공시일	2017-06-28
기준일	2017-06-27

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	2017-06-28
기준일	2017-06-27

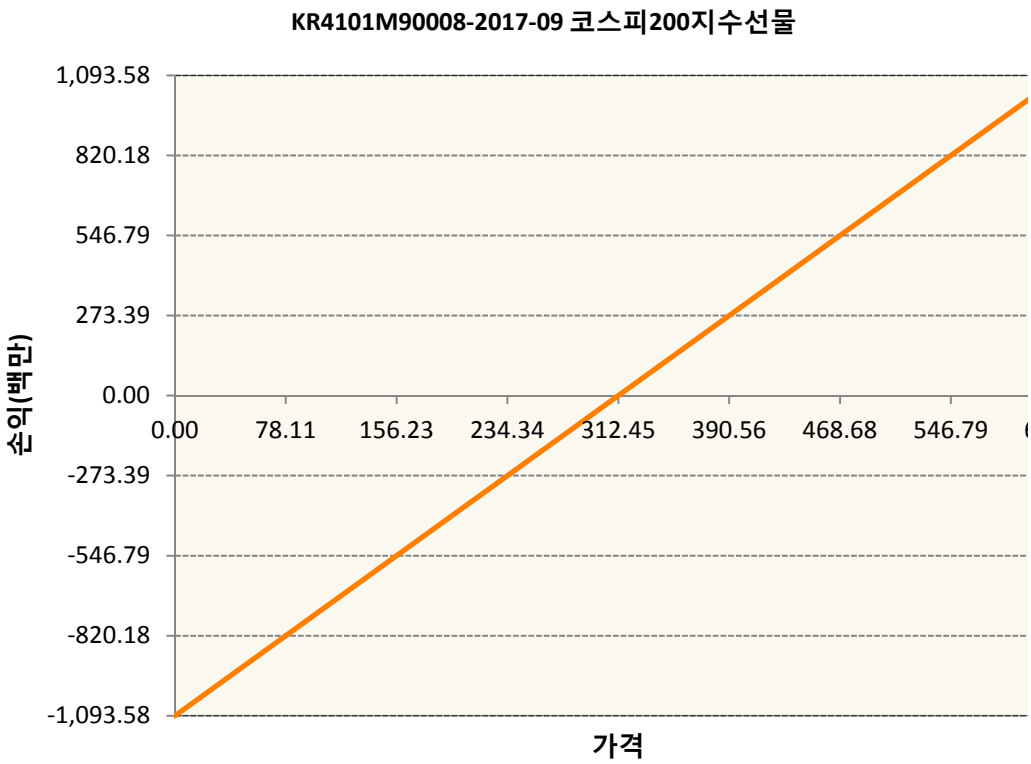
스마트인덱스모

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	1,094	0	1,094	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	2017-06-28
기준일	2017-06-27

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	1,003

* 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	2017-06-28
기준일	2017-06-27

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	377

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

326

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-06-28
기준일	2017-06-27

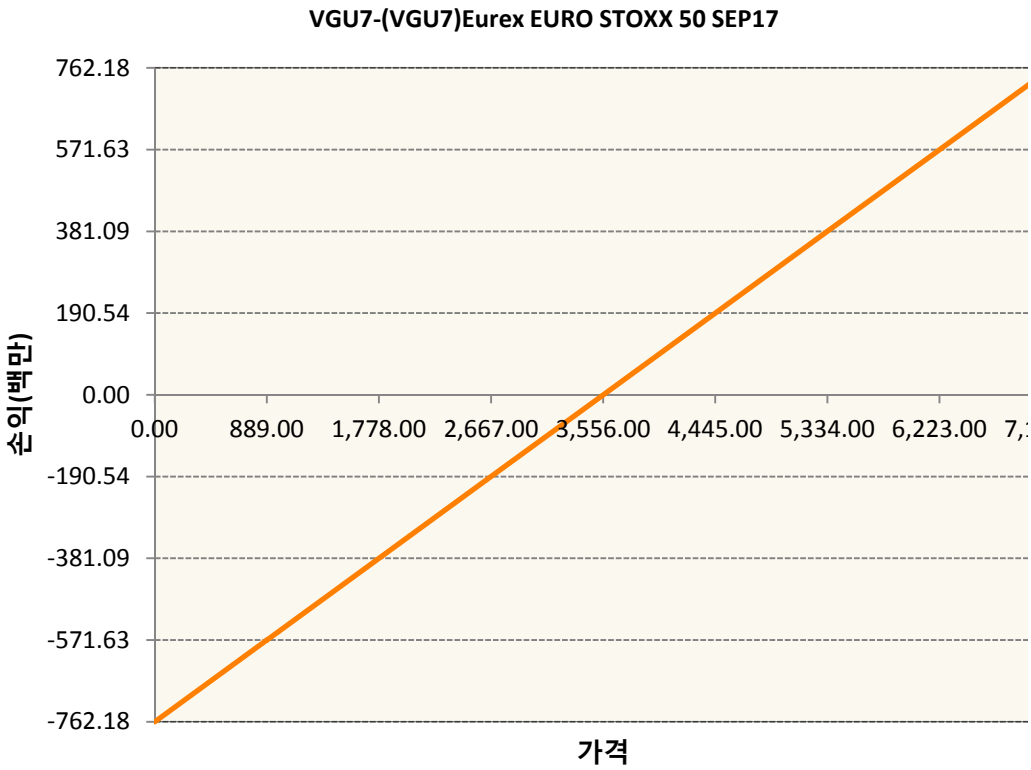
유로인덱스모(주식-파생형)

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)

55

공시일	2017-06-28
기준일	2017-06-27

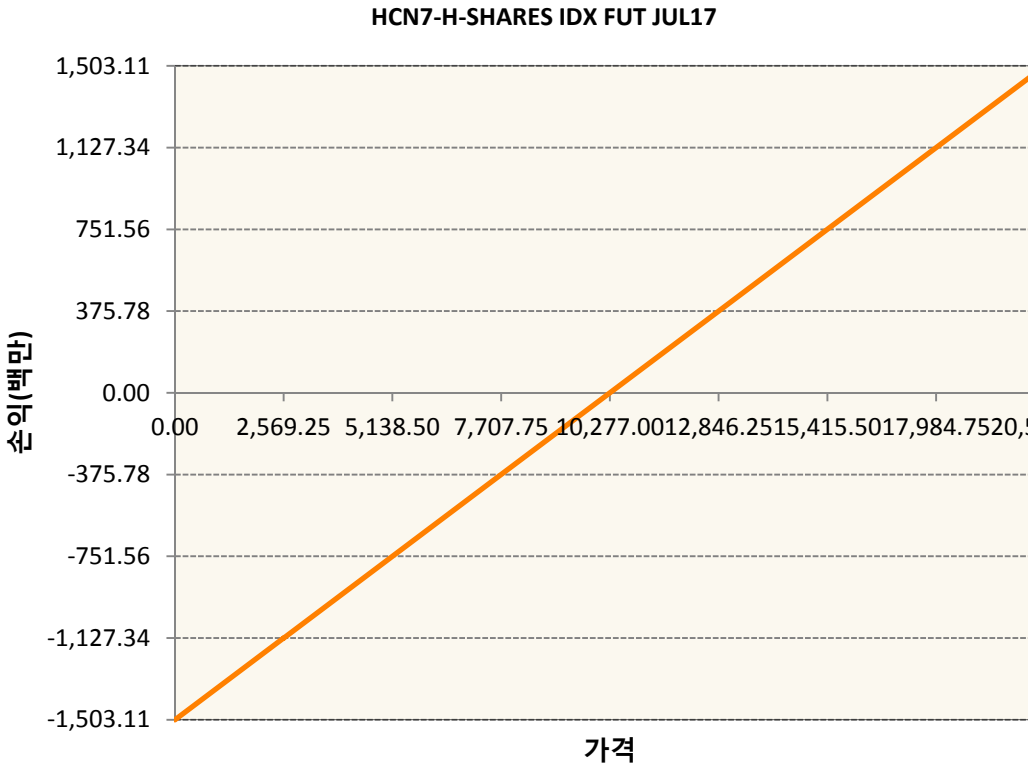
차이나인덱스모(주식-파생형)

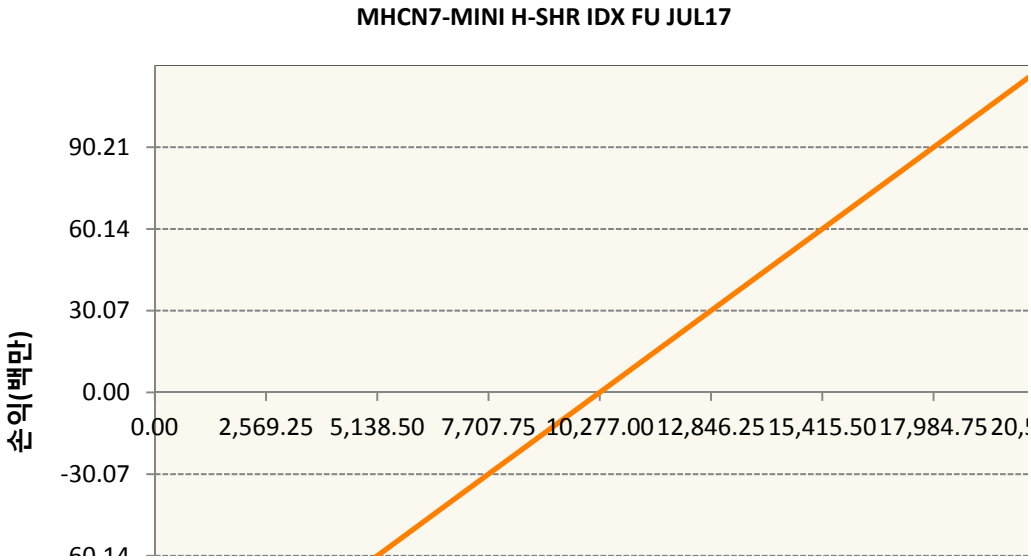
1. 계약금액

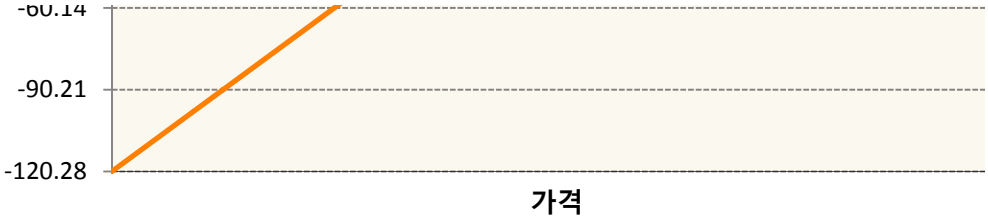
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,623	0	1,623	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

HCN7	H-SHARES IDX FUT JUL17	120
MHCN7	MINI H-SHR IDX FU JUL17	10

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

131

공시일	2017-06-28
기준일	2017-06-27

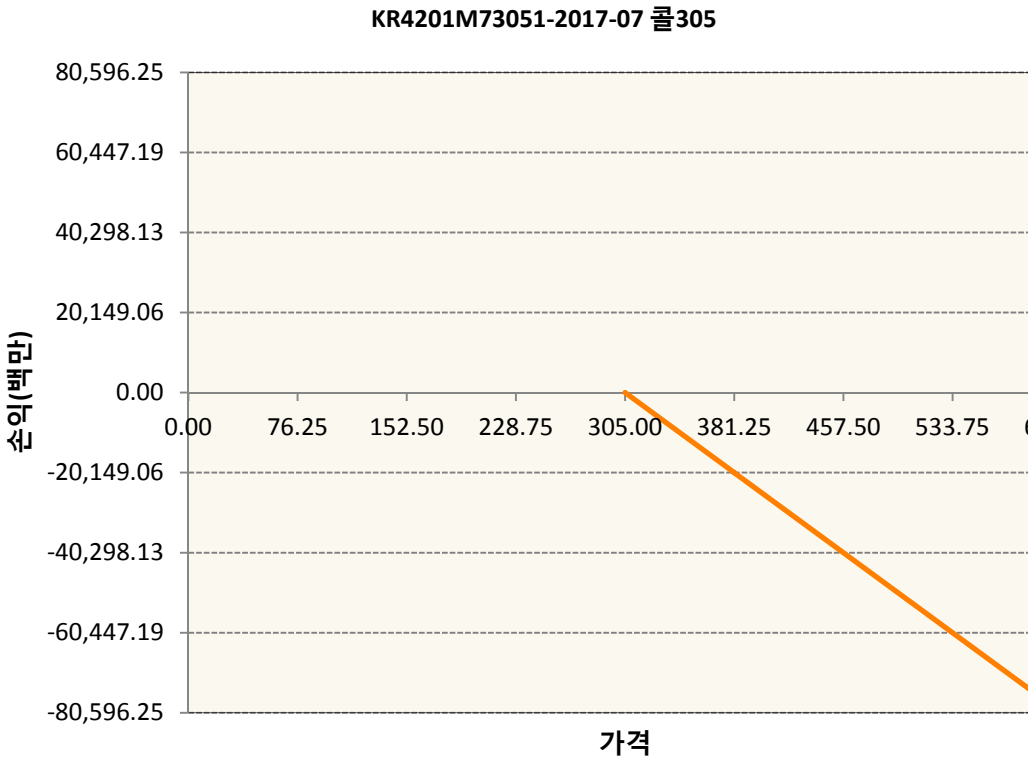
커버드콜모(주식혼합-파생형)

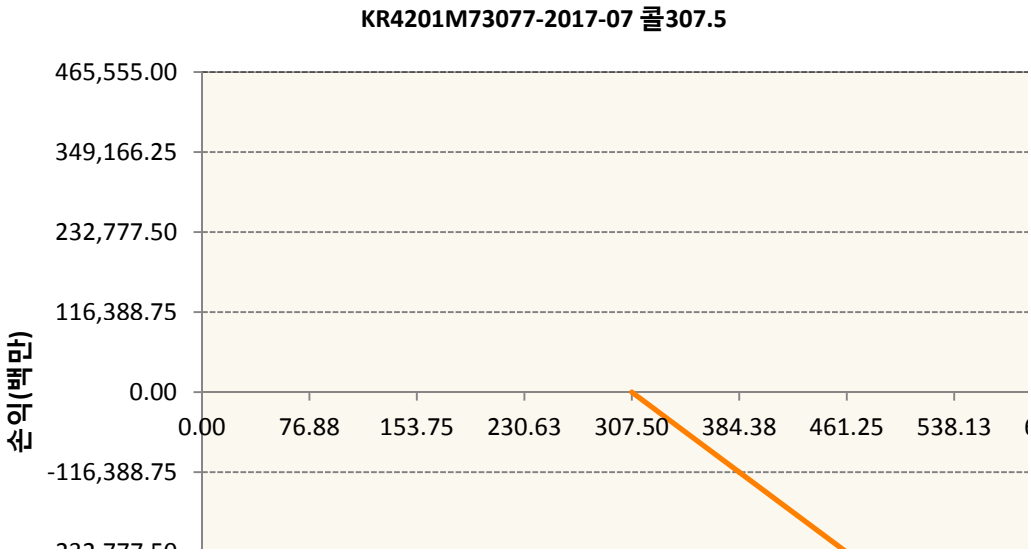
1. 계약금액

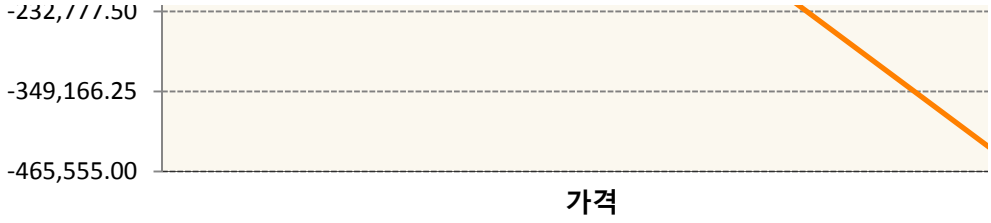
(단위:백만원)

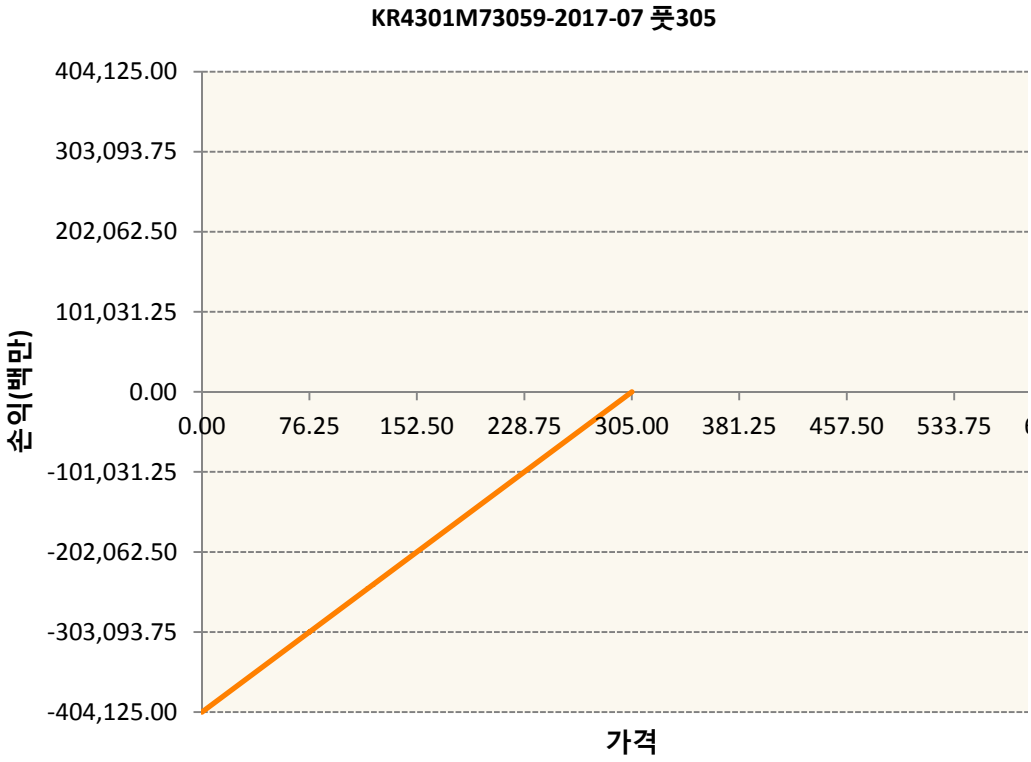
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	45,850	-45,850	장내
누계	유가증권	옵션	0	981,026	-981,026	장내

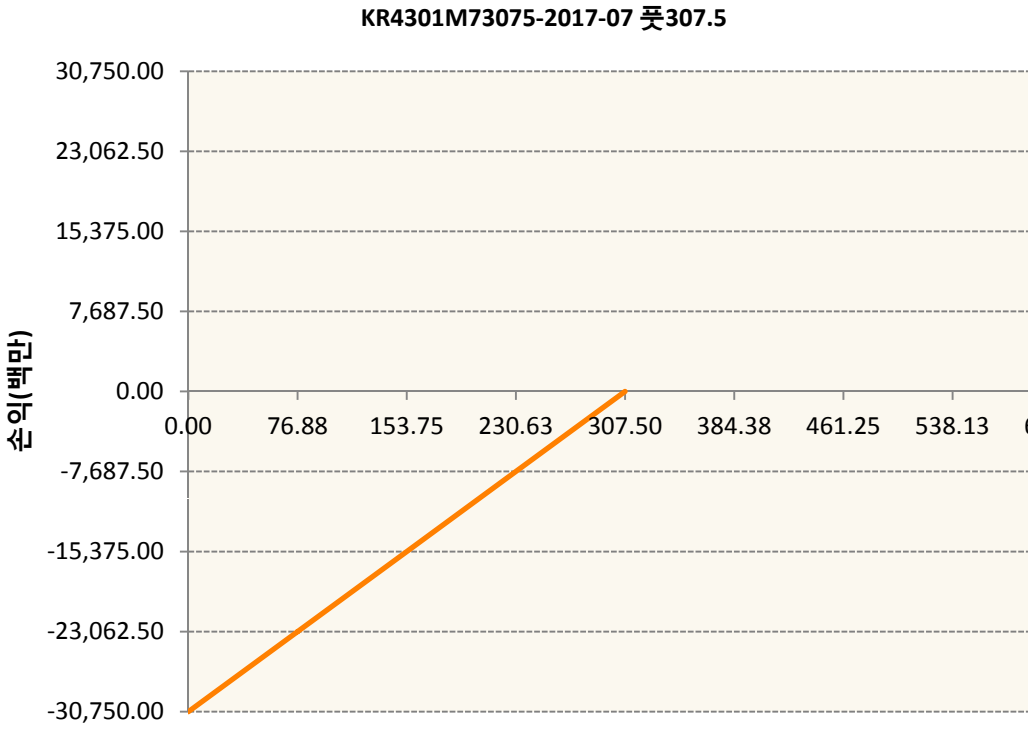
2. 만기시점의 손익구조






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


KR4301M73059-2017-07 풋305
404,125.00
303,093.75
202,062.50
101,031.25
0.00
-101,031.25
-202,062.50
-303,093.75
-404,125.00
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						6,409
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	2,063	2,062	2,061	2,059	2,055	2,049	2,041
-5.33%	2,038	2,022	2,000	1,975	1,945	1,912	1,876
-2.67%	1,621	1,557	1,493	1,429	1,364	1,299	1,235
0%	110	78	41	0	-44	-90	-139
2.67%	-2,015	-2,017	-2,022	-2,029	-2,040	-2,053	-2,070
5.33%	-4,211	-4,211	-4,211	-4,212	-4,213	-4,214	-4,217
8.00%	-6,409	-6,409	-6,409	-6,409	-6,409	-6,409	-6,409
KR4201M73(	2017-07 콜307.5						35,880
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	8,882	8,881	8,879	8,874	8,864	8,848	8,823
-5.33%	8,839	8,795	8,730	8,643	8,535	8,405	8,257
-2.67%	7,592	7,283	6,964	6,635	6,300	5,959	5,614
0%	893	610	311	0	-321	-650	-985
2.67%	-10,726	-10,766	-10,827	-10,909	-11,013	-11,138	-11,284
5.33%	-23,282	-23,283	-23,286	-23,293	-23,305	-23,326	-23,356
8.00%	-35,875	-35,875	-35,875	-35,875	-35,876	-35,877	-35,880
KR4301M73(	2017-07 풋305						22,828
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-22,720	-22,722	-22,728	-22,740	-22,759	-22,788	-22,828
-5.33%	-11,821	-11,905	-12,012	-12,141	-12,289	-12,455	-12,636
-2.67%	-2,892	-3,213	-3,535	-3,858	-4,181	-4,505	-4,830
0%	553	390	204	0	-220	-454	-698
2.67%	918	905	881	845	793	726	643
5.33%	926	926	925	923	919	910	897
8.00%	926	926	926	926	926	925	924
KR4301M73(	2017-07 풋307.5						1,913
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,909	-1,909	-1,909	-1,909	-1,910	-1,911	-1,913
-5.33%	-1,080	-1,083	-1,087	-1,093	-1,100	-1,108	-1,118
-2.67%	-330	-351	-372	-394	-416	-438	-461
0%	59	40	21	0	-21	-43	-65
2.67%	123	121	117	111	104	96	86

5.33%	126	126	125	125	124	123	121
8.00%	126	126	126	126	126	126	125

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

75,712

공시일	2017-06-28
기준일	2017-06-27

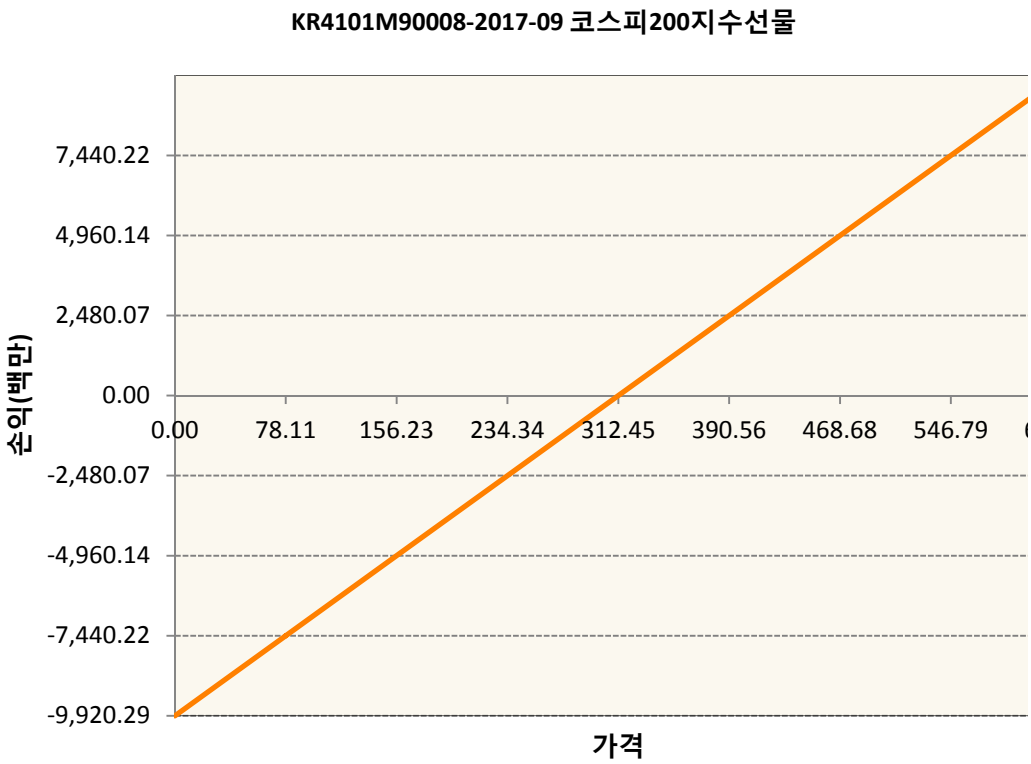
ETF스마트레버리지목표전환형6호

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	9,920	0	9,920	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101M90(2017-09 코스피200지수선물							793
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-793	-793	-793	-793	-793	-793	-793
-5.33%	-529	-529	-529	-529	-529	-529	-529
-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%	529	529	529	529	529	529	529
8.00%	793	793	793	793	793	793	793

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

512

공시일	2017-06-28
기준일	2017-06-27

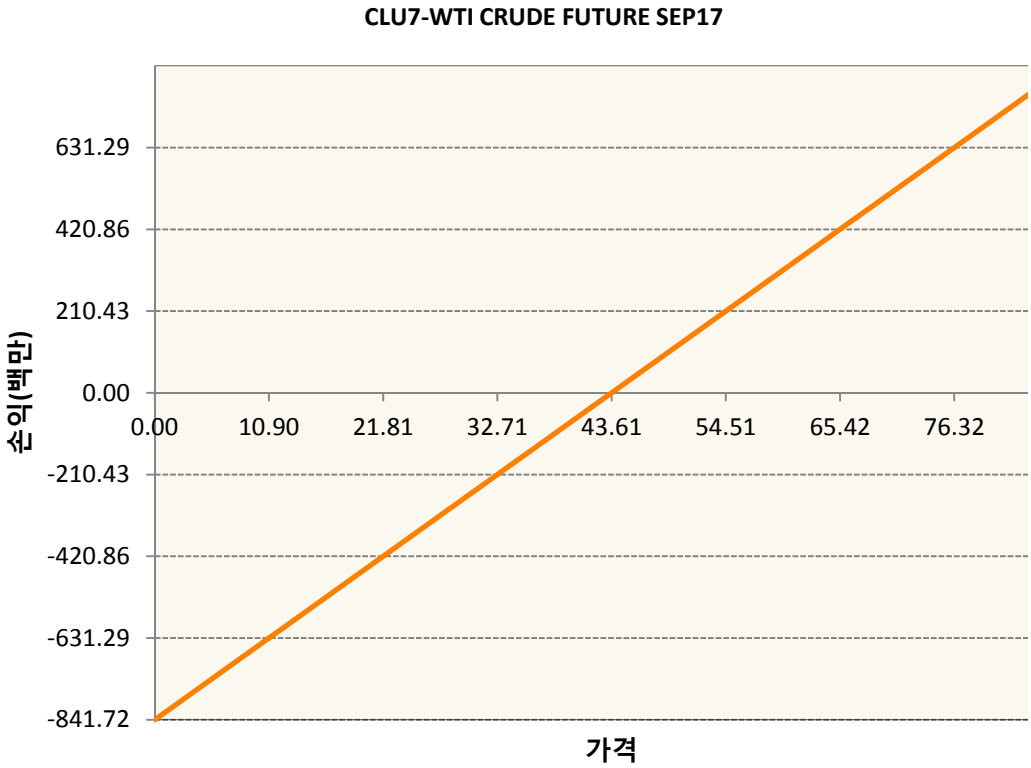
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

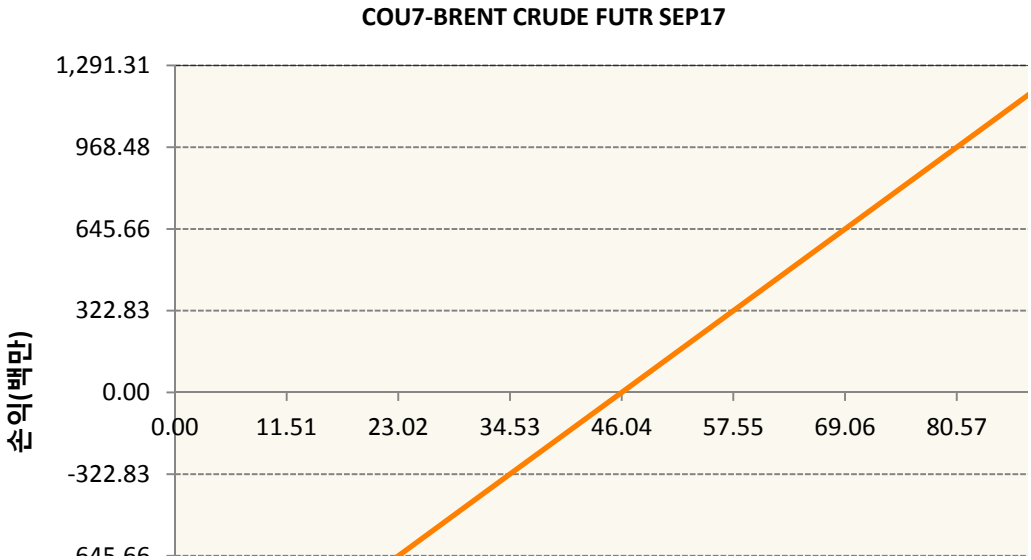
1. 계약금액

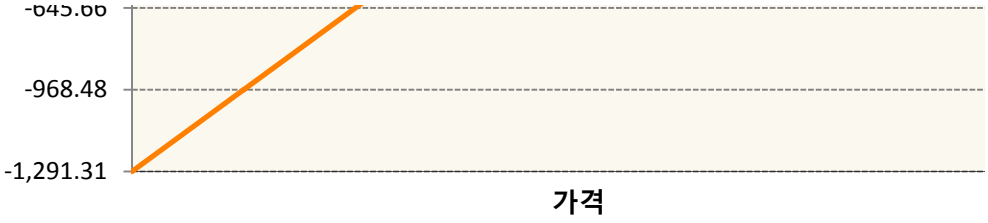
(단위:백만원)

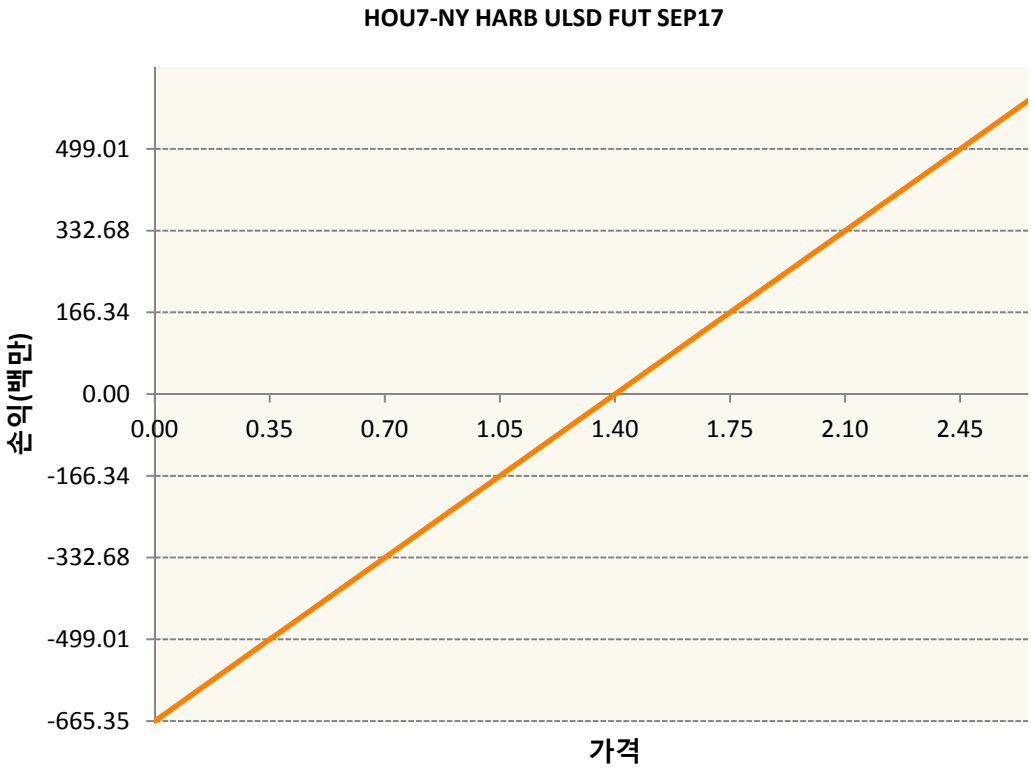
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	4,925	227	4,698	

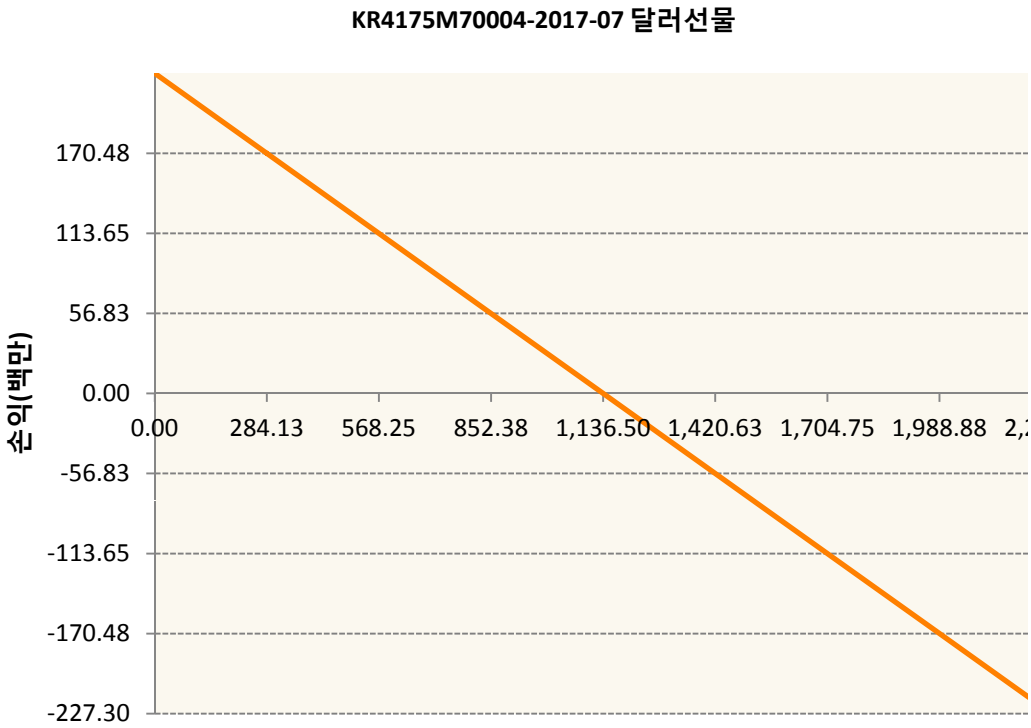
2. 만기시점의 손익구조



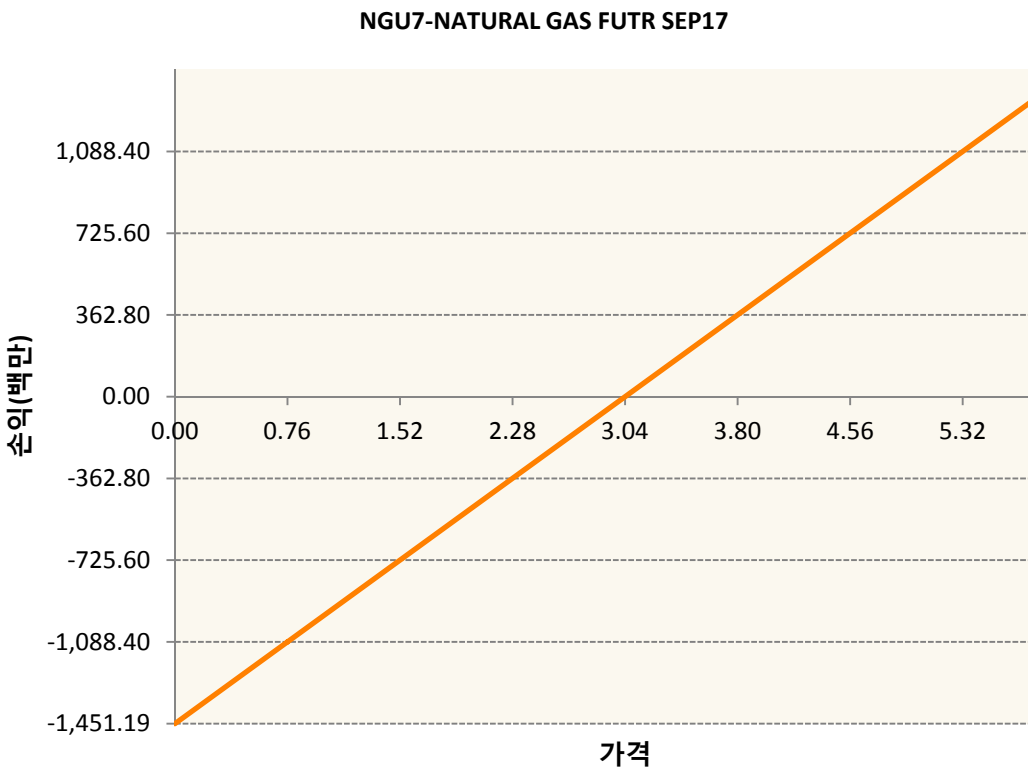


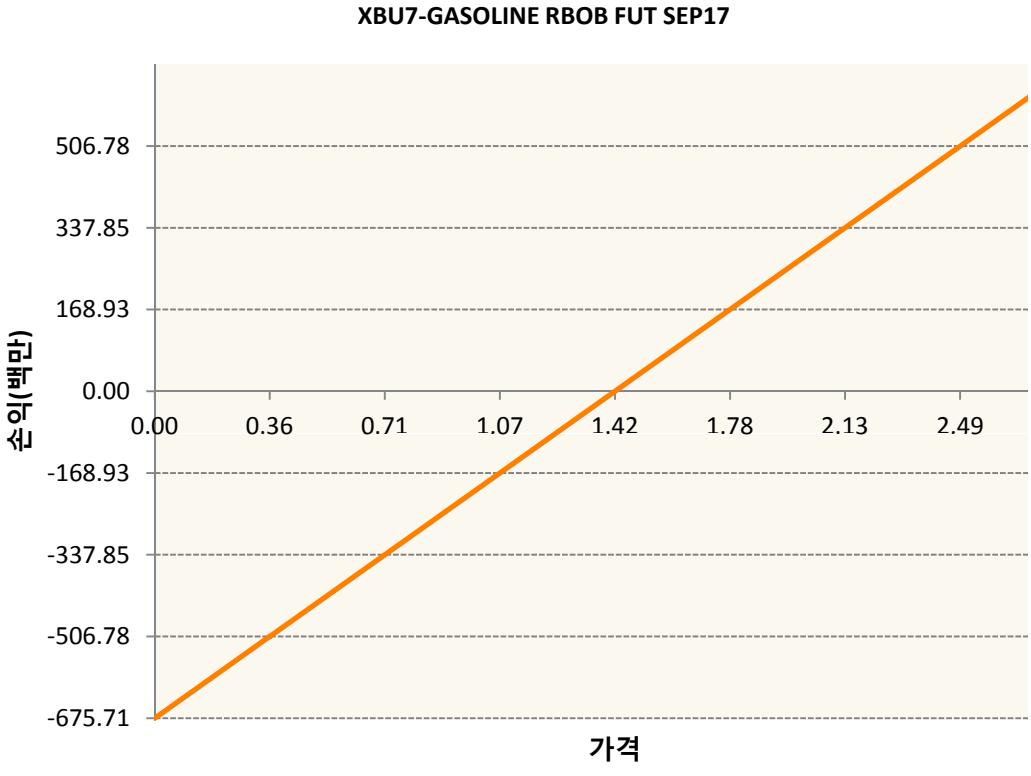

-968.48
-1,291.31
가격


HOU7-NY HARB ULSD FUT SEP17
499.01
332.68
166.34
0.00
-166.34
-332.68
-499.01
-665.35
0.00
0.35
0.70
1.05
1.40
1.75
2.10
2.45
순이익(백만)
가격


KR4175M70004-2017-07 달러선물
170.48
113.65
56.83
0.00
-56.83
-113.65
-170.48
-227.30
0.00
284.13
568.25
852.38
1,136.50
1,420.63
1,704.75
1,988.88
순이익(백만)

가격


NGU7-NATURAL GAS FUTR SEP17
1,088.40
725.60
362.80
0.00
-362.80
-725.60
-1,088.40
-1,451.19
0.00
0.76
1.52
2.28
3.04
3.80
4.56
5.32
순익(백만)
가격


XBU7-GASOLINE RBOB FUT SEP17
506.78
337.85
168.93
0.00
-168.93
-337.85
-506.78
-675.71
0.00
0.36
0.71
1.07
1.42
1.78
2.13
2.49
순익(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	116
XBU7	GASOLINE RBOB FUT SEP17	54

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

789

공시일	2017-06-28
기준일	2017-06-27

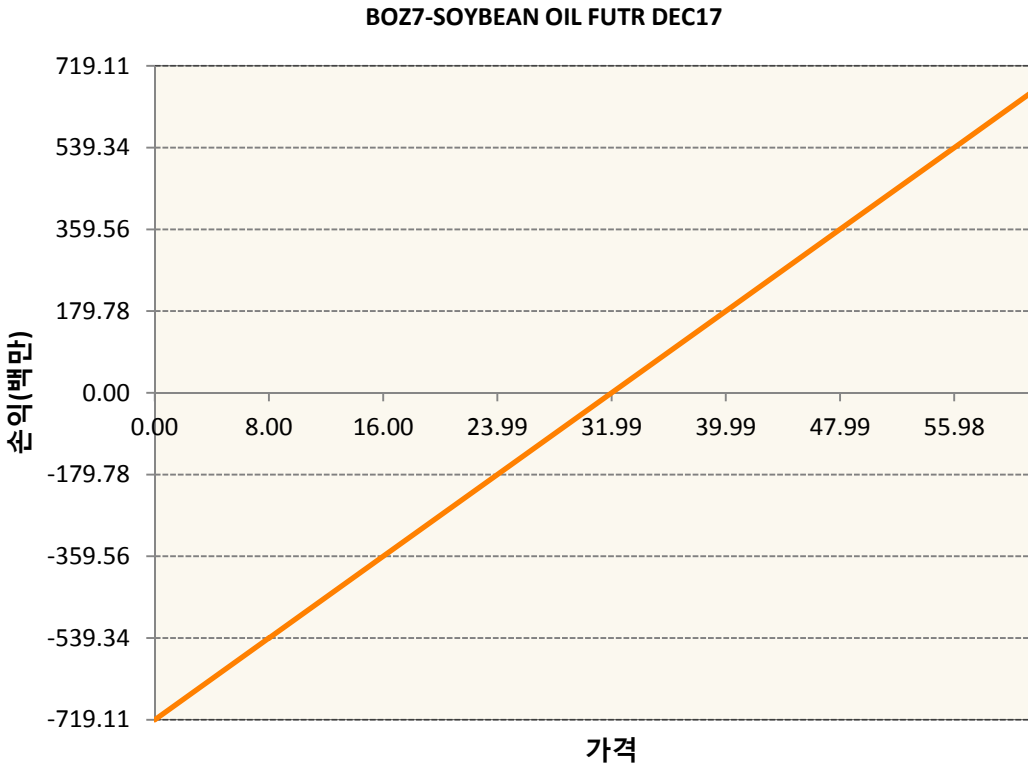
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

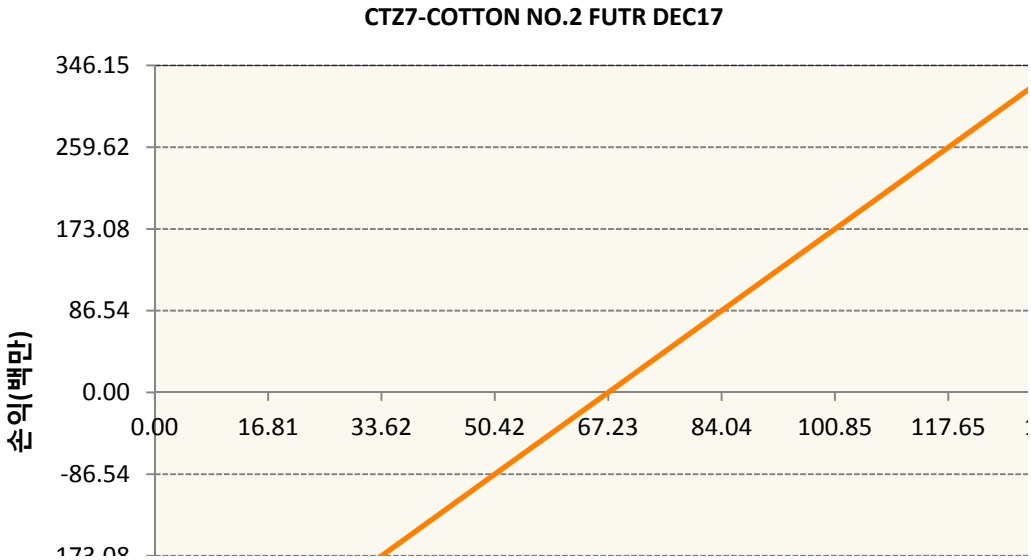
1. 계약금액

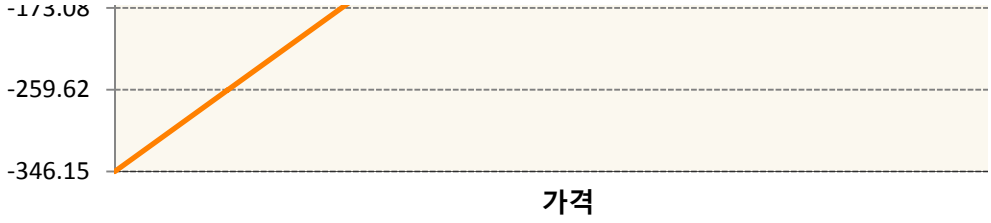
(단위:백만원)

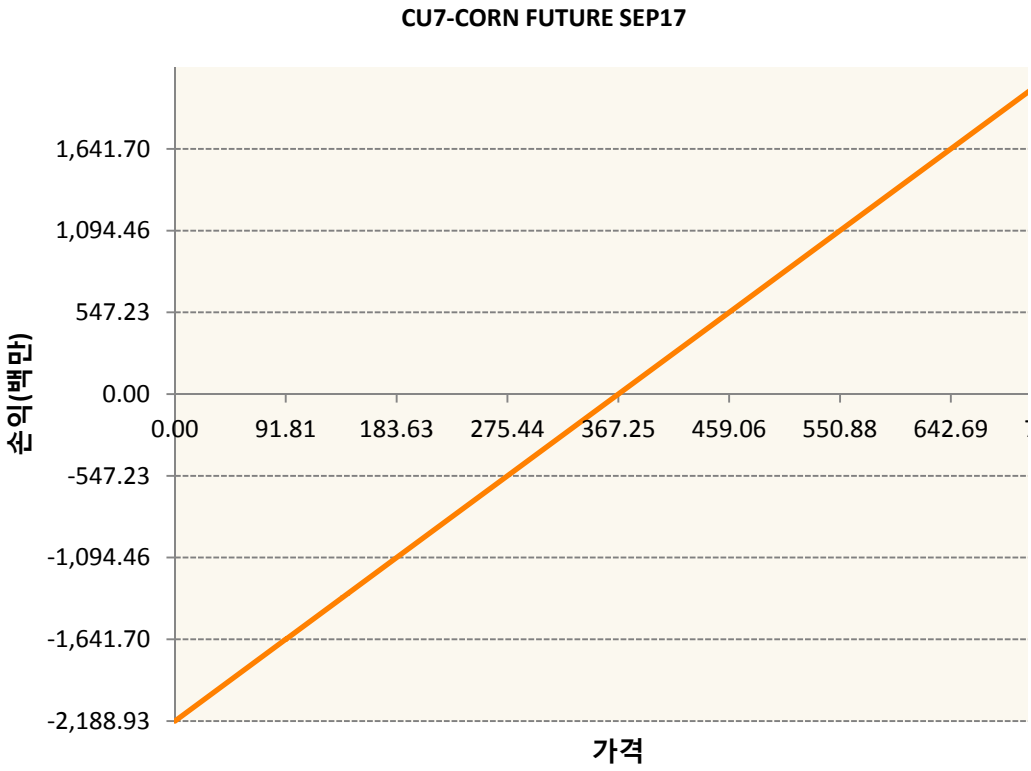
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	8,138	398	7,740	

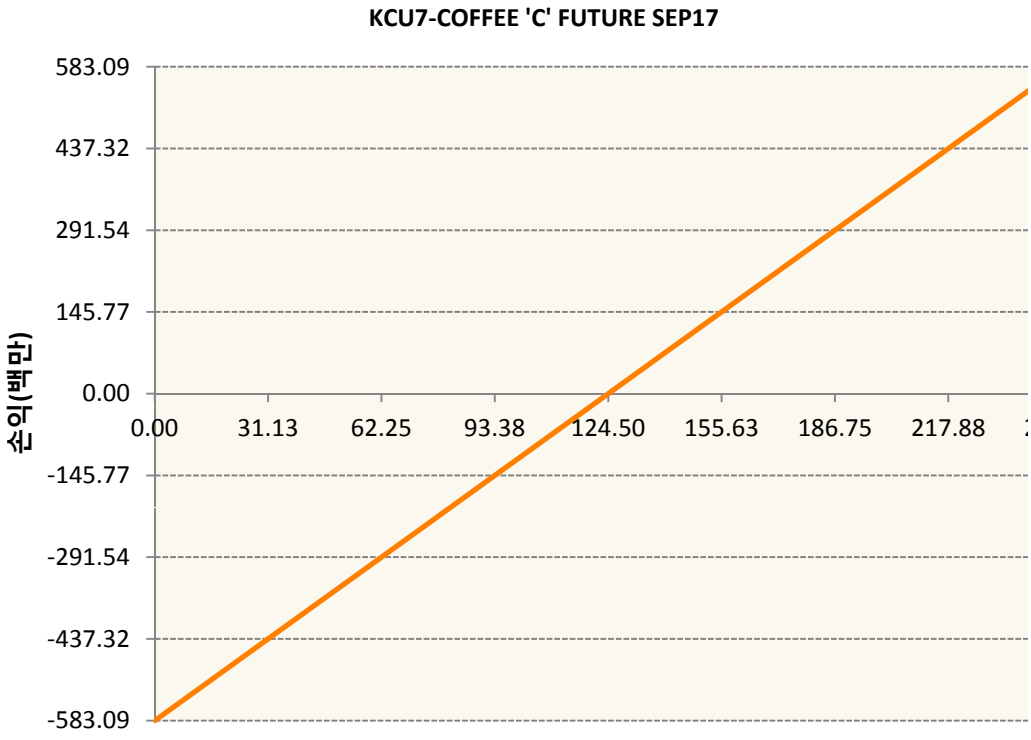
2. 만기시점의 손익구조



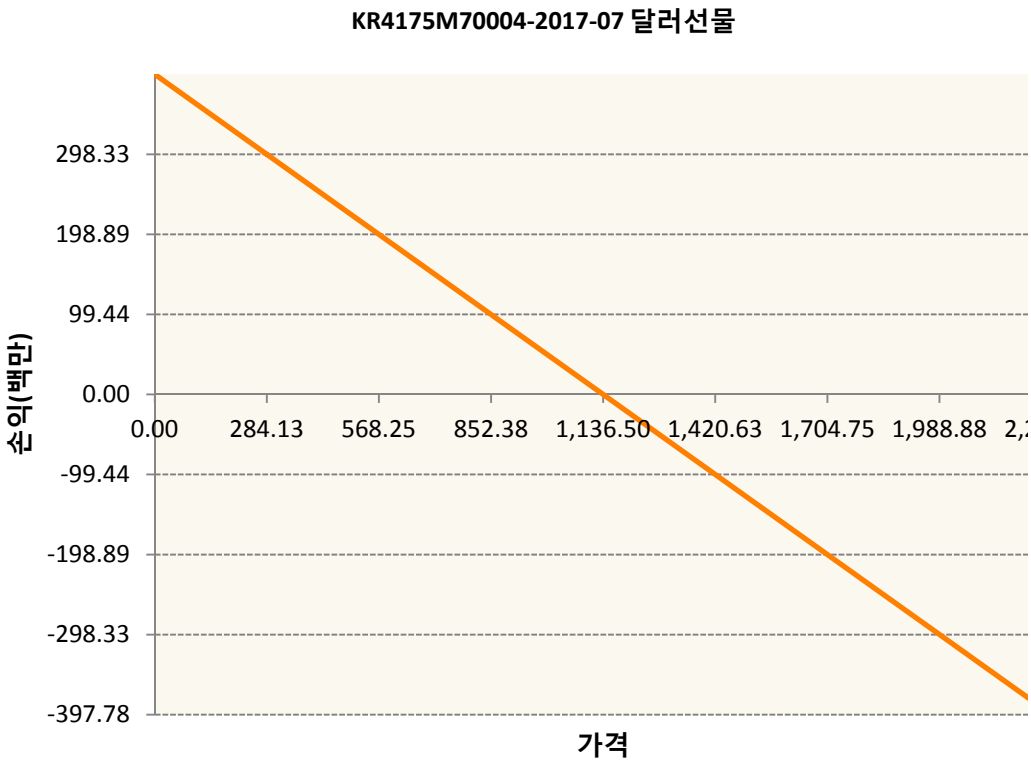


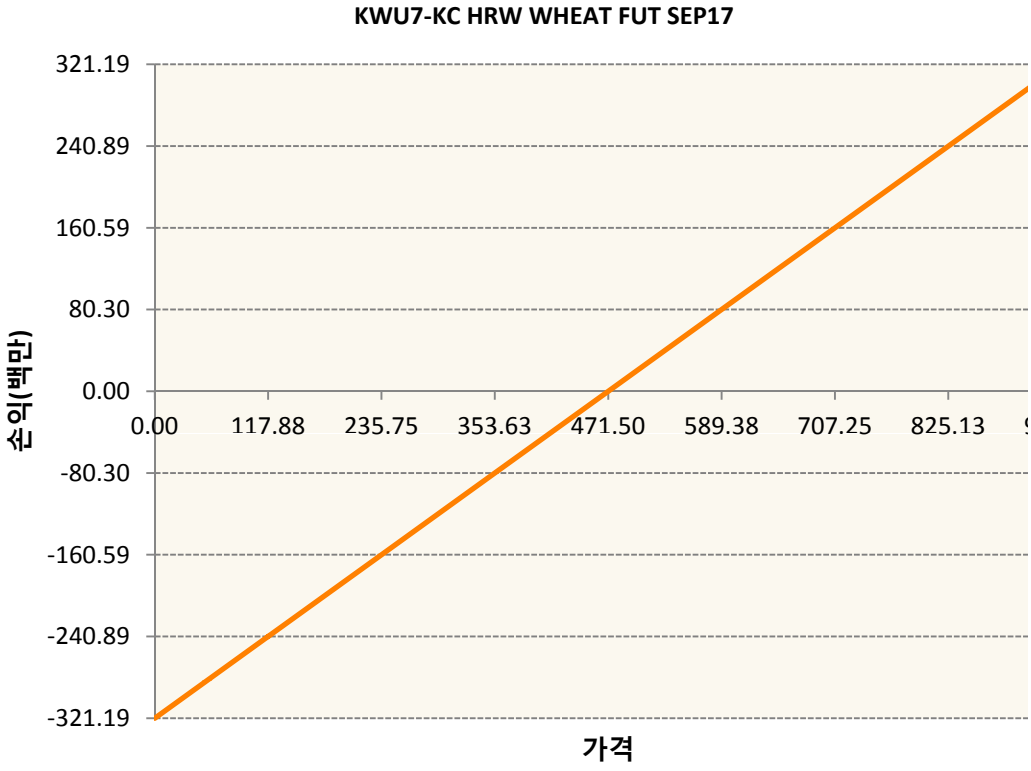

-259.62
-346.15
가격

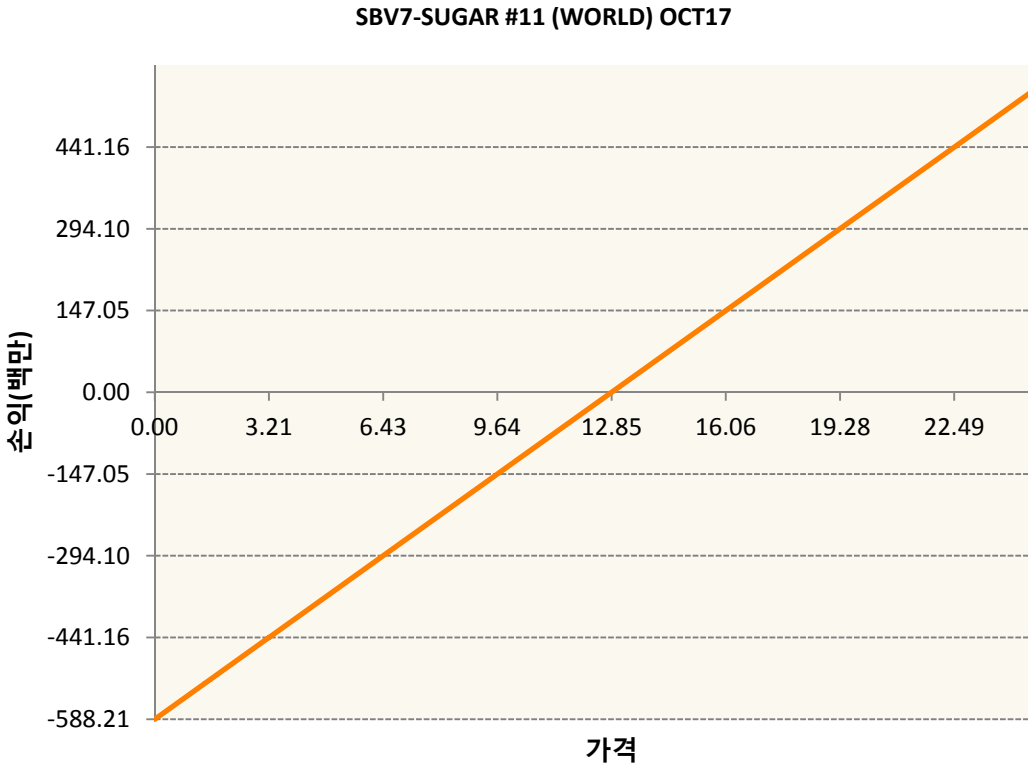

CU7-CORN FUTURE SEP17
1,641.70
1,094.46
547.23
0.00
-547.23
-1,094.46
-1,641.70
-2,188.93
0.00
91.81
183.63
275.44
367.25
459.06
550.88
642.69
순익(백만)
가격

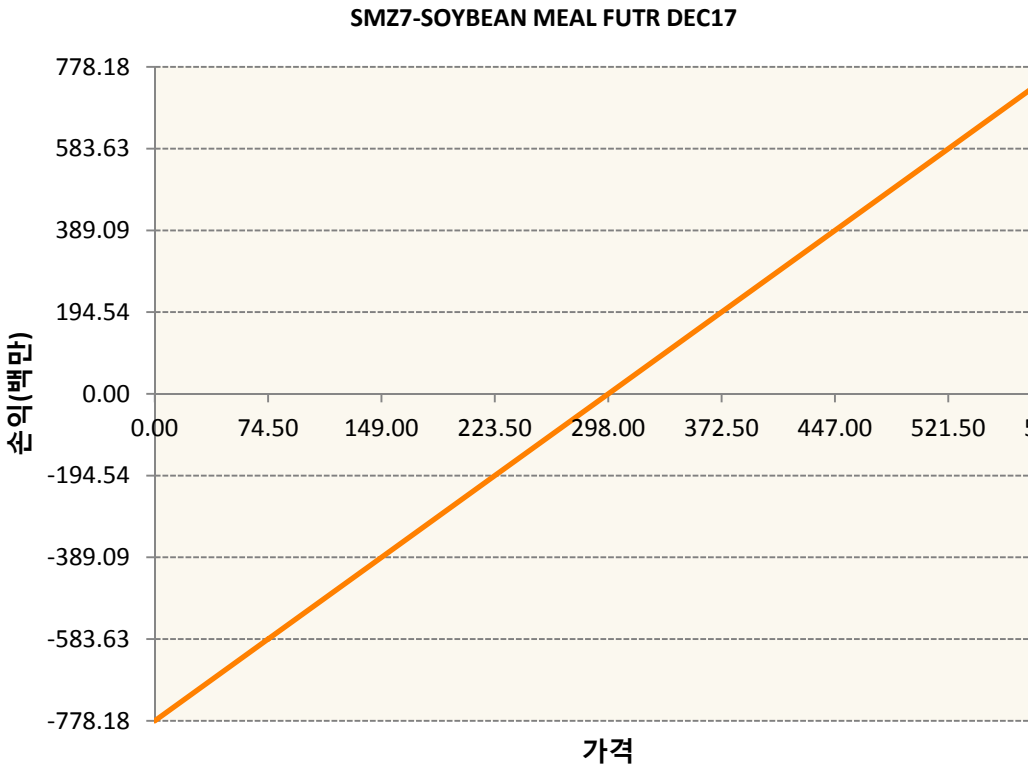

KCU7-COFFEE 'C' FUTURE SEP17
583.09
437.32
291.54
145.77
0.00
-145.77
-291.54
-437.32
-583.09
0.00
31.13
62.25
93.38
124.50
155.63
186.75
217.88
순익(백만)

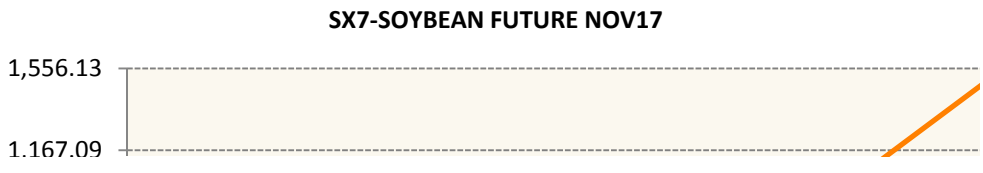
가격

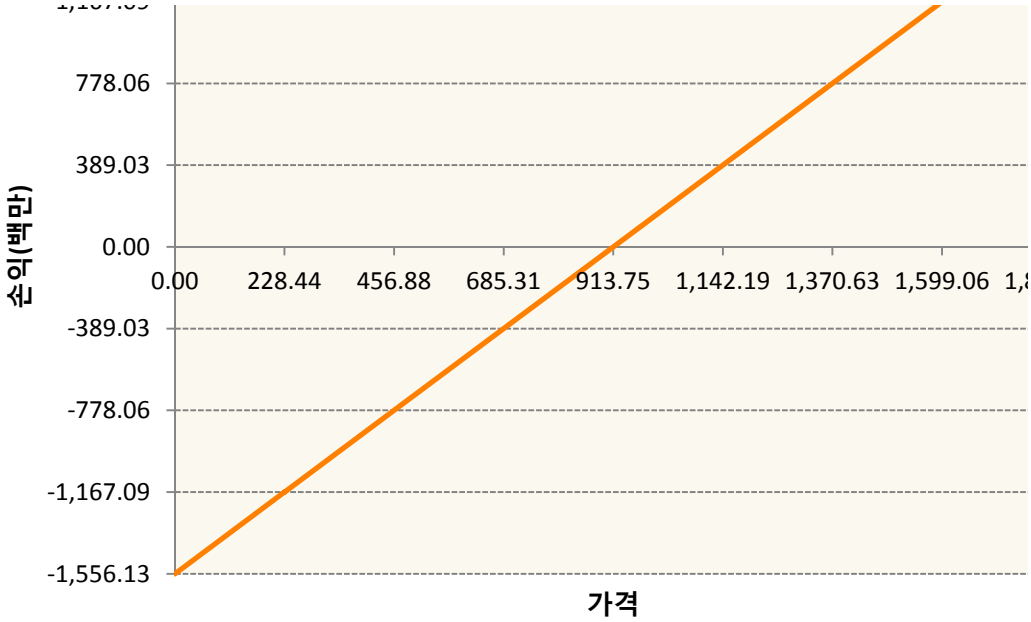

KR4175M70004-2017-07 달러선물
298.33
198.89
99.44
0.00
-99.44
-198.89
-298.33
-397.78
0.00
284.13
568.25
852.38
1,136.50
1,420.63
1,704.75
1,988.88
손익(백만)
가격


KWU7-KC HRW WHEAT FUT SEP17
321.19
240.89
160.59
80.30
0.00
-80.30
-160.59
-240.89
-321.19
0.00
117.88
235.75
353.63
471.50
589.38
707.25
825.13
손익(백만)
가격

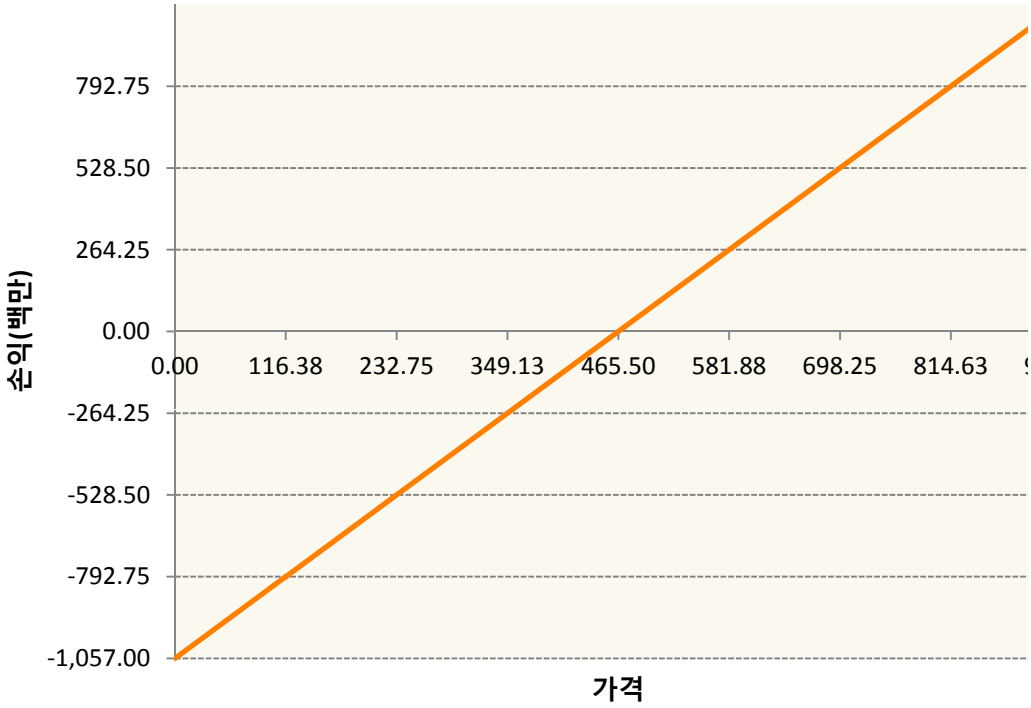

SBV7-SUGAR #11 (WORLD) OCT17
441.16
294.10
147.05
0.00
-147.05
-294.10
-441.16
-588.21
0.00
3.21
6.43
9.64
12.85
16.06
19.28
22.49
손익(백만)
가격


SMZ7-SOYBEAN MEAL FUTR DEC17
778.18
583.63
389.09
194.54
0.00
-194.54
-389.09
-583.63
-778.18
0.00
74.50
149.00
223.50
298.00
372.50
447.00
521.50
손익(백만)
가격


SX7-SOYBEAN FUTURE NOV17
1,556.13
1,167.09



WU7-WHEAT FUTURE(CBT) SEP17



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

BOZ7	SOYBEAN OIL FUTR DEC17	58
CTZ7	COTTON NO.2 FUTR DEC17	28
CU7	CORN FUTURE SEP17	175
KCU7	COFFEE 'C' FUTURE SEP17	47
KR4175M70(	2017-07 달러선물	32

KWU7	KC HRW WHEAT FUT SEP17	26
SBV7	SUGAR #11 (WORLD) OCT17	47
SMZ7	SOYBEAN MEAL FUTR DEC17	62
SX7	SOYBEAN FUTURE NOV17	124
WU7	WHEAT FUTURE(CBT) SEP17	85

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

739