공시일	2017-08-31
기준일	2017-08-30

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	2017-08-31
기준일	2017-08-30

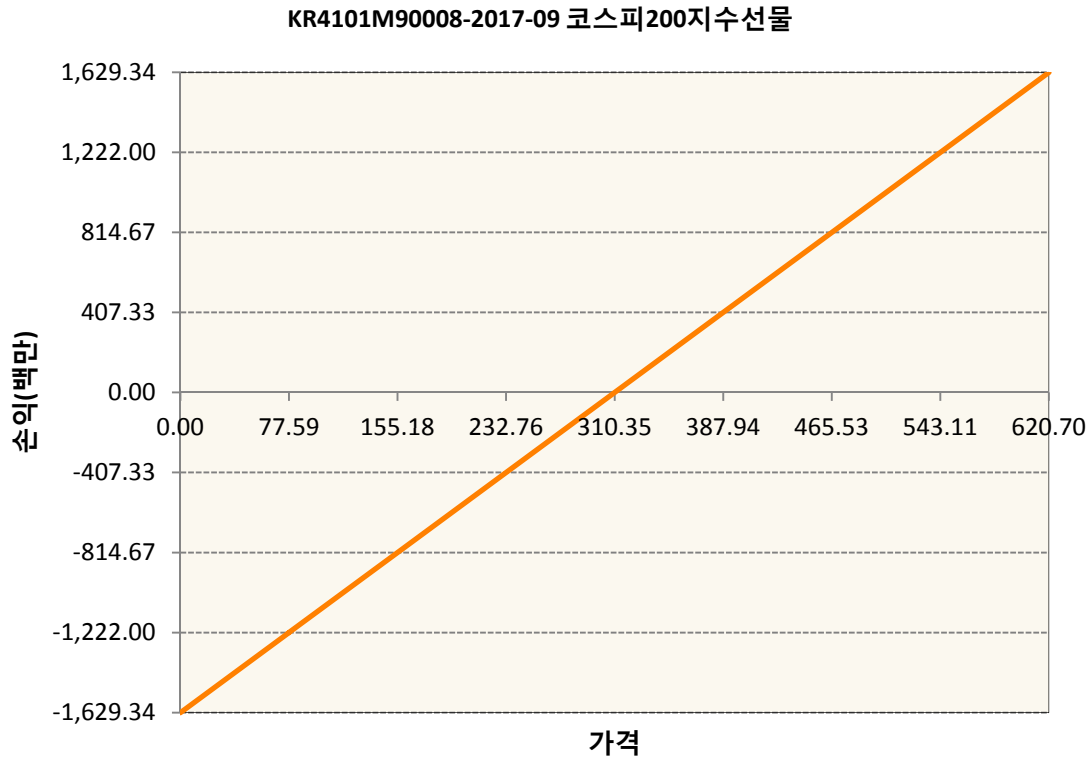
스마트인덱스모

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	1,629	0	1,629	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	2017-08-31
기준일	2017-08-30

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)

459

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-08-31
기준일	2017-08-30

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	412

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

354

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-08-31
기준일	2017-08-30

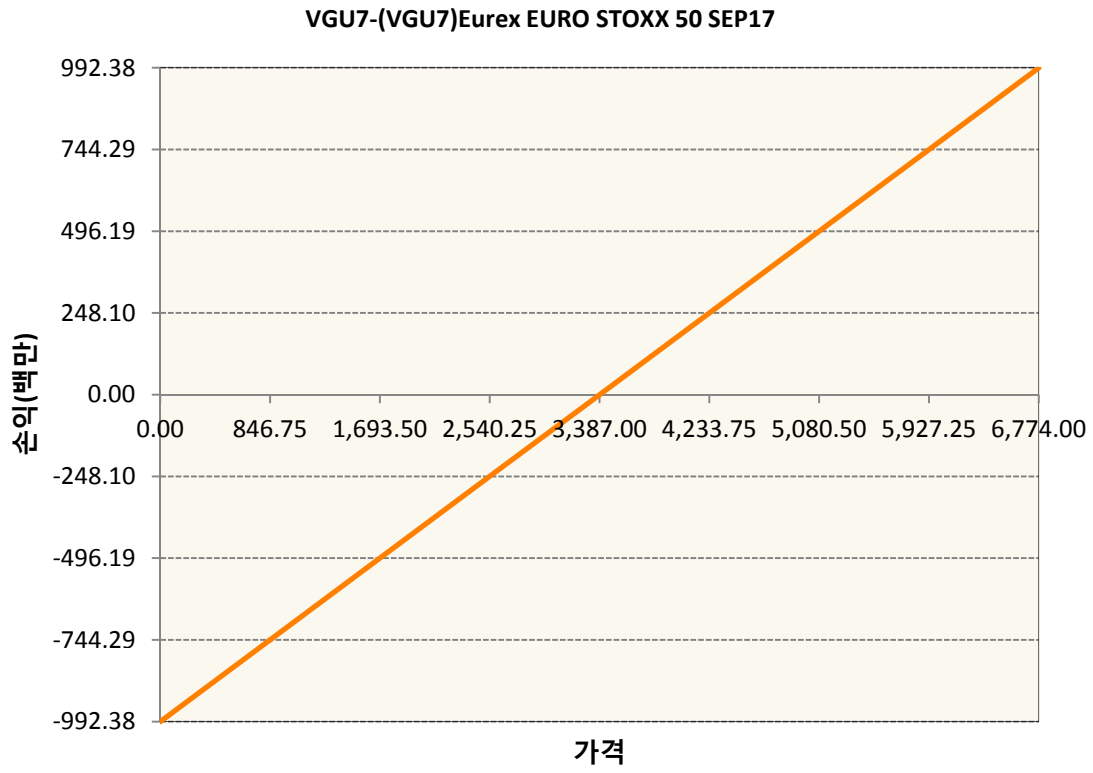
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	992	0	992	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGU7	(VGU7)Eurex EURO STOXX 50 SEP17	79

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

(단위:백만원)

64

공시일	2017-08-31
기준일	2017-08-30

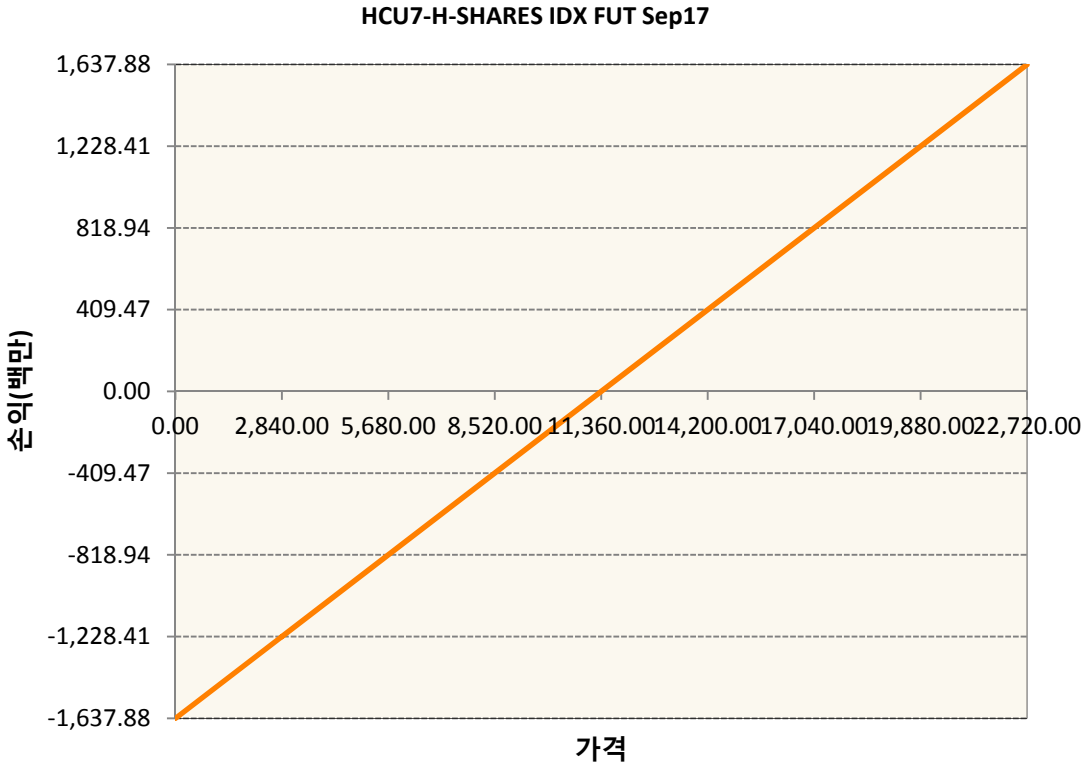
차이나인덱스모(주식-파생형)

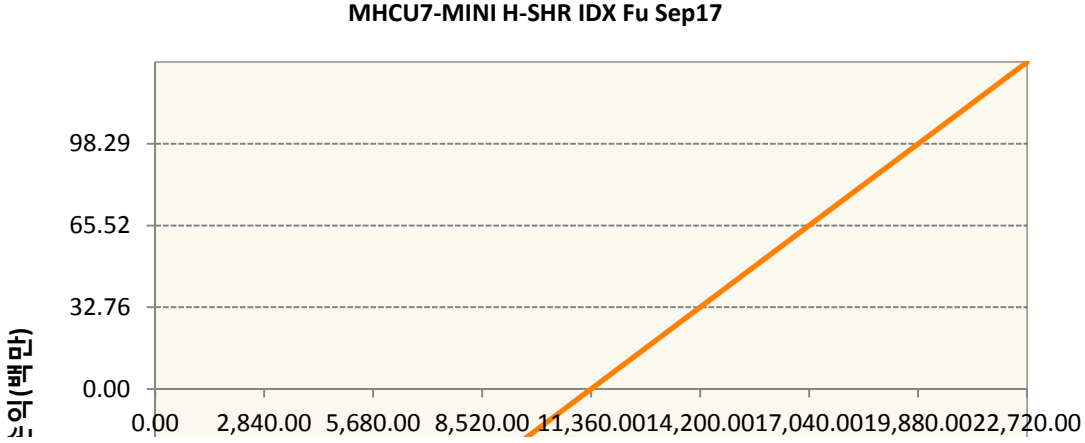
1. 계약금액

(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	1,638	0	1,638	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	2017-08-31
기준일	2017-08-30

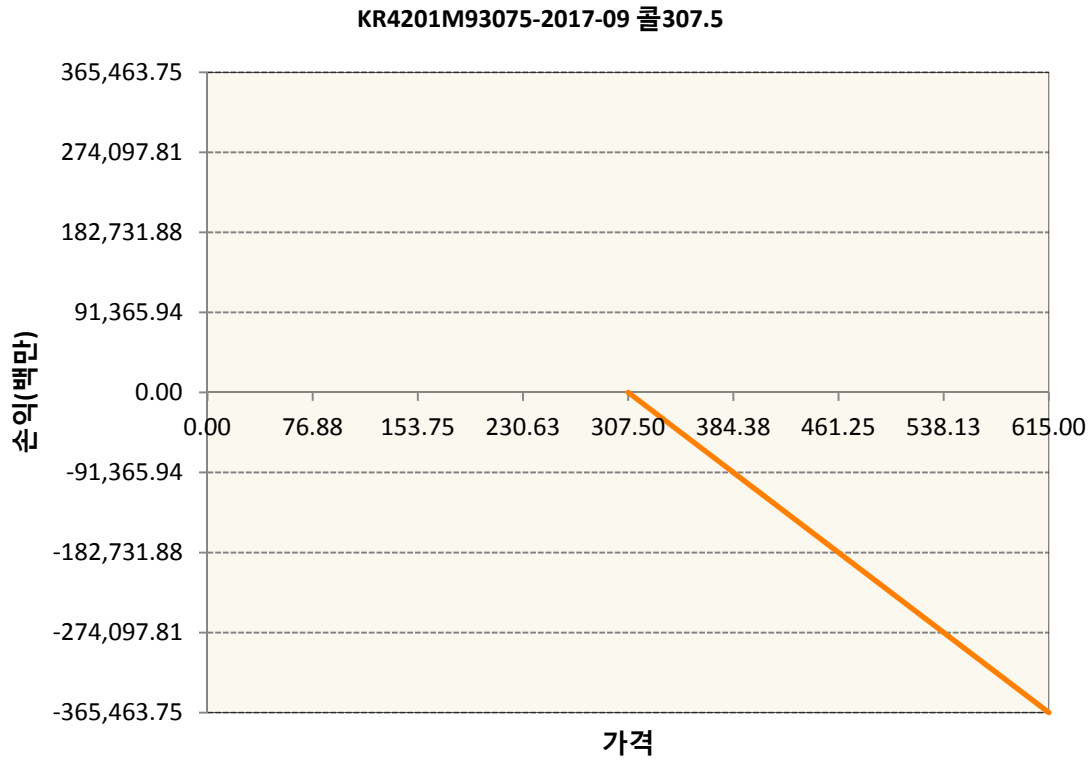
커버드콜모(주식혼합-파생형)

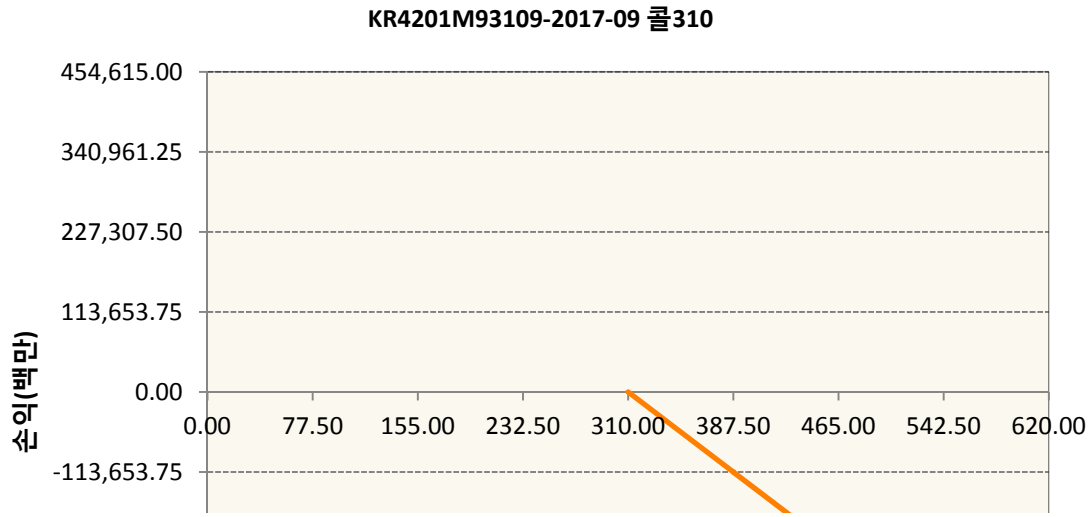
1. 계약금액

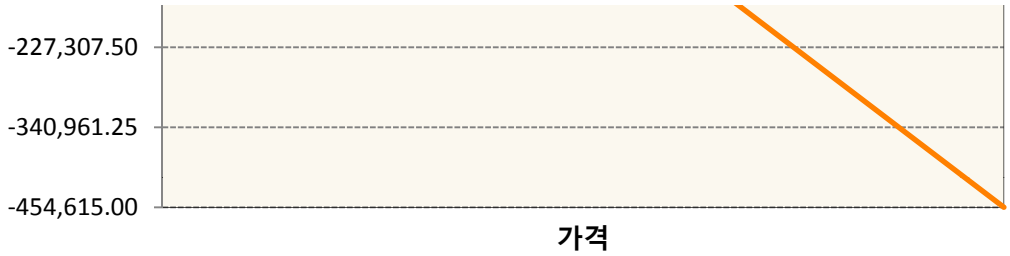
(단위:백만원)

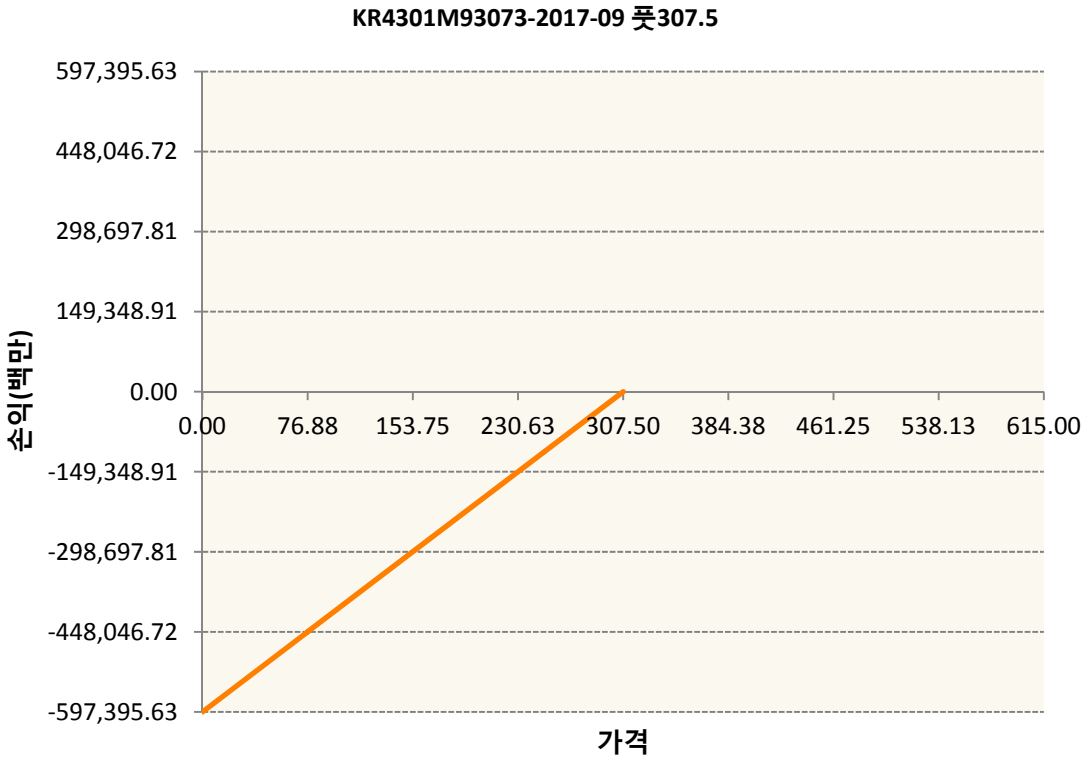
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	1,481,722	-1,481,722	장내

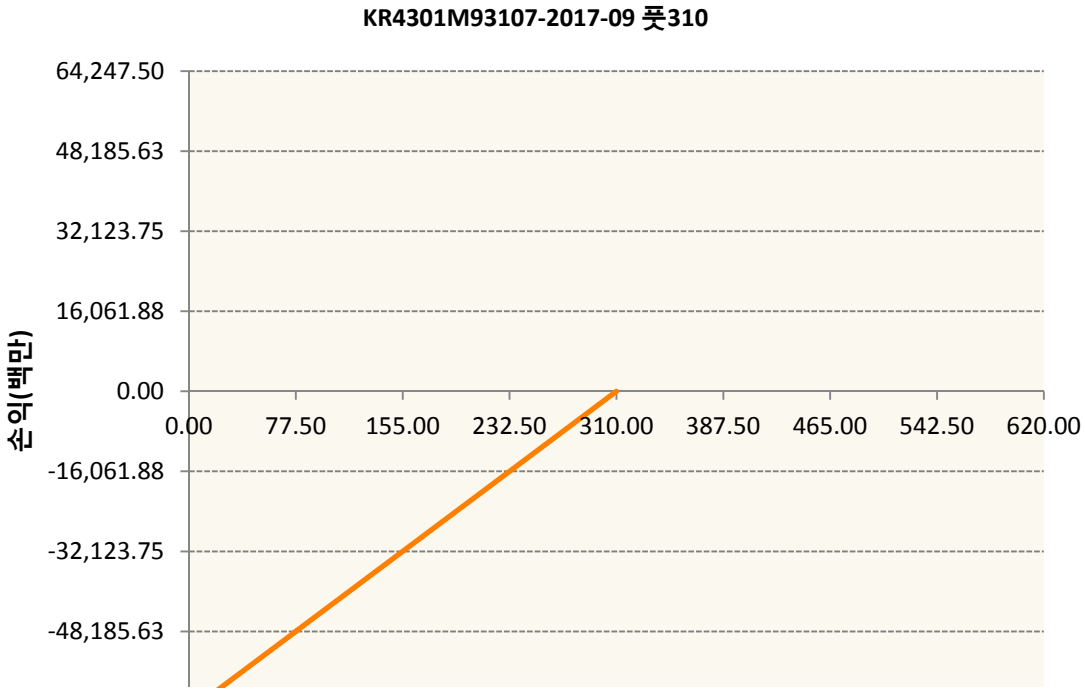
2. 만기시점의 손익구조

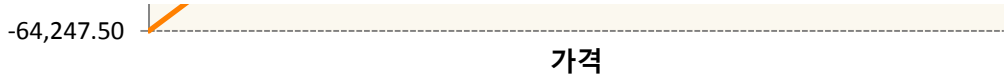





-227,307.50
-340,961.25
-454,615.00
가격


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							24,610
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	7,996	7,938	7,851	7,733	7,584	7,406	7,199
-5.33%	7,594	7,367	7,101	6,801	6,472	6,119	5,745
-2.67%	5,900	5,428	4,942	4,446	3,942	3,431	2,915
0%	1,650	1,102	551	0	-553	-1,106	-1,660
2.67%	-5,433	-5,804	-6,205	-6,630	-7,074	-7,533	-8,005
5.33%	-14,338	-14,492	-14,687	-14,920	-15,187	-15,486	-15,811
8.00%	-23,949	-23,989	-24,054	-24,148	-24,272	-24,426	-24,610
KR4201M93: 2017-09 콜310							28,910
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	8,010	7,966	7,894	7,790	7,651	7,478	7,271
-5.33%	7,714	7,509	7,255	6,956	6,617	6,244	5,840
-2.67%	6,257	5,752	5,219	4,663	4,090	3,502	2,903
0%	2,075	1,383	692	0	-692	-1,383	-2,075
2.67%	-5,674	-6,225	-6,801	-7,396	-8,006	-8,628	-9,260
5.33%	-16,130	-16,396	-16,714	-17,078	-17,481	-17,917	-18,383
8.00%	-27,816	-27,898	-28,018	-28,180	-28,384	-28,628	-28,910
KR4301M93(2017-09 풋307.5							36,328
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-35,025	-35,120	-35,263	-35,455	-35,698	-35,990	-36,328
-5.33%	-19,650	-20,022	-20,457	-20,947	-21,484	-22,062	-22,673
-2.67%	-6,387	-7,159	-7,954	-8,765	-9,589	-10,424	-11,267
0%	2,697	1,801	901	0	-903	-1,808	-2,713
2.67%	7,151	6,544	5,889	5,195	4,469	3,718	2,946
5.33%	8,626	8,375	8,057	7,676	7,238	6,751	6,219
8.00%	8,949	8,883	8,776	8,623	8,420	8,168	7,867
KR4301M93: 2017-09 풋310							4,103
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-3,999	-4,005	-4,015	-4,030	-4,050	-4,074	-4,103
-5.33%	-2,330	-2,359	-2,395	-2,437	-2,485	-2,538	-2,595
-2.67%	-826	-897	-973	-1,051	-1,132	-1,215	-1,300
0%	293	195	98	0	-98	-195	-293
2.67%	908	830	749	665	579	491	402

5.33%	1,141	1,103	1,058	1,007	950	888	823
8.00%	1,200	1,188	1,171	1,148	1,119	1,085	1,045

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

97,949

공시일	2017-08-31
기준일	2017-08-30

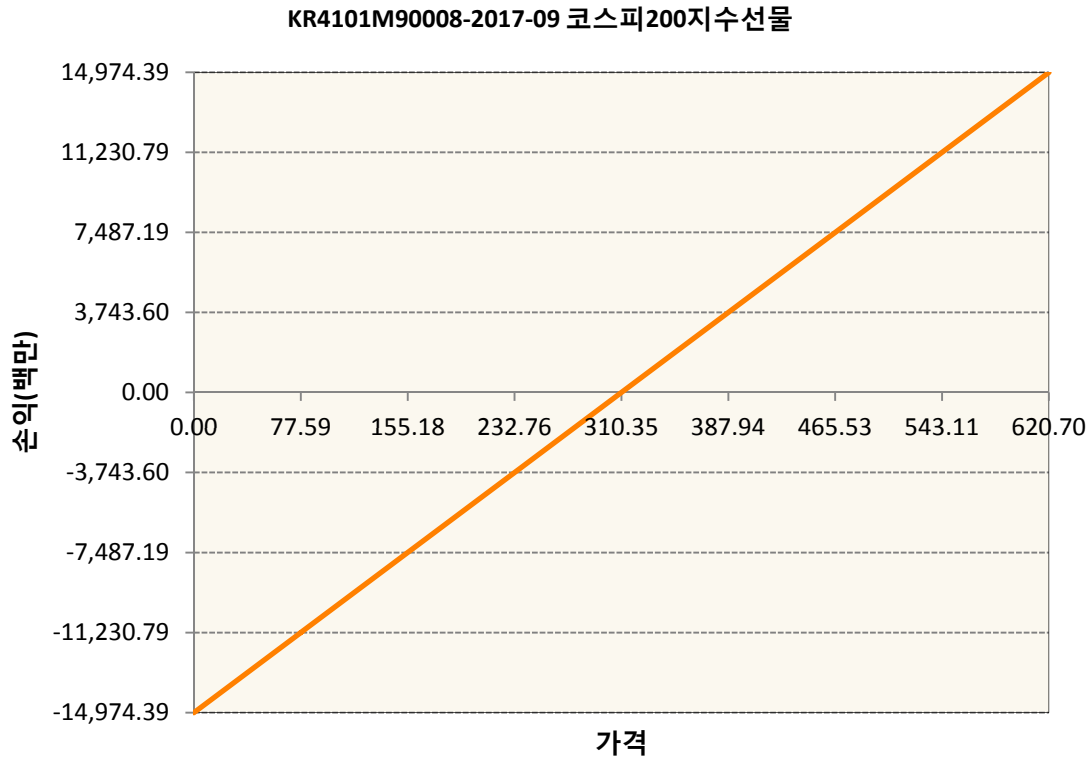
ETF스마트레버리지목표전환형6호

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	14,974	0	14,974	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	2017-08-31
기준일	2017-08-30

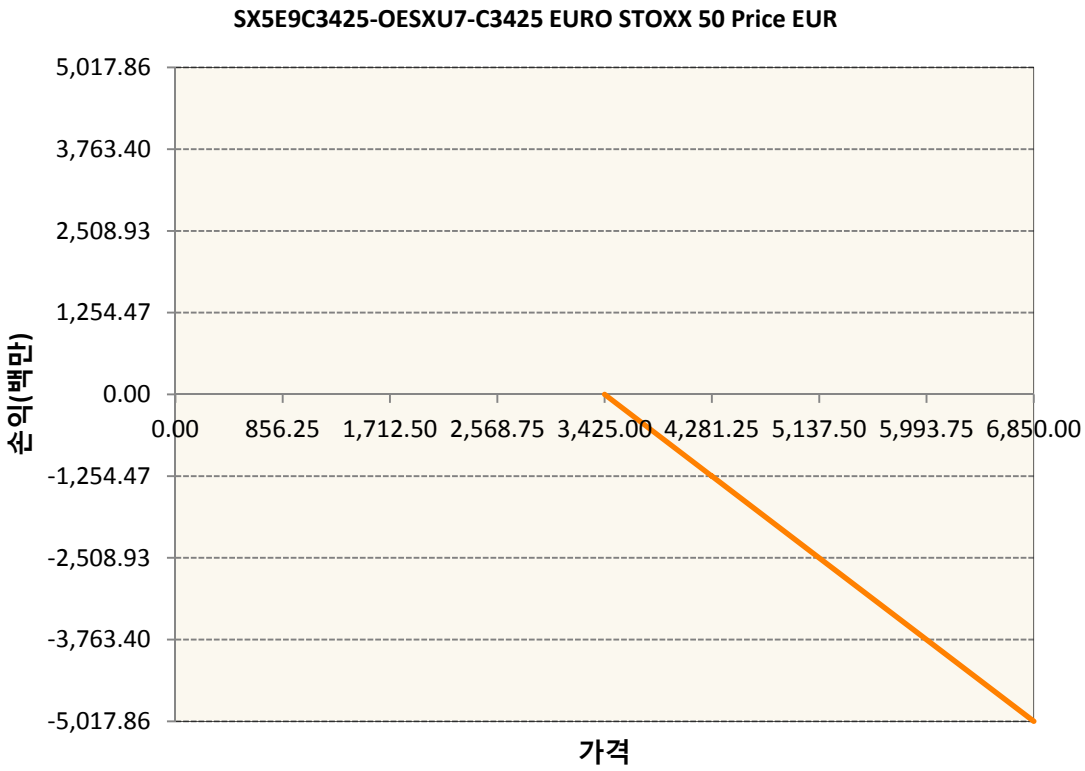
유로커버드콜(주식혼합-파생형)

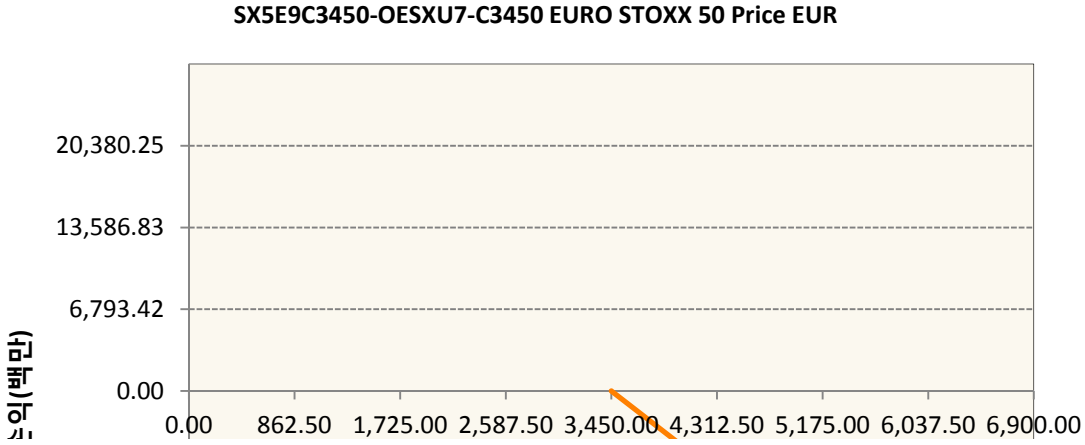
1. 계약금액

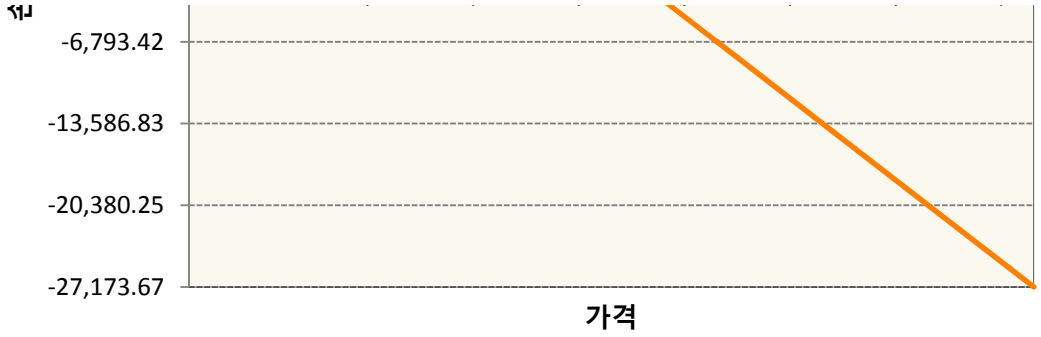
(단위:백만원)

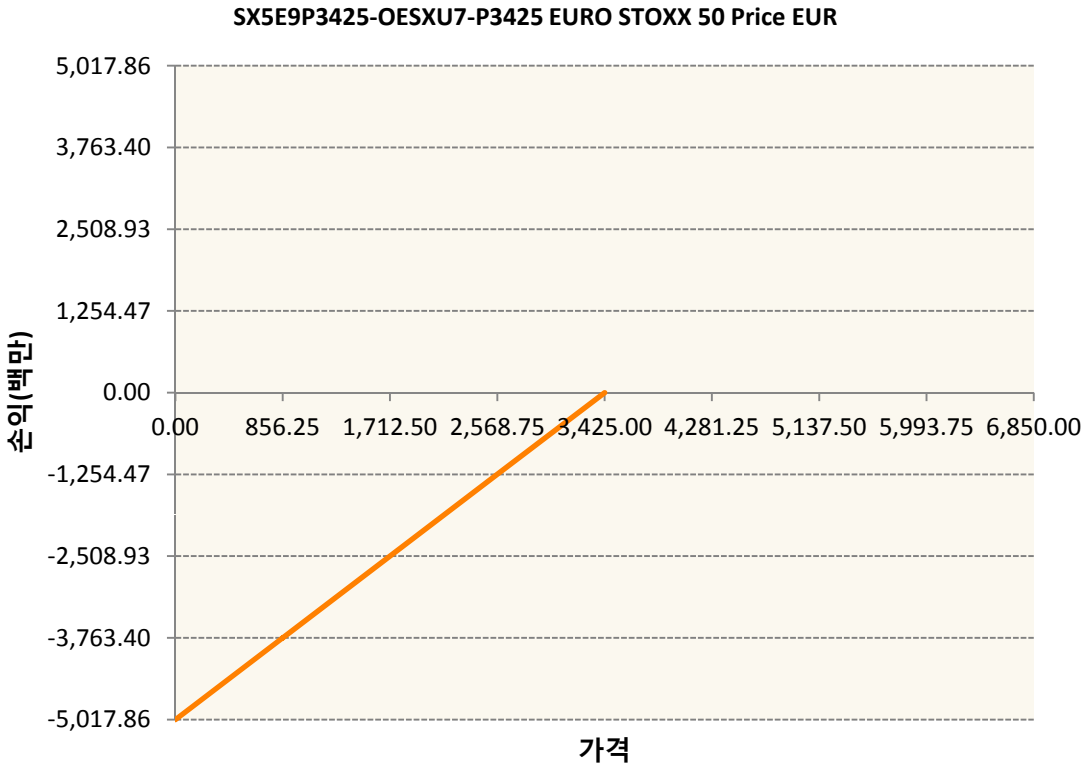
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	27,333	0	27,333	
누계	유가증권	옵션	0	64,383	-64,383	장내

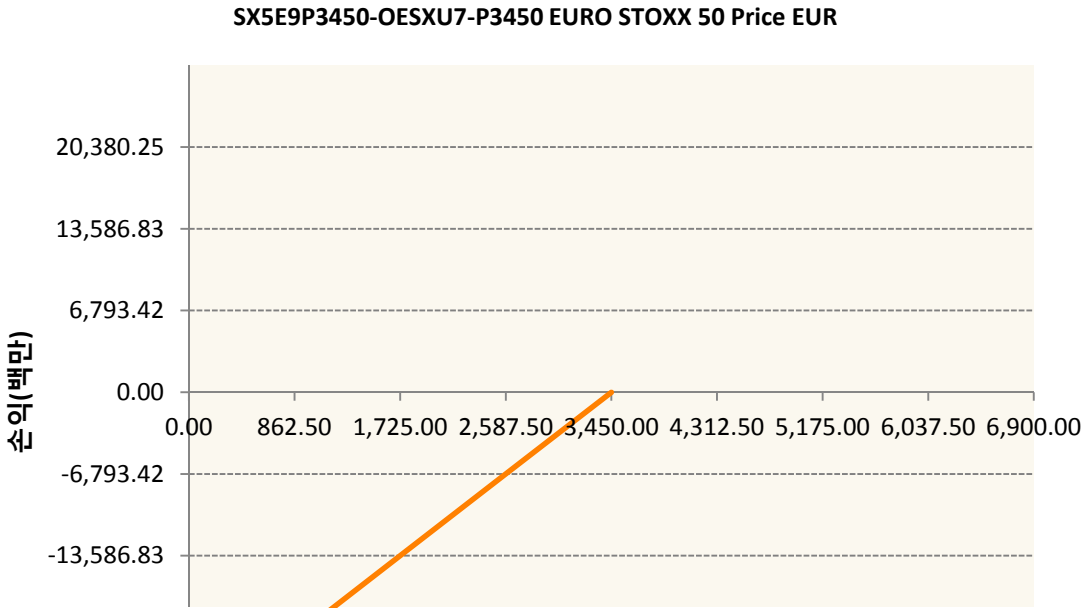
2. 만기시점의 손익구조

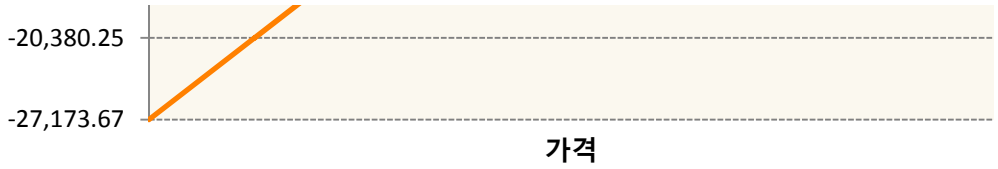


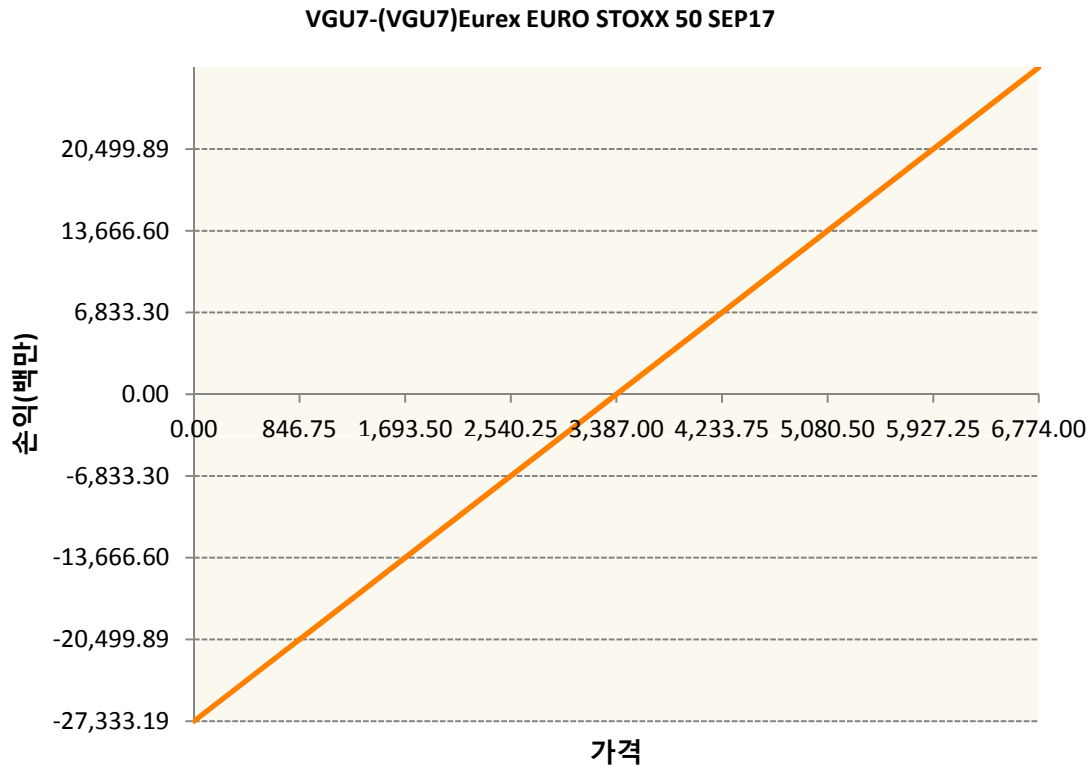



-6,793.42
-13,586.83
-20,380.25
-27,173.67
가격


SX5E9P3425-OESXU7-P3425 EURO STOXX 50 Price EUR
5,017.86
3,763.40
2,508.93
1,254.47
0.00
-1,254.47
-2,508.93
-3,763.40
-5,017.86
손익(백만)
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
가격


SX5E9P3450-OESXU7-P3450 EURO STOXX 50 Price EUR
20,380.25
13,586.83
6,793.42
0.00
-6,793.42
-13,586.83
손익(백만)
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





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
SX5E9C3425	OESXU7-C3425 EURO STOXX 50 Price EUR	401
SX5E9C3450	OESXU7-C3450 EURO STOXX 50 Price EUR	2,174
SX5E9P3425	OESXU7-P3425 EURO STOXX 50 Price EUR	401
SX5E9P3450	OESXU7-P3450 EURO STOXX 50 Price EUR	2,174
VGU7	(VGU7)Eurex EURO STOXX 50 SEP17	2,187

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	5,891

공시일	2017-08-31
기준일	2017-08-30

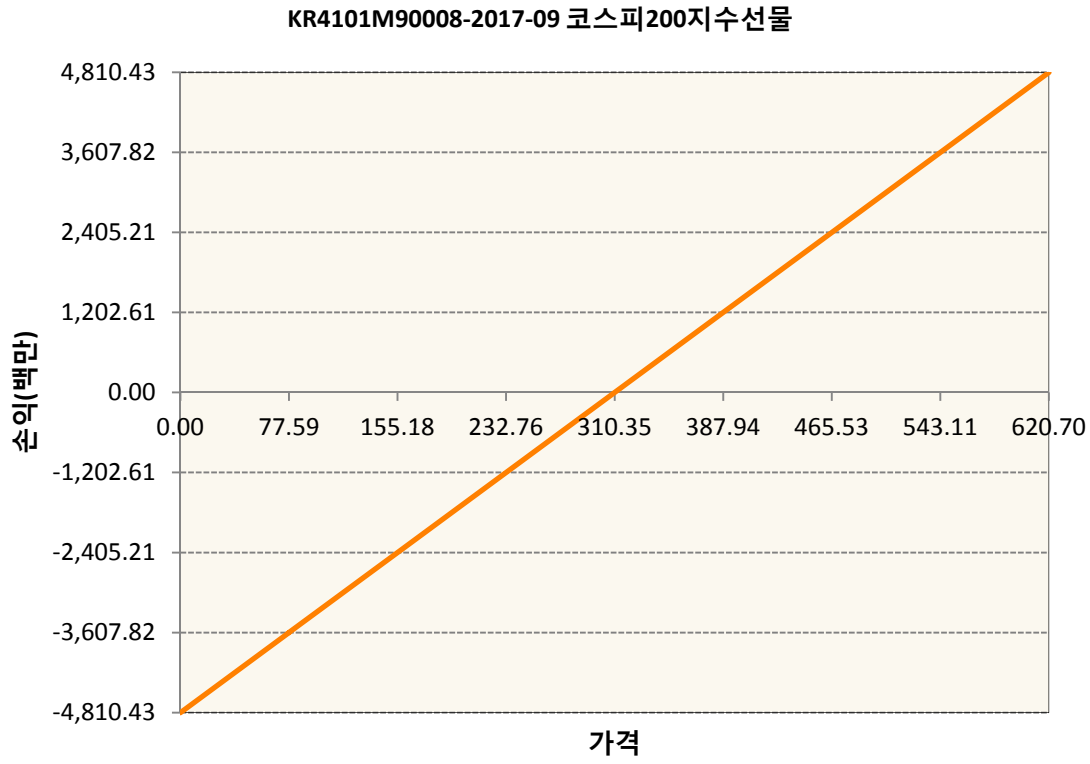
ETF스마트레버리지목표전환형7호

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	4,810	0	4,810	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	2017-08-31
기준일	2017-08-30

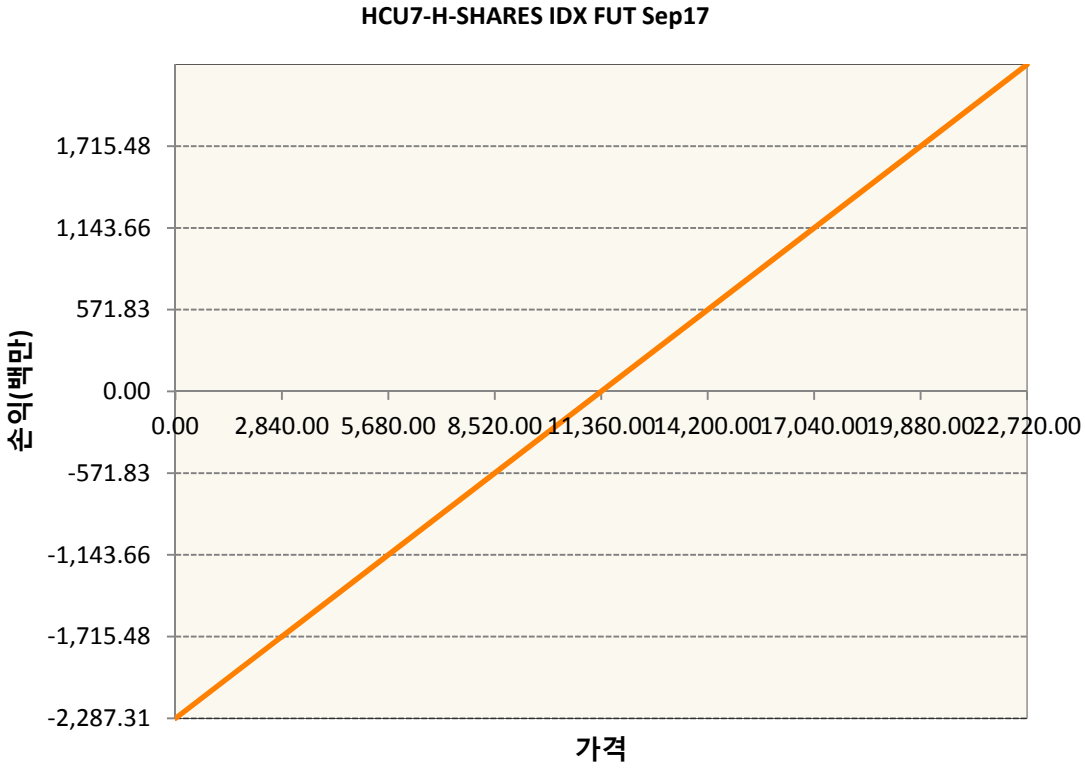
홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생

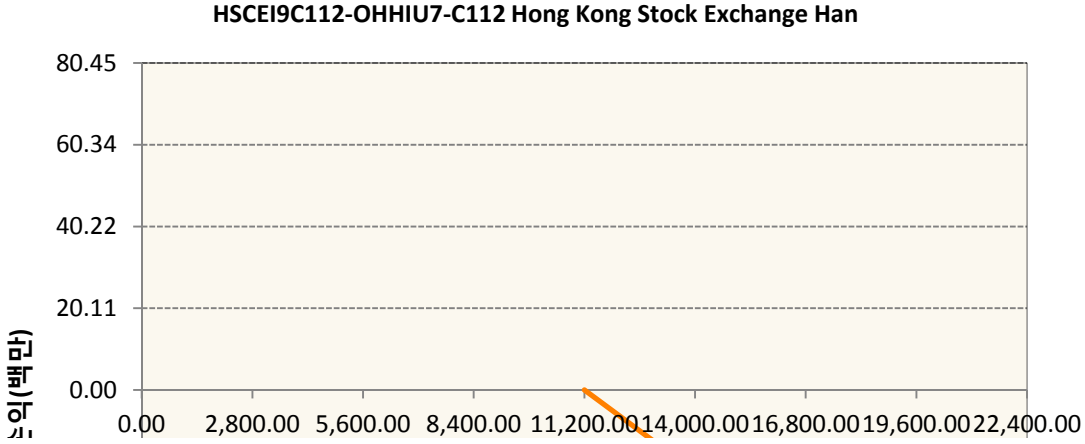
1. 계약금액

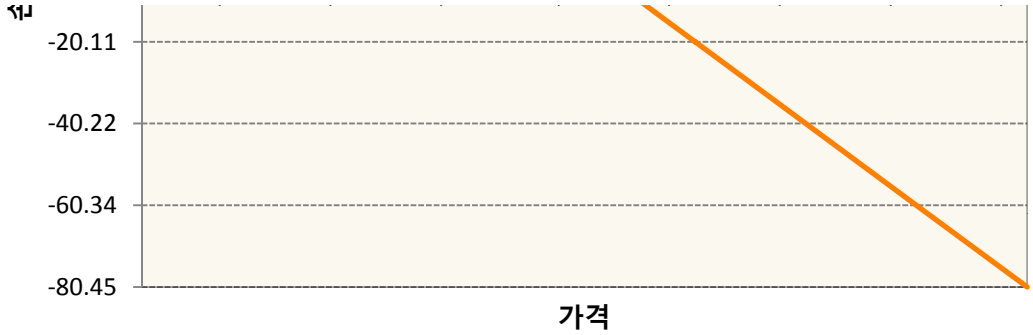
(단위:백만원)

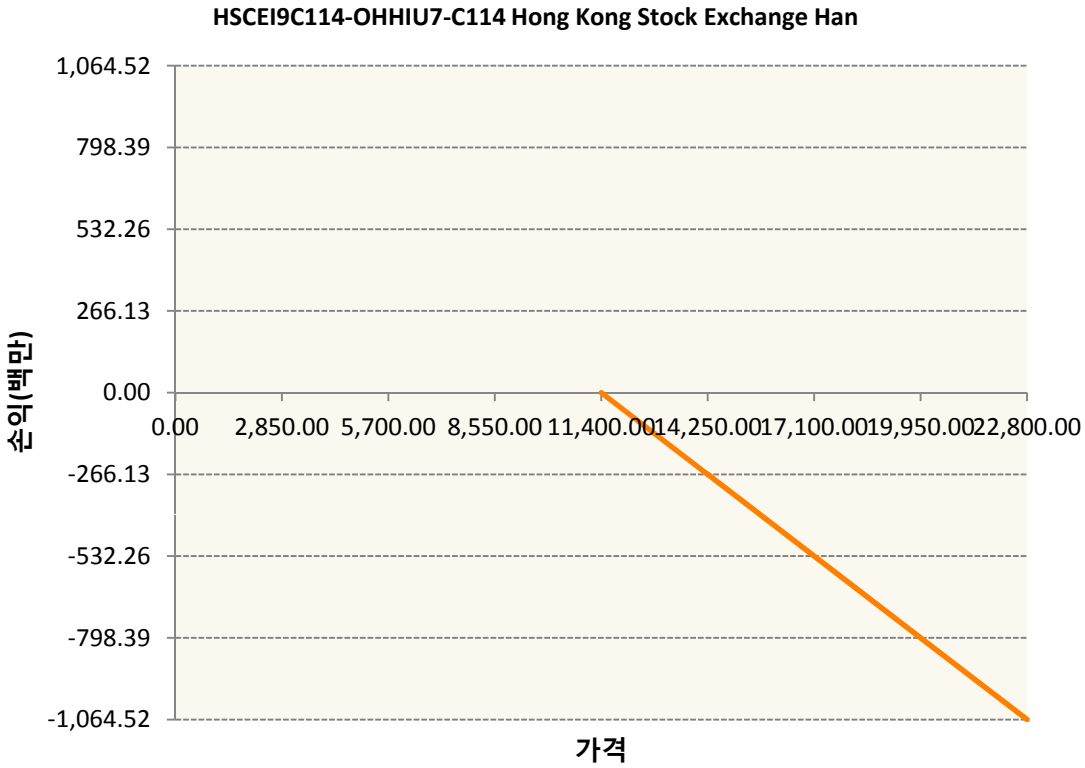
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,287	0	2,287	장내
누계	유가증권	옵션	0	2,290	-2,290	장내

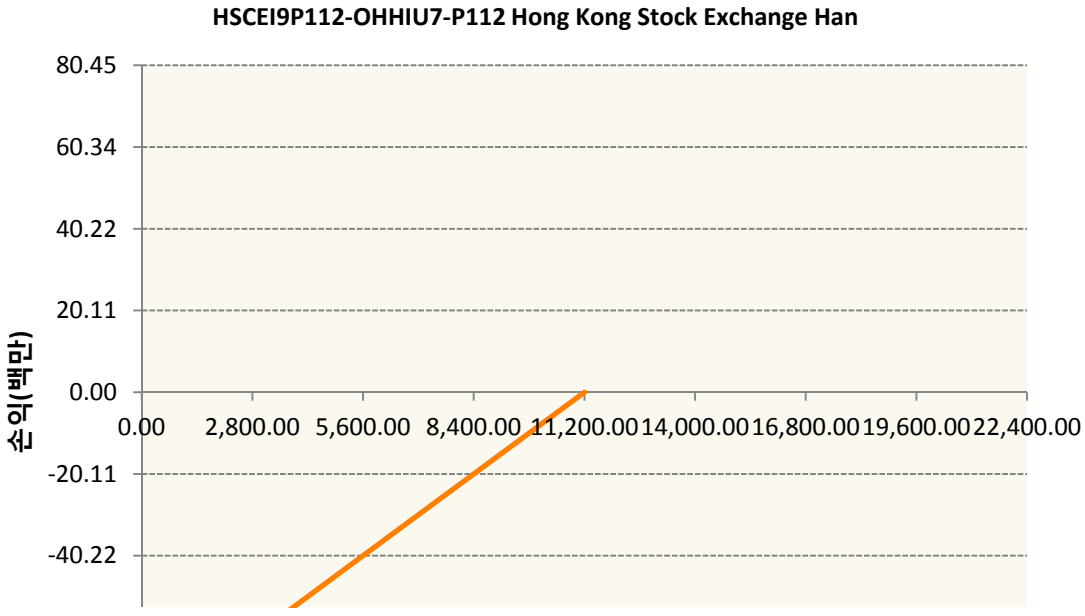
2. 만기시점의 손익구조

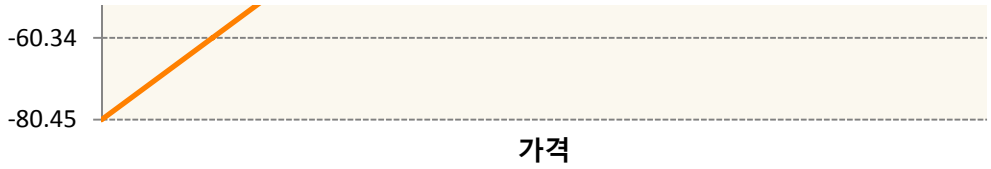


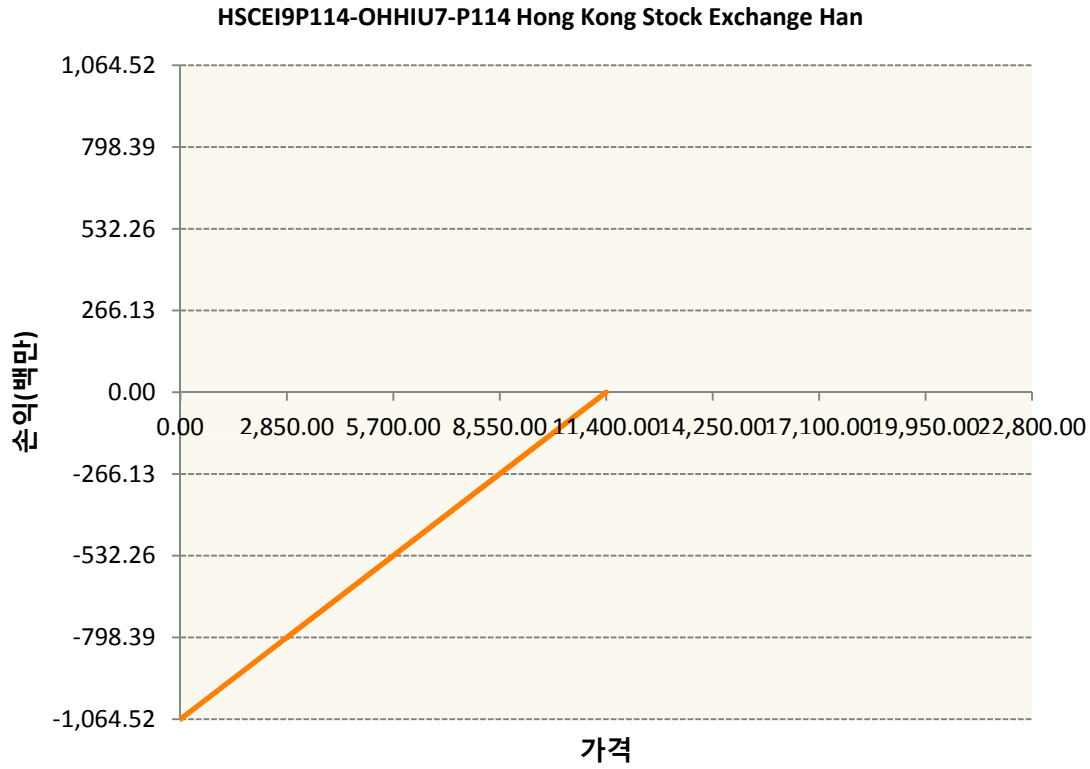



-20.11
-40.22
-60.34
-80.45
가격


HSCEI9C114-OHHIU7-C114 Hong Kong Stock Exchange Han
1,064.52
798.39
532.26
266.13
0.00
-266.13
-532.26
-798.39
-1,064.52
0.00
2,850.00
5,700.00
8,550.00
11,400.00
14,250.00
17,100.00
19,950.00
22,800.00
손익(백만)
가격


HSCEI9P112-OHHIU7-P112 Hong Kong Stock Exchange Han
80.45
60.34
40.22
20.11
0.00
-20.11
-40.22
0.00
2,800.00
5,600.00
8,400.00
11,200.00
14,000.00
16,800.00
19,600.00
22,400.00
손익(백만)





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

HCU7	H-SHARES IDX FUT Sep17	183
HSCEI9C112	OHHIU7-C112 Hong Kong Stock Exchange Han	6
HSCEI9C114	OHHIU7-C114 Hong Kong Stock Exchange Han	85
HSCEI9P112	OHHIU7-P112 Hong Kong Stock Exchange Han	6
HSCEI9P114	OHHIU7-P114 Hong Kong Stock Exchange Han	85

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

316

공시일	2017-08-31
기준일	2017-08-30

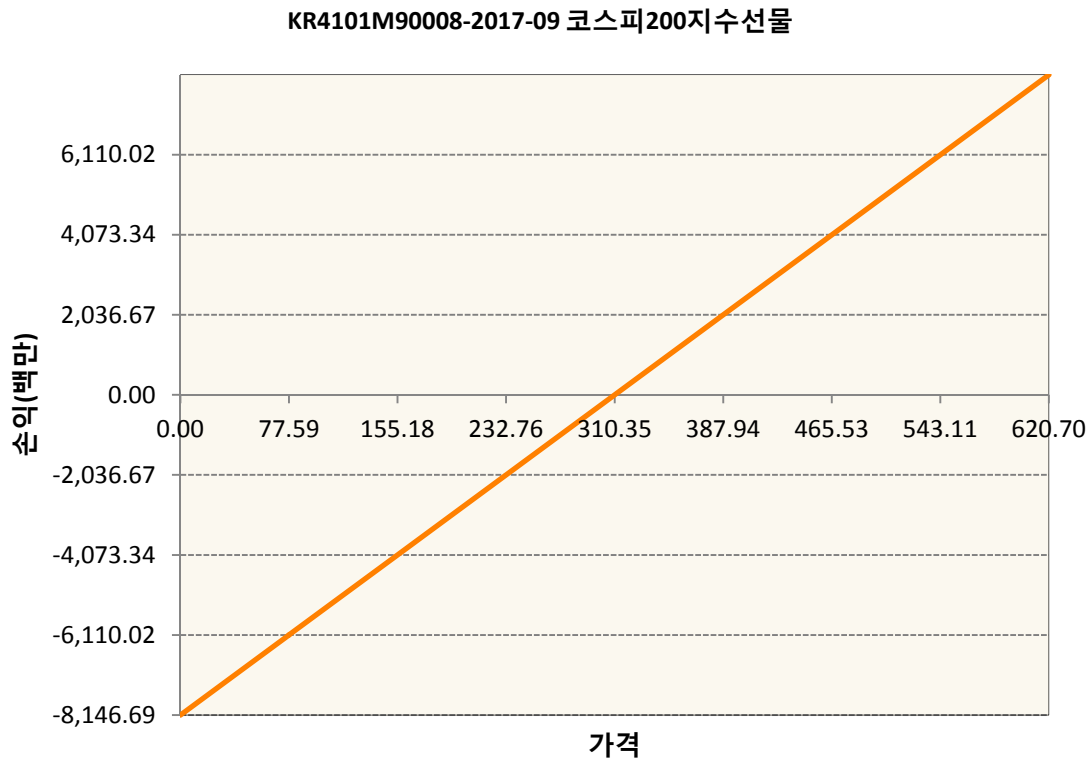
코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼

1. 계약금액

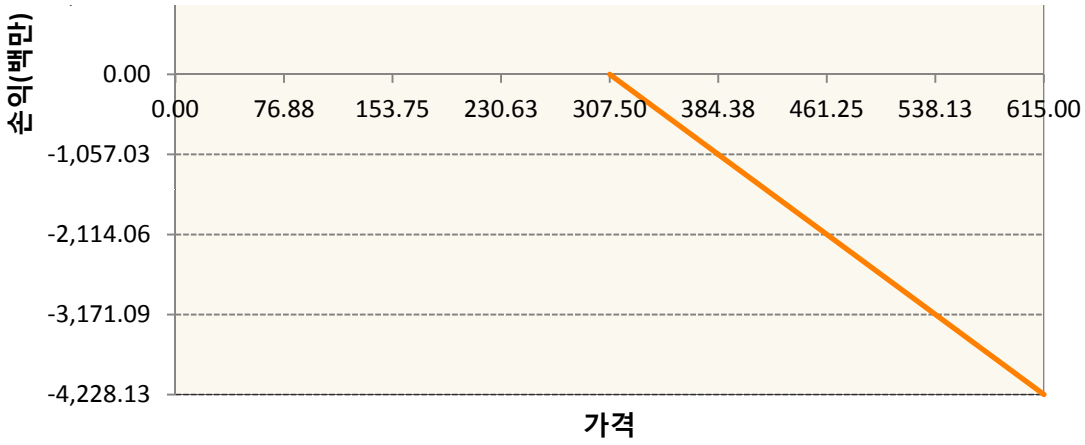
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	18,500	0	18,500	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	8,147	0	8,147	장내
누계	유가증권	스왑	18,500	0	18,500	장외
누계	유가증권	옵션	0	18,119	-18,119	장내

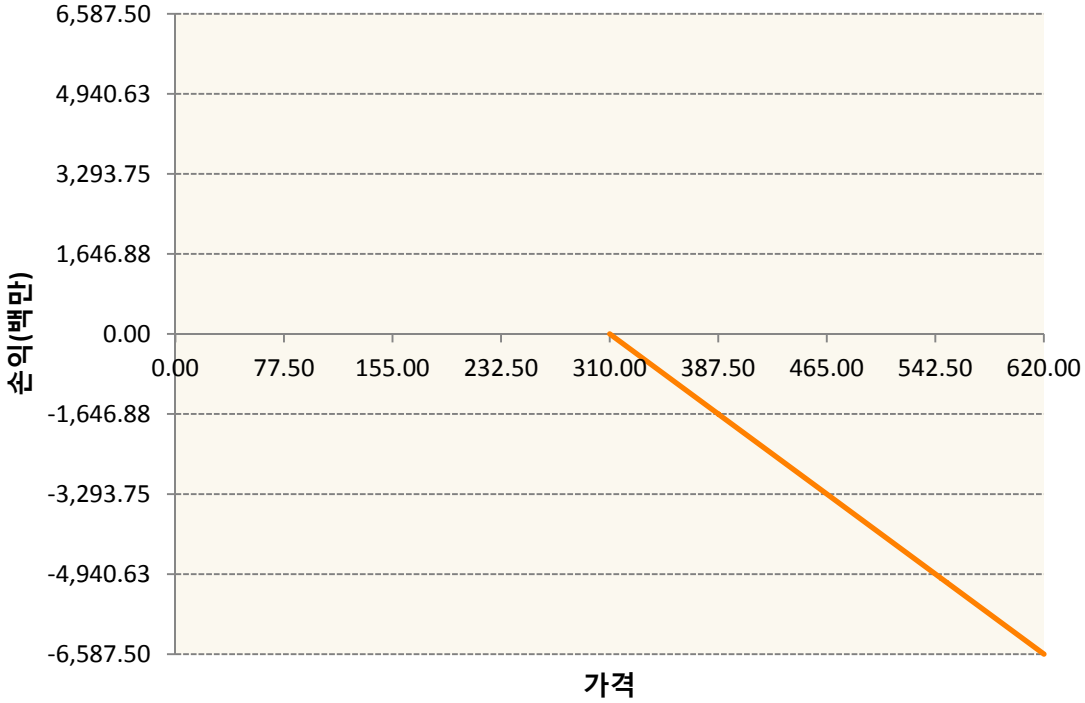
2. 만기시점의 손익구조



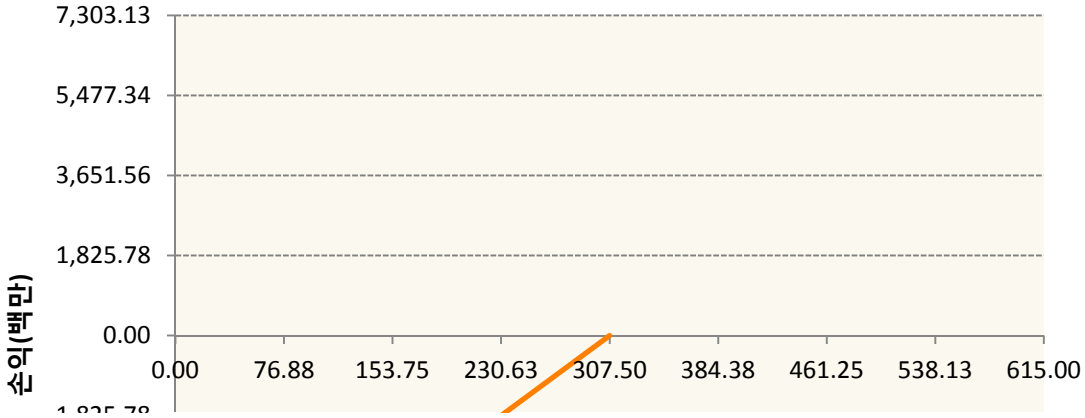




KR4201M93109-2017-09 콜310



KR4301M93073-2017-09 풋307.5





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_2							1,469
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,469	-1,469	-1,469	-1,469	-1,469	-1,469	-1,469
-5.33%	-979	-979	-979	-979	-979	-979	-979
-2.67%	-490	-490	-490	-490	-490	-490	-490
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	490	490	490	490	490	490	490
5.33%	979	979	979	979	979	979	979
8.00%	1,469	1,469	1,469	1,469	1,469	1,469	1,469
KR4101M90(2017-09 코스피200지수선물							650
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-650	-650	-650	-650	-650	-650	-650
-5.33%	-434	-434	-434	-434	-434	-434	-434
-2.67%	-217	-217	-217	-217	-217	-217	-217
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	217	217	217	217	217	217	217
5.33%	434	434	434	434	434	434	434
8.00%	650	650	650	650	650	650	650
KR4201M93(2017-09 콜307.5							285
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	93	92	91	89	88	86	83
-5.33%	88	85	82	79	75	71	66
-2.67%	68	63	57	51	46	40	34
0%	19	13	6	0	-6	-13	-19
2.67%	-63	-67	-72	-77	-82	-87	-93
5.33%	-166	-168	-170	-173	-176	-179	-183
8.00%	-277	-278	-278	-279	-281	-283	-285
KR4201M93: 2017-09 콜310							419
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%

-8.00%	116	115	114	113	111	108	105
-5.33%	112	109	105	101	96	90	85
-2.67%	91	83	76	68	59	51	42
0%	30	20	10	0	-10	-20	-30
2.67%	-82	-90	-99	-107	-116	-125	-134
5.33%	-234	-238	-242	-247	-253	-260	-266
8.00%	-403	-404	-406	-408	-411	-415	-419
	KR4301M93(2017-09 풋307.5						444
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-428	-429	-431	-433	-436	-440	-444
-5.33%	-240	-245	-250	-256	-263	-270	-277
-2.67%	-78	-88	-97	-107	-117	-127	-138
0%	33	22	11	0	-11	-22	-33
2.67%	87	80	72	64	55	45	36
5.33%	105	102	98	94	88	83	76
8.00%	109	109	107	105	103	100	96

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

3,070

공시일	2017-08-31
기준일	2017-08-30

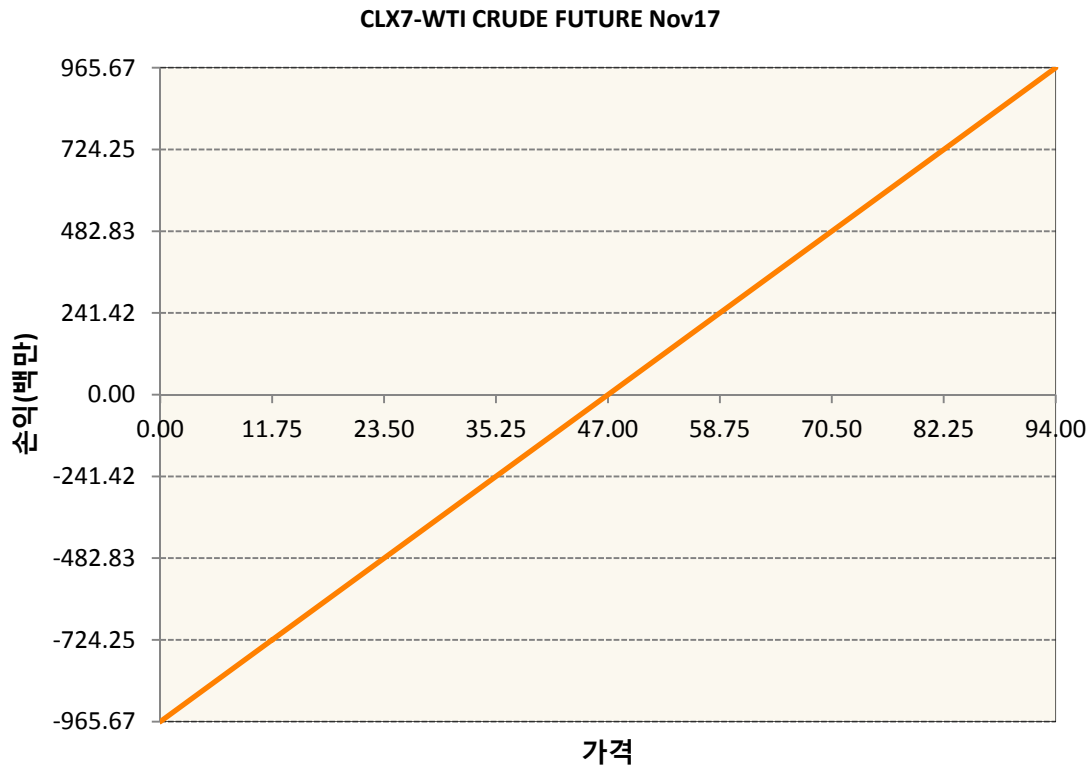
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

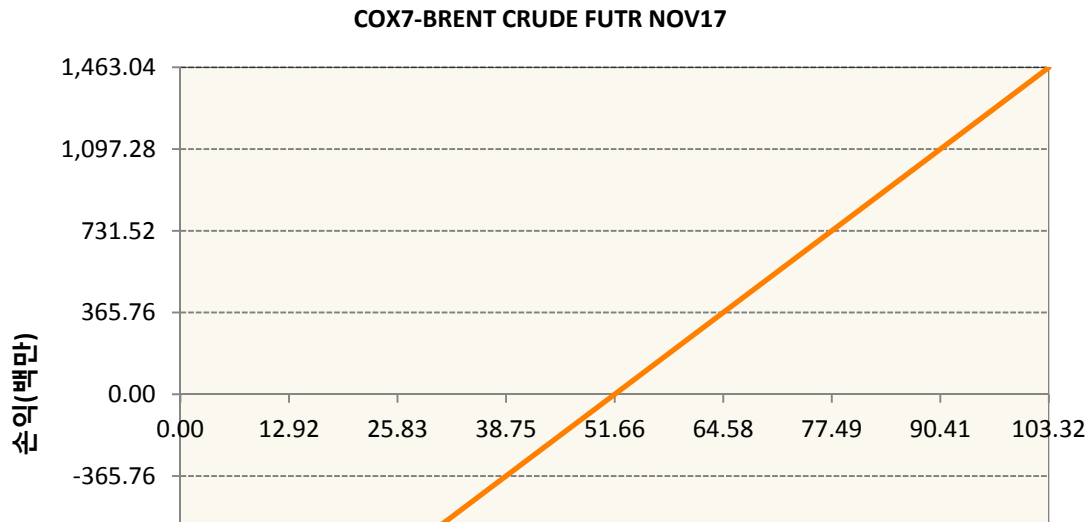
1. 계약금액

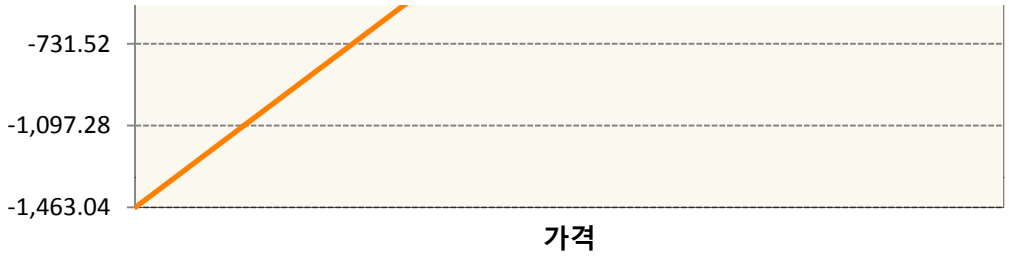
(단위:백만원)

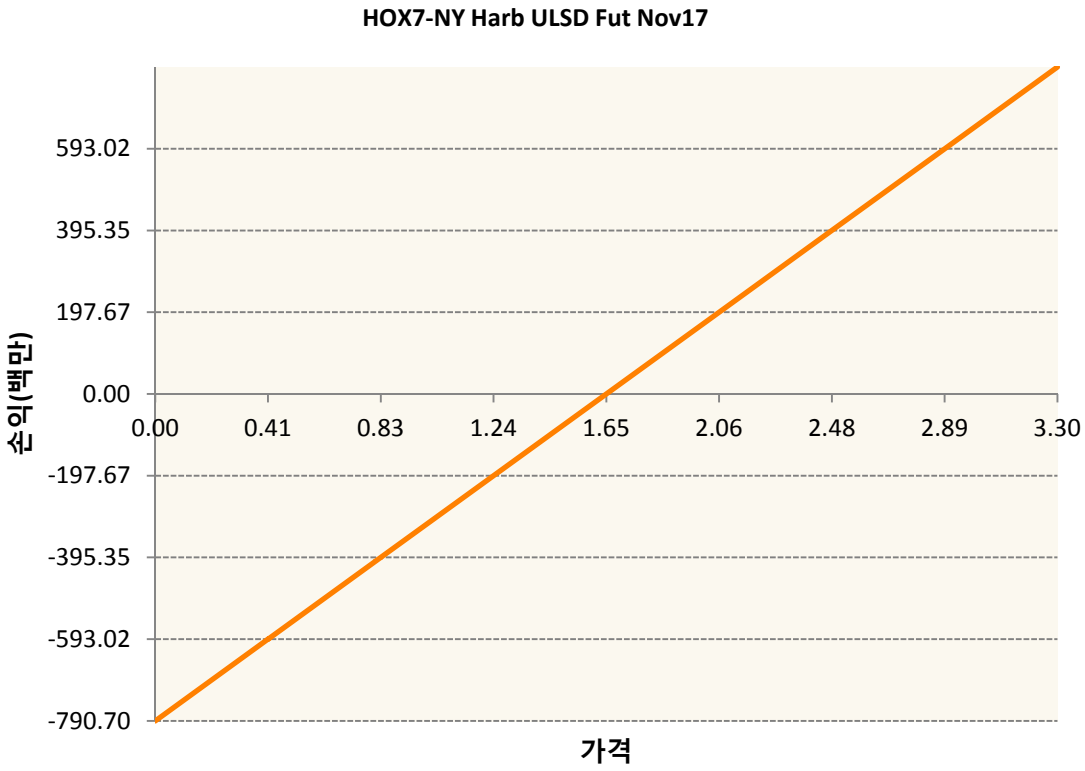
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	5,410	506	4,904	

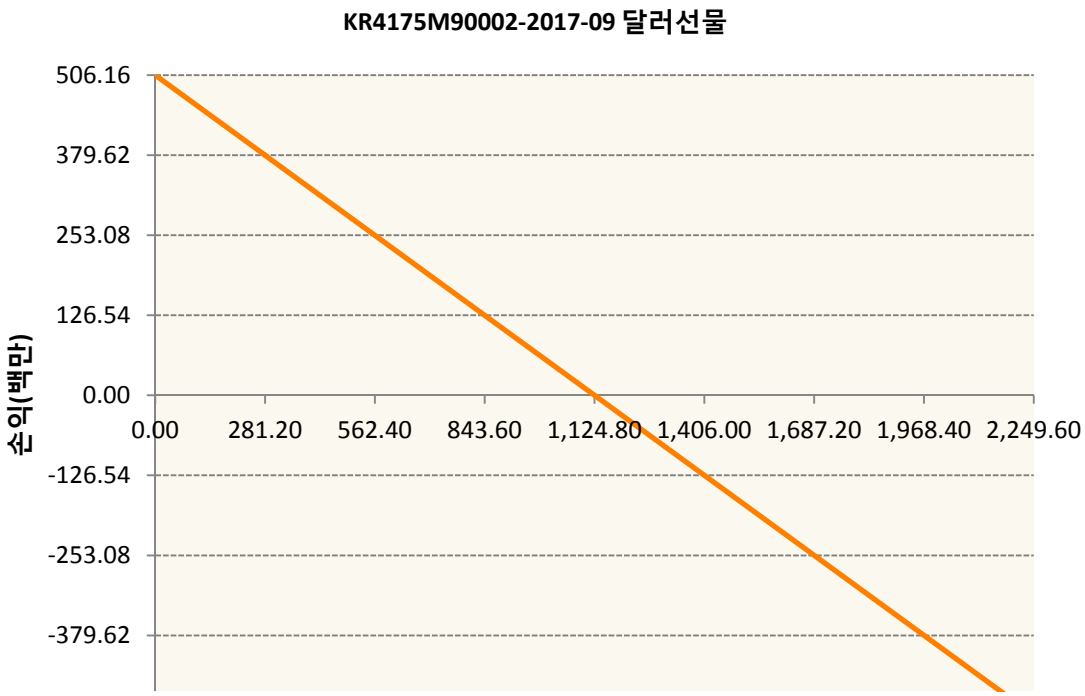
2. 만기시점의 손익구조

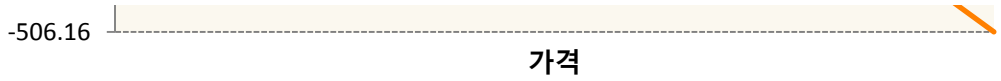


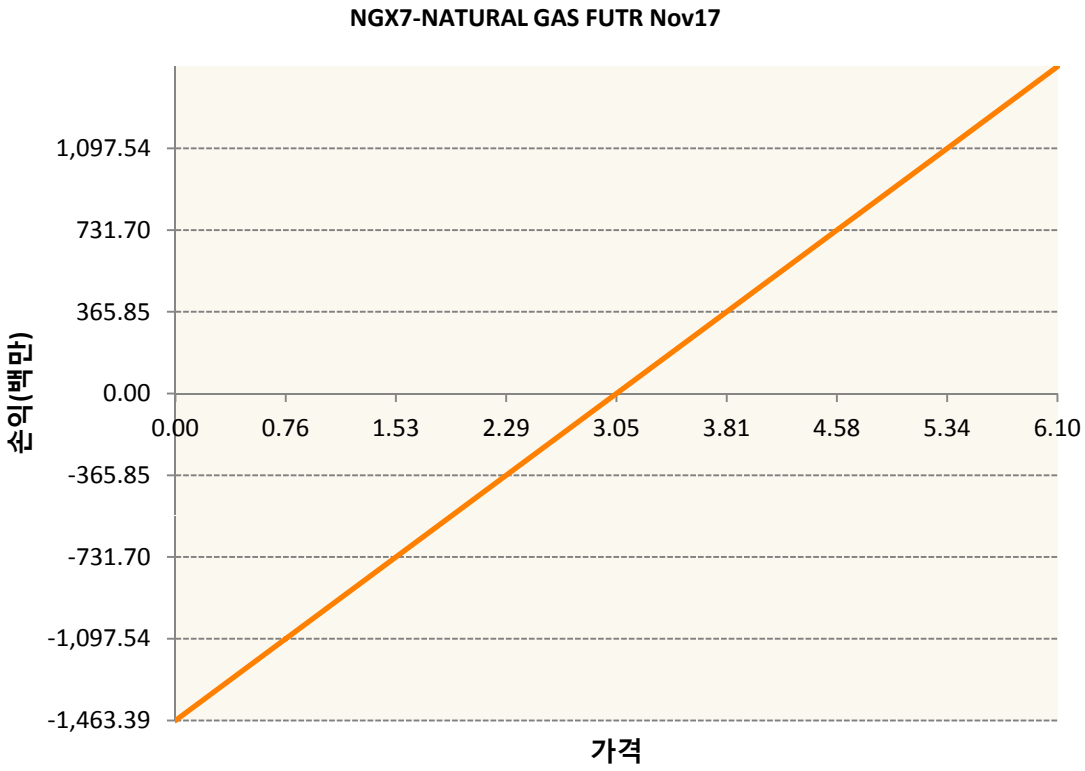


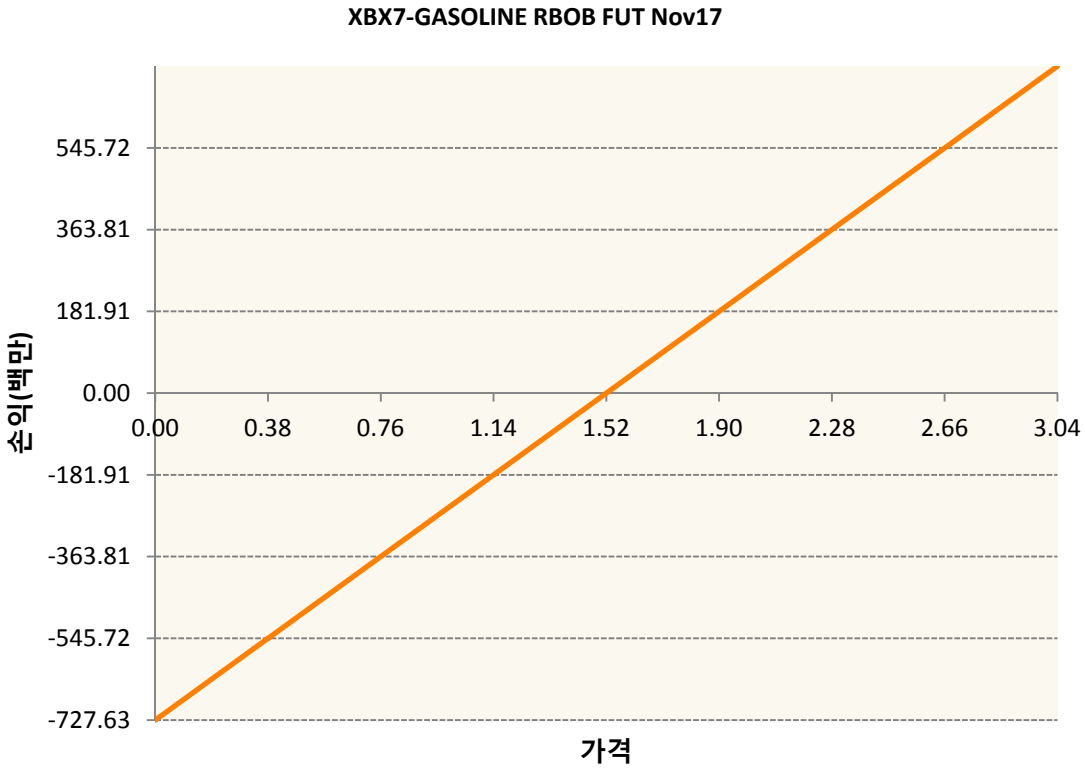

-731.52
-1,097.28
-1,463.04
가격


HOX7-NY Harb ULSD Fut Nov17
593.02
395.35
197.67
0.00
-197.67
-395.35
-593.02
-790.70
0.00
0.41
0.83
1.24
1.65
2.06
2.48
2.89
3.30
손익(백만)
가격


KR4175M90002-2017-09 달러선물
506.16
379.62
253.08
126.54
0.00
-126.54
-253.08
-379.62
0.00
281.20
562.40
843.60
1,124.80
1,406.00
1,687.20
1,968.40
2,249.60
손익(백만)


-506.16
가격


NGX7-NATURAL GAS FUTR Nov17
손익(백만)
1,097.54
731.70
365.85
0.00
-365.85
-731.70
-1,097.54
-1,463.39
0.00
0.76
1.53
2.29
3.05
3.81
4.58
5.34
6.10
가격


XBX7-GASOLINE RBOB FUT Nov17
손익(백만)
545.72
363.81
181.91
0.00
-181.91
-363.81
-545.72
-727.63
0.00
0.38
0.76
1.14
1.52
1.90
2.28
2.66
3.04
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	40
NGX7	NATURAL GAS FUTR Nov17	117
XBX7	GASOLINE RBOB FUT Nov17	58

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

774

공시일	2017-08-31
기준일	2017-08-30

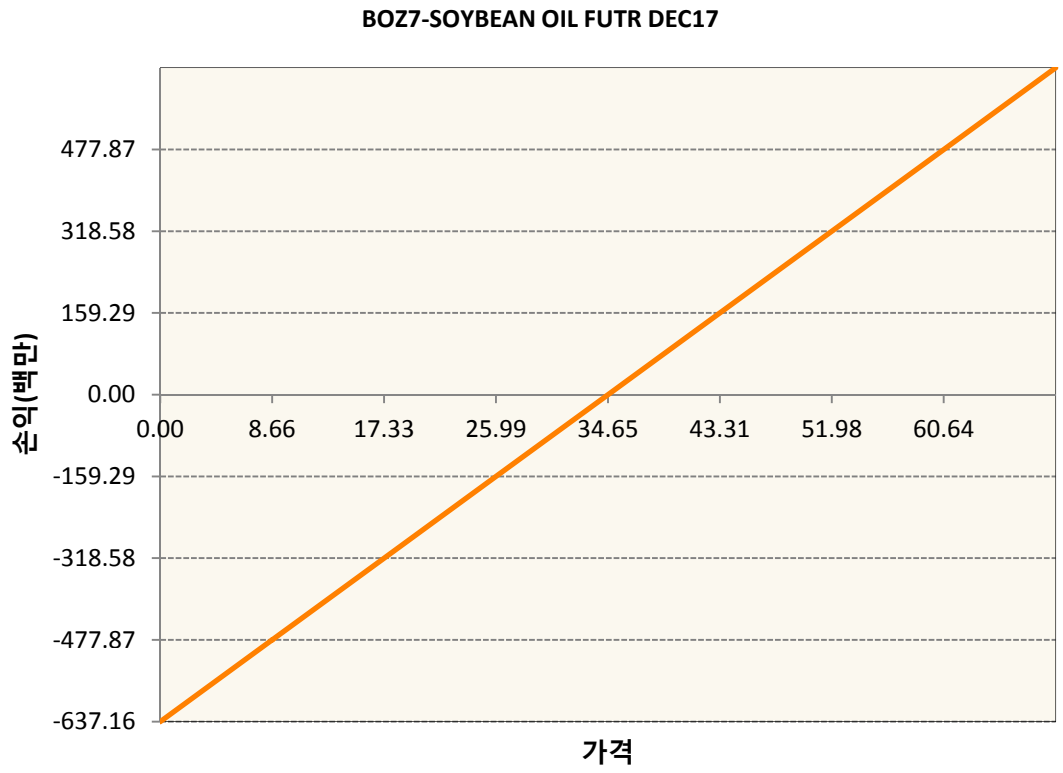
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

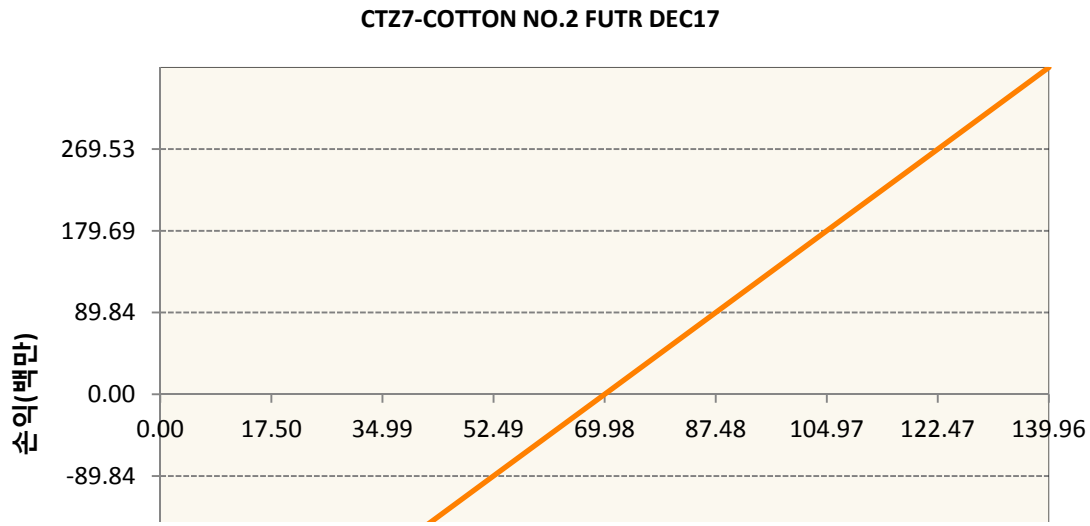
1. 계약금액

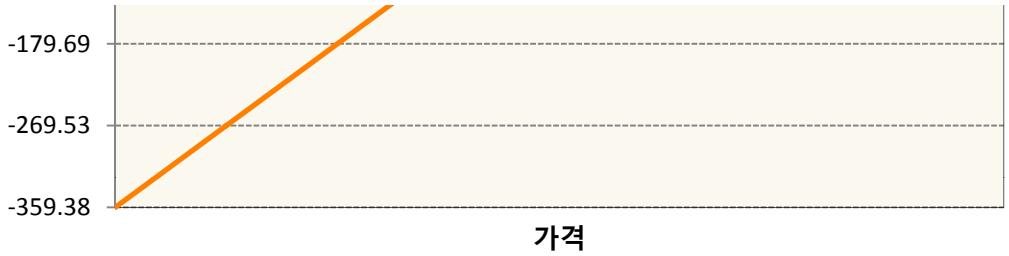
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	6,848	337	6,511	

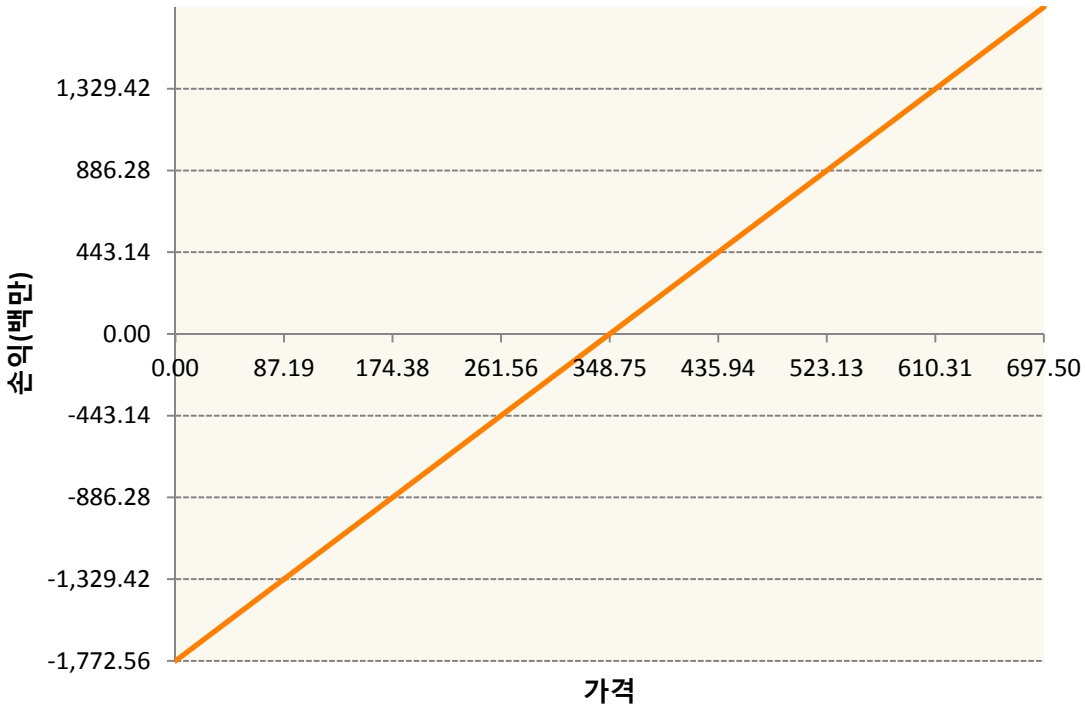
2. 만기시점의 손익구조



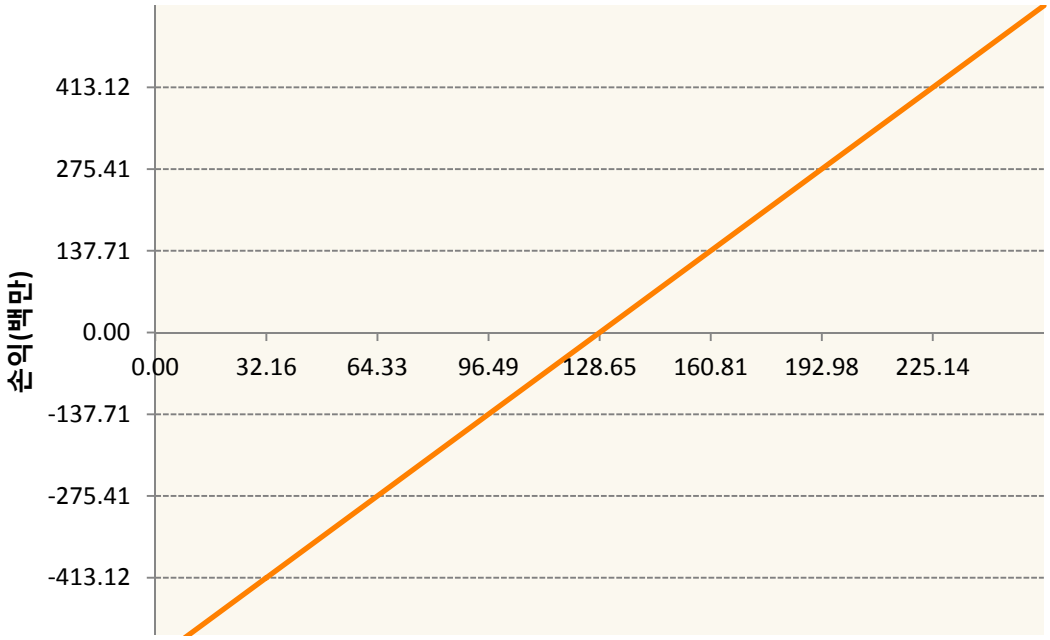


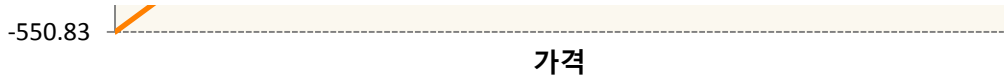


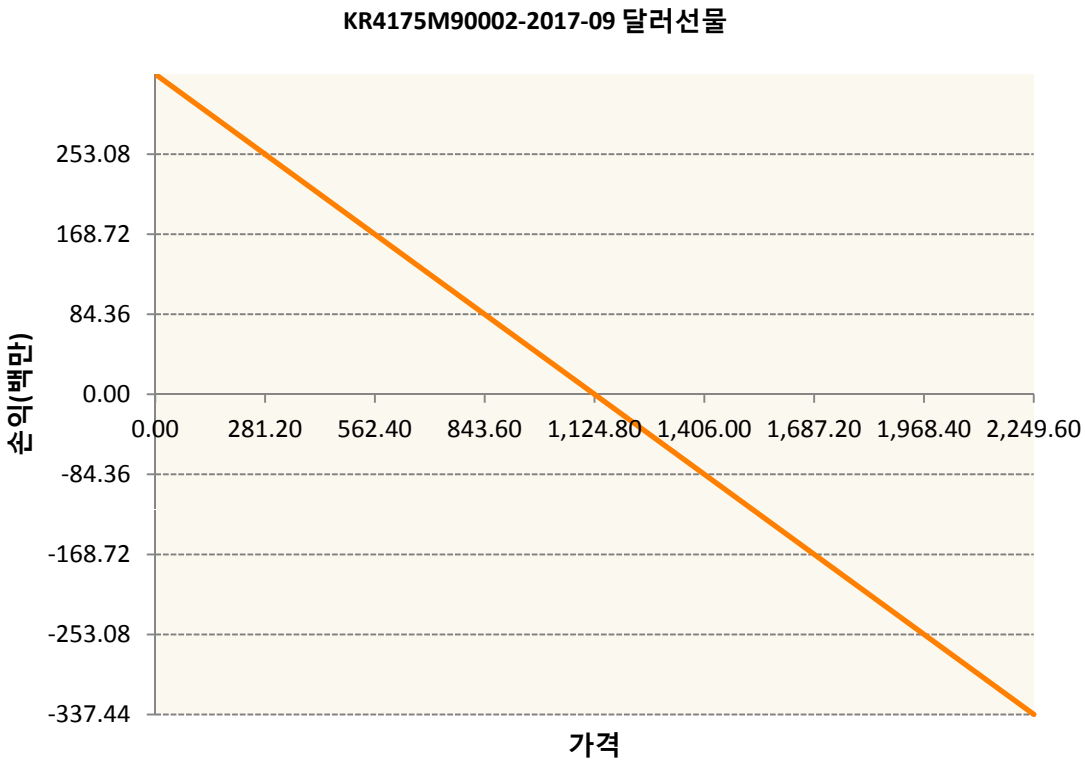
CZ7-CORN FUTURE DEC17

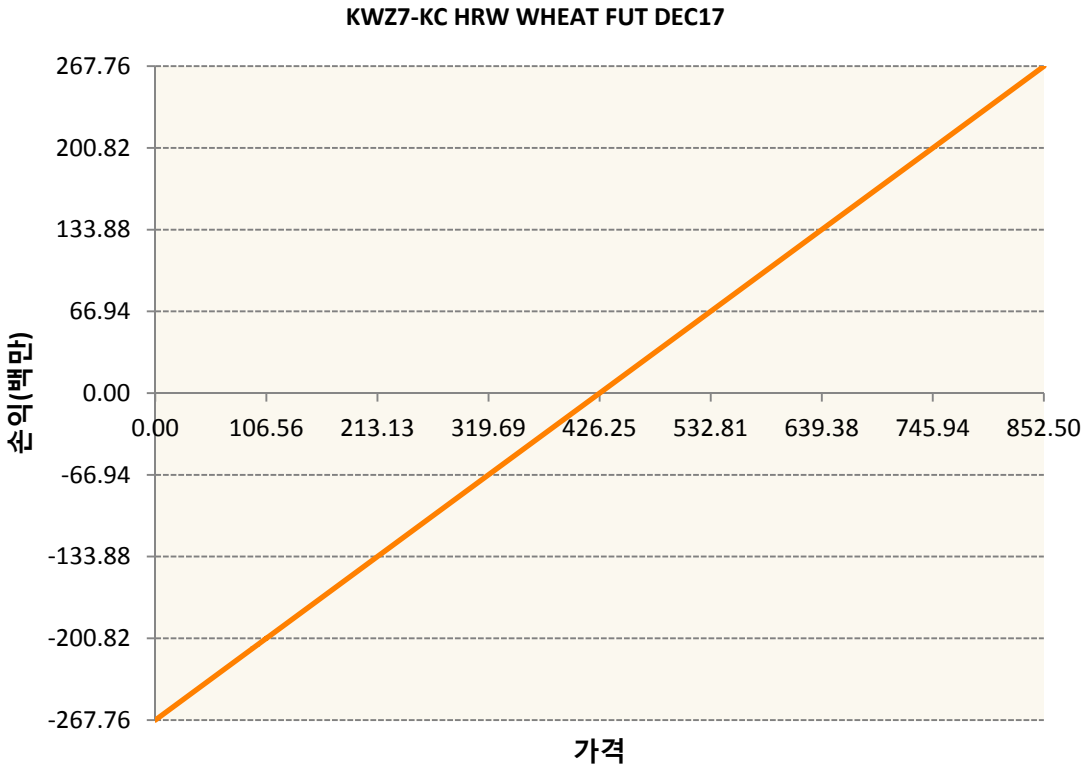


KCZ7-COFFEE 'C' FUTURE DEC17

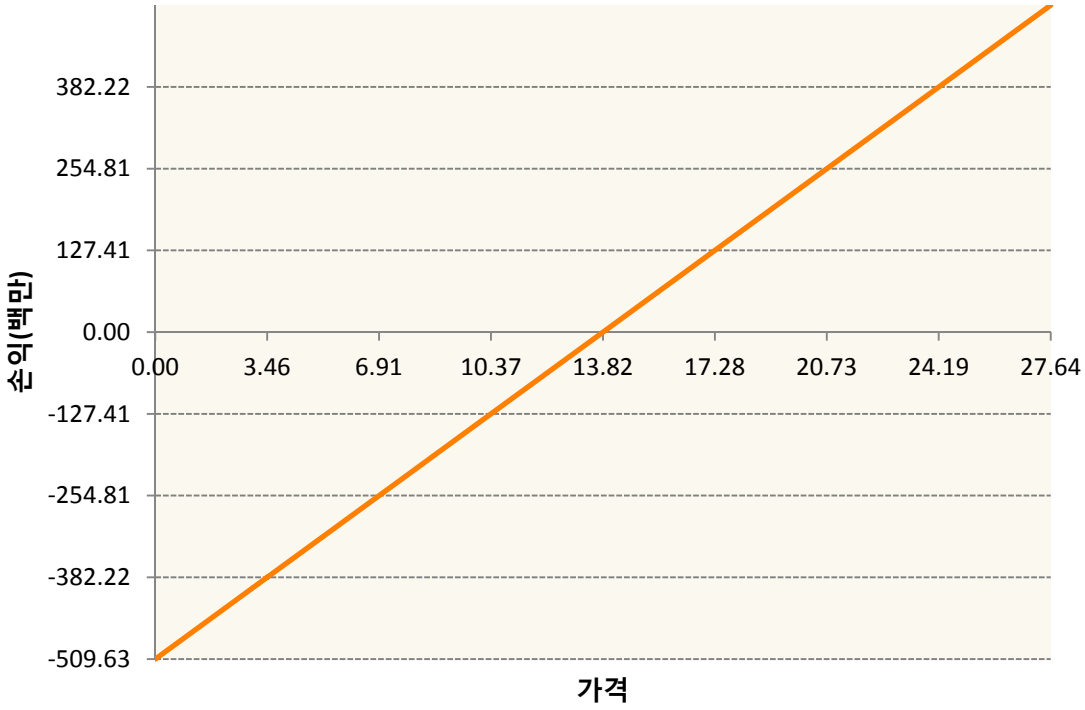



-550.83
가격

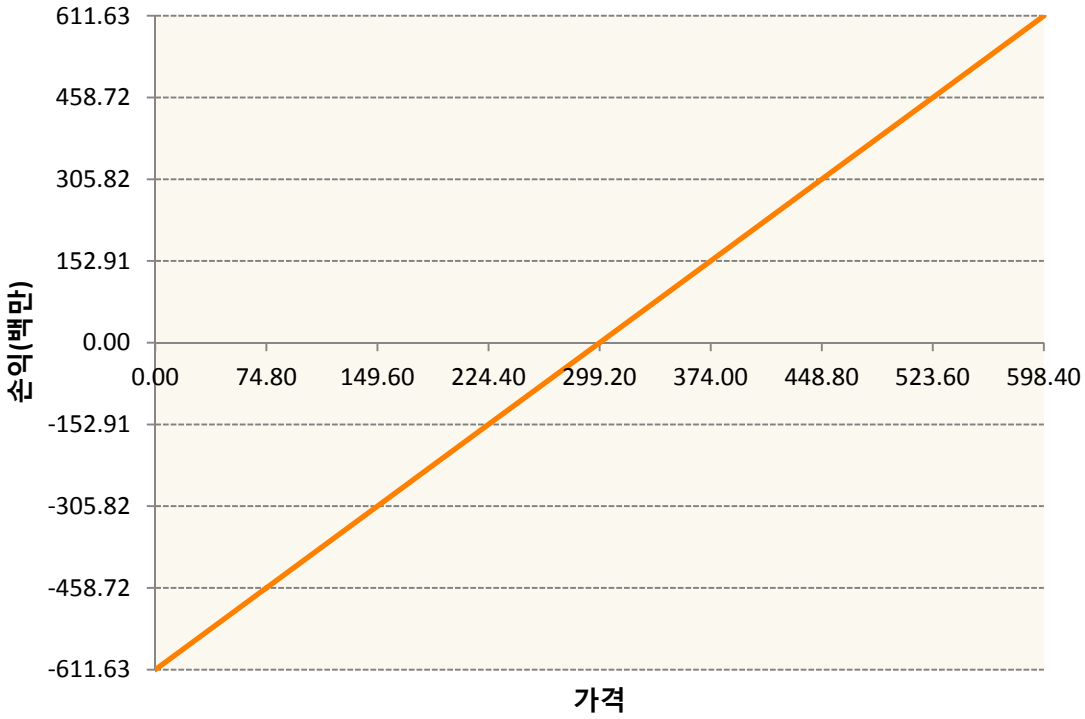

KR4175M90002-2017-09 달러선물
253.08
168.72
84.36
0.00
-84.36
-168.72
-253.08
-337.44
0.00
281.20
562.40
843.60
1,124.80
1,406.00
1,687.20
1,968.40
2,249.60
손익(백만)
가격


KWZ7-KC HRW WHEAT FUT DEC17
267.76
200.82
133.88
66.94
0.00
-66.94
-133.88
-200.82
-267.76
0.00
106.56
213.13
319.69
426.25
532.81
639.38
745.94
852.50
손익(백만)
가격

SBV7-SUGAR #11 (WORLD) OCT17

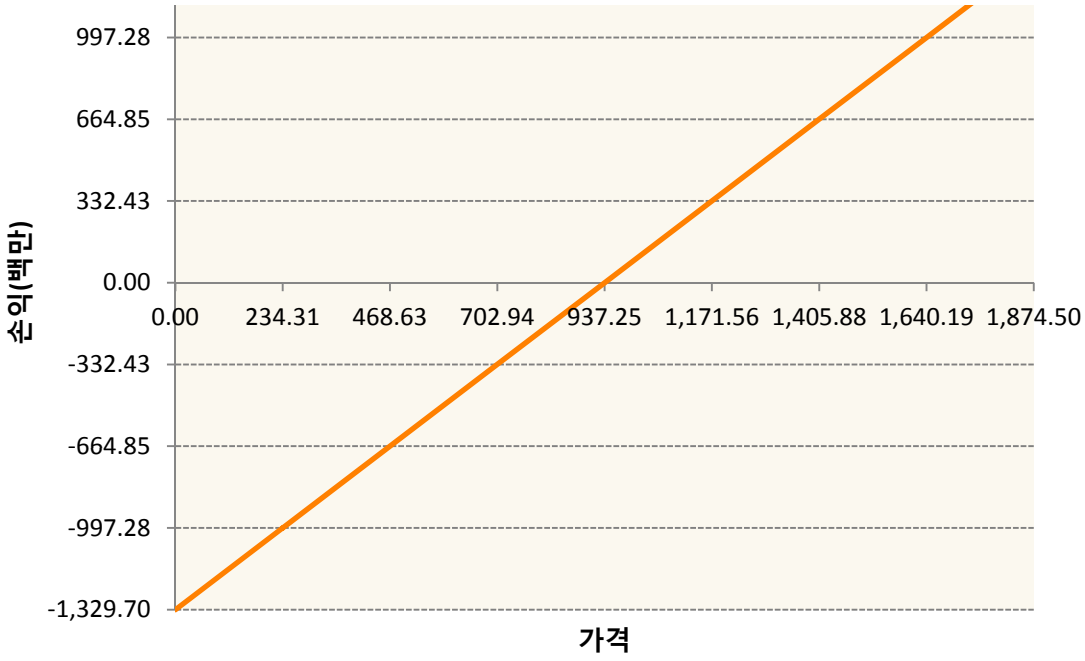


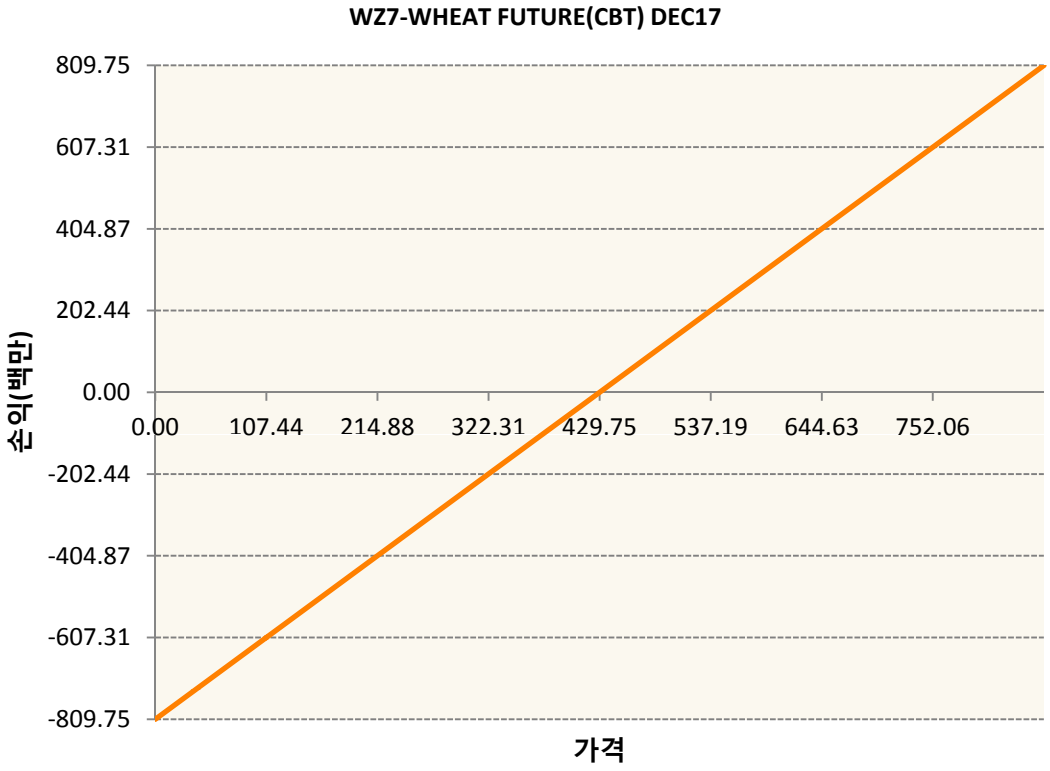
SMZ7-SOYBEAN MEAL FUTR DEC17



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	142
KCZ7	COFFEE 'C' FUTURE DEC17	44
KR4175M90(	2017-09 달러선물	27

KWZ7	KC HRW WHEAT FUT DEC17	21
SBV7	SUGAR #11 (WORLD) OCT17	41
SMZ7	SOYBEAN MEAL FUTR DEC17	49
SX7	SOYBEAN FUTURE NOV17	106
WZ7	WHEAT FUTURE(CBT) DEC17	65

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

646