공시일	2017-07-18
기준일	2017-07-17

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	2017-07-18
기준일	2017-07-17

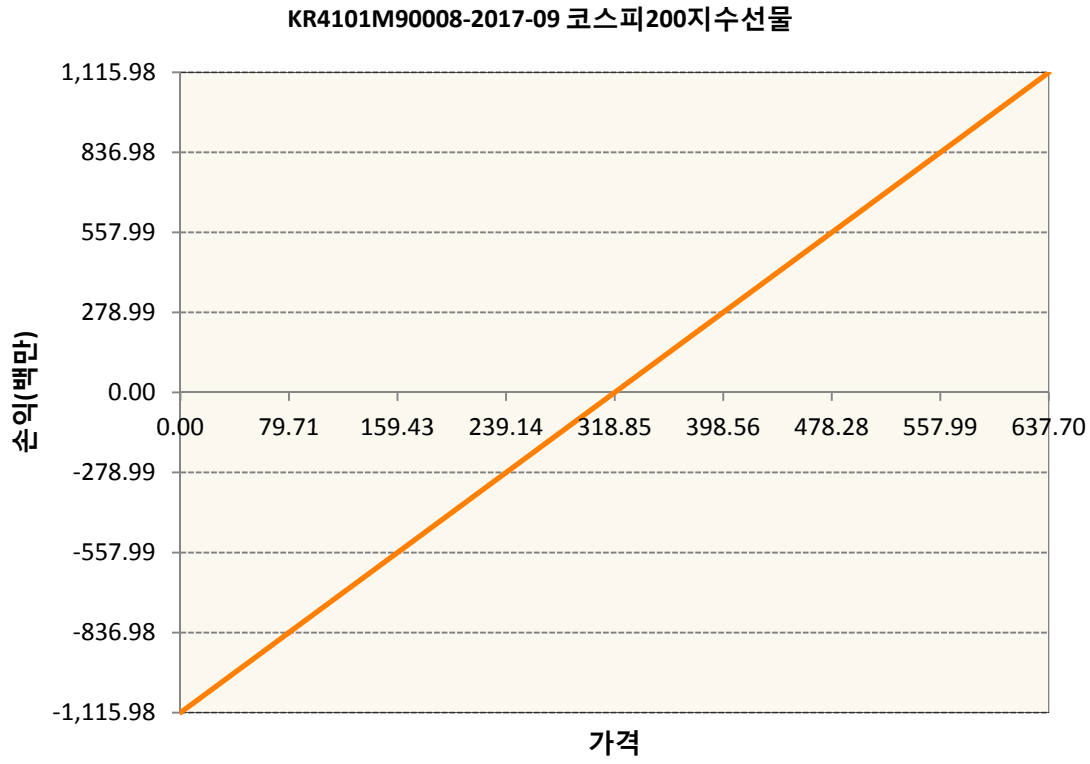
스마트인덱스모

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	1,116	0	1,116	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	2017-07-18
기준일	2017-07-17

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	1,014

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

486

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-07-18
기준일	2017-07-17

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	365

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

308

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-07-18
기준일	2017-07-17

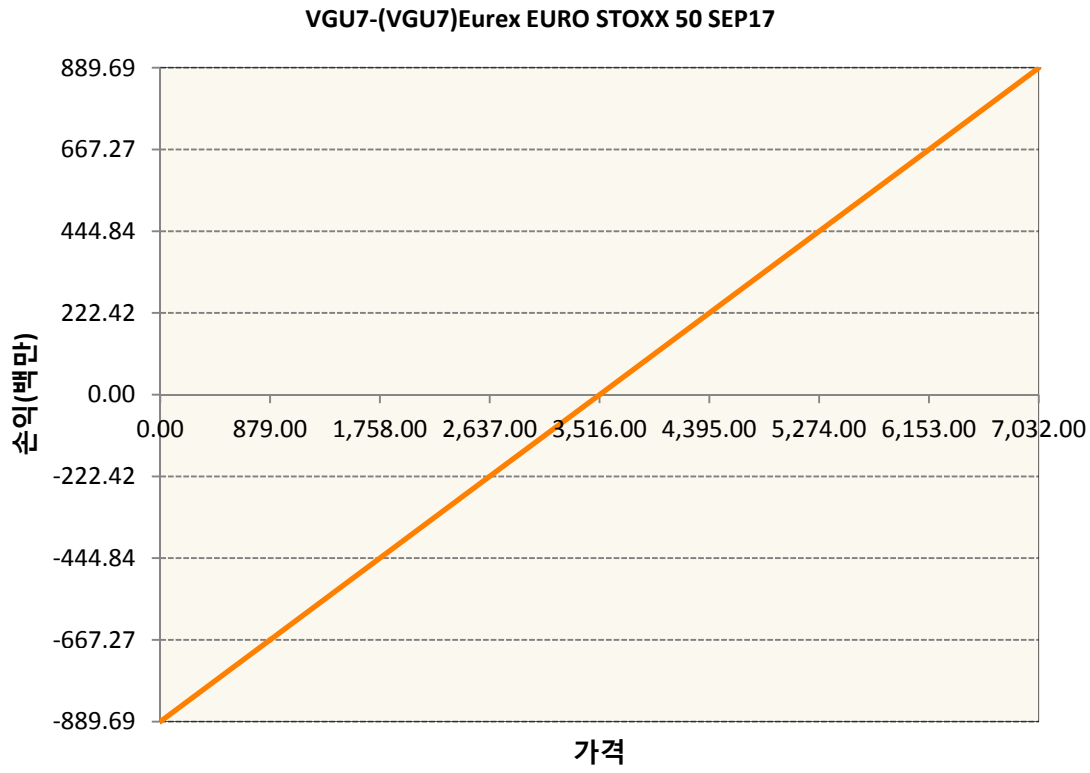
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	890	0	890	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGU7	(VGU7)Eurex EURO STOXX 50 SEP17	71

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

(단위:백만원)

61

공시일	2017-07-18
기준일	2017-07-17

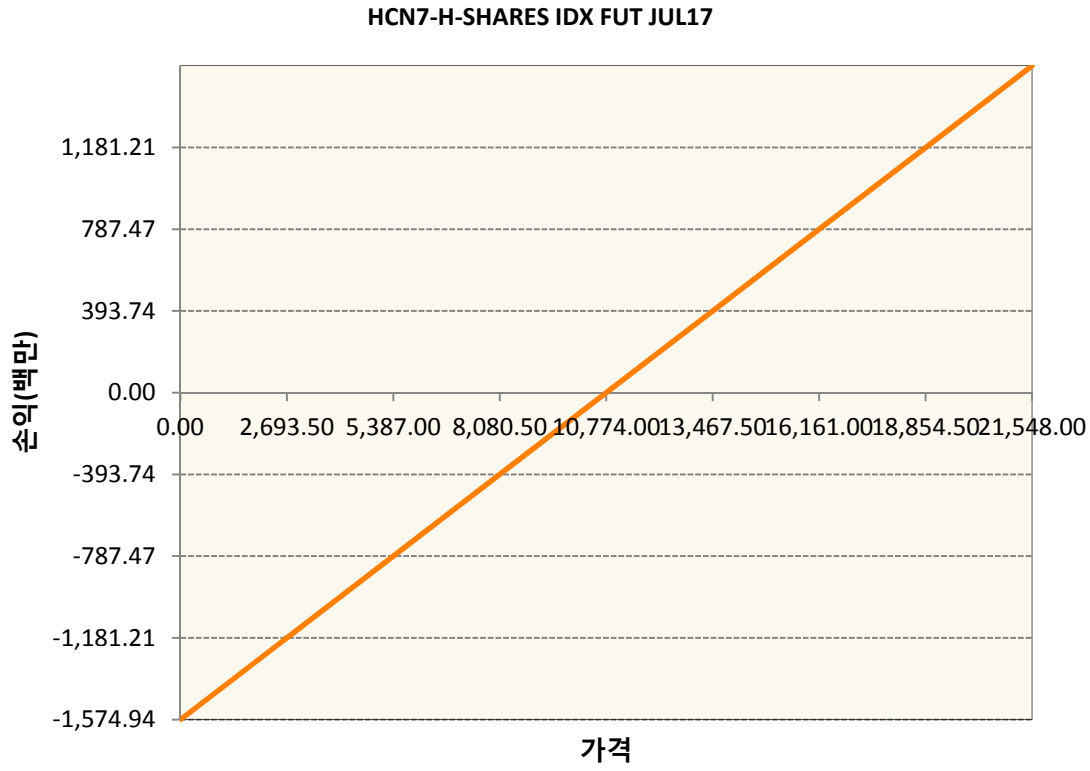
차이나인덱스모(주식-파생형)

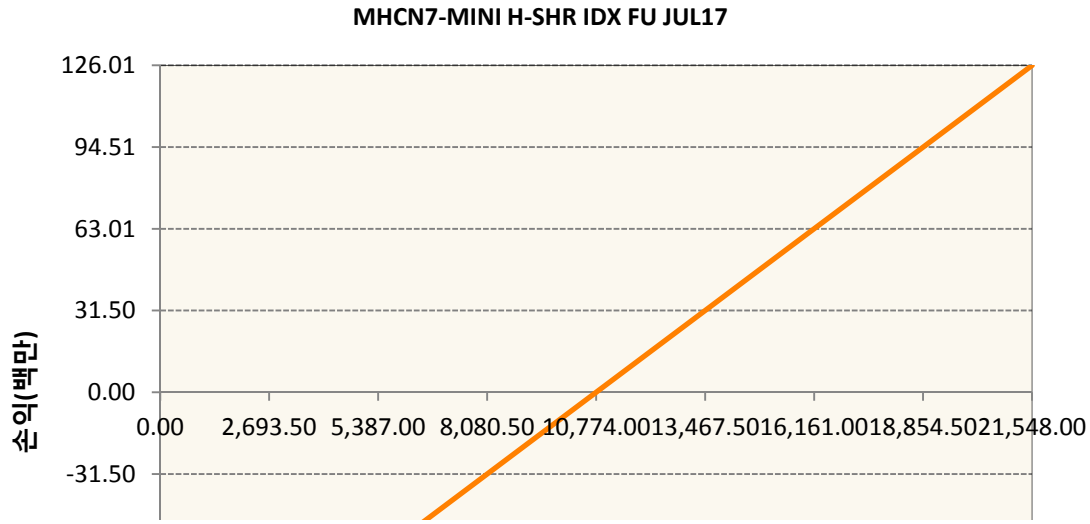
1. 계약금액

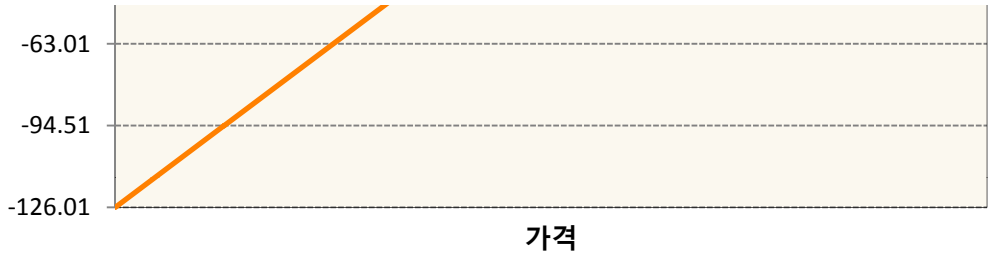
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,701	0	1,701	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCN7	H-SHARES IDX FUT JUL17	126
MHCN7	MINI H-SHR IDX FU JUL17	10

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	131

공시일	2017-07-18
기준일	2017-07-17

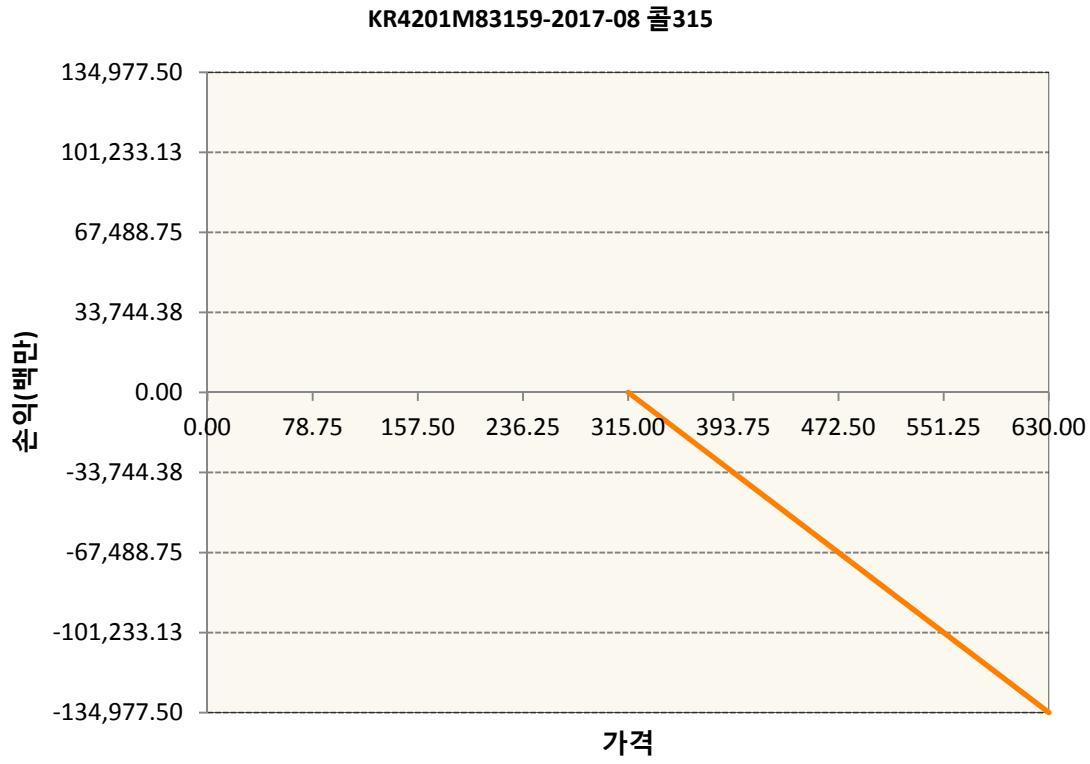
커버드콜모(주식혼합-파생형)

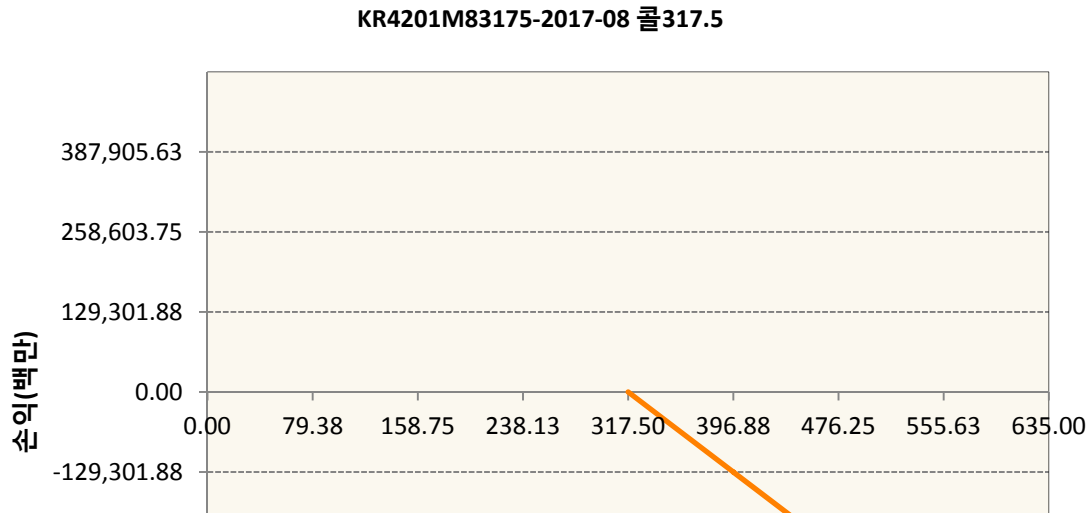
1. 계약금액

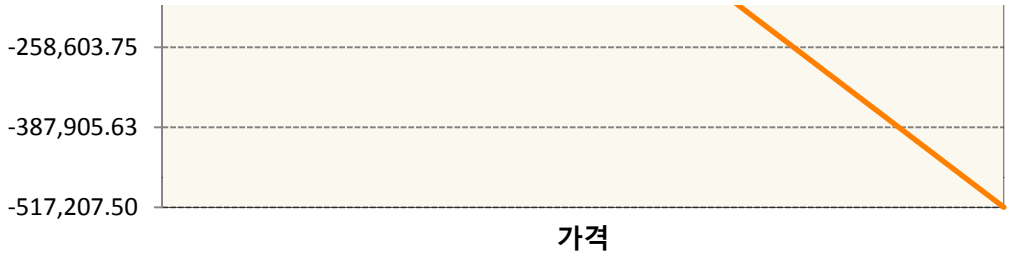
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	24,090	-24,090	장내
누계	유가증권	옵션	0	1,204,614	-1,204,614	장내

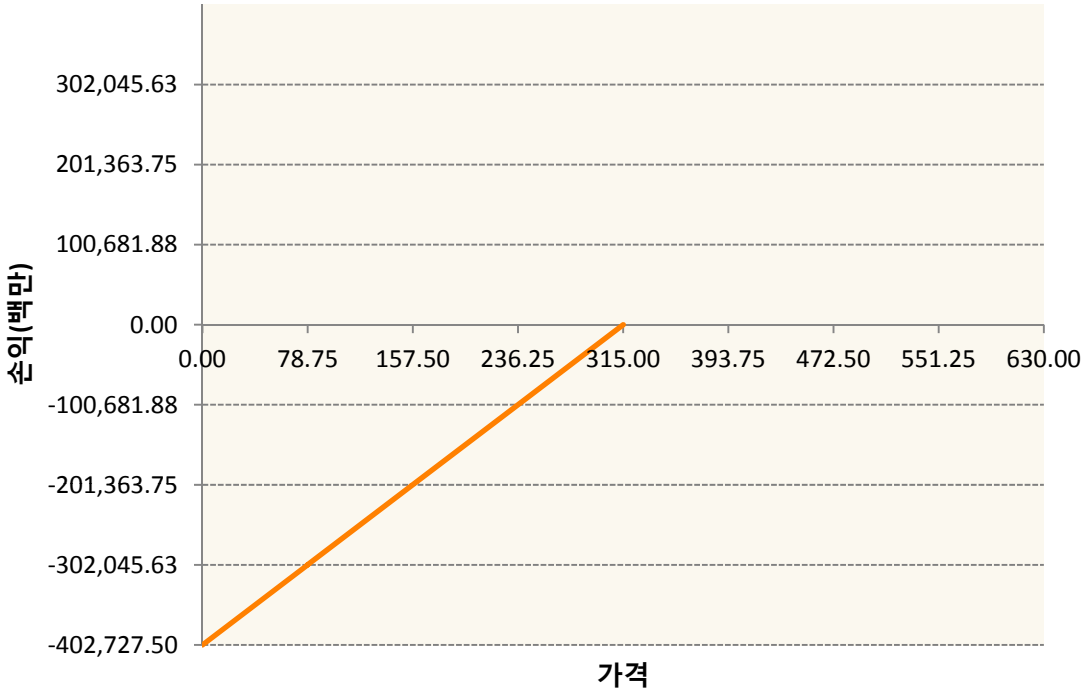
2. 만기시점의 손익구조



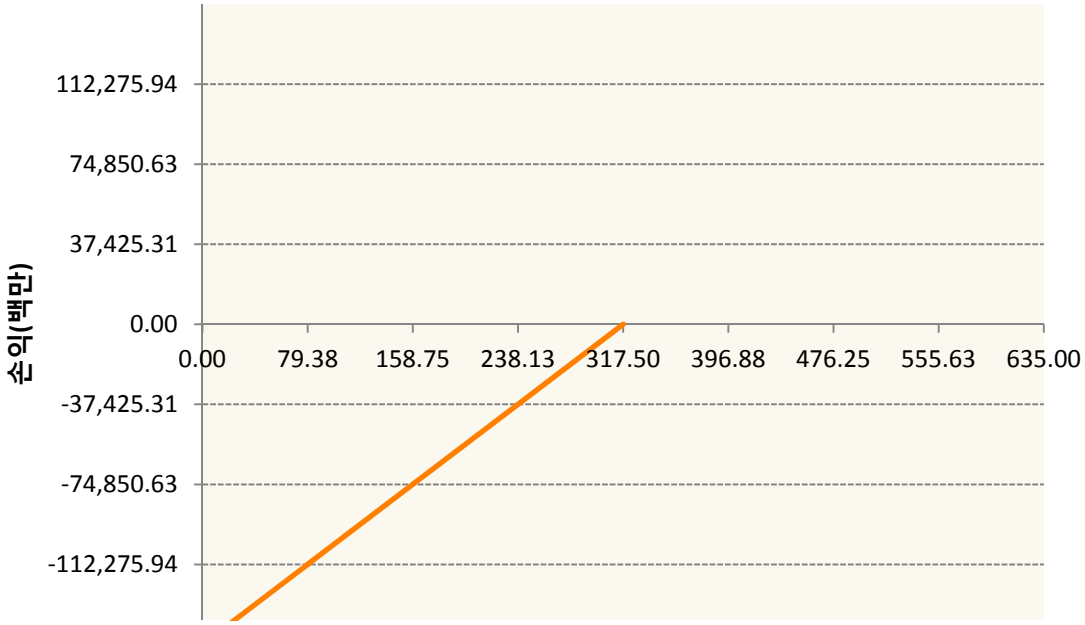




KR4301M83157-2017-08 풋315



KR4301M83173-2017-08 풋317.5





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201M83: 2017-08 콜315							9,020
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	3,836	3,763	3,672	3,564	3,441	3,305	3,158
-5.33%	3,475	3,313	3,137	2,950	2,754	2,551	2,341
-2.67%	2,538	2,295	2,049	1,801	1,552	1,301	1,050
0%	766	512	257	0	-257	-515	-774
2.67%	-1,837	-2,027	-2,229	-2,441	-2,660	-2,885	-3,115
5.33%	-5,025	-5,130	-5,254	-5,396	-5,552	-5,720	-5,900
8.00%	-8,510	-8,554	-8,614	-8,692	-8,786	-8,896	-9,020
KR4201M83: 2017-08 콜317.5							32,941
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	12,554	12,345	12,069	11,730	11,332	10,881	10,382
-5.33%	11,564	11,047	10,467	9,835	9,160	8,449	7,707
-2.67%	8,750	7,888	7,006	6,107	5,195	4,273	3,343
0%	2,991	1,995	997	0	-998	-1,995	-2,993
2.67%	-6,029	-6,853	-7,708	-8,587	-9,486	-10,400	-11,326
5.33%	-17,592	-18,091	-18,660	-19,287	-19,964	-20,682	-21,434
8.00%	-30,585	-30,812	-31,112	-31,480	-31,911	-32,401	-32,941
KR4301M83: 2017-08 풋315							25,710
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-25,642	-25,643	-25,646	-25,652	-25,664	-25,682	-25,710
-5.33%	-14,833	-14,873	-14,933	-15,013	-15,113	-15,233	-15,371
-2.67%	-4,904	-5,169	-5,448	-5,738	-6,037	-6,343	-6,655
0%	956	645	325	0	-330	-664	-1,001
2.67%	2,322	2,247	2,148	2,024	1,878	1,713	1,528
5.33%	2,417	2,413	2,403	2,386	2,358	2,318	2,265
8.00%	2,419	2,419	2,419	2,418	2,415	2,410	2,401
KR4301M83: 2017-08 풋317.5							10,176
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-10,163	-10,163	-10,164	-10,165	-10,167	-10,170	-10,176
-5.33%	-6,167	-6,173	-6,184	-6,201	-6,224	-6,253	-6,288
-2.67%	-2,329	-2,397	-2,475	-2,559	-2,649	-2,744	-2,844
0%	394	263	131	0	-132	-263	-395
2.67%	1,270	1,219	1,159	1,091	1,015	932	844

5.33%	1,360	1,356	1,348	1,334	1,316	1,291	1,259
8.00%	1,363	1,363	1,362	1,361	1,359	1,356	1,349

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

82,650

공시일	2017-07-18
기준일	2017-07-17

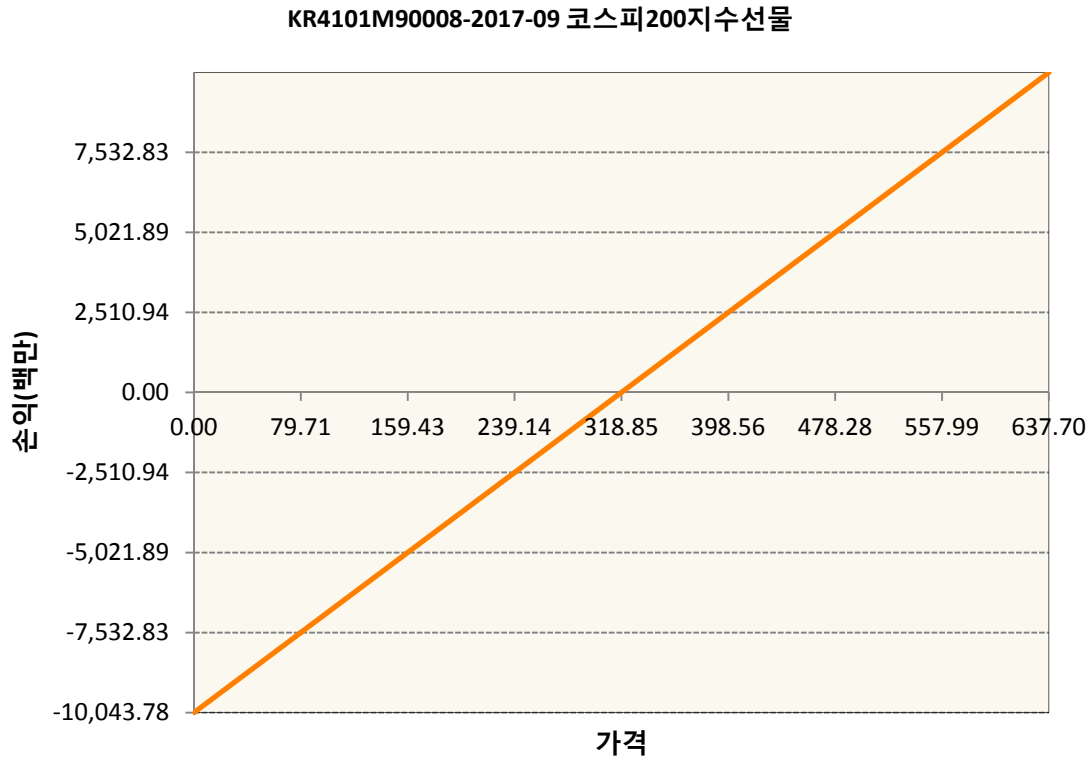
ETF스마트레버리지목표전환형6호

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	80	-80	장내
누계	유가증권	선물	10,044	0	10,044	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101M90(2017-09 코스피200지수선물							803
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-803	-803	-803	-803	-803	-803	-803
-5.33%	-535	-535	-535	-535	-535	-535	-535
-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%	535	535	535	535	535	535	535
8.00%	803	803	803	803	803	803	803

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

481

공시일	2017-07-18
기준일	2017-07-17

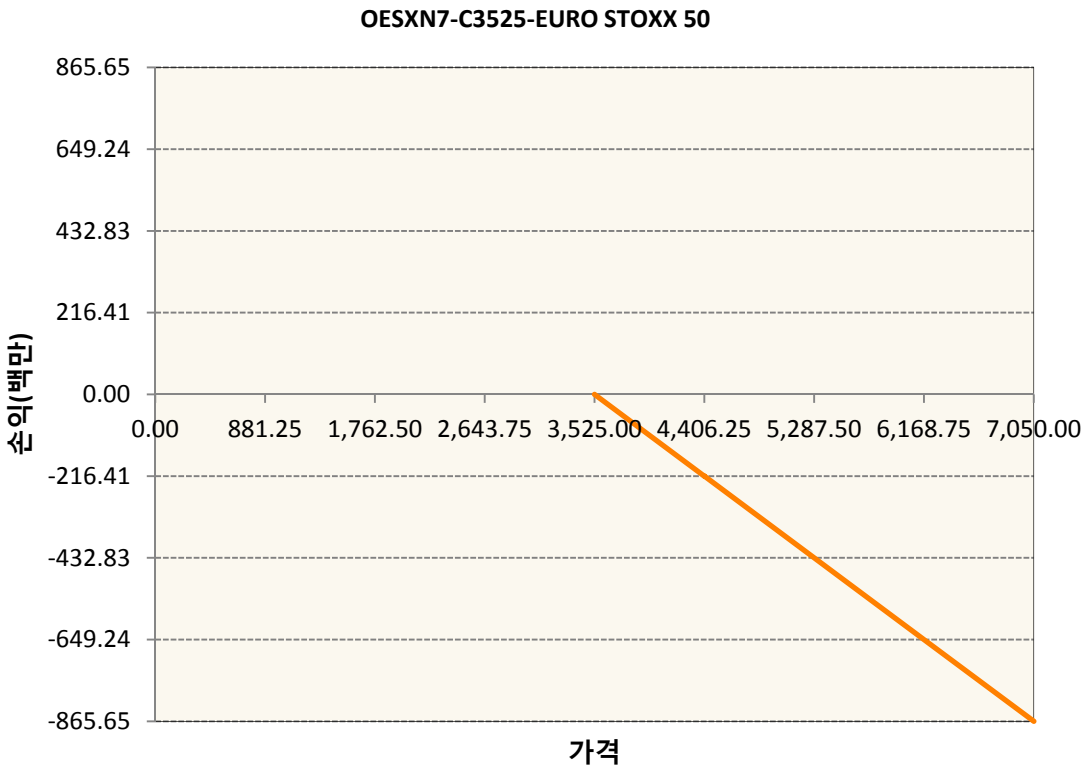
유로커버드콜(주식혼합-파생형)

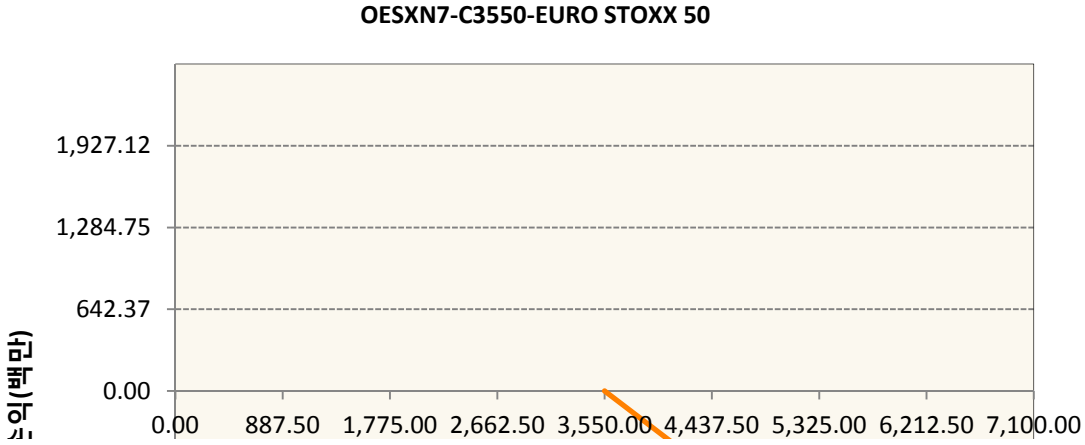
1. 계약금액

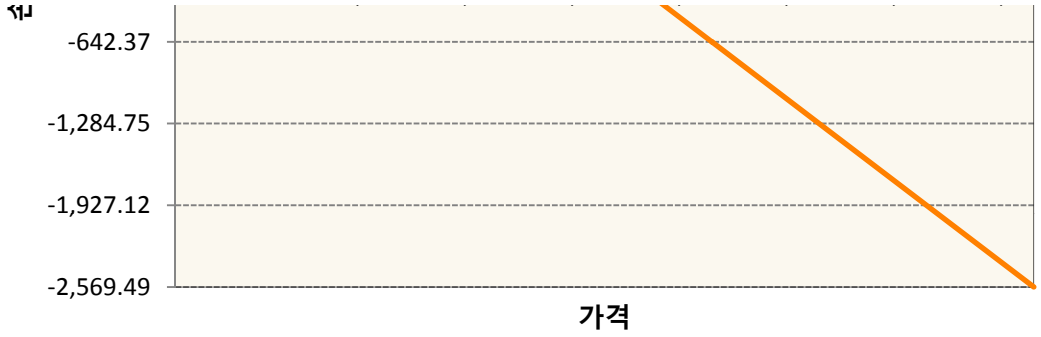
(단위:백만원)

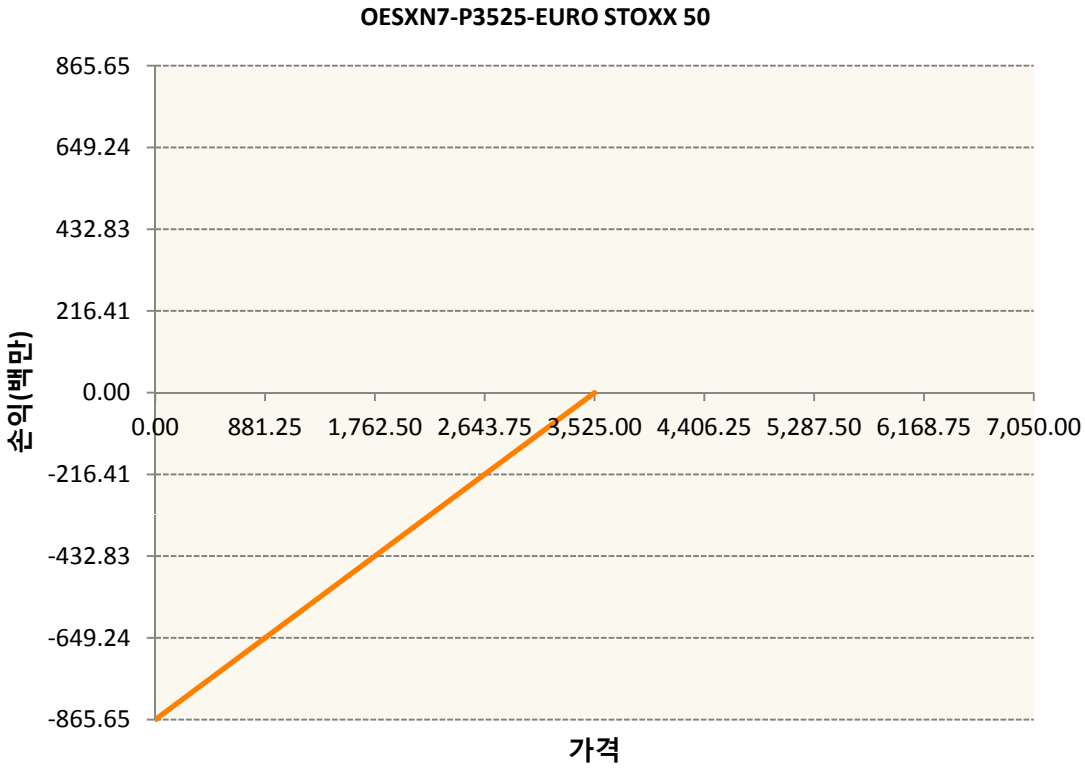
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	3,420	0	3,420	
누계	유가증권	옵션	0	6,870	-6,870	장내

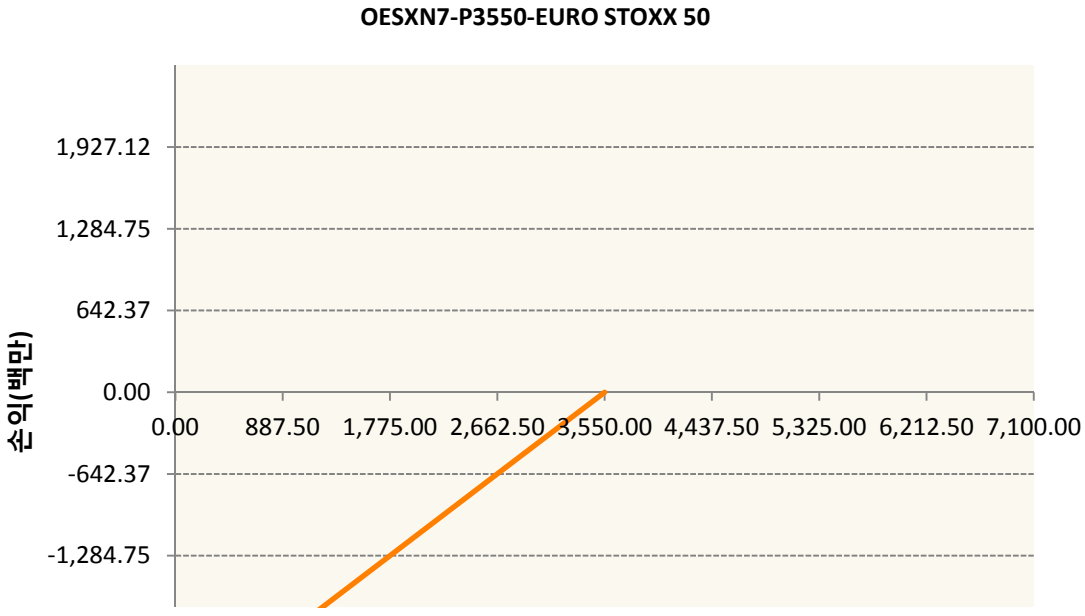
2. 만기시점의 손익구조

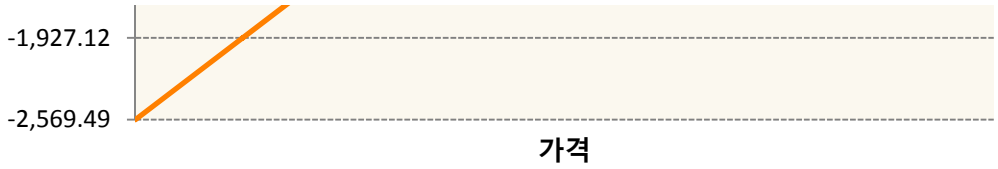


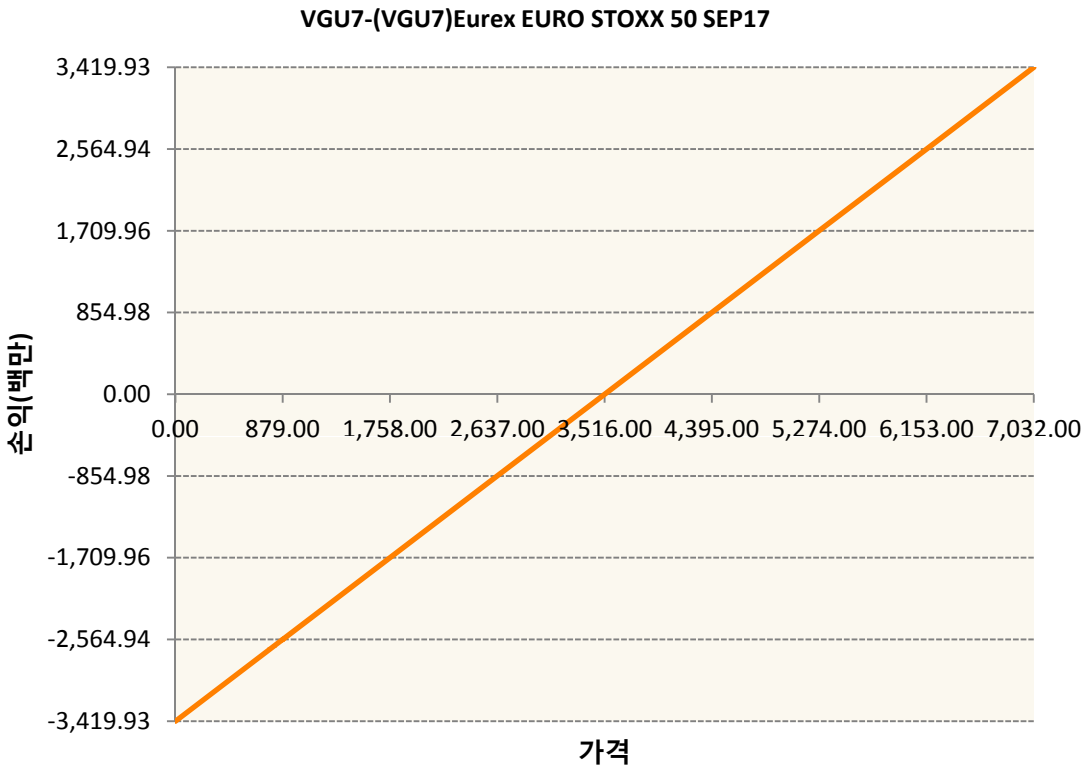



-642.37
-1,284.75
-1,927.12
-2,569.49
가격


OESXN7-P3525-EURO STOXX 50
865.65
649.24
432.83
216.41
0.00
-216.41
-432.83
-649.24
-865.65
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
1,927.12
1,284.75
642.37
0.00
-642.37
-1,284.75
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	69
OESXN7-C3!	EURO STOXX 50	206
OESXN7-P3!	EURO STOXX 50	69
OESXN7-P3!	EURO STOXX 50	206
VGU7	(VGU7)Eurex EURO STOXX 50 SEP17	274

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	704

공시일	2017-07-18
기준일	2017-07-17

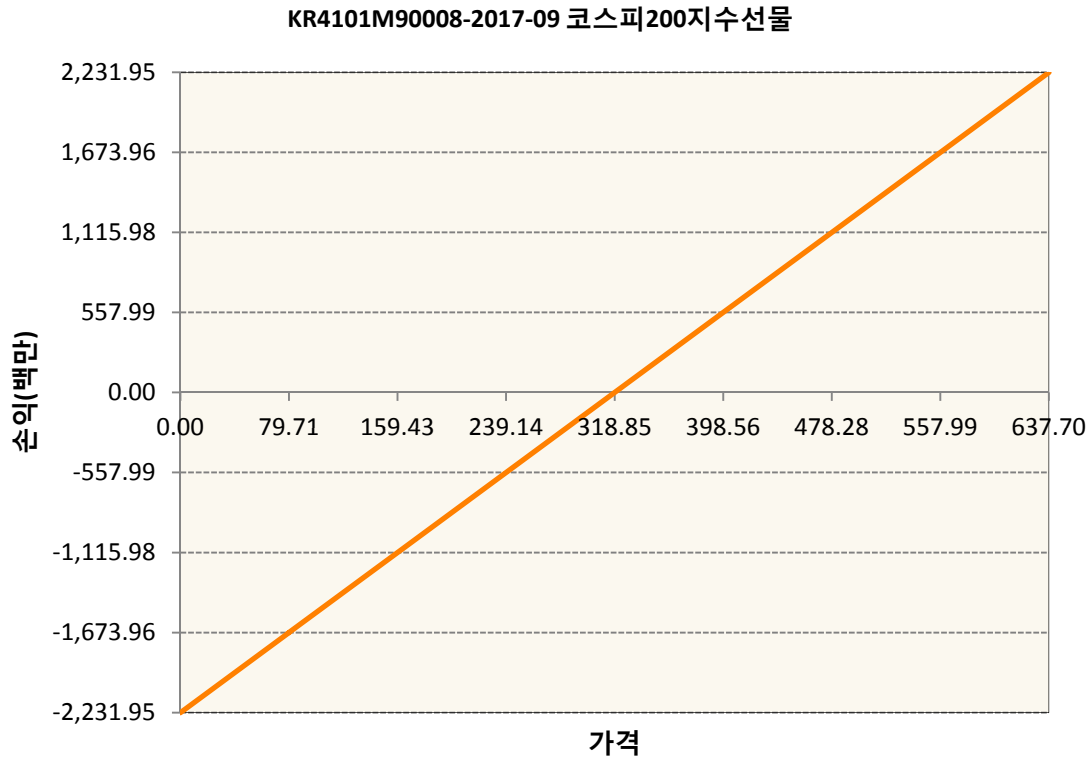
ETF스마트레버리지목표전환형7호

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	2,234	0	2,234	장내
누계	유가증권	선물	2,232	0	2,232	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101M90(2017-09 코스피200지수선물							178
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-178	-178	-178	-178	-178	-178	-178
-5.33%	-119	-119	-119	-119	-119	-119	-119
-2.67%	-59	-59	-59	-59	-59	-59	-59
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	59	59	59	59	59	59	59
5.33%	119	119	119	119	119	119	119
8.00%	178	178	178	178	178	178	178

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

107

공시일	2017-07-18
기준일	2017-07-17

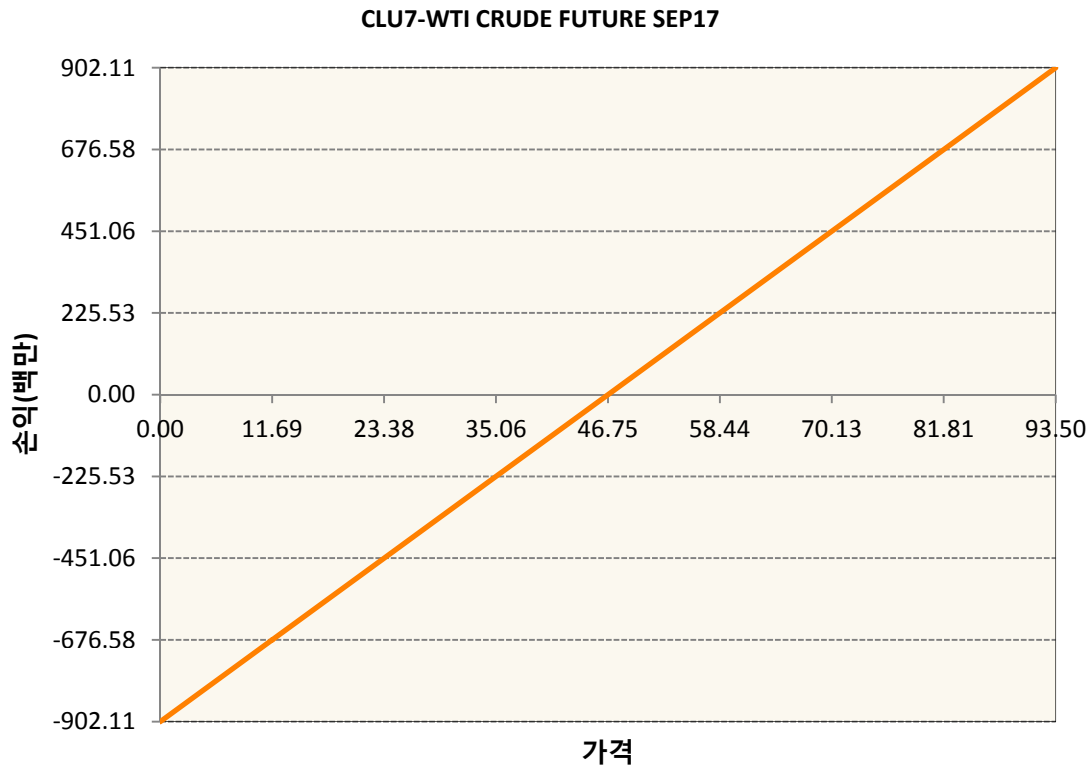
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

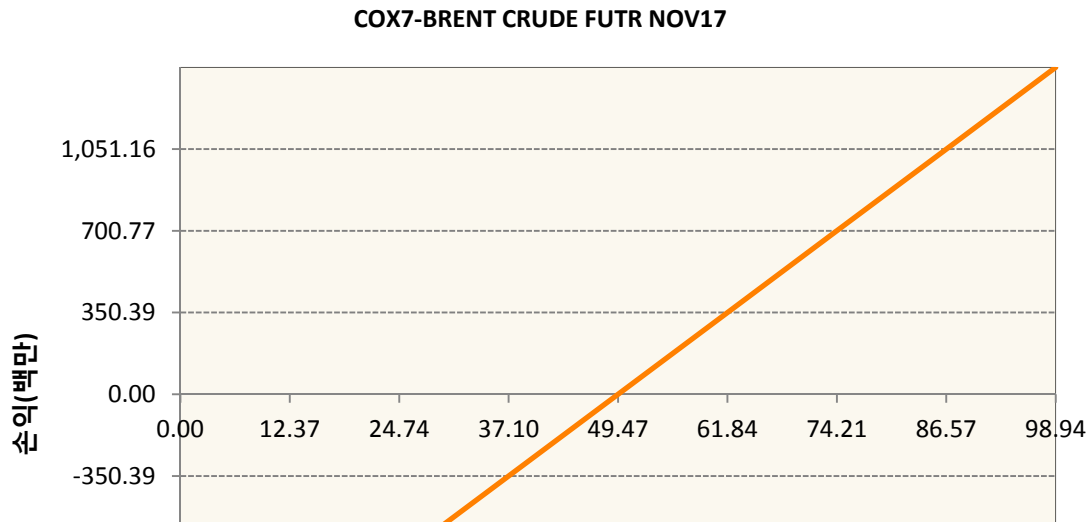
1. 계약금액

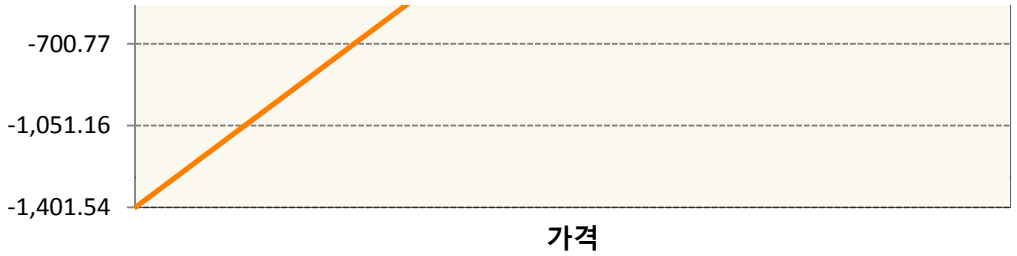
(단위:백만원)

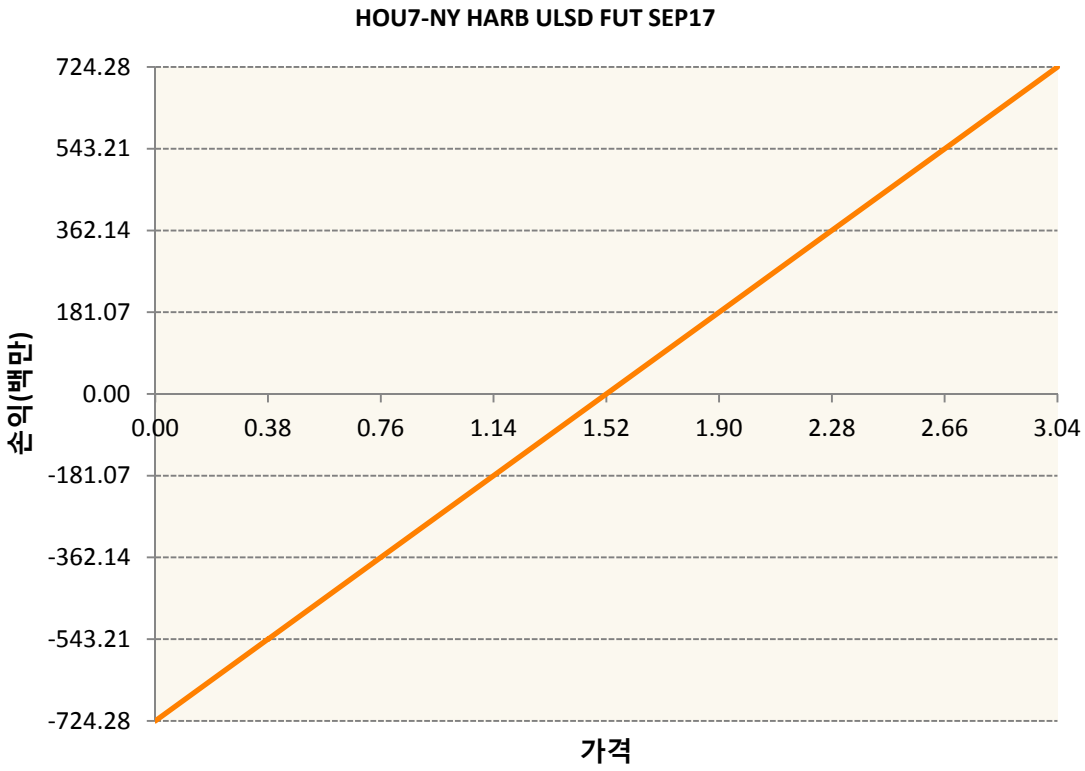
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	5,175	226	4,950	

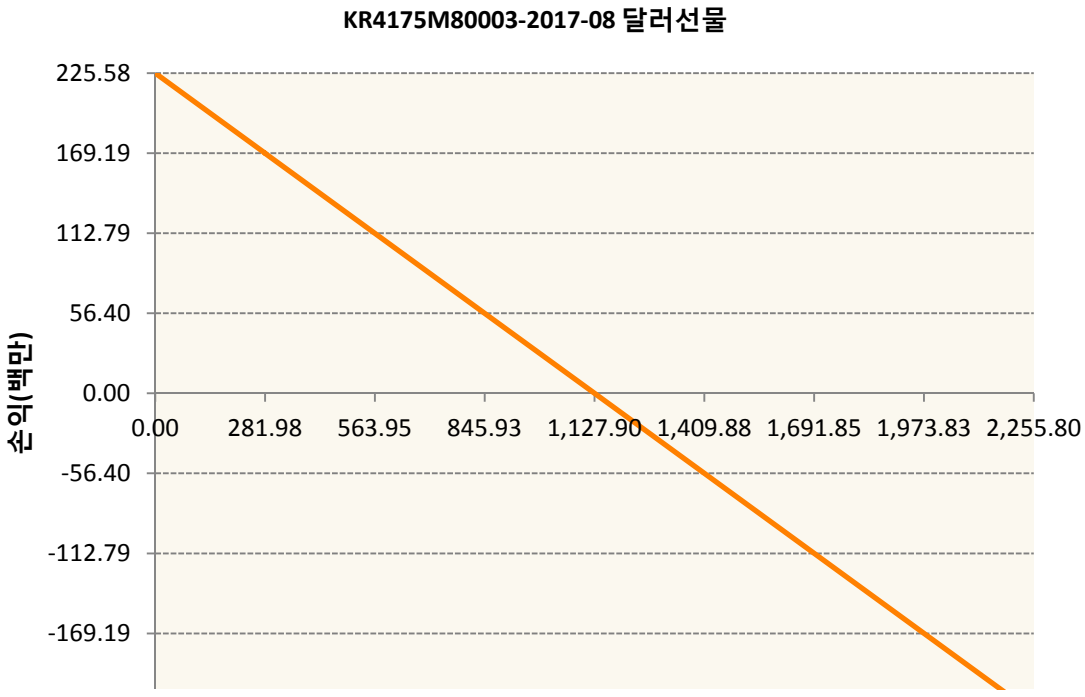
2. 만기시점의 손익구조

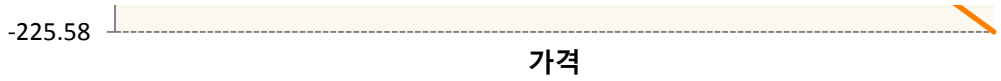


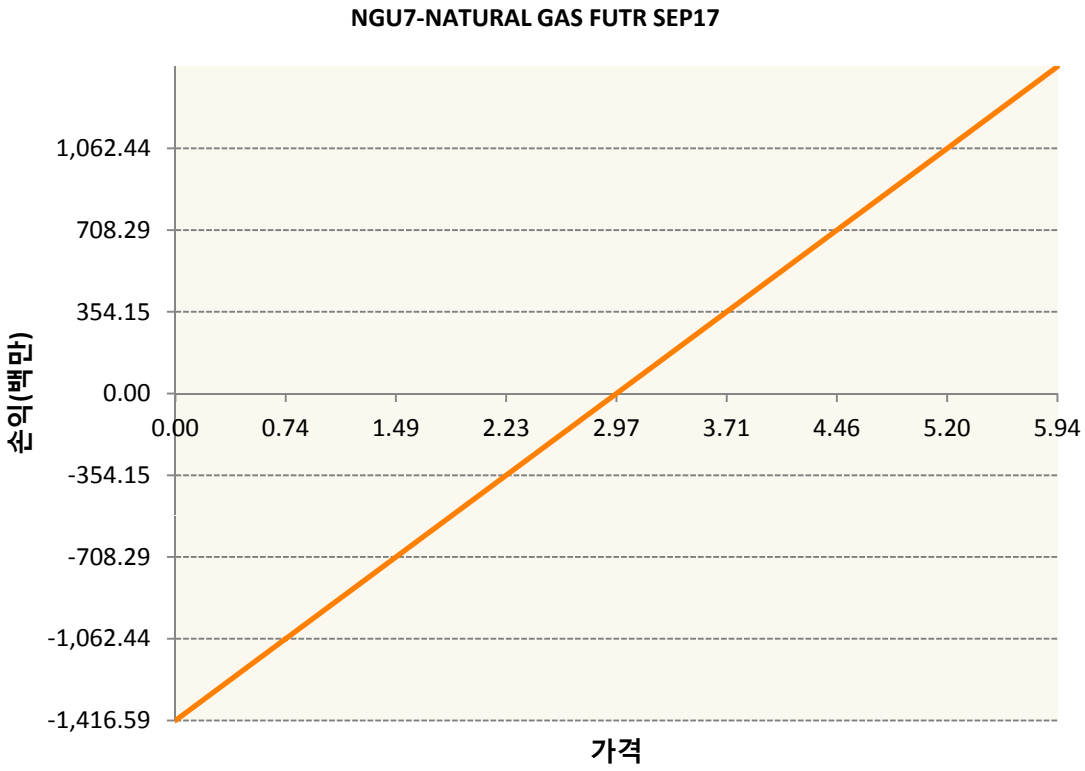


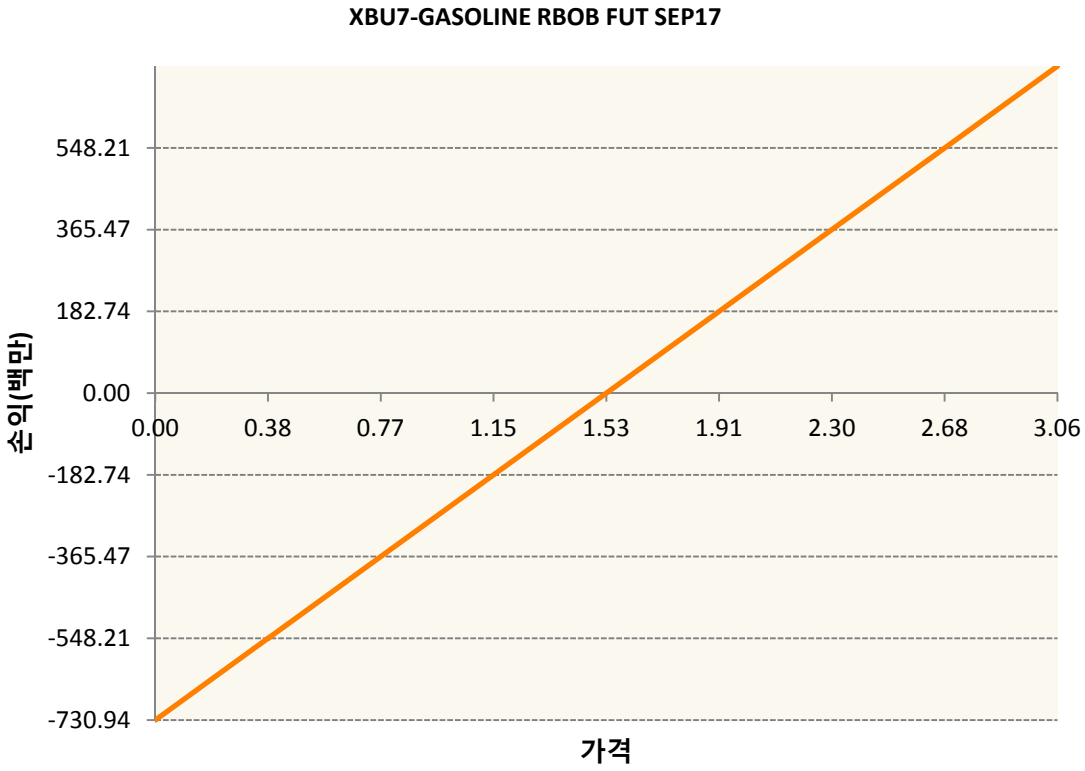

-700.77
-1,051.16
-1,401.54
가격


HOU7-NY HARB ULSD FUT SEP17
724.28
543.21
362.14
181.07
0.00
-181.07
-362.14
-543.21
-724.28
0.00
0.38
0.76
1.14
1.52
1.90
2.28
2.66
3.04
손익(만)
가격


KR4175M80003-2017-08 달러선물
225.58
169.19
112.79
56.40
0.00
-56.40
-112.79
-169.19
0.00
281.98
563.95
845.93
1,127.90
1,409.88
1,691.85
1,973.83
2,255.80
손익(만)


-225.58
가격


NGU7-NATURAL GAS FUTR SEP17
손익(백만)
1,062.44
708.29
354.15
0.00
-354.15
-708.29
-1,062.44
-1,416.59
0.00
0.74
1.49
2.23
2.97
3.71
4.46
5.20
5.94
가격


XBU7-GASOLINE RBOB FUT SEP17
손익(백만)
548.21
365.47
182.74
0.00
-182.74
-365.47
-548.21
-730.94
0.00
0.38
0.77
1.15
1.53
1.91
2.30
2.68
3.06
가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLU7	WTI CRUDE FUTURE SEP17	72
COX7	BRENT CRUDE FUTR NOV17	112
HOU7	NY HARB ULSD FUT SEP17	58
KR4175M80(	2017-08 달러선물	18
NGU7	NATURAL GAS FUTR SEP17	113
XBU7	GASOLINE RBOB FUT SEP17	58

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

789

공시일	2017-07-18
기준일	2017-07-17

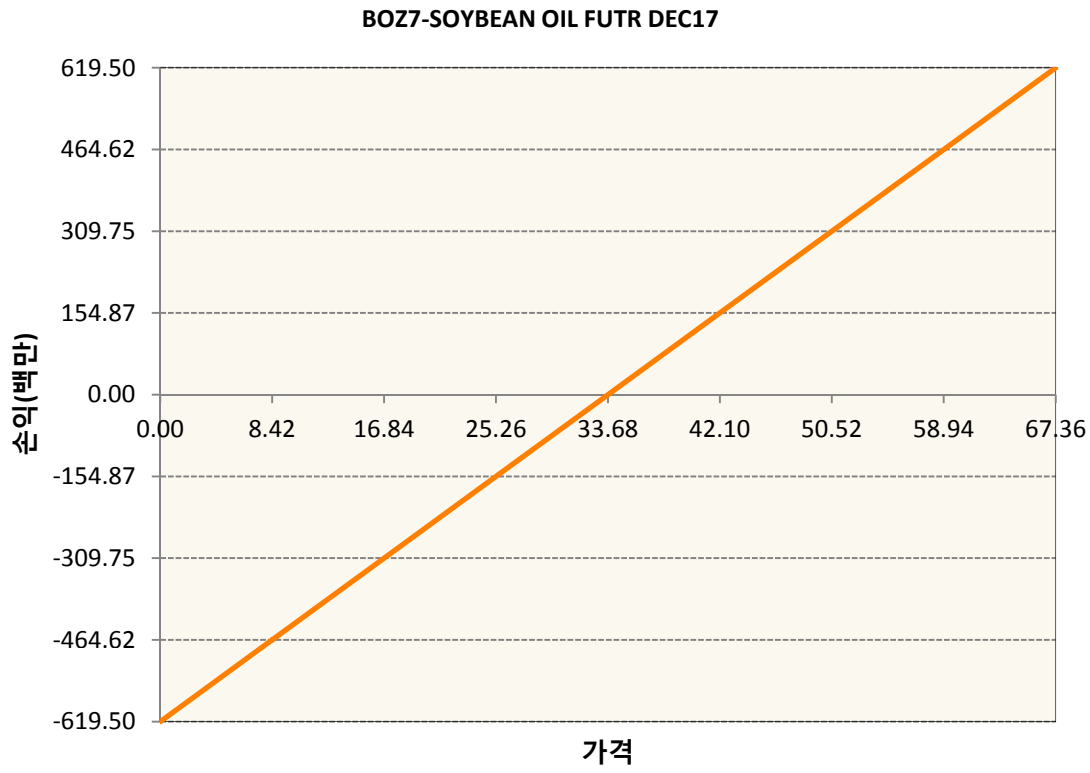
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

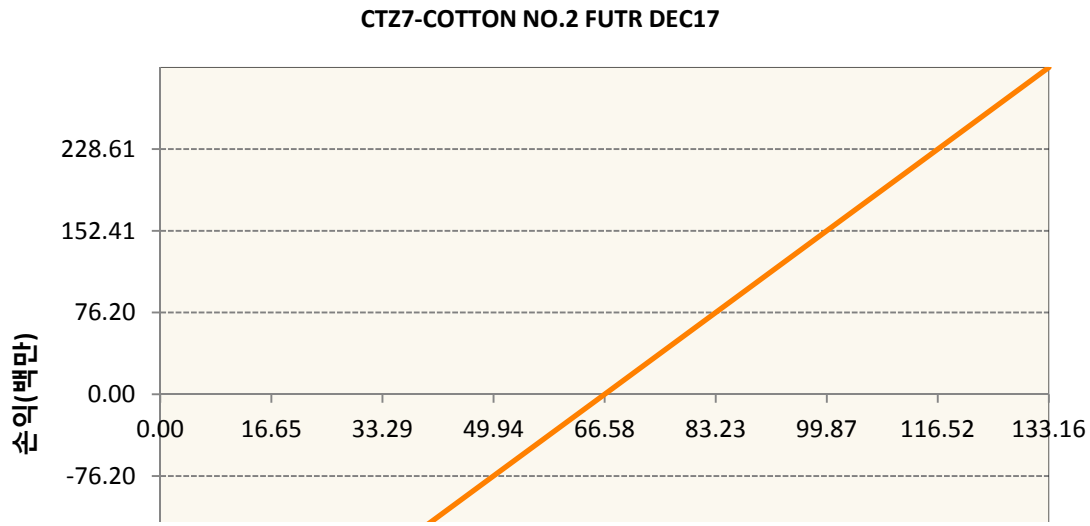
1. 계약금액

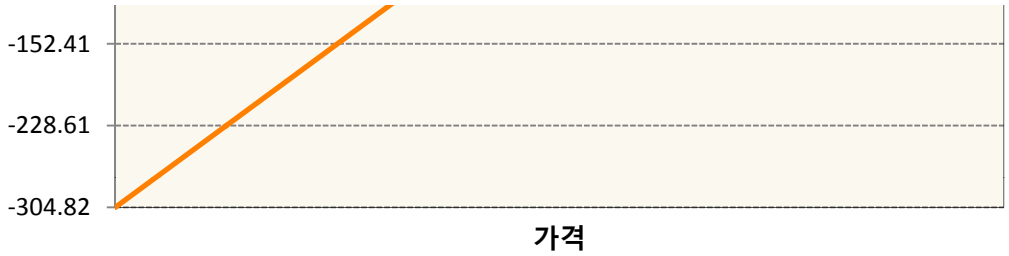
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	7,104	395	6,709	

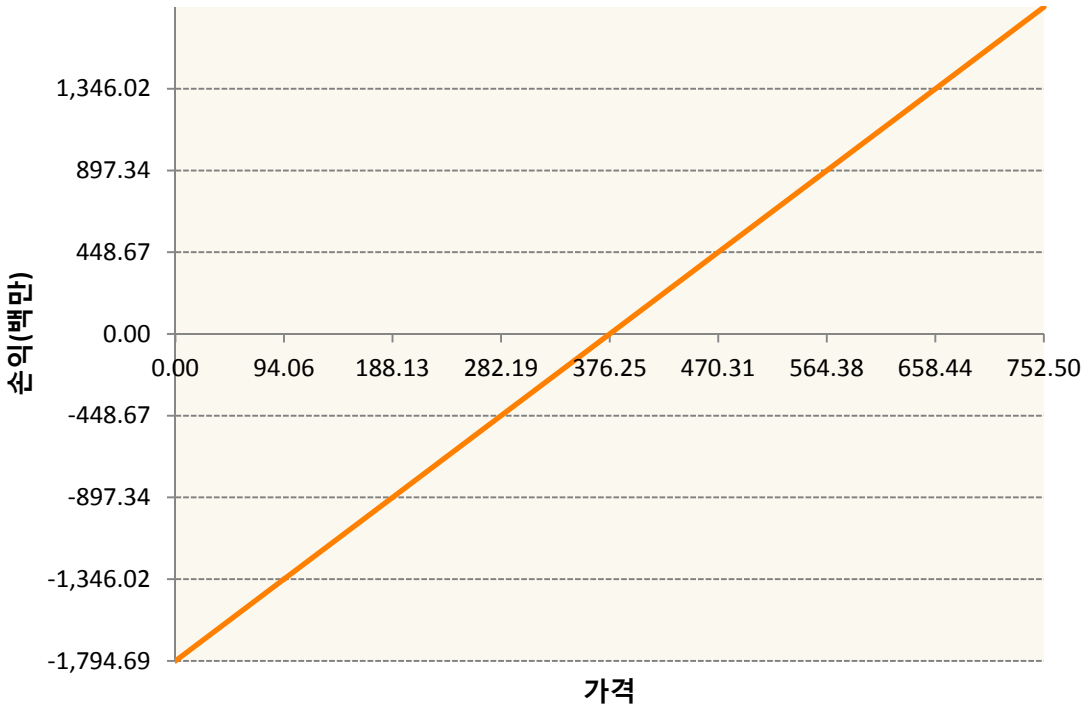
2. 만기시점의 손익구조



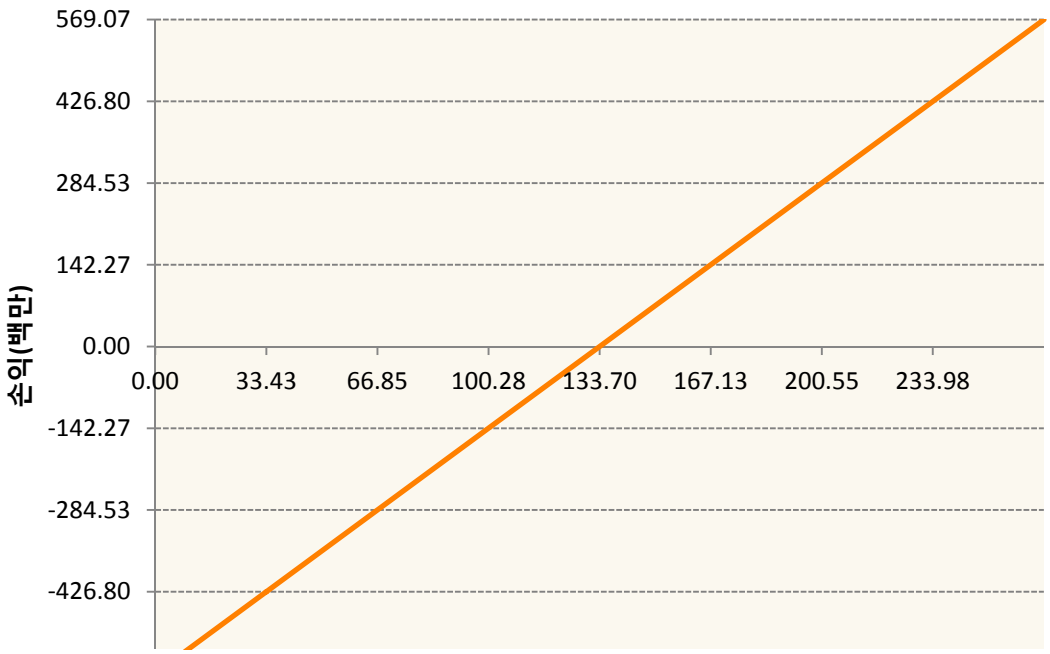


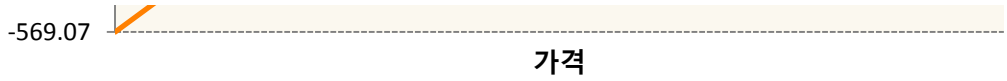


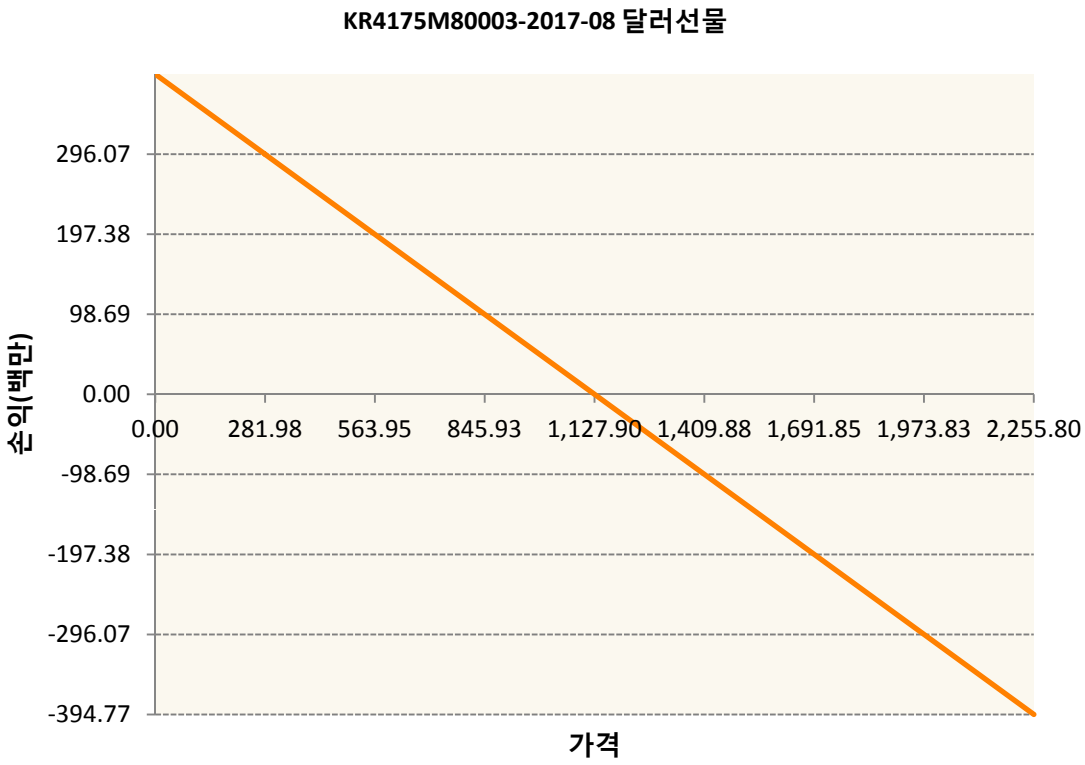
CU7-CORN FUTURE SEP17

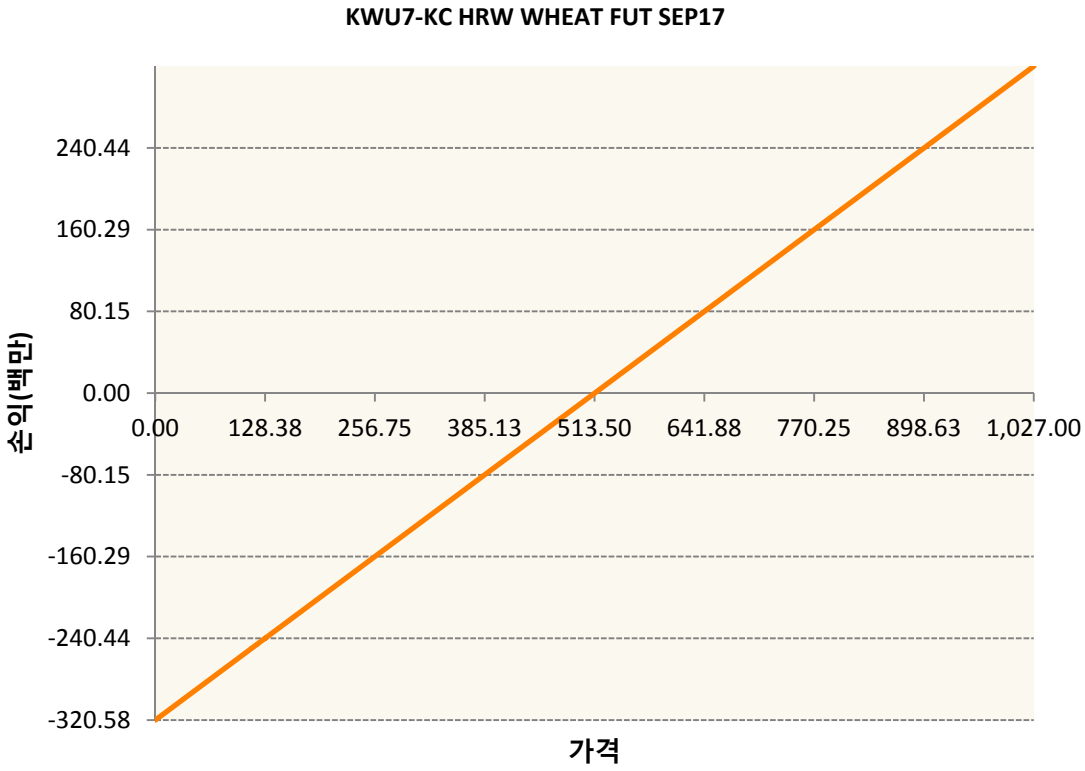


KCU7-COFFEE 'C' FUTURE SEP17

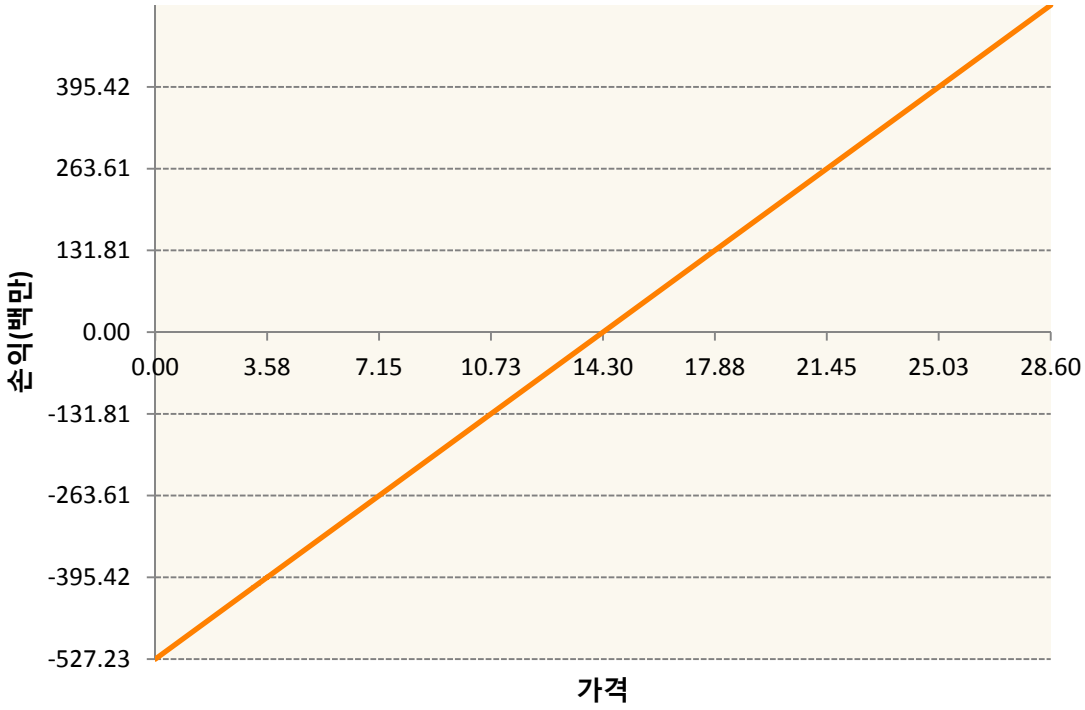



-569.07
가격

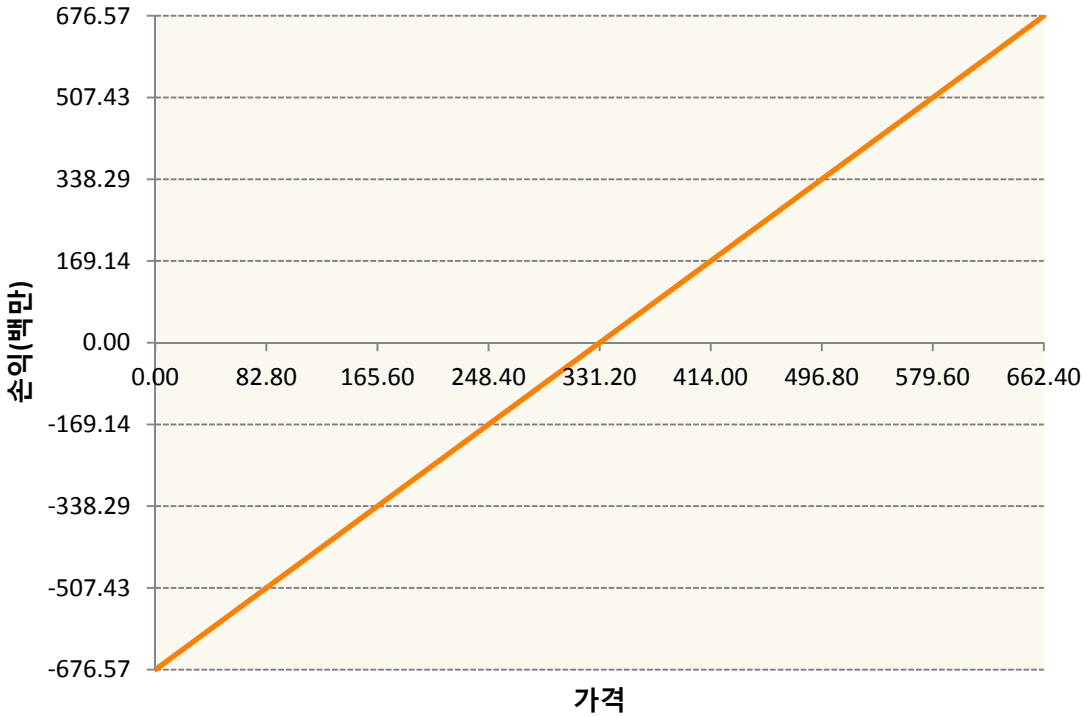

KR4175M80003-2017-08 달러선물
296.07
197.38
98.69
0.00
-98.69
-197.38
-296.07
-394.77
0.00
281.98
563.95
845.93
1,127.90
1,409.88
1,691.85
1,973.83
2,255.80
손익(백만)
가격


KWU7-KC HRW WHEAT FUT SEP17
240.44
160.29
80.15
0.00
-80.15
-160.29
-240.44
-320.58
0.00
128.38
256.75
385.13
513.50
641.88
770.25
898.63
1,027.00
손익(백만)
가격

SBV7-SUGAR #11 (WORLD) OCT17

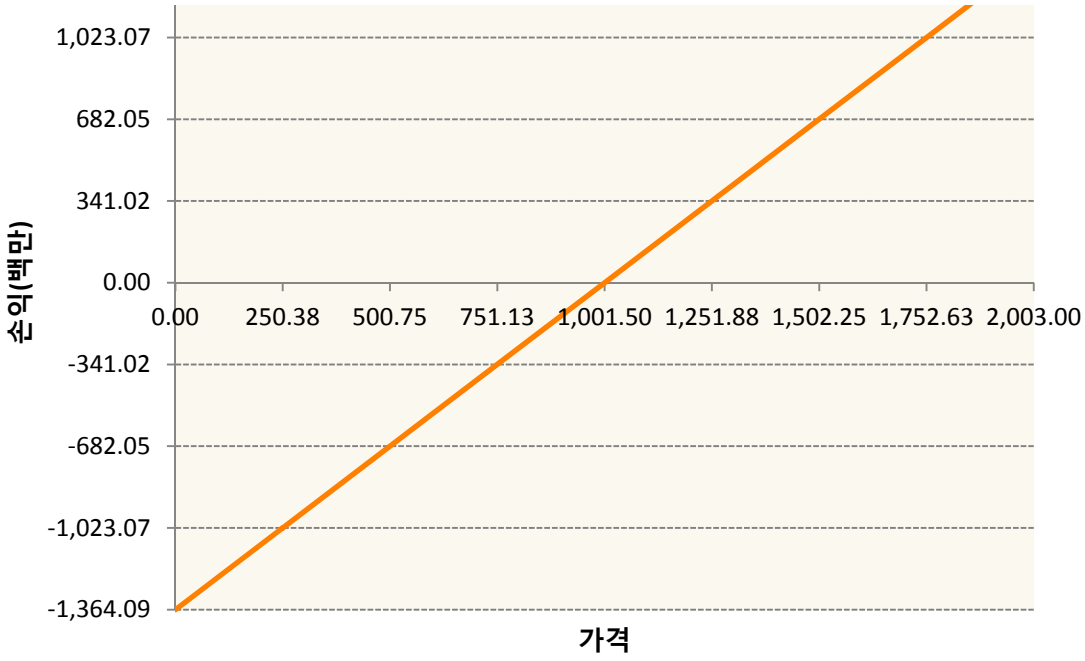


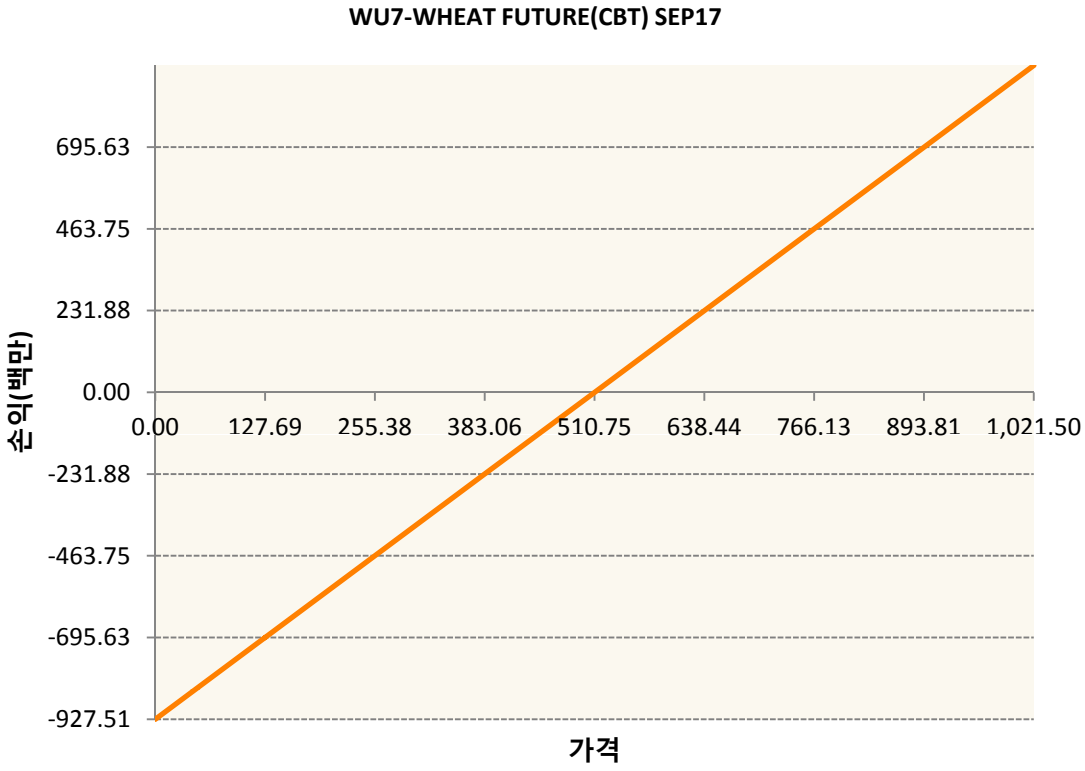
SMZ7-SOYBEAN MEAL FUTR DEC17



SX7-SOYBEAN FUTURE NOV17







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
BOZ7	SOYBEAN OIL FUTR DEC17	50
CTZ7	COTTON NO.2 FUTR DEC17	24
CU7	CORN FUTURE SEP17	144
KCU7	COFFEE 'C' FUTURE SEP17	46
KR4175M80(	2017-08 달러선물	32

KWU7	KC HRW WHEAT FUT SEP17	26
SBV7	SUGAR #11 (WORLD) OCT17	42
SMZ7	SOYBEAN MEAL FUTR DEC17	54
SX7	SOYBEAN FUTURE NOV17	109
WU7	WHEAT FUTURE(CBT) SEP17	74

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

667