공시일	2017-08-04
기준일	2017-08-03

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	2017-08-04
기준일	2017-08-03

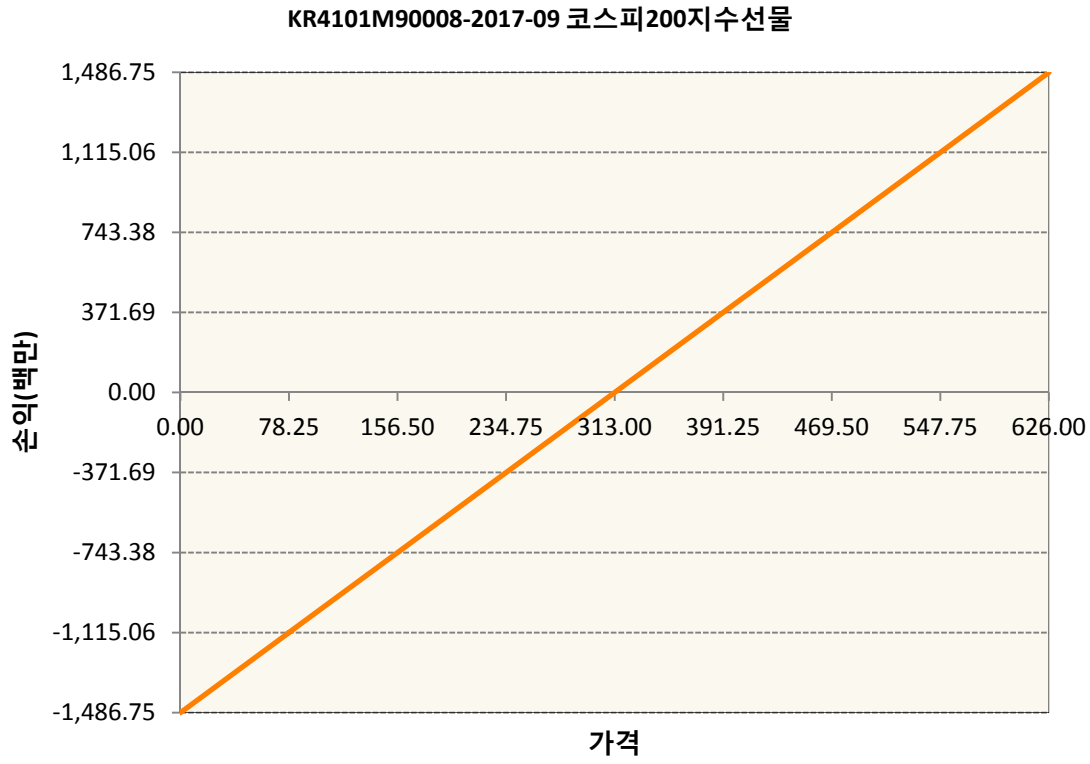
스마트인덱스모

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	1,487	0	1,487	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%	-79	-79	-79	-79	-79	-79	-79
-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%	79	79	79	79	79	79	79
8.00%	119	119	119	119	119	119	119

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

73

공시일	2017-08-04
기준일	2017-08-03

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)

474

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-08-04
기준일	2017-08-03

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)

335

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-08-04
기준일	2017-08-03

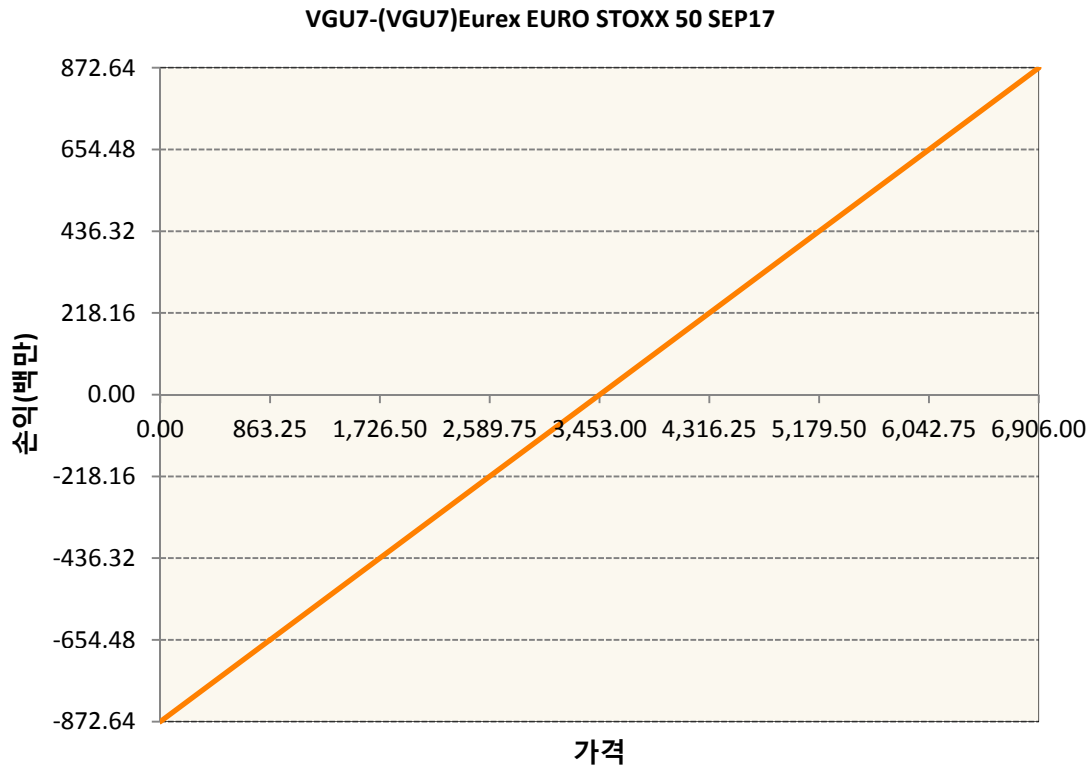
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	873	0	873	

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	2017-08-04
기준일	2017-08-03

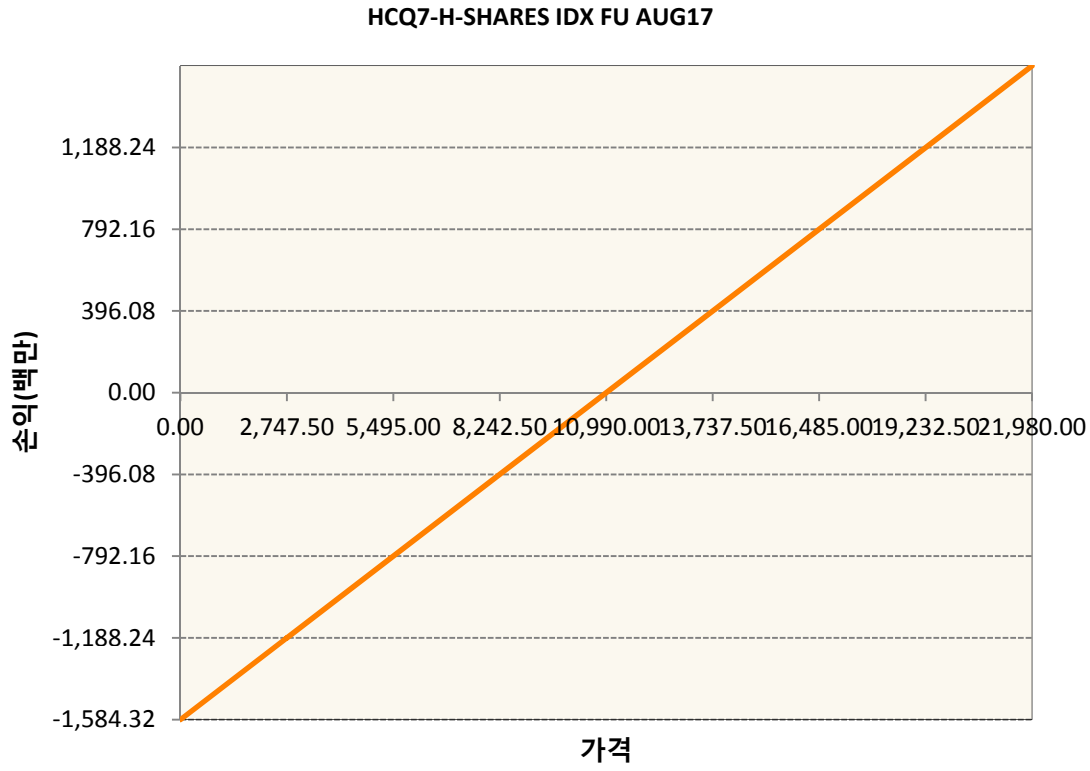
차이나인덱스모(주식-파생형)

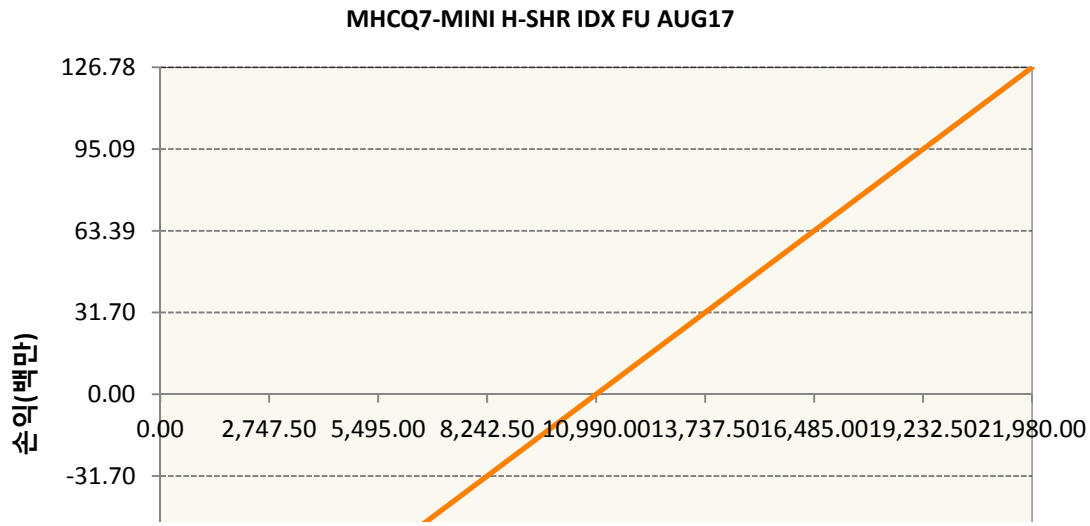
1. 계약금액

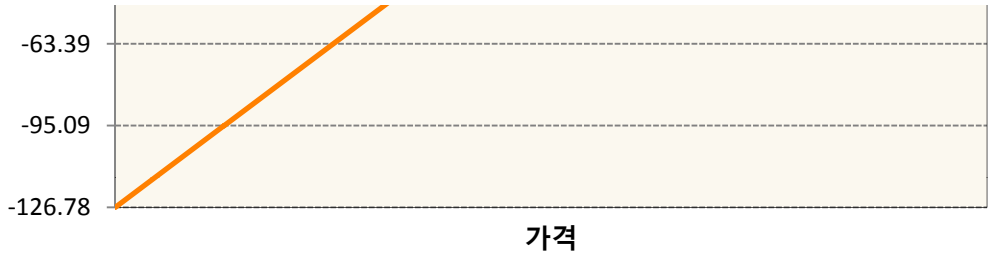
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,711	0	1,711	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCQ7	H-SHARES IDX FU AUG17	127
MHCQ7	MINI H-SHR IDX FU AUG17	10

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	121

공시일	2017-08-04
기준일	2017-08-03

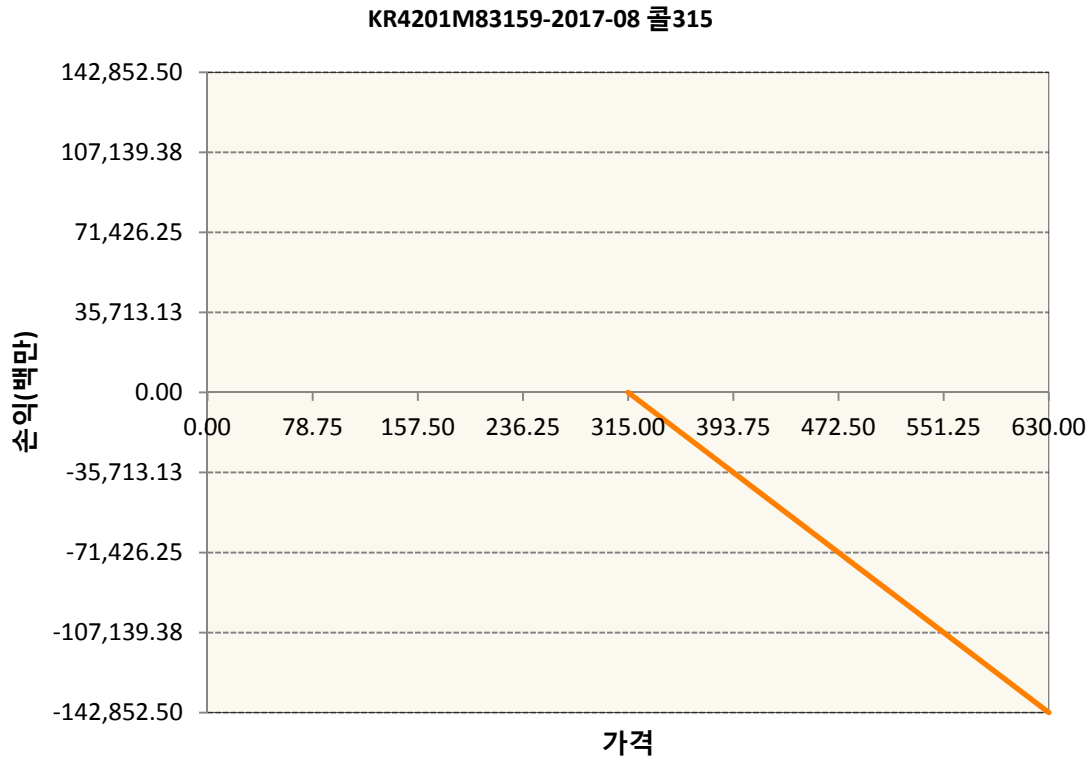
커버드콜모(주식혼합-파생형)

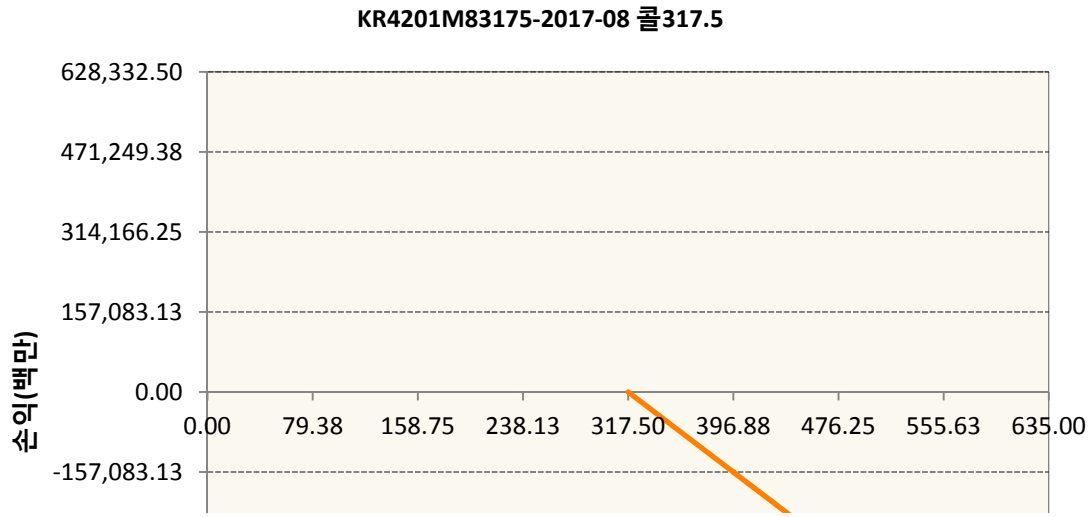
1. 계약금액

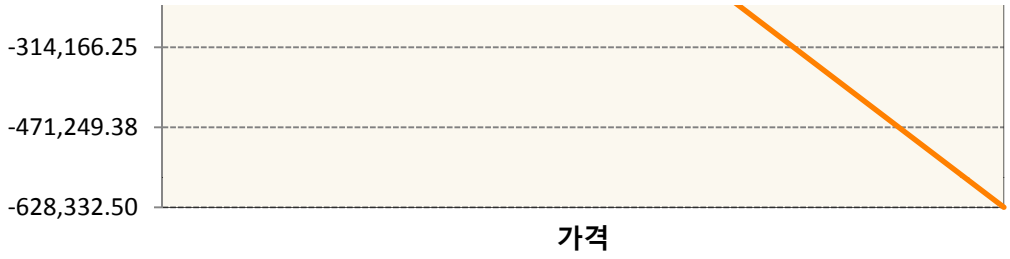
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	31,864	-31,864	장내
누계	유가증권	옵션	0	1,394,489	-1,394,489	장내

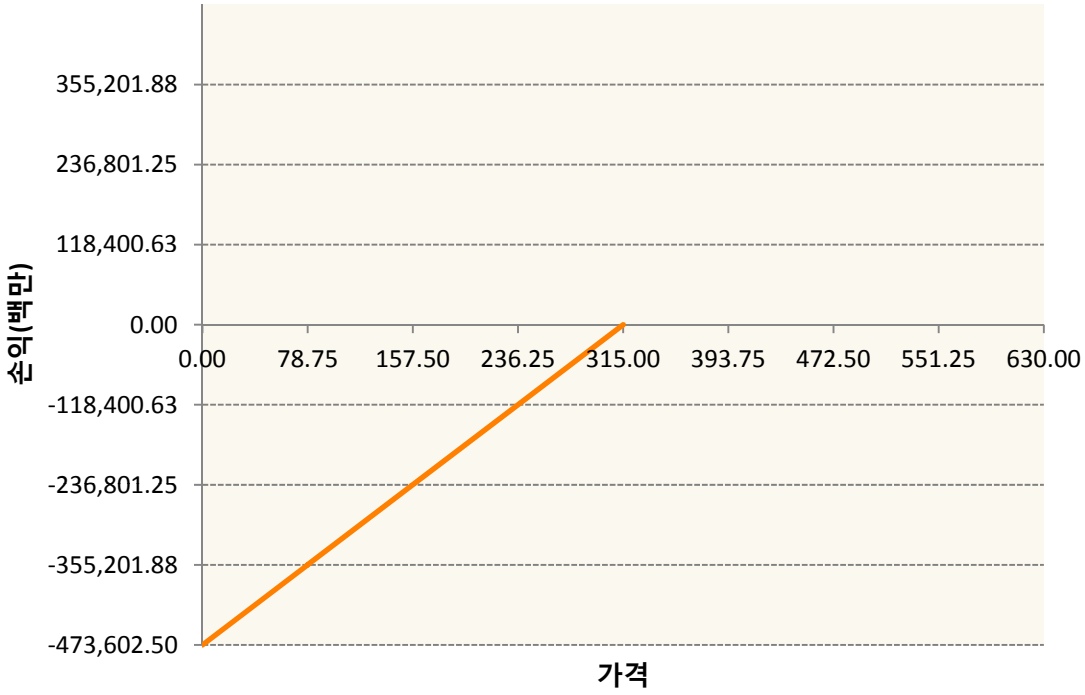
2. 만기시점의 손익구조



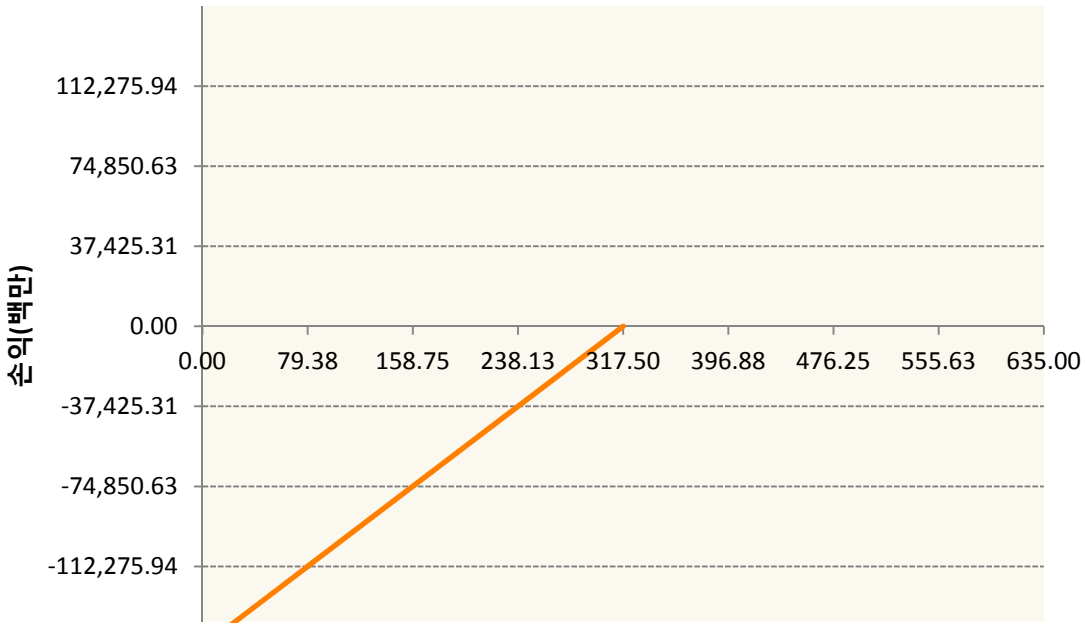




KR4301M83157-2017-08 풋315



KR4301M83173-2017-08 풋317.5





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201M83: 2017-08 콜315							8,937
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,263	1,263	1,262	1,260	1,257	1,252	1,243
-5.33%	1,259	1,252	1,241	1,224	1,200	1,169	1,131
-2.67%	1,162	1,107	1,041	965	882	791	693
0%	432	289	145	0	-146	-293	-440
2.67%	-1,744	-1,864	-1,989	-2,119	-2,252	-2,387	-2,525
5.33%	-5,105	-5,141	-5,188	-5,245	-5,311	-5,386	-5,469
8.00%	-8,834	-8,838	-8,846	-8,859	-8,878	-8,904	-8,937
KR4201M83: 2017-08 콜317.5							36,016
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	3,825	3,825	3,824	3,820	3,813	3,800	3,778
-5.33%	3,819	3,807	3,782	3,739	3,674	3,585	3,468
-2.67%	3,625	3,477	3,283	3,046	2,770	2,457	2,112
0%	1,660	1,127	572	0	-585	-1,180	-1,783
2.67%	-5,779	-6,401	-7,032	-7,670	-8,312	-8,958	-9,608
5.33%	-19,276	-19,531	-19,836	-20,184	-20,570	-20,988	-21,435
8.00%	-35,308	-35,348	-35,415	-35,513	-35,646	-35,814	-36,016
KR4301M83: 2017-08 풋315							33,430
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-33,364	-33,365	-33,367	-33,373	-33,383	-33,401	-33,430
-5.33%	-20,861	-20,882	-20,919	-20,976	-21,055	-21,158	-21,284
-2.67%	-8,665	-8,847	-9,066	-9,316	-9,594	-9,896	-10,218
0%	1,431	958	481	0	-484	-971	-1,459
2.67%	6,735	6,338	5,922	5,493	5,052	4,602	4,145
5.33%	8,110	7,991	7,836	7,647	7,426	7,177	6,903
8.00%	8,265	8,251	8,225	8,181	8,118	8,032	7,923
KR4301M83: 2017-08 풋317.5							10,876
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-10,865	-10,865	-10,865	-10,866	-10,868	-10,871	-10,876
-5.33%	-6,941	-6,944	-6,950	-6,960	-6,975	-6,997	-7,025
-2.67%	-3,062	-3,097	-3,143	-3,200	-3,266	-3,340	-3,422
0%	396	268	136	0	-139	-281	-425
2.67%	2,549	2,400	2,250	2,098	1,945	1,791	1,636

5.33%	3,258	3,197	3,125	3,042	2,950	2,850	2,744
8.00%	3,364	3,355	3,339	3,315	3,283	3,243	3,195

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

98,569

공시일	2017-08-04
기준일	2017-08-03

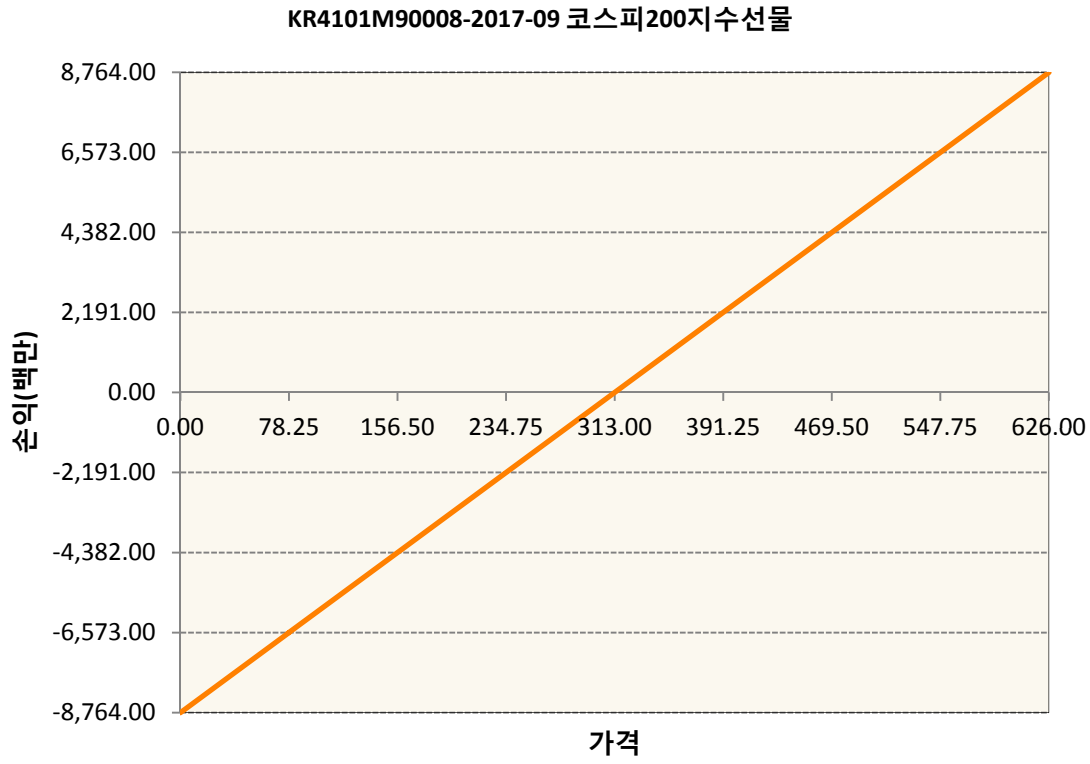
ETF스마트레버리지목표전환형6호

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	235	-235	장내
누계	유가증권	선물	8,764	0	8,764	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101M90(2017-09 코스피200지수선물							700
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-700	-700	-700	-700	-700	-700	-700
-5.33%	-466	-466	-466	-466	-466	-466	-466
-2.67%	-233	-233	-233	-233	-233	-233	-233
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	233	233	233	233	233	233	233
5.33%	466	466	466	466	466	466	466
8.00%	700	700	700	700	700	700	700

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

433

공시일	2017-08-04
기준일	2017-08-03

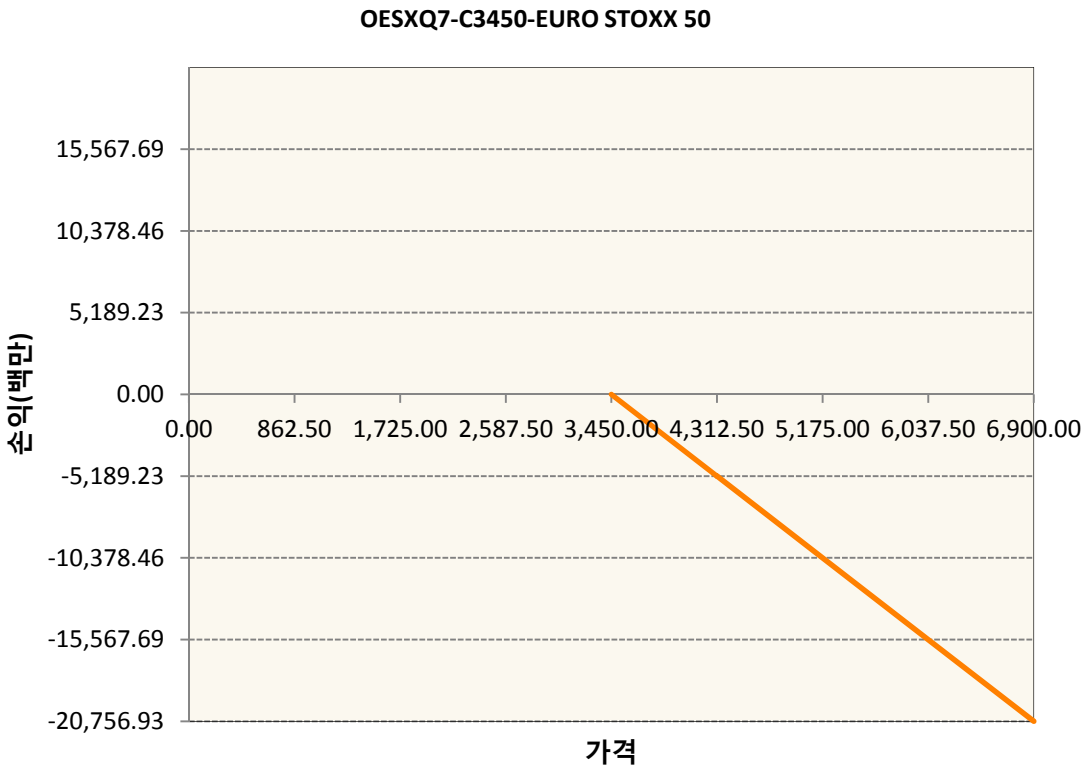
유로커버드콜(주식혼합-파생형)

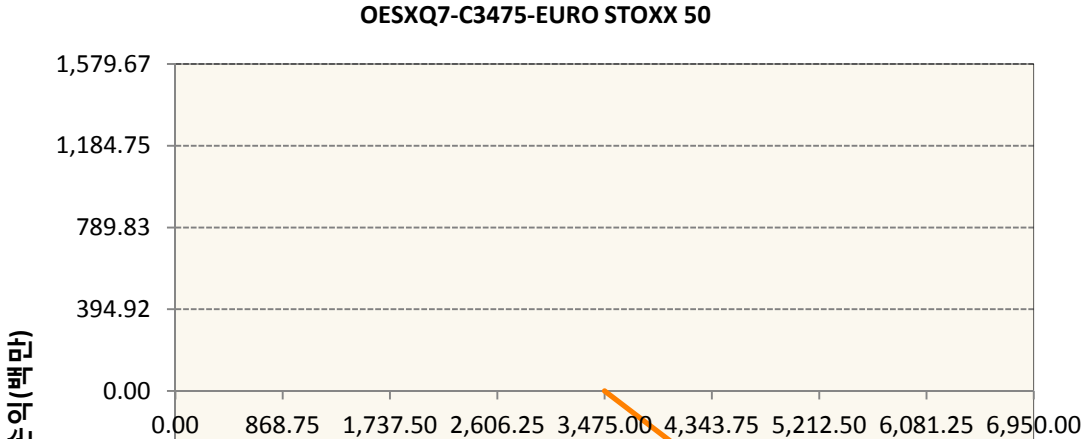
1. 계약금액

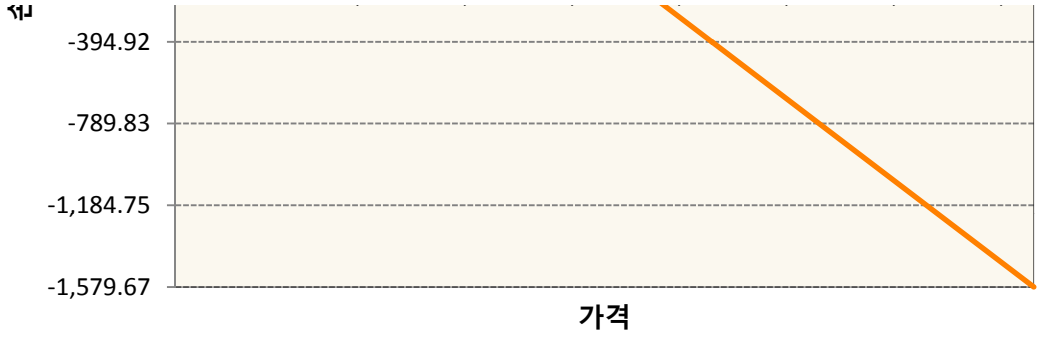
(단위:백만원)

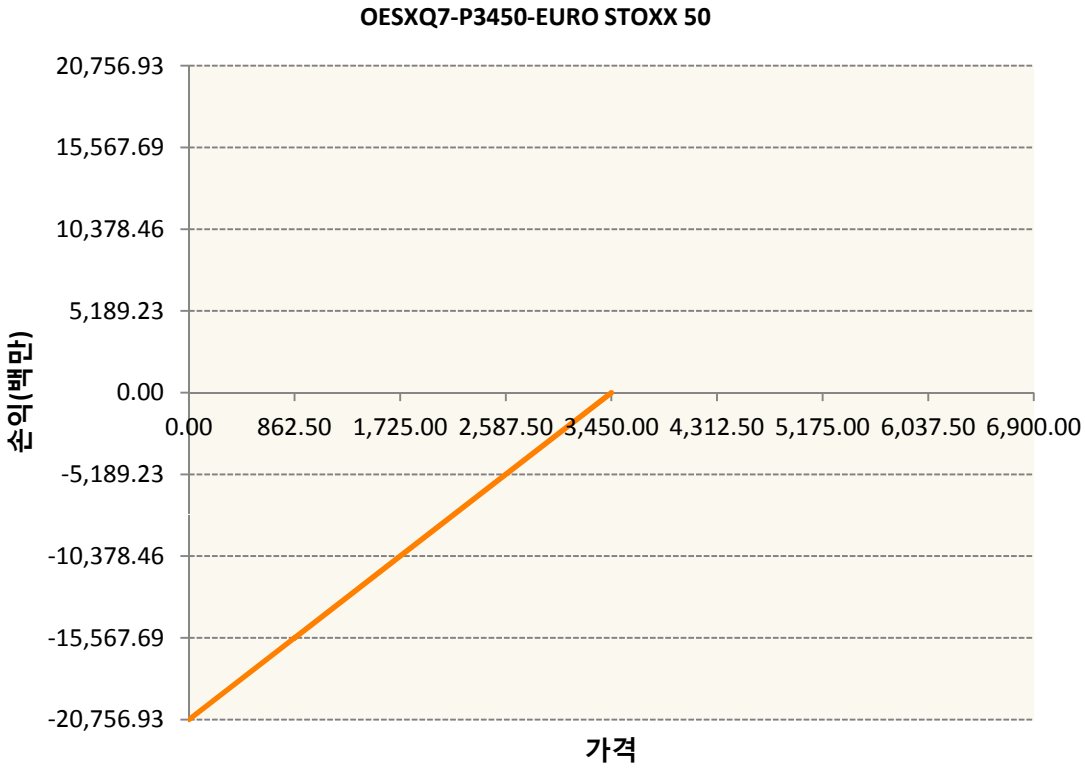
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	21,835	0	21,835	
누계	유가증권	옵션	0	44,673	-44,673	장내

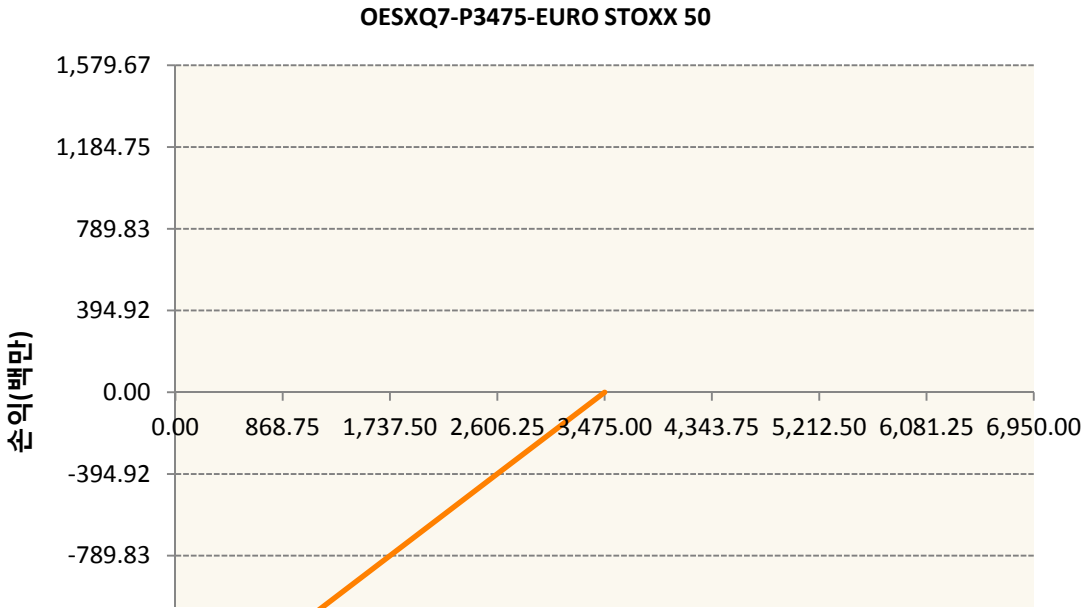
2. 만기시점의 손익구조

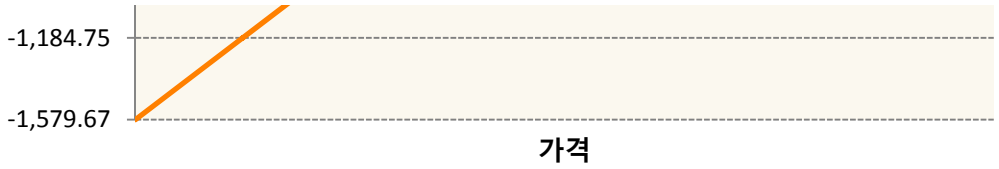


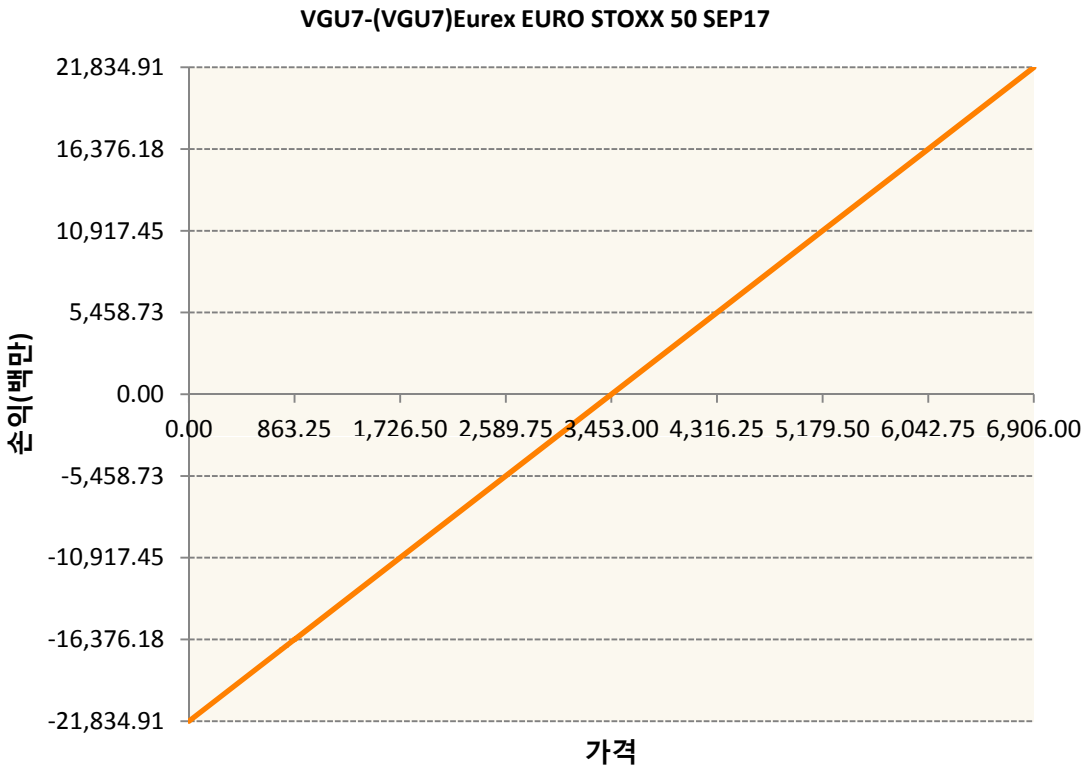



-394.92
-789.83
-1,184.75
-1,579.67
가격


OESXQ7-P3450-EURO STOXX 50
20,756.93
15,567.69
10,378.46
5,189.23
0.00
-5,189.23
-10,378.46
-15,567.69
-20,756.93
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
1,579.67
1,184.75
789.83
394.92
0.00
-394.92
-789.83
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	1,661
OESXQ7-C3	EURO STOXX 50	126
OESXQ7-P3	EURO STOXX 50	1,661
OESXQ7-P3	EURO STOXX 50	126
VGU7	(VGU7)Eurex EURO STOXX 50 SEP17	1,747

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

4,424

공시일	2017-08-04
기준일	2017-08-03

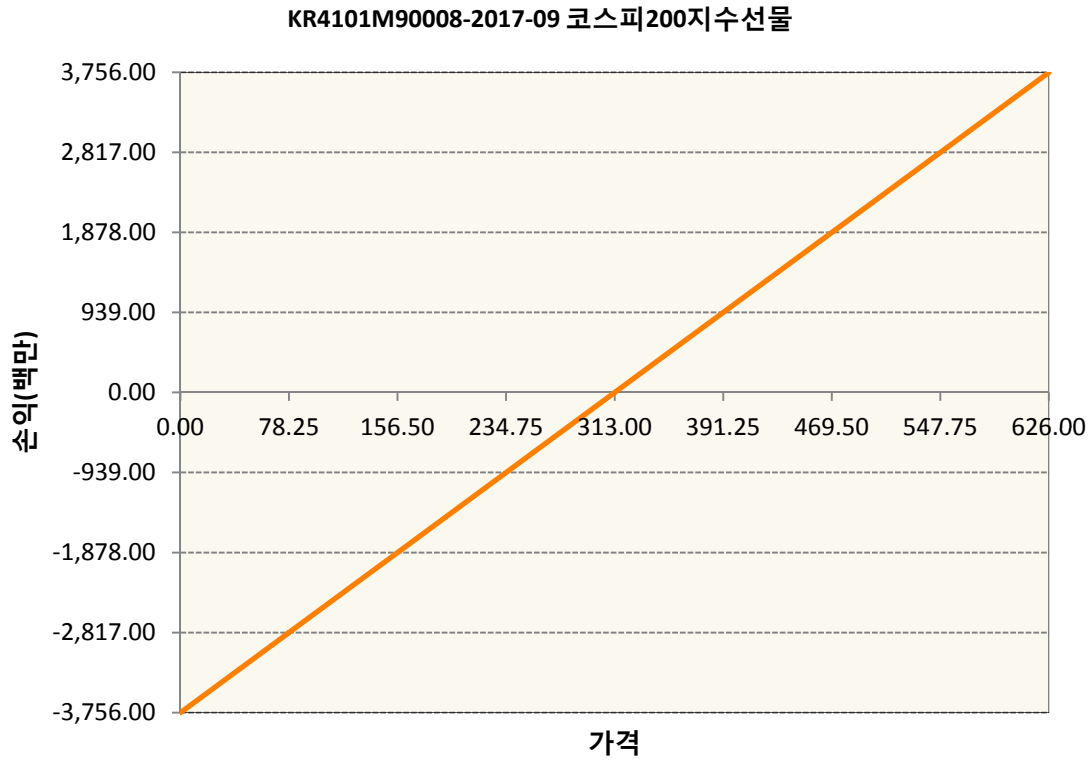
ETF스마트레버리지목표전환형7호

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	1,565	0	1,565	장내
누계	유가증권	선물	3,756	0	3,756	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101M90(2017-09 코스피200지수선물							300
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-300	-300	-300	-300	-300	-300	-300
-5.33%	-200	-200	-200	-200	-200	-200	-200
-2.67%	-100	-100	-100	-100	-100	-100	-100
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	100	100	100	100	100	100	100
5.33%	200	200	200	200	200	200	200
8.00%	300	300	300	300	300	300	300

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

185

공시일	2017-08-04
기준일	2017-08-03

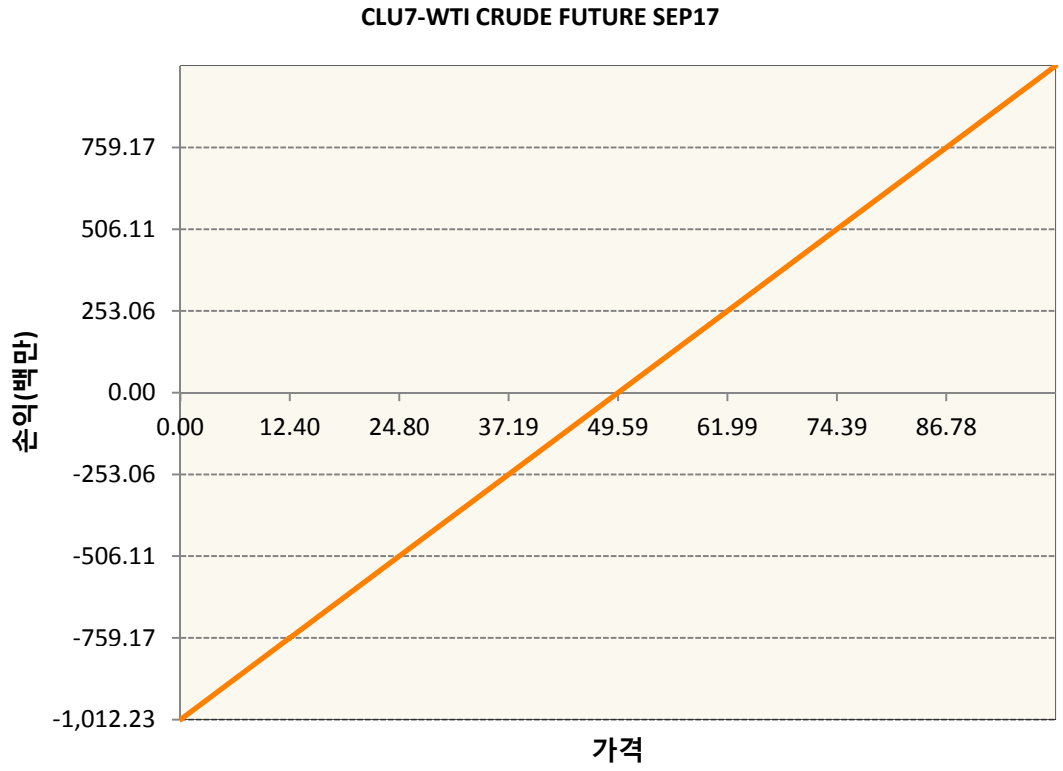
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

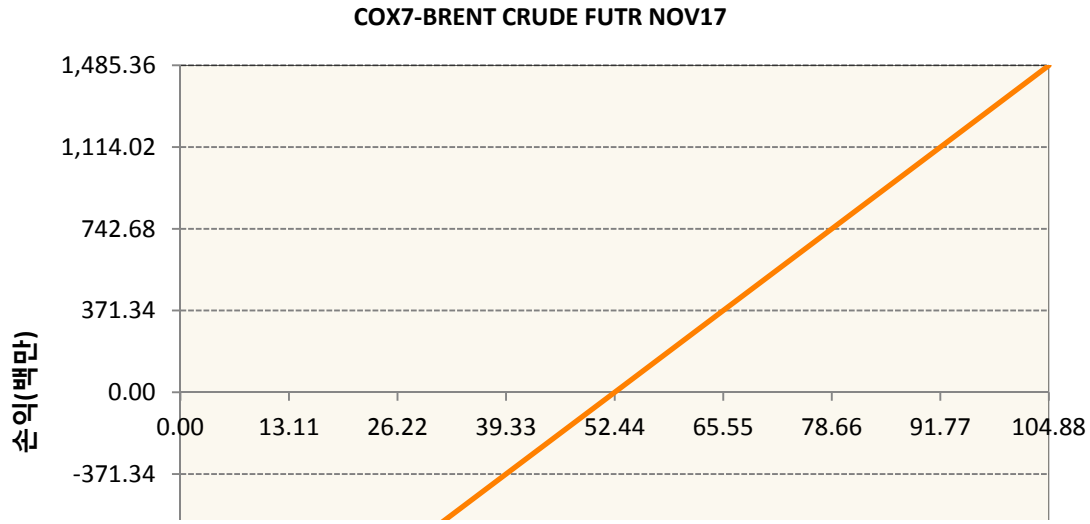
1. 계약금액

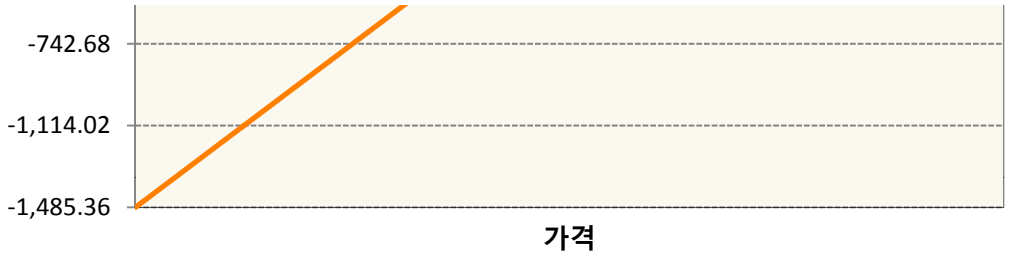
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	5,413	339	5,074	

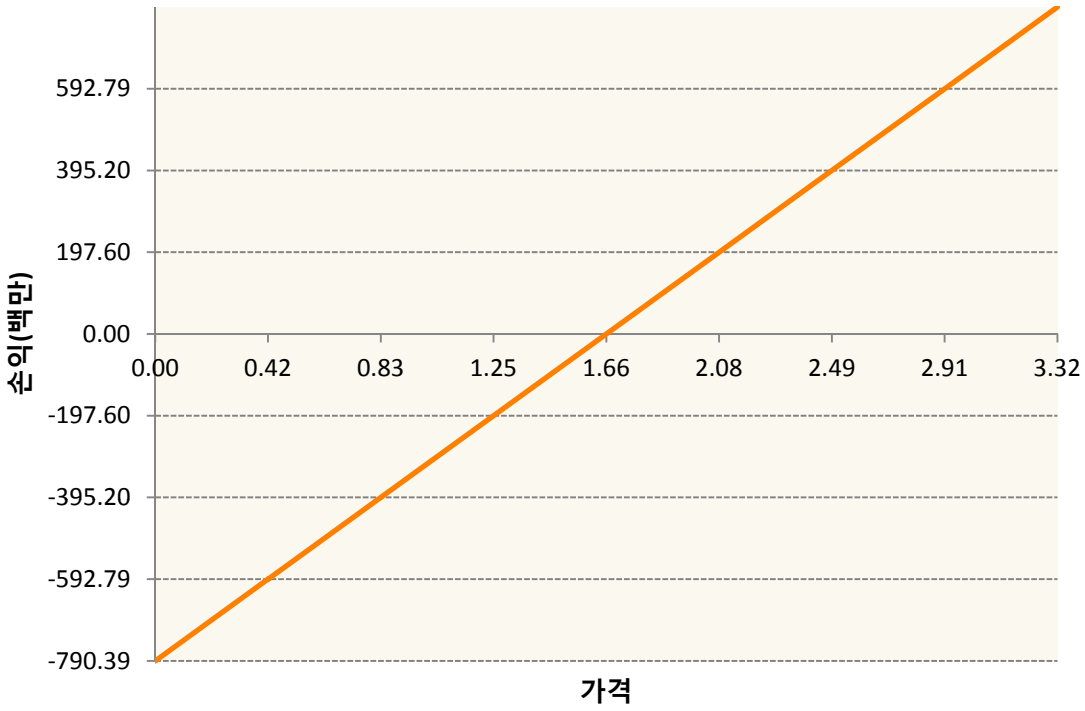
2. 만기시점의 손익구조



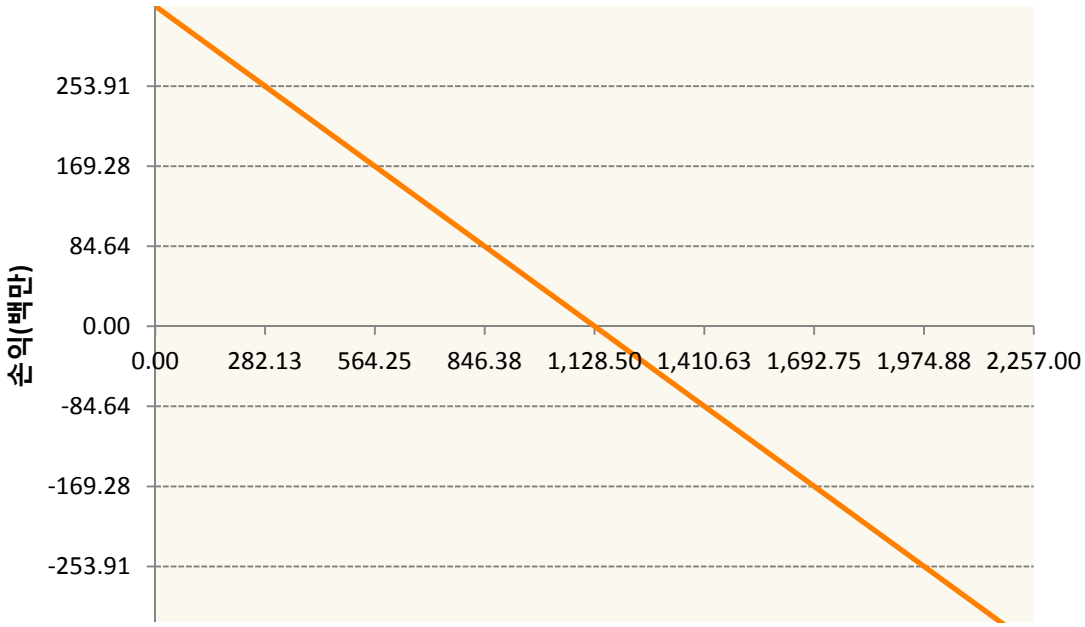


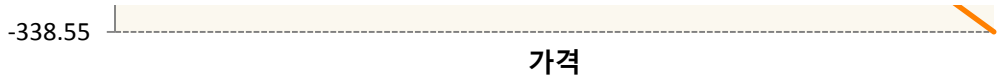


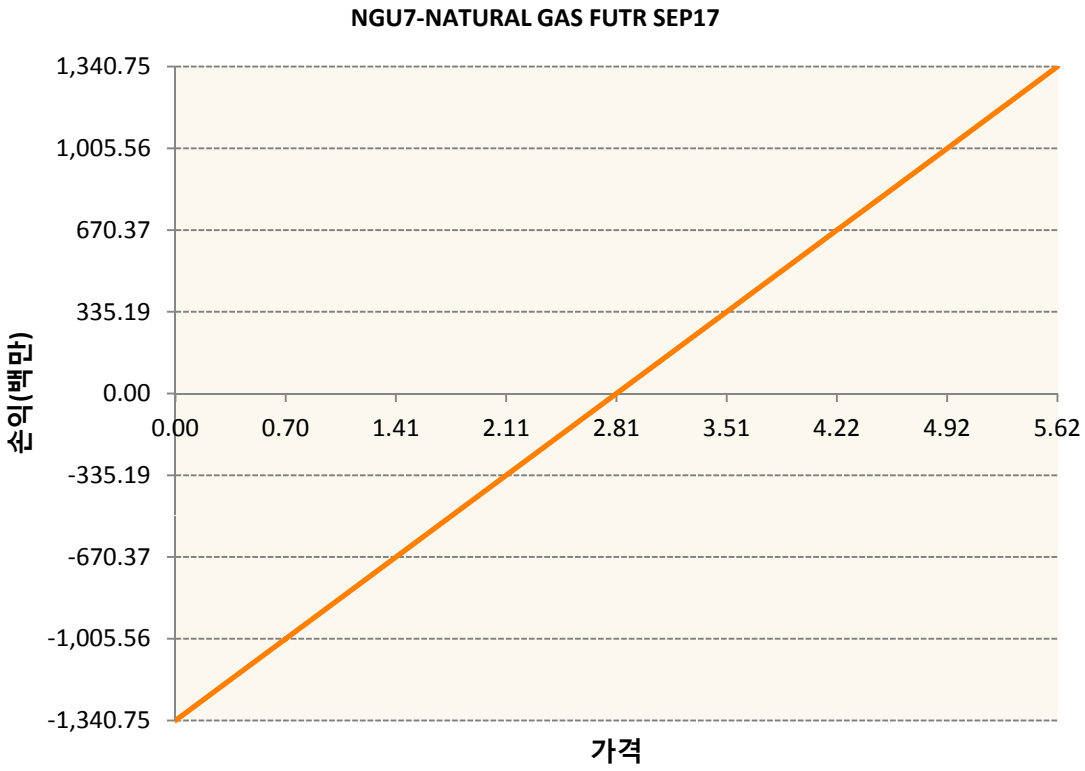
HOU7-NY HARB ULSD FUT SEP17

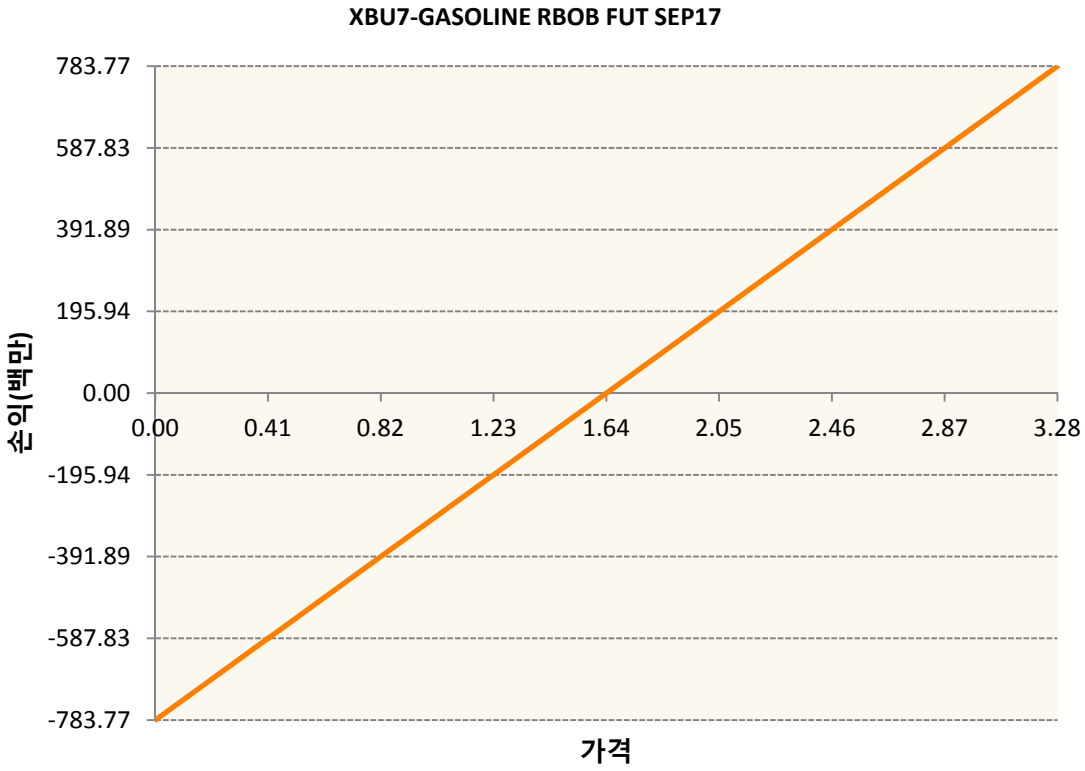


KR4175M80003-2017-08 달러선물




-338.55
가격


NGU7-NATURAL GAS FUTR SEP17
1,340.75
1,005.56
670.37
335.19
0.00
-335.19
-670.37
-1,005.56
-1,340.75
0.00
0.70
1.41
2.11
2.81
3.51
4.22
4.92
5.62
손익(백만)
가격


XBU7-GASOLINE RBOB FUT SEP17
783.77
587.83
391.89
195.94
0.00
-195.94
-391.89
-587.83
-783.77
0.00
0.41
0.82
1.23
1.64
2.05
2.46
2.87
3.28
손익(백만)
가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLU7	WTI CRUDE FUTURE SEP17	81
COX7	BRENT CRUDE FUTR NOV17	119
HOU7	NY HARB ULSD FUT SEP17	63
KR4175M80(	2017-08 달러선물	27
NGU7	NATURAL GAS FUTR SEP17	107
XBU7	GASOLINE RBOB FUT SEP17	63

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

782

공시일	2017-08-04
기준일	2017-08-03

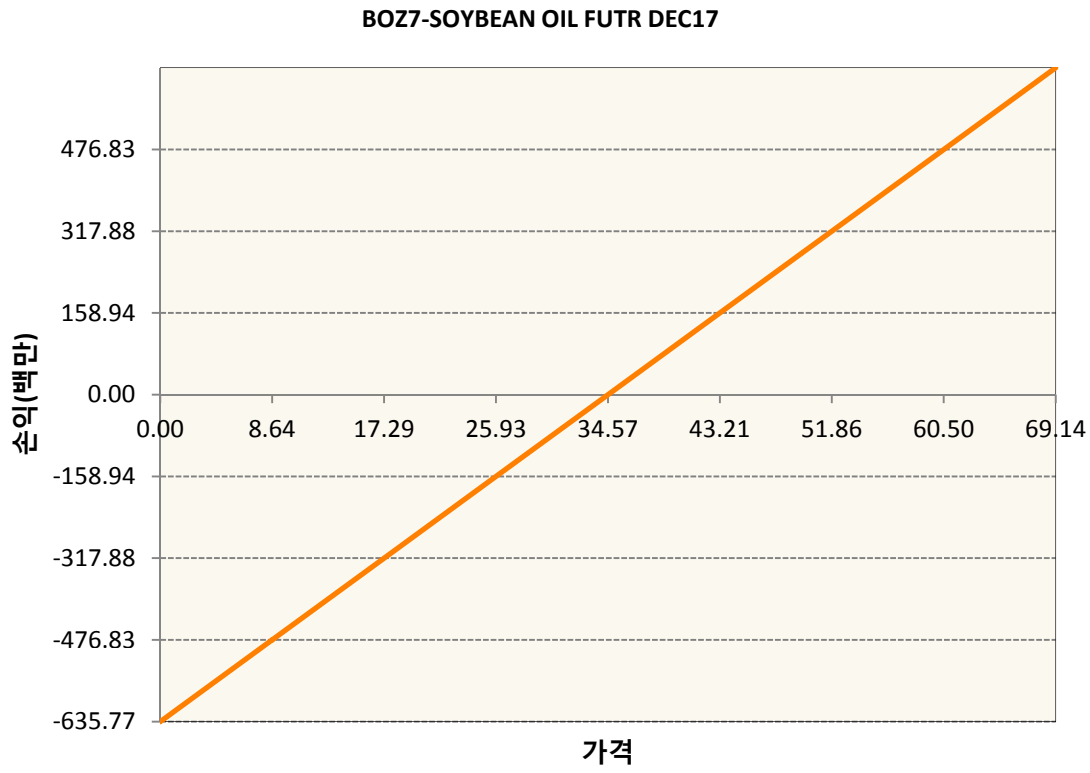
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

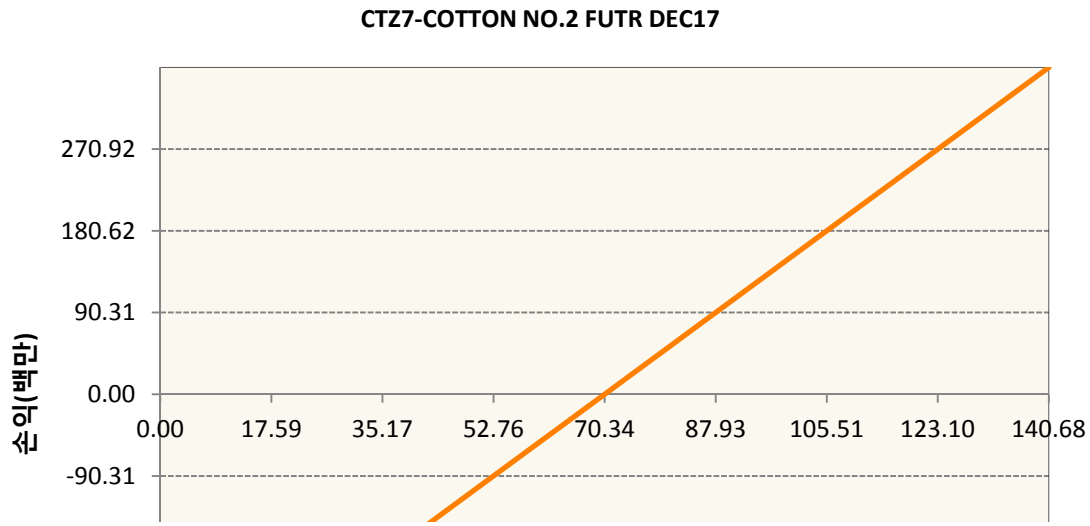
1. 계약금액

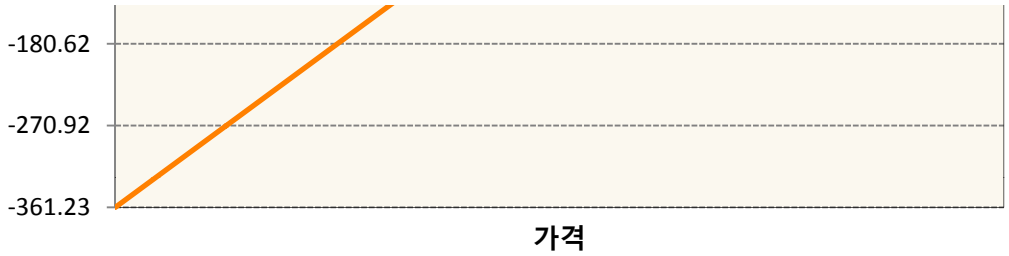
(단위:백만원)

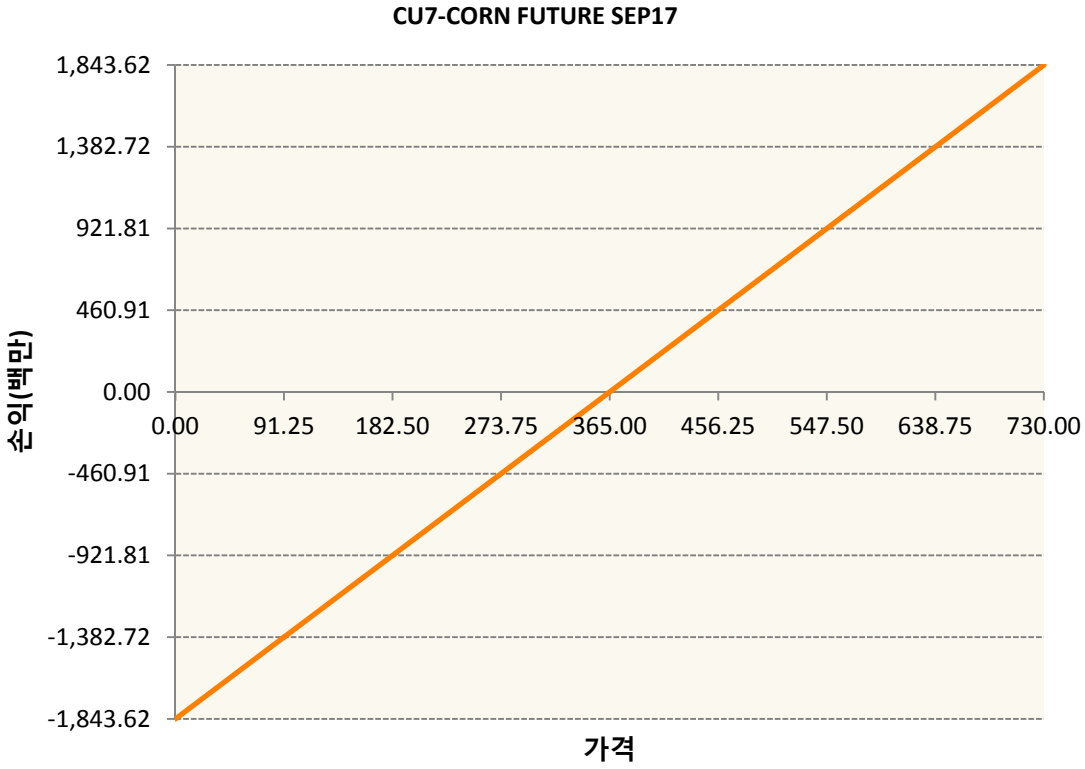
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	7,167	395	6,772	

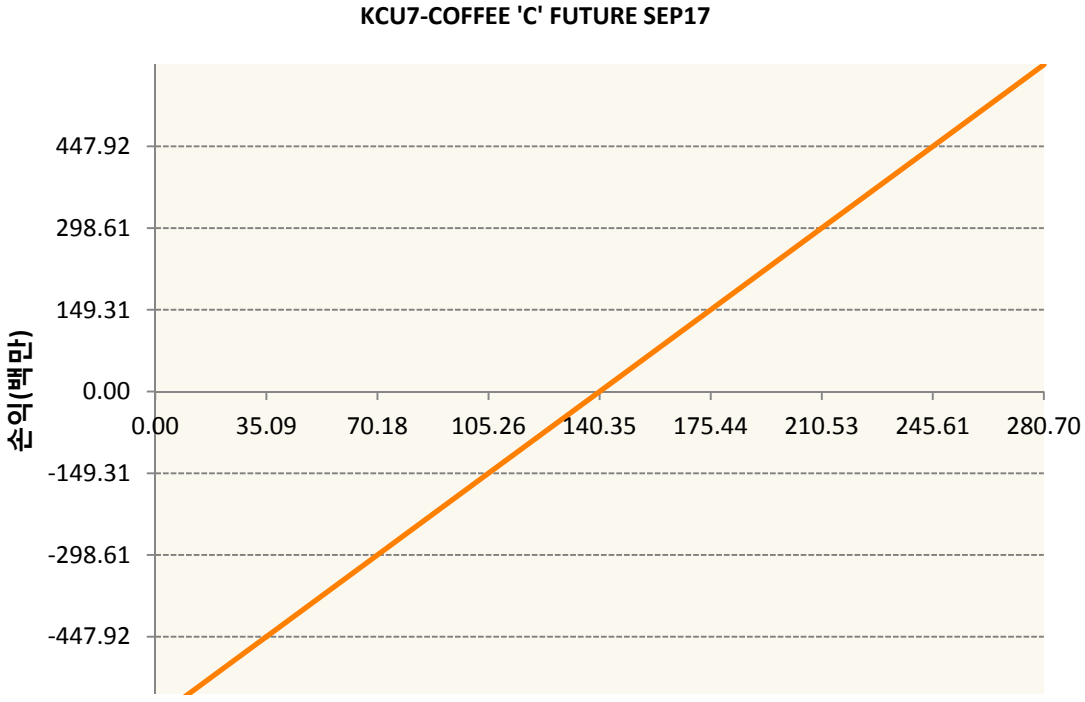
2. 만기시점의 손익구조

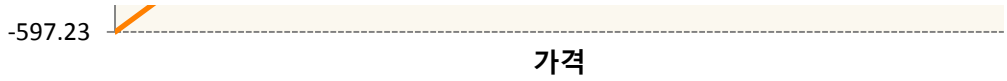


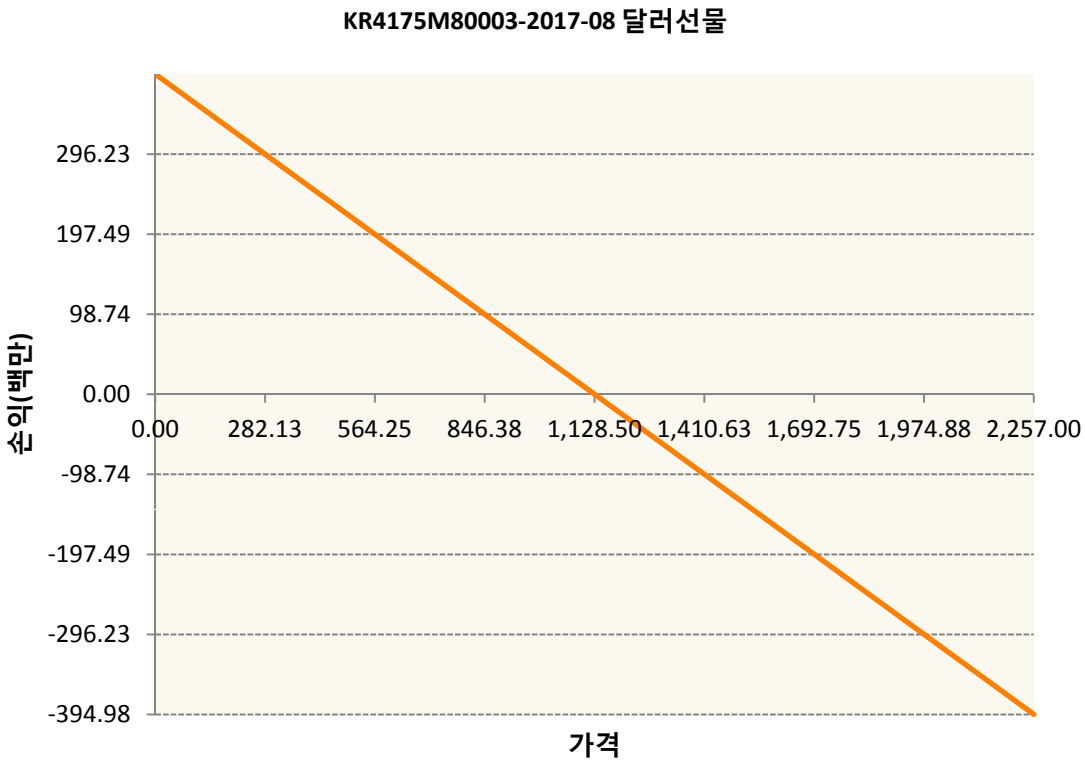


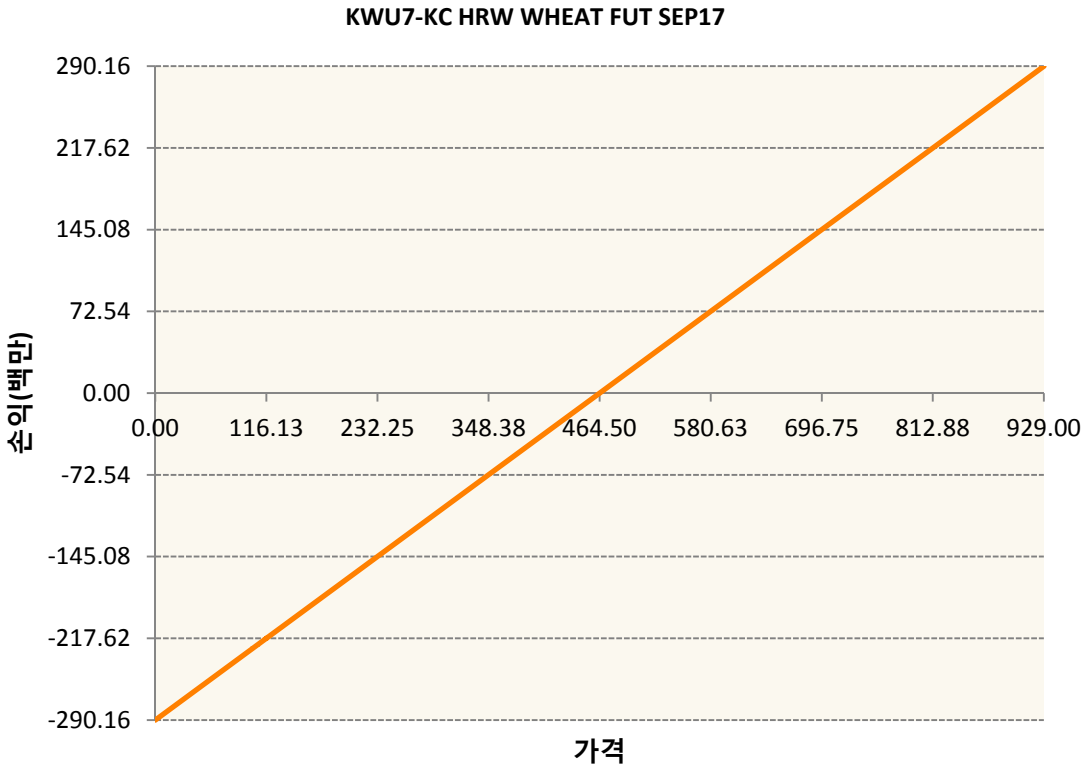

-180.62
-270.92
-361.23
가격

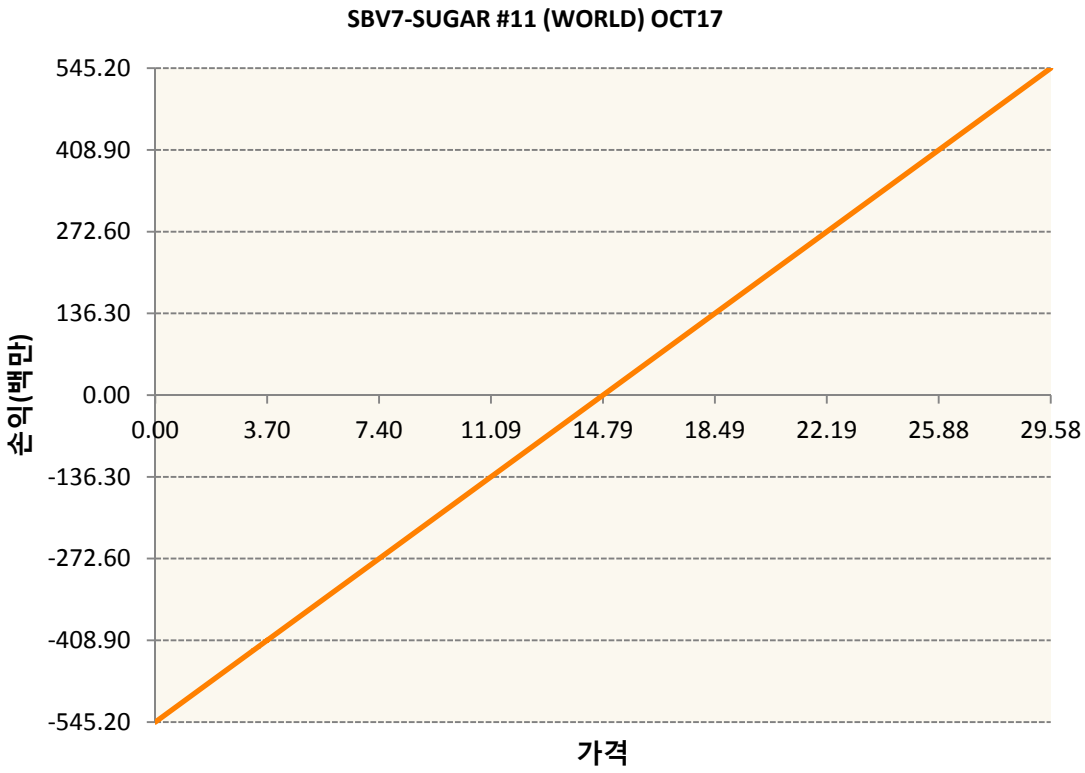

CU7-CORN FUTURE SEP17
1,843.62
1,382.72
921.81
460.91
0.00
-460.91
-921.81
-1,382.72
-1,843.62
0.00
91.25
182.50
273.75
365.00
456.25
547.50
638.75
730.00
손익(백만)
가격

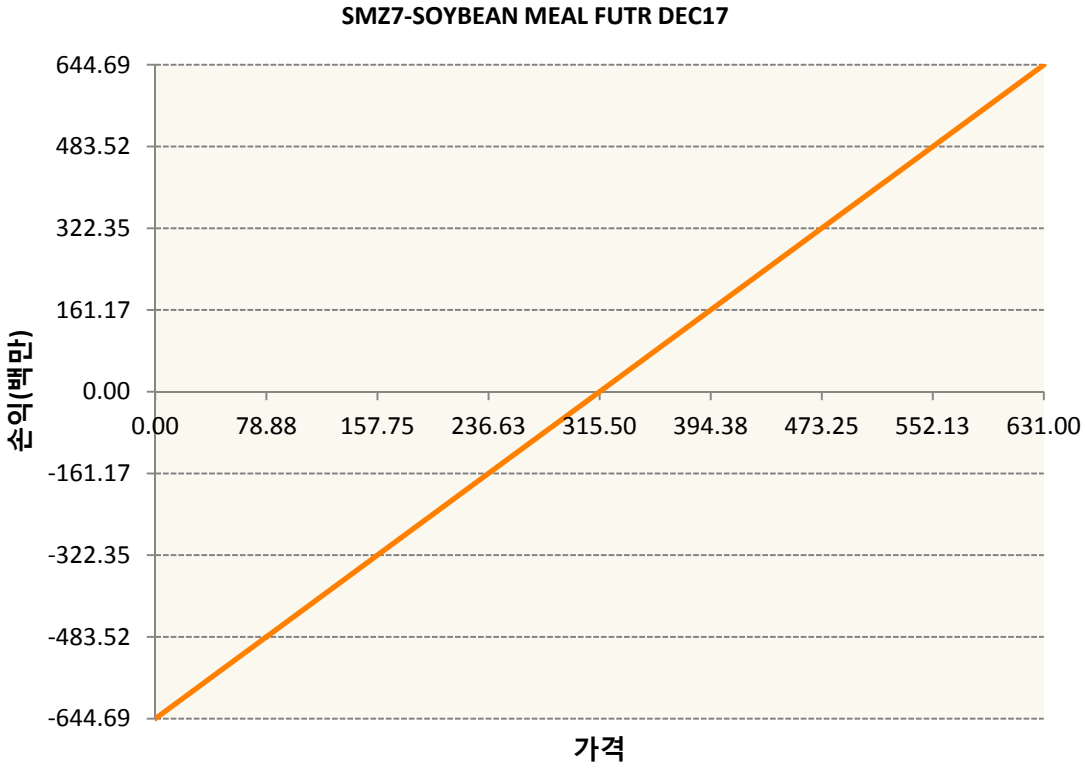

KCU7-COFFEE 'C' FUTURE SEP17
447.92
298.61
149.31
0.00
-149.31
-298.61
-447.92
0.00
35.09
70.18
105.26
140.35
175.44
210.53
245.61
280.70
손익(백만)

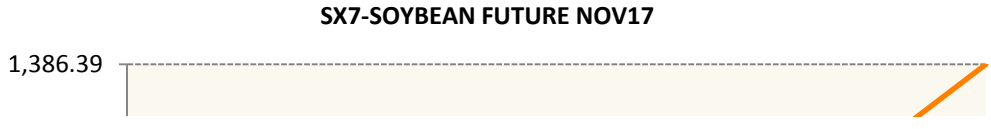

-597.23
가격

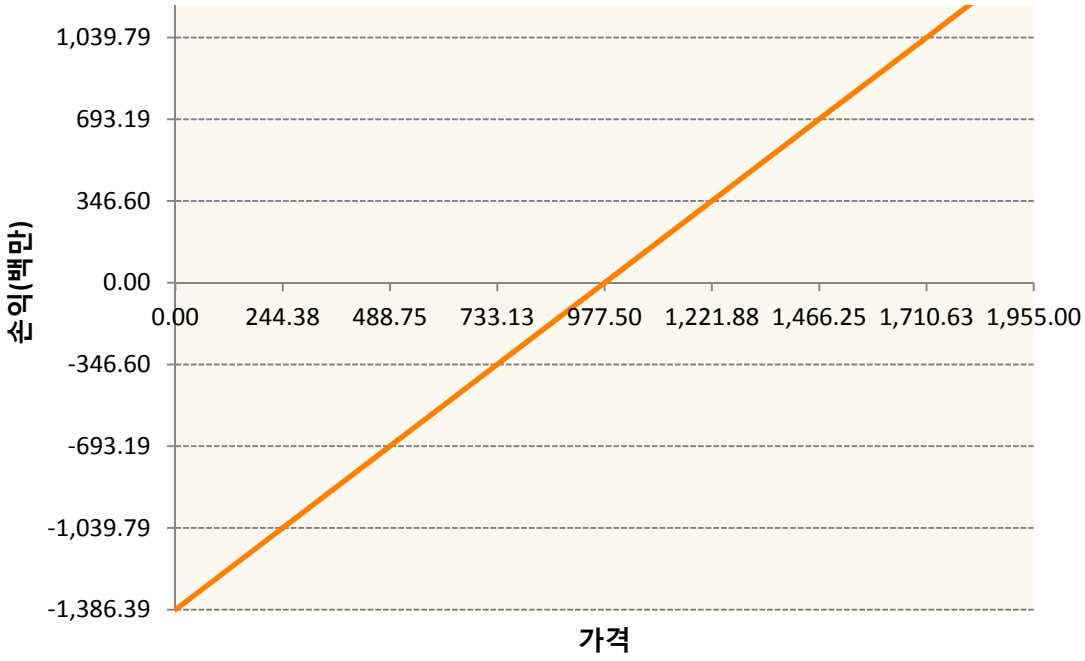

KR4175M80003-2017-08 달러선물
296.23
197.49
98.74
0.00
-98.74
-197.49
-296.23
-394.98
0.00
282.13
564.25
846.38
1,128.50
1,410.63
1,692.75
1,974.88
2,257.00
손익(백만)
가격

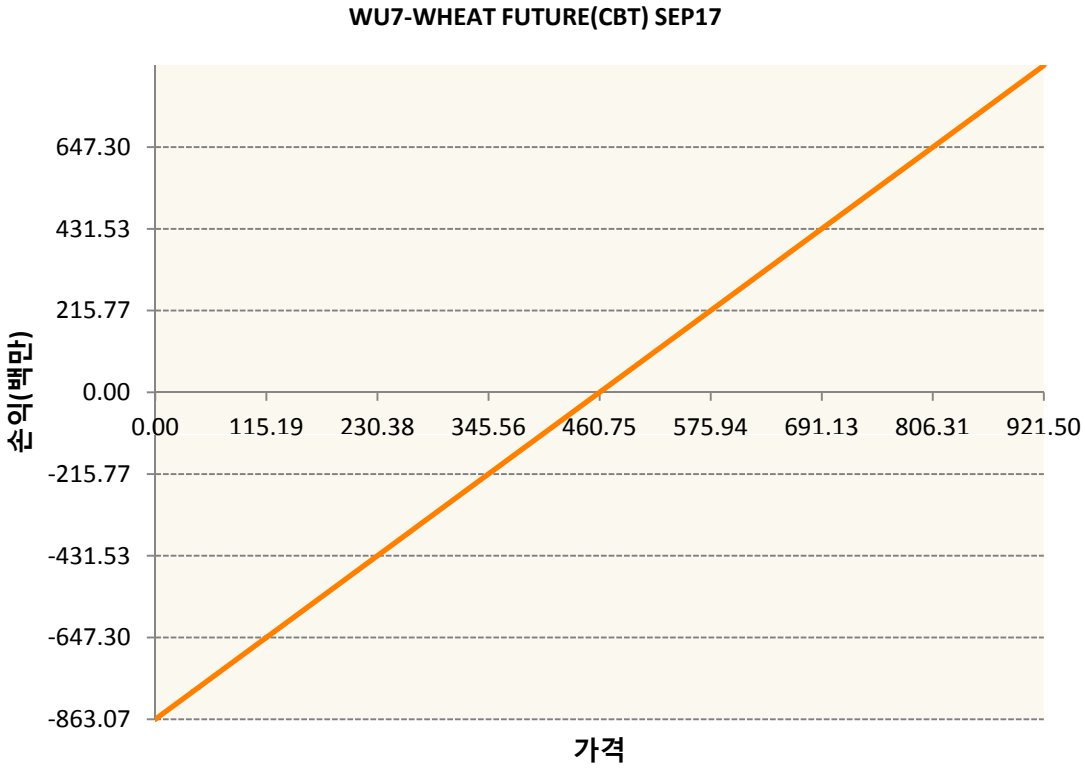

KWU7-KC HRW WHEAT FUT SEP17
290.16
217.62
145.08
72.54
0.00
-72.54
-145.08
-217.62
-290.16
0.00
116.13
232.25
348.38
464.50
580.63
696.75
812.88
929.00
손익(백만)
가격


SBV7-SUGAR #11 (WORLD) OCT17
545.20
408.90
272.60
136.30
0.00
-136.30
-272.60
-408.90
-545.20
0.00
3.70
7.40
11.09
14.79
18.49
22.19
25.88
29.58
손익(백만)
가격


SMZ7-SOYBEAN MEAL FUTR DEC17
644.69
483.52
322.35
161.17
0.00
-161.17
-322.35
-483.52
-644.69
0.00
78.88
157.75
236.63
315.50
394.38
473.25
552.13
631.00
손익(백만)
가격


SX7-SOYBEAN FUTURE NOV17
1,386.39





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
BOZ7	SOYBEAN OIL FUTR DEC17	51
CTZ7	COTTON NO.2 FUTR DEC17	29
CU7	CORN FUTURE SEP17	147
KCU7	COFFEE 'C' FUTURE SEP17	48
KR4175M80(	2017-08 달러선물	32

KWU7	KC HRW WHEAT FUT SEP17	23
SBV7	SUGAR #11 (WORLD) OCT17	44
SMZ7	SOYBEAN MEAL FUTR DEC17	52
SX7	SOYBEAN FUTURE NOV17	111
WU7	WHEAT FUTURE(CBT) SEP17	69

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

674