공시일	2017-07-13
기준일	2017-07-12

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	2017-07-13
기준일	2017-07-12

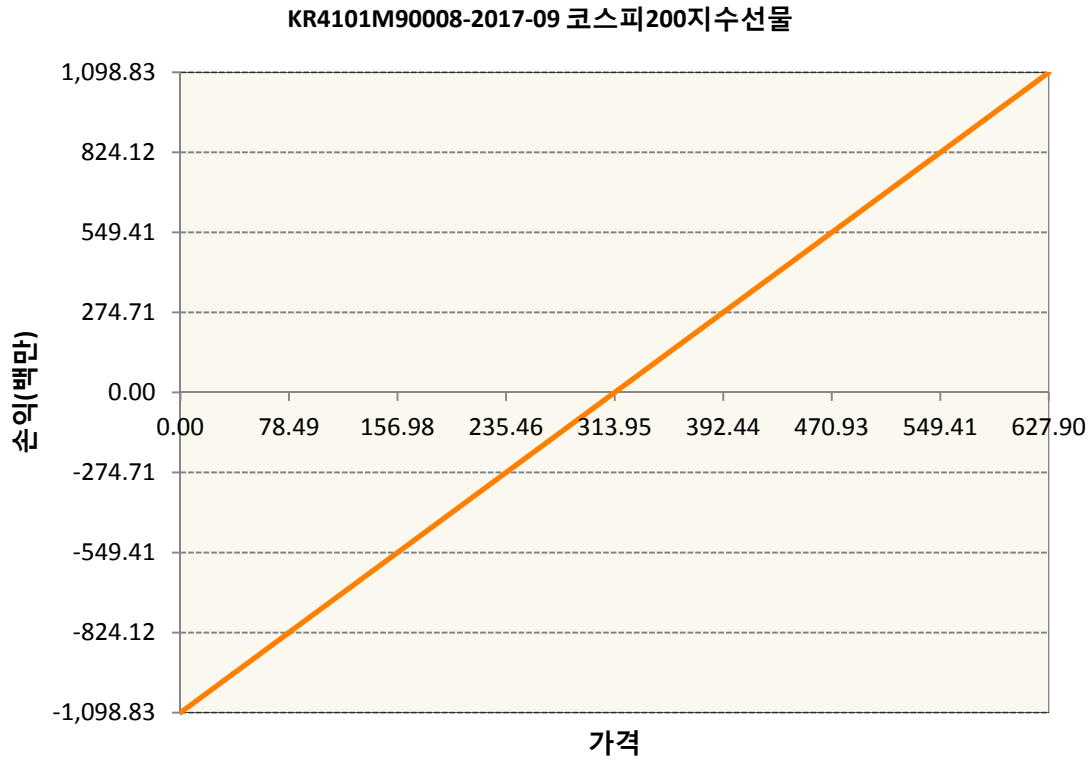
스마트인덱스모

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	2017-07-13
기준일	2017-07-12

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	997

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

479

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-07-13
기준일	2017-07-12

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)

322

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-07-13
기준일	2017-07-12

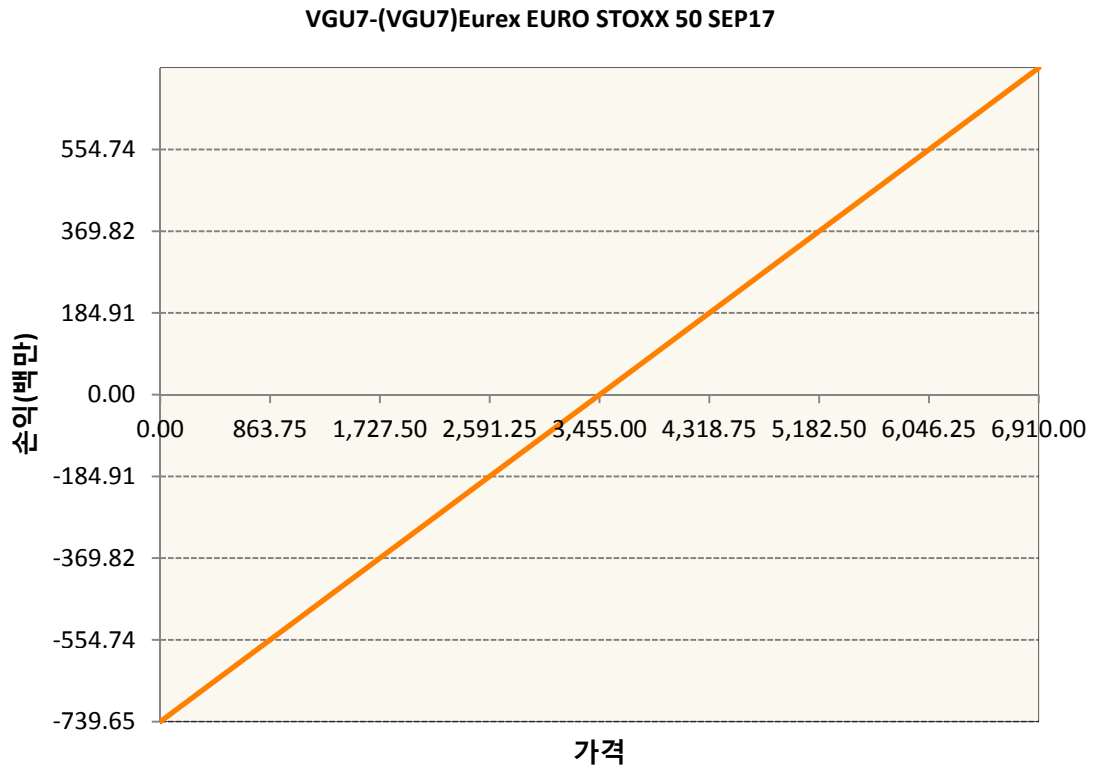
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	740	0	740	

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	2017-07-13
기준일	2017-07-12

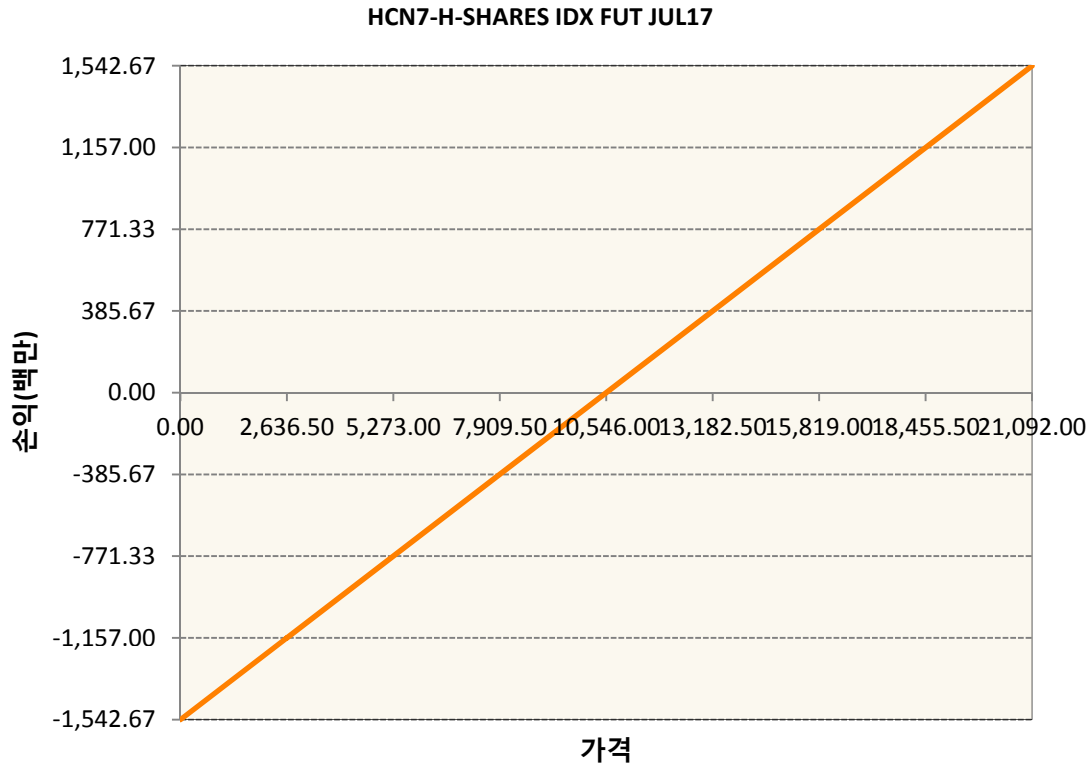
차이나인덱스모(주식-파생형)

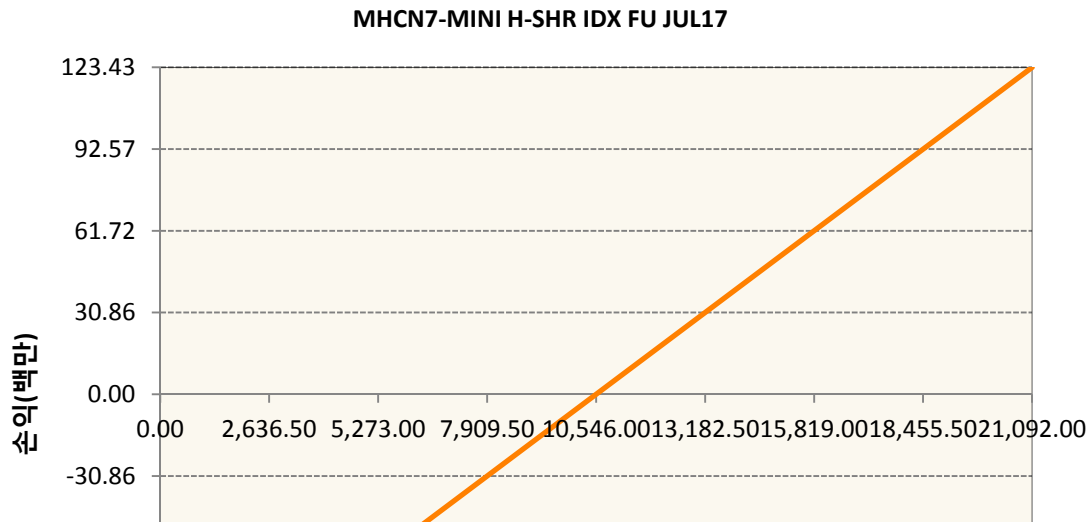
1. 계약금액

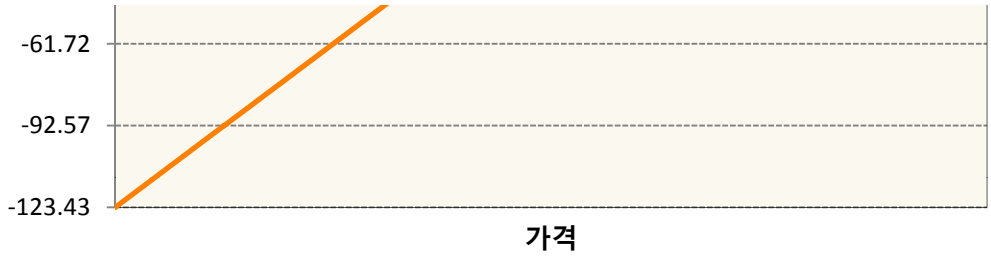
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,666	0	1,666	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCN7	H-SHARES IDX FUT JUL17	123
MHCN7	MINI H-SHR IDX FU JUL17	10

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	129

공시일	2017-07-13
기준일	2017-07-12

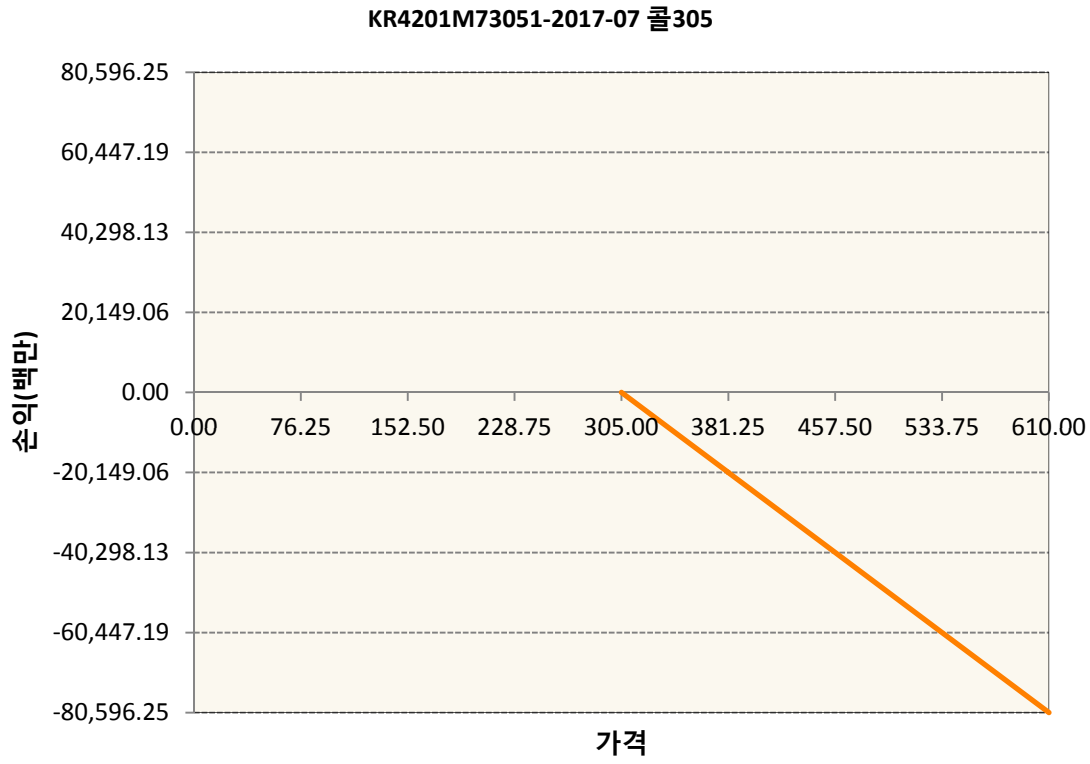
커버드콜모(주식혼합-파생형)

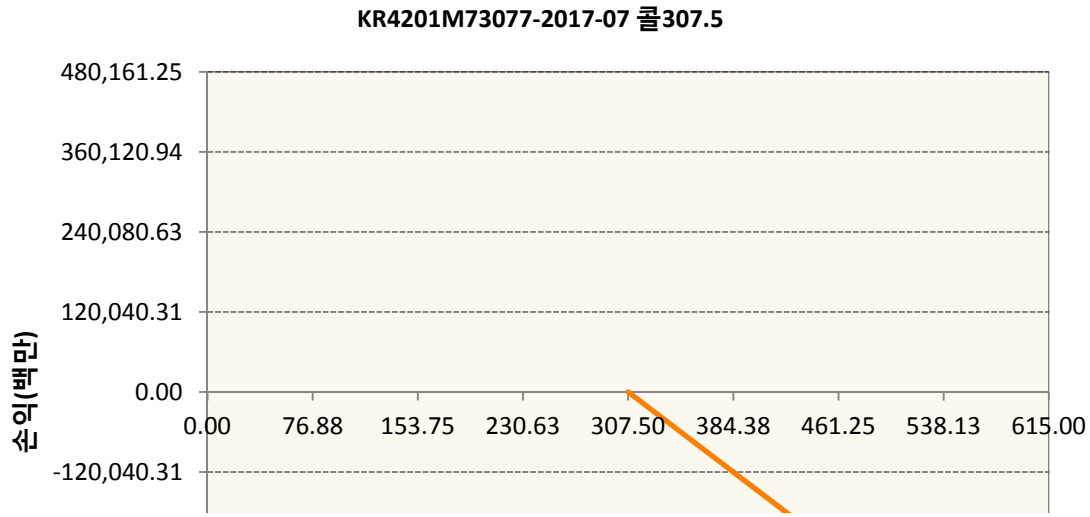
1. 계약금액

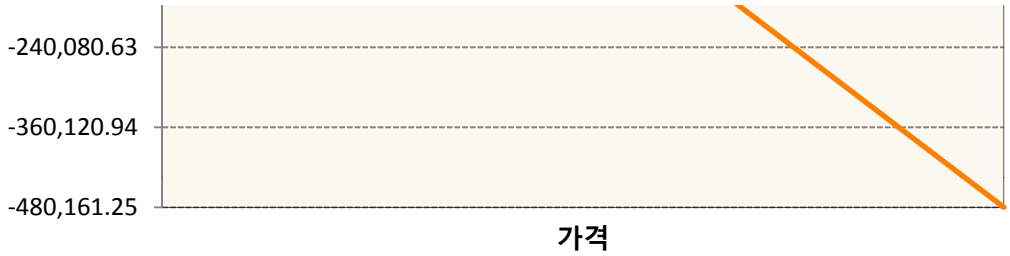
(단위:백만원)

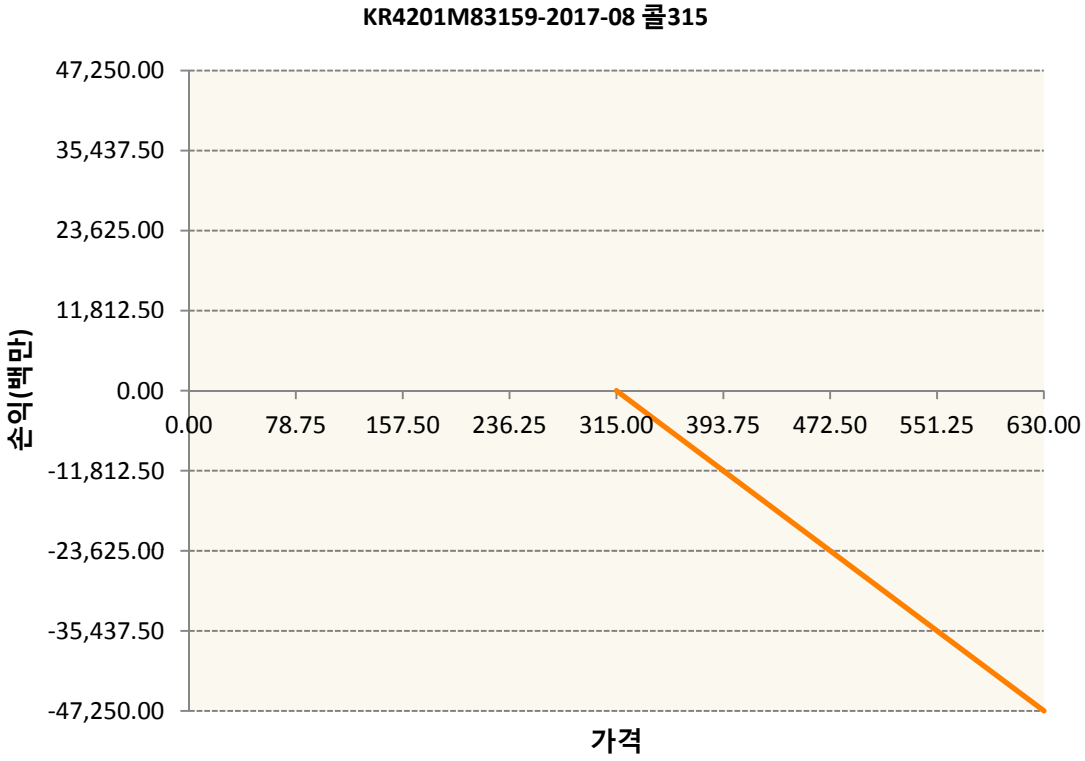
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	45,190	47,708	-2,517	장내
누계	유가증권	옵션	0	1,119,258	-1,119,258	장내

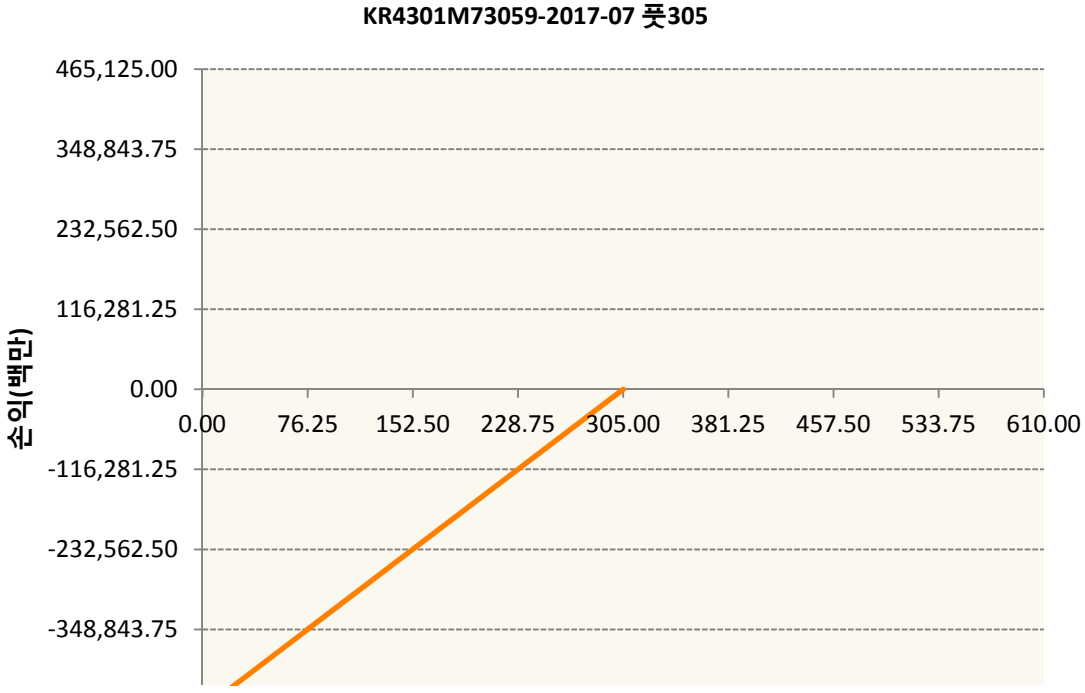
2. 만기시점의 손익구조

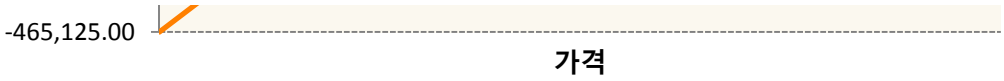


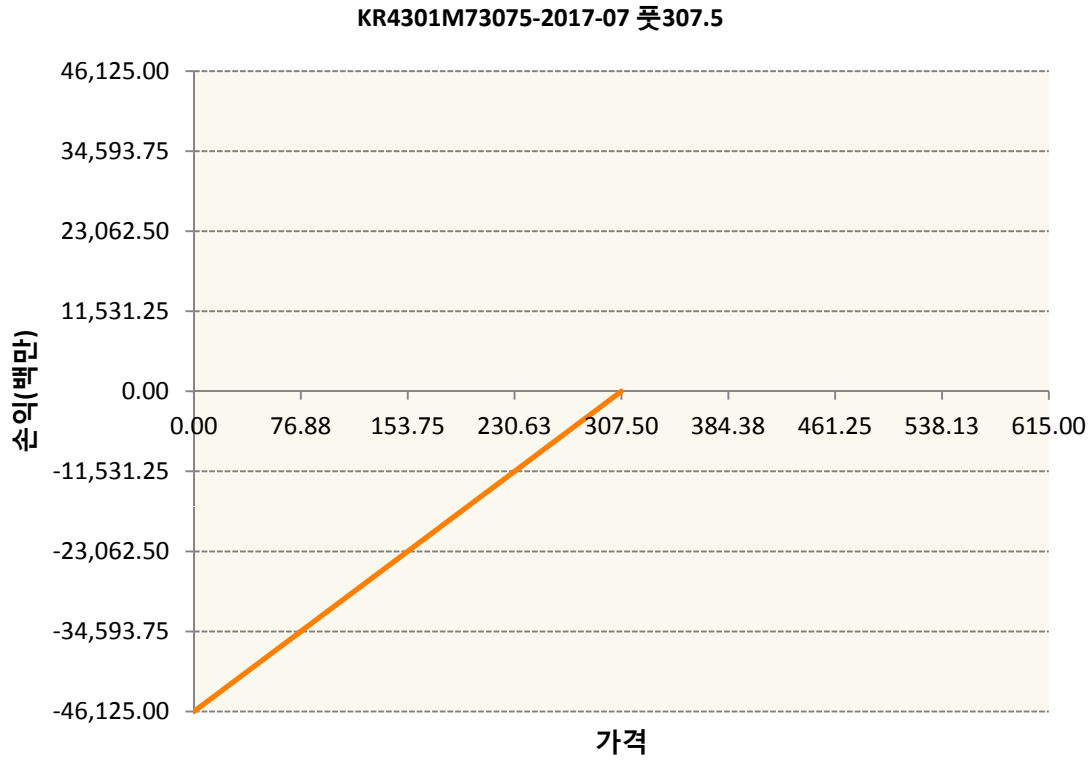



-240,080.63
-360,120.94
-480,161.25
가격


KR4201M83159-2017-08 콜315
47,250.00
35,437.50
23,625.00
11,812.50
0.00
-11,812.50
-23,625.00
-35,437.50
-47,250.00
0.00
78.75
157.50
236.25
315.00
393.75
472.50
551.25
630.00
손익(백만)
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
0.00
76.25
152.50
228.75
305.00
381.25
457.50
533.75
610.00
손익(백만)





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201M73(2017-07 콜305							6,624
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	2,271	2,271	2,271	2,271	2,271	2,271	2,271
-5.33%	2,271	2,270	2,269	2,266	2,263	2,258	2,252
-2.67%	1,944	1,911	1,878	1,844	1,811	1,778	1,745
0%	4	3	2	0	-3	-8	-14
2.67%	-2,205	-2,205	-2,205	-2,205	-2,205	-2,205	-2,205
5.33%	-4,415	-4,415	-4,415	-4,415	-4,415	-4,415	-4,415
8.00%	-6,624	-6,624	-6,624	-6,624	-6,624	-6,624	-6,624
KR4201M73(2017-07 콜307.5							39,026
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	9,637	9,637	9,637	9,637	9,637	9,637	9,637
-5.33%	9,637	9,637	9,636	9,634	9,629	9,621	9,609
-2.67%	9,108	8,961	8,806	8,645	8,479	8,308	8,135
0%	116	90	51	0	-63	-137	-221
2.67%	-12,912	-12,912	-12,912	-12,912	-12,913	-12,914	-12,916

5.33%	-25,969	-25,969	-25,969	-25,969	-25,969	-25,969	-25,969
8.00%	-39,026	-39,026	-39,026	-39,026	-39,026	-39,026	-39,026
	KR4201M83: 2017-08 콜315						2,829
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,110	1,085	1,053	1,015	970	920	865
-5.33%	1,014	961	901	835	765	691	614
-2.67%	775	689	600	510	417	323	228
0%	311	208	104	0	-104	-208	-312
2.67%	-412	-509	-608	-707	-808	-909	-1,010
5.33%	-1,366	-1,437	-1,514	-1,595	-1,680	-1,767	-1,857
8.00%	-2,478	-2,520	-2,570	-2,627	-2,690	-2,757	-2,829
	KR4301M73(2017-07 풋305						25,172
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-25,172	-25,172	-25,172	-25,172	-25,172	-25,172	-25,172
-5.33%	-12,420	-12,420	-12,420	-12,420	-12,420	-12,420	-12,420
-2.67%	-707	-802	-897	-992	-1,087	-1,183	-1,278
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	0	0	0	0	0	0	0
5.33%	0	0	0	0	0	0	0
8.00%	0	0	0	0	0	0	0
	KR4301M73(2017-07 풋307.5						2,851
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-2,851	-2,851	-2,851	-2,851	-2,851	-2,851	-2,851
-5.33%	-1,597	-1,597	-1,597	-1,597	-1,597	-1,597	-1,597
-2.67%	-347	-350	-354	-358	-363	-368	-374
0%	0	0	0	0	0	0	-1
2.67%	0	0	0	0	0	0	0
5.33%	0	0	0	0	0	0	0
8.00%	0	0	0	0	0	0	0

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

73,207

공시일	2017-07-13
기준일	2017-07-12

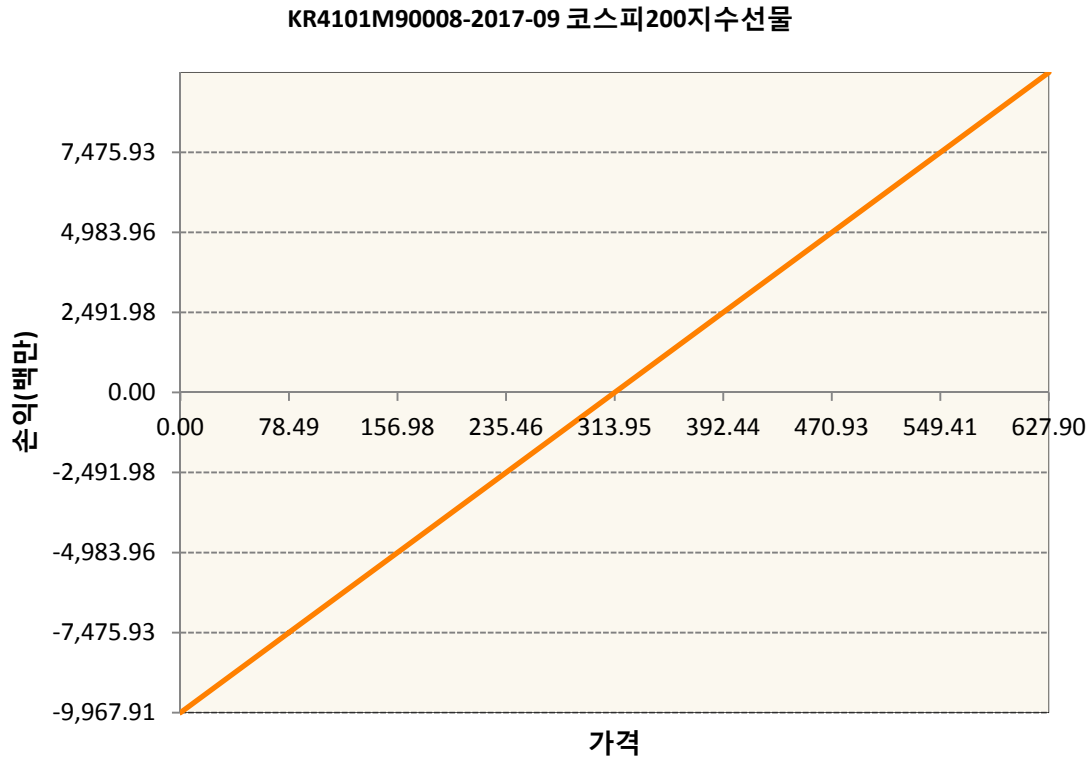
ETF스마트레버리지목표전환형6호

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	9,968	0	9,968	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101M90(2017-09 코스피200지수선물							796
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-796	-796	-796	-796	-796	-796	-796
-5.33%	-531	-531	-531	-531	-531	-531	-531
-2.67%	-265	-265	-265	-265	-265	-265	-265
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	265	265	265	265	265	265	265
5.33%	531	531	531	531	531	531	531
8.00%	796	796	796	796	796	796	796

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

481

공시일	2017-07-13
기준일	2017-07-12

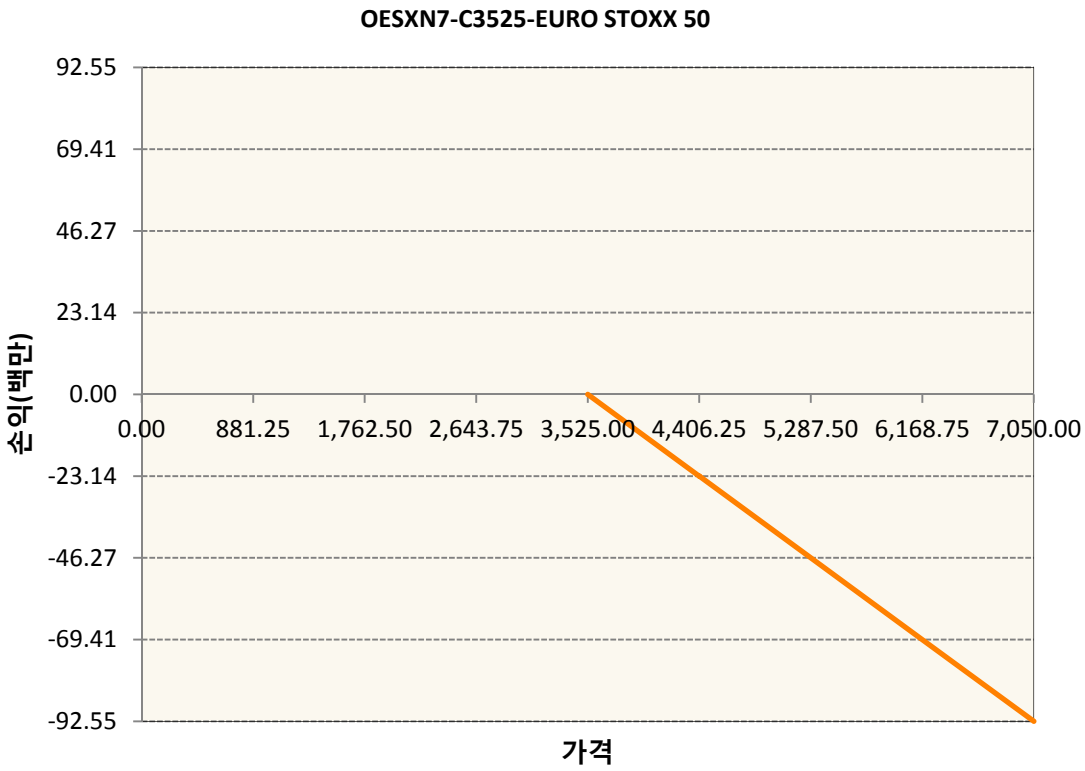
유로커버드콜(주식혼합-파생형)

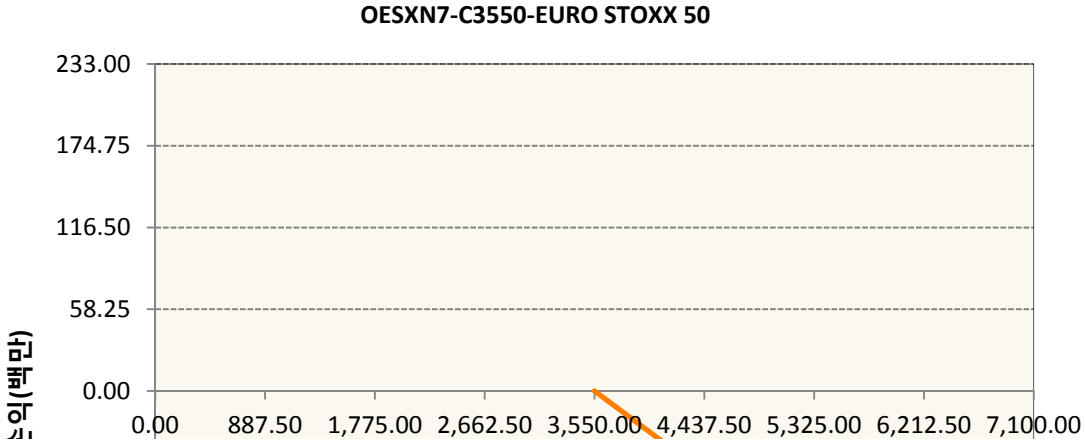
1. 계약금액

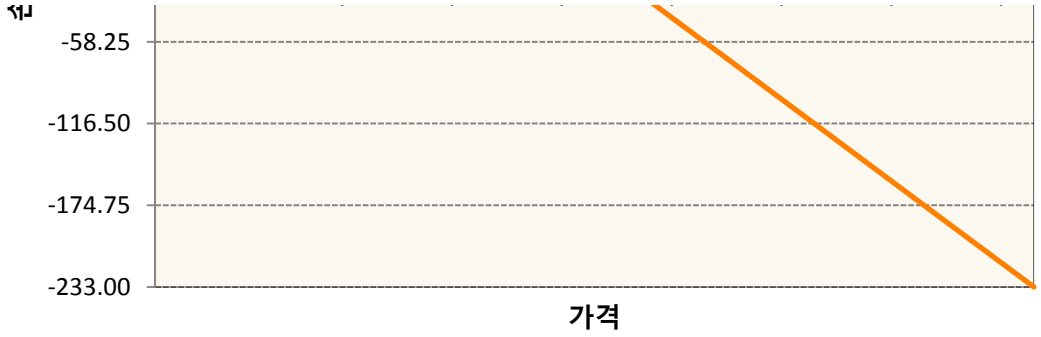
(단위:백만원)

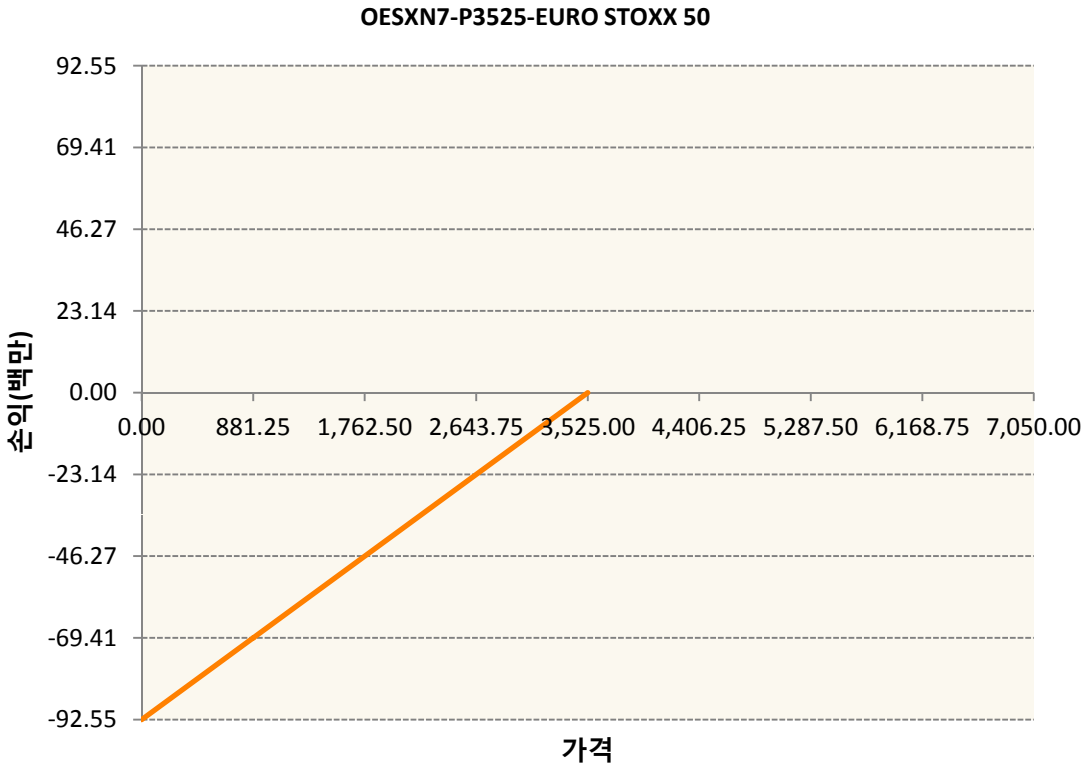
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	317	0	317	
누계	유가증권	옵션	0	651	-651	장내

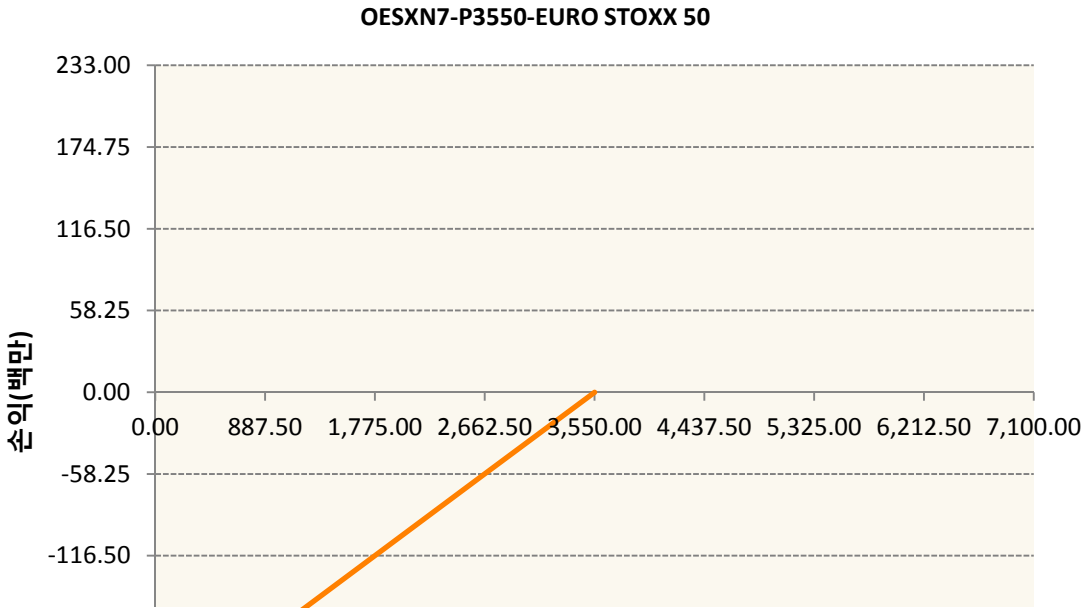
2. 만기시점의 손익구조

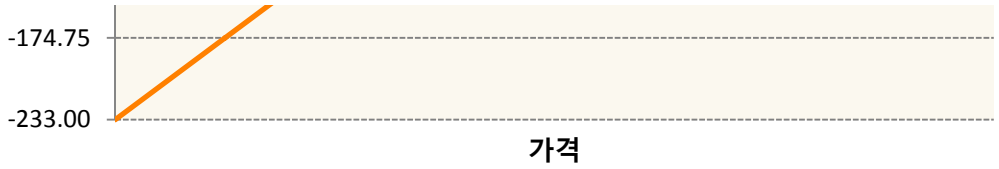


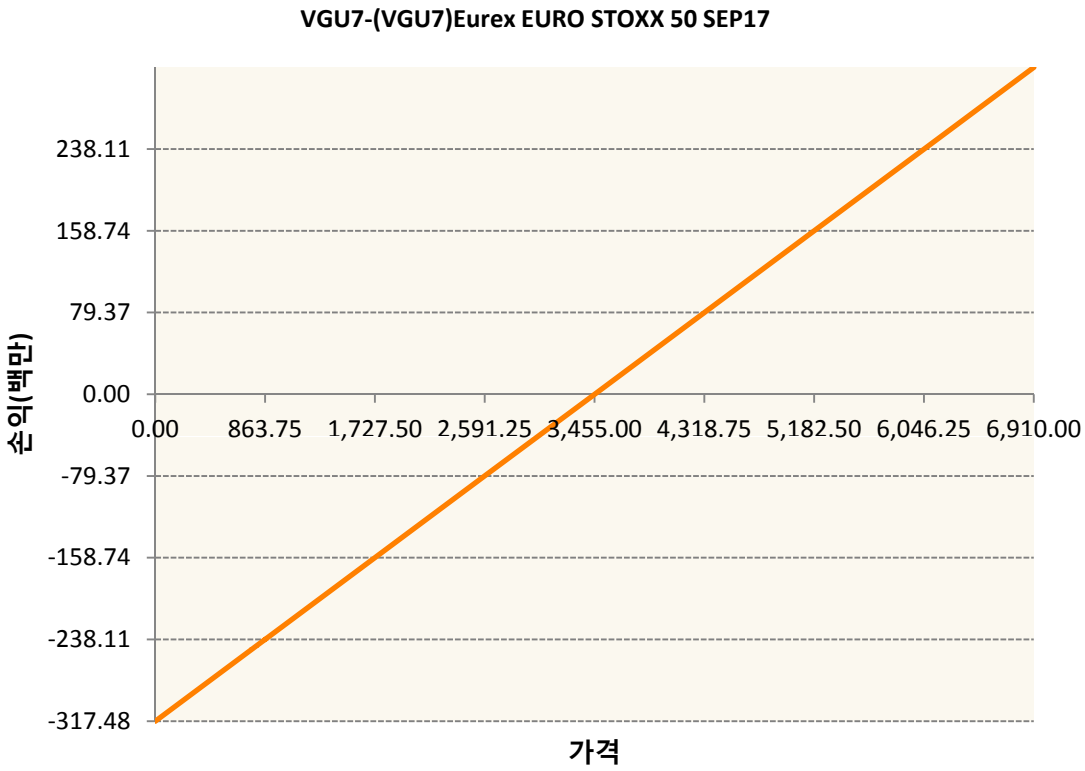



-58.25
-116.50
-174.75
-233.00
가격


OESXN7-P3525-EURO STOXX 50
92.55
69.41
46.27
23.14
0.00
-23.14
-46.27
-69.41
-92.55
0.00
881.25
1,762.50
2,643.75
3,525.00
4,406.25
5,287.50
6,168.75
7,050.00
손익(백만)
가격


OESXN7-P3550-EURO STOXX 50
233.00
174.75
116.50
58.25
0.00
-58.25
-116.50
0.00
887.50
1,775.00
2,662.50
3,550.00
4,437.50
5,325.00
6,212.50
7,100.00
손익(백만)





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
OESXN7-C3!	EURO STOXX 50	7
OESXN7-C3!	EURO STOXX 50	19
OESXN7-P3!	EURO STOXX 50	7
OESXN7-P3!	EURO STOXX 50	19
VGU7	(VGU7)Eurex EURO STOXX 50 SEP17	25

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	67

공시일	2017-07-13
기준일	2017-07-12

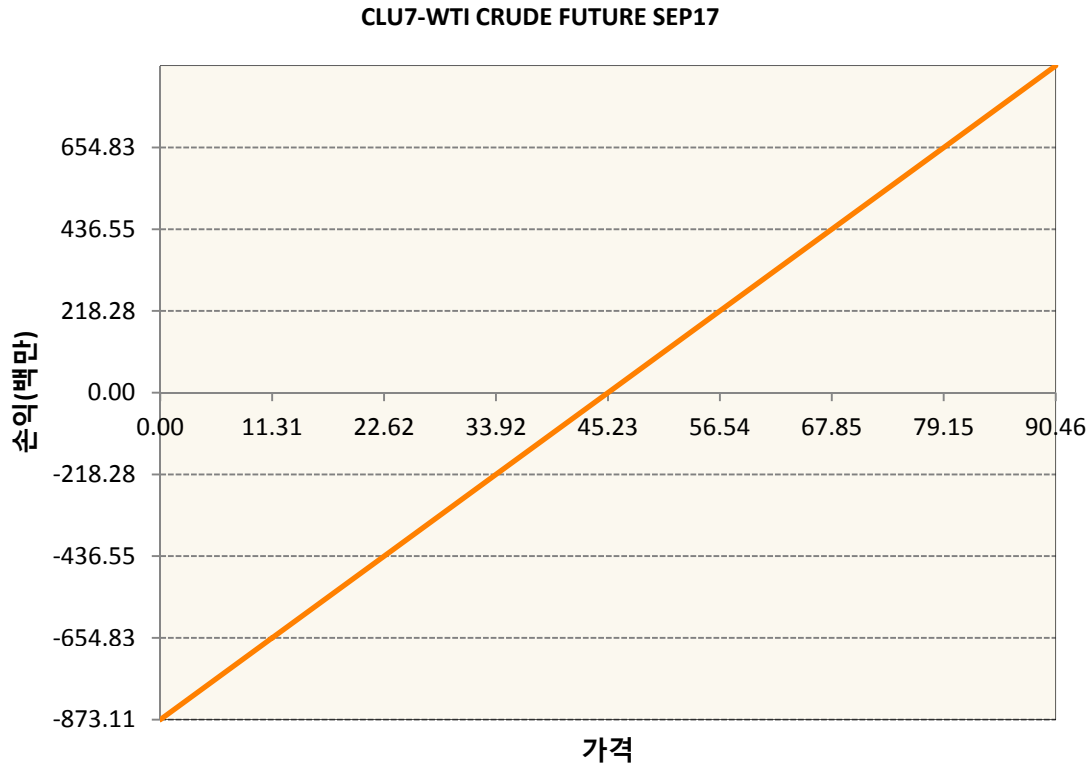
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

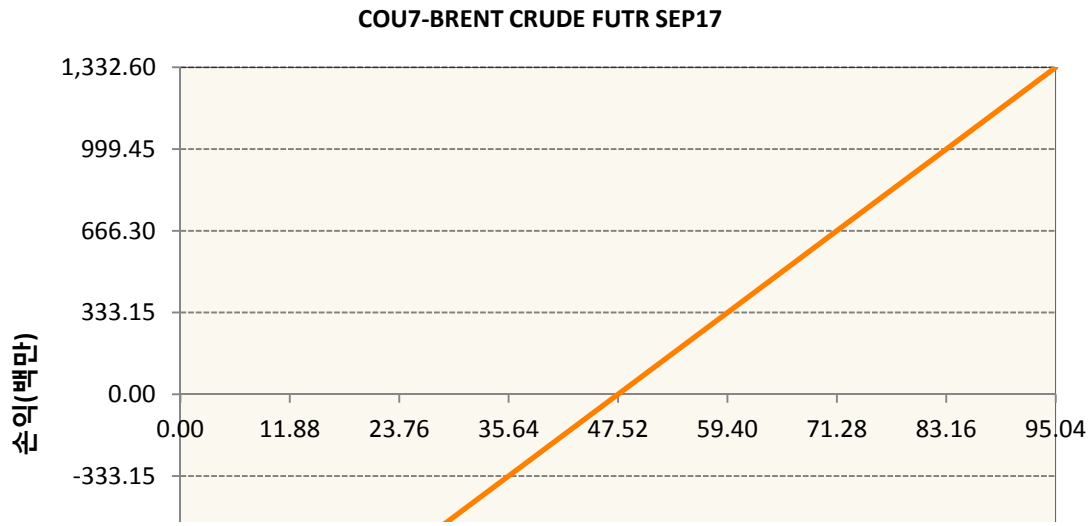
1. 계약금액

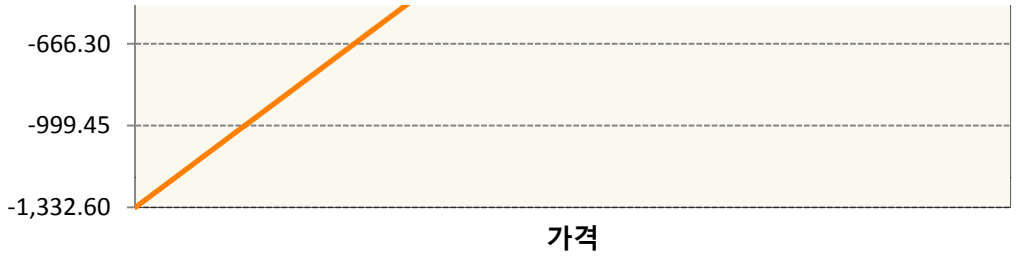
(단위:백만원)

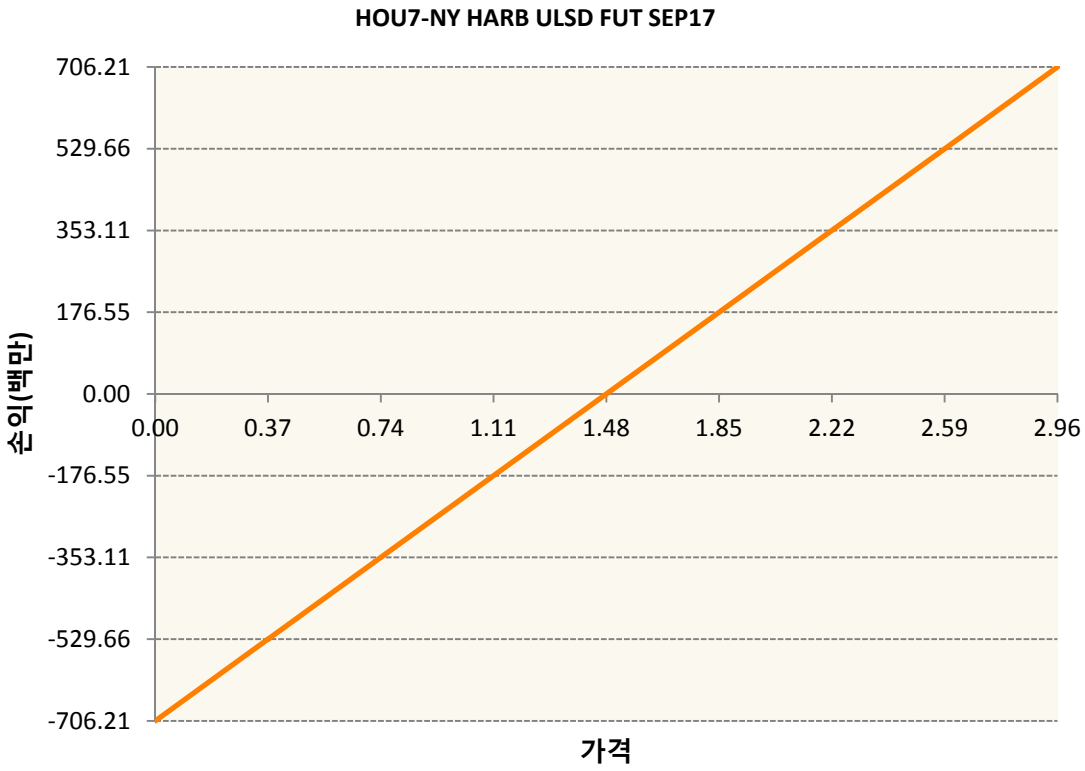
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	5,076	229	4,847	

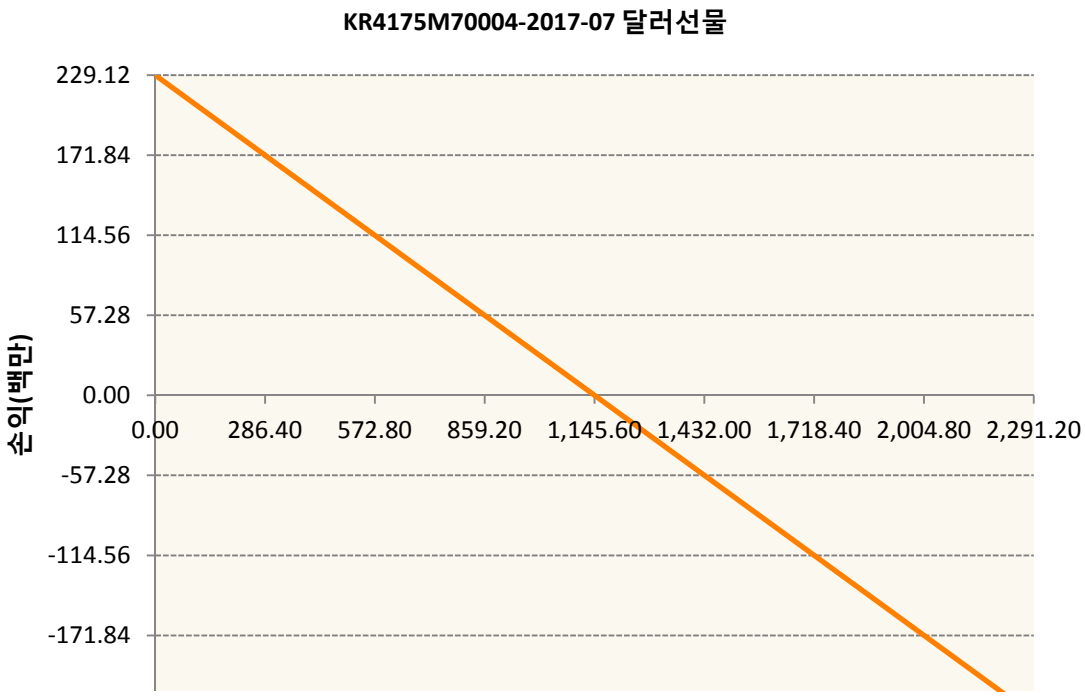
2. 만기시점의 손익구조

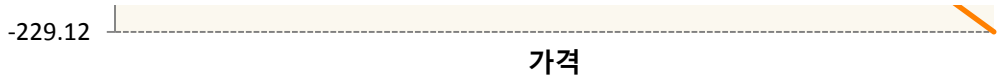


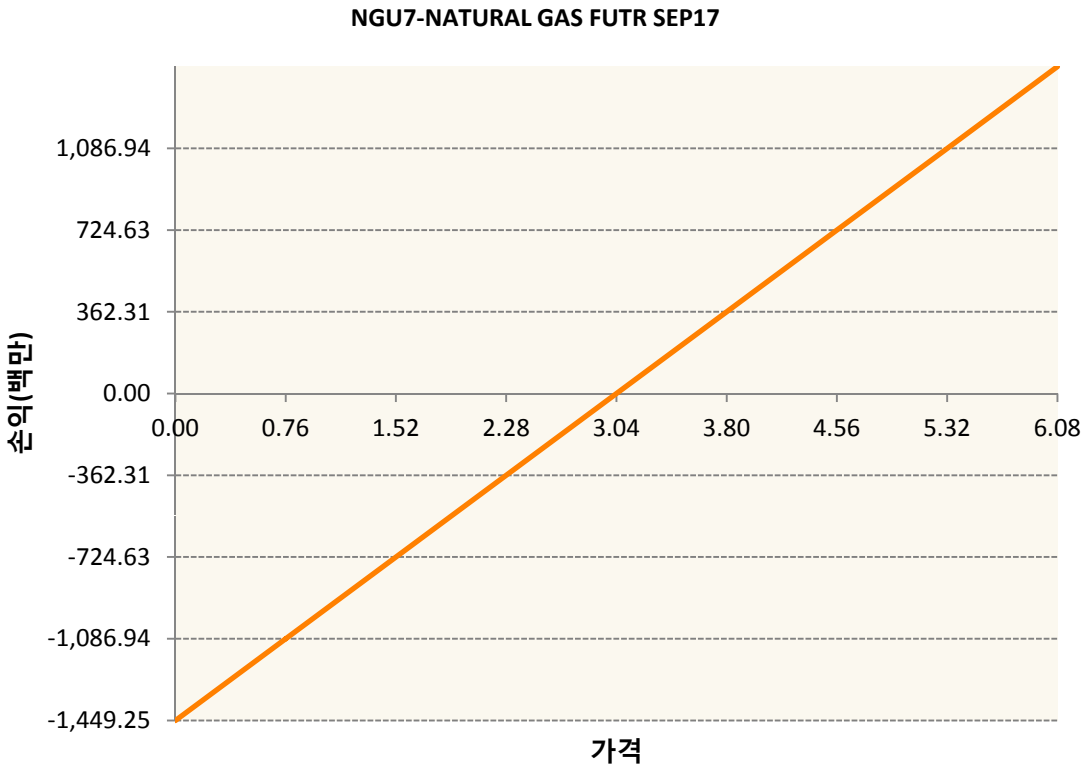


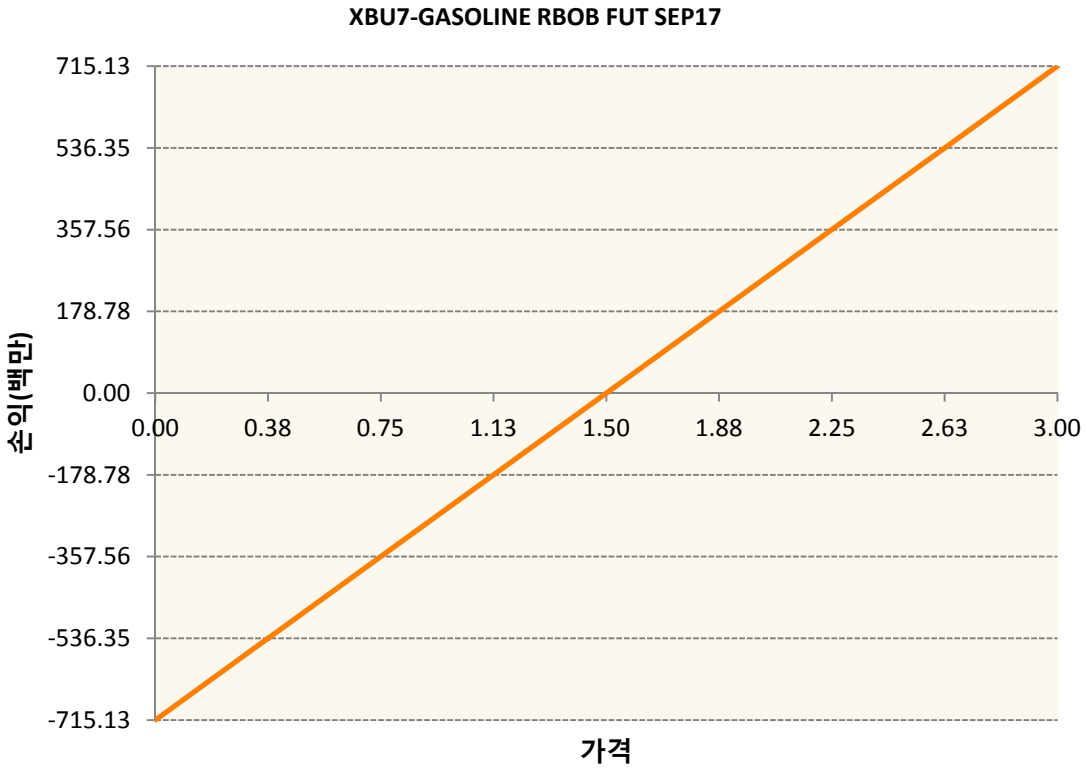

-666.30
-999.45
-1,332.60
가격


HOU7-NY HARB ULSD FUT SEP17
706.21
529.66
353.11
176.55
0.00
-176.55
-353.11
-529.66
-706.21
0.00
0.37
0.74
1.11
1.48
1.85
2.22
2.59
2.96
손익(백만)
가격


KR4175M70004-2017-07 달러선물
229.12
171.84
114.56
57.28
0.00
-57.28
-114.56
-171.84
0.00
286.40
572.80
859.20
1,145.60
1,432.00
1,718.40
2,004.80
2,291.20
손익(백만)


-229.12
가격


NGU7-NATURAL GAS FUTR SEP17
손익(백만)
1,086.94
724.63
362.31
0.00
-362.31
-724.63
-1,086.94
-1,449.25
0.00
0.76
1.52
2.28
3.04
3.80
4.56
5.32
6.08
가격


XBU7-GASOLINE RBOB FUT SEP17
손익(백만)
715.13
536.35
357.56
178.78
0.00
-178.78
-357.56
-536.35
-715.13
0.00
0.38
0.75
1.13
1.50
1.88
2.25
2.63
3.00
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	56
KR4175M70(	2017-07 달러선물	18
NGU7	NATURAL GAS FUTR SEP17	116
XBU7	GASOLINE RBOB FUT SEP17	57

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

785

공시일	2017-07-13
기준일	2017-07-12

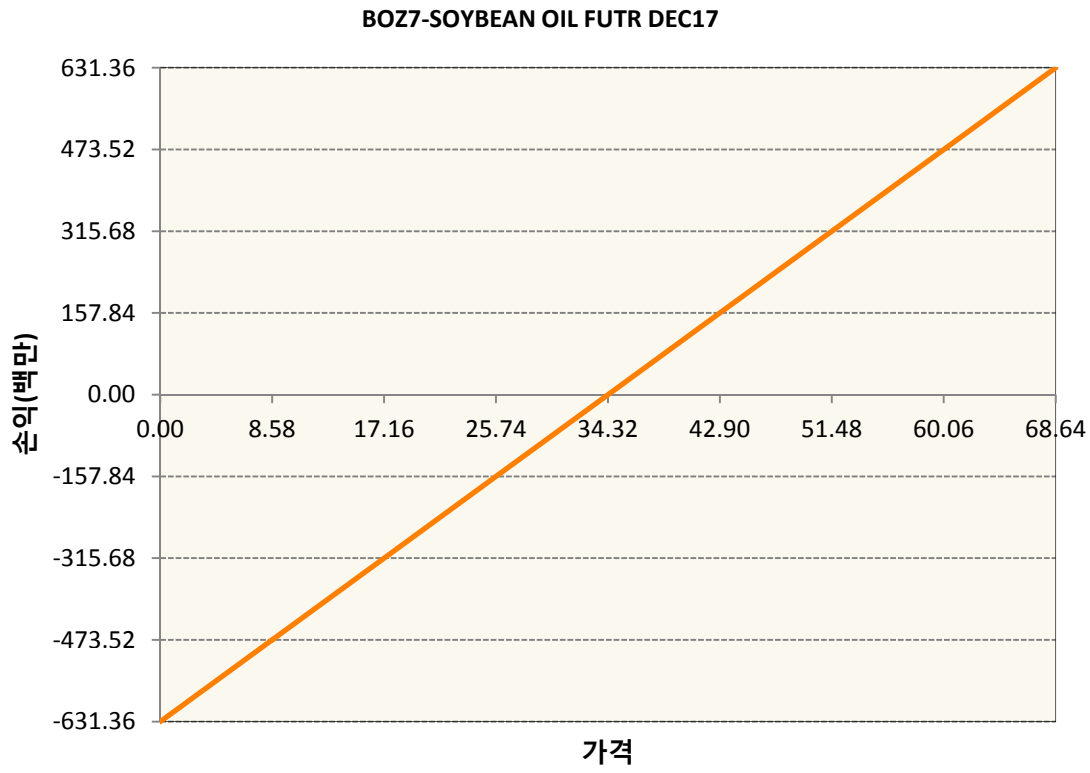
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

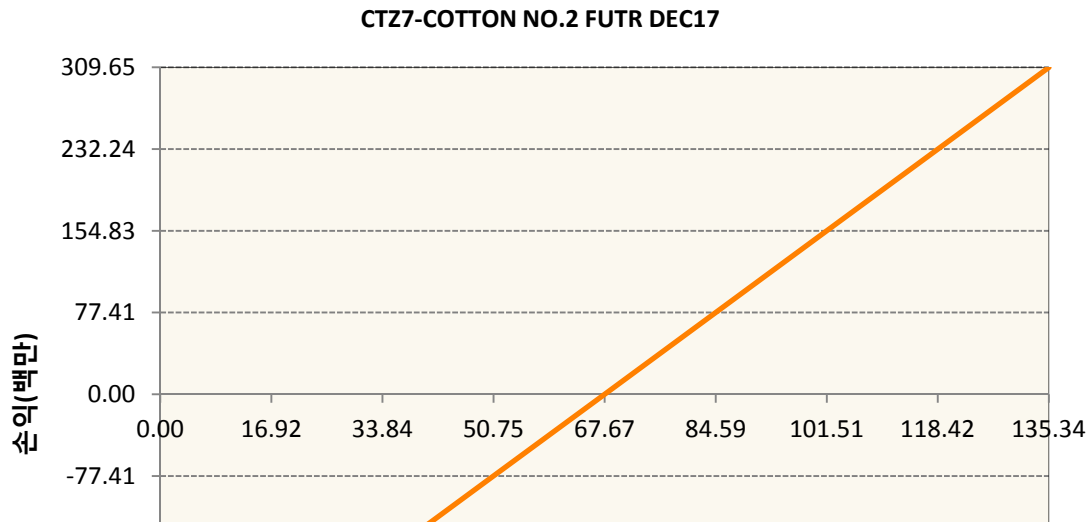
1. 계약금액

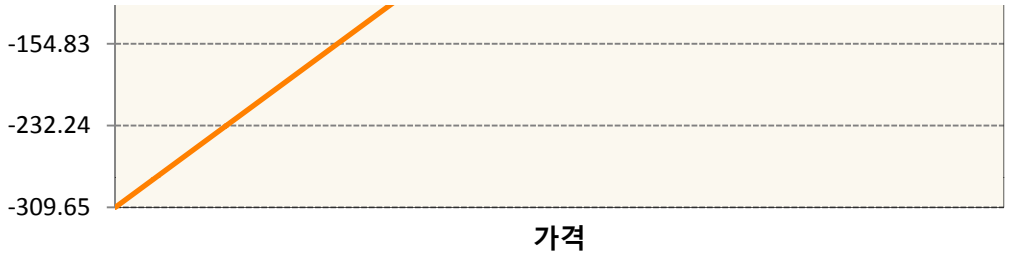
(단위:백만원)

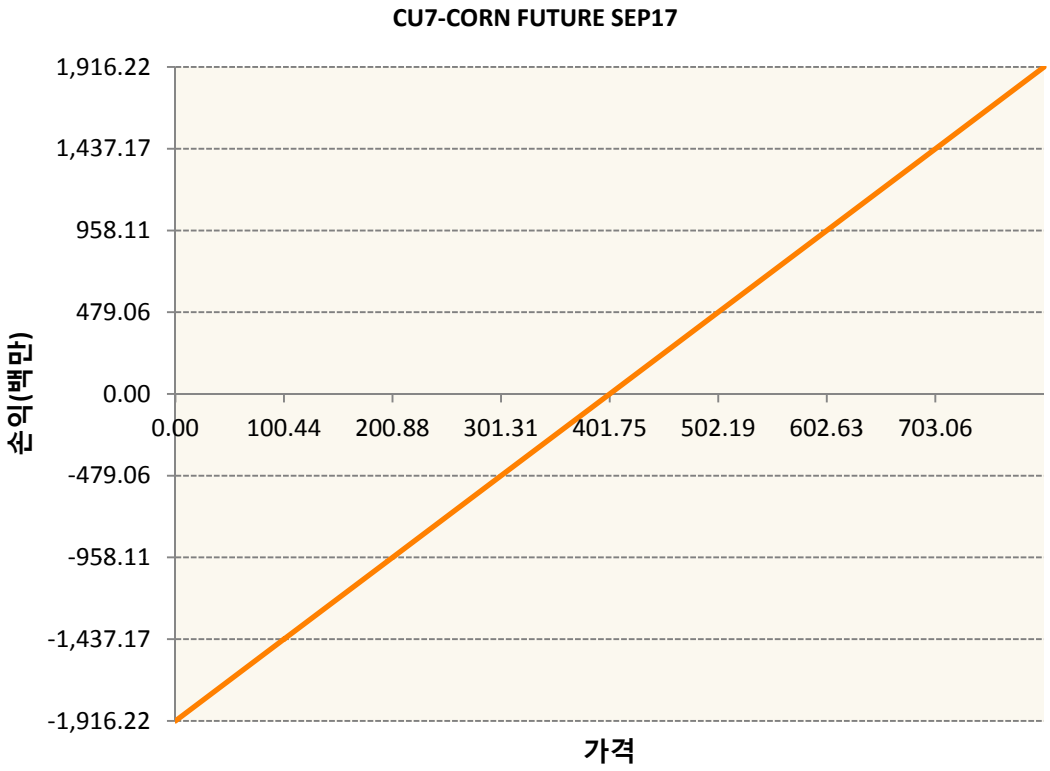
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	7,378	401	6,977	

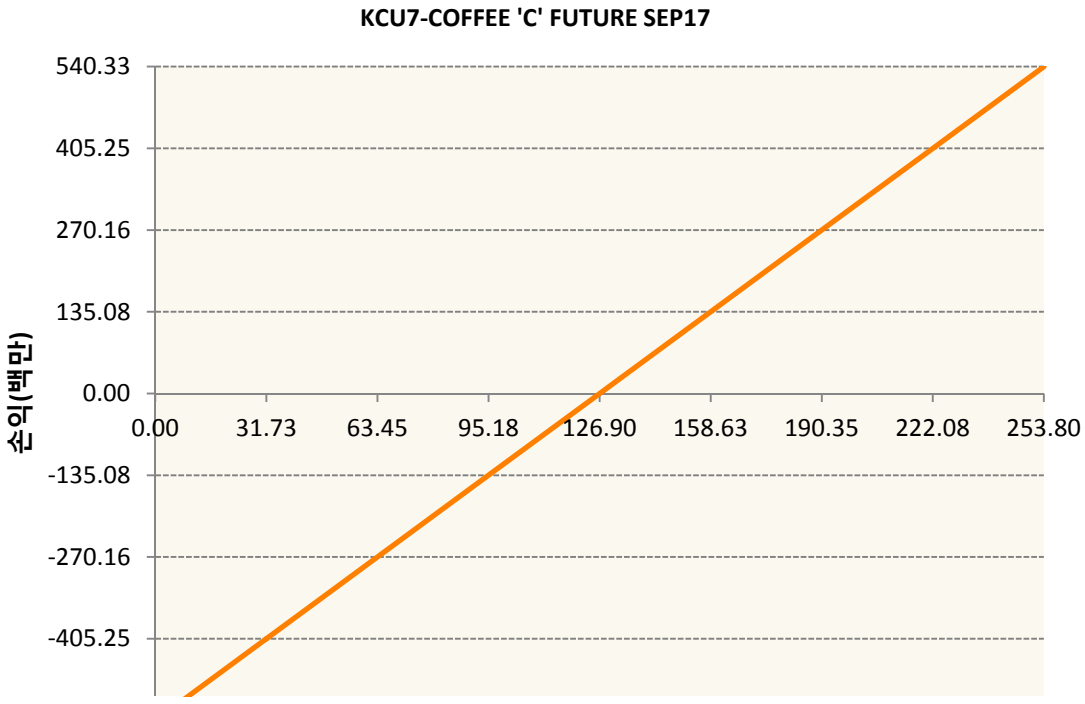
2. 만기시점의 손익구조

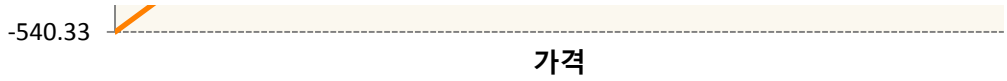


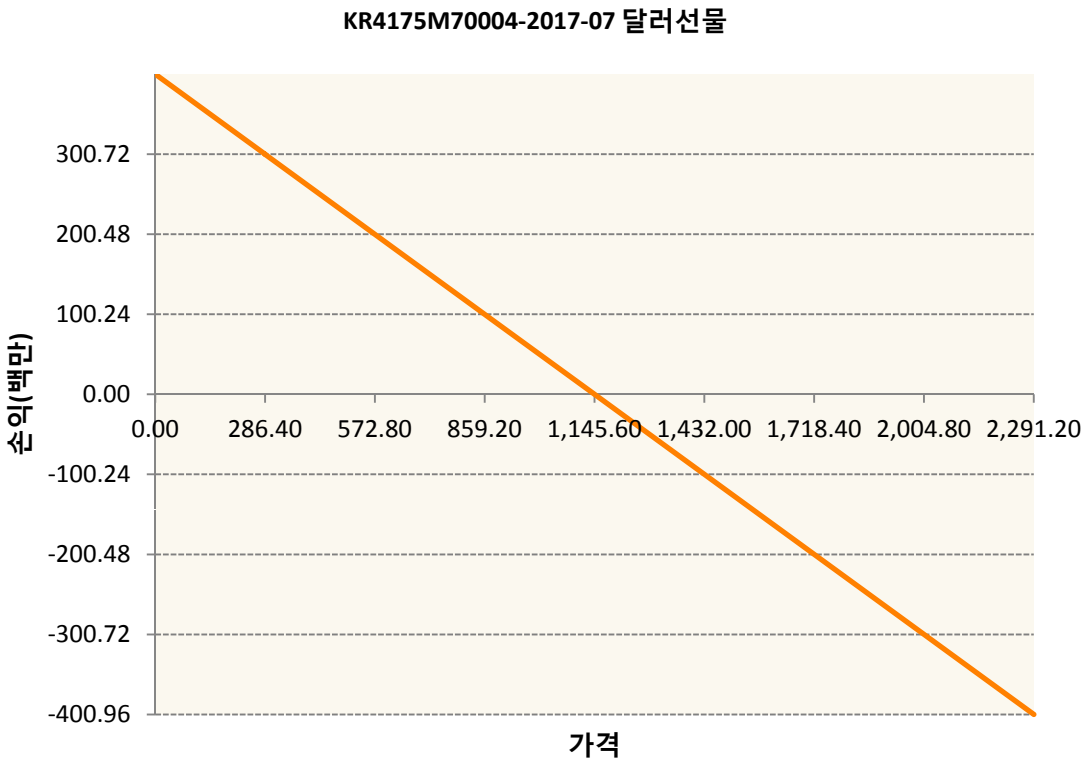


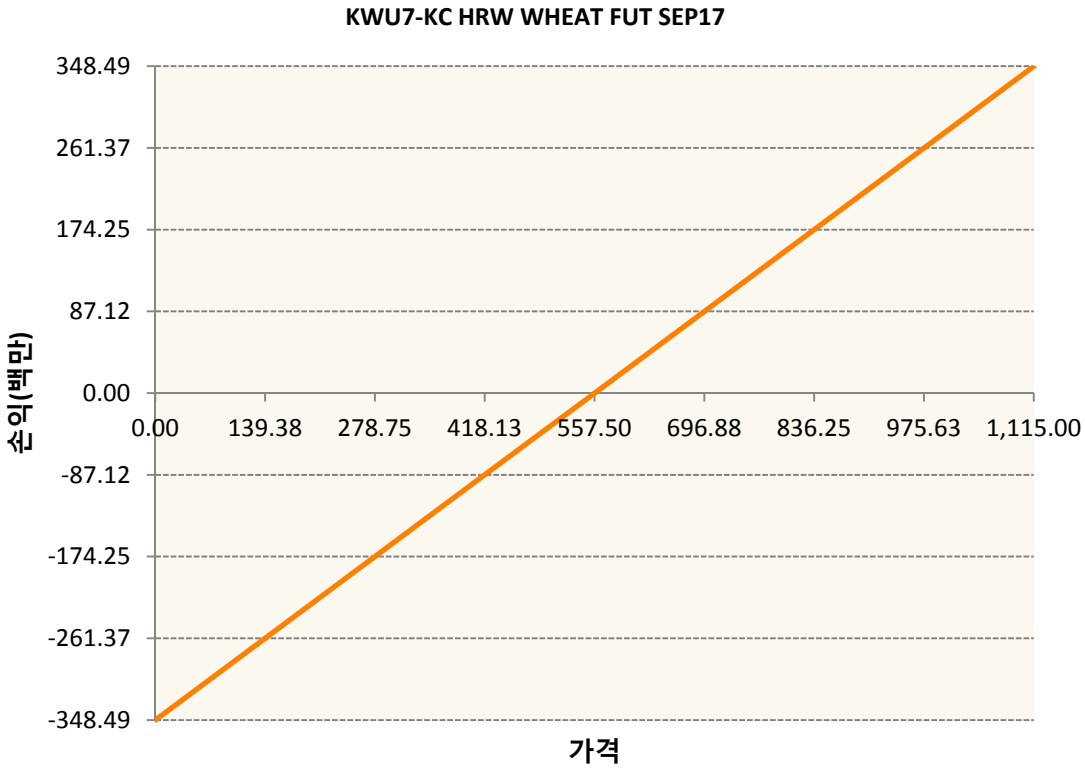

-154.83
-232.24
-309.65
가격

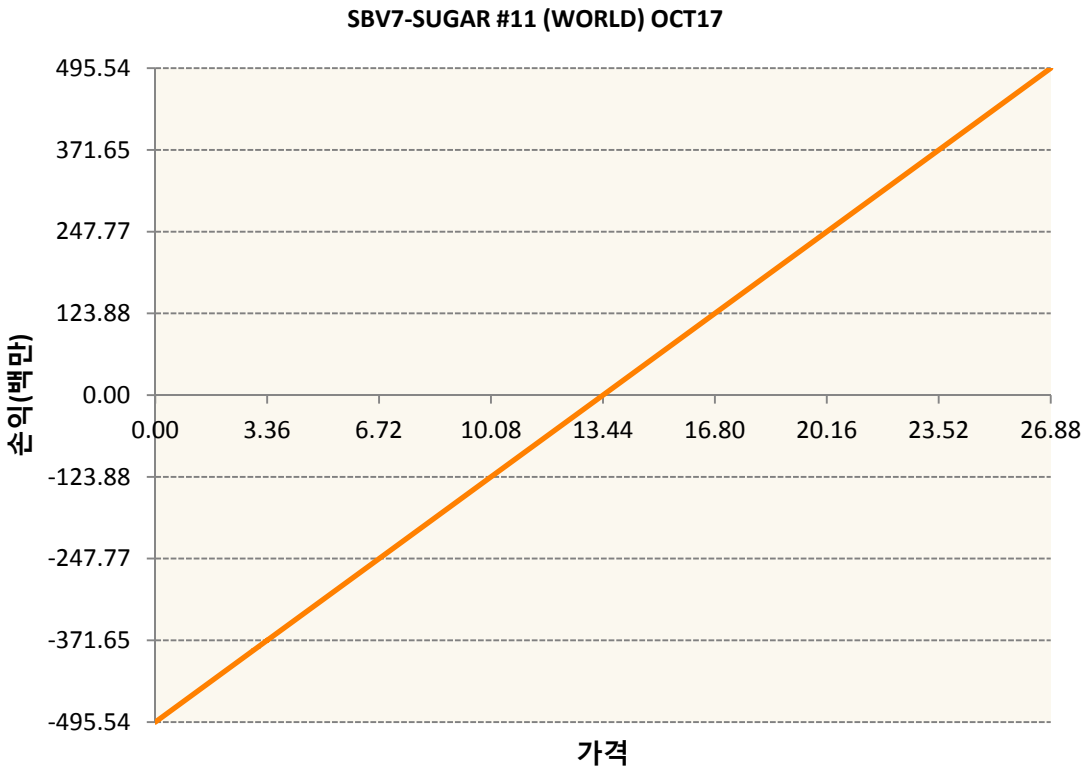

CU7-CORN FUTURE SEP17
1,916.22
1,437.17
958.11
479.06
0.00
-479.06
-958.11
-1,437.17
-1,916.22
0.00
100.44
200.88
301.31
401.75
502.19
602.63
703.06
손익(백만)
가격

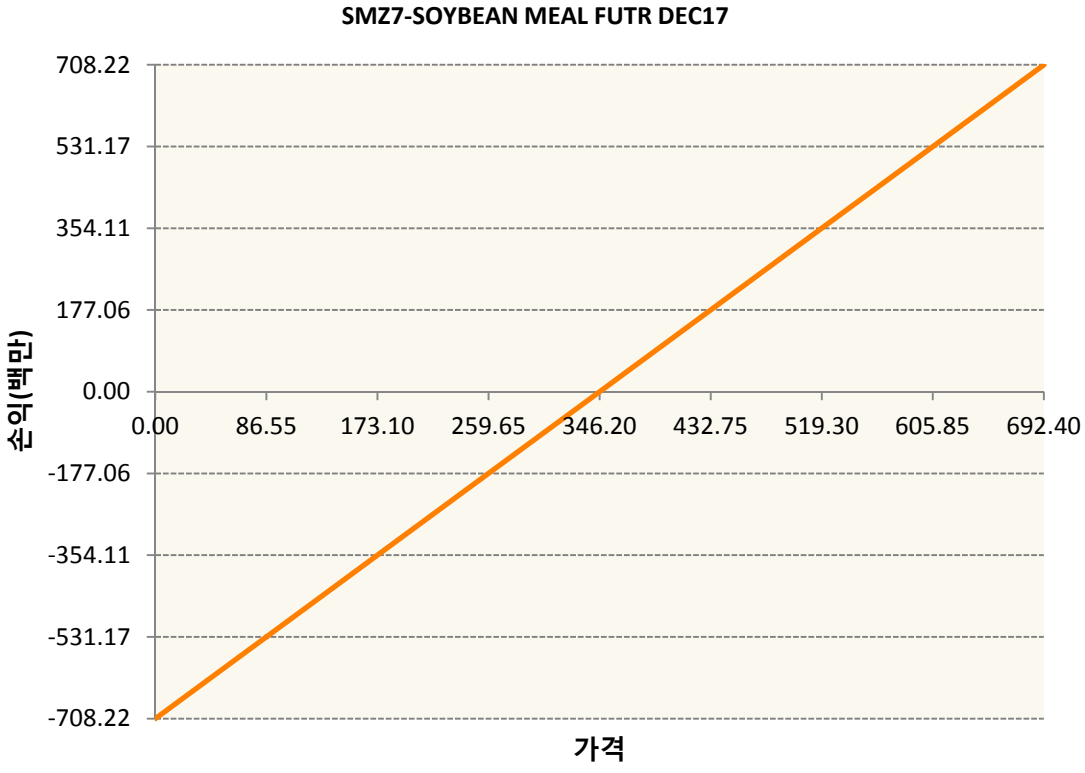

KCU7-COFFEE 'C' FUTURE SEP17
540.33
405.25
270.16
135.08
0.00
-135.08
-270.16
-405.25
0.00
31.73
63.45
95.18
126.90
158.63
190.35
222.08
253.80
손익(백만)

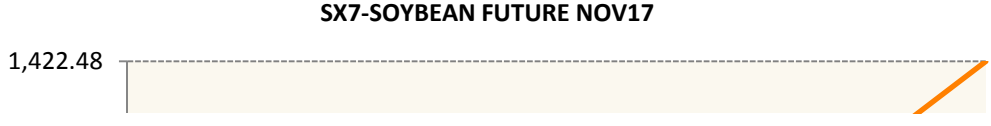

-540.33
가격

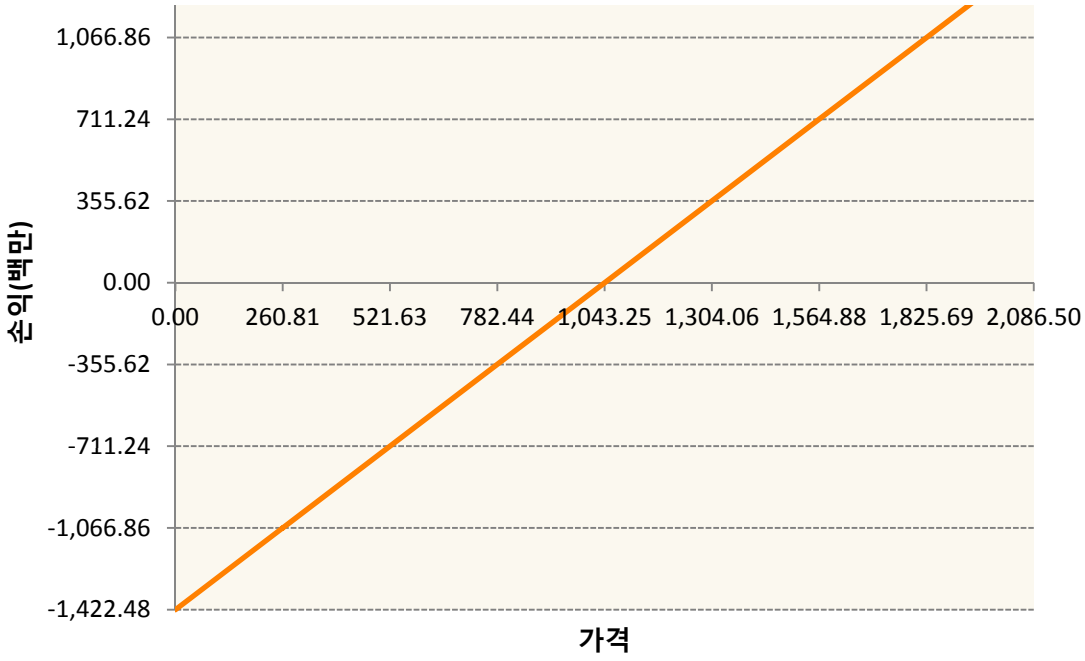

KR4175M70004-2017-07 달러선물
300.72
200.48
100.24
0.00
-100.24
-200.48
-300.72
-400.96
0.00
286.40
572.80
859.20
1,145.60
1,432.00
1,718.40
2,004.80
2,291.20
손익(백만)
가격

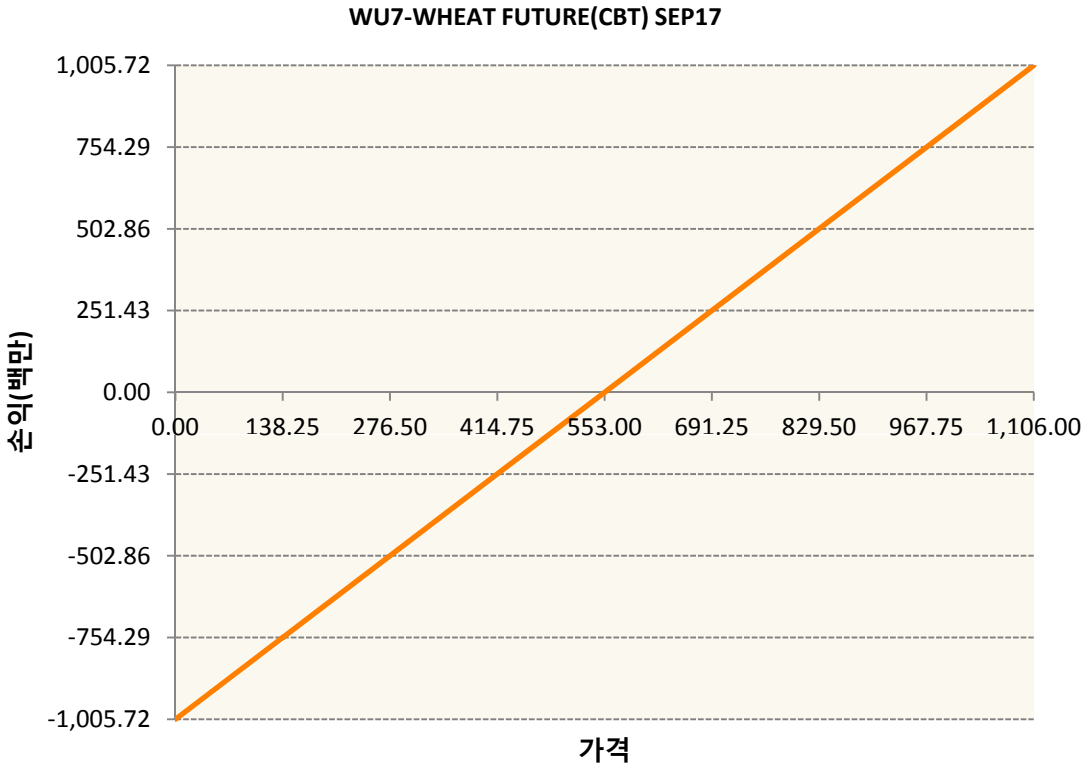

KWU7-KC HRW WHEAT FUT SEP17
348.49
261.37
174.25
87.12
0.00
-87.12
-174.25
-261.37
-348.49
0.00
139.38
278.75
418.13
557.50
696.88
836.25
975.63
1,115.00
손익(백만)
가격


SBV7-SUGAR #11 (WORLD) OCT17
495.54
371.65
247.77
123.88
0.00
-123.88
-247.77
-371.65
-495.54
0.00
3.36
6.72
10.08
13.44
16.80
20.16
23.52
26.88
손익(백만)
가격


SMZ7-SOYBEAN MEAL FUTR DEC17
708.22
531.17
354.11
177.06
0.00
-177.06
-354.11
-531.17
-708.22
0.00
86.55
173.10
259.65
346.20
432.75
519.30
605.85
692.40
손익(백만)
가격


SX7-SOYBEAN FUTURE NOV17
1,422.48





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

BOZ7	SOYBEAN OIL FUTR DEC17	51
CTZ7	COTTON NO.2 FUTR DEC17	25
CU7	CORN FUTURE SEP17	153
KCU7	COFFEE 'C' FUTURE SEP17	43
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	114
WU7	WHEAT FUTURE(CBT) SEP17	80

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

682