공시일	2017-08-08
기준일	2017-08-07

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	2017-08-08
기준일	2017-08-07

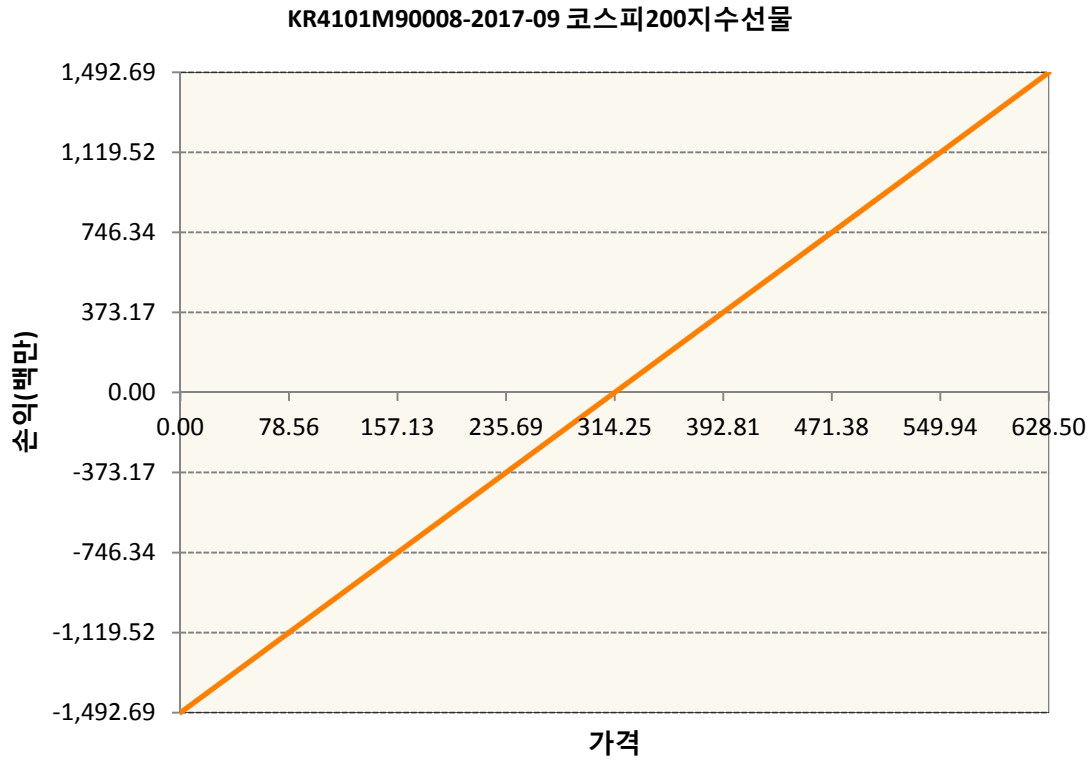
스마트인덱스모

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	1,493	0	1,493	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	2017-08-08
기준일	2017-08-07

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	1,025

* 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	2017-08-08
기준일	2017-08-07

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	396

* 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	2017-08-08
기준일	2017-08-07

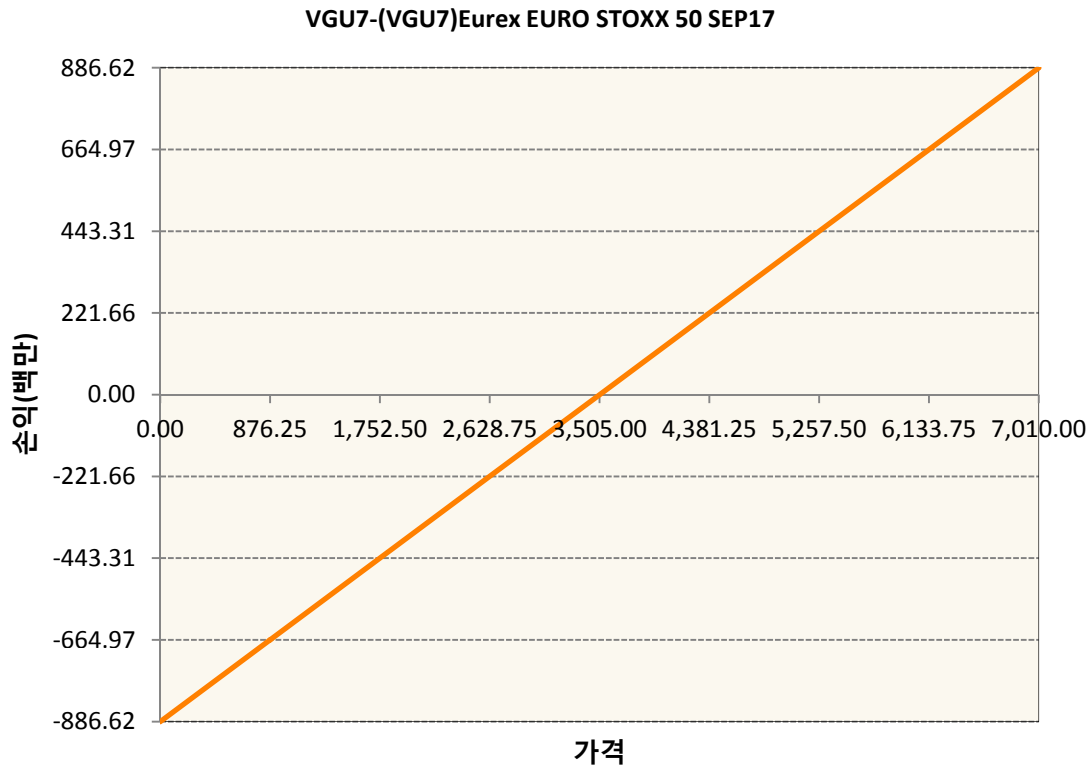
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	887	0	887	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGU7	(VGU7)Eurex EURO STOXX 50 SEP17	71

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

(단위:백만원)

58

공시일	2017-08-08
기준일	2017-08-07

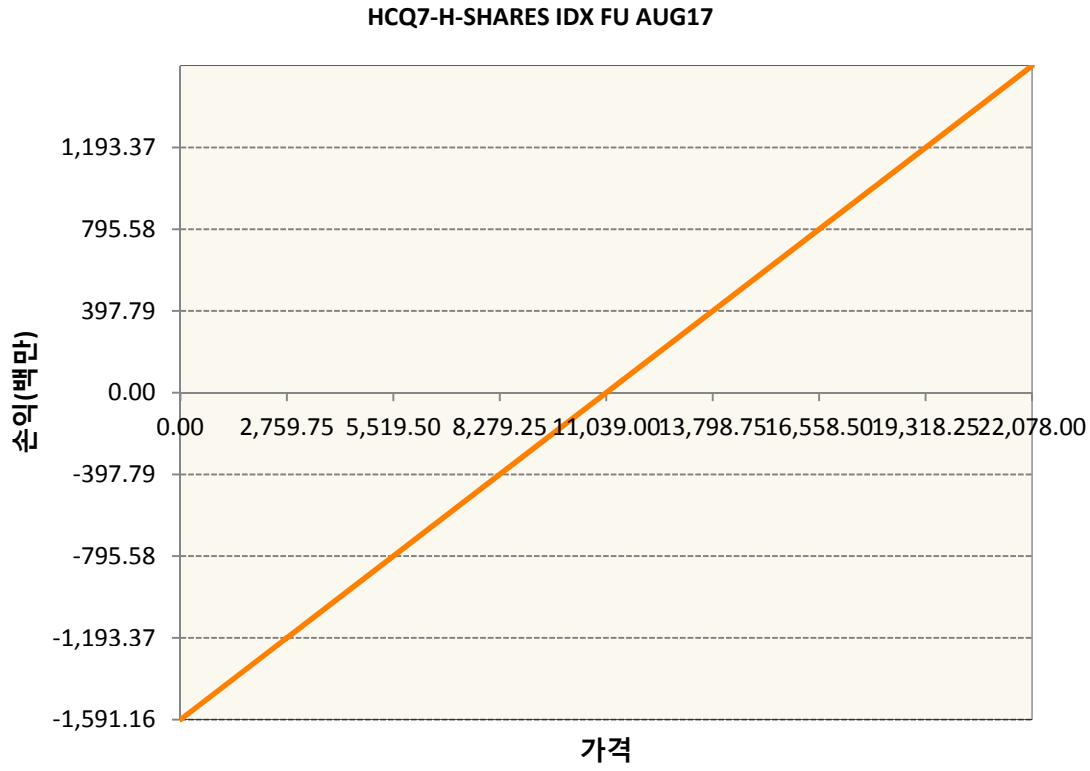
차이나인덱스모(주식-파생형)

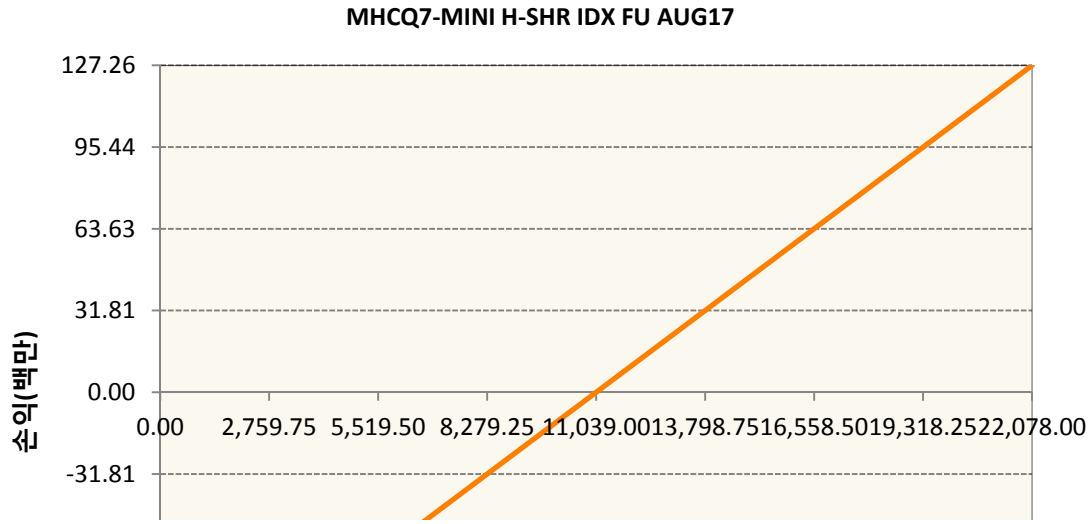
1. 계약금액

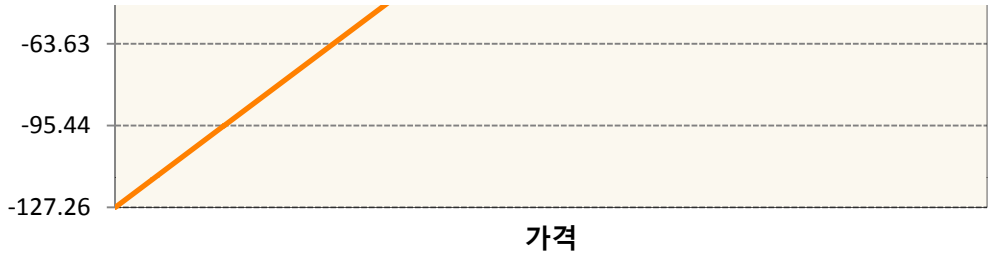
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,718	0	1,718	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	2017-08-08
기준일	2017-08-07

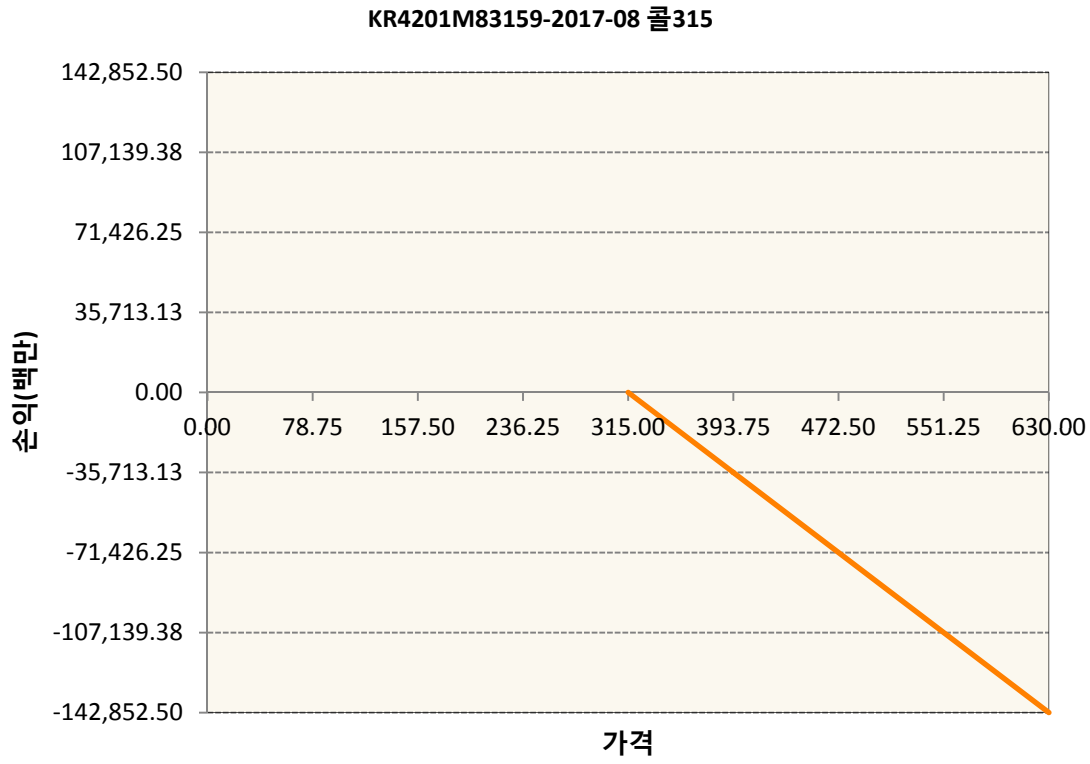
커버드콜모(주식혼합-파생형)

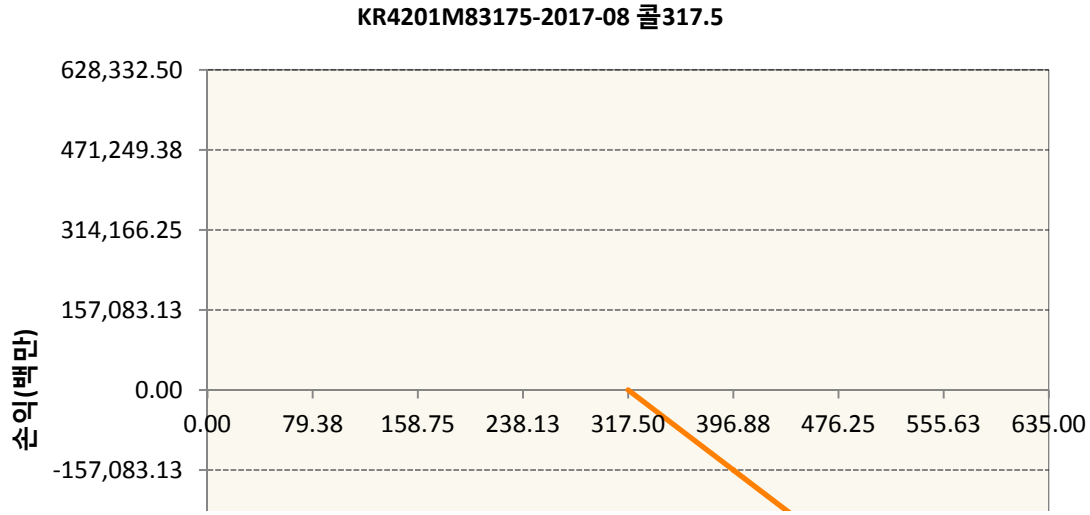
1. 계약금액

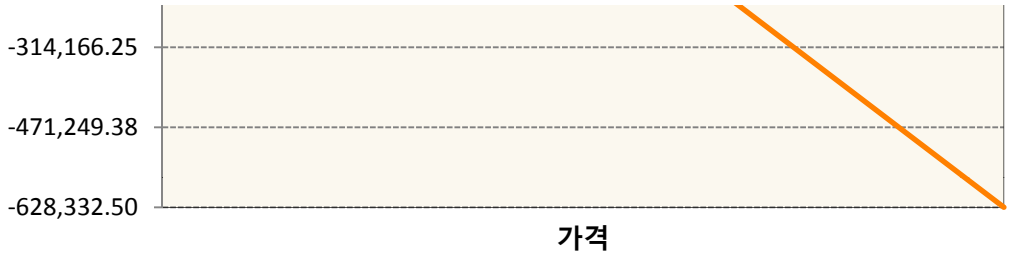
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	15,820	-15,820	장내
누계	유가증권	옵션	0	1,410,239	-1,410,239	장내

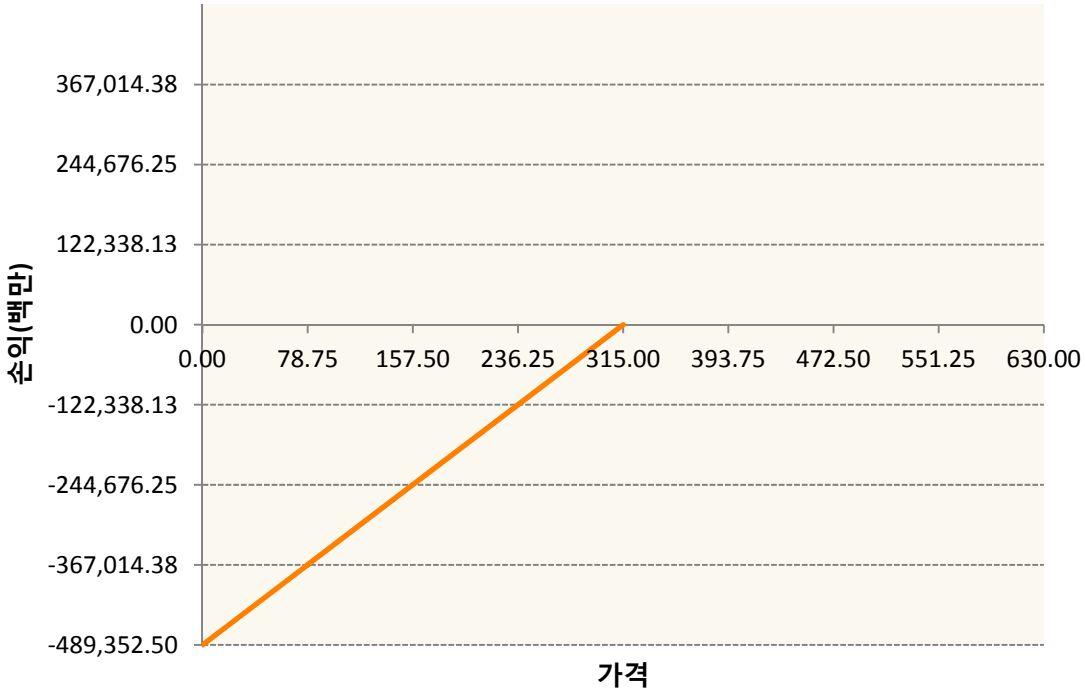
2. 만기시점의 손익구조



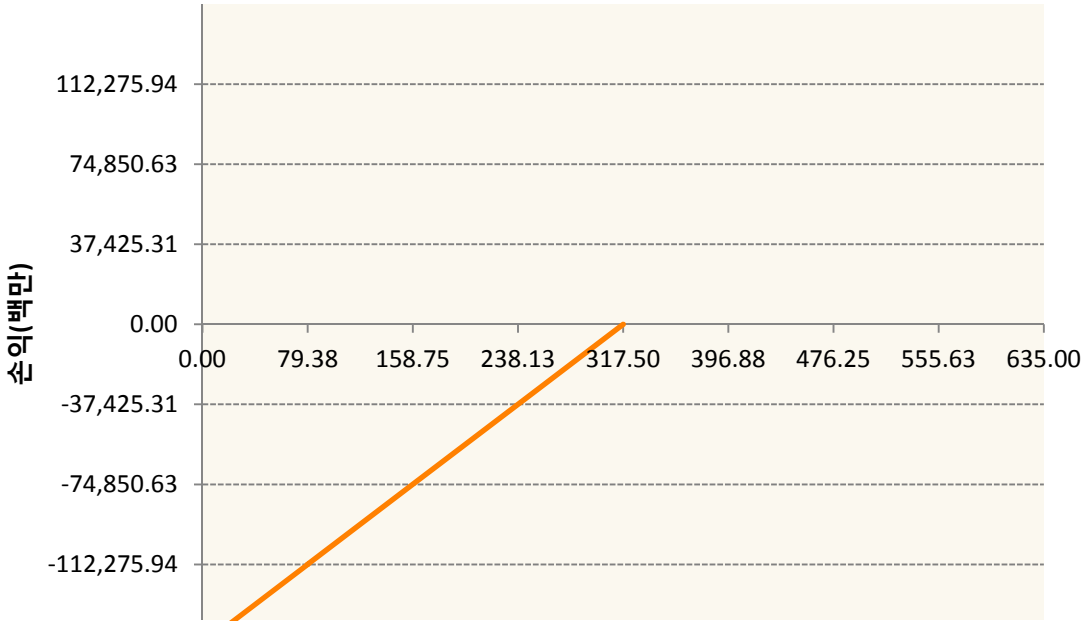




KR4301M83157-2017-08 풋315



KR4301M83173-2017-08 풋317.5





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201M83: 2017-08 콜315							9,973
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	946	946	946	946	946	946	945
-5.33%	946	945	945	944	941	937	931
-2.67%	926	909	886	857	822	782	736
0%	287	191	96	0	-96	-192	-289
2.67%	-2,444	-2,480	-2,523	-2,573	-2,628	-2,688	-2,752
5.33%	-6,175	-6,176	-6,178	-6,183	-6,191	-6,202	-6,216
8.00%	-9,971	-9,971	-9,971	-9,971	-9,971	-9,972	-9,973
KR4201M83: 2017-08 콜317.5							40,364
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	2,354	2,354	2,354	2,354	2,354	2,353	2,353
-5.33%	2,354	2,353	2,353	2,351	2,348	2,341	2,329
-2.67%	2,334	2,307	2,264	2,200	2,116	2,009	1,882
0%	1,047	712	362	0	-371	-749	-1,134
2.67%	-8,044	-8,324	-8,626	-8,948	-9,284	-9,632	-9,991
5.33%	-23,782	-23,801	-23,835	-23,886	-23,957	-24,049	-24,162
8.00%	-40,337	-40,337	-40,337	-40,339	-40,343	-40,351	-40,364
KR4301M83: 2017-08 풋315							35,776
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-35,775	-35,775	-35,775	-35,775	-35,775	-35,775	-35,776
-5.33%	-22,770	-22,771	-22,772	-22,777	-22,785	-22,798	-22,819
-2.67%	-9,833	-9,890	-9,969	-10,069	-10,189	-10,327	-10,482
0%	982	656	328	0	-329	-659	-989
2.67%	4,633	4,510	4,361	4,191	4,002	3,797	3,578
5.33%	4,857	4,853	4,845	4,828	4,803	4,766	4,716
8.00%	4,859	4,859	4,859	4,858	4,858	4,855	4,851
KR4301M83: 2017-08 풋317.5							11,280
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-11,280	-11,280	-11,280	-11,280	-11,280	-11,280	-11,280
-5.33%	-7,333	-7,333	-7,333	-7,334	-7,335	-7,336	-7,339
-2.67%	-3,391	-3,397	-3,408	-3,423	-3,443	-3,468	-3,499
0%	250	170	86	0	-88	-179	-270
2.67%	2,031	1,964	1,892	1,815	1,735	1,652	1,567

5.33%	2,228	2,223	2,215	2,203	2,186	2,164	2,137
8.00%	2,231	2,231	2,231	2,230	2,229	2,227	2,224

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

121,269

공시일	2017-08-08
기준일	2017-08-07

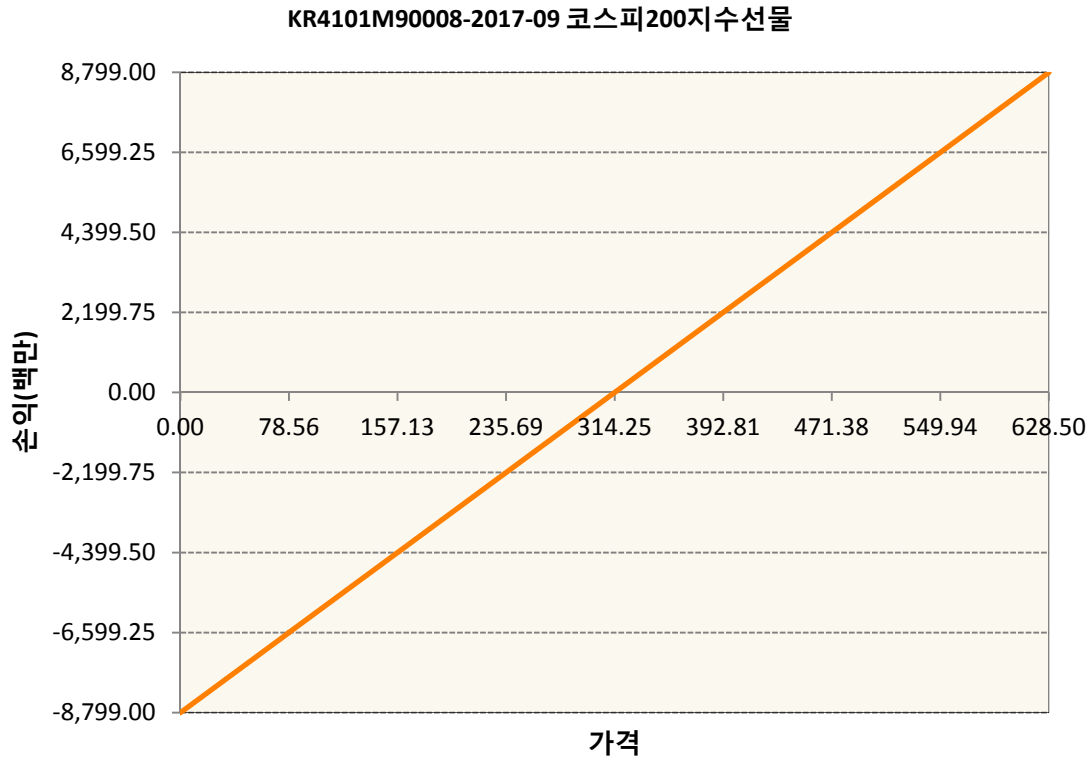
ETF스마트레버리지목표전환형6호

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	8,799	0	8,799	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101M90(2017-09 코스피200지수선물							703
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-703	-703	-703	-703	-703	-703	-703
-5.33%	-469	-469	-469	-469	-469	-469	-469
-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%	469	469	469	469	469	469	469
8.00%	703	703	703	703	703	703	703

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

430

공시일	2017-08-08
기준일	2017-08-07

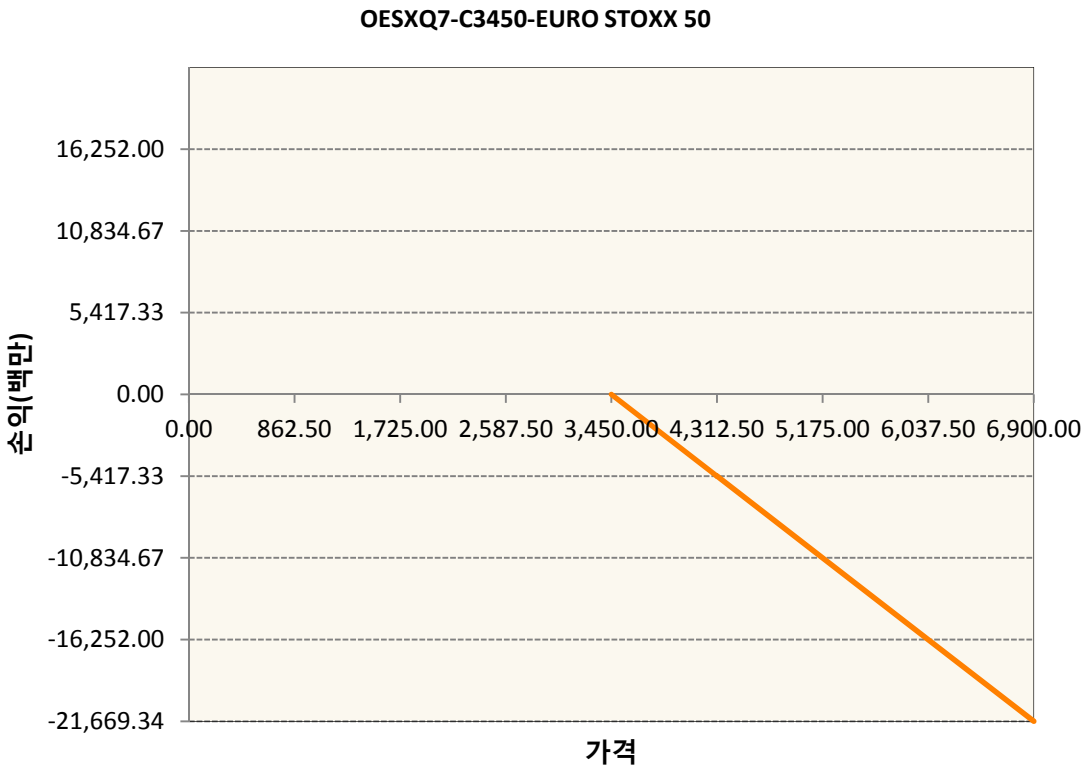
유로커버드콜(주식혼합-파생형)

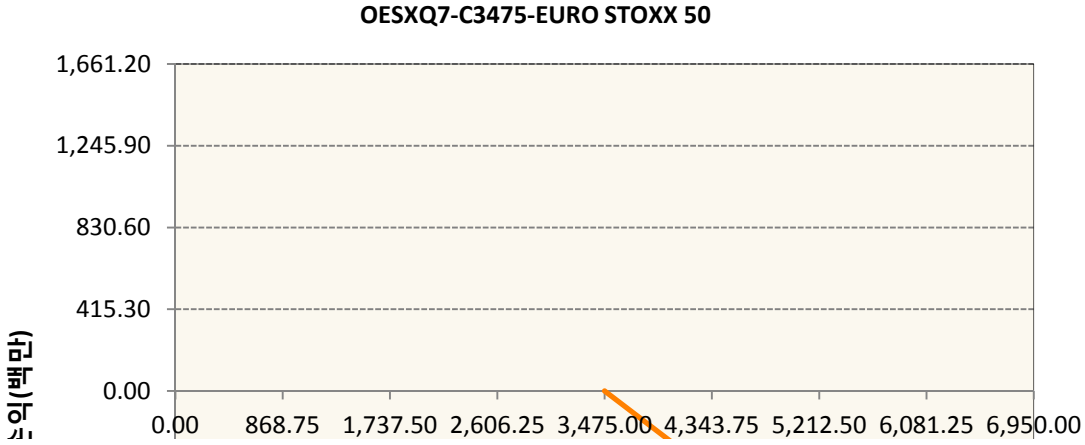
1. 계약금액

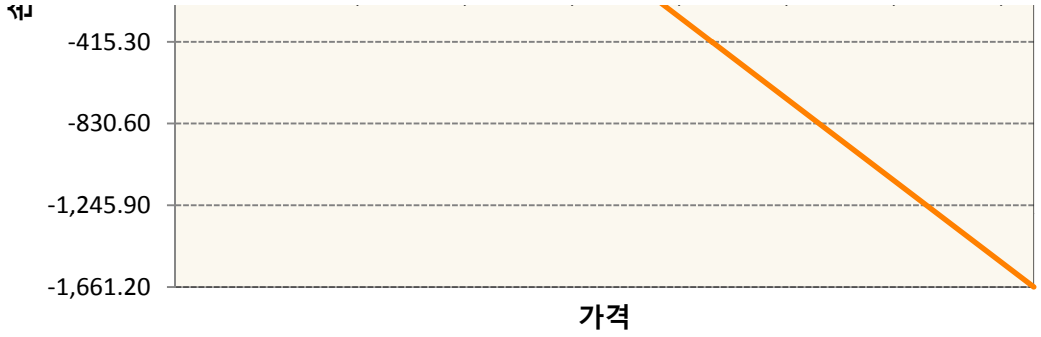
(단위:백만원)

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	23,339	0	23,339	
누계	유가증권	옵션	0	46,661	-46,661	장내

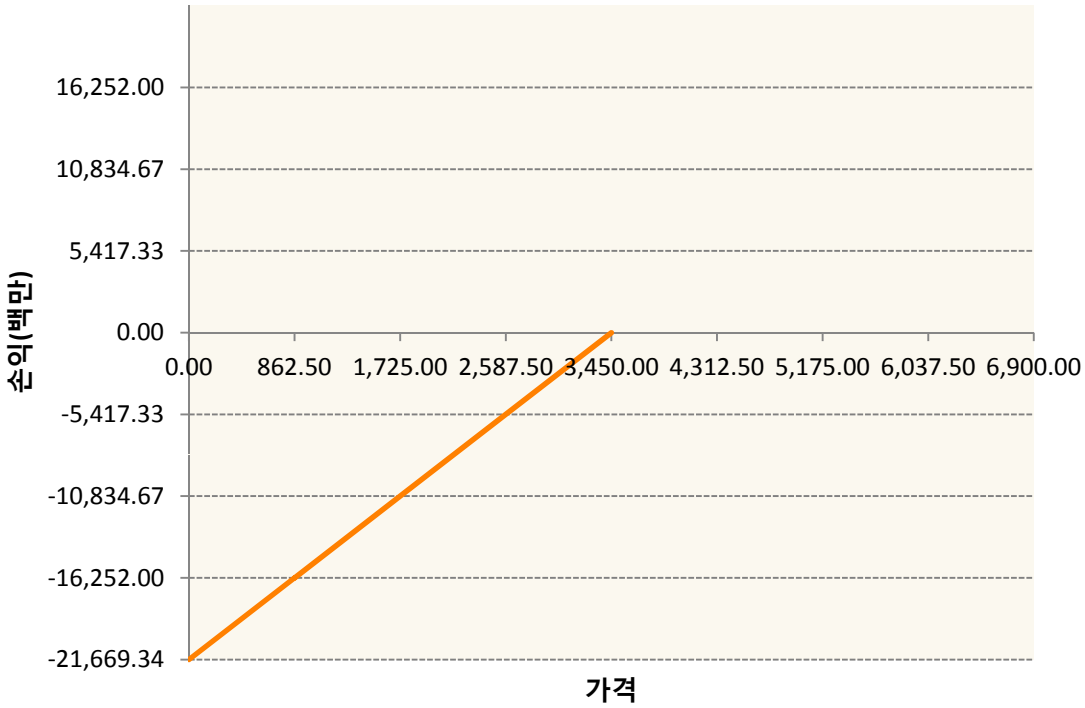
2. 만기시점의 손익구조



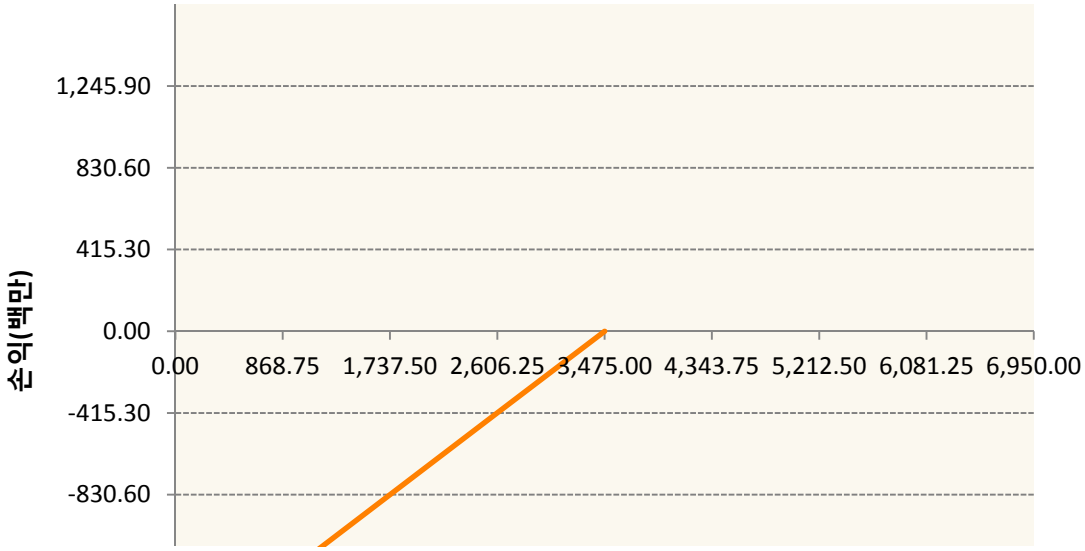


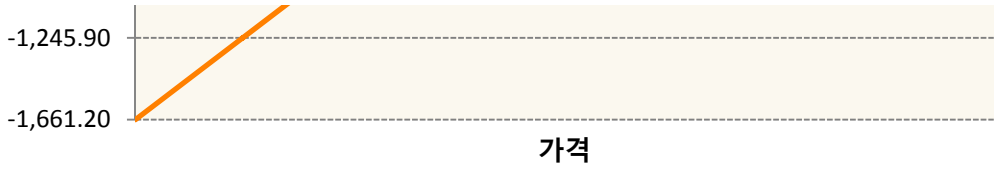


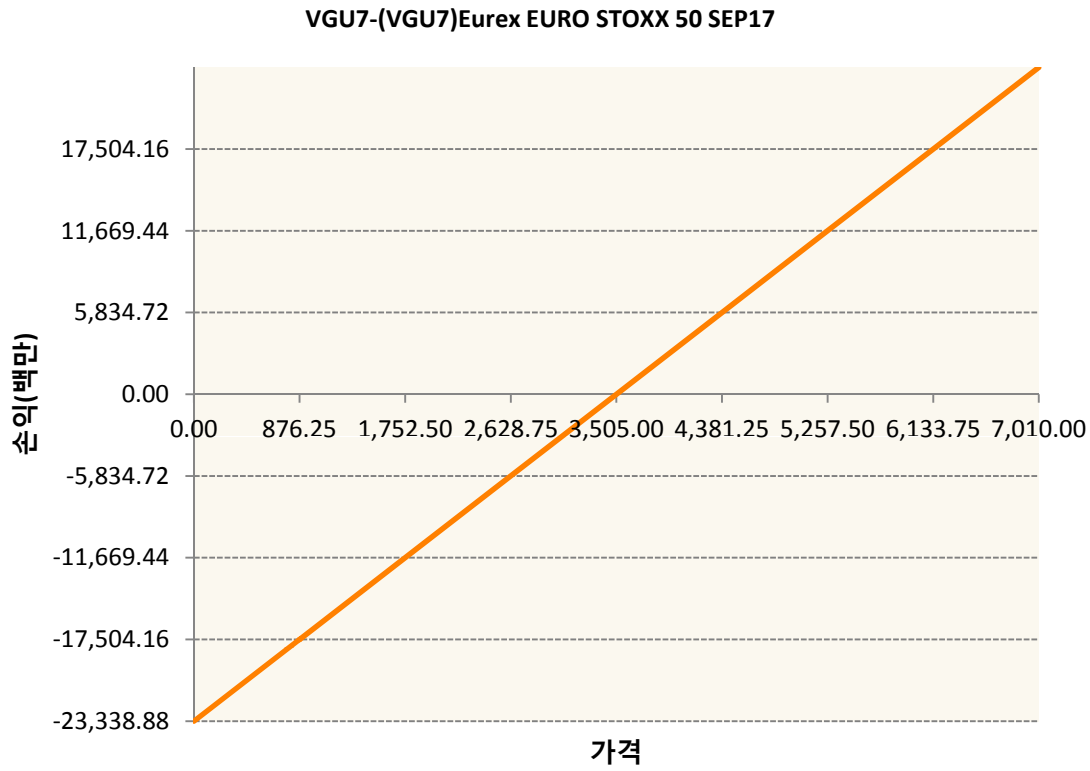
OESXQ7-P3450-EURO STOXX 50



OESXQ7-P3475-EURO STOXX 50







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
OESXQ7-C3	EURO STOXX 50	1,734
OESXQ7-C3	EURO STOXX 50	133
OESXQ7-P3	EURO STOXX 50	1,734
OESXQ7-P3	EURO STOXX 50	133
VGU7	(VGU7)Eurex EURO STOXX 50 SEP17	1,867

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	4,599

공시일	2017-08-08
기준일	2017-08-07

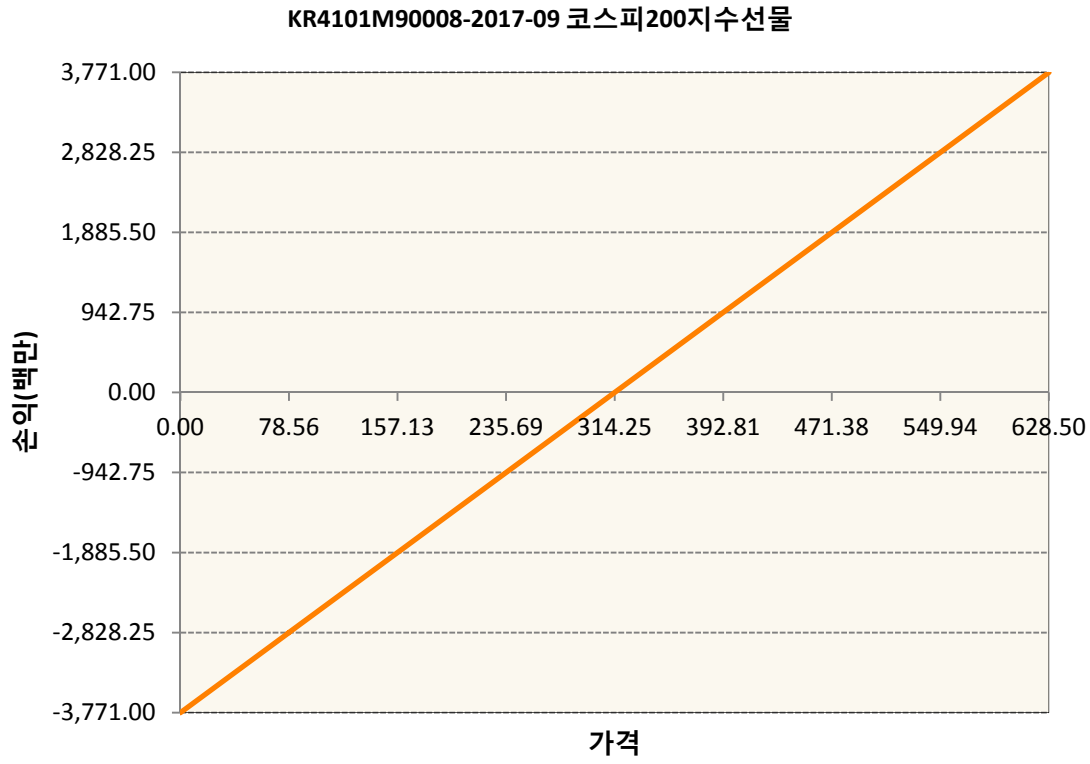
ETF스마트레버리지목표전환형7호

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	3,771	0	3,771	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)

184

공시일	2017-08-08
기준일	2017-08-07

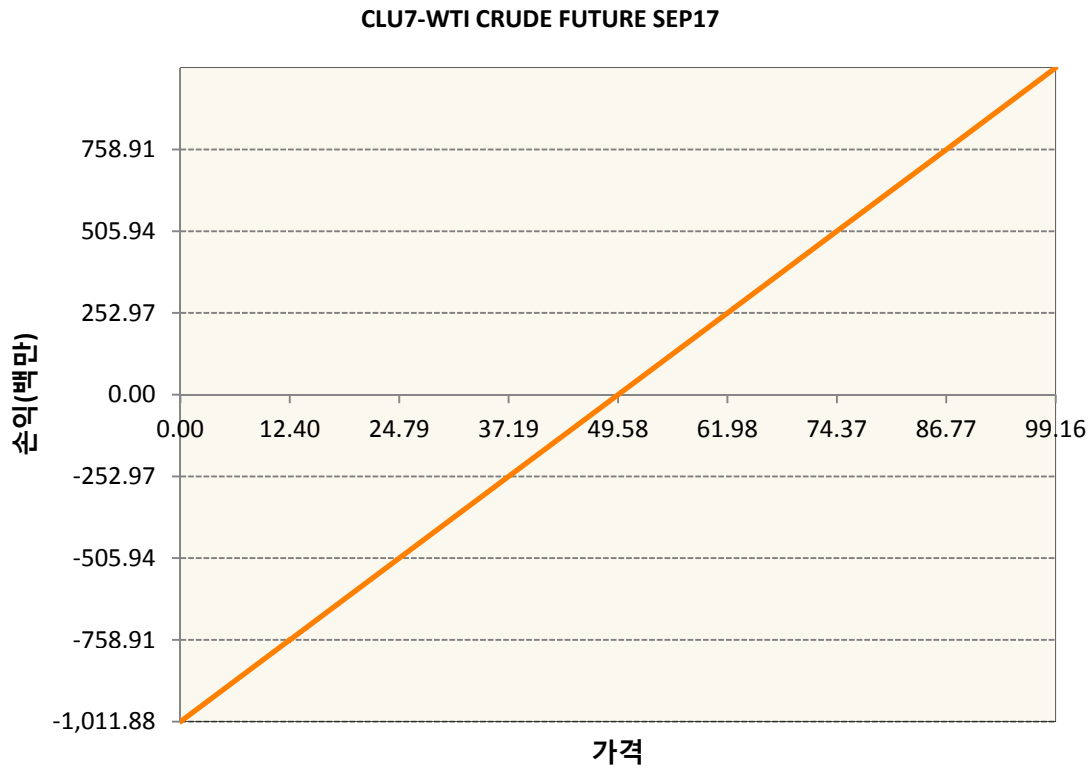
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

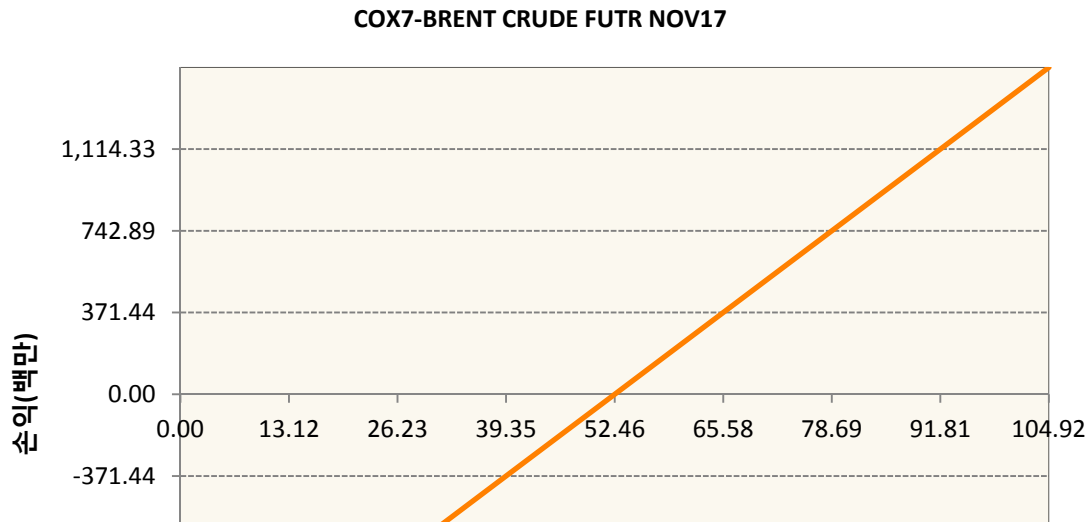
1. 계약금액

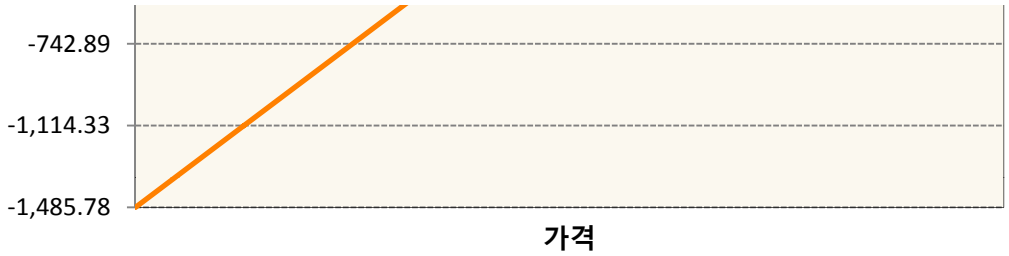
(단위:백만원)

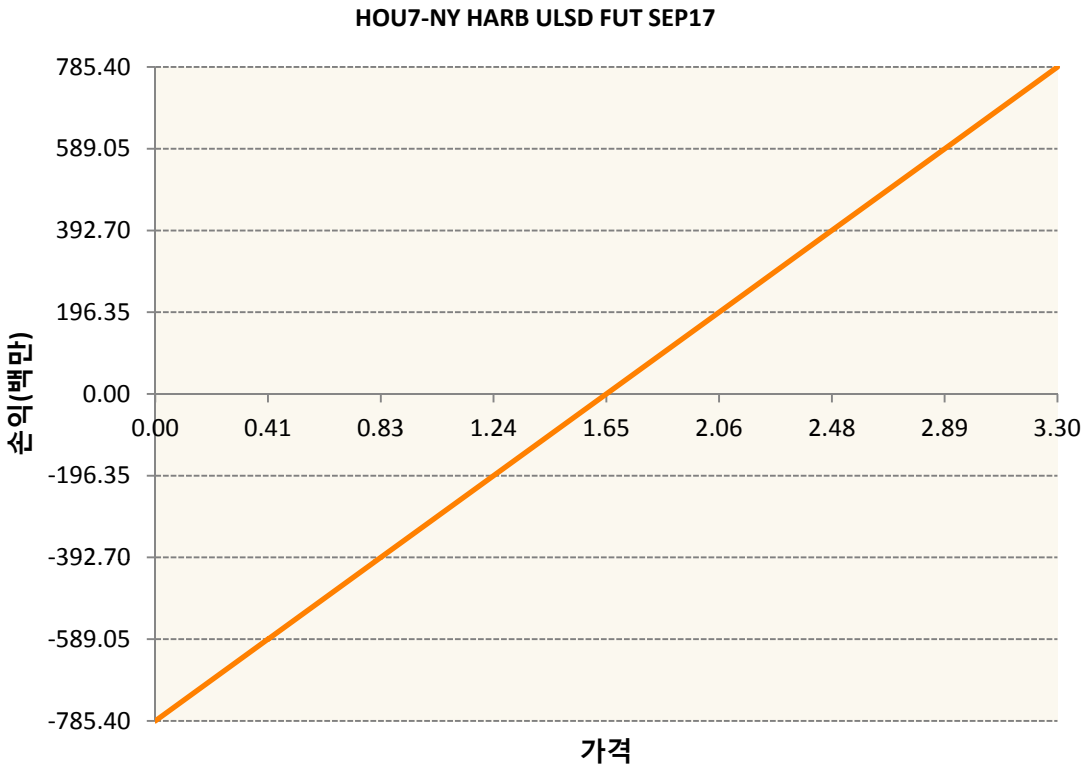
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	5,391	338	5,052	

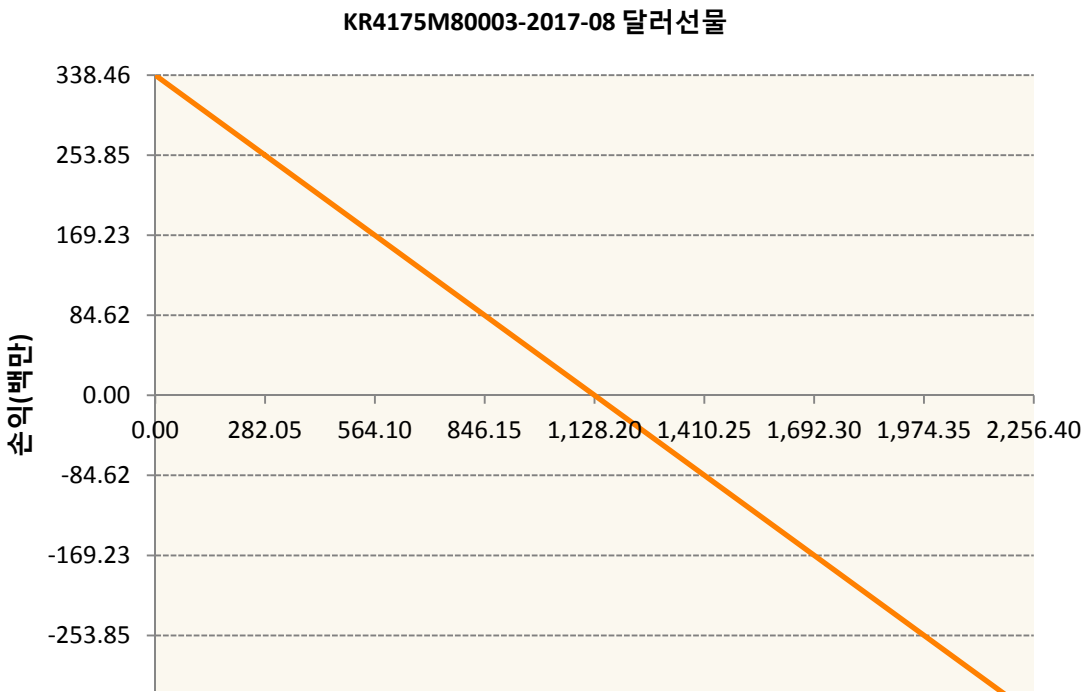
2. 만기시점의 손익구조

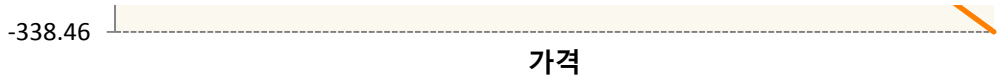


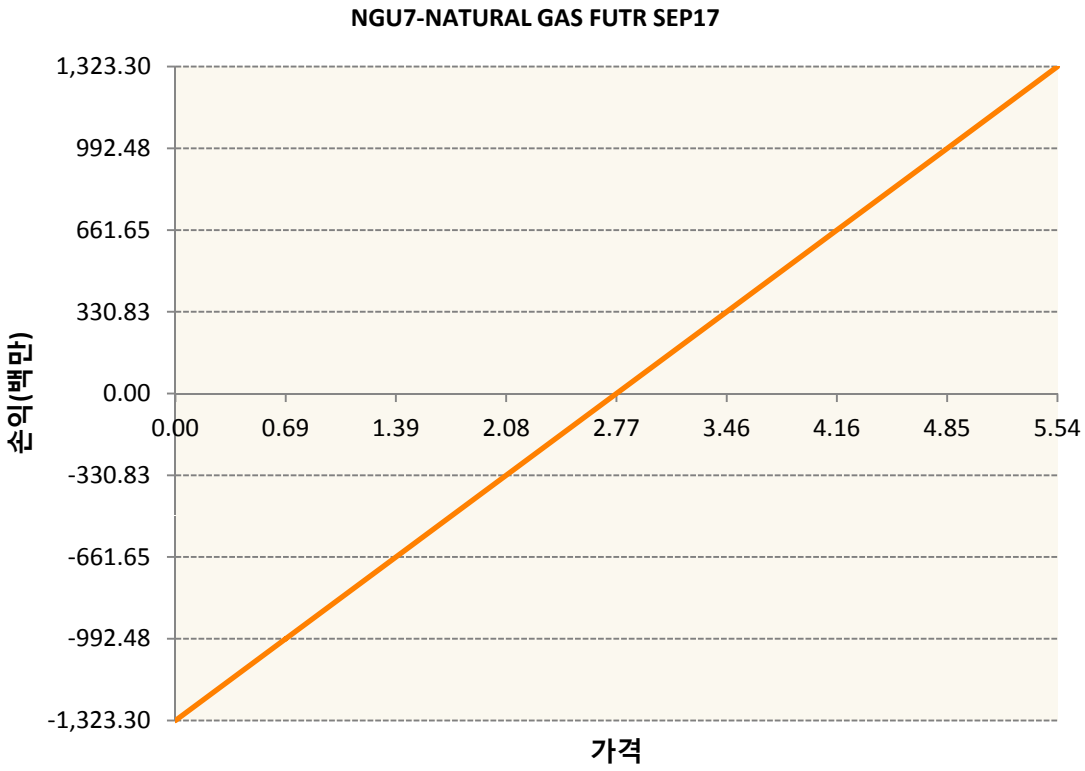


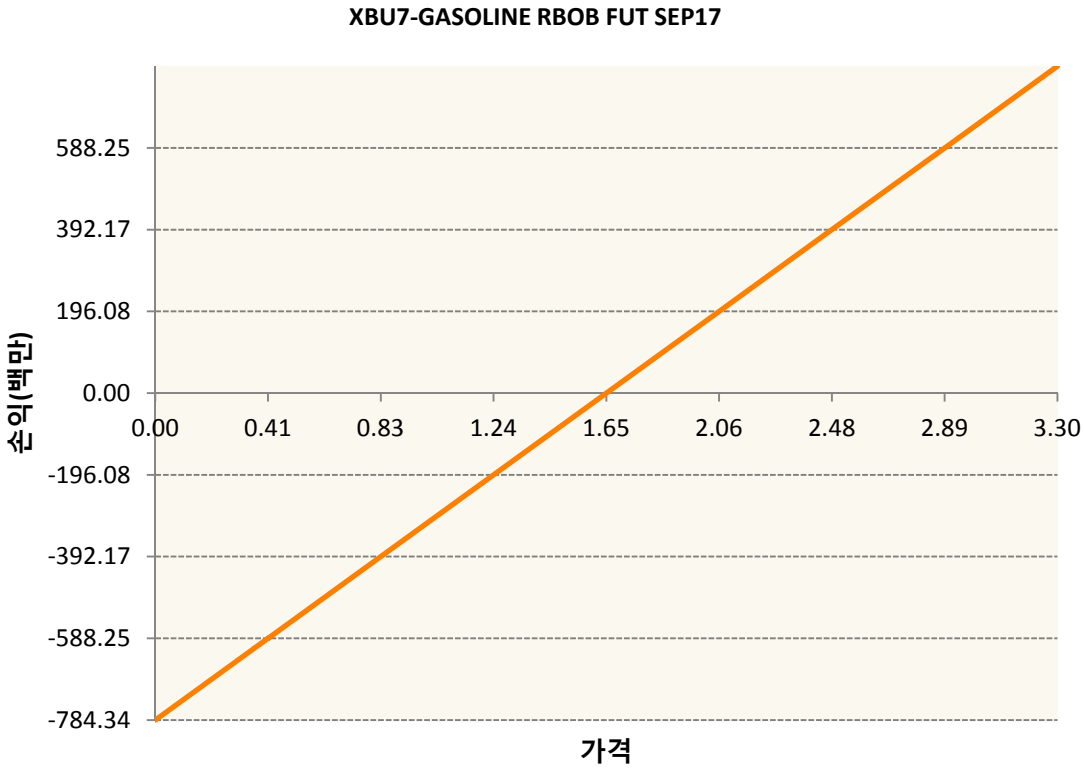

-742.89
-1,114.33
-1,485.78
가격


HOU7-NY HARB ULSD FUT SEP17
785.40
589.05
392.70
196.35
0.00
-196.35
-392.70
-589.05
-785.40
0.00
0.41
0.83
1.24
1.65
2.06
2.48
2.89
3.30
손익(만)
가격


KR4175M80003-2017-08 달러선물
338.46
253.85
169.23
84.62
0.00
-84.62
-169.23
-253.85
0.00
282.05
564.10
846.15
1,128.20
1,410.25
1,692.30
1,974.35
2,256.40
손익(만)


-338.46
가격


NGU7-NATURAL GAS FUTR SEP17
1,323.30
992.48
661.65
330.83
0.00
-330.83
-661.65
-992.48
-1,323.30
0.00
0.69
1.39
2.08
2.77
3.46
4.16
4.85
5.54
손익(백만)
가격


XBU7-GASOLINE RBOB FUT SEP17
588.25
392.17
196.08
0.00
-196.08
-392.17
-588.25
-784.34
0.00
0.41
0.83
1.24
1.65
2.06
2.48
2.89
3.30
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	106
XBU7	GASOLINE RBOB FUT SEP17	63

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

777

공시일	2017-08-08
기준일	2017-08-07

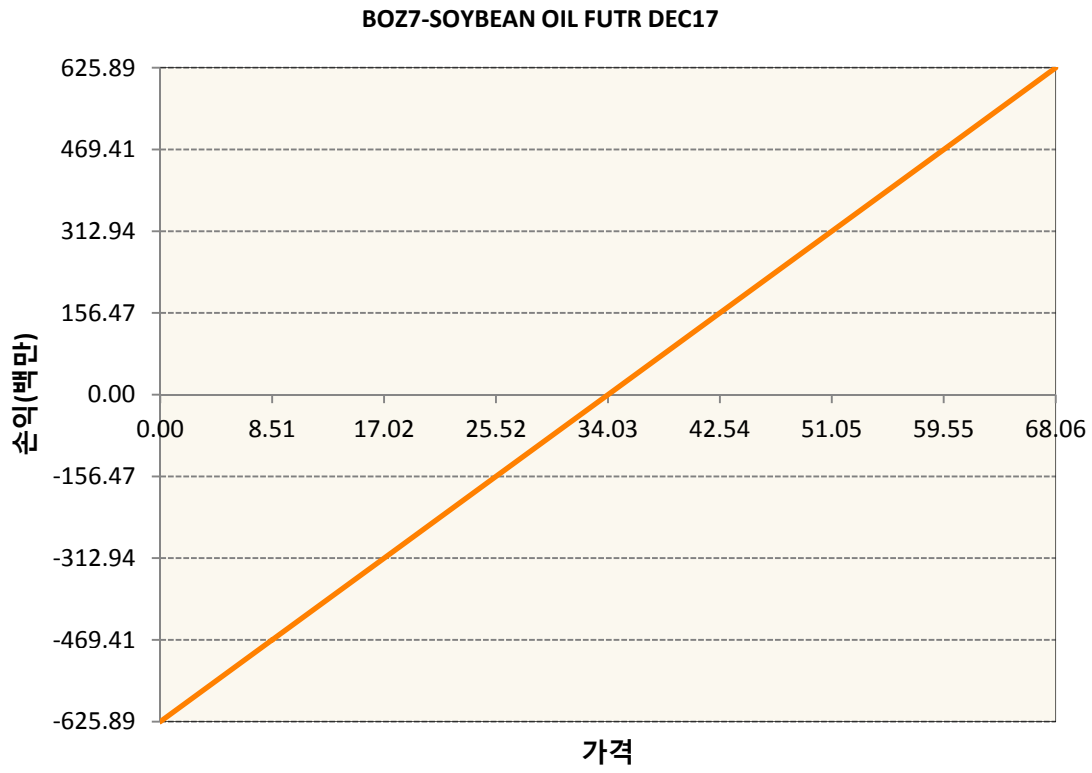
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

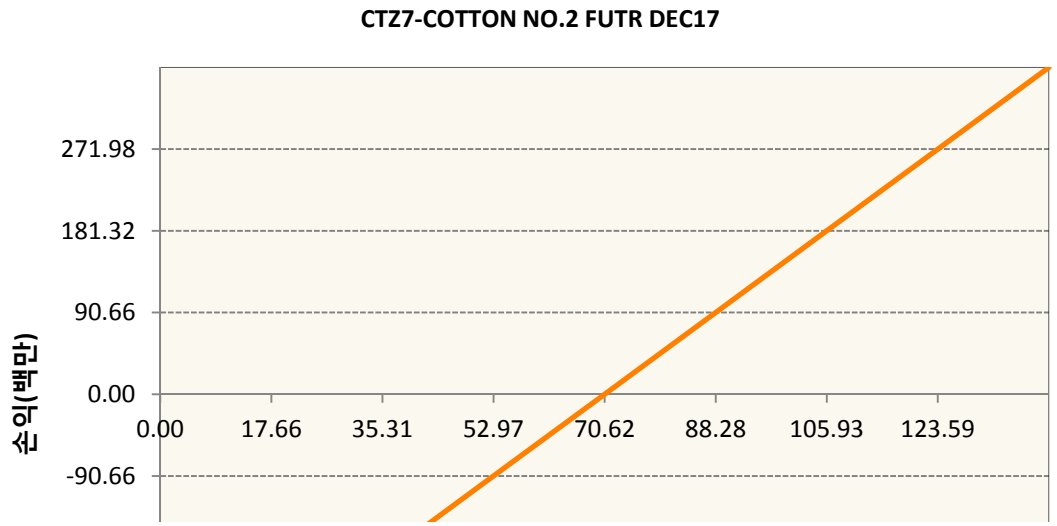
1. 계약금액

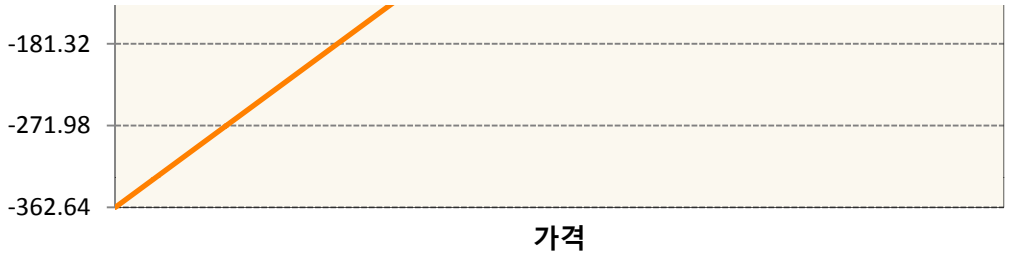
(단위:백만원)

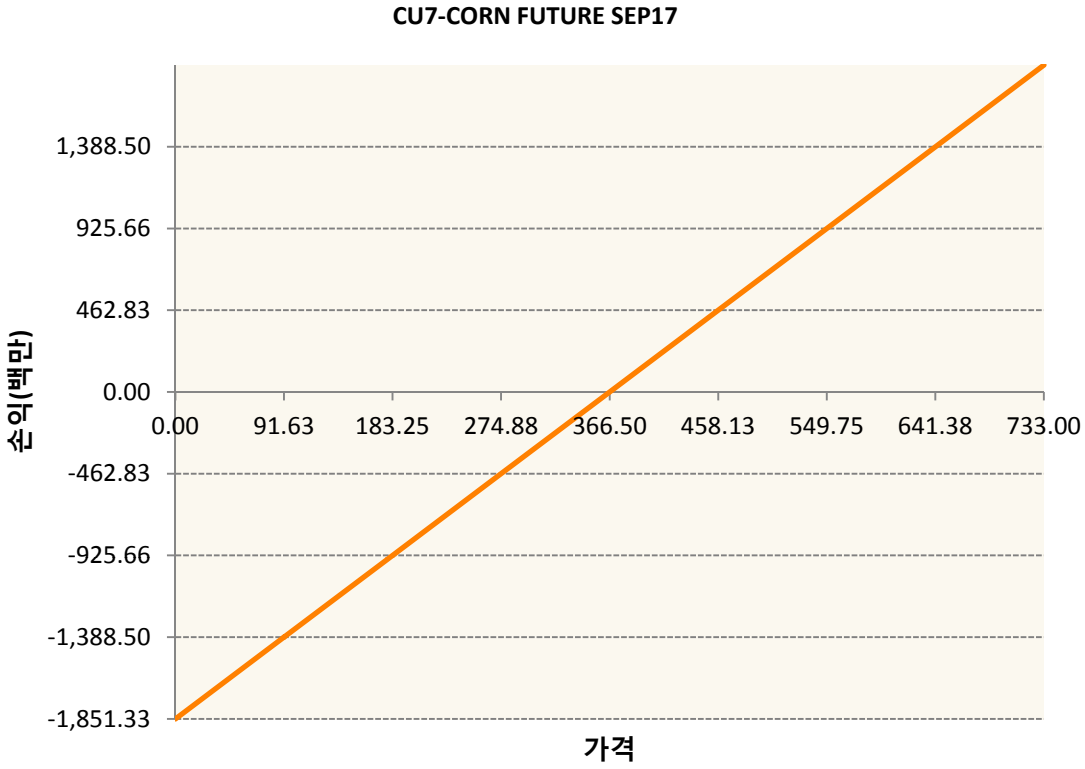
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	7,086	395	6,691	

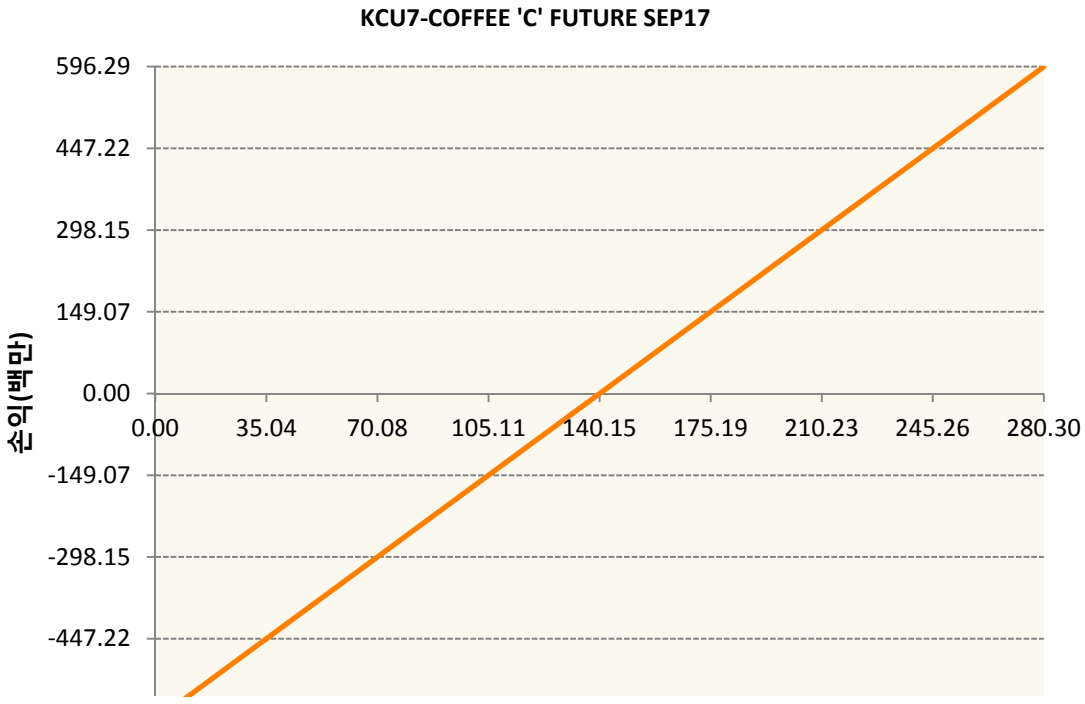
2. 만기시점의 손익구조

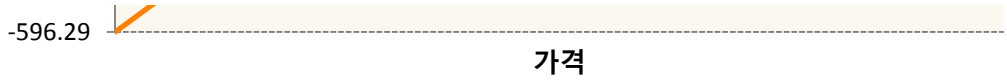


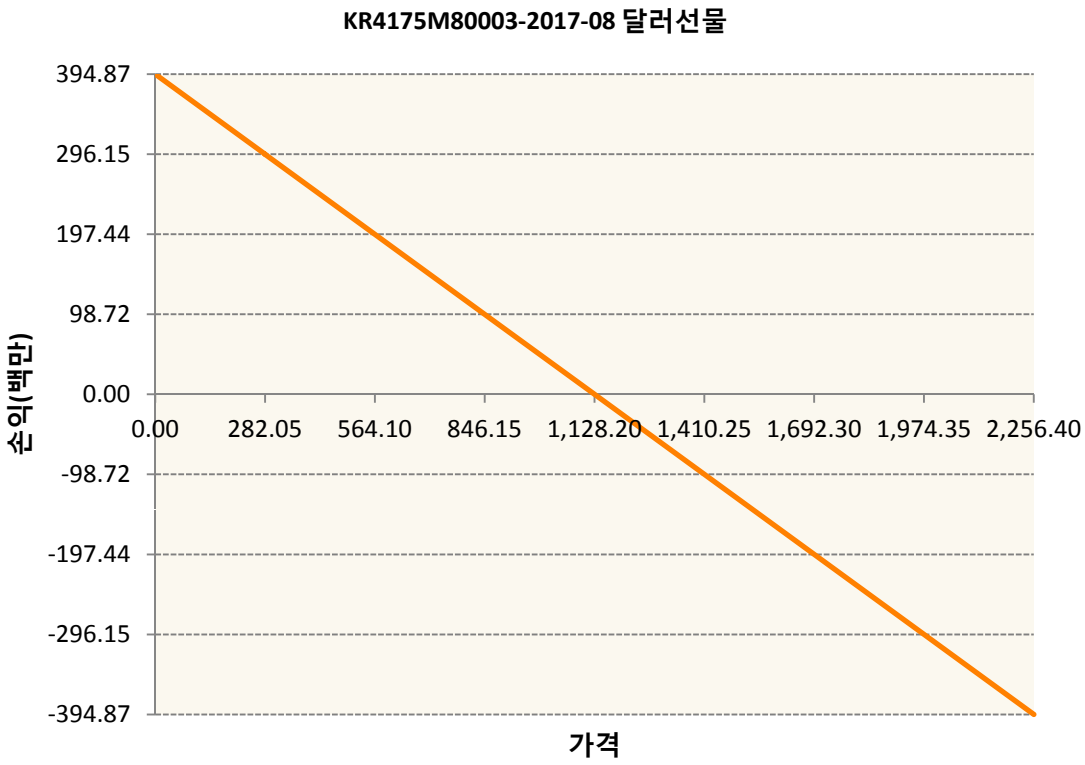


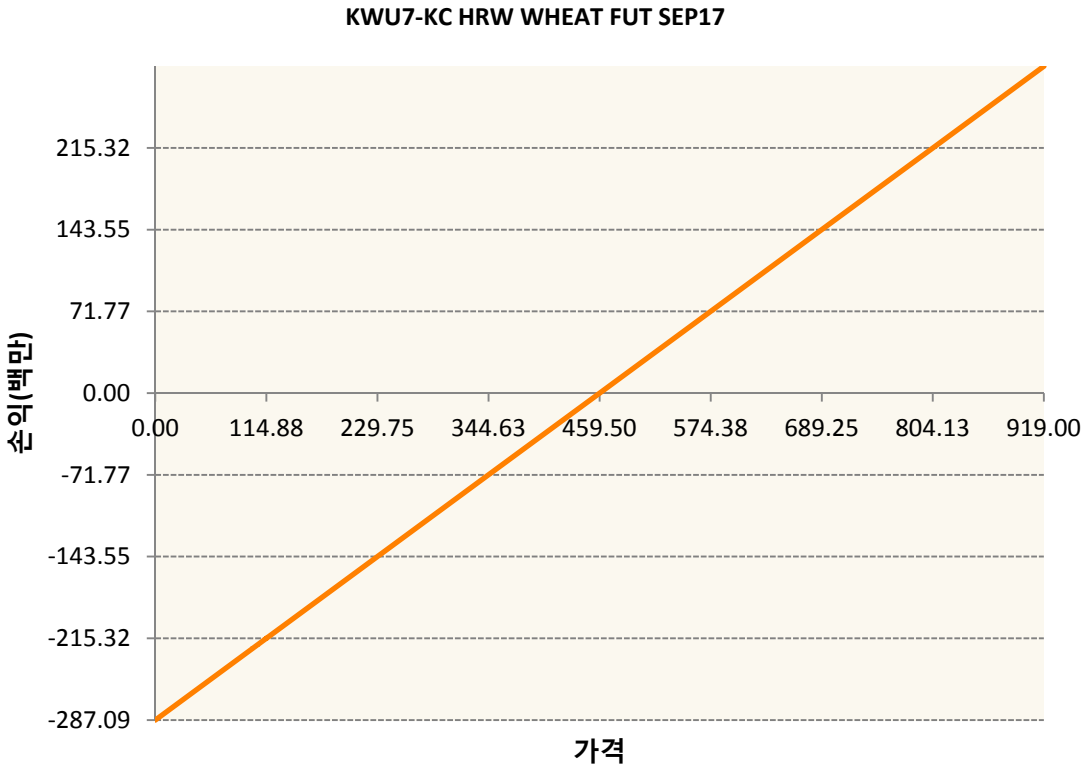

-181.32
-271.98
-362.64
가격


CU7-CORN FUTURE SEP17
1,388.50
925.66
462.83
0.00
-462.83
-925.66
-1,388.50
-1,851.33
0.00
91.63
183.25
274.88
366.50
458.13
549.75
641.38
733.00
손익(백만)
가격

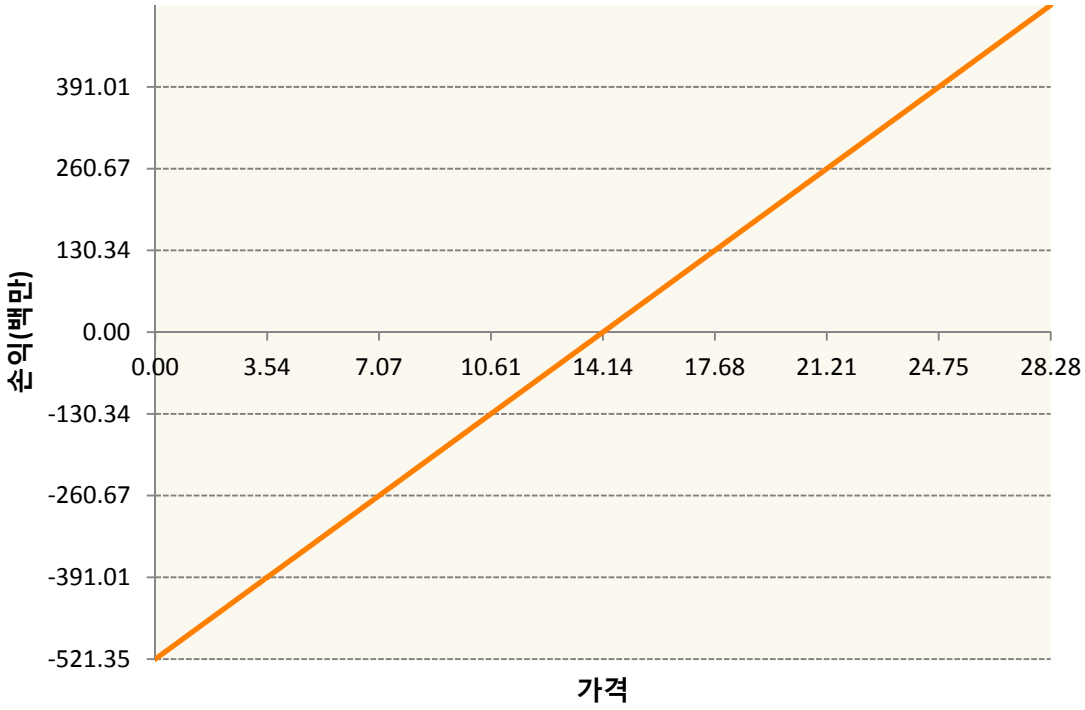

KCU7-COFFEE 'C' FUTURE SEP17
596.29
447.22
298.15
149.07
0.00
-149.07
-298.15
-447.22
0.00
35.04
70.08
105.11
140.15
175.19
210.23
245.26
280.30
손익(백만)


-596.29
가격

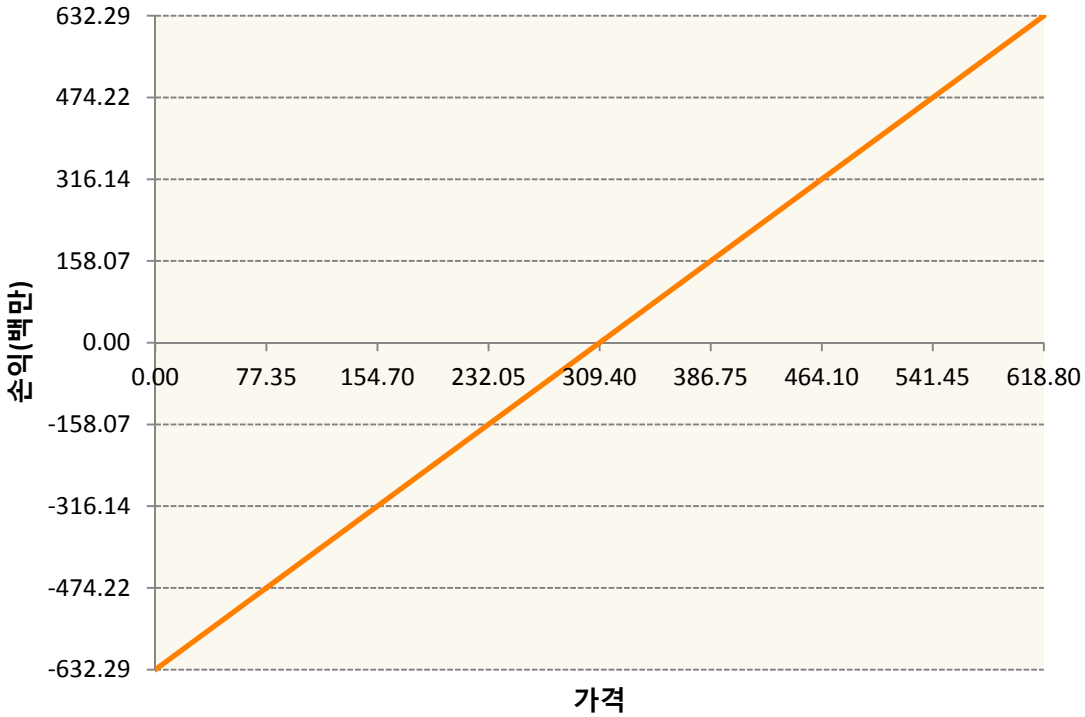

KR4175M80003-2017-08 달러선물
394.87
296.15
197.44
98.72
0.00
-98.72
-197.44
-296.15
-394.87
0.00
282.05
564.10
846.15
1,128.20
1,410.25
1,692.30
1,974.35
2,256.40
손익(백만)
가격


KWU7-KC HRW WHEAT FUT SEP17
215.32
143.55
71.77
0.00
-71.77
-143.55
-215.32
-287.09
0.00
114.88
229.75
344.63
459.50
574.38
689.25
804.13
919.00
손익(백만)
가격

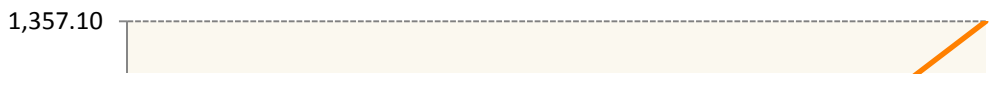
SBV7-SUGAR #11 (WORLD) OCT17

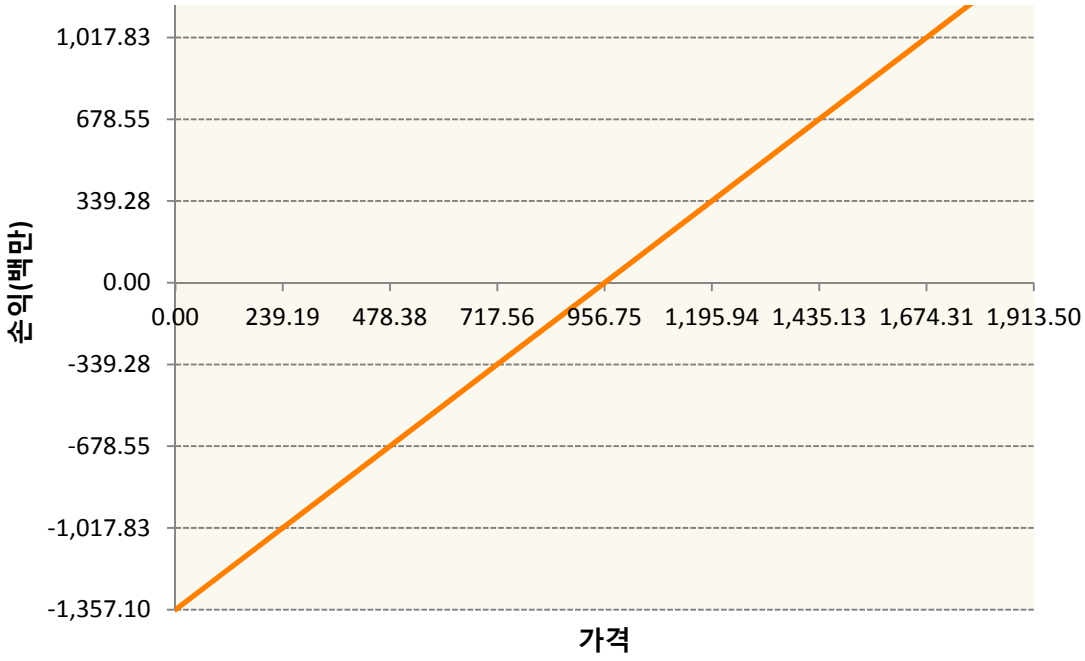


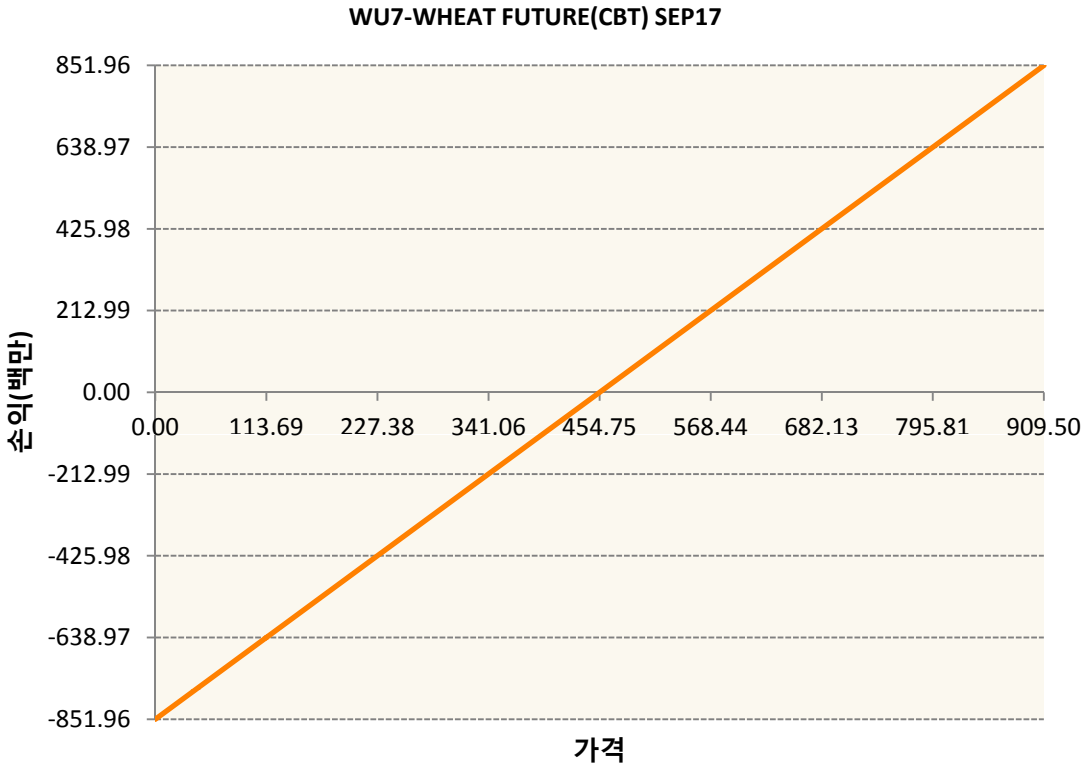
SMZ7-SOYBEAN MEAL FUTR DEC17



SX7-SOYBEAN FUTURE NOV17







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
BOZ7	SOYBEAN OIL FUTR DEC17	50
CTZ7	COTTON NO.2 FUTR DEC17	29
CU7	CORN FUTURE SEP17	148
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	68

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

667