공시일	2017-07-12
기준일	2017-07-11

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	2017-07-12
기준일	2017-07-11

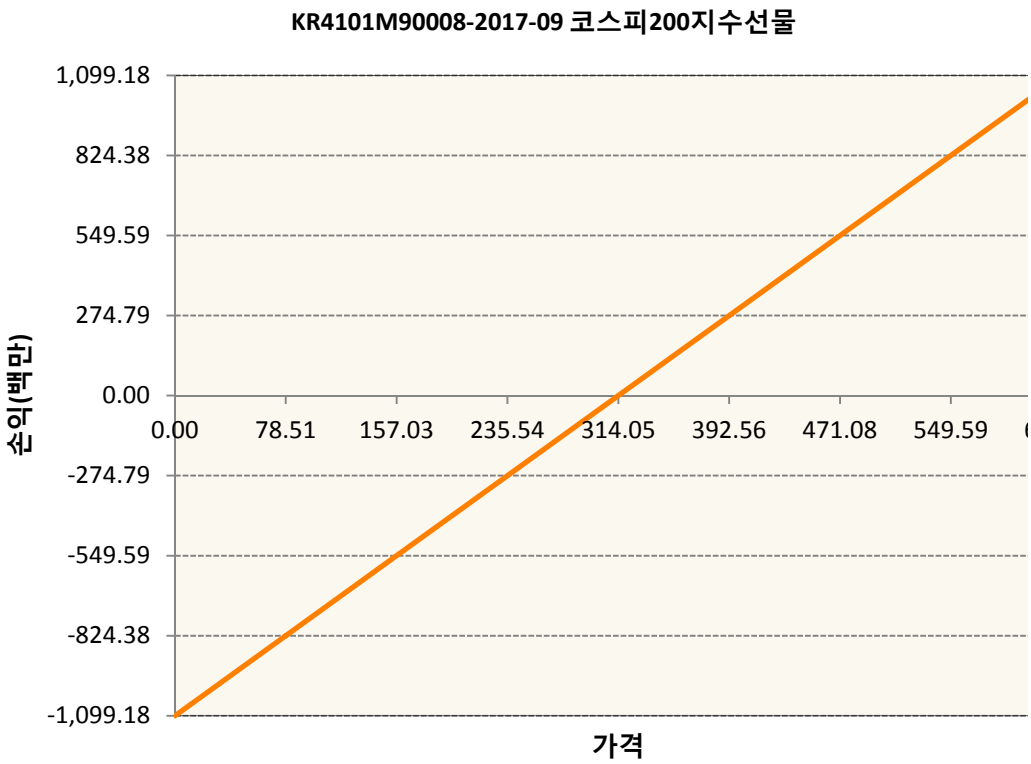
스마트인덱스모

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	1,099	0	1,099	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101M90(2017-09 코스피200지수선물							88
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-88	-88	-88	-88	-88	-88	-88
-5.33%	-59	-59	-59	-59	-59	-59	-59
-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%	59	59	59	59	59	59	59
8.00%	88	88	88	88	88	88	88

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

53

공시일	2017-07-12
기준일	2017-07-11

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	998

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

480

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-07-12
기준일	2017-07-11

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	380

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

320

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-07-12
기준일	2017-07-11

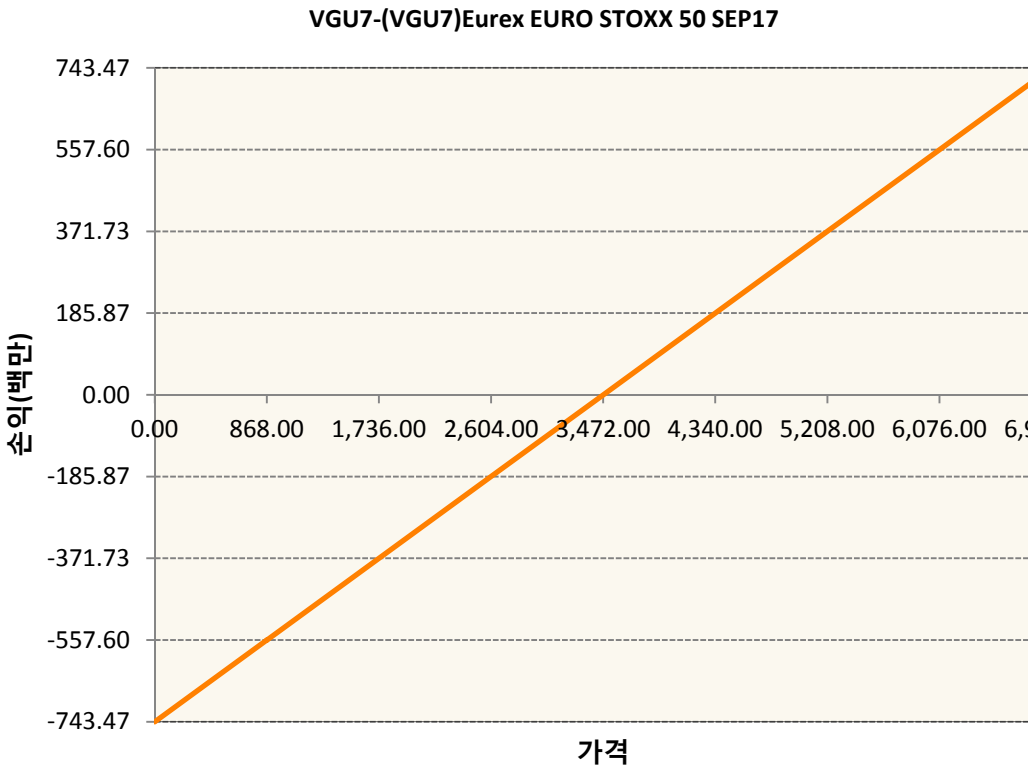
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	743	0	743	

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)

51

공시일	2017-07-12
기준일	2017-07-11

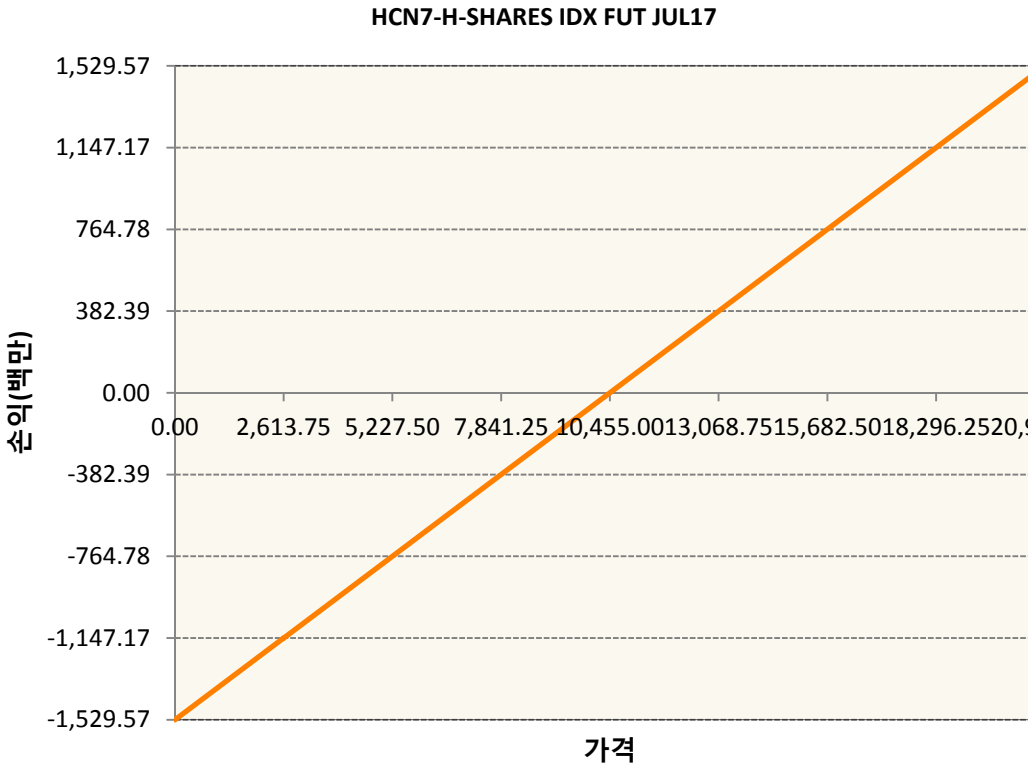
차이나인덱스모(주식-파생형)

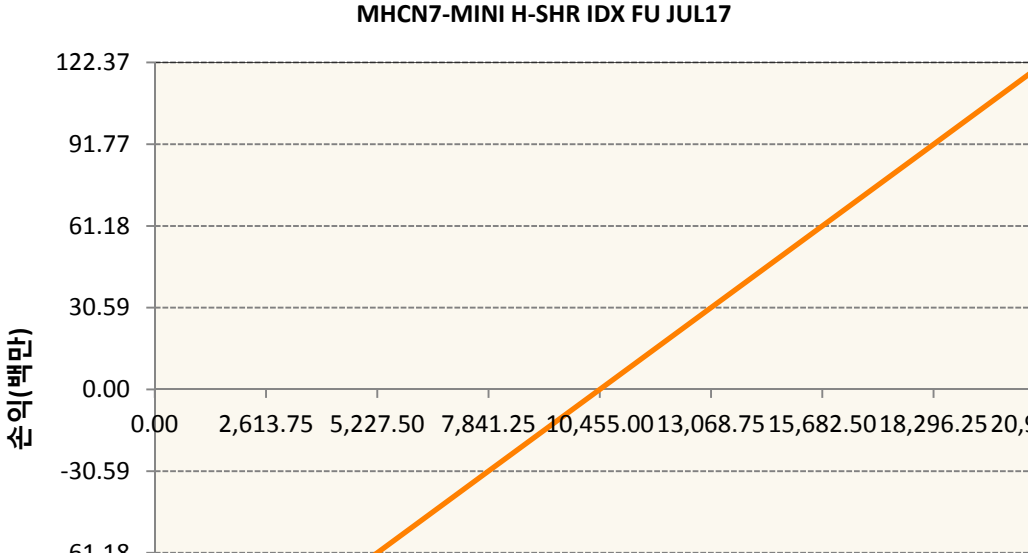
1. 계약금액

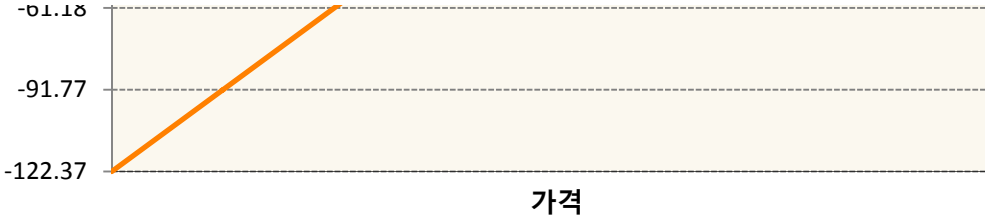
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,652	0	1,652	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCN7	H-SHARES IDX FUT JUL17	122
MHCN7	MINI H-SHR IDX FU JUL17	10

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	127

공시일	2017-07-12
기준일	2017-07-11

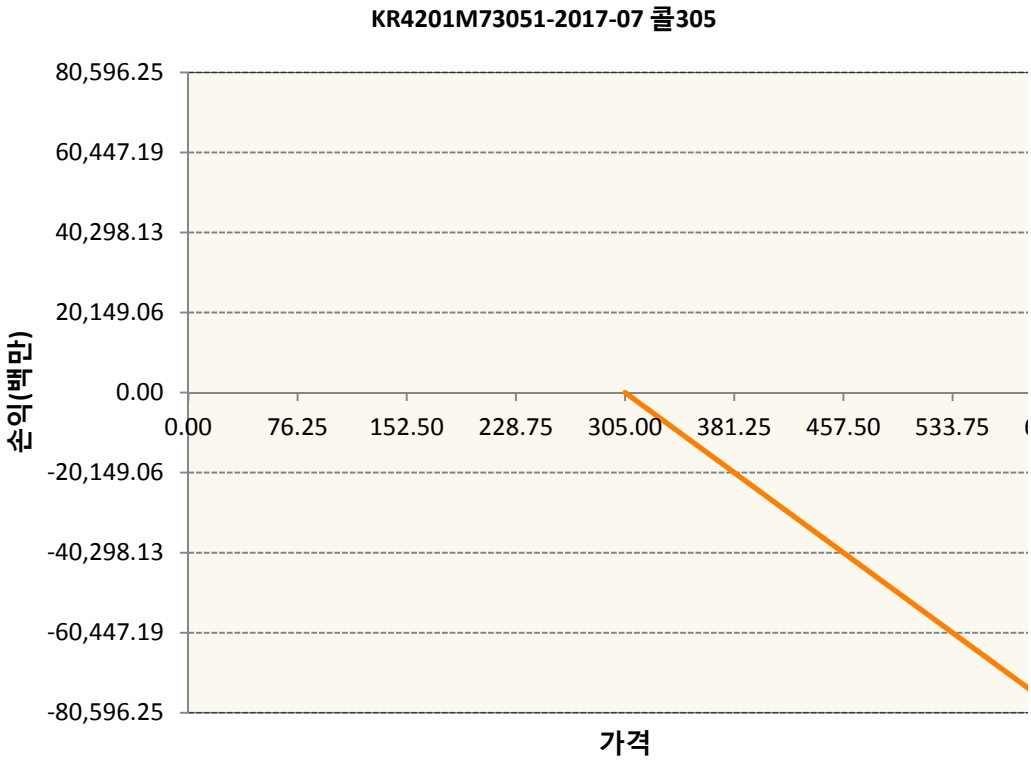
커버드콜모(주식혼합-파생형)

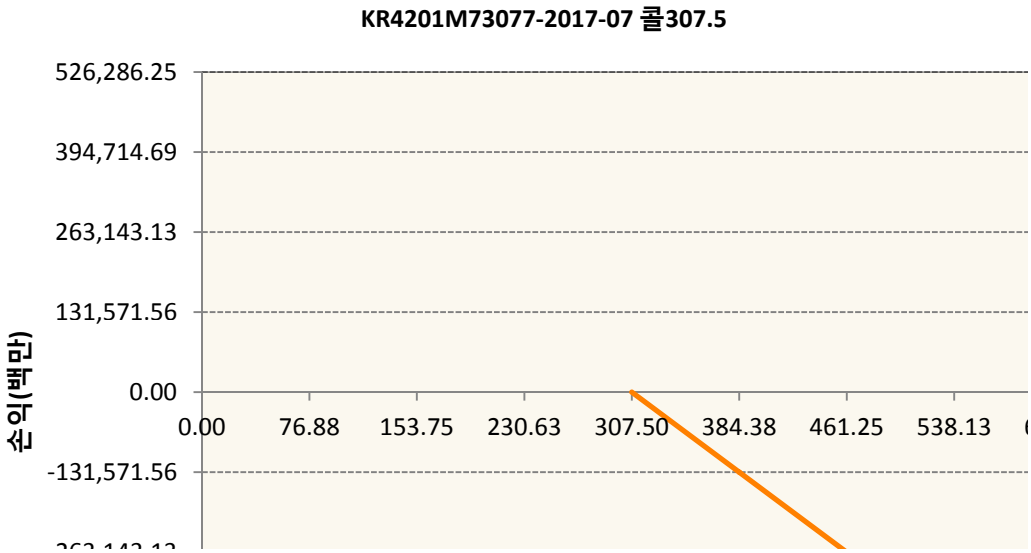
1. 계약금액

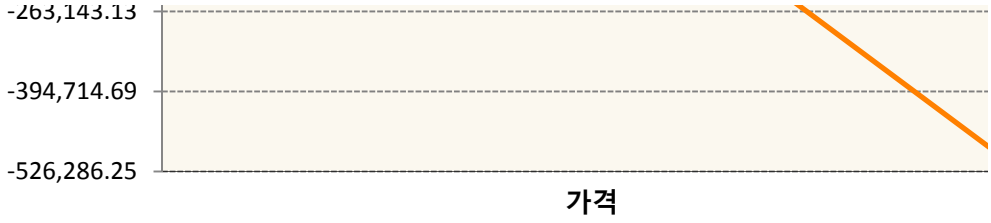
(단위:백만원)

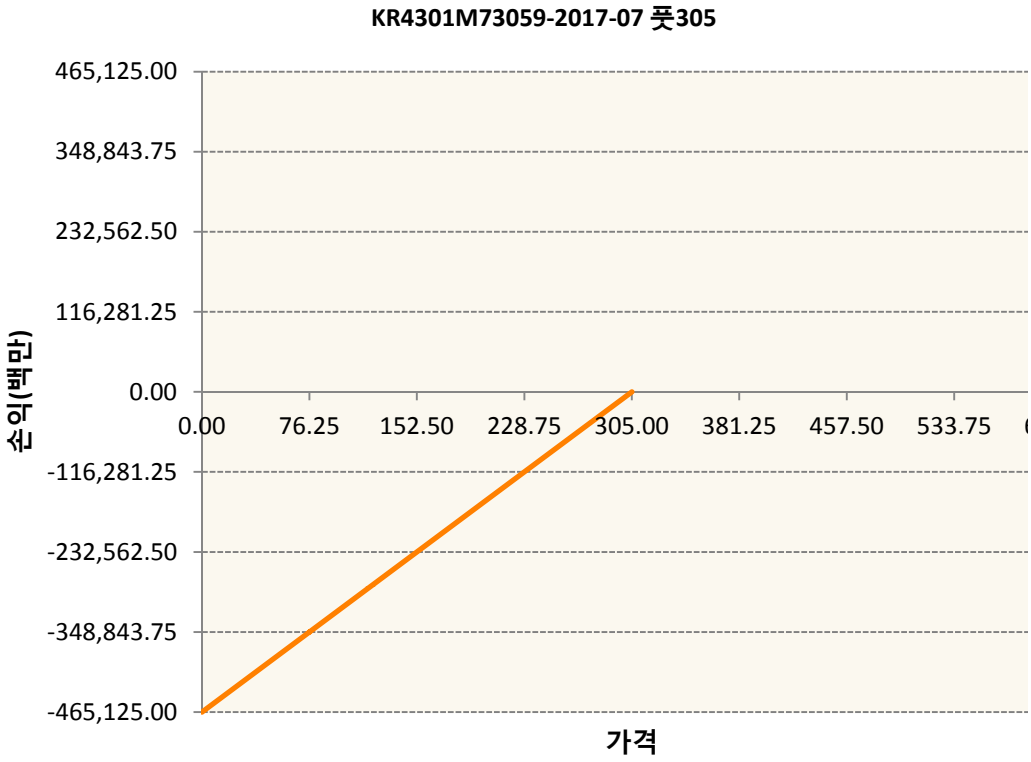
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	23,458	-23,458	장내
누계	유가증권	옵션	0	1,118,133	-1,118,133	장내

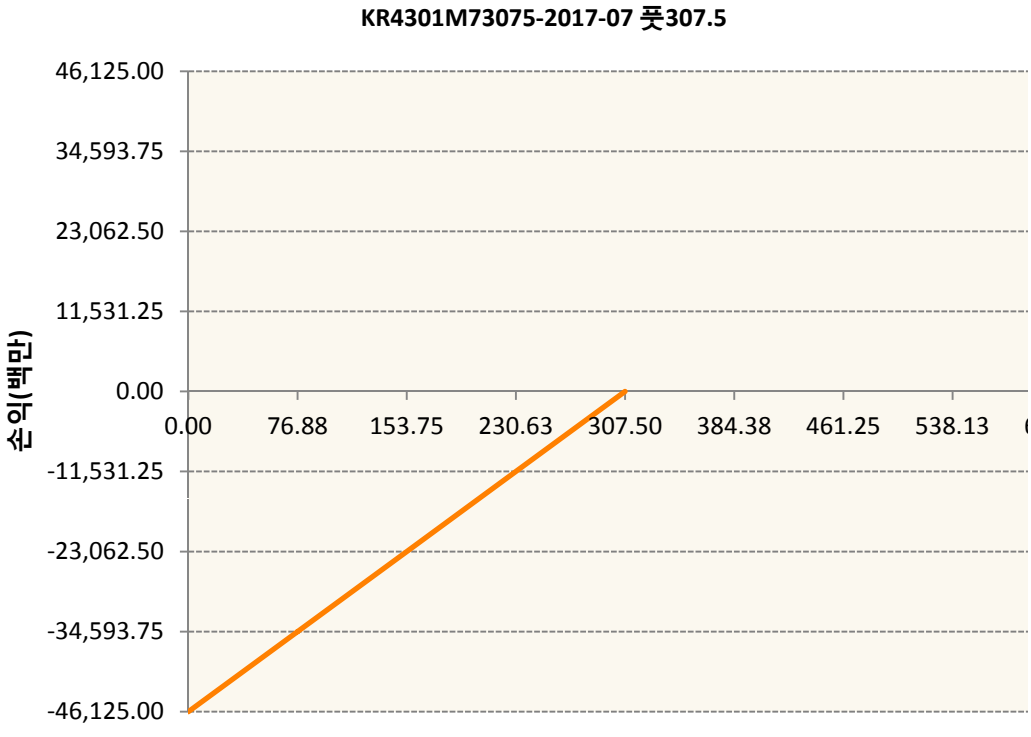
2. 만기시점의 손익구조






-263,143.13
-394,714.69
-526,286.25
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						6,595
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	2,303	2,303	2,303	2,303	2,302	2,301	2,300
-5.33%	2,296	2,289	2,279	2,267	2,252	2,234	2,214
-2.67%	1,852	1,806	1,759	1,713	1,666	1,619	1,573
0%	27	21	12	0	-15	-32	-52
2.67%	-2,176	-2,176	-2,176	-2,177	-2,177	-2,178	-2,180
5.33%	-4,386	-4,386	-4,386	-4,386	-4,386	-4,386	-4,386
8.00%	-6,595	-6,595	-6,595	-6,595	-6,595	-6,595	-6,595
KR4201M73(	2017-07 콜307.5						42,331
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	11,023	11,023	11,023	11,023	11,022	11,021	11,018
-5.33%	11,016	11,004	10,983	10,951	10,905	10,846	10,772
-2.67%	9,808	9,545	9,276	9,001	8,722	8,440	8,155
0%	400	288	154	0	-171	-358	-557
2.67%	-13,709	-13,710	-13,714	-13,721	-13,734	-13,754	-13,782
5.33%	-28,020	-28,020	-28,020	-28,020	-28,020	-28,020	-28,021
8.00%	-42,331	-42,331	-42,331	-42,331	-42,331	-42,331	-42,331
KR4301M73(	2017-07 풋305						25,156
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-25,156	-25,156	-25,156	-25,156	-25,156	-25,156	-25,156
-5.33%	-12,405	-12,405	-12,405	-12,406	-12,408	-12,412	-12,418
-2.67%	-1,077	-1,214	-1,352	-1,489	-1,627	-1,765	-1,902
0%	1	1	1	0	-2	-5	-10
2.67%	1	1	1	1	1	1	1
5.33%	1	1	1	1	1	1	1
8.00%	1	1	1	1	1	1	1
KR4301M73(	2017-07 풋307.5						2,847
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-2,847	-2,847	-2,847	-2,847	-2,847	-2,847	-2,847
-5.33%	-1,593	-1,593	-1,593	-1,593	-1,593	-1,593	-1,593
-2.67%	-360	-368	-376	-386	-396	-406	-417
0%	2	2	1	0	-2	-4	-6
2.67%	2	2	2	2	2	2	2

5.33%	2	2	2	2	2	2	2
8.00%	2	2	2	2	2	2	2

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

76,508

공시일	2017-07-12
기준일	2017-07-11

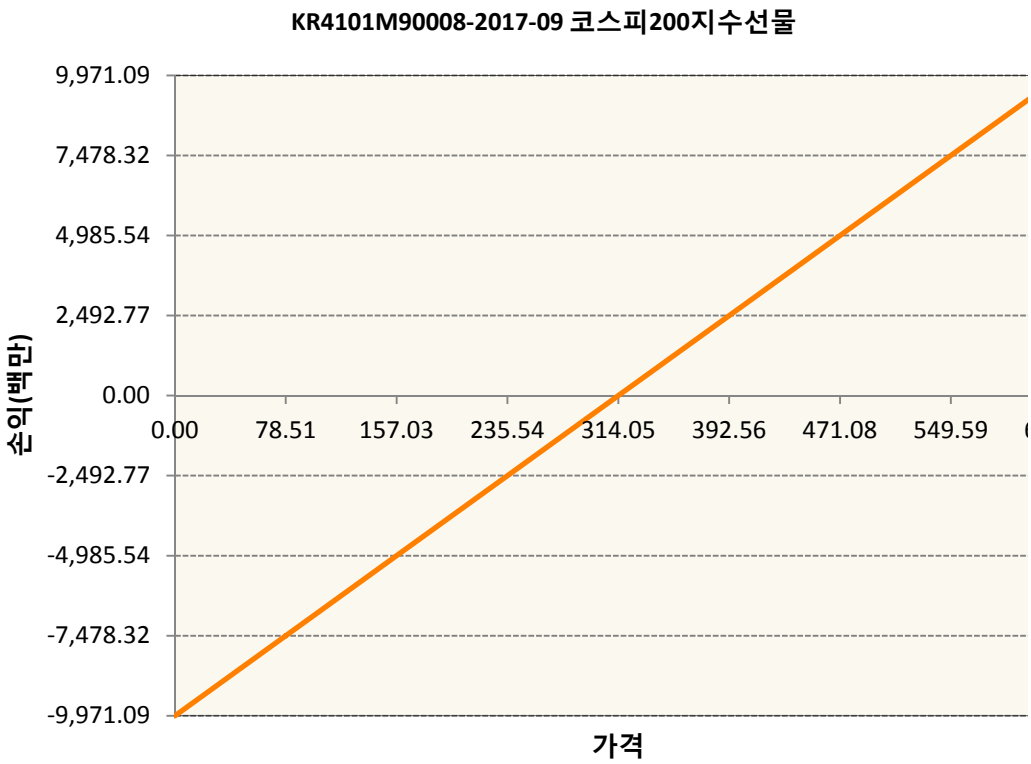
ETF스마트레버리지목표전환형6호

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	9,971	0	9,971	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101M90(2017-09 코스피200지수선물							797
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-797	-797	-797	-797	-797	-797	-797
-5.33%	-531	-531	-531	-531	-531	-531	-531
-2.67%	-266	-266	-266	-266	-266	-266	-266
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	266	266	266	266	266	266	266
5.33%	531	531	531	531	531	531	531
8.00%	797	797	797	797	797	797	797

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

481

공시일	2017-07-12
기준일	2017-07-11

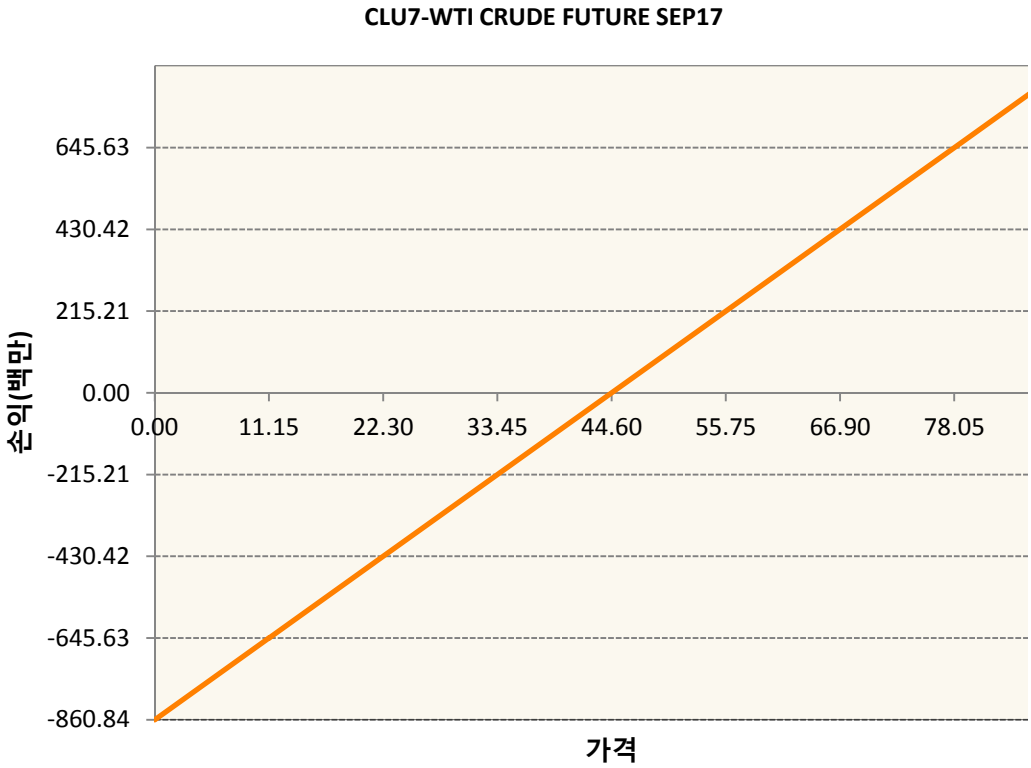
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

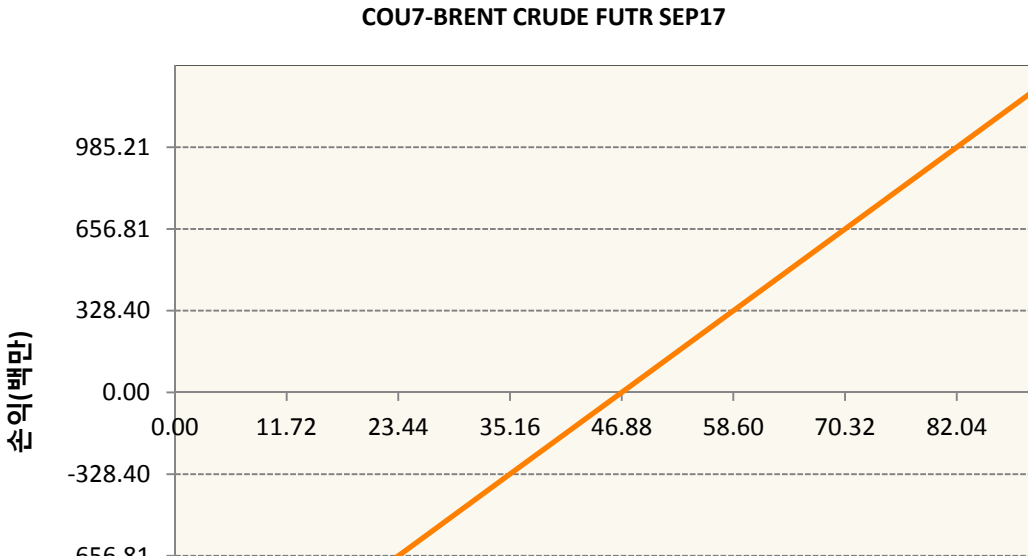
1. 계약금액

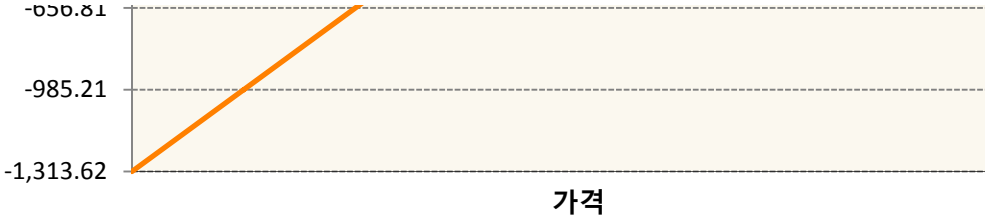
(단위:백만원)

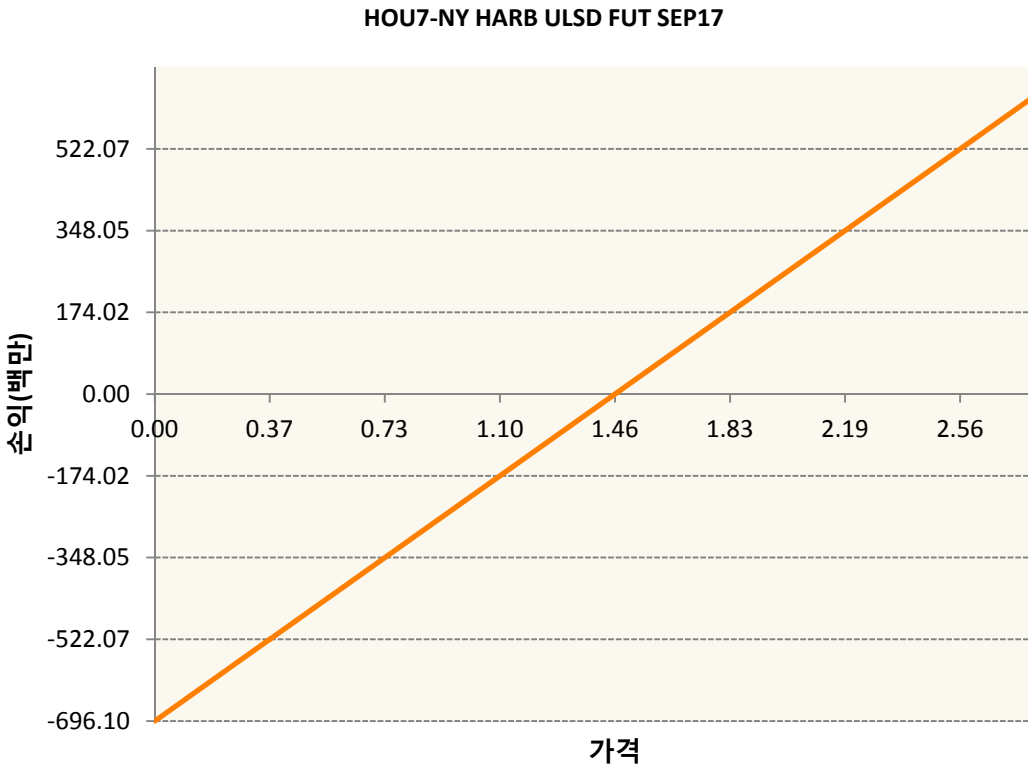
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	4,973	230	4,743	

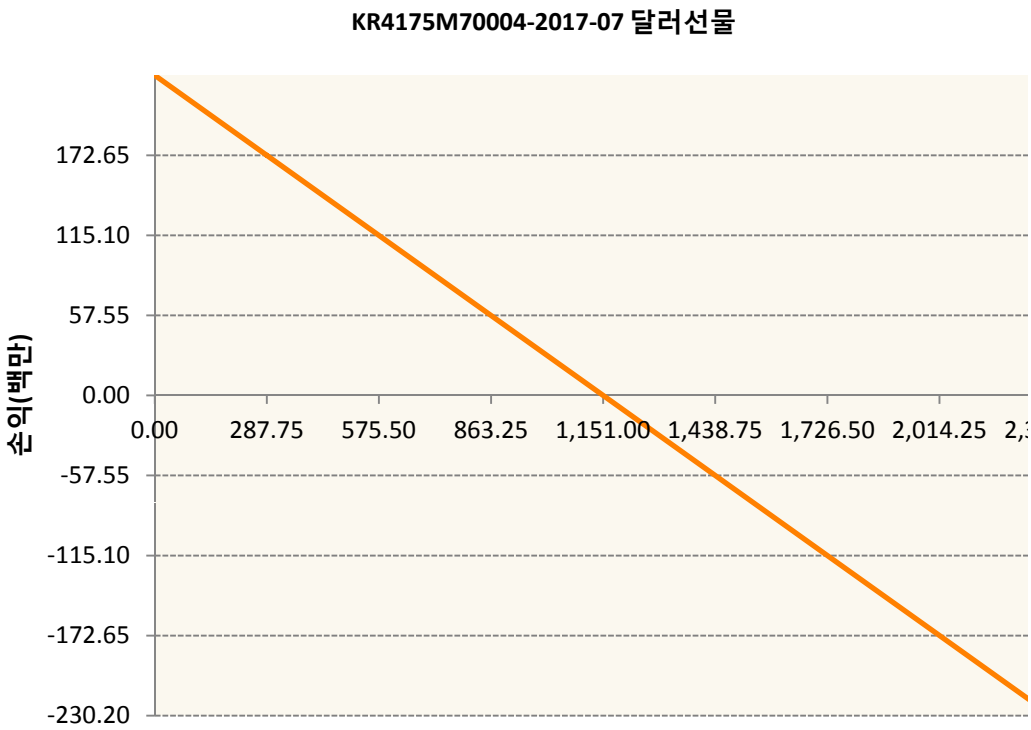
2. 만기시점의 손익구조



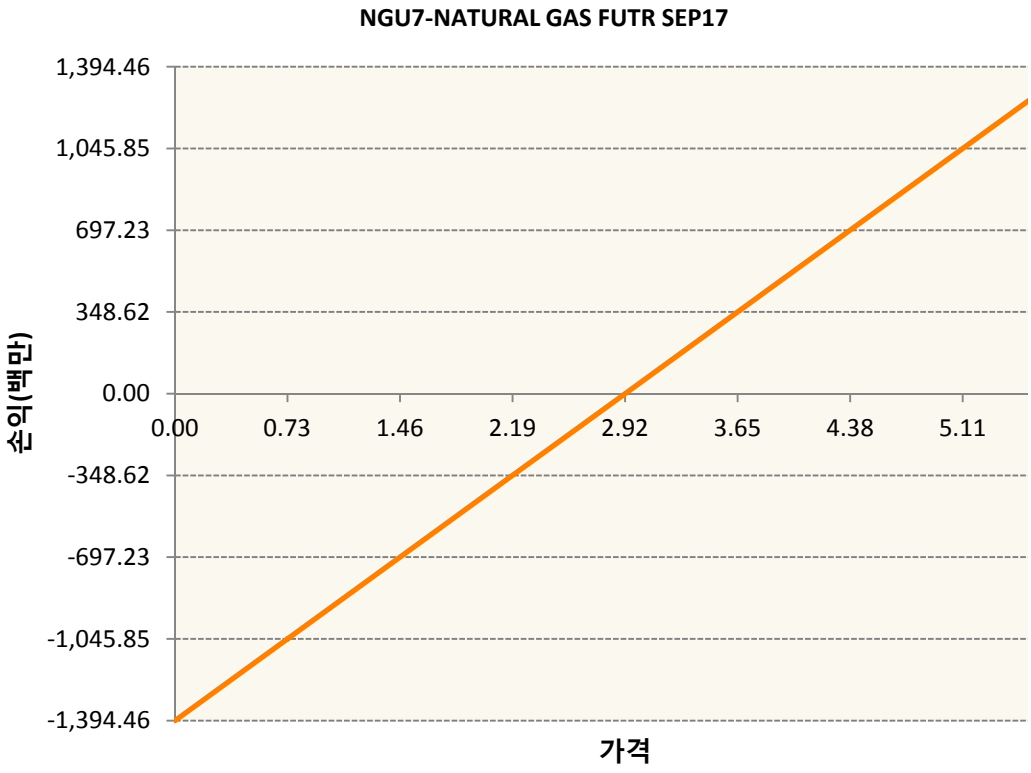


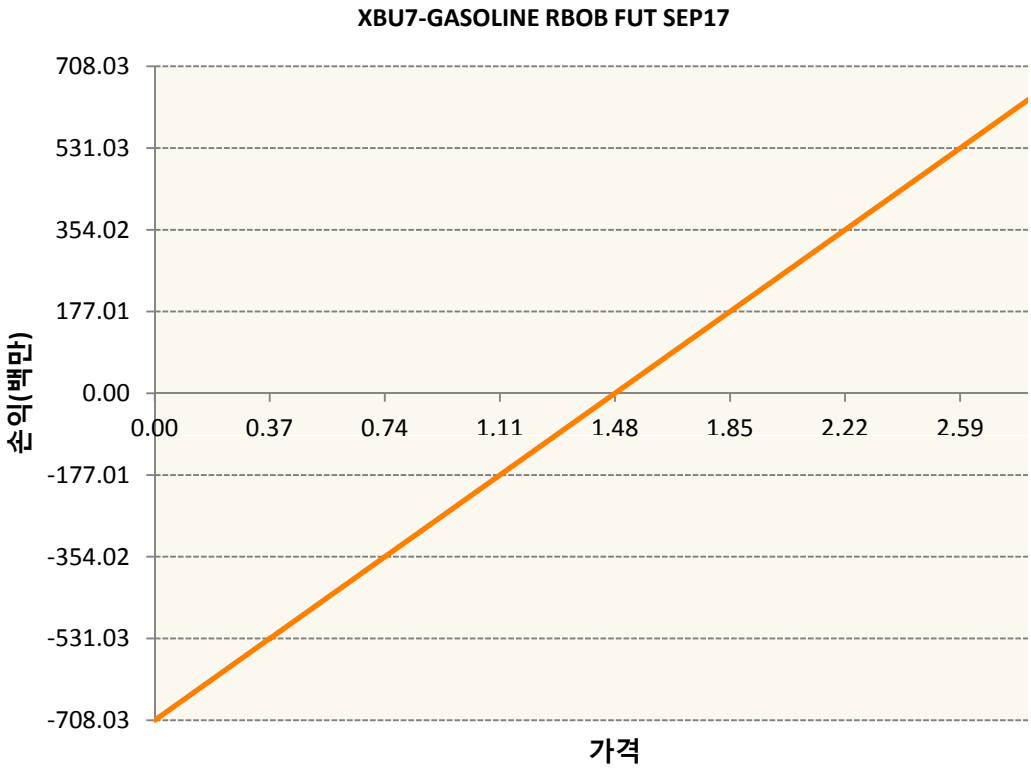

-656.81
-985.21
-1,313.62
가격


HOU7-NY HARB ULSD FUT SEP17
522.07
348.05
174.02
0.00
-174.02
-348.05
-522.07
-696.10
0.00
0.37
0.73
1.10
1.46
1.83
2.19
2.56
손익(백만)
가격


KR4175M70004-2017-07 달러선물
172.65
115.10
57.55
0.00
-57.55
-115.10
-172.65
-230.20
0.00
287.75
575.50
863.25
1,151.00
1,438.75
1,726.50
2,014.25
손익(백만)

가격


NGU7-NATURAL GAS FUTR SEP17
1,394.46
1,045.85
697.23
348.62
0.00
-348.62
-697.23
-1,045.85
-1,394.46
0.00
0.73
1.46
2.19
2.92
3.65
4.38
5.11
손익(백만)
가격


XBU7-GASOLINE RBOB FUT SEP17
708.03
531.03
354.02
177.01
0.00
-177.01
-354.02
-531.03
-708.03
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	56
KR4175M70(	2017-07 달러선물	18
NGU7	NATURAL GAS FUTR SEP17	112
XBU7	GASOLINE RBOB FUT SEP17	57

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

770

공시일	2017-07-12
기준일	2017-07-11

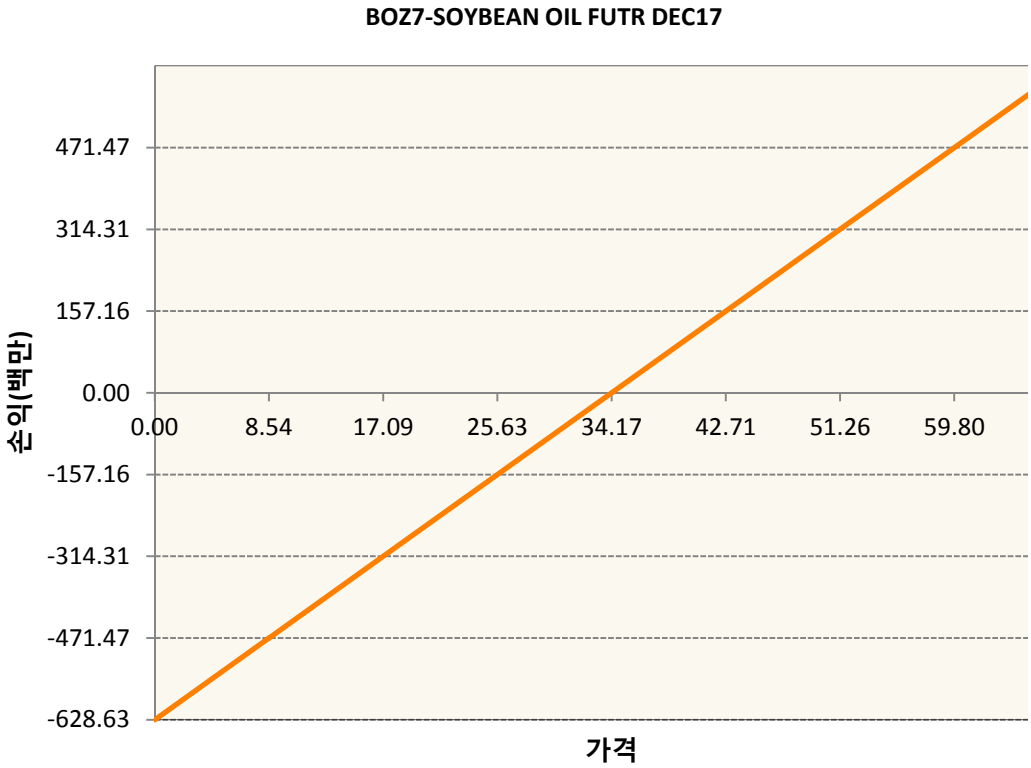
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

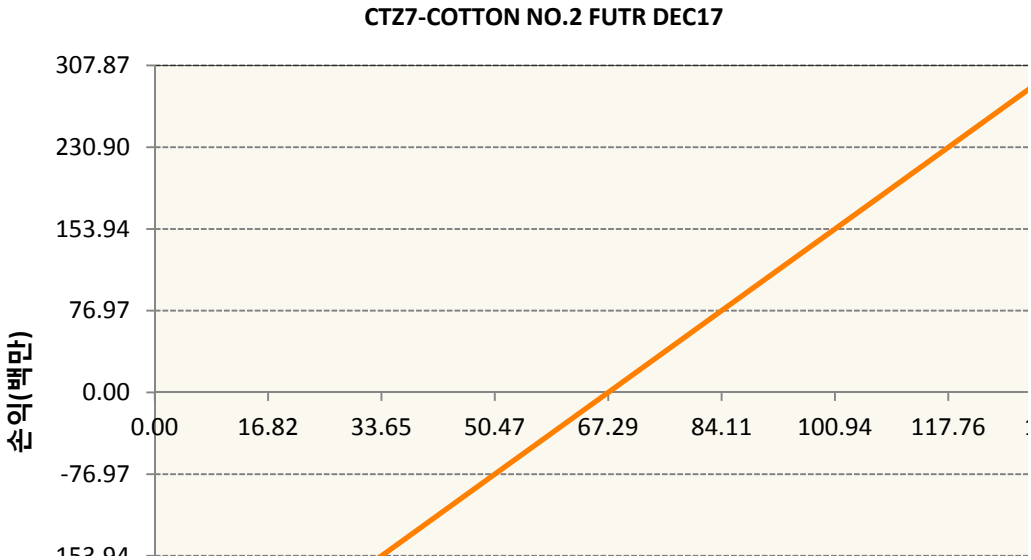
1. 계약금액

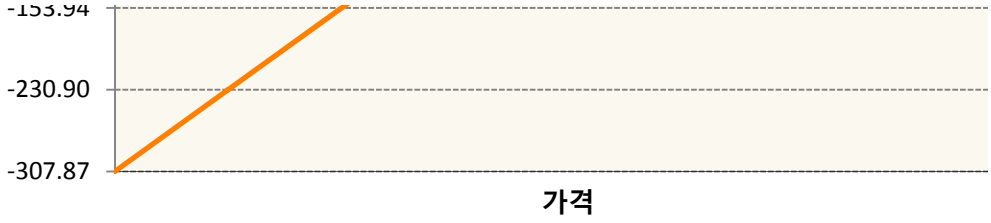
(단위:백만원)

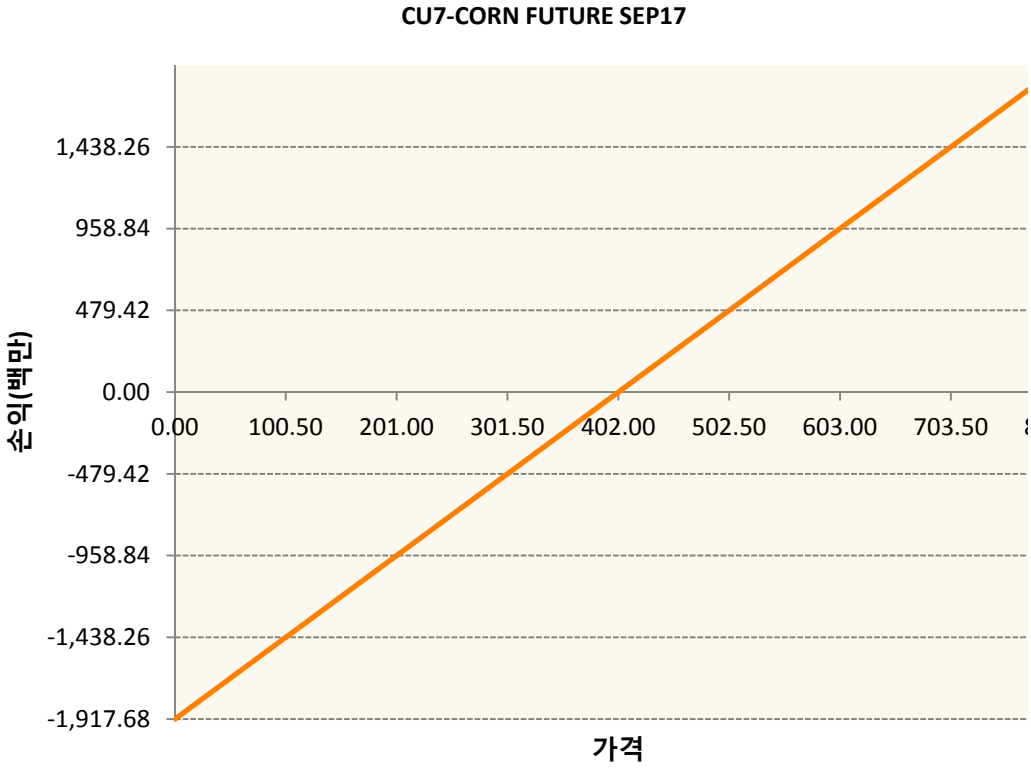
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	7,376	403	6,973	

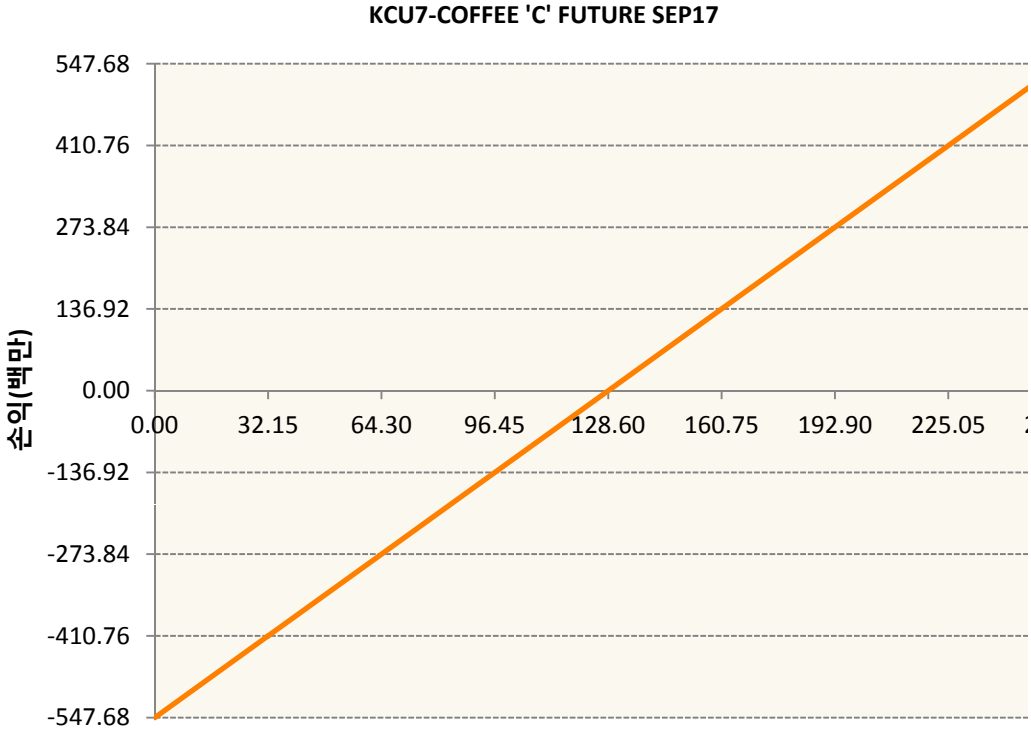
2. 만기시점의 손익구조





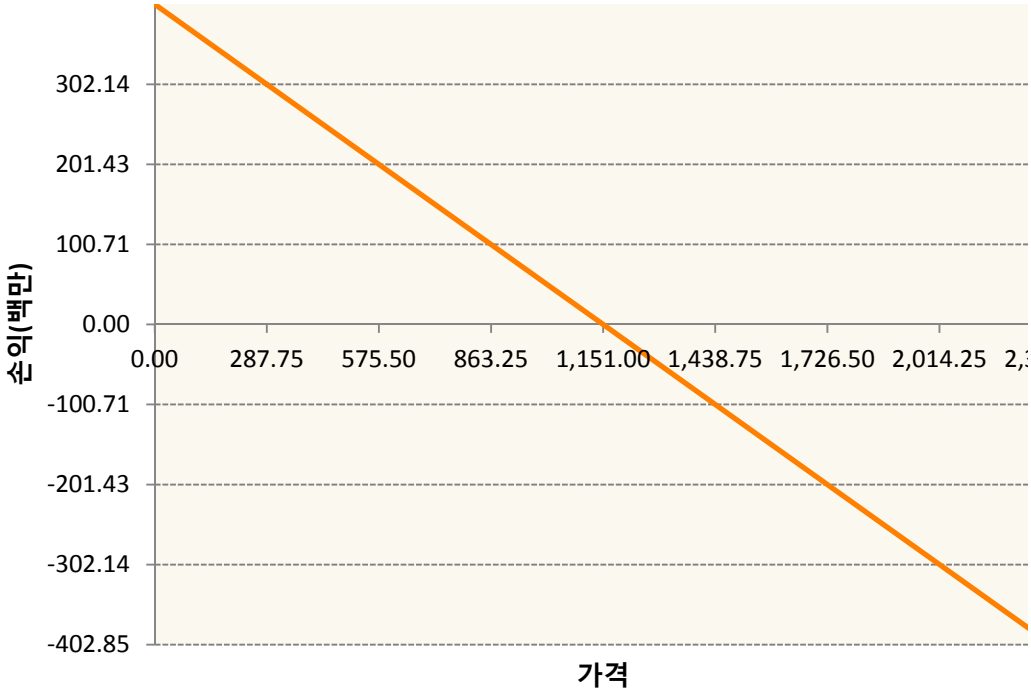

-153.94
-230.90
-307.87
가격


CU7-CORN FUTURE SEP17
1,438.26
958.84
479.42
0.00
-479.42
-958.84
-1,438.26
-1,917.68
0.00
100.50
201.00
301.50
402.00
502.50
603.00
703.50
순익(백만)
가격

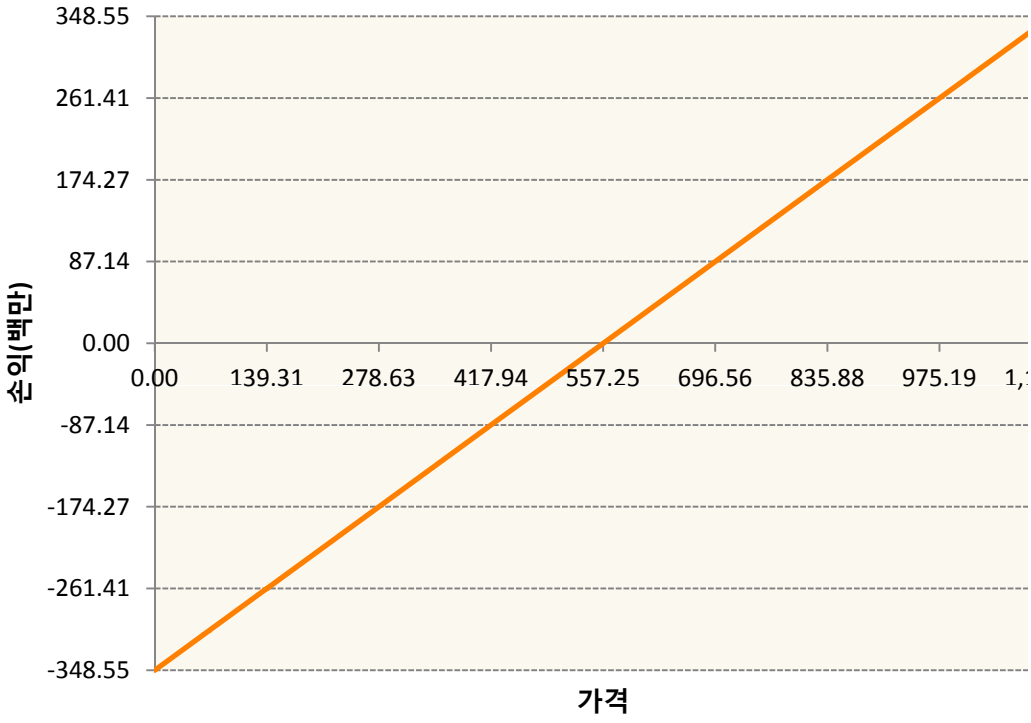

KCU7-COFFEE 'C' FUTURE SEP17
547.68
410.76
273.84
136.92
0.00
-136.92
-273.84
-410.76
-547.68
0.00
32.15
64.30
96.45
128.60
160.75
192.90
225.05
순익(백만)

가격

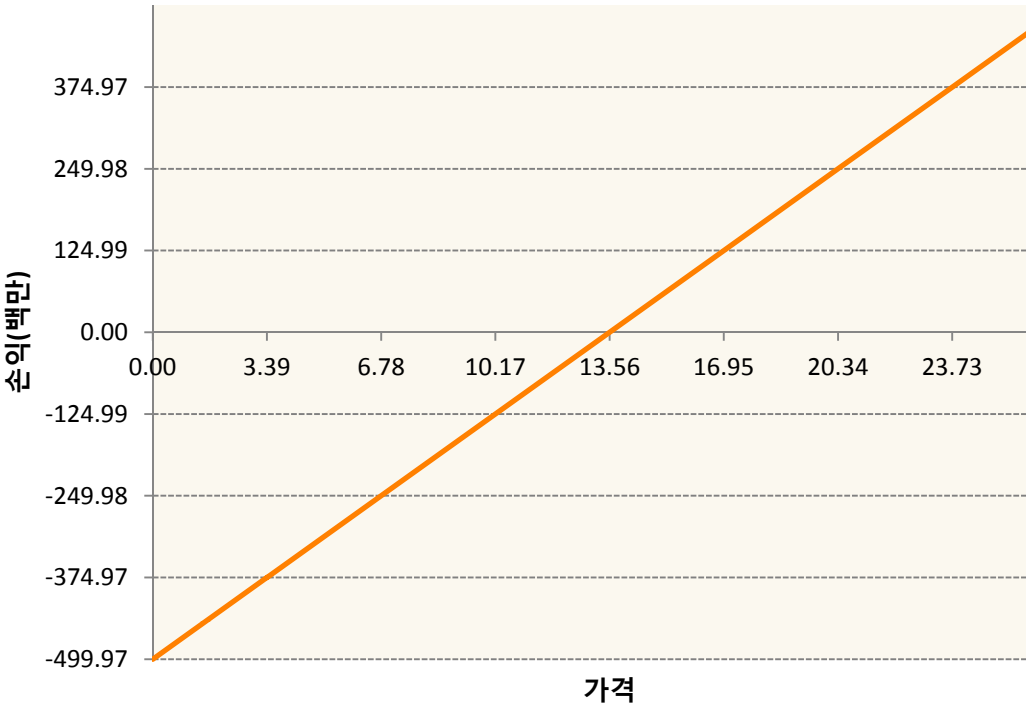
KR4175M70004-2017-07 달러선물



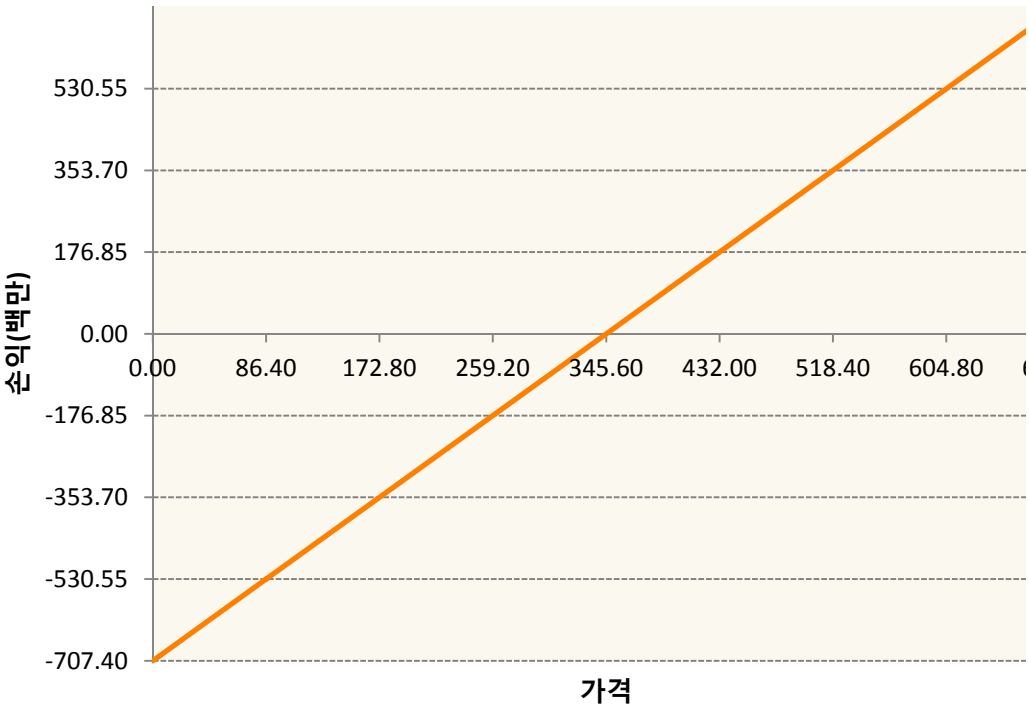
KWU7-KC HRW WHEAT FUT SEP17



SBV7-SUGAR #11 (WORLD) OCT17

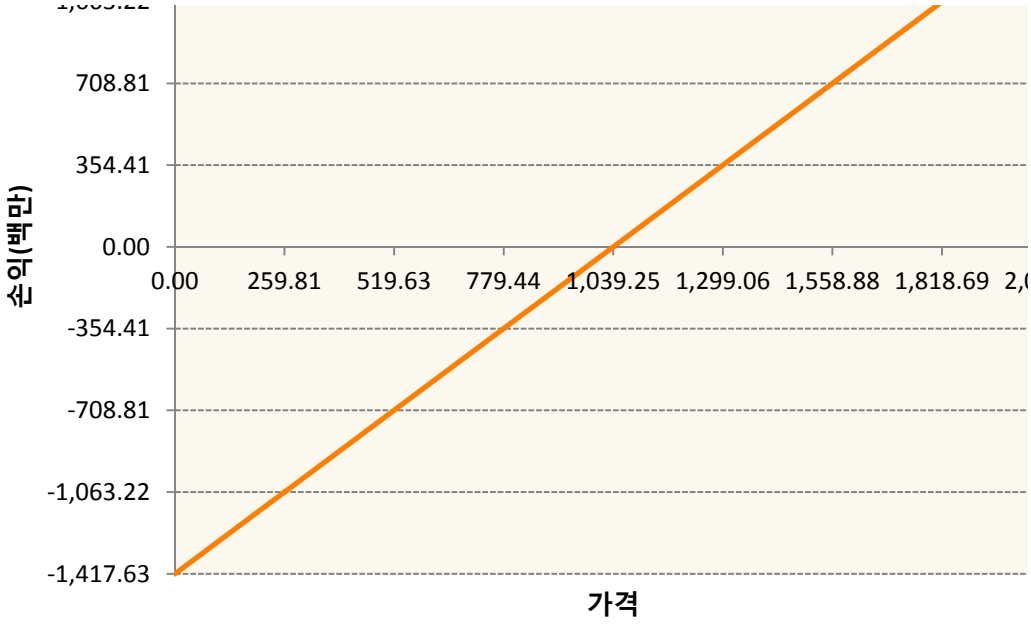


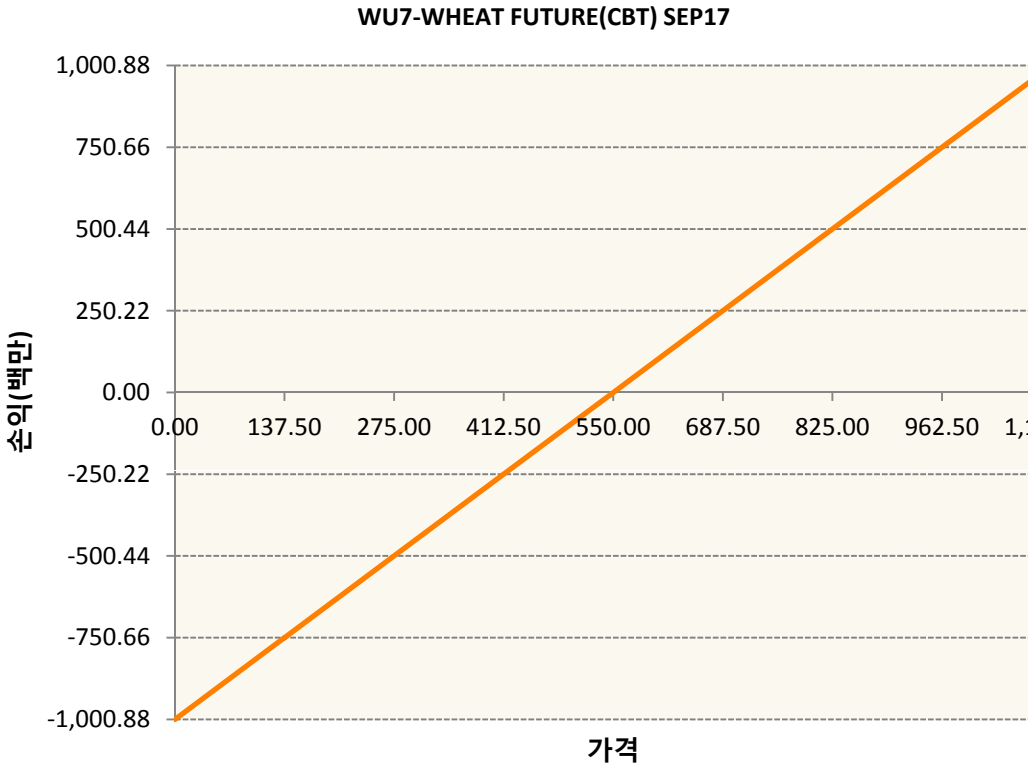
SMZ7-SOYBEAN MEAL FUTR DEC17



SX7-SOYBEAN FUTURE NOV17







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

BOZ7	SOYBEAN OIL FUTR DEC17	50
CTZ7	COTTON NO.2 FUTR DEC17	25
CU7	CORN FUTURE SEP17	153
KCU7	COFFEE 'C' FUTURE SEP17	44
KR4175M70(	2017-07 달러선물	32

KWU7	KC HRW WHEAT FUT SEP17	28
SBV7	SUGAR #11 (WORLD) OCT17	40
SMZ7	SOYBEAN MEAL FUTR DEC17	57
SX7	SOYBEAN FUTURE NOV17	113
WU7	WHEAT FUTURE(CBT) SEP17	80

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

682