공시일	2017-07-07
기준일	2017-07-06

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	2017-07-07
기준일	2017-07-06

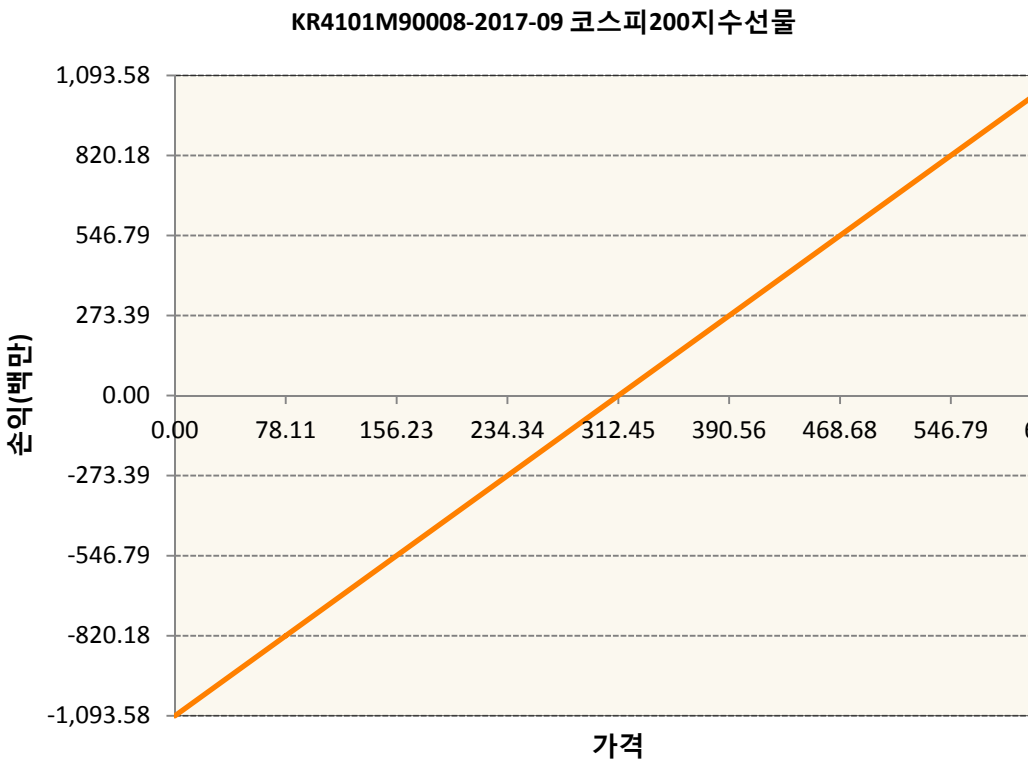
스마트인덱스모

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	2017-07-07
기준일	2017-07-06

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)

485

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-07-07
기준일	2017-07-06

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)

324

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-07-07
기준일	2017-07-06

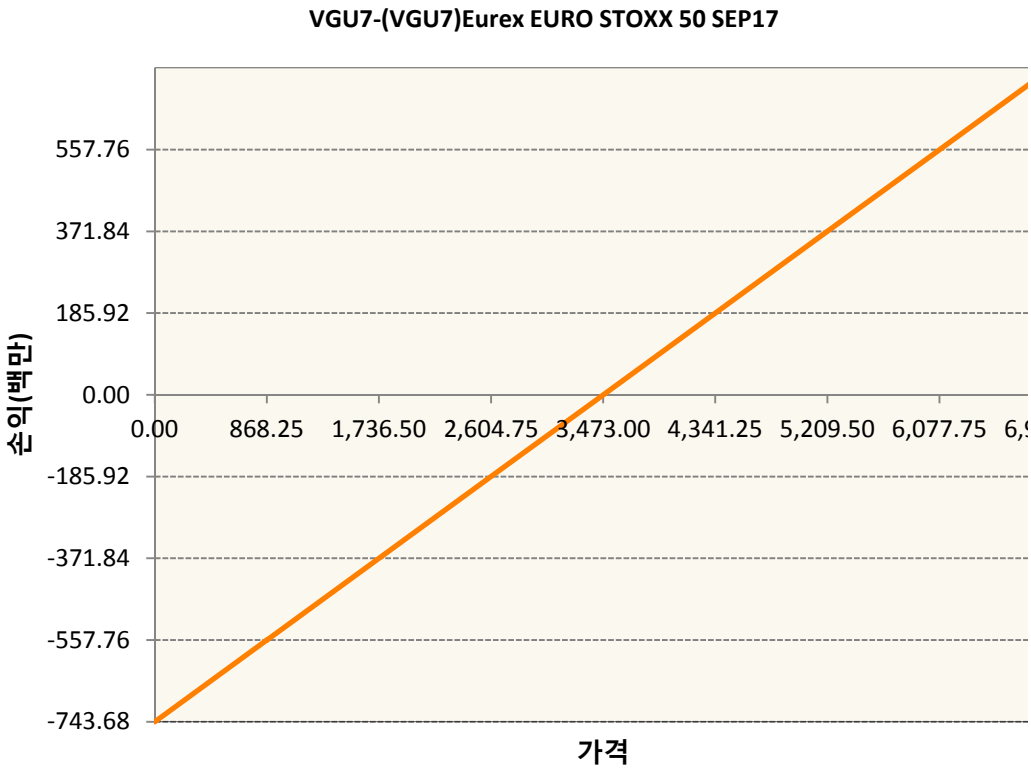
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	744	0	744	

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	2017-07-07
기준일	2017-07-06

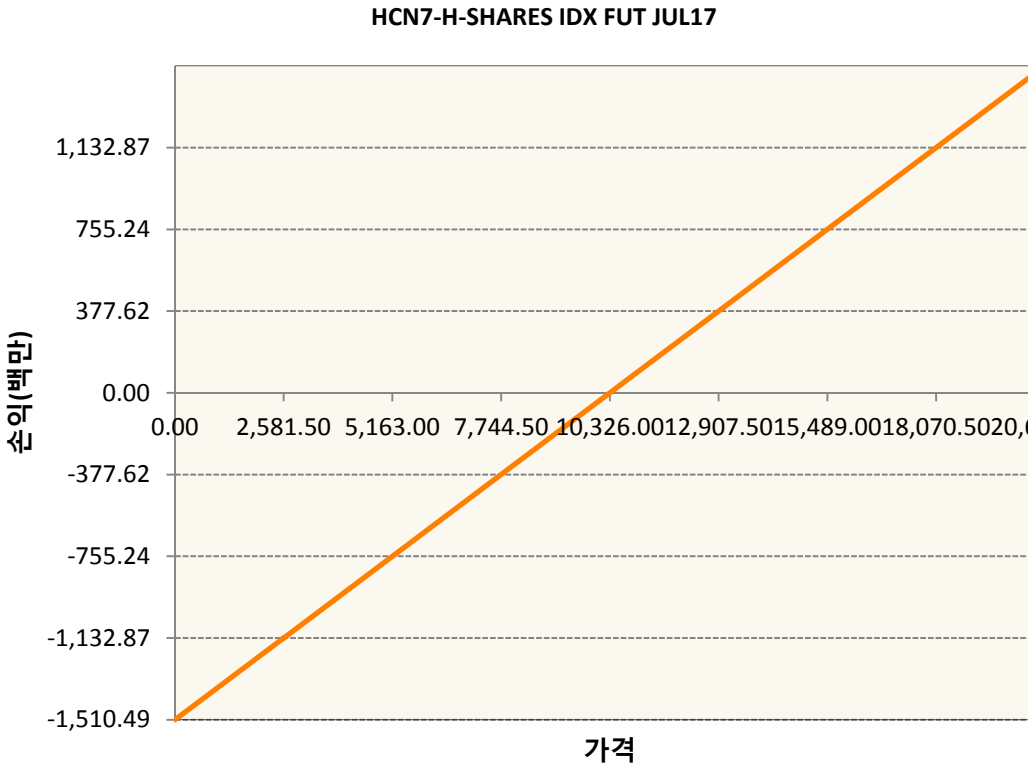
차이나인덱스모(주식-파생형)

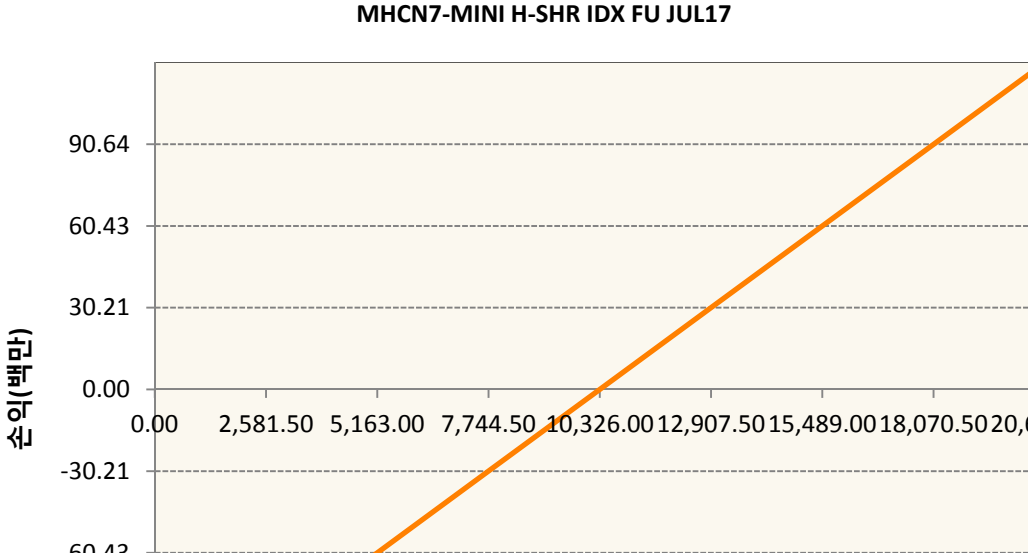
1. 계약금액

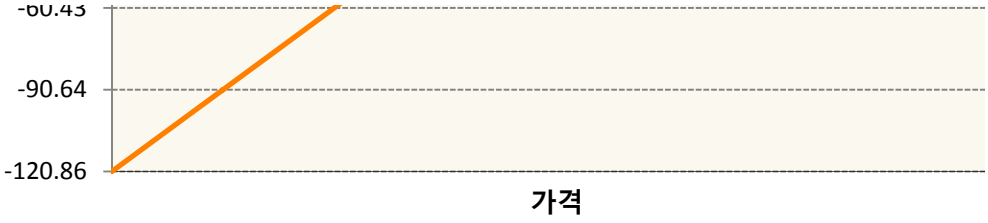
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,631	0	1,631	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)
	129

공시일	2017-07-07
기준일	2017-07-06

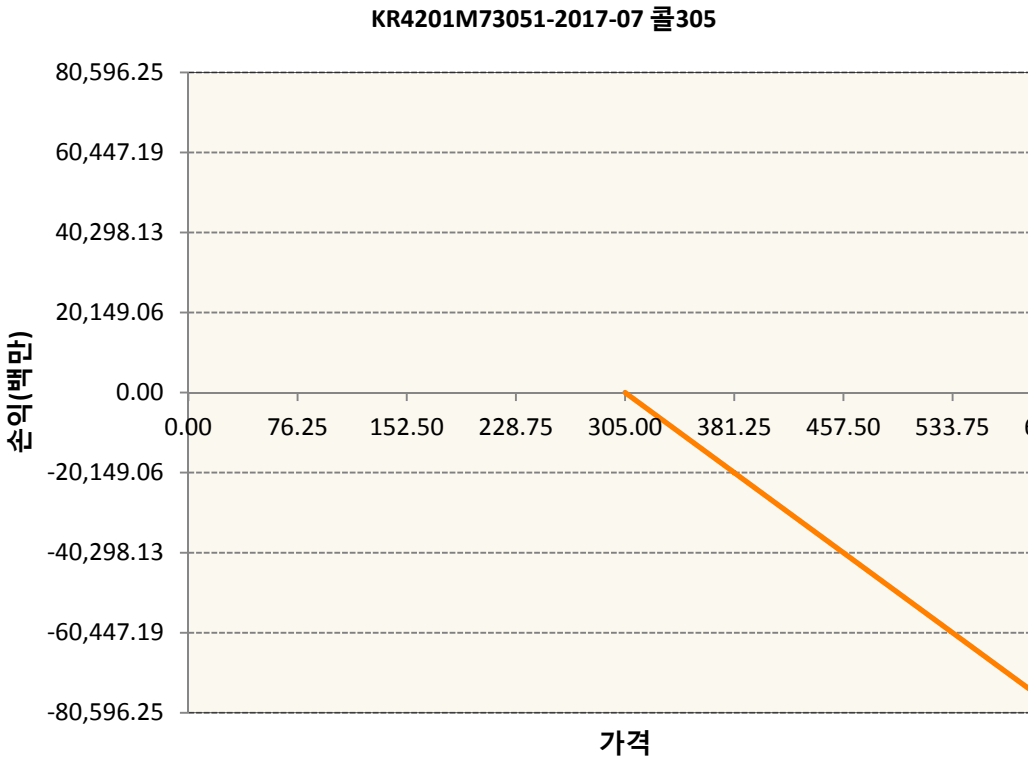
커버드콜모(주식혼합-파생형)

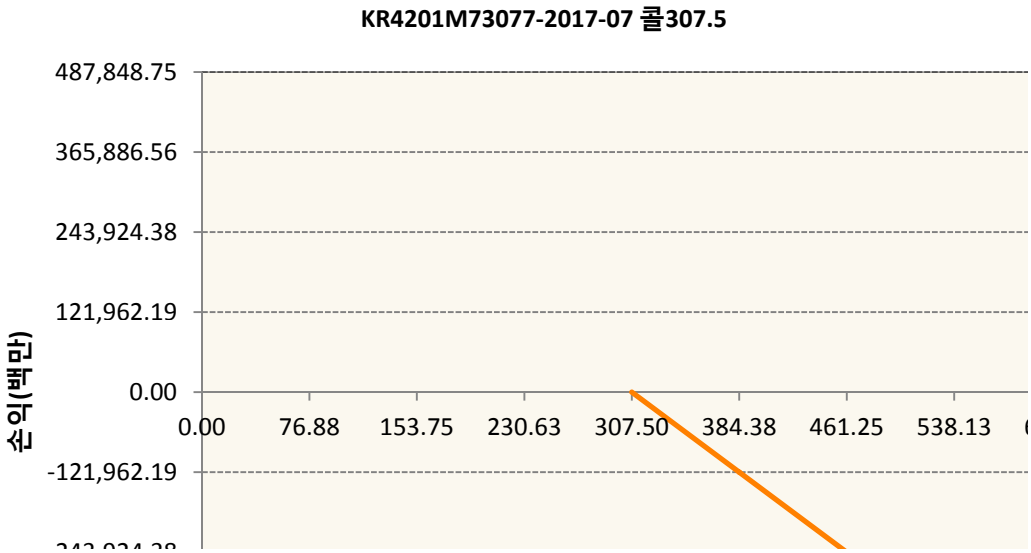
1. 계약금액

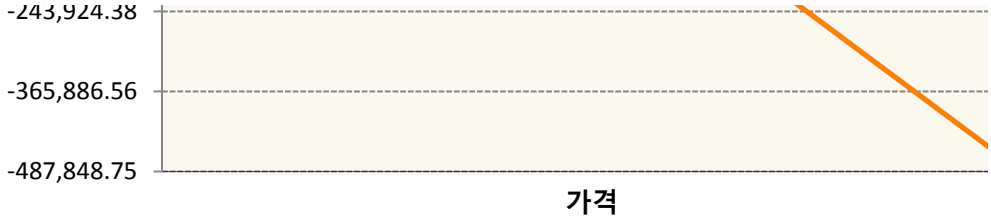
(단위:백만원)

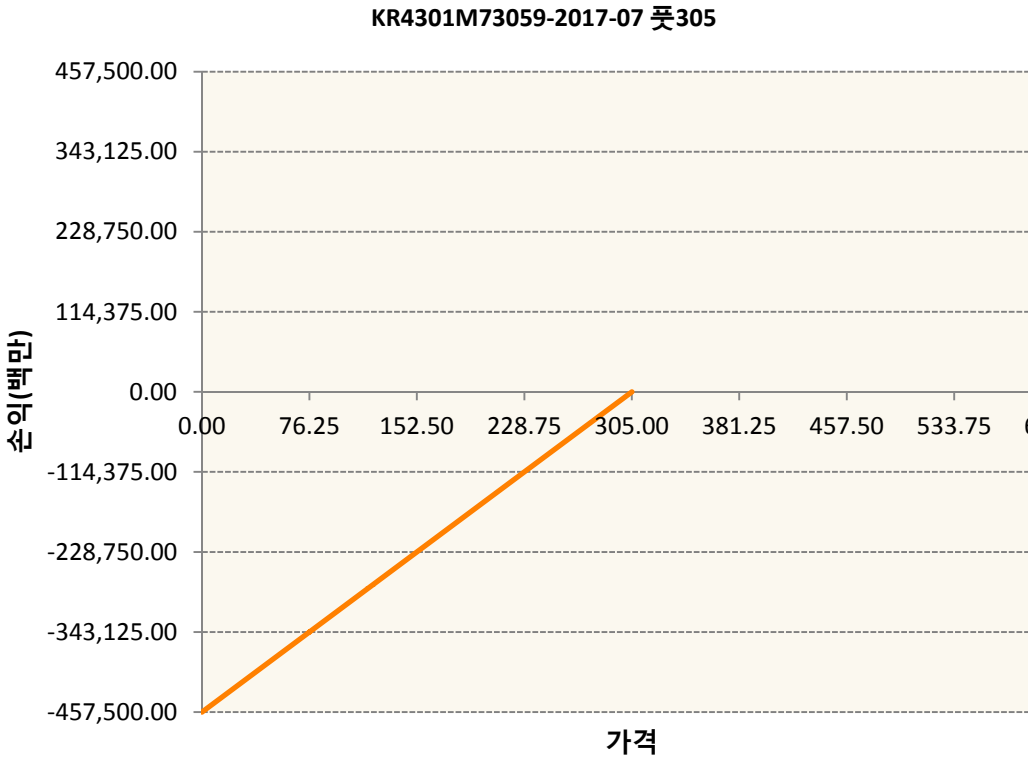
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	15,341	-15,341	장내
누계	유가증권	옵션	0	1,072,070	-1,072,070	장내

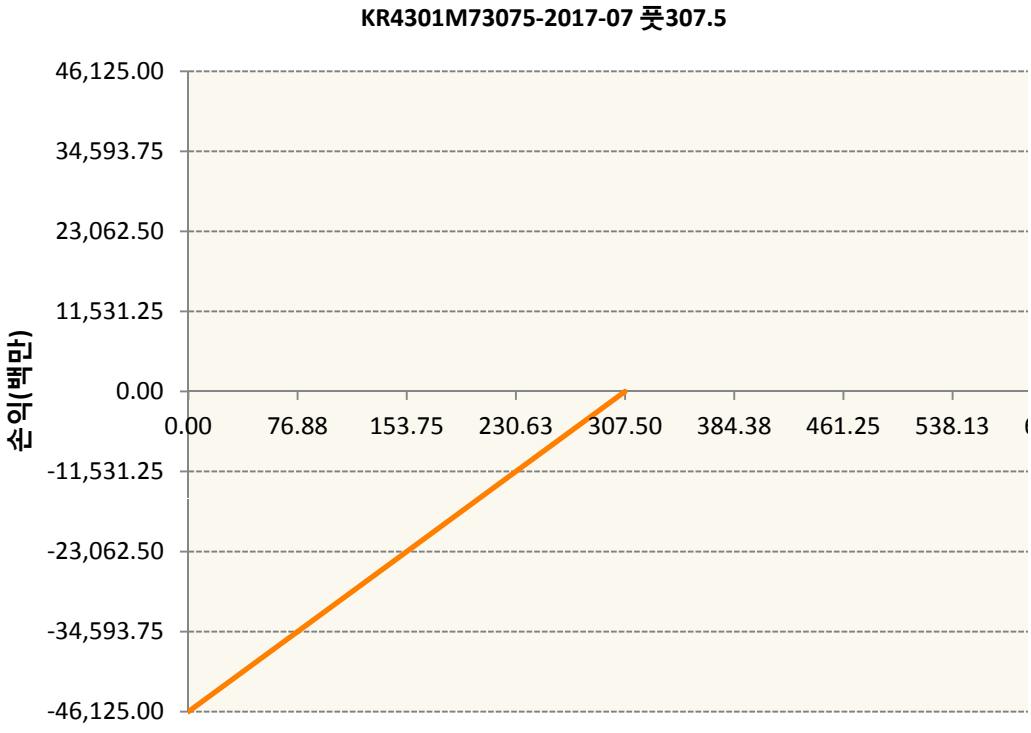
2. 만기시점의 손익구조






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


KR4301M73059-2017-07 풋305
457,500.00
343,125.00
228,750.00
114,375.00
0.00
-114,375.00
-228,750.00
-343,125.00
-457,500.00
0.00
76.25
152.50
228.75
305.00
381.25
457.50
533.75
손익(백만)
가격


KR4301M73075-2017-07 풋307.5
46,125.00
34,593.75
23,062.50
11,531.25
0.00
-11,531.25
-23,062.50
-34,593.75
-46,125.00
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							6,171
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	2,244	2,237	2,226	2,210	2,189	2,164	2,134
-5.33%	2,150	2,106	2,056	2,001	1,941	1,878	1,811
-2.67%	1,602	1,512	1,421	1,331	1,240	1,149	1,058
0%	210	144	74	0	-76	-155	-235
2.67%	-1,788	-1,807	-1,832	-1,863	-1,901	-1,943	-1,990
5.33%	-3,962	-3,965	-3,969	-3,976	-3,987	-4,002	-4,021
8.00%	-6,158	-6,158	-6,159	-6,160	-6,162	-6,165	-6,171
KR4201M73(2017-07 콜307.5							35,898
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	10,734	10,713	10,675	10,617	10,535	10,429	10,296
-5.33%	10,450	10,273	10,056	9,804	9,520	9,208	8,873
-2.67%	8,291	7,799	7,296	6,785	6,268	5,746	5,221
0%	1,498	1,010	510	0	-517	-1,040	-1,568
2.67%	-9,701	-9,887	-10,115	-10,380	-10,678	-11,005	-11,356
5.33%	-22,597	-22,626	-22,677	-22,753	-22,856	-22,988	-23,149
8.00%	-35,767	-35,769	-35,775	-35,788	-35,810	-35,846	-35,898
KR4301M73(2017-07 풋305							26,694
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-26,684	-26,684	-26,685	-26,685	-26,686	-26,689	-26,694
-5.33%	-14,228	-14,247	-14,278	-14,322	-14,379	-14,451	-14,537
-2.67%	-3,249	-3,505	-3,764	-4,024	-4,287	-4,550	-4,814
0%	295	216	117	0	-134	-282	-443
2.67%	418	418	415	410	401	386	364
5.33%	419	419	419	419	418	418	417
8.00%	419	419	419	419	419	419	419
KR4301M73(2017-07 풋307.5							2,984
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-2,984	-2,984	-2,984	-2,984	-2,984	-2,984	-2,984
-5.33%	-1,737	-1,738	-1,738	-1,740	-1,743	-1,746	-1,751
-2.67%	-545	-562	-582	-602	-624	-646	-668
0%	55	38	20	0	-21	-42	-64
2.67%	101	100	99	98	95	91	87

5.33%	101	101	101	101	101	101	101
8.00%	101	101	101	101	101	101	101

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

75,723

공시일	2017-07-07
기준일	2017-07-06

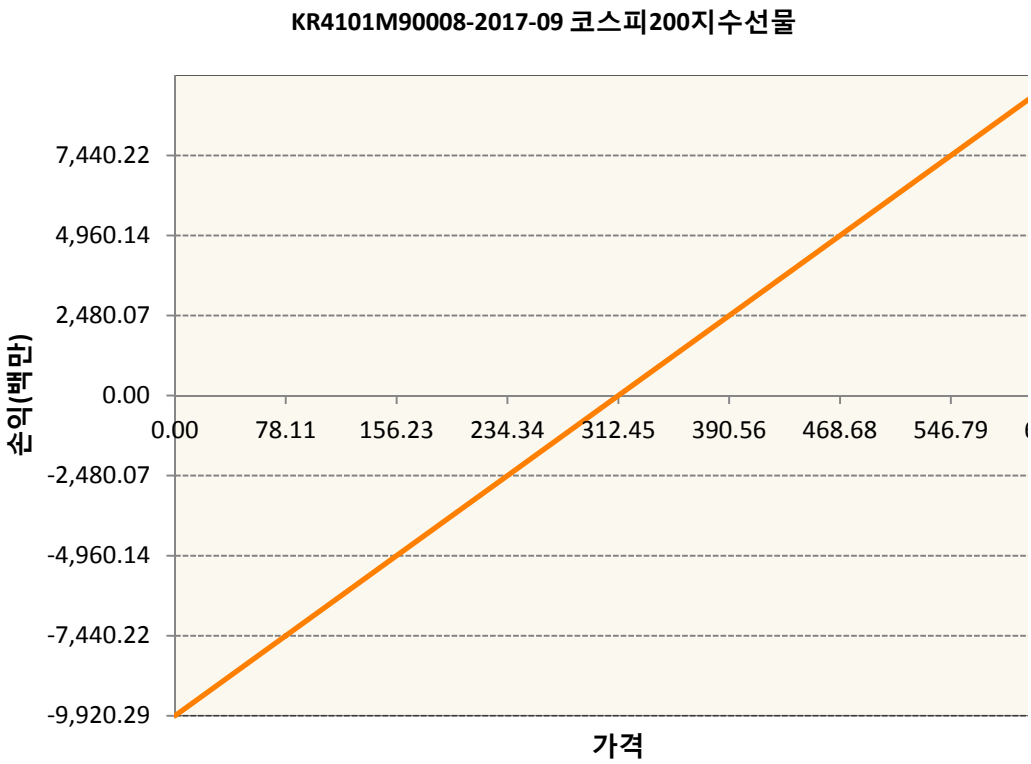
ETF스마트레버리지목표전환형6호

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)

490

공시일	2017-07-07
기준일	2017-07-06

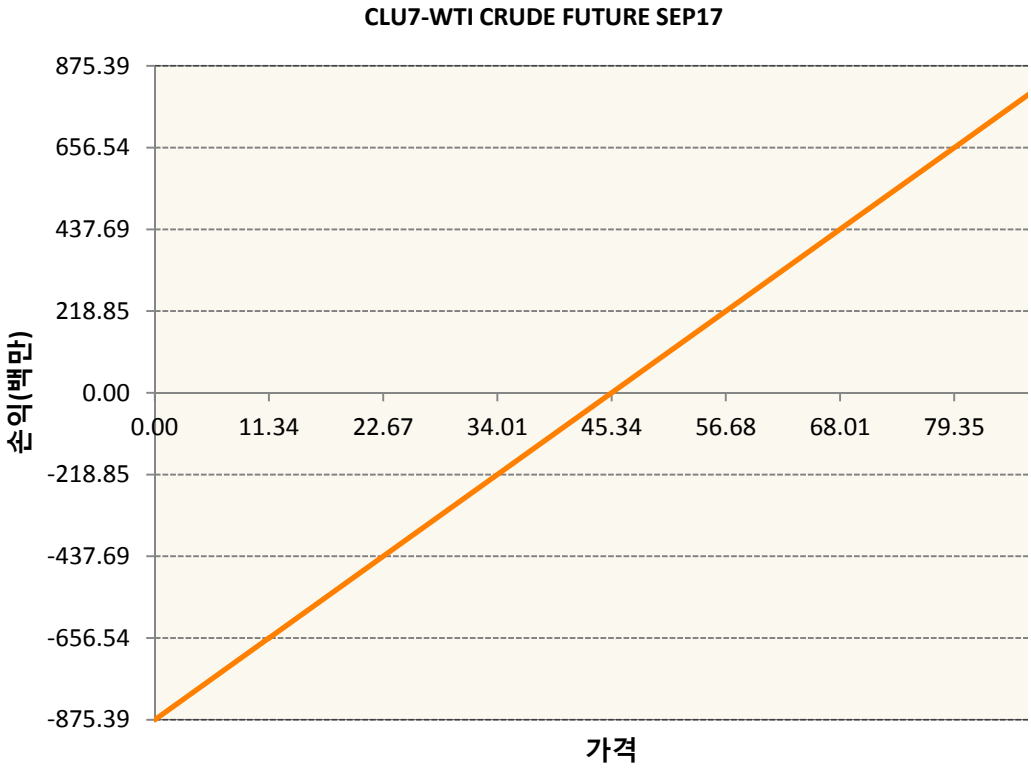
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

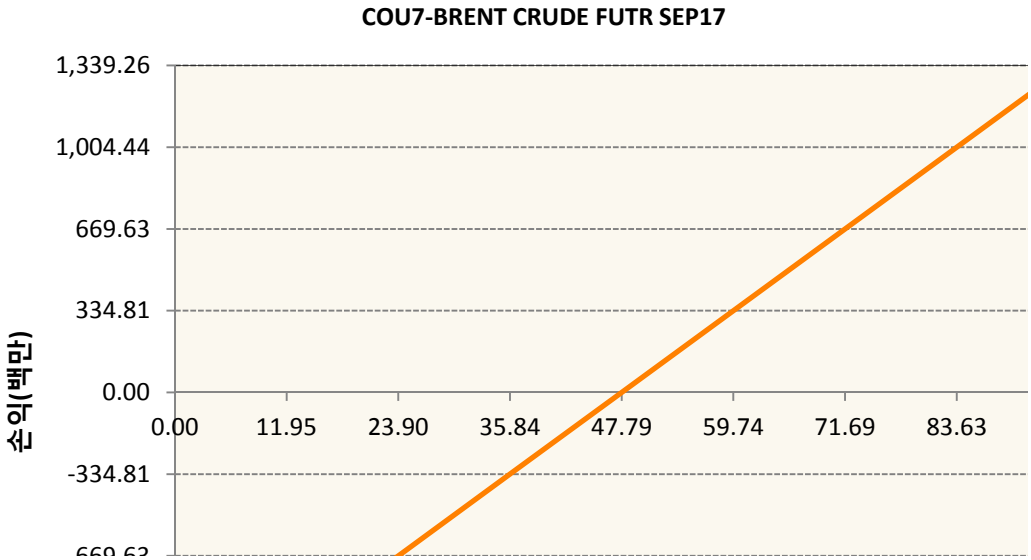
1. 계약금액

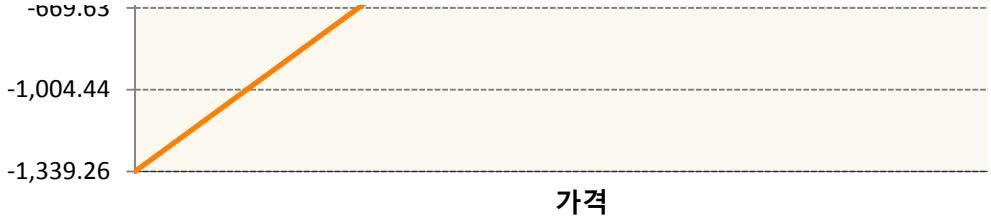
(단위:백만원)

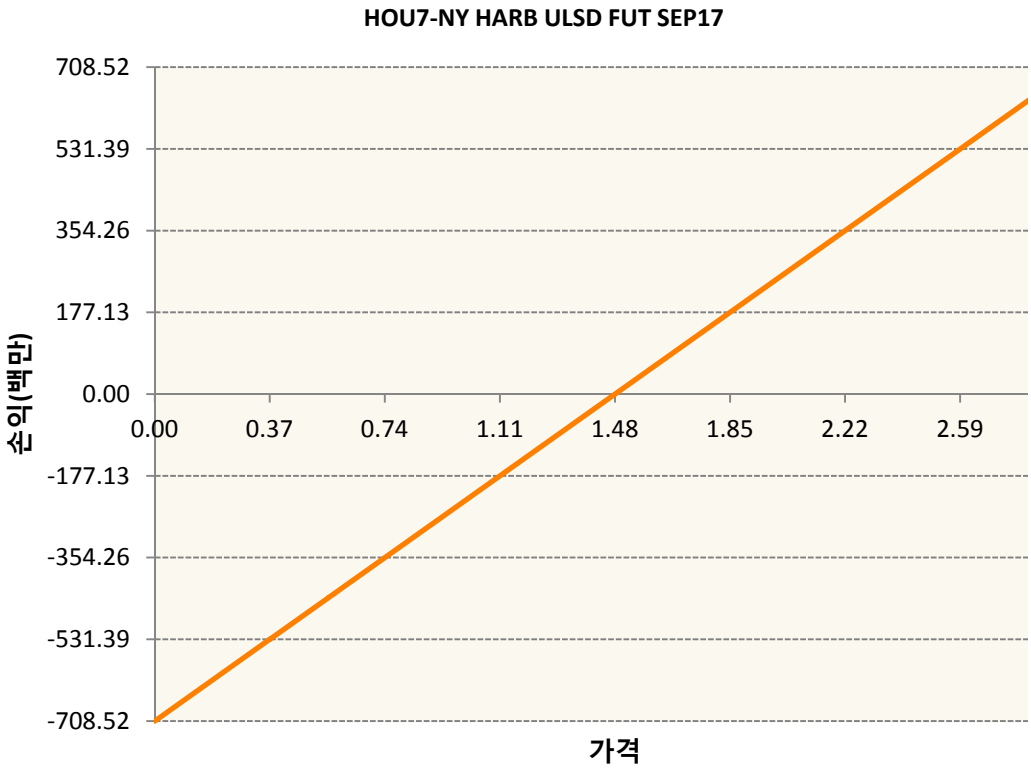
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	4,987	231	4,755	

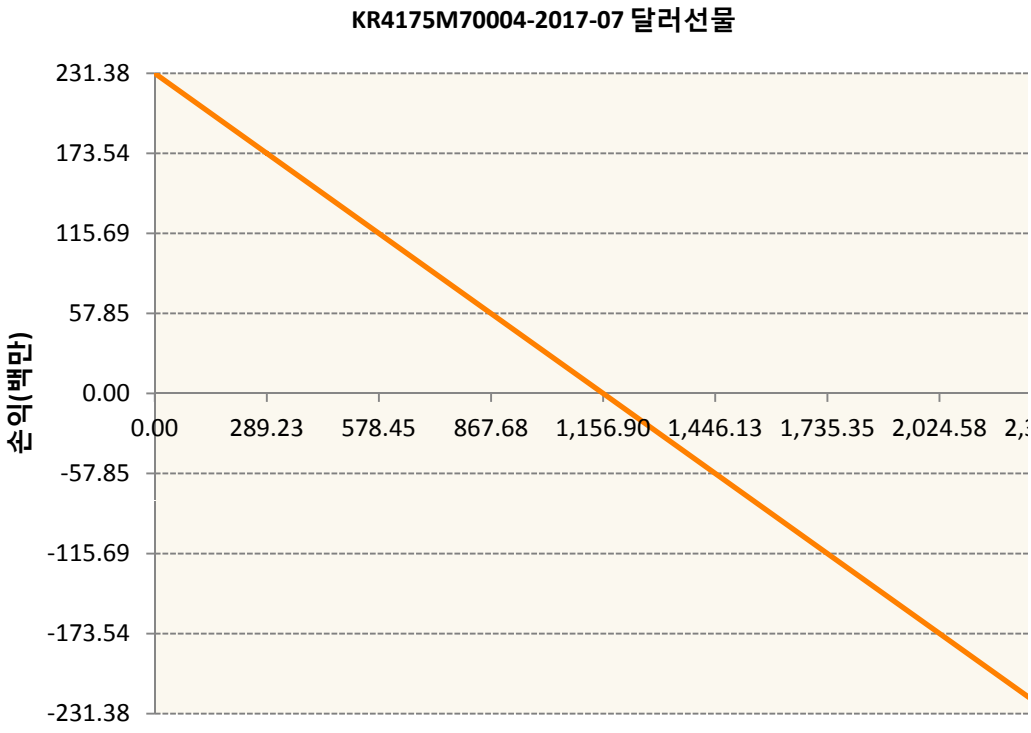
2. 만기시점의 손익구조



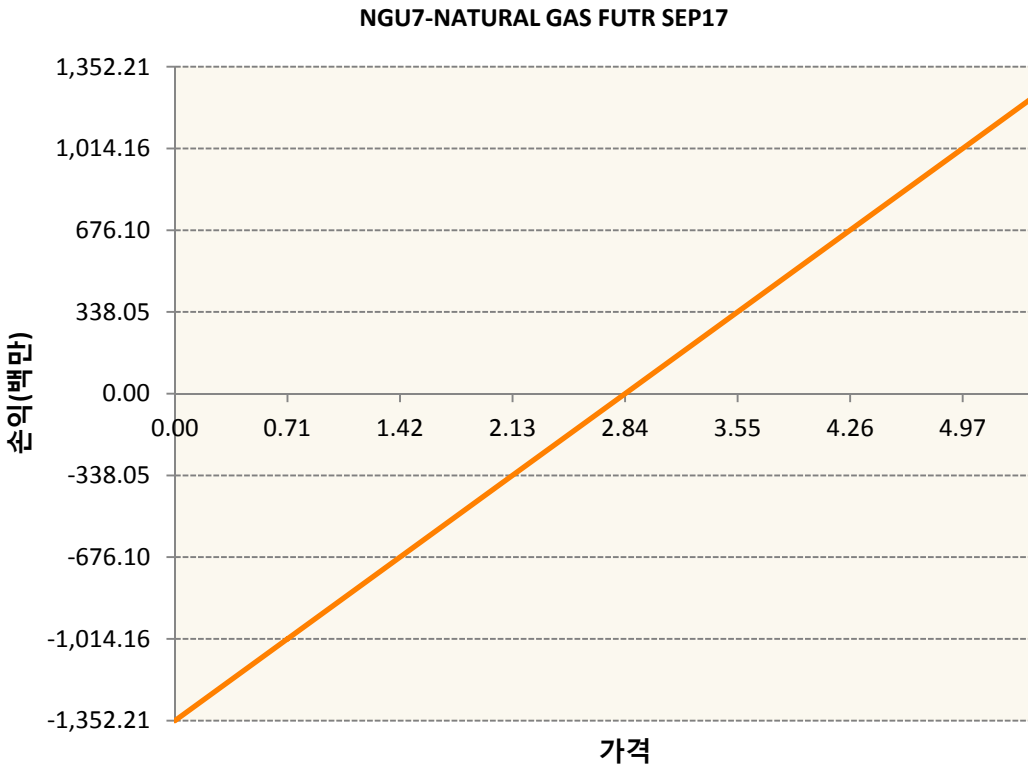


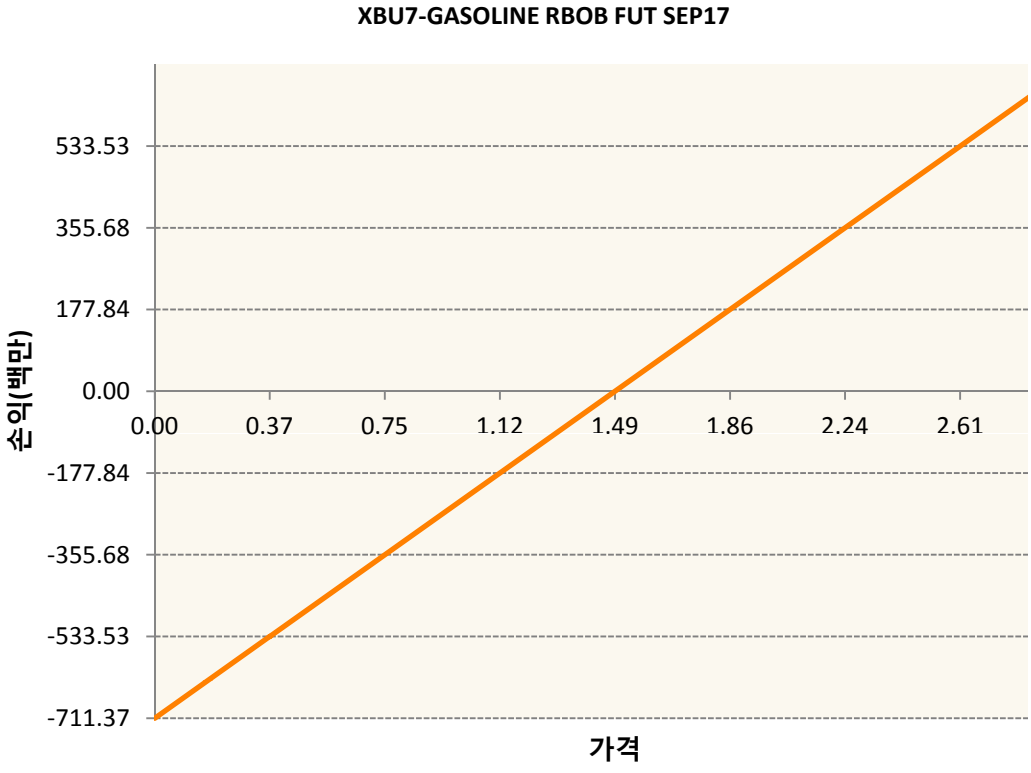

-669.63
-1,004.44
-1,339.26
가격


HOU7-NY HARB ULSD FUT SEP17
708.52
531.39
354.26
177.13
0.00
-177.13
-354.26
-531.39
-708.52
0.00
0.37
0.74
1.11
1.48
1.85
2.22
2.59
손익(백만)
가격


KR4175M70004-2017-07 달러선물
231.38
173.54
115.69
57.85
0.00
-57.85
-115.69
-173.54
-231.38
0.00
289.23
578.45
867.68
1,156.90
1,446.13
1,735.35
2,024.58
손익(백만)

가격


NGU7-NATURAL GAS FUTR SEP17
1,352.21
1,014.16
676.10
338.05
0.00
-338.05
-676.10
-1,014.16
-1,352.21
0.00
0.71
1.42
2.13
2.84
3.55
4.26
4.97
손익(백만)
가격


XBU7-GASOLINE RBOB FUT SEP17
533.53
355.68
177.84
0.00
-177.84
-355.68
-533.53
-711.37
0.00
0.37
0.75
1.12
1.49
1.86
2.24
2.61
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	57
KR4175M70(	2017-07 달러선물	19
NGU7	NATURAL GAS FUTR SEP17	108
XBU7	GASOLINE RBOB FUT SEP17	57

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

780

공시일	2017-07-07
기준일	2017-07-06

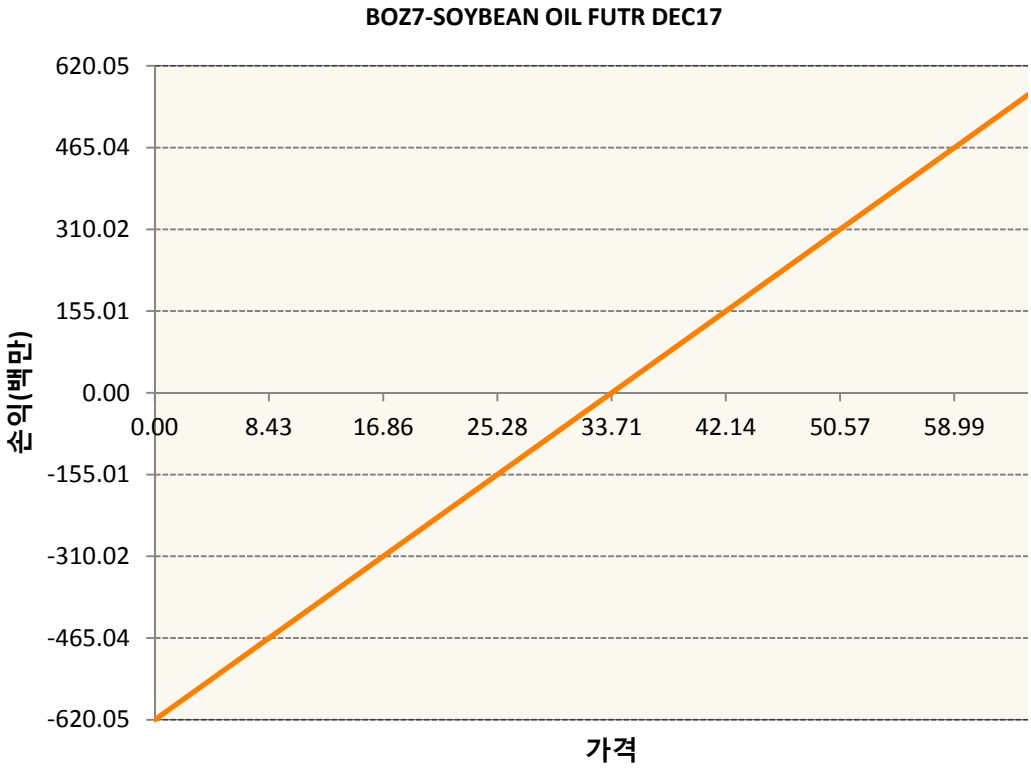
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

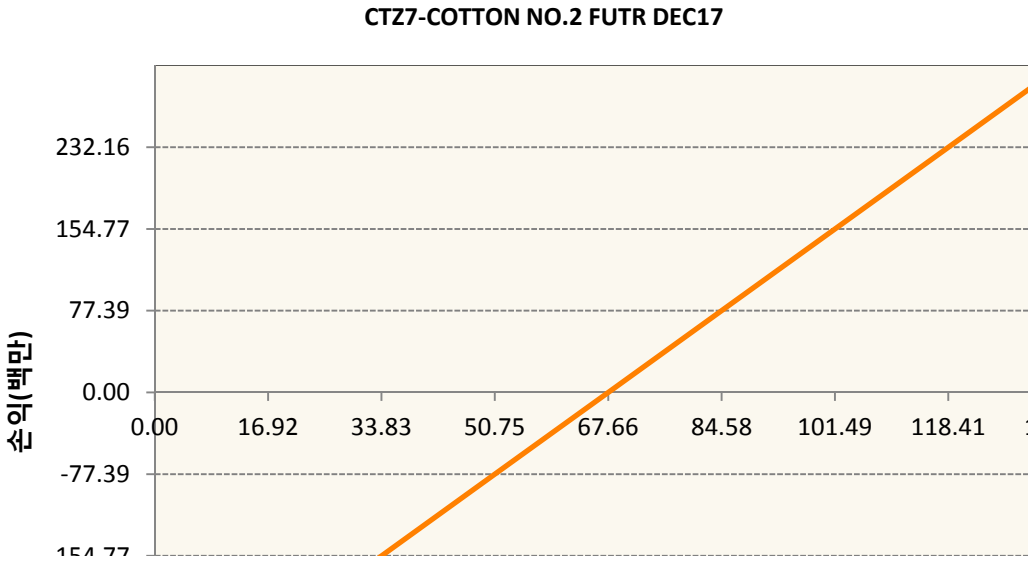
1. 계약금액

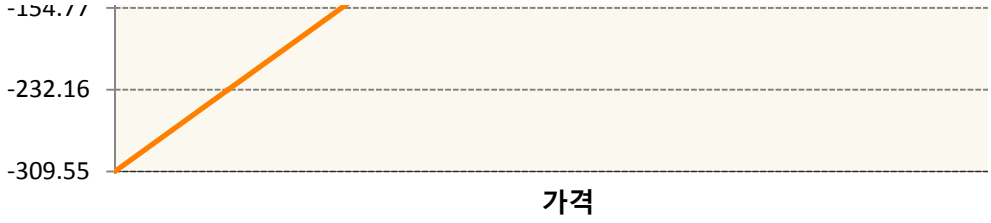
(단위:백만원)

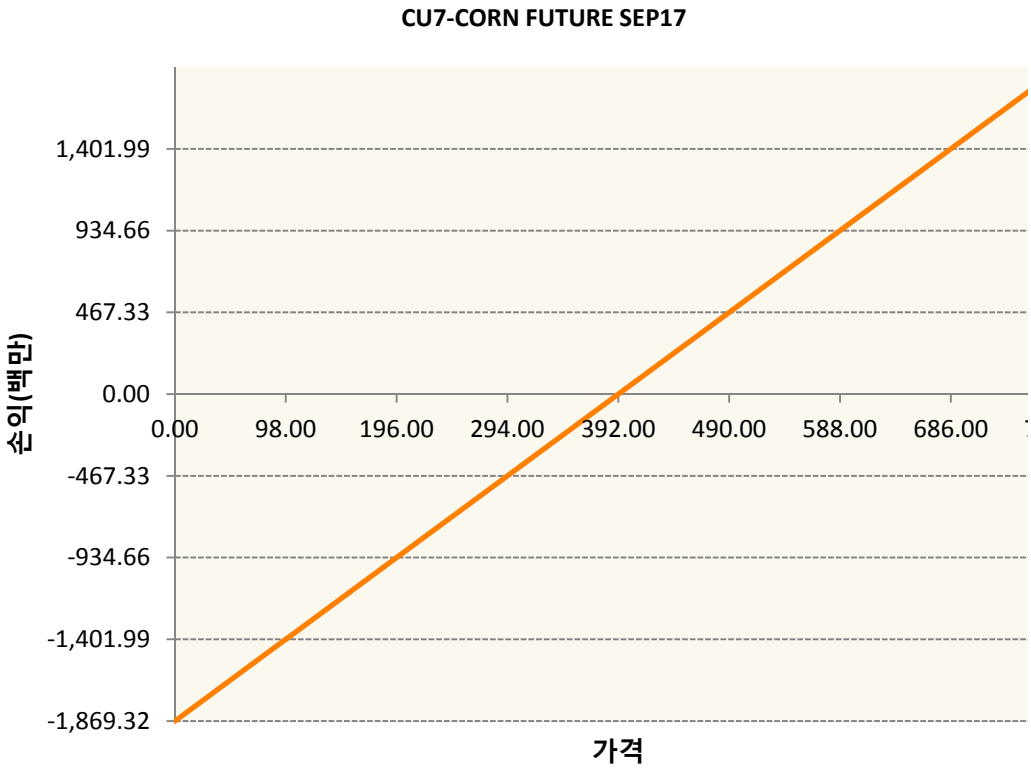
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	7,257	405	6,852	

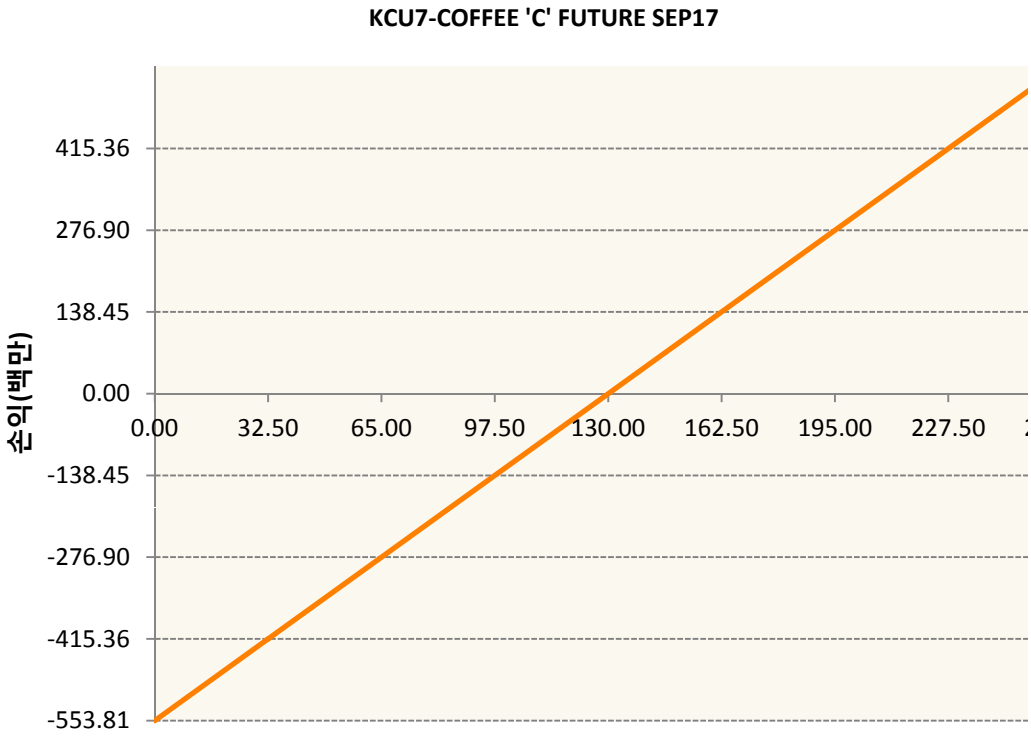
2. 만기시점의 손익구조



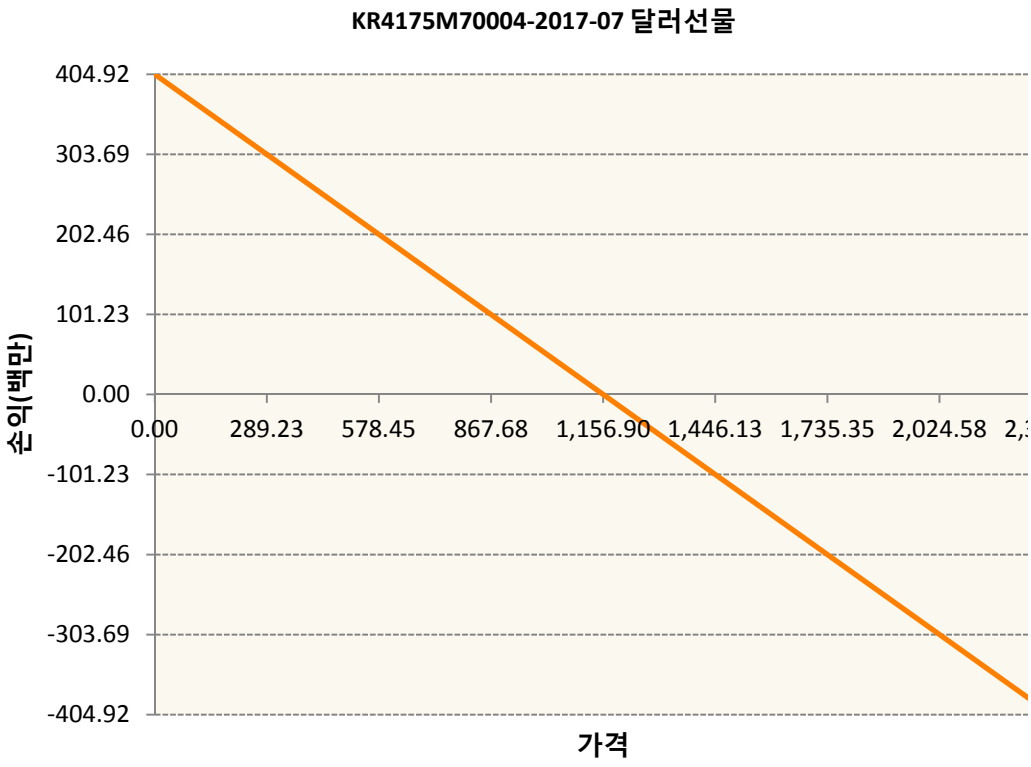


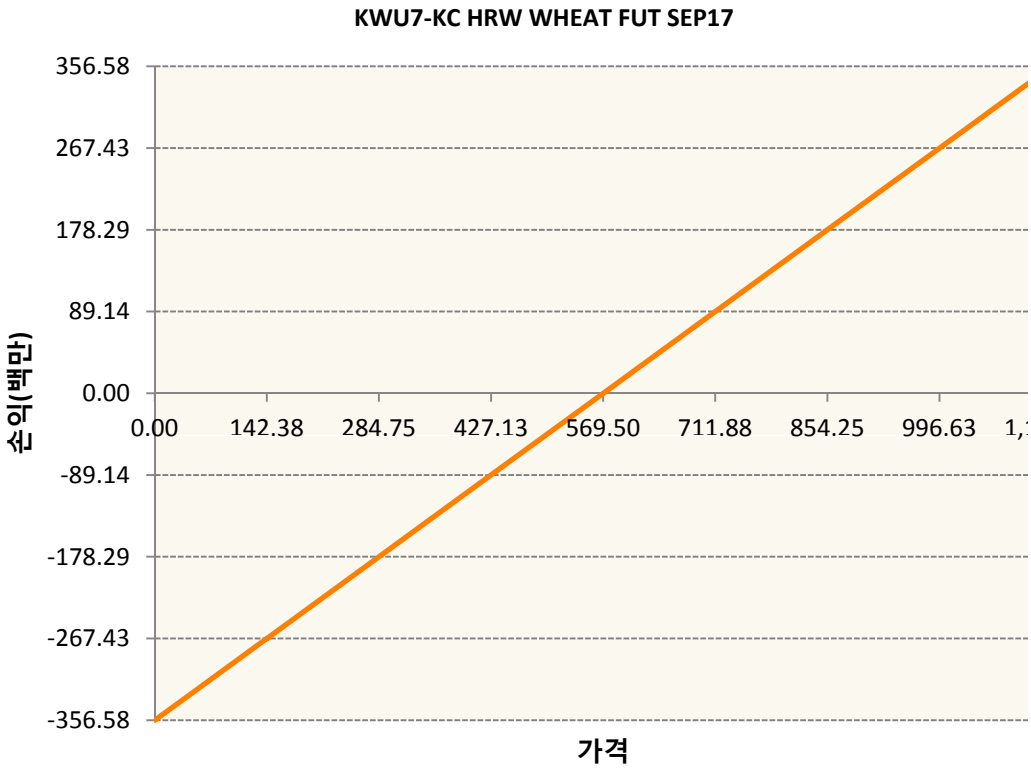

-232.16
-309.55
가격

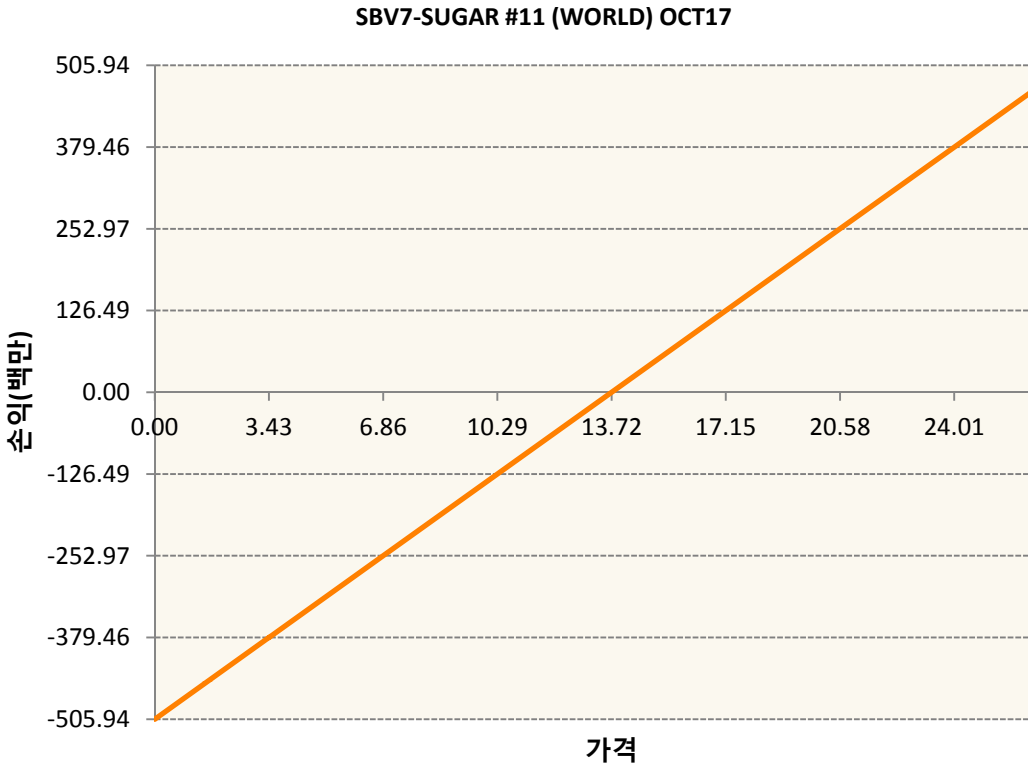

CU7-CORN FUTURE SEP17
1,401.99
934.66
467.33
0.00
-467.33
-934.66
-1,401.99
-1,869.32
0.00
98.00
196.00
294.00
392.00
490.00
588.00
686.00
순익(백만)
가격

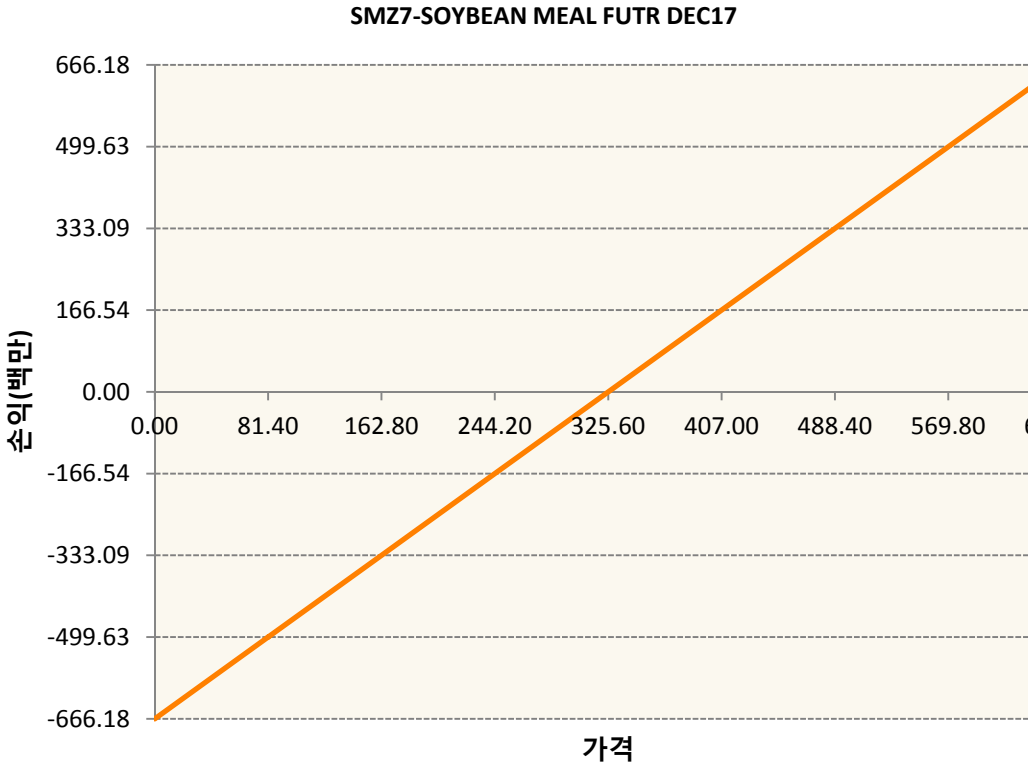

KCU7-COFFEE 'C' FUTURE SEP17
415.36
276.90
138.45
0.00
-138.45
-276.90
-415.36
-553.81
0.00
32.50
65.00
97.50
130.00
162.50
195.00
227.50
순익(백만)

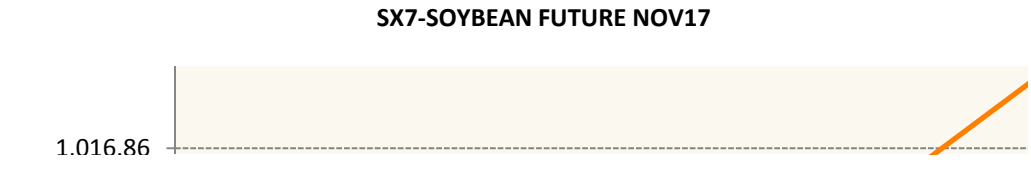
가격

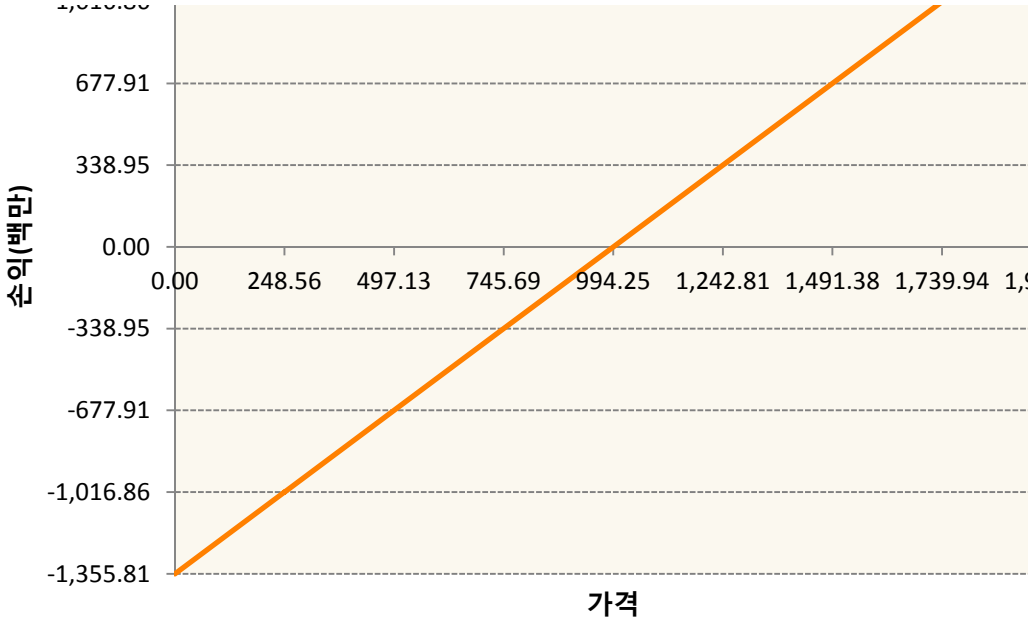

KR4175M70004-2017-07 달러선물
404.92
303.69
202.46
101.23
0.00
-101.23
-202.46
-303.69
-404.92
0.00
289.23
578.45
867.68
1,156.90
1,446.13
1,735.35
2,024.58
손익(백만)
가격

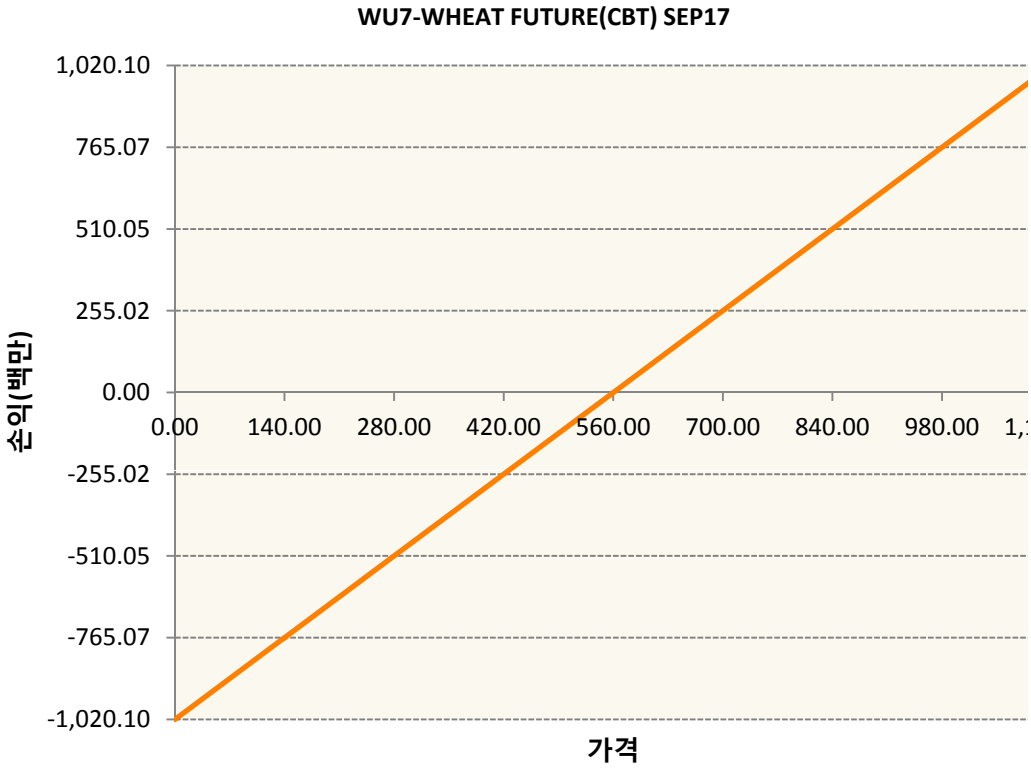

KWU7-KC HRW WHEAT FUT SEP17
356.58
267.43
178.29
89.14
0.00
-89.14
-178.29
-267.43
-356.58
0.00
142.38
284.75
427.13
569.50
711.88
854.25
996.63
손익(백만)
가격


SBV7-SUGAR #11 (WORLD) OCT17
505.94
379.46
252.97
126.49
0.00
-126.49
-252.97
-379.46
-505.94
0.00
3.43
6.86
10.29
13.72
17.15
20.58
24.01
손익(백만)
가격


SMZ7-SOYBEAN MEAL FUTR DEC17
666.18
499.63
333.09
166.54
0.00
-166.54
-333.09
-499.63
-666.18
0.00
81.40
162.80
244.20
325.60
407.00
488.40
569.80
손익(백만)
가격


SX7-SOYBEAN FUTURE NOV17
1,016.86





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
BOZ7	SOYBEAN OIL FUTR DEC17	50
CTZ7	COTTON NO.2 FUTR DEC17	25
CU7	CORN FUTURE SEP17	150
KCU7	COFFEE 'C' FUTURE SEP17	44
KR4175M70(	2017-07 달러선물	32

KWU7	KC HRW WHEAT FUT SEP17	29
SBV7	SUGAR #11 (WORLD) OCT17	40
SMZ7	SOYBEAN MEAL FUTR DEC17	53
SX7	SOYBEAN FUTURE NOV17	108
WU7	WHEAT FUTURE(CBT) SEP17	82

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

671