공시일	2017-07-20
기준일	2017-07-19

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	2017-07-20
기준일	2017-07-19

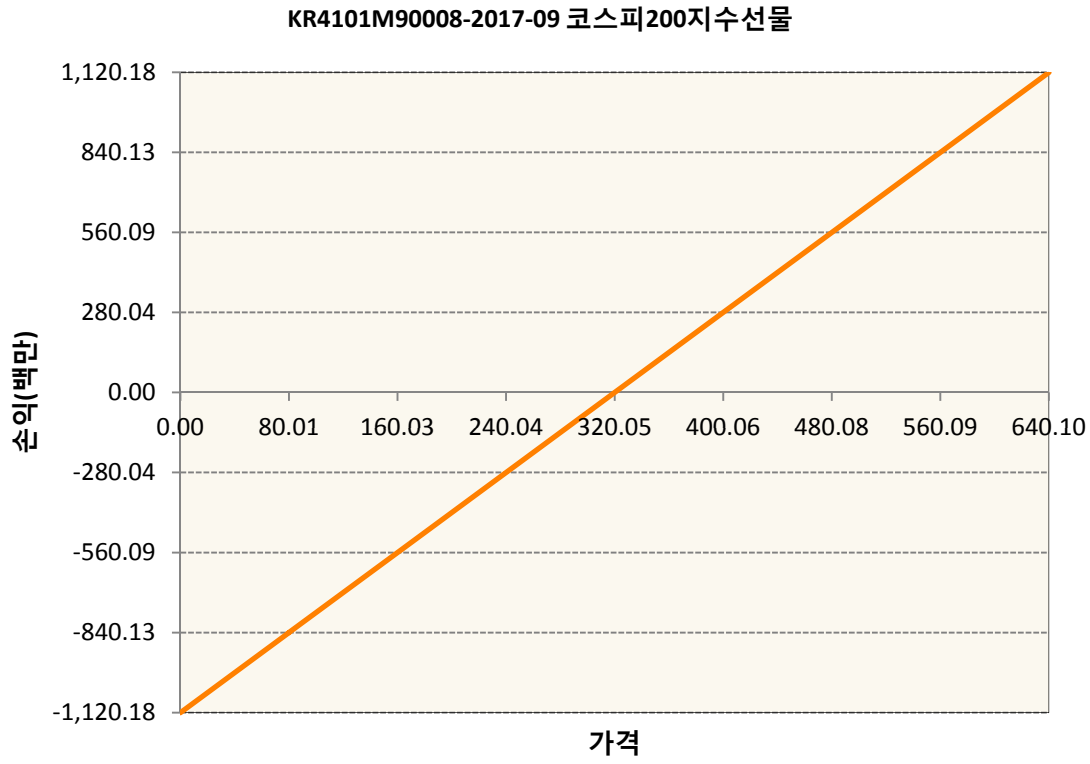
스마트인덱스모

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	1,120	0	1,120	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%	-60	-60	-60	-60	-60	-60	-60
-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%	60	60	60	60	60	60	60
8.00%	89	89	89	89	89	89	89

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

53

공시일	2017-07-20
기준일	2017-07-19

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	1,015

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

480

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-07-20
기준일	2017-07-19

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	377

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

331

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-07-20
기준일	2017-07-19

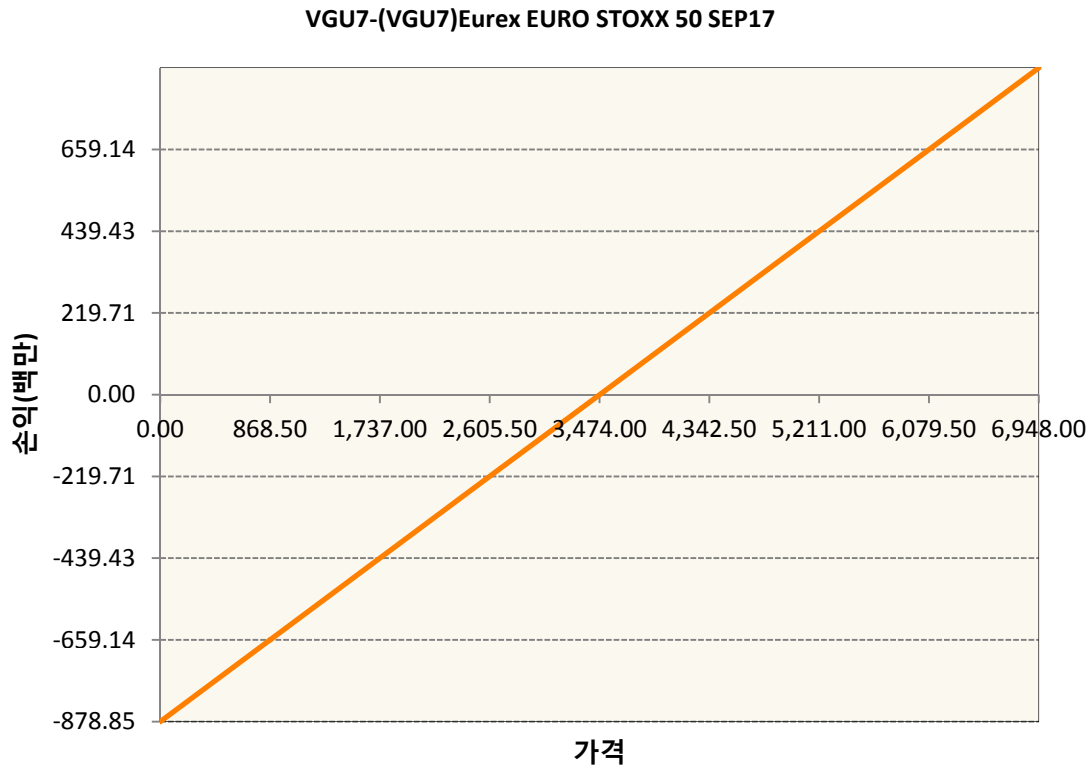
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	879	0	879	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGU7	(VGU7)Eurex EURO STOXX 50 SEP17	70

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

(단위:백만원)

60

공시일	2017-07-20
기준일	2017-07-19

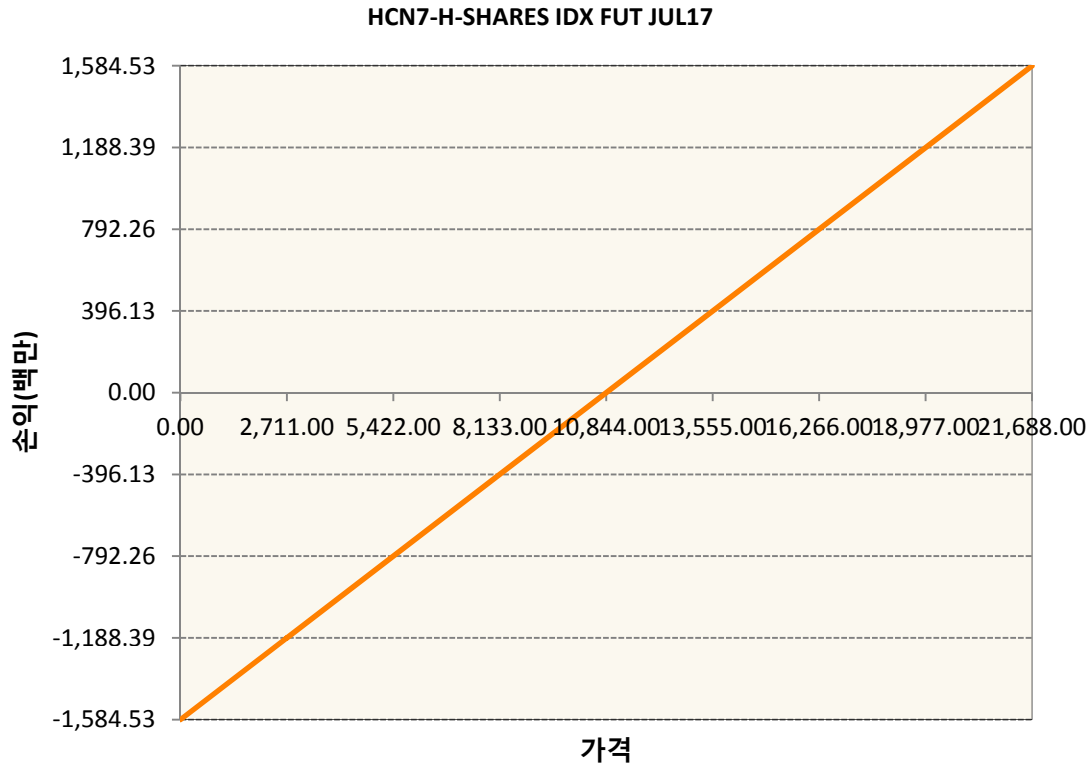
차이나인덱스모(주식-파생형)

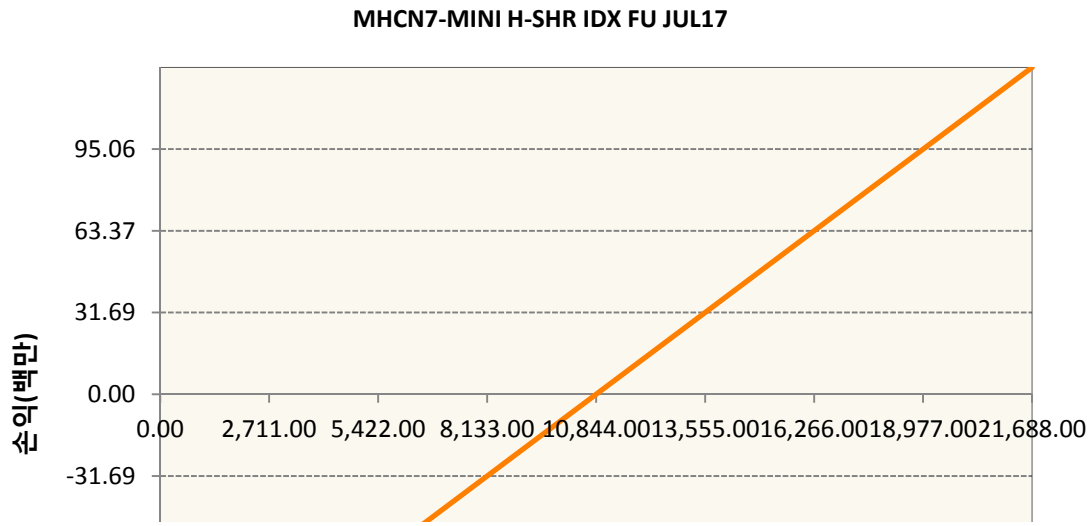
1. 계약금액

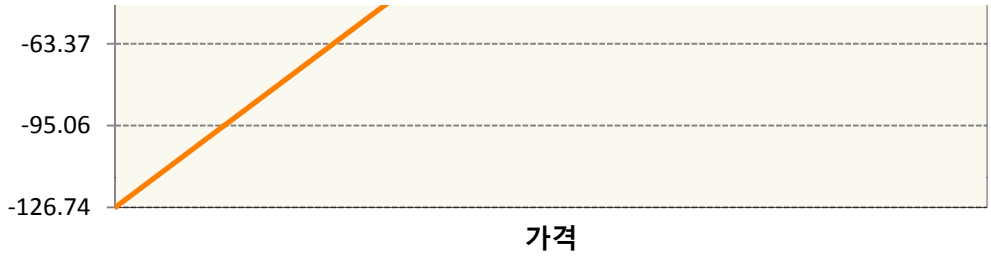
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,711	0	1,711	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCN7	H-SHARES IDX FUT JUL17	127
MHCN7	MINI H-SHR IDX FU JUL17	10

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

공시일	2017-07-20
기준일	2017-07-19

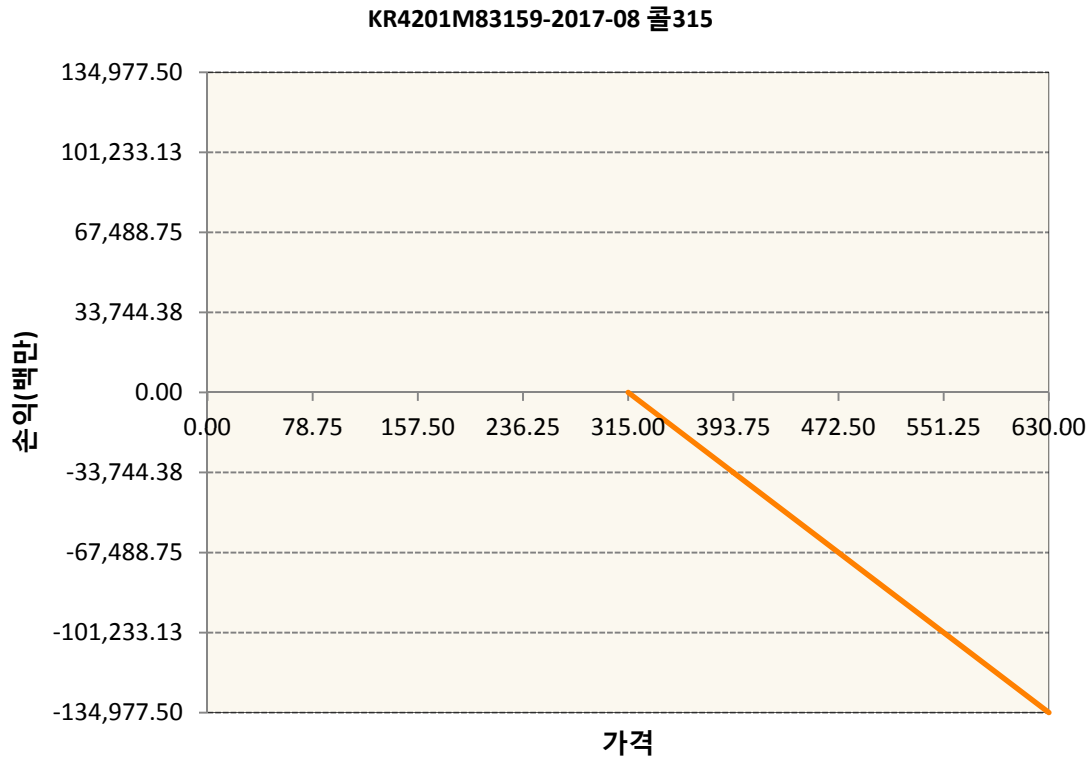
커버드콜모(주식혼합-파생형)

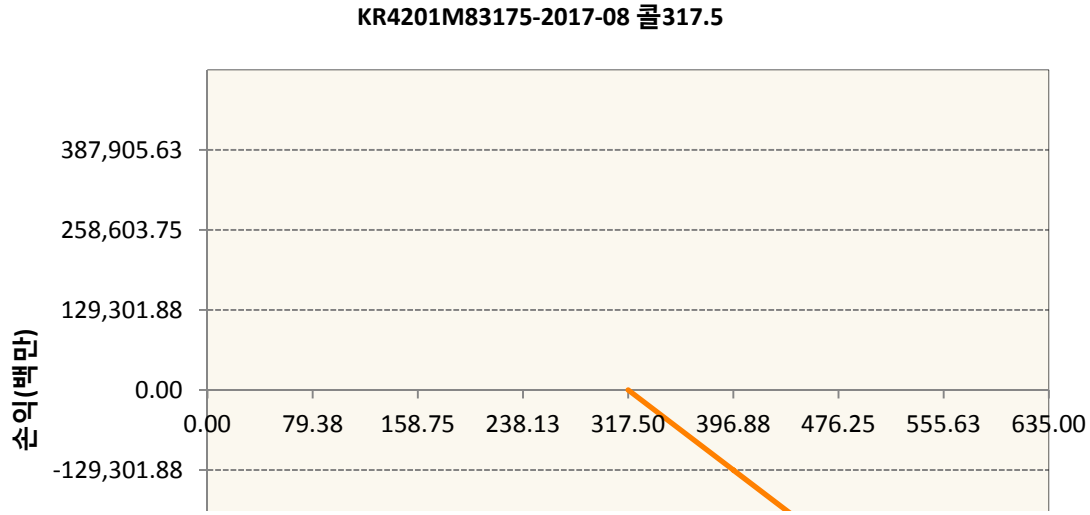
1. 계약금액

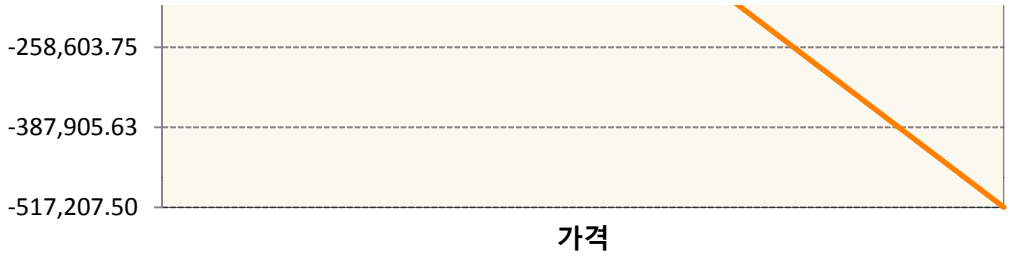
(단위:백만원)

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

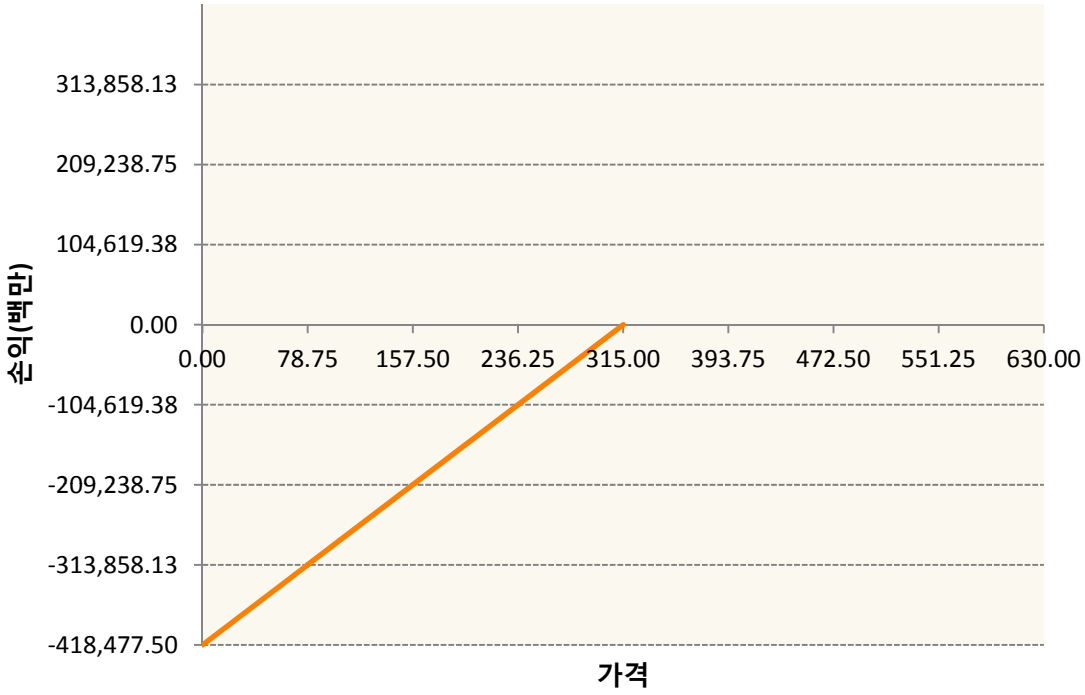
2. 만기시점의 손익구조



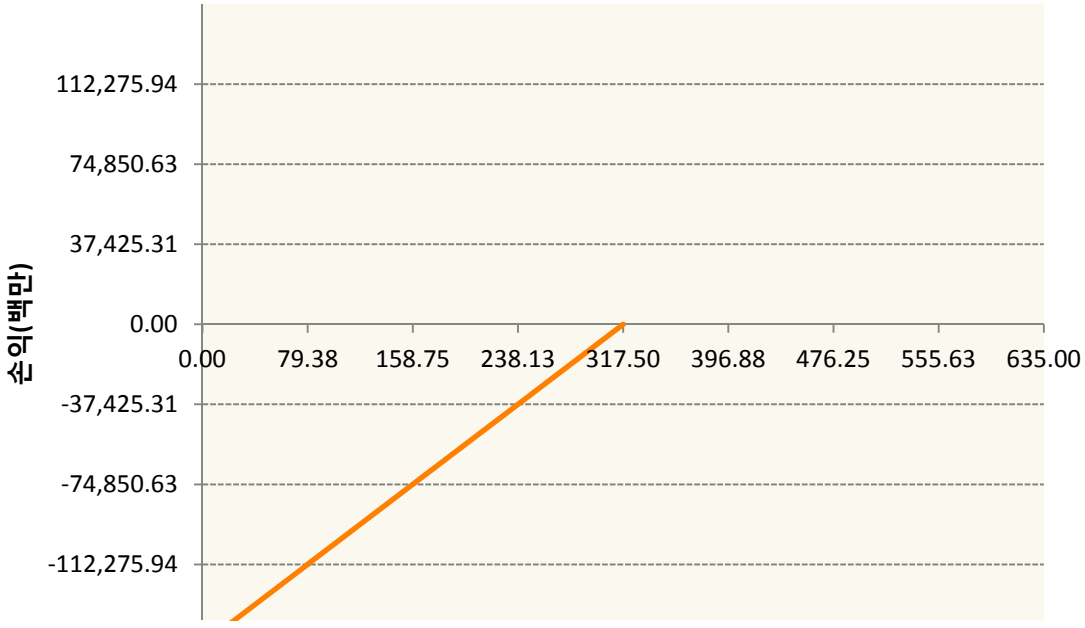




KR4301M83157-2017-08 풋315



KR4301M83173-2017-08 풋317.5





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201M83: 2017-08 콜315							9,136
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	3,818	3,753	3,671	3,572	3,459	3,333	3,196
-5.33%	3,475	3,322	3,156	2,979	2,793	2,599	2,400
-2.67%	2,539	2,305	2,069	1,831	1,591	1,351	1,110
0%	728	487	244	0	-245	-491	-737
2.67%	-1,942	-2,115	-2,300	-2,495	-2,698	-2,908	-3,123
5.33%	-5,190	-5,278	-5,386	-5,510	-5,649	-5,800	-5,963
8.00%	-8,710	-8,744	-8,792	-8,856	-8,935	-9,029	-9,136
KR4201M83: 2017-08 콜317.5							33,371
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	12,424	12,241	11,996	11,690	11,329	10,916	10,457
-5.33%	11,500	11,018	10,475	9,881	9,244	8,572	7,871
-2.67%	8,719	7,893	7,046	6,184	5,310	4,427	3,536
0%	2,857	1,906	953	0	-954	-1,907	-2,861
2.67%	-6,399	-7,158	-7,951	-8,771	-9,613	-10,471	-11,344
5.33%	-18,209	-18,640	-19,141	-19,701	-20,312	-20,965	-21,655
8.00%	-31,365	-31,545	-31,790	-32,099	-32,469	-32,894	-33,371
KR4301M83: 2017-08 풋315							26,575
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-26,519	-26,520	-26,522	-26,527	-26,536	-26,551	-26,575
-5.33%	-15,266	-15,303	-15,359	-15,434	-15,529	-15,644	-15,776
-2.67%	-4,941	-5,209	-5,490	-5,782	-6,083	-6,390	-6,702
0%	912	617	313	0	-319	-643	-970
2.67%	2,101	2,044	1,965	1,862	1,738	1,594	1,431
5.33%	2,164	2,162	2,156	2,145	2,126	2,097	2,056
8.00%	2,165	2,165	2,165	2,165	2,163	2,160	2,155
KR4301M83: 2017-08 풋317.5							10,156
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-10,146	-10,146	-10,146	-10,147	-10,149	-10,151	-10,156
-5.33%	-6,144	-6,149	-6,158	-6,173	-6,193	-6,219	-6,251
-2.67%	-2,296	-2,362	-2,437	-2,518	-2,604	-2,696	-2,791
0%	372	249	125	0	-125	-250	-375
2.67%	1,146	1,107	1,057	999	934	862	784

5.33%	1,211	1,208	1,203	1,194	1,180	1,162	1,138
8.00%	1,212	1,212	1,212	1,211	1,210	1,208	1,204

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

84,542

공시일	2017-07-20
기준일	2017-07-19

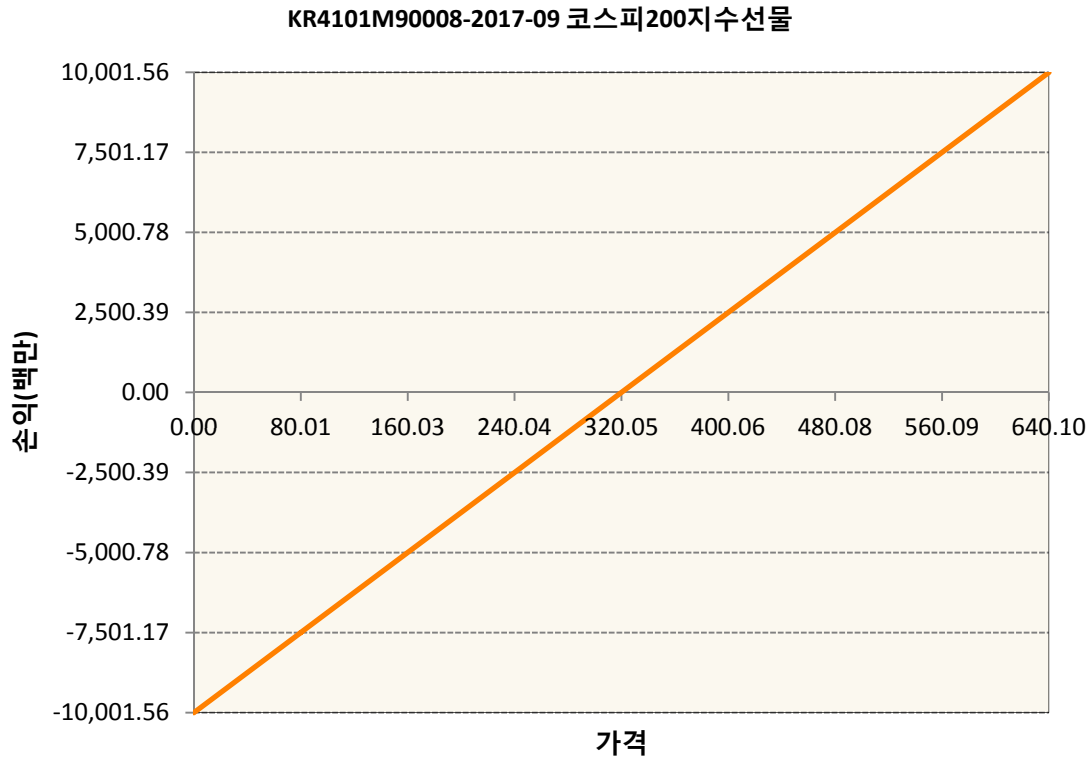
ETF스마트레버리지목표전환형6호

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	10,002	0	10,002	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%	-532	-532	-532	-532	-532	-532	-532
-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%	532	532	532	532	532	532	532
8.00%	797	797	797	797	797	797	797

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

477

공시일	2017-07-20
기준일	2017-07-19

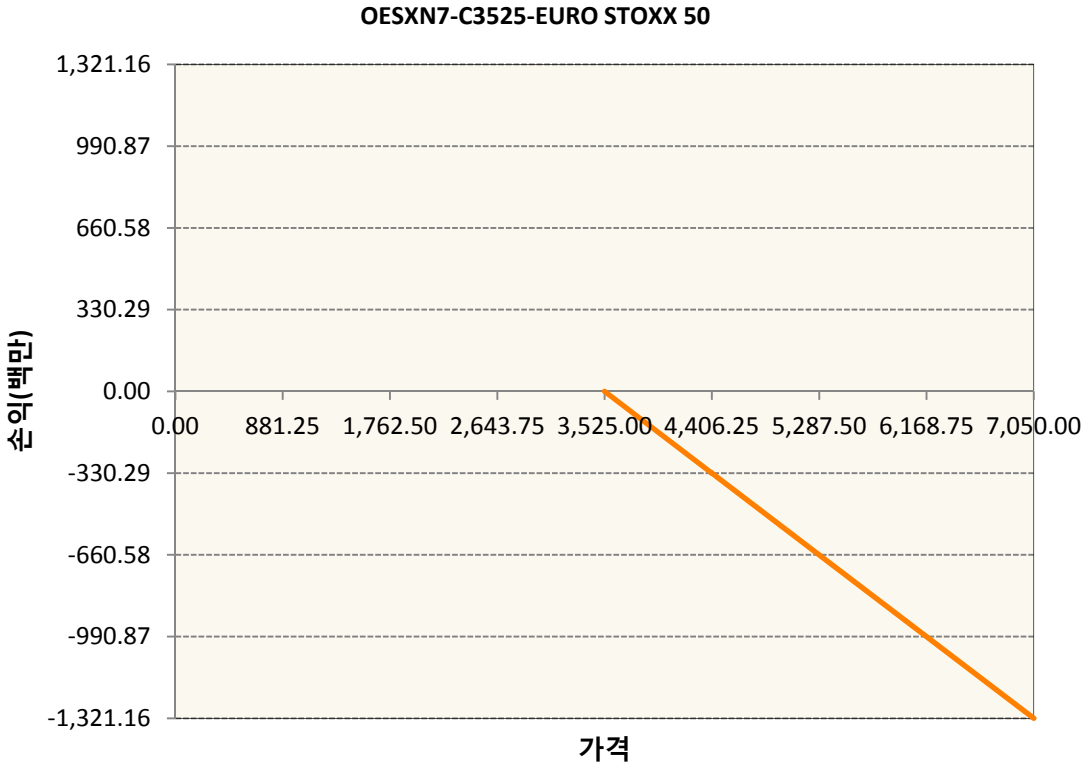
유로커버드콜(주식혼합-파생형)

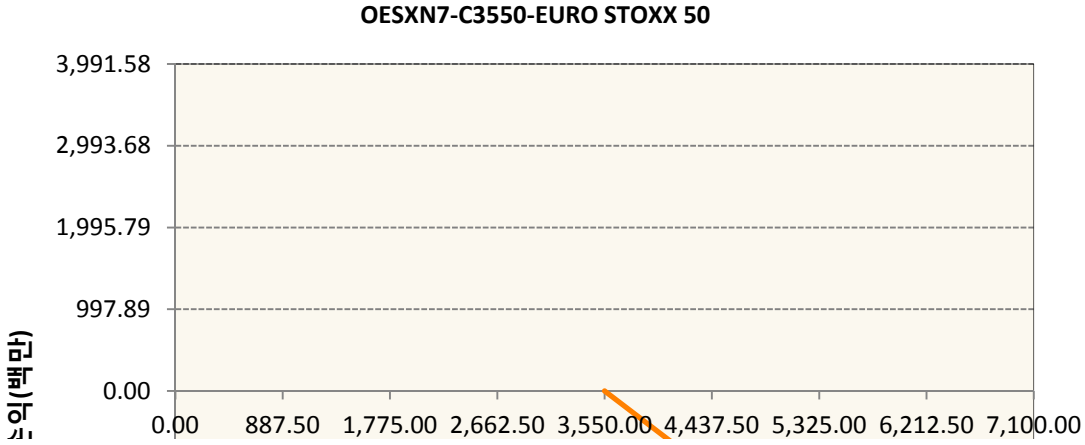
1. 계약금액

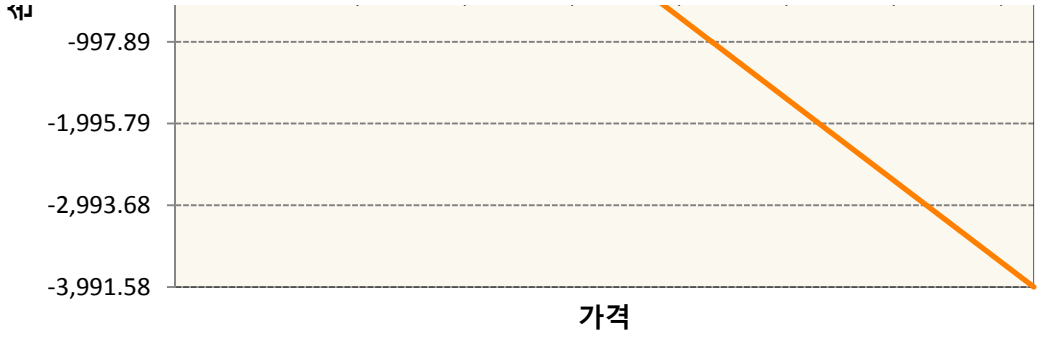
(단위:백만원)

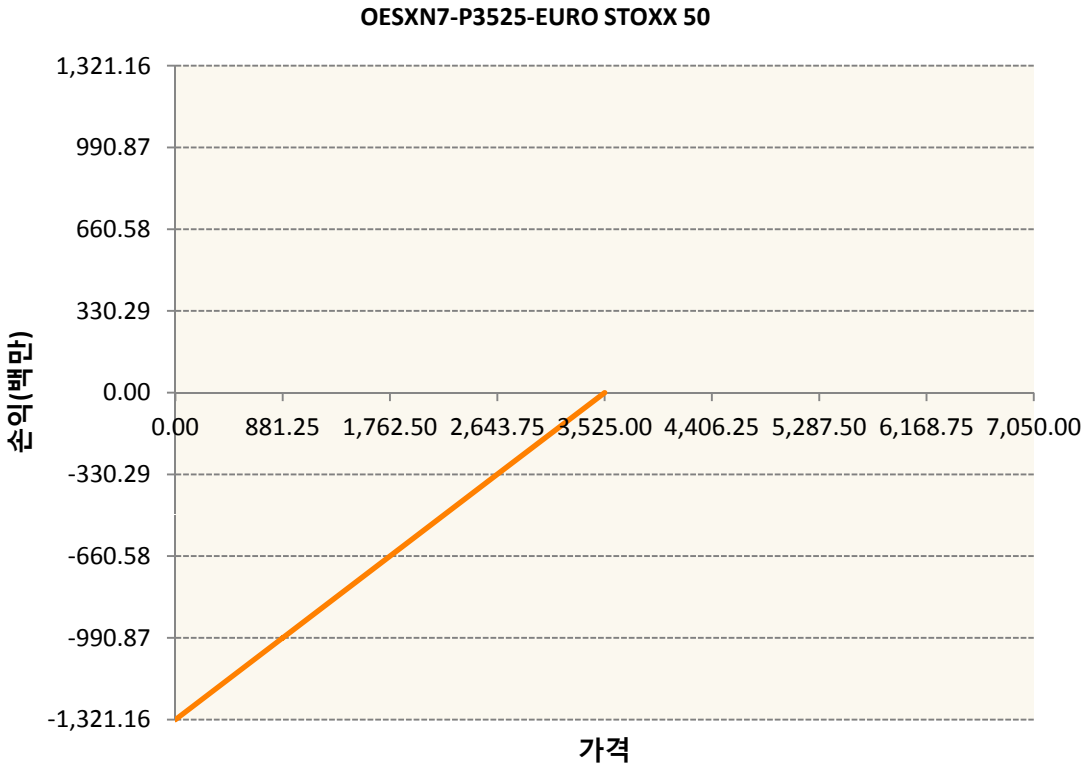
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	5,221	0	5,221	
누계	유가증권	옵션	0	10,625	-10,625	장내

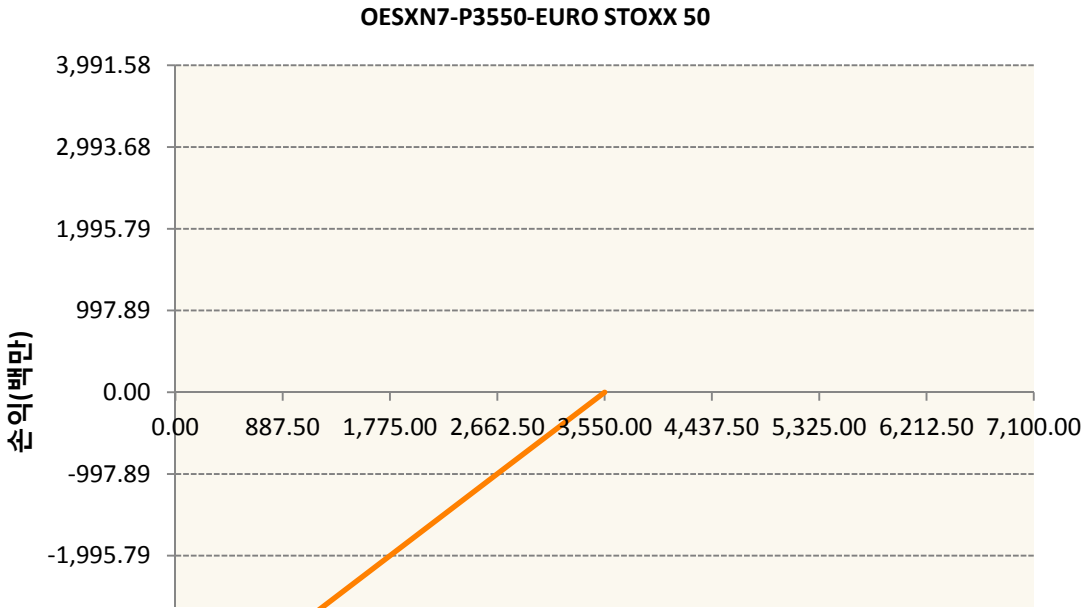
2. 만기시점의 손익구조

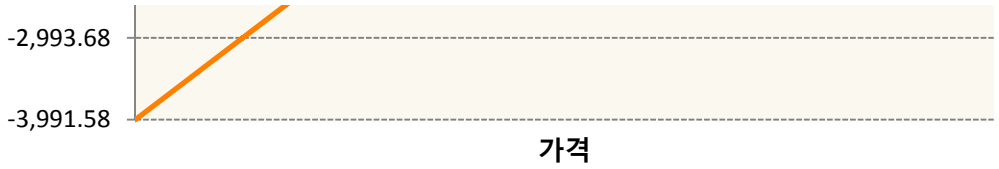


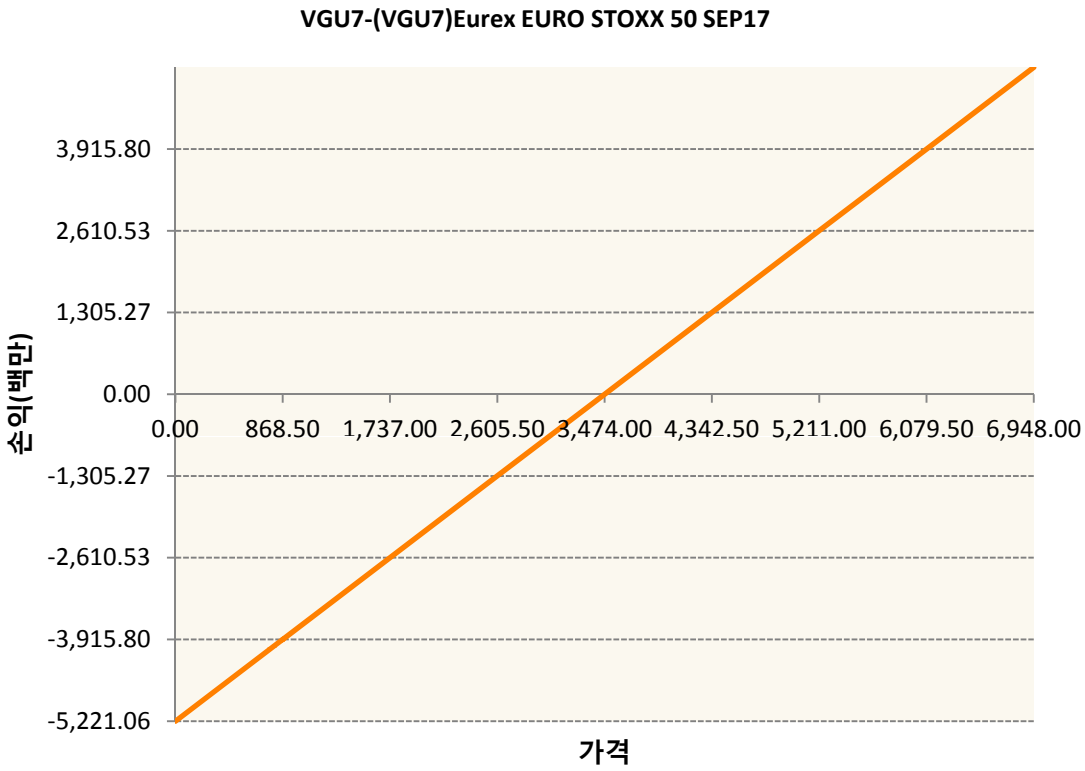



-997.89
-1,995.79
-2,993.68
-3,991.58
가격


OESXN7-P3525-EURO STOXX 50
1,321.16
990.87
660.58
330.29
0.00
-330.29
-660.58
-990.87
-1,321.16
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
3,991.58
2,993.68
1,995.79
997.89
0.00
-997.89
-1,995.79
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	106
OESXN7-C3!	EURO STOXX 50	319
OESXN7-P3!	EURO STOXX 50	106
OESXN7-P3!	EURO STOXX 50	319
VGU7	(VGU7)Eurex EURO STOXX 50 SEP17	418

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,077

공시일	2017-07-20
기준일	2017-07-19

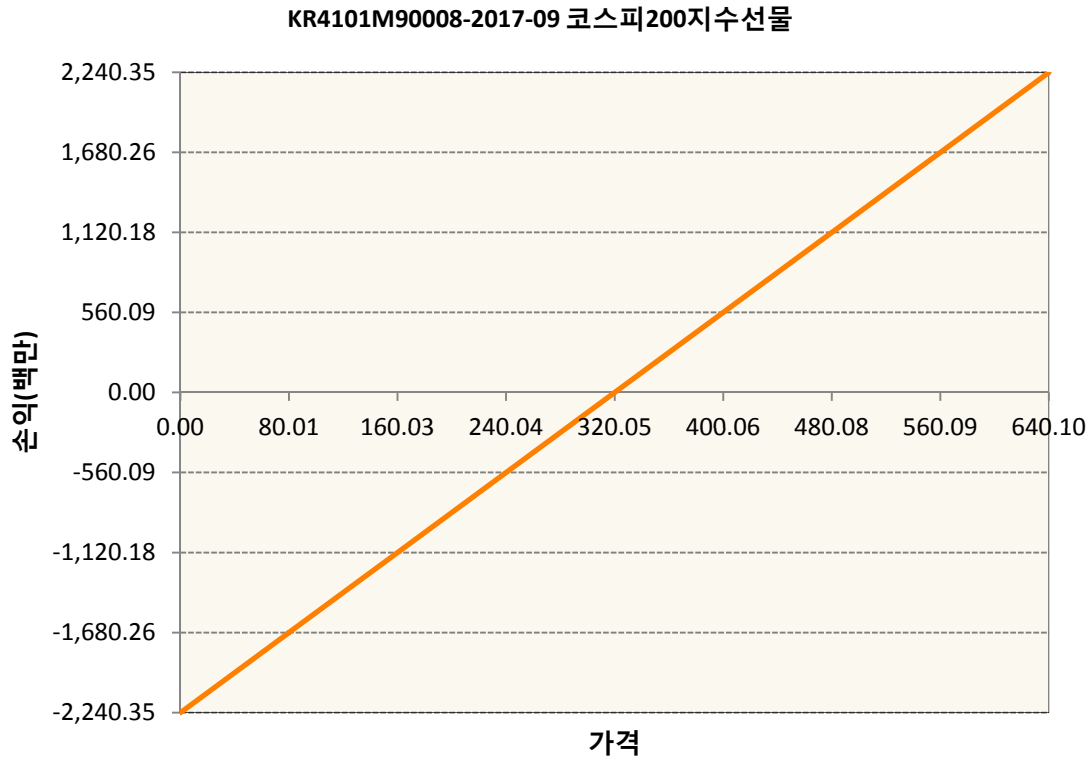
ETF스마트레버리지목표전환형7호

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	2,240	0	2,240	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101M90(2017-09 코스피200지수선물							179
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-179	-179	-179	-179	-179	-179	-179
-5.33%	-119	-119	-119	-119	-119	-119	-119
-2.67%	-60	-60	-60	-60	-60	-60	-60
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	60	60	60	60	60	60	60
5.33%	119	119	119	119	119	119	119
8.00%	179	179	179	179	179	179	179

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

107

공시일	2017-07-20
기준일	2017-07-19

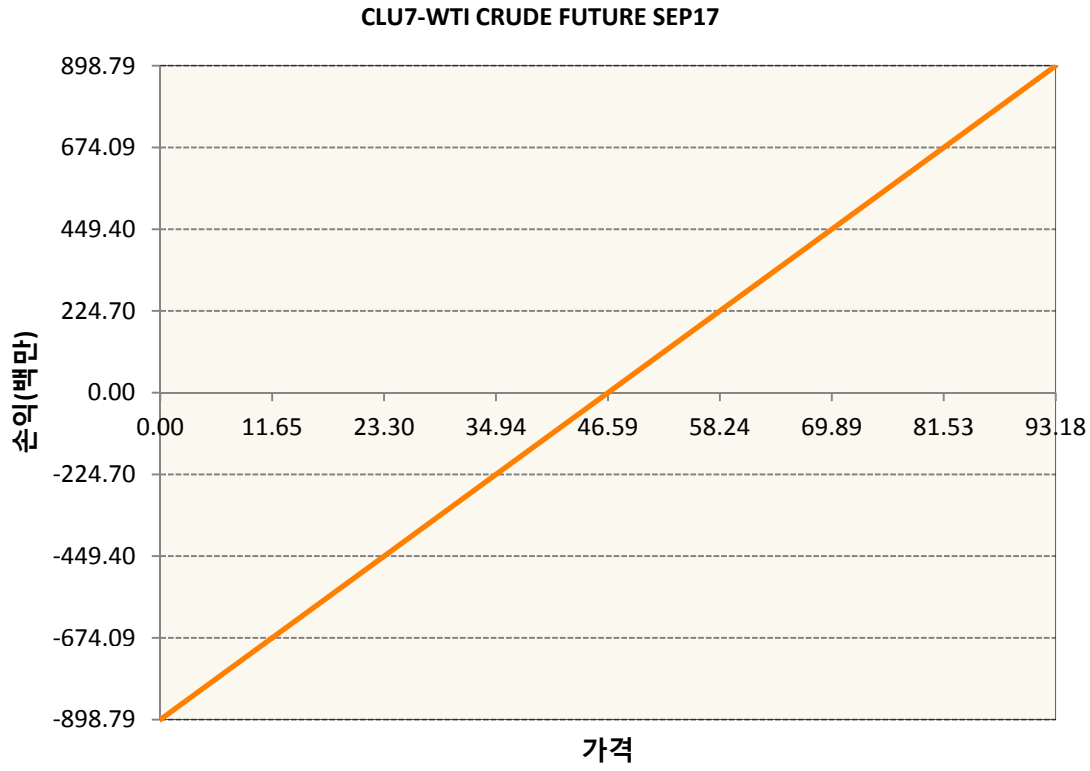
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

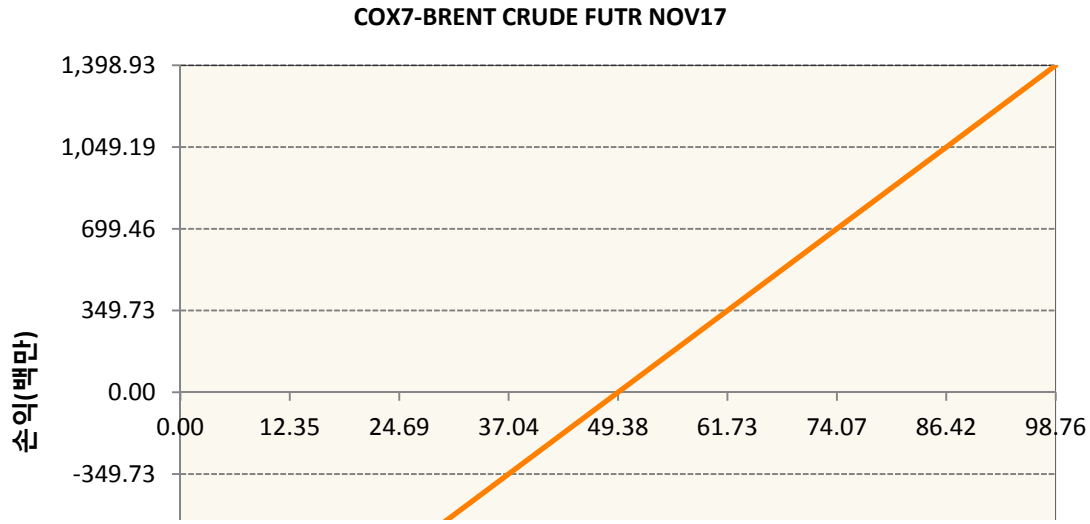
1. 계약금액

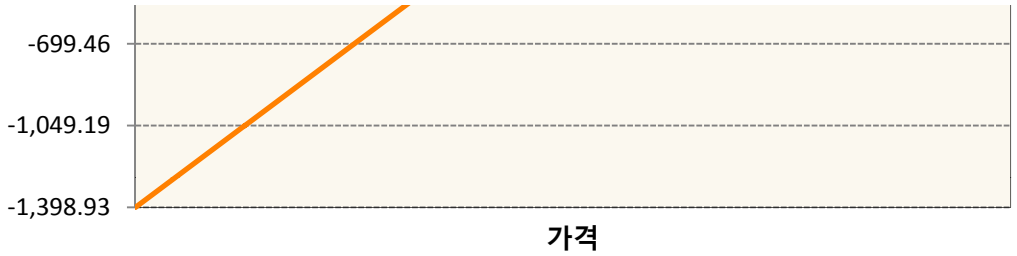
(단위:백만원)

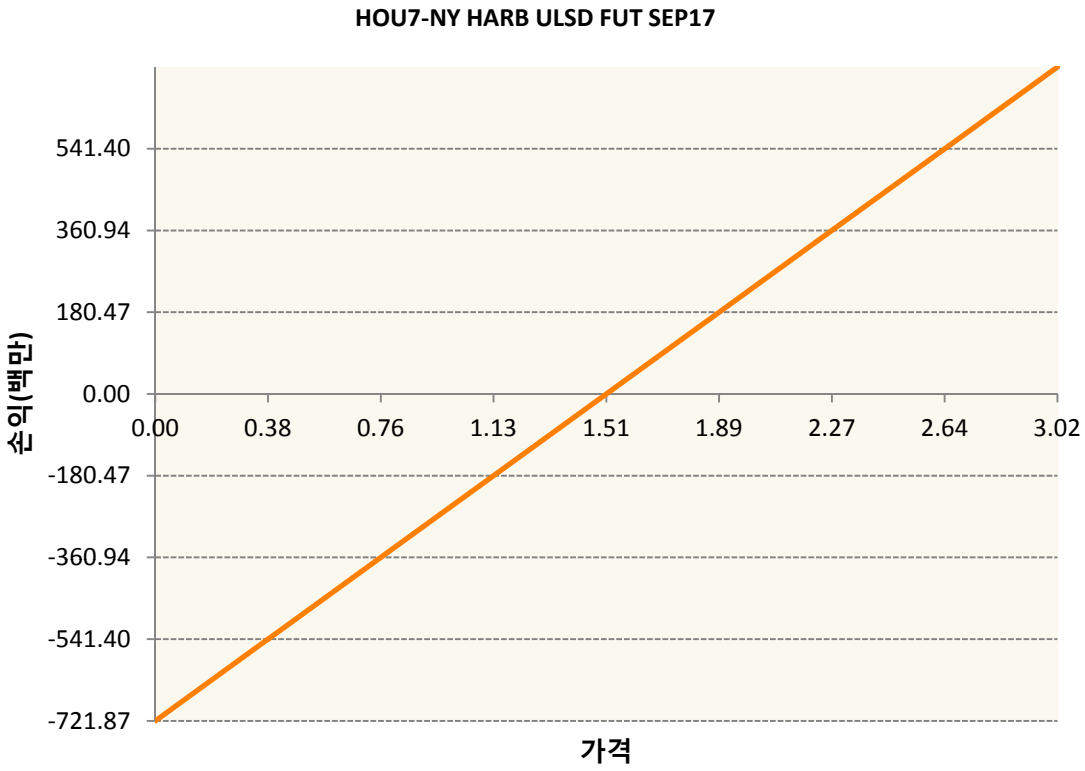
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	5,218	224	4,994	

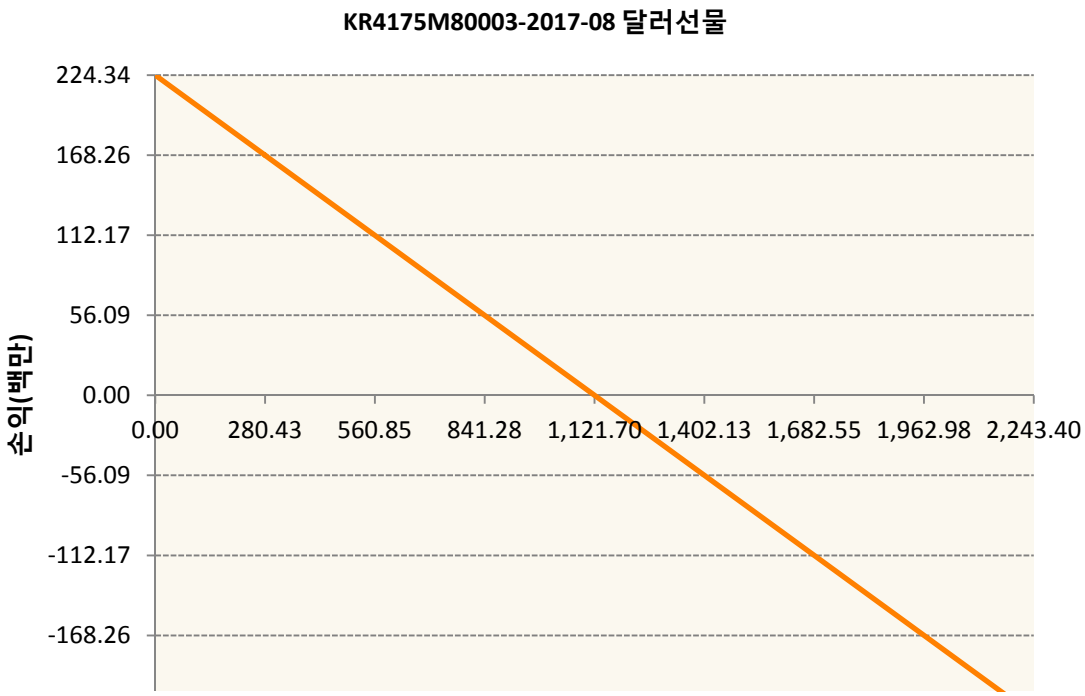
2. 만기시점의 손익구조

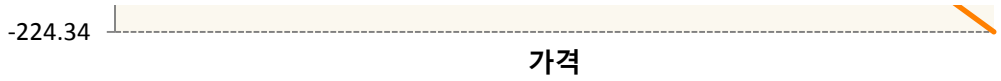


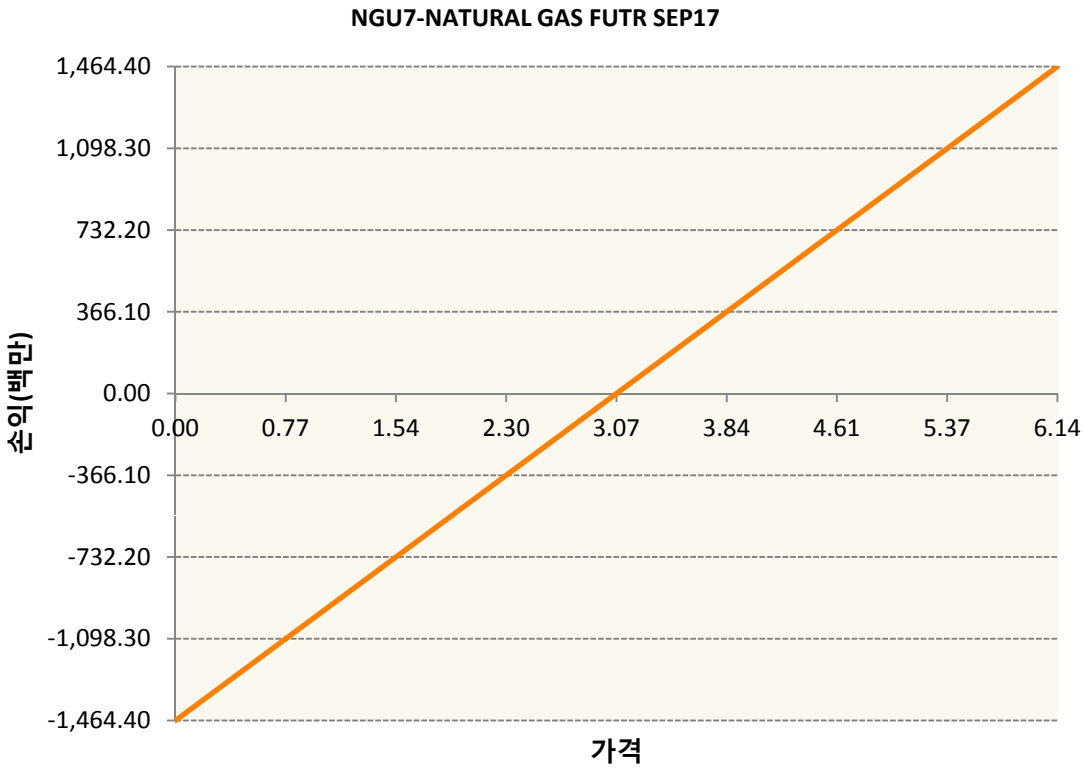


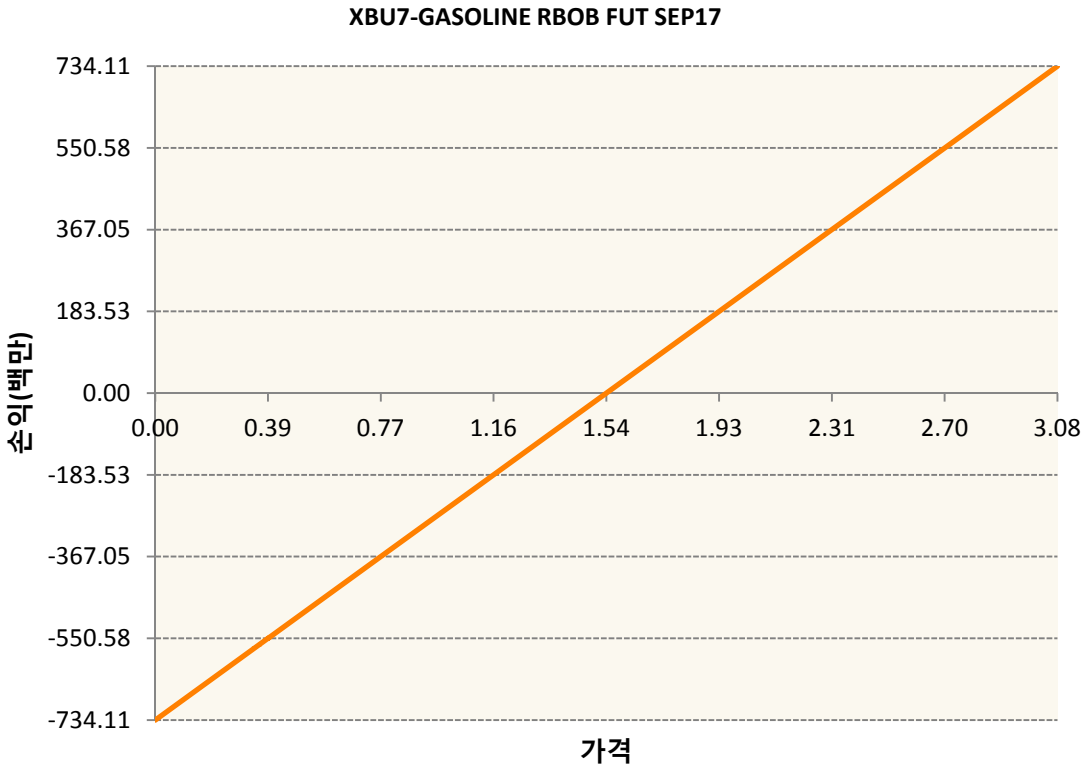

-699.46
-1,049.19
-1,398.93
가격


HOU7-NY HARB ULSD FUT SEP17
541.40
360.94
180.47
0.00
-180.47
-360.94
-541.40
-721.87
0.00
0.38
0.76
1.13
1.51
1.89
2.27
2.64
3.02
손익(만)
가격


KR4175M80003-2017-08 달러선물
224.34
168.26
112.17
56.09
0.00
-56.09
-112.17
-168.26
0.00
280.43
560.85
841.28
1,121.70
1,402.13
1,682.55
1,962.98
2,243.40
손익(만)


-224.34
가격


NGU7-NATURAL GAS FUTR SEP17
1,464.40
1,098.30
732.20
366.10
0.00
-366.10
-732.20
-1,098.30
-1,464.40
0.00
0.77
1.54
2.30
3.07
3.84
4.61
5.37
6.14
손익(백만)
가격


XBU7-GASOLINE RBOB FUT SEP17
734.11
550.58
367.05
183.53
0.00
-183.53
-367.05
-550.58
-734.11
0.00
0.39
0.77
1.16
1.54
1.93
2.31
2.70
3.08
손익(백만)
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	117
XBU7	GASOLINE RBOB FUT SEP17	59

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

786

공시일	2017-07-20
기준일	2017-07-19

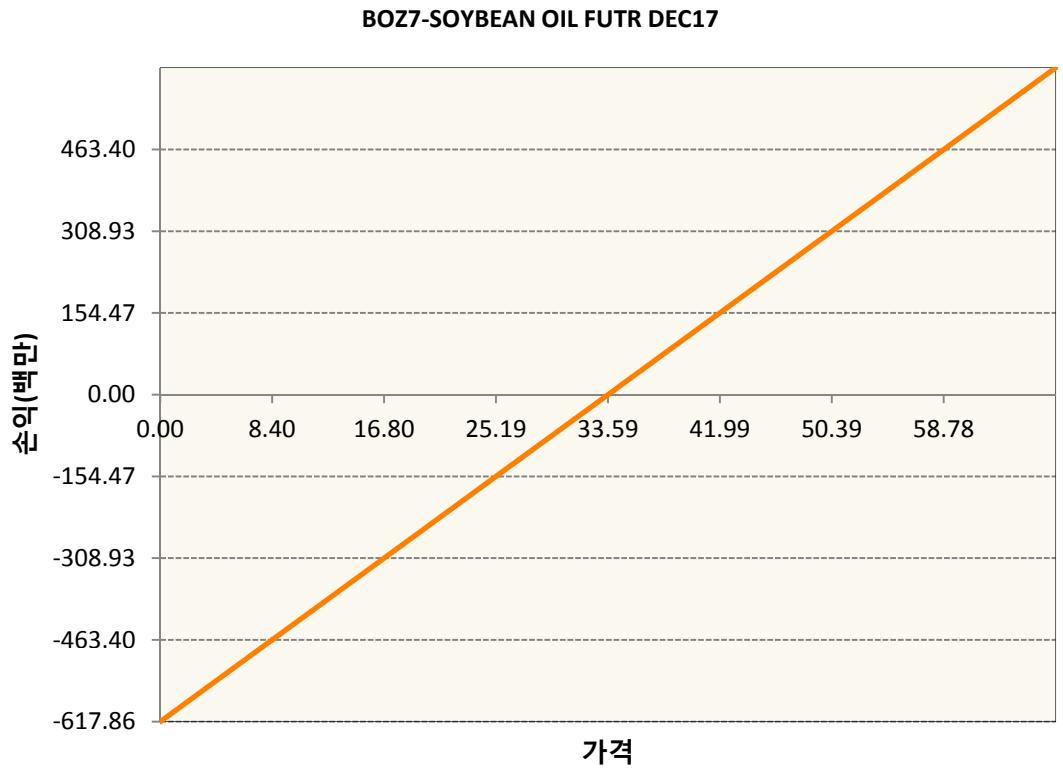
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

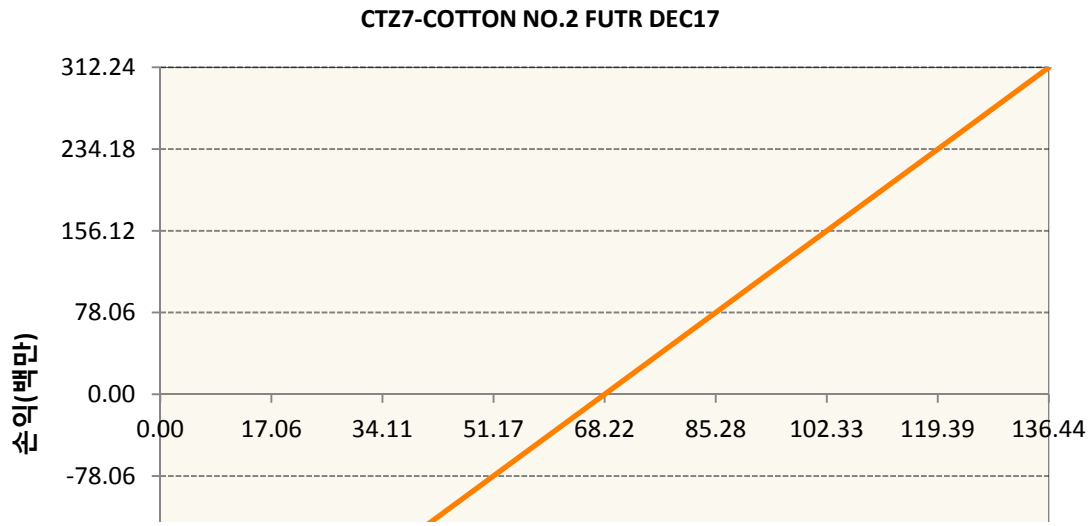
1. 계약금액

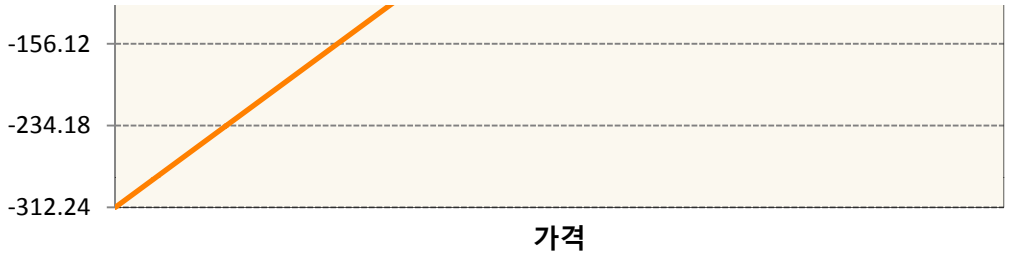
(단위:백만원)

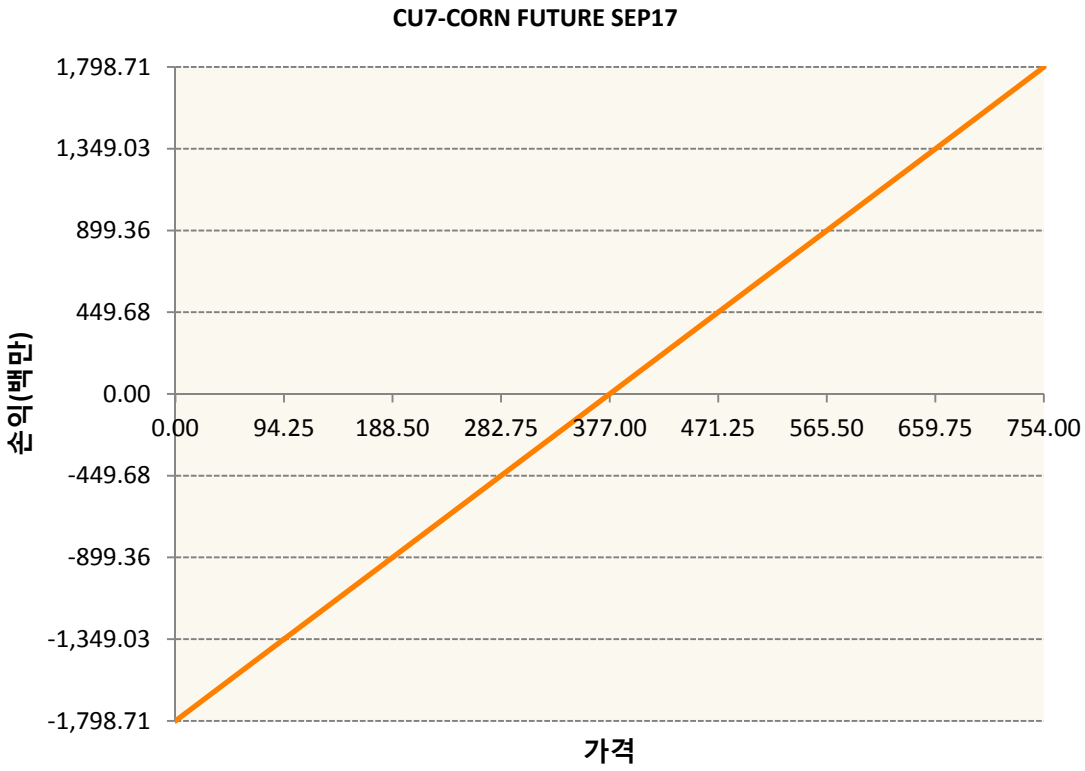
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	7,091	393	6,698	

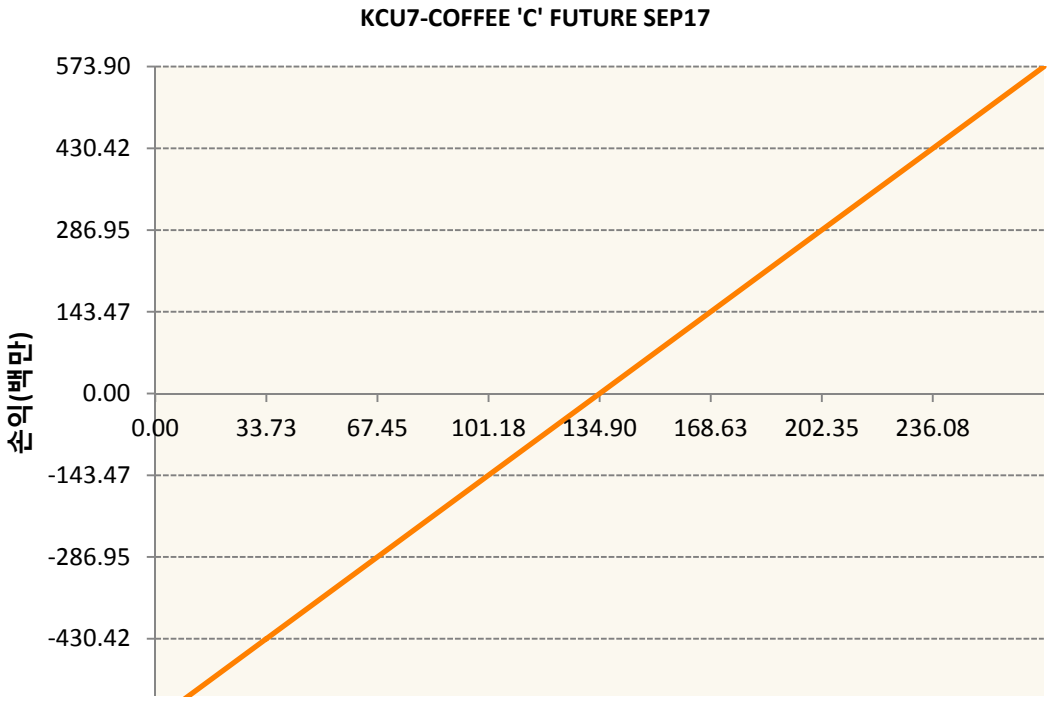
2. 만기시점의 손익구조

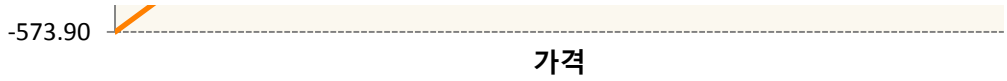


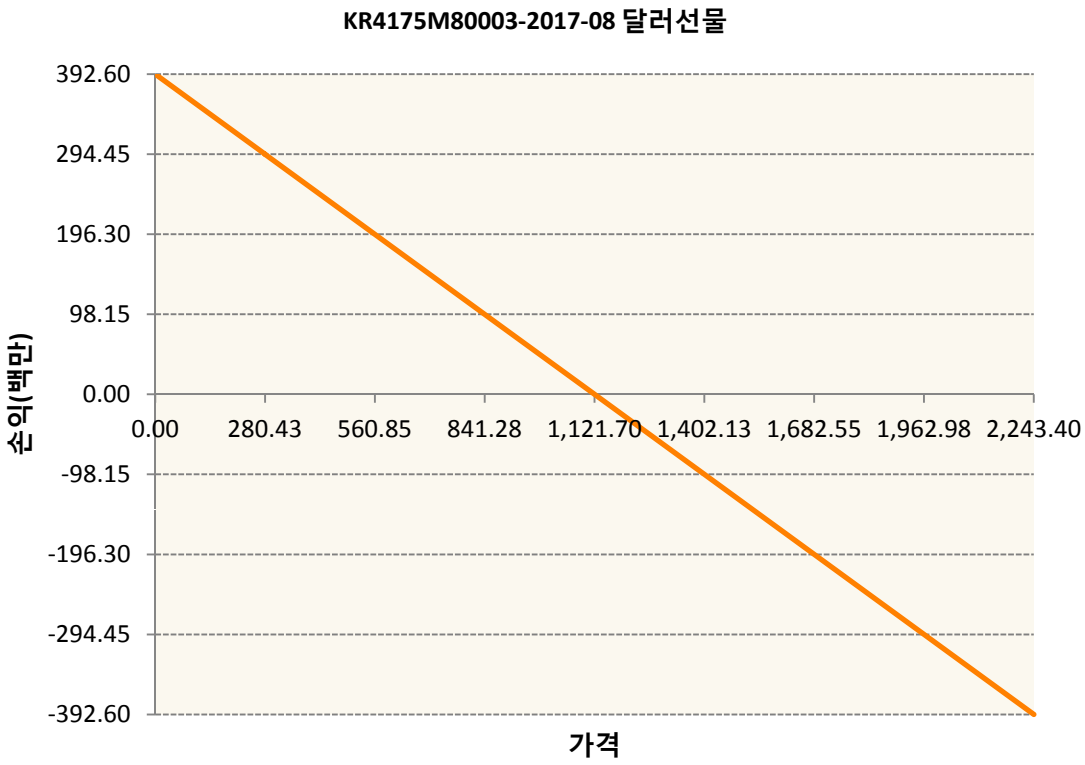


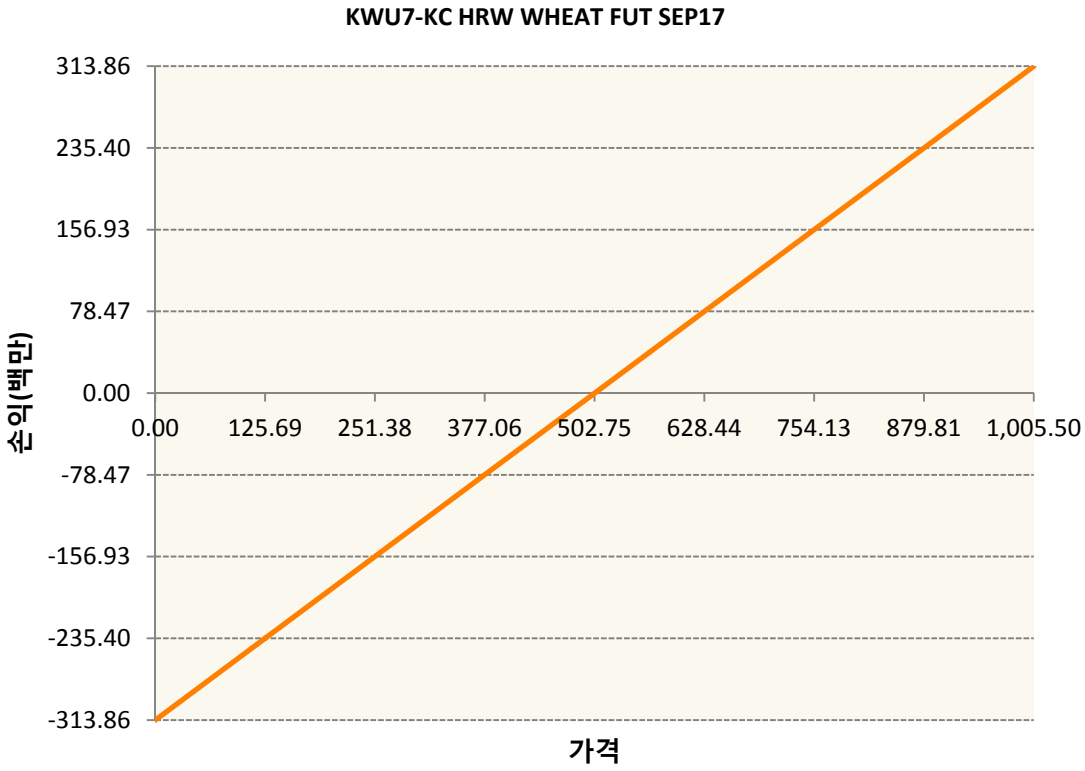

-156.12
-234.18
-312.24
가격


CU7-CORN FUTURE SEP17
1,798.71
1,349.03
899.36
449.68
0.00
-449.68
-899.36
-1,349.03
-1,798.71
0.00
94.25
188.50
282.75
377.00
471.25
565.50
659.75
754.00
손익(백만)
가격

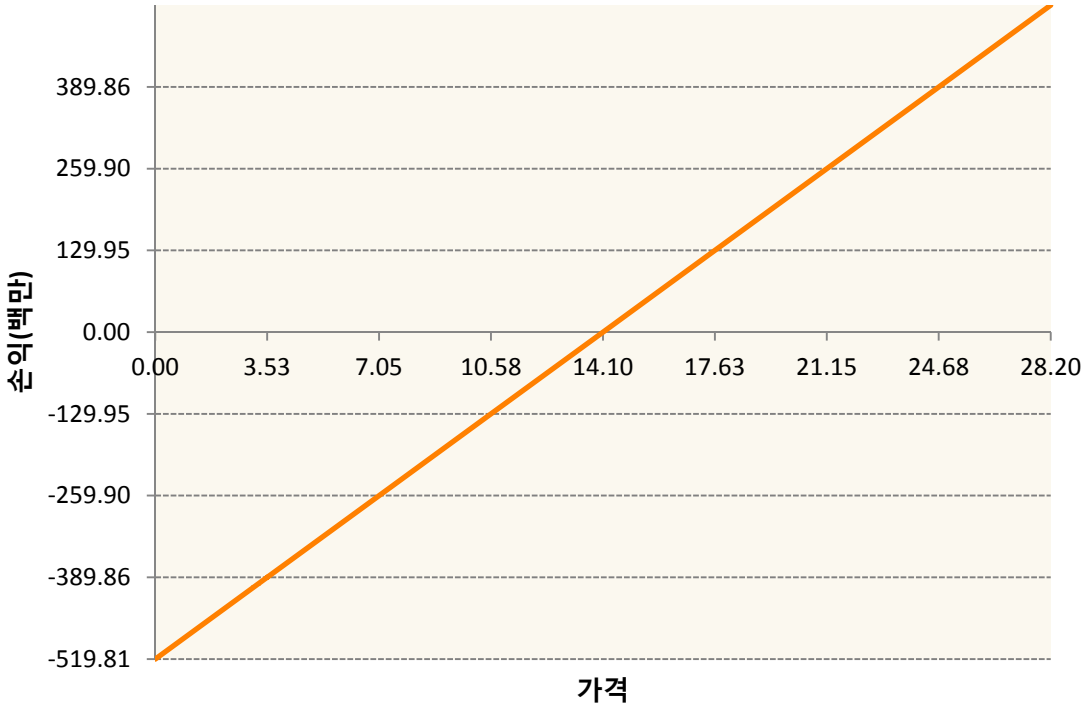

KCU7-COFFEE 'C' FUTURE SEP17
573.90
430.42
286.95
143.47
0.00
-143.47
-286.95
-430.42
0.00
33.73
67.45
101.18
134.90
168.63
202.35
236.08
손익(백만)


-573.90
가격

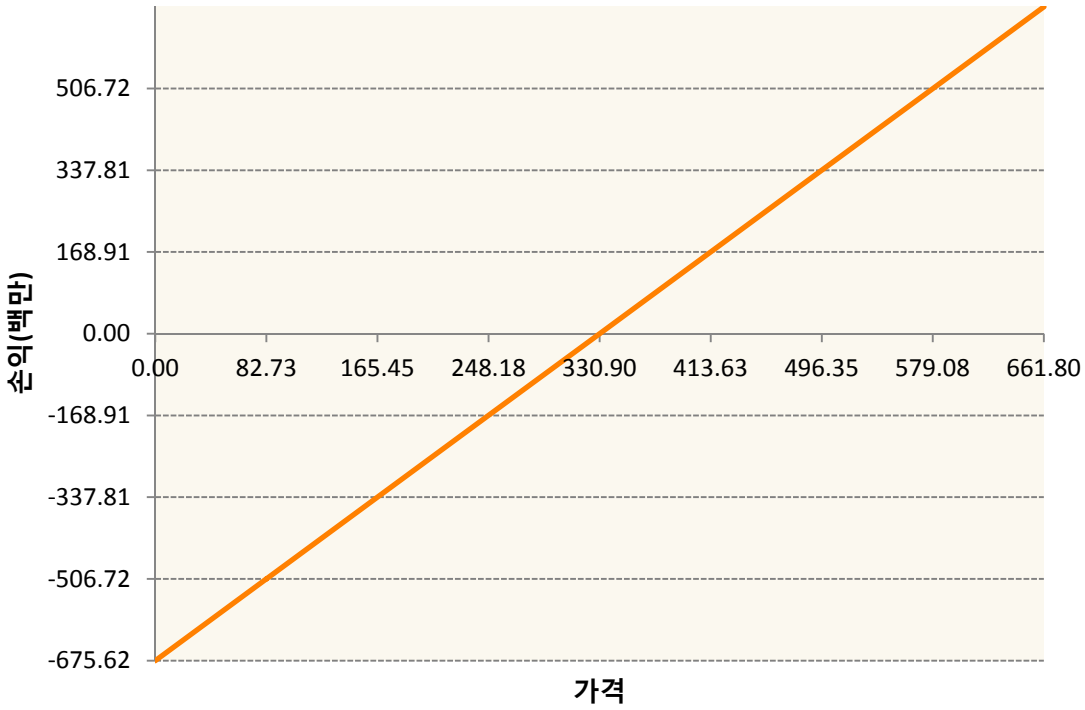

KR4175M80003-2017-08 달러선물
392.60
294.45
196.30
98.15
0.00
-98.15
-196.30
-294.45
-392.60
0.00
280.43
560.85
841.28
1,121.70
1,402.13
1,682.55
1,962.98
2,243.40
손익(백만)
가격


KWU7-KC HRW WHEAT FUT SEP17
313.86
235.40
156.93
78.47
0.00
-78.47
-156.93
-235.40
-313.86
0.00
125.69
251.38
377.06
502.75
628.44
754.13
879.81
1,005.50
손익(백만)
가격

SBV7-SUGAR #11 (WORLD) OCT17

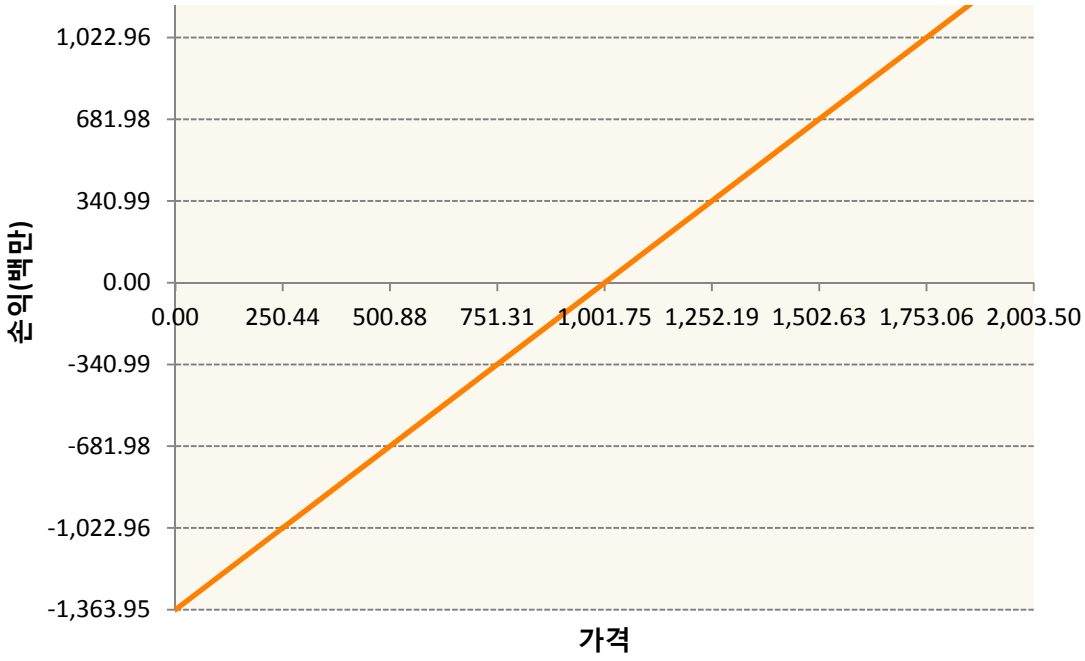


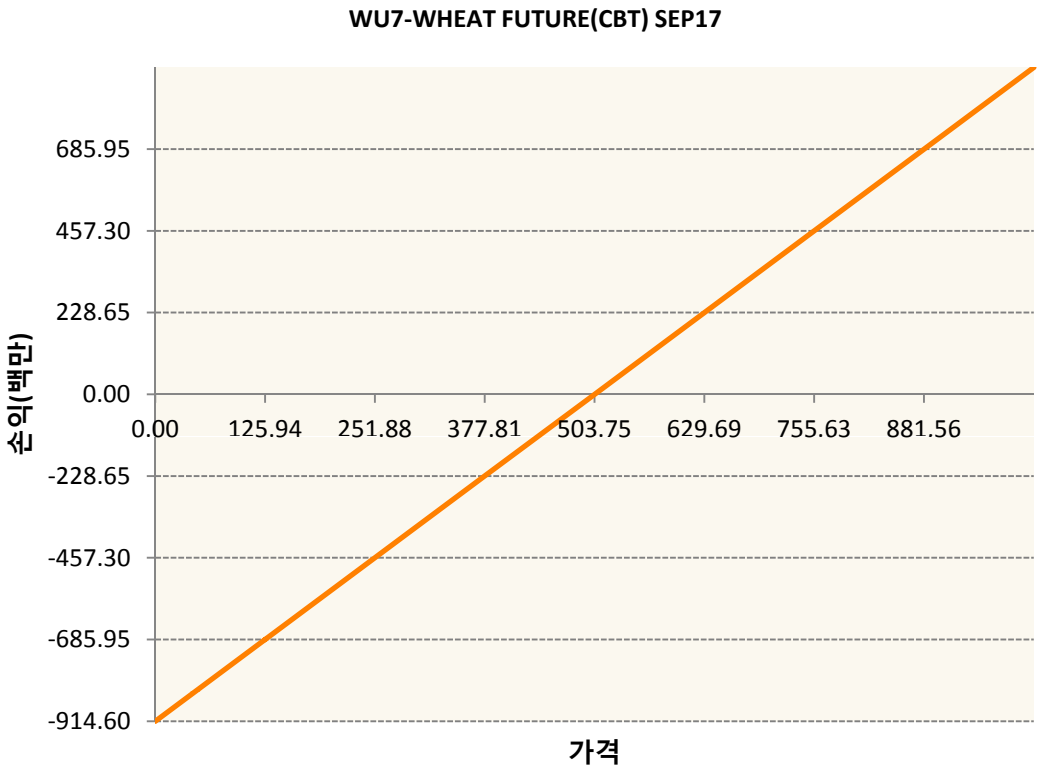
SMZ7-SOYBEAN MEAL FUTR DEC17



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	144
KCU7	COFFEE 'C' FUTURE SEP17	46
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)

665