공시일	2017-08-29
기준일	2017-08-28

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	2017-08-29
기준일	2017-08-28

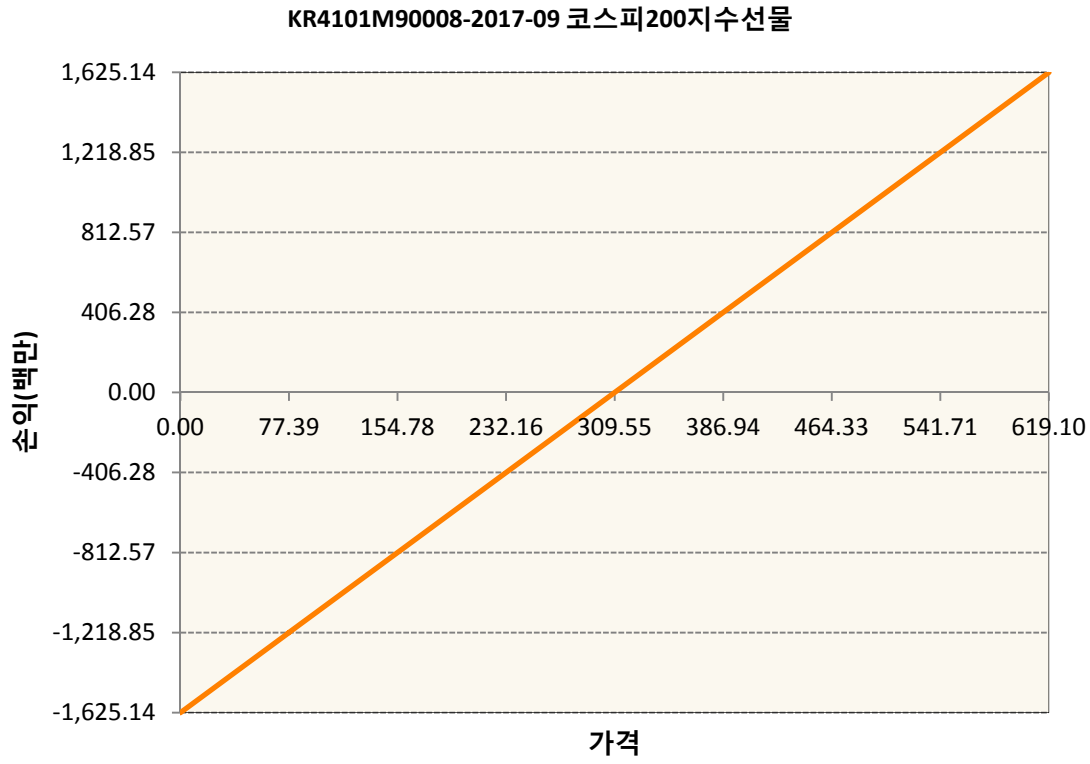
스마트인덱스모

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	1,625	0	1,625	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101M90(2017-09 코스피200지수선물							130
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-130	-130	-130	-130	-130	-130	-130
-5.33%	-87	-87	-87	-87	-87	-87	-87
-2.67%	-43	-43	-43	-43	-43	-43	-43
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	43	43	43	43	43	43	43
5.33%	87	87	87	87	87	87	87
8.00%	130	130	130	130	130	130	130

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

81

공시일	2017-08-29
기준일	2017-08-28

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)

463

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-08-29
기준일	2017-08-28

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	407

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

348

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-08-29
기준일	2017-08-28

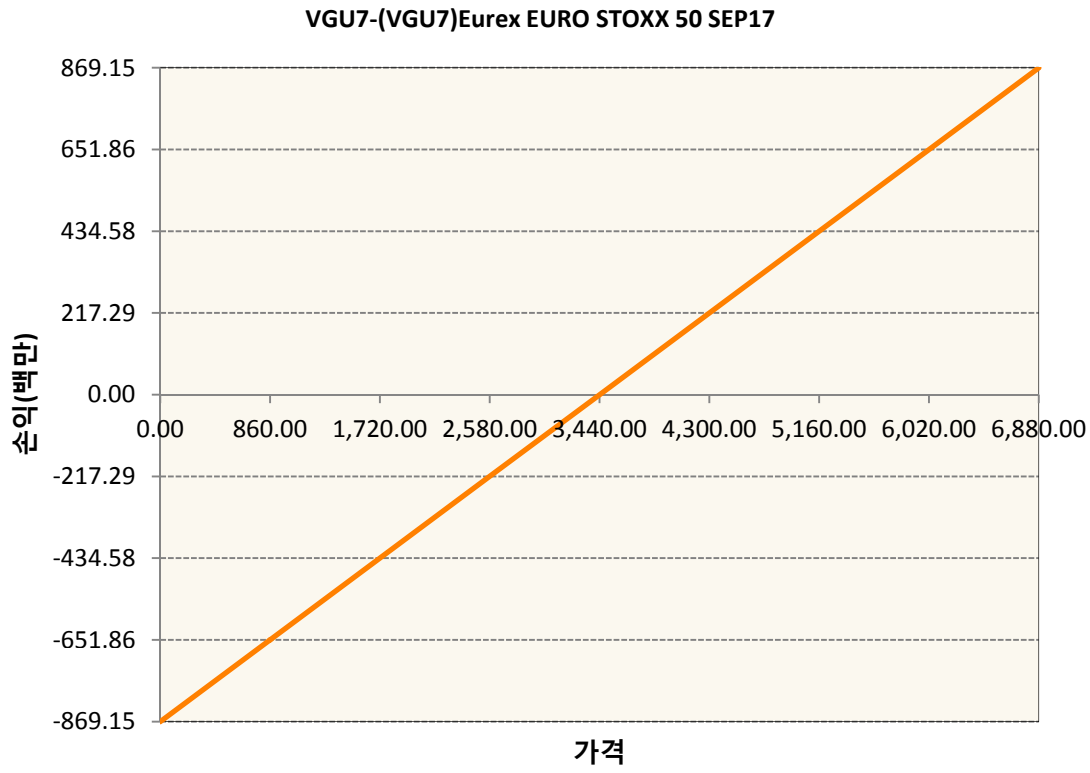
유로인덱스모(주식-파생형)

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	70

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

(단위:백만원)

56

공시일	2017-08-29
기준일	2017-08-28

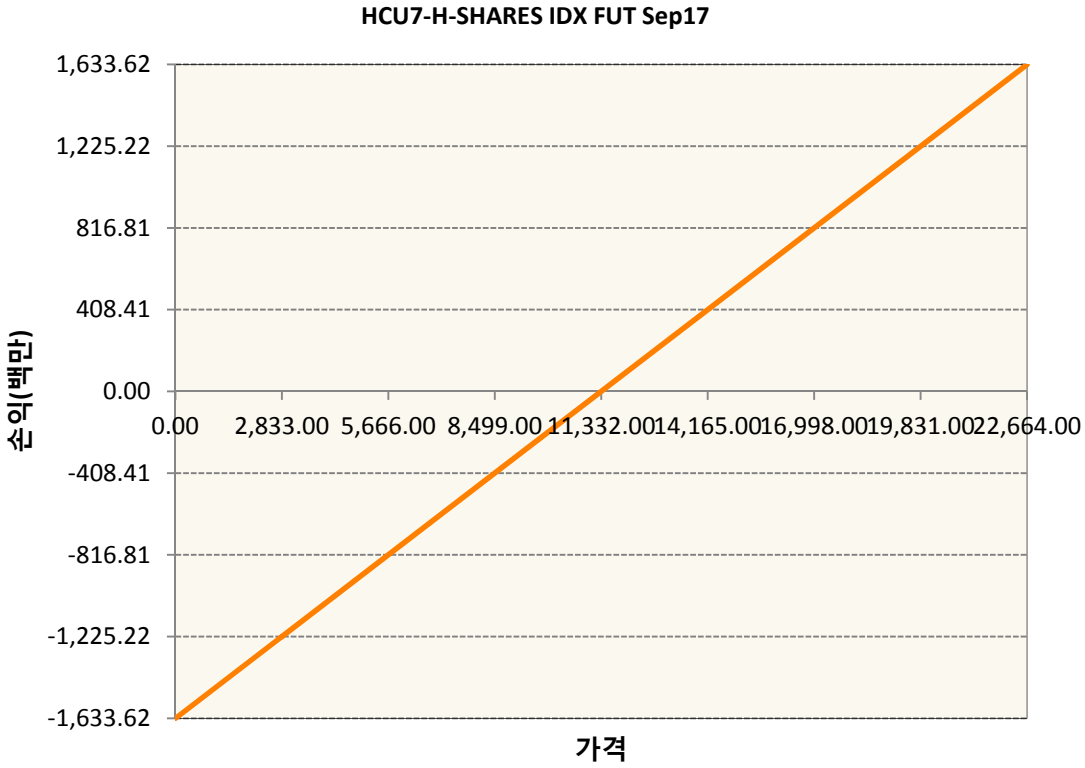
차이나인덱스모(주식-파생형)

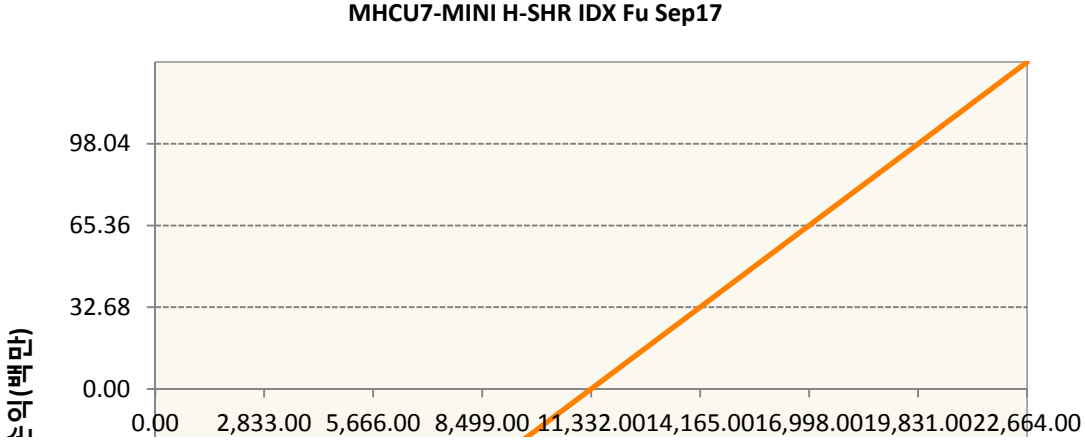
1. 계약금액

(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	131	0	131	
누계	유가증권	선물	1,634	0	1,634	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCU7	H-SHARES IDX FUT Sep17	131
MHCU7	MINI H-SHR IDX Fu Sep17	10

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	122

공시일	2017-08-29
기준일	2017-08-28

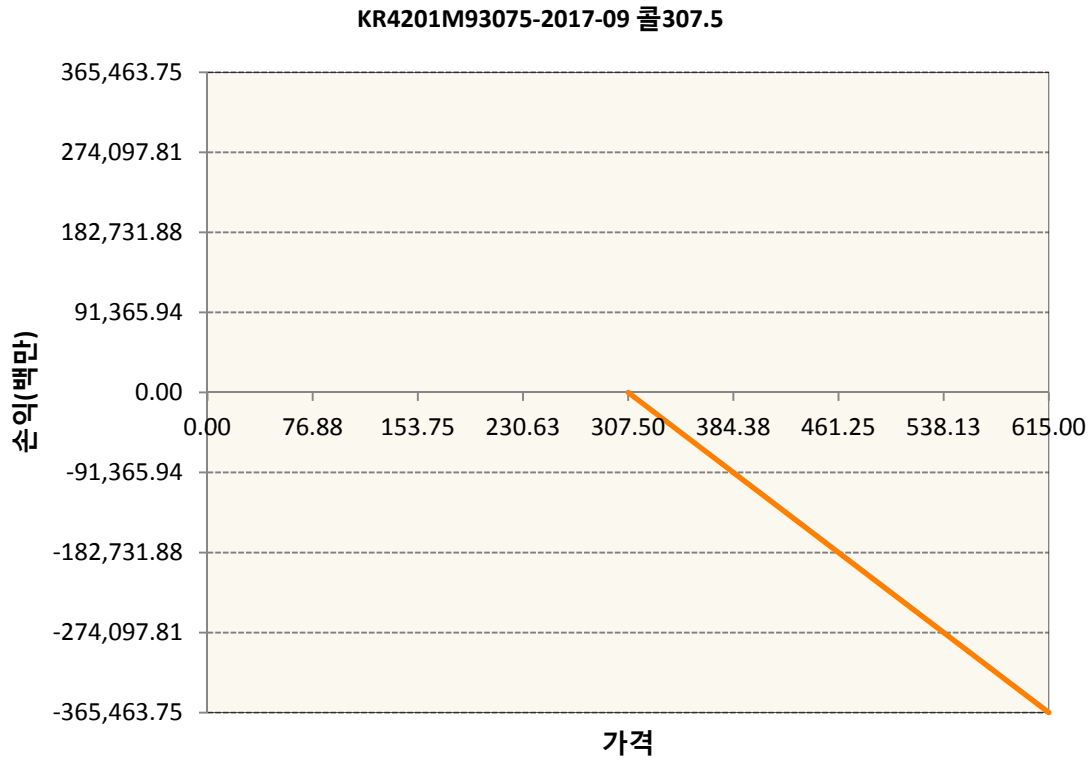
커버드콜모(주식혼합-파생형)

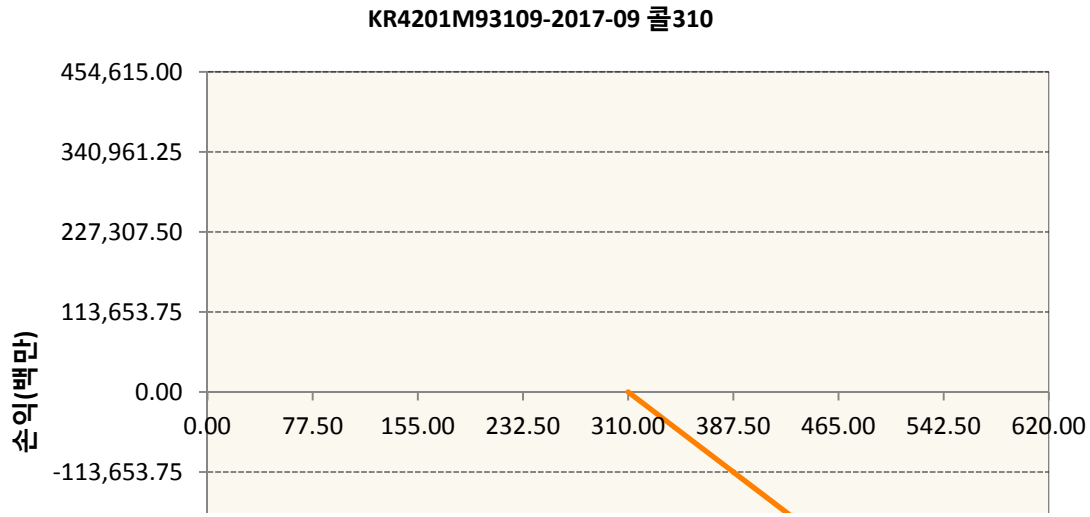
1. 계약금액

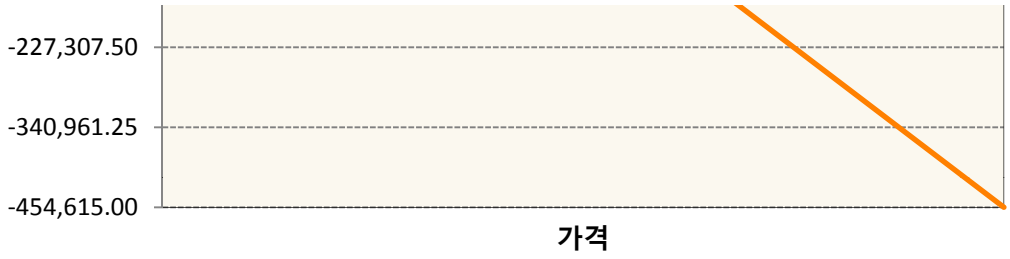
(단위:백만원)

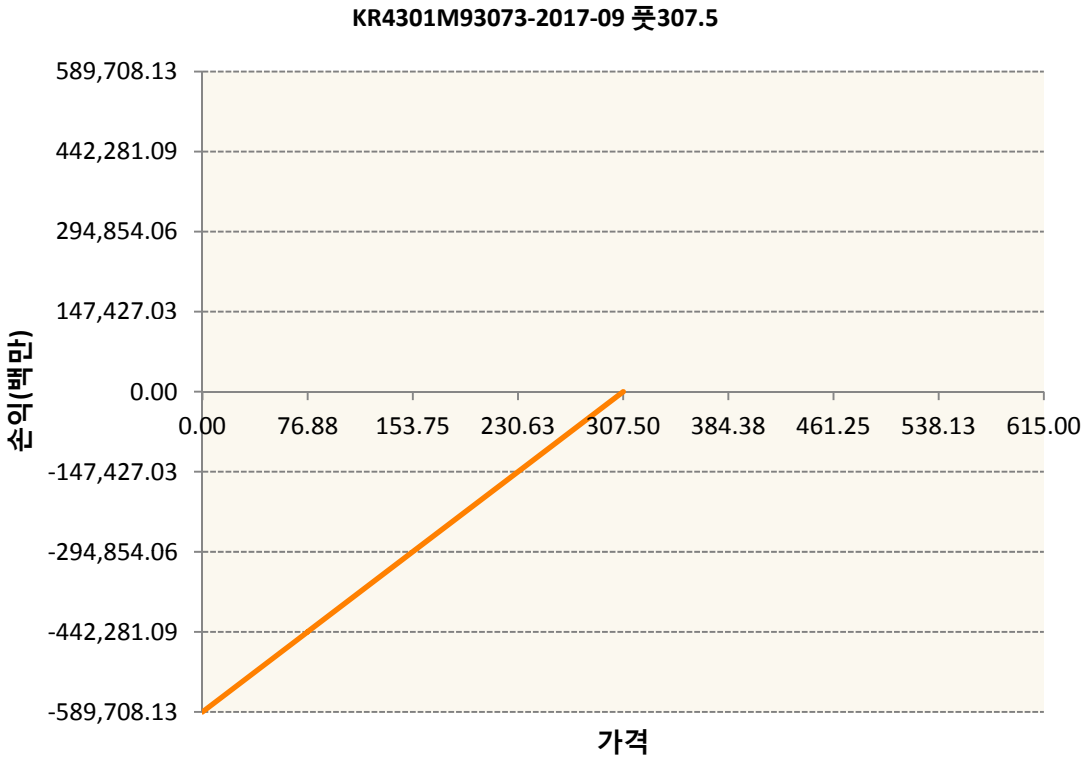
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	1,466,284	-1,466,284	장내

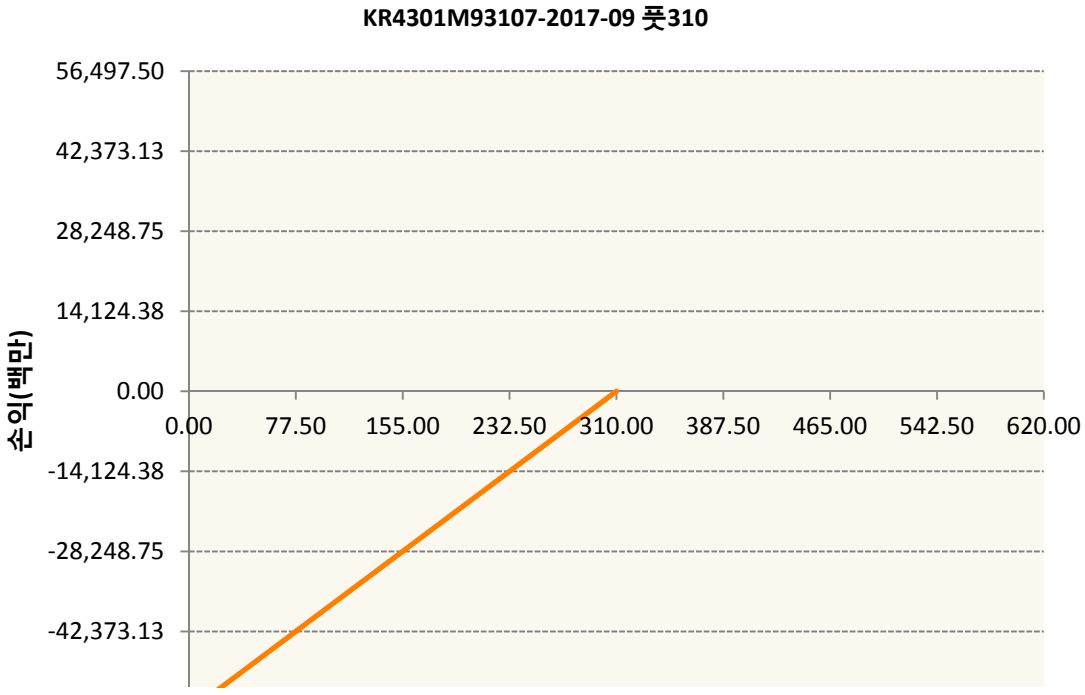
2. 만기시점의 손익구조

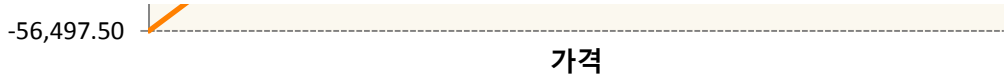





-227,307.50
-340,961.25
-454,615.00
가격


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							24,311
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	8,344	8,263	8,148	7,998	7,813	7,597	7,350
-5.33%	7,849	7,581	7,273	6,931	6,559	6,163	5,747
-2.67%	6,027	5,515	4,990	4,454	3,911	3,361	2,807
0%	1,769	1,181	591	0	-592	-1,184	-1,778
2.67%	-5,162	-5,584	-6,035	-6,508	-6,999	-7,505	-8,023
5.33%	-13,908	-14,105	-14,346	-14,627	-14,945	-15,293	-15,669
8.00%	-23,440	-23,501	-23,594	-23,722	-23,885	-24,081	-24,311
KR4201M93: 2017-09 콜310							28,581
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	8,474	8,409	8,309	8,171	7,993	7,776	7,523
-5.33%	8,089	7,839	7,536	7,186	6,795	6,368	5,911
-2.67%	6,471	5,915	5,331	4,725	4,101	3,463	2,814
0%	2,217	1,478	739	0	-739	-1,478	-2,217
2.67%	-5,391	-6,002	-6,636	-7,288	-7,953	-8,630	-9,317
5.33%	-15,633	-15,959	-16,338	-16,764	-17,230	-17,729	-18,257
8.00%	-27,189	-27,305	-27,469	-27,680	-27,938	-28,240	-28,581
KR4301M93(2017-09 풋307.5							35,595
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-33,991	-34,121	-34,307	-34,549	-34,847	-35,197	-35,595
-5.33%	-18,971	-19,403	-19,901	-20,453	-21,052	-21,691	-22,363
-2.67%	-6,093	-6,919	-7,767	-8,631	-9,508	-10,394	-11,289
0%	2,855	1,906	954	0	-955	-1,911	-2,868
2.67%	7,488	6,808	6,081	5,317	4,524	3,708	2,872
5.33%	9,194	8,877	8,488	8,034	7,522	6,959	6,353
8.00%	9,632	9,533	9,383	9,177	8,915	8,597	8,227
KR4301M93: 2017-09 풋310							3,575
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-3,457	-3,465	-3,477	-3,494	-3,516	-3,543	-3,575
-5.33%	-2,001	-2,032	-2,070	-2,113	-2,162	-2,215	-2,272
-2.67%	-699	-768	-841	-916	-994	-1,073	-1,154
0%	276	184	92	0	-92	-184	-276
2.67%	833	757	679	598	515	431	345

5.33%	1,064	1,023	976	923	865	803	738
8.00%	1,131	1,116	1,096	1,070	1,038	1,000	958

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

94,631

공시일	2017-08-29
기준일	2017-08-28

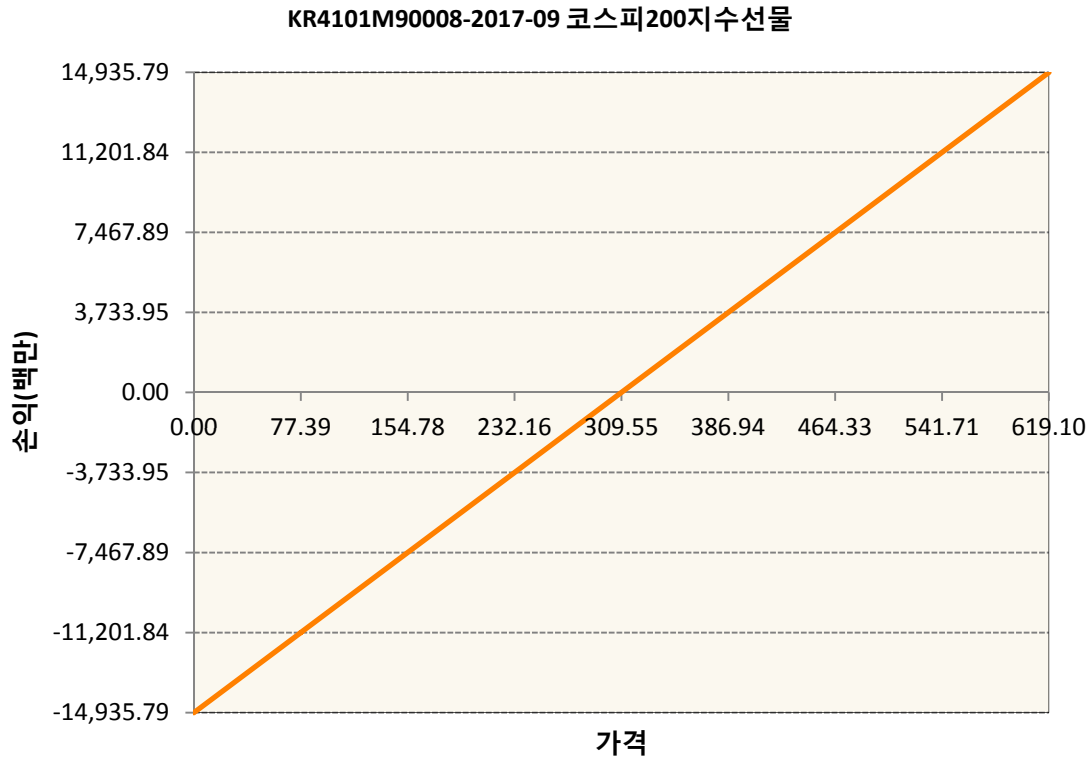
ETF스마트레버리지목표전환형6호

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	14,936	0	14,936	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)

744

공시일	2017-08-29
기준일	2017-08-28

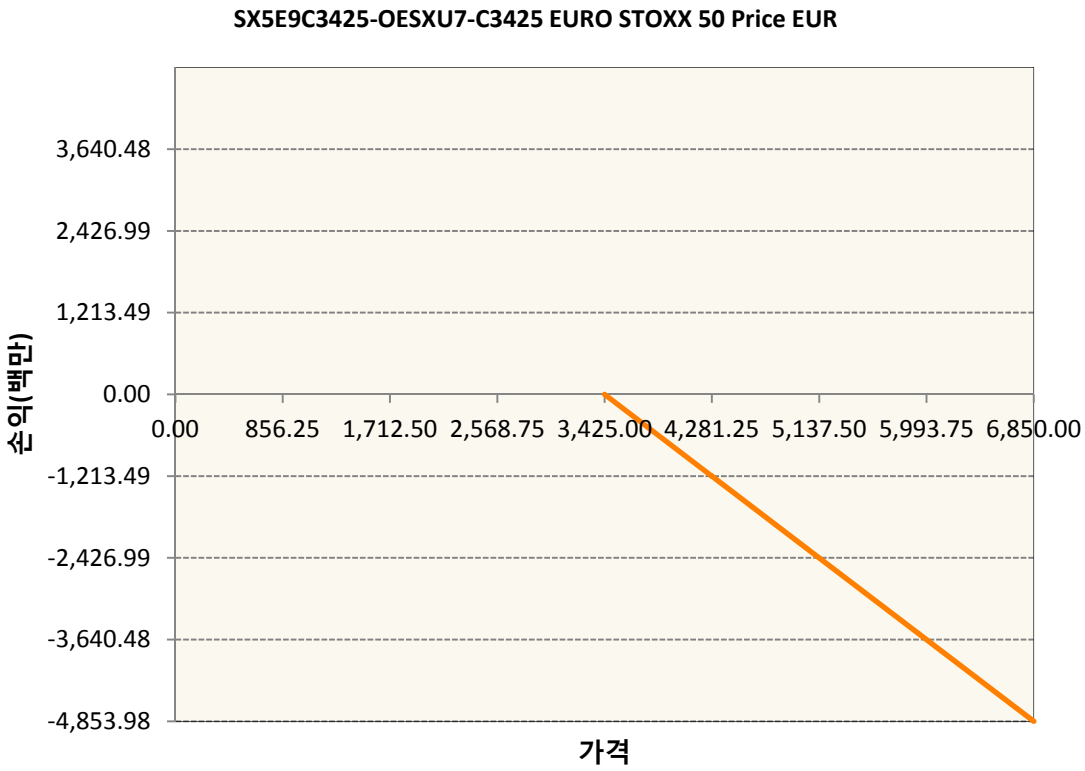
유로커버드콜(주식혼합-파생형)

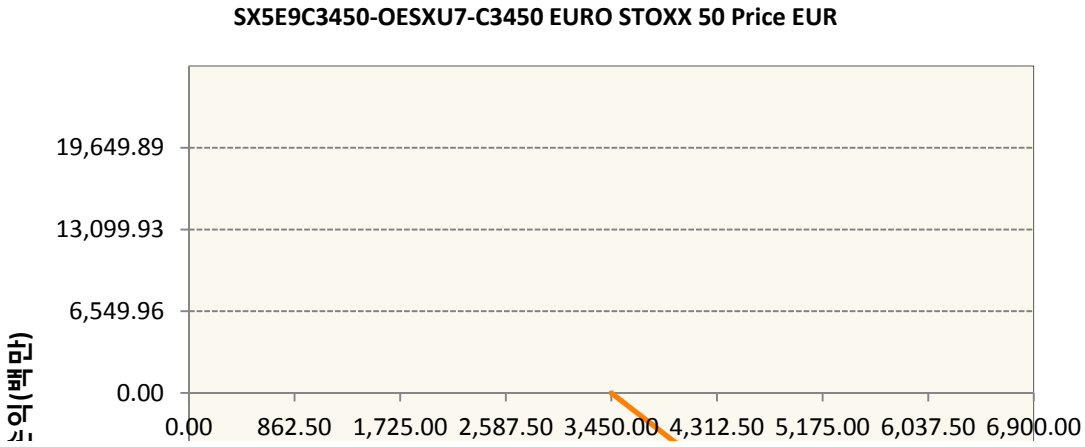
1. 계약금액

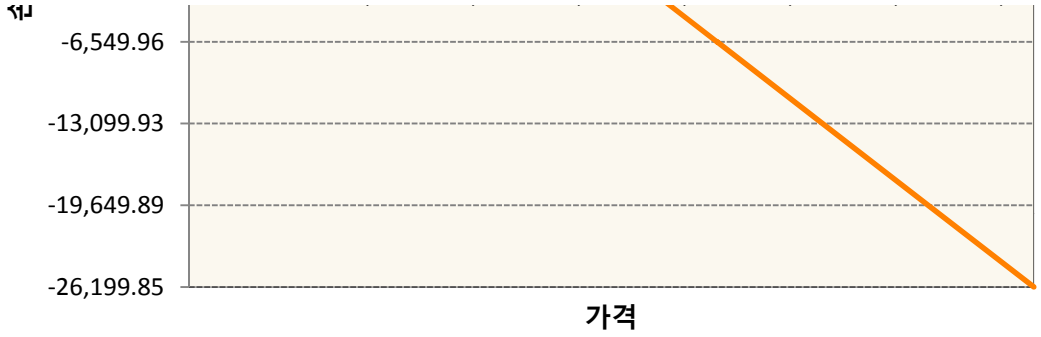
(단위:백만원)

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	26,801	0	26,801	
누계	유가증권	옵션	0	62,108	-62,108	장내

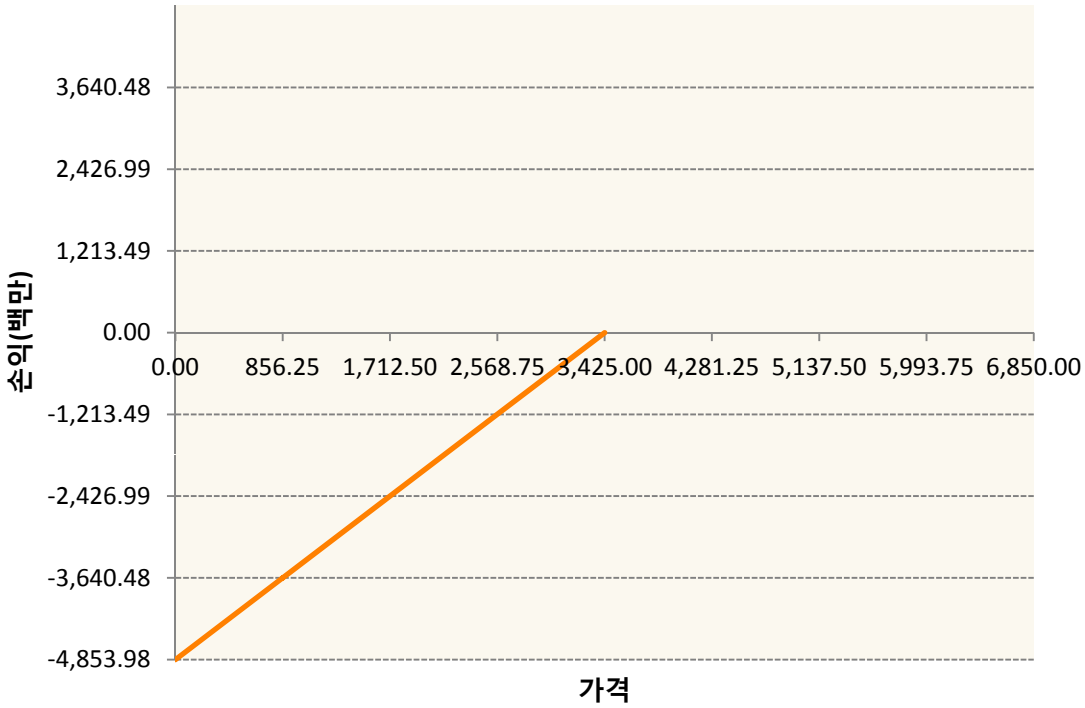
2. 만기시점의 손익구조



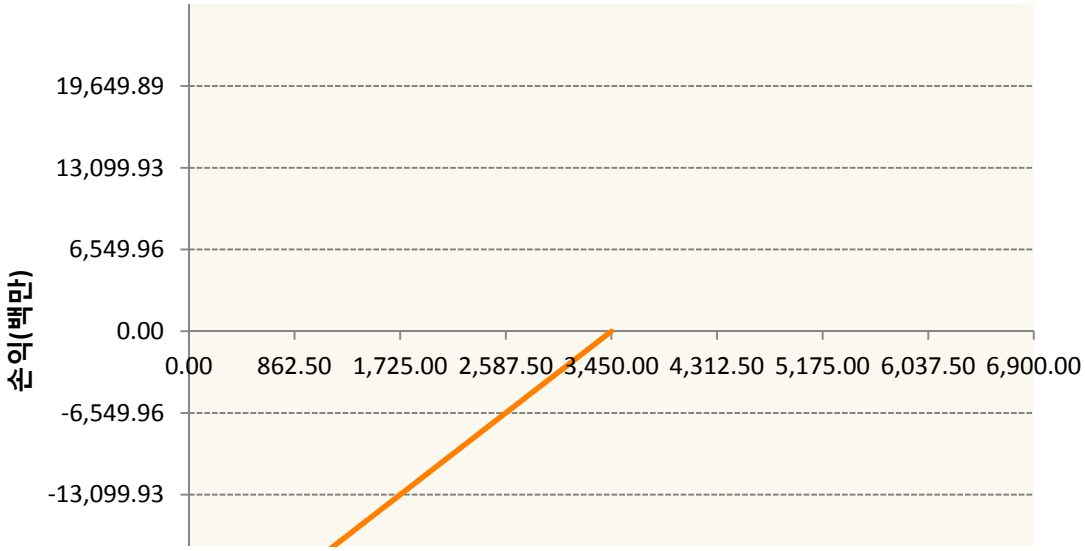


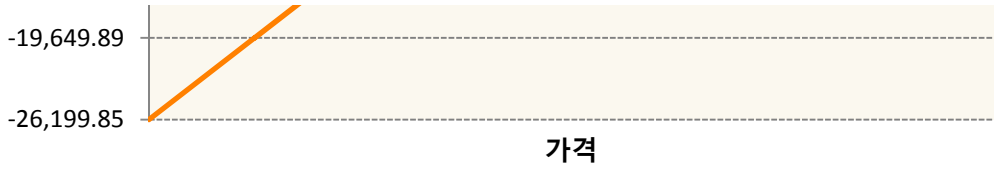


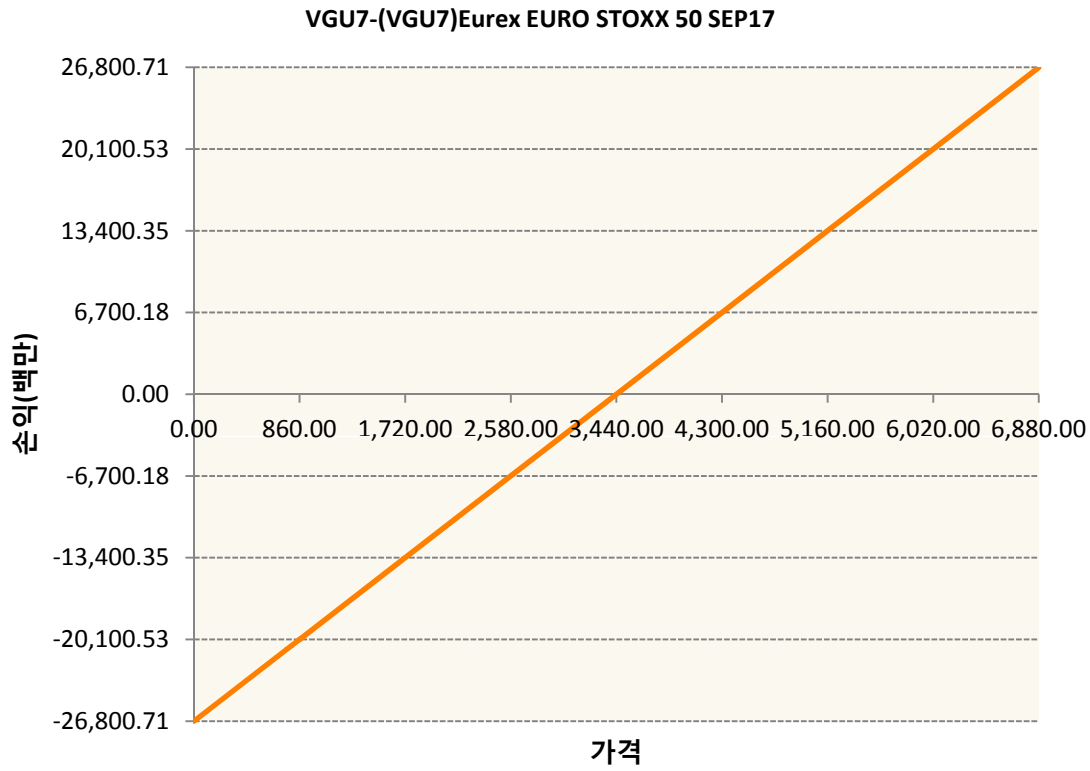
SX5E9P3425-OESXU7-P3425 EURO STOXX 50 Price EUR



SX5E9P3450-OESXU7-P3450 EURO STOXX 50 Price EUR







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

SX5E9C3425	OESXU7-C3425 EURO STOXX 50 Price EUR	388
SX5E9C3450	OESXU7-C3450 EURO STOXX 50 Price EUR	2,096
SX5E9P3425	OESXU7-P3425 EURO STOXX 50 Price EUR	388
SX5E9P3450	OESXU7-P3450 EURO STOXX 50 Price EUR	2,096
VGU7	(VGU7)Eurex EURO STOXX 50 SEP17	2,144

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

5,714

공시일	2017-08-29
기준일	2017-08-28

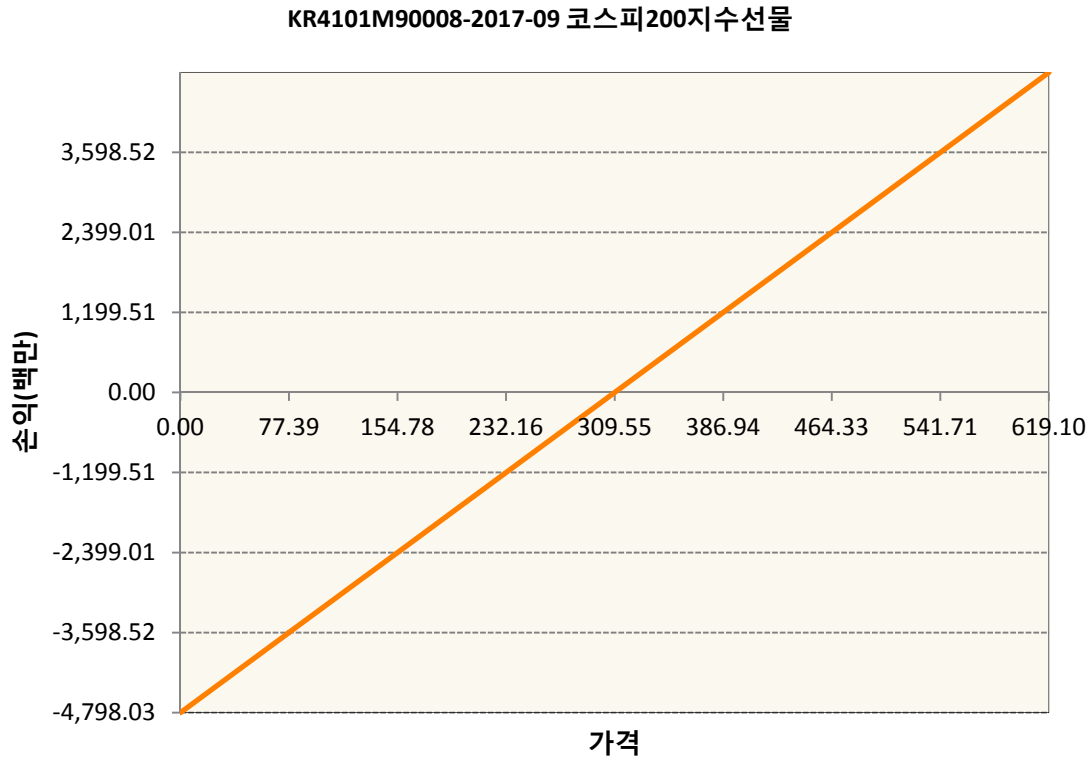
ETF스마트레버리지목표전환형7호

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	4,798	0	4,798	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	2017-08-29
기준일	2017-08-28

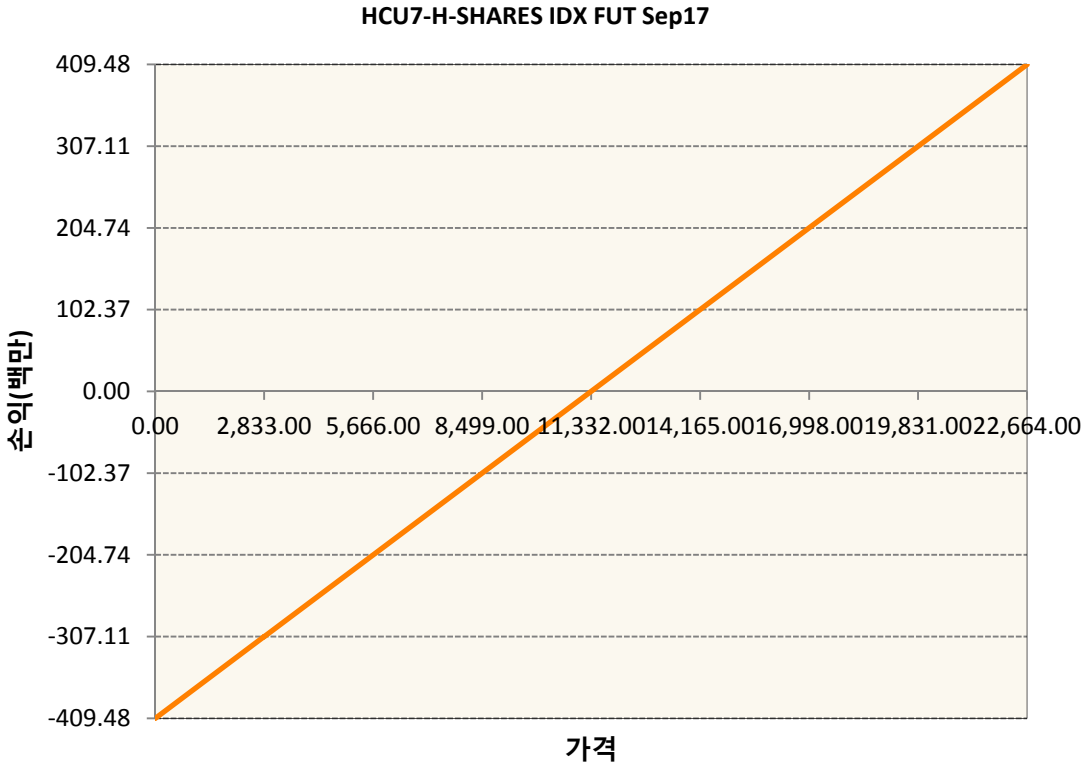
홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생

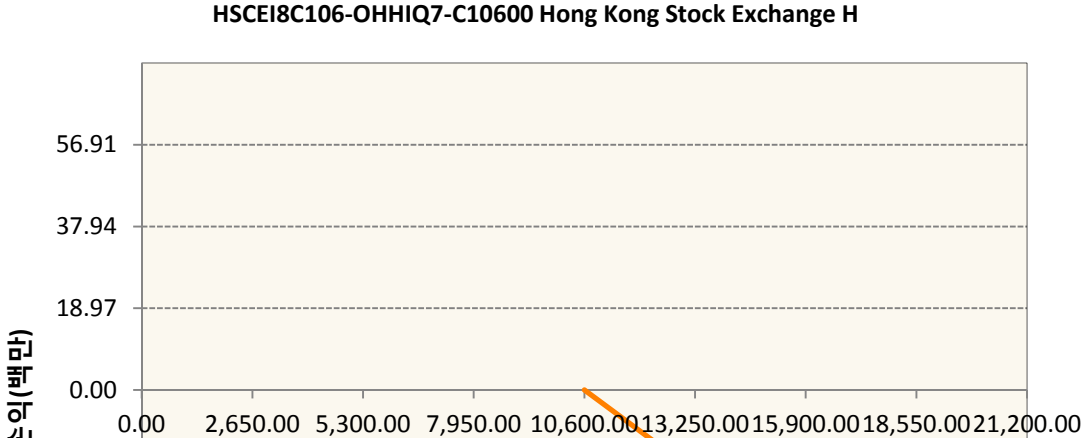
1. 계약금액

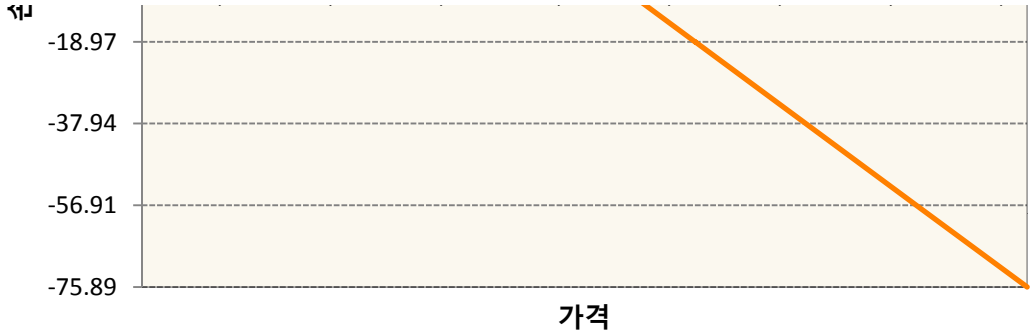
(단위:백만원)

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	770	-770	장내

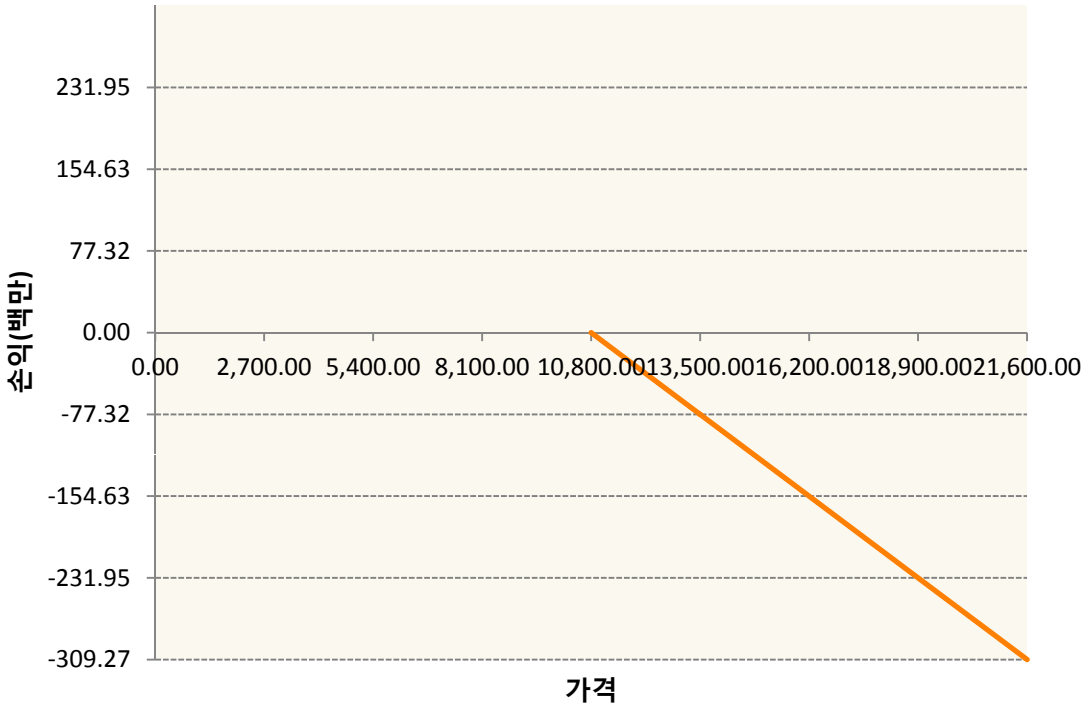
2. 만기시점의 손익구조



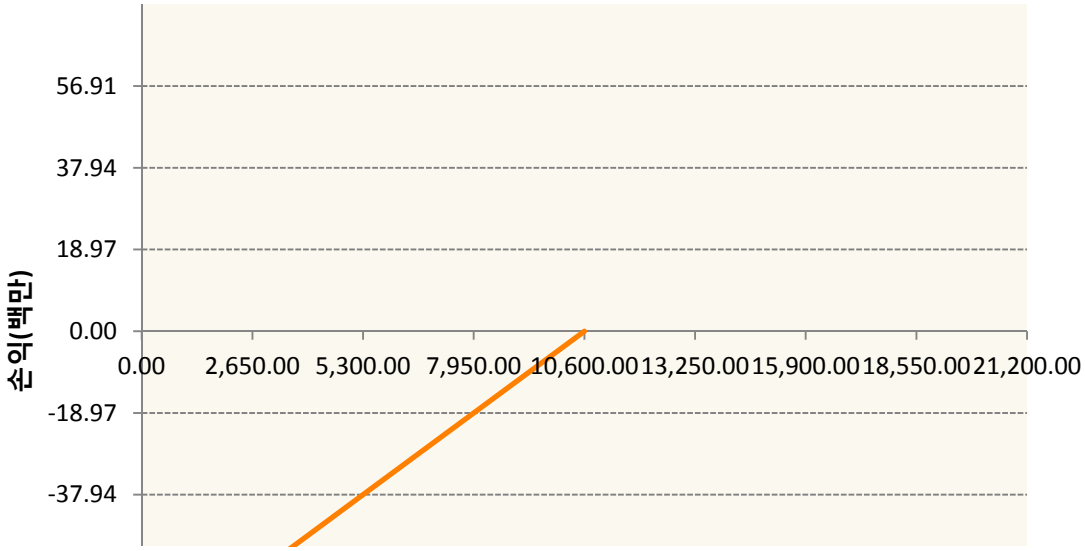


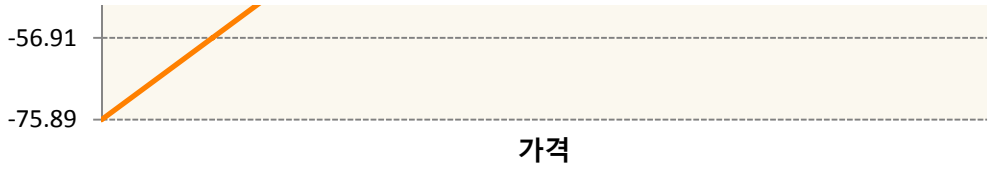


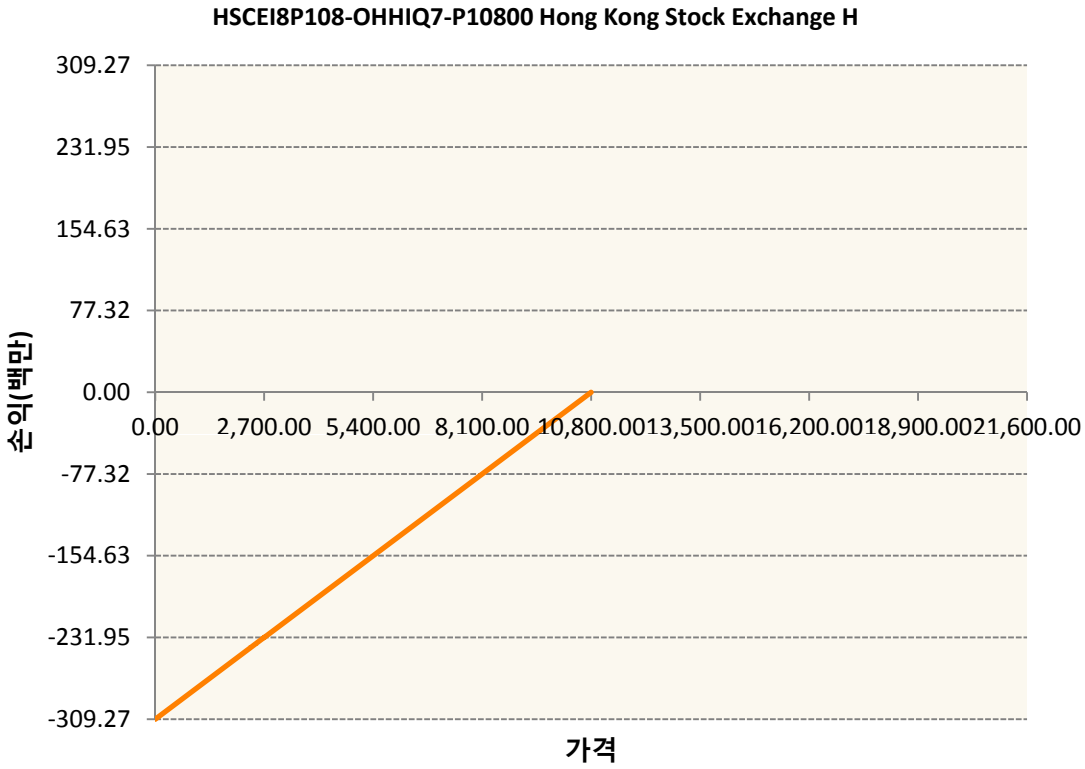
HSCEI8C108-OHHIQ7-C10800 Hong Kong Stock Exchange H



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	2017-08-29
기준일	2017-08-28

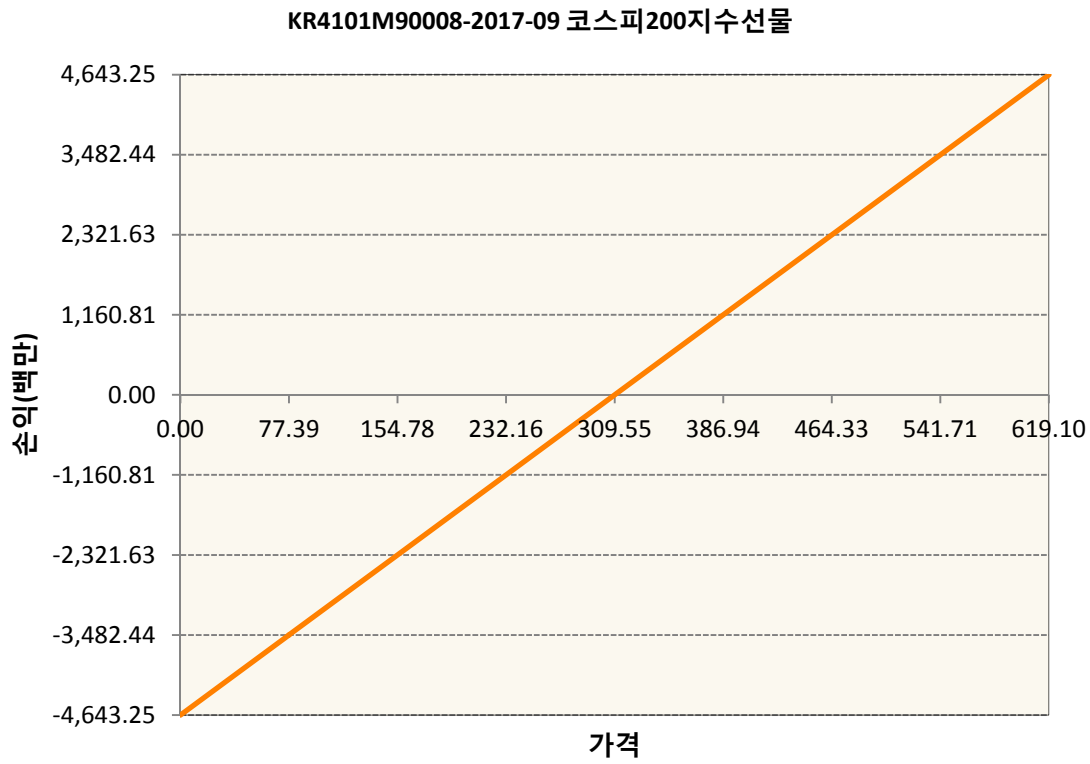
코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼

1. 계약금액

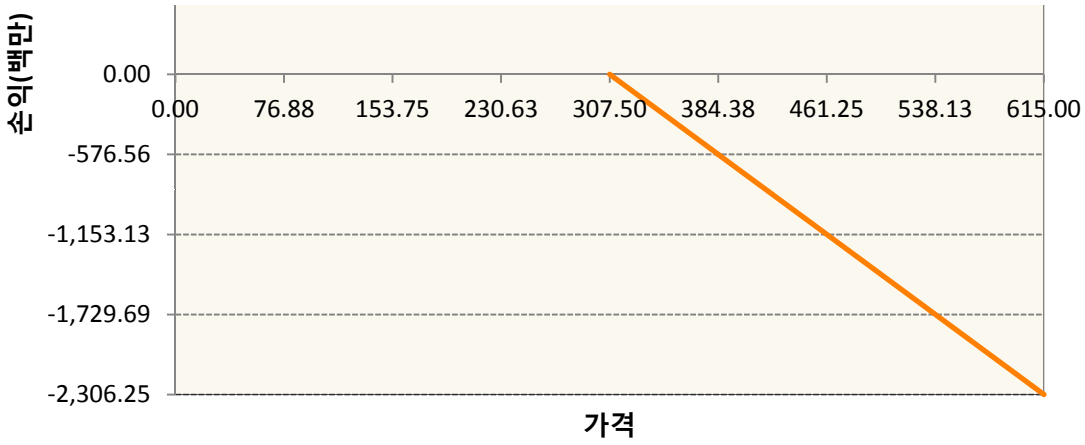
(단위:백만원)

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	4,643	0	4,643	장내
누계	유가증권	스왑	15,000	0	15,000	장외
누계	유가증권	옵션	0	14,647	-14,647	장내

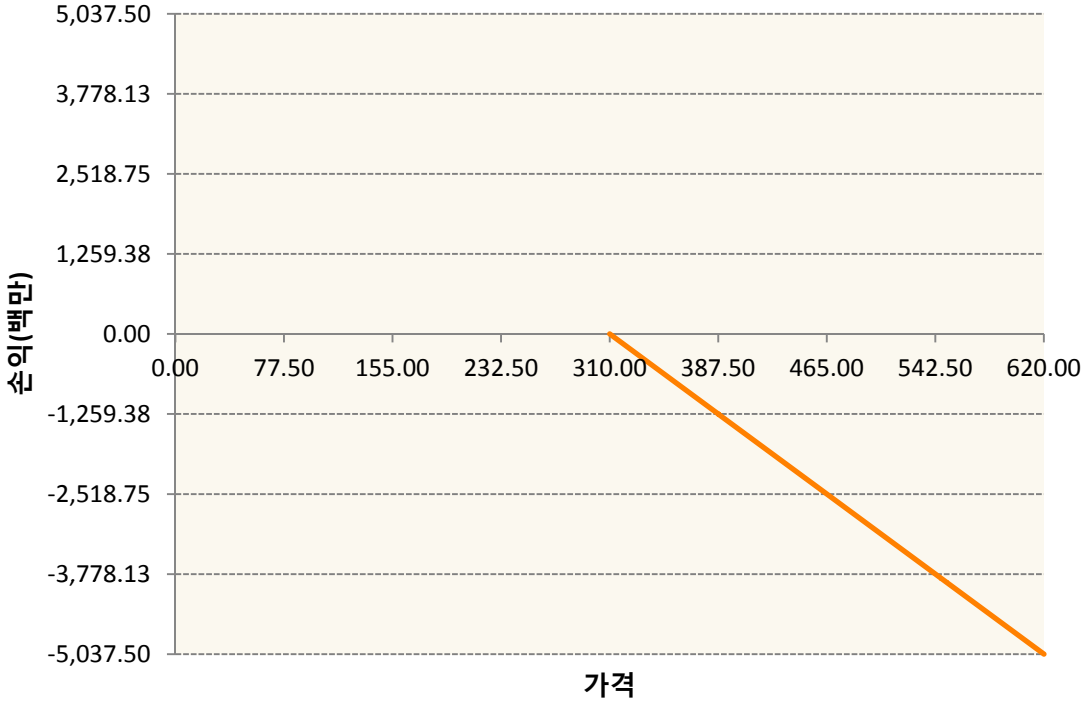
2. 만기시점의 손익구조



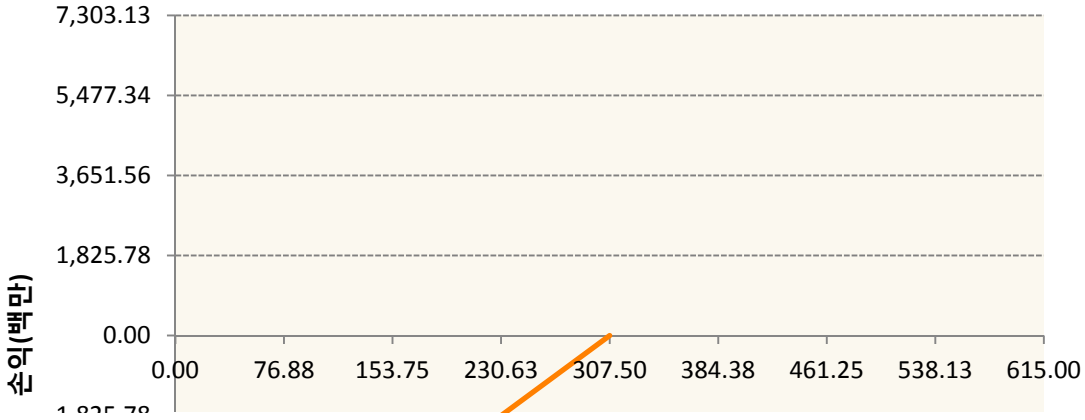




KR4201M93109-2017-09 콜310



KR4301M93073-2017-09 풋307.5





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

	KR4101M90(2017-09 코스피200지수선물						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%	-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%	371	371	371	371	371	371	371
	KR4201M93(2017-09 콜307.5						153
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	53	52	51	50	49	48	46
-5.33%	50	48	46	44	41	39	36
-2.67%	38	35	31	28	25	21	18
0%	11	7	4	0	-4	-7	-11
2.67%	-33	-35	-38	-41	-44	-47	-51
5.33%	-88	-89	-91	-92	-94	-97	-99
8.00%	-148	-148	-149	-150	-151	-152	-153
	KR4201M93: 2017-09 콜310						317
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	94	93	92	91	89	86	83
-5.33%	90	87	84	80	75	71	65
-2.67%	72	66	59	52	45	38	31
0%	25	16	8	0	-8	-16	-25
2.67%	-60	-67	-74	-81	-88	-96	-103
5.33%	-173	-177	-181	-186	-191	-196	-202
8.00%	-301	-303	-304	-307	-310	-313	-317
	KR4301M93(2017-09 풋307.5						441
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-421	-423	-425	-428	-432	-436	-441
-5.33%	-235	-240	-246	-253	-261	-269	-277
-2.67%	-75	-86	-96	-107	-118	-129	-140
0%	35	24	12	0	-12	-24	-36
2.67%	93	84	75	66	56	46	36
5.33%	114	110	105	99	93	86	79
8.00%	119	118	116	114	110	106	102

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

1,163

공시일	2017-08-29
기준일	2017-08-28

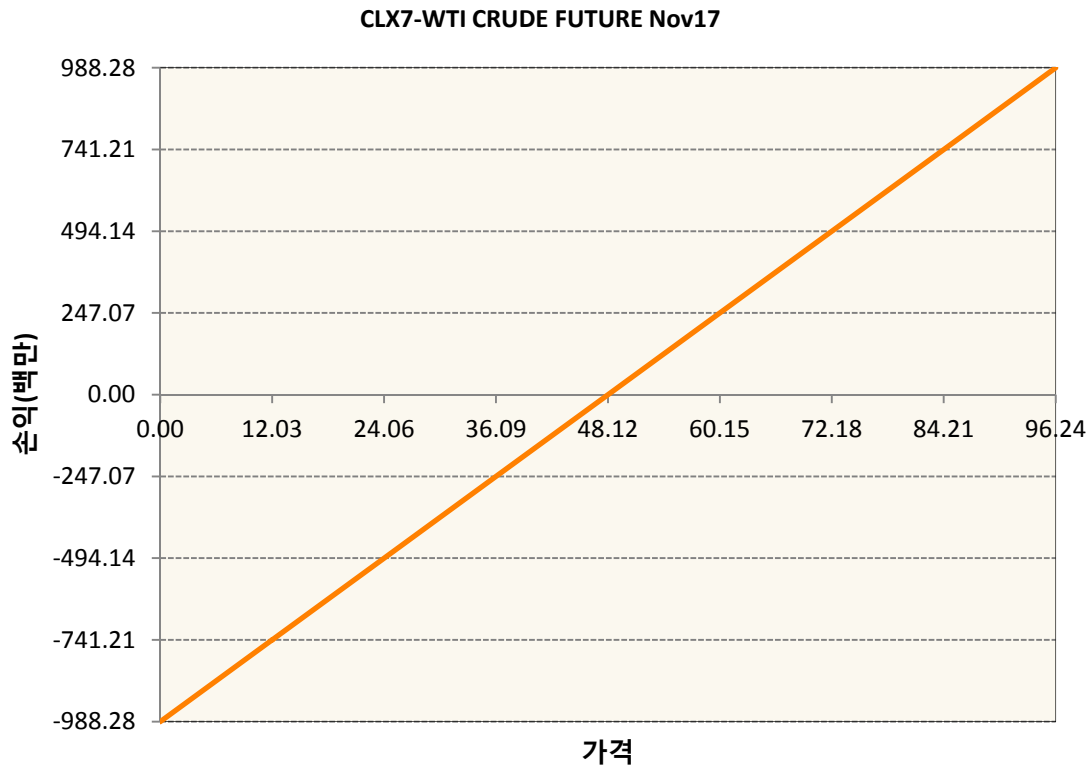
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

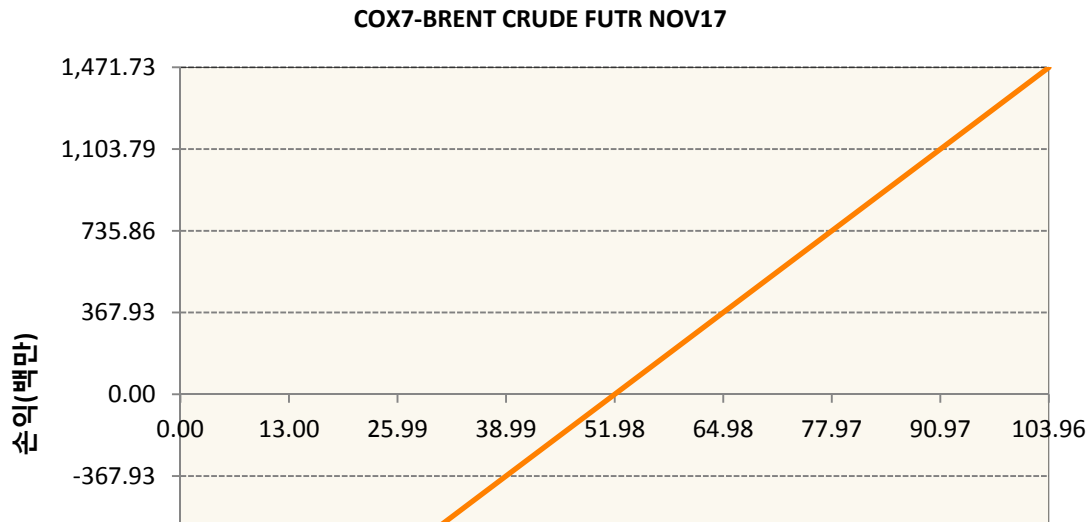
1. 계약금액

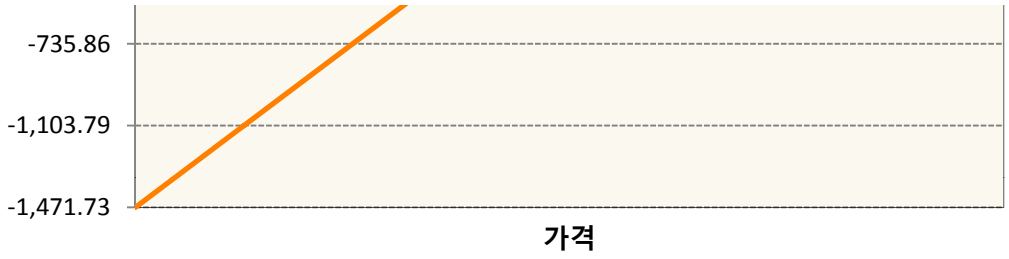
(단위:백만원)

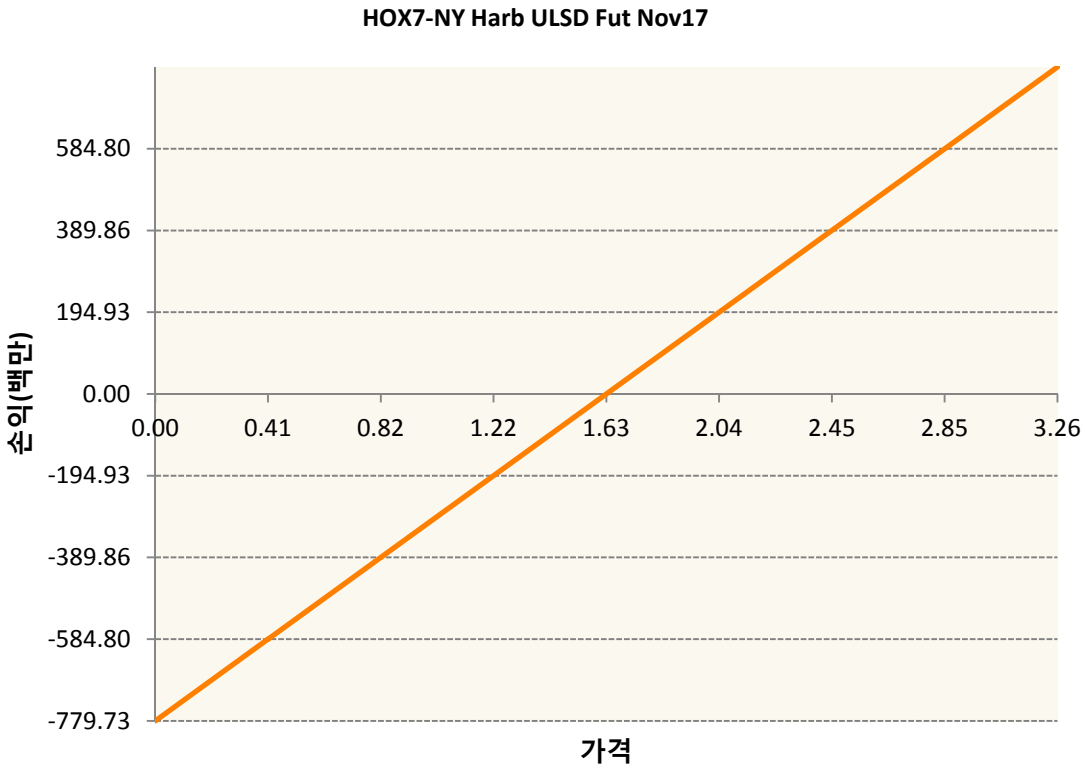
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	5,395	504	4,891	

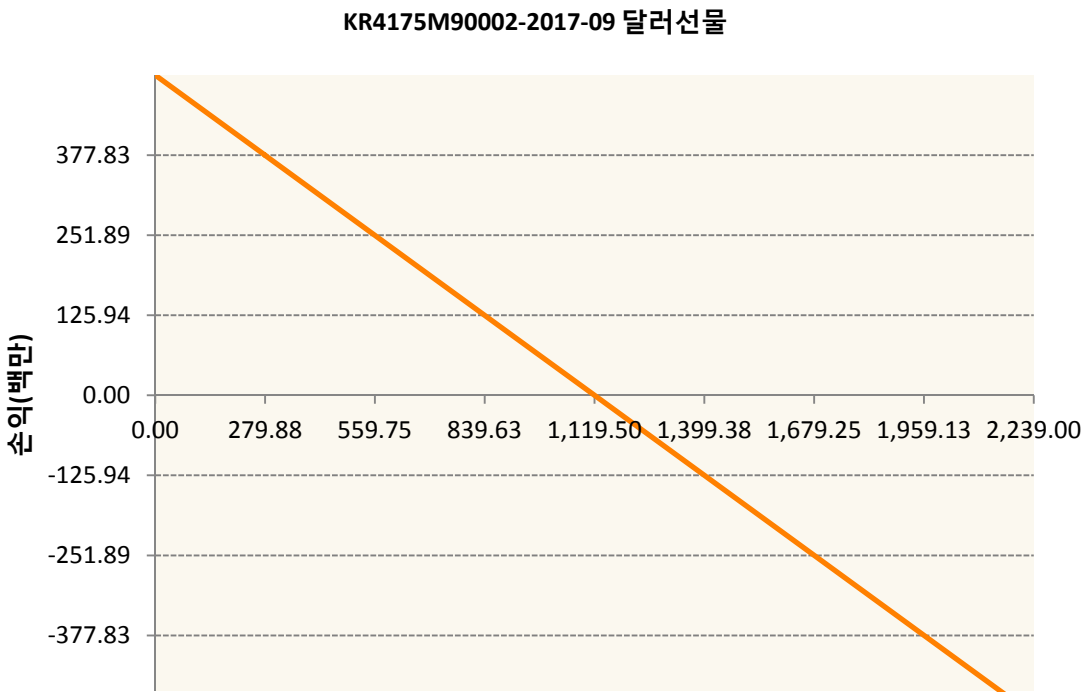
2. 만기시점의 손익구조

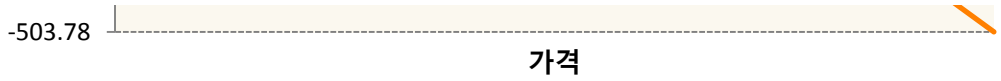


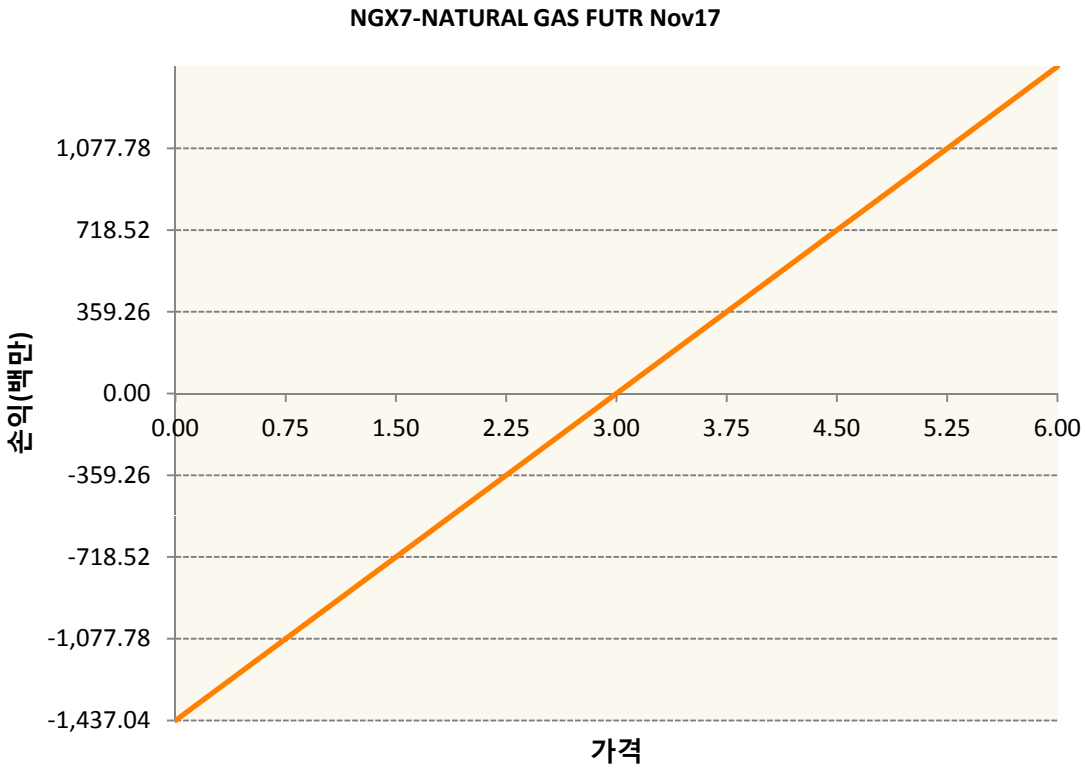


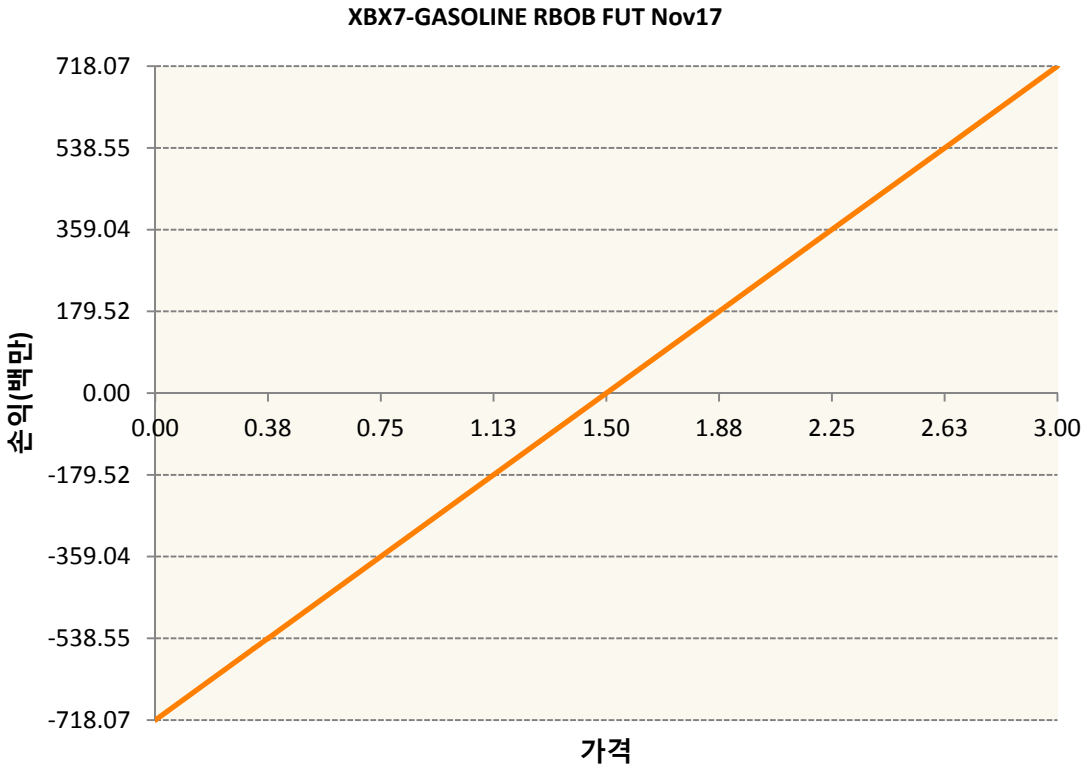

-735.86
-1,103.79
-1,471.73
가격


HOX7-NY Harb ULSD Fut Nov17
584.80
389.86
194.93
0.00
-194.93
-389.86
-584.80
-779.73
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
377.83
251.89
125.94
0.00
-125.94
-251.89
-377.83
0.00
279.88
559.75
839.63
1,119.50
1,399.38
1,679.25
1,959.13
2,239.00
손익(백만)


-503.78
가격


NGX7-NATURAL GAS FUTR Nov17
1,077.78
718.52
359.26
0.00
-359.26
-718.52
-1,077.78
-1,437.04
0.00
0.75
1.50
2.25
3.00
3.75
4.50
5.25
6.00
손익(백만)
가격


XBX7-GASOLINE RBOB FUT Nov17
718.07
538.55
359.04
179.52
0.00
-179.52
-359.04
-538.55
-718.07
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	79
COX7	BRENT CRUDE FUTR NOV17	118
HOX7	NY Harb ULSD Fut Nov17	62
KR4175M90(	2017-09 달러선물	40
NGX7	NATURAL GAS FUTR Nov17	115
XBX7	GASOLINE RBOB FUT Nov17	57

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

774

공시일	2017-08-29
기준일	2017-08-28

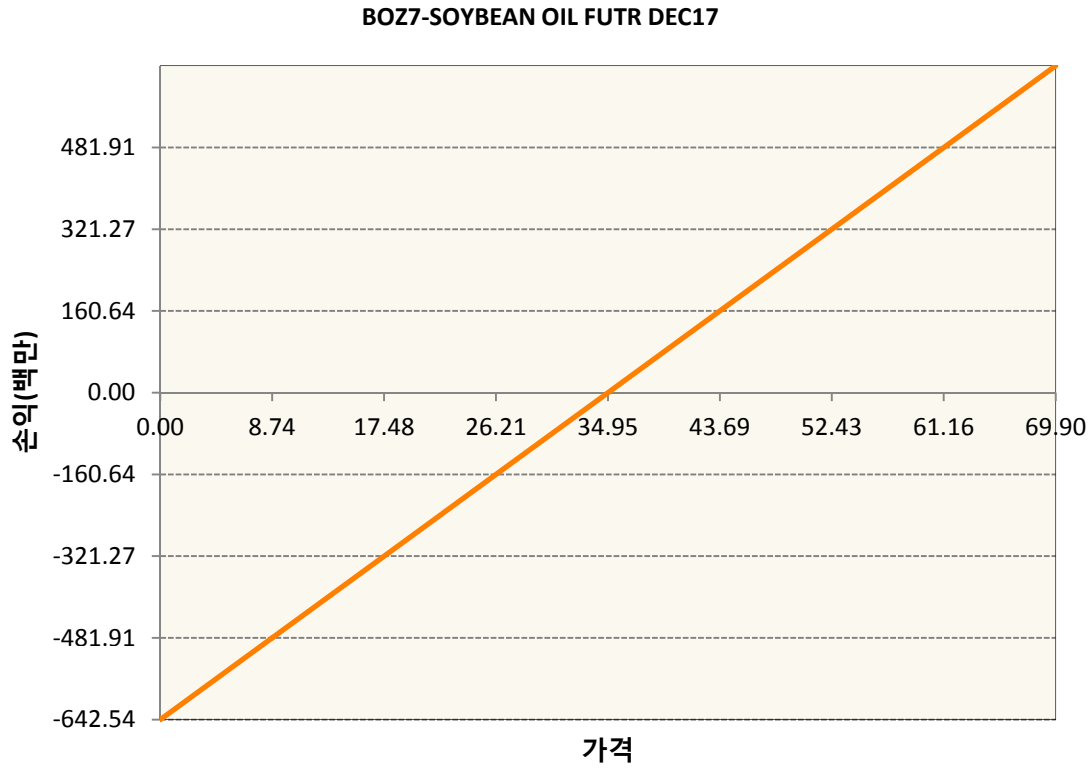
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

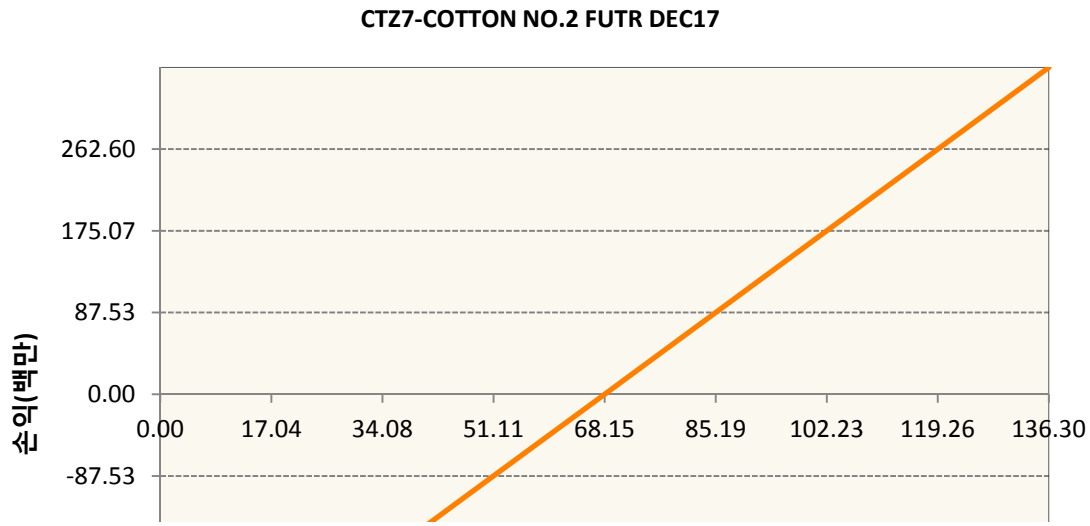
1. 계약금액

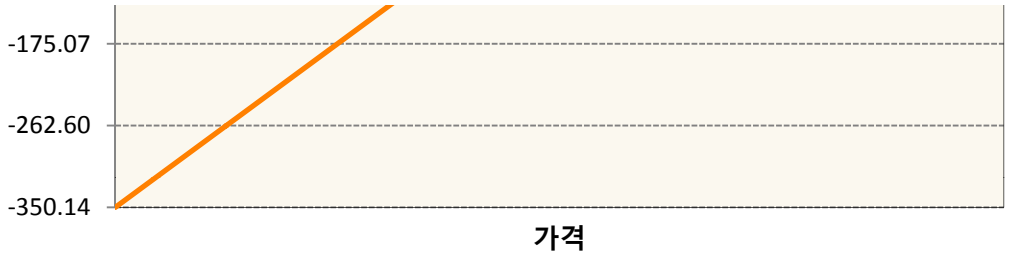
(단위:백만원)

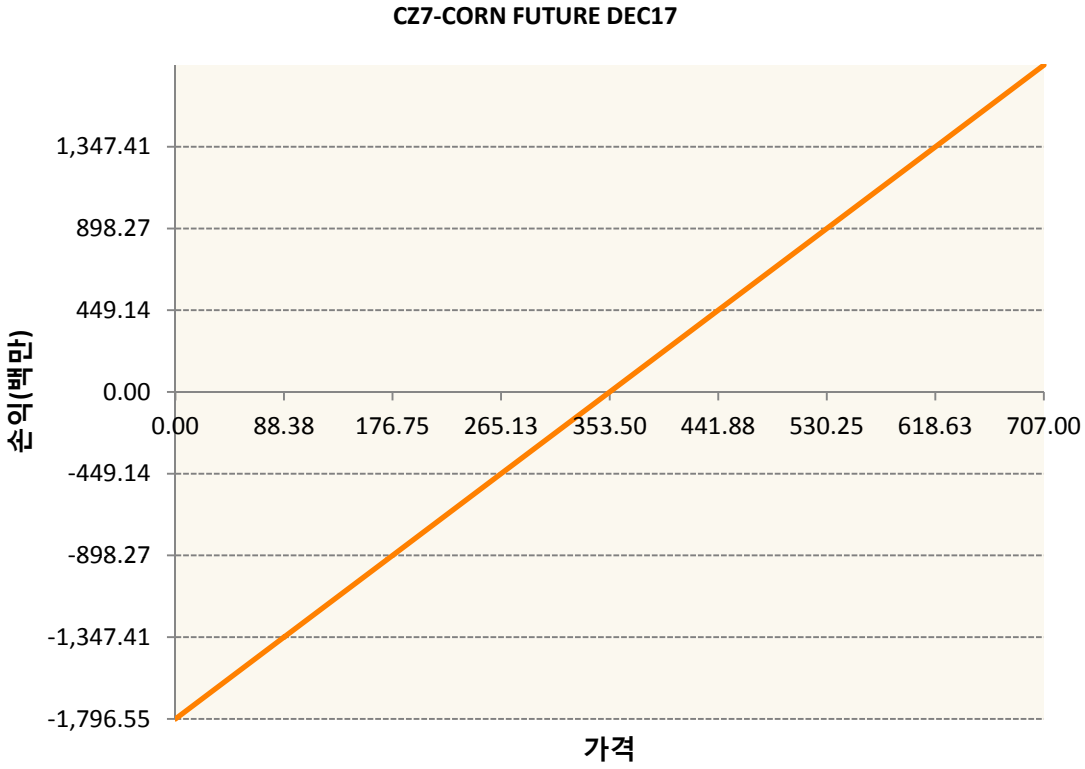
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	6,914	336	6,578	

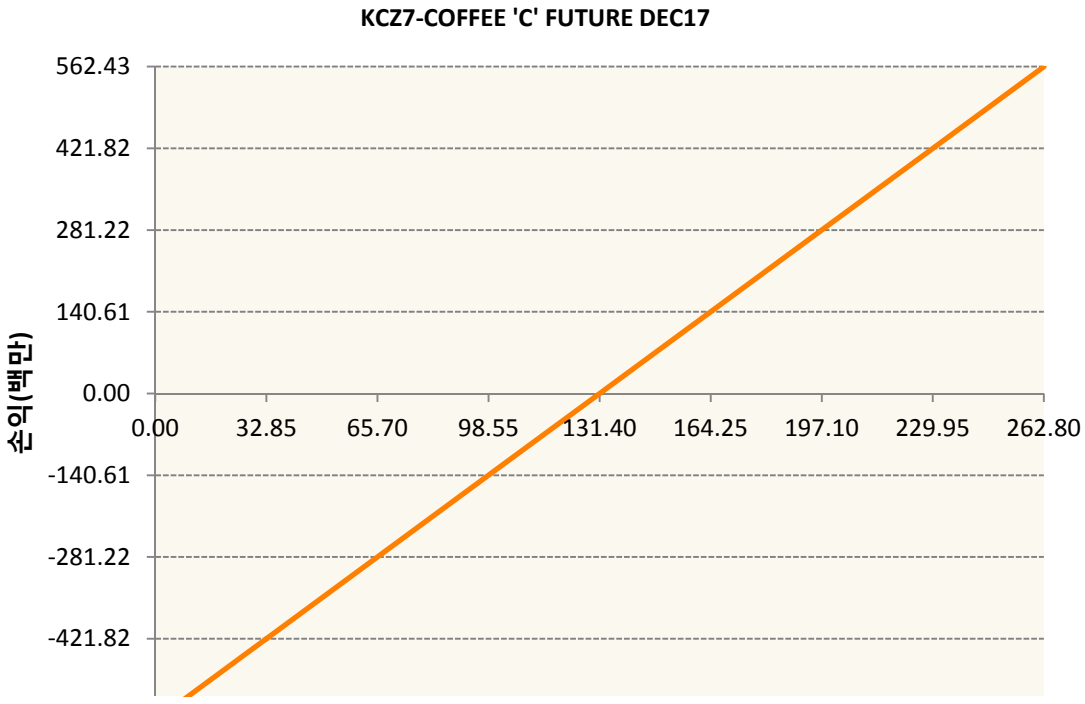
2. 만기시점의 손익구조

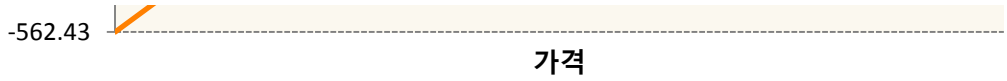


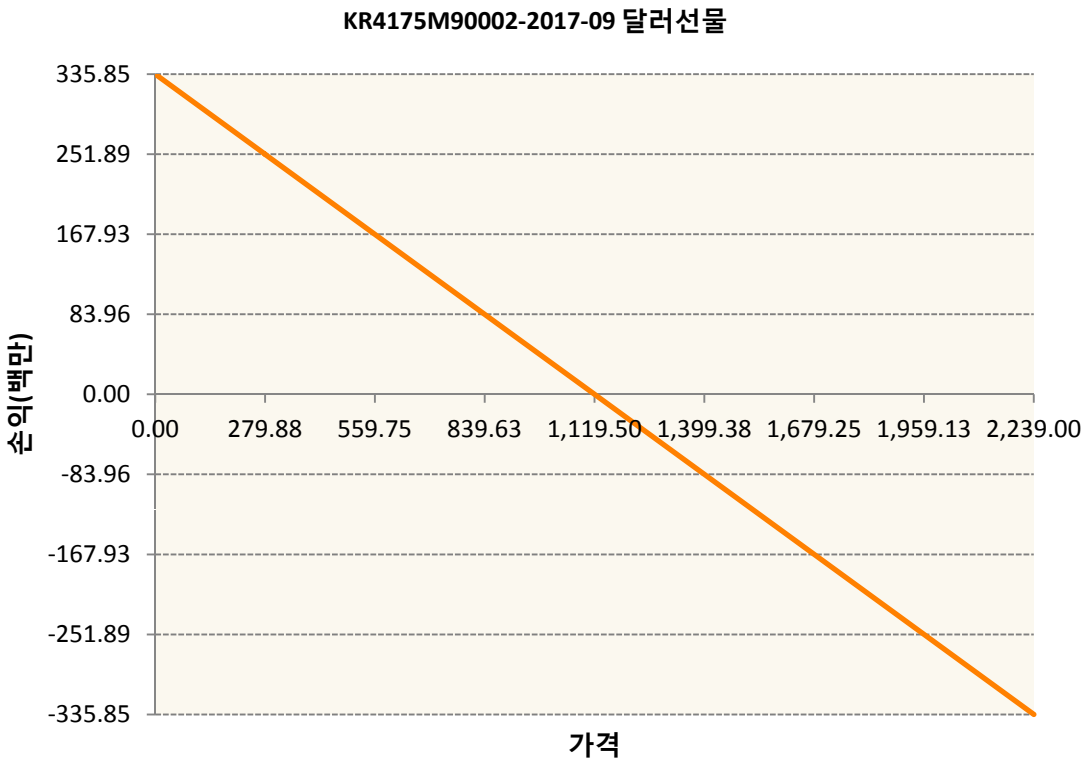


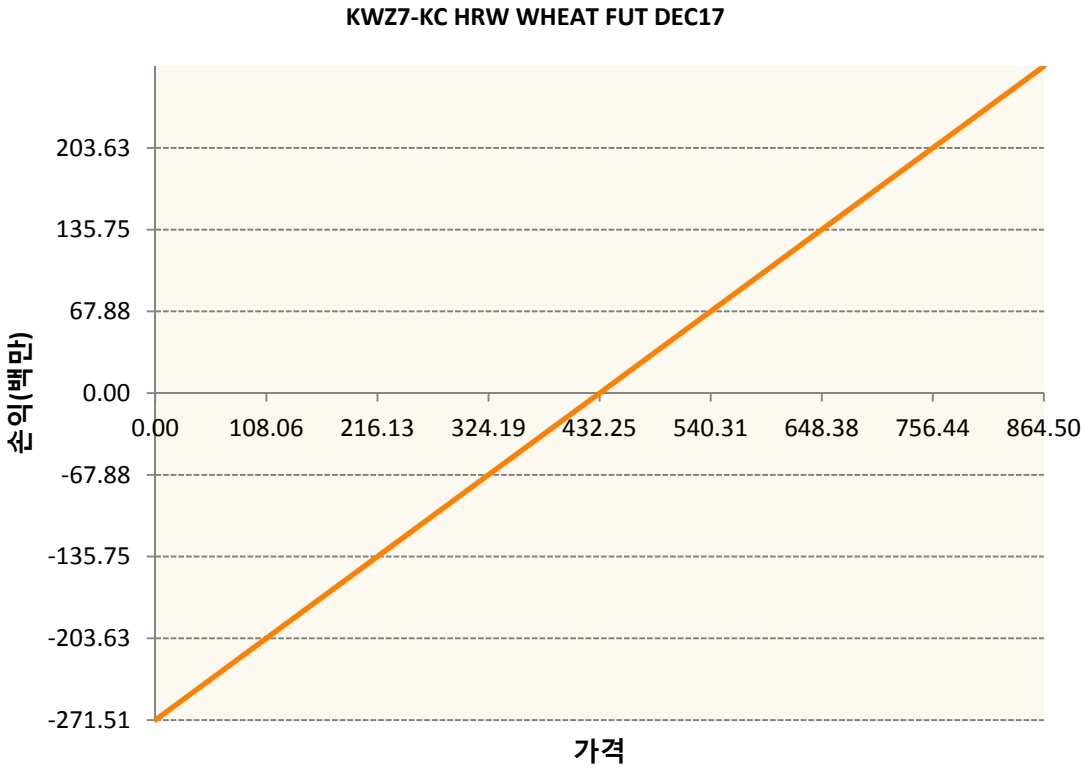

-175.07
-262.60
-350.14
가격

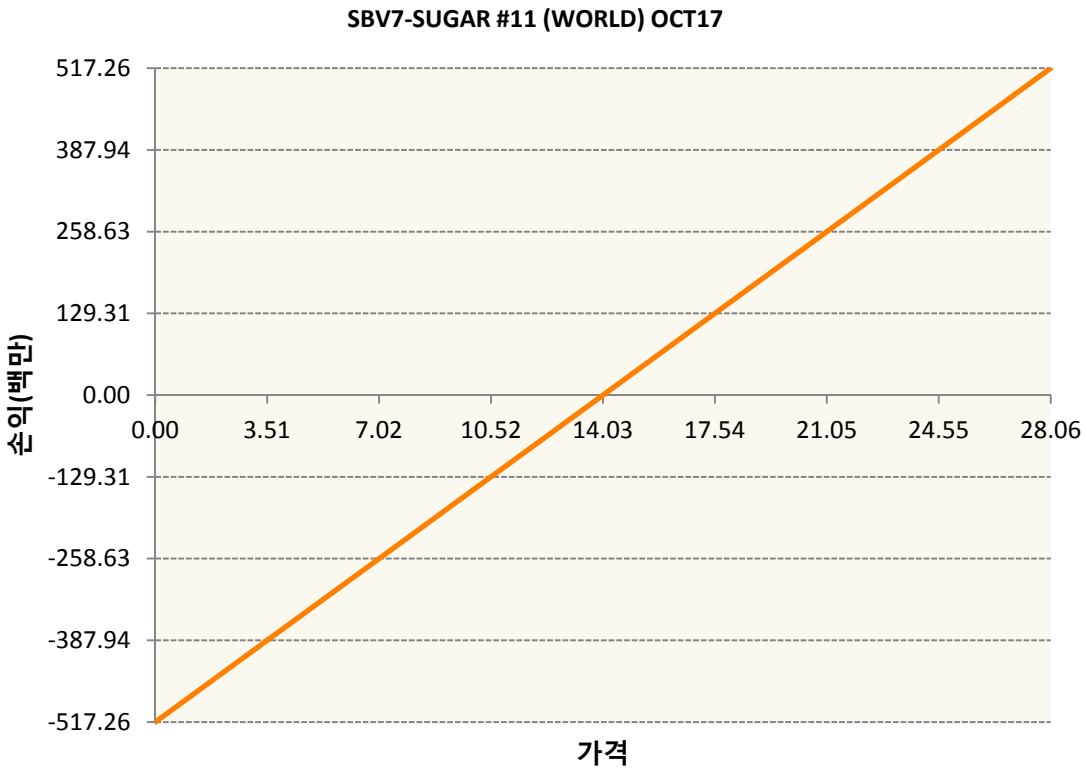

CZ7-CORN FUTURE DEC17
1,347.41
898.27
449.14
0.00
-449.14
-898.27
-1,347.41
-1,796.55
0.00
88.38
176.75
265.13
353.50
441.88
530.25
618.63
707.00
손익(백만)
가격

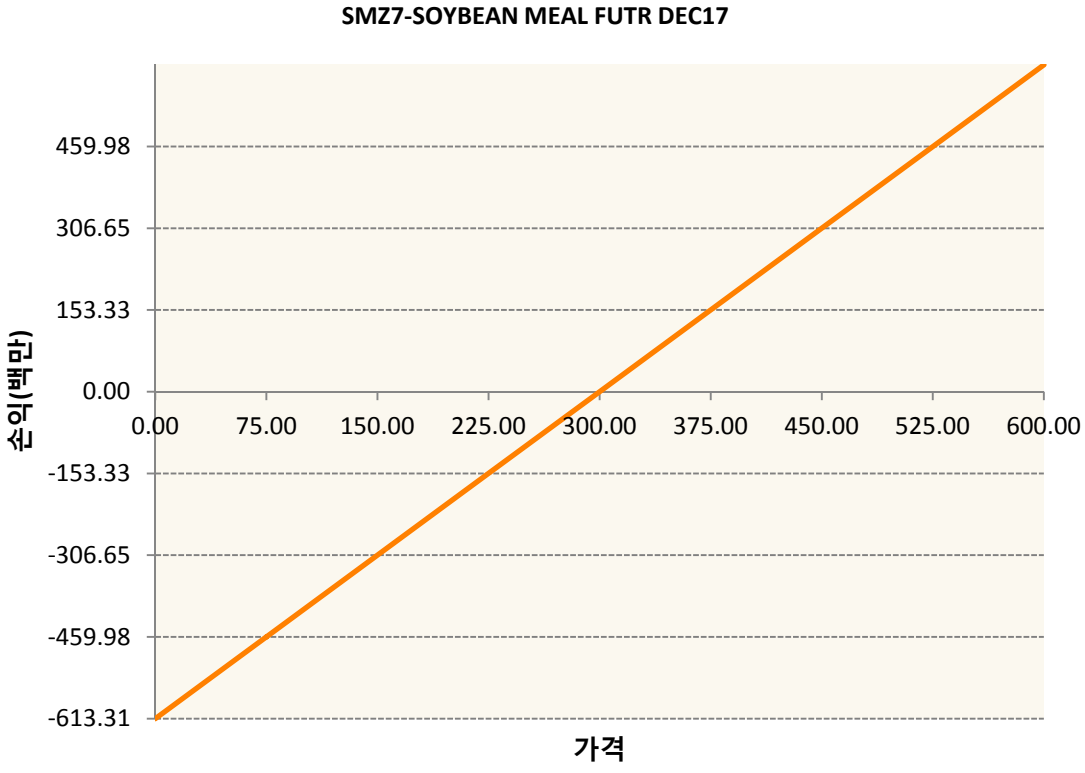

KCZ7-COFFEE 'C' FUTURE DEC17
562.43
421.82
281.22
140.61
0.00
-140.61
-281.22
-421.82
0.00
32.85
65.70
98.55
131.40
164.25
197.10
229.95
262.80
손익(백만)


-562.43
가격

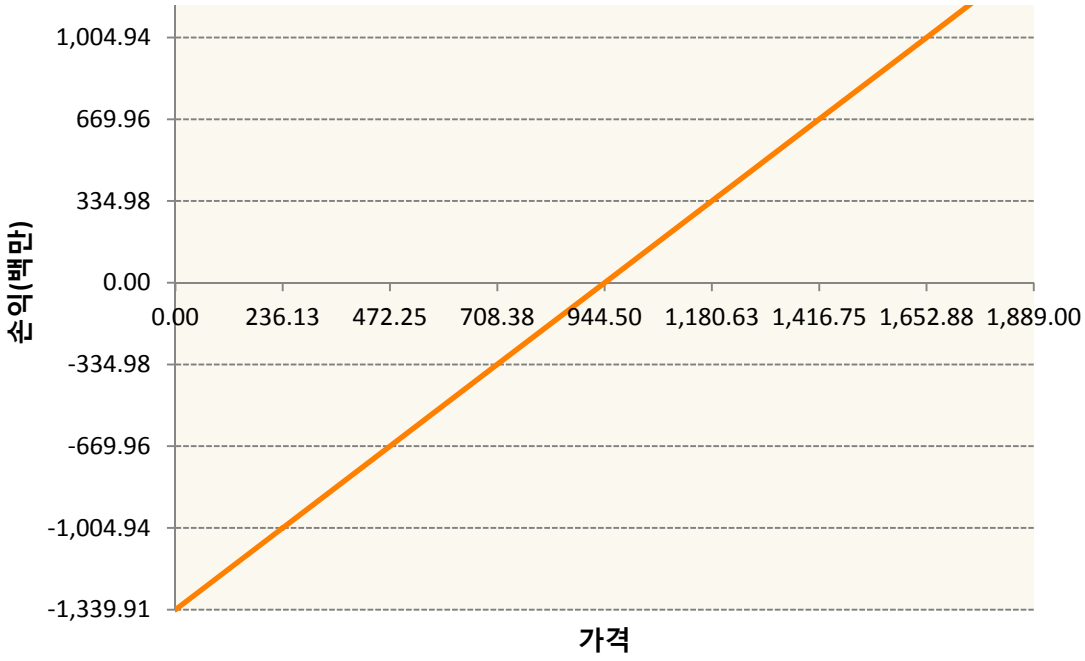

KR4175M90002-2017-09 달러선물
335.85
251.89
167.93
83.96
0.00
-83.96
-167.93
-251.89
-335.85
0.00
279.88
559.75
839.63
1,119.50
1,399.38
1,679.25
1,959.13
2,239.00
손익(백만)
가격

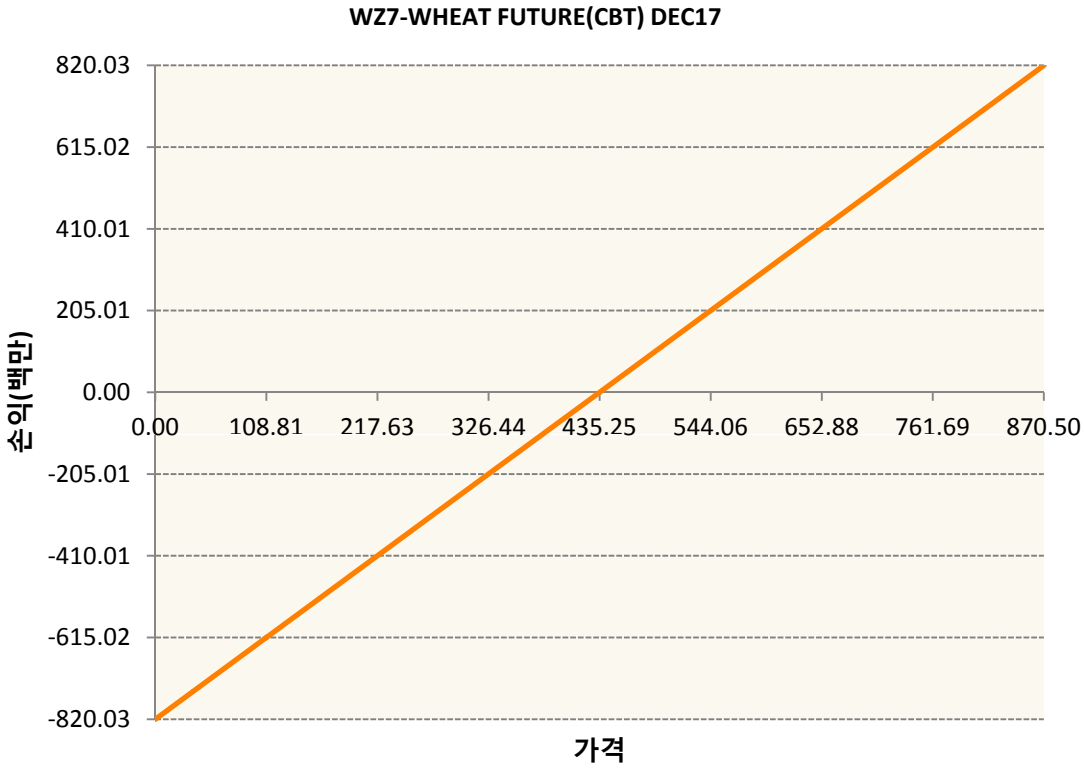

KWZ7-KC HRW WHEAT FUT DEC17
203.63
135.75
67.88
0.00
-67.88
-135.75
-203.63
-271.51
0.00
108.06
216.13
324.19
432.25
540.31
648.38
756.44
864.50
손익(백만)
가격


SBV7-SUGAR #11 (WORLD) OCT17
517.26
387.94
258.63
129.31
0.00
-129.31
-258.63
-387.94
-517.26
0.00
3.51
7.02
10.52
14.03
17.54
21.05
24.55
28.06
손익(백만)
가격


SMZ7-SOYBEAN MEAL FUTR DEC17
459.98
306.65
153.33
0.00
-153.33
-306.65
-459.98
-613.31
0.00
75.00
150.00
225.00
300.00
375.00
450.00
525.00
600.00
손익(백만)
가격


SX7-SOYBEAN FUTURE NOV17
1,339.91





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
BOZ7	SOYBEAN OIL FUTR DEC17	51
CTZ7	COTTON NO.2 FUTR DEC17	28
CZ7	CORN FUTURE DEC17	144
KCZ7	COFFEE 'C' FUTURE DEC17	45
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	66

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

652