공시일	2017-08-07
기준일	2017-08-04

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	2017-08-07
기준일	2017-08-04

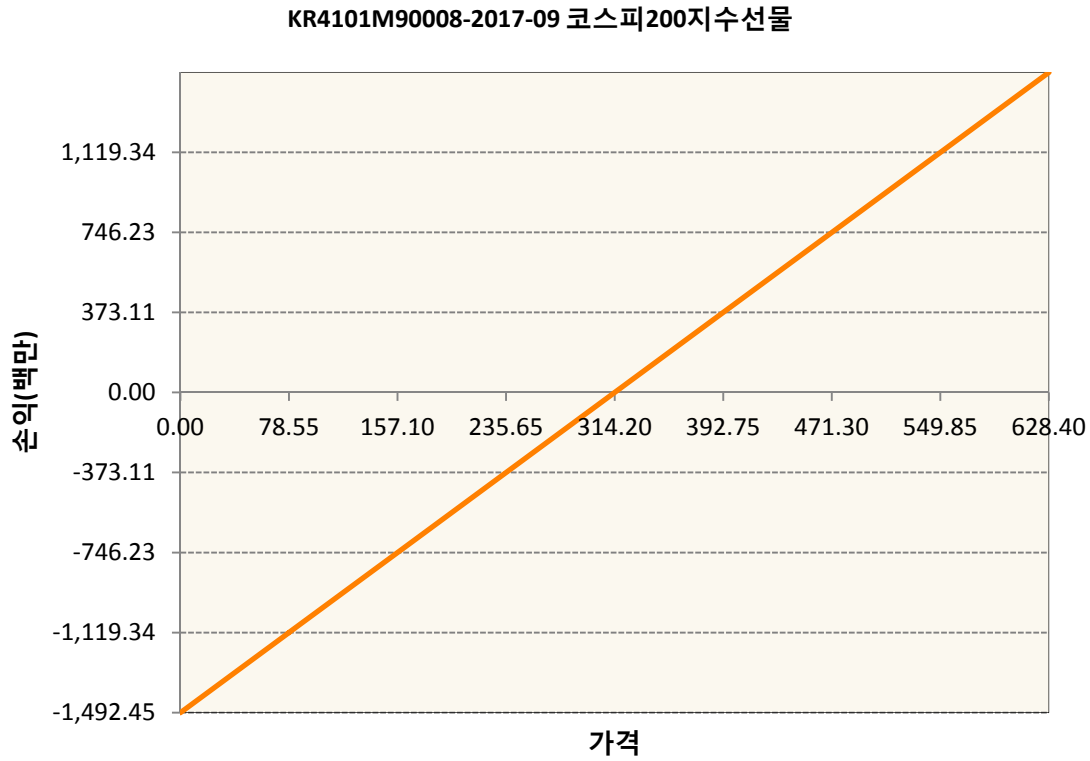
스마트인덱스모

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	1,492	0	1,492	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	2017-08-07
기준일	2017-08-04

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)

473

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-08-07
기준일	2017-08-04

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	390

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

333

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-08-07
기준일	2017-08-04

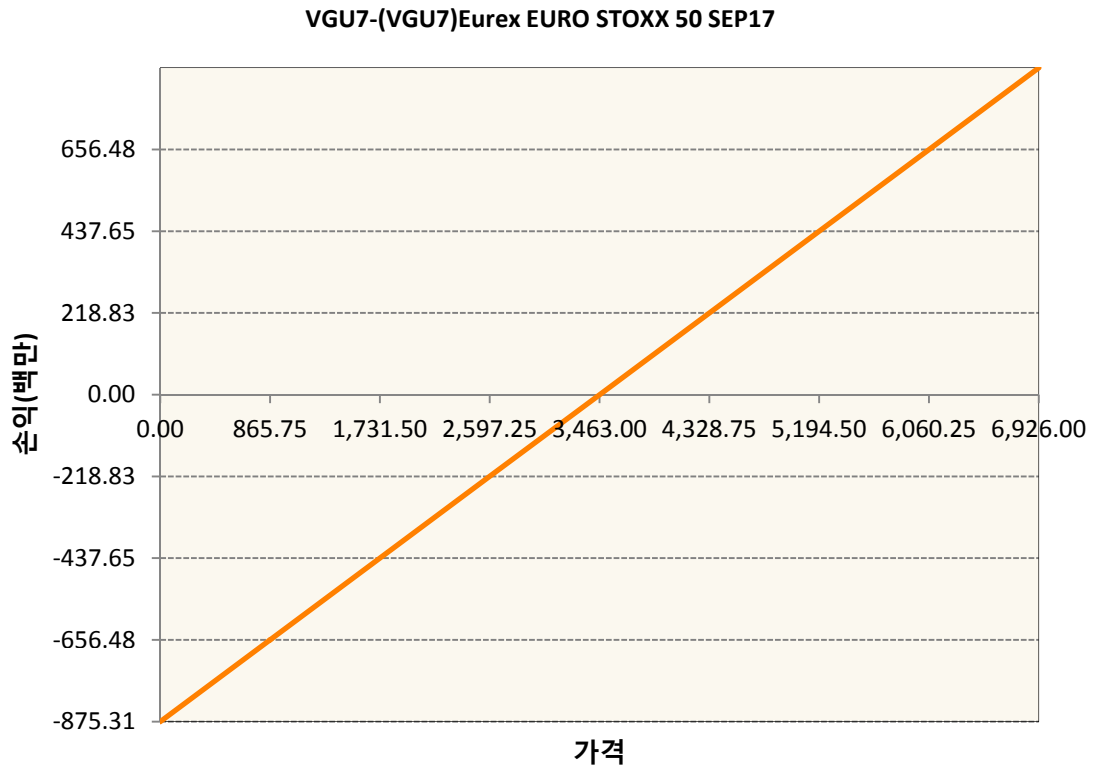
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	875	0	875	

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	2017-08-07
기준일	2017-08-04

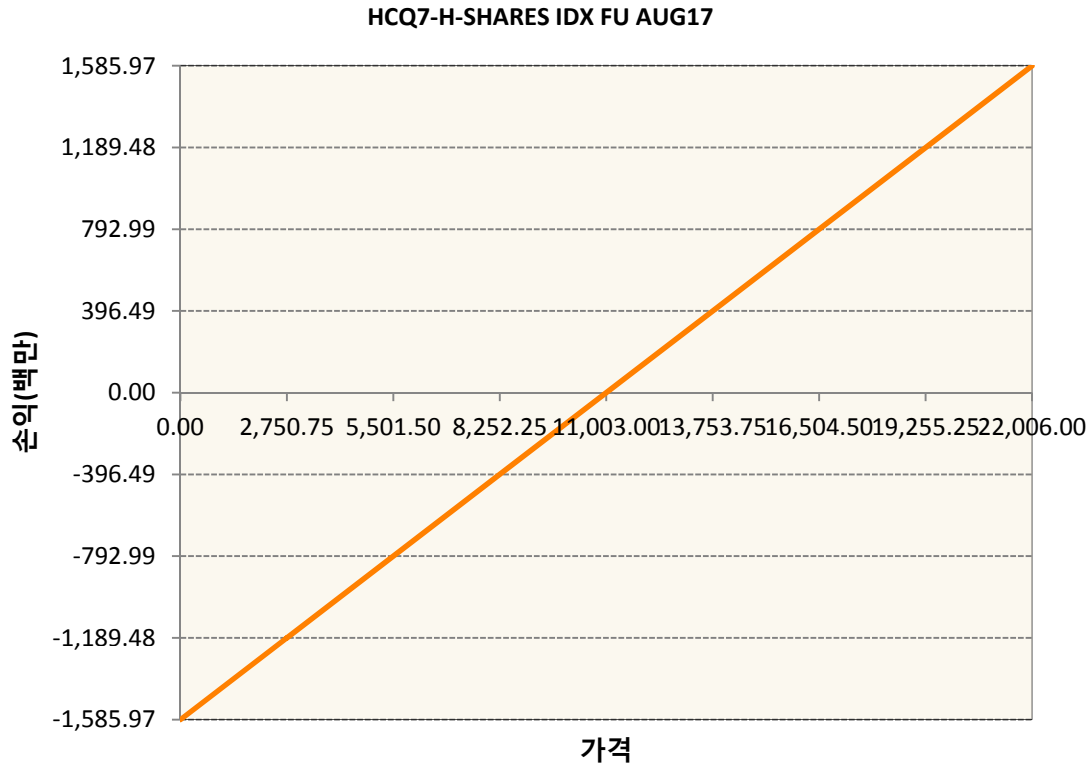
차이나인덱스모(주식-파생형)

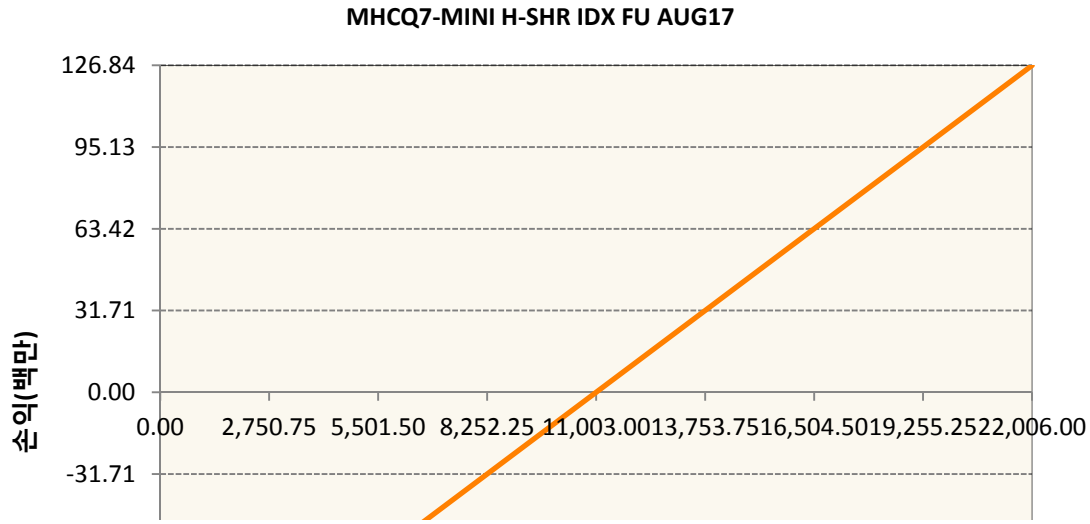
1. 계약금액

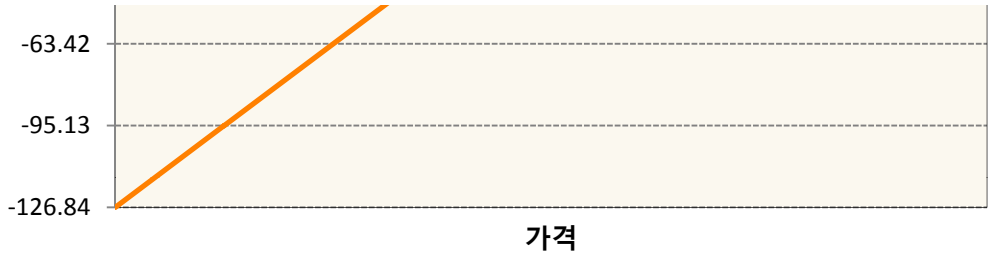
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,713	0	1,713	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	2017-08-07
기준일	2017-08-04

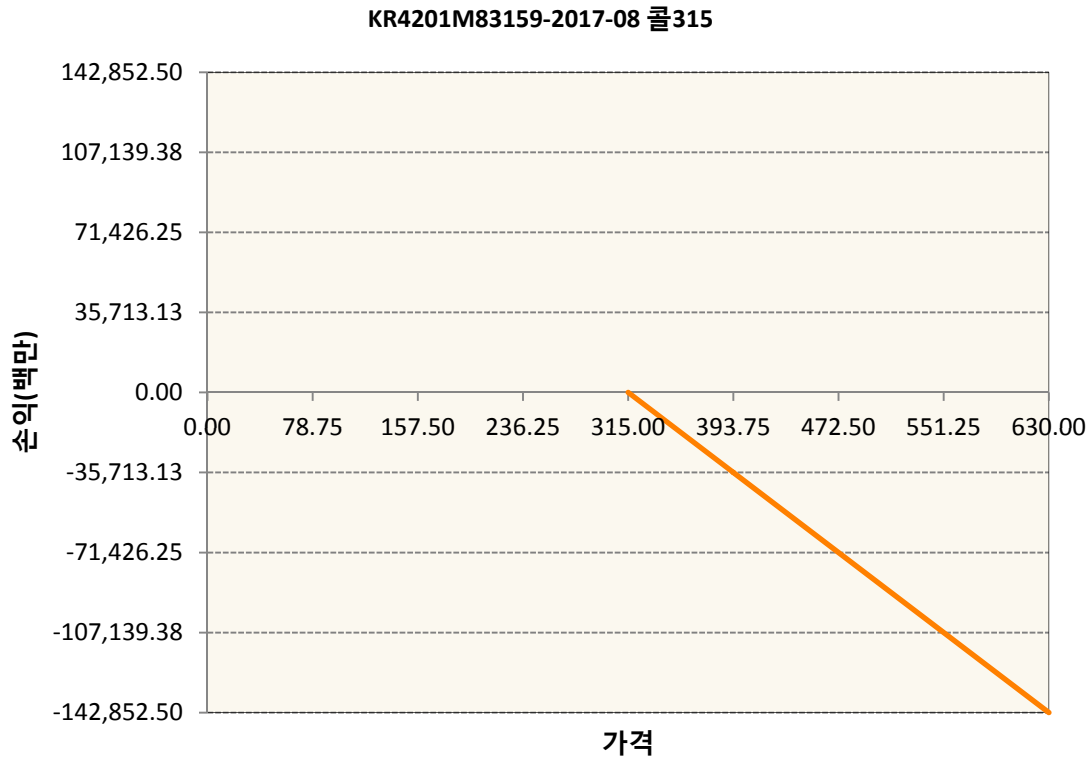
커버드콜모(주식혼합-파생형)

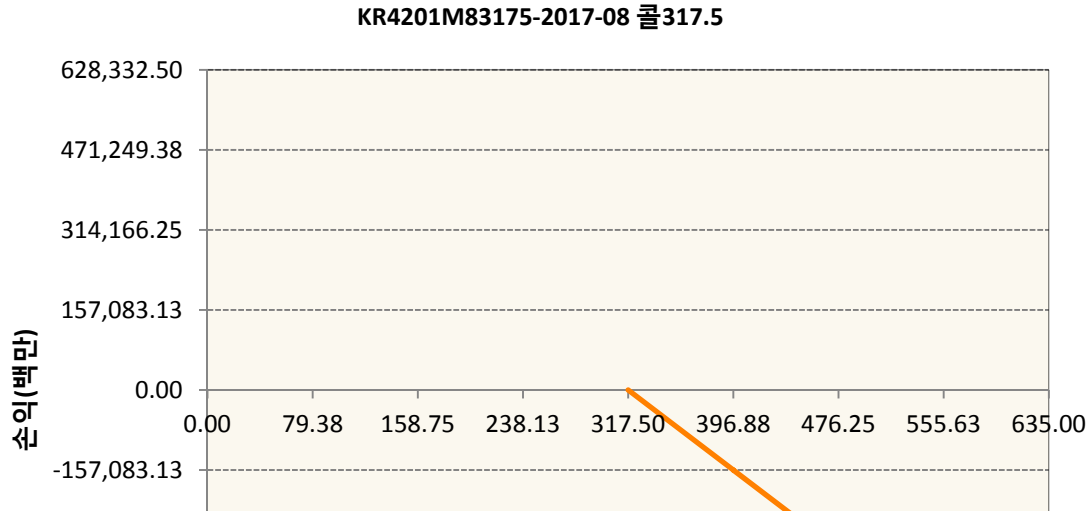
1. 계약금액

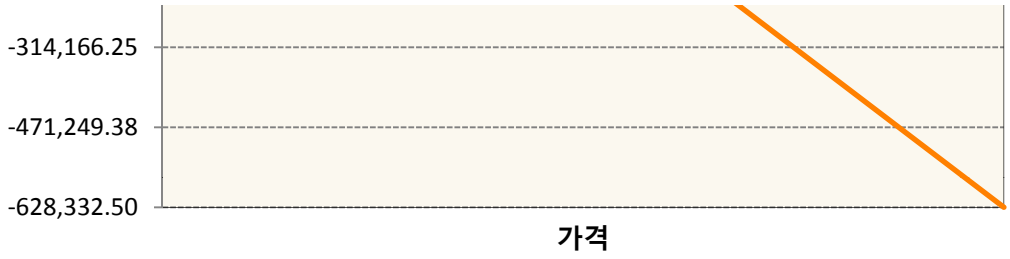
(단위:백만원)

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

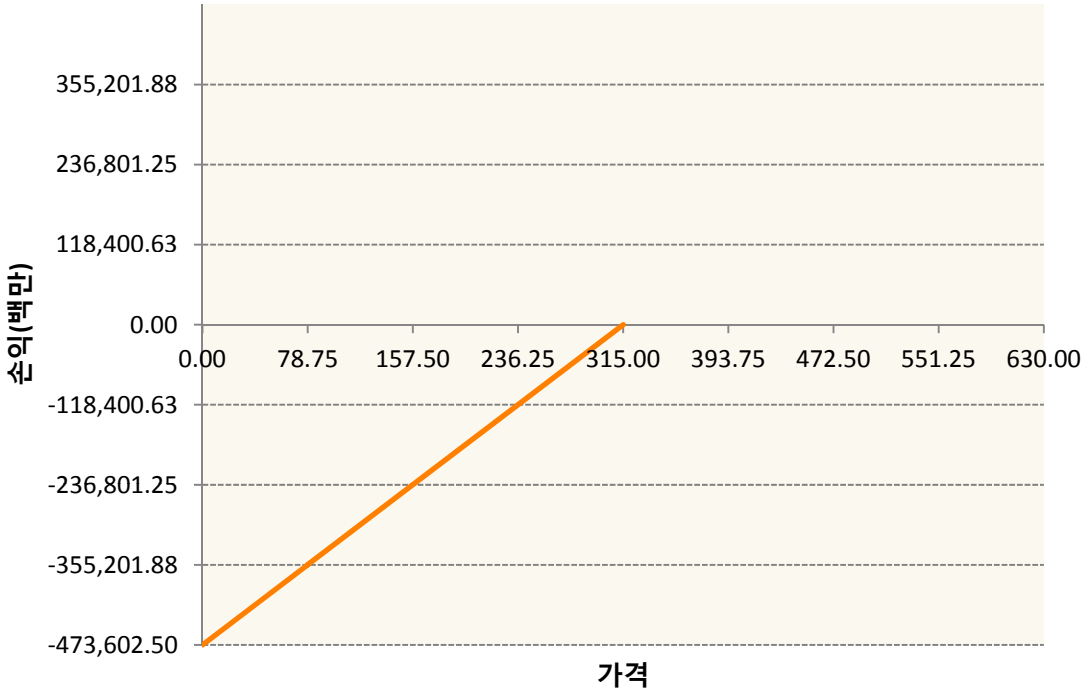
2. 만기시점의 손익구조



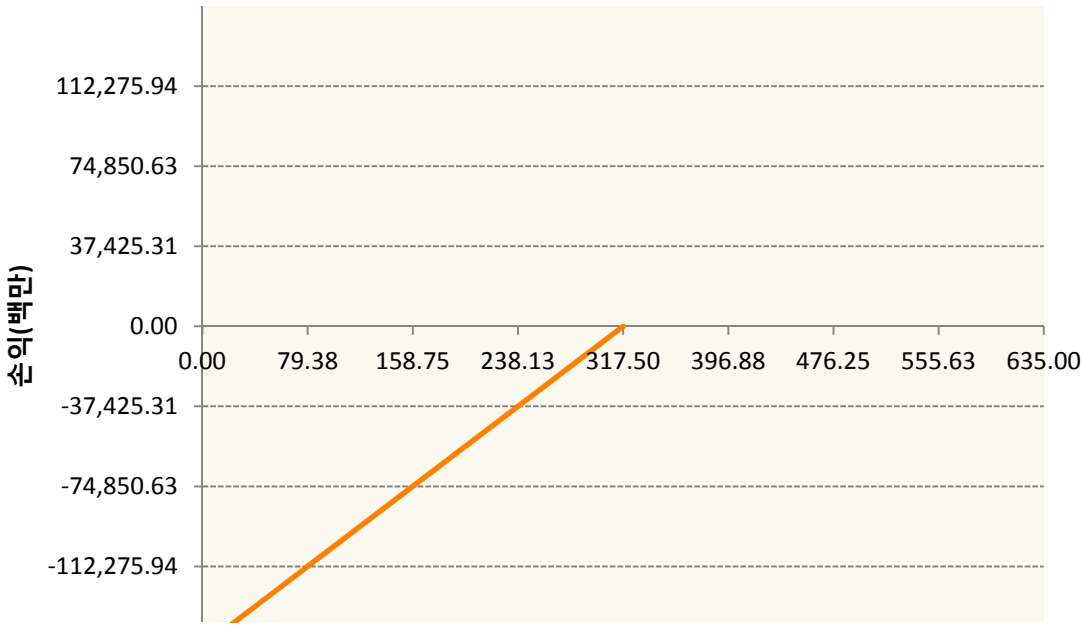




KR4301M83157-2017-08 풋315



KR4301M83173-2017-08 풋317.5





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201M83: 2017-08 콜315							9,389
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,328	1,328	1,328	1,327	1,325	1,322	1,316
-5.33%	1,326	1,321	1,312	1,299	1,279	1,254	1,222
-2.67%	1,231	1,178	1,117	1,046	968	883	793
0%	406	271	136	0	-136	-273	-409
2.67%	-2,034	-2,124	-2,223	-2,327	-2,436	-2,549	-2,665
5.33%	-5,568	-5,586	-5,612	-5,646	-5,688	-5,739	-5,797
8.00%	-9,341	-9,342	-9,344	-9,350	-9,358	-9,371	-9,389
KR4201M83: 2017-08 콜317.5							38,039
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	3,942	3,942	3,941	3,940	3,936	3,928	3,914
-5.33%	3,938	3,930	3,913	3,881	3,832	3,762	3,669
-2.67%	3,761	3,627	3,452	3,237	2,986	2,701	2,387
0%	1,594	1,076	544	0	-553	-1,112	-1,678
2.67%	-6,856	-7,371	-7,903	-8,448	-9,003	-9,565	-10,134
5.33%	-21,334	-21,481	-21,672	-21,904	-22,173	-22,477	-22,811
8.00%	-37,675	-37,689	-37,715	-37,760	-37,828	-37,920	-38,039
KR4301M83: 2017-08 풋315							33,331
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-33,289	-33,290	-33,291	-33,294	-33,300	-33,312	-33,331
-5.33%	-20,734	-20,750	-20,779	-20,824	-20,888	-20,973	-21,078
-2.67%	-8,485	-8,658	-8,863	-9,097	-9,356	-9,636	-9,935
0%	1,346	899	450	0	-451	-903	-1,356
2.67%	5,822	5,521	5,196	4,851	4,489	4,115	3,730
5.33%	6,669	6,610	6,524	6,411	6,270	6,103	5,911
8.00%	6,726	6,723	6,714	6,697	6,668	6,626	6,567
KR4301M83: 2017-08 풋317.5							10,888
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-10,882	-10,882	-10,882	-10,882	-10,883	-10,885	-10,888
-5.33%	-6,942	-6,944	-6,948	-6,956	-6,968	-6,984	-7,006
-2.67%	-3,044	-3,076	-3,118	-3,169	-3,229	-3,297	-3,371
0%	380	256	130	0	-132	-265	-400
2.67%	2,307	2,184	2,057	1,927	1,795	1,661	1,526

5.33%	2,798	2,763	2,717	2,662	2,598	2,525	2,446
8.00%	2,845	2,841	2,835	2,824	2,808	2,786	2,758

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

104,401

공시일	2017-08-07
기준일	2017-08-04

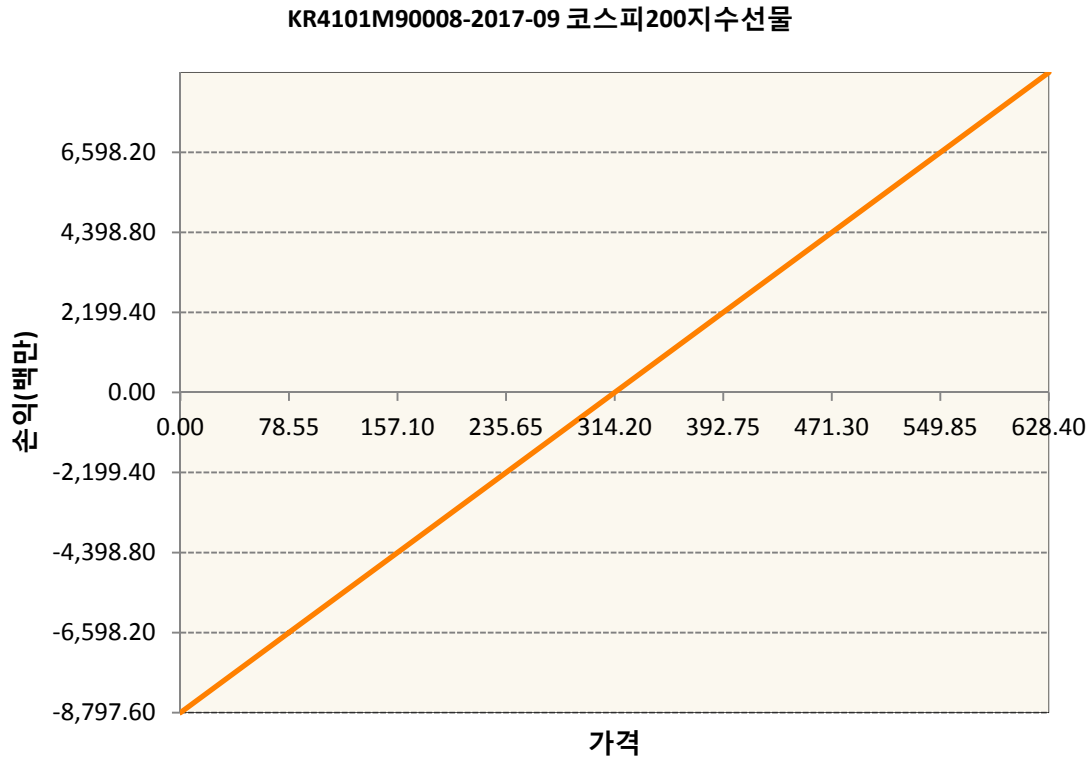
ETF스마트레버리지목표전환형6호

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	8,798	0	8,798	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101M90(2017-09 코스피200지수선물							702
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-702	-702	-702	-702	-702	-702	-702
-5.33%	-468	-468	-468	-468	-468	-468	-468
-2.67%	-234	-234	-234	-234	-234	-234	-234
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	234	234	234	234	234	234	234
5.33%	468	468	468	468	468	468	468
8.00%	702	702	702	702	702	702	702

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

433

공시일	2017-08-07
기준일	2017-08-04

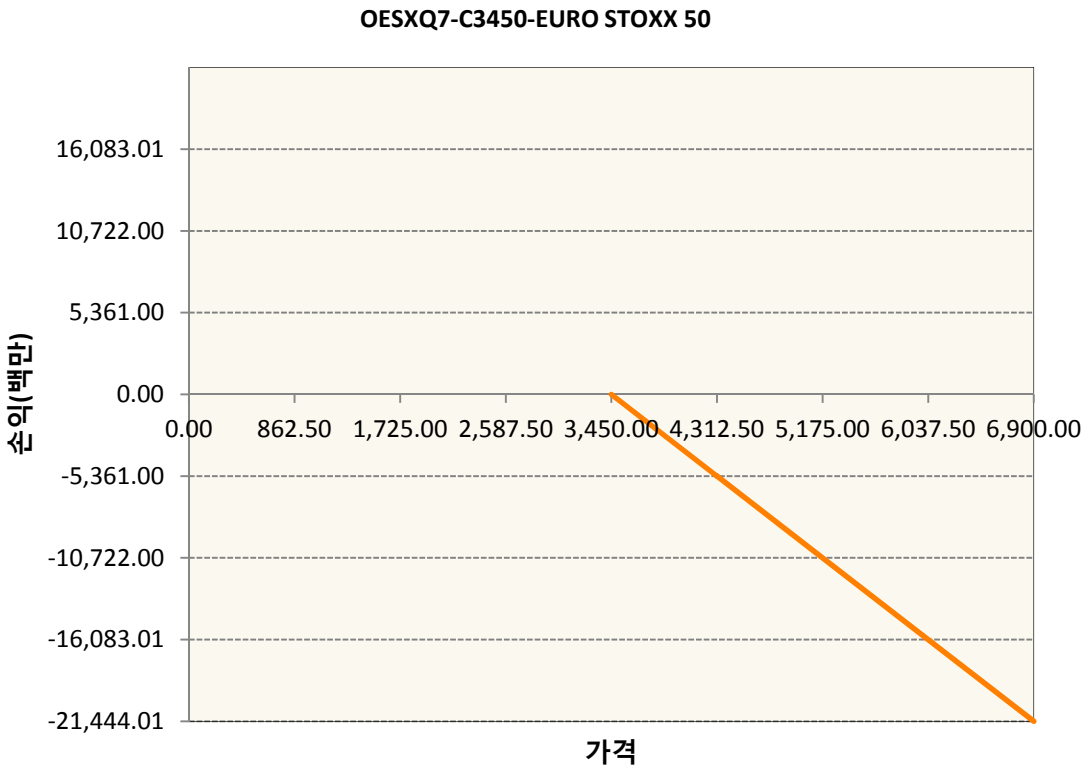
유로커버드콜(주식혼합-파생형)

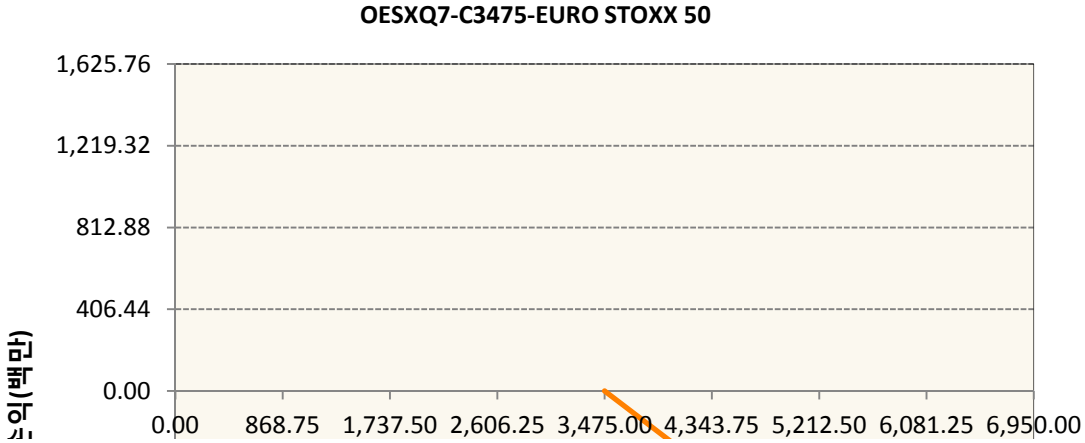
1. 계약금액

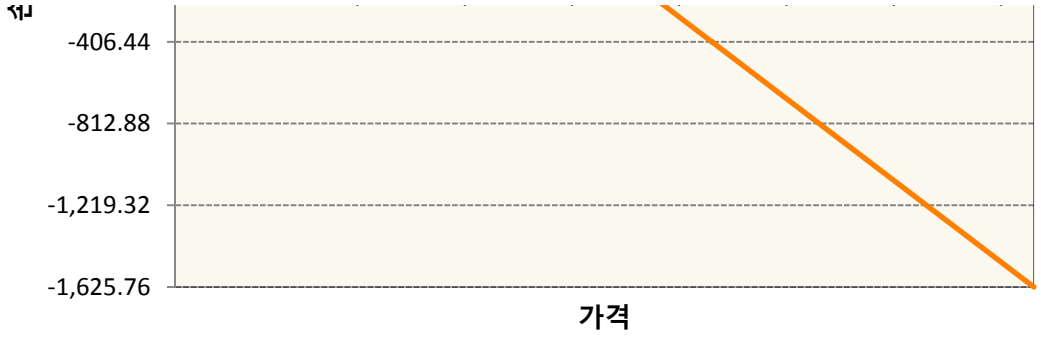
(단위:백만원)

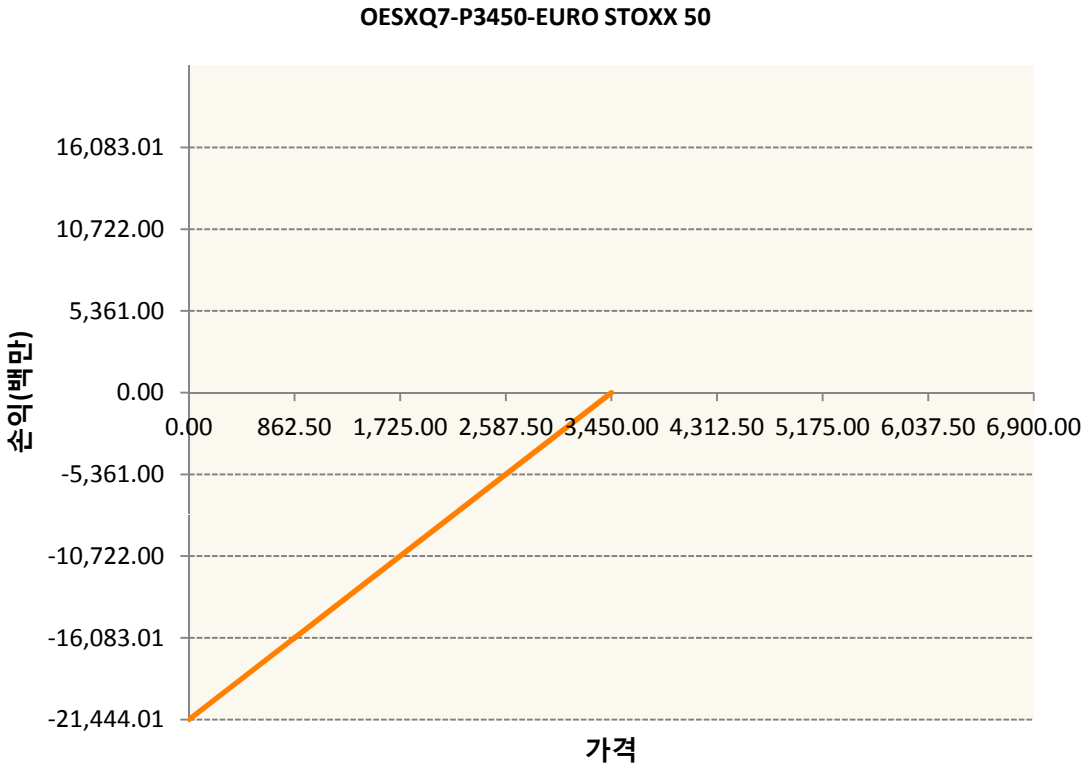
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	22,639	0	22,639	
누계	유가증권	옵션	0	46,140	-46,140	장내

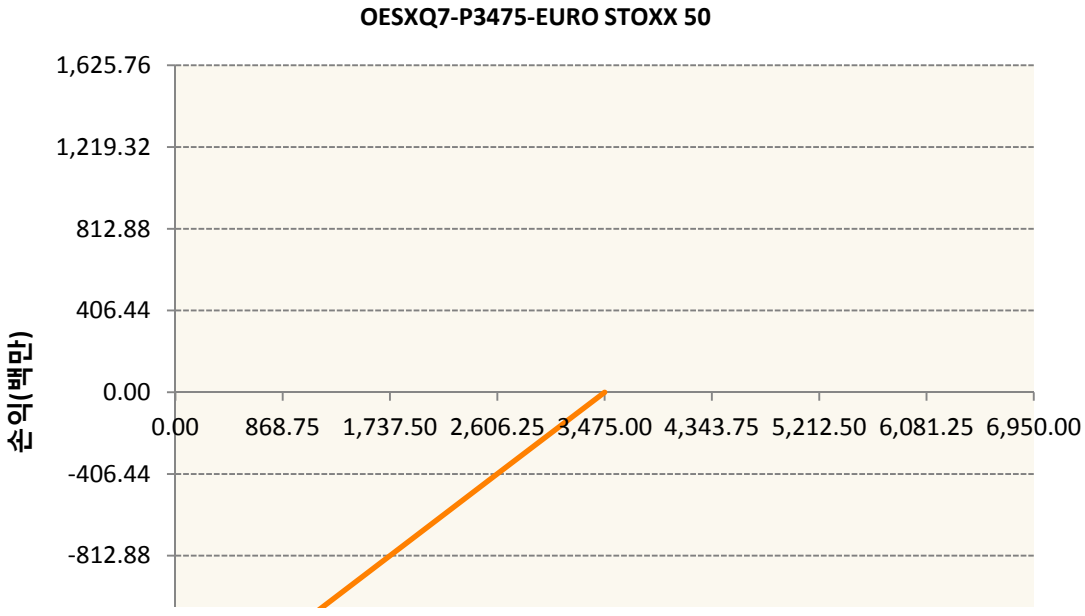
2. 만기시점의 손익구조

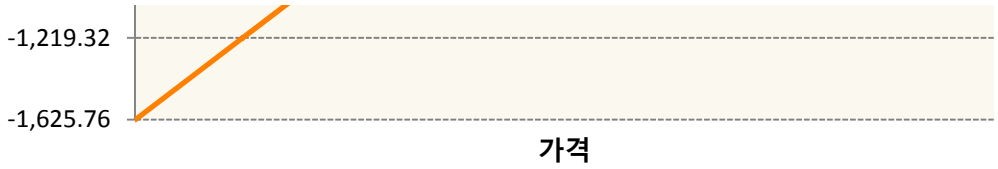


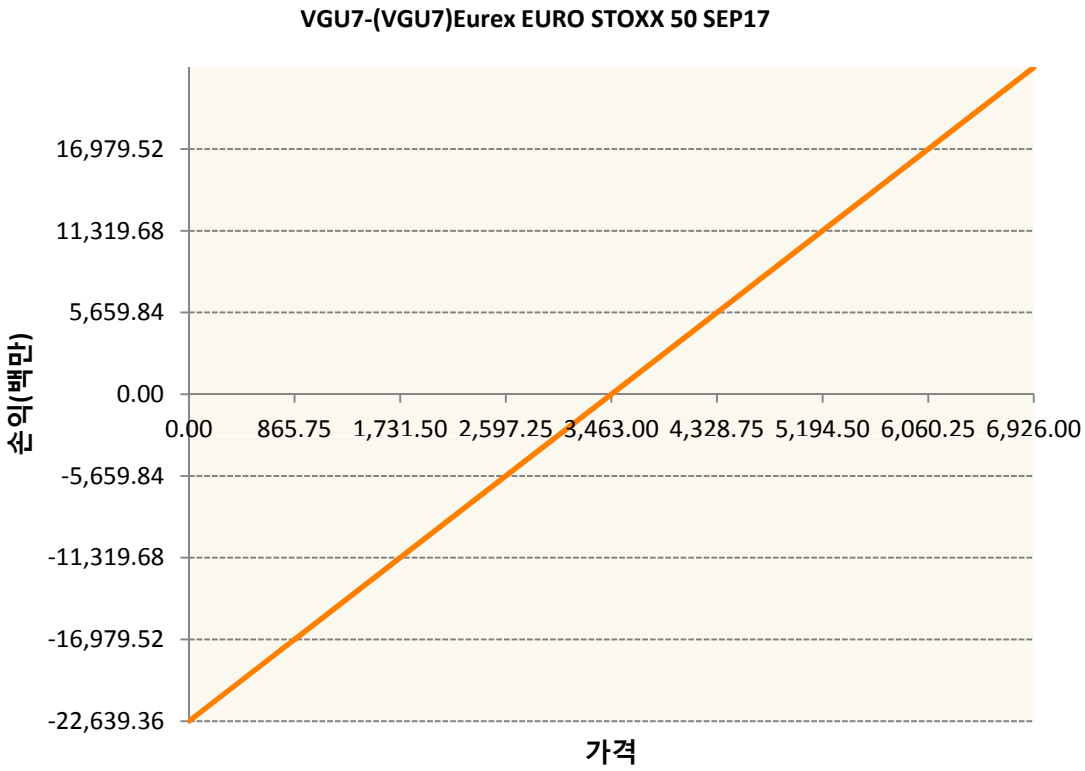



-406.44
-812.88
-1,219.32
-1,625.76
가격


OESXQ7-P3450-EURO STOXX 50
16,083.01
10,722.00
5,361.00
0.00
-5,361.00
-10,722.00
-16,083.01
-21,444.01
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
1,625.76
1,219.32
812.88
406.44
0.00
-406.44
-812.88
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	1,716
OESXQ7-C3	EURO STOXX 50	130
OESXQ7-P3	EURO STOXX 50	1,716
OESXQ7-P3	EURO STOXX 50	130
VGU7	(VGU7)Eurex EURO STOXX 50 SEP17	1,811

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	4,565

공시일	2017-08-07
기준일	2017-08-04

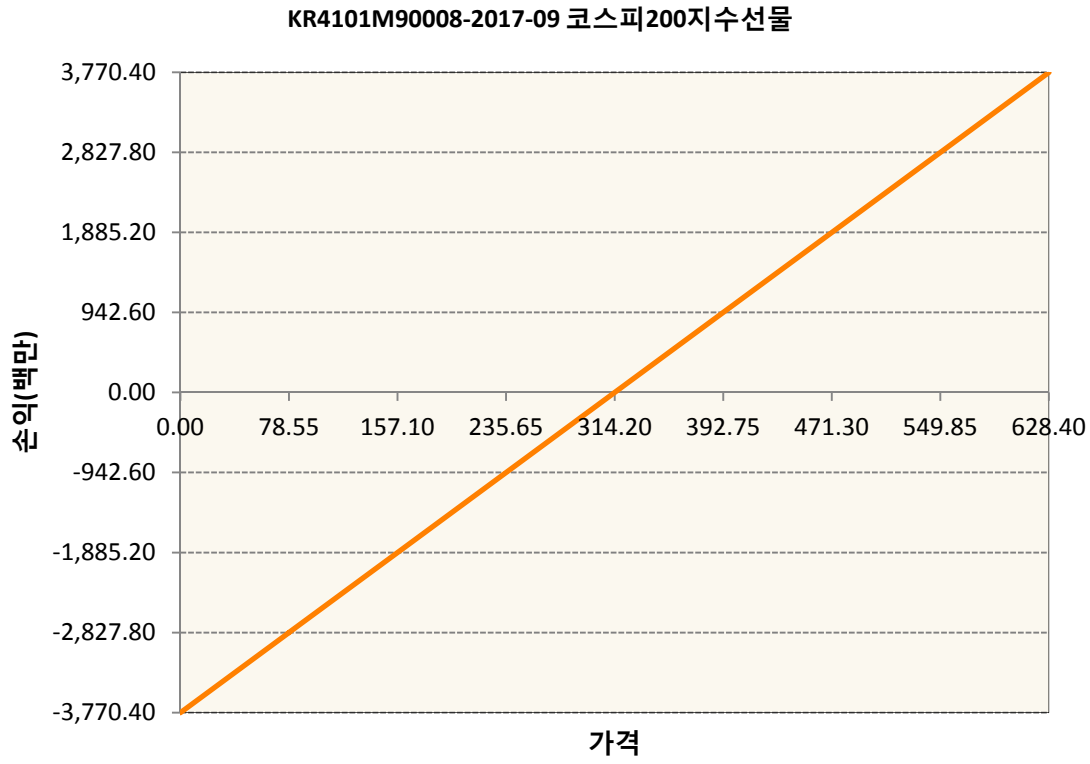
ETF스마트레버리지목표전환형7호

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	3,770	0	3,770	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101M90(2017-09 코스피200지수선물							301
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-301	-301	-301	-301	-301	-301	-301
-5.33%	-201	-201	-201	-201	-201	-201	-201
-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%	201	201	201	201	201	201	201
8.00%	301	301	301	301	301	301	301

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

186

공시일	2017-08-07
기준일	2017-08-04

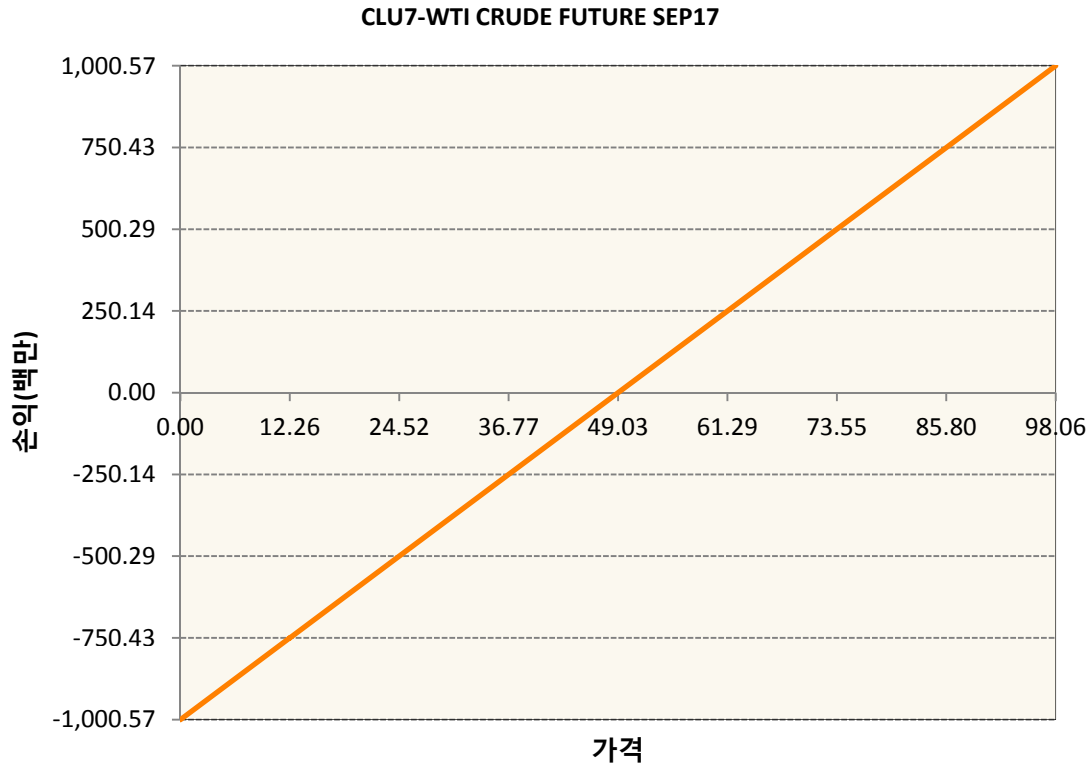
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

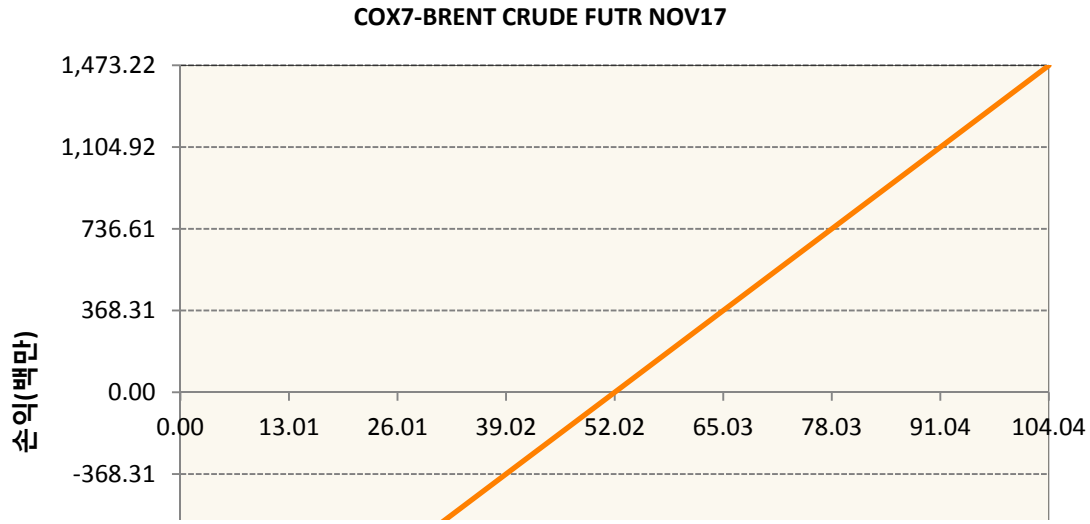
1. 계약금액

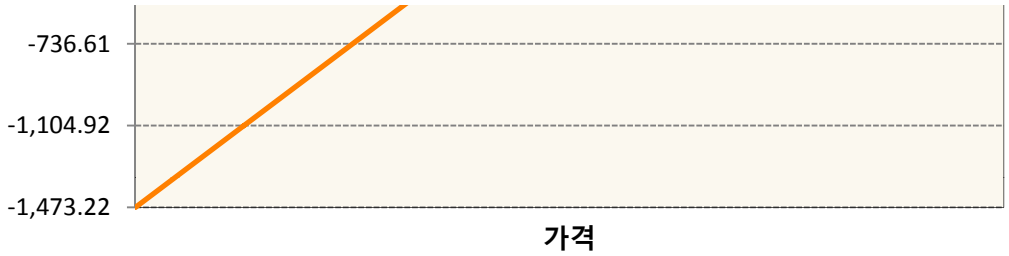
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	5,367	338	5,030	

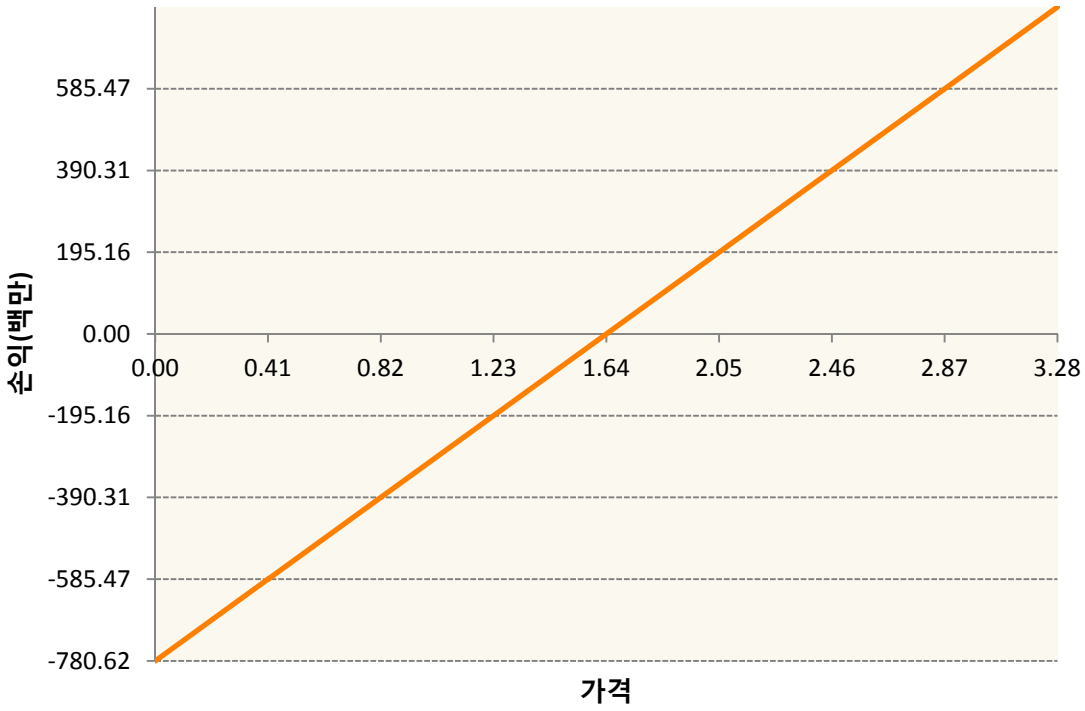
2. 만기시점의 손익구조



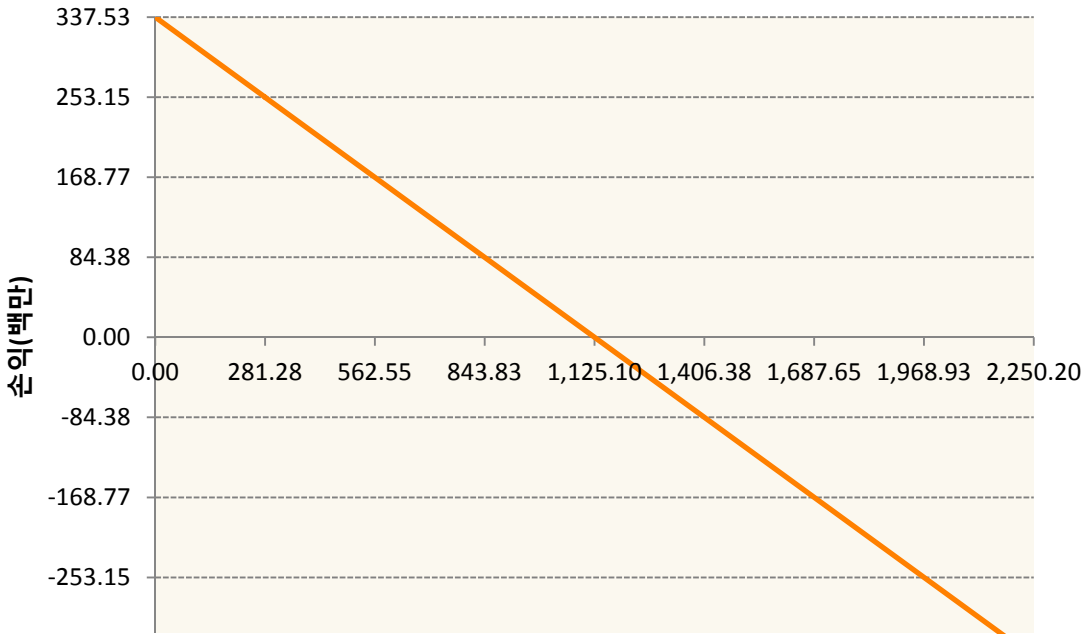


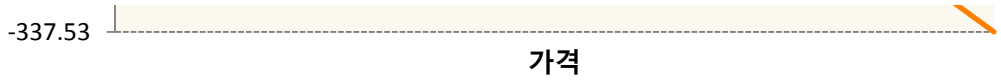


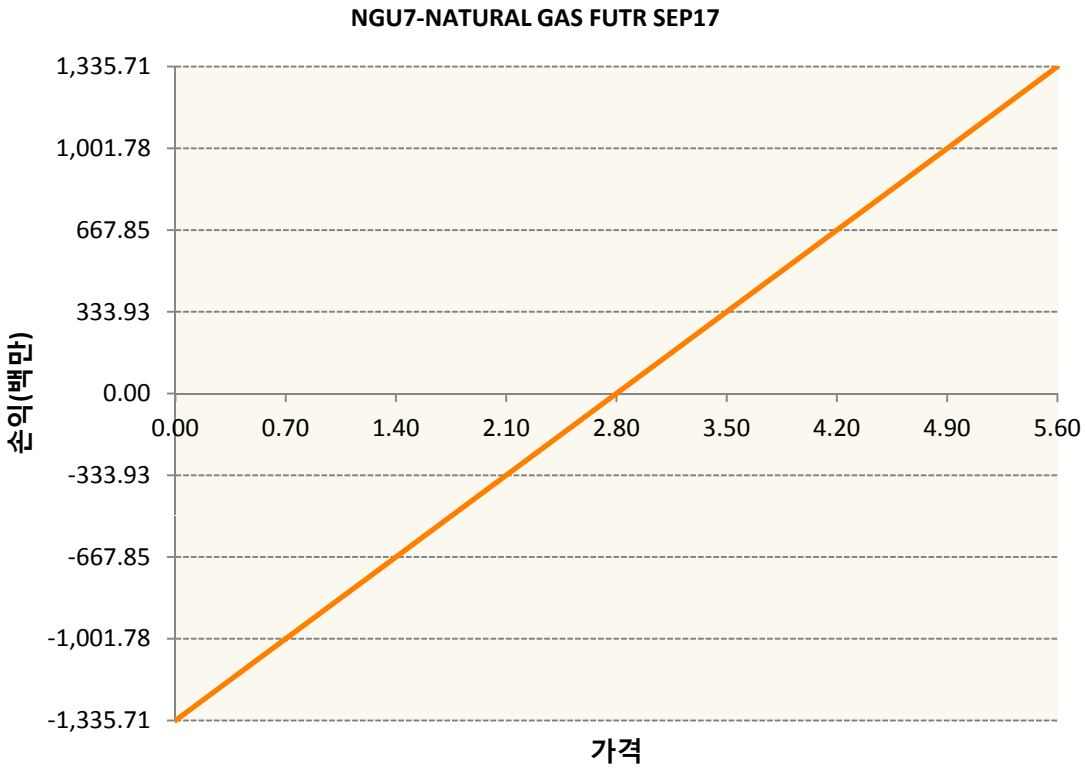
HOU7-NY HARB ULSD FUT SEP17

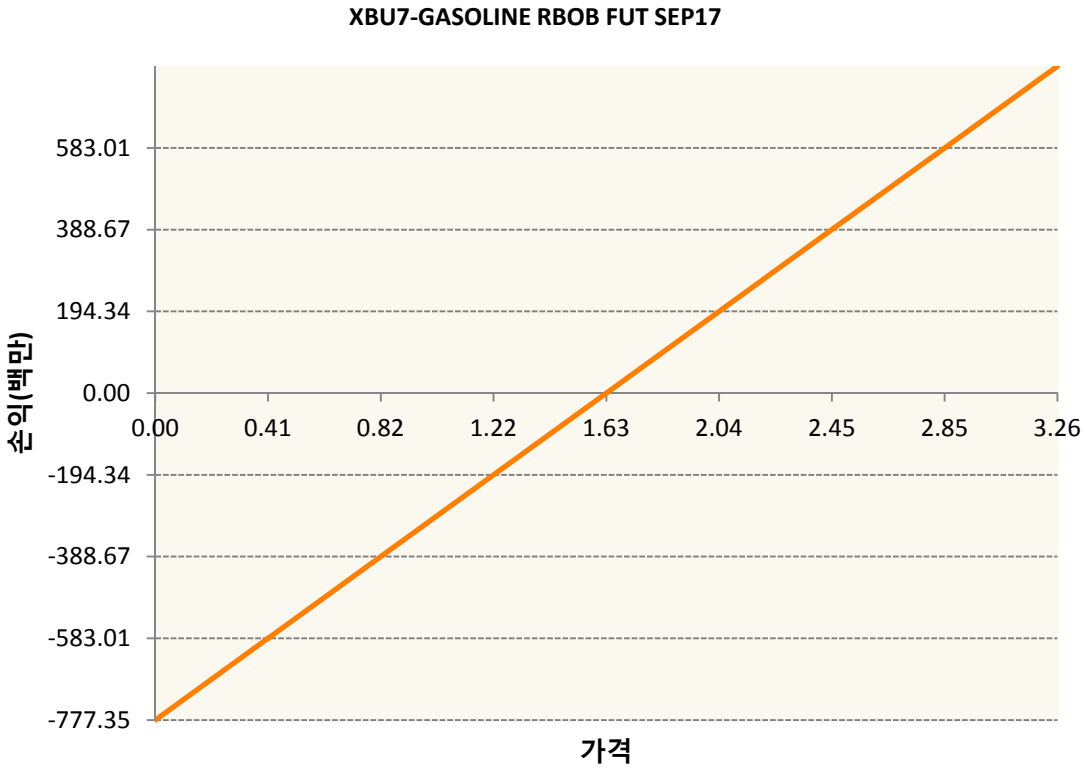


KR4175M80003-2017-08 달러선물




-337.53
가격


NGU7-NATURAL GAS FUTR SEP17
1,335.71
1,001.78
667.85
333.93
0.00
-333.93
-667.85
-1,001.78
-1,335.71
0.00
0.70
1.40
2.10
2.80
3.50
4.20
4.90
5.60
손익(백만)
가격


XBU7-GASOLINE RBOB FUT SEP17
583.01
388.67
194.34
0.00
-194.34
-388.67
-583.01
-777.35
0.00
0.41
0.82
1.22
1.63
2.04
2.45
2.85
3.26
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	62
KR4175M80(	2017-08 달러선물	27
NGU7	NATURAL GAS FUTR SEP17	107
XBU7	GASOLINE RBOB FUT SEP17	62

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

775

공시일	2017-08-07
기준일	2017-08-04

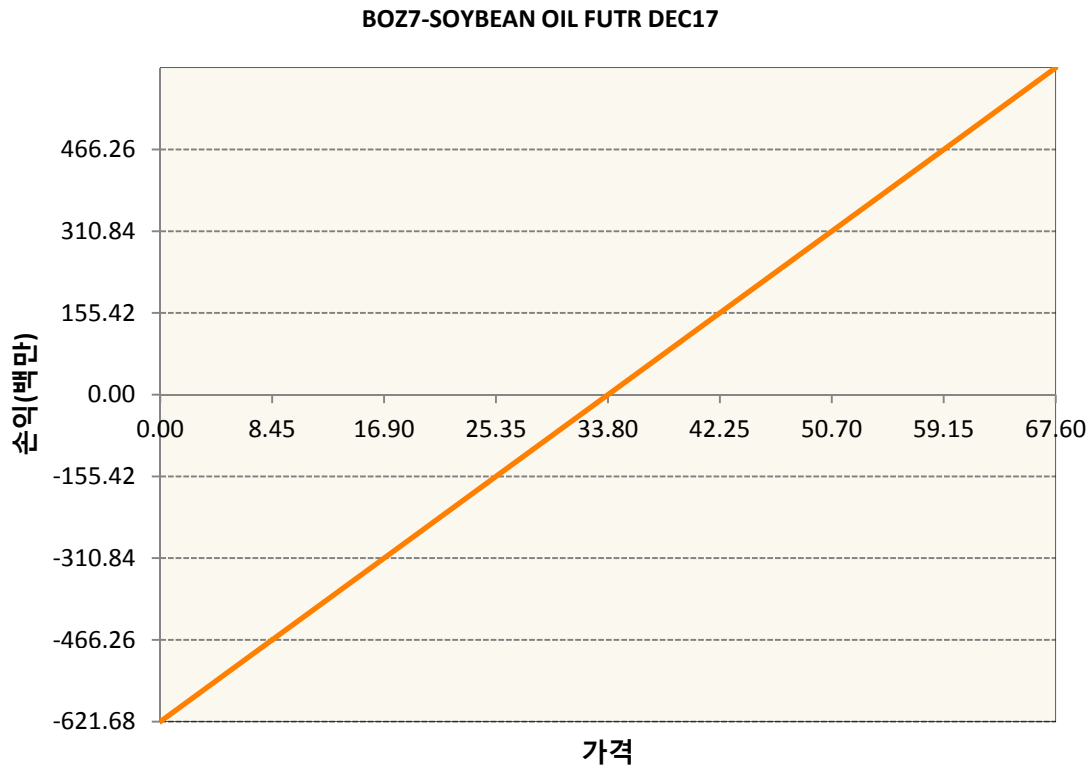
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

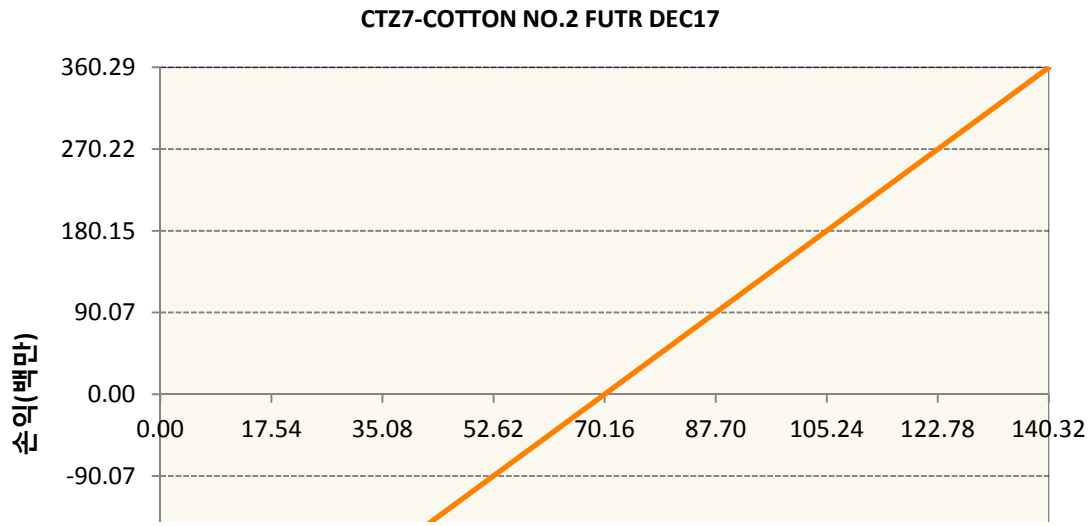
1. 계약금액

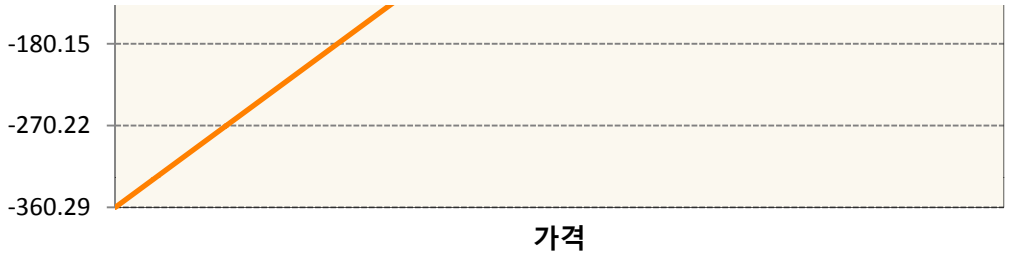
(단위:백만원)

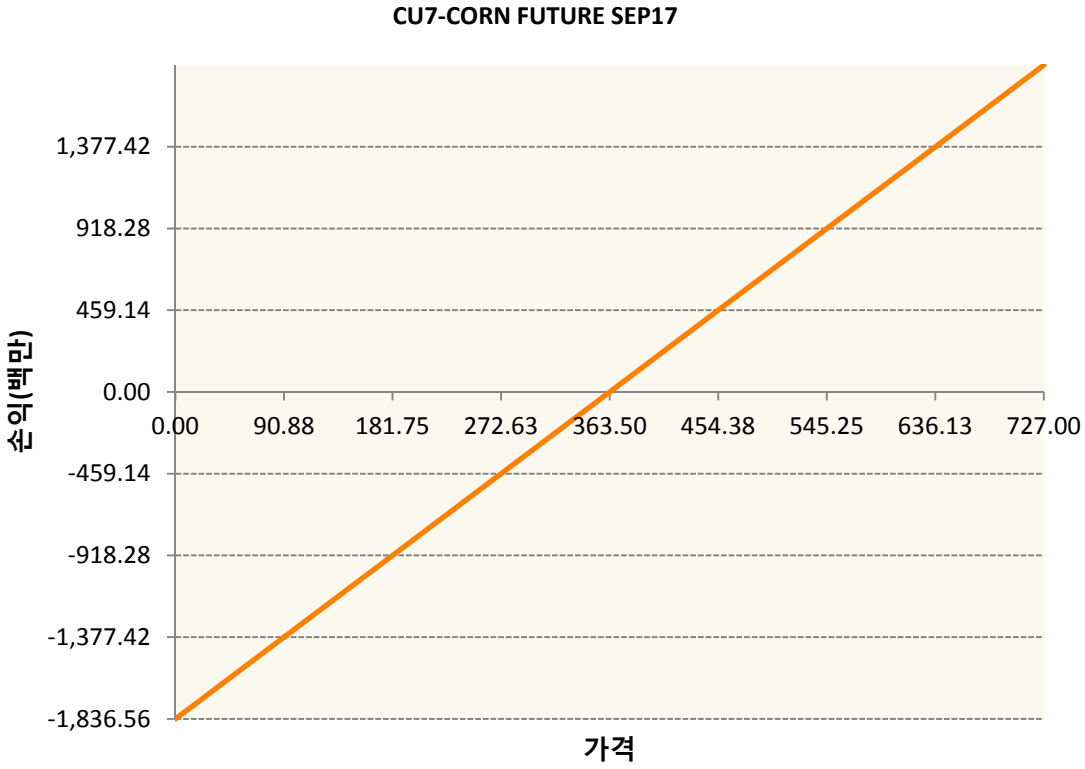
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	7,088	394	6,695	

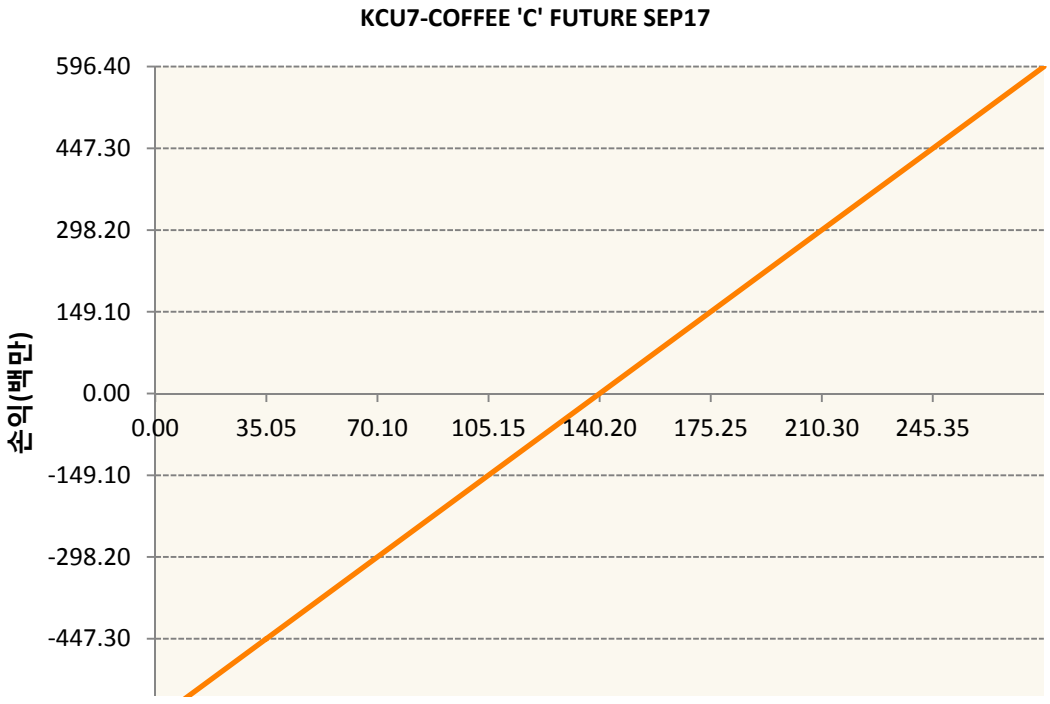
2. 만기시점의 손익구조

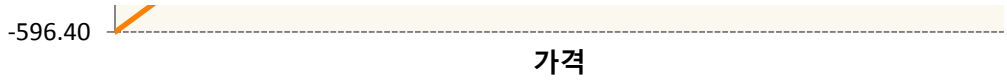


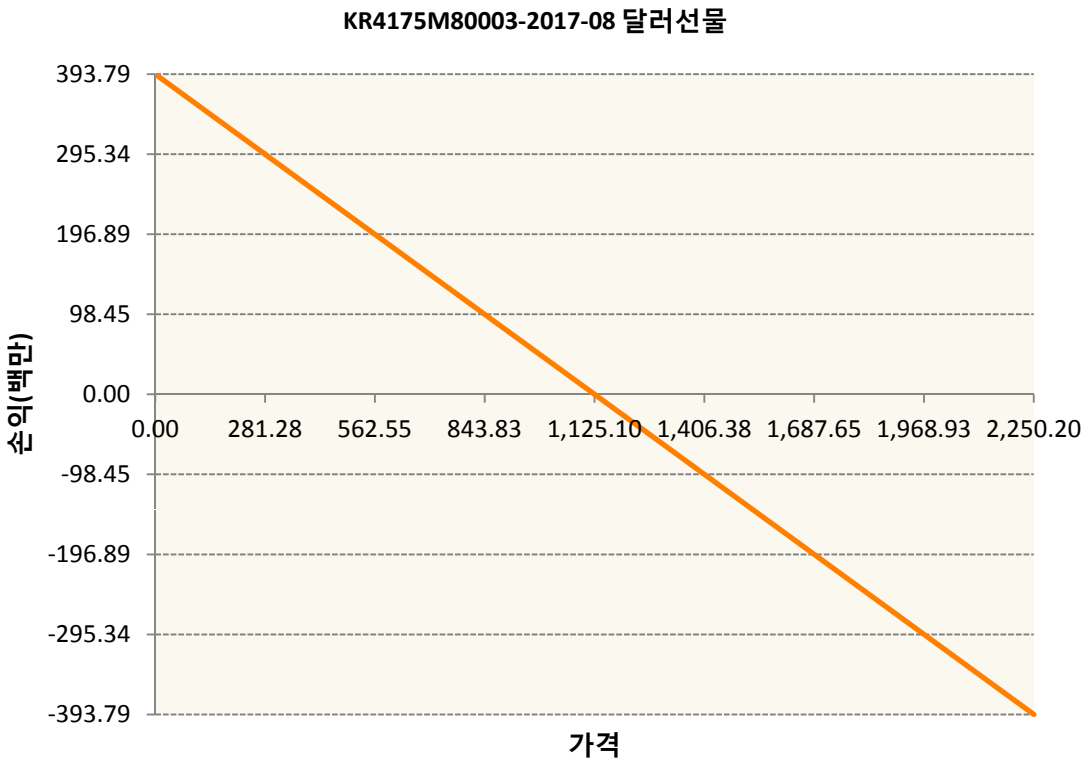


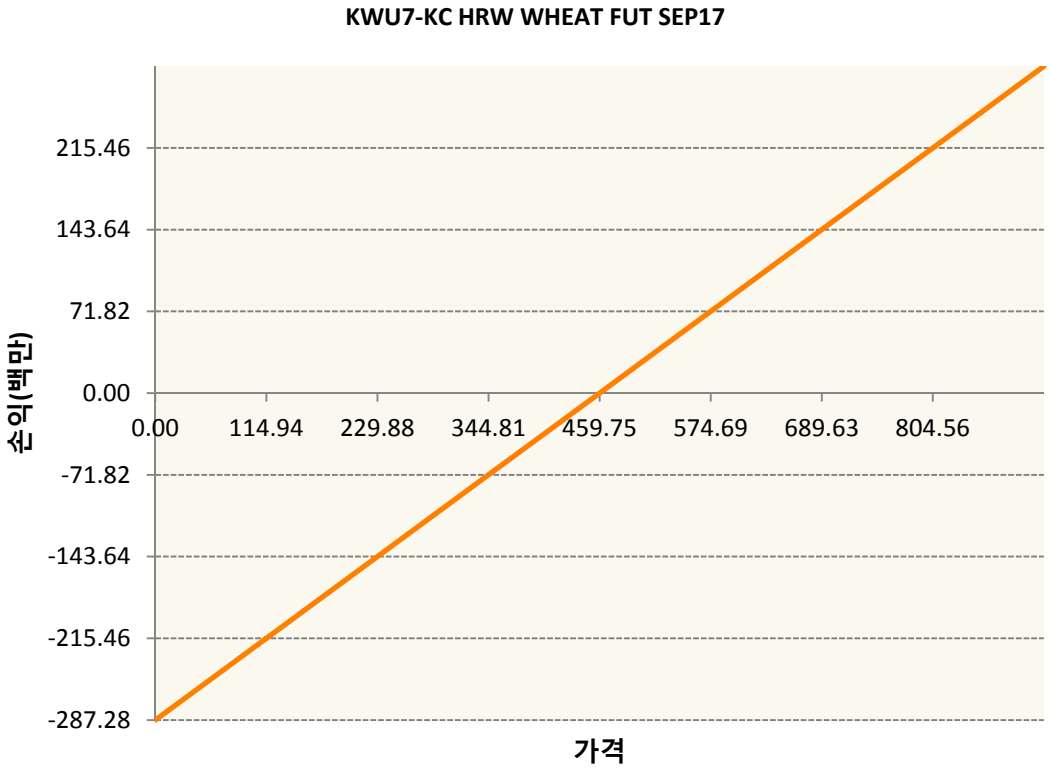

-180.15
-270.22
-360.29
가격

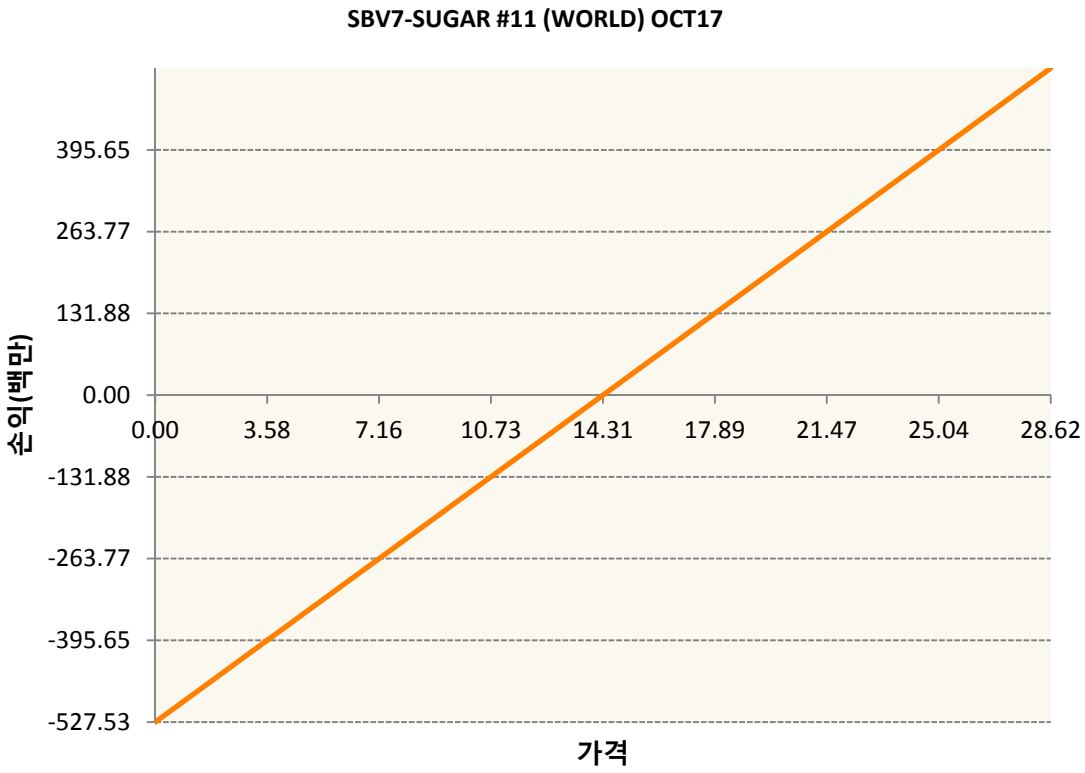

CU7-CORN FUTURE SEP17
1,377.42
918.28
459.14
0.00
-459.14
-918.28
-1,377.42
-1,836.56
0.00
90.88
181.75
272.63
363.50
454.38
545.25
636.13
727.00
손익(백만)
가격

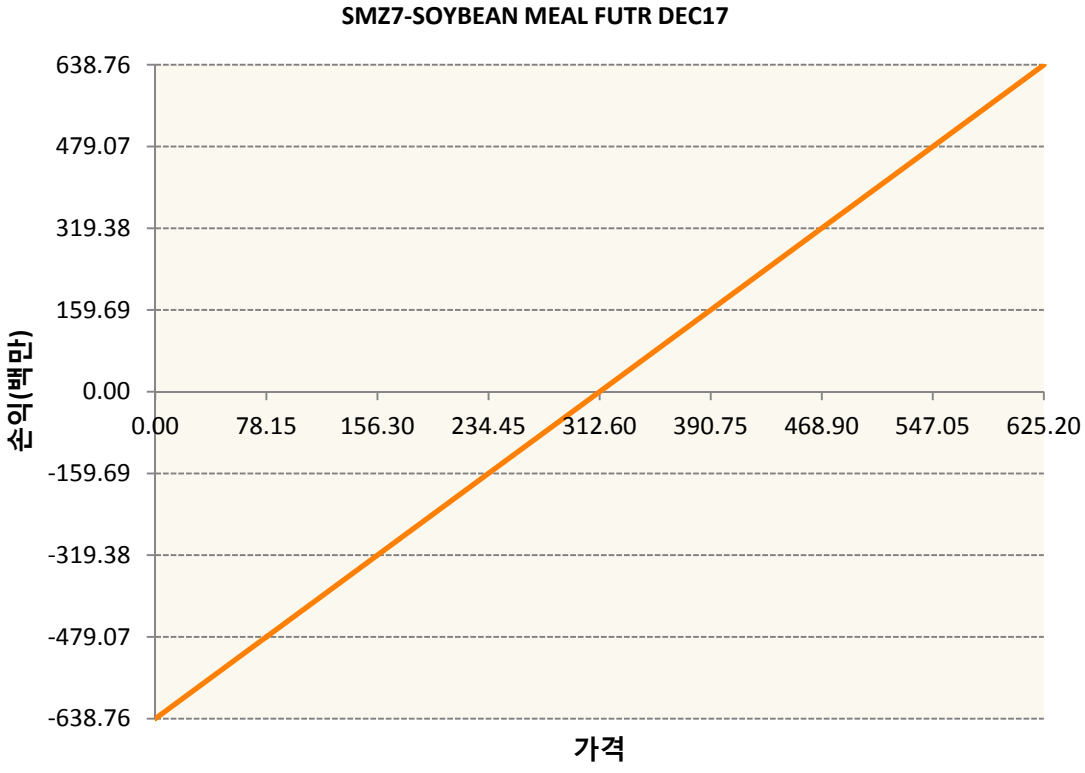

KCU7-COFFEE 'C' FUTURE SEP17
596.40
447.30
298.20
149.10
0.00
-149.10
-298.20
-447.30
0.00
35.05
70.10
105.15
140.20
175.25
210.30
245.35
손익(백만)

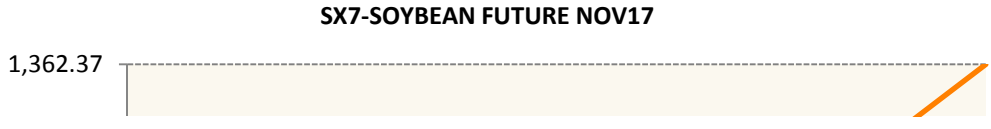

-596.40
가격

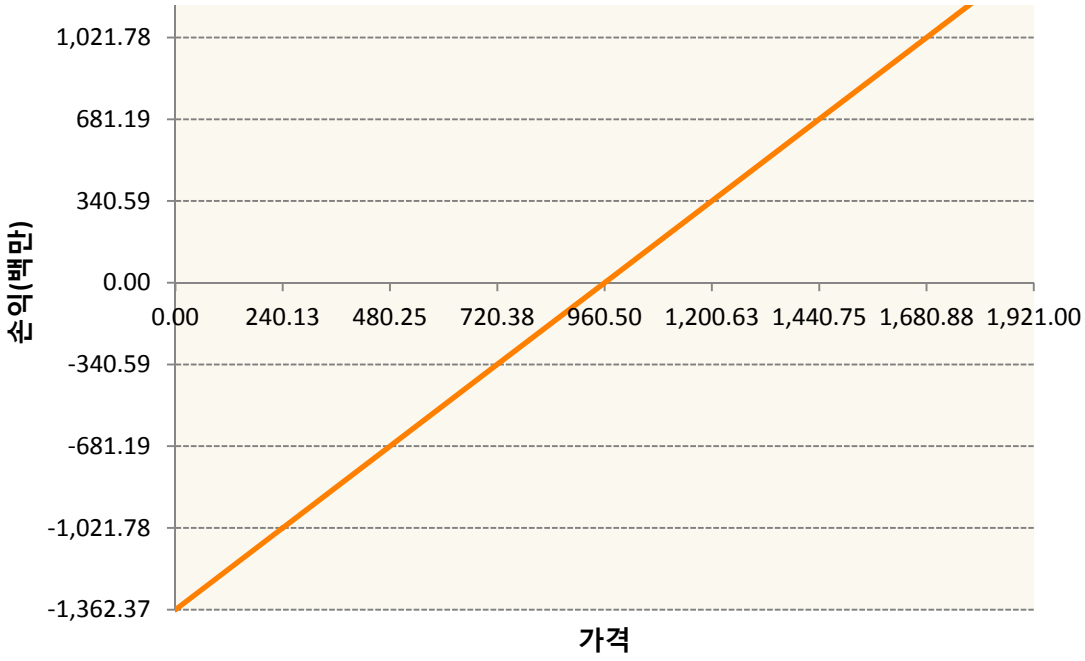

KR4175M80003-2017-08 달러선물
393.79
295.34
196.89
98.45
0.00
-98.45
-196.89
-295.34
-393.79
0.00
281.28
562.55
843.83
1,125.10
1,406.38
1,687.65
1,968.93
2,250.20
손익(백만)
가격

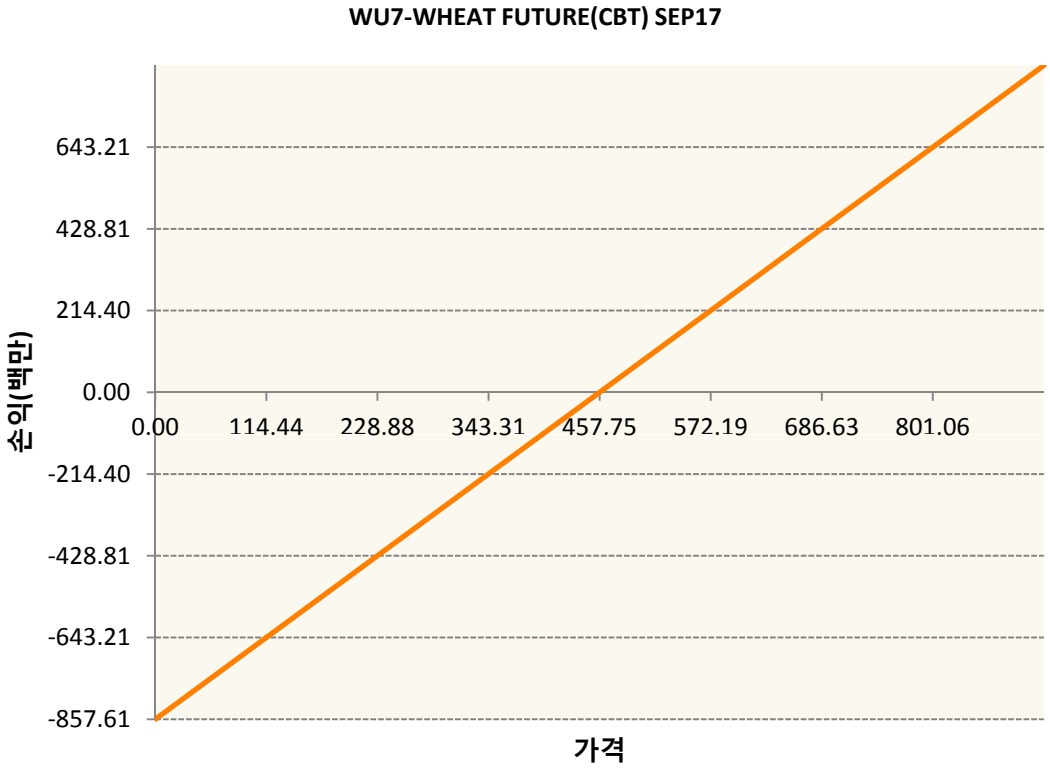

KWU7-KC HRW WHEAT FUT SEP17
215.46
143.64
71.82
0.00
-71.82
-143.64
-215.46
-287.28
0.00
114.94
229.88
344.81
459.75
574.69
689.63
804.56
손익(백만)
가격


SBV7-SUGAR #11 (WORLD) OCT17
395.65
263.77
131.88
0.00
-131.88
-263.77
-395.65
-527.53
0.00
3.58
7.16
10.73
14.31
17.89
21.47
25.04
28.62
손익(백만)
가격


SMZ7-SOYBEAN MEAL FUTR DEC17
638.76
479.07
319.38
159.69
0.00
-159.69
-319.38
-479.07
-638.76
0.00
78.15
156.30
234.45
312.60
390.75
468.90
547.05
625.20
손익(백만)
가격


SX7-SOYBEAN FUTURE NOV17
1,362.37





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
BOZ7	SOYBEAN OIL FUTR DEC17	50
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	42
SMZ7	SOYBEAN MEAL FUTR DEC17	51
SX7	SOYBEAN FUTURE NOV17	109
WU7	WHEAT FUTURE(CBT) SEP17	69

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

667