공시일	2017-06-26
기준일	2017-06-23

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	2017-06-26
기준일	2017-06-23

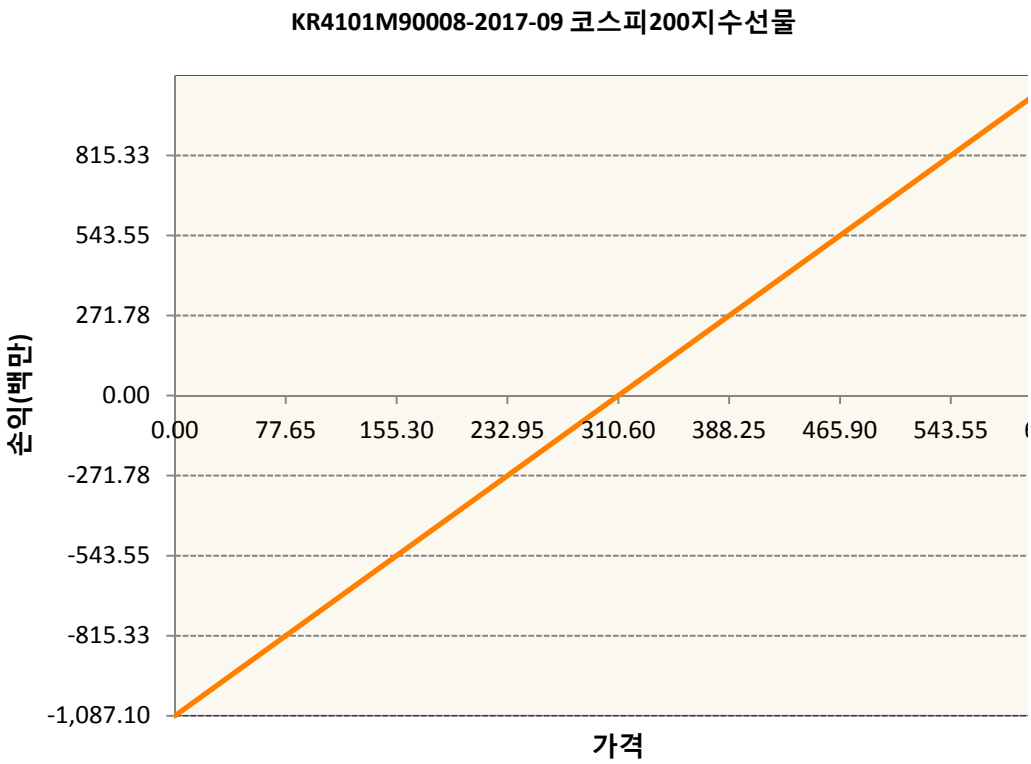
스마트인덱스모

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	1,087	0	1,087	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	2017-06-26
기준일	2017-06-23

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)

502

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-06-26
기준일	2017-06-23

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	370

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

319

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-06-26
기준일	2017-06-23

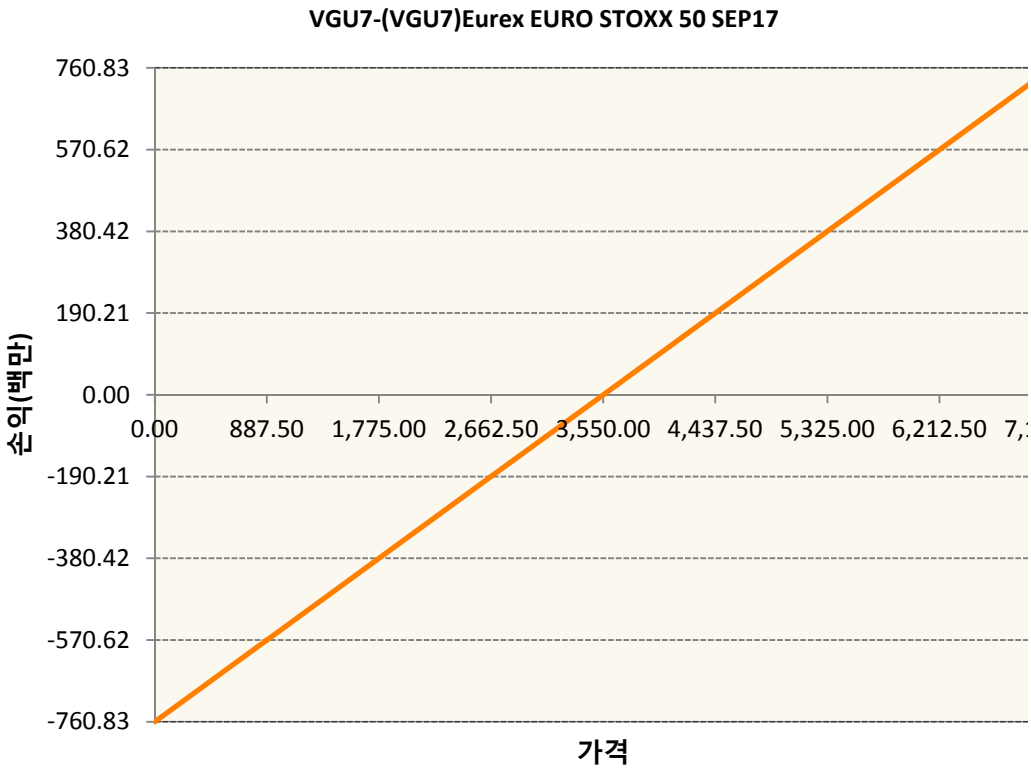
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	761	0	761	

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)

55

공시일	2017-06-26
기준일	2017-06-23

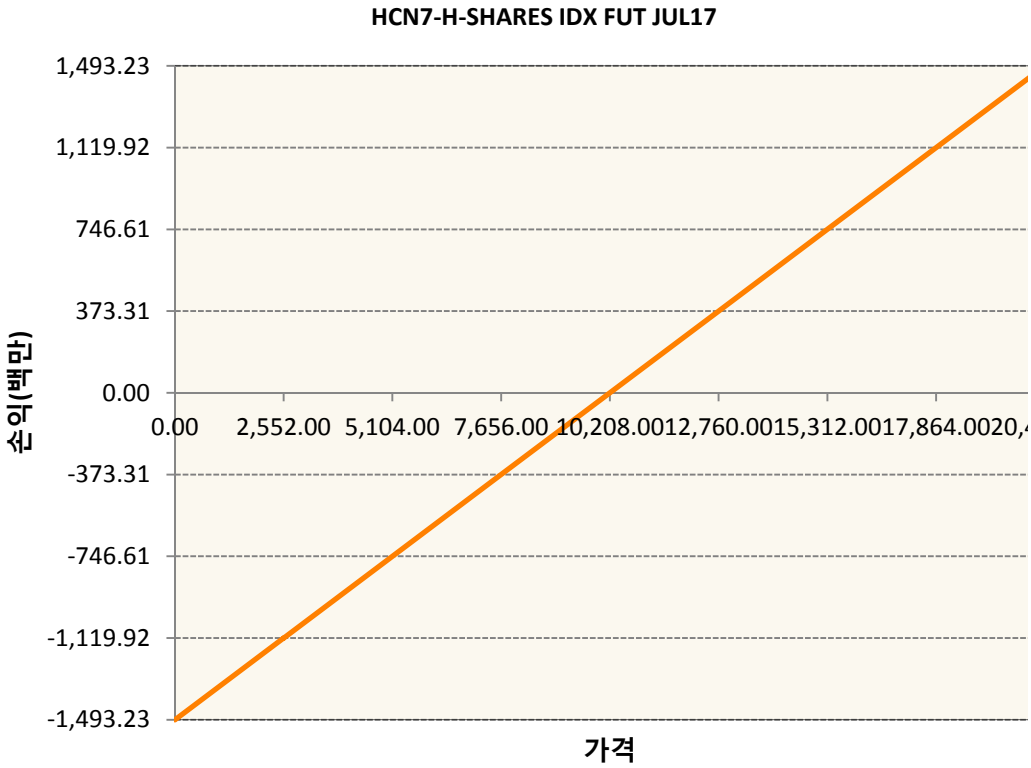
차이나인덱스모(주식-파생형)

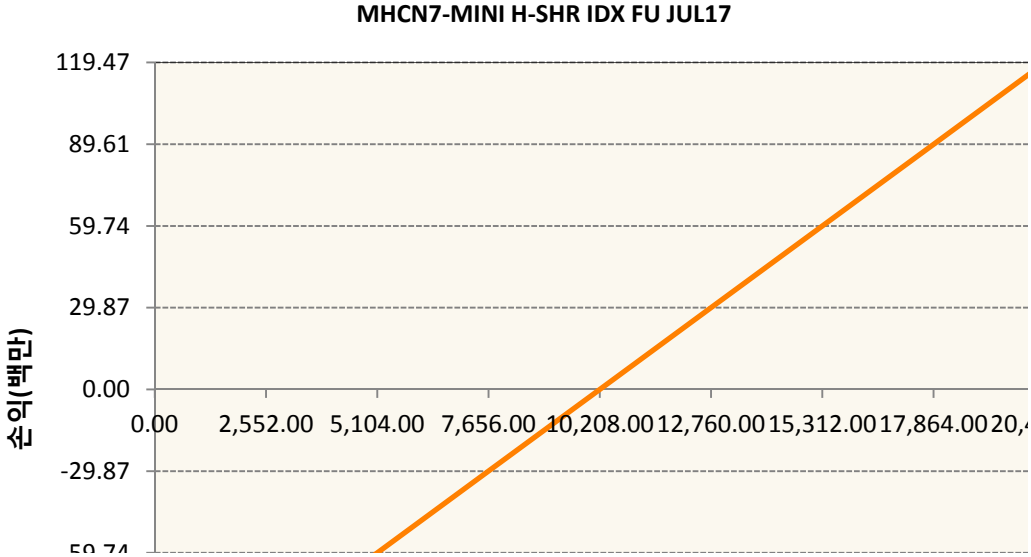
1. 계약금액

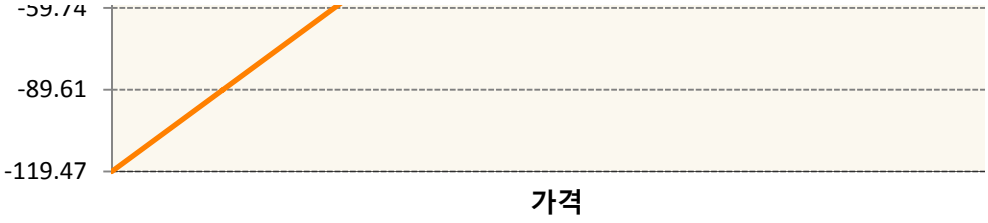
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,613	0	1,613	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	2017-06-26
기준일	2017-06-23

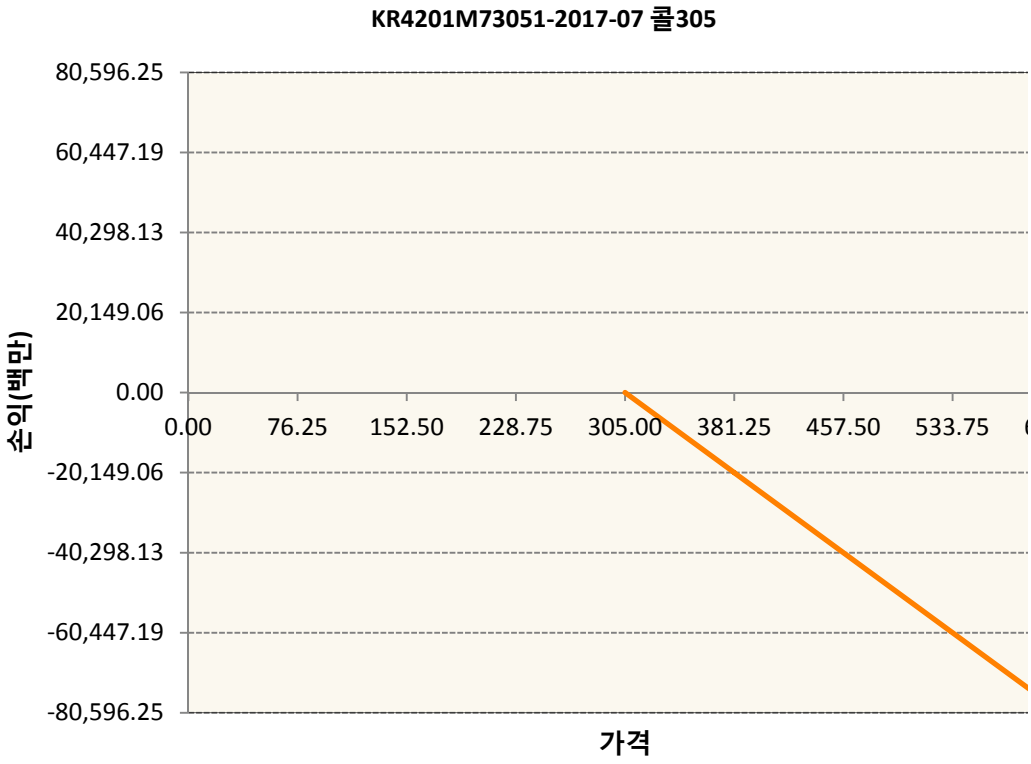
커버드콜모(주식혼합-파생형)

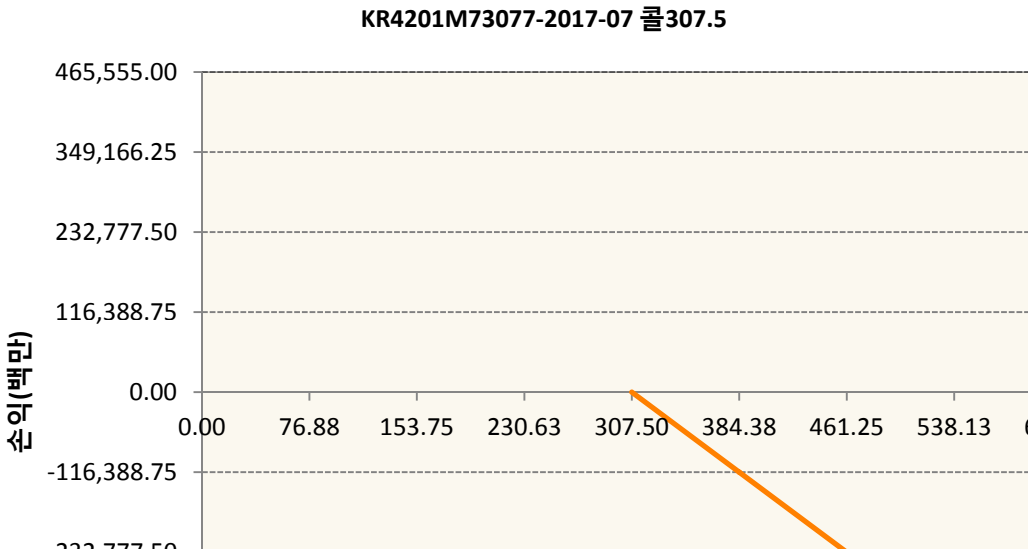
1. 계약금액

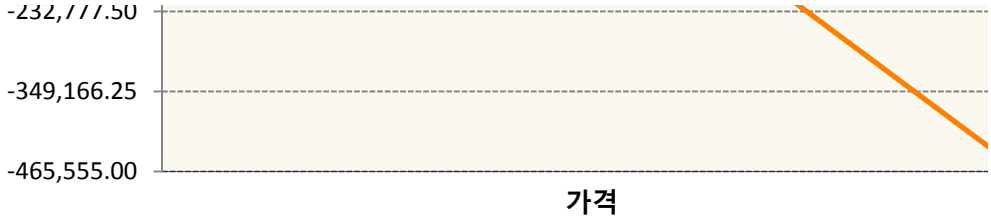
(단위:백만원)

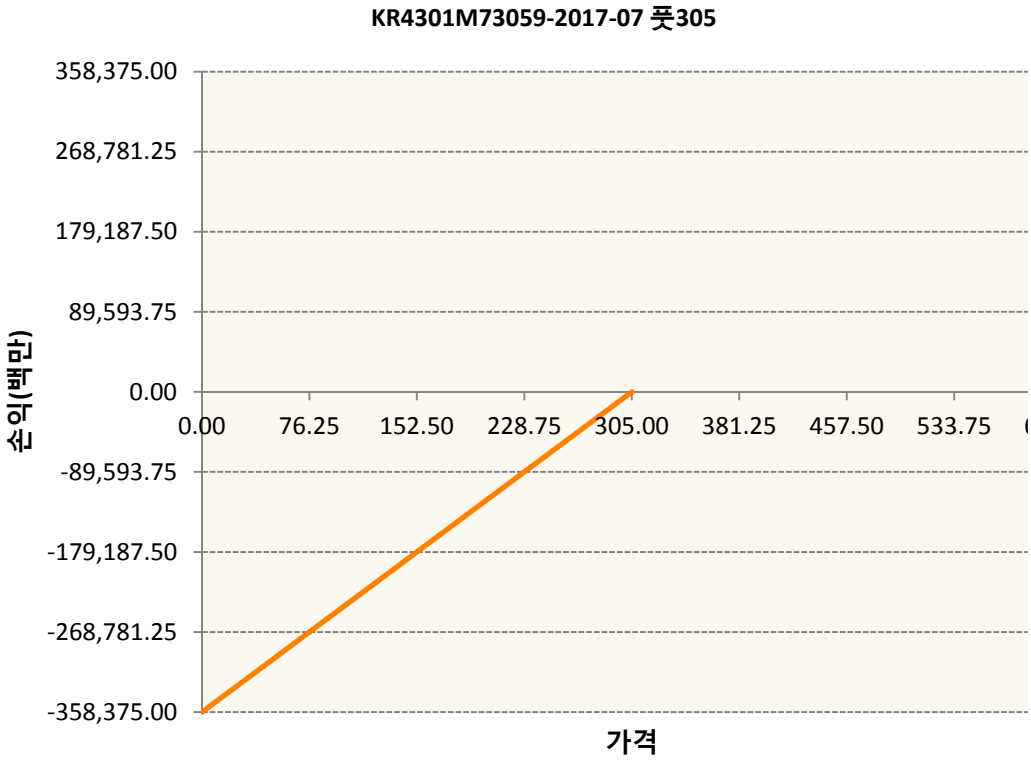
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	935,276	-935,276	장내

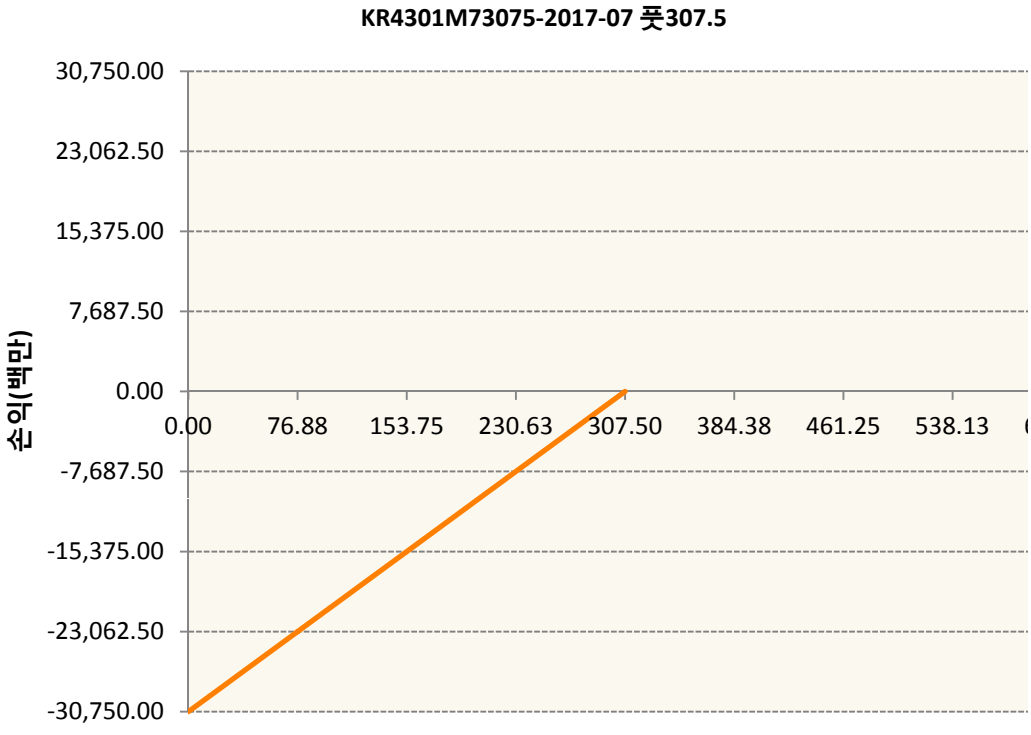
2. 만기시점의 손익구조






-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						6,227
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,714	1,714	1,713	1,711	1,707	1,702	1,694
-5.33%	1,698	1,685	1,668	1,646	1,619	1,589	1,556
-2.67%	1,408	1,346	1,282	1,218	1,153	1,087	1,021
0%	160	109	56	0	-58	-118	-179
2.67%	-1,864	-1,872	-1,884	-1,900	-1,920	-1,944	-1,972
5.33%	-4,041	-4,041	-4,042	-4,043	-4,046	-4,051	-4,058
8.00%	-6,225	-6,225	-6,225	-6,225	-6,225	-6,226	-6,227
KR4201M73(	2017-07 콜307.5						34,495
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	7,232	7,231	7,229	7,224	7,215	7,199	7,175
-5.33%	7,203	7,169	7,116	7,043	6,947	6,831	6,693
-2.67%	6,365	6,092	5,799	5,491	5,170	4,839	4,500
0%	1,128	757	381	0	-385	-773	-1,163
2.67%	-9,577	-9,673	-9,799	-9,952	-10,130	-10,331	-10,552
5.33%	-21,961	-21,967	-21,979	-22,001	-22,035	-22,084	-22,149
8.00%	-34,474	-34,474	-34,475	-34,476	-34,479	-34,485	-34,495
KR4301M73(	2017-07 풋305						21,606
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-21,518	-21,519	-21,524	-21,533	-21,549	-21,572	-21,606
-5.33%	-11,875	-11,933	-12,011	-12,109	-12,226	-12,360	-12,509
-2.67%	-3,454	-3,730	-4,012	-4,298	-4,587	-4,879	-5,174
0%	709	486	249	0	-258	-523	-794
2.67%	1,426	1,391	1,338	1,267	1,178	1,071	947
5.33%	1,459	1,458	1,455	1,447	1,434	1,414	1,384
8.00%	1,460	1,460	1,460	1,459	1,459	1,457	1,453
KR4301M73(	2017-07 풋307.5						2,006
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-2,002	-2,002	-2,003	-2,003	-2,003	-2,004	-2,006
-5.33%	-1,178	-1,180	-1,183	-1,188	-1,194	-1,202	-1,211
-2.67%	-406	-424	-444	-464	-485	-507	-529
0%	74	50	25	0	-25	-51	-77
2.67%	194	188	179	169	158	144	130

5.33%	203	202	202	200	198	195	190
8.00%	203	203	203	203	203	202	202

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

74,703

공시일	2017-06-26
기준일	2017-06-23

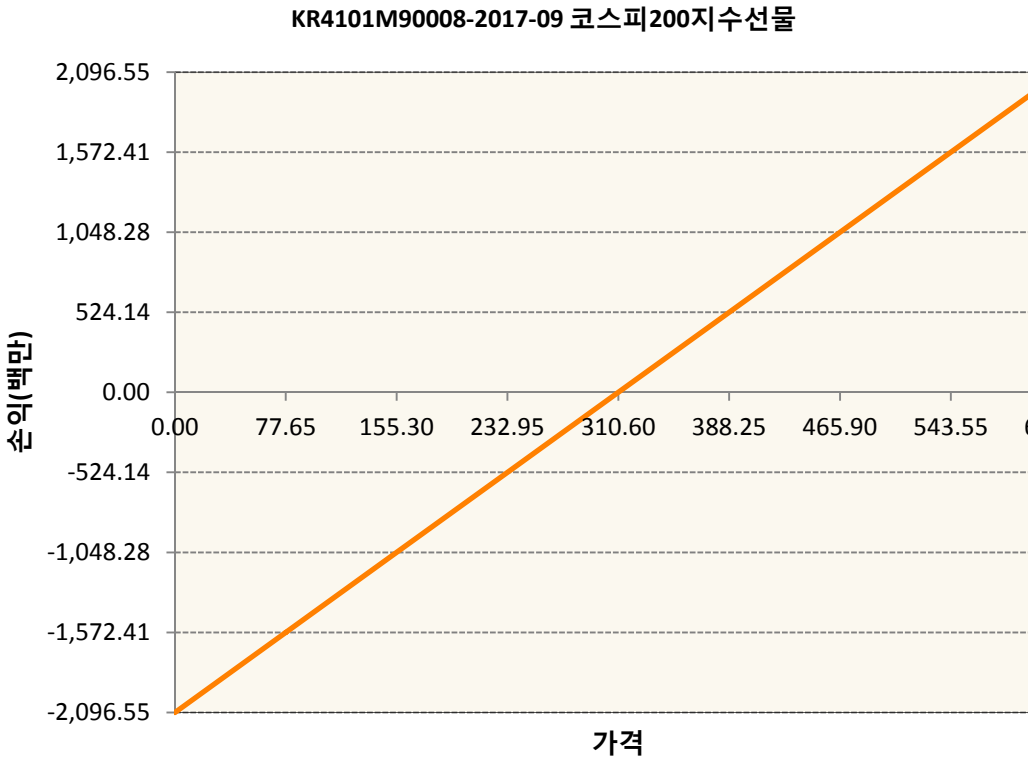
커버드콜목표전환형증권투자신탁

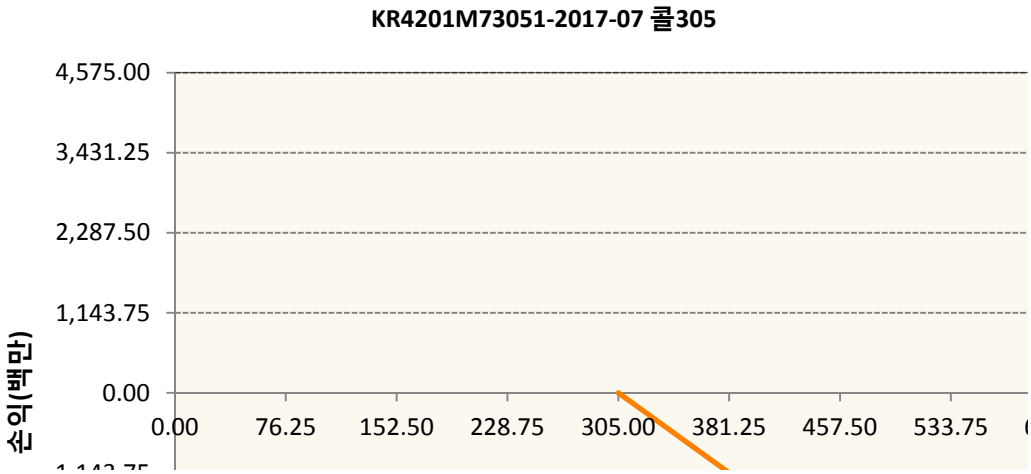
1. 계약금액

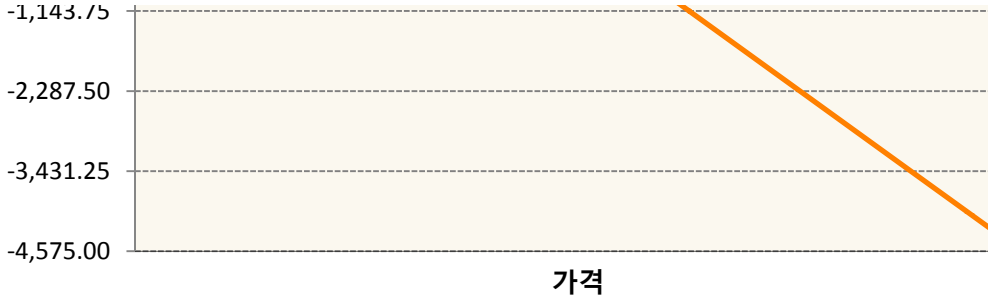
(단위:백만원)

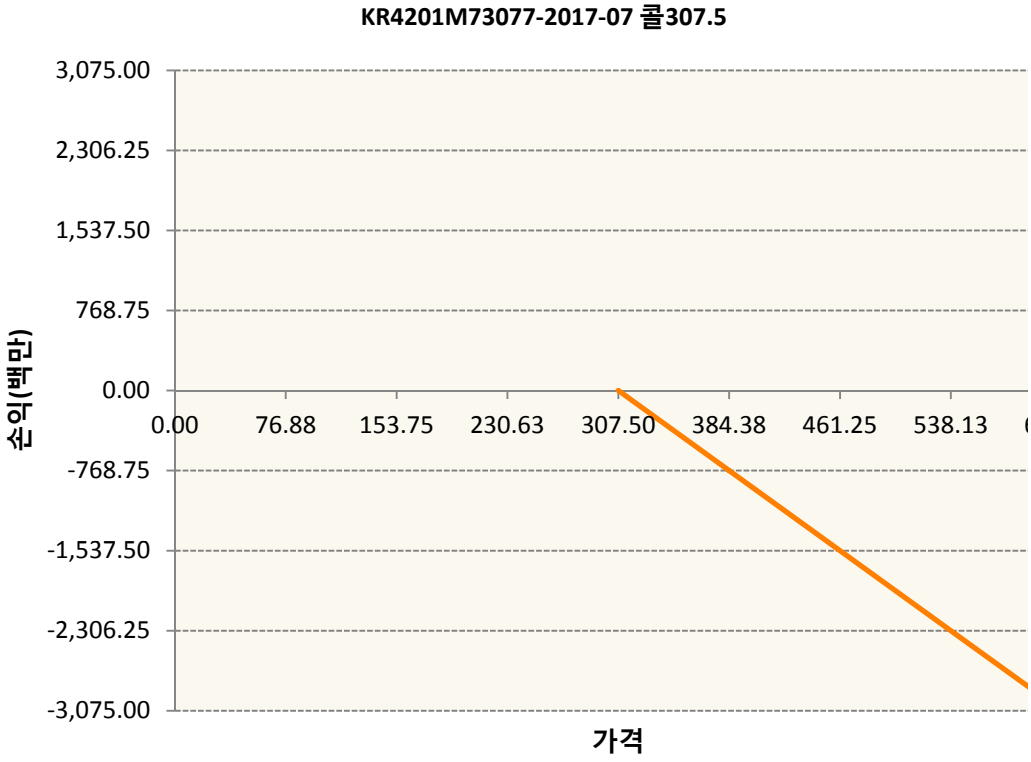
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,097	0	2,097	장내
누계	유가증권	옵션	0	8,803	-8,803	장내

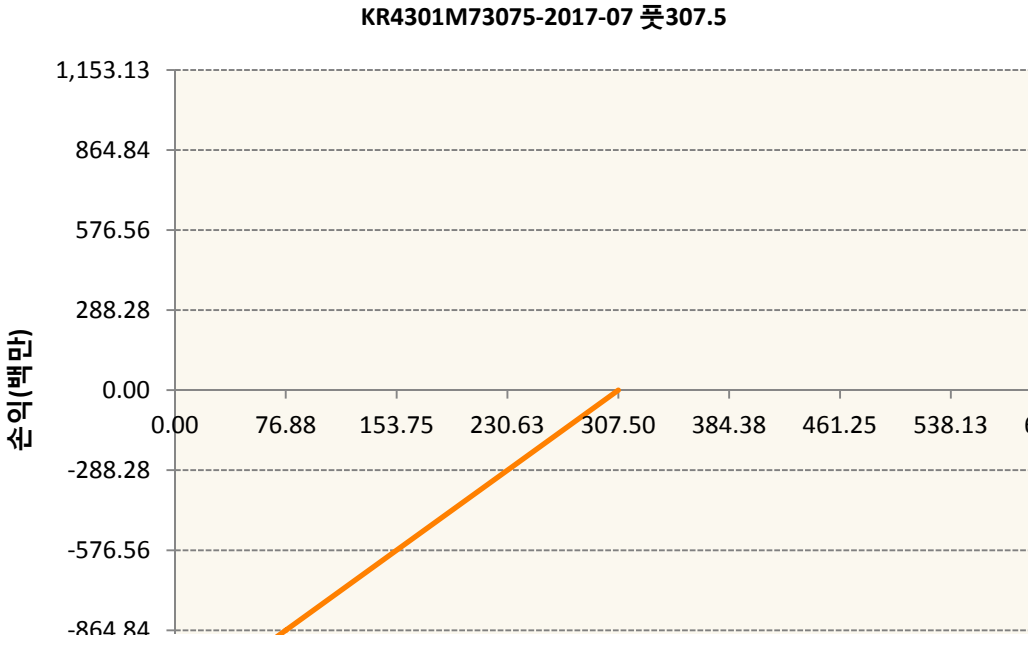
2. 만기시점의 손익구조

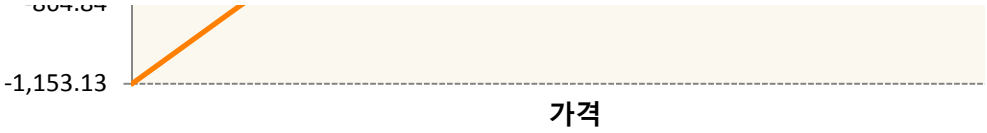





-1,143.75
-2,287.50
-3,431.25
-4,575.00
가격


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							168
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-168	-168	-168	-168	-168	-168	-168
-5.33%	-112	-112	-112	-112	-112	-112	-112
-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%	112	112	112	112	112	112	112
8.00%	168	168	168	168	168	168	168
KR4201M73(2017-07 콜305							353
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	97	97	97	97	97	97	96
-5.33%	96	96	95	93	92	90	88
-2.67%	80	76	73	69	65	62	58
0%	9	6	3	0	-3	-7	-10
2.67%	-106	-106	-107	-108	-109	-110	-112
5.33%	-229	-229	-229	-230	-230	-230	-230
8.00%	-353	-353	-353	-353	-353	-353	-353
KR4201M73(2017-07 콜307.5							228
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	48	48	48	48	48	48	47
-5.33%	48	47	47	47	46	45	44
-2.67%	42	40	38	36	34	32	30
0%	7	5	3	0	-3	-5	-8
2.67%	-63	-64	-65	-66	-67	-68	-70
5.33%	-145	-145	-145	-145	-146	-146	-146
8.00%	-228	-228	-228	-228	-228	-228	-228
KR4301M73(2017-07 풋307.5							75
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-75	-75	-75	-75	-75	-75	-75
-5.33%	-44	-44	-44	-45	-45	-45	-45
-2.67%	-15	-16	-17	-17	-18	-19	-20

0%	3	2	1	0	-1	-2	-3
2.67%	7	7	7	6	6	5	5
5.33%	8	8	8	8	7	7	7
8.00%	8	8	8	8	8	8	8

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

910

공시일	2017-06-26
기준일	2017-06-23

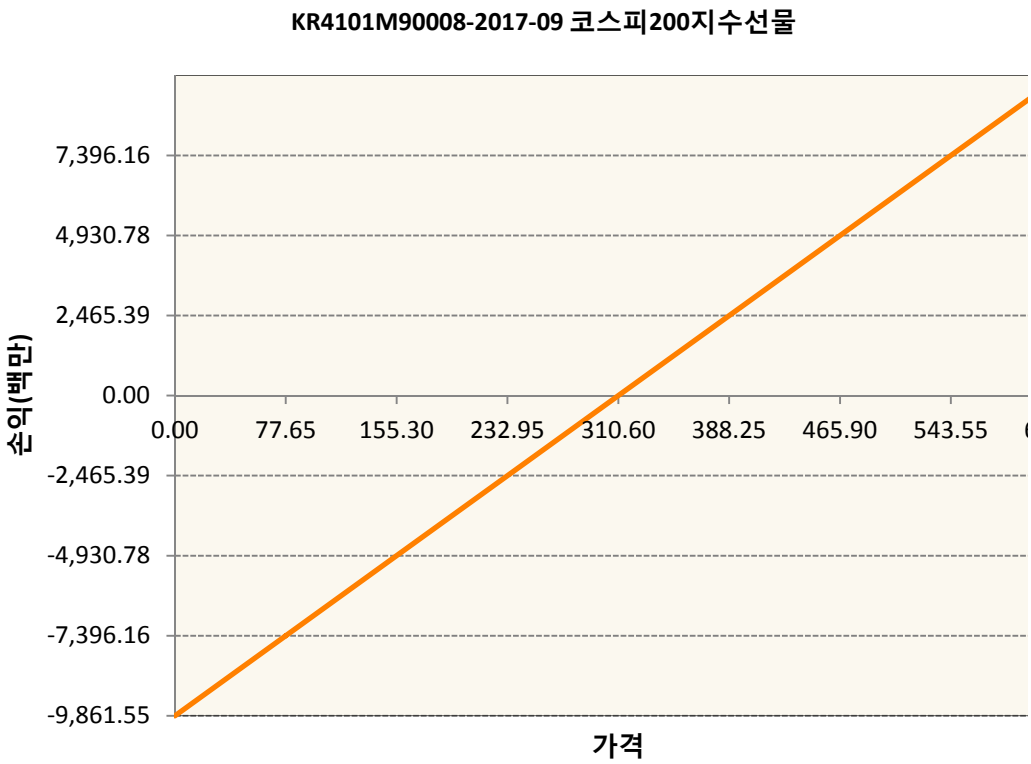
ETF스마트레버리지목표전환형6호

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	9,862	0	9,862	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101M90(2017-09 코스피200지수선물							788
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-788	-788	-788	-788	-788	-788	-788
-5.33%	-525	-525	-525	-525	-525	-525	-525
-2.67%	-263	-263	-263	-263	-263	-263	-263
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	263	263	263	263	263	263	263
5.33%	525	525	525	525	525	525	525
8.00%	788	788	788	788	788	788	788

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

509

공시일	2017-06-26
기준일	2017-06-23

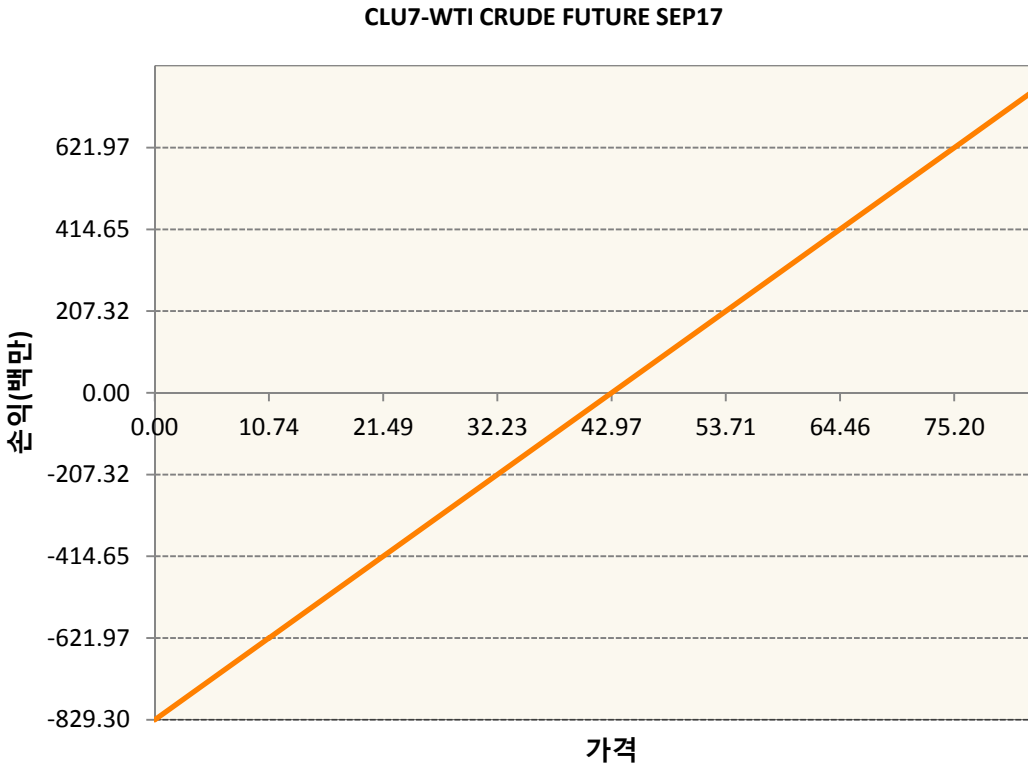
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

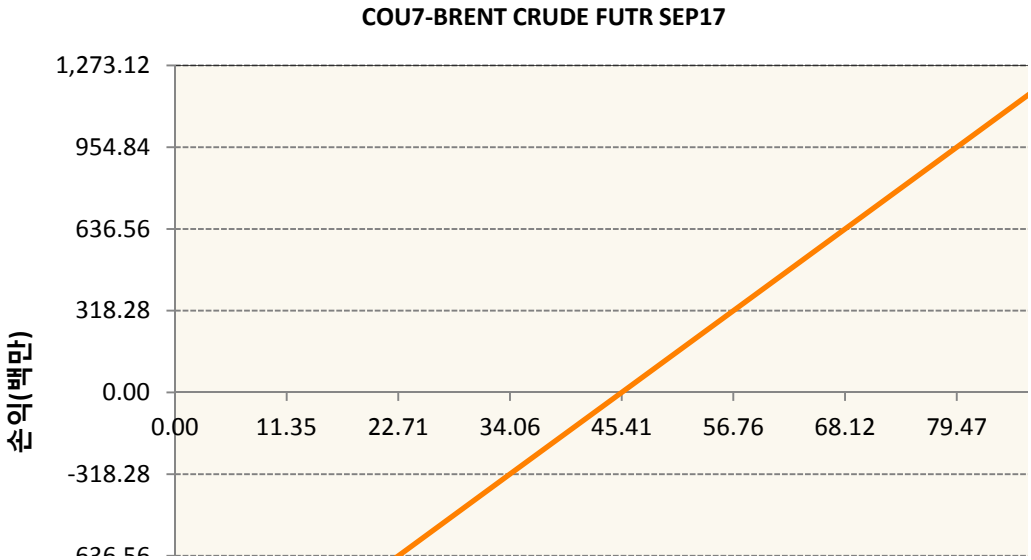
1. 계약금액

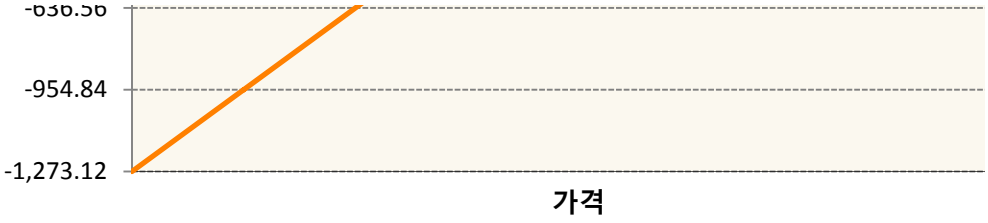
(단위:백만원)

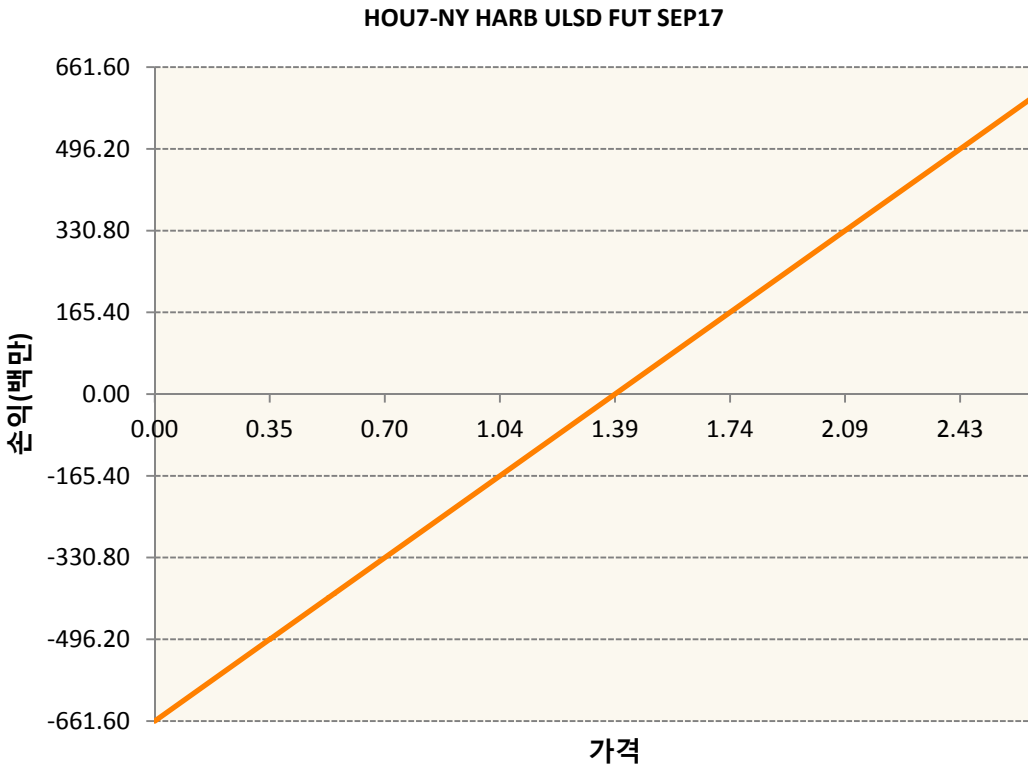
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	4,826	228	4,598	

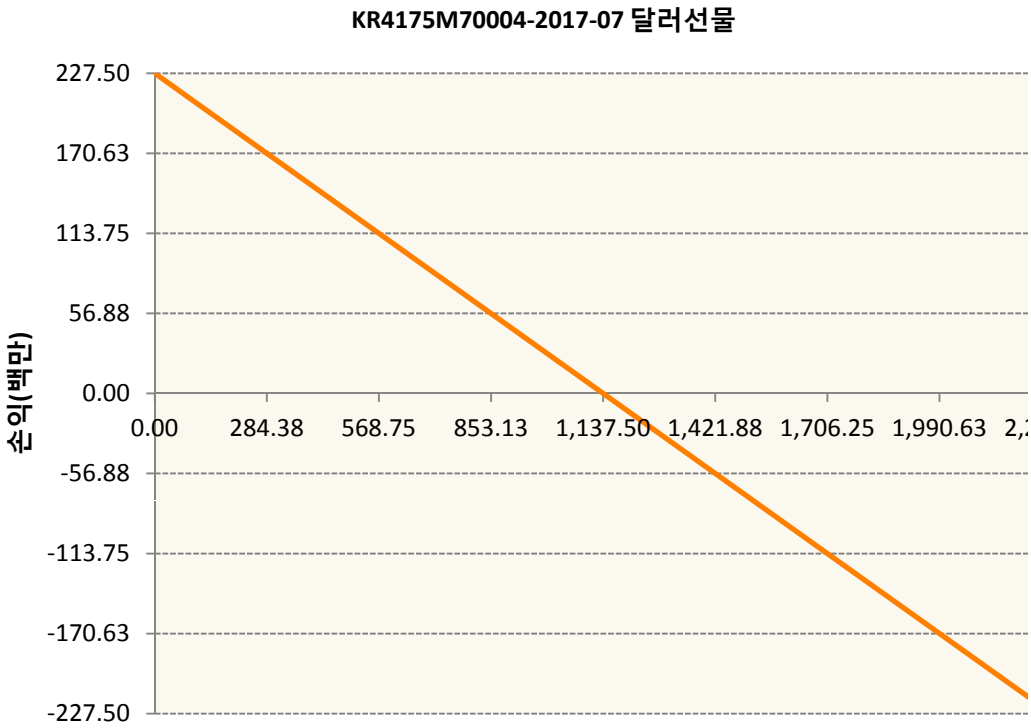
2. 만기시점의 손익구조



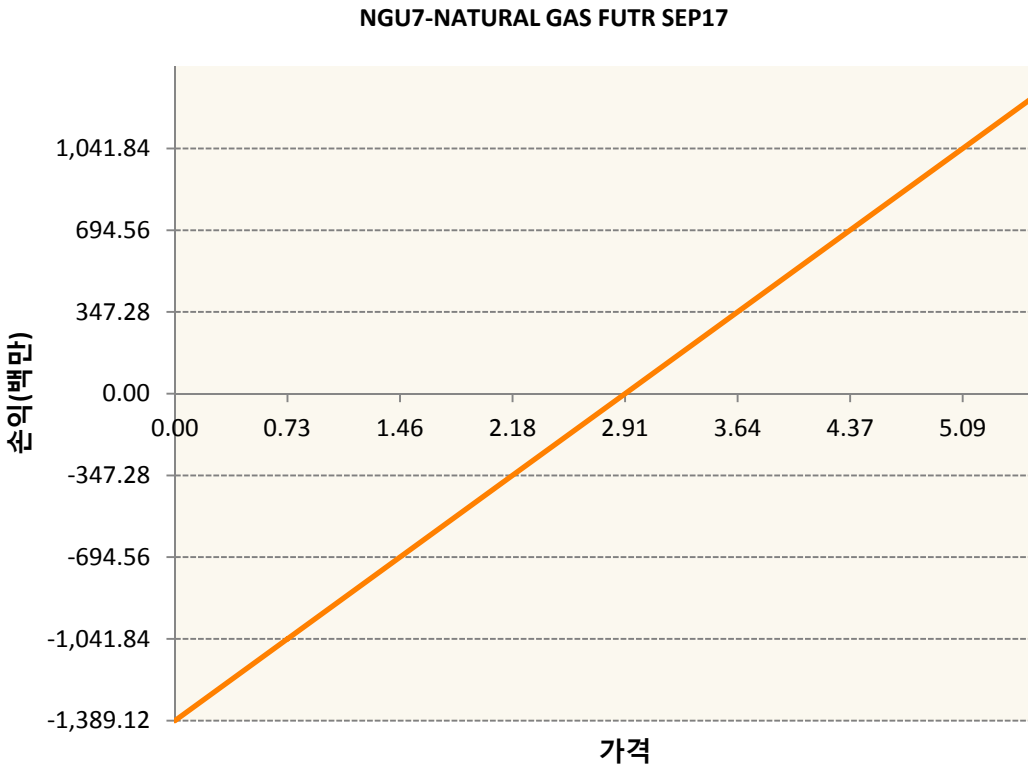


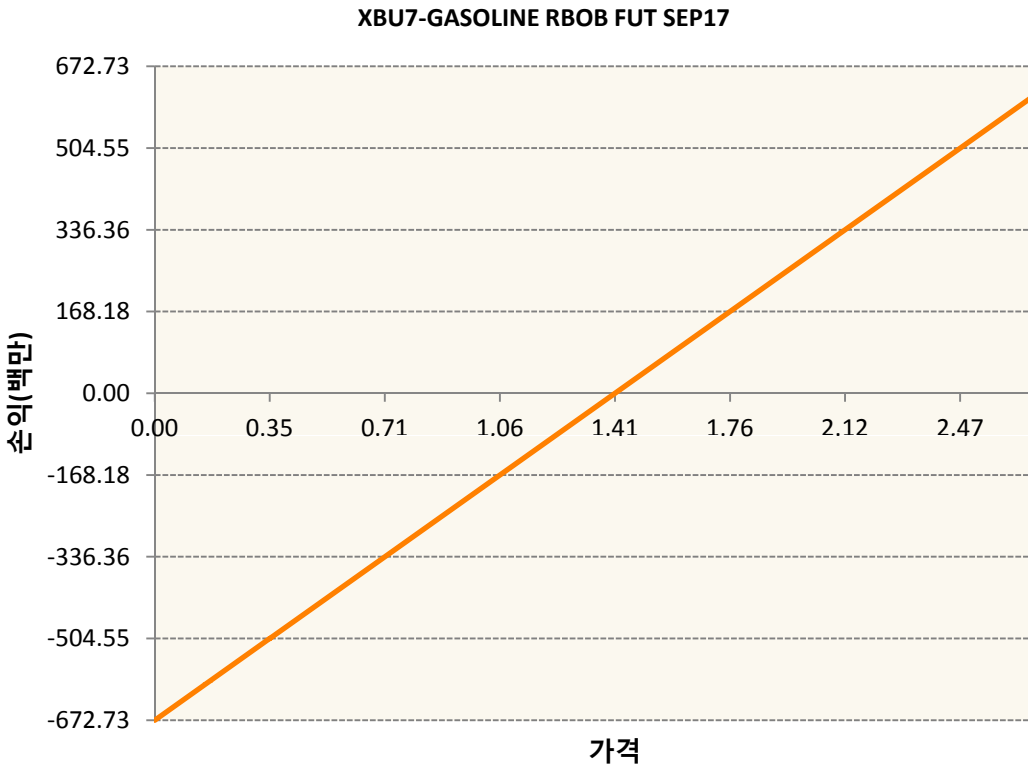

-954.84
-1,273.12
가격


HOU7-NY HARB ULSD FUT SEP17
661.60
496.20
330.80
165.40
0.00
-165.40
-330.80
-496.20
-661.60
0.00
0.35
0.70
1.04
1.39
1.74
2.09
2.43
손익(백만)
가격


KR4175M70004-2017-07 달러선물
227.50
170.63
113.75
56.88
0.00
-56.88
-113.75
-170.63
-227.50
0.00
284.38
568.75
853.13
1,137.50
1,421.88
1,706.25
1,990.63
손익(백만)

가격


NGU7-NATURAL GAS FUTR SEP17
1,041.84
694.56
347.28
0.00
-347.28
-694.56
-1,041.84
-1,389.12
0.00
0.73
1.46
2.18
2.91
3.64
4.37
5.09
손익(백만)
가격


XBU7-GASOLINE RBOB FUT SEP17
672.73
504.55
336.36
168.18
0.00
-168.18
-336.36
-504.55
-672.73
0.00
0.35
0.71
1.06
1.41
1.76
2.12
2.47
손익(백만)
가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLU7	WTI CRUDE FUTURE SEP17	66
COU7	BRENT CRUDE FUTR SEP17	102
HOU7	NY HARB ULSD FUT SEP17	53
KR4175M70(	2017-07 달러선물	18
NGU7	NATURAL GAS FUTR SEP17	111
XBU7	GASOLINE RBOB FUT SEP17	54

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

784

공시일	2017-06-26
기준일	2017-06-23

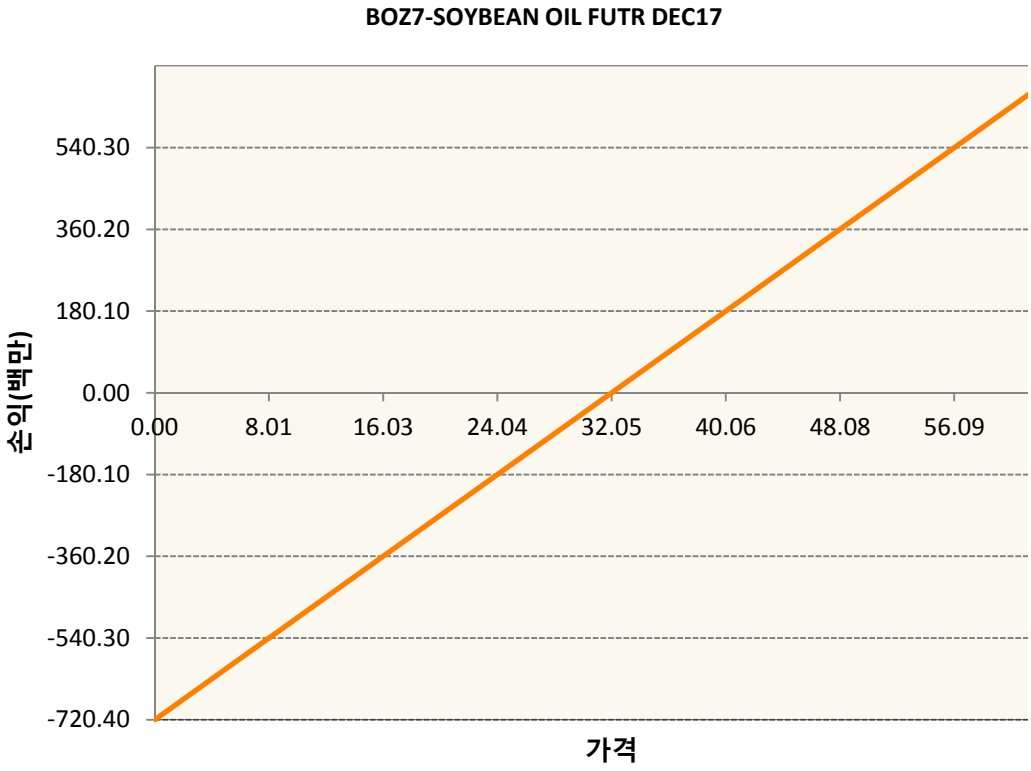
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

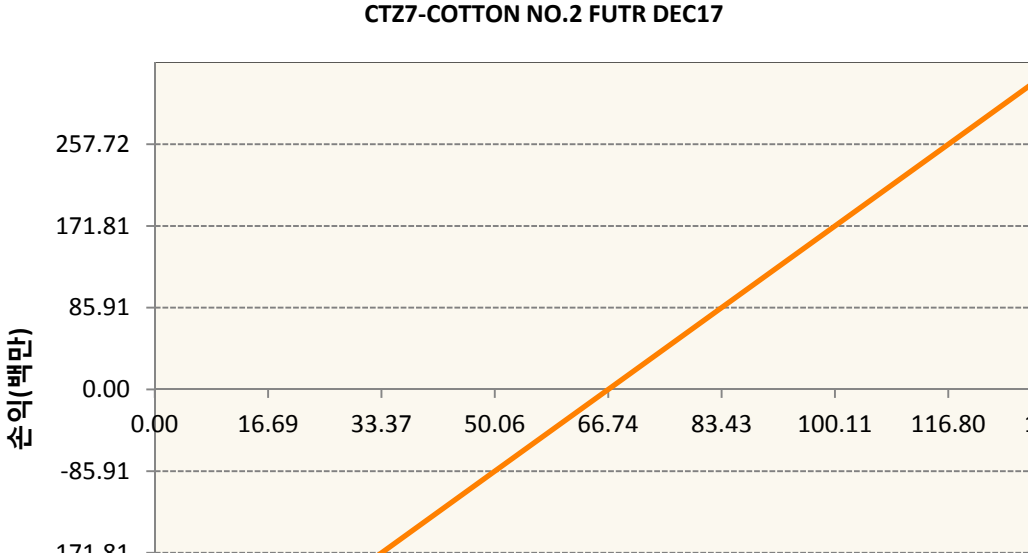
1. 계약금액

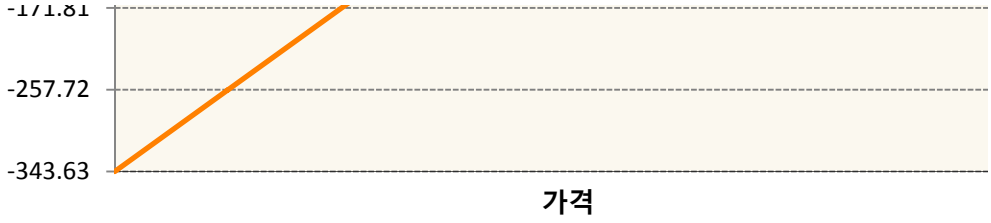
(단위:백만원)

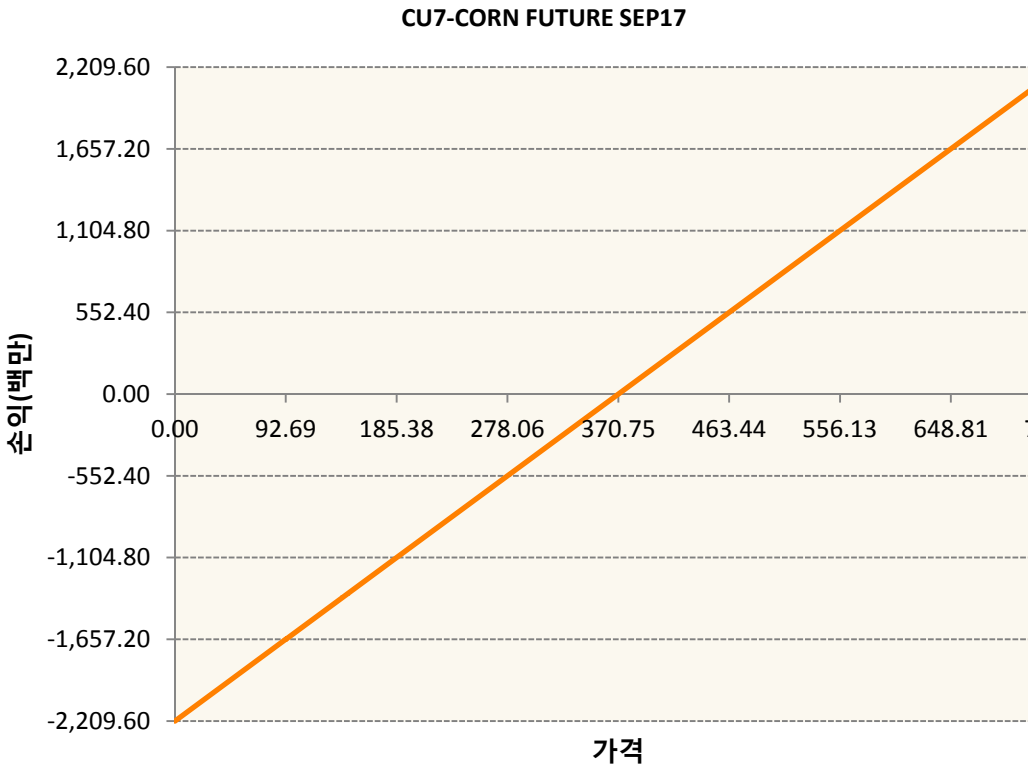
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	8,159	398	7,761	

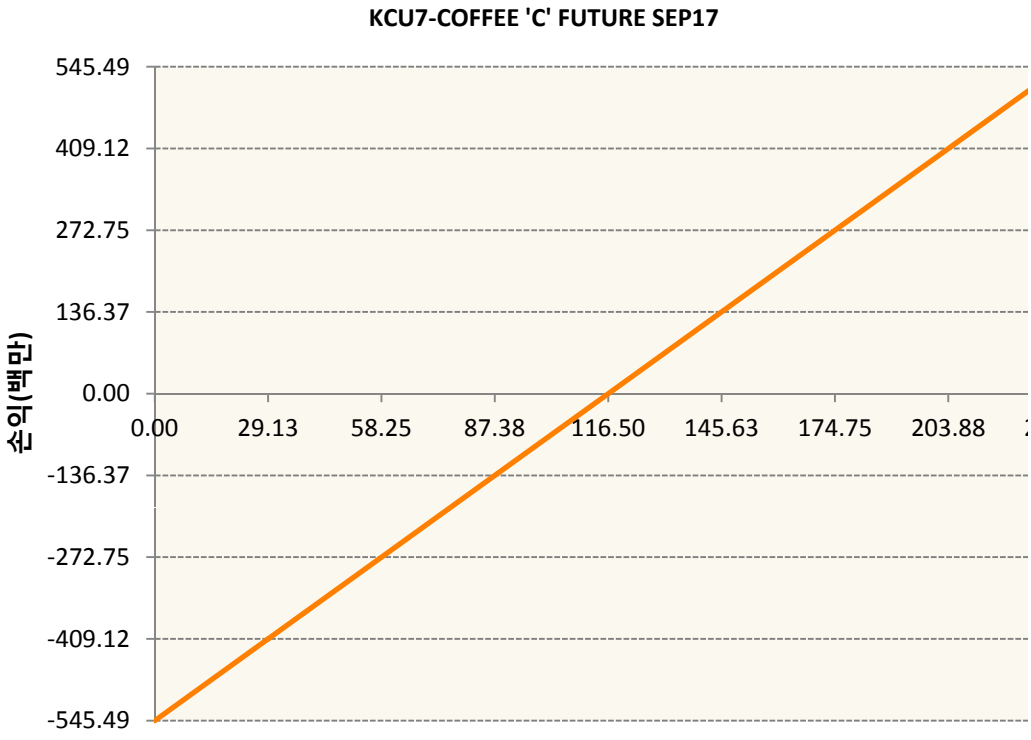
2. 만기시점의 손익구조



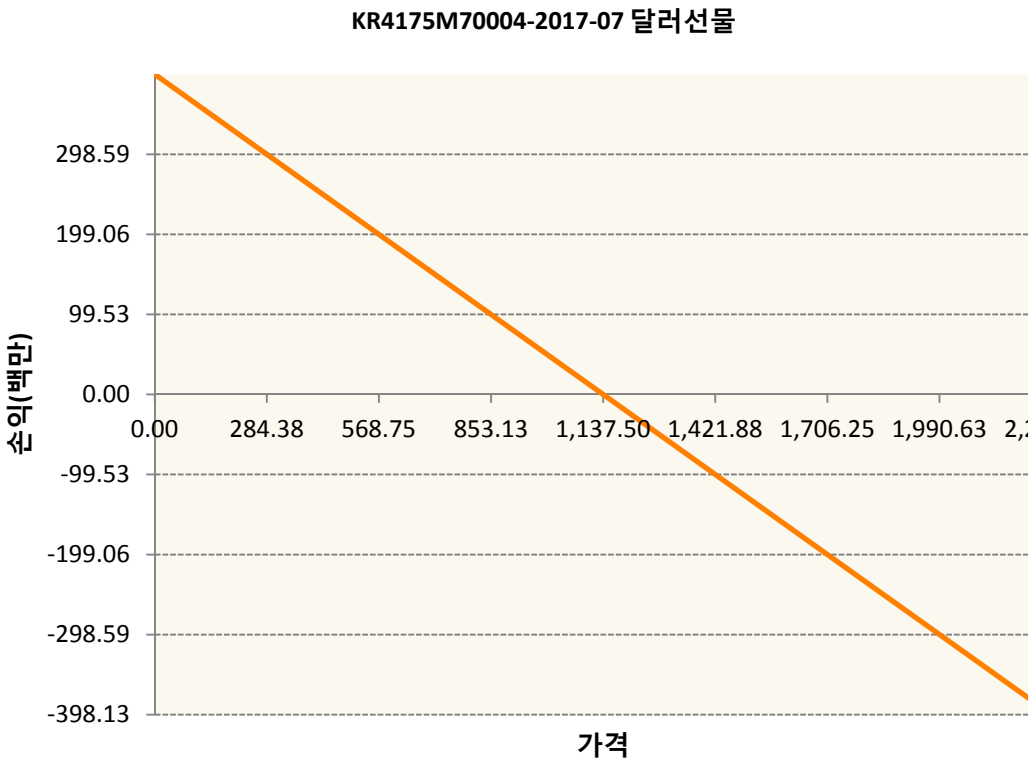


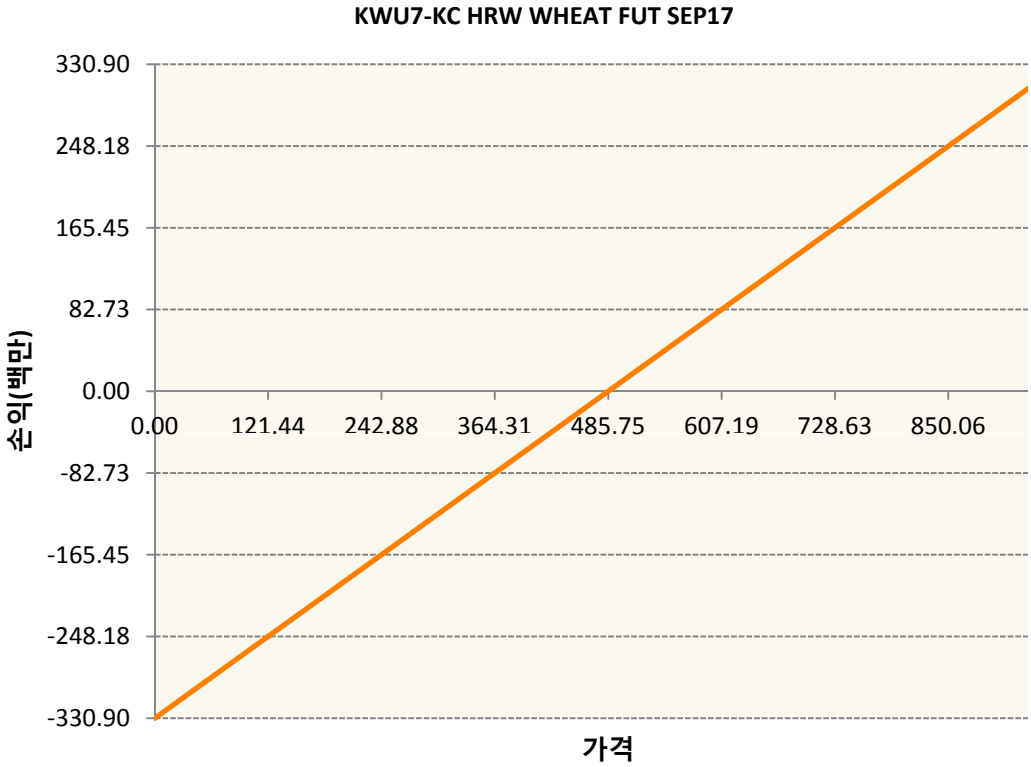

-257.72
-343.63
가격

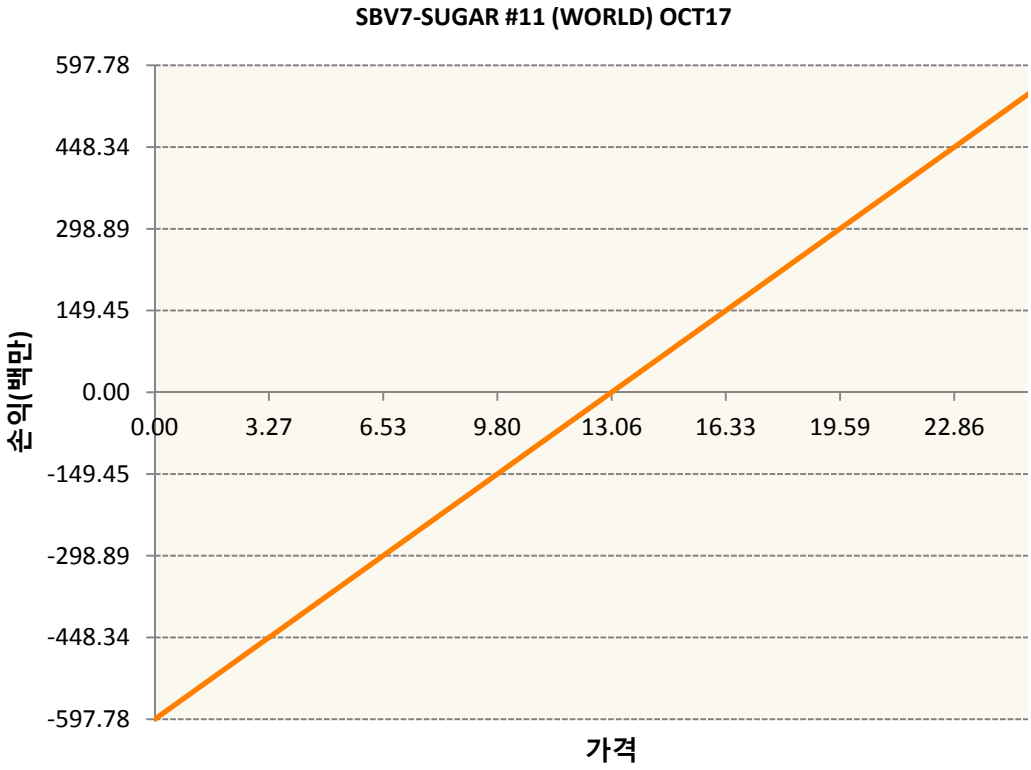

CU7-CORN FUTURE SEP17
2,209.60
1,657.20
1,104.80
552.40
0.00
-552.40
-1,104.80
-1,657.20
-2,209.60
0.00
92.69
185.38
278.06
370.75
463.44
556.13
648.81
손익(백만)
가격

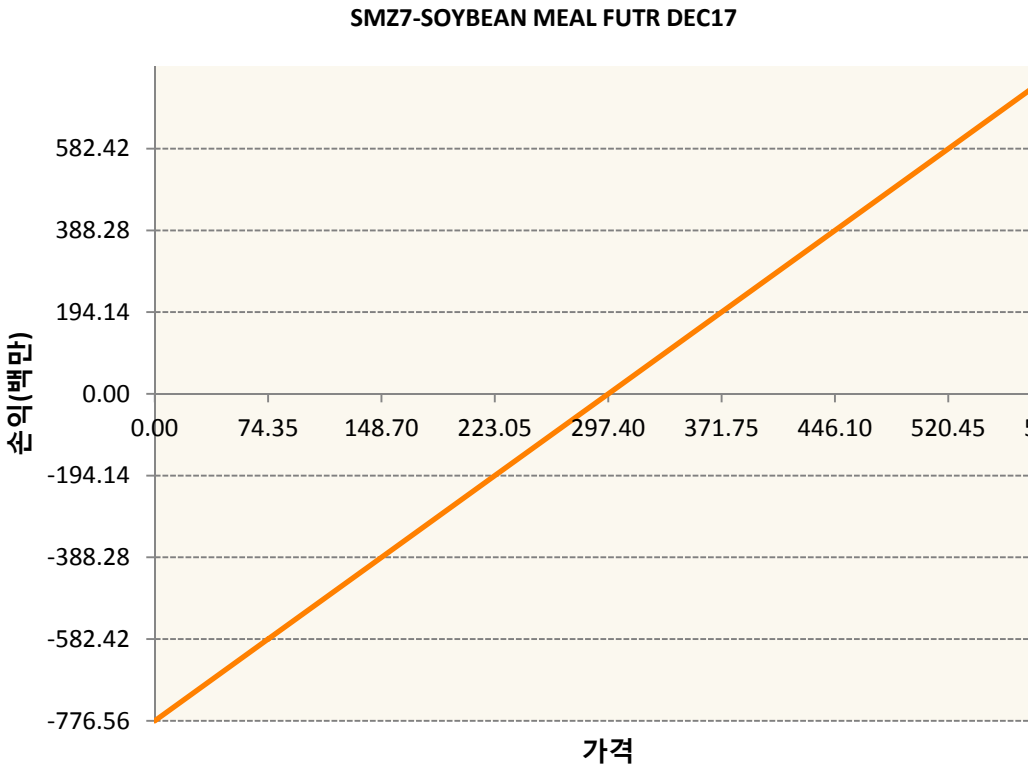

KCU7-COFFEE 'C' FUTURE SEP17
545.49
409.12
272.75
136.37
0.00
-136.37
-272.75
-409.12
-545.49
0.00
29.13
58.25
87.38
116.50
145.63
174.75
203.88
손익(백만)

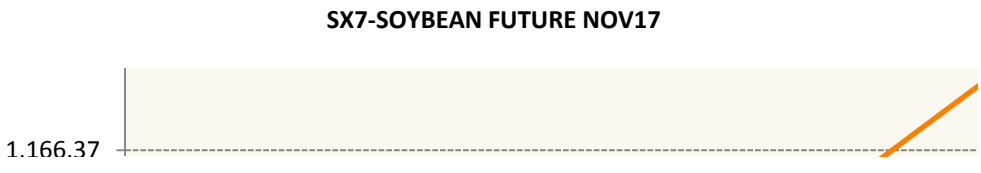
가격

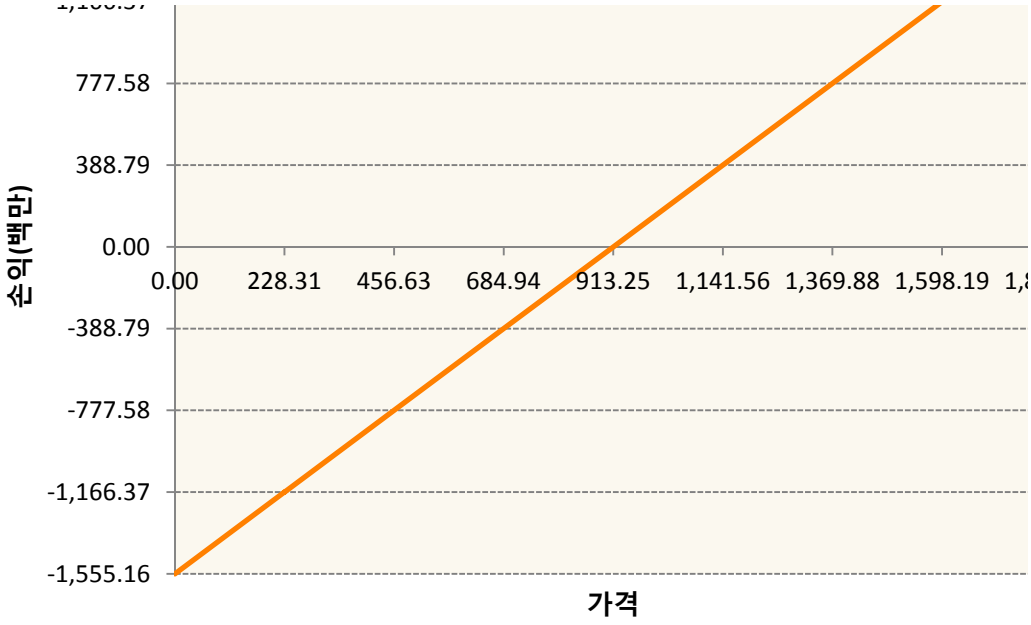

KR4175M70004-2017-07 달러선물
298.59
199.06
99.53
0.00
-99.53
-199.06
-298.59
-398.13
0.00
284.38
568.75
853.13
1,137.50
1,421.88
1,706.25
1,990.63
손익(백만)
가격

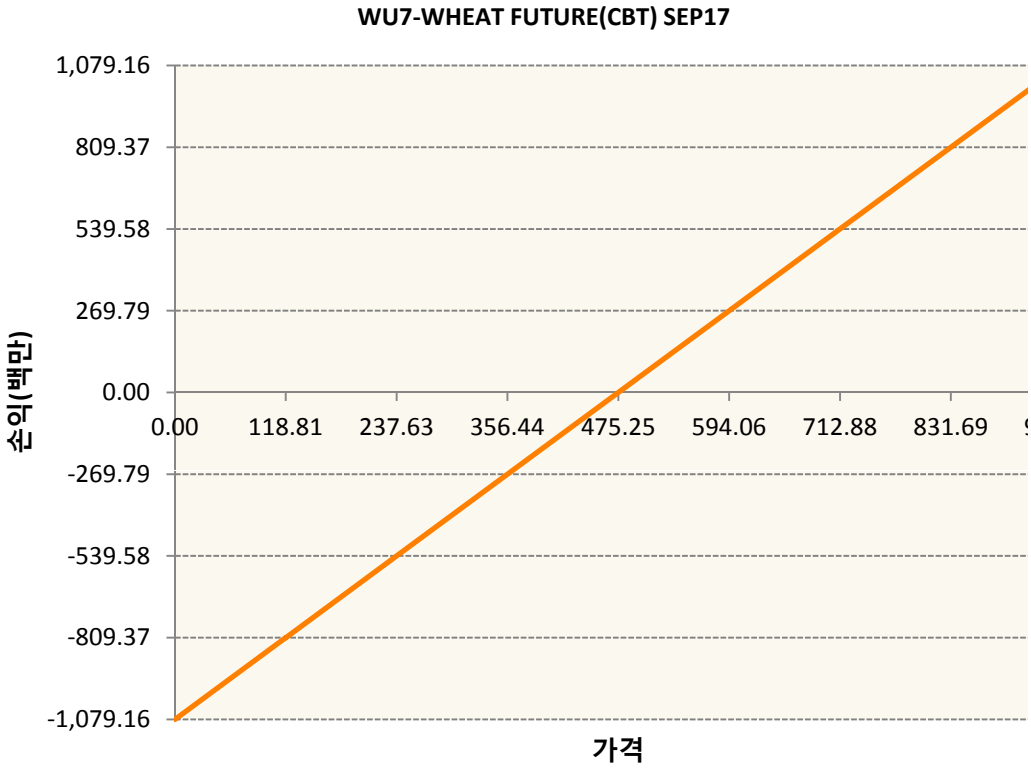

KWU7-KC HRW WHEAT FUT SEP17
330.90
248.18
165.45
82.73
0.00
-82.73
-165.45
-248.18
-330.90
0.00
121.44
242.88
364.31
485.75
607.19
728.63
850.06
손익(백만)
가격


SBV7-SUGAR #11 (WORLD) OCT17
597.78
448.34
298.89
149.45
0.00
-149.45
-298.89
-448.34
-597.78
0.00
3.27
6.53
9.80
13.06
16.33
19.59
22.86
손익(백만)
가격


SMZ7-SOYBEAN MEAL FUTR DEC17
582.42
388.28
194.14
0.00
-194.14
-388.28
-582.42
-776.56
0.00
74.35
148.70
223.05
297.40
371.75
446.10
520.45
손익(백만)
가격


SX7-SOYBEAN FUTURE NOV17
1,166.37





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

BOZ7	SOYBEAN OIL FUTR DEC17	58
CTZ7	COTTON NO.2 FUTR DEC17	27
CU7	CORN FUTURE SEP17	177
KCU7	COFFEE 'C' FUTURE SEP17	44
KR4175M70(	2017-07 달러선물	32

KWU7	KC HRW WHEAT FUT SEP17	26
SBV7	SUGAR #11 (WORLD) OCT17	48
SMZ7	SOYBEAN MEAL FUTR DEC17	62
SX7	SOYBEAN FUTURE NOV17	124
WU7	WHEAT FUTURE(CBT) SEP17	86

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

739