공시일	2017-07-06
기준일	2017-07-05

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	2017-07-06
기준일	2017-07-05

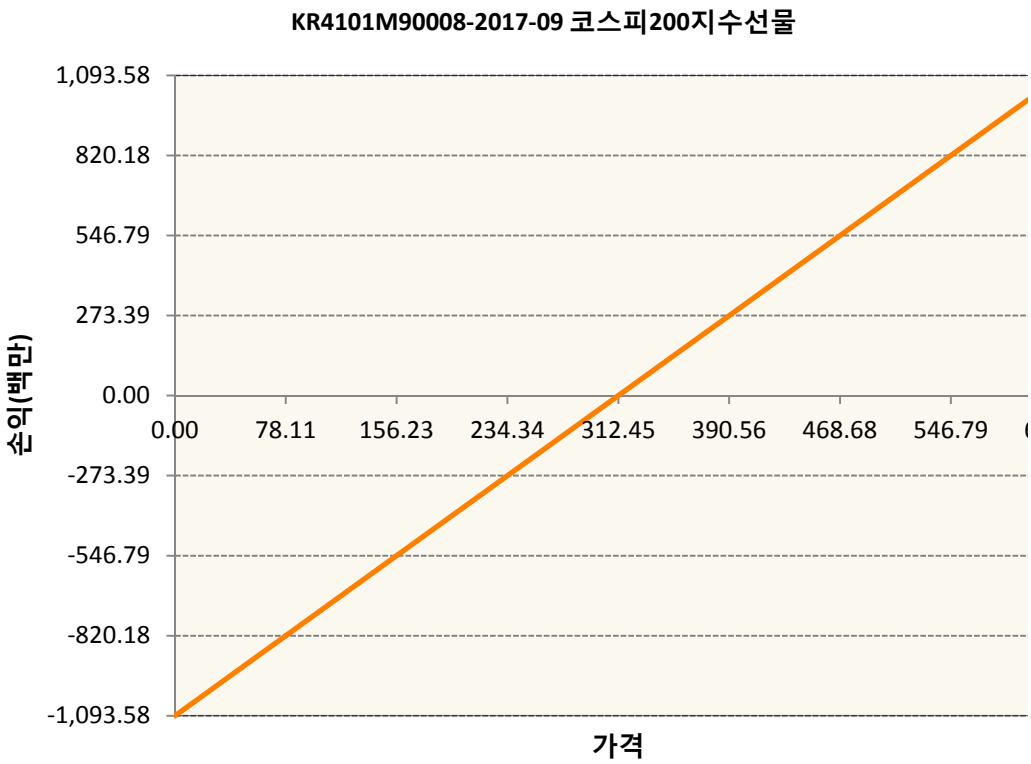
스마트인덱스모

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	1,094	0	1,094	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	2017-07-06
기준일	2017-07-05

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)

485

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-07-06
기준일	2017-07-05

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	384

* 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	2017-07-06
기준일	2017-07-05

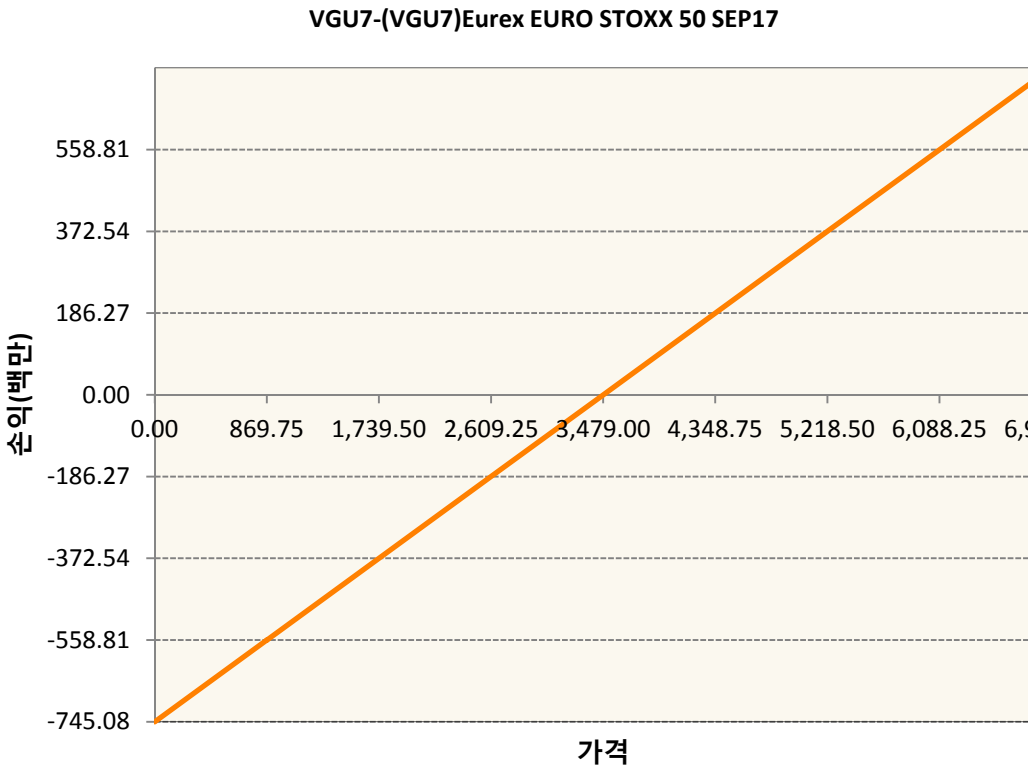
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	745	0	745	

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	2017-07-06
기준일	2017-07-05

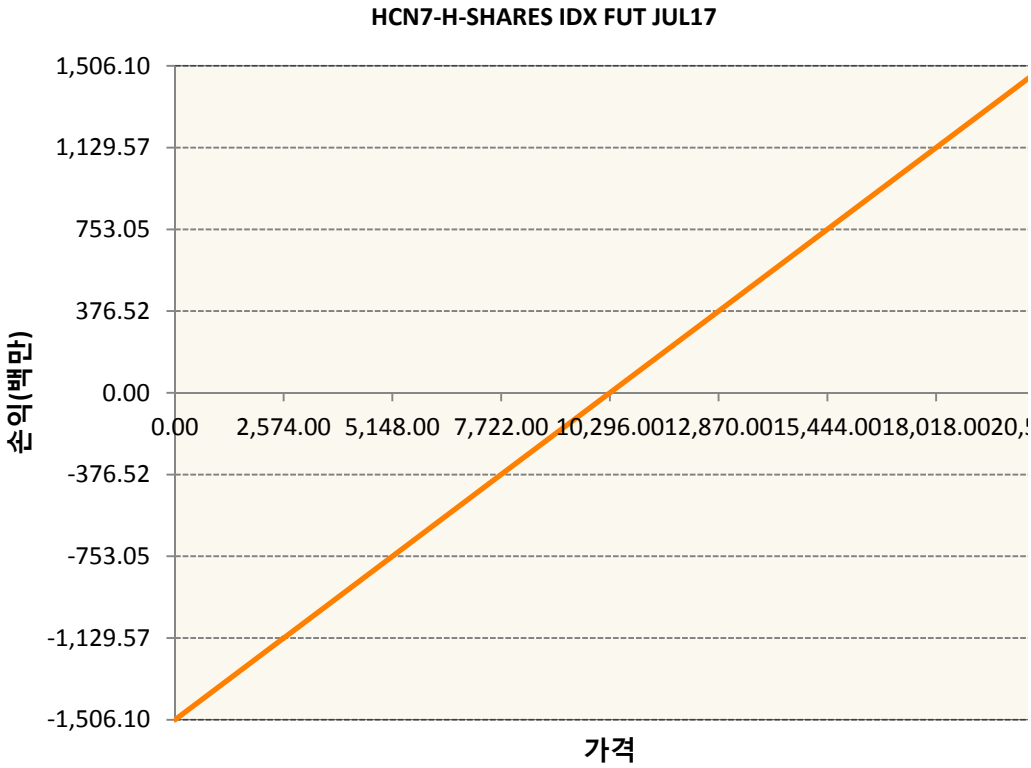
차이나인덱스모(주식-파생형)

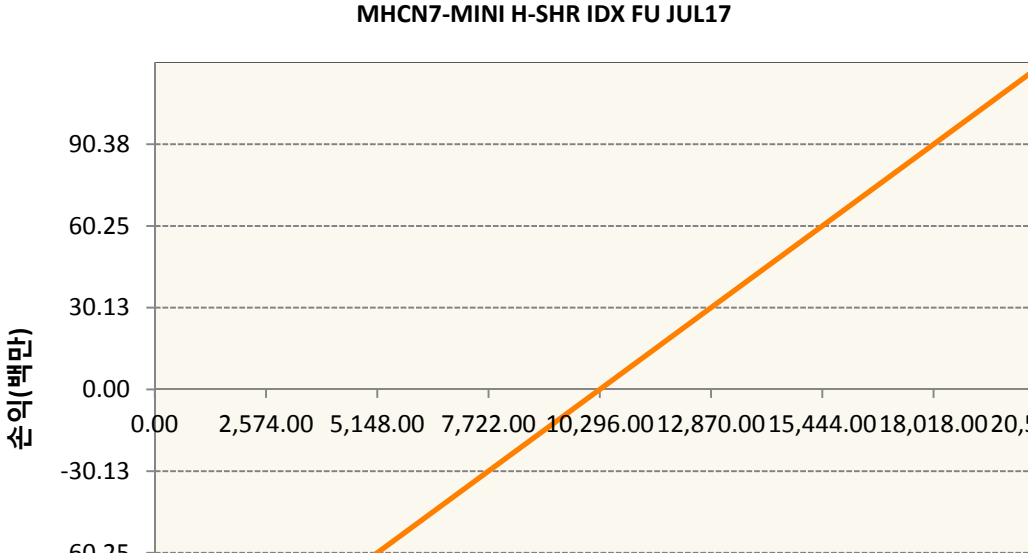
1. 계약금액

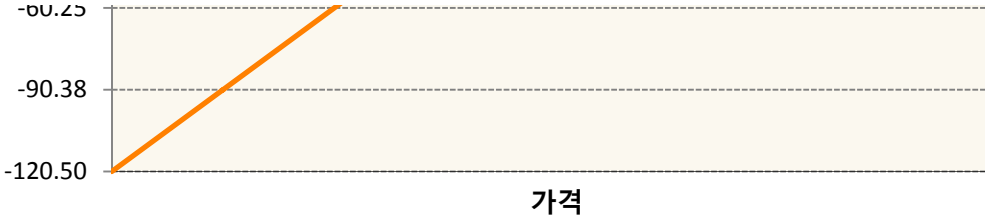
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,627	0	1,627	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	2017-07-06
기준일	2017-07-05

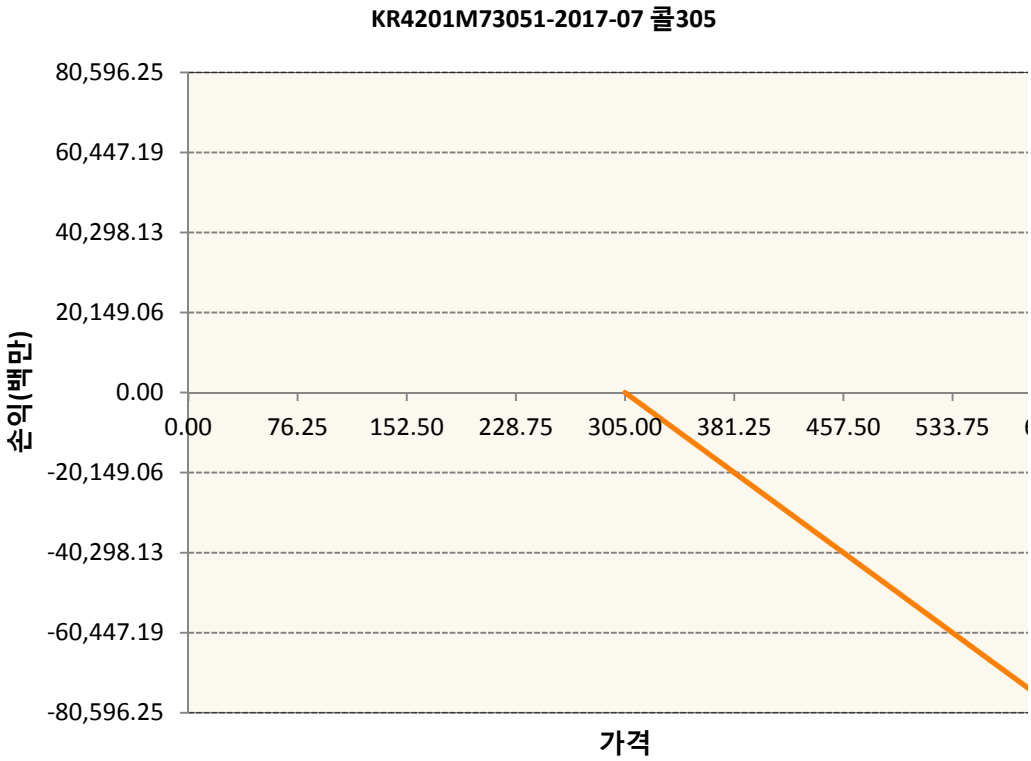
커버드콜모(주식혼합-파생형)

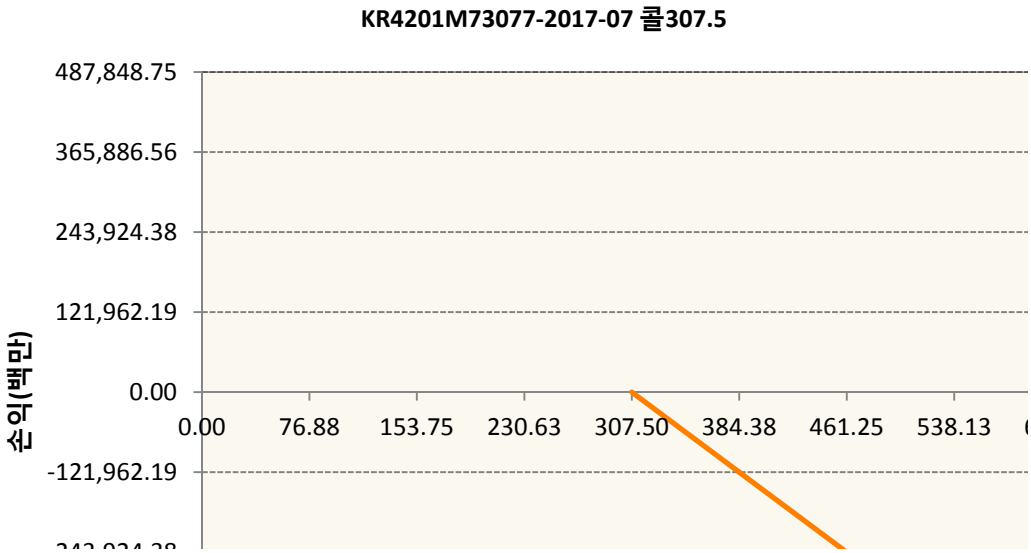
1. 계약금액

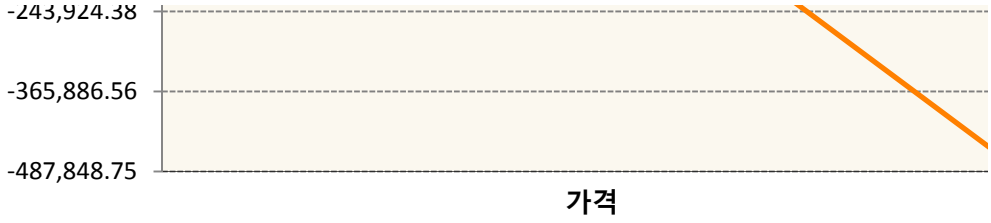
(단위:백만원)

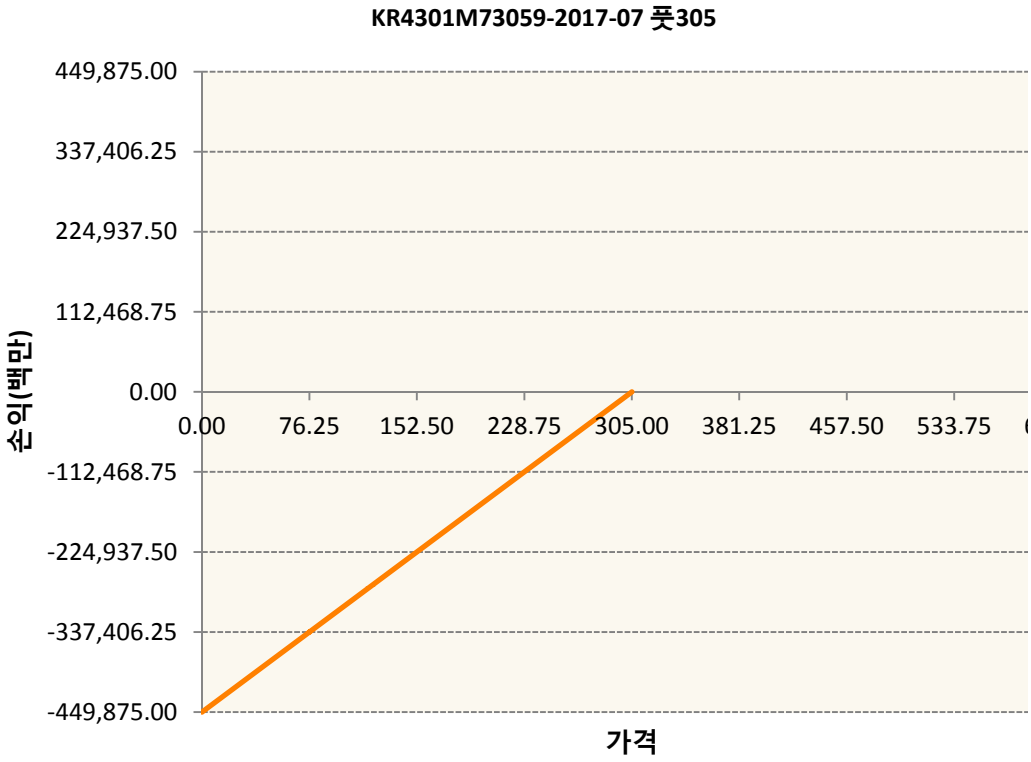
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	1,056,758	-1,056,758	장내

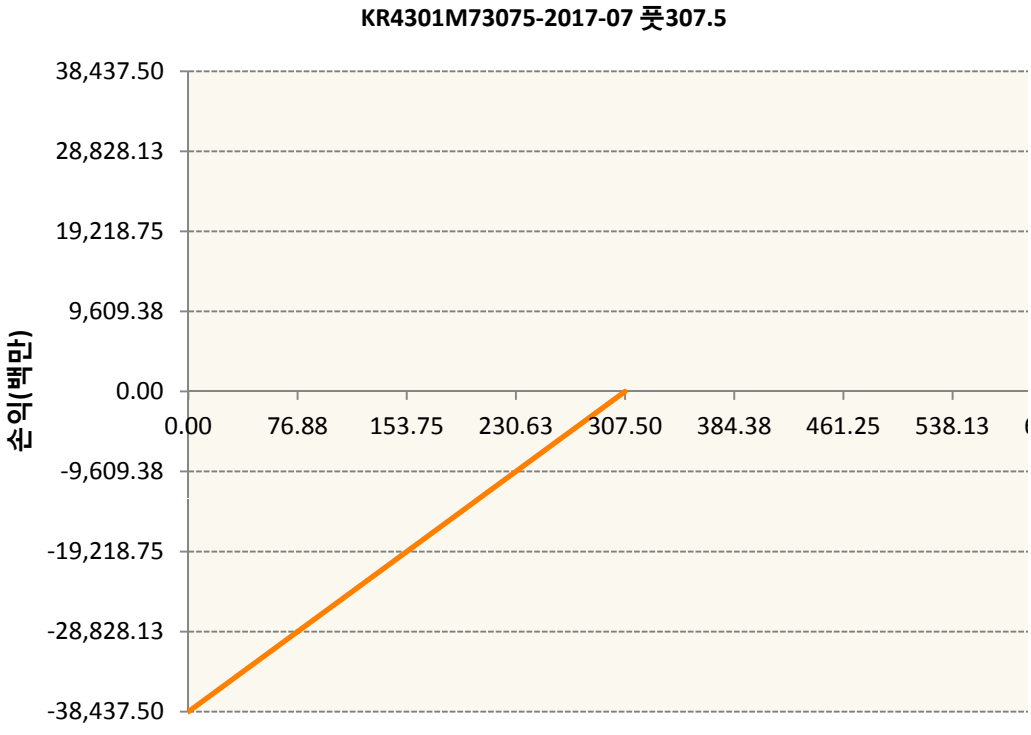
2. 만기시점의 손익구조






-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							6,096
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	2,293	2,282	2,266	2,245	2,218	2,185	2,147
-5.33%	2,175	2,123	2,065	2,001	1,933	1,862	1,787
-2.67%	1,602	1,504	1,406	1,308	1,210	1,112	1,013
0%	239	163	83	0	-85	-173	-262
2.67%	-1,719	-1,745	-1,778	-1,819	-1,865	-1,917	-1,974
5.33%	-3,879	-3,883	-3,891	-3,903	-3,920	-3,941	-3,967
8.00%	-6,073	-6,073	-6,074	-6,076	-6,080	-6,086	-6,096
KR4201M73(2017-07 콜307.5							35,406
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	11,115	11,080	11,022	10,936	10,822	10,678	10,504
-5.33%	10,730	10,508	10,244	9,942	9,607	9,245	8,858
-2.67%	8,378	7,839	7,290	6,733	6,170	5,603	5,032
0%	1,656	1,114	561	0	-568	-1,141	-1,718
2.67%	-9,272	-9,513	-9,799	-10,123	-10,480	-10,866	-11,277
5.33%	-22,038	-22,089	-22,169	-22,281	-22,427	-22,606	-22,818
8.00%	-35,183	-35,189	-35,202	-35,226	-35,266	-35,325	-35,406
KR4301M73(2017-07 풋305							26,200
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-26,175	-26,175	-26,176	-26,178	-26,181	-26,188	-26,200
-5.33%	-13,949	-13,983	-14,033	-14,100	-14,185	-14,286	-14,402
-2.67%	-3,350	-3,633	-3,918	-4,206	-4,495	-4,785	-5,077
0%	409	294	156	0	-173	-360	-560
2.67%	624	621	614	601	580	550	508
5.33%	625	625	625	625	624	623	620
8.00%	625	625	625	625	625	625	625
KR4301M73(2017-07 풋307.5							2,472
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-2,471	-2,471	-2,471	-2,471	-2,471	-2,472	-2,472
-5.33%	-1,433	-1,434	-1,435	-1,438	-1,441	-1,446	-1,452
-2.67%	-453	-470	-489	-509	-530	-551	-573
0%	56	39	20	0	-21	-42	-64
2.67%	112	111	109	106	102	96	90

5.33%	112	112	112	112	112	112	111
8.00%	112	112	112	112	112	112	112

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

73,913

공시일	2017-07-06
기준일	2017-07-05

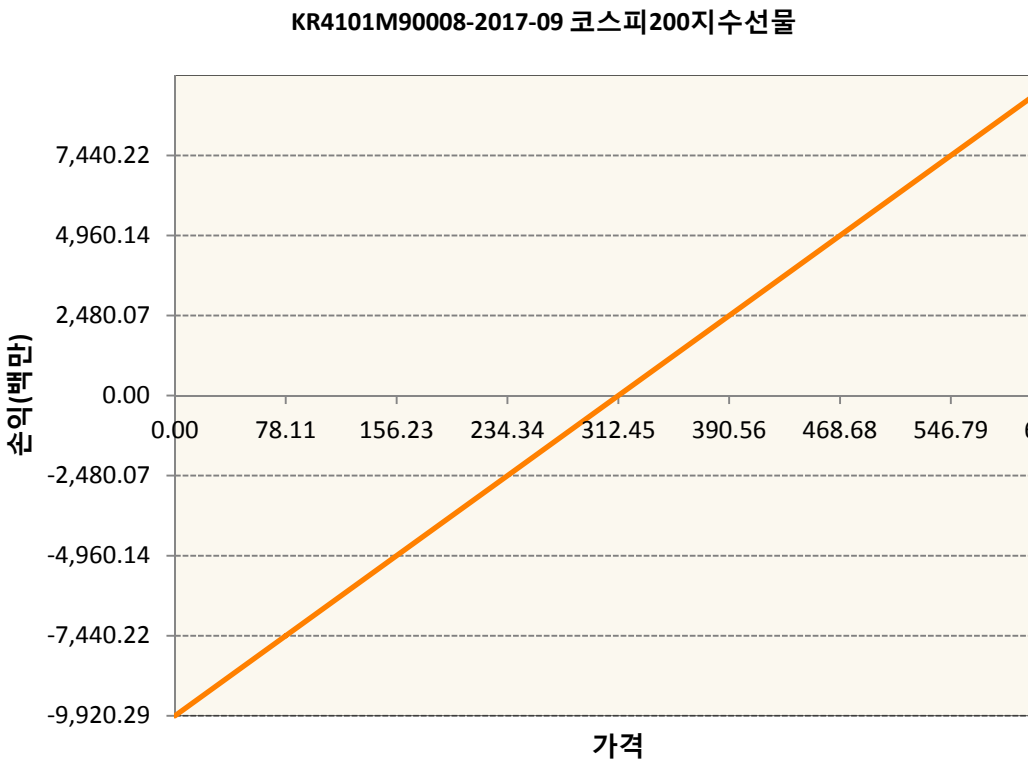
ETF스마트레버리지목표전환형6호

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	9,920	0	9,920	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)

491

공시일	2017-07-06
기준일	2017-07-05

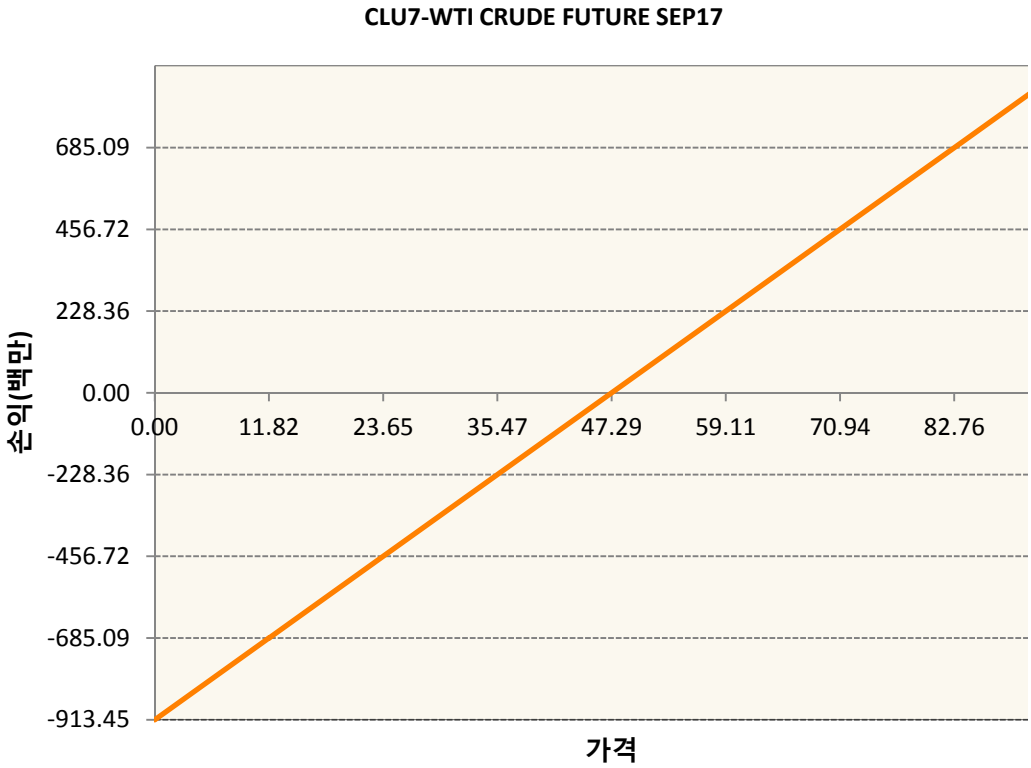
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

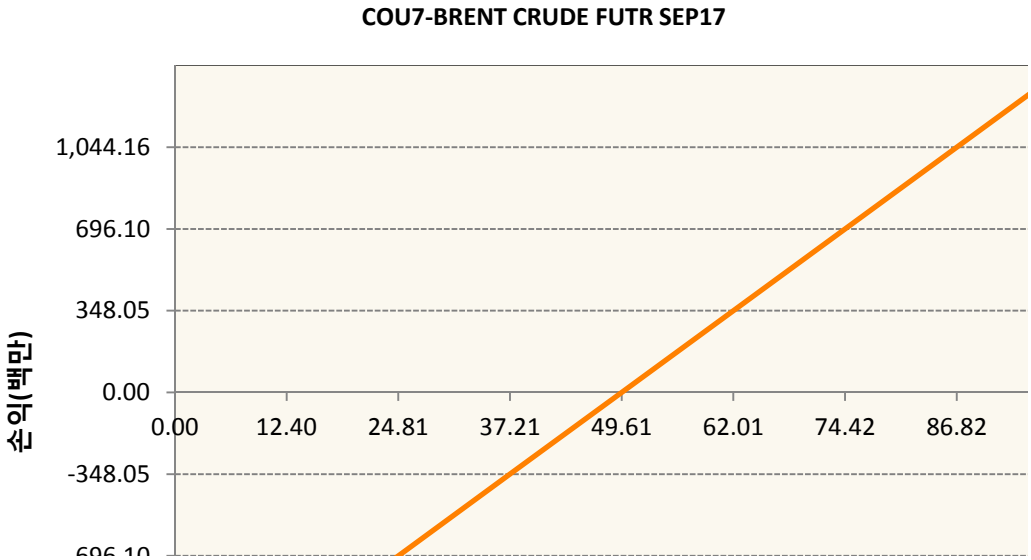
1. 계약금액

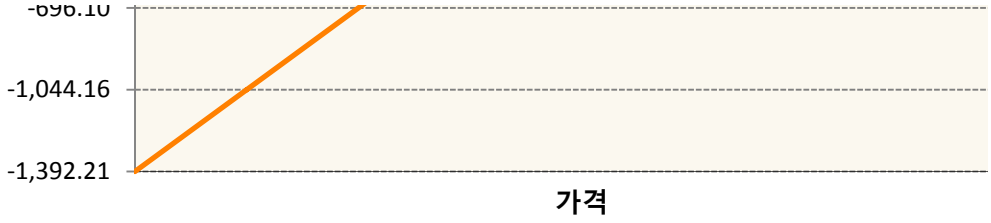
(단위:백만원)

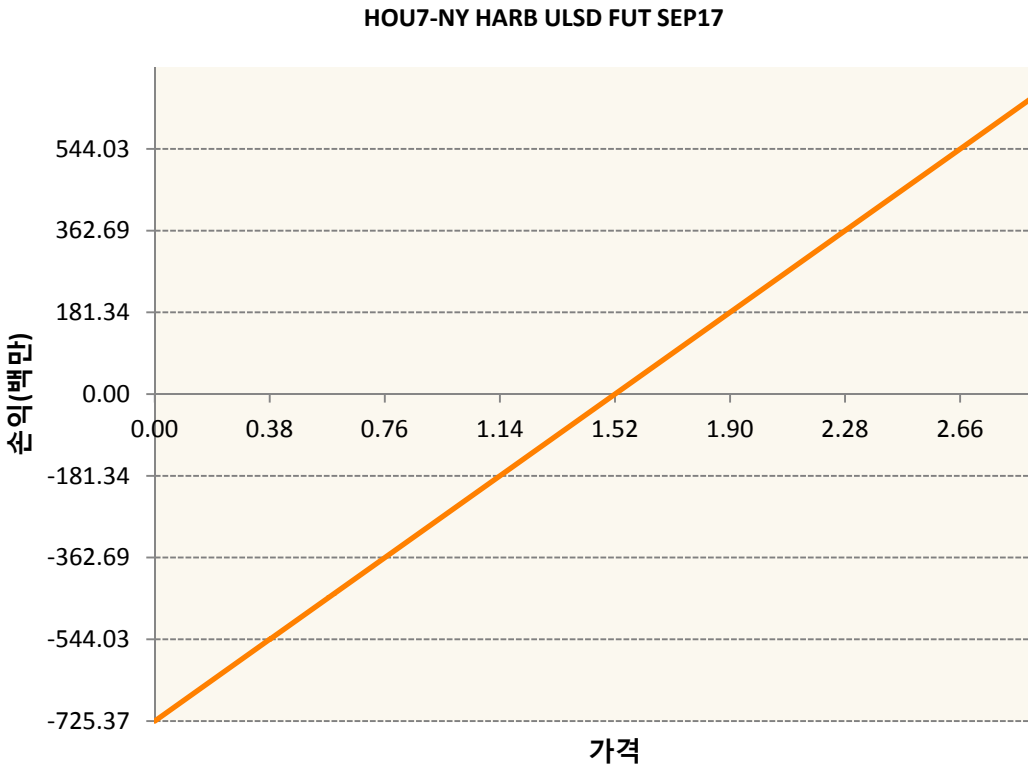
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	5,168	230	4,938	

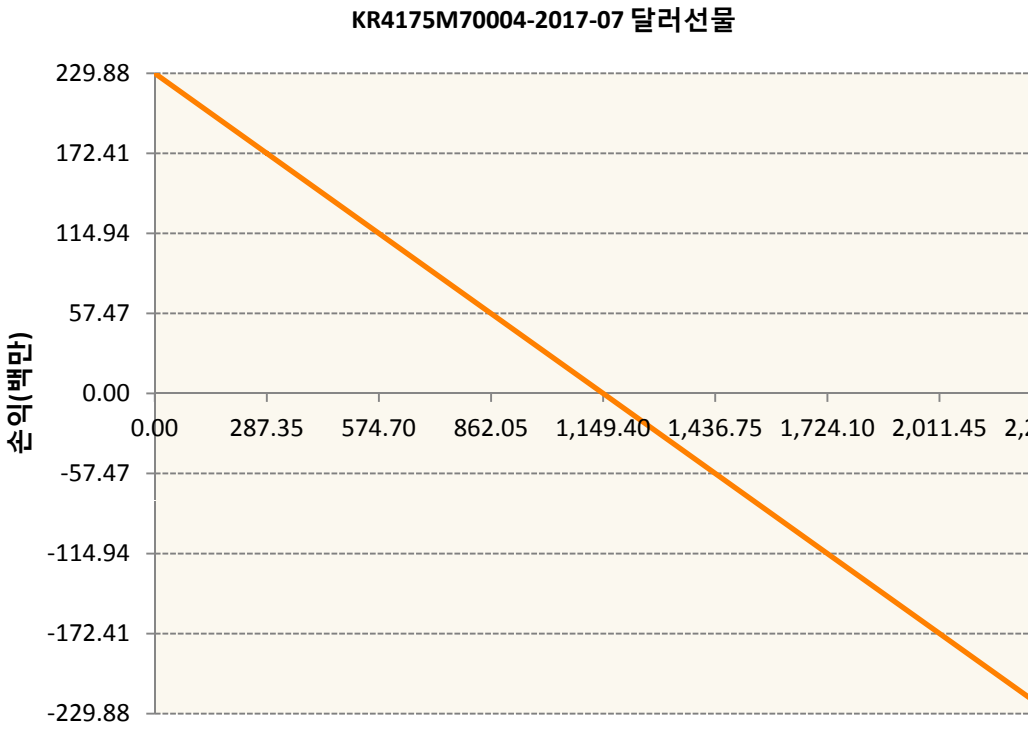
2. 만기시점의 손익구조



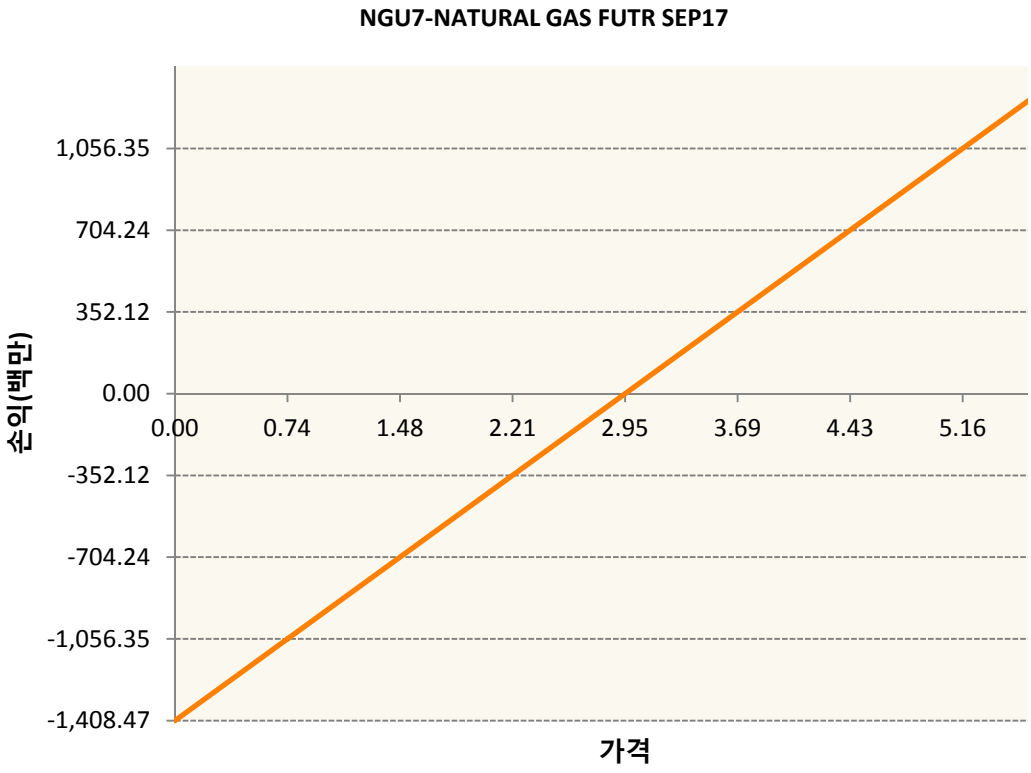


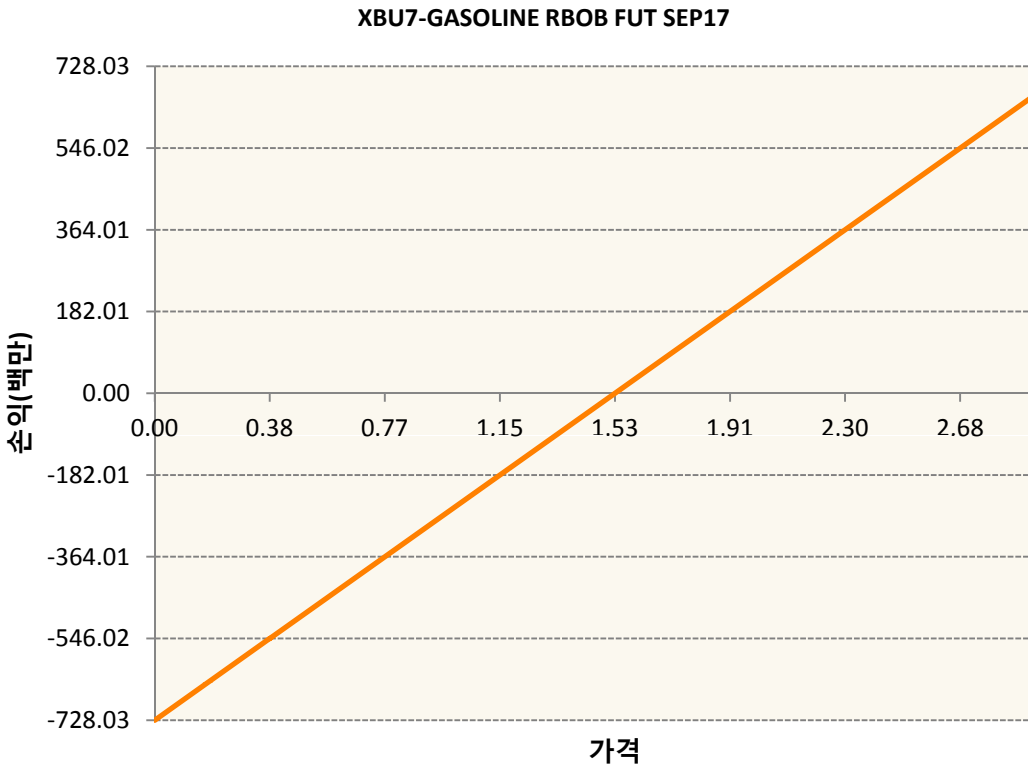

-696.10
-1,044.16
-1,392.21
가격


HOU7-NY HARB ULSD FUT SEP17
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
229.88
172.41
114.94
57.47
0.00
-57.47
-114.94
-172.41
-229.88
0.00
287.35
574.70
862.05
1,149.40
1,436.75
1,724.10
2,011.45
손익(백만)

가격


NGU7-NATURAL GAS FUTR SEP17
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
728.03
546.02
364.01
182.01
0.00
-182.01
-364.01
-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	111
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)

795

공시일	2017-07-06
기준일	2017-07-05

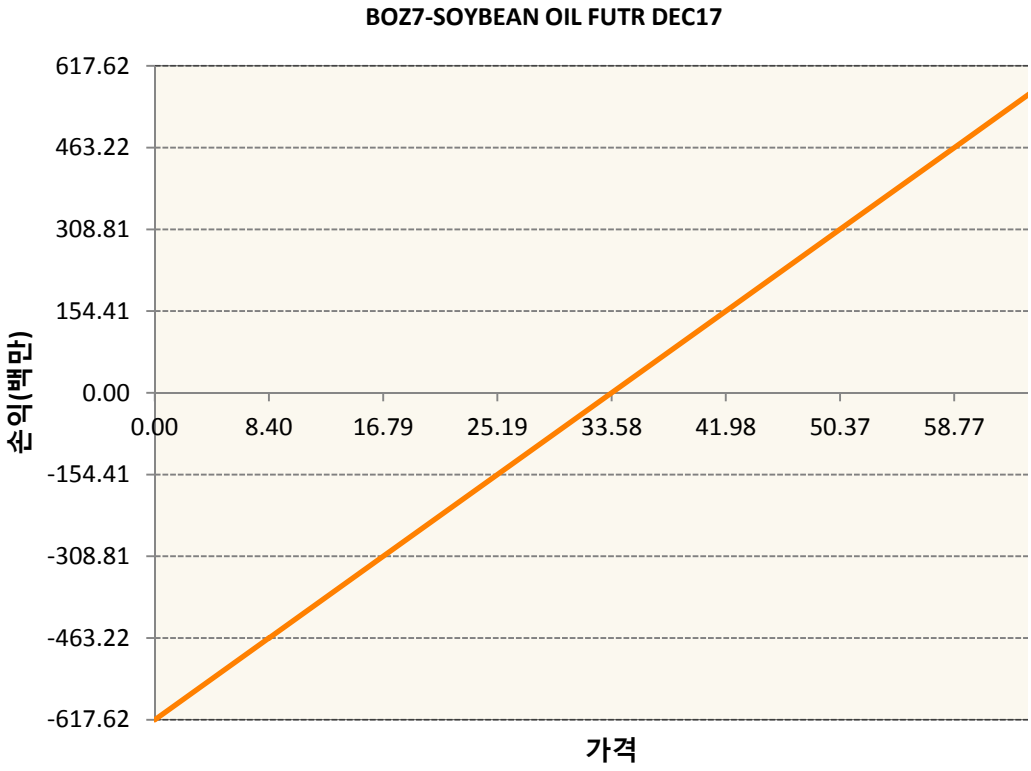
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

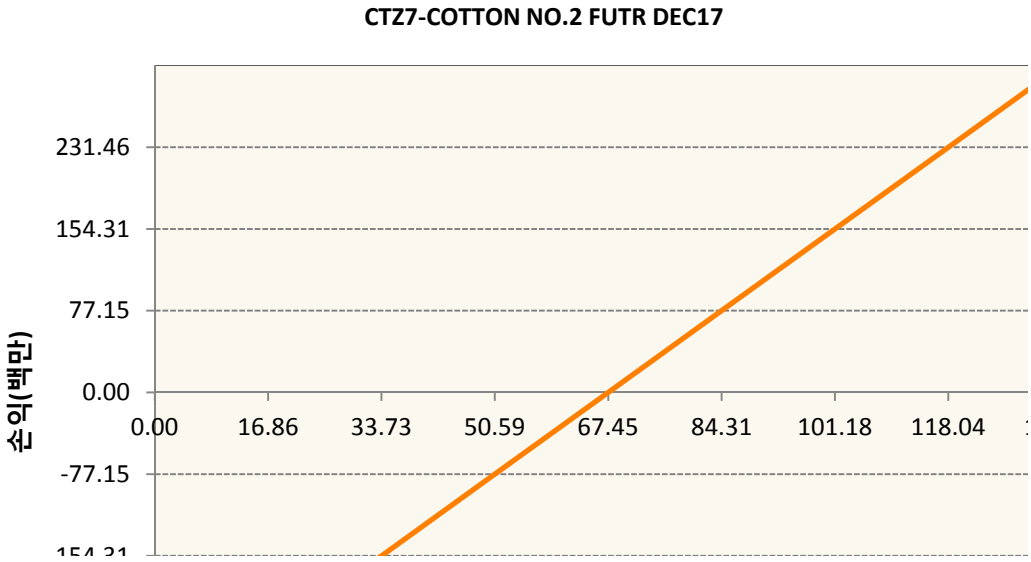
1. 계약금액

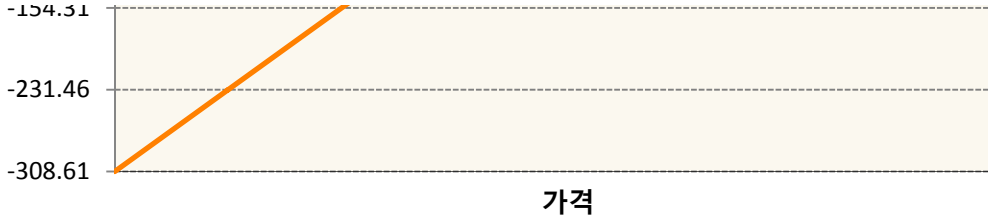
(단위:백만원)

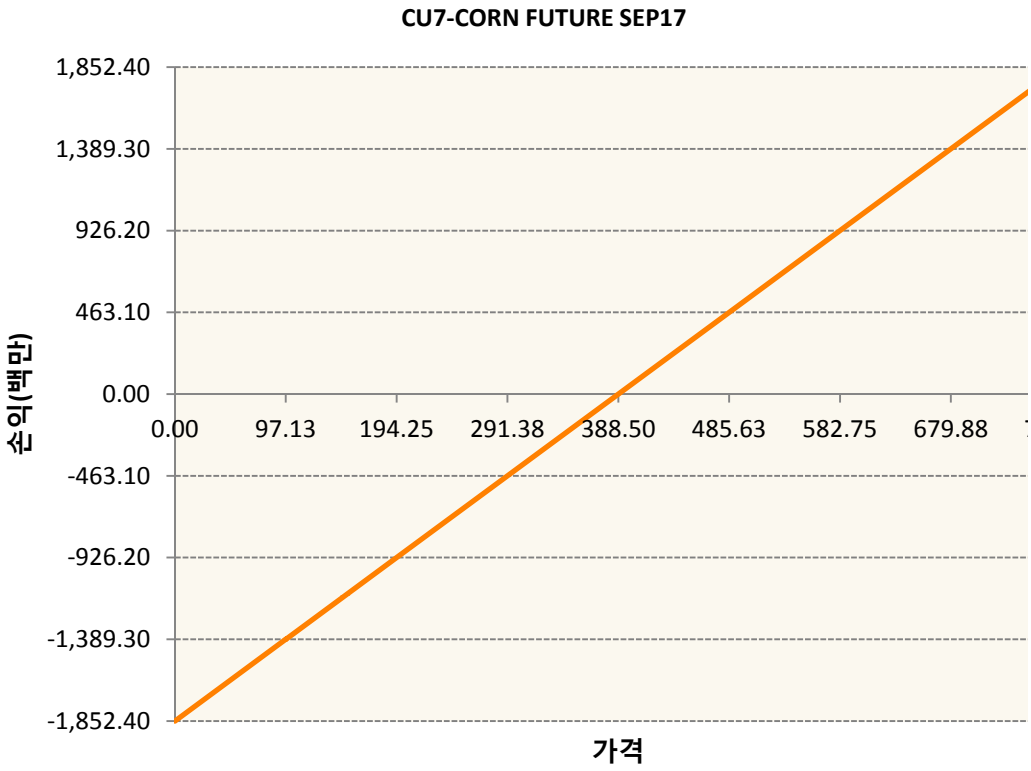
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	7,188	402	6,786	

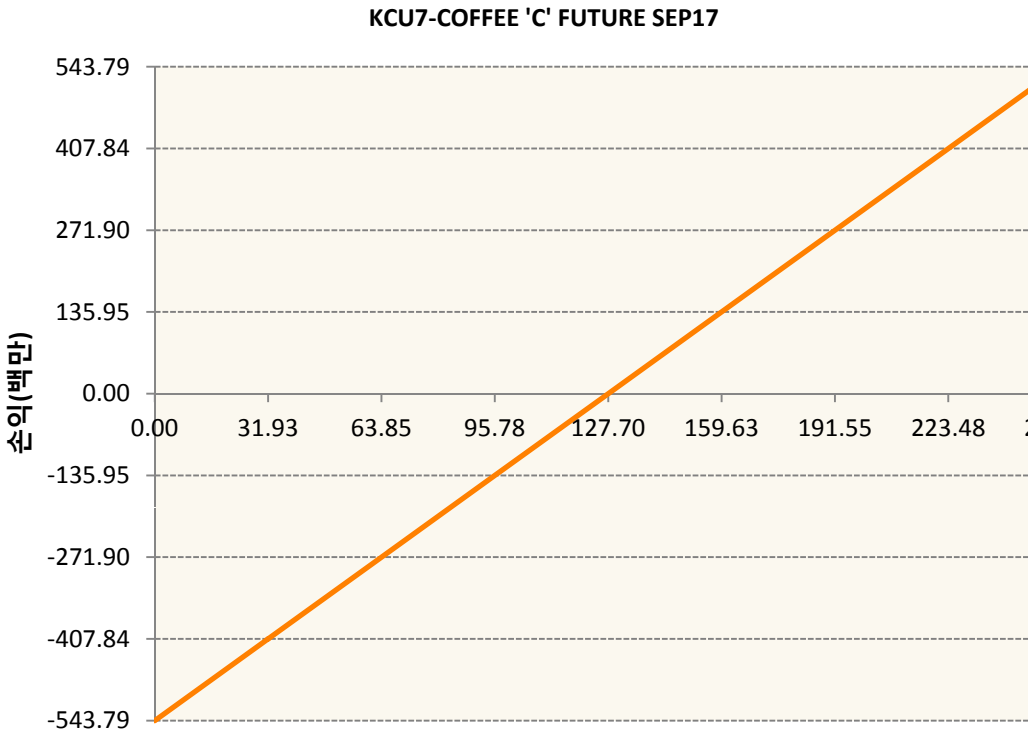
2. 만기시점의 손익구조



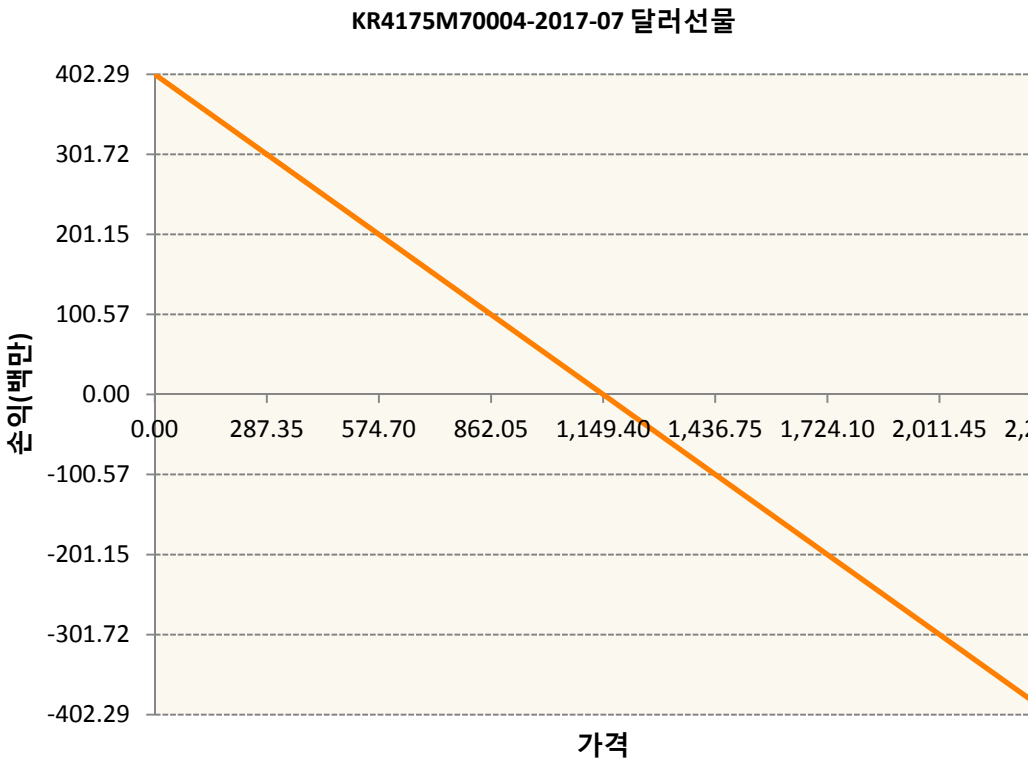


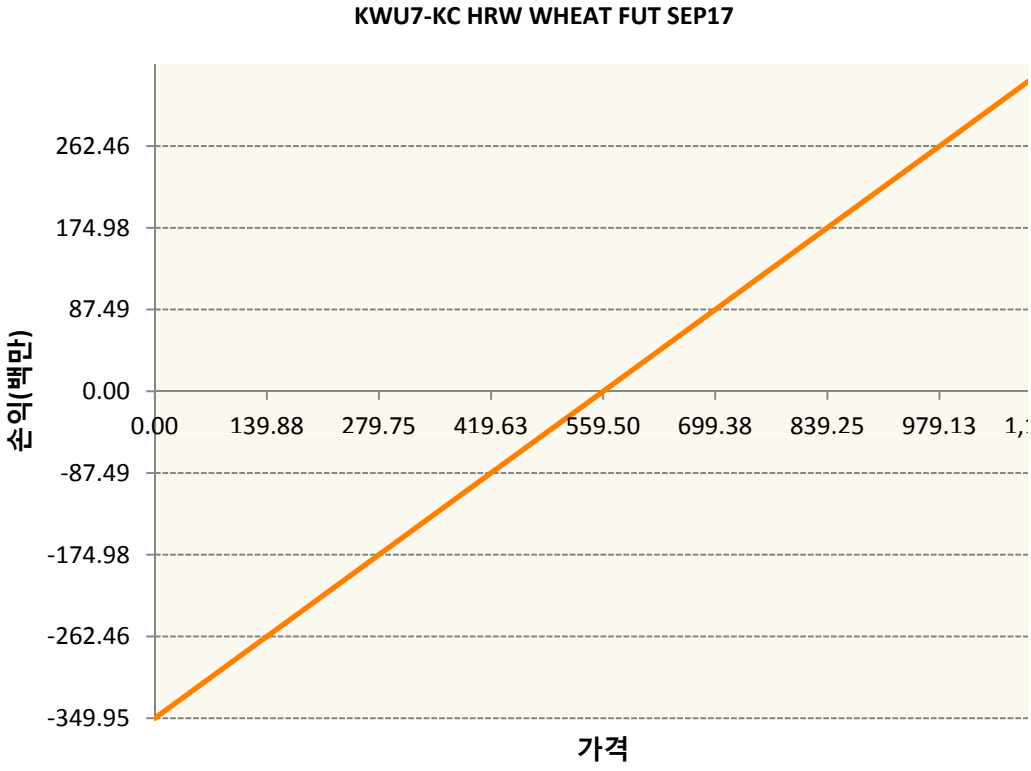

-154.31
-231.46
-308.61
가격

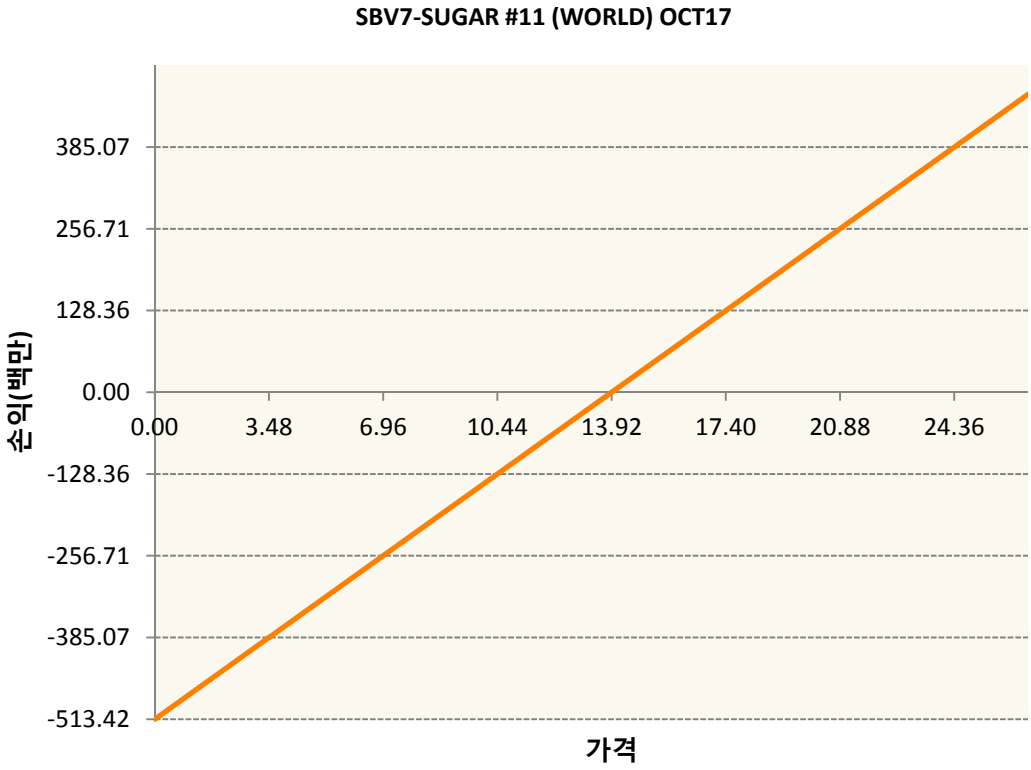

CU7-CORN FUTURE SEP17
1,852.40
1,389.30
926.20
463.10
0.00
-463.10
-926.20
-1,389.30
-1,852.40
0.00
97.13
194.25
291.38
388.50
485.63
582.75
679.88
순익(백만)
가격

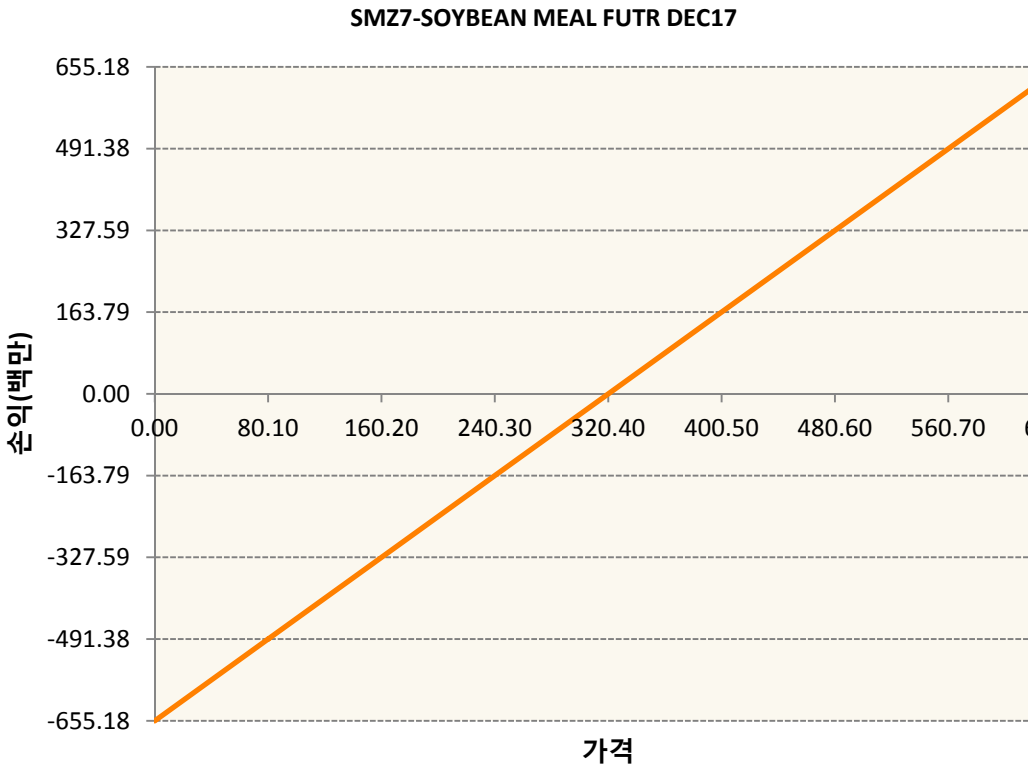

KCU7-COFFEE 'C' FUTURE SEP17
543.79
407.84
271.90
135.95
0.00
-135.95
-271.90
-407.84
-543.79
0.00
31.93
63.85
95.78
127.70
159.63
191.55
223.48
순익(백만)

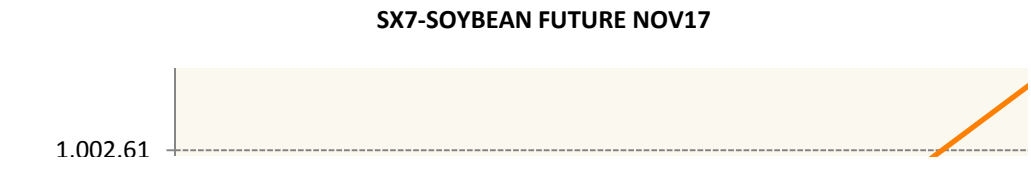
가격

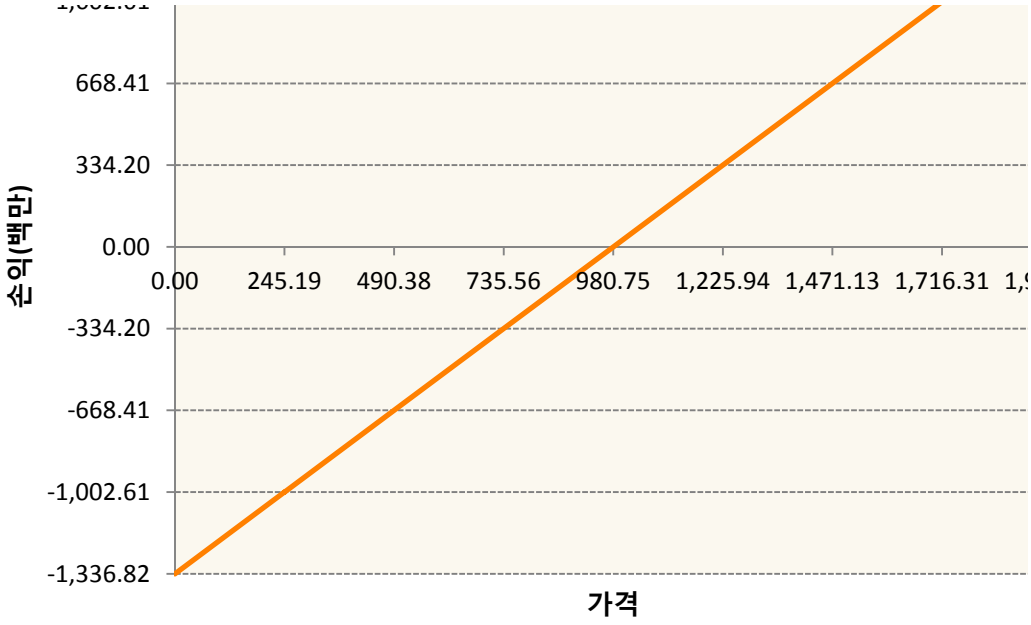

KR4175M70004-2017-07 달러선물
402.29
301.72
201.15
100.57
0.00
-100.57
-201.15
-301.72
-402.29
0.00
287.35
574.70
862.05
1,149.40
1,436.75
1,724.10
2,011.45
손익(백만)
가격


KWU7-KC HRW WHEAT FUT SEP17
262.46
174.98
87.49
0.00
-87.49
-174.98
-262.46
-349.95
0.00
139.88
279.75
419.63
559.50
699.38
839.25
979.13
손익(백만)
가격

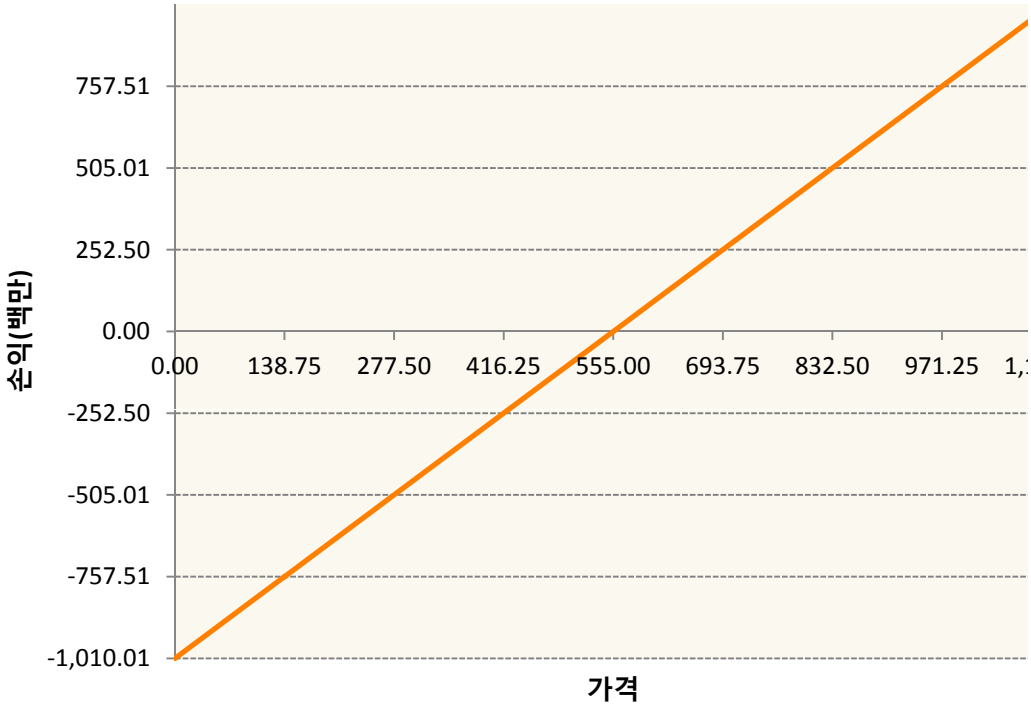

SBV7-SUGAR #11 (WORLD) OCT17
385.07
256.71
128.36
0.00
-128.36
-256.71
-385.07
-513.42
손익(백만)
0.00
3.48
6.96
10.44
13.92
17.40
20.88
24.36
가격


SMZ7-SOYBEAN MEAL FUTR DEC17
655.18
491.38
327.59
163.79
0.00
-163.79
-327.59
-491.38
-655.18
손익(백만)
0.00
80.10
160.20
240.30
320.40
400.50
480.60
560.70
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)

665