공시일	2017-07-21
기준일	2017-07-20

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	2017-07-21
기준일	2017-07-20

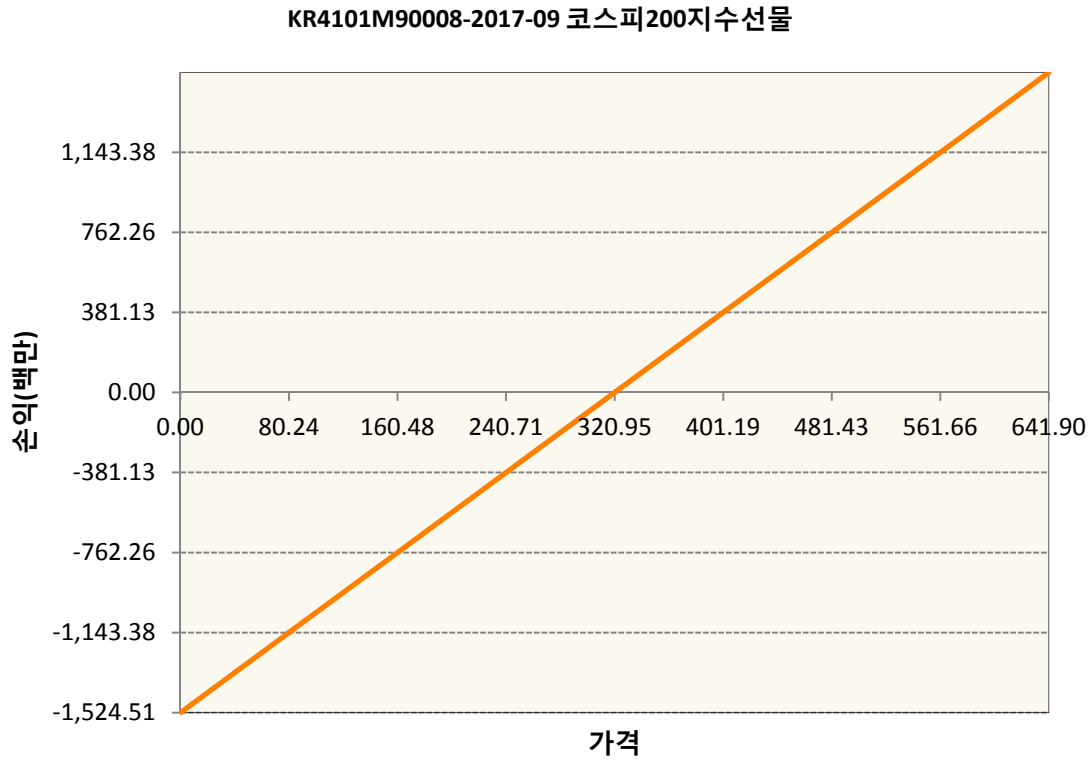
스마트인덱스모

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	401	0	401	장내
누계	유가증권	선물	1,525	0	1,525	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101M90(2017-09 코스피200지수선물							122
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-122	-122	-122	-122	-122	-122	-122
-5.33%	-81	-81	-81	-81	-81	-81	-81
-2.67%	-41	-41	-41	-41	-41	-41	-41
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	41	41	41	41	41	41	41
5.33%	81	81	81	81	81	81	81
8.00%	122	122	122	122	122	122	122

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

73

공시일	2017-07-21
기준일	2017-07-20

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	1,020

* 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	2017-07-21
기준일	2017-07-20

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	379

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

336

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-07-21
기준일	2017-07-20

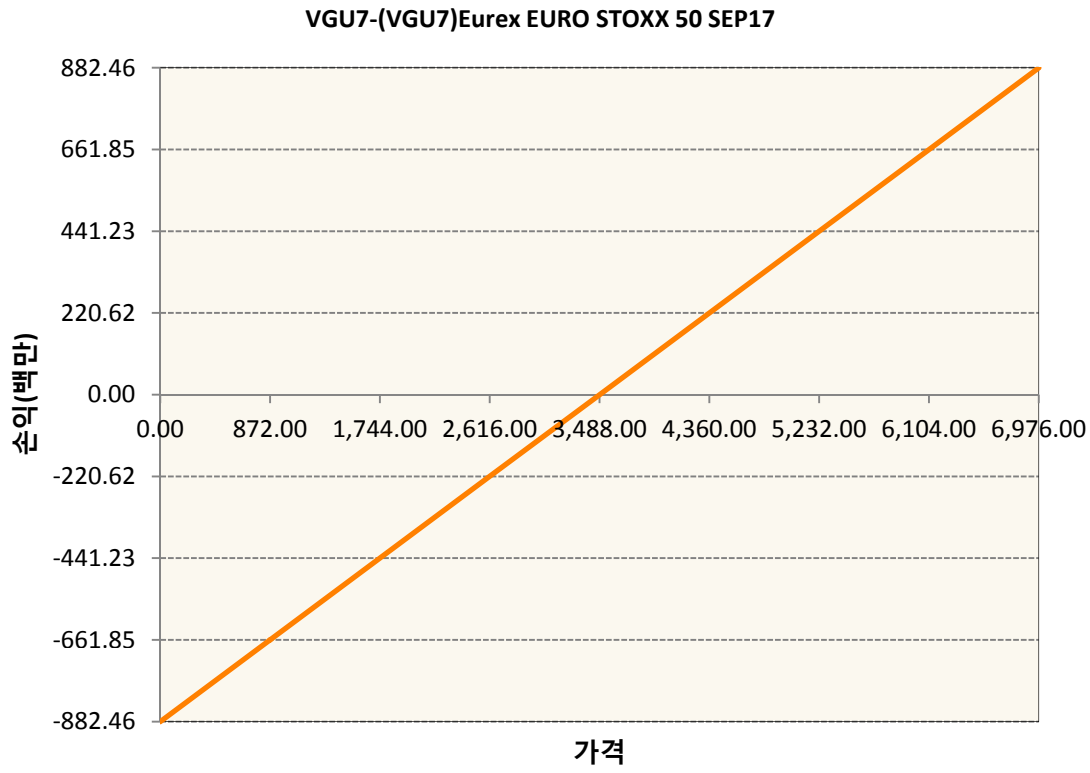
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	882	0	882	

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)

59

공시일	2017-07-21
기준일	2017-07-20

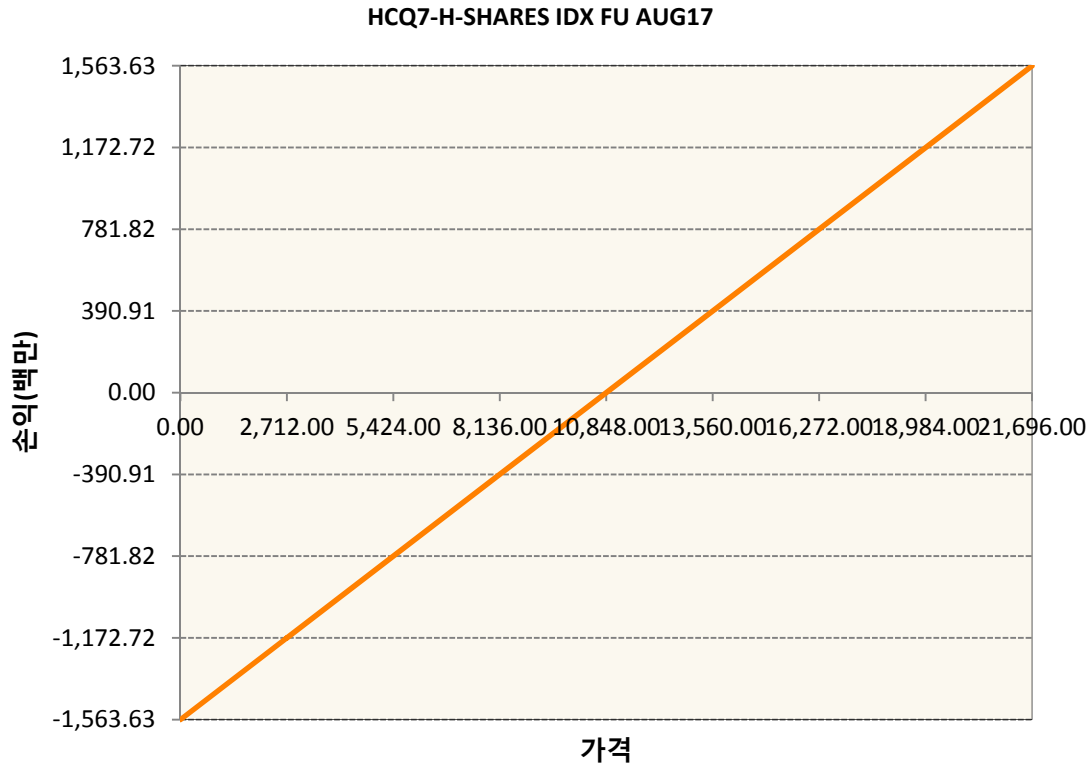
차이나인덱스모(주식-파생형)

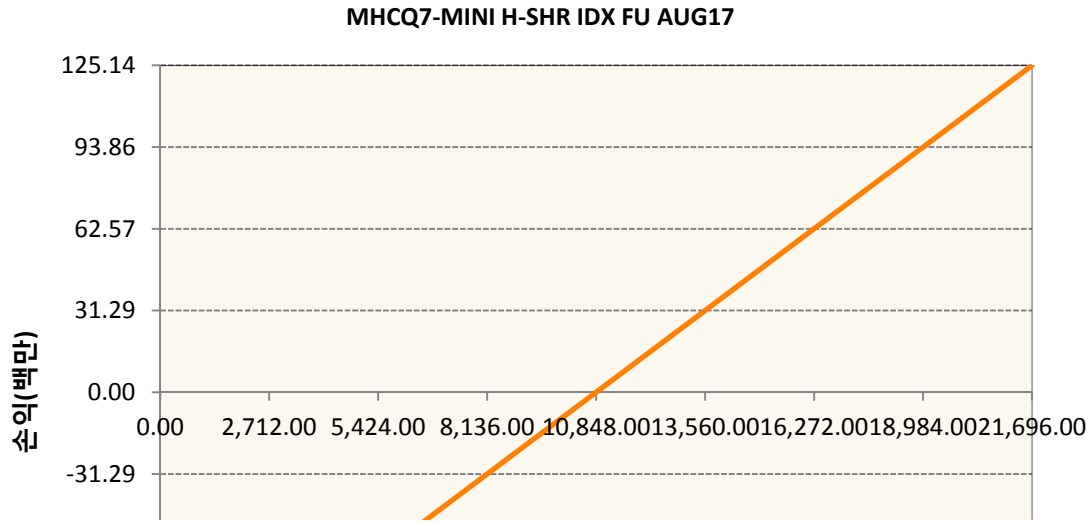
1. 계약금액

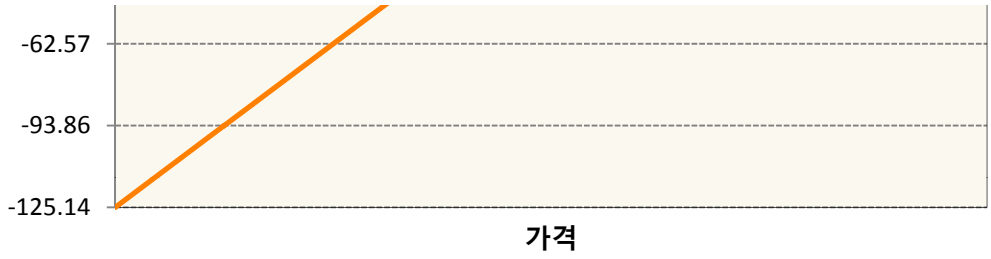
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,689	0	1,689	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCQ7	H-SHARES IDX FU AUG17	125
MHCQ7	MINI H-SHR IDX FU AUG17	10

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	128

공시일	2017-07-21
기준일	2017-07-20

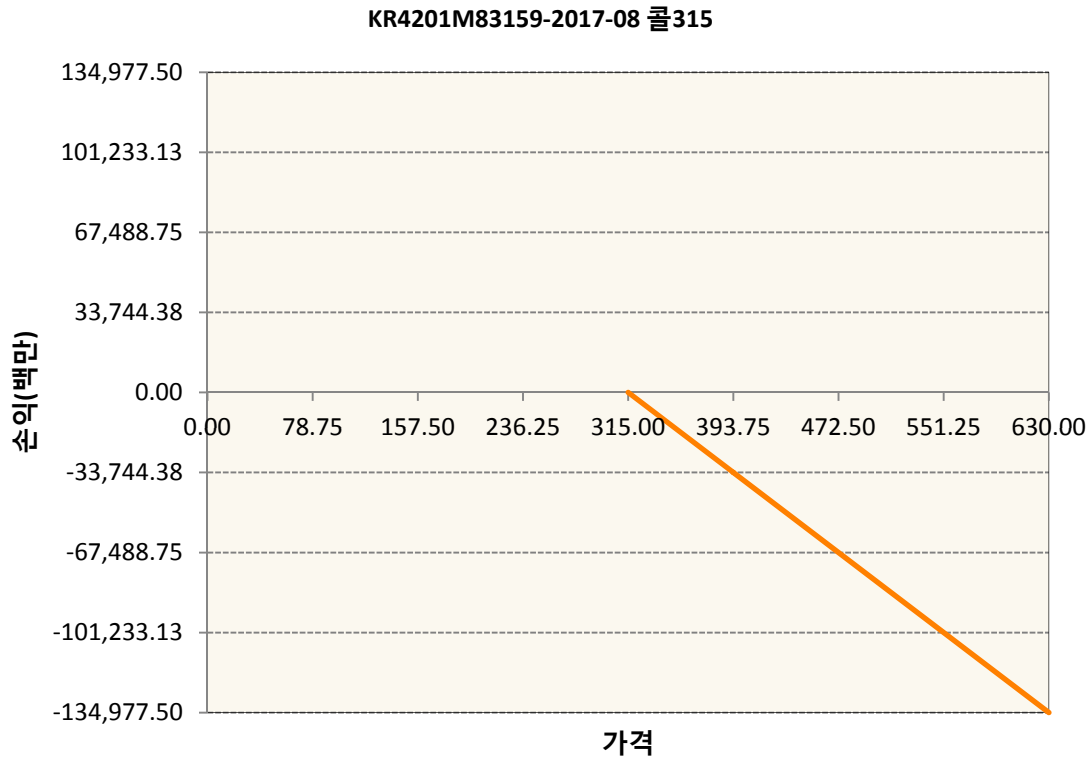
커버드콜모(주식혼합-파생형)

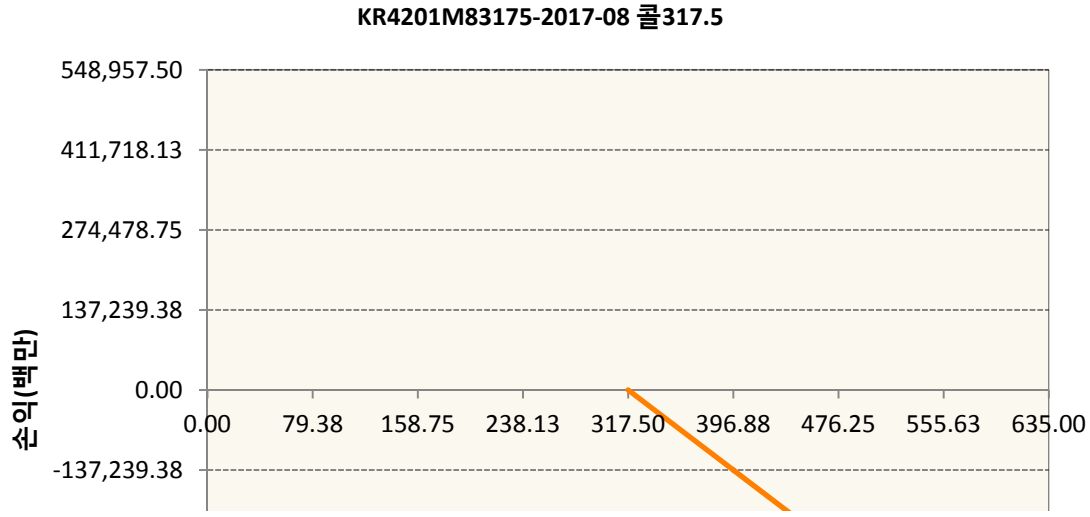
1. 계약금액

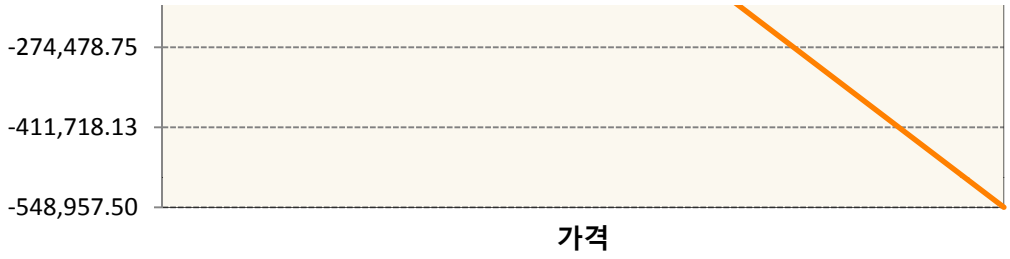
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	32,162	-32,162	장내
누계	유가증권	옵션	0	1,252,114	-1,252,114	장내

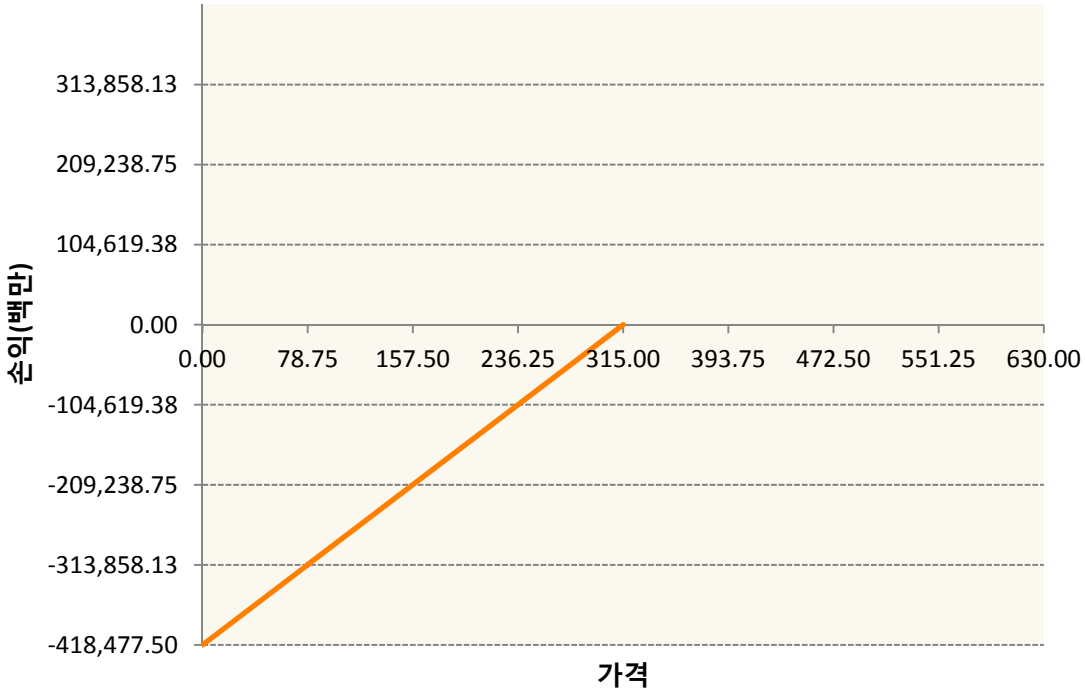
2. 만기시점의 손익구조



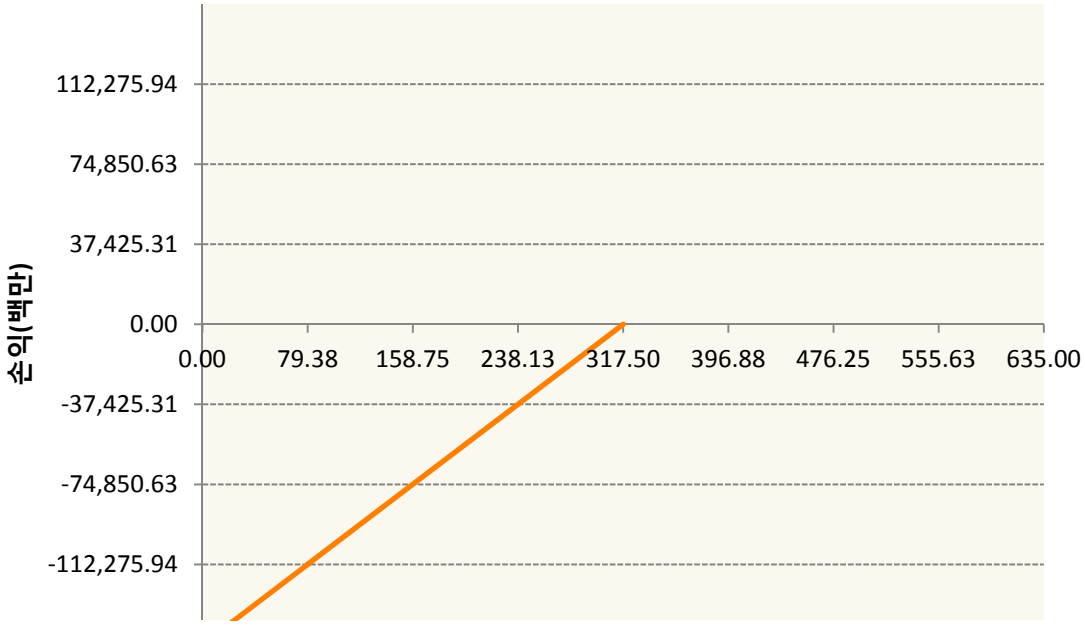




KR4301M83157-2017-08 풋315



KR4301M83173-2017-08 풋317.5





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201M83: 2017-08 콜315							9,441
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	4,173	4,101	4,011	3,906	3,788	3,657	3,516
-5.33%	3,767	3,603	3,429	3,245	3,053	2,856	2,654
-2.67%	2,690	2,455	2,218	1,981	1,743	1,504	1,266
0%	684	459	231	0	-233	-467	-703
2.67%	-2,166	-2,312	-2,473	-2,646	-2,829	-3,020	-3,217
5.33%	-5,530	-5,597	-5,682	-5,784	-5,901	-6,031	-6,173
8.00%	-9,109	-9,132	-9,166	-9,214	-9,276	-9,352	-9,441
KR4201M83: 2017-08 콜317.5							36,736
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	14,470	14,254	13,971	13,625	13,221	12,764	12,261
-5.33%	13,305	12,752	12,140	11,479	10,780	10,047	9,288
-2.67%	9,880	8,980	8,065	7,141	6,209	5,270	4,326
0%	2,909	1,944	973	0	-976	-1,954	-2,934
2.67%	-7,690	-8,394	-9,144	-9,933	-10,750	-11,592	-12,454
5.33%	-20,777	-21,137	-21,572	-22,072	-22,631	-23,238	-23,889
8.00%	-35,041	-35,174	-35,367	-35,621	-35,936	-36,309	-36,736
KR4301M83: 2017-08 풋315							25,271
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-25,204	-25,205	-25,208	-25,214	-25,226	-25,244	-25,271
-5.33%	-13,913	-13,964	-14,036	-14,129	-14,242	-14,373	-14,522
-2.67%	-3,972	-4,271	-4,576	-4,886	-5,200	-5,517	-5,836
0%	721	497	256	0	-267	-544	-829
2.67%	1,383	1,357	1,316	1,258	1,181	1,086	974
5.33%	1,403	1,403	1,401	1,397	1,389	1,375	1,354
8.00%	1,403	1,403	1,403	1,403	1,403	1,402	1,400
KR4301M83: 2017-08 풋317.5							9,790
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-9,779	-9,779	-9,780	-9,780	-9,782	-9,785	-9,790
-5.33%	-5,757	-5,765	-5,778	-5,796	-5,820	-5,850	-5,887
-2.67%	-1,972	-2,052	-2,138	-2,229	-2,324	-2,422	-2,522
0%	328	221	111	0	-113	-227	-342
2.67%	817	795	766	729	684	633	575

5.33%	841	841	839	835	829	819	805
8.00%	842	842	842	842	841	840	839

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

84,804

공시일	2017-07-21
기준일	2017-07-20

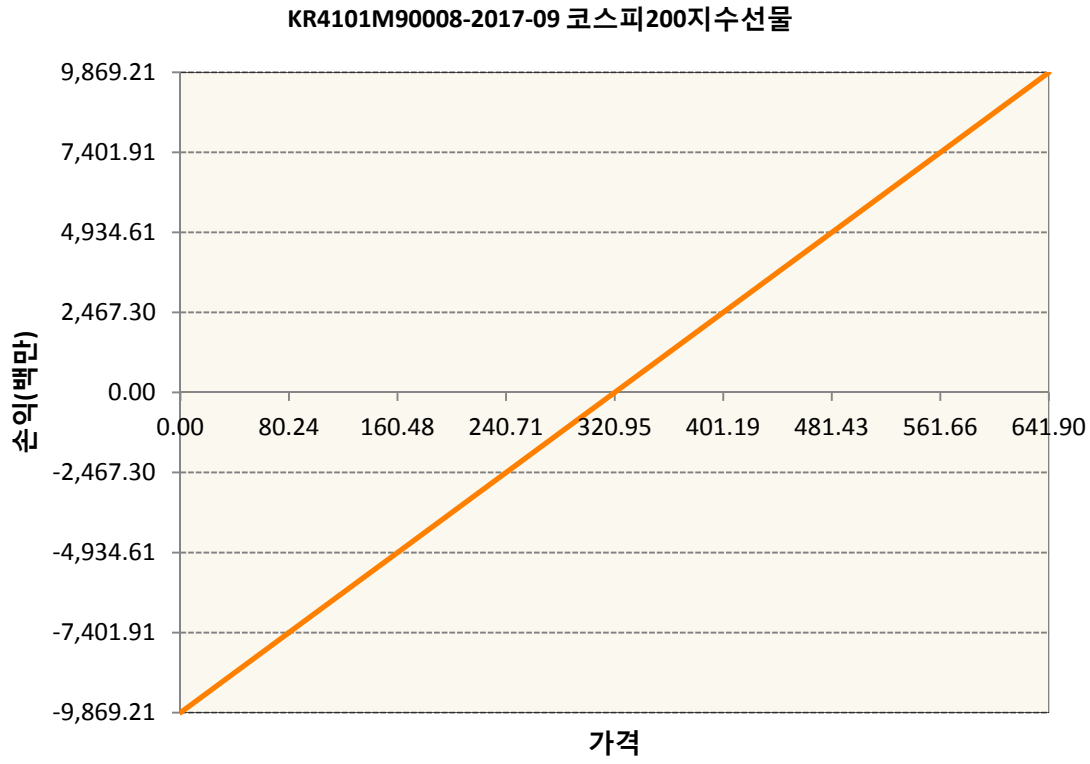
ETF스마트레버리지목표전환형6호

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	161	-161	장내
누계	유가증권	선물	9,869	0	9,869	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101M90(2017-09 코스피200지수선물							789
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-789	-789	-789	-789	-789	-789	-789
-5.33%	-526	-526	-526	-526	-526	-526	-526
-2.67%	-263	-263	-263	-263	-263	-263	-263
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	263	263	263	263	263	263	263
5.33%	526	526	526	526	526	526	526
8.00%	789	789	789	789	789	789	789

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

472

공시일	2017-07-21
기준일	2017-07-20

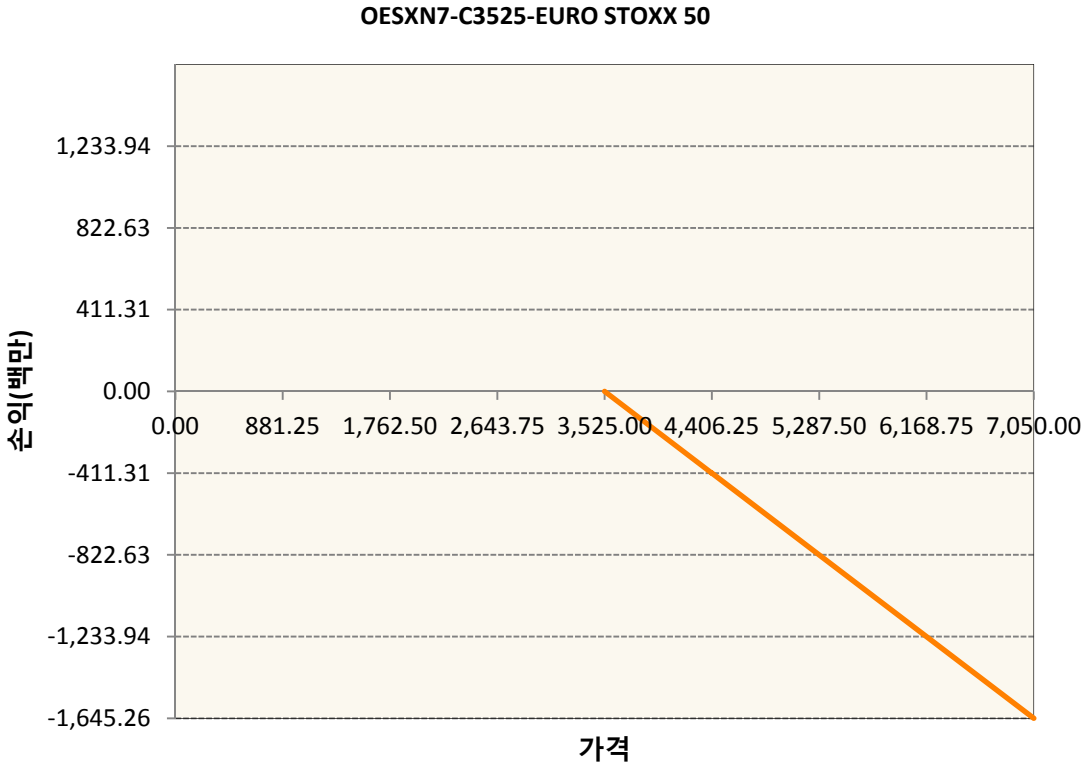
유로커버드콜(주식혼합-파생형)

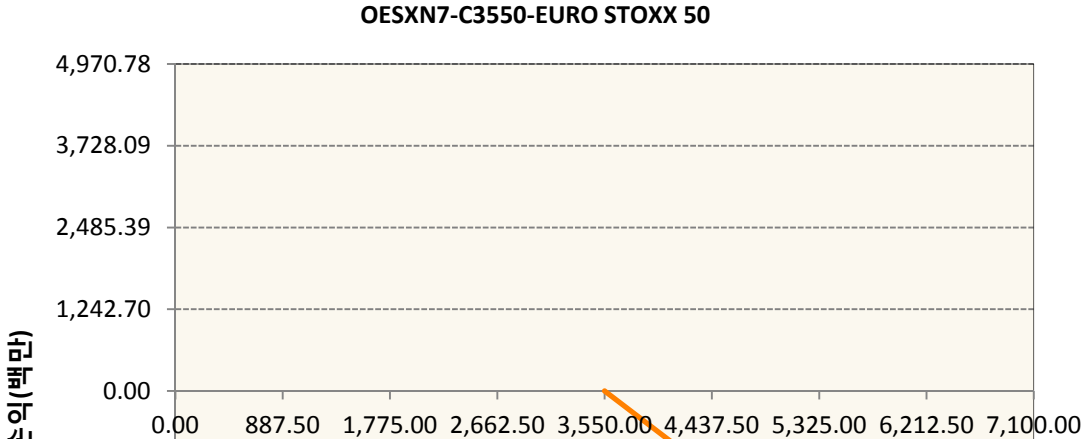
1. 계약금액

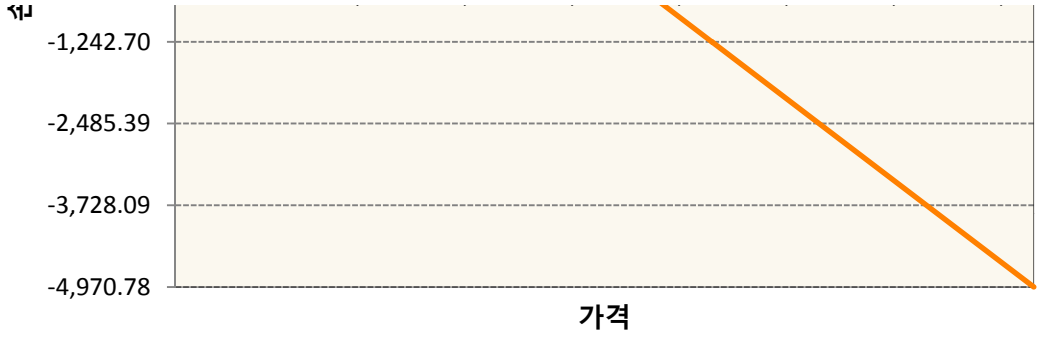
(단위:백만원)

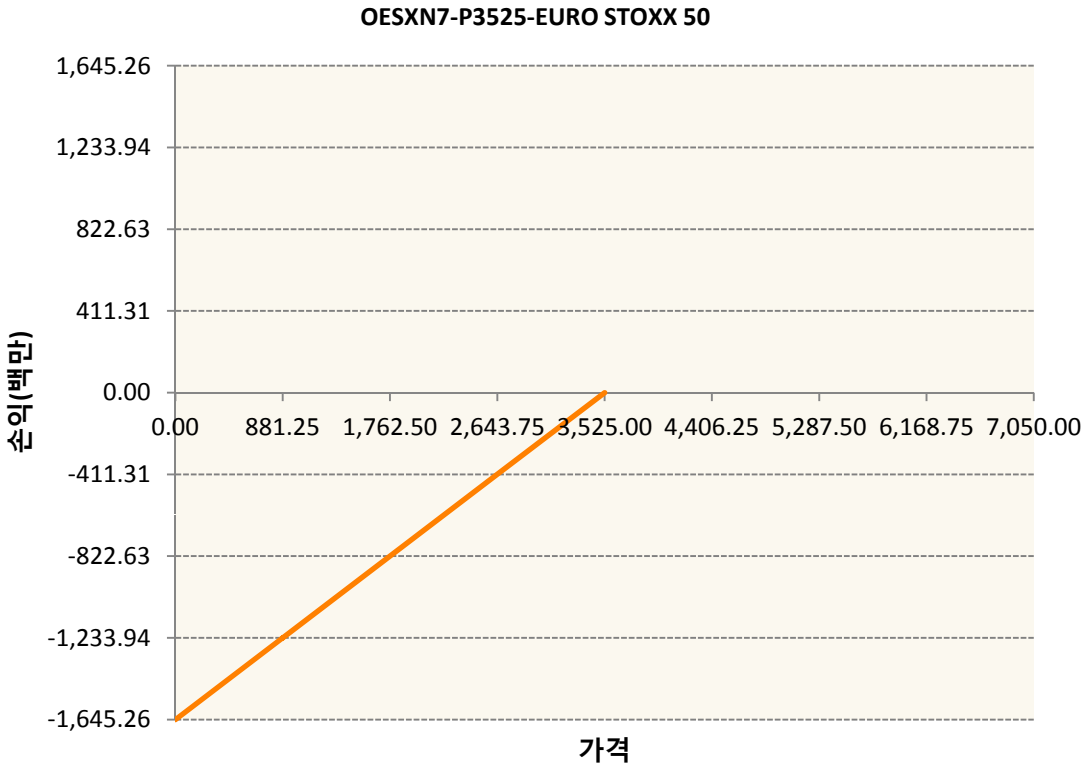
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	6,508	0	6,508	
누계	유가증권	옵션	0	13,232	-13,232	장내

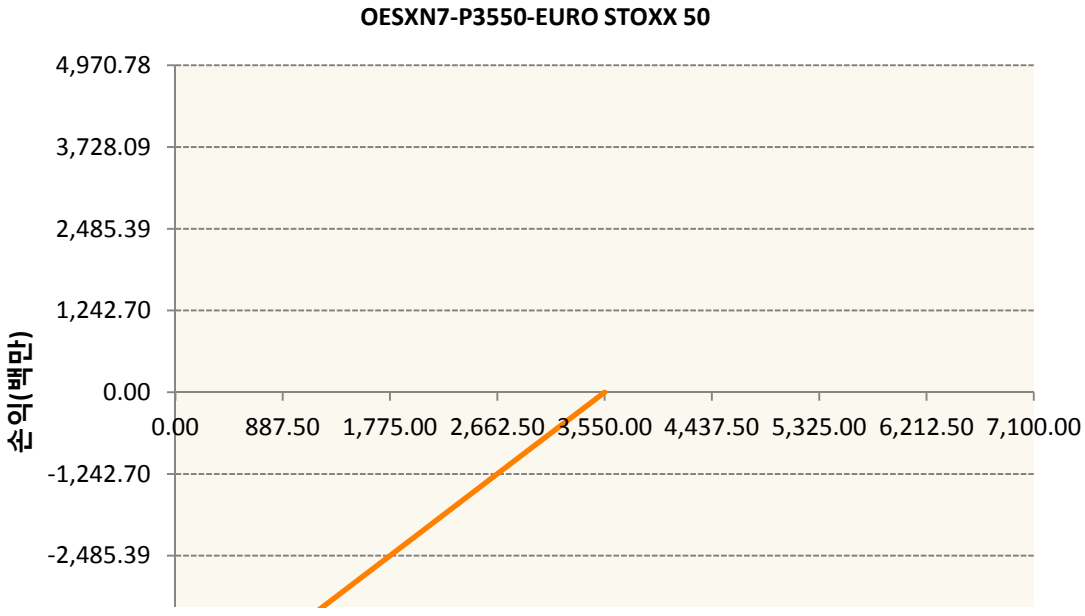
2. 만기시점의 손익구조

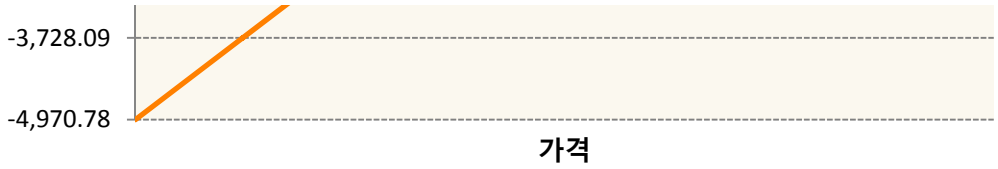


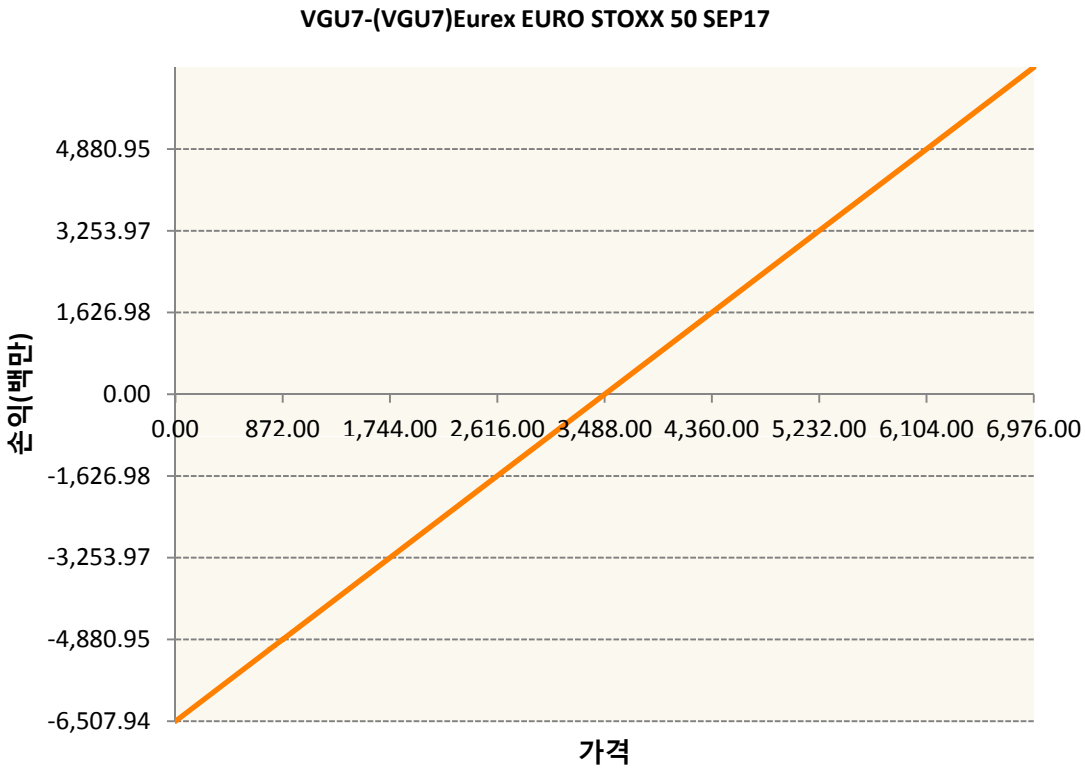



-1,242.70
-2,485.39
-3,728.09
-4,970.78
가격


OESXN7-P3525-EURO STOXX 50
1,645.26
1,233.94
822.63
411.31
0.00
-411.31
-822.63
-1,233.94
-1,645.26
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
4,970.78
3,728.09
2,485.39
1,242.70
0.00
-1,242.70
-2,485.39
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	132
OESXN7-C3!	EURO STOXX 50	398
OESXN7-P3!	EURO STOXX 50	132
OESXN7-P3!	EURO STOXX 50	398
VGU7	(VGU7)Eurex EURO STOXX 50 SEP17	521

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,330

공시일	2017-07-21
기준일	2017-07-20

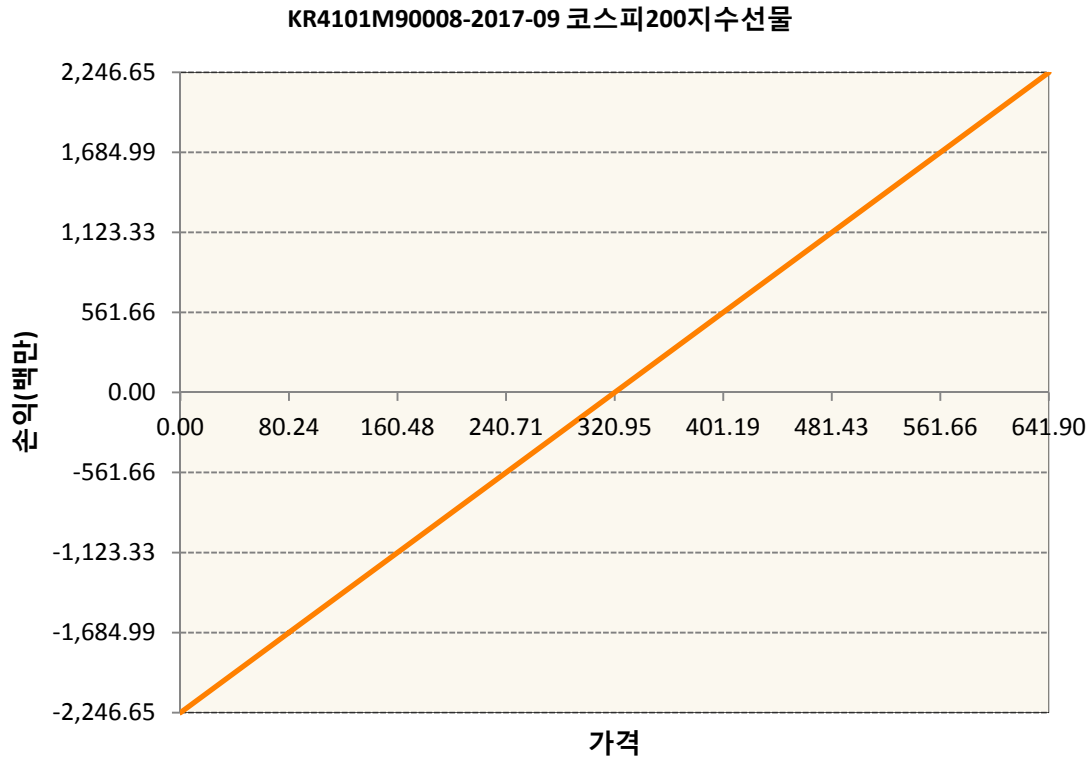
ETF스마트레버리지목표전환형7호

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	2,247	0	2,247	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101M90(2017-09 코스피200지수선물							180
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-180	-180	-180	-180	-180	-180	-180
-5.33%	-120	-120	-120	-120	-120	-120	-120
-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%	120	120	120	120	120	120	120
8.00%	180	180	180	180	180	180	180

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

108

공시일	2017-07-21
기준일	2017-07-20

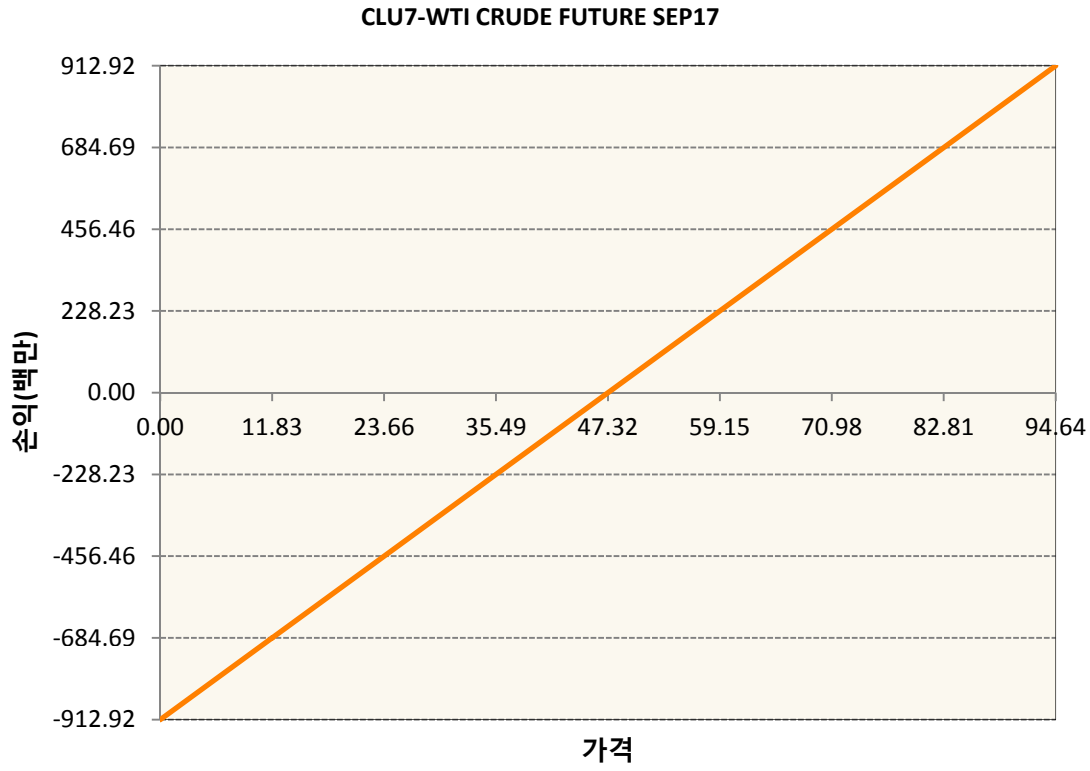
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

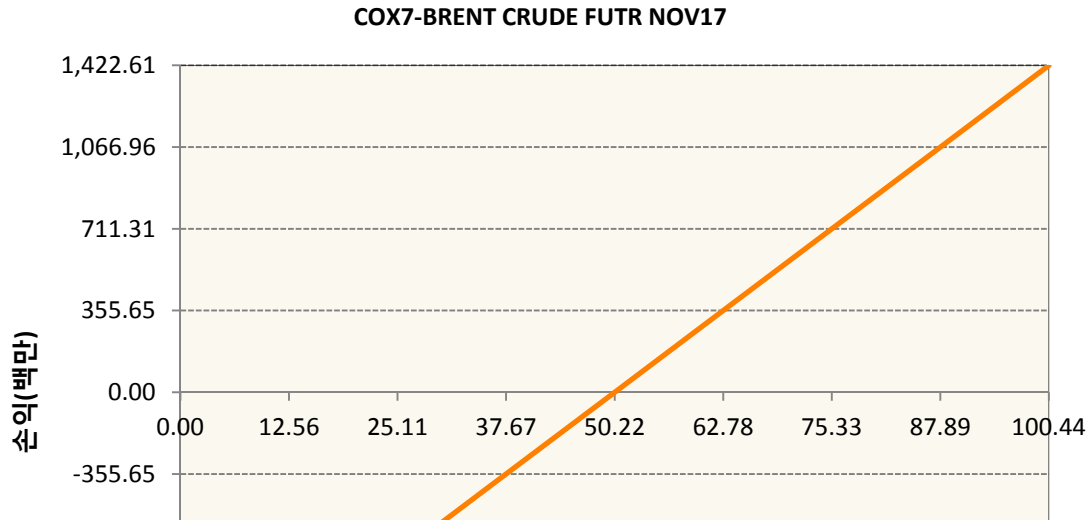
1. 계약금액

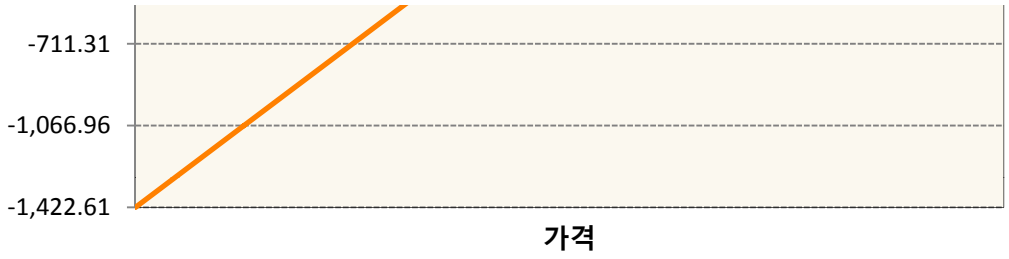
(단위:백만원)

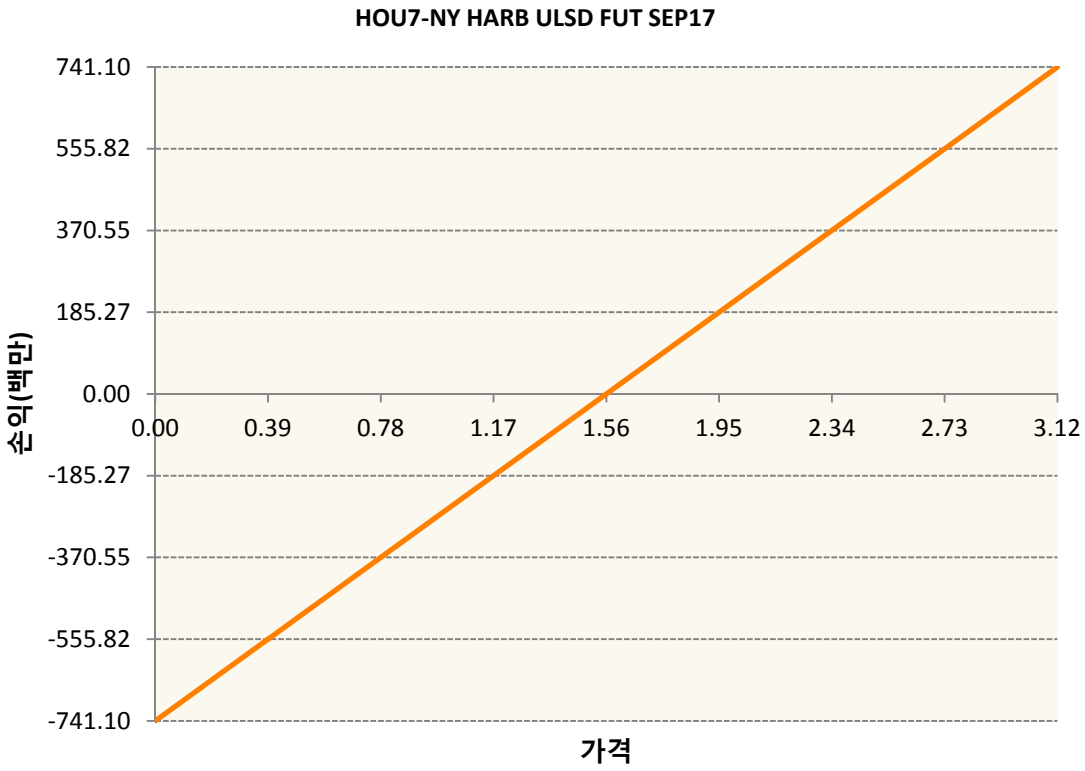
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	5,285	225	5,060	

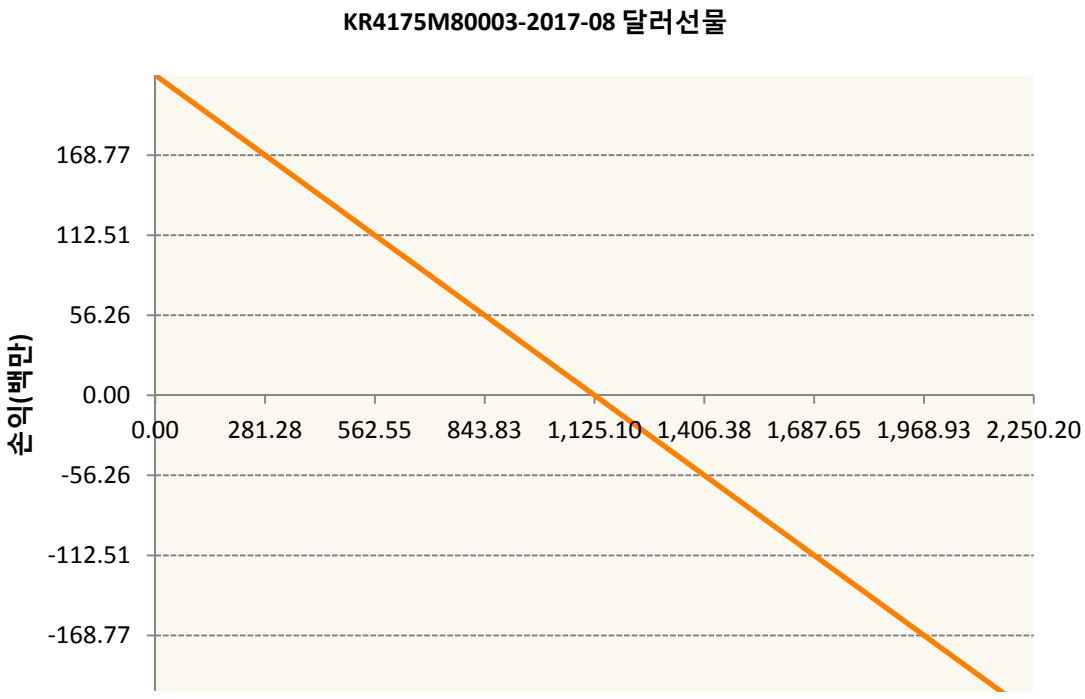
2. 만기시점의 손익구조

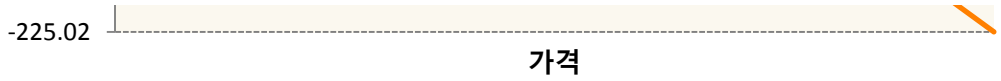


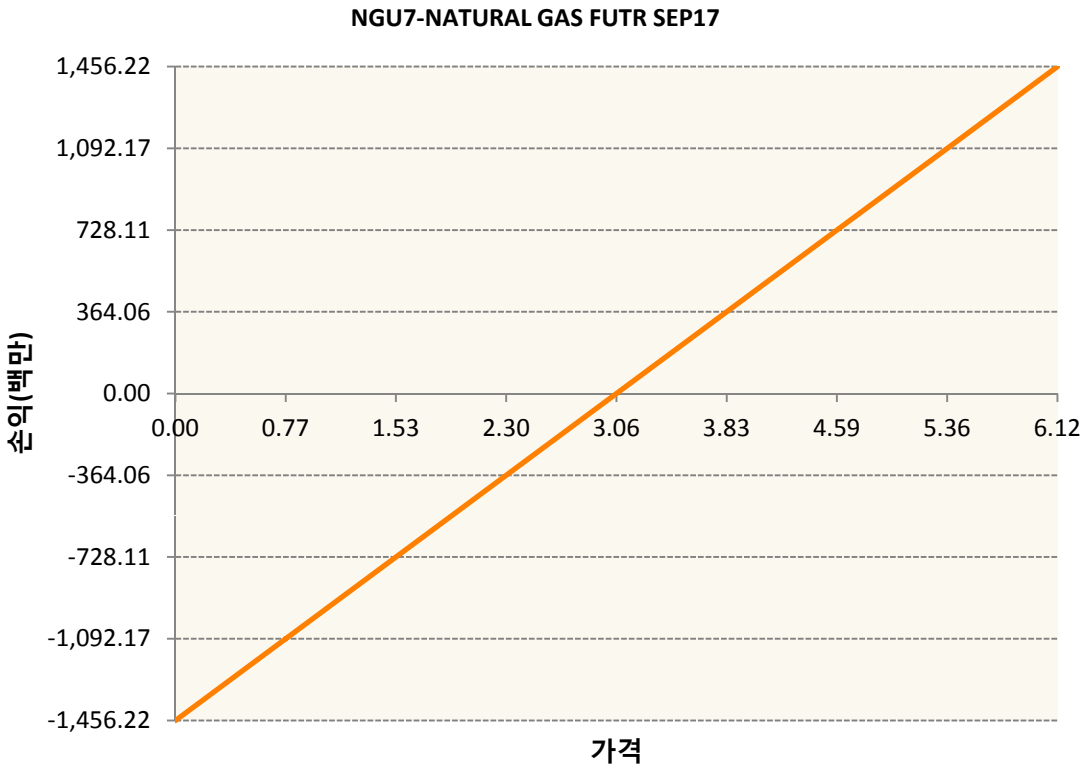


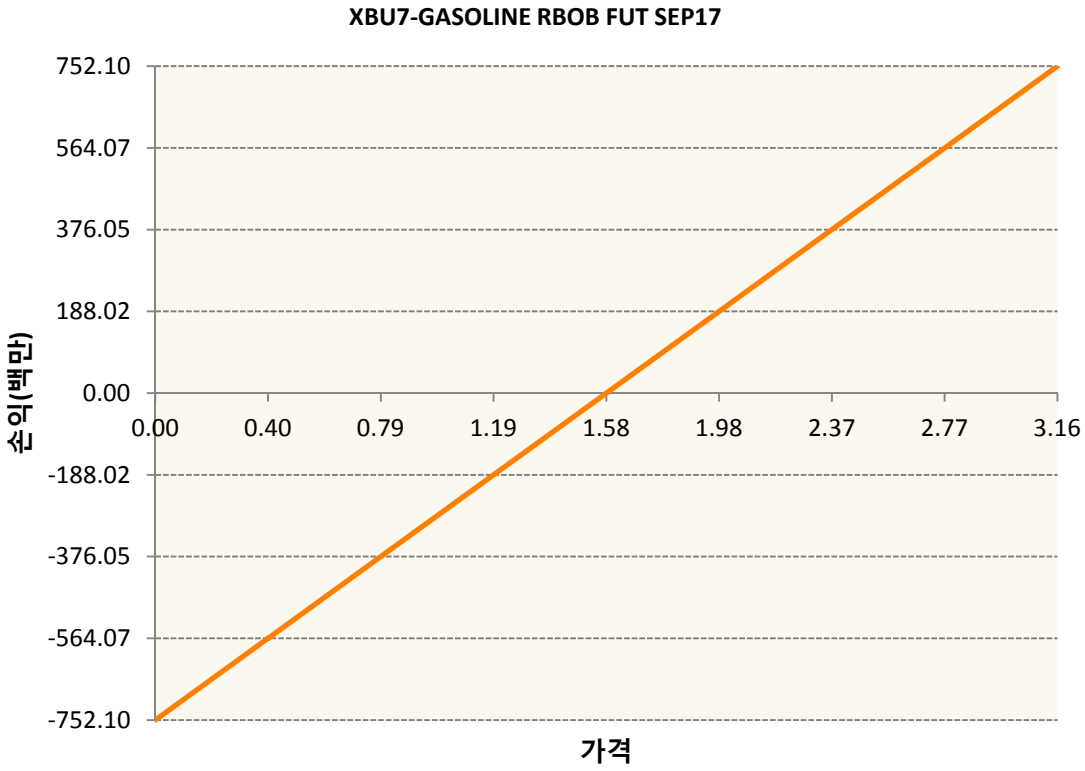

-711.31
-1,066.96
-1,422.61
가격


HOU7-NY HARB ULSD FUT SEP17
741.10
555.82
370.55
185.27
0.00
-185.27
-370.55
-555.82
-741.10
0.00
0.39
0.78
1.17
1.56
1.95
2.34
2.73
3.12
손익(백만)
가격


KR4175M80003-2017-08 달러선물
168.77
112.51
56.26
0.00
-56.26
-112.51
-168.77
0.00
281.28
562.55
843.83
1,125.10
1,406.38
1,687.65
1,968.93
2,250.20
손익(백만)


-225.02
가격


NGU7-NATURAL GAS FUTR SEP17
1,456.22
1,092.17
728.11
364.06
0.00
-364.06
-728.11
-1,092.17
-1,456.22
0.00
0.77
1.53
2.30
3.06
3.83
4.59
5.36
6.12
손익(백만)
가격


XBU7-GASOLINE RBOB FUT SEP17
752.10
564.07
376.05
188.02
0.00
-188.02
-376.05
-564.07
-752.10
0.00
0.40
0.79
1.19
1.58
1.98
2.37
2.77
3.16
손익(백만)
가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLU7	WTI CRUDE FUTURE SEP17	73
COX7	BRENT CRUDE FUTR NOV17	114
HOU7	NY HARB ULSD FUT SEP17	59
KR4175M80(	2017-08 달러선물	18
NGU7	NATURAL GAS FUTR SEP17	116
XBU7	GASOLINE RBOB FUT SEP17	60

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

793

공시일	2017-07-21
기준일	2017-07-20

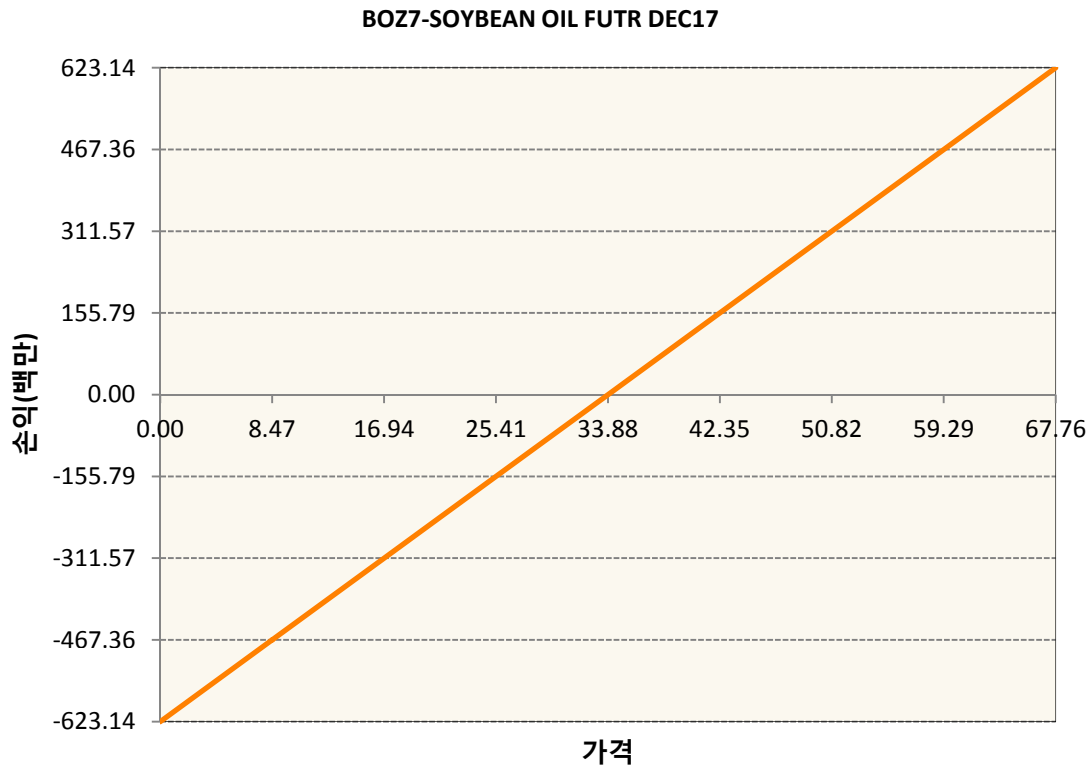
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

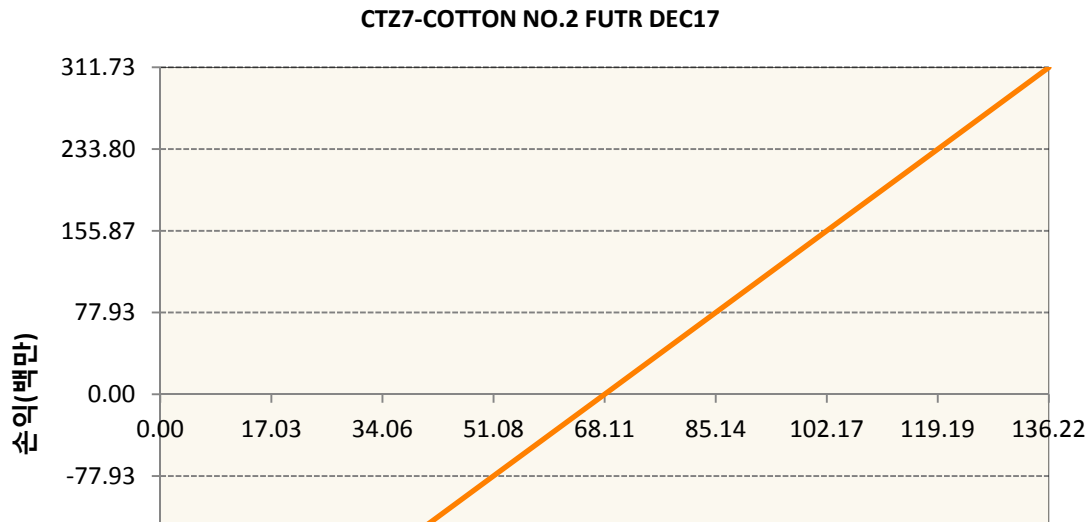
1. 계약금액

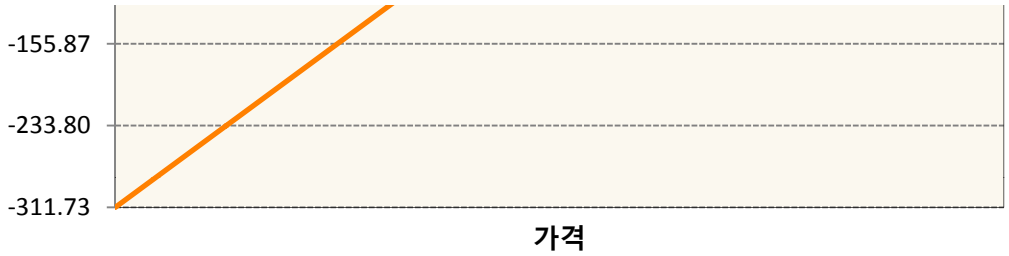
(단위:백만원)

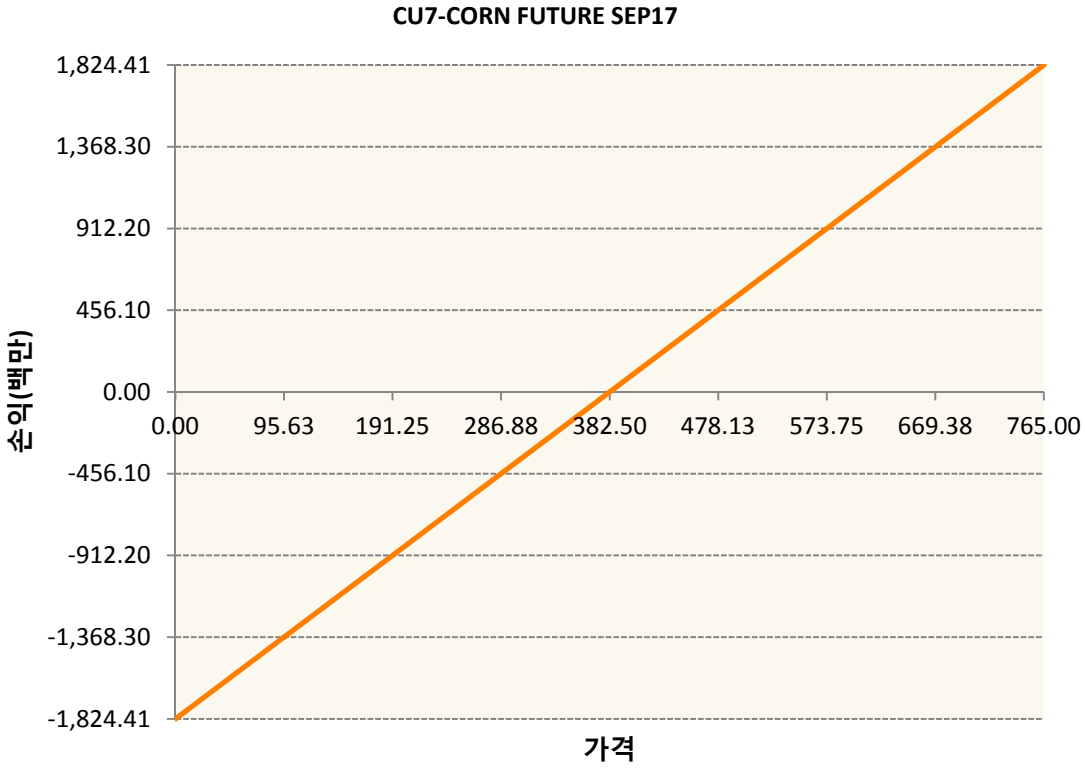
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	7,159	394	6,765	

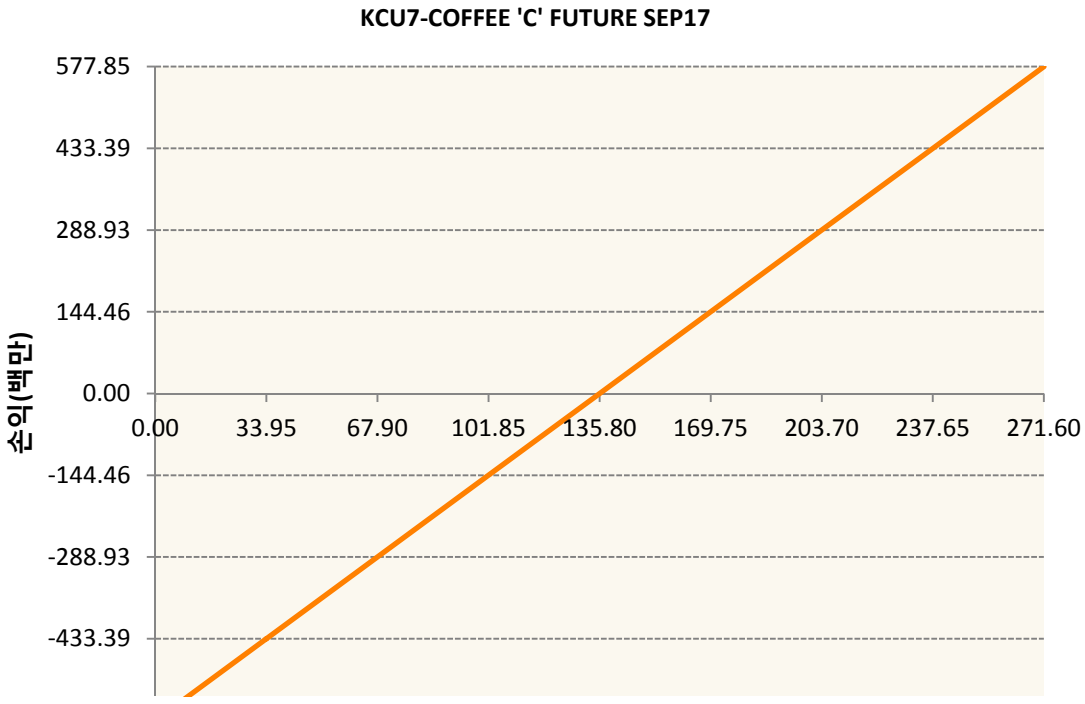
2. 만기시점의 손익구조

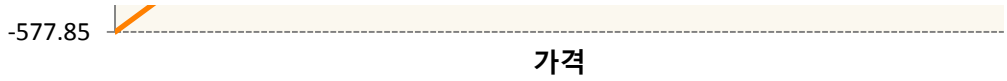


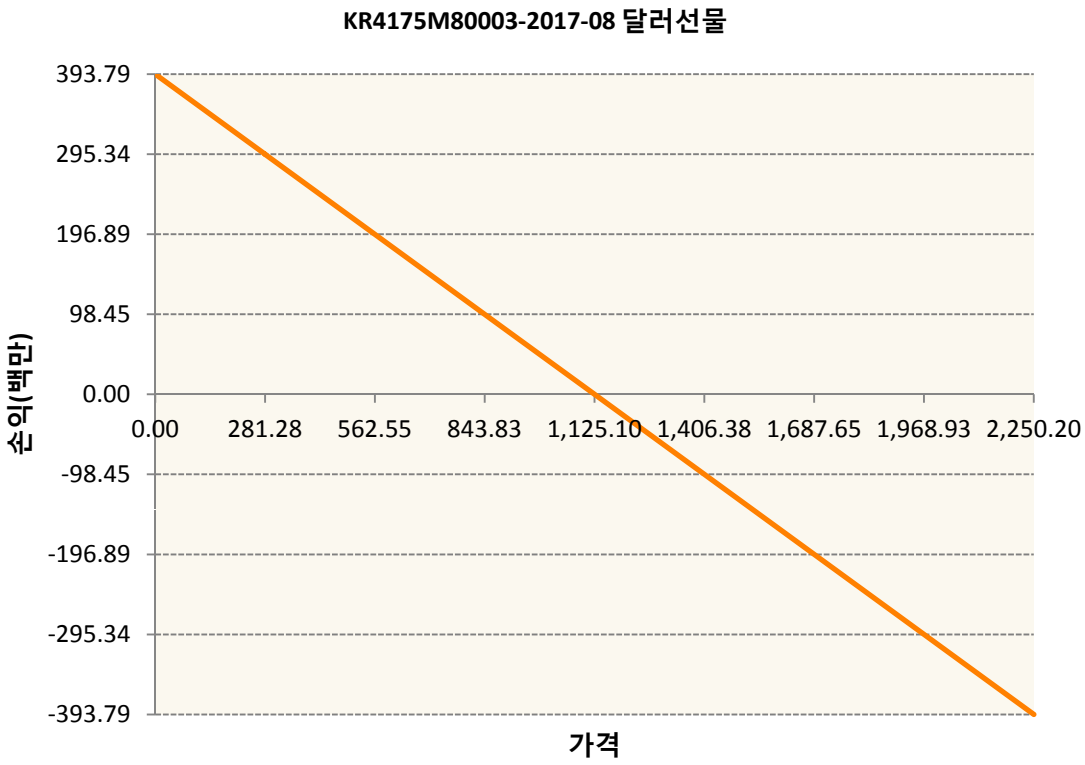


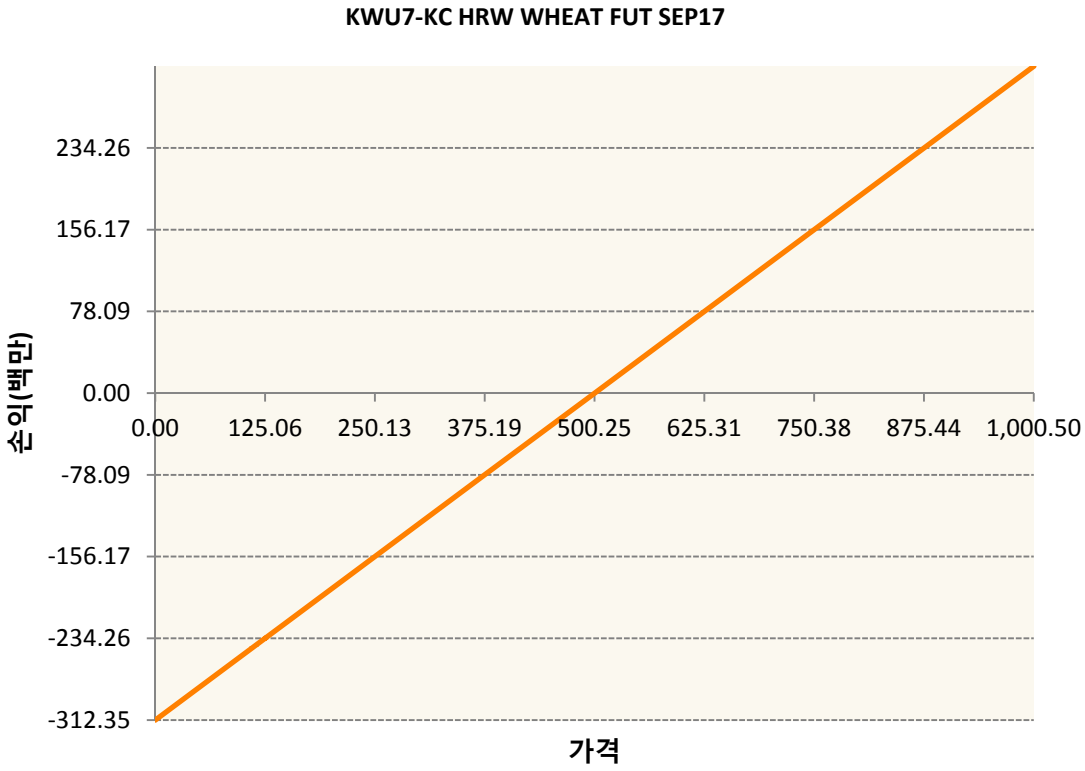

-155.87
-233.80
-311.73
가격


CU7-CORN FUTURE SEP17
1,824.41
1,368.30
912.20
456.10
0.00
-456.10
-912.20
-1,368.30
-1,824.41
0.00
95.63
191.25
286.88
382.50
478.13
573.75
669.38
765.00
손익(백만)
가격

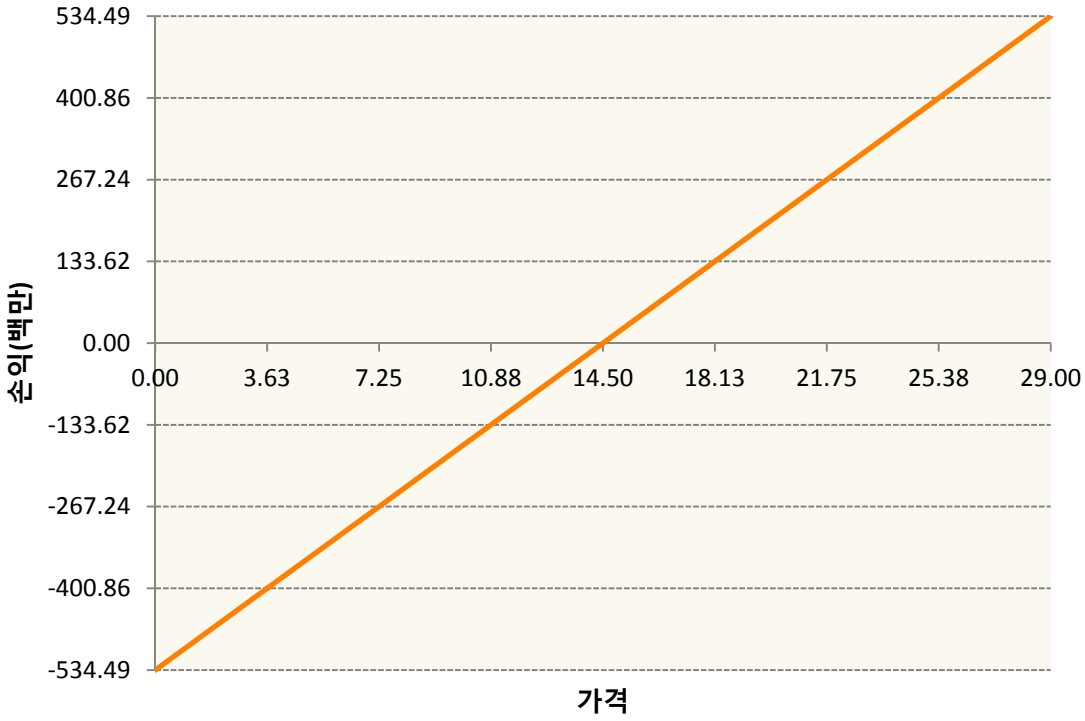

KCU7-COFFEE 'C' FUTURE SEP17
577.85
433.39
288.93
144.46
0.00
-144.46
-288.93
-433.39
0.00
33.95
67.90
101.85
135.80
169.75
203.70
237.65
271.60
손익(백만)


-577.85
가격

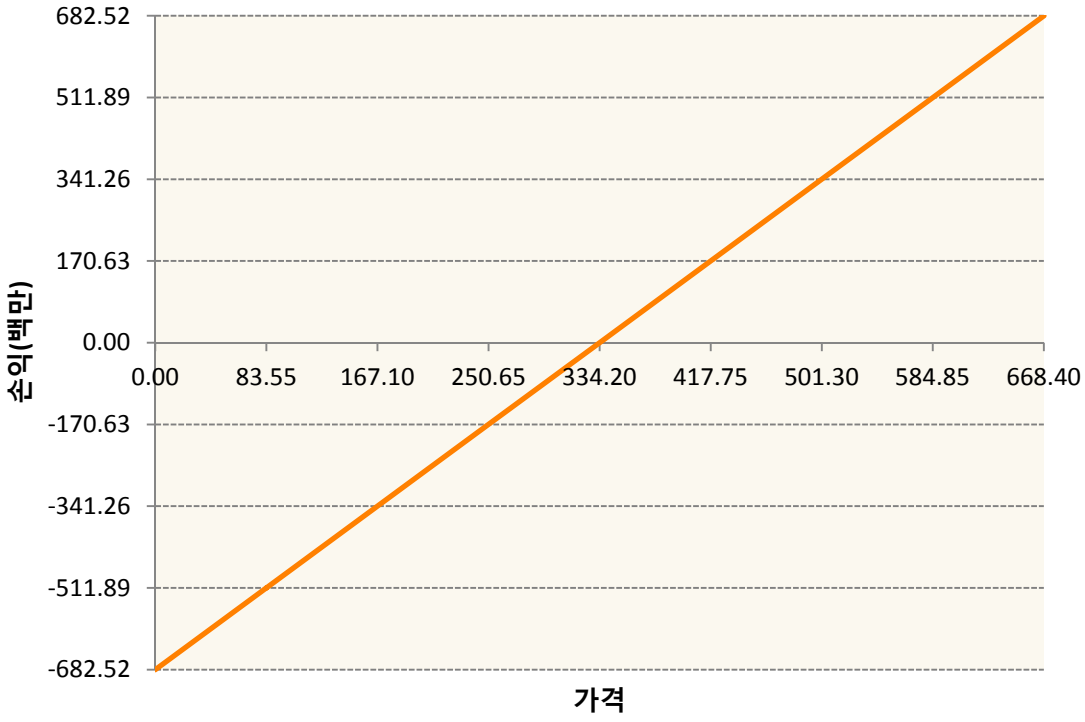

KR4175M80003-2017-08 달러선물
393.79
295.34
196.89
98.45
0.00
-98.45
-196.89
-295.34
-393.79
0.00
281.28
562.55
843.83
1,125.10
1,406.38
1,687.65
1,968.93
2,250.20
손익(백만)
가격


KWU7-KC HRW WHEAT FUT SEP17
234.26
156.17
78.09
0.00
-78.09
-156.17
-234.26
-312.35
0.00
125.06
250.13
375.19
500.25
625.31
750.38
875.44
1,000.50
손익(백만)
가격

SBV7-SUGAR #11 (WORLD) OCT17

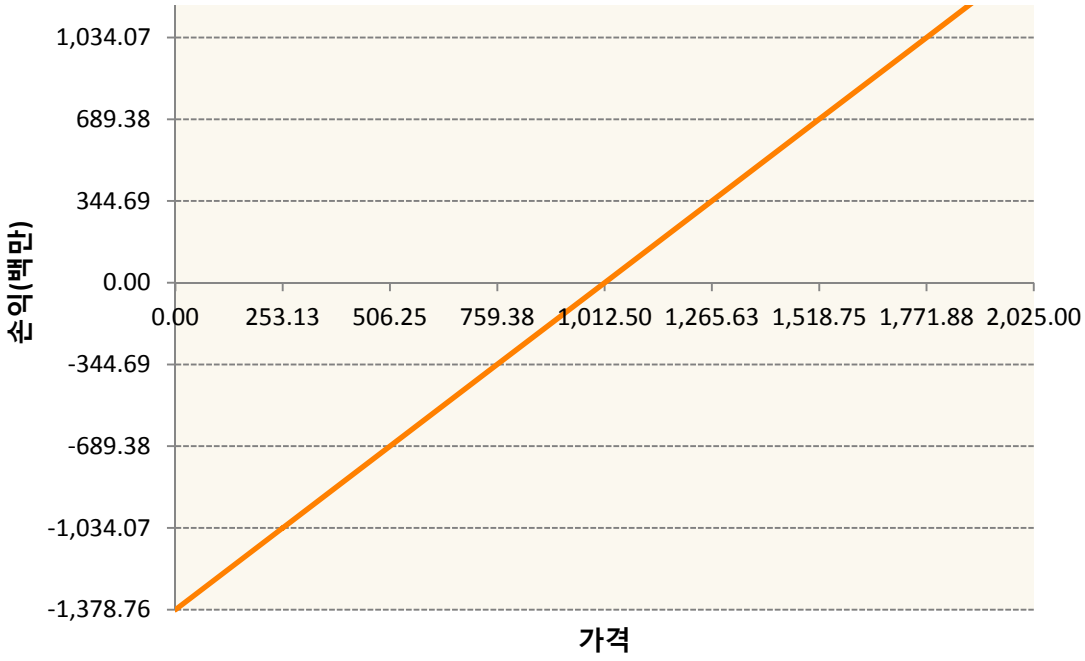


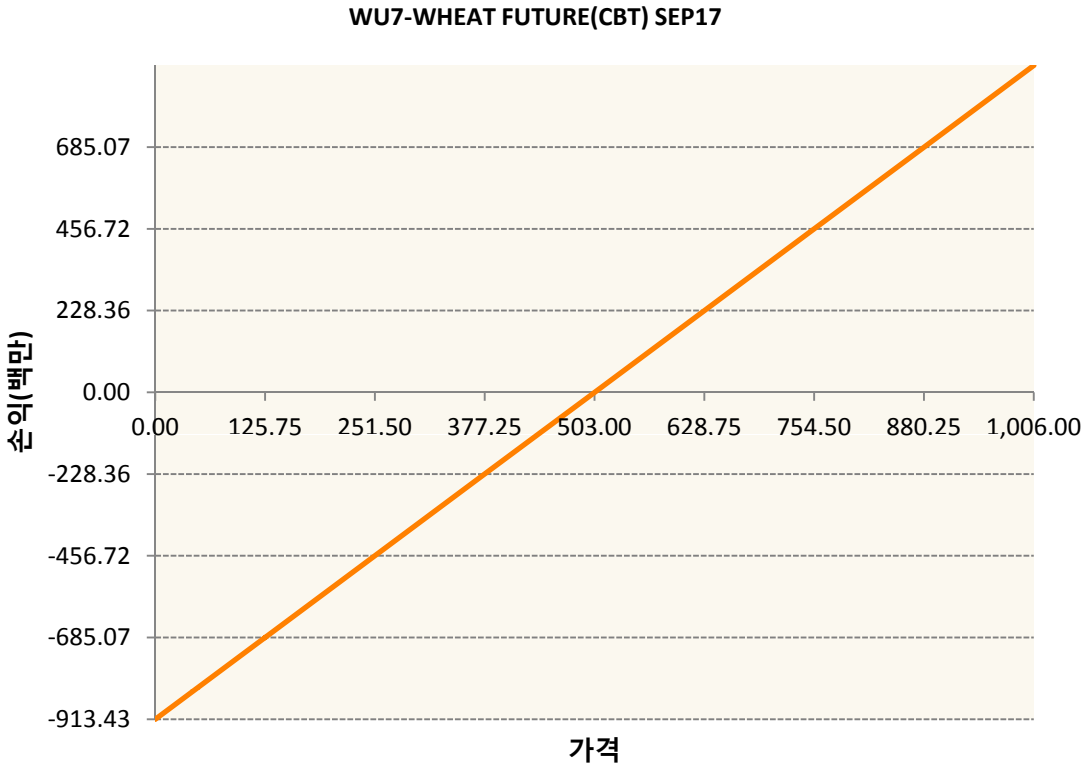
SMZ7-SOYBEAN MEAL FUTR DEC17



SX7-SOYBEAN FUTURE NOV17







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
BOZ7	SOYBEAN OIL FUTR DEC17	50
CTZ7	COTTON NO.2 FUTR DEC17	25
CU7	CORN FUTURE SEP17	146
KCU7	COFFEE 'C' FUTURE SEP17	46
KR4175M80(	2017-08 달러선물	32

KWU7	KC HRW WHEAT FUT SEP17	25
SBV7	SUGAR #11 (WORLD) OCT17	43
SMZ7	SOYBEAN MEAL FUTR DEC17	55
SX7	SOYBEAN FUTURE NOV17	110
WU7	WHEAT FUTURE(CBT) SEP17	73

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

671