공시일	2017-07-24
기준일	2017-07-21

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	2017-07-24
기준일	2017-07-21

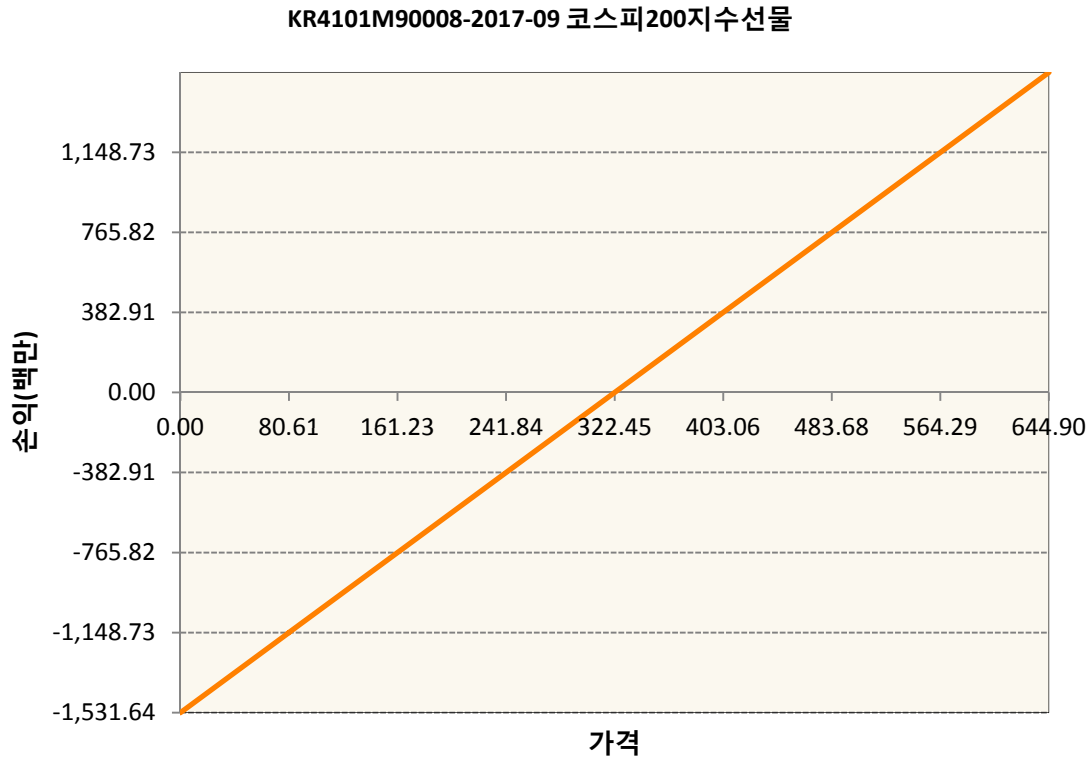
스마트인덱스모

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	1,532	0	1,532	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%	-82	-82	-82	-82	-82	-82	-82
-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%	82	82	82	82	82	82	82
8.00%	122	122	122	122	122	122	122

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

73

공시일	2017-07-24
기준일	2017-07-21

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	1,022

* 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	2017-07-24
기준일	2017-07-21

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)

338

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-07-24
기준일	2017-07-21

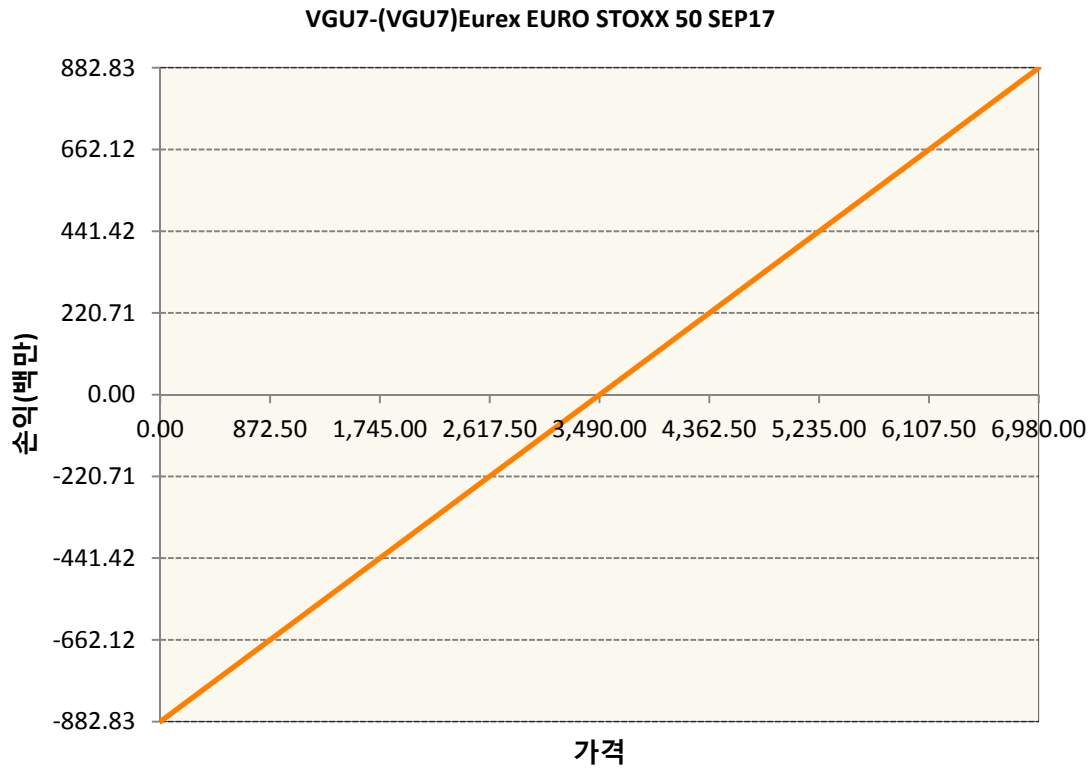
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	883	0	883	

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	2017-07-24
기준일	2017-07-21

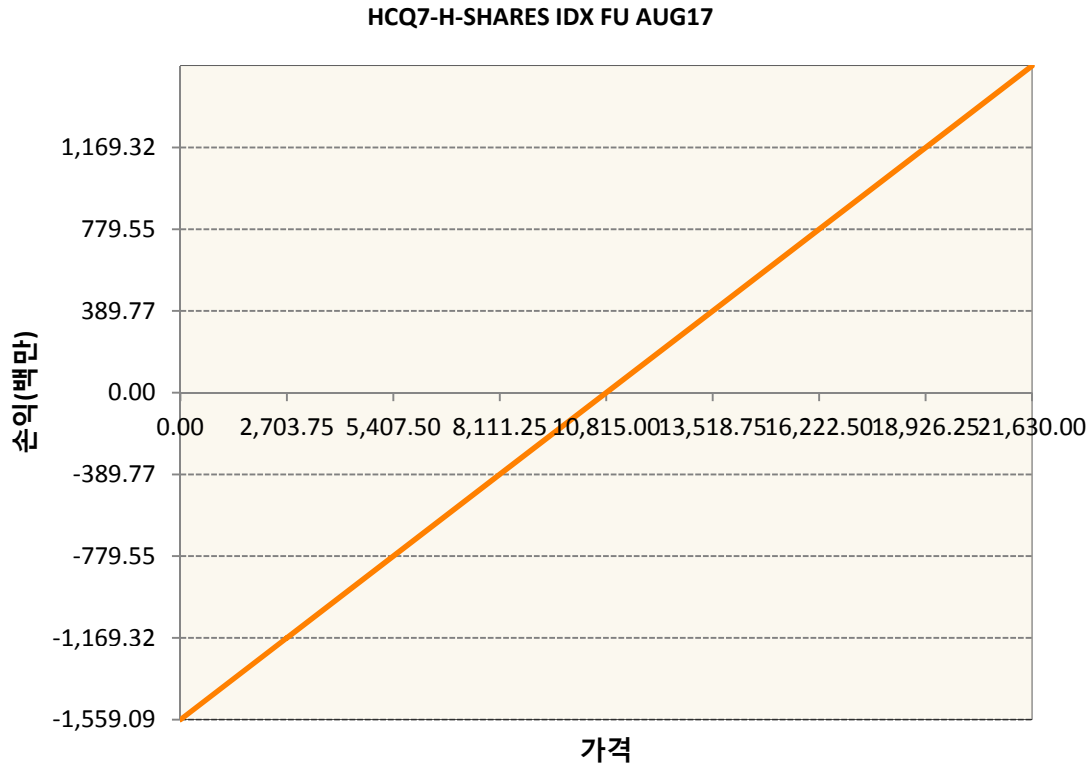
차이나인덱스모(주식-파생형)

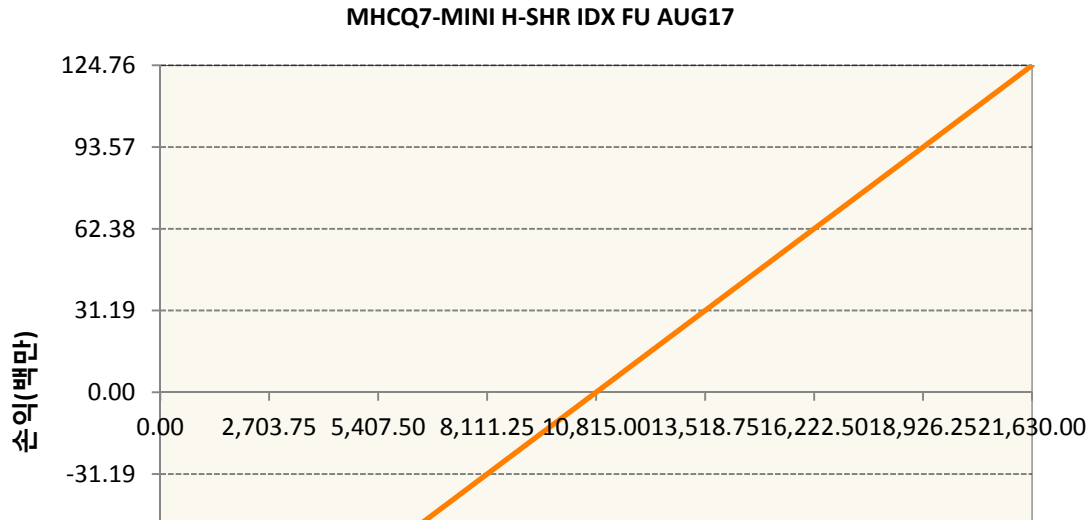
1. 계약금액

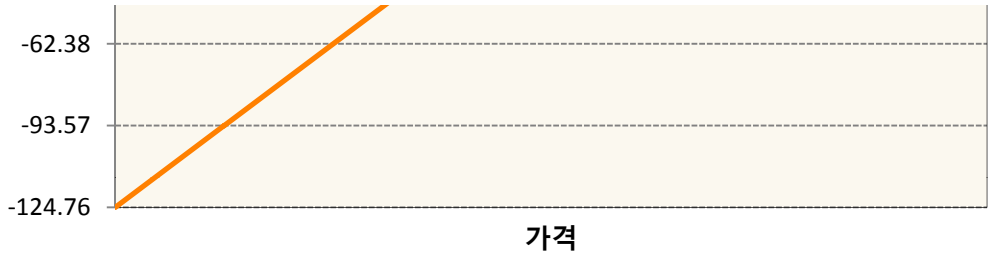
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,684	0	1,684	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)
	127

공시일	2017-07-24
기준일	2017-07-21

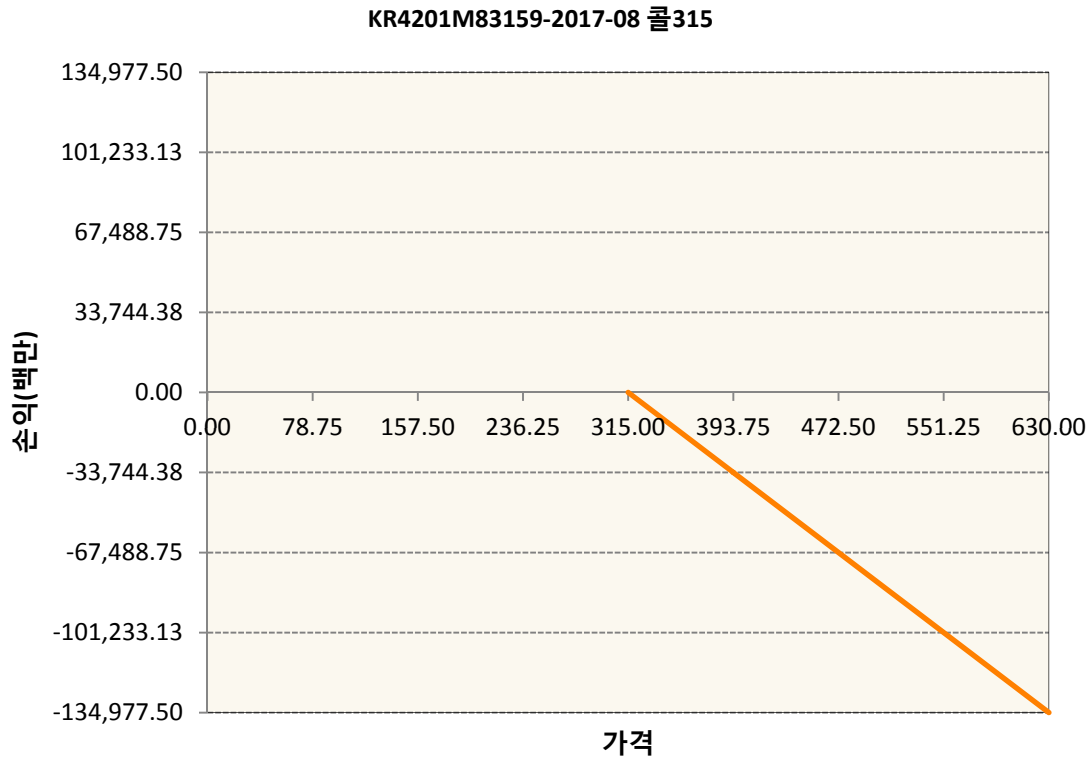
커버드콜모(주식혼합-파생형)

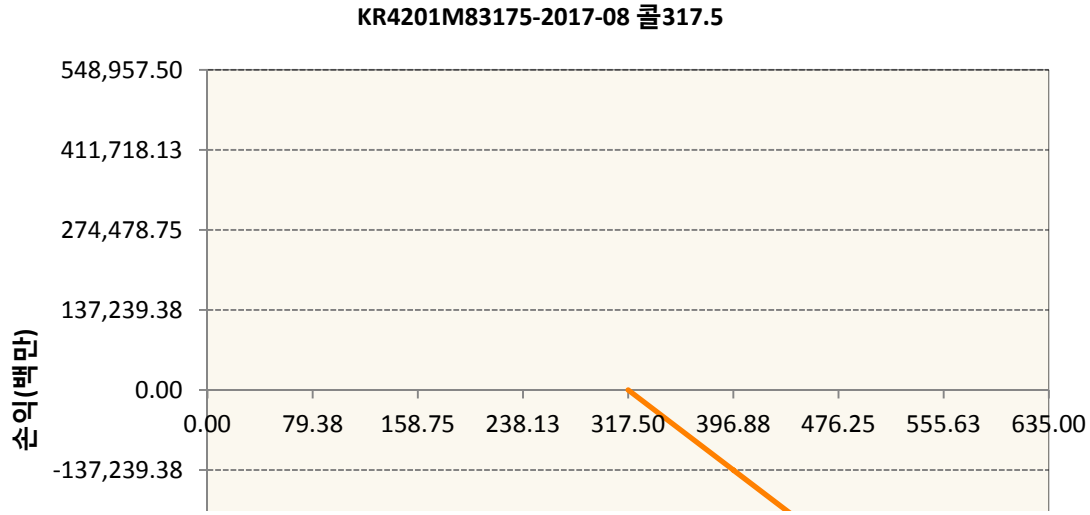
1. 계약금액

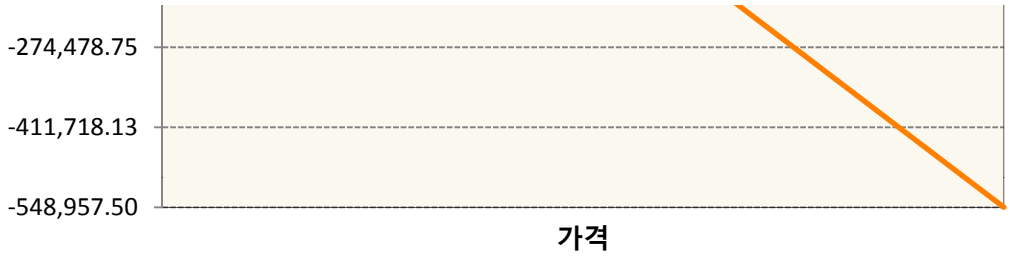
(단위:백만원)

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

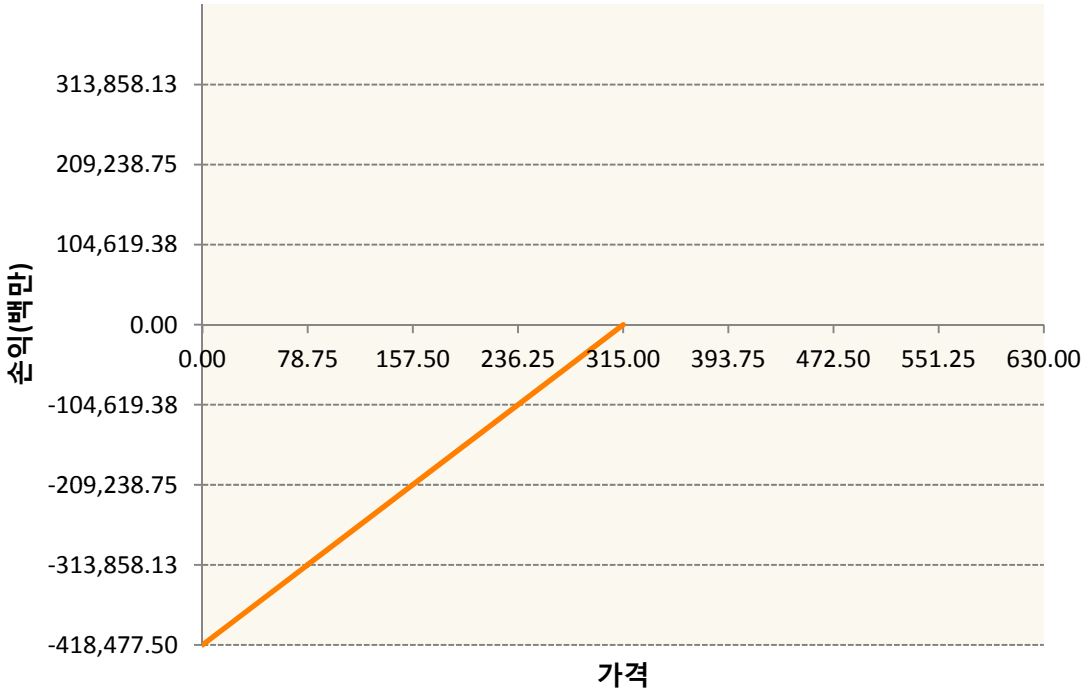
2. 만기시점의 손익구조



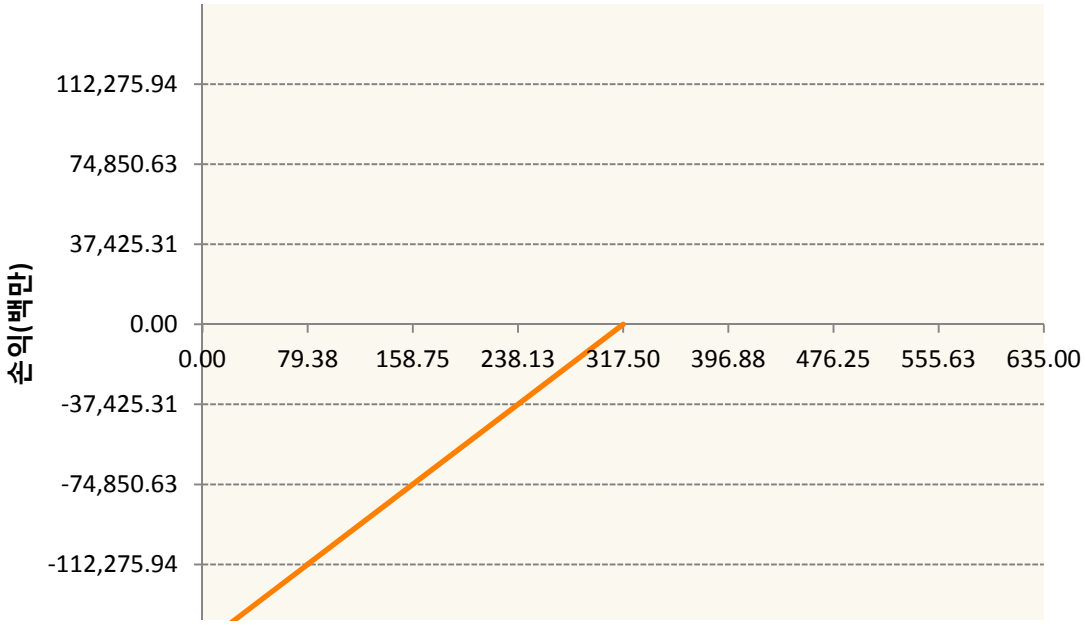




KR4301M83157-2017-08 풋315



KR4301M83173-2017-08 풋317.5





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4201M83: 2017-08 콜315							9,664
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	4,410	4,335	4,244	4,138	4,019	3,888	3,747
-5.33%	3,964	3,797	3,620	3,435	3,244	3,047	2,847
-2.67%	2,788	2,556	2,324	2,091	1,858	1,625	1,391
0%	638	430	217	0	-220	-443	-667
2.67%	-2,341	-2,465	-2,606	-2,759	-2,924	-3,097	-3,279
5.33%	-5,784	-5,835	-5,903	-5,988	-6,087	-6,199	-6,324
8.00%	-9,402	-9,418	-9,442	-9,479	-9,528	-9,589	-9,664
KR4201M83: 2017-08 콜317.5							37,695
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	15,312	15,089	14,801	14,451	14,045	13,589	13,088
-5.33%	14,035	13,467	12,844	12,178	11,476	10,744	9,989
-2.67%	10,283	9,383	8,475	7,560	6,640	5,716	4,789
0%	2,764	1,850	928	0	-933	-1,871	-2,812
2.67%	-8,399	-9,015	-9,685	-10,398	-11,146	-11,923	-12,723
5.33%	-21,873	-22,158	-22,516	-22,939	-23,421	-23,955	-24,535
8.00%	-36,334	-36,428	-36,572	-36,770	-37,024	-37,333	-37,695
KR4301M83: 2017-08 풋315							24,314
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-24,253	-24,254	-24,257	-24,262	-24,272	-24,289	-24,314
-5.33%	-12,930	-12,986	-13,063	-13,160	-13,276	-13,409	-13,559
-2.67%	-3,287	-3,588	-3,892	-4,198	-4,506	-4,815	-5,125
0%	542	382	200	0	-215	-443	-681
2.67%	907	897	878	847	803	745	671
5.33%	913	913	913	912	909	903	893
8.00%	913	913	913	913	913	913	912
KR4301M83: 2017-08 풋317.5							9,526
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-9,516	-9,517	-9,517	-9,517	-9,519	-9,522	-9,526
-5.33%	-5,480	-5,488	-5,501	-5,520	-5,545	-5,575	-5,611
-2.67%	-1,740	-1,825	-1,914	-2,007	-2,103	-2,201	-2,301
0%	273	186	95	0	-98	-197	-299
2.67%	584	574	557	535	506	471	430

5.33%	593	593	592	591	588	584	576
8.00%	593	593	593	593	593	593	592

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

83,237

공시일	2017-07-24
기준일	2017-07-21

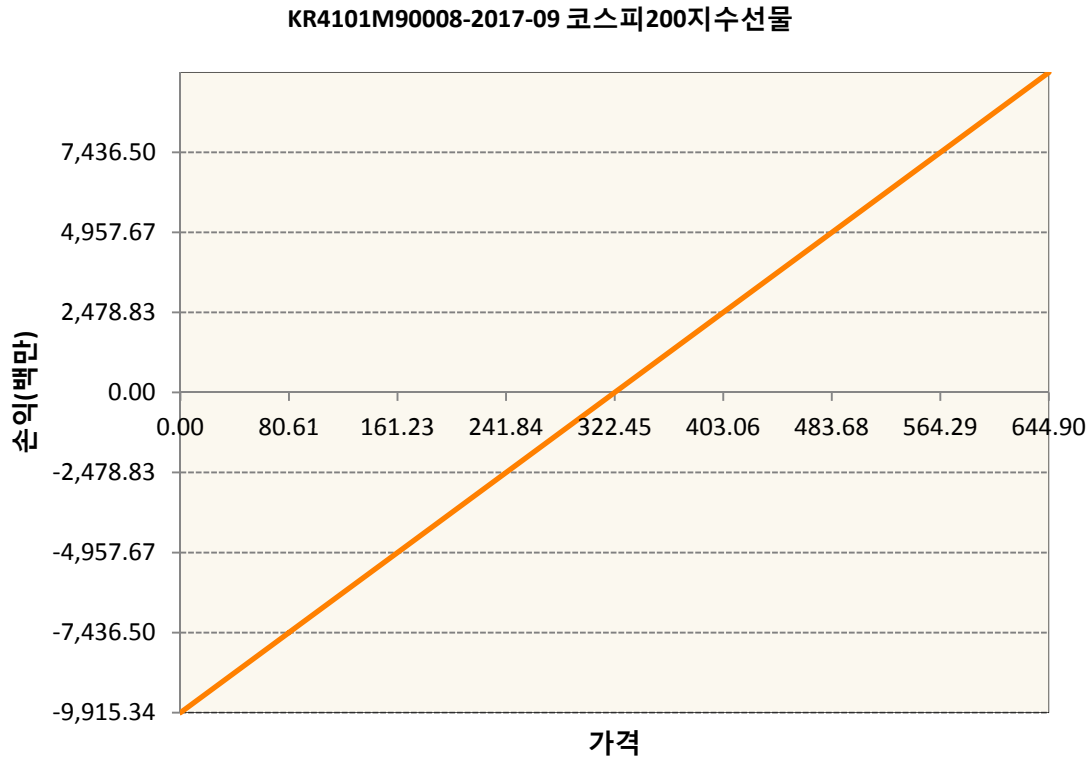
ETF스마트레버리지목표전환형6호

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	9,915	0	9,915	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101M90(2017-09 코스피200지수선물							792
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-792	-792	-792	-792	-792	-792	-792
-5.33%	-528	-528	-528	-528	-528	-528	-528
-2.67%	-264	-264	-264	-264	-264	-264	-264
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	264	264	264	264	264	264	264
5.33%	528	528	528	528	528	528	528
8.00%	792	792	792	792	792	792	792

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

474

공시일	2017-07-24
기준일	2017-07-21

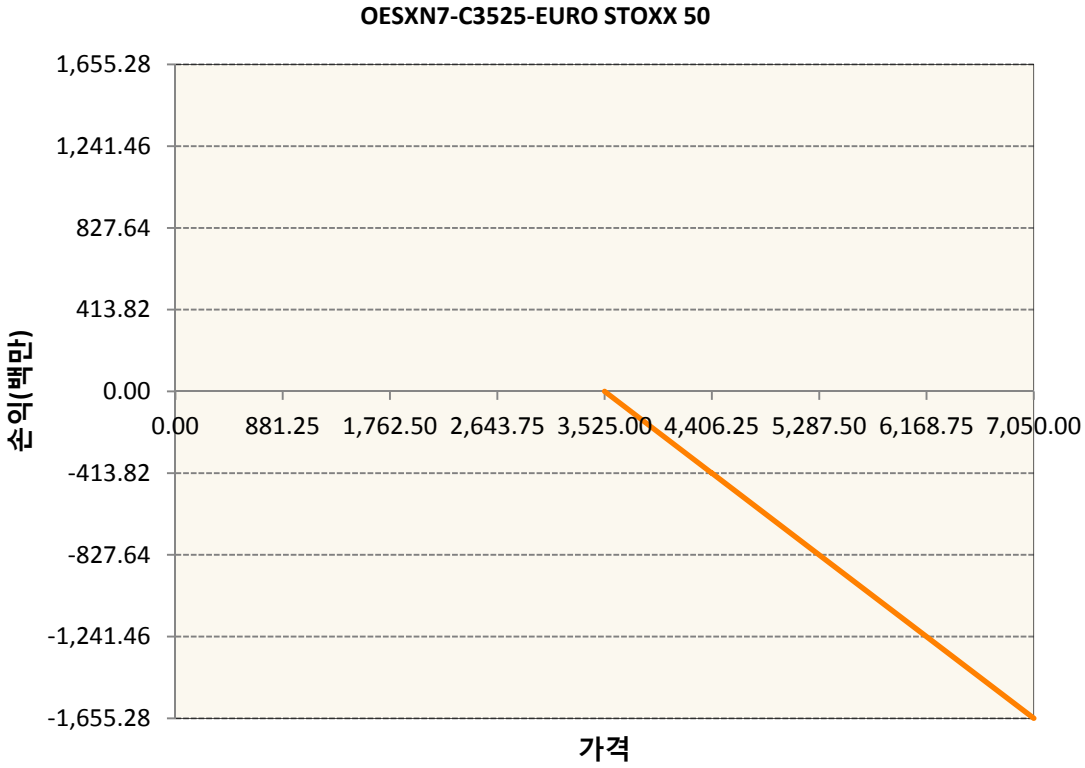
유로커버드콜(주식혼합-파생형)

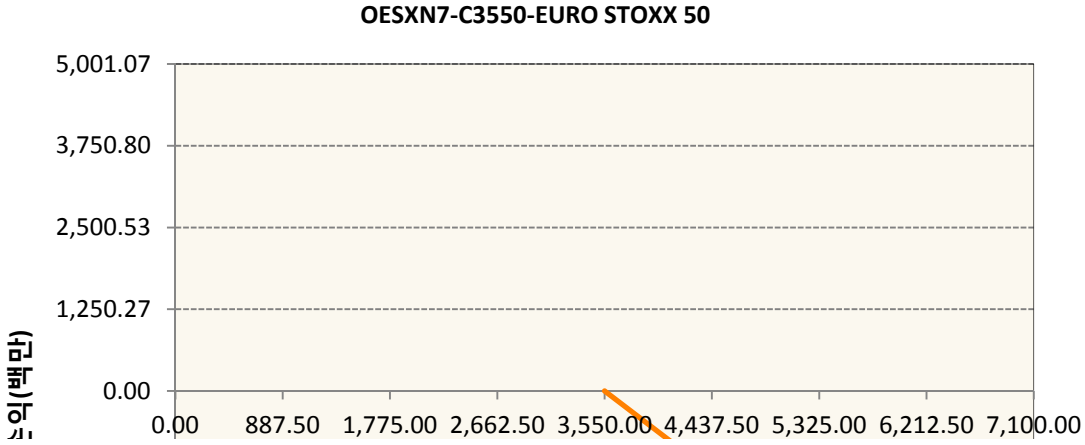
1. 계약금액

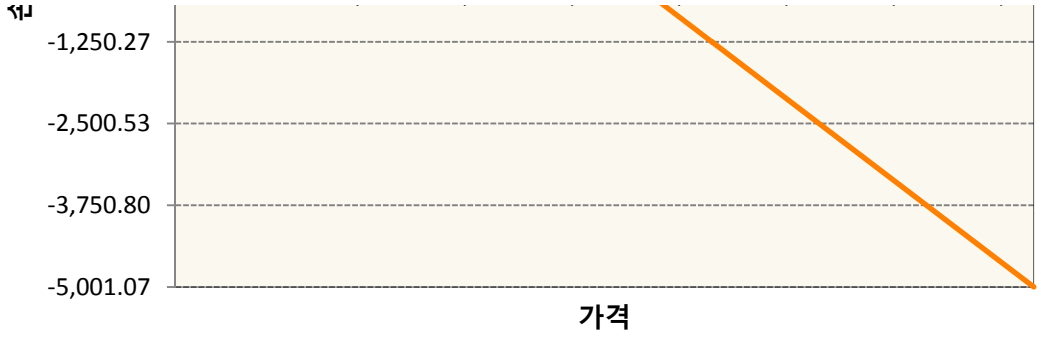
(단위:백만원)

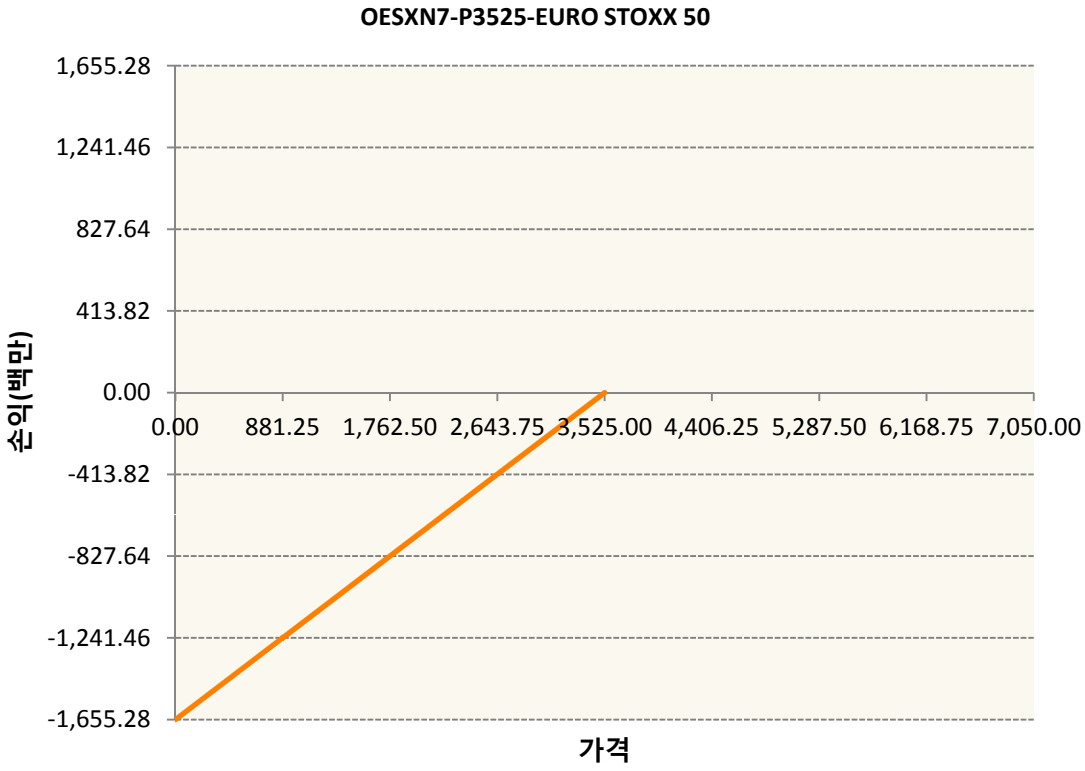
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	7,559	0	7,559	
누계	유가증권	옵션	0	13,313	-13,313	장내

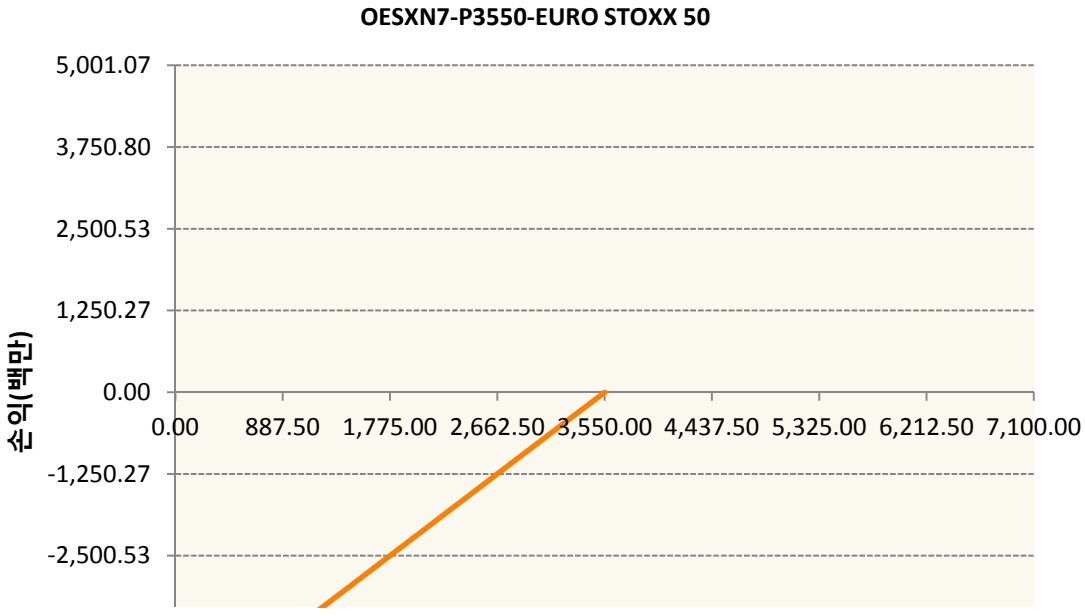
2. 만기시점의 손익구조

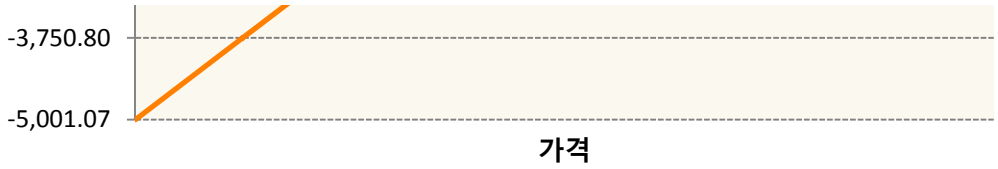


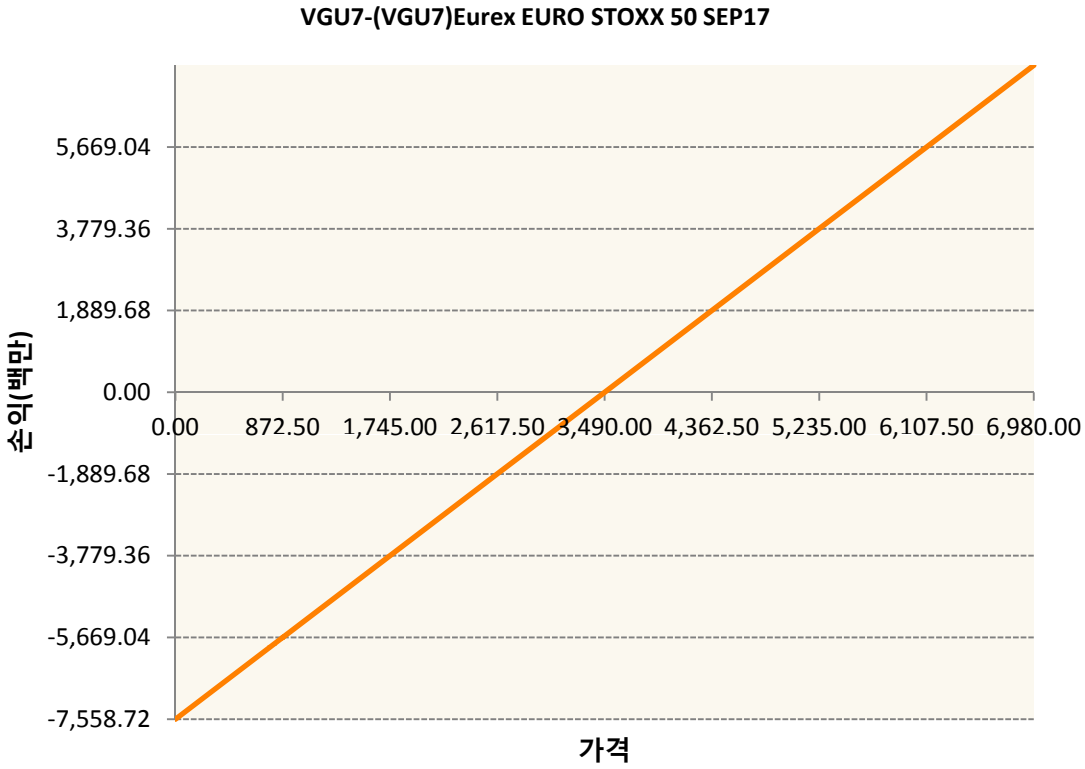



-1,250.27
-2,500.53
-3,750.80
-5,001.07
가격


OESXN7-P3525-EURO STOXX 50
1,655.28
1,241.46
827.64
413.82
0.00
-413.82
-827.64
-1,241.46
-1,655.28
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
5,001.07
3,750.80
2,500.53
1,250.27
0.00
-1,250.27
-2,500.53
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	400
OESXN7-P3!	EURO STOXX 50	132
OESXN7-P3!	EURO STOXX 50	400
VGU7	(VGU7)Eurex EURO STOXX 50 SEP17	605

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,399

공시일	2017-07-24
기준일	2017-07-21

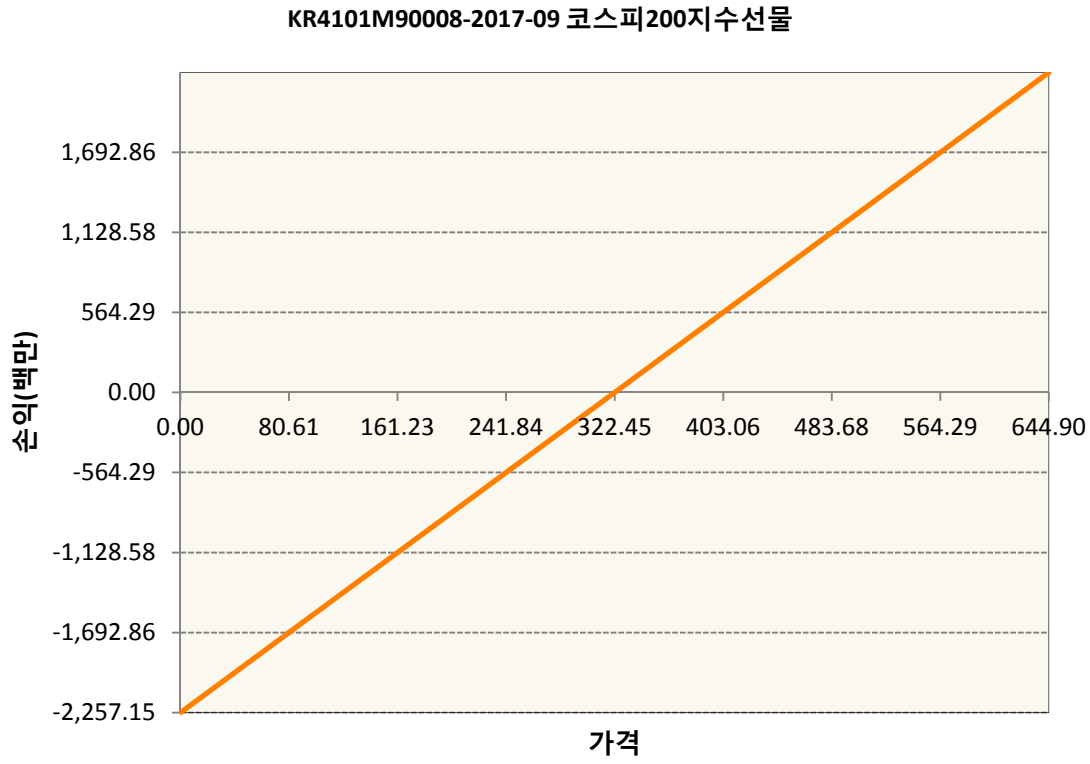
ETF스마트레버리지목표전환형7호

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	2,257	0	2,257	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	2017-07-24
기준일	2017-07-21

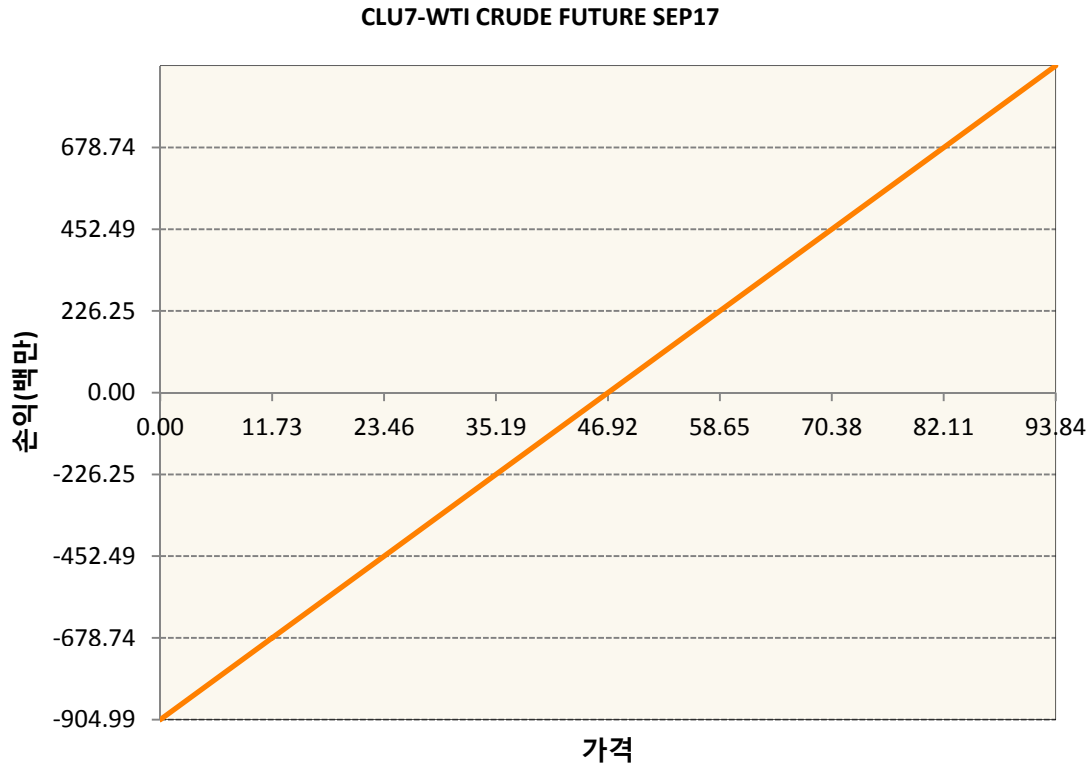
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

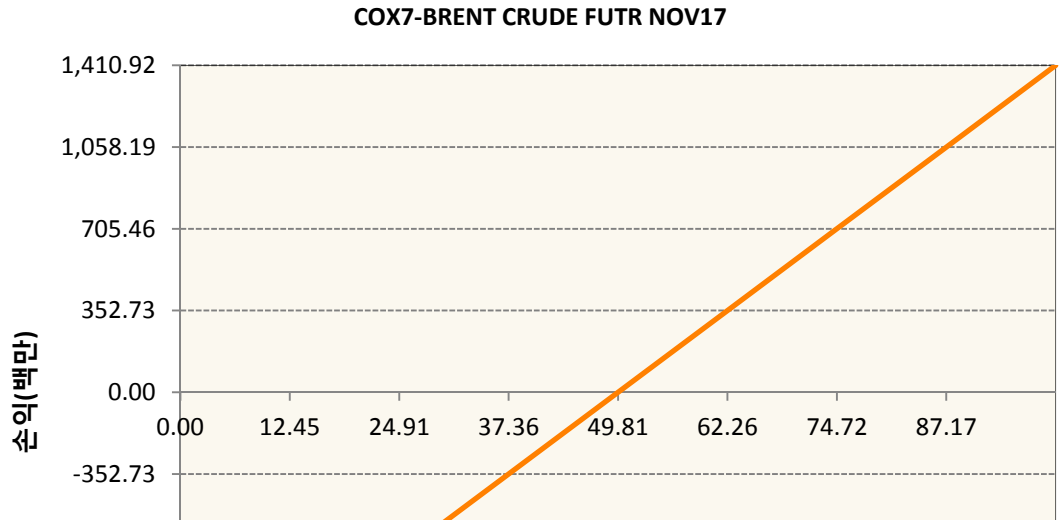
1. 계약금액

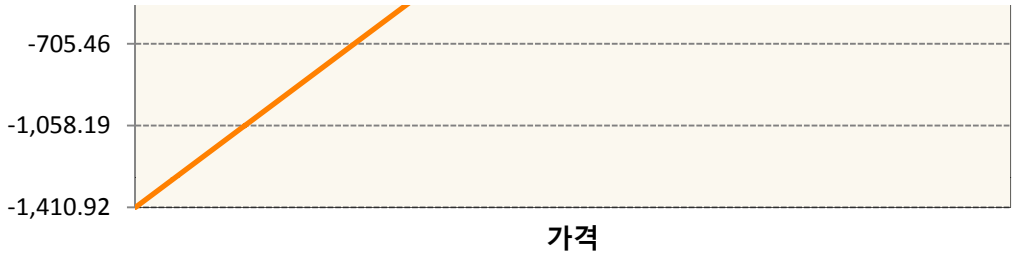
(단위:백만원)

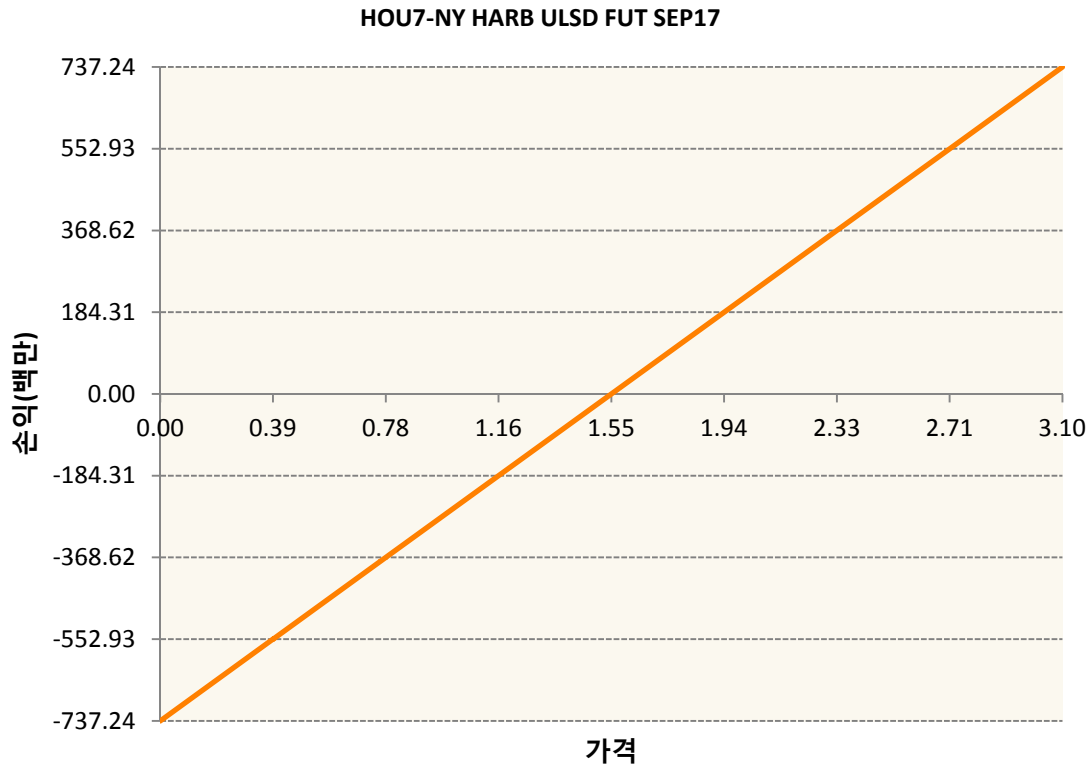
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	5,247	224	5,024	

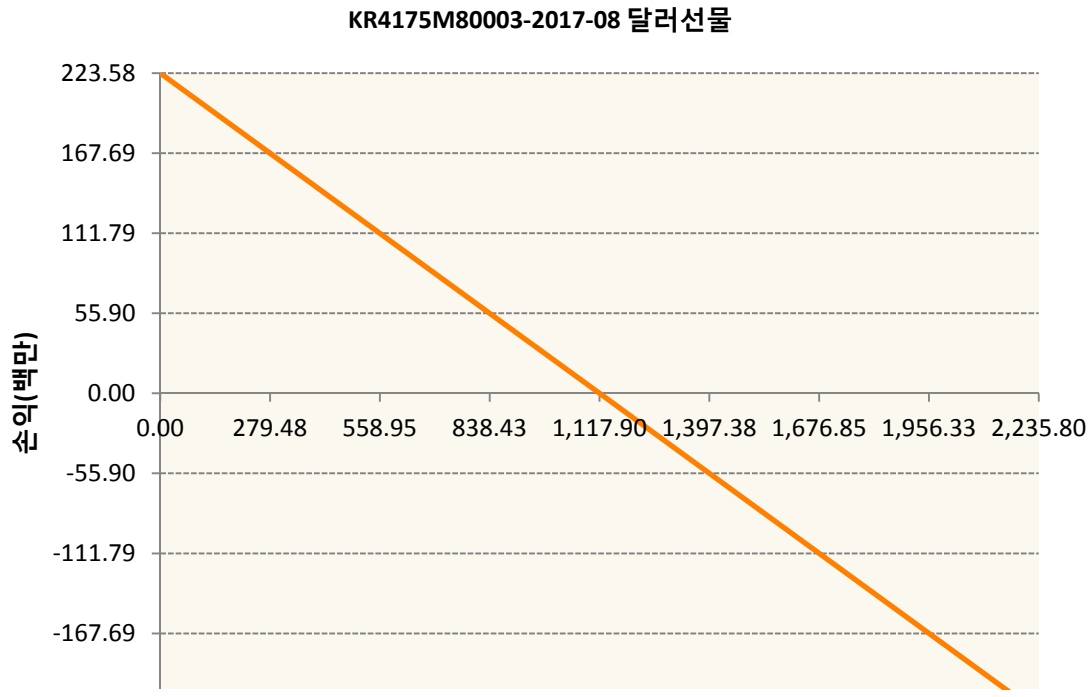
2. 만기시점의 손익구조

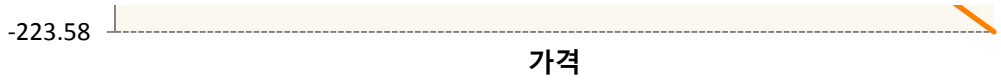


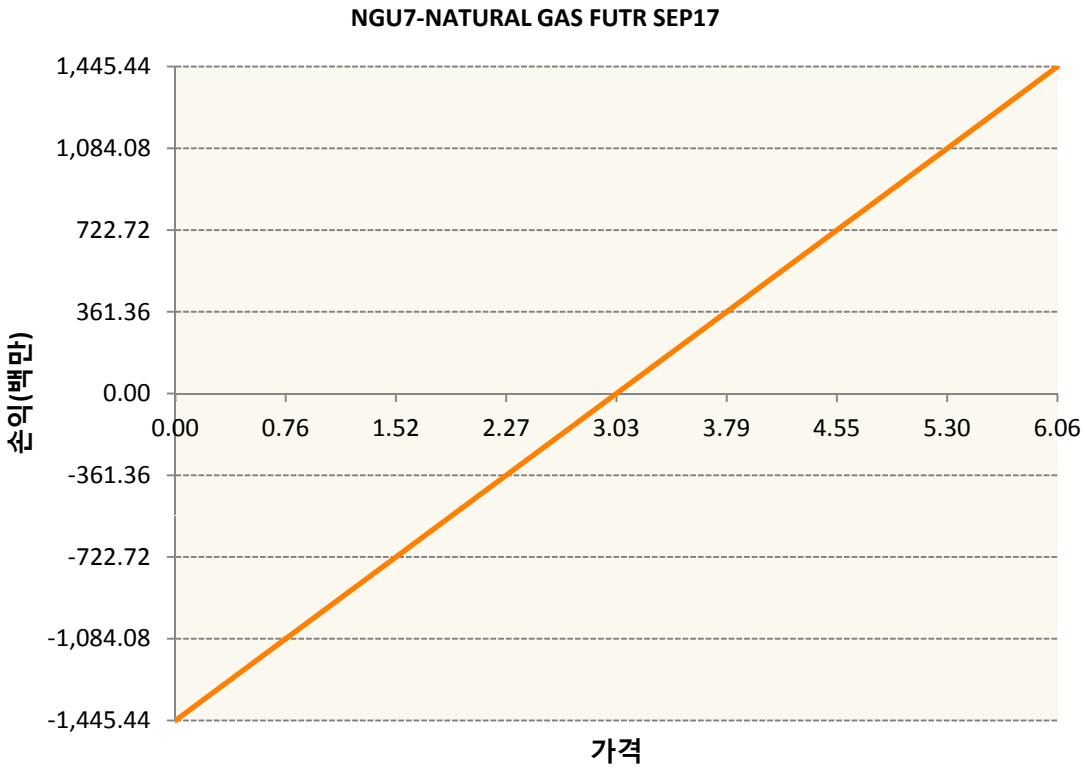


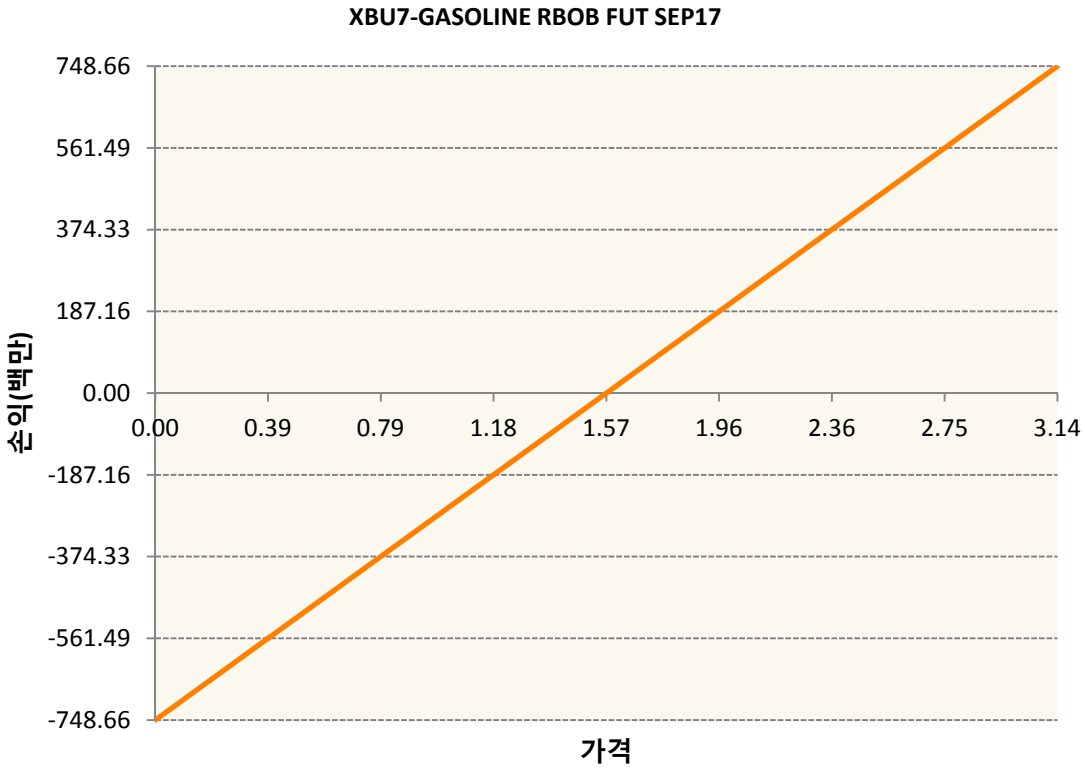

-705.46
-1,058.19
-1,410.92
가격


HOU7-NY HARB ULSD FUT SEP17
737.24
552.93
368.62
184.31
0.00
-184.31
-368.62
-552.93
-737.24
0.00
0.39
0.78
1.16
1.55
1.94
2.33
2.71
3.10
손익(백만)
가격


KR4175M80003-2017-08 달러선물
223.58
167.69
111.79
55.90
0.00
-55.90
-111.79
-167.69
0.00
279.48
558.95
838.43
1,117.90
1,397.38
1,676.85
1,956.33
2,235.80
손익(백만)


-223.58
가격


NGU7-NATURAL GAS FUTR SEP17
1,445.44
1,084.08
722.72
361.36
0.00
-361.36
-722.72
-1,084.08
-1,445.44
0.00
0.76
1.52
2.27
3.03
3.79
4.55
5.30
6.06
손익(백만)
가격


XBU7-GASOLINE RBOB FUT SEP17
748.66
561.49
374.33
187.16
0.00
-187.16
-374.33
-561.49
-748.66
0.00
0.39
0.79
1.18
1.57
1.96
2.36
2.75
3.14
손익(백만)
가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLU7	WTI CRUDE FUTURE SEP17	72
COX7	BRENT CRUDE FUTR NOV17	113
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)

784

공시일	2017-07-24
기준일	2017-07-21

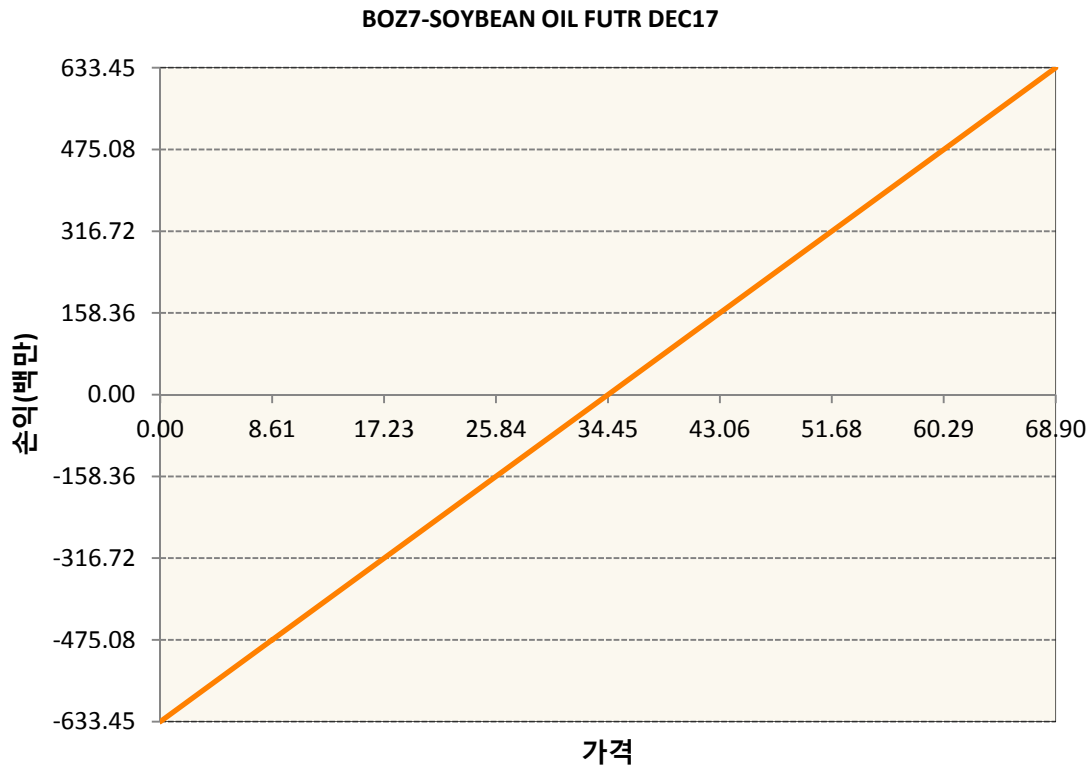
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

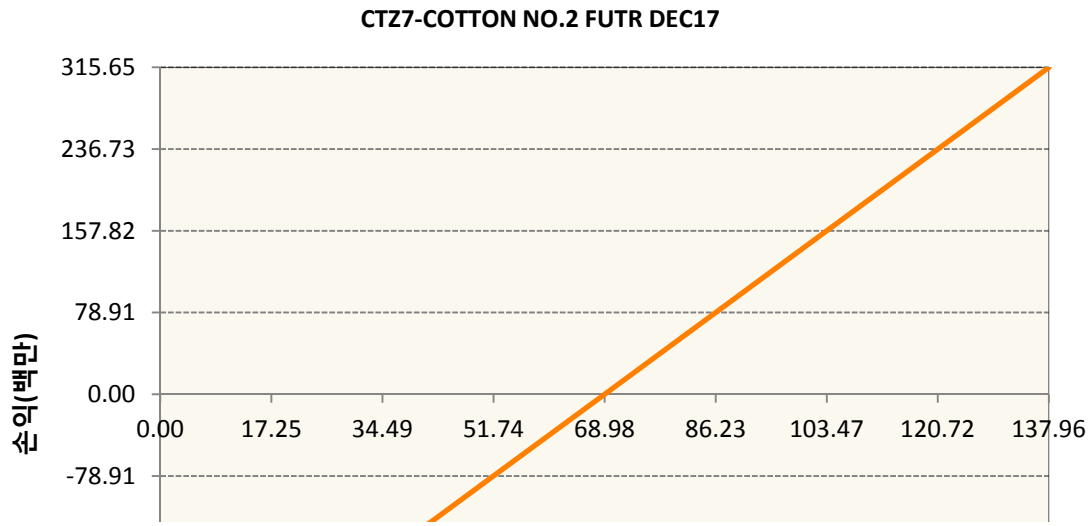
1. 계약금액

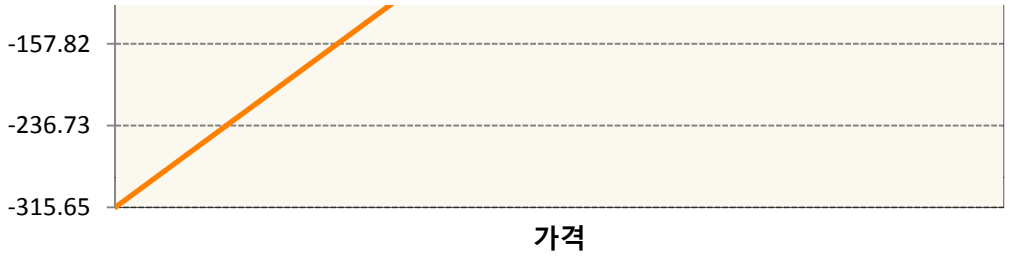
(단위:백만원)

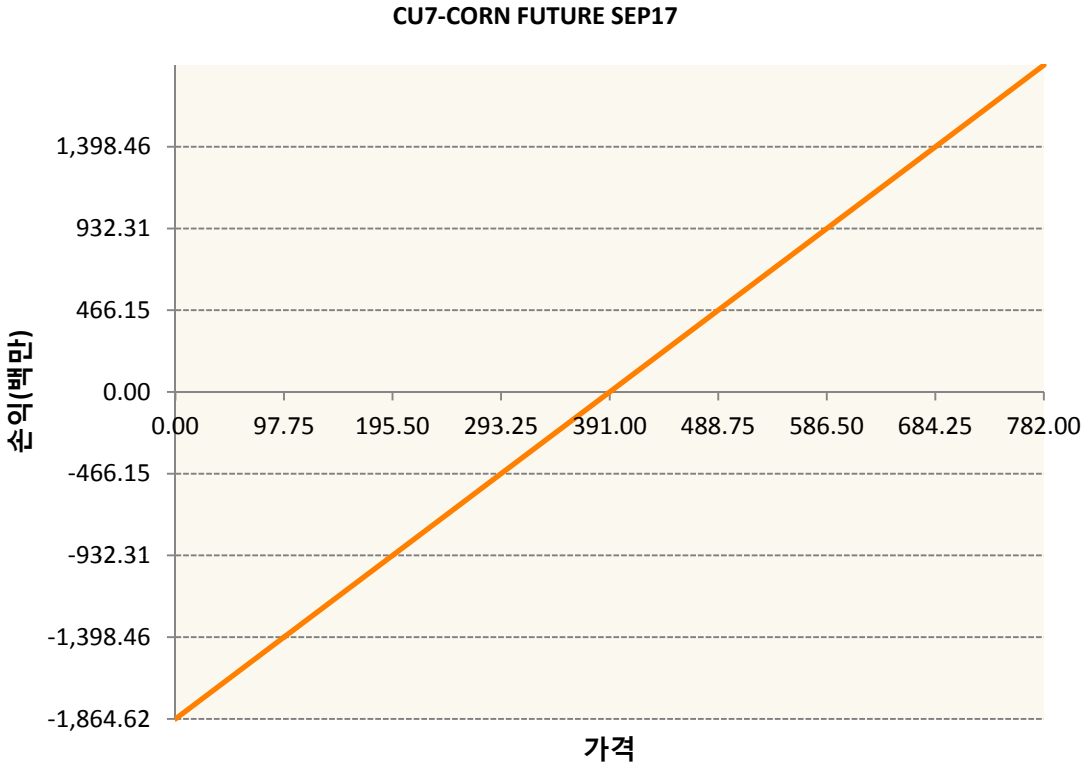
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	7,239	391	6,848	

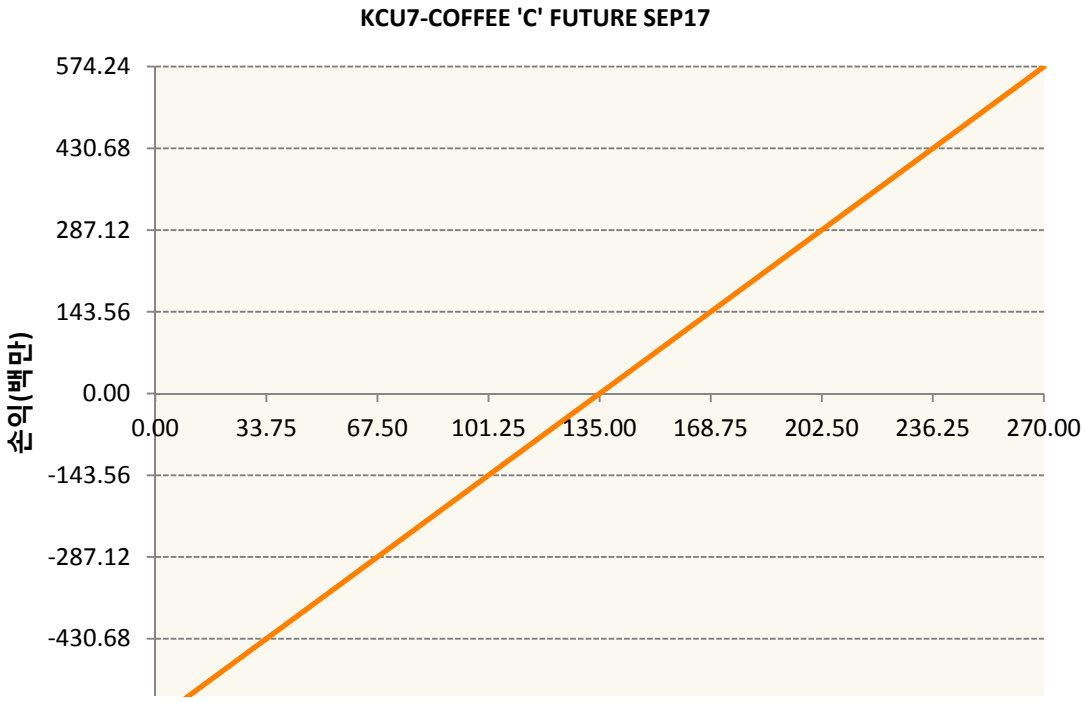
2. 만기시점의 손익구조

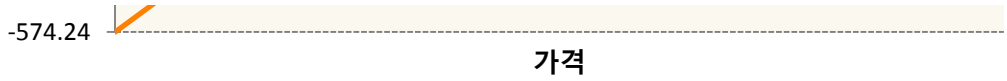


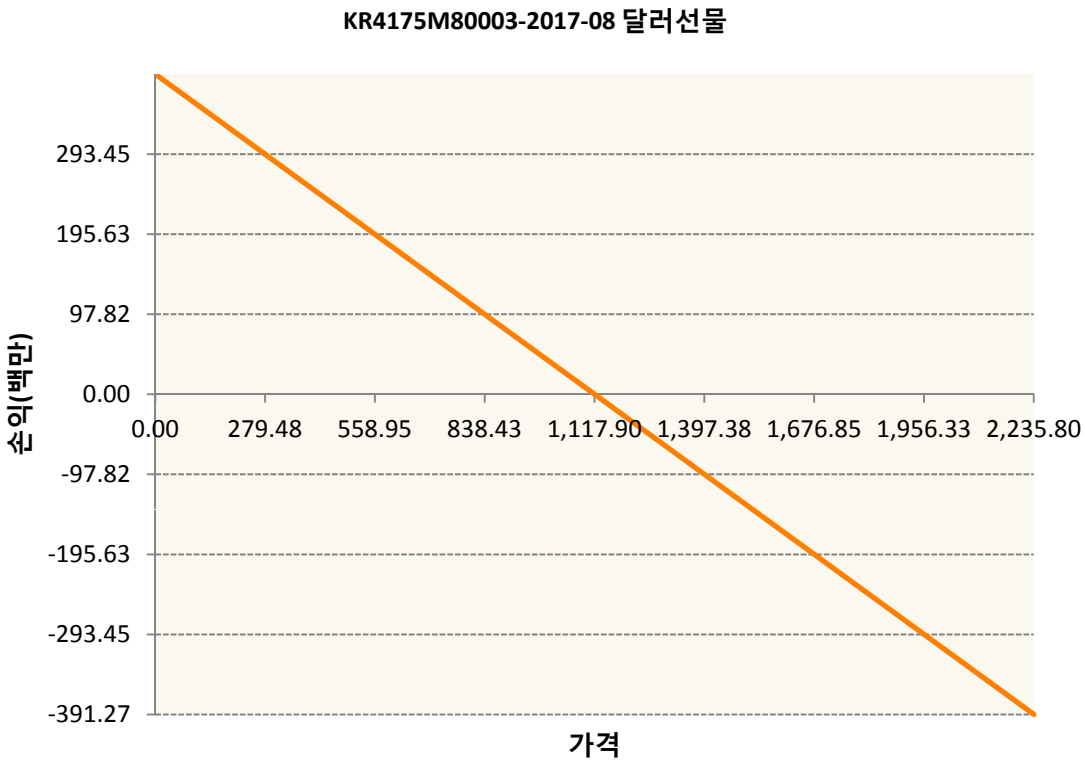


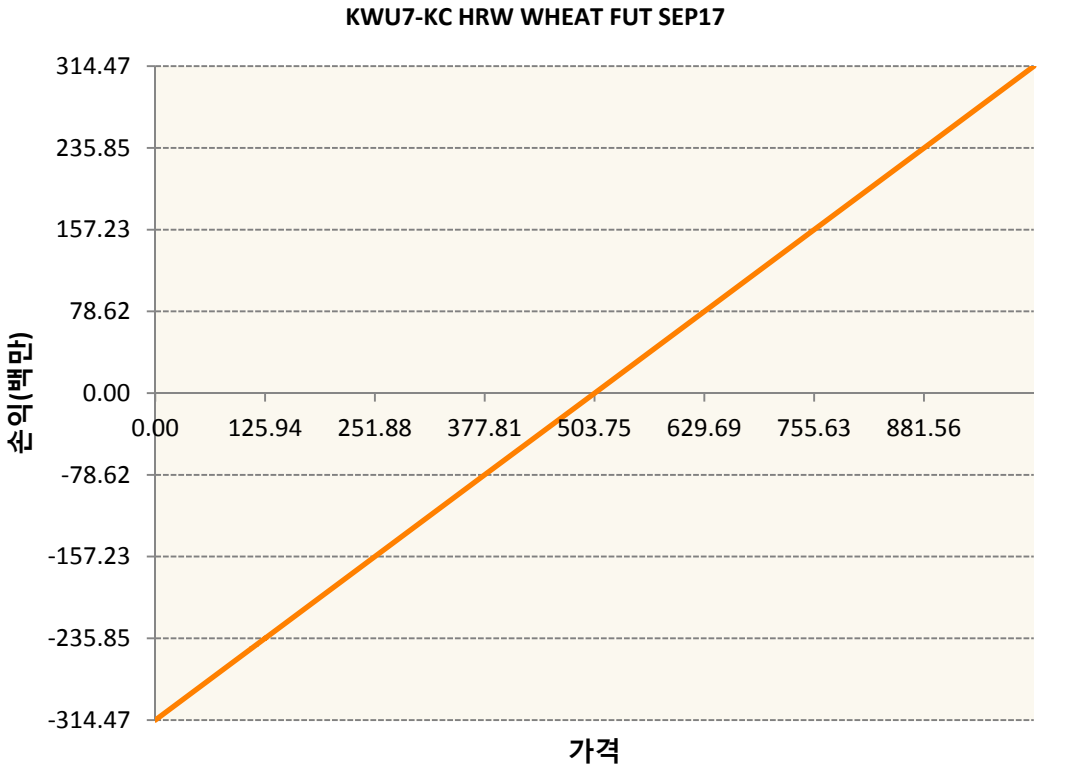

-157.82
-236.73
-315.65
가격

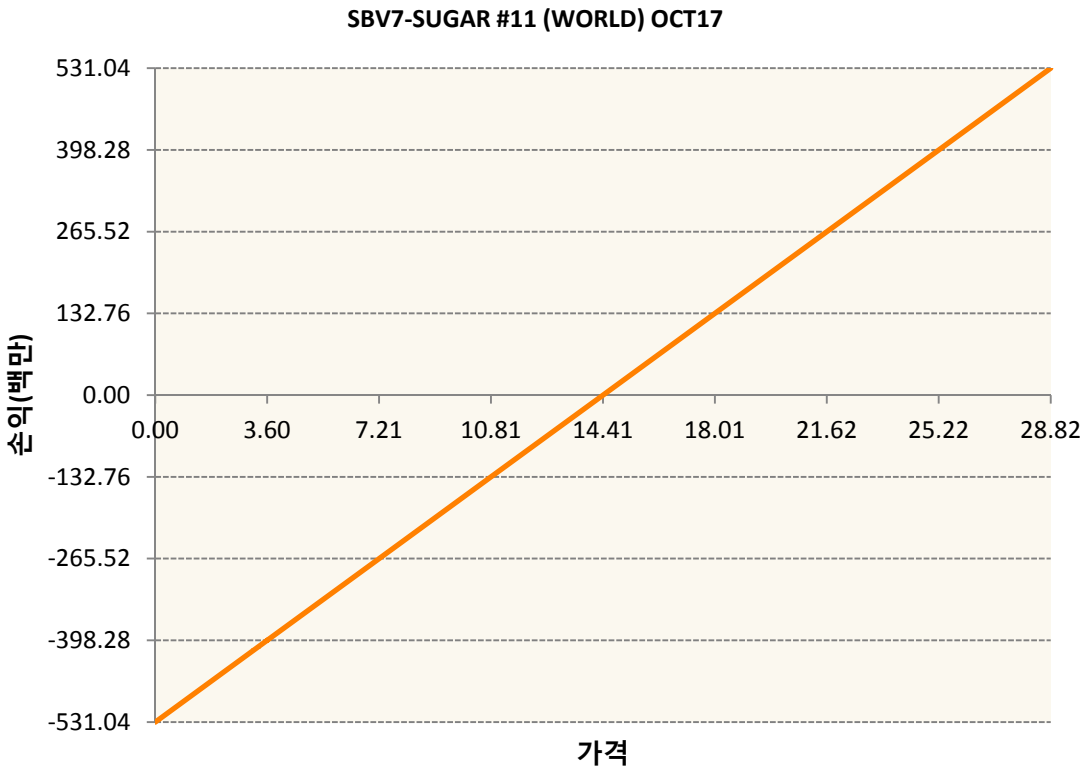

CU7-CORN FUTURE SEP17
1,398.46
932.31
466.15
0.00
-466.15
-932.31
-1,398.46
-1,864.62
손익(백만)
0.00
97.75
195.50
293.25
391.00
488.75
586.50
684.25
782.00
가격

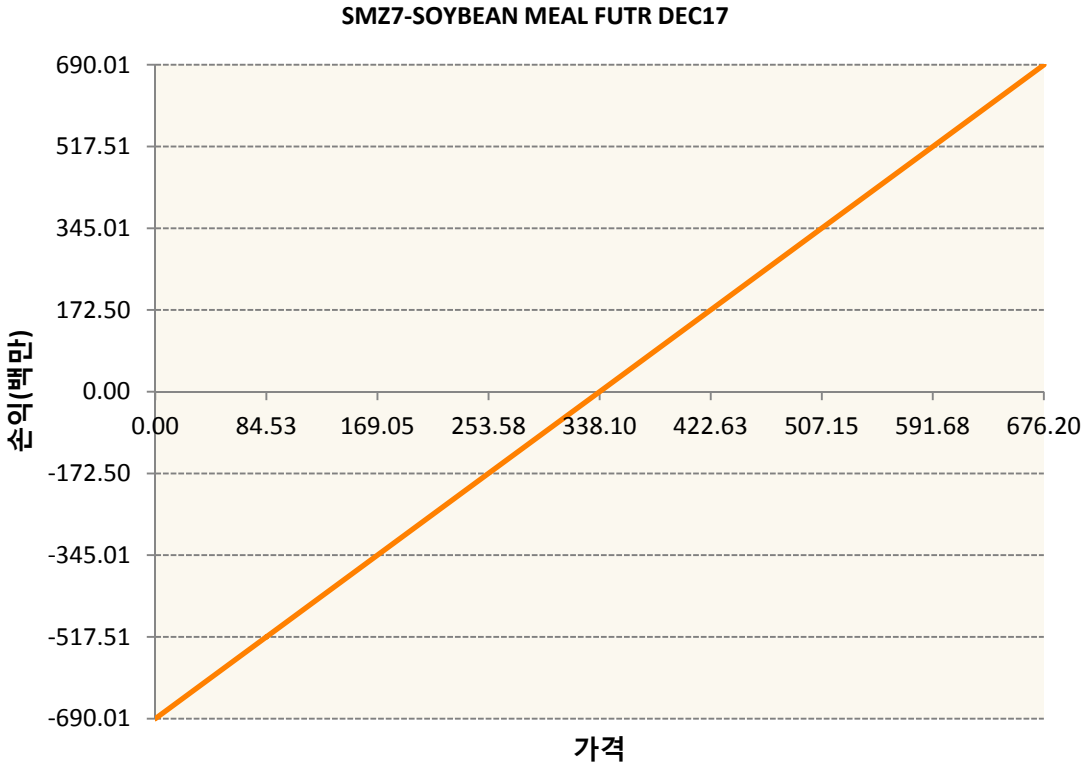

KCU7-COFFEE 'C' FUTURE SEP17
574.24
430.68
287.12
143.56
0.00
-143.56
-287.12
-430.68
손익(백만)
0.00
33.75
67.50
101.25
135.00
168.75
202.50
236.25
270.00

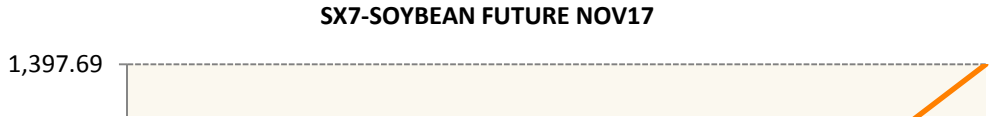

-574.24
가격

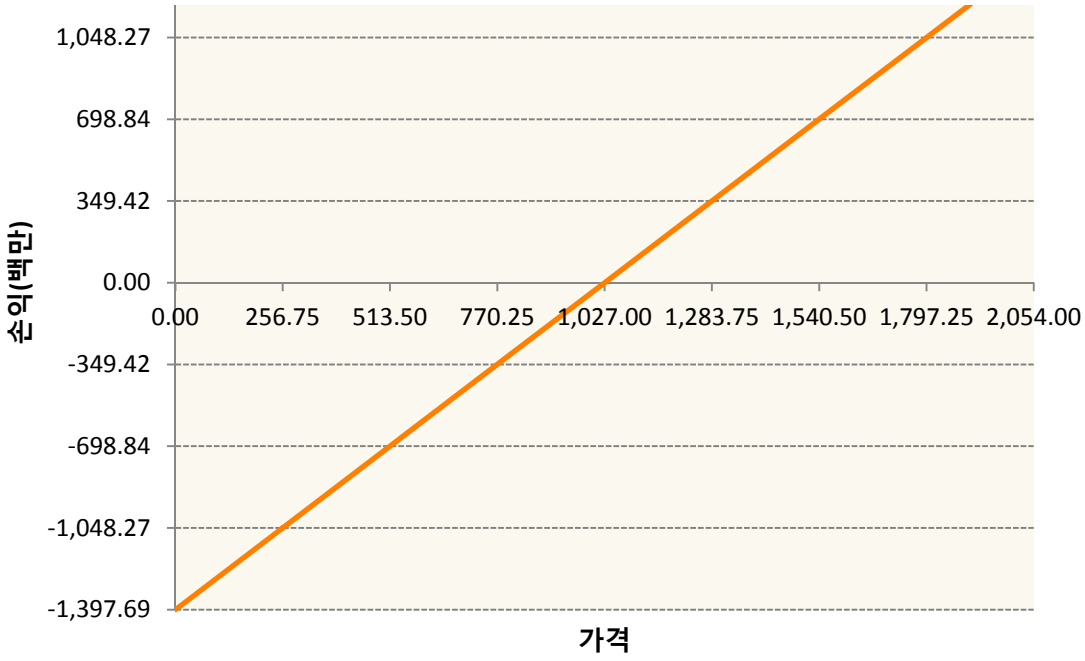

KR4175M80003-2017-08 달러선물
293.45
195.63
97.82
0.00
-97.82
-195.63
-293.45
-391.27
0.00
279.48
558.95
838.43
1,117.90
1,397.38
1,676.85
1,956.33
2,235.80
손익(백만)
가격

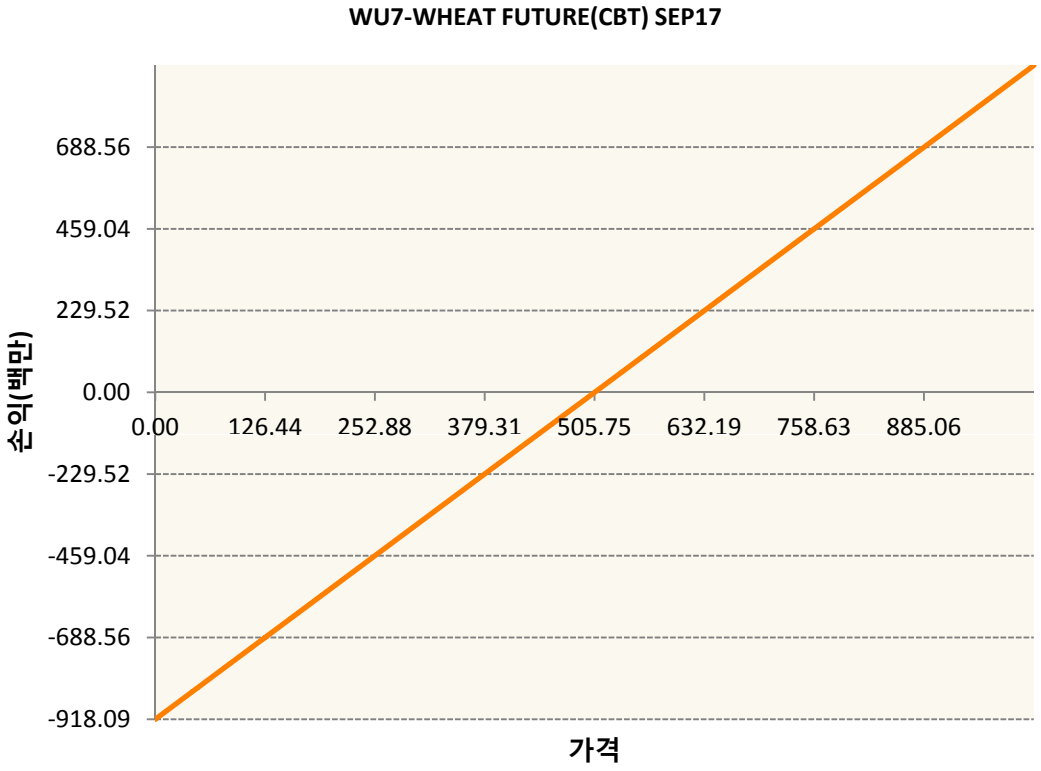

KWU7-KC HRW WHEAT FUT SEP17
314.47
235.85
157.23
78.62
0.00
-78.62
-157.23
-235.85
-314.47
0.00
125.94
251.88
377.81
503.75
629.69
755.63
881.56
손익(백만)
가격


SBV7-SUGAR #11 (WORLD) OCT17
531.04
398.28
265.52
132.76
0.00
-132.76
-265.52
-398.28
-531.04
0.00
3.60
7.21
10.81
14.41
18.01
21.62
25.22
28.82
손익(백만)
가격


SMZ7-SOYBEAN MEAL FUTR DEC17
690.01
517.51
345.01
172.50
0.00
-172.50
-345.01
-517.51
-690.01
0.00
84.53
169.05
253.58
338.10
422.63
507.15
591.68
676.20
손익(백만)
가격


SX7-SOYBEAN FUTURE NOV17
1,397.69





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

BOZ7	SOYBEAN OIL FUTR DEC17	51
CTZ7	COTTON NO.2 FUTR DEC17	25
CU7	CORN FUTURE SEP17	149
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	55
SX7	SOYBEAN FUTURE NOV17	112
WU7	WHEAT FUTURE(CBT) SEP17	73

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

678