공시일	2017-08-03
기준일	2017-08-02

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	2017-08-03
기준일	2017-08-02

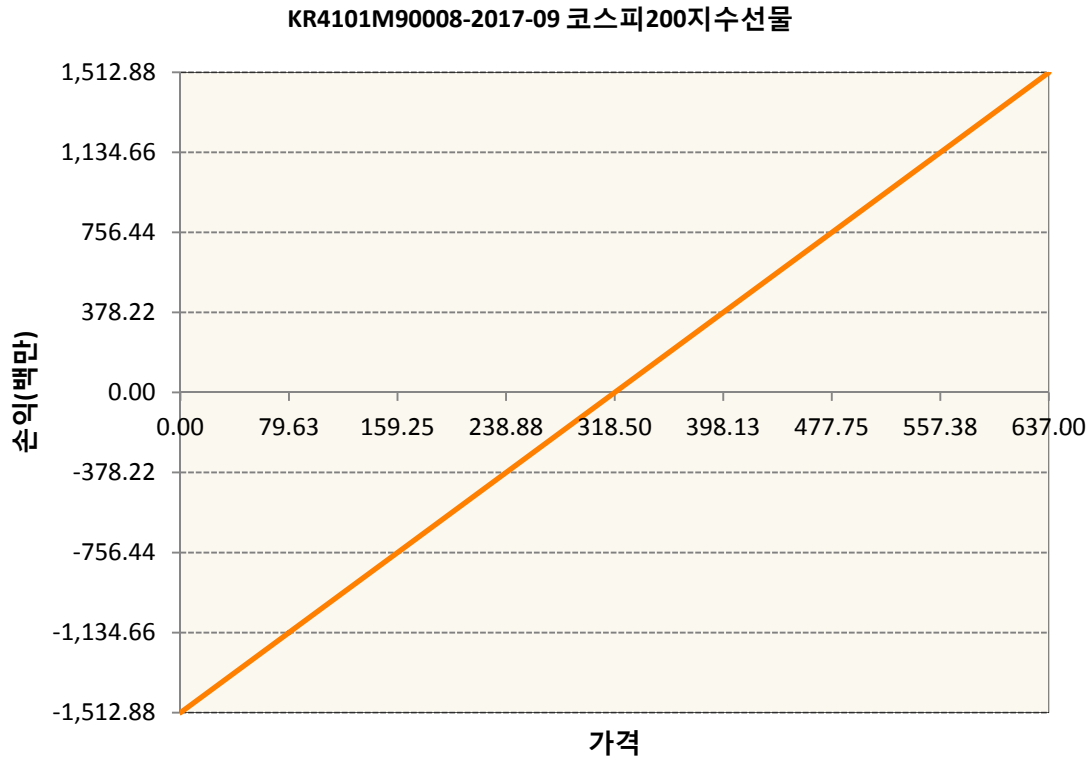
스마트인덱스모

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	1,513	0	1,513	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%	-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%	121	121	121	121	121	121	121

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

74

공시일	2017-08-03
기준일	2017-08-02

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	1,026

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

477

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-08-03
기준일	2017-08-02

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	392

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

336

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-08-03
기준일	2017-08-02

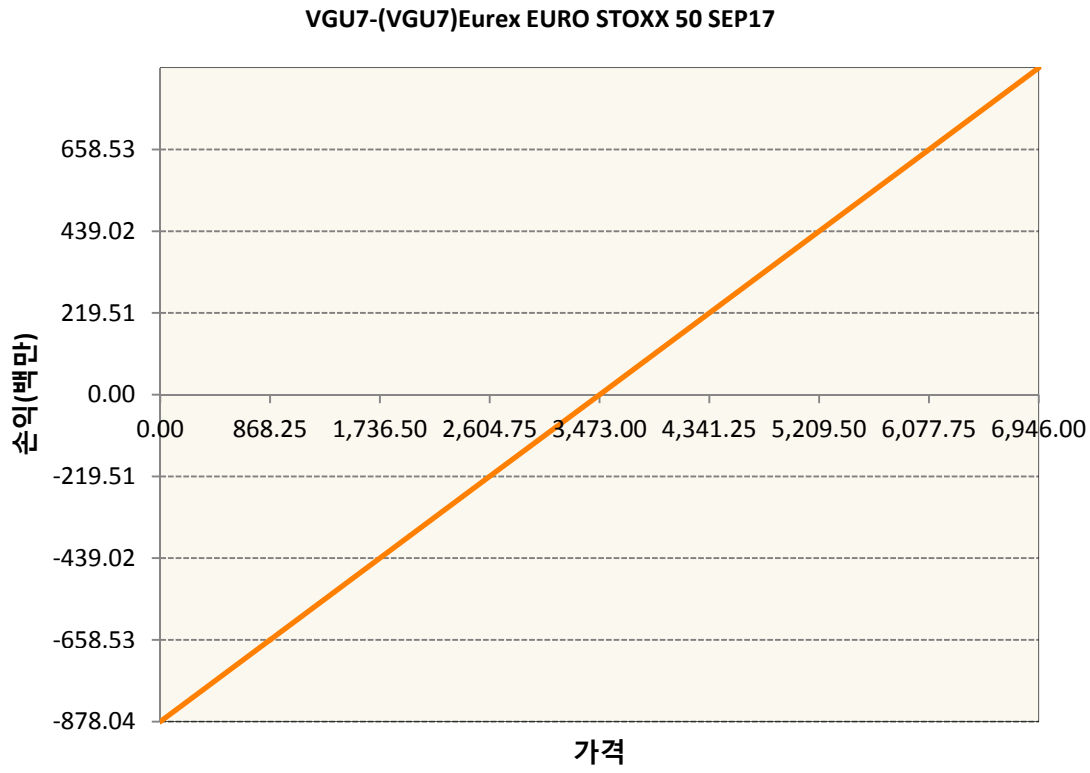
유로인덱스모(주식-파생형)

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	2017-08-03
기준일	2017-08-02

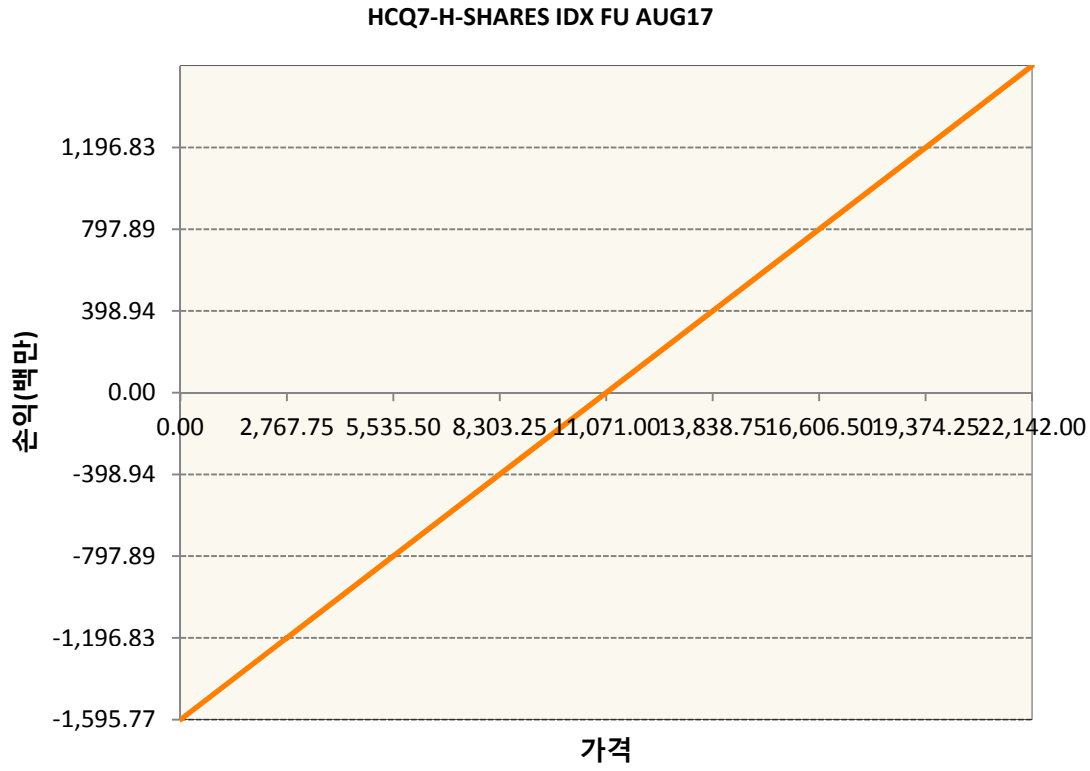
차이나인덱스모(주식-파생형)

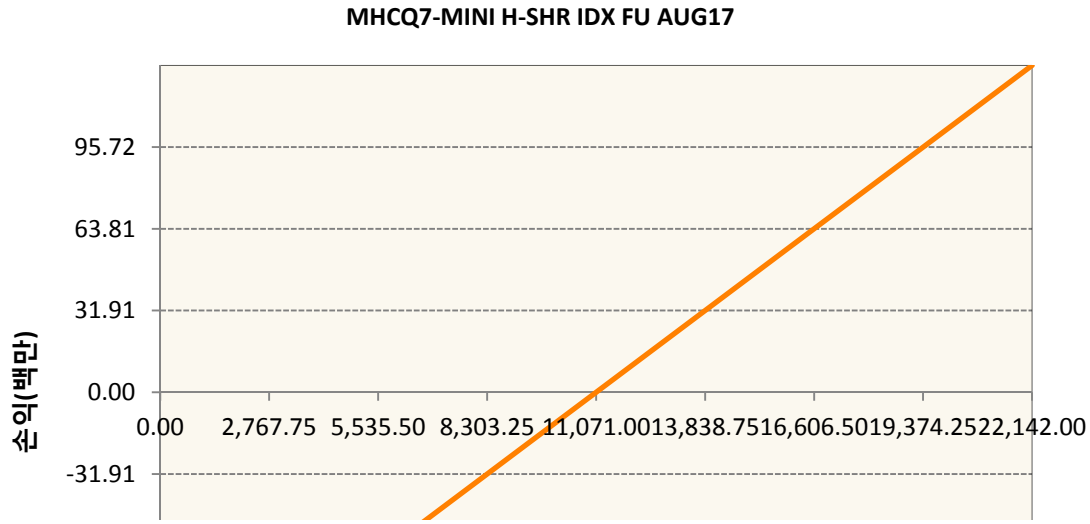
1. 계약금액

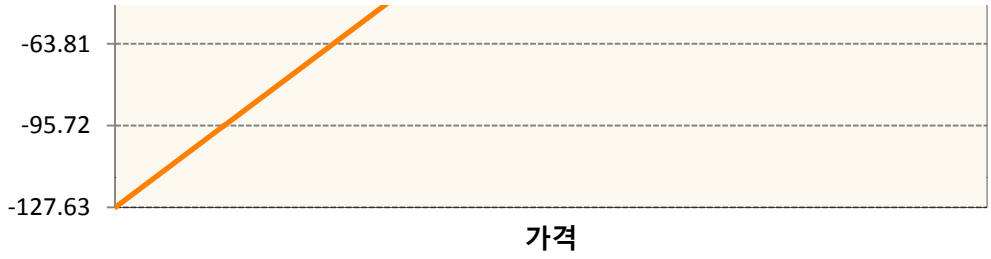
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,723	0	1,723	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	2017-08-03
기준일	2017-08-02

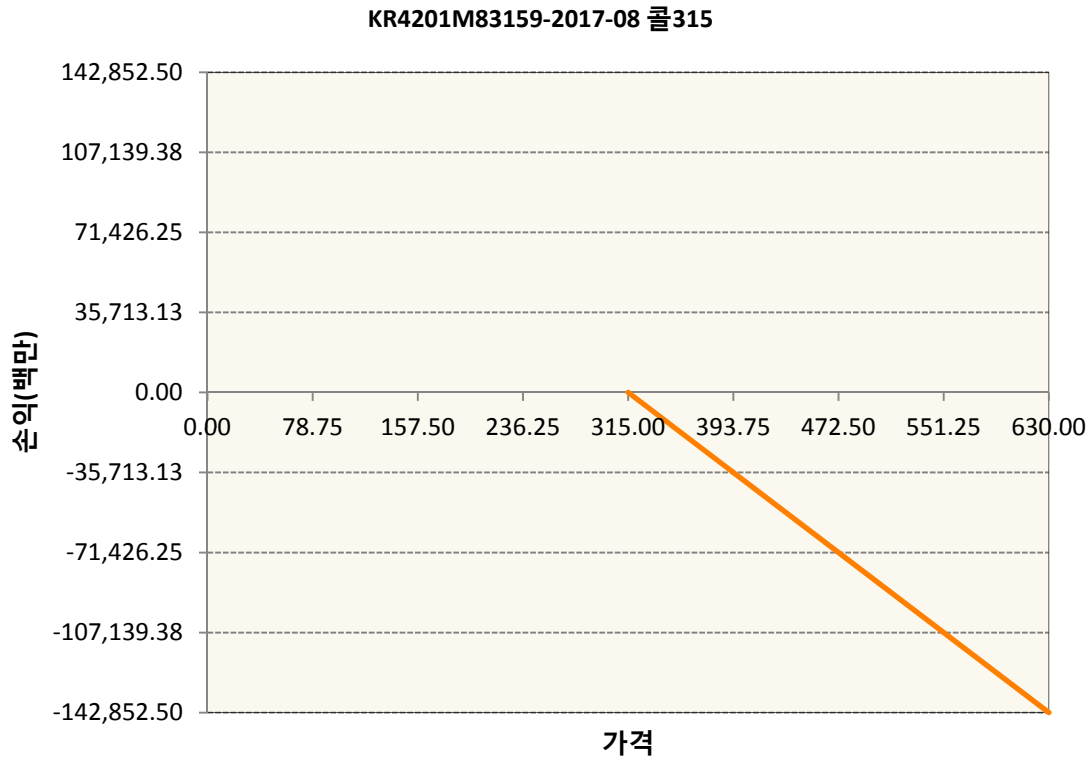
커버드콜모(주식혼합-파생형)

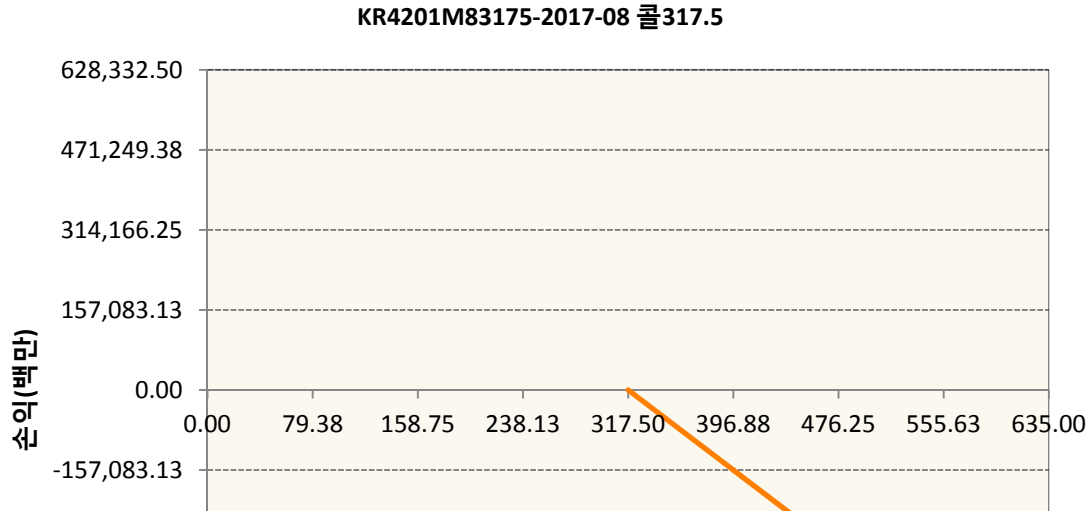
1. 계약금액

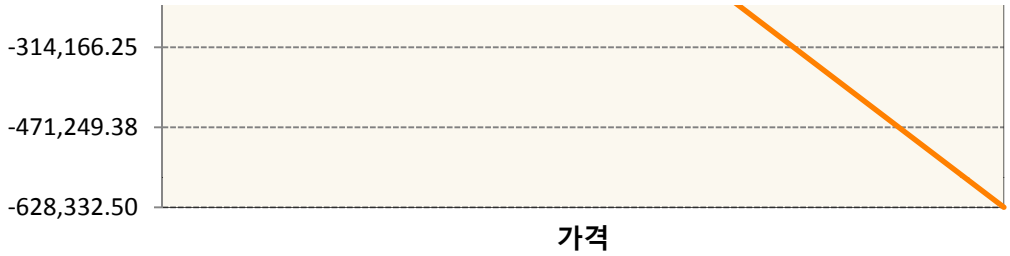
(단위:백만원)

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

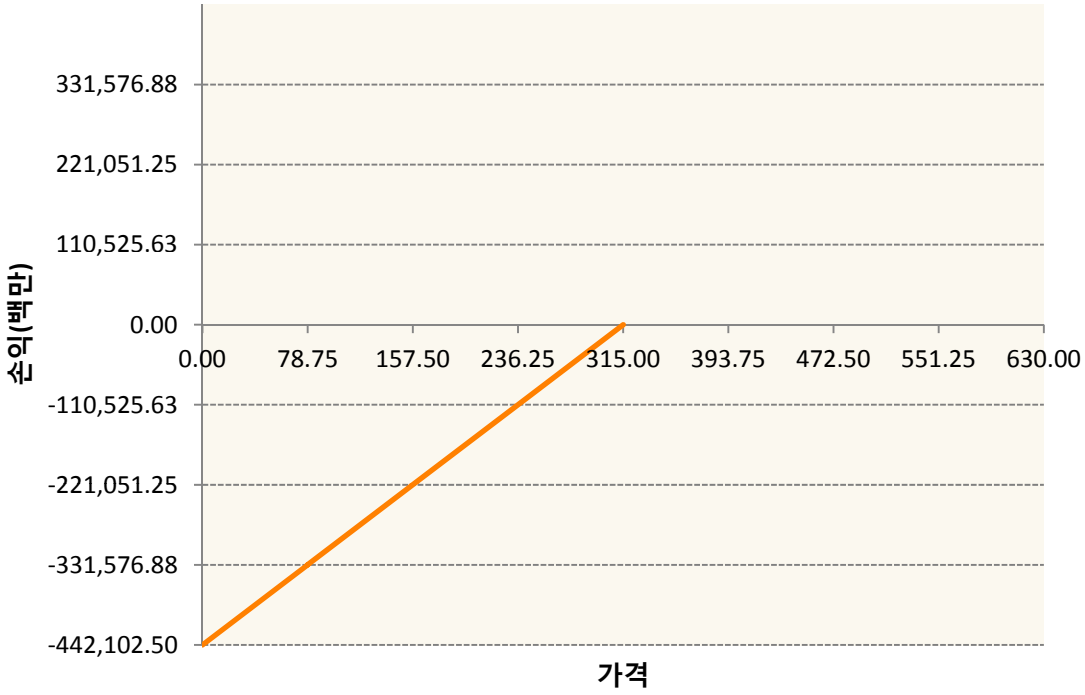
2. 만기시점의 손익구조



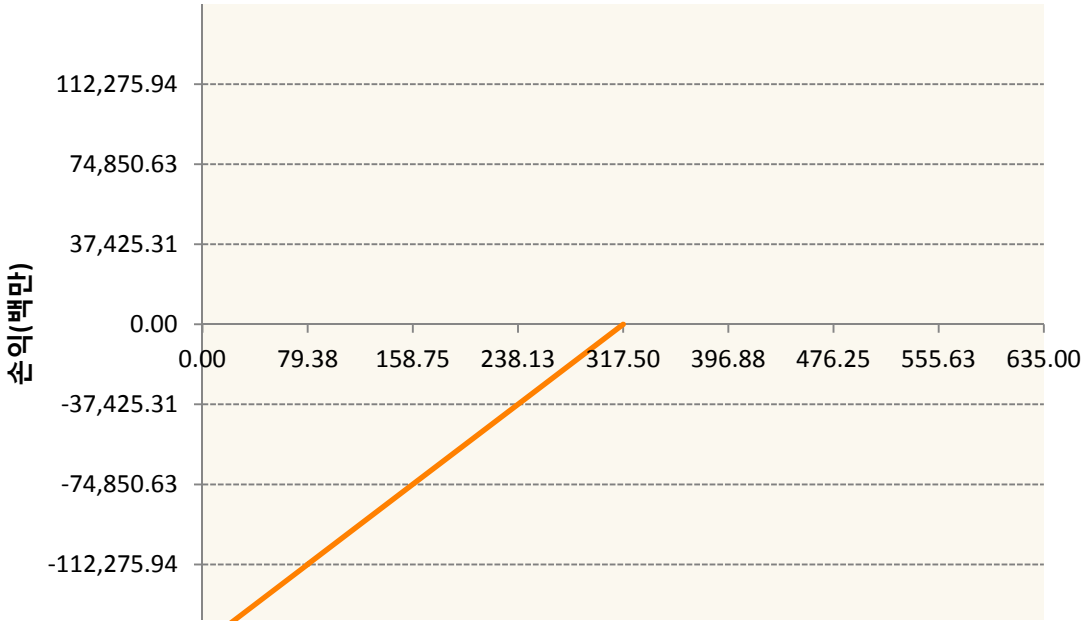




KR4301M83157-2017-08 풋315



KR4301M83173-2017-08 풋317.5





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201M83: 2017-08 콜315							10,182
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	2,605	2,602	2,596	2,585	2,568	2,546	2,517
-5.33%	2,559	2,524	2,477	2,421	2,354	2,279	2,196
-2.67%	2,119	1,993	1,862	1,727	1,588	1,447	1,303
0%	465	311	156	0	-157	-314	-473
2.67%	-2,595	-2,665	-2,747	-2,839	-2,940	-3,048	-3,162
5.33%	-6,301	-6,315	-6,335	-6,365	-6,403	-6,450	-6,506
8.00%	-10,132	-10,133	-10,135	-10,141	-10,150	-10,163	-10,182
KR4201M83: 2017-08 콜317.5							42,332
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	8,672	8,666	8,652	8,625	8,582	8,518	8,430
-5.33%	8,583	8,493	8,364	8,194	7,982	7,732	7,446
-2.67%	7,461	7,032	6,564	6,063	5,536	4,988	4,421
0%	2,123	1,415	708	0	-708	-1,415	-2,123
2.67%	-9,652	-10,085	-10,560	-11,068	-11,605	-12,163	-12,741
5.33%	-25,323	-25,430	-25,581	-25,777	-26,017	-26,297	-26,616
8.00%	-41,972	-41,984	-42,008	-42,051	-42,117	-42,210	-42,332
KR4301M83: 2017-08 풋315							27,869
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-27,596	-27,606	-27,626	-27,659	-27,710	-27,779	-27,869
-5.33%	-15,852	-15,962	-16,105	-16,281	-16,486	-16,718	-16,975
-2.67%	-5,329	-5,717	-6,122	-6,541	-6,971	-7,409	-7,854
0%	1,438	963	483	0	-486	-973	-1,462
2.67%	3,856	3,638	3,384	3,099	2,787	2,454	2,101
5.33%	4,271	4,230	4,166	4,075	3,956	3,810	3,638
8.00%	4,303	4,300	4,291	4,275	4,247	4,205	4,146
KR4301M83: 2017-08 풋317.5							9,971
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-9,913	-9,915	-9,918	-9,924	-9,935	-9,950	-9,971
-5.33%	-5,941	-5,963	-5,993	-6,034	-6,084	-6,144	-6,212
-2.67%	-2,215	-2,318	-2,429	-2,549	-2,674	-2,805	-2,940
0%	506	337	169	0	-169	-337	-506
2.67%	1,694	1,590	1,477	1,356	1,228	1,095	958

5.33%	1,953	1,928	1,892	1,845	1,788	1,721	1,645
8.00%	1,979	1,977	1,971	1,961	1,945	1,923	1,894

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

100,753

공시일	2017-08-03
기준일	2017-08-02

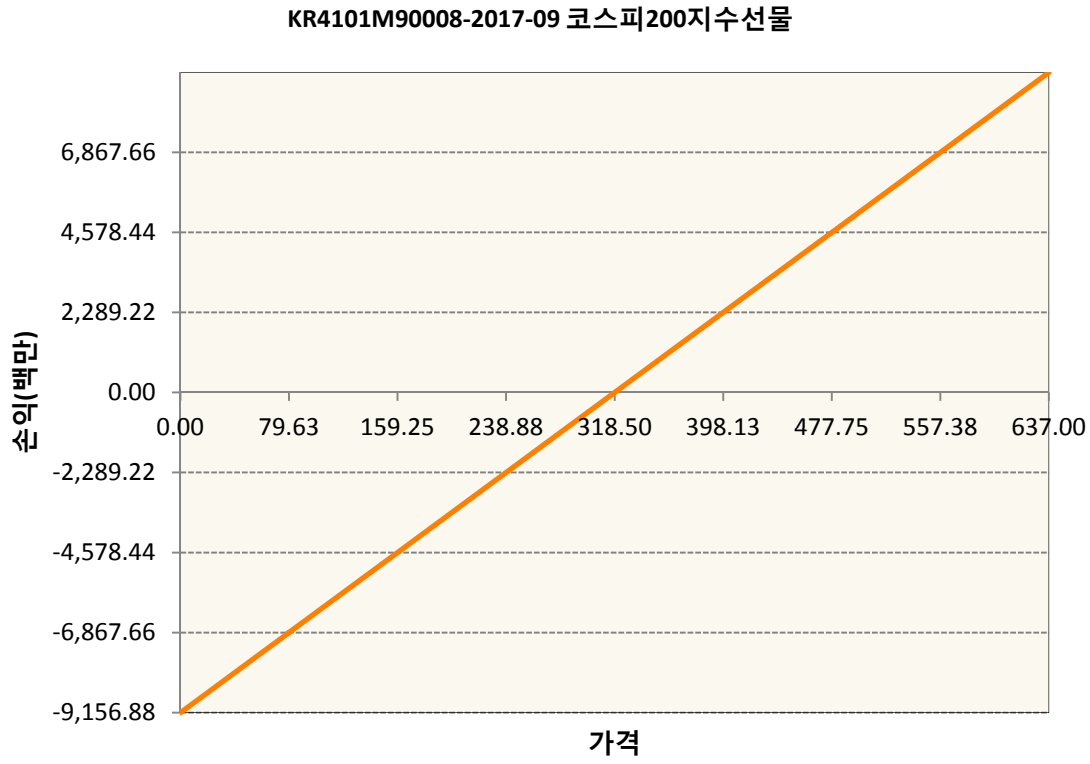
ETF스마트레버리지목표전환형6호

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	9,157	0	9,157	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101M90(2017-09 코스피200지수선물							731
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-731	-731	-731	-731	-731	-731	-731
-5.33%	-487	-487	-487	-487	-487	-487	-487
-2.67%	-244	-244	-244	-244	-244	-244	-244
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	244	244	244	244	244	244	244
5.33%	487	487	487	487	487	487	487
8.00%	731	731	731	731	731	731	731

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

447

공시일	2017-08-03
기준일	2017-08-02

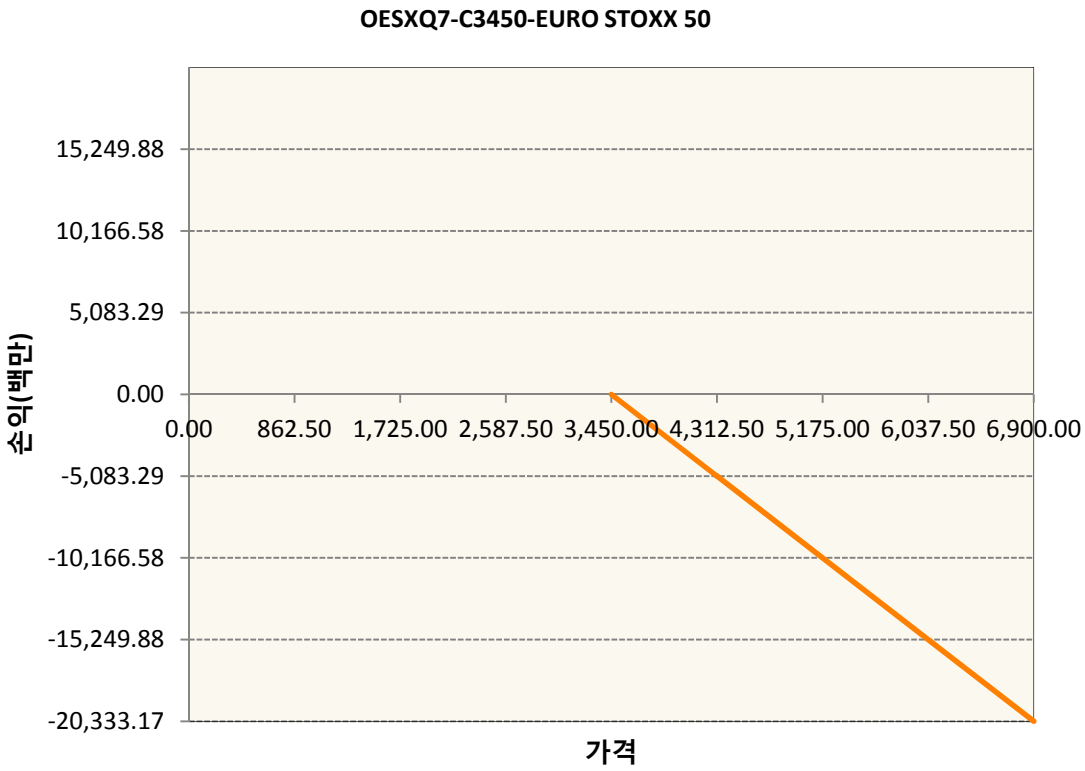
유로커버드콜(주식혼합-파생형)

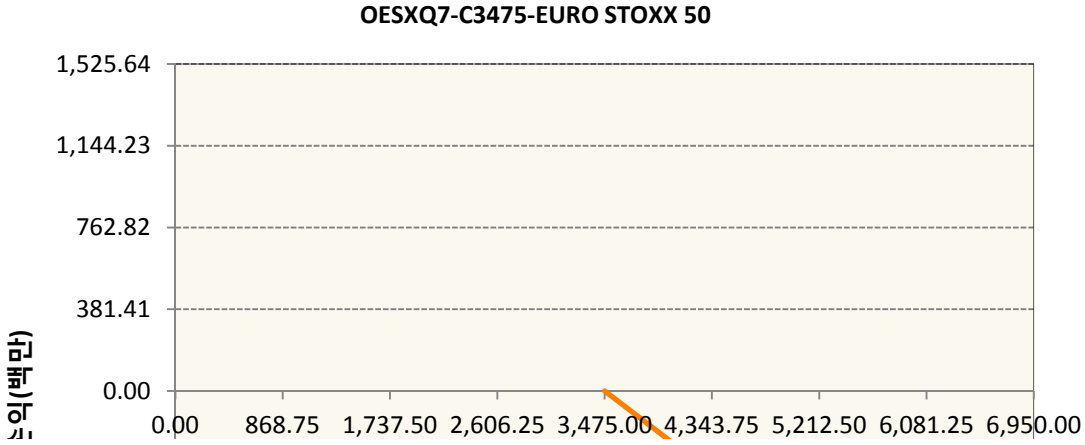
1. 계약금액

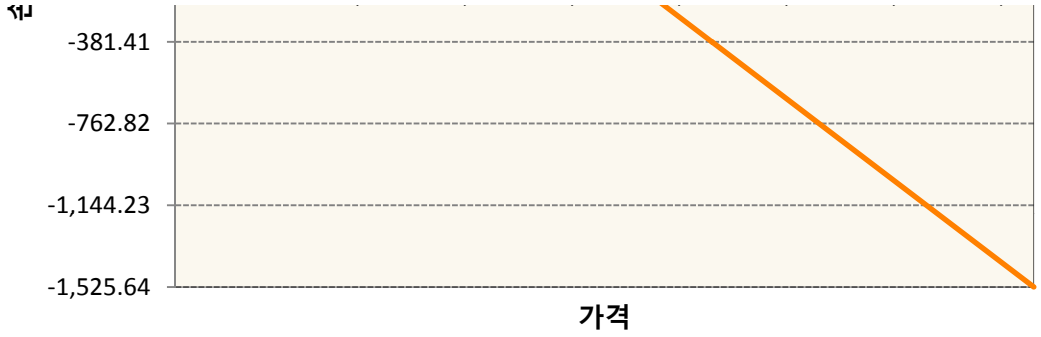
(단위:백만원)

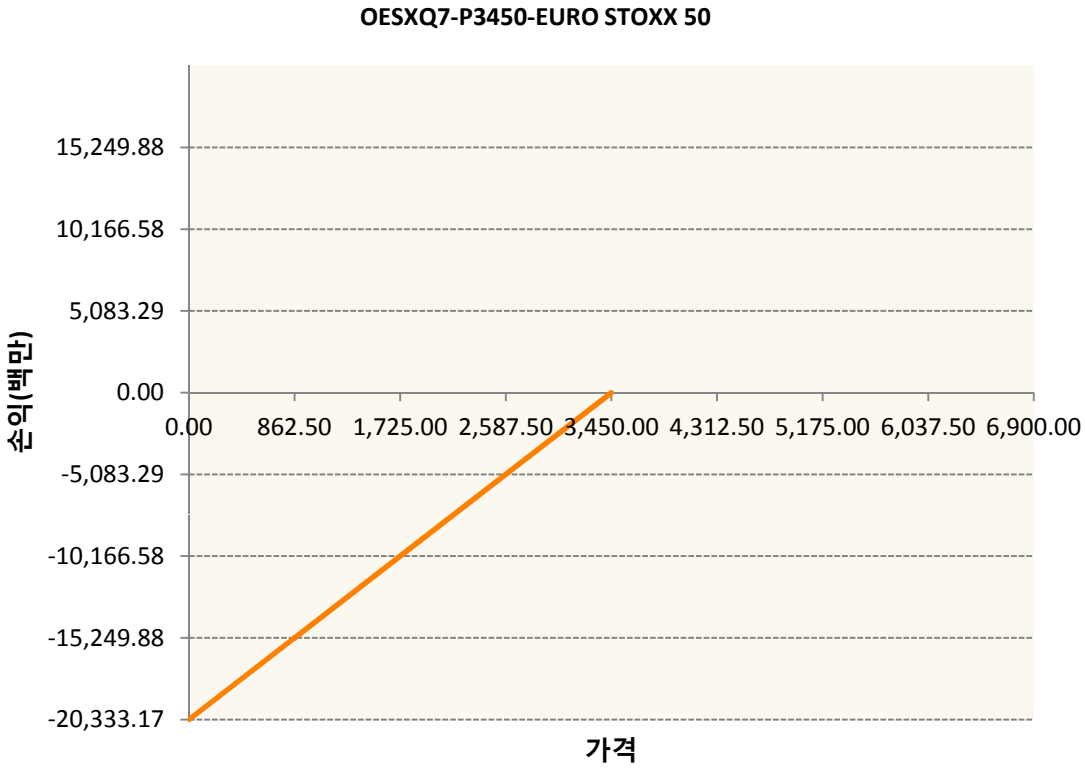
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	21,592	0	21,592	
누계	유가증권	옵션	0	43,718	-43,718	장내

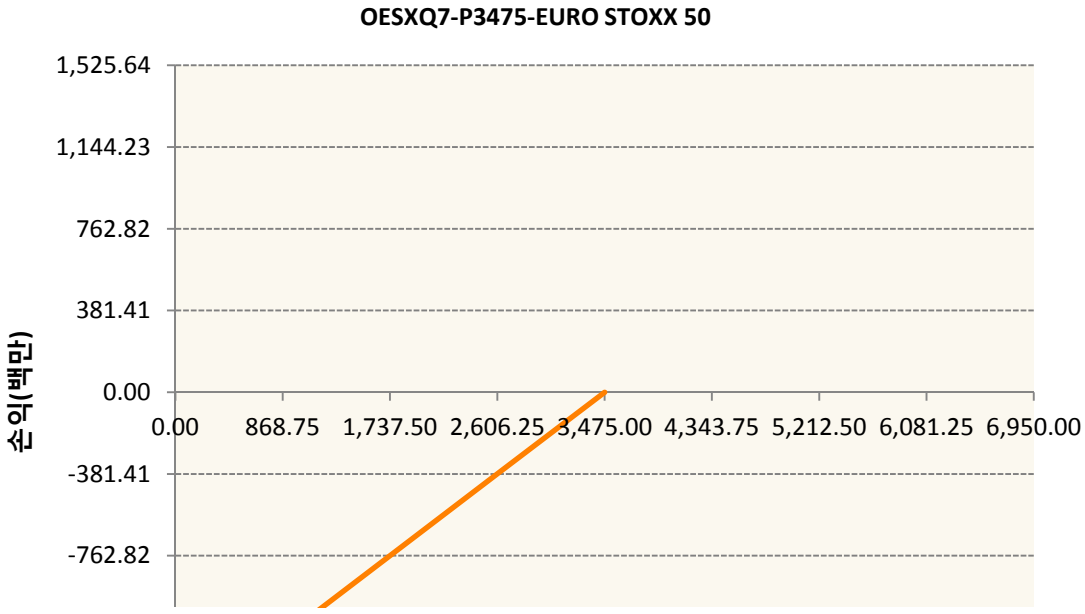
2. 만기시점의 손익구조

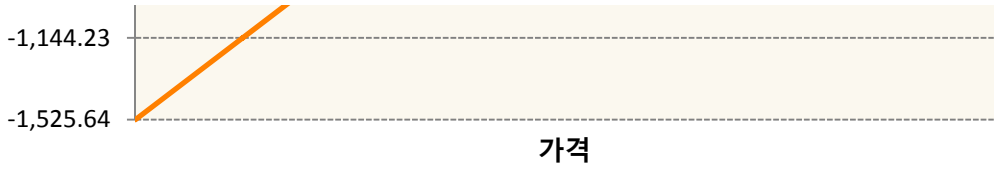


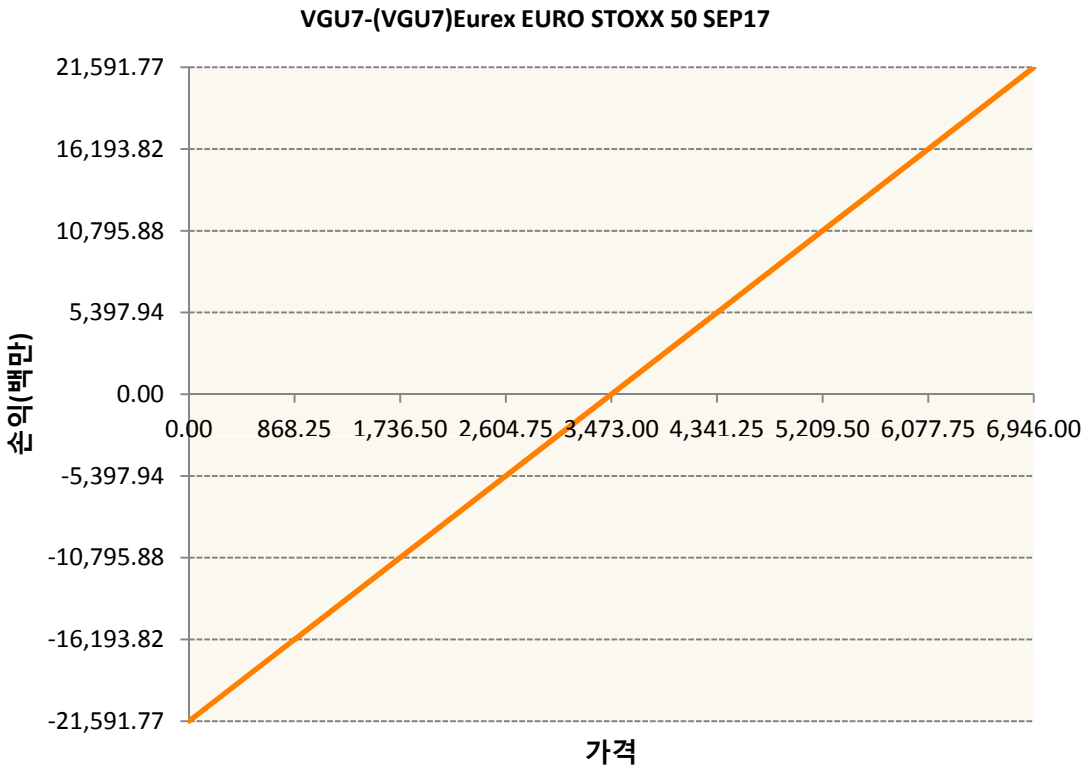



-381.41
-762.82
-1,144.23
-1,525.64
가격


OESXQ7-P3450-EURO STOXX 50
15,249.88
10,166.58
5,083.29
0.00
-5,083.29
-10,166.58
-15,249.88
-20,333.17
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
1,525.64
1,144.23
762.82
381.41
0.00
-381.41
-762.82
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	1,627
OESXQ7-C3	EURO STOXX 50	122
OESXQ7-P3	EURO STOXX 50	1,627
OESXQ7-P3	EURO STOXX 50	122
VGU7	(VGU7)Eurex EURO STOXX 50 SEP17	1,727

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

4,344

공시일	2017-08-03
기준일	2017-08-02

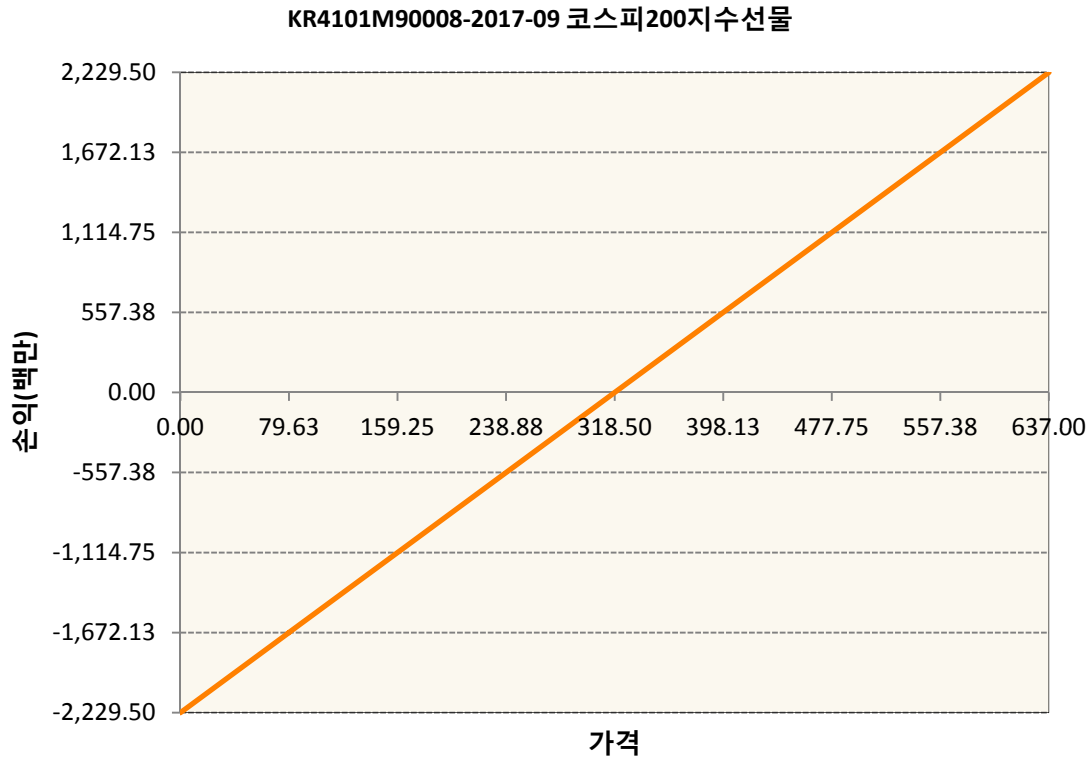
ETF스마트레버리지목표전환형7호

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	2,230	0	2,230	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%	-119	-119	-119	-119	-119	-119	-119
-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%	119	119	119	119	119	119	119
8.00%	178	178	178	178	178	178	178

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

109

공시일	2017-08-03
기준일	2017-08-02

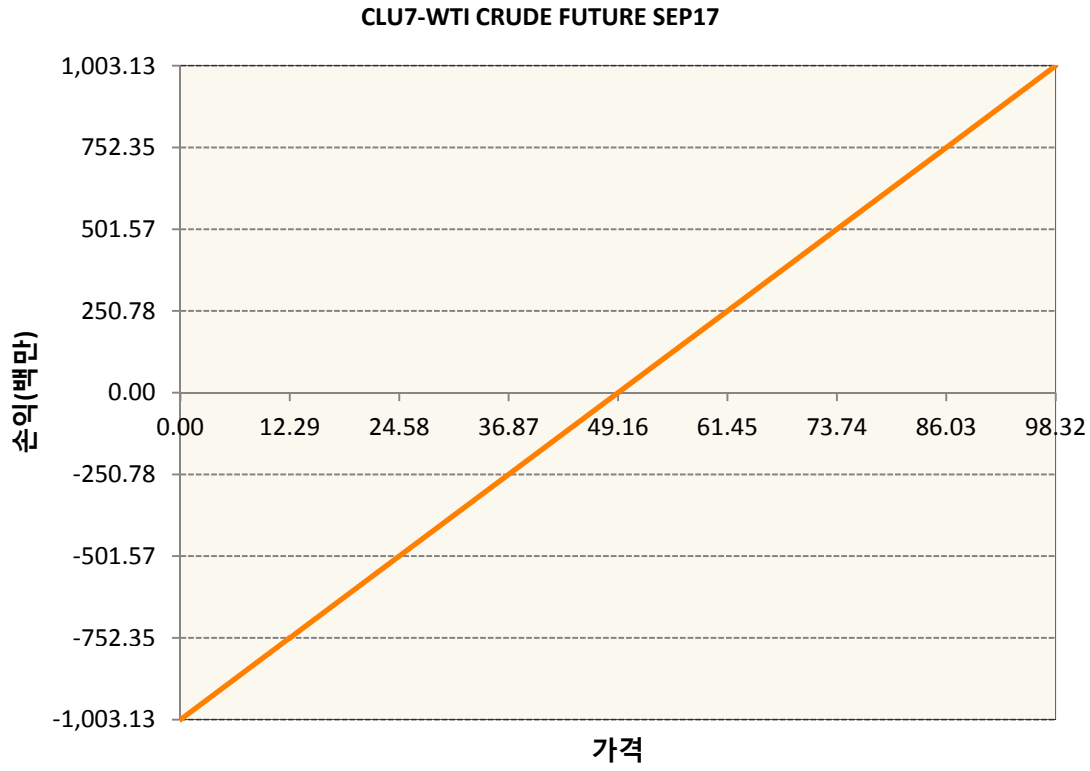
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

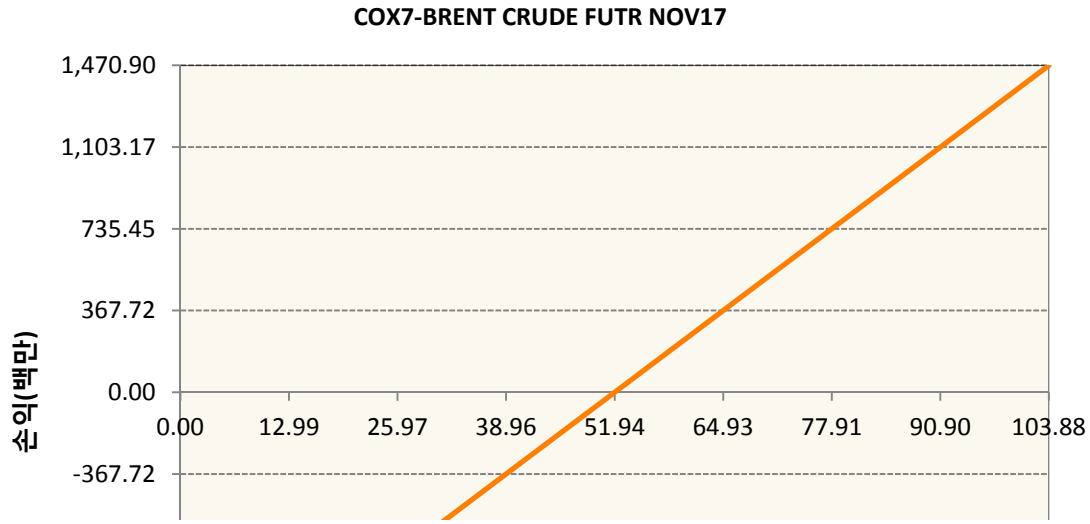
1. 계약금액

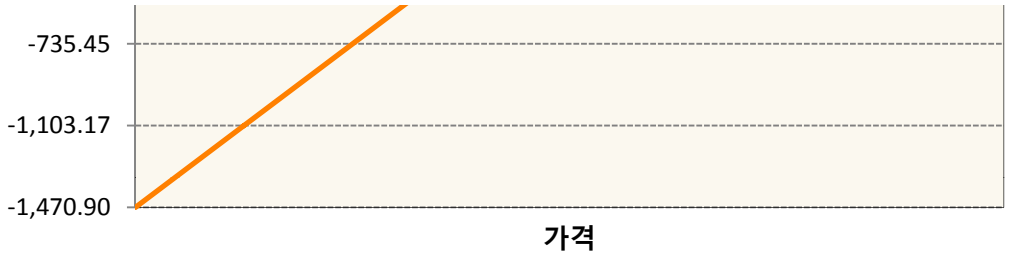
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	5,392	225	5,167	

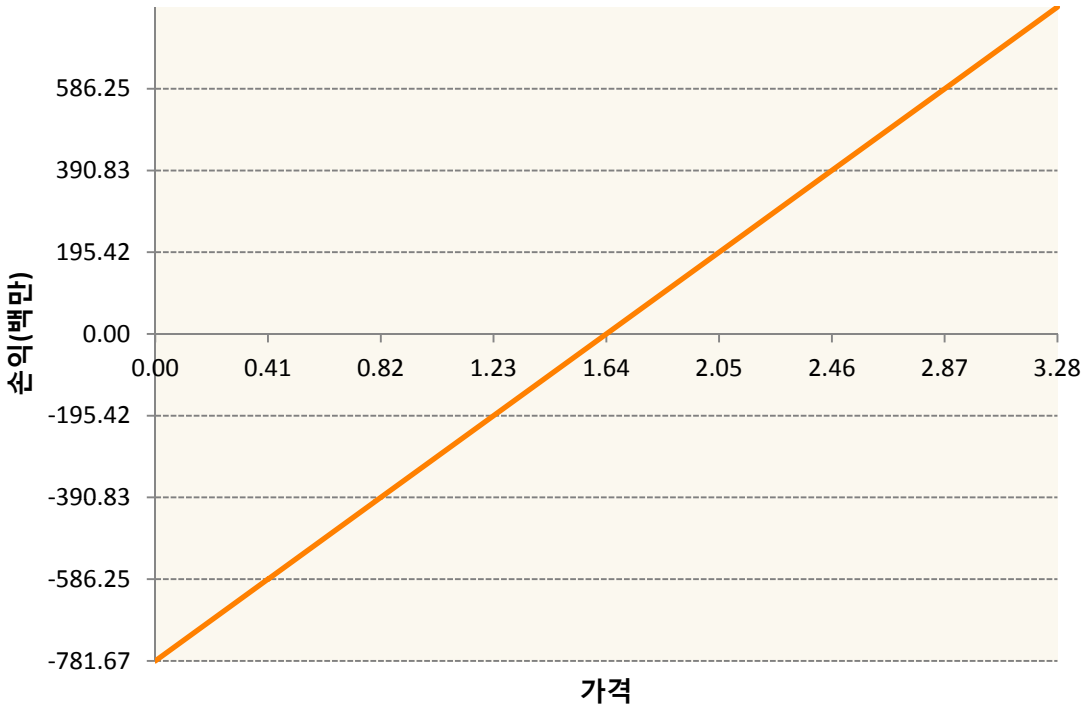
2. 만기시점의 손익구조



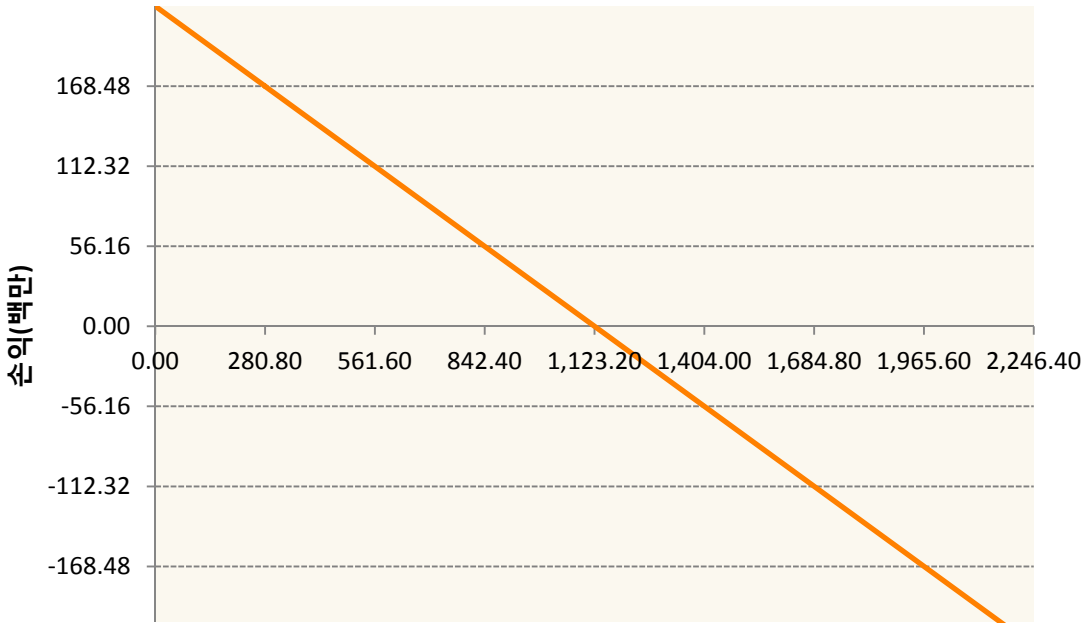


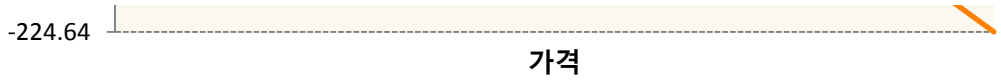


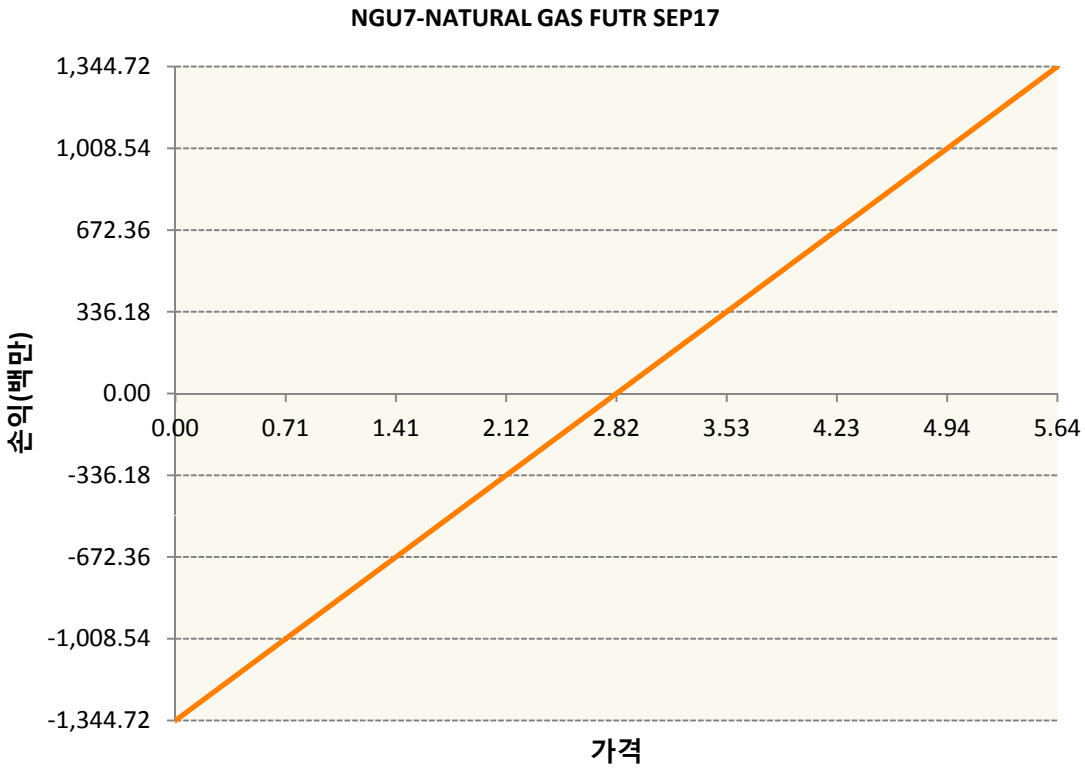
HOU7-NY HARB ULSD FUT SEP17

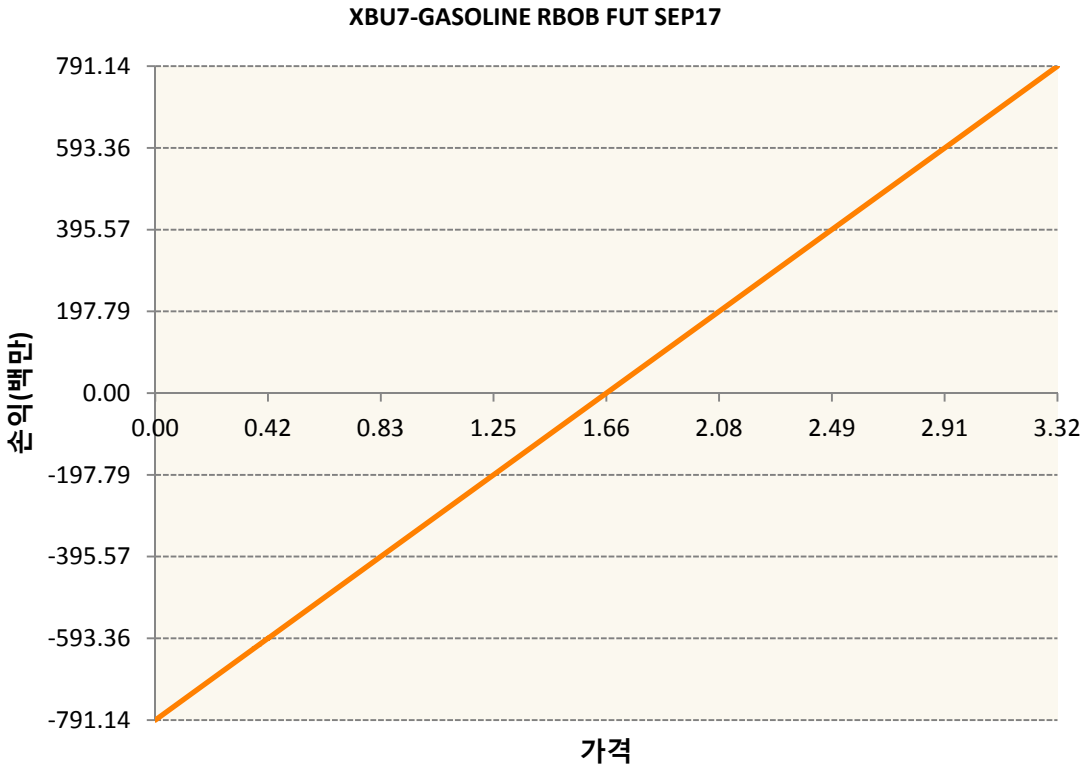


KR4175M80003-2017-08 달러선물




-224.64
가격


NGU7-NATURAL GAS FUTR SEP17
1,344.72
1,008.54
672.36
336.18
0.00
-336.18
-672.36
-1,008.54
-1,344.72
0.00
0.71
1.41
2.12
2.82
3.53
4.23
4.94
5.64
손익(백만)
가격


XBU7-GASOLINE RBOB FUT SEP17
791.14
593.36
395.57
197.79
0.00
-197.79
-395.57
-593.36
-791.14
0.00
0.42
0.83
1.25
1.66
2.08
2.49
2.91
3.32
손익(백만)
가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLU7	WTI CRUDE FUTURE SEP17	80
COX7	BRENT CRUDE FUTR NOV17	118
HOU7	NY HARB ULSD FUT SEP17	63
KR4175M80(	2017-08 달러선물	18
NGU7	NATURAL GAS FUTR SEP17	108
XBU7	GASOLINE RBOB FUT SEP17	63

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

790

공시일	2017-08-03
기준일	2017-08-02

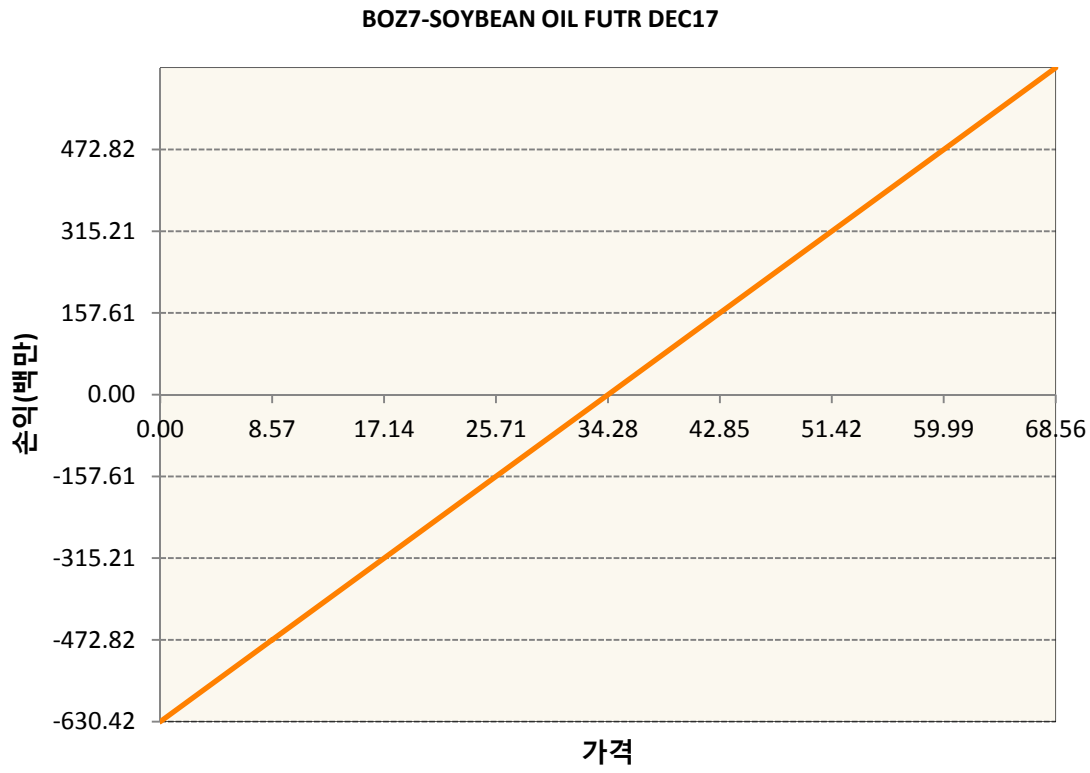
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

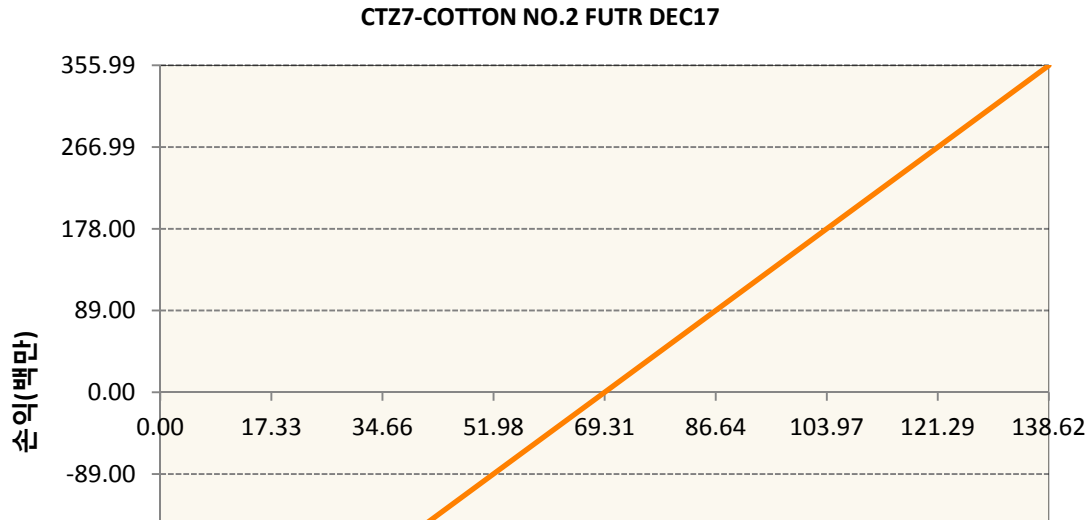
1. 계약금액

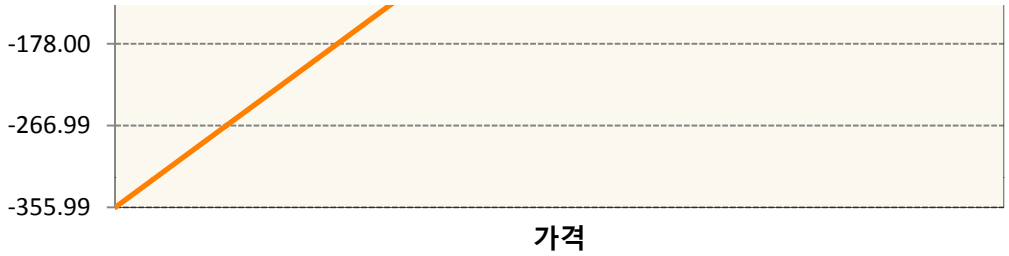
(단위:백만원)

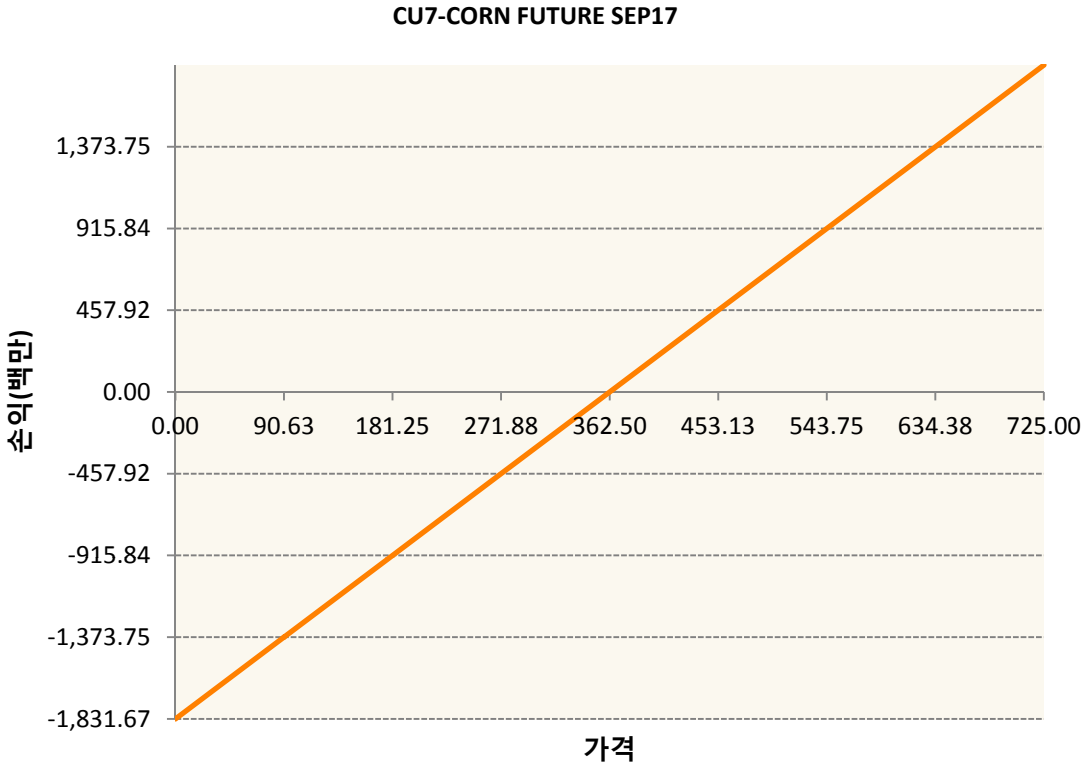
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	7,128	393	6,735	

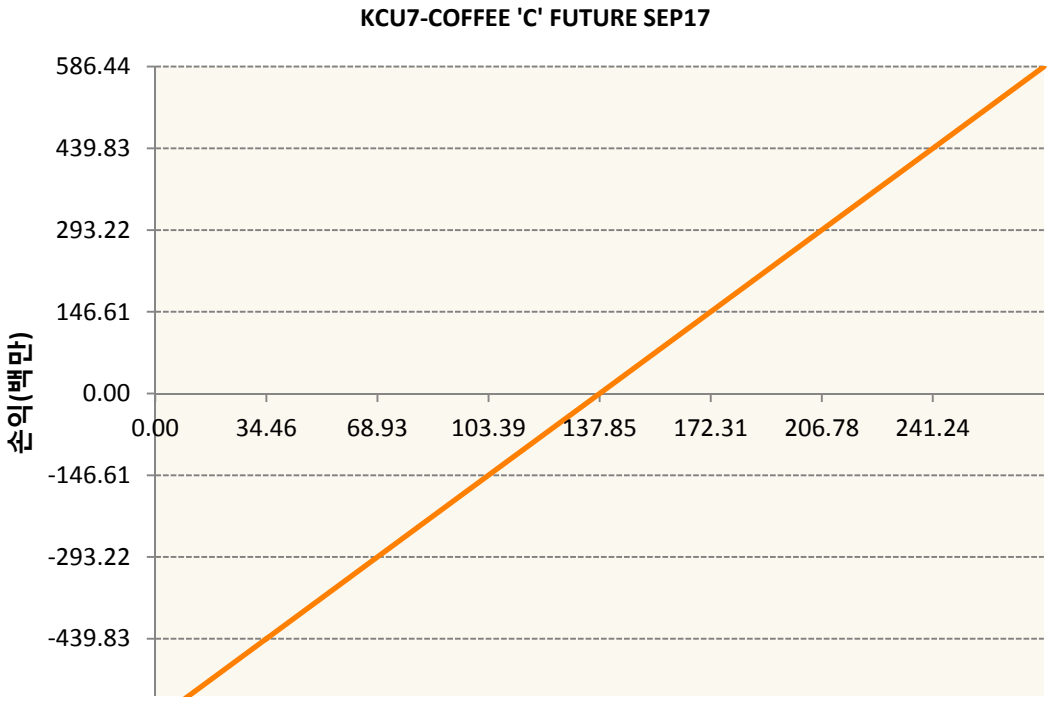
2. 만기시점의 손익구조

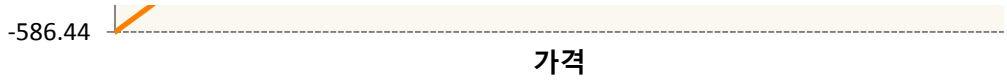


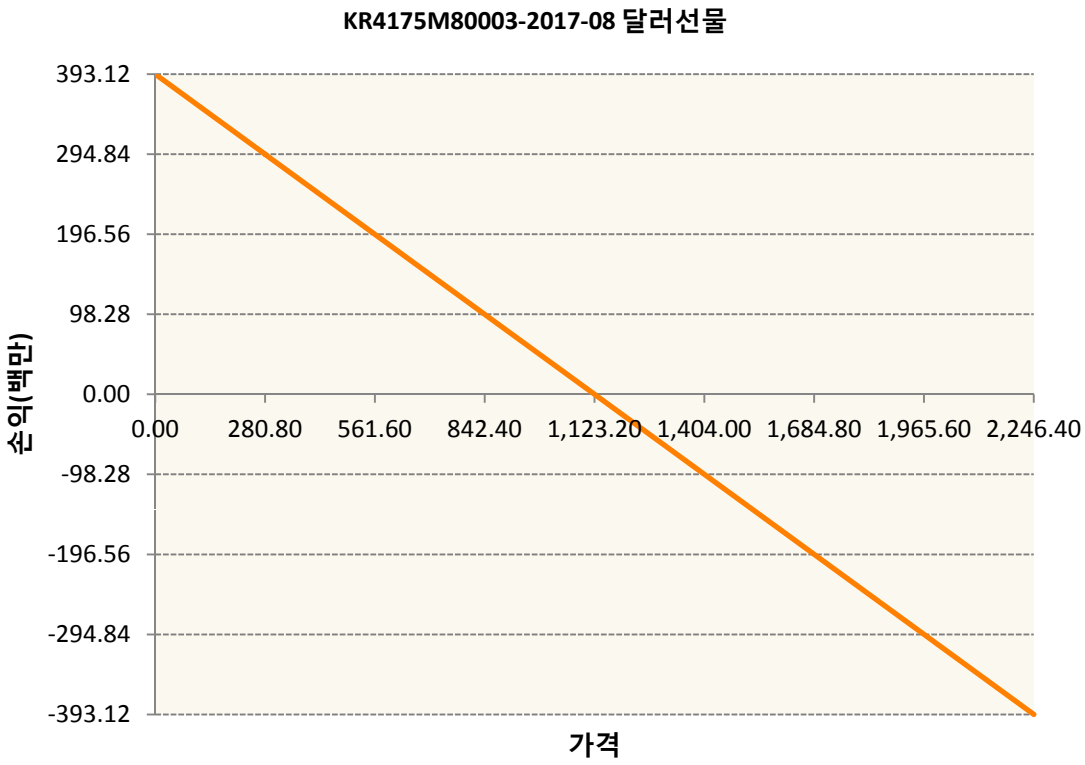


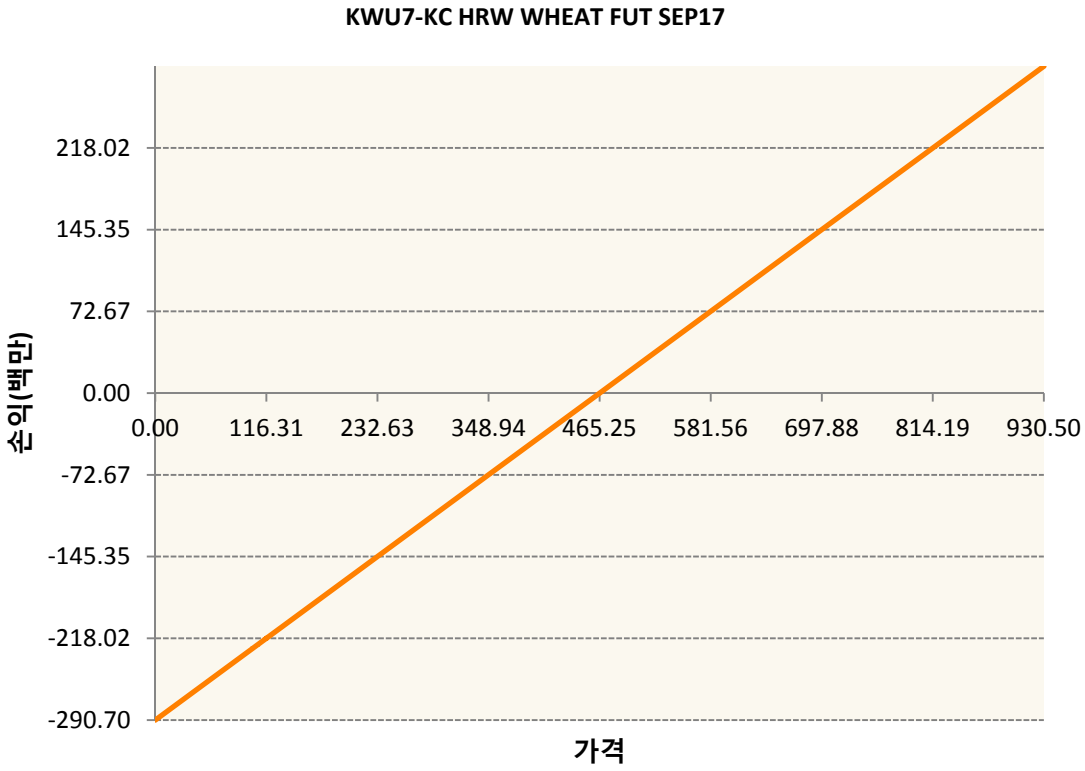

-178.00
-266.99
-355.99
가격


CU7-CORN FUTURE SEP17
1,373.75
915.84
457.92
0.00
-457.92
-915.84
-1,373.75
-1,831.67
0.00
90.63
181.25
271.88
362.50
453.13
543.75
634.38
725.00
손익(백만)
가격

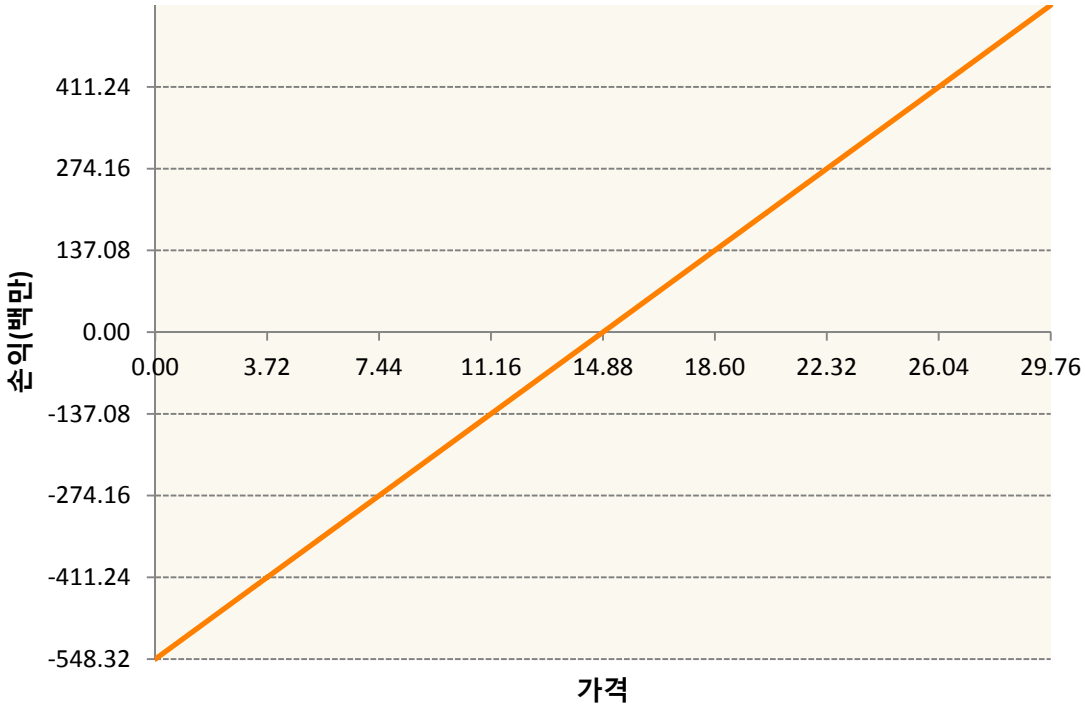

KCU7-COFFEE 'C' FUTURE SEP17
586.44
439.83
293.22
146.61
0.00
-146.61
-293.22
-439.83
0.00
34.46
68.93
103.39
137.85
172.31
206.78
241.24
손익(백만)


-586.44
가격

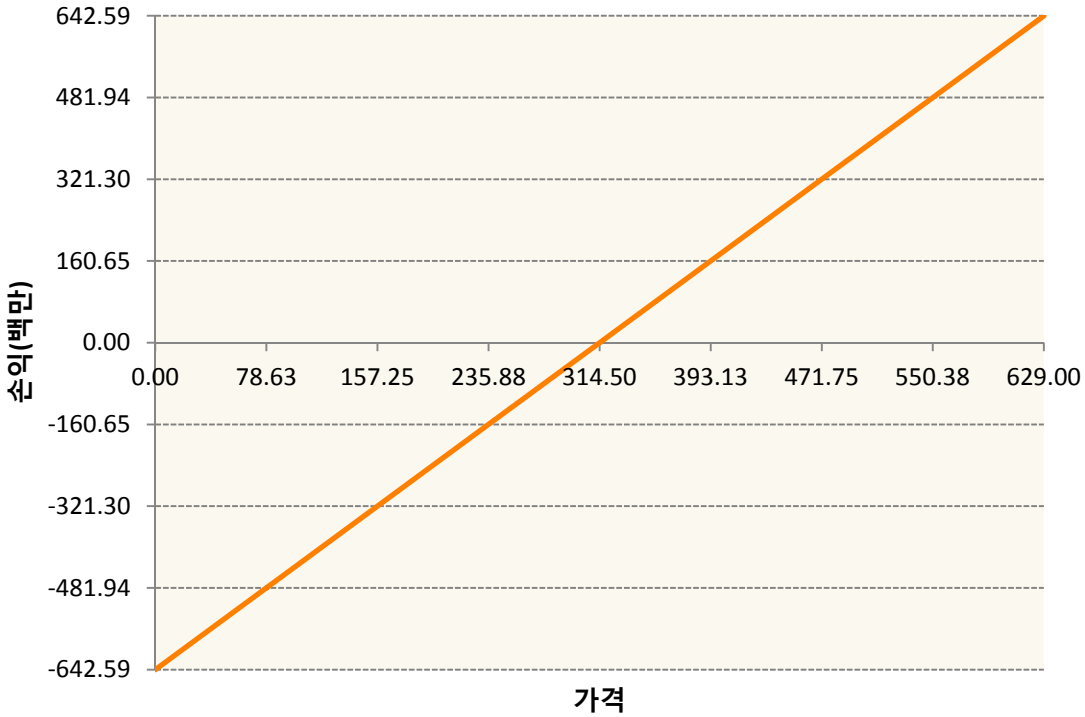

KR4175M80003-2017-08 달러선물
393.12
294.84
196.56
98.28
0.00
-98.28
-196.56
-294.84
-393.12
0.00
280.80
561.60
842.40
1,123.20
1,404.00
1,684.80
1,965.60
2,246.40
손익(백만)
가격


KWU7-KC HRW WHEAT FUT SEP17
218.02
145.35
72.67
0.00
-72.67
-145.35
-218.02
-290.70
0.00
116.31
232.63
348.94
465.25
581.56
697.88
814.19
930.50
손익(백만)
가격

SBV7-SUGAR #11 (WORLD) OCT17

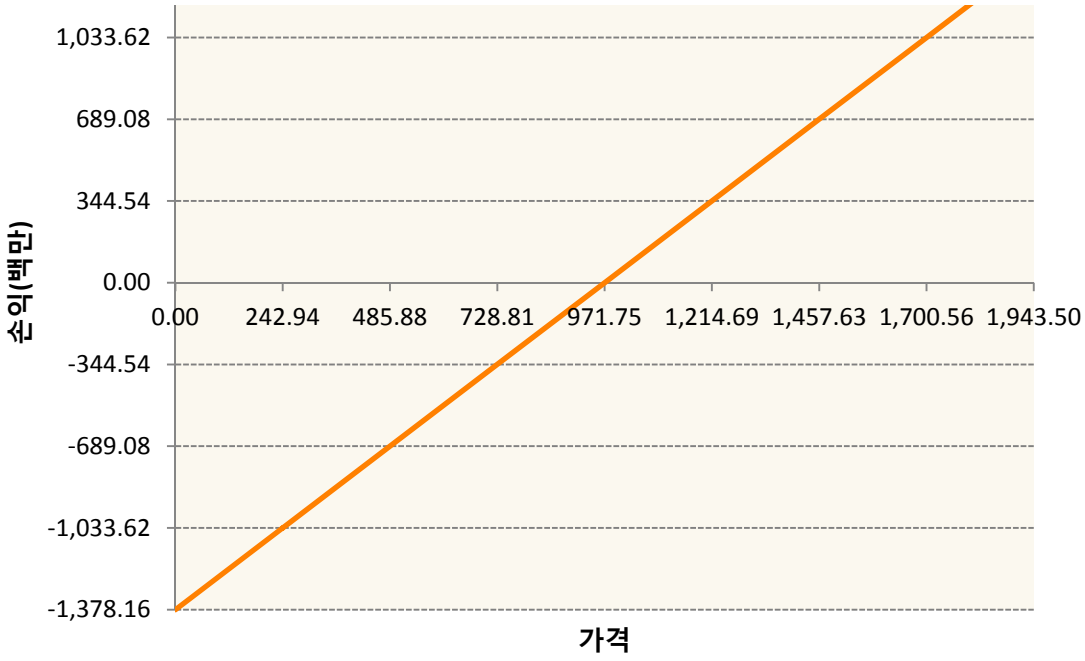


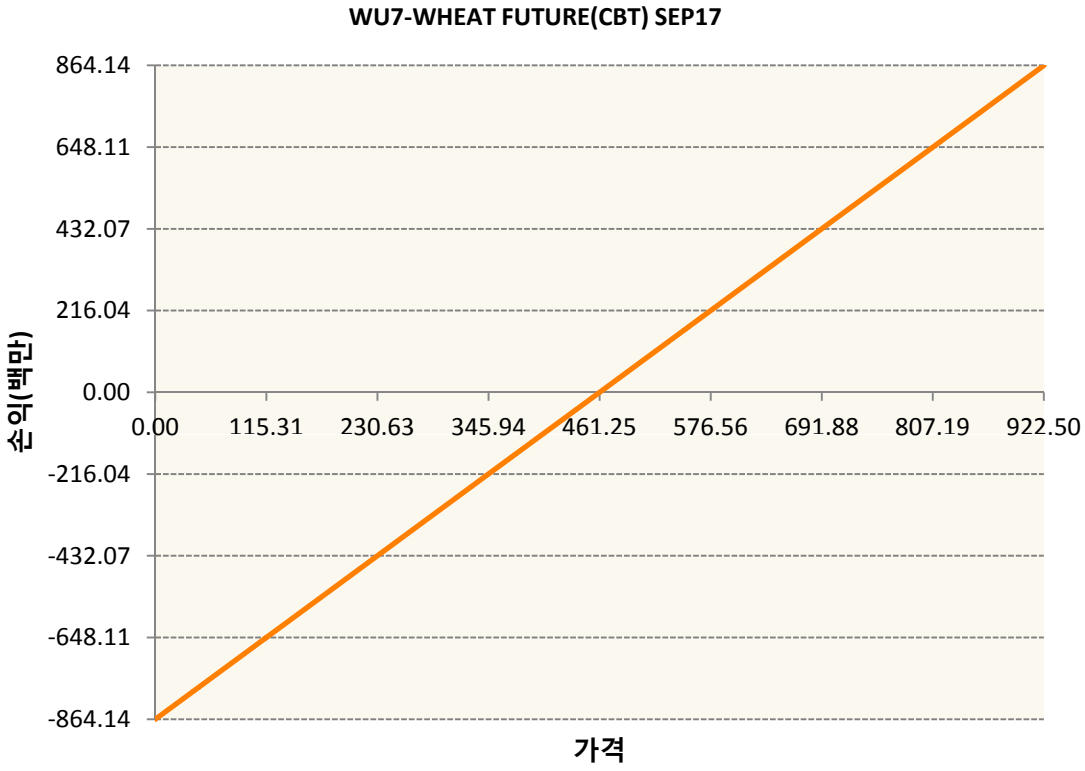
SMZ7-SOYBEAN MEAL FUTR DEC17



SX7-SOYBEAN FUTURE NOV17







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
BOZ7	SOYBEAN OIL FUTR DEC17	50
CTZ7	COTTON NO.2 FUTR DEC17	28
CU7	CORN FUTURE SEP17	147
KCU7	COFFEE 'C' FUTURE SEP17	47
KR4175M80(	2017-08 달러선물	31

KWU7	KC HRW WHEAT FUT SEP17	23
SBV7	SUGAR #11 (WORLD) OCT17	44
SMZ7	SOYBEAN MEAL FUTR DEC17	51
SX7	SOYBEAN FUTURE NOV17	110
WU7	WHEAT FUTURE(CBT) SEP17	69

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

671