공시일	2017-07-25
기준일	2017-07-24

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	2017-07-25
기준일	2017-07-24

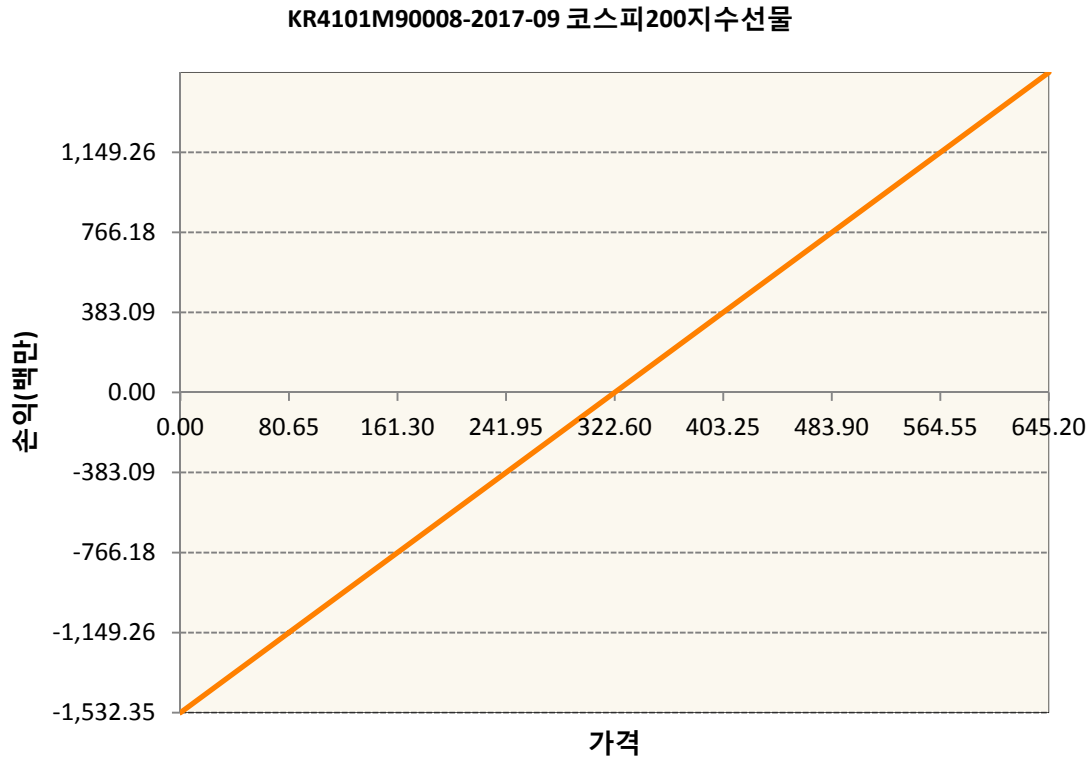
스마트인덱스모

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	2017-07-25
기준일	2017-07-24

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)

481

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-07-25
기준일	2017-07-24

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	385

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

341

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-07-25
기준일	2017-07-24

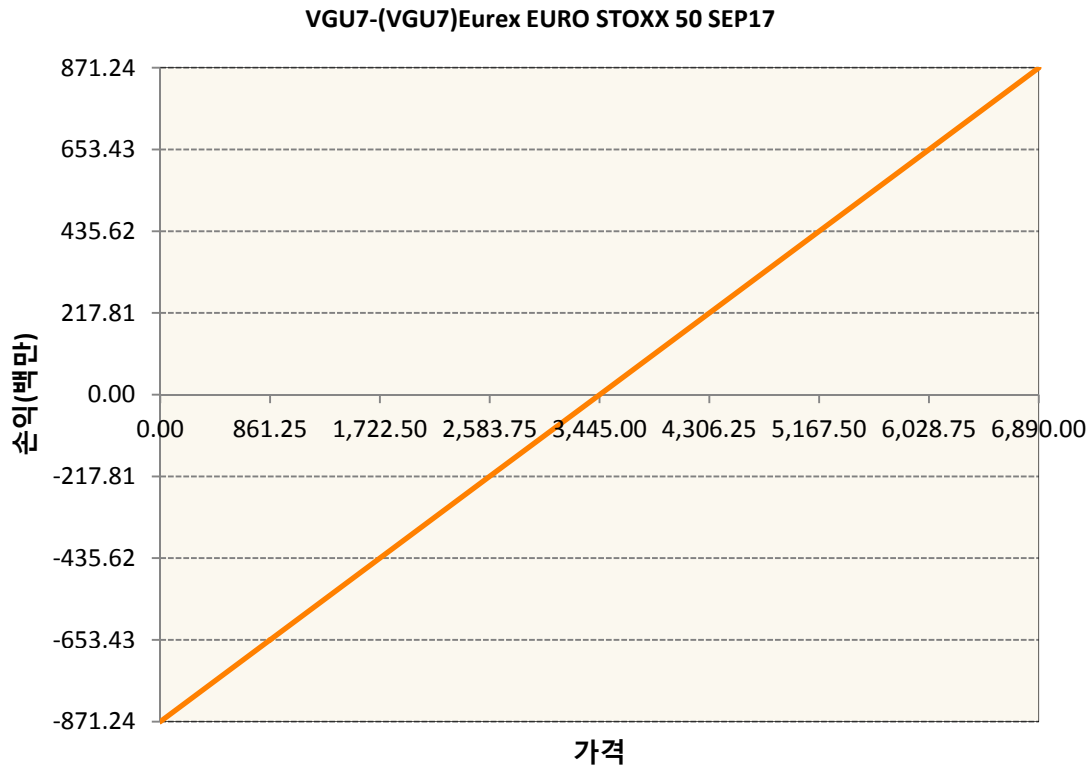
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	871	0	871	

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)

58

공시일	2017-07-25
기준일	2017-07-24

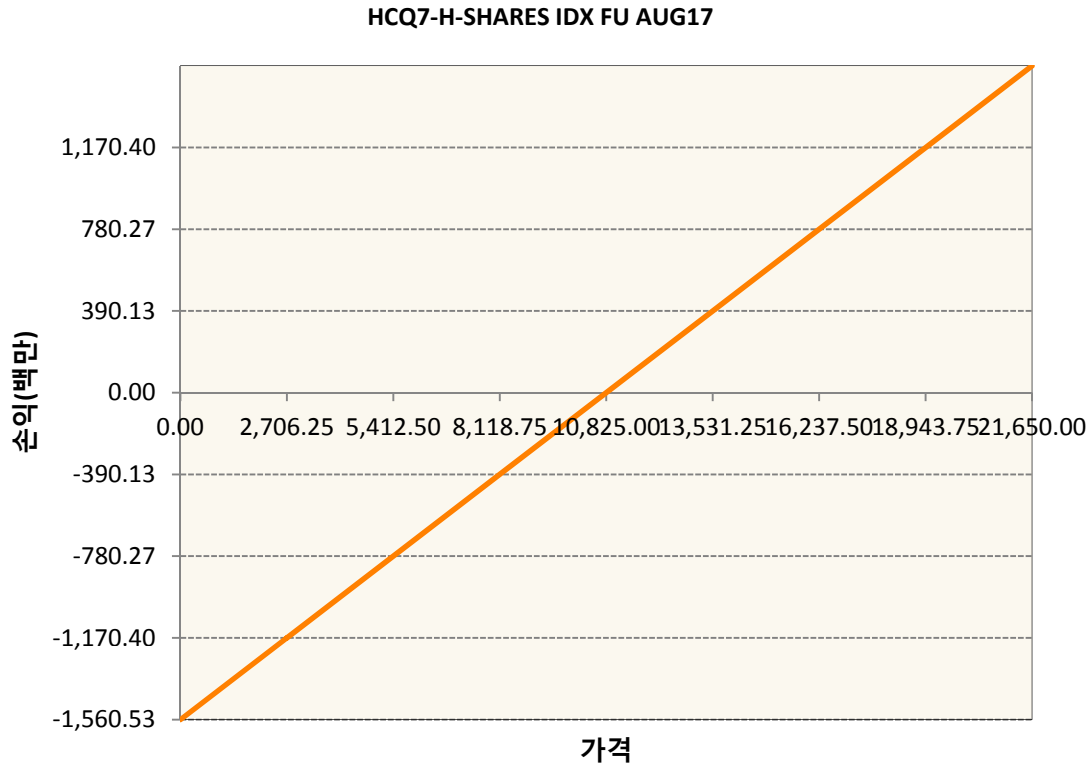
차이나인덱스모(주식-파생형)

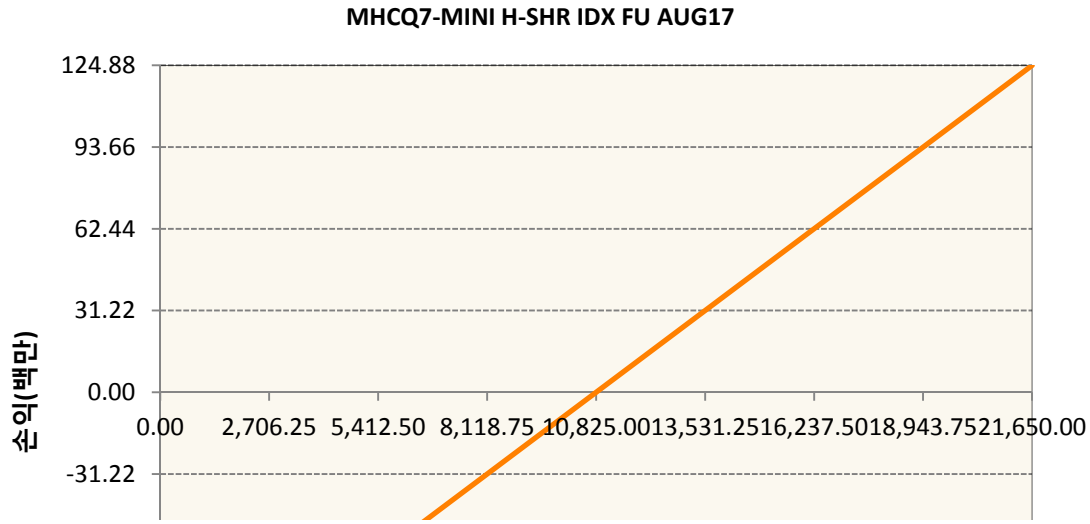
1. 계약금액

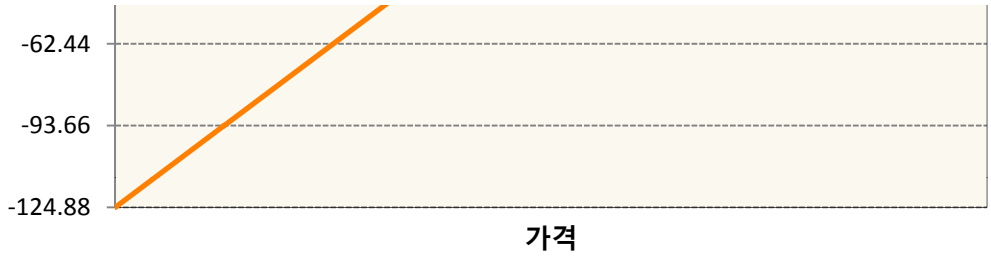
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,685	0	1,685	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	2017-07-25
기준일	2017-07-24

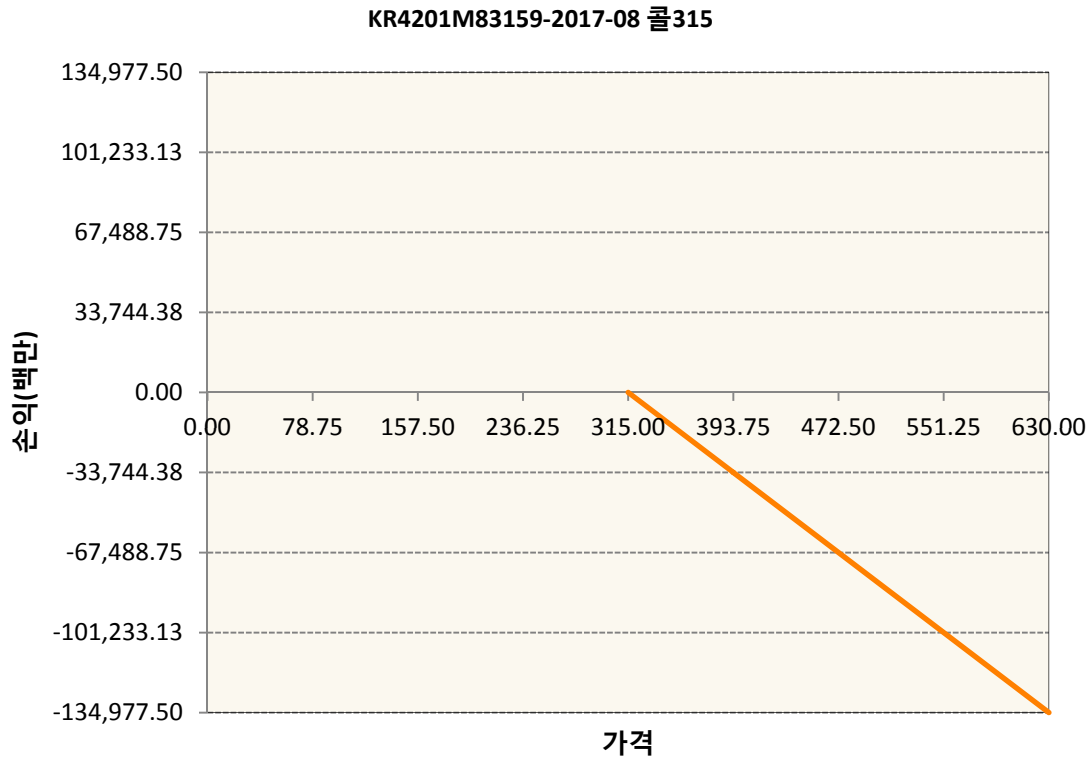
커버드콜모(주식혼합-파생형)

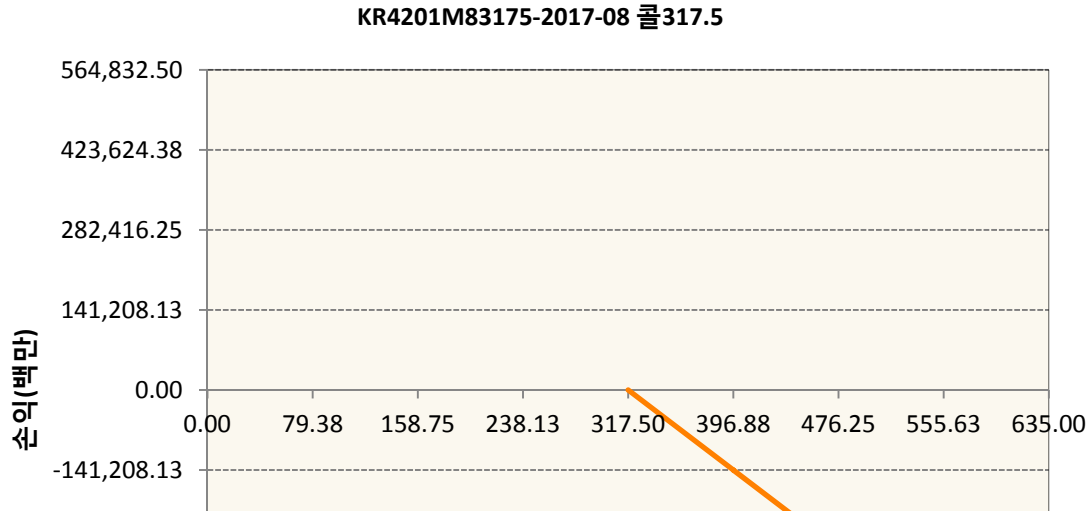
1. 계약금액

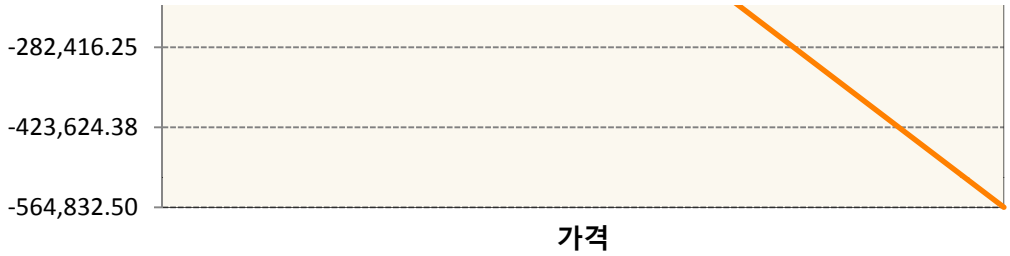
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	16,128	-16,128	장내
누계	유가증권	옵션	0	1,267,989	-1,267,989	장내

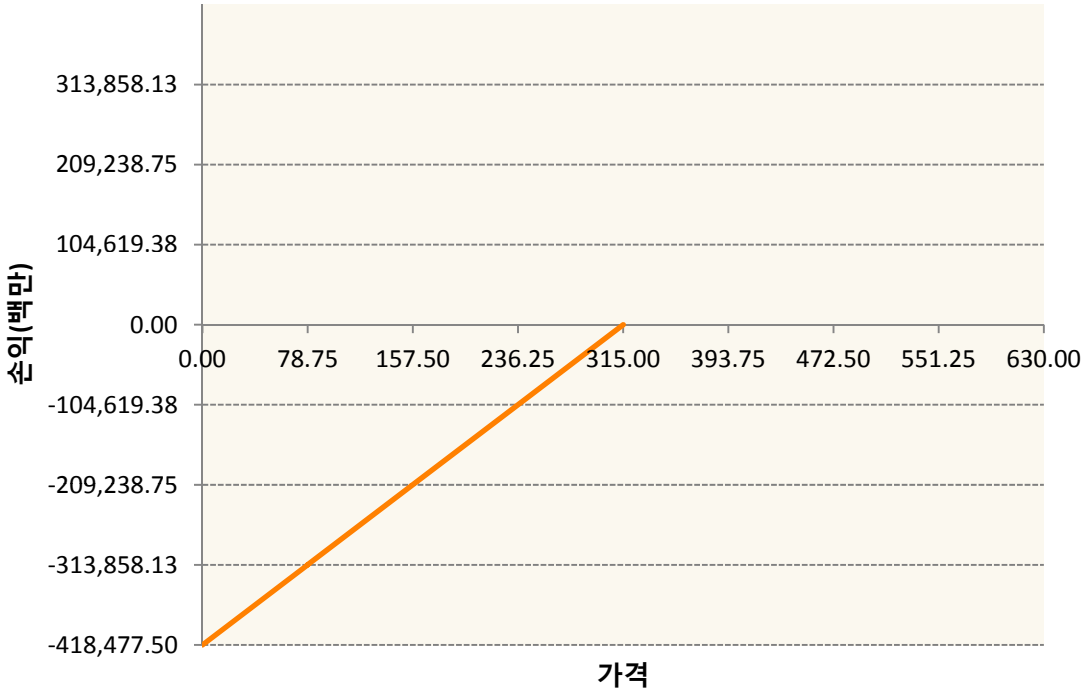
2. 만기시점의 손익구조



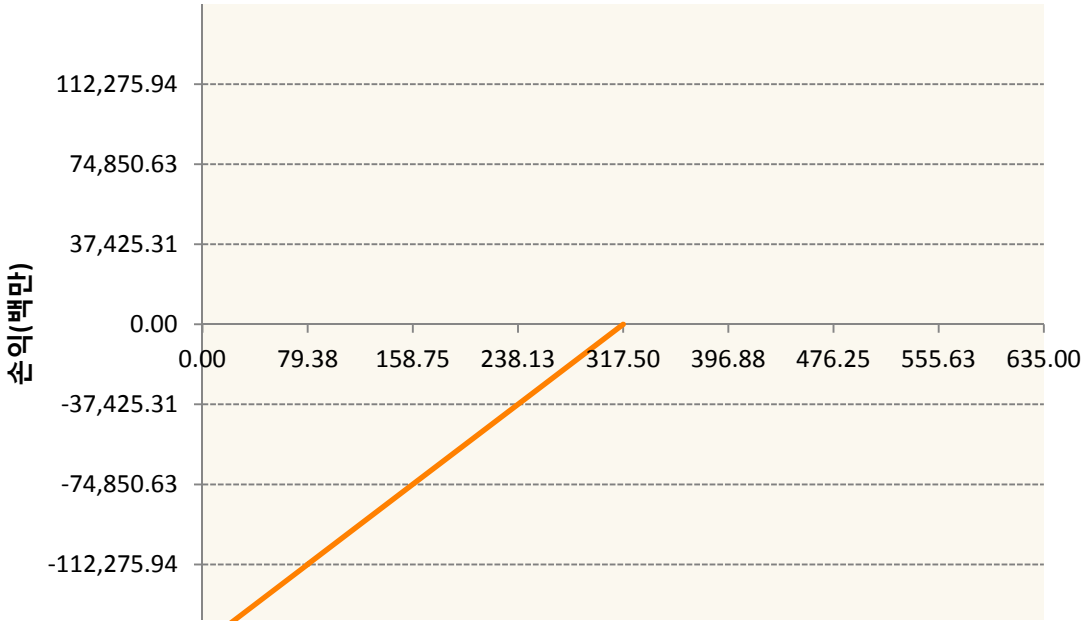




KR4301M83157-2017-08 풋315



KR4301M83173-2017-08 풋317.5





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201M83: 2017-08 콜315							9,813
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	4,311	4,253	4,180	4,092	3,992	3,880	3,759
-5.33%	3,920	3,772	3,614	3,448	3,275	3,097	2,915
-2.67%	2,772	2,557	2,342	2,127	1,912	1,696	1,481
0%	574	388	196	0	-199	-402	-606
2.67%	-2,490	-2,590	-2,706	-2,835	-2,976	-3,126	-3,284
5.33%	-5,992	-6,027	-6,076	-6,140	-6,216	-6,306	-6,407
8.00%	-9,635	-9,644	-9,658	-9,682	-9,715	-9,759	-9,813
KR4201M83: 2017-08 콜317.5							39,400
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	15,227	15,056	14,826	14,539	14,198	13,808	13,374
-5.33%	14,121	13,616	13,056	12,451	11,810	11,137	10,439
-2.67%	10,438	9,586	8,725	7,857	6,984	6,108	5,227
0%	2,593	1,738	873	0	-879	-1,763	-2,651
2.67%	-9,231	-9,762	-10,349	-10,983	-11,655	-12,358	-13,087
5.33%	-23,387	-23,599	-23,877	-24,218	-24,615	-25,064	-25,560
8.00%	-38,407	-38,464	-38,558	-38,697	-38,883	-39,117	-39,400
KR4301M83: 2017-08 풋315							24,259
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-24,225	-24,225	-24,226	-24,229	-24,234	-24,244	-24,259
-5.33%	-12,869	-12,910	-12,968	-13,044	-13,137	-13,246	-13,371
-2.67%	-3,129	-3,407	-3,687	-3,969	-4,253	-4,538	-4,823
0%	429	306	162	0	-178	-369	-572
2.67%	674	669	659	643	616	579	531
5.33%	676	676	675	675	674	672	667
8.00%	676	676	676	676	676	675	675
KR4301M83: 2017-08 풋317.5							9,545
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-9,540	-9,540	-9,541	-9,541	-9,542	-9,543	-9,545
-5.33%	-5,498	-5,503	-5,512	-5,525	-5,543	-5,567	-5,595
-2.67%	-1,719	-1,796	-1,877	-1,961	-2,048	-2,138	-2,229
0%	234	161	82	0	-85	-173	-264
2.67%	471	465	456	441	422	397	367

5.33%	475	475	475	474	473	471	467
8.00%	475	475	475	475	475	475	475

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

85,533

공시일	2017-07-25
기준일	2017-07-24

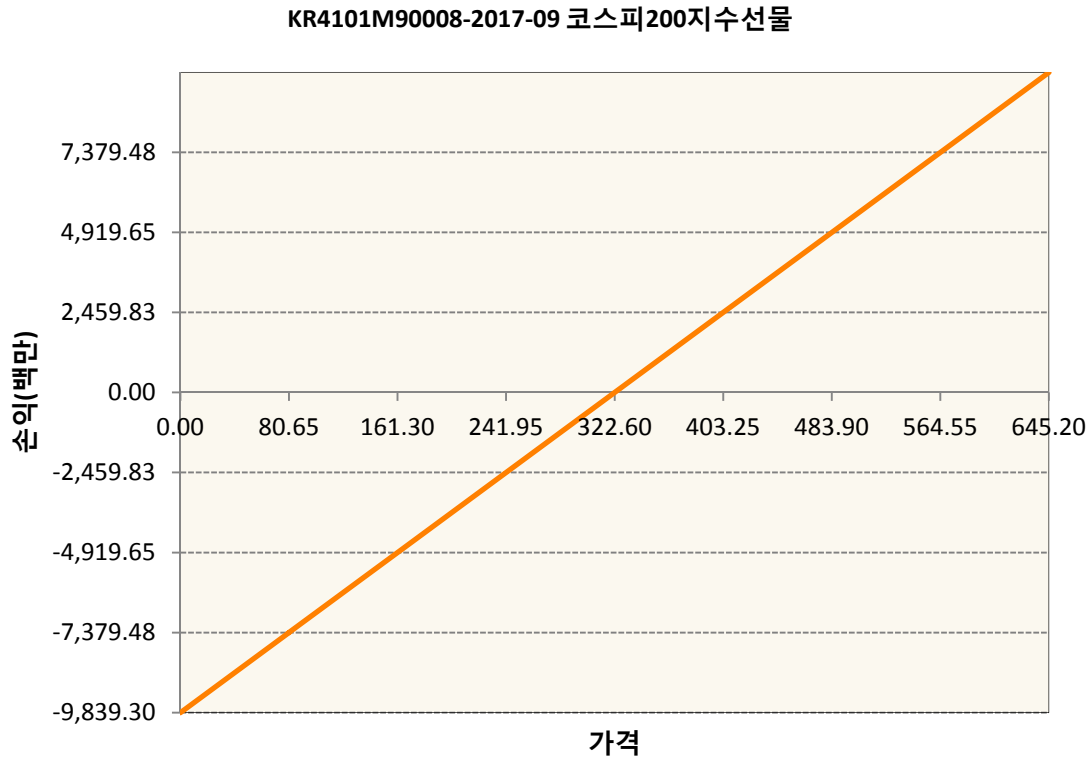
ETF스마트레버리지목표전환형6호

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	81	-81	장내
누계	유가증권	선물	9,839	0	9,839	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101M90(2017-09 코스피200지수선물							786
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-786	-786	-786	-786	-786	-786	-786
-5.33%	-524	-524	-524	-524	-524	-524	-524
-2.67%	-262	-262	-262	-262	-262	-262	-262
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	262	262	262	262	262	262	262
5.33%	524	524	524	524	524	524	524
8.00%	786	786	786	786	786	786	786

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

470

공시일	2017-07-25
기준일	2017-07-24

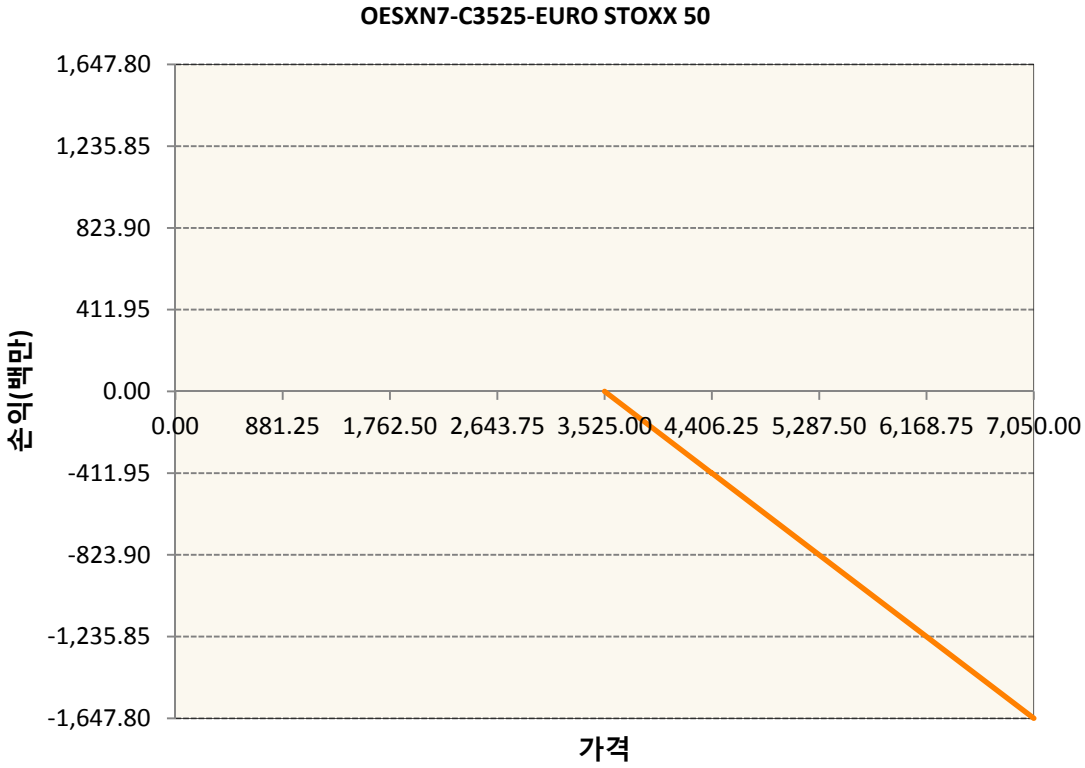
유로커버드콜(주식혼합-파생형)

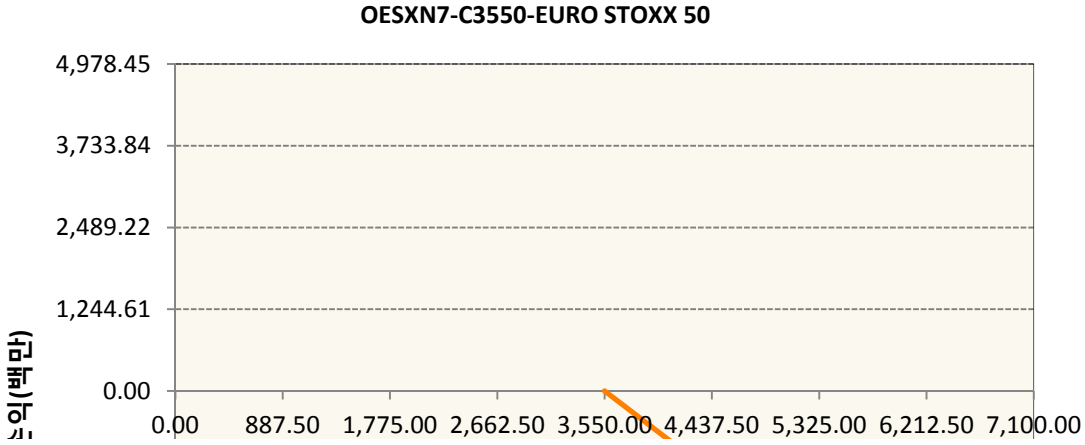
1. 계약금액

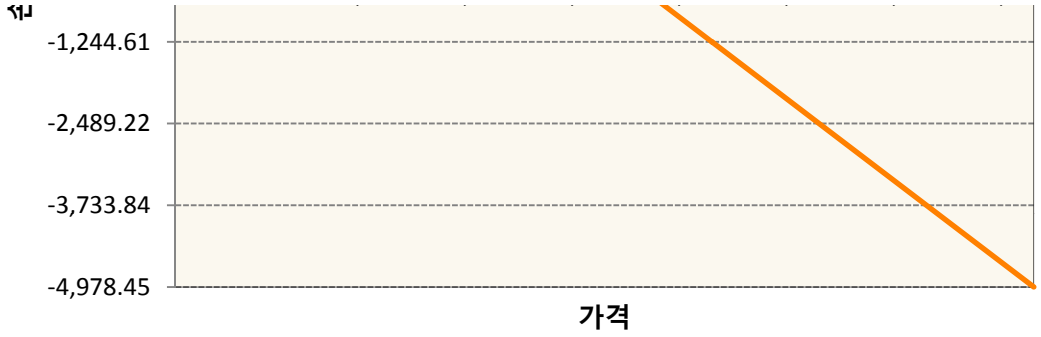
(단위:백만원)

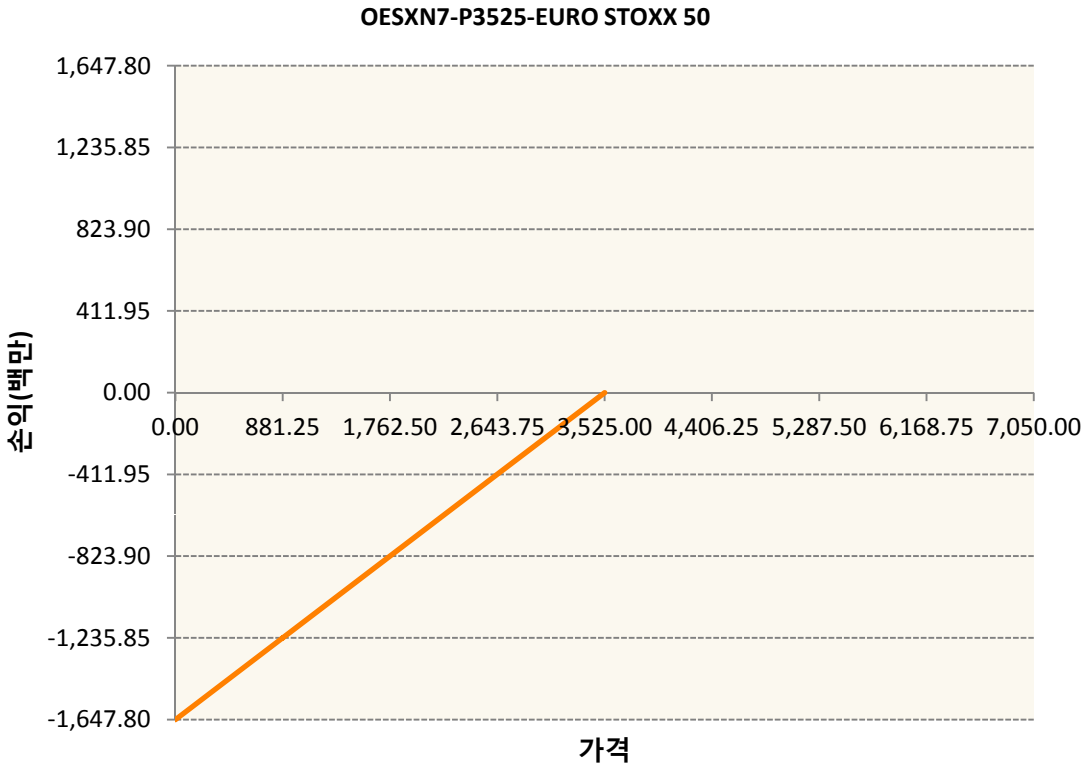
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	10,145	0	10,145	
누계	유가증권	옵션	0	13,252	-13,252	장내

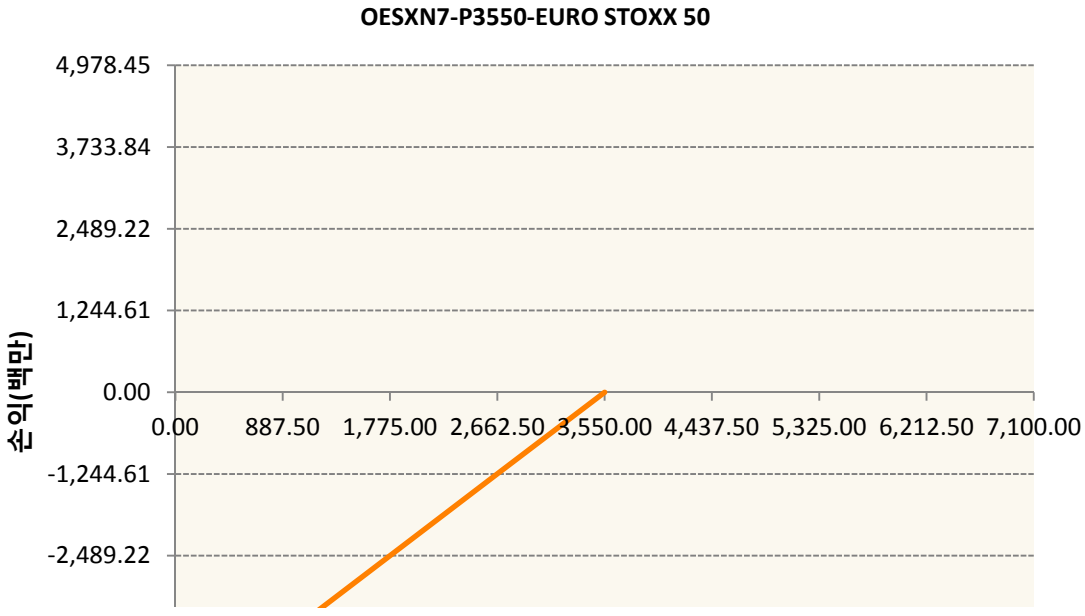
2. 만기시점의 손익구조

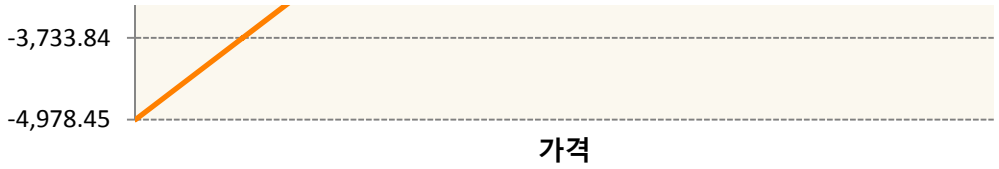


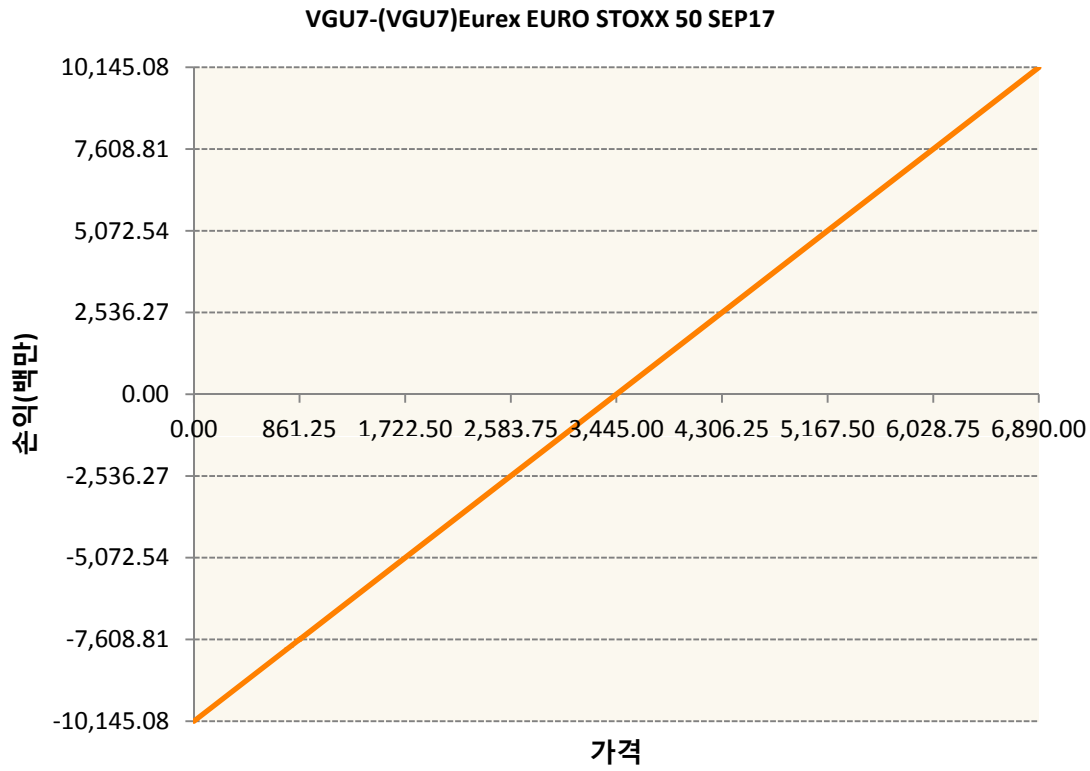



-1,244.61
-2,489.22
-3,733.84
-4,978.45
가격


OESXN7-P3525-EURO STOXX 50
1,647.80
1,235.85
823.90
411.95
0.00
-411.95
-823.90
-1,235.85
-1,647.80
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
4,978.45
3,733.84
2,489.22
1,244.61
0.00
-1,244.61
-2,489.22
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	812

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,565

공시일	2017-07-25
기준일	2017-07-24

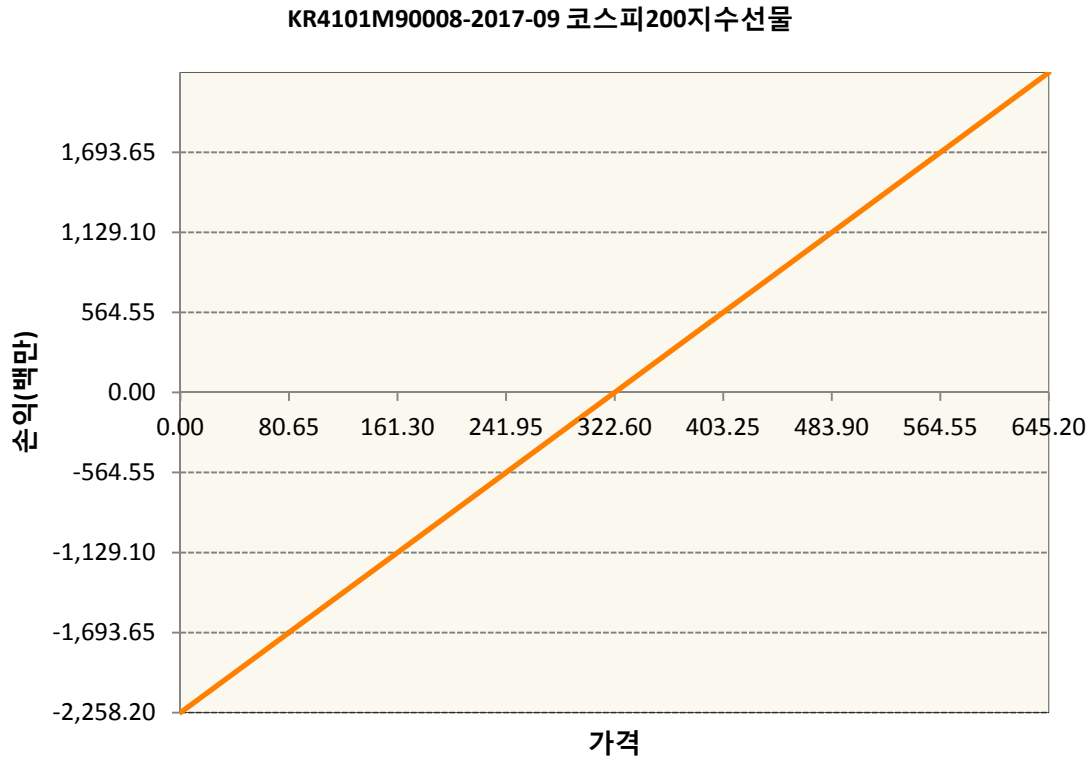
ETF스마트레버리지목표전환형7호

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	2,258	0	2,258	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	2017-07-25
기준일	2017-07-24

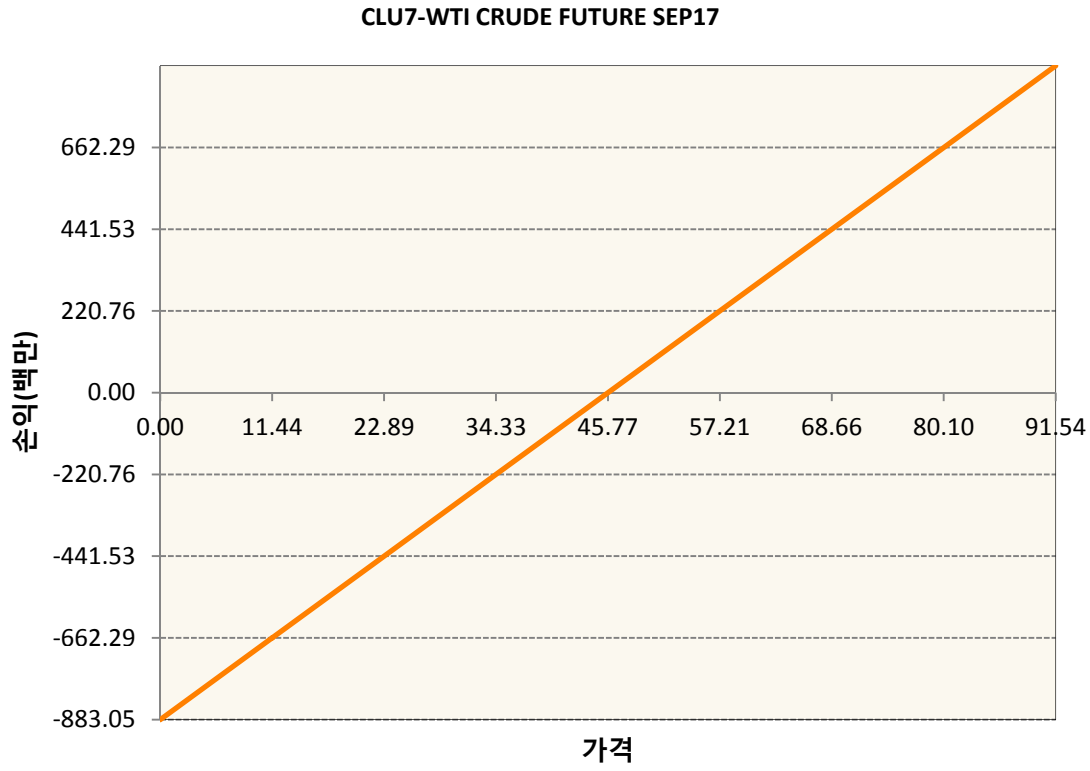
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

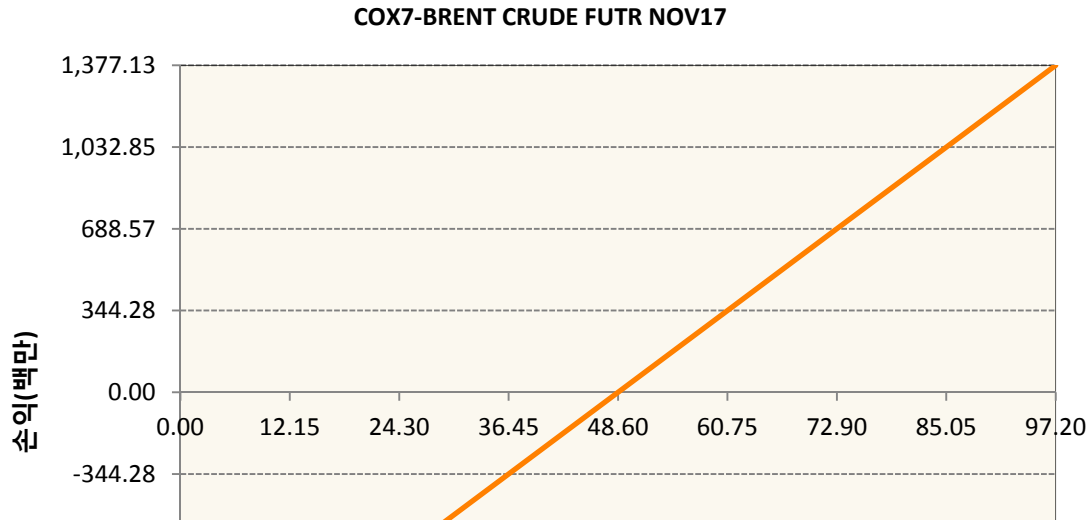
1. 계약금액

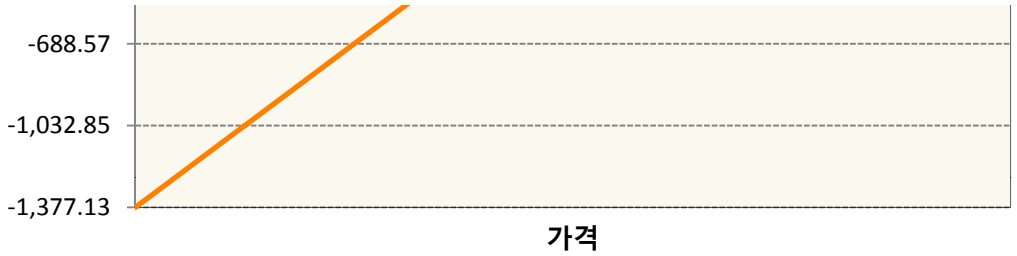
(단위:백만원)

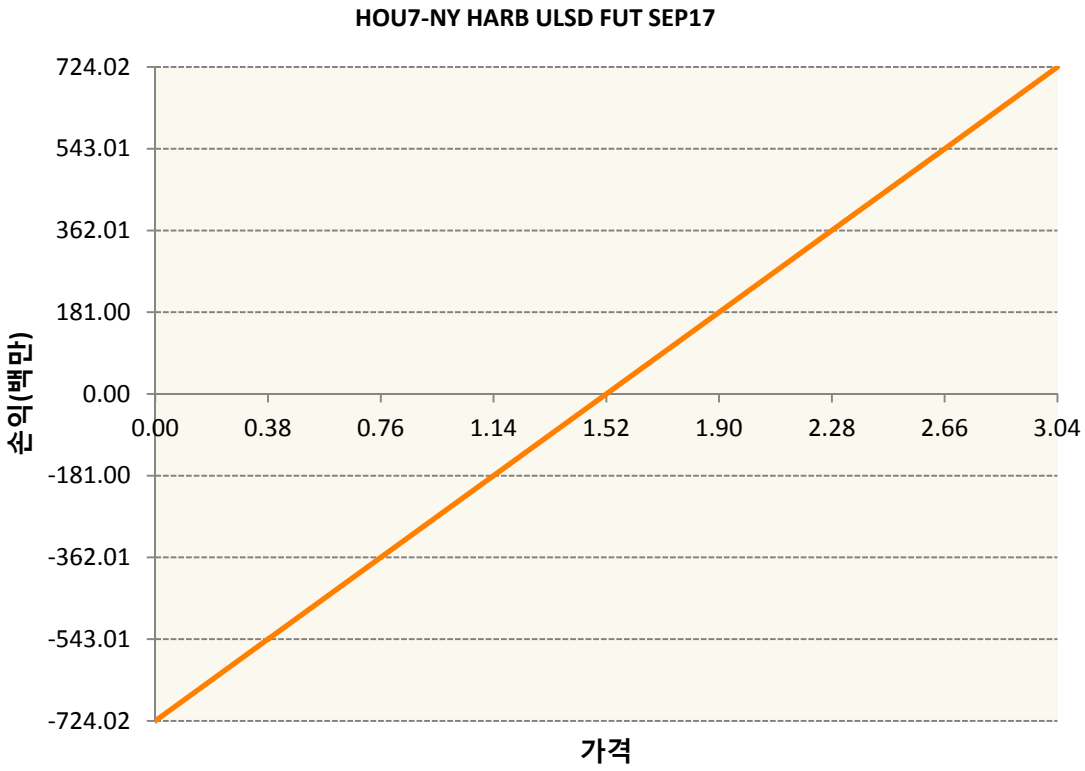
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	5,126	223	4,904	

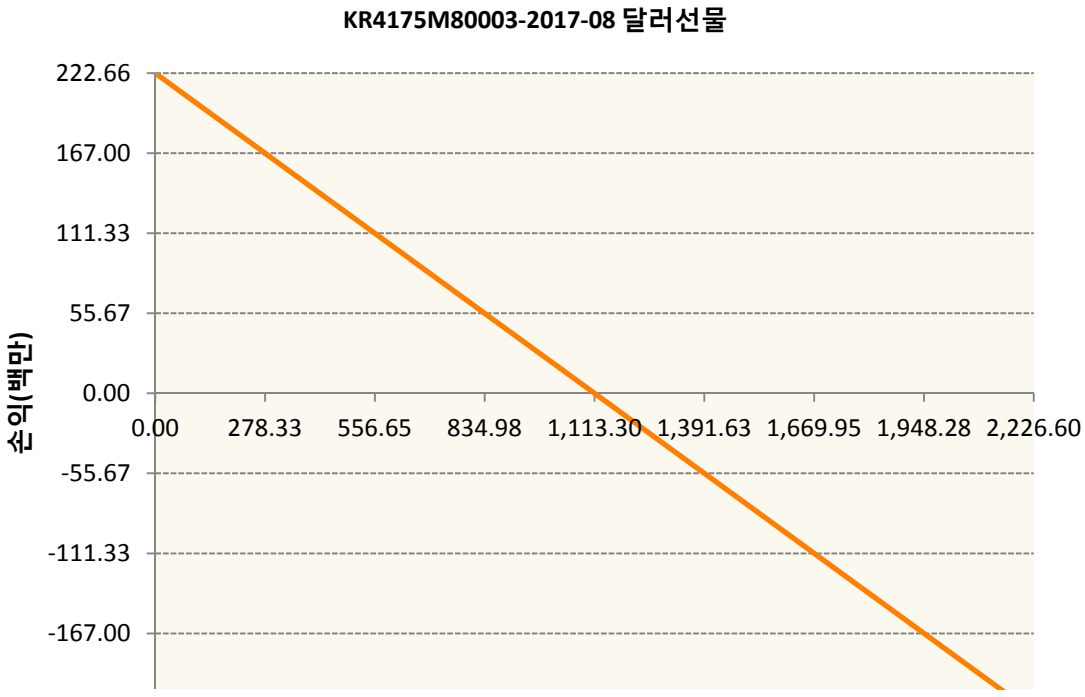
2. 만기시점의 손익구조

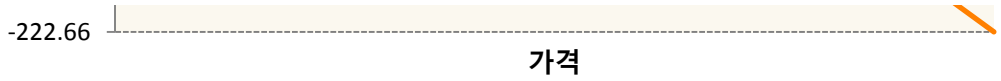


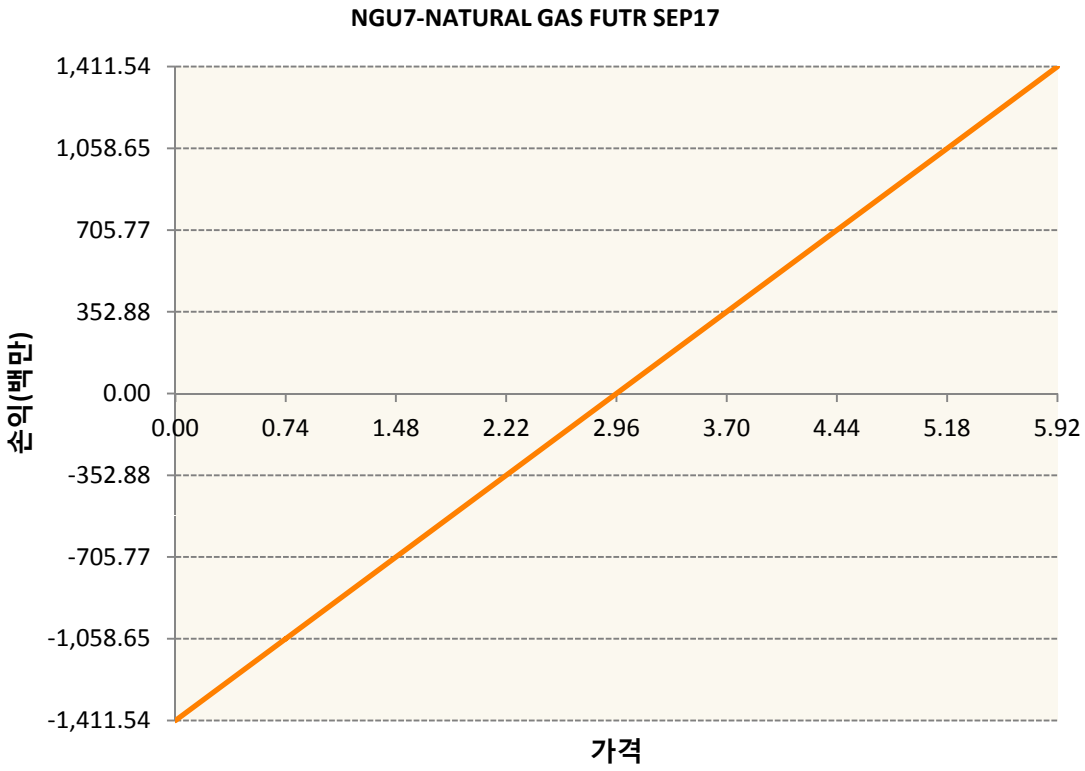


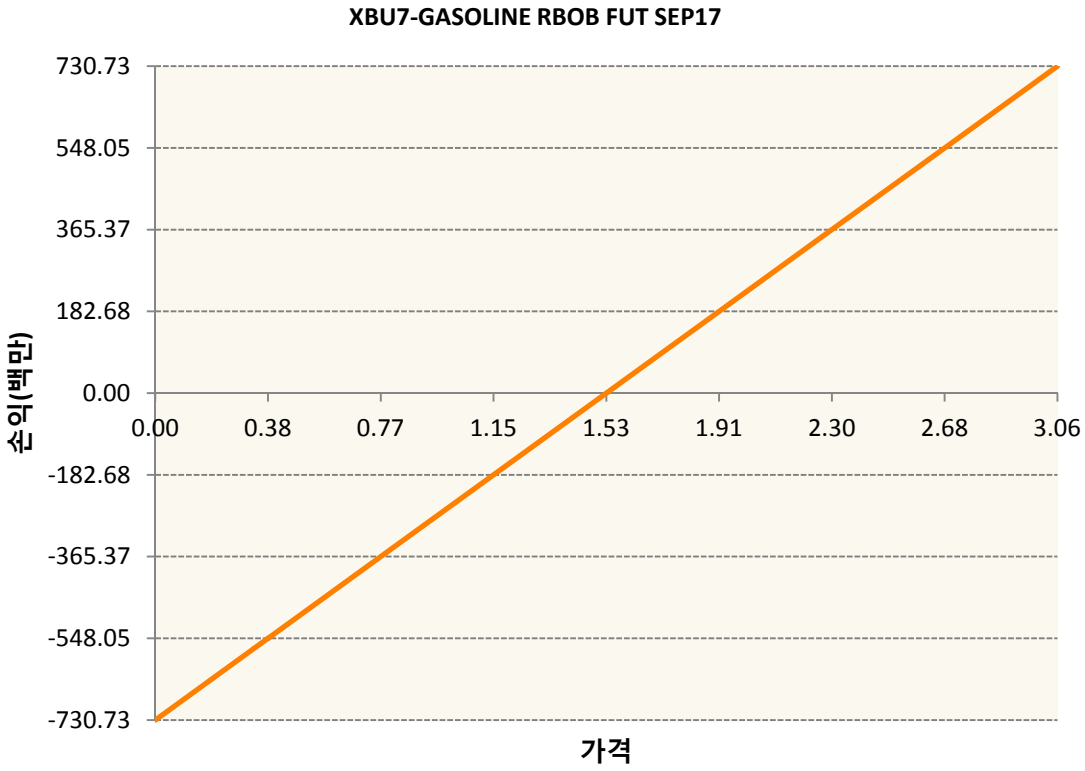

-688.57
-1,032.85
-1,377.13
가격


HOU7-NY HARB ULSD FUT SEP17
724.02
543.01
362.01
181.00
0.00
-181.00
-362.01
-543.01
-724.02
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
222.66
167.00
111.33
55.67
0.00
-55.67
-111.33
-167.00
0.00
278.33
556.65
834.98
1,113.30
1,391.63
1,669.95
1,948.28
2,226.60
손익(만)


-222.66
가격


NGU7-NATURAL GAS FUTR SEP17
1,411.54
1,058.65
705.77
352.88
0.00
-352.88
-705.77
-1,058.65
-1,411.54
0.00
0.74
1.48
2.22
2.96
3.70
4.44
5.18
5.92
손익(백만)
가격


XBU7-GASOLINE RBOB FUT SEP17
730.73
548.05
365.37
182.68
0.00
-182.68
-365.37
-548.05
-730.73
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	110
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)

766

공시일	2017-07-25
기준일	2017-07-24

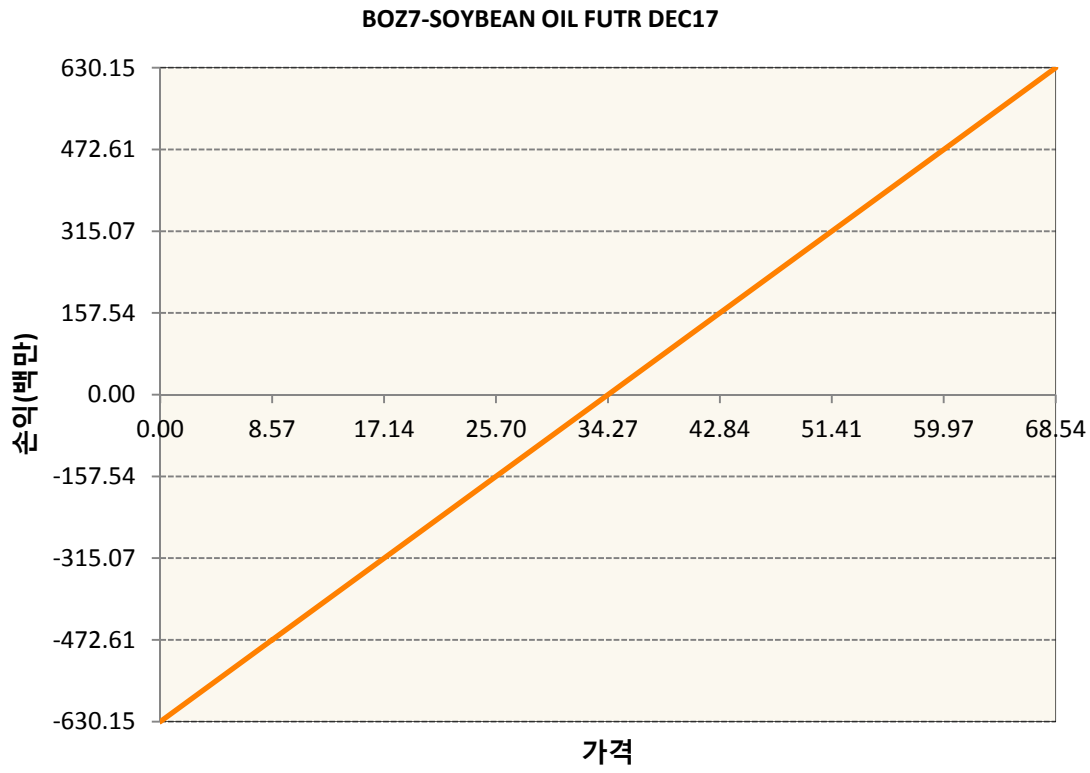
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

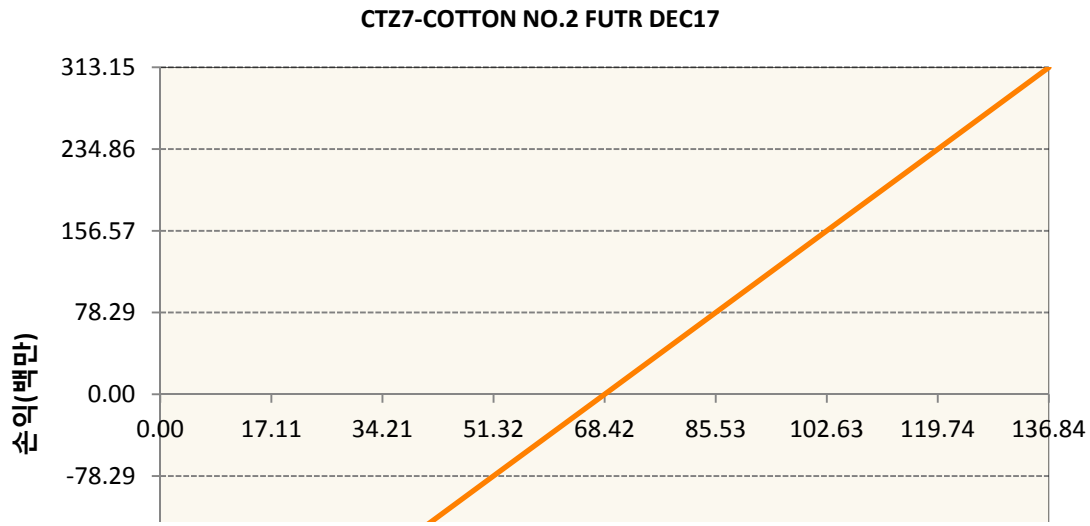
1. 계약금액

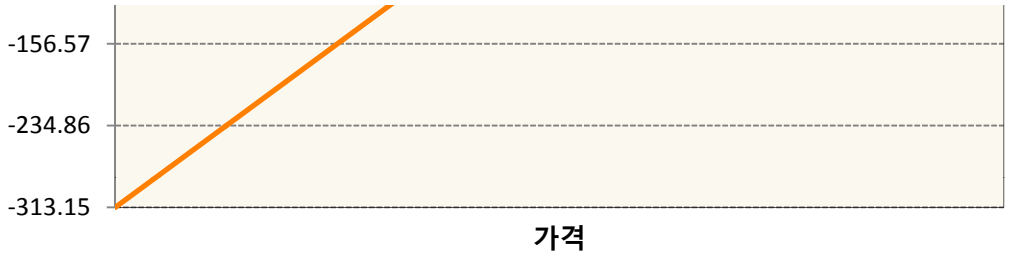
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	7,161	390	6,771	

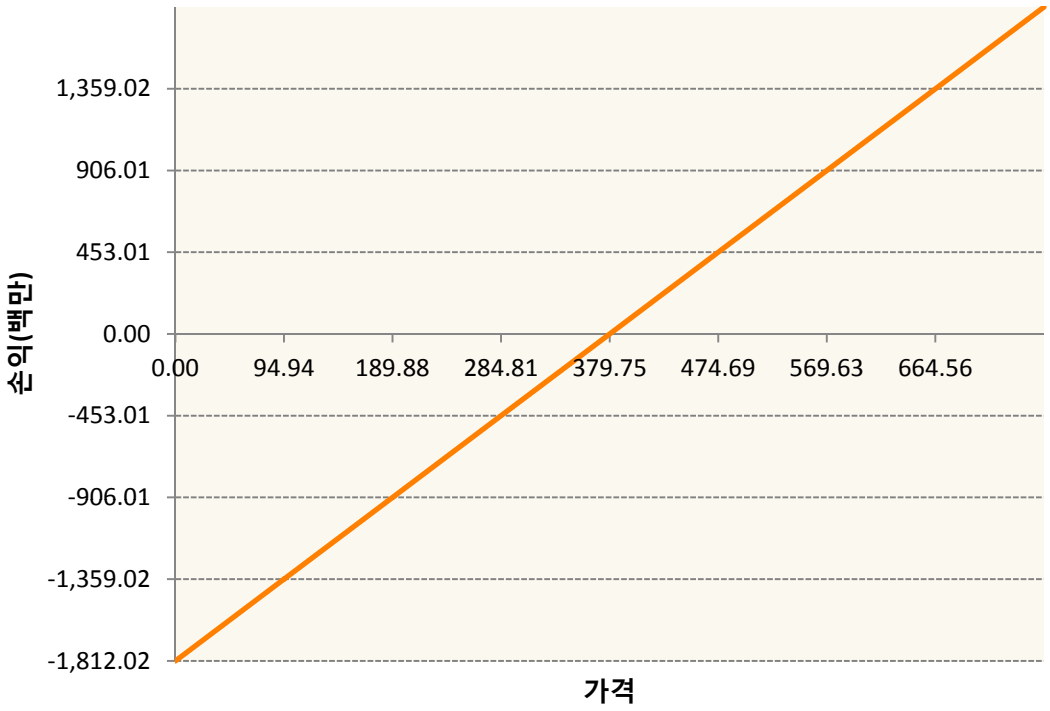
2. 만기시점의 손익구조



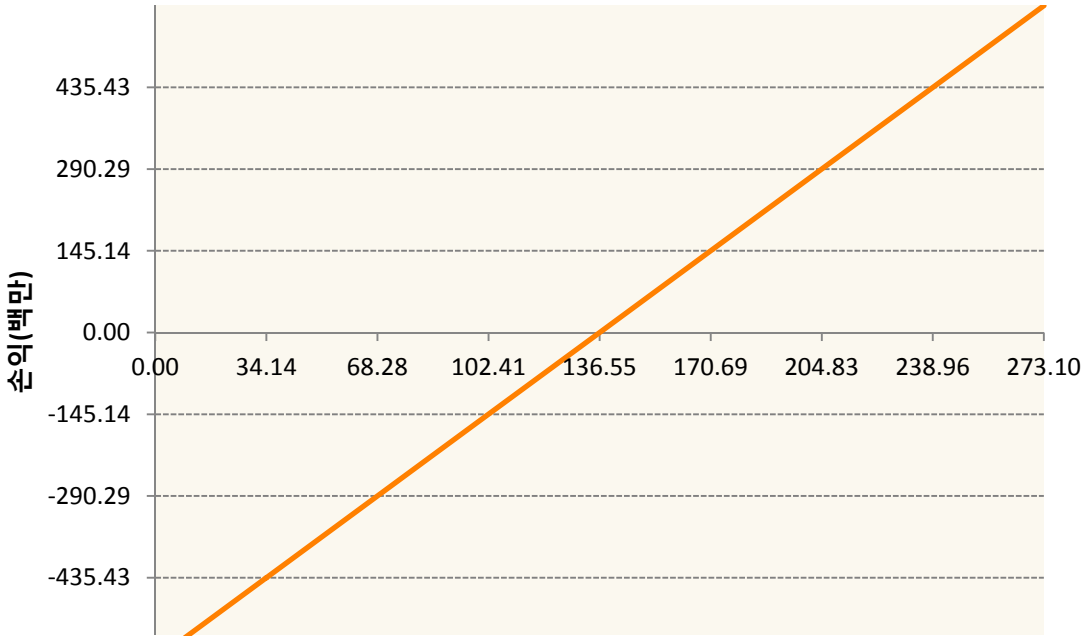


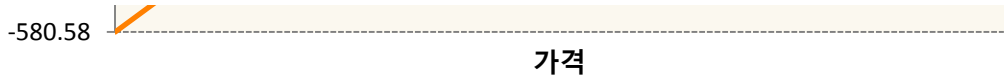


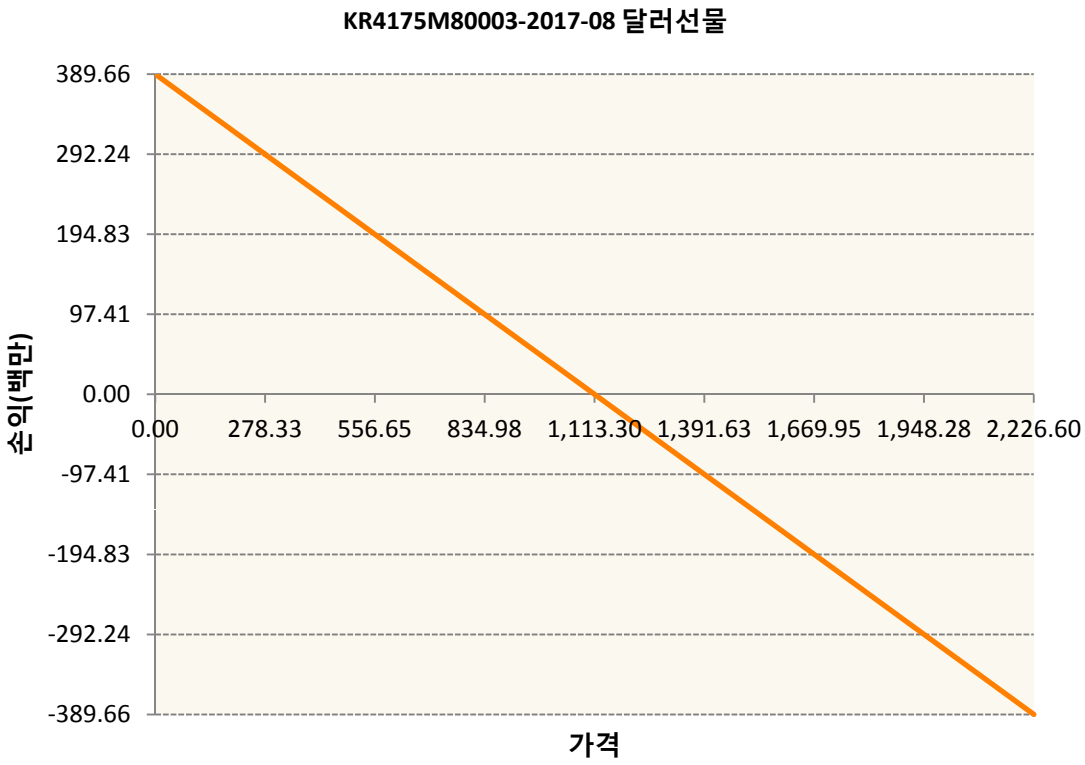
CU7-CORN FUTURE SEP17

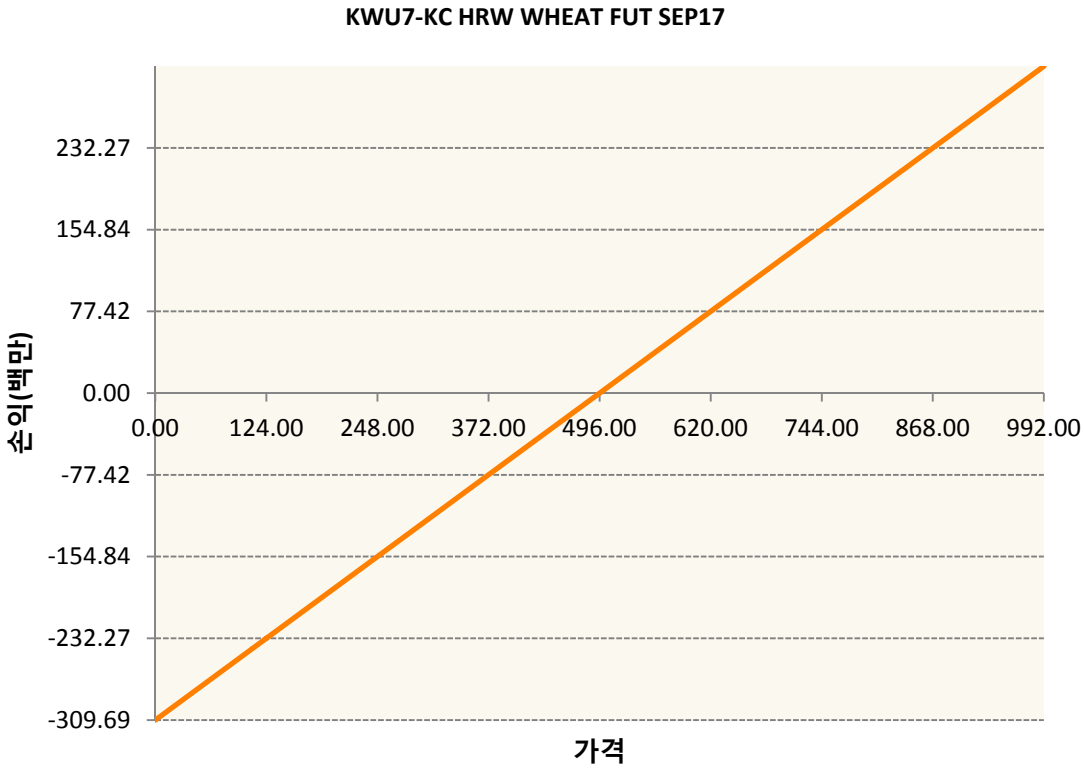


KCU7-COFFEE 'C' FUTURE SEP17

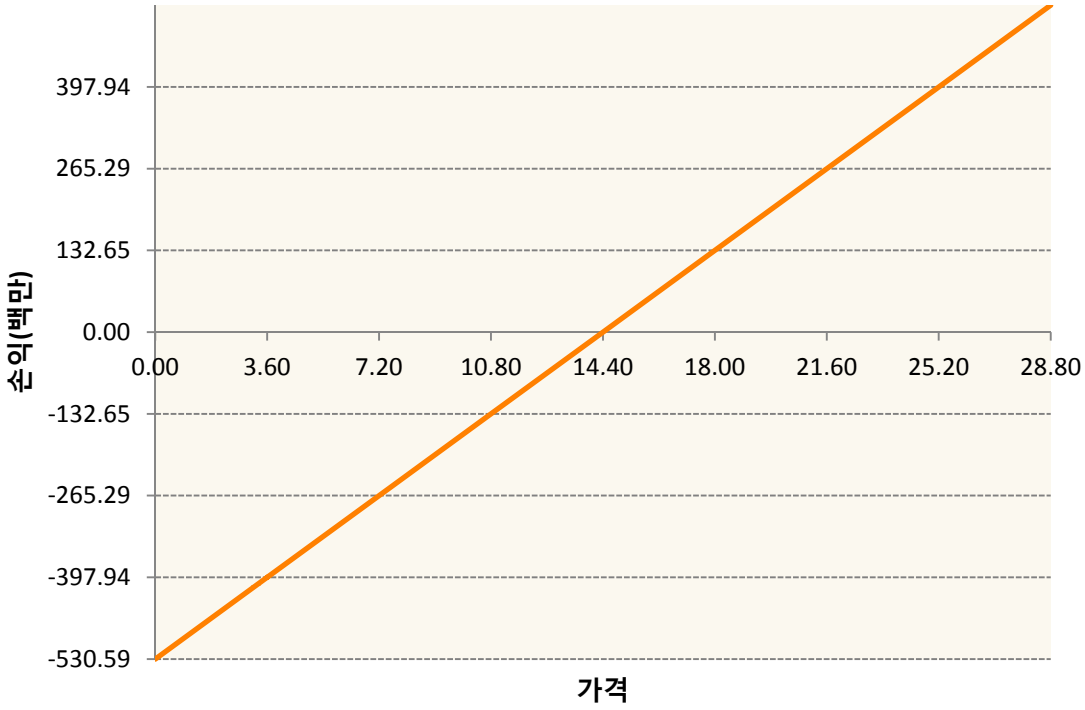



-580.58
가격

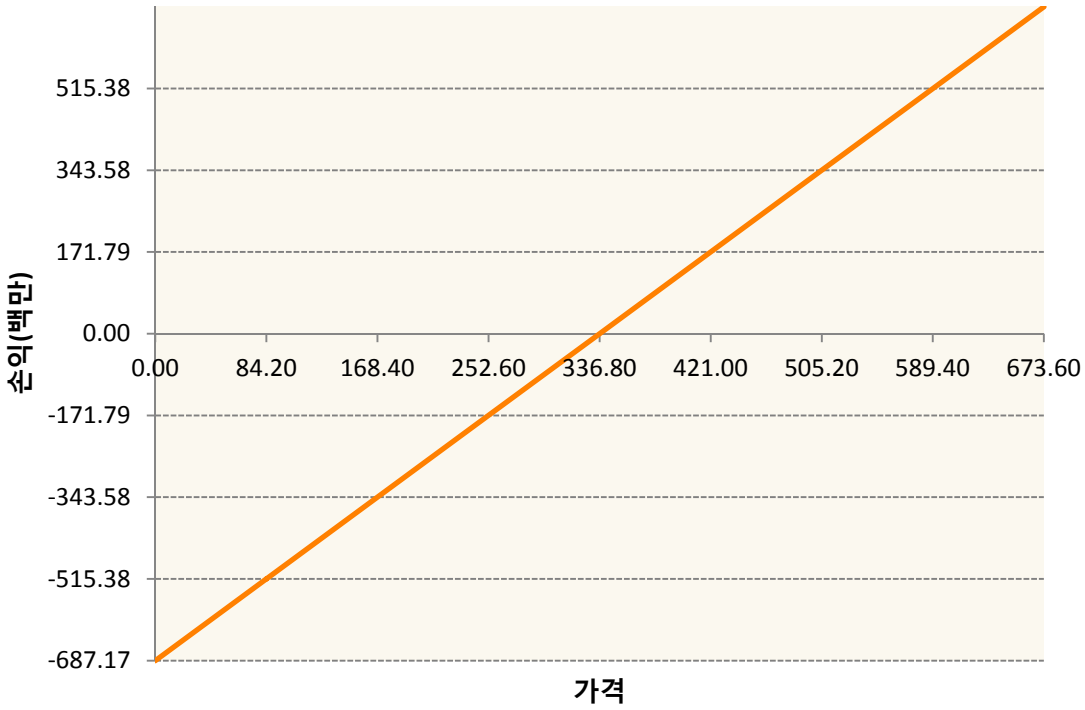

KR4175M80003-2017-08 달러선물
389.66
292.24
194.83
97.41
0.00
-97.41
-194.83
-292.24
-389.66
0.00
278.33
556.65
834.98
1,113.30
1,391.63
1,669.95
1,948.28
2,226.60
손익(백만)
가격


KWU7-KC HRW WHEAT FUT SEP17
232.27
154.84
77.42
0.00
-77.42
-154.84
-232.27
-309.69
0.00
124.00
248.00
372.00
496.00
620.00
744.00
868.00
992.00
손익(백만)
가격

SBV7-SUGAR #11 (WORLD) OCT17

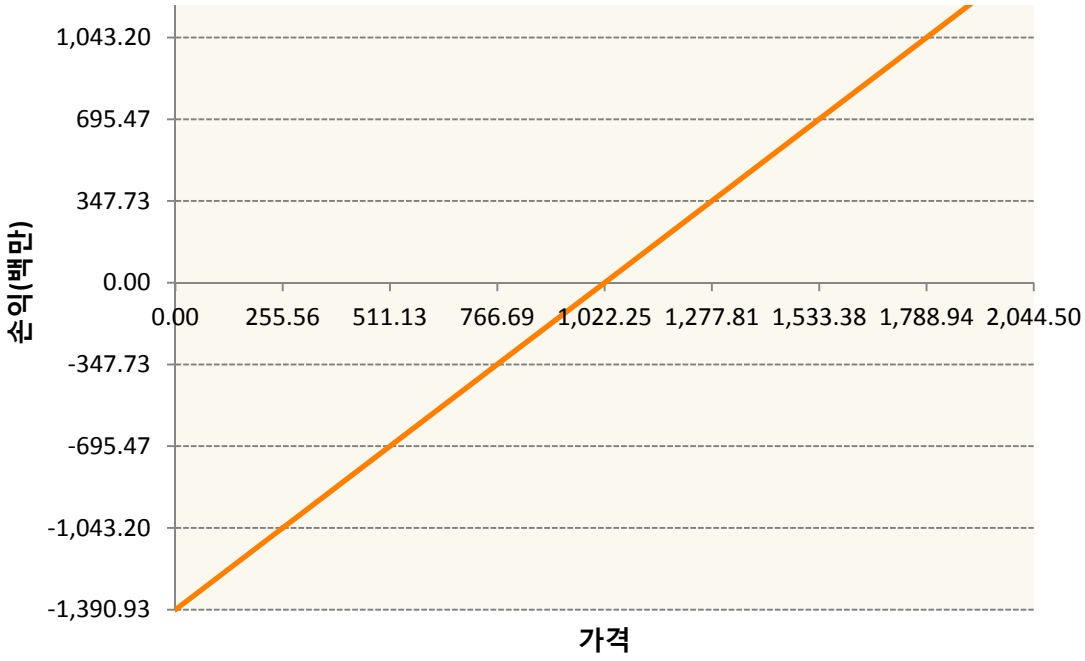


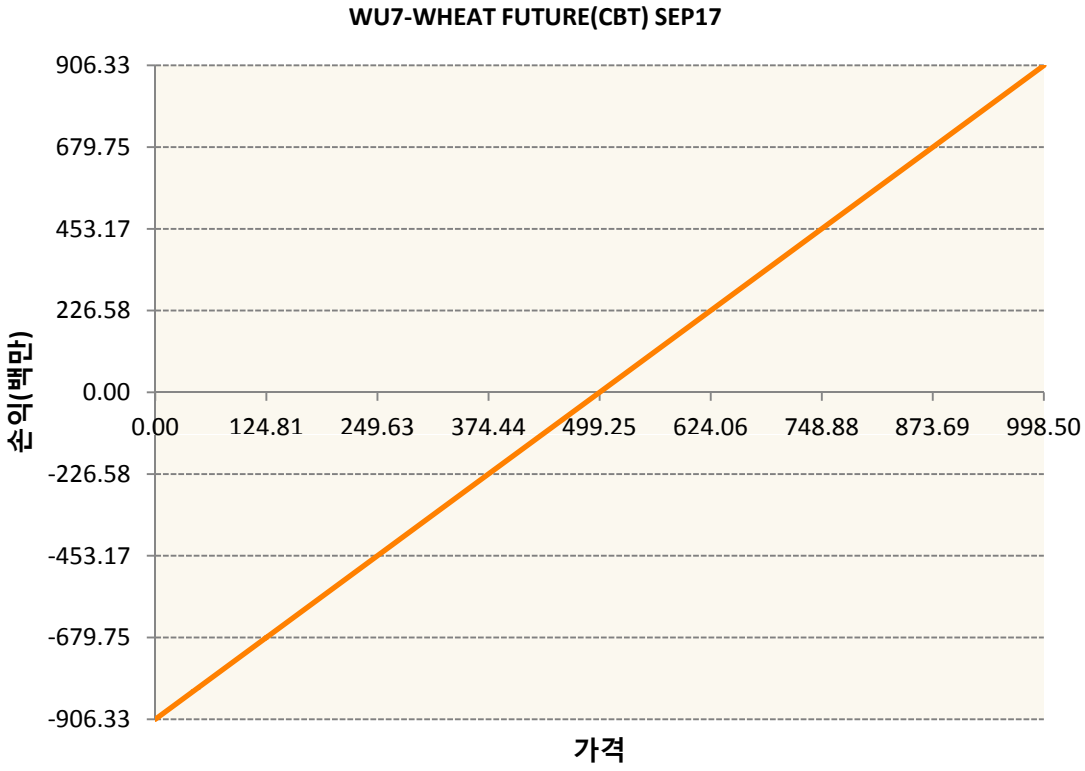
SMZ7-SOYBEAN MEAL FUTR DEC17



SX7-SOYBEAN FUTURE NOV17







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
BOZ7	SOYBEAN OIL FUTR DEC17	50
CTZ7	COTTON NO.2 FUTR DEC17	25
CU7	CORN FUTURE SEP17	145
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	111
WU7	WHEAT FUTURE(CBT) SEP17	73

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

672