공시일	2017-06-22
기준일	2017-06-21

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	2017-06-22
기준일	2017-06-21

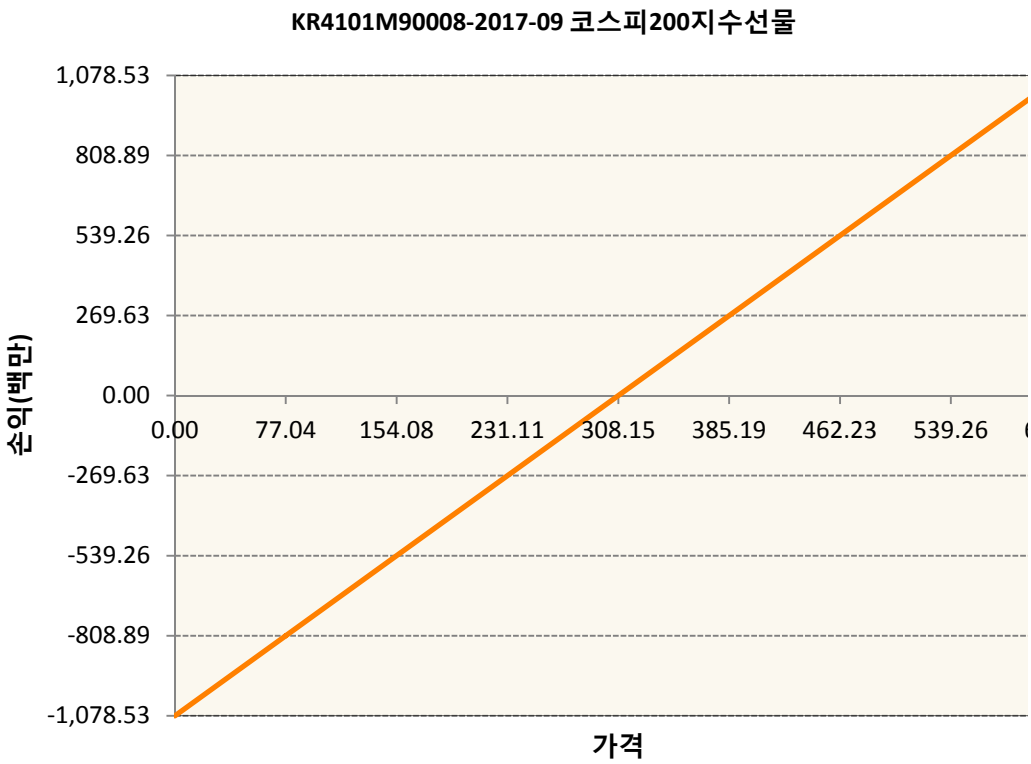
스마트인덱스모

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	1,079	0	1,079	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101M90(2017-09 코스피200지수선물							86
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-86	-86	-86	-86	-86	-86	-86
-5.33%	-57	-57	-57	-57	-57	-57	-57
-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%	57	57	57	57	57	57	57
8.00%	86	86	86	86	86	86	86

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

56

공시일	2017-06-22
기준일	2017-06-21

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	1,000

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

507

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-06-22
기준일	2017-06-21

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	2017-06-22
기준일	2017-06-21

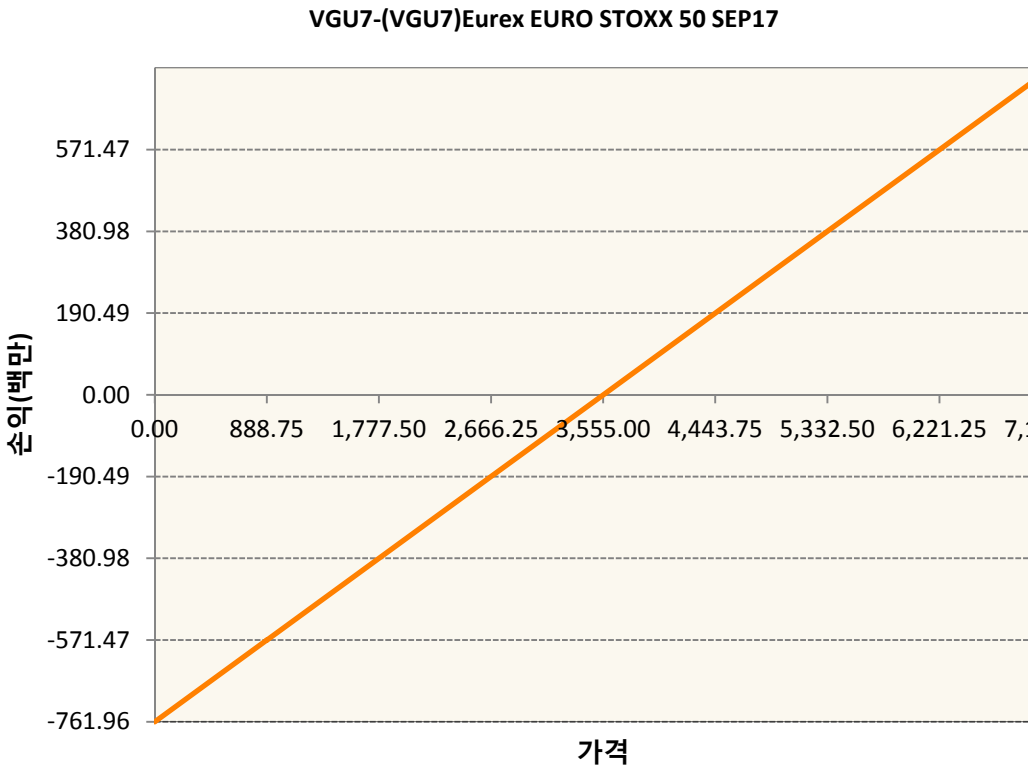
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	762	0	762	

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	2017-06-22
기준일	2017-06-21

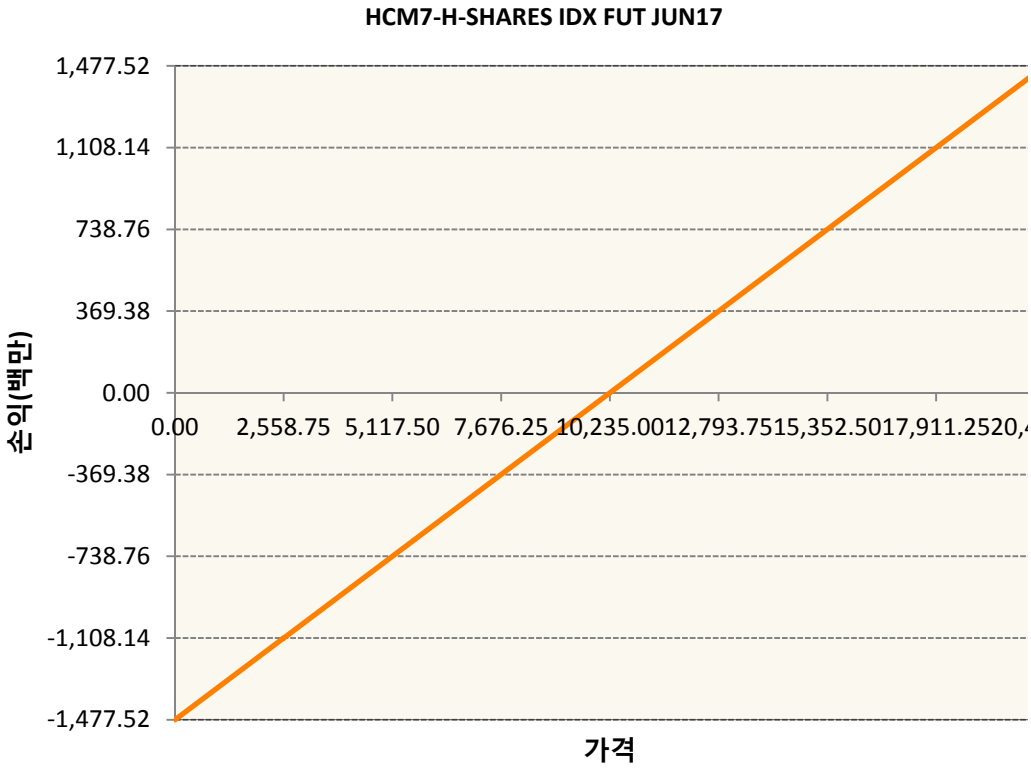
차이나인덱스모(주식-파생형)

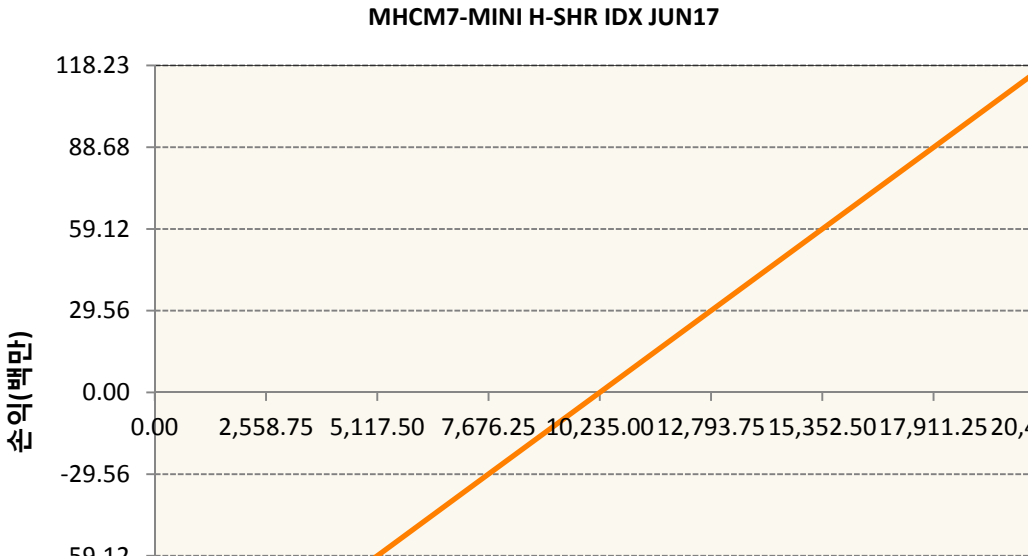
1. 계약금액

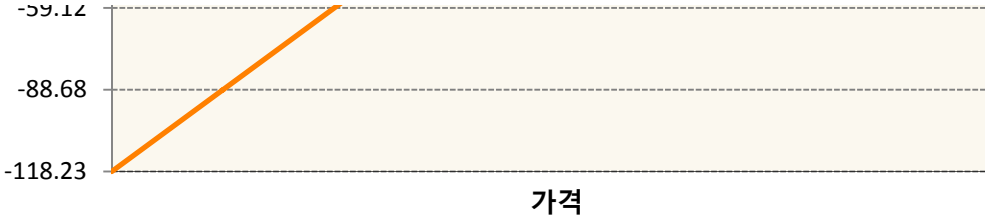
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,596	0	1,596	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCM7	H-SHARES IDX FUT JUN17	118
MHCM7	MINI H-SHR IDX JUN17	9

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	130

공시일	2017-06-22
기준일	2017-06-21

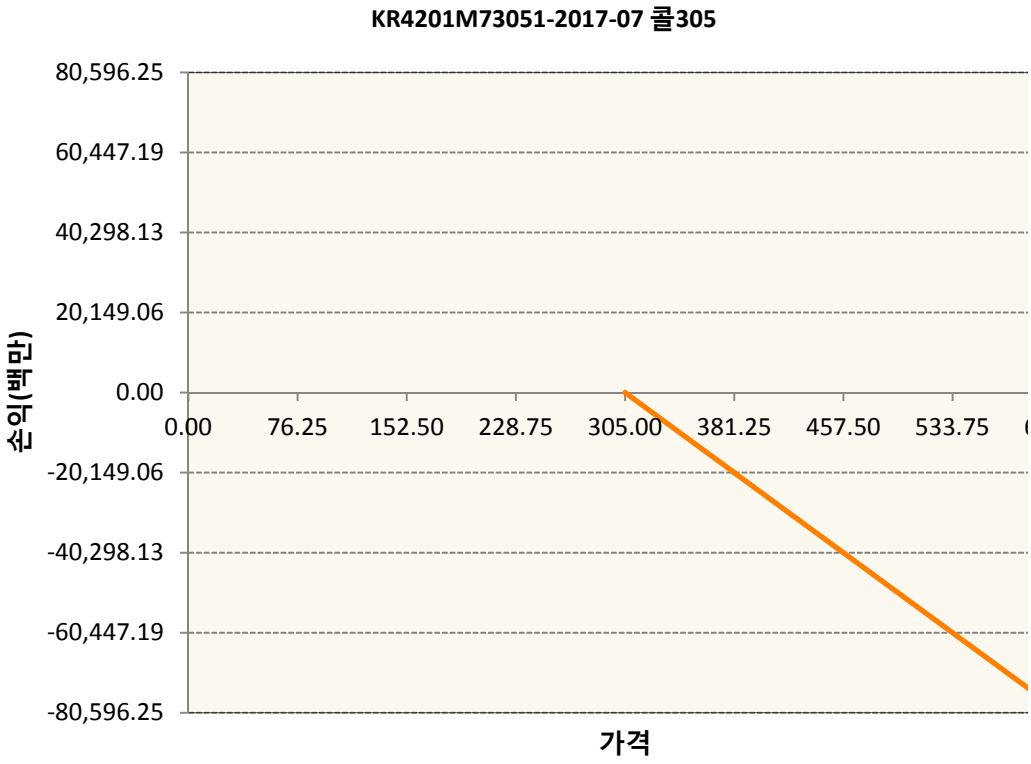
커버드콜모(주식혼합-파생형)

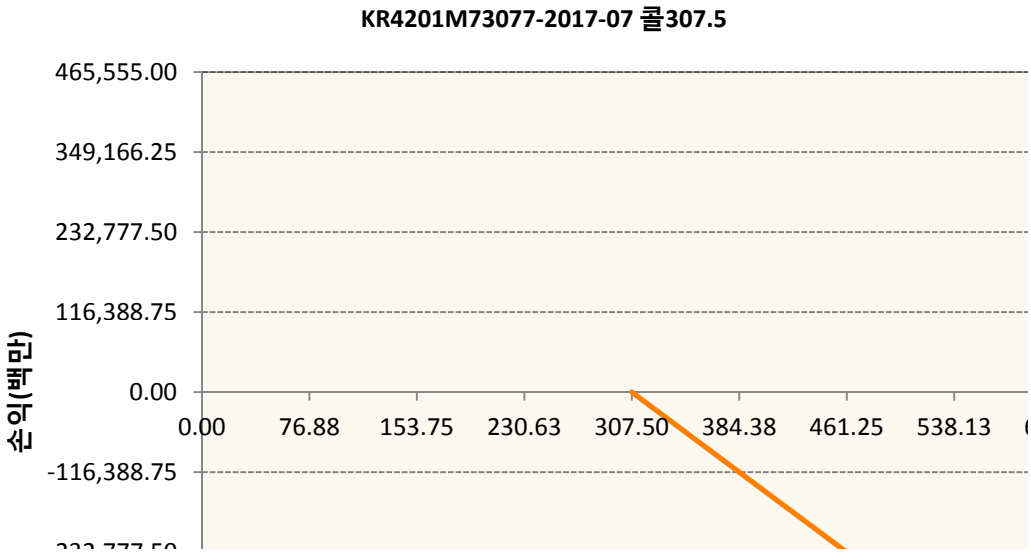
1. 계약금액

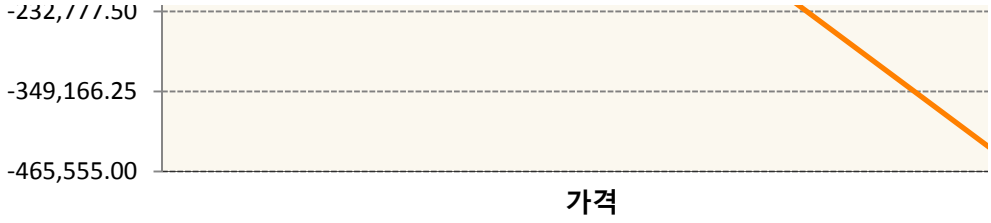
(단위:백만원)

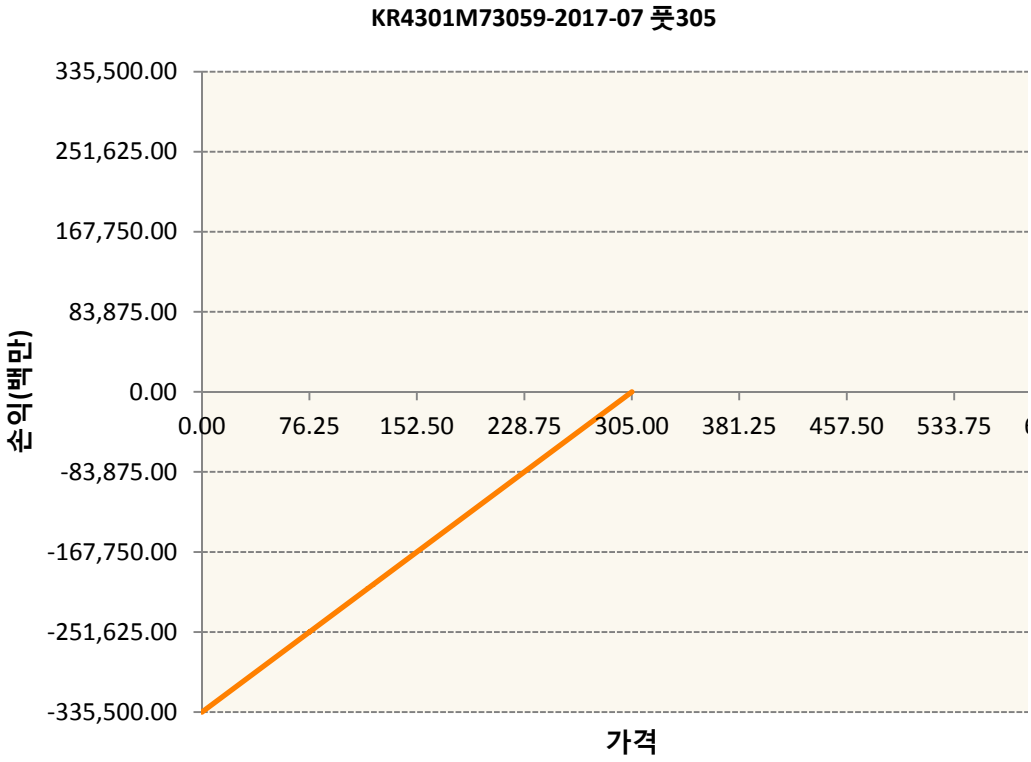
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	912,401	-912,401	장내

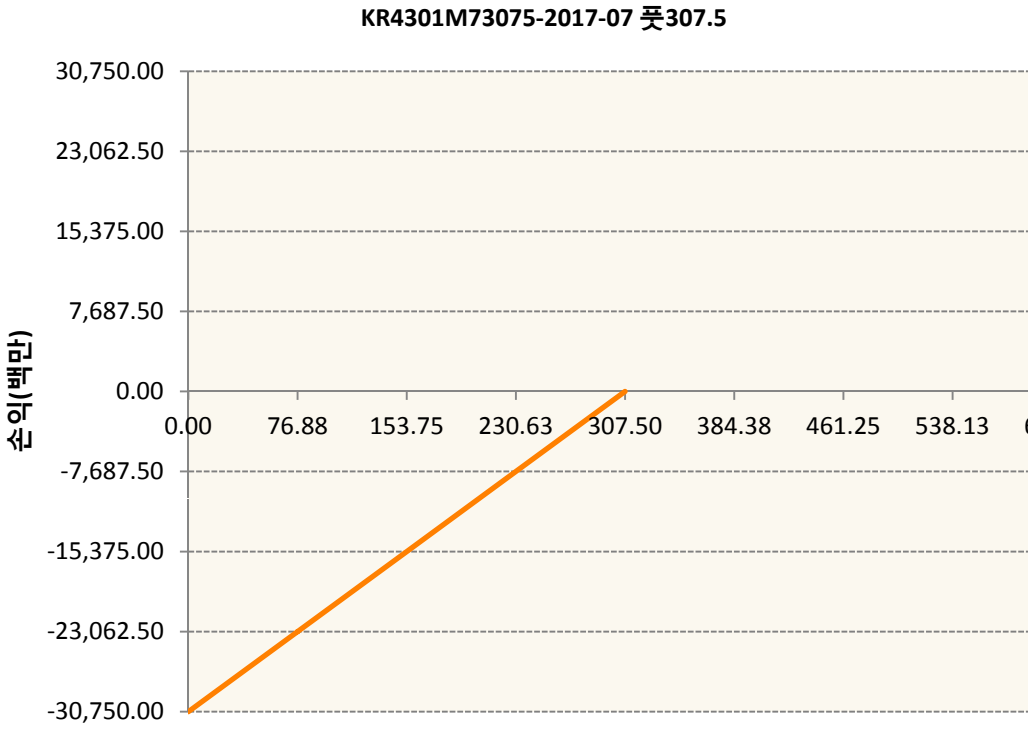
2. 만기시점의 손익구조






-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							5,869
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,295	1,295	1,294	1,292	1,289	1,284	1,277
-5.33%	1,286	1,277	1,263	1,245	1,223	1,196	1,166
-2.67%	1,114	1,060	1,003	942	880	815	750
0%	220	147	74	0	-74	-149	-225
2.67%	-1,572	-1,597	-1,627	-1,663	-1,703	-1,748	-1,795
5.33%	-3,697	-3,699	-3,704	-3,711	-3,722	-3,736	-3,754
8.00%	-5,860	-5,861	-5,861	-5,861	-5,863	-5,865	-5,869
KR4201M73(2017-07 콜307.5							31,978
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	5,340	5,339	5,337	5,333	5,324	5,308	5,284
-5.33%	5,322	5,298	5,258	5,198	5,116	5,013	4,888
-2.67%	4,841	4,625	4,378	4,107	3,815	3,506	3,181
0%	1,334	889	445	0	-445	-889	-1,334
2.67%	-7,616	-7,847	-8,107	-8,393	-8,699	-9,022	-9,361
5.33%	-19,501	-19,535	-19,589	-19,666	-19,767	-19,893	-20,042
8.00%	-31,878	-31,880	-31,884	-31,893	-31,911	-31,938	-31,978
KR4301M73(2017-07 풋305							21,721
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-21,644	-21,646	-21,649	-21,657	-21,670	-21,691	-21,721
-5.33%	-12,670	-12,709	-12,765	-12,840	-12,933	-13,044	-13,171
-2.67%	-4,374	-4,599	-4,839	-5,090	-5,350	-5,618	-5,892
0%	915	613	308	0	-310	-622	-935
2.67%	2,470	2,366	2,239	2,090	1,922	1,737	1,538
5.33%	2,635	2,625	2,606	2,575	2,531	2,472	2,398
8.00%	2,641	2,641	2,640	2,637	2,631	2,620	2,603
KR4301M73(2017-07 풋307.5							2,109
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-2,105	-2,105	-2,105	-2,106	-2,106	-2,107	-2,109
-5.33%	-1,287	-1,289	-1,291	-1,295	-1,301	-1,307	-1,316
-2.67%	-500	-514	-530	-548	-567	-588	-609
0%	88	59	29	0	-29	-59	-88
2.67%	316	301	284	265	245	223	201

5.33%	351	348	345	340	333	325	315
8.00%	352	352	352	351	350	348	346

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

71,432

공시일	2017-06-22
기준일	2017-06-21

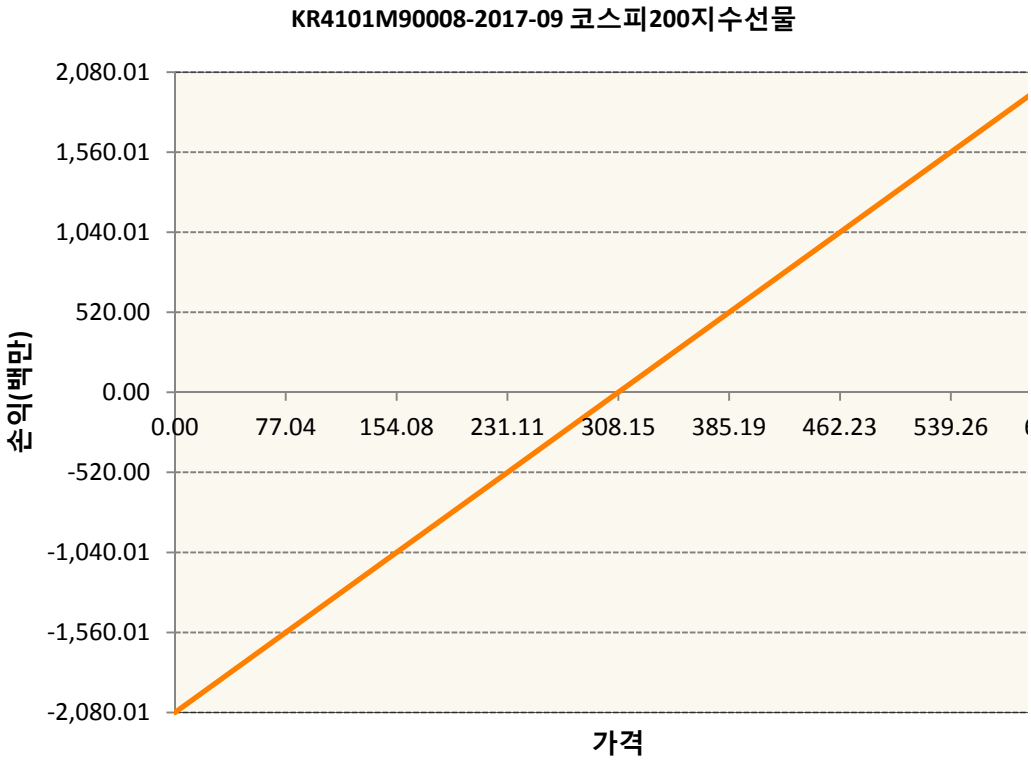
커버드콜목표전환형증권투자신탁

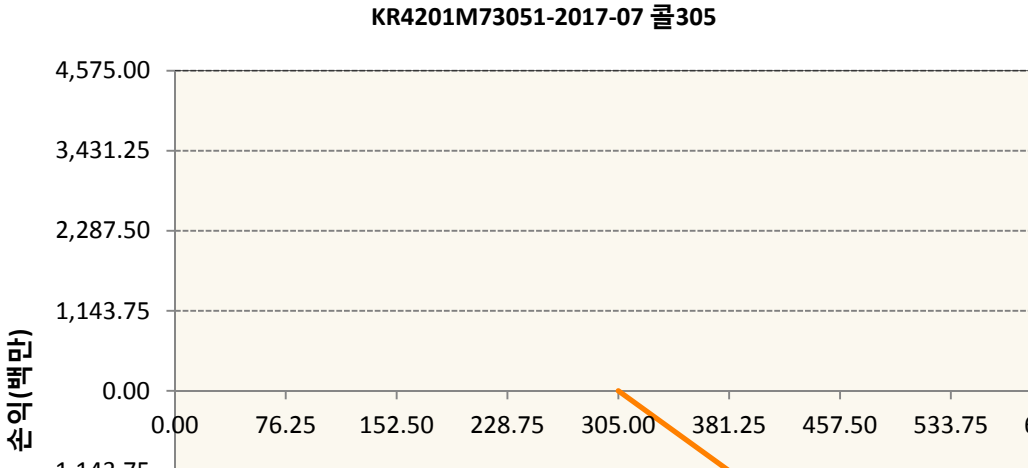
1. 계약금액

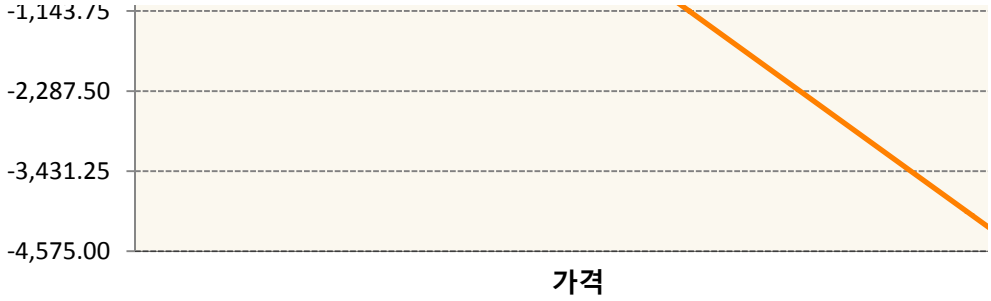
(단위:백만원)

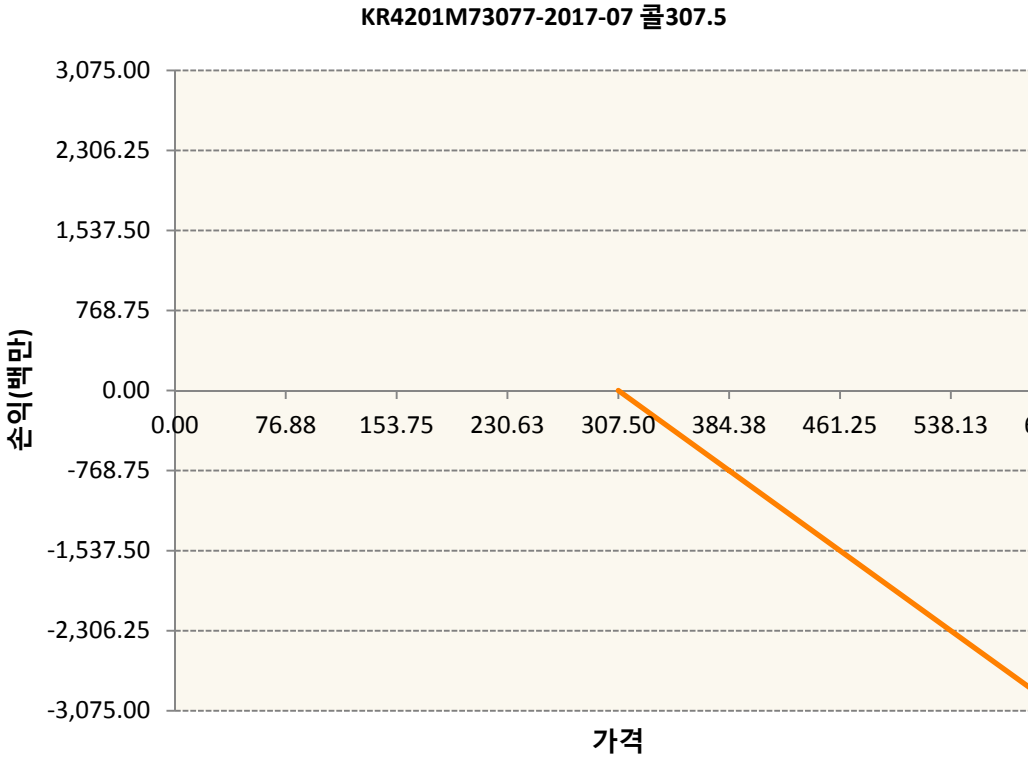
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,080	0	2,080	장내
누계	유가증권	옵션	0	8,803	-8,803	장내

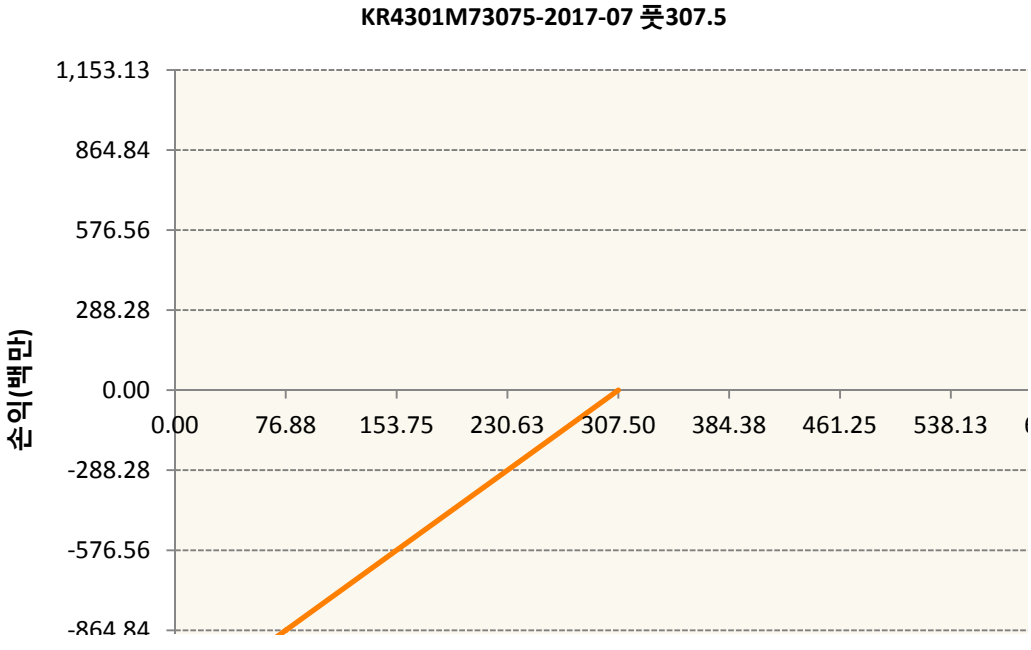
2. 만기시점의 손익구조

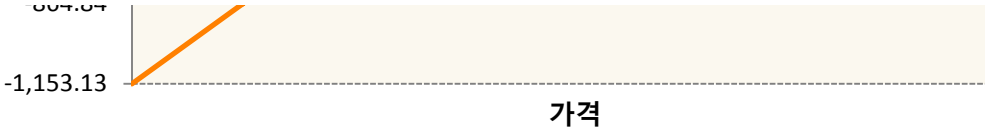





-1,143.75
-2,287.50
-3,431.25
-4,575.00
가격


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							166
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-166	-166	-166	-166	-166	-166	-166
-5.33%	-111	-111	-111	-111	-111	-111	-111
-2.67%	-55	-55	-55	-55	-55	-55	-55
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	55	55	55	55	55	55	55
5.33%	111	111	111	111	111	111	111
8.00%	166	166	166	166	166	166	166
KR4201M73(2017-07 콜305							333
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	74	74	73	73	73	73	72
-5.33%	73	72	72	71	69	68	66
-2.67%	63	60	57	53	50	46	43
0%	12	8	4	0	-4	-8	-13
2.67%	-89	-91	-92	-94	-97	-99	-102
5.33%	-210	-210	-210	-211	-211	-212	-213
8.00%	-333	-333	-333	-333	-333	-333	-333
KR4201M73(2017-07 콜307.5							211
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	35	35	35	35	35	35	35
-5.33%	35	35	35	34	34	33	32
-2.67%	32	31	29	27	25	23	21
0%	9	6	3	0	-3	-6	-9
2.67%	-50	-52	-54	-55	-57	-60	-62
5.33%	-129	-129	-129	-130	-131	-131	-132
8.00%	-211	-211	-211	-211	-211	-211	-211
KR4301M73(2017-07 풋307.5							79
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-79	-79	-79	-79	-79	-79	-79
-5.33%	-48	-48	-48	-49	-49	-49	-49
-2.67%	-19	-19	-20	-21	-21	-22	-23

0%	3	2	1	0	-1	-2	-3
2.67%	12	11	11	10	9	8	8
5.33%	13	13	13	13	12	12	12
8.00%	13	13	13	13	13	13	13

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

852

공시일	2017-06-22
기준일	2017-06-21

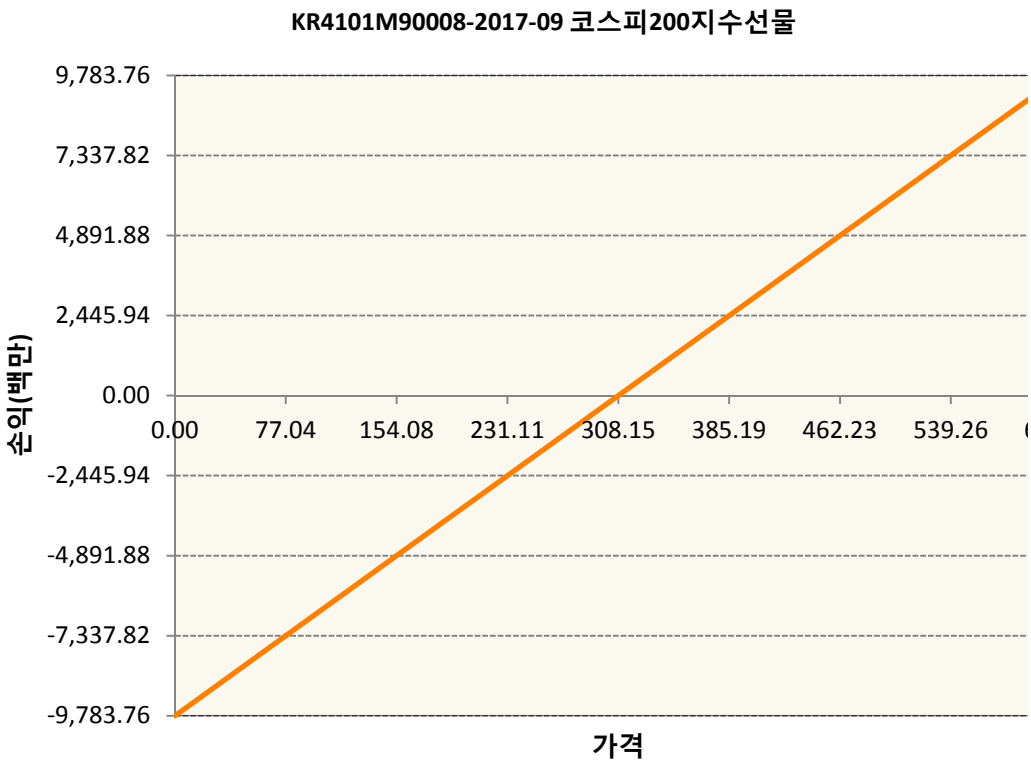
ETF스마트레버리지목표전환형6호

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	9,784	0	9,784	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101M90(2017-09 코스피200지수선물							781
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-781	-781	-781	-781	-781	-781	-781
-5.33%	-521	-521	-521	-521	-521	-521	-521
-2.67%	-260	-260	-260	-260	-260	-260	-260
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	260	260	260	260	260	260	260
5.33%	521	521	521	521	521	521	521
8.00%	781	781	781	781	781	781	781

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

508

공시일	2017-06-22
기준일	2017-06-21

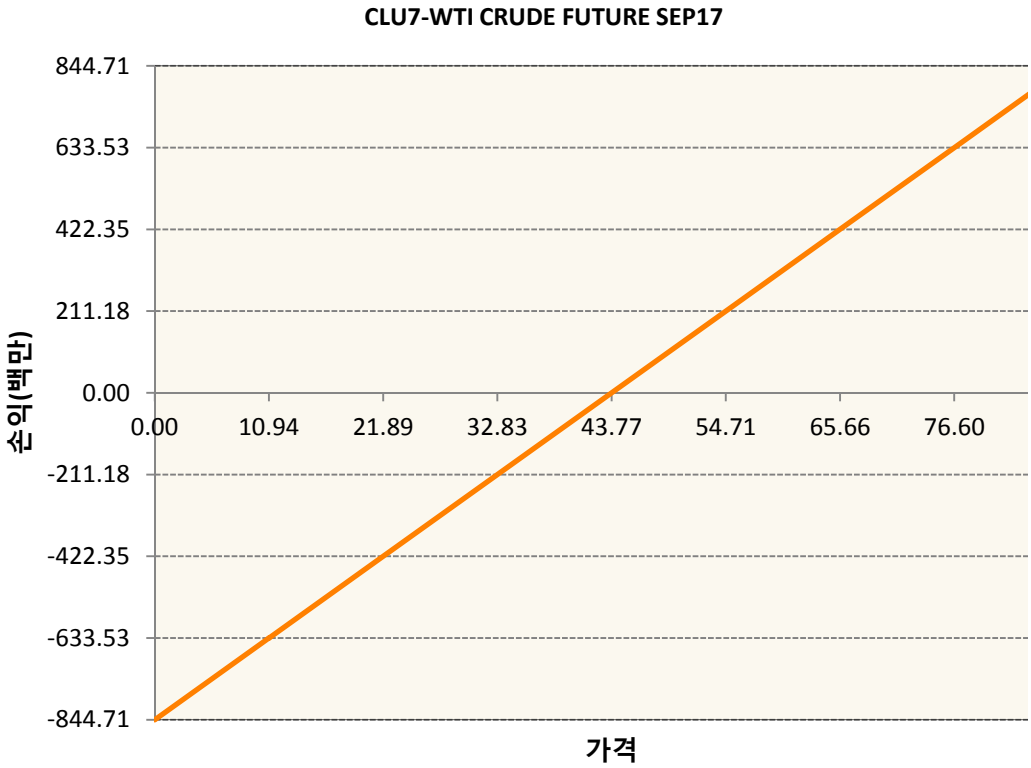
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

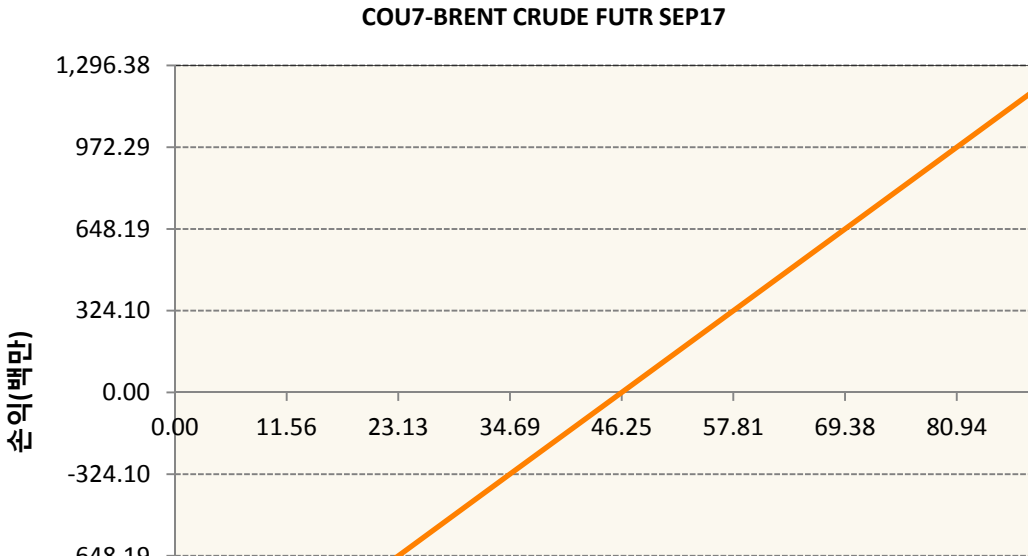
1. 계약금액

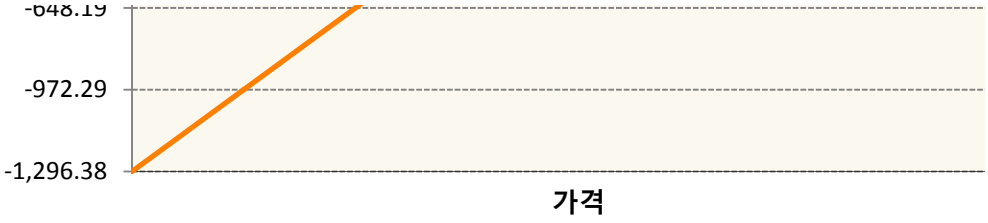
(단위:백만원)

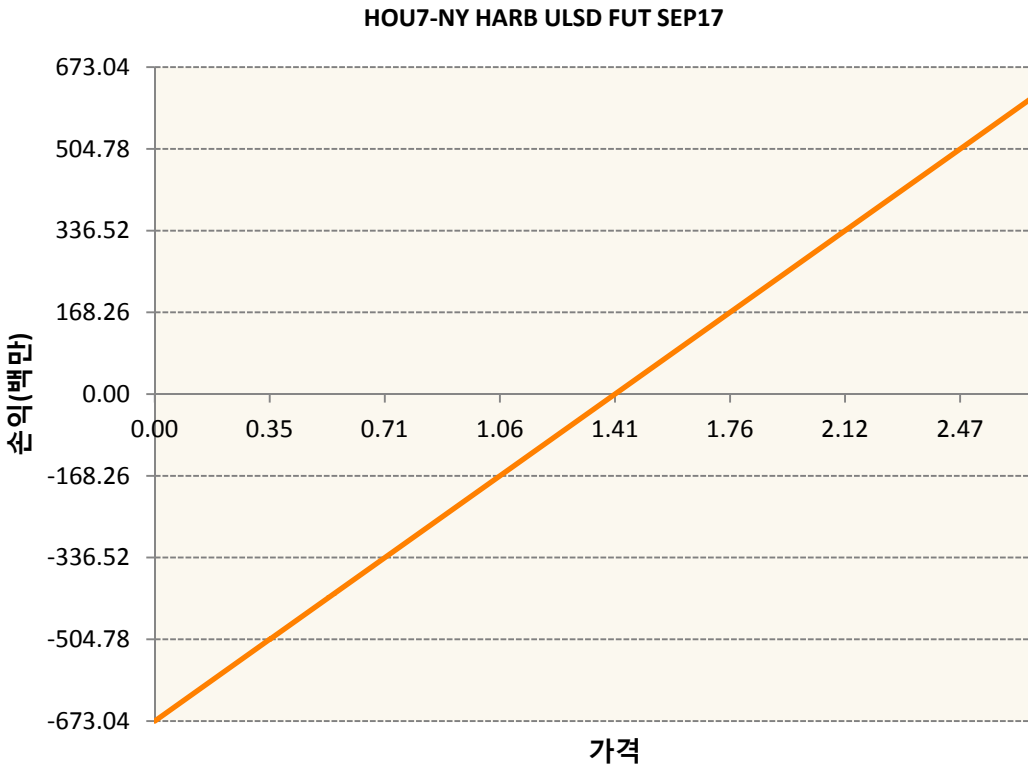
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	4,884	229	4,655	

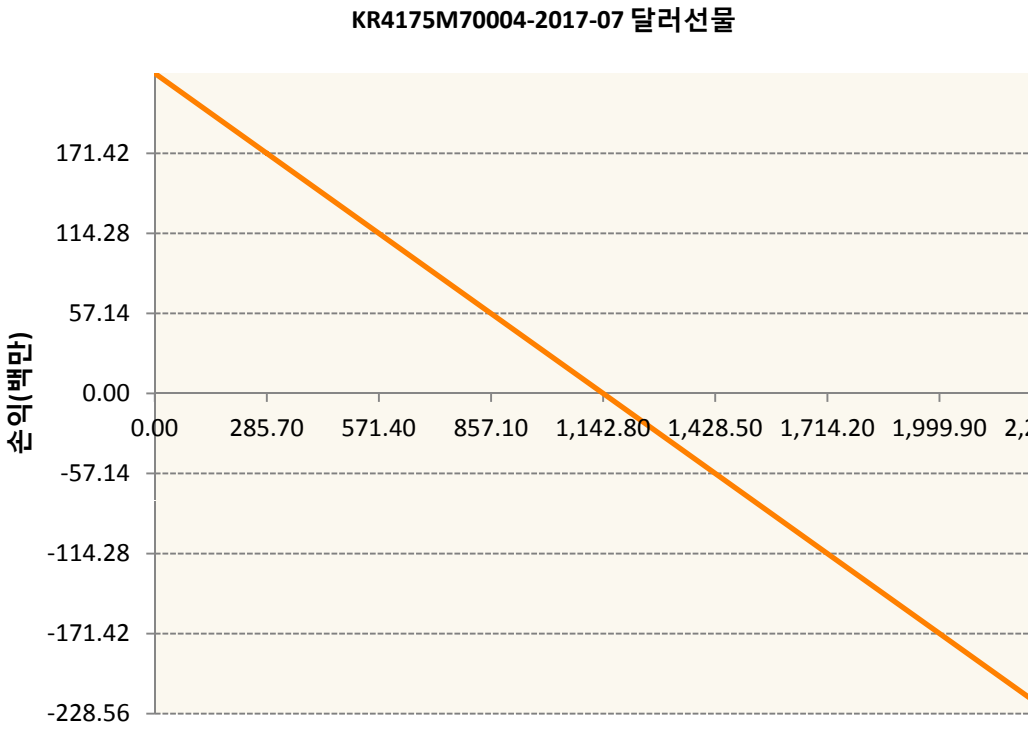
2. 만기시점의 손익구조



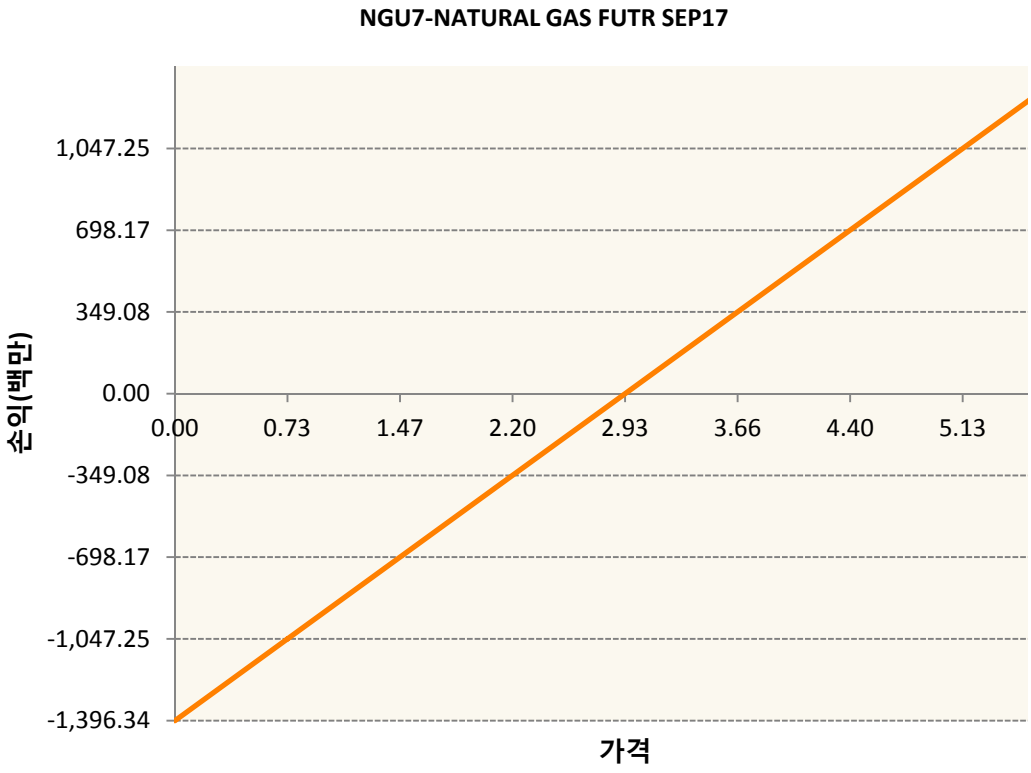


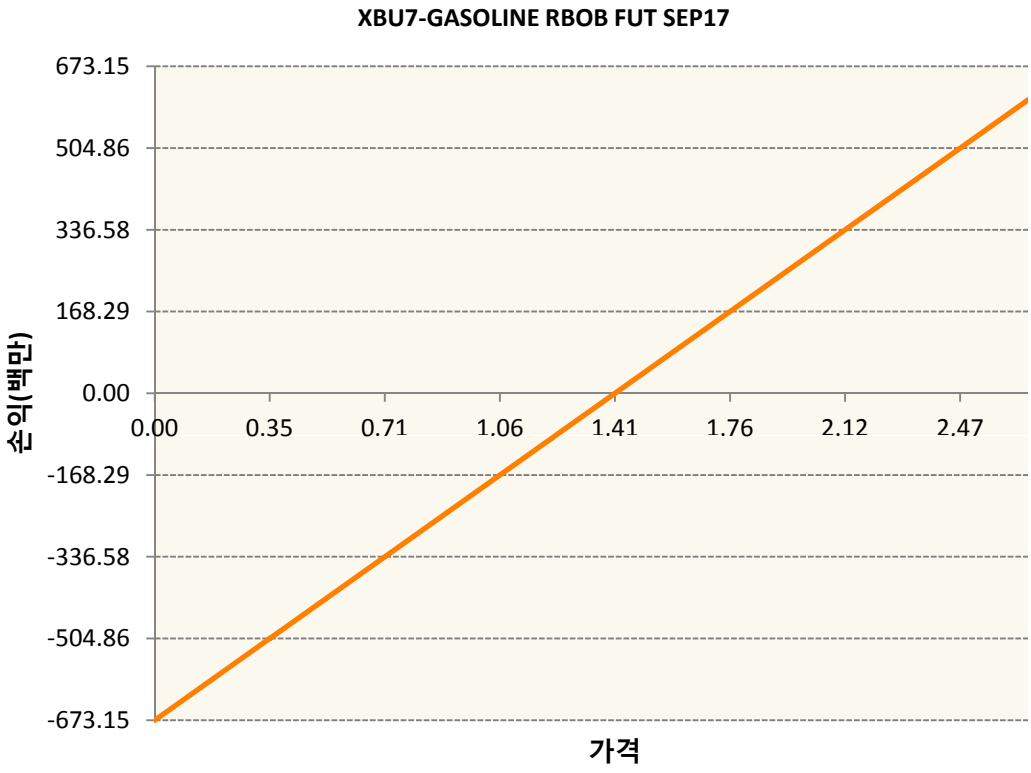

-648.19
-972.29
-1,296.38
가격


HOU7-NY HARB ULSD FUT SEP17
673.04
504.78
336.52
168.26
0.00
-168.26
-336.52
-504.78
-673.04
0.00
0.35
0.71
1.06
1.41
1.76
2.12
2.47
손익(백만)
가격


KR4175M70004-2017-07 달러선물
171.42
114.28
57.14
0.00
-57.14
-114.28
-171.42
-228.56
0.00
285.70
571.40
857.10
1,142.80
1,428.50
1,714.20
1,999.90
손익(백만)

가격


NGU7-NATURAL GAS FUTR SEP17
1,047.25
698.17
349.08
0.00
-349.08
-698.17
-1,047.25
-1,396.34
0.00
0.73
1.47
2.20
2.93
3.66
4.40
5.13
순익(백만)
가격


XBU7-GASOLINE RBOB FUT SEP17
673.15
504.86
336.58
168.29
0.00
-168.29
-336.58
-504.86
-673.15
0.00
0.35
0.71
1.06
1.41
1.76
2.12
2.47
순익(백만)
가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLU7	WTI CRUDE FUTURE SEP17	68
COU7	BRENT CRUDE FUTR SEP17	104
HOU7	NY HARB ULSD FUT SEP17	54
KR4175M70(	2017-07 달러선물	18
NGU7	NATURAL GAS FUTR SEP17	112
XBU7	GASOLINE RBOB FUT SEP17	54

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

796

공시일	2017-06-22
기준일	2017-06-21

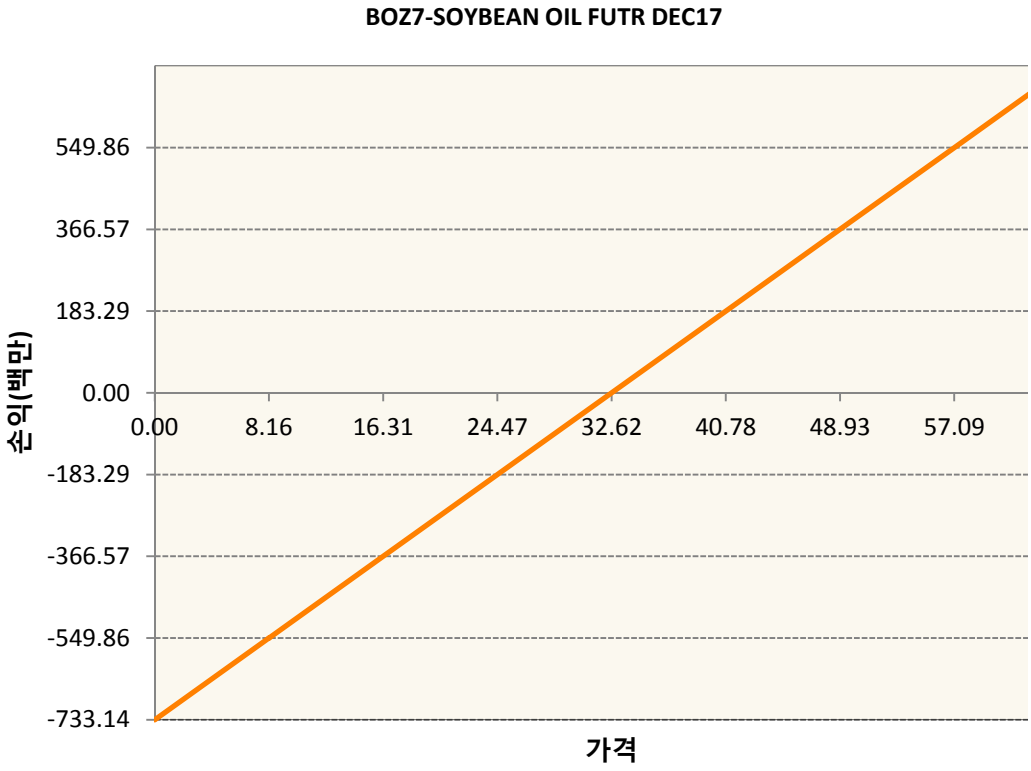
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

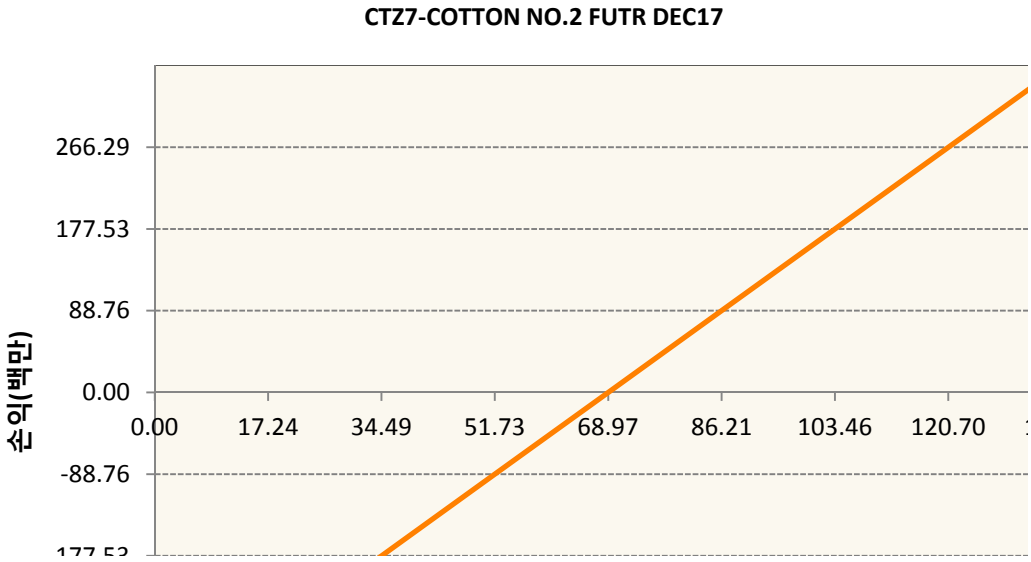
1. 계약금액

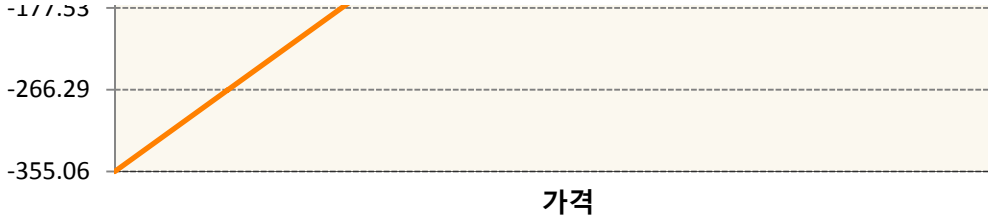
(단위:백만원)

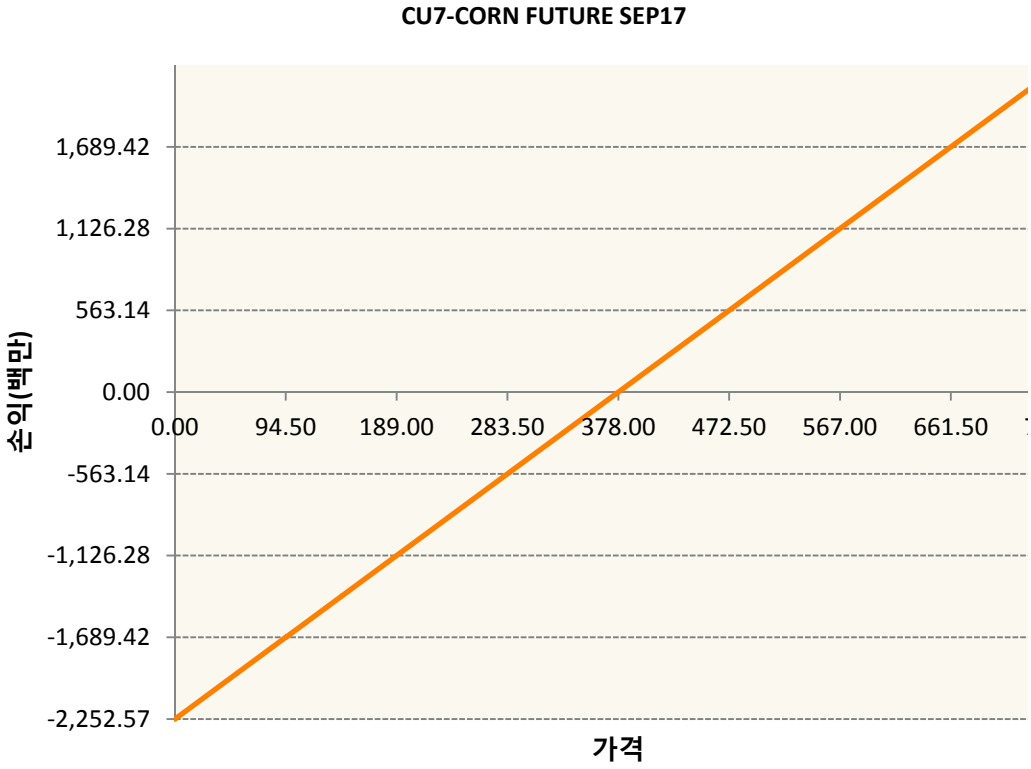
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	8,398	400	7,998	

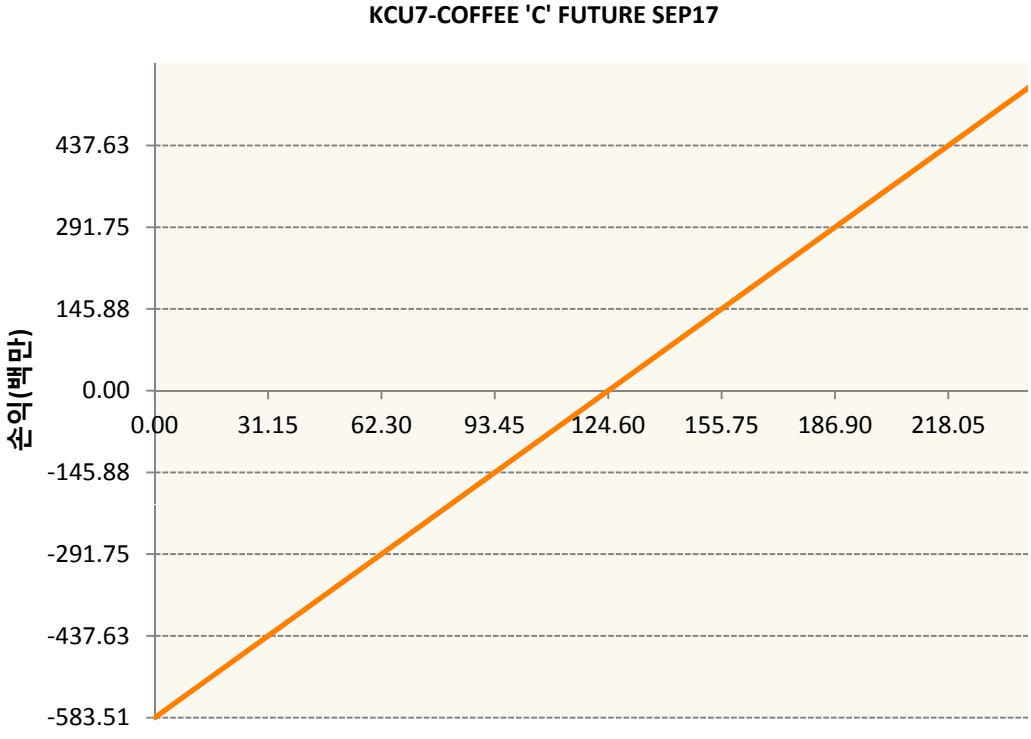
2. 만기시점의 손익구조





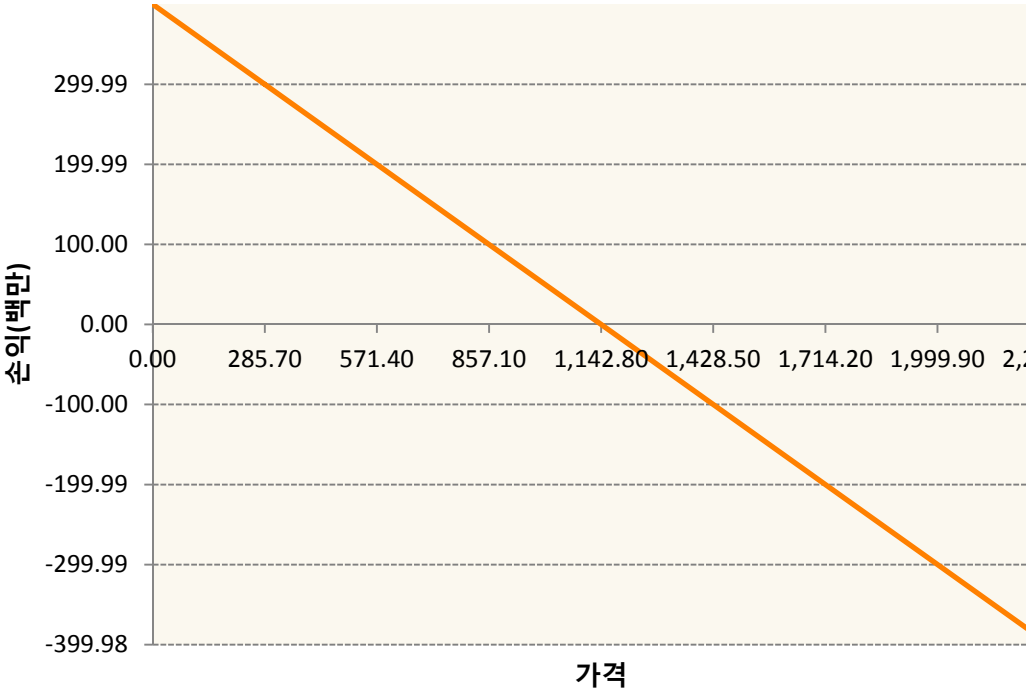

-266.29
-355.06
가격


CU7-CORN FUTURE SEP17
1,689.42
1,126.28
563.14
0.00
-563.14
-1,126.28
-1,689.42
-2,252.57
0.00
94.50
189.00
283.50
378.00
472.50
567.00
661.50
손익(백만)
가격

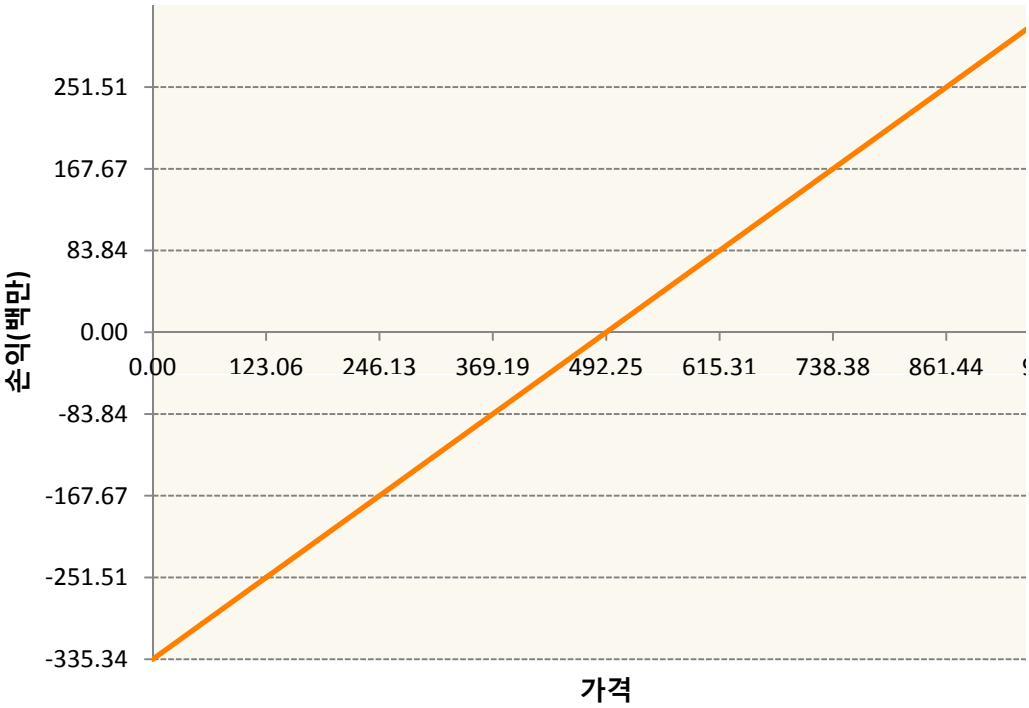

KCU7-COFFEE 'C' FUTURE SEP17
437.63
291.75
145.88
0.00
-145.88
-291.75
-437.63
-583.51
0.00
31.15
62.30
93.45
124.60
155.75
186.90
218.05
손익(백만)

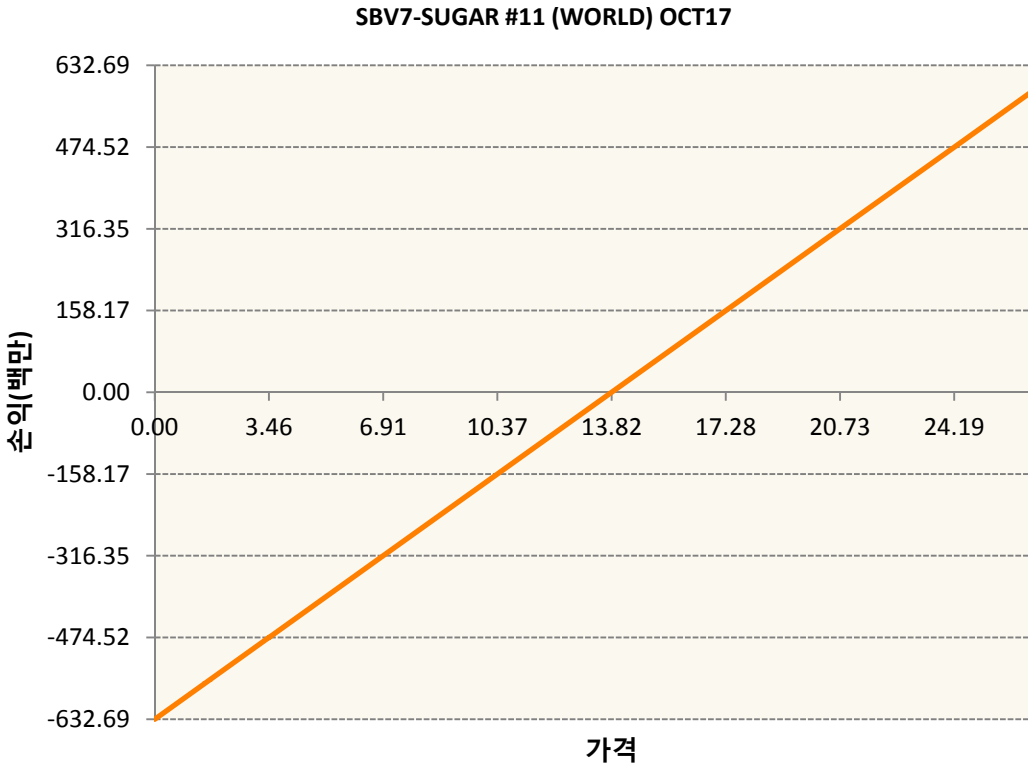
가격

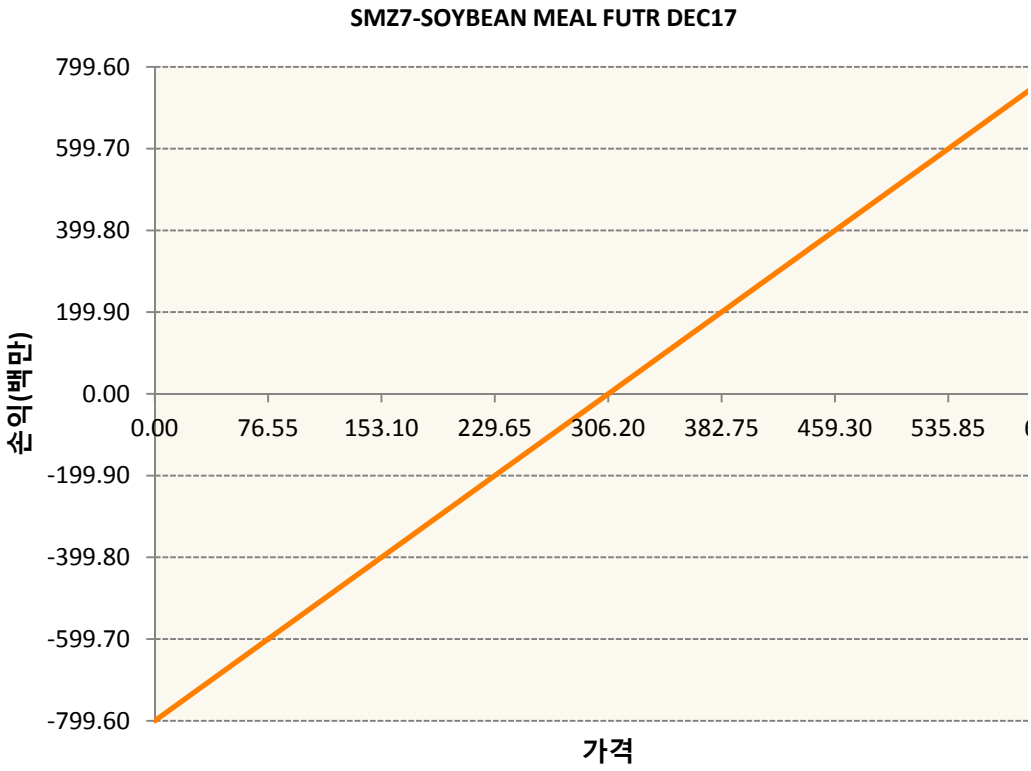
KR4175M70004-2017-07 달러선물

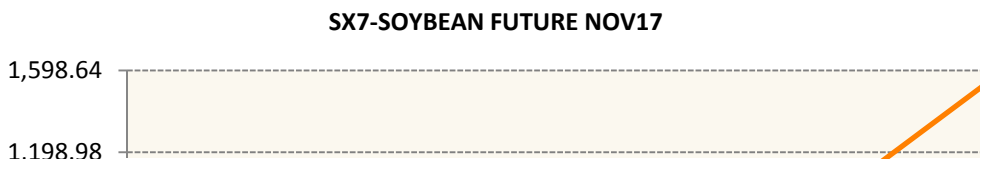


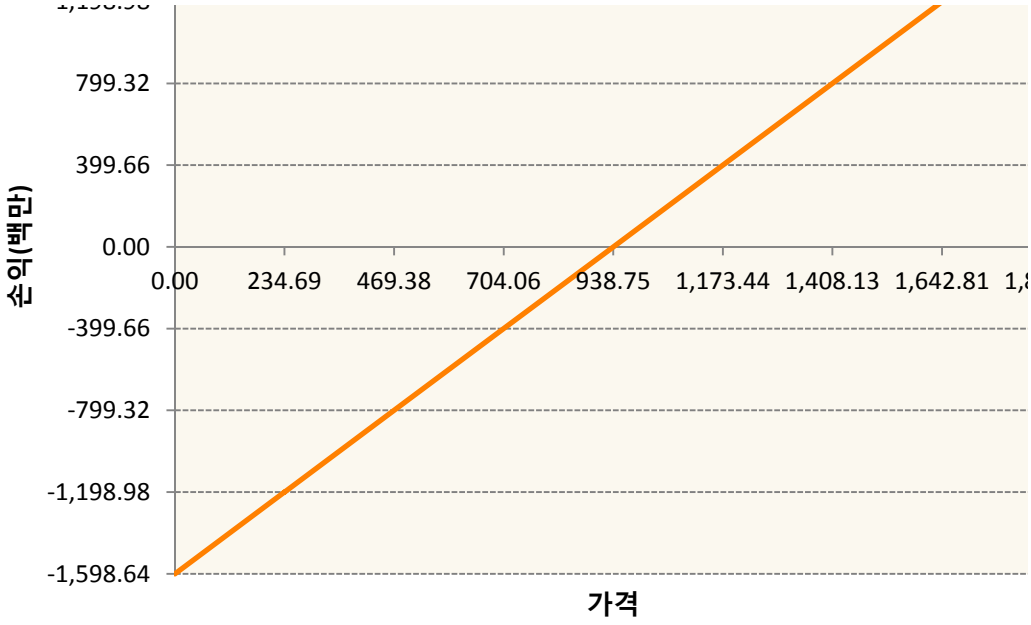
KWU7-KC HRW WHEAT FUT SEP17

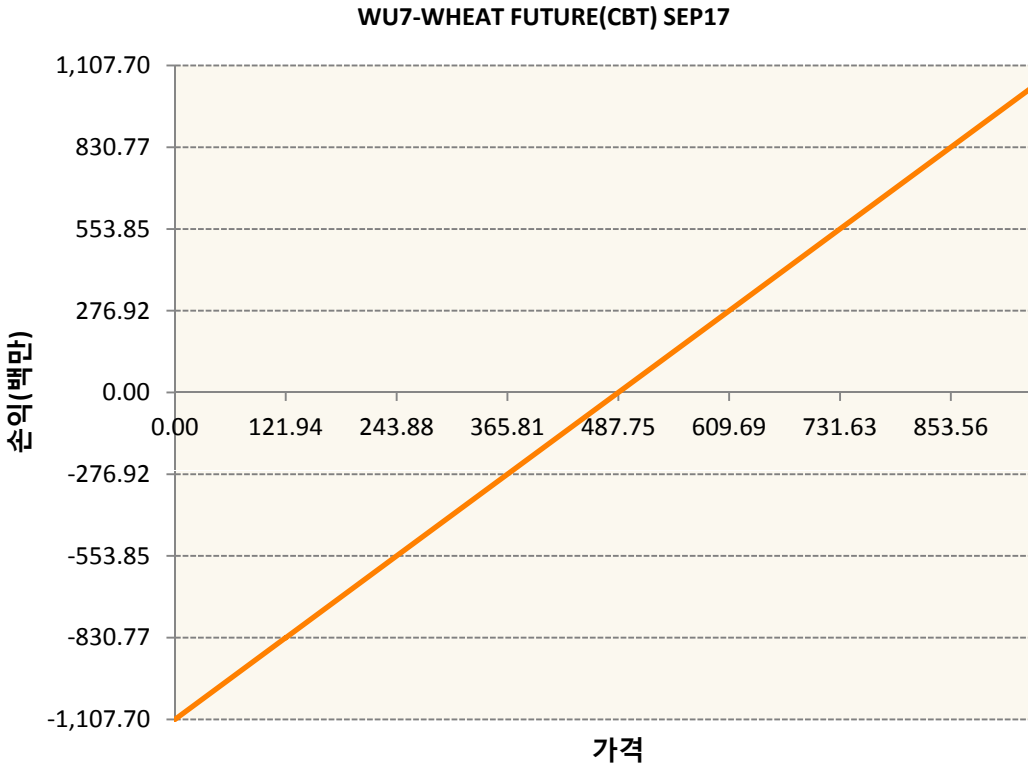



SBV7-SUGAR #11 (WORLD) OCT17
632.69
474.52
316.35
158.17
0.00
-158.17
-316.35
-474.52
-632.69
0.00
3.46
6.91
10.37
13.82
17.28
20.73
24.19
손익(백만)
가격


SMZ7-SOYBEAN MEAL FUTR DEC17
799.60
599.70
399.80
199.90
0.00
-199.90
-399.80
-599.70
-799.60
0.00
76.55
153.10
229.65
306.20
382.75
459.30
535.85
손익(백만)
가격


SX7-SOYBEAN FUTURE NOV17
1,598.64
1,198.98





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
BOZ7	SOYBEAN OIL FUTR DEC17	59
CTZ7	COTTON NO.2 FUTR DEC17	28
CU7	CORN FUTURE SEP17	180
KCU7	COFFEE 'C' FUTURE SEP17	47
KR4175M70(	2017-07 달러선물	32

KWU7	KC HRW WHEAT FUT SEP17	27
SBV7	SUGAR #11 (WORLD) OCT17	51
SMZ7	SOYBEAN MEAL FUTR DEC17	64
SX7	SOYBEAN FUTURE NOV17	128
WU7	WHEAT FUTURE(CBT) SEP17	89

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

761