공시일	2017-06-27
기준일	2017-06-26

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	2017-06-27
기준일	2017-06-26

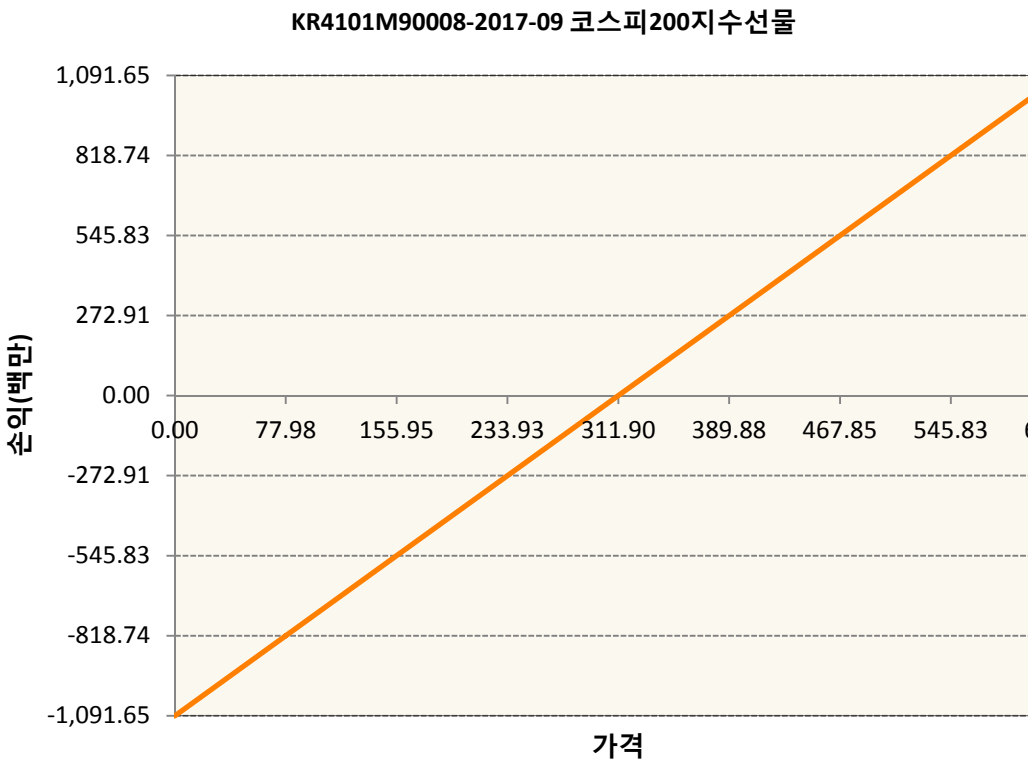
스마트인덱스모

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	1,092	0	1,092	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	2017-06-27
기준일	2017-06-26

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	1,001

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

497

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-06-27
기준일	2017-06-26

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	376

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

323

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-06-27
기준일	2017-06-26

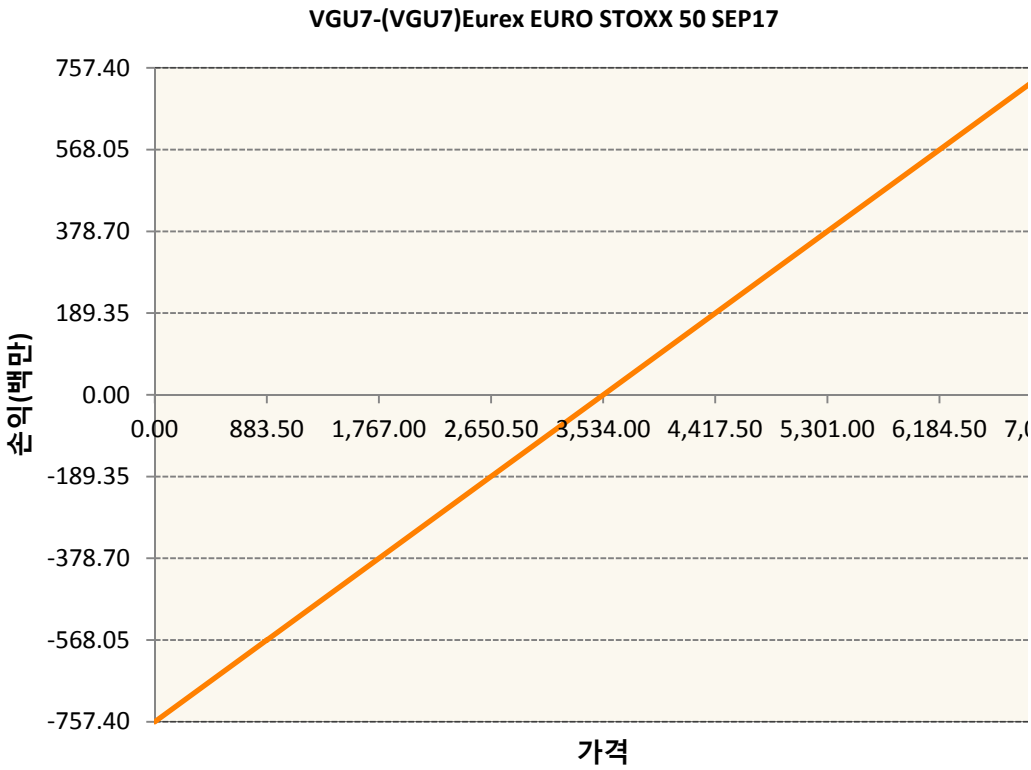
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	757	0	757	

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	2017-06-27
기준일	2017-06-26

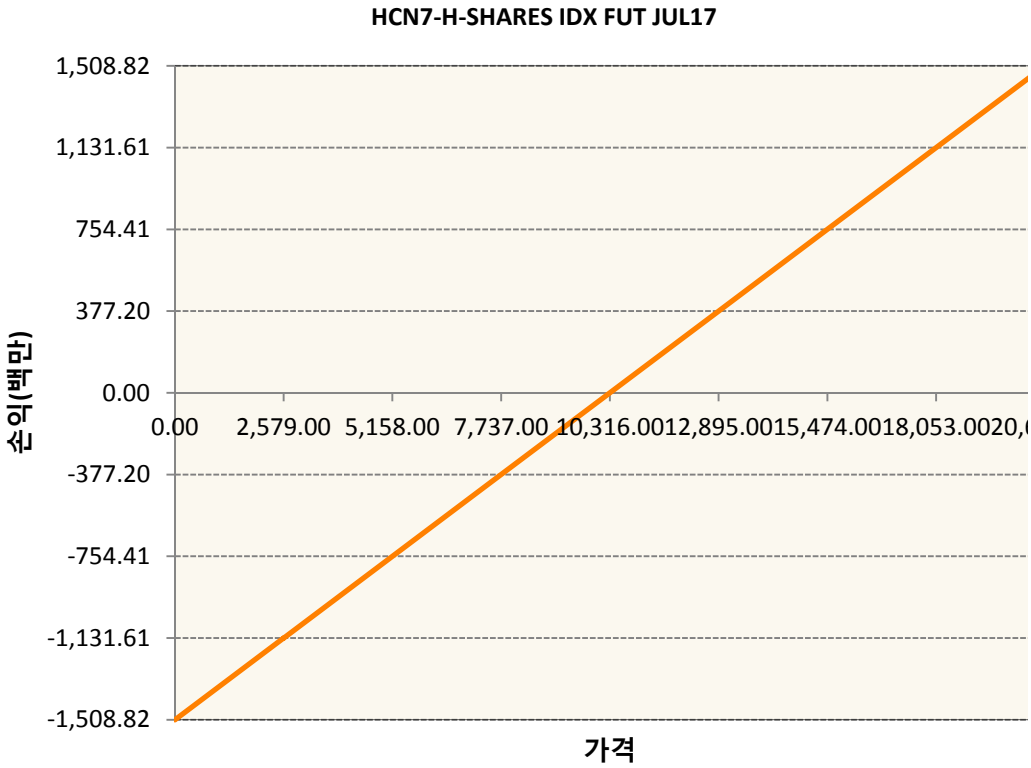
차이나인덱스모(주식-파생형)

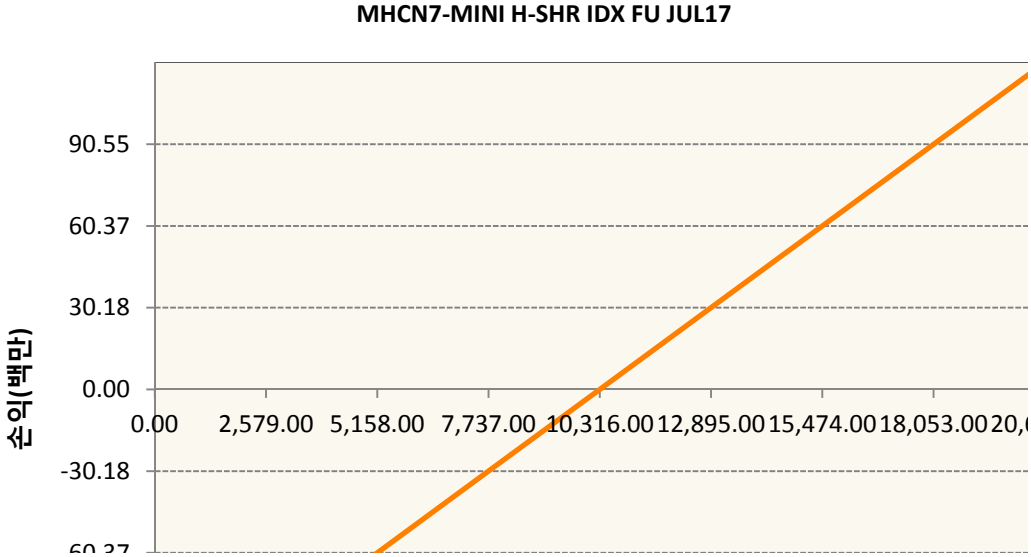
1. 계약금액

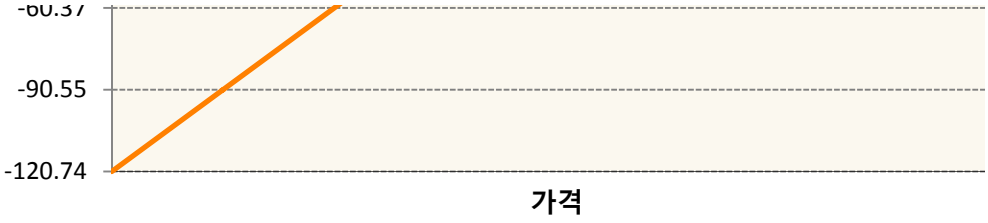
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,630	0	1,630	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCN7	H-SHARES IDX FUT JUL17	121
MHCN7	MINI H-SHR IDX FU JUL17	10

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

공시일	2017-06-27
기준일	2017-06-26

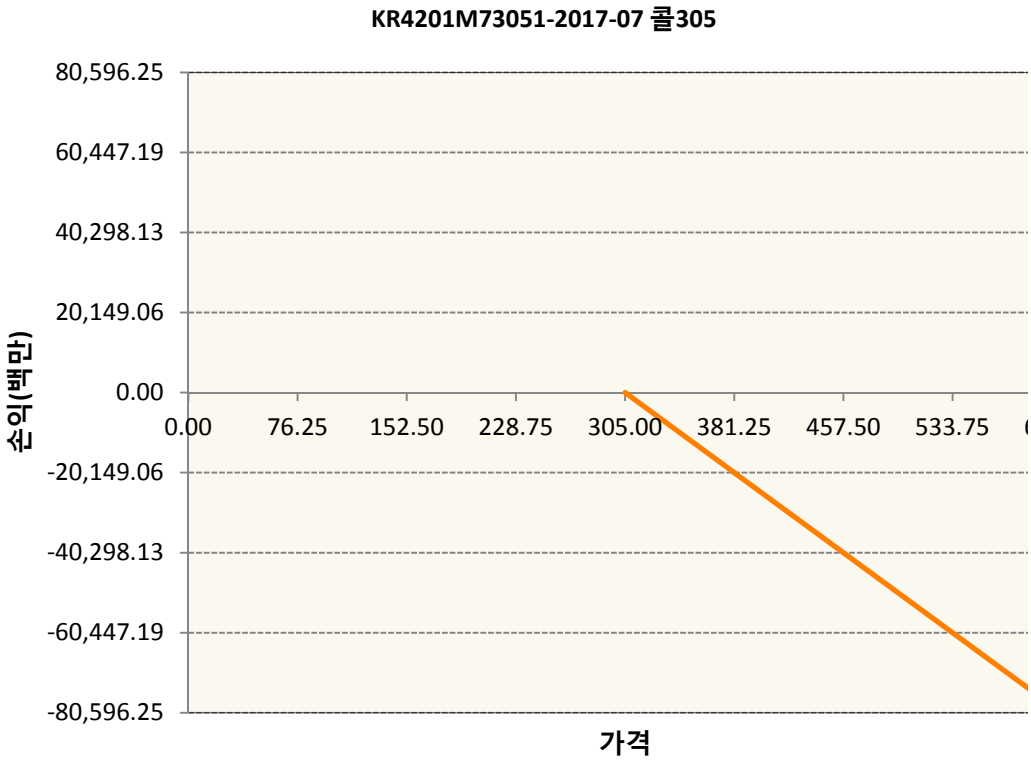
커버드콜모(주식혼합-파생형)

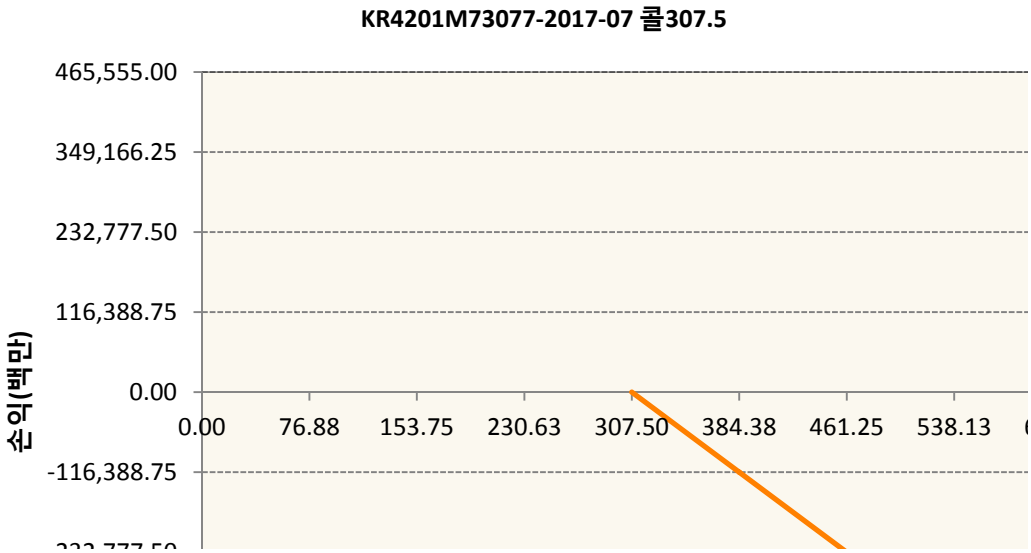
1. 계약금액

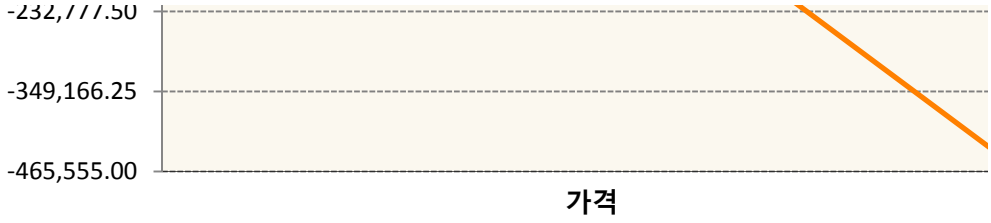
(단위:백만원)

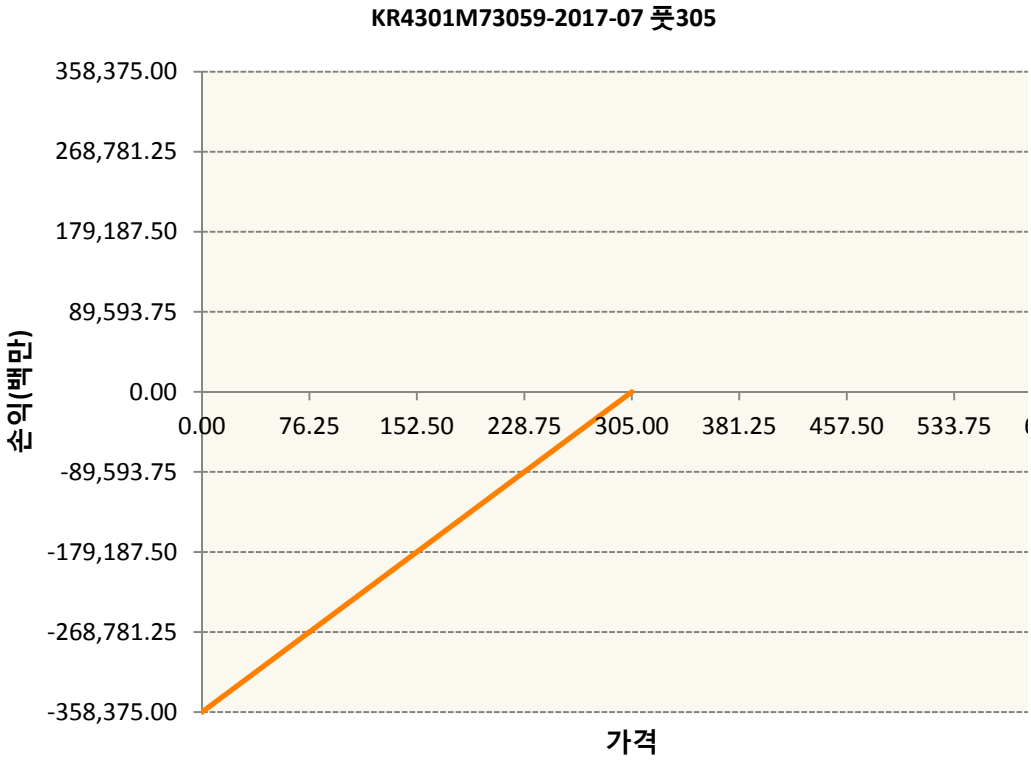
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	935,276	-935,276	장내

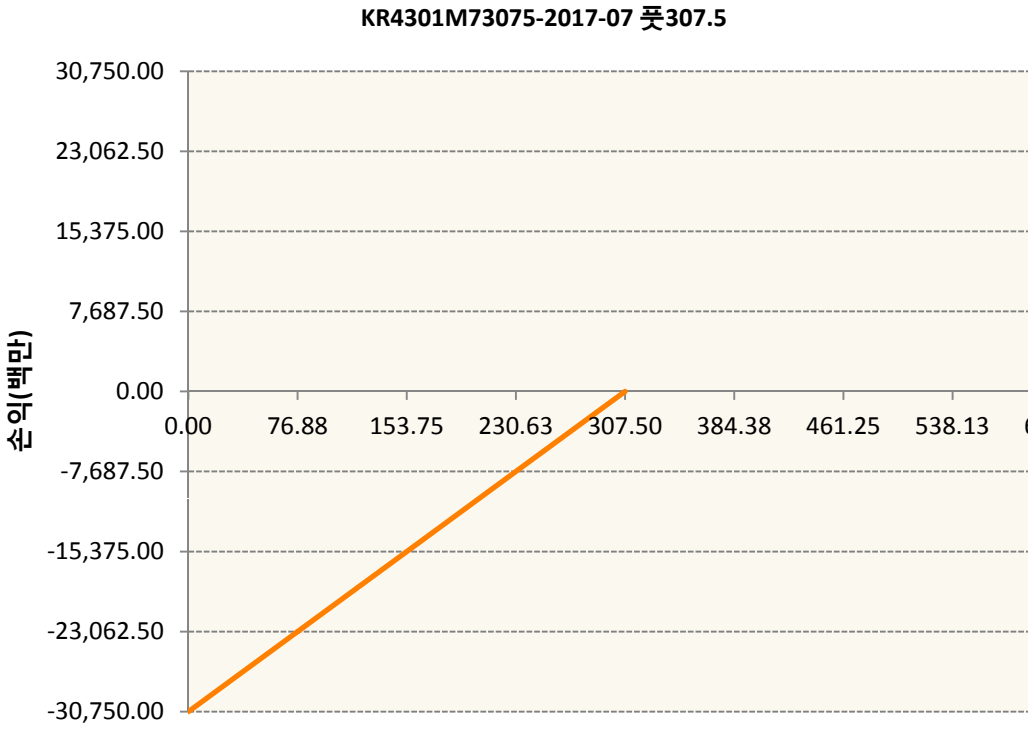
2. 만기시점의 손익구조






-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							6,381
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	2,025	2,024	2,023	2,021	2,016	2,010	2,002
-5.33%	2,000	1,983	1,961	1,935	1,904	1,871	1,834
-2.67%	1,594	1,529	1,464	1,398	1,333	1,267	1,201
0%	120	84	44	0	-47	-96	-148
2.67%	-1,991	-1,994	-2,000	-2,009	-2,021	-2,036	-2,055
5.33%	-4,185	-4,185	-4,185	-4,185	-4,187	-4,189	-4,192
8.00%	-6,381	-6,381	-6,381	-6,381	-6,381	-6,381	-6,381
KR4201M73(2017-07 콜307.5							35,666
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	8,721	8,721	8,718	8,712	8,701	8,683	8,656
-5.33%	8,676	8,629	8,562	8,472	8,359	8,226	8,072
-2.67%	7,453	7,141	6,818	6,485	6,145	5,798	5,447
0%	946	644	327	0	-336	-680	-1,029
2.67%	-10,541	-10,590	-10,662	-10,757	-10,875	-11,016	-11,177
5.33%	-23,075	-23,077	-23,081	-23,090	-23,106	-23,132	-23,169
8.00%	-35,658	-35,658	-35,658	-35,658	-35,659	-35,661	-35,666
KR4301M73(2017-07 풋305							20,396
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-20,292	-20,295	-20,301	-20,312	-20,331	-20,358	-20,396
-5.33%	-10,638	-10,714	-10,811	-10,929	-11,063	-11,214	-11,378
-2.67%	-2,677	-2,966	-3,257	-3,548	-3,841	-4,134	-4,427
0%	534	374	195	0	-209	-429	-658
2.67%	914	899	873	834	780	711	628
5.33%	924	924	923	920	915	905	890
8.00%	924	924	924	924	924	923	922
KR4301M73(2017-07 풋307.5							1,922
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,917	-1,917	-1,918	-1,918	-1,919	-1,920	-1,922
-5.33%	-1,089	-1,092	-1,097	-1,103	-1,110	-1,119	-1,129
-2.67%	-339	-359	-381	-403	-425	-448	-471
0%	62	43	22	0	-22	-45	-68
2.67%	135	132	127	121	113	104	93

5.33%	138	138	138	137	136	134	132
8.00%	138	138	138	138	138	138	138

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

73,374

공시일	2017-06-27
기준일	2017-06-26

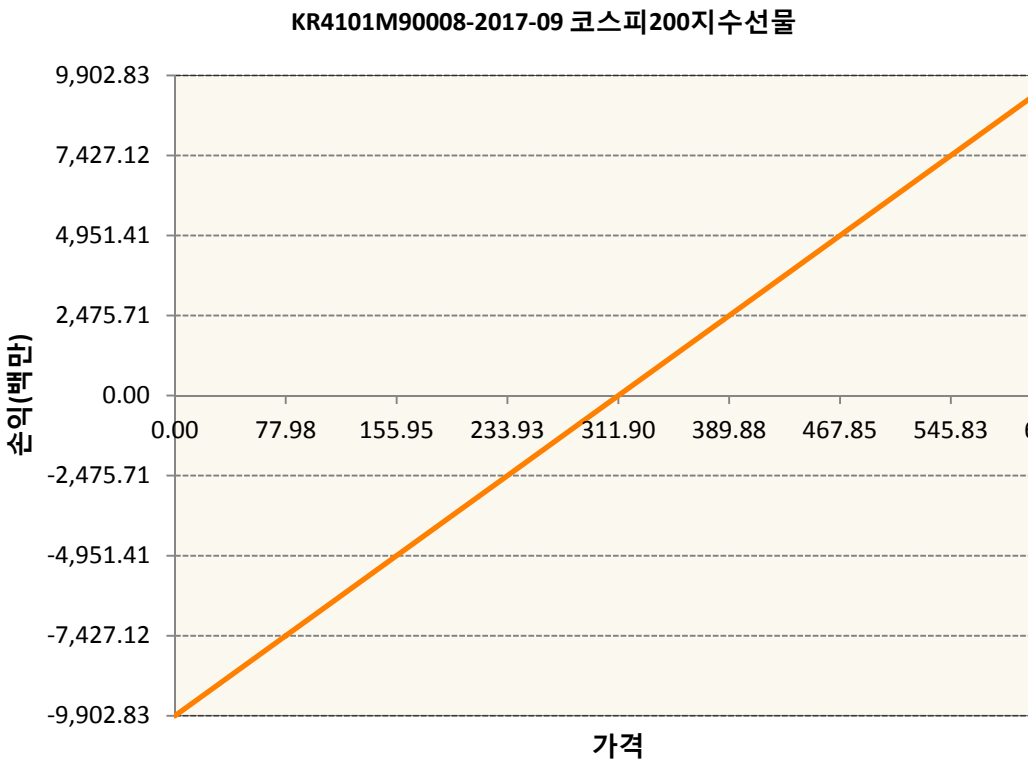
ETF스마트레버리지목표전환형6호

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	9,903	0	9,903	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101M90(2017-09 코스피200지수선물							792
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-792	-792	-792	-792	-792	-792	-792
-5.33%	-528	-528	-528	-528	-528	-528	-528
-2.67%	-264	-264	-264	-264	-264	-264	-264
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	264	264	264	264	264	264	264
5.33%	528	528	528	528	528	528	528
8.00%	792	792	792	792	792	792	792

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

512

공시일	2017-06-27
기준일	2017-06-26

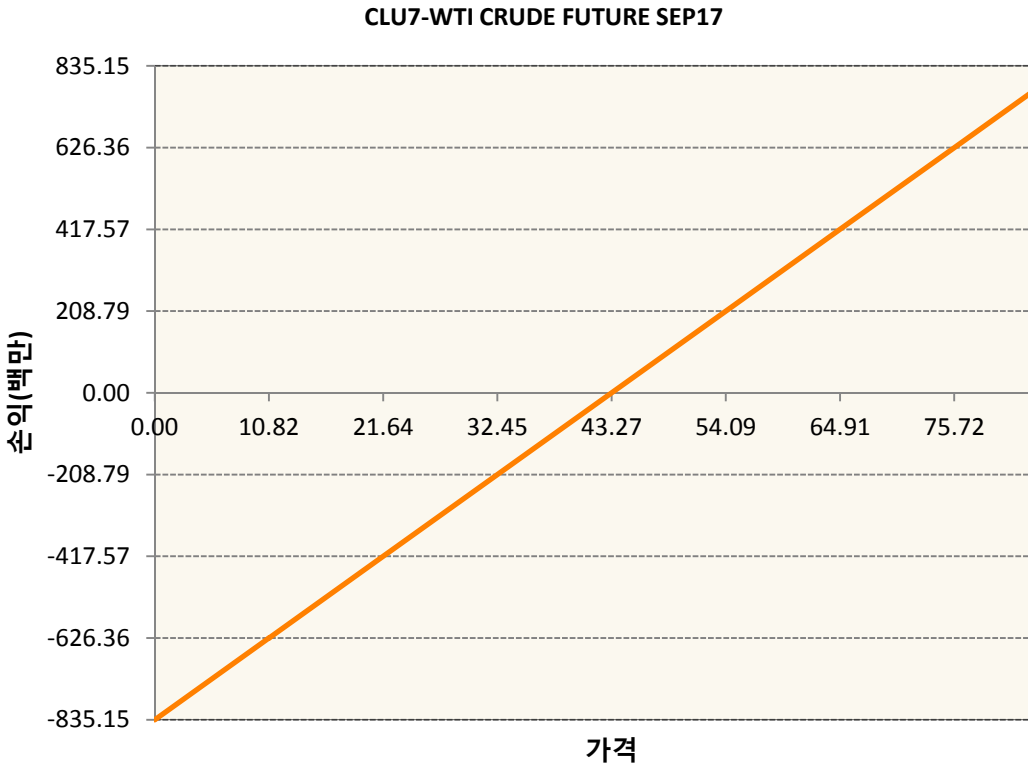
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

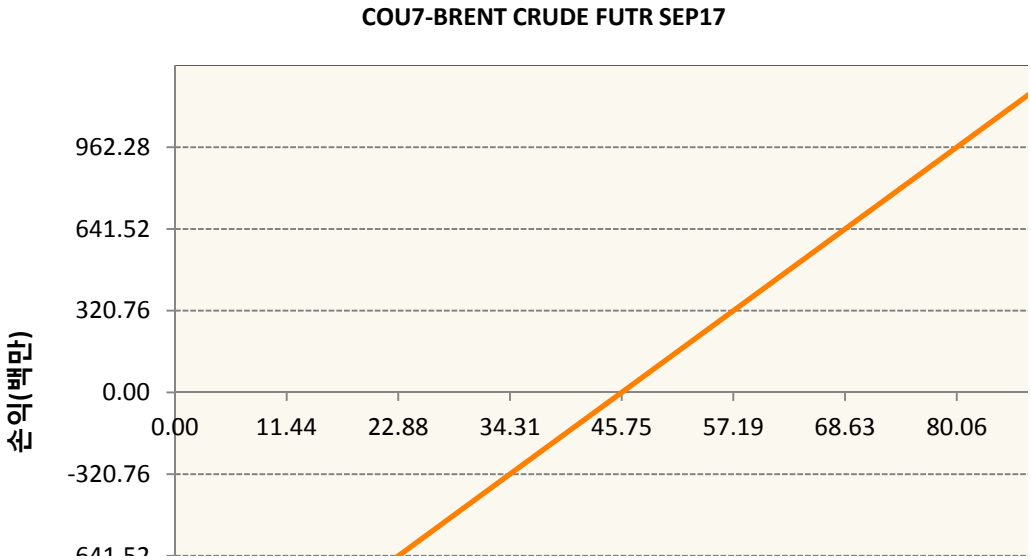
1. 계약금액

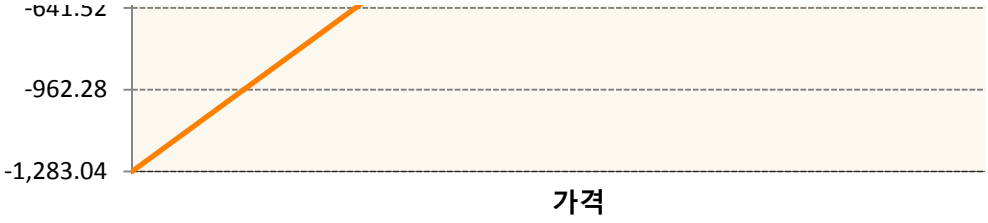
(단위:백만원)

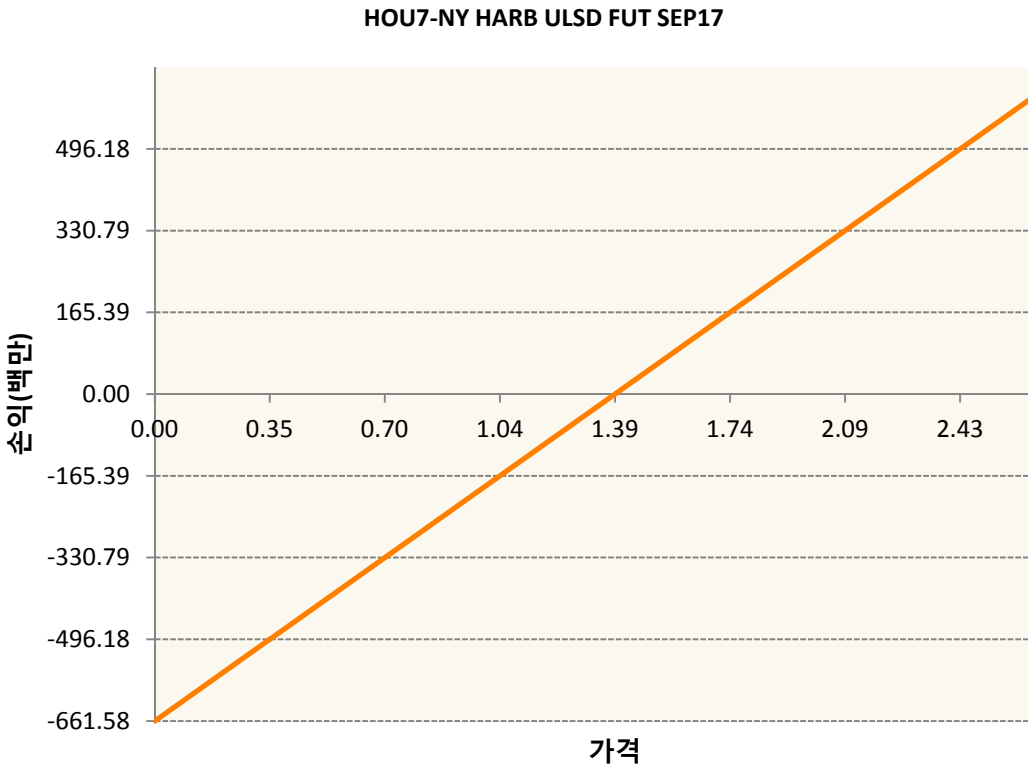
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	4,858	227	4,631	

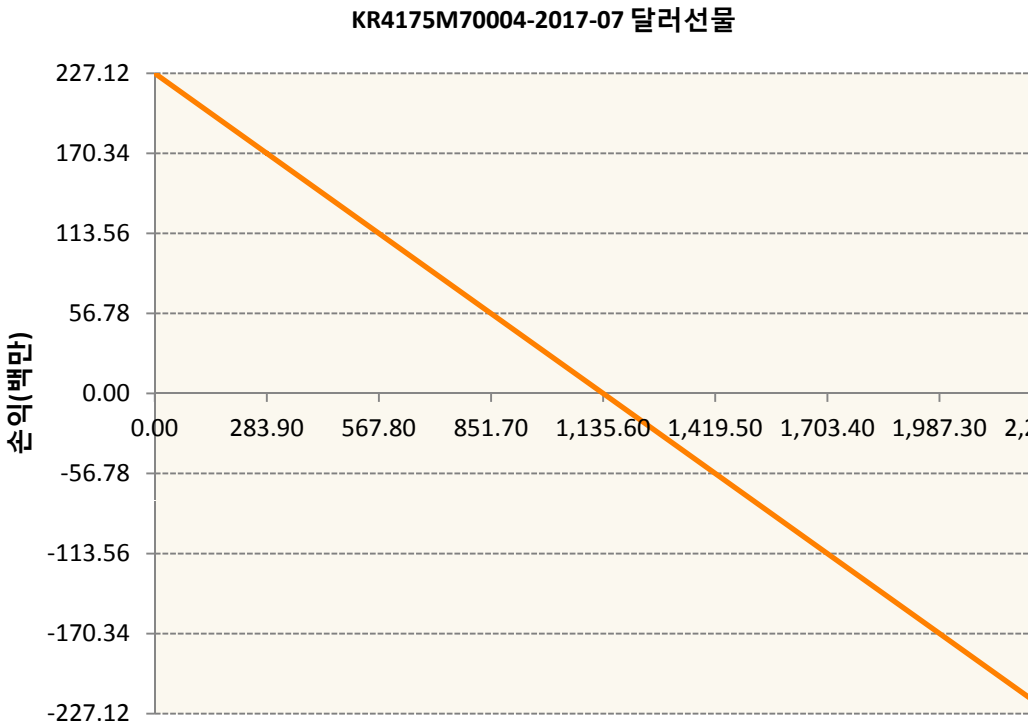
2. 만기시점의 손익구조



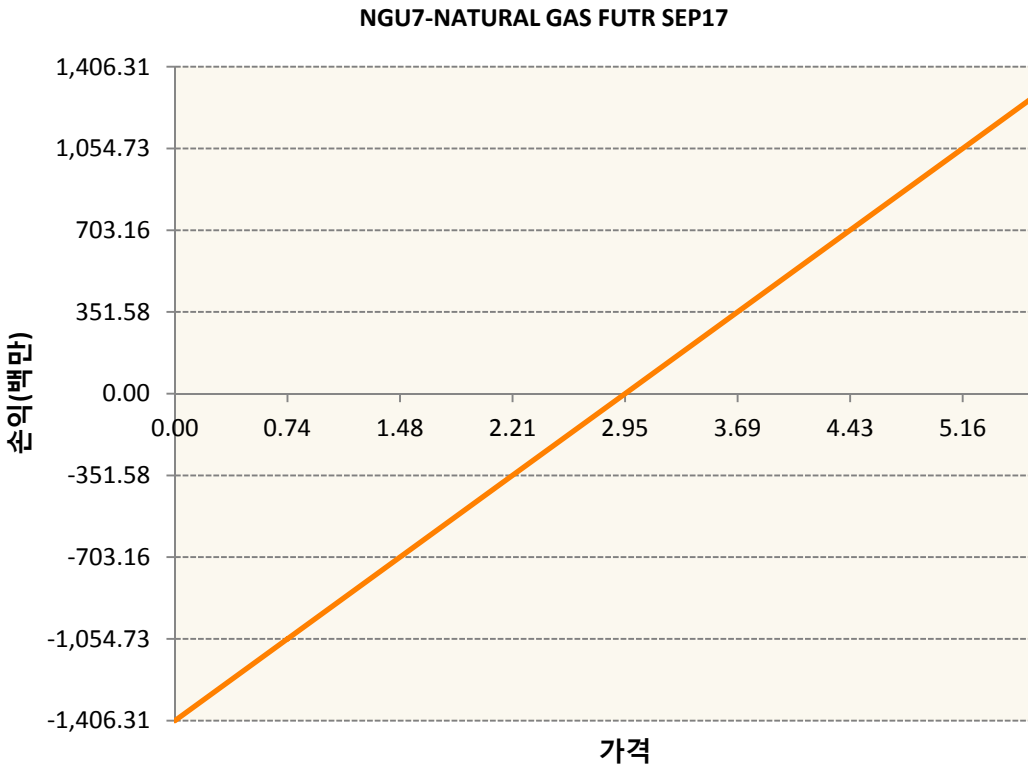


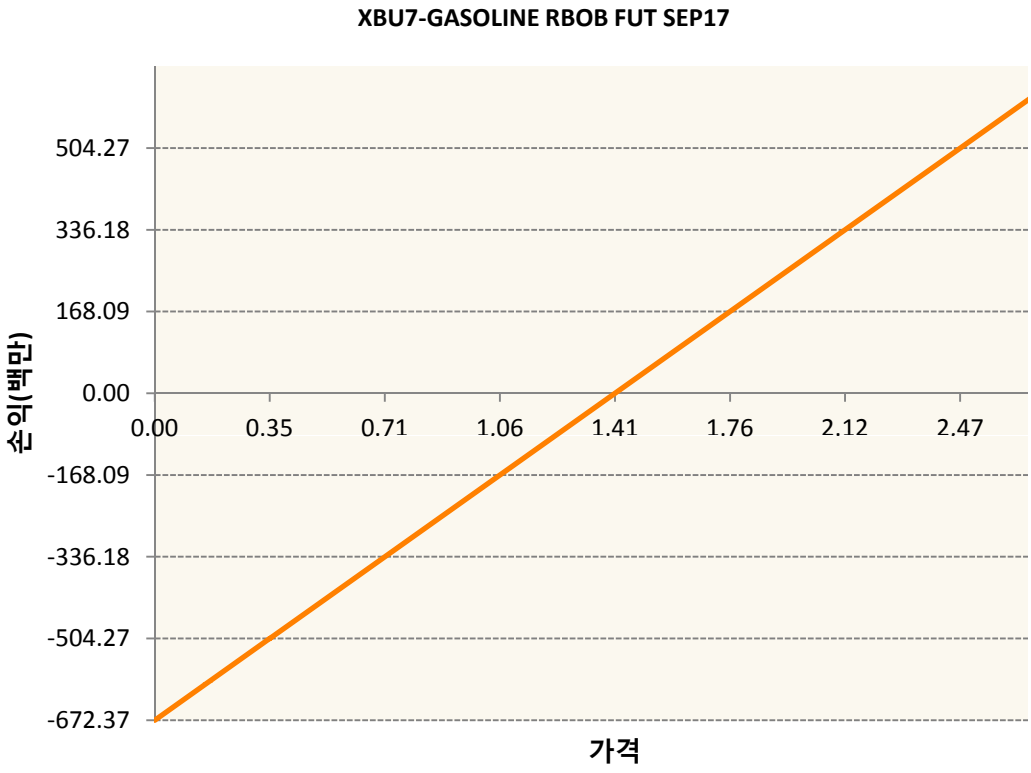

-641.52
-962.28
-1,283.04
가격


HOU7-NY HARB ULSD FUT SEP17
496.18
330.79
165.39
0.00
-165.39
-330.79
-496.18
-661.58
0.00
0.35
0.70
1.04
1.39
1.74
2.09
2.43
손익(백만)
가격


KR4175M70004-2017-07 달러선물
227.12
170.34
113.56
56.78
0.00
-56.78
-113.56
-170.34
-227.12
0.00
283.90
567.80
851.70
1,135.60
1,419.50
1,703.40
1,987.30
손익(백만)

가격


NGU7-NATURAL GAS FUTR SEP17
1,406.31
1,054.73
703.16
351.58
0.00
-351.58
-703.16
-1,054.73
-1,406.31
0.00
0.74
1.48
2.21
2.95
3.69
4.43
5.16
손익(백만)
가격


XBU7-GASOLINE RBOB FUT SEP17
504.27
336.18
168.09
0.00
-168.09
-336.18
-504.27
-672.37
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	67
COU7	BRENT CRUDE FUTR SEP17	103
HOU7	NY HARB ULSD FUT SEP17	53
KR4175M70(	2017-07 달러선물	18
NGU7	NATURAL GAS FUTR SEP17	113
XBU7	GASOLINE RBOB FUT SEP17	54

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

783

공시일	2017-06-27
기준일	2017-06-26

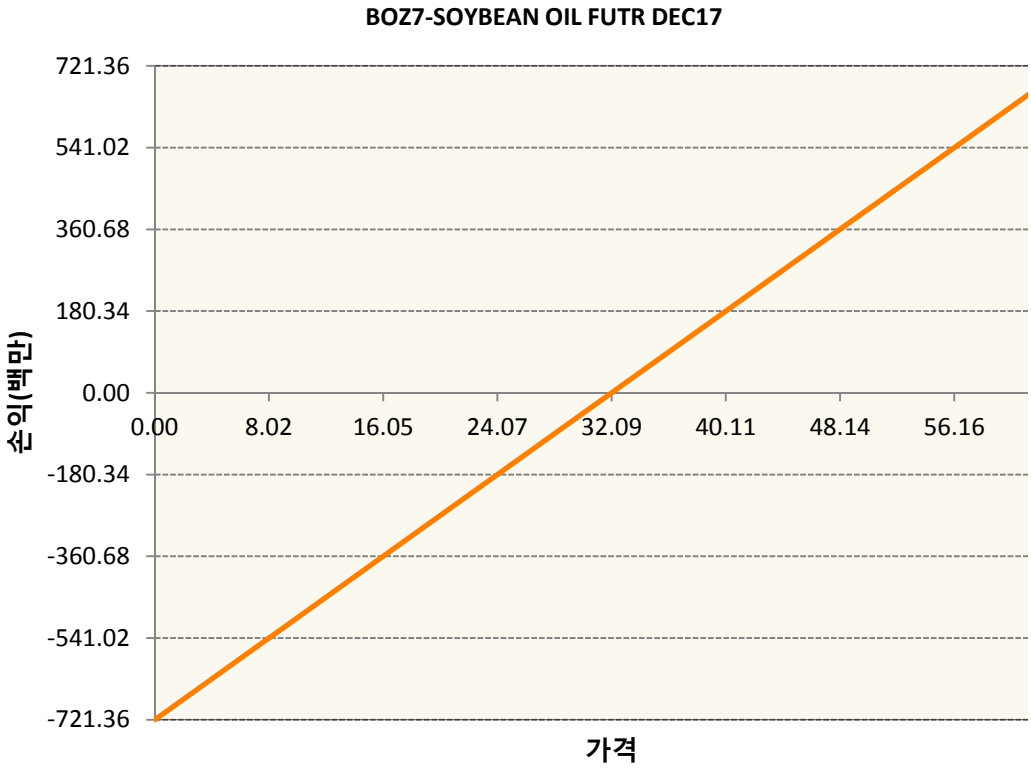
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

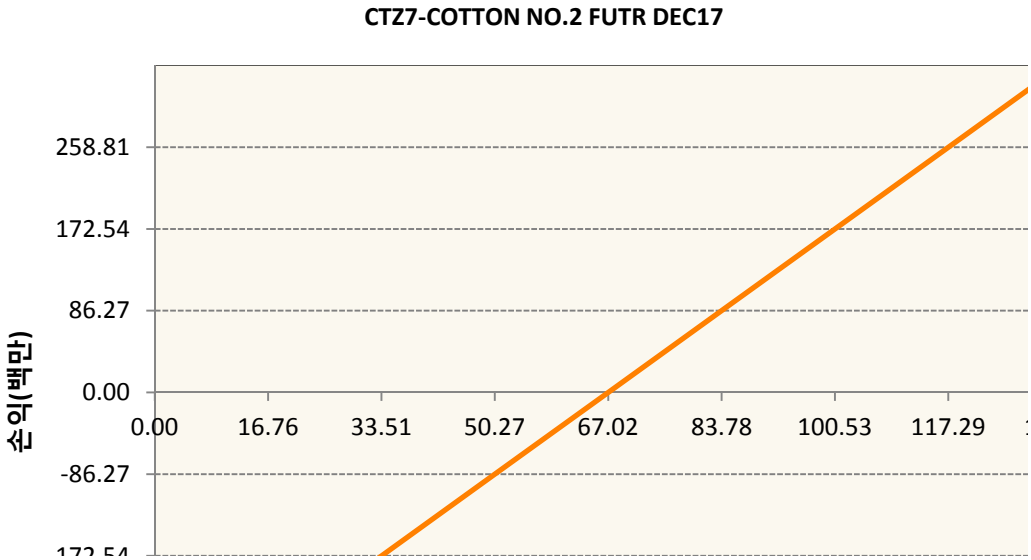
1. 계약금액

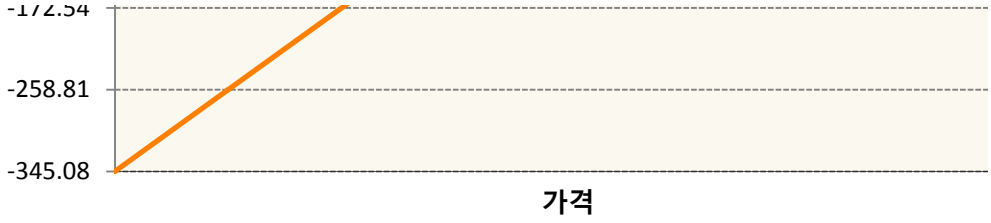
(단위:백만원)

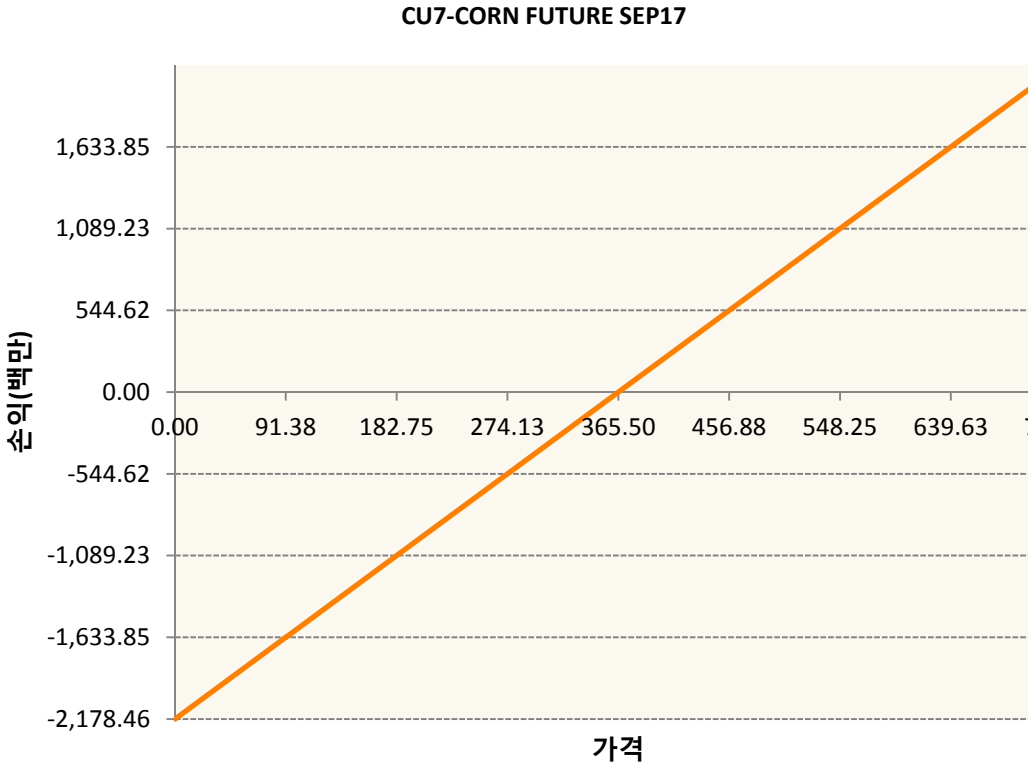
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	8,155	397	7,758	

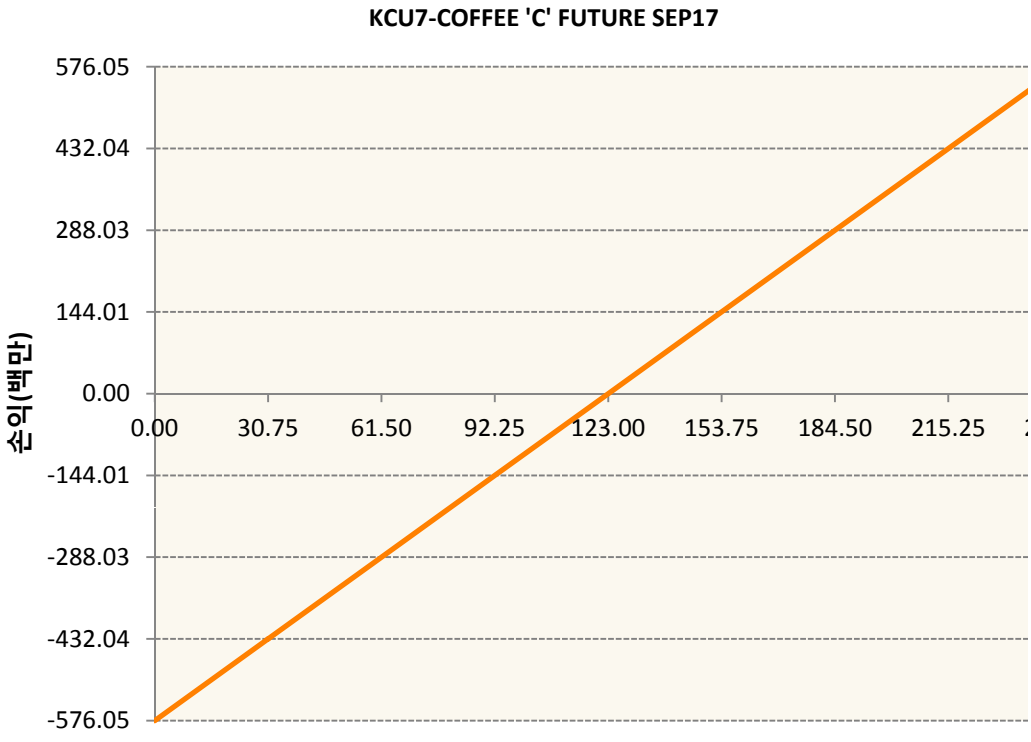
2. 만기시점의 손익구조





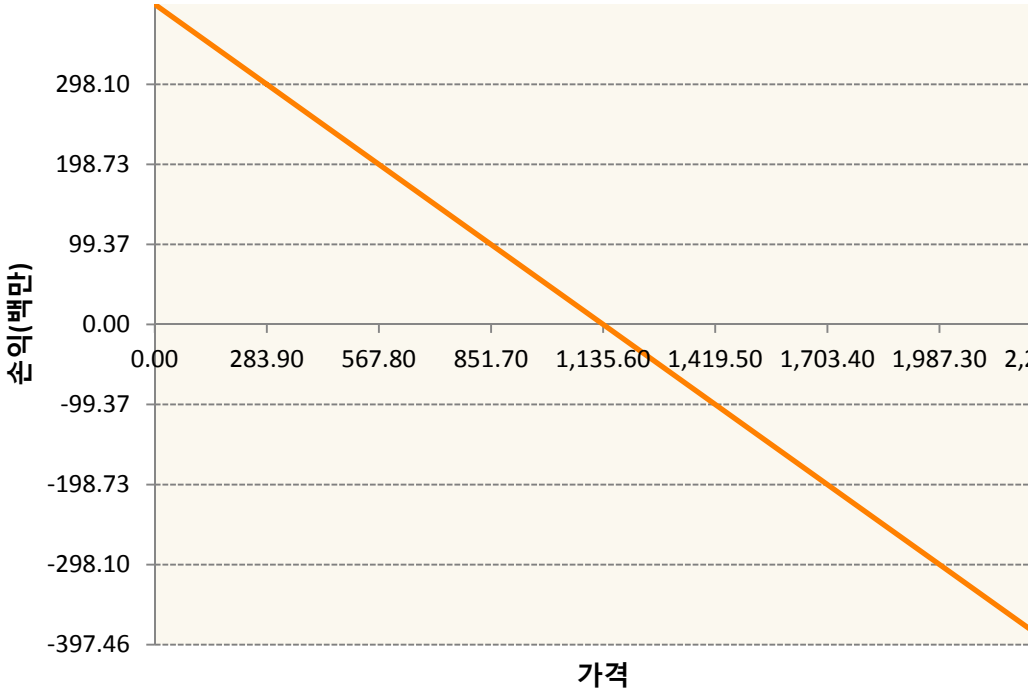

-258.81
-345.08
가격


CU7-CORN FUTURE SEP17
1,633.85
1,089.23
544.62
0.00
-544.62
-1,089.23
-1,633.85
-2,178.46
0.00
91.38
182.75
274.13
365.50
456.88
548.25
639.63
순익(백만)
가격

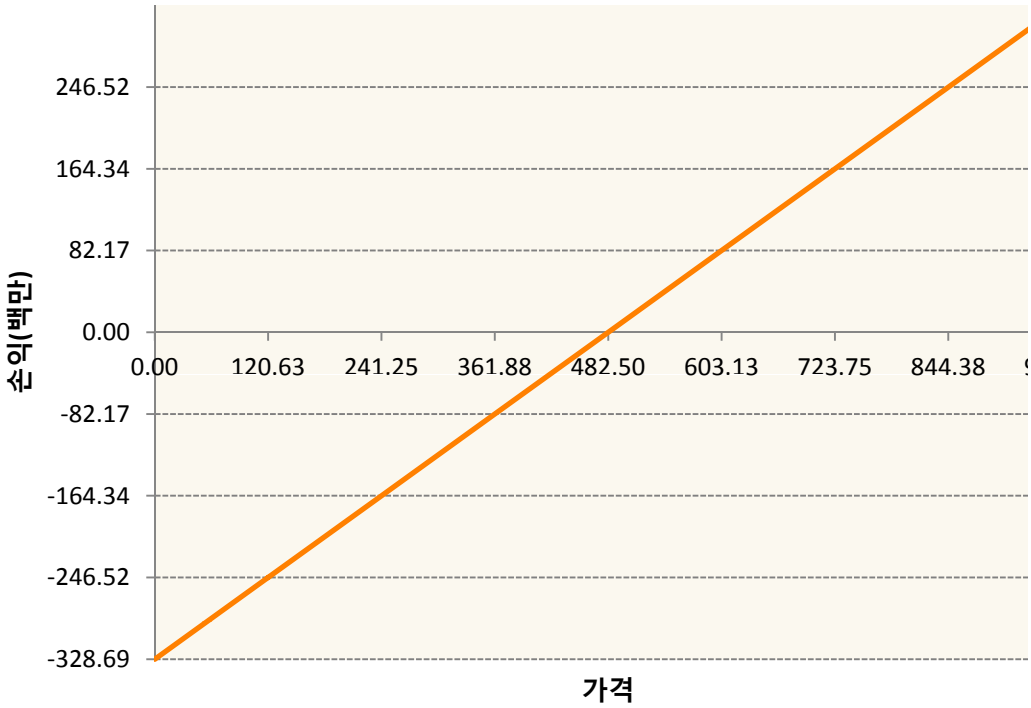

KCU7-COFFEE 'C' FUTURE SEP17
576.05
432.04
288.03
144.01
0.00
-144.01
-288.03
-432.04
-576.05
0.00
30.75
61.50
92.25
123.00
153.75
184.50
215.25
순익(백만)

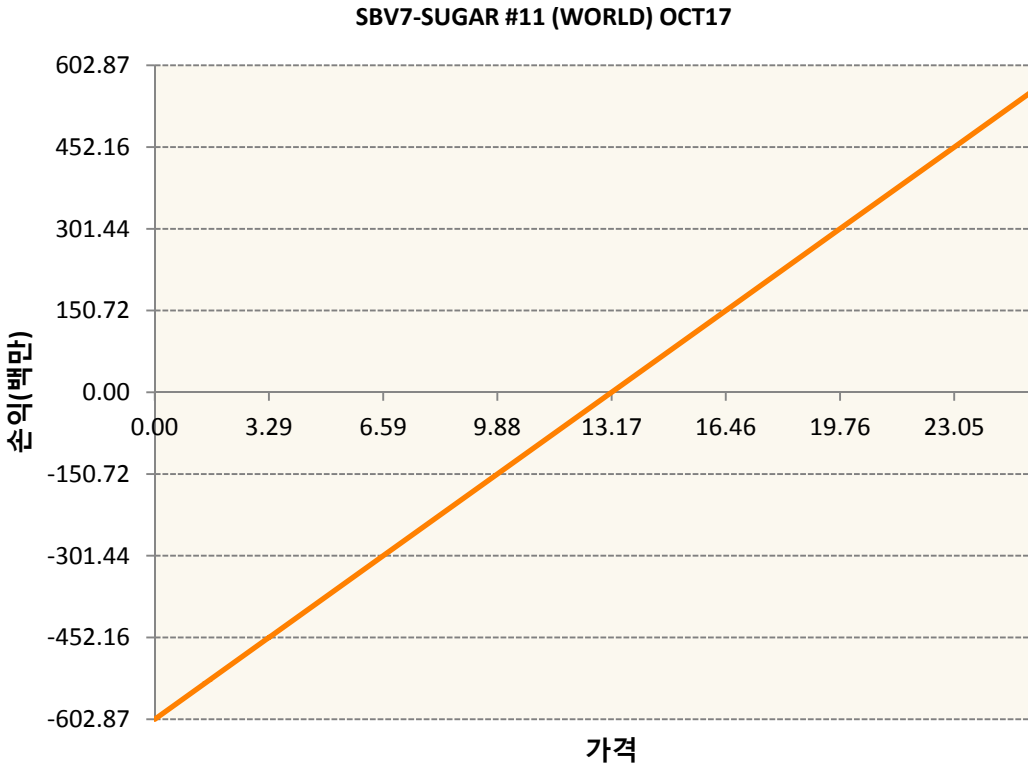
가격

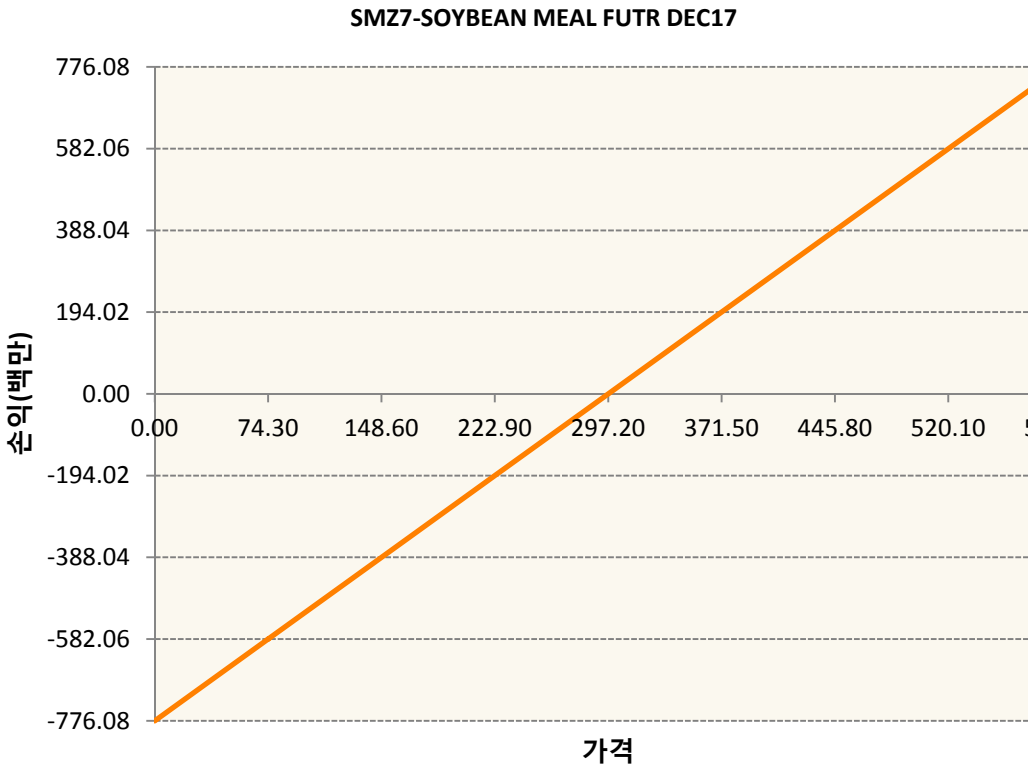
KR4175M70004-2017-07 달러선물

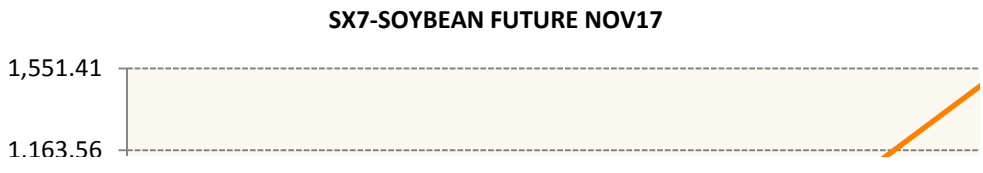


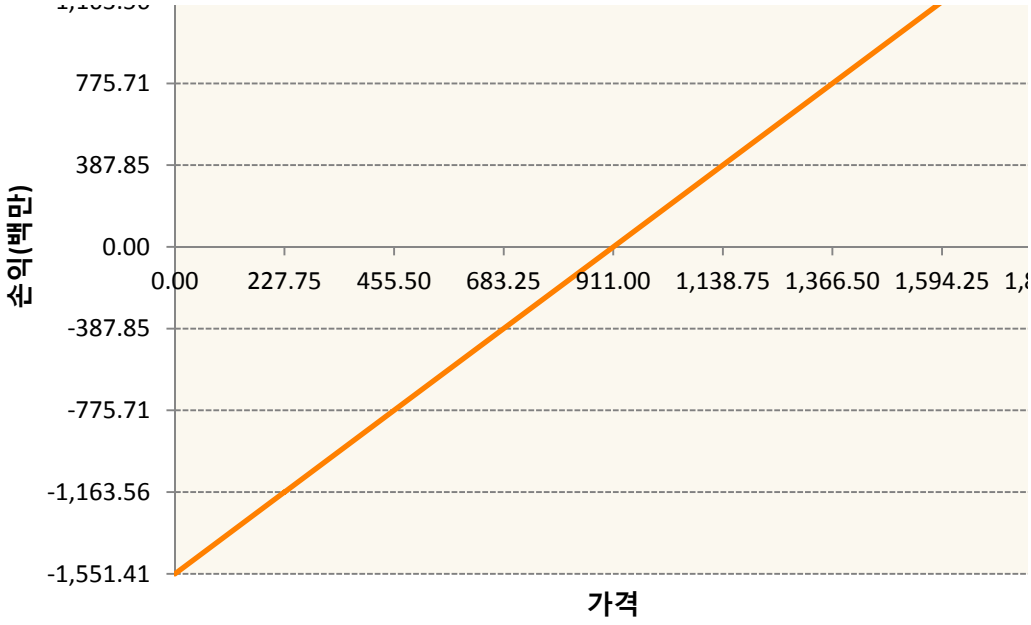
KWU7-KC HRW WHEAT FUT SEP17

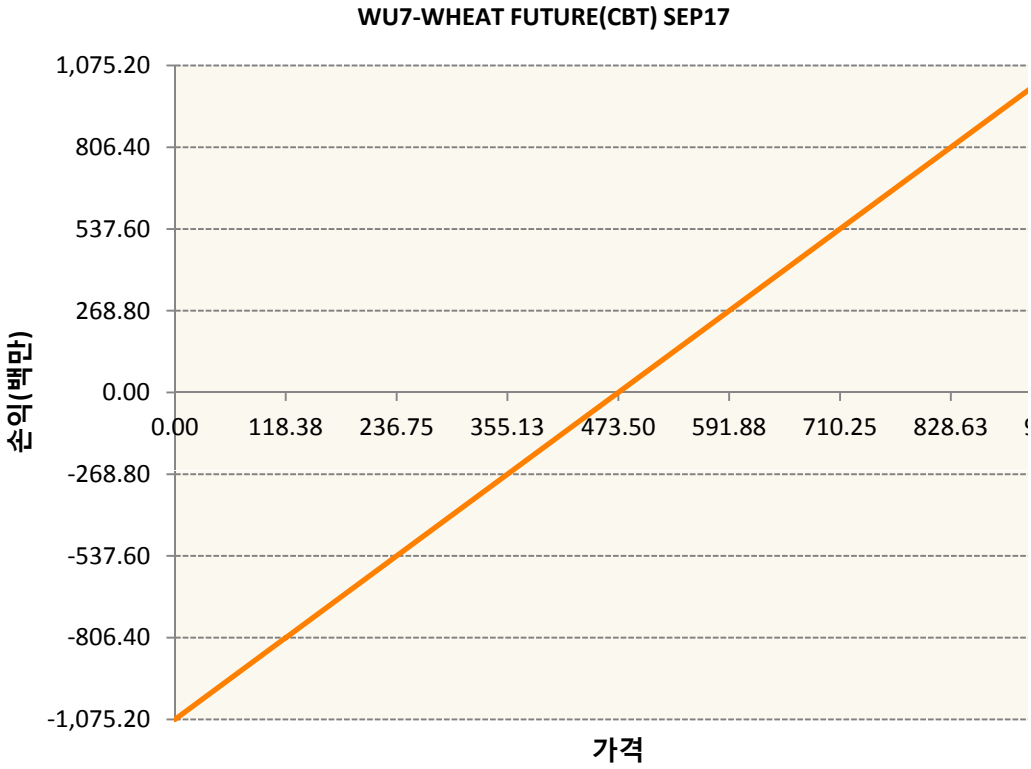



SBV7-SUGAR #11 (WORLD) OCT17
602.87
452.16
301.44
150.72
0.00
-150.72
-301.44
-452.16
-602.87
0.00
3.29
6.59
9.88
13.17
16.46
19.76
23.05
손익(백만)
가격


SMZ7-SOYBEAN MEAL FUTR DEC17
776.08
582.06
388.04
194.02
0.00
-194.02
-388.04
-582.06
-776.08
0.00
74.30
148.60
222.90
297.20
371.50
445.80
520.10
손익(백만)
가격


SX7-SOYBEAN FUTURE NOV17
1,551.41
1,163.56





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
BOZ7	SOYBEAN OIL FUTR DEC17	58
CTZ7	COTTON NO.2 FUTR DEC17	28
CU7	CORN FUTURE SEP17	174
KCU7	COFFEE 'C' FUTURE SEP17	46
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)

741