공시일	2017-08-02
기준일	2017-08-01

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	2017-08-02
기준일	2017-08-01

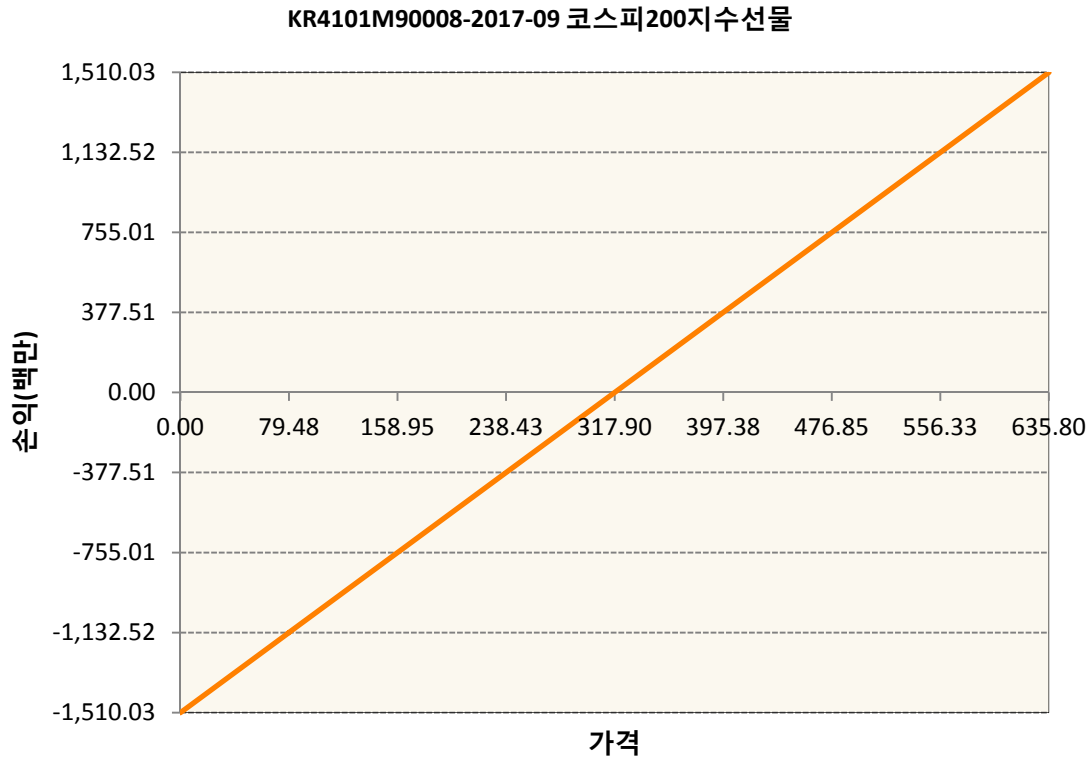
스마트인덱스모

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	1,510	0	1,510	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101M90(2017-09 코스피200지수선물							120
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-120	-120	-120	-120	-120	-120	-120
-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%	120	120	120	120	120	120	120

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

74

공시일	2017-08-02
기준일	2017-08-01

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)

475

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-08-02
기준일	2017-08-01

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	394

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

338

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-08-02
기준일	2017-08-01

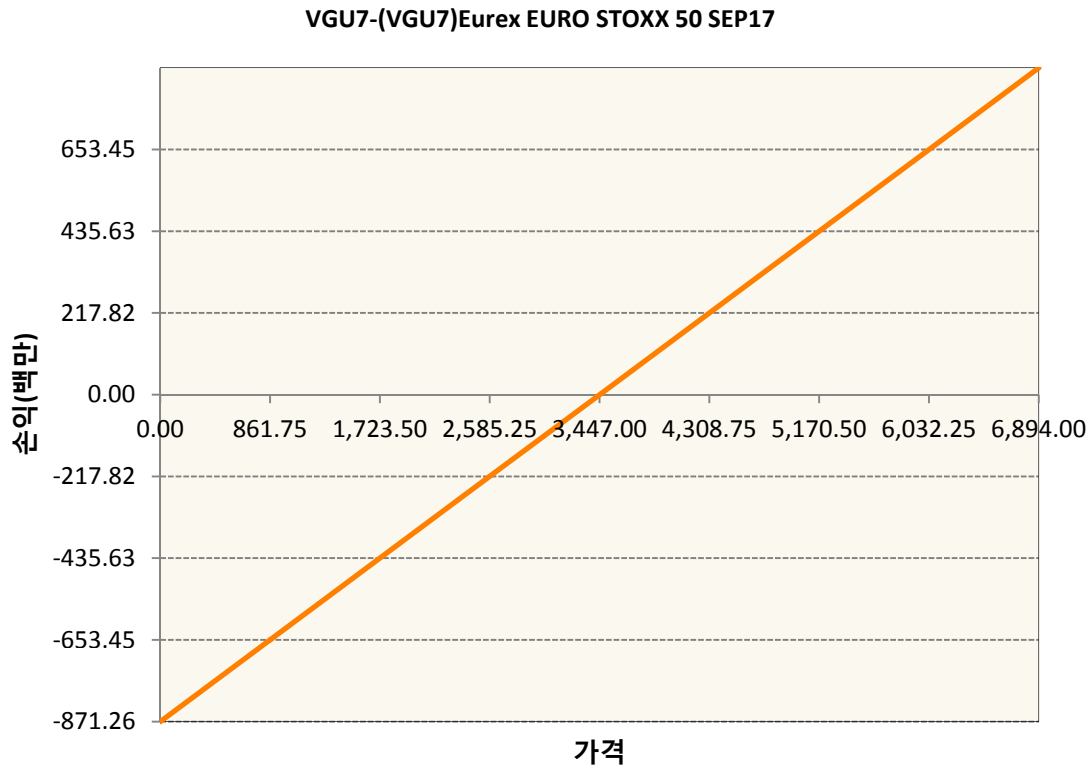
유로인덱스모(주식-파생형)

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	2017-08-02
기준일	2017-08-01

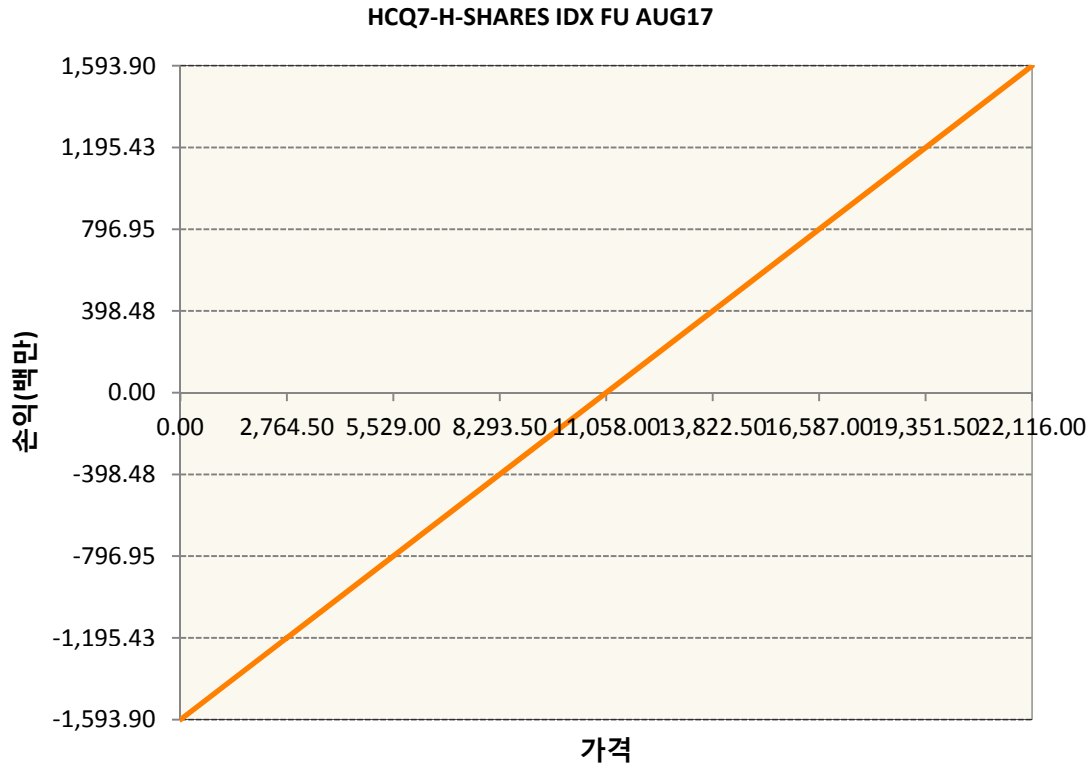
차이나인덱스모(주식-파생형)

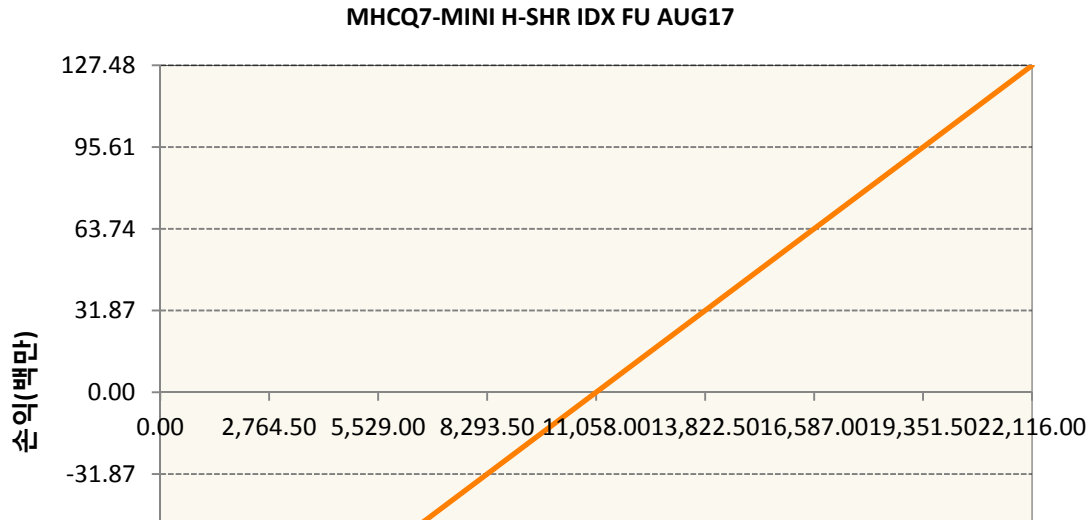
1. 계약금액

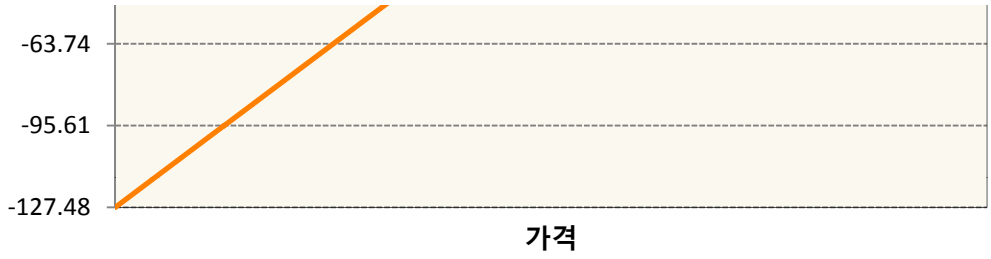
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,721	0	1,721	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCQ7	H-SHARES IDX FU AUG17	128
MHCQ7	MINI H-SHR IDX FU AUG17	10

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	122

공시일	2017-08-02
기준일	2017-08-01

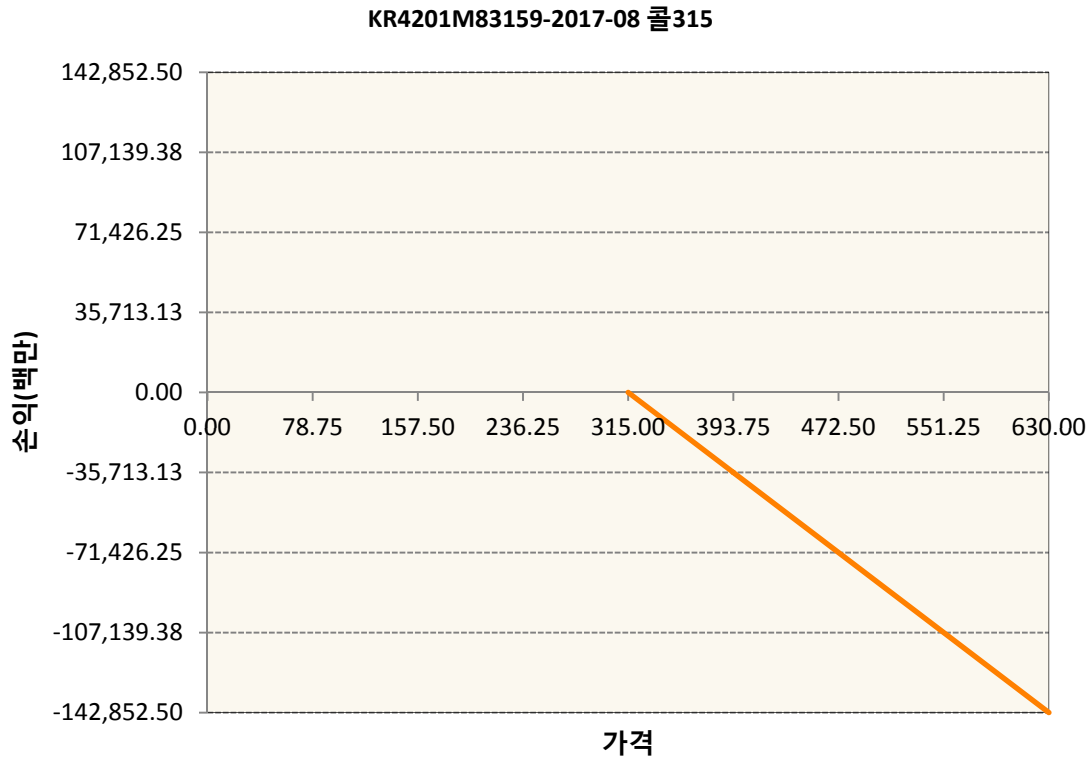
커버드콜모(주식혼합-파생형)

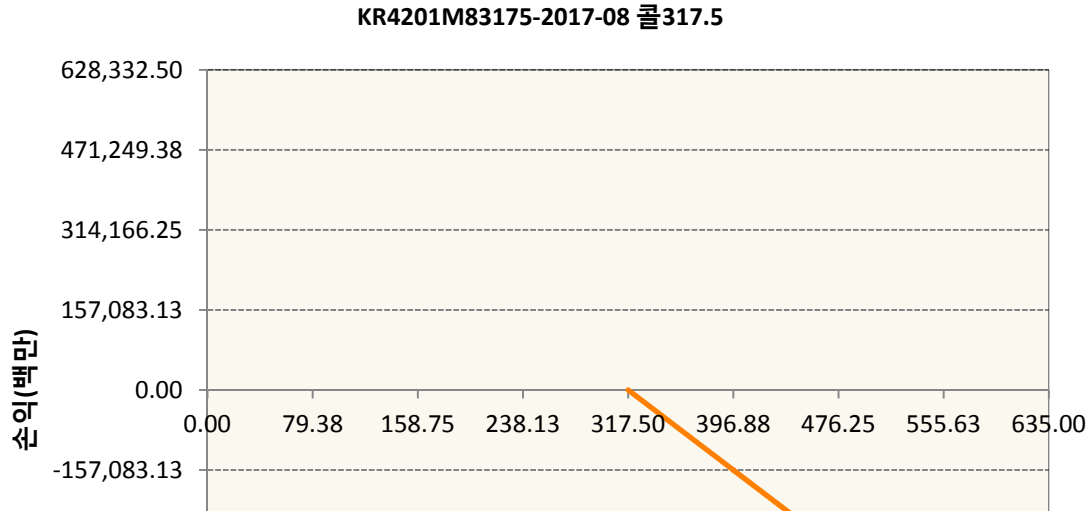
1. 계약금액

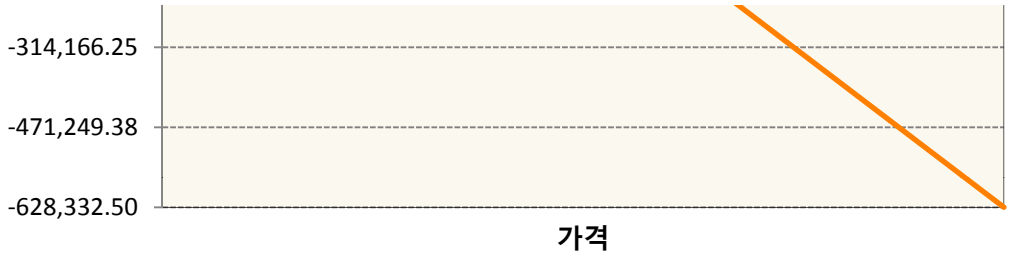
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	23,711	-23,711	장내
누계	유가증권	옵션	0	1,362,989	-1,362,989	장내

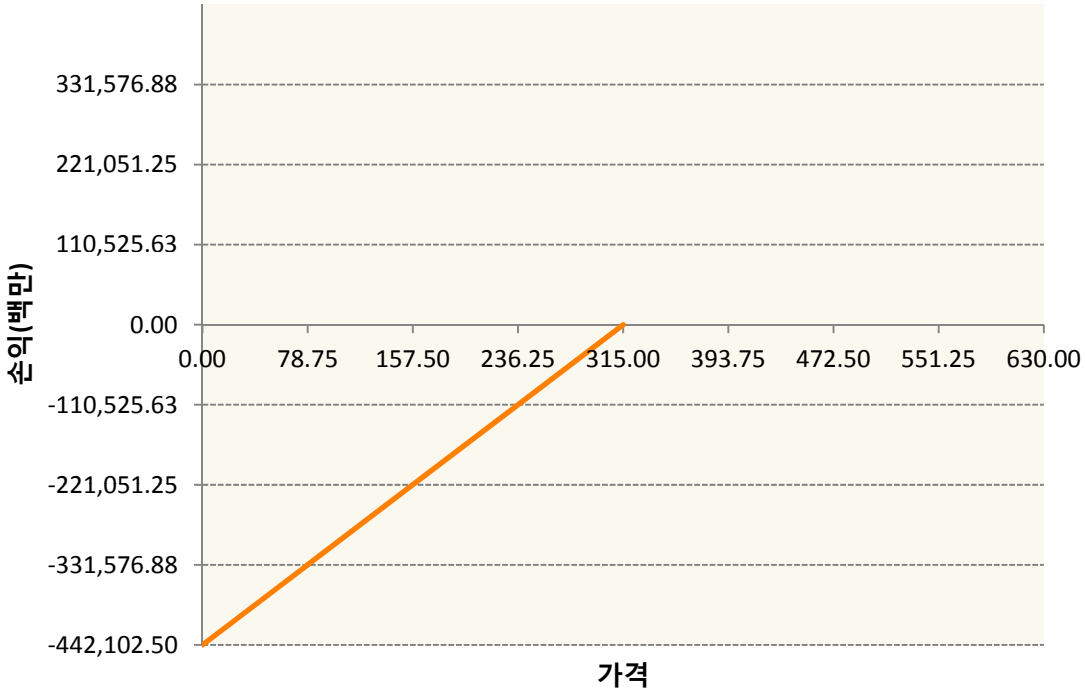
2. 만기시점의 손익구조



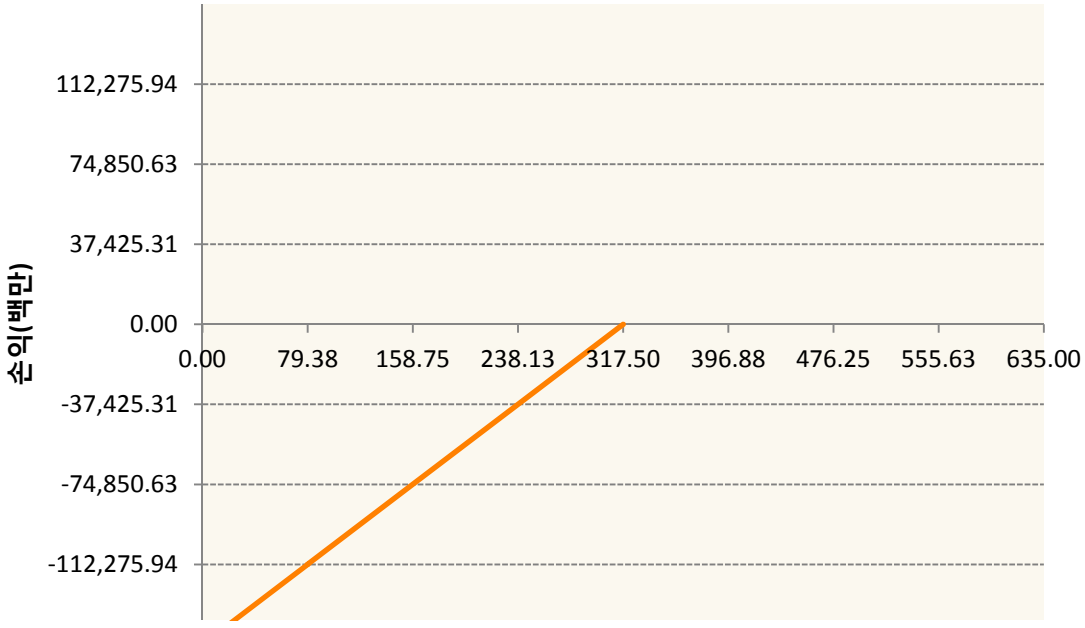




KR4301M83157-2017-08 풋315



KR4301M83173-2017-08 풋317.5





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201M83: 2017-08 콜315							9,954
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	2,545	2,541	2,533	2,519	2,499	2,472	2,438
-5.33%	2,493	2,454	2,403	2,341	2,269	2,187	2,098
-2.67%	2,060	1,930	1,794	1,653	1,507	1,359	1,208
0%	503	336	168	0	-169	-338	-507
2.67%	-2,419	-2,508	-2,609	-2,720	-2,838	-2,963	-3,093
5.33%	-6,060	-6,081	-6,113	-6,155	-6,207	-6,269	-6,340
8.00%	-9,872	-9,875	-9,880	-9,890	-9,905	-9,926	-9,954
KR4201M83: 2017-08 콜317.5							41,266
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	8,541	8,532	8,513	8,478	8,423	8,343	8,237
-5.33%	8,434	8,331	8,184	7,992	7,756	7,479	7,164
-2.67%	7,299	6,851	6,361	5,836	5,282	4,705	4,109
0%	2,247	1,498	749	0	-749	-1,499	-2,248
2.67%	-8,909	-9,428	-9,984	-10,569	-11,179	-11,808	-12,453
5.33%	-24,184	-24,344	-24,556	-24,819	-25,129	-25,482	-25,874
8.00%	-40,717	-40,740	-40,784	-40,855	-40,957	-41,094	-41,266
KR4301M83: 2017-08 풋315							28,038
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-27,707	-27,720	-27,746	-27,788	-27,850	-27,933	-28,038
-5.33%	-16,007	-16,128	-16,286	-16,478	-16,702	-16,954	-17,231
-2.67%	-5,486	-5,888	-6,310	-6,747	-7,196	-7,655	-8,122
0%	1,556	1,039	521	0	-522	-1,045	-1,569
2.67%	4,375	4,098	3,786	3,445	3,079	2,692	2,288
5.33%	4,968	4,902	4,805	4,676	4,514	4,323	4,103
8.00%	5,031	5,023	5,007	4,977	4,931	4,865	4,778
KR4301M83: 2017-08 풋317.5							9,992
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-9,919	-9,921	-9,926	-9,934	-9,948	-9,966	-9,992
-5.33%	-5,960	-5,985	-6,020	-6,065	-6,122	-6,188	-6,263
-2.67%	-2,246	-2,352	-2,469	-2,594	-2,726	-2,864	-3,006
0%	535	357	179	0	-179	-357	-536
2.67%	1,862	1,739	1,606	1,467	1,321	1,171	1,018

5.33%	2,208	2,170	2,119	2,056	1,982	1,898	1,805
8.00%	2,254	2,248	2,237	2,221	2,196	2,164	2,123

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

98,164

공시일	2017-08-02
기준일	2017-08-01

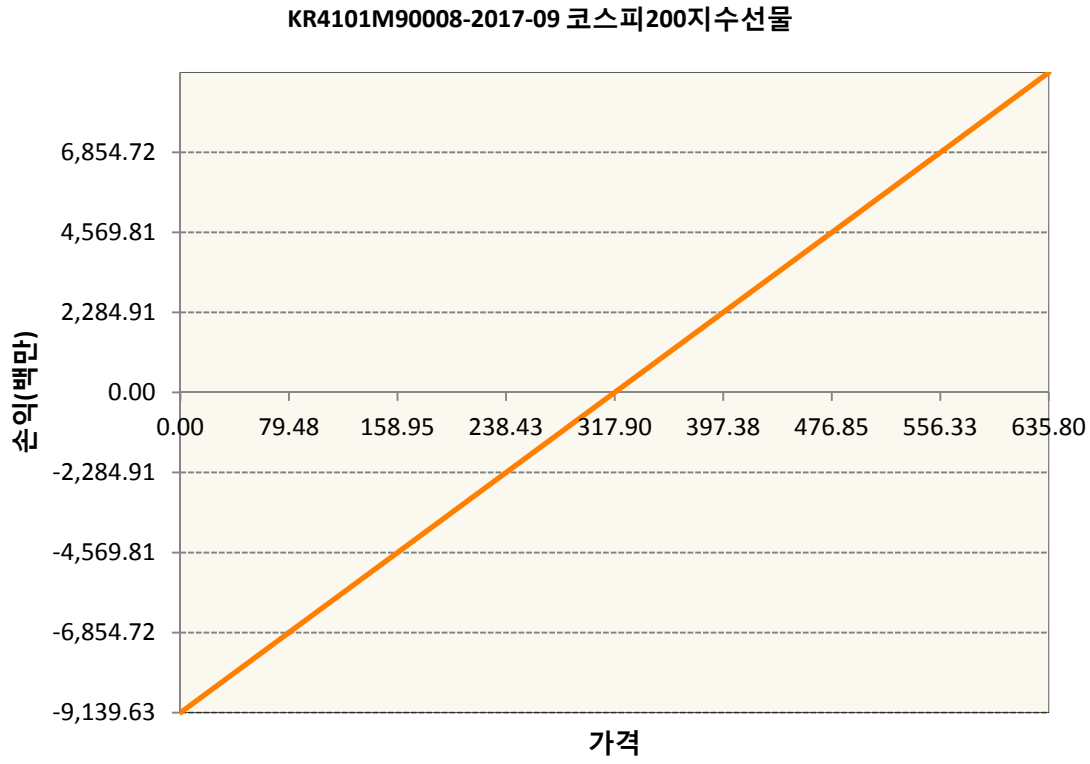
ETF스마트레버리지목표전환형6호

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	159	-159	장내
누계	유가증권	선물	9,140	0	9,140	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101M90(2017-09 코스피200지수선물							729
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-729	-729	-729	-729	-729	-729	-729
-5.33%	-486	-486	-486	-486	-486	-486	-486
-2.67%	-243	-243	-243	-243	-243	-243	-243
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	243	243	243	243	243	243	243
5.33%	486	486	486	486	486	486	486
8.00%	729	729	729	729	729	729	729

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

446

공시일	2017-08-02
기준일	2017-08-01

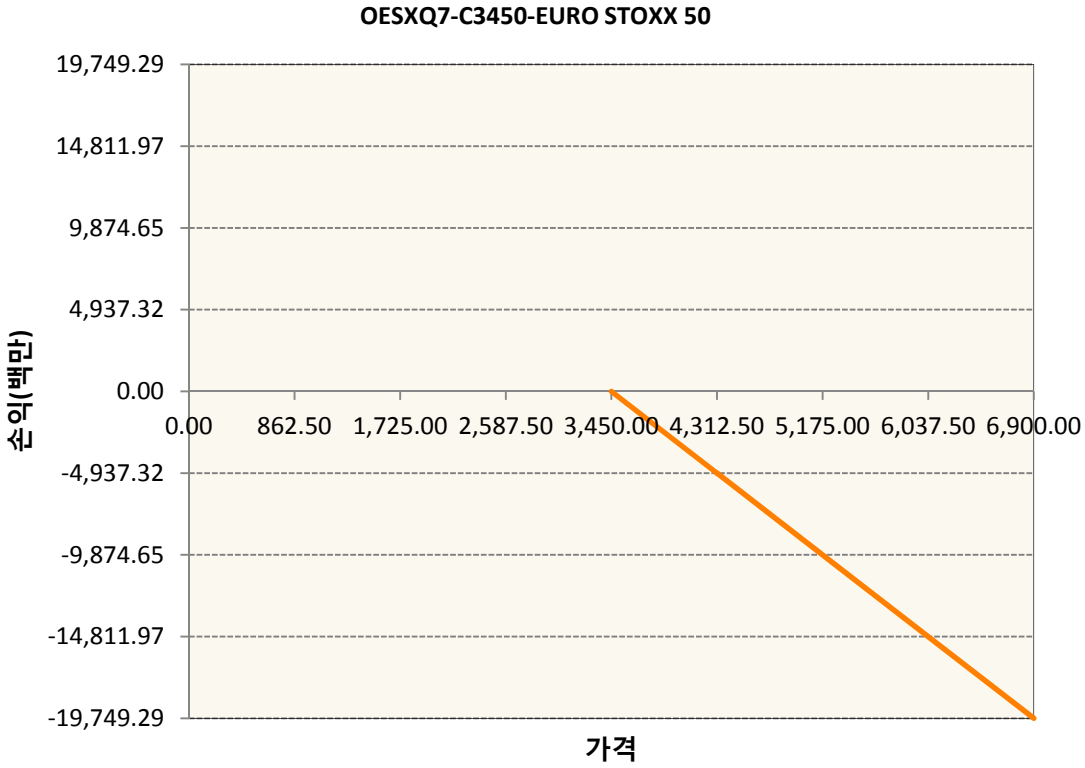
유로커버드콜(주식혼합-파생형)

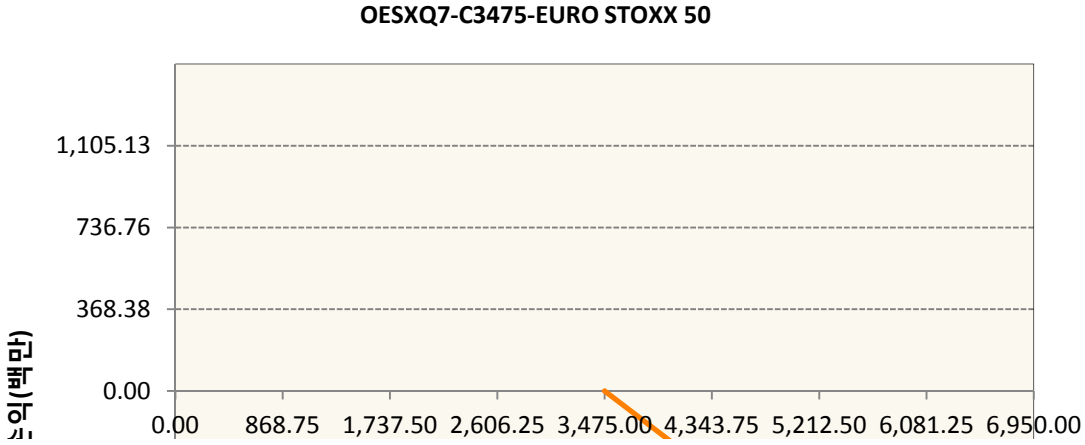
1. 계약금액

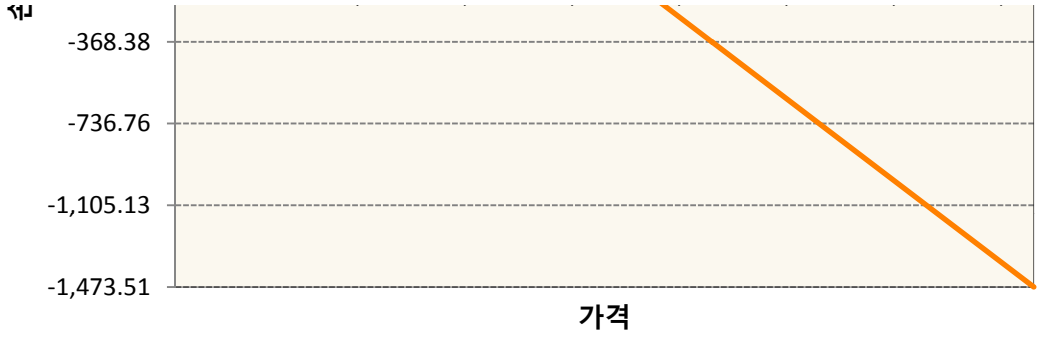
(단위:백만원)

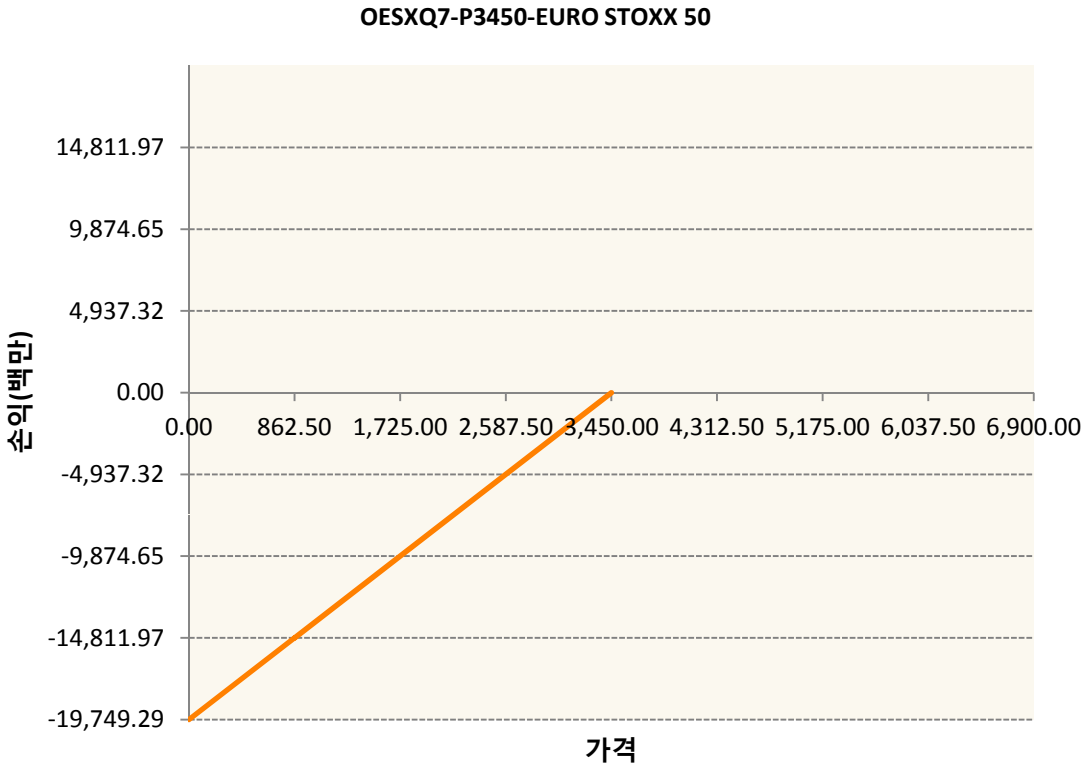
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	20,879	0	20,879	
누계	유가증권	옵션	0	42,446	-42,446	장내

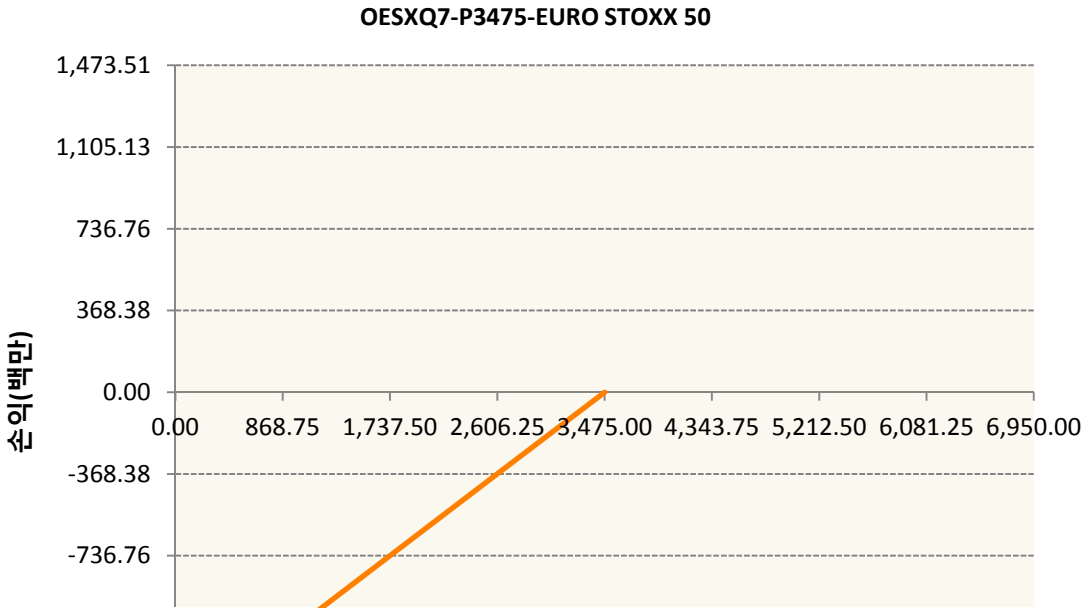
2. 만기시점의 손익구조

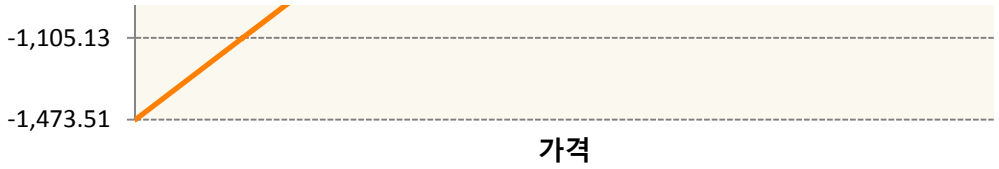


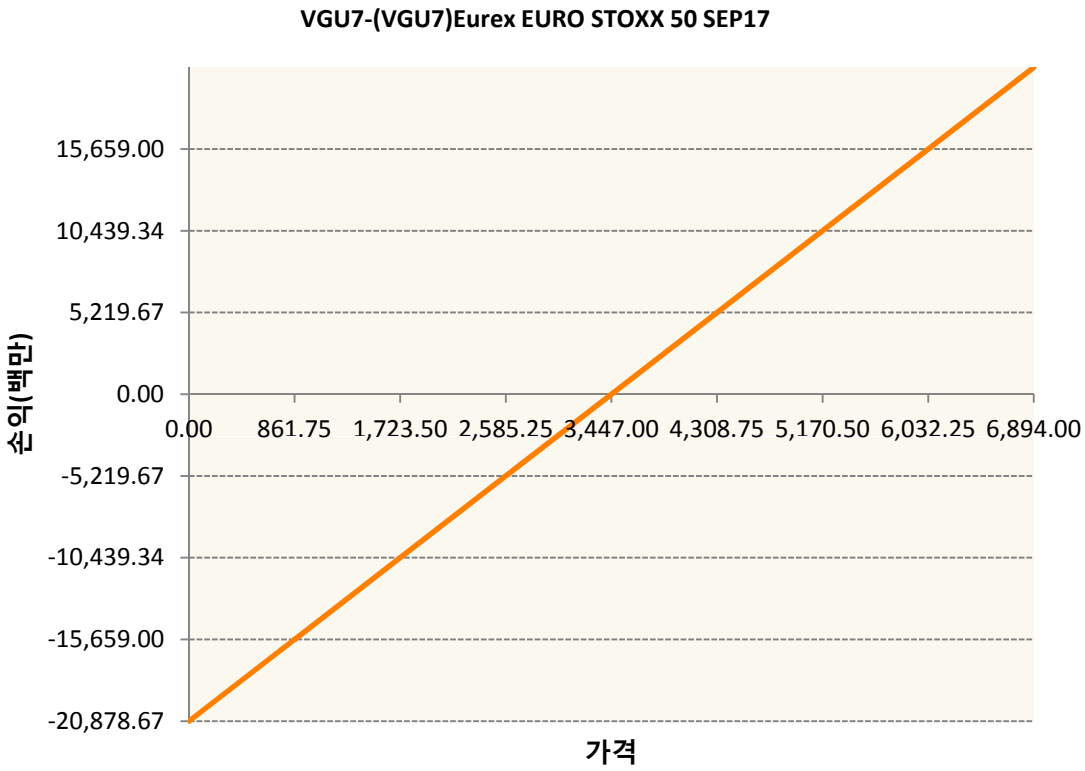



-368.38
-736.76
-1,105.13
-1,473.51
가격


OESXQ7-P3450-EURO STOXX 50
14,811.97
9,874.65
4,937.32
0.00
-4,937.32
-9,874.65
-14,811.97
-19,749.29
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
1,473.51
1,105.13
736.76
368.38
0.00
-368.38
-736.76
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	1,580
OESXQ7-C3	EURO STOXX 50	118
OESXQ7-P3	EURO STOXX 50	1,580
OESXQ7-P3	EURO STOXX 50	118
VGU7	(VGU7)Eurex EURO STOXX 50 SEP17	1,670

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	4,210

공시일	2017-08-02
기준일	2017-08-01

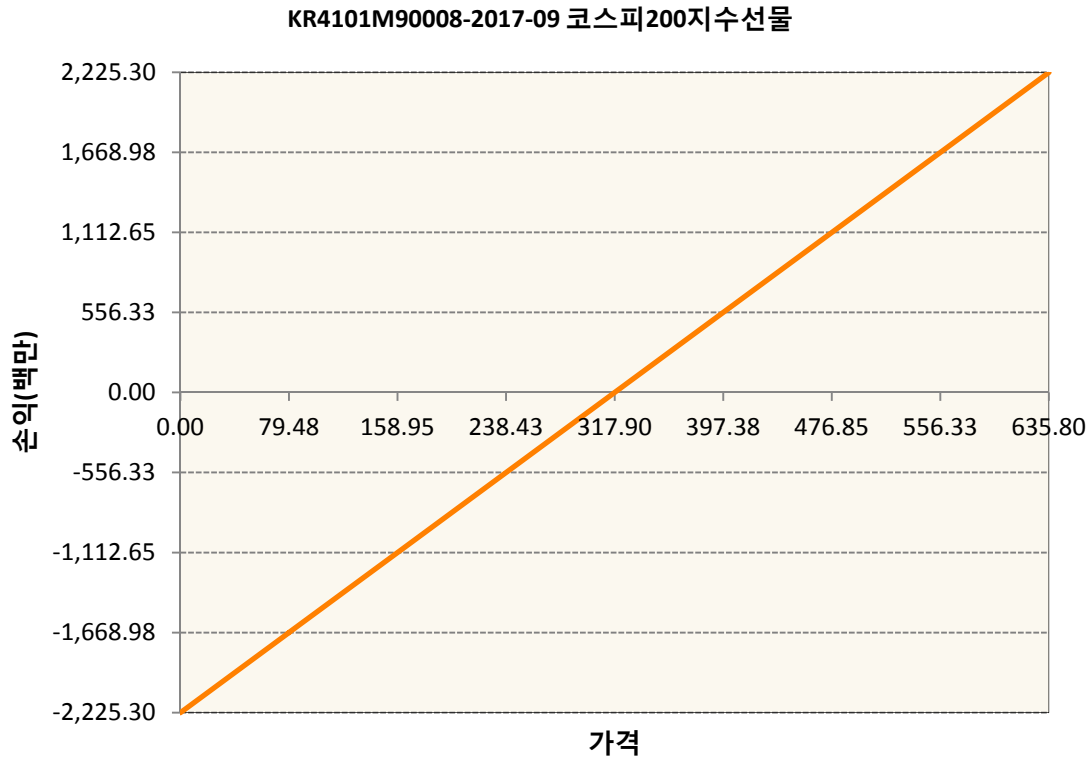
ETF스마트레버리지목표전환형7호

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	2,225	0	2,225	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101M90(2017-09 코스피200지수선물							178
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-178	-178	-178	-178	-178	-178	-178
-5.33%	-118	-118	-118	-118	-118	-118	-118
-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%	118	118	118	118	118	118	118
8.00%	178	178	178	178	178	178	178

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

109

공시일	2017-08-02
기준일	2017-08-01

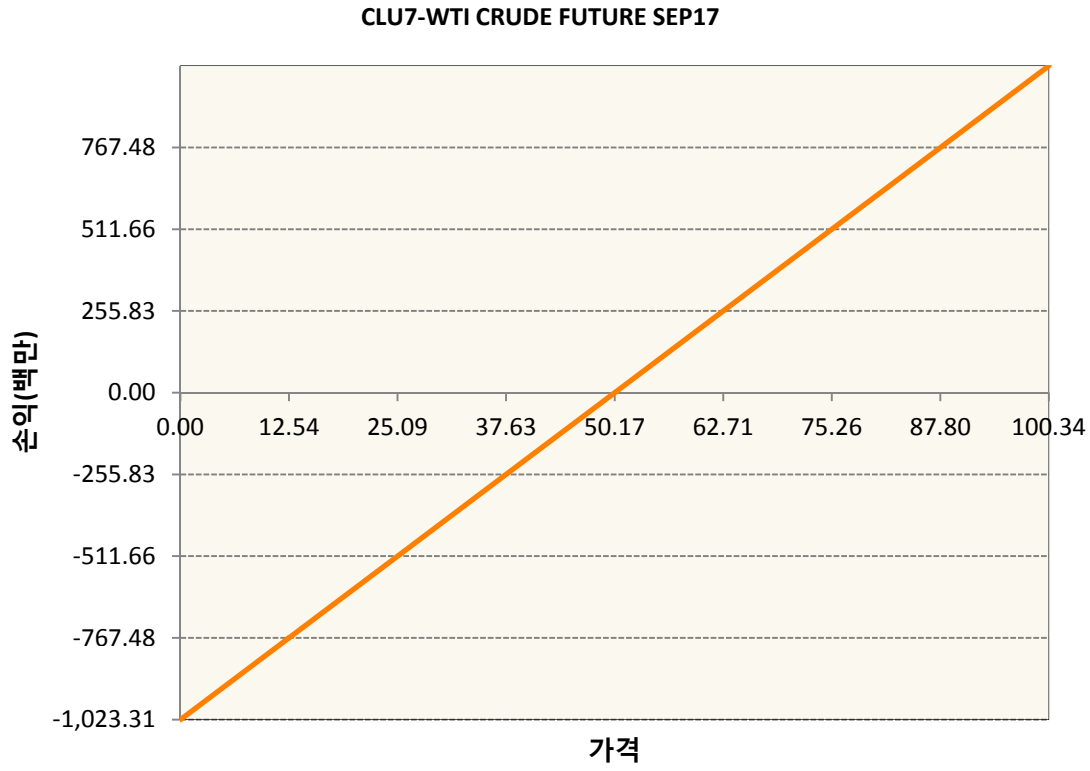
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

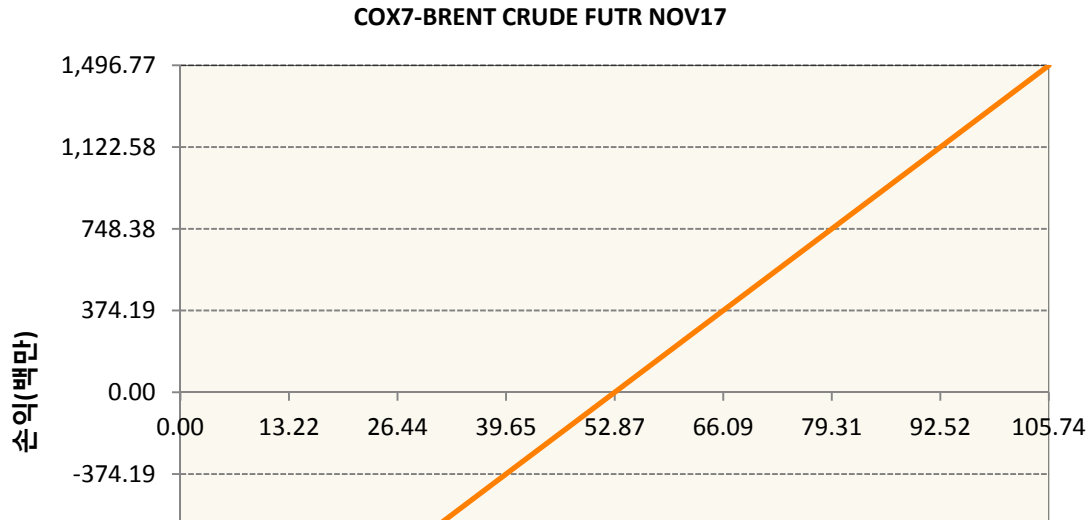
1. 계약금액

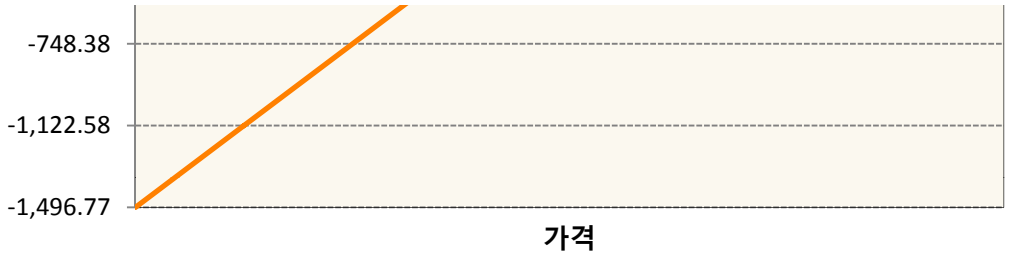
(단위:백만원)

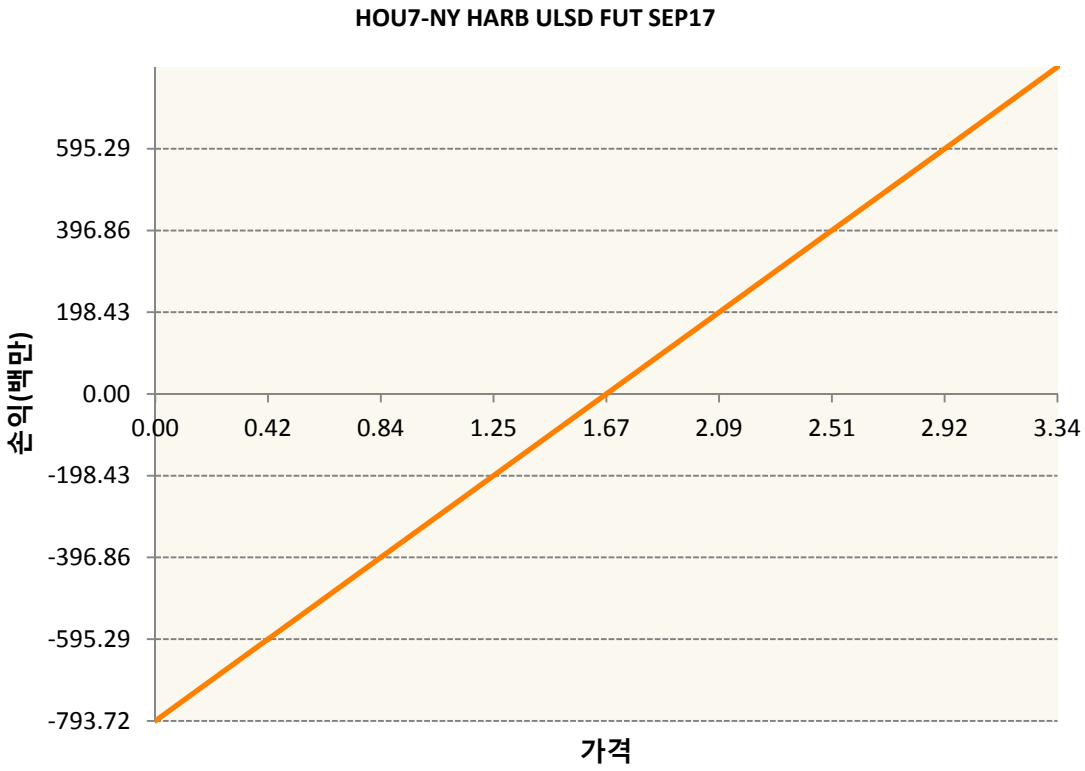
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	5,445	224	5,221	

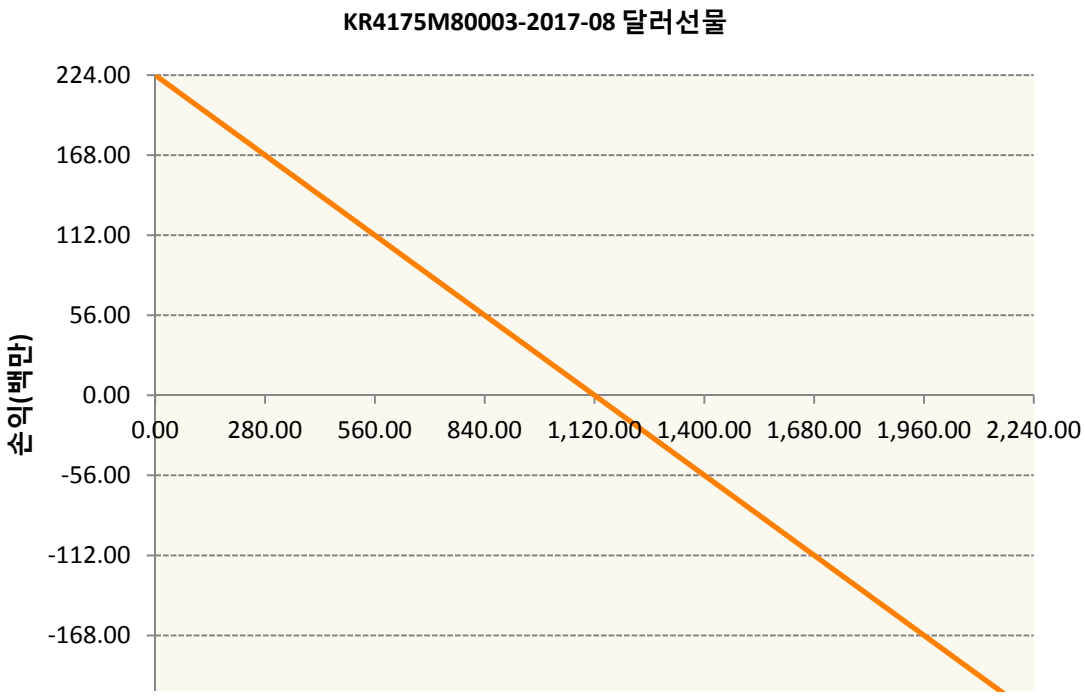
2. 만기시점의 손익구조

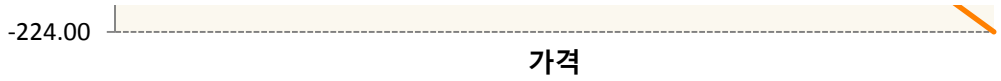


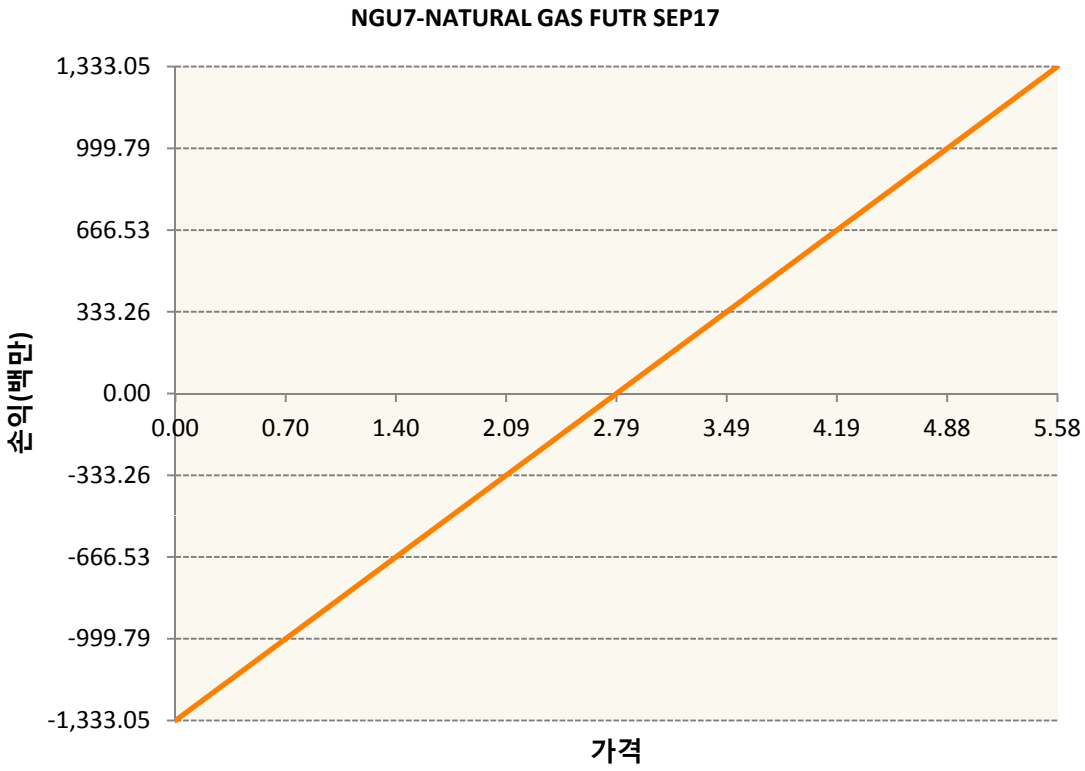


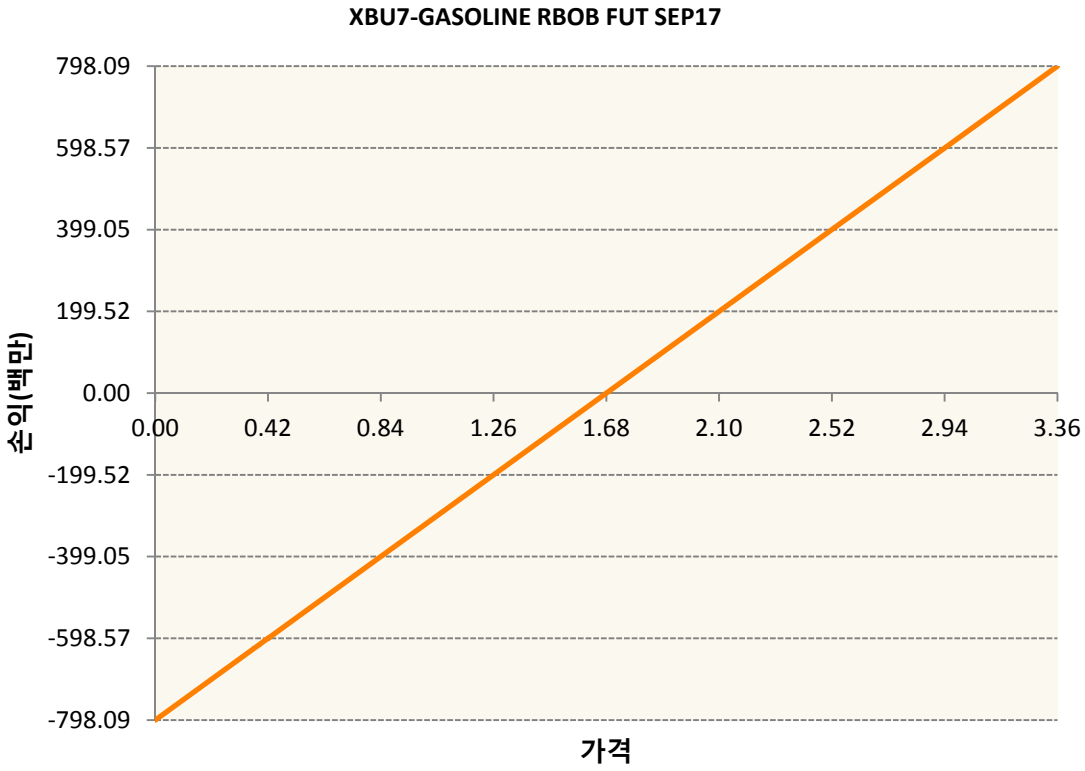

-748.38
-1,122.58
-1,496.77
가격


HOU7-NY HARB ULSD FUT SEP17
595.29
396.86
198.43
0.00
-198.43
-396.86
-595.29
-793.72
0.00
0.42
0.84
1.25
1.67
2.09
2.51
2.92
3.34
손익(만)
가격


KR4175M80003-2017-08 달러선물
224.00
168.00
112.00
56.00
0.00
-56.00
-112.00
-168.00
0.00
280.00
560.00
840.00
1,120.00
1,400.00
1,680.00
1,960.00
2,240.00
손익(만)


-224.00
가격


NGU7-NATURAL GAS FUTR SEP17
1,333.05
999.79
666.53
333.26
0.00
-333.26
-666.53
-999.79
-1,333.05
0.00
0.70
1.40
2.09
2.79
3.49
4.19
4.88
5.58
손익(백만)
가격


XBU7-GASOLINE RBOB FUT SEP17
798.09
598.57
399.05
199.52
0.00
-199.52
-399.05
-598.57
-798.09
0.00
0.42
0.84
1.26
1.68
2.10
2.52
2.94
3.36
손익(백만)
가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLU7	WTI CRUDE FUTURE SEP17	82
COX7	BRENT CRUDE FUTR NOV17	120
HOU7	NY HARB ULSD FUT SEP17	63
KR4175M80(	2017-08 달러선물	18
NGU7	NATURAL GAS FUTR SEP17	107
XBU7	GASOLINE RBOB FUT SEP17	64

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

798

공시일	2017-08-02
기준일	2017-08-01

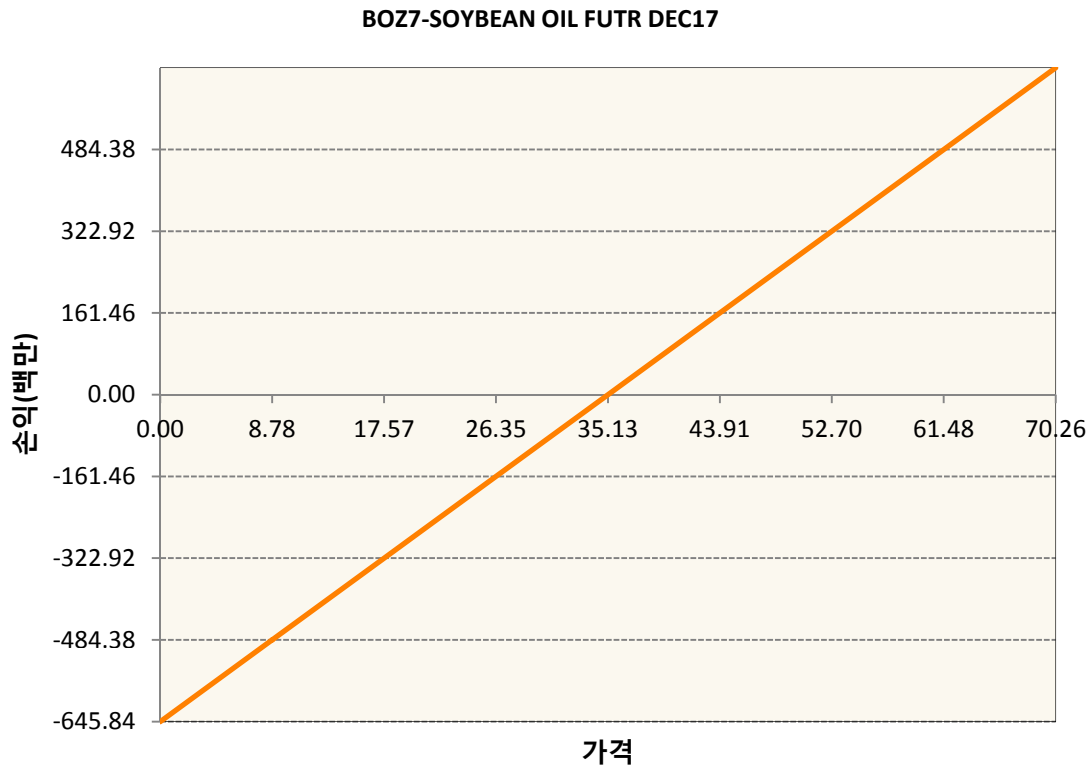
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

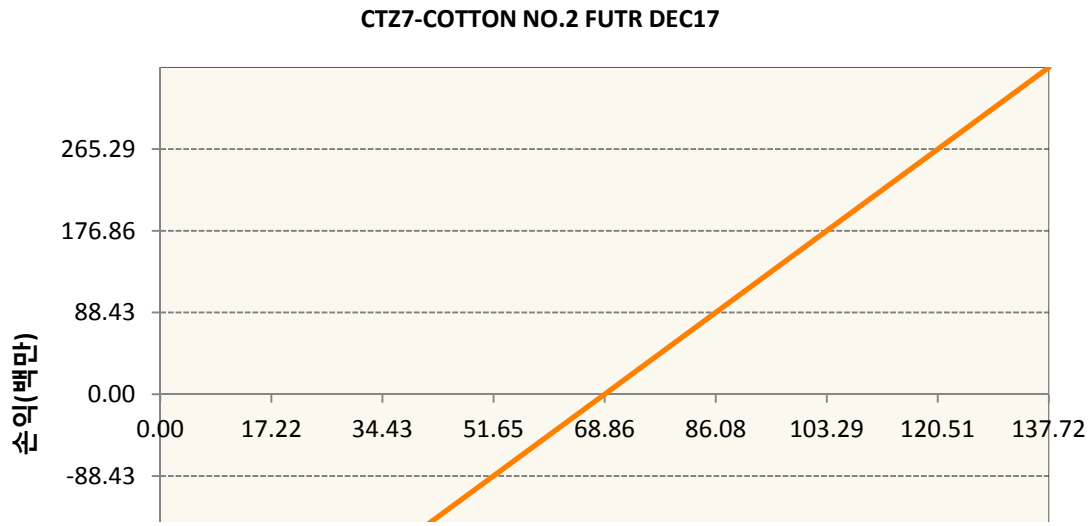
1. 계약금액

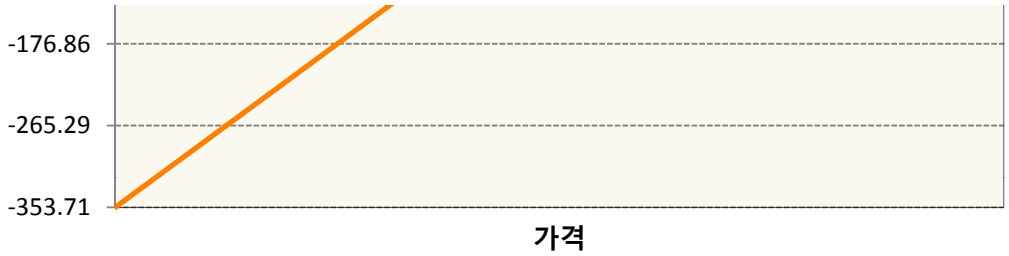
(단위:백만원)

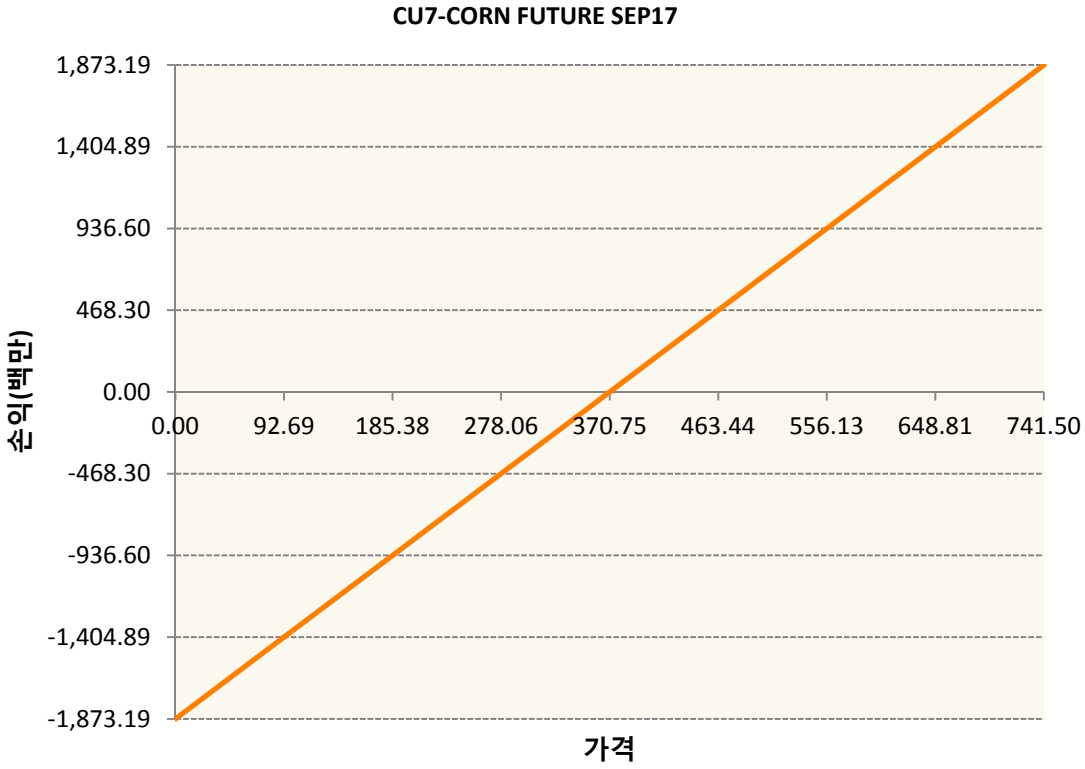
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	7,292	392	6,900	

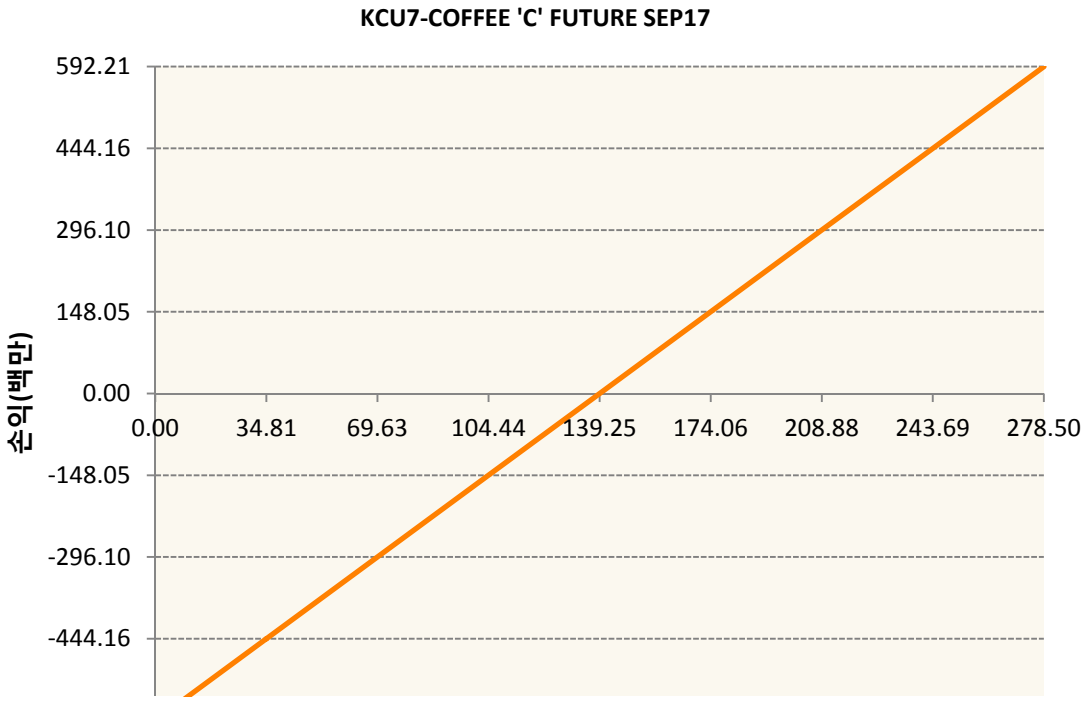
2. 만기시점의 손익구조

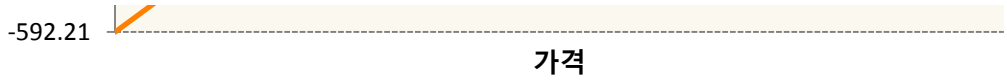


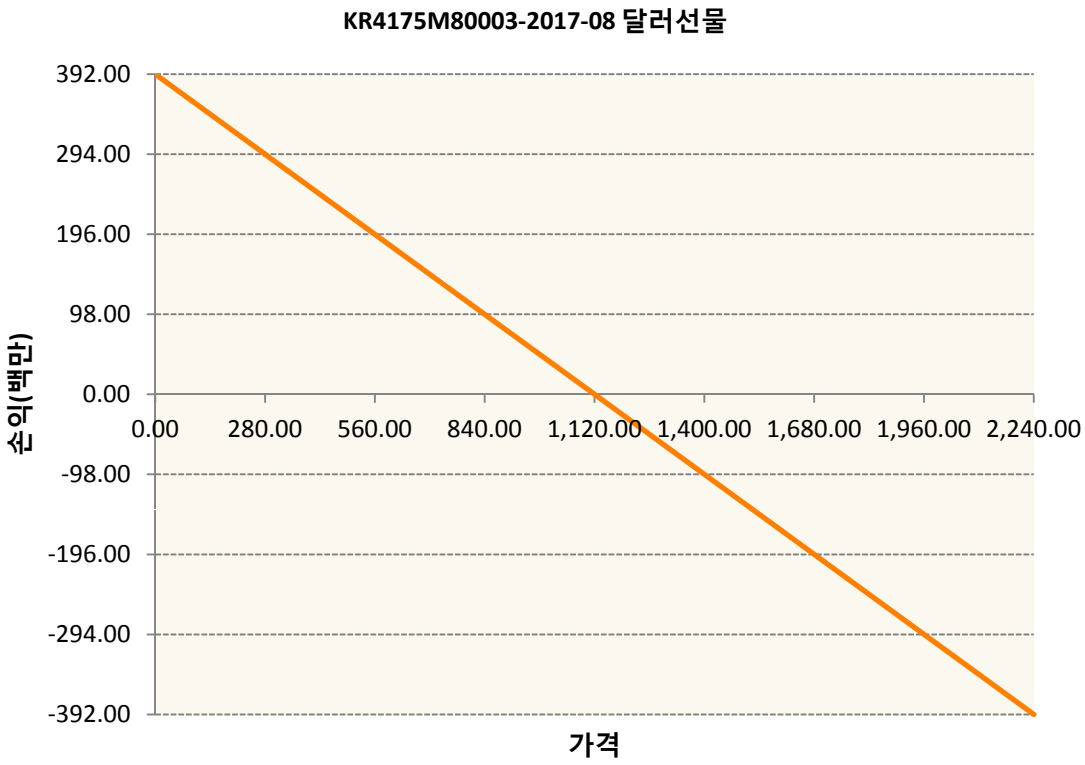


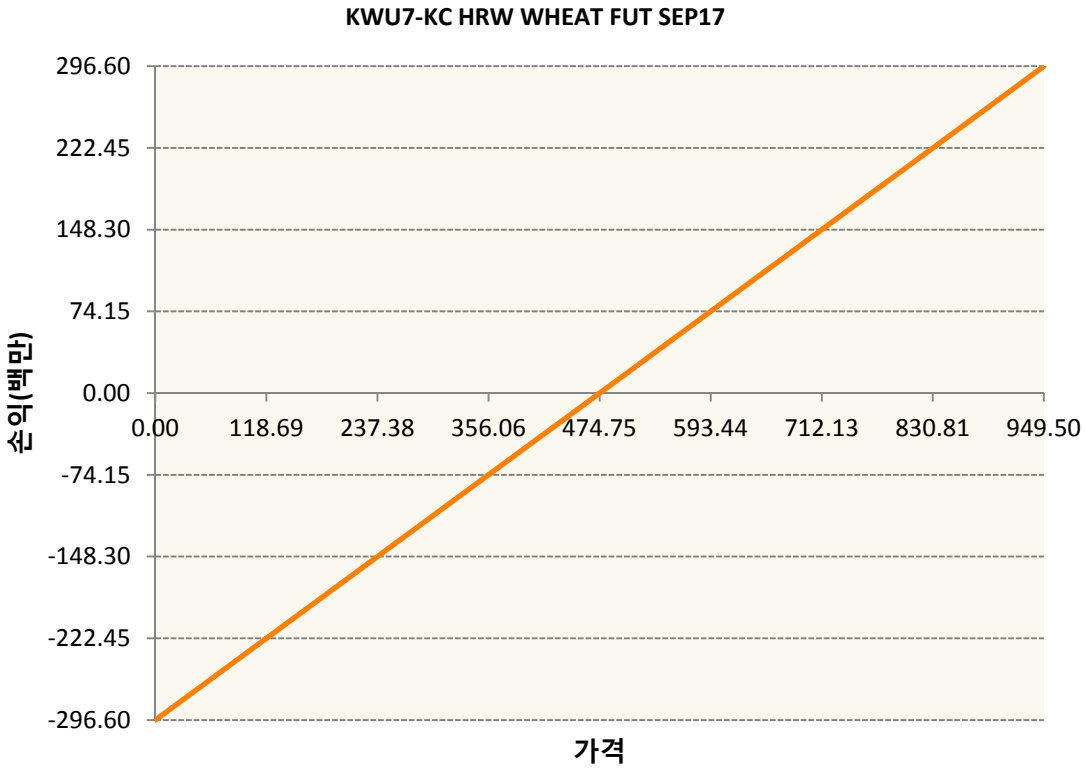

-176.86
-265.29
-353.71
가격


CU7-CORN FUTURE SEP17
1,873.19
1,404.89
936.60
468.30
0.00
-468.30
-936.60
-1,404.89
-1,873.19
0.00
92.69
185.38
278.06
370.75
463.44
556.13
648.81
741.50
손익(백만)
가격

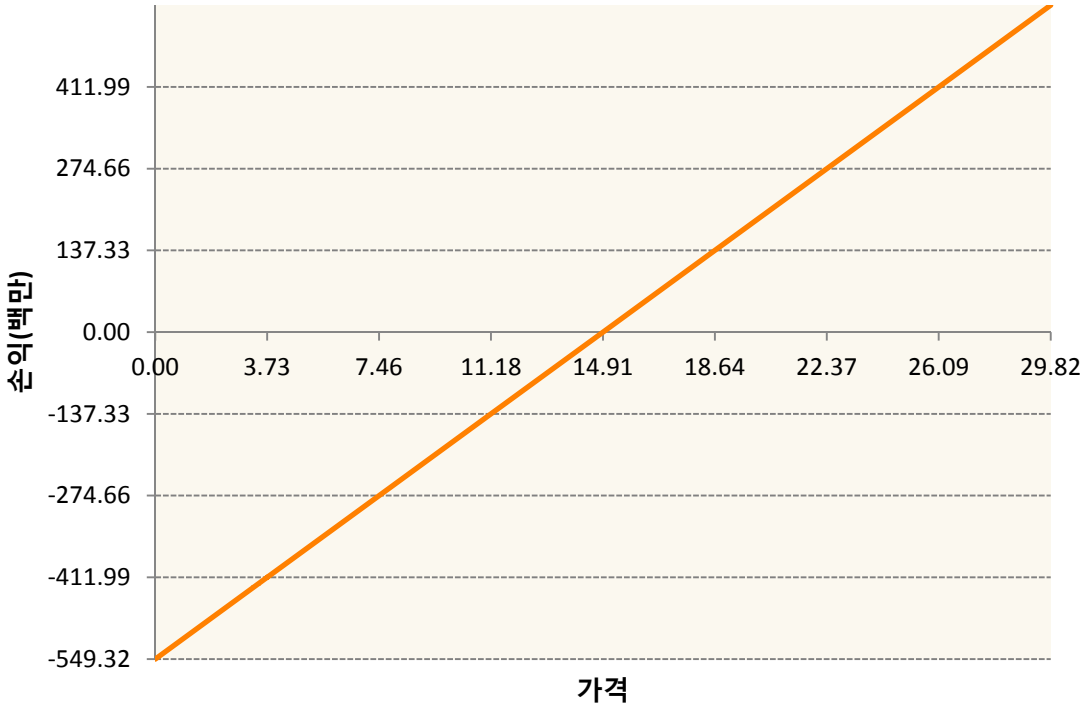

KCU7-COFFEE 'C' FUTURE SEP17
592.21
444.16
296.10
148.05
0.00
-148.05
-296.10
-444.16
0.00
34.81
69.63
104.44
139.25
174.06
208.88
243.69
278.50
손익(백만)


-592.21
가격

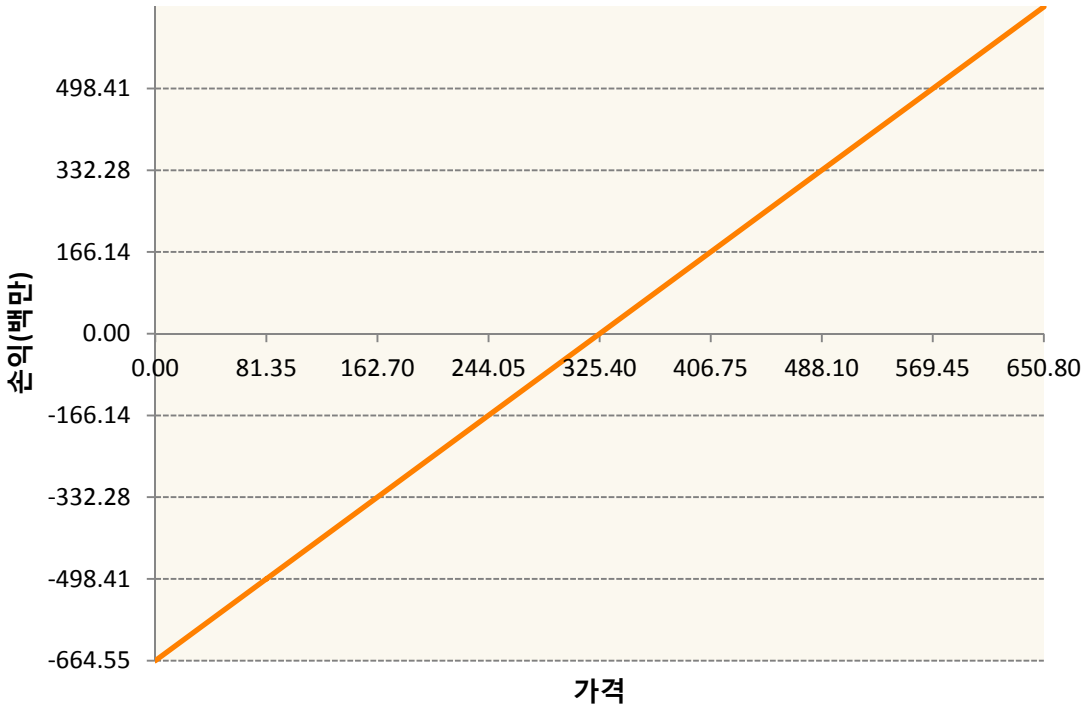

KR4175M80003-2017-08 달러선물
392.00
294.00
196.00
98.00
0.00
-98.00
-196.00
-294.00
-392.00
0.00
280.00
560.00
840.00
1,120.00
1,400.00
1,680.00
1,960.00
2,240.00
손익(백만)
가격


KWU7-KC HRW WHEAT FUT SEP17
296.60
222.45
148.30
74.15
0.00
-74.15
-148.30
-222.45
-296.60
0.00
118.69
237.38
356.06
474.75
593.44
712.13
830.81
949.50
손익(백만)
가격

SBV7-SUGAR #11 (WORLD) OCT17

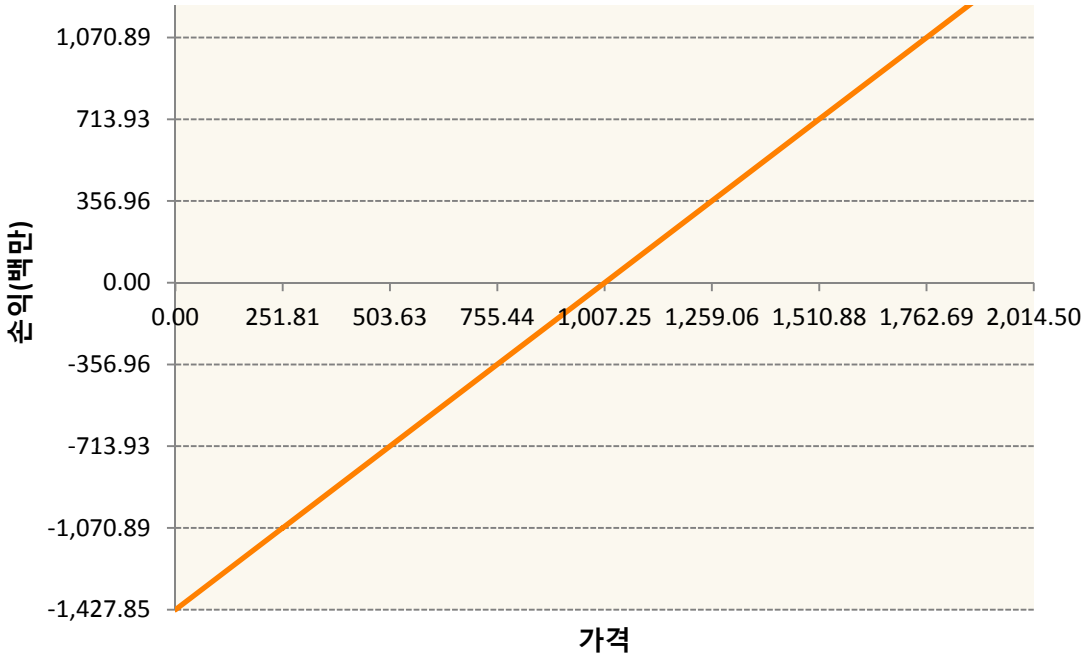


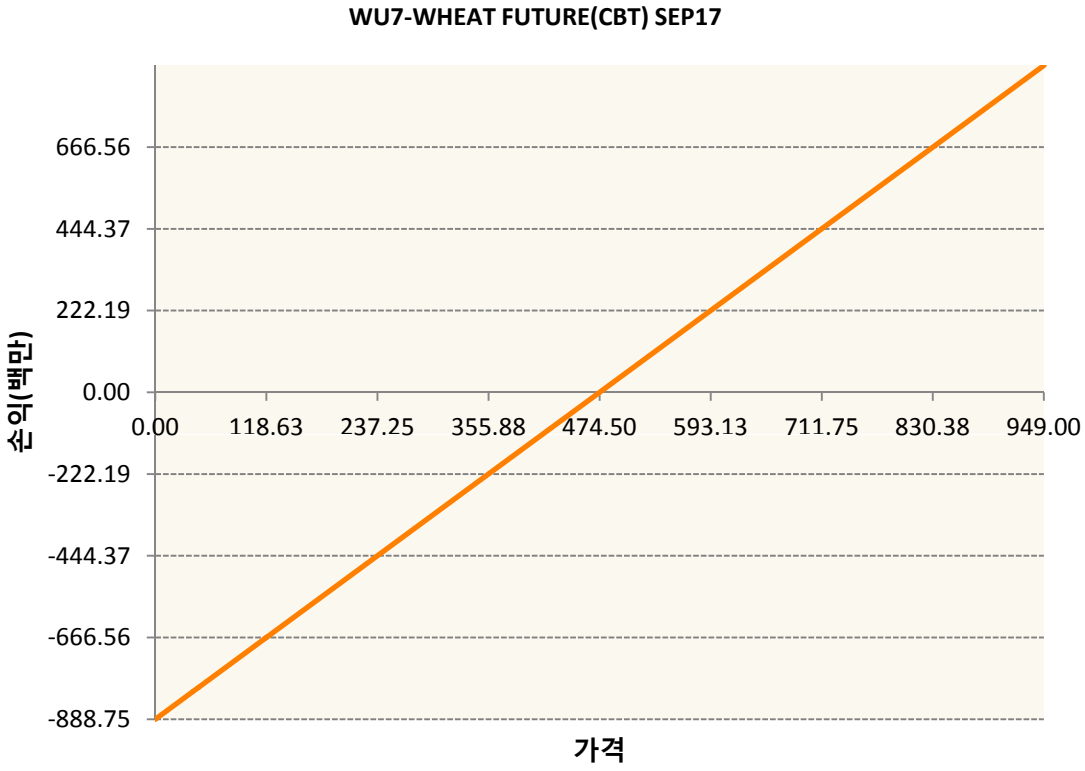
SMZ7-SOYBEAN MEAL FUTR DEC17



SX7-SOYBEAN FUTURE NOV17







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
BOZ7	SOYBEAN OIL FUTR DEC17	52
CTZ7	COTTON NO.2 FUTR DEC17	28
CU7	CORN FUTURE SEP17	150
KCU7	COFFEE 'C' FUTURE SEP17	47
KR4175M80(	2017-08 달러선물	31

KWU7	KC HRW WHEAT FUT SEP17	24
SBV7	SUGAR #11 (WORLD) OCT17	44
SMZ7	SOYBEAN MEAL FUTR DEC17	53
SX7	SOYBEAN FUTURE NOV17	114
WU7	WHEAT FUTURE(CBT) SEP17	71

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

683