공시일	2017-08-09
기준일	2017-08-08

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	2017-08-09
기준일	2017-08-08

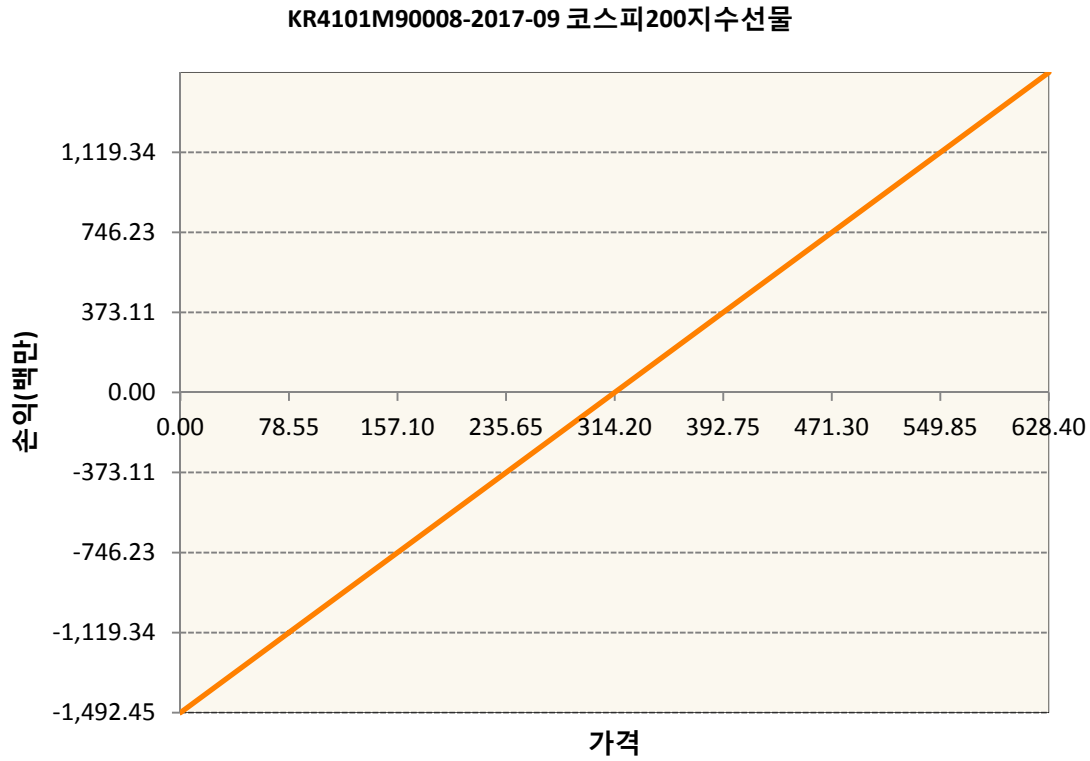
스마트인덱스모

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	2017-08-09
기준일	2017-08-08

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	1,027

* 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	2017-08-09
기준일	2017-08-08

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)

339

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-08-09
기준일	2017-08-08

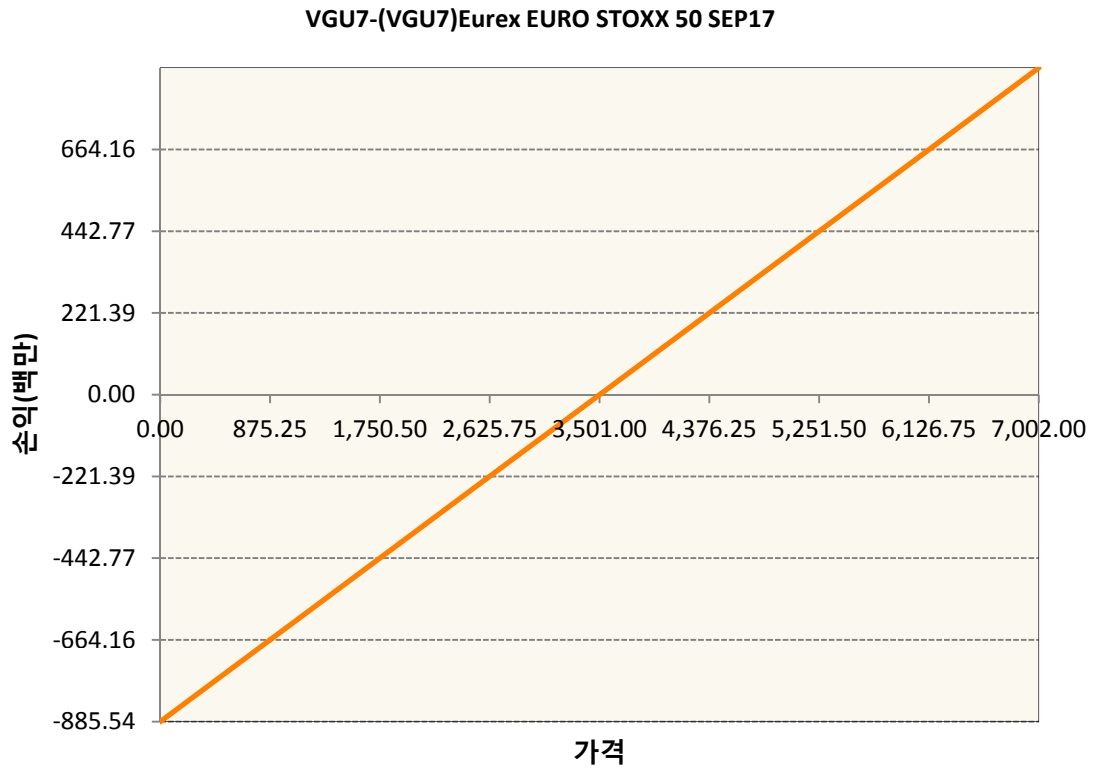
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	886	0	886	

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	2017-08-09
기준일	2017-08-08

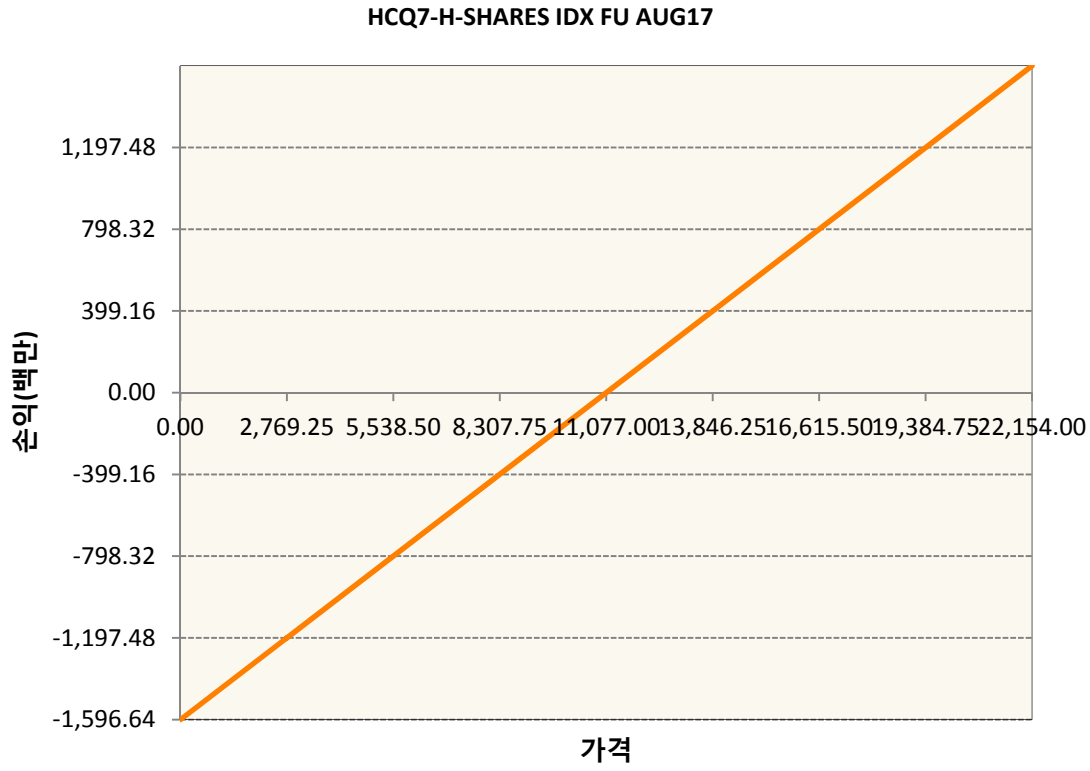
차이나인덱스모(주식-파생형)

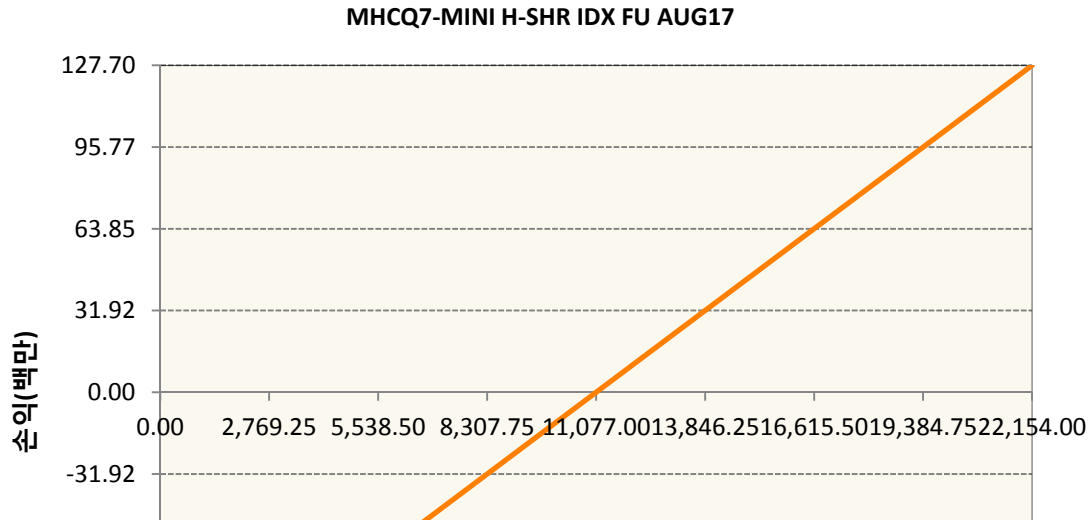
1. 계약금액

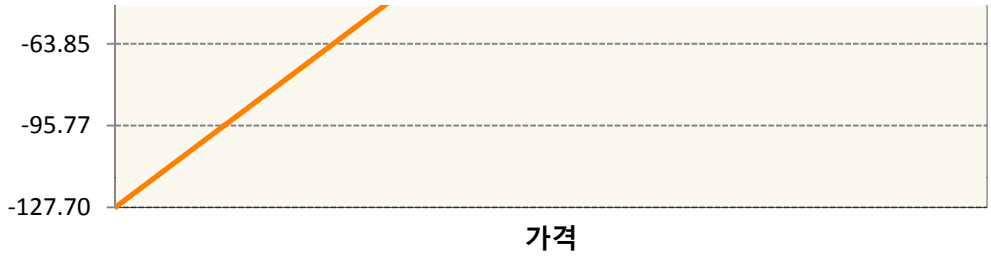
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,724	0	1,724	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)
	121

공시일	2017-08-09
기준일	2017-08-08

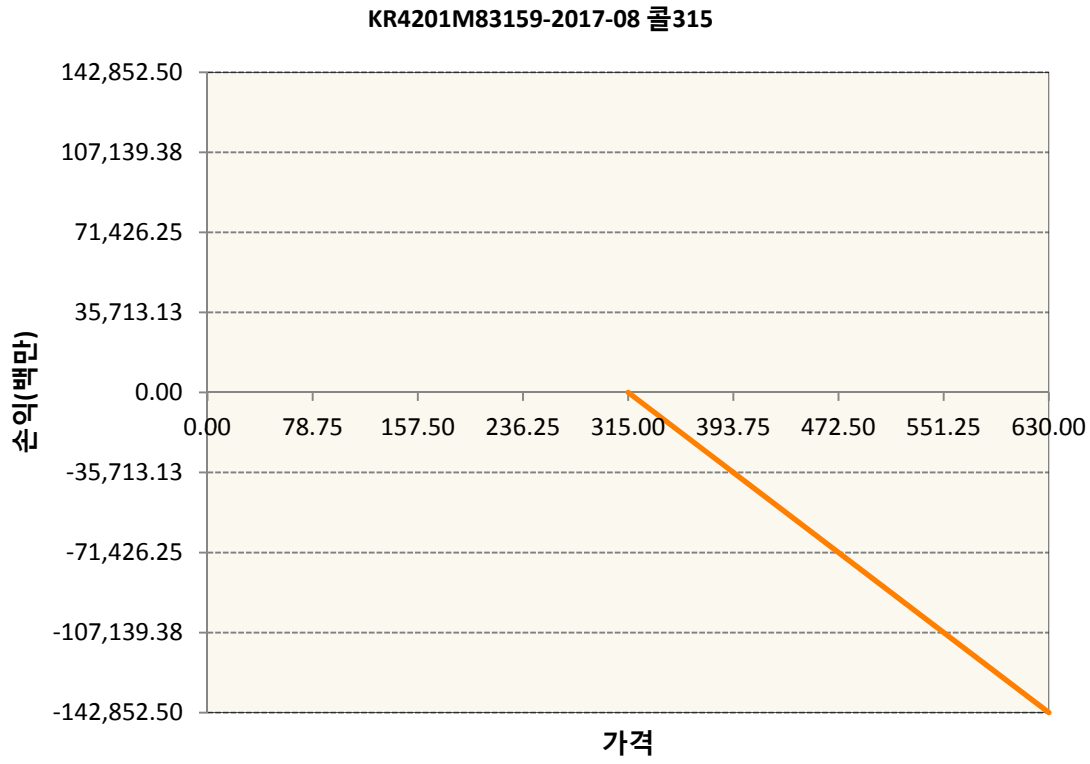
커버드콜모(주식혼합-파생형)

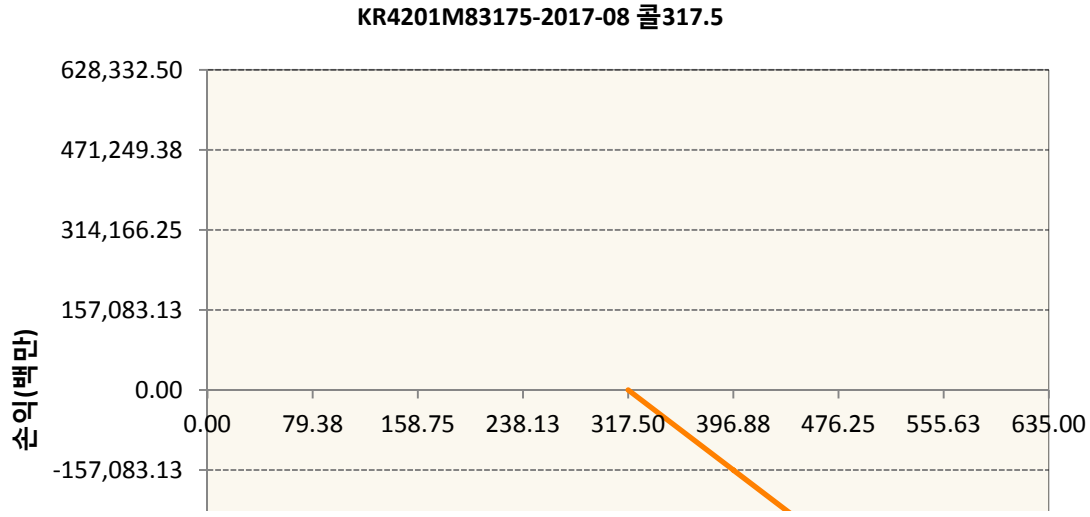
1. 계약금액

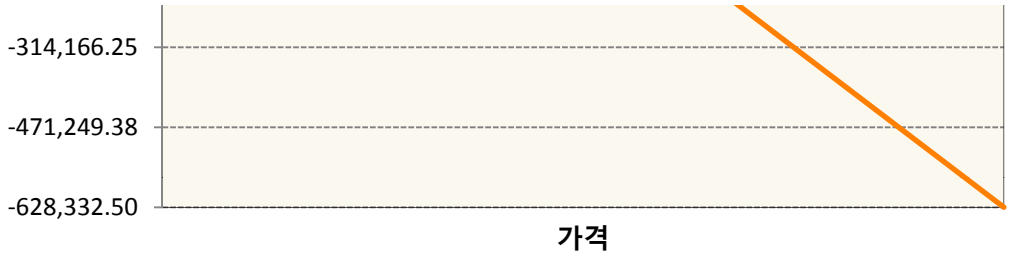
(단위:백만원)

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

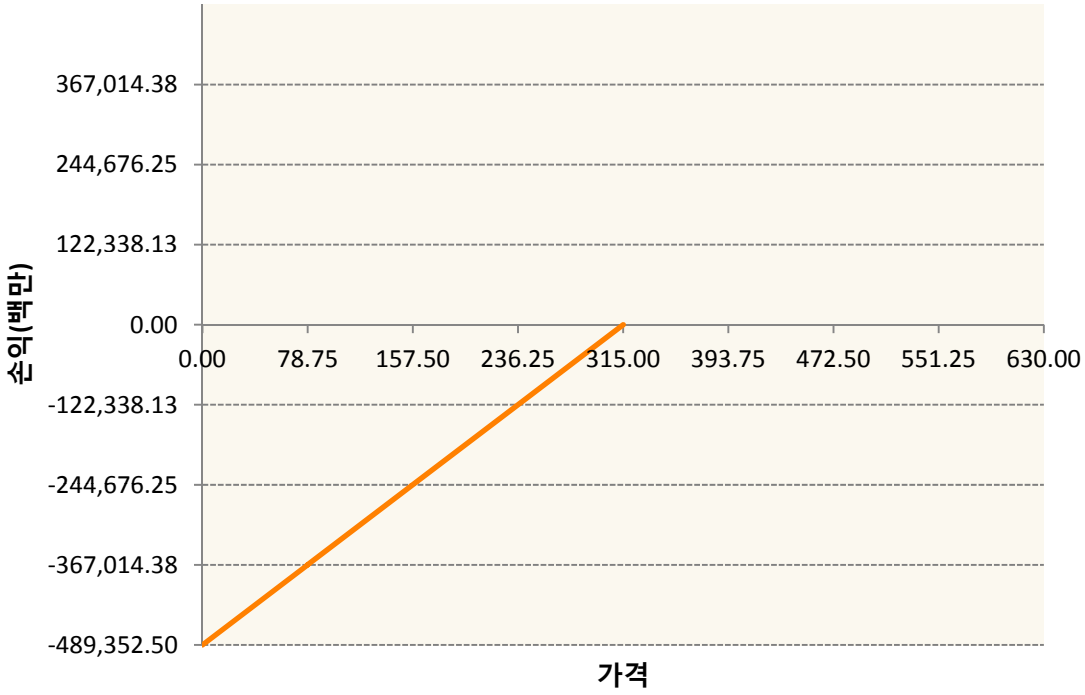
2. 만기시점의 손익구조



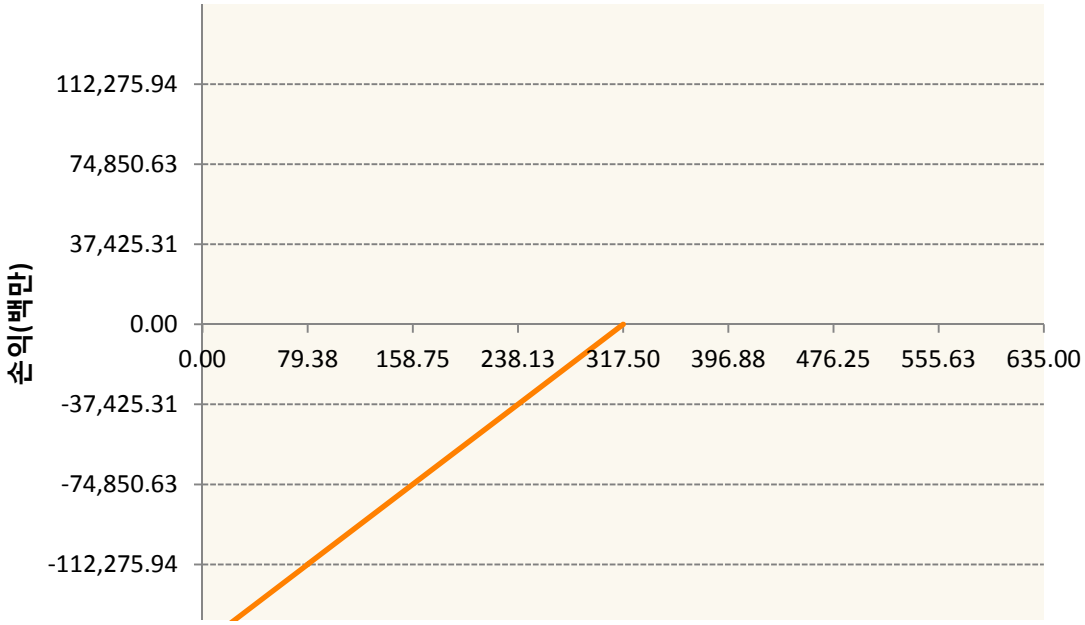




KR4301M83157-2017-08 풋315



KR4301M83173-2017-08 풋317.5





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201M83: 2017-08 콜315							10,012
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	632	632	632	632	632	632	632
-5.33%	632	632	632	631	631	631	630
-2.67%	629	624	617	607	593	574	552
0%	223	150	75	0	-76	-152	-229
2.67%	-2,466	-2,488	-2,516	-2,550	-2,588	-2,630	-2,676
5.33%	-6,222	-6,222	-6,222	-6,224	-6,226	-6,230	-6,235
8.00%	-10,012	-10,012	-10,012	-10,012	-10,012	-10,012	-10,012
KR4201M83: 2017-08 콜317.5							40,195
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,306	1,306	1,306	1,306	1,306	1,306	1,306
-5.33%	1,306	1,306	1,306	1,306	1,306	1,305	1,304
-2.67%	1,305	1,301	1,293	1,278	1,253	1,217	1,169
0%	698	484	250	0	-263	-536	-818
2.67%	-7,703	-7,915	-8,147	-8,396	-8,659	-8,933	-9,216
5.33%	-23,655	-23,660	-23,671	-23,689	-23,719	-23,761	-23,816
8.00%	-40,191	-40,191	-40,191	-40,191	-40,192	-40,193	-40,195
KR4301M83: 2017-08 풋315							36,783
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-36,783	-36,783	-36,783	-36,783	-36,783	-36,783	-36,783
-5.33%	-23,801	-23,801	-23,801	-23,801	-23,802	-23,804	-23,807
-2.67%	-10,829	-10,843	-10,867	-10,903	-10,952	-11,014	-11,090
0%	765	513	258	0	-260	-522	-785
2.67%	4,535	4,459	4,363	4,248	4,117	3,972	3,813
5.33%	4,651	4,650	4,649	4,645	4,637	4,624	4,605
8.00%	4,651	4,651	4,651	4,651	4,651	4,651	4,650
KR4301M83: 2017-08 풋317.5							11,509
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-11,509	-11,509	-11,509	-11,509	-11,509	-11,509	-11,509
-5.33%	-7,569	-7,569	-7,569	-7,569	-7,569	-7,569	-7,570
-2.67%	-3,629	-3,630	-3,632	-3,636	-3,642	-3,650	-3,662
0%	166	115	59	0	-63	-128	-195
2.67%	2,105	2,054	1,999	1,940	1,877	1,812	1,745

5.33%	2,244	2,243	2,241	2,236	2,229	2,219	2,206
8.00%	2,245	2,245	2,245	2,245	2,245	2,244	2,244

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

126,626

공시일	2017-08-09
기준일	2017-08-08

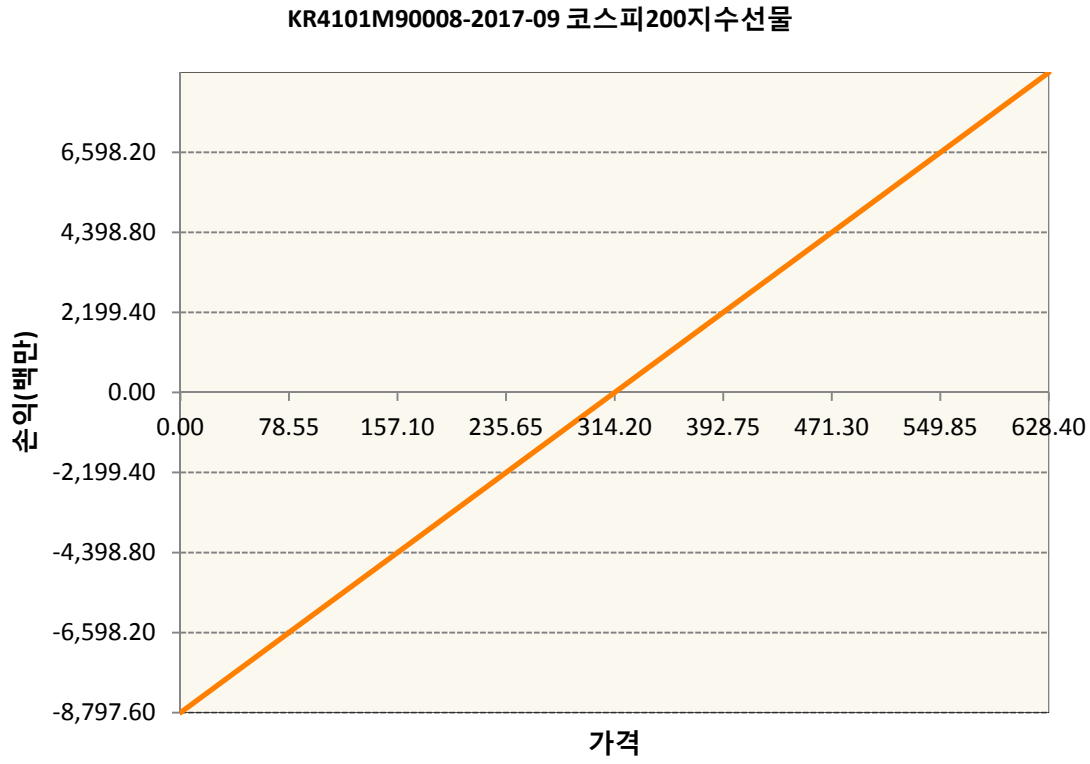
ETF스마트레버리지목표전환형6호

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)

429

공시일	2017-08-09
기준일	2017-08-08

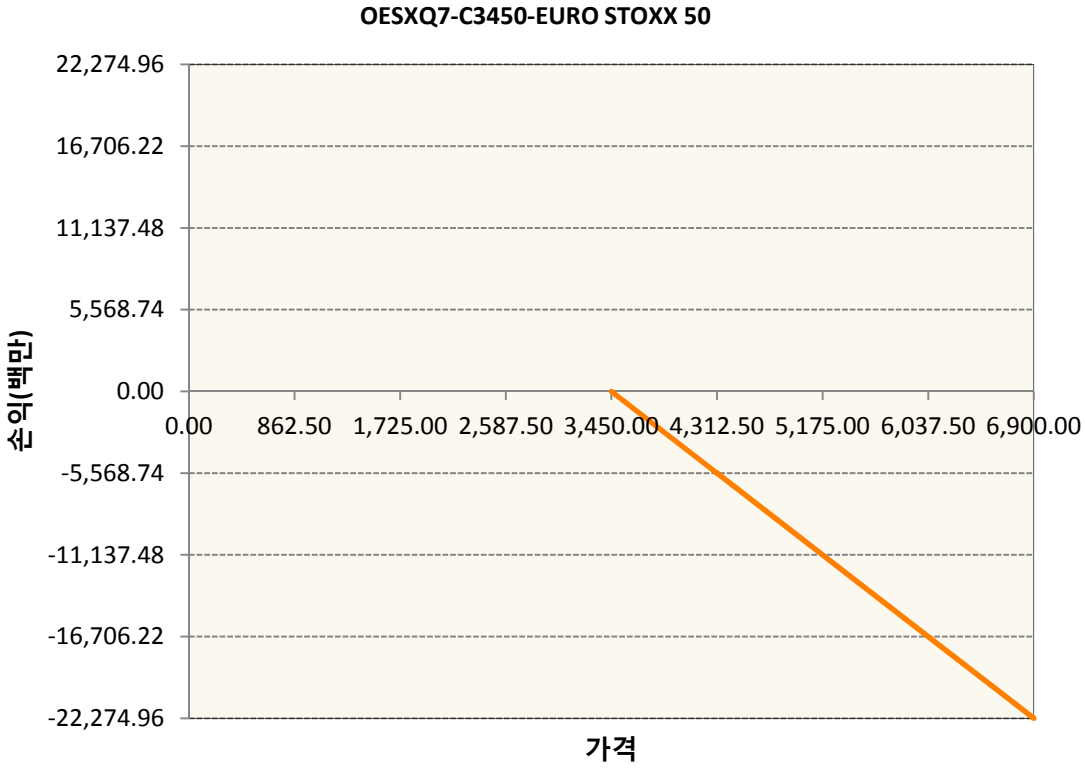
유로커버드콜(주식혼합-파생형)

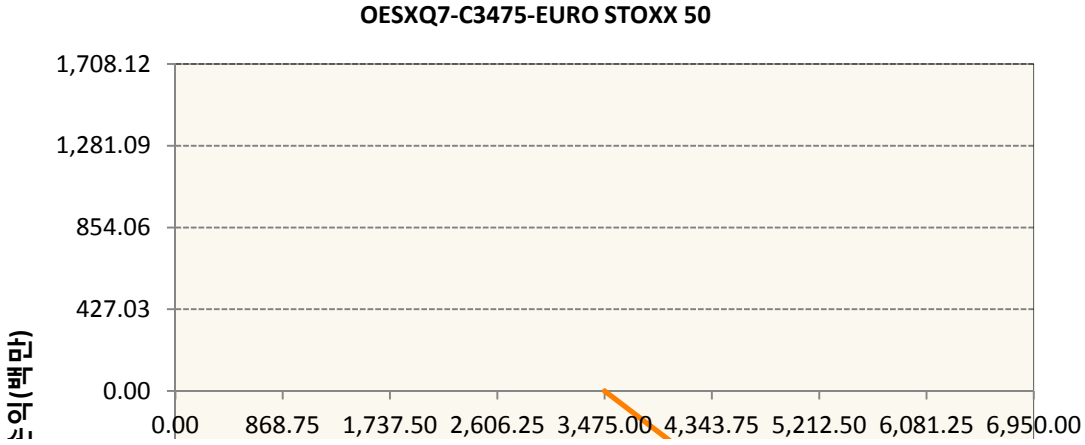
1. 계약금액

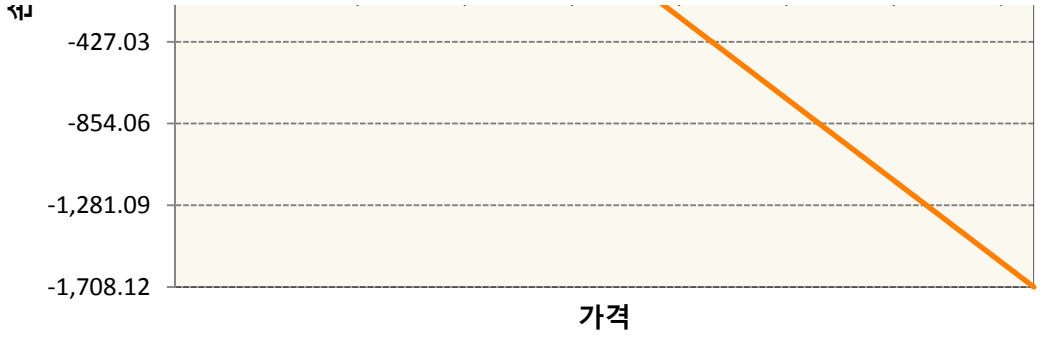
(단위:백만원)

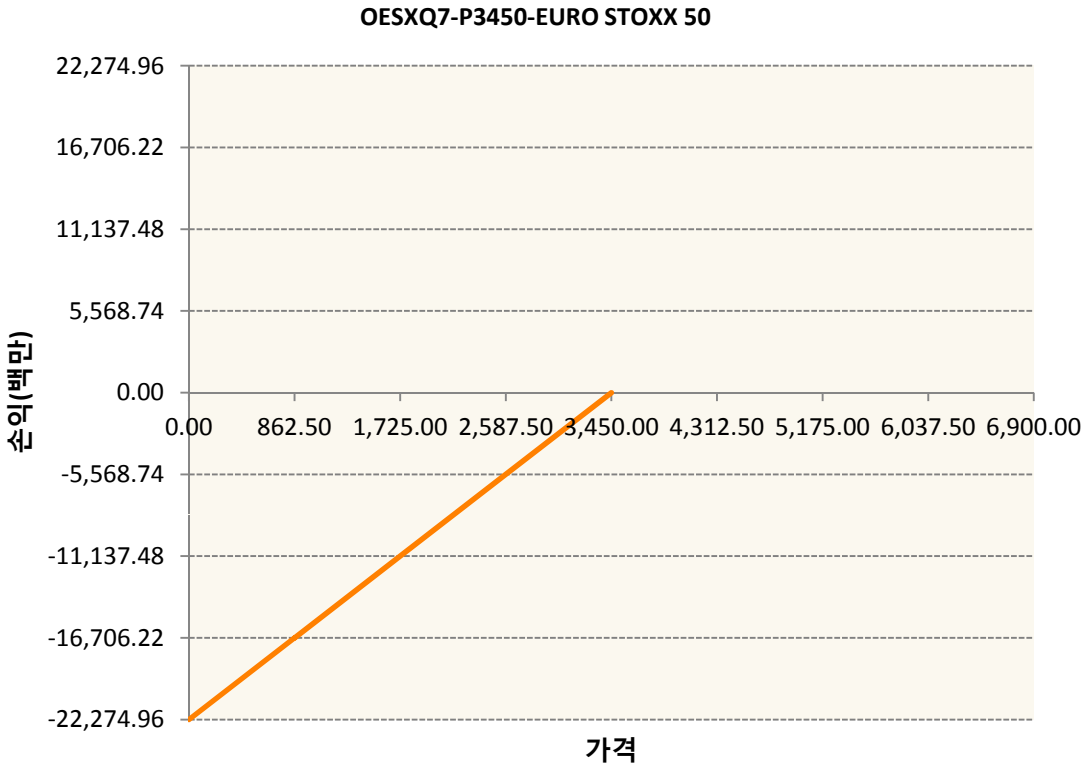
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	23,310	0	23,310	
누계	유가증권	옵션	0	47,966	-47,966	장내

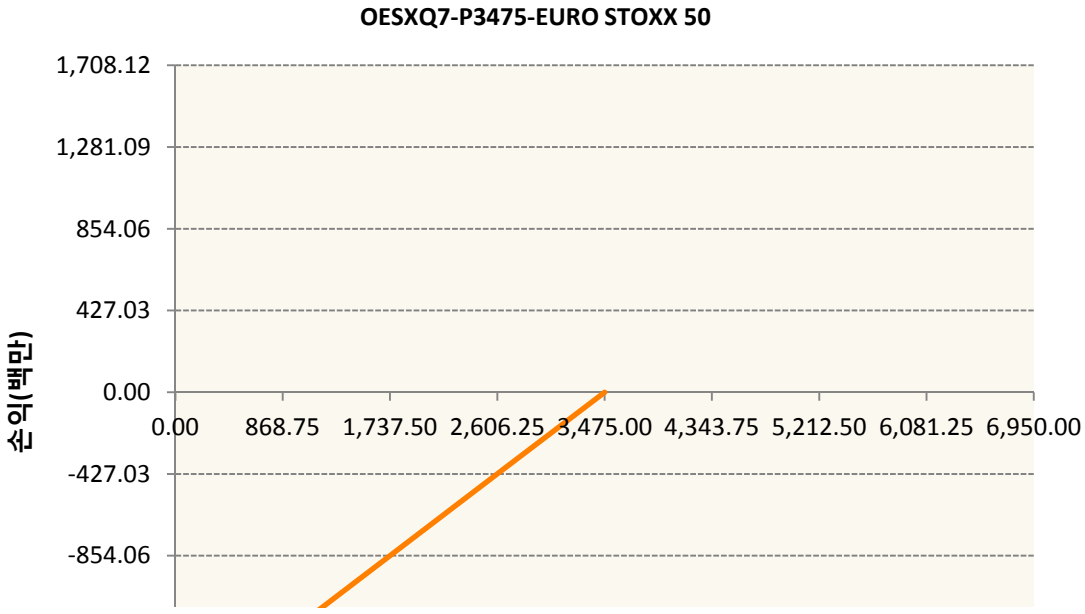
2. 만기시점의 손익구조

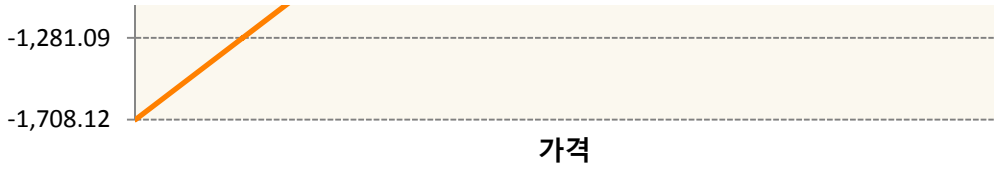


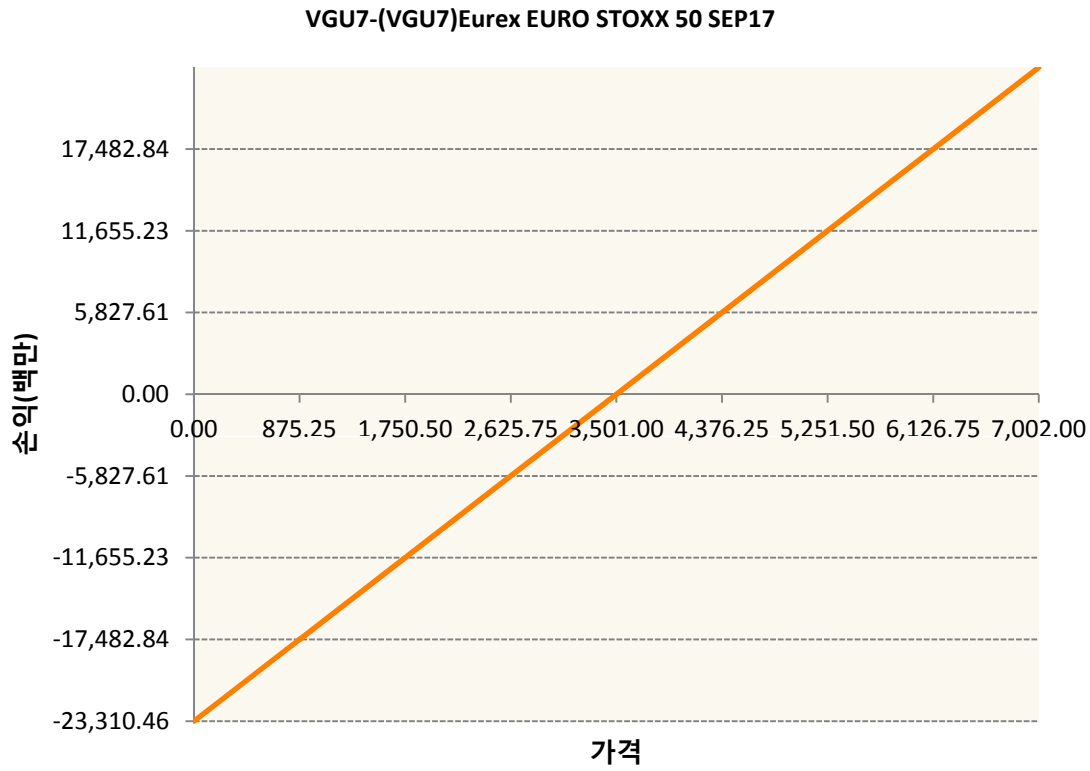



-427.03
-854.06
-1,281.09
-1,708.12
가격


OESXQ7-P3450-EURO STOXX 50
22,274.96
16,706.22
11,137.48
5,568.74
0.00
-5,568.74
-11,137.48
-16,706.22
-22,274.96
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
1,708.12
1,281.09
854.06
427.03
0.00
-427.03
-854.06
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	1,782
OESXQ7-C3	EURO STOXX 50	137
OESXQ7-P3	EURO STOXX 50	1,782
OESXQ7-P3	EURO STOXX 50	137
VGU7	(VGU7)Eurex EURO STOXX 50 SEP17	1,865

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	4,683

공시일	2017-08-09
기준일	2017-08-08

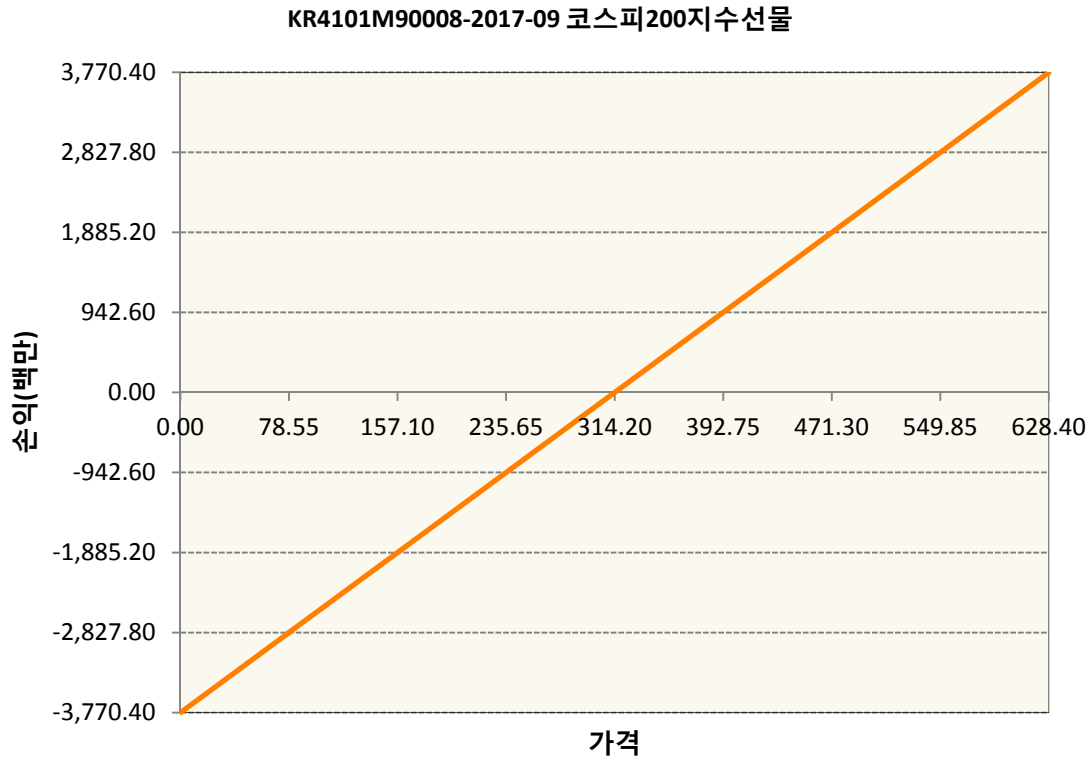
ETF스마트레버리지목표전환형7호

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)

184

공시일	2017-08-09
기준일	2017-08-08

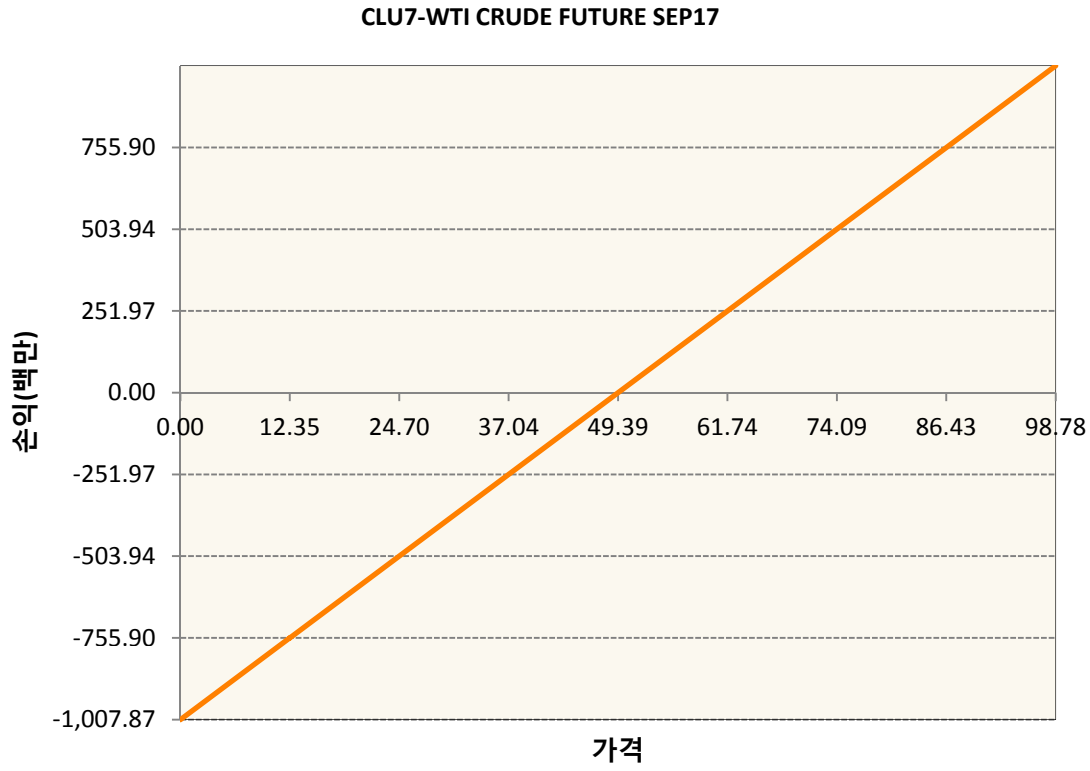
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

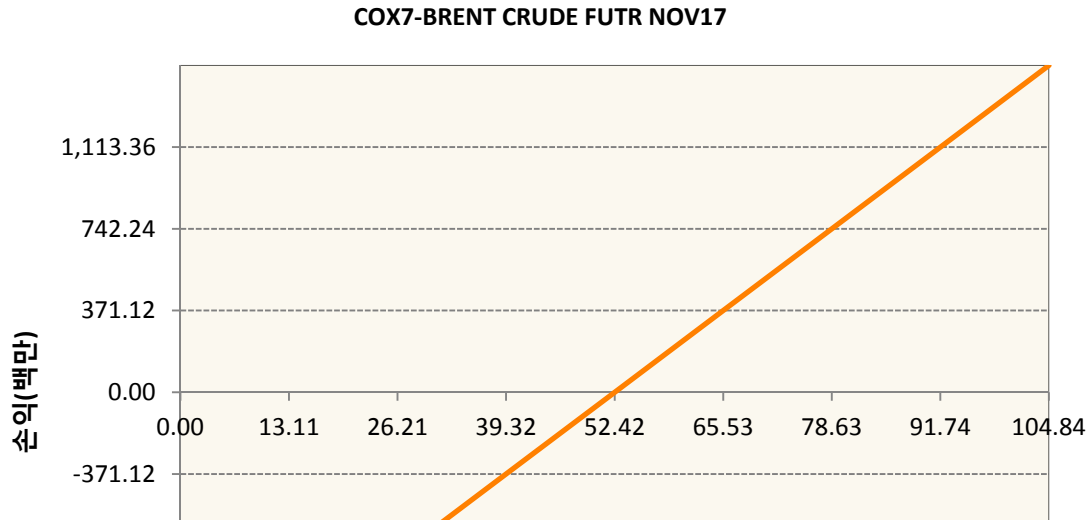
1. 계약금액

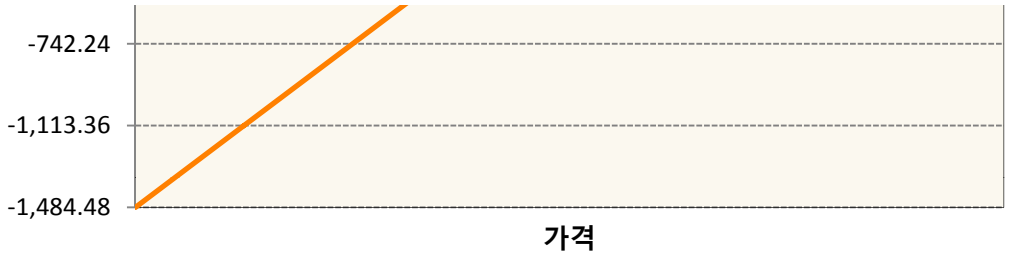
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	5,386	338	5,048	

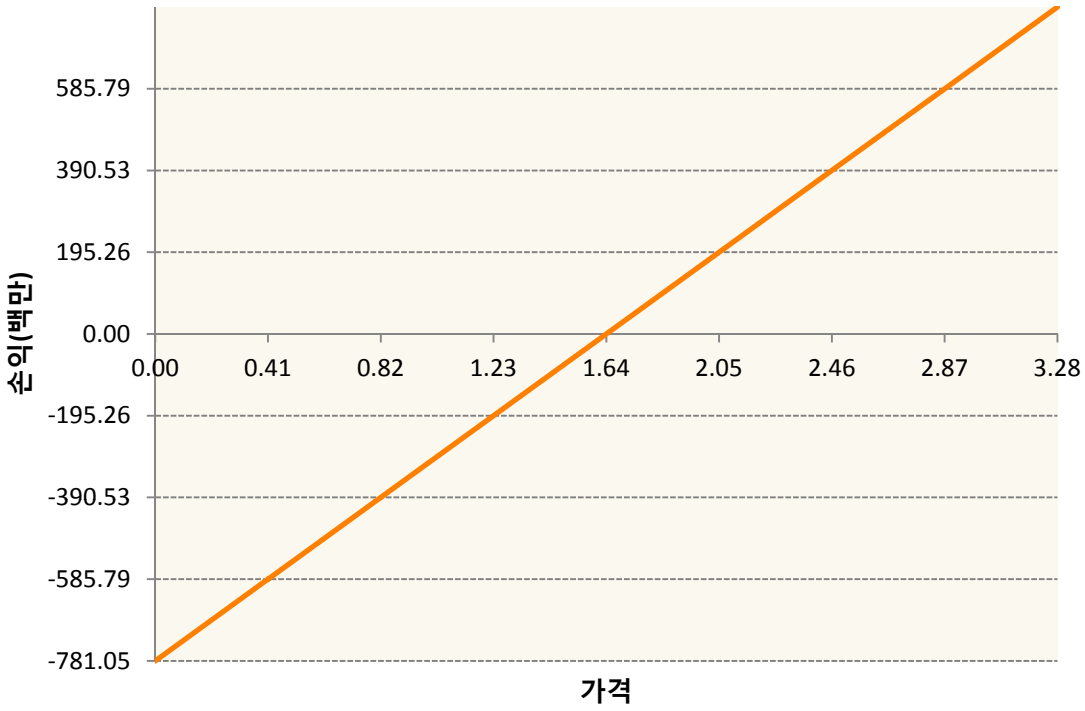
2. 만기시점의 손익구조



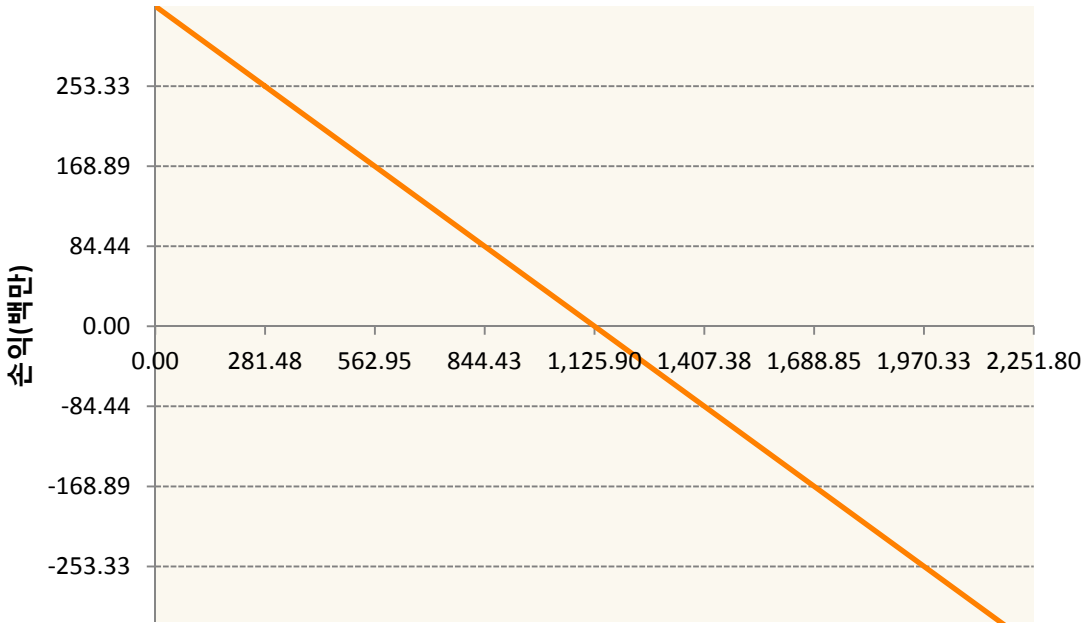


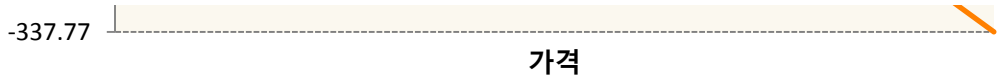


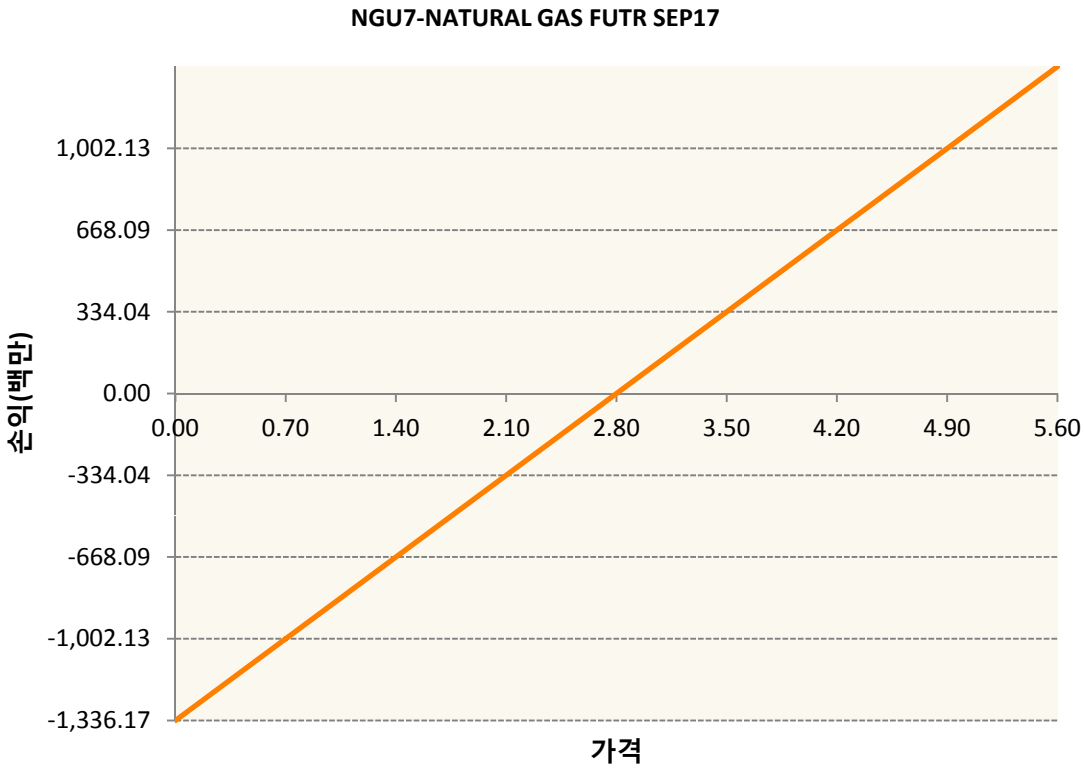
HOU7-NY HARB ULSD FUT SEP17

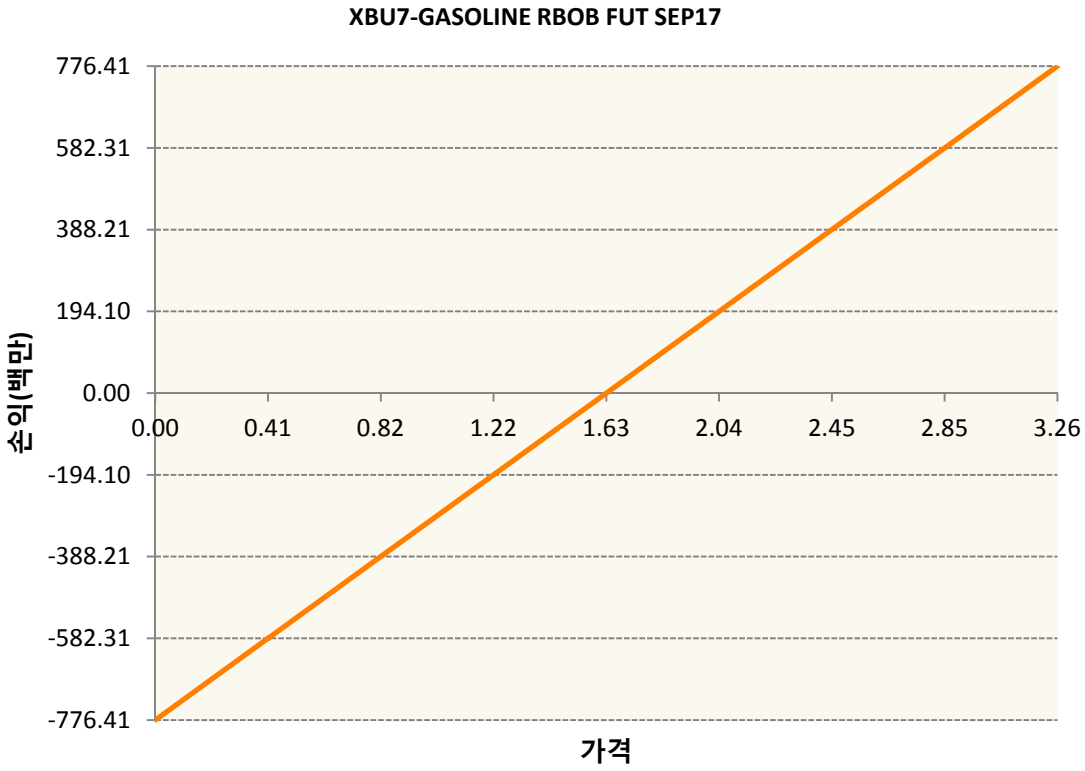


KR4175M80003-2017-08 달러선물




-337.77
가격


NGU7-NATURAL GAS FUTR SEP17
손익(백만)
1,002.13
668.09
334.04
0.00
-334.04
-668.09
-1,002.13
-1,336.17
0.00
0.70
1.40
2.10
2.80
3.50
4.20
4.90
5.60
가격


XBU7-GASOLINE RBOB FUT SEP17
손익(백만)
776.41
582.31
388.21
194.10
0.00
-194.10
-388.21
-582.31
-776.41
0.00
0.41
0.82
1.22
1.63
2.04
2.45
2.85
3.26
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	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	2017-08-09
기준일	2017-08-08

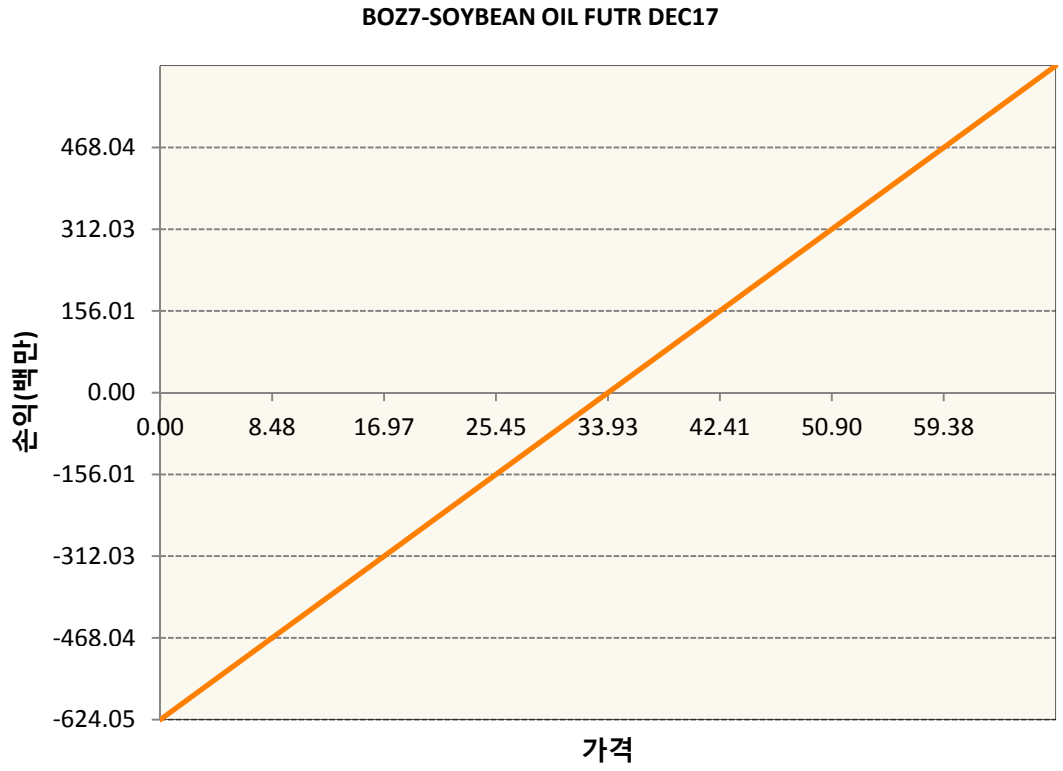
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

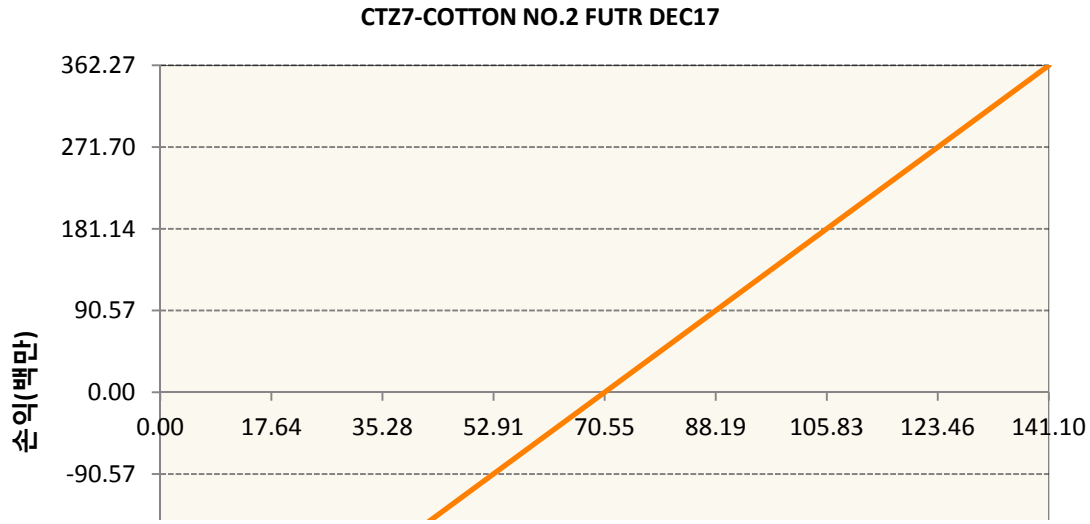
1. 계약금액

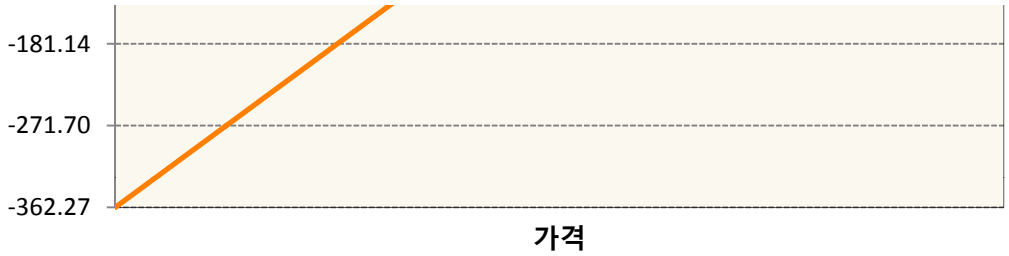
(단위:백만원)

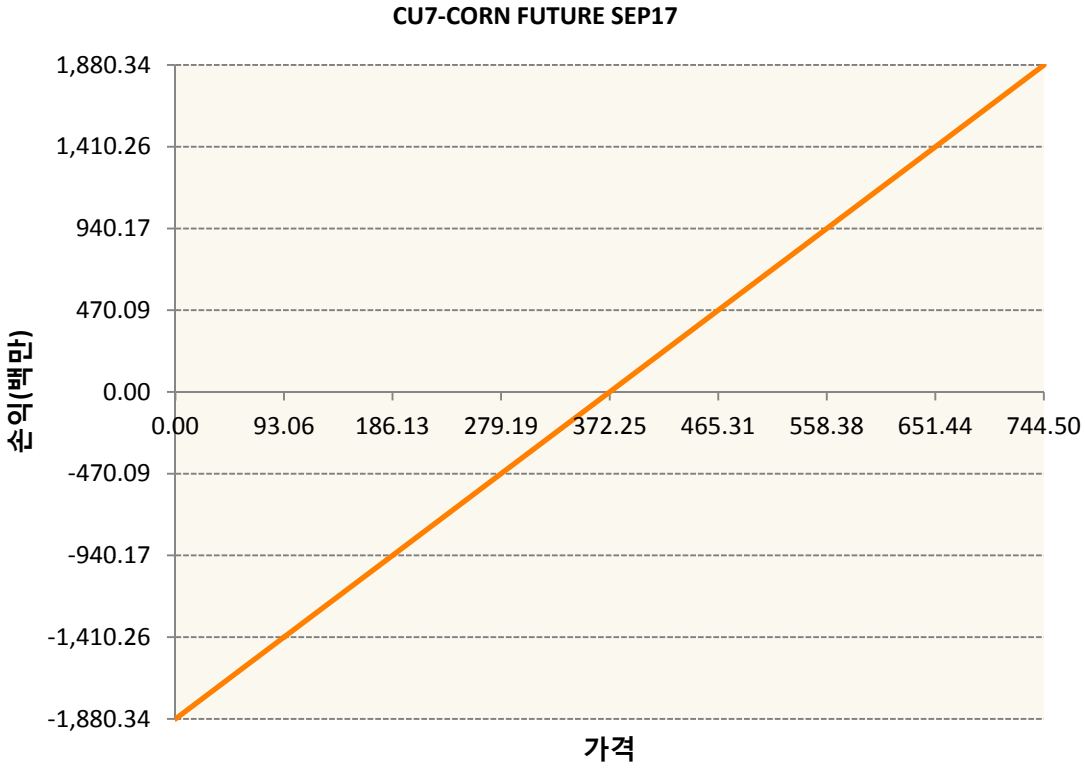
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	7,160	394	6,766	

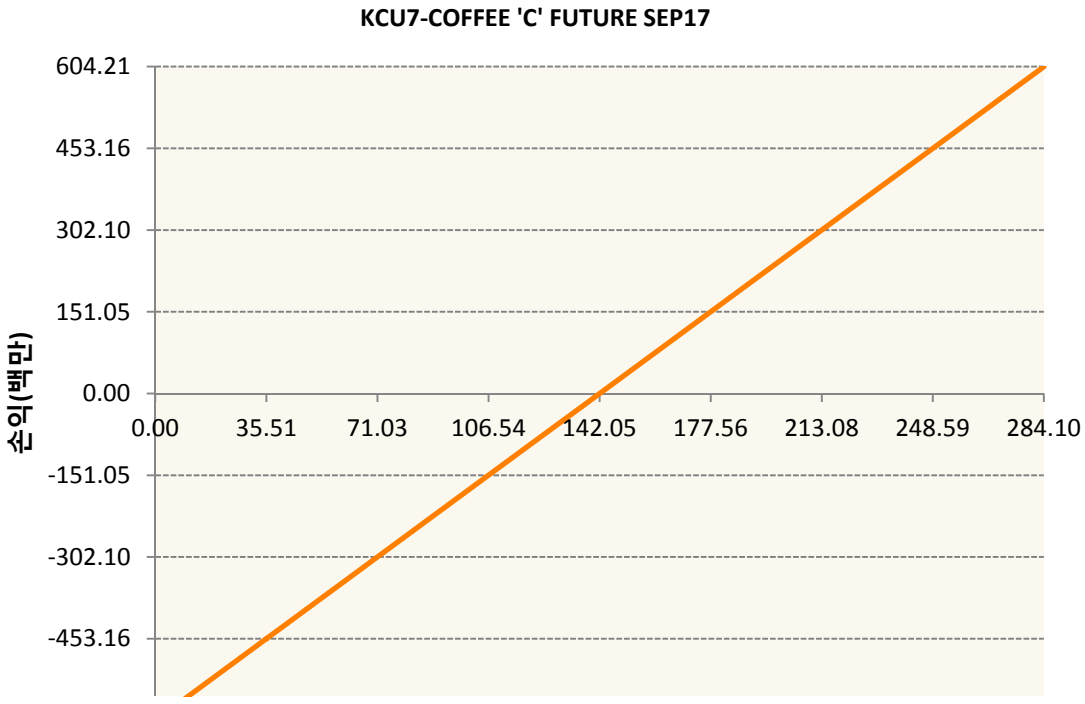
2. 만기시점의 손익구조

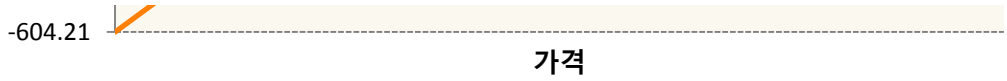


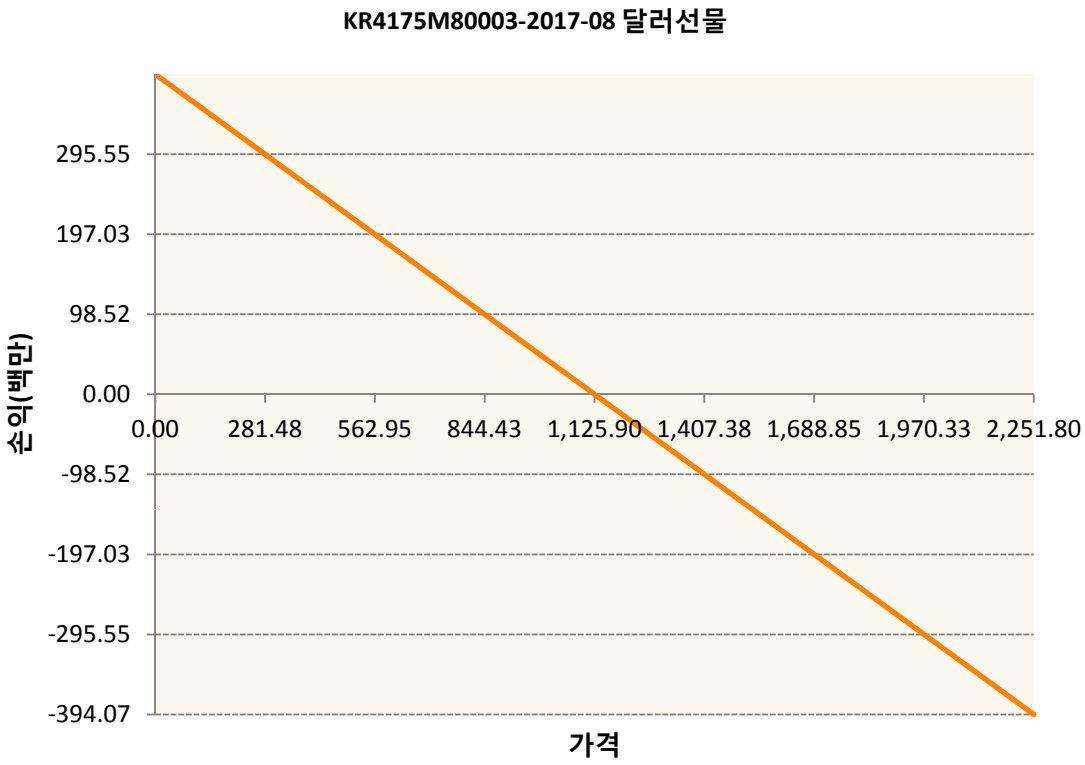


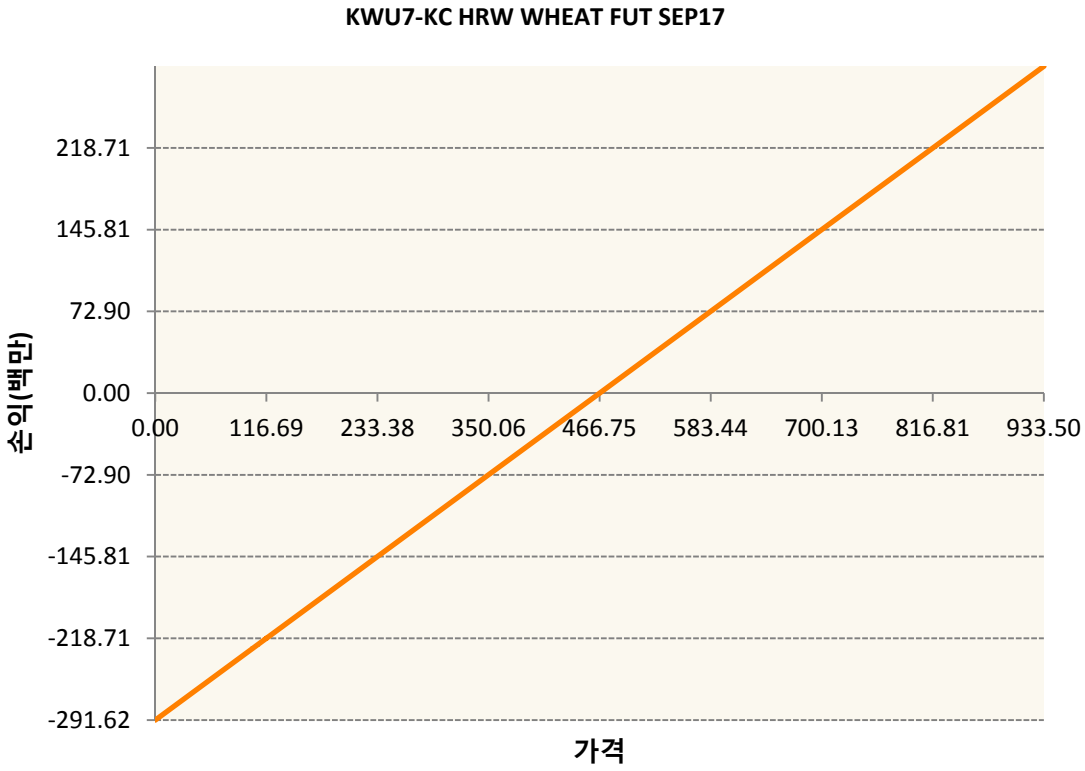

-181.14
-271.70
-362.27
가격

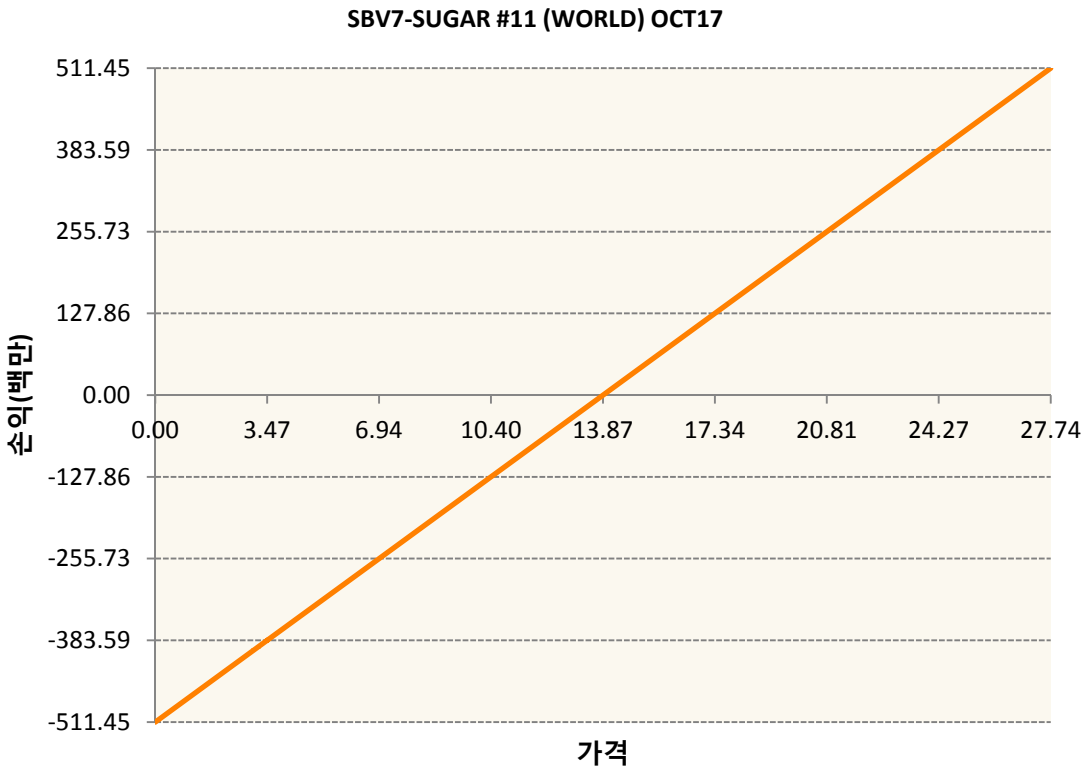

CU7-CORN FUTURE SEP17
1,880.34
1,410.26
940.17
470.09
0.00
-470.09
-940.17
-1,410.26
-1,880.34
0.00
93.06
186.13
279.19
372.25
465.31
558.38
651.44
744.50
손익(백만)
가격

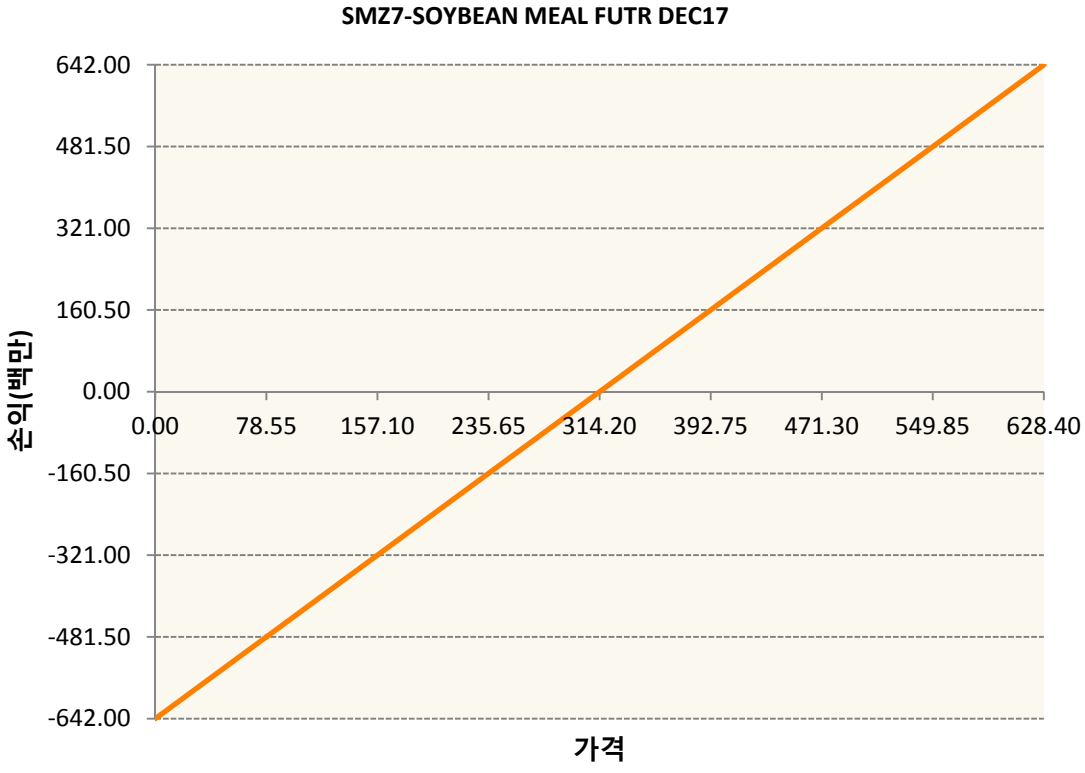

KCU7-COFFEE 'C' FUTURE SEP17
604.21
453.16
302.10
151.05
0.00
-151.05
-302.10
-453.16
0.00
35.51
71.03
106.54
142.05
177.56
213.08
248.59
284.10
손익(백만)

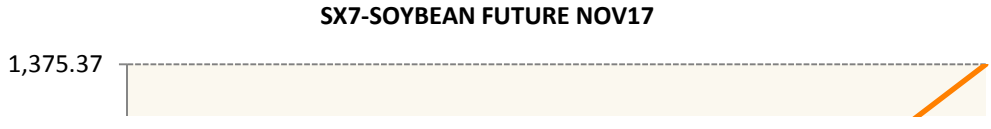

-604.21
가격

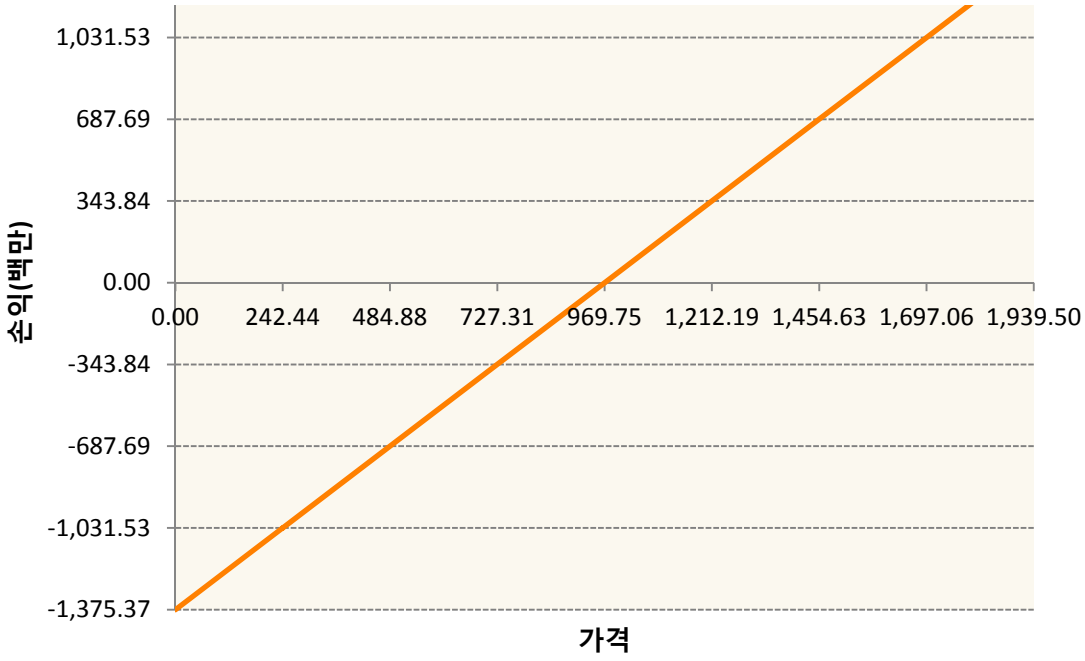

KR4175M80003-2017-08 달러선물
295.55
197.03
98.52
0.00
-98.52
-197.03
-295.55
-394.07
0.00
281.48
562.95
844.43
1,125.90
1,407.38
1,688.85
1,970.33
2,251.80
손익(백만)
가격

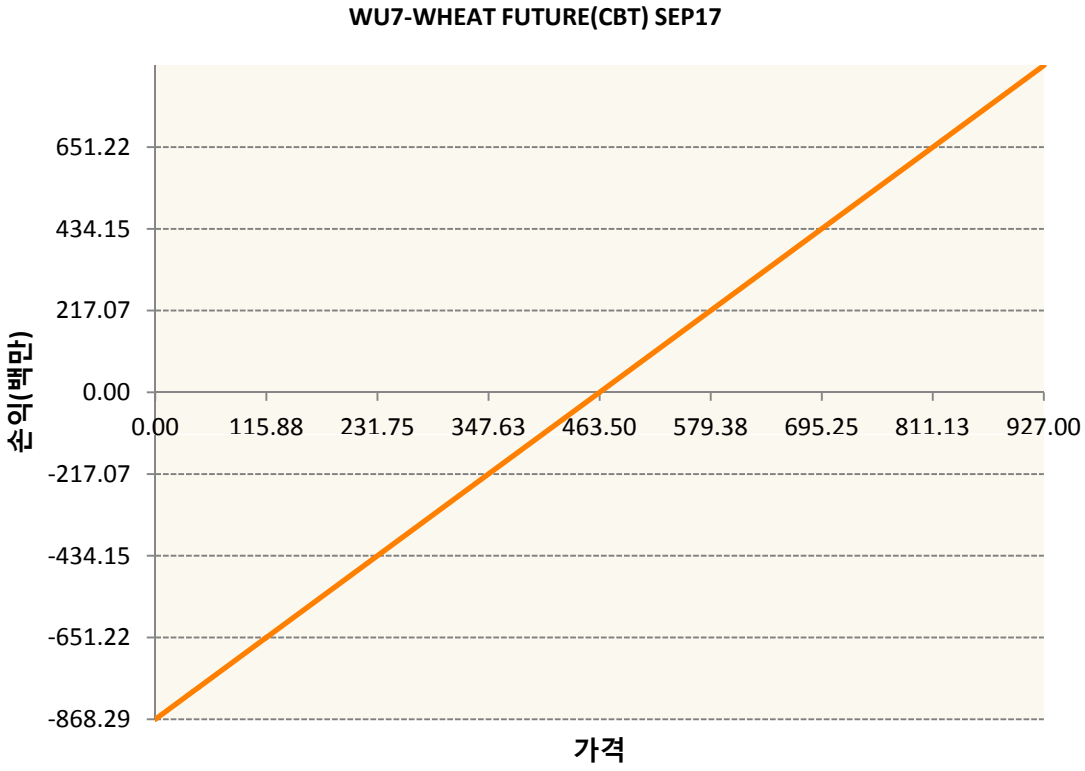

KWU7-KC HRW WHEAT FUT SEP17
218.71
145.81
72.90
0.00
-72.90
-145.81
-218.71
-291.62
0.00
116.69
233.38
350.06
466.75
583.44
700.13
816.81
933.50
손익(백만)
가격


SBV7-SUGAR #11 (WORLD) OCT17
511.45
383.59
255.73
127.86
0.00
-127.86
-255.73
-383.59
-511.45
0.00
3.47
6.94
10.40
13.87
17.34
20.81
24.27
27.74
손익(백만)
가격


SMZ7-SOYBEAN MEAL FUTR DEC17
642.00
481.50
321.00
160.50
0.00
-160.50
-321.00
-481.50
-642.00
0.00
78.55
157.10
235.65
314.20
392.75
471.30
549.85
628.40
손익(백만)
가격


SX7-SOYBEAN FUTURE NOV17
1,375.37





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
BOZ7	SOYBEAN OIL FUTR DEC17	50
CTZ7	COTTON NO.2 FUTR DEC17	29
CU7	CORN FUTURE SEP17	150
KCU7	COFFEE 'C' FUTURE SEP17	48
KR4175M80(	2017-08 달러선물	32

KWU7	KC HRW WHEAT FUT SEP17	23
SBV7	SUGAR #11 (WORLD) OCT17	41
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)

673