공시일	2017-07-27
기준일	2017-07-26

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	2017-07-27
기준일	2017-07-26

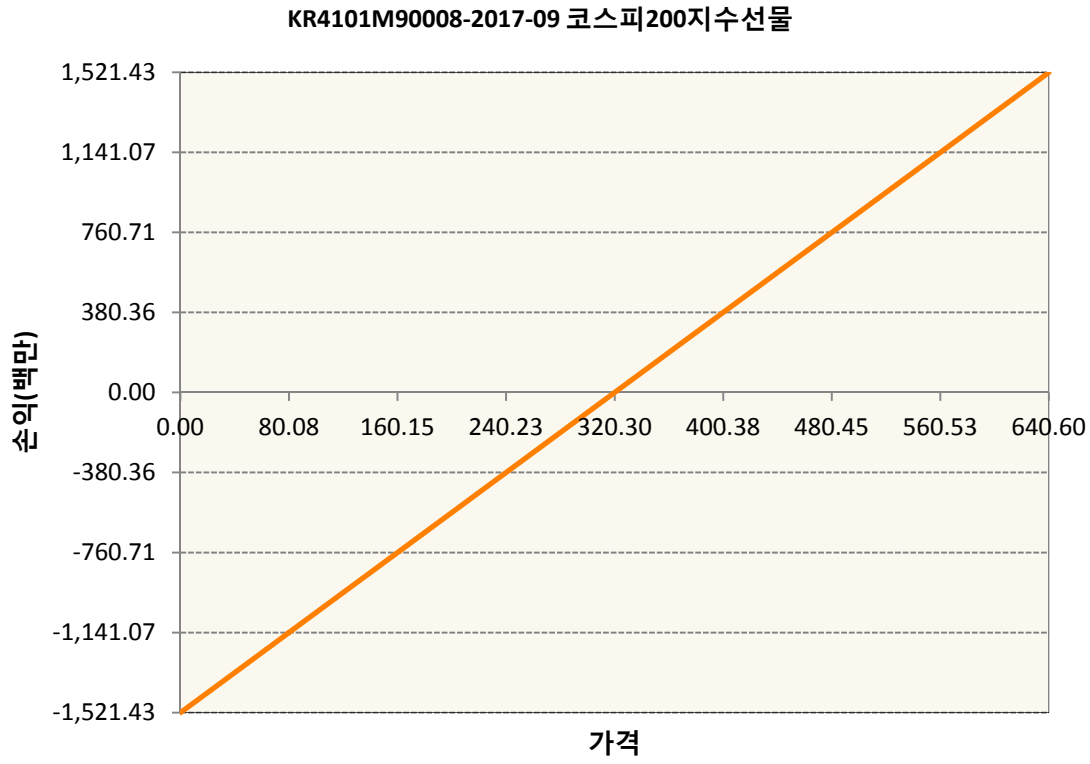
스마트인덱스모

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	1,521	0	1,521	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101M90(2017-09 코스피200지수선물							121
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-121	-121	-121	-121	-121	-121	-121
-5.33%	-81	-81	-81	-81	-81	-81	-81
-2.67%	-40	-40	-40	-40	-40	-40	-40
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	40	40	40	40	40	40	40
5.33%	81	81	81	81	81	81	81
8.00%	121	121	121	121	121	121	121

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

73

공시일	2017-07-27
기준일	2017-07-26

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	1,021

* 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	2017-07-27
기준일	2017-07-26

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	2017-07-27
기준일	2017-07-26

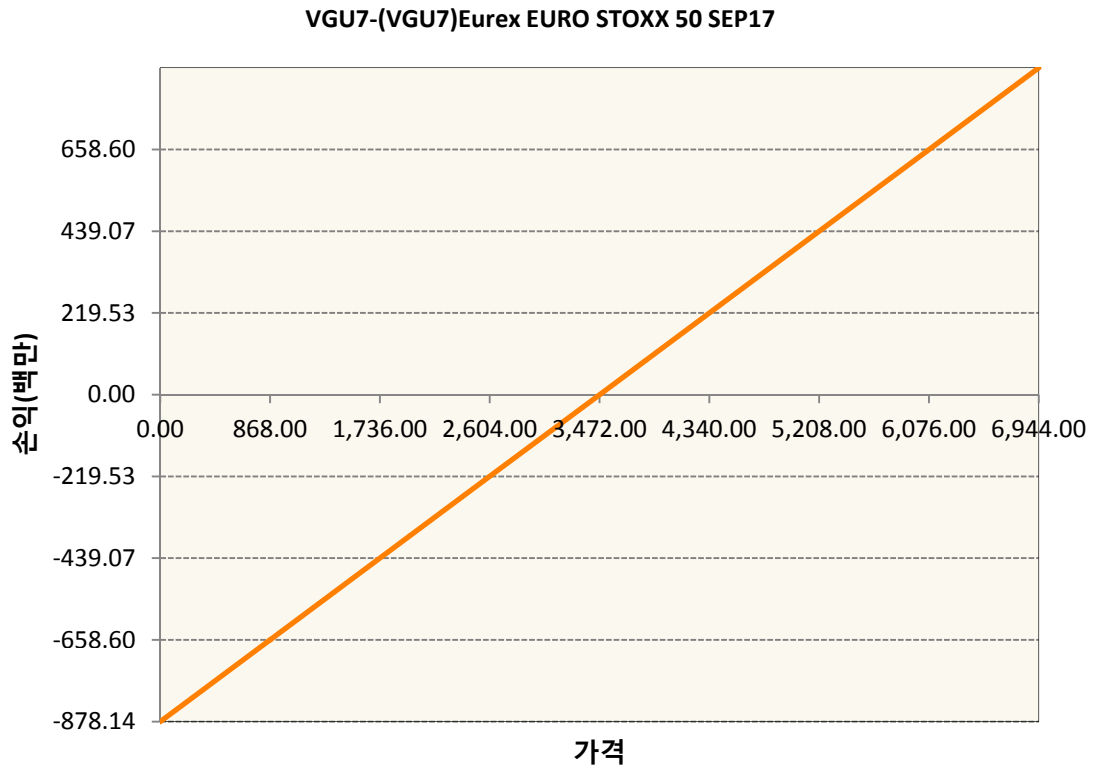
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	878	0	878	

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	2017-07-27
기준일	2017-07-26

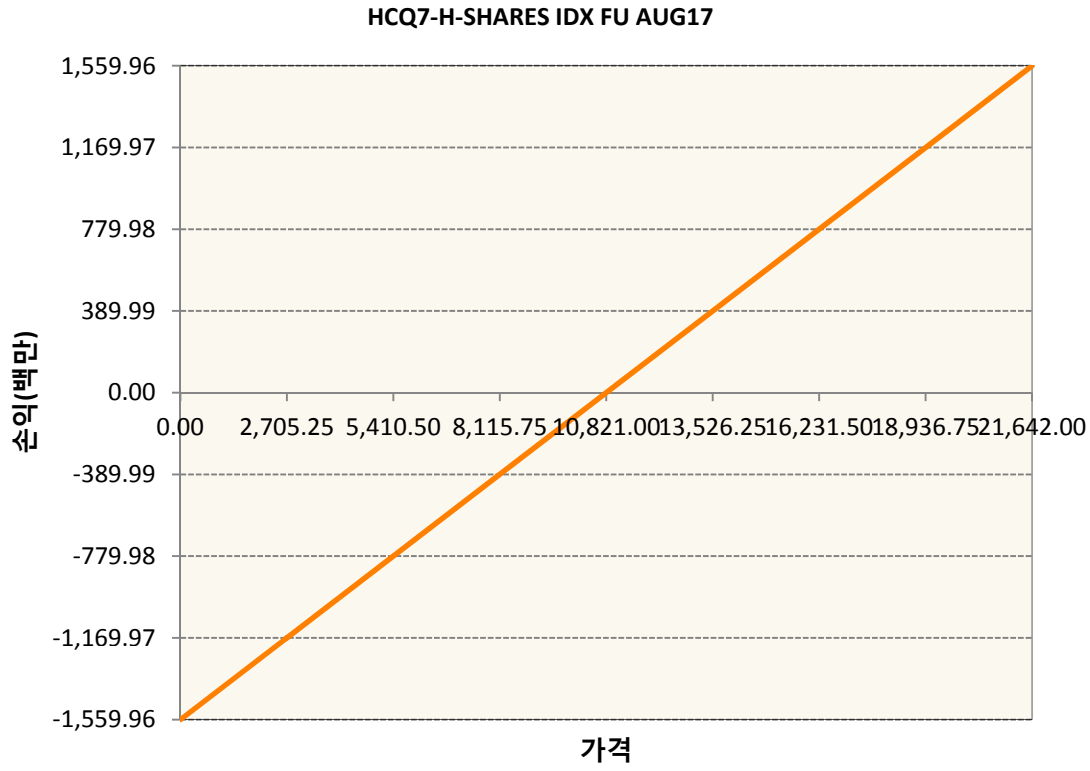
차이나인덱스모(주식-파생형)

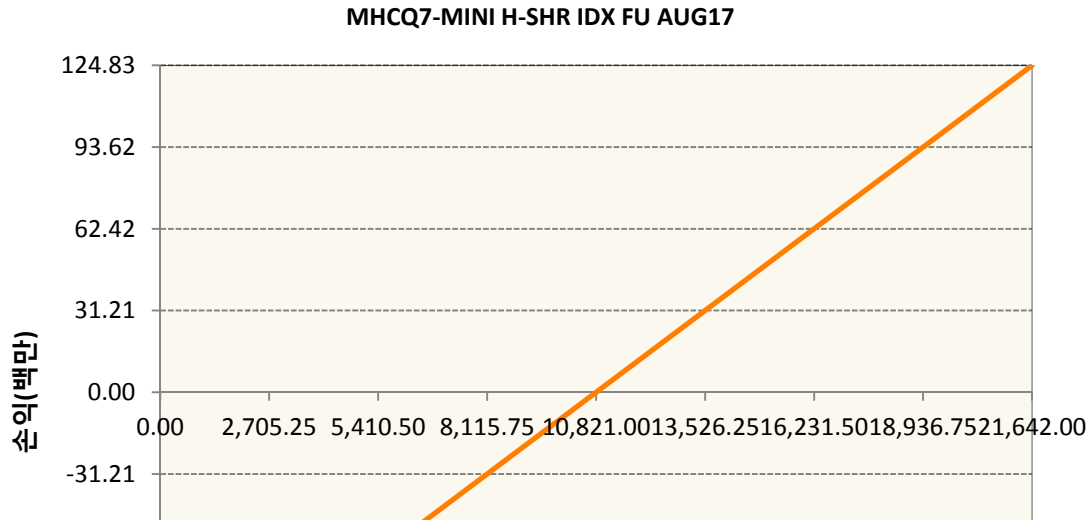
1. 계약금액

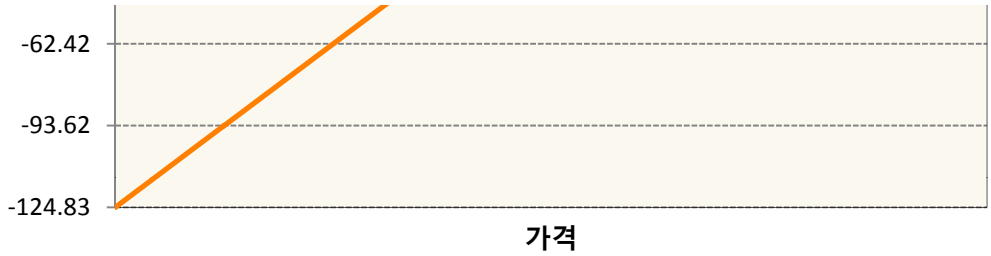
(단위:백만원)

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)
	122

공시일	2017-07-27
기준일	2017-07-26

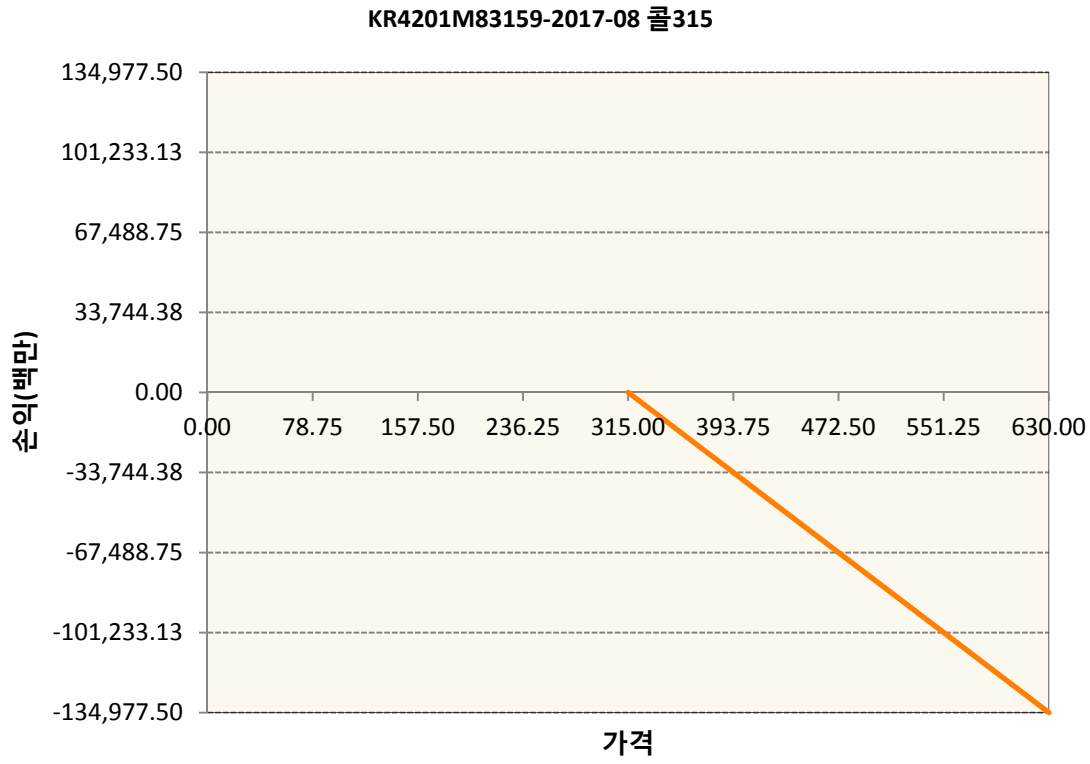
커버드콜모(주식혼합-파생형)

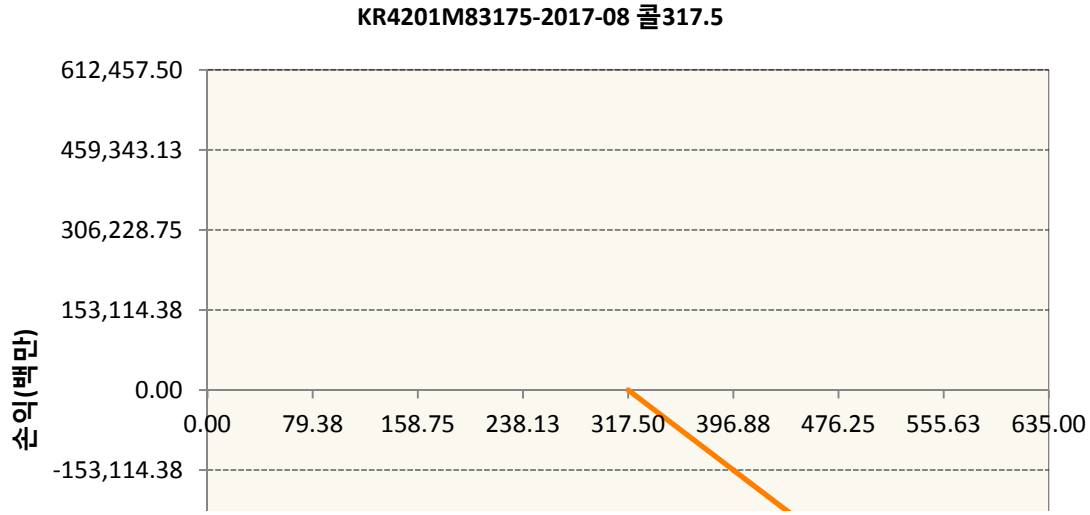
1. 계약금액

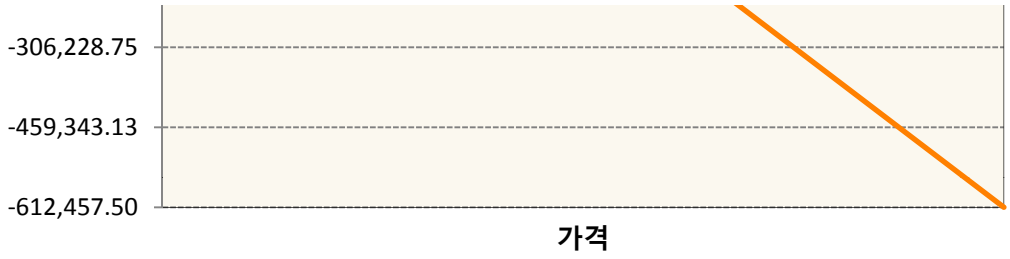
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	1,315,614	-1,315,614	장내

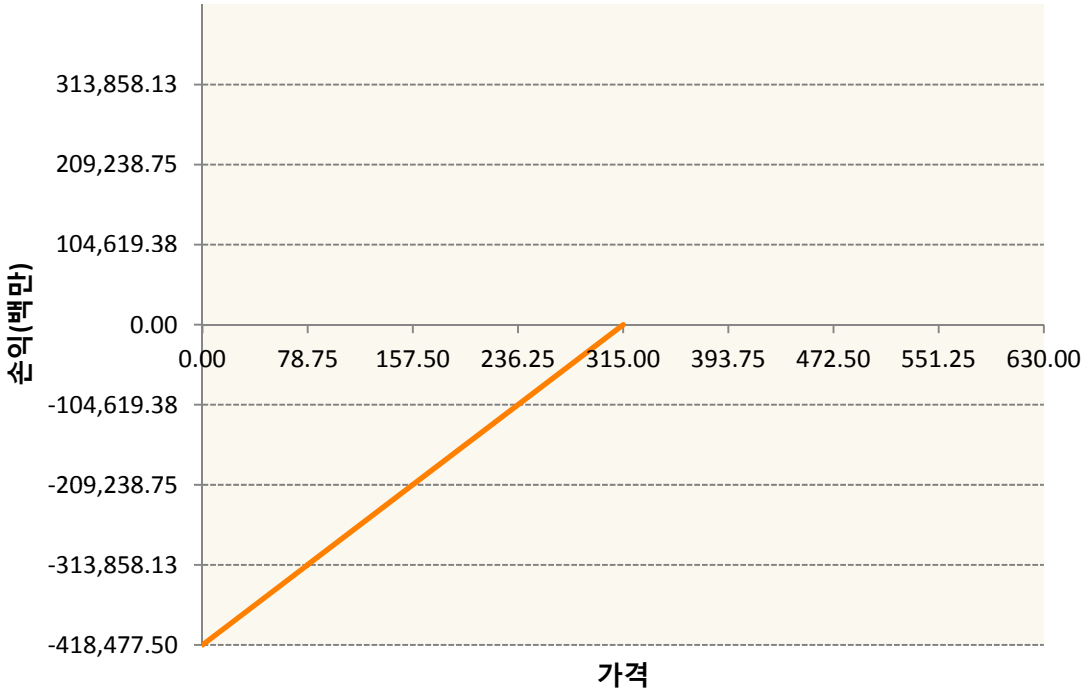
2. 만기시점의 손익구조



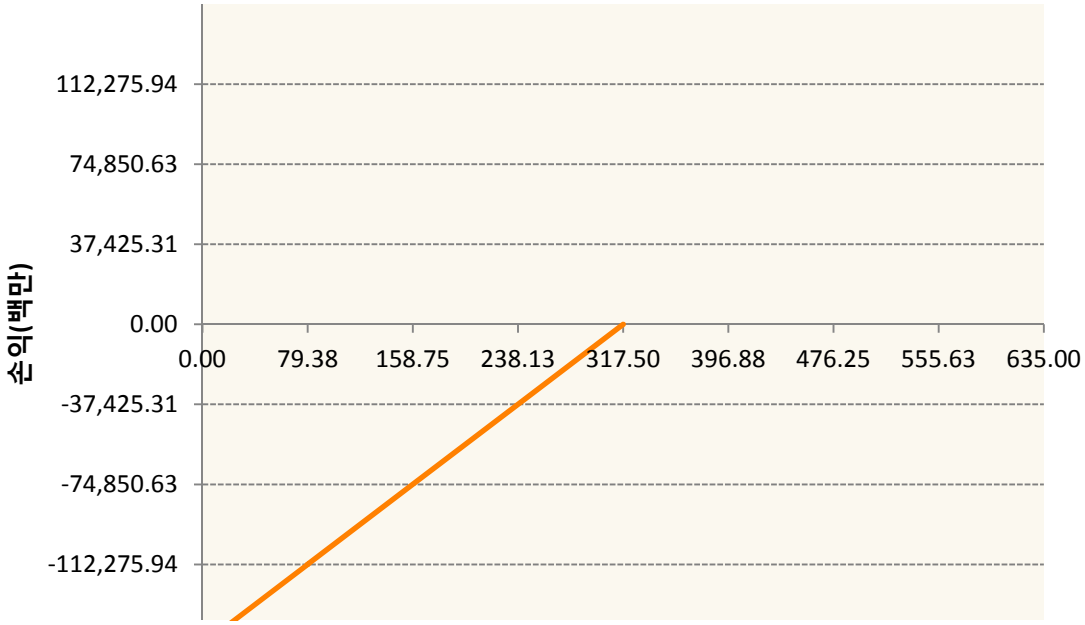




KR4301M83157-2017-08 풋315



KR4301M83173-2017-08 풋317.5





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201M83: 2017-08 콜315							9,486
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	3,523	3,491	3,446	3,388	3,318	3,237	3,146
-5.33%	3,295	3,187	3,067	2,935	2,794	2,646	2,492
-2.67%	2,458	2,266	2,071	1,875	1,677	1,479	1,280
0%	586	393	197	0	-199	-399	-600
2.67%	-2,277	-2,391	-2,518	-2,656	-2,804	-2,959	-3,121
5.33%	-5,693	-5,734	-5,790	-5,859	-5,942	-6,036	-6,141
8.00%	-9,296	-9,305	-9,322	-9,348	-9,383	-9,429	-9,486
KR4201M83: 2017-08 콜317.5							41,000
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	13,156	13,061	12,918	12,725	12,479	12,184	11,842
-5.33%	12,508	12,135	11,696	11,200	10,655	10,069	9,447
-2.67%	9,755	8,970	8,161	7,333	6,491	5,638	4,775
0%	2,783	1,858	930	0	-931	-1,863	-2,796
2.67%	-8,937	-9,577	-10,264	-10,989	-11,745	-12,526	-13,328
5.33%	-23,773	-24,043	-24,383	-24,787	-25,249	-25,762	-26,320
8.00%	-39,841	-39,914	-40,030	-40,195	-40,412	-40,681	-41,000
KR4301M83: 2017-08 풋315							26,723
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-26,711	-26,711	-26,711	-26,712	-26,713	-26,717	-26,723
-5.33%	-15,409	-15,423	-15,446	-15,482	-15,530	-15,593	-15,669
-2.67%	-4,828	-5,039	-5,262	-5,495	-5,735	-5,982	-6,234
0%	648	445	228	0	-237	-481	-731
2.67%	1,302	1,287	1,261	1,223	1,170	1,103	1,021
5.33%	1,313	1,312	1,312	1,311	1,308	1,302	1,292
8.00%	1,313	1,313	1,313	1,313	1,313	1,312	1,312
KR4301M83: 2017-08 풋317.5							10,284
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-10,282	-10,282	-10,282	-10,282	-10,282	-10,283	-10,284
-5.33%	-6,268	-6,270	-6,273	-6,278	-6,286	-6,298	-6,313
-2.67%	-2,351	-2,397	-2,450	-2,509	-2,574	-2,643	-2,715
0%	295	197	99	0	-100	-200	-301
2.67%	825	810	788	760	726	685	639

5.33%	842	842	841	839	836	831	824
8.00%	842	842	842	842	842	842	841

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

96,018

공시일	2017-07-27
기준일	2017-07-26

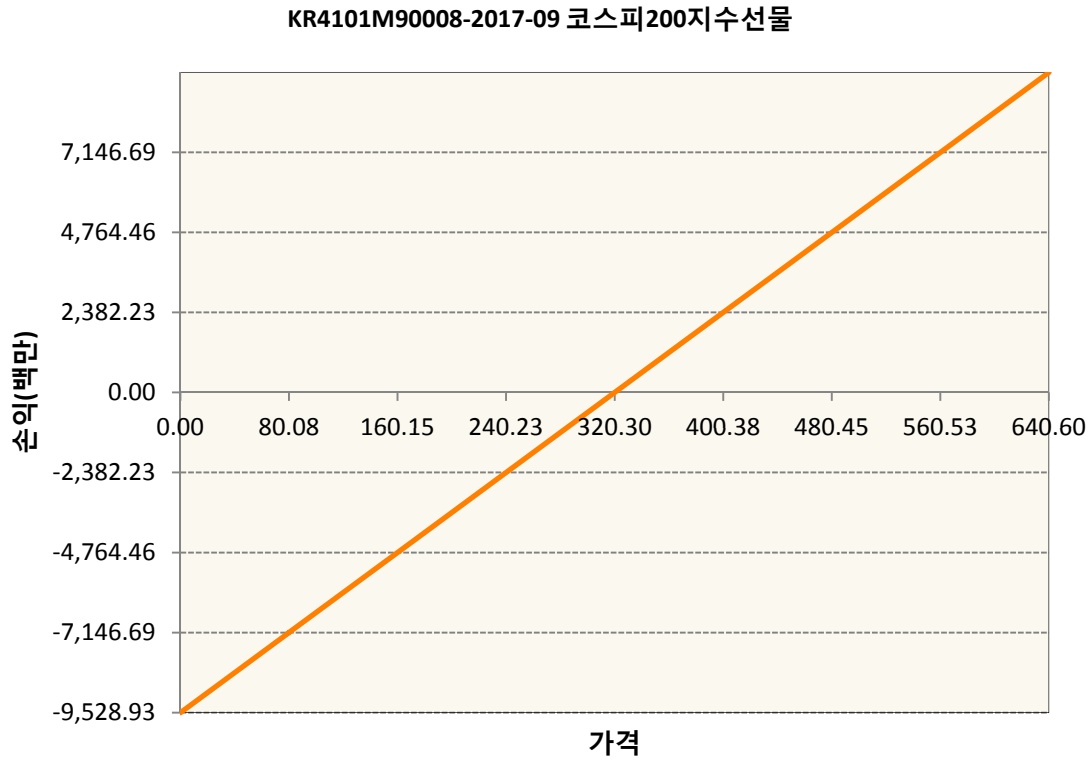
ETF스마트레버리지목표전환형6호

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	9,529	0	9,529	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101M90(2017-09 코스피200지수선물							760
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-760	-760	-760	-760	-760	-760	-760
-5.33%	-507	-507	-507	-507	-507	-507	-507
-2.67%	-253	-253	-253	-253	-253	-253	-253
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	253	253	253	253	253	253	253
5.33%	507	507	507	507	507	507	507
8.00%	760	760	760	760	760	760	760

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

456

공시일	2017-07-27
기준일	2017-07-26

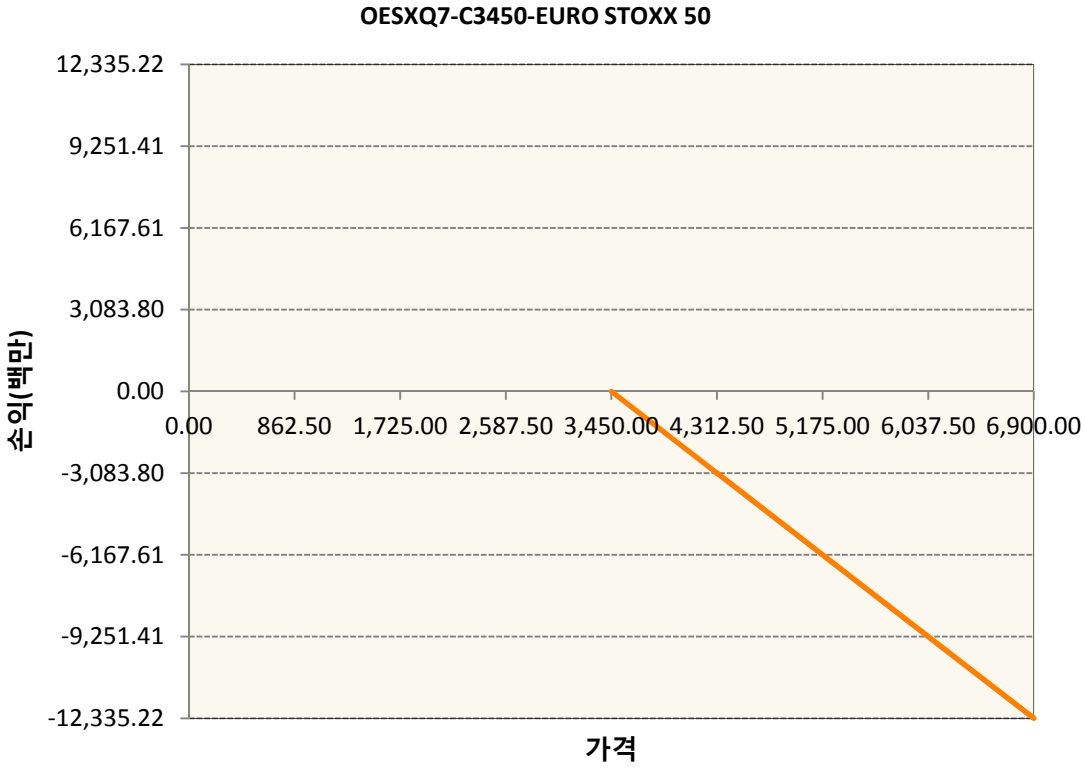
유로커버드콜(주식혼합-파생형)

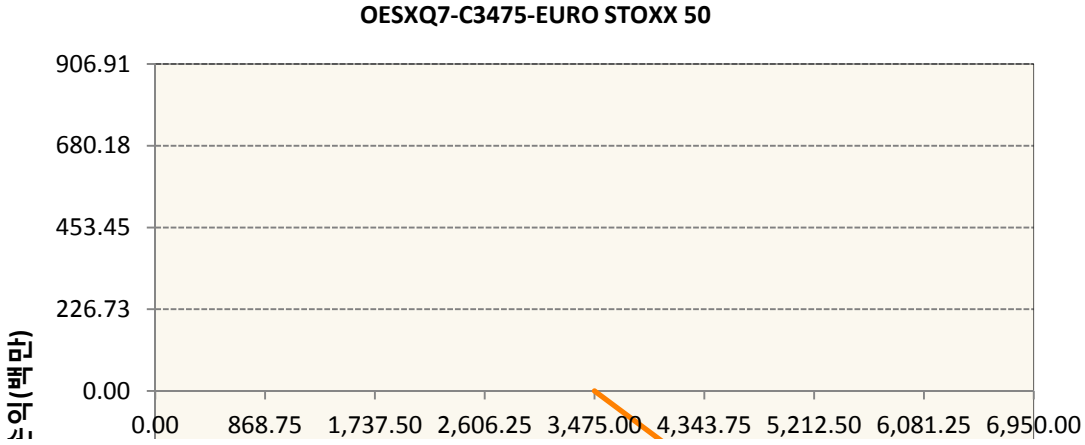
1. 계약금액

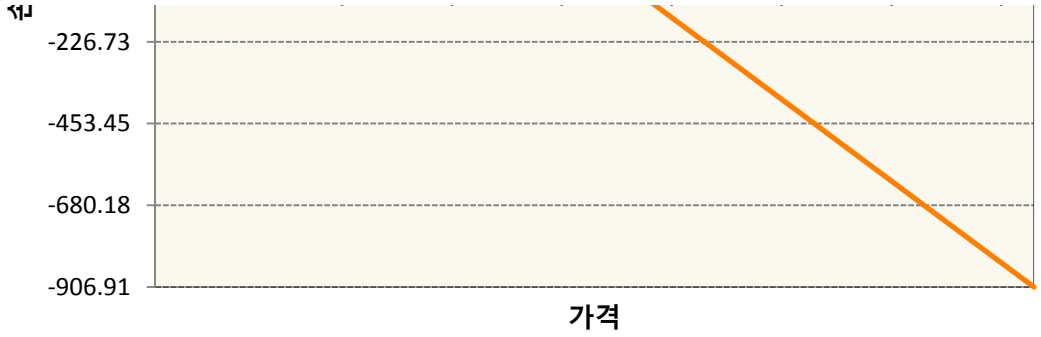
(단위:백만원)

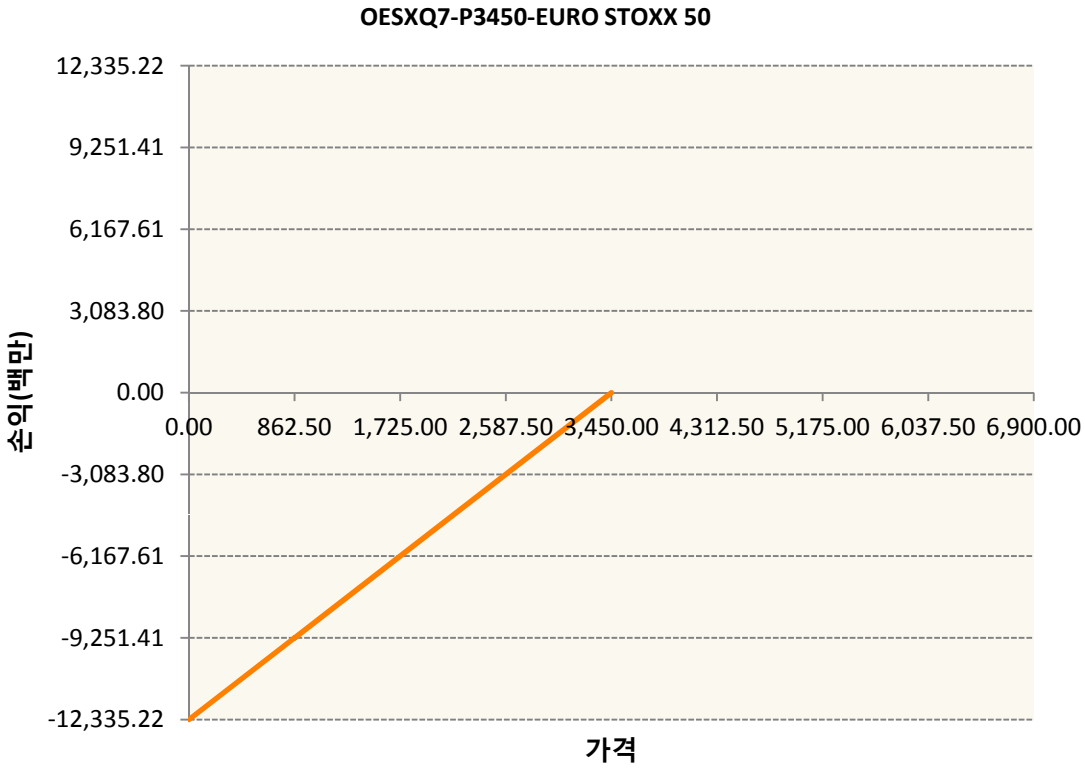
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	13,253	0	13,253	
누계	유가증권	옵션	0	26,484	-26,484	장내

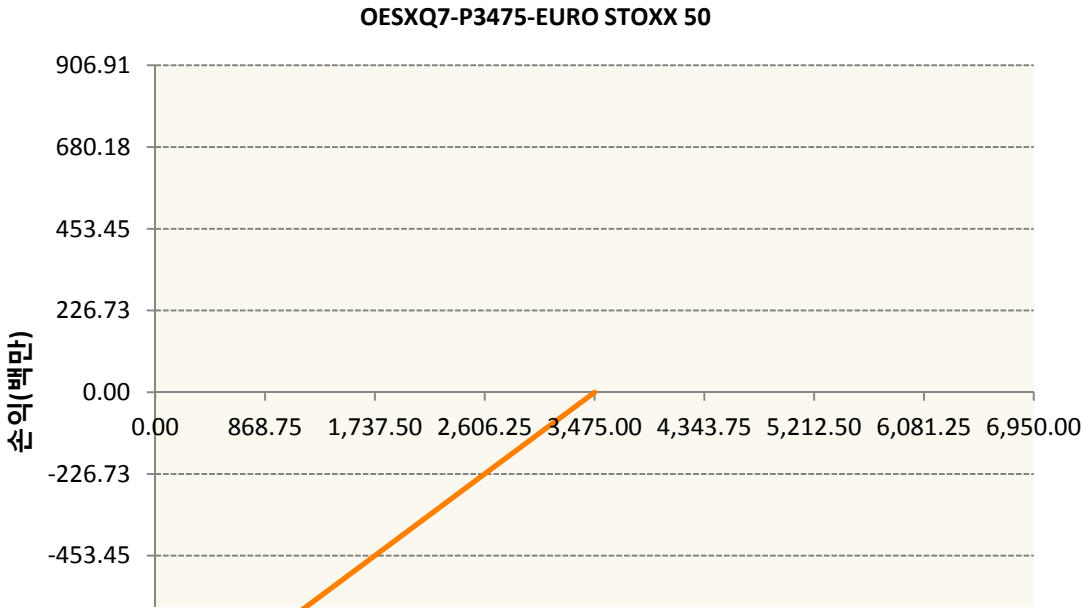
2. 만기시점의 손익구조

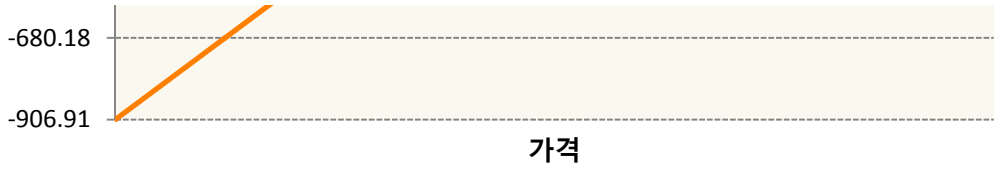


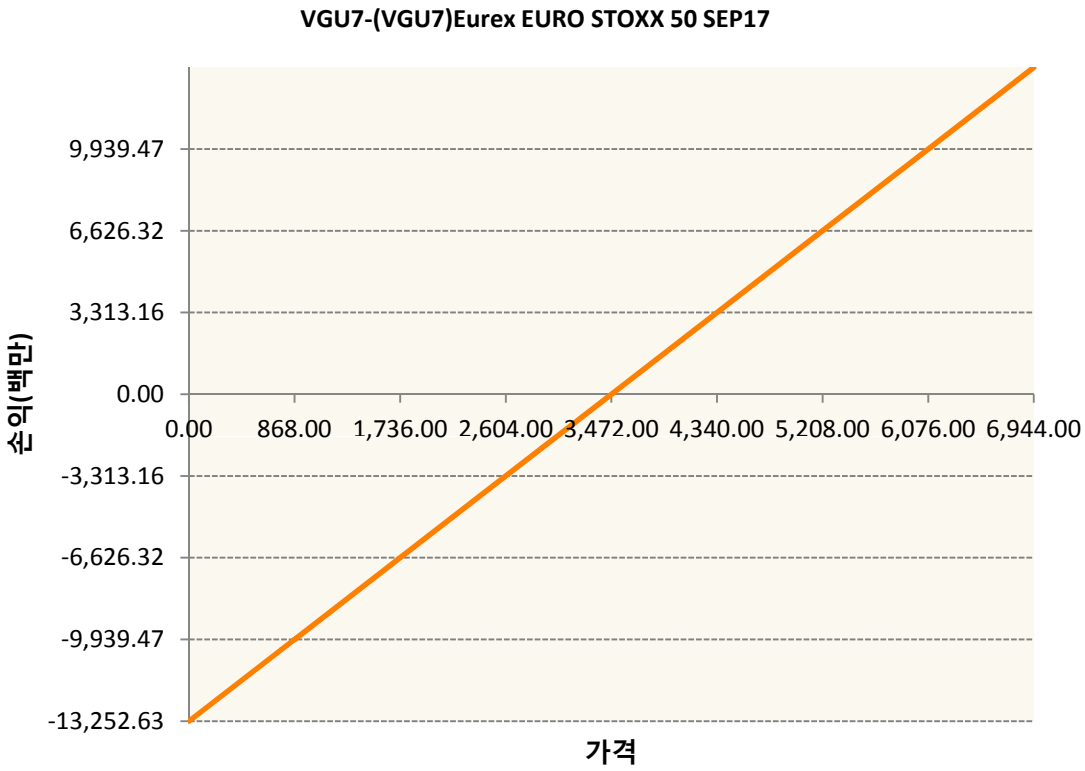



-226.73
-453.45
-680.18
-906.91
가격


OESXQ7-P3450-EURO STOXX 50
12,335.22
9,251.41
6,167.61
3,083.80
0.00
-3,083.80
-6,167.61
-9,251.41
-12,335.22
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
906.91
680.18
453.45
226.73
0.00
-226.73
-453.45
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	987
OESXQ7-C3	EURO STOXX 50	73
OESXQ7-P3	EURO STOXX 50	987
OESXQ7-P3	EURO STOXX 50	73
VGU7	(VGU7)Eurex EURO STOXX 50 SEP17	1,060

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	2,646

공시일	2017-07-27
기준일	2017-07-26

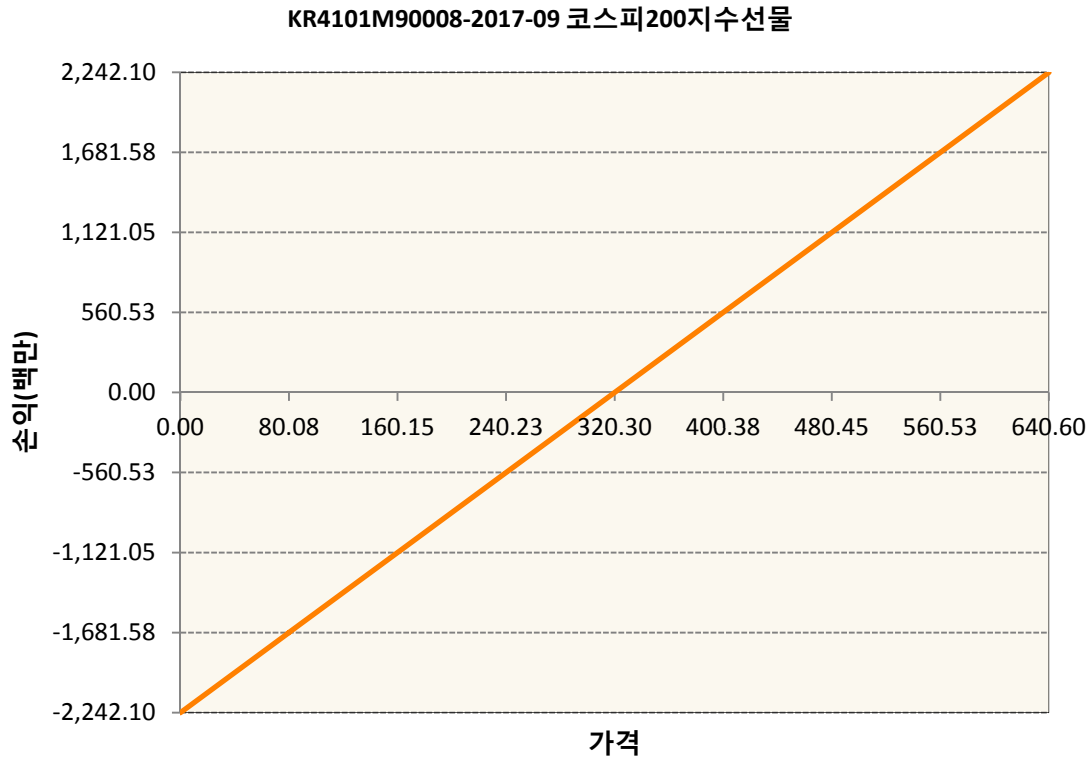
ETF스마트레버리지목표전환형7호

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	2,242	0	2,242	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	2017-07-27
기준일	2017-07-26

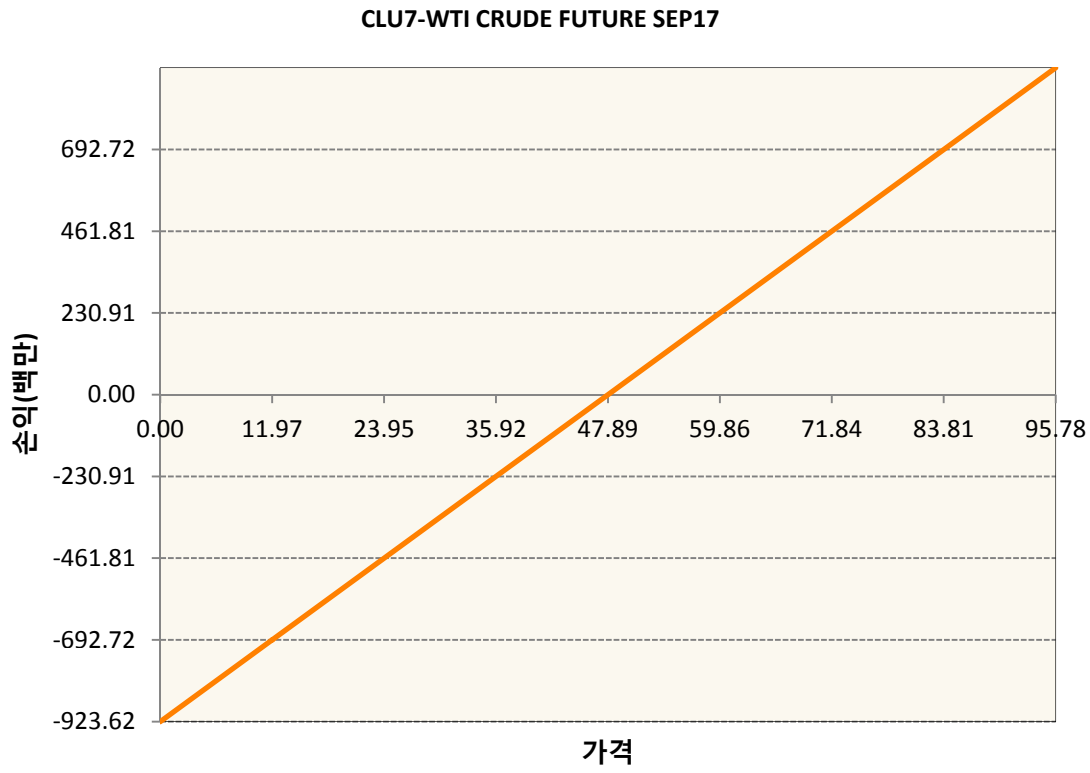
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

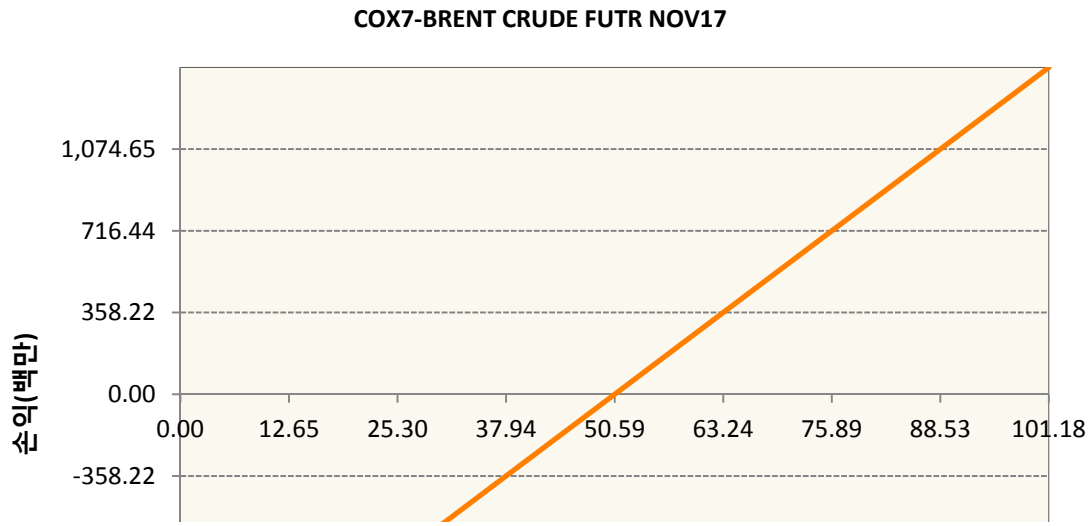
1. 계약금액

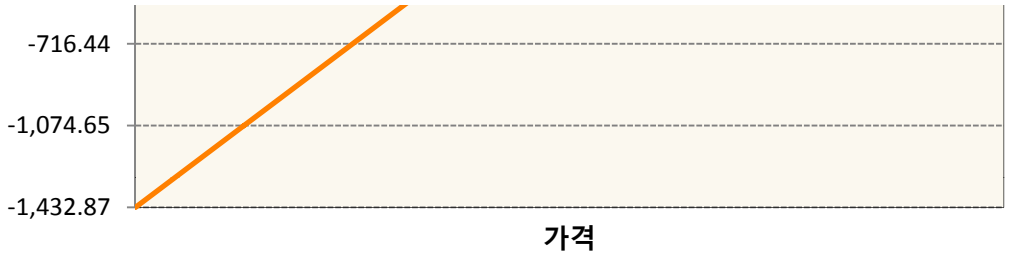
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	5,252	224	5,028	

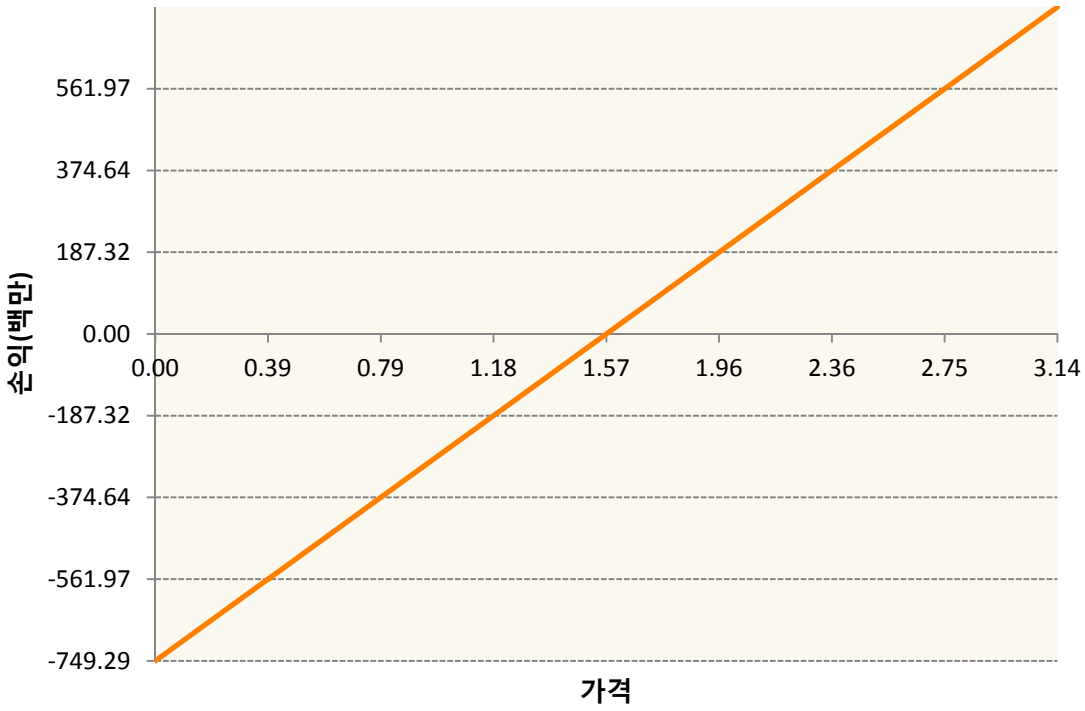
2. 만기시점의 손익구조



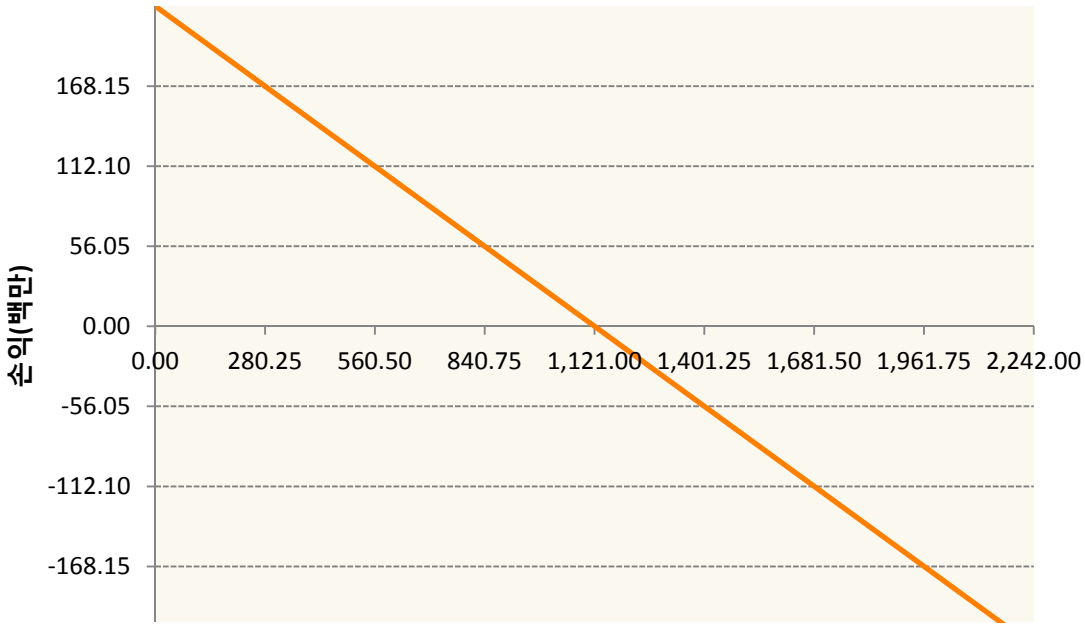


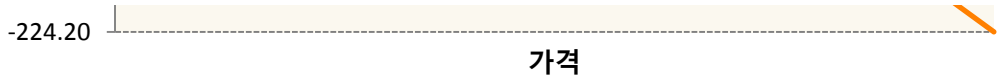


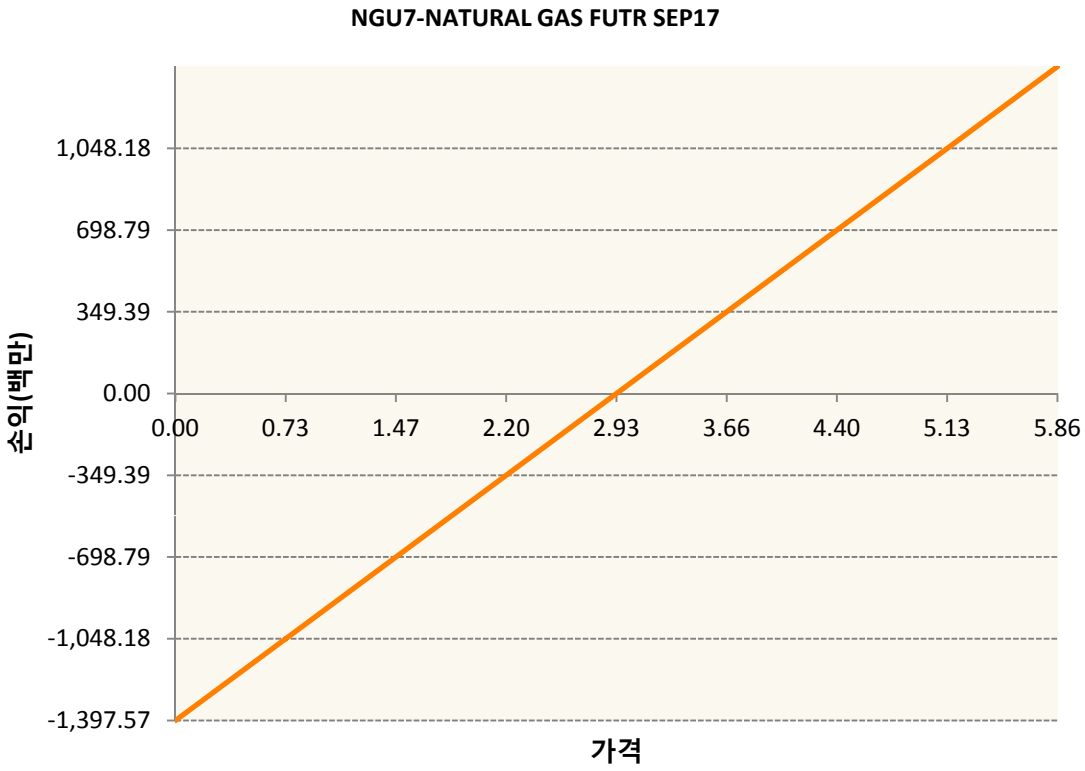
HOU7-NY HARB ULSD FUT SEP17

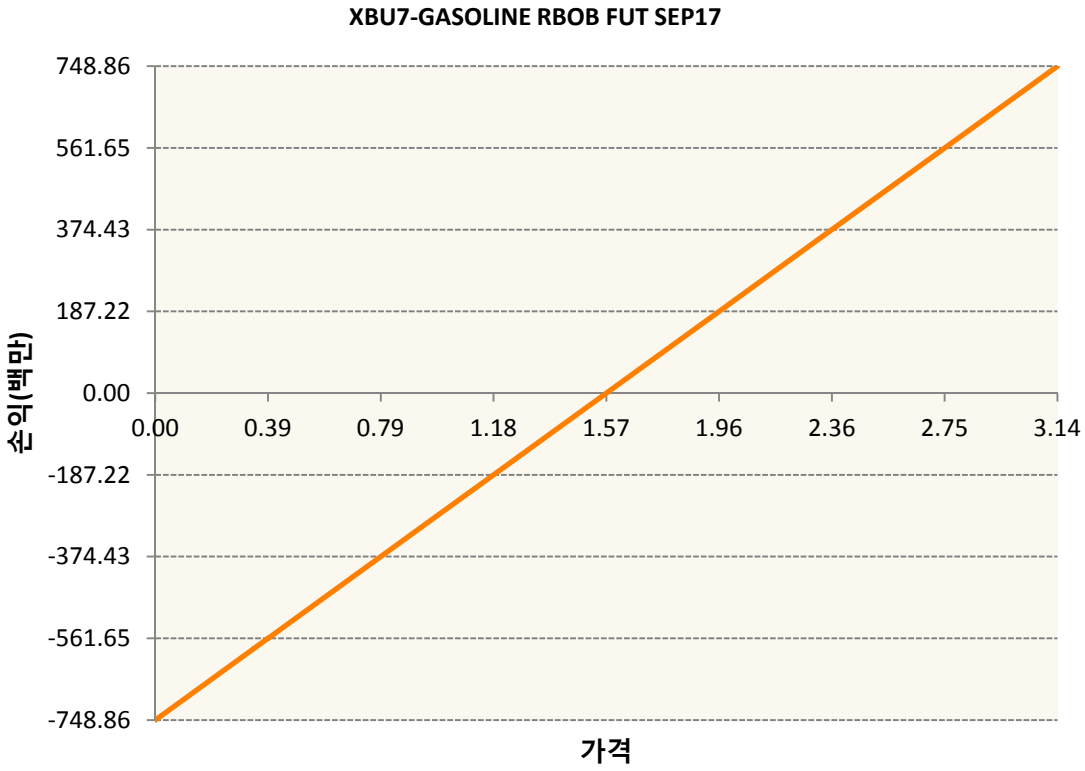


KR4175M80003-2017-08 달러선물




-224.20
가격


NGU7-NATURAL GAS FUTR SEP17
손익(백만)
1,048.18
698.79
349.39
0.00
-349.39
-698.79
-1,048.18
-1,397.57
0.00
0.73
1.47
2.20
2.93
3.66
4.40
5.13
5.86
가격


XBU7-GASOLINE RBOB FUT SEP17
손익(백만)
748.86
561.65
374.43
187.22
0.00
-187.22
-374.43
-561.65
-748.86
0.00
0.39
0.79
1.18
1.57
1.96
2.36
2.75
3.14
가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLU7	WTI CRUDE FUTURE SEP17	74
COX7	BRENT CRUDE FUTR NOV17	115
HOU7	NY HARB ULSD FUT SEP17	60
KR4175M80(	2017-08 달러선물	18
NGU7	NATURAL GAS FUTR SEP17	112
XBU7	GASOLINE RBOB FUT SEP17	60

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

780

공시일	2017-07-27
기준일	2017-07-26

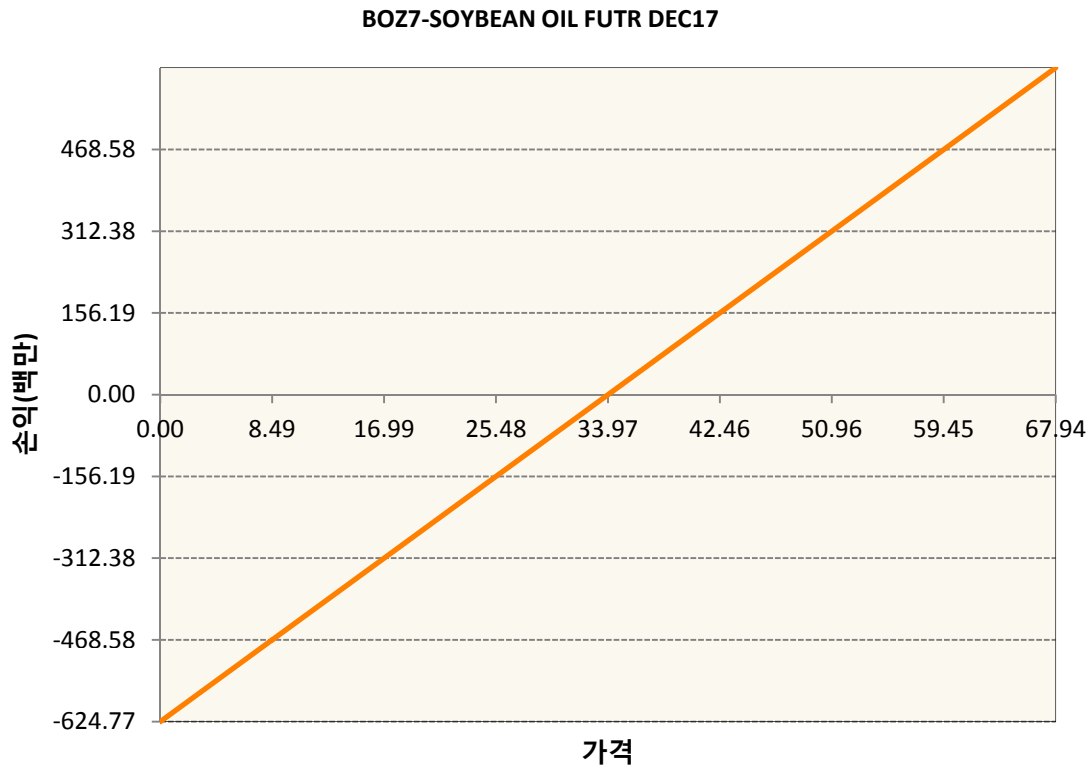
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

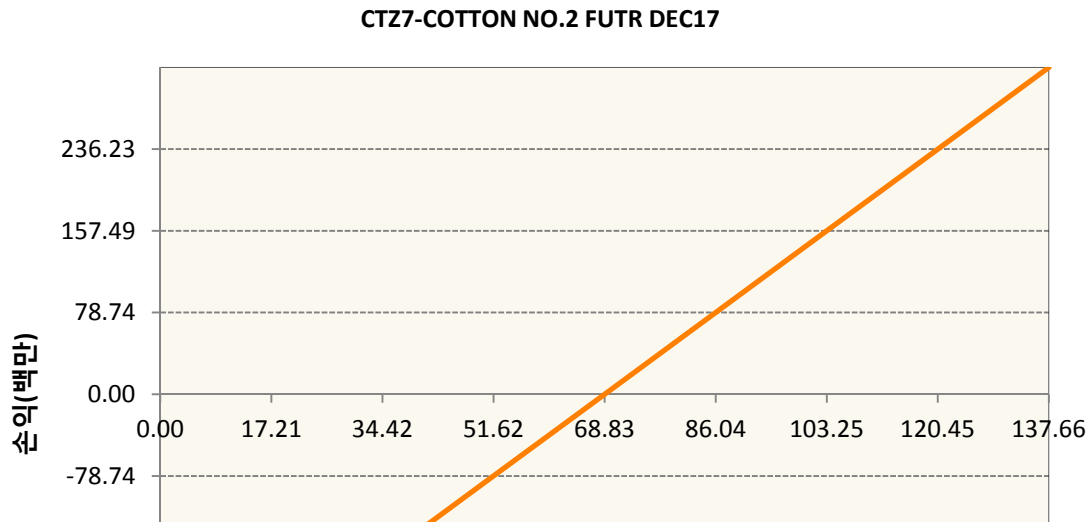
1. 계약금액

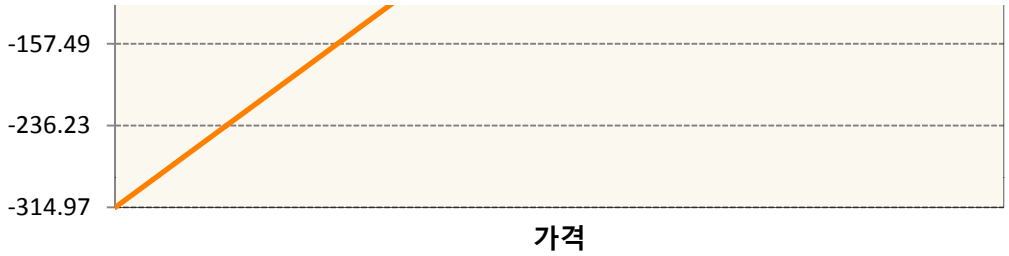
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	6,940	392	6,548	

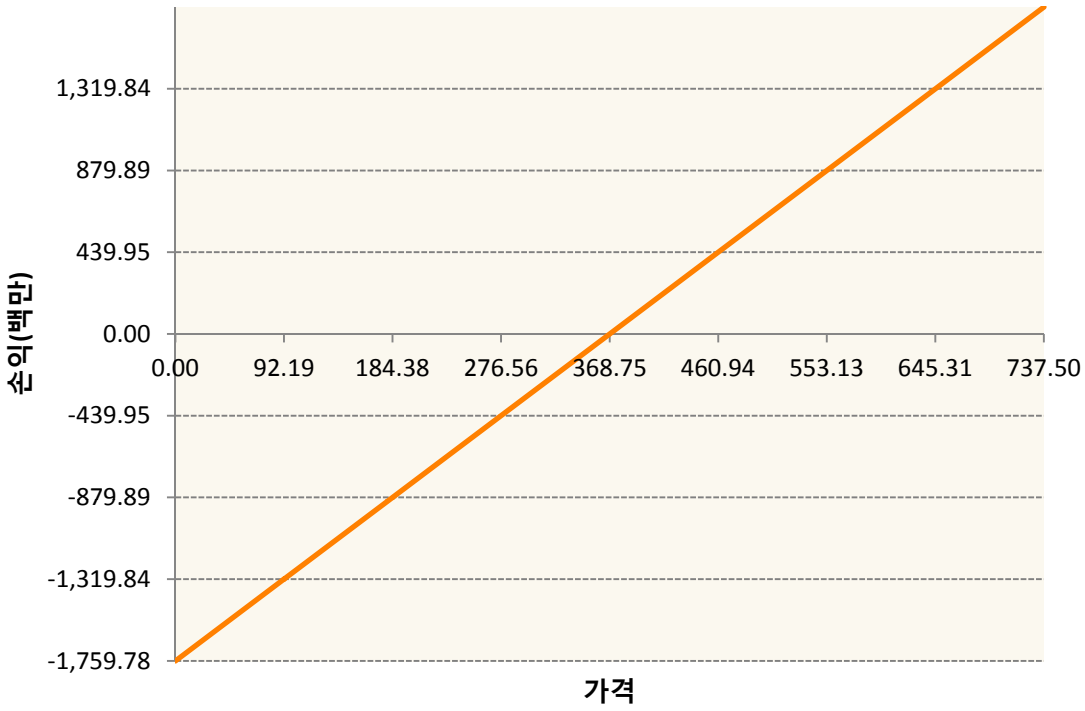
2. 만기시점의 손익구조



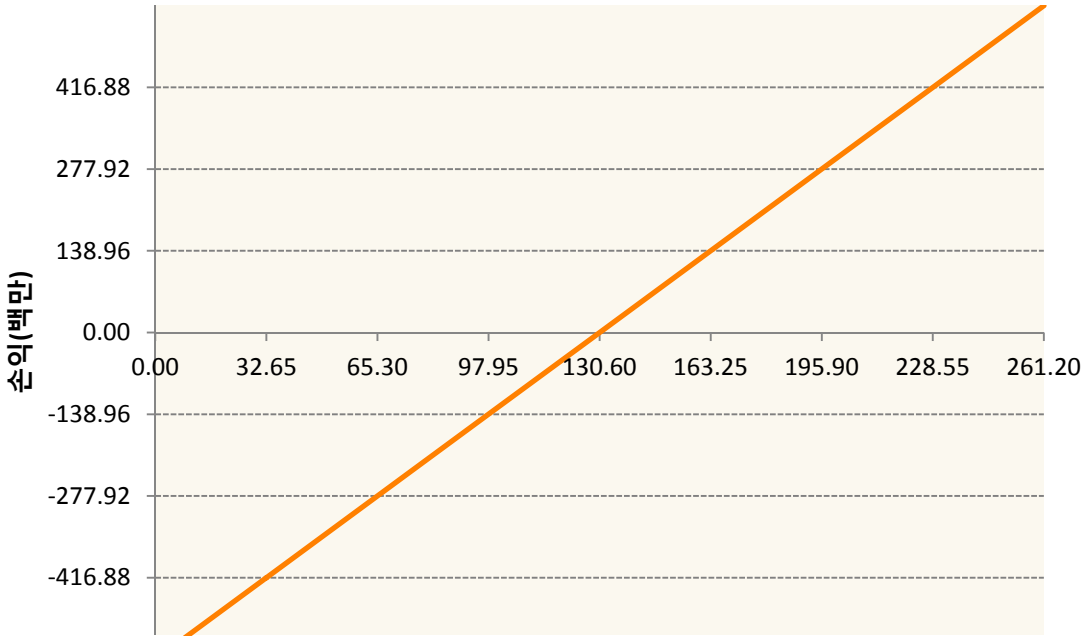


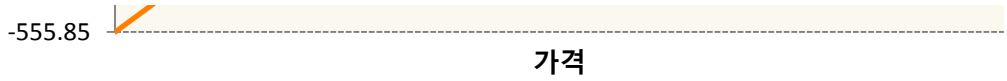


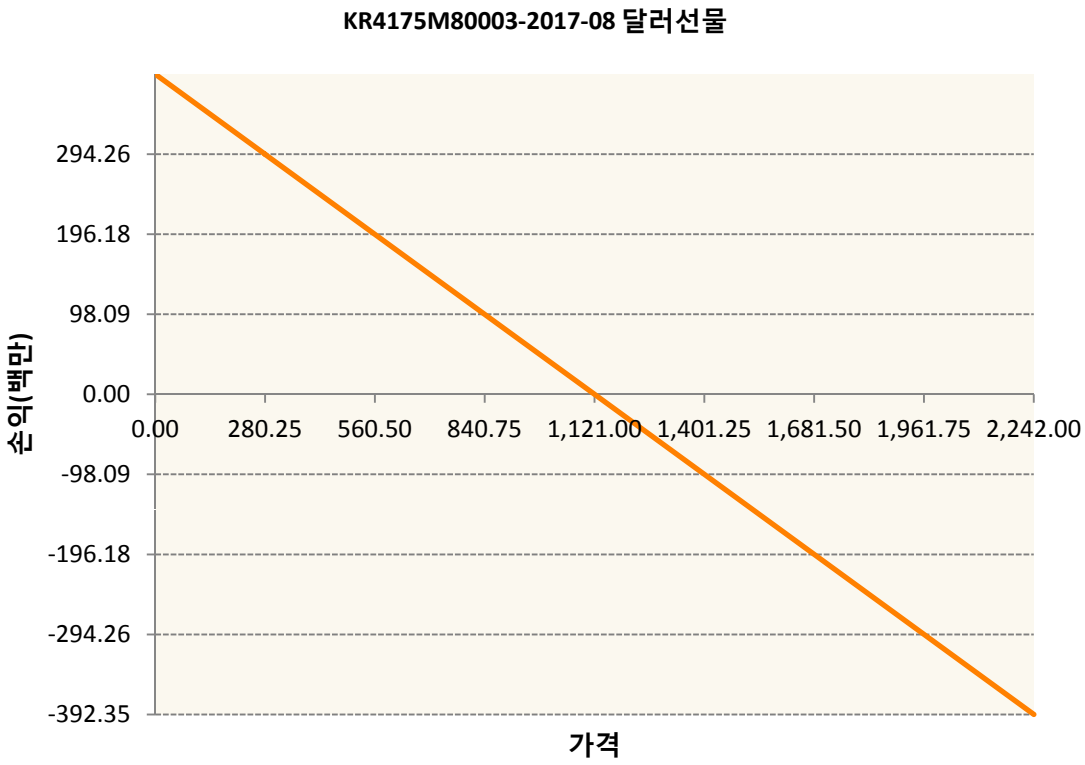
CU7-CORN FUTURE SEP17

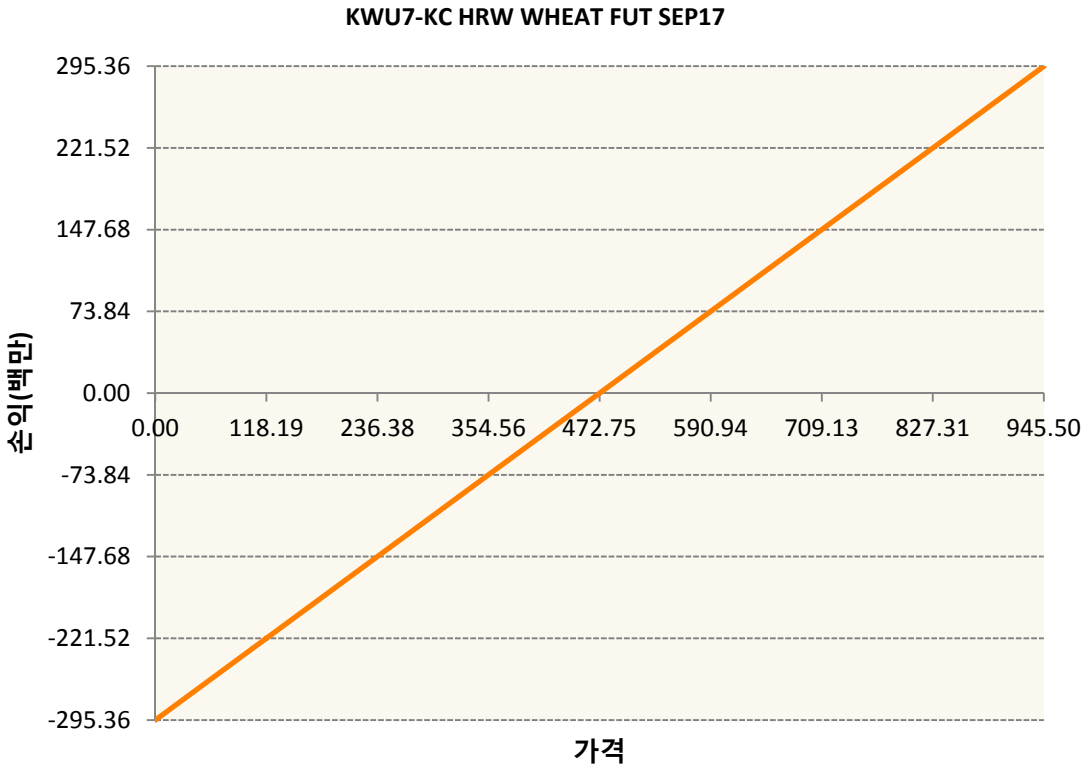


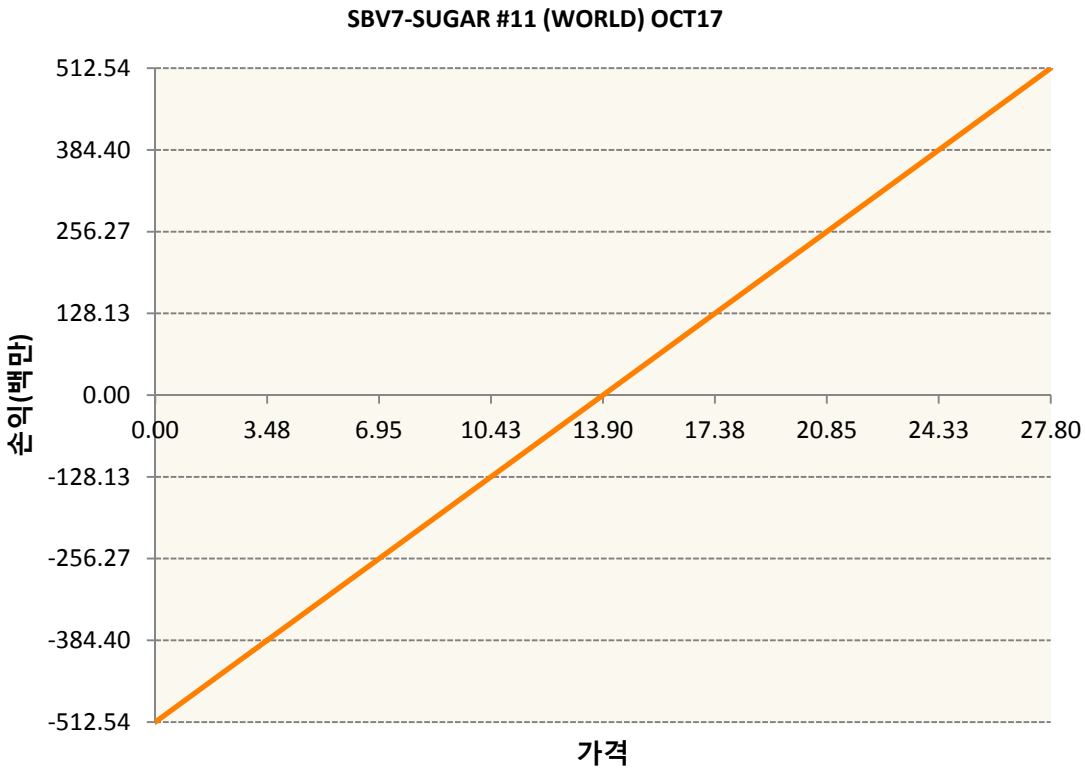
KCU7-COFFEE 'C' FUTURE SEP17

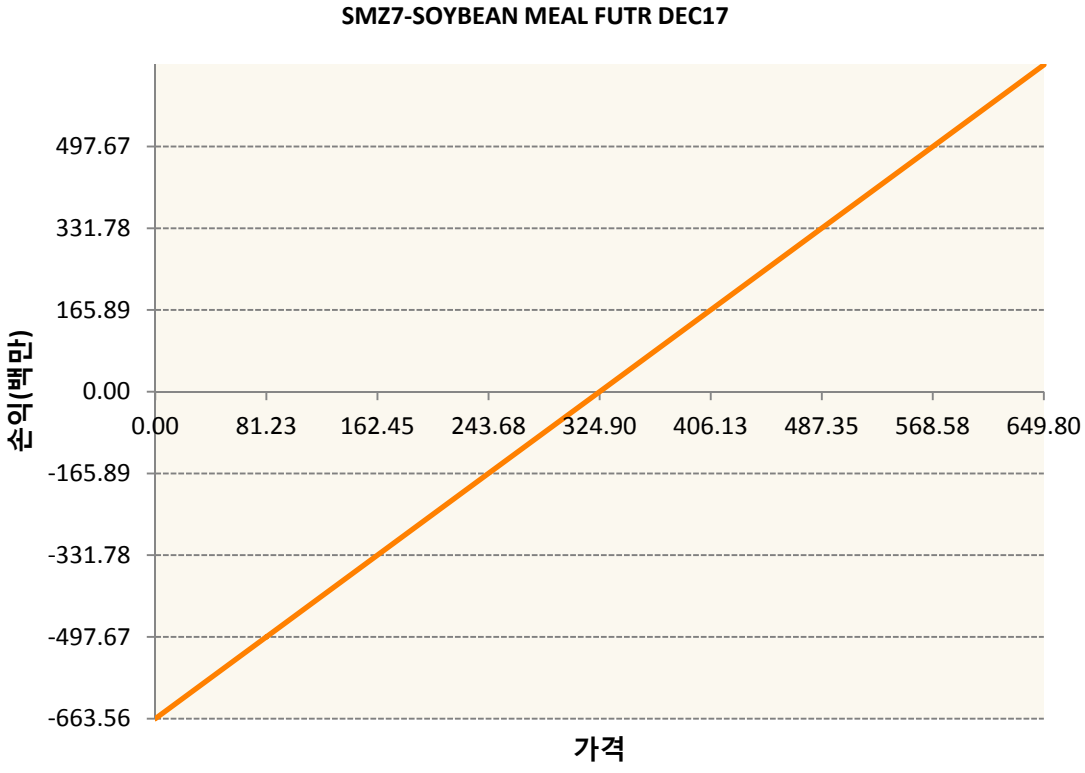


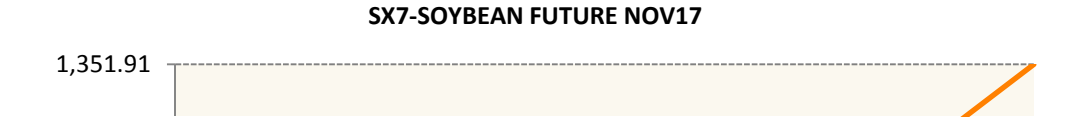

-555.85
가격

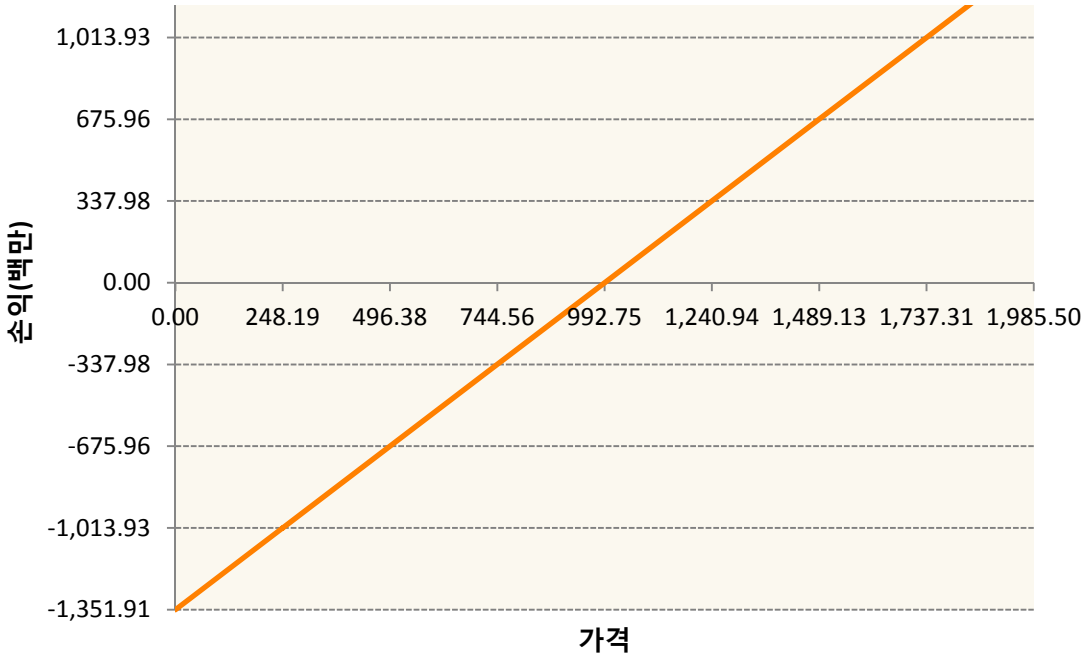

KR4175M80003-2017-08 달러선물
294.26
196.18
98.09
0.00
-98.09
-196.18
-294.26
-392.35
0.00
280.25
560.50
840.75
1,121.00
1,401.25
1,681.50
1,961.75
2,242.00
손익(백만)
가격

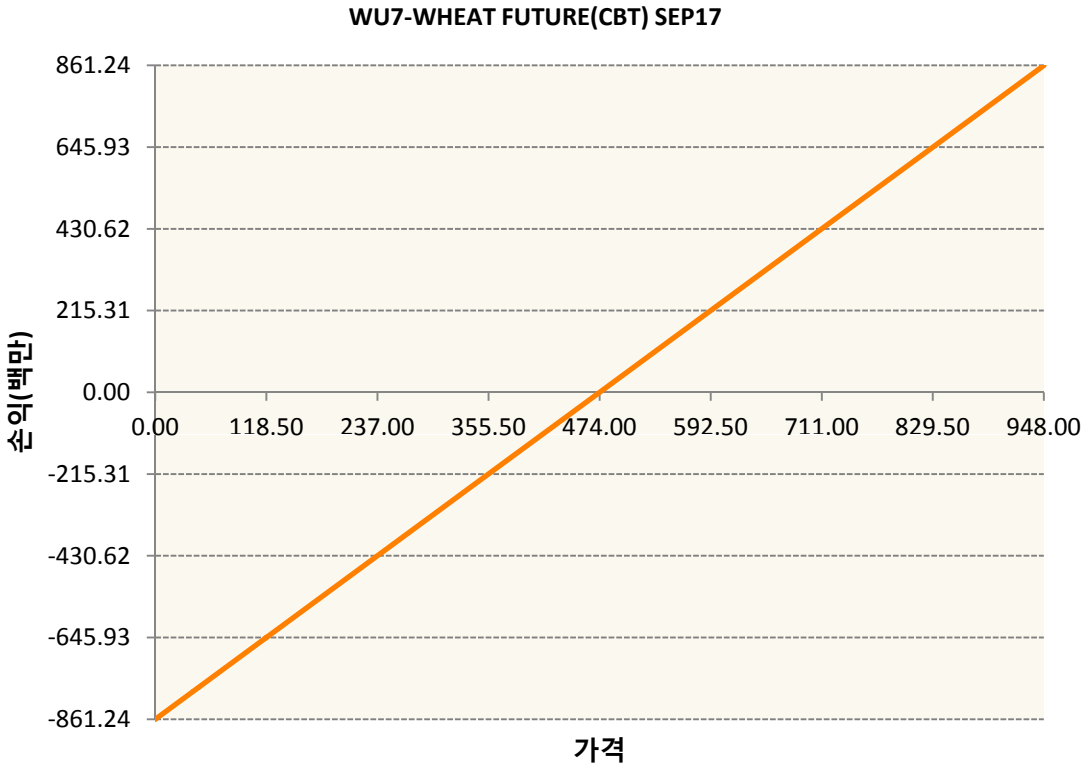

KWU7-KC HRW WHEAT FUT SEP17
295.36
221.52
147.68
73.84
0.00
-73.84
-147.68
-221.52
-295.36
0.00
118.19
236.38
354.56
472.75
590.94
709.13
827.31
945.50
손익(백만)
가격


SBV7-SUGAR #11 (WORLD) OCT17
512.54
384.40
256.27
128.13
0.00
-128.13
-256.27
-384.40
-512.54
0.00
3.48
6.95
10.43
13.90
17.38
20.85
24.33
27.80
손익(백만)
가격


SMZ7-SOYBEAN MEAL FUTR DEC17
497.67
331.78
165.89
0.00
-165.89
-331.78
-497.67
-663.56
0.00
81.23
162.45
243.68
324.90
406.13
487.35
568.58
649.80
손익(백만)
가격


SX7-SOYBEAN FUTURE NOV17
1,351.91





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

BOZ7	SOYBEAN OIL FUTR DEC17	50
CTZ7	COTTON NO.2 FUTR DEC17	25
CU7	CORN FUTURE SEP17	141
KCU7	COFFEE 'C' FUTURE SEP17	44
KR4175M80(	2017-08 달러선물	31

KWU7	KC HRW WHEAT FUT SEP17	24
SBV7	SUGAR #11 (WORLD) OCT17	41
SMZ7	SOYBEAN MEAL FUTR DEC17	53
SX7	SOYBEAN FUTURE NOV17	108
WU7	WHEAT FUTURE(CBT) SEP17	69

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

652