| 공시일 | 2017-07-04 |
|---|---|
| 기준일 | 2017-07-03 |

# 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 | 2017-07-04 |
| 기준일 | 2017-07-03 |

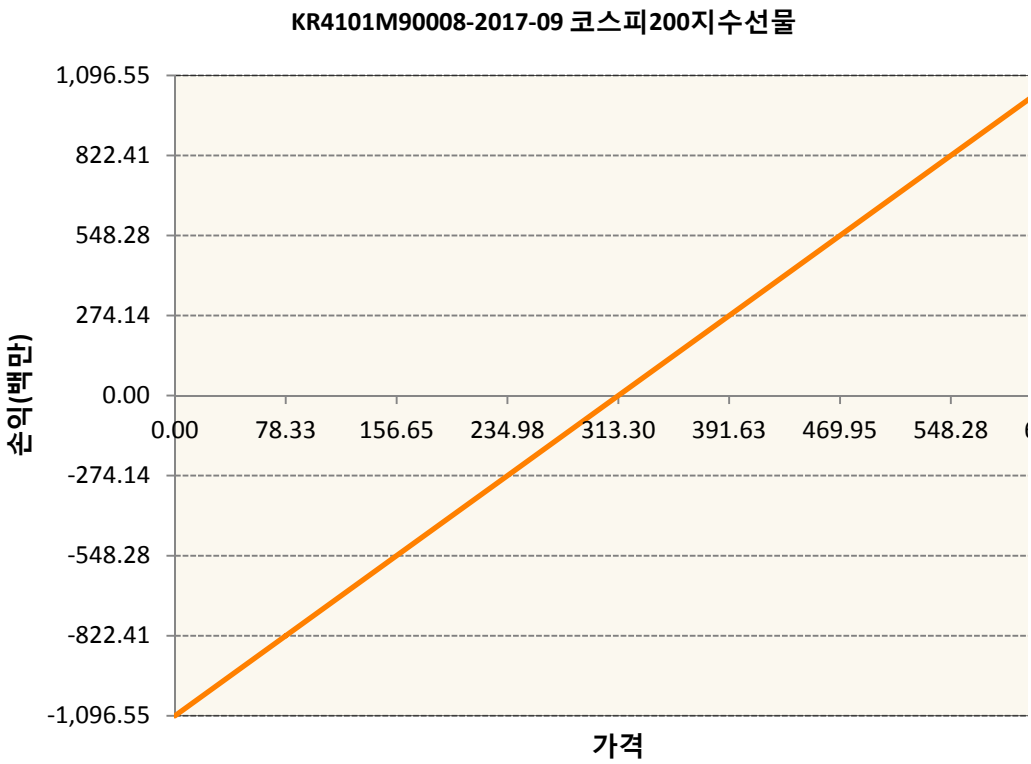
# 스마트인덱스모

## 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 | 1,097 | 0 | 1,097 | 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 | 2017-07-04 |
| 기준일 | 2017-07-03 |

# 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)

| |
|---|
| **490** |

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

| 공시일 | 2017-07-04 |
|---|---|
| 기준일 | 2017-07-03 |

# 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 | 383 |

* 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 | 2017-07-04 |
| 기준일 | 2017-07-03 |

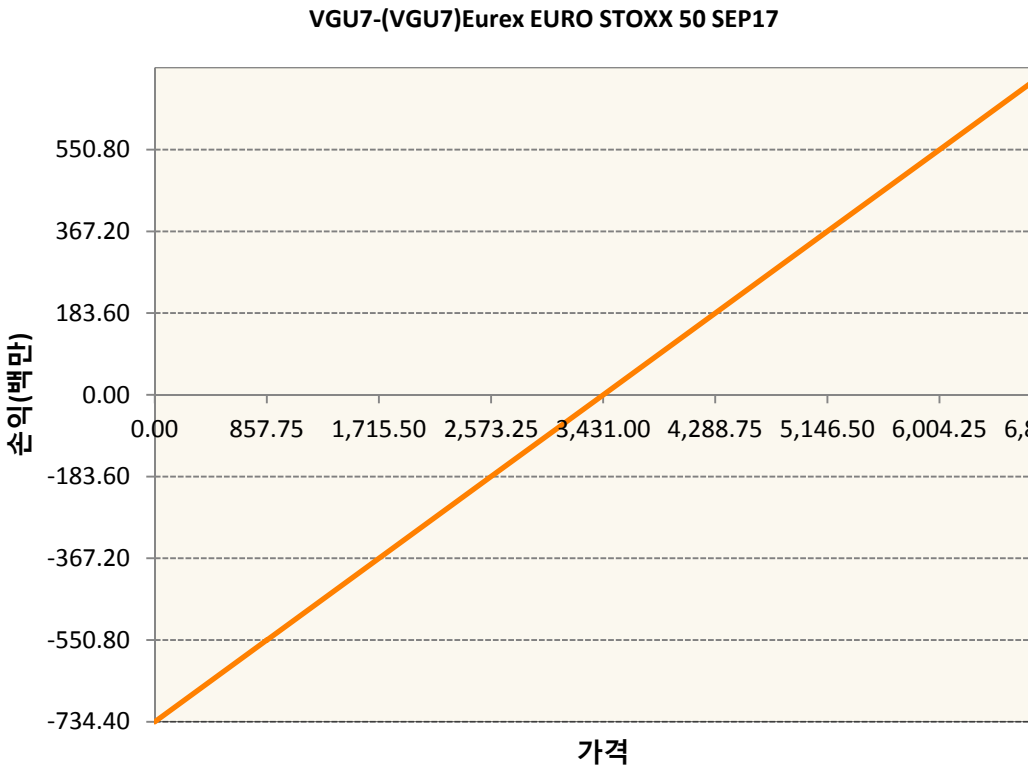
# 유로인덱스모(주식-파생형)

## 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 734 | 0 | 734 | |

## 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)

**53**

| | |
|---|---|
| 공시일 | 2017-07-04 |
| 기준일 | 2017-07-03 |

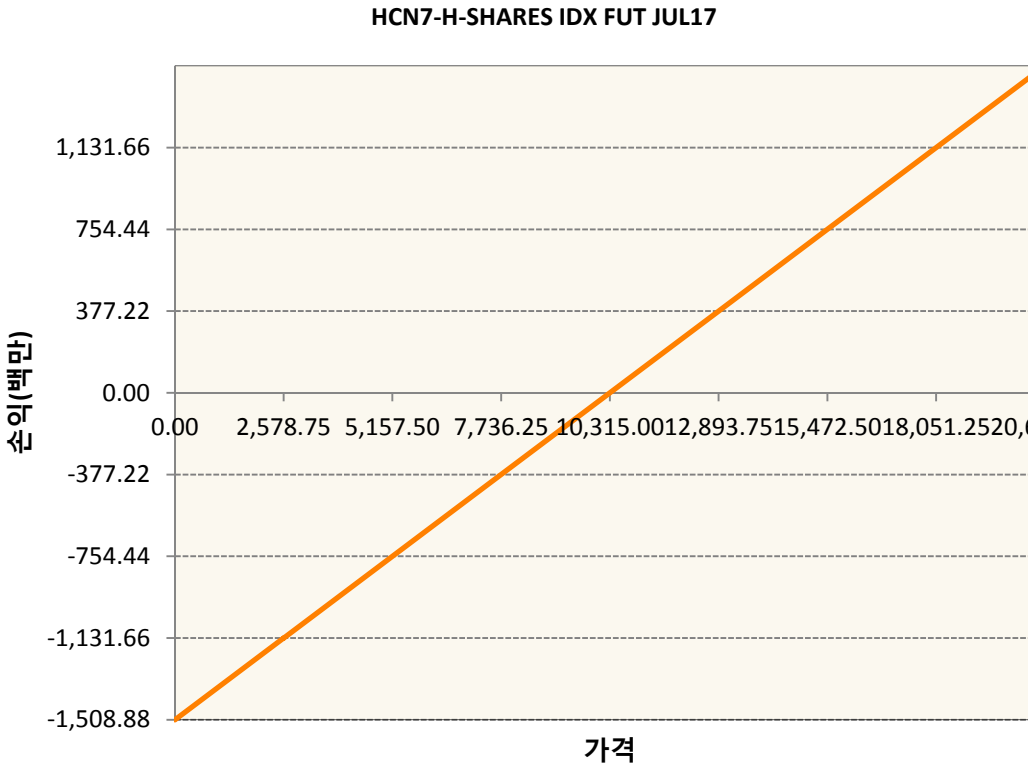
# 차이나인덱스모(주식-파생형)

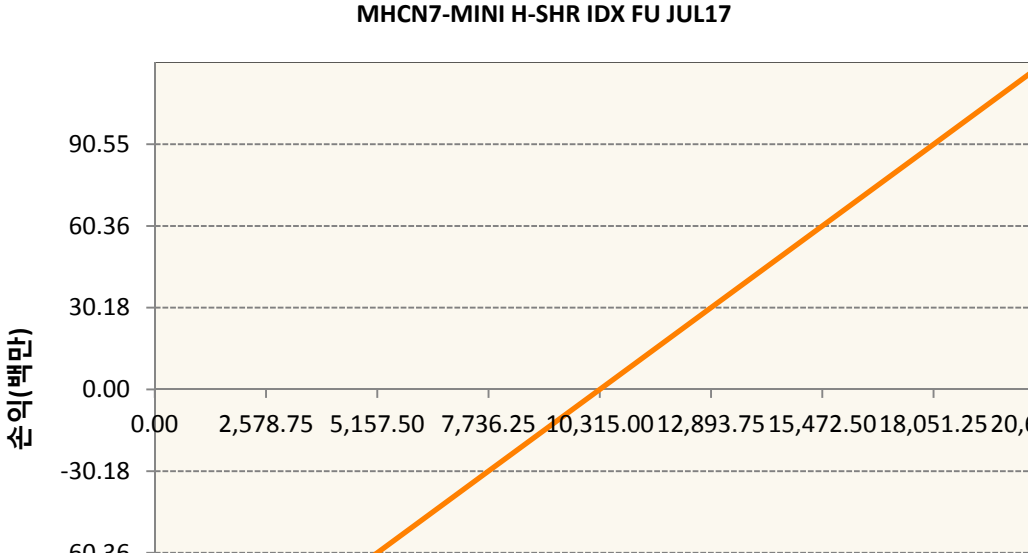
## 1. 계약금액

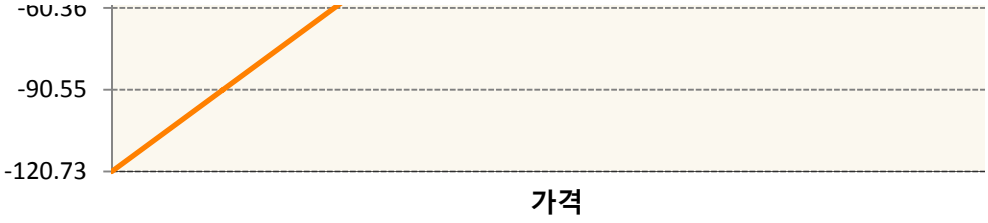
(단위:백만원)

| 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) |
|---|---|
| | **130** |

| | |
|---|---|
| 공시일 | 2017-07-04 |
| 기준일 | 2017-07-03 |

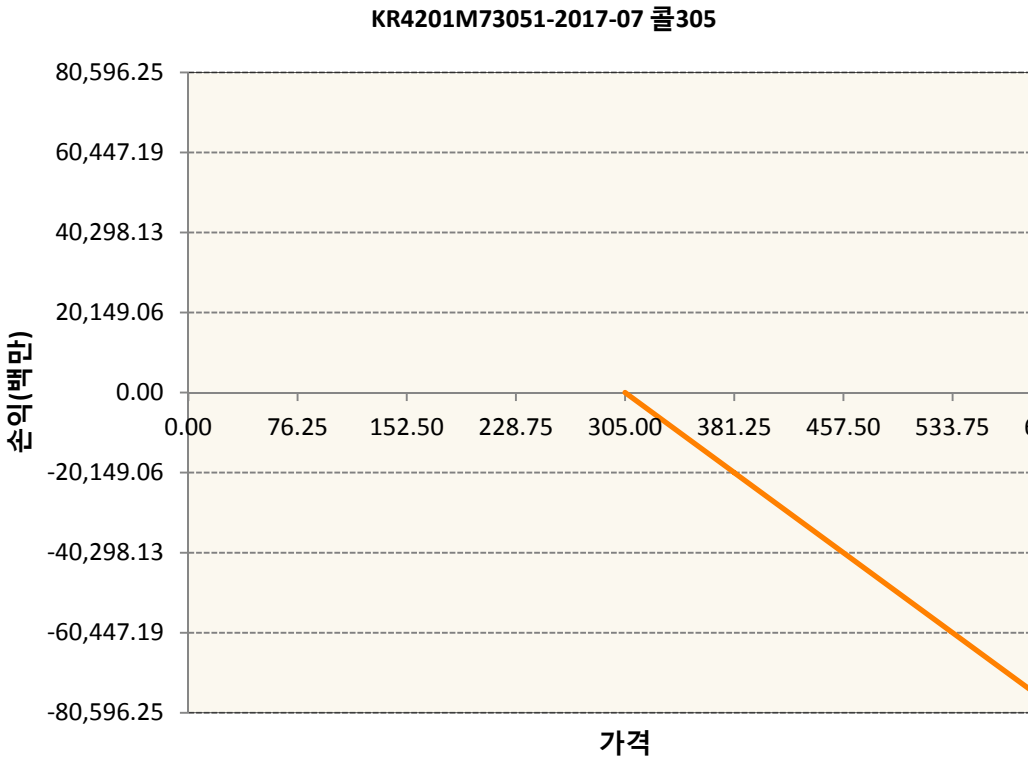
# 커버드콜모(주식혼합-파생형)

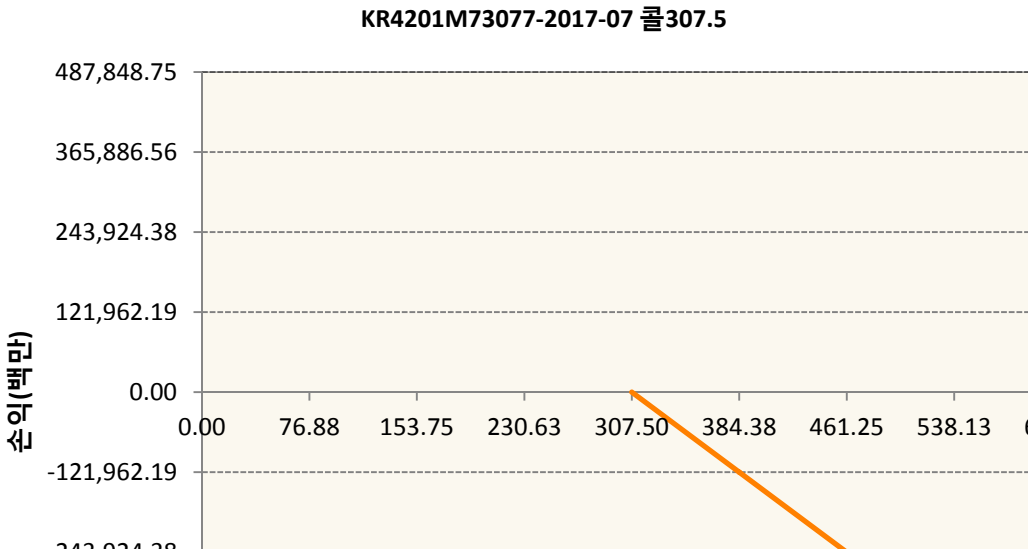
## 1. 계약금액

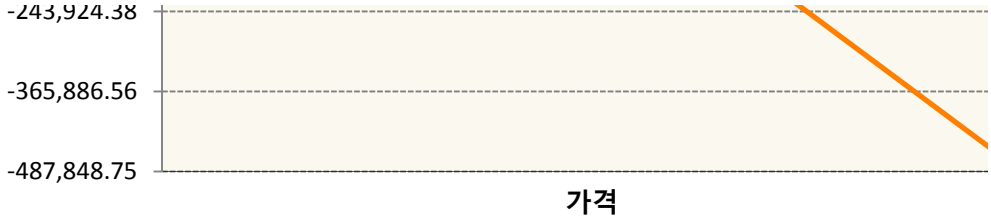
(단위:백만원)

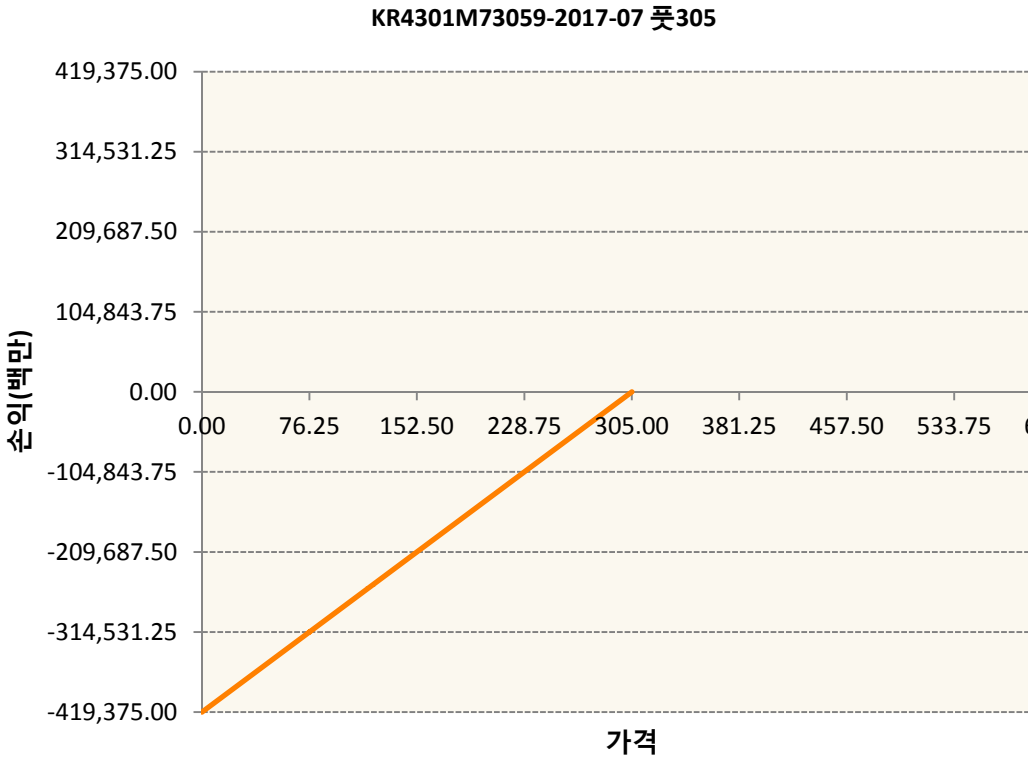
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 유가증권 | 옵션 | 0 | 7,638 | -7,638 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션 | 0 | 1,026,258 | -1,026,258 | 장내 |

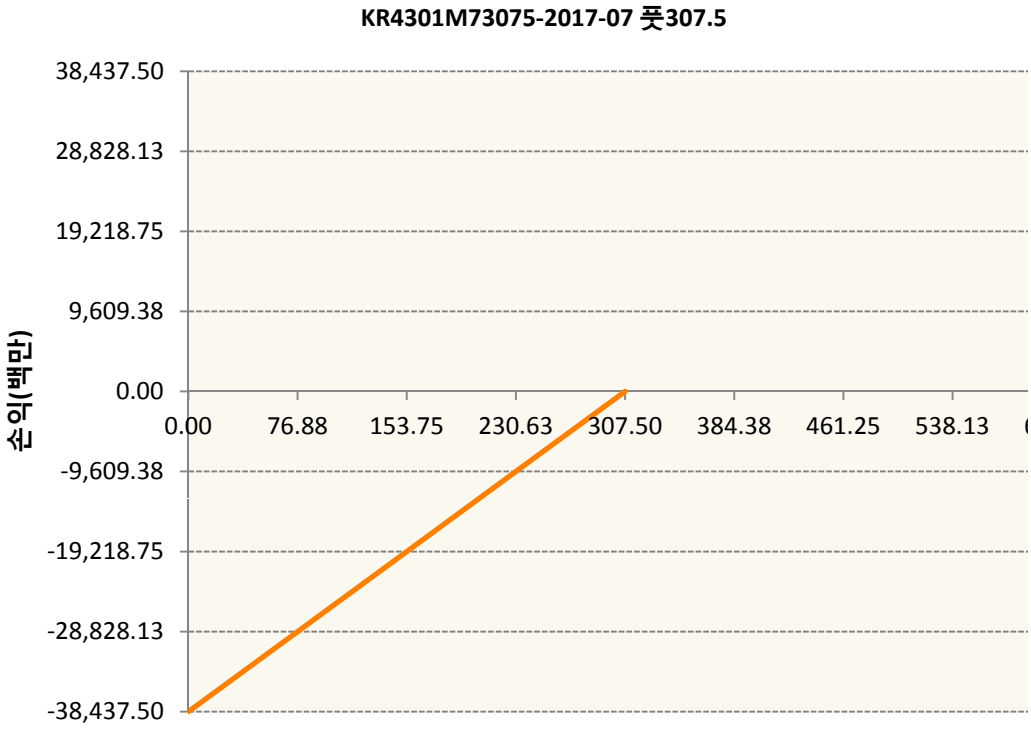
## 2. 만기시점의 손익구조




-243,924.38
-365,886.56
-487,848.75
가격


KR4301M73059-2017-07 풋305
419,375.00
314,531.25
209,687.50
104,843.75
0.00
-104,843.75
-209,687.50
-314,531.25
-419,375.00
0.00
76.25
152.50
228.75
305.00
381.25
457.50
533.75
손익(백만)
가격


KR4301M73075-2017-07 풋307.5
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 | | | | | | 6,076 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 기초자산의 변동성 | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | 2,491 | 2,472 | 2,447 | 2,414 | 2,376 | 2,331 | 2,281 |
| -5.33% | 2,320 | 2,253 | 2,181 | 2,103 | 2,022 | 1,938 | 1,850 |
| -2.67% | 1,661 | 1,553 | 1,446 | 1,338 | 1,230 | 1,123 | 1,015 |
| 0% | 260 | 177 | 90 | 0 | -93 | -188 | -285 |
| 2.67% | -1,689 | -1,721 | -1,761 | -1,809 | -1,863 | -1,924 | -1,989 |
| 5.33% | -3,844 | -3,850 | -3,862 | -3,878 | -3,900 | -3,928 | -3,962 |
| 8.00% | -6,039 | -6,040 | -6,042 | -6,046 | -6,052 | -6,062 | -6,076 |
| KR4201M73( | 2017-07 콜307.5 | | | | | | 35,327 |
| | 기초자산의 변동성 | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | 12,323 | 12,256 | 12,154 | 12,017 | 11,843 | 11,634 | 11,392 |
| -5.33% | 11,712 | 11,408 | 11,060 | 10,674 | 10,257 | 9,814 | 9,348 |
| -2.67% | 8,859 | 8,248 | 7,629 | 7,005 | 6,377 | 5,746 | 5,113 |
| 0% | 1,788 | 1,204 | 607 | 0 | -615 | -1,236 | -1,862 |
| 2.67% | -9,137 | -9,418 | -9,747 | -10,116 | -10,521 | -10,956 | -11,417 |
| 5.33% | -21,849 | -21,921 | -22,029 | -22,176 | -22,361 | -22,583 | -22,842 |
| 8.00% | -34,997 | -35,008 | -35,030 | -35,069 | -35,129 | -35,215 | -35,327 |
| KR4301M73( | 2017-07 풋305 | | | | | | 23,741 |
| | 기초자산의 변동성 | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | -23,710 | -23,710 | -23,711 | -23,714 | -23,719 | -23,727 | -23,741 |
| -5.33% | -12,307 | -12,349 | -12,408 | -12,484 | -12,577 | -12,685 | -12,808 |
| -2.67% | -2,732 | -3,006 | -3,281 | -3,557 | -3,834 | -4,111 | -4,388 |
| 0% | 335 | 243 | 131 | 0 | -147 | -309 | -484 |
| 2.67% | 487 | 485 | 480 | 470 | 454 | 430 | 396 |
| 5.33% | 488 | 488 | 488 | 488 | 487 | 486 | 484 |
| 8.00% | 488 | 488 | 488 | 488 | 488 | 488 | 488 |
| KR4301M73( | 2017-07 풋307.5 | | | | | | 2,417 |
| | 기초자산의 변동성 | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | -2,416 | -2,416 | -2,416 | -2,416 | -2,416 | -2,417 | -2,417 |
| -5.33% | -1,376 | -1,377 | -1,379 | -1,383 | -1,387 | -1,393 | -1,400 |
| -2.67% | -410 | -430 | -451 | -472 | -494 | -517 | -540 |
| 0% | 52 | 36 | 19 | 0 | -19 | -40 | -61 |
| 2.67% | 96 | 95 | 93 | 91 | 88 | 83 | 77 |

| | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 5.33% | 96 | 96 | 96 | 96 | 96 | 96 | 95 |
| 8.00% | 96 | 96 | 96 | 96 | 96 | 96 | 96 |

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

| |
|---|
| **69,338** |

| | |
|---|---|
| 공시일 | 2017-07-04 |
| 기준일 | 2017-07-03 |

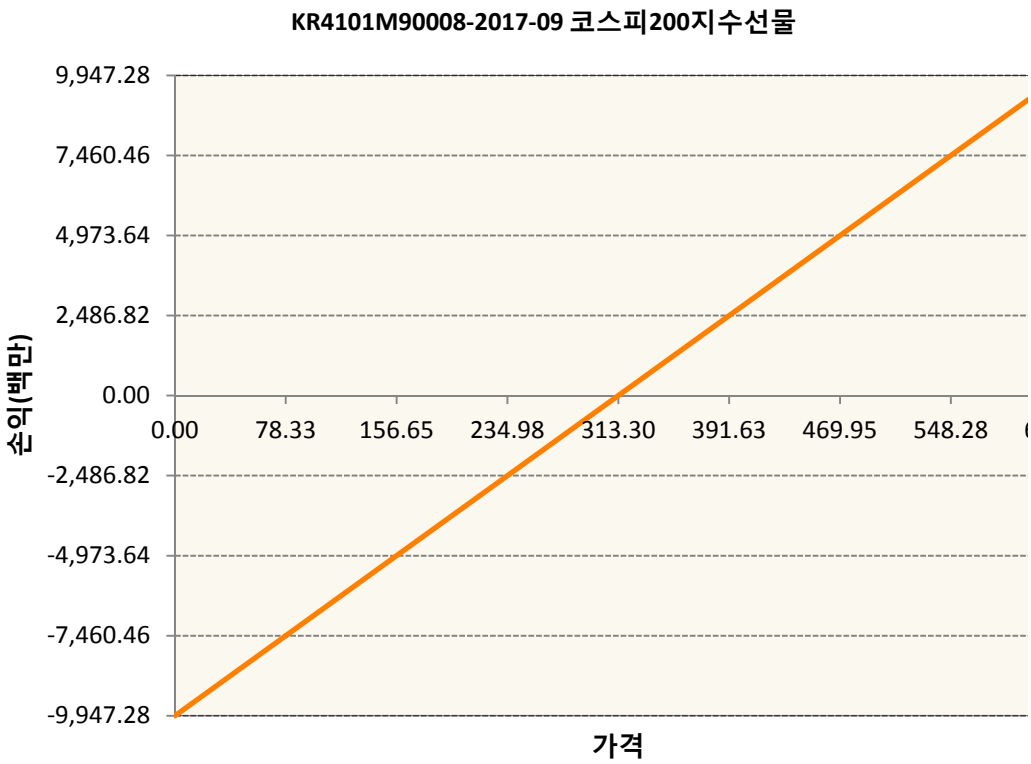
# ETF스마트레버리지목표전환형6호

## 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 | 9,947 | 0 | 9,947 | 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)

| 493 |
|---|

| | |
|---|---|
| 공시일 | 2017-07-04 |
| 기준일 | 2017-07-03 |

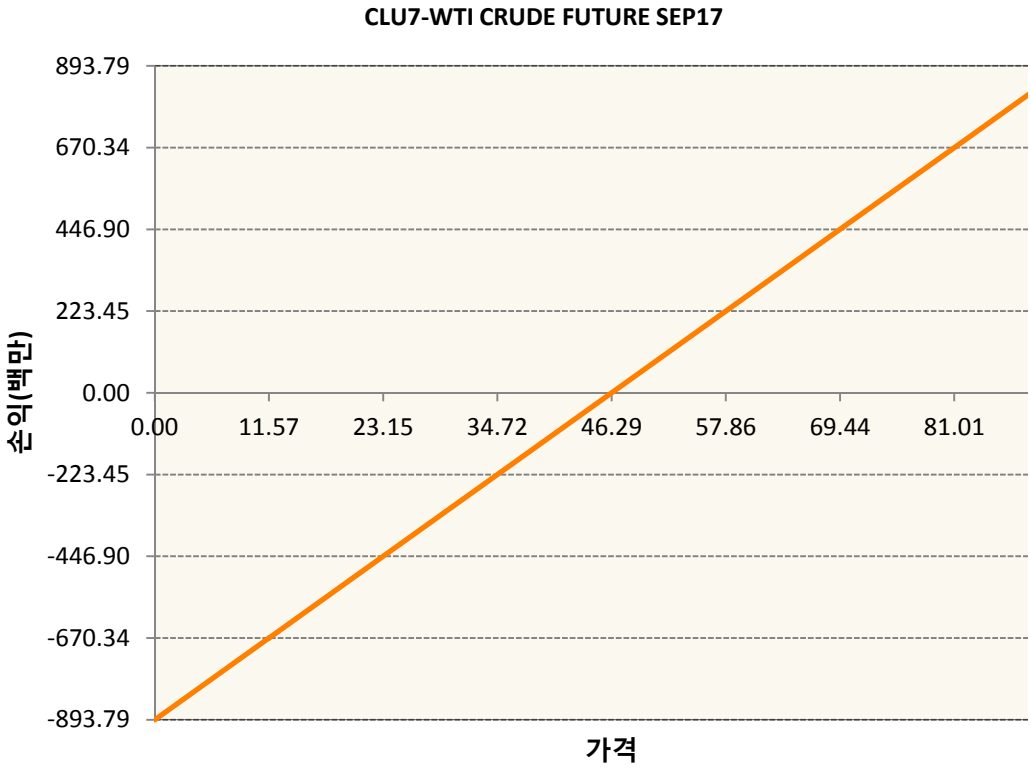
# 에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

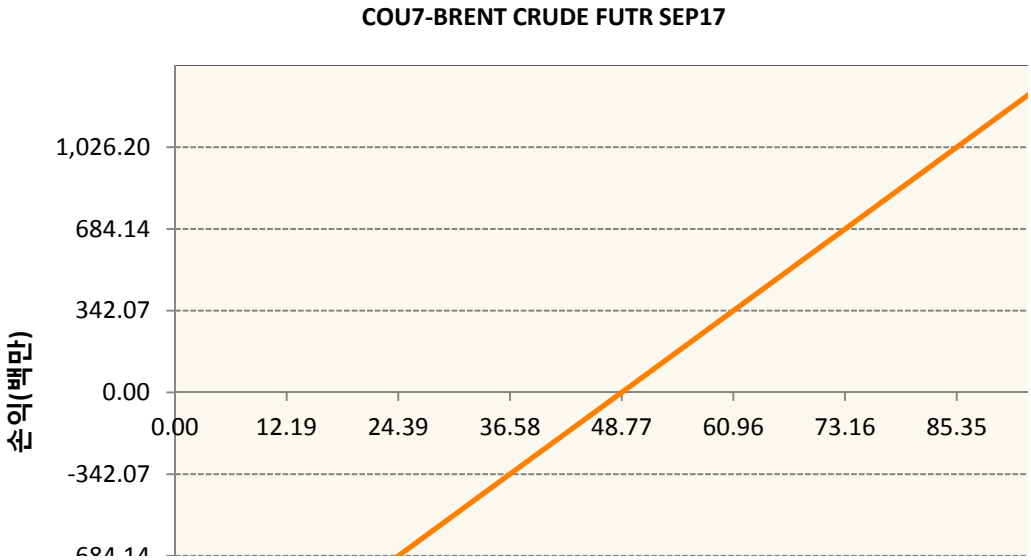
## 1. 계약금액

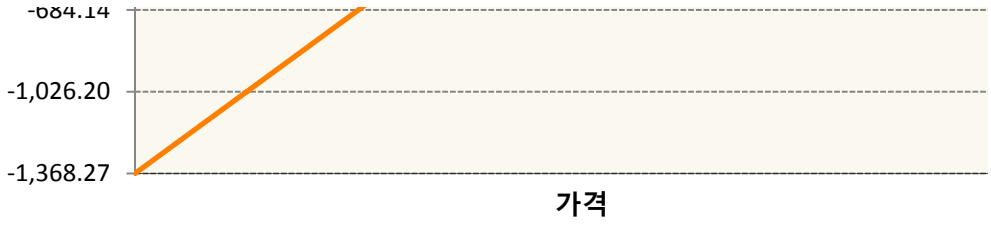
(단위:백만원)

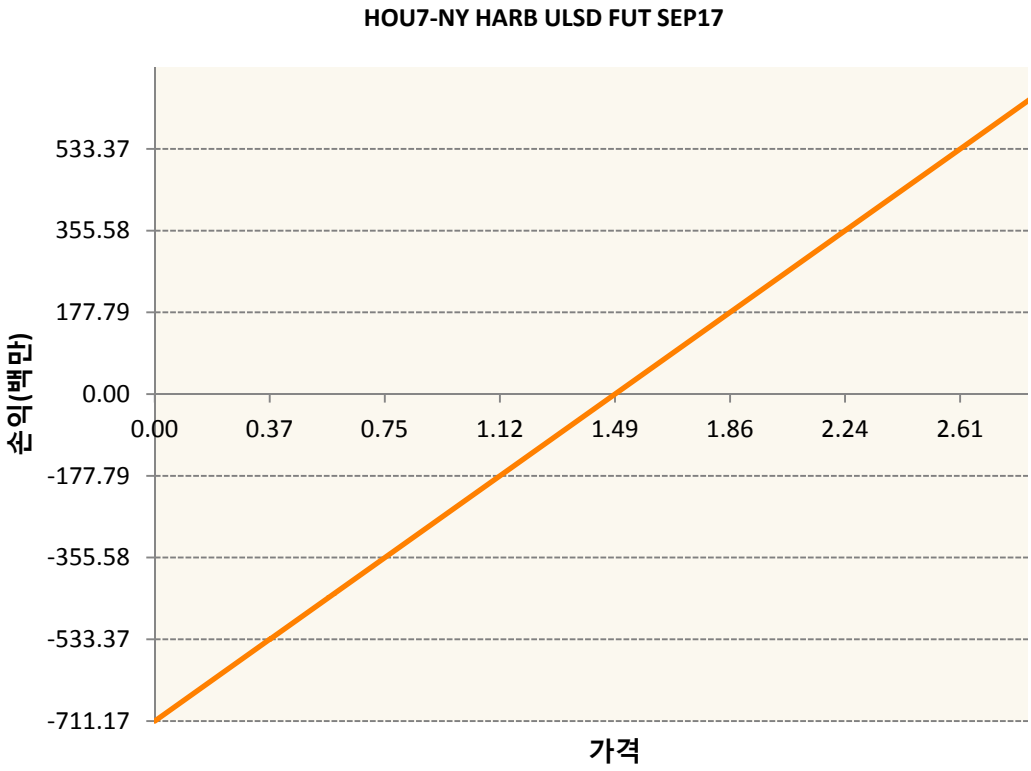
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 5,136 | 229 | 4,907 | |

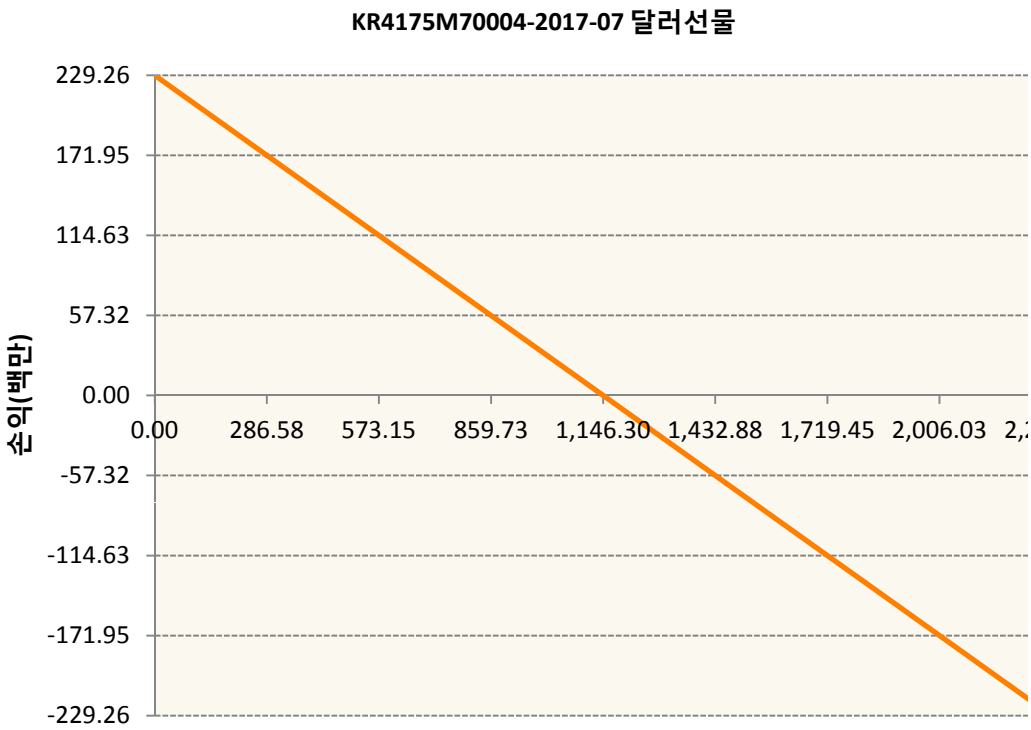
## 2. 만기시점의 손익구조



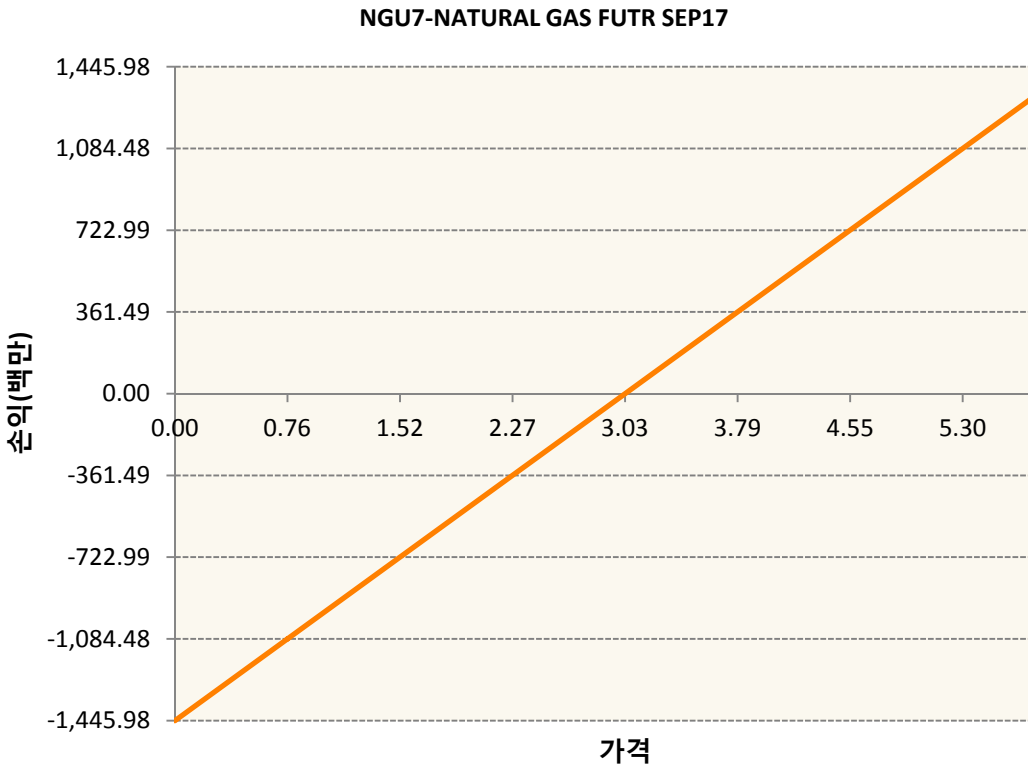



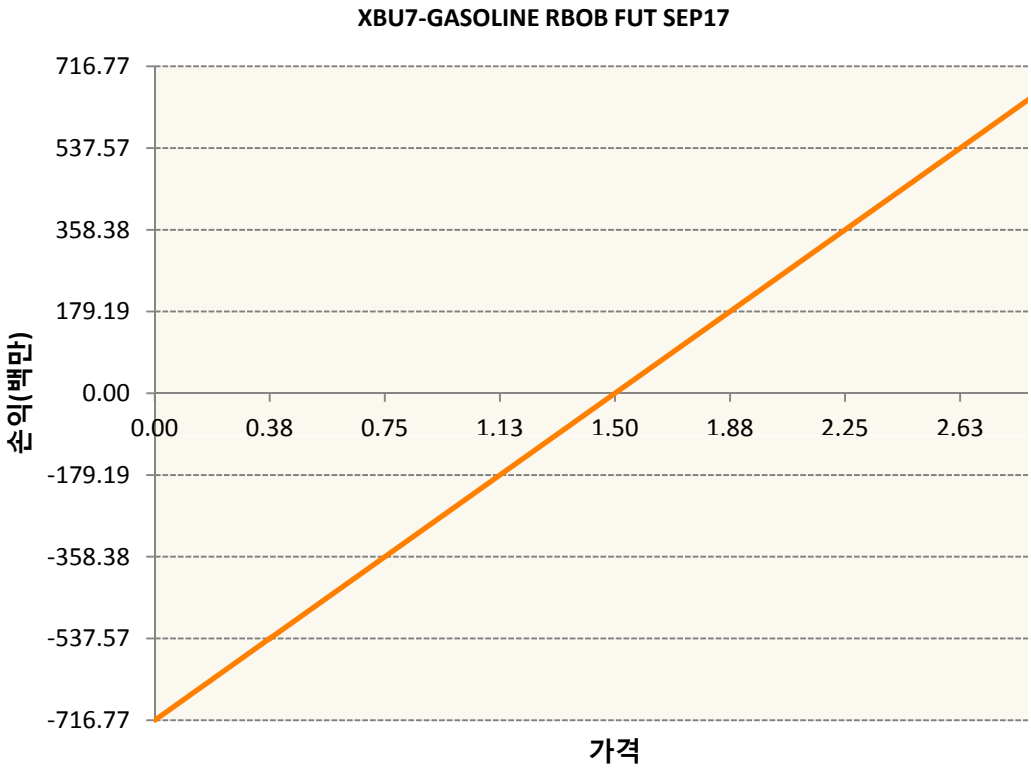

-684.14
-1,026.20
-1,368.27
가격


HOU7-NY HARB ULSD FUT SEP17
533.37
355.58
177.79
0.00
-177.79
-355.58
-533.37
-711.17
0.00
0.37
0.75
1.12
1.49
1.86
2.24
2.61
손익(백만)
가격


KR4175M70004-2017-07 달러선물
229.26
171.95
114.63
57.32
0.00
-57.32
-114.63
-171.95
-229.26
0.00
286.58
573.15
859.73
1,146.30
1,432.88
1,719.45
2,006.03
손익(백만)

가격


NGU7-NATURAL GAS FUTR SEP17
1,445.98
1,084.48
722.99
361.49
0.00
-361.49
-722.99
-1,084.48
-1,445.98
0.00
0.76
1.52
2.27
3.03
3.79
4.55
5.30
손익(백만)
가격


XBU7-GASOLINE RBOB FUT SEP17
716.77
537.57
358.38
179.19
0.00
-179.19
-358.38
-537.57
-716.77
0.00
0.38
0.75
1.13
1.50
1.88
2.25
2.63
손익(백만)
가격

**3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)** (단위:백만원)

| | | |
|---|---|---|
| CLU7 | WTI CRUDE FUTURE SEP17 | 72 |
| COU7 | BRENT CRUDE FUTR SEP17 | 109 |
| HOU7 | NY HARB ULSD FUT SEP17 | 57 |
| KR4175M70( | 2017-07 달러선물 | 18 |
| NGU7 | NATURAL GAS FUTR SEP17 | 116 |
| XBU7 | GASOLINE RBOB FUT SEP17 | 57 |

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

| |
|---|
| **812** |

| | |
|---|---|
| 공시일 | 2017-07-04 |
| 기준일 | 2017-07-03 |

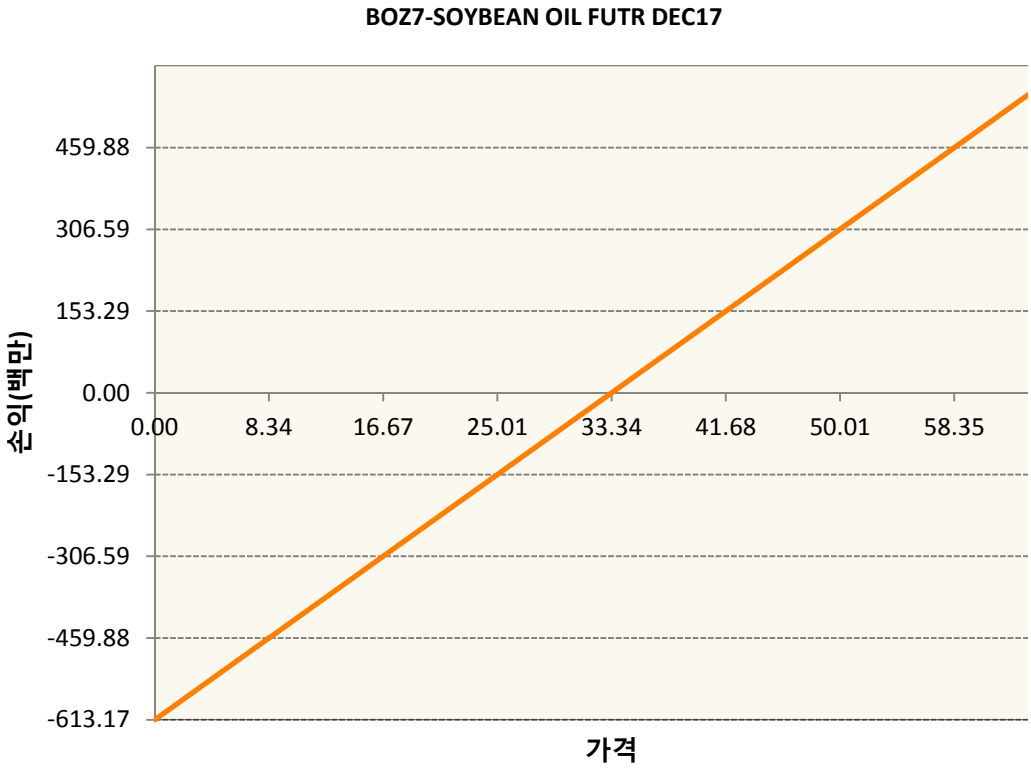
# 애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

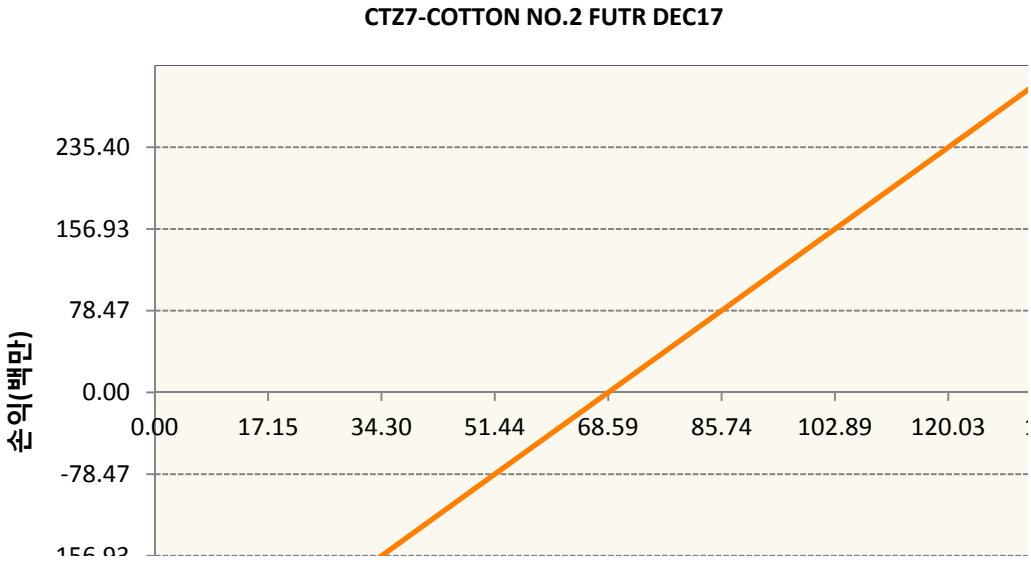
## 1. 계약금액

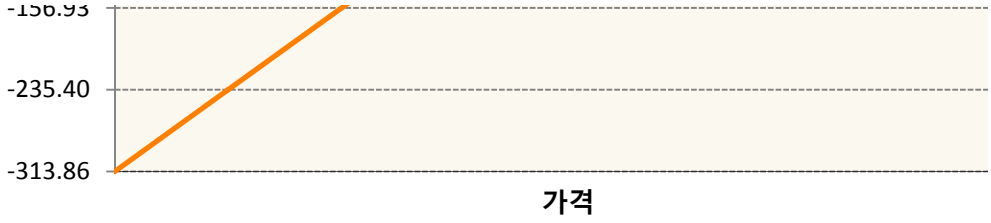
(단위:백만원)

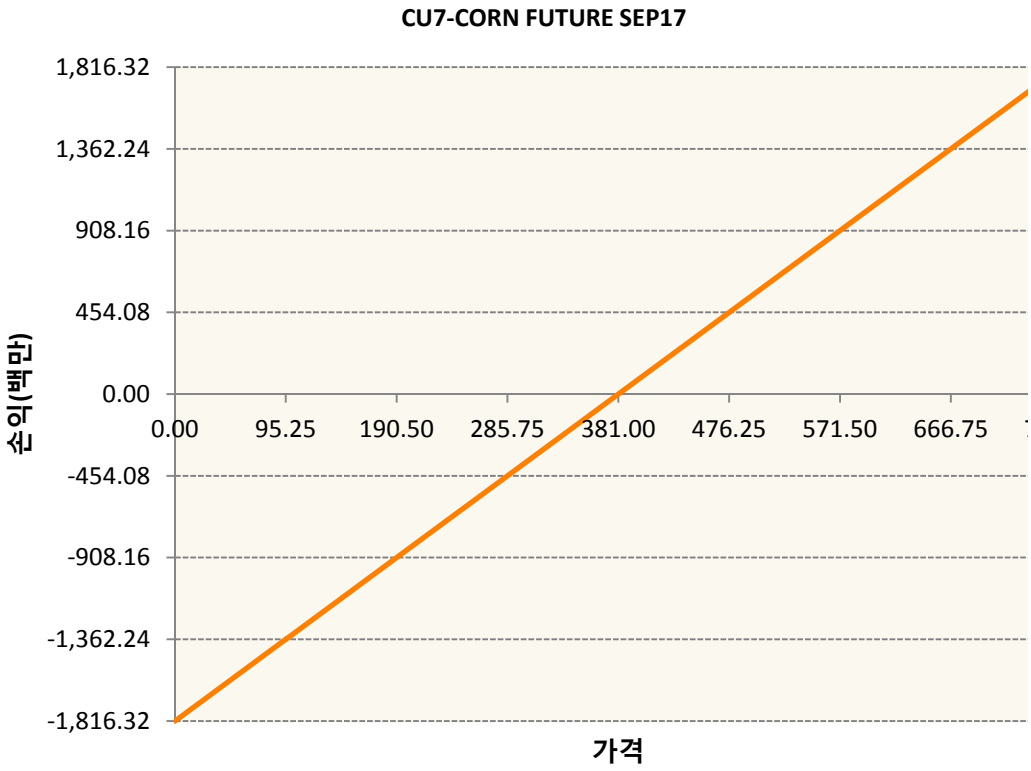
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 7,012 | 401 | 6,611 | |

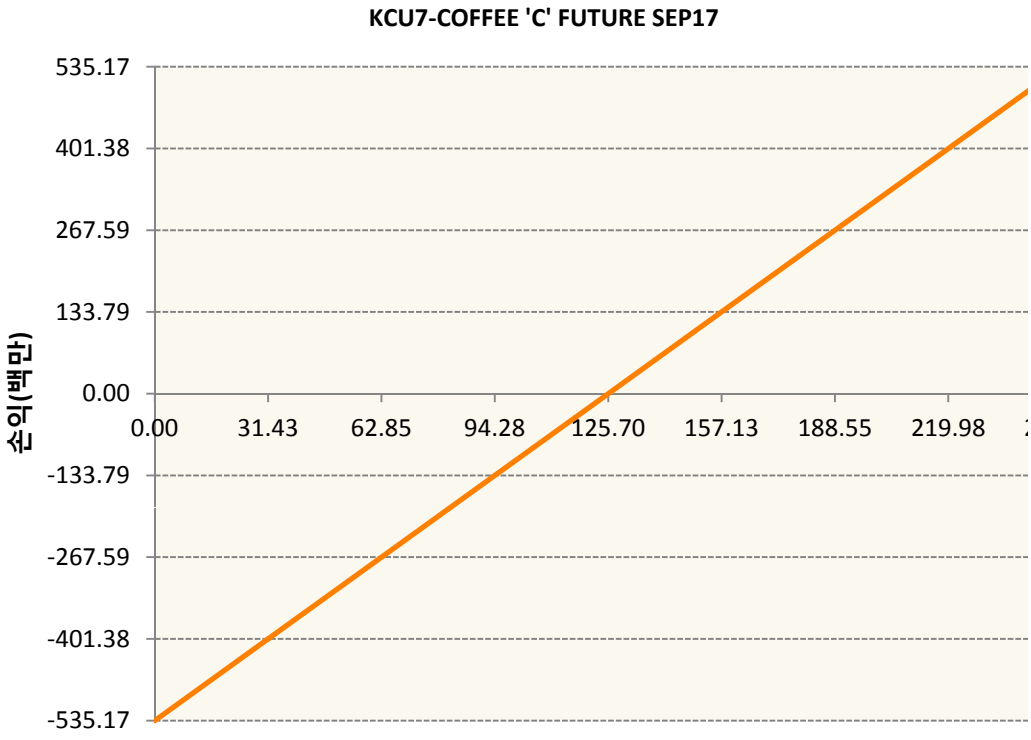
## 2. 만기시점의 손익구조



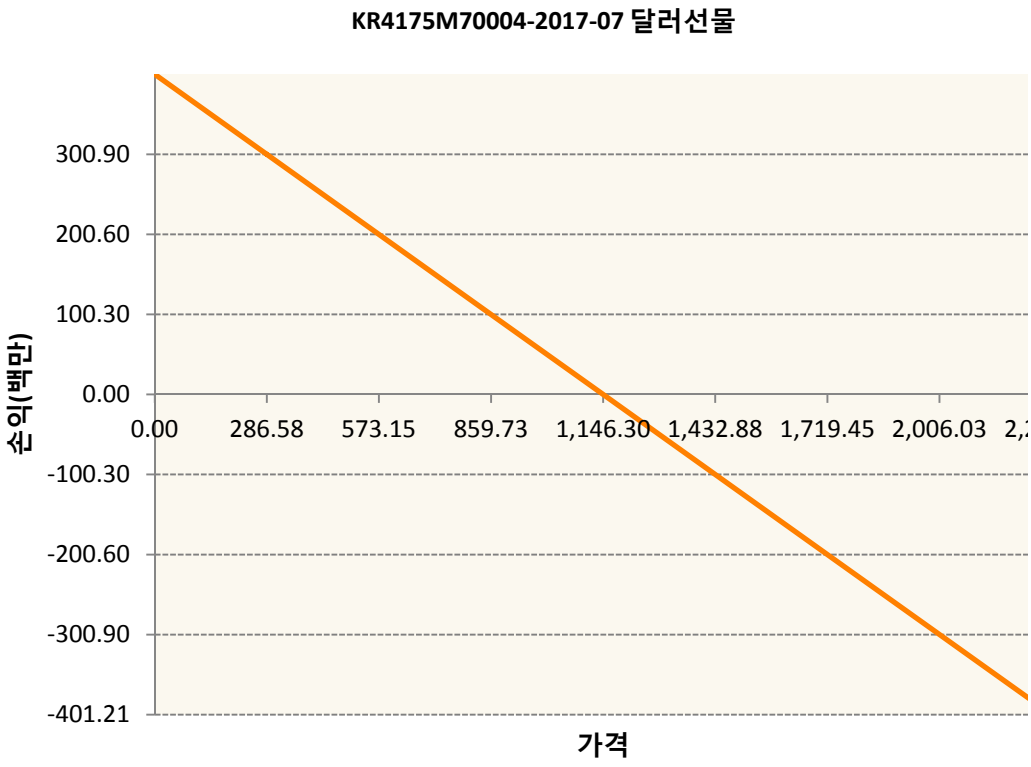



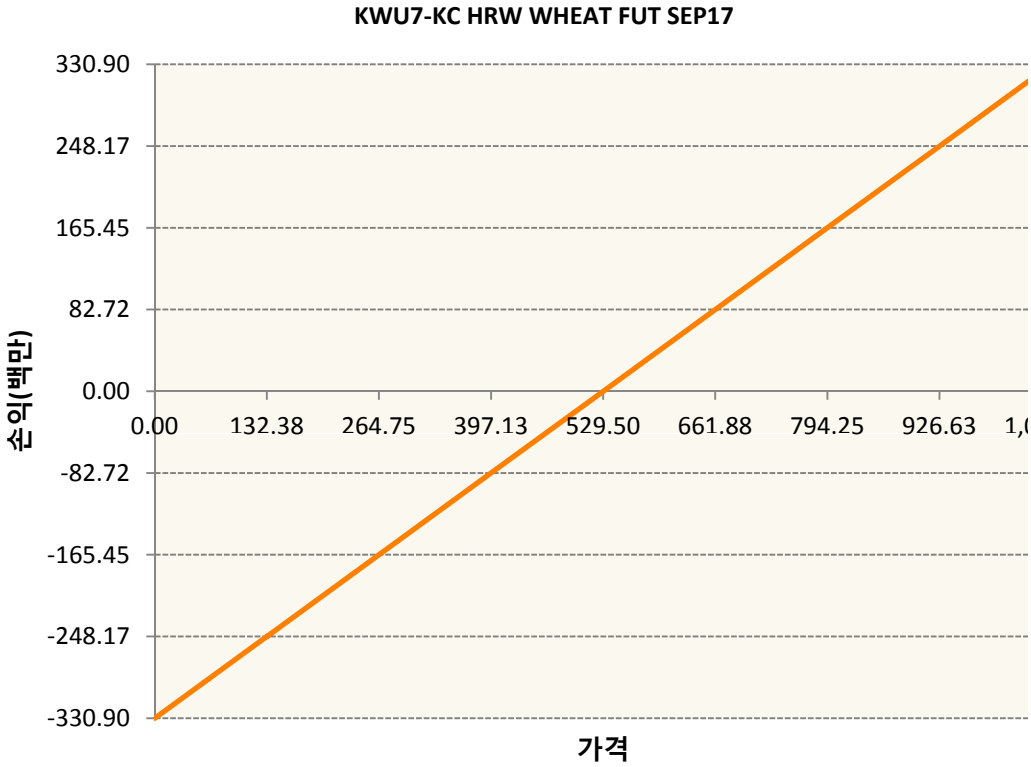

-235.40
-313.86
가격


CU7-CORN FUTURE SEP17
1,816.32
1,362.24
908.16
454.08
0.00
-454.08
-908.16
-1,362.24
-1,816.32
0.00
95.25
190.50
285.75
381.00
476.25
571.50
666.75
손익(백만)
가격

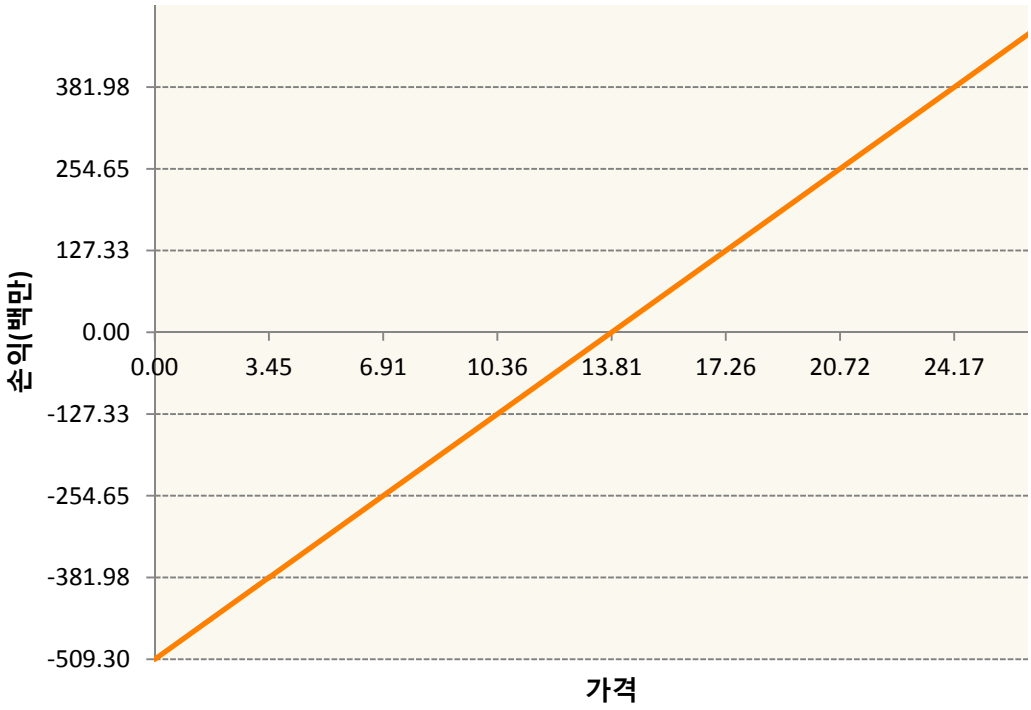

KCU7-COFFEE 'C' FUTURE SEP17
535.17
401.38
267.59
133.79
0.00
-133.79
-267.59
-401.38
-535.17
0.00
31.43
62.85
94.28
125.70
157.13
188.55
219.98
손익(백만)

가격

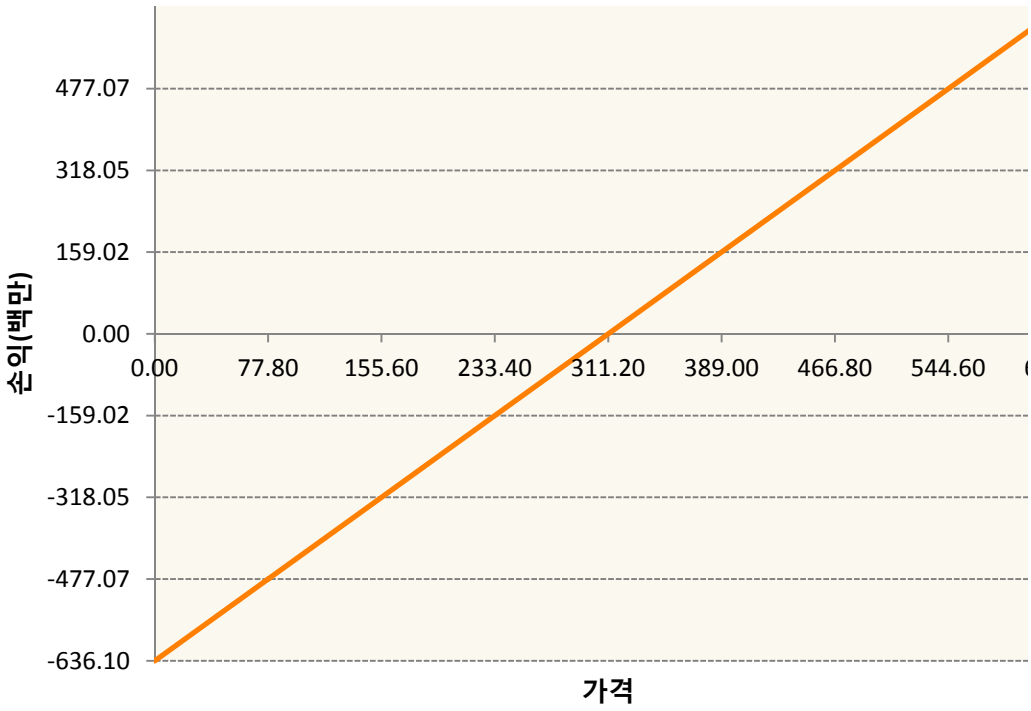

KR4175M70004-2017-07 달러선물
300.90
200.60
100.30
0.00
-100.30
-200.60
-300.90
-401.21
0.00
286.58
573.15
859.73
1,146.30
1,432.88
1,719.45
2,006.03
손익(백만)
가격


KWU7-KC HRW WHEAT FUT SEP17
330.90
248.17
165.45
82.72
0.00
-82.72
-165.45
-248.17
-330.90
0.00
132.38
264.75
397.13
529.50
661.88
794.25
926.63
손익(백만)
가격

SBV7-SUGAR #11 (WORLD) OCT17

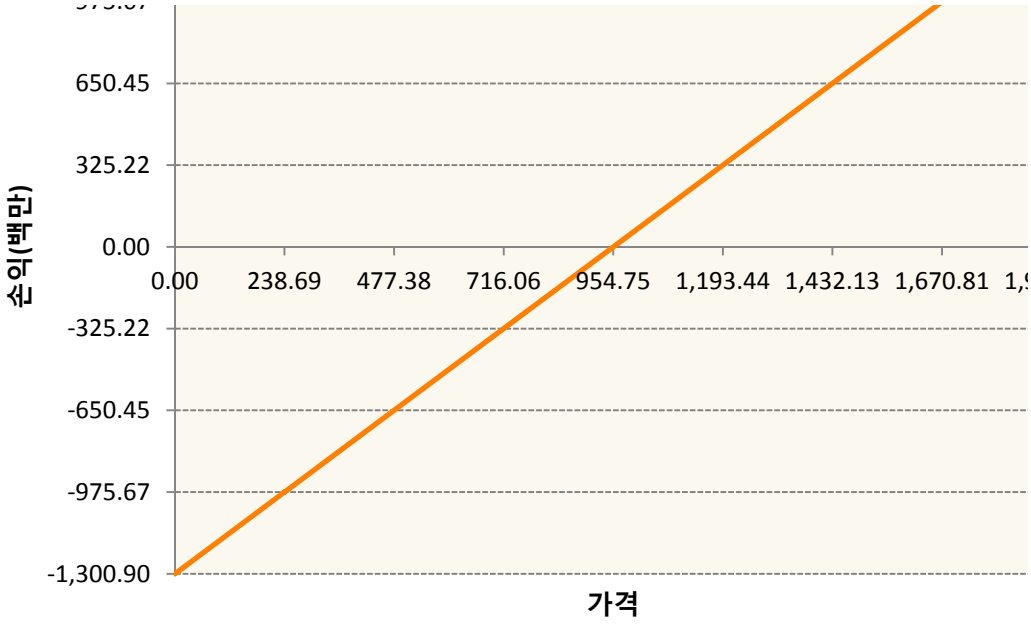



SMZ7-SOYBEAN MEAL FUTR DEC17

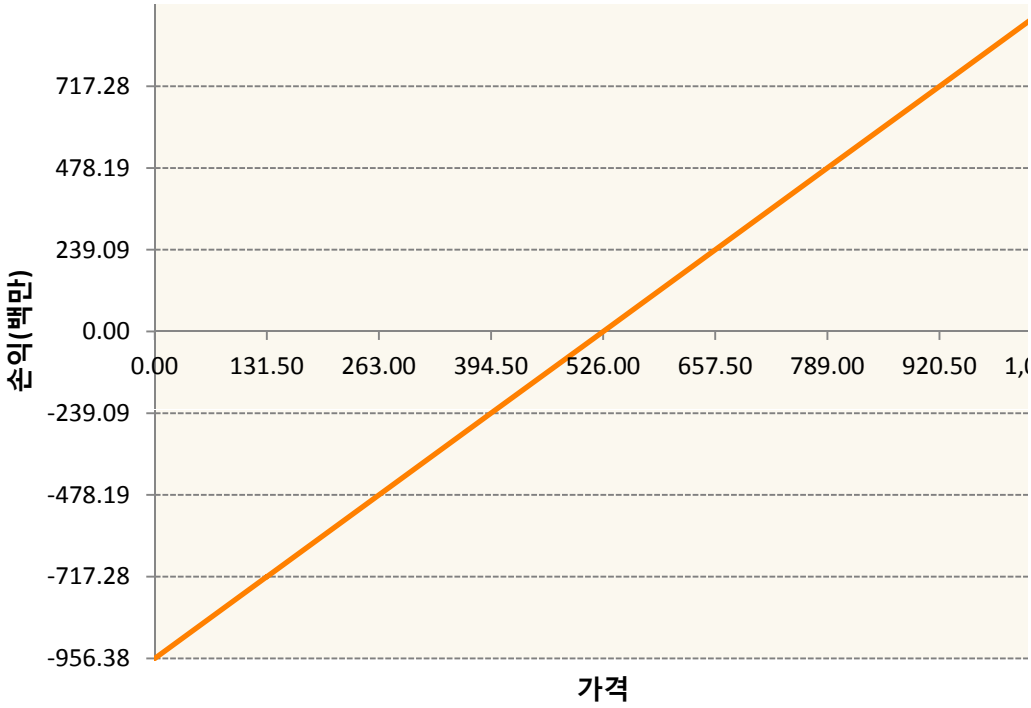



SX7-SOYBEAN FUTURE NOV17






WU7-WHEAT FUTURE(CBT) SEP17




| 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) | | (단위:백만원) |
|---|---|---|
| BOZ7 | SOYBEAN OIL FUTR DEC17 | 49 |
| CTZ7 | COTTON NO.2 FUTR DEC17 | 25 |
| CU7 | CORN FUTURE SEP17 | 145 |
| KCU7 | COFFEE 'C' FUTURE SEP17 | 43 |
| KR4175M70( | 2017-07 달러선물 | 32 |

| | | |
|---|---|---|
| KWU7 | KC HRW WHEAT FUT SEP17 | 26 |
| SBV7 | SUGAR #11 (WORLD) OCT17 | 41 |
| SMZ7 | SOYBEAN MEAL FUTR DEC17 | 51 |
| SX7 | SOYBEAN FUTURE NOV17 | 104 |
| WU7 | WHEAT FUTURE(CBT) SEP17 | 77 |

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

| |
|---|
| **648** |