공시일	2017-07-19
기준일	2017-07-18

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	2017-07-19
기준일	2017-07-18

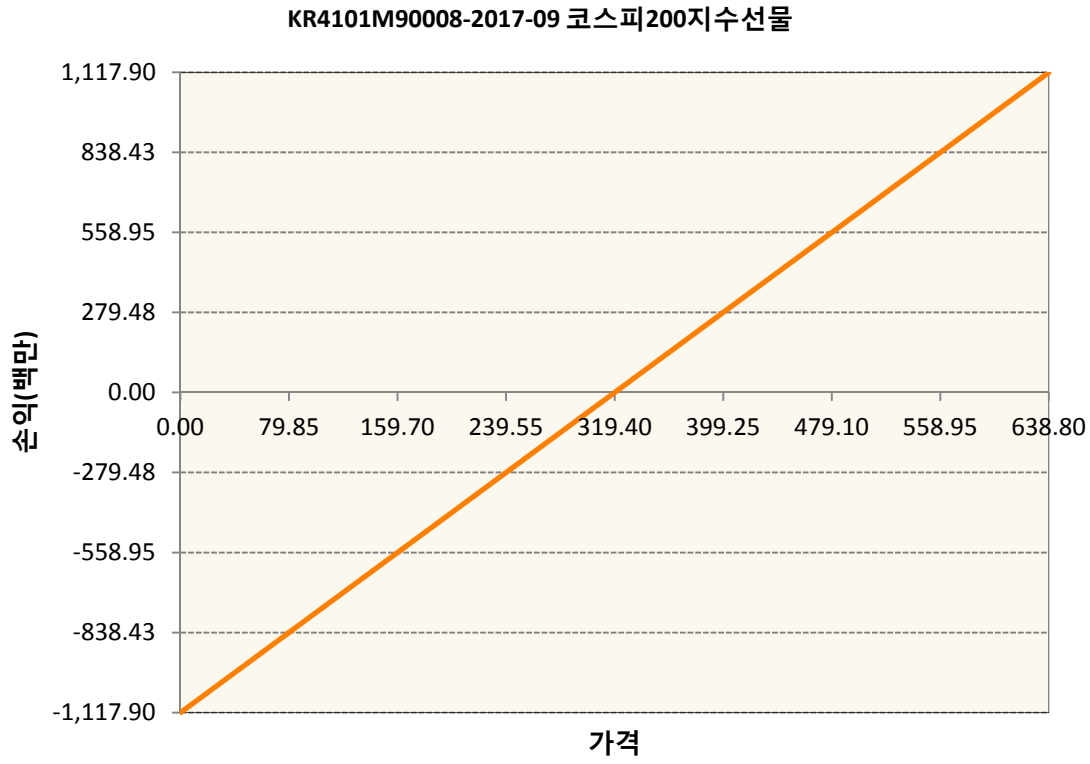
스마트인덱스모

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	1,118	0	1,118	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	2017-07-19
기준일	2017-07-18

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)

481

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-07-19
기준일	2017-07-18

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	370

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

324

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-07-19
기준일	2017-07-18

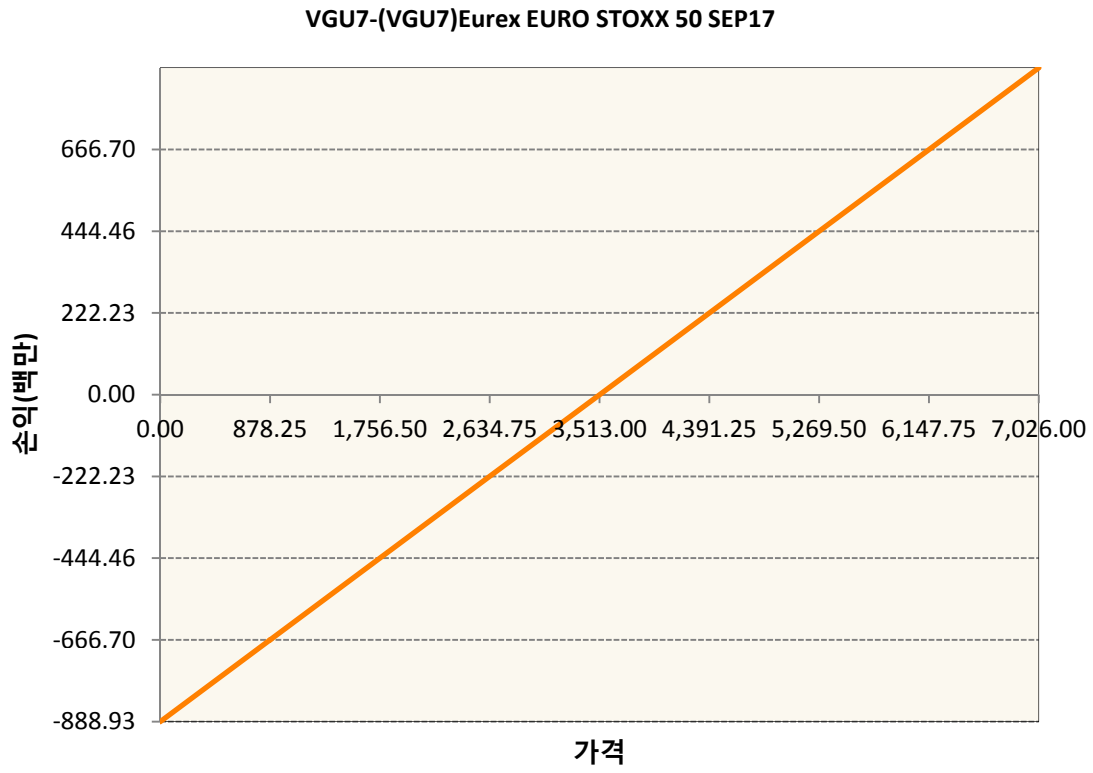
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	889	0	889	

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)

60

공시일	2017-07-19
기준일	2017-07-18

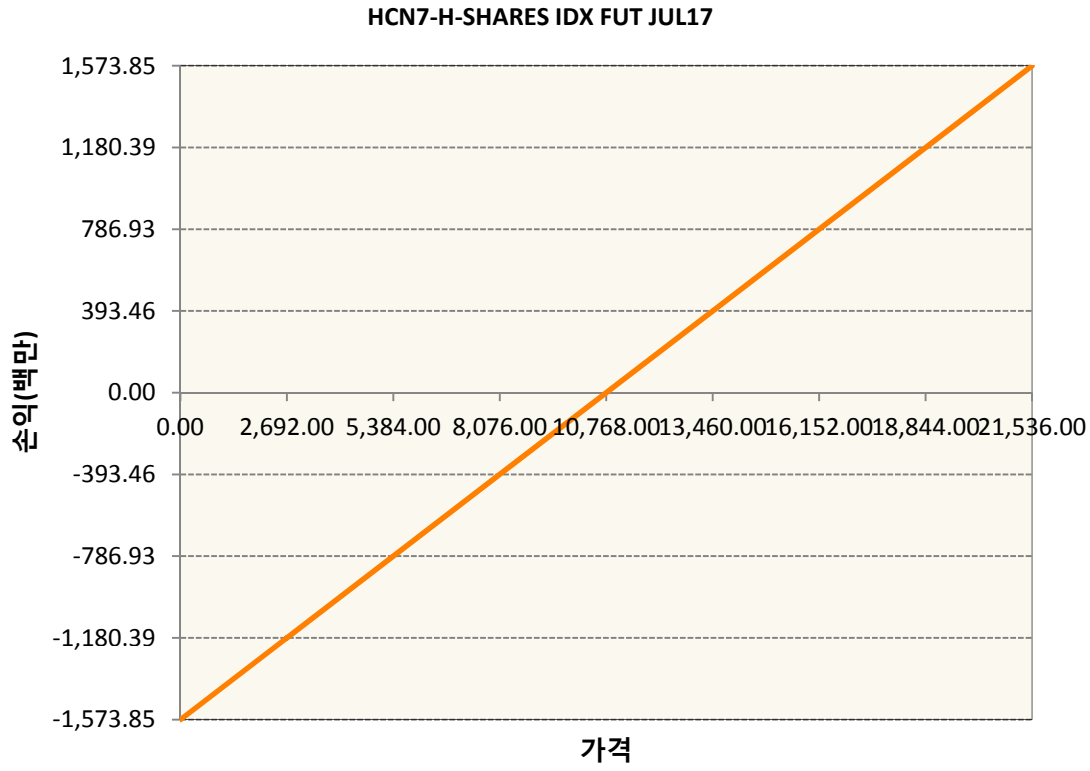
차이나인덱스모(주식-파생형)

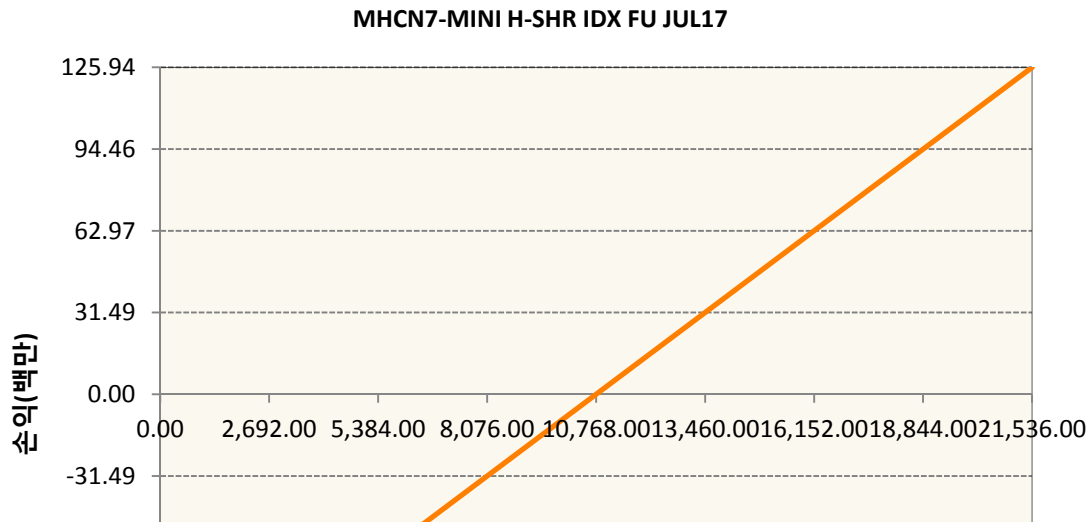
1. 계약금액

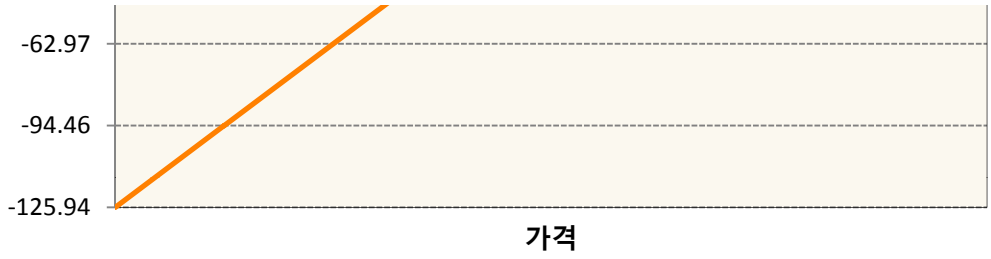
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,700	0	1,700	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)
	130

공시일	2017-07-19
기준일	2017-07-18

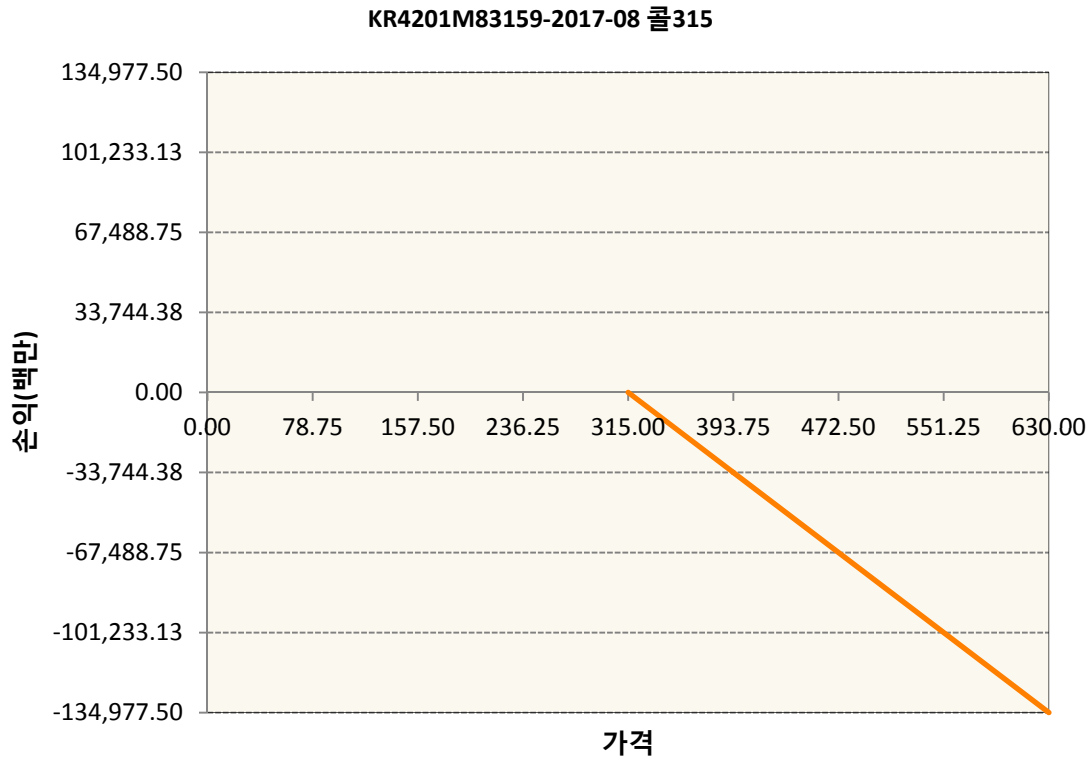
커버드콜모(주식혼합-파생형)

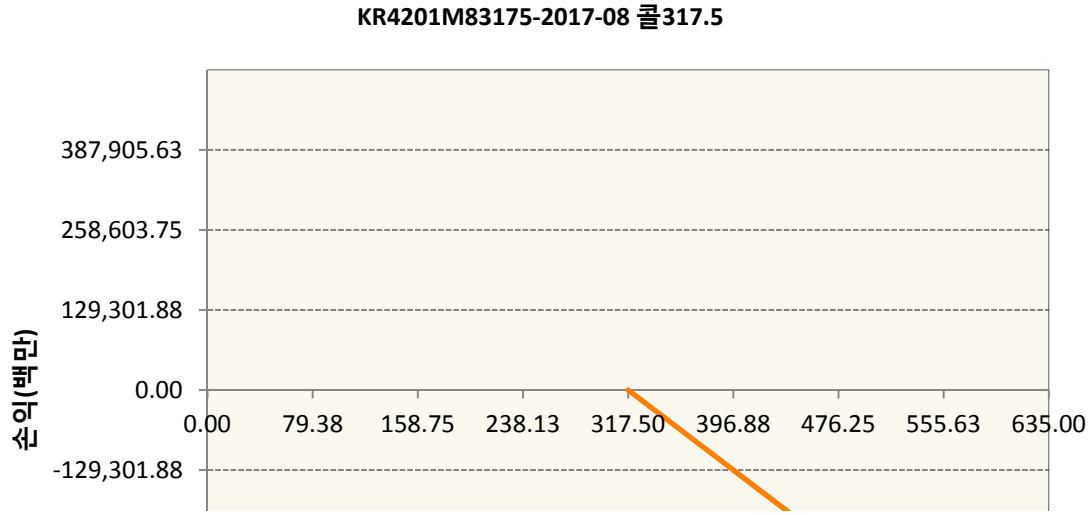
1. 계약금액

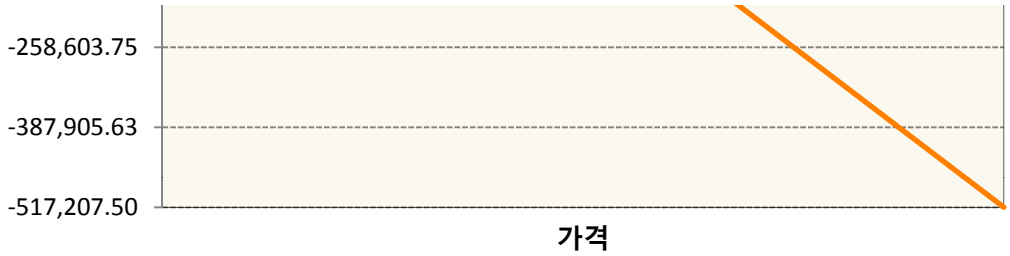
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	15,833	-15,833	장내
누계	유가증권	옵션	0	1,220,364	-1,220,364	장내

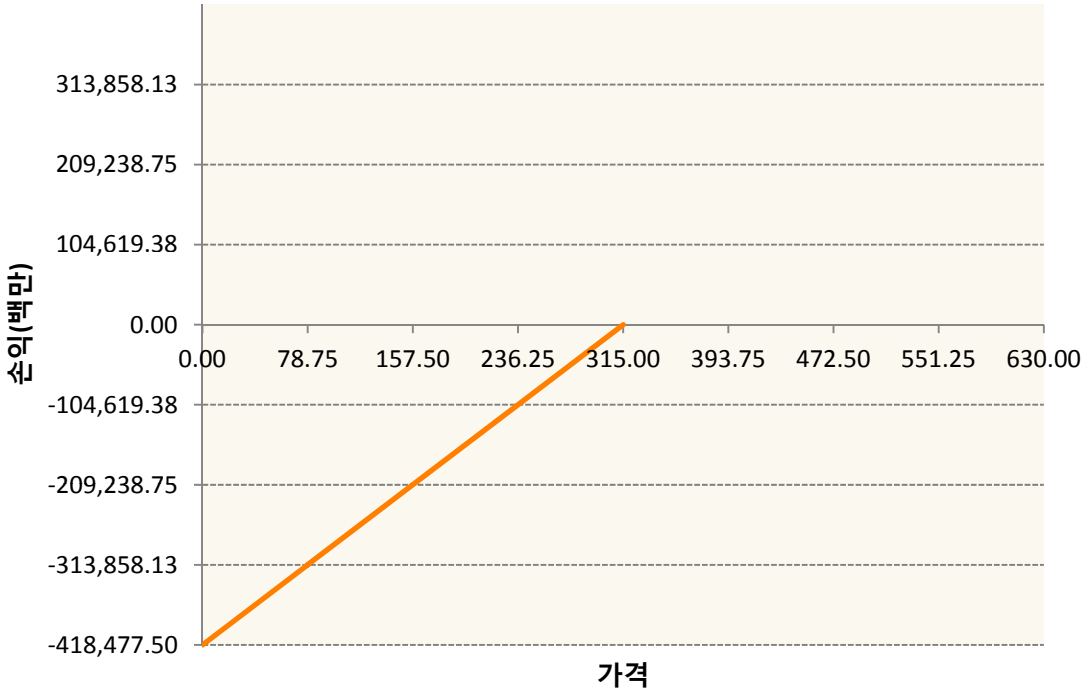
2. 만기시점의 손익구조



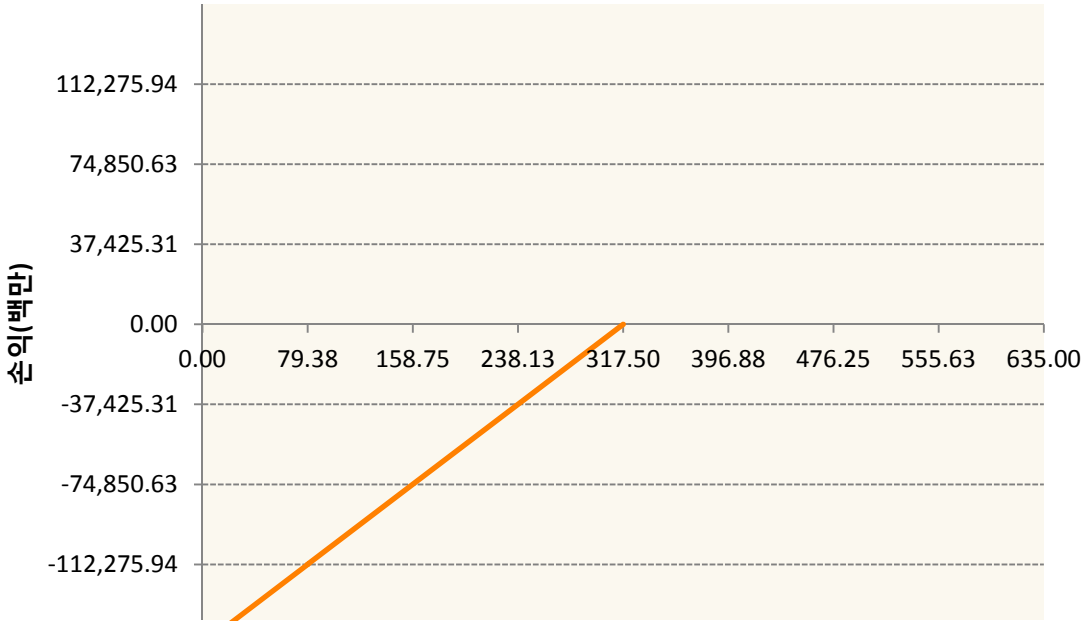




KR4301M83157-2017-08 풋315



KR4301M83173-2017-08 풋317.5





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201M83: 2017-08 콜315							9,065
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	3,815	3,746	3,659	3,556	3,438	3,308	3,165
-5.33%	3,464	3,307	3,136	2,955	2,764	2,565	2,361
-2.67%	2,532	2,294	2,053	1,810	1,566	1,320	1,074
0%	749	500	251	0	-252	-504	-757
2.67%	-1,881	-2,063	-2,258	-2,462	-2,674	-2,892	-3,115
5.33%	-5,094	-5,191	-5,308	-5,441	-5,590	-5,750	-5,922
8.00%	-8,594	-8,633	-8,688	-8,759	-8,847	-8,949	-9,065
KR4201M83: 2017-08 콜317.5							33,104
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	12,446	12,251	11,991	11,670	11,291	10,859	10,381
-5.33%	11,495	10,997	10,436	9,824	9,169	8,478	7,757
-2.67%	8,712	7,869	7,005	6,125	5,232	4,330	3,419
0%	2,928	1,953	977	0	-977	-1,954	-2,931
2.67%	-6,180	-6,975	-7,803	-8,655	-9,528	-10,417	-11,319
5.33%	-17,844	-18,313	-18,852	-19,449	-20,096	-20,785	-21,509
8.00%	-30,908	-31,113	-31,388	-31,729	-32,132	-32,593	-33,104
KR4301M83: 2017-08 풋315							26,678
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-26,614	-26,615	-26,617	-26,623	-26,634	-26,652	-26,678
-5.33%	-15,374	-15,414	-15,473	-15,553	-15,654	-15,774	-15,913
-2.67%	-5,049	-5,321	-5,608	-5,905	-6,212	-6,525	-6,845
0%	964	651	329	0	-334	-673	-1,015
2.67%	2,301	2,231	2,137	2,018	1,877	1,715	1,534
5.33%	2,386	2,382	2,374	2,359	2,334	2,297	2,247
8.00%	2,387	2,387	2,387	2,386	2,384	2,380	2,372
KR4301M83: 2017-08 풋317.5							10,173
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-10,162	-10,162	-10,162	-10,163	-10,164	-10,168	-10,173
-5.33%	-6,163	-6,169	-6,179	-6,195	-6,217	-6,244	-6,278
-2.67%	-2,320	-2,388	-2,464	-2,547	-2,636	-2,729	-2,827
0%	386	258	129	0	-129	-258	-388
2.67%	1,226	1,180	1,124	1,059	987	908	824

5.33%	1,307	1,303	1,296	1,285	1,268	1,245	1,217
8.00%	1,309	1,309	1,309	1,308	1,306	1,303	1,298

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

84,142

공시일	2017-07-19
기준일	2017-07-18

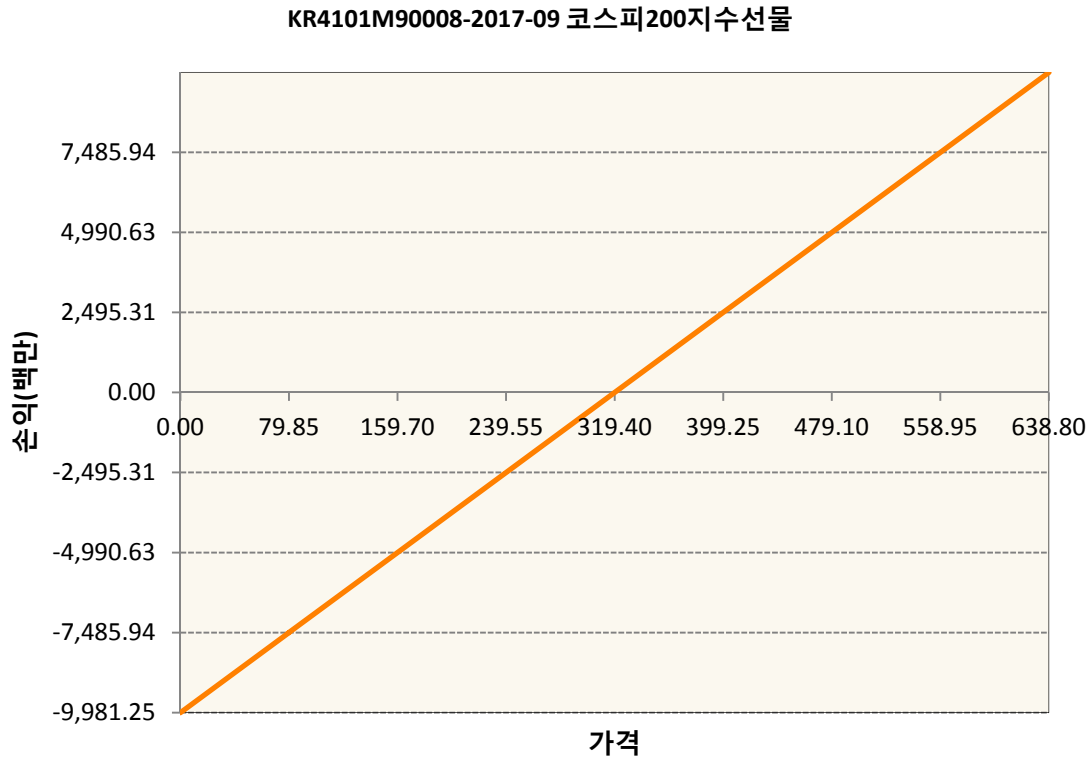
ETF스마트레버리지목표전환형6호

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	9,981	0	9,981	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)

477

공시일	2017-07-19
기준일	2017-07-18

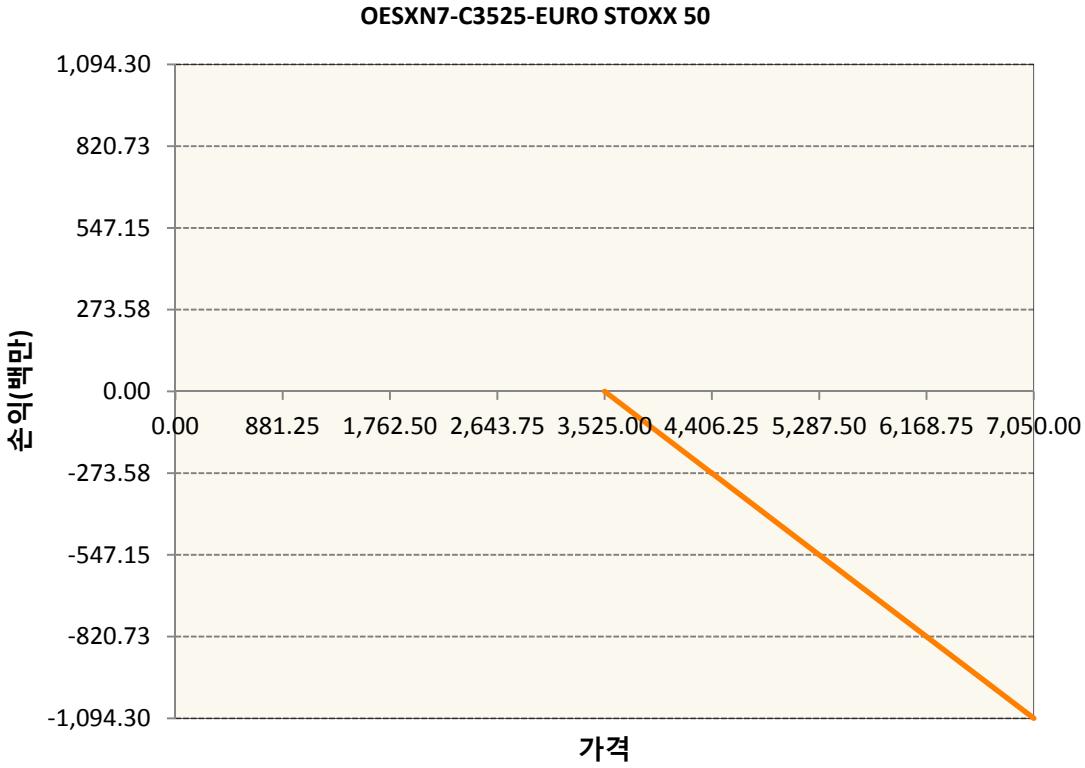
유로커버드콜(주식혼합-파생형)

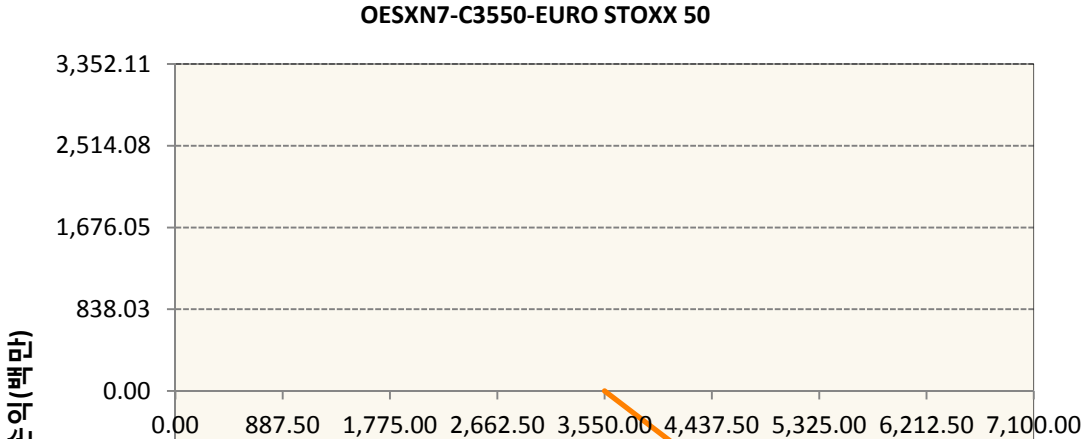
1. 계약금액

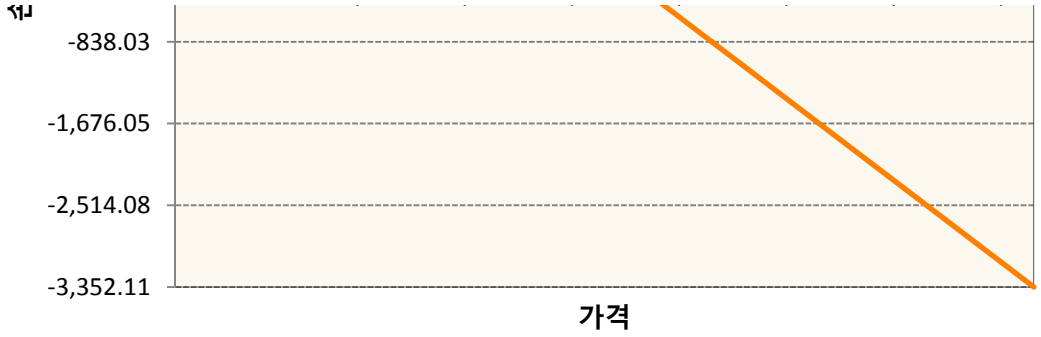
(단위:백만원)

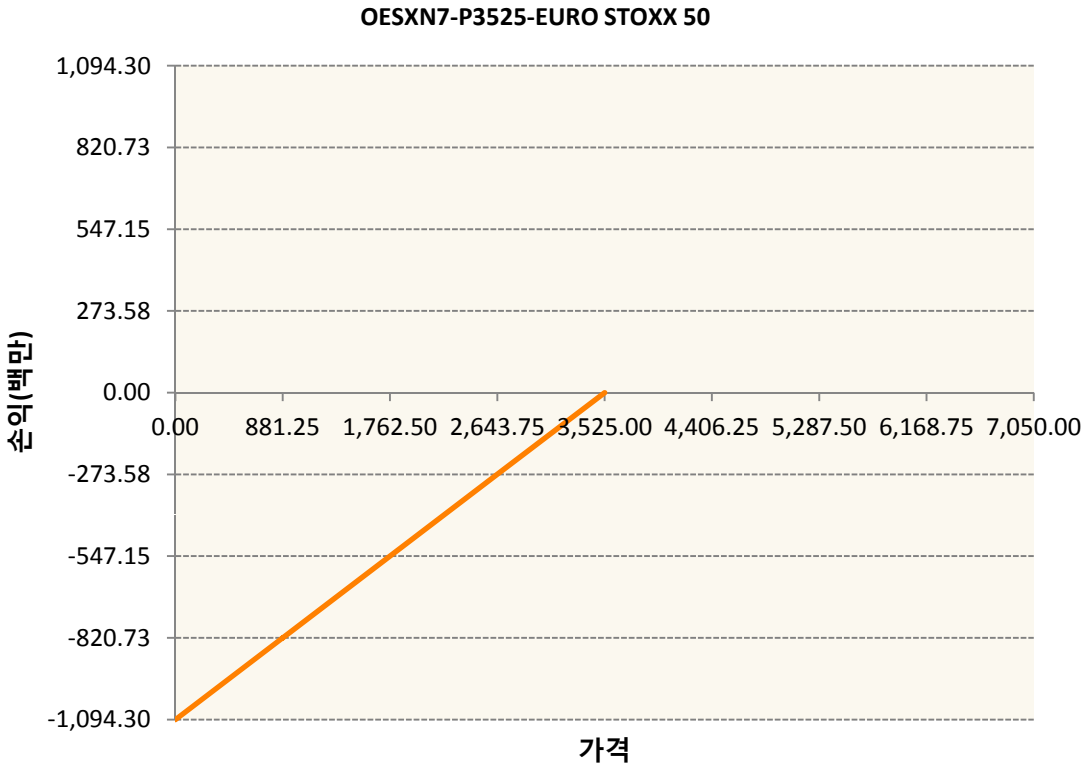
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	4,417	0	4,417	
누계	유가증권	옵션	0	8,893	-8,893	장내

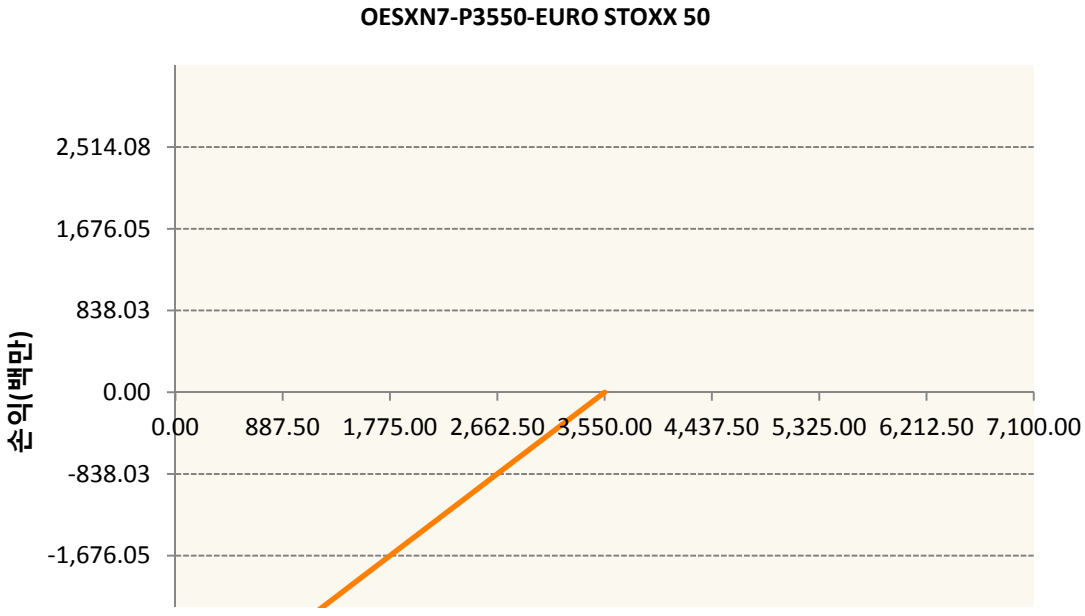
2. 만기시점의 손익구조

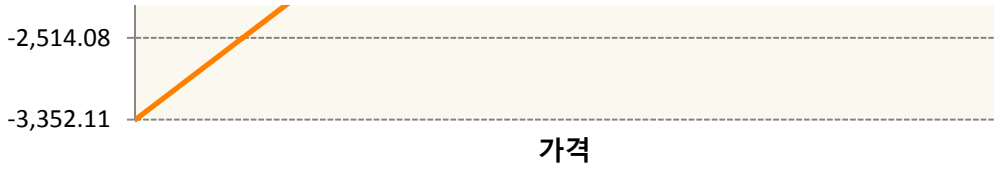


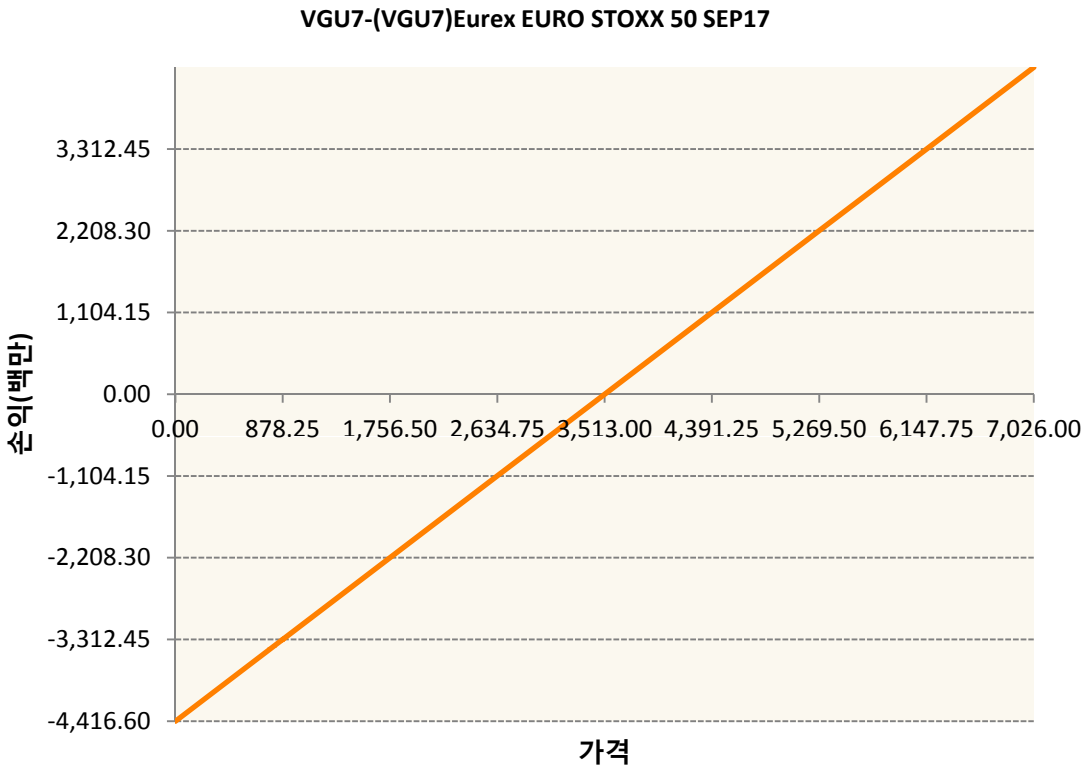



-838.03
-1,676.05
-2,514.08
-3,352.11
가격


OESXN7-P3525-EURO STOXX 50
1,094.30
820.73
547.15
273.58
0.00
-273.58
-547.15
-820.73
-1,094.30
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
2,514.08
1,676.05
838.03
0.00
-838.03
-1,676.05
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	88
OESXN7-C3!	EURO STOXX 50	268
OESXN7-P3!	EURO STOXX 50	88
OESXN7-P3!	EURO STOXX 50	268
VGU7	(VGU7)Eurex EURO STOXX 50 SEP17	353

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

906

공시일	2017-07-19
기준일	2017-07-18

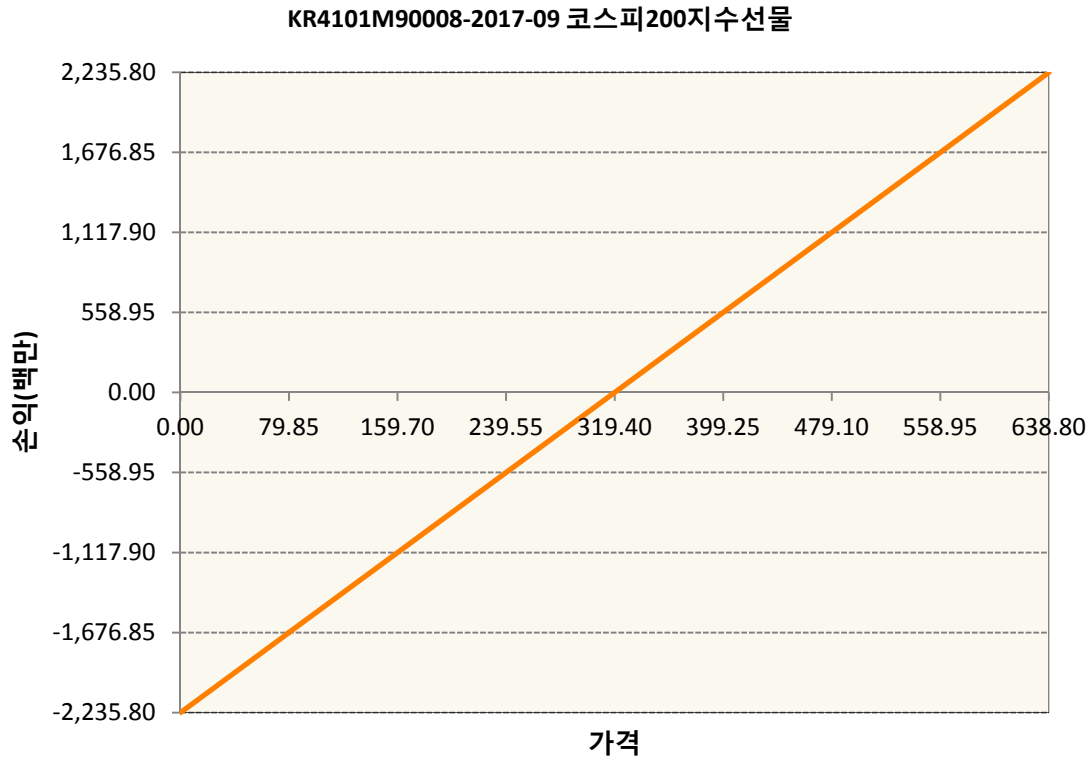
ETF스마트레버리지목표전환형7호

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	2,236	0	2,236	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	2017-07-19
기준일	2017-07-18

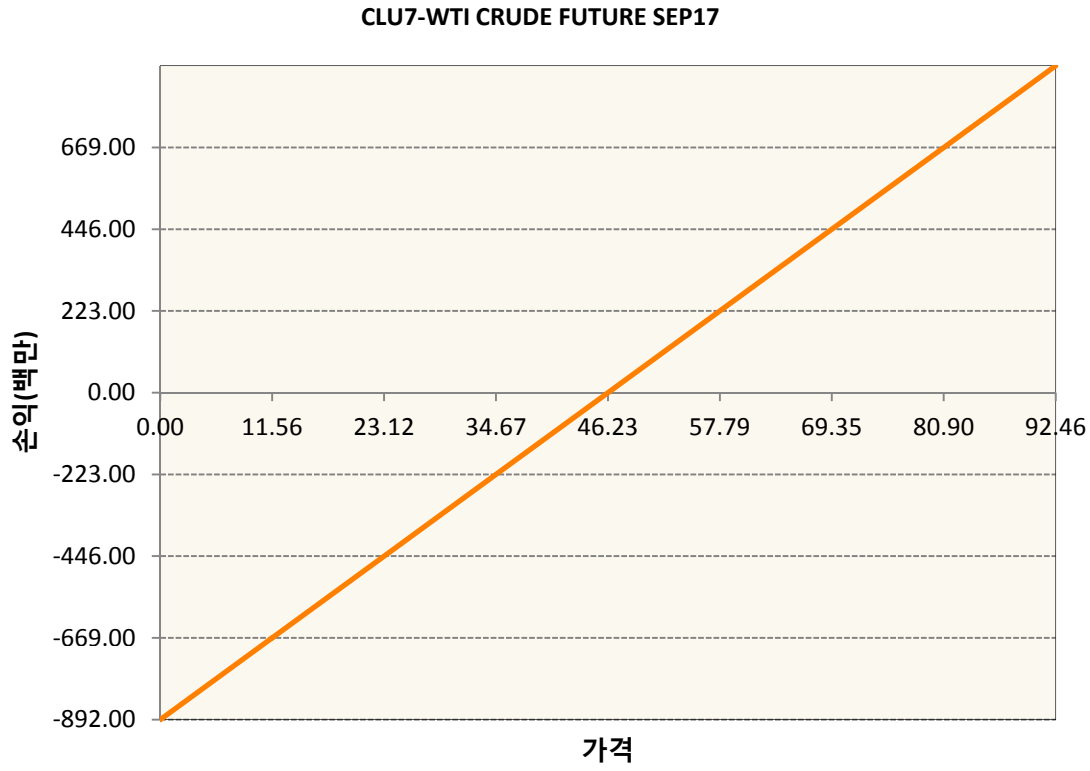
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

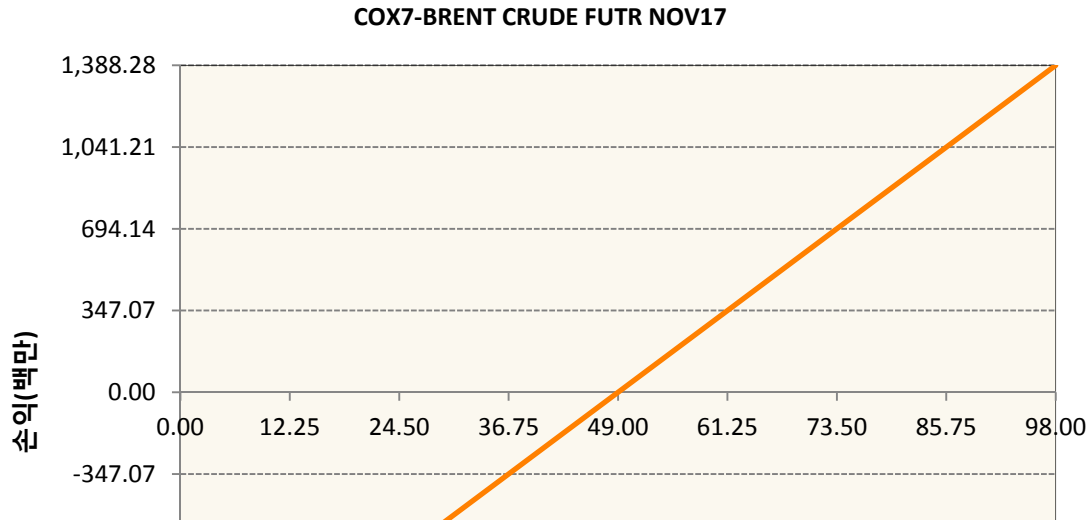
1. 계약금액

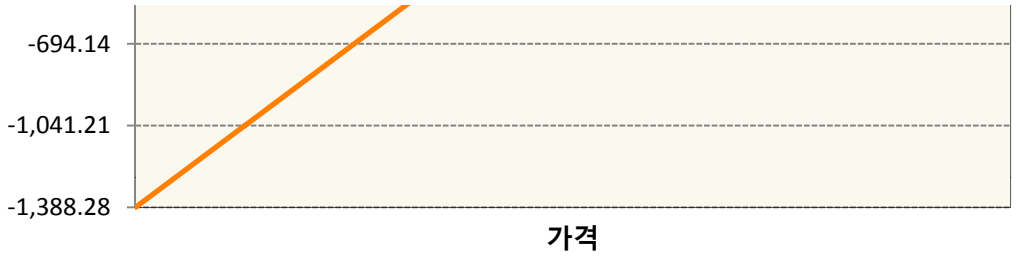
(단위:백만원)

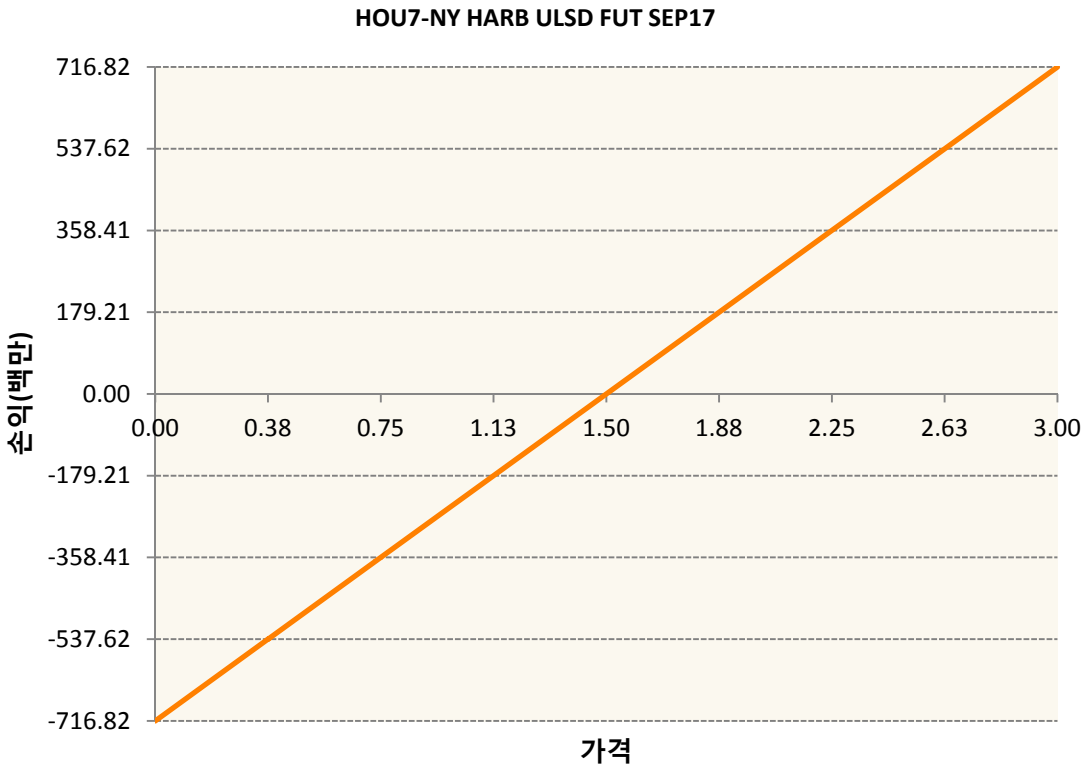
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	5,158	225	4,933	

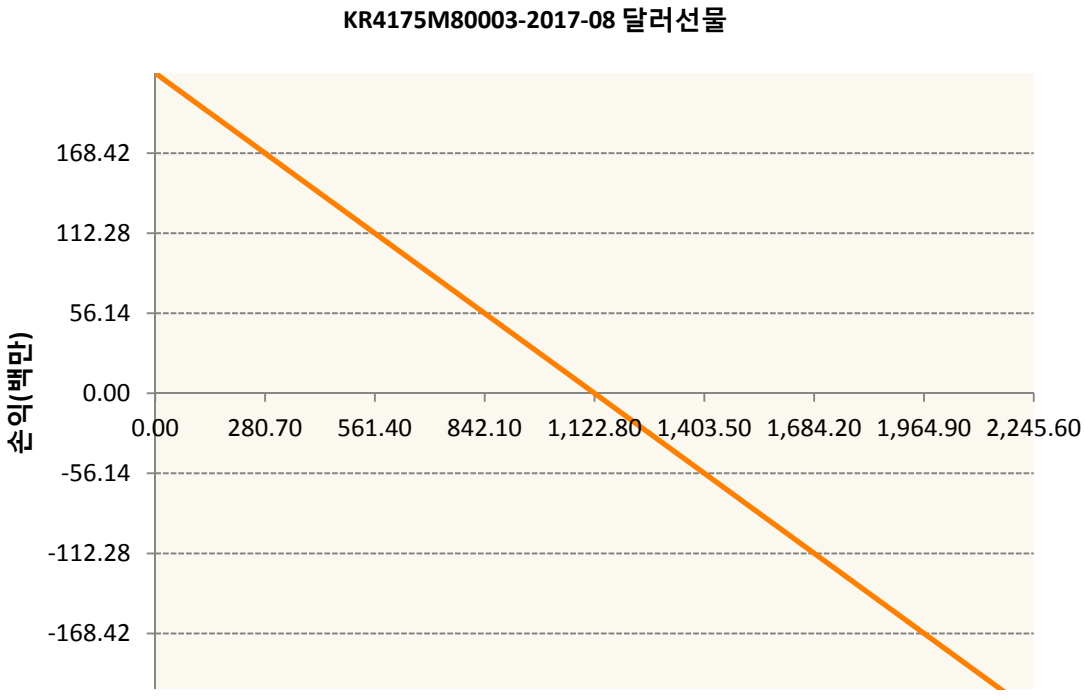
2. 만기시점의 손익구조

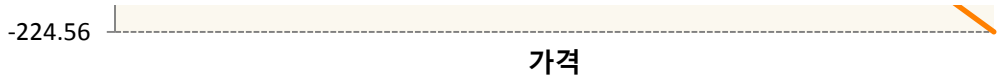


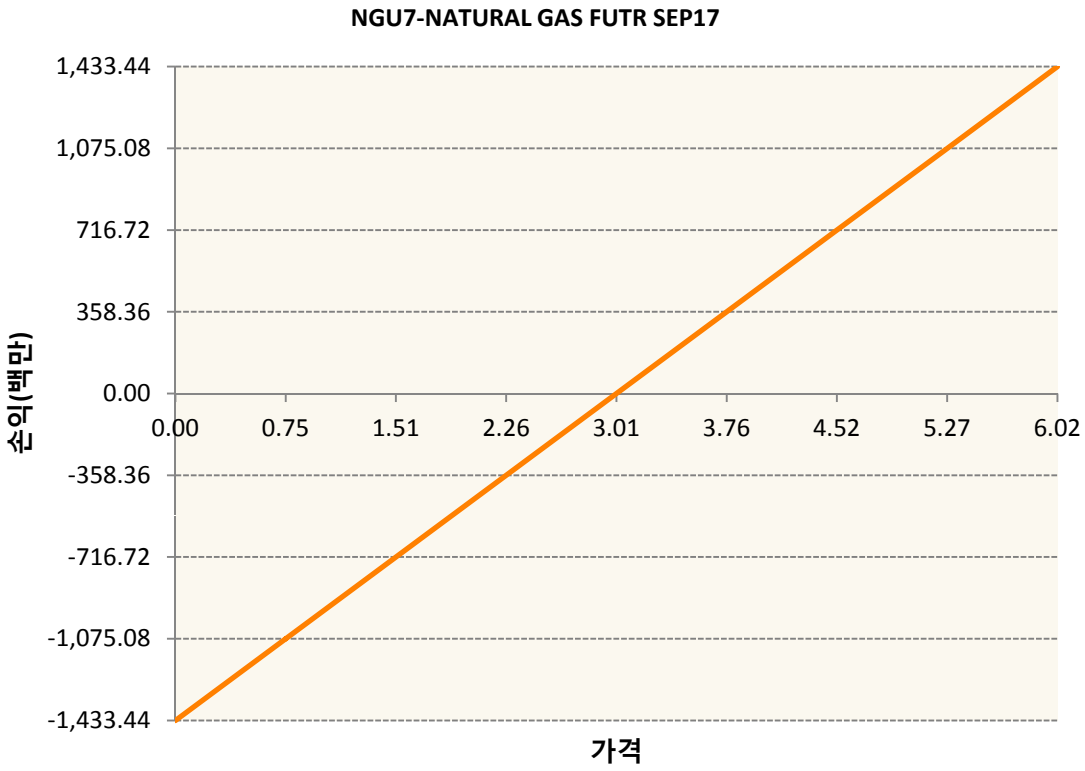


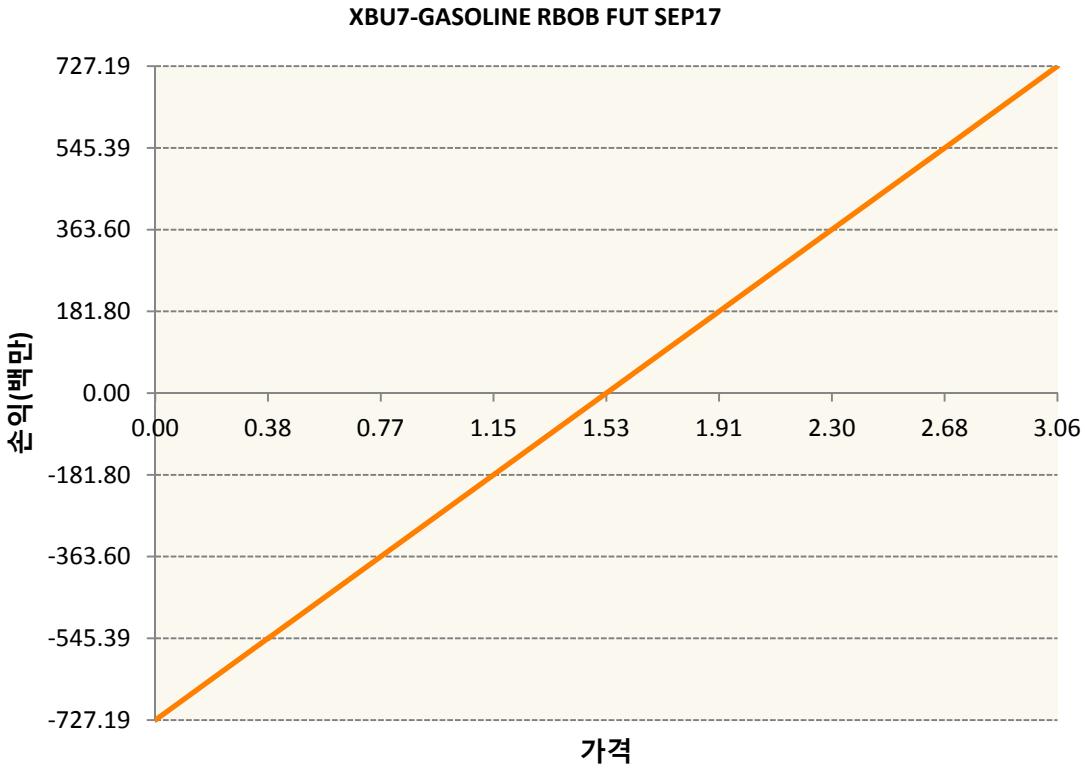

-694.14
-1,041.21
-1,388.28
가격


HOU7-NY HARB ULSD FUT SEP17
716.82
537.62
358.41
179.21
0.00
-179.21
-358.41
-537.62
-716.82
0.00
0.38
0.75
1.13
1.50
1.88
2.25
2.63
3.00
손익(만)
가격


KR4175M80003-2017-08 달러선물
168.42
112.28
56.14
0.00
-56.14
-112.28
-168.42
0.00
280.70
561.40
842.10
1,122.80
1,403.50
1,684.20
1,964.90
2,245.60
손익(만)


-224.56
가격


NGU7-NATURAL GAS FUTR SEP17
1,433.44
1,075.08
716.72
358.36
0.00
-358.36
-716.72
-1,075.08
-1,433.44
0.00
0.75
1.51
2.26
3.01
3.76
4.52
5.27
6.02
손익(백만)
가격


XBU7-GASOLINE RBOB FUT SEP17
727.19
545.39
363.60
181.80
0.00
-181.80
-363.60
-545.39
-727.19
0.00
0.38
0.77
1.15
1.53
1.91
2.30
2.68
3.06
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	115
XBU7	GASOLINE RBOB FUT SEP17	58

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

786

공시일	2017-07-19
기준일	2017-07-18

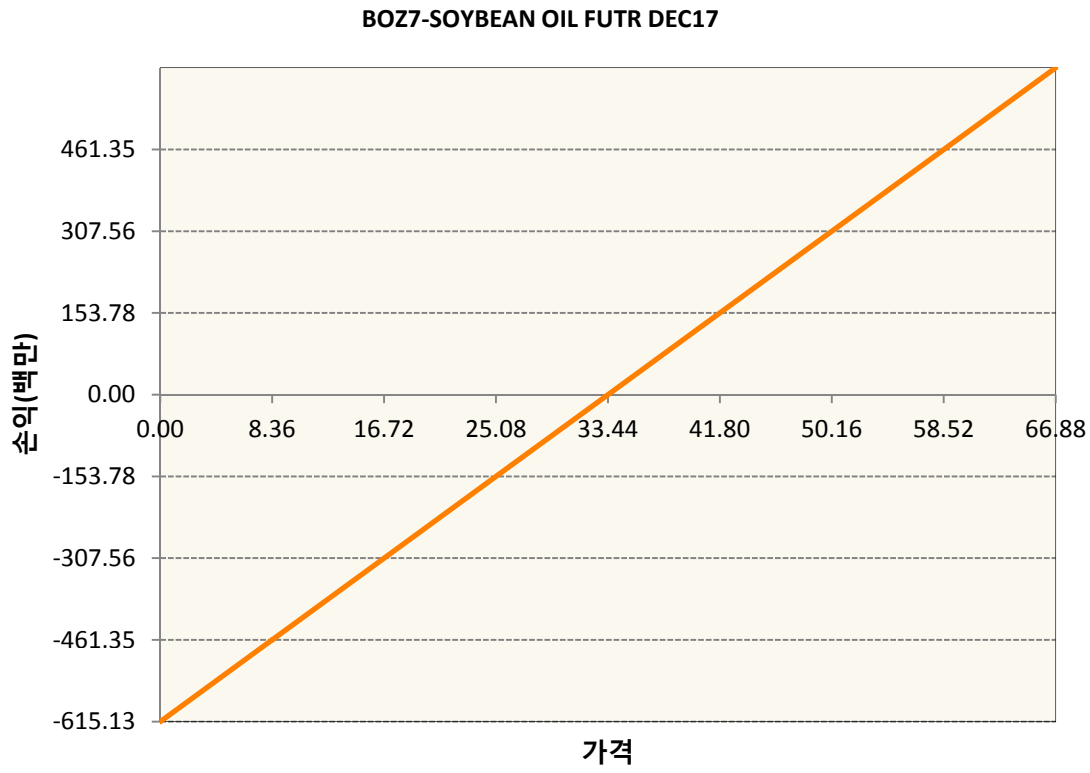
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

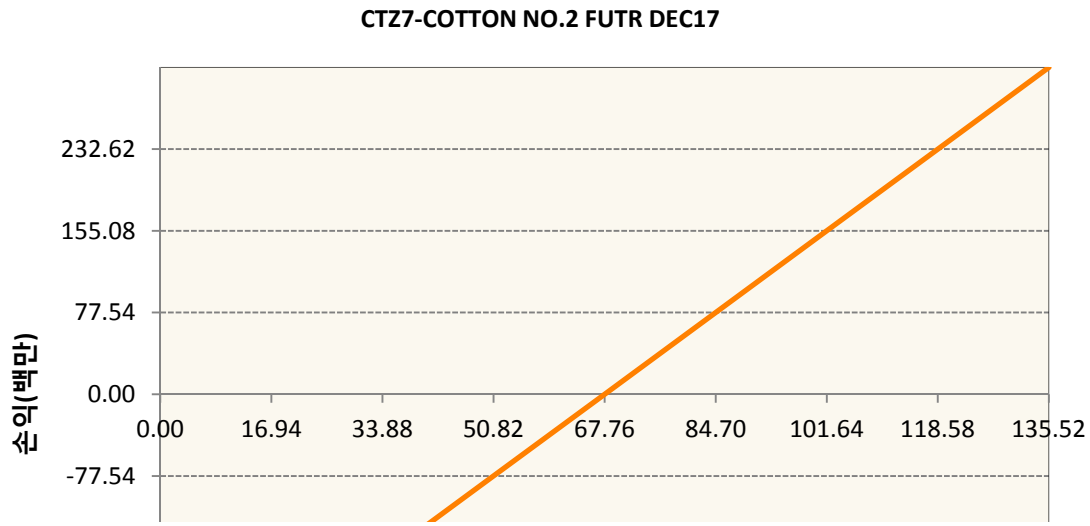
1. 계약금액

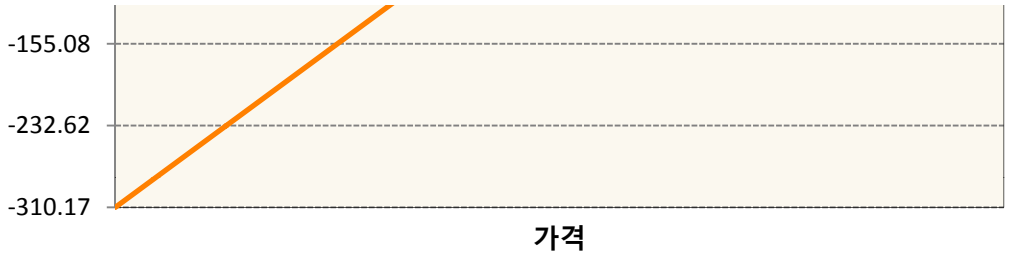
(단위:백만원)

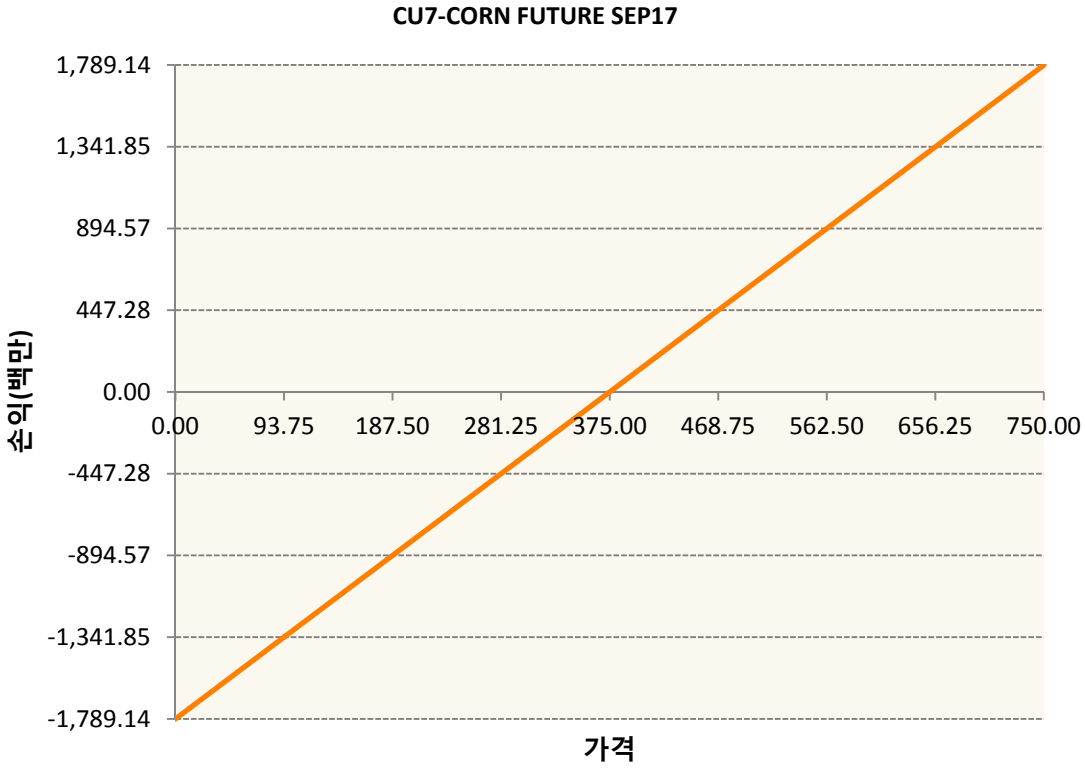
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	7,068	393	6,675	

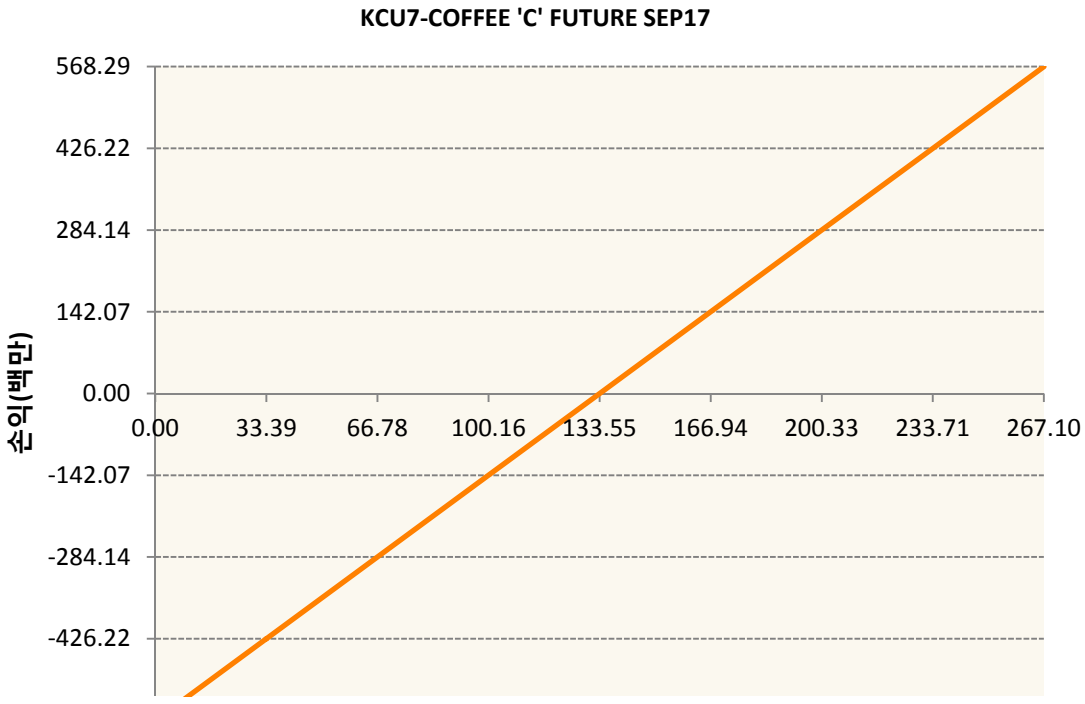
2. 만기시점의 손익구조

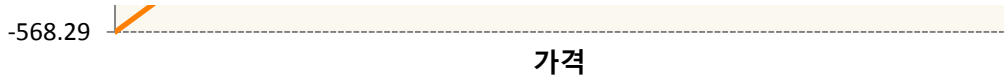


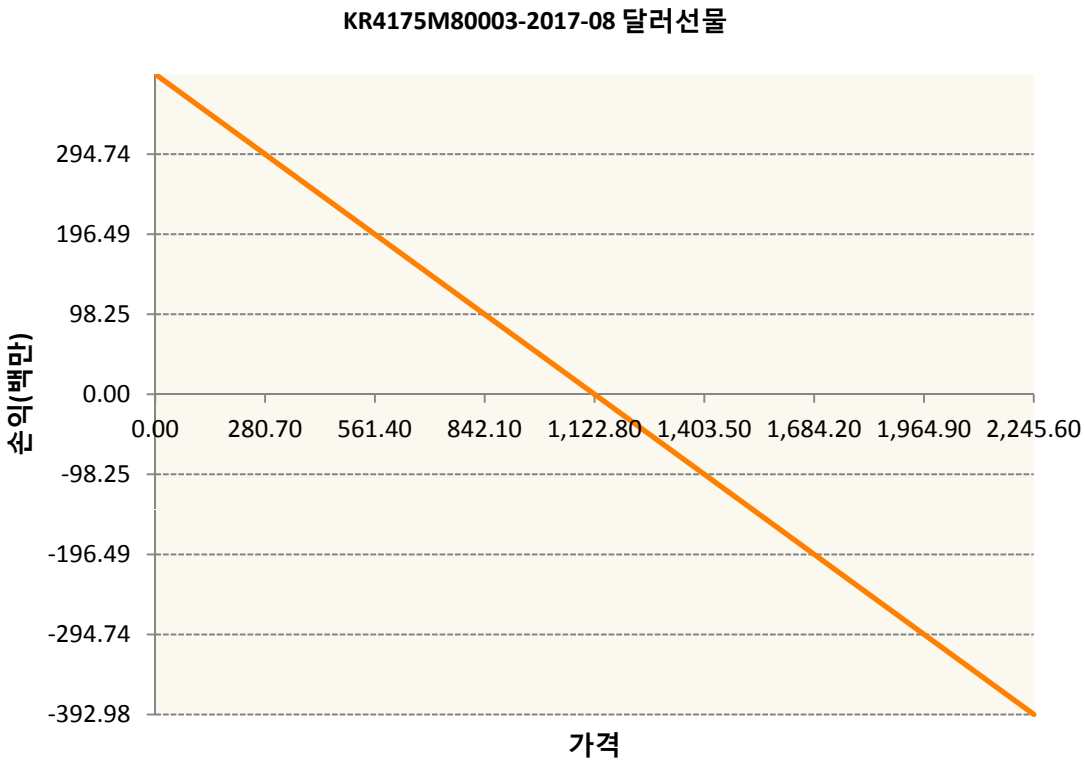


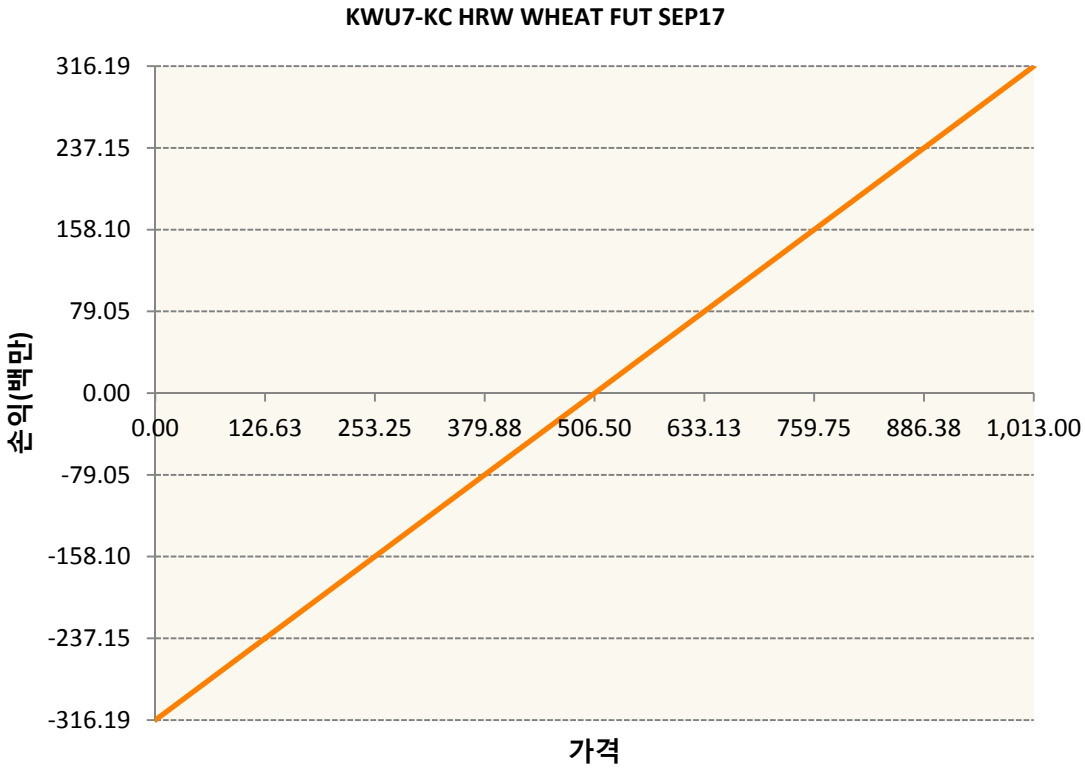

-155.08
-232.62
-310.17
가격


CU7-CORN FUTURE SEP17
1,789.14
1,341.85
894.57
447.28
0.00
-447.28
-894.57
-1,341.85
-1,789.14
0.00
93.75
187.50
281.25
375.00
468.75
562.50
656.25
750.00
손익(백만)
가격

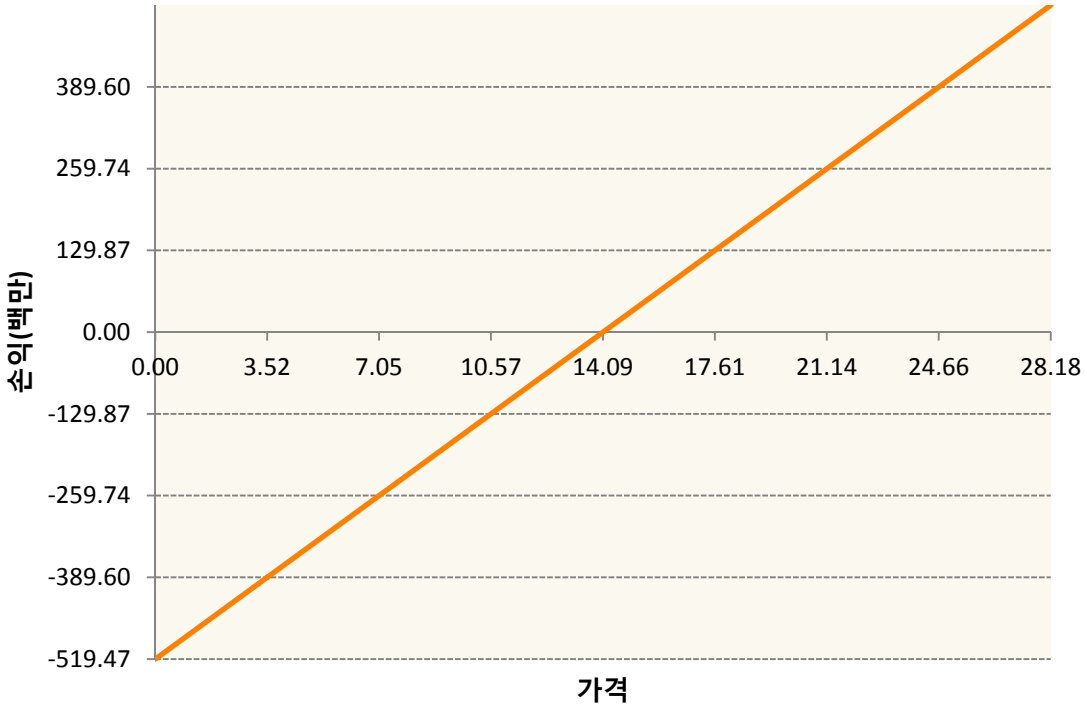

KCU7-COFFEE 'C' FUTURE SEP17
568.29
426.22
284.14
142.07
0.00
-142.07
-284.14
-426.22
0.00
33.39
66.78
100.16
133.55
166.94
200.33
233.71
267.10
손익(백만)


-568.29
가격

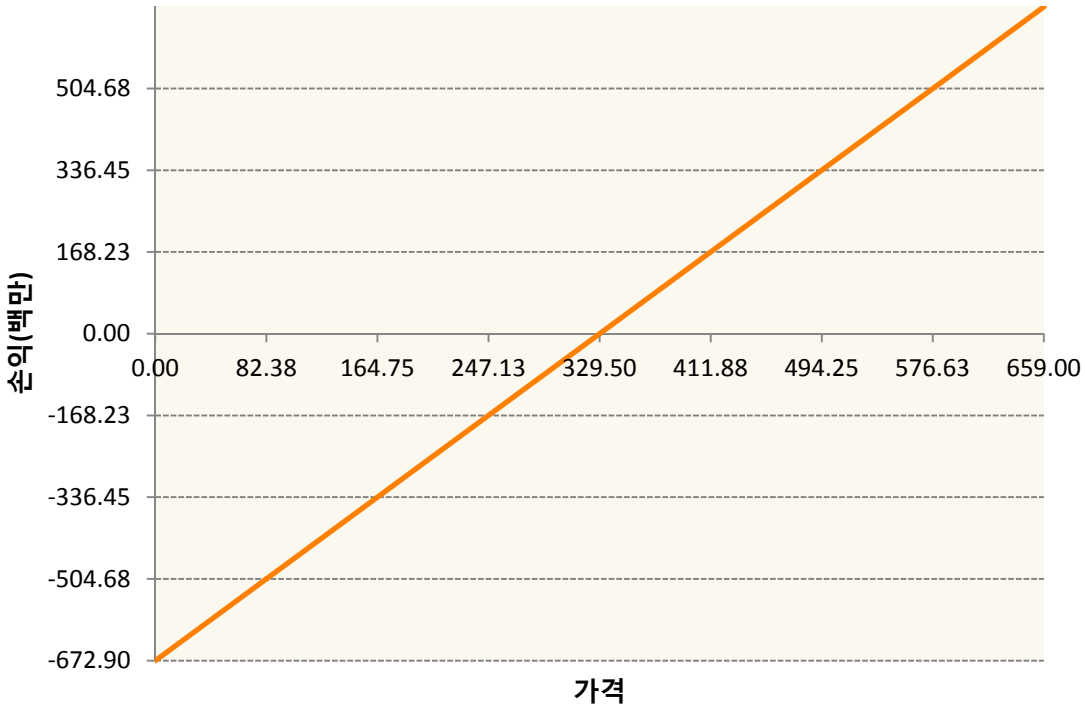

KR4175M80003-2017-08 달러선물
294.74
196.49
98.25
0.00
-98.25
-196.49
-294.74
-392.98
0.00
280.70
561.40
842.10
1,122.80
1,403.50
1,684.20
1,964.90
2,245.60
손익(백만)
가격


KWU7-KC HRW WHEAT FUT SEP17
316.19
237.15
158.10
79.05
0.00
-79.05
-158.10
-237.15
-316.19
0.00
126.63
253.25
379.88
506.50
633.13
759.75
886.38
1,013.00
손익(백만)
가격

SBV7-SUGAR #11 (WORLD) OCT17

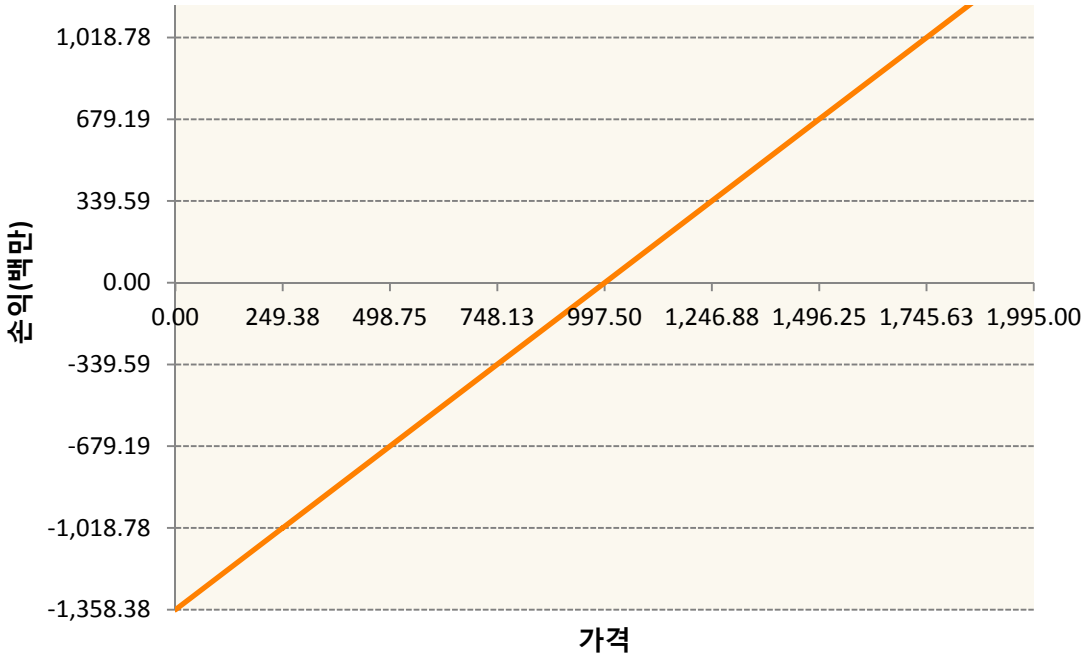


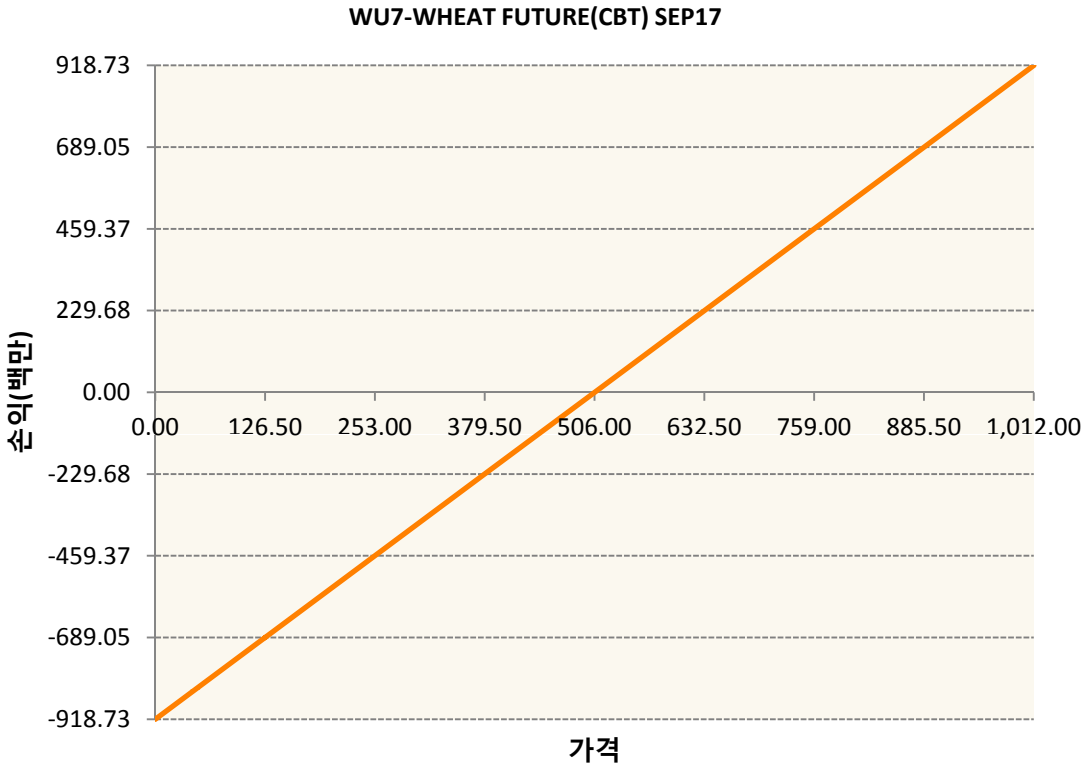
SMZ7-SOYBEAN MEAL FUTR DEC17



SX7-SOYBEAN FUTURE NOV17







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
BOZ7	SOYBEAN OIL FUTR DEC17	49
CTZ7	COTTON NO.2 FUTR DEC17	25
CU7	CORN FUTURE SEP17	143
KCU7	COFFEE 'C' FUTURE SEP17	45
KR4175M80(	2017-08 달러선물	31

KWU7	KC HRW WHEAT FUT SEP17	25
SBV7	SUGAR #11 (WORLD) OCT17	42
SMZ7	SOYBEAN MEAL FUTR DEC17	54
SX7	SOYBEAN FUTURE NOV17	109
WU7	WHEAT FUTURE(CBT) SEP17	73

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

664