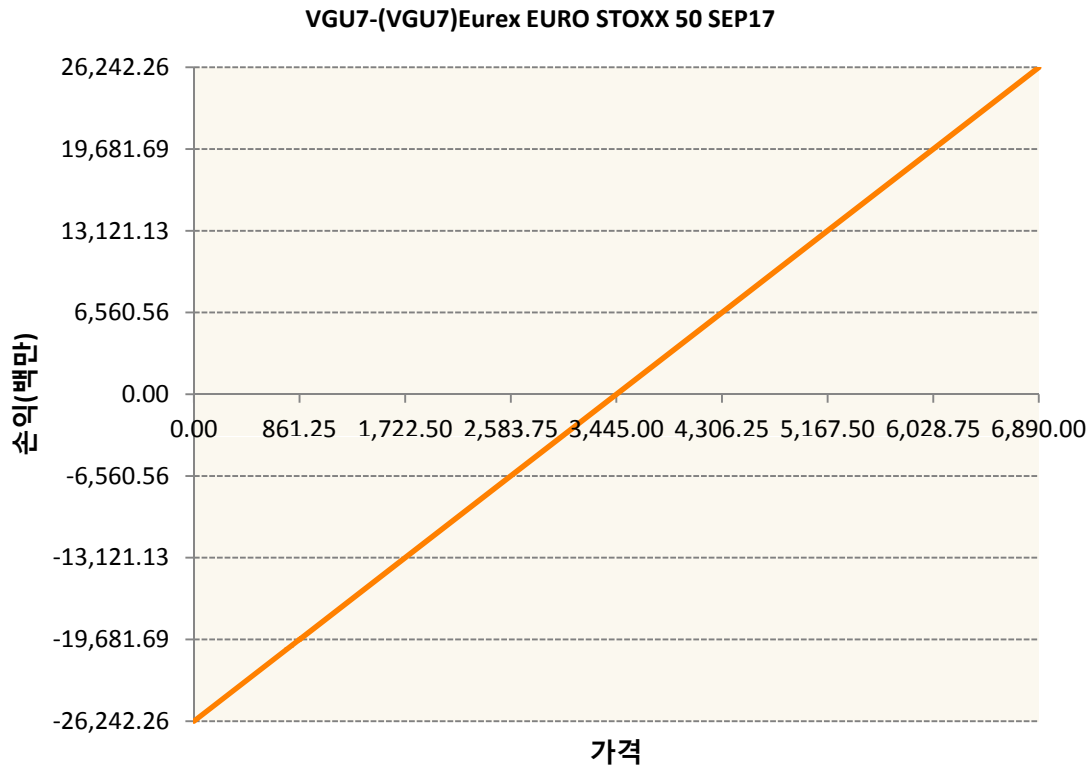



-6,384.20
-12,768.40
-19,152.61
-25,536.81
가격


SX5E9P3425-OESXU7-P3425 EURO STOXX 50 Price EUR
4,733.54
3,550.16
2,366.77
1,183.39
0.00
-1,183.39
-2,366.77
-3,550.16
-4,733.54
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
25,536.81
19,152.61
12,768.40
6,384.20
0.00
-6,384.20
-12,768.40
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	379
SX5E9C3450	OESXU7-C3450 EURO STOXX 50 Price EUR	2,043
SX5E9P3425	OESXU7-P3425 EURO STOXX 50 Price EUR	379
SX5E9P3450	OESXU7-P3450 EURO STOXX 50 Price EUR	2,043
VGU7	(VGU7)Eurex EURO STOXX 50 SEP17	2,099

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	5,615

공시일	2017-08-28
기준일	2017-08-25

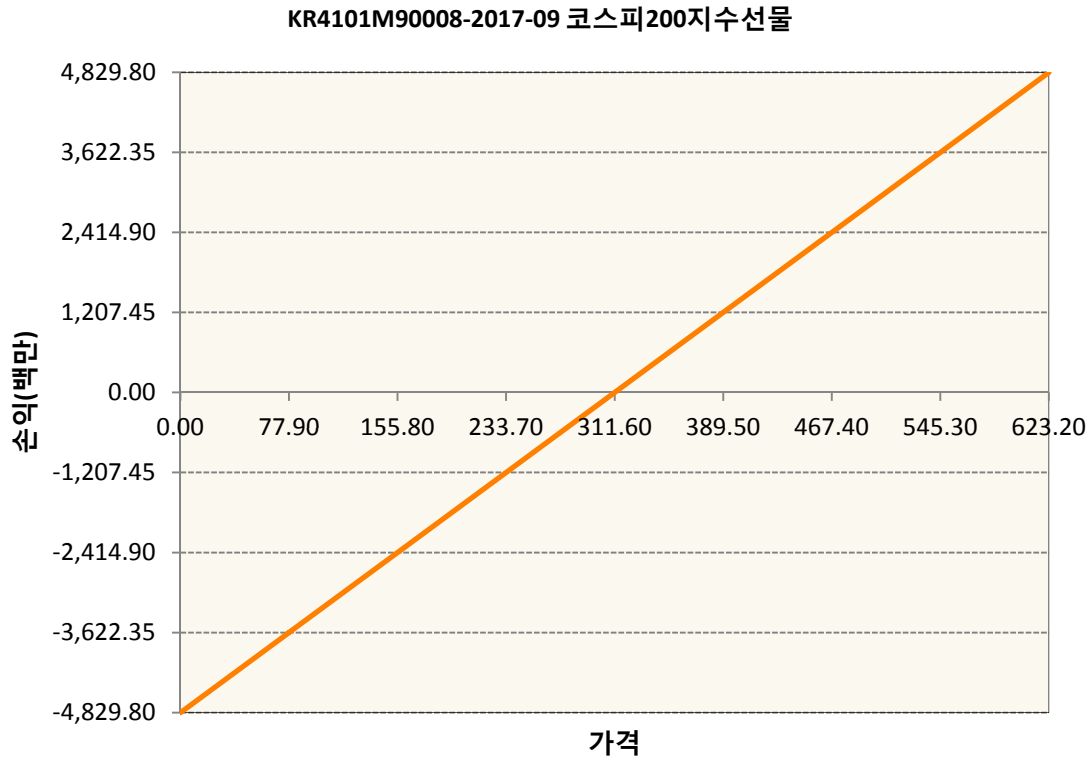
ETF스마트레버리지목표전환형7호

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	4,830	0	4,830	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101M90(2017-09 코스피200지수선물							386
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-386	-386	-386	-386	-386	-386	-386
-5.33%	-257	-257	-257	-257	-257	-257	-257
-2.67%	-129	-129	-129	-129	-129	-129	-129
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	129	129	129	129	129	129	129
5.33%	257	257	257	257	257	257	257
8.00%	386	386	386	386	386	386	386

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

240

공시일	2017-08-28
기준일	2017-08-25

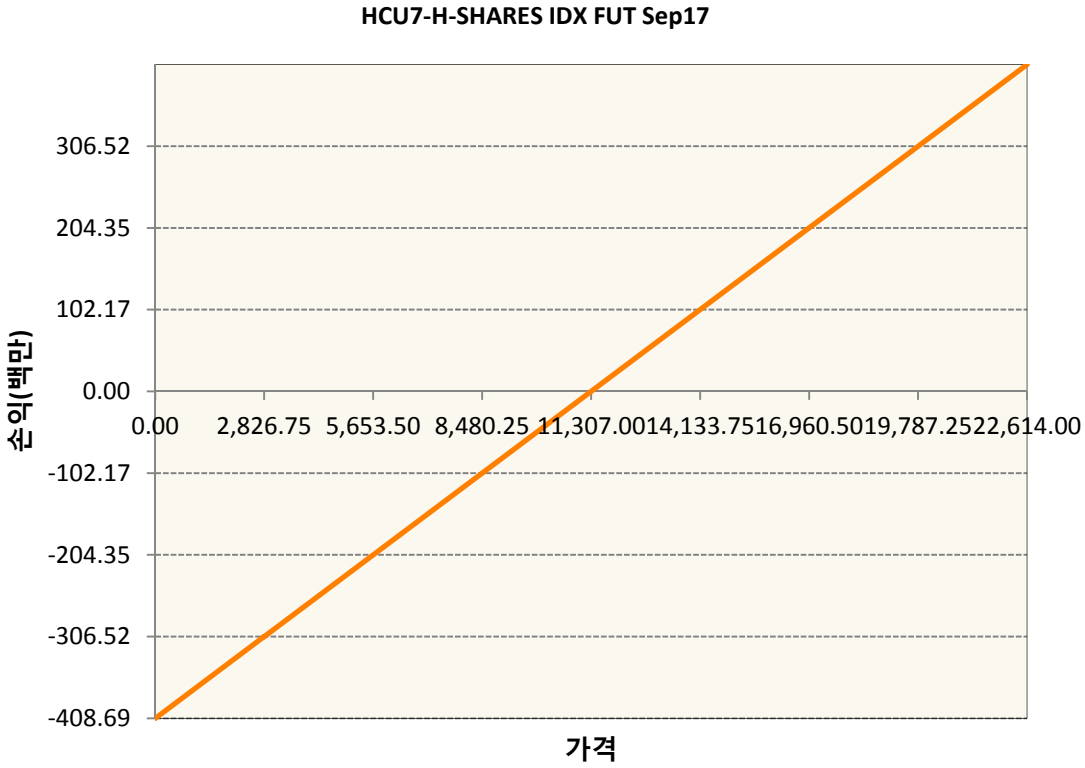
홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생

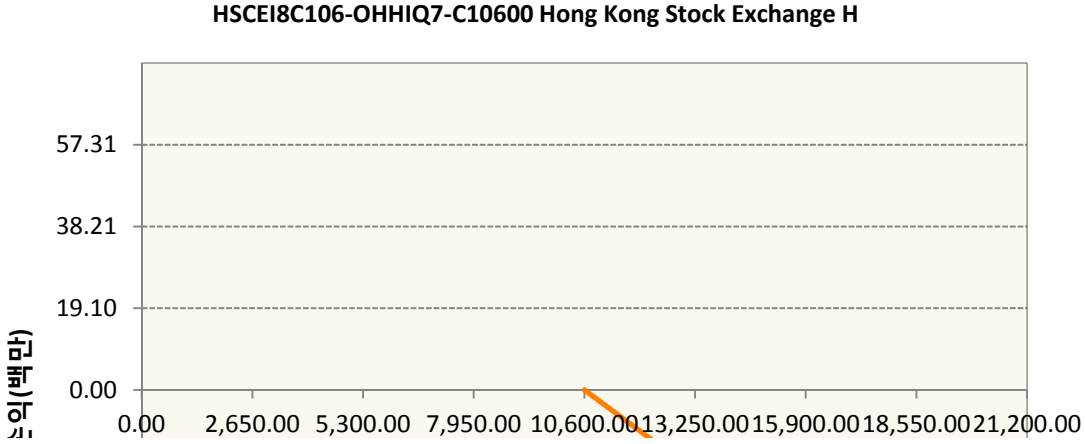
1. 계약금액

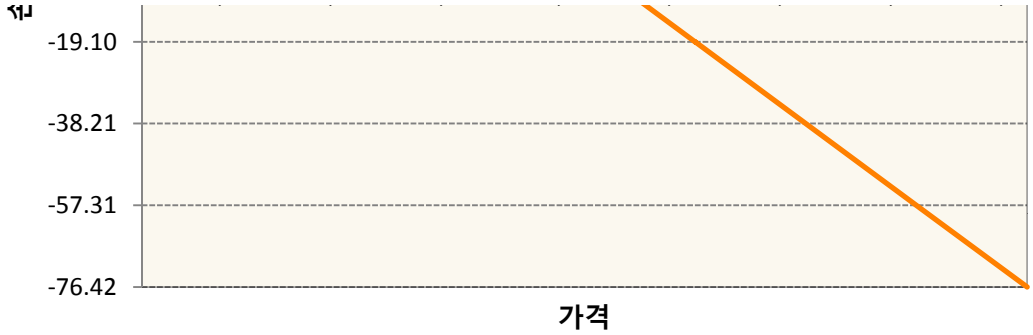
(단위:백만원)

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	409	0	409	장내
누계	유가증권	옵션	0	776	-776	장내

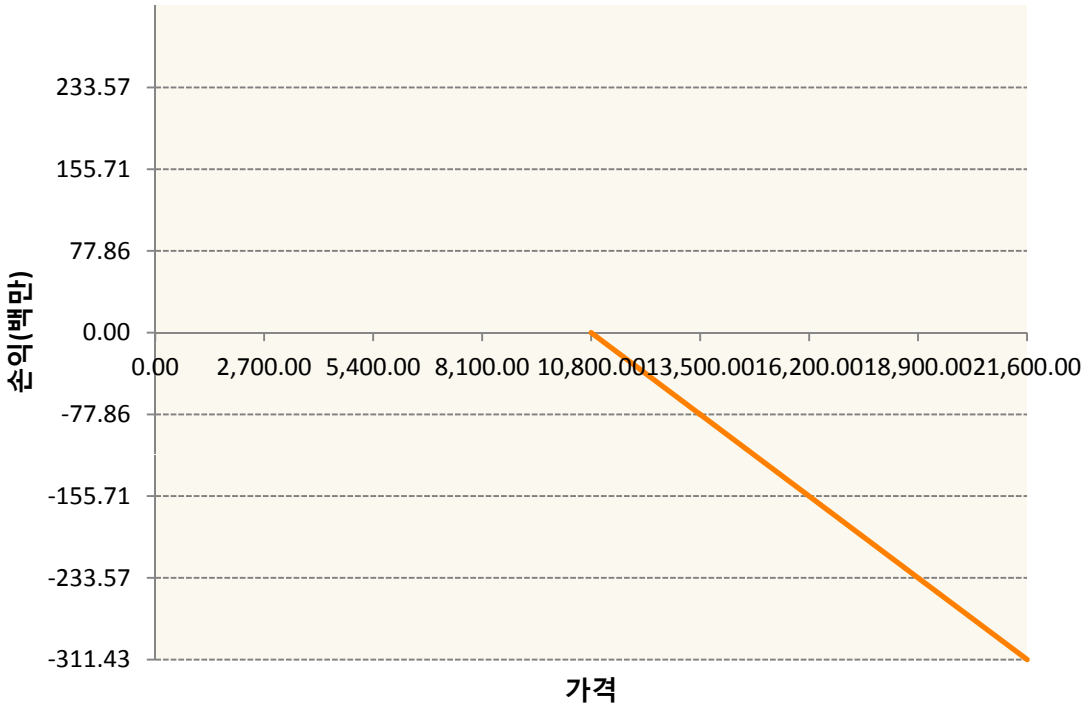
2. 만기시점의 손익구조



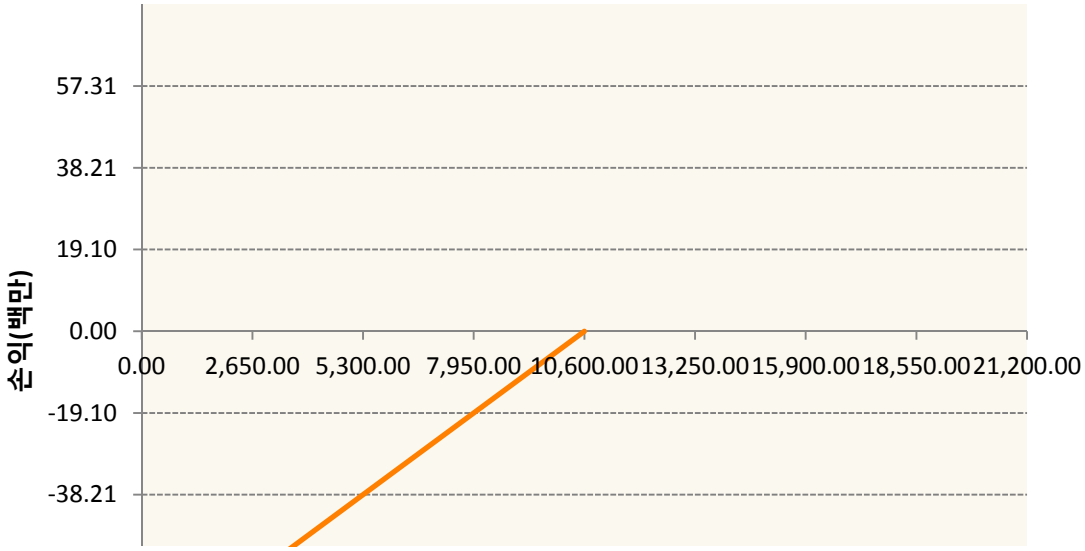


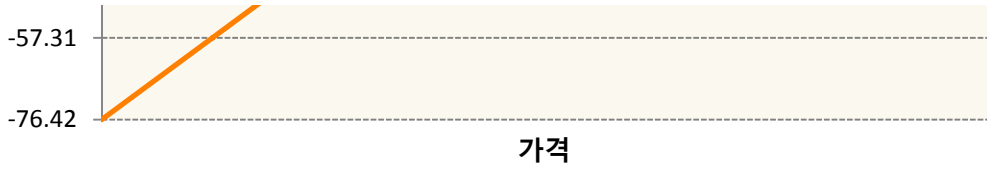


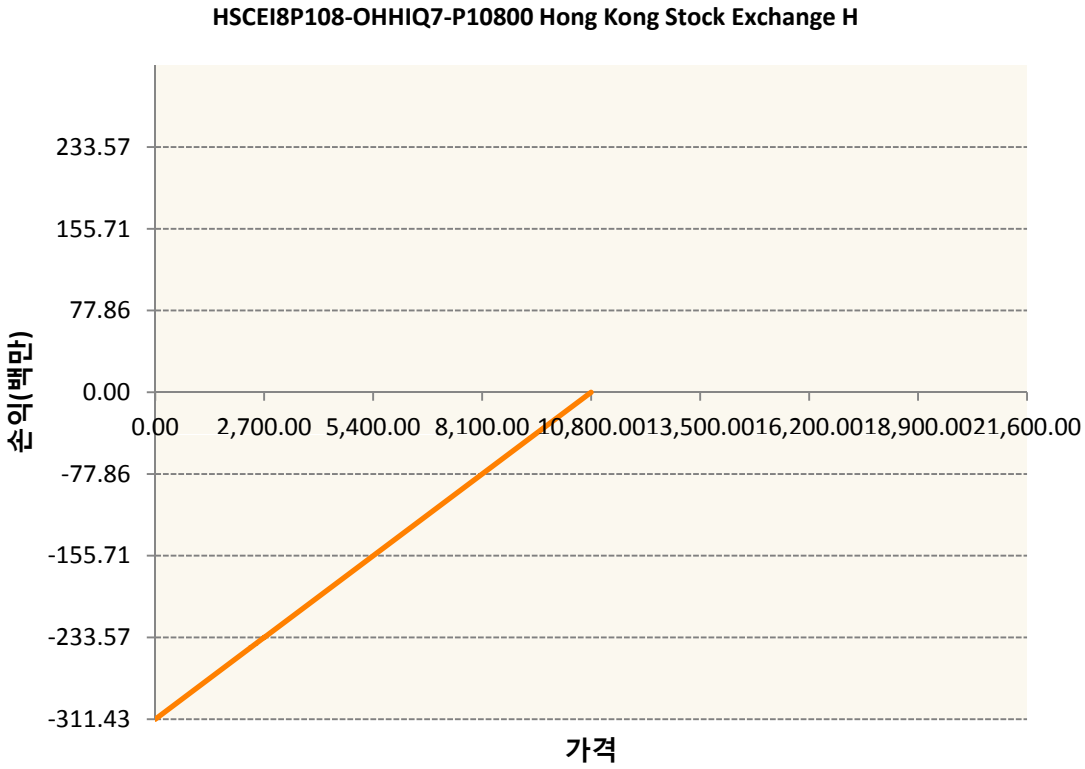
HSCEI8C108-OHHIQ7-C10800 Hong Kong Stock Exchange H



HSCEI8P106-OHHIQ7-P10600 Hong Kong Stock Exchange H







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)	(단위:백만원)
HCU7 H-SHARES IDX FUT Sep17	33
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)
	82

공시일	2017-08-28
기준일	2017-08-25

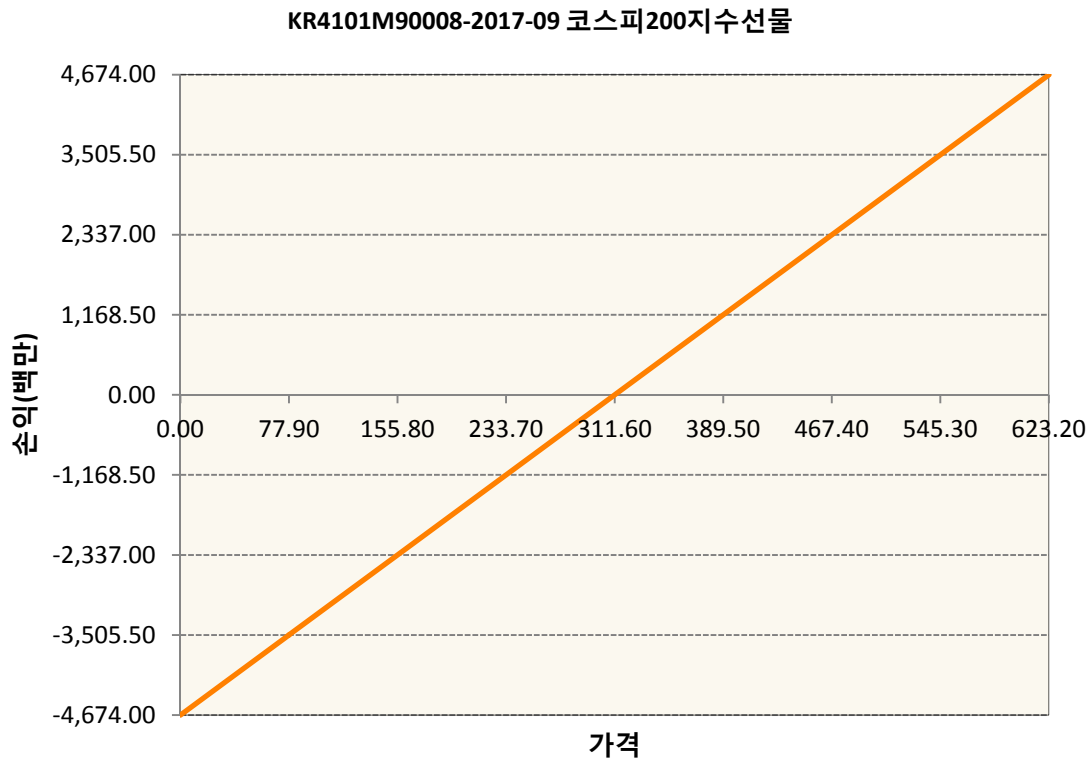
코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼

1. 계약금액

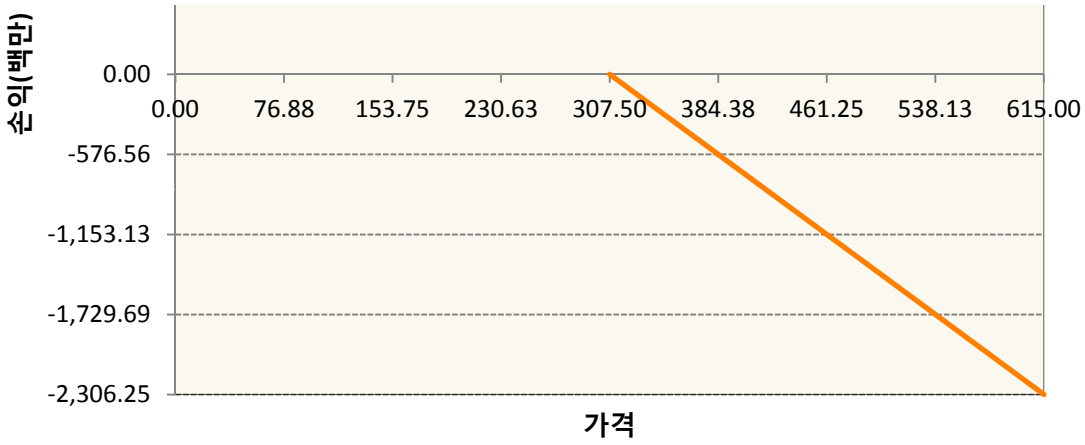
(단위:백만원)

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	4,674	0	4,674	장내
누계	유가증권	스왑	15,000	0	15,000	장외
누계	유가증권	옵션	0	14,647	-14,647	장내

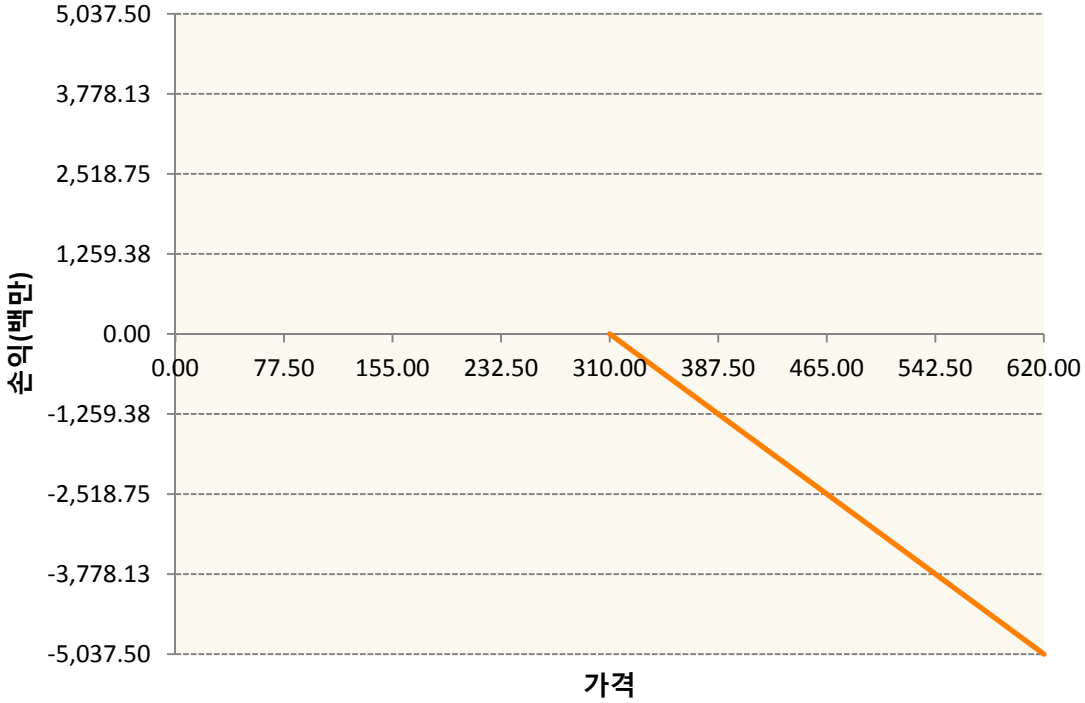
2. 만기시점의 손익구조



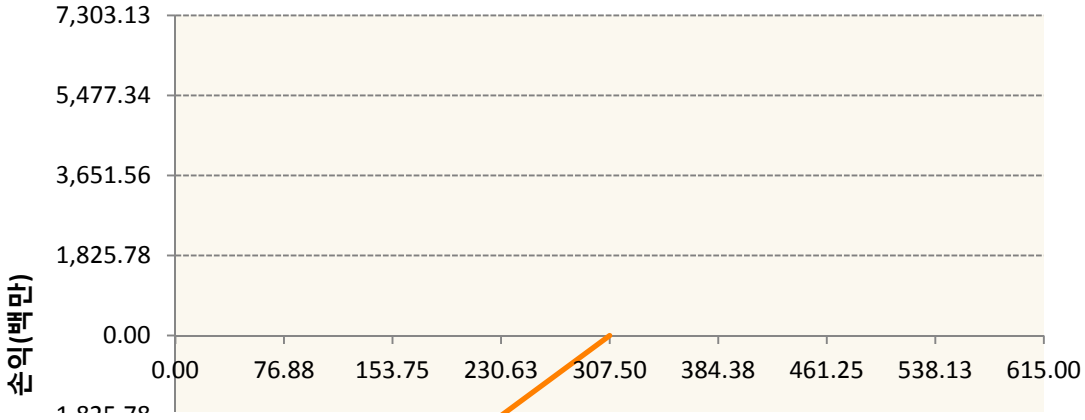




KR4201M93109-2017-09 콜310



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						157
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	62	62	60	59	57	55	53
-5.33%	57	55	53	50	47	44	41
-2.67%	42	39	35	31	27	23	19
0%	12	8	4	0	-4	-8	-12
2.67%	-34	-37	-40	-43	-46	-50	-53
5.33%	-91	-92	-93	-95	-97	-100	-102
8.00%	-151	-152	-152	-153	-154	-155	-157
	KR4201M93: 2017-09 콜310						326
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	114	113	111	108	105	102	98
-5.33%	107	103	98	93	87	82	75
-2.67%	82	75	67	59	51	43	35
0%	26	18	9	0	-9	-18	-26
2.67%	-64	-71	-78	-86	-93	-101	-109
5.33%	-181	-184	-189	-193	-199	-205	-211
8.00%	-310	-311	-313	-316	-319	-322	-326
	KR4301M93(2017-09 풋307.5						422
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-393	-396	-400	-404	-409	-415	-422
-5.33%	-212	-219	-227	-236	-245	-255	-265
-2.67%	-63	-75	-87	-99	-111	-123	-135
0%	37	25	12	0	-12	-25	-38
2.67%	88	80	70	61	51	40	29
5.33%	107	103	98	92	86	78	70
8.00%	112	111	109	106	103	98	93

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

1,143

공시일	2017-08-28
기준일	2017-08-25

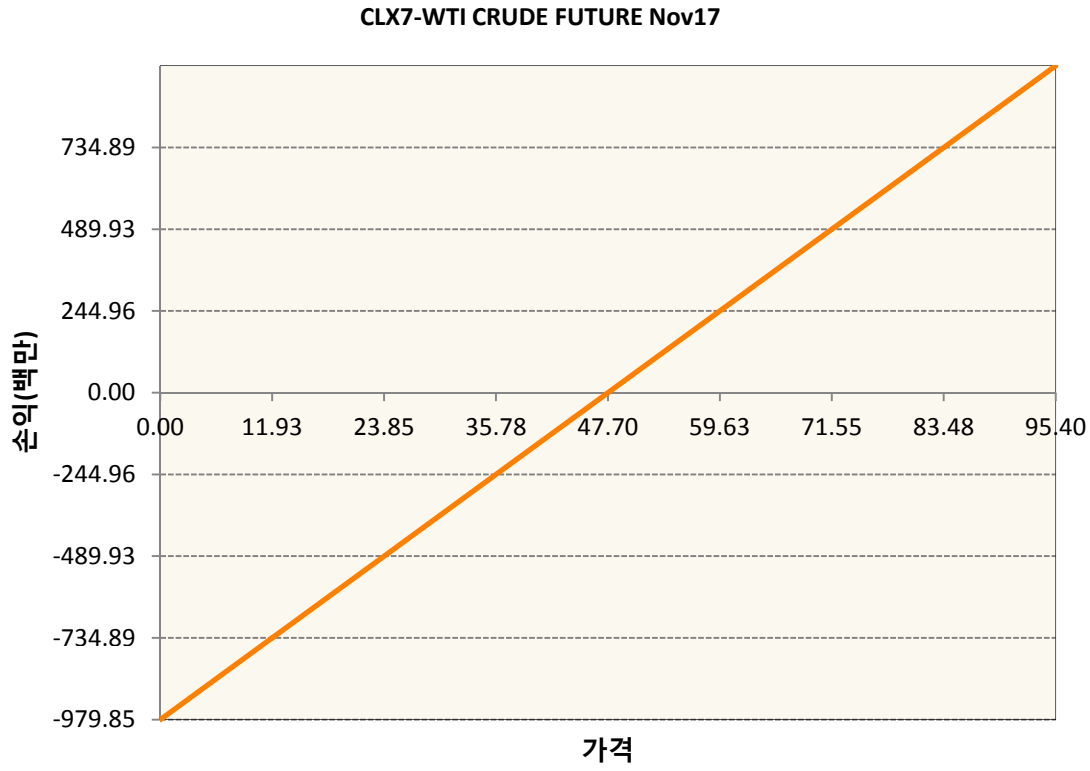
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

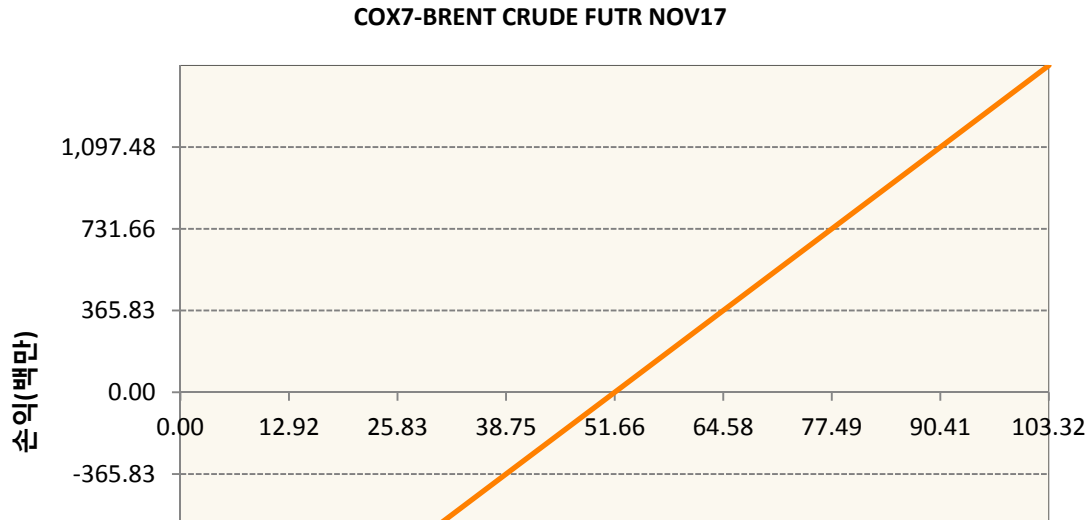
1. 계약금액

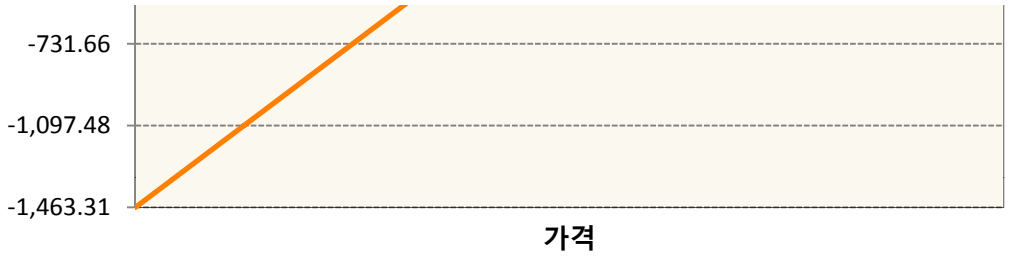
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	5,405	508	4,898	

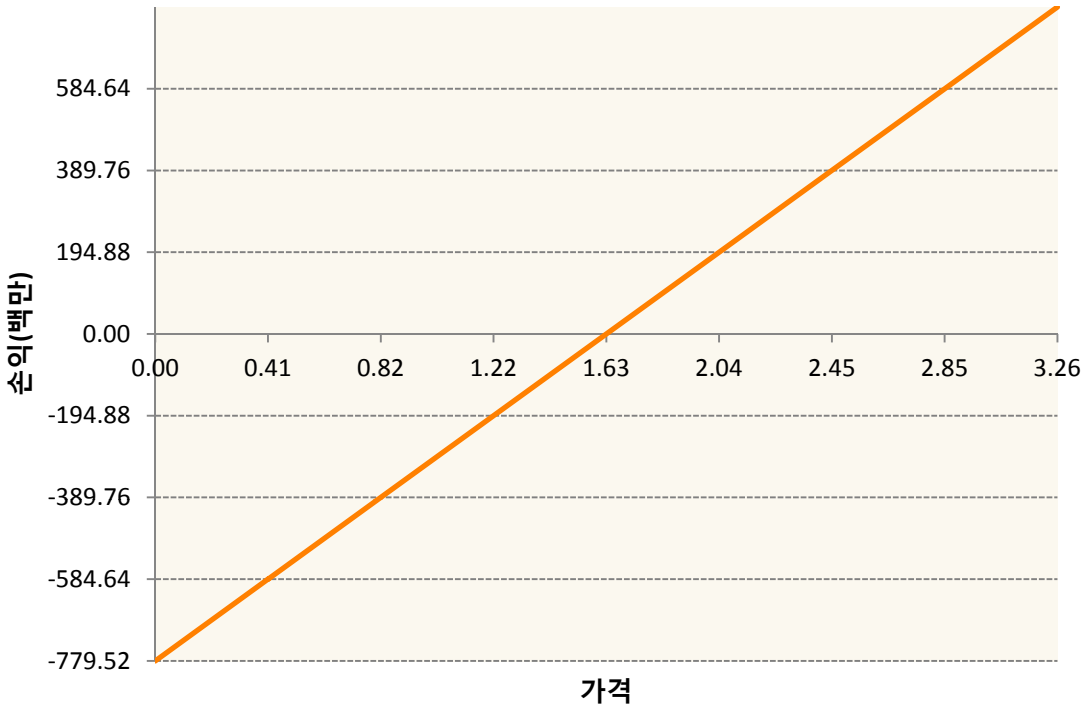
2. 만기시점의 손익구조



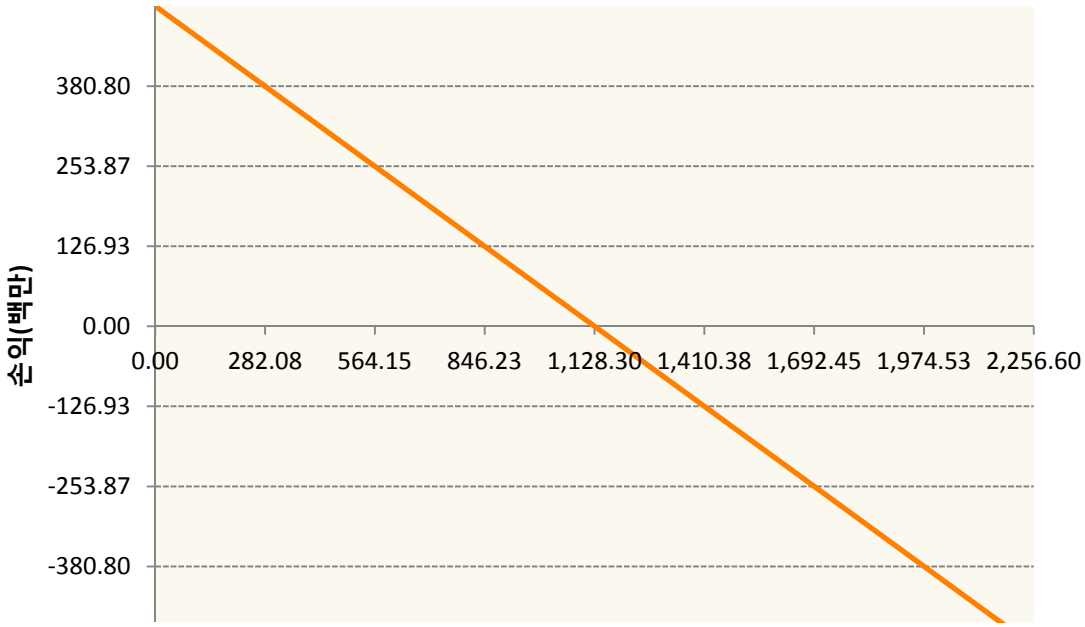


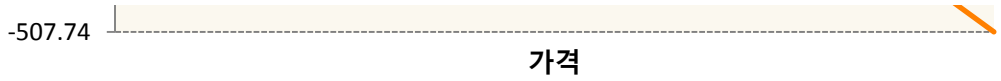


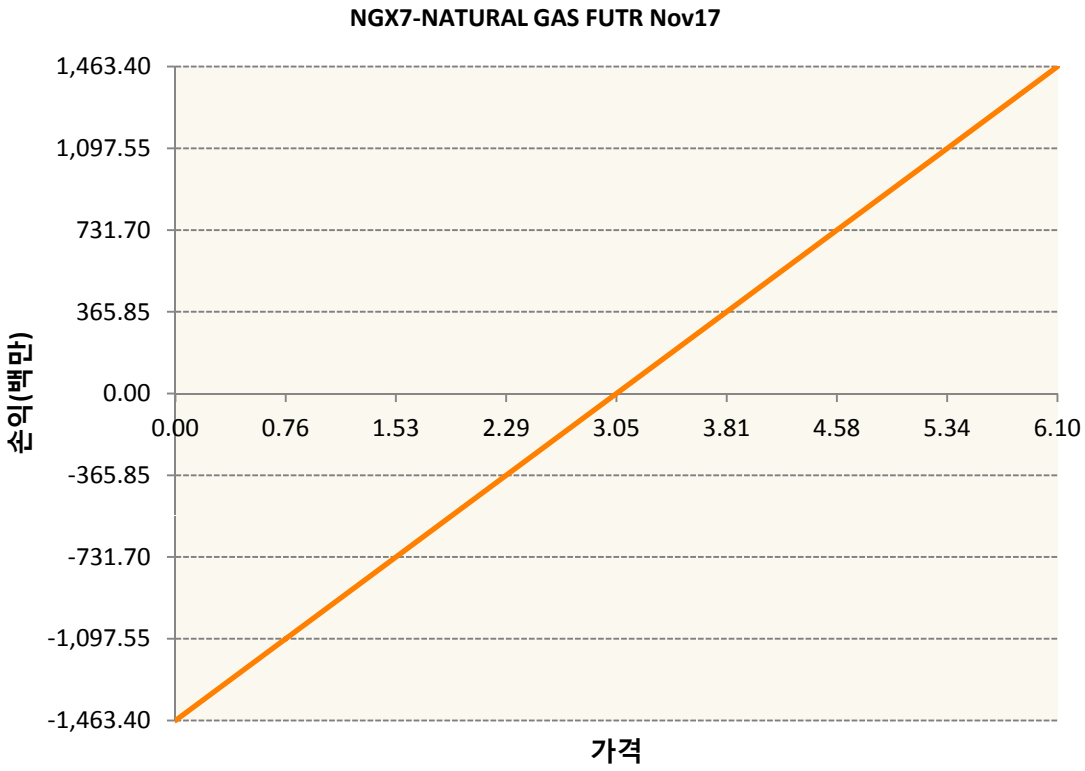
HOX7-NY Harb ULSD Fut Nov17

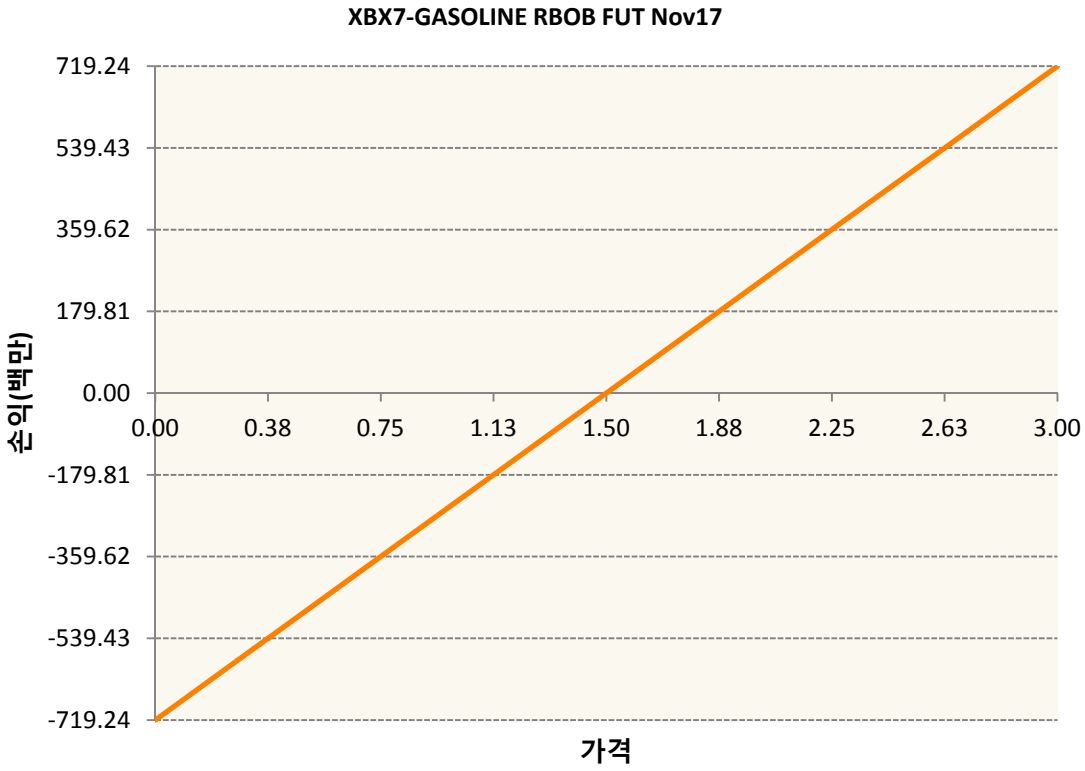


KR4175M90002-2017-09 달러선물




-507.74
가격


NGX7-NATURAL GAS FUTR Nov17
1,463.40
1,097.55
731.70
365.85
0.00
-365.85
-731.70
-1,097.55
-1,463.40
0.00
0.76
1.53
2.29
3.05
3.81
4.58
5.34
6.10
손익(백만)
가격


XBX7-GASOLINE RBOB FUT Nov17
719.24
539.43
359.62
179.81
0.00
-179.81
-359.62
-539.43
-719.24
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	78
COX7	BRENT CRUDE FUTR NOV17	117
HOX7	NY Harb ULSD Fut Nov17	62
KR4175M90(	2017-09 달러선물	41
NGX7	NATURAL GAS FUTR Nov17	117
XBX7	GASOLINE RBOB FUT Nov17	58

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

777

공시일	2017-08-28
기준일	2017-08-25

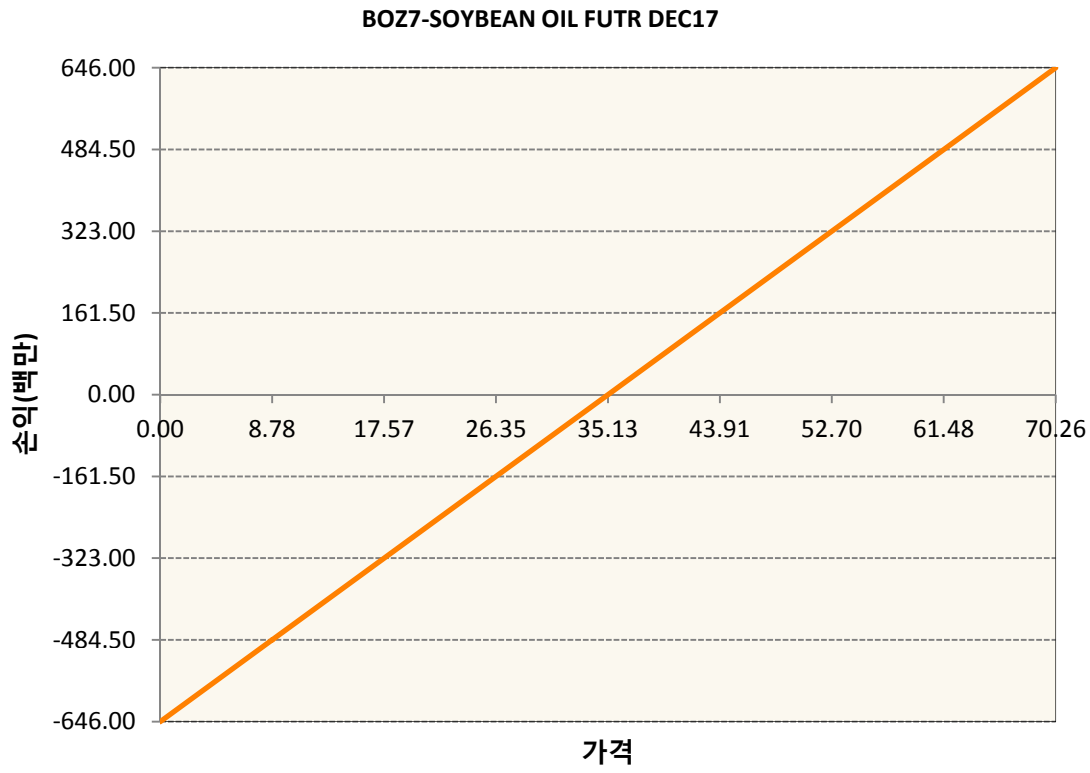
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

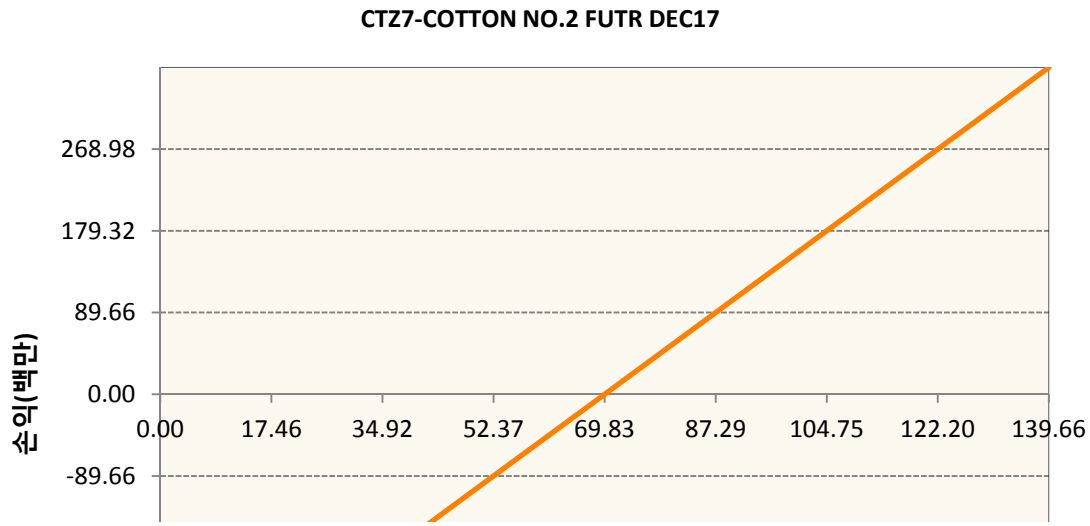
1. 계약금액

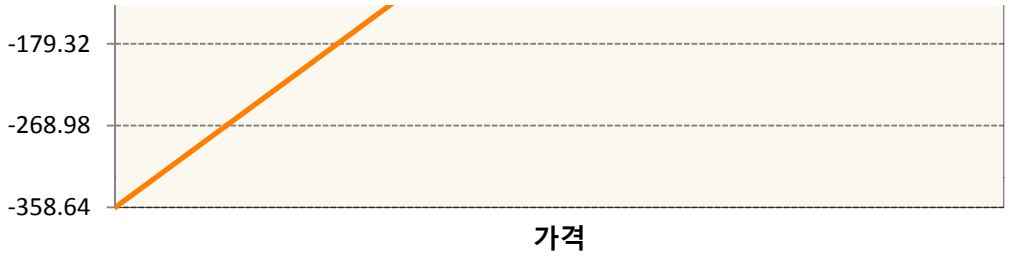
(단위:백만원)

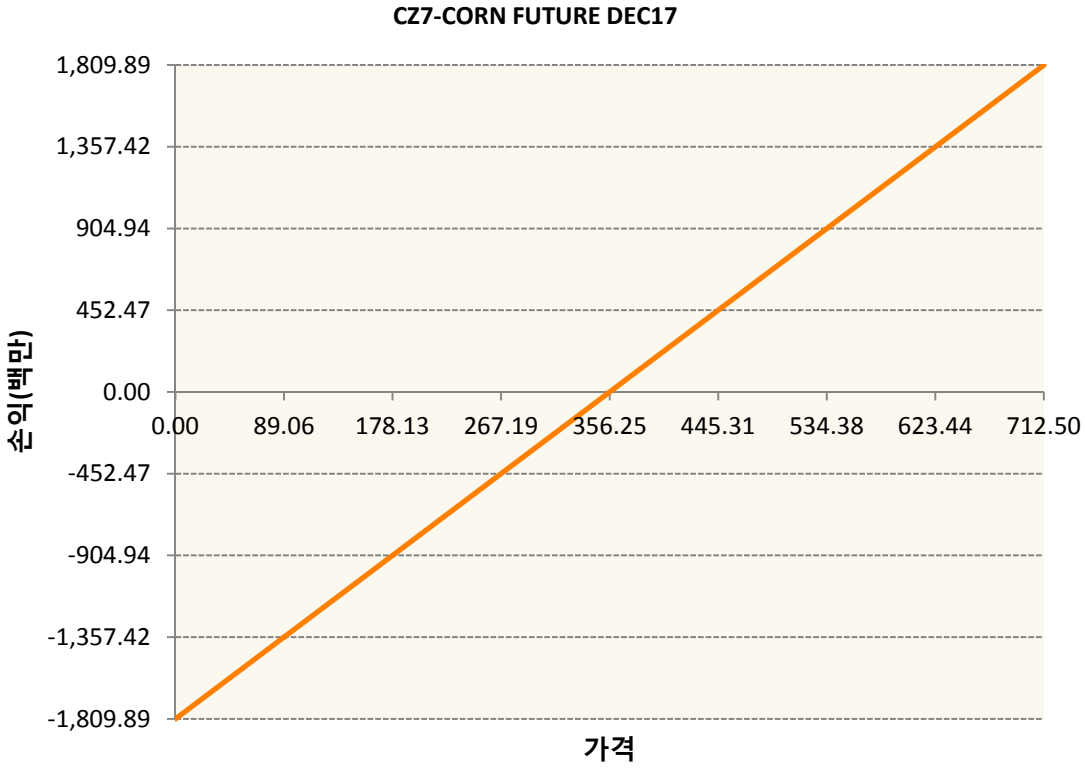
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	6,927	338	6,589	

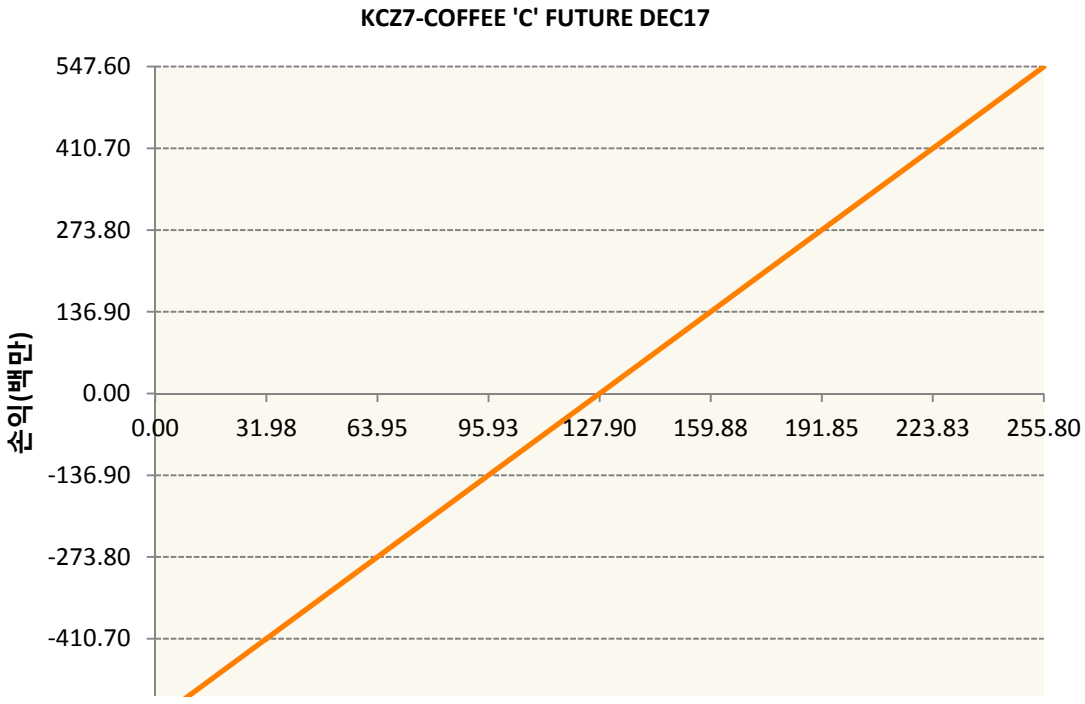
2. 만기시점의 손익구조

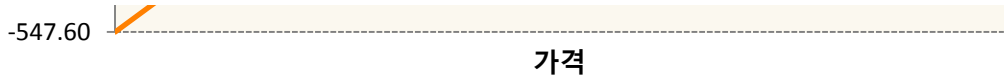


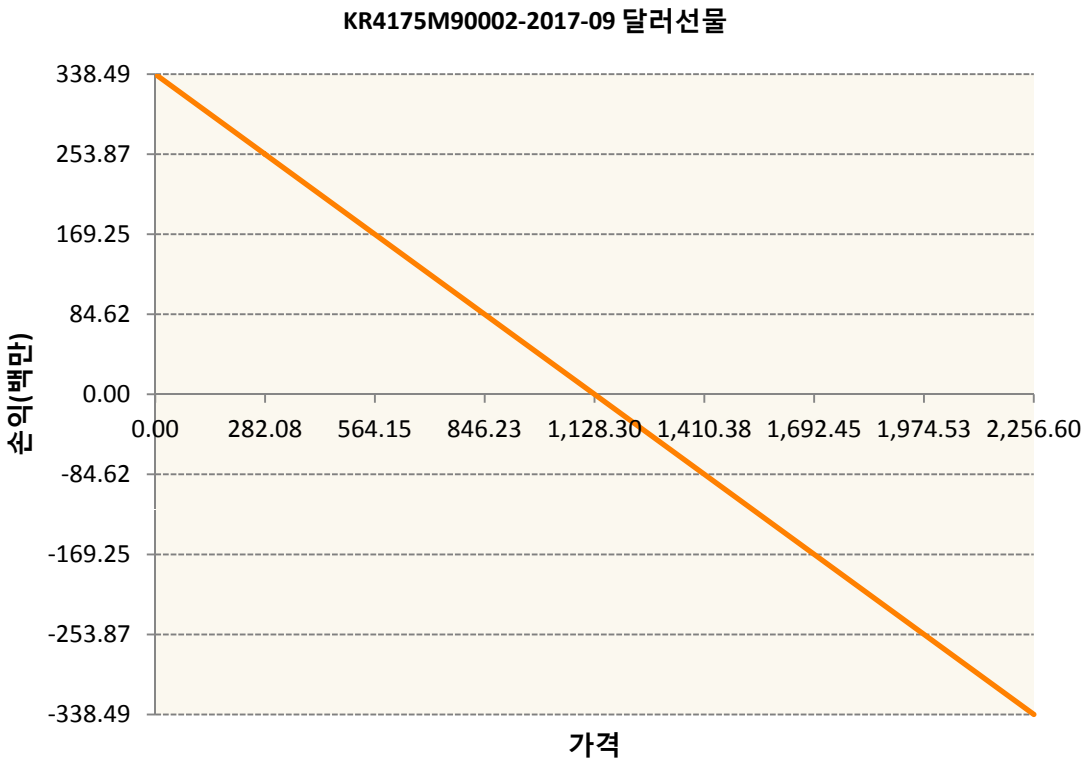


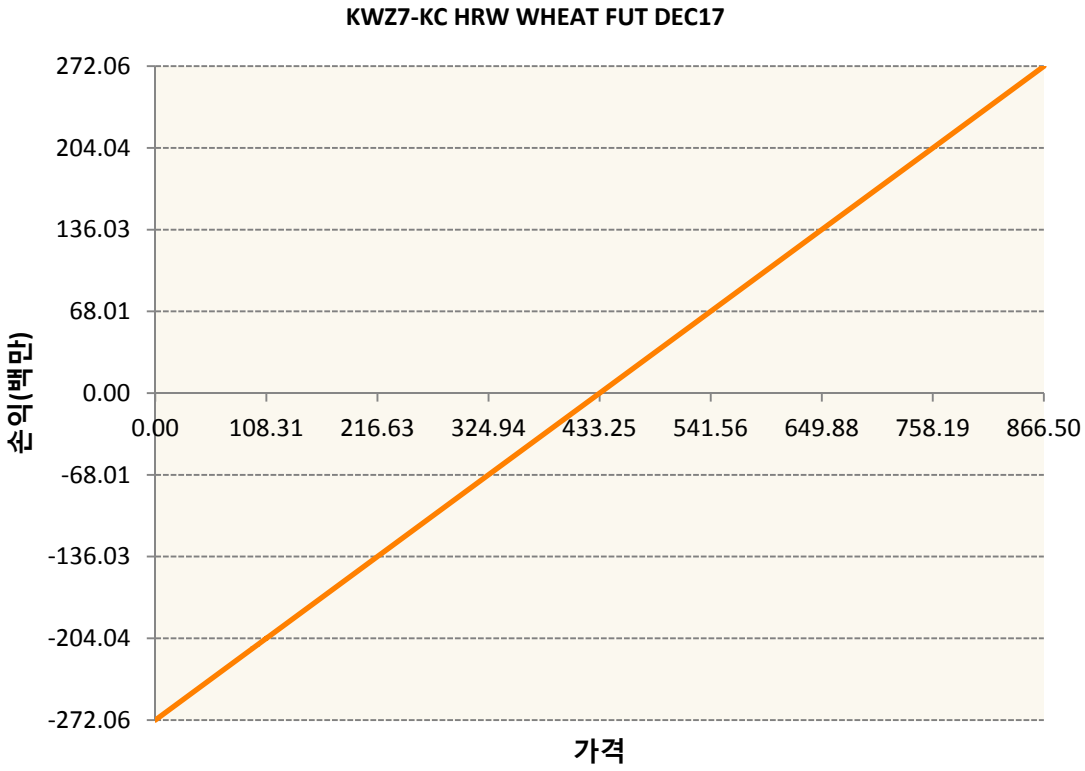

-179.32
-268.98
-358.64
가격

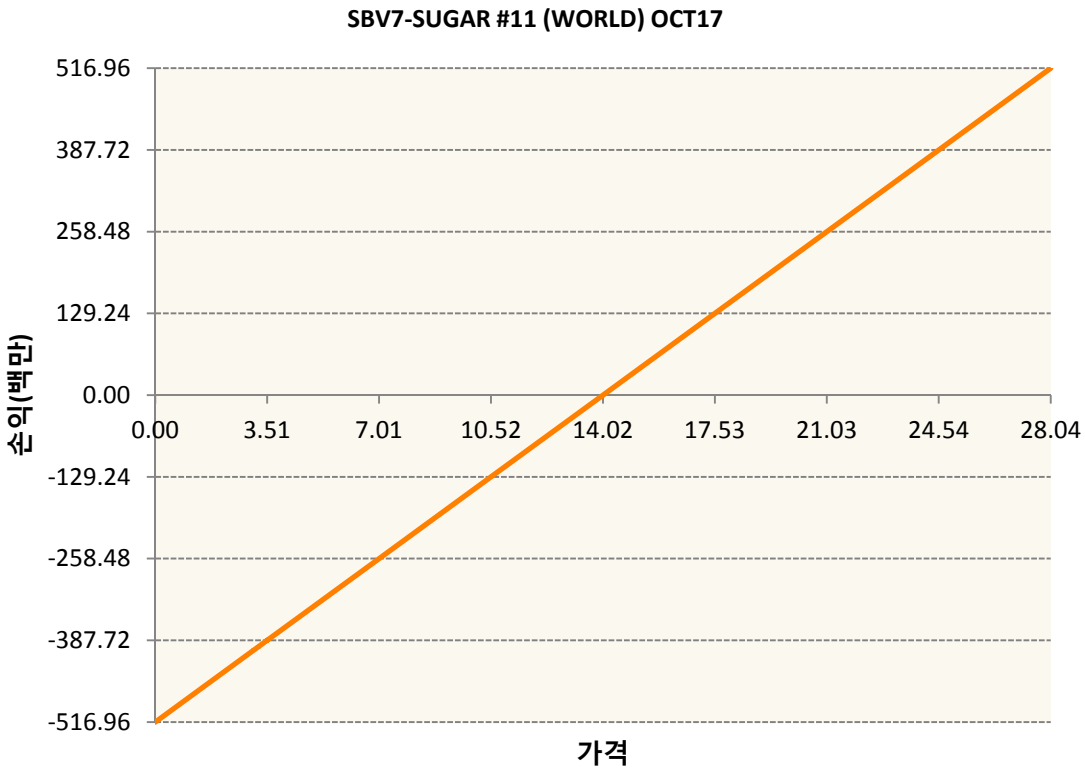

CZ7-CORN FUTURE DEC17
1,809.89
1,357.42
904.94
452.47
0.00
-452.47
-904.94
-1,357.42
-1,809.89
0.00
89.06
178.13
267.19
356.25
445.31
534.38
623.44
712.50
손익(백만)
가격

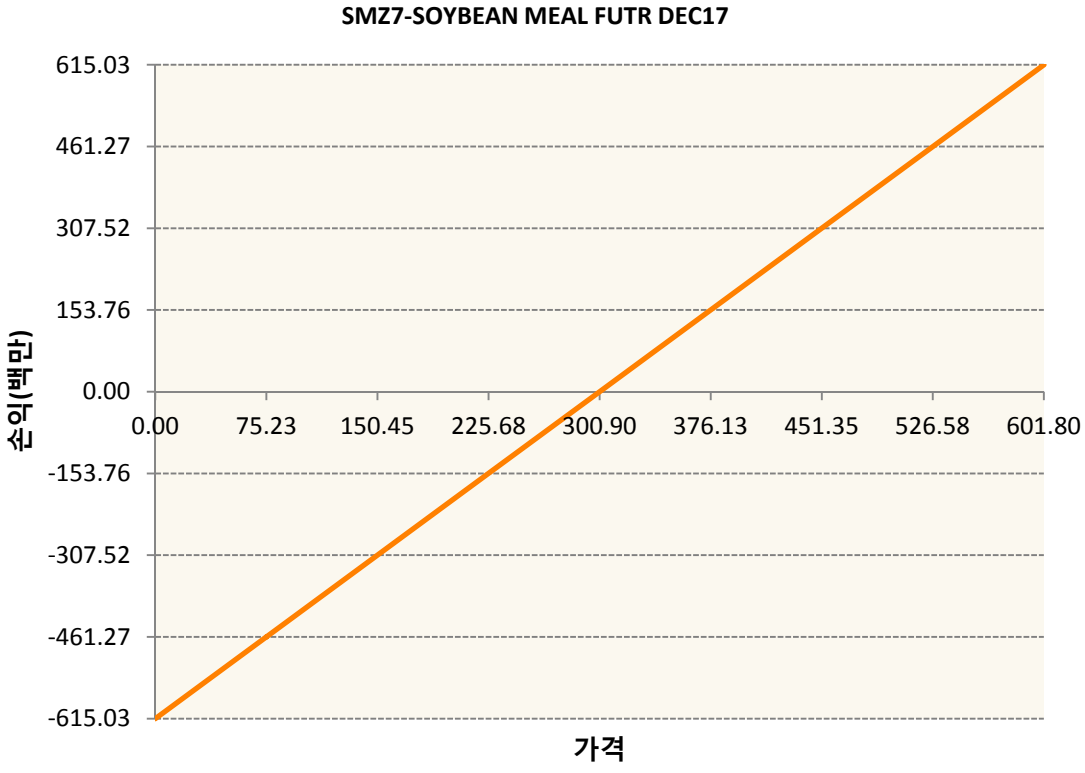

KCZ7-COFFEE 'C' FUTURE DEC17
547.60
410.70
273.80
136.90
0.00
-136.90
-273.80
-410.70
0.00
31.98
63.95
95.93
127.90
159.88
191.85
223.83
255.80
손익(백만)

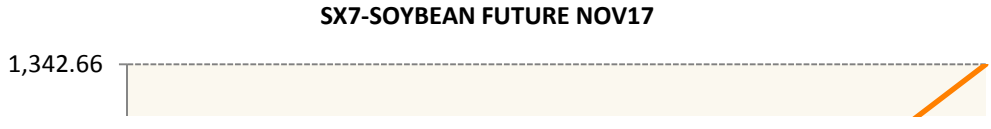

-547.60
가격

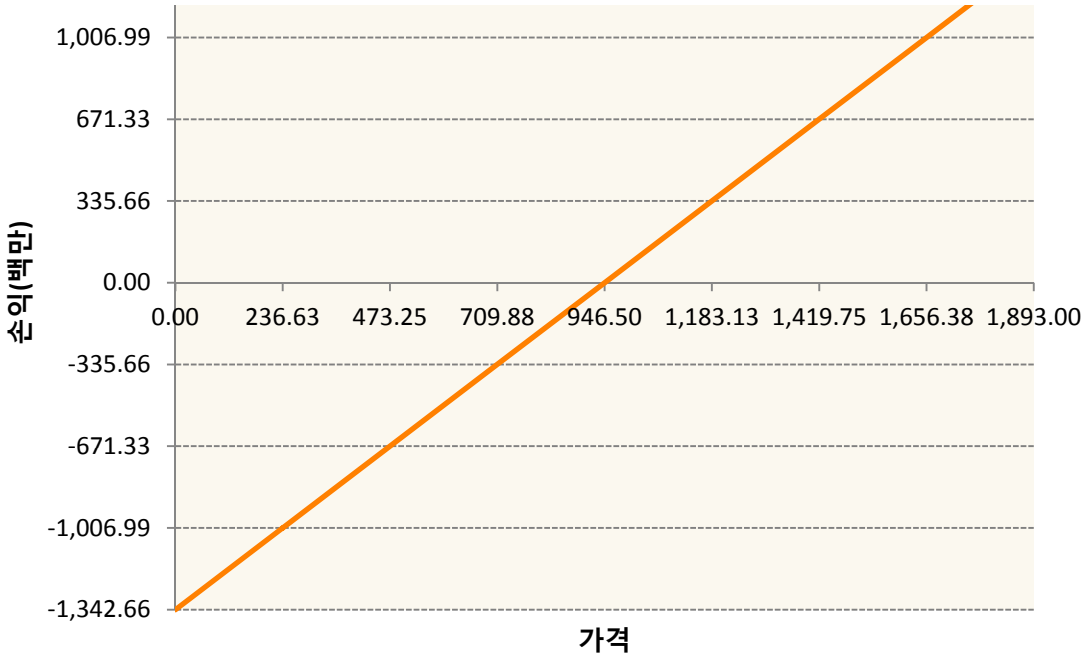

KR4175M90002-2017-09 달러선물
338.49
253.87
169.25
84.62
0.00
-84.62
-169.25
-253.87
-338.49
0.00
282.08
564.15
846.23
1,128.30
1,410.38
1,692.45
1,974.53
2,256.60
손익(백만)
가격


KWZ7-KC HRW WHEAT FUT DEC17
272.06
204.04
136.03
68.01
0.00
-68.01
-136.03
-204.04
-272.06
0.00
108.31
216.63
324.94
433.25
541.56
649.88
758.19
866.50
손익(백만)
가격

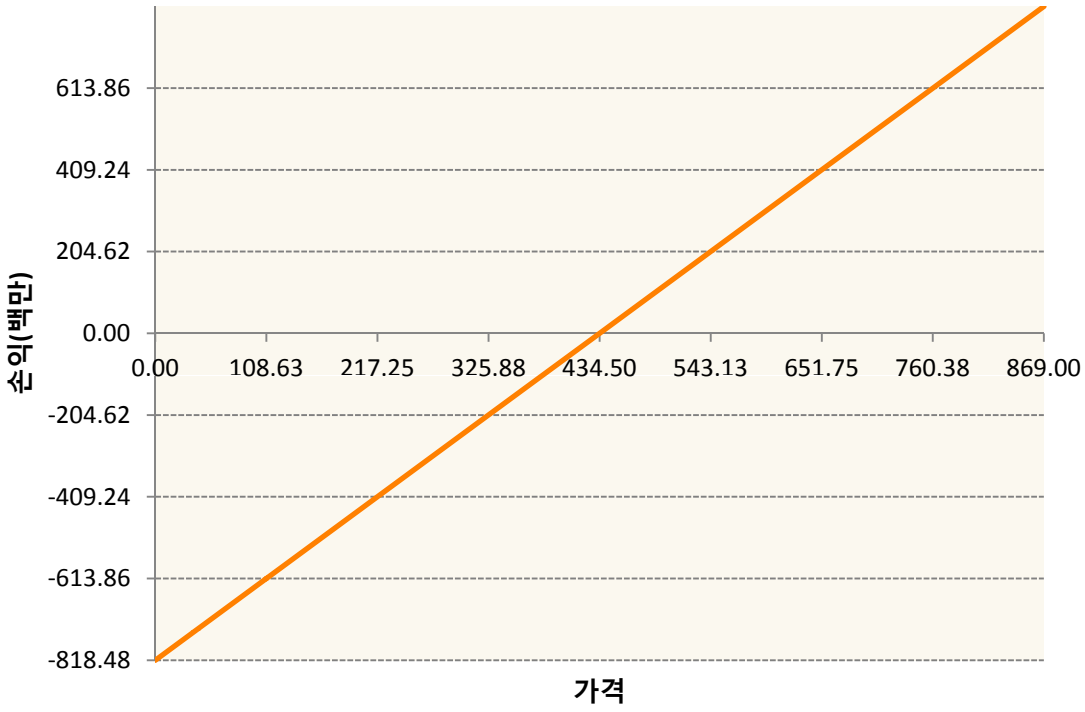

SBV7-SUGAR #11 (WORLD) OCT17
516.96
387.72
258.48
129.24
0.00
-129.24
-258.48
-387.72
-516.96
0.00
3.51
7.01
10.52
14.02
17.53
21.03
24.54
28.04
손익(백만)
가격


SMZ7-SOYBEAN MEAL FUTR DEC17
615.03
461.27
307.52
153.76
0.00
-153.76
-307.52
-461.27
-615.03
0.00
75.23
150.45
225.68
300.90
376.13
451.35
526.58
601.80
손익(백만)
가격


SX7-SOYBEAN FUTURE NOV17
1,342.66



WZ7-WHEAT FUTURE(CBT) DEC17



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

BOZ7	SOYBEAN OIL FUTR DEC17	52
CTZ7	COTTON NO.2 FUTR DEC17	29
CZ7	CORN FUTURE DEC17	145
KCZ7	COFFEE 'C' FUTURE DEC17	44
KR4175M90(	2017-09 달러선물	27

KWZ7	KC HRW WHEAT FUT DEC17	22
SBV7	SUGAR #11 (WORLD) OCT17	41
SMZ7	SOYBEAN MEAL FUTR DEC17	49
SX7	SOYBEAN FUTURE NOV17	107
WZ7	WHEAT FUTURE(CBT) DEC17	65

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

653