공시일	2017-07-31
기준일	2017-07-28

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	2017-07-31
기준일	2017-07-28

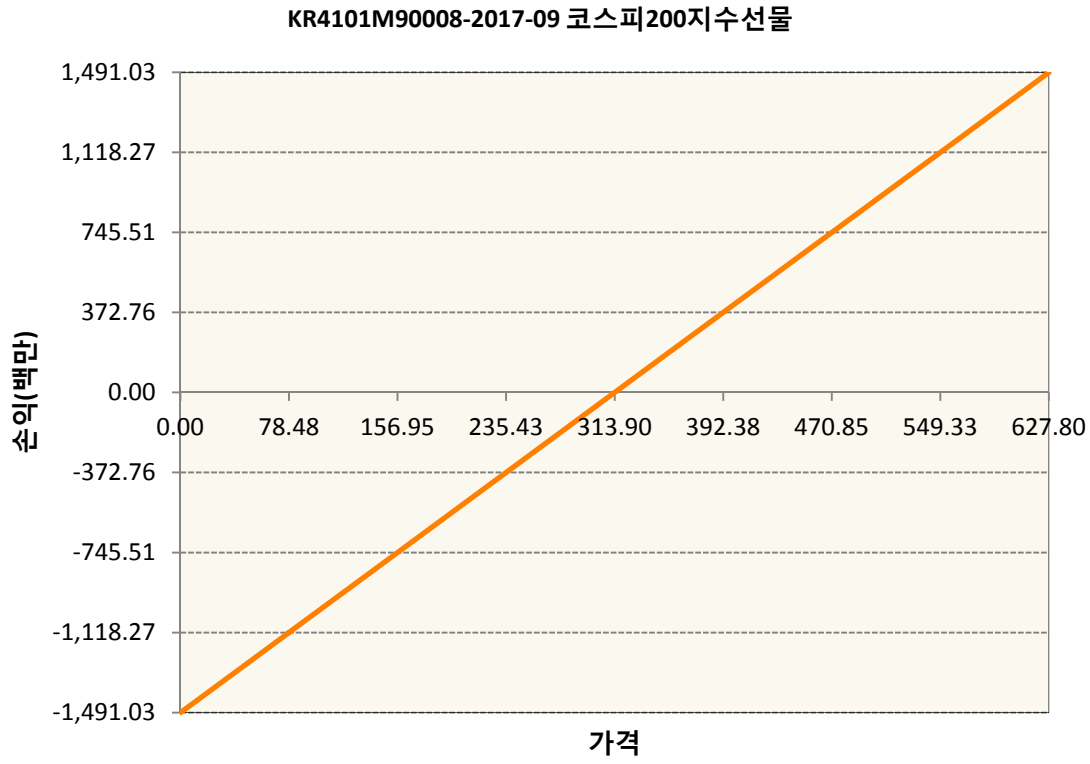
스마트인덱스모

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	1,491	0	1,491	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101M90(2017-09 코스피200지수선물							119
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-119	-119	-119	-119	-119	-119	-119
-5.33%	-80	-80	-80	-80	-80	-80	-80
-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%	80	80	80	80	80	80	80
8.00%	119	119	119	119	119	119	119

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

73

공시일	2017-07-31
기준일	2017-07-28

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)

475

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-07-31
기준일	2017-07-28

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	389

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

344

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-07-31
기준일	2017-07-28

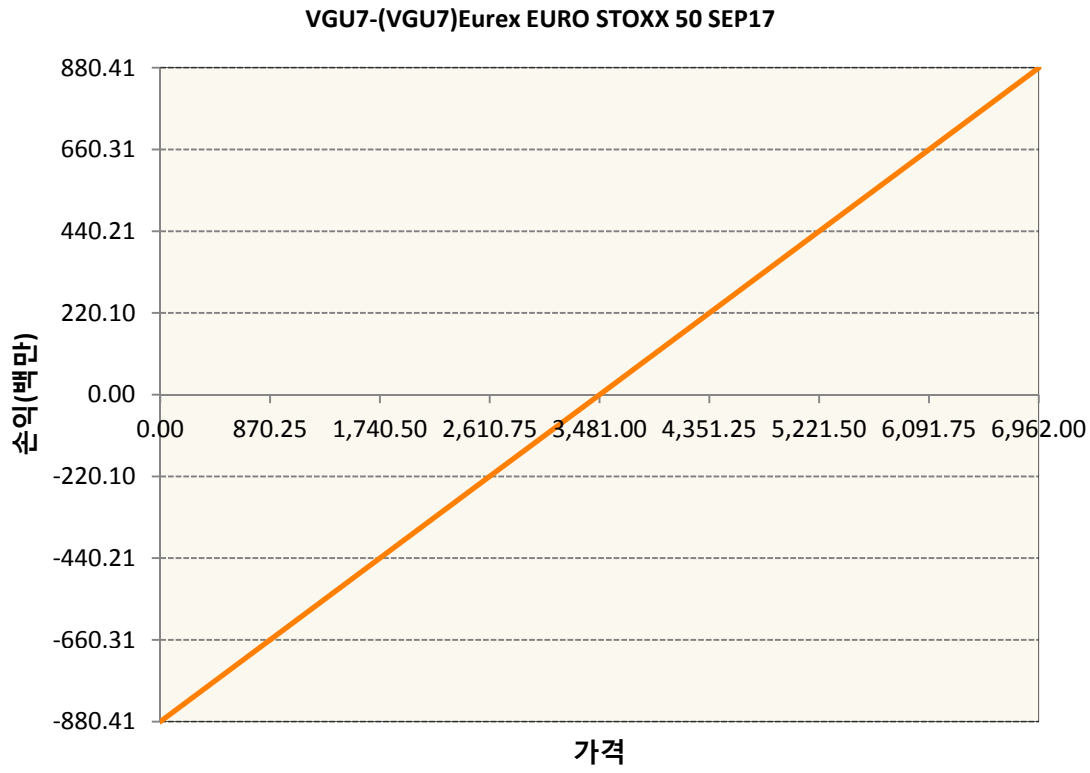
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	880	0	880	

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	2017-07-31
기준일	2017-07-28

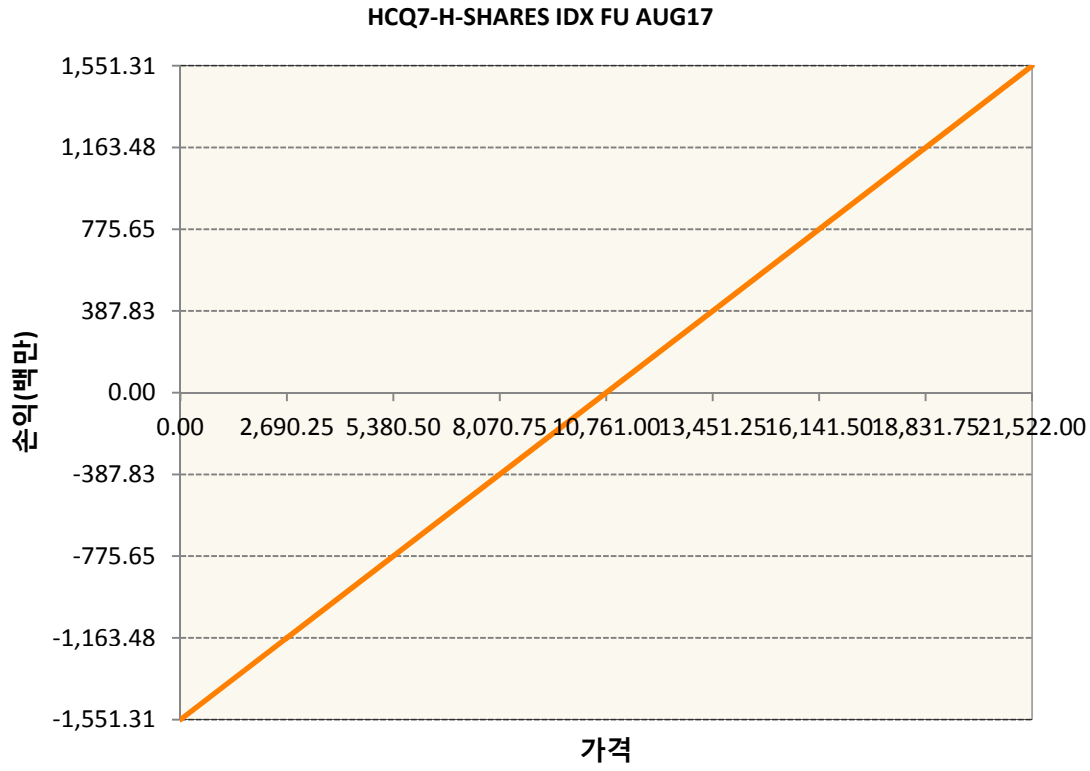
차이나인덱스모(주식-파생형)

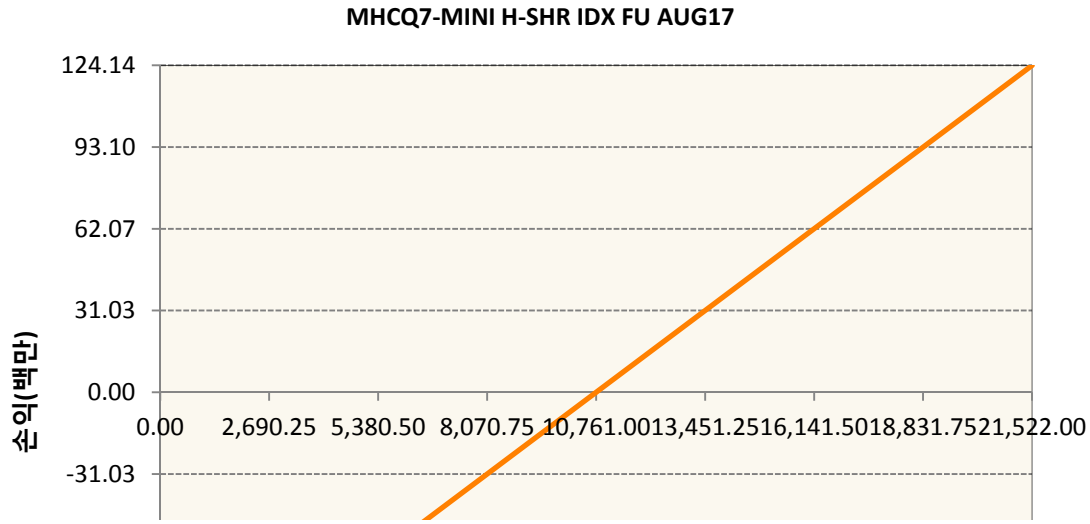
1. 계약금액

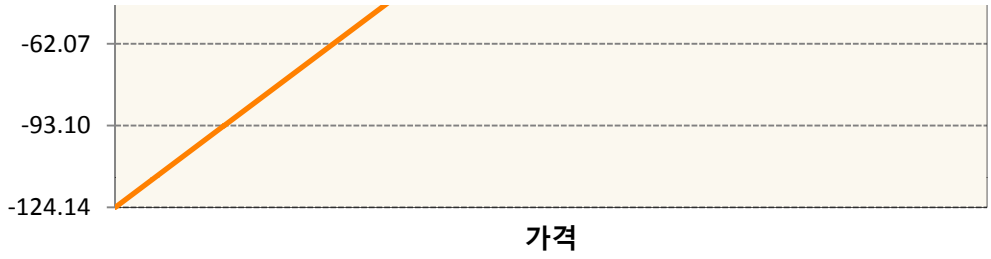
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,675	0	1,675	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCQ7	H-SHARES IDX FU AUG17	124
MHCQ7	MINI H-SHR IDX FU AUG17	10

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	120

공시일	2017-07-31
기준일	2017-07-28

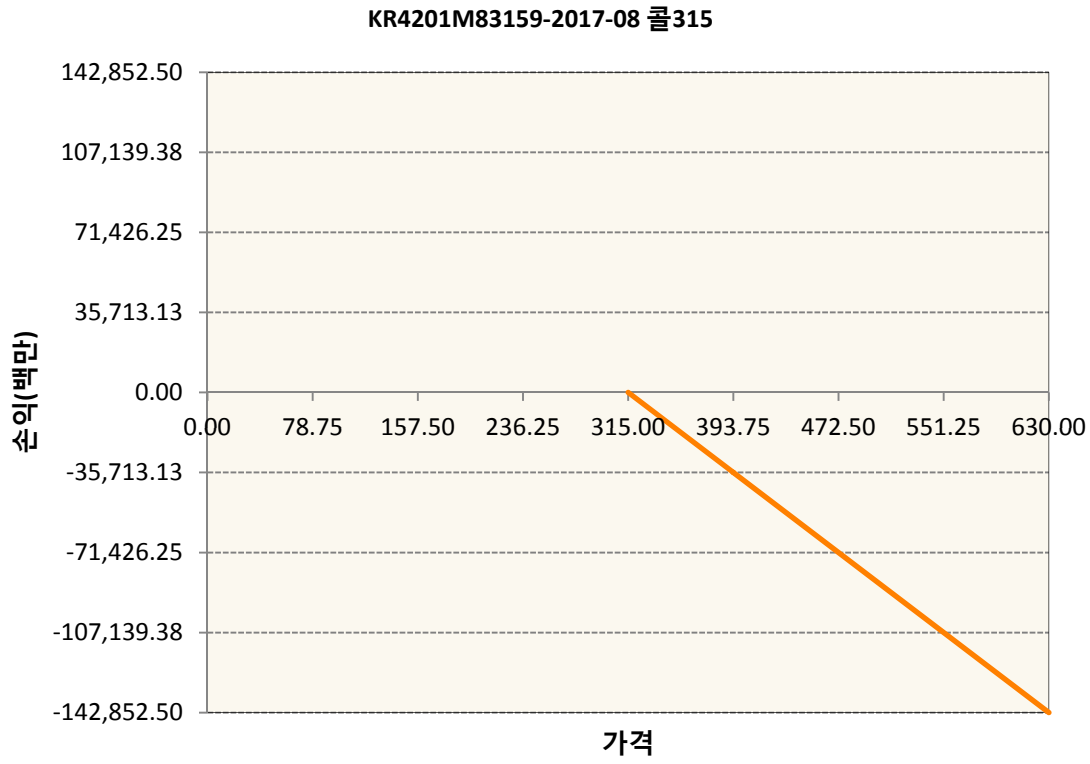
커버드콜모(주식혼합-파생형)

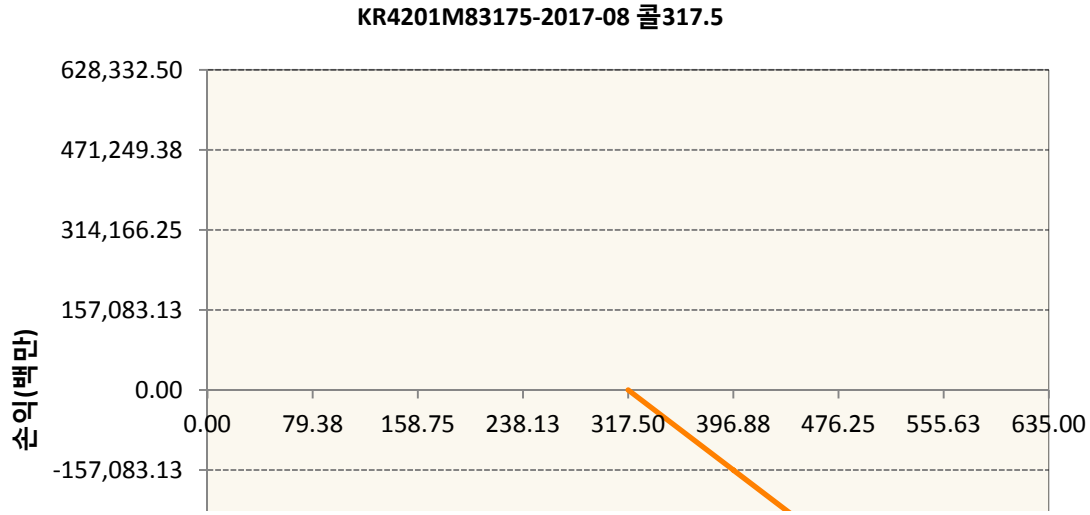
1. 계약금액

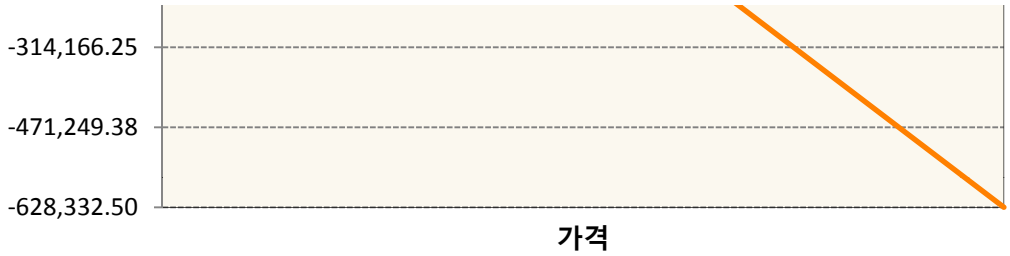
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	7,954	-7,954	장내
누계	유가증권	옵션	0	1,339,364	-1,339,364	장내

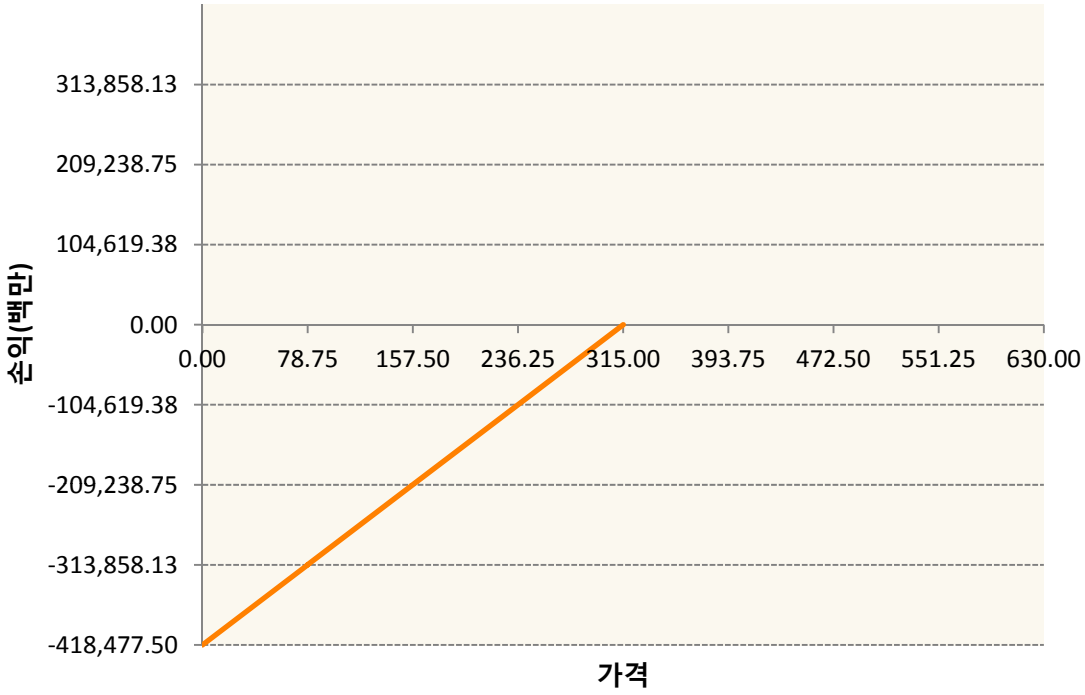
2. 만기시점의 손익구조



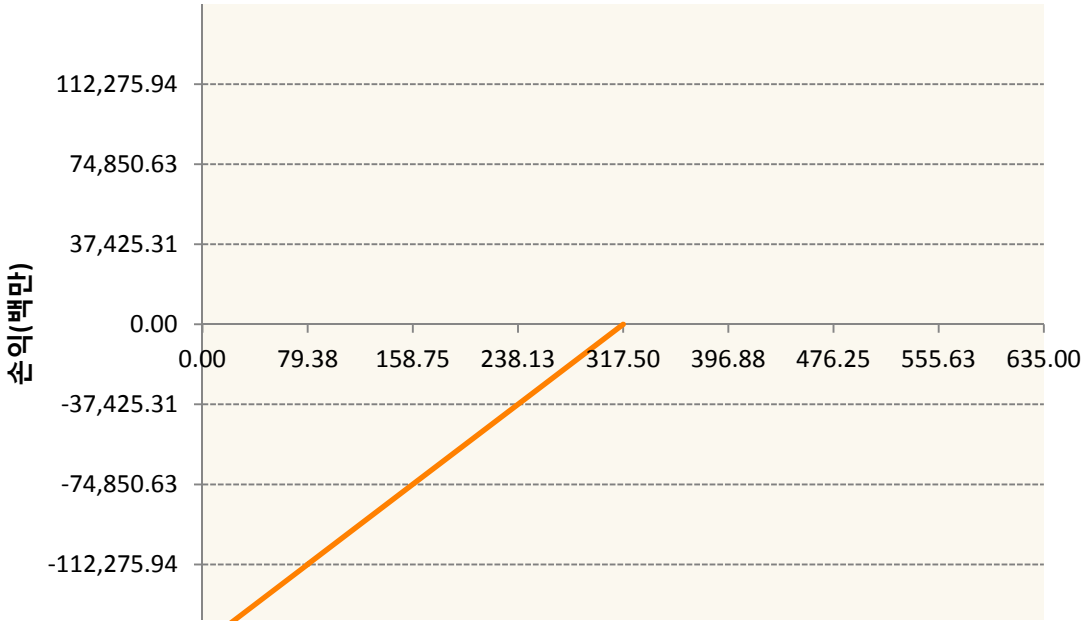




KR4301M83157-2017-08 풋315



KR4301M83173-2017-08 풋317.5





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201M83: 2017-08 콜315							9,008
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	2,320	2,310	2,293	2,268	2,232	2,187	2,132
-5.33%	2,249	2,196	2,128	2,047	1,953	1,848	1,733
-2.67%	1,855	1,711	1,556	1,394	1,226	1,053	875
0%	629	419	210	0	-210	-420	-629
2.67%	-1,748	-1,918	-2,095	-2,278	-2,465	-2,656	-2,849
5.33%	-5,017	-5,098	-5,194	-5,305	-5,427	-5,560	-5,701
8.00%	-8,686	-8,709	-8,745	-8,792	-8,852	-8,925	-9,008
KR4201M83: 2017-08 콜317.5							37,030
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	8,012	7,987	7,940	7,864	7,753	7,604	7,415
-5.33%	7,840	7,683	7,467	7,195	6,867	6,489	6,066
-2.67%	6,713	6,204	5,639	5,027	4,376	3,694	2,986
0%	2,657	1,778	892	0	-896	-1,796	-2,698
2.67%	-6,220	-7,065	-7,925	-8,797	-9,678	-10,566	-11,460
5.33%	-19,524	-19,997	-20,533	-21,123	-21,757	-22,428	-23,130
8.00%	-35,180	-35,341	-35,564	-35,847	-36,189	-36,585	-37,030
KR4301M83: 2017-08 풋315							27,124
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-26,570	-26,599	-26,650	-26,725	-26,829	-26,962	-27,124
-5.33%	-15,656	-15,812	-16,010	-16,249	-16,524	-16,831	-17,167
-2.67%	-5,689	-6,112	-6,563	-7,038	-7,531	-8,038	-8,558
0%	1,842	1,228	614	0	-614	-1,229	-1,844
2.67%	6,001	5,503	4,984	4,449	3,901	3,343	2,777
5.33%	7,549	7,312	7,029	6,706	6,348	5,959	5,544
8.00%	7,923	7,854	7,751	7,612	7,435	7,224	6,978
KR4301M83: 2017-08 풋317.5							10,076
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-9,934	-9,940	-9,951	-9,969	-9,995	-10,031	-10,076
-5.33%	-6,027	-6,065	-6,116	-6,181	-6,259	-6,349	-6,450
-2.67%	-2,348	-2,469	-2,604	-2,750	-2,905	-3,067	-3,236
0%	633	424	212	0	-214	-428	-643
2.67%	2,466	2,264	2,059	1,852	1,642	1,430	1,217

5.33%	3,244	3,131	3,003	2,863	2,712	2,552	2,384
8.00%	3,461	3,423	3,370	3,302	3,221	3,126	3,020

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

86,833

공시일	2017-07-31
기준일	2017-07-28

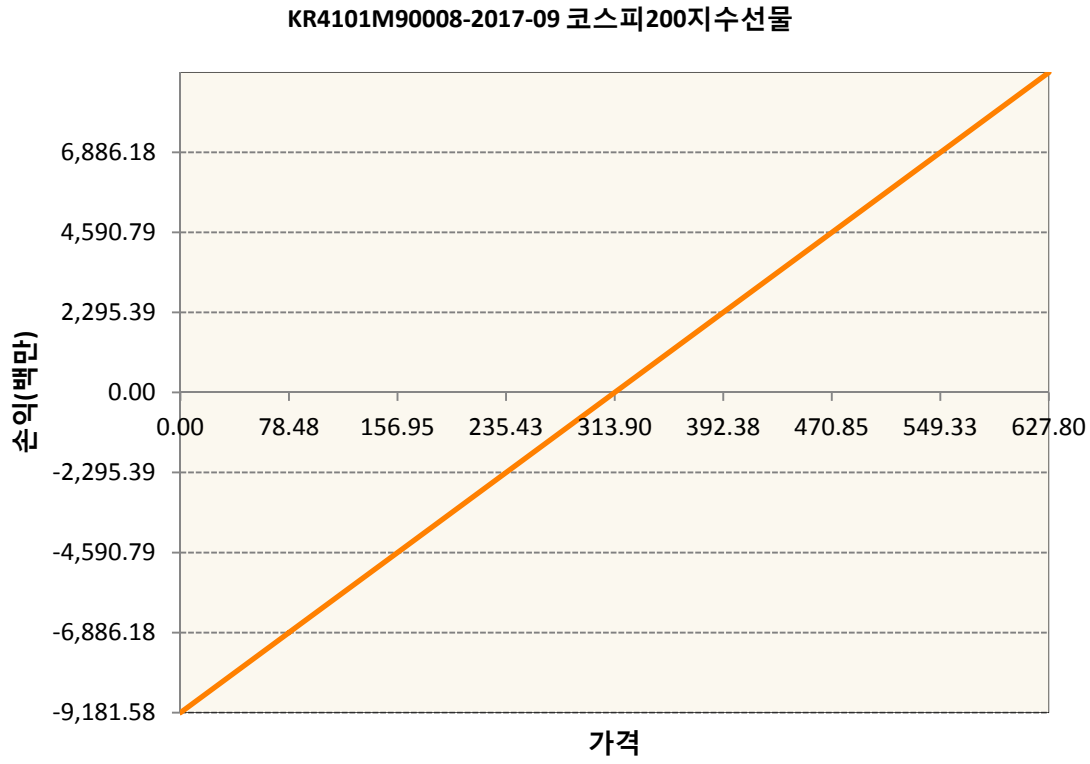
ETF스마트레버리지목표전환형6호

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	157	-157	장내
누계	유가증권	선물	9,182	0	9,182	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101M90(2017-09 코스피200지수선물							735
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-735	-735	-735	-735	-735	-735	-735
-5.33%	-490	-490	-490	-490	-490	-490	-490
-2.67%	-245	-245	-245	-245	-245	-245	-245
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	245	245	245	245	245	245	245
5.33%	490	490	490	490	490	490	490
8.00%	735	735	735	735	735	735	735

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

449

공시일	2017-07-31
기준일	2017-07-28

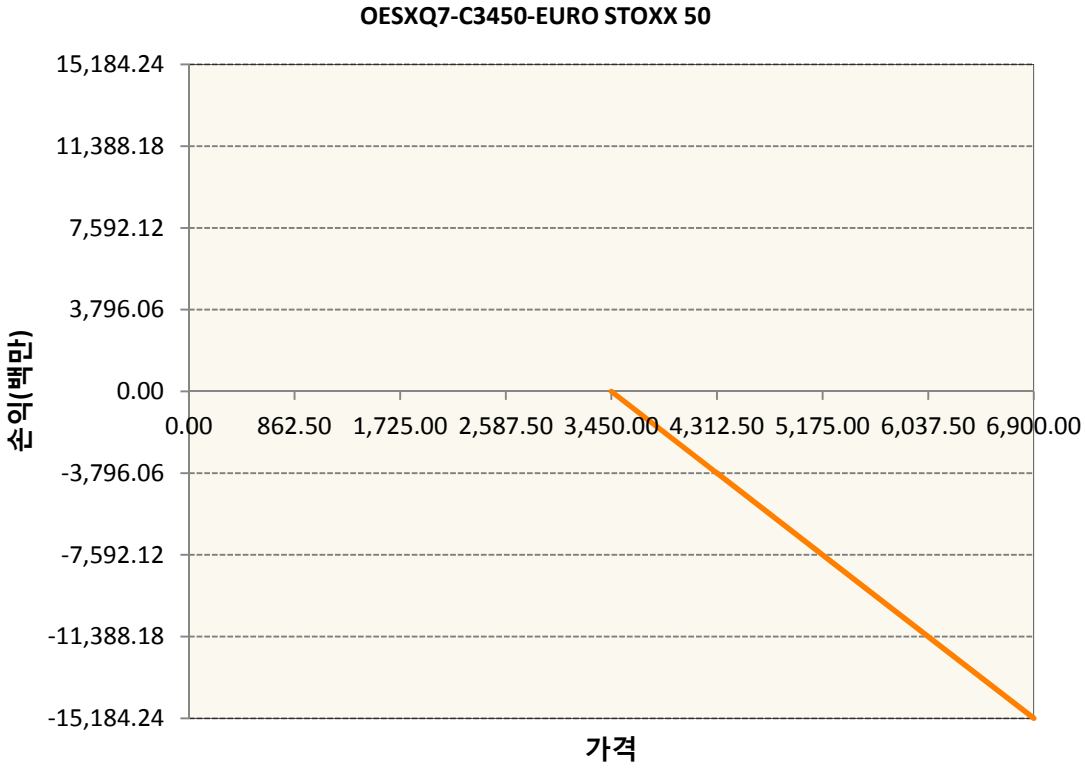
유로커버드콜(주식혼합-파생형)

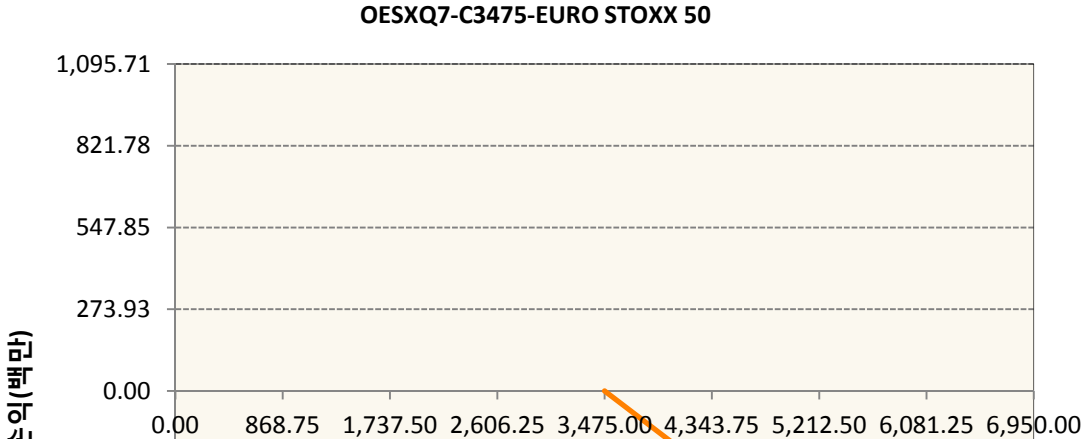
1. 계약금액

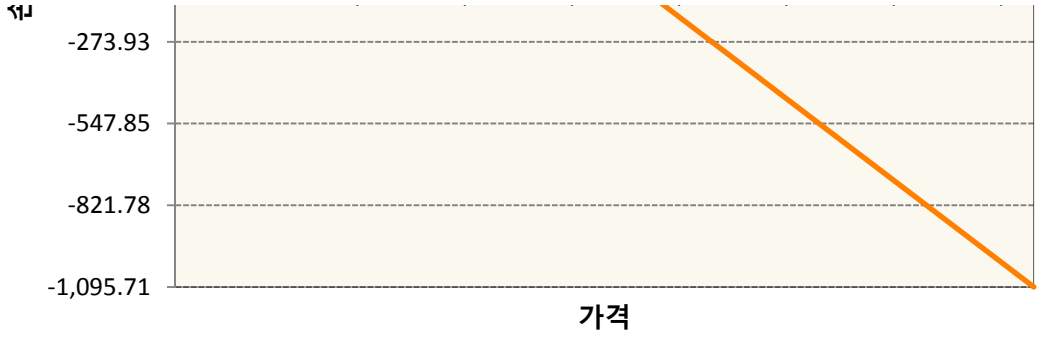
(단위:백만원)

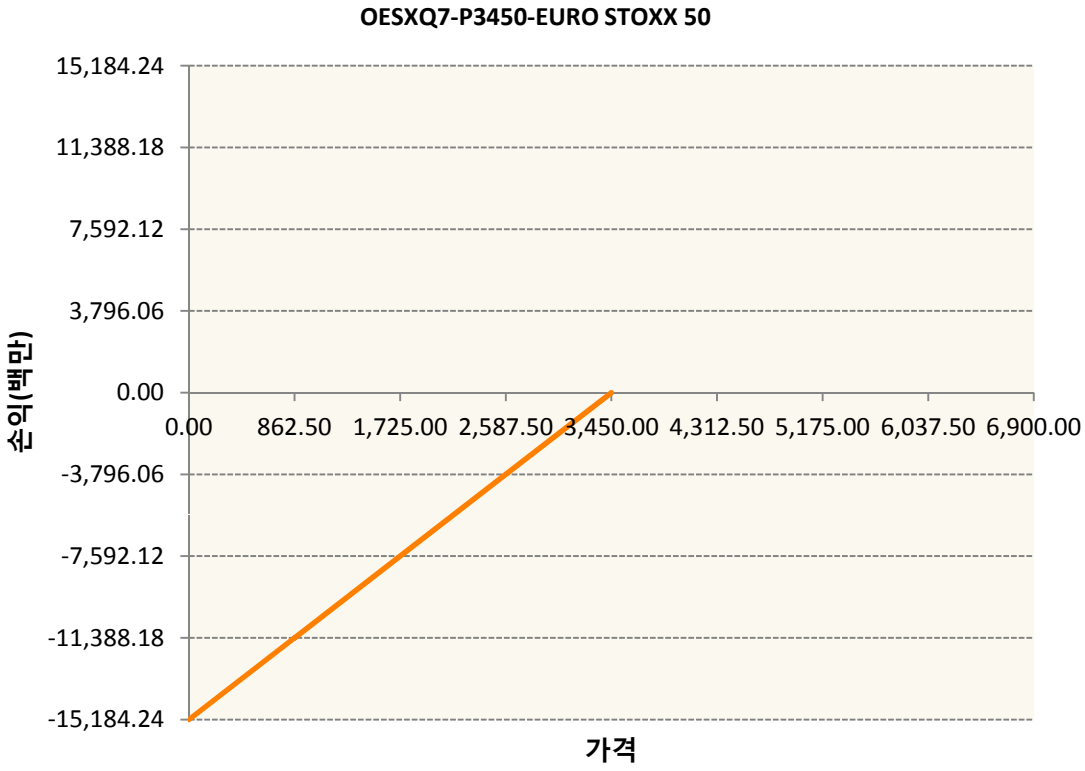
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	16,253	0	16,253	
누계	유가증권	옵션	0	32,560	-32,560	장내

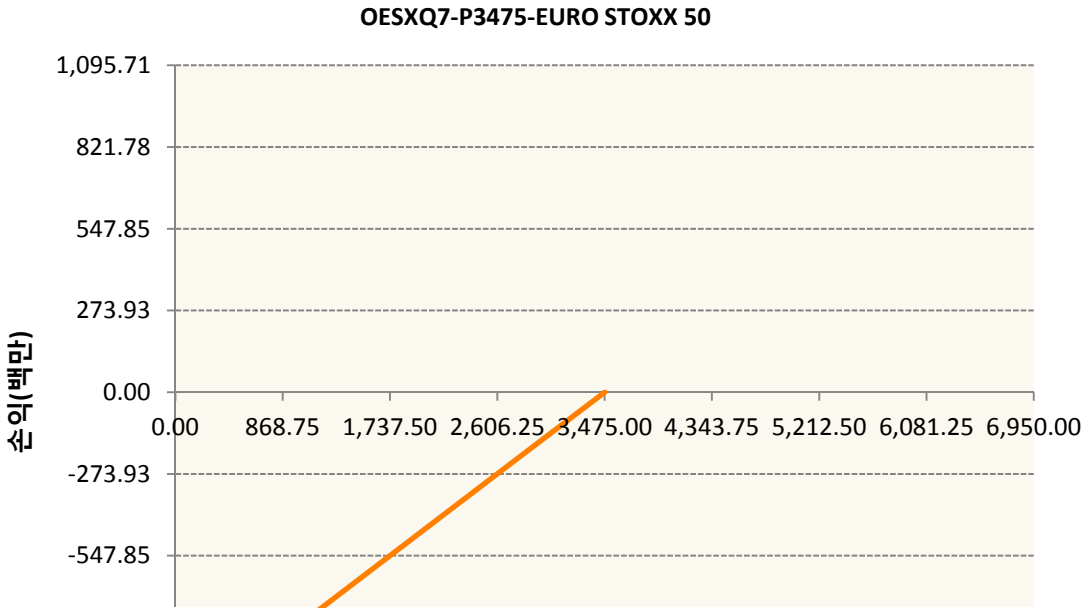
2. 만기시점의 손익구조

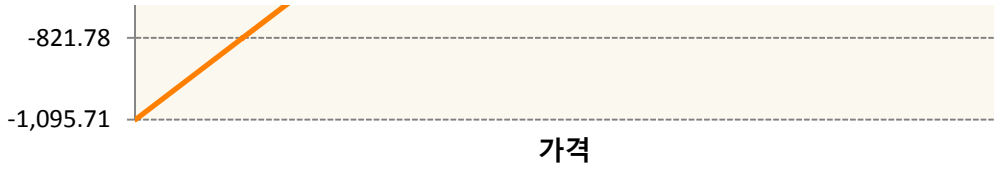


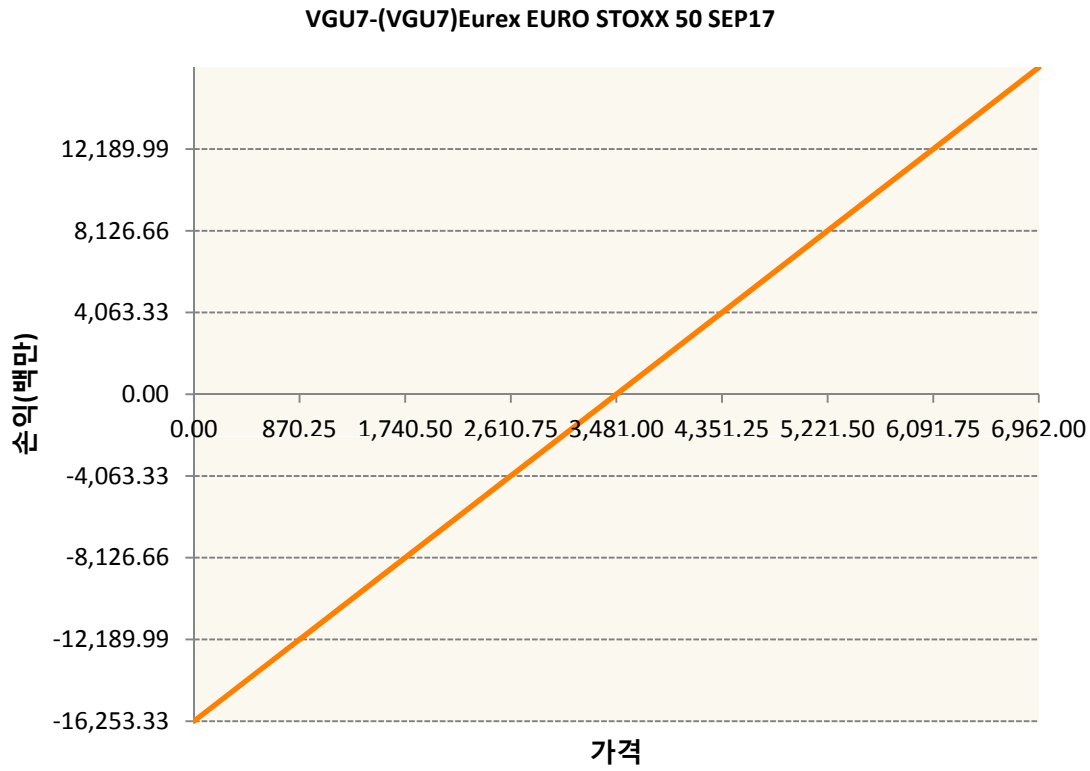



-273.93
-547.85
-821.78
-1,095.71
가격


OESXQ7-P3450-EURO STOXX 50
15,184.24
11,388.18
7,592.12
3,796.06
0.00
-3,796.06
-7,592.12
-11,388.18
-15,184.24
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
1,095.71
821.78
547.85
273.93
0.00
-273.93
-547.85
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	1,215
OESXQ7-C3	EURO STOXX 50	88
OESXQ7-P3	EURO STOXX 50	1,215
OESXQ7-P3	EURO STOXX 50	88
VGU7	(VGU7)Eurex EURO STOXX 50 SEP17	1,300

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	3,247

공시일	2017-07-31
기준일	2017-07-28

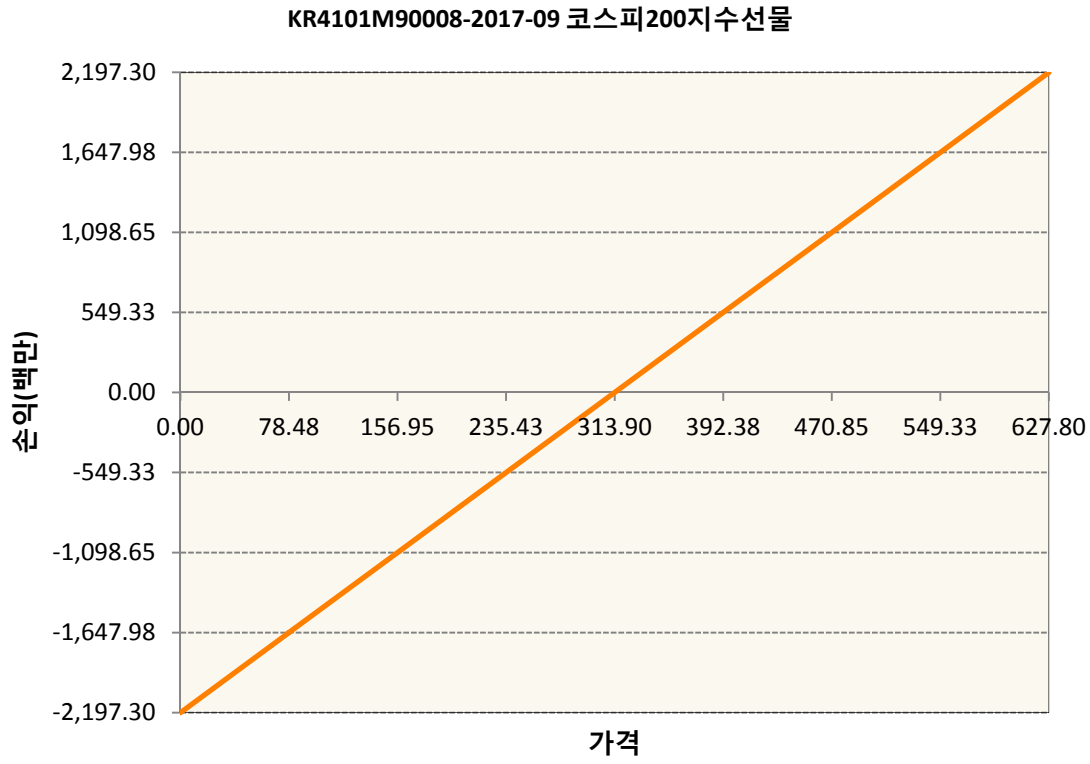
ETF스마트레버리지목표전환형7호

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	2,197	0	2,197	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101M90(2017-09 코스피200지수선물							176
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-176	-176	-176	-176	-176	-176	-176
-5.33%	-117	-117	-117	-117	-117	-117	-117
-2.67%	-59	-59	-59	-59	-59	-59	-59
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	59	59	59	59	59	59	59
5.33%	117	117	117	117	117	117	117
8.00%	176	176	176	176	176	176	176

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

107

공시일	2017-07-31
기준일	2017-07-28

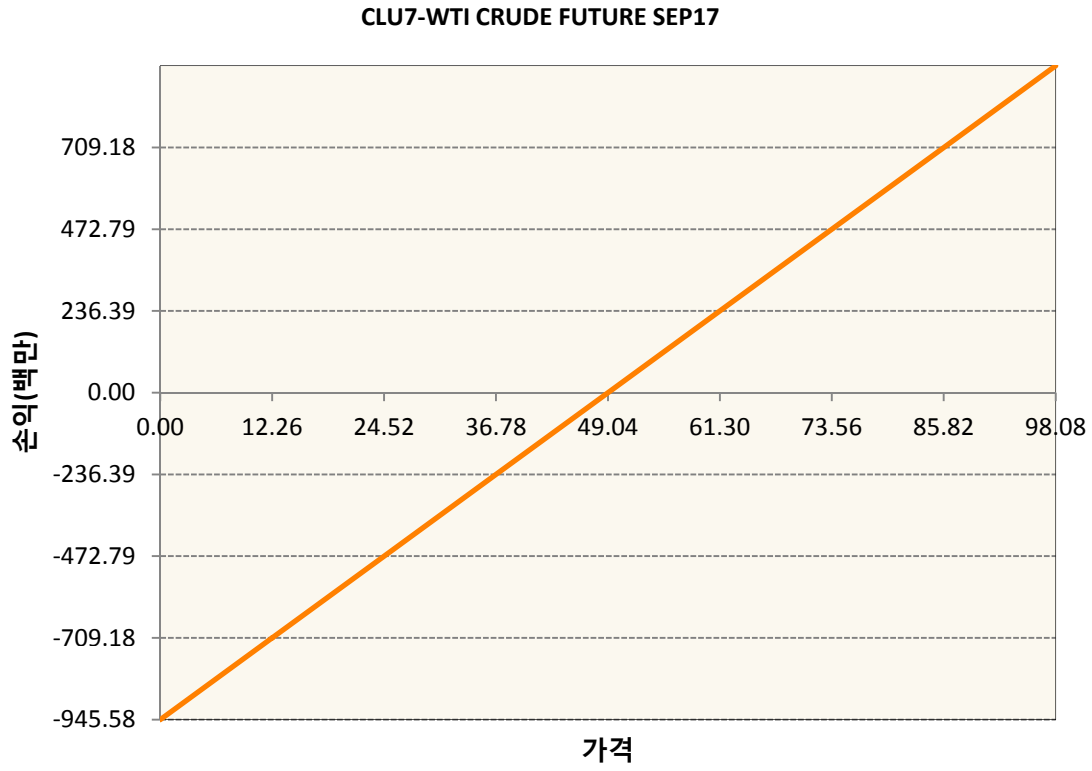
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

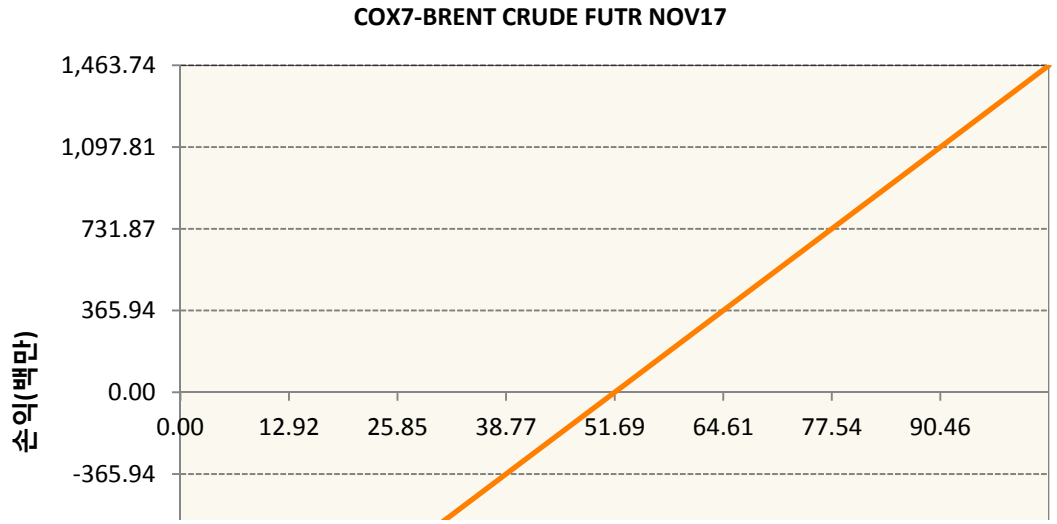
1. 계약금액

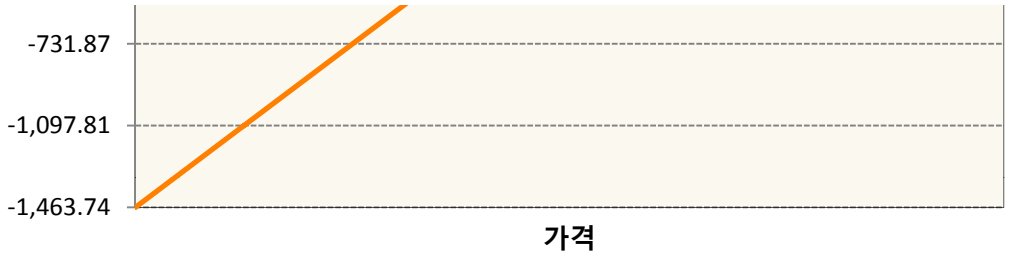
(단위:백만원)

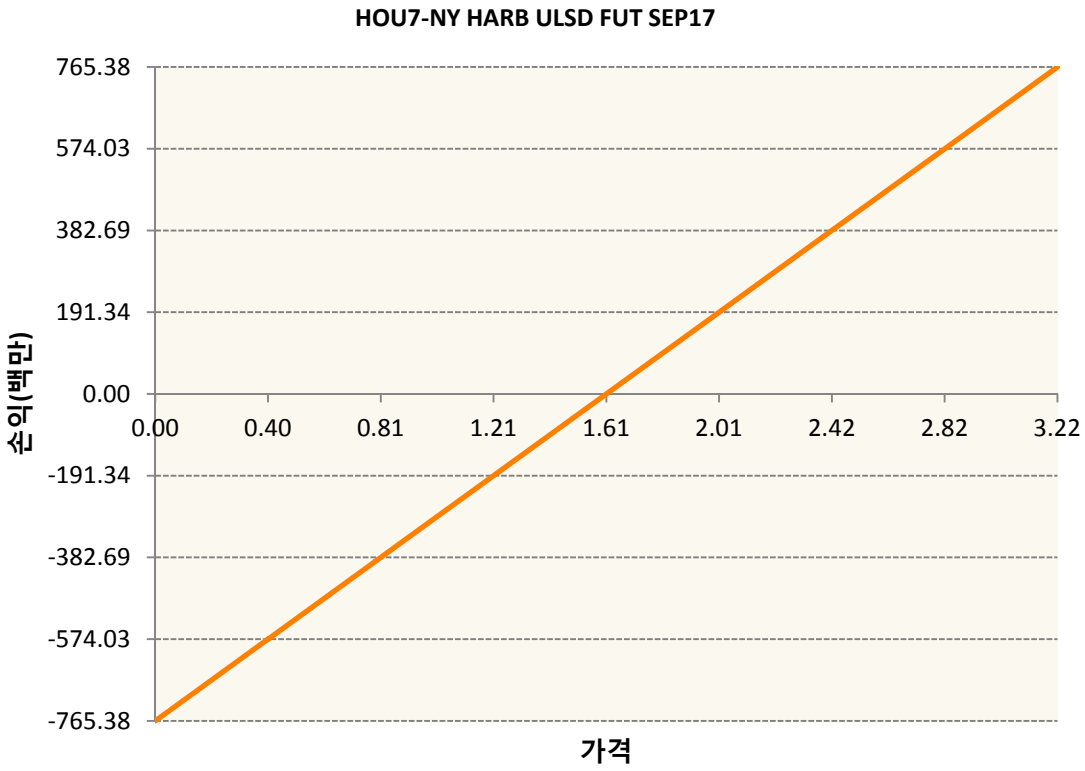
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	5,361	224	5,136	

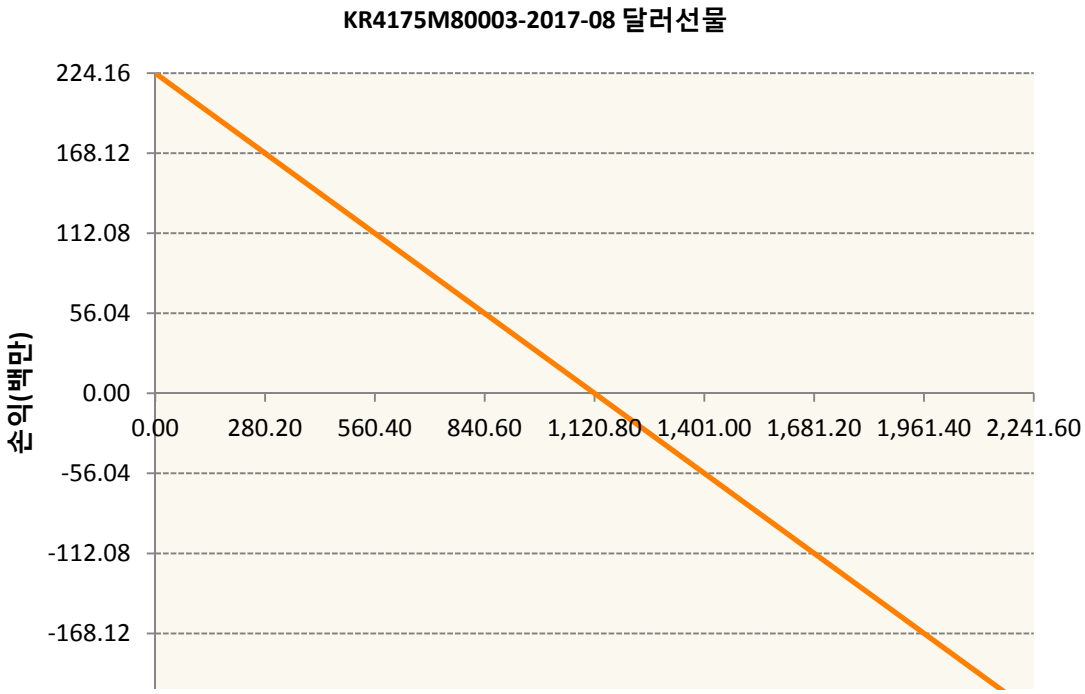
2. 만기시점의 손익구조

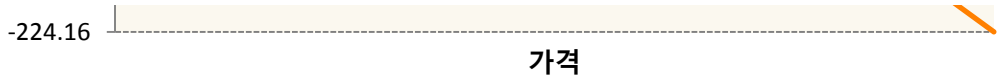


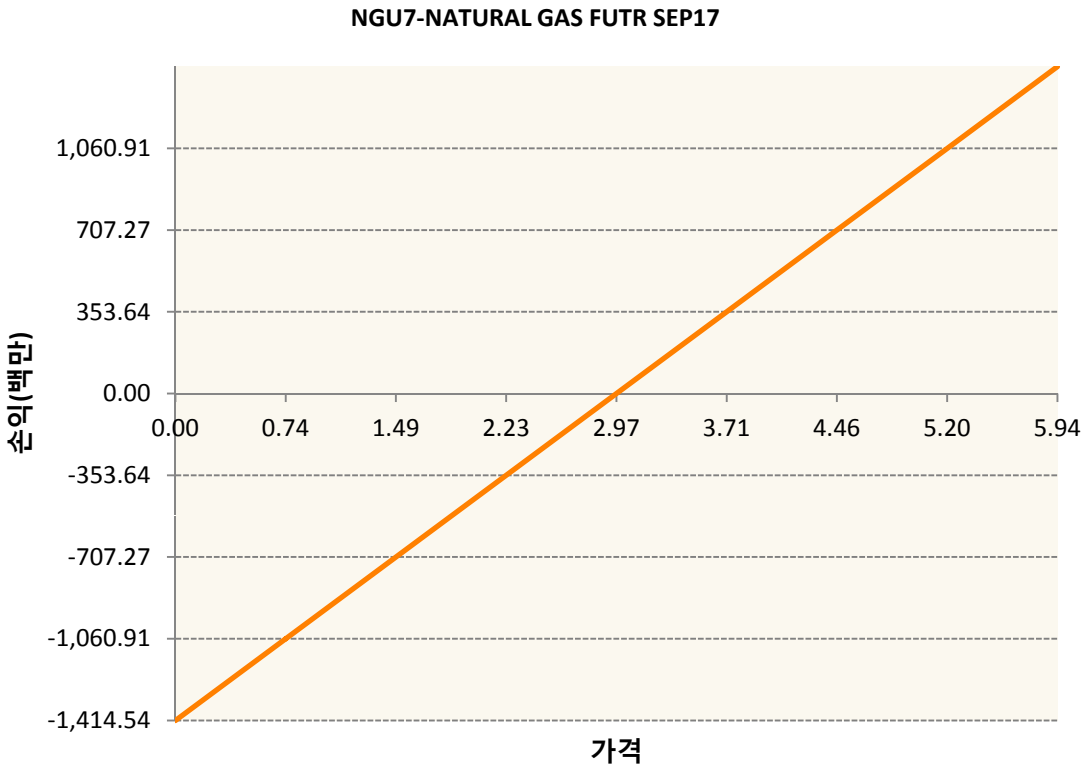


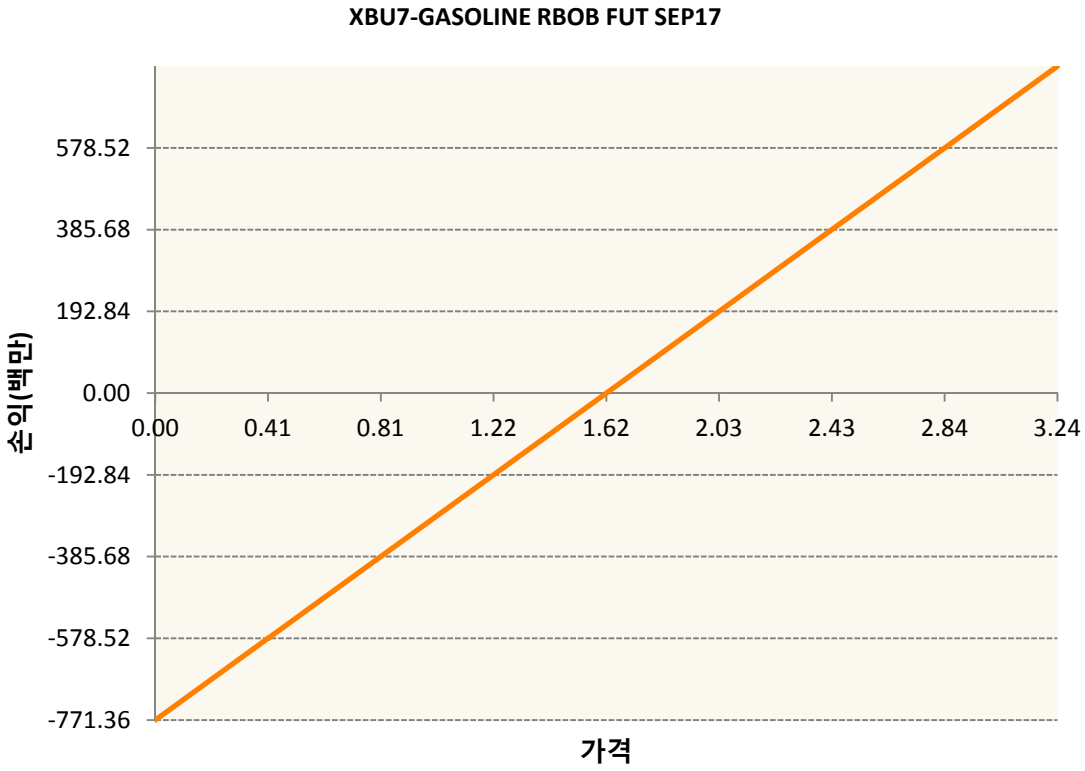

-731.87
-1,097.81
-1,463.74
가격


HOU7-NY HARB ULSD FUT SEP17
765.38
574.03
382.69
191.34
0.00
-191.34
-382.69
-574.03
-765.38
0.00
0.40
0.81
1.21
1.61
2.01
2.42
2.82
3.22
손익(만)
가격


KR4175M80003-2017-08 달러선물
224.16
168.12
112.08
56.04
0.00
-56.04
-112.08
-168.12
0.00
280.20
560.40
840.60
1,120.80
1,401.00
1,681.20
1,961.40
2,241.60
손익(만)


-224.16
가격


NGU7-NATURAL GAS FUTR SEP17
손익(백만)
1,060.91
707.27
353.64
0.00
-353.64
-707.27
-1,060.91
-1,414.54
0.00
0.74
1.49
2.23
2.97
3.71
4.46
5.20
5.94
가격


XBU7-GASOLINE RBOB FUT SEP17
손익(백만)
578.52
385.68
192.84
0.00
-192.84
-385.68
-578.52
-771.36
0.00
0.41
0.81
1.22
1.62
2.03
2.43
2.84
3.24
가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLU7	WTI CRUDE FUTURE SEP17	76
COX7	BRENT CRUDE FUTR NOV17	117
HOU7	NY HARB ULSD FUT SEP17	61
KR4175M80(	2017-08 달러선물	18
NGU7	NATURAL GAS FUTR SEP17	113
XBU7	GASOLINE RBOB FUT SEP17	62

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

792

공시일	2017-07-31
기준일	2017-07-28

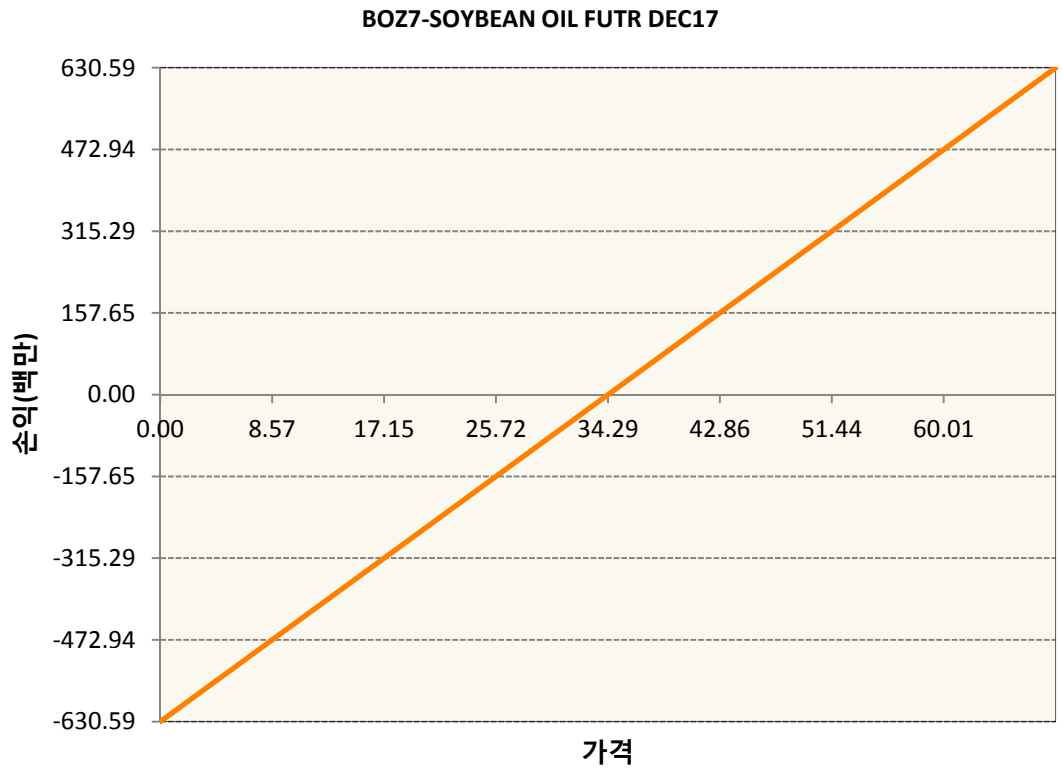
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

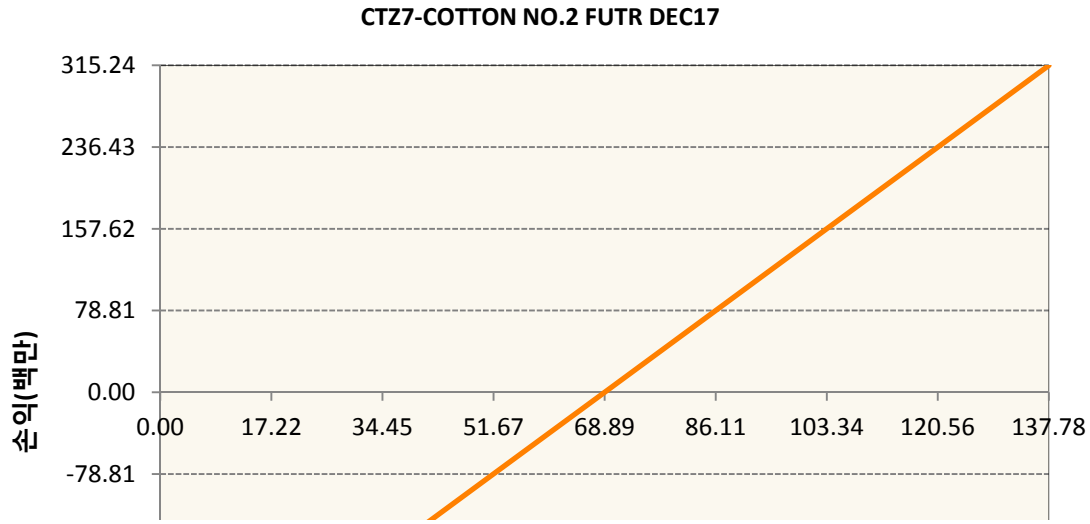
1. 계약금액

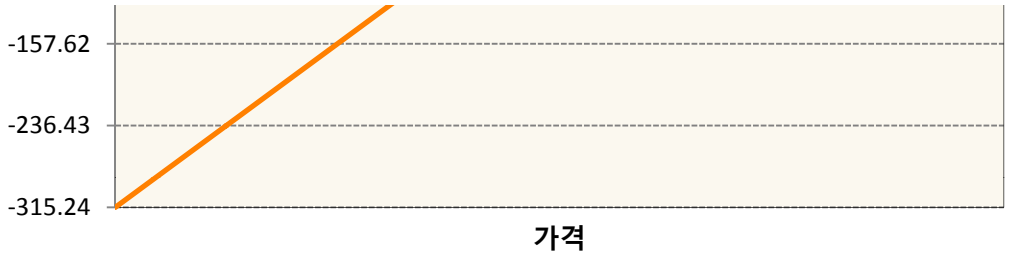
(단위:백만원)

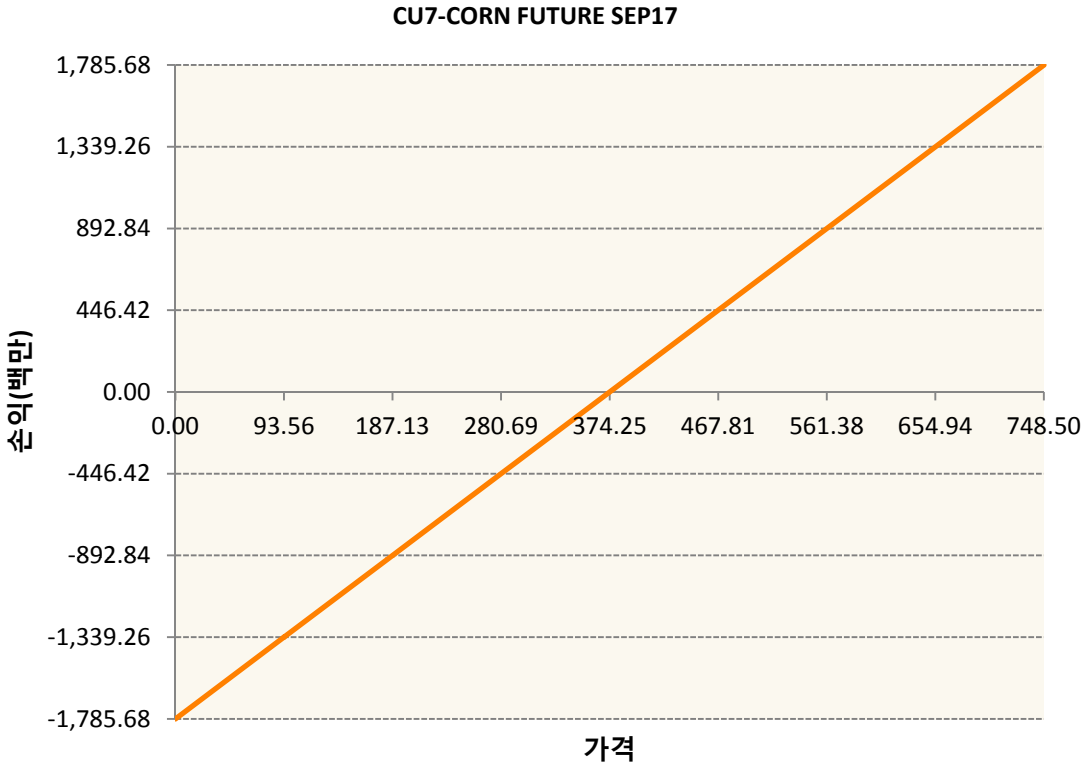
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	7,057	392	6,665	

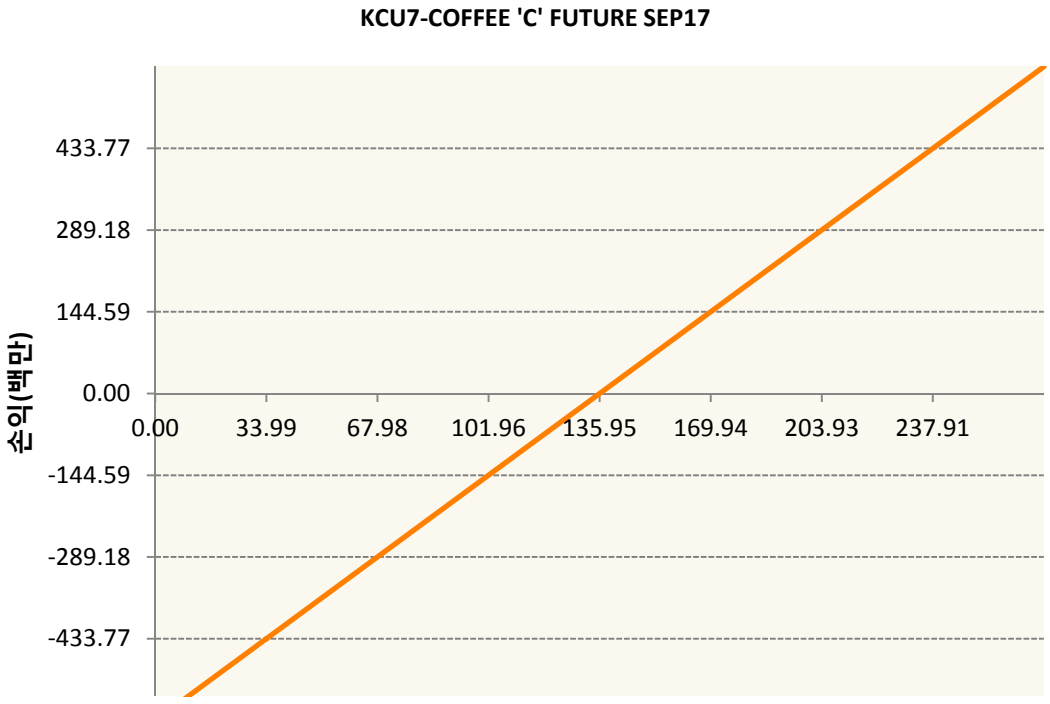
2. 만기시점의 손익구조

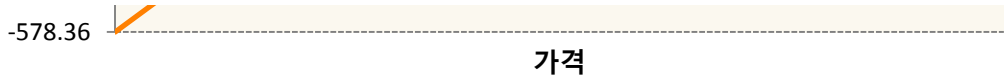


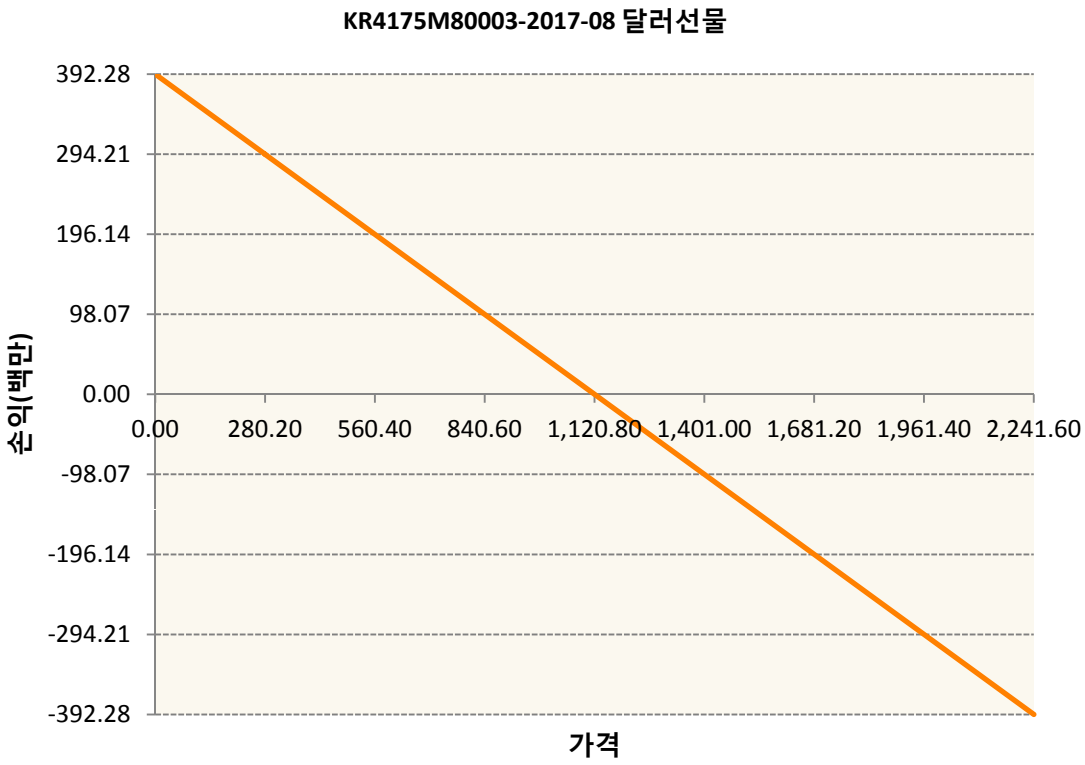


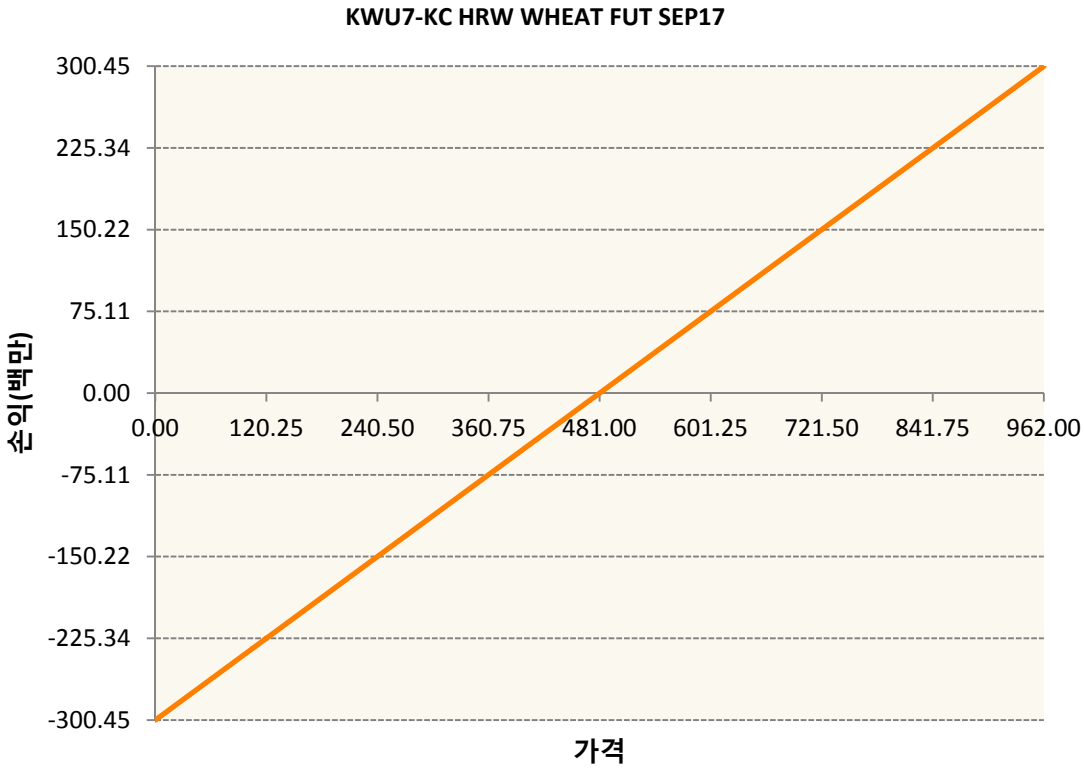

-157.62
-236.43
-315.24
가격


CU7-CORN FUTURE SEP17
1,785.68
1,339.26
892.84
446.42
0.00
-446.42
-892.84
-1,339.26
-1,785.68
0.00
93.56
187.13
280.69
374.25
467.81
561.38
654.94
748.50
손익(백만)
가격

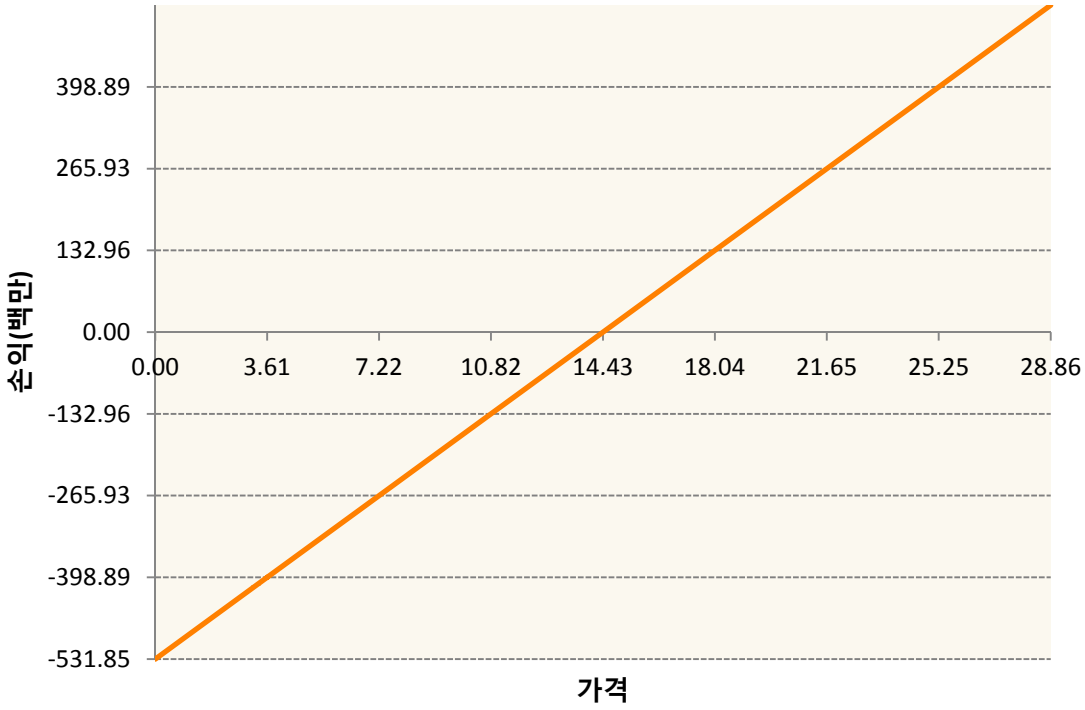

KCU7-COFFEE 'C' FUTURE SEP17
433.77
289.18
144.59
0.00
-144.59
-289.18
-433.77
0.00
33.99
67.98
101.96
135.95
169.94
203.93
237.91
손익(백만)


-578.36
가격

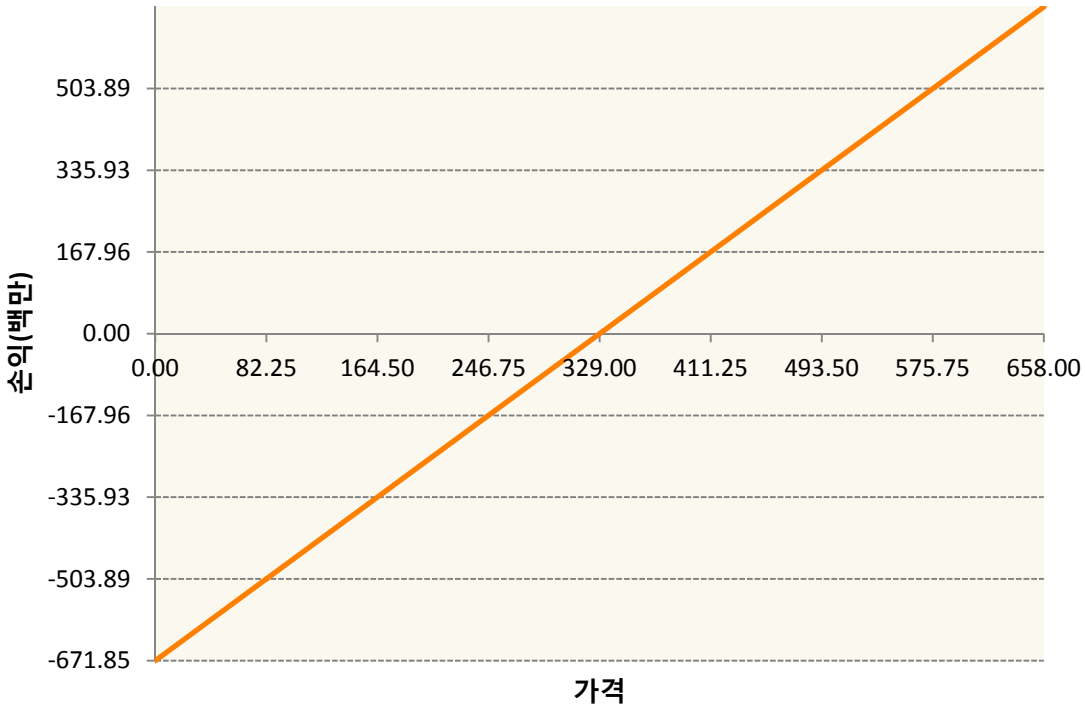

KR4175M80003-2017-08 달러선물
392.28
294.21
196.14
98.07
0.00
-98.07
-196.14
-294.21
-392.28
0.00
280.20
560.40
840.60
1,120.80
1,401.00
1,681.20
1,961.40
2,241.60
손익(백만)
가격


KWU7-KC HRW WHEAT FUT SEP17
300.45
225.34
150.22
75.11
0.00
-75.11
-150.22
-225.34
-300.45
0.00
120.25
240.50
360.75
481.00
601.25
721.50
841.75
962.00
손익(백만)
가격

SBV7-SUGAR #11 (WORLD) OCT17

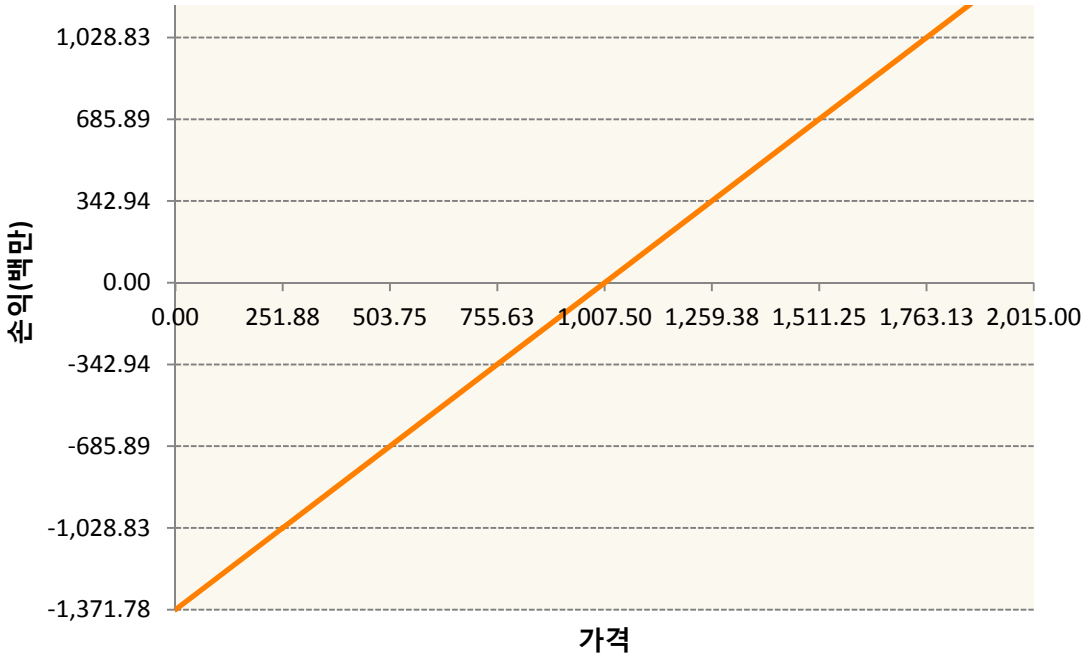


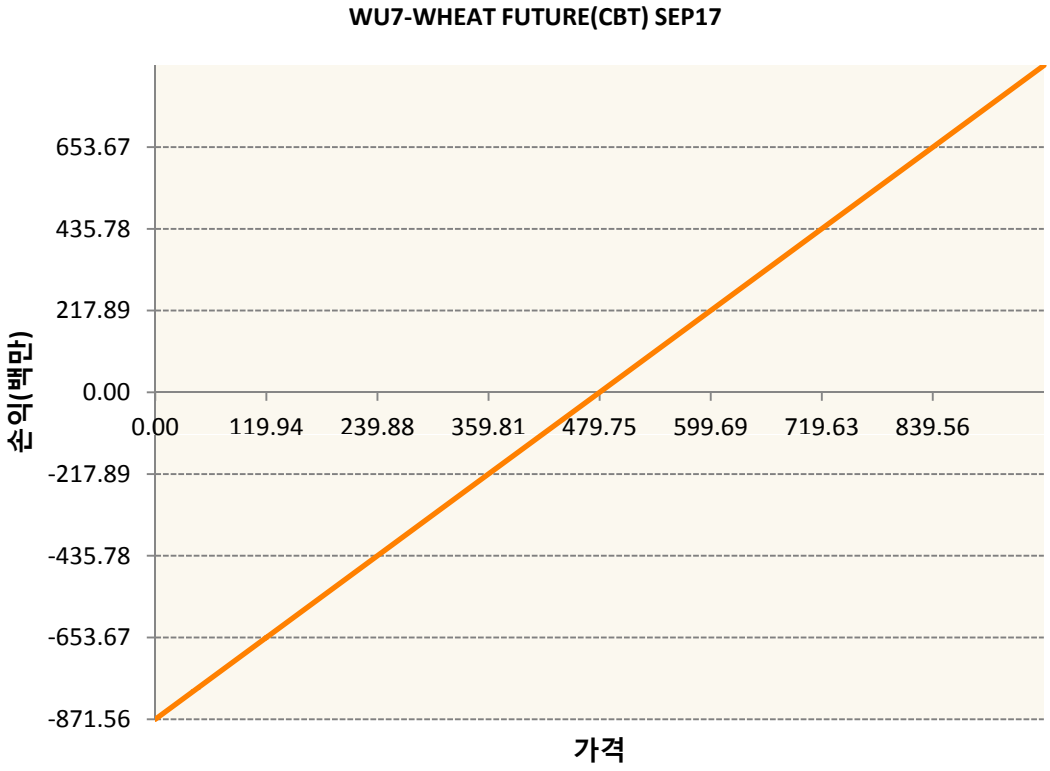
SMZ7-SOYBEAN MEAL FUTR DEC17



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	143
KCU7	COFFEE 'C' FUTURE SEP17	46
KR4175M80(	2017-08 달러선물	31

KWU7	KC HRW WHEAT FUT SEP17	24
SBV7	SUGAR #11 (WORLD) OCT17	43
SMZ7	SOYBEAN MEAL FUTR DEC17	54
SX7	SOYBEAN FUTURE NOV17	110
WU7	WHEAT FUTURE(CBT) SEP17	70

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

661