공시일	2017-07-05
기준일	2017-07-04

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	2017-07-05
기준일	2017-07-04

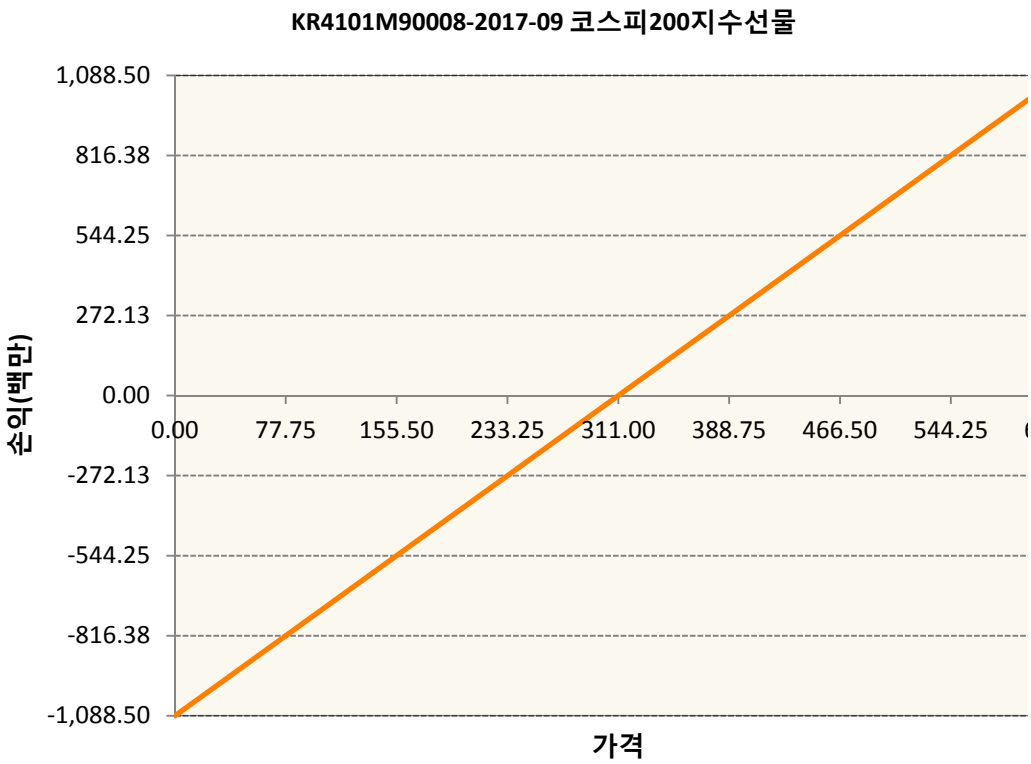
스마트인덱스모

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	1,089	0	1,089	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	2017-07-05
기준일	2017-07-04

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	1,000

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

489

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-07-05
기준일	2017-07-04

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	2017-07-05
기준일	2017-07-04

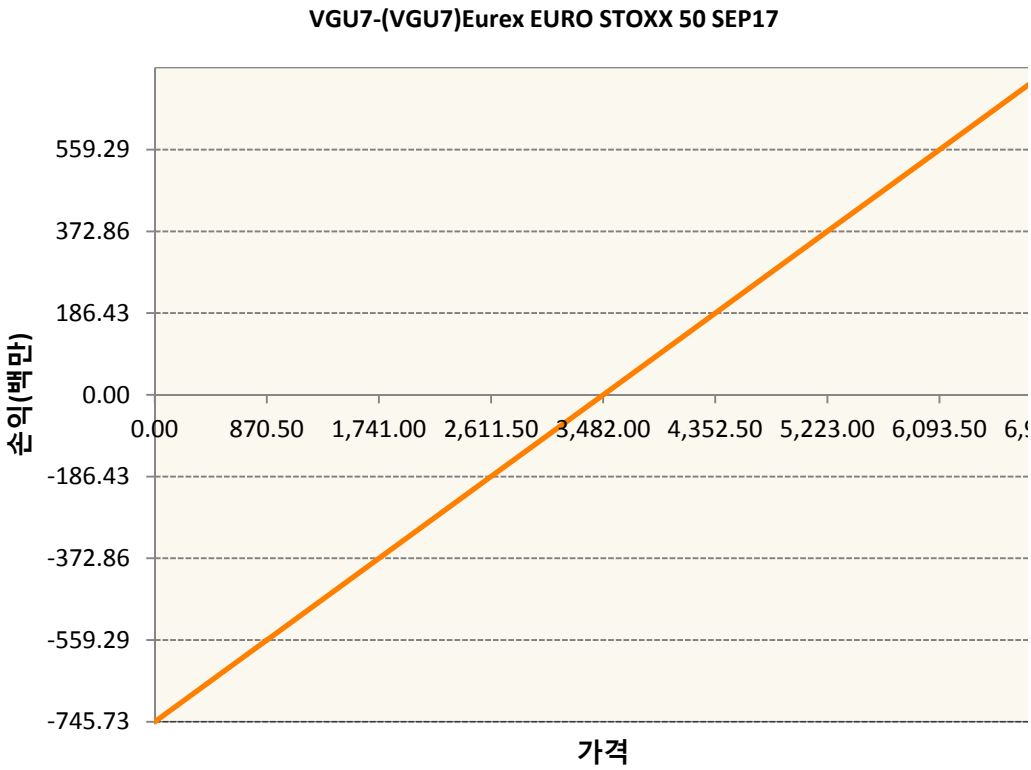
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	746	0	746	

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)

53

공시일	2017-07-05
기준일	2017-07-04

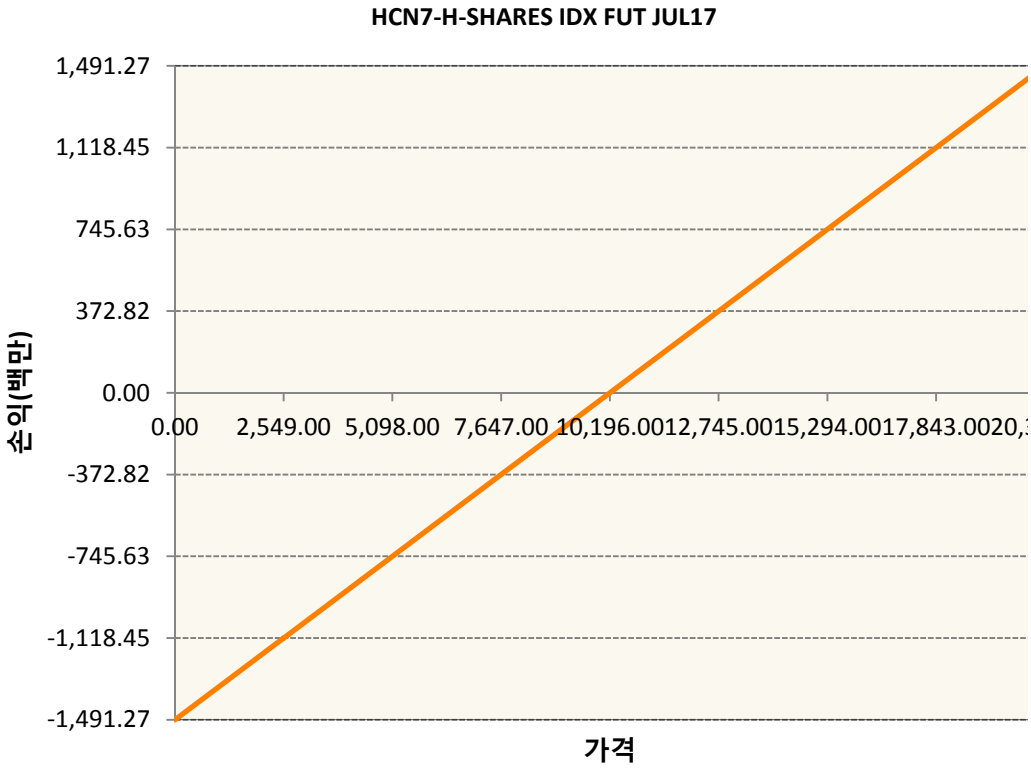
차이나인덱스모(주식-파생형)

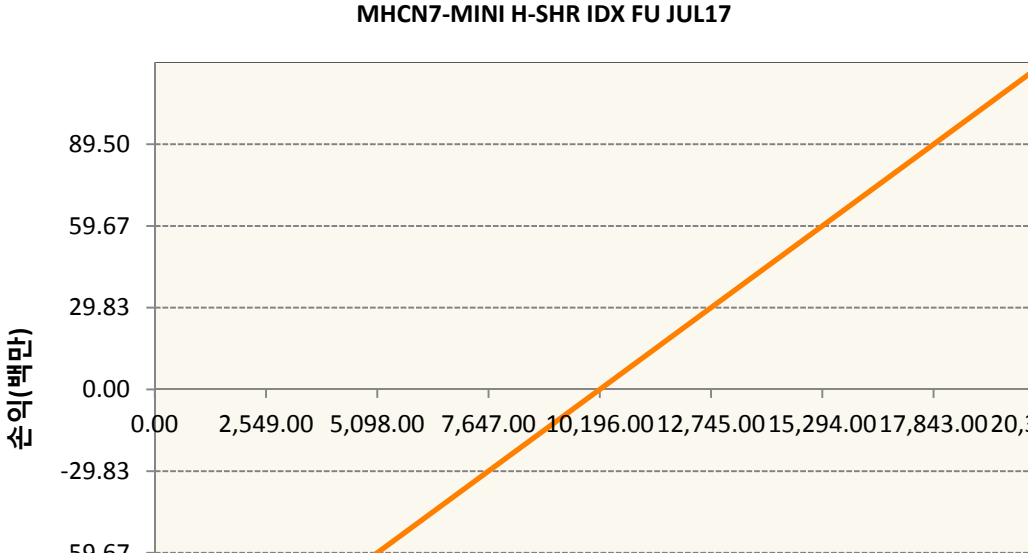
1. 계약금액

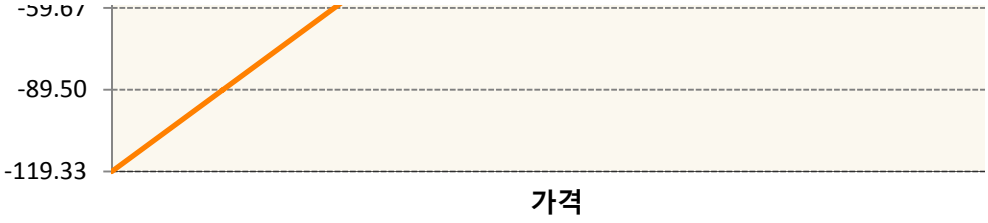
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,611	0	1,611	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	2017-07-05
기준일	2017-07-04

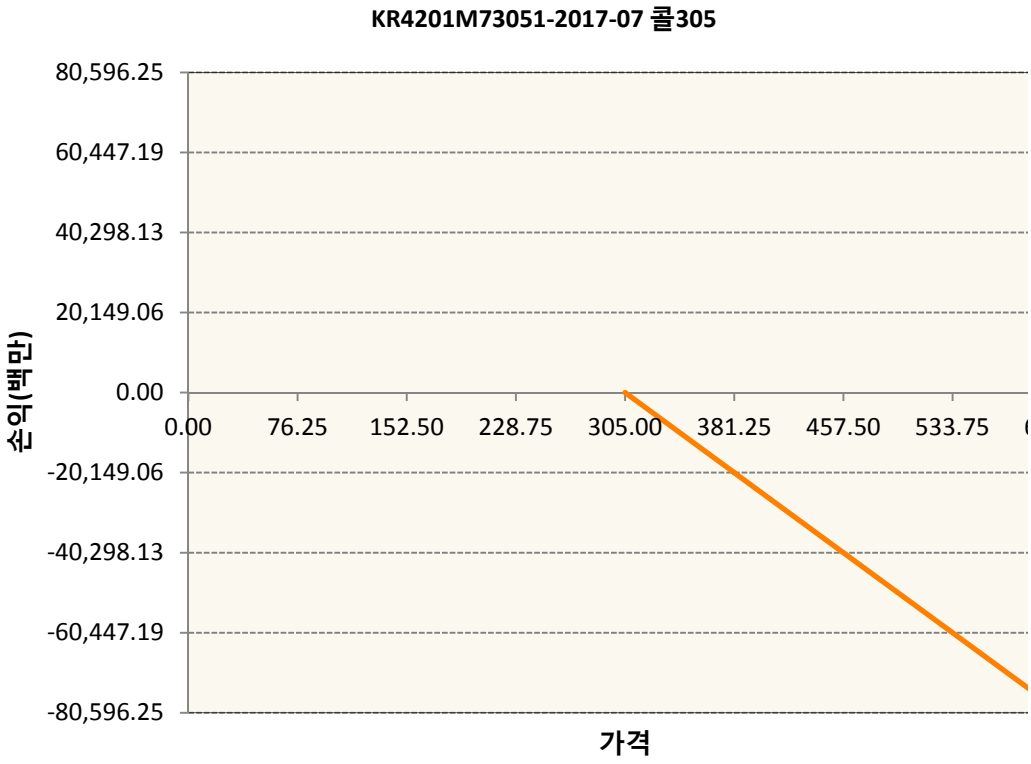
커버드콜모(주식혼합-파생형)

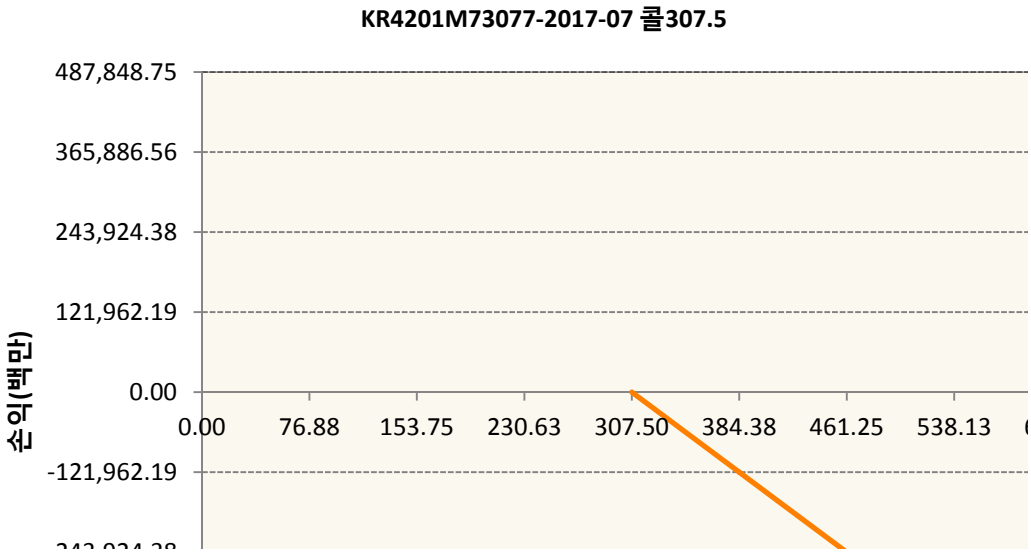
1. 계약금액

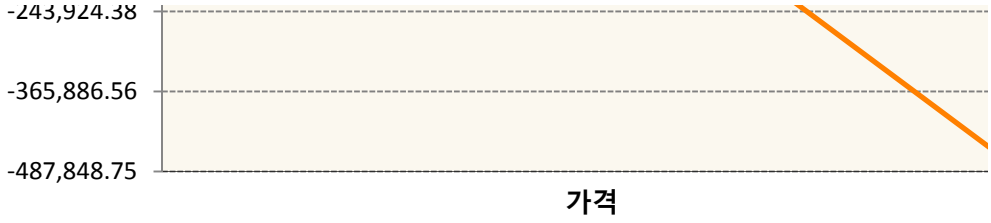
(단위:백만원)

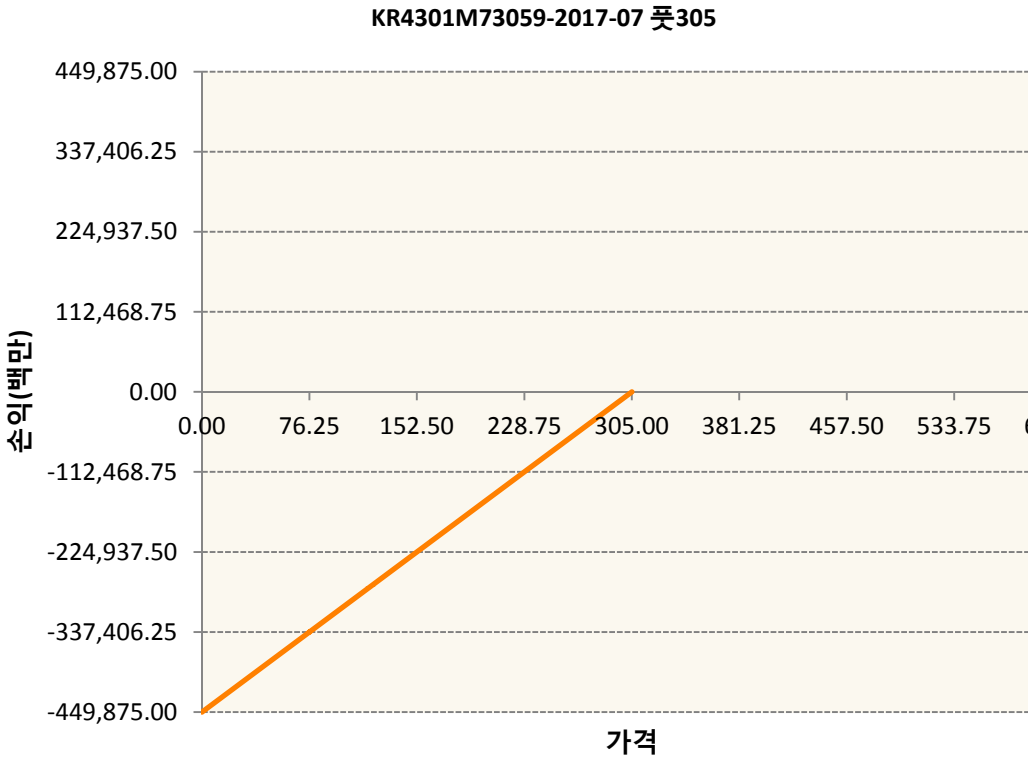
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	30,555	-30,555	장내
누계	유가증권	옵션	0	1,056,758	-1,056,758	장내

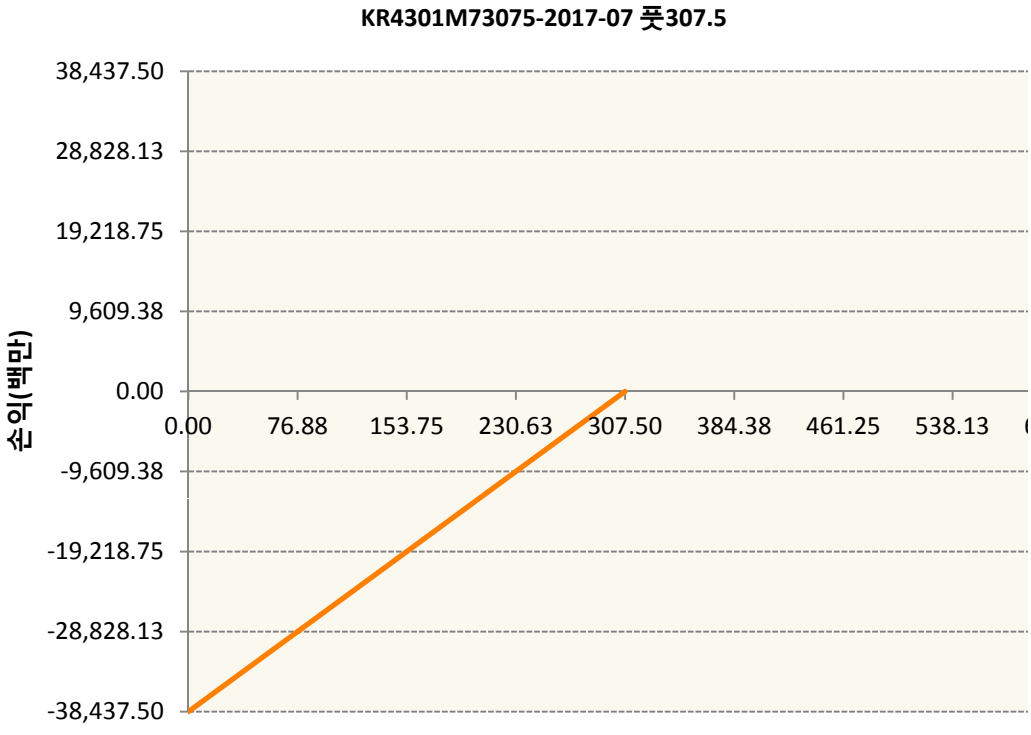
2. 만기시점의 손익구조






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


KR4301M73059-2017-07 풋305
449,875.00
337,406.25
224,937.50
112,468.75
0.00
-112,468.75
-224,937.50
-337,406.25
-449,875.00
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							5,915
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	2,121	2,109	2,092	2,069	2,040	2,005	1,965
-5.33%	2,012	1,961	1,902	1,837	1,768	1,694	1,617
-2.67%	1,508	1,407	1,305	1,202	1,099	996	893
0%	281	190	96	0	-98	-196	-296
2.67%	-1,571	-1,611	-1,660	-1,715	-1,776	-1,843	-1,914
5.33%	-3,691	-3,700	-3,715	-3,735	-3,762	-3,794	-3,832
8.00%	-5,870	-5,872	-5,874	-5,879	-5,887	-5,899	-5,915
KR4201M73(2017-07 콜307.5							34,173
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	10,283	10,244	10,180	10,086	9,961	9,804	9,616
-5.33%	9,918	9,697	9,429	9,121	8,776	8,402	8,000
-2.67%	7,841	7,296	6,735	6,163	5,581	4,991	4,395
0%	1,862	1,246	625	0	-628	-1,259	-1,891
2.67%	-8,318	-8,658	-9,040	-9,459	-9,906	-10,379	-10,873
5.33%	-20,738	-20,835	-20,972	-21,150	-21,368	-21,623	-21,913
8.00%	-33,770	-33,786	-33,816	-33,866	-33,940	-34,042	-34,173
KR4301M73(2017-07 풋305							27,441
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-27,409	-27,410	-27,411	-27,413	-27,418	-27,427	-27,441
-5.33%	-15,232	-15,264	-15,313	-15,380	-15,465	-15,568	-15,687
-2.67%	-4,299	-4,580	-4,869	-5,164	-5,463	-5,765	-6,071
0%	639	444	230	0	-243	-497	-760
2.67%	1,159	1,146	1,123	1,086	1,035	968	885
5.33%	1,168	1,168	1,167	1,166	1,163	1,156	1,146
8.00%	1,168	1,168	1,168	1,168	1,168	1,167	1,167
KR4301M73(2017-07 풋307.5							2,552
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-2,551	-2,551	-2,551	-2,551	-2,551	-2,551	-2,552
-5.33%	-1,517	-1,518	-1,519	-1,522	-1,526	-1,531	-1,537
-2.67%	-527	-544	-562	-582	-602	-624	-646
0%	74	50	25	0	-26	-52	-78
2.67%	180	177	172	166	157	148	136

5.33%	184	184	183	183	182	181	179
8.00%	184	184	184	184	184	184	183

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

75,618

공시일	2017-07-05
기준일	2017-07-04

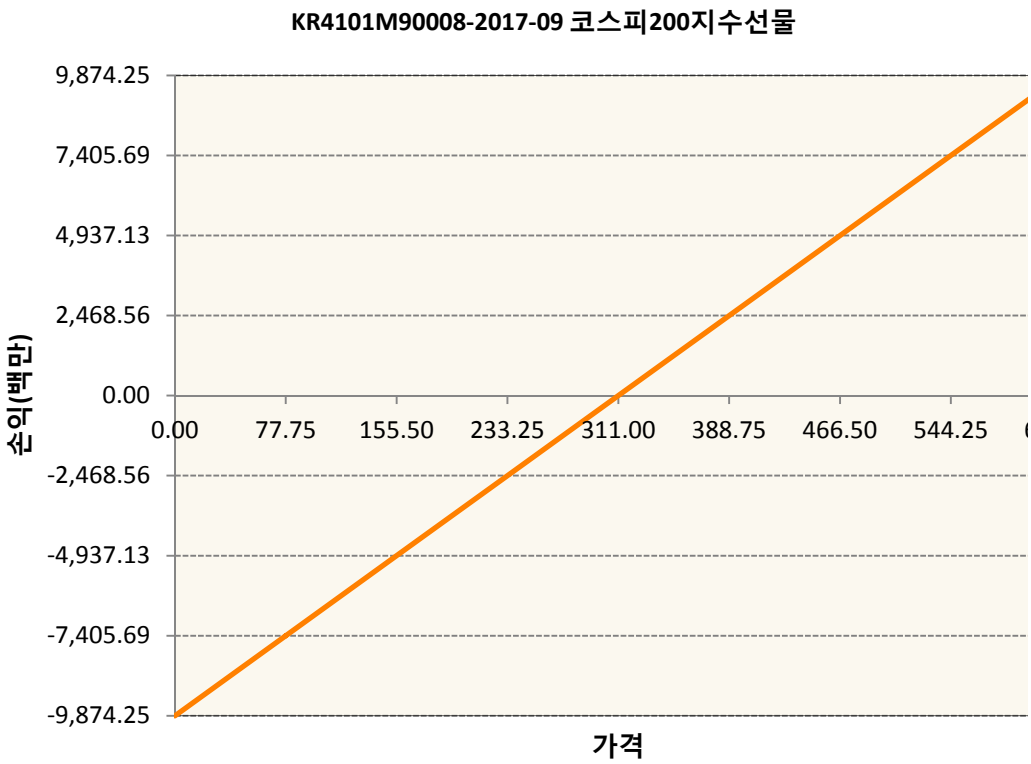
ETF스마트레버리지목표전환형6호

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	9,874	0	9,874	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101M90(2017-09 코스피200지수선물							789
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-789	-789	-789	-789	-789	-789	-789
-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%	789	789	789	789	789	789	789

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

490

공시일	2017-07-05
기준일	2017-07-04

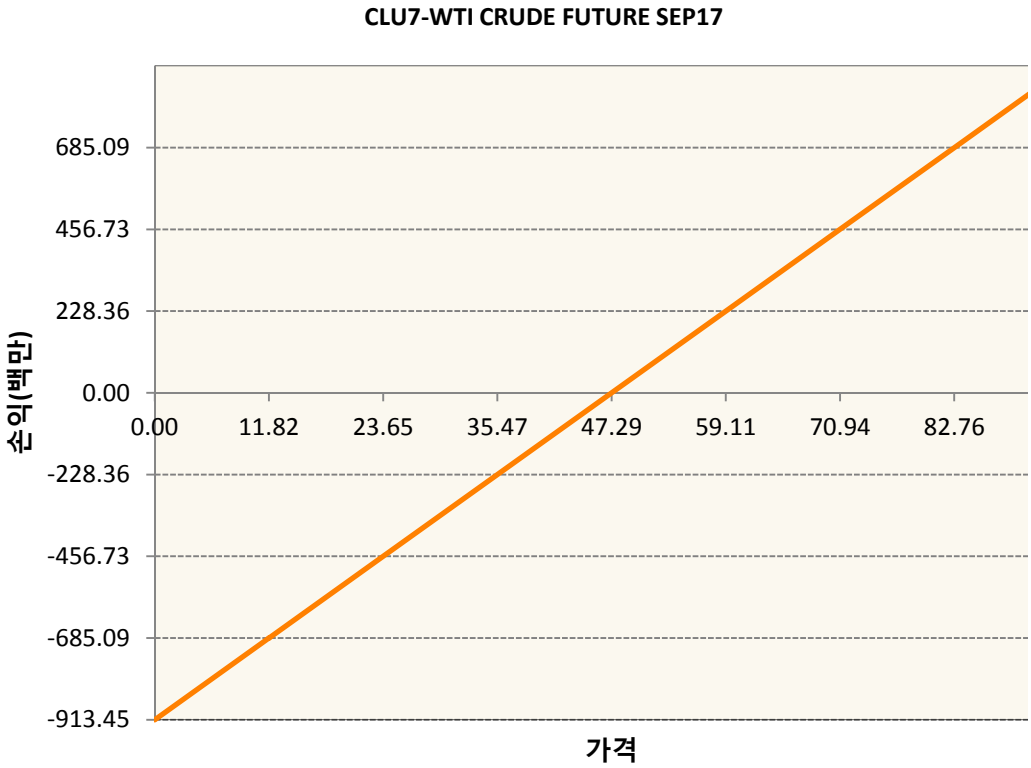
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

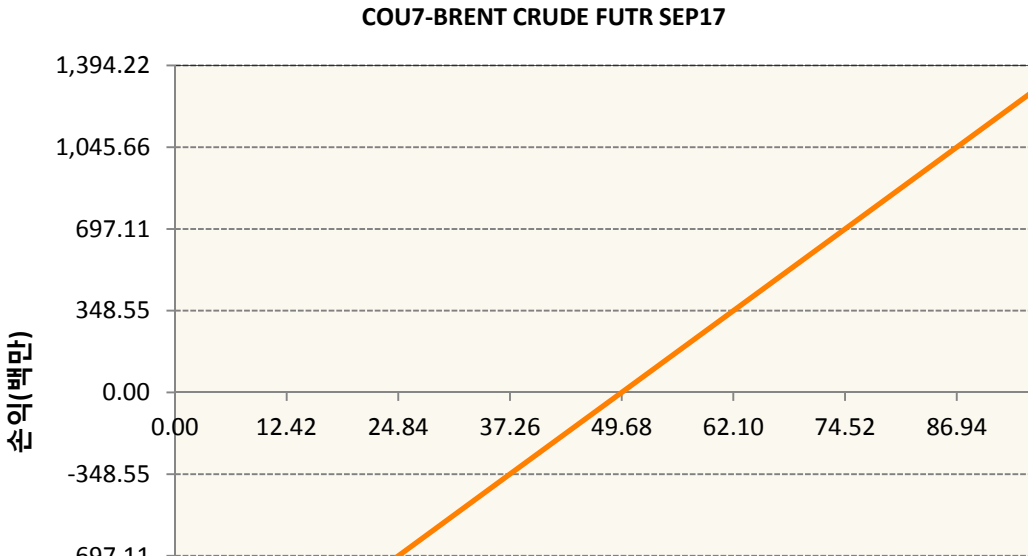
1. 계약금액

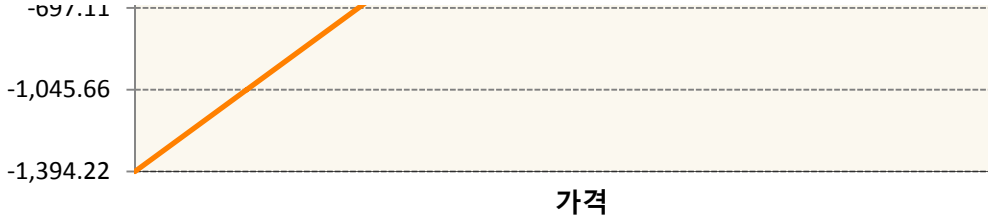
(단위:백만원)

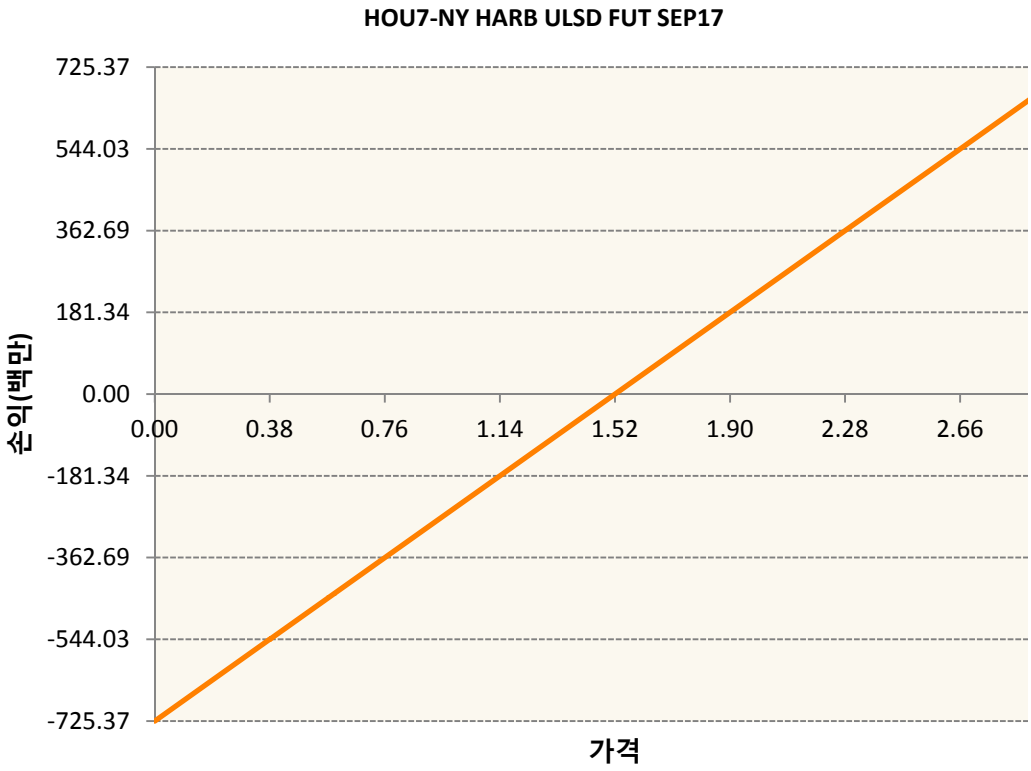
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	5,170	230	4,940	

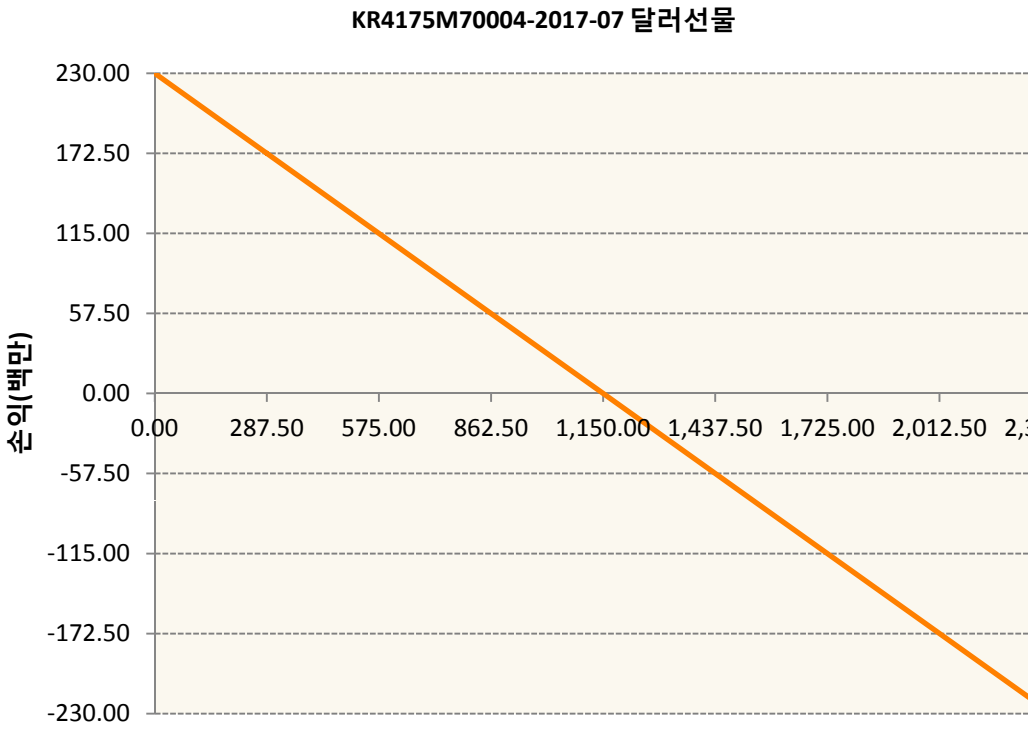
2. 만기시점의 손익구조



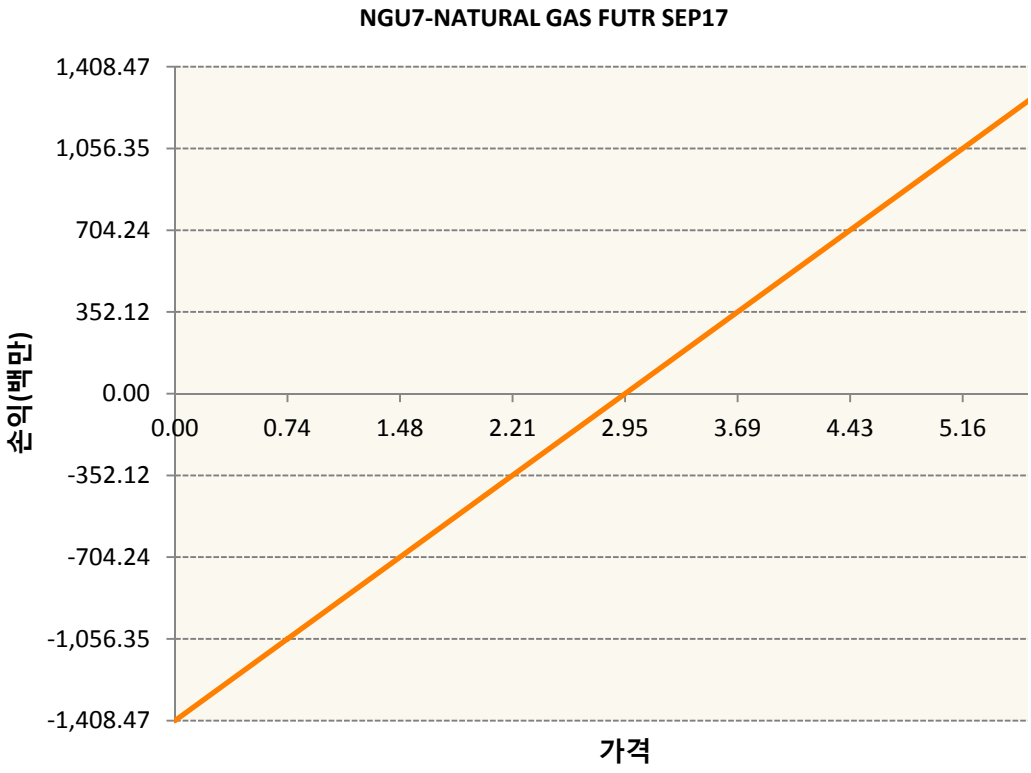


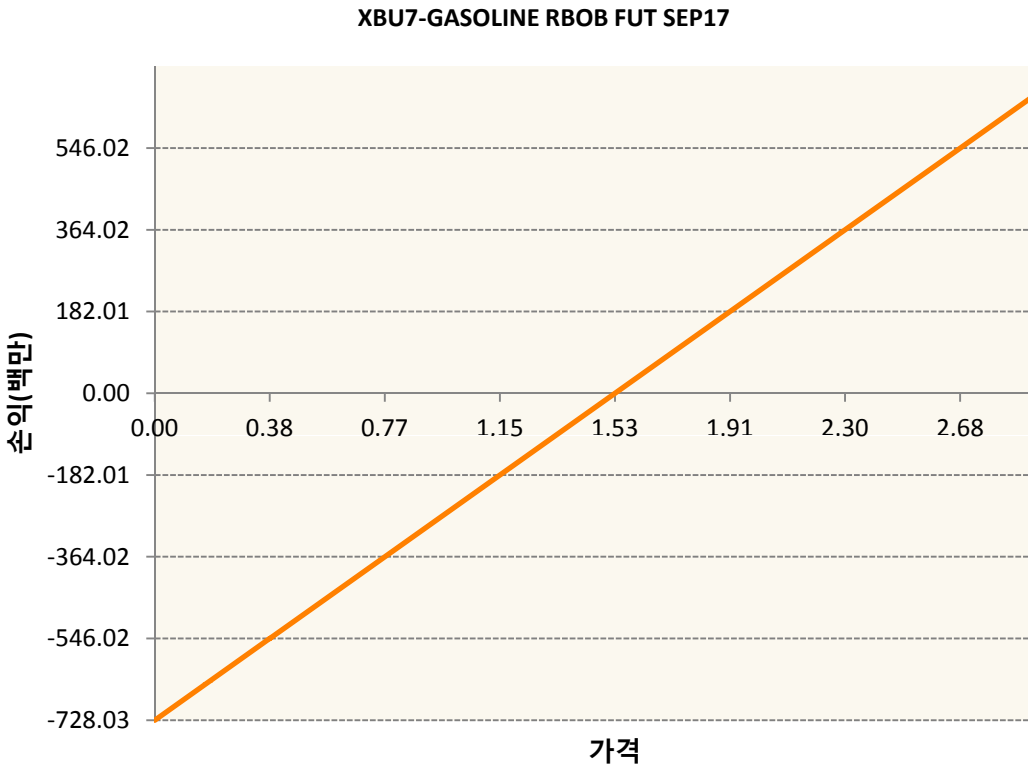

-697.11
-1,045.66
-1,394.22
가격


HOU7-NY HARB ULSD FUT SEP17
725.37
544.03
362.69
181.34
0.00
-181.34
-362.69
-544.03
-725.37
0.00
0.38
0.76
1.14
1.52
1.90
2.28
2.66
손익(백만)
가격


KR4175M70004-2017-07 달러선물
230.00
172.50
115.00
57.50
0.00
-57.50
-115.00
-172.50
-230.00
0.00
287.50
575.00
862.50
1,150.00
1,437.50
1,725.00
2,012.50
손익(백만)

가격


NGU7-NATURAL GAS FUTR SEP17
1,408.47
1,056.35
704.24
352.12
0.00
-352.12
-704.24
-1,056.35
-1,408.47
0.00
0.74
1.48
2.21
2.95
3.69
4.43
5.16
손익(백만)
가격


XBU7-GASOLINE RBOB FUT SEP17
546.02
364.02
182.01
0.00
-182.01
-364.02
-546.02
-728.03
0.00
0.38
0.77
1.15
1.53
1.91
2.30
2.68
손익(백만)
가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLU7	WTI CRUDE FUTURE SEP17	73
COU7	BRENT CRUDE FUTR SEP17	112
HOU7	NY HARB ULSD FUT SEP17	58
KR4175M70(	2017-07 달러선물	18
NGU7	NATURAL GAS FUTR SEP17	113
XBU7	GASOLINE RBOB FUT SEP17	58

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

815

공시일	2017-07-05
기준일	2017-07-04

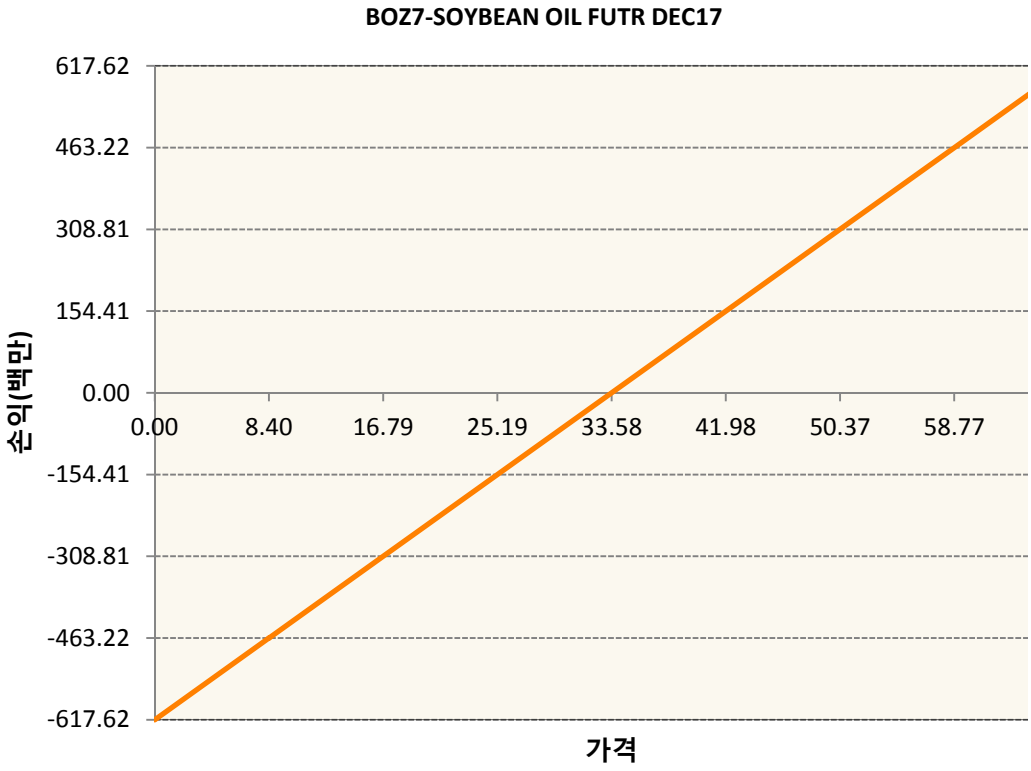
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

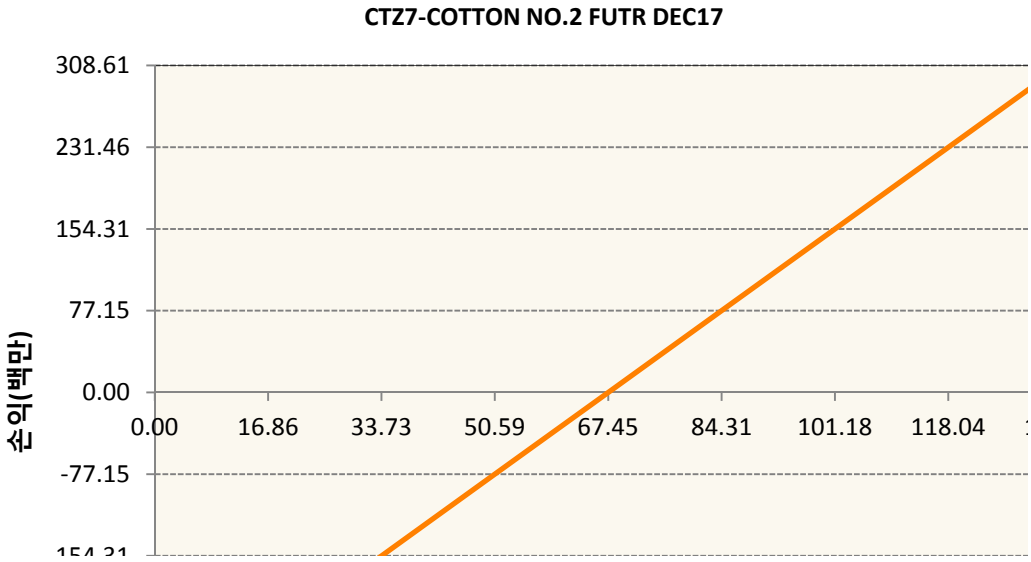
1. 계약금액

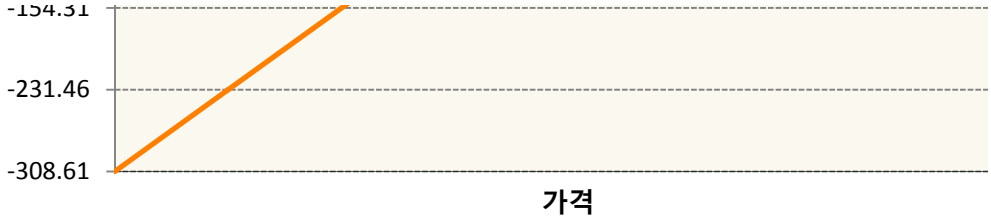
(단위:백만원)

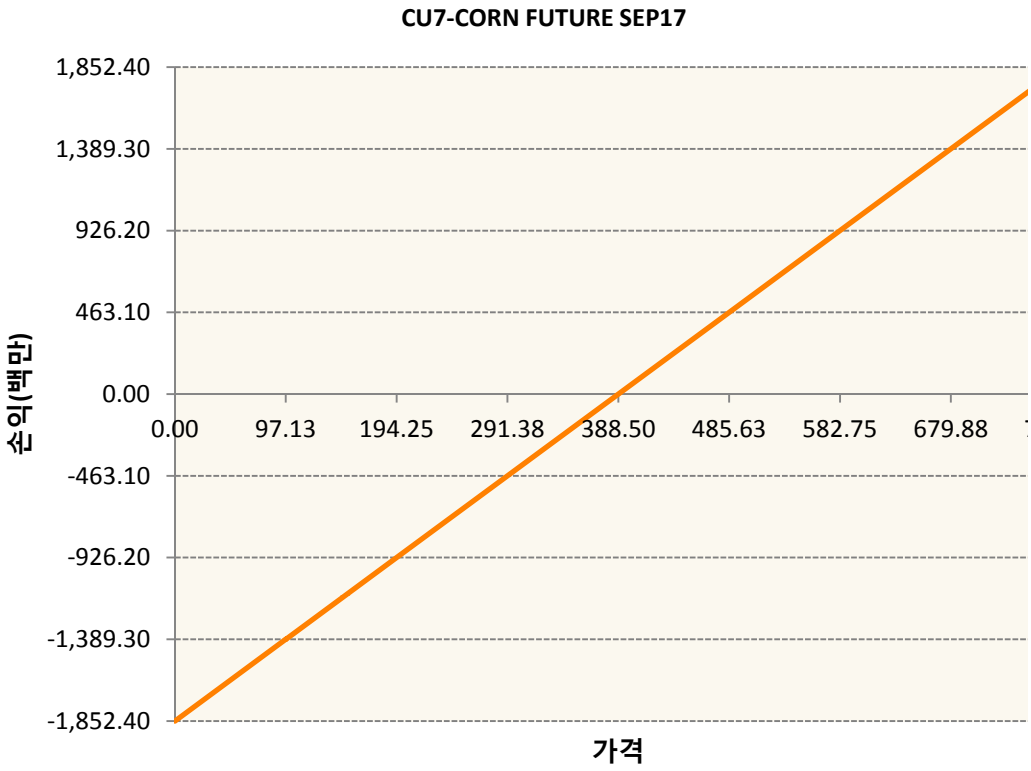
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	7,188	403	6,785	

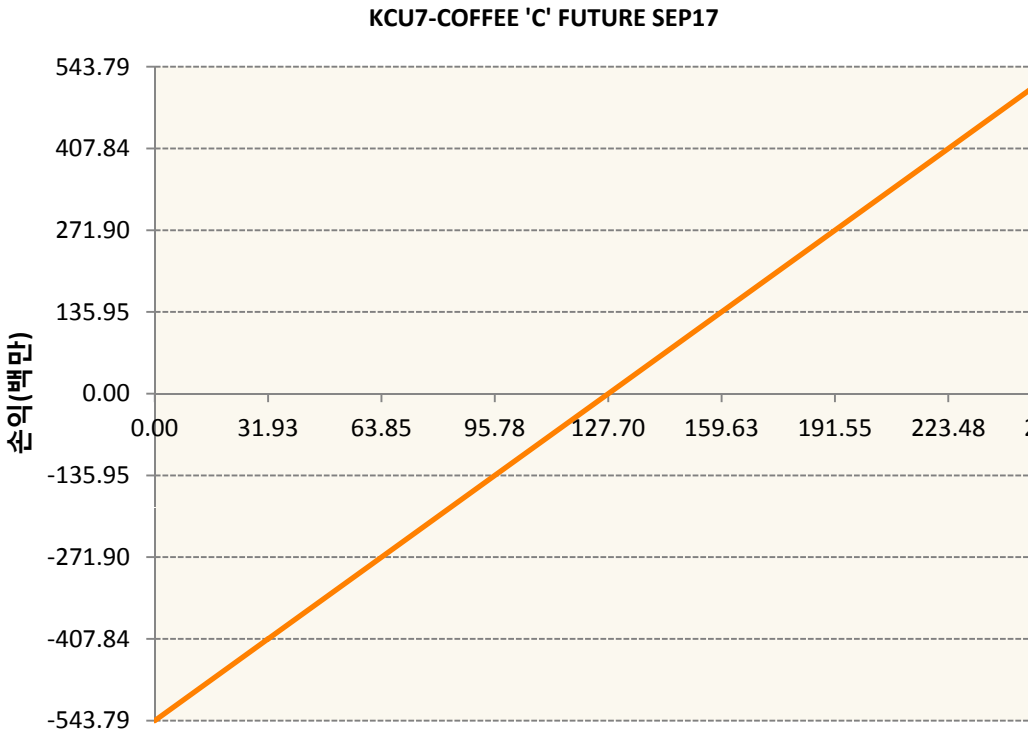
2. 만기시점의 손익구조



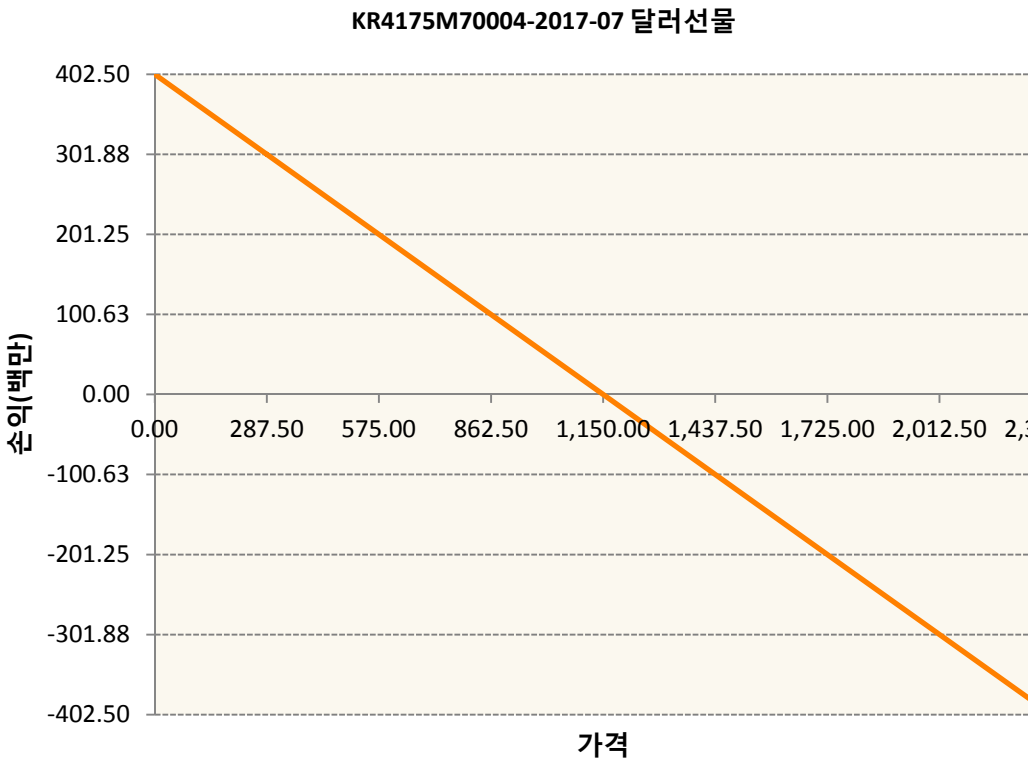


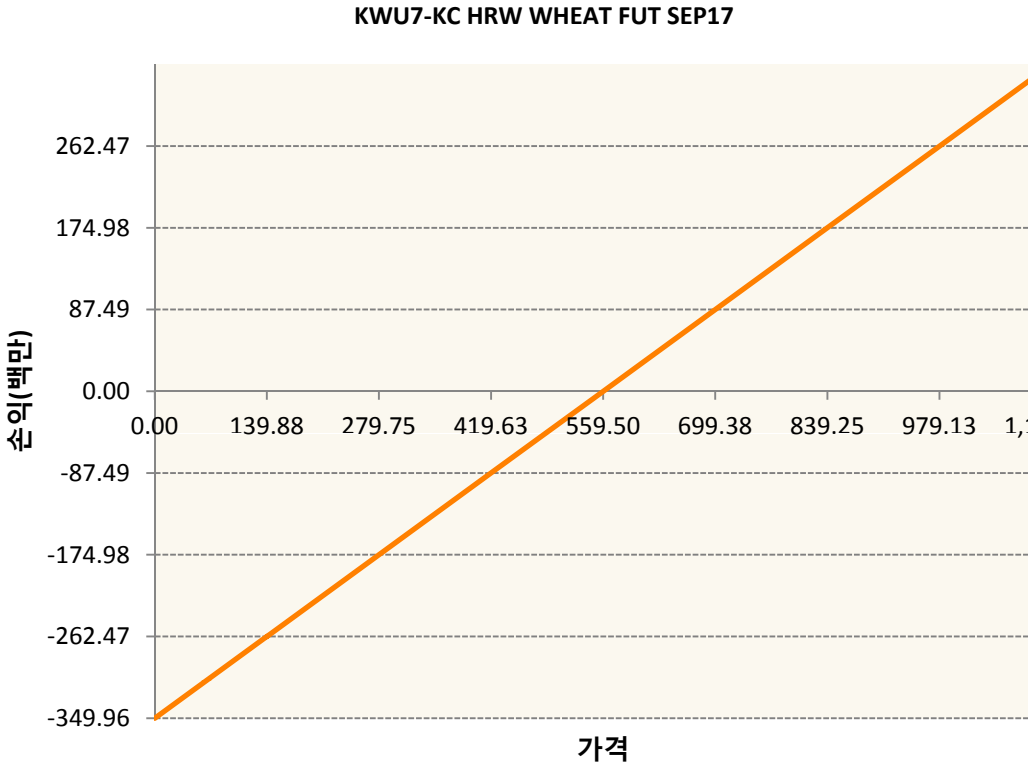

-154.31
-231.46
-308.61
가격

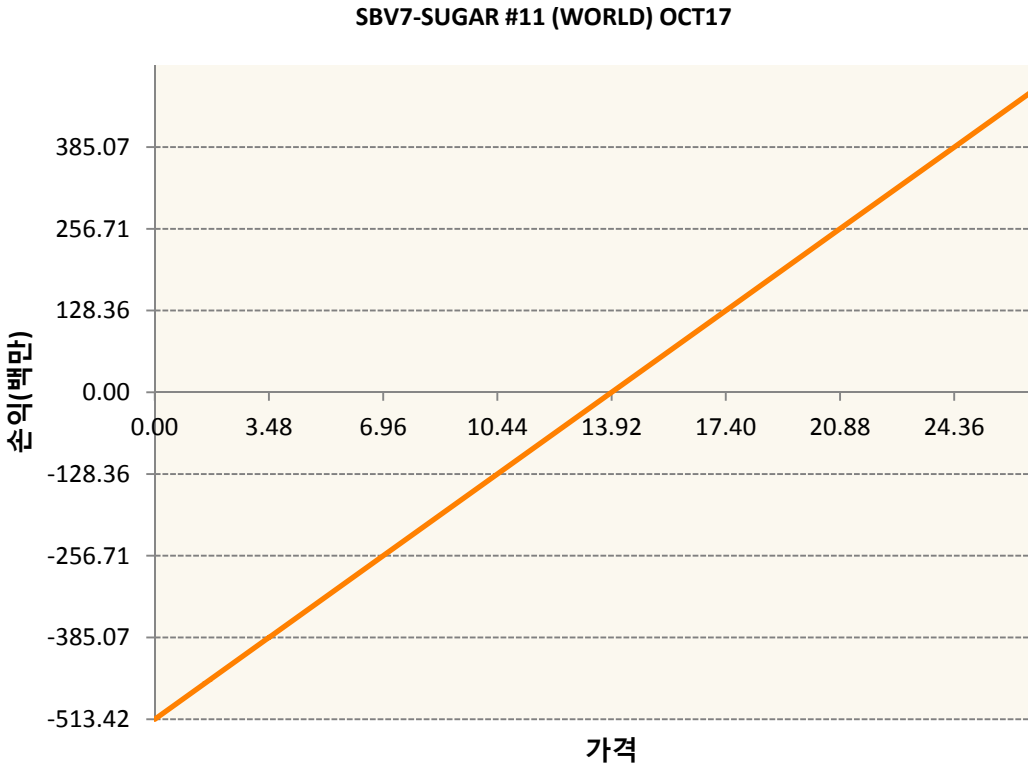

CU7-CORN FUTURE SEP17
1,852.40
1,389.30
926.20
463.10
0.00
-463.10
-926.20
-1,389.30
-1,852.40
0.00
97.13
194.25
291.38
388.50
485.63
582.75
679.88
순익(백만)
가격

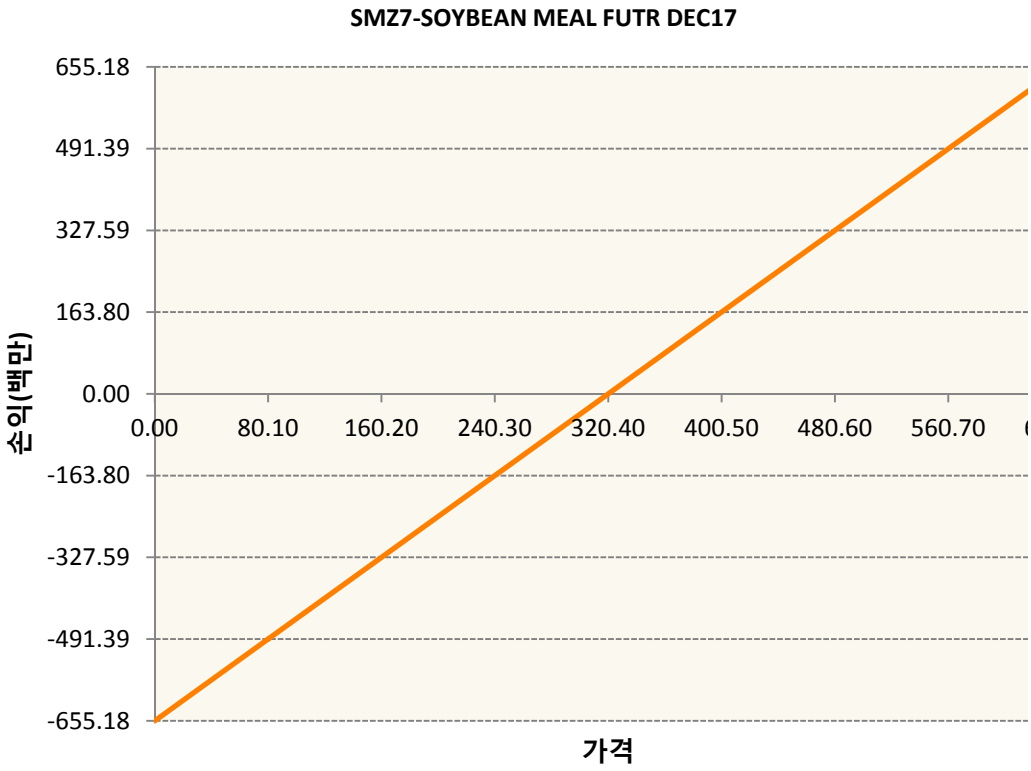

KCU7-COFFEE 'C' FUTURE SEP17
543.79
407.84
271.90
135.95
0.00
-135.95
-271.90
-407.84
-543.79
0.00
31.93
63.85
95.78
127.70
159.63
191.55
223.48
순익(백만)

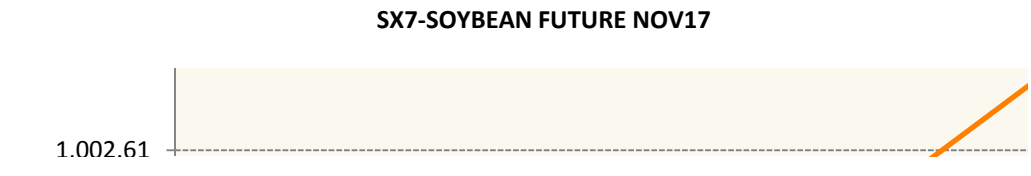
가격

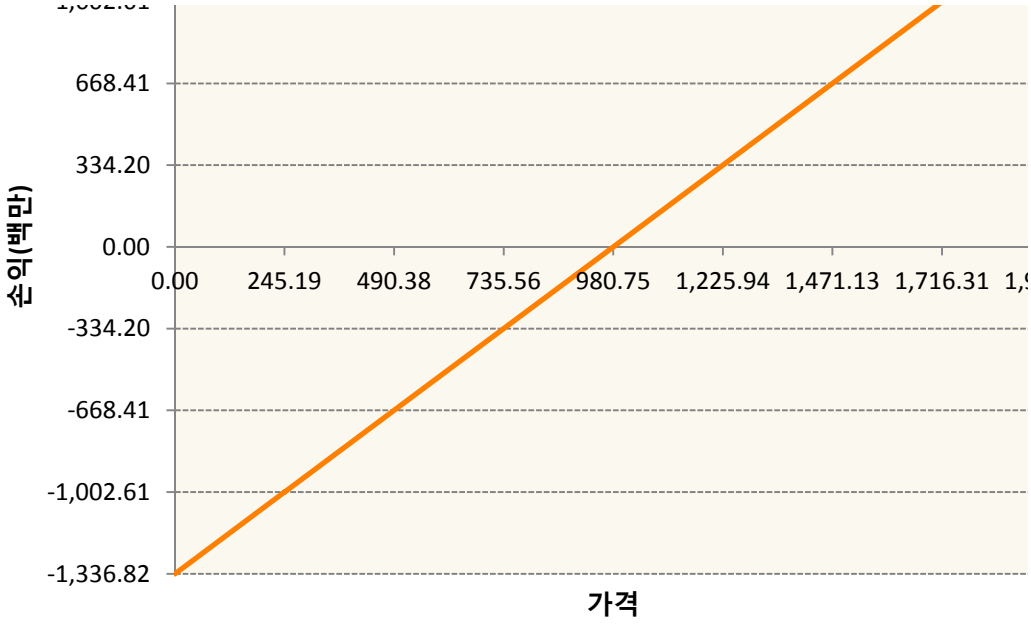

KR4175M70004-2017-07 달러선물
402.50
301.88
201.25
100.63
0.00
-100.63
-201.25
-301.88
-402.50
0.00
287.50
575.00
862.50
1,150.00
1,437.50
1,725.00
2,012.50
손익(백만)
가격


KWU7-KC HRW WHEAT FUT SEP17
262.47
174.98
87.49
0.00
-87.49
-174.98
-262.47
-349.96
0.00
139.88
279.75
419.63
559.50
699.38
839.25
979.13
손익(백만)
가격

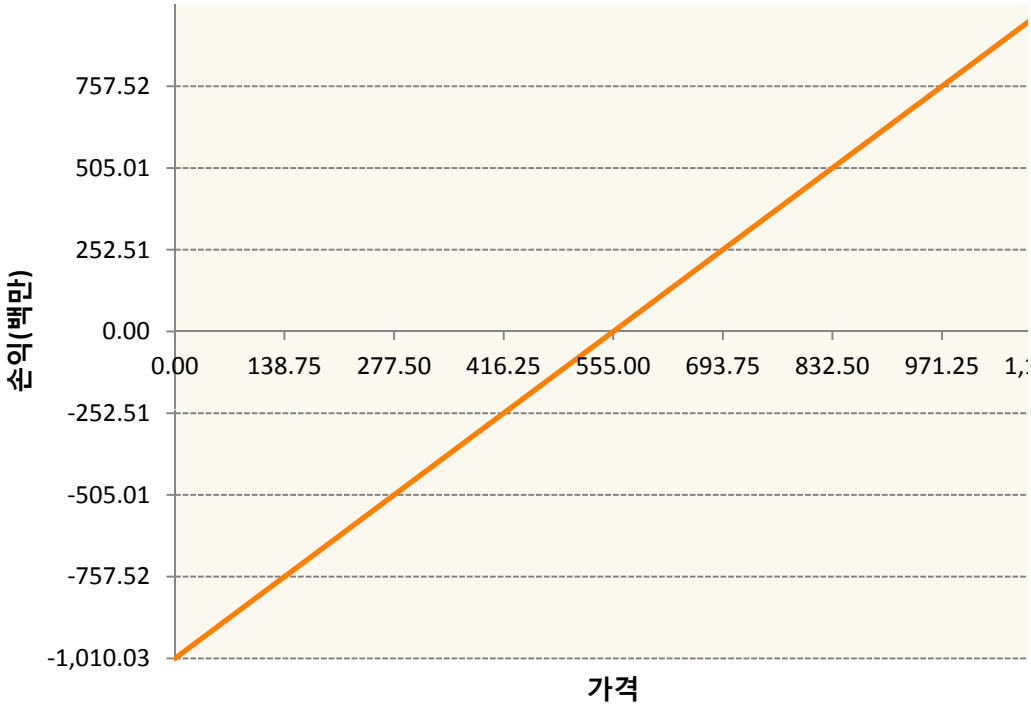

SBV7-SUGAR #11 (WORLD) OCT17
385.07
256.71
128.36
0.00
-128.36
-256.71
-385.07
-513.42
0.00
3.48
6.96
10.44
13.92
17.40
20.88
24.36
손익(백만)
가격


SMZ7-SOYBEAN MEAL FUTR DEC17
655.18
491.39
327.59
163.80
0.00
-163.80
-327.59
-491.39
-655.18
0.00
80.10
160.20
240.30
320.40
400.50
480.60
560.70
손익(백만)
가격


SX7-SOYBEAN FUTURE NOV17
1,002.61



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	148
KCU7	COFFEE 'C' FUTURE SEP17	44
KR4175M70(	2017-07 달러선물	32

KWU7	KC HRW WHEAT FUT SEP17	28
SBV7	SUGAR #11 (WORLD) OCT17	41
SMZ7	SOYBEAN MEAL FUTR DEC17	52
SX7	SOYBEAN FUTURE NOV17	107
WU7	WHEAT FUTURE(CBT) SEP17	81

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

666