공시일	2017-07-11
기준일	2017-07-10

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	2017-07-11
기준일	2017-07-10

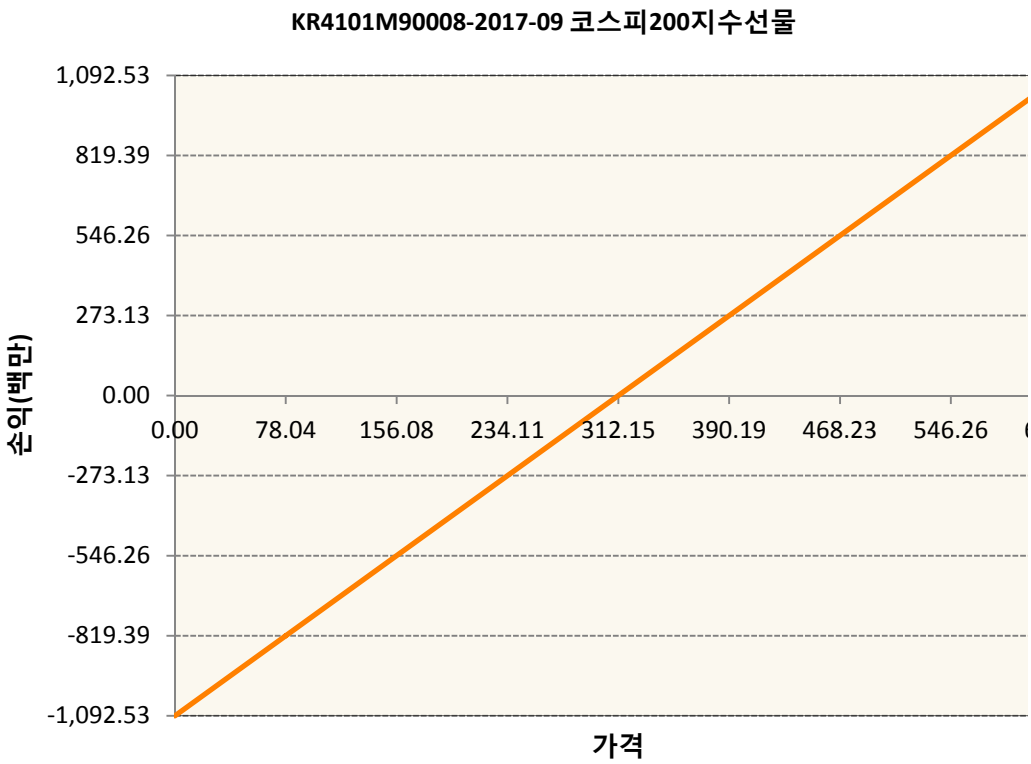
스마트인덱스모

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	1,093	0	1,093	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)

53

공시일	2017-07-11
기준일	2017-07-10

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	996

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

481

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-07-11
기준일	2017-07-10

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	385

* 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	2017-07-11
기준일	2017-07-10

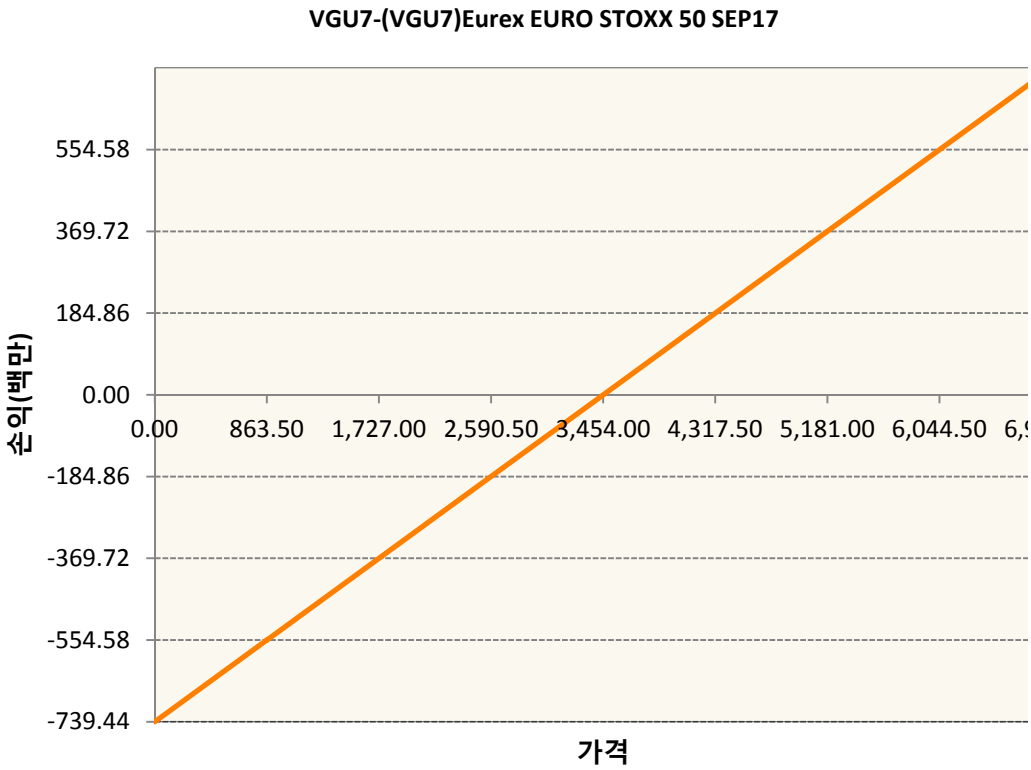
유로인덱스모(주식-파생형)

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	2017-07-11
기준일	2017-07-10

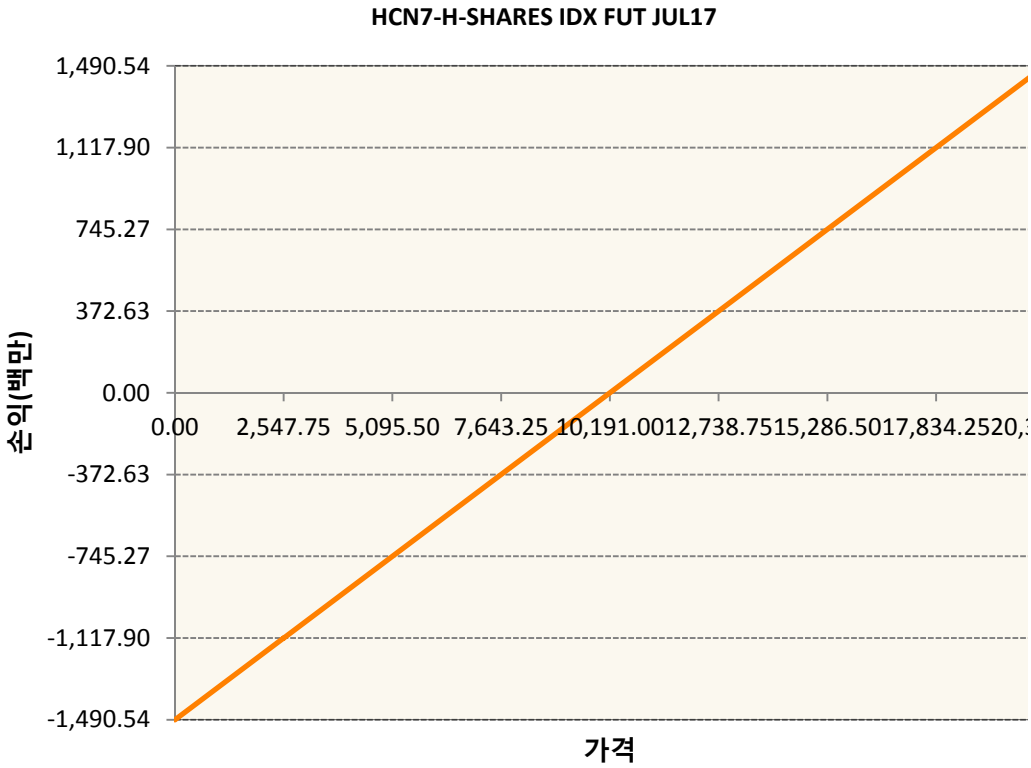
차이나인덱스모(주식-파생형)

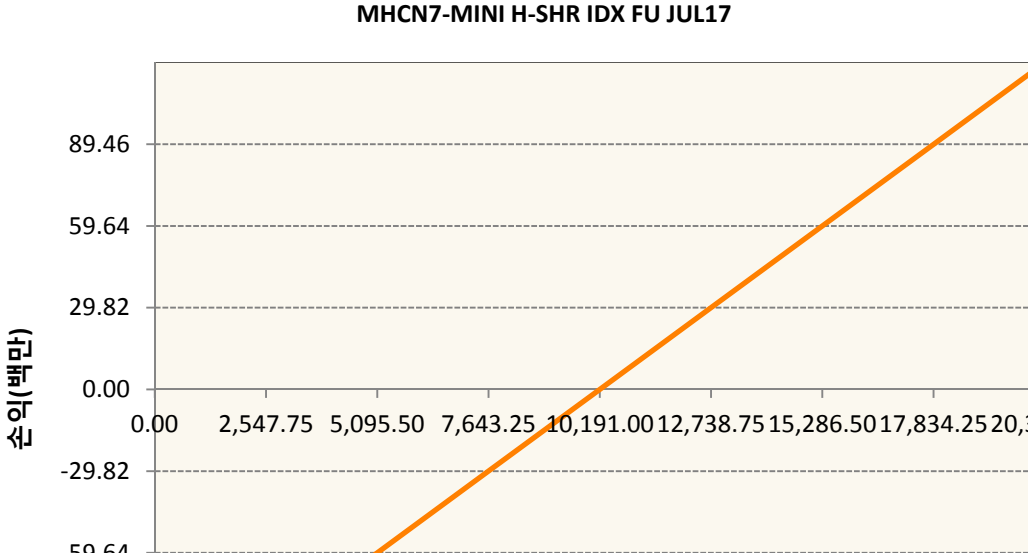
1. 계약금액

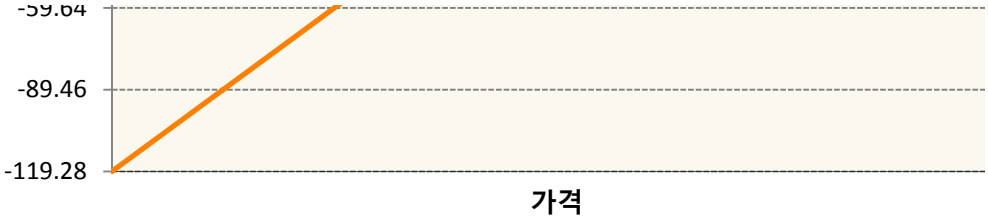
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,610	0	1,610	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)

125

공시일	2017-07-11
기준일	2017-07-10

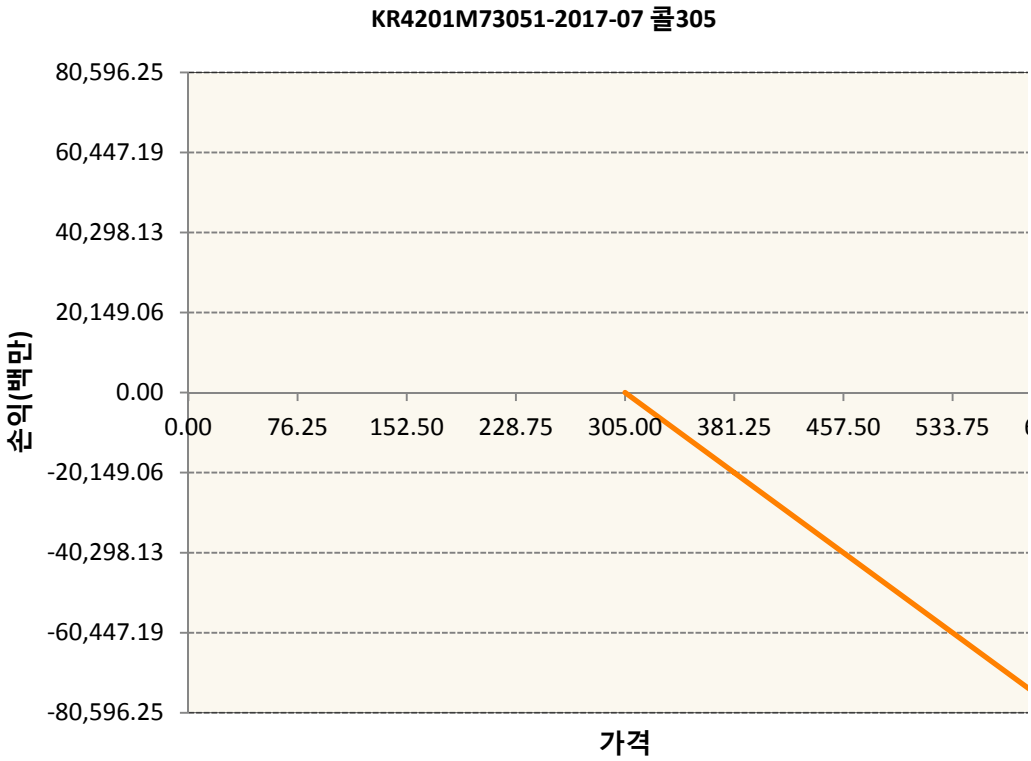
커버드콜모(주식혼합-파생형)

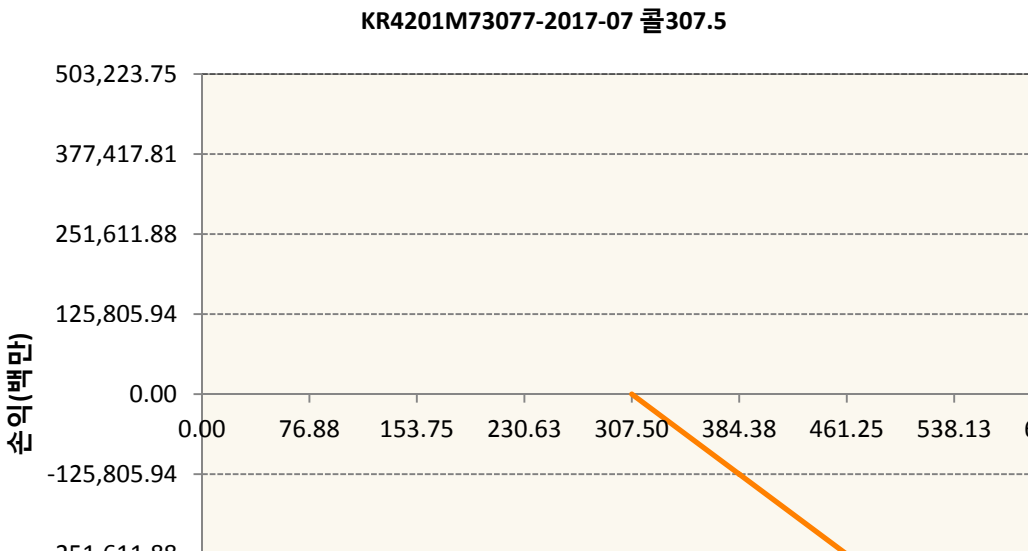
1. 계약금액

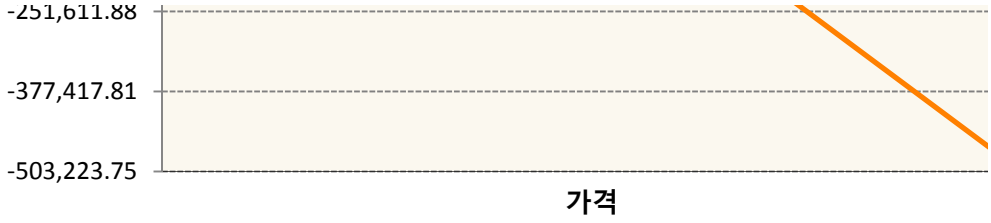
(단위:백만원)

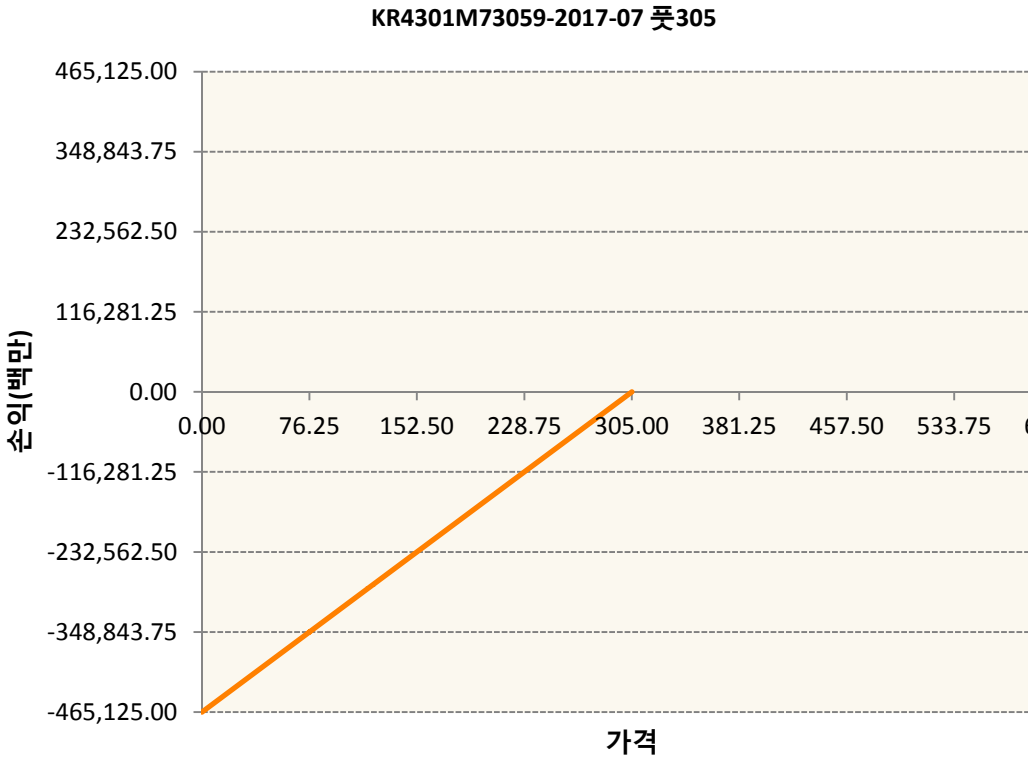
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	1,095,070	-1,095,070	장내

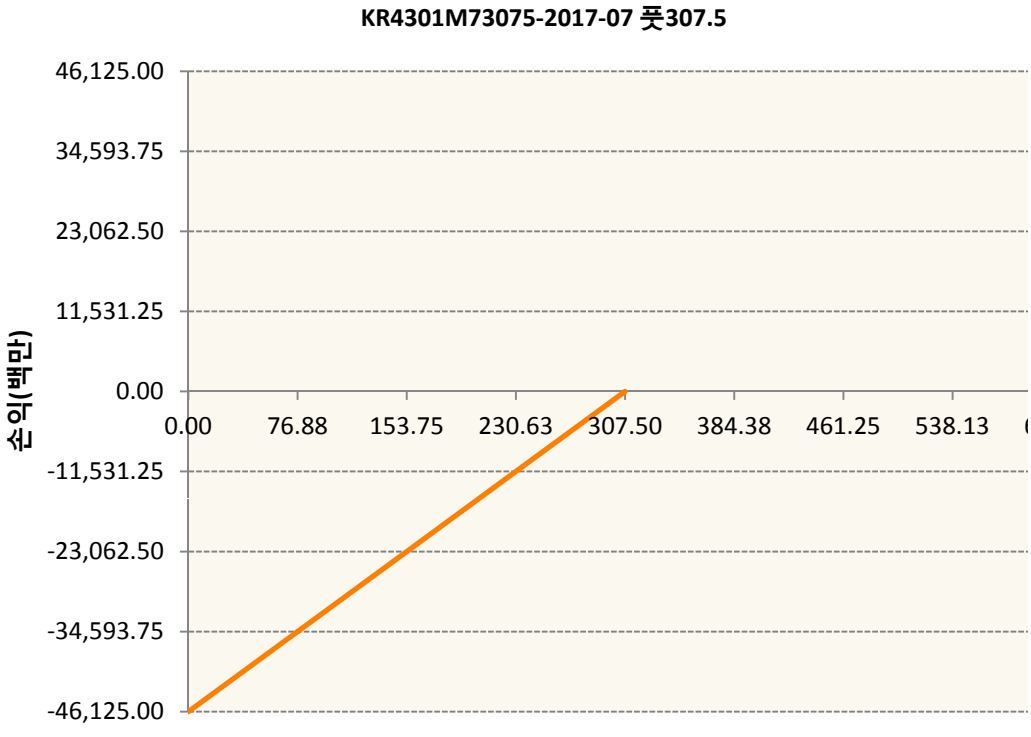
2. 만기시점의 손익구조






-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						6,428
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,862	1,862	1,861	1,861	1,860	1,857	1,854
-5.33%	1,853	1,845	1,834	1,819	1,800	1,779	1,754
-2.67%	1,550	1,496	1,441	1,386	1,330	1,274	1,218
0%	94	67	35	0	-38	-78	-121
2.67%	-2,040	-2,041	-2,044	-2,048	-2,055	-2,064	-2,075
5.33%	-4,234	-4,234	-4,234	-4,234	-4,234	-4,235	-4,236
8.00%	-6,428	-6,428	-6,428	-6,428	-6,428	-6,428	-6,428
KR4201M73(	2017-07 콜307.5						38,903
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	8,347	8,347	8,347	8,345	8,343	8,338	8,329
-5.33%	8,335	8,318	8,287	8,242	8,180	8,101	8,004
-2.67%	7,501	7,248	6,978	6,695	6,401	6,099	5,789
0%	865	590	300	0	-309	-626	-949
2.67%	-11,742	-11,770	-11,813	-11,875	-11,956	-12,057	-12,177
5.33%	-25,311	-25,311	-25,313	-25,315	-25,321	-25,332	-25,350
8.00%	-38,902	-38,902	-38,902	-38,902	-38,902	-38,902	-38,903
KR4301M73(	2017-07 풋305						28,073
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-28,073	-28,073	-28,073	-28,073	-28,073	-28,073	-28,073
-5.33%	-15,408	-15,409	-15,409	-15,411	-15,414	-15,420	-15,429
-2.67%	-3,310	-3,452	-3,599	-3,751	-3,907	-4,065	-4,226
0%	63	50	29	0	-39	-87	-144
2.67%	73	73	73	73	73	72	72
5.33%	73	73	73	73	73	73	73
8.00%	73	73	73	73	73	73	73
KR4301M73(	2017-07 풋307.5						3,108
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-3,108	-3,108	-3,108	-3,108	-3,108	-3,108	-3,108
-5.33%	-1,862	-1,862	-1,862	-1,862	-1,862	-1,862	-1,862
-2.67%	-624	-630	-636	-644	-652	-662	-672
0%	23	17	9	0	-10	-21	-32
2.67%	36	36	36	36	36	35	35

5.33%	36	36	36	36	36	36	36
8.00%	36	36	36	36	36	36	36

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

86,144

공시일	2017-07-11
기준일	2017-07-10

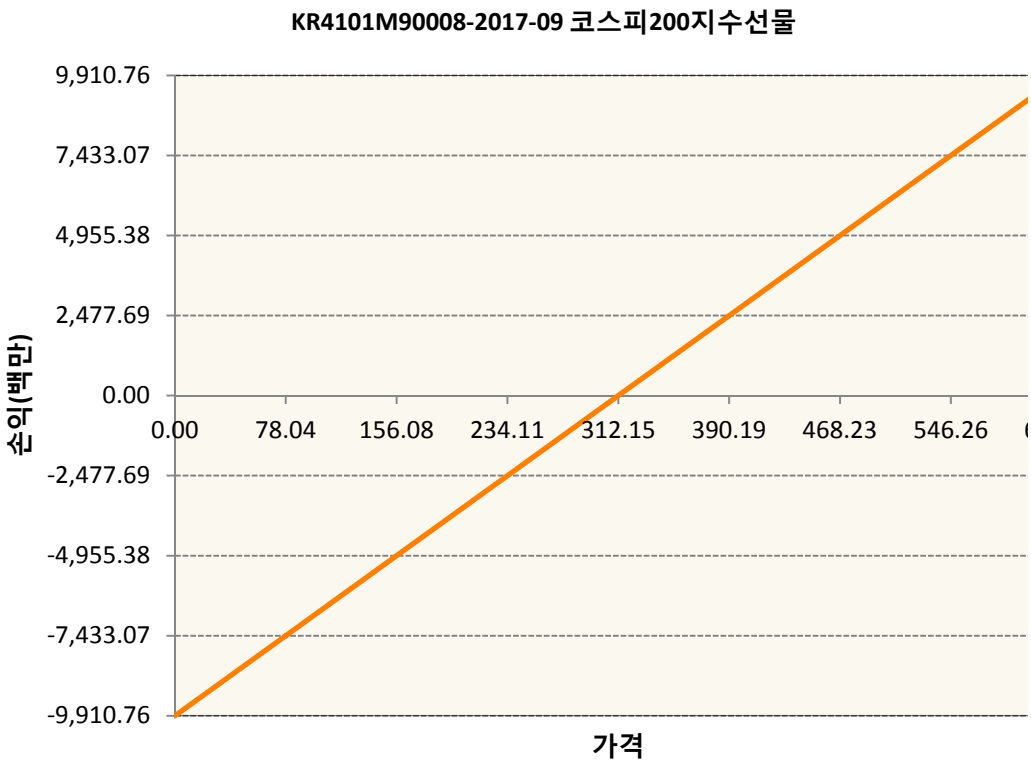
ETF스마트레버리지목표전환형6호

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	9,911	0	9,911	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101M90(2017-09 코스피200지수선물							791
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-791	-791	-791	-791	-791	-791	-791
-5.33%	-527	-527	-527	-527	-527	-527	-527
-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%	527	527	527	527	527	527	527
8.00%	791	791	791	791	791	791	791

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

480

공시일	2017-07-11
기준일	2017-07-10

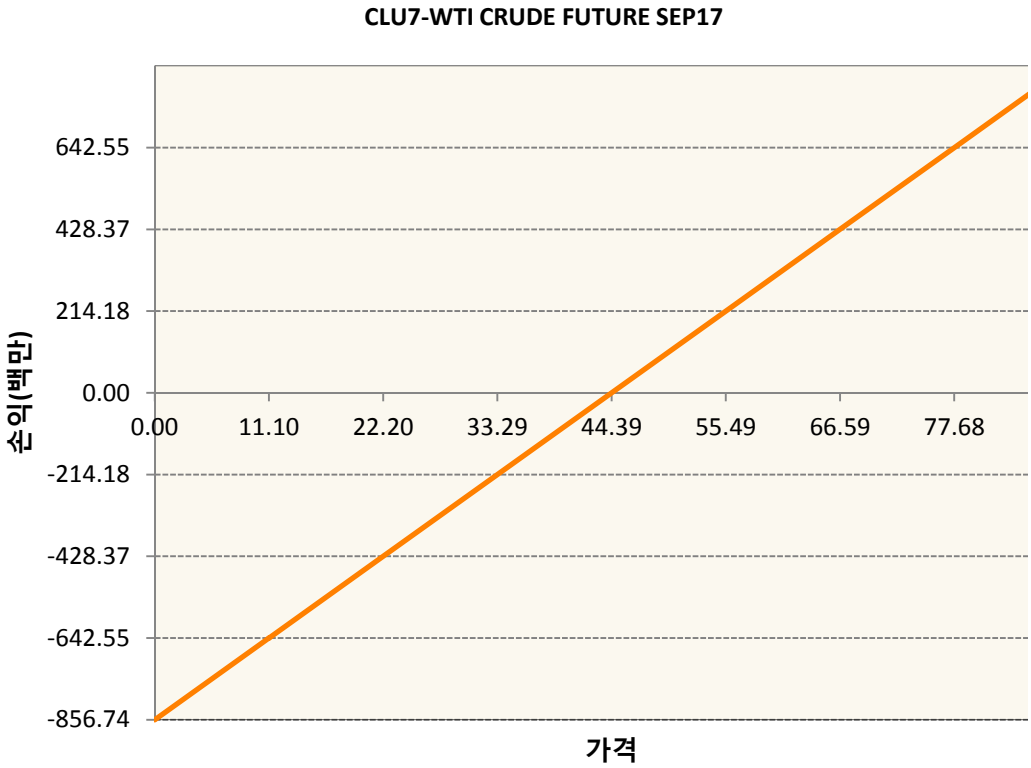
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

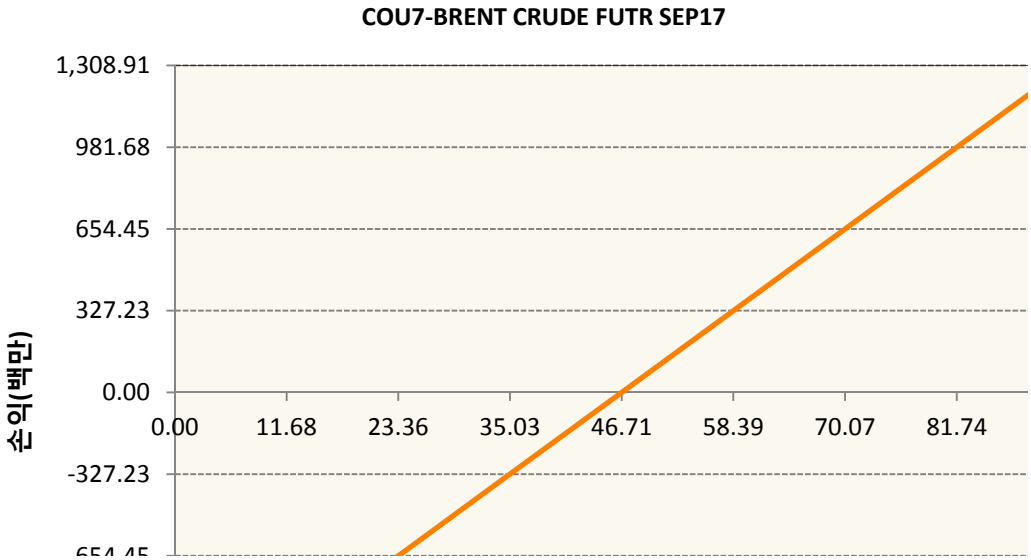
1. 계약금액

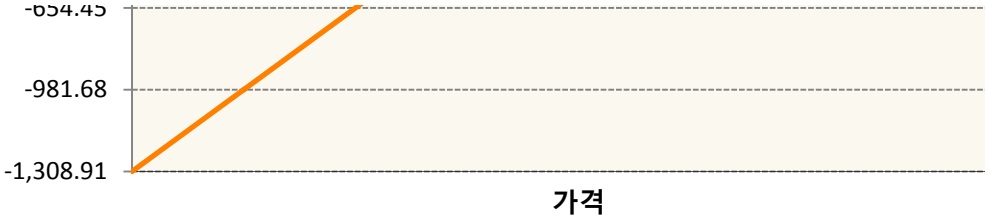
(단위:백만원)

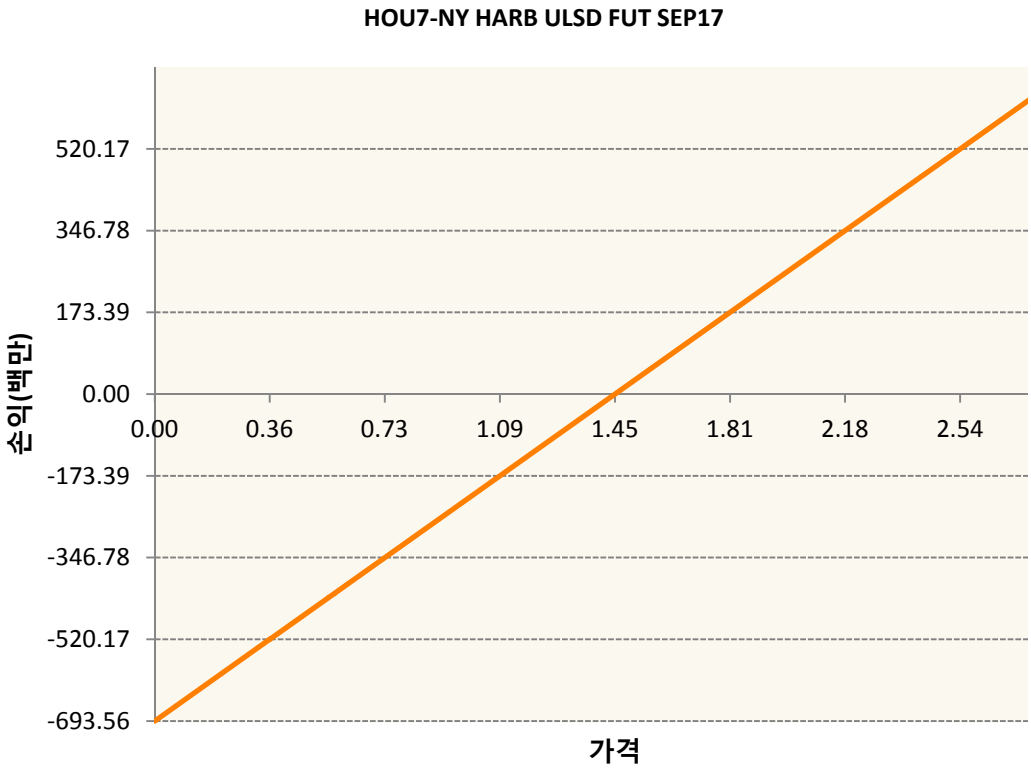
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	4,928	230	4,698	

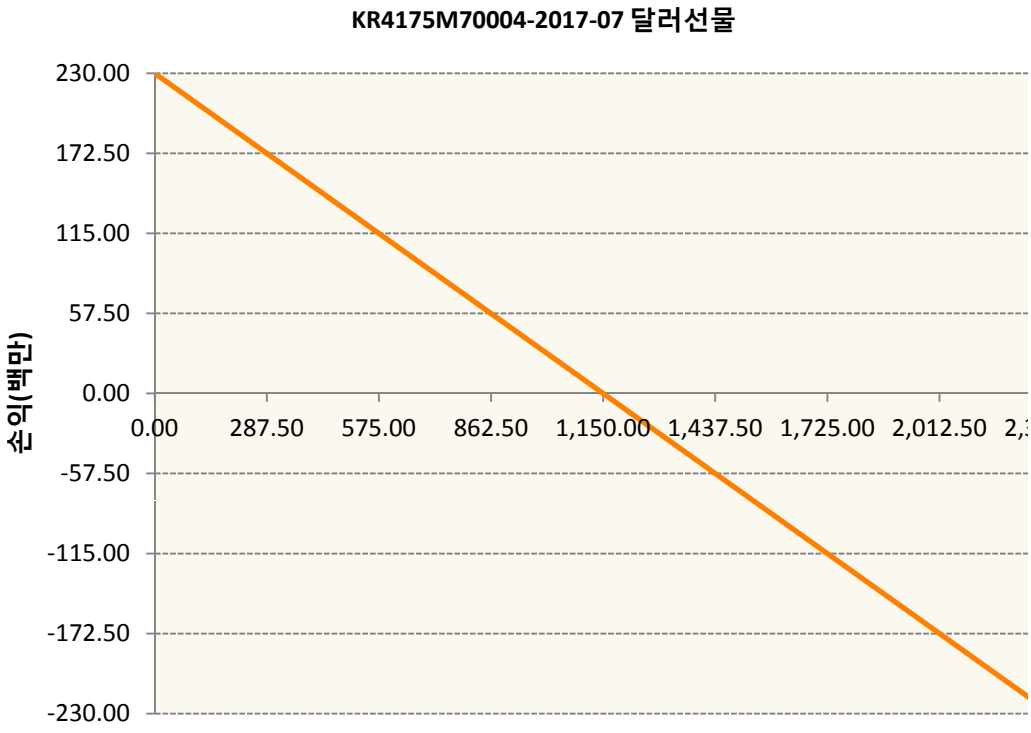
2. 만기시점의 손익구조



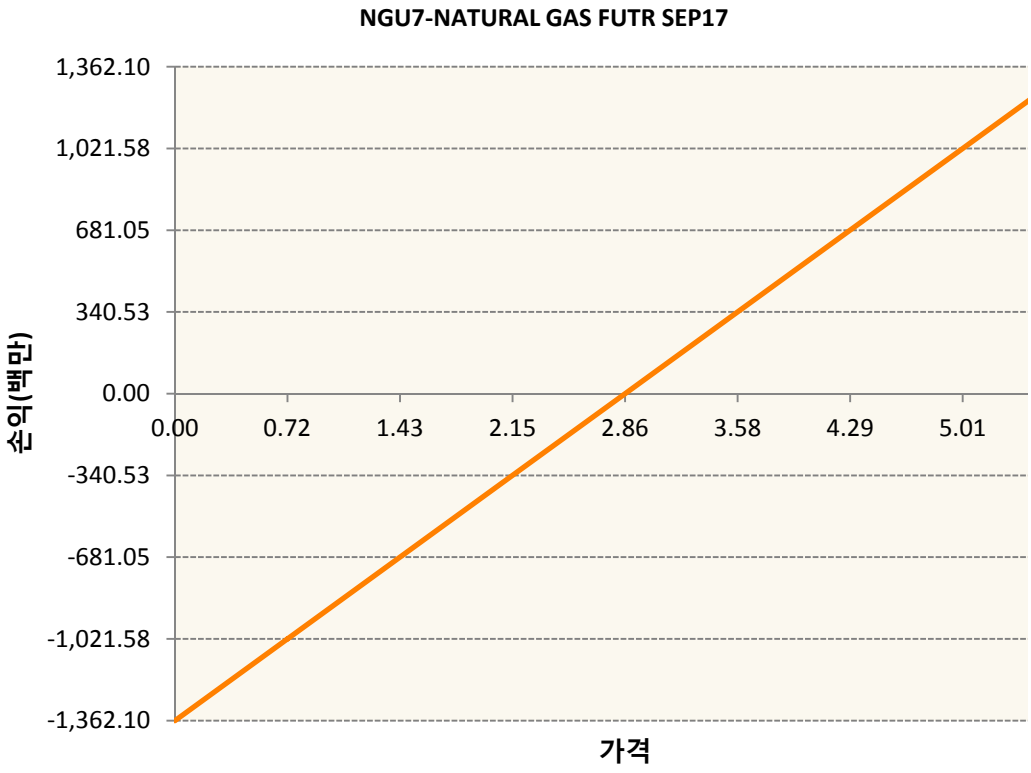


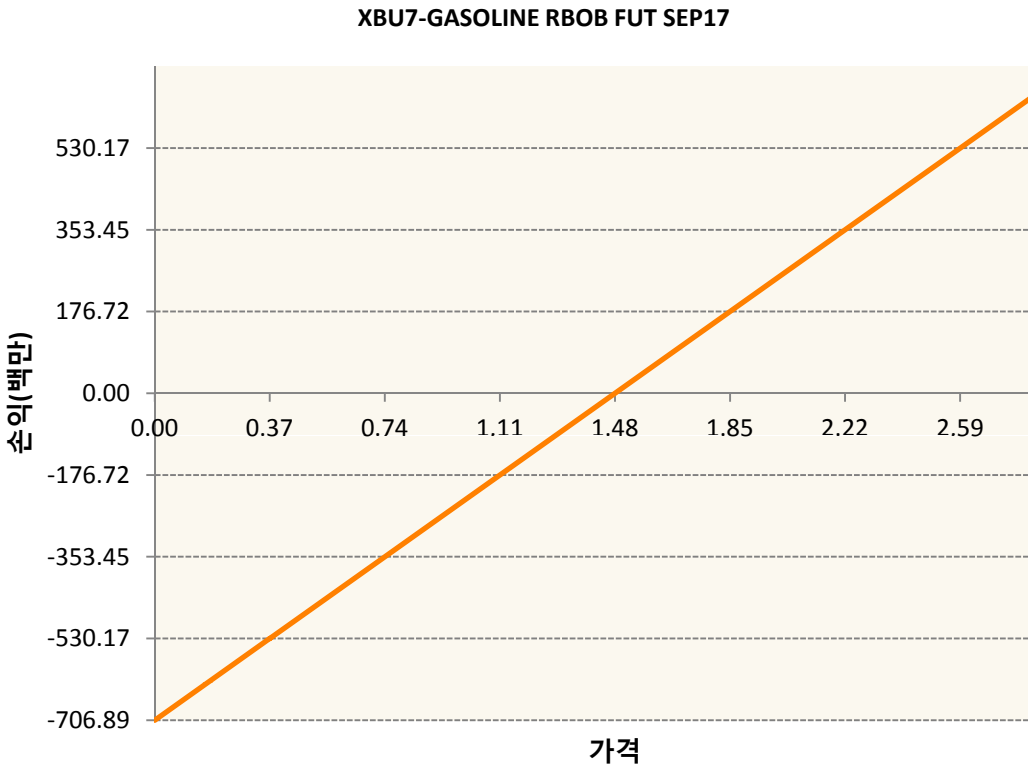

-654.45
-981.68
-1,308.91
가격


HOU7-NY HARB ULSD FUT SEP17
520.17
346.78
173.39
0.00
-173.39
-346.78
-520.17
-693.56
0.00
0.36
0.73
1.09
1.45
1.81
2.18
2.54
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
1,362.10
1,021.58
681.05
340.53
0.00
-340.53
-681.05
-1,021.58
-1,362.10
0.00
0.72
1.43
2.15
2.86
3.58
4.29
5.01
손익(백만)
가격


XBU7-GASOLINE RBOB FUT SEP17
530.17
353.45
176.72
0.00
-176.72
-353.45
-530.17
-706.89
0.00
0.37
0.74
1.11
1.48
1.85
2.22
2.59
손익(백만)
가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLU7	WTI CRUDE FUTURE SEP17	69
COU7	BRENT CRUDE FUTR SEP17	105
HOU7	NY HARB ULSD FUT SEP17	55
KR4175M70(	2017-07 달러선물	18
NGU7	NATURAL GAS FUTR SEP17	109
XBU7	GASOLINE RBOB FUT SEP17	57

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

763

공시일	2017-07-11
기준일	2017-07-10

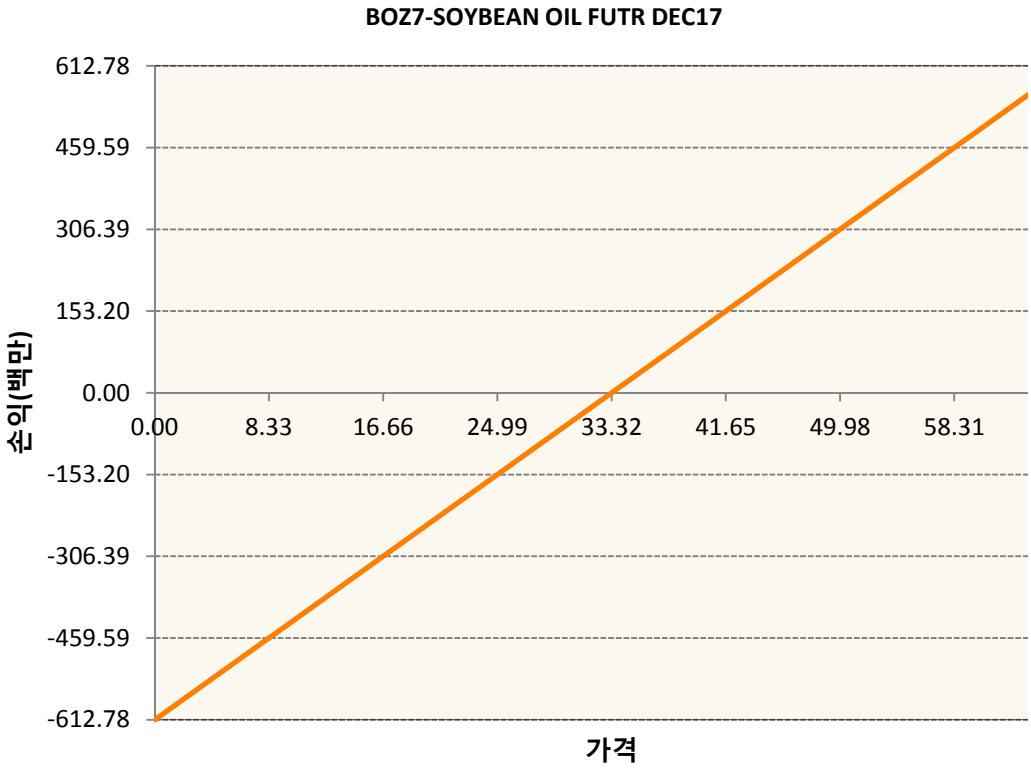
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

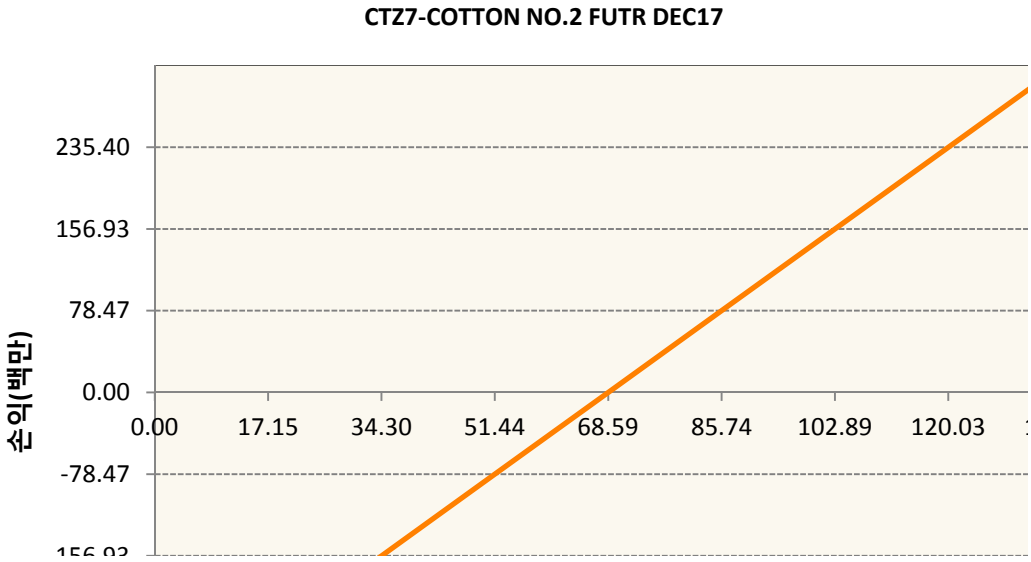
1. 계약금액

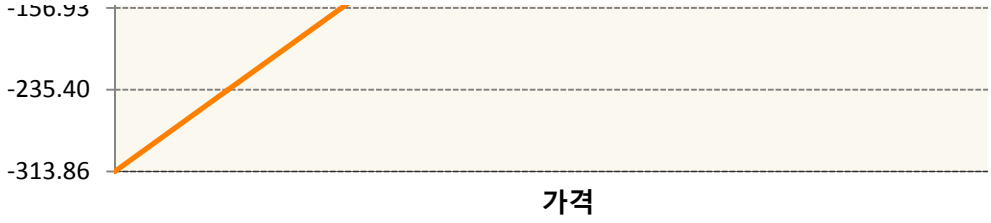
(단위:백만원)

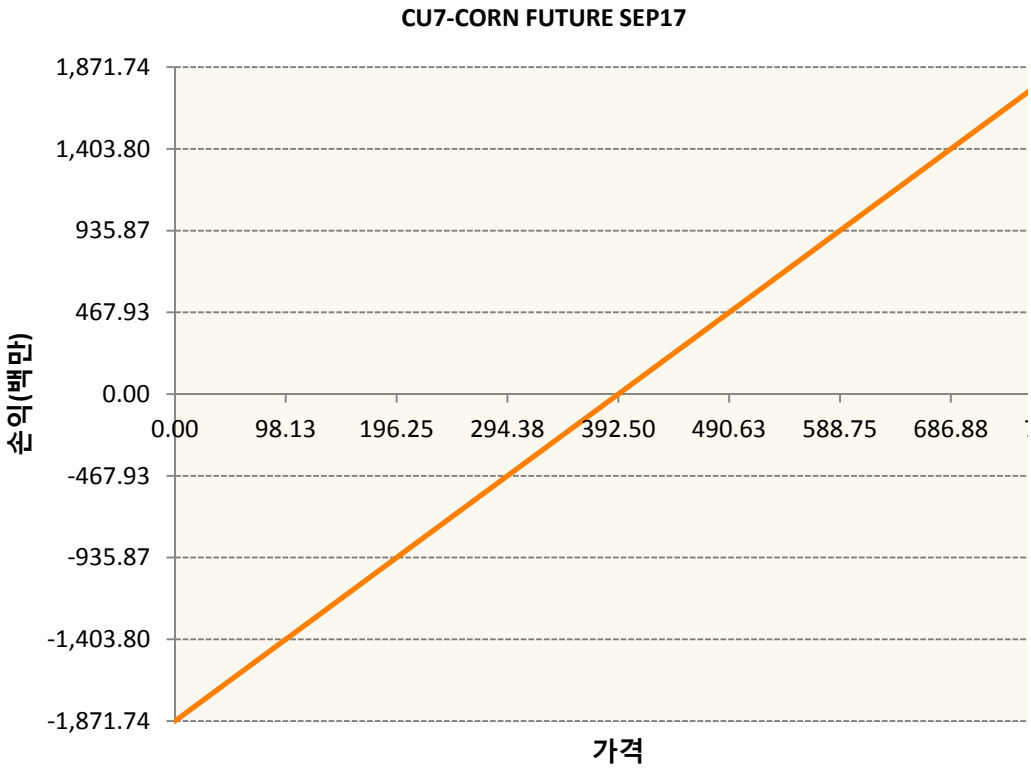
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	7,258	403	6,856	

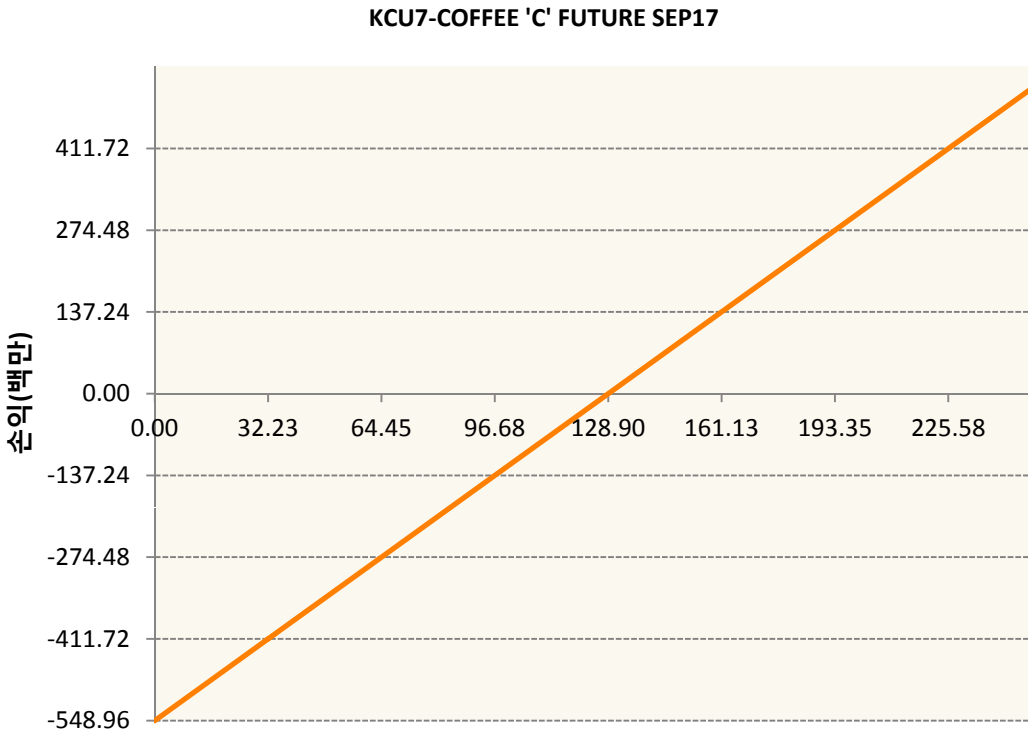
2. 만기시점의 손익구조



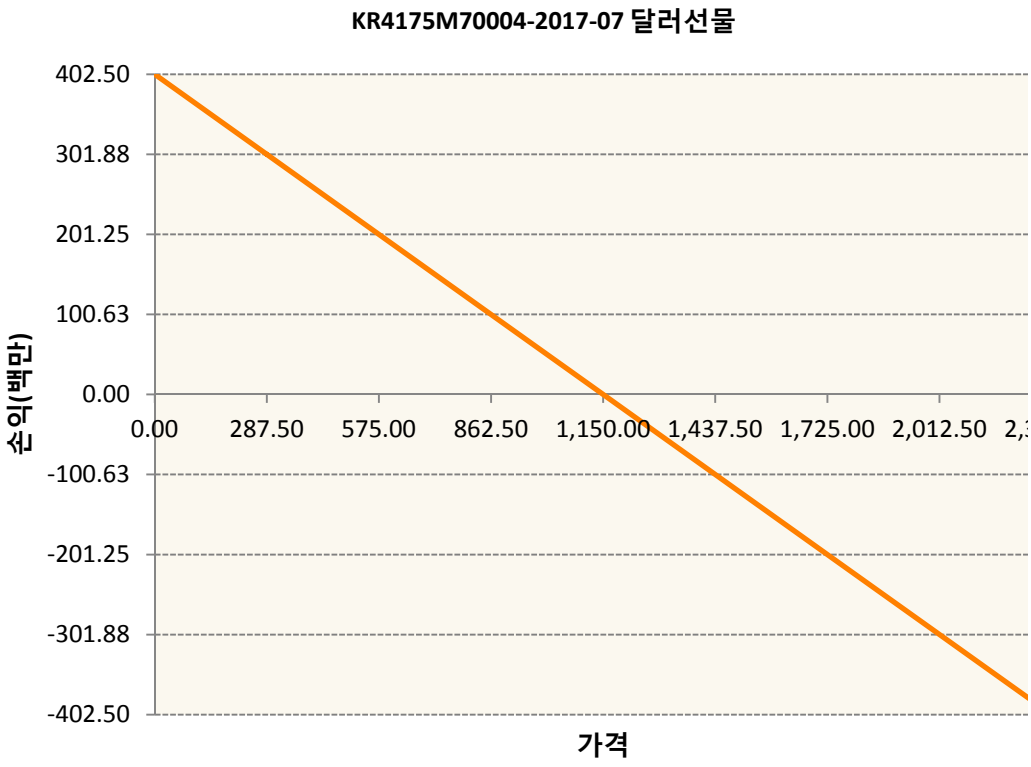


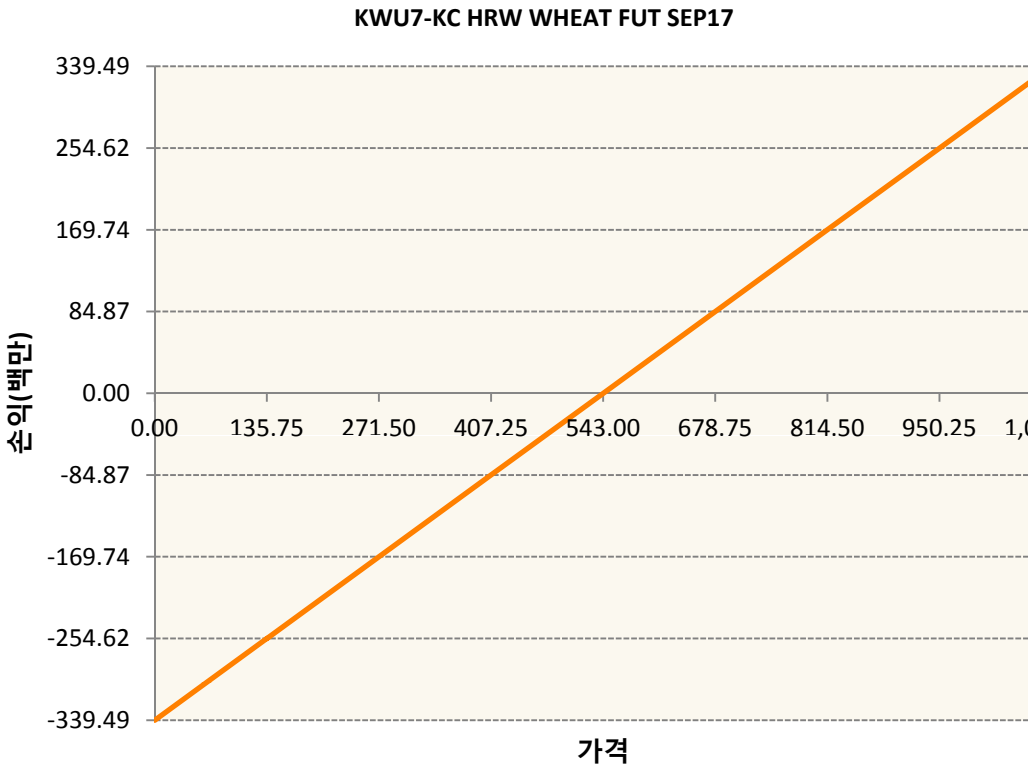

-235.40
-313.86
가격

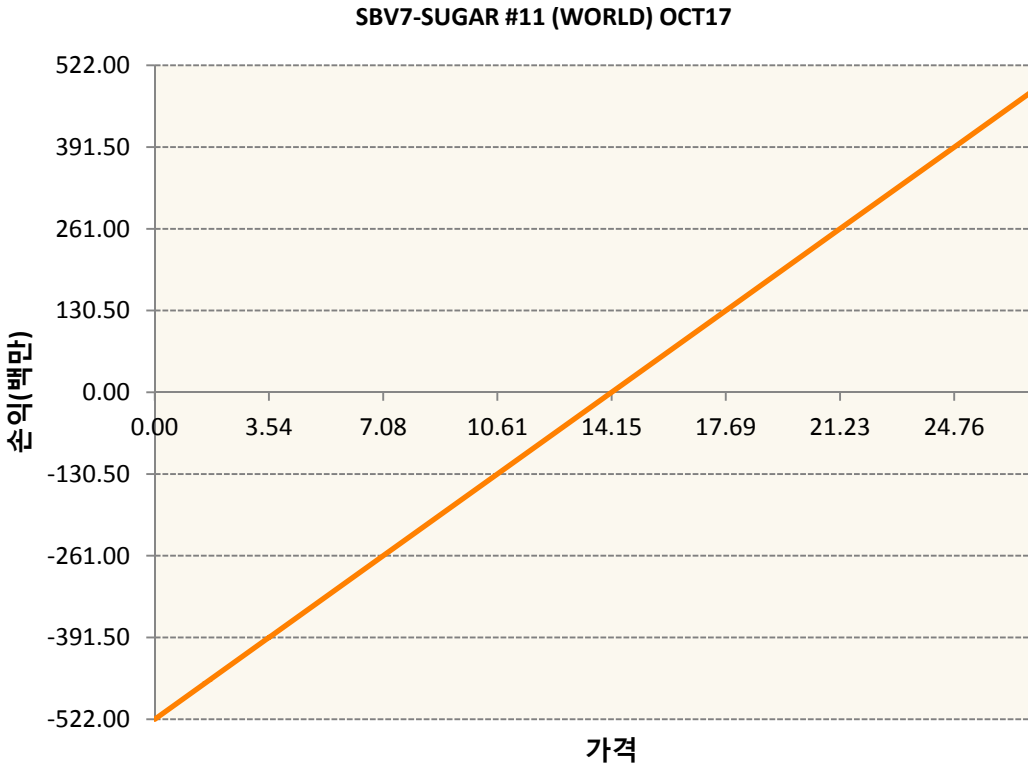

CU7-CORN FUTURE SEP17
1,871.74
1,403.80
935.87
467.93
0.00
-467.93
-935.87
-1,403.80
-1,871.74
0.00
98.13
196.25
294.38
392.50
490.63
588.75
686.88
손익(백만)
가격

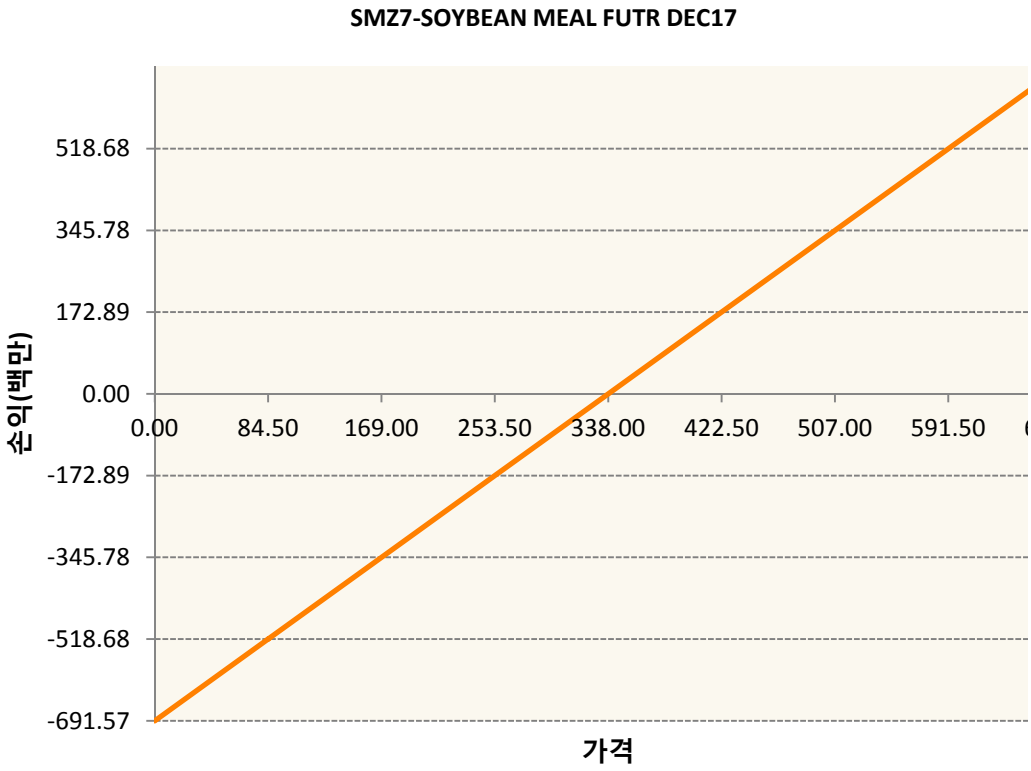

KCU7-COFFEE 'C' FUTURE SEP17
411.72
274.48
137.24
0.00
-137.24
-274.48
-411.72
-548.96
0.00
32.23
64.45
96.68
128.90
161.13
193.35
225.58
손익(백만)

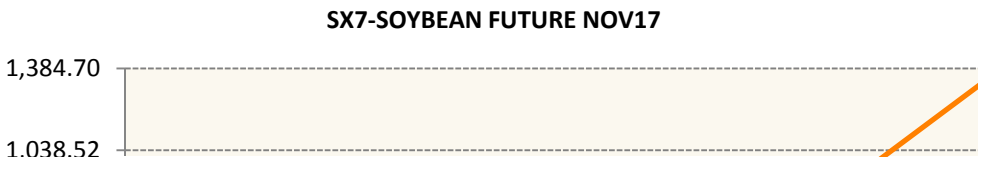
가격

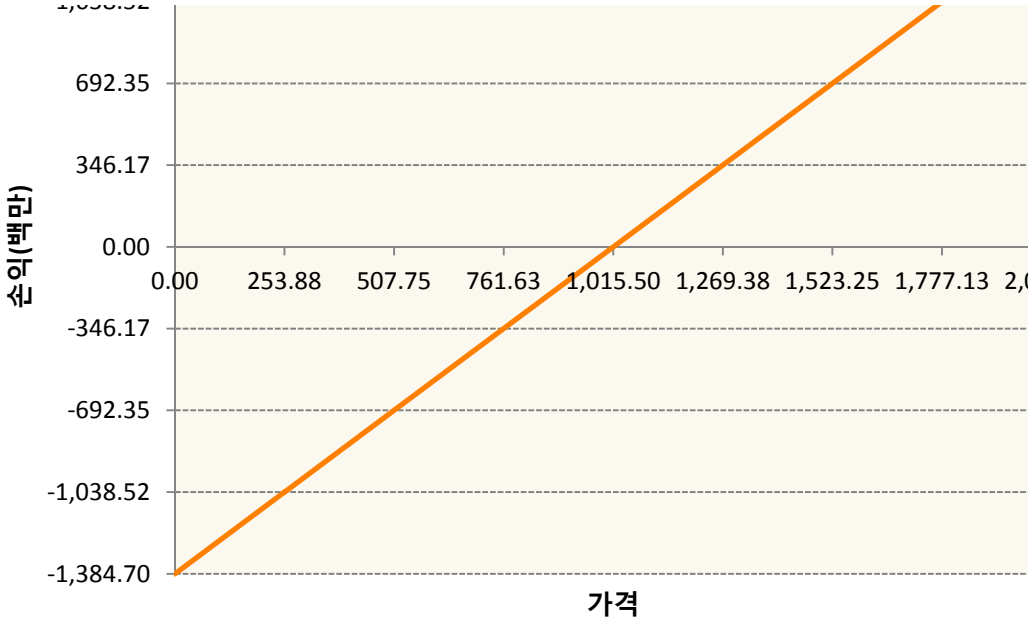

KR4175M70004-2017-07 달러선물
402.50
301.88
201.25
100.63
0.00
-100.63
-201.25
-301.88
-402.50
0.00
287.50
575.00
862.50
1,150.00
1,437.50
1,725.00
2,012.50
손익(백만)
가격

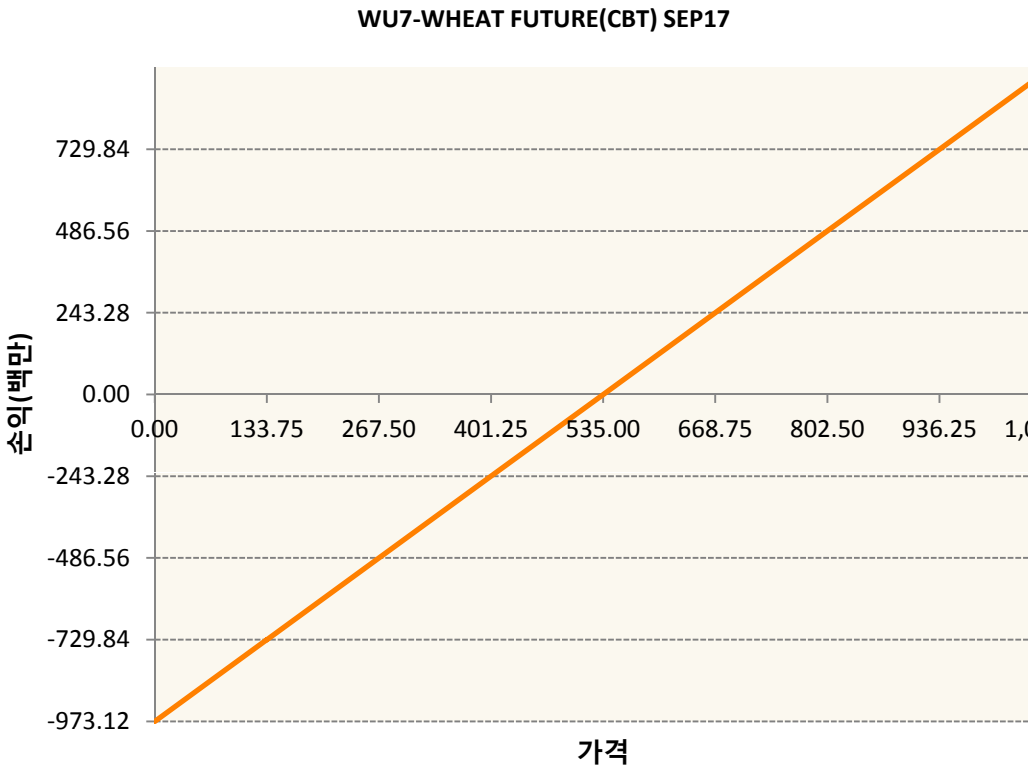

KWU7-KC HRW WHEAT FUT SEP17
339.49
254.62
169.74
84.87
0.00
-84.87
-169.74
-254.62
-339.49
0.00
135.75
271.50
407.25
543.00
678.75
814.50
950.25
손익(백만)
가격


SBV7-SUGAR #11 (WORLD) OCT17
522.00
391.50
261.00
130.50
0.00
-130.50
-261.00
-391.50
-522.00
0.00
3.54
7.08
10.61
14.15
17.69
21.23
24.76
손익(백만)
가격


SMZ7-SOYBEAN MEAL FUTR DEC17
518.68
345.78
172.89
0.00
-172.89
-345.78
-518.68
-691.57
0.00
84.50
169.00
253.50
338.00
422.50
507.00
591.50
손익(백만)
가격


SX7-SOYBEAN FUTURE NOV17
1,384.70
1,038.52





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
BOZ7	SOYBEAN OIL FUTR DEC17	49
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	27
SBV7	SUGAR #11 (WORLD) OCT17	42
SMZ7	SOYBEAN MEAL FUTR DEC17	55
SX7	SOYBEAN FUTURE NOV17	111
WU7	WHEAT FUTURE(CBT) SEP17	78

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

669