공시일	2017-07-26
기준일	2017-07-25

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	2017-07-26
기준일	2017-07-25

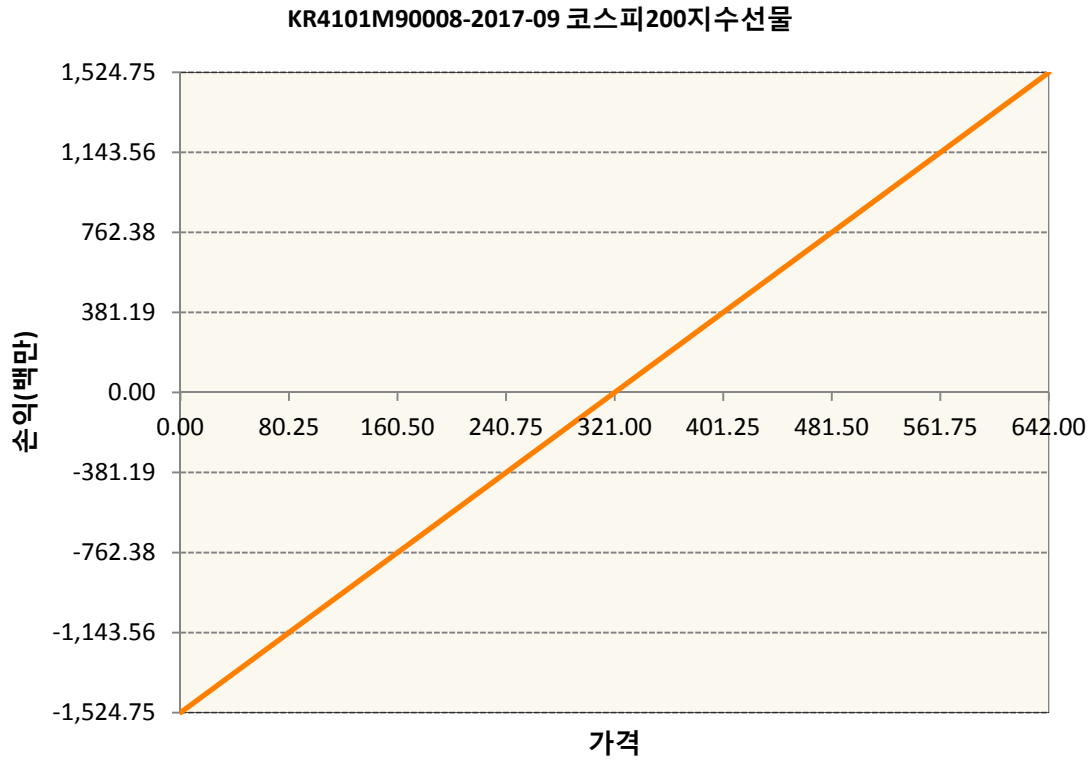
스마트인덱스모

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	1,525	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	2017-07-26
기준일	2017-07-25

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	1,018

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

479

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-07-26
기준일	2017-07-25

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	383

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

340

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-07-26
기준일	2017-07-25

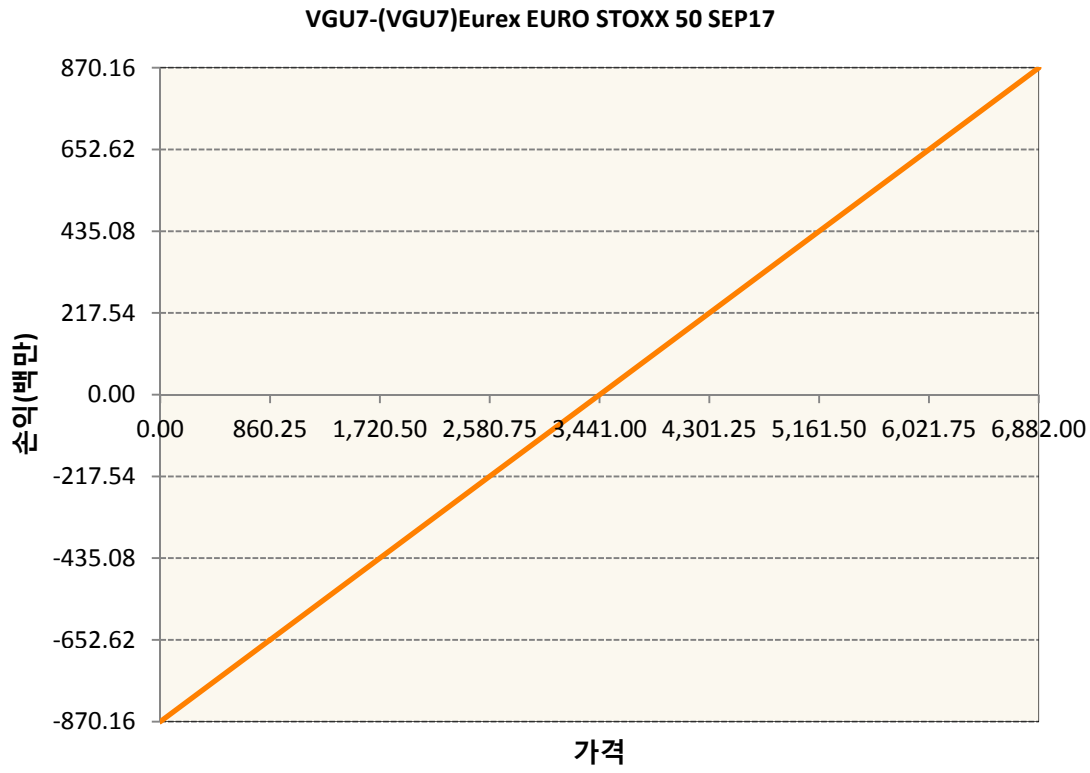
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	870	0	870	

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	2017-07-26
기준일	2017-07-25

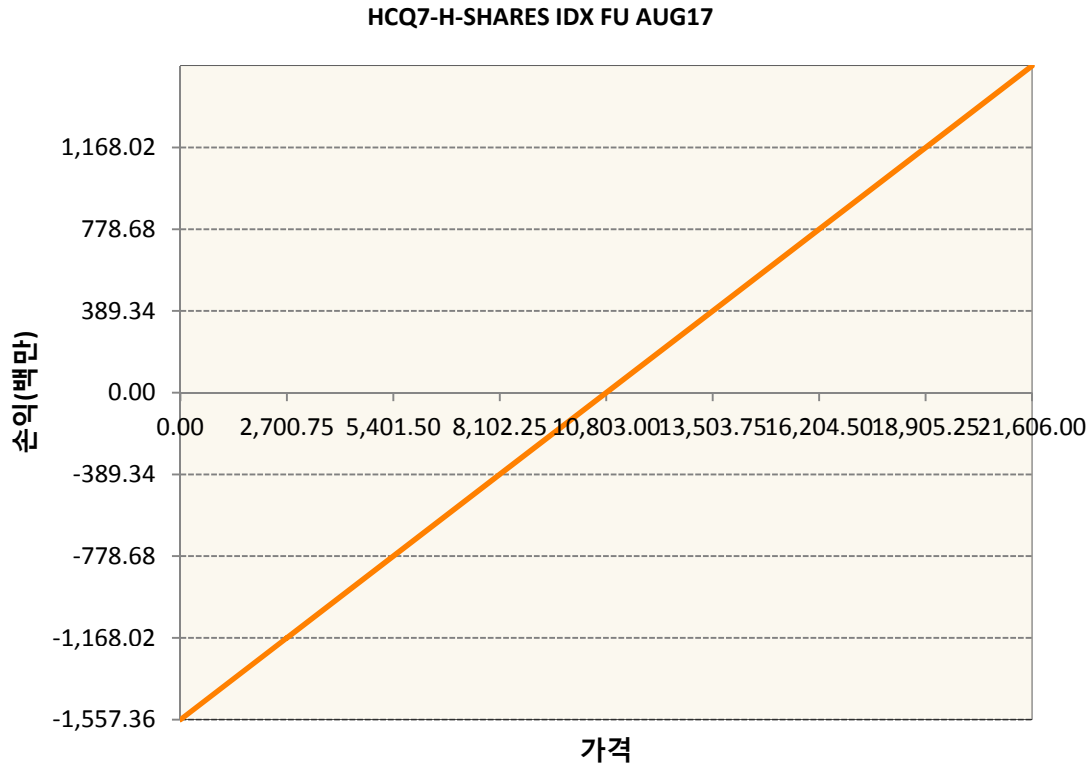
차이나인덱스모(주식-파생형)

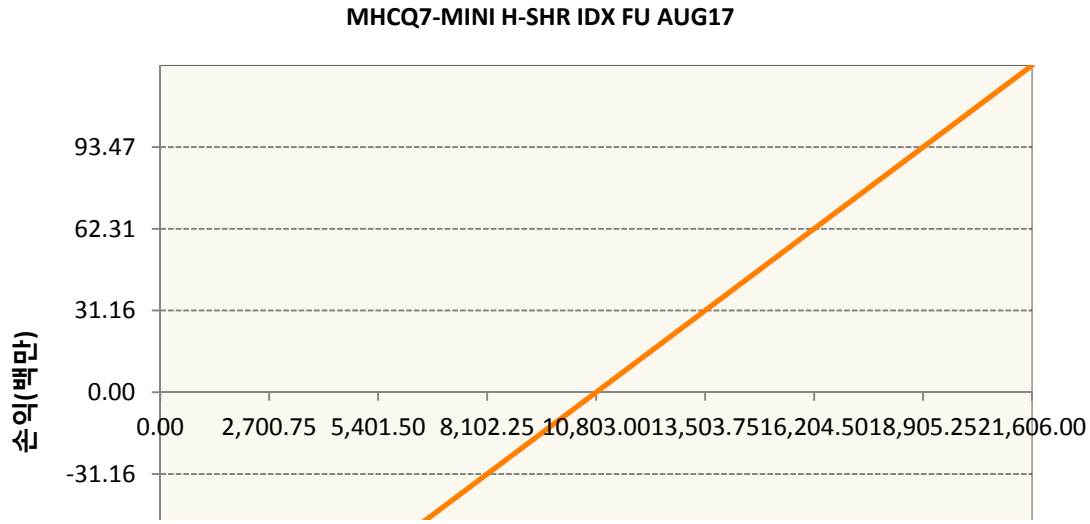
1. 계약금액

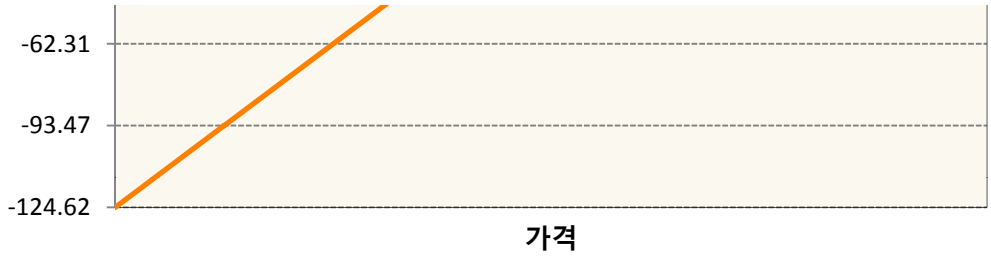
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,682	0	1,682	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)
	126

공시일	2017-07-26
기준일	2017-07-25

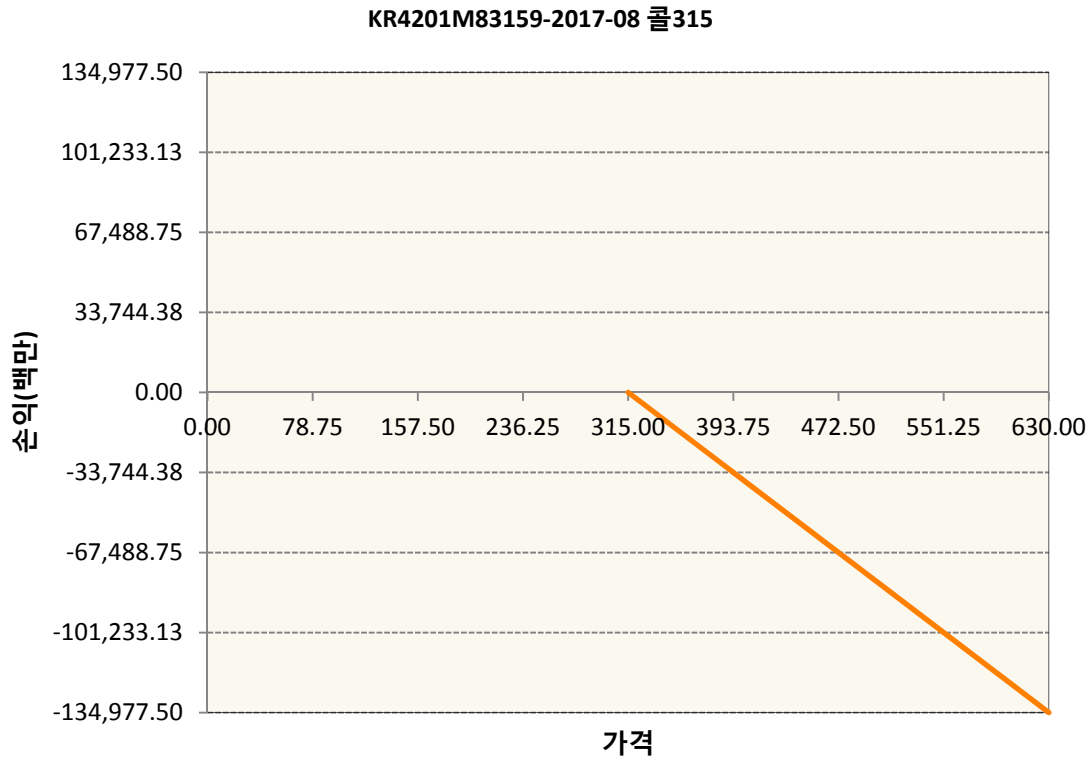
커버드콜모(주식혼합-파생형)

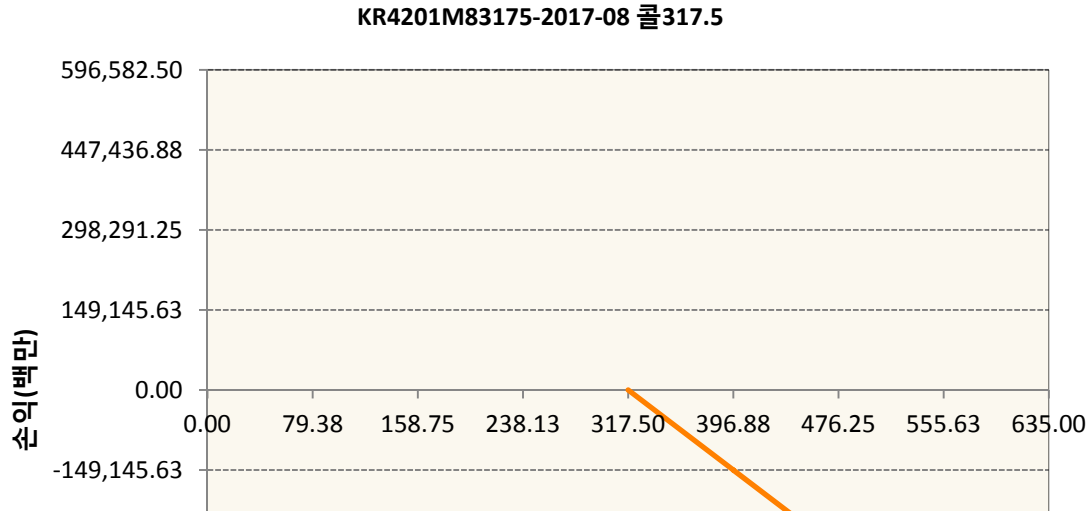
1. 계약금액

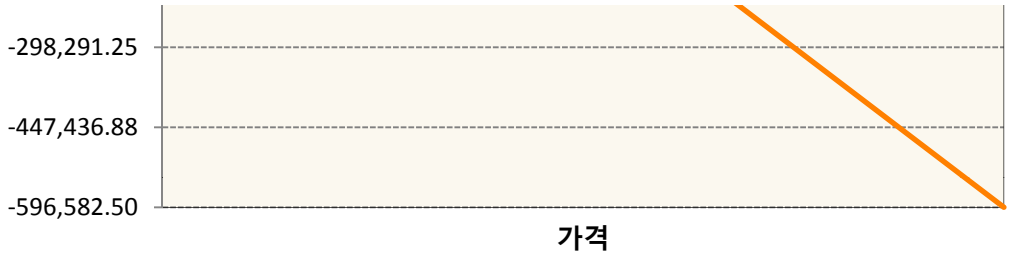
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	1,299,739	-1,299,739	장내

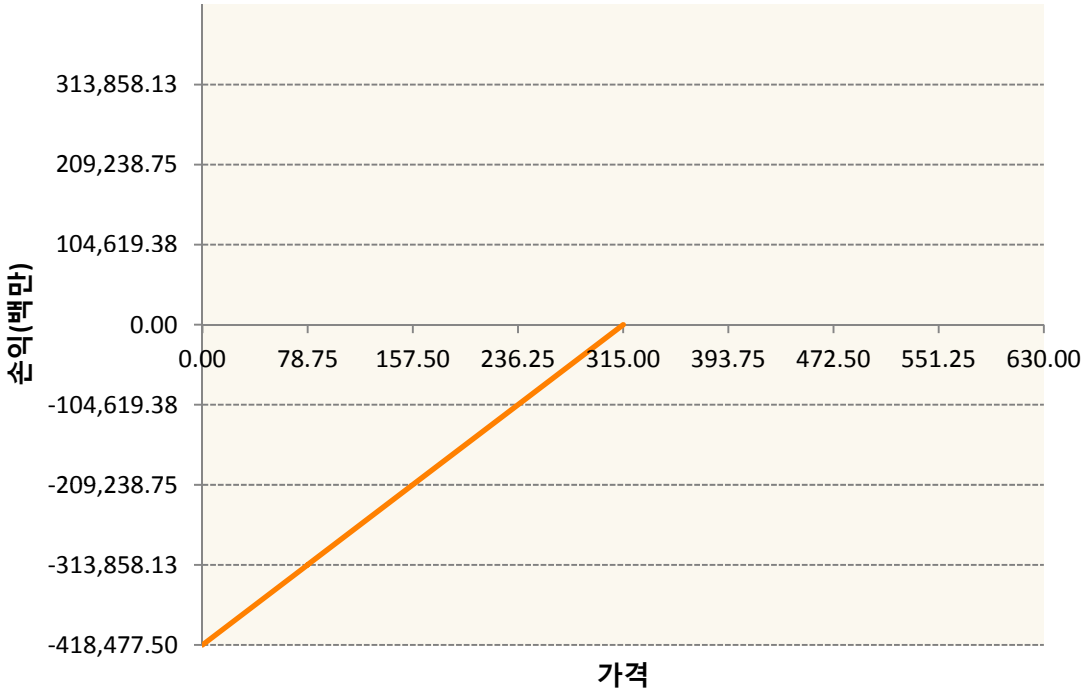
2. 만기시점의 손익구조



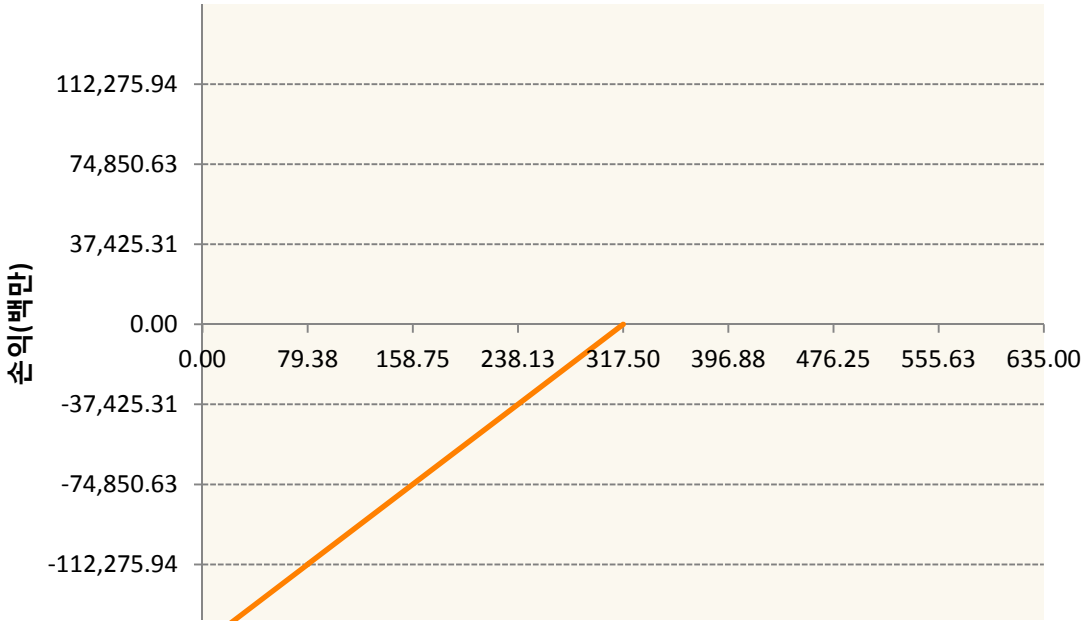




KR4301M83157-2017-08 풋315



KR4301M83173-2017-08 풋317.5





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4201M83: 2017-08 콜315							9,558
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	3,765	3,724	3,669	3,600	3,519	3,427	3,324
-5.33%	3,487	3,365	3,230	3,085	2,932	2,772	2,607
-2.67%	2,556	2,354	2,150	1,945	1,739	1,532	1,325
0%	594	399	201	0	-203	-407	-612
2.67%	-2,316	-2,430	-2,558	-2,698	-2,847	-3,004	-3,169
5.33%	-5,748	-5,790	-5,847	-5,918	-6,002	-6,099	-6,207
8.00%	-9,359	-9,369	-9,387	-9,414	-9,451	-9,499	-9,558
KR4201M83: 2017-08 콜317.5							40,330
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	13,828	13,706	13,532	13,303	13,020	12,686	12,305
-5.33%	13,034	12,611	12,124	11,583	10,996	10,371	9,714
-2.67%	9,987	9,167	8,329	7,476	6,612	5,739	4,859
0%	2,768	1,849	926	0	-928	-1,859	-2,790
2.67%	-8,917	-9,540	-10,212	-10,925	-11,671	-12,443	-13,237
5.33%	-23,469	-23,734	-24,069	-24,469	-24,926	-25,436	-25,990
8.00%	-39,158	-39,232	-39,350	-39,517	-39,737	-40,008	-40,330
KR4301M83: 2017-08 풋315							26,054
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-26,035	-26,035	-26,035	-26,036	-26,039	-26,045	-26,054
-5.33%	-14,716	-14,737	-14,770	-14,817	-14,880	-14,958	-15,050
-2.67%	-4,339	-4,577	-4,823	-5,077	-5,337	-5,601	-5,869
0%	605	419	216	0	-227	-463	-706
2.67%	1,135	1,123	1,101	1,068	1,021	959	883
5.33%	1,143	1,143	1,143	1,142	1,139	1,134	1,125
8.00%	1,143	1,143	1,143	1,143	1,143	1,143	1,143
KR4301M83: 2017-08 풋317.5							10,083
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-10,080	-10,080	-10,080	-10,081	-10,081	-10,082	-10,083
-5.33%	-6,059	-6,061	-6,066	-6,073	-6,084	-6,100	-6,119
-2.67%	-2,173	-2,229	-2,291	-2,359	-2,432	-2,509	-2,588
0%	287	193	97	0	-99	-198	-299
2.67%	731	718	699	674	643	605	562

5.33%	743	743	743	741	739	734	727
8.00%	743	743	743	743	743	743	743

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

92,726

공시일	2017-07-26
기준일	2017-07-25

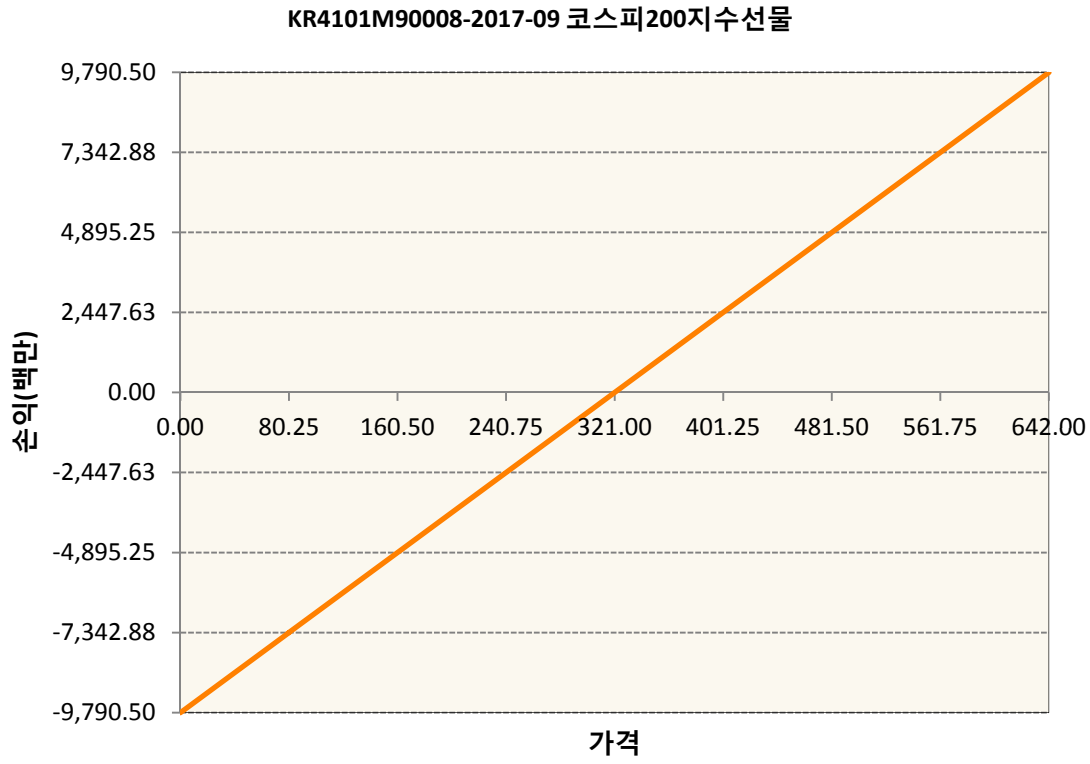
ETF스마트레버리지목표전환형6호

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	9,791	0	9,791	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101M90(2017-09 코스피200지수선물							781
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-781	-781	-781	-781	-781	-781	-781
-5.33%	-521	-521	-521	-521	-521	-521	-521
-2.67%	-260	-260	-260	-260	-260	-260	-260
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	260	260	260	260	260	260	260
5.33%	521	521	521	521	521	521	521
8.00%	781	781	781	781	781	781	781

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

469

공시일	2017-07-26
기준일	2017-07-25

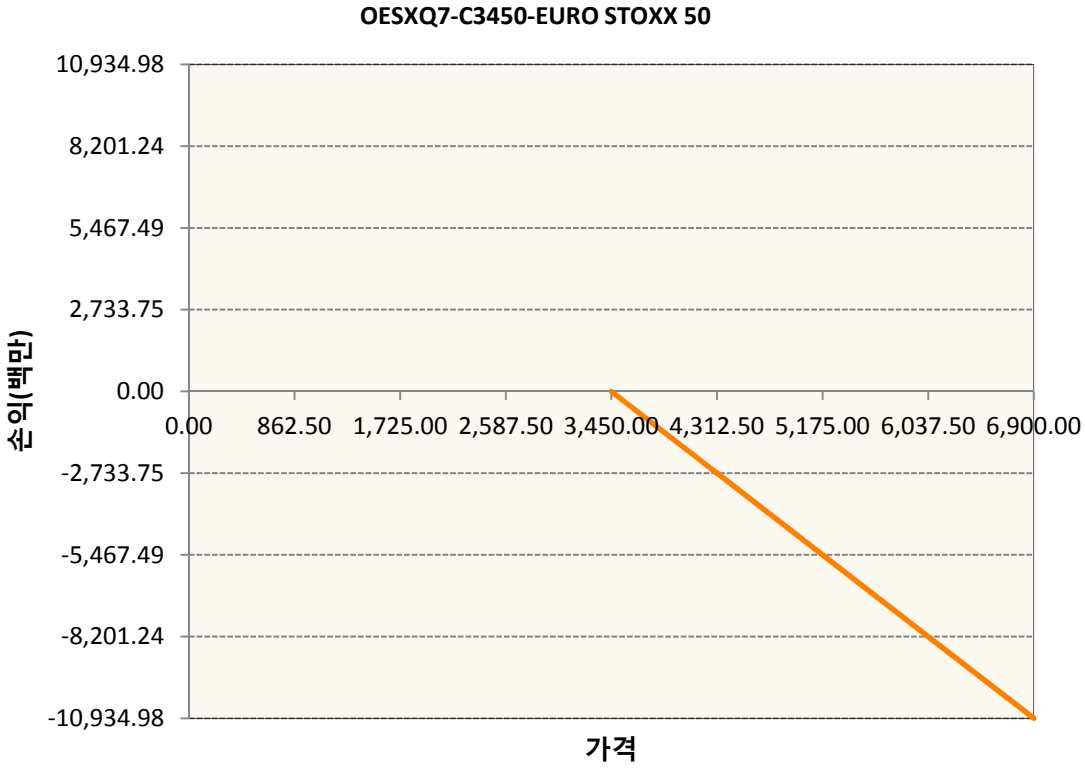
유로커버드콜(주식혼합-파생형)

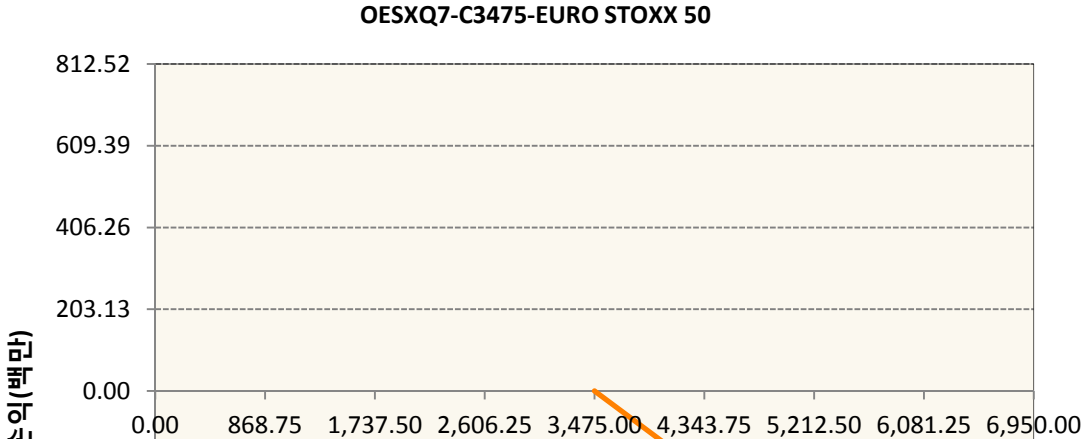
1. 계약금액

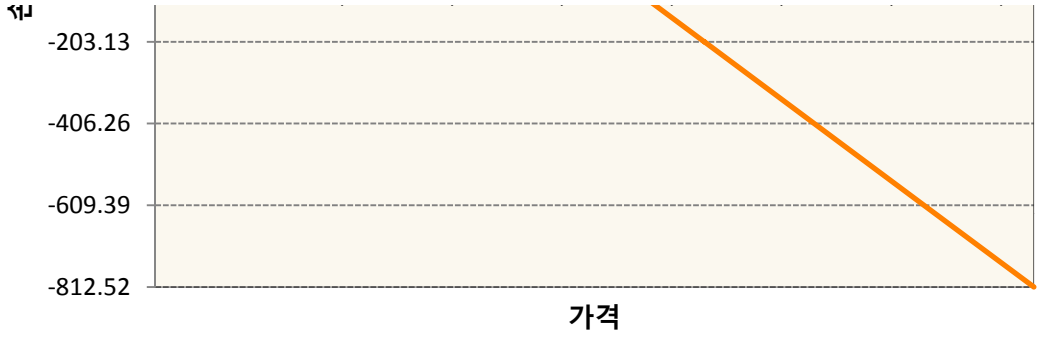
(단위:백만원)

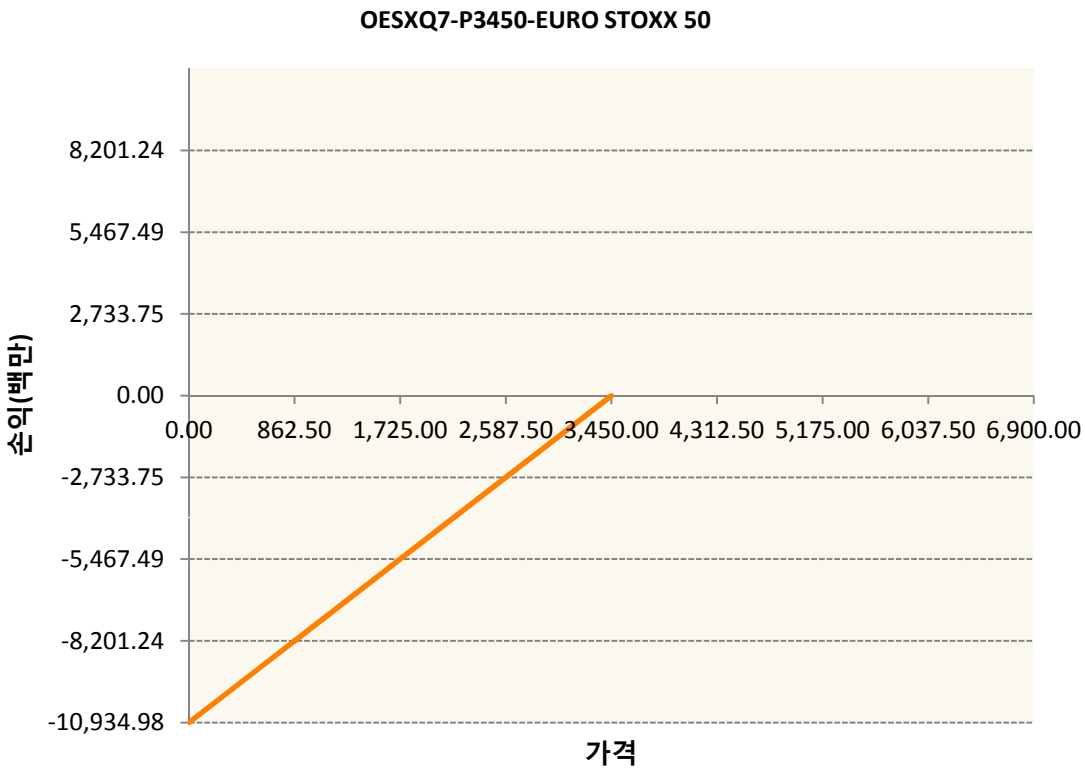
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	11,698	0	11,698	
누계	유가증권	옵션	0	23,495	-23,495	장내

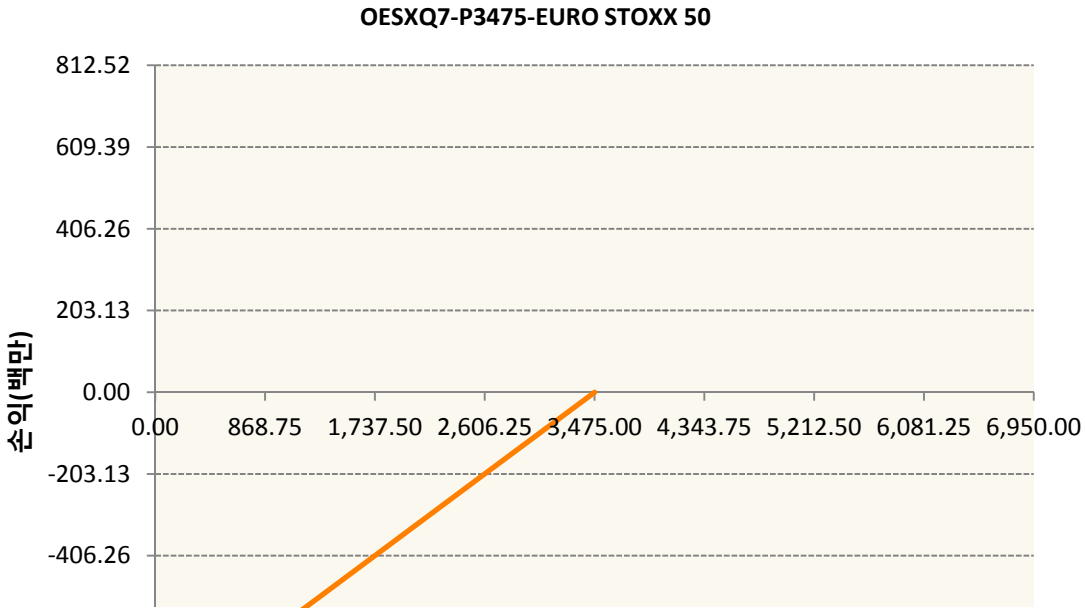
2. 만기시점의 손익구조

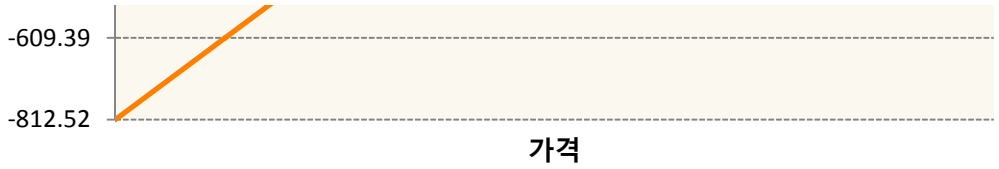


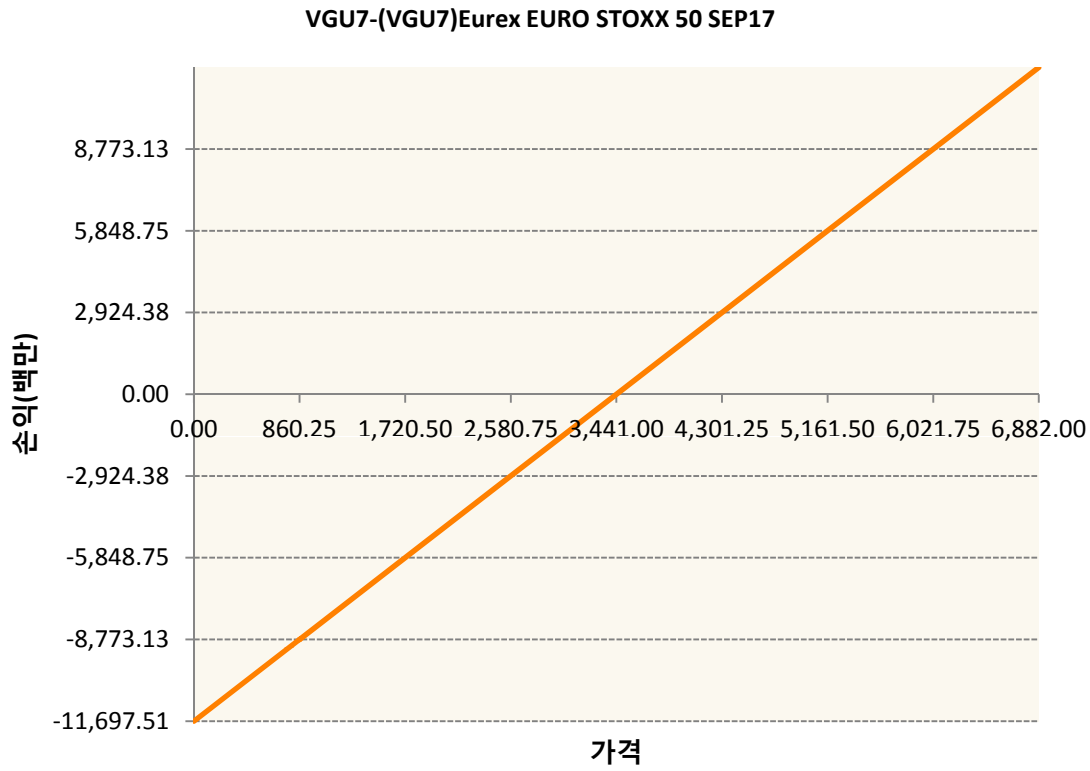



-203.13
-406.26
-609.39
-812.52
가격


OESXQ7-P3450-EURO STOXX 50
8,201.24
5,467.49
2,733.75
0.00
-2,733.75
-5,467.49
-8,201.24
-10,934.98
0.00
862.50
1,725.00
2,587.50
3,450.00
4,312.50
5,175.00
6,037.50
6,900.00
손익(백만)
가격


OESXQ7-P3475-EURO STOXX 50
812.52
609.39
406.26
203.13
0.00
-203.13
-406.26
0.00
868.75
1,737.50
2,606.25
3,475.00
4,343.75
5,212.50
6,081.25
6,950.00
손익(백만)





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
OESXQ7-C3	EURO STOXX 50	875
OESXQ7-C3	EURO STOXX 50	65
OESXQ7-P3	EURO STOXX 50	875
OESXQ7-P3	EURO STOXX 50	65
VGU7	(VGU7)Eurex EURO STOXX 50 SEP17	936

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	2,353

공시일	2017-07-26
기준일	2017-07-25

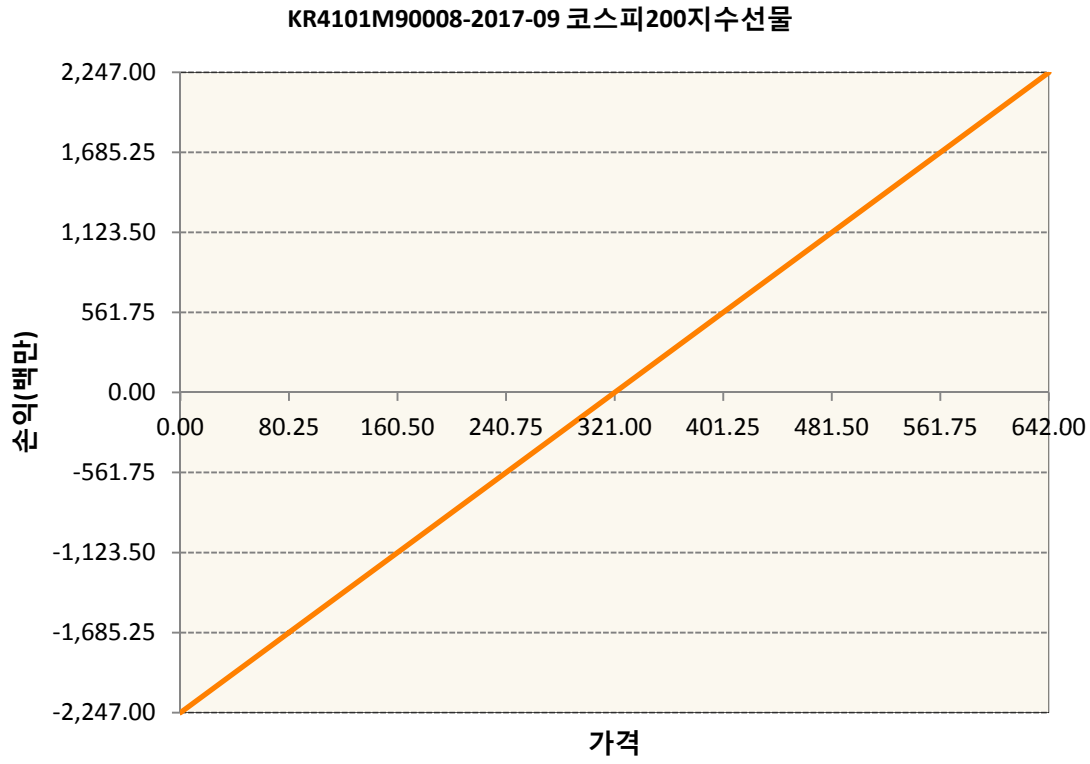
ETF스마트레버리지목표전환형7호

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							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%	-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%	179	179	179	179	179	179	179

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

108

공시일	2017-07-26
기준일	2017-07-25

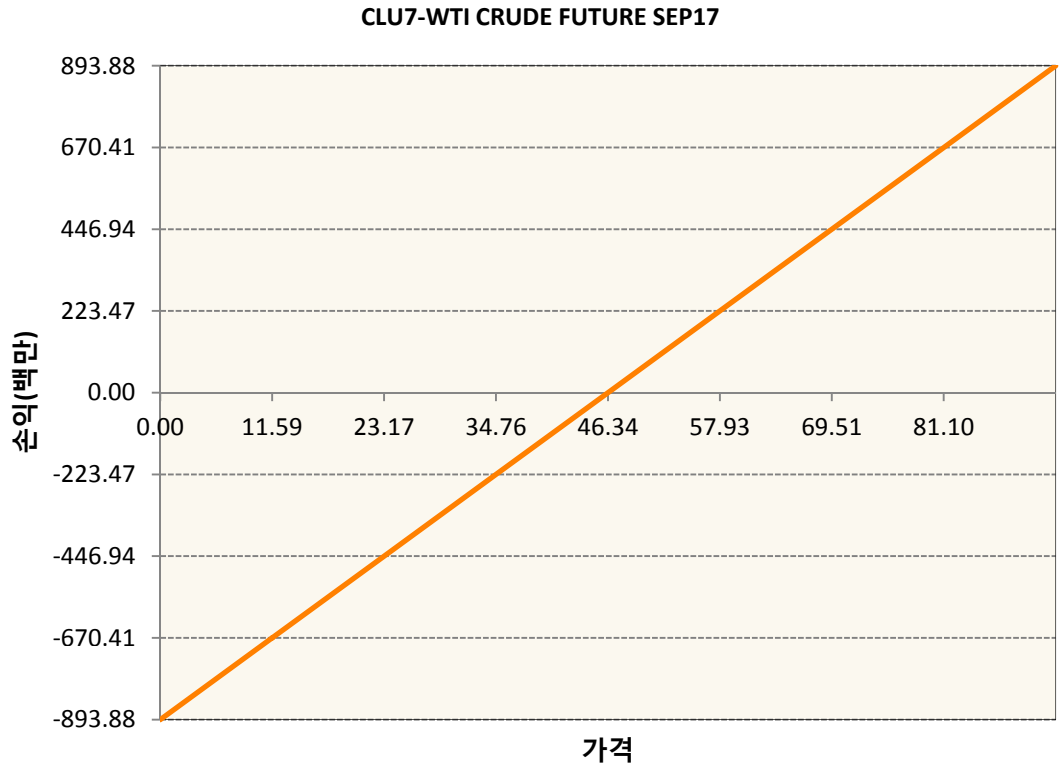
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

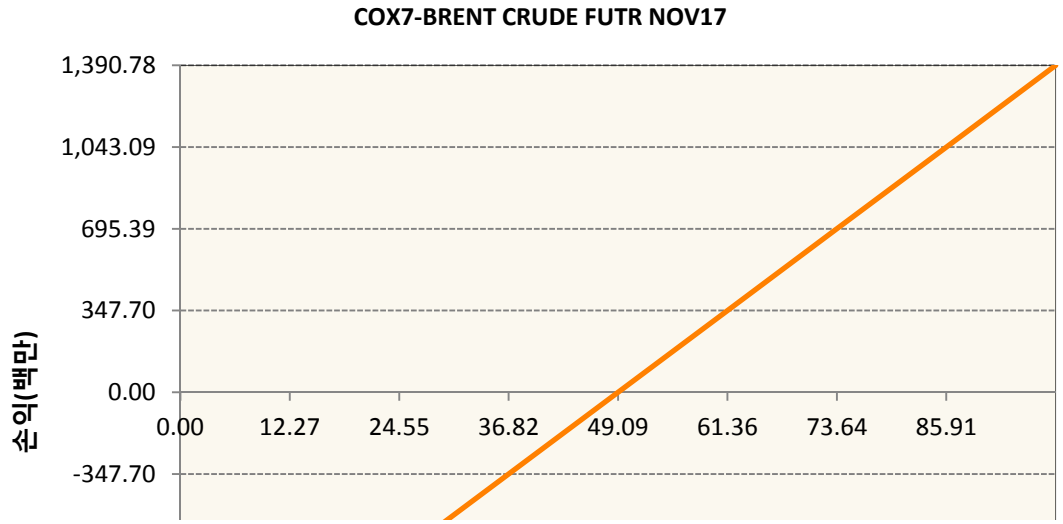
1. 계약금액

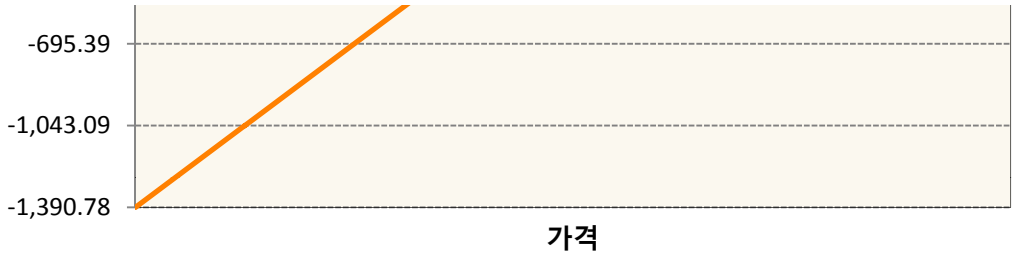
(단위:백만원)

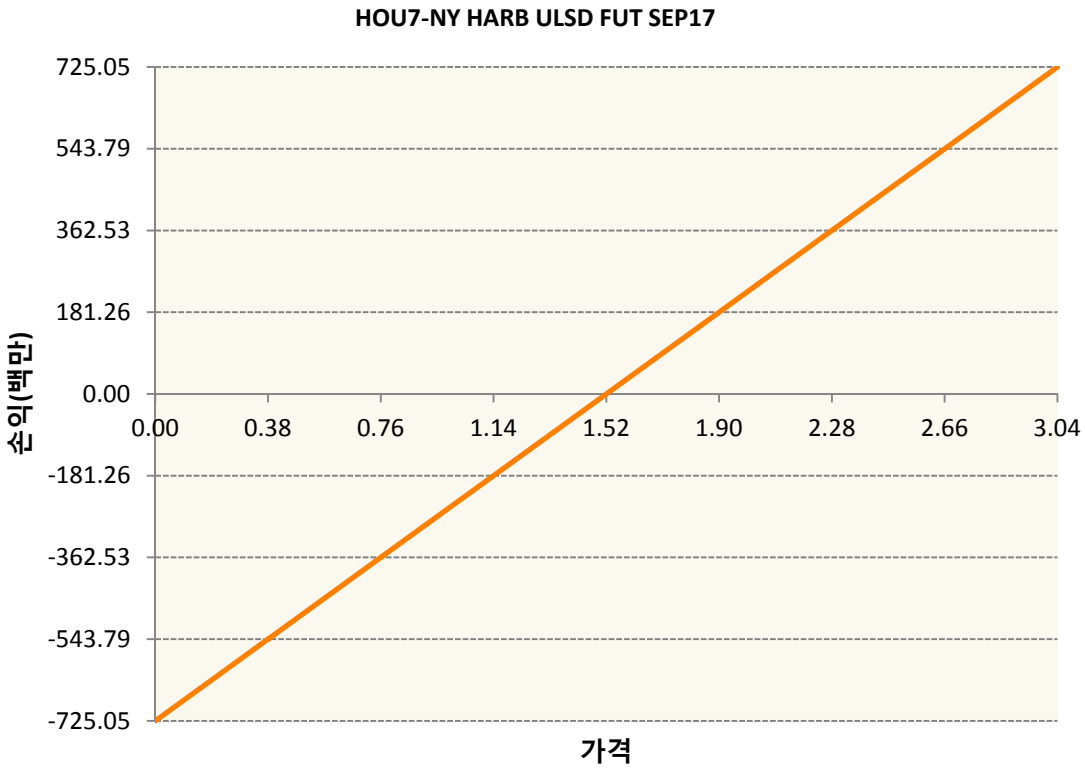
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	5,115	223	4,892	

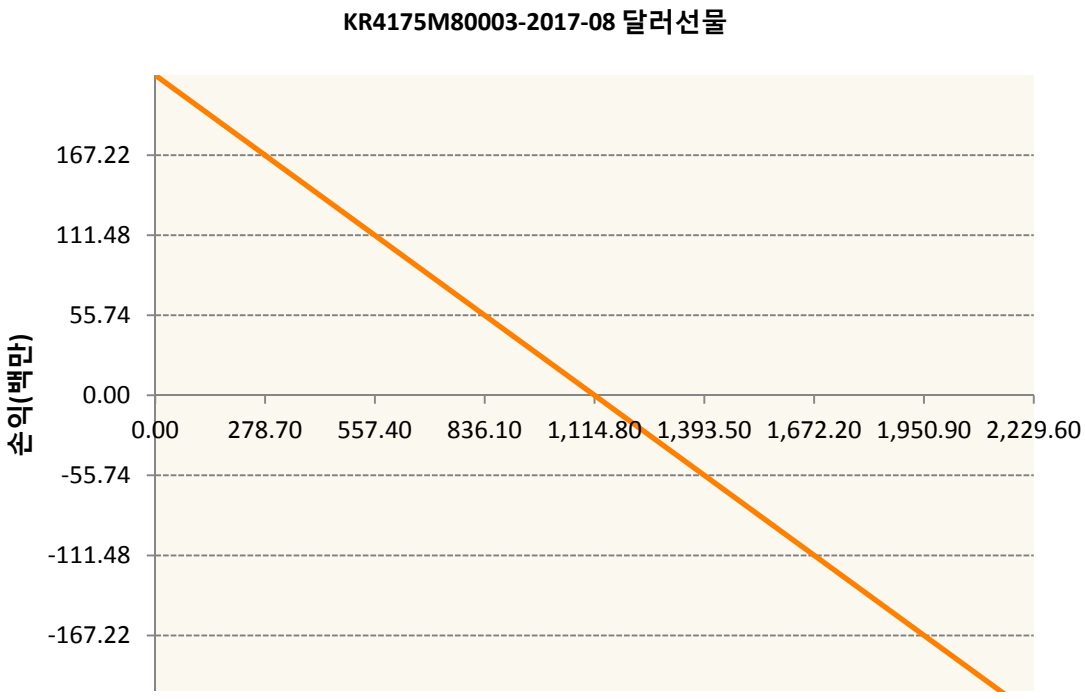
2. 만기시점의 손익구조

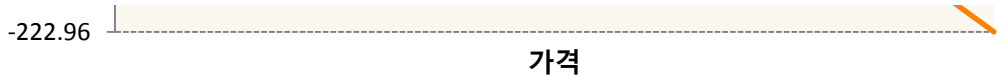


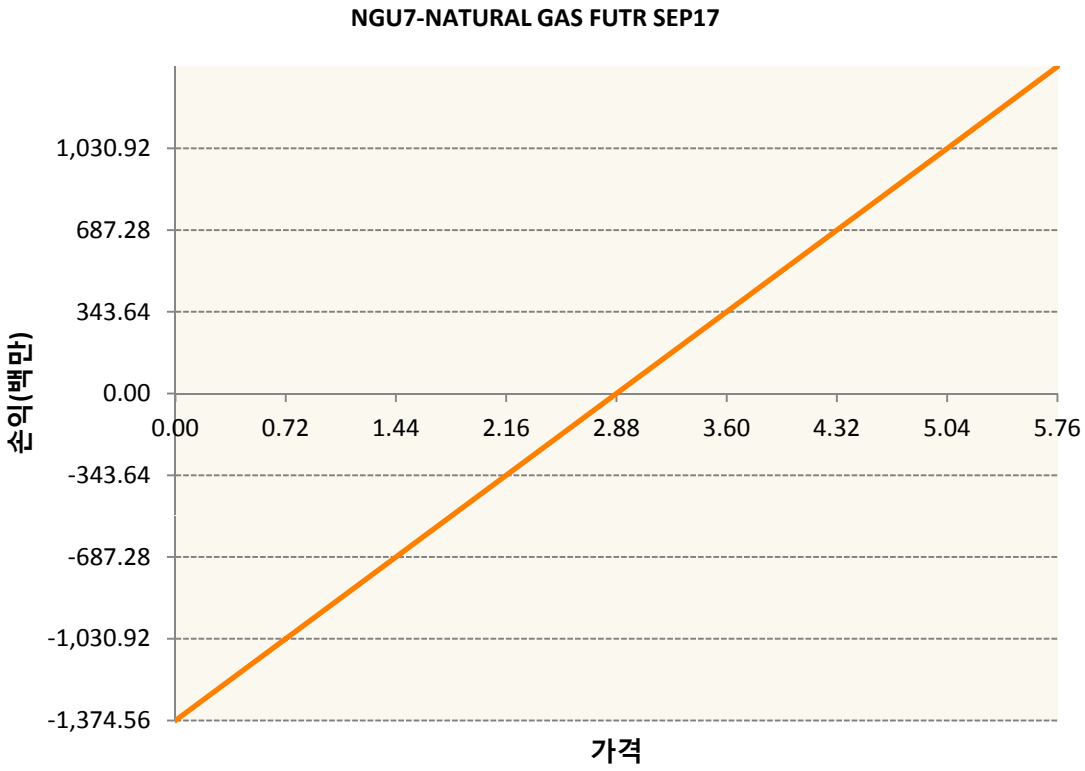


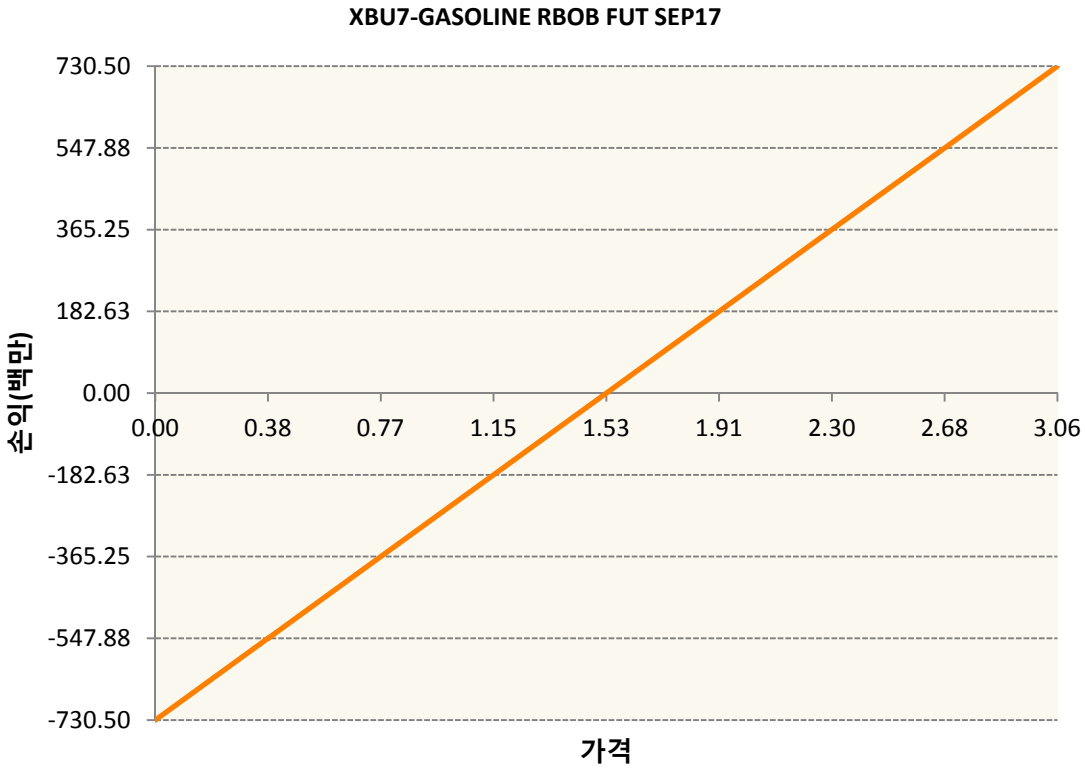

-695.39
-1,043.09
-1,390.78
가격


HOU7-NY HARB ULSD FUT SEP17
725.05
543.79
362.53
181.26
0.00
-181.26
-362.53
-543.79
-725.05
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
167.22
111.48
55.74
0.00
-55.74
-111.48
-167.22
0.00
278.70
557.40
836.10
1,114.80
1,393.50
1,672.20
1,950.90
2,229.60
손익(만)


-222.96
가격


NGU7-NATURAL GAS FUTR SEP17
손익(백만)
1,030.92
687.28
343.64
0.00
-343.64
-687.28
-1,030.92
-1,374.56
0.00
0.72
1.44
2.16
2.88
3.60
4.32
5.04
5.76
가격


XBU7-GASOLINE RBOB FUT SEP17
손익(백만)
730.50
547.88
365.25
182.63
0.00
-182.63
-365.25
-547.88
-730.50
0.00
0.38
0.77
1.15
1.53
1.91
2.30
2.68
3.06
가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLU7	WTI CRUDE FUTURE SEP17	72
COX7	BRENT CRUDE FUTR NOV17	111
HOU7	NY HARB ULSD FUT SEP17	58
KR4175M80(	2017-08 달러선물	18
NGU7	NATURAL GAS FUTR SEP17	110
XBU7	GASOLINE RBOB FUT SEP17	58

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

762

공시일	2017-07-26
기준일	2017-07-25

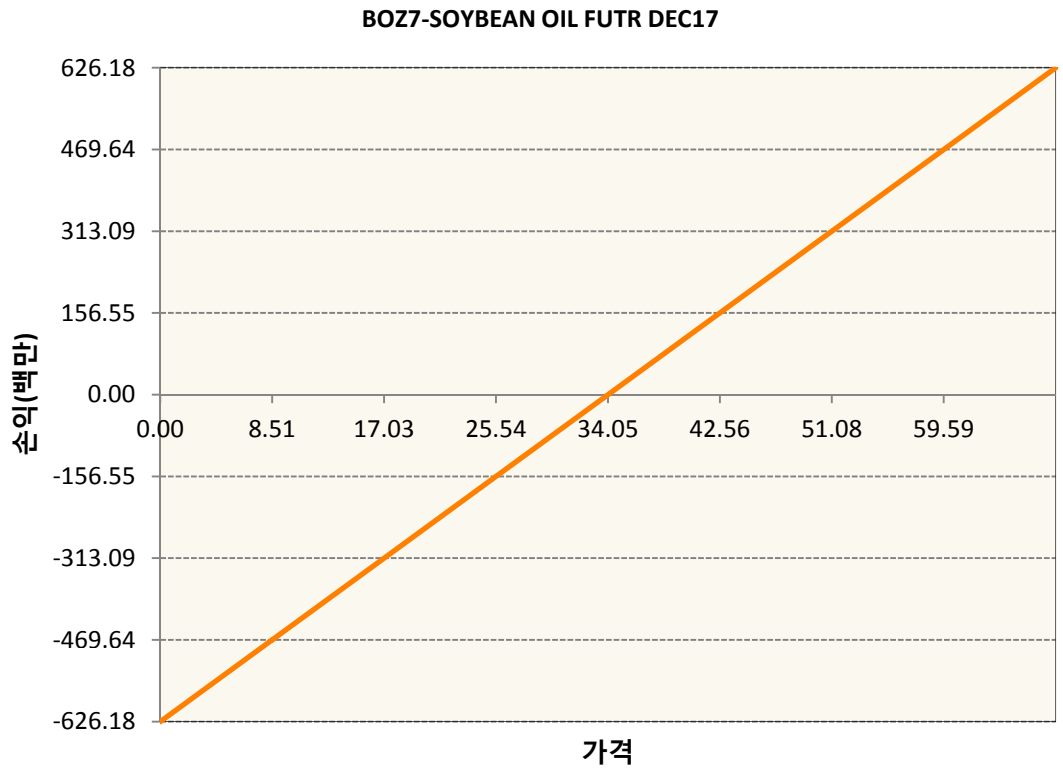
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

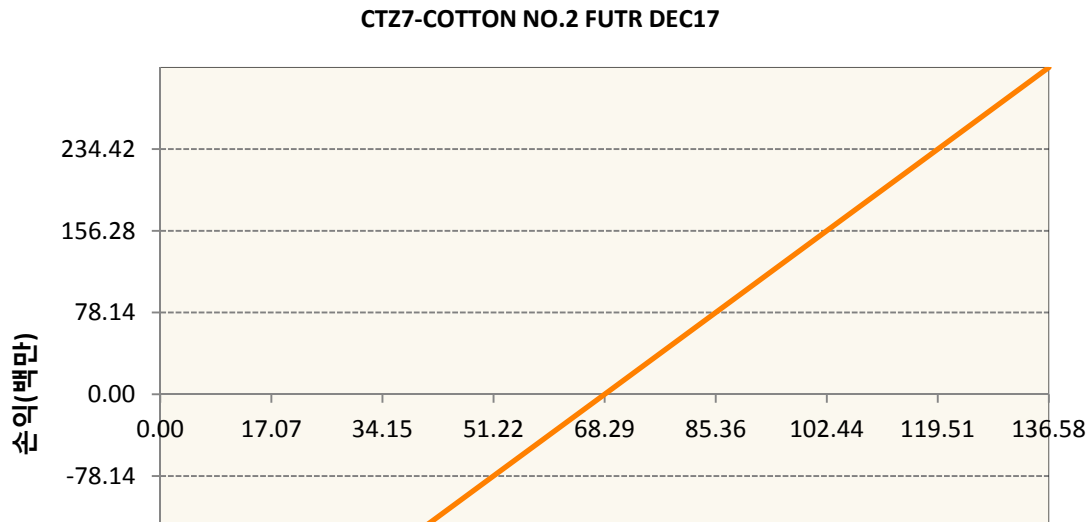
1. 계약금액

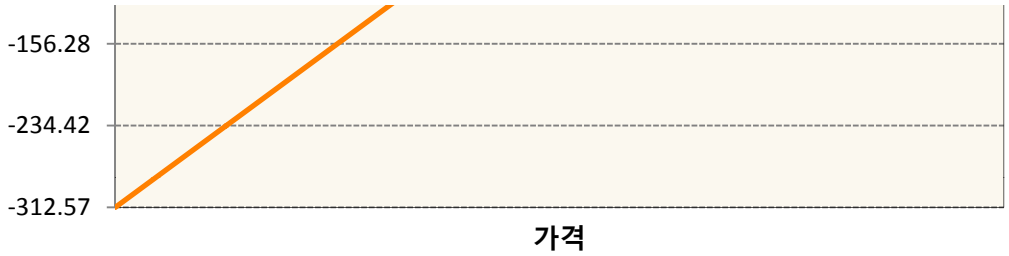
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	7,079	390	6,689	

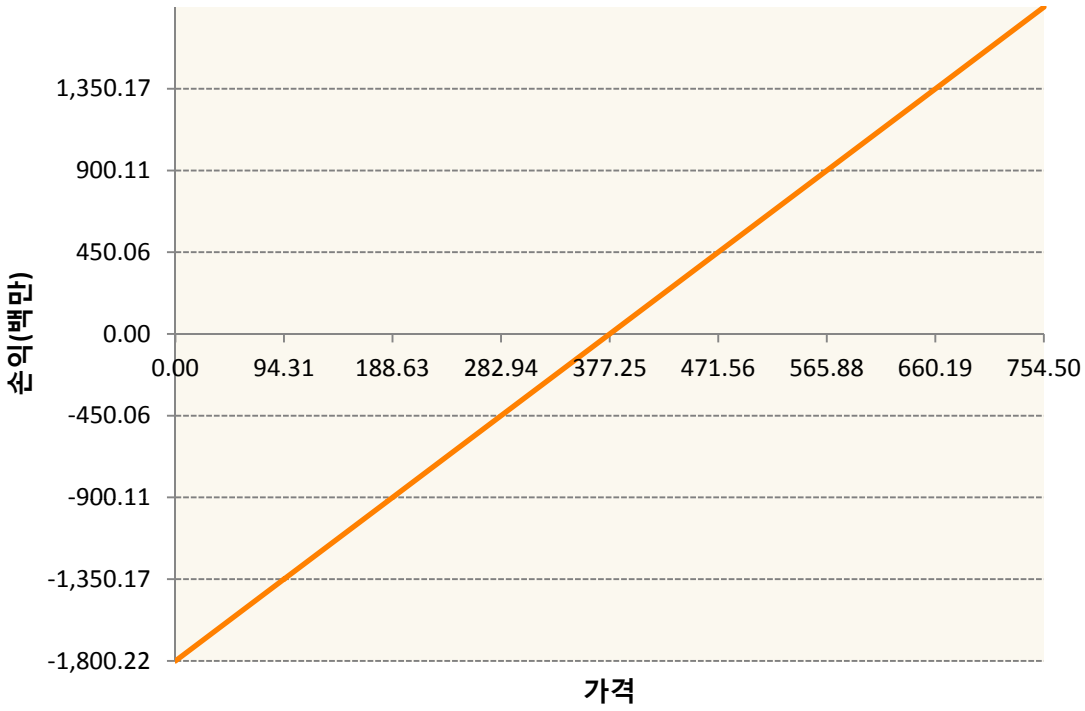
2. 만기시점의 손익구조



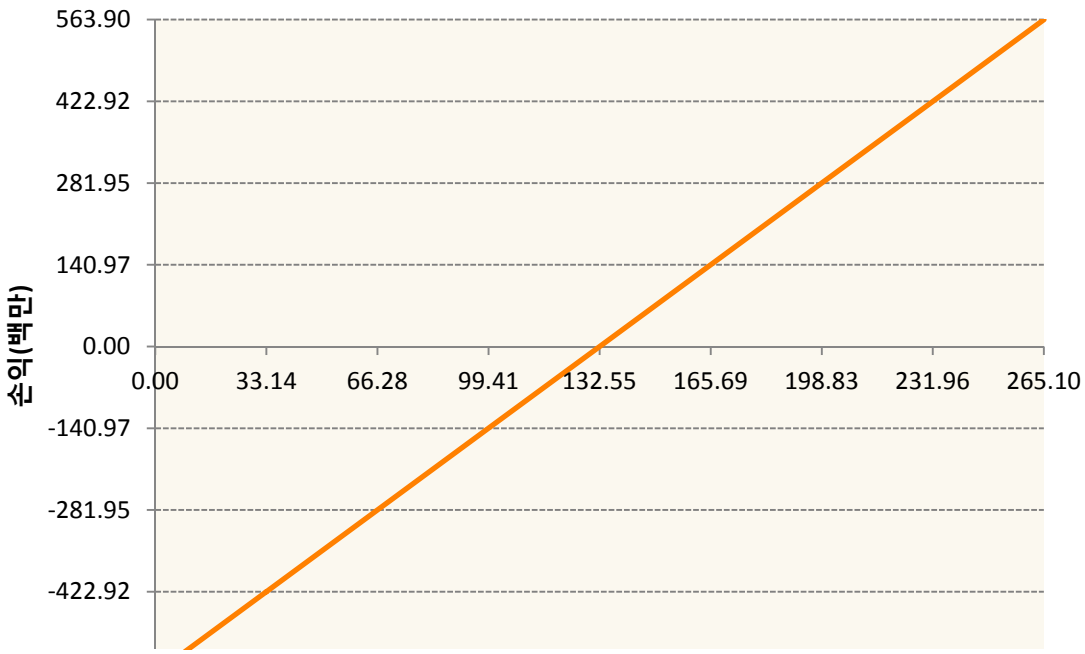


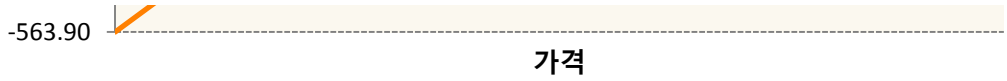


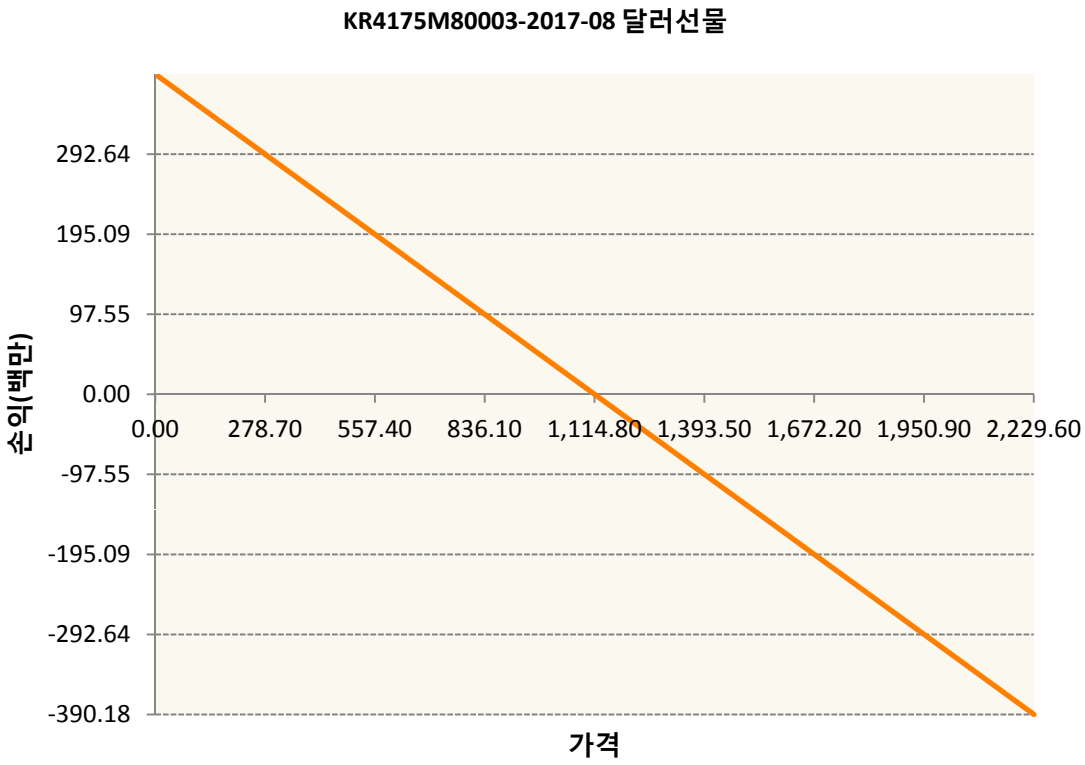
CU7-CORN FUTURE SEP17

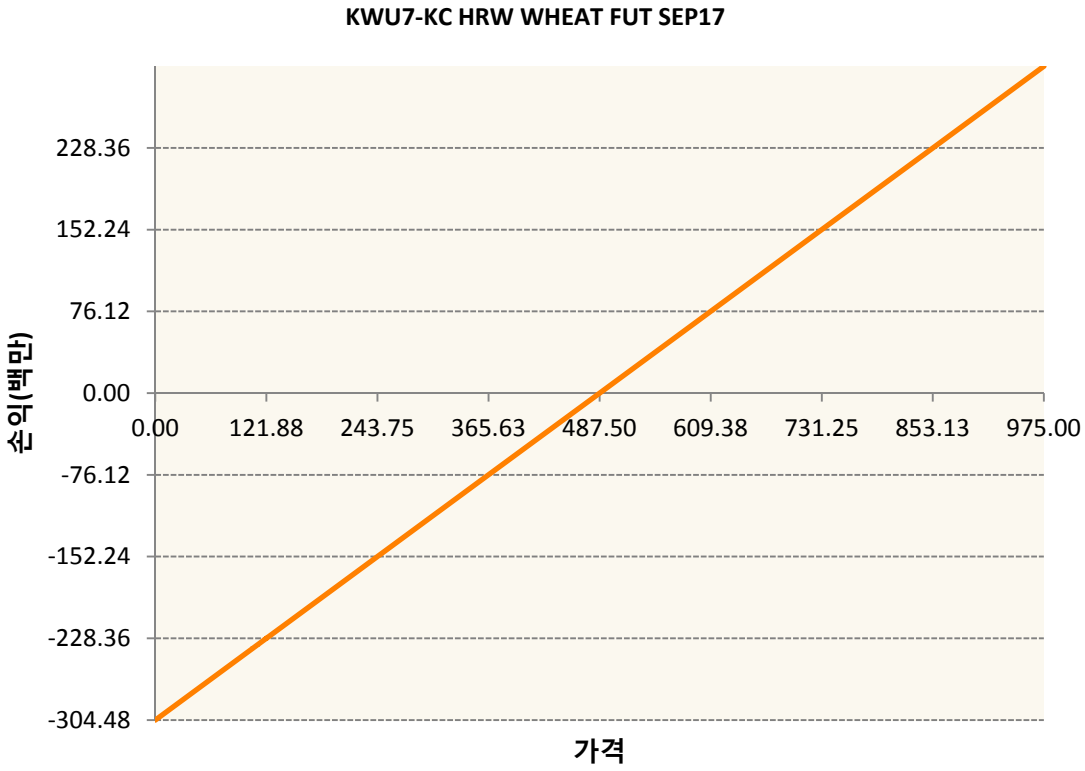


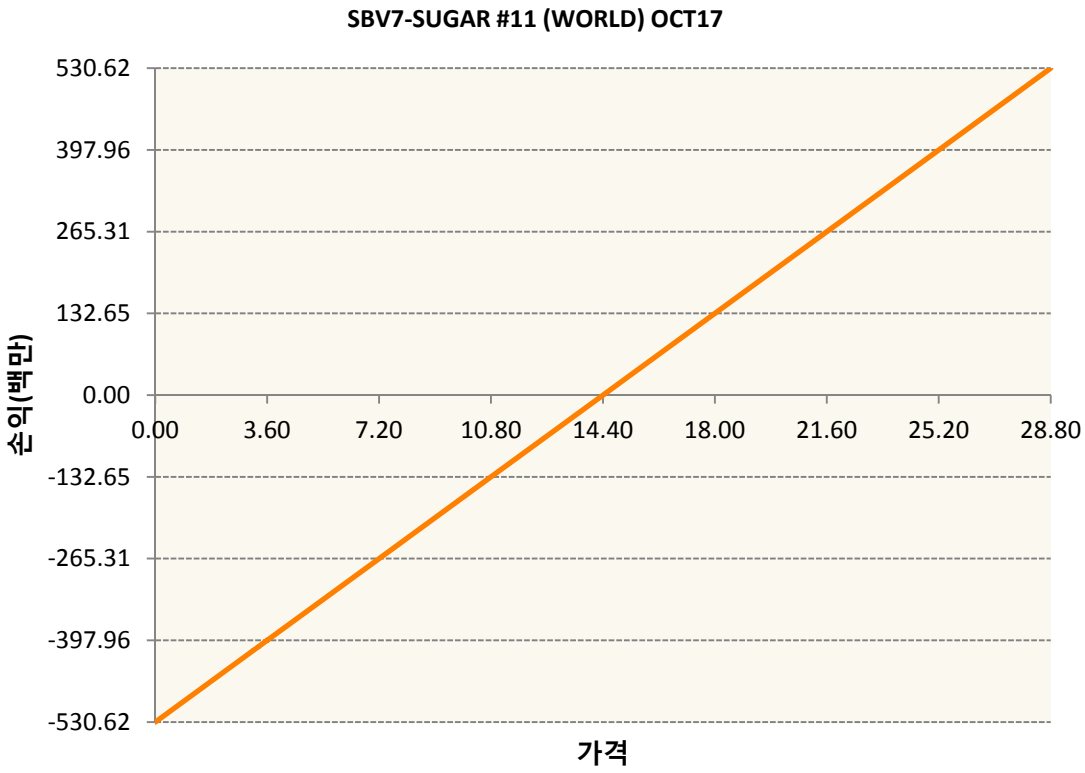
KCU7-COFFEE 'C' FUTURE SEP17

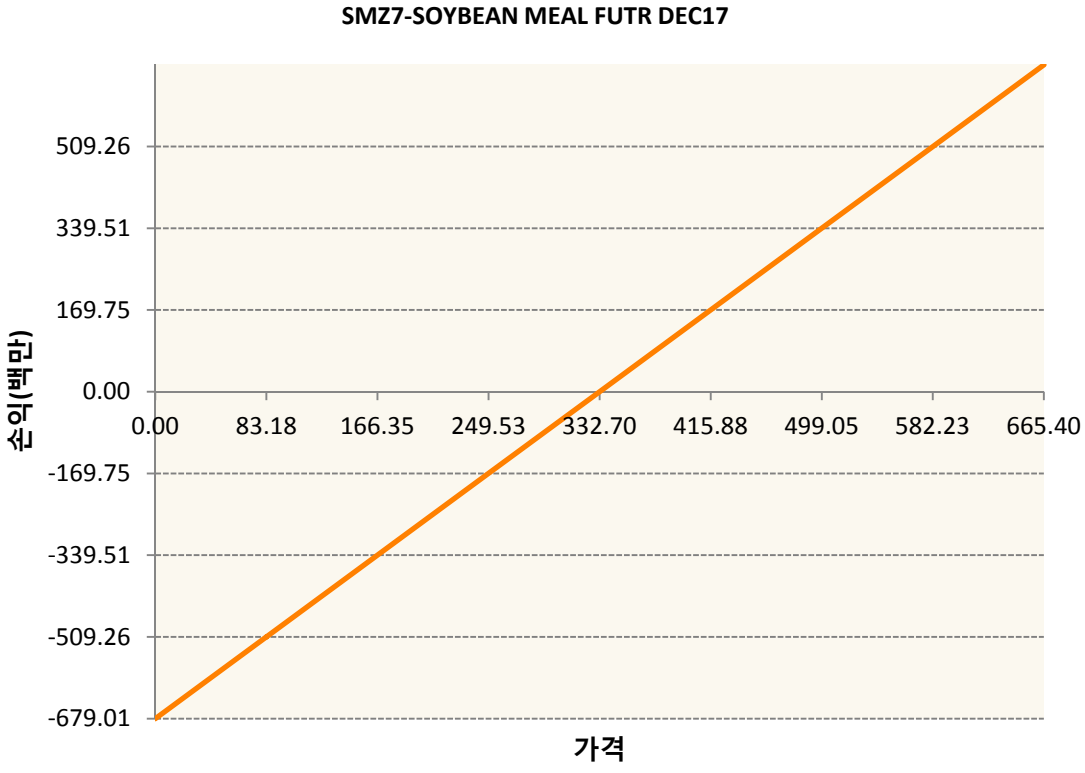


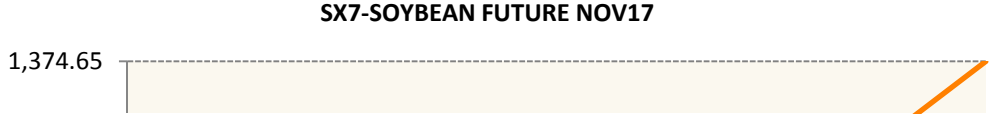

-563.90
가격

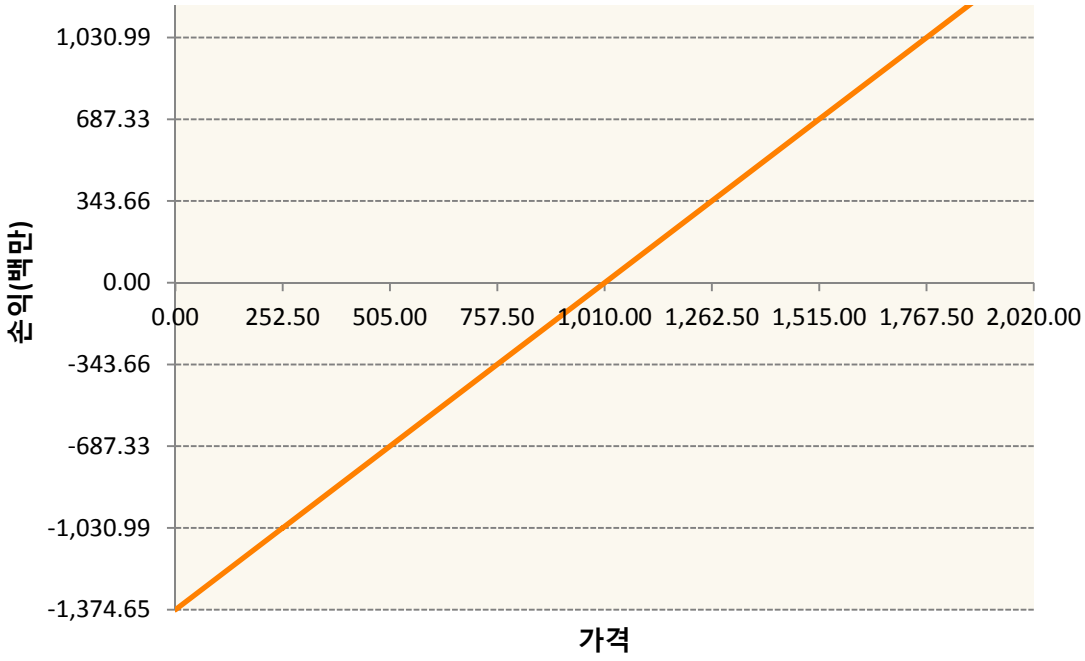

KR4175M80003-2017-08 달러선물
292.64
195.09
97.55
0.00
-97.55
-195.09
-292.64
-390.18
0.00
278.70
557.40
836.10
1,114.80
1,393.50
1,672.20
1,950.90
2,229.60
손익(백만)
가격

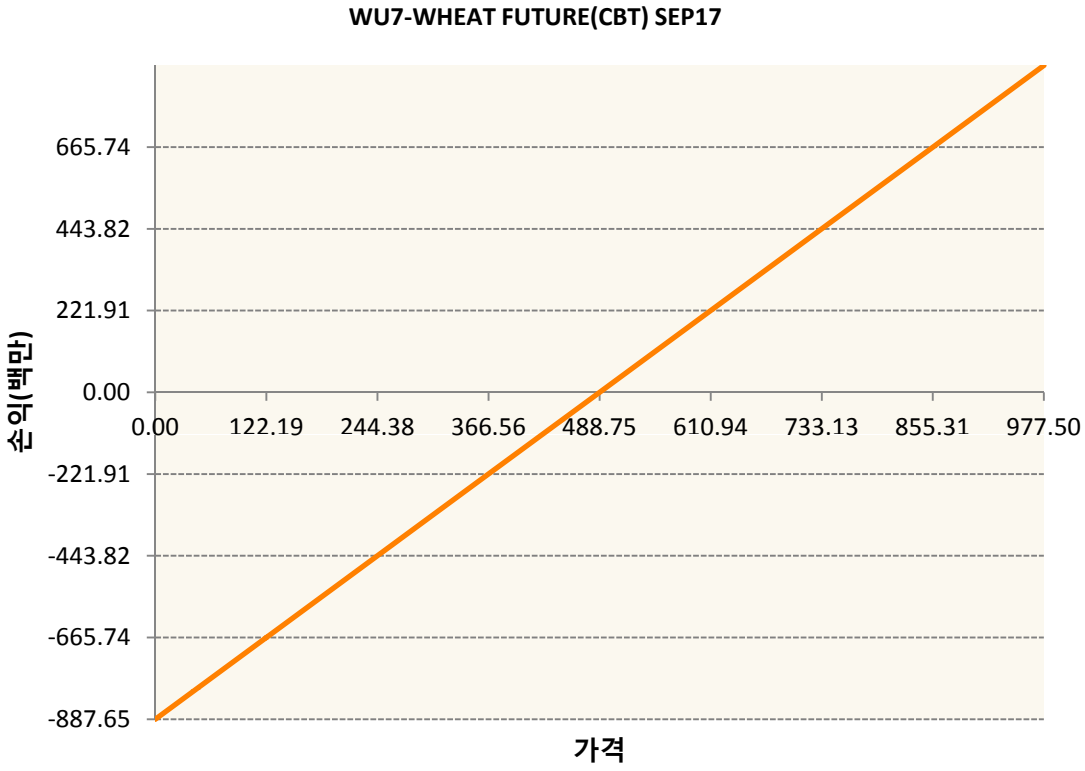

KWU7-KC HRW WHEAT FUT SEP17
228.36
152.24
76.12
0.00
-76.12
-152.24
-228.36
-304.48
0.00
121.88
243.75
365.63
487.50
609.38
731.25
853.13
975.00
손익(백만)
가격


SBV7-SUGAR #11 (WORLD) OCT17
530.62
397.96
265.31
132.65
0.00
-132.65
-265.31
-397.96
-530.62
0.00
3.60
7.20
10.80
14.40
18.00
21.60
25.20
28.80
손익(백만)
가격


SMZ7-SOYBEAN MEAL FUTR DEC17
509.26
339.51
169.75
0.00
-169.75
-339.51
-509.26
-679.01
0.00
83.18
166.35
249.53
332.70
415.88
499.05
582.23
665.40
손익(백만)
가격


SX7-SOYBEAN FUTURE NOV17
1,374.65





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

BOZ7	SOYBEAN OIL FUTR DEC17	50
CTZ7	COTTON NO.2 FUTR DEC17	25
CU7	CORN FUTURE SEP17	144
KCU7	COFFEE 'C' FUTURE SEP17	45
KR4175M80(	2017-08 달러선물	31

KWU7	KC HRW WHEAT FUT SEP17	24
SBV7	SUGAR #11 (WORLD) OCT17	42
SMZ7	SOYBEAN MEAL FUTR DEC17	54
SX7	SOYBEAN FUTURE NOV17	110
WU7	WHEAT FUTURE(CBT) SEP17	71

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

665