공시일	2017-06-29
기준일	2017-06-28

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	2017-06-29
기준일	2017-06-28

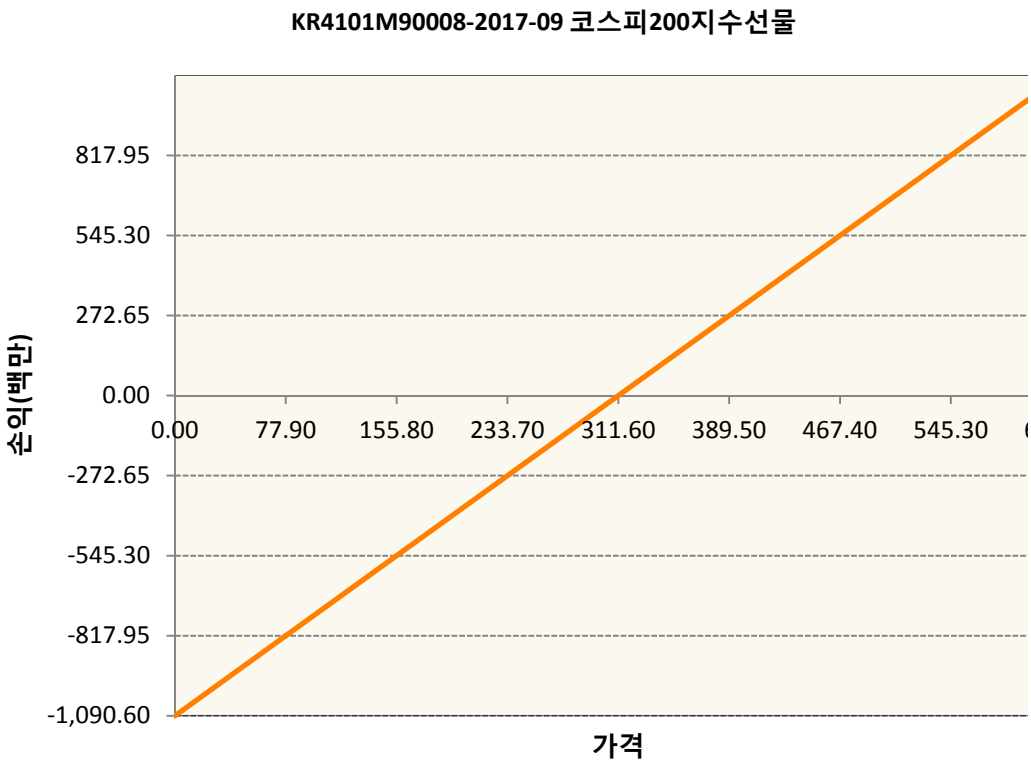
스마트인덱스모

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	1,091	0	1,091	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)

54

공시일	2017-06-29
기준일	2017-06-28

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	997

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

495

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-06-29
기준일	2017-06-28

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)

322

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-06-29
기준일	2017-06-28

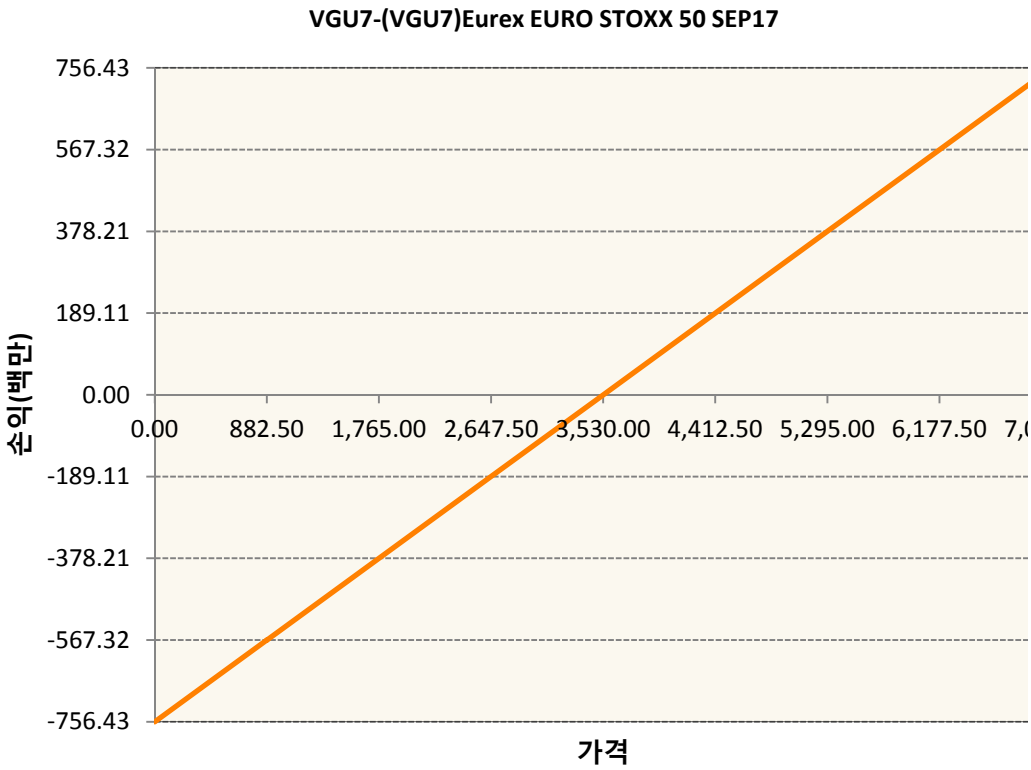
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	756	0	756	

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	2017-06-29
기준일	2017-06-28

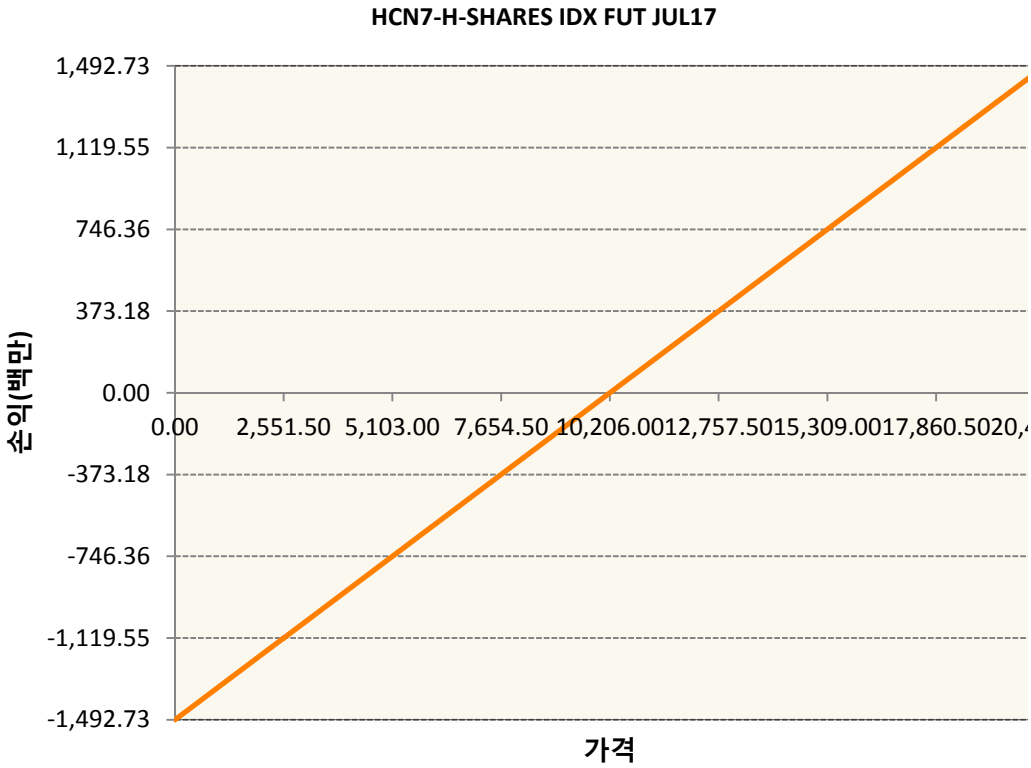
차이나인덱스모(주식-파생형)

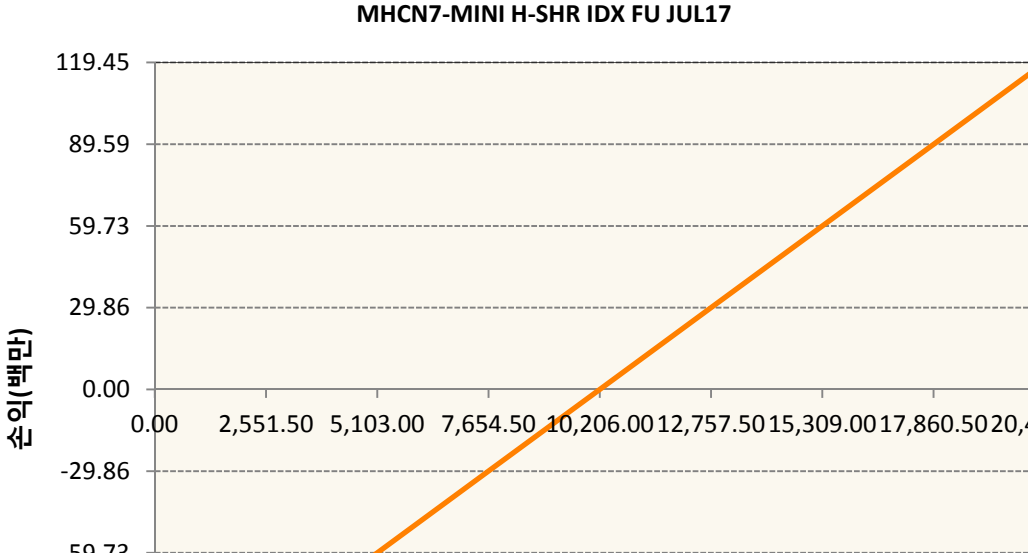
1. 계약금액

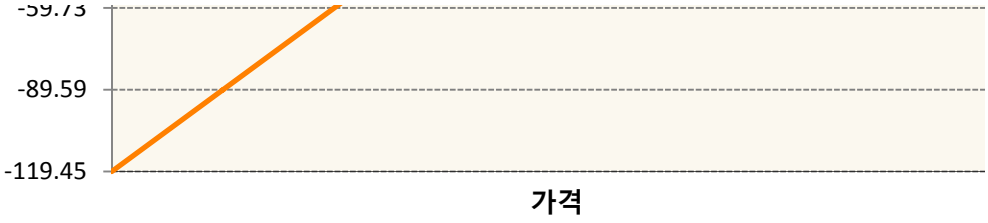
(단위:백만원)

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)

129

공시일	2017-06-29
기준일	2017-06-28

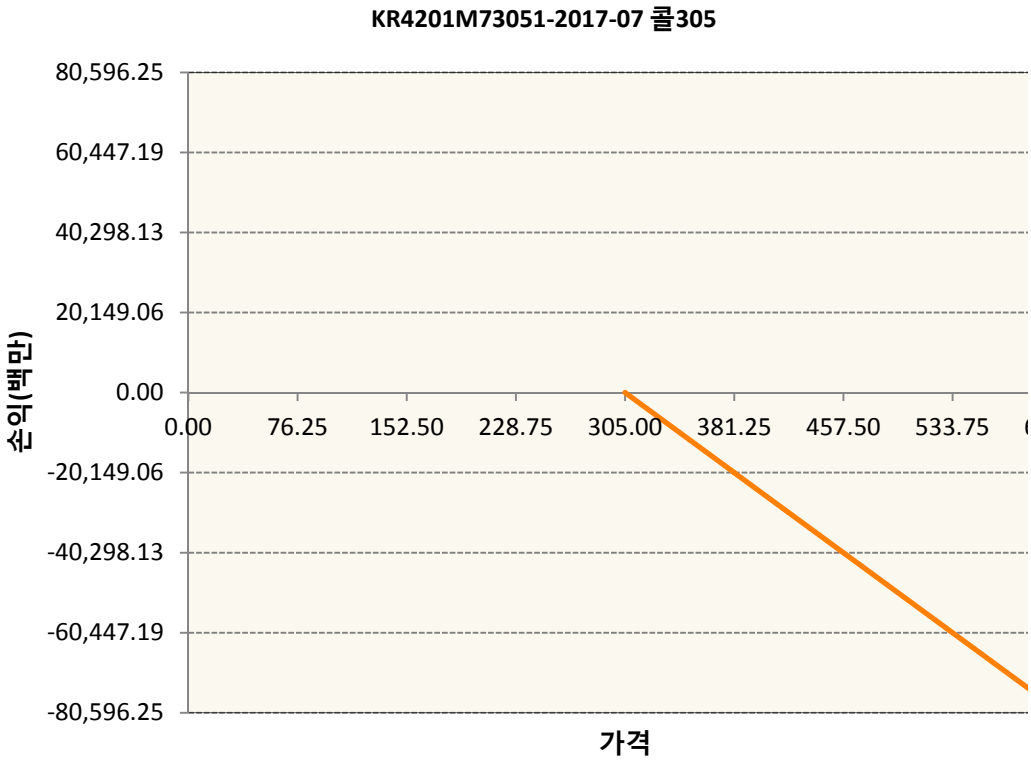
커버드콜모(주식혼합-파생형)

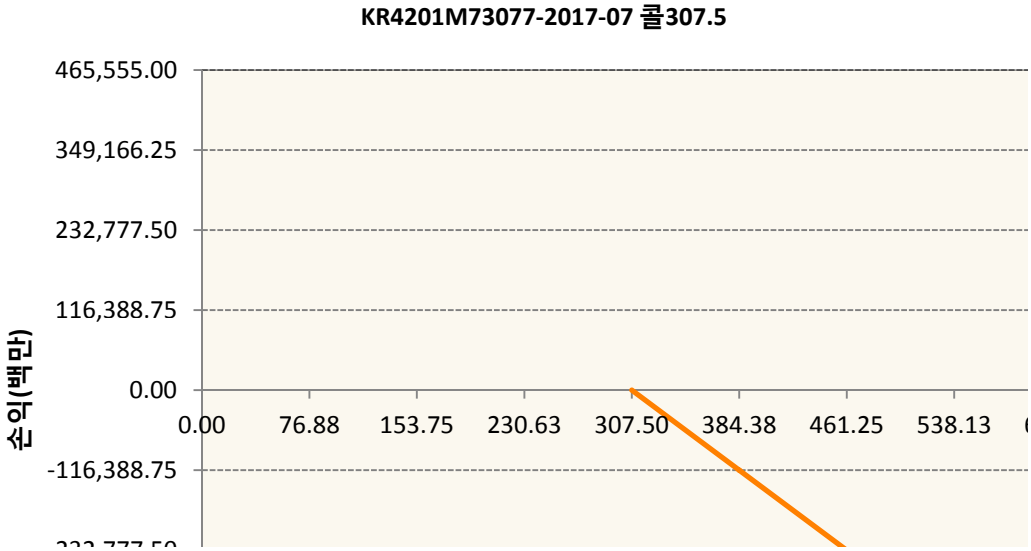
1. 계약금액

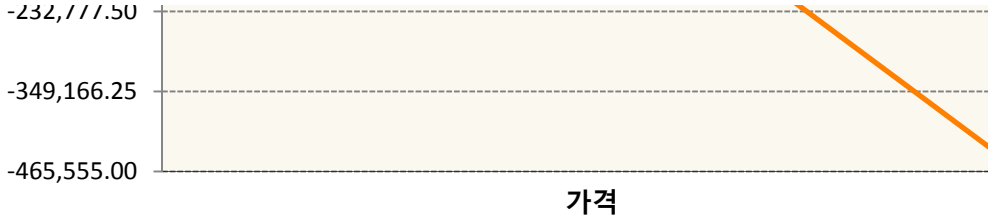
(단위:백만원)

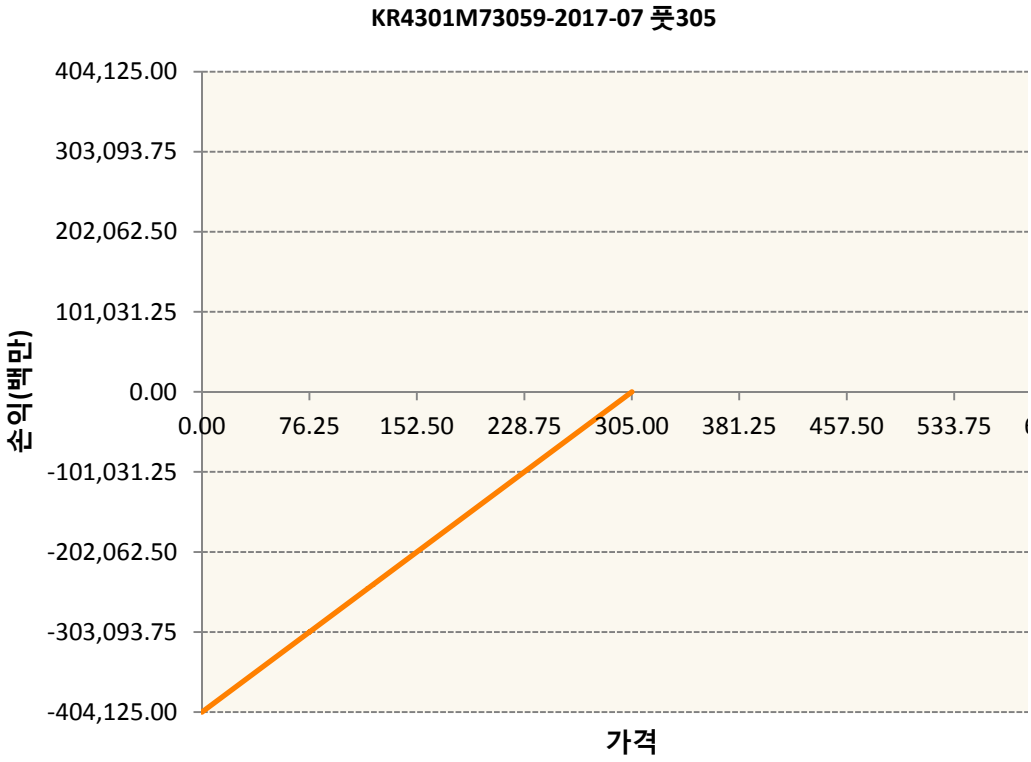
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	981,026	-981,026	장내

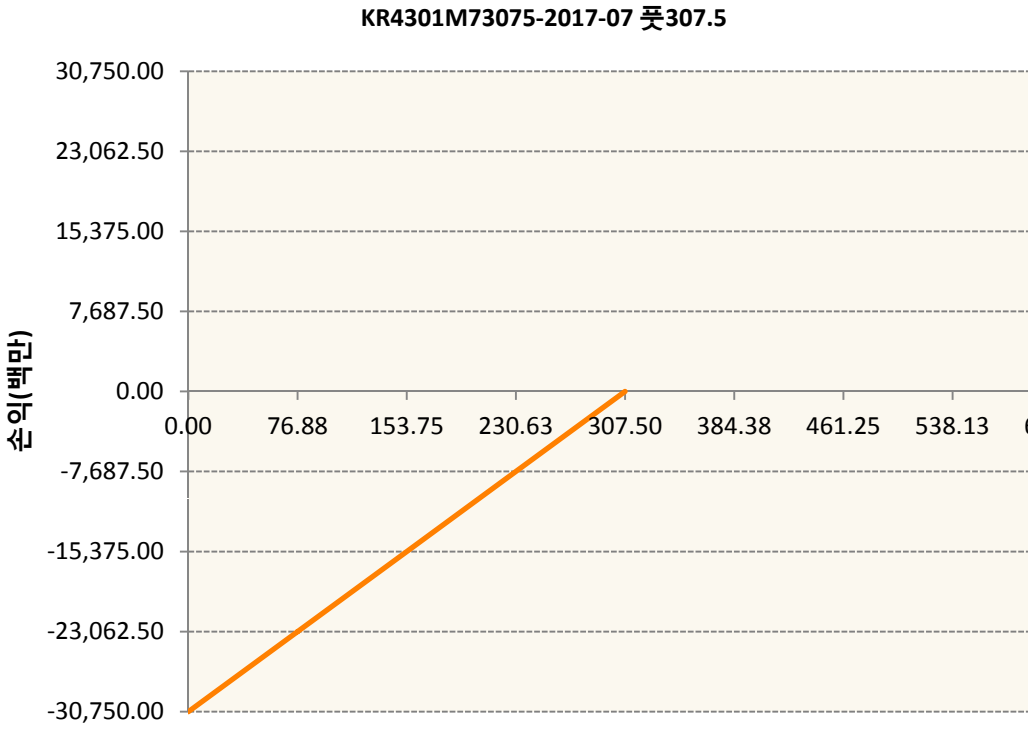
2. 만기시점의 손익구조






-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							6,331
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,776	1,776	1,776	1,775	1,772	1,769	1,764
-5.33%	1,765	1,754	1,740	1,721	1,699	1,674	1,645
-2.67%	1,470	1,412	1,353	1,293	1,233	1,172	1,111
0%	128	89	46	0	-48	-99	-151
2.67%	-1,956	-1,959	-1,966	-1,975	-1,987	-2,003	-2,022
5.33%	-4,142	-4,142	-4,142	-4,143	-4,144	-4,146	-4,149
8.00%	-6,331	-6,331	-6,331	-6,331	-6,331	-6,331	-6,331
KR4201M73(2017-07 콜307.5							35,252
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	7,424	7,424	7,423	7,420	7,415	7,406	7,391
-5.33%	7,405	7,381	7,342	7,285	7,210	7,116	7,003
-2.67%	6,605	6,352	6,082	5,797	5,501	5,197	4,884
0%	972	657	332	0	-338	-680	-1,026
2.67%	-10,221	-10,276	-10,354	-10,455	-10,578	-10,723	-10,887
5.33%	-22,704	-22,706	-22,710	-22,719	-22,735	-22,760	-22,796
8.00%	-35,245	-35,245	-35,245	-35,246	-35,246	-35,248	-35,252
KR4301M73(2017-07 풋305							24,084
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-24,021	-24,022	-24,024	-24,030	-24,041	-24,059	-24,084
-5.33%	-13,104	-13,156	-13,228	-13,320	-13,432	-13,561	-13,706
-2.67%	-3,604	-3,895	-4,191	-4,491	-4,794	-5,099	-5,406
0%	639	444	230	0	-242	-494	-755
2.67%	1,170	1,151	1,119	1,073	1,010	931	836
5.33%	1,183	1,183	1,182	1,179	1,173	1,163	1,147
8.00%	1,183	1,183	1,183	1,183	1,183	1,182	1,181
KR4301M73(2017-07 풋307.5							1,997
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,995	-1,995	-1,995	-1,995	-1,995	-1,996	-1,997
-5.33%	-1,168	-1,169	-1,172	-1,176	-1,181	-1,187	-1,194
-2.67%	-392	-409	-427	-445	-465	-485	-506
0%	64	43	22	0	-22	-45	-68
2.67%	153	150	145	138	130	120	109

5.33%	157	157	157	156	155	153	151
8.00%	157	157	157	157	157	157	157

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

78,735

공시일	2017-06-29
기준일	2017-06-28

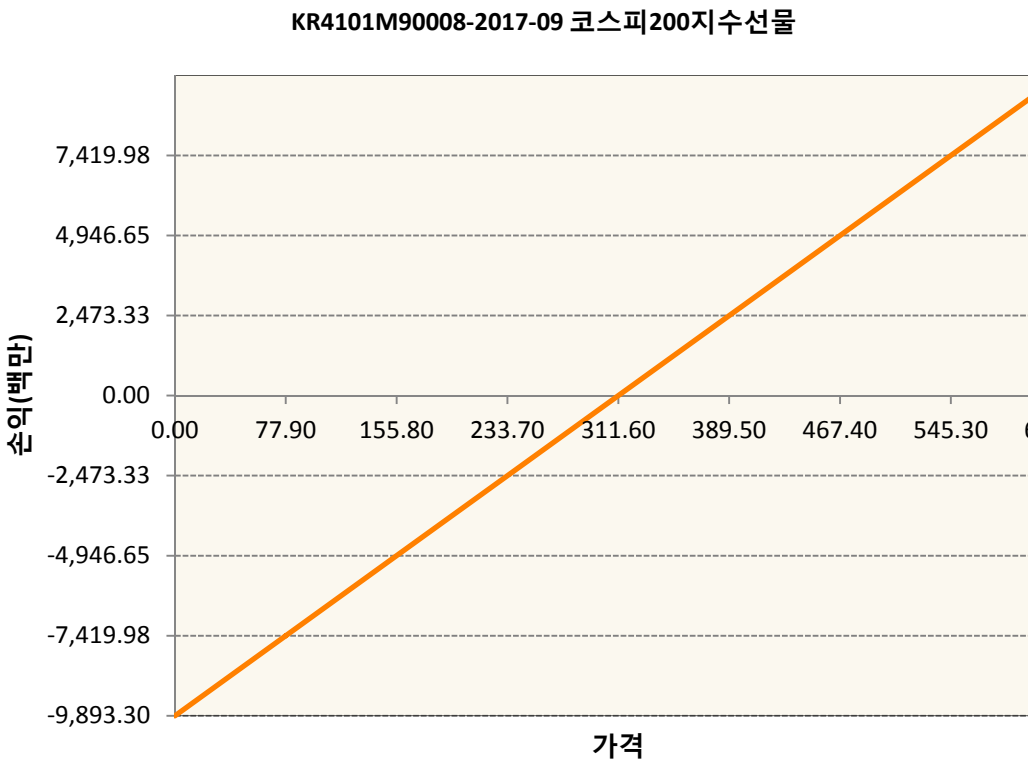
ETF스마트레버리지목표전환형6호

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	9,893	0	9,893	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101M90(2017-09 코스피200지수선물							790
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-790	-790	-790	-790	-790	-790	-790
-5.33%	-526	-526	-526	-526	-526	-526	-526
-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%	526	526	526	526	526	526	526
8.00%	790	790	790	790	790	790	790

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

491

공시일	2017-06-29
기준일	2017-06-28

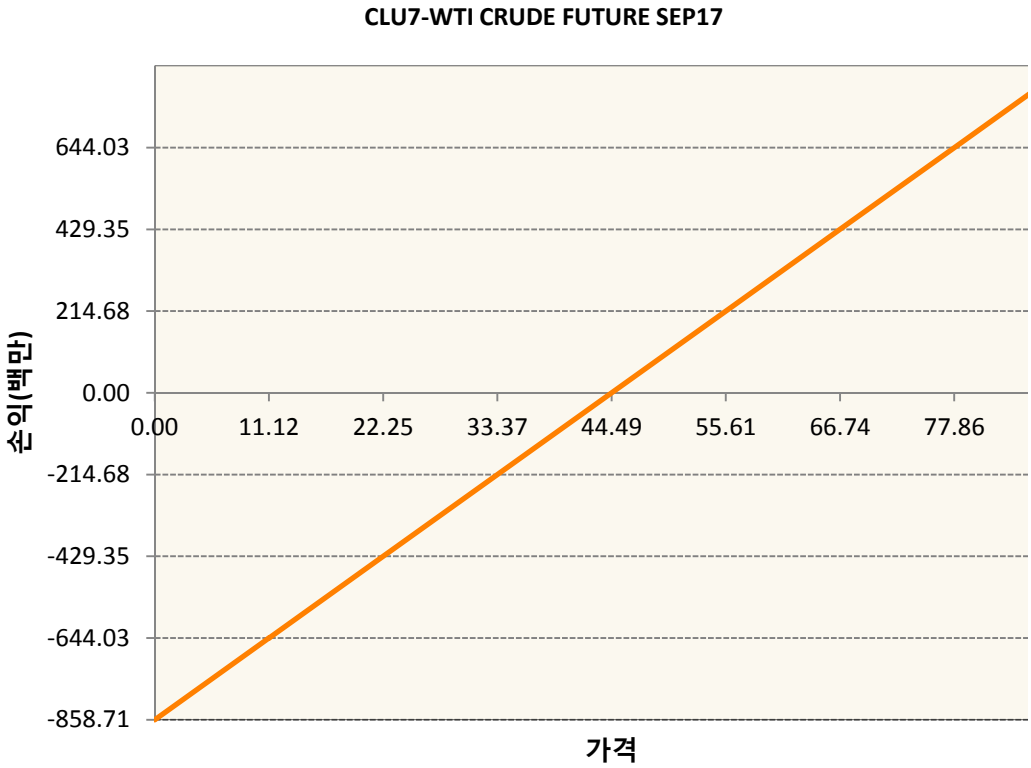
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

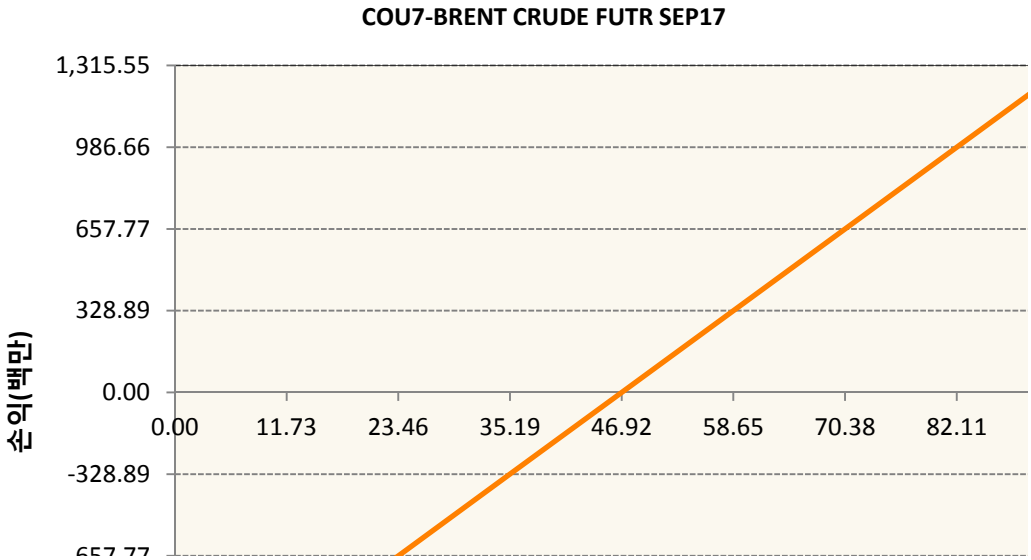
1. 계약금액

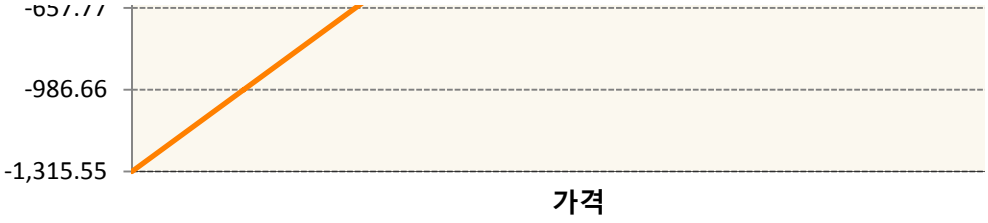
(단위:백만원)

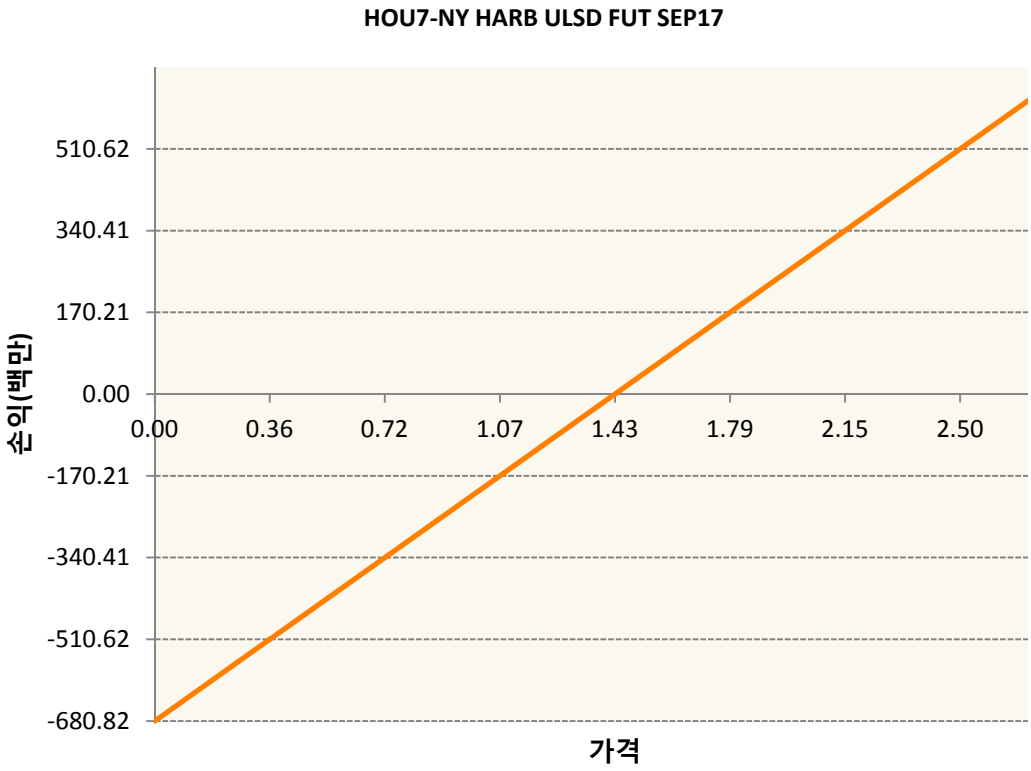
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	5,002	229	4,773	

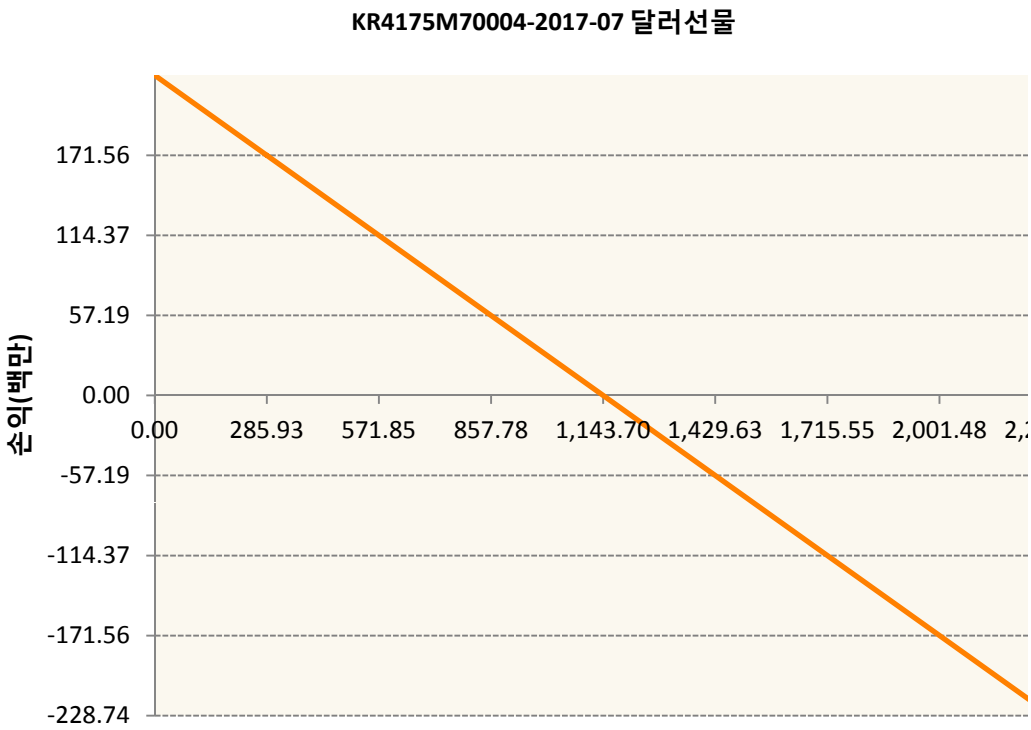
2. 만기시점의 손익구조



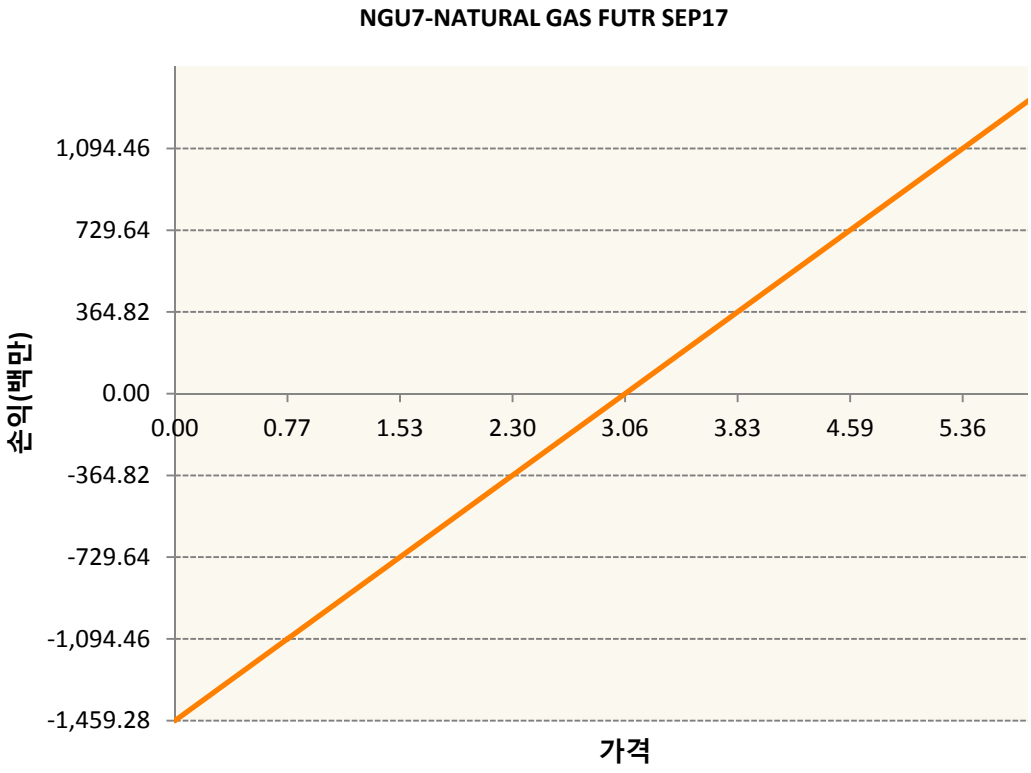


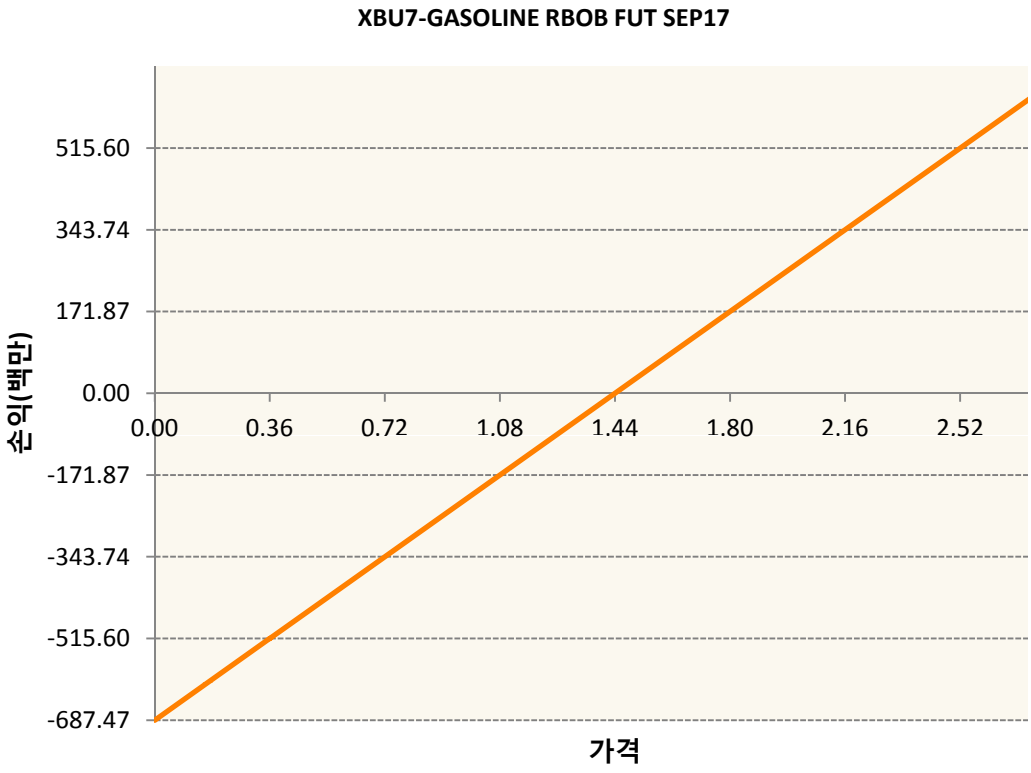

-986.66
-1,315.55
가격


HOU7-NY HARB ULSD FUT SEP17
510.62
340.41
170.21
0.00
-170.21
-340.41
-510.62
-680.82
0.00
0.36
0.72
1.07
1.43
1.79
2.15
2.50
순이익(백만)
가격


KR4175M70004-2017-07 달러선물
171.56
114.37
57.19
0.00
-57.19
-114.37
-171.56
-228.74
0.00
285.93
571.85
857.78
1,143.70
1,429.63
1,715.55
2,001.48
순이익(백만)

가격


NGU7-NATURAL GAS FUTR SEP17
1,094.46
729.64
364.82
0.00
-364.82
-729.64
-1,094.46
-1,459.28
0.00
0.77
1.53
2.30
3.06
3.83
4.59
5.36
손익(백만)
가격


XBU7-GASOLINE RBOB FUT SEP17
515.60
343.74
171.87
0.00
-171.87
-343.74
-515.60
-687.47
0.00
0.36
0.72
1.08
1.44
1.80
2.16
2.52
손익(백만)
가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLU7	WTI CRUDE FUTURE SEP17	69
COU7	BRENT CRUDE FUTR SEP17	105
HOU7	NY HARB ULSD FUT SEP17	54
KR4175M70(	2017-07 달러선물	18
NGU7	NATURAL GAS FUTR SEP17	117
XBU7	GASOLINE RBOB FUT SEP17	55

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

800

공시일	2017-06-29
기준일	2017-06-28

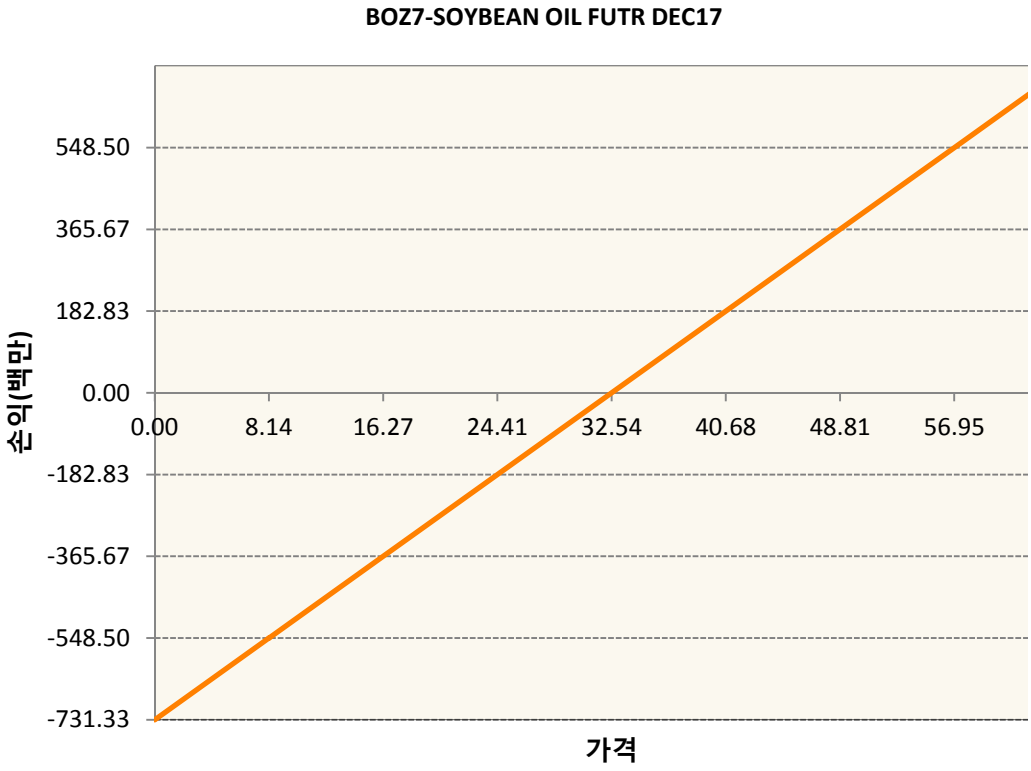
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

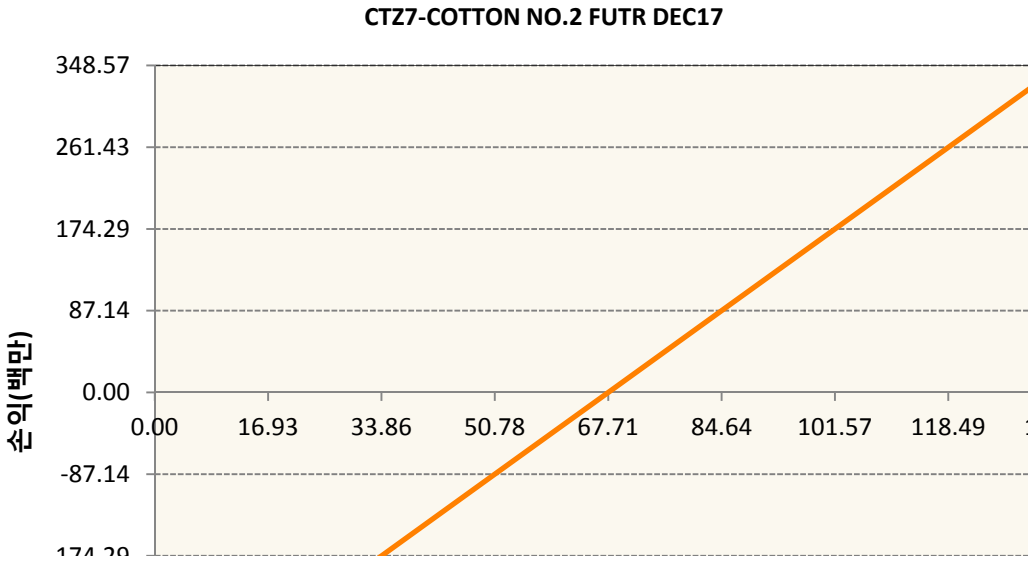
1. 계약금액

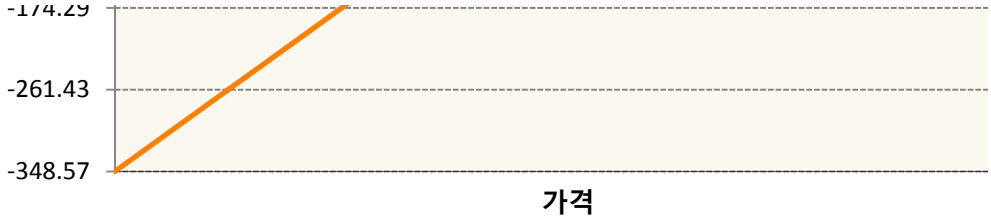
(단위:백만원)

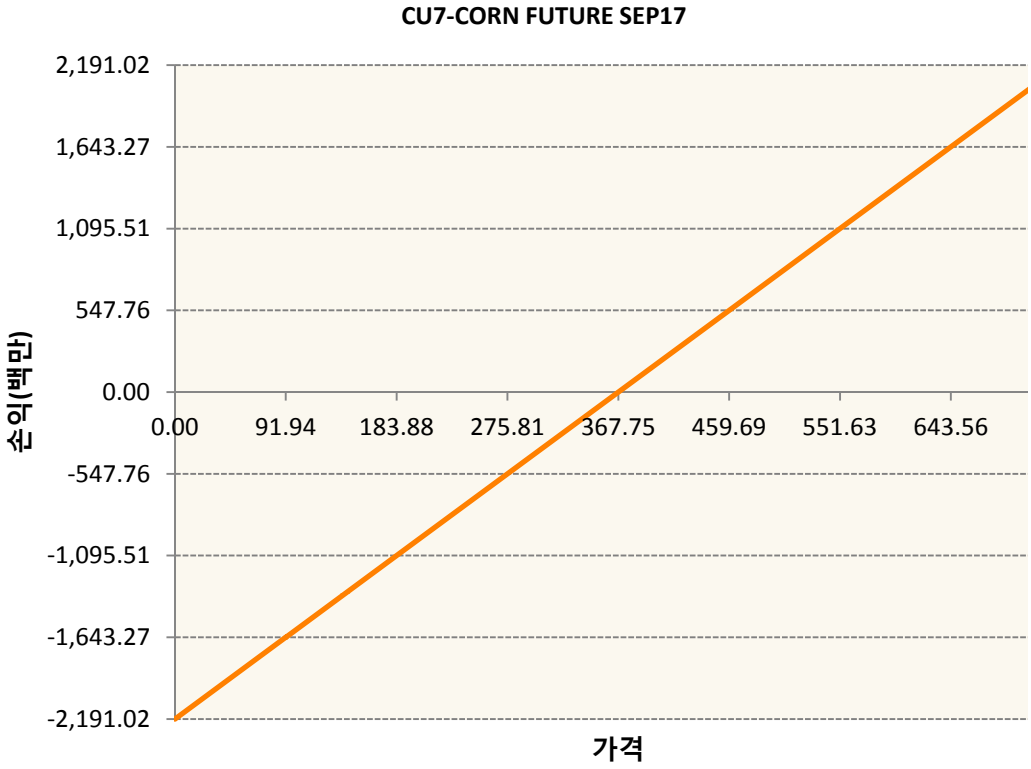
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	8,176	400	7,776	

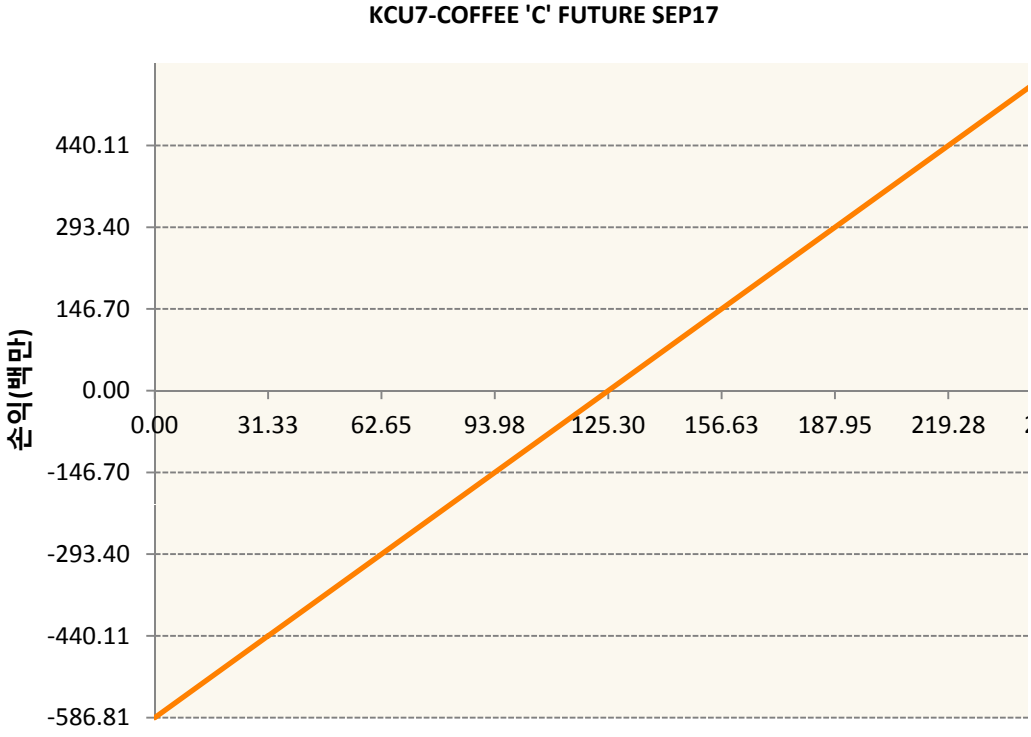
2. 만기시점의 손익구조





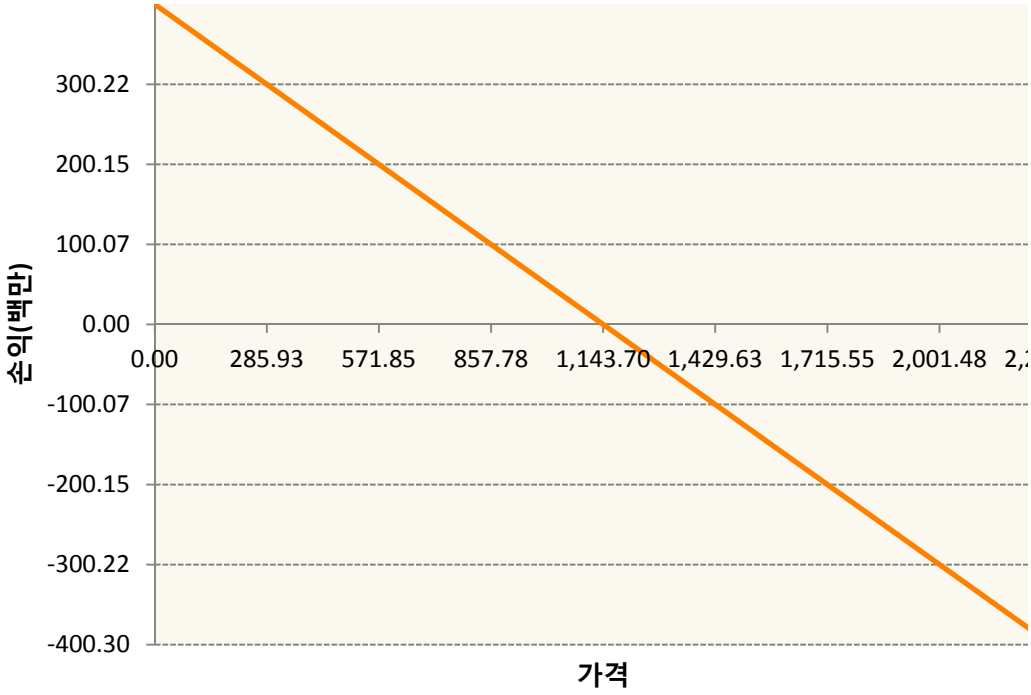

-174.29
-261.43
-348.57
가격


CU7-CORN FUTURE SEP17
2,191.02
1,643.27
1,095.51
547.76
0.00
-547.76
-1,095.51
-1,643.27
-2,191.02
0.00
91.94
183.88
275.81
367.75
459.69
551.63
643.56
순익(백만)
가격

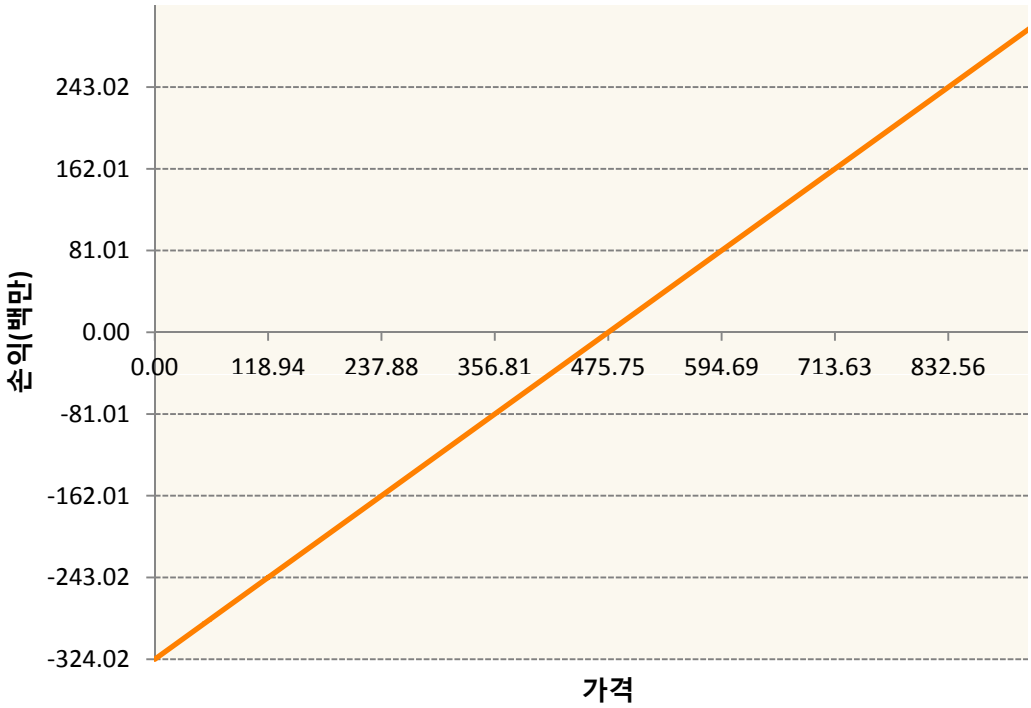

KCU7-COFFEE 'C' FUTURE SEP17
440.11
293.40
146.70
0.00
-146.70
-293.40
-440.11
-586.81
0.00
31.33
62.65
93.98
125.30
156.63
187.95
219.28
순익(백만)

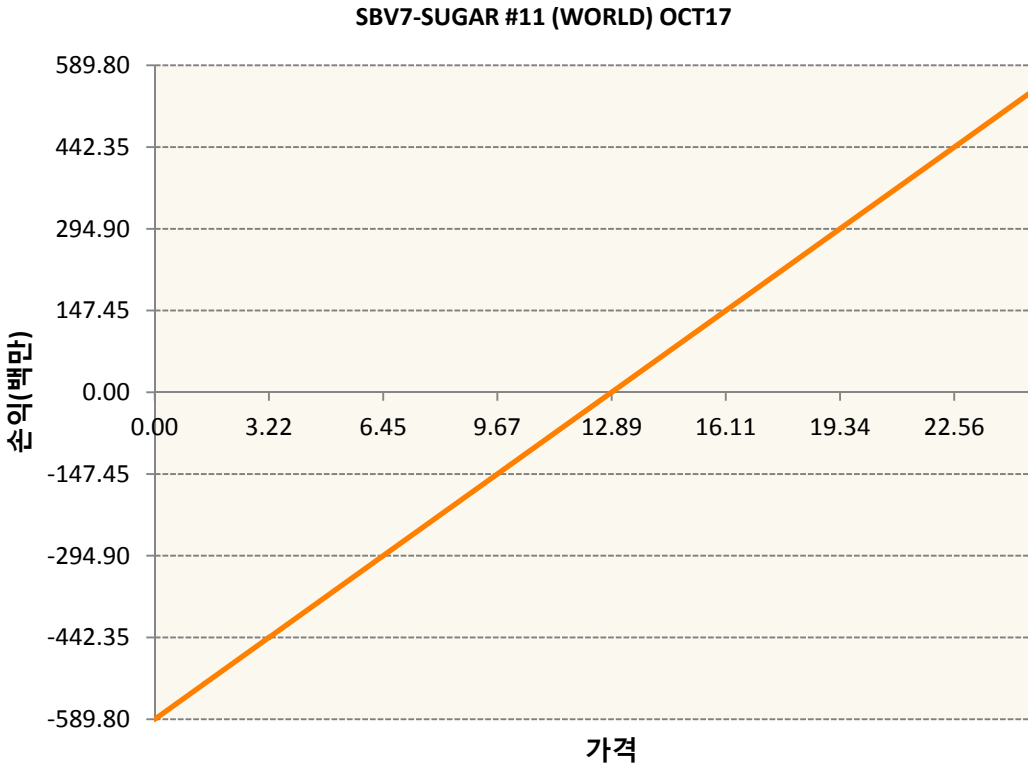
가격

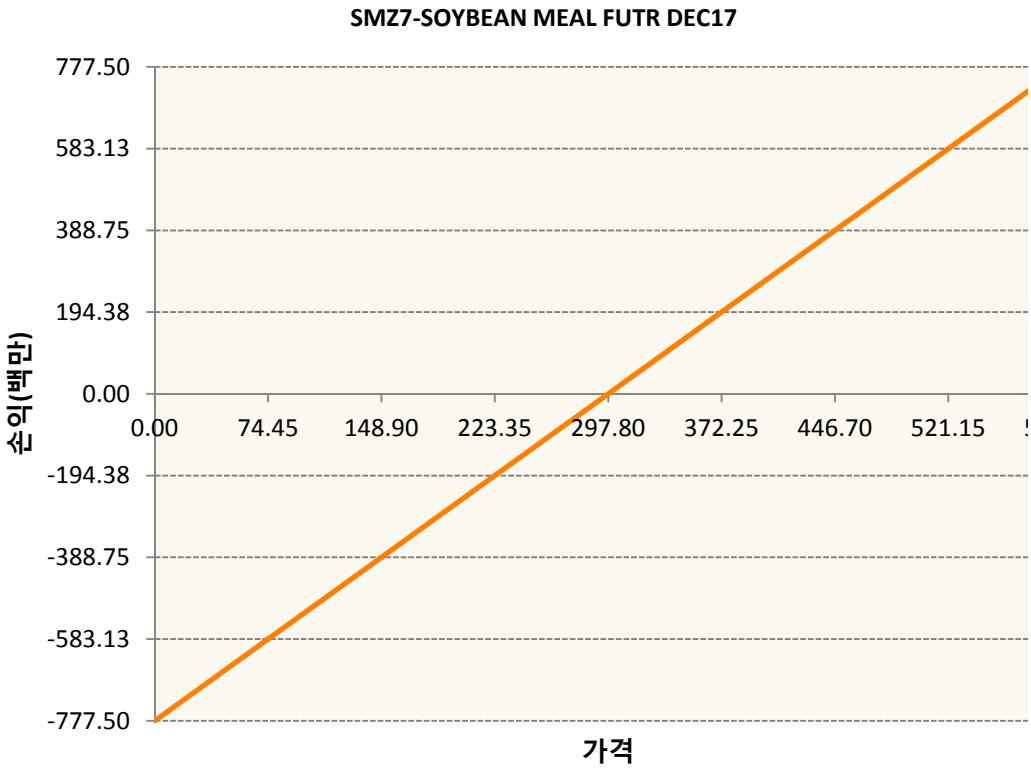
KR4175M70004-2017-07 달러선물

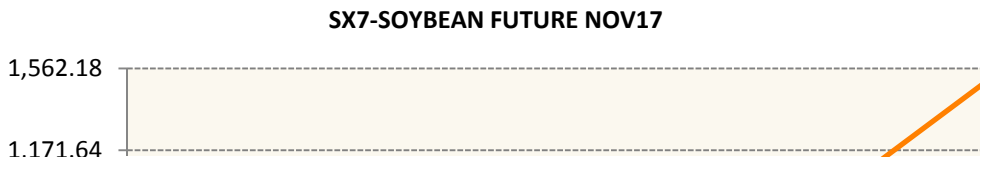


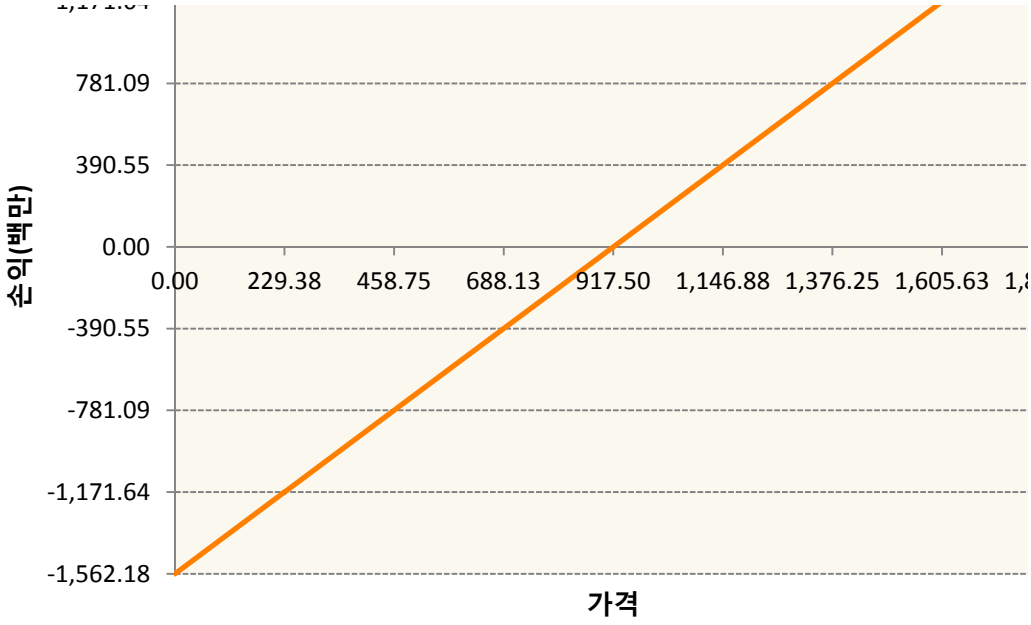
KWU7-KC HRW WHEAT FUT SEP17

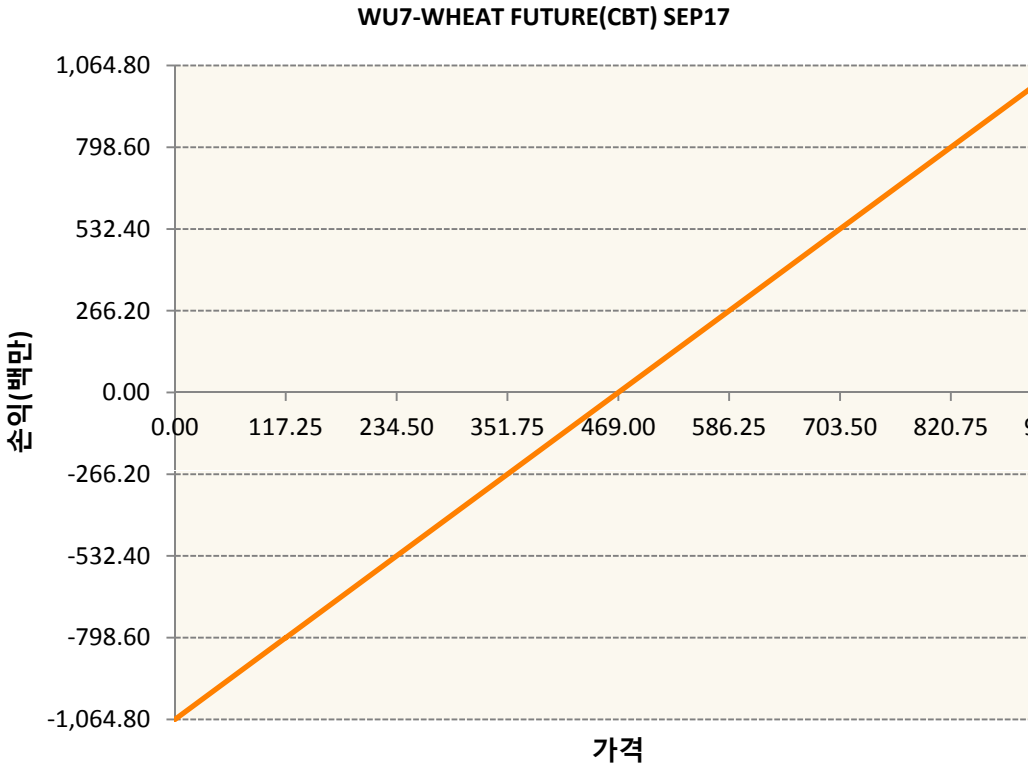



SBV7-SUGAR #11 (WORLD) OCT17
589.80
442.35
294.90
147.45
0.00
-147.45
-294.90
-442.35
-589.80
0.00
3.22
6.45
9.67
12.89
16.11
19.34
22.56
손익(백만)
가격


SMZ7-SOYBEAN MEAL FUTR DEC17
777.50
583.13
388.75
194.38
0.00
-194.38
-388.75
-583.13
-777.50
0.00
74.45
148.90
223.35
297.80
372.25
446.70
521.15
손익(백만)
가격


SX7-SOYBEAN FUTURE NOV17
1,562.18
1,171.64





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

BOZ7	SOYBEAN OIL FUTR DEC17	59
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	125
WU7	WHEAT FUTURE(CBT) SEP17	85

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

742