공시일	2017-08-30
기준일	2017-08-29

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	2017-08-30
기준일	2017-08-29

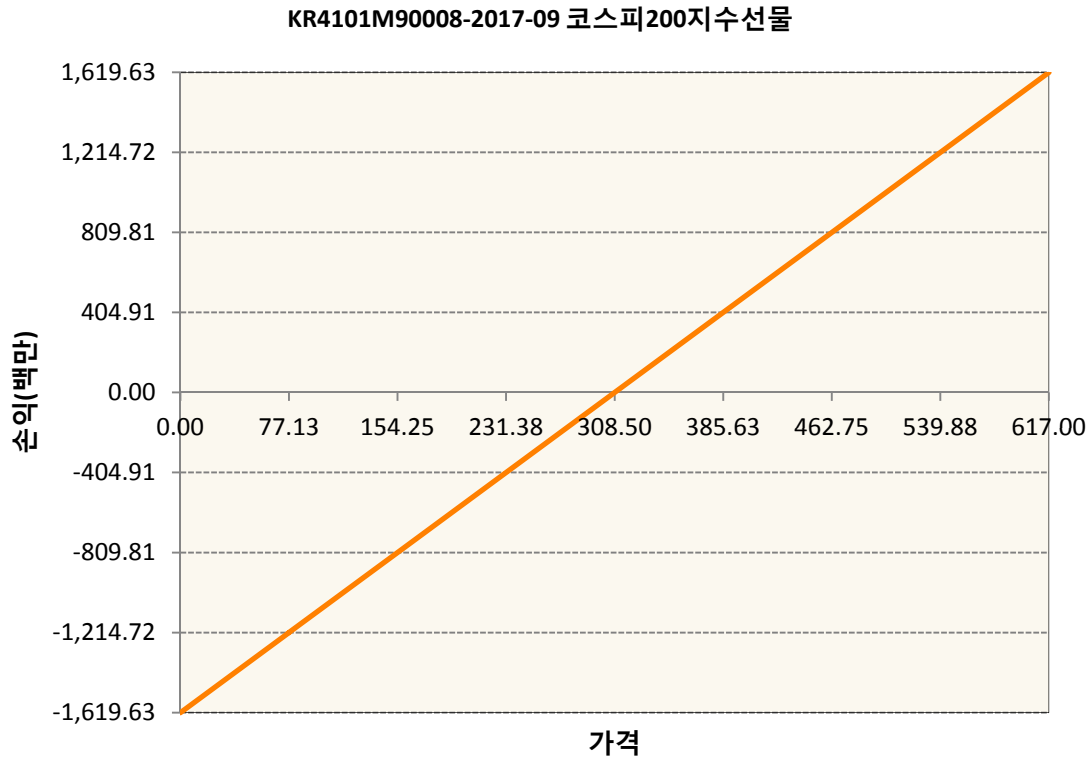
스마트인덱스모

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	1,620	0	1,620	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%	-86	-86	-86	-86	-86	-86	-86
-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%	86	86	86	86	86	86	86
8.00%	130	130	130	130	130	130	130

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

81

공시일	2017-08-30
기준일	2017-08-29

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	1,015

* 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	2017-08-30
기준일	2017-08-29

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	408

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

350

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-08-30
기준일	2017-08-29

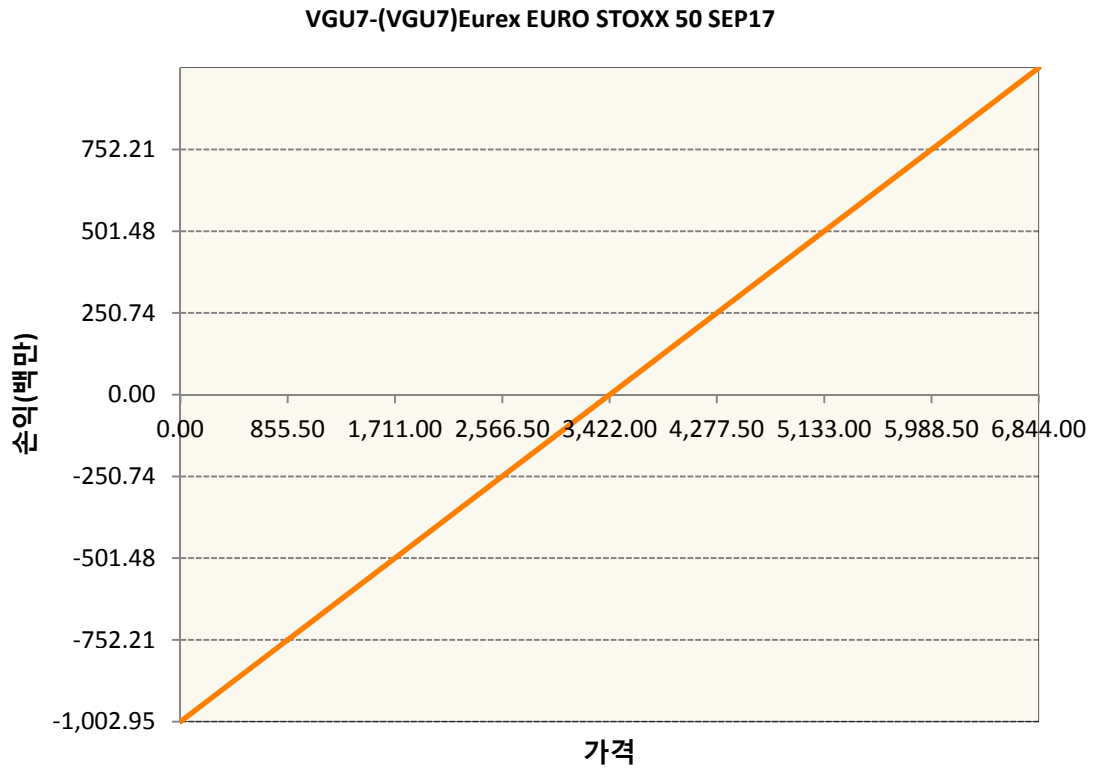
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,003	0	1,003	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGU7	(VGU7)Eurex EURO STOXX 50 SEP17	80

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

(단위:백만원)

64

공시일	2017-08-30
기준일	2017-08-29

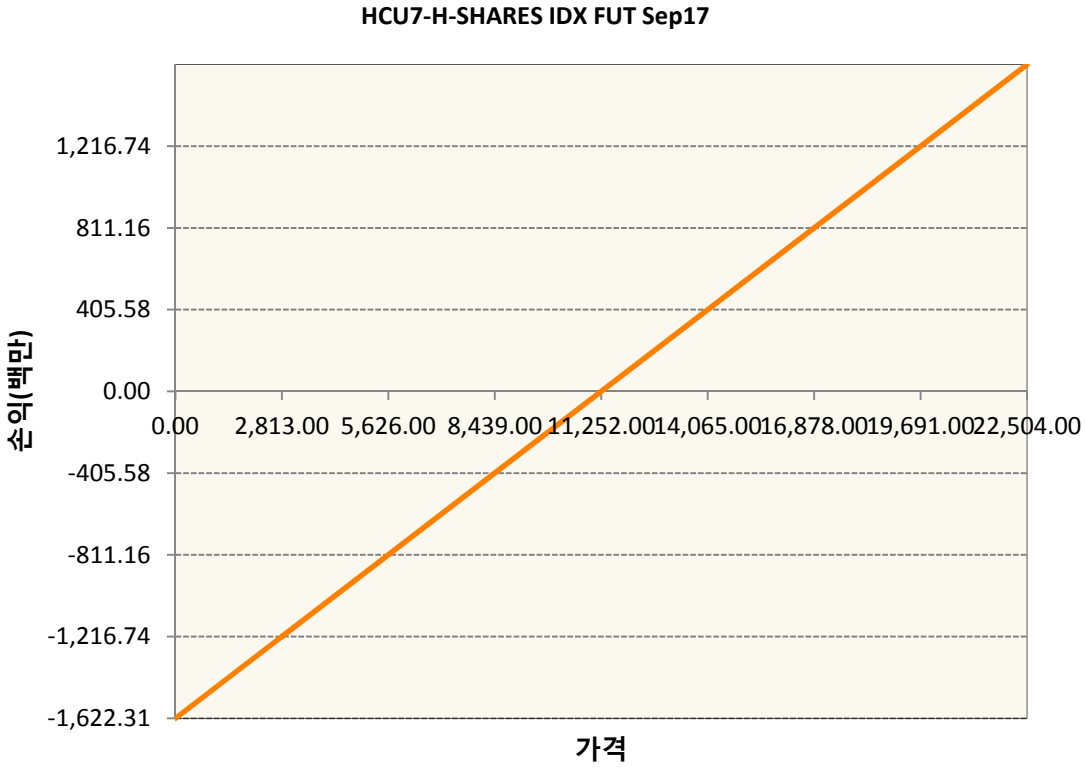
차이나인덱스모(주식-파생형)

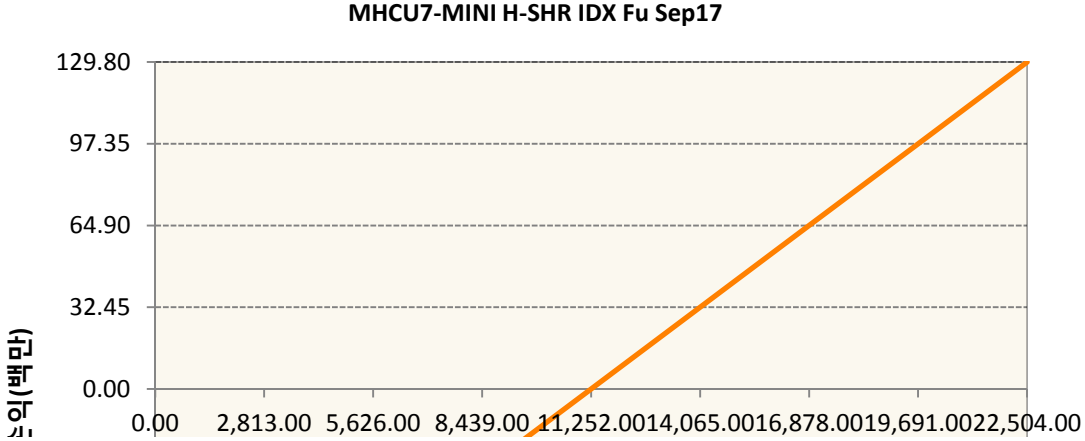
1. 계약금액

(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	1,622	0	1,622	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	2017-08-30
기준일	2017-08-29

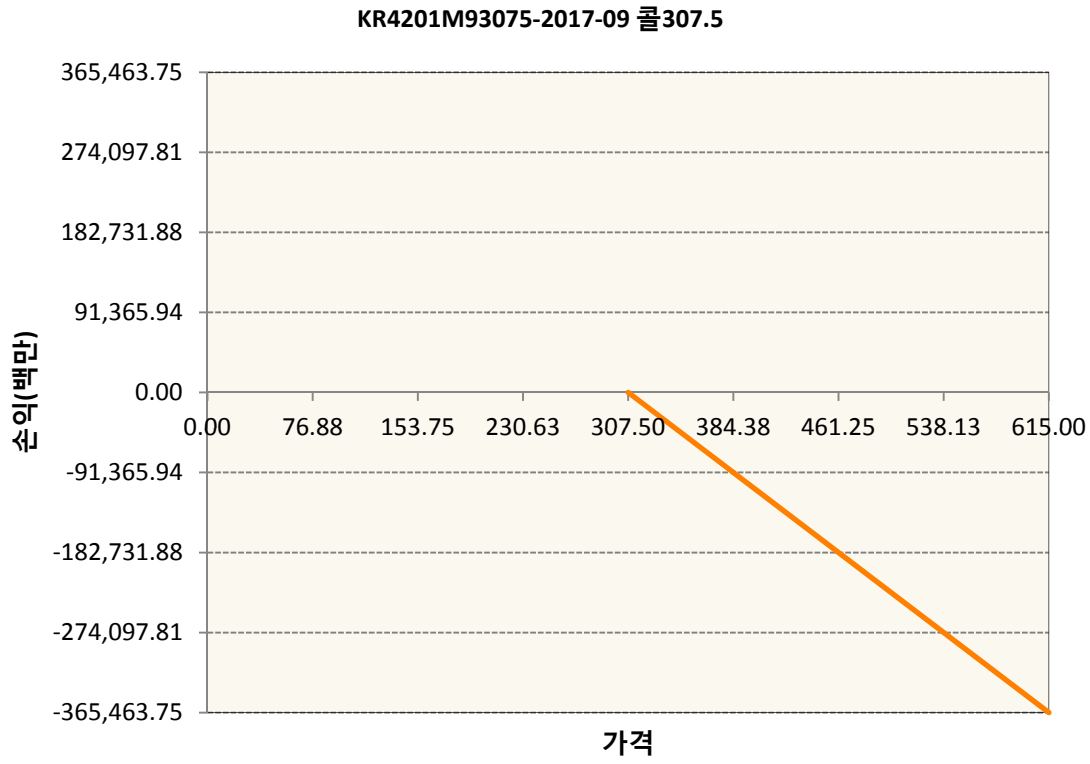
커버드콜모(주식혼합-파생형)

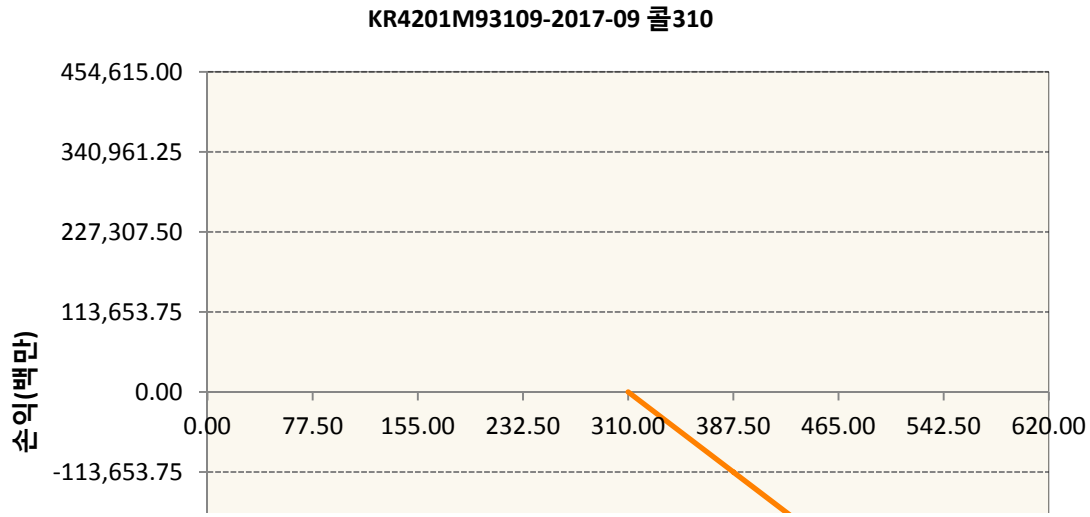
1. 계약금액

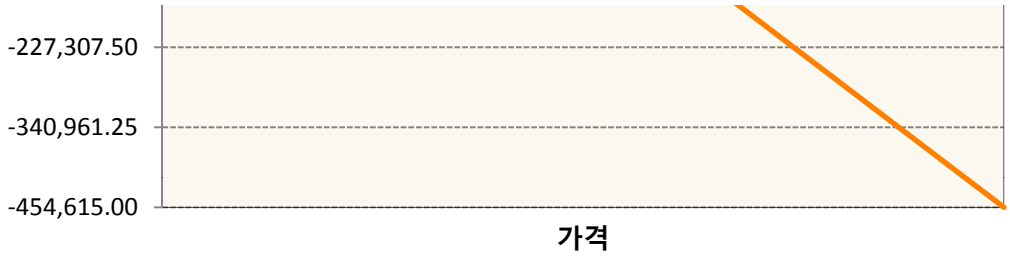
(단위:백만원)

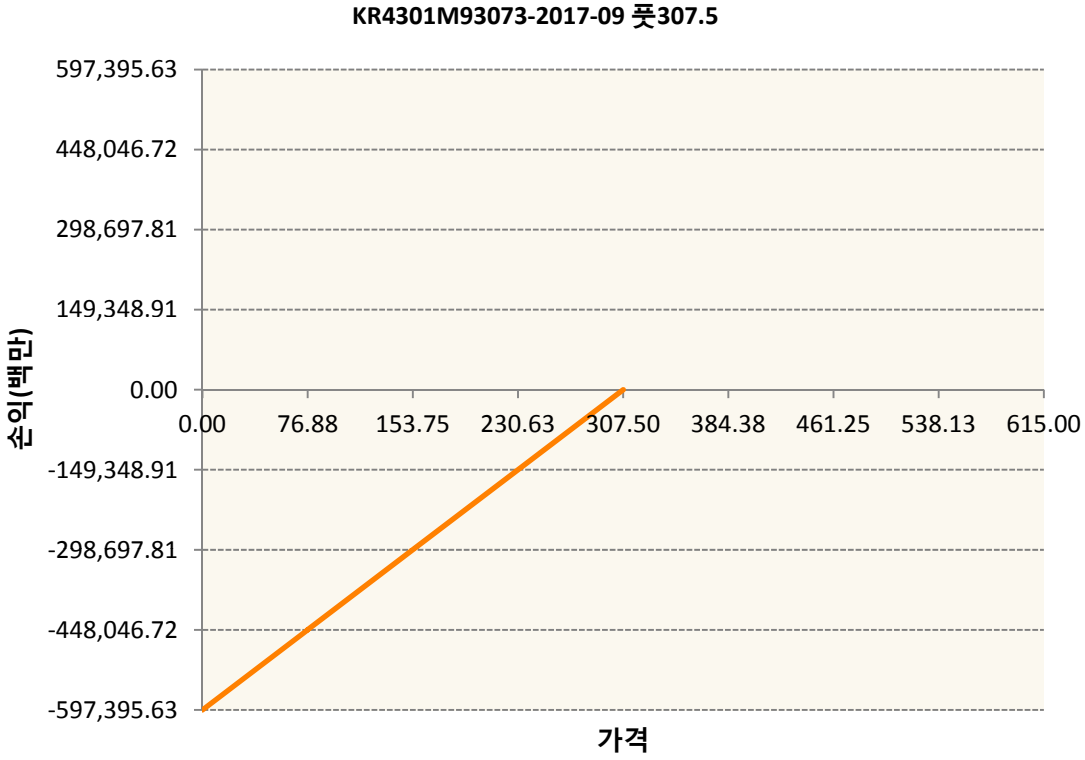
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	15,659	-15,659	장내
누계	유가증권	옵션	0	1,481,722	-1,481,722	장내

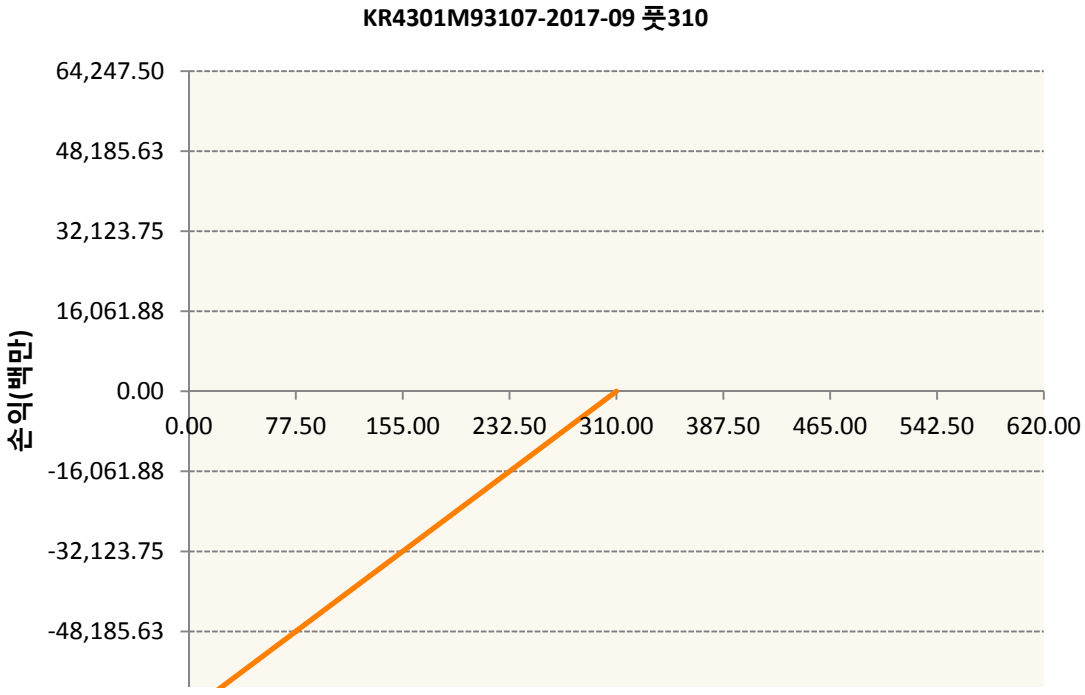
2. 만기시점의 손익구조






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


KR4301M93073-2017-09 풋307.5
597,395.63
448,046.72
298,697.81
149,348.91
0.00
-149,348.91
-298,697.81
-448,046.72
-597,395.63
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
64,247.50
48,185.63
32,123.75
16,061.88
0.00
-16,061.88
-32,123.75
-48,185.63
0.00
77.50
155.00
232.50
310.00
387.50
465.00
542.50
620.00
손익(백만)



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4201M93(2017-09 콜307.5							23,892
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	7,693	7,628	7,532	7,403	7,241	7,048	6,826
-5.33%	7,291	7,057	6,781	6,469	6,127	5,759	5,369
-2.67%	5,698	5,216	4,718	4,207	3,686	3,156	2,620
0%	1,758	1,173	586	0	-587	-1,174	-1,761
2.67%	-4,909	-5,348	-5,811	-6,295	-6,794	-7,306	-7,828
5.33%	-13,513	-13,723	-13,977	-14,271	-14,599	-14,956	-15,340
8.00%	-22,981	-23,048	-23,148	-23,283	-23,452	-23,656	-23,892
KR4201M93: 2017-09 콜310							27,999
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	7,744	7,693	7,611	7,495	7,341	7,151	6,925
-5.33%	7,439	7,225	6,959	6,645	6,290	5,898	5,474
-2.67%	6,052	5,539	4,994	4,423	3,831	3,223	2,600
0%	2,175	1,451	726	0	-726	-1,452	-2,179
2.67%	-5,071	-5,698	-6,344	-7,004	-7,676	-8,357	-9,045
5.33%	-15,090	-15,436	-15,834	-16,276	-16,755	-17,265	-17,802
8.00%	-26,546	-26,672	-26,846	-27,069	-27,338	-27,649	-27,999
KR4301M93(2017-09 풋307.5							36,779
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-35,362	-35,468	-35,625	-35,836	-36,100	-36,415	-36,779
-5.33%	-20,040	-20,423	-20,874	-21,383	-21,942	-22,543	-23,181
-2.67%	-6,664	-7,452	-8,267	-9,102	-9,954	-10,820	-11,695
0%	2,874	1,917	959	0	-959	-1,918	-2,878
2.67%	7,954	7,237	6,480	5,690	4,874	4,037	3,183
5.33%	9,870	9,526	9,111	8,631	8,095	7,510	6,883
8.00%	10,371	10,261	10,099	9,878	9,601	9,268	8,882
KR4301M93: 2017-09 풋310							4,135
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-4,019	-4,027	-4,038	-4,055	-4,076	-4,103	-4,135
-5.33%	-2,358	-2,388	-2,426	-2,470	-2,520	-2,576	-2,636
-2.67%	-849	-922	-999	-1,080	-1,163	-1,249	-1,337
0%	307	205	103	0	-103	-205	-308
2.67%	988	899	808	715	620	524	426

5.33%	1,277	1,228	1,172	1,109	1,041	969	893
8.00%	1,362	1,344	1,320	1,288	1,250	1,206	1,157

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

95,629

공시일	2017-08-30
기준일	2017-08-29

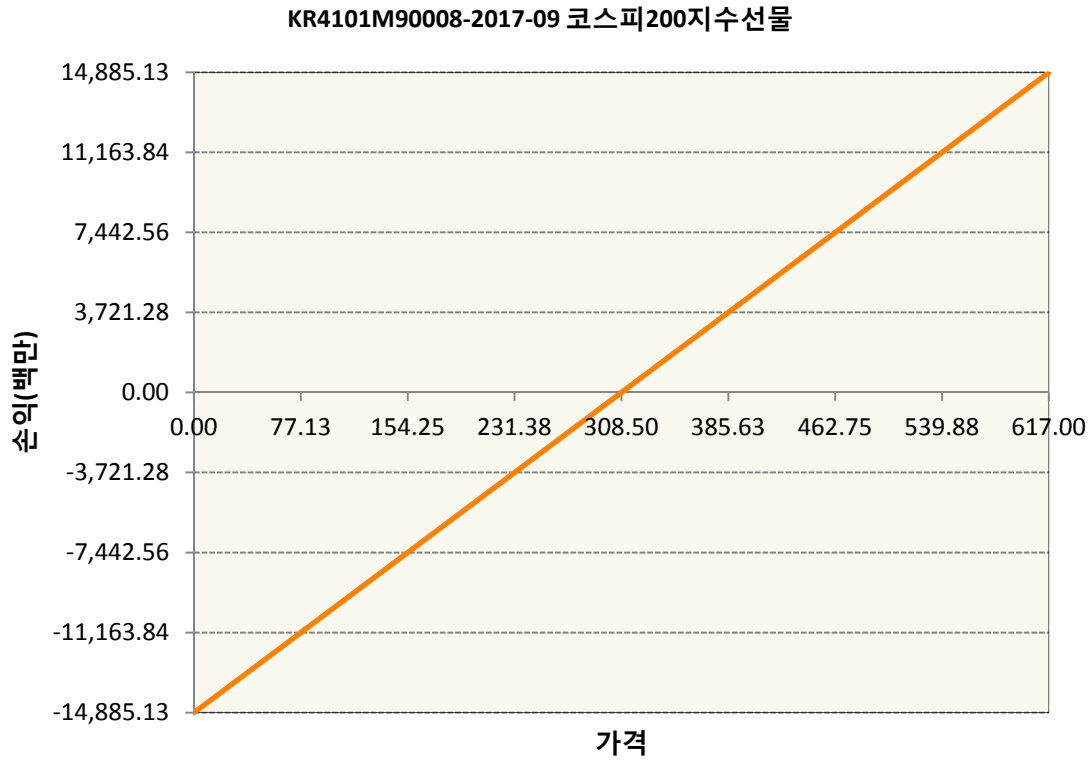
ETF스마트레버리지목표전환형6호

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	14,885	0	14,885	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101M90(2017-09 코스피200지수선물							1,191
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,191	-1,191	-1,191	-1,191	-1,191	-1,191	-1,191
-5.33%	-794	-794	-794	-794	-794	-794	-794
-2.67%	-397	-397	-397	-397	-397	-397	-397
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	397	397	397	397	397	397	397
5.33%	794	794	794	794	794	794	794
8.00%	1,191	1,191	1,191	1,191	1,191	1,191	1,191

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

742

공시일	2017-08-30
기준일	2017-08-29

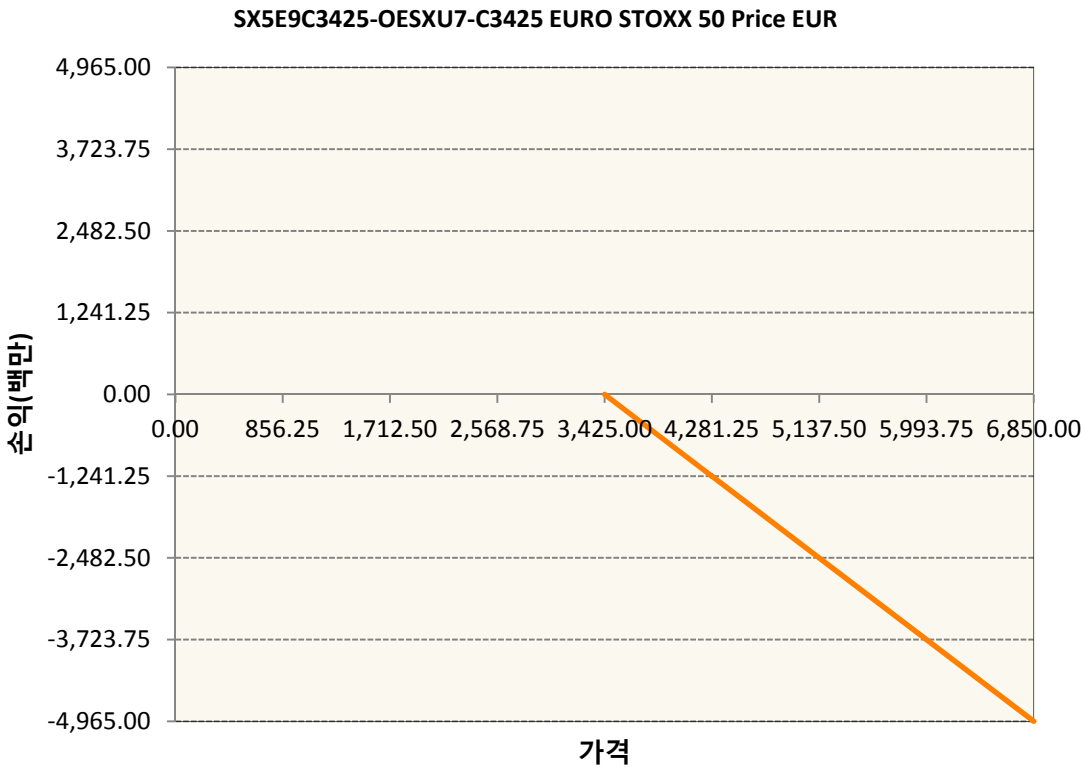
유로커버드콜(주식혼합-파생형)

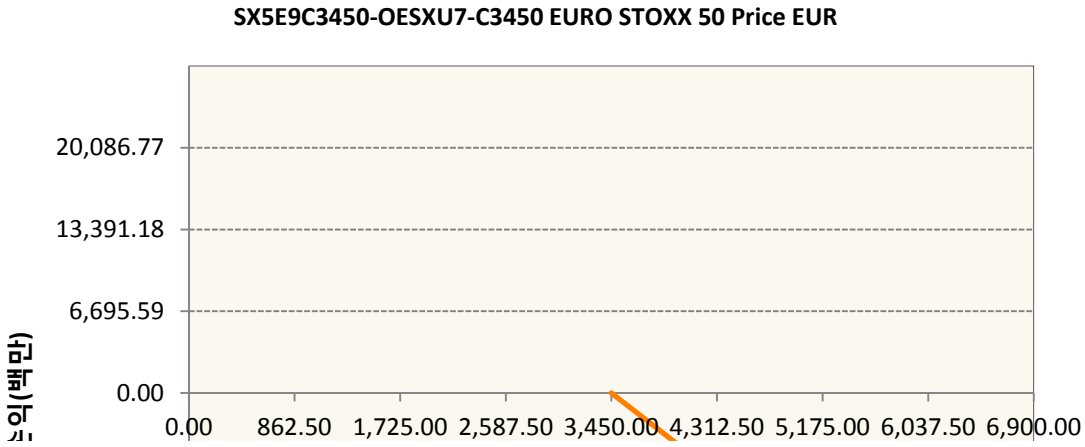
1. 계약금액

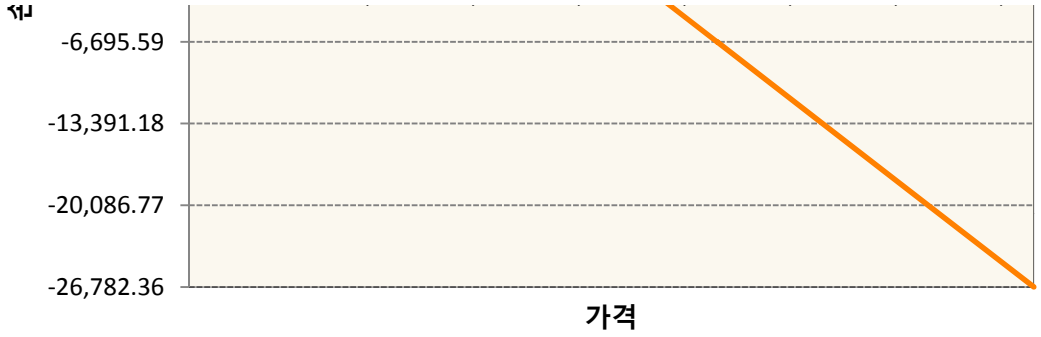
(단위:백만원)

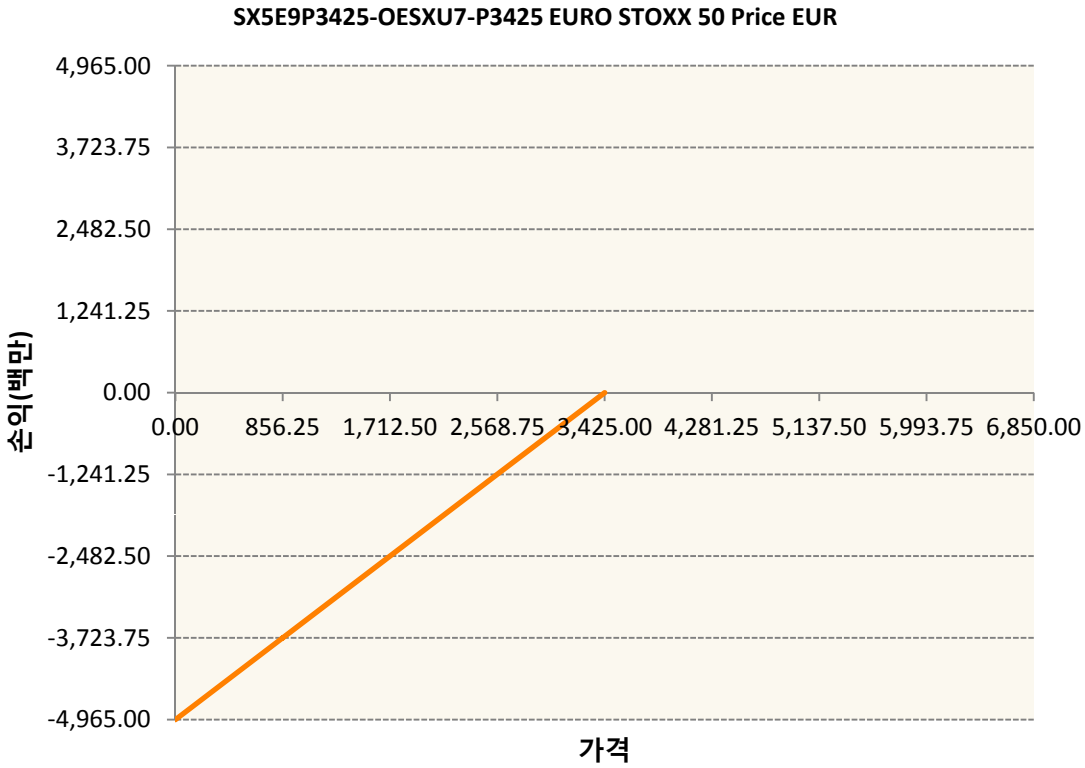
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	26,930	0	26,930	
누계	유가증권	옵션	0	63,301	-63,301	장내

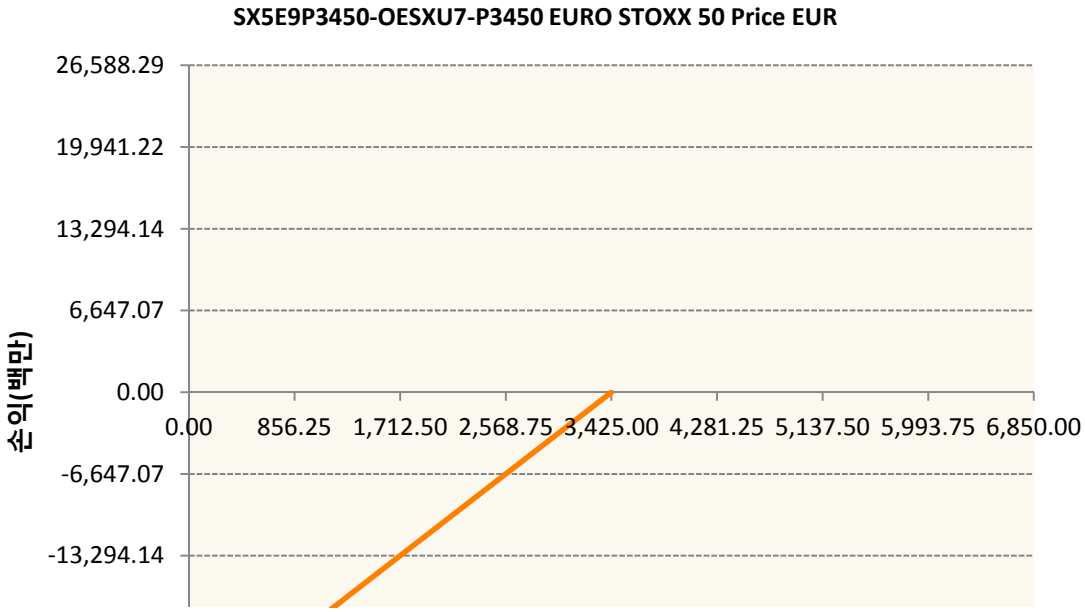
2. 만기시점의 손익구조

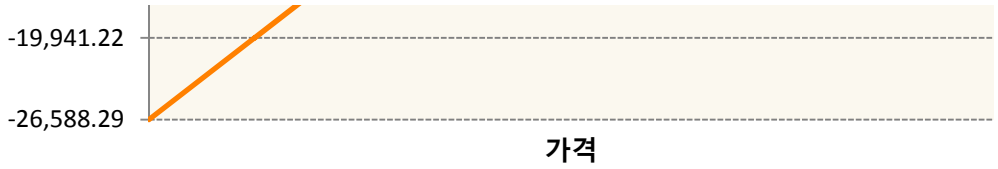


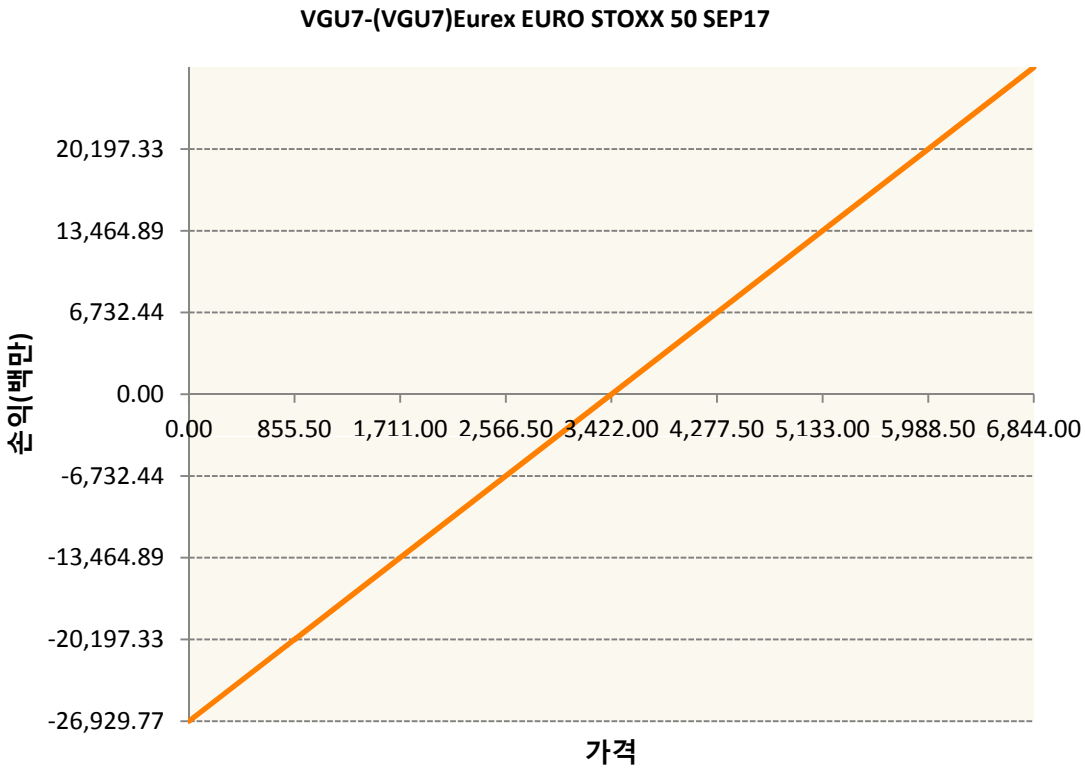



-6,695.59
-13,391.18
-20,086.77
-26,782.36
가격


SX5E9P3425-OESXU7-P3425 EURO STOXX 50 Price EUR
4,965.00
3,723.75
2,482.50
1,241.25
0.00
-1,241.25
-2,482.50
-3,723.75
-4,965.00
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
26,588.29
19,941.22
13,294.14
6,647.07
0.00
-6,647.07
-13,294.14
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)





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
SX5E9C3425	OESXU7-C3425 EURO STOXX 50 Price EUR	397
SX5E9C3450	OESXU7-C3450 EURO STOXX 50 Price EUR	2,143
SX5E9P3425	OESXU7-P3425 EURO STOXX 50 Price EUR	397
SX5E9P3450	OESXU7-P3450 EURO STOXX 50 Price EUR	2,127
VGU7	(VGU7)Eurex EURO STOXX 50 SEP17	2,154

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	5,802

공시일	2017-08-30
기준일	2017-08-29

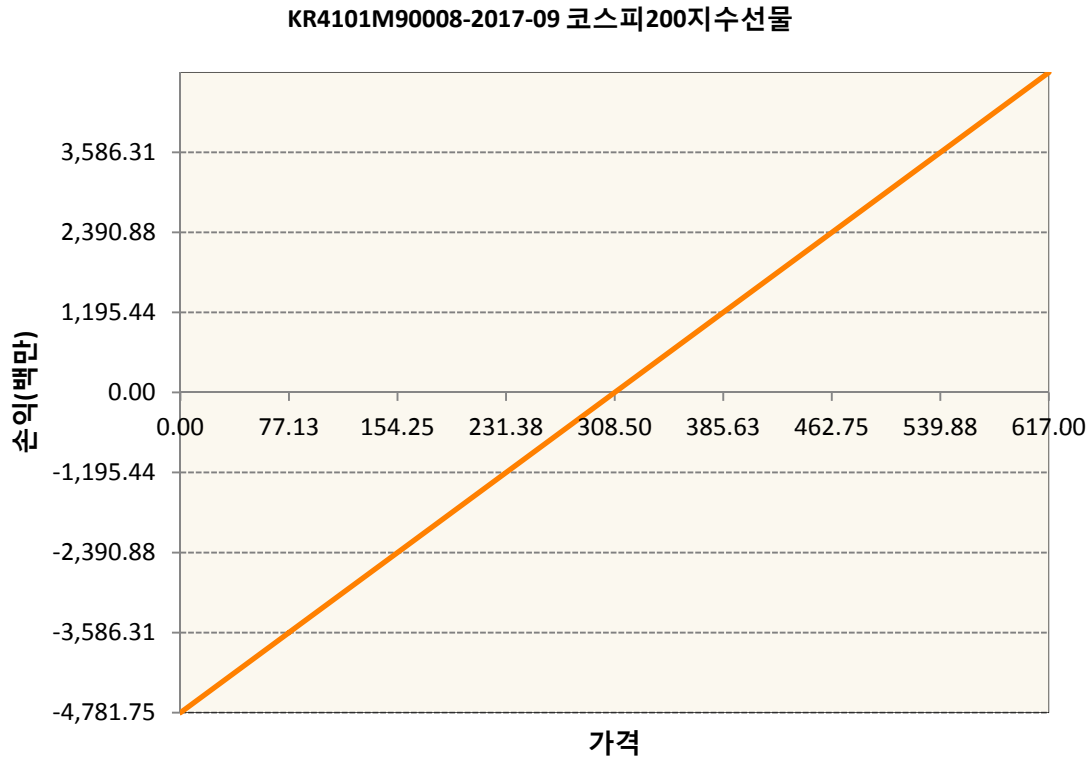
ETF스마트레버리지목표전환형7호

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	4,782	0	4,782	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101M90(2017-09 코스피200지수선물							383
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-383	-383	-383	-383	-383	-383	-383
-5.33%	-255	-255	-255	-255	-255	-255	-255
-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%	255	255	255	255	255	255	255
8.00%	383	383	383	383	383	383	383

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

238

공시일	2017-08-30
기준일	2017-08-29

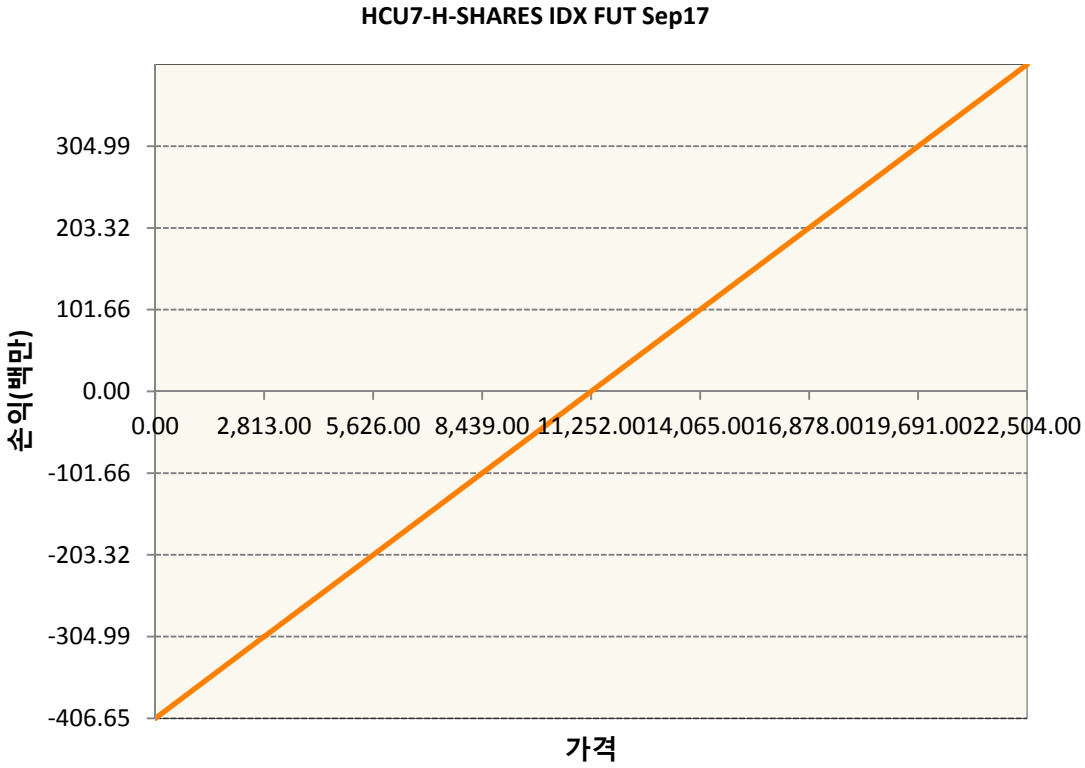
홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생

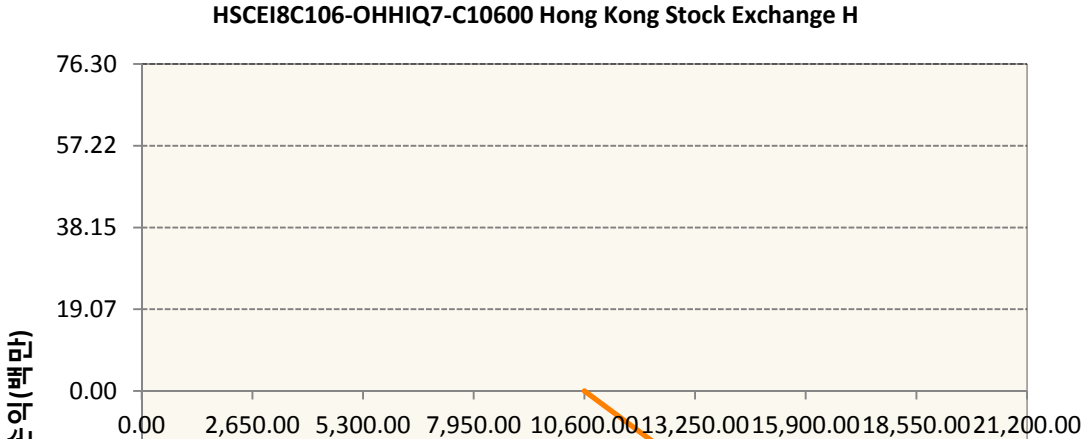
1. 계약금액

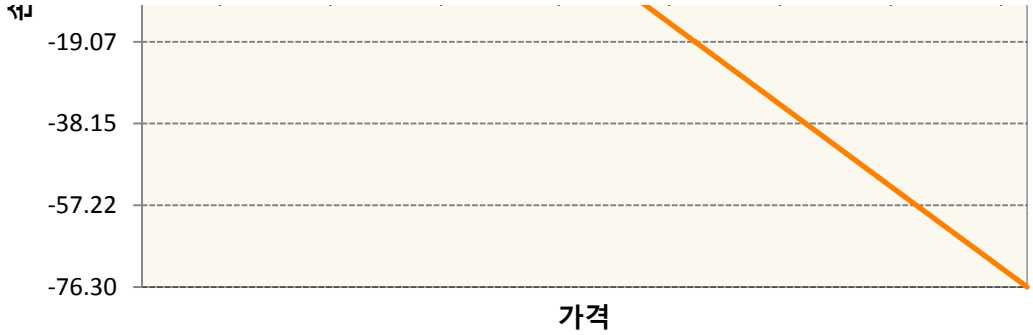
(단위:백만원)

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	407	0	407	장내
누계	유가증권	옵션	0	775	-775	장내

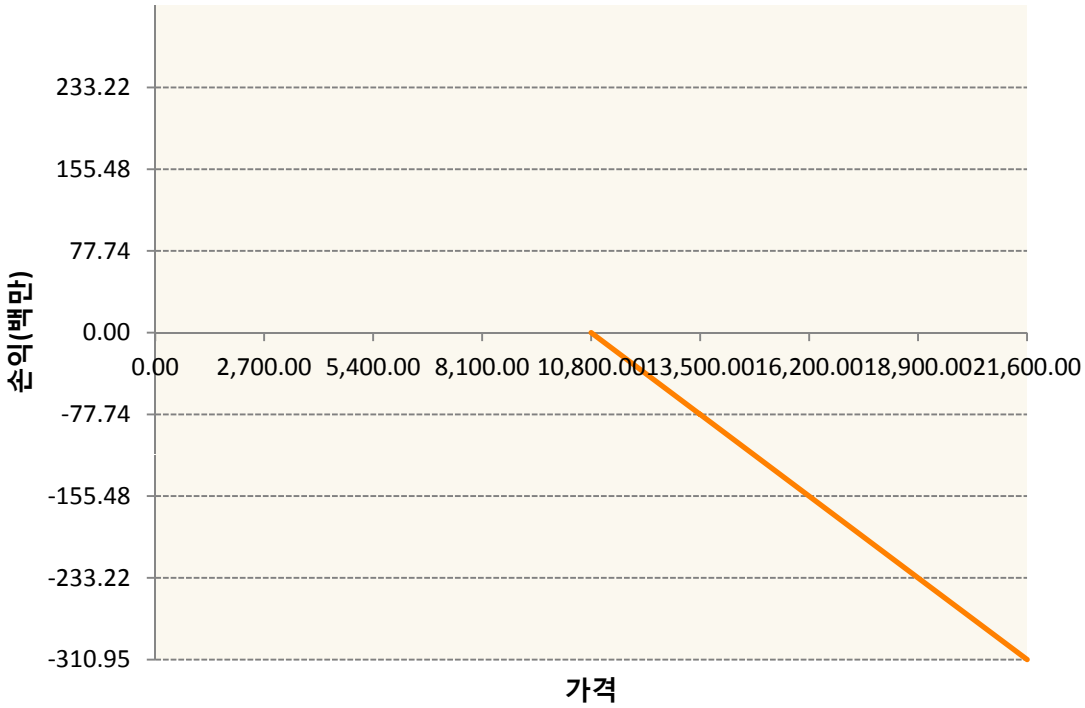
2. 만기시점의 손익구조



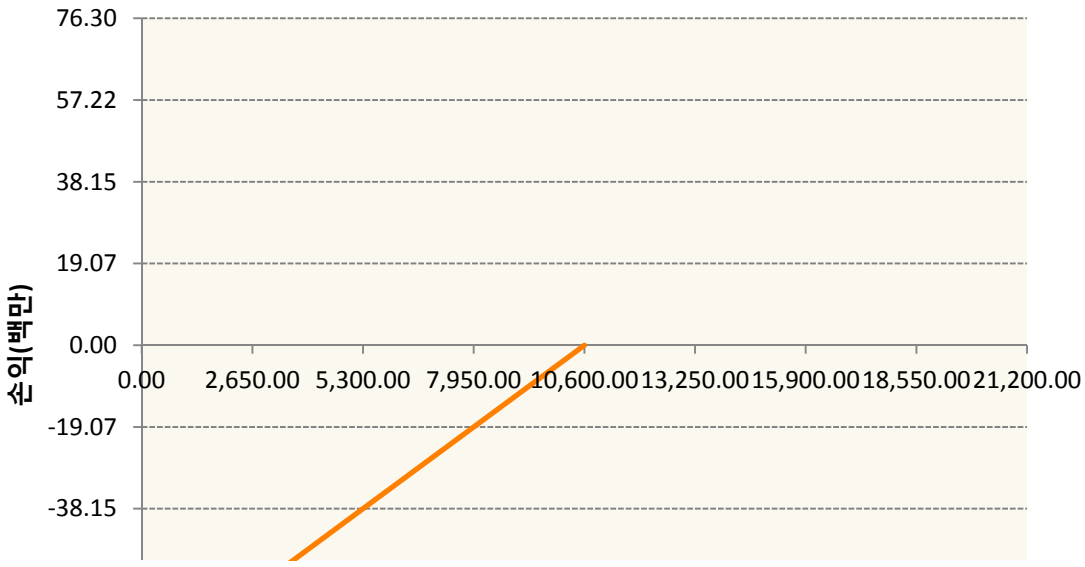


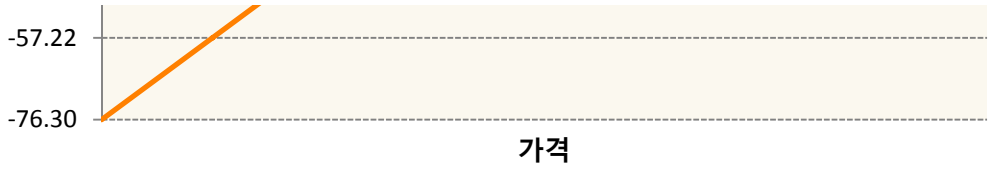


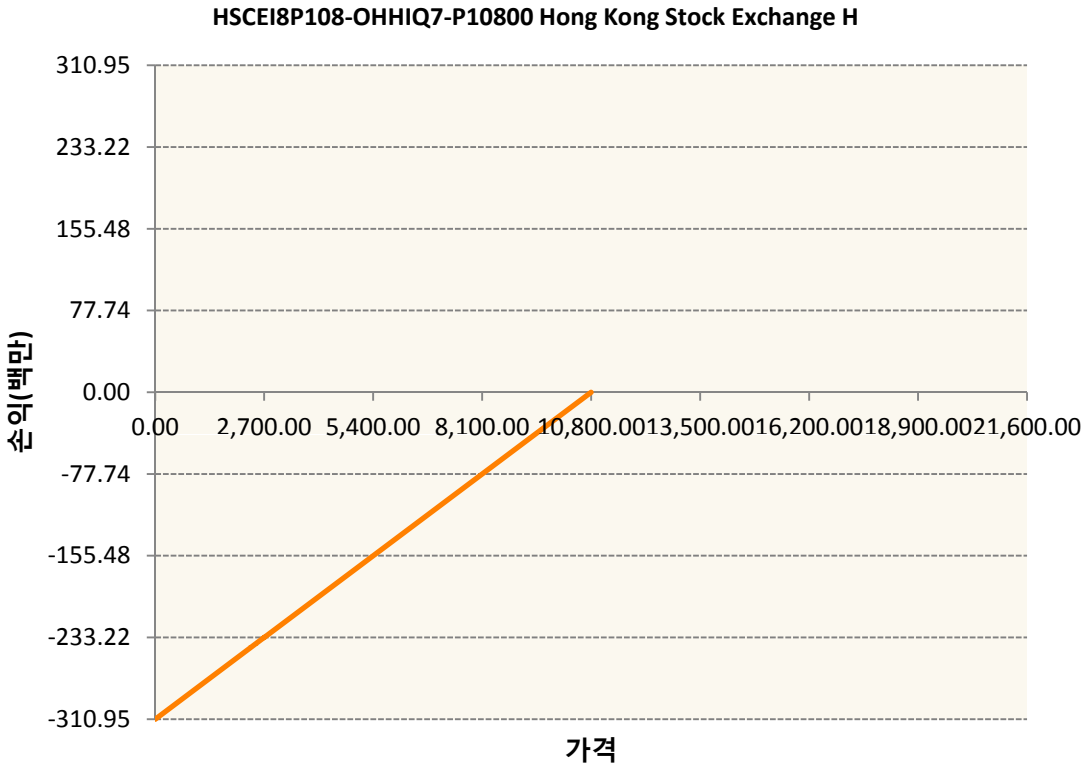
HSCEI8C108-OHHIQ7-C10800 Hong Kong Stock Exchange H



HSCEI8P106-OHHIQ7-P10600 Hong Kong Stock Exchange H







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCU7	H-SHARES IDX FUT Sep17	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	2017-08-30
기준일	2017-08-29

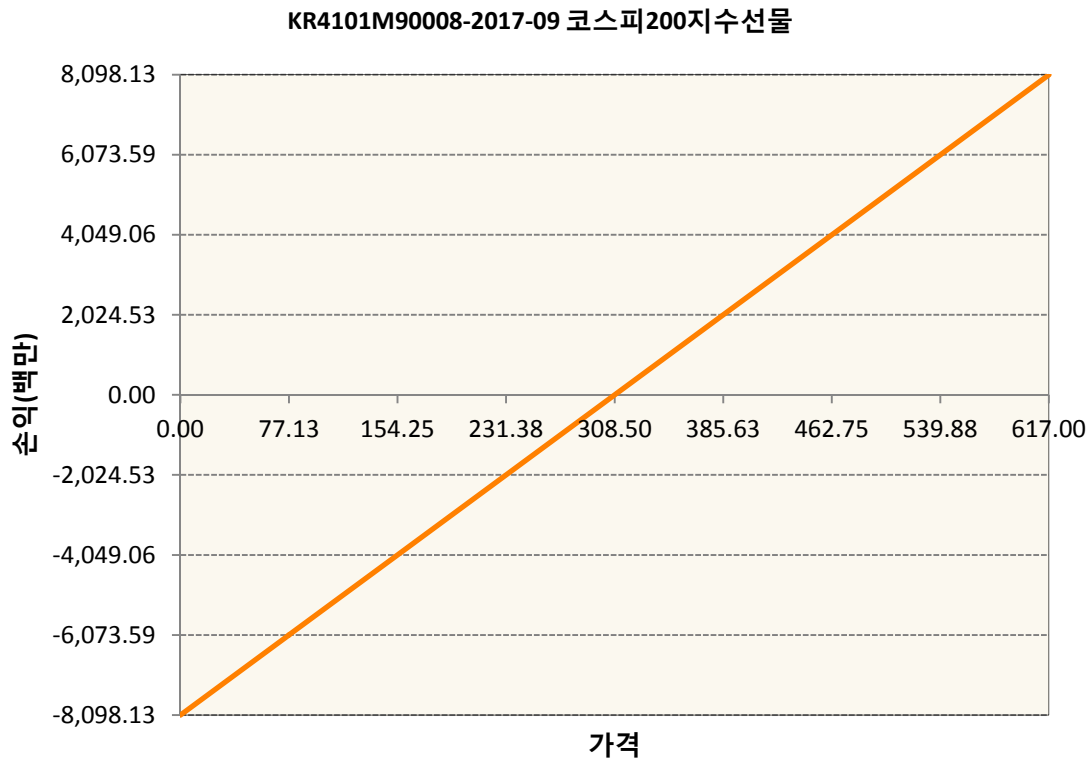
코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼

1. 계약금액

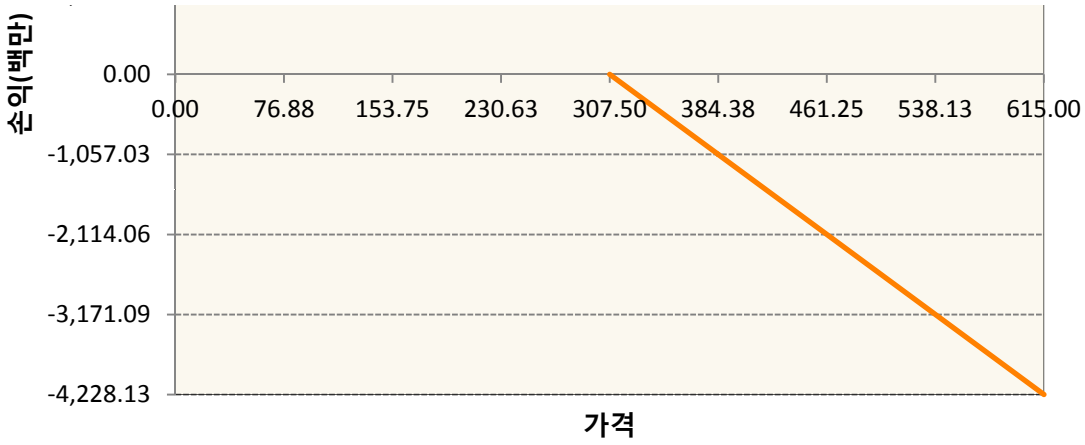
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	3,449	0	3,449	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	3,498	-3,498	장내
누계	유가증권	선물	8,098	0	8,098	장내
누계	유가증권	스왑	15,000	0	15,000	장외
누계	유가증권	옵션	0	18,119	-18,119	장내

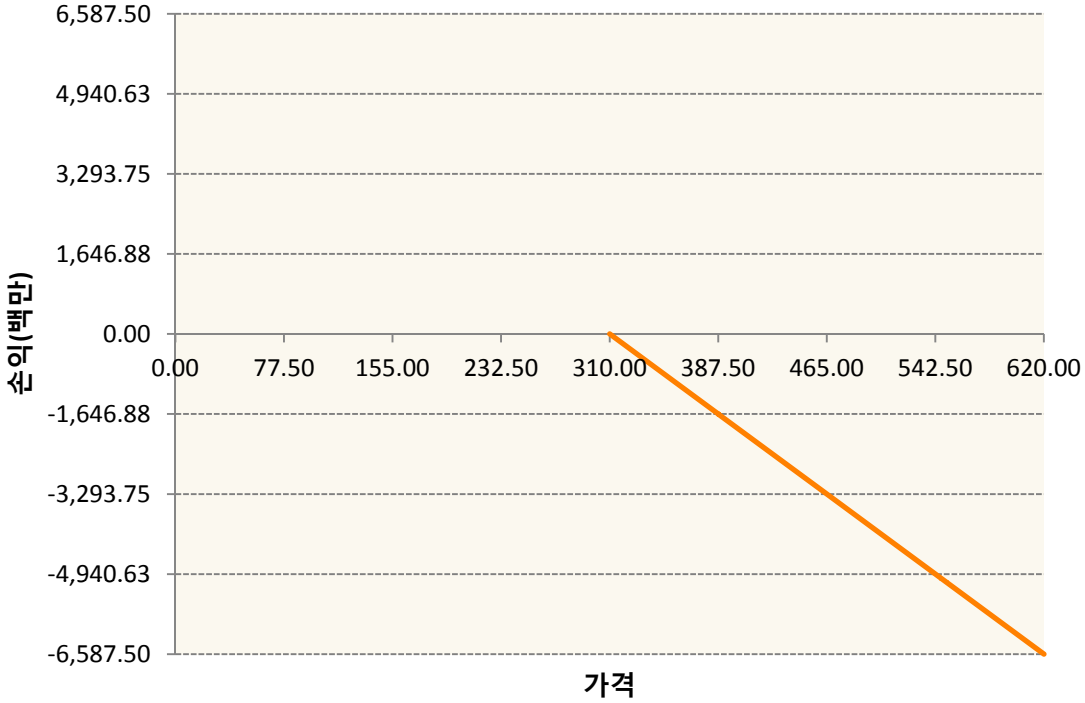
2. 만기시점의 손익구조



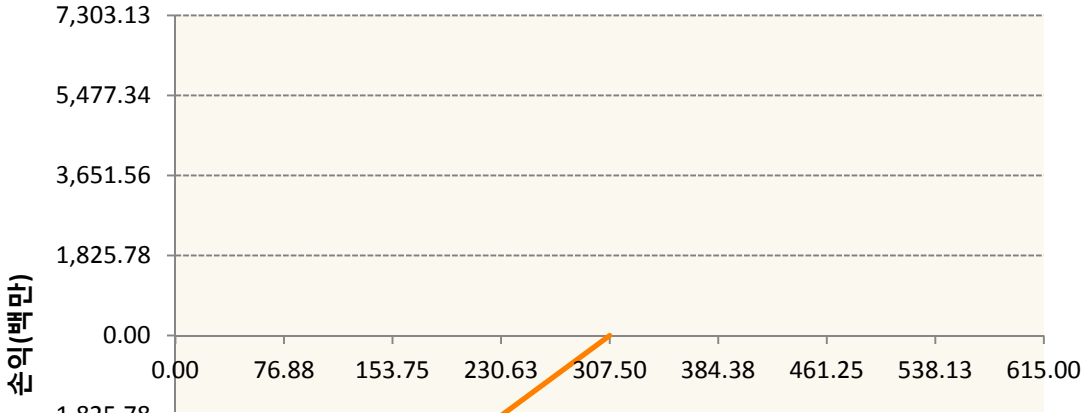




KR4201M93109-2017-09 콜310



KR4301M93073-2017-09 풋307.5





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX							0
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	0	0	0	0	0	0	0
-5.33%	0	0	0	0	0	0	0
-2.67%	0	0	0	0	0	0	0
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	0	0	0	0	0	0	0
5.33%	0	0	0	0	0	0	0
8.00%	0	0	0	0	0	0	0
KR4101M90(2017-09 코스피200지수선물							648
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-648	-648	-648	-648	-648	-648	-648
-5.33%	-432	-432	-432	-432	-432	-432	-432
-2.67%	-216	-216	-216	-216	-216	-216	-216
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	216	216	216	216	216	216	216
5.33%	432	432	432	432	432	432	432
8.00%	648	648	648	648	648	648	648
KR4201M93(2017-09 콜307.5							276
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	89	88	87	86	84	82	79
-5.33%	84	82	78	75	71	67	62
-2.67%	66	60	55	49	43	37	30
0%	20	14	7	0	-7	-14	-20
2.67%	-57	-62	-67	-73	-79	-85	-91
5.33%	-156	-159	-162	-165	-169	-173	-177
8.00%	-266	-267	-268	-269	-271	-274	-276
KR4201M93: 2017-09 콜310							406
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%

-8.00%	112	111	110	109	106	104	100
-5.33%	108	105	101	96	91	85	79
-2.67%	88	80	72	64	56	47	38
0%	32	21	11	0	-11	-21	-32
2.67%	-73	-83	-92	-101	-111	-121	-131
5.33%	-219	-224	-229	-236	-243	-250	-258
8.00%	-385	-386	-389	-392	-396	-401	-406
	KR4301M93(2017-09 풋307.5						450
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-432	-434	-436	-438	-441	-445	-450
-5.33%	-245	-250	-255	-261	-268	-276	-283
-2.67%	-81	-91	-101	-111	-122	-132	-143
0%	35	23	12	0	-12	-23	-35
2.67%	97	88	79	70	60	49	39
5.33%	121	116	111	106	99	92	84
8.00%	127	125	123	121	117	113	109

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

1,568

공시일	2017-08-30
기준일	2017-08-29

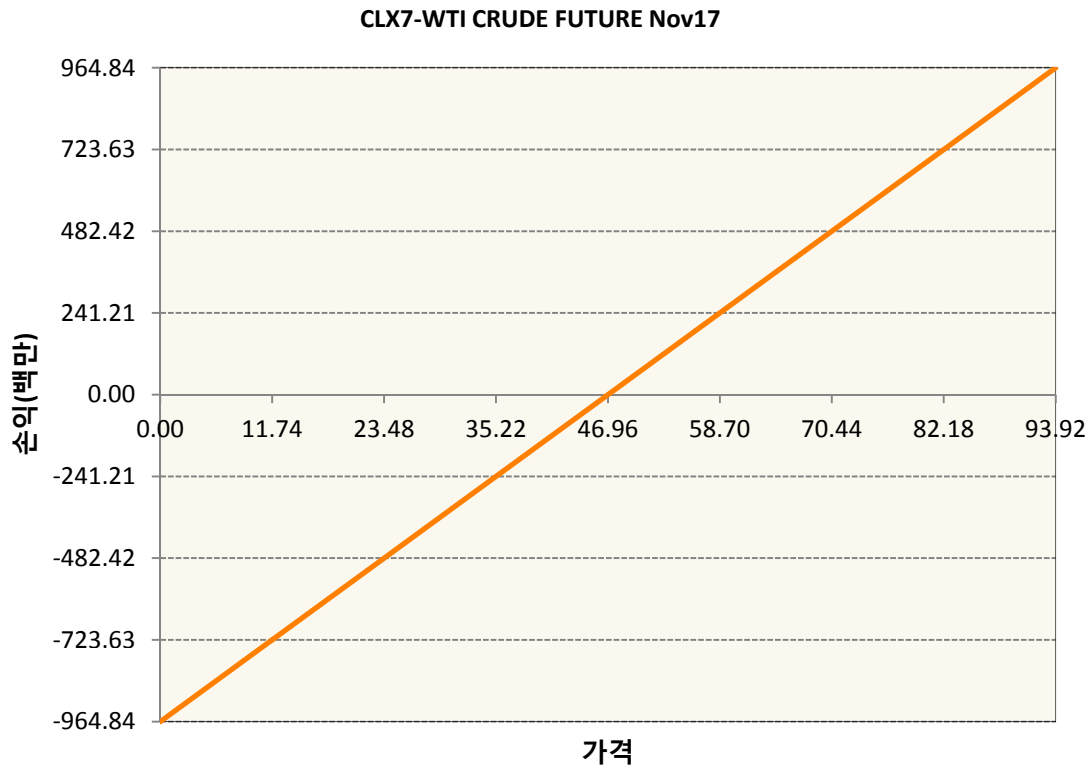
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

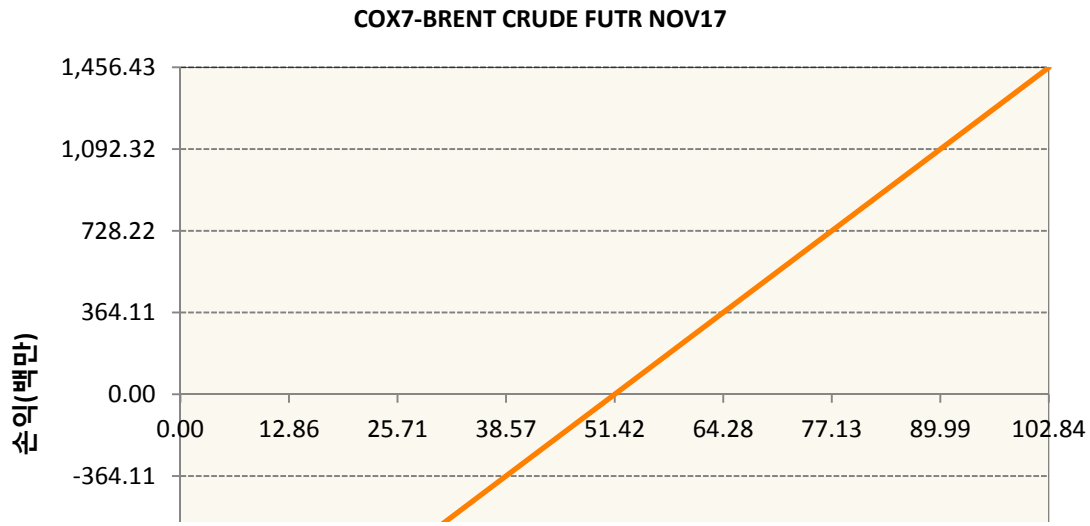
1. 계약금액

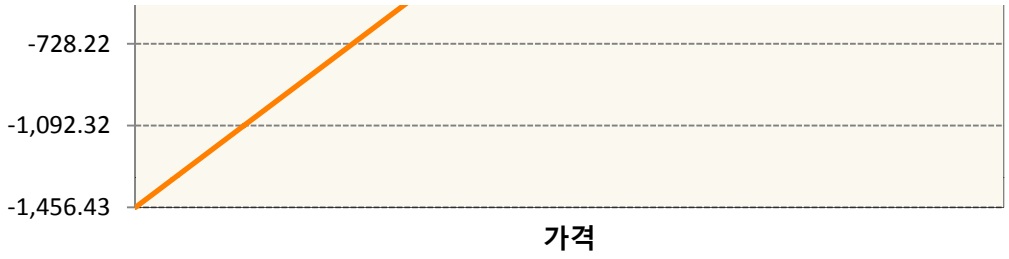
(단위:백만원)

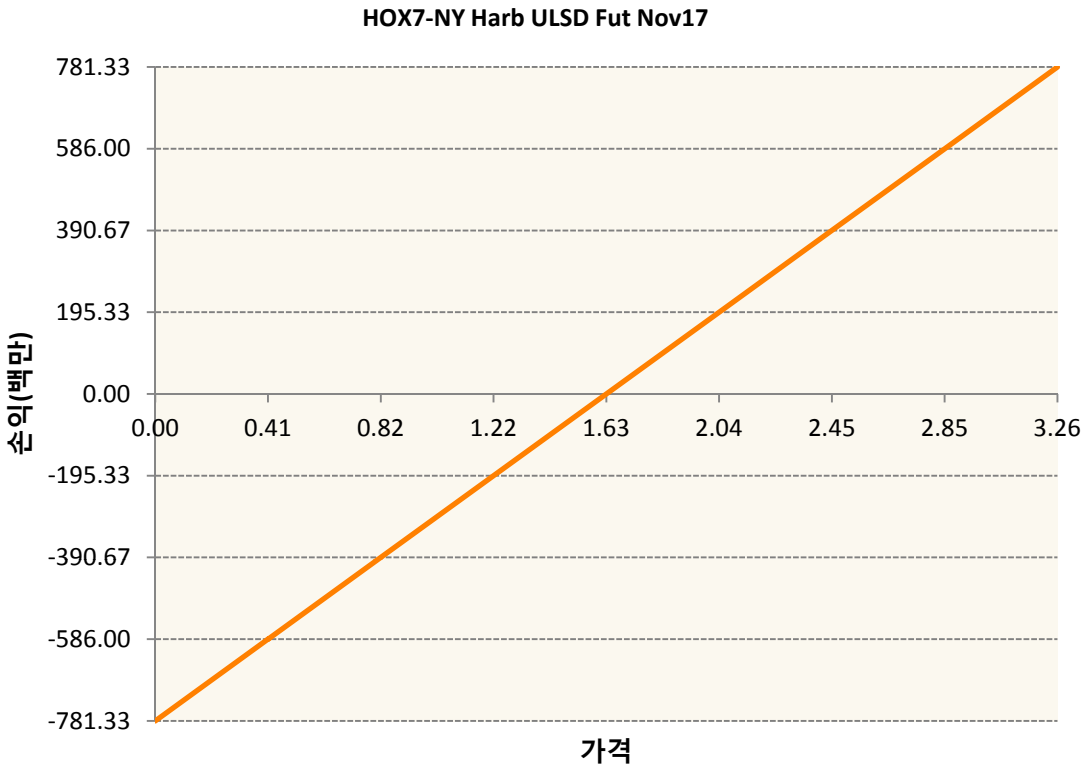
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	5,376	507	4,870	

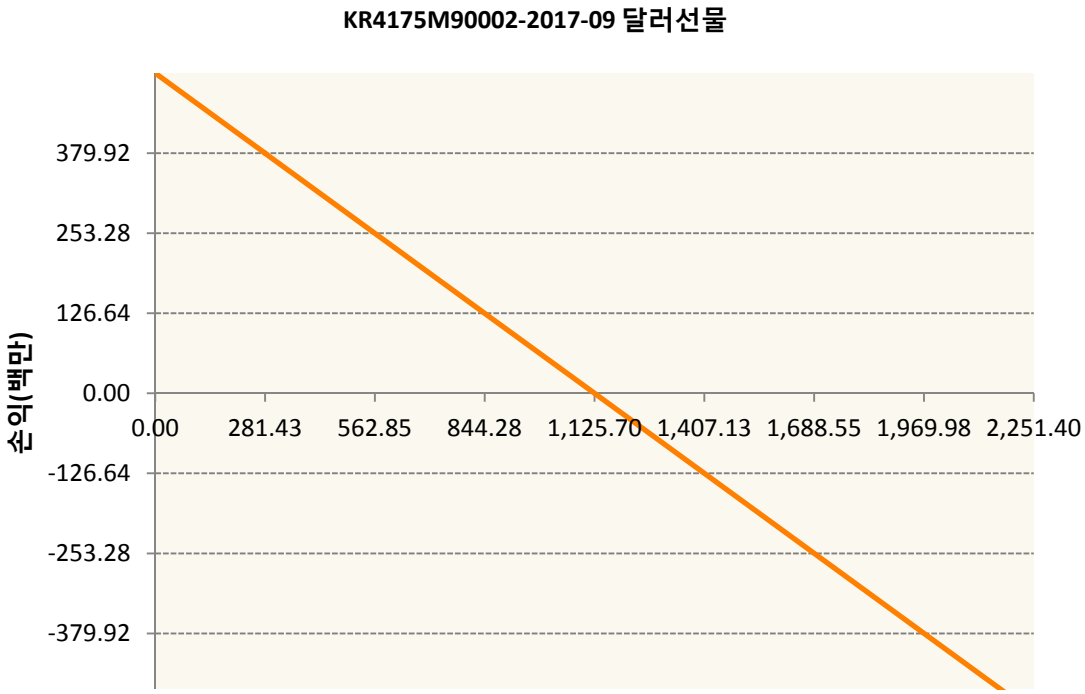
2. 만기시점의 손익구조

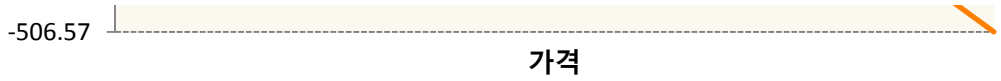


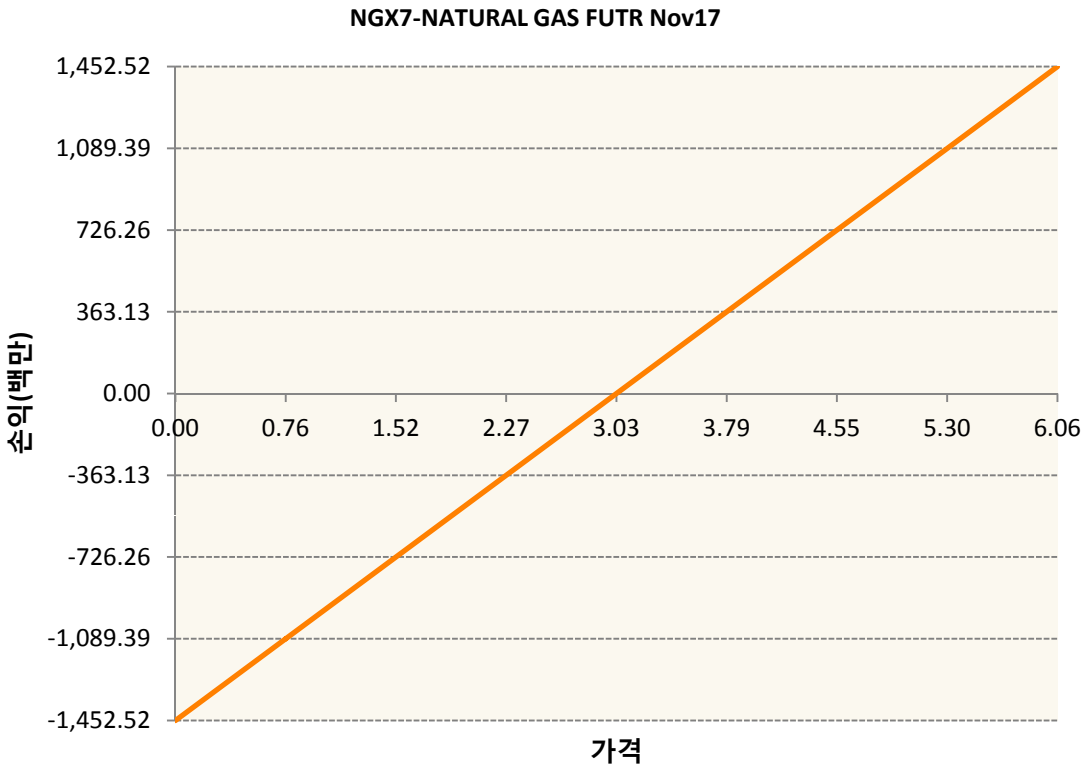


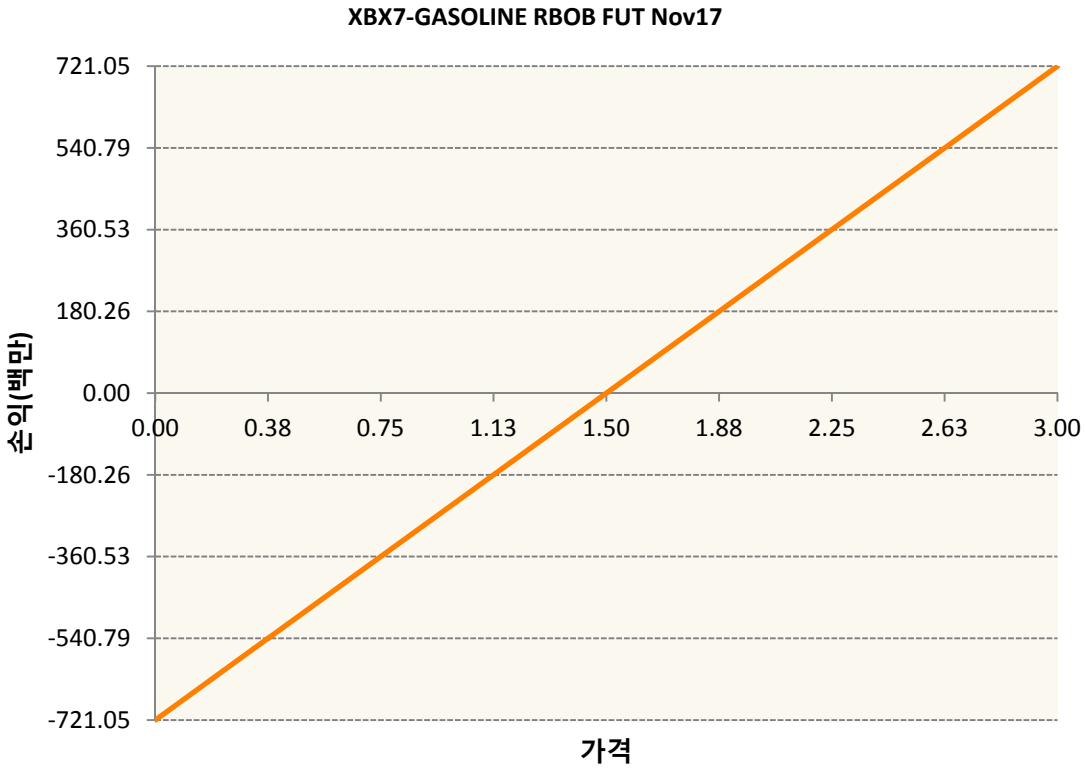

-728.22
-1,092.32
-1,456.43
가격


HOX7-NY Harb ULSD Fut Nov17
781.33
586.00
390.67
195.33
0.00
-195.33
-390.67
-586.00
-781.33
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
379.92
253.28
126.64
0.00
-126.64
-253.28
-379.92
0.00
281.43
562.85
844.28
1,125.70
1,407.13
1,688.55
1,969.98
2,251.40
손익(백만)


-506.57
가격


NGX7-NATURAL GAS FUTR Nov17
1,452.52
1,089.39
726.26
363.13
0.00
-363.13
-726.26
-1,089.39
-1,452.52
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
721.05
540.79
360.53
180.26
0.00
-180.26
-360.53
-540.79
-721.05
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	77
COX7	BRENT CRUDE FUTR NOV17	117
HOX7	NY Harb ULSD Fut Nov17	63
KR4175M90(	2017-09 달러선물	41
NGX7	NATURAL GAS FUTR Nov17	116
XBX7	GASOLINE RBOB FUT Nov17	58

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

770

공시일	2017-08-30
기준일	2017-08-29

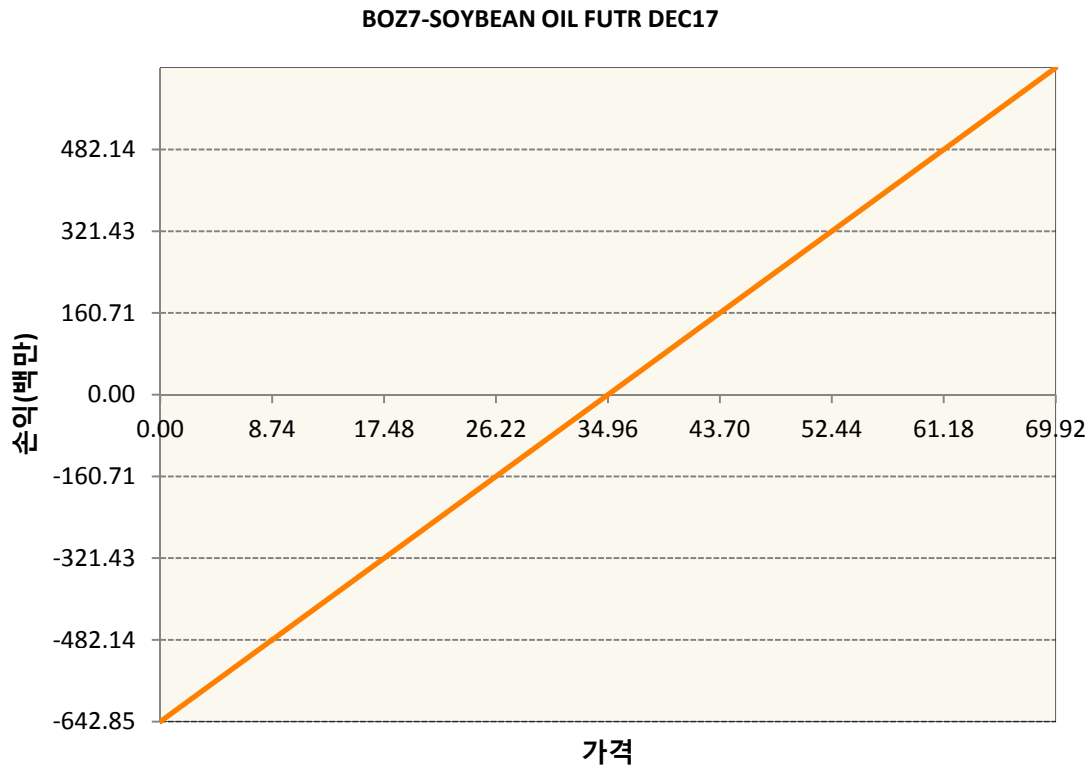
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

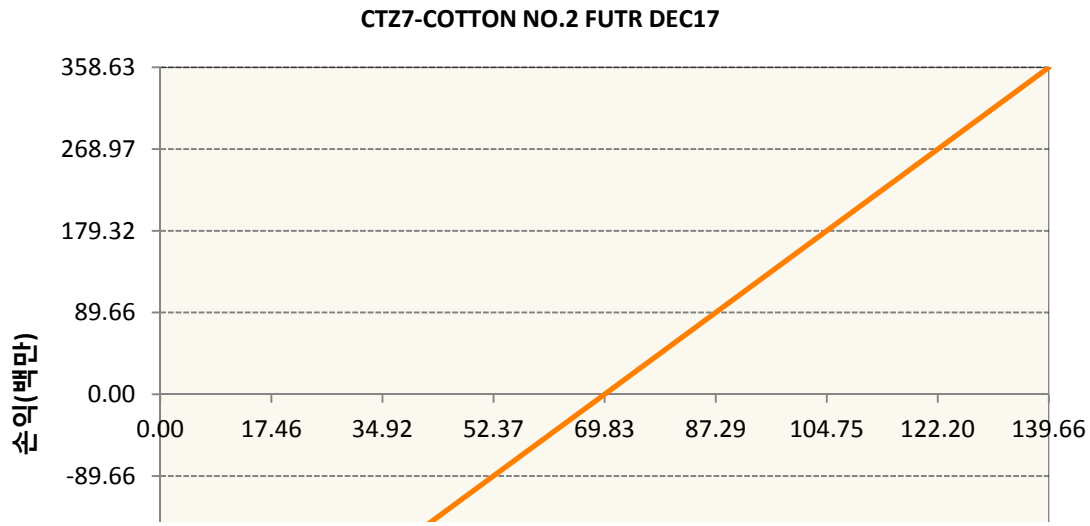
1. 계약금액

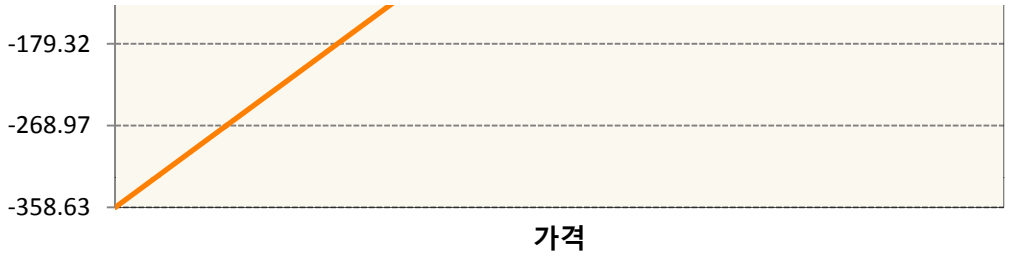
(단위:백만원)

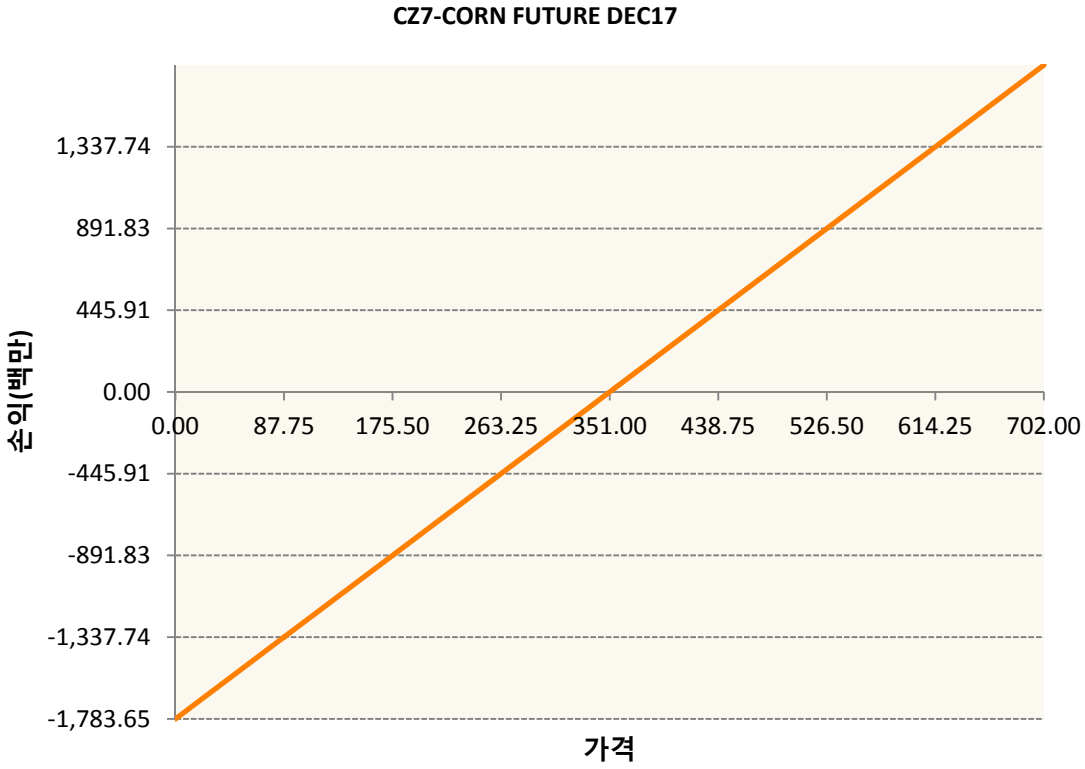
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	6,896	338	6,558	

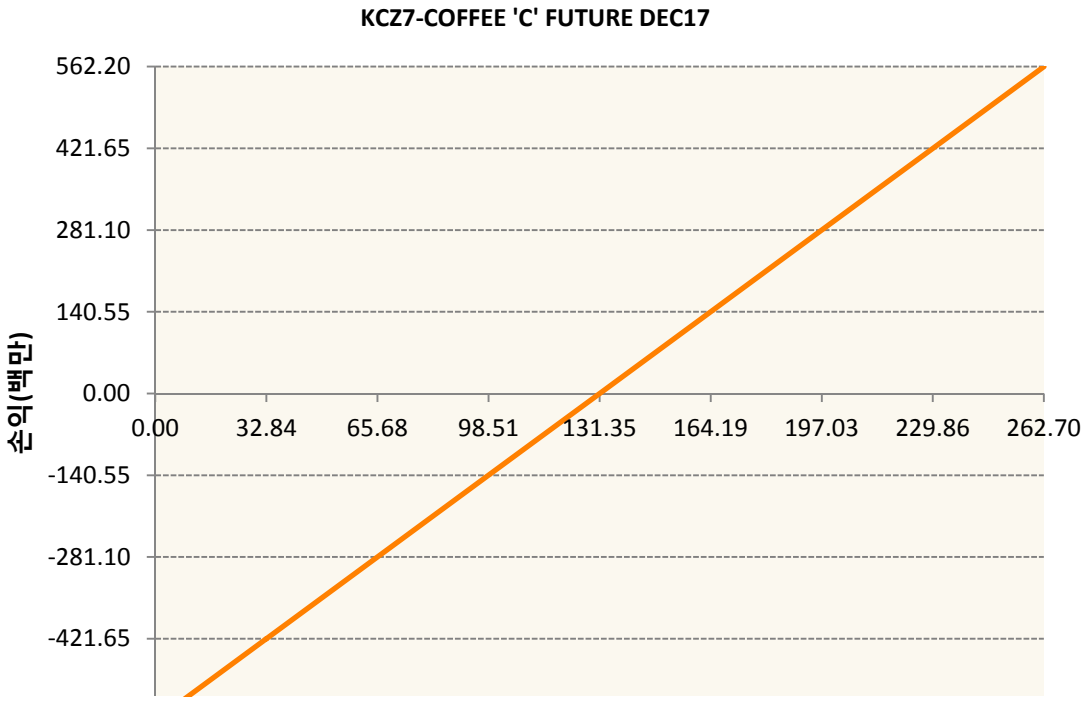
2. 만기시점의 손익구조

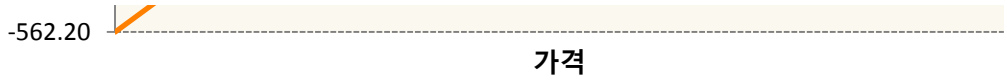


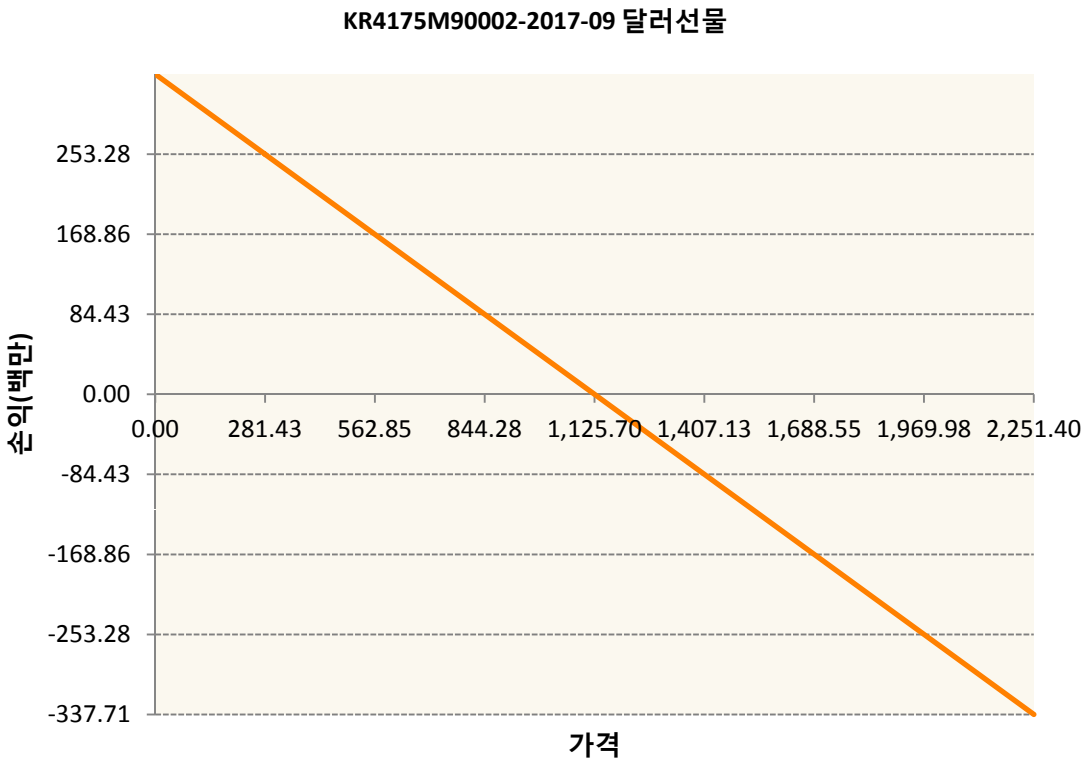


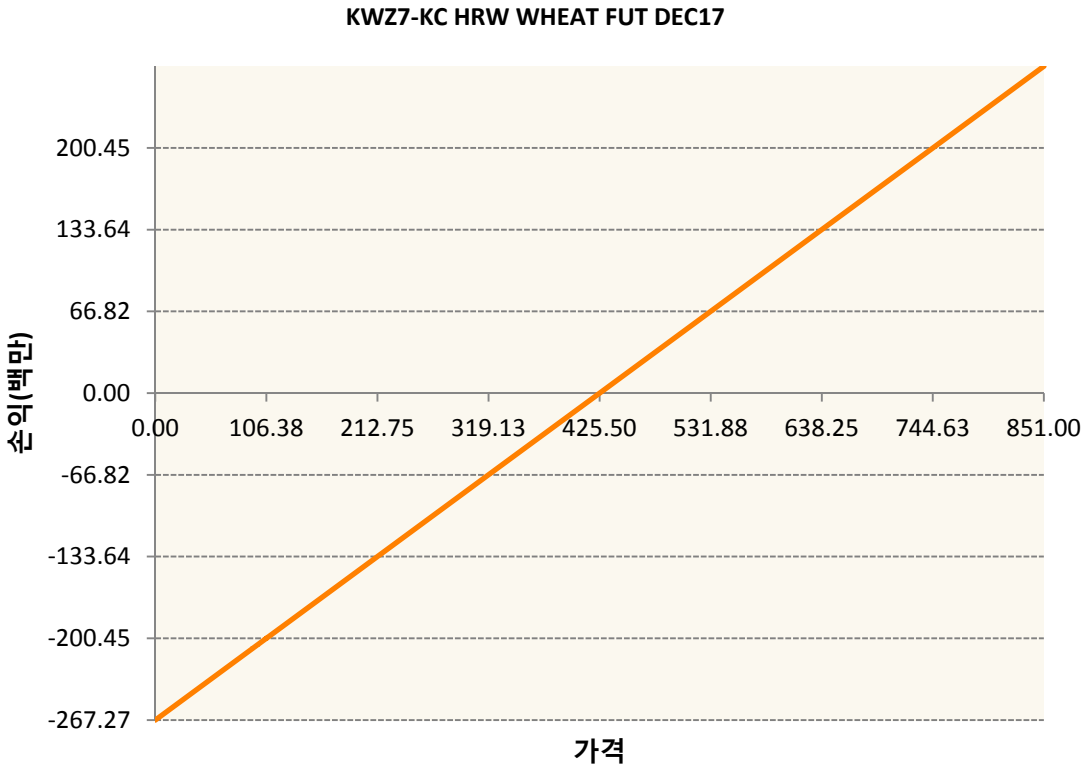

-179.32
-268.97
-358.63
가격


CZ7-CORN FUTURE DEC17
1,337.74
891.83
445.91
0.00
-445.91
-891.83
-1,337.74
-1,783.65
0.00
87.75
175.50
263.25
351.00
438.75
526.50
614.25
702.00
손익(백만)
가격

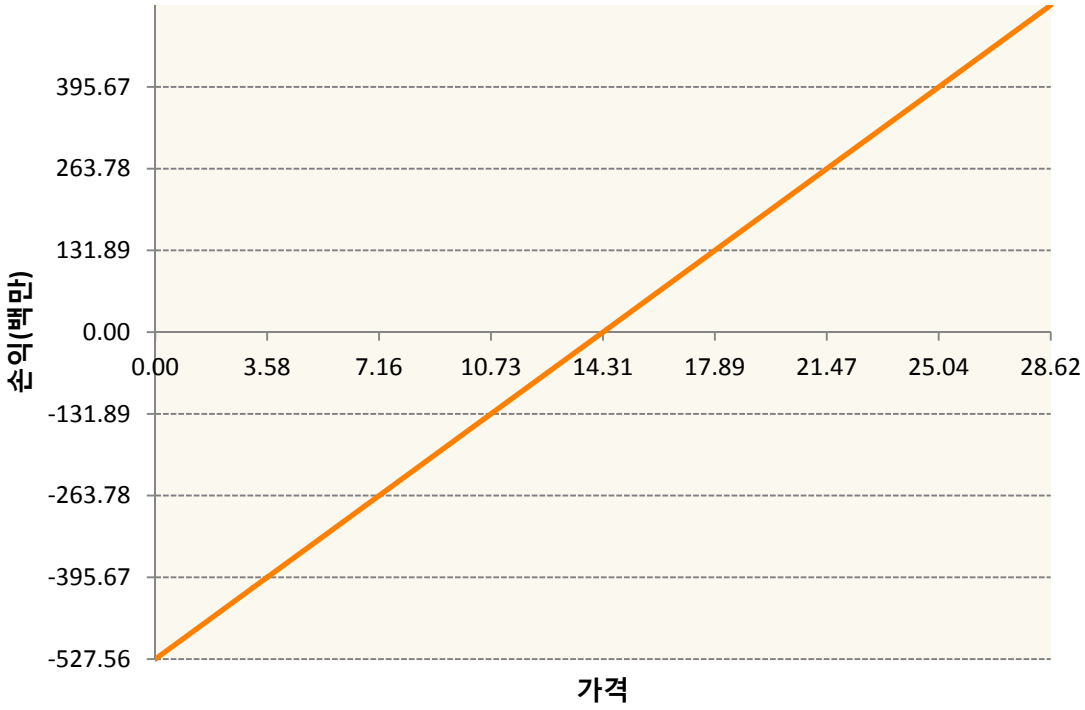

KCZ7-COFFEE 'C' FUTURE DEC17
562.20
421.65
281.10
140.55
0.00
-140.55
-281.10
-421.65
0.00
32.84
65.68
98.51
131.35
164.19
197.03
229.86
262.70
손익(백만)


-562.20
가격

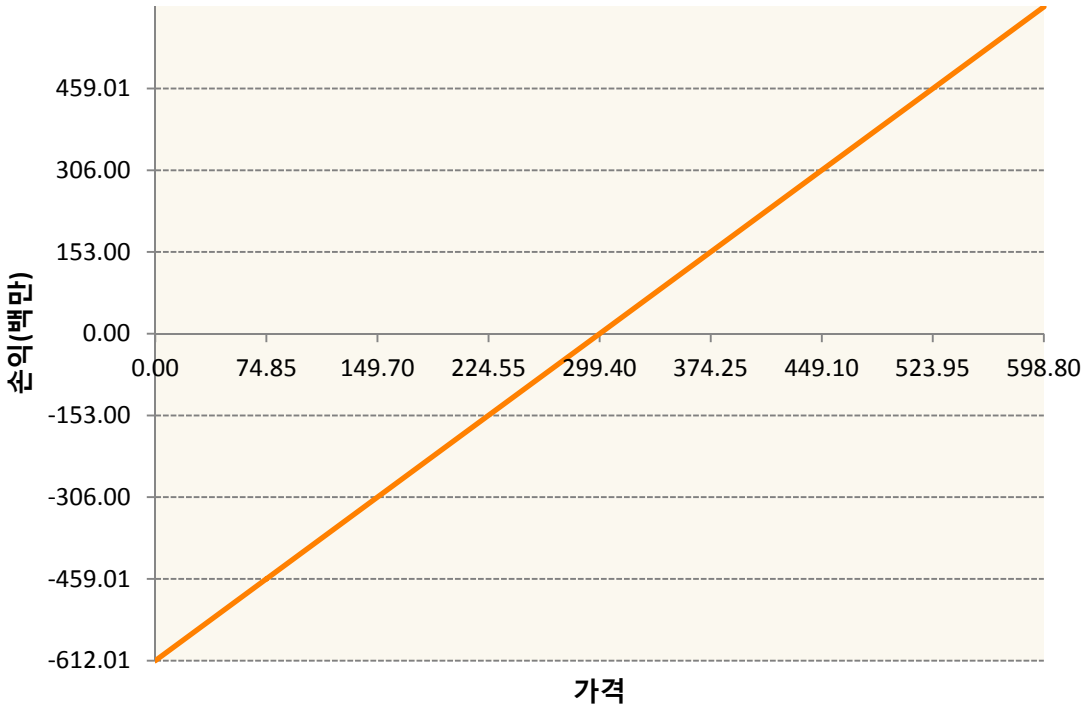

KR4175M90002-2017-09 달러선물
253.28
168.86
84.43
0.00
-84.43
-168.86
-253.28
-337.71
0.00
281.43
562.85
844.28
1,125.70
1,407.13
1,688.55
1,969.98
2,251.40
손익(백만)
가격


KWZ7-KC HRW WHEAT FUT DEC17
200.45
133.64
66.82
0.00
-66.82
-133.64
-200.45
-267.27
0.00
106.38
212.75
319.13
425.50
531.88
638.25
744.63
851.00
손익(백만)
가격

SBV7-SUGAR #11 (WORLD) OCT17

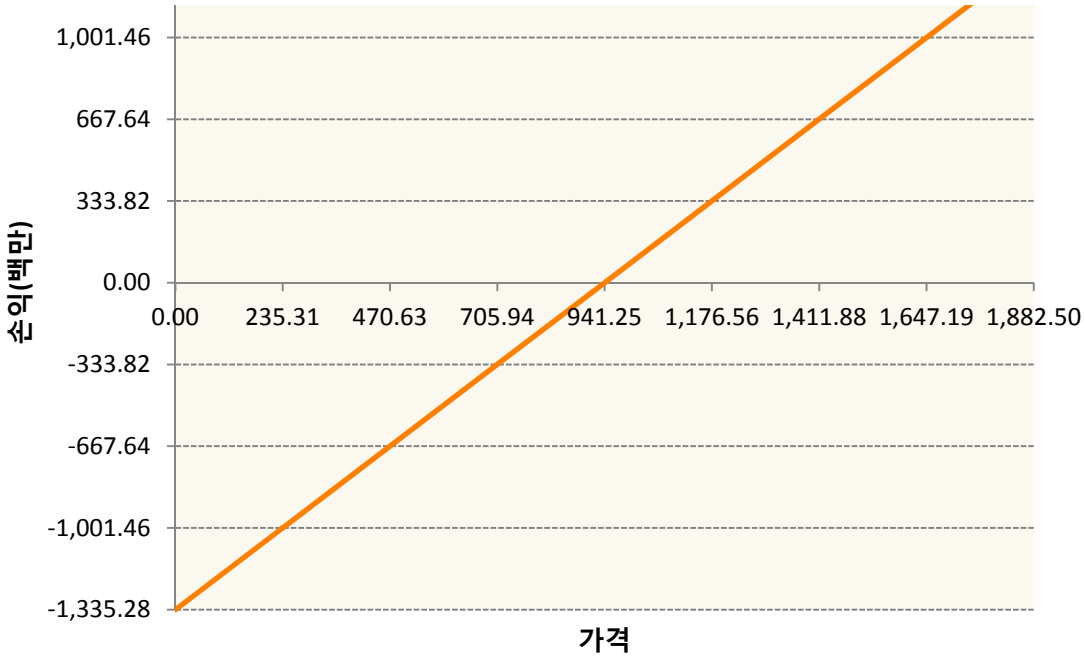


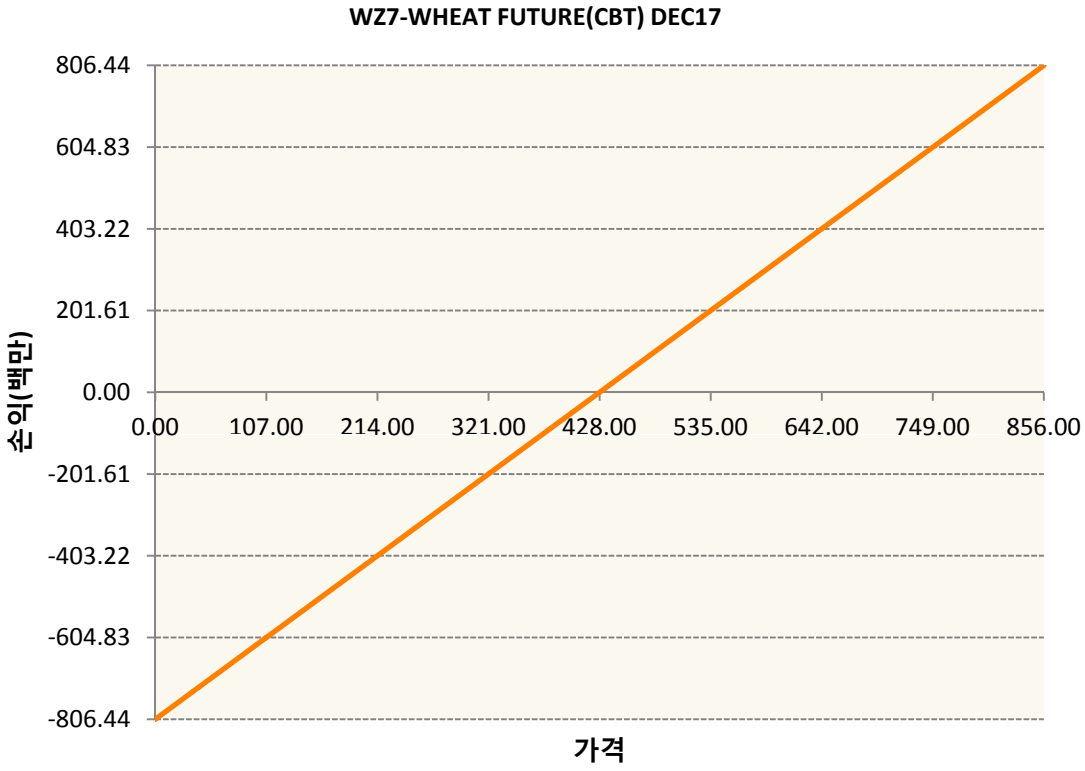
SMZ7-SOYBEAN MEAL FUTR DEC17



SX7-SOYBEAN FUTURE NOV17







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
BOZ7	SOYBEAN OIL FUTR DEC17	51
CTZ7	COTTON NO.2 FUTR DEC17	29
CZ7	CORN FUTURE DEC17	143
KCZ7	COFFEE 'C' FUTURE DEC17	45
KR4175M90(	2017-09 달러선물	27

KWZ7	KC HRW WHEAT FUT DEC17	21
SBV7	SUGAR #11 (WORLD) OCT17	42
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)

650