공시일	2017-09-01
기준일	2017-08-31

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	2017-09-01
기준일	2017-08-31

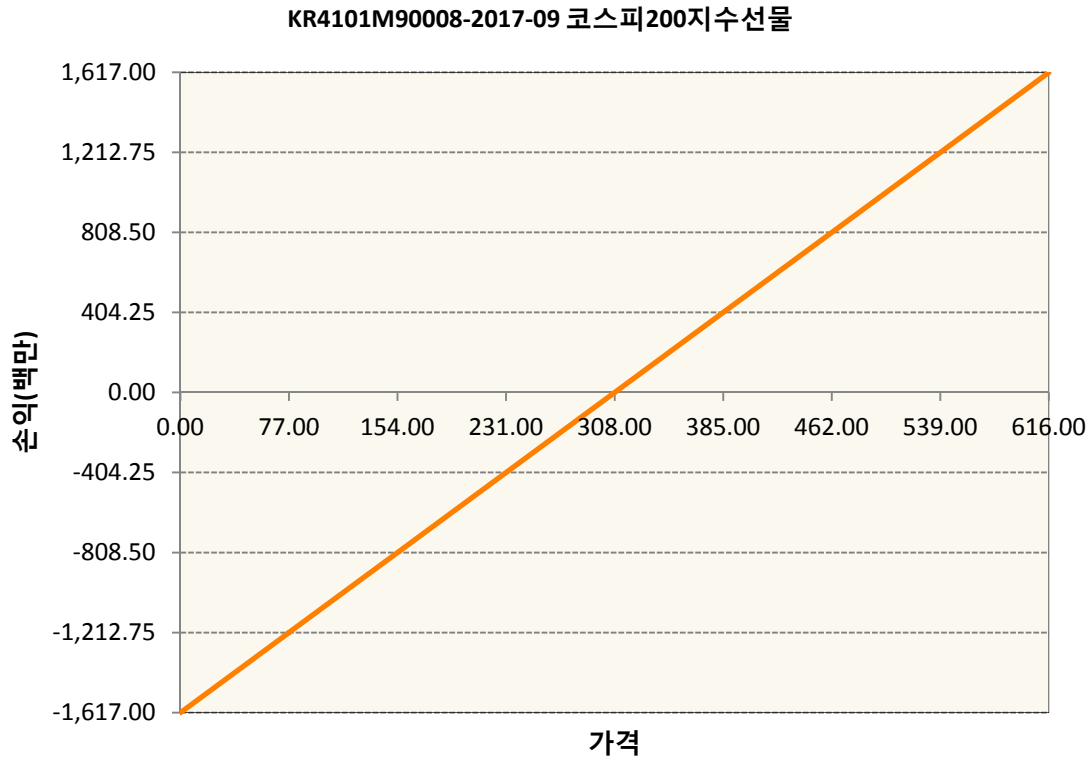
스마트인덱스모

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	1,617	0	1,617	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

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

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

81

공시일	2017-09-01
기준일	2017-08-31

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	1,016

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

460

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-09-01
기준일	2017-08-31

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	414

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

356

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-09-01
기준일	2017-08-31

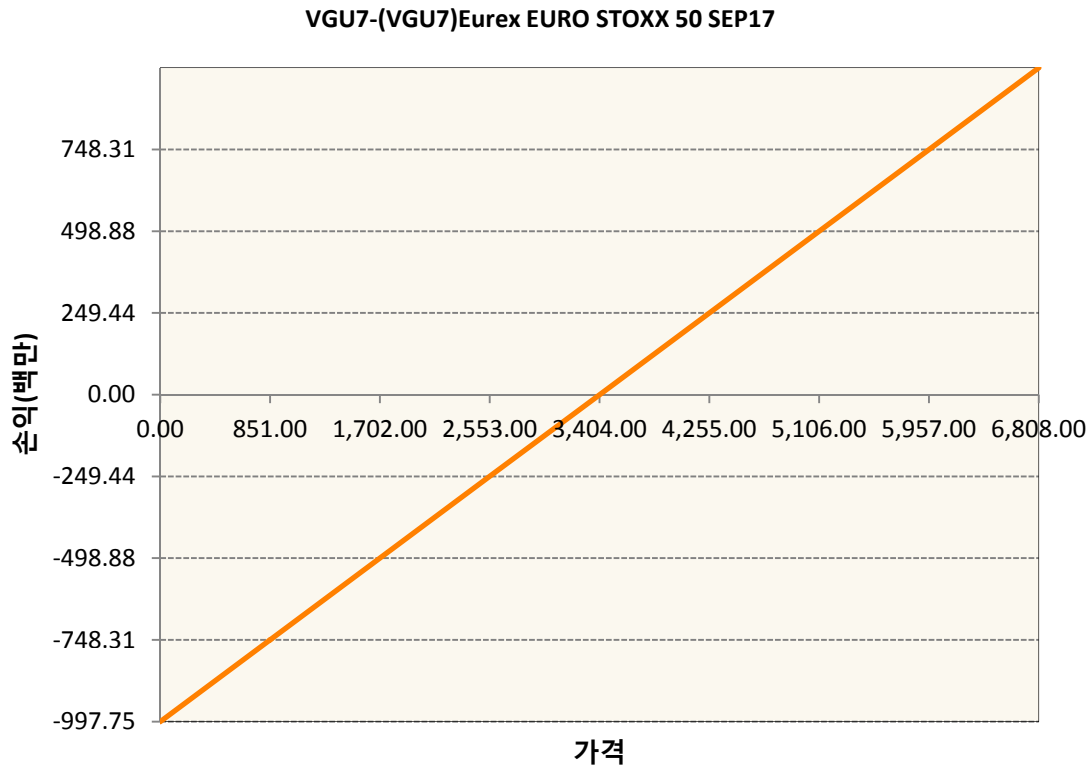
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	998	0	998	

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	2017-09-01
기준일	2017-08-31

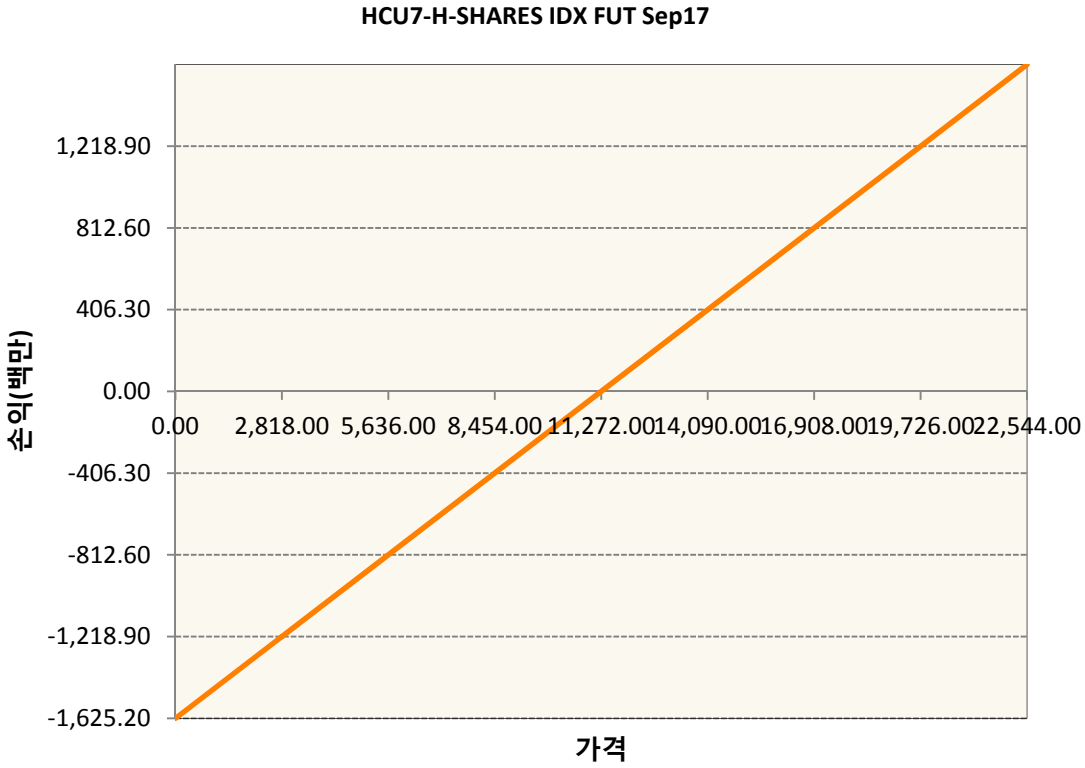
차이나인덱스모(주식-파생형)

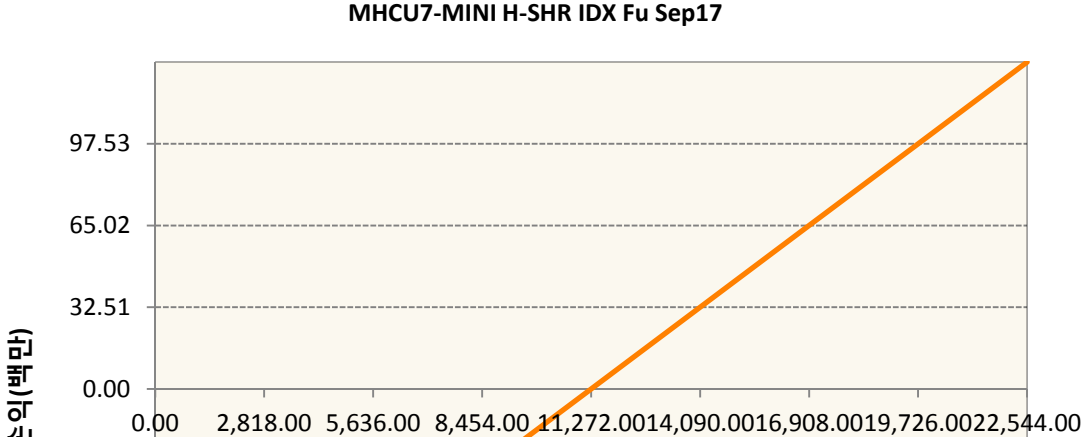
1. 계약금액

(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	1,625	0	1,625	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	2017-09-01
기준일	2017-08-31

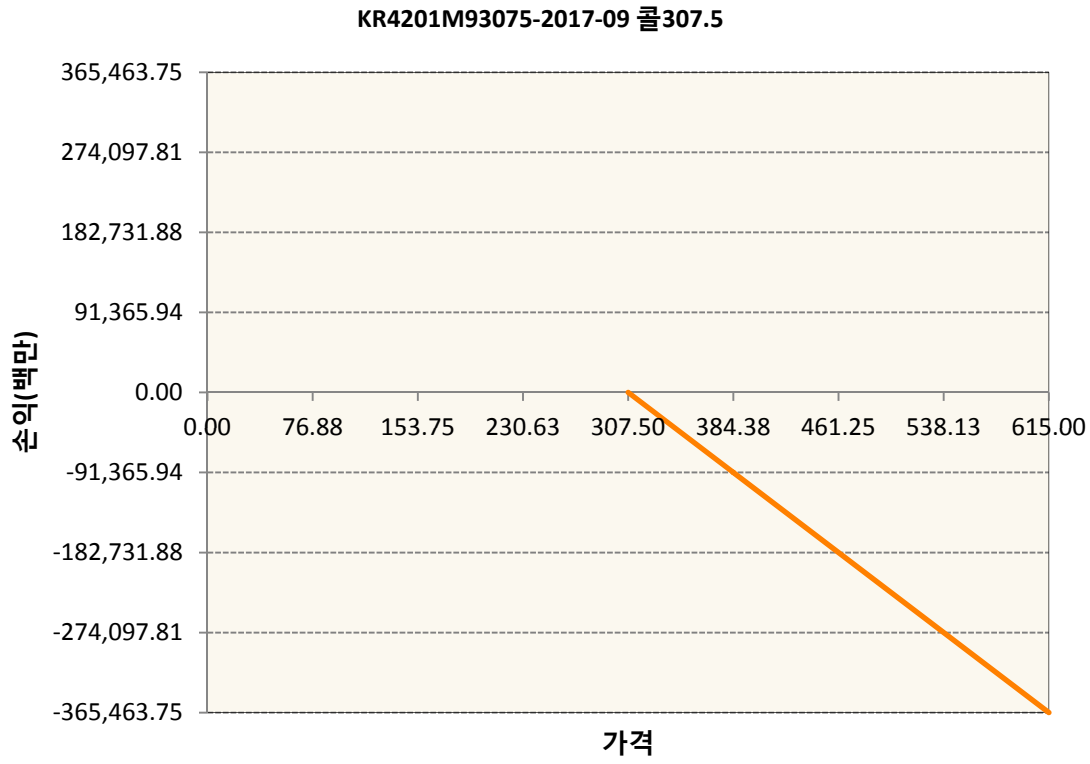
커버드콜모(주식혼합-파생형)

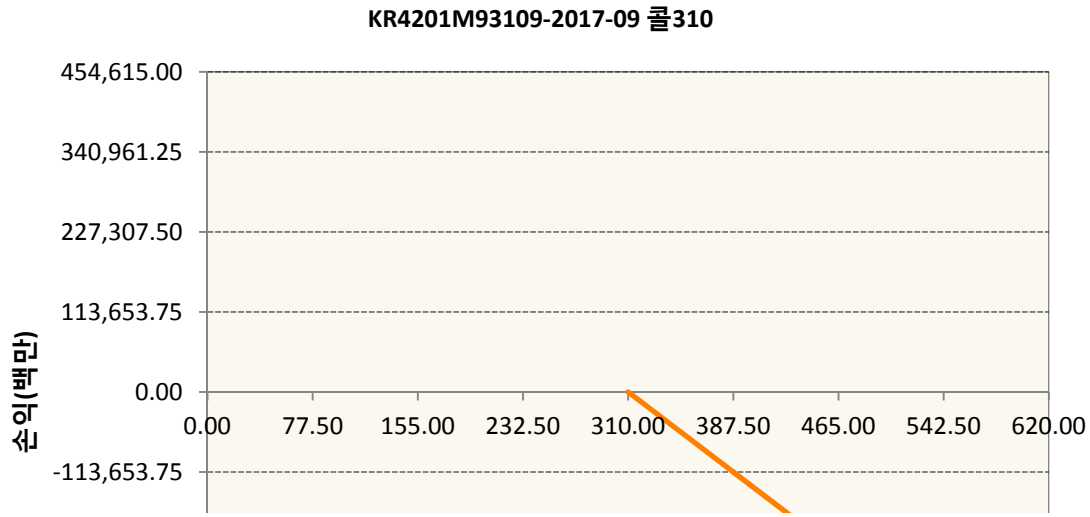
1. 계약금액

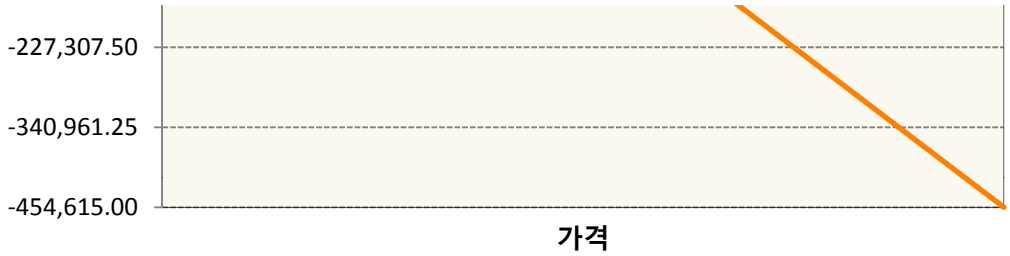
(단위:백만원)

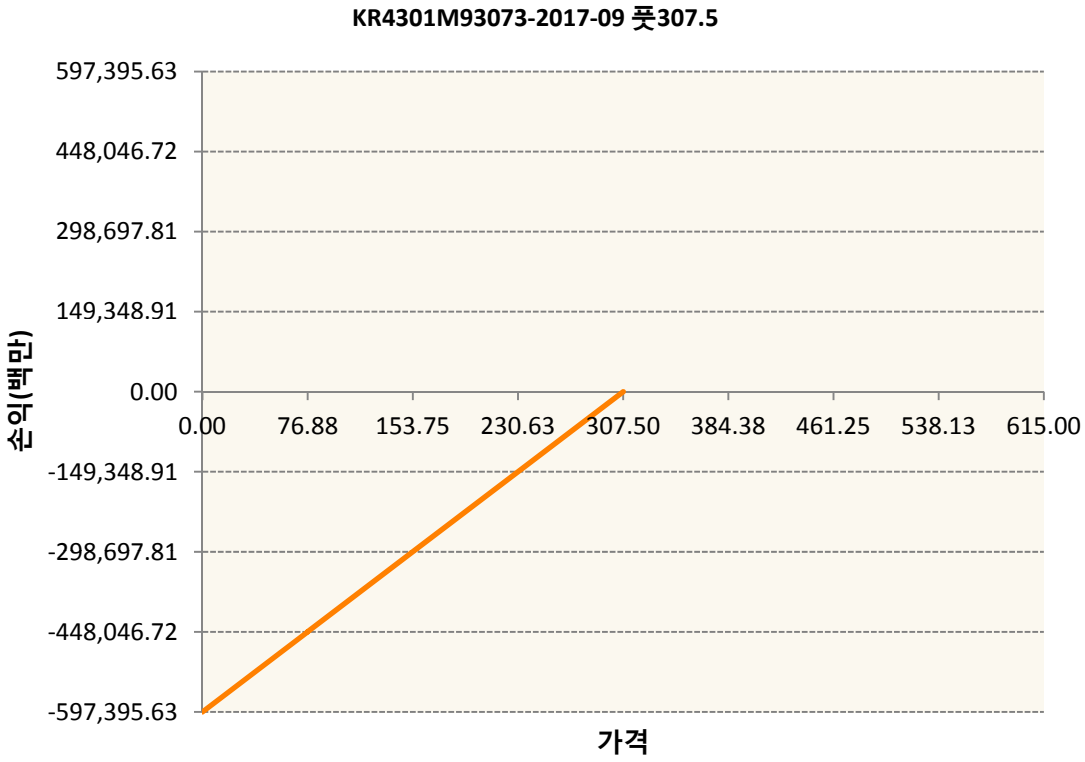
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	1,481,722	-1,481,722	장내

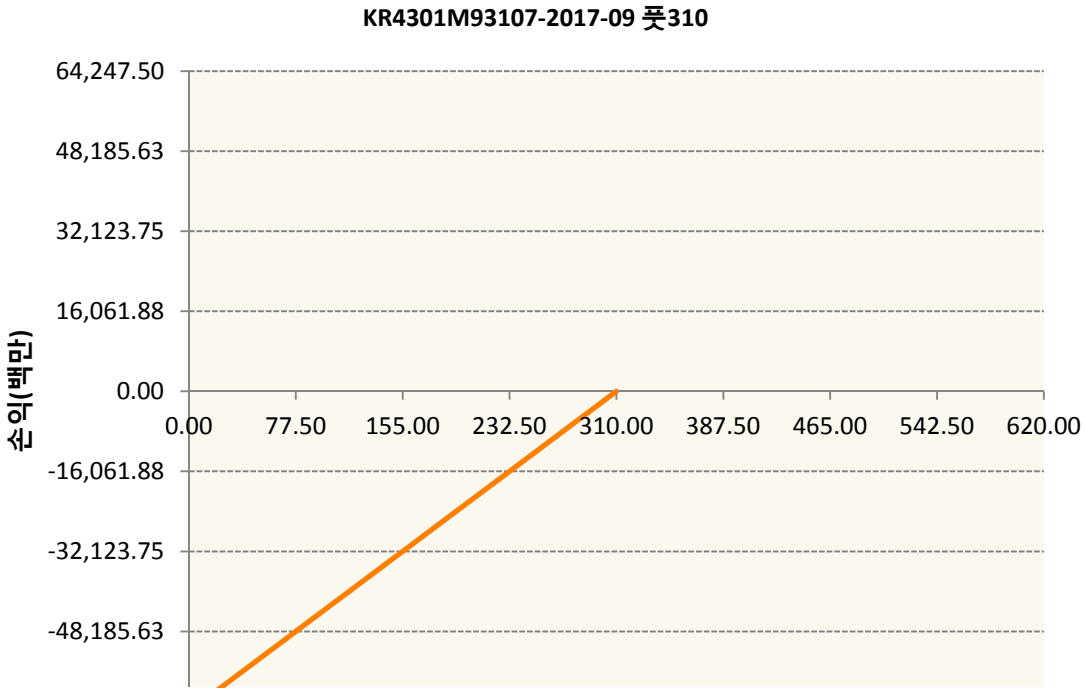
2. 만기시점의 손익구조

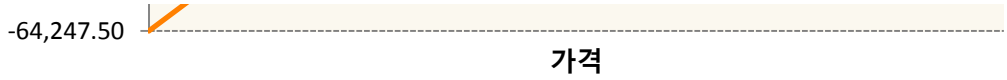





-227,307.50
-340,961.25
-454,615.00
가격


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							23,962
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	6,959	6,920	6,859	6,771	6,656	6,513	6,343
-5.33%	6,685	6,508	6,292	6,041	5,760	5,453	5,122
-2.67%	5,352	4,930	4,490	4,035	3,569	3,093	2,609
0%	1,627	1,085	542	0	-543	-1,085	-1,628
2.67%	-5,034	-5,429	-5,848	-6,287	-6,741	-7,208	-7,686
5.33%	-13,732	-13,903	-14,114	-14,362	-14,644	-14,954	-15,289
8.00%	-23,259	-23,305	-23,376	-23,478	-23,609	-23,771	-23,962
KR4201M93: 2017-09 콜310							27,994
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	6,858	6,830	6,781	6,706	6,602	6,467	6,301
-5.33%	6,666	6,513	6,314	6,072	5,790	5,472	5,121
-2.67%	5,562	5,128	4,659	4,162	3,643	3,105	2,552
0%	1,999	1,334	667	0	-668	-1,337	-2,007
2.67%	-5,160	-5,734	-6,327	-6,933	-7,551	-8,177	-8,811
5.33%	-15,282	-15,574	-15,916	-16,301	-16,721	-17,173	-17,650
8.00%	-26,832	-26,924	-27,056	-27,231	-27,447	-27,702	-27,994
KR4301M93(2017-09 풋307.5							37,516
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-36,510	-36,573	-36,673	-36,817	-37,005	-37,239	-37,516
-5.33%	-20,995	-21,285	-21,638	-22,048	-22,507	-23,010	-23,551
-2.67%	-7,213	-7,902	-8,622	-9,365	-10,128	-10,906	-11,696
0%	2,659	1,773	887	0	-887	-1,774	-2,661
2.67%	7,733	7,088	6,402	5,685	4,942	4,179	3,398
5.33%	9,476	9,197	8,852	8,446	7,987	7,480	6,932
8.00%	9,865	9,790	9,673	9,508	9,293	9,028	8,716
KR4301M93: 2017-09 풋310							4,218
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-4,139	-4,143	-4,150	-4,161	-4,175	-4,194	-4,218
-5.33%	-2,464	-2,485	-2,513	-2,547	-2,587	-2,632	-2,682
-2.67%	-917	-978	-1,044	-1,115	-1,188	-1,264	-1,342
0%	282	188	94	0	-94	-189	-284
2.67%	974	892	809	723	636	547	458

5.33%	1,246	1,204	1,156	1,102	1,042	979	911
8.00%	1,316	1,303	1,285	1,260	1,229	1,193	1,152

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

98,172

공시일	2017-09-01
기준일	2017-08-31

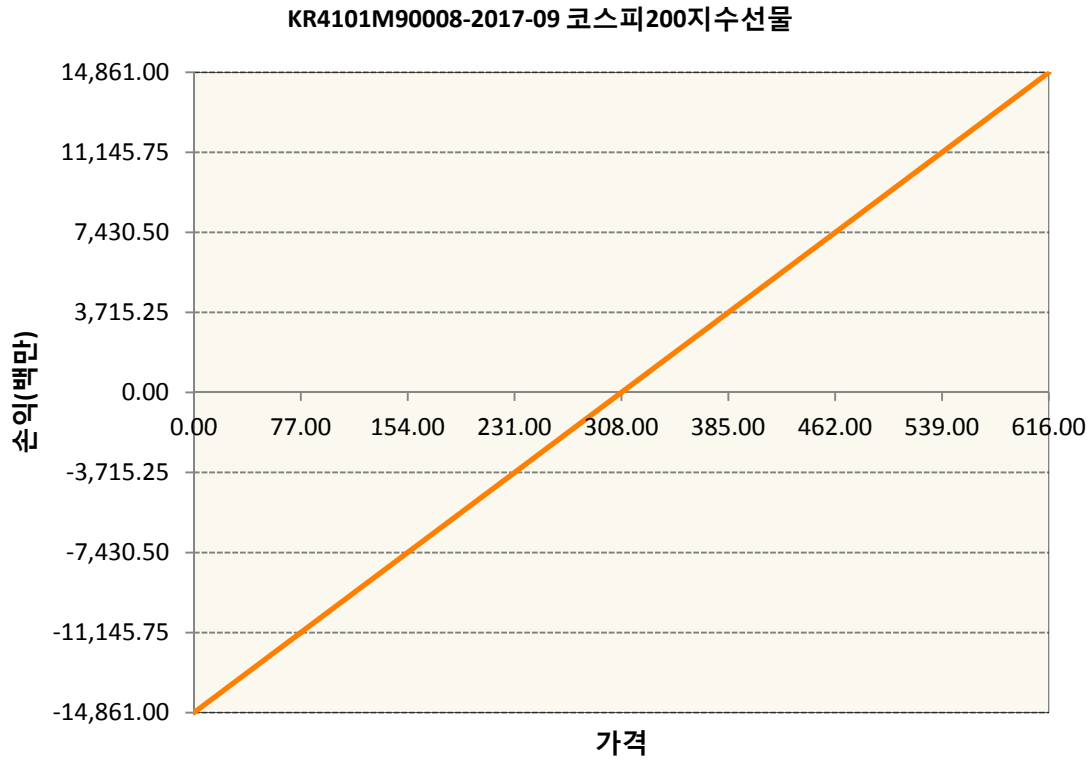
ETF스마트레버리지목표전환형6호

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	14,861	0	14,861	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101M90(2017-09 코스피200지수선물							1,190
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,190	-1,190	-1,190	-1,190	-1,190	-1,190	-1,190
-5.33%	-793	-793	-793	-793	-793	-793	-793
-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%	793	793	793	793	793	793	793
8.00%	1,190	1,190	1,190	1,190	1,190	1,190	1,190

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

741

공시일	2017-09-01
기준일	2017-08-31

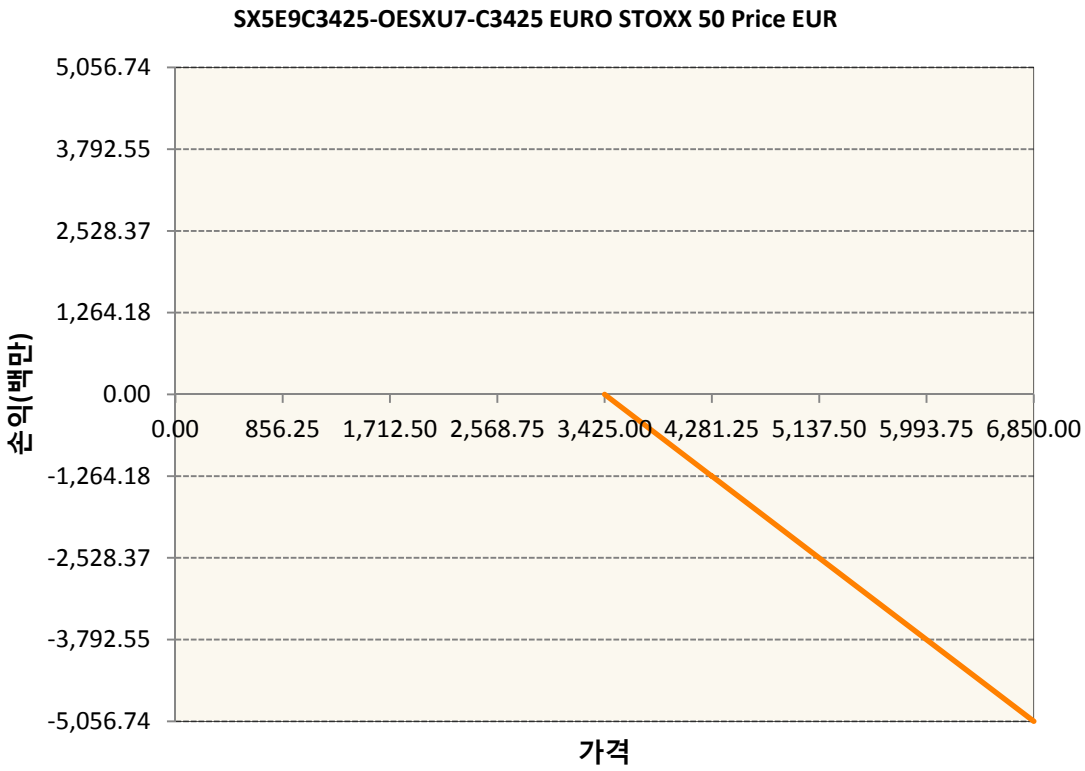
유로커버드콜(주식혼합-파생형)

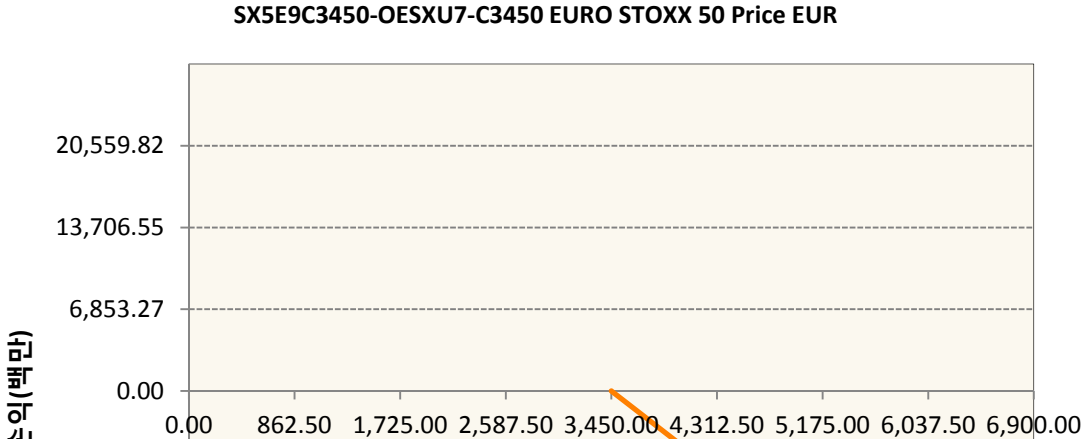
1. 계약금액

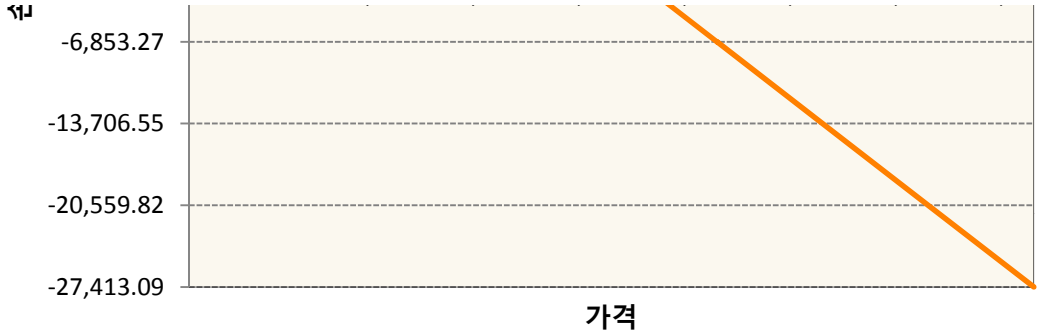
(단위:백만원)

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	27,796	0	27,796	
누계	유가증권	옵션	0	64,940	-64,940	장내

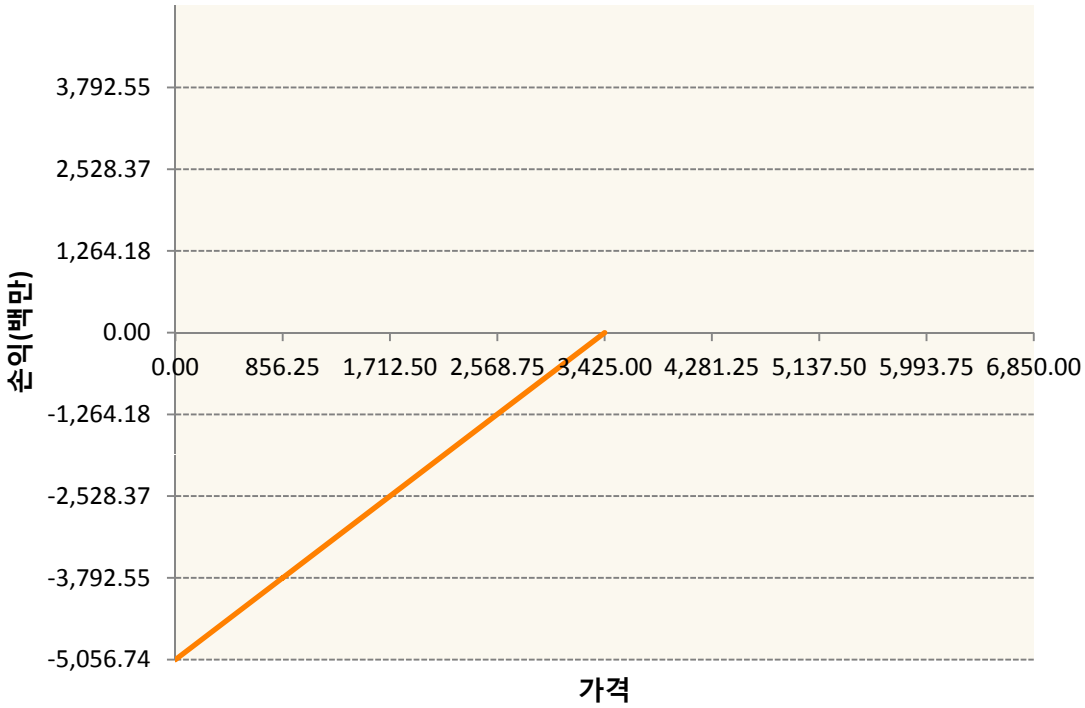
2. 만기시점의 손익구조



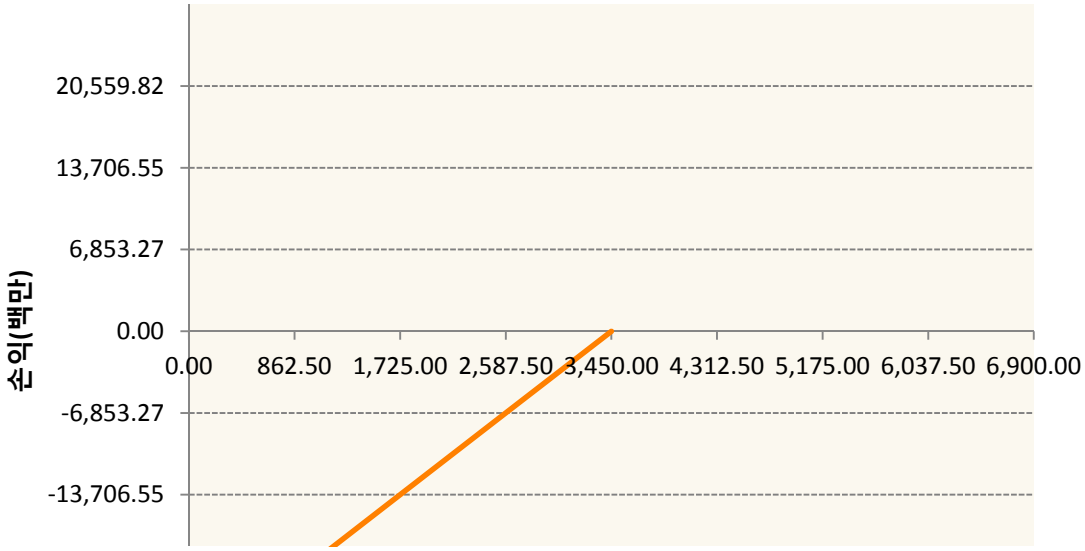


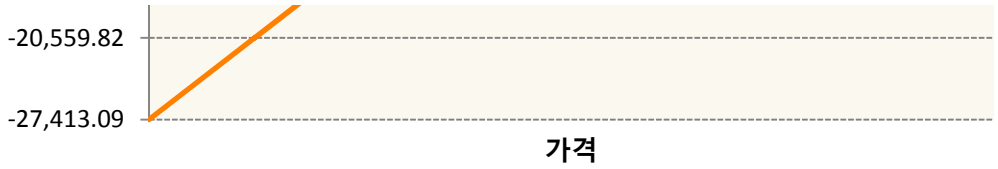


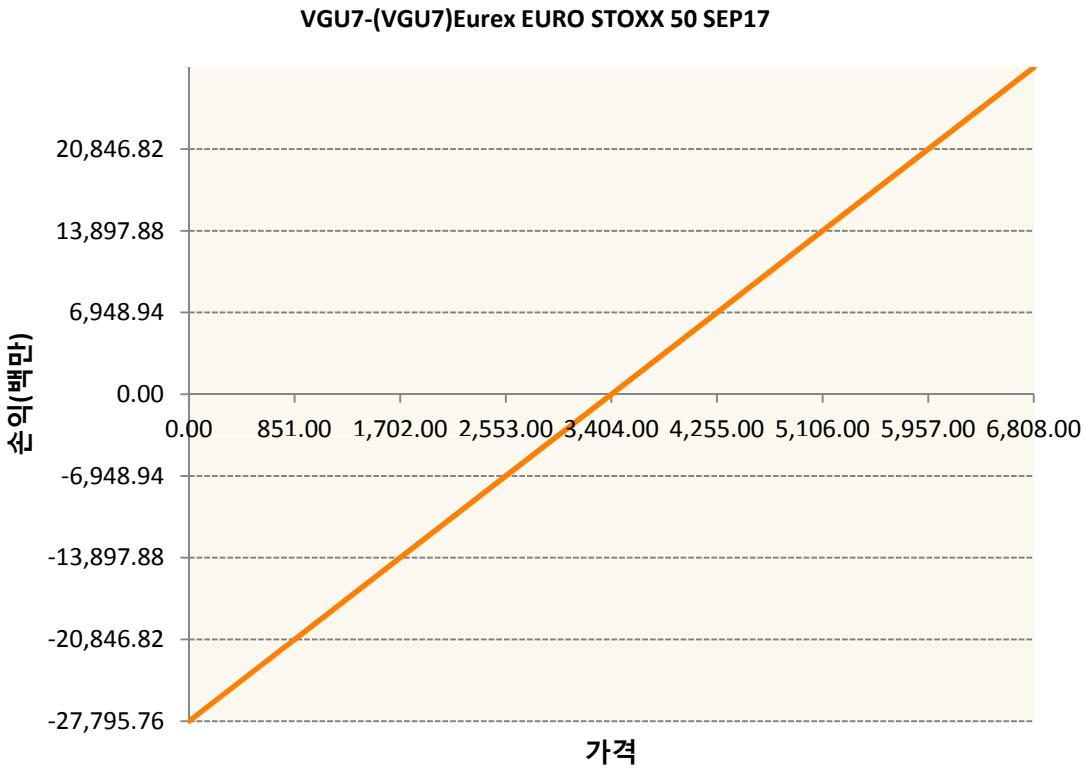
SX5E9P3425-OESXU7-P3425 EURO STOXX 50 Price EUR



SX5E9P3450-OESXU7-P3450 EURO STOXX 50 Price EUR







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
SX5E9C3425	OESXU7-C3425 EURO STOXX 50 Price EUR	405
SX5E9C3450	OESXU7-C3450 EURO STOXX 50 Price EUR	2,193
SX5E9P3425	OESXU7-P3425 EURO STOXX 50 Price EUR	405
SX5E9P3450	OESXU7-P3450 EURO STOXX 50 Price EUR	2,193
VGU7	(VGU7)Eurex EURO STOXX 50 SEP17	2,224

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	5,938

공시일	2017-09-01
기준일	2017-08-31

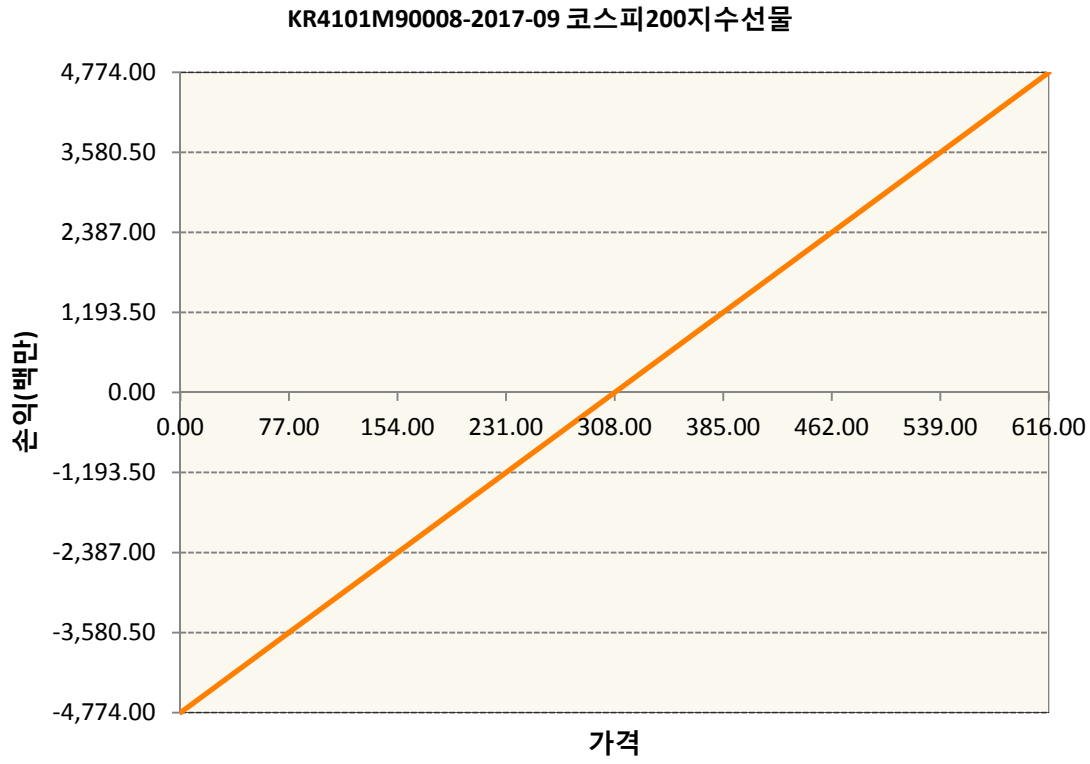
ETF스마트레버리지목표전환형7호

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	4,774	0	4,774	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101M90(2017-09 코스피200지수선물							382
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-382	-382	-382	-382	-382	-382	-382
-5.33%	-255	-255	-255	-255	-255	-255	-255
-2.67%	-127	-127	-127	-127	-127	-127	-127
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	127	127	127	127	127	127	127
5.33%	255	255	255	255	255	255	255
8.00%	382	382	382	382	382	382	382

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

238

공시일	2017-09-01
기준일	2017-08-31

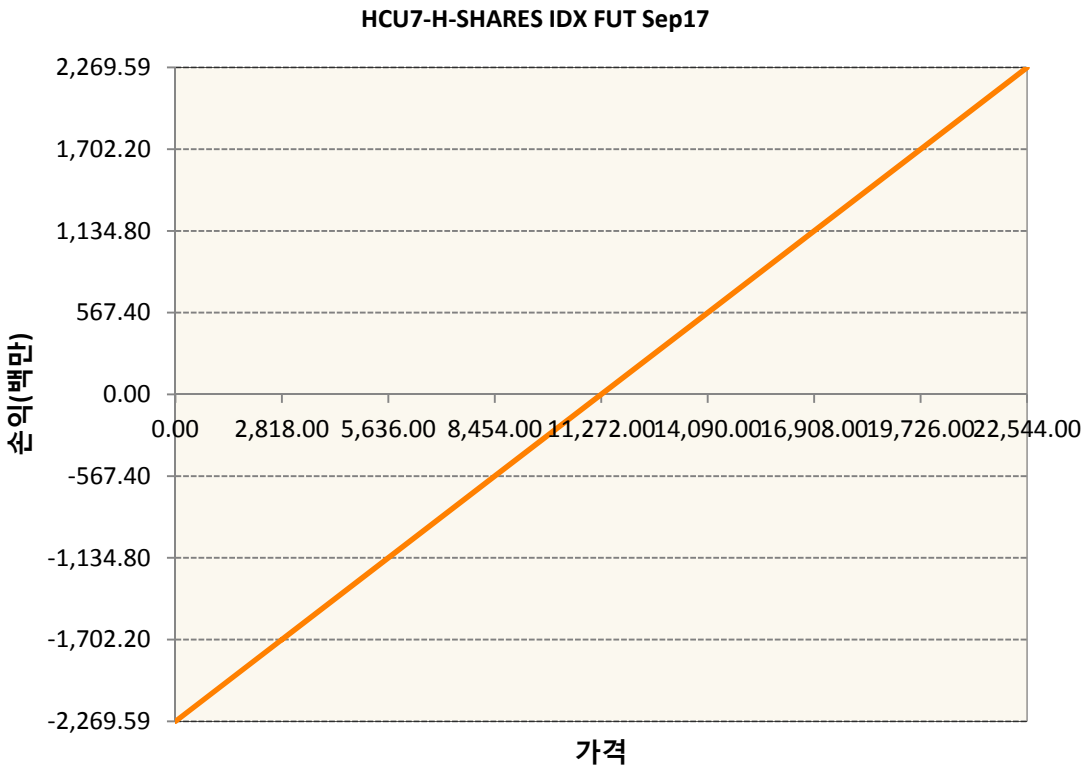
홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생

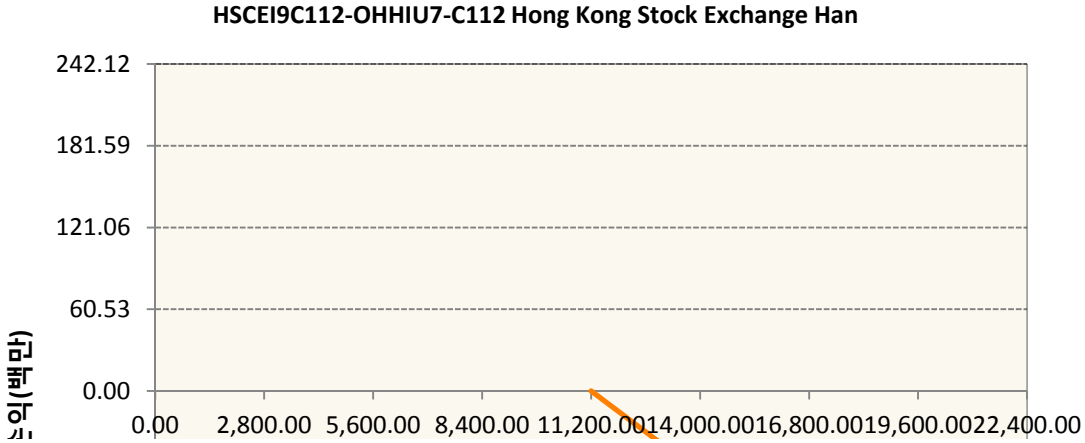
1. 계약금액

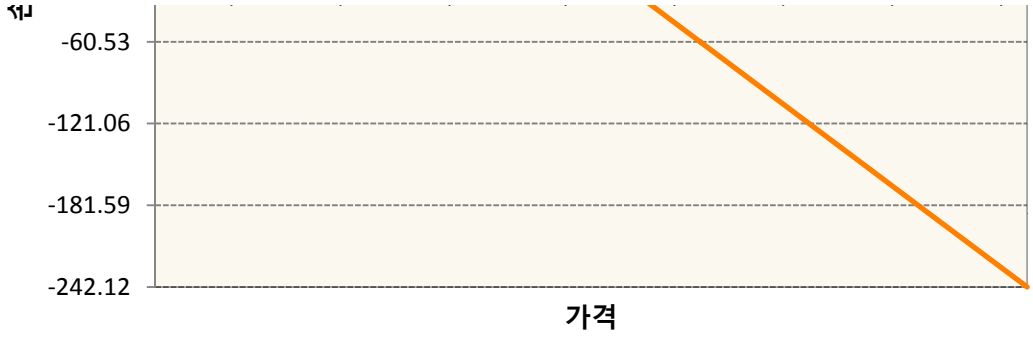
(단위:백만원)

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	2,270	0	2,270	장내
누계	유가증권	옵션	0	4,592	-4,592	장내

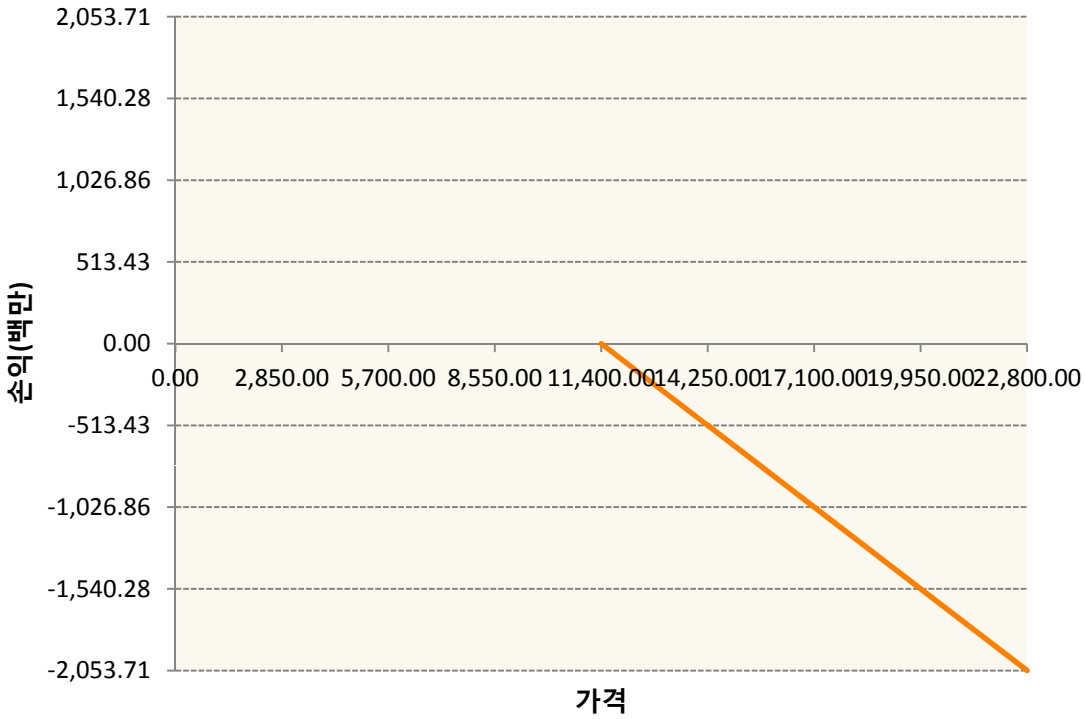
2. 만기시점의 손익구조



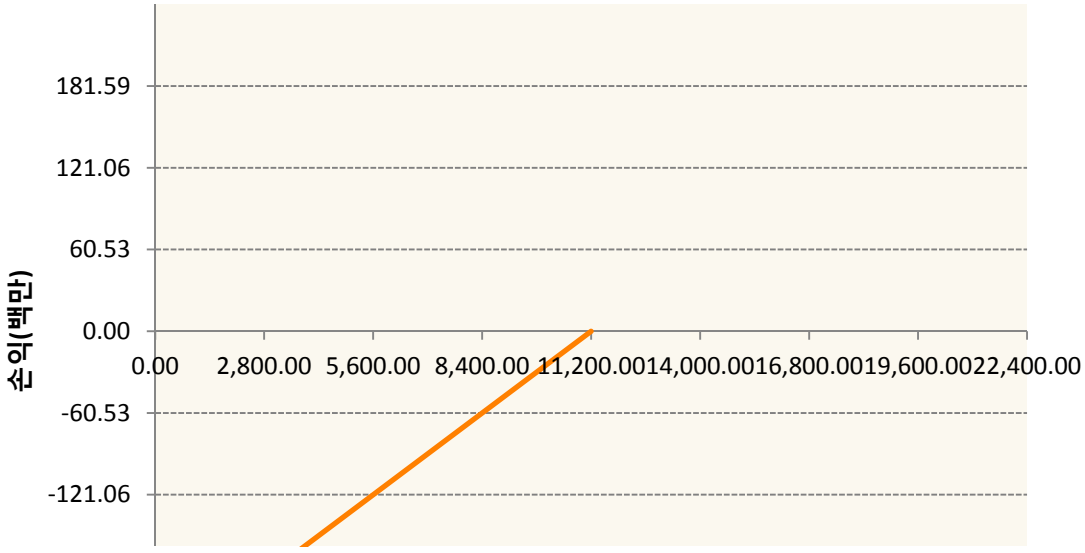


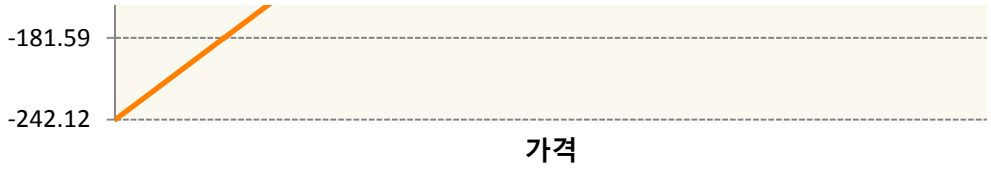


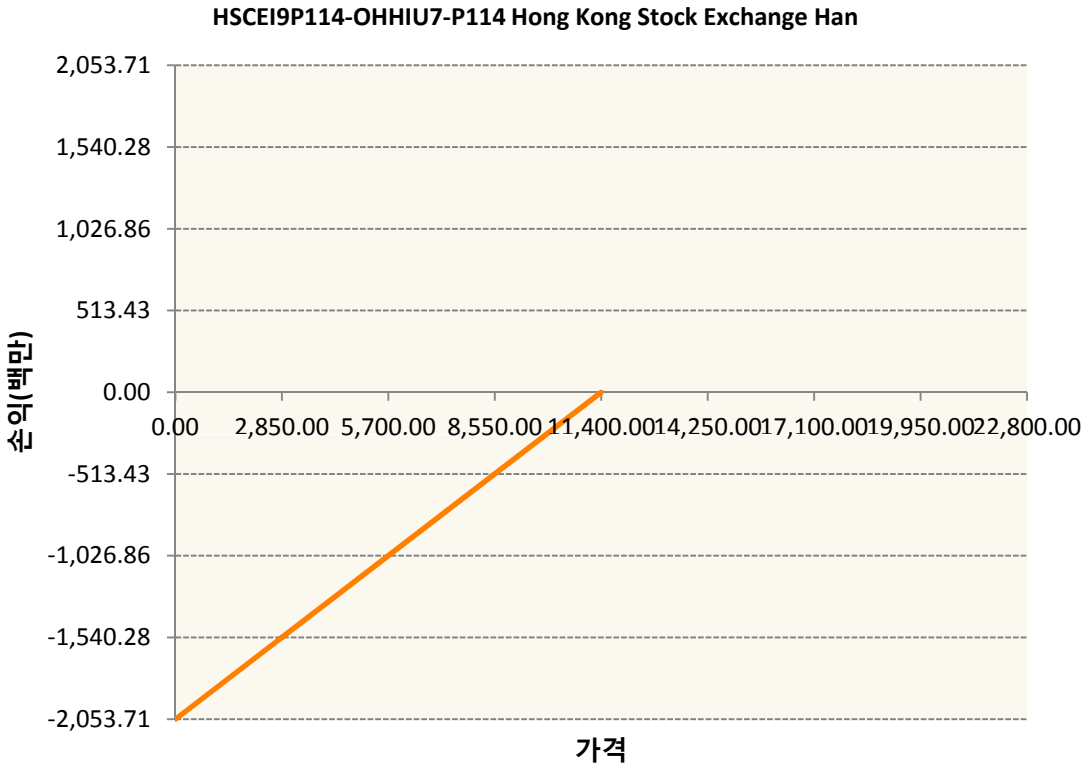
HSCEI9C114-OHHIU7-C114 Hong Kong Stock Exchange Han



HSCEI9P112-OHHIU7-P112 Hong Kong Stock Exchange Han







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

HCU7	H-SHARES IDX FUT Sep17	182
HSCEI9C112	OHHIU7-C112 Hong Kong Stock Exchange Han	19
HSCEI9C114	OHHIU7-C114 Hong Kong Stock Exchange Han	164
HSCEI9P112	OHHIU7-P112 Hong Kong Stock Exchange Han	19
HSCEI9P114	OHHIU7-P114 Hong Kong Stock Exchange Han	164

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

474

공시일	2017-09-01
기준일	2017-08-31

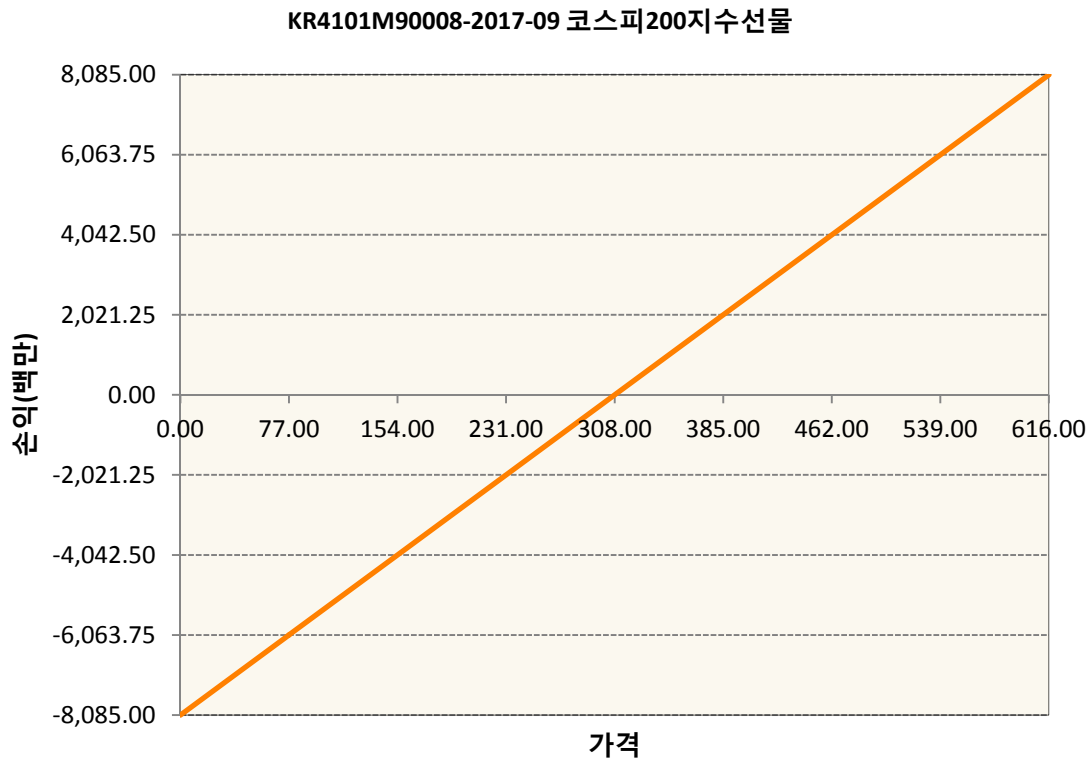
코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼

1. 계약금액

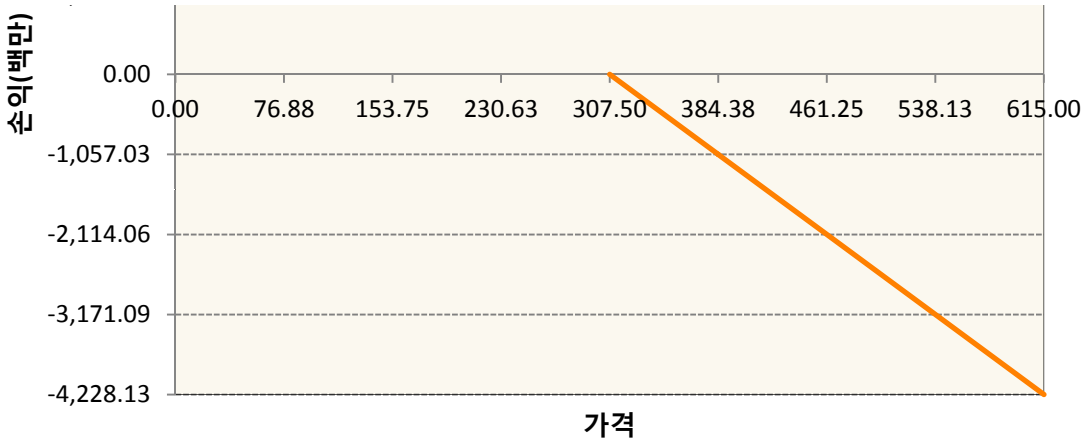
(단위:백만원)

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	8,085	0	8,085	장내
누계	유가증권	스왑	18,500	0	18,500	장외
누계	유가증권	옵션	0	18,119	-18,119	장내

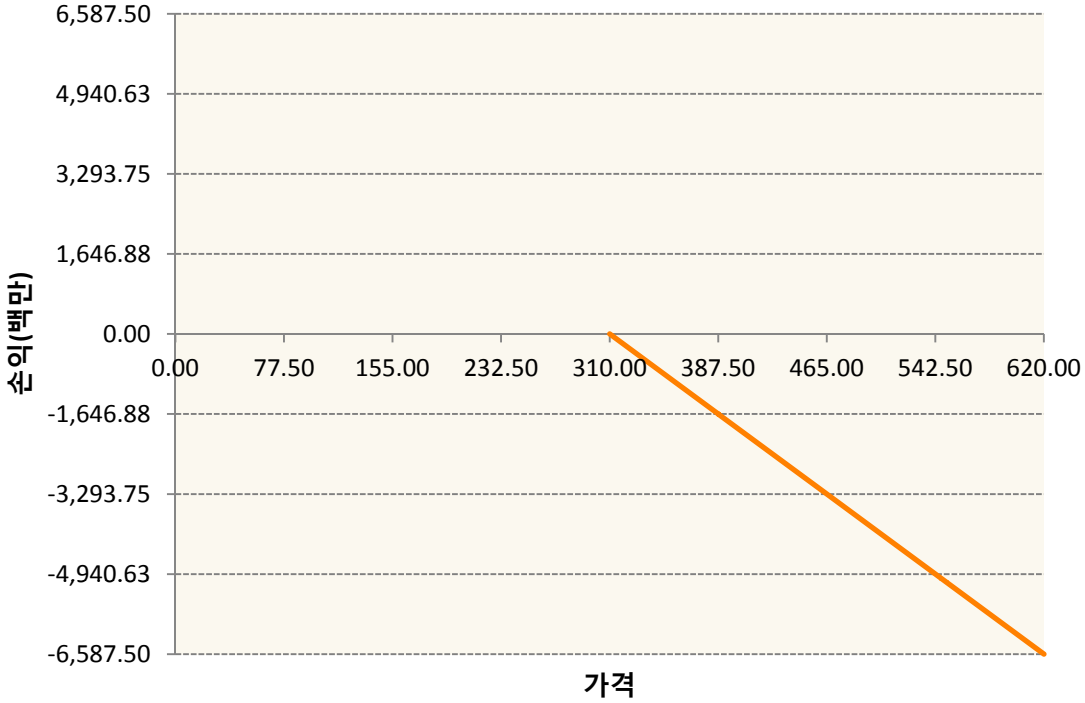
2. 만기시점의 손익구조



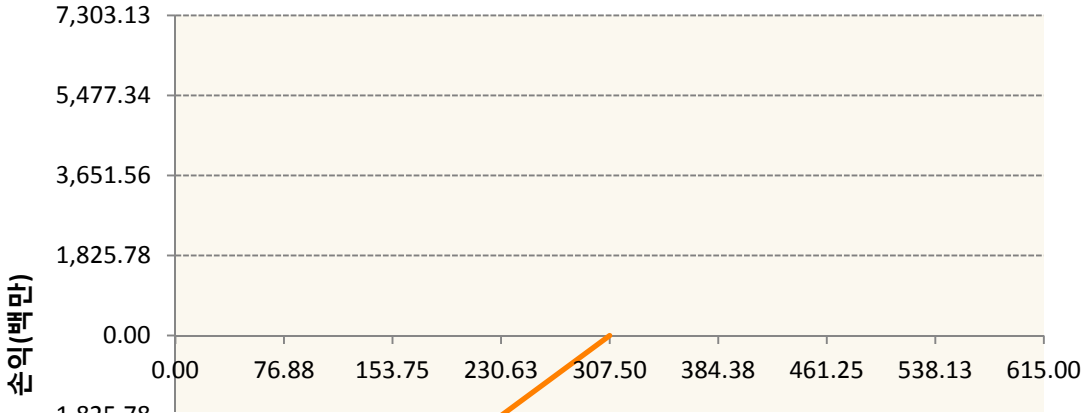




KR4201M93109-2017-09 콜310



KR4301M93073-2017-09 풋307.5





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_2							1,473
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,473	-1,473	-1,473	-1,473	-1,473	-1,473	-1,473
-5.33%	-982	-982	-982	-982	-982	-982	-982
-2.67%	-491	-491	-491	-491	-491	-491	-491
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	491	491	491	491	491	491	491
5.33%	982	982	982	982	982	982	982
8.00%	1,473	1,473	1,473	1,473	1,473	1,473	1,473
KR4101M90(2017-09 코스피200지수선물							647
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-647	-647	-647	-647	-647	-647	-647
-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%	647	647	647	647	647	647	647
KR4201M93(2017-09 콜307.5							277
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	81	80	79	78	77	75	73
-5.33%	77	75	73	70	67	63	59
-2.67%	62	57	52	47	41	36	30
0%	19	13	6	0	-6	-13	-19
2.67%	-58	-63	-68	-73	-78	-83	-89
5.33%	-159	-161	-163	-166	-169	-173	-177
8.00%	-269	-270	-270	-272	-273	-275	-277
KR4201M93: 2017-09 콜310							406
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%

-8.00%	99	99	98	97	96	94	91
-5.33%	97	94	91	88	84	79	74
-2.67%	81	74	68	60	53	45	37
0%	29	19	10	0	-10	-19	-29
2.67%	-75	-83	-92	-100	-109	-118	-128
5.33%	-221	-226	-231	-236	-242	-249	-256
8.00%	-389	-390	-392	-395	-398	-401	-406
	KR4301M93(2017-09 풋307.5						459
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-446	-447	-448	-450	-452	-455	-459
-5.33%	-257	-260	-265	-270	-275	-281	-288
-2.67%	-88	-97	-105	-114	-124	-133	-143
0%	33	22	11	0	-11	-22	-33
2.67%	95	87	78	69	60	51	42
5.33%	116	112	108	103	98	91	85
8.00%	121	120	118	116	114	110	107

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

3,071

공시일	2017-09-01
기준일	2017-08-31

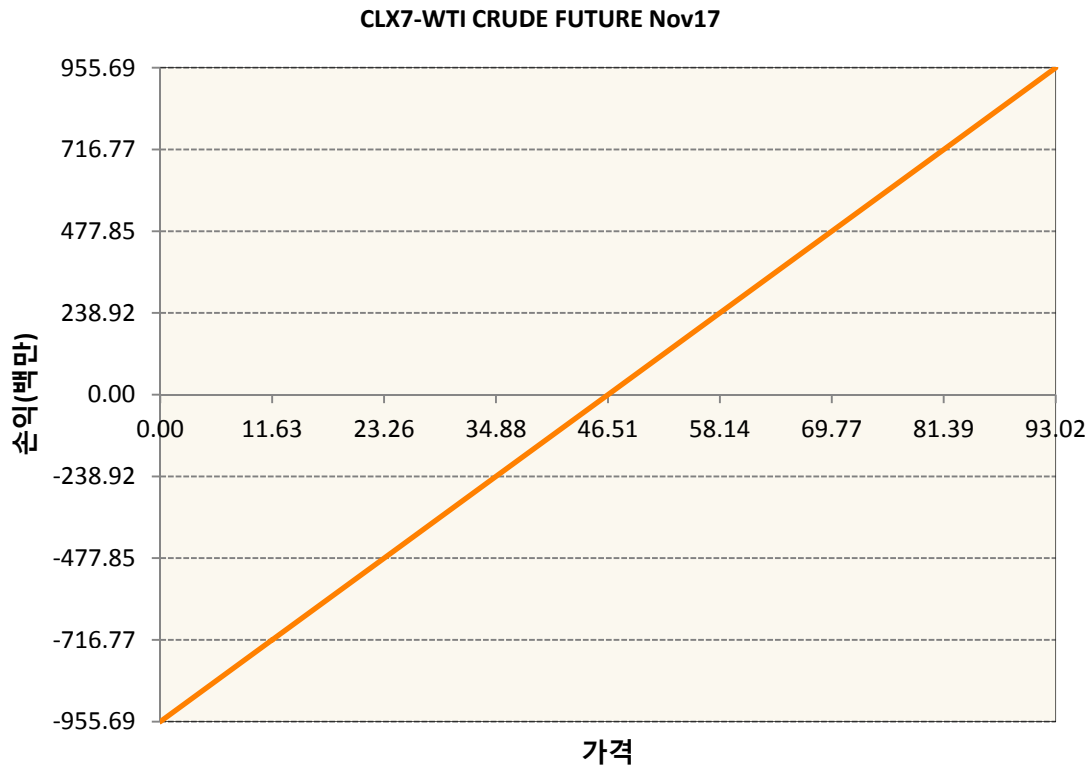
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

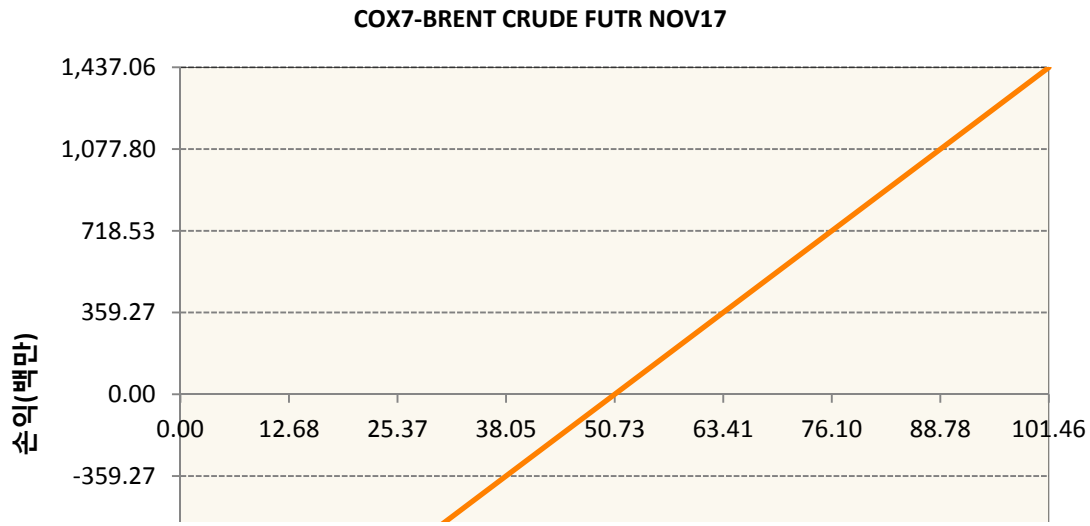
1. 계약금액

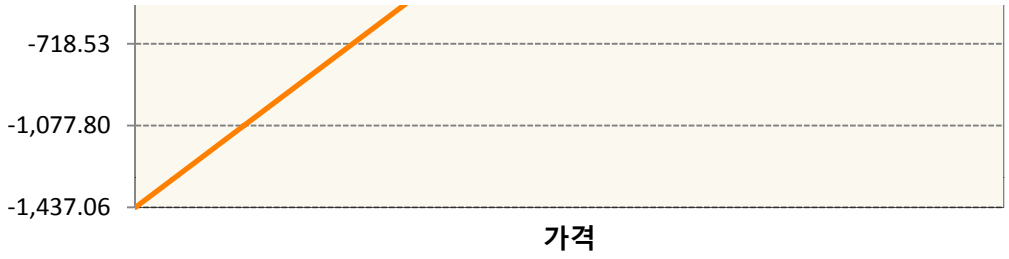
(단위:백만원)

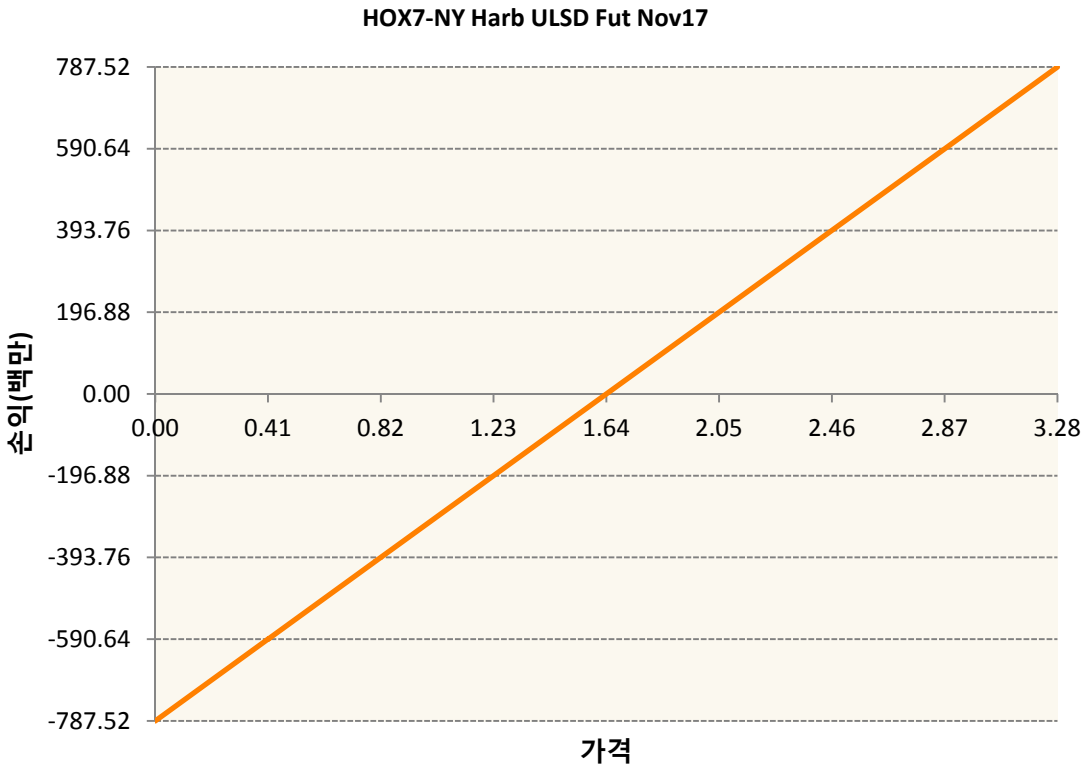
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	5,351	507	4,844	

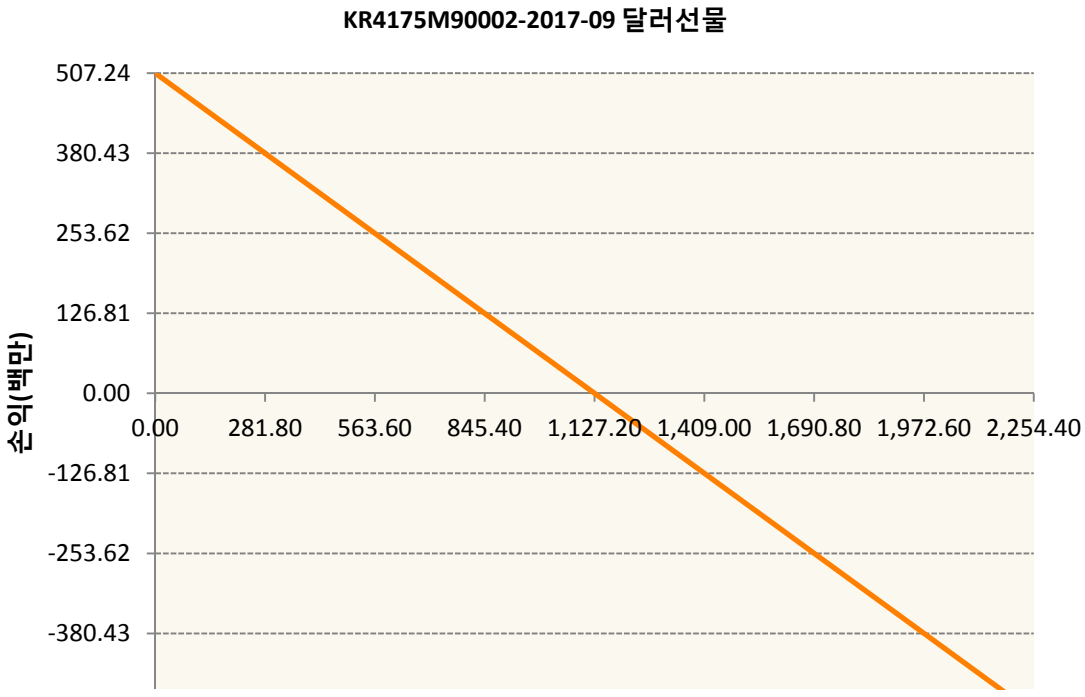
2. 만기시점의 손익구조

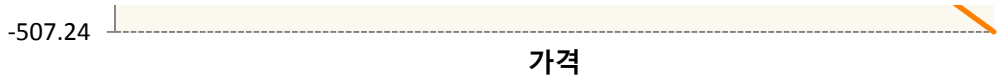


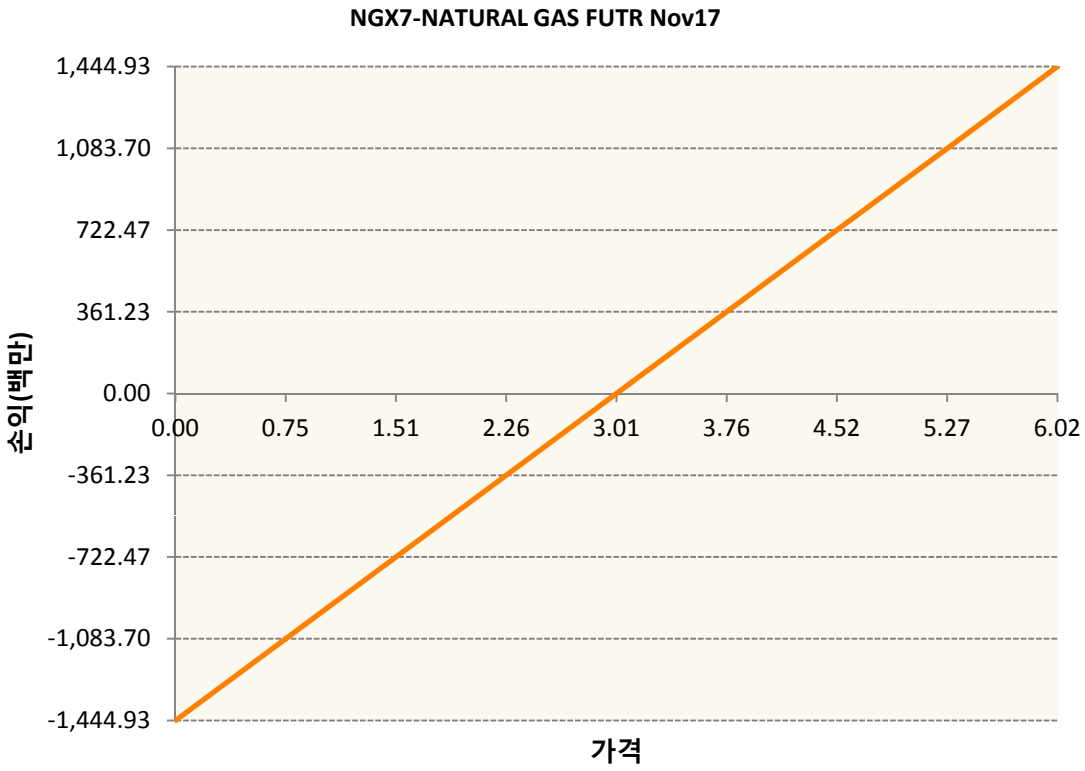


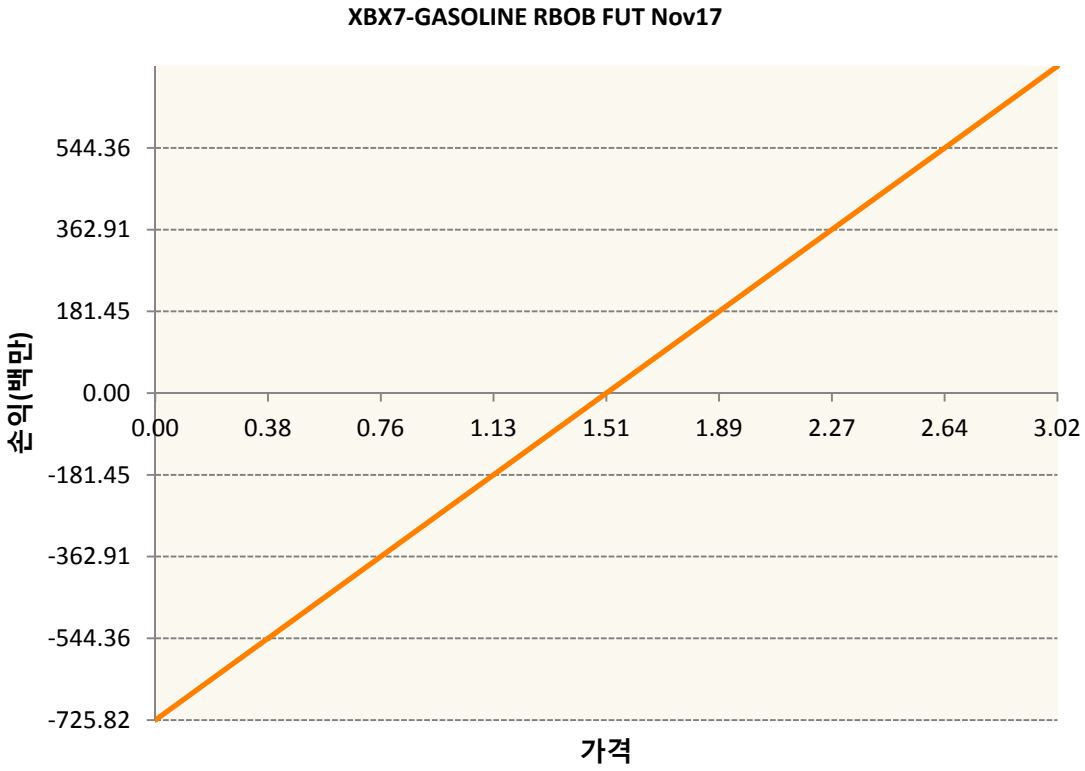

-718.53
-1,077.80
-1,437.06
가격


HOX7-NY Harb ULSD Fut Nov17
787.52
590.64
393.76
196.88
0.00
-196.88
-393.76
-590.64
-787.52
0.00
0.41
0.82
1.23
1.64
2.05
2.46
2.87
3.28
손익(만)
가격


KR4175M90002-2017-09 달러선물
507.24
380.43
253.62
126.81
0.00
-126.81
-253.62
-380.43
0.00
281.80
563.60
845.40
1,127.20
1,409.00
1,690.80
1,972.60
2,254.40
손익(만)


-507.24
가격


NGX7-NATURAL GAS FUTR Nov17
1,444.93
1,083.70
722.47
361.23
0.00
-361.23
-722.47
-1,083.70
-1,444.93
0.00
0.75
1.51
2.26
3.01
3.76
4.52
5.27
6.02
손익(백만)
가격


XBX7-GASOLINE RBOB FUT Nov17
544.36
362.91
181.45
0.00
-181.45
-362.91
-544.36
-725.82
0.00
0.38
0.76
1.13
1.51
1.89
2.27
2.64
3.02
손익(백만)
가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLX7	WTI CRUDE FUTURE Nov17	76
COX7	BRENT CRUDE FUTR NOV17	115
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)

765

공시일	2017-09-01
기준일	2017-08-31

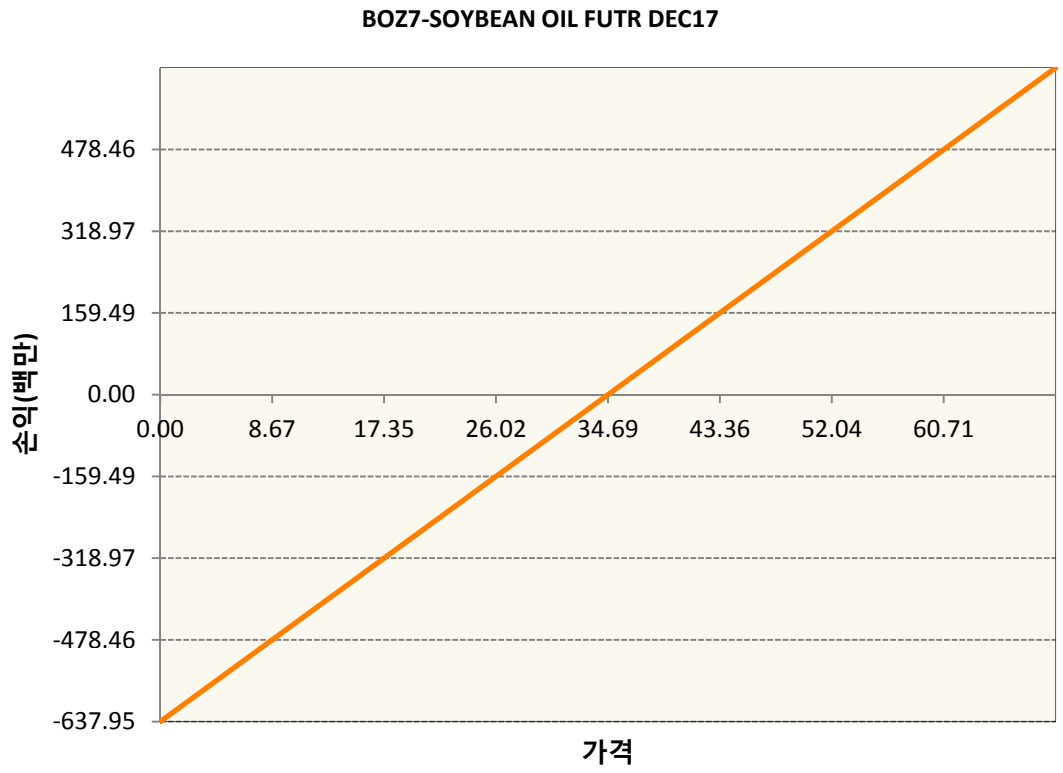
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

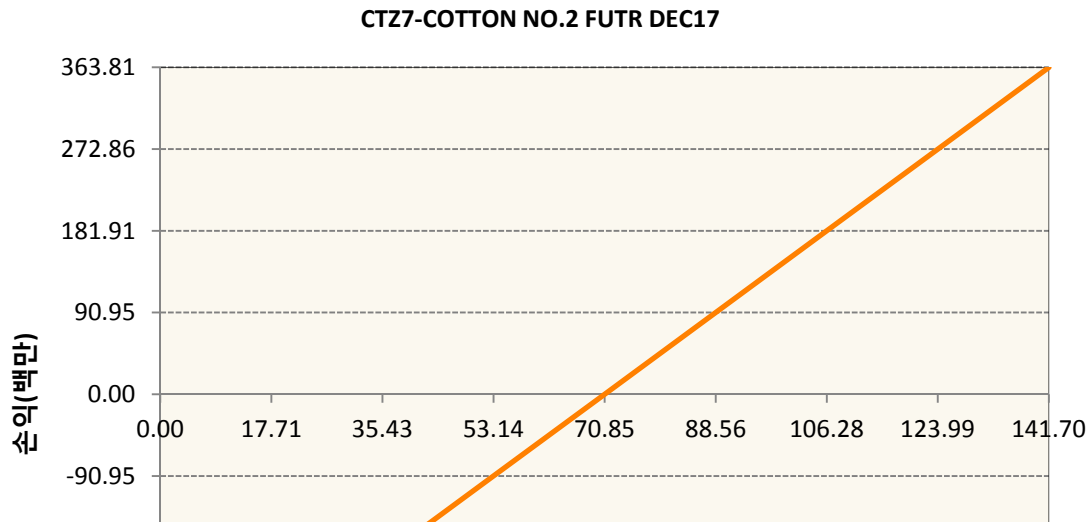
1. 계약금액

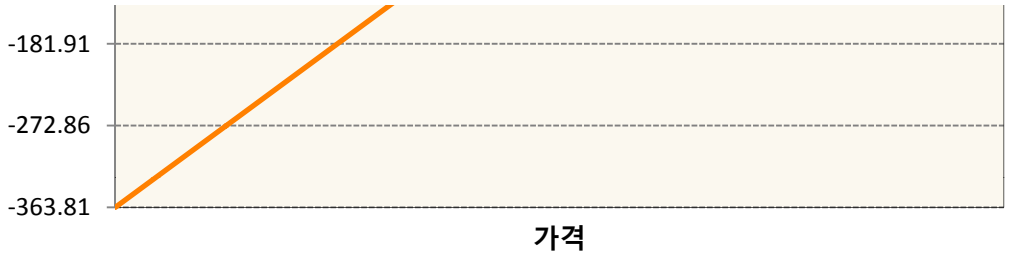
(단위:백만원)

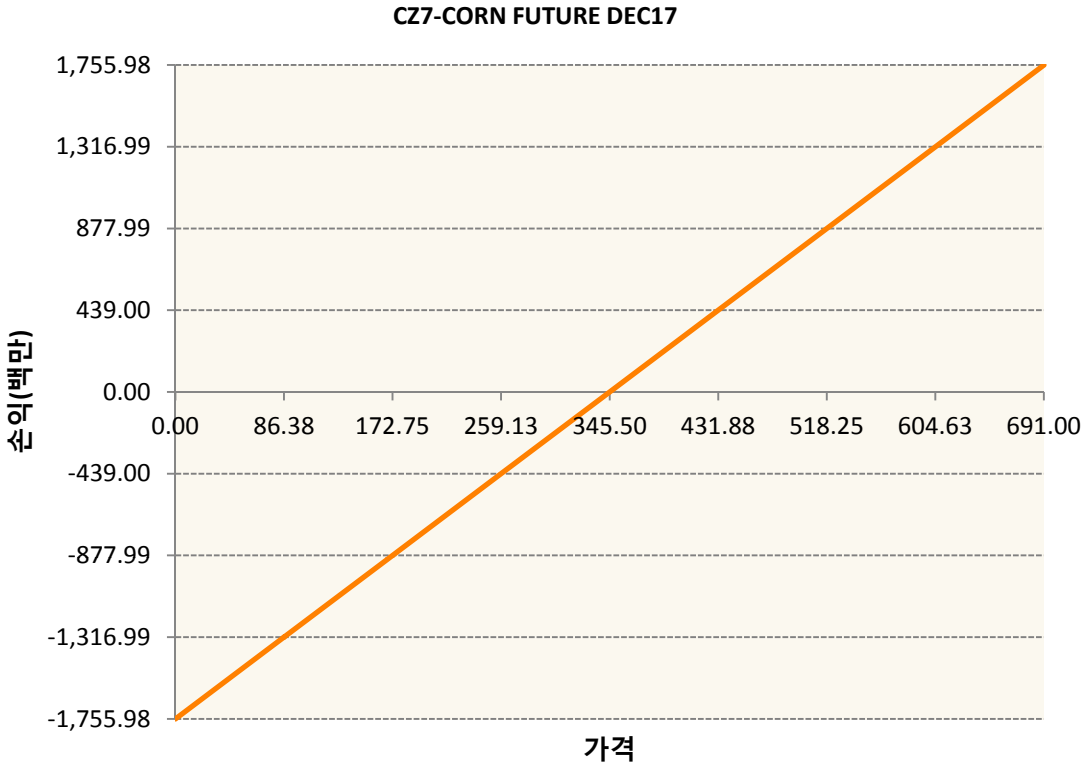
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	6,831	338	6,493	

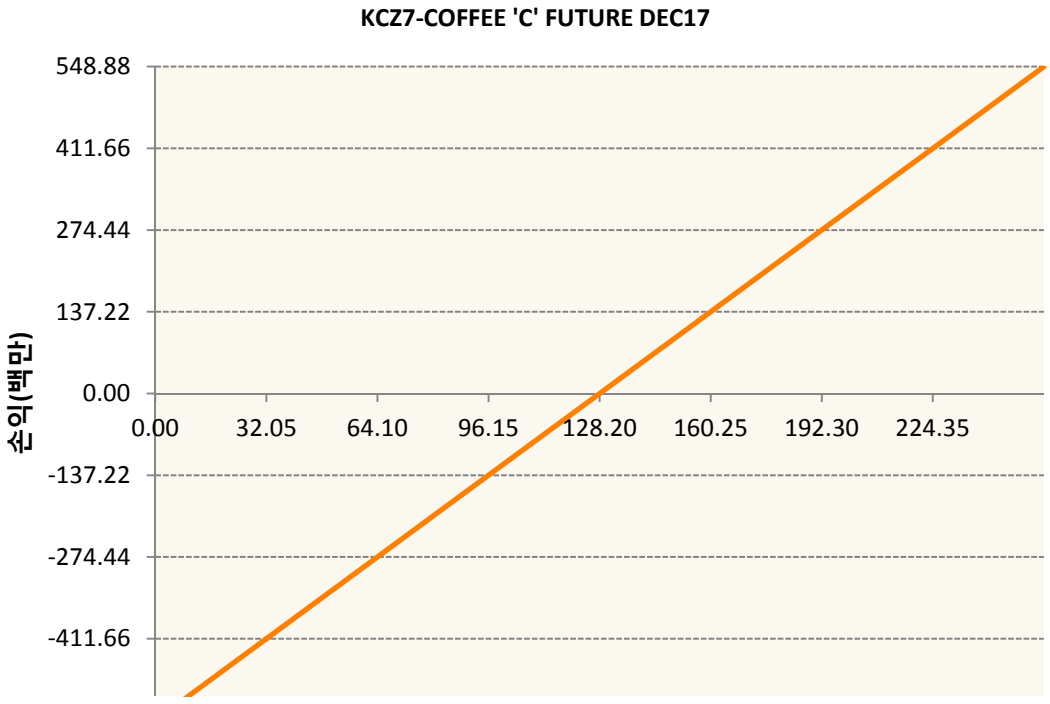
2. 만기시점의 손익구조

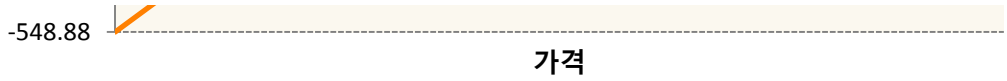


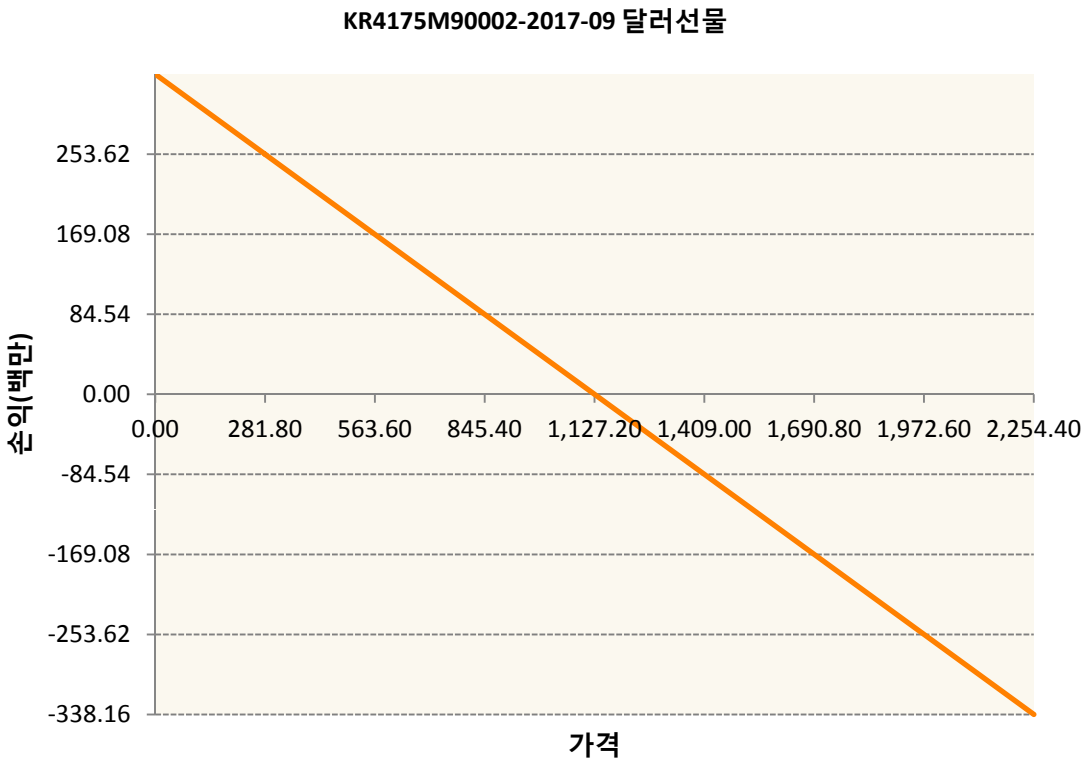


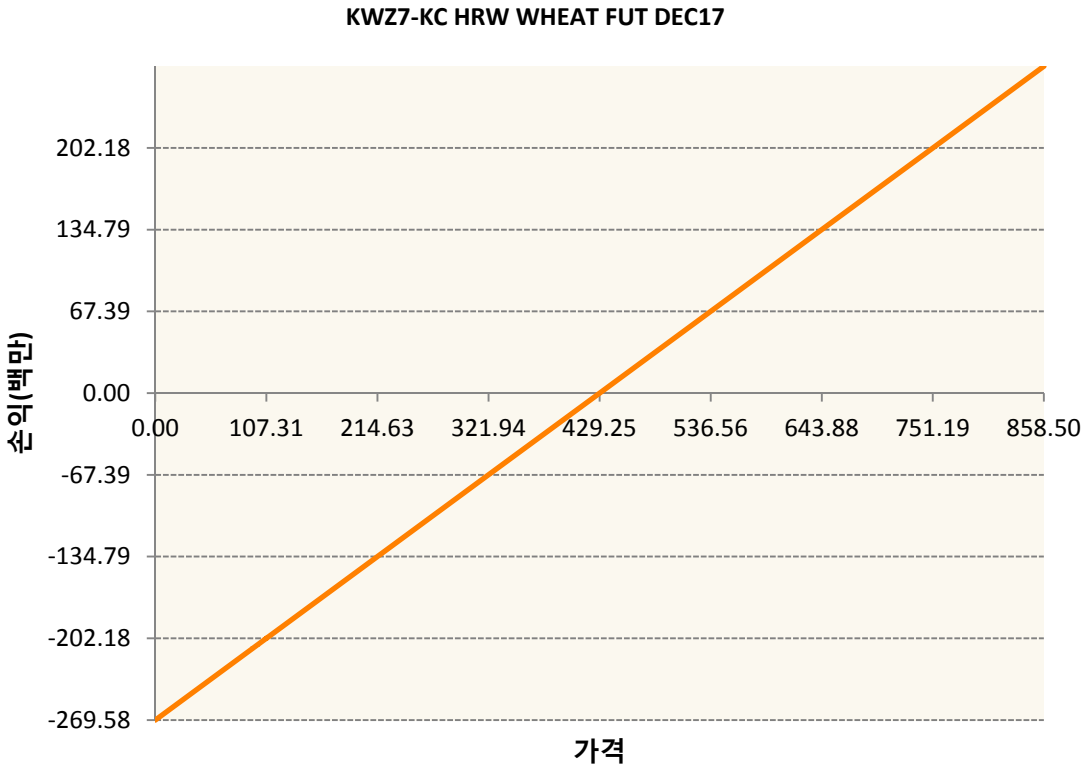

-181.91
-272.86
-363.81
가격


CZ7-CORN FUTURE DEC17
1,755.98
1,316.99
877.99
439.00
0.00
-439.00
-877.99
-1,316.99
-1,755.98
0.00
86.38
172.75
259.13
345.50
431.88
518.25
604.63
691.00
손익(백만)
가격

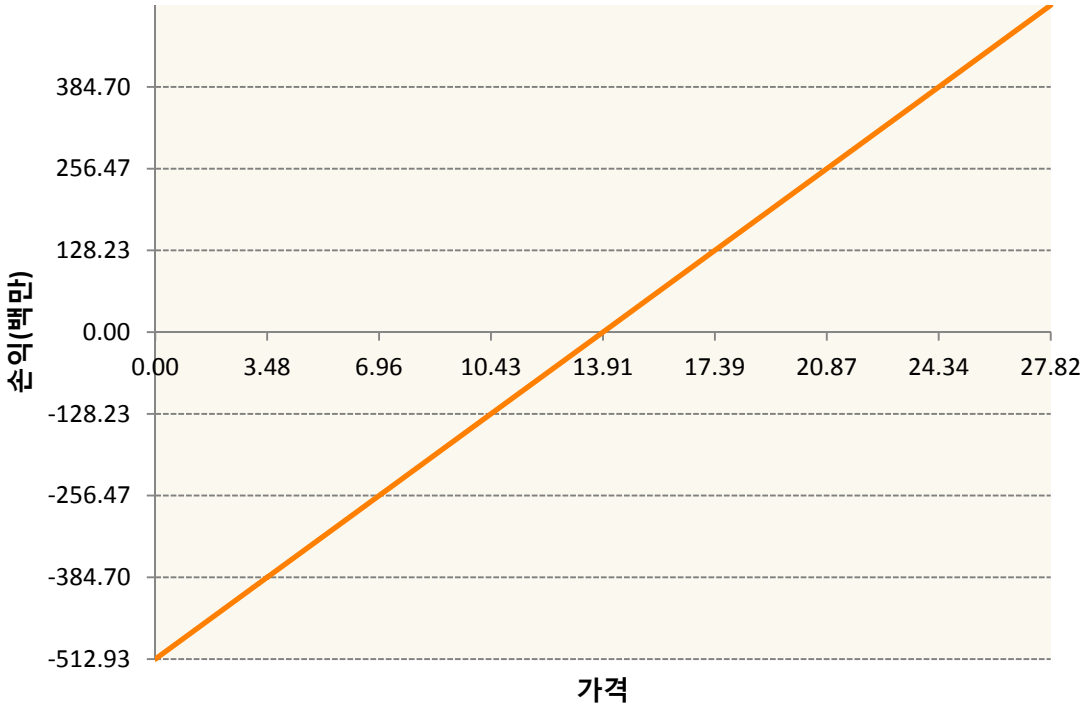

KCZ7-COFFEE 'C' FUTURE DEC17
548.88
411.66
274.44
137.22
0.00
-137.22
-274.44
-411.66
0.00
32.05
64.10
96.15
128.20
160.25
192.30
224.35
손익(백만)


-548.88
가격

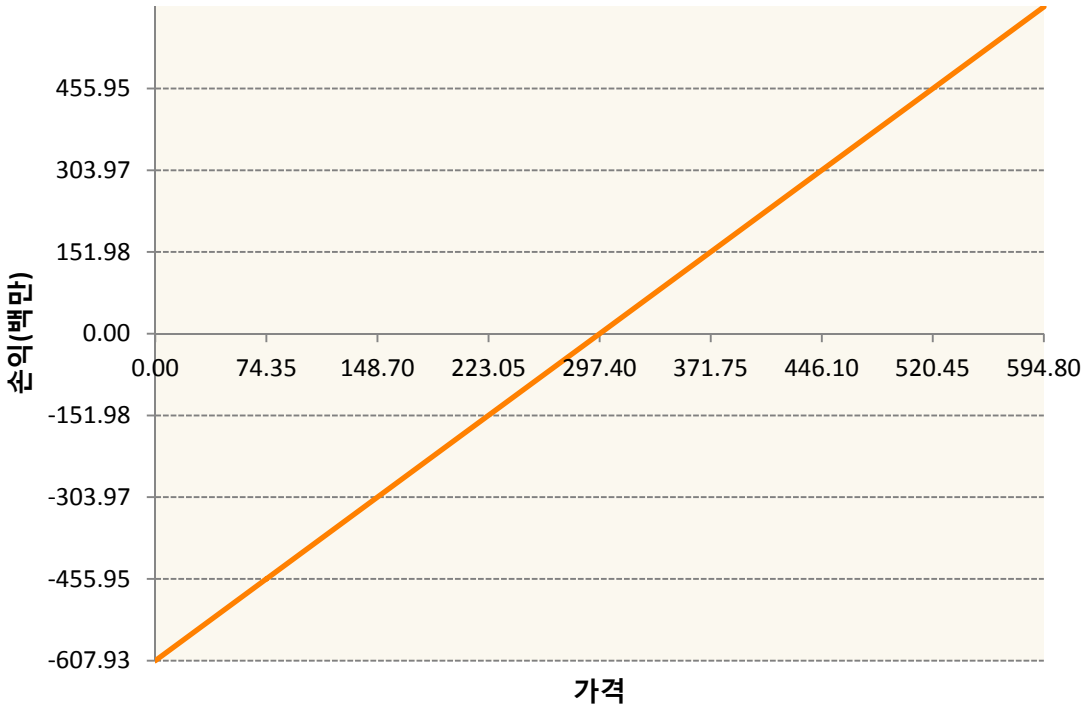

KR4175M90002-2017-09 달러선물
253.62
169.08
84.54
0.00
-84.54
-169.08
-253.62
-338.16
0.00
281.80
563.60
845.40
1,127.20
1,409.00
1,690.80
1,972.60
2,254.40
손익(백만)
가격


KWZ7-KC HRW WHEAT FUT DEC17
202.18
134.79
67.39
0.00
-67.39
-134.79
-202.18
-269.58
0.00
107.31
214.63
321.94
429.25
536.56
643.88
751.19
858.50
손익(백만)
가격

SBV7-SUGAR #11 (WORLD) OCT17

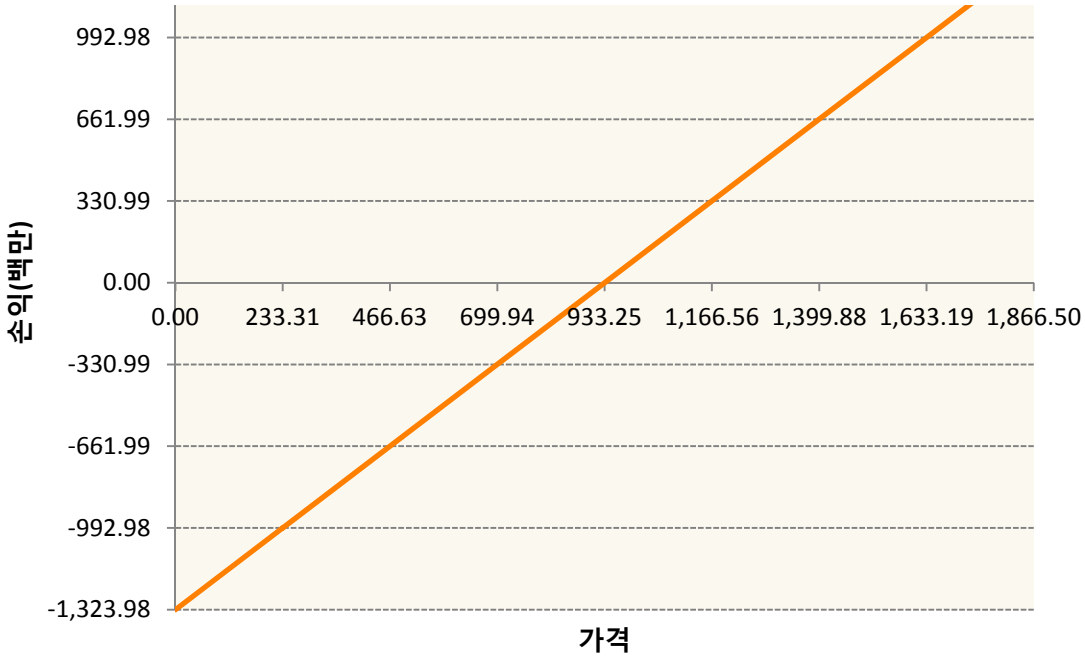


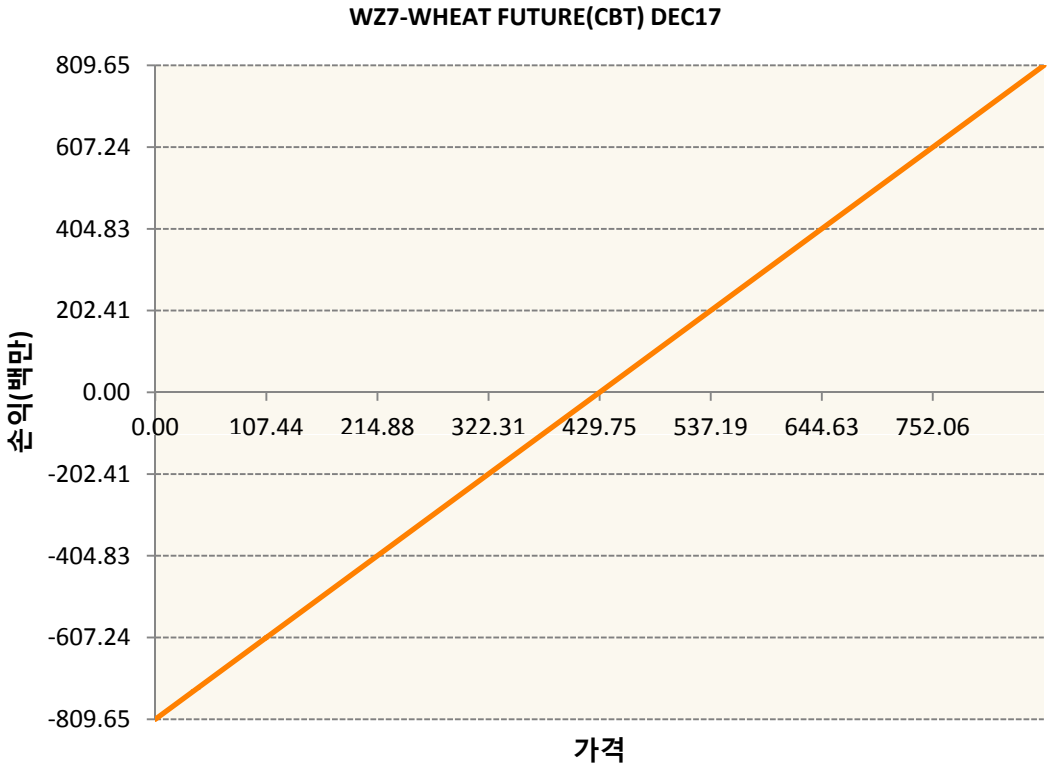
SMZ7-SOYBEAN MEAL FUTR DEC17



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	140
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	106
WZ7	WHEAT FUTURE(CBT) DEC17	65

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

644