공시일	2017-06-21
기준일	2017-06-20

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	2017-06-21
기준일	2017-06-20

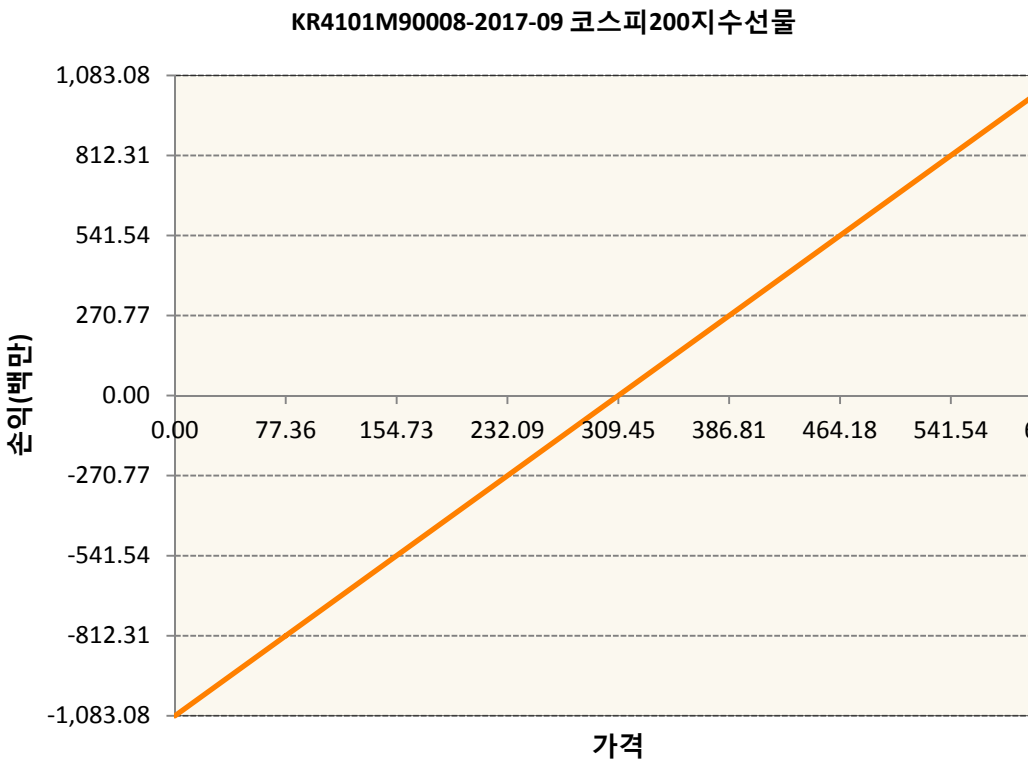
스마트인덱스모

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	1,083	0	1,083	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101M90(2017-09 코스피200지수선물							87
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-87	-87	-87	-87	-87	-87	-87
-5.33%	-58	-58	-58	-58	-58	-58	-58
-2.67%	-29	-29	-29	-29	-29	-29	-29
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	29	29	29	29	29	29	29
5.33%	58	58	58	58	58	58	58
8.00%	87	87	87	87	87	87	87

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

56

공시일	2017-06-21
기준일	2017-06-20

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	12,360	0	12,360	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWMXWO0(신한MXWO 미래S170523	1,007

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

510

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-06-21
기준일	2017-06-20

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	374

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

322

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-06-21
기준일	2017-06-20

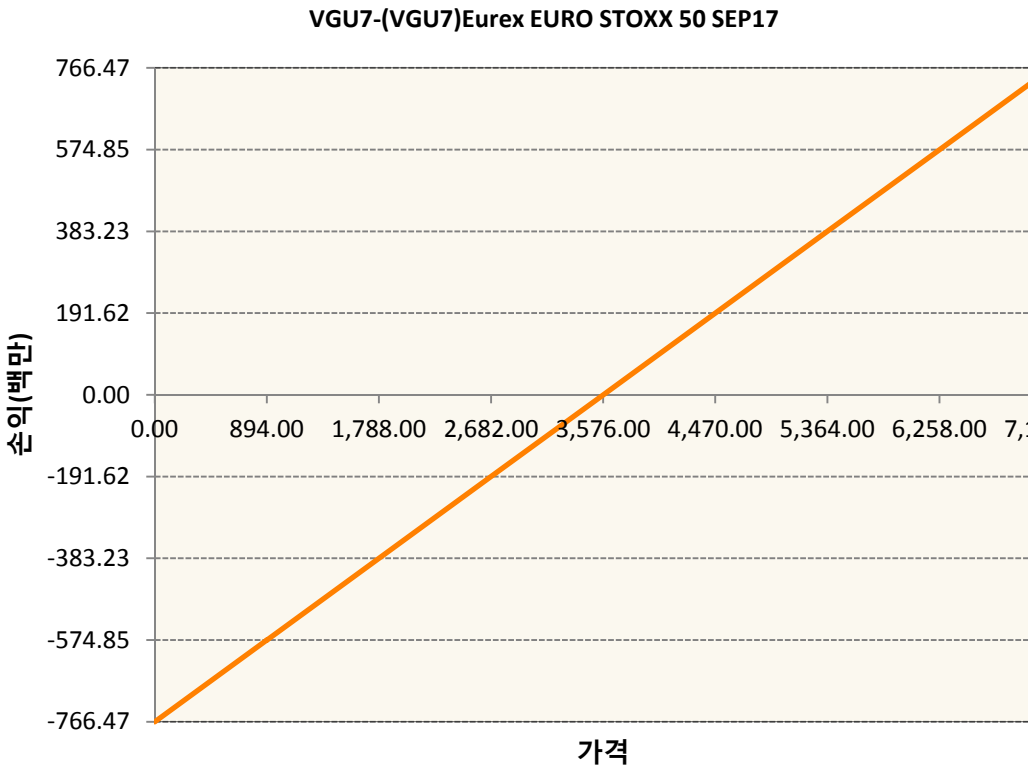
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	766	0	766	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGU7	(VGU7)Eurex EURO STOXX 50 SEP17	61

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

(단위:백만원)

56

공시일	2017-06-21
기준일	2017-06-20

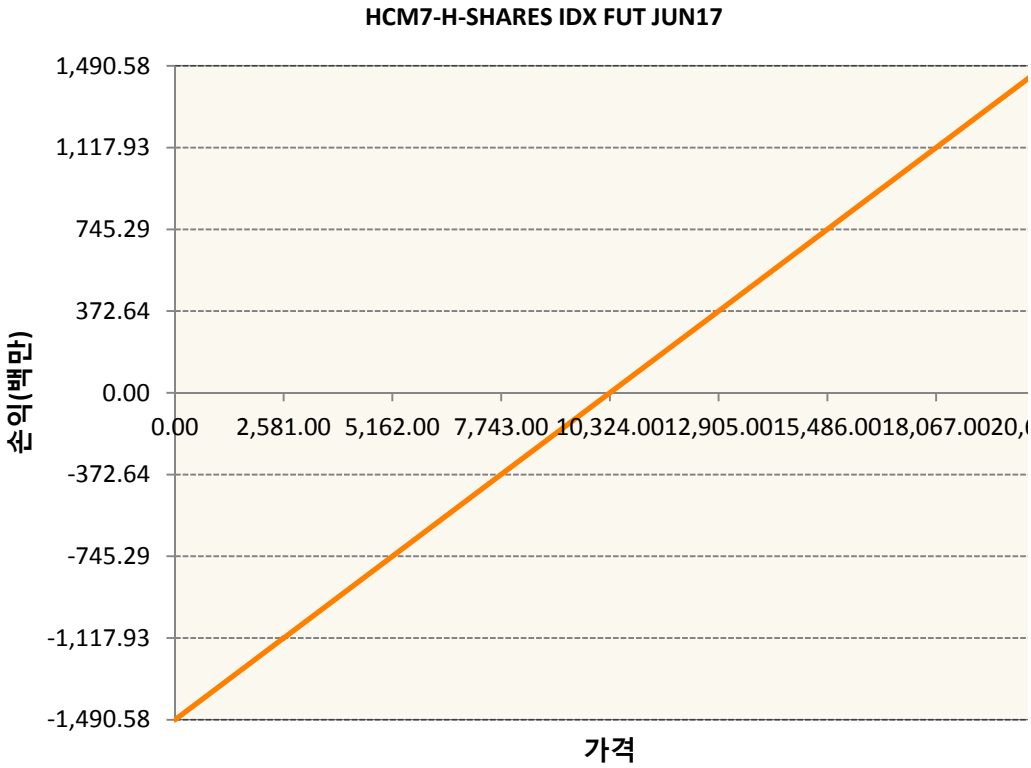
차이나인덱스모(주식-파생형)

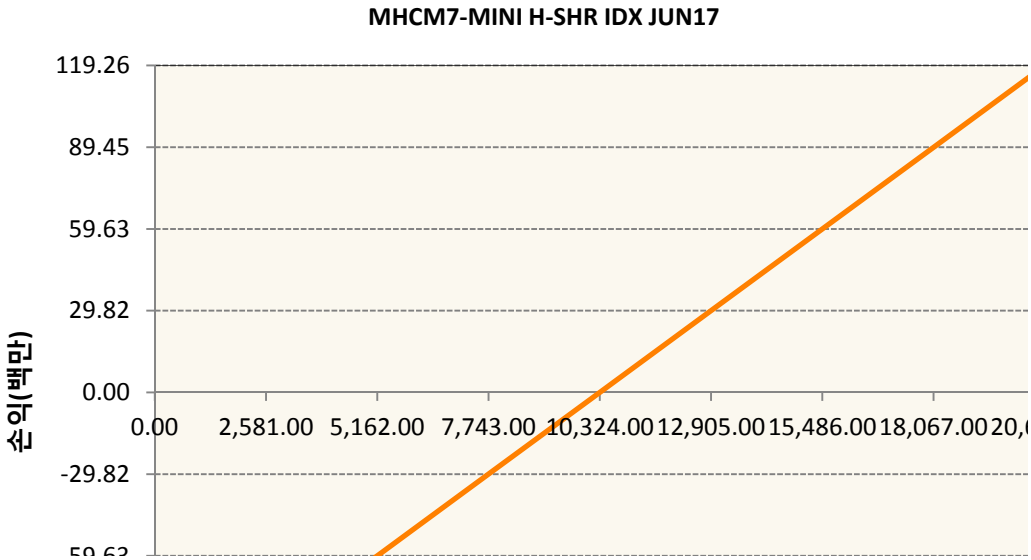
1. 계약금액

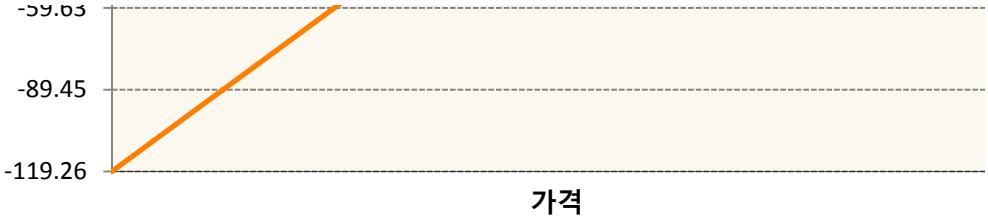
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,610	0	1,610	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

HCM7	H-SHARES IDX FUT JUN17	119
MHCM7	MINI H-SHR IDX JUN17	10

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

133

공시일	2017-06-21
기준일	2017-06-20

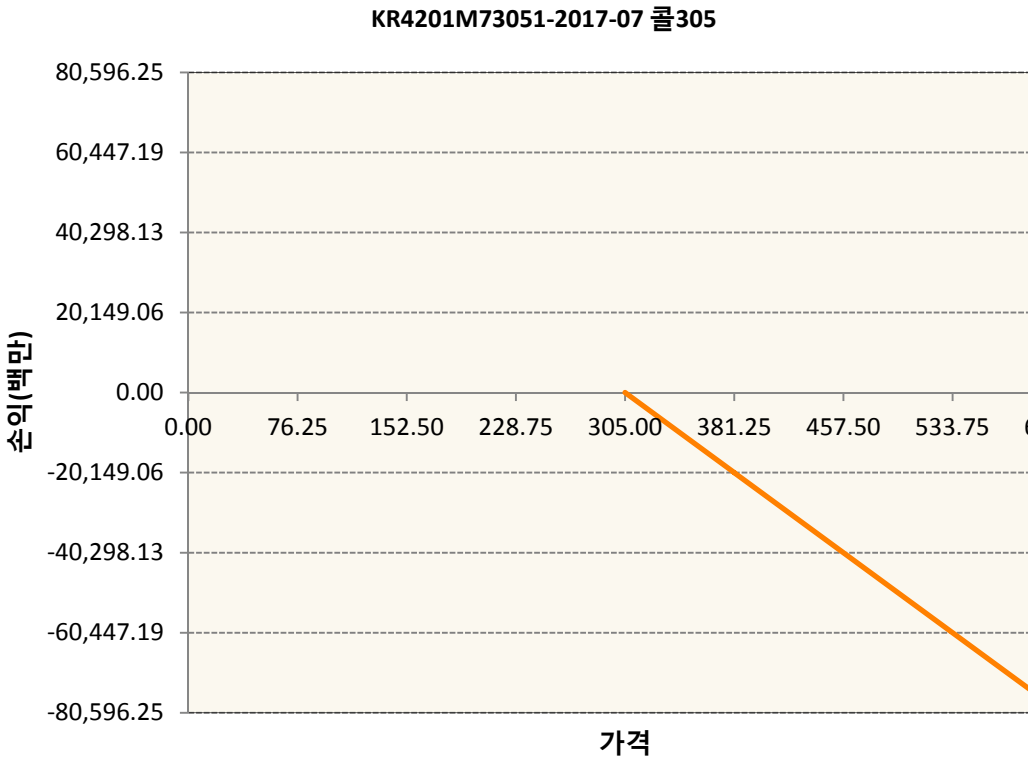
커버드콜모(주식혼합-파생형)

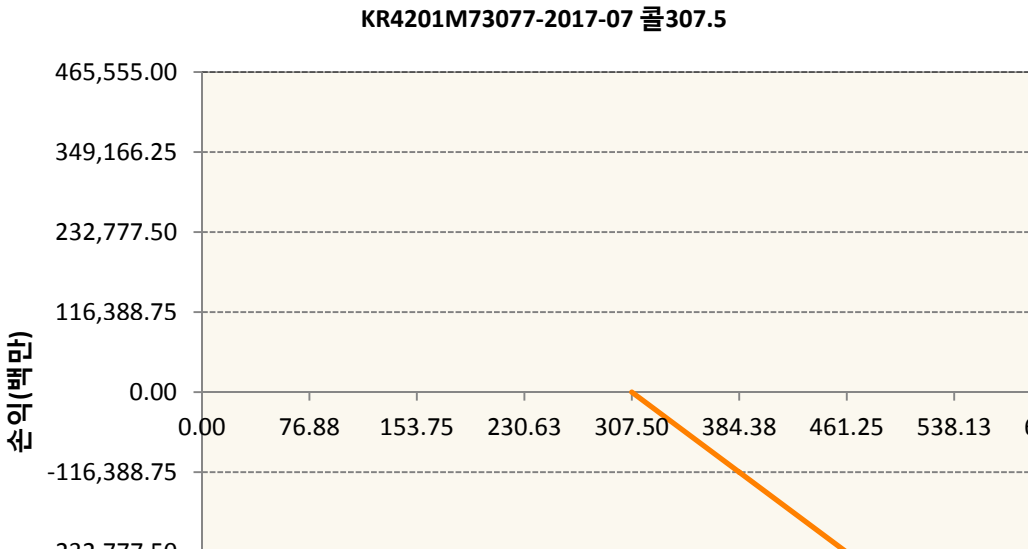
1. 계약금액

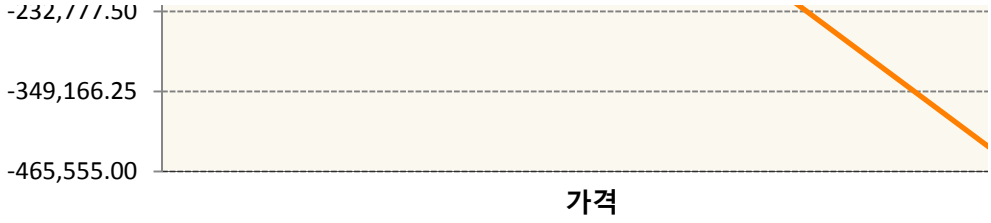
(단위:백만원)

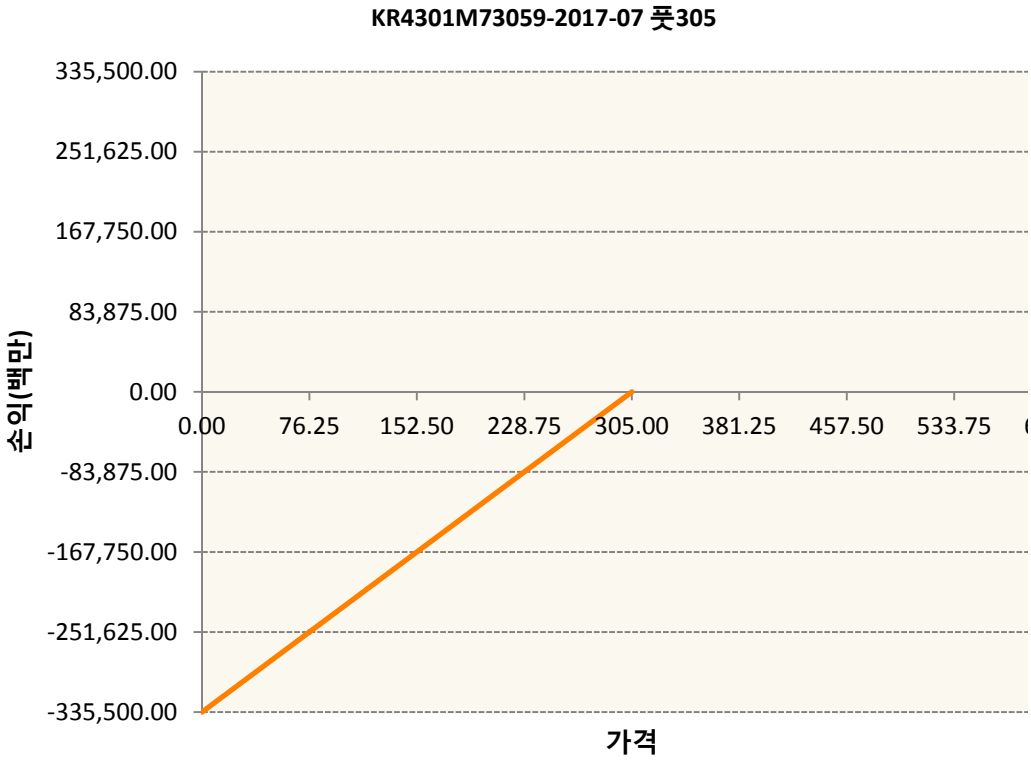
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	15,588	-15,588	장내
누계	유가증권	옵션	0	912,401	-912,401	장내

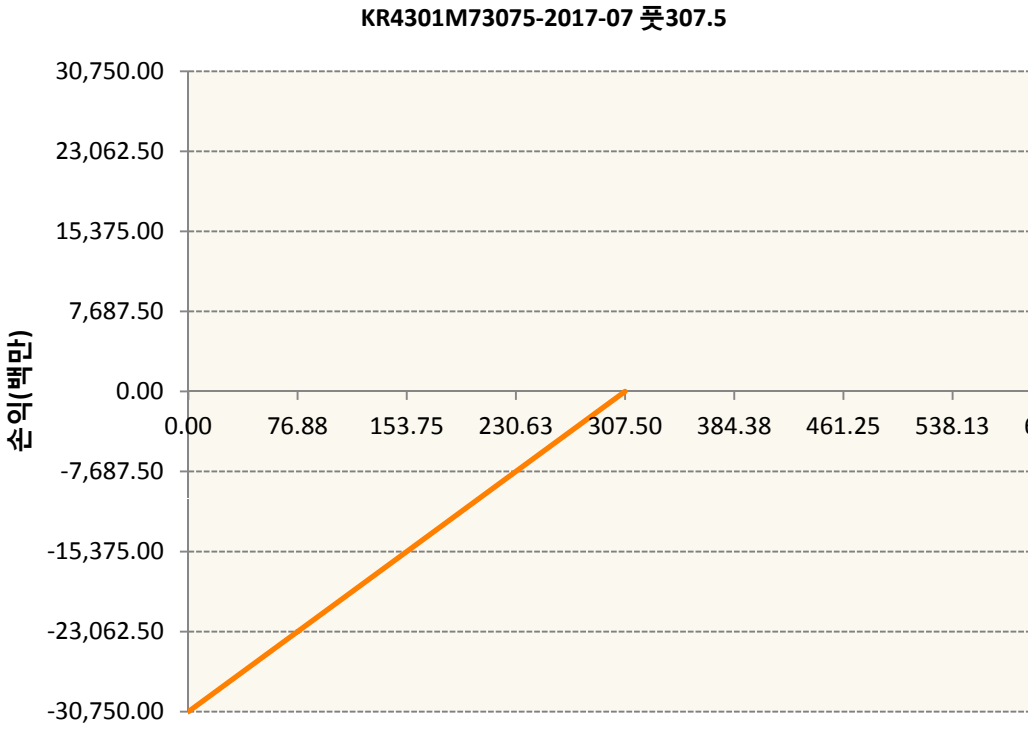
2. 만기시점의 손익구조






-232,777.50
-349,166.25
-465,555.00
가격


KR4301M73059-2017-07 풋305
335,500.00
251,625.00
167,750.00
83,875.00
0.00
-83,875.00
-167,750.00
-251,625.00
-335,500.00
0.00
76.25
152.50
228.75
305.00
381.25
457.50
533.75
손익(백만)
가격


KR4301M73075-2017-07 풋307.5
30,750.00
23,062.50
15,375.00
7,687.50
0.00
-7,687.50
-15,375.00
-23,062.50
-30,750.00
0.00
76.88
153.75
230.63
307.50
384.38
461.25
538.13
손익(백만)

가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201M73(2017-07 콜305							6,061
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,610	1,609	1,608	1,604	1,599	1,591	1,581
-5.33%	1,590	1,575	1,554	1,529	1,498	1,464	1,425
-2.67%	1,318	1,252	1,185	1,116	1,046	975	903
0%	201	136	69	0	-70	-141	-213
2.67%	-1,723	-1,740	-1,762	-1,789	-1,822	-1,858	-1,899
5.33%	-3,879	-3,880	-3,883	-3,887	-3,895	-3,905	-3,919
8.00%	-6,055	-6,056	-6,056	-6,056	-6,057	-6,059	-6,061
KR4201M73(2017-07 콜307.5							33,354
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	6,852	6,851	6,847	6,838	6,822	6,797	6,760
-5.33%	6,812	6,767	6,700	6,608	6,491	6,350	6,186
-2.67%	5,983	5,694	5,383	5,052	4,706	4,348	3,980
0%	1,311	877	439	0	-441	-883	-1,325
2.67%	-8,651	-8,821	-9,024	-9,257	-9,514	-9,794	-10,092
5.33%	-20,824	-20,843	-20,878	-20,930	-21,004	-21,100	-21,217
8.00%	-33,287	-33,288	-33,290	-33,296	-33,307	-33,325	-33,354
KR4301M73(2017-07 풋305							20,613
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-20,490	-20,494	-20,501	-20,515	-20,537	-20,569	-20,613
-5.33%	-11,508	-11,573	-11,659	-11,766	-11,892	-12,036	-12,196
-2.67%	-3,578	-3,851	-4,131	-4,418	-4,710	-5,006	-5,305
0%	835	565	286	0	-292	-588	-888
2.67%	1,893	1,823	1,730	1,616	1,481	1,328	1,158
5.33%	1,983	1,978	1,966	1,946	1,916	1,873	1,816
8.00%	1,985	1,985	1,985	1,983	1,980	1,973	1,961
KR4301M73(2017-07 풋307.5							2,026
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-2,019	-2,020	-2,020	-2,020	-2,021	-2,023	-2,026
-5.33%	-1,198	-1,201	-1,206	-1,212	-1,219	-1,229	-1,239
-2.67%	-429	-448	-469	-490	-513	-537	-561
0%	87	58	29	0	-29	-58	-88
2.67%	253	241	228	213	196	177	157

5.33%	273	271	269	266	261	254	247
8.00%	273	273	273	273	272	271	269

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

71,267

공시일	2017-06-21
기준일	2017-06-20

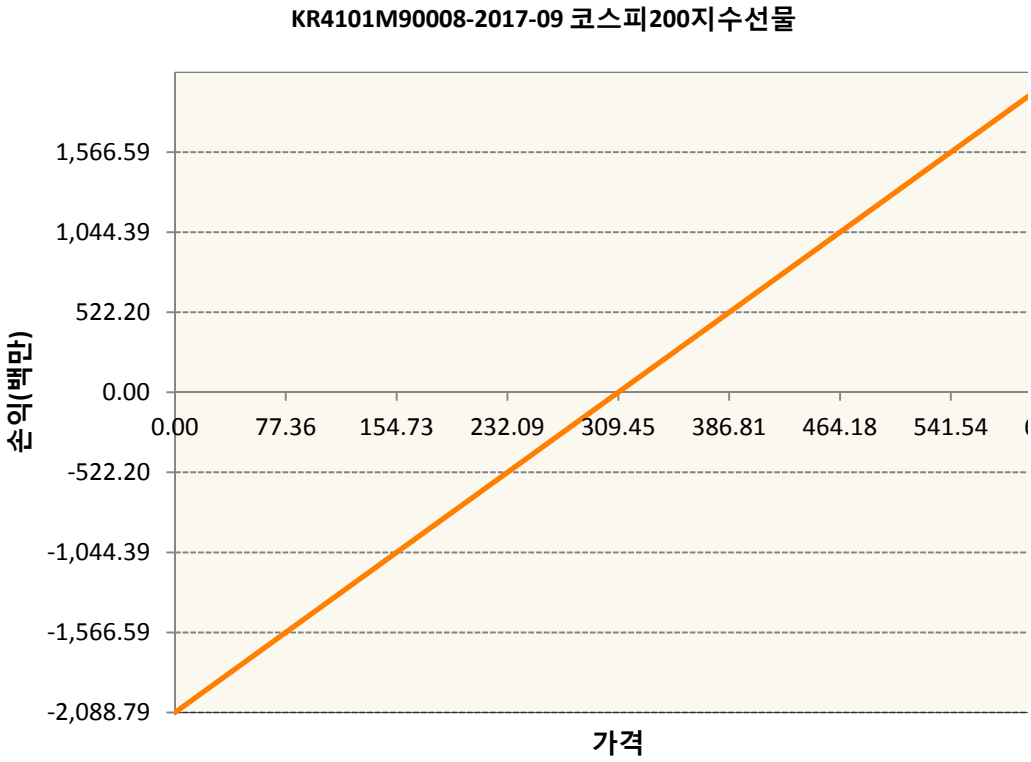
커버드콜목표전환형증권투자신탁

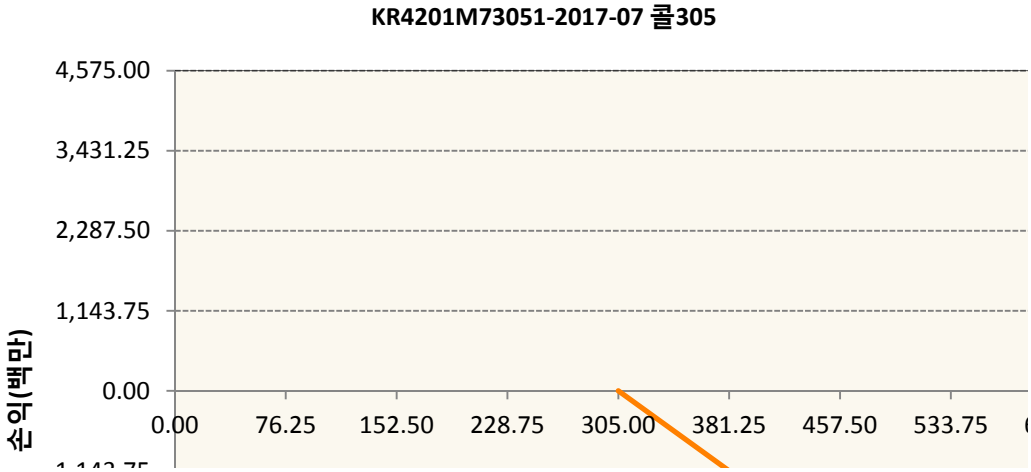
1. 계약금액

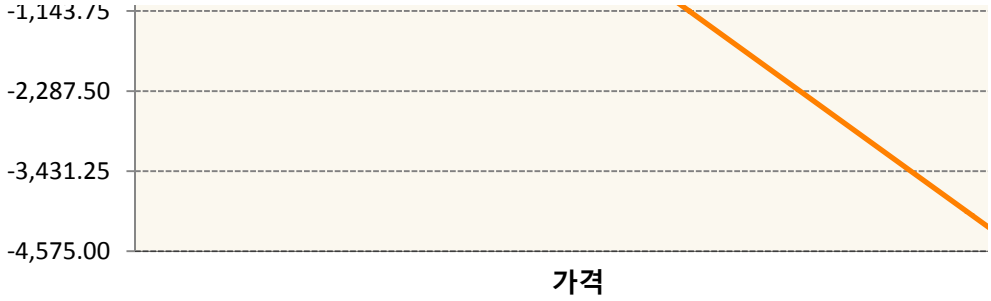
(단위:백만원)

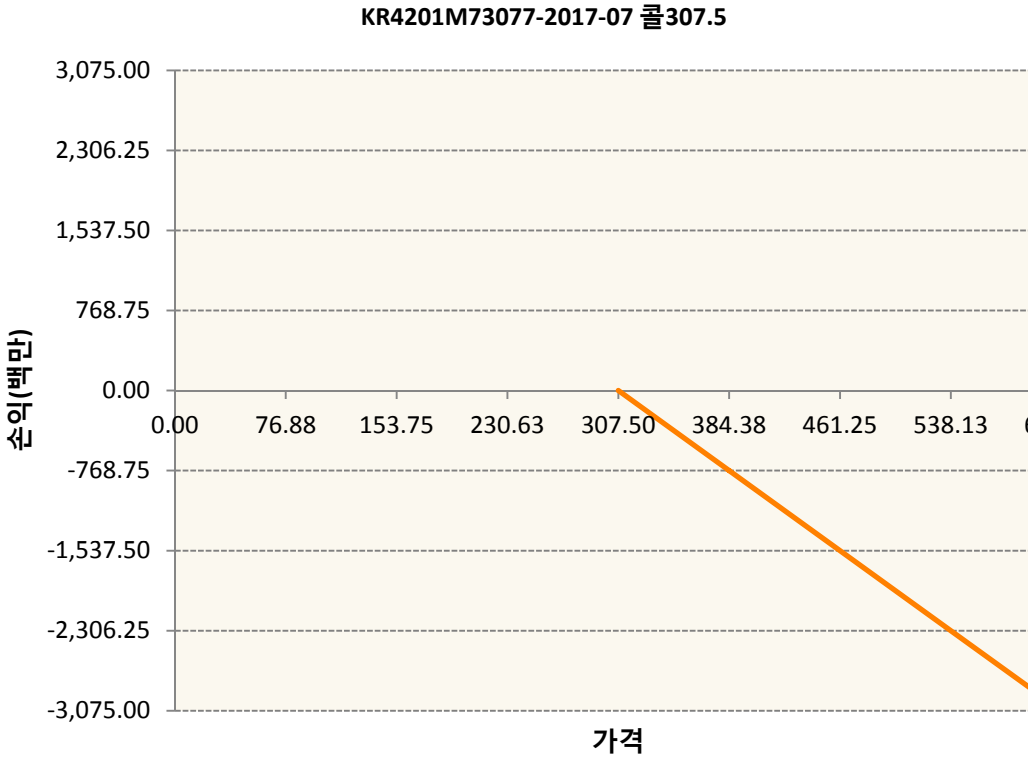
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	305	0	305	장내
누계	유가증권	선물	2,089	0	2,089	장내
누계	유가증권	옵션	0	8,803	-8,803	장내

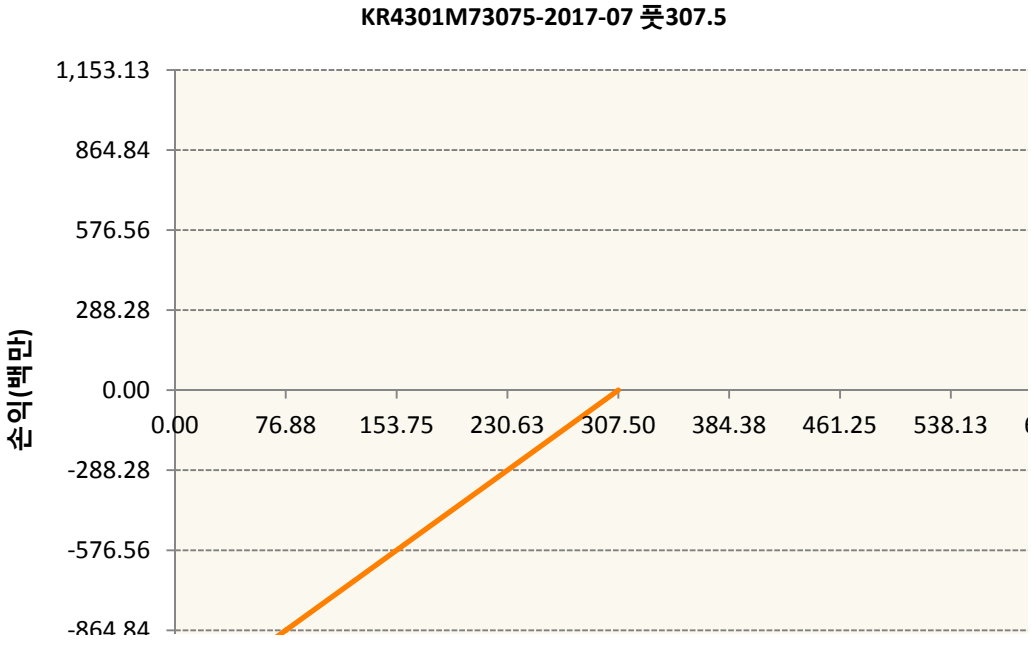
2. 만기시점의 손익구조

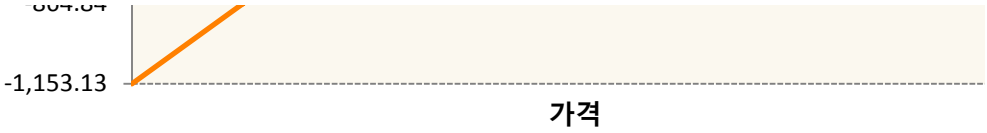





-1,143.75
-2,287.50
-3,431.25
-4,575.00
가격


KR4201M73077-2017-07 콜307.5
3,075.00
2,306.25
1,537.50
768.75
0.00
-768.75
-1,537.50
-2,306.25
-3,075.00
0.00
76.88
153.75
230.63
307.50
384.38
461.25
538.13
순익(백만)
가격


KR4301M73075-2017-07 풋307.5
1,153.13
864.84
576.56
288.28
0.00
-288.28
-576.56
-864.84
0.00
76.88
153.75
230.63
307.50
384.38
461.25
538.13
순익(백만)



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101M90(2017-09 코스피200지수선물							167
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-167	-167	-167	-167	-167	-167	-167
-5.33%	-111	-111	-111	-111	-111	-111	-111
-2.67%	-56	-56	-56	-56	-56	-56	-56
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	56	56	56	56	56	56	56
5.33%	111	111	111	111	111	111	111
8.00%	167	167	167	167	167	167	167
KR4201M73(2017-07 콜305							344
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	91	91	91	91	91	90	90
-5.33%	90	89	88	87	85	83	81
-2.67%	75	71	67	63	59	55	51
0%	11	8	4	0	-4	-8	-12
2.67%	-98	-99	-100	-102	-103	-105	-108
5.33%	-220	-220	-220	-221	-221	-222	-222
8.00%	-344	-344	-344	-344	-344	-344	-344
KR4201M73(2017-07 콜307.5							220
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	45	45	45	45	45	45	45
-5.33%	45	45	44	44	43	42	41
-2.67%	40	38	36	33	31	29	26
0%	9	6	3	0	-3	-6	-9
2.67%	-57	-58	-60	-61	-63	-65	-67
5.33%	-138	-138	-138	-138	-139	-139	-140
8.00%	-220	-220	-220	-220	-220	-220	-220
KR4301M73(2017-07 풋307.5							76
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-76	-76	-76	-76	-76	-76	-76
-5.33%	-45	-45	-45	-45	-46	-46	-46
-2.67%	-16	-17	-18	-18	-19	-20	-21

0%	3	2	1	0	-1	-2	-3
2.67%	9	9	9	8	7	7	6
5.33%	10	10	10	10	10	10	9
8.00%	10	10	10	10	10	10	10

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

874

공시일	2017-06-21
기준일	2017-06-20

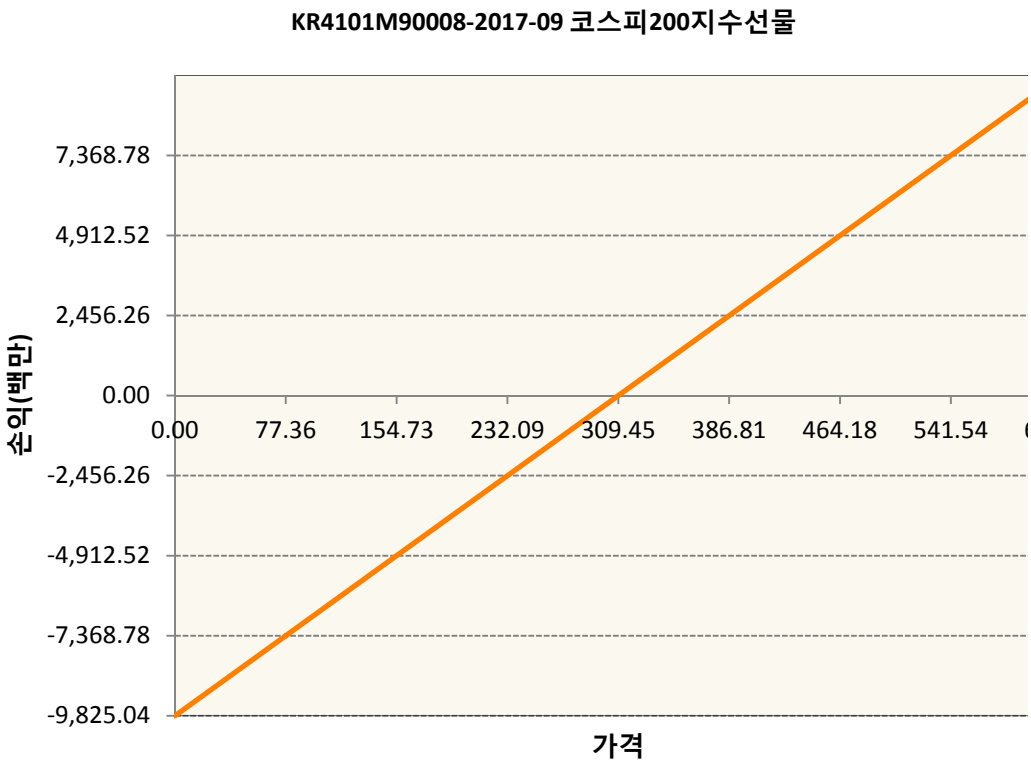
ETF스마트레버리지목표전환형6호

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	310	0	310	장내
누계	유가증권	선물	9,825	0	9,825	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101M90(2017-09 코스피200지수선물							786
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-786	-786	-786	-786	-786	-786	-786
-5.33%	-524	-524	-524	-524	-524	-524	-524
-2.67%	-262	-262	-262	-262	-262	-262	-262
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	262	262	262	262	262	262	262
5.33%	524	524	524	524	524	524	524
8.00%	786	786	786	786	786	786	786

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

510

공시일	2017-06-21
기준일	2017-06-20

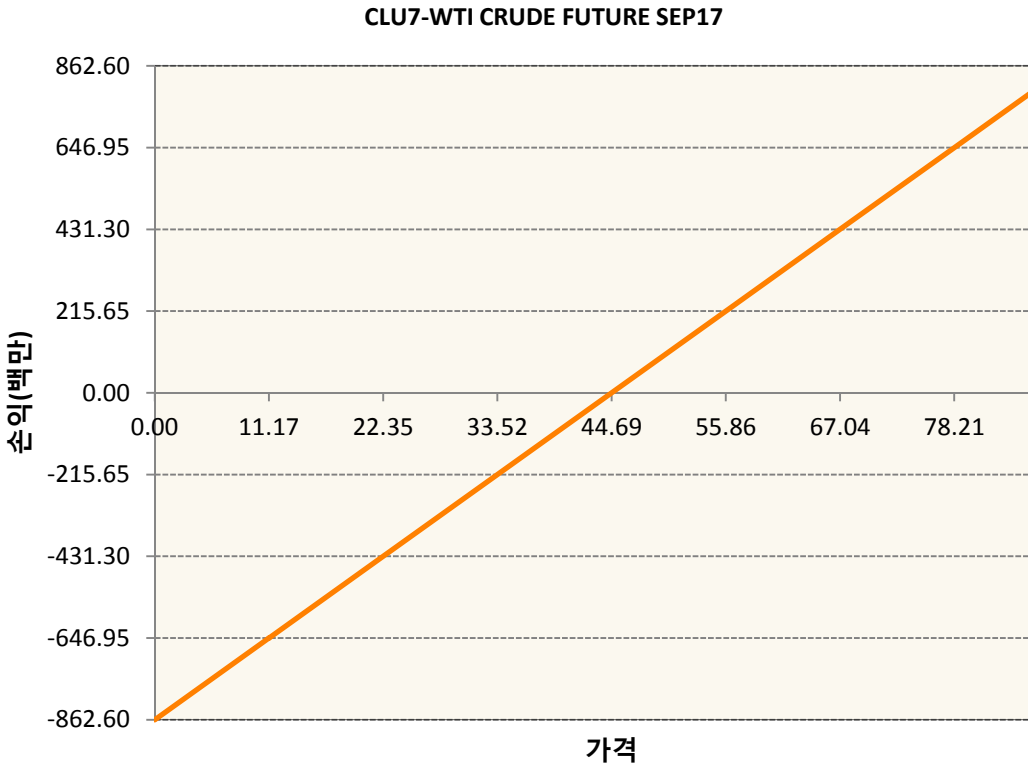
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

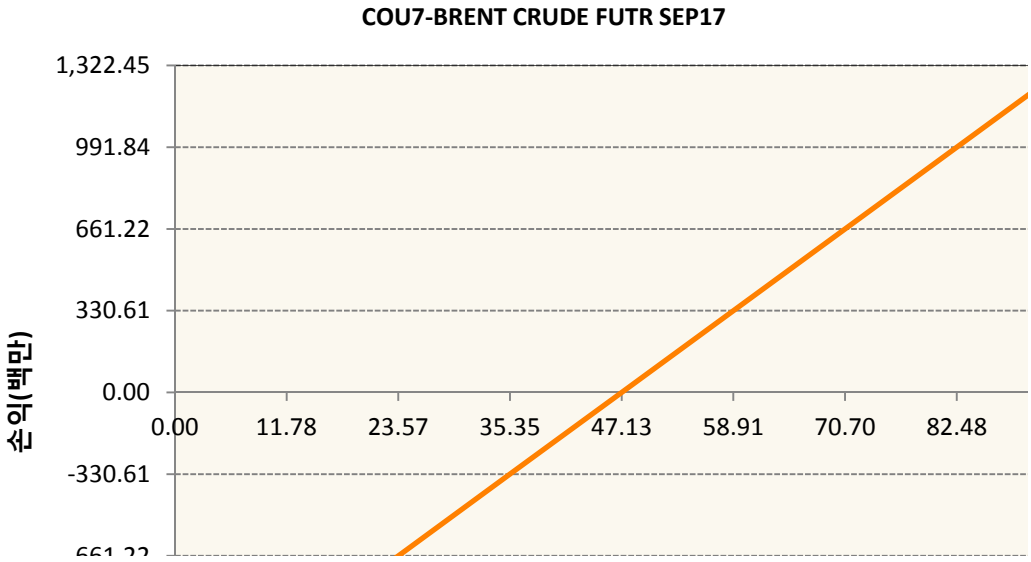
1. 계약금액

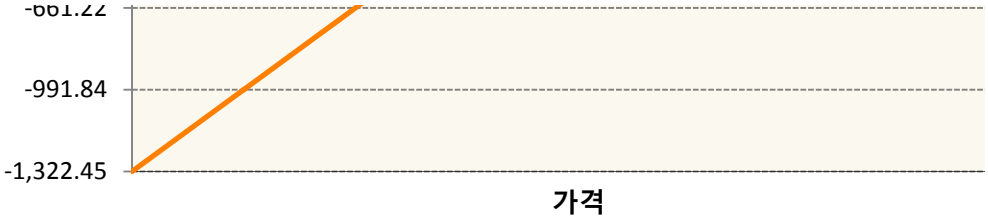
(단위:백만원)

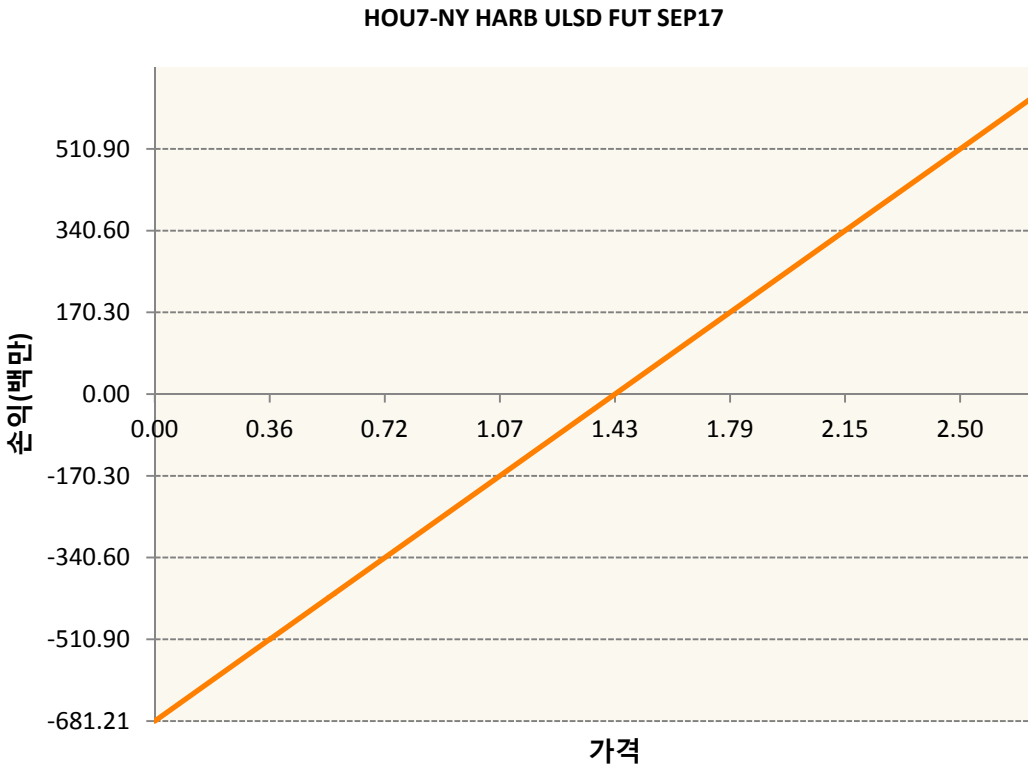
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	4,939	227	4,712	

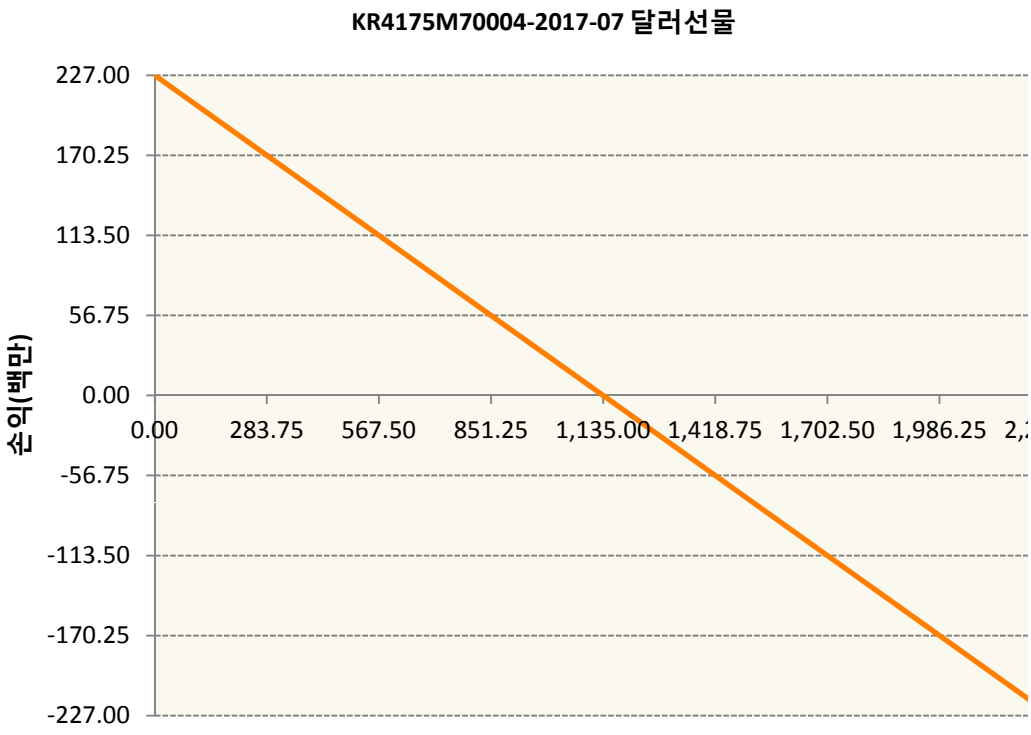
2. 만기시점의 손익구조



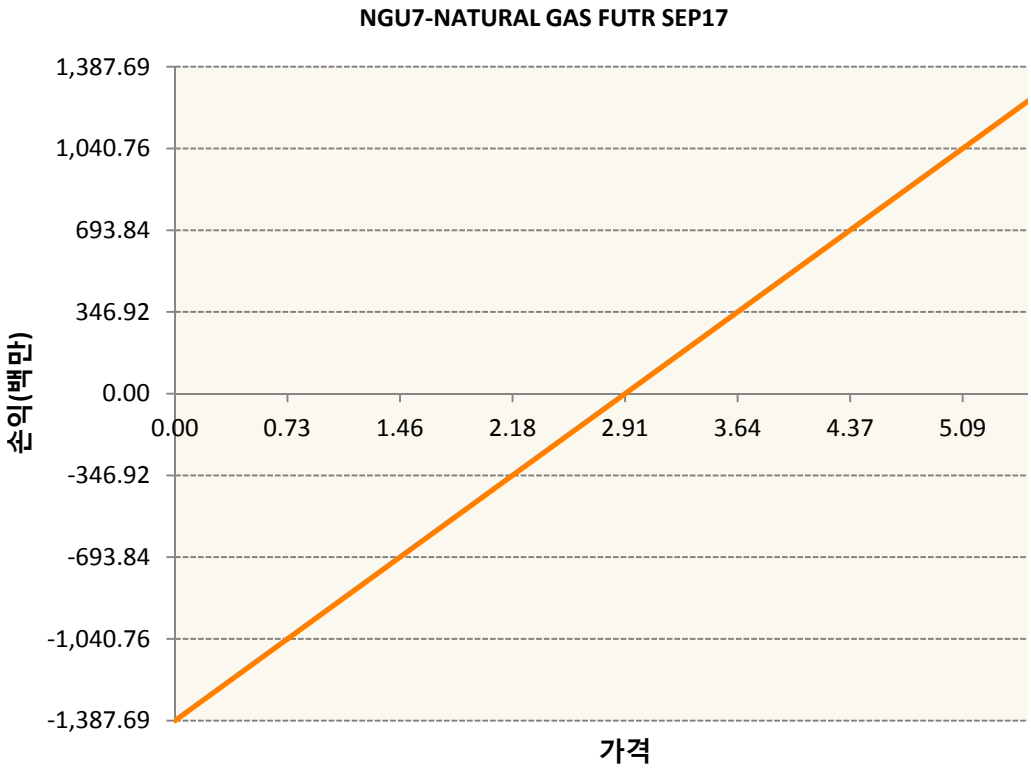


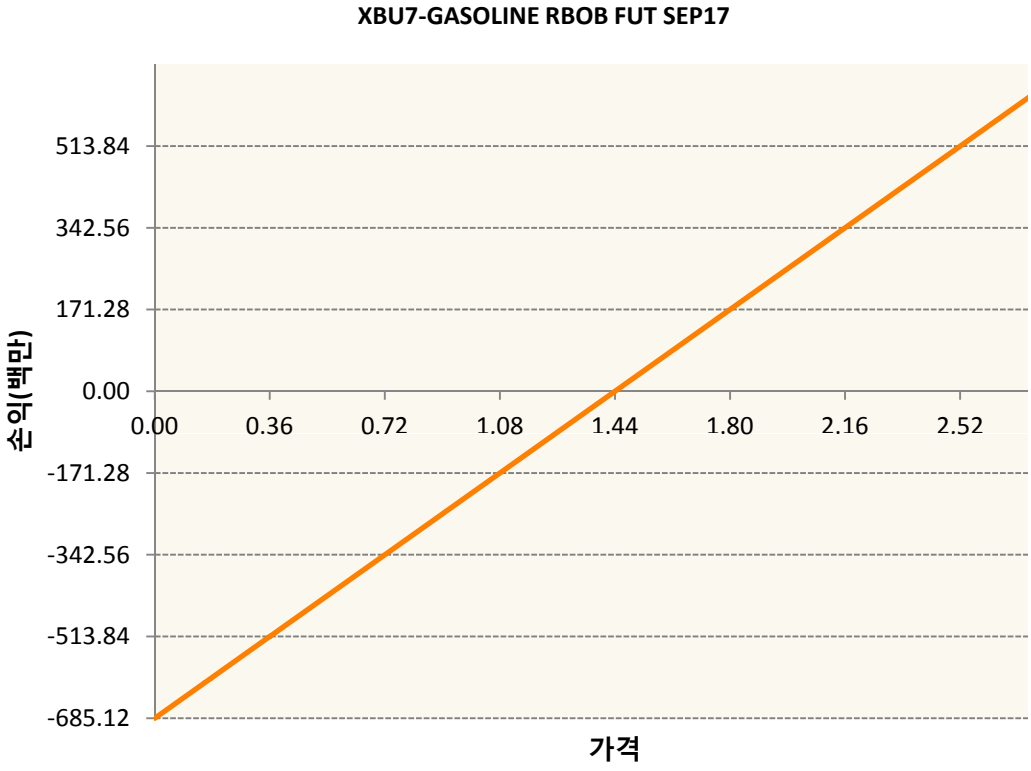

-661.22
-991.84
-1,322.45
가격


HOU7-NY HARB ULSD FUT SEP17
510.90
340.60
170.30
0.00
-170.30
-340.60
-510.90
-681.21
0.00
0.36
0.72
1.07
1.43
1.79
2.15
2.50
손익(백만)
가격


KR4175M70004-2017-07 달러선물
227.00
170.25
113.50
56.75
0.00
-56.75
-113.50
-170.25
-227.00
0.00
283.75
567.50
851.25
1,135.00
1,418.75
1,702.50
1,986.25
손익(백만)

가격


NGU7-NATURAL GAS FUTR SEP17
1,387.69
1,040.76
693.84
346.92
0.00
-346.92
-693.84
-1,040.76
-1,387.69
0.00
0.73
1.46
2.18
2.91
3.64
4.37
5.09
순익(백만)
가격


XBU7-GASOLINE RBOB FUT SEP17
513.84
342.56
171.28
0.00
-171.28
-342.56
-513.84
-685.12
0.00
0.36
0.72
1.08
1.44
1.80
2.16
2.52
순익(백만)
가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLU7	WTI CRUDE FUTURE SEP17	69
COU7	BRENT CRUDE FUTR SEP17	106
HOU7	NY HARB ULSD FUT SEP17	54
KR4175M70(	2017-07 달러선물	18
NGU7	NATURAL GAS FUTR SEP17	111
XBU7	GASOLINE RBOB FUT SEP17	55

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

806

공시일	2017-06-21
기준일	2017-06-20

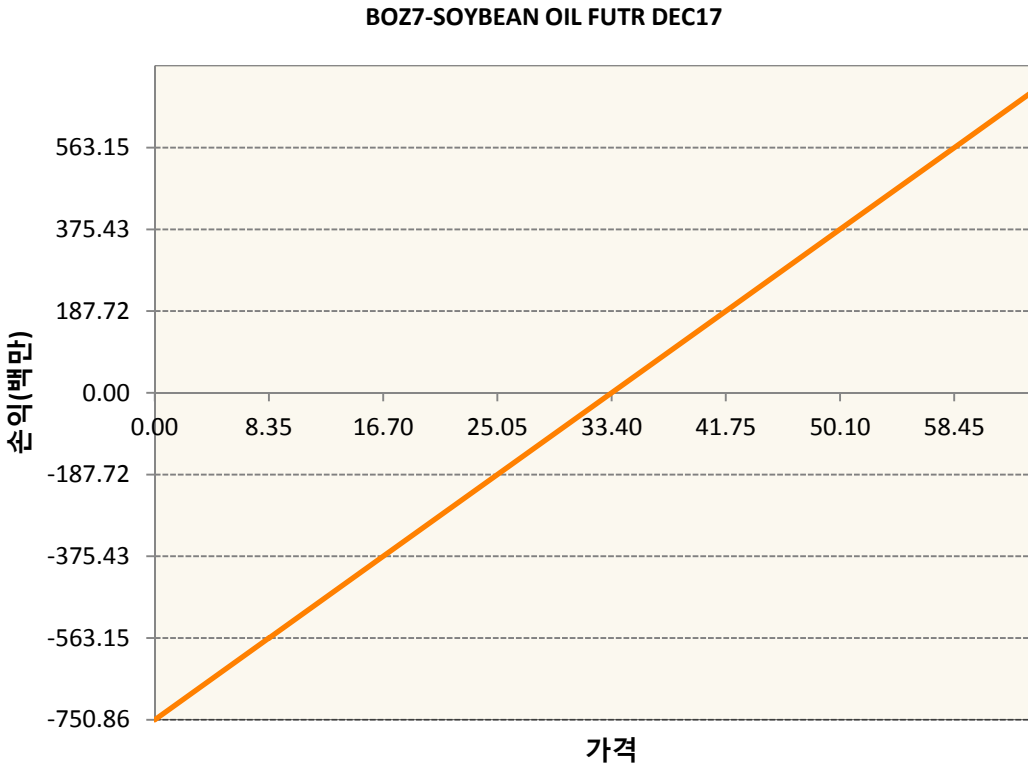
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

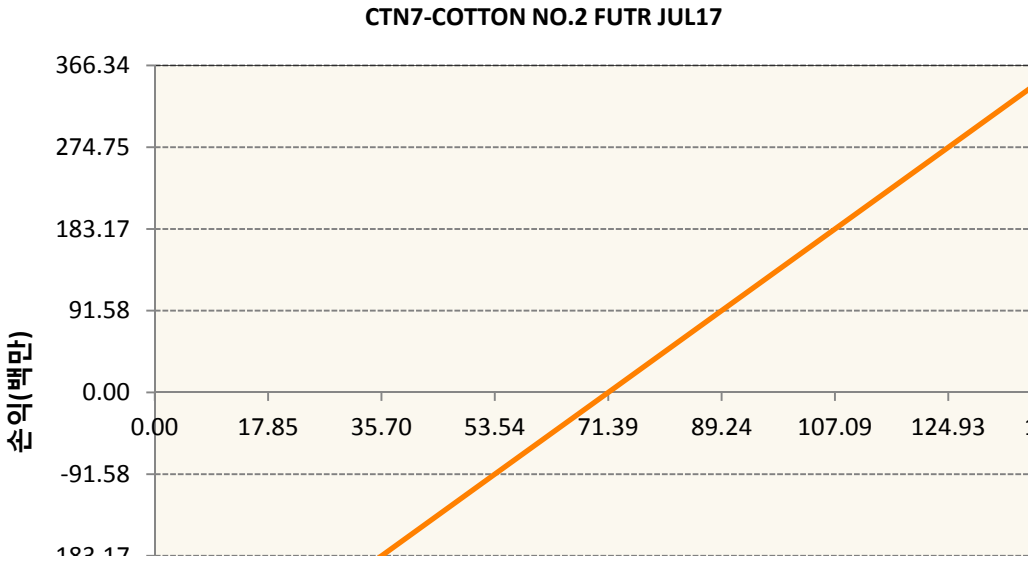
1. 계약금액

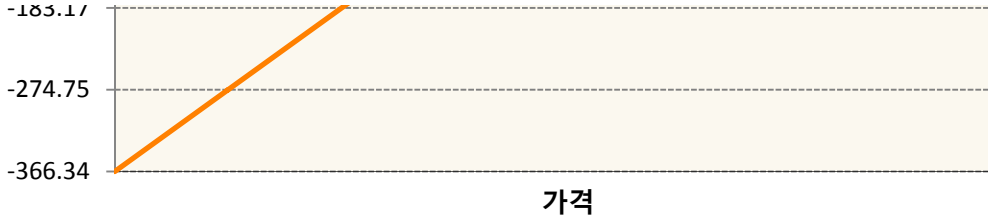
(단위:백만원)

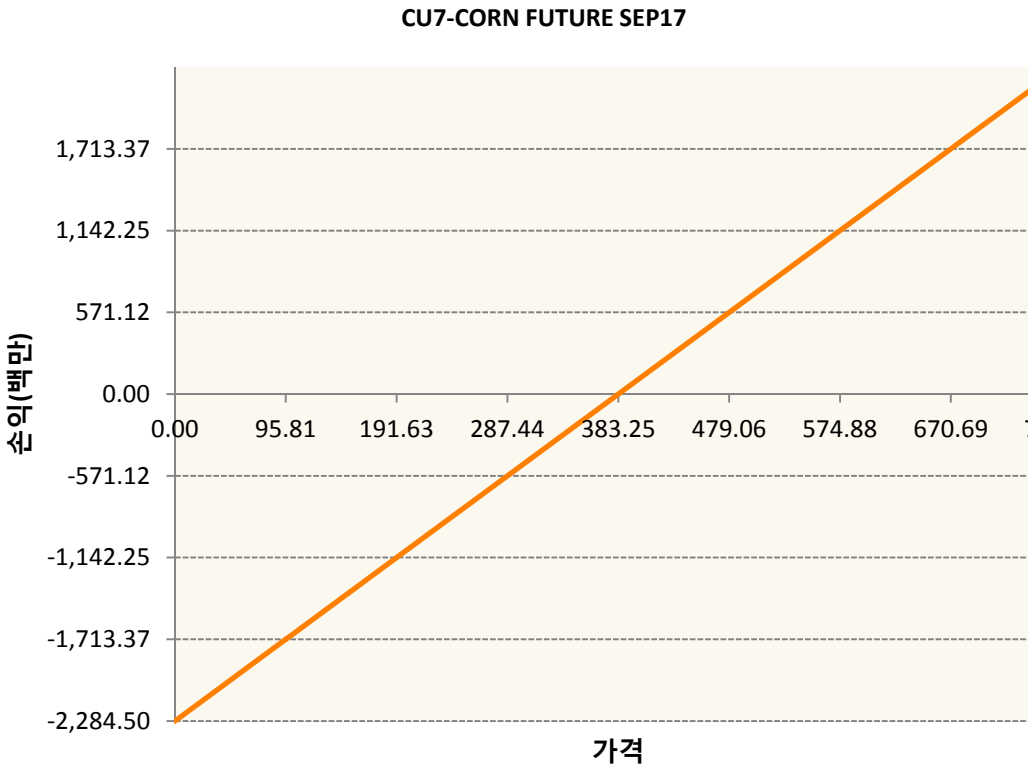
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	8,469	397	8,072	

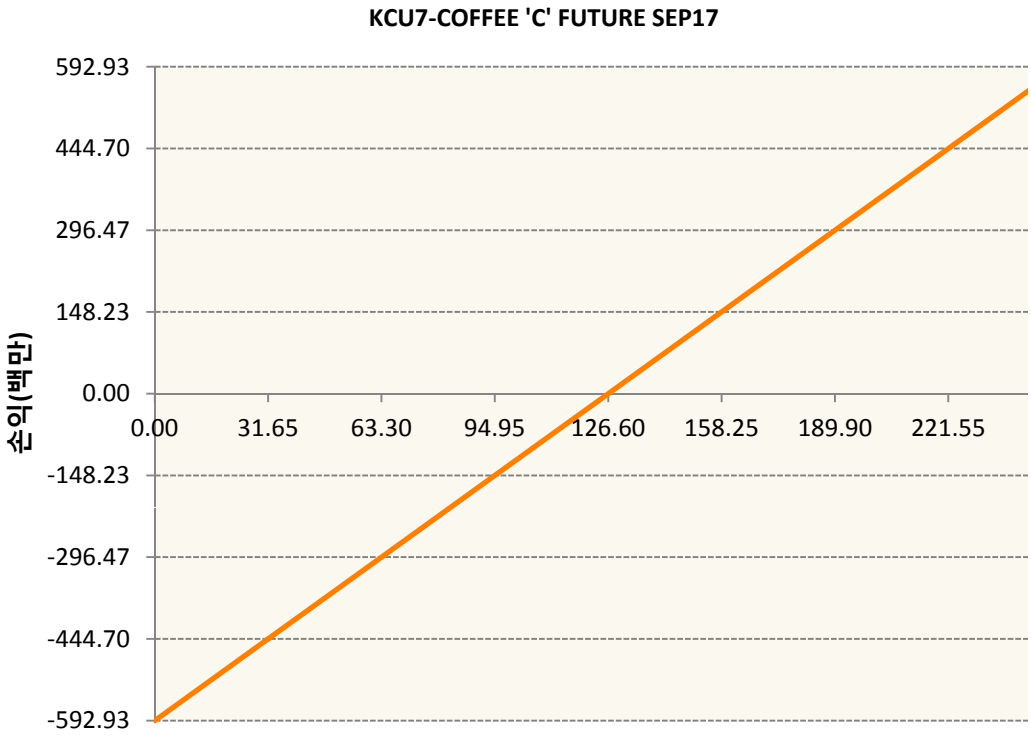
2. 만기시점의 손익구조



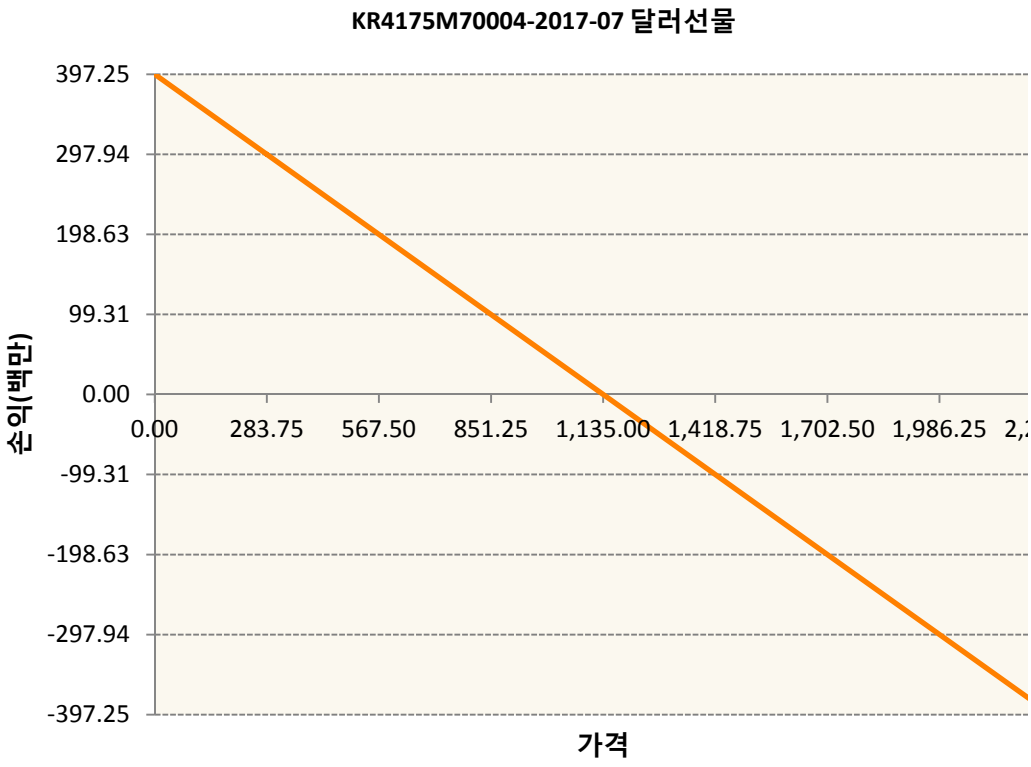


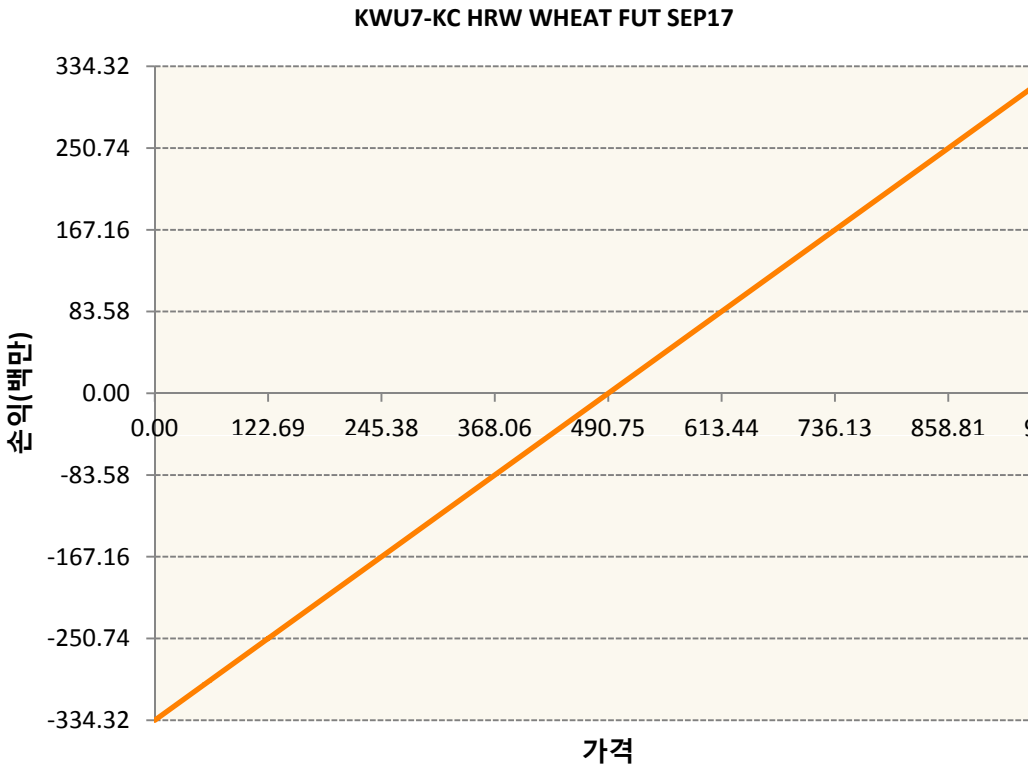

-274.75
-366.34
가격

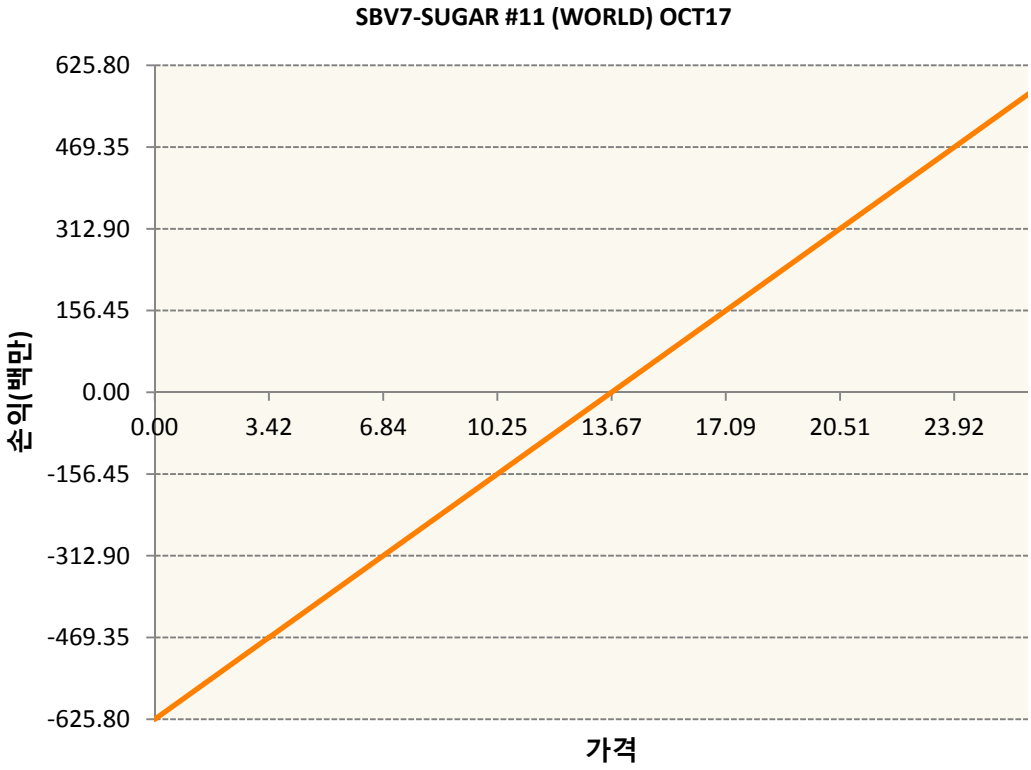

CU7-CORN FUTURE SEP17
1,713.37
1,142.25
571.12
0.00
-571.12
-1,142.25
-1,713.37
-2,284.50
0.00
95.81
191.63
287.44
383.25
479.06
574.88
670.69
손익(백만)
가격

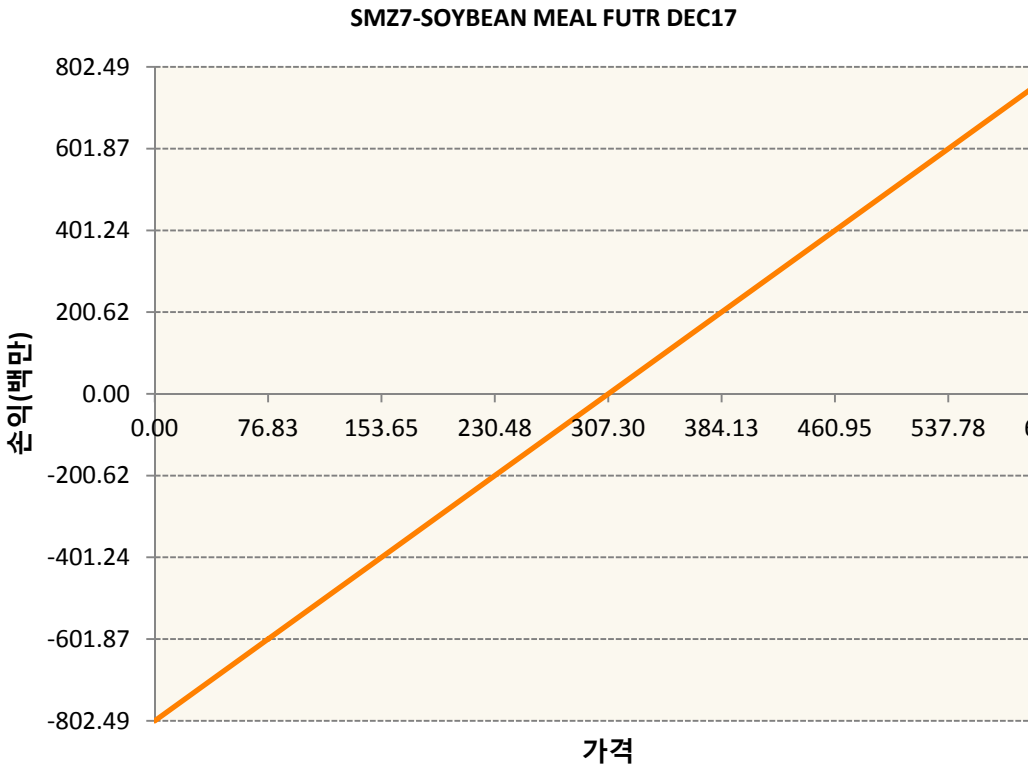

KCU7-COFFEE 'C' FUTURE SEP17
592.93
444.70
296.47
148.23
0.00
-148.23
-296.47
-444.70
-592.93
0.00
31.65
63.30
94.95
126.60
158.25
189.90
221.55
손익(백만)

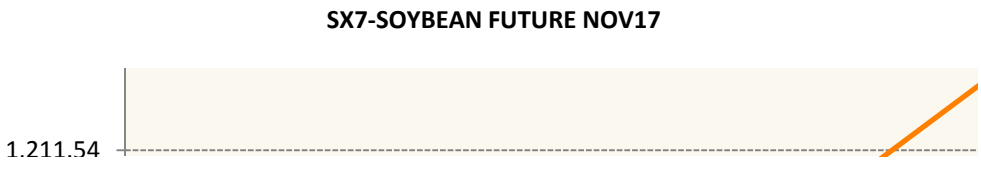
가격

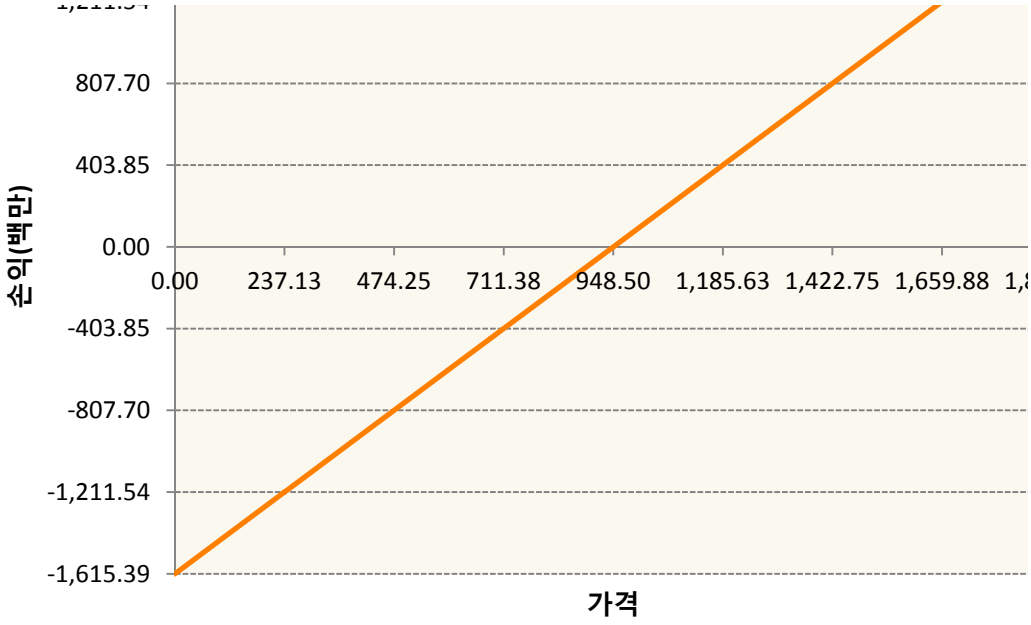

KR4175M70004-2017-07 달러선물
397.25
297.94
198.63
99.31
0.00
-99.31
-198.63
-297.94
-397.25
0.00
283.75
567.50
851.25
1,135.00
1,418.75
1,702.50
1,986.25
손익(백만)
가격

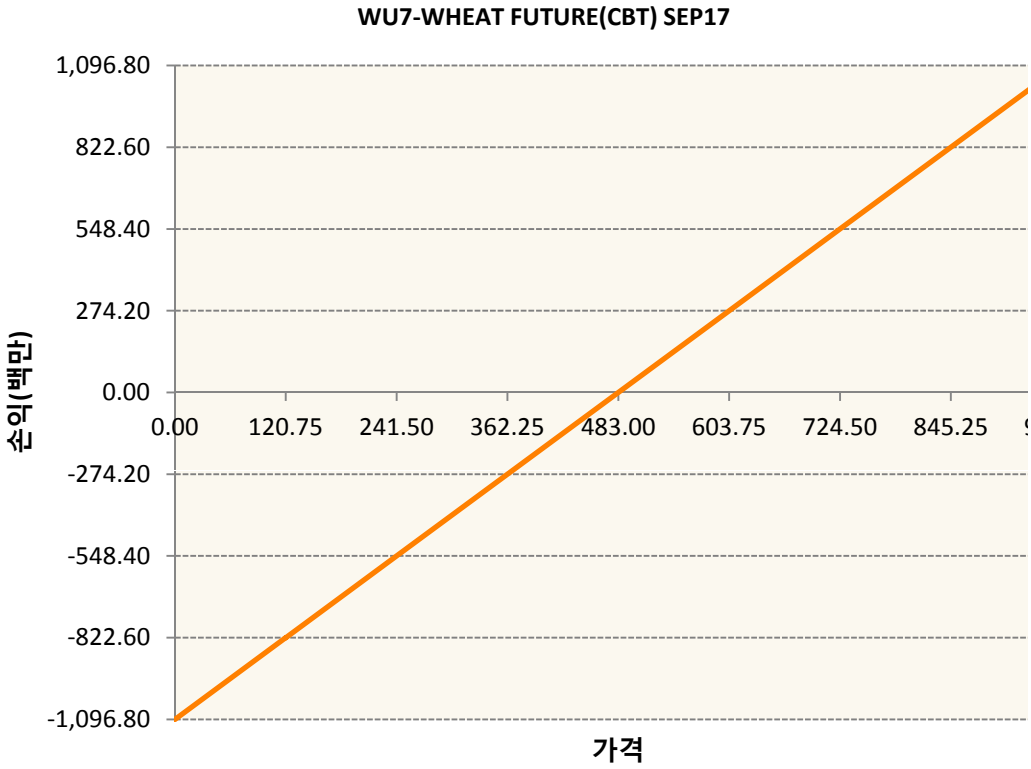

KWU7-KC HRW WHEAT FUT SEP17
334.32
250.74
167.16
83.58
0.00
-83.58
-167.16
-250.74
-334.32
0.00
122.69
245.38
368.06
490.75
613.44
736.13
858.81
손익(백만)
가격


SBV7-SUGAR #11 (WORLD) OCT17
625.80
469.35
312.90
156.45
0.00
-156.45
-312.90
-469.35
-625.80
0.00
3.42
6.84
10.25
13.67
17.09
20.51
23.92
손익(백만)
가격


SMZ7-SOYBEAN MEAL FUTR DEC17
802.49
601.87
401.24
200.62
0.00
-200.62
-401.24
-601.87
-802.49
0.00
76.83
153.65
230.48
307.30
384.13
460.95
537.78
손익(백만)
가격


SX7-SOYBEAN FUTURE NOV17
1,211.54





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

BOZ7	SOYBEAN OIL FUTR DEC17	60
CTN7	COTTON NO.2 FUTR JUL17	29
CU7	CORN FUTURE SEP17	183
KCU7	COFFEE 'C' FUTURE SEP17	47
KR4175M70(	2017-07 달러선물	32

KWU7	KC HRW WHEAT FUT SEP17	27
SBV7	SUGAR #11 (WORLD) OCT17	50
SMZ7	SOYBEAN MEAL FUTR DEC17	64
SX7	SOYBEAN FUTURE NOV17	129
WU7	WHEAT FUTURE(CBT) SEP17	88

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

766