공시일	2017-07-03
기준일	2017-06-30

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	2017-07-03
기준일	2017-06-30

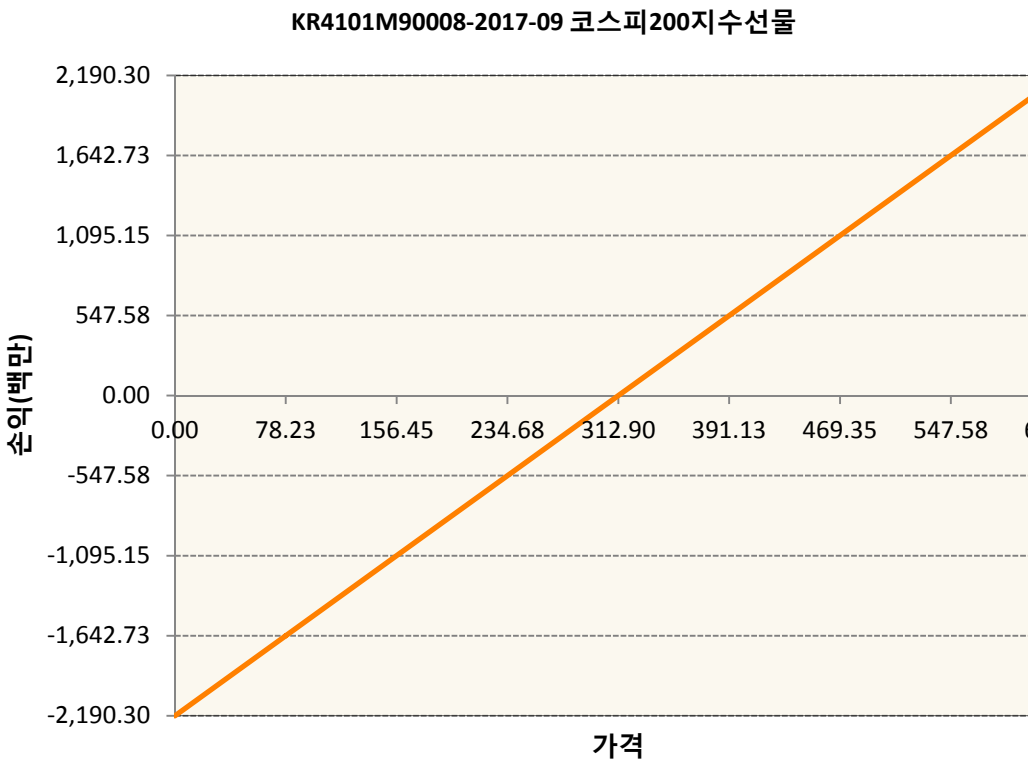
스마트인덱스모

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	2,190	0	2,190	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	2017-07-03
기준일	2017-06-30

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)

493

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-07-03
기준일	2017-06-30

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	381

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

324

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-07-03
기준일	2017-06-30

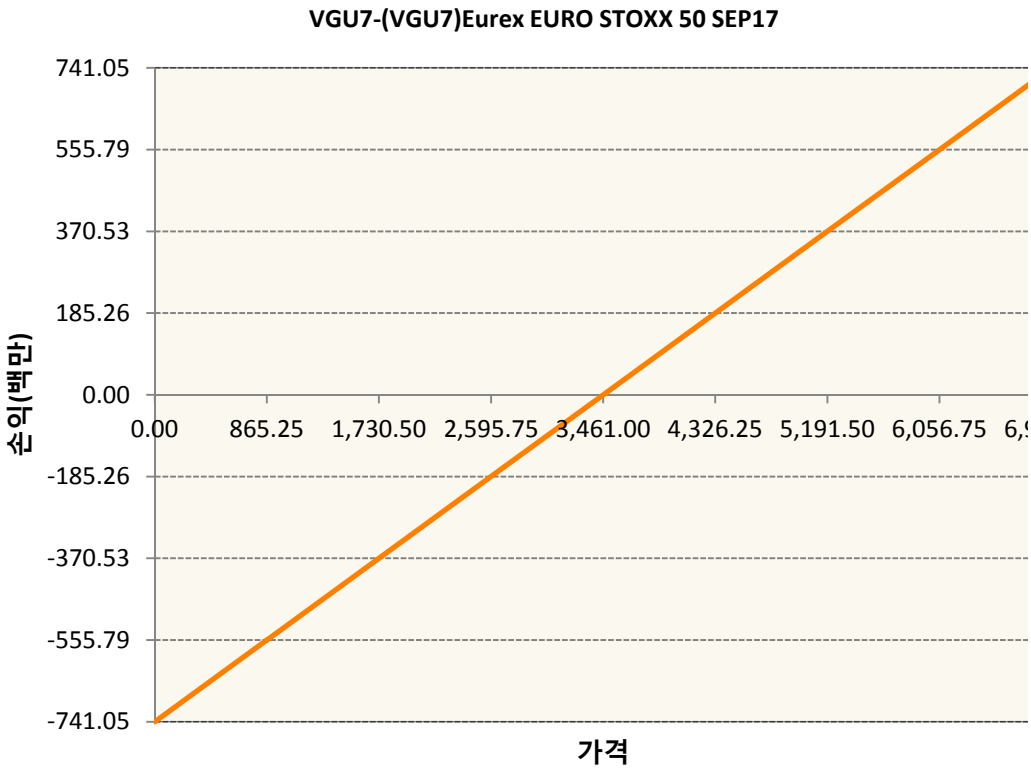
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	741	0	741	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGU7	(VGU7)Eurex EURO STOXX 50 SEP17	59

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

(단위:백만원)

54

공시일	2017-07-03
기준일	2017-06-30

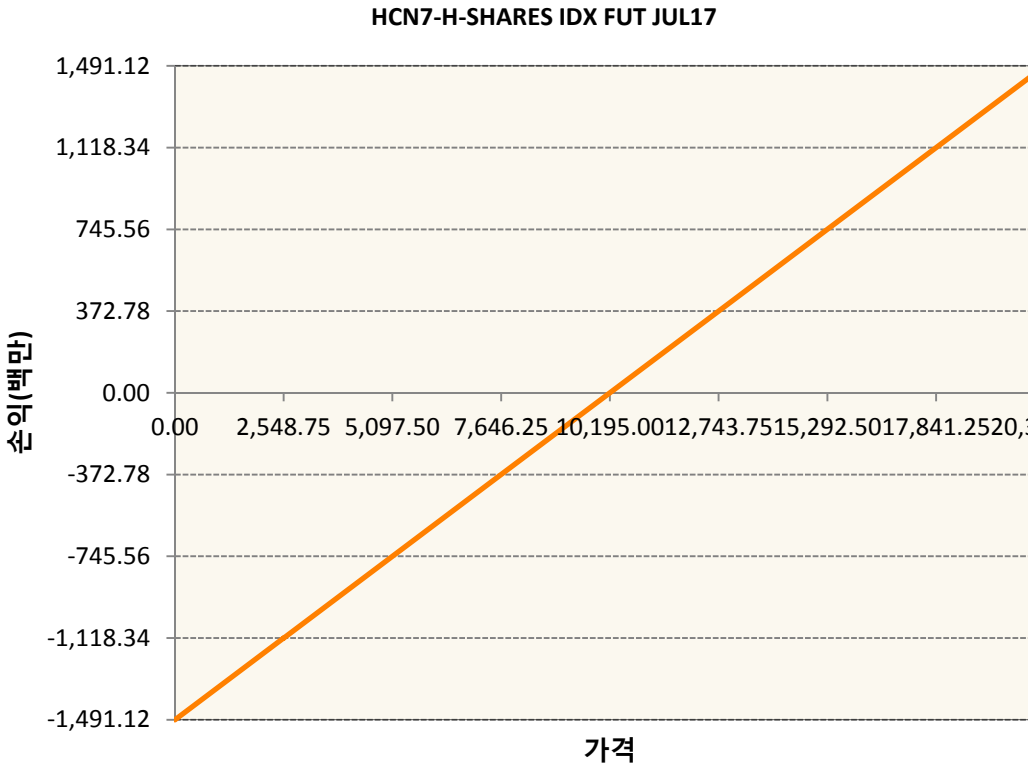
차이나인덱스모(주식-파생형)

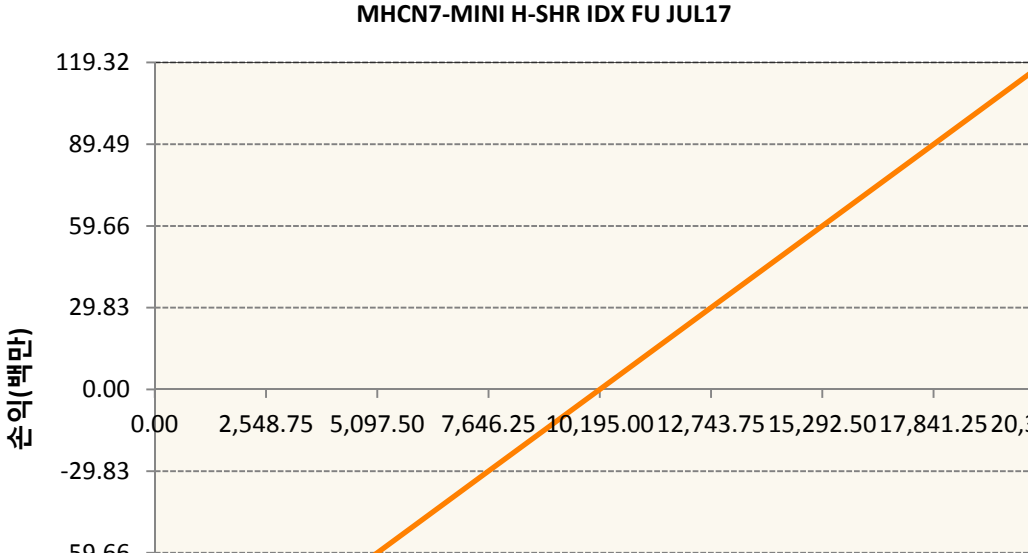
1. 계약금액

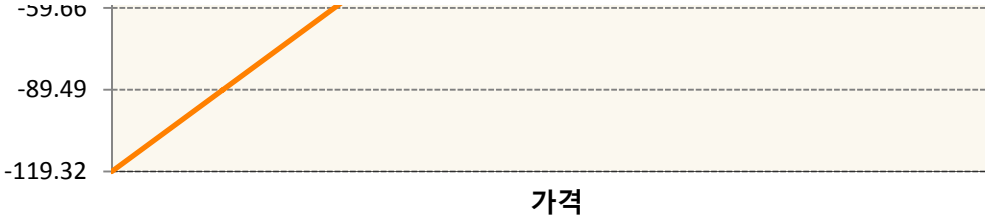
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,610	0	1,610	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)
	128

공시일	2017-07-03
기준일	2017-06-30

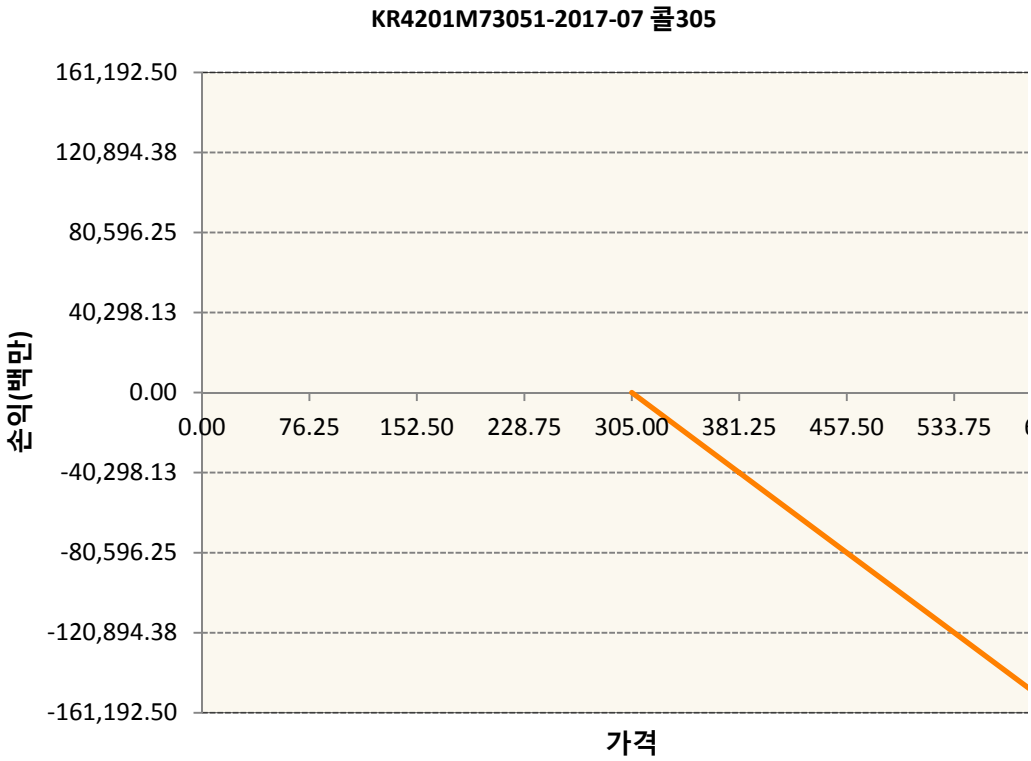
커버드콜모(주식혼합-파생형)

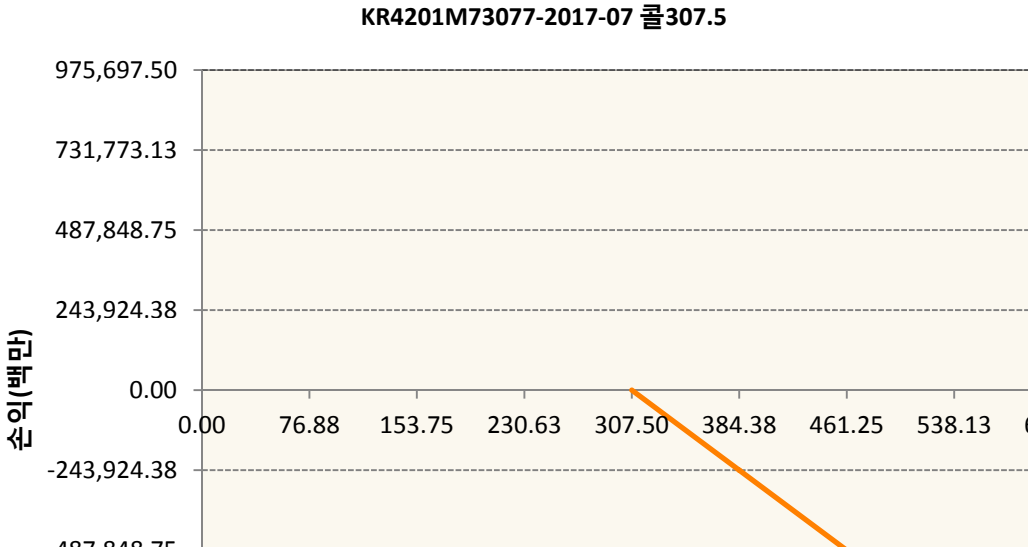
1. 계약금액

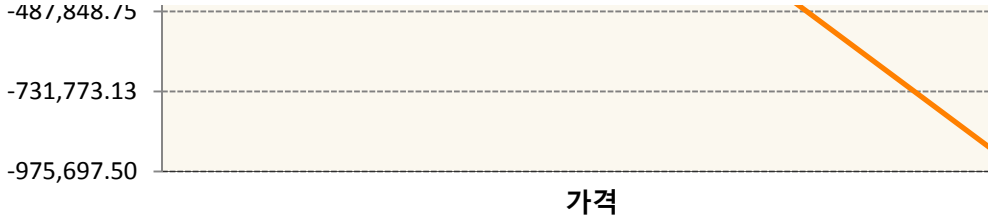
(단위:백만원)

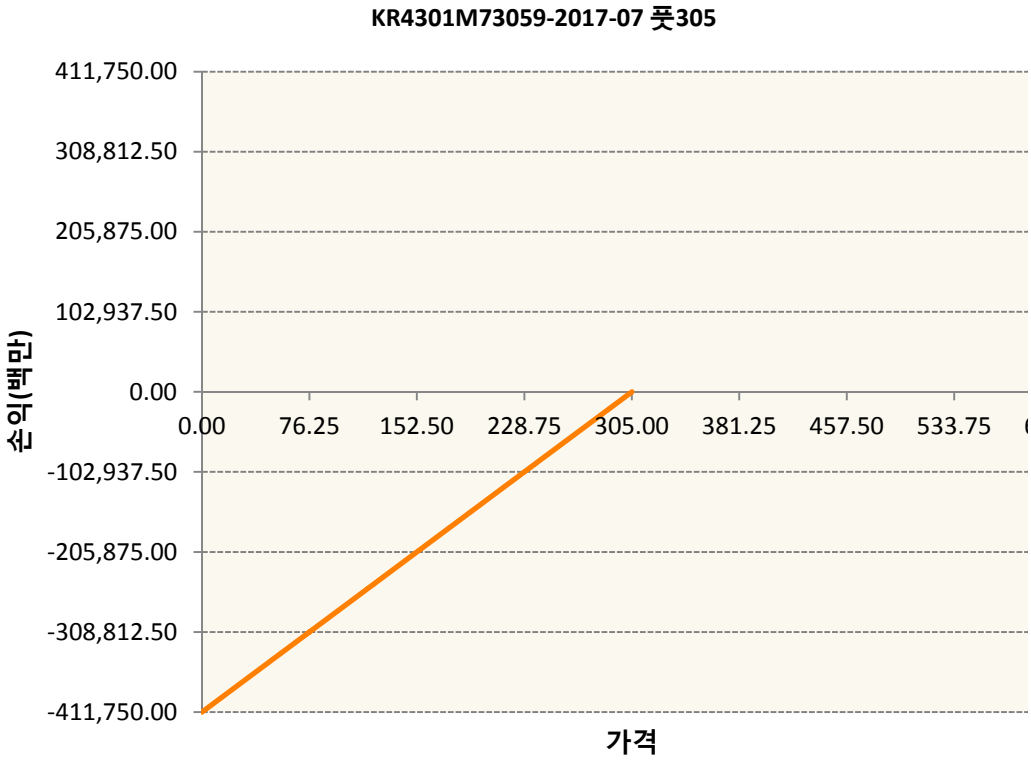
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	7,640	-7,640	장내
누계	유가증권	옵션	0	1,587,078	-1,587,078	장내

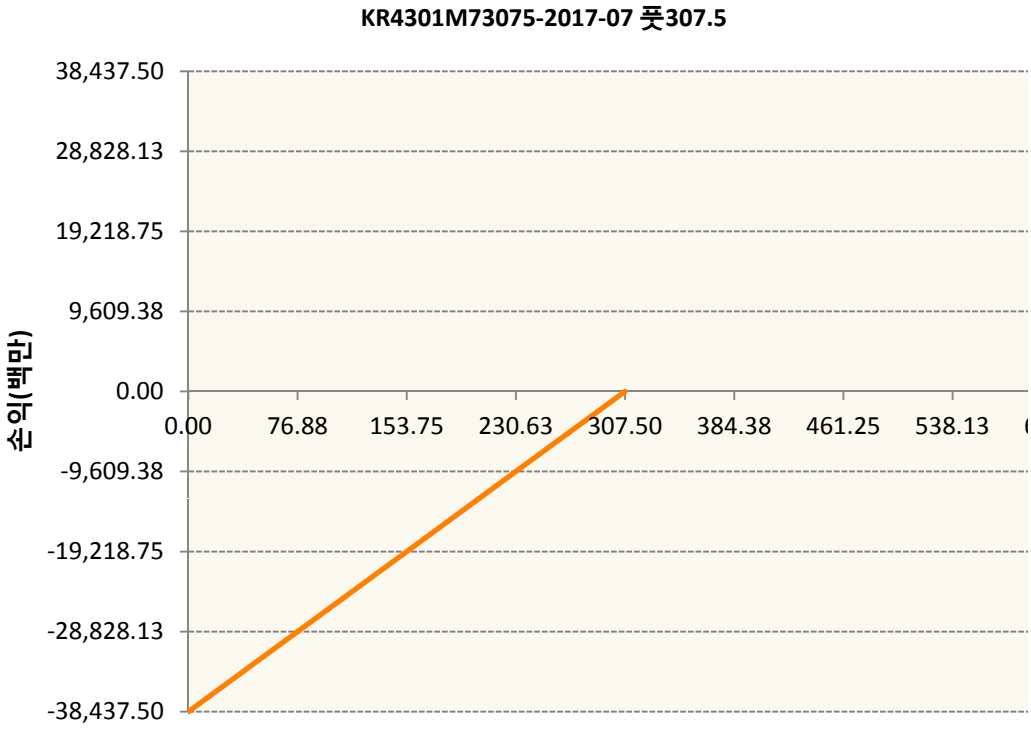
2. 만기시점의 손익구조






-731,773.13
-975,697.50
가격


KR4301M73059-2017-07 풋305
411,750.00
308,812.50
205,875.00
102,937.50
0.00
-102,937.50
-205,875.00
-308,812.50
-411,750.00
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							5,906
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	2,509	2,481	2,444	2,399	2,347	2,289	2,224
-5.33%	2,302	2,222	2,136	2,045	1,949	1,851	1,750
-2.67%	1,640	1,519	1,397	1,275	1,154	1,032	910
0%	320	217	110	0	-112	-225	-340
2.67%	-1,534	-1,586	-1,647	-1,716	-1,792	-1,873	-1,959
5.33%	-3,643	-3,659	-3,682	-3,713	-3,752	-3,798	-3,850
8.00%	-5,824	-5,827	-5,833	-5,844	-5,859	-5,879	-5,906
KR4201M73(2017-07 콜307.5							34,246
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	12,626	12,511	12,352	12,148	11,900	11,611	11,286
-5.33%	11,821	11,437	11,007	10,536	10,033	9,503	8,950
-2.67%	8,837	8,146	7,447	6,742	6,032	5,318	4,600
0%	2,115	1,418	713	0	-718	-1,440	-2,166
2.67%	-8,204	-8,617	-9,077	-9,577	-10,111	-10,672	-11,255
5.33%	-20,541	-20,691	-20,892	-21,143	-21,441	-21,783	-22,163
8.00%	-33,560	-33,595	-33,655	-33,748	-33,876	-34,042	-34,246
KR4301M73(2017-07 풋305							23,808
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-23,758	-23,759	-23,761	-23,765	-23,774	-23,788	-23,808
-5.33%	-12,600	-12,651	-12,721	-12,811	-12,918	-13,042	-13,182
-2.67%	-3,117	-3,406	-3,697	-3,990	-4,285	-4,580	-4,877
0%	480	341	179	0	-195	-402	-621
2.67%	778	771	757	733	698	651	590
5.33%	782	781	781	781	779	775	768
8.00%	782	782	782	782	782	781	781
KR4301M73(2017-07 풋307.5							2,447
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-2,445	-2,445	-2,445	-2,445	-2,446	-2,446	-2,447
-5.33%	-1,408	-1,410	-1,412	-1,417	-1,422	-1,429	-1,438
-2.67%	-444	-465	-487	-510	-534	-558	-583
0%	66	45	23	0	-24	-48	-73
2.67%	138	136	132	127	121	113	104

5.33%	139	139	139	139	139	138	136
8.00%	139	139	139	139	139	139	139

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

68,312

공시일	2017-07-03
기준일	2017-06-30

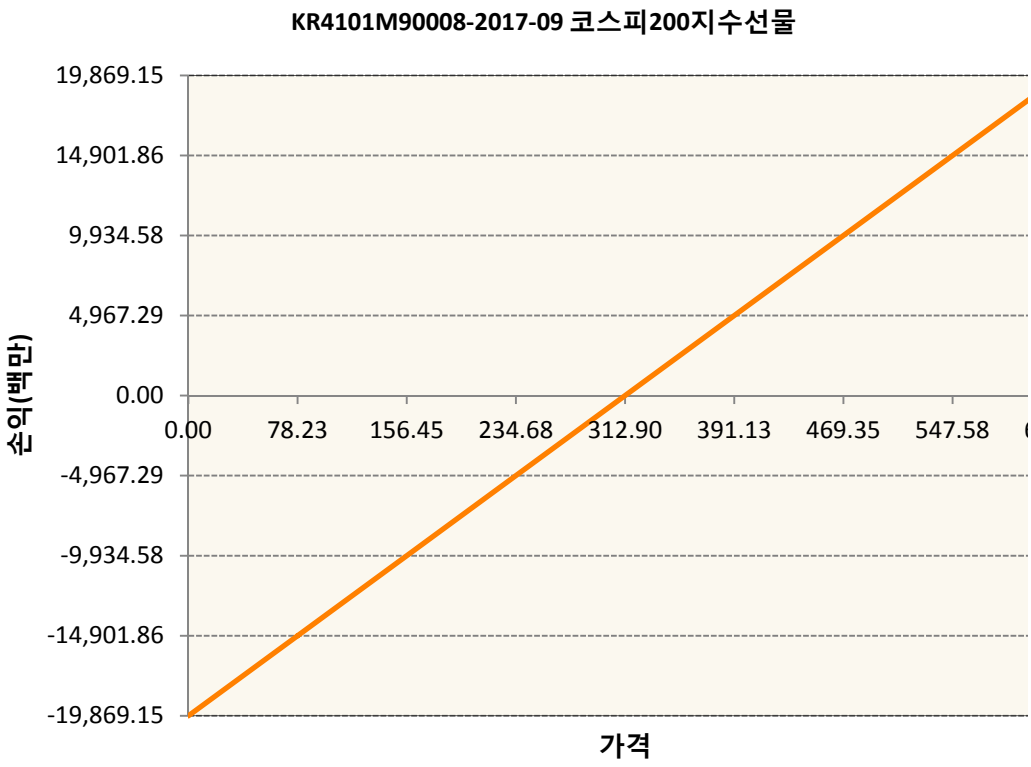
ETF스마트레버리지목표전환형6호

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	19,869	0	19,869	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)

493

공시일	2017-07-03
기준일	2017-06-30

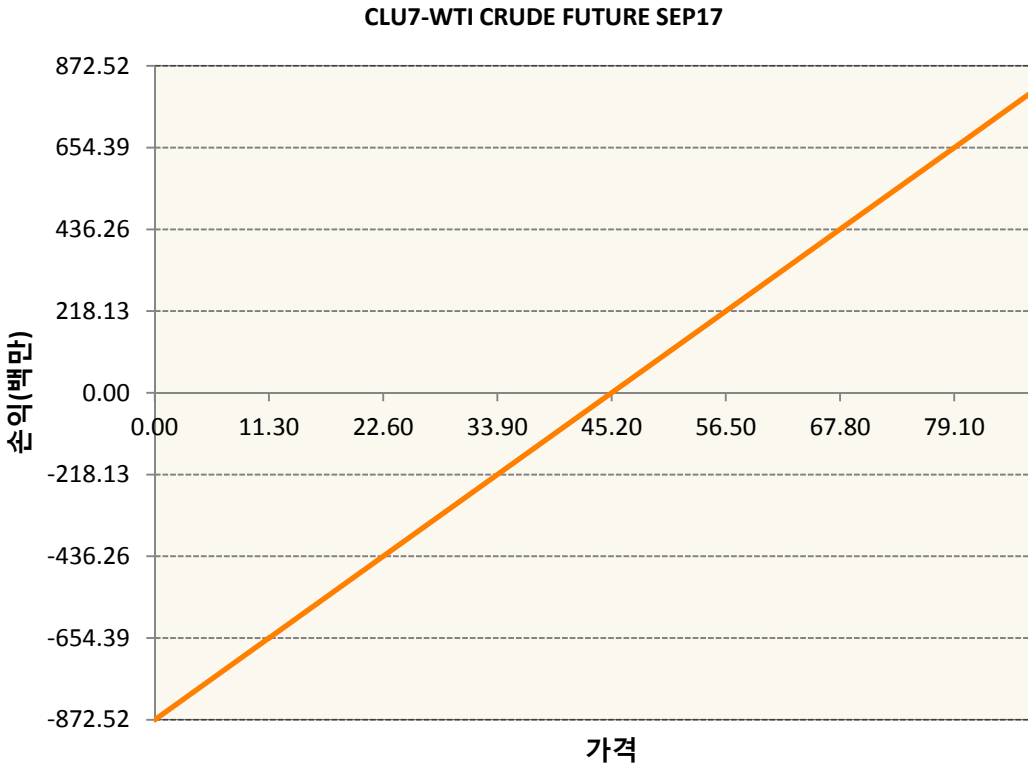
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

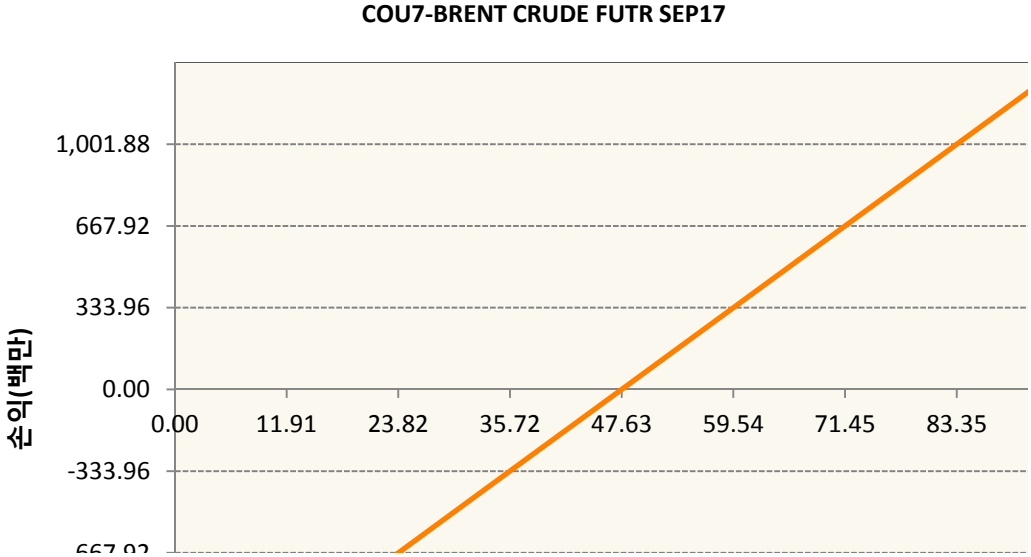
1. 계약금액

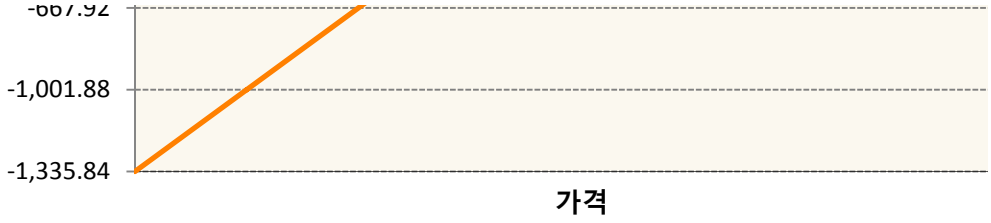
(단위:백만원)

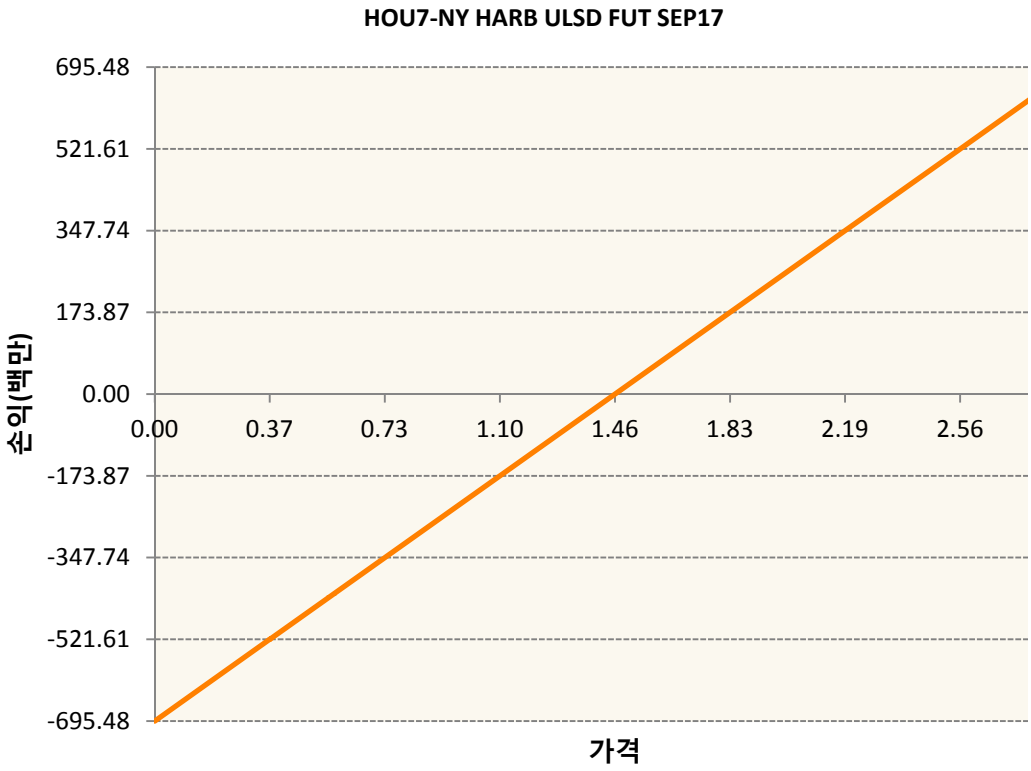
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	5,052	229	4,823	

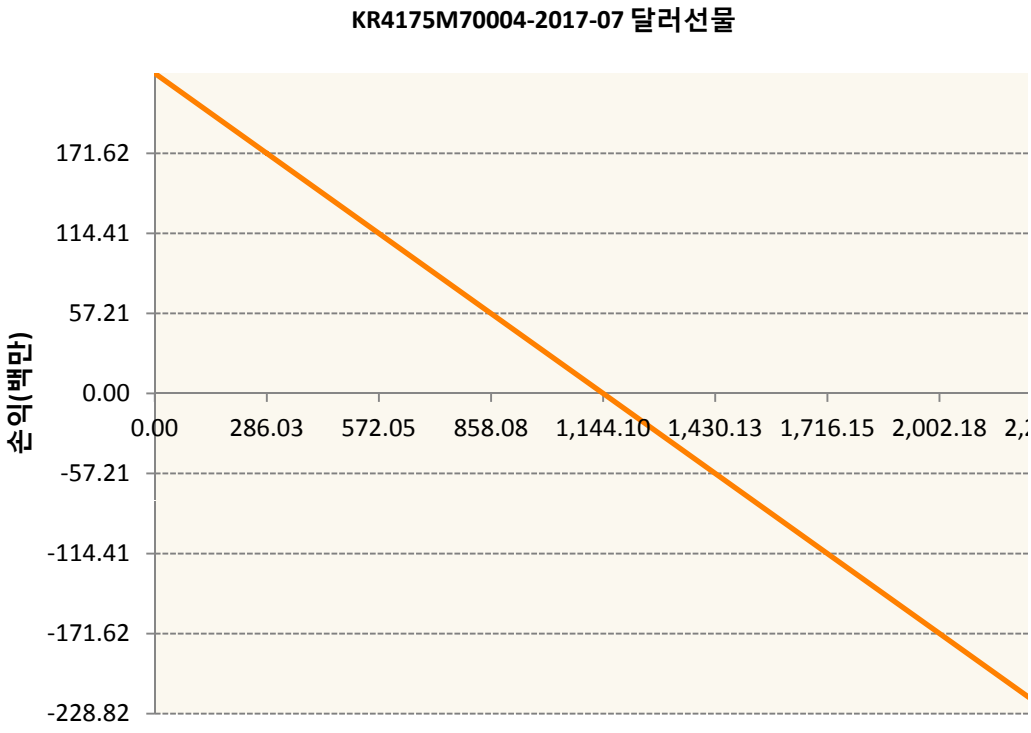
2. 만기시점의 손익구조



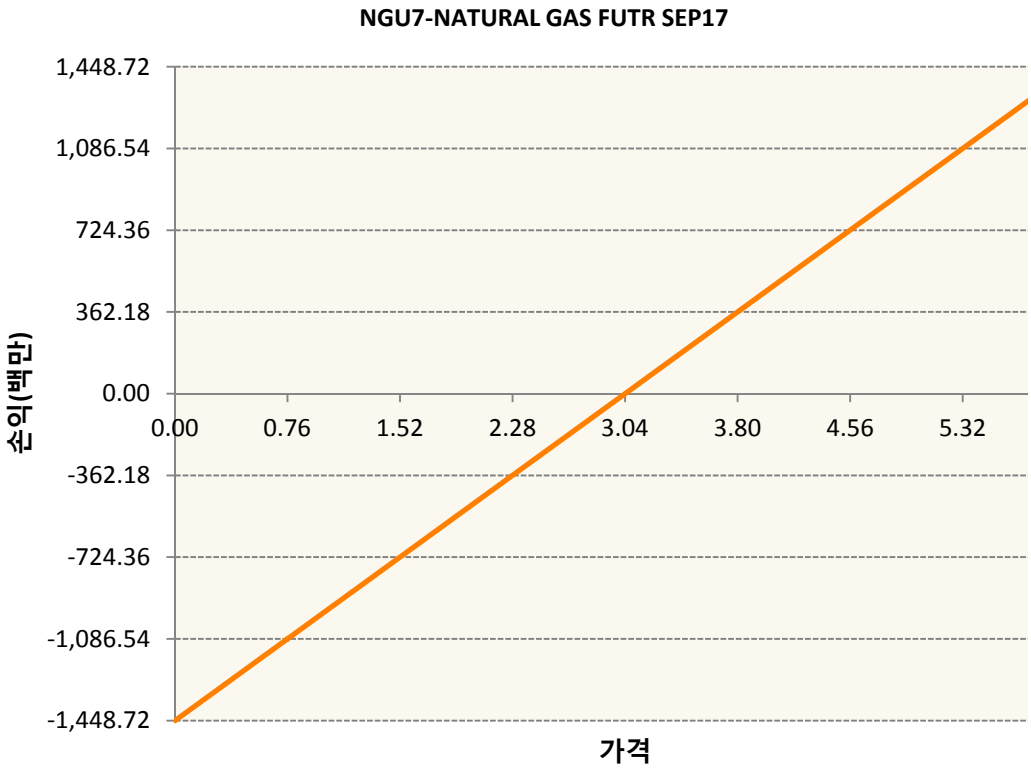


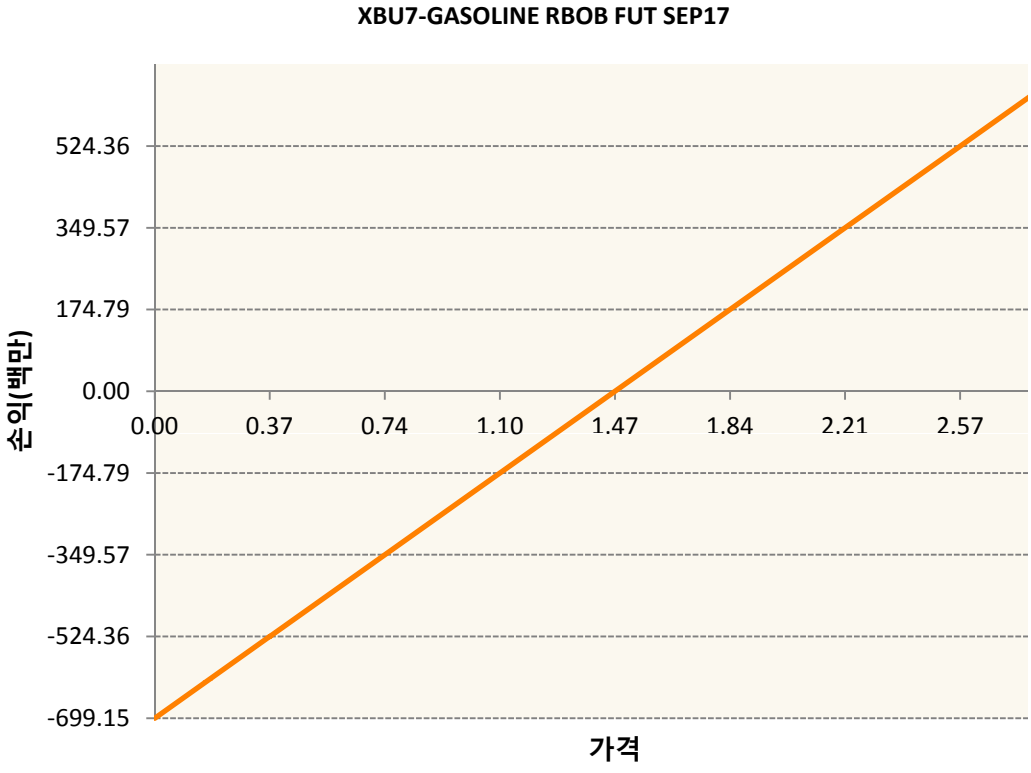

-667.92
-1,001.88
-1,335.84
가격


HOU7-NY HARB ULSD FUT SEP17
695.48
521.61
347.74
173.87
0.00
-173.87
-347.74
-521.61
-695.48
0.00
0.37
0.73
1.10
1.46
1.83
2.19
2.56
손익(백만)
가격


KR4175M70004-2017-07 달러선물
171.62
114.41
57.21
0.00
-57.21
-114.41
-171.62
-228.82
0.00
286.03
572.05
858.08
1,144.10
1,430.13
1,716.15
2,002.18
손익(백만)

가격


NGU7-NATURAL GAS FUTR SEP17
1,448.72
1,086.54
724.36
362.18
0.00
-362.18
-724.36
-1,086.54
-1,448.72
0.00
0.76
1.52
2.28
3.04
3.80
4.56
5.32
손익(백만)
가격


XBU7-GASOLINE RBOB FUT SEP17
524.36
349.57
174.79
0.00
-174.79
-349.57
-524.36
-699.15
0.00
0.37
0.74
1.10
1.47
1.84
2.21
2.57
손익(백만)
가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLU7	WTI CRUDE FUTURE SEP17	70
COU7	BRENT CRUDE FUTR SEP17	107
HOU7	NY HARB ULSD FUT SEP17	56
KR4175M70(	2017-07 달러선물	18
NGU7	NATURAL GAS FUTR SEP17	116
XBU7	GASOLINE RBOB FUT SEP17	56

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

800

공시일	2017-07-03
기준일	2017-06-30

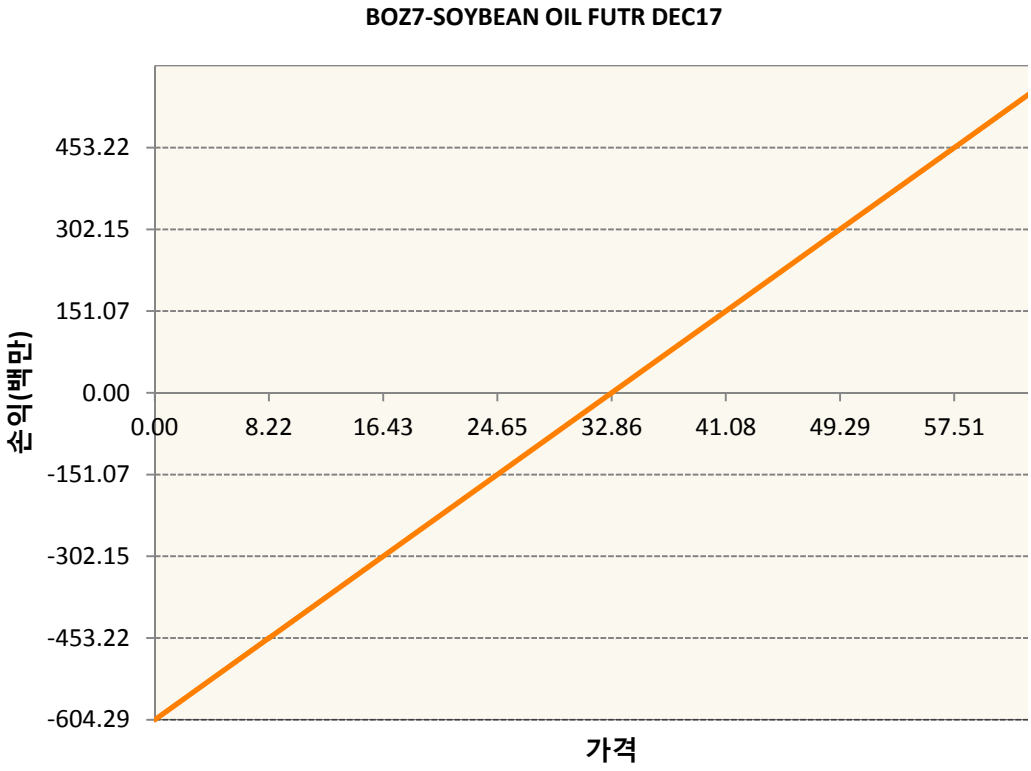
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

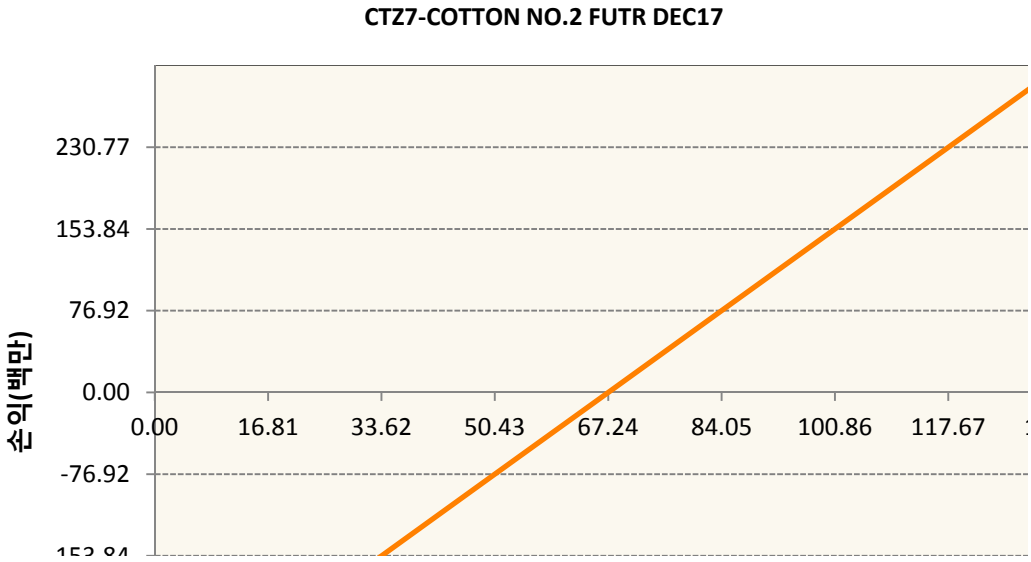
1. 계약금액

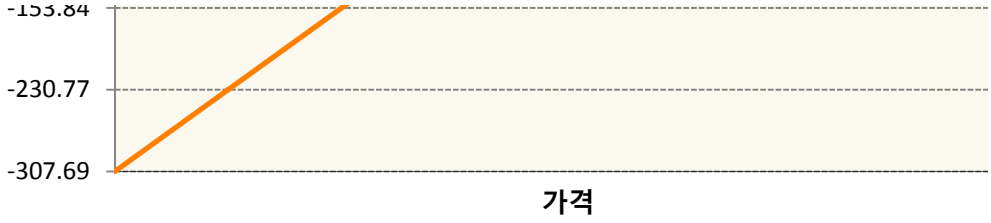
(단위:백만원)

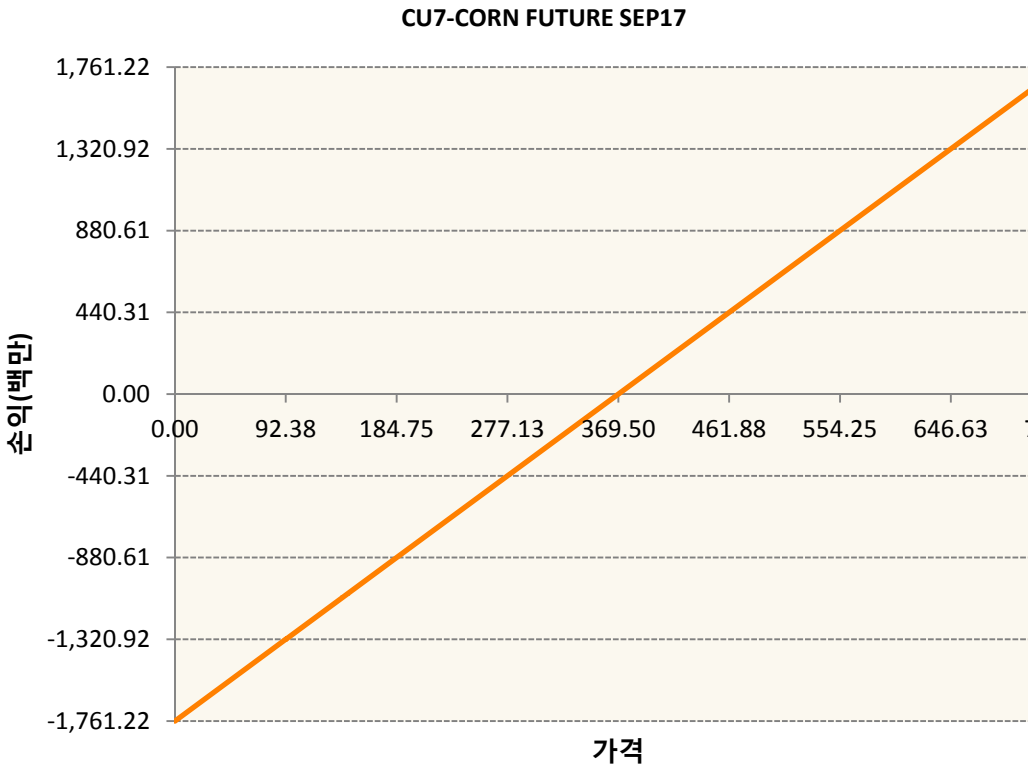
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	6,795	400	6,394	

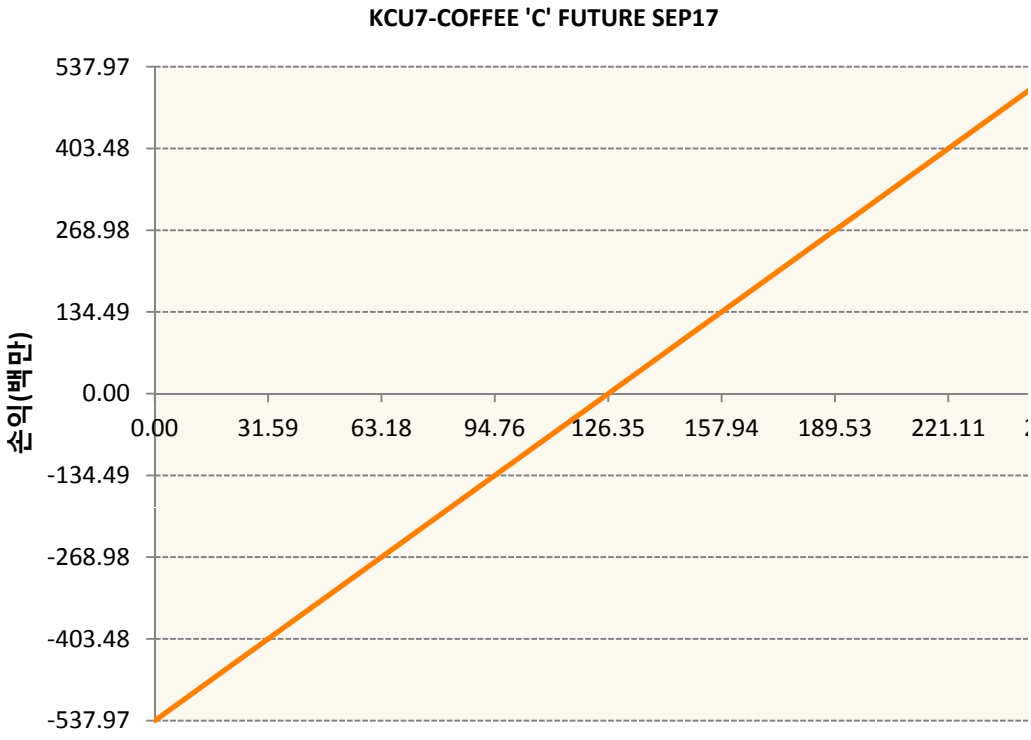
2. 만기시점의 손익구조





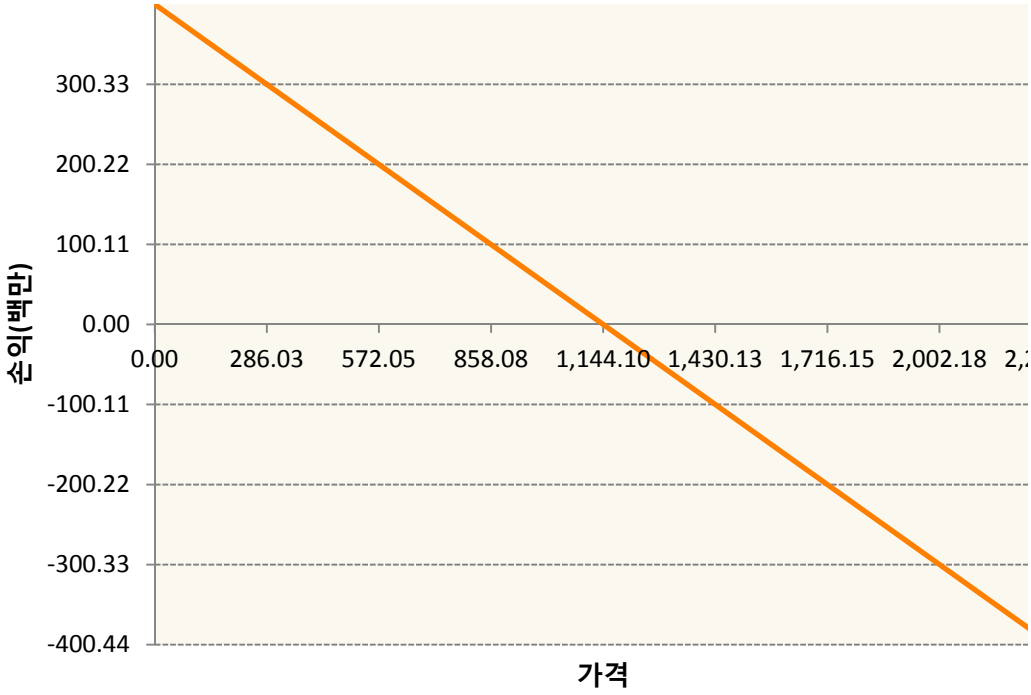

-153.84
-230.77
-307.69
가격


CU7-CORN FUTURE SEP17
1,761.22
1,320.92
880.61
440.31
0.00
-440.31
-880.61
-1,320.92
-1,761.22
0.00
92.38
184.75
277.13
369.50
461.88
554.25
646.63
순익(백만)
가격

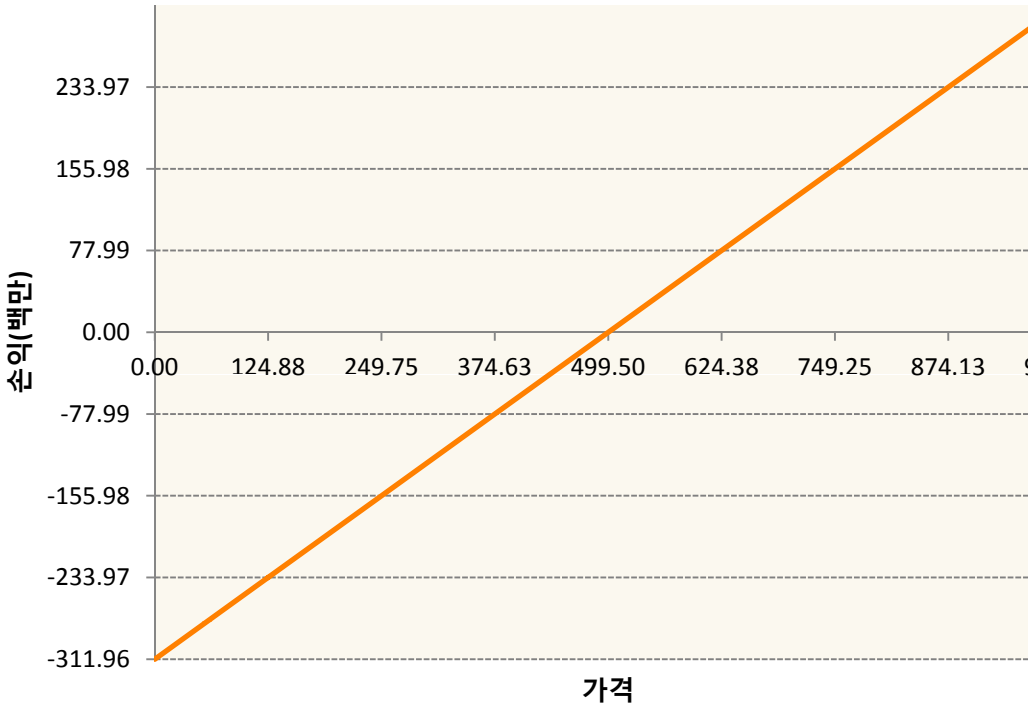

KCU7-COFFEE 'C' FUTURE SEP17
537.97
403.48
268.98
134.49
0.00
-134.49
-268.98
-403.48
-537.97
0.00
31.59
63.18
94.76
126.35
157.94
189.53
221.11
순익(백만)

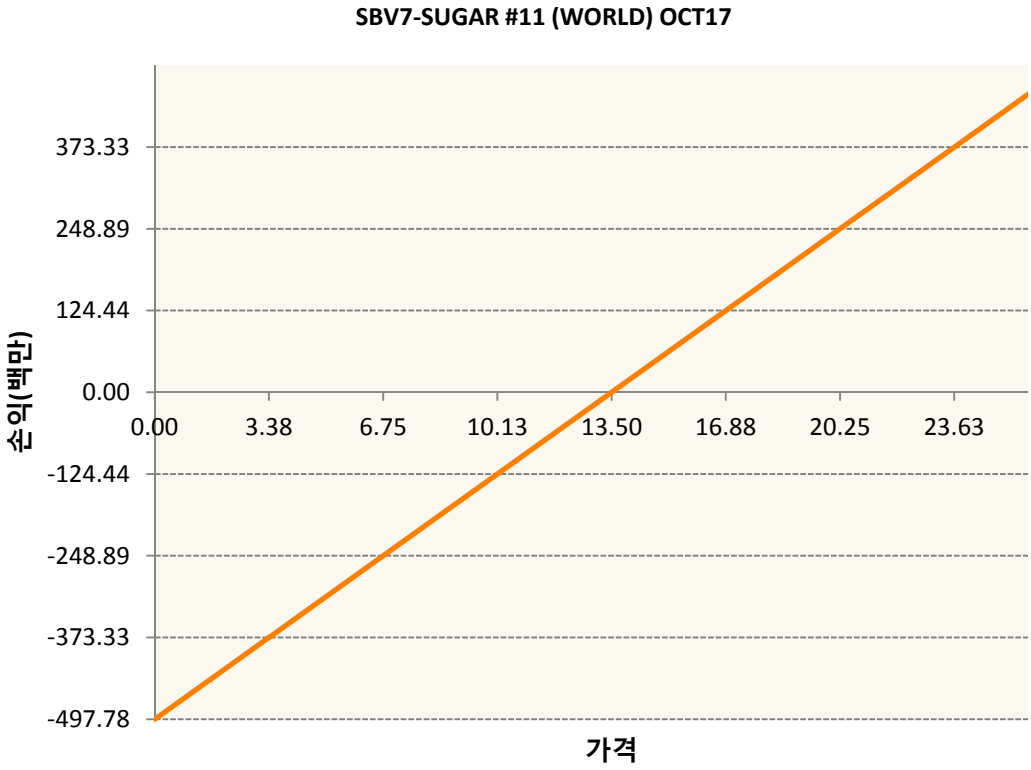
가격

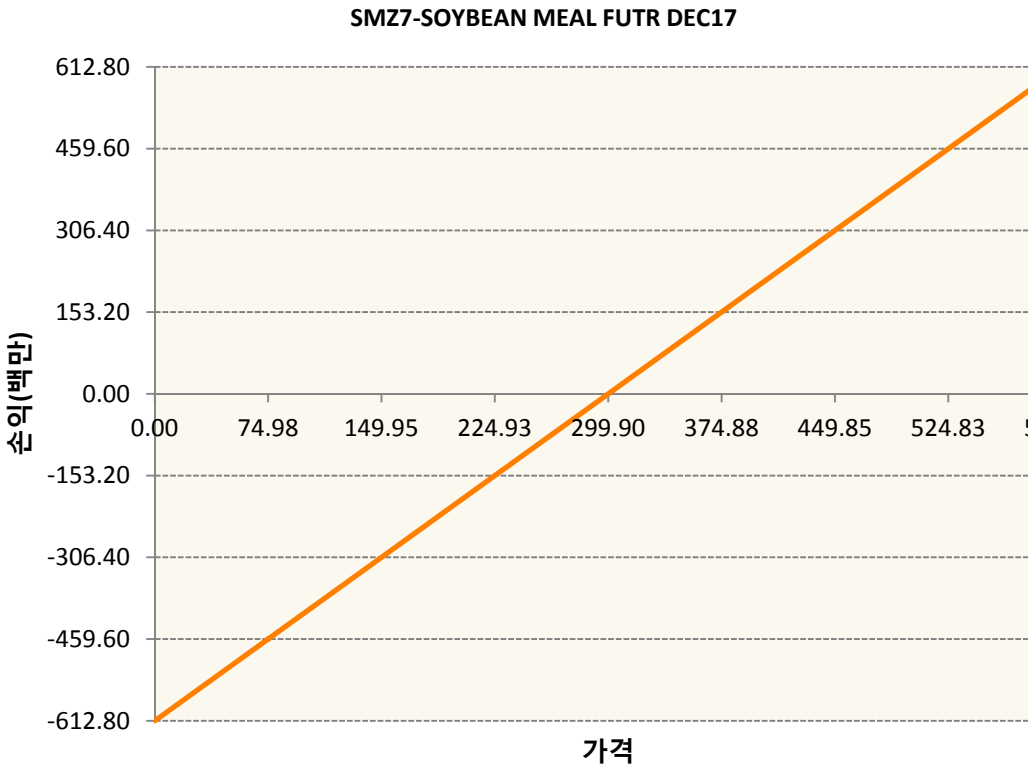
KR4175M70004-2017-07 달러선물

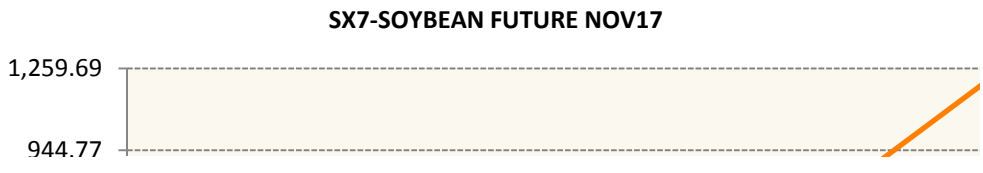


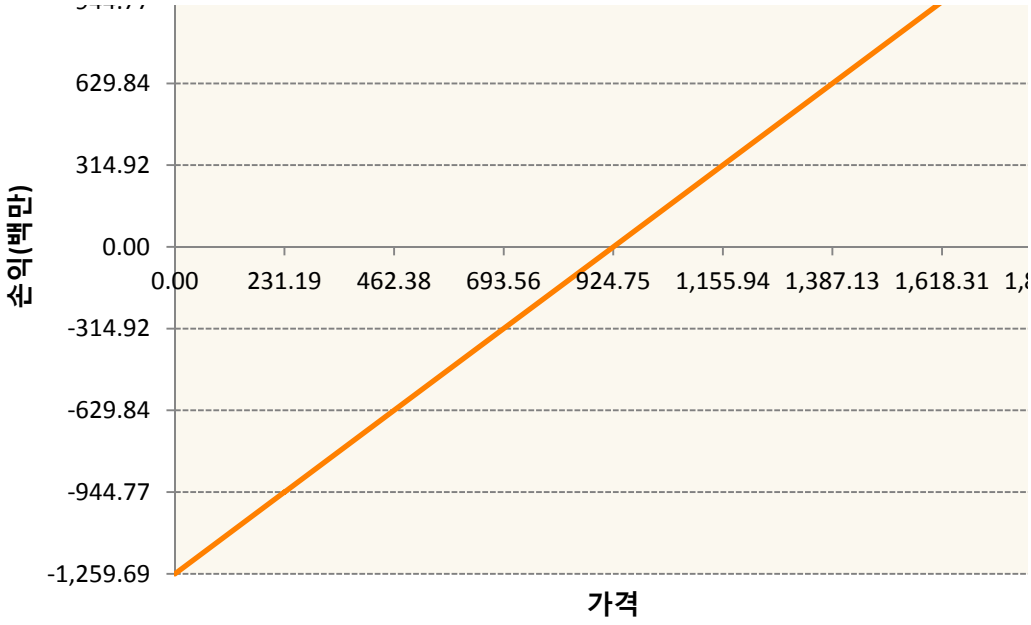
KWU7-KC HRW WHEAT FUT SEP17

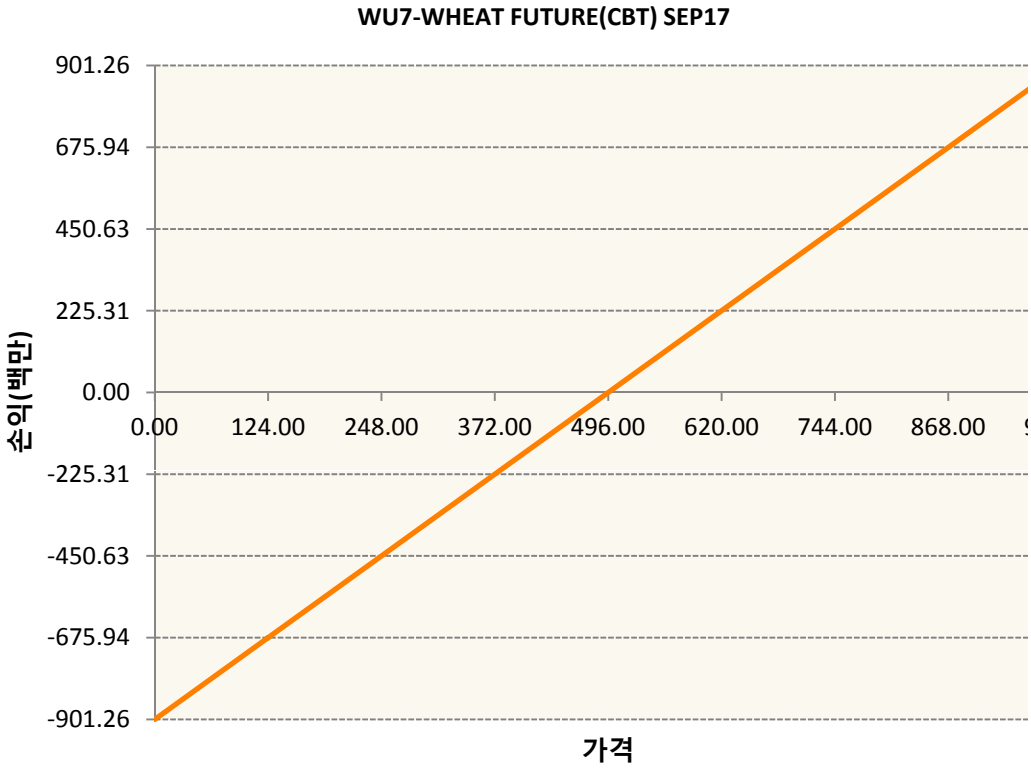



SBV7-SUGAR #11 (WORLD) OCT17
373.33
248.89
124.44
0.00
-124.44
-248.89
-373.33
-497.78
0.00
3.38
6.75
10.13
13.50
16.88
20.25
23.63
손익(백만)
가격


SMZ7-SOYBEAN MEAL FUTR DEC17
612.80
459.60
306.40
153.20
0.00
-153.20
-306.40
-459.60
-612.80
0.00
74.98
149.95
224.93
299.90
374.88
449.85
524.83
손익(백만)
가격


SX7-SOYBEAN FUTURE NOV17
1,259.69
944.77





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
BOZ7	SOYBEAN OIL FUTR DEC17	48
CTZ7	COTTON NO.2 FUTR DEC17	25
CU7	CORN FUTURE SEP17	141
KCU7	COFFEE 'C' FUTURE SEP17	43
KR4175M70(	2017-07 달러선물	32

KWU7	KC HRW WHEAT FUT SEP17	25
SBV7	SUGAR #11 (WORLD) OCT17	40
SMZ7	SOYBEAN MEAL FUTR DEC17	49
SX7	SOYBEAN FUTURE NOV17	101
WU7	WHEAT FUTURE(CBT) SEP17	72

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

624