공시일	2017-06-30
기준일	2017-06-29

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	2017-06-30
기준일	2017-06-29

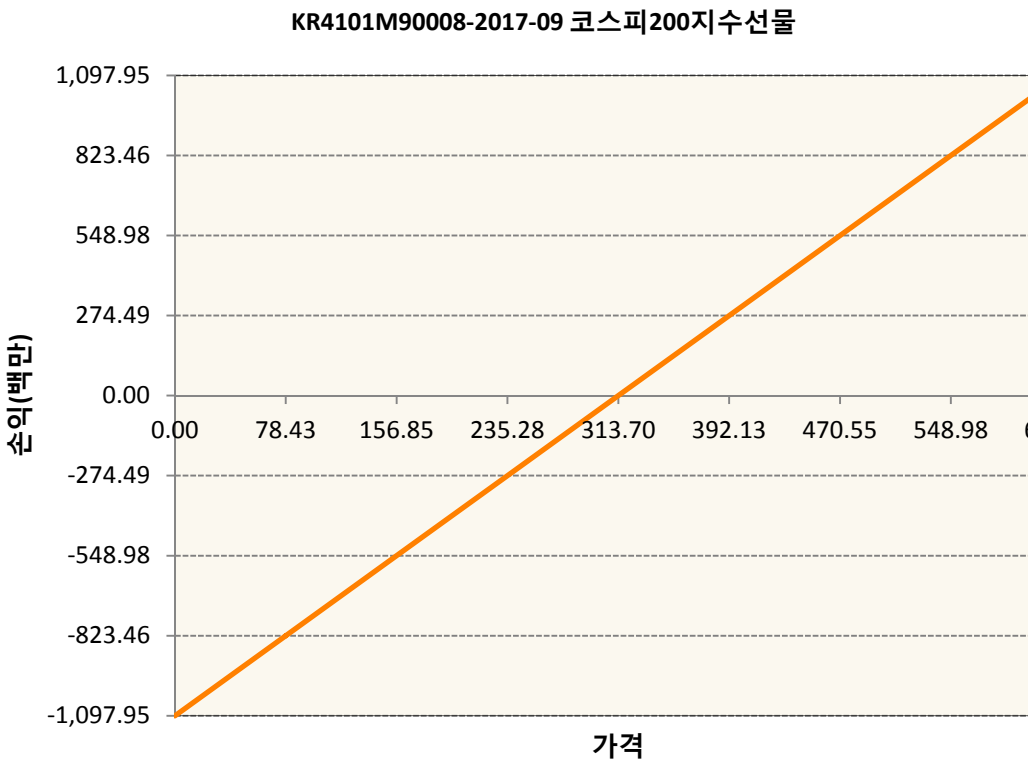
스마트인덱스모

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	1,098	0	1,098	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101M90(2017-09 코스피200지수선물							88
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-88	-88	-88	-88	-88	-88	-88
-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%	88	88	88	88	88	88	88

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

54

공시일	2017-06-30
기준일	2017-06-29

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	1,005

* 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	2017-06-30
기준일	2017-06-29

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	379

* 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	2017-06-30
기준일	2017-06-29

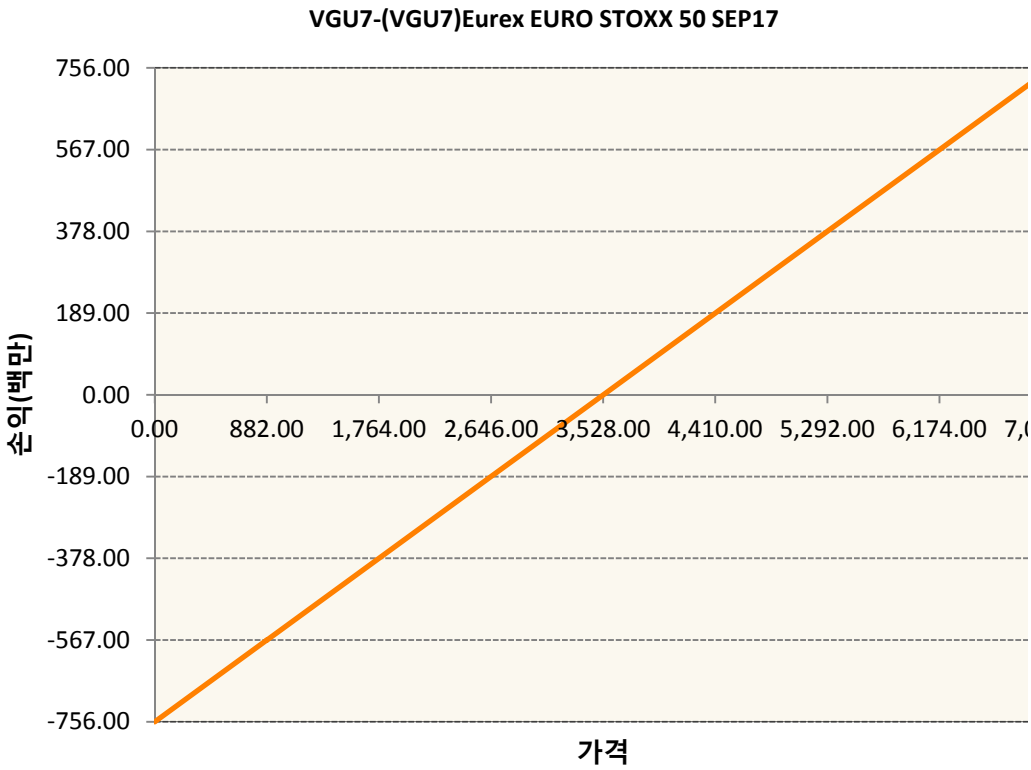
유로인덱스모(주식-파생형)

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	60

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

(단위:백만원)

54

공시일	2017-06-30
기준일	2017-06-29

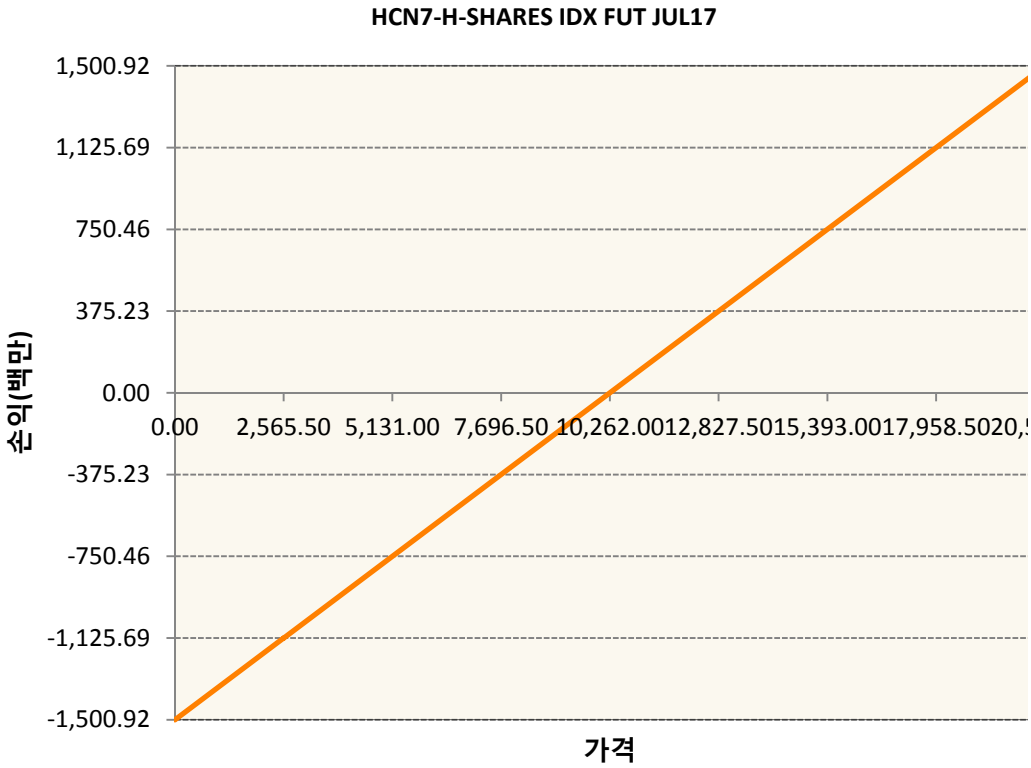
차이나인덱스모(주식-파생형)

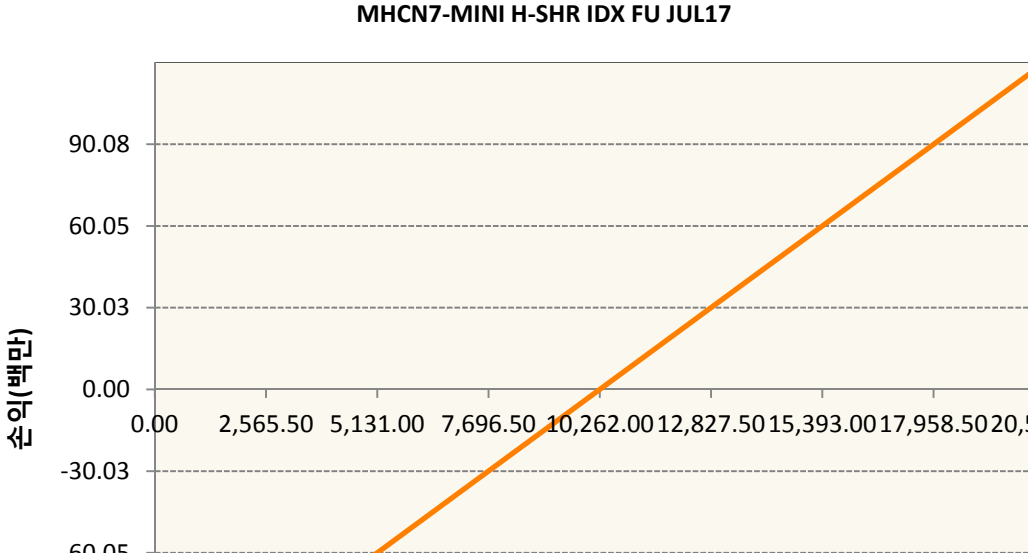
1. 계약금액

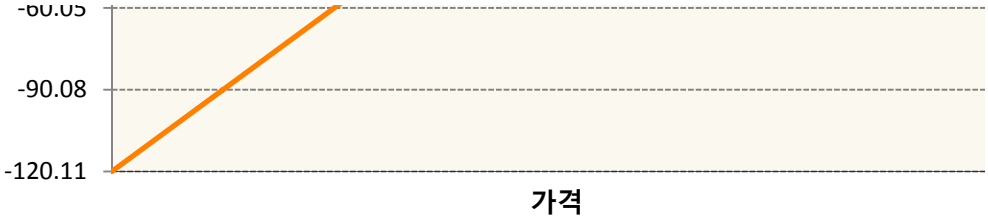
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,621	0	1,621	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)
	129

공시일	2017-06-30
기준일	2017-06-29

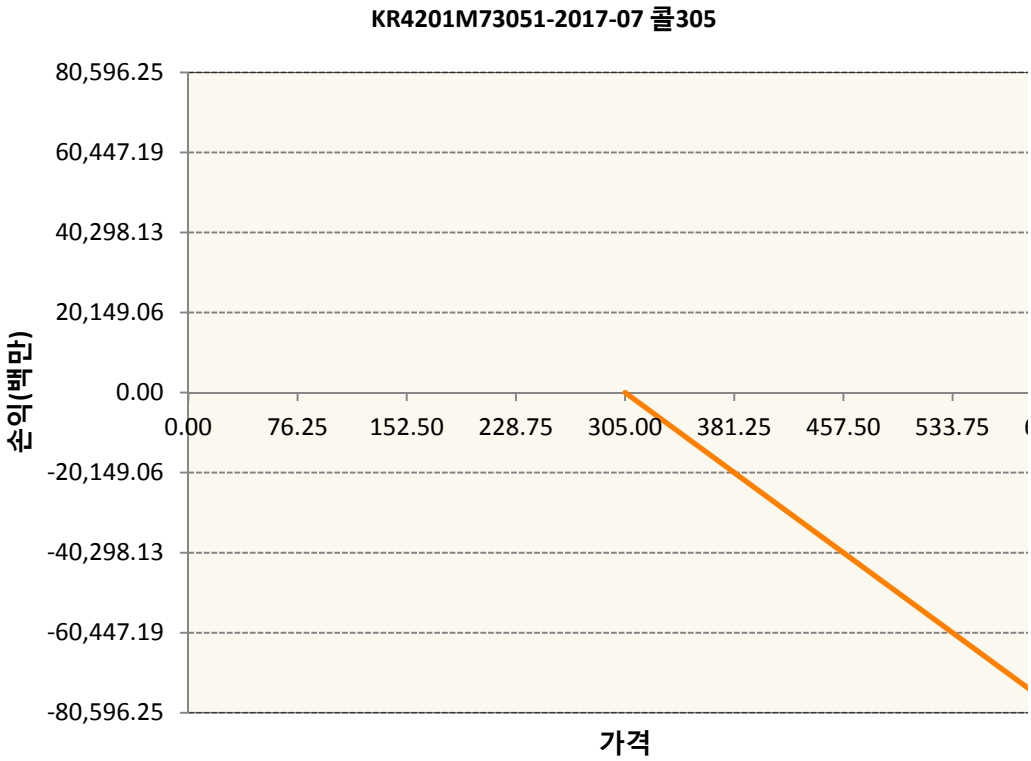
커버드콜모(주식혼합-파생형)

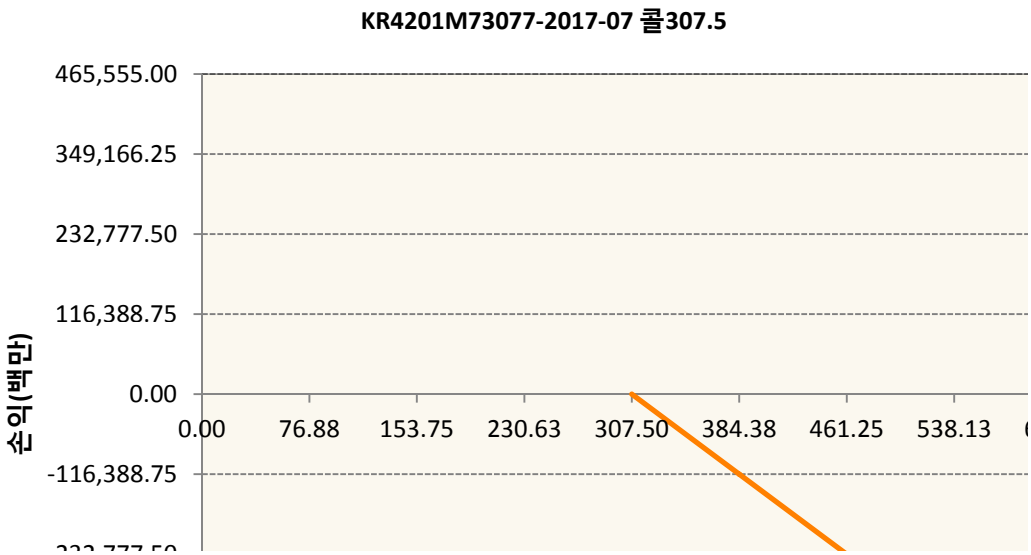
1. 계약금액

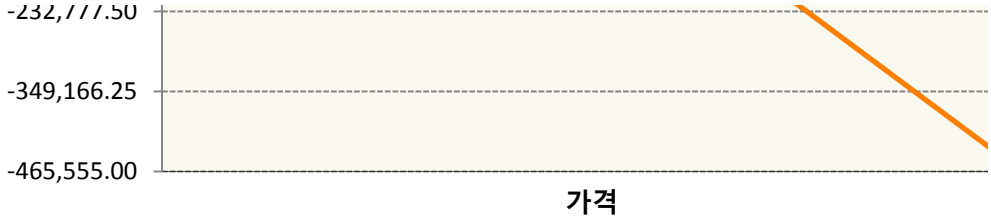
(단위:백만원)

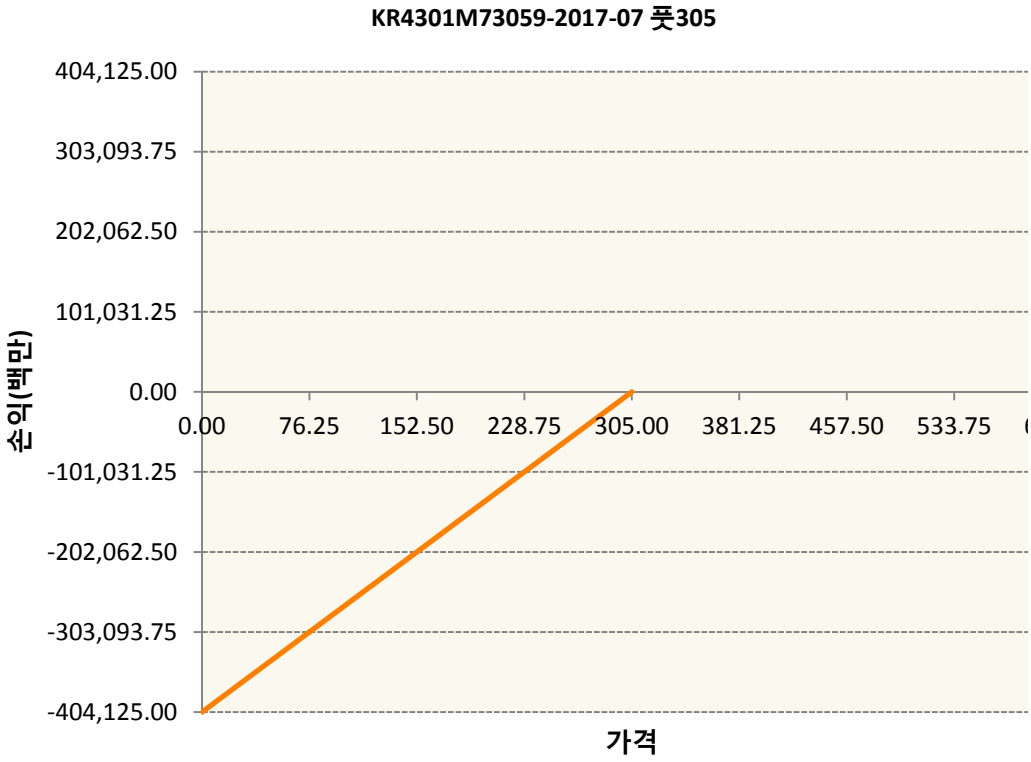
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	7,707	-7,707	장내
누계	유가증권	옵션	0	988,714	-988,714	장내

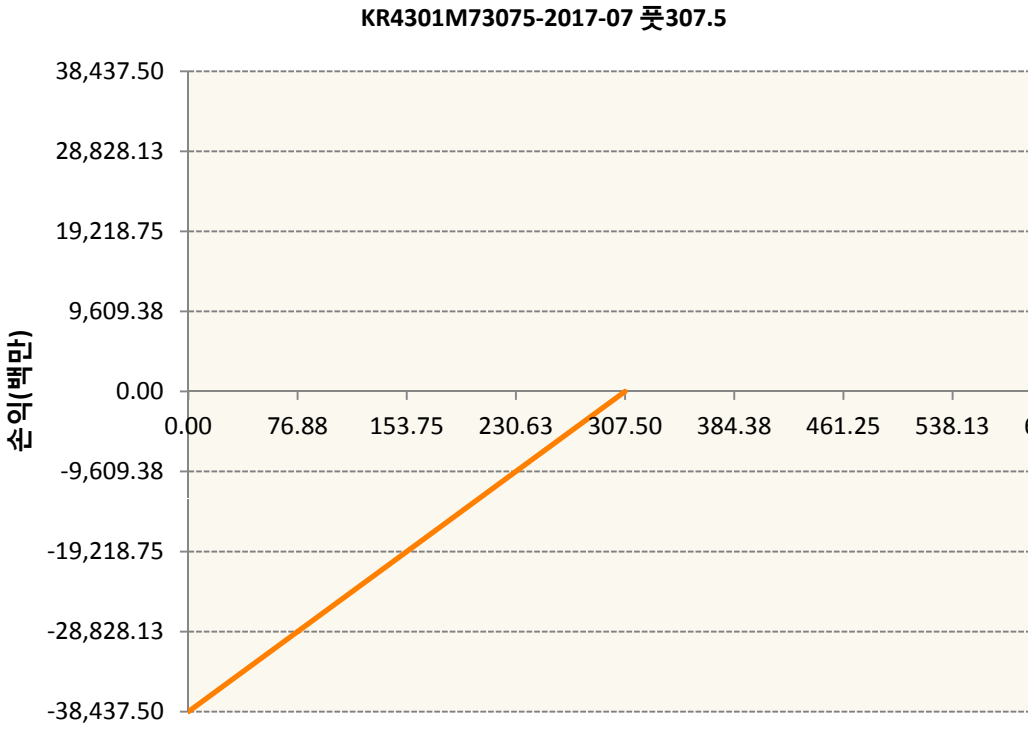
2. 만기시점의 손익구조






-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
38,437.50
28,828.13
19,218.75
9,609.38
0.00
-9,609.38
-19,218.75
-28,828.13
-38,437.50
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							6,470
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	2,129	2,129	2,128	2,126	2,124	2,119	2,113
-5.33%	2,109	2,094	2,075	2,052	2,026	1,996	1,964
-2.67%	1,678	1,618	1,557	1,497	1,436	1,376	1,315
0%	86	62	33	0	-36	-75	-117
2.67%	-2,068	-2,069	-2,072	-2,076	-2,082	-2,091	-2,102
5.33%	-4,269	-4,269	-4,269	-4,269	-4,269	-4,270	-4,271
8.00%	-6,470	-6,470	-6,470	-6,470	-6,470	-6,470	-6,470
KR4201M73(2017-07 콜307.5							36,353
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	9,133	9,132	9,131	9,128	9,122	9,111	9,093
-5.33%	9,100	9,065	9,012	8,939	8,846	8,735	8,605
-2.67%	7,860	7,567	7,264	6,954	6,637	6,317	5,992
0%	758	522	268	0	-280	-570	-868
2.67%	-11,144	-11,166	-11,203	-11,256	-11,328	-11,418	-11,526
5.33%	-23,740	-23,740	-23,741	-23,744	-23,750	-23,760	-23,777
8.00%	-36,351	-36,351	-36,351	-36,351	-36,351	-36,352	-36,353

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

76,112

공시일	2017-06-30
기준일	2017-06-29

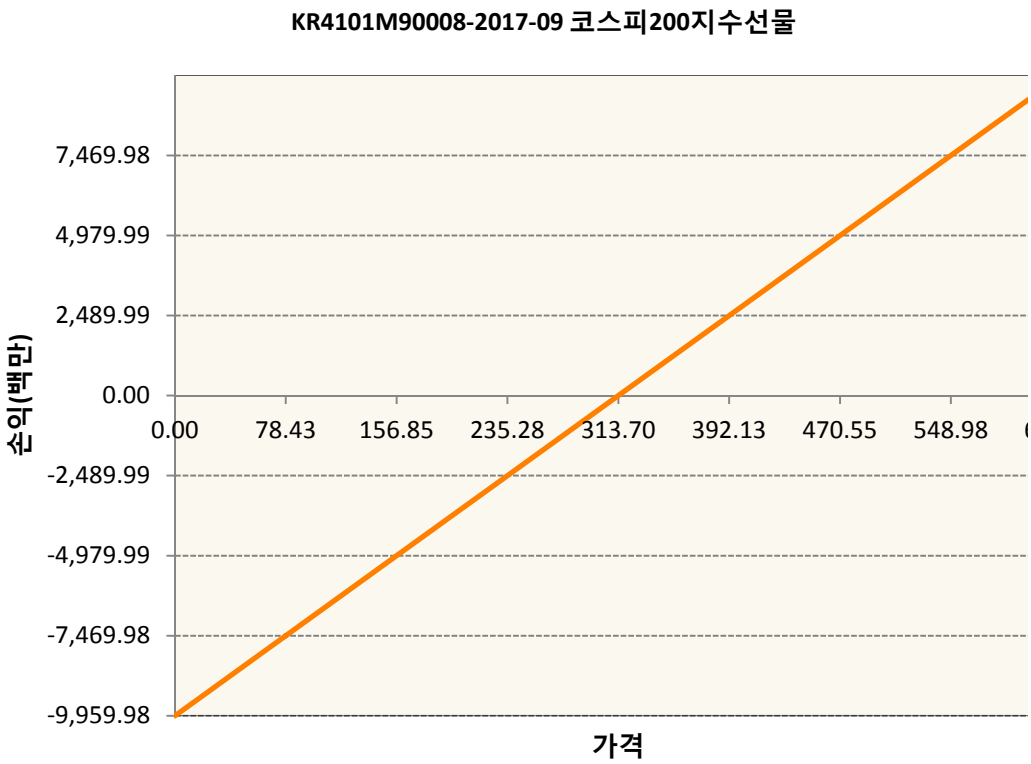
ETF스마트레버리지목표전환형6호

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	9,960	0	9,960	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101M90(2017-09 코스피200지수선물							794
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-794	-794	-794	-794	-794	-794	-794
-5.33%	-529	-529	-529	-529	-529	-529	-529
-2.67%	-265	-265	-265	-265	-265	-265	-265
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	265	265	265	265	265	265	265
5.33%	529	529	529	529	529	529	529
8.00%	794	794	794	794	794	794	794

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

494

공시일	2017-06-30
기준일	2017-06-29

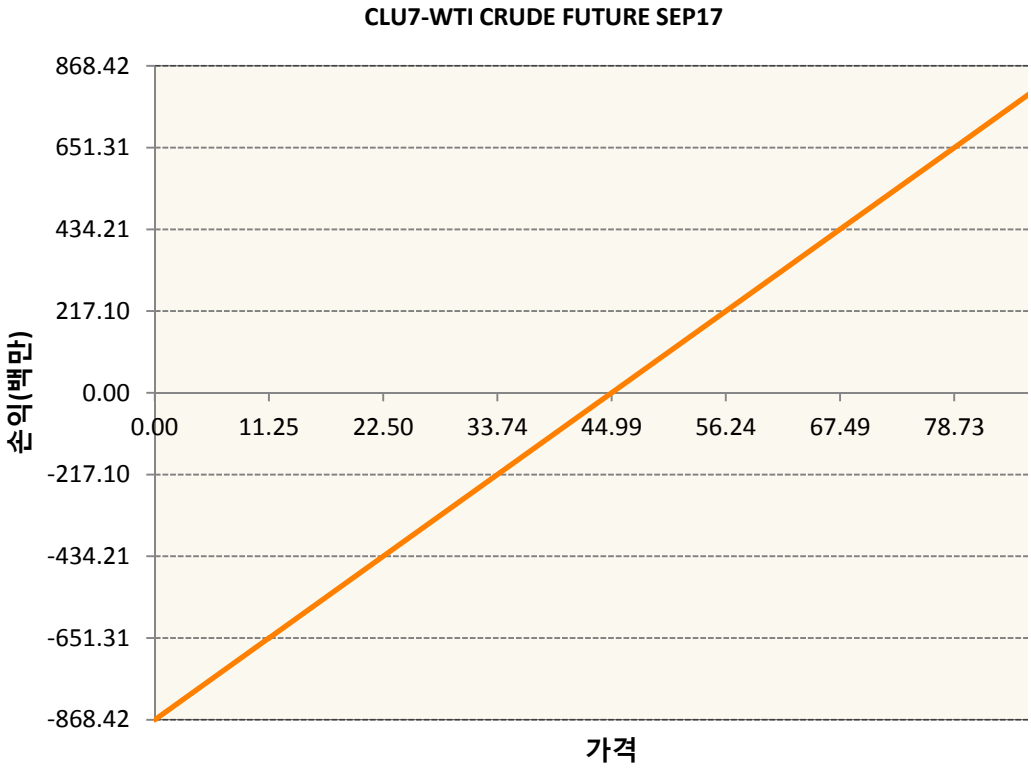
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

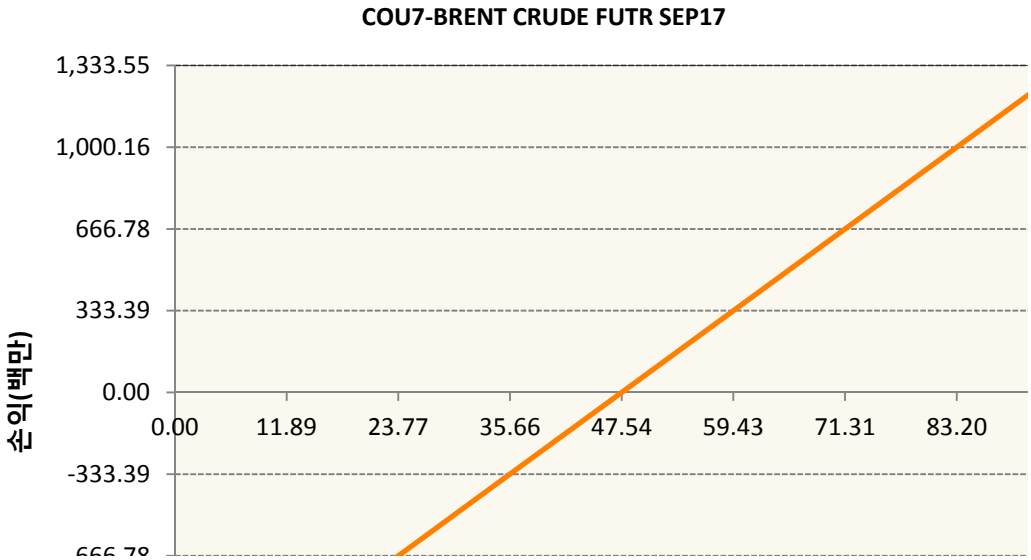
1. 계약금액

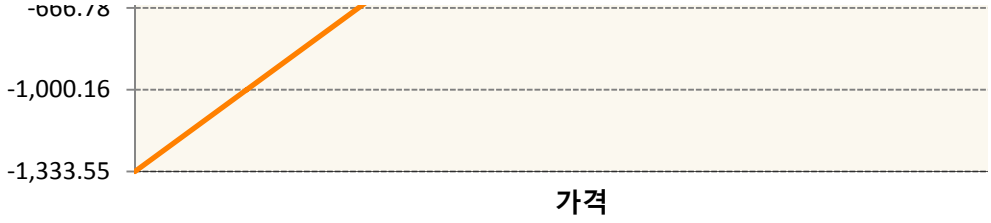
(단위:백만원)

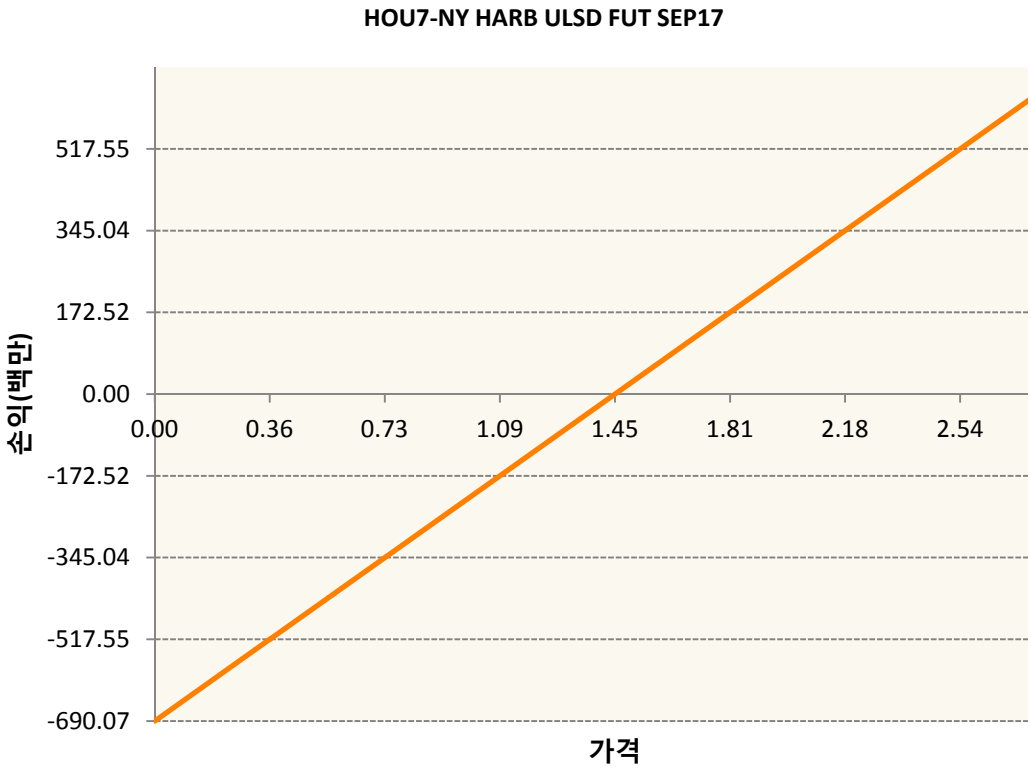
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	5,062	228	4,834	

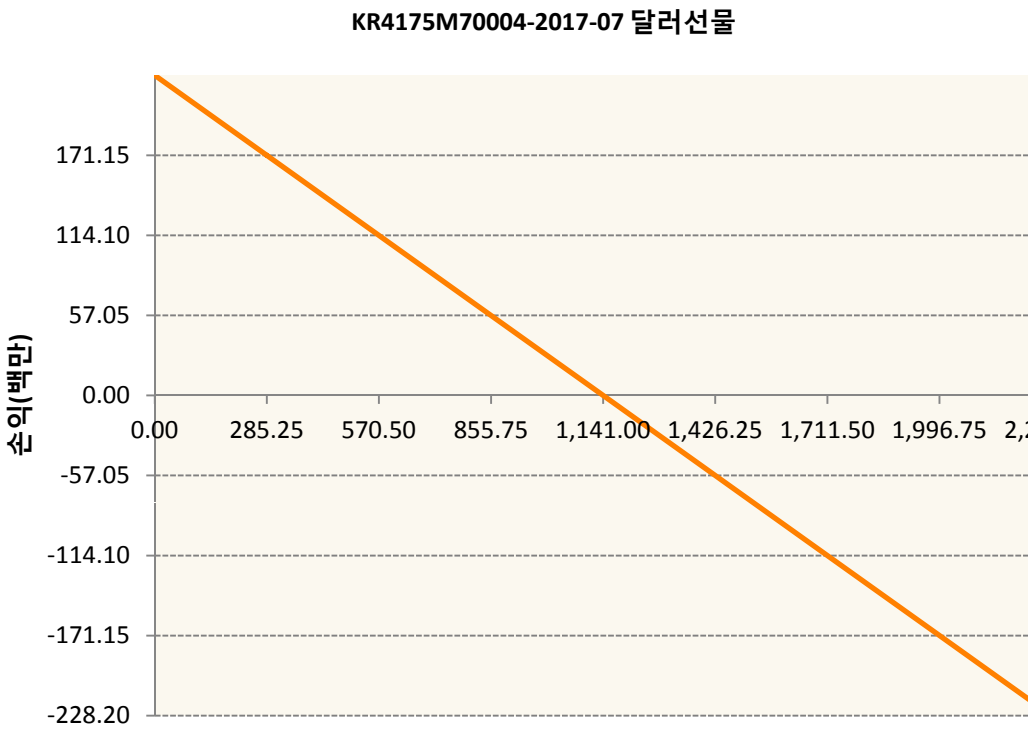
2. 만기시점의 손익구조



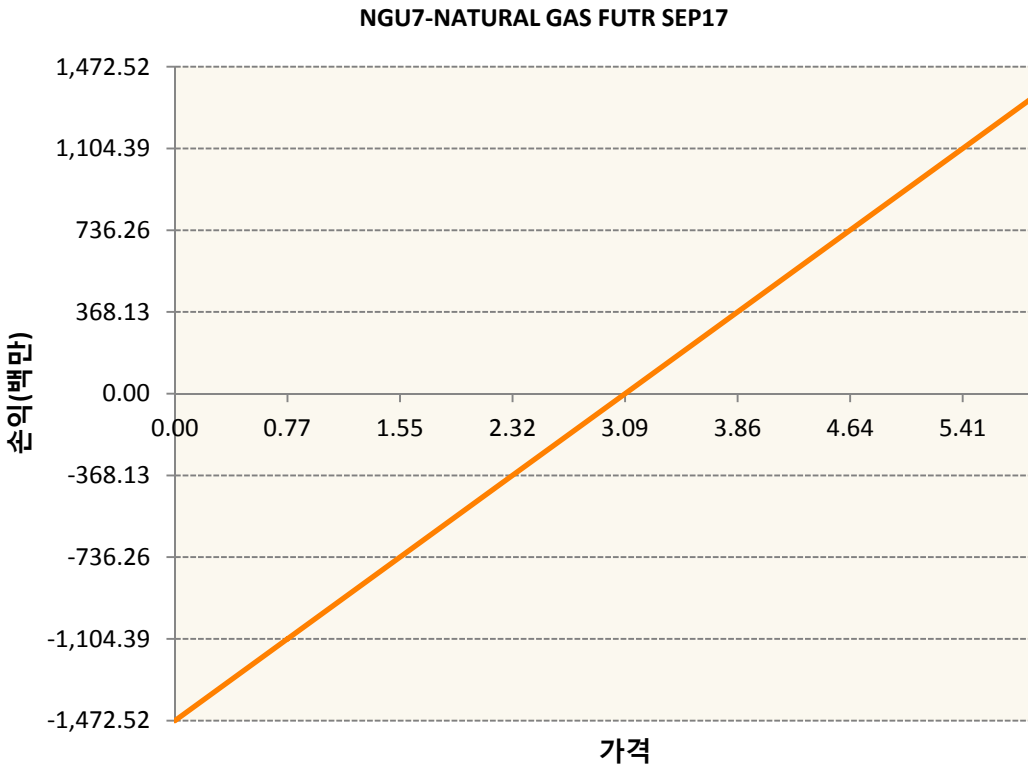


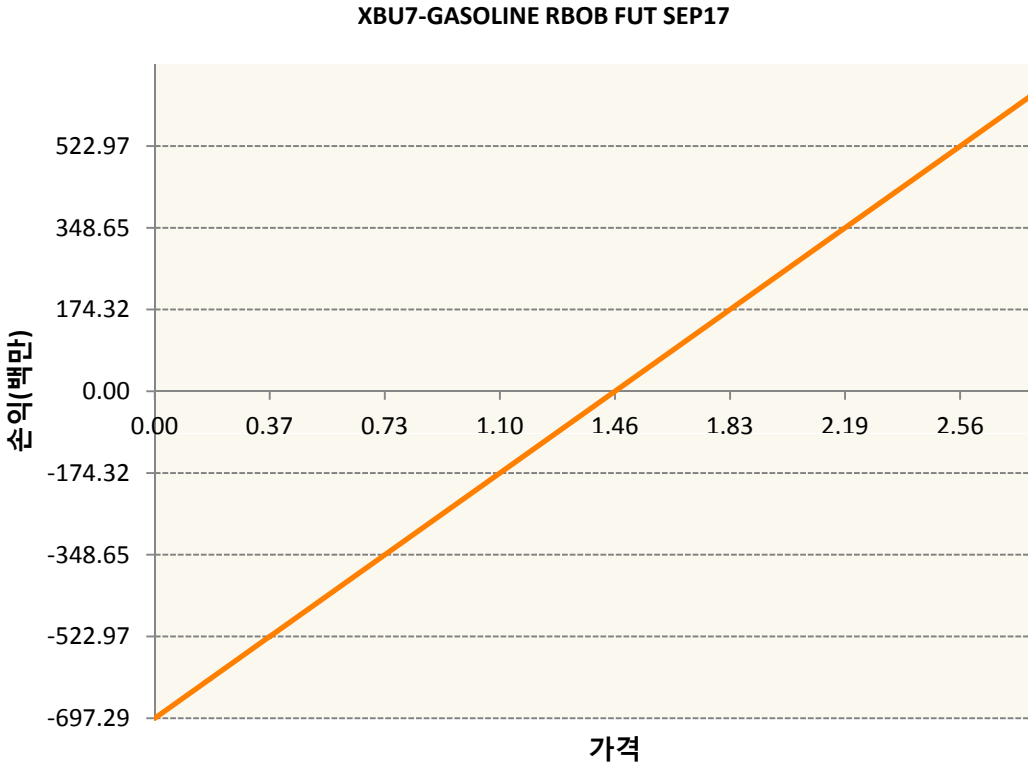

-1,000.16
-1,333.55
가격


HOU7-NY HARB ULSD FUT SEP17
517.55
345.04
172.52
0.00
-172.52
-345.04
-517.55
-690.07
0.00
0.36
0.73
1.09
1.45
1.81
2.18
2.54
순이익(백만)
가격


KR4175M70004-2017-07 달러선물
171.15
114.10
57.05
0.00
-57.05
-114.10
-171.15
-228.20
0.00
285.25
570.50
855.75
1,141.00
1,426.25
1,711.50
1,996.75
순이익(백만)

가격


NGU7-NATURAL GAS FUTR SEP17
1,472.52
1,104.39
736.26
368.13
0.00
-368.13
-736.26
-1,104.39
-1,472.52
0.00
0.77
1.55
2.32
3.09
3.86
4.64
5.41
손익(백만)
가격


XBU7-GASOLINE RBOB FUT SEP17
522.97
348.65
174.32
0.00
-174.32
-348.65
-522.97
-697.29
0.00
0.37
0.73
1.10
1.46
1.83
2.19
2.56
손익(백만)
가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLU7	WTI CRUDE FUTURE SEP17	69
COU7	BRENT CRUDE FUTR SEP17	107
HOU7	NY HARB ULSD FUT SEP17	55
KR4175M70(	2017-07 달러선물	18
NGU7	NATURAL GAS FUTR SEP17	118
XBU7	GASOLINE RBOB FUT SEP17	56

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

807

공시일	2017-06-30
기준일	2017-06-29

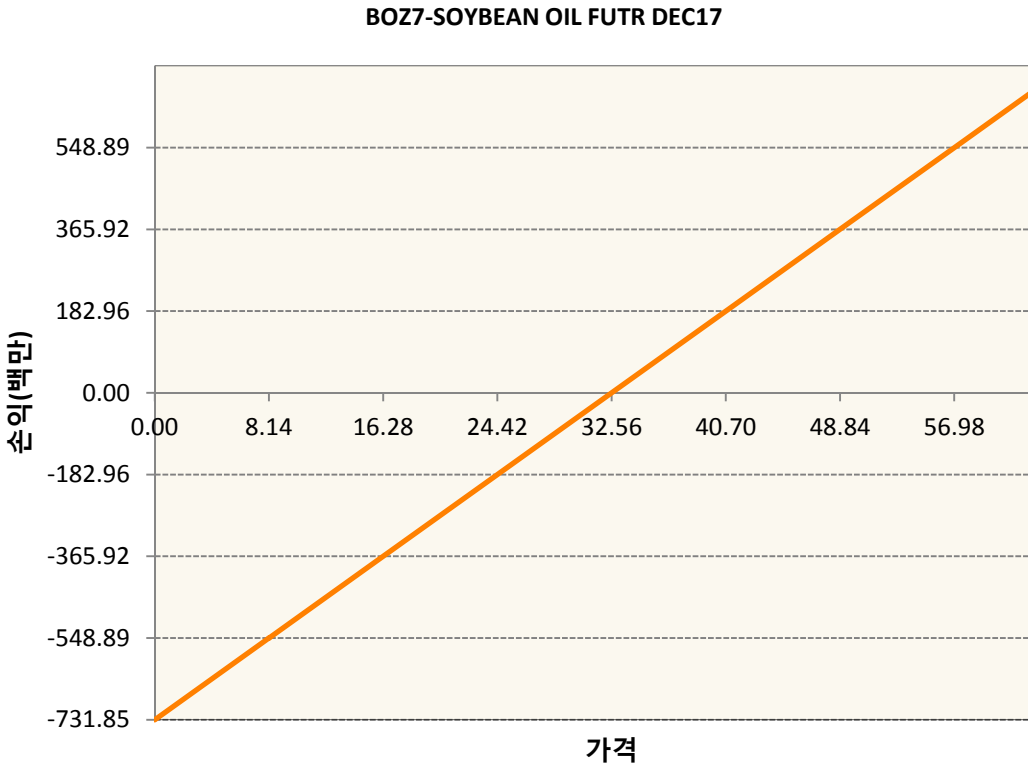
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

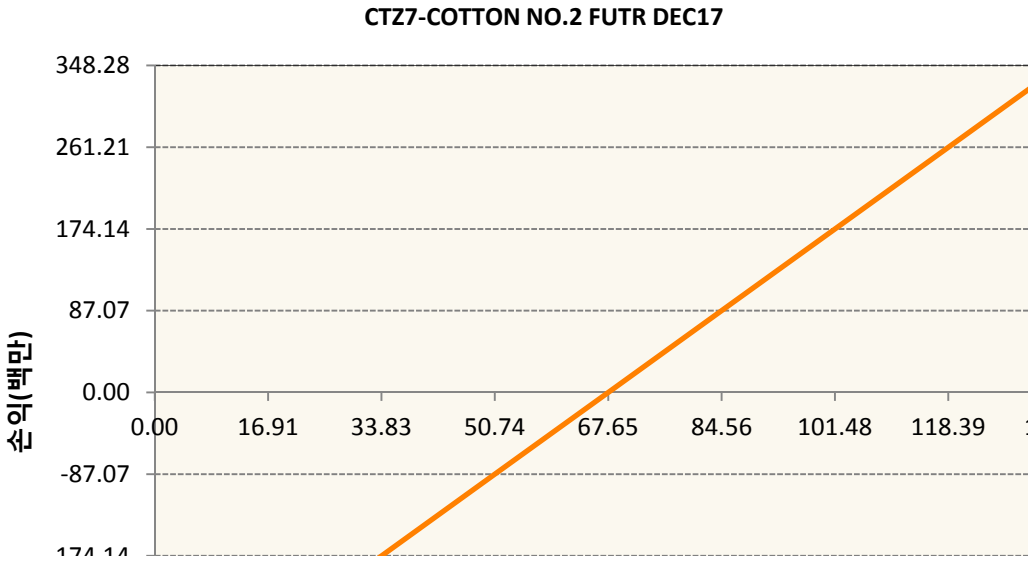
1. 계약금액

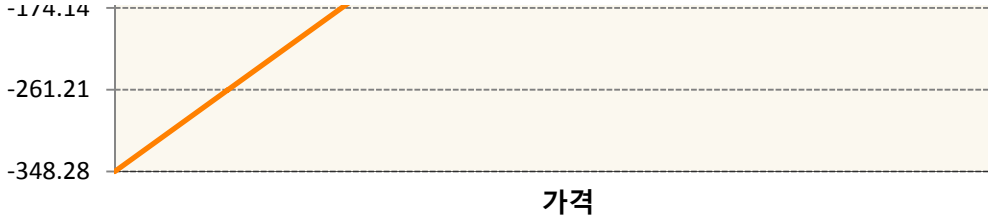
(단위:백만원)

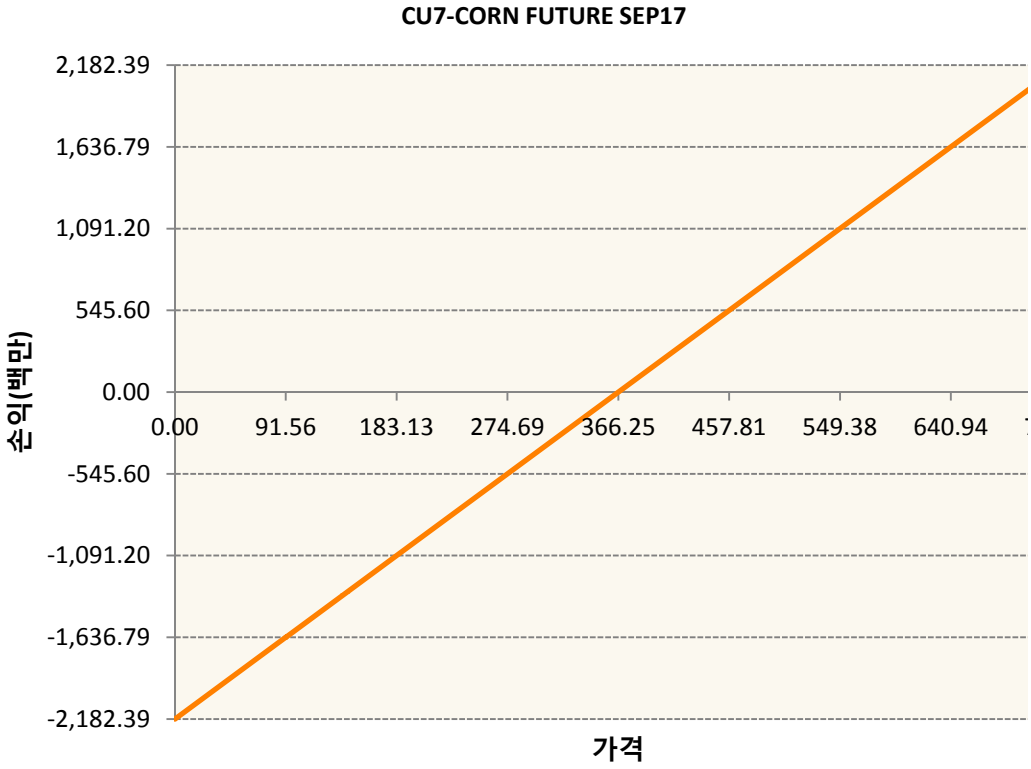
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	8,183	399	7,783	

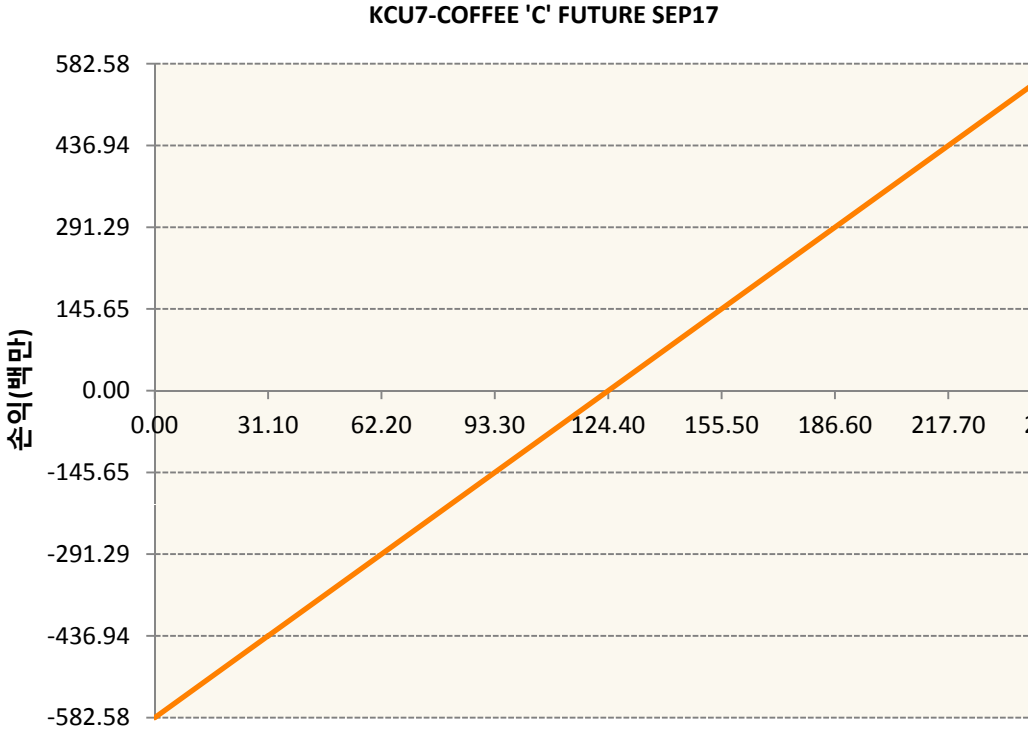
2. 만기시점의 손익구조





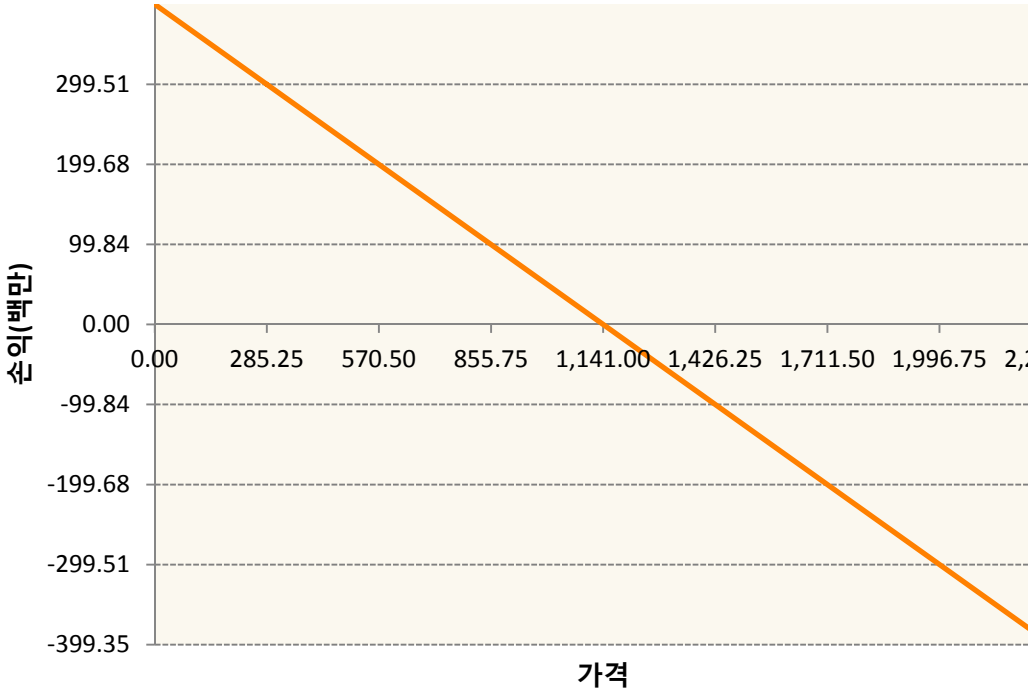

-174.14
-261.21
-348.28
가격


CU7-CORN FUTURE SEP17
2,182.39
1,636.79
1,091.20
545.60
0.00
-545.60
-1,091.20
-1,636.79
-2,182.39
0.00
91.56
183.13
274.69
366.25
457.81
549.38
640.94
순익(백만)
가격

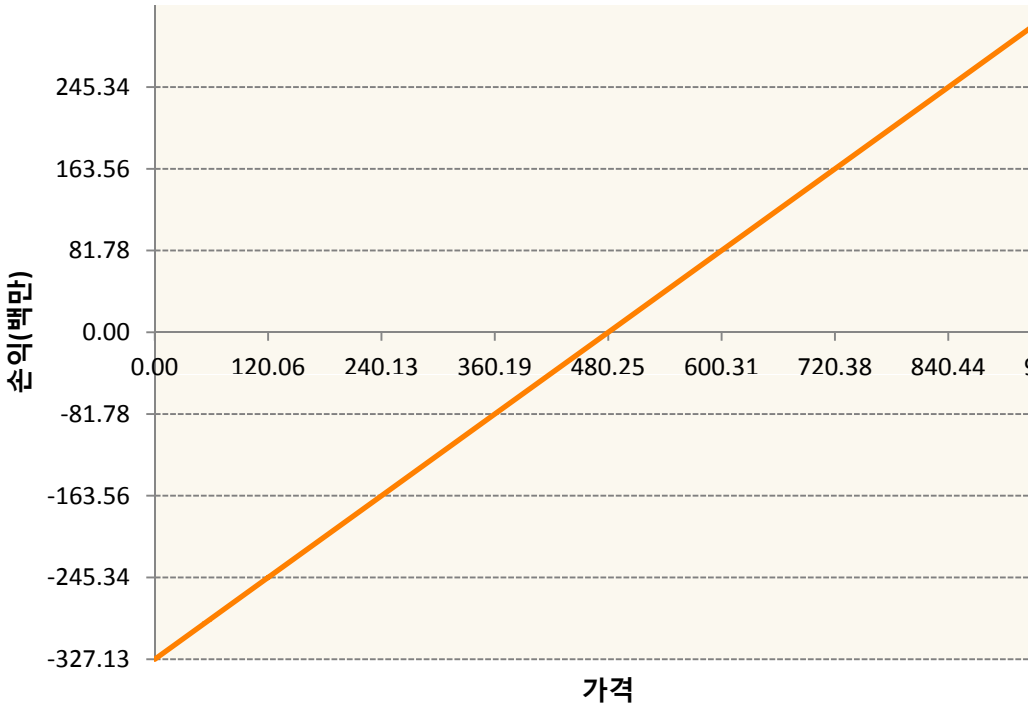

KCU7-COFFEE 'C' FUTURE SEP17
582.58
436.94
291.29
145.65
0.00
-145.65
-291.29
-436.94
-582.58
0.00
31.10
62.20
93.30
124.40
155.50
186.60
217.70
순익(백만)

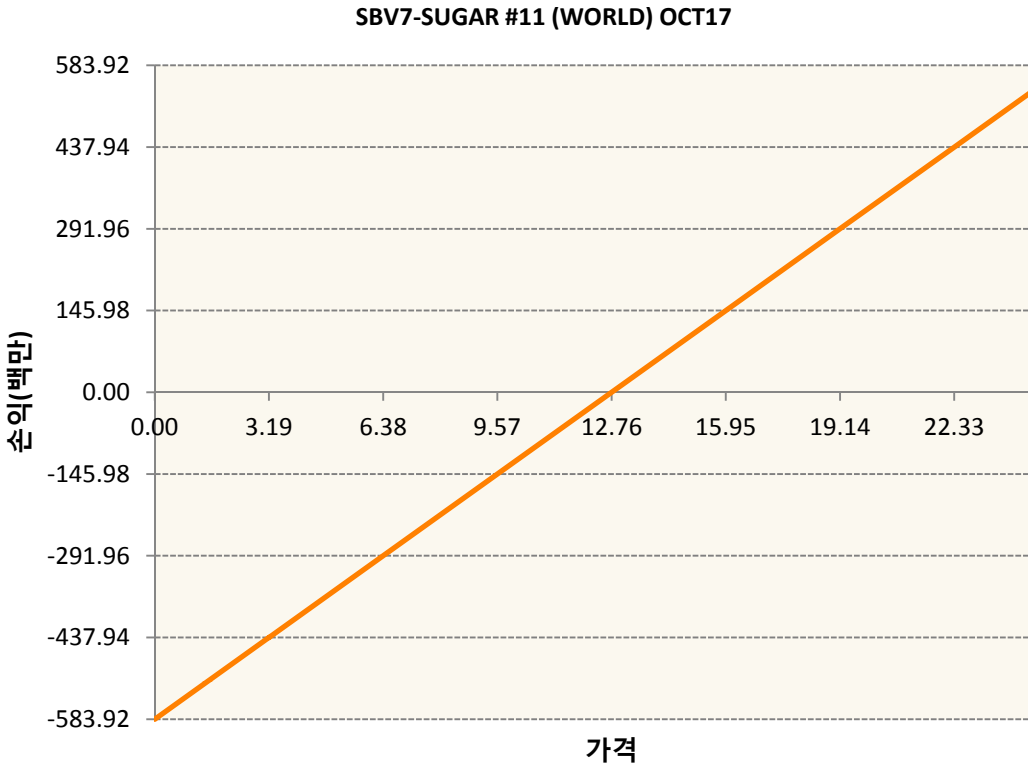
가격

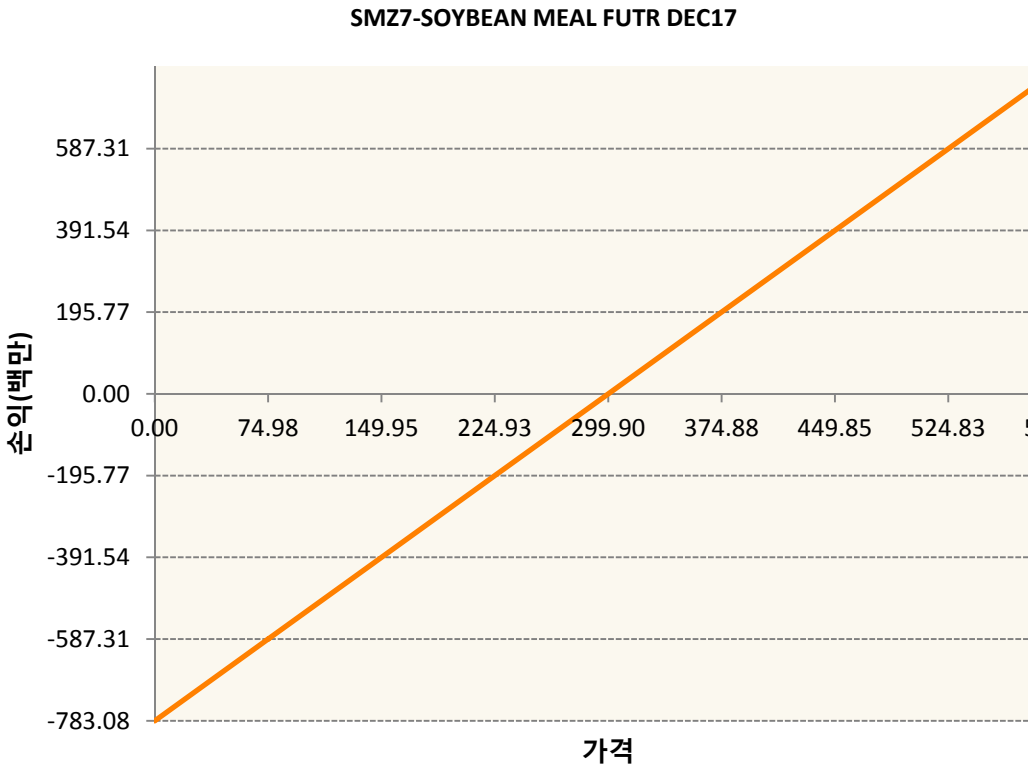
KR4175M70004-2017-07 달러선물

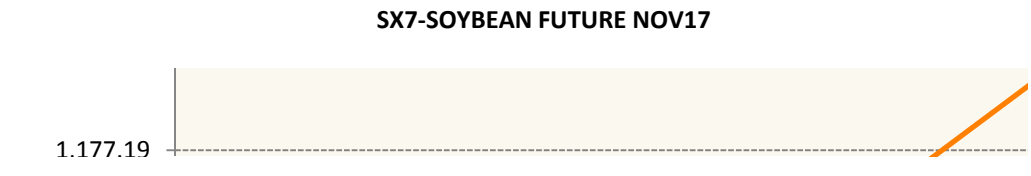


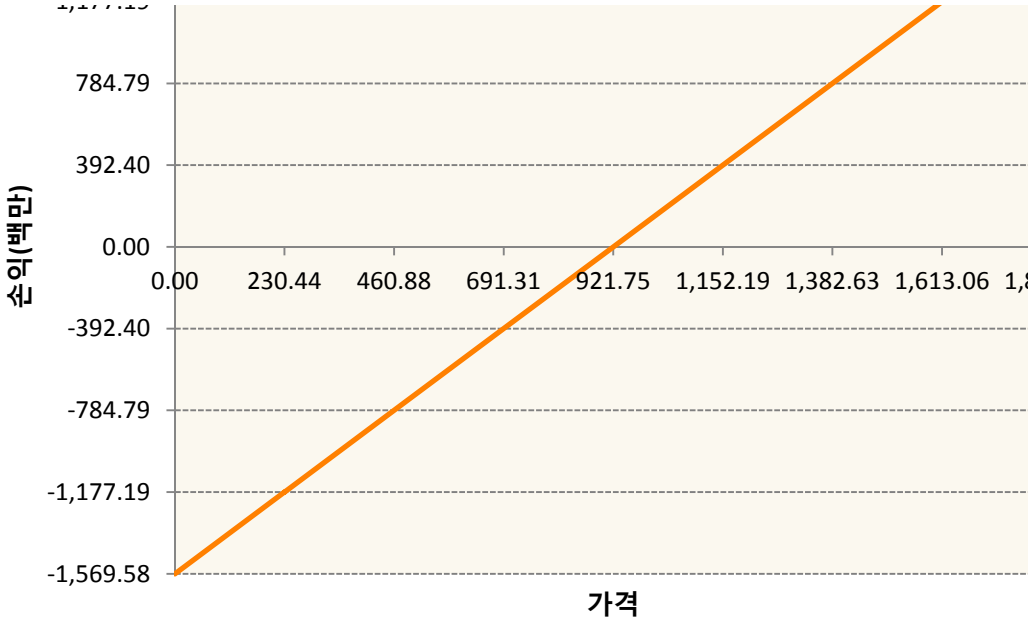
KWU7-KC HRW WHEAT FUT SEP17

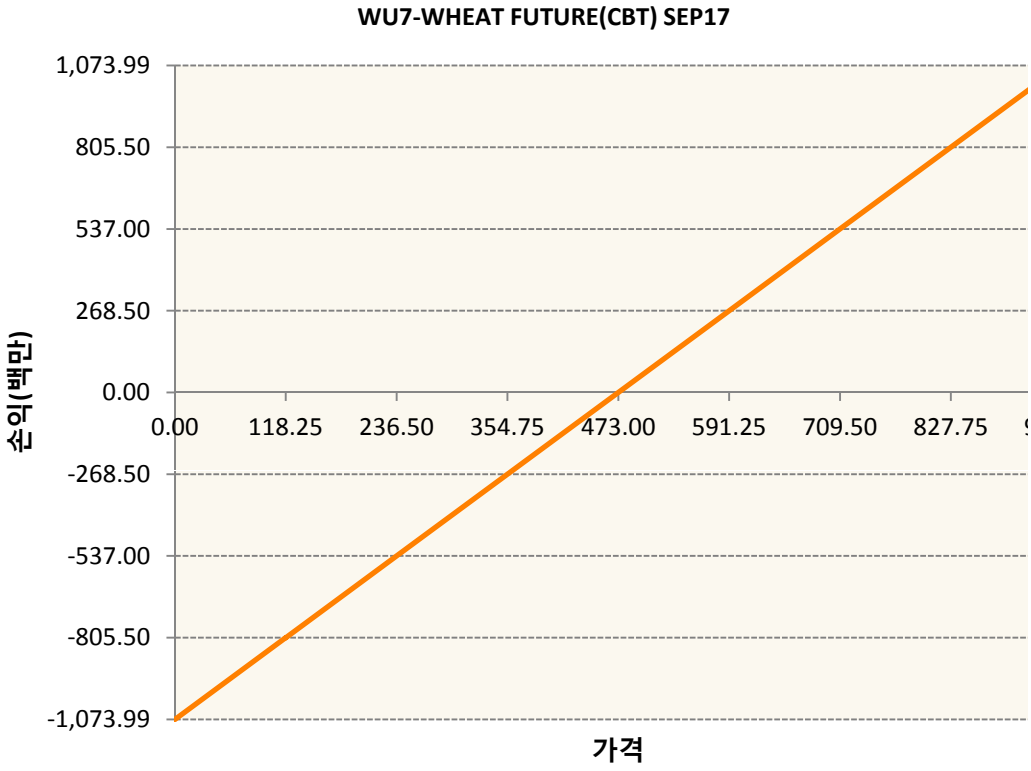



SBV7-SUGAR #11 (WORLD) OCT17
583.92
437.94
291.96
145.98
0.00
-145.98
-291.96
-437.94
-583.92
0.00
3.19
6.38
9.57
12.76
15.95
19.14
22.33
손익(백만)
가격


SMZ7-SOYBEAN MEAL FUTR DEC17
587.31
391.54
195.77
0.00
-195.77
-391.54
-587.31
-783.08
0.00
74.98
149.95
224.93
299.90
374.88
449.85
524.83
손익(백만)
가격


SX7-SOYBEAN FUTURE NOV17
1.177.19





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	63
SX7	SOYBEAN FUTURE NOV17	126
WU7	WHEAT FUTURE(CBT) SEP17	86

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

742