공시일	2017-07-14
기준일	2017-07-13

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	2017-07-14
기준일	2017-07-13

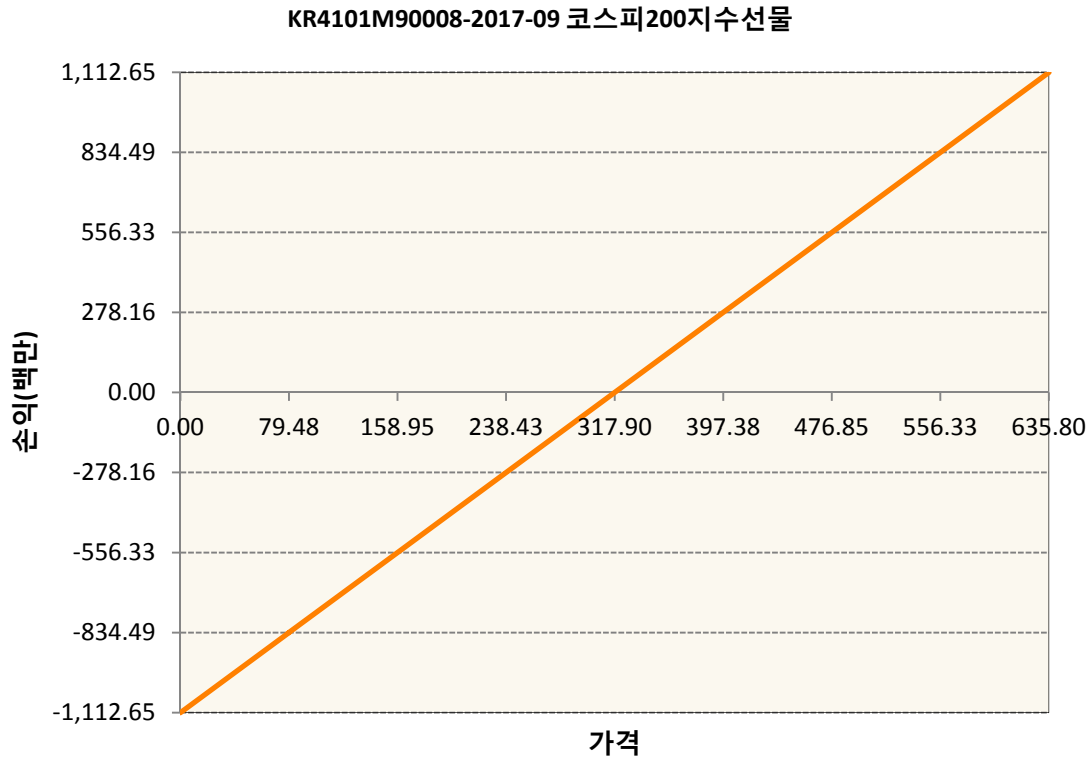
스마트인덱스모

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	1,113	0	1,113	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101M90(2017-09 코스피200지수선물							89
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-89	-89	-89	-89	-89	-89	-89
-5.33%	-59	-59	-59	-59	-59	-59	-59
-2.67%	-30	-30	-30	-30	-30	-30	-30
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	30	30	30	30	30	30	30
5.33%	59	59	59	59	59	59	59
8.00%	89	89	89	89	89	89	89

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

53

공시일	2017-07-14
기준일	2017-07-13

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	1,006

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

482

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-07-14
기준일	2017-07-13

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	382

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

323

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-07-14
기준일	2017-07-13

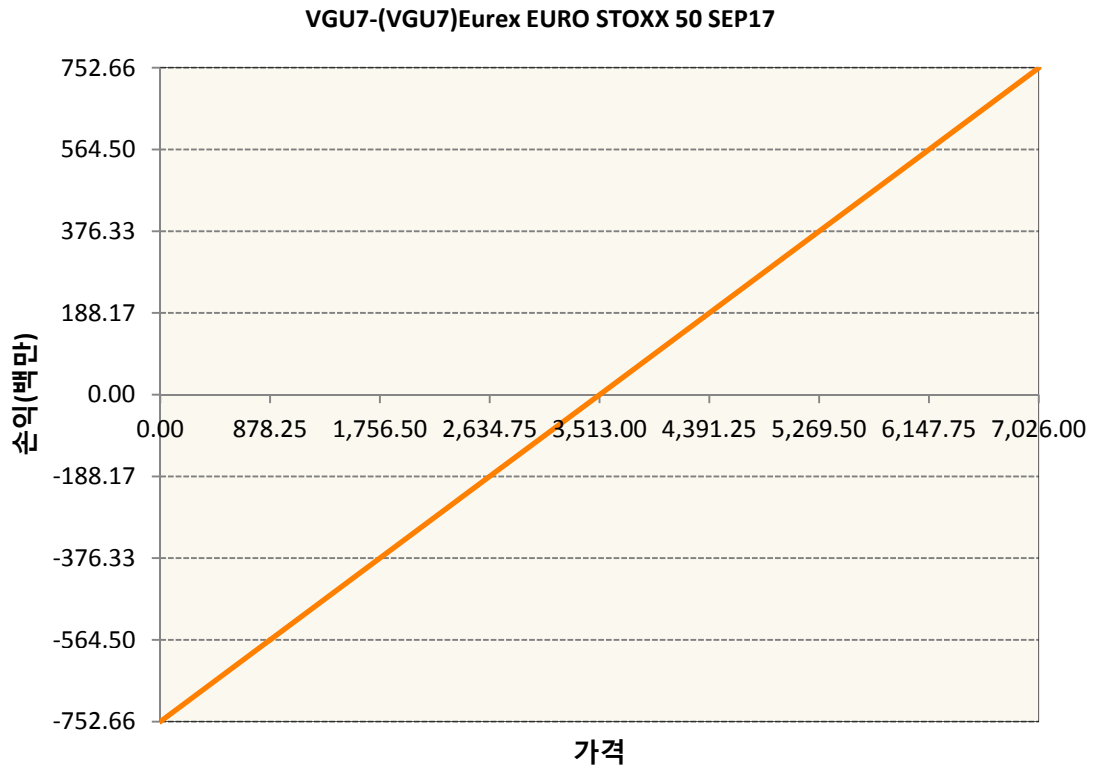
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	753	0	753	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGU7	(VGU7)Eurex EURO STOXX 50 SEP17	60

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

(단위:백만원)

52

공시일	2017-07-14
기준일	2017-07-13

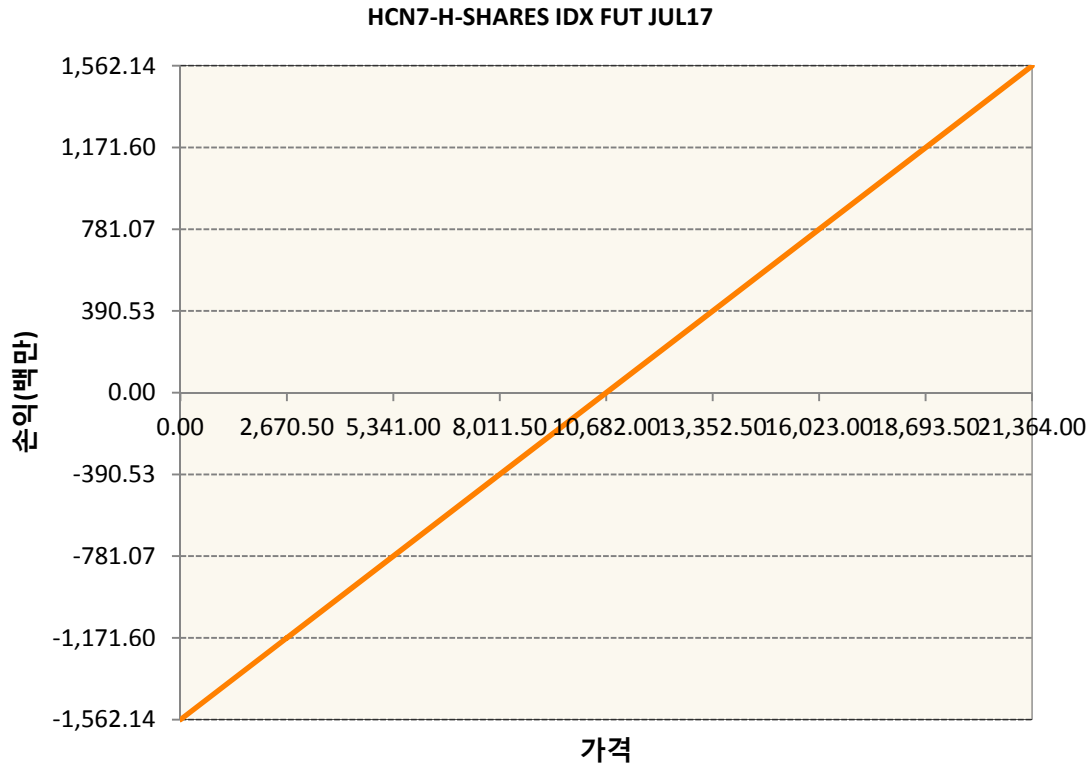
차이나인덱스모(주식-파생형)

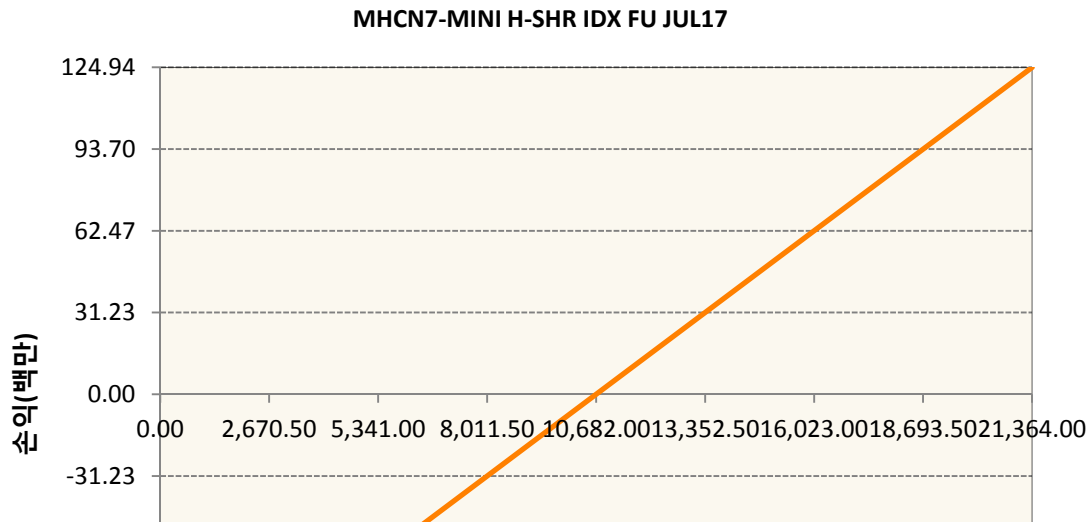
1. 계약금액

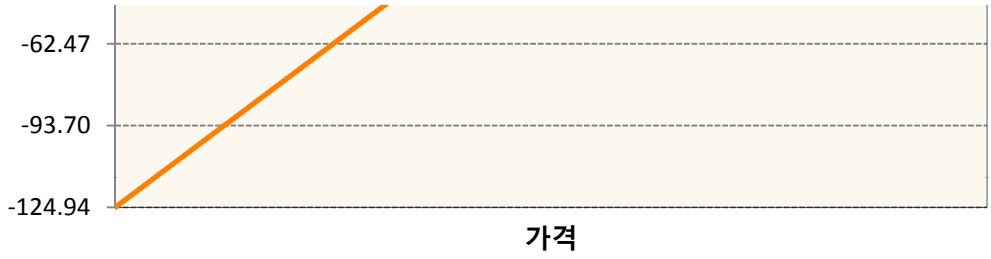
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,687	0	1,687	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCN7	H-SHARES IDX FUT JUL17	125
MHCN7	MINI H-SHR IDX FU JUL17	10

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	130

공시일	2017-07-14
기준일	2017-07-13

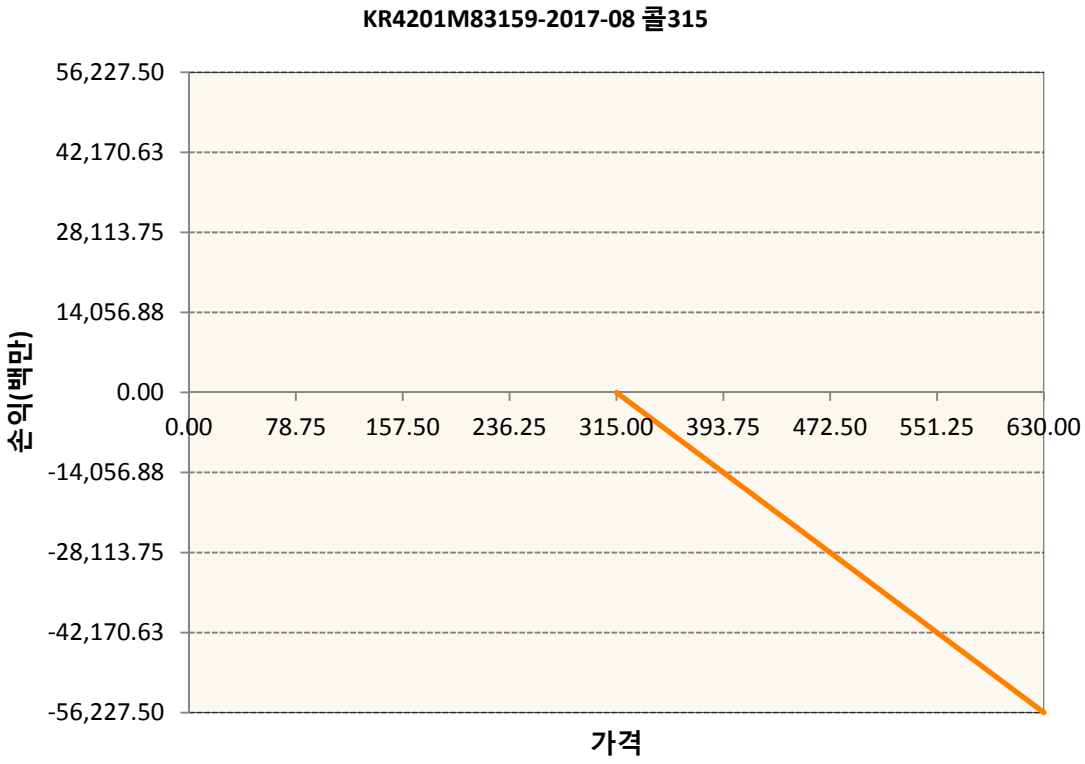
커버드콜모(주식혼합-파생형)

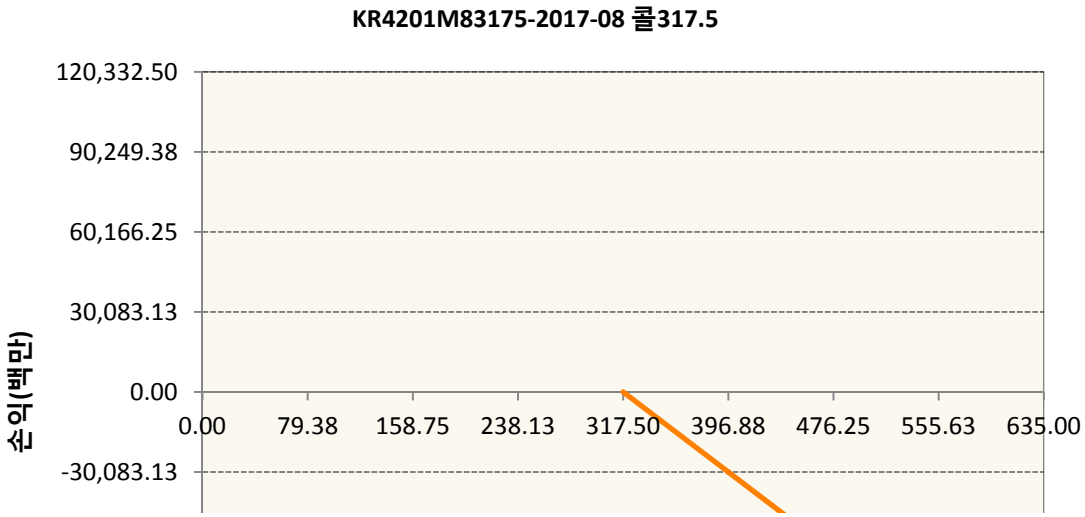
1. 계약금액

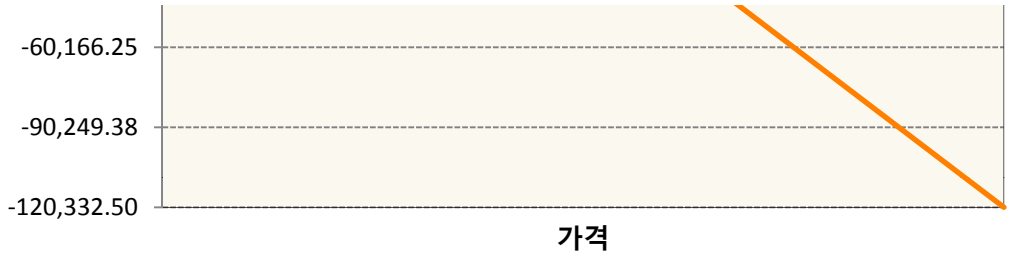
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	251,081	-251,081	장내
누계	유가증권	옵션	0	295,551	-295,551	장내

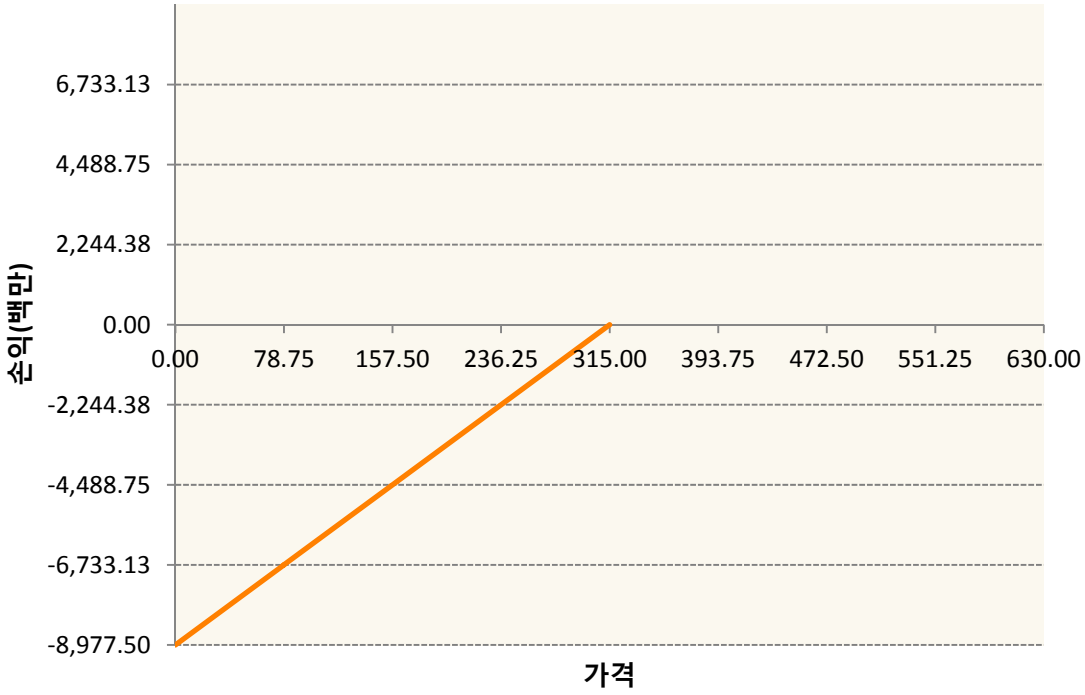
2. 만기시점의 손익구조



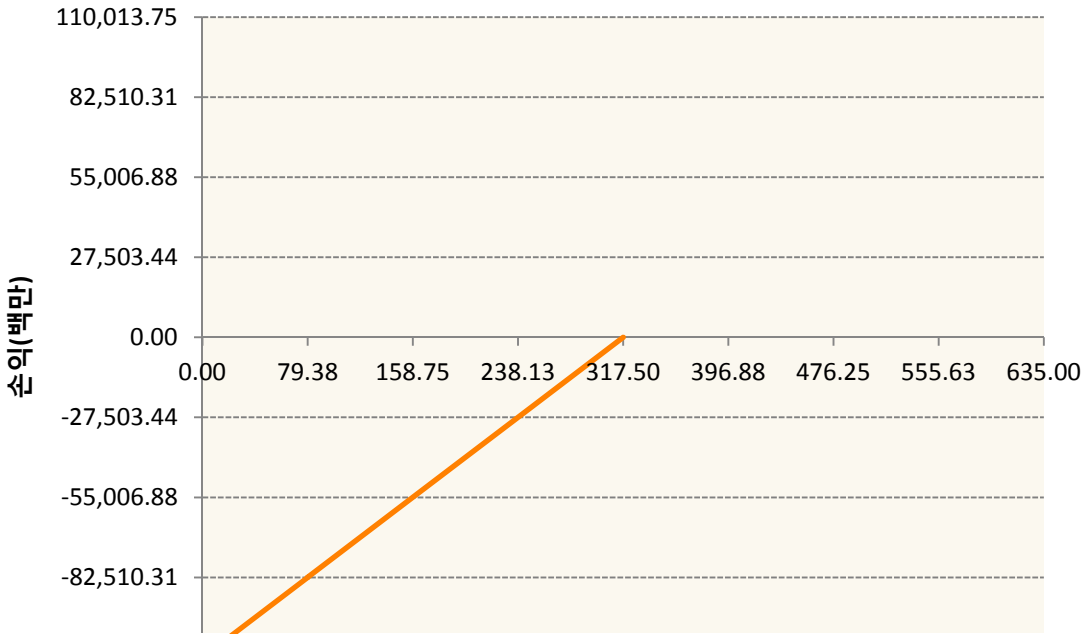




KR4301M83157-2017-08 풋315



KR4301M83173-2017-08 풋317.5





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201M83: 2017-08 콜315							3,570
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,506	1,472	1,430	1,380	1,323	1,260	1,192
-5.33%	1,362	1,291	1,214	1,131	1,043	952	858
-2.67%	1,011	904	796	686	574	462	349
0%	358	239	119	0	-119	-239	-359
2.67%	-618	-719	-824	-931	-1,040	-1,151	-1,263
5.33%	-1,852	-1,919	-1,993	-2,074	-2,160	-2,250	-2,345
8.00%	-3,243	-3,278	-3,321	-3,373	-3,433	-3,498	-3,570
KR4201M83: 2017-08 콜317.5							7,265
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	2,773	2,717	2,643	2,554	2,450	2,332	2,202
-5.33%	2,546	2,418	2,274	2,117	1,948	1,769	1,583
-2.67%	1,950	1,741	1,524	1,302	1,075	845	613
0%	764	510	255	0	-255	-510	-765
2.67%	-1,111	-1,345	-1,583	-1,825	-2,069	-2,315	-2,563
5.33%	-3,585	-3,752	-3,932	-4,124	-4,326	-4,535	-4,750
8.00%	-6,457	-6,550	-6,663	-6,792	-6,937	-7,095	-7,265
KR4301M83: 2017-08 풋315							594
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-592	-592	-592	-592	-593	-593	-594
-5.33%	-353	-354	-355	-357	-359	-362	-366
-2.67%	-128	-134	-140	-147	-153	-161	-168
0%	27	18	9	0	-9	-18	-27
2.67%	82	78	73	68	62	56	50
5.33%	90	89	88	87	85	83	80
8.00%	90	90	90	90	90	89	88
KR4301M83: 2017-08 풋317.5							7,643
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-7,628	-7,629	-7,629	-7,630	-7,633	-7,637	-7,643
-5.33%	-4,712	-4,718	-4,727	-4,741	-4,760	-4,785	-4,814
-2.67%	-1,888	-1,936	-1,991	-2,053	-2,121	-2,193	-2,269
0%	327	218	109	0	-109	-219	-329
2.67%	1,323	1,252	1,174	1,092	1,006	917	825

5.33%	1,518	1,503	1,482	1,454	1,419	1,378	1,330
8.00%	1,533	1,531	1,529	1,524	1,517	1,505	1,490

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

20,211

공시일	2017-07-14
기준일	2017-07-13

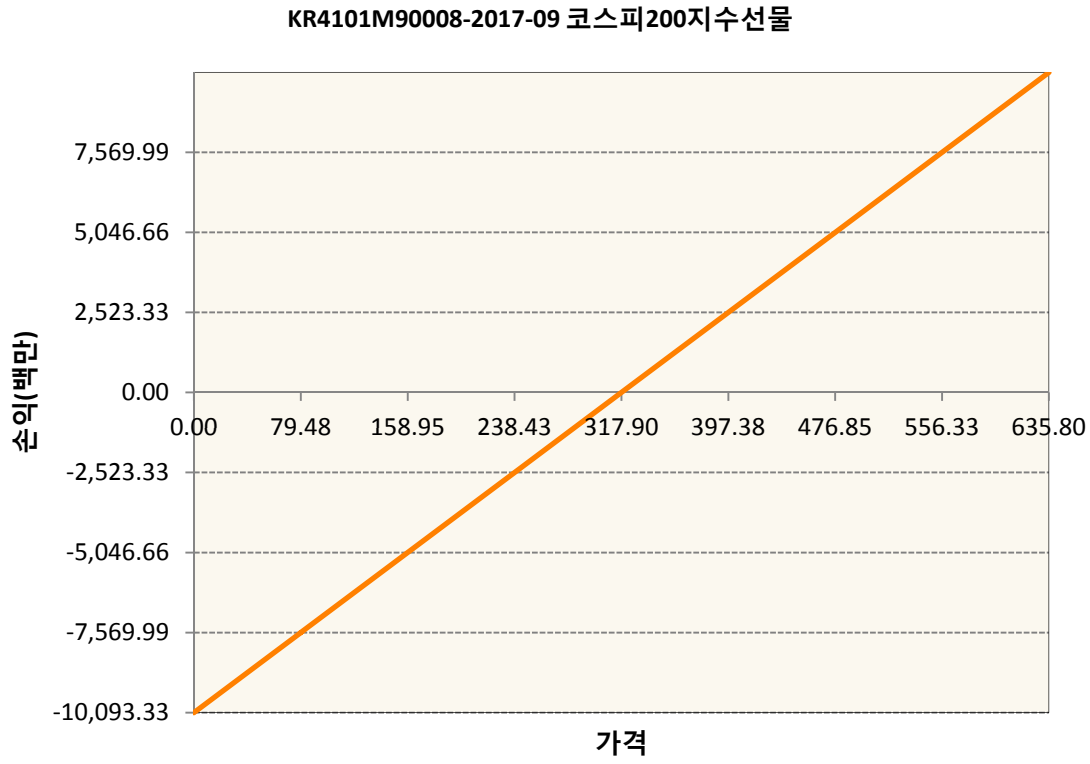
ETF스마트레버리지목표전환형6호

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	10,093	0	10,093	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101M90(2017-09 코스피200지수선물							804
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-804	-804	-804	-804	-804	-804	-804
-5.33%	-536	-536	-536	-536	-536	-536	-536
-2.67%	-268	-268	-268	-268	-268	-268	-268
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	268	268	268	268	268	268	268
5.33%	536	536	536	536	536	536	536
8.00%	804	804	804	804	804	804	804

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

482

공시일	2017-07-14
기준일	2017-07-13

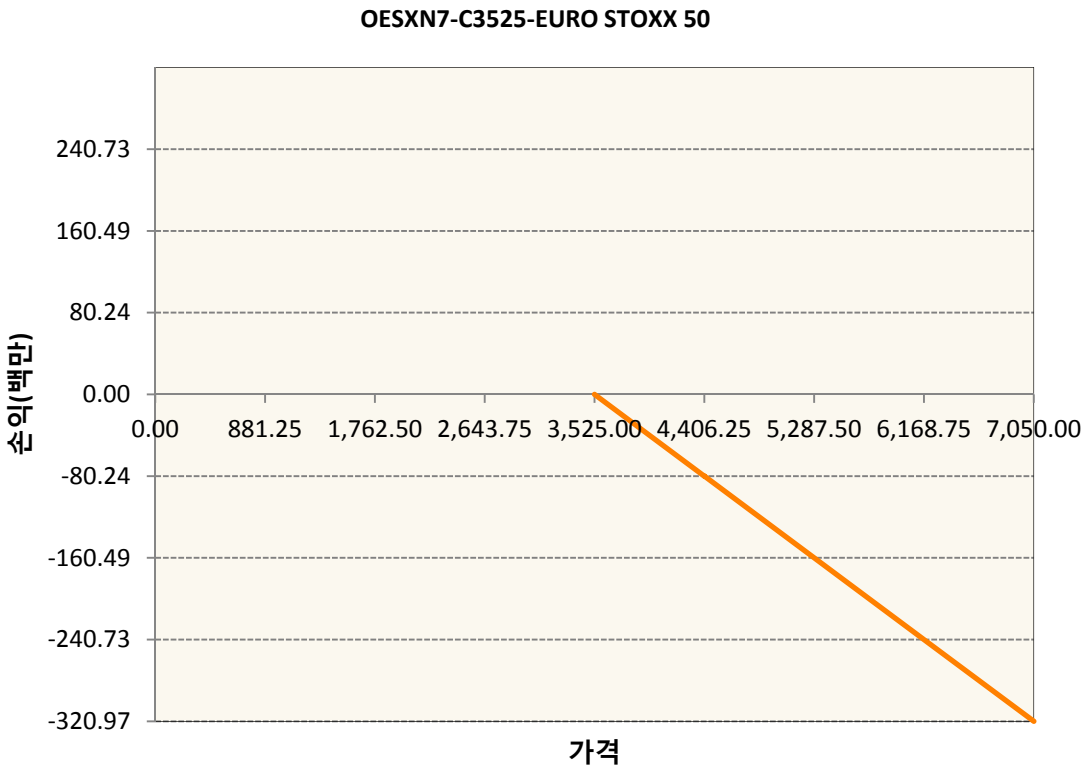
유로커버드콜(주식혼합-파생형)

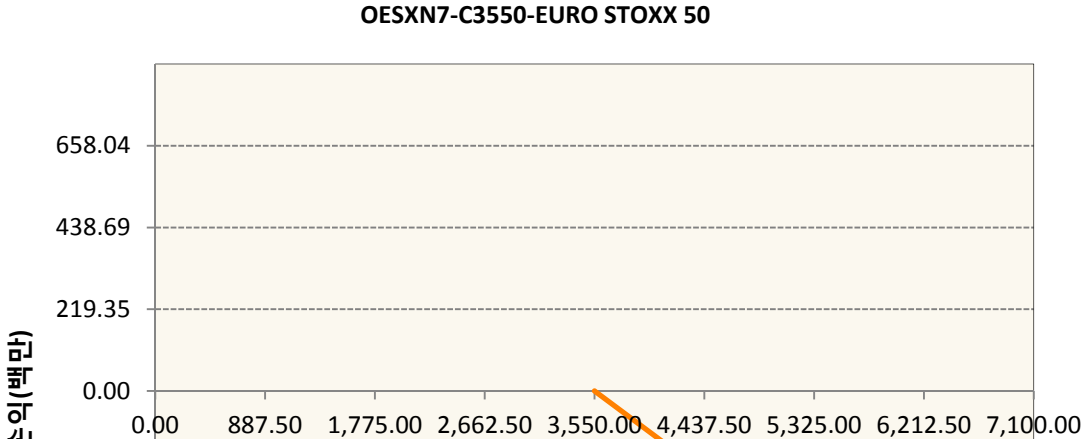
1. 계약금액

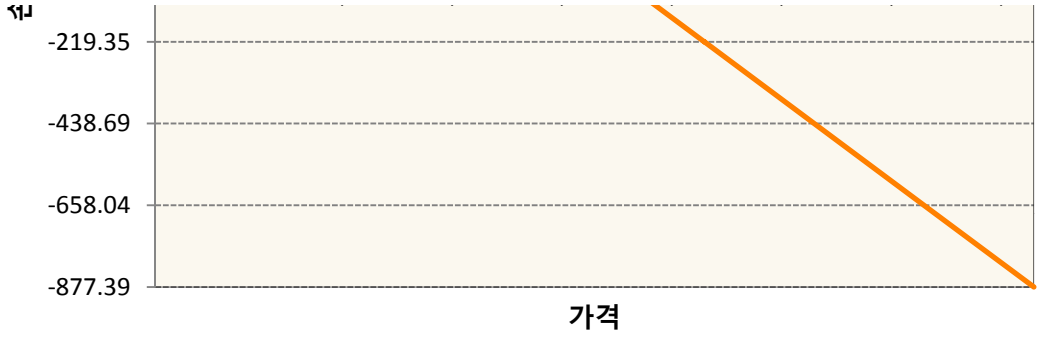
(단위:백만원)

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	1,191	0	1,191	
누계	유가증권	옵션	0	2,397	-2,397	장내

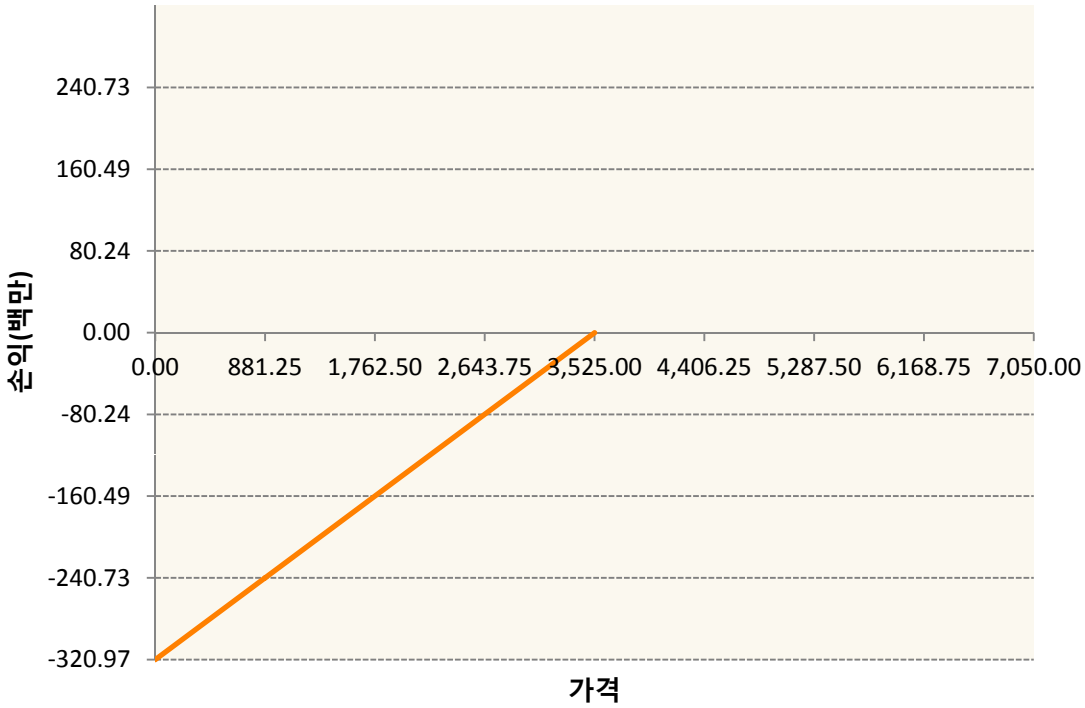
2. 만기시점의 손익구조



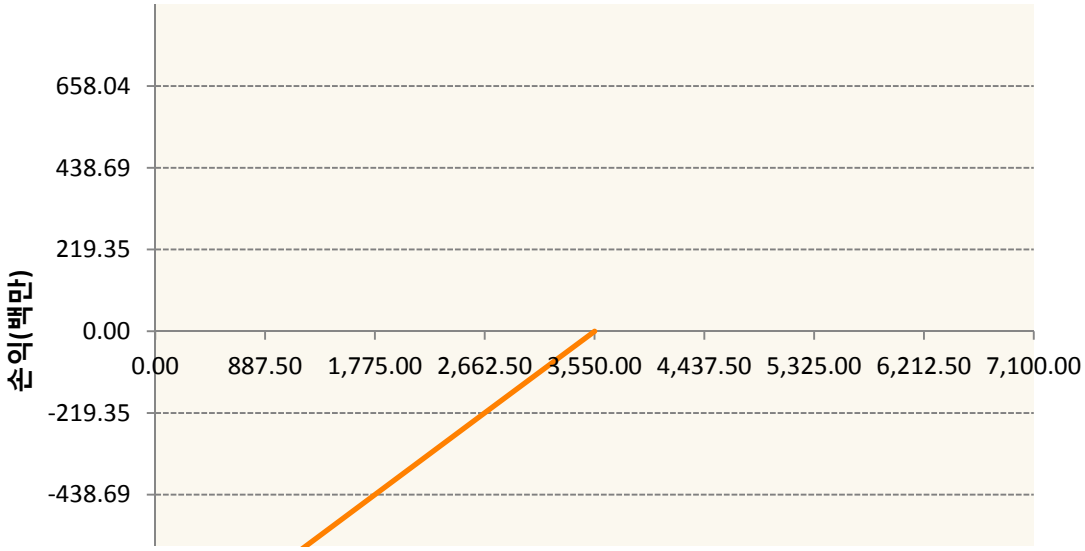


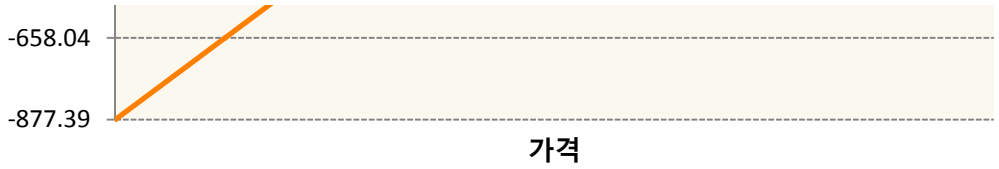


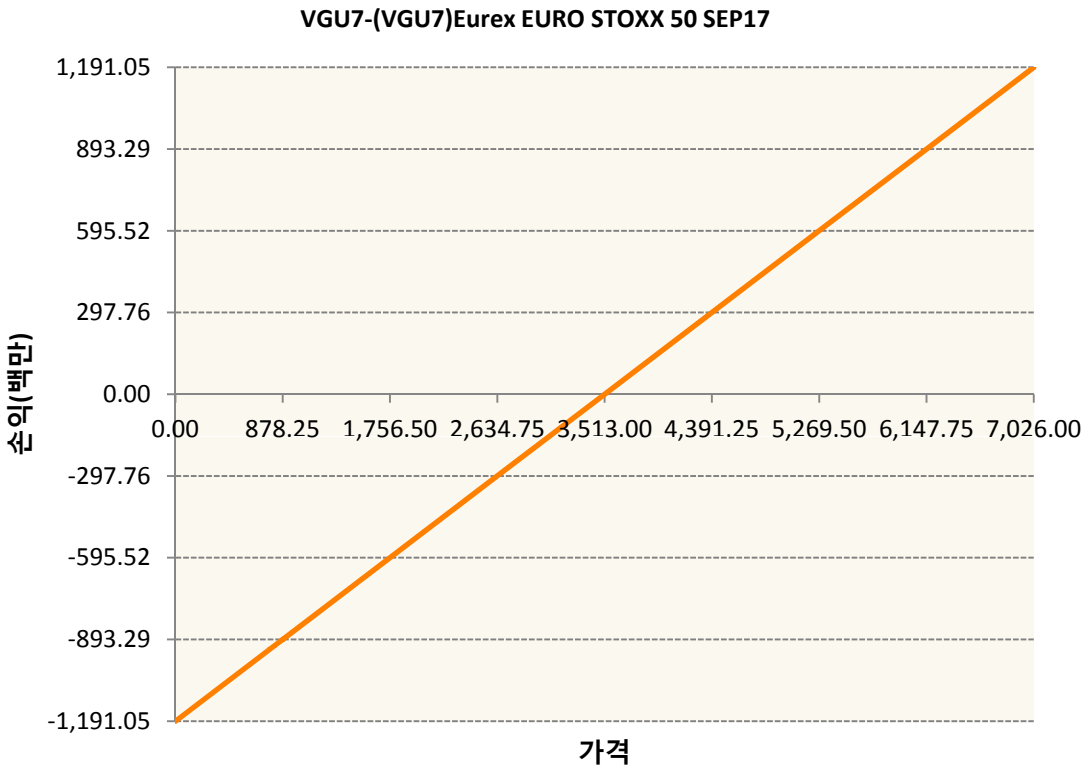
OESXN7-P3525-EURO STOXX 50



OESXN7-P3550-EURO STOXX 50







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
OESXN7-C3!	EURO STOXX 50	26
OESXN7-C3!	EURO STOXX 50	70
OESXN7-P3!	EURO STOXX 50	26
OESXN7-P3!	EURO STOXX 50	70
VGU7	(VGU7)Eurex EURO STOXX 50 SEP17	95

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	246

공시일	2017-07-14
기준일	2017-07-13

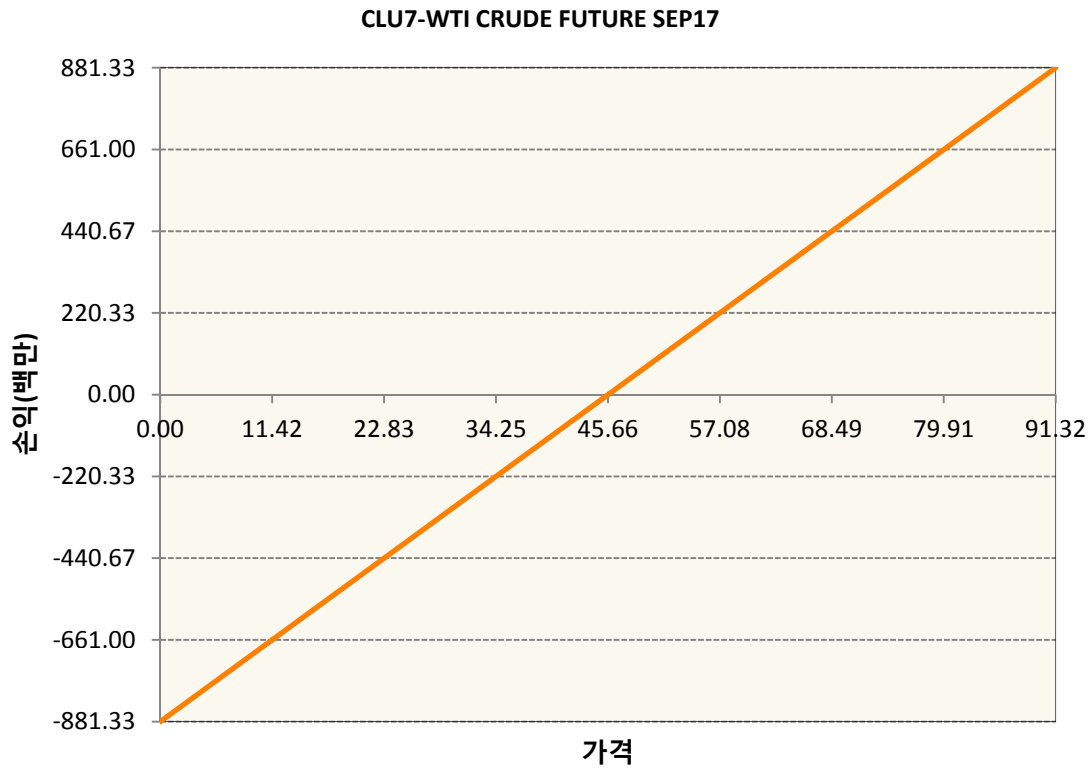
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

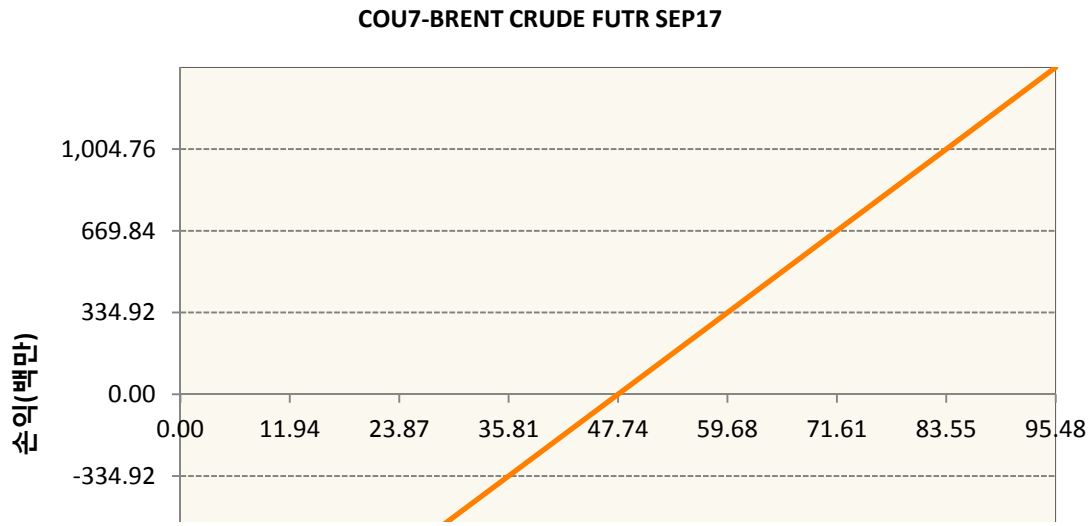
1. 계약금액

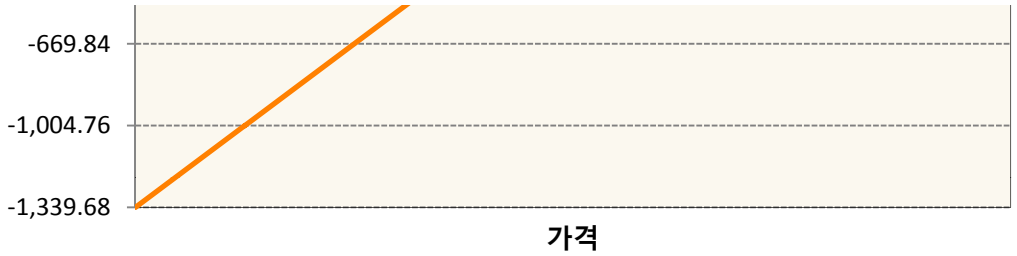
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	5,060	227	4,833	

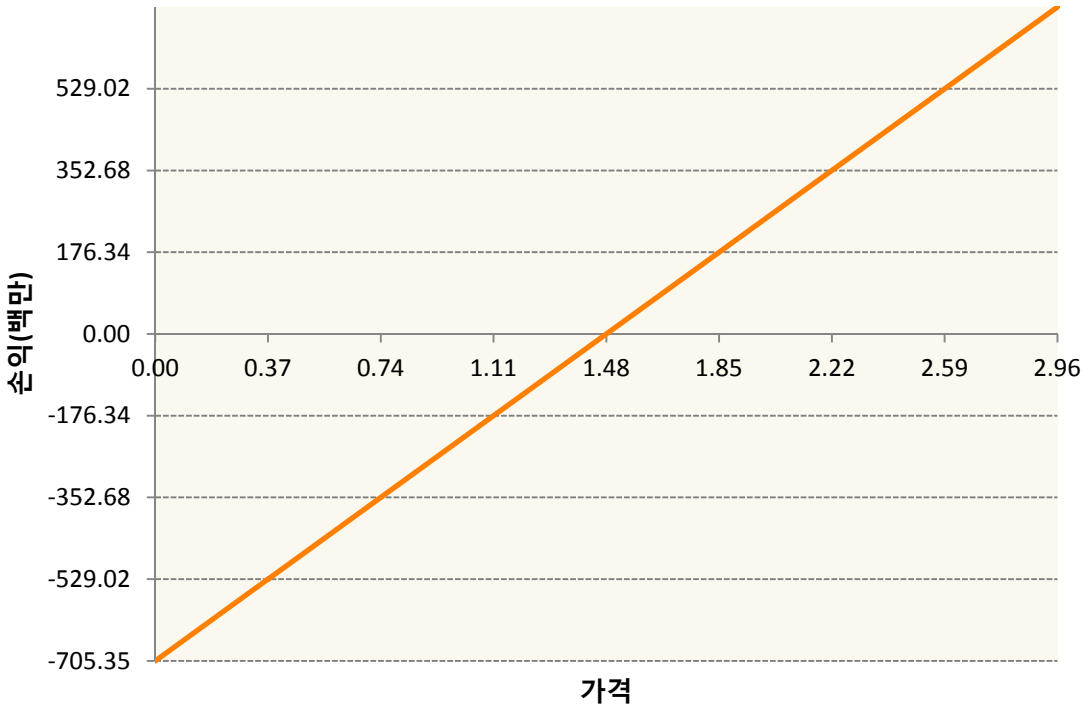
2. 만기시점의 손익구조



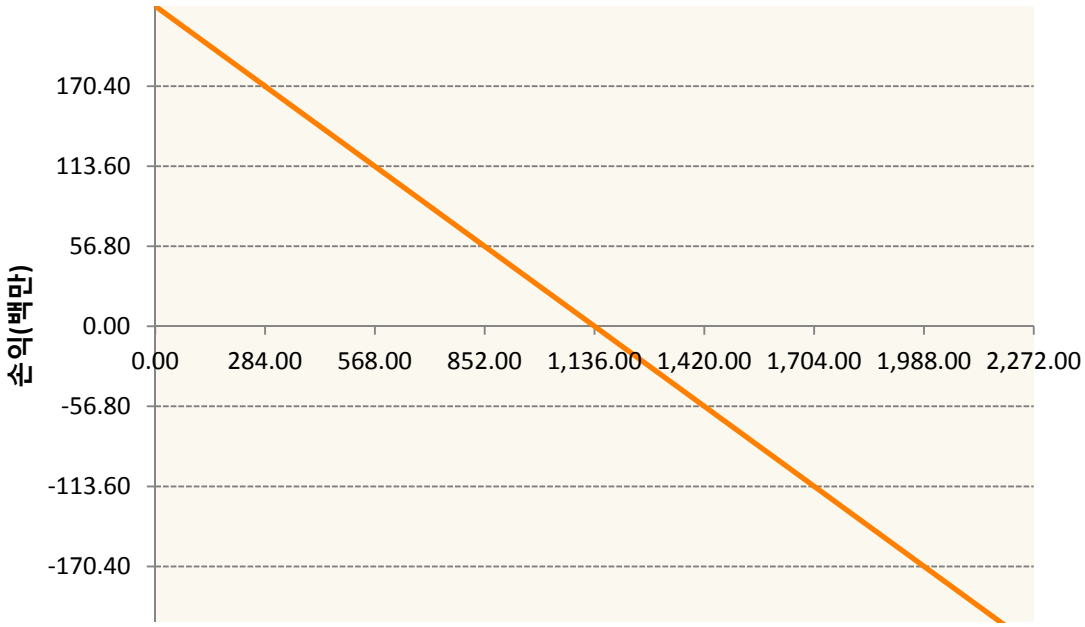


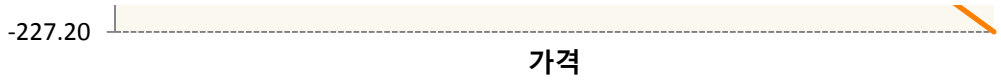


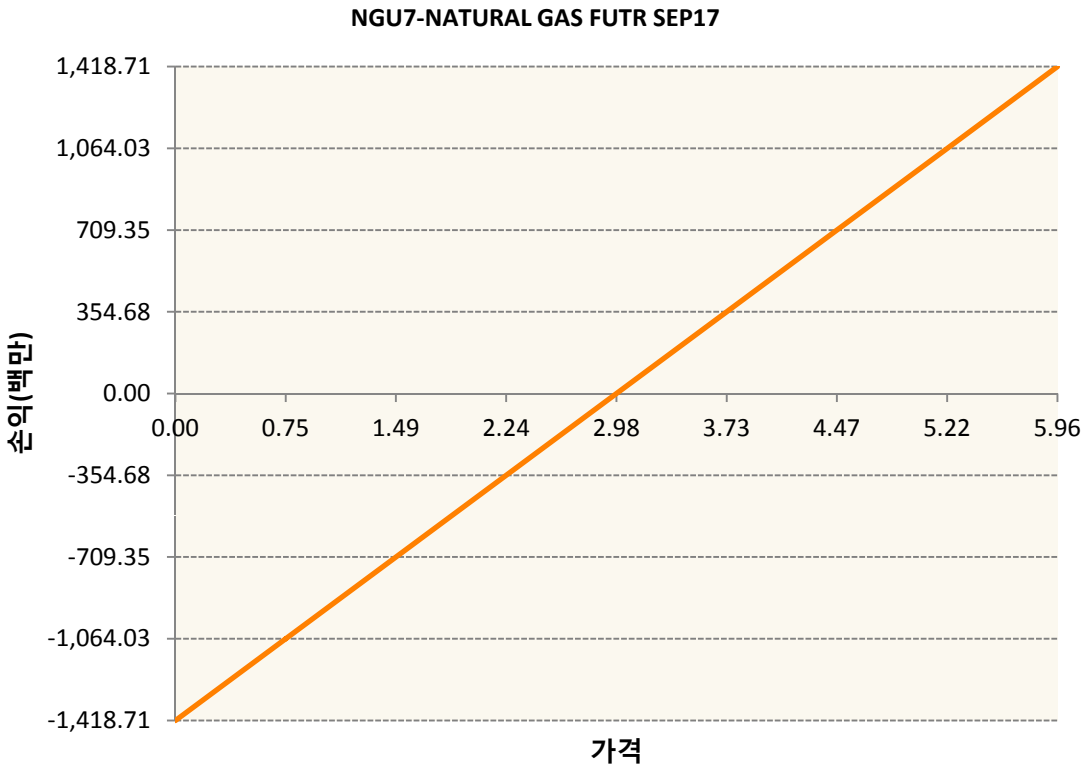
HOU7-NY HARB ULSD FUT SEP17

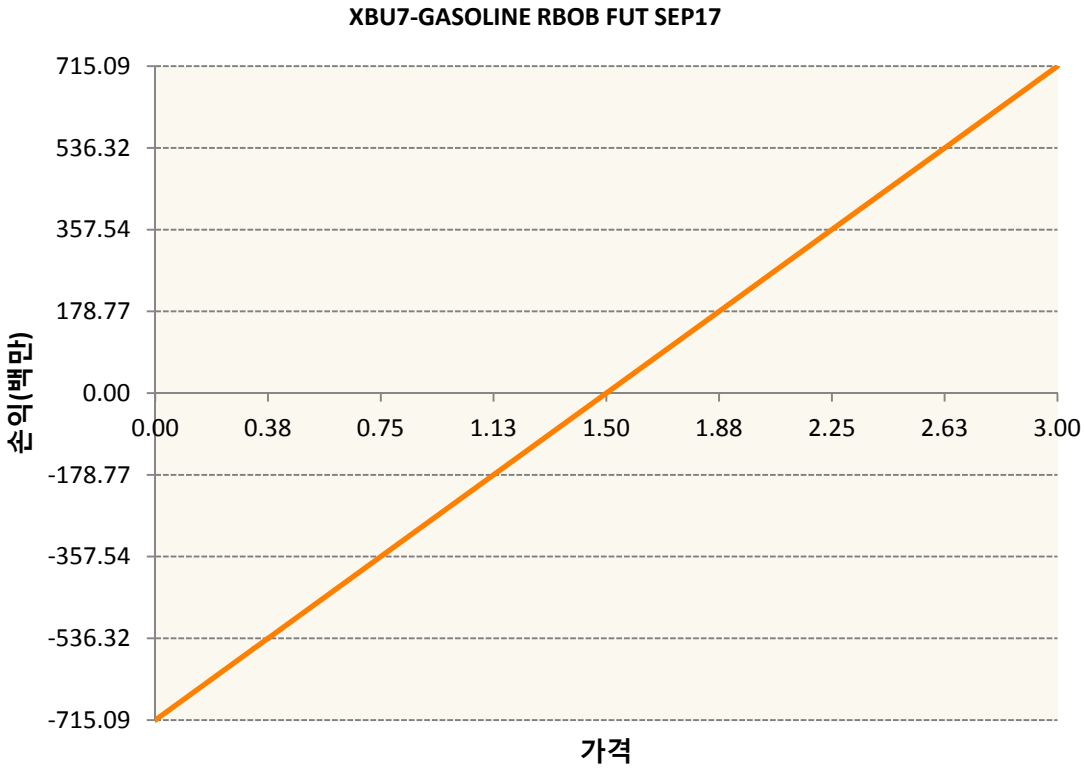


KR4175M80003-2017-08 달러선물




-227.20
가격


NGU7-NATURAL GAS FUTR SEP17
1,418.71
1,064.03
709.35
354.68
0.00
-354.68
-709.35
-1,064.03
-1,418.71
0.00
0.75
1.49
2.24
2.98
3.73
4.47
5.22
5.96
손익(백만)
가격


XBU7-GASOLINE RBOB FUT SEP17
715.09
536.32
357.54
178.77
0.00
-178.77
-357.54
-536.32
-715.09
0.00
0.38
0.75
1.13
1.50
1.88
2.25
2.63
3.00
손익(백만)
가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLU7	WTI CRUDE FUTURE SEP17	71
COU7	BRENT CRUDE FUTR SEP17	107
HOU7	NY HARB ULSD FUT SEP17	56
KR4175M80(	2017-08 달러선물	18
NGU7	NATURAL GAS FUTR SEP17	113
XBU7	GASOLINE RBOB FUT SEP17	57

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

779

공시일	2017-07-14
기준일	2017-07-13

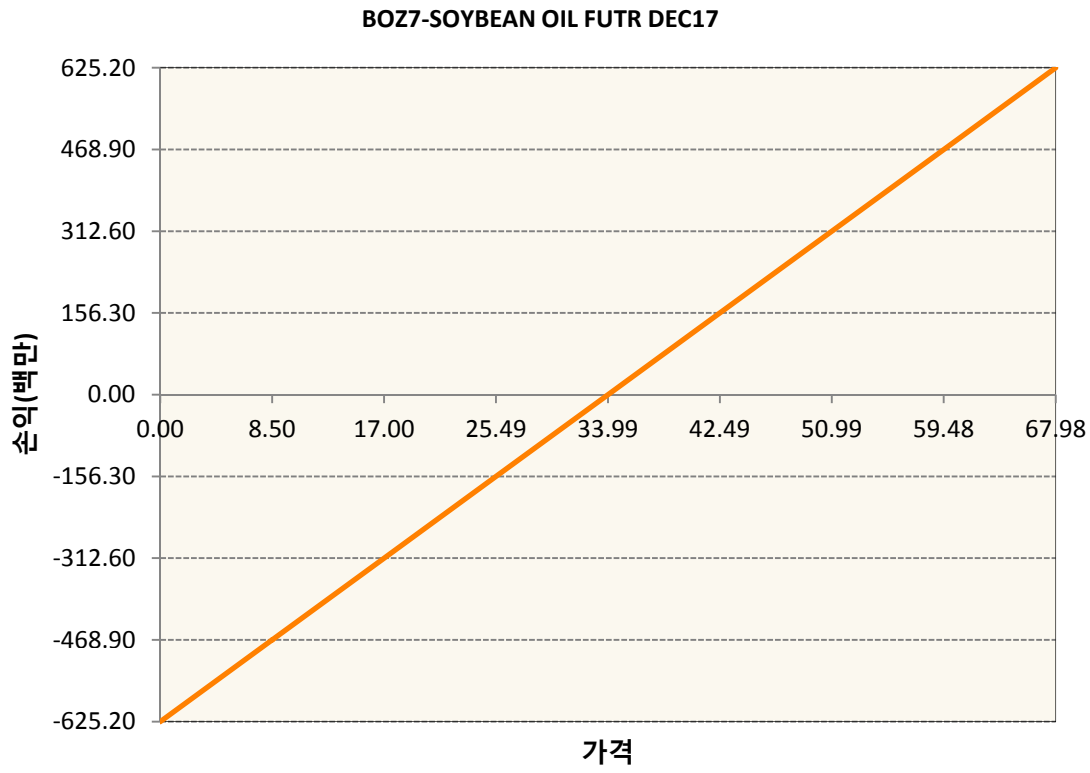
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

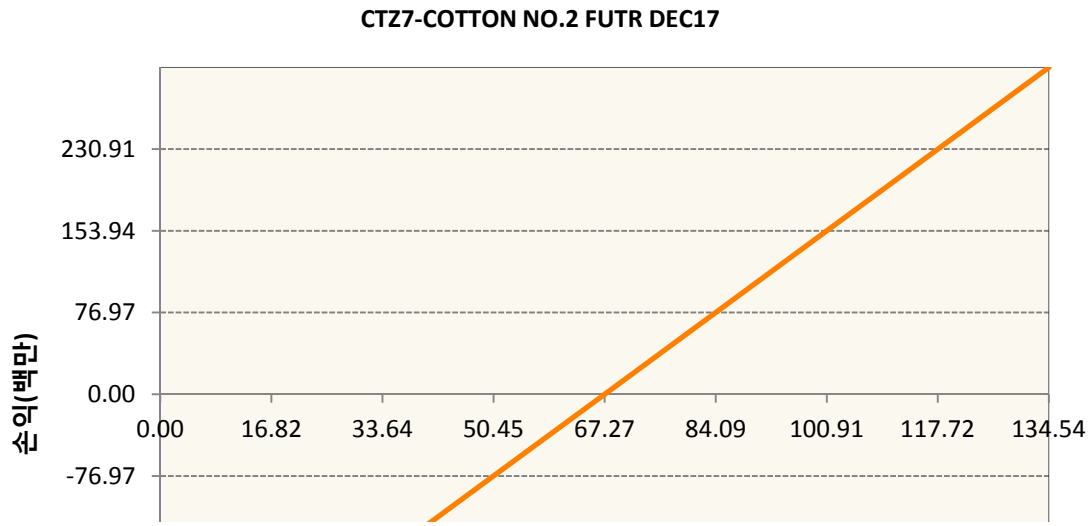
1. 계약금액

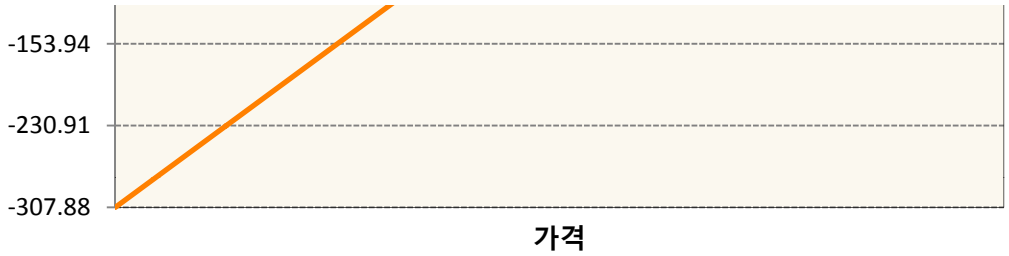
(단위:백만원)

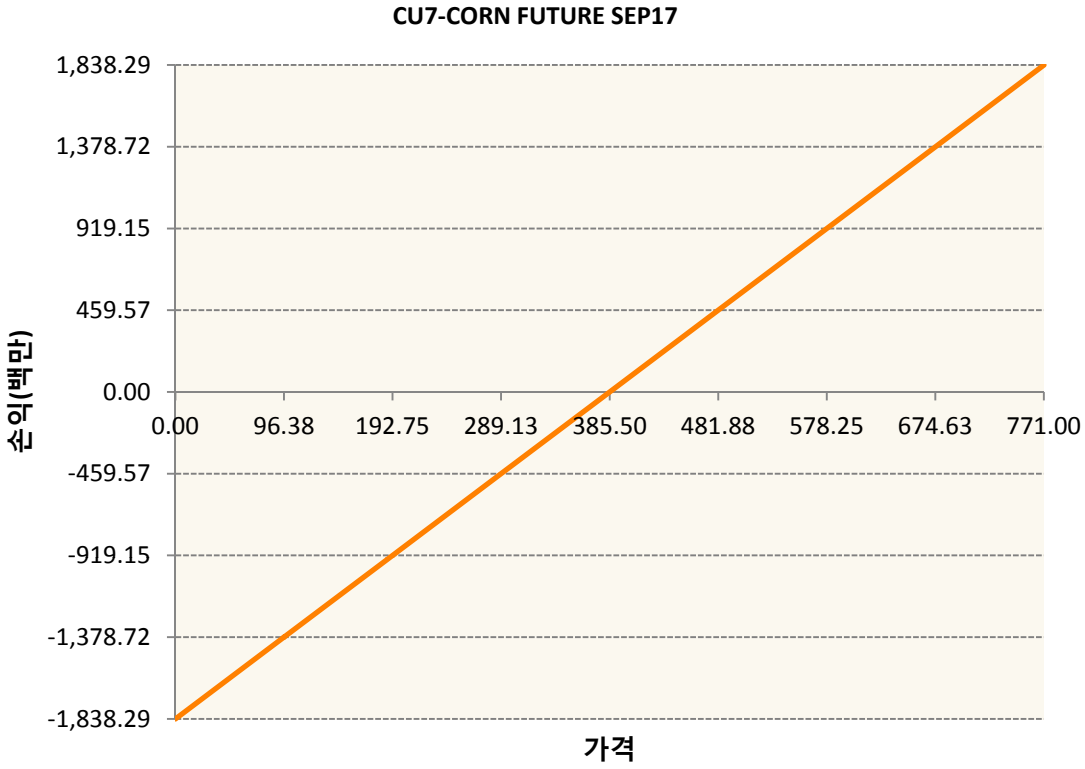
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	7,238	398	6,840	

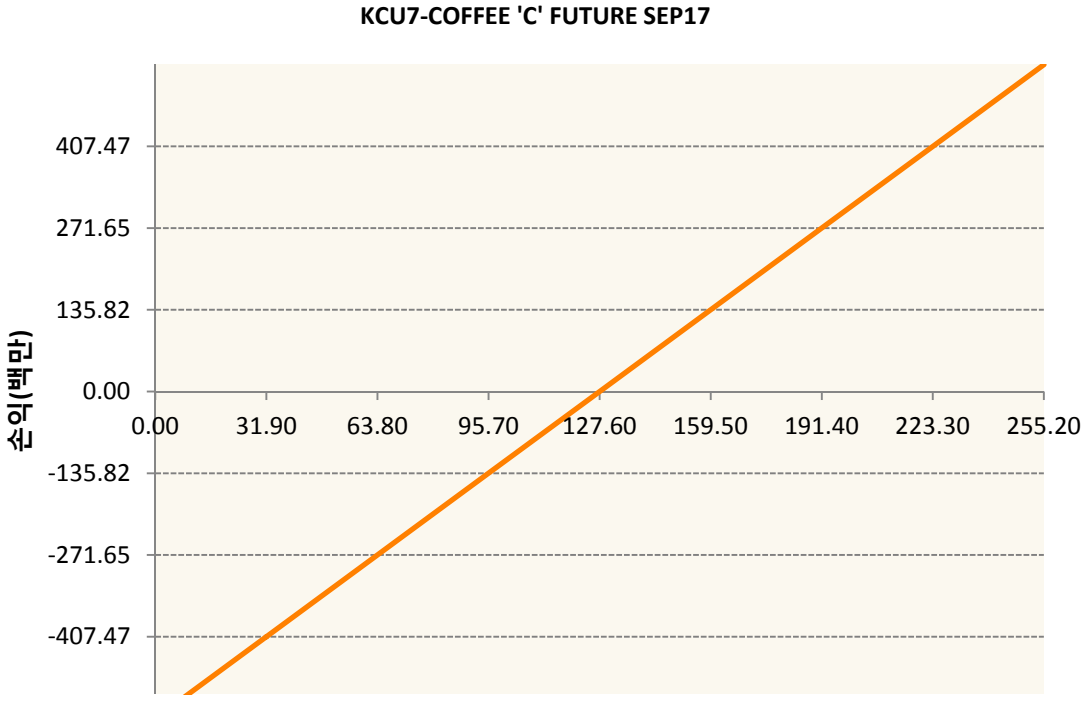
2. 만기시점의 손익구조

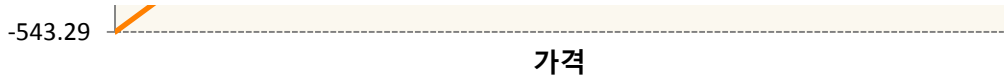


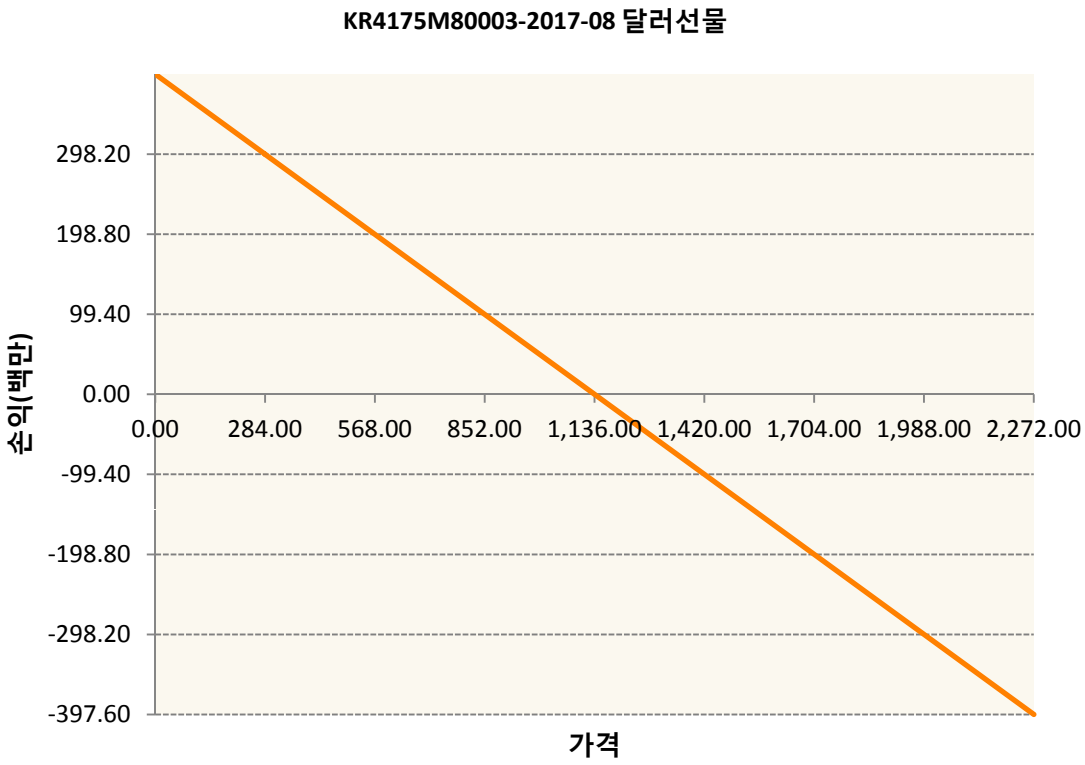


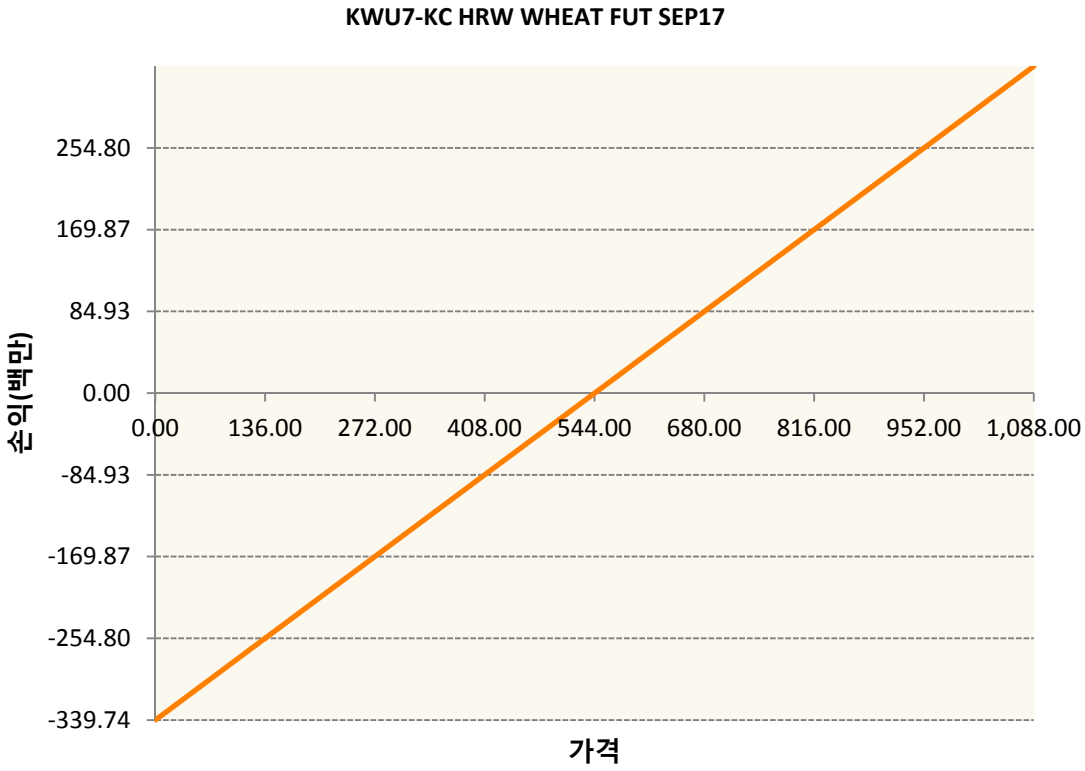

-153.94
-230.91
-307.88
가격

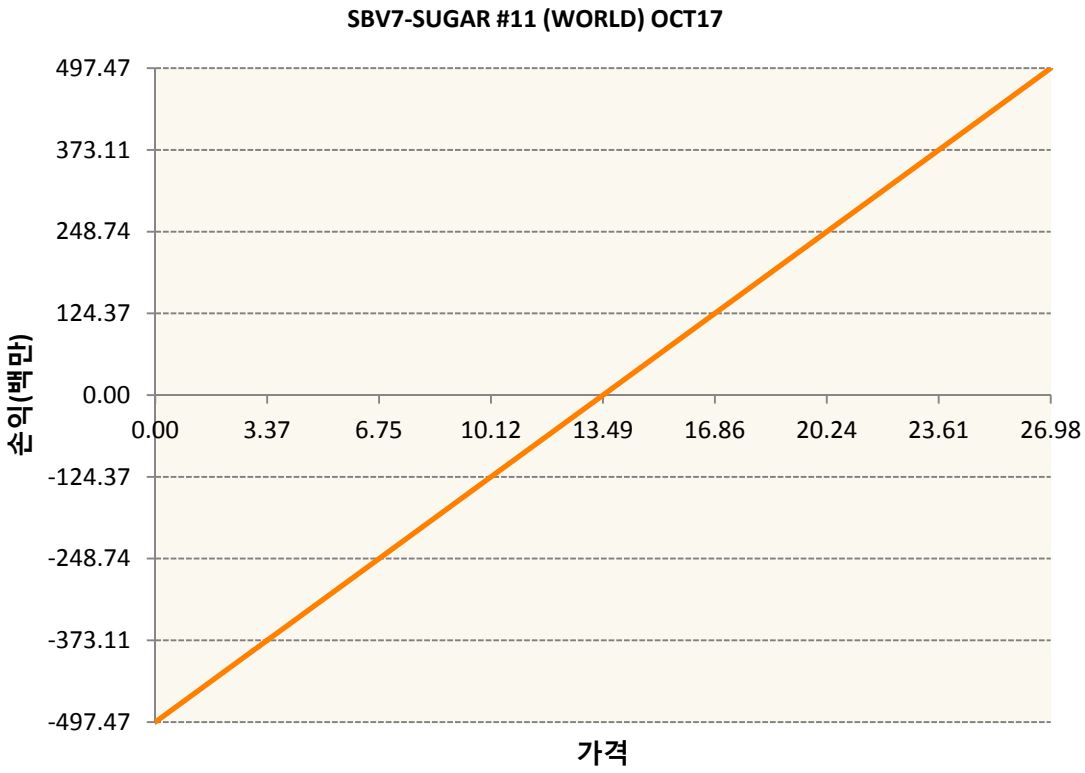

CU7-CORN FUTURE SEP17
1,838.29
1,378.72
919.15
459.57
0.00
-459.57
-919.15
-1,378.72
-1,838.29
0.00
96.38
192.75
289.13
385.50
481.88
578.25
674.63
771.00
손익(백만)
가격

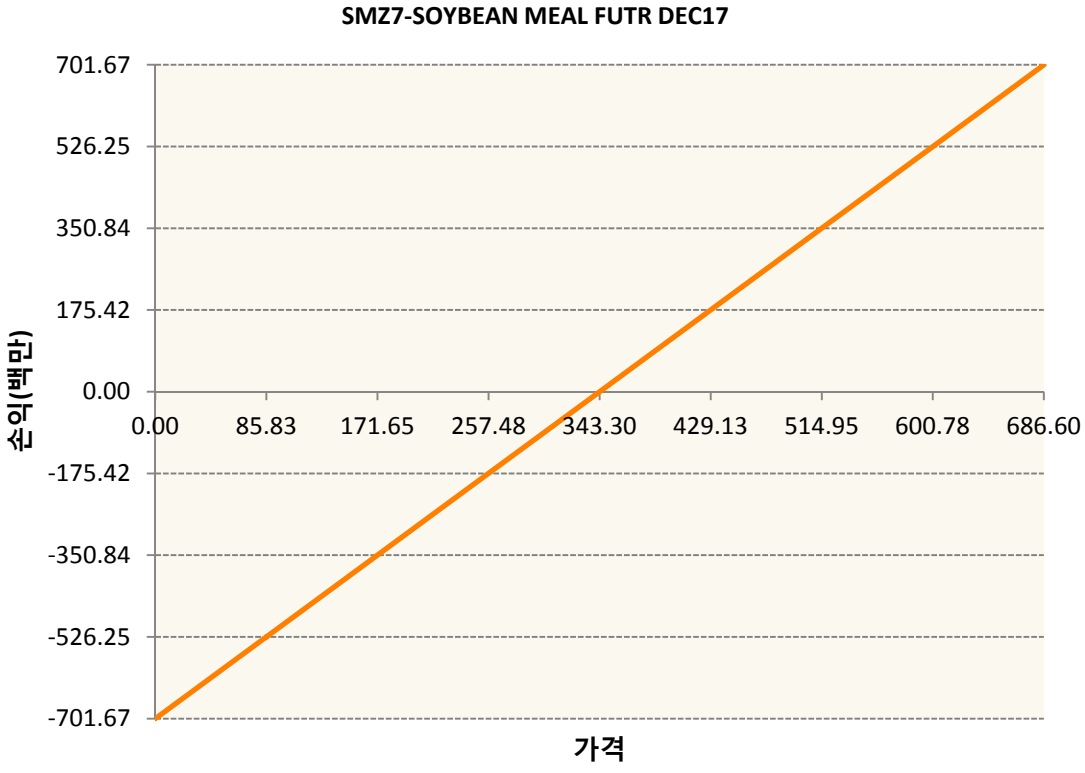

KCU7-COFFEE 'C' FUTURE SEP17
407.47
271.65
135.82
0.00
-135.82
-271.65
-407.47
0.00
31.90
63.80
95.70
127.60
159.50
191.40
223.30
255.20
손익(백만)

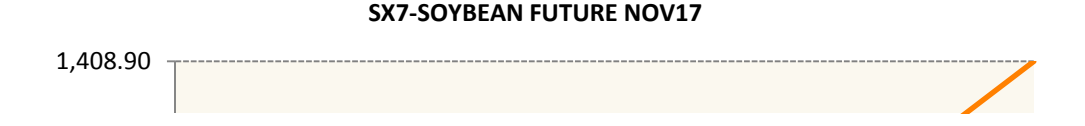

-543.29
가격

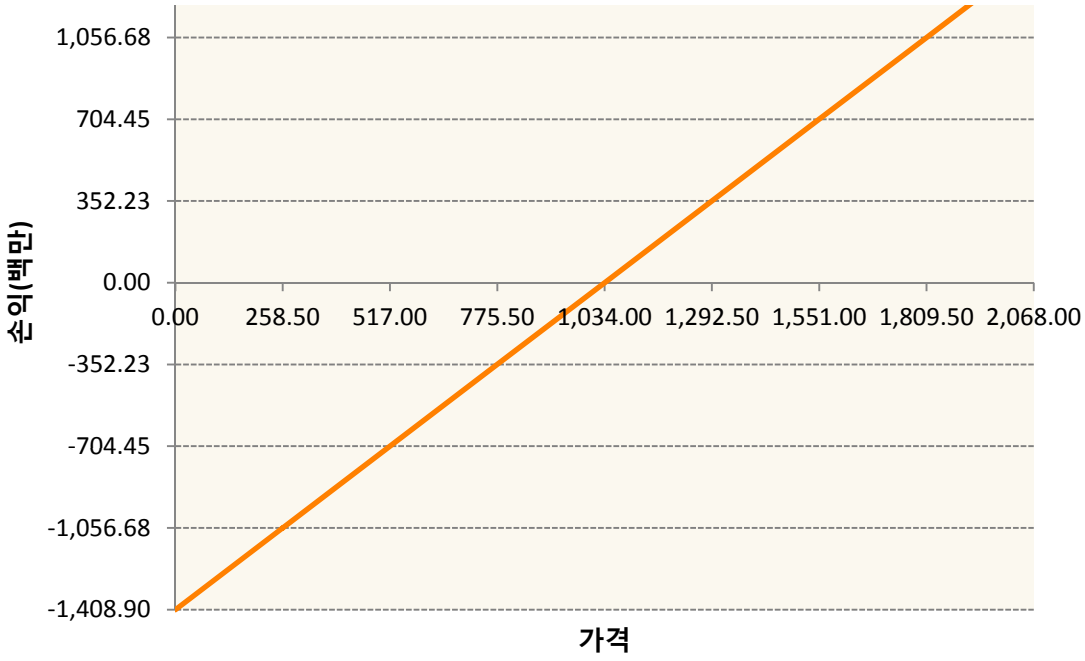

KR4175M80003-2017-08 달러선물
298.20
198.80
99.40
0.00
-99.40
-198.80
-298.20
-397.60
0.00
284.00
568.00
852.00
1,136.00
1,420.00
1,704.00
1,988.00
2,272.00
손익(백만)
가격

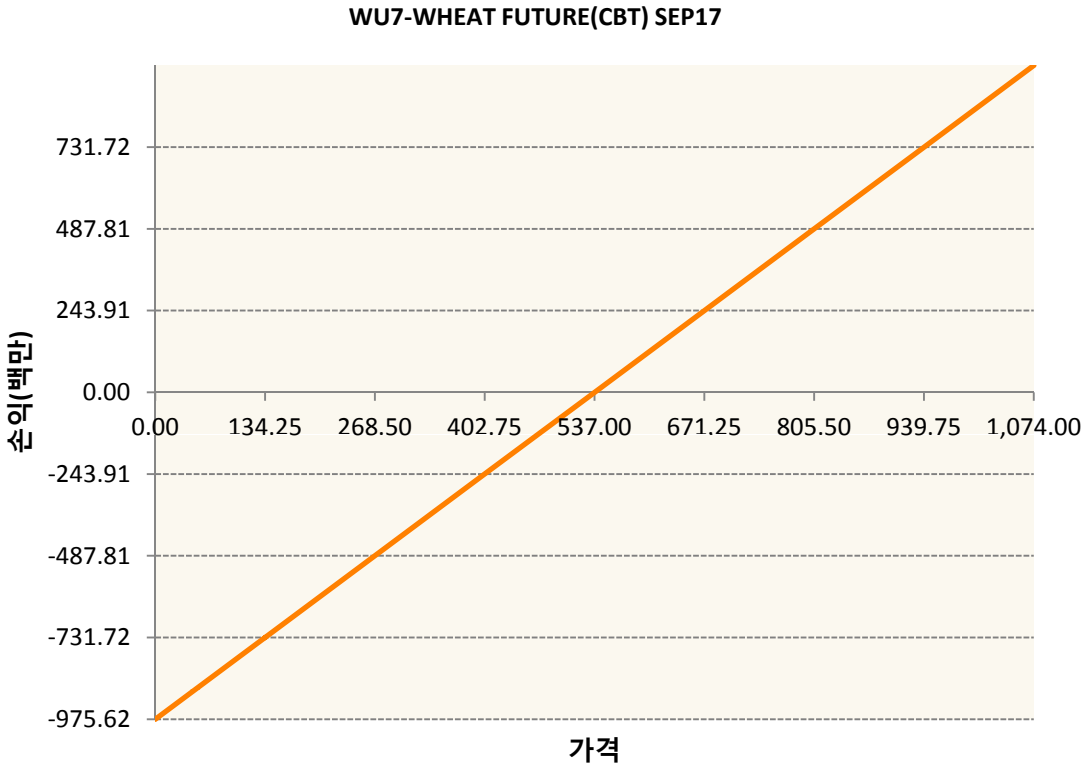

KWU7-KC HRW WHEAT FUT SEP17
254.80
169.87
84.93
0.00
-84.93
-169.87
-254.80
-339.74
0.00
136.00
272.00
408.00
544.00
680.00
816.00
952.00
1,088.00
손익(백만)
가격


SBV7-SUGAR #11 (WORLD) OCT17
497.47
373.11
248.74
124.37
0.00
-124.37
-248.74
-373.11
-497.47
0.00
3.37
6.75
10.12
13.49
16.86
20.24
23.61
26.98
손익(백만)
가격


SMZ7-SOYBEAN MEAL FUTR DEC17
701.67
526.25
350.84
175.42
0.00
-175.42
-350.84
-526.25
-701.67
0.00
85.83
171.65
257.48
343.30
429.13
514.95
600.78
686.60
손익(백만)
가격


SX7-SOYBEAN FUTURE NOV17
1,408.90





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
BOZ7	SOYBEAN OIL FUTR DEC17	50
CTZ7	COTTON NO.2 FUTR DEC17	25
CU7	CORN FUTURE SEP17	147
KCU7	COFFEE 'C' FUTURE SEP17	43
KR4175M80(	2017-08 달러선물	32

KWU7	KC HRW WHEAT FUT SEP17	27
SBV7	SUGAR #11 (WORLD) OCT17	40
SMZ7	SOYBEAN MEAL FUTR DEC17	56
SX7	SOYBEAN FUTURE NOV17	113
WU7	WHEAT FUTURE(CBT) SEP17	78

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

670