공시일	2017-07-10
기준일	2017-07-07

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	2017-07-10
기준일	2017-07-07

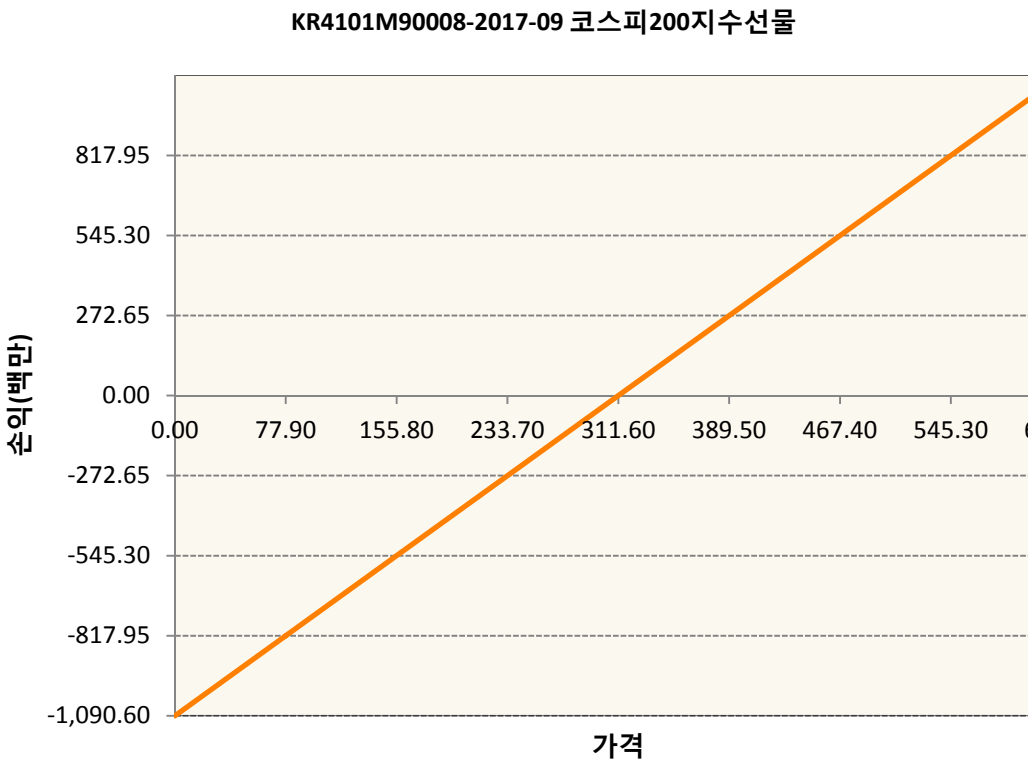
스마트인덱스모

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	1,091	0	1,091	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	2017-07-10
기준일	2017-07-07

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	994

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

483

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-07-10
기준일	2017-07-07

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	386

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

325

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-07-10
기준일	2017-07-07

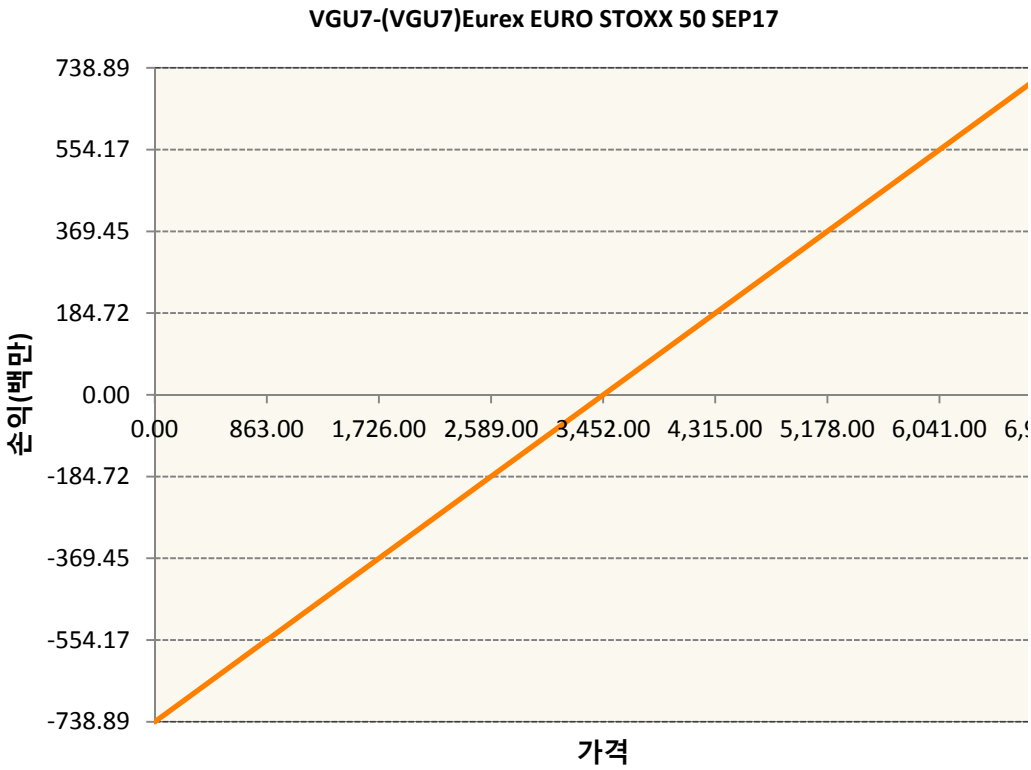
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	739	0	739	

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)

52

공시일	2017-07-10
기준일	2017-07-07

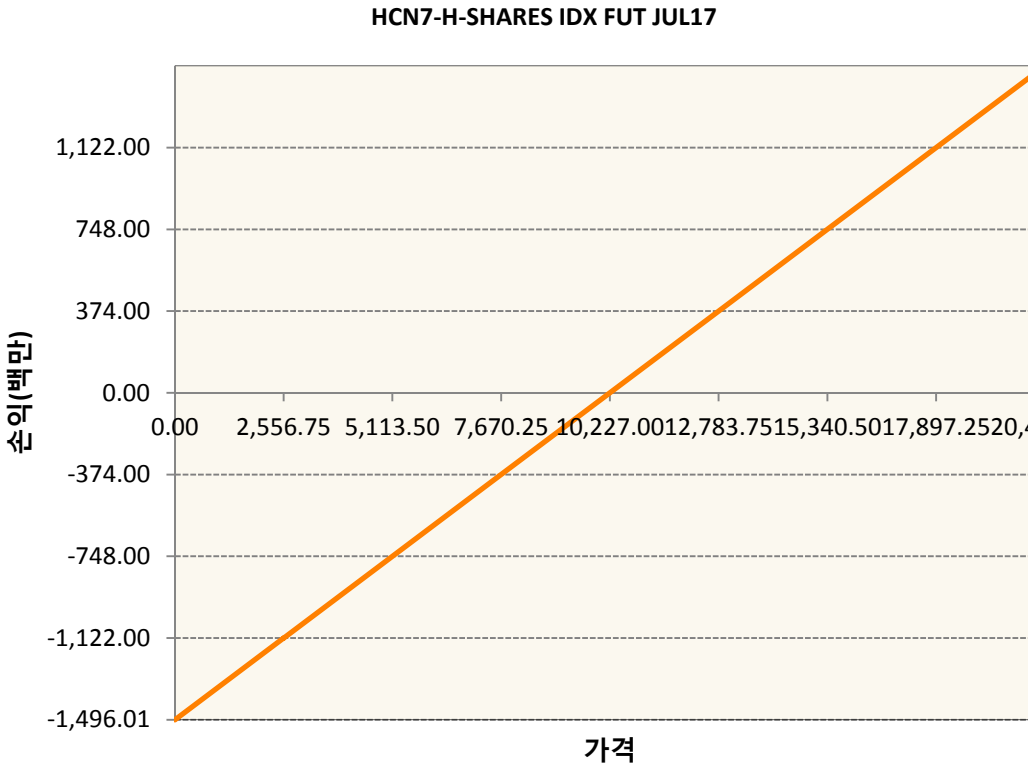
차이나인덱스모(주식-파생형)

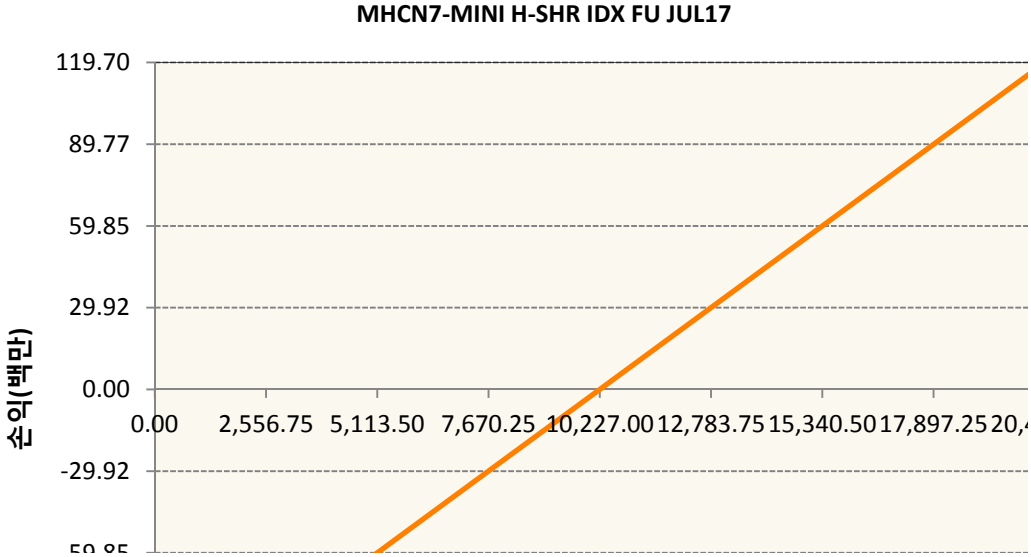
1. 계약금액

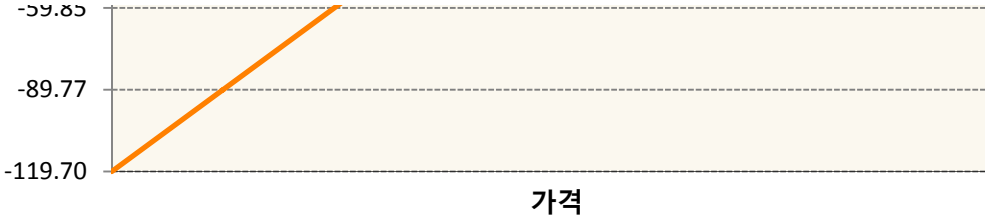
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,616	0	1,616	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)
	127

공시일	2017-07-10
기준일	2017-07-07

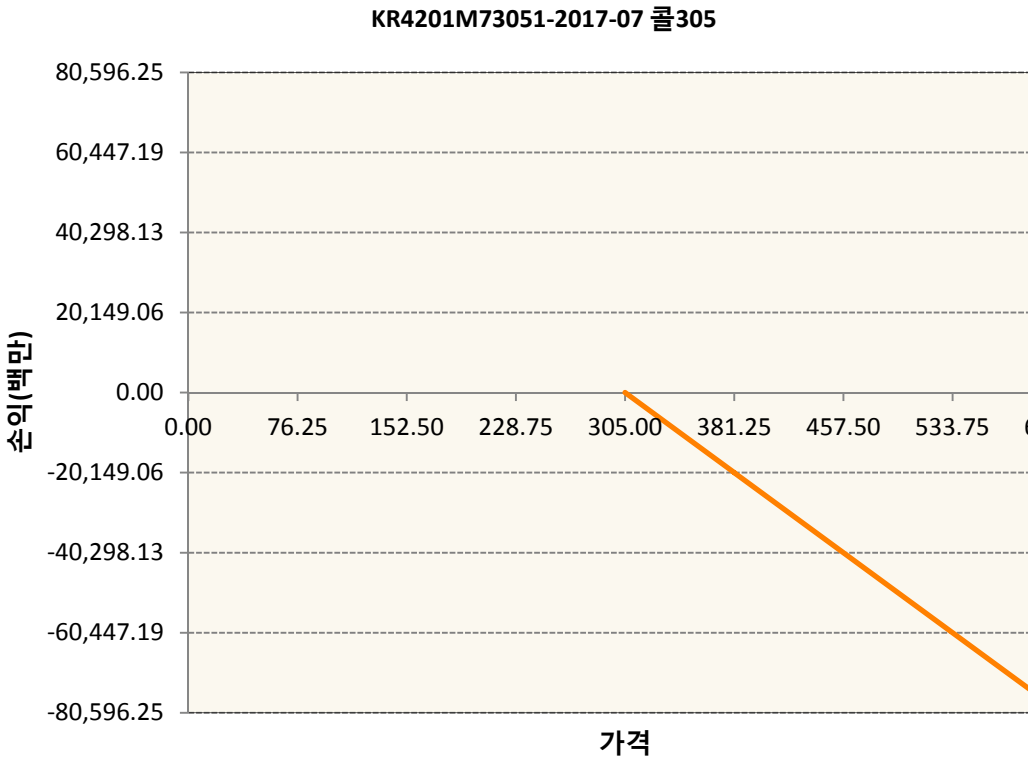
커버드콜모(주식혼합-파생형)

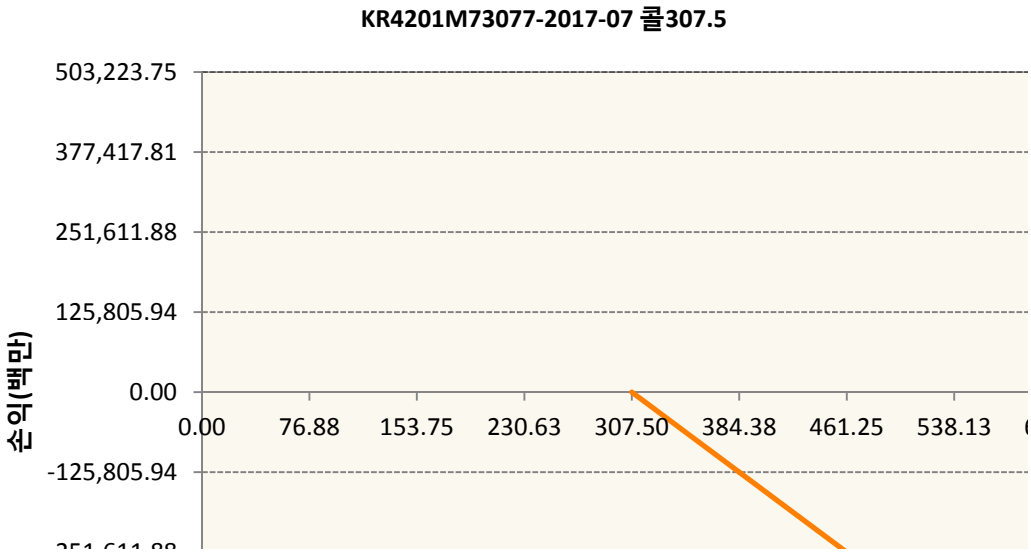
1. 계약금액

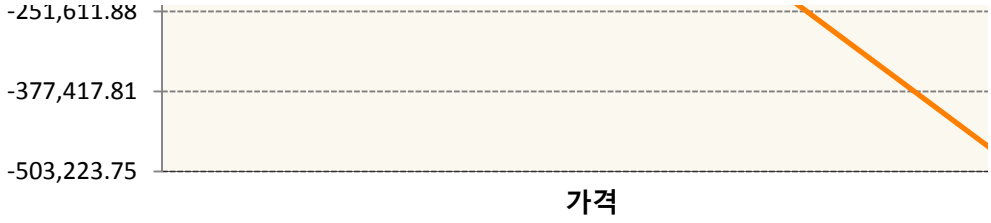
(단위:백만원)

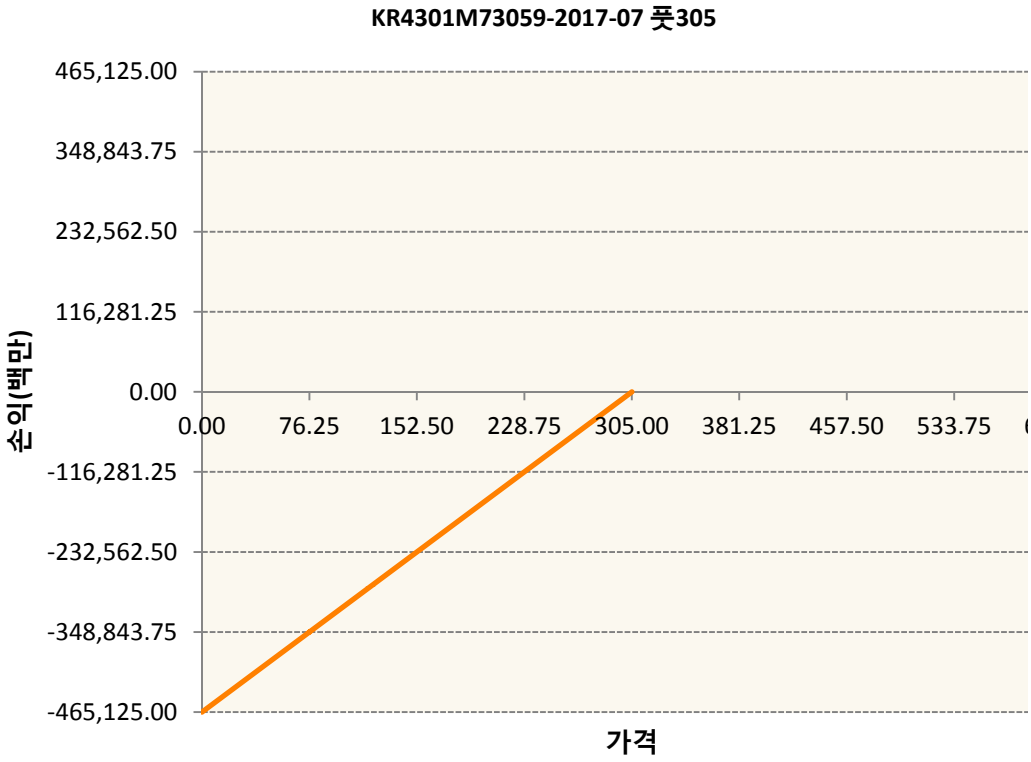
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	23,225	-23,225	장내
누계	유가증권	옵션	0	1,095,070	-1,095,070	장내

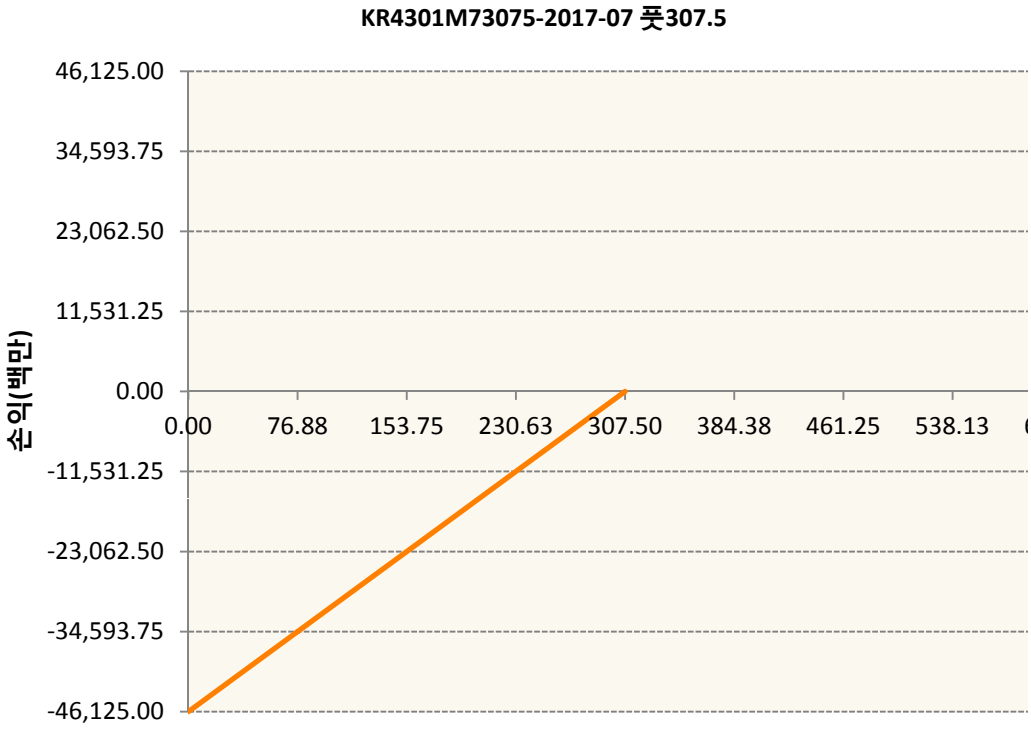
2. 만기시점의 손익구조






-251,611.88
-377,417.81
-503,223.75
가격


KR4301M73059-2017-07 풋305
465,125.00
348,843.75
232,562.50
116,281.25
0.00
-116,281.25
-232,562.50
-348,843.75
-465,125.00
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							6,129
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,938	1,936	1,930	1,922	1,911	1,895	1,876
-5.33%	1,890	1,861	1,826	1,786	1,741	1,692	1,640
-2.67%	1,479	1,400	1,320	1,239	1,158	1,076	994
0%	204	139	71	0	-73	-148	-224
2.67%	-1,765	-1,783	-1,806	-1,835	-1,869	-1,908	-1,952
5.33%	-3,932	-3,934	-3,938	-3,943	-3,952	-3,965	-3,981
8.00%	-6,120	-6,120	-6,120	-6,121	-6,122	-6,125	-6,129
KR4201M73(2017-07 콜307.5							36,645
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	9,277	9,270	9,255	9,227	9,184	9,123	9,042
-5.33%	9,146	9,041	8,901	8,727	8,521	8,287	8,026
-2.67%	7,622	7,205	6,770	6,322	5,863	5,395	4,920
0%	1,484	997	501	0	-506	-1,015	-1,526
2.67%	-9,760	-9,945	-10,169	-10,428	-10,718	-11,034	-11,374
5.33%	-23,009	-23,034	-23,077	-23,143	-23,234	-23,352	-23,496
8.00%	-36,546	-36,548	-36,552	-36,560	-36,577	-36,604	-36,645
KR4301M73(2017-07 풋305							28,725
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-28,722	-28,722	-28,722	-28,723	-28,723	-28,723	-28,725
-5.33%	-16,095	-16,101	-16,113	-16,133	-16,161	-16,201	-16,251
-2.67%	-4,310	-4,519	-4,736	-4,959	-5,187	-5,419	-5,655
0%	355	255	136	0	-150	-313	-486
2.67%	543	543	540	534	524	508	485
5.33%	544	544	544	544	544	543	543
8.00%	544	544	544	544	544	544	544
KR4301M73(2017-07 풋307.5							3,125
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-3,124	-3,124	-3,124	-3,124	-3,124	-3,124	-3,125
-5.33%	-1,882	-1,882	-1,883	-1,883	-1,884	-1,886	-1,888
-2.67%	-664	-675	-689	-703	-719	-736	-755
0%	61	41	21	0	-22	-44	-67
2.67%	129	128	127	125	122	118	113

5.33%	129	129	129	129	129	129	129
8.00%	129	129	129	129	129	129	129

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

82,969

공시일	2017-07-10
기준일	2017-07-07

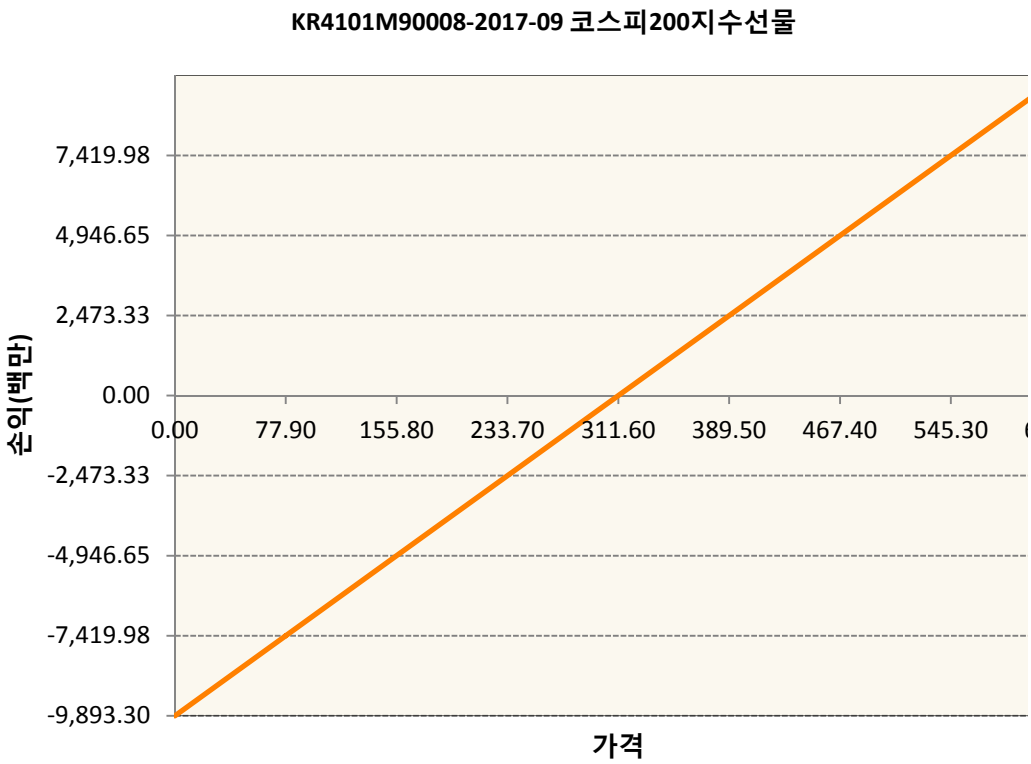
ETF스마트레버리지목표전환형6호

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	9,893	0	9,893	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)

489

공시일	2017-07-10
기준일	2017-07-07

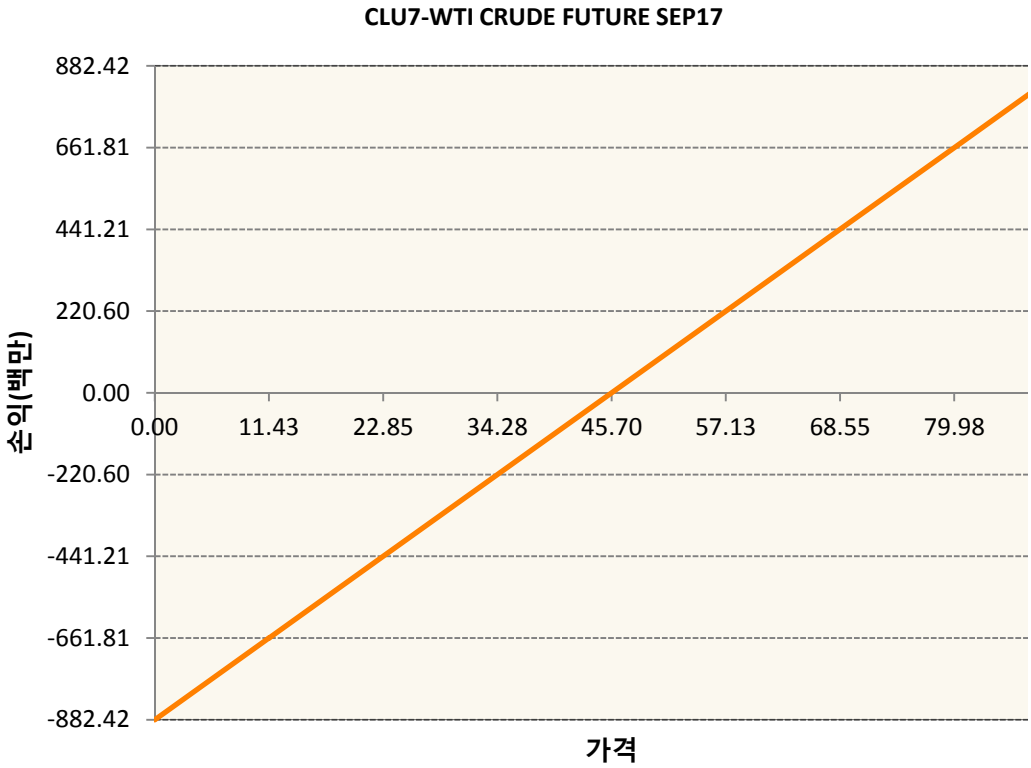
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

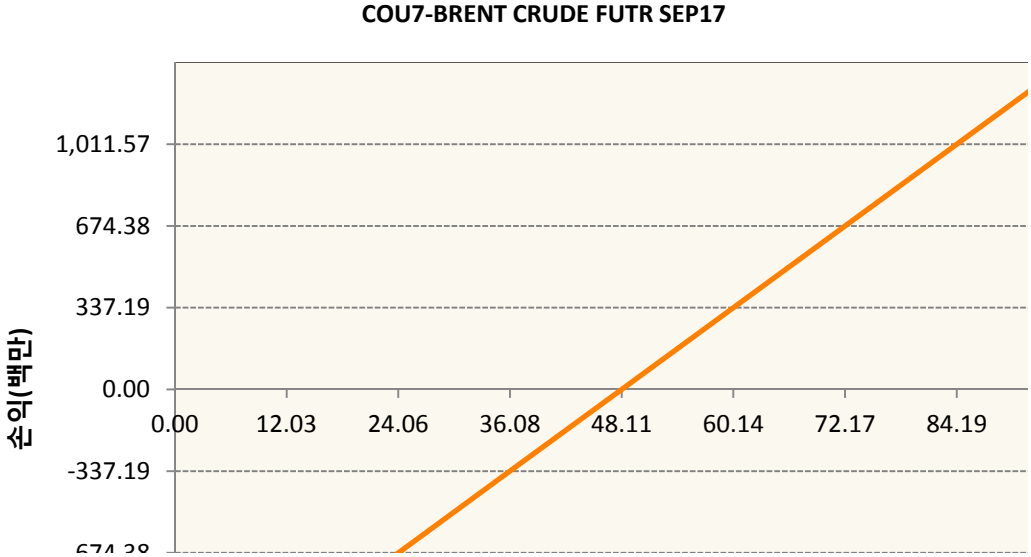
1. 계약금액

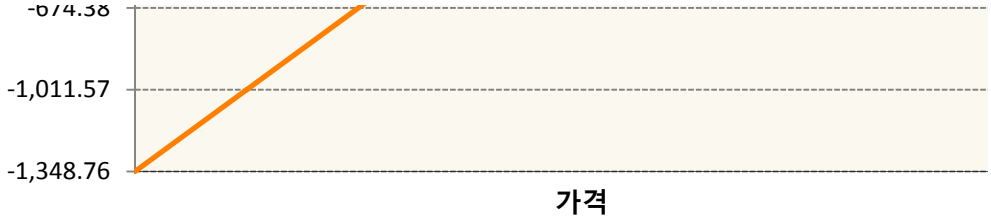
(단위:백만원)

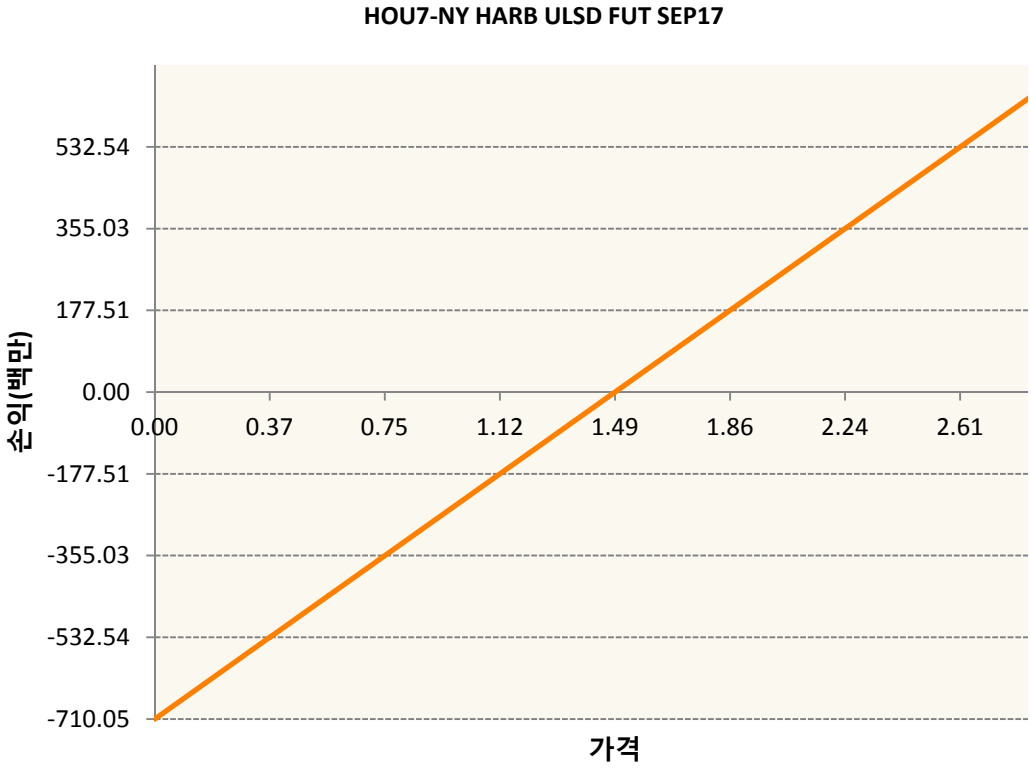
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	5,037	231	4,806	

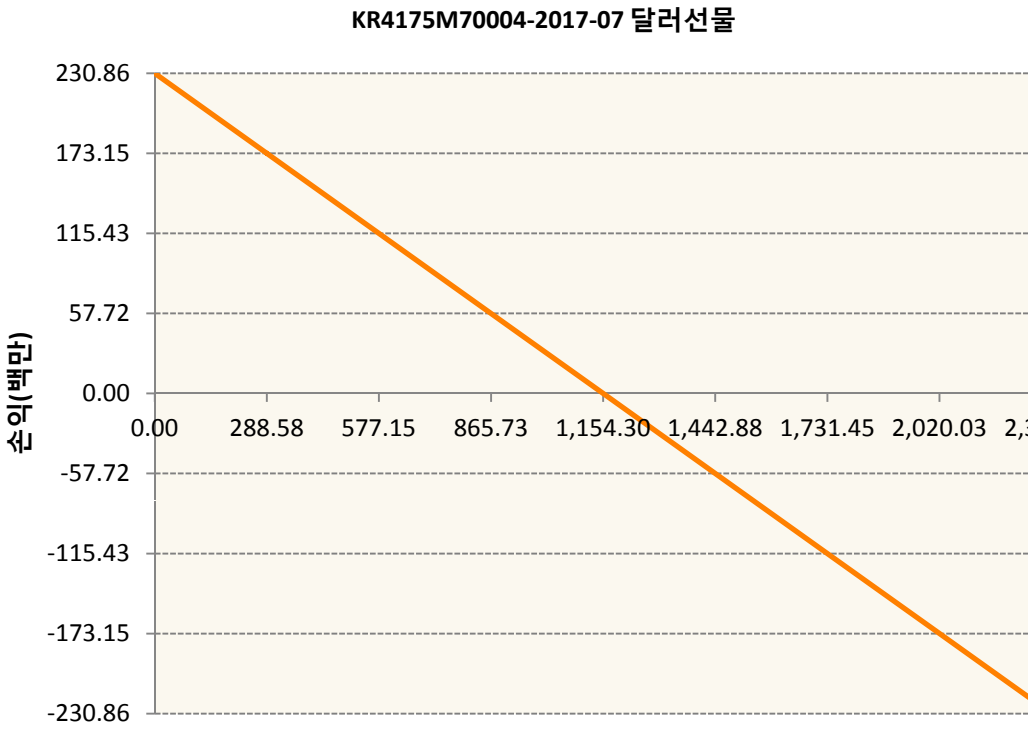
2. 만기시점의 손익구조



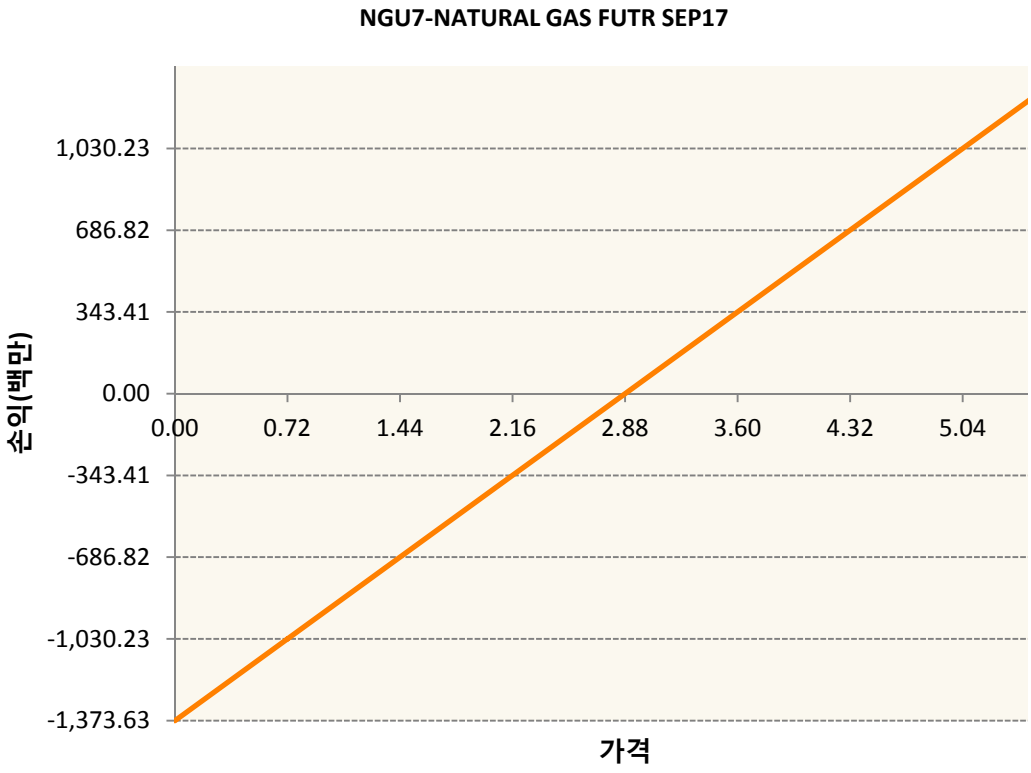


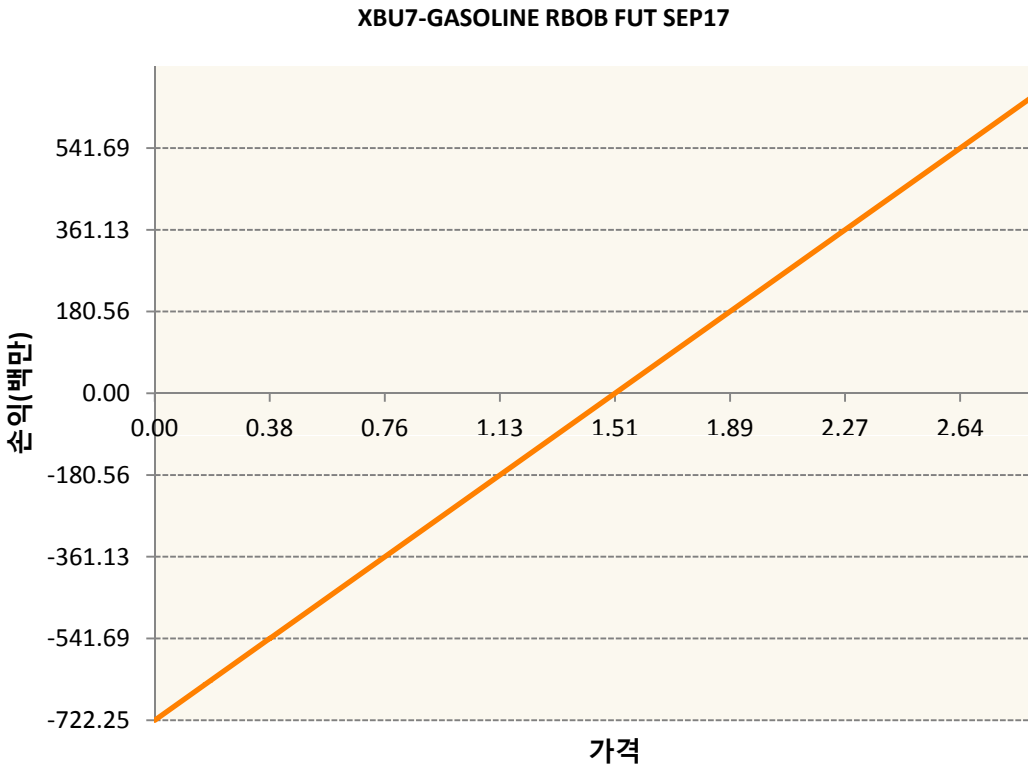

-1,011.57
-1,348.76
가격


HOU7-NY HARB ULSD FUT SEP17
532.54
355.03
177.51
0.00
-177.51
-355.03
-532.54
-710.05
0.00
0.37
0.75
1.12
1.49
1.86
2.24
2.61
순이익(백만)
가격


KR4175M70004-2017-07 달러선물
230.86
173.15
115.43
57.72
0.00
-57.72
-115.43
-173.15
-230.86
0.00
288.58
577.15
865.73
1,154.30
1,442.88
1,731.45
2,020.03
순이익(백만)

가격


NGU7-NATURAL GAS FUTR SEP17
1,030.23
686.82
343.41
0.00
-343.41
-686.82
-1,030.23
-1,373.63
0.00
0.72
1.44
2.16
2.88
3.60
4.32
5.04
손익(백만)
가격


XBU7-GASOLINE RBOB FUT SEP17
541.69
361.13
180.56
0.00
-180.56
-361.13
-541.69
-722.25
0.00
0.38
0.76
1.13
1.51
1.89
2.27
2.64
손익(백만)
가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLU7	WTI CRUDE FUTURE SEP17	71
COU7	BRENT CRUDE FUTR SEP17	108
HOU7	NY HARB ULSD FUT SEP17	57
KR4175M70(	2017-07 달러선물	18
NGU7	NATURAL GAS FUTR SEP17	110
XBU7	GASOLINE RBOB FUT SEP17	58

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

783

공시일	2017-07-10
기준일	2017-07-07

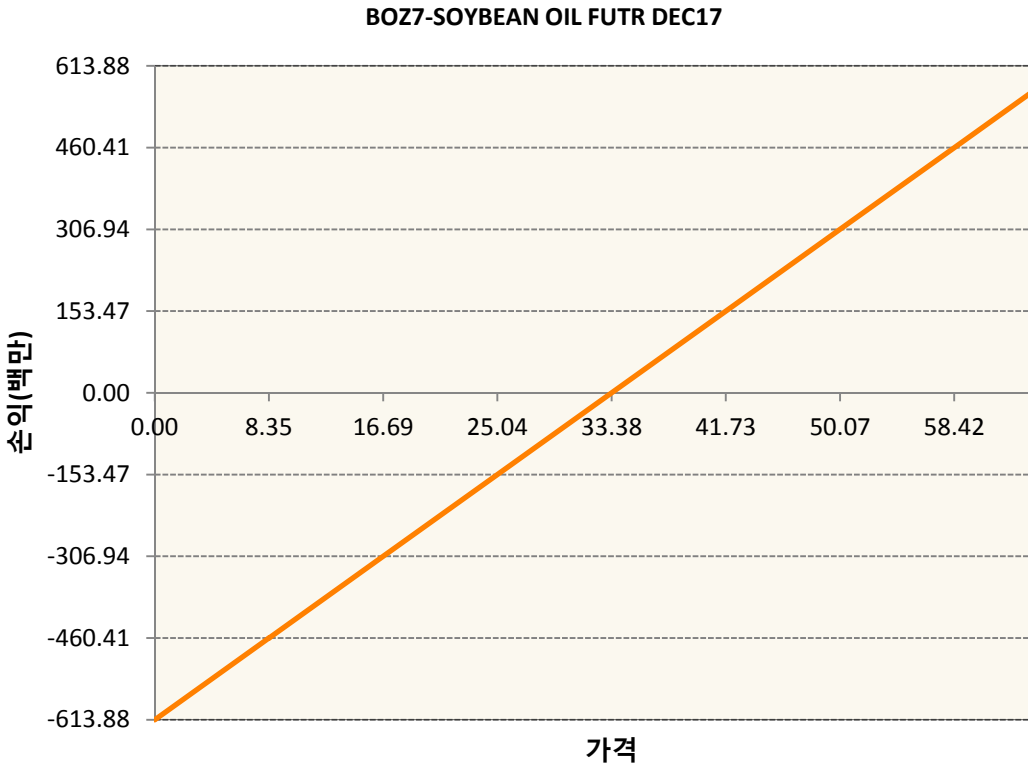
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

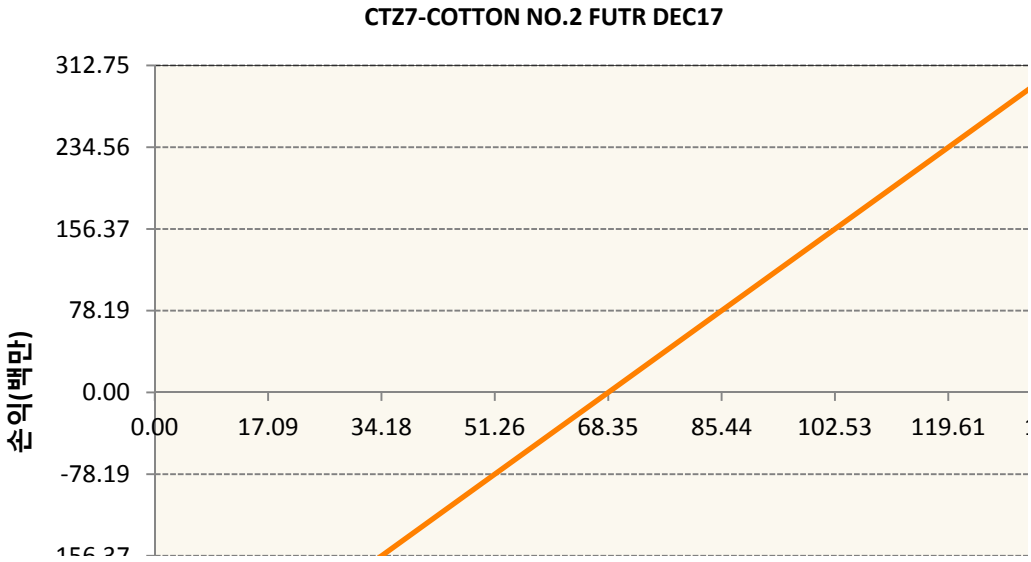
1. 계약금액

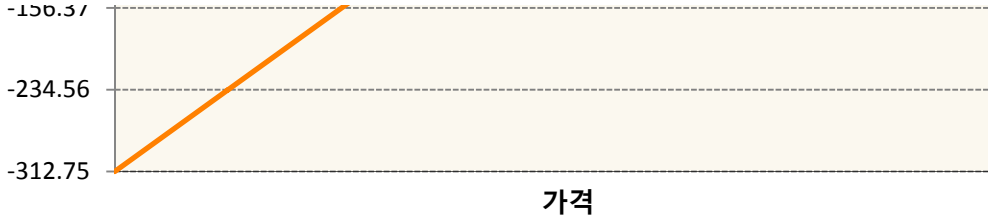
(단위:백만원)

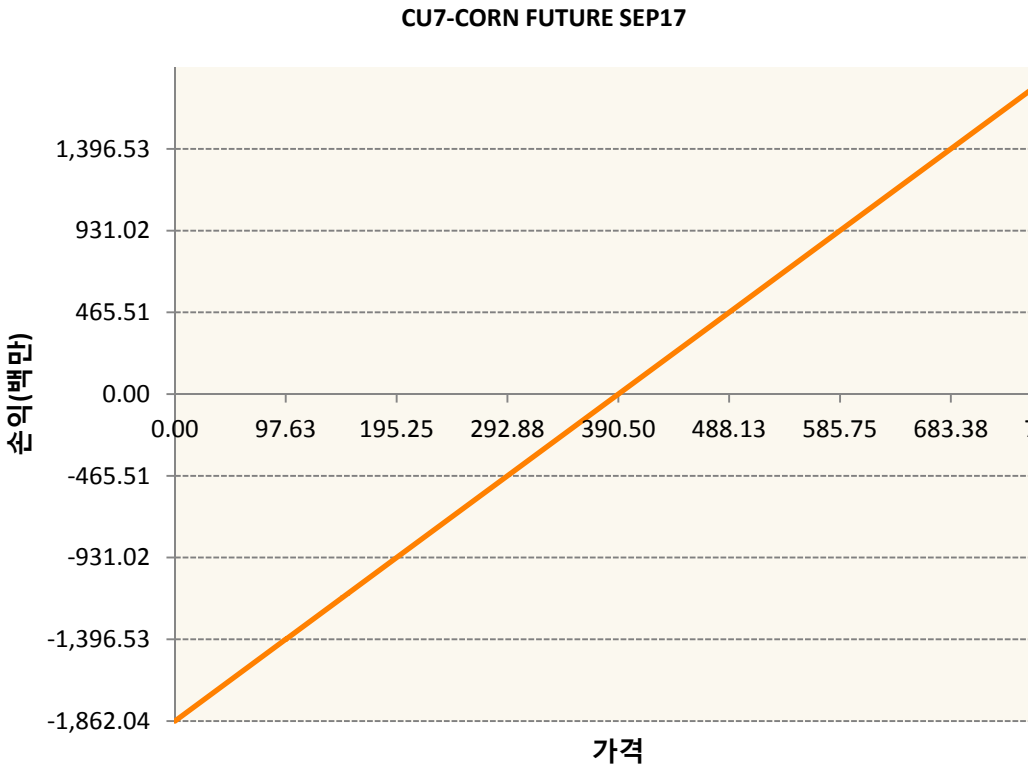
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	7,212	404	6,808	

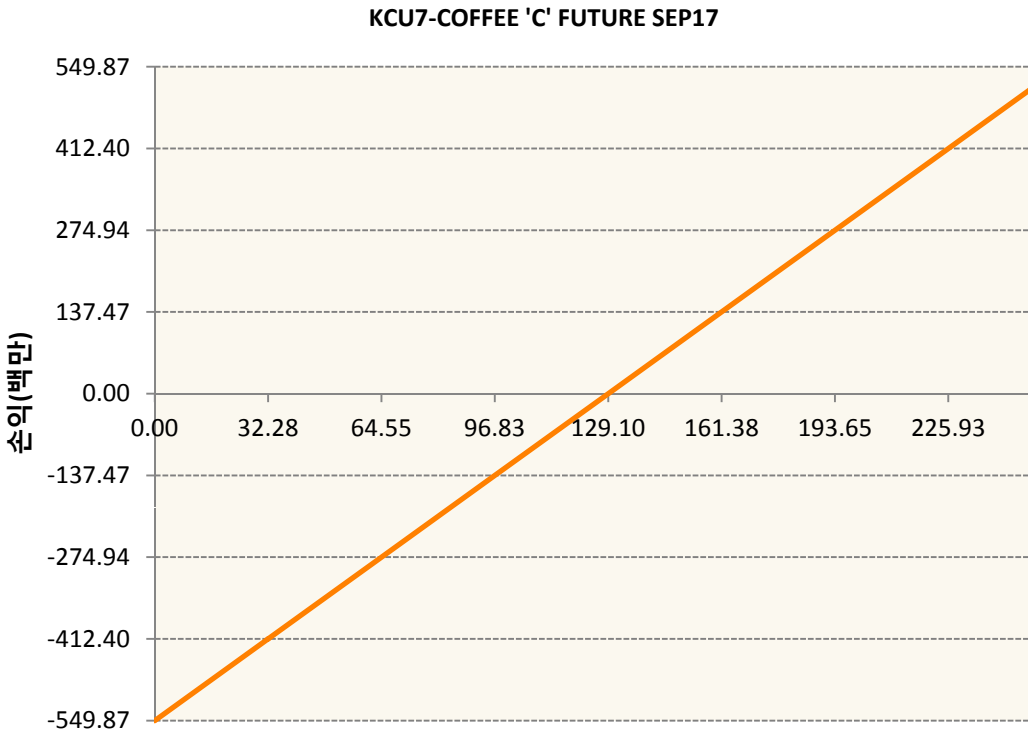
2. 만기시점의 손익구조





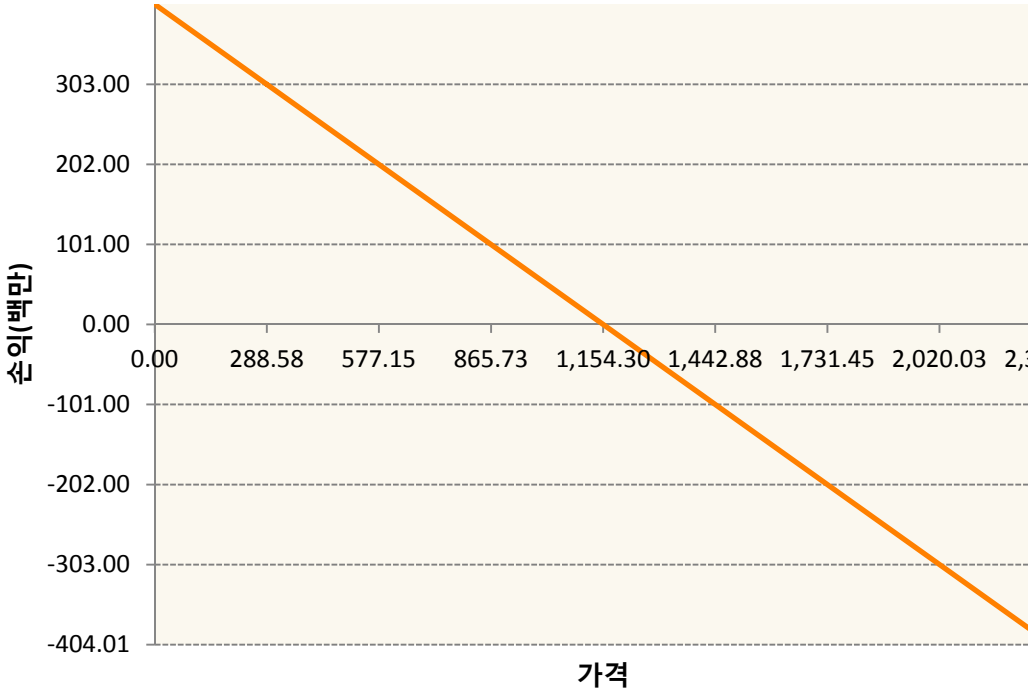

-234.56
-312.75
가격


CU7-CORN FUTURE SEP17
1,396.53
931.02
465.51
0.00
-465.51
-931.02
-1,396.53
-1,862.04
0.00
97.63
195.25
292.88
390.50
488.13
585.75
683.38
손익(백만)
가격

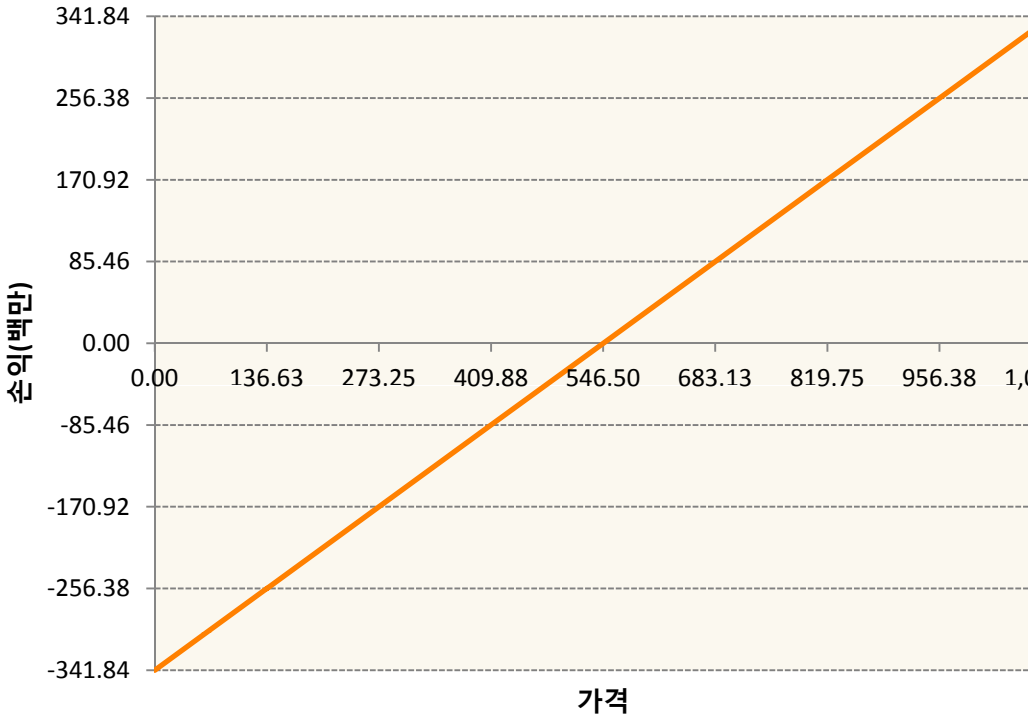

KCU7-COFFEE 'C' FUTURE SEP17
549.87
412.40
274.94
137.47
0.00
-137.47
-274.94
-412.40
-549.87
0.00
32.28
64.55
96.83
129.10
161.38
193.65
225.93
손익(백만)

가격

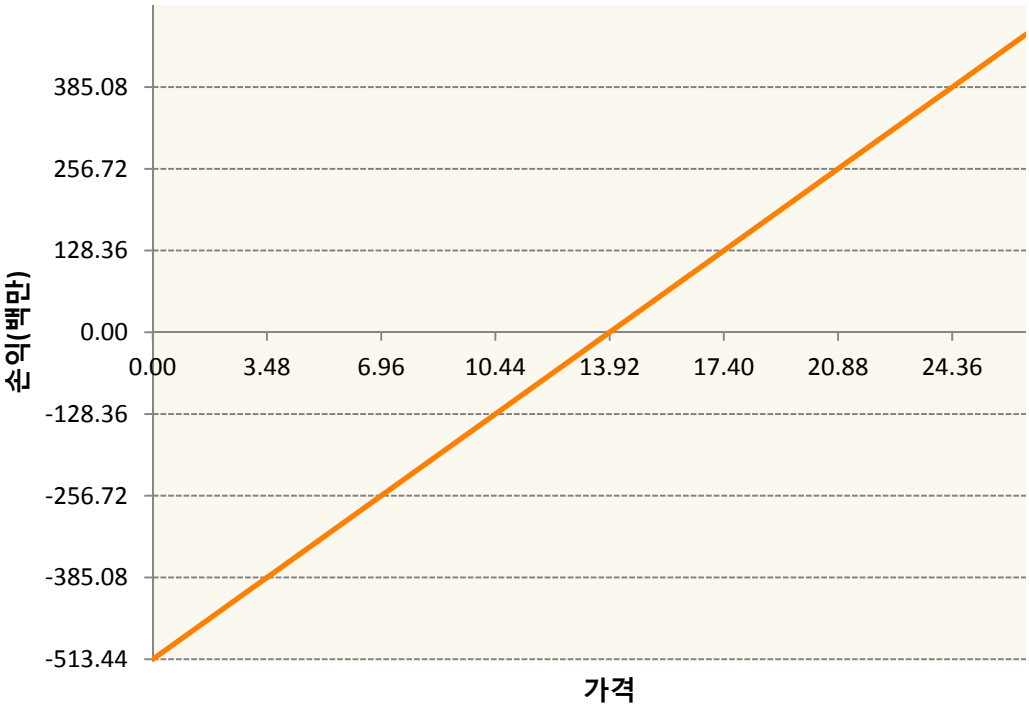
KR4175M70004-2017-07 달러선물



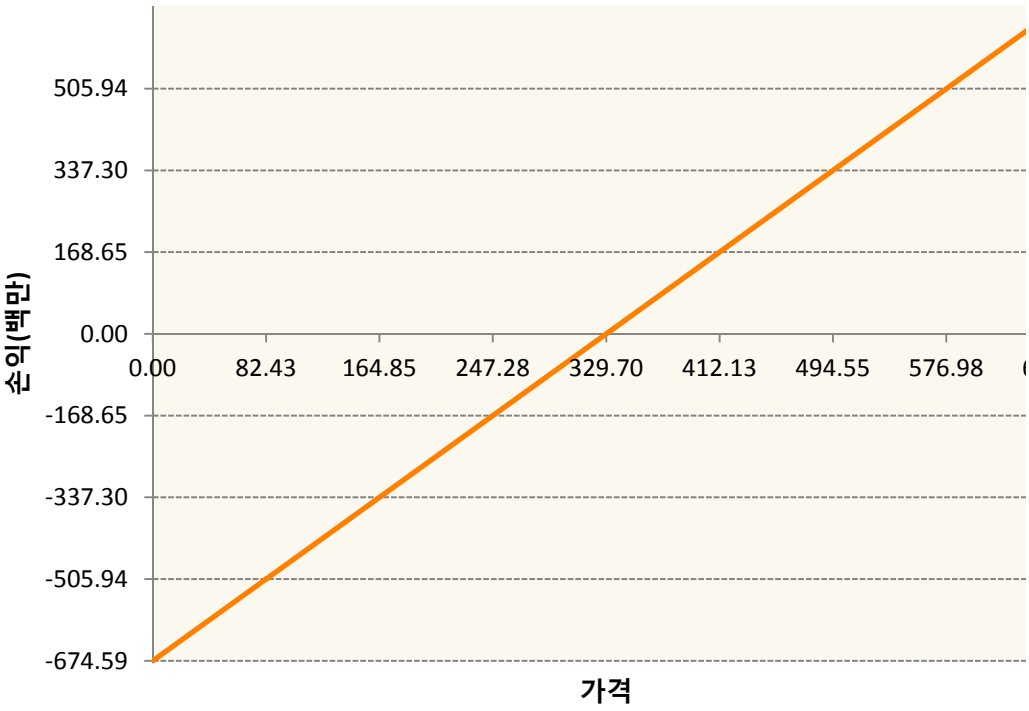
KWU7-KC HRW WHEAT FUT SEP17



SBV7-SUGAR #11 (WORLD) OCT17

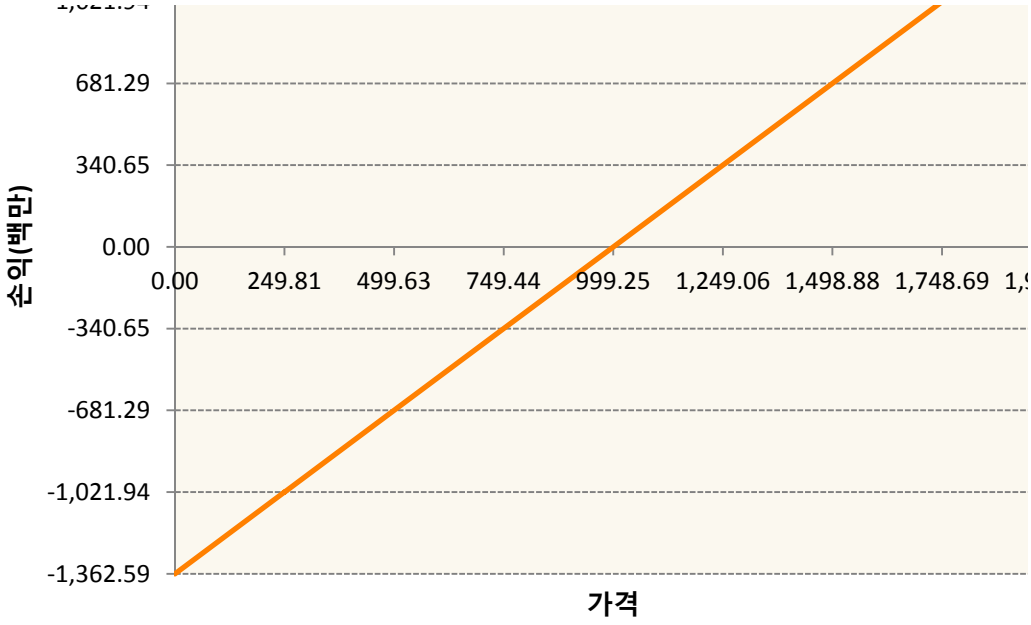


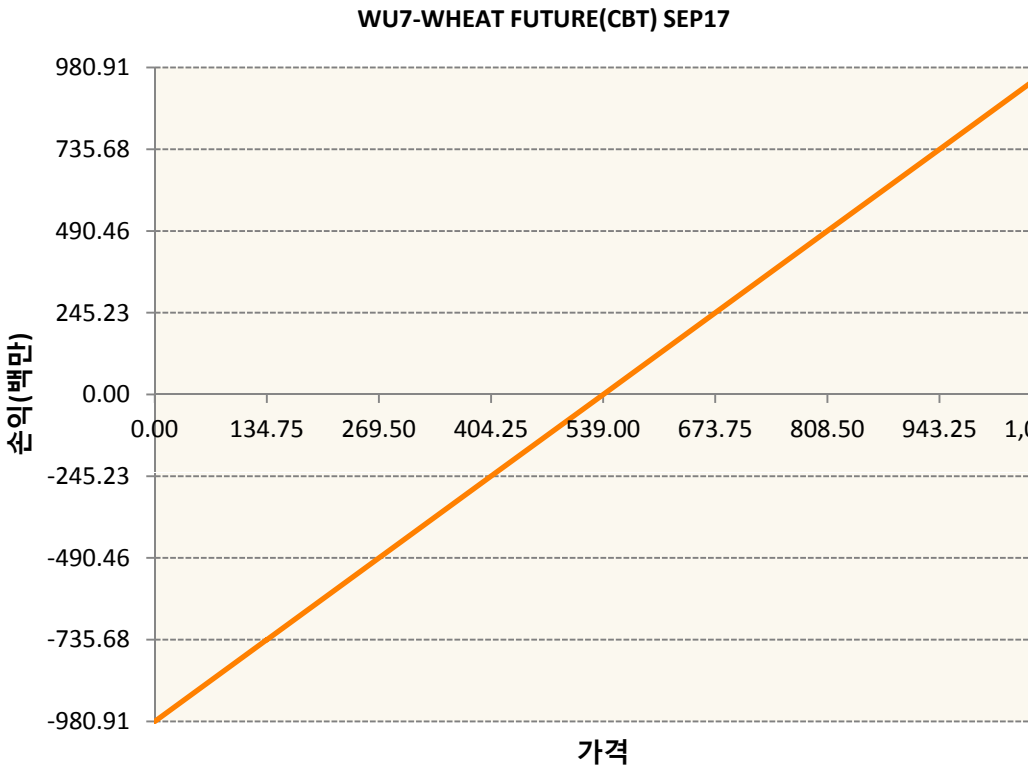
SMZ7-SOYBEAN MEAL FUTR DEC17



SX7-SOYBEAN FUTURE NOV17







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
BOZ7	SOYBEAN OIL FUTR DEC17	49
CTZ7	COTTON NO.2 FUTR DEC17	25
CU7	CORN FUTURE SEP17	149
KCU7	COFFEE 'C' FUTURE SEP17	44
KR4175M70(	2017-07 달러선물	32

KWU7	KC HRW WHEAT FUT SEP17	27
SBV7	SUGAR #11 (WORLD) OCT17	41
SMZ7	SOYBEAN MEAL FUTR DEC17	54
SX7	SOYBEAN FUTURE NOV17	109
WU7	WHEAT FUTURE(CBT) SEP17	78

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

666