공시일	2017-07-28
기준일	2017-07-27

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	2017-07-28
기준일	2017-07-27

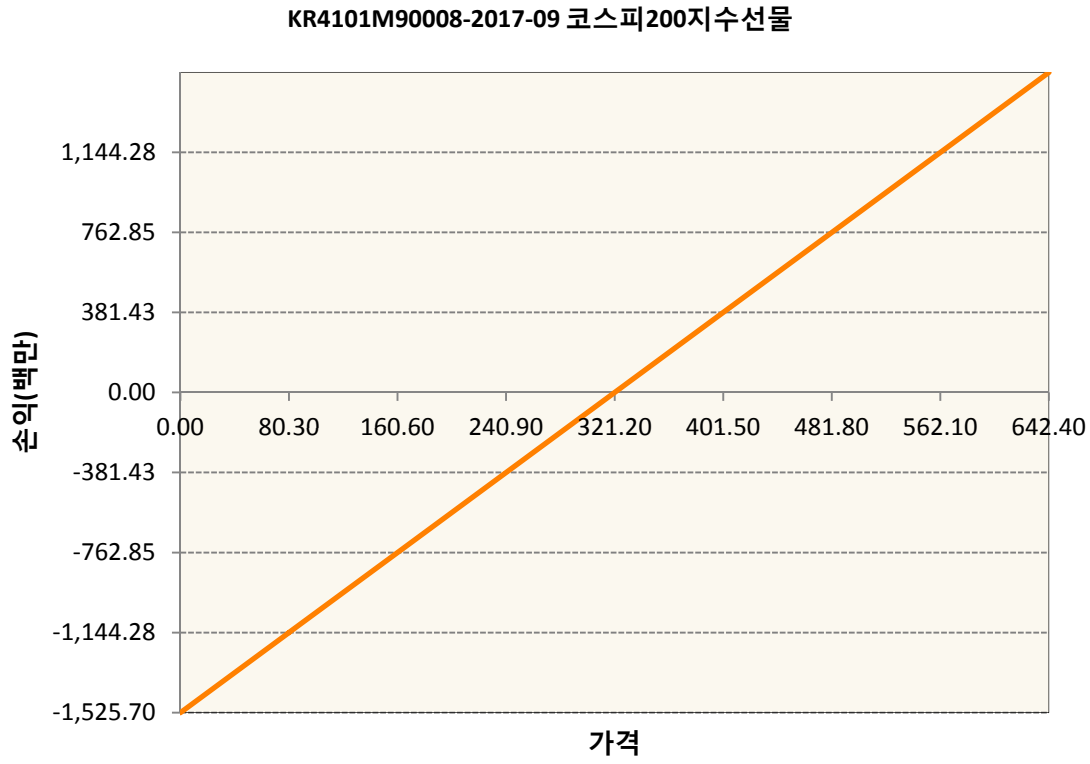
스마트인덱스모

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	1,526	0	1,526	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	2017-07-28
기준일	2017-07-27

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	2017-07-28
기준일	2017-07-27

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	386

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

342

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-07-28
기준일	2017-07-27

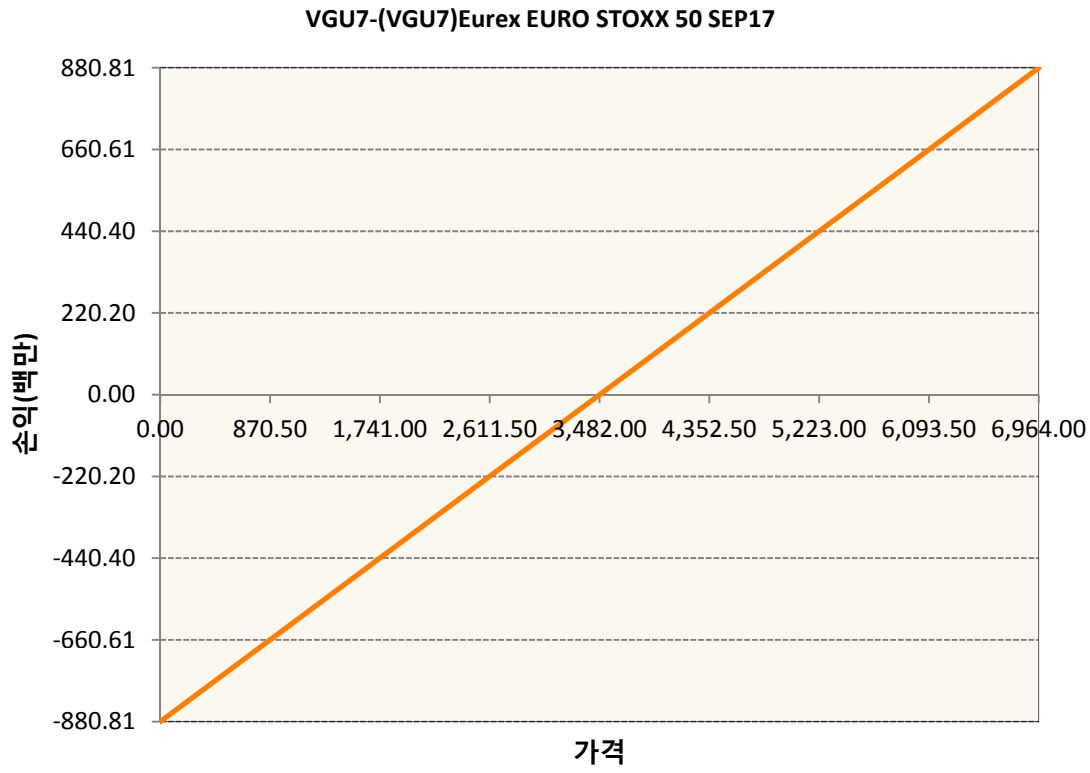
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	881	0	881	

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)

59

공시일	2017-07-28
기준일	2017-07-27

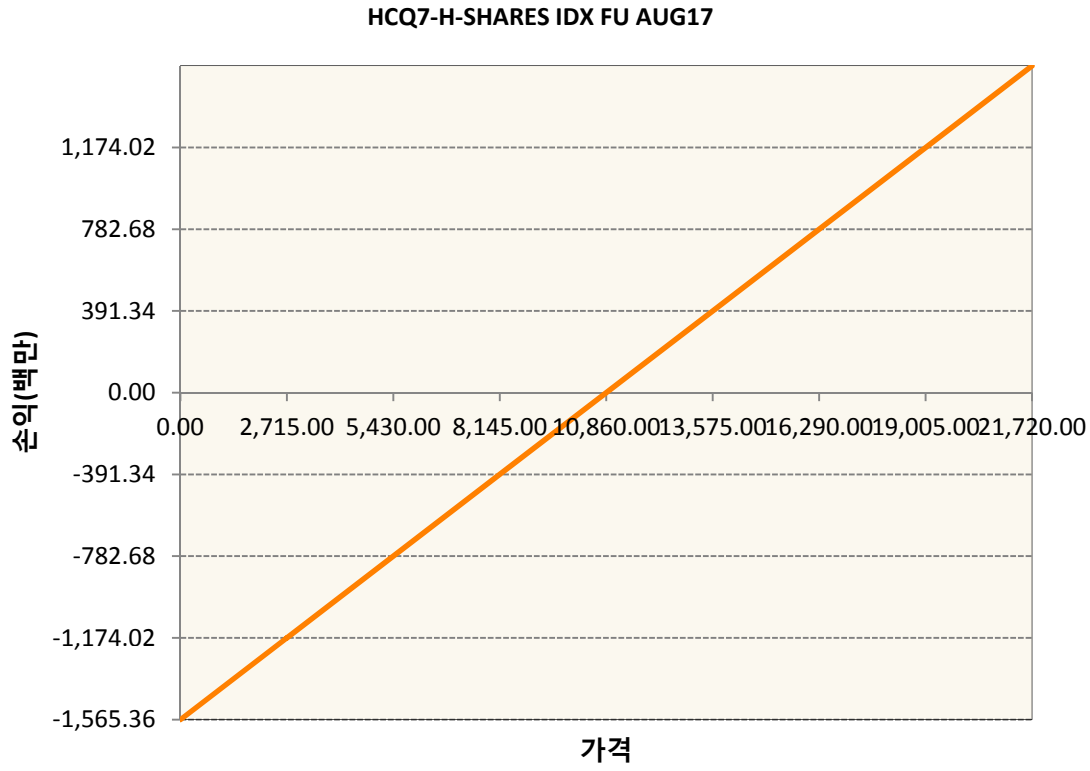
차이나인덱스모(주식-파생형)

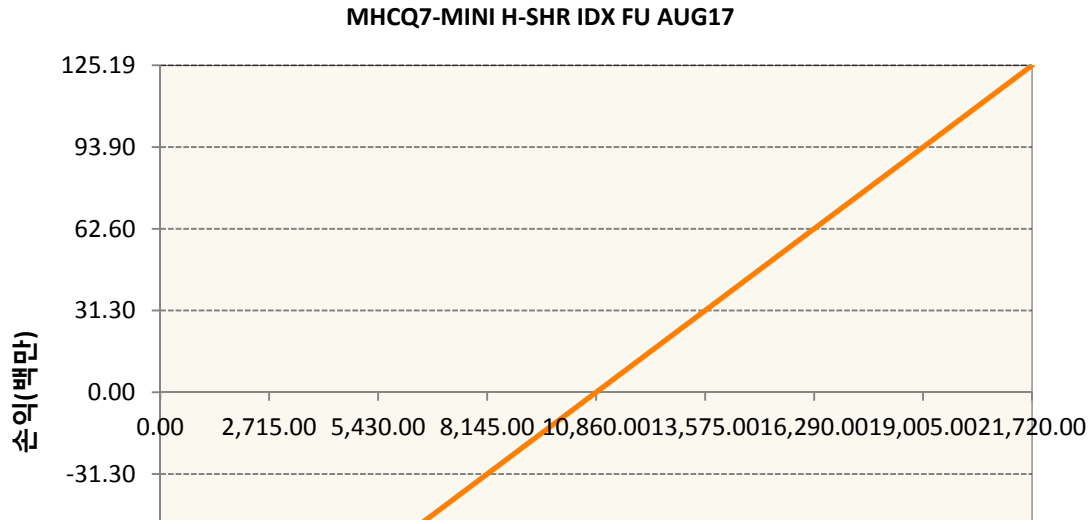
1. 계약금액

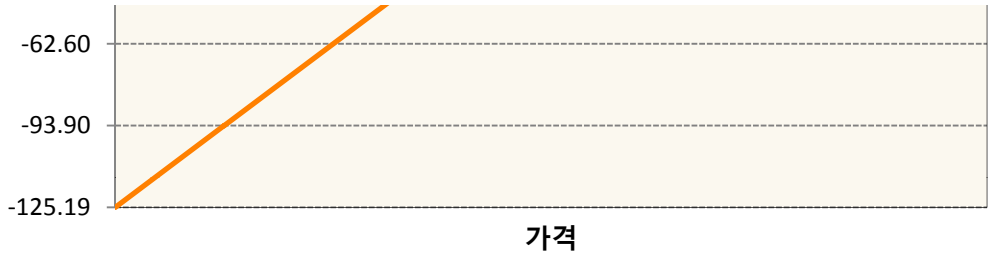
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,691	0	1,691	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)
	123

공시일	2017-07-28
기준일	2017-07-27

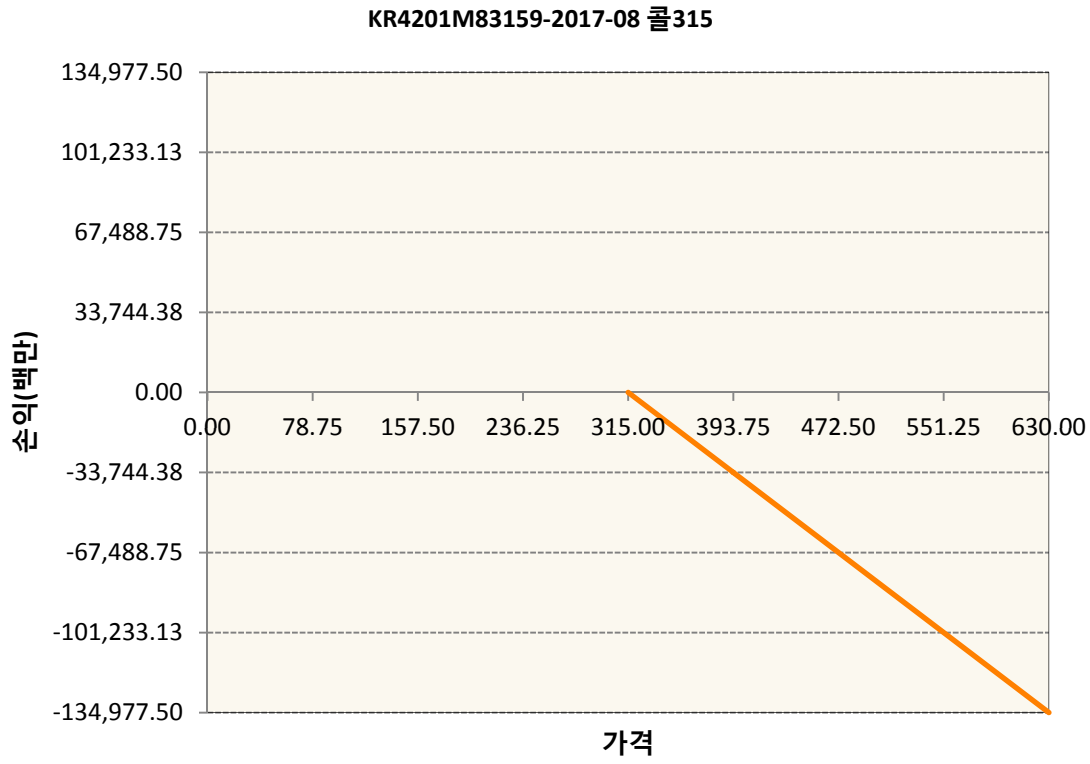
커버드콜모(주식혼합-파생형)

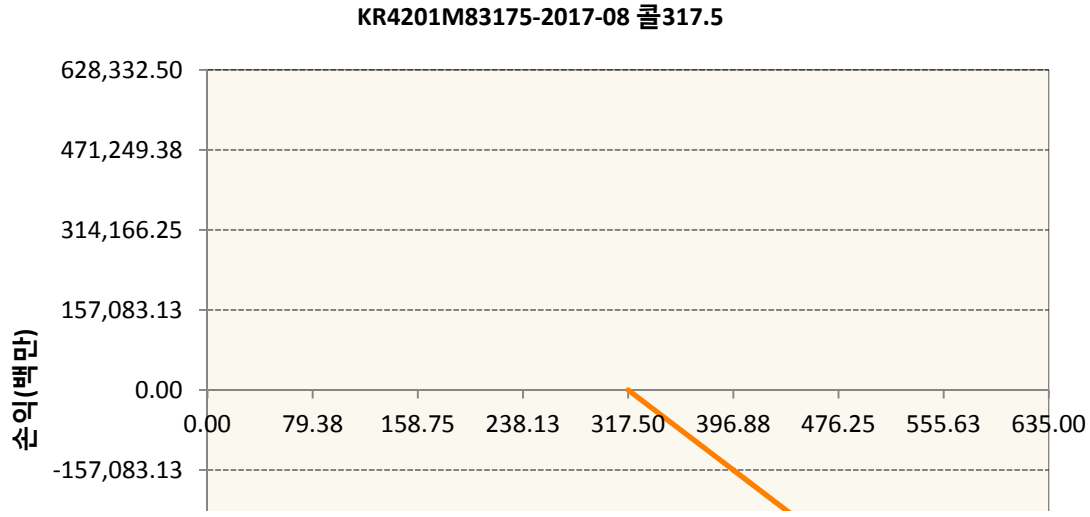
1. 계약금액

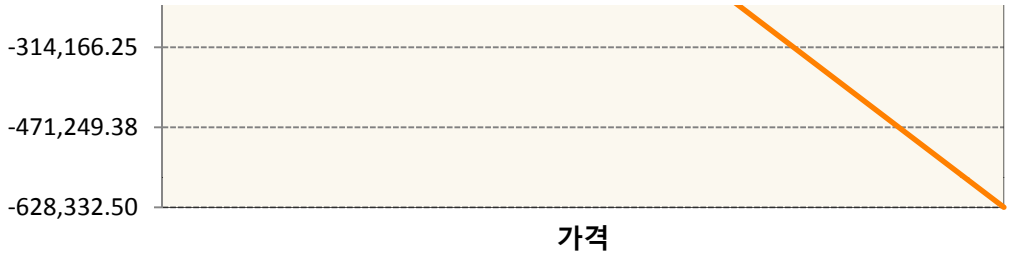
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	16,079	-16,079	장내
누계	유가증권	옵션	0	1,331,489	-1,331,489	장내

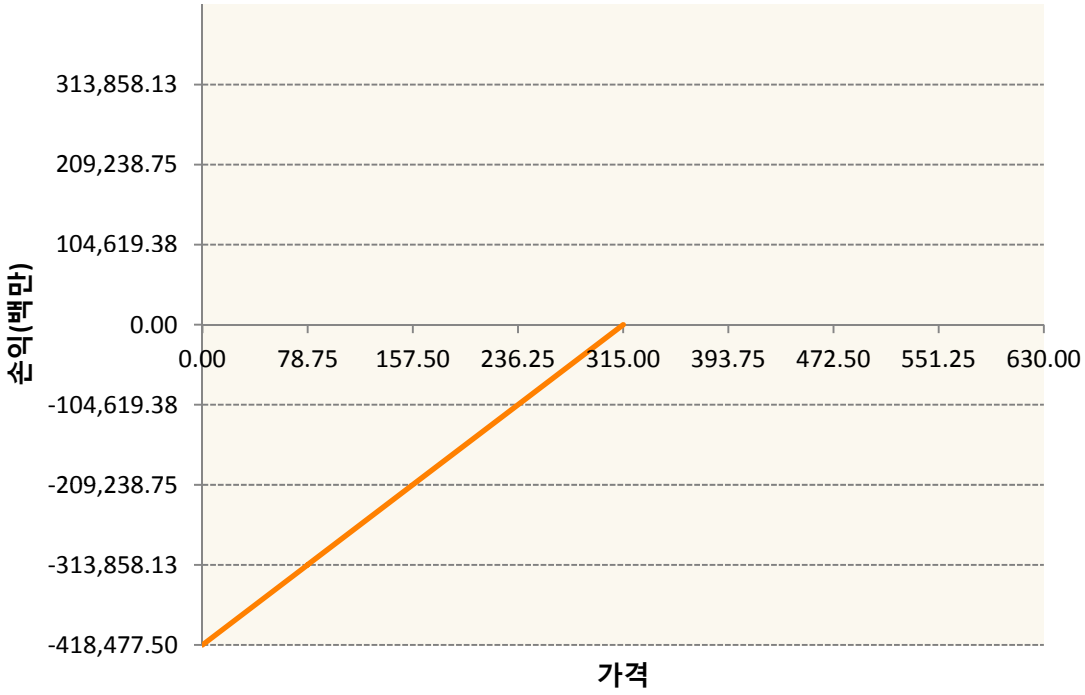
2. 만기시점의 손익구조



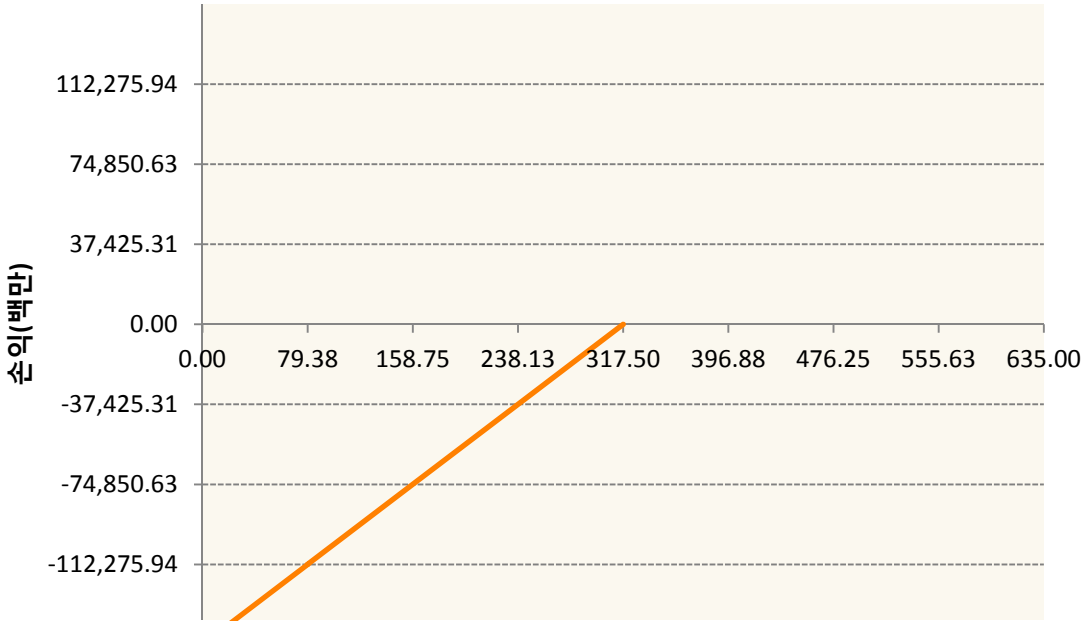




KR4301M83157-2017-08 풋315



KR4301M83173-2017-08 풋317.5





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201M83: 2017-08 콜315							9,710
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	3,732	3,699	3,653	3,596	3,526	3,446	3,355
-5.33%	3,483	3,372	3,249	3,117	2,976	2,828	2,675
-2.67%	2,563	2,372	2,180	1,987	1,793	1,598	1,403
0%	545	367	185	0	-187	-377	-567
2.67%	-2,450	-2,544	-2,653	-2,773	-2,904	-3,043	-3,189
5.33%	-5,937	-5,967	-6,009	-6,064	-6,131	-6,210	-6,300
8.00%	-9,569	-9,575	-9,586	-9,604	-9,630	-9,665	-9,710
KR4201M83: 2017-08 콜317.5							43,187
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	14,308	14,210	14,064	13,866	13,617	13,318	12,972
-5.33%	13,587	13,193	12,735	12,221	11,661	11,061	10,427
-2.67%	10,479	9,669	8,839	7,995	7,140	6,276	5,405
0%	2,714	1,815	909	0	-913	-1,828	-2,746
2.67%	-9,982	-10,546	-11,165	-11,828	-12,529	-13,261	-14,017
5.33%	-25,619	-25,828	-26,103	-26,442	-26,839	-27,289	-27,786
8.00%	-42,279	-42,327	-42,409	-42,534	-42,704	-42,921	-43,187
KR4301M83: 2017-08 풋315							25,896
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-25,885	-25,885	-25,885	-25,886	-25,887	-25,890	-25,896
-5.33%	-14,547	-14,562	-14,586	-14,623	-14,673	-14,735	-14,812
-2.67%	-4,122	-4,345	-4,576	-4,813	-5,055	-5,301	-5,551
0%	492	345	180	0	-192	-394	-604
2.67%	854	848	837	819	790	751	700
5.33%	857	857	856	856	855	853	849
8.00%	857	857	857	857	857	857	856
KR4301M83: 2017-08 풋317.5							10,069
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-10,068	-10,068	-10,068	-10,068	-10,068	-10,068	-10,069
-5.33%	-6,041	-6,042	-6,045	-6,050	-6,058	-6,070	-6,085
-2.67%	-2,135	-2,186	-2,243	-2,305	-2,371	-2,442	-2,515
0%	252	171	86	0	-88	-178	-268
2.67%	596	589	577	561	540	513	481

5.33%	601	601	601	601	600	597	594
8.00%	601	601	601	601	601	601	601

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

96,159

공시일	2017-07-28
기준일	2017-07-27

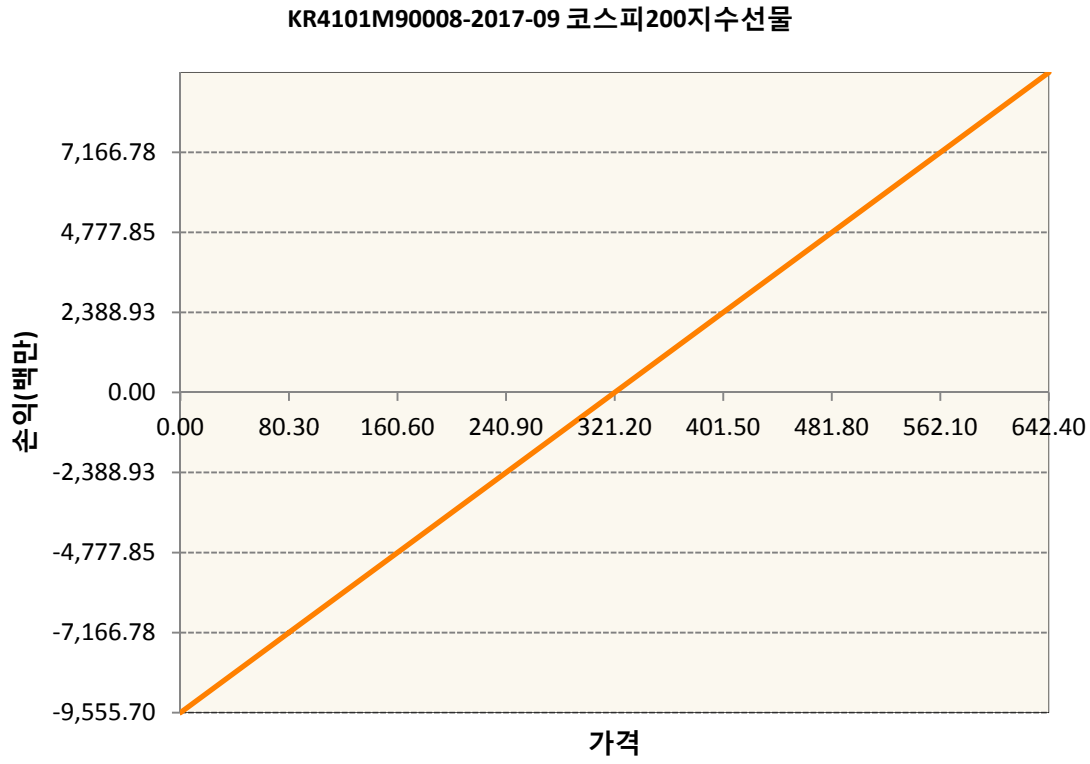
ETF스마트레버리지목표전환형6호

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	9,556	0	9,556	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101M90(2017-09 코스피200지수선물							763
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-763	-763	-763	-763	-763	-763	-763
-5.33%	-509	-509	-509	-509	-509	-509	-509
-2.67%	-254	-254	-254	-254	-254	-254	-254
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	254	254	254	254	254	254	254
5.33%	509	509	509	509	509	509	509
8.00%	763	763	763	763	763	763	763

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

458

공시일	2017-07-28
기준일	2017-07-27

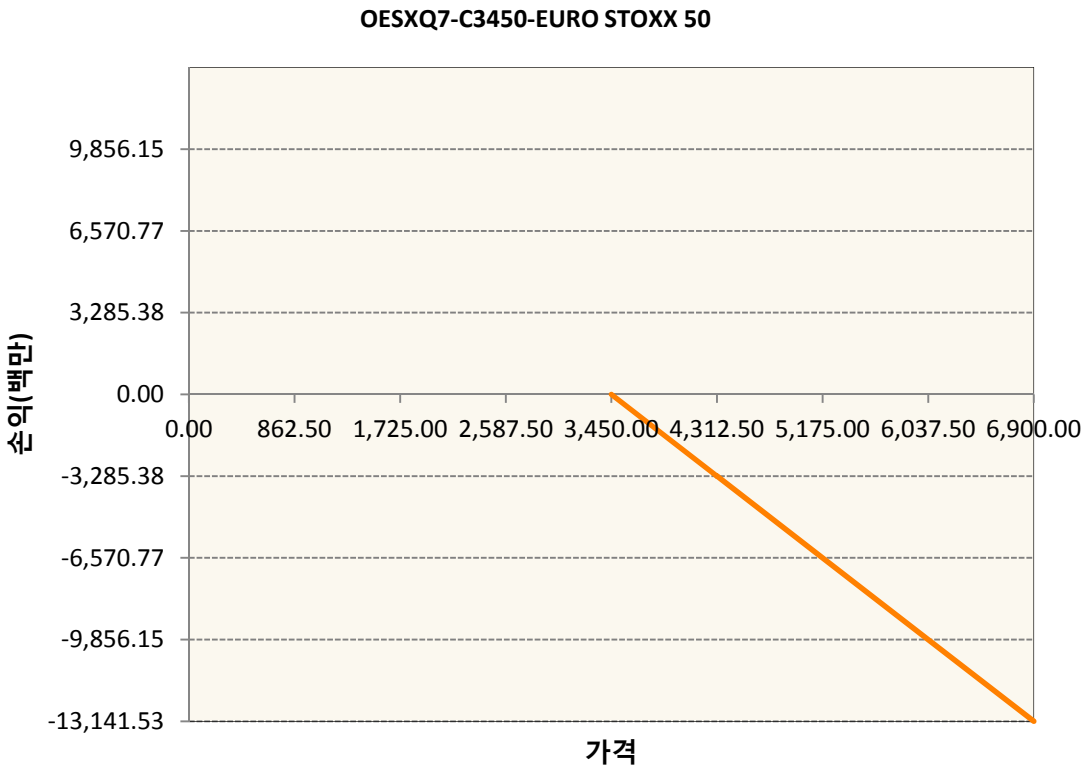
유로커버드콜(주식혼합-파생형)

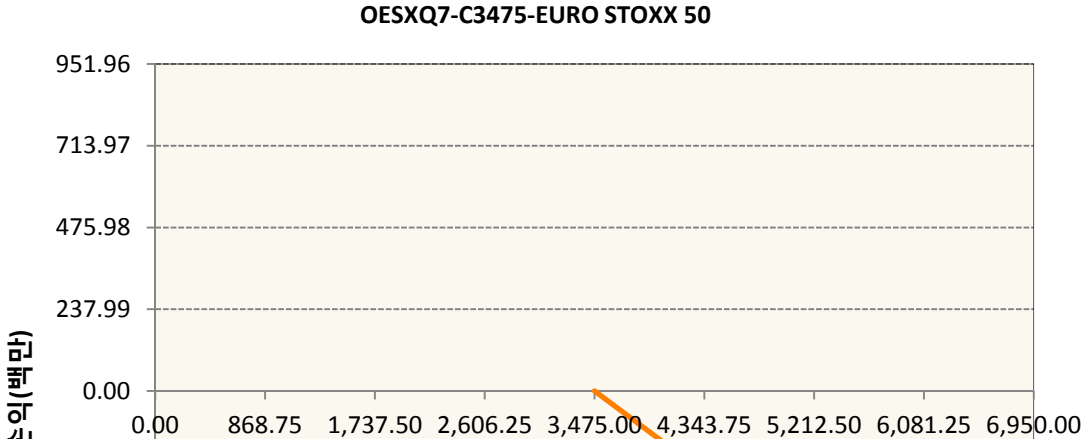
1. 계약금액

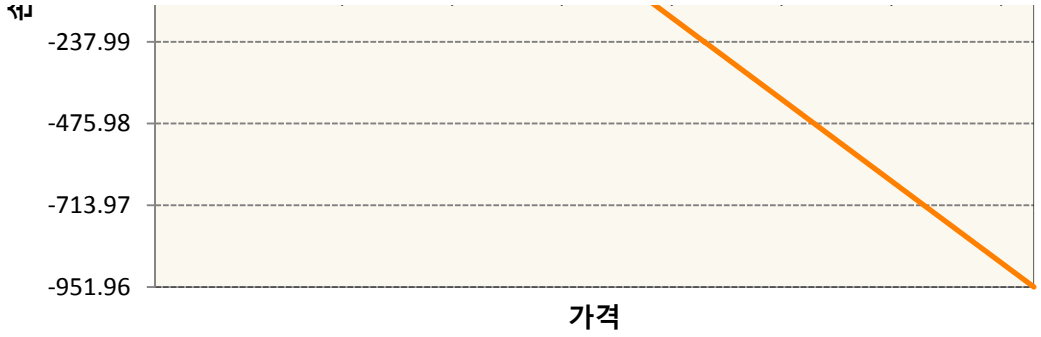
(단위:백만원)

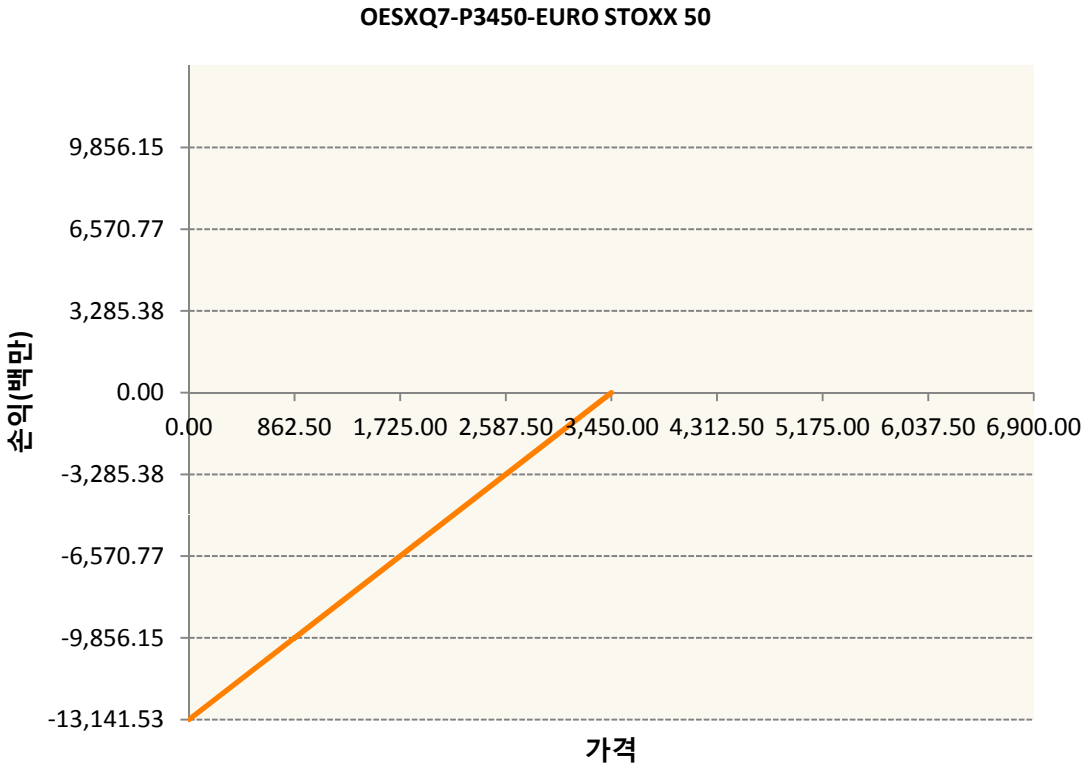
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	14,154	0	14,154	
누계	유가증권	옵션	0	28,187	-28,187	장내

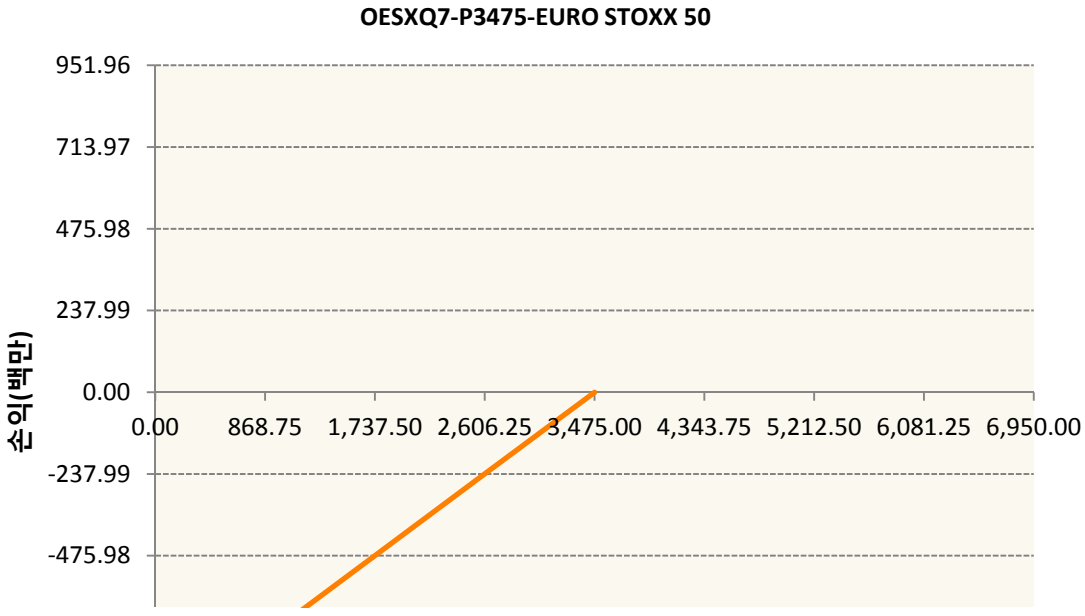
2. 만기시점의 손익구조

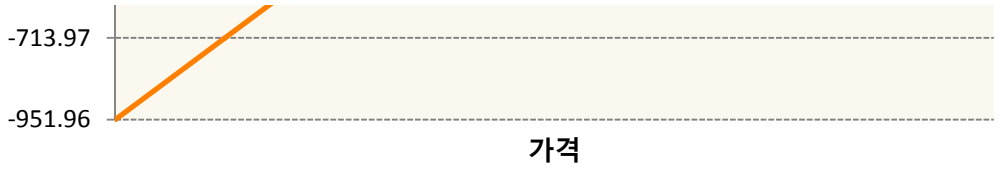


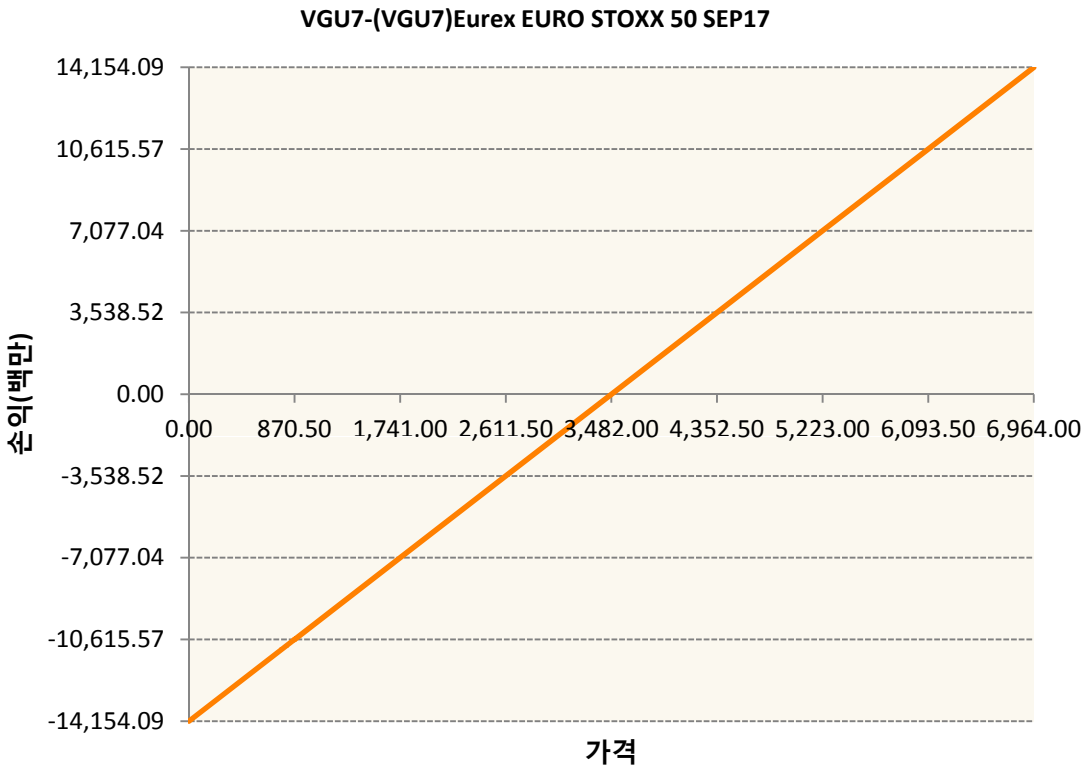



-237.99
-475.98
-713.97
-951.96
가격


OESXQ7-P3450-EURO STOXX 50
9,856.15
6,570.77
3,285.38
0.00
-3,285.38
-6,570.77
-9,856.15
-13,141.53
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
951.96
713.97
475.98
237.99
0.00
-237.99
-475.98
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	1,051
OESXQ7-C3	EURO STOXX 50	76
OESXQ7-P3	EURO STOXX 50	1,051
OESXQ7-P3	EURO STOXX 50	76
VGU7	(VGU7)Eurex EURO STOXX 50 SEP17	1,132

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	2,818

공시일	2017-07-28
기준일	2017-07-27

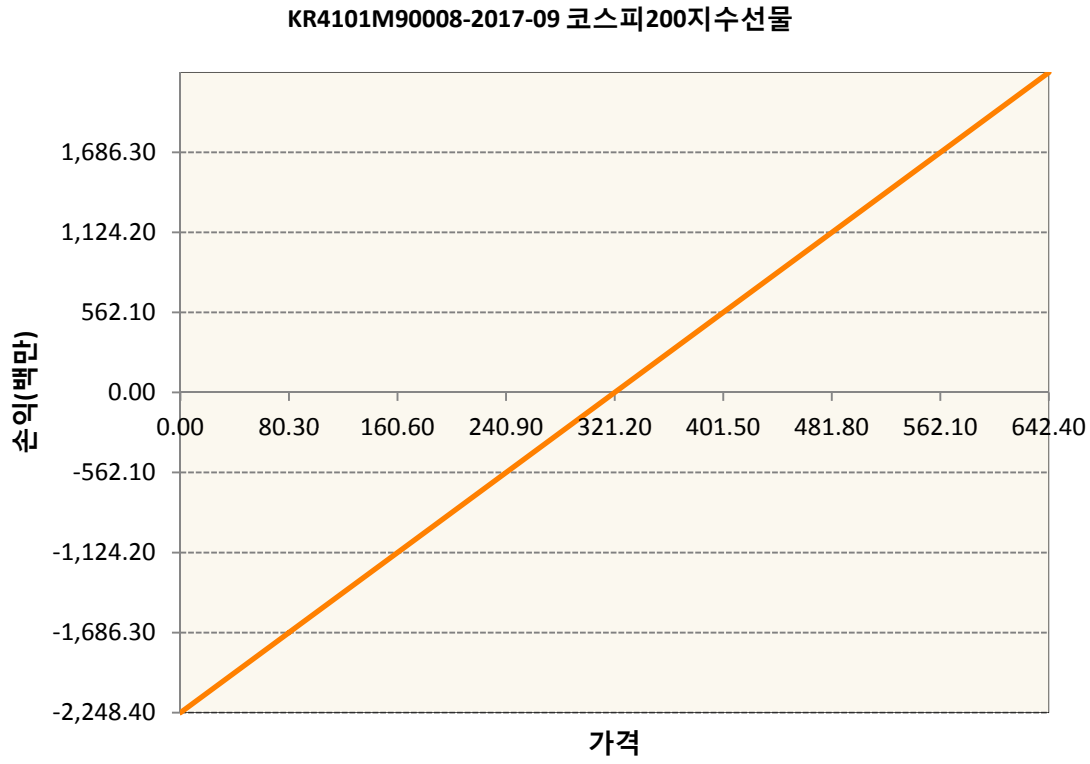
ETF스마트레버리지목표전환형7호

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	2,248	0	2,248	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	2017-07-28
기준일	2017-07-27

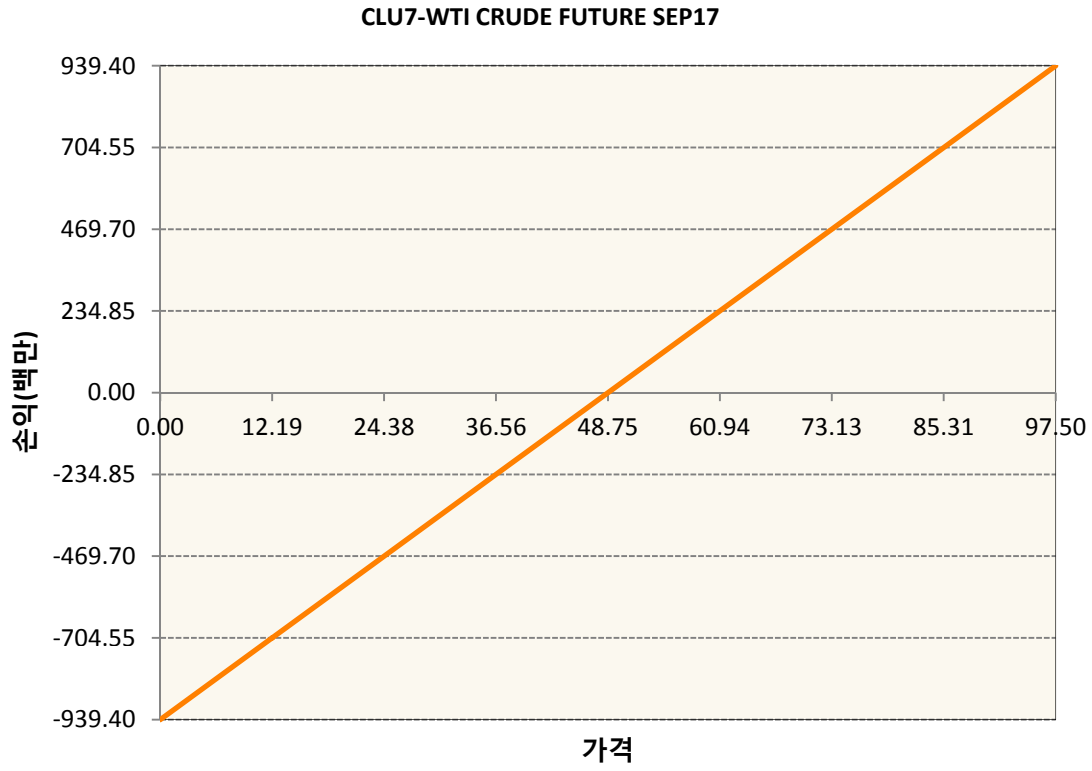
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

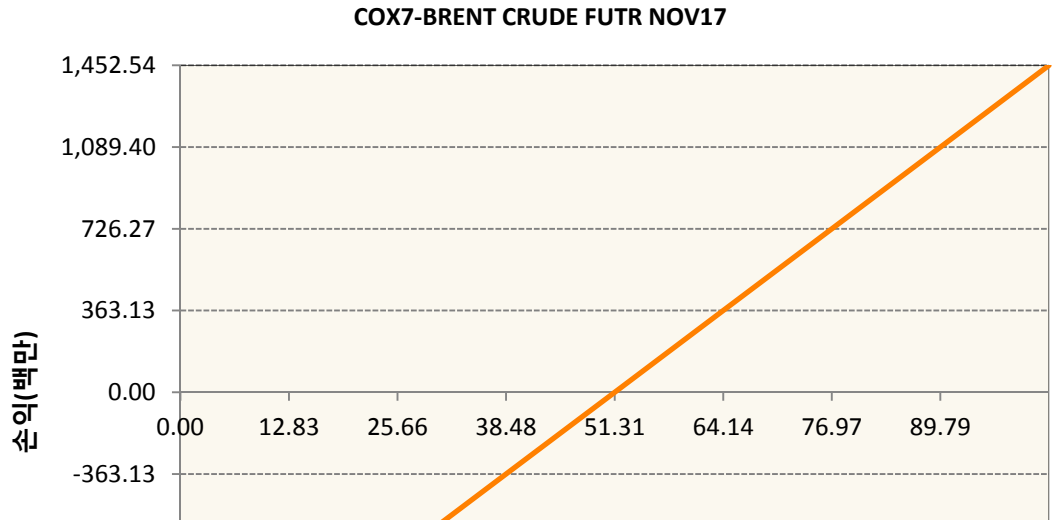
1. 계약금액

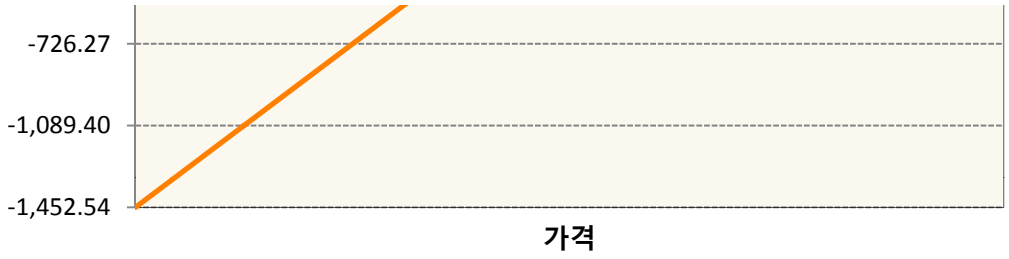
(단위:백만원)

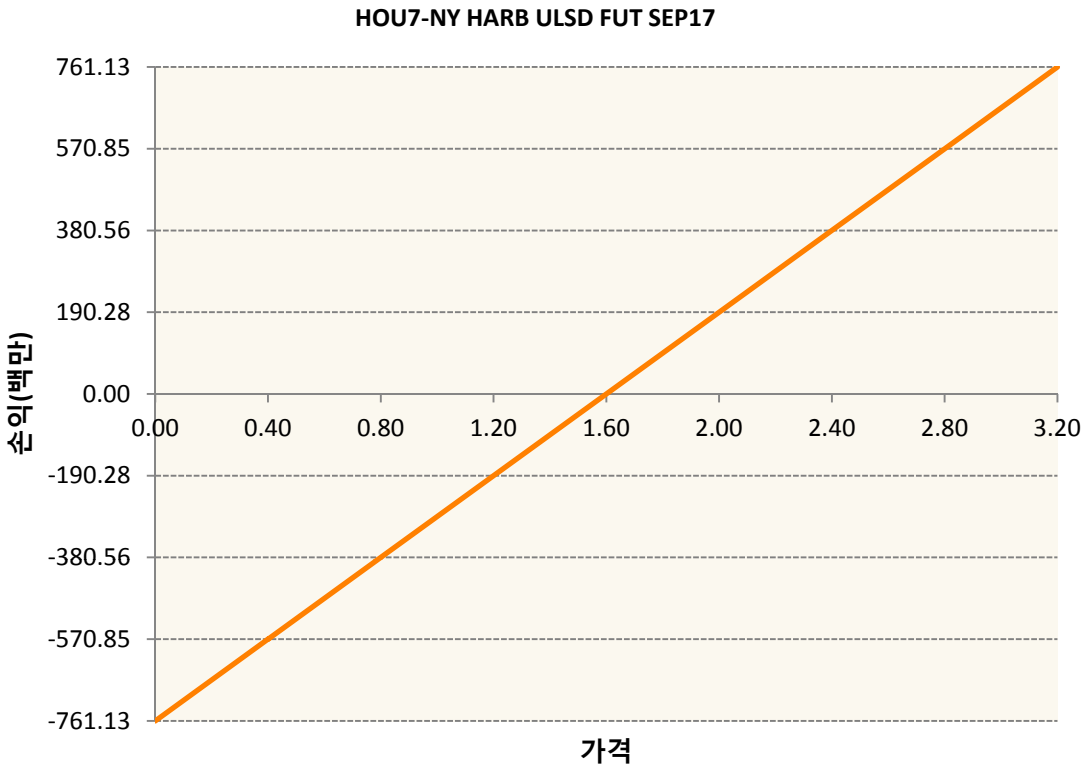
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	5,301	223	5,079	

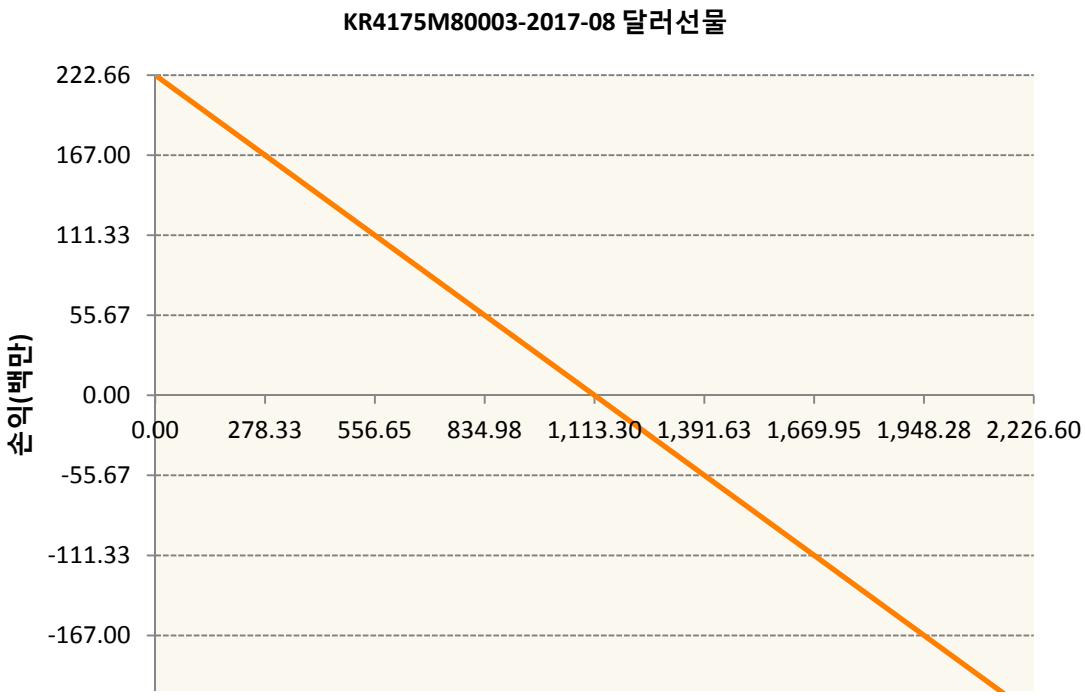
2. 만기시점의 손익구조

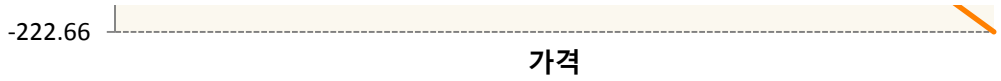


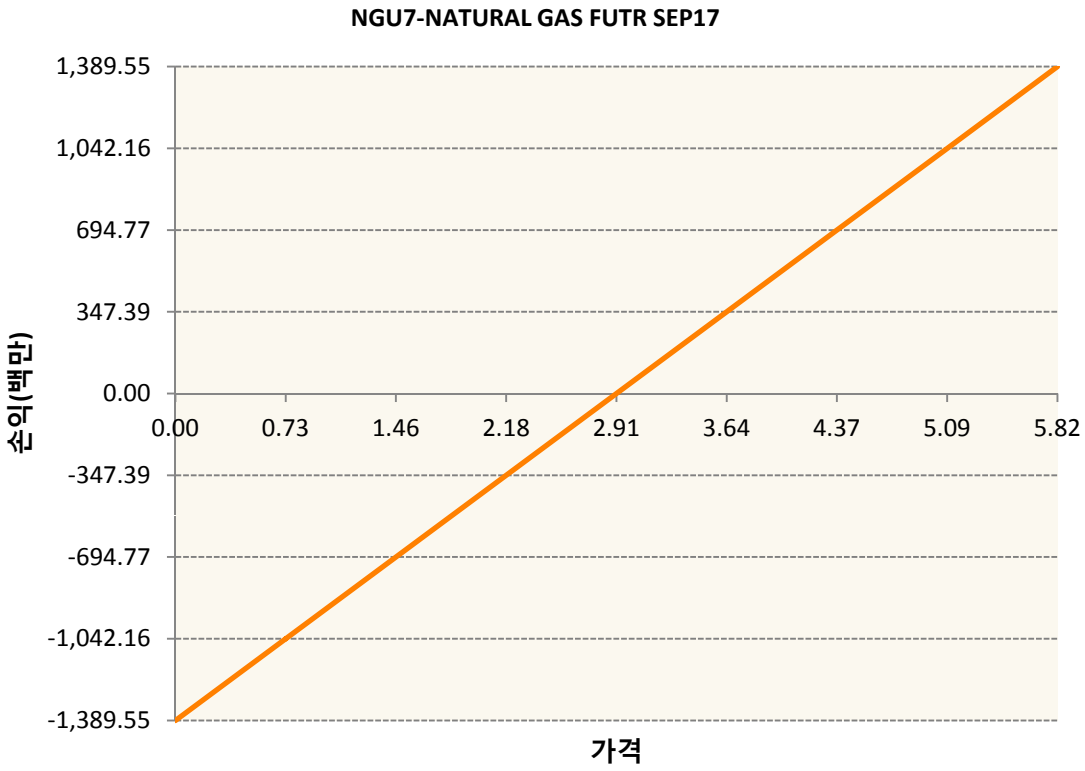


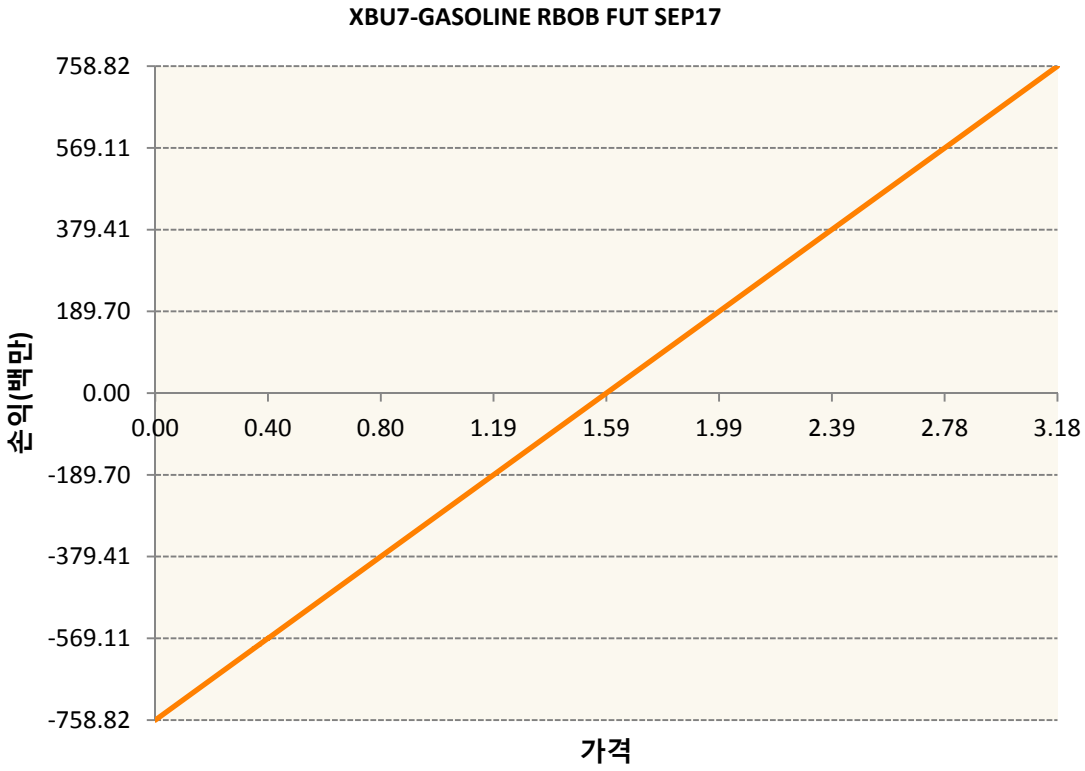

-726.27
-1,089.40
-1,452.54
가격


HOU7-NY HARB ULSD FUT SEP17
761.13
570.85
380.56
190.28
0.00
-190.28
-380.56
-570.85
-761.13
0.00
0.40
0.80
1.20
1.60
2.00
2.40
2.80
3.20
손익(백만)
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(백만)


-222.66
가격


NGU7-NATURAL GAS FUTR SEP17
1,389.55
1,042.16
694.77
347.39
0.00
-347.39
-694.77
-1,042.16
-1,389.55
0.00
0.73
1.46
2.18
2.91
3.64
4.37
5.09
5.82
손익(백만)
가격


XBU7-GASOLINE RBOB FUT SEP17
758.82
569.11
379.41
189.70
0.00
-189.70
-379.41
-569.11
-758.82
0.00
0.40
0.80
1.19
1.59
1.99
2.39
2.78
3.18
손익(백만)
가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLU7	WTI CRUDE FUTURE SEP17	75
COX7	BRENT CRUDE FUTR NOV17	116
HOU7	NY HARB ULSD FUT SEP17	61
KR4175M80(	2017-08 달러선물	18
NGU7	NATURAL GAS FUTR SEP17	111
XBU7	GASOLINE RBOB FUT SEP17	61

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

784

공시일	2017-07-28
기준일	2017-07-27

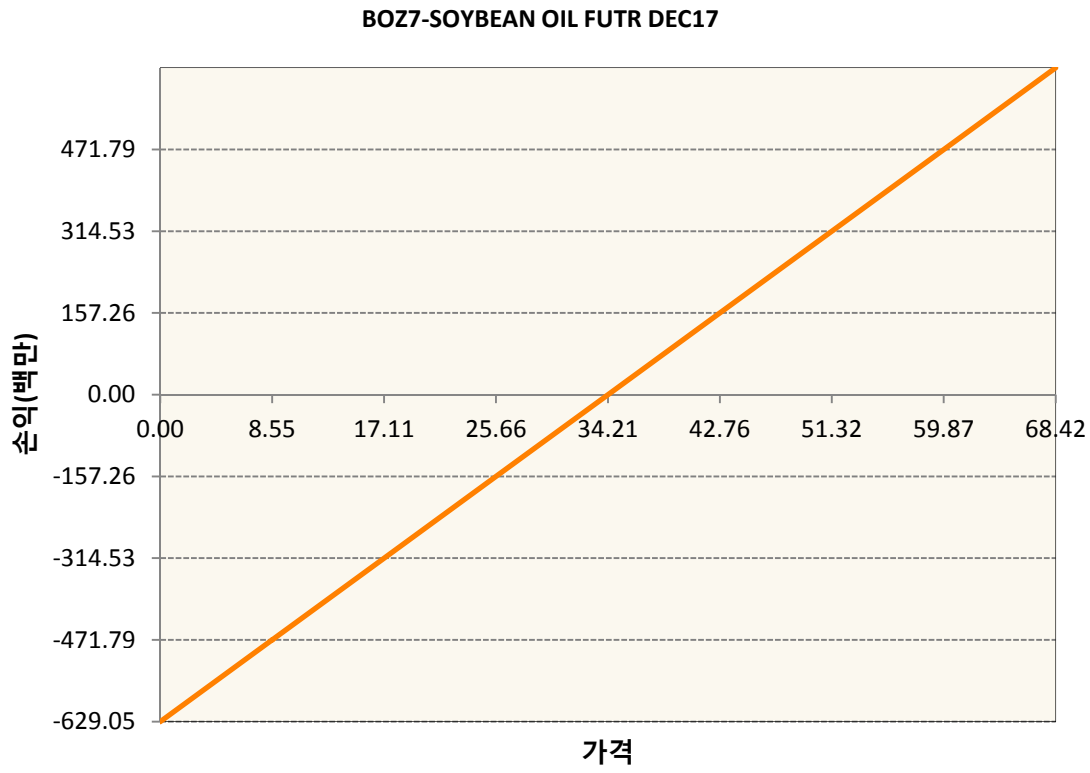
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

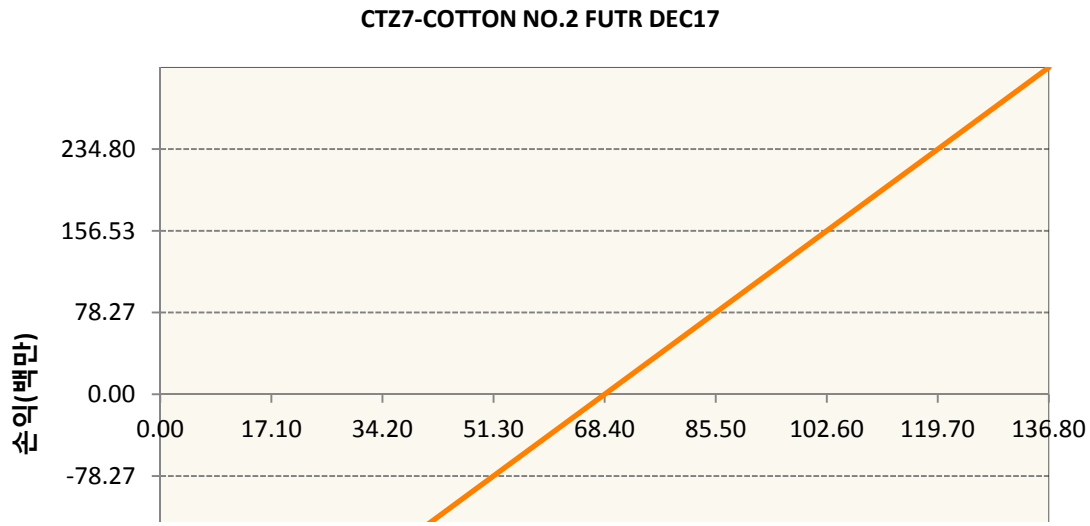
1. 계약금액

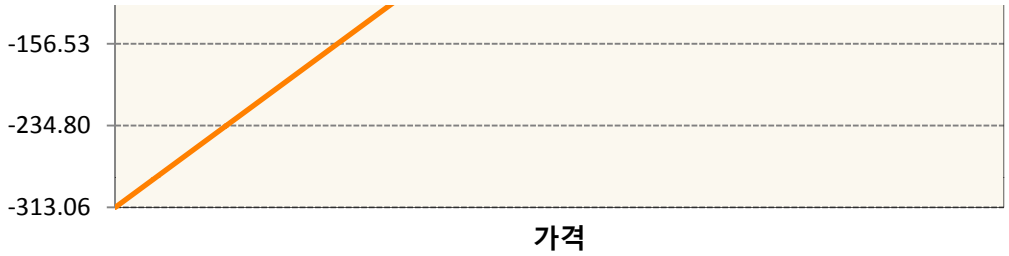
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	7,012	390	6,623	

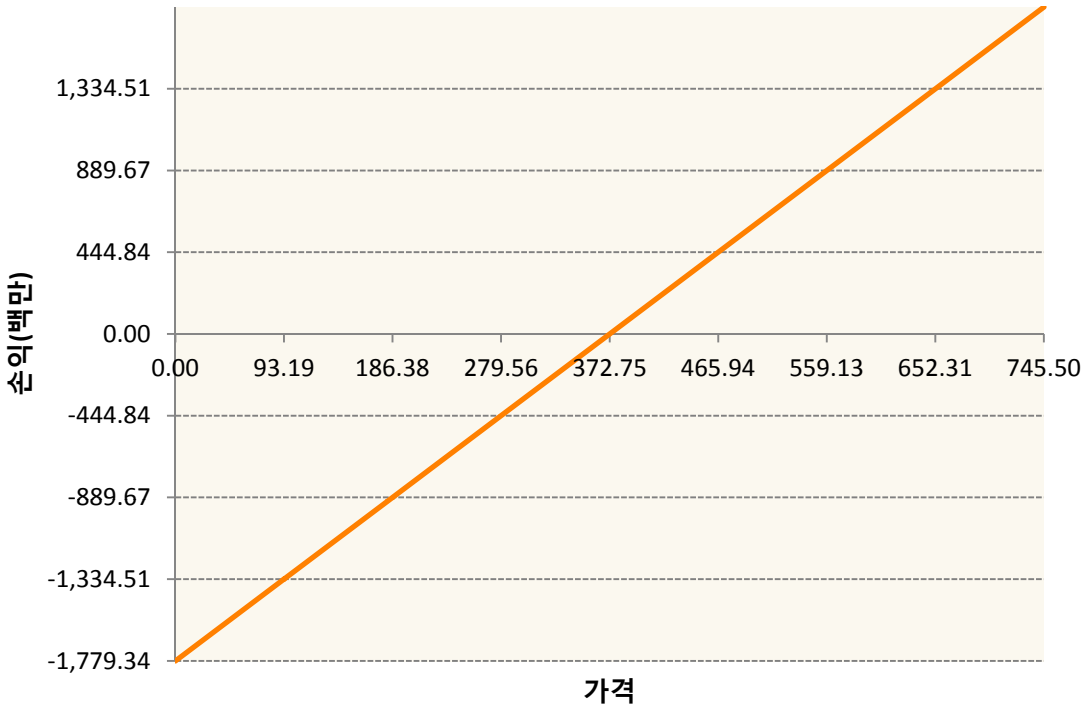
2. 만기시점의 손익구조



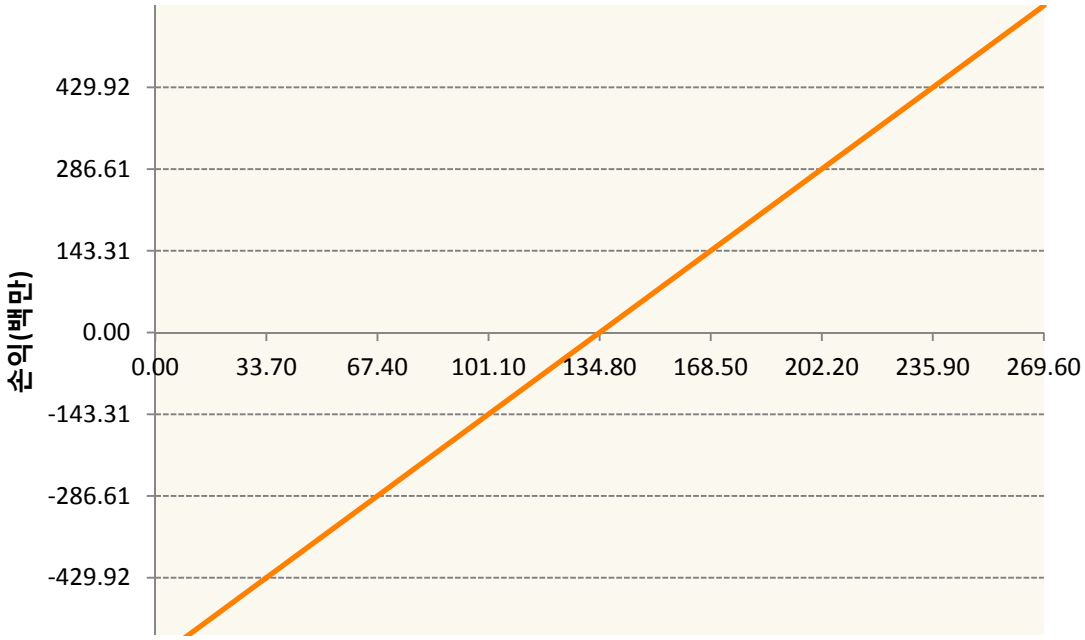


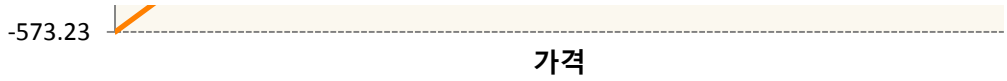


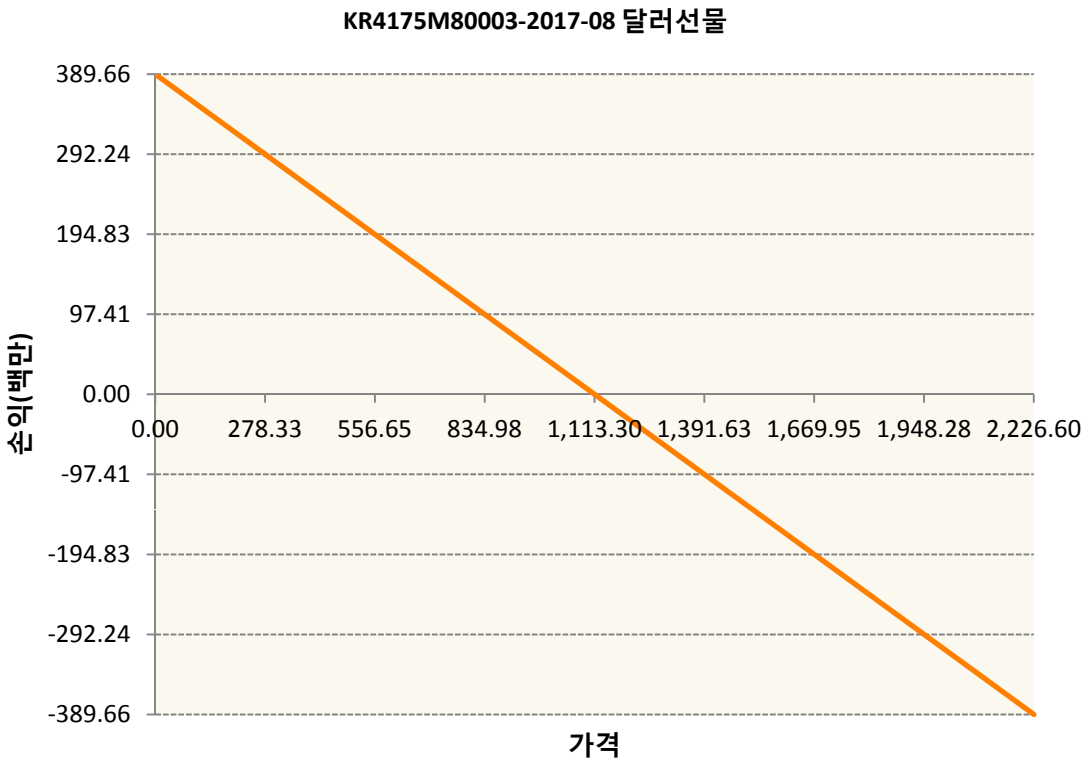
CU7-CORN FUTURE SEP17

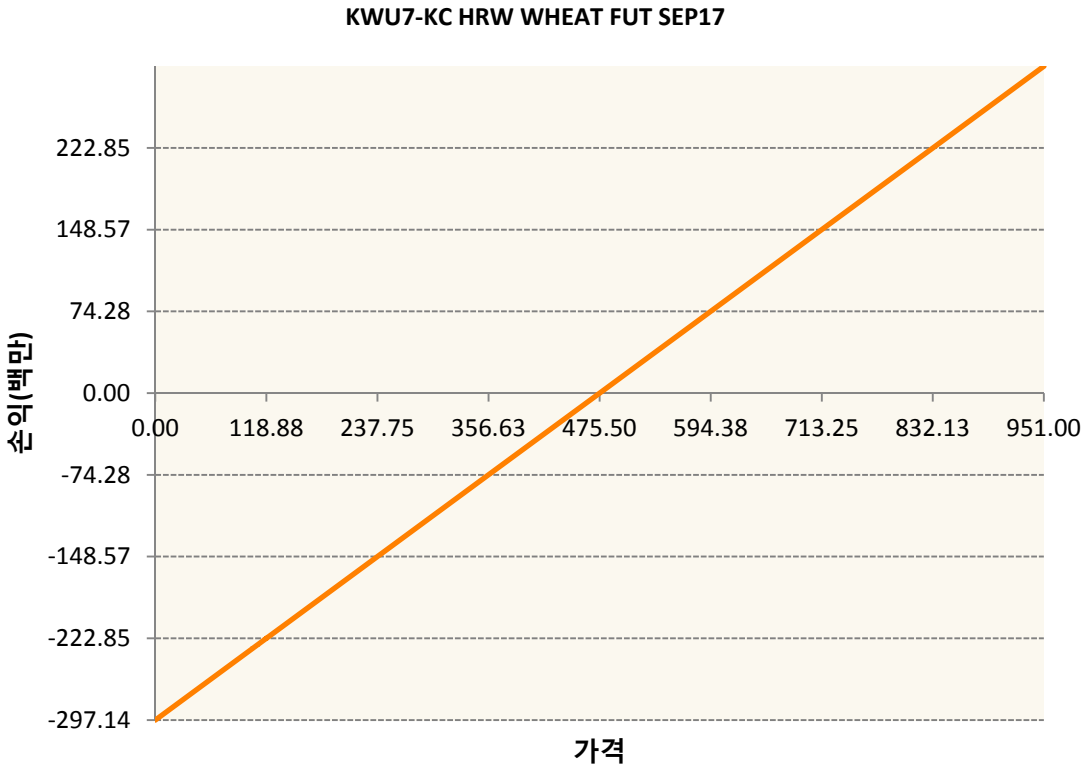


KCU7-COFFEE 'C' FUTURE SEP17

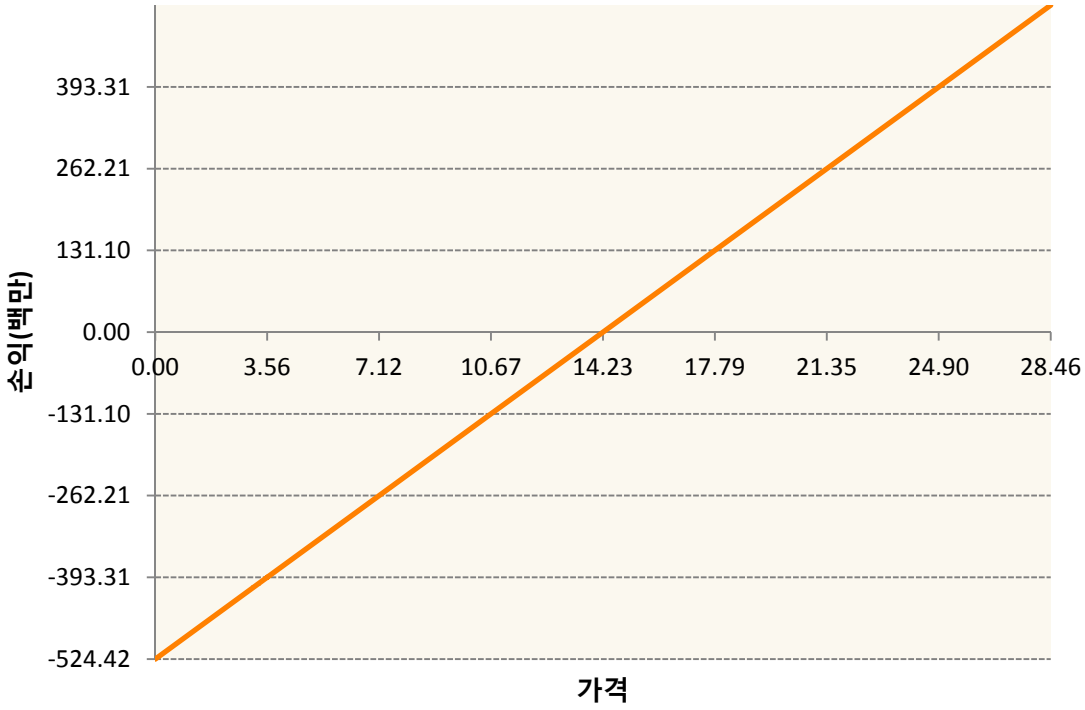



-573.23
가격

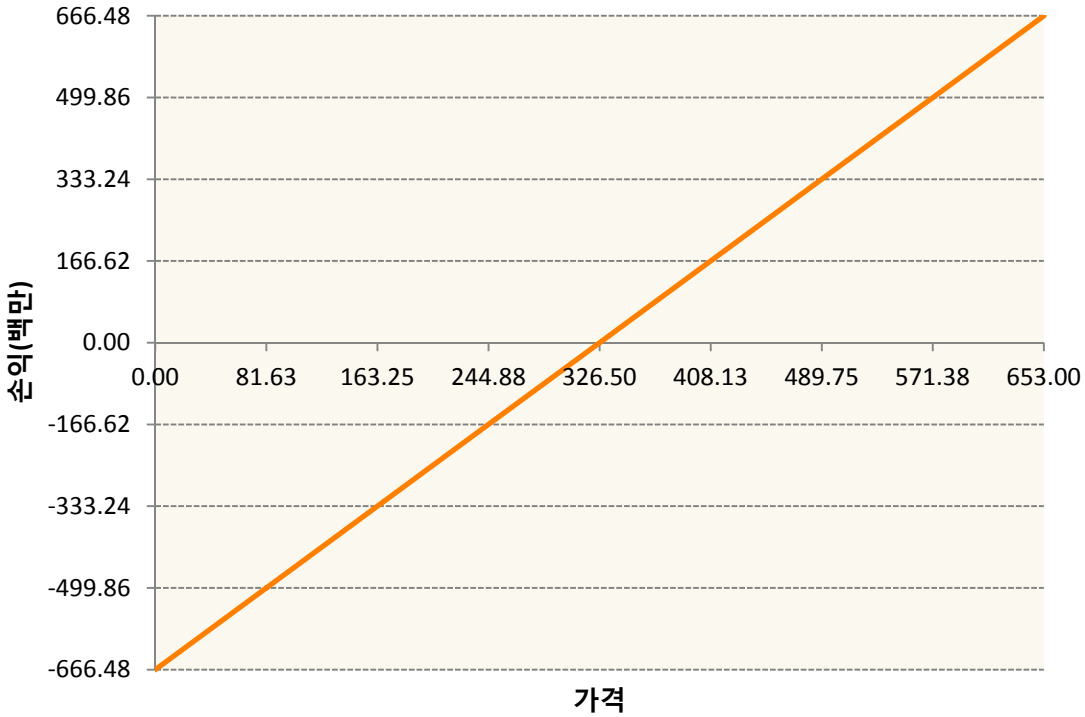

KR4175M80003-2017-08 달러선물
389.66
292.24
194.83
97.41
0.00
-97.41
-194.83
-292.24
-389.66
0.00
278.33
556.65
834.98
1,113.30
1,391.63
1,669.95
1,948.28
2,226.60
손익(백만)
가격


KWU7-KC HRW WHEAT FUT SEP17
222.85
148.57
74.28
0.00
-74.28
-148.57
-222.85
-297.14
0.00
118.88
237.75
356.63
475.50
594.38
713.25
832.13
951.00
손익(백만)
가격

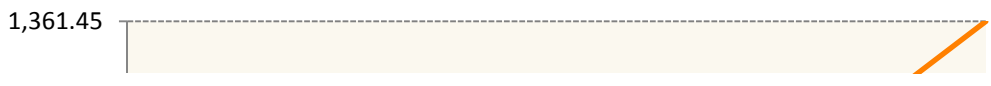
SBV7-SUGAR #11 (WORLD) OCT17

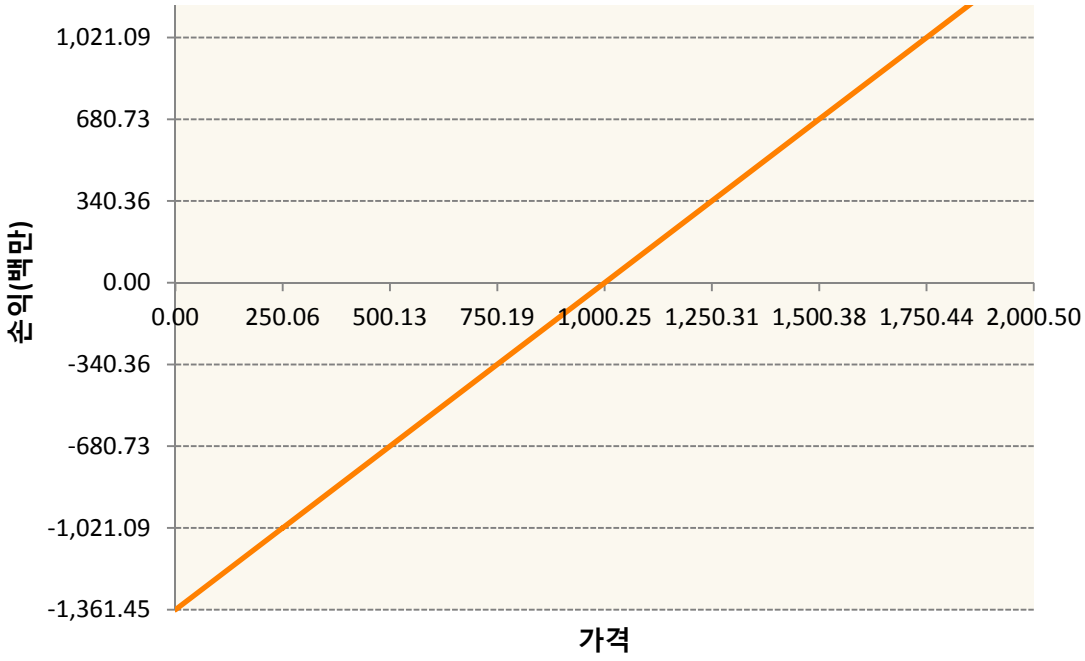


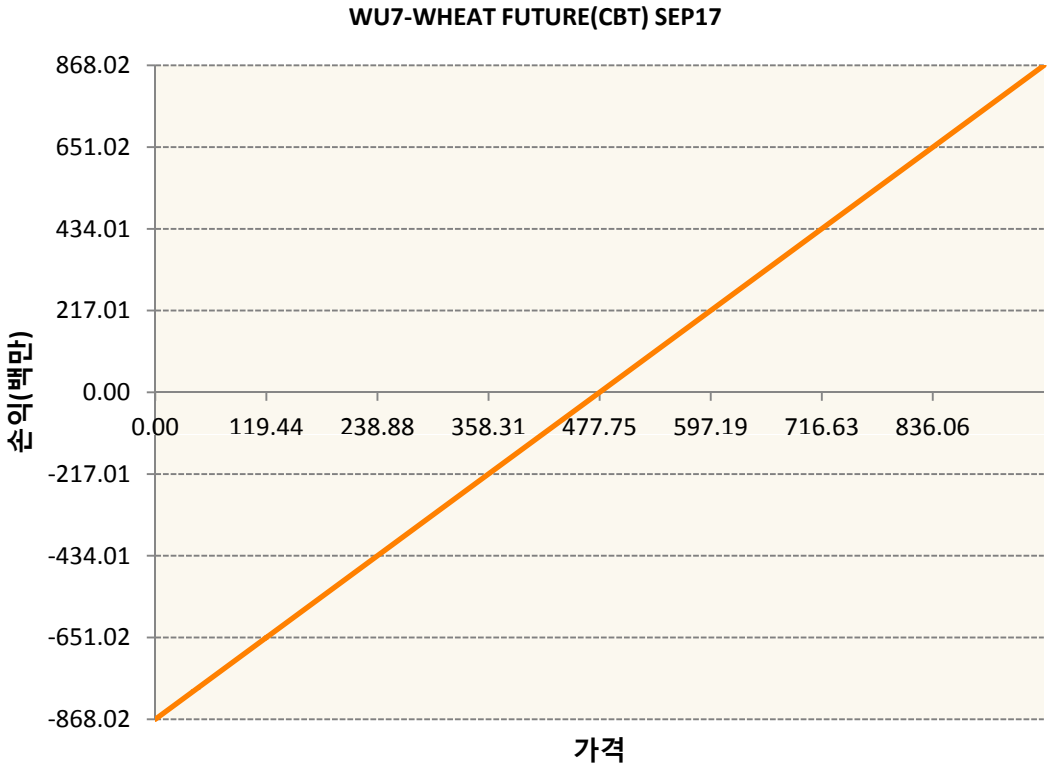
SMZ7-SOYBEAN MEAL FUTR DEC17



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	142
KCU7	COFFEE 'C' FUTURE SEP17	46
KR4175M80(	2017-08 달러선물	31

KWU7	KC HRW WHEAT FUT SEP17	24
SBV7	SUGAR #11 (WORLD) OCT17	42
SMZ7	SOYBEAN MEAL FUTR DEC17	53
SX7	SOYBEAN FUTURE NOV17	109
WU7	WHEAT FUTURE(CBT) SEP17	69

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

656