공시일	2017-06-23
기준일	2017-06-22

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	2017-06-23
기준일	2017-06-22

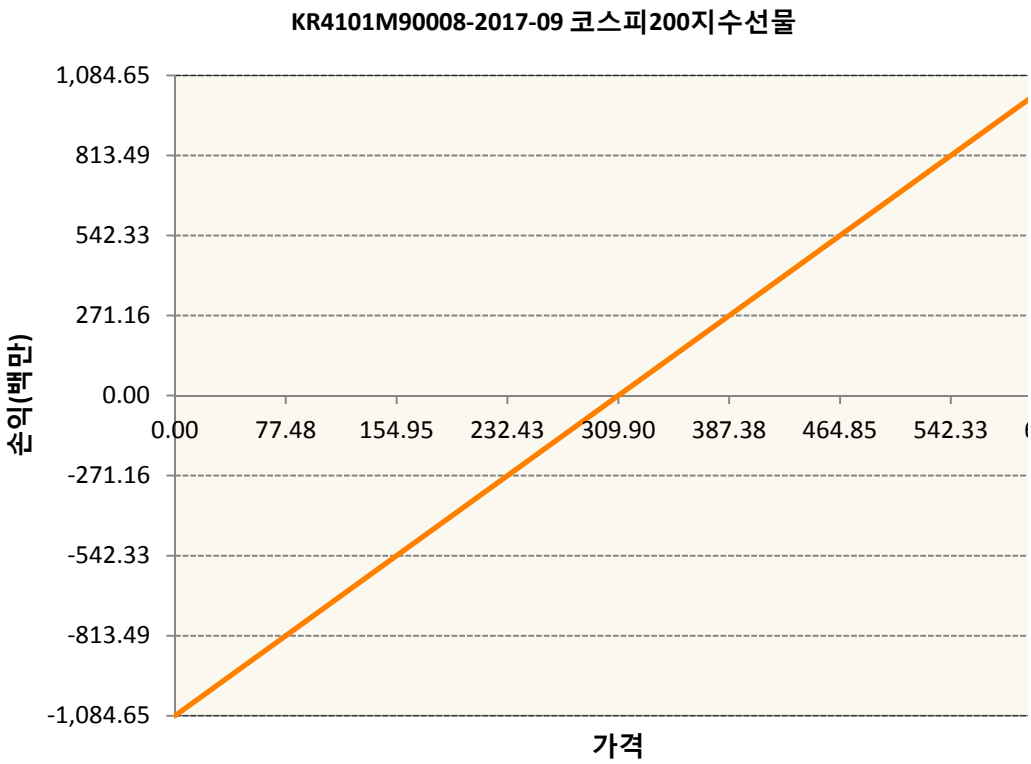
스마트인덱스모

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	1,085	0	1,085	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	2017-06-23
기준일	2017-06-22

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	999

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

506

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-06-23
기준일	2017-06-22

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	369

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

317

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-06-23
기준일	2017-06-22

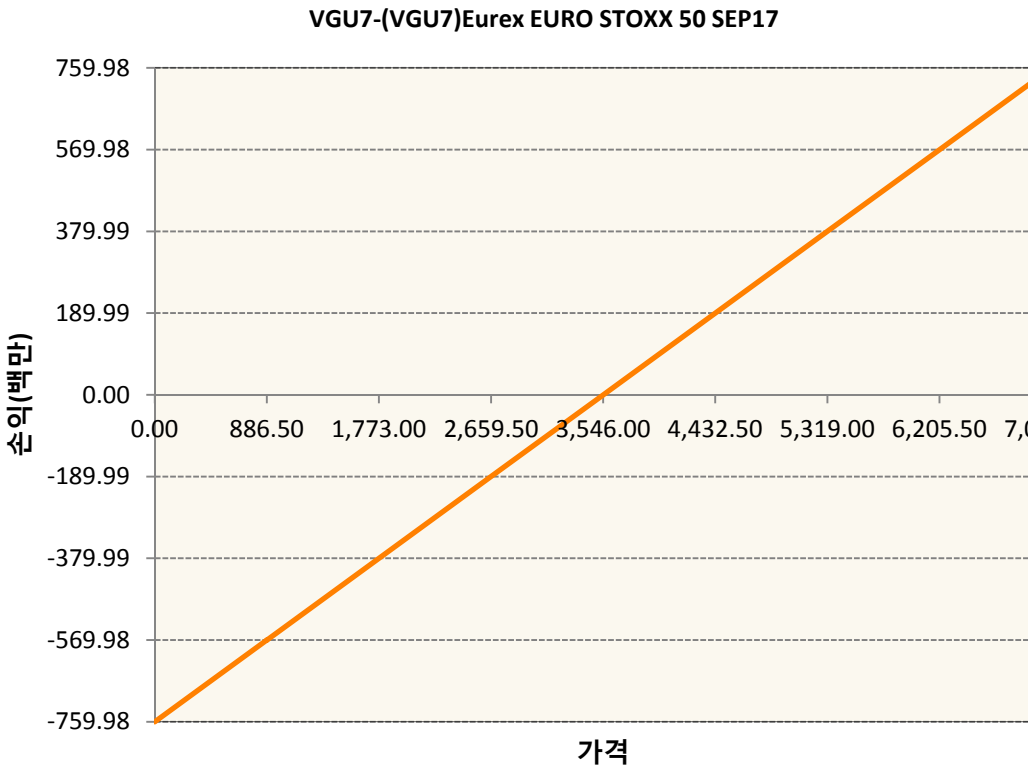
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	760	0	760	

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	2017-06-23
기준일	2017-06-22

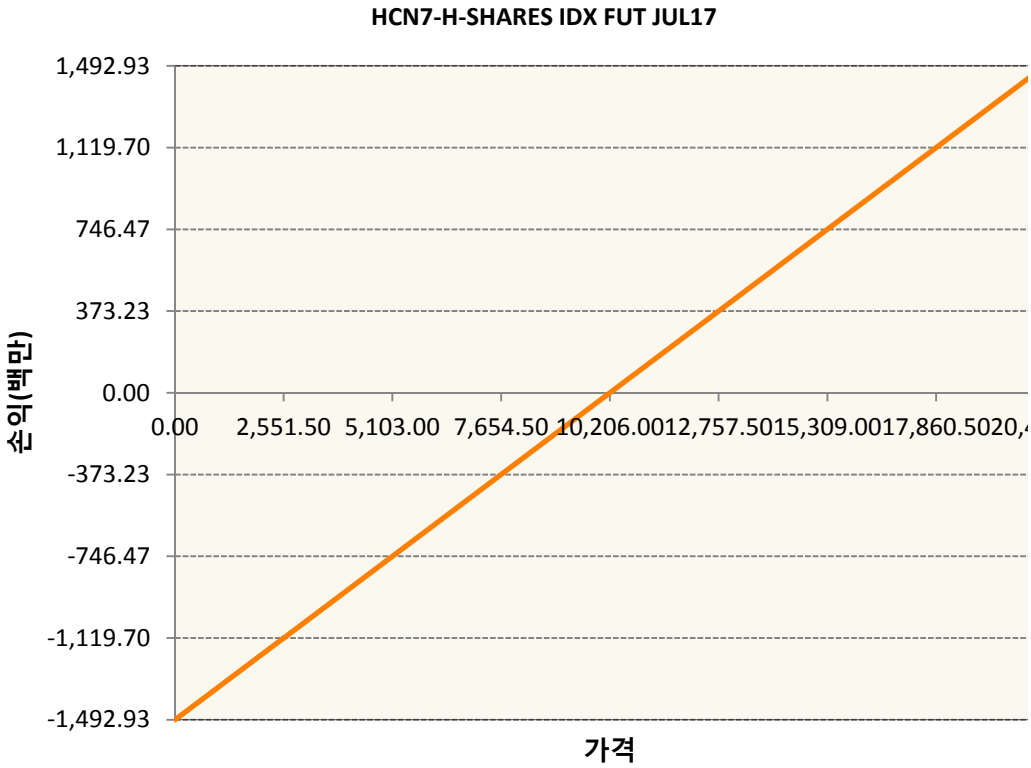
차이나인덱스모(주식-파생형)

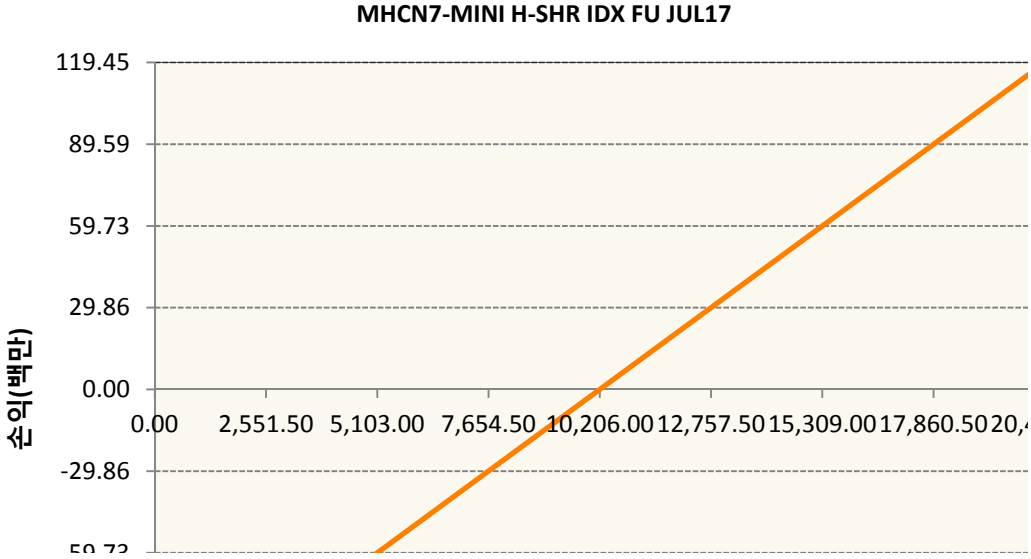
1. 계약금액

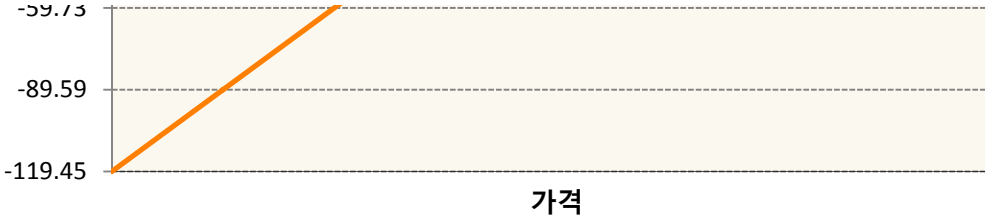
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,612	0	1,612	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCN7	H-SHARES IDX FUT JUL17	119
MHCN7	MINI H-SHR IDX FU JUL17	10

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	131

공시일	2017-06-23
기준일	2017-06-22

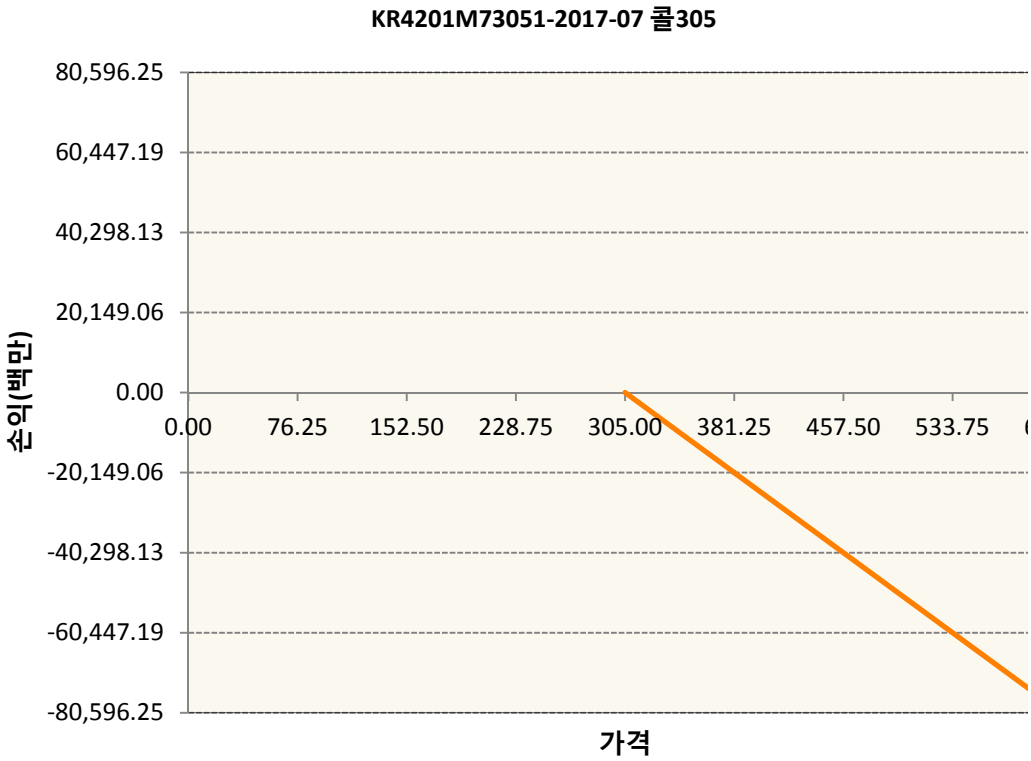
커버드콜모(주식혼합-파생형)

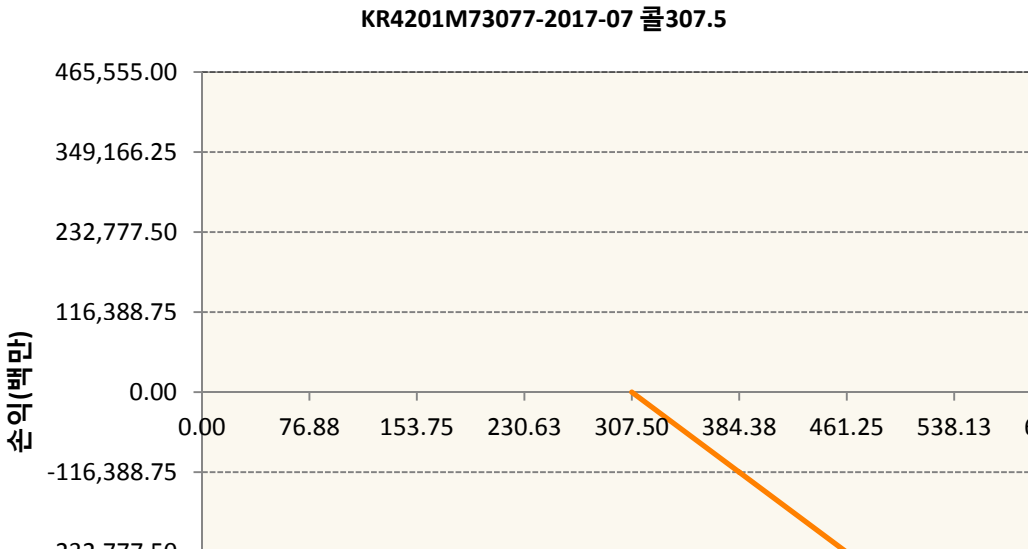
1. 계약금액

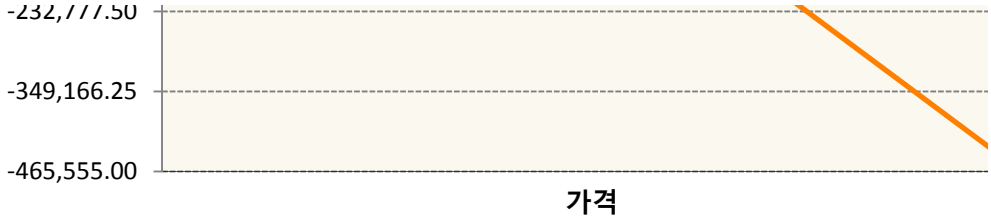
(단위:백만원)

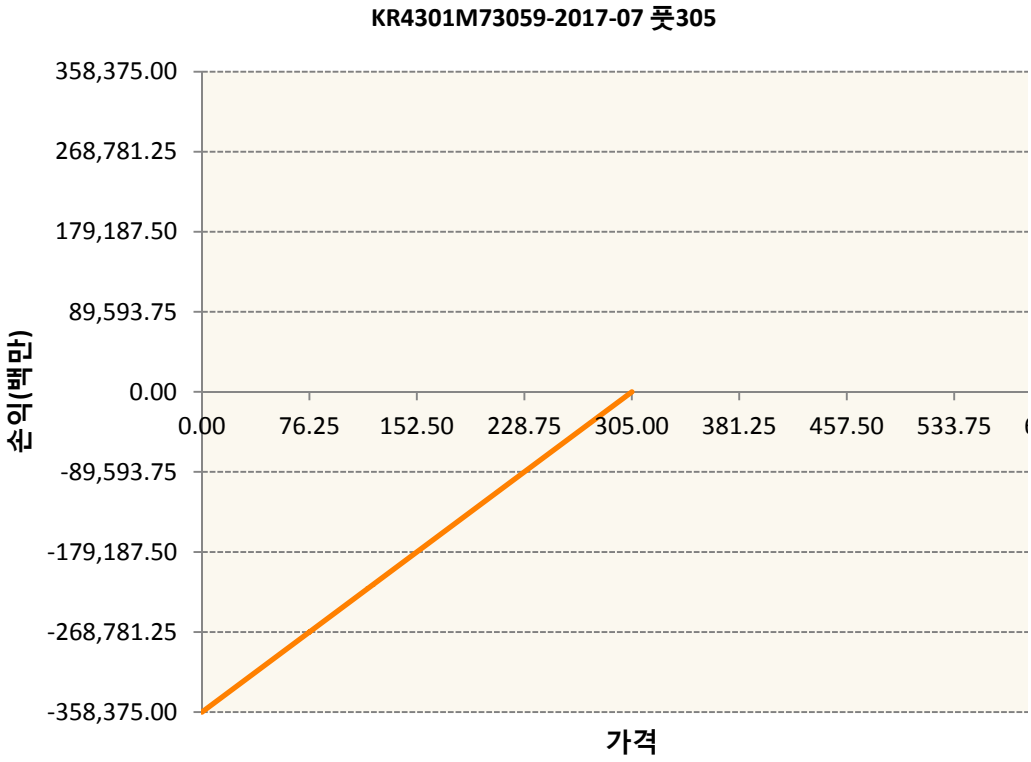
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	23,001	-23,001	장내
누계	유가증권	옵션	0	935,276	-935,276	장내

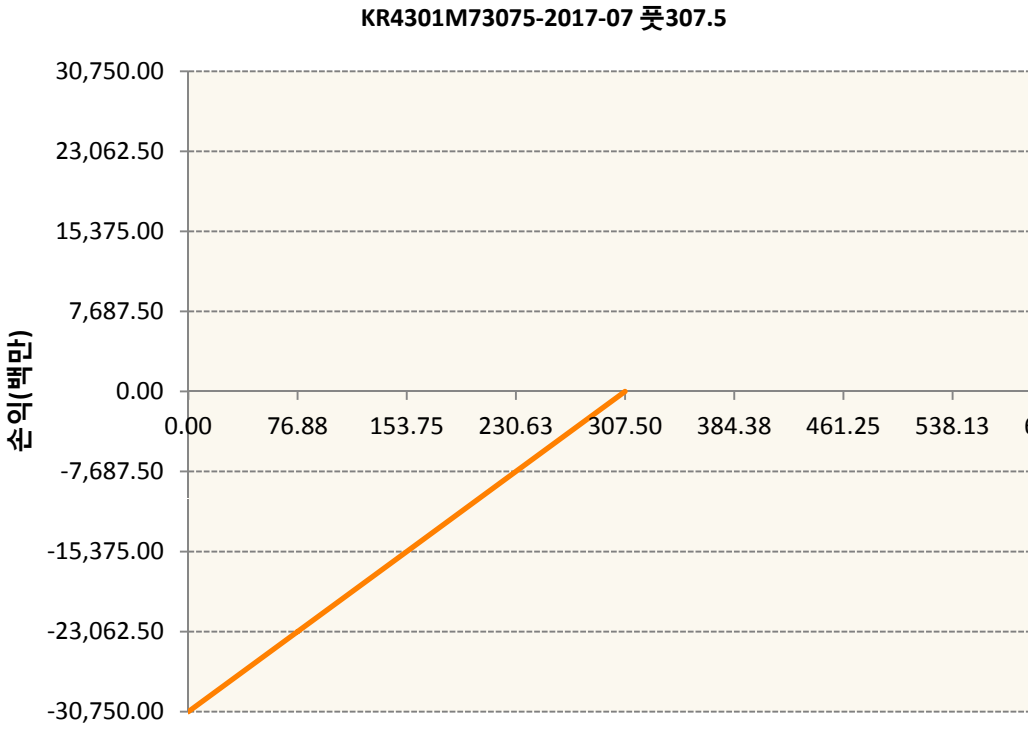
2. 만기시점의 손익구조






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


KR4301M73059-2017-07 풋305
358,375.00
268,781.25
179,187.50
89,593.75
0.00
-89,593.75
-179,187.50
-268,781.25
-358,375.00
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							6,128
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,588	1,587	1,586	1,584	1,581	1,575	1,567
-5.33%	1,574	1,561	1,545	1,523	1,498	1,468	1,435
-2.67%	1,321	1,260	1,197	1,133	1,068	1,002	935
0%	181	123	62	0	-64	-129	-195
2.67%	-1,782	-1,794	-1,810	-1,832	-1,858	-1,888	-1,922
5.33%	-3,947	-3,947	-3,949	-3,952	-3,956	-3,963	-3,973
8.00%	-6,125	-6,125	-6,125	-6,126	-6,126	-6,127	-6,128
KR4201M73(2017-07 콜307.5							33,786
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	6,661	6,660	6,658	6,653	6,644	6,627	6,602
-5.33%	6,635	6,603	6,552	6,481	6,387	6,272	6,135
-2.67%	5,908	5,648	5,365	5,063	4,746	4,417	4,078
0%	1,216	813	408	0	-410	-821	-1,233
2.67%	-9,002	-9,135	-9,300	-9,493	-9,711	-9,950	-10,209
5.33%	-21,272	-21,282	-21,304	-21,338	-21,389	-21,459	-21,547
8.00%	-33,749	-33,749	-33,750	-33,753	-33,758	-33,769	-33,786
KR4301M73(2017-07 풋305							22,095
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-22,005	-22,006	-22,011	-22,020	-22,036	-22,061	-22,095
-5.33%	-12,379	-12,433	-12,508	-12,602	-12,716	-12,848	-12,996
-2.67%	-3,815	-4,085	-4,364	-4,649	-4,940	-5,234	-5,532
0%	805	547	278	0	-285	-575	-869
2.67%	1,766	1,712	1,638	1,542	1,427	1,293	1,141
5.33%	1,827	1,824	1,817	1,805	1,784	1,753	1,710
8.00%	1,828	1,828	1,828	1,827	1,825	1,821	1,814
KR4301M73(2017-07 풋307.5							2,038
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-2,034	-2,034	-2,034	-2,034	-2,035	-2,036	-2,038
-5.33%	-1,211	-1,213	-1,216	-1,221	-1,227	-1,235	-1,244
-2.67%	-434	-451	-470	-490	-511	-533	-555
0%	80	54	27	0	-27	-54	-81
2.67%	230	221	210	198	183	167	150

5.33%	244	243	242	240	236	232	226
8.00%	244	244	244	244	244	243	242

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

74,430

공시일	2017-06-23
기준일	2017-06-22

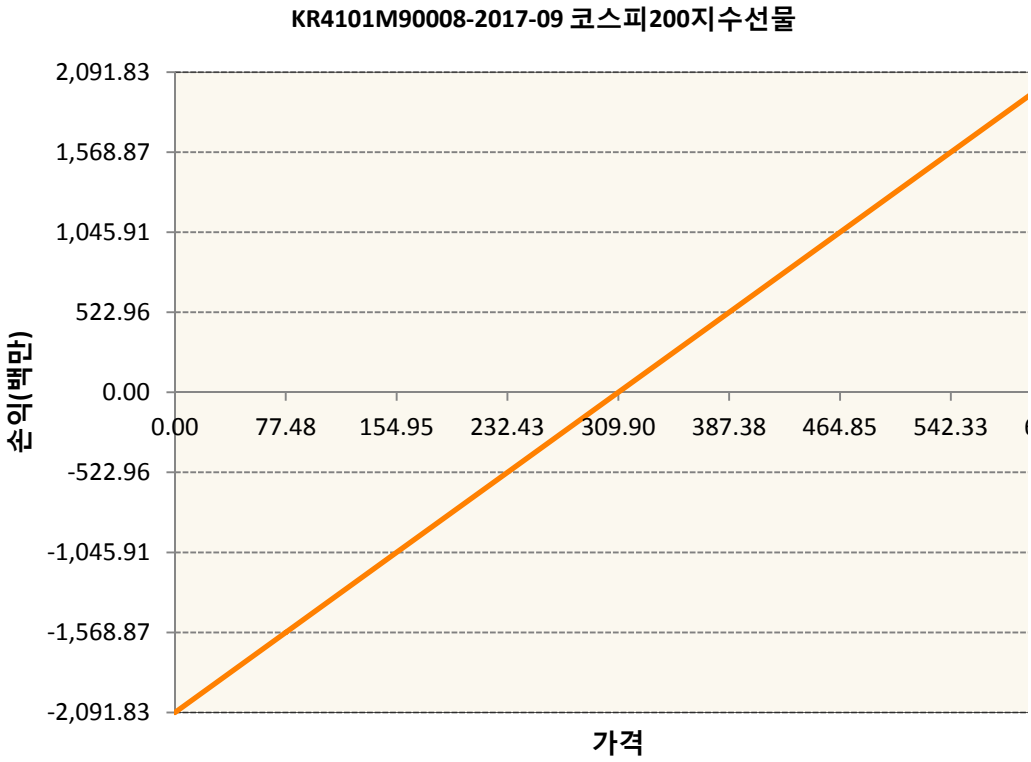
커버드콜목표전환형증권투자신탁

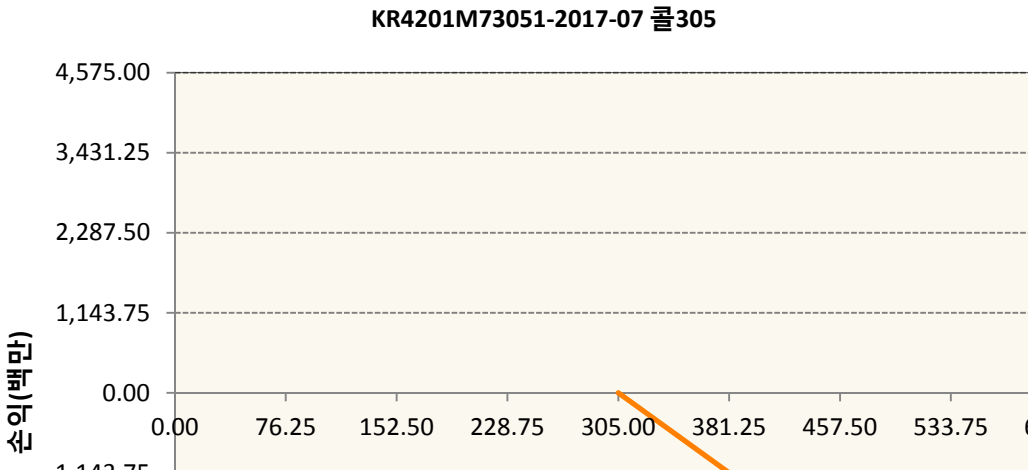
1. 계약금액

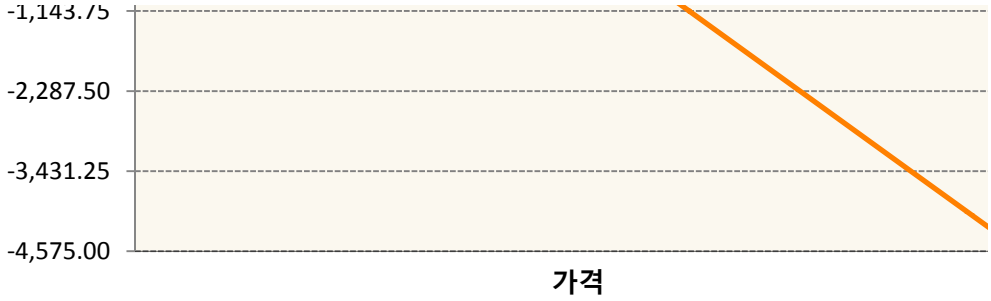
(단위:백만원)

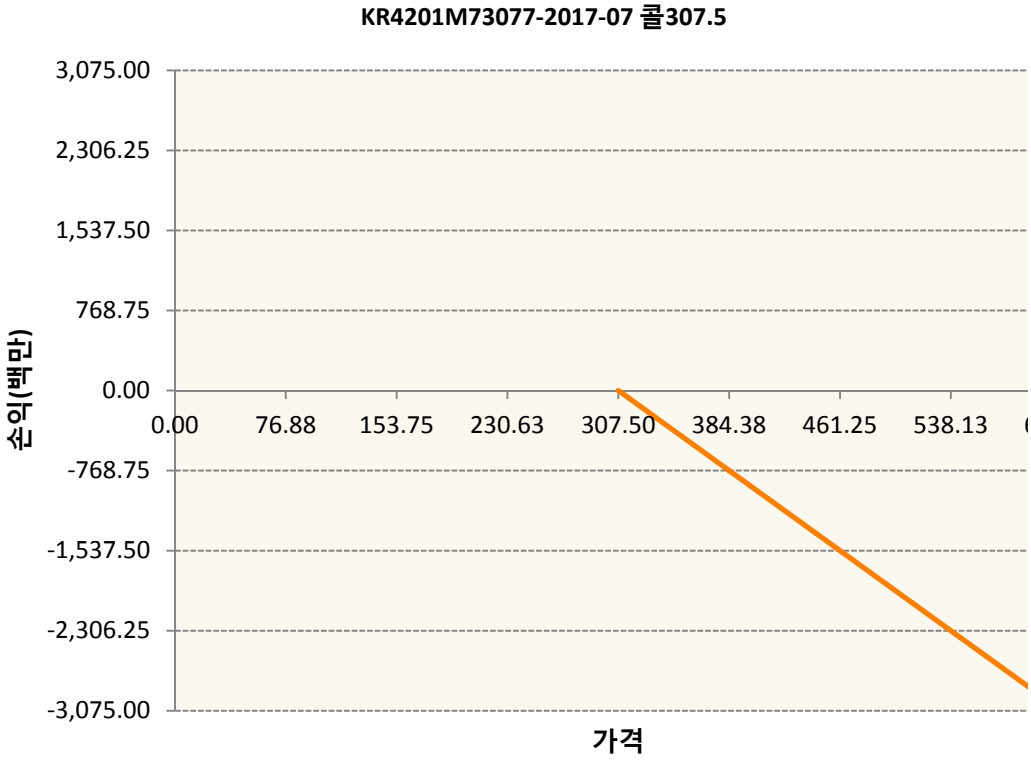
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,092	0	2,092	장내
누계	유가증권	옵션	0	8,803	-8,803	장내

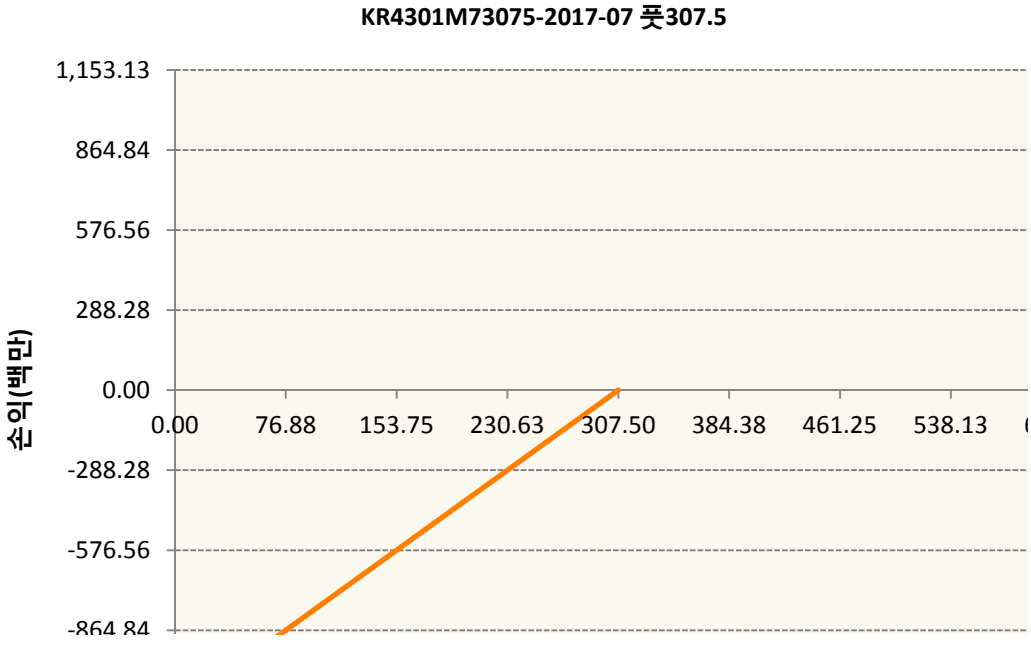
2. 만기시점의 손익구조

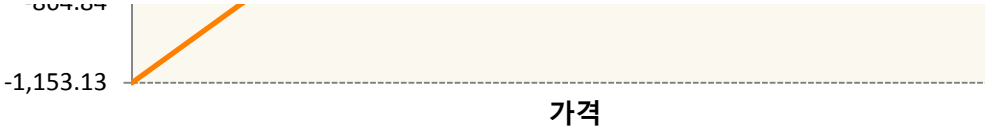





-1,143.75
-2,287.50
-3,431.25
-4,575.00
가격


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							348
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	90	90	90	90	90	89	89
-5.33%	89	89	88	86	85	83	81
-2.67%	75	72	68	64	61	57	53
0%	10	7	4	0	-4	-7	-11
2.67%	-101	-102	-103	-104	-105	-107	-109
5.33%	-224	-224	-224	-224	-225	-225	-226
8.00%	-348	-348	-348	-348	-348	-348	-348
KR4201M73(2017-07 콜307.5							223
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	44	44	44	44	44	44	44
-5.33%	44	44	43	43	42	41	41
-2.67%	39	37	35	33	31	29	27
0%	8	5	3	0	-3	-5	-8
2.67%	-59	-60	-61	-63	-64	-66	-67
5.33%	-140	-141	-141	-141	-141	-142	-142
8.00%	-223	-223	-223	-223	-223	-223	-223
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	-46	-46	-46	-46	-47
-2.67%	-16	-17	-18	-18	-19	-20	-21

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

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

895

공시일	2017-06-23
기준일	2017-06-22

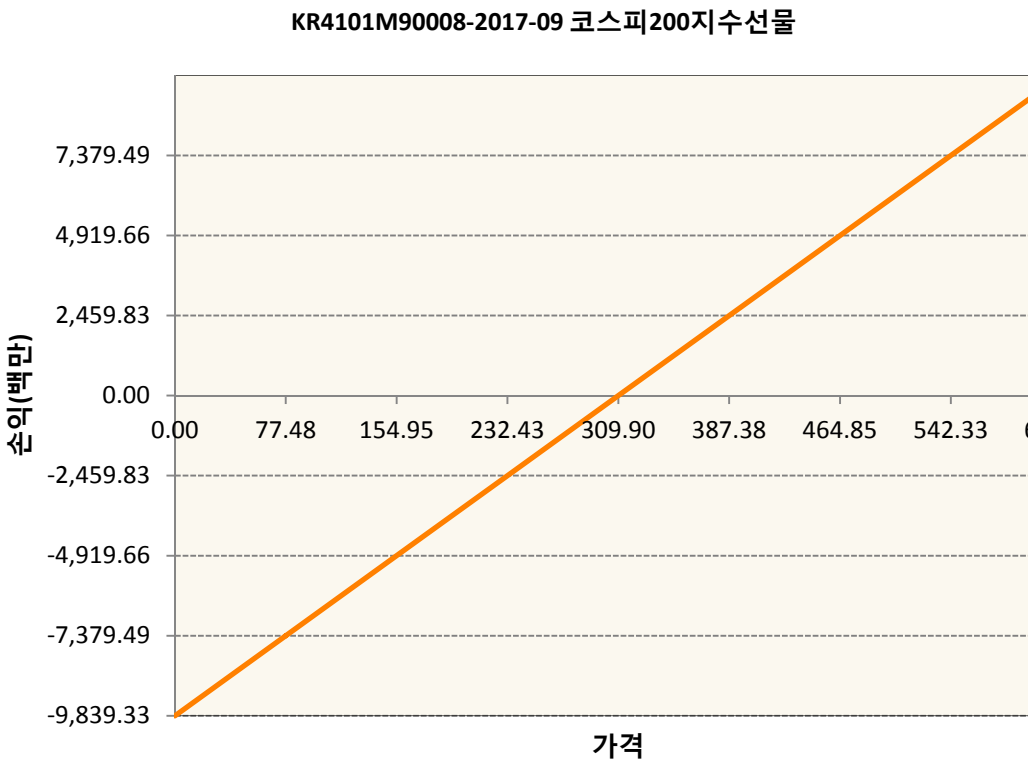
ETF스마트레버리지목표전환형6호

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	9,839	0	9,839	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)

508

공시일	2017-06-23
기준일	2017-06-22

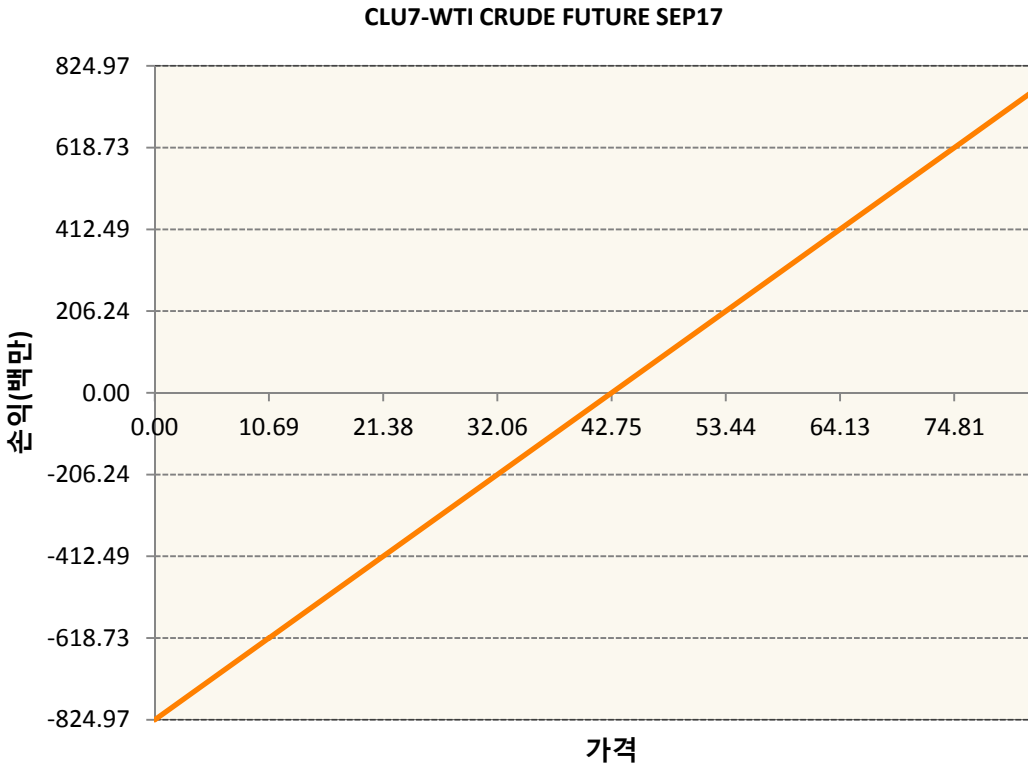
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

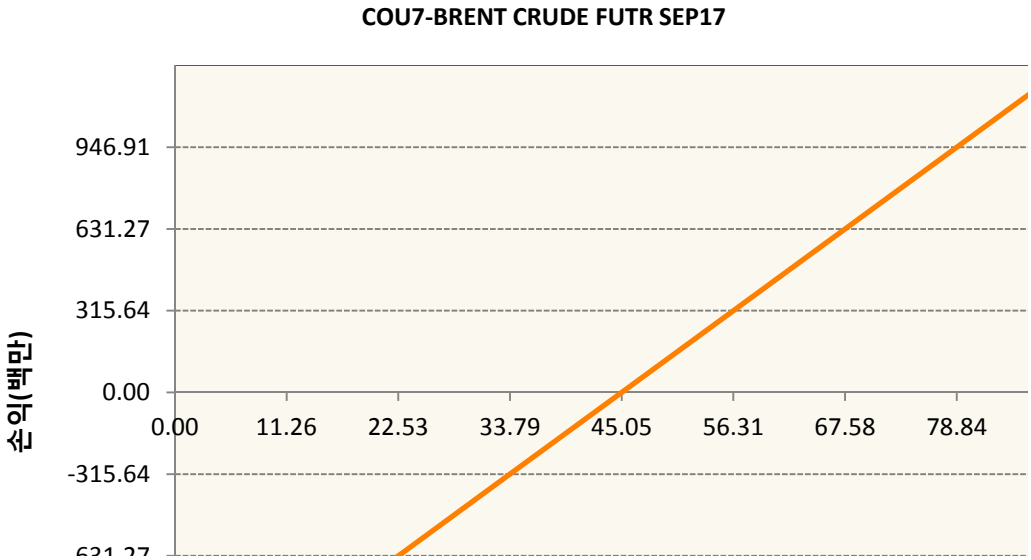
1. 계약금액

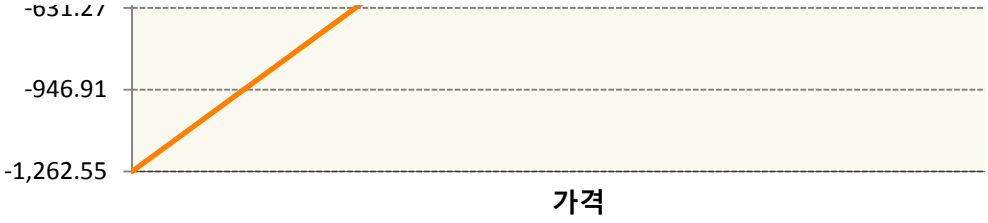
(단위:백만원)

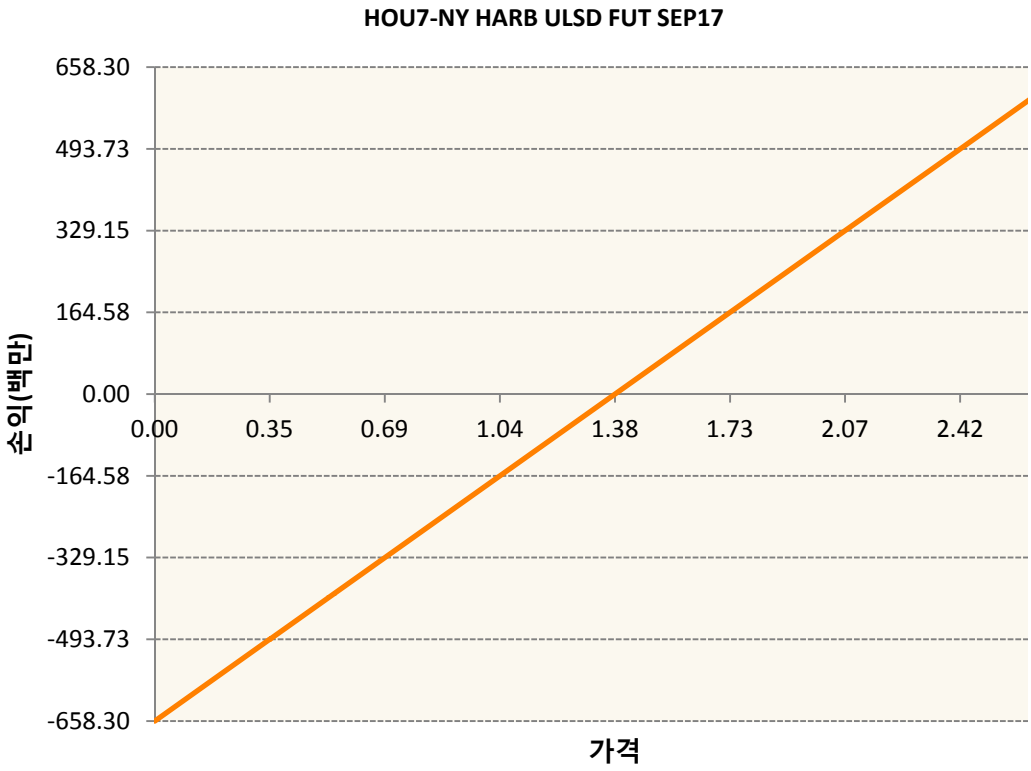
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	4,800	228	4,572	

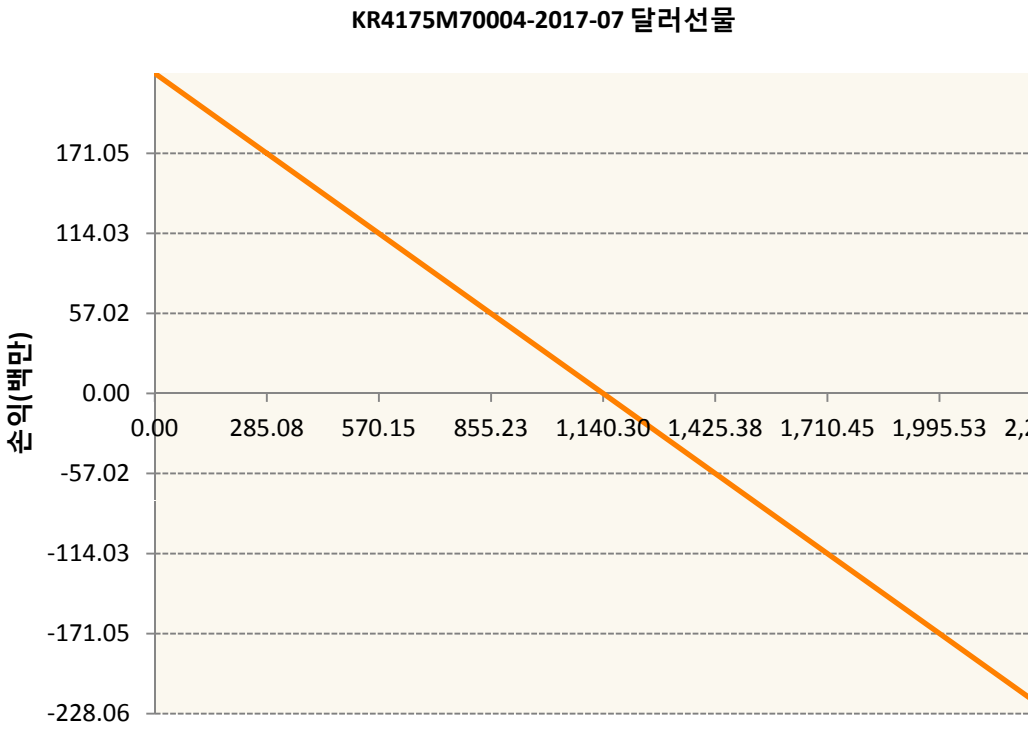
2. 만기시점의 손익구조



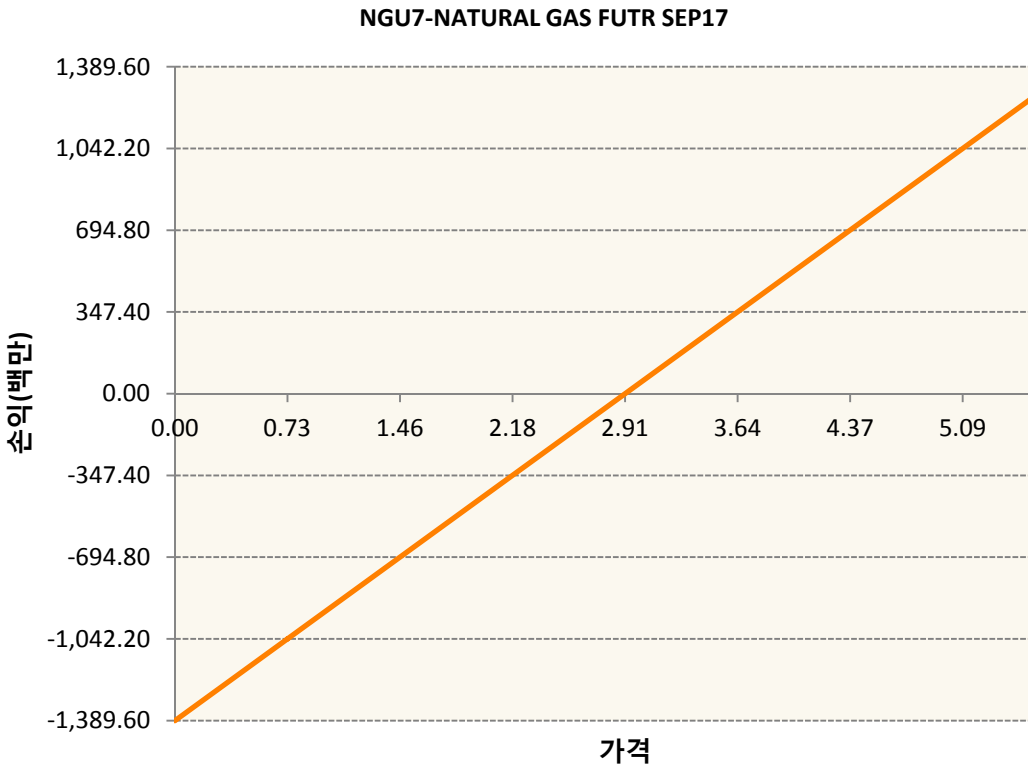


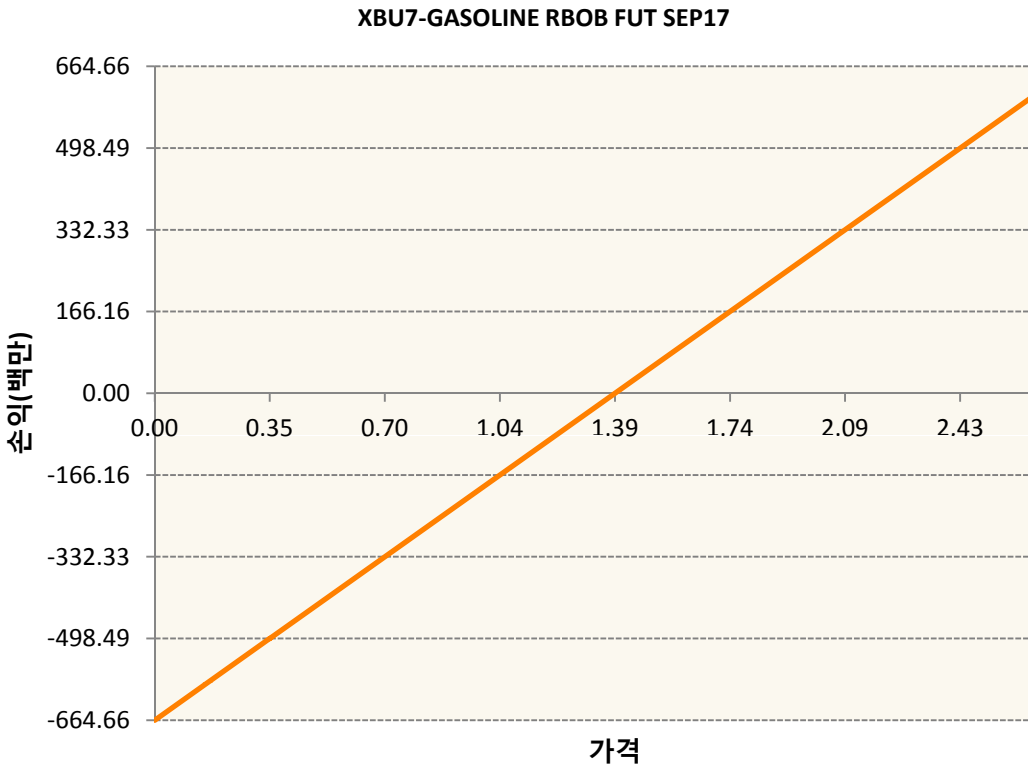

-946.91
-1,262.55
가격


HOU7-NY HARB ULSD FUT SEP17
658.30
493.73
329.15
164.58
0.00
-164.58
-329.15
-493.73
-658.30
0.00
0.35
0.69
1.04
1.38
1.73
2.07
2.42
순이익(백만)
가격


KR4175M70004-2017-07 달러선물
171.05
114.03
57.02
0.00
-57.02
-114.03
-171.05
-228.06
0.00
285.08
570.15
855.23
1,140.30
1,425.38
1,710.45
1,995.53
순이익(백만)

가격


NGU7-NATURAL GAS FUTR SEP17
1,389.60
1,042.20
694.80
347.40
0.00
-347.40
-694.80
-1,042.20
-1,389.60
0.00
0.73
1.46
2.18
2.91
3.64
4.37
5.09
손익(백만)
가격


XBU7-GASOLINE RBOB FUT SEP17
664.66
498.49
332.33
166.16
0.00
-166.16
-332.33
-498.49
-664.66
0.00
0.35
0.70
1.04
1.39
1.74
2.09
2.43
손익(백만)
가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLU7	WTI CRUDE FUTURE SEP17	66
COU7	BRENT CRUDE FUTR SEP17	101
HOU7	NY HARB ULSD FUT SEP17	53
KR4175M70(	2017-07 달러선물	18
NGU7	NATURAL GAS FUTR SEP17	111
XBU7	GASOLINE RBOB FUT SEP17	53

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

783

공시일	2017-06-23
기준일	2017-06-22

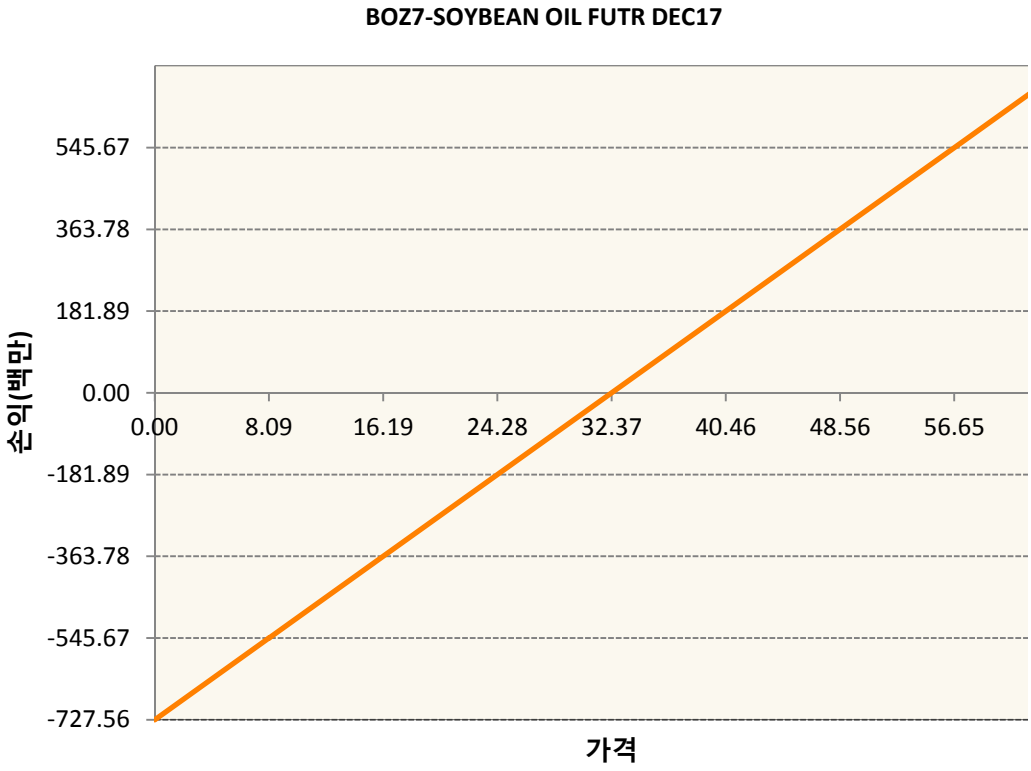
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

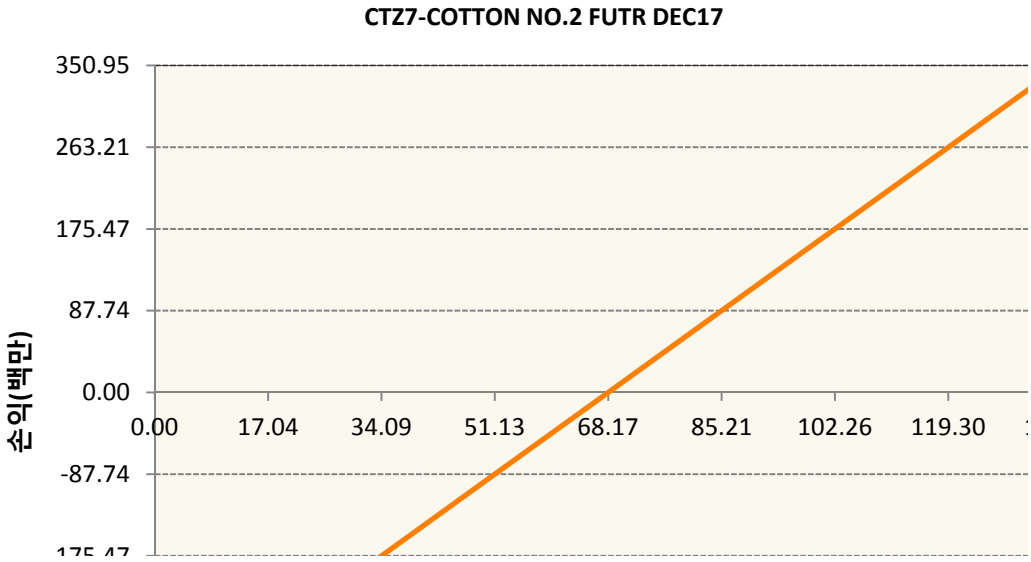
1. 계약금액

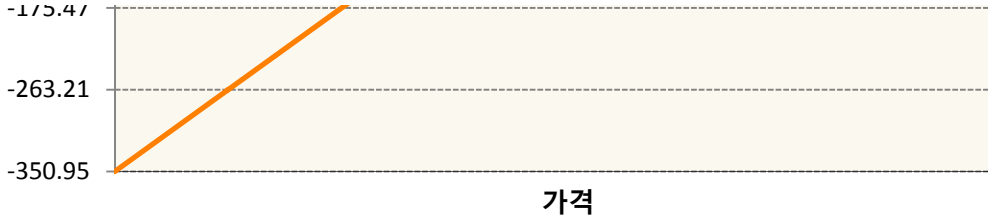
(단위:백만원)

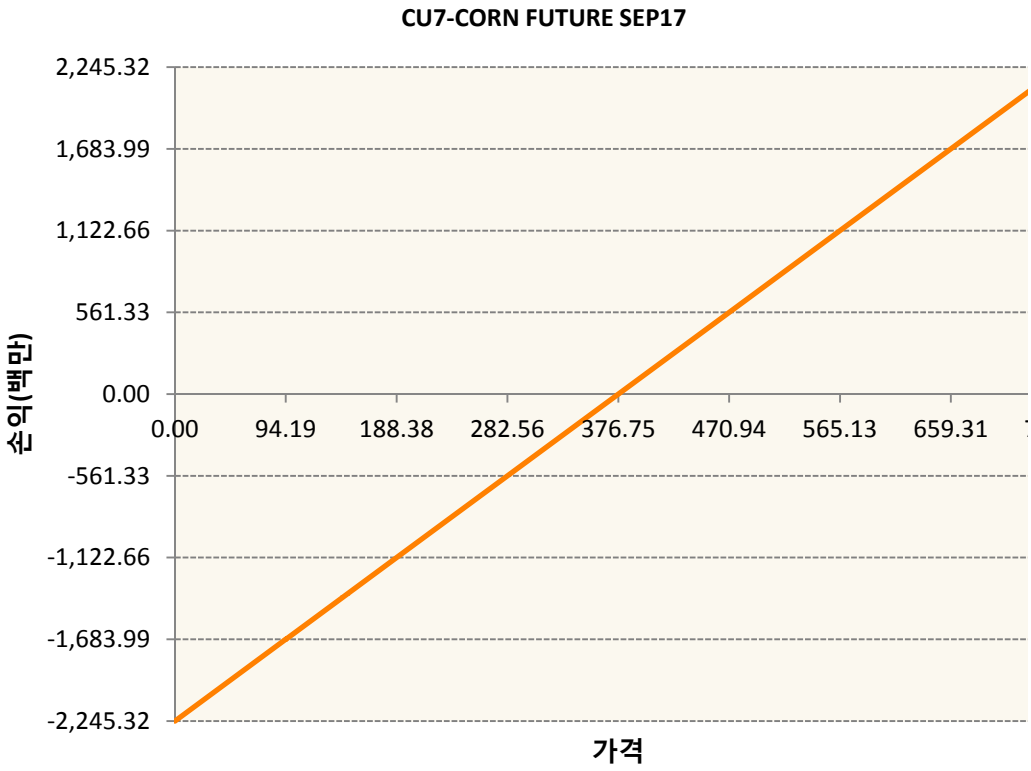
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	8,292	399	7,893	

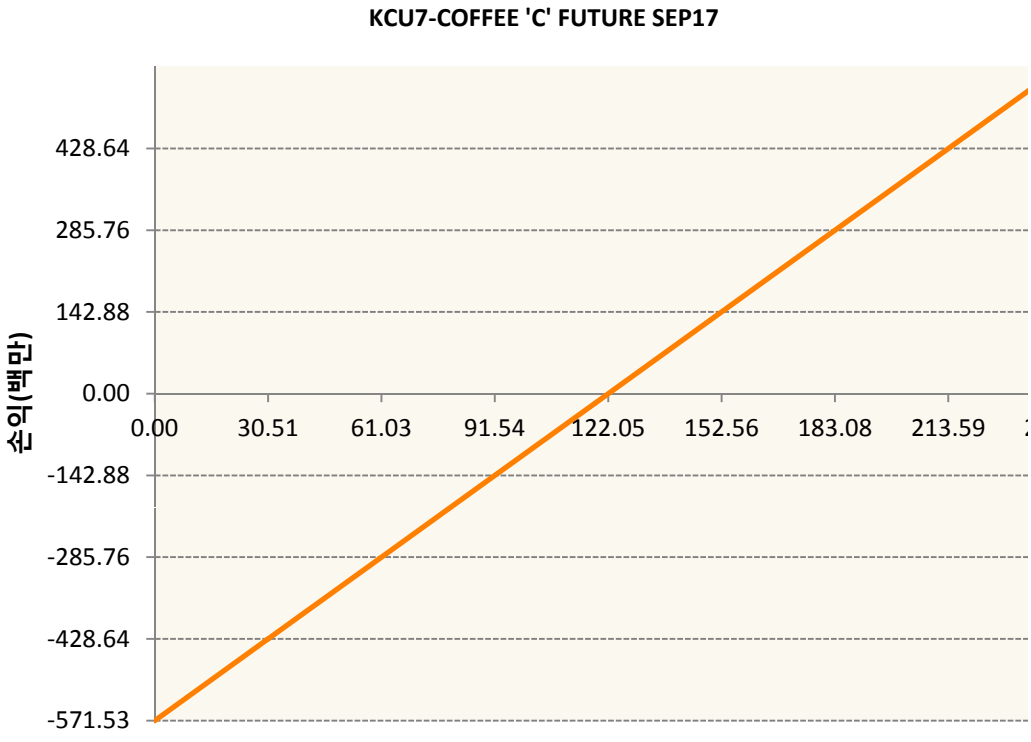
2. 만기시점의 손익구조





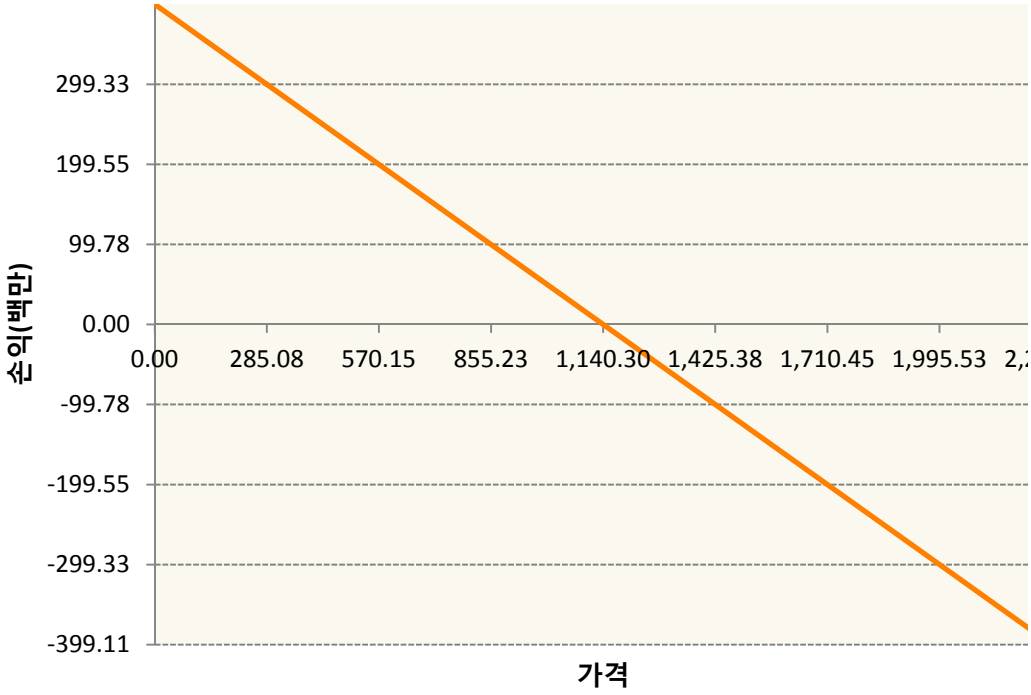

-263.21
-350.95
가격


CU7-CORN FUTURE SEP17
2,245.32
1,683.99
1,122.66
561.33
0.00
-561.33
-1,122.66
-1,683.99
-2,245.32
0.00
94.19
188.38
282.56
376.75
470.94
565.13
659.31
손익(백만)
가격

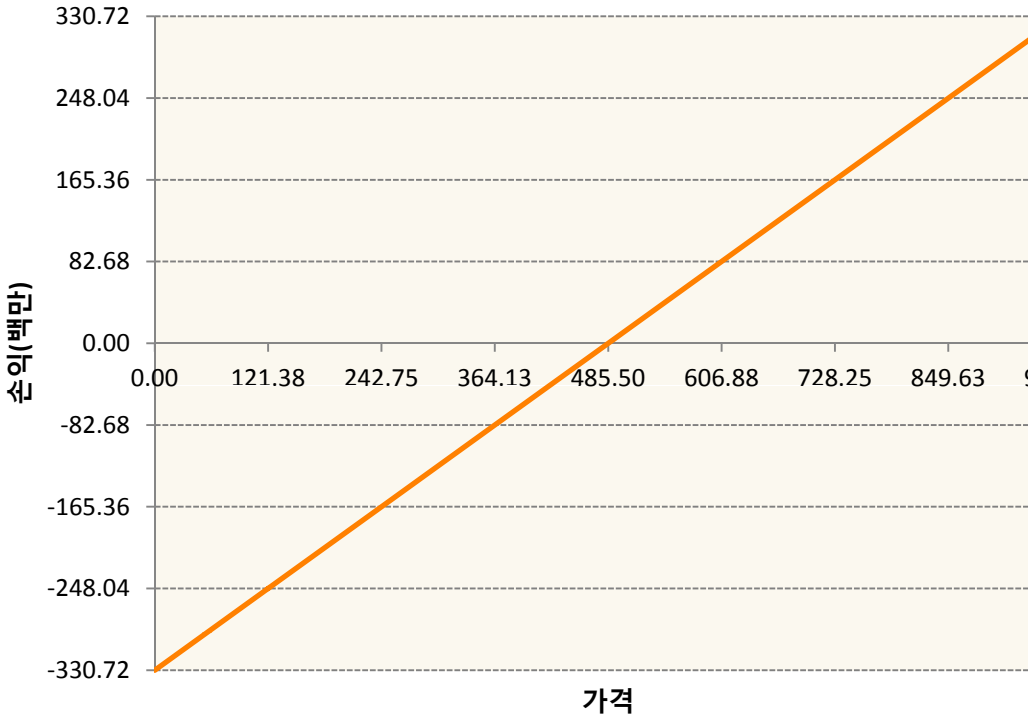

KCU7-COFFEE 'C' FUTURE SEP17
428.64
285.76
142.88
0.00
-142.88
-285.76
-428.64
-571.53
0.00
30.51
61.03
91.54
122.05
152.56
183.08
213.59
손익(백만)

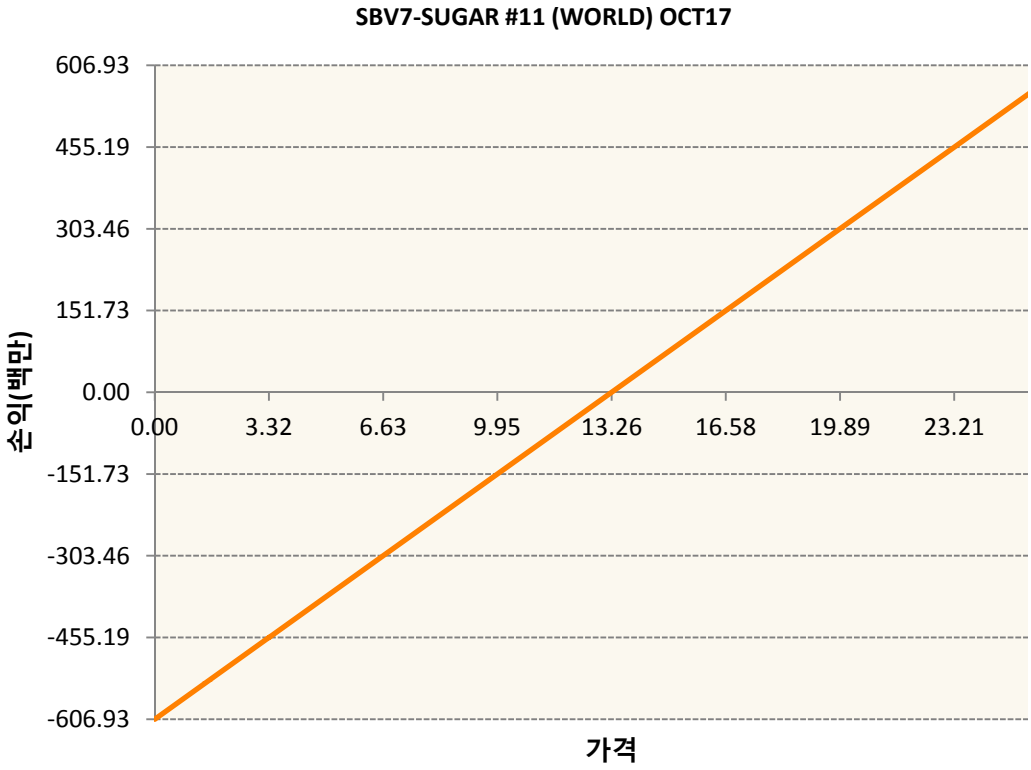
가격

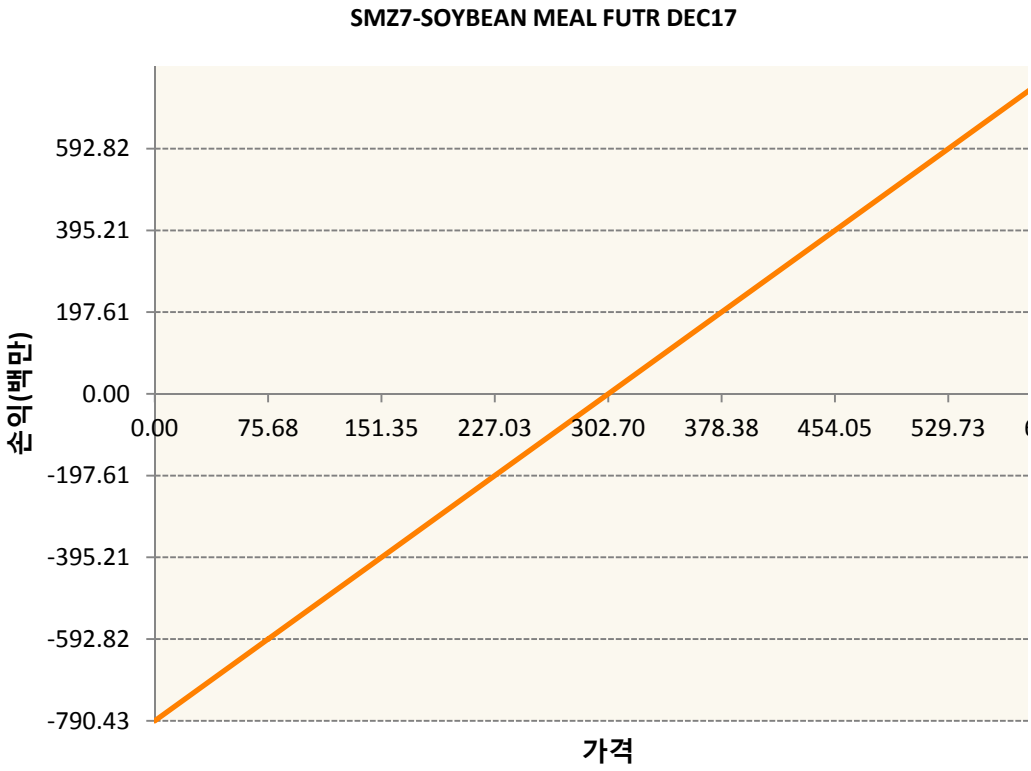
KR4175M70004-2017-07 달러선물

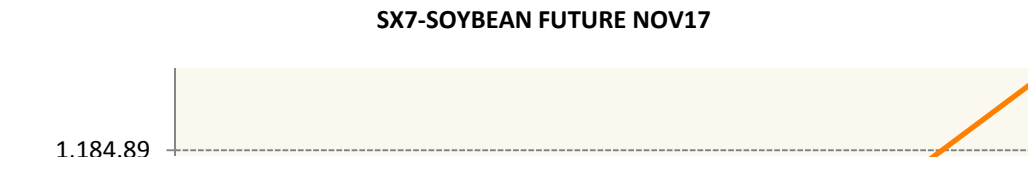


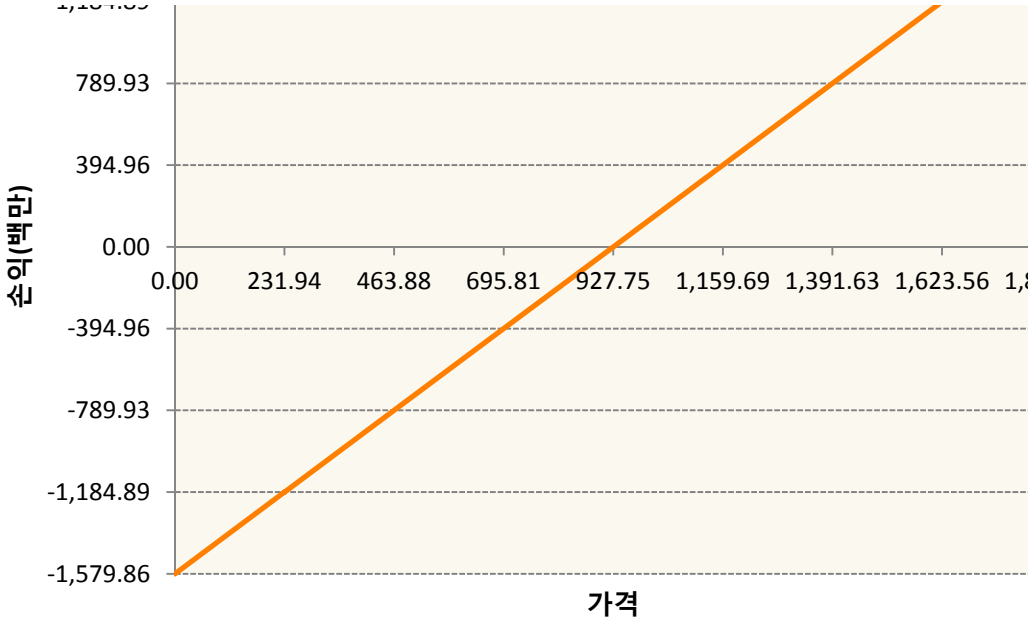
KWU7-KC HRW WHEAT FUT SEP17

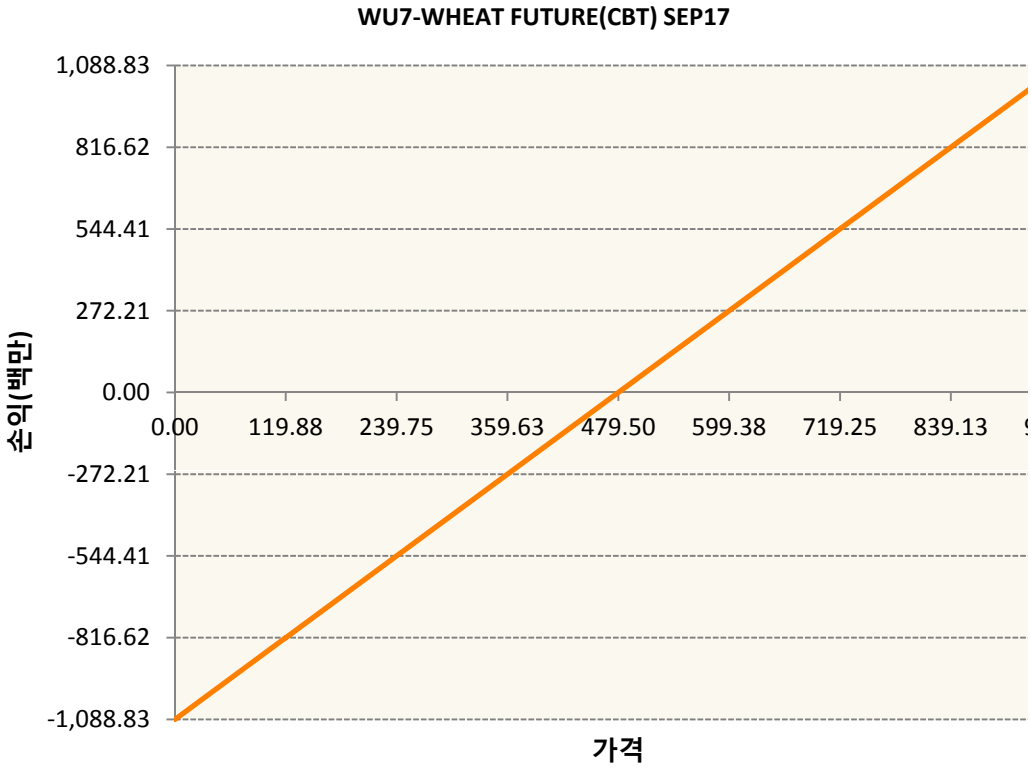



SBV7-SUGAR #11 (WORLD) OCT17
606.93
455.19
303.46
151.73
0.00
-151.73
-303.46
-455.19
-606.93
손익(백만)
0.00
3.32
6.63
9.95
13.26
16.58
19.89
23.21
가격


SMZ7-SOYBEAN MEAL FUTR DEC17
592.82
395.21
197.61
0.00
-197.61
-395.21
-592.82
-790.43
손익(백만)
0.00
75.68
151.35
227.03
302.70
378.38
454.05
529.73
가격


SX7-SOYBEAN FUTURE NOV17
1,184.89





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

BOZ7	SOYBEAN OIL FUTR DEC17	58
CTZ7	COTTON NO.2 FUTR DEC17	28
CU7	CORN FUTURE SEP17	180
KCU7	COFFEE 'C' FUTURE SEP17	46
KR4175M70(	2017-07 달러선물	32

KWU7	KC HRW WHEAT FUT SEP17	26
SBV7	SUGAR #11 (WORLD) OCT17	49
SMZ7	SOYBEAN MEAL FUTR DEC17	63
SX7	SOYBEAN FUTURE NOV17	126
WU7	WHEAT FUTURE(CBT) SEP17	87

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

751