공시일	2017-07-17
기준일	2017-07-14

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	2017-07-17
기준일	2017-07-14

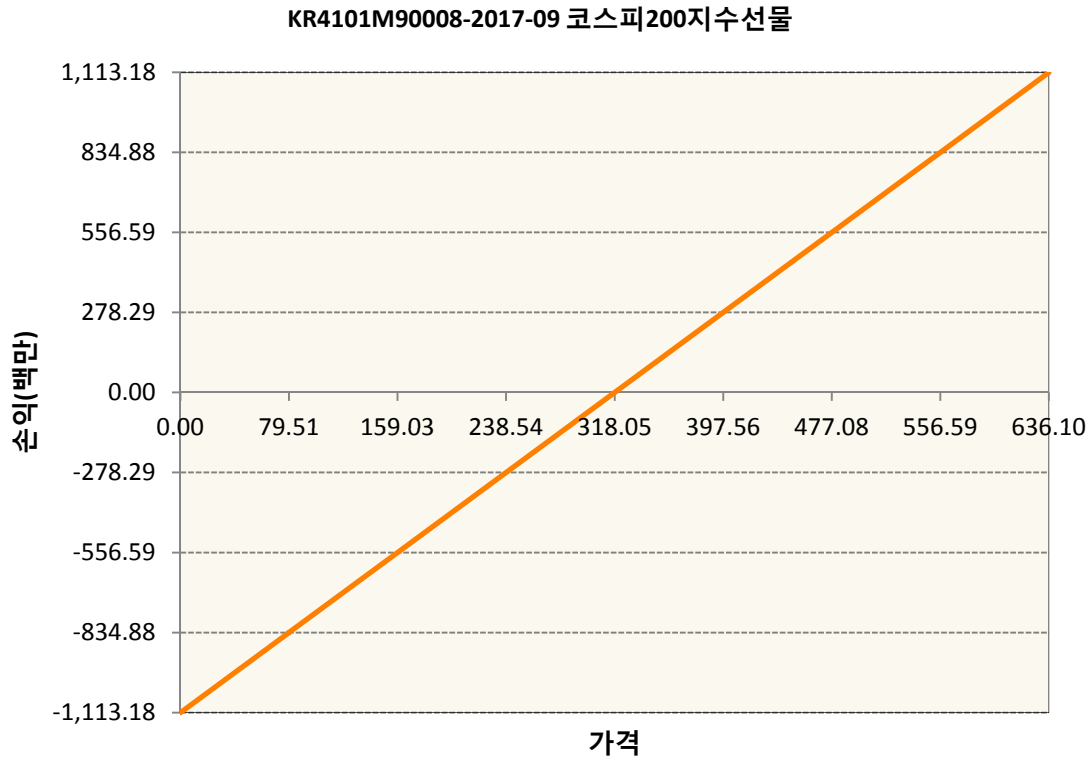
스마트인덱스모

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	2017-07-17
기준일	2017-07-14

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	1,008

* 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	2017-07-17
기준일	2017-07-14

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	381

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

321

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-07-17
기준일	2017-07-14

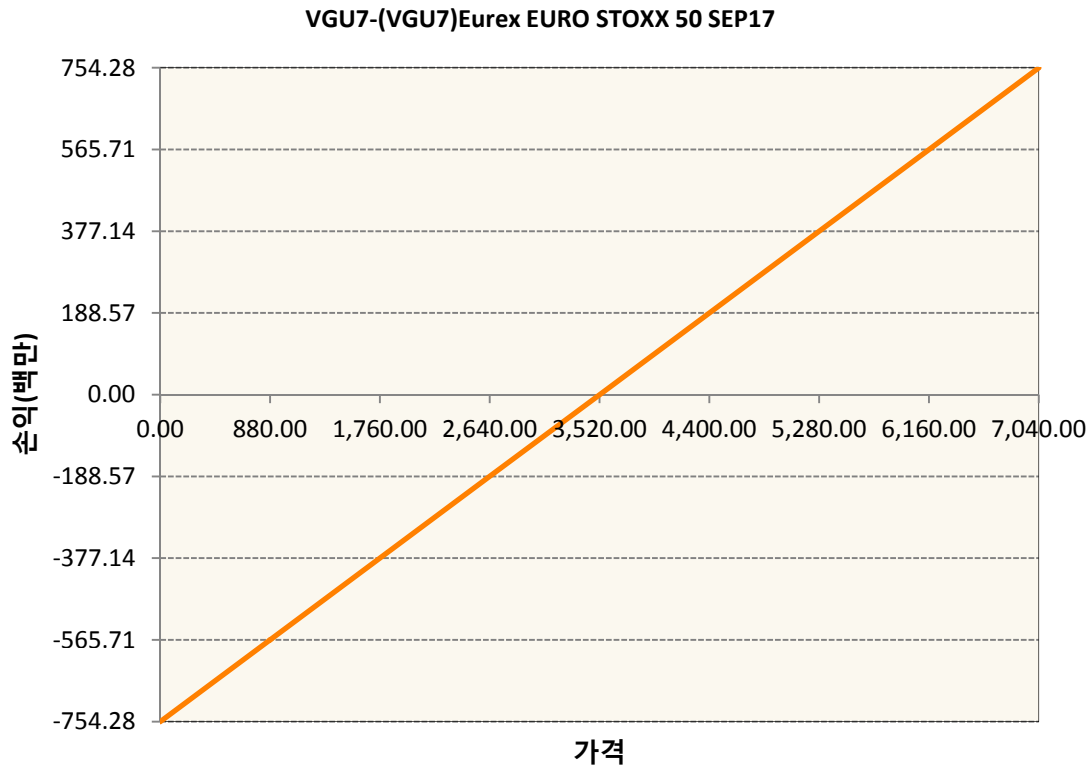
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	754	0	754	

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	2017-07-17
기준일	2017-07-14

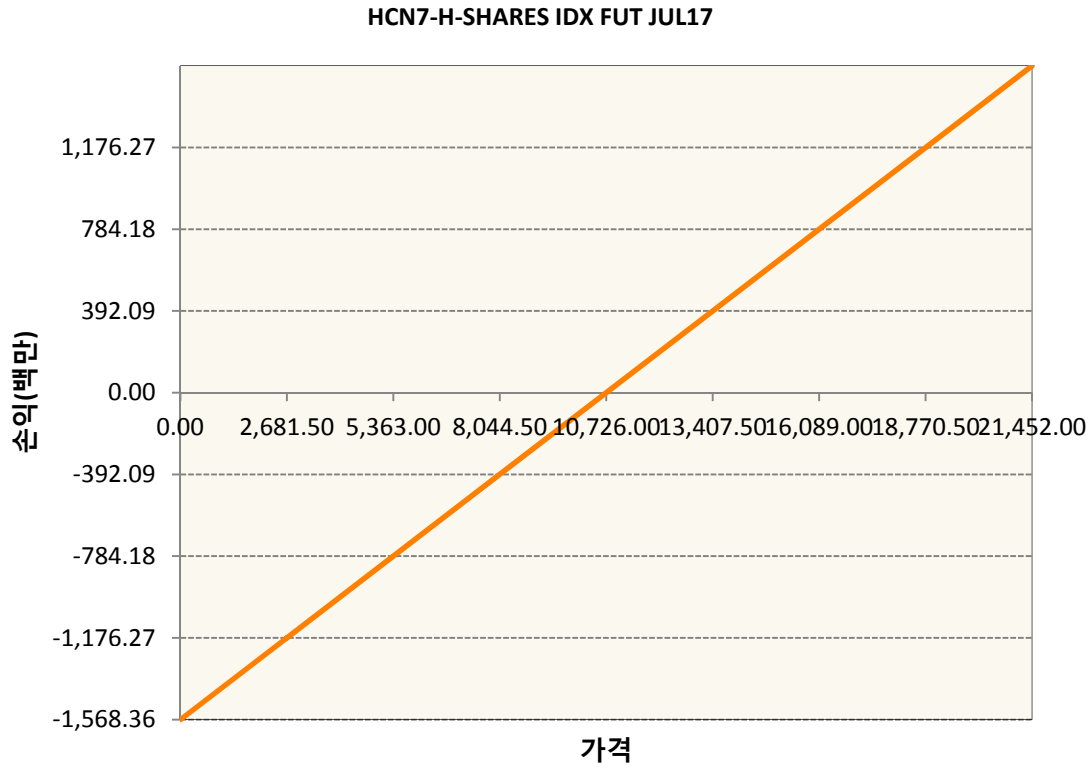
차이나인덱스모(주식-파생형)

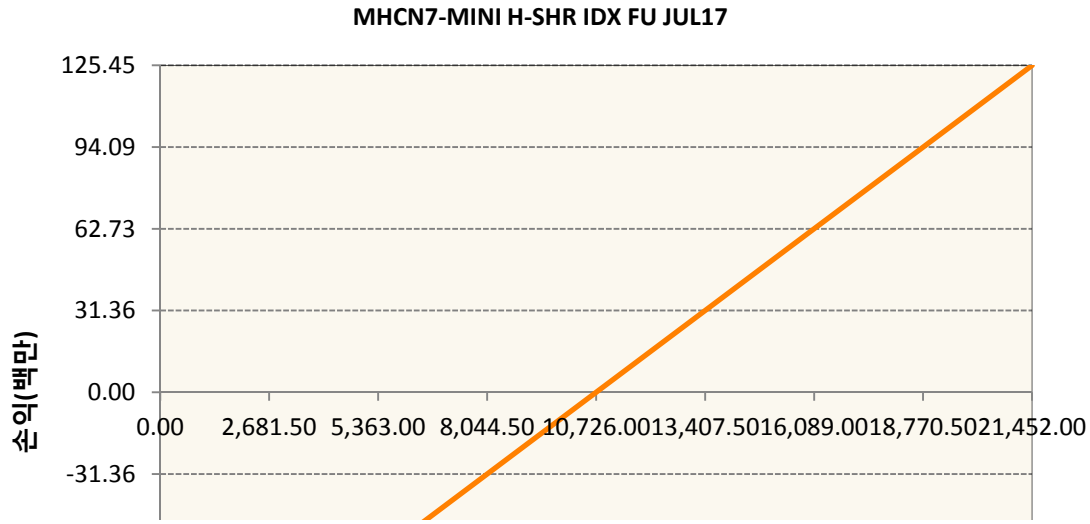
1. 계약금액

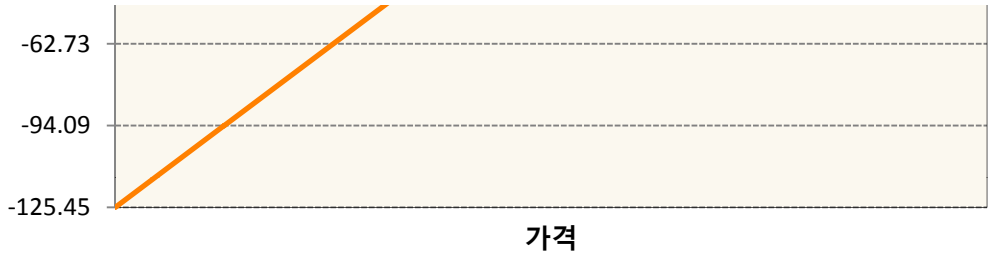
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,694	0	1,694	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)
	131

공시일	2017-07-17
기준일	2017-07-14

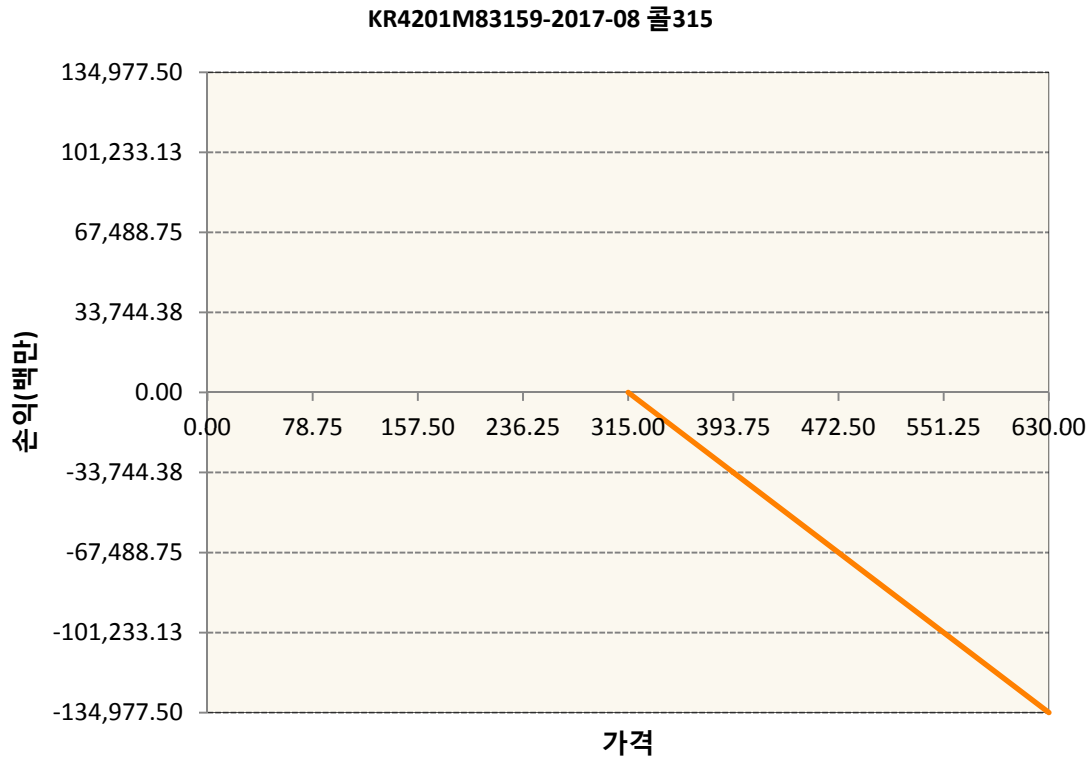
커버드콜모(주식혼합-파생형)

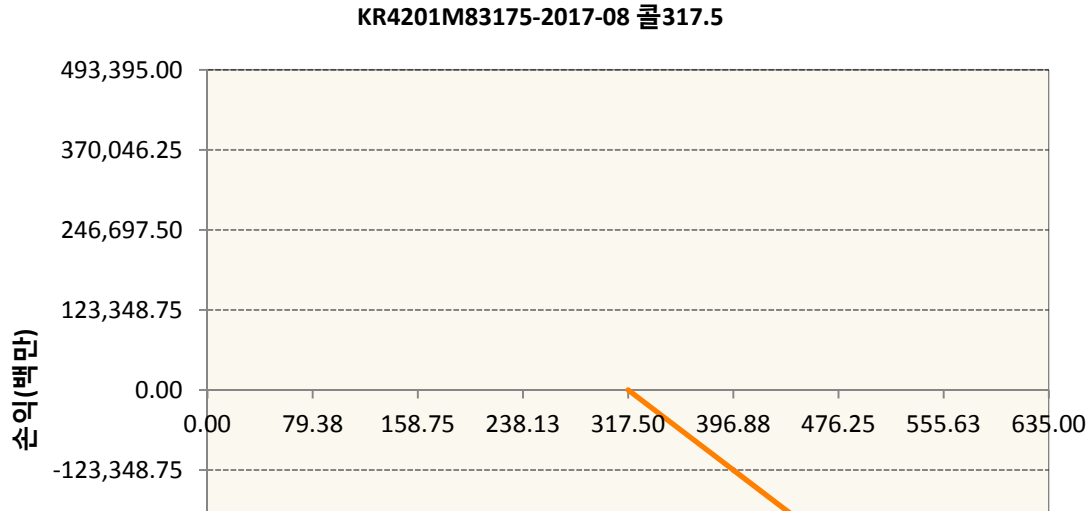
1. 계약금액

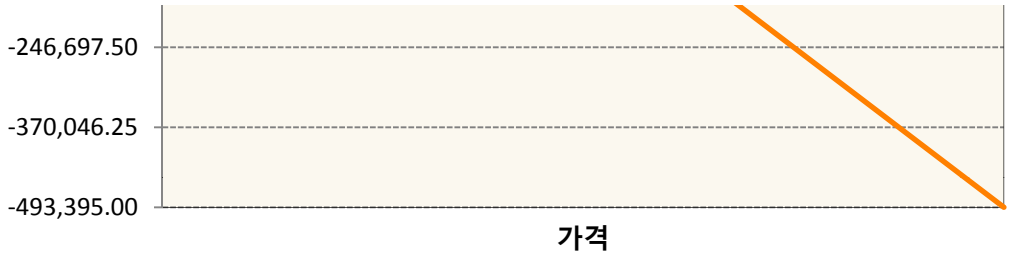
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	893,242	-893,242	장내
누계	유가증권	옵션	0	1,180,801	-1,180,801	장내

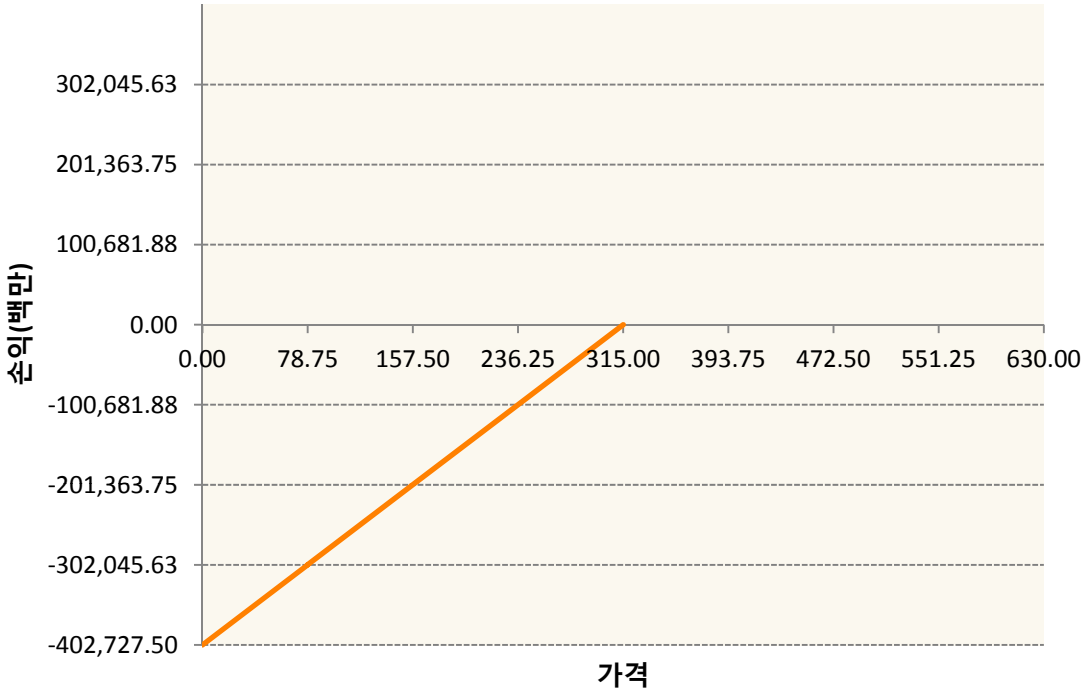
2. 만기시점의 손익구조



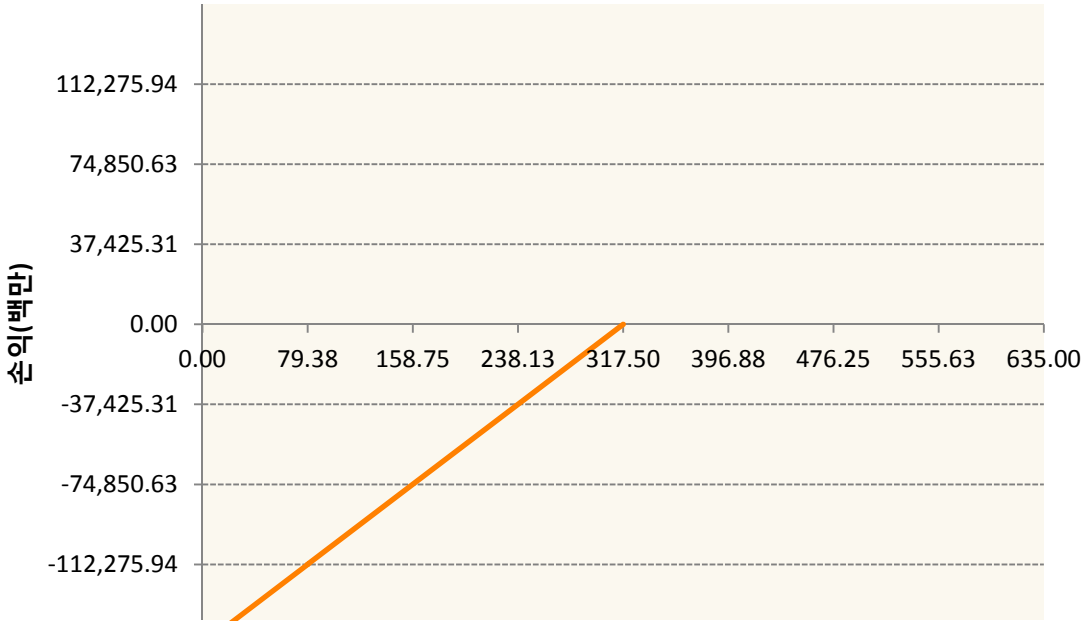




KR4301M83157-2017-08 풋315



KR4301M83173-2017-08 풋317.5





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201M83: 2017-08 콜315							8,756
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	3,757	3,675	3,573	3,453	3,318	3,168	3,006
-5.33%	3,390	3,218	3,032	2,833	2,624	2,407	2,183
-2.67%	2,493	2,238	1,979	1,717	1,452	1,186	919
0%	833	556	278	0	-279	-557	-836
2.67%	-1,617	-1,842	-2,077	-2,319	-2,567	-2,820	-3,077
5.33%	-4,671	-4,811	-4,970	-5,145	-5,335	-5,536	-5,747
8.00%	-8,071	-8,139	-8,227	-8,334	-8,459	-8,601	-8,756
KR4201M83: 2017-08 콜317.5							30,475
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	11,809	11,578	11,278	10,913	10,488	10,009	9,483
-5.33%	10,827	10,298	9,704	9,057	8,367	7,639	6,881
-2.67%	8,226	7,364	6,478	5,572	4,652	3,719	2,778
0%	3,063	2,042	1,021	0	-1,021	-2,041	-3,062
2.67%	-5,011	-5,913	-6,838	-7,780	-8,735	-9,702	-10,677
5.33%	-15,515	-16,123	-16,794	-17,517	-18,282	-19,082	-19,911
8.00%	-27,542	-27,862	-28,259	-28,726	-29,256	-29,842	-30,475
KR4301M83: 2017-08 풋315							26,296
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-26,220	-26,221	-26,224	-26,232	-26,245	-26,266	-26,296
-5.33%	-15,449	-15,488	-15,547	-15,627	-15,728	-15,849	-15,990
-2.67%	-5,414	-5,668	-5,941	-6,229	-6,529	-6,838	-7,156
0%	1,088	728	366	0	-368	-737	-1,108
2.67%	3,009	2,886	2,734	2,557	2,357	2,138	1,902
5.33%	3,209	3,197	3,175	3,140	3,089	3,020	2,934
8.00%	3,216	3,215	3,214	3,211	3,204	3,192	3,174
KR4301M83: 2017-08 풋317.5							10,323
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-10,309	-10,309	-10,309	-10,310	-10,313	-10,317	-10,323
-5.33%	-6,327	-6,334	-6,345	-6,362	-6,385	-6,416	-6,452
-2.67%	-2,480	-2,545	-2,619	-2,702	-2,792	-2,887	-2,987
0%	421	281	140	0	-140	-281	-421
2.67%	1,550	1,477	1,395	1,304	1,207	1,105	998

5.33%	1,716	1,706	1,689	1,665	1,634	1,595	1,549
8.00%	1,724	1,724	1,723	1,720	1,715	1,707	1,695

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

80,460

공시일	2017-07-17
기준일	2017-07-14

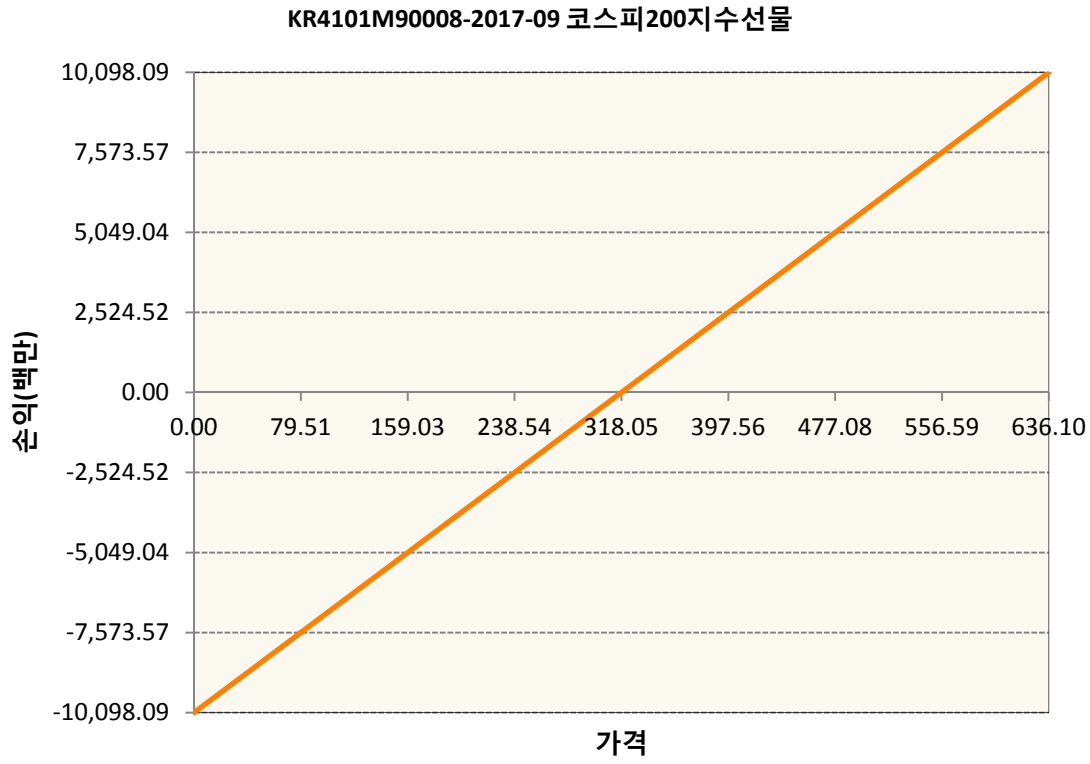
ETF스마트레버리지목표전환형6호

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	10,098	0	10,098	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101M90(2017-09 코스피200지수선물							806
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-806	-806	-806	-806	-806	-806	-806
-5.33%	-537	-537	-537	-537	-537	-537	-537
-2.67%	-269	-269	-269	-269	-269	-269	-269
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	269	269	269	269	269	269	269
5.33%	537	537	537	537	537	537	537
8.00%	806	806	806	806	806	806	806

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

484

공시일	2017-07-17
기준일	2017-07-14

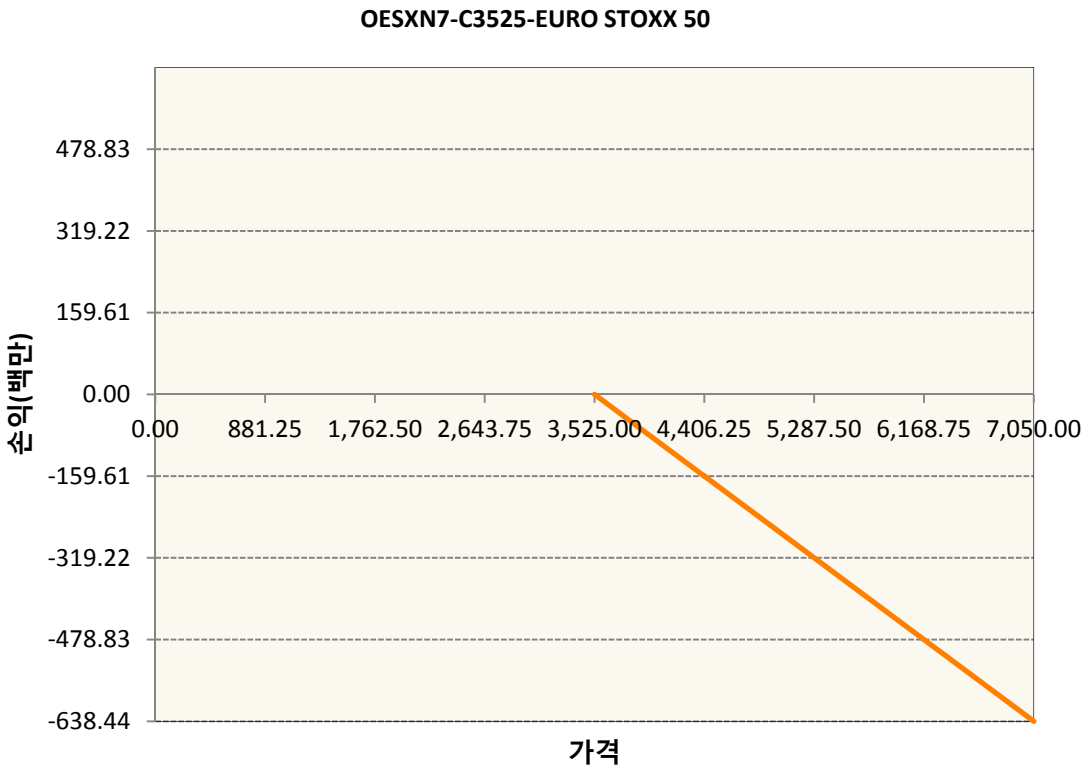
유로커버드콜(주식혼합-파생형)

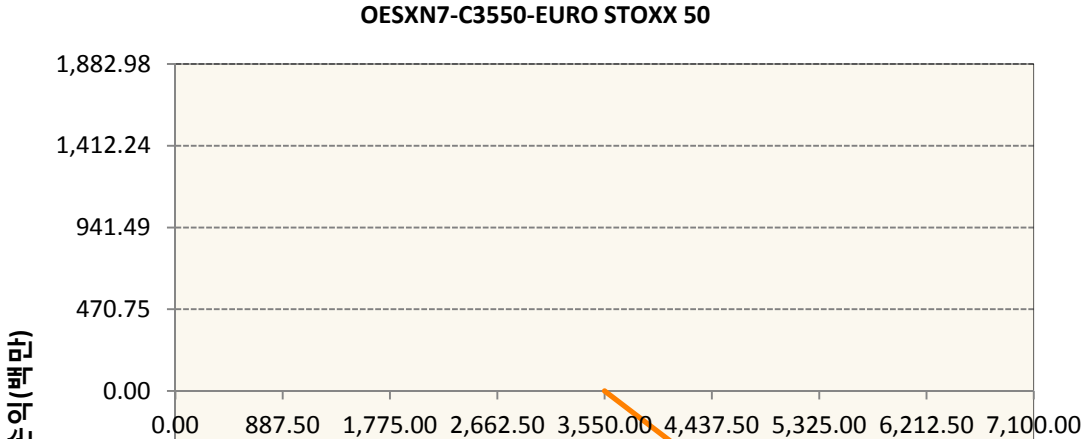
1. 계약금액

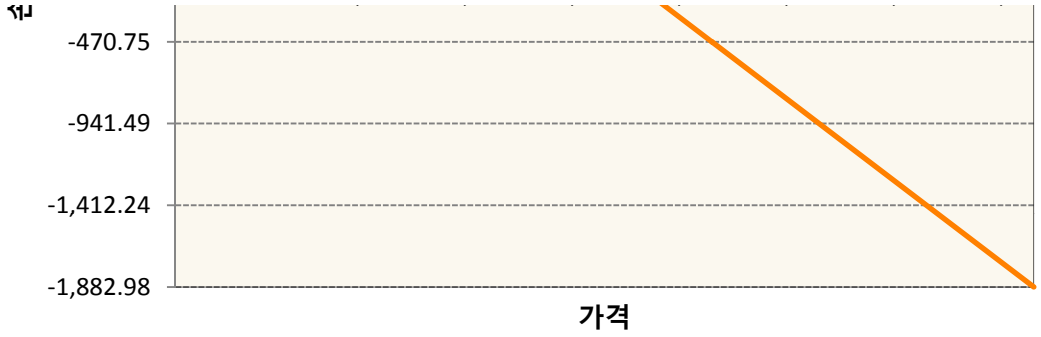
(단위:백만원)

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	2,514	0	2,514	
누계	유가증권	옵션	0	5,043	-5,043	장내

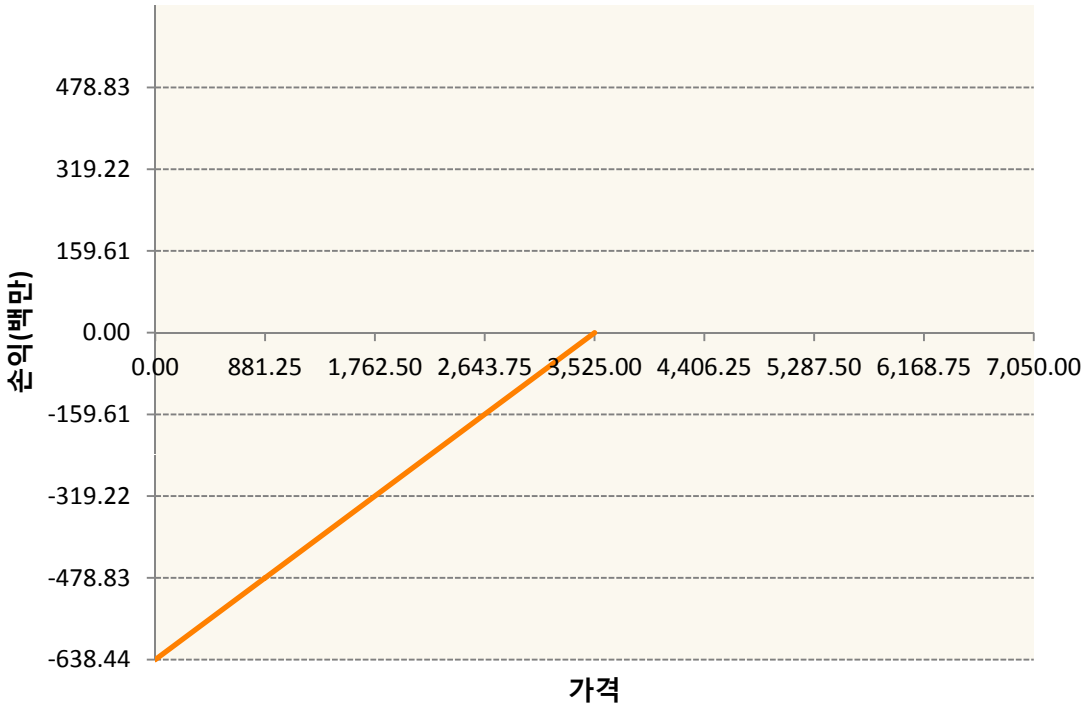
2. 만기시점의 손익구조



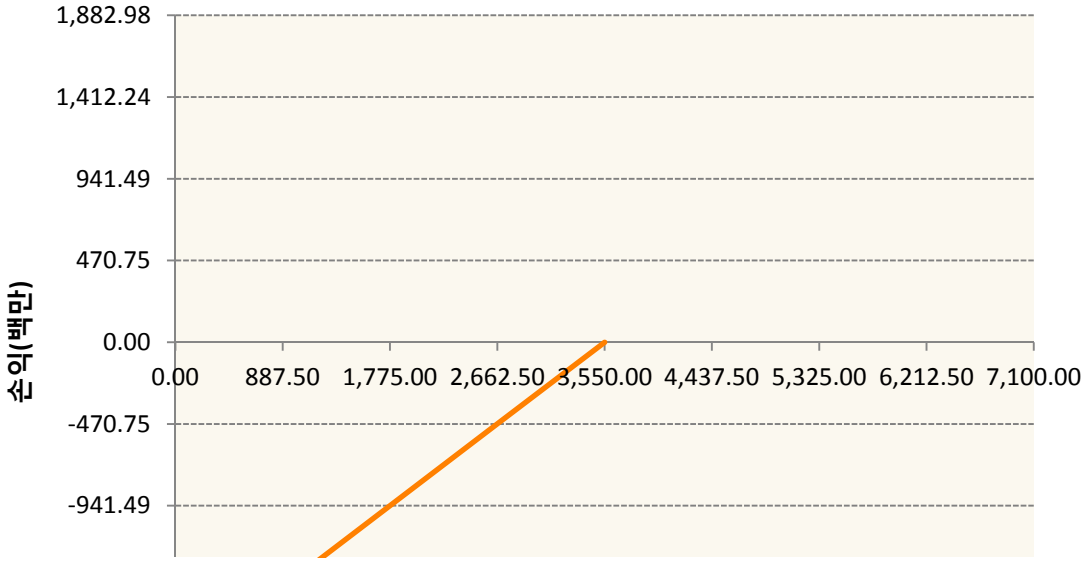


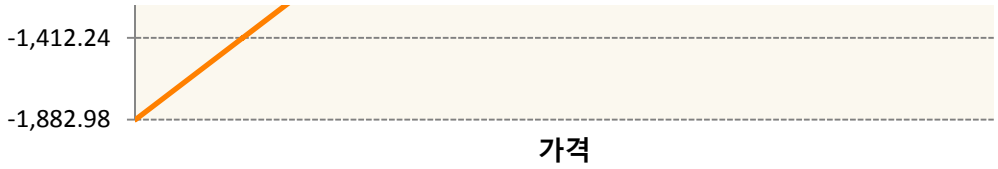


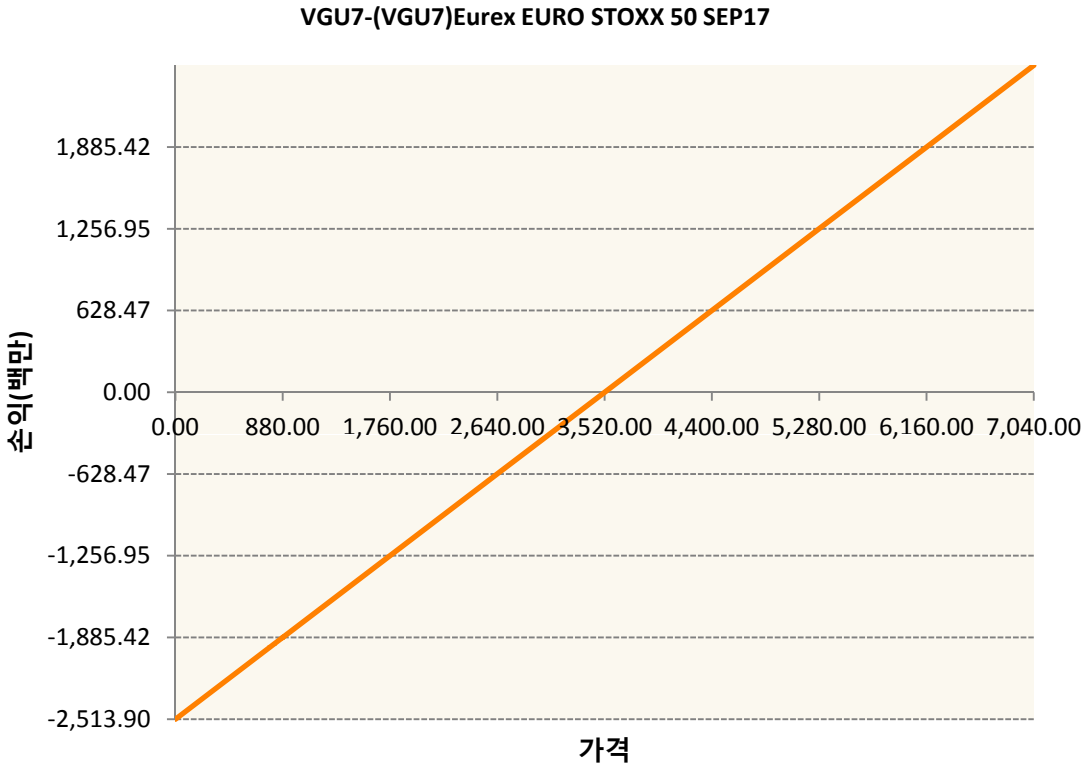
OESXN7-P3525-EURO STOXX 50



OESXN7-P3550-EURO STOXX 50







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
OESXN7-C3!	EURO STOXX 50	51
OESXN7-C3!	EURO STOXX 50	151
OESXN7-P3!	EURO STOXX 50	51
OESXN7-P3!	EURO STOXX 50	151
VGU7	(VGU7)Eurex EURO STOXX 50 SEP17	201

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	518

공시일	2017-07-17
기준일	2017-07-14

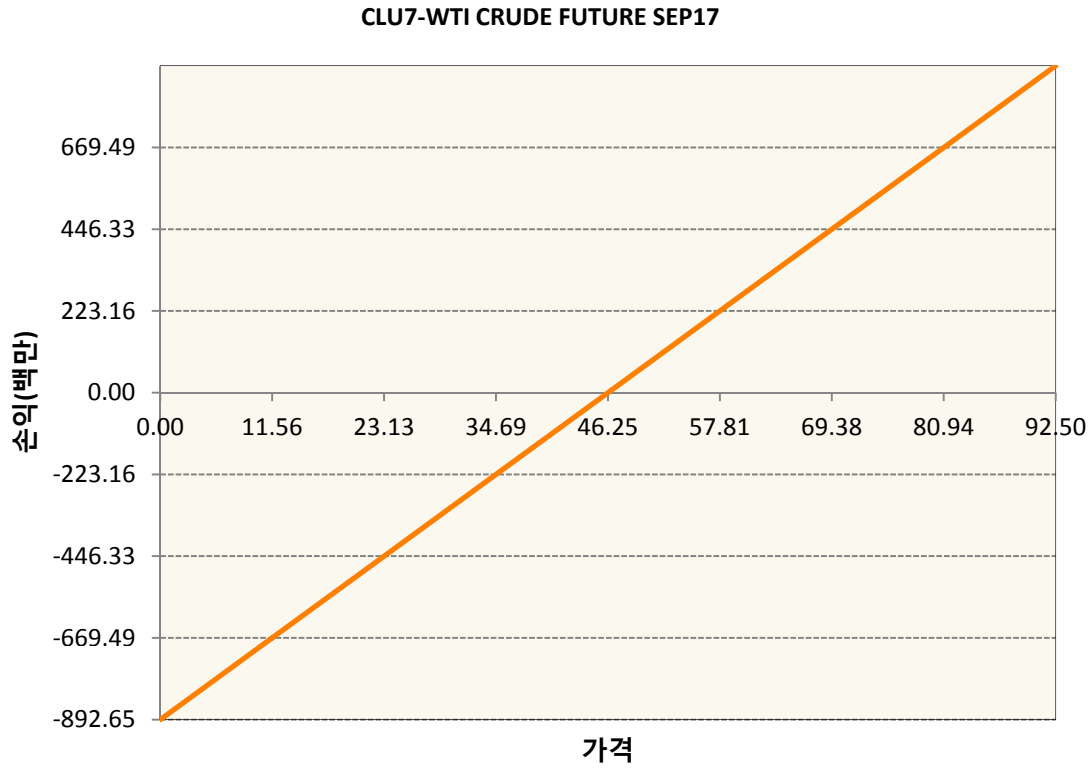
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

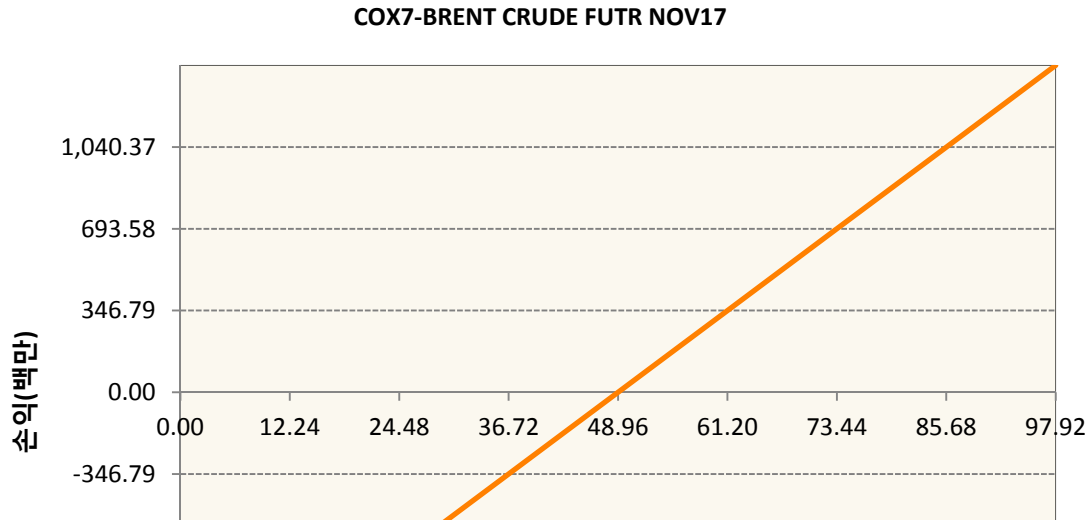
1. 계약금액

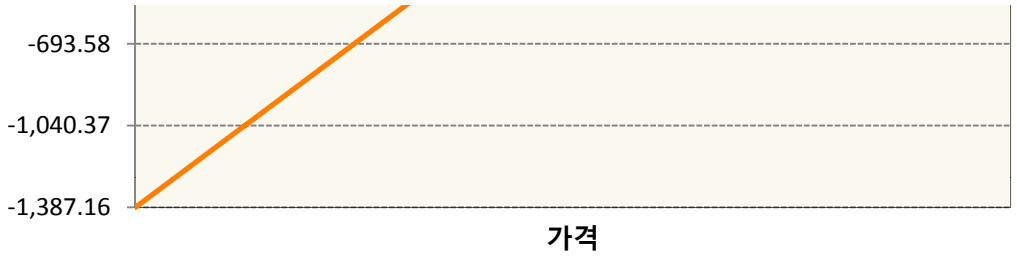
(단위:백만원)

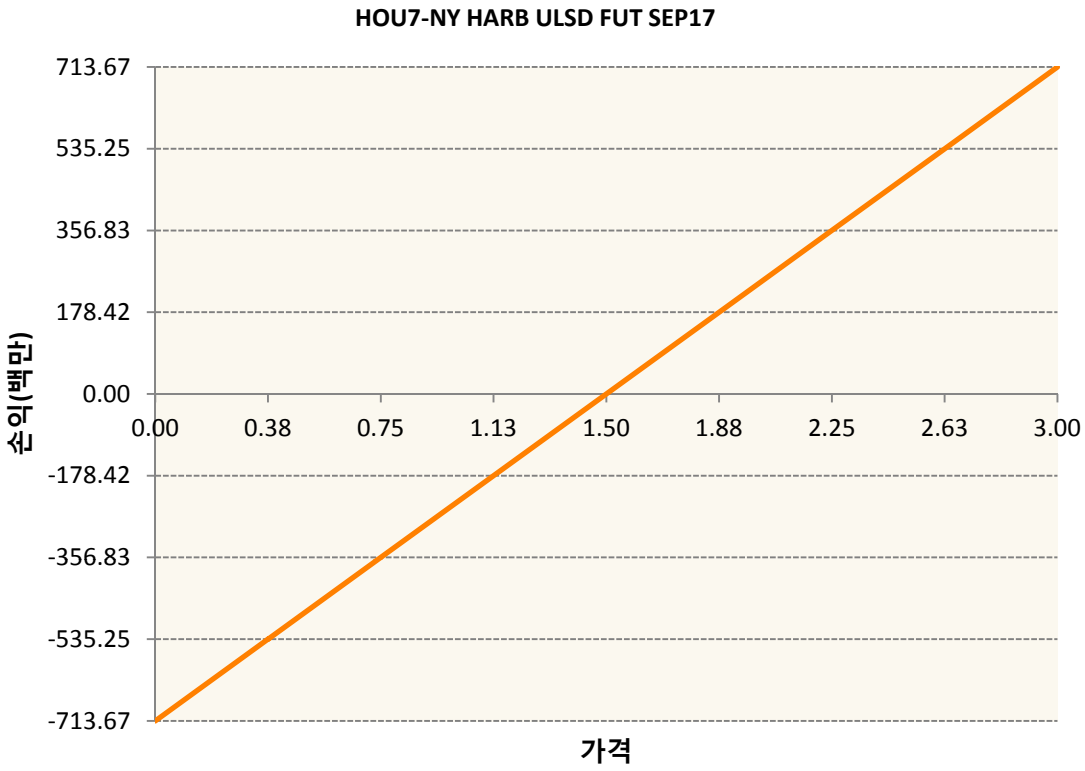
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	5,117	227	4,890	

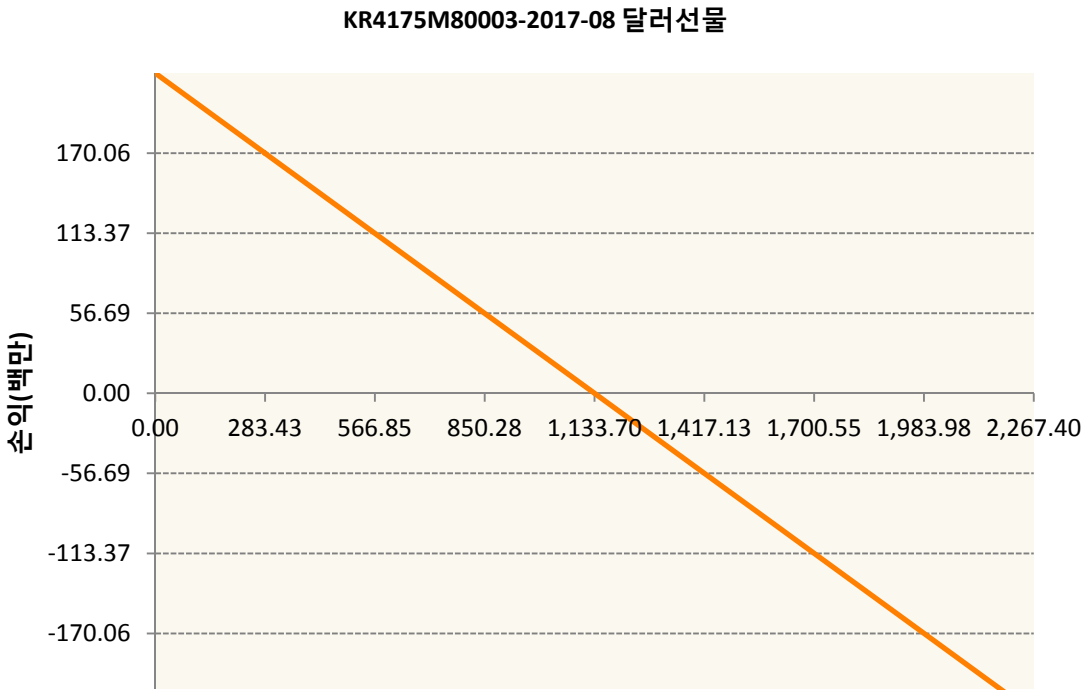
2. 만기시점의 손익구조

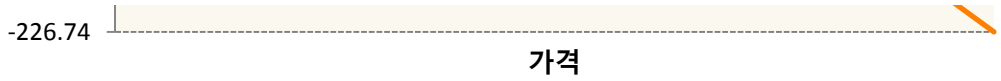


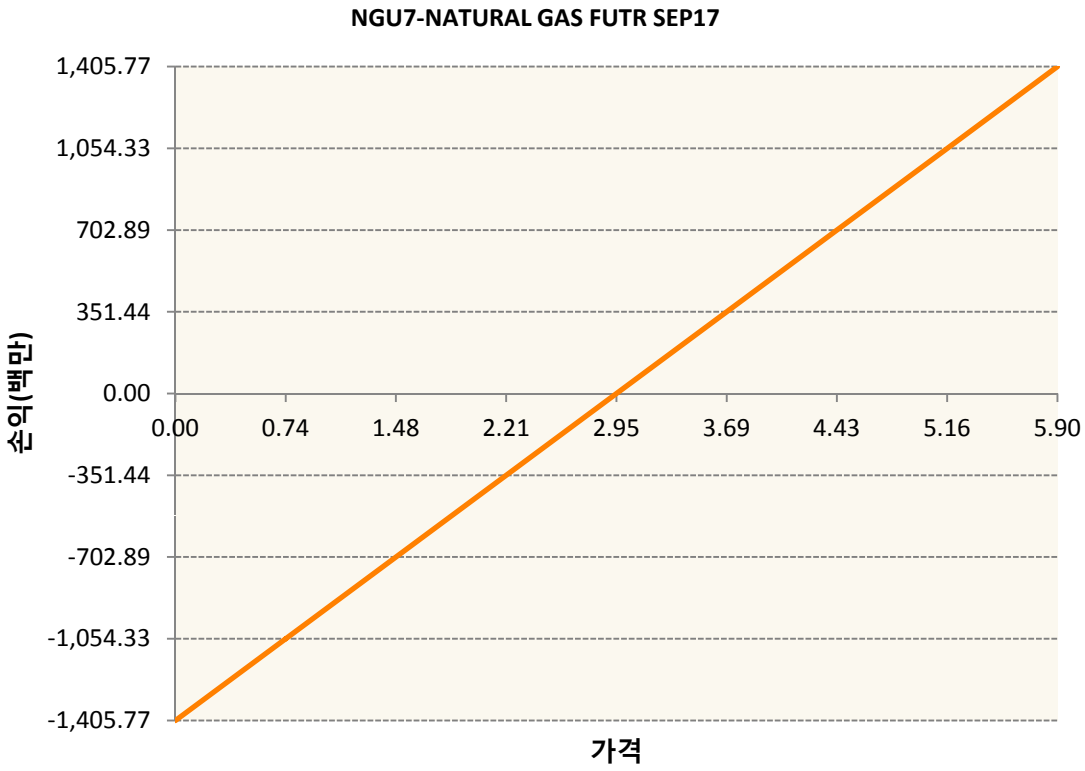


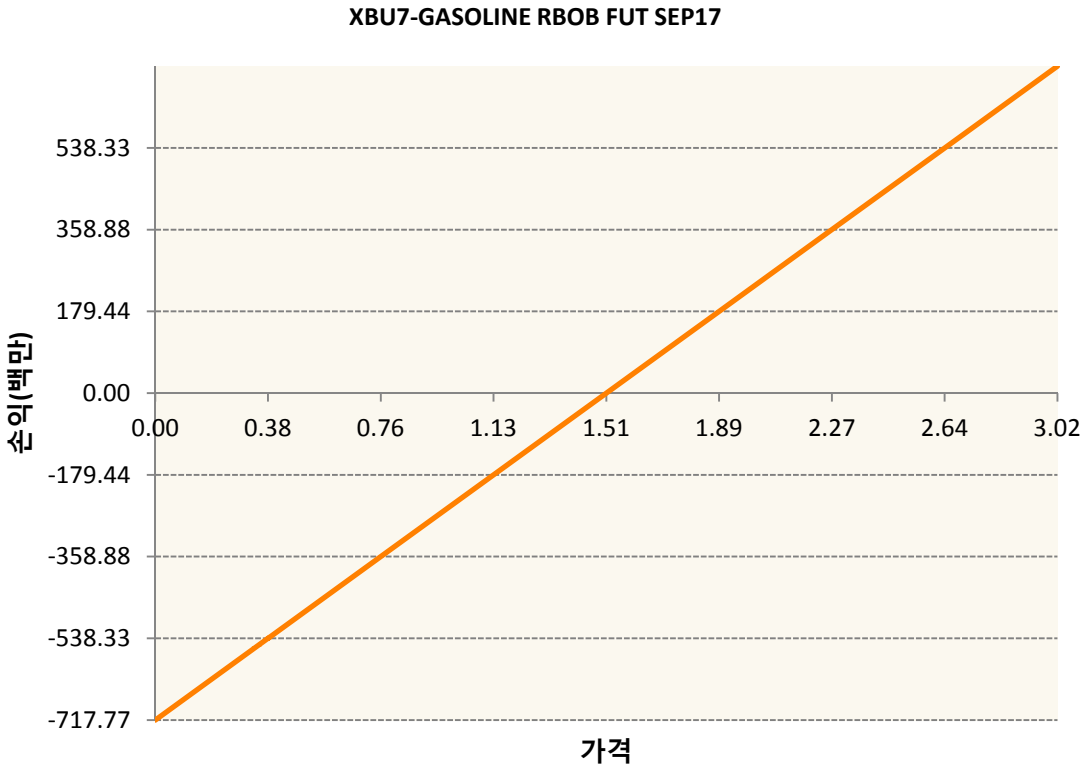

-693.58
-1,040.37
-1,387.16
가격


HOU7-NY HARB ULSD FUT SEP17
713.67
535.25
356.83
178.42
0.00
-178.42
-356.83
-535.25
-713.67
0.00
0.38
0.75
1.13
1.50
1.88
2.25
2.63
3.00
손익(백만)
가격


KR4175M80003-2017-08 달러선물
170.06
113.37
56.69
0.00
-56.69
-113.37
-170.06
0.00
283.43
566.85
850.28
1,133.70
1,417.13
1,700.55
1,983.98
2,267.40
손익(백만)


-226.74
가격


NGU7-NATURAL GAS FUTR SEP17
1,405.77
1,054.33
702.89
351.44
0.00
-351.44
-702.89
-1,054.33
-1,405.77
0.00
0.74
1.48
2.21
2.95
3.69
4.43
5.16
5.90
손익(백만)
가격


XBU7-GASOLINE RBOB FUT SEP17
538.33
358.88
179.44
0.00
-179.44
-358.88
-538.33
-717.77
0.00
0.38
0.76
1.13
1.51
1.89
2.27
2.64
3.02
손익(백만)
가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLU7	WTI CRUDE FUTURE SEP17	71
COX7	BRENT CRUDE FUTR NOV17	111
HOU7	NY HARB ULSD FUT SEP17	57
KR4175M80(	2017-08 달러선물	18
NGU7	NATURAL GAS FUTR SEP17	112
XBU7	GASOLINE RBOB FUT SEP17	57

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

783

공시일	2017-07-17
기준일	2017-07-14

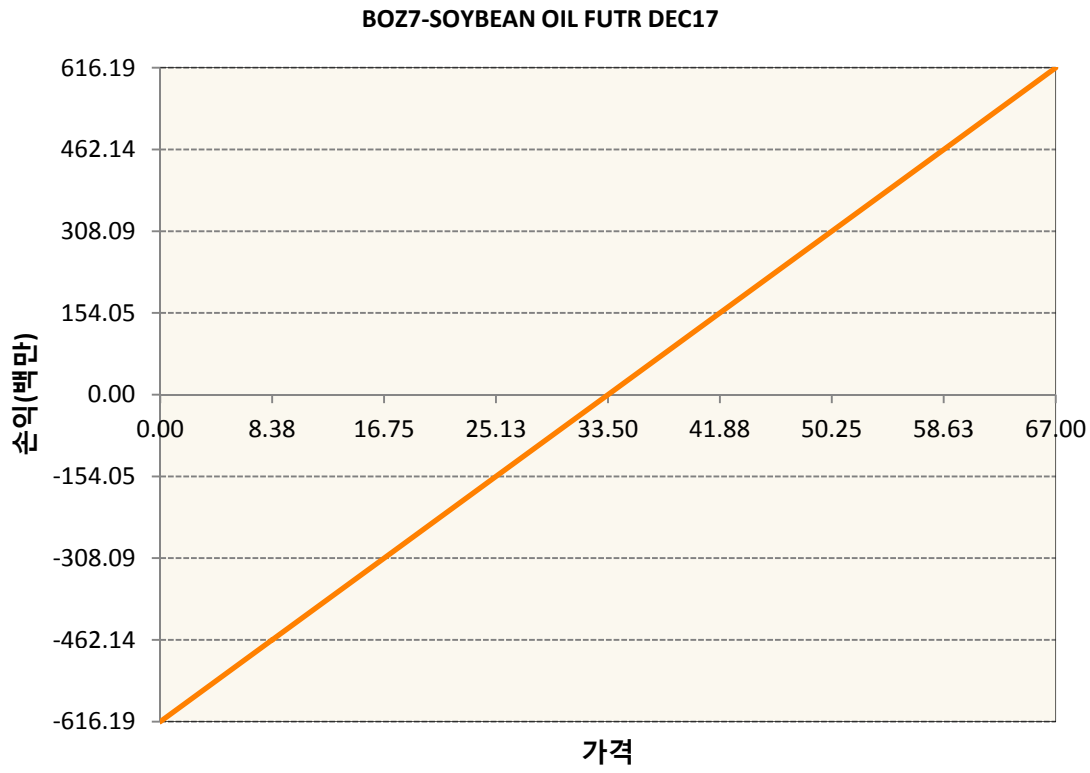
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

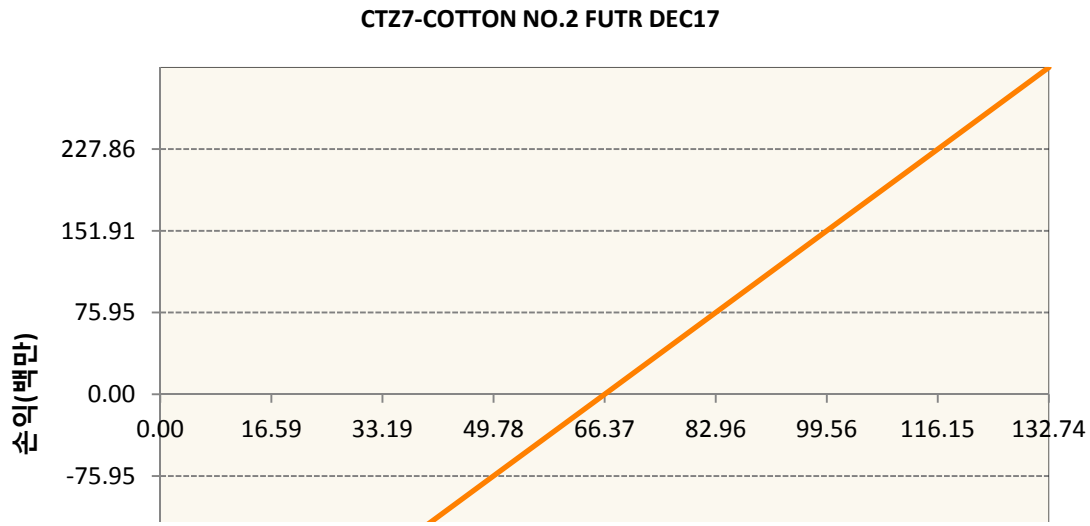
1. 계약금액

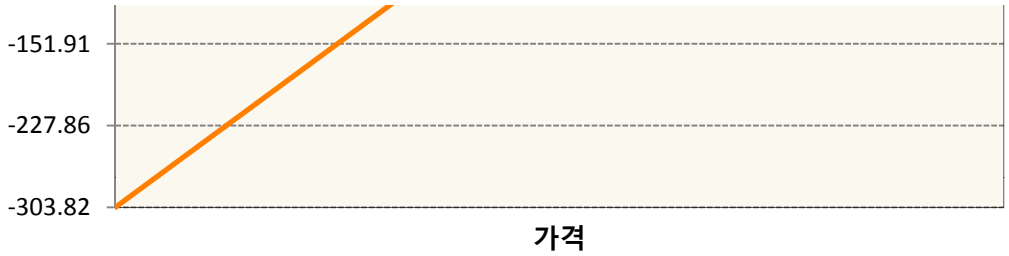
(단위:백만원)

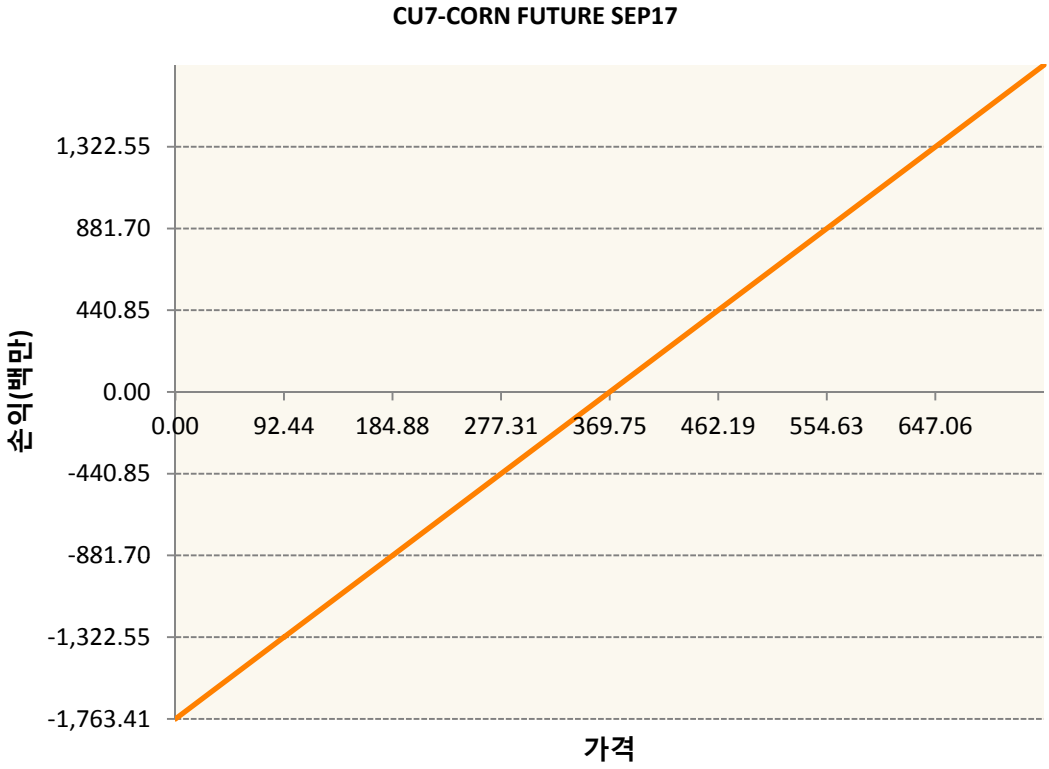
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	7,025	397	6,628	

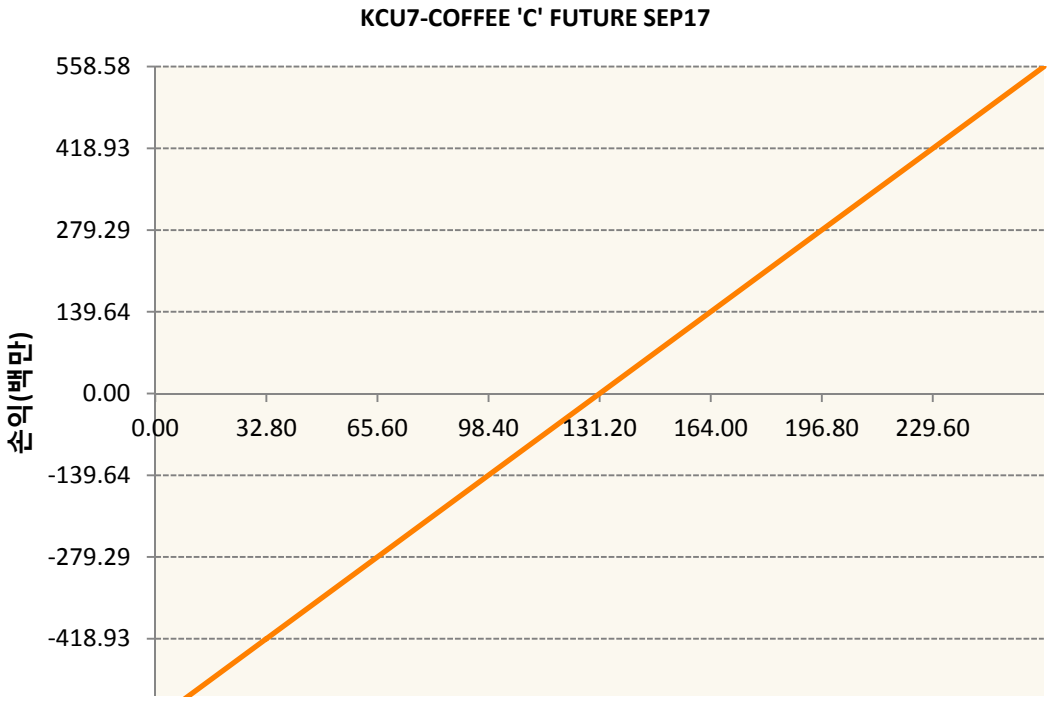
2. 만기시점의 손익구조

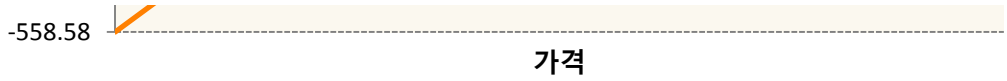


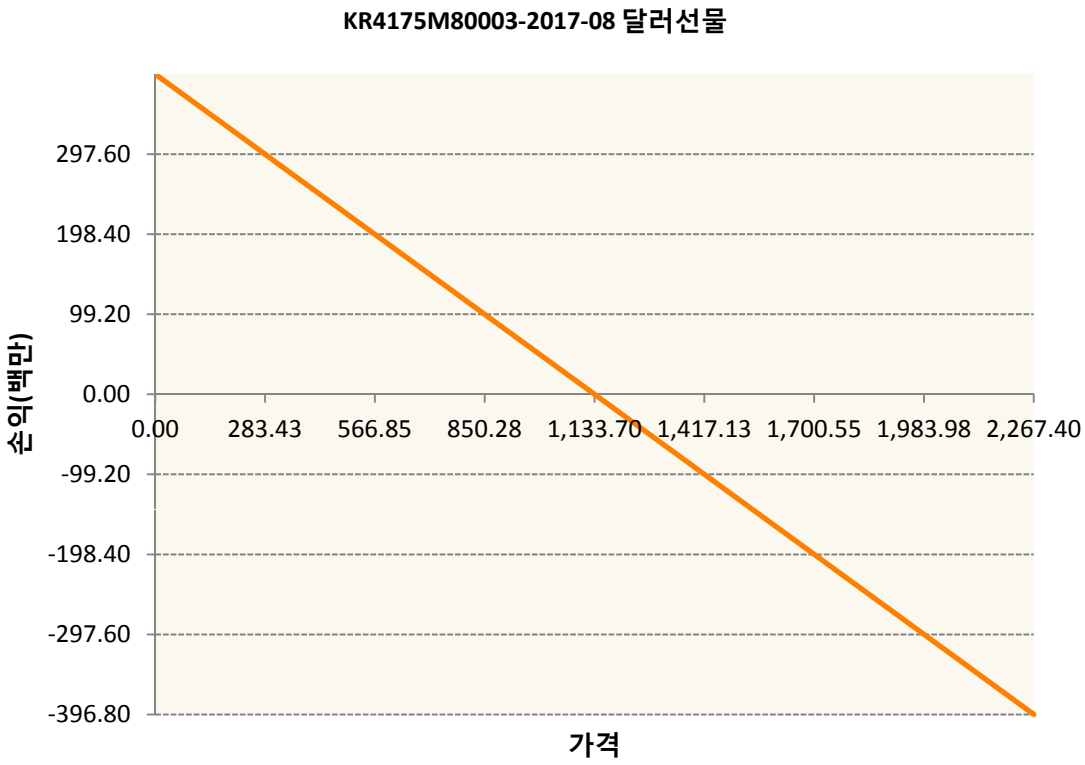


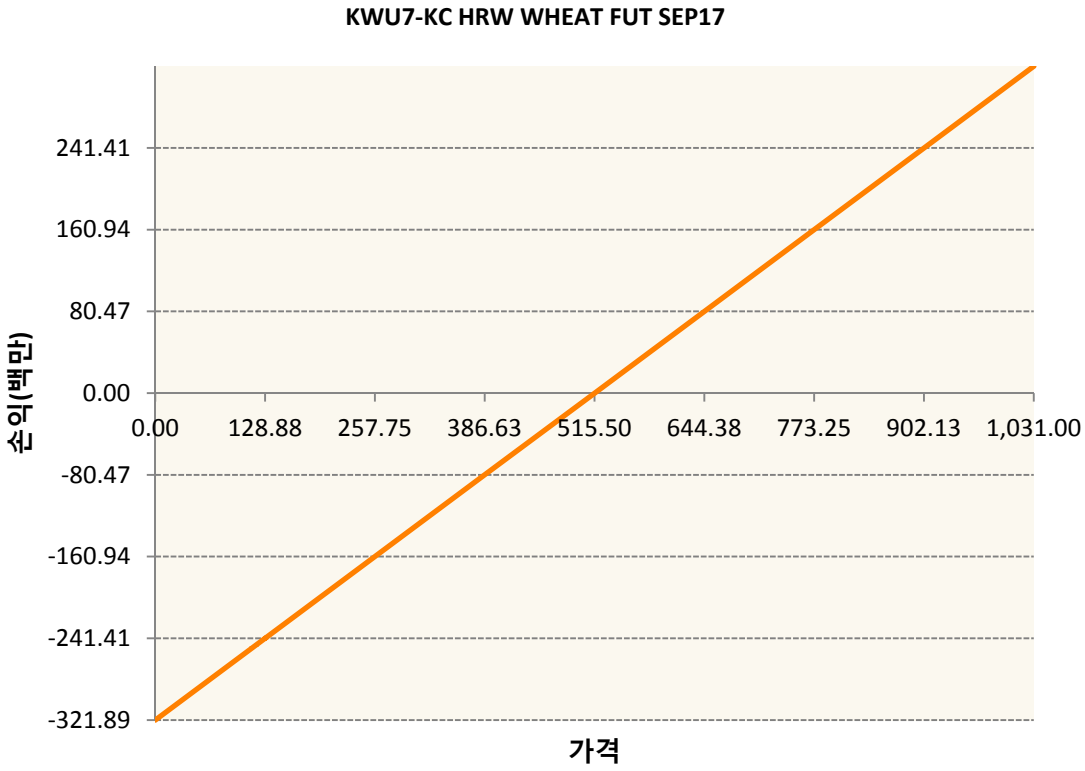

-151.91
-227.86
-303.82
가격


CU7-CORN FUTURE SEP17
1,322.55
881.70
440.85
0.00
-440.85
-881.70
-1,322.55
-1,763.41
0.00
92.44
184.88
277.31
369.75
462.19
554.63
647.06
손익(백만)
가격

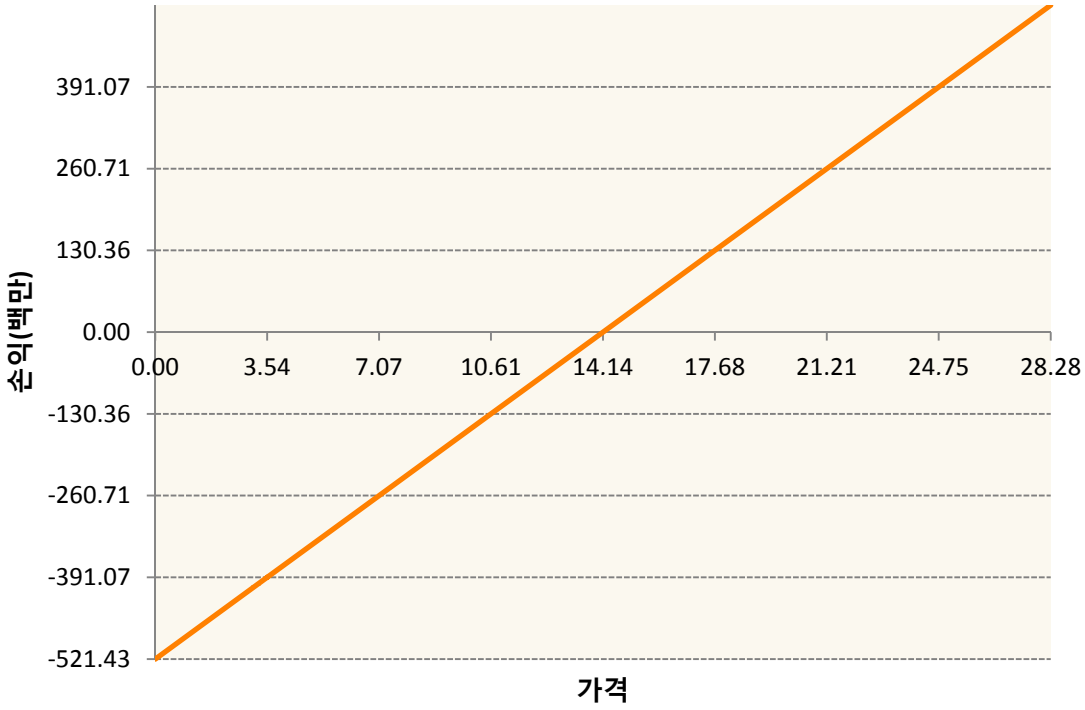

KCU7-COFFEE 'C' FUTURE SEP17
558.58
418.93
279.29
139.64
0.00
-139.64
-279.29
-418.93
0.00
32.80
65.60
98.40
131.20
164.00
196.80
229.60
손익(백만)


-558.58
가격

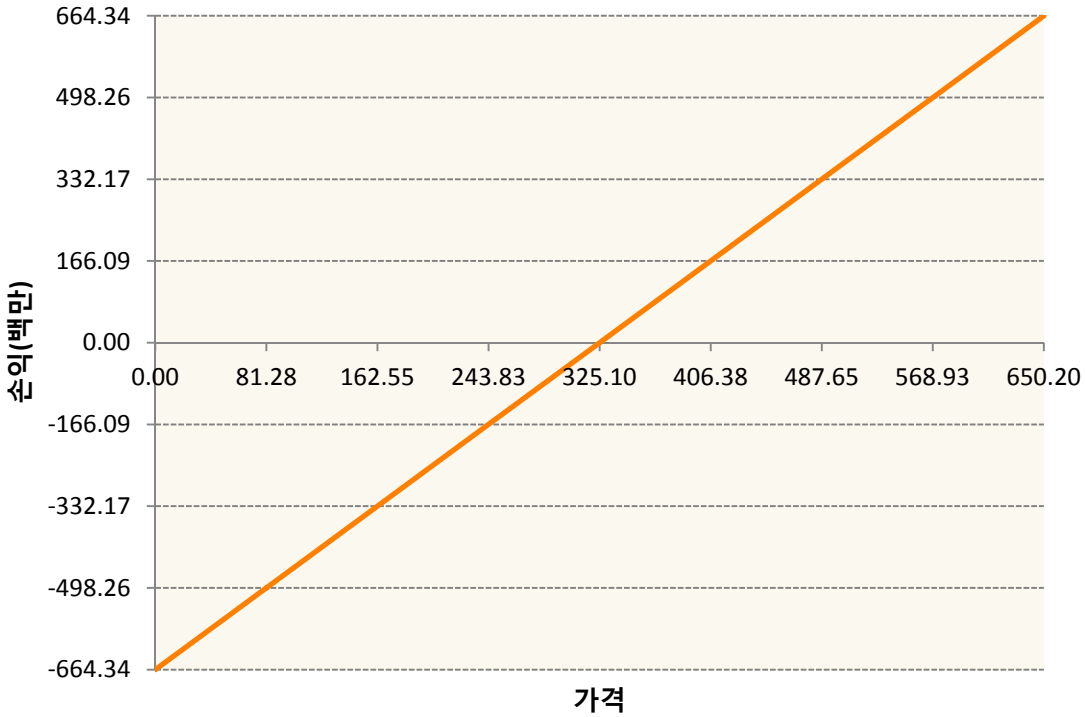

KR4175M80003-2017-08 달러선물
297.60
198.40
99.20
0.00
-99.20
-198.40
-297.60
-396.80
0.00
283.43
566.85
850.28
1,133.70
1,417.13
1,700.55
1,983.98
2,267.40
손익(백만)
가격


KWU7-KC HRW WHEAT FUT SEP17
241.41
160.94
80.47
0.00
-80.47
-160.94
-241.41
-321.89
0.00
128.88
257.75
386.63
515.50
644.38
773.25
902.13
1,031.00
손익(백만)
가격

SBV7-SUGAR #11 (WORLD) OCT17

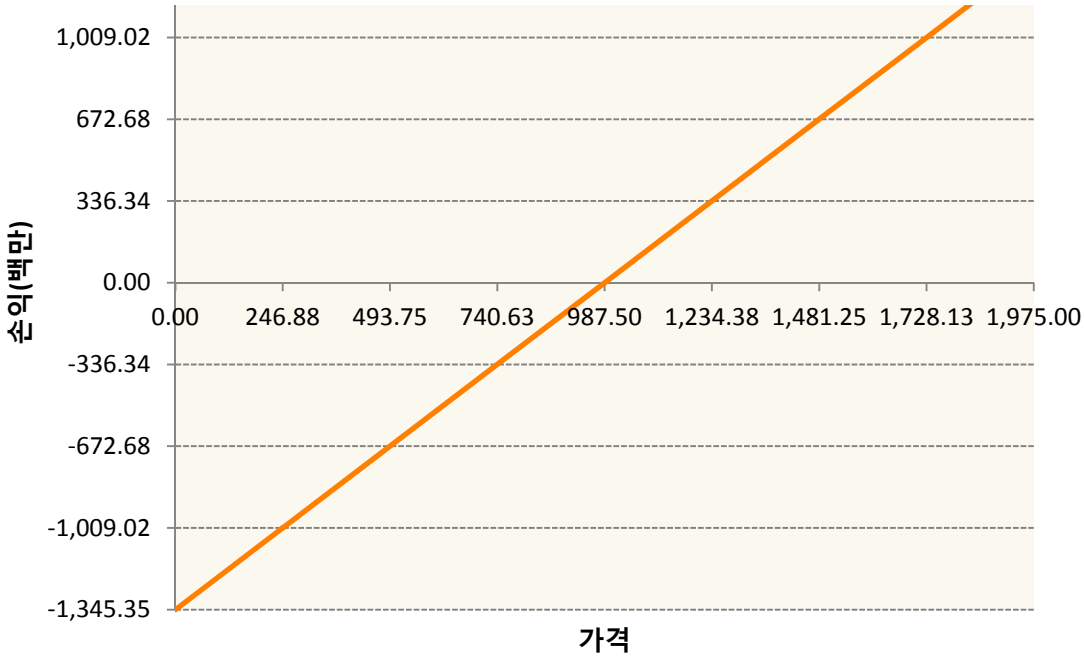


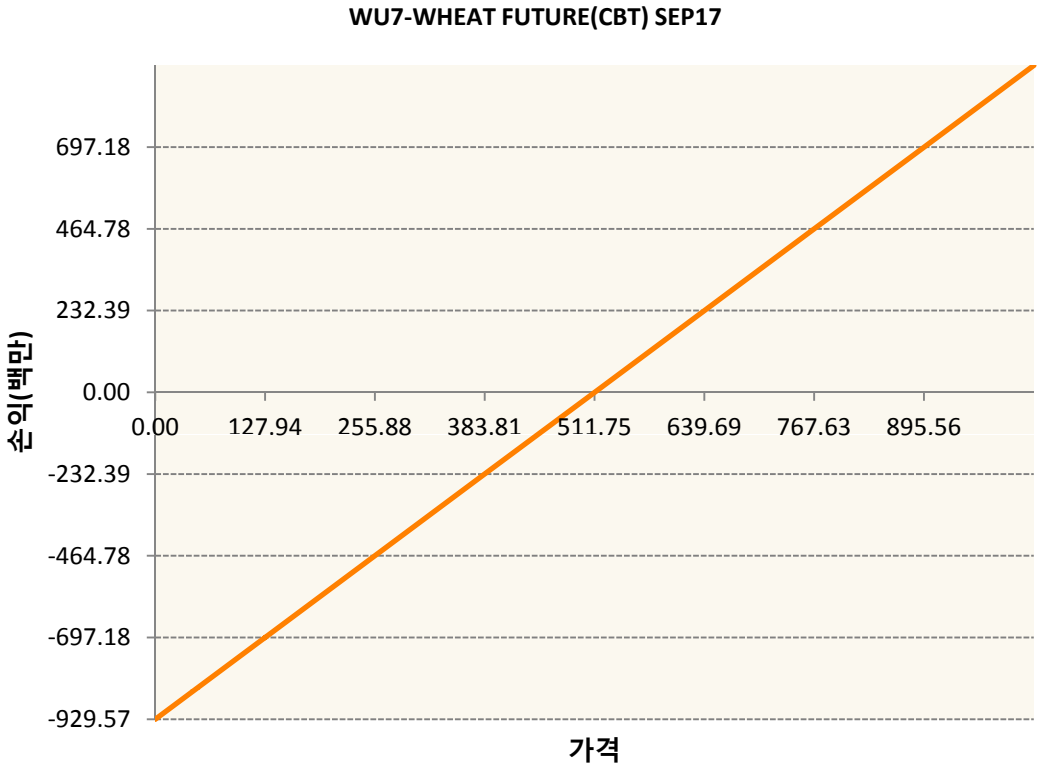
SMZ7-SOYBEAN MEAL FUTR DEC17



SX7-SOYBEAN FUTURE NOV17







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
BOZ7	SOYBEAN OIL FUTR DEC17	49
CTZ7	COTTON NO.2 FUTR DEC17	24
CU7	CORN FUTURE SEP17	141
KCU7	COFFEE 'C' FUTURE SEP17	45
KR4175M80(	2017-08 달러선물	32

KWU7	KC HRW WHEAT FUT SEP17	26
SBV7	SUGAR #11 (WORLD) OCT17	42
SMZ7	SOYBEAN MEAL FUTR DEC17	53
SX7	SOYBEAN FUTURE NOV17	108
WU7	WHEAT FUTURE(CBT) SEP17	74

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

659