공시일	2017-08-10
기준일	2017-08-09

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	2017-08-10
기준일	2017-08-09

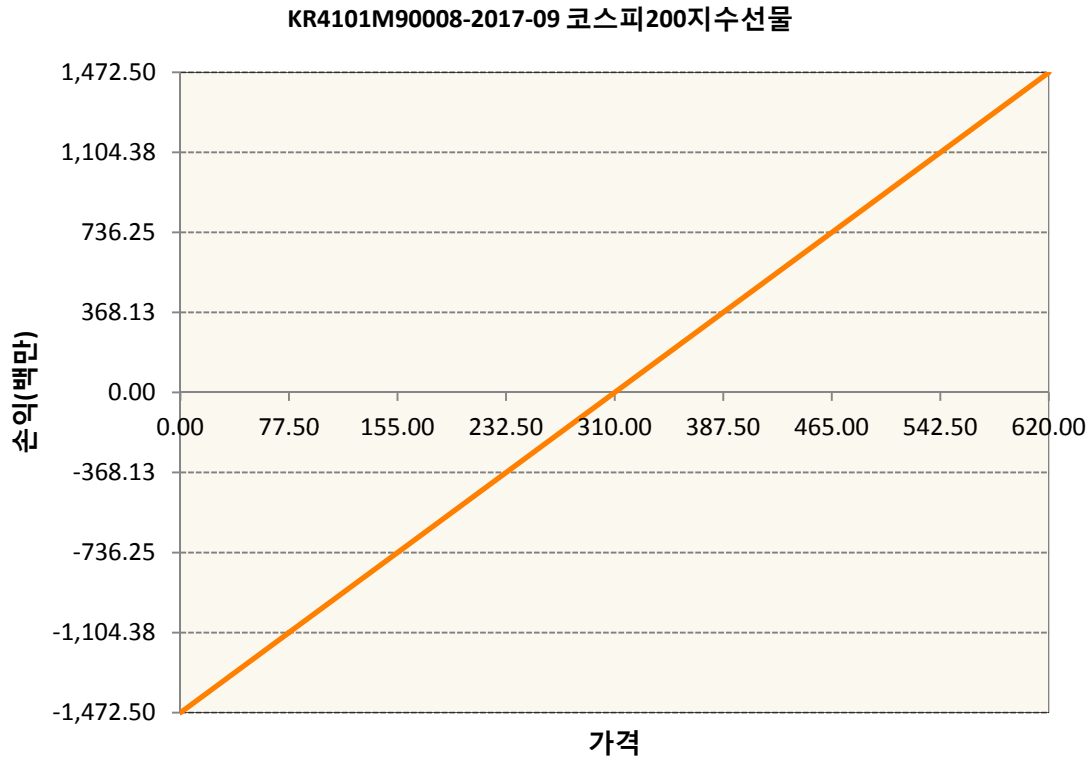
스마트인덱스모

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	1,473	0	1,473	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101M90(2017-09 코스피200지수선물							118
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-118	-118	-118	-118	-118	-118	-118
-5.33%	-78	-78	-78	-78	-78	-78	-78
-2.67%	-39	-39	-39	-39	-39	-39	-39
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	39	39	39	39	39	39	39
5.33%	78	78	78	78	78	78	78
8.00%	118	118	118	118	118	118	118

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

72

공시일	2017-08-10
기준일	2017-08-09

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)

472

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-08-10
기준일	2017-08-09

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	400

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

342

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-08-10
기준일	2017-08-09

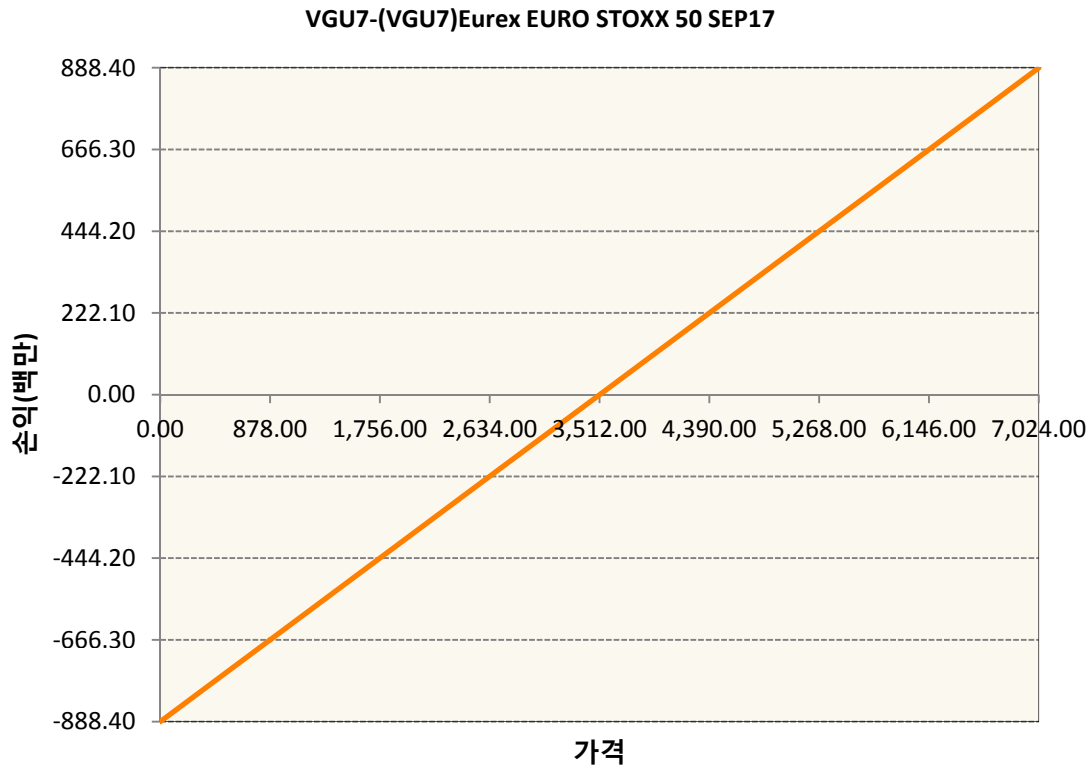
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	888	0	888	

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	2017-08-10
기준일	2017-08-09

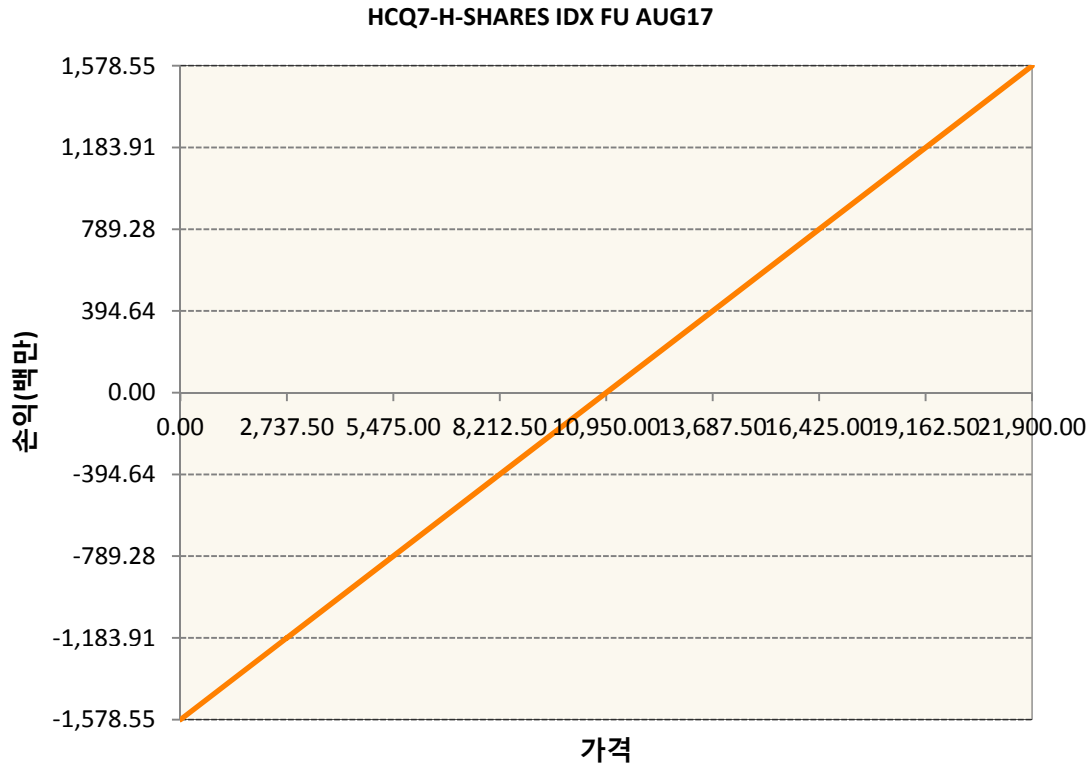
차이나인덱스모(주식-파생형)

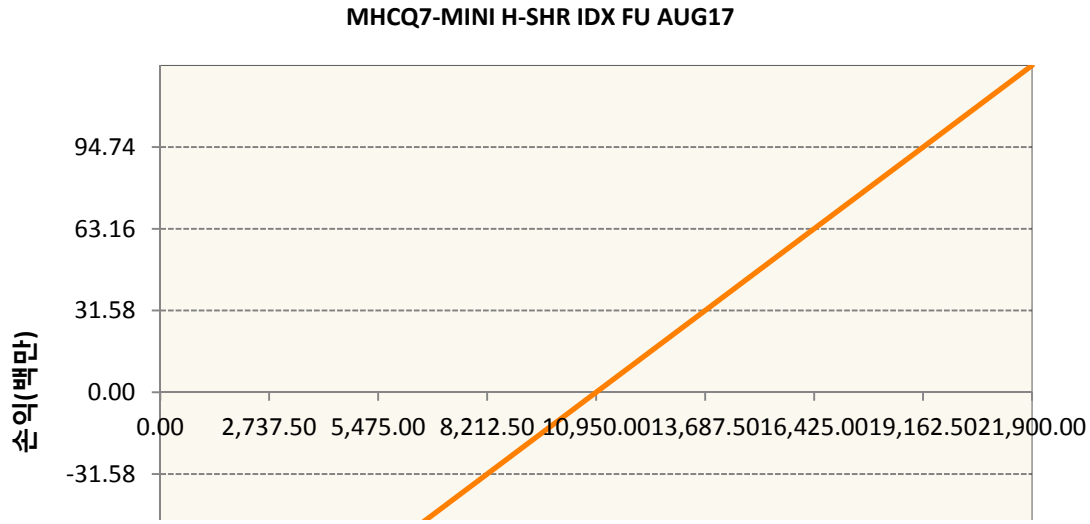
1. 계약금액

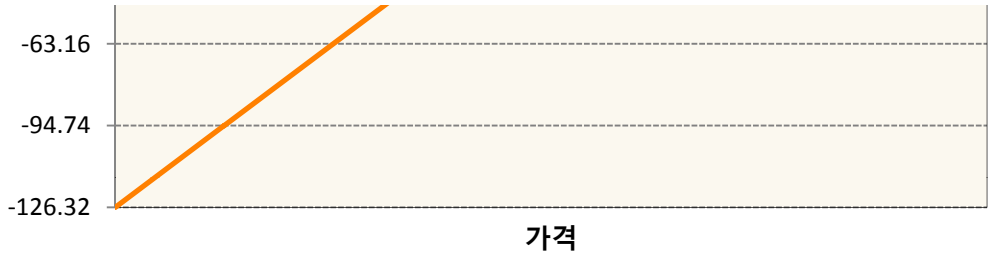
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,705	0	1,705	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCQ7	H-SHARES IDX FU AUG17	126
MHCQ7	MINI H-SHR IDX FU AUG17	10

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	119

공시일	2017-08-10
기준일	2017-08-09

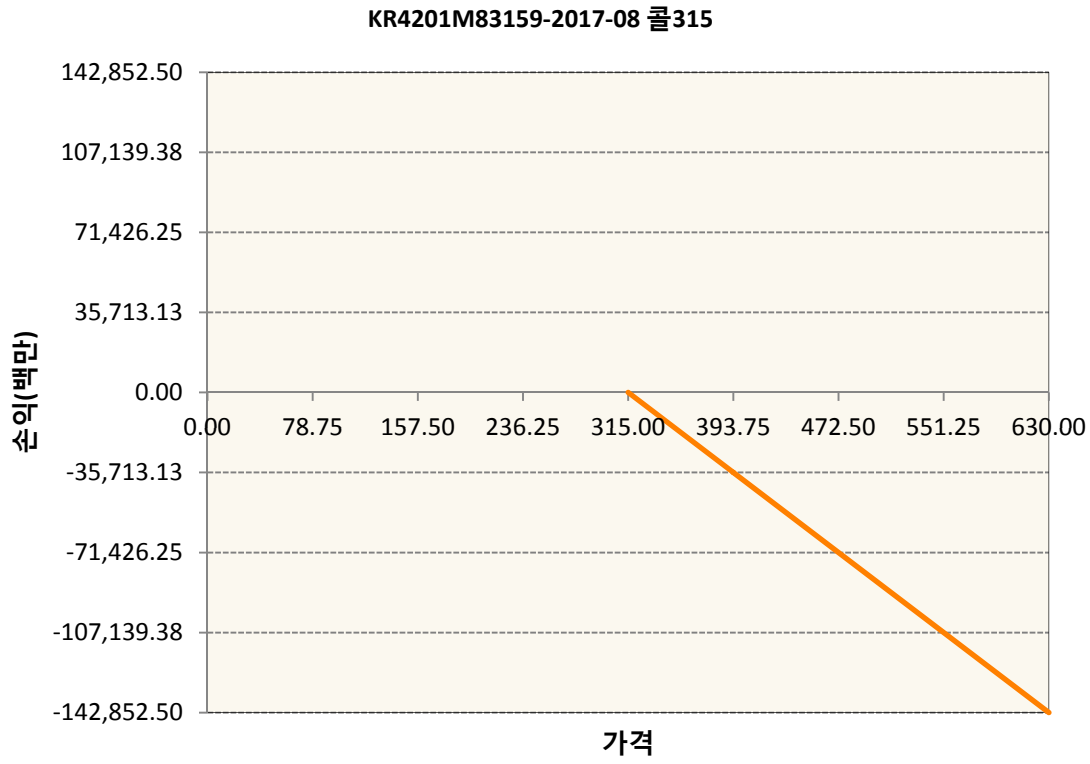
커버드콜모(주식혼합-파생형)

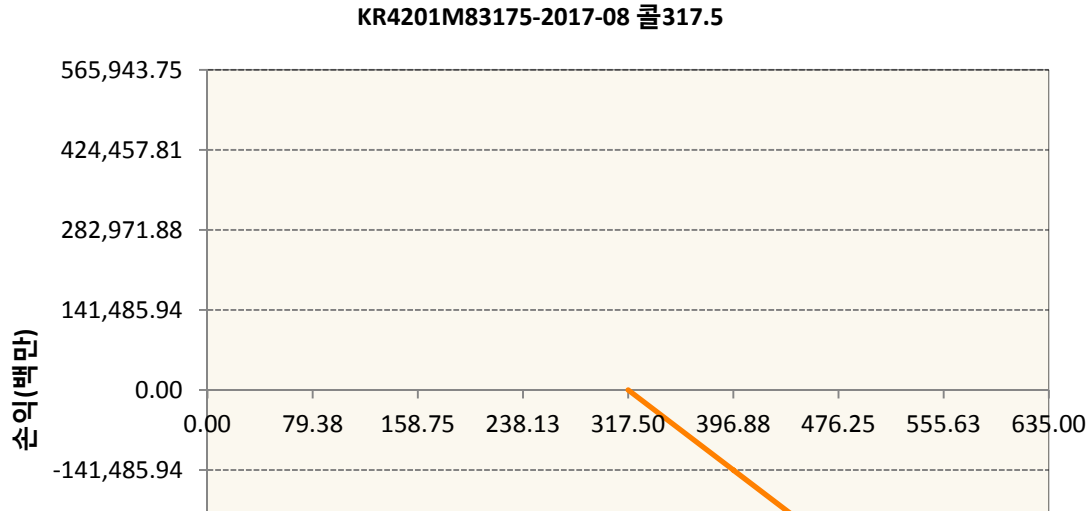
1. 계약금액

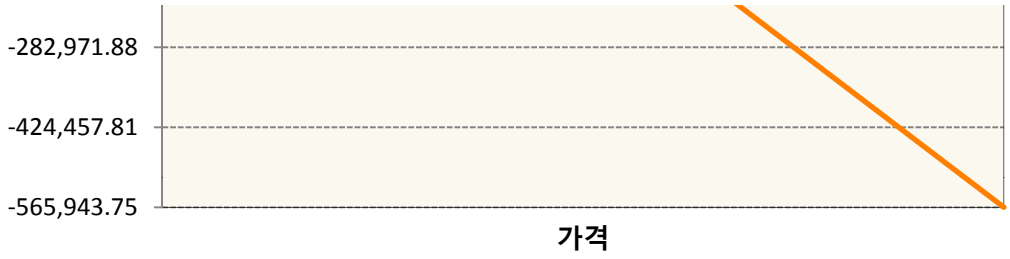
(단위:백만원)

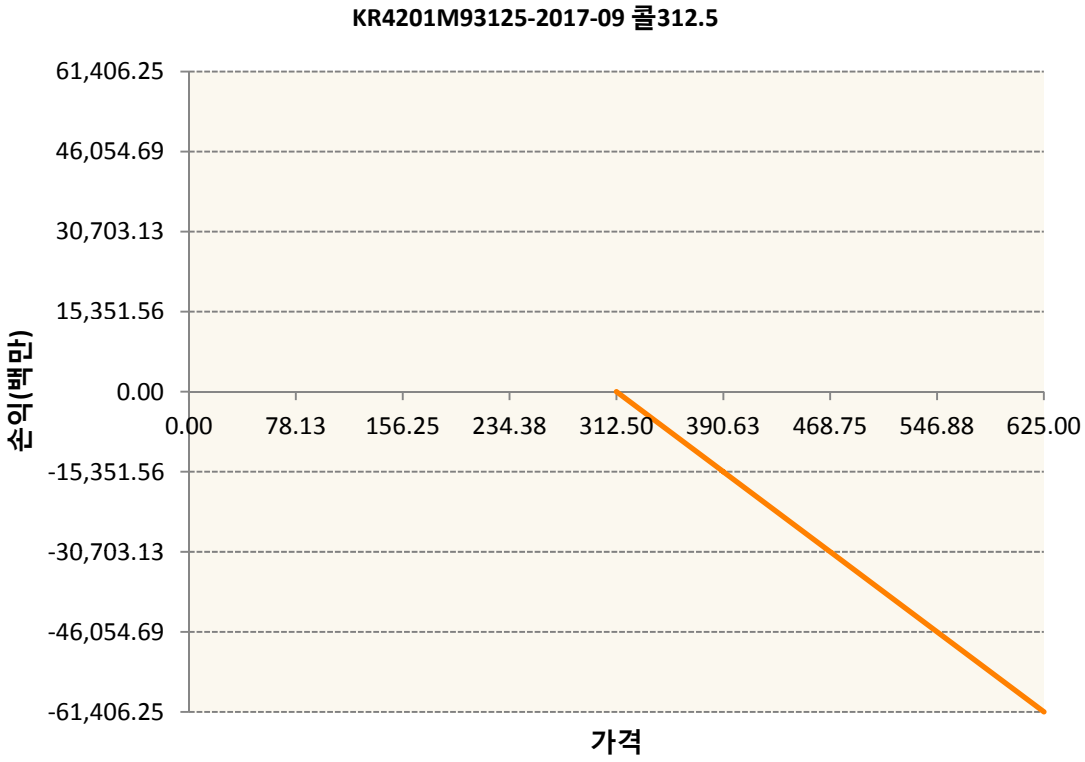
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	62,379	62,216	163	장내
누계	유가증권	옵션	0	1,409,256	-1,409,256	장내

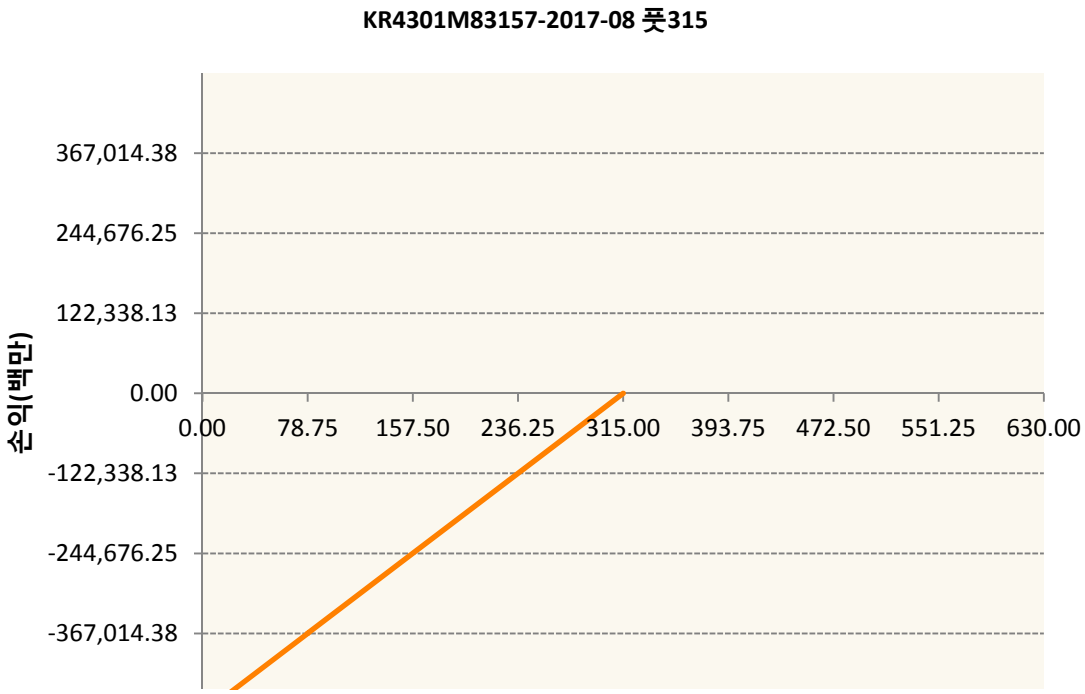
2. 만기시점의 손익구조



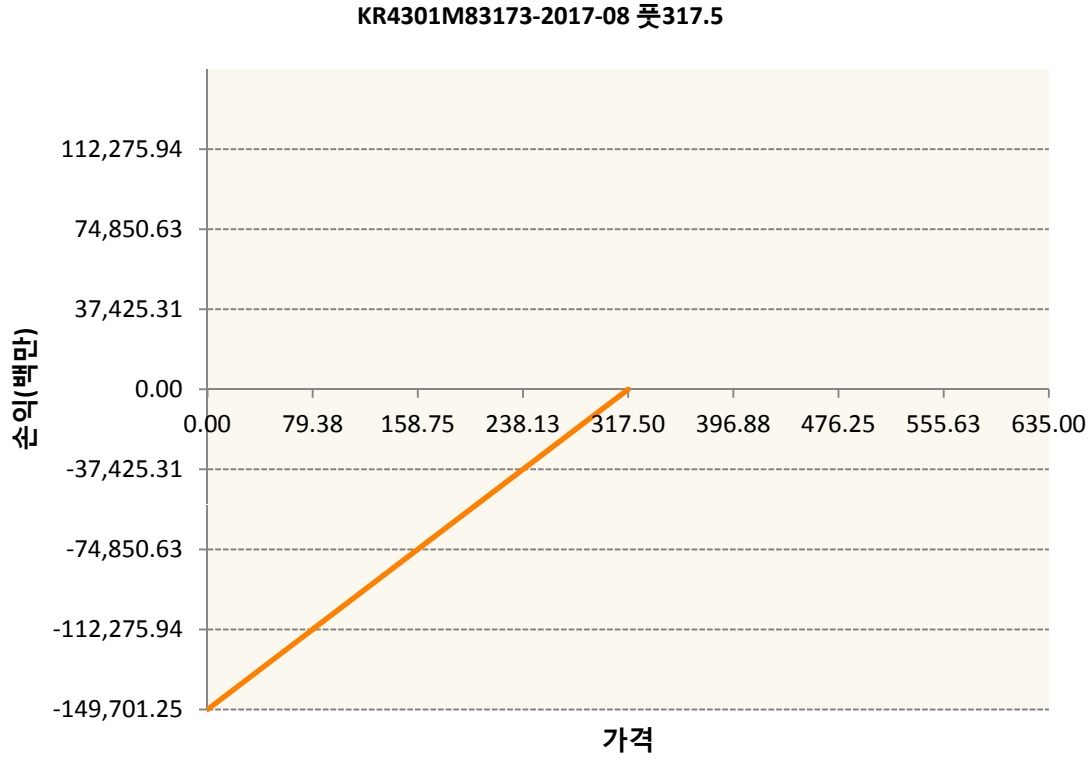



-282,971.88
-424,457.81
-565,943.75
가격


KR4201M93125-2017-09 콜312.5
61,406.25
46,054.69
30,703.13
15,351.56
0.00
-15,351.56
-30,703.13
-46,054.69
-61,406.25
손익(백만)
0.00
78.13
156.25
234.38
312.50
390.63
468.75
546.88
625.00
가격


KR4301M83157-2017-08 풋315
367,014.38
244,676.25
122,338.13
0.00
-122,338.13
-244,676.25
-367,014.38
손익(백만)
0.00
78.75
157.50
236.25
315.00
393.75
472.50
551.25
630.00





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201M83: 2017-08 콜315							8,679
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	65	65	65	65	65	65	65
-5.33%	65	65	65	65	65	65	65
-2.67%	65	65	65	65	65	64	64
0%	49	37	20	0	-24	-51	-81
2.67%	-1,320	-1,361	-1,404	-1,450	-1,498	-1,547	-1,597
5.33%	-4,936	-4,936	-4,936	-4,937	-4,939	-4,942	-4,947
8.00%	-8,678	-8,678	-8,678	-8,678	-8,678	-8,679	-8,679
KR4201M83: 2017-08 콜317.5							29,857
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	55	55	55	55	55	55	55
-5.33%	55	55	55	55	55	55	55
-2.67%	55	55	55	55	55	54	54
0%	49	41	25	0	-35	-81	-137
2.67%	-2,321	-2,557	-2,792	-3,027	-3,263	-3,498	-3,734

5.33%	-15,148	-15,155	-15,168	-15,189	-15,220	-15,260	-15,312
8.00%	-29,856	-29,856	-29,856	-29,856	-29,856	-29,857	-29,857
	KR4201M93:2017-09 콜312.5						3,547
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,481	1,438	1,384	1,321	1,249	1,170	1,083
-5.33%	1,339	1,256	1,165	1,066	960	850	735
-2.67%	1,023	899	770	638	504	367	229
0%	452	302	151	0	-151	-302	-454
2.67%	-416	-565	-714	-864	-1,015	-1,166	-1,318
5.33%	-1,563	-1,685	-1,812	-1,943	-2,078	-2,216	-2,356
8.00%	-2,924	-3,007	-3,100	-3,202	-3,312	-3,427	-3,547
	KR4301M83:2017-08 풋315						38,243
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-38,243	-38,243	-38,243	-38,243	-38,243	-38,243	-38,243
-5.33%	-25,421	-25,421	-25,421	-25,421	-25,421	-25,421	-25,421
-2.67%	-12,599	-12,599	-12,599	-12,599	-12,600	-12,601	-12,604
0%	168	126	70	0	-82	-175	-278
2.67%	8,299	8,161	8,012	7,855	7,692	7,523	7,349
5.33%	8,737	8,736	8,734	8,731	8,724	8,714	8,698
8.00%	8,737	8,737	8,737	8,737	8,737	8,737	8,737
	KR4301M83:2017-08 풋317.5						11,660
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-11,660	-11,660	-11,660	-11,660	-11,660	-11,660	-11,660
-5.33%	-7,769	-7,769	-7,769	-7,769	-7,769	-7,769	-7,769
-2.67%	-3,877	-3,877	-3,877	-3,877	-3,877	-3,877	-3,877
0%	13	11	7	0	-9	-21	-36
2.67%	3,277	3,215	3,153	3,091	3,029	2,966	2,904
5.33%	3,776	3,774	3,771	3,765	3,757	3,746	3,733
8.00%	3,777	3,777	3,777	3,777	3,777	3,777	3,777

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

97,208

공시일	2017-08-10
기준일	2017-08-09

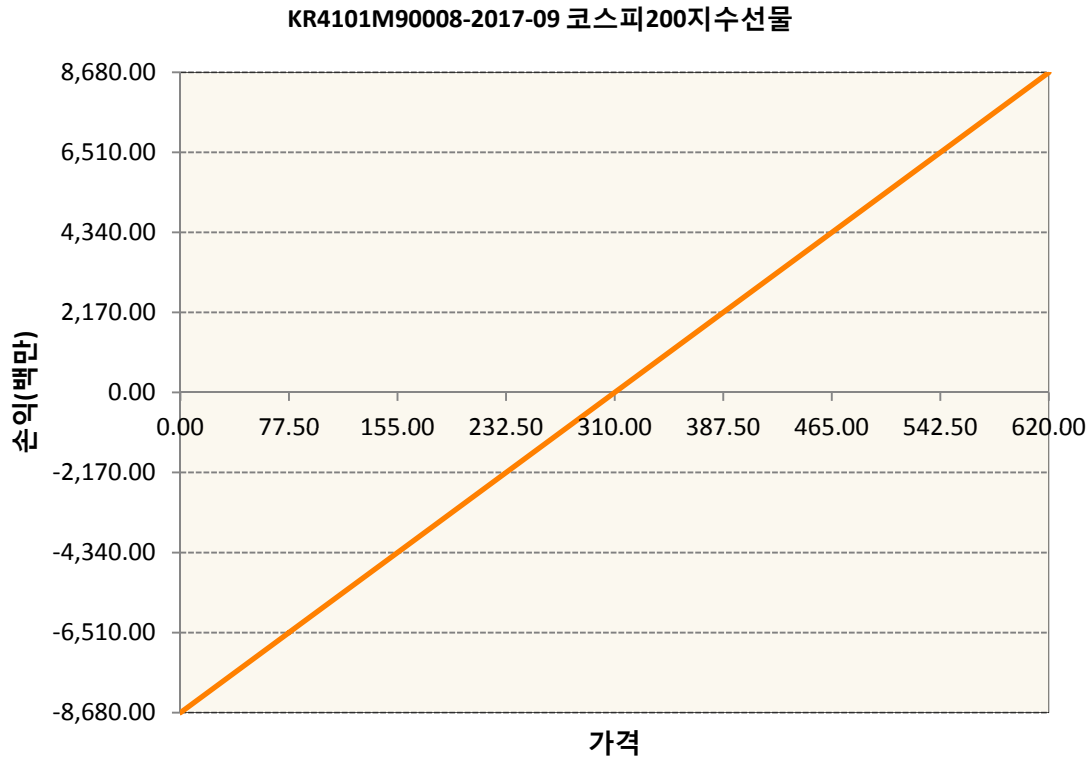
ETF스마트레버리지목표전환형6호

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	8,680	0	8,680	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101M90(2017-09 코스피200지수선물							693
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-693	-693	-693	-693	-693	-693	-693
-5.33%	-462	-462	-462	-462	-462	-462	-462
-2.67%	-231	-231	-231	-231	-231	-231	-231
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	231	231	231	231	231	231	231
5.33%	462	462	462	462	462	462	462
8.00%	693	693	693	693	693	693	693

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

425

공시일	2017-08-10
기준일	2017-08-09

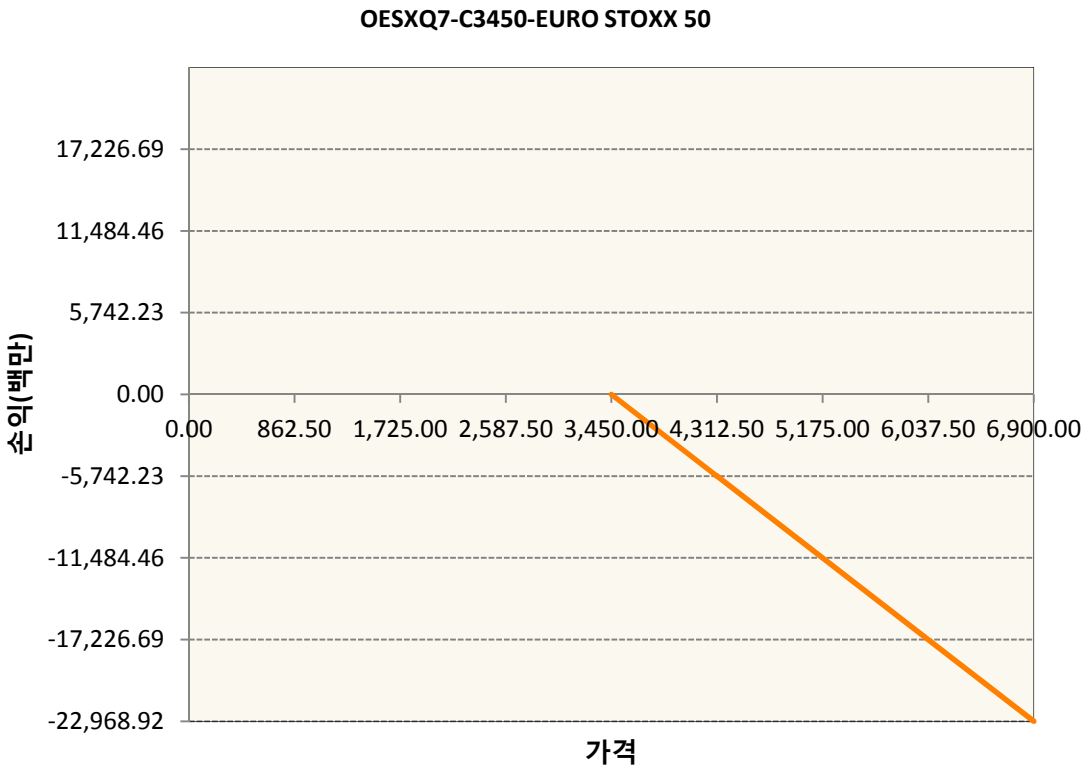
유로커버드콜(주식혼합-파생형)

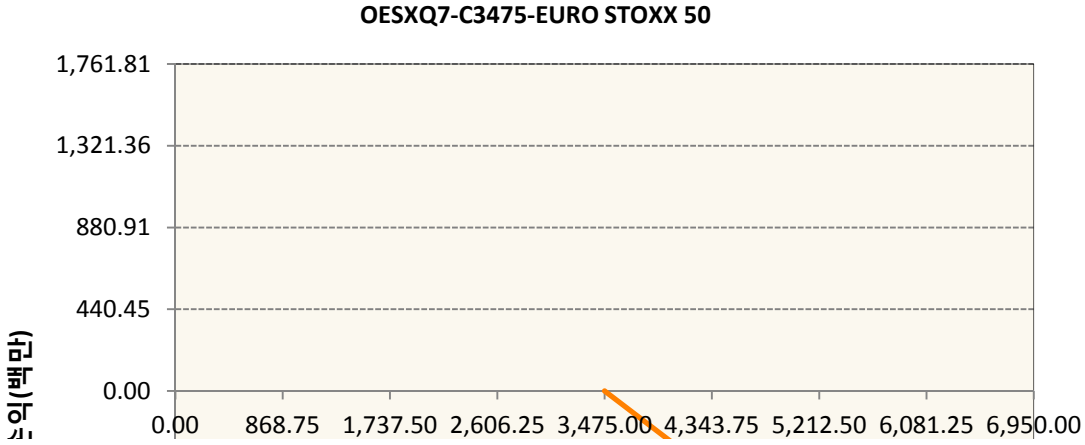
1. 계약금액

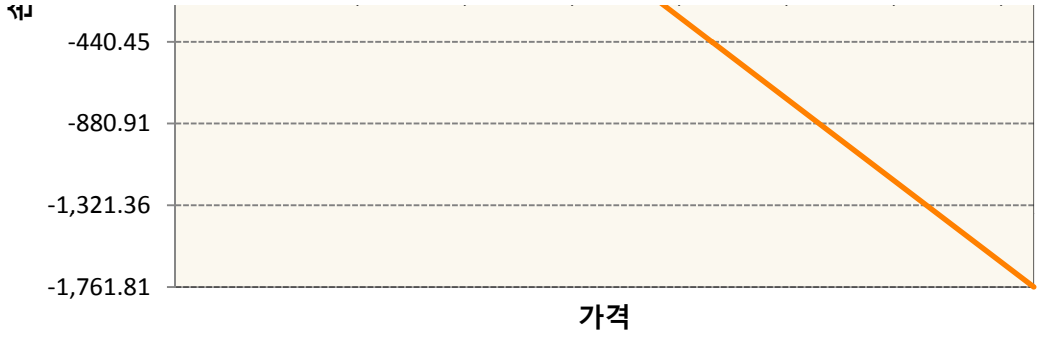
(단위:백만원)

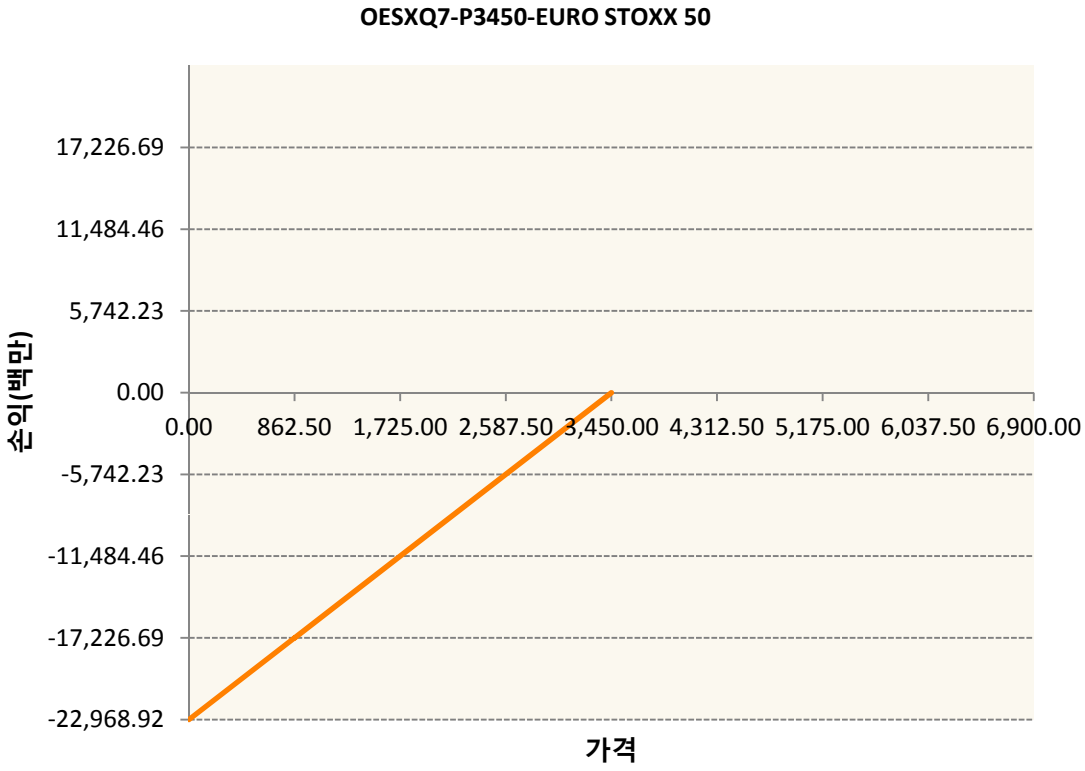
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	23,902	0	23,902	
누계	유가증권	옵션	0	49,461	-49,461	장내

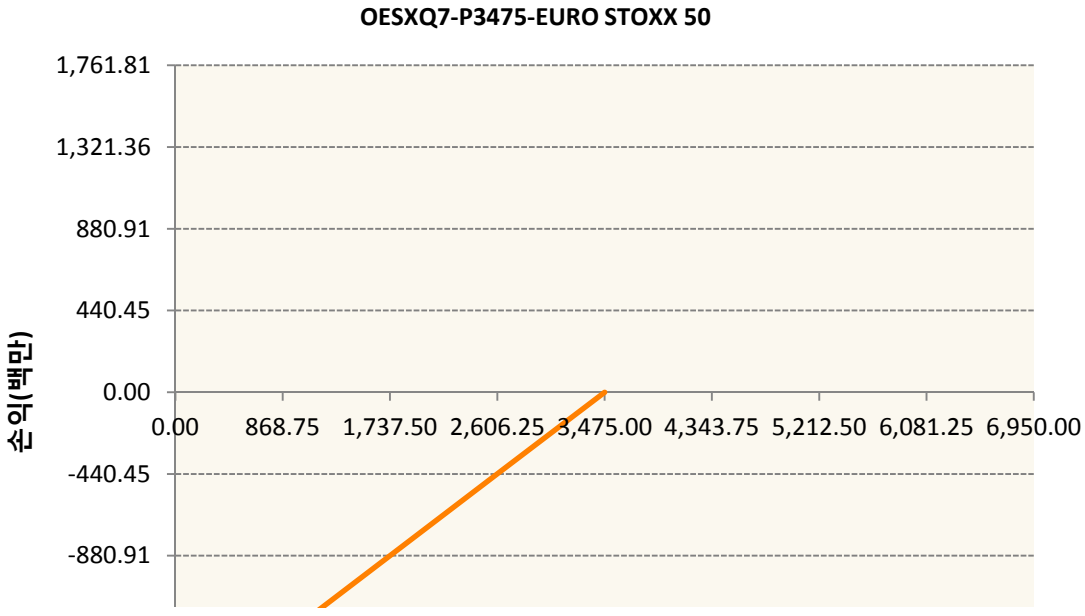
2. 만기시점의 손익구조

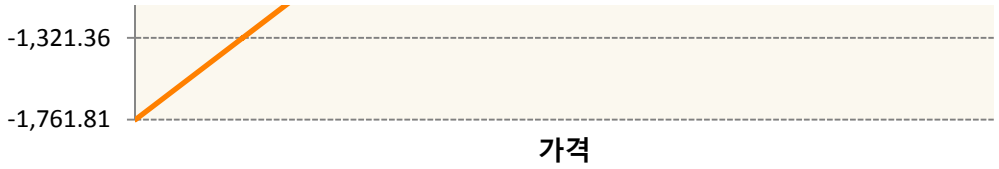


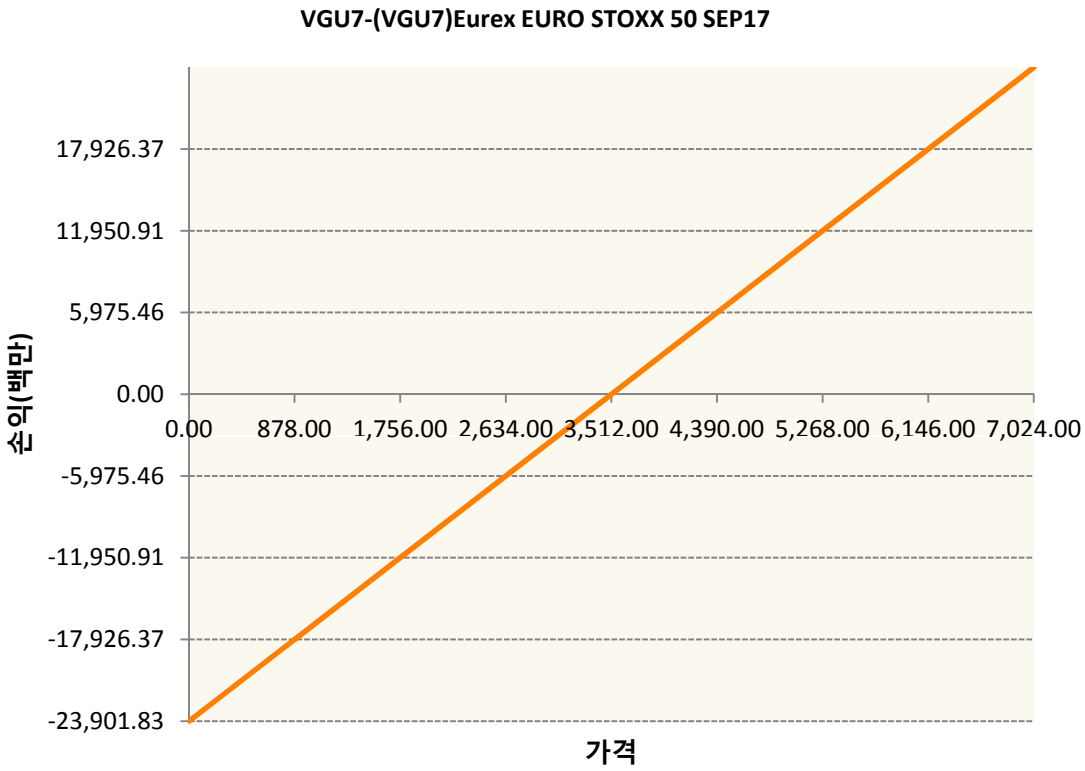



-440.45
-880.91
-1,321.36
-1,761.81
가격


OESXQ7-P3450-EURO STOXX 50
17,226.69
11,484.46
5,742.23
0.00
-5,742.23
-11,484.46
-17,226.69
-22,968.92
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
1,761.81
1,321.36
880.91
440.45
0.00
-440.45
-880.91
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	1,838
OESXQ7-C3	EURO STOXX 50	141
OESXQ7-P3	EURO STOXX 50	1,838
OESXQ7-P3	EURO STOXX 50	141
VGU7	(VGU7)Eurex EURO STOXX 50 SEP17	1,912

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	4,818

공시일	2017-08-10
기준일	2017-08-09

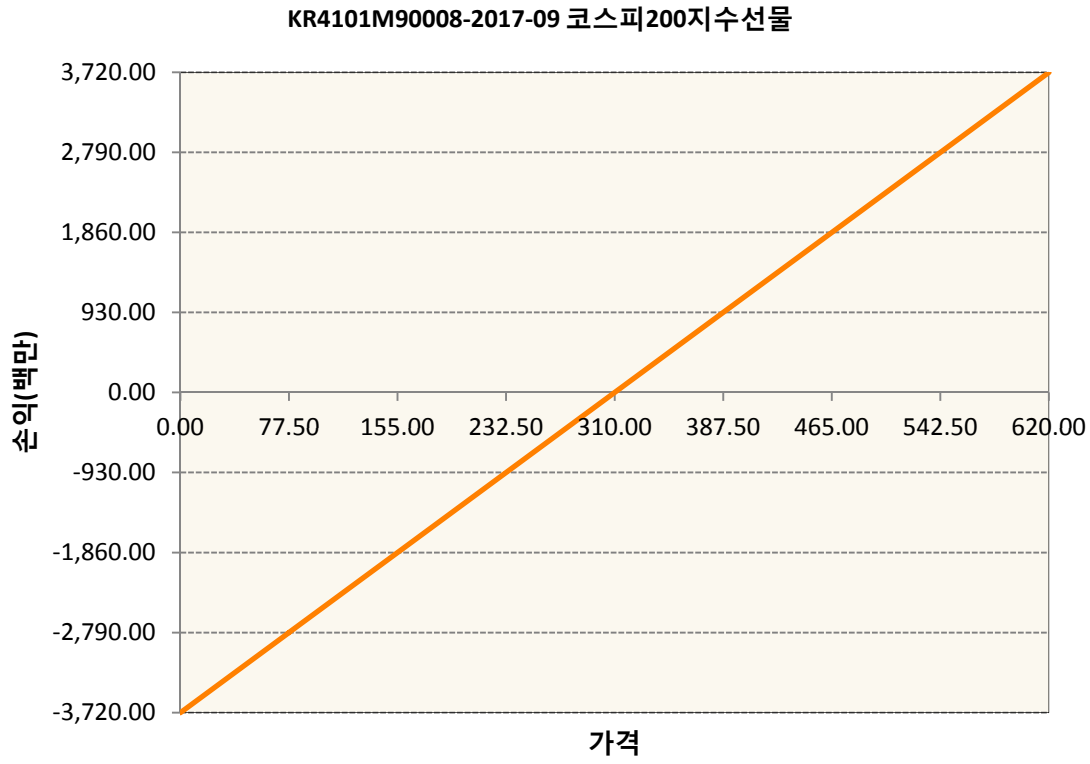
ETF스마트레버리지목표전환형7호

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	3,720	0	3,720	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101M90(2017-09 코스피200지수선물							297
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-297	-297	-297	-297	-297	-297	-297
-5.33%	-198	-198	-198	-198	-198	-198	-198
-2.67%	-99	-99	-99	-99	-99	-99	-99
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	99	99	99	99	99	99	99
5.33%	198	198	198	198	198	198	198
8.00%	297	297	297	297	297	297	297

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

182

공시일	2017-08-10
기준일	2017-08-09

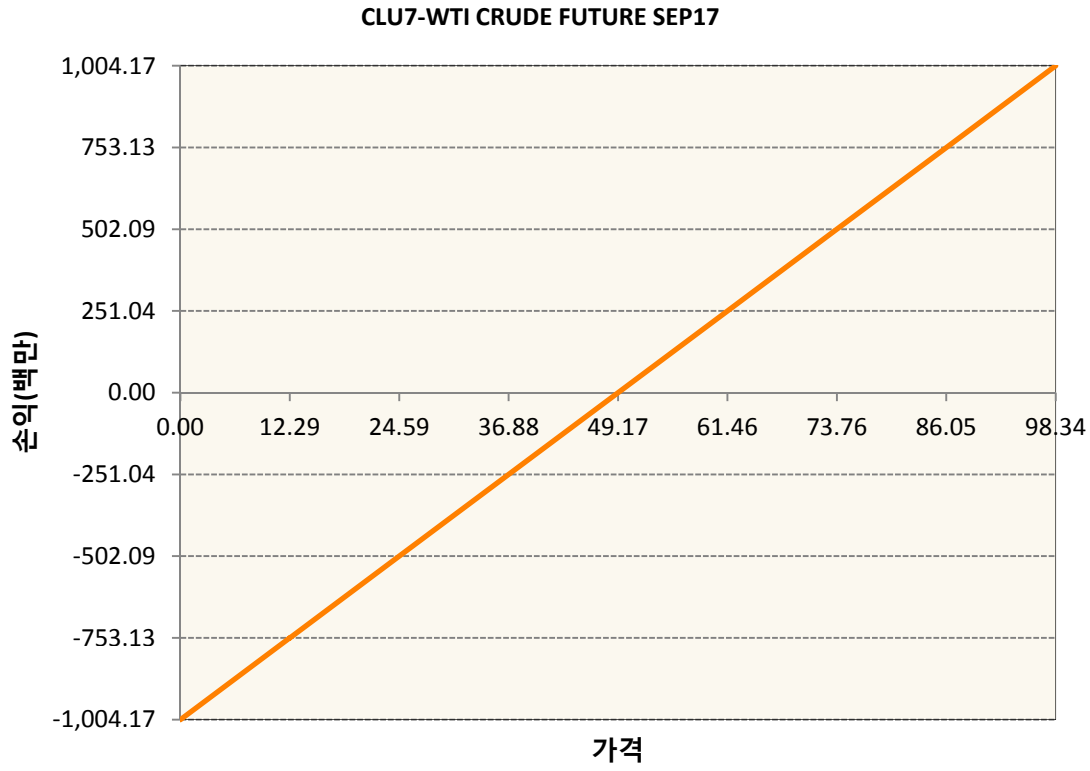
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

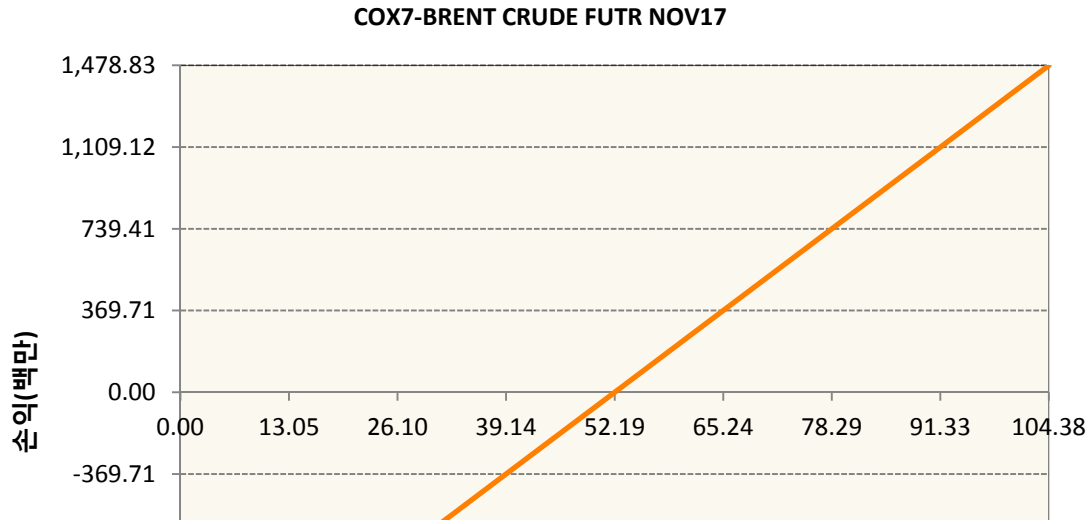
1. 계약금액

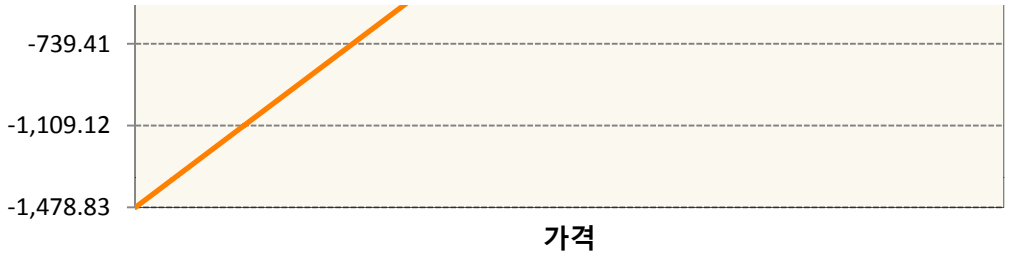
(단위:백만원)

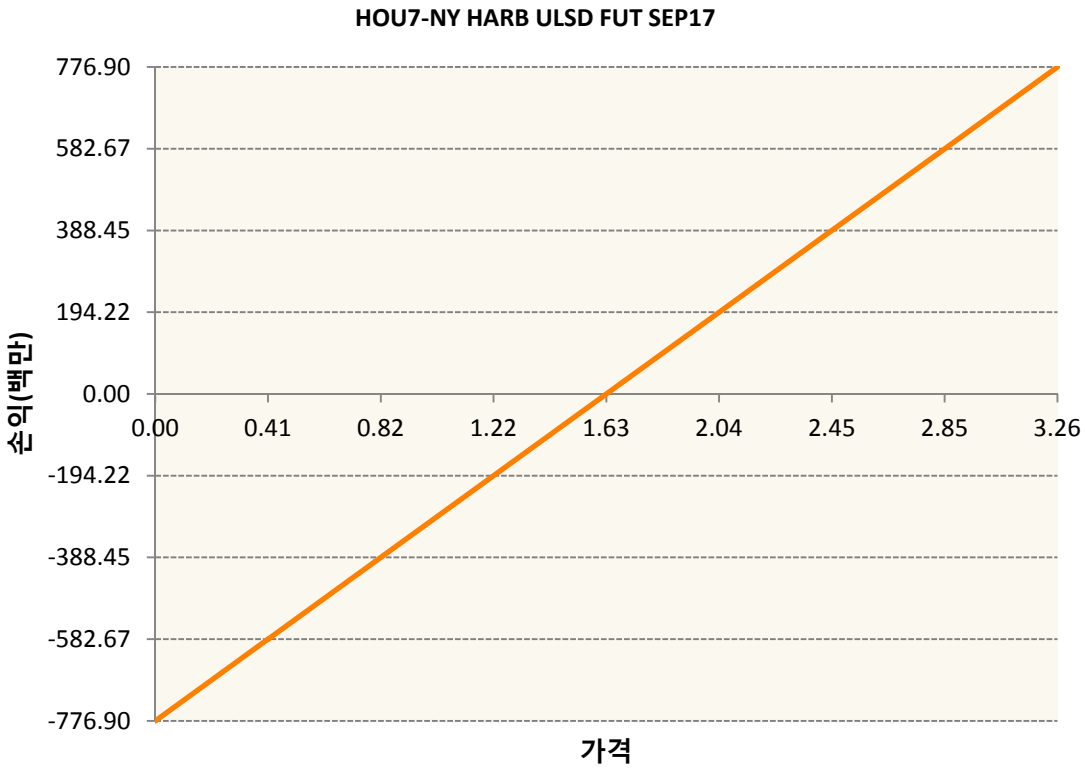
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	5,379	340	5,038	

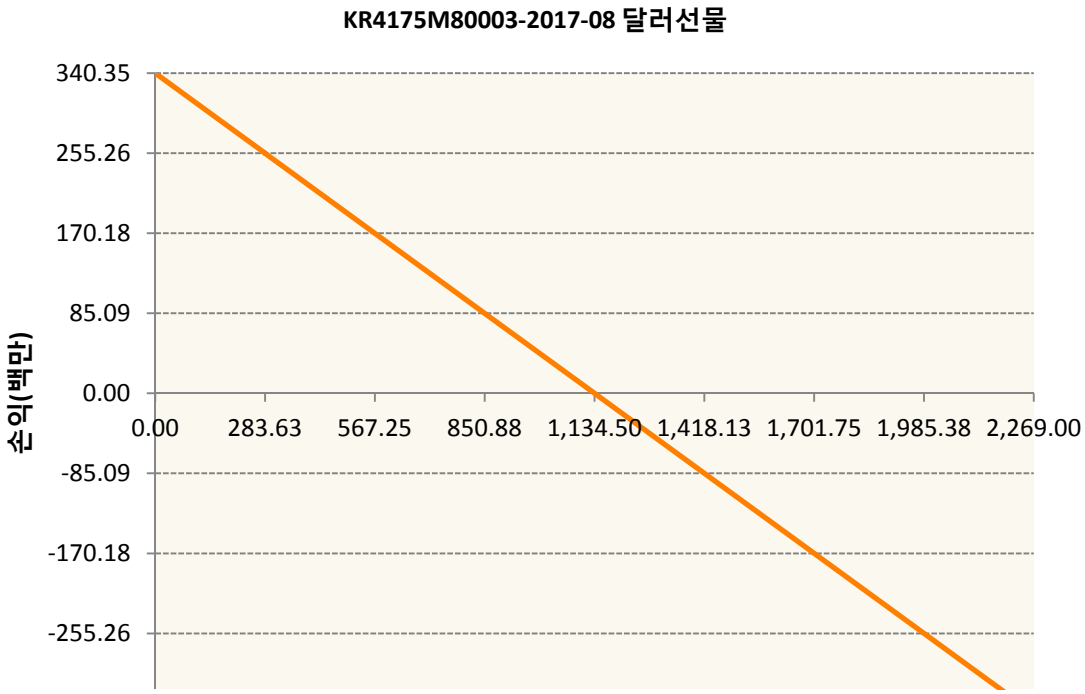
2. 만기시점의 손익구조

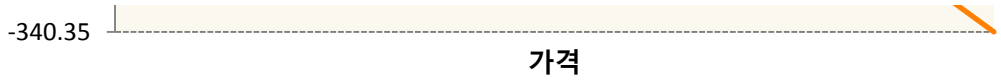


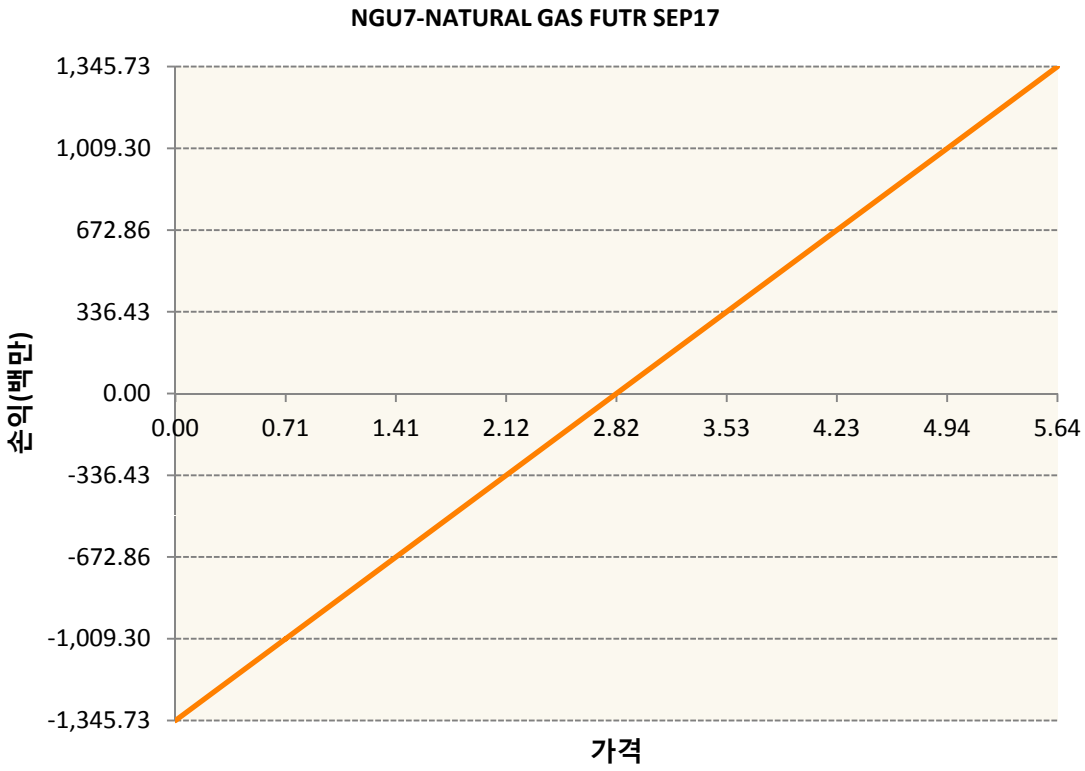


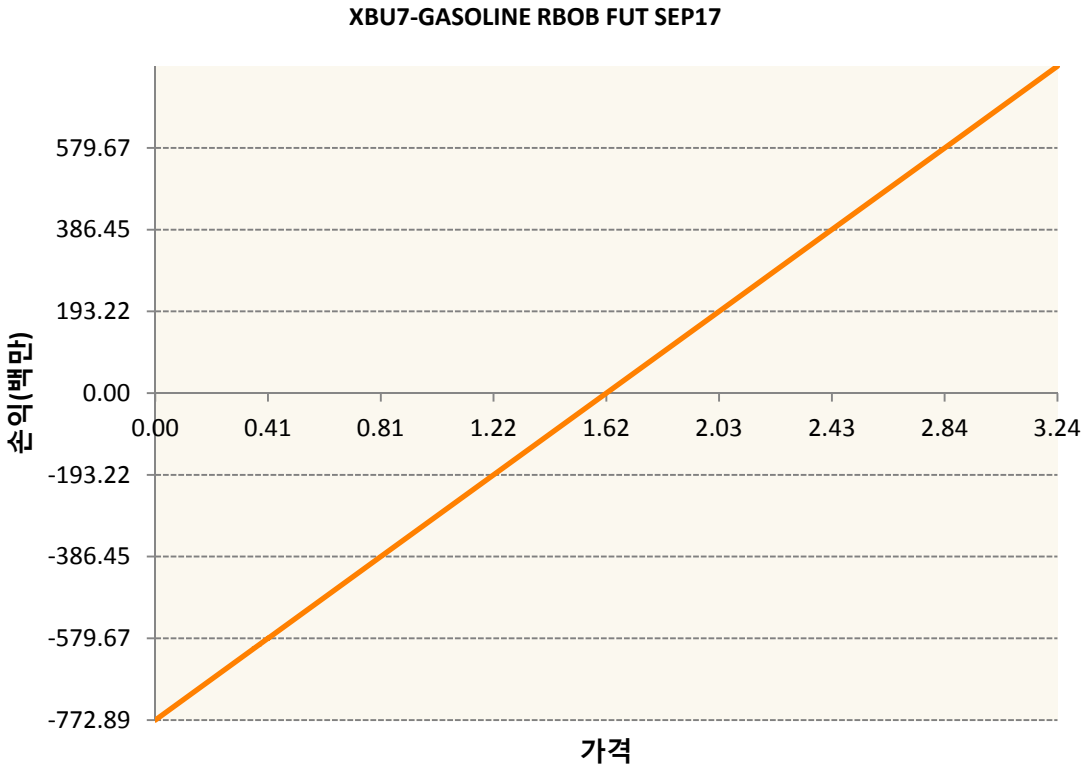

-739.41
-1,109.12
-1,478.83
가격


HOU7-NY HARB ULSD FUT SEP17
776.90
582.67
388.45
194.22
0.00
-194.22
-388.45
-582.67
-776.90
0.00
0.41
0.82
1.22
1.63
2.04
2.45
2.85
3.26
손익(만)
가격


KR4175M80003-2017-08 달러선물
340.35
255.26
170.18
85.09
0.00
-85.09
-170.18
-255.26
0.00
283.63
567.25
850.88
1,134.50
1,418.13
1,701.75
1,985.38
2,269.00
손익(만)


-340.35
가격


NGU7-NATURAL GAS FUTR SEP17
1,345.73
1,009.30
672.86
336.43
0.00
-336.43
-672.86
-1,009.30
-1,345.73
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
579.67
386.45
193.22
0.00
-193.22
-386.45
-579.67
-772.89
0.00
0.41
0.81
1.22
1.62
2.03
2.43
2.84
3.24
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	108
XBU7	GASOLINE RBOB FUT SEP17	62

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

772

공시일	2017-08-10
기준일	2017-08-09

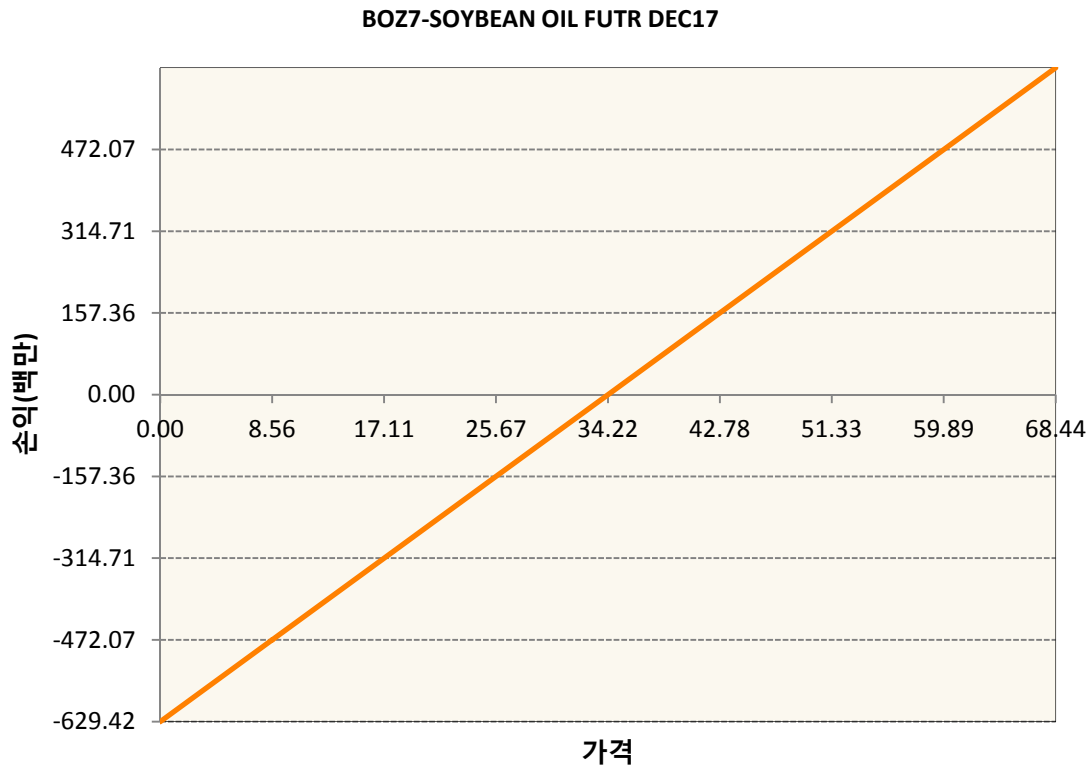
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

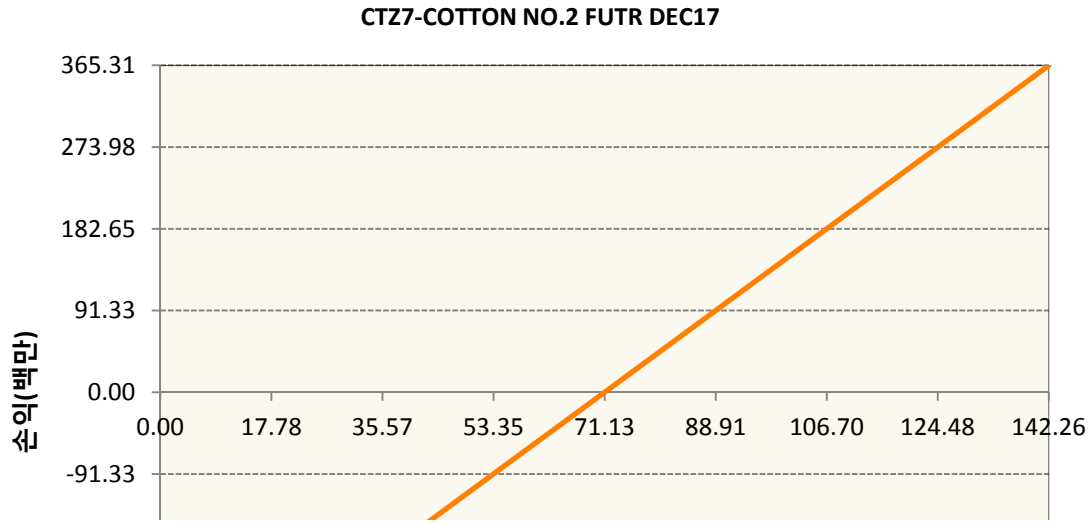
1. 계약금액

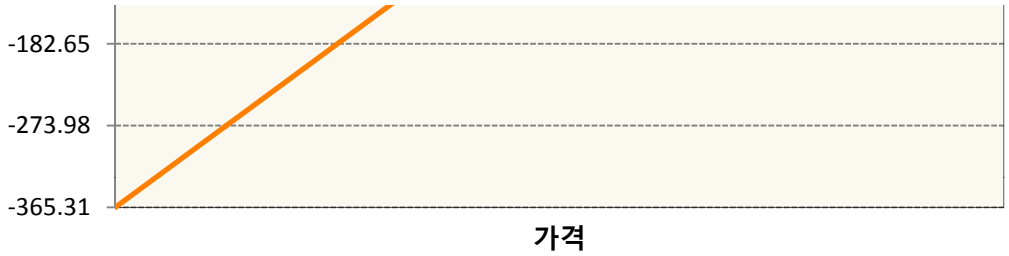
(단위:백만원)

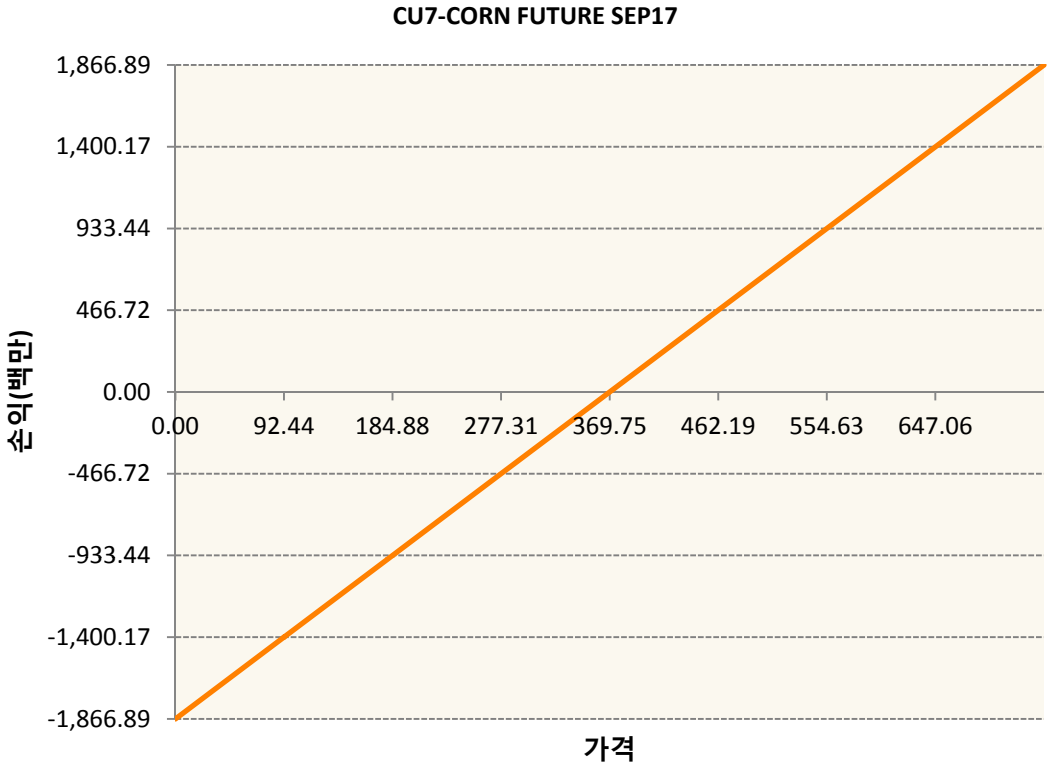
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	7,144	397	6,747	

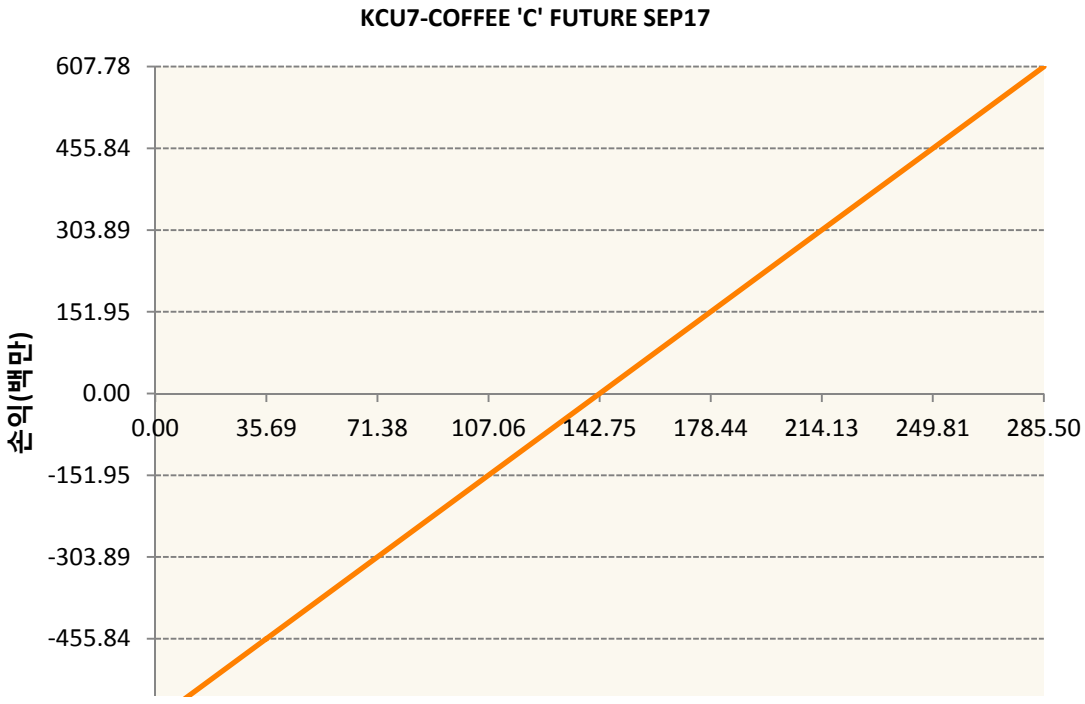
2. 만기시점의 손익구조

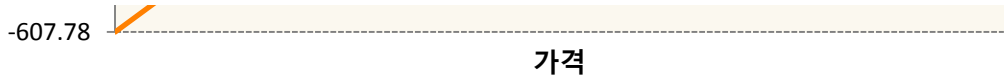


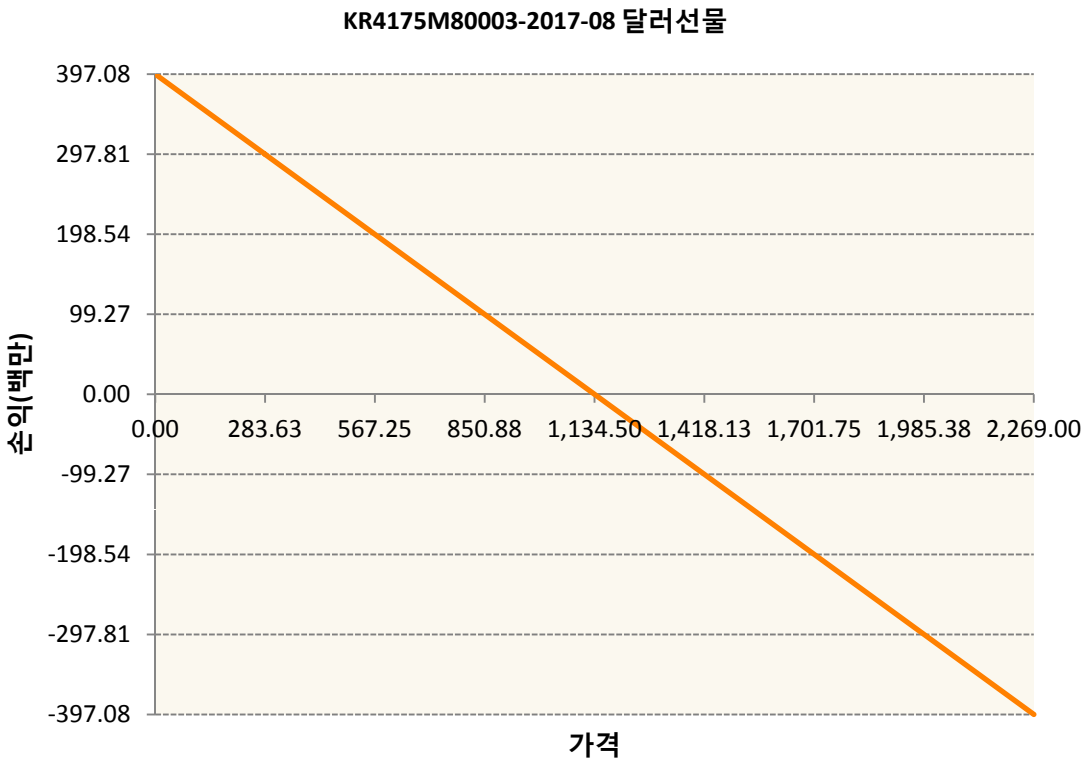


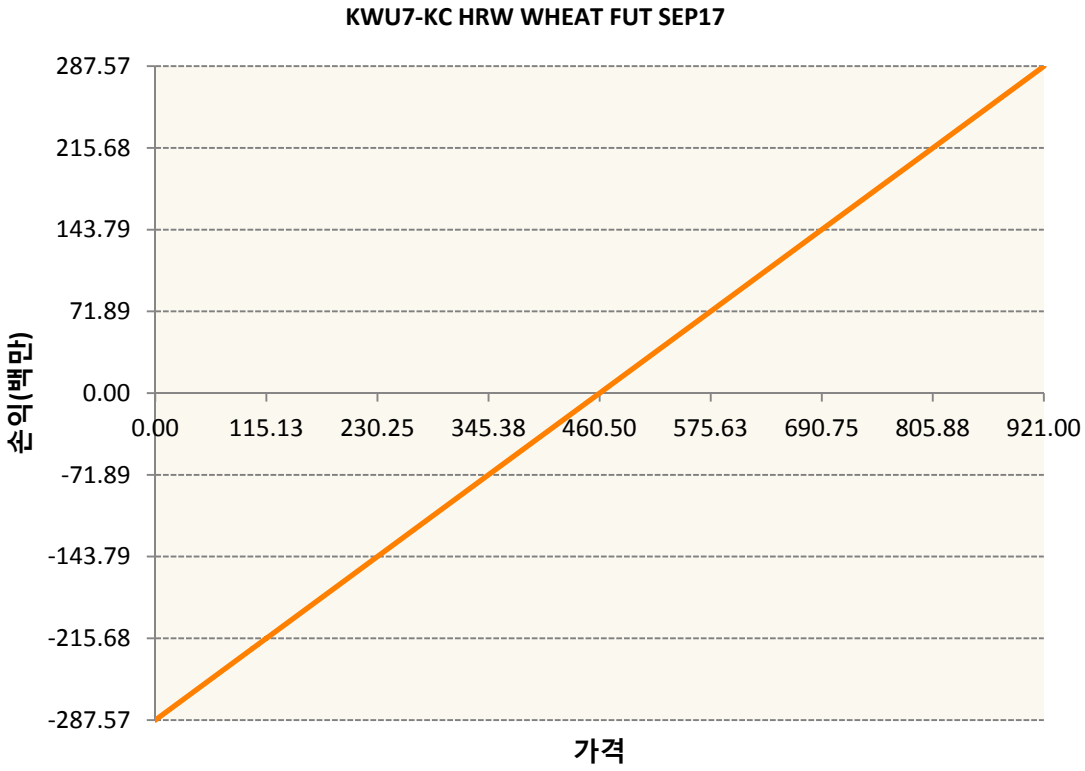

-182.65
-273.98
-365.31
가격

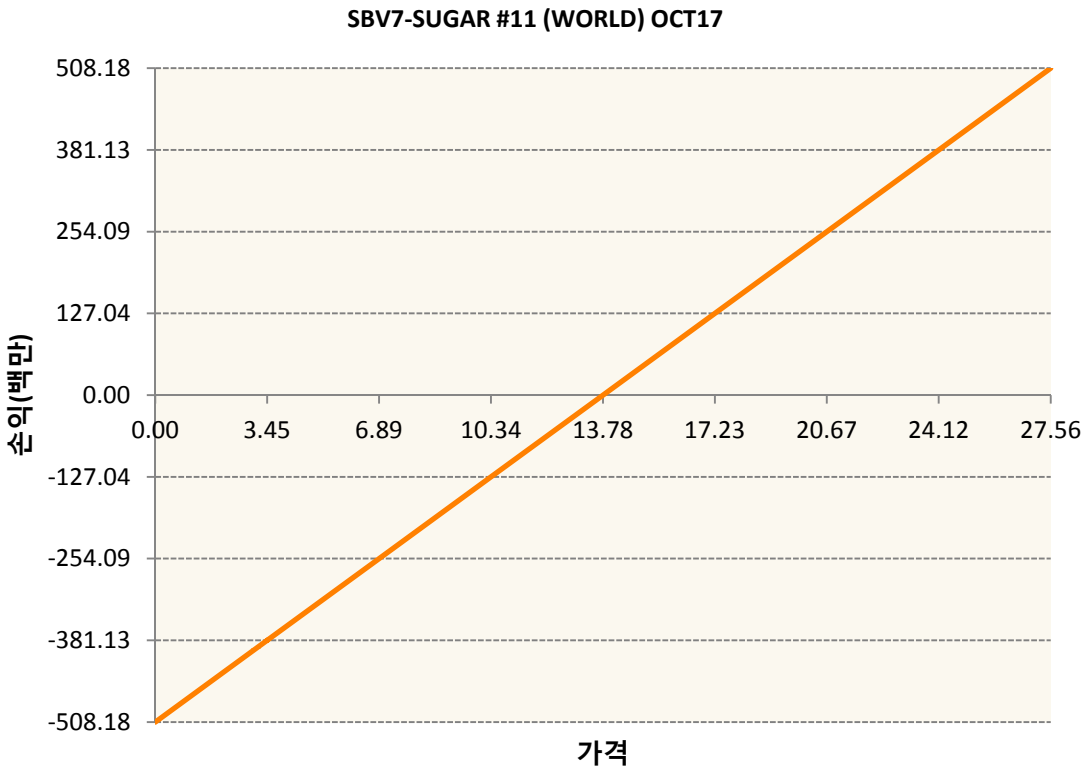

CU7-CORN FUTURE SEP17
1,866.89
1,400.17
933.44
466.72
0.00
-466.72
-933.44
-1,400.17
-1,866.89
0.00
92.44
184.88
277.31
369.75
462.19
554.63
647.06
손익(백만)
가격

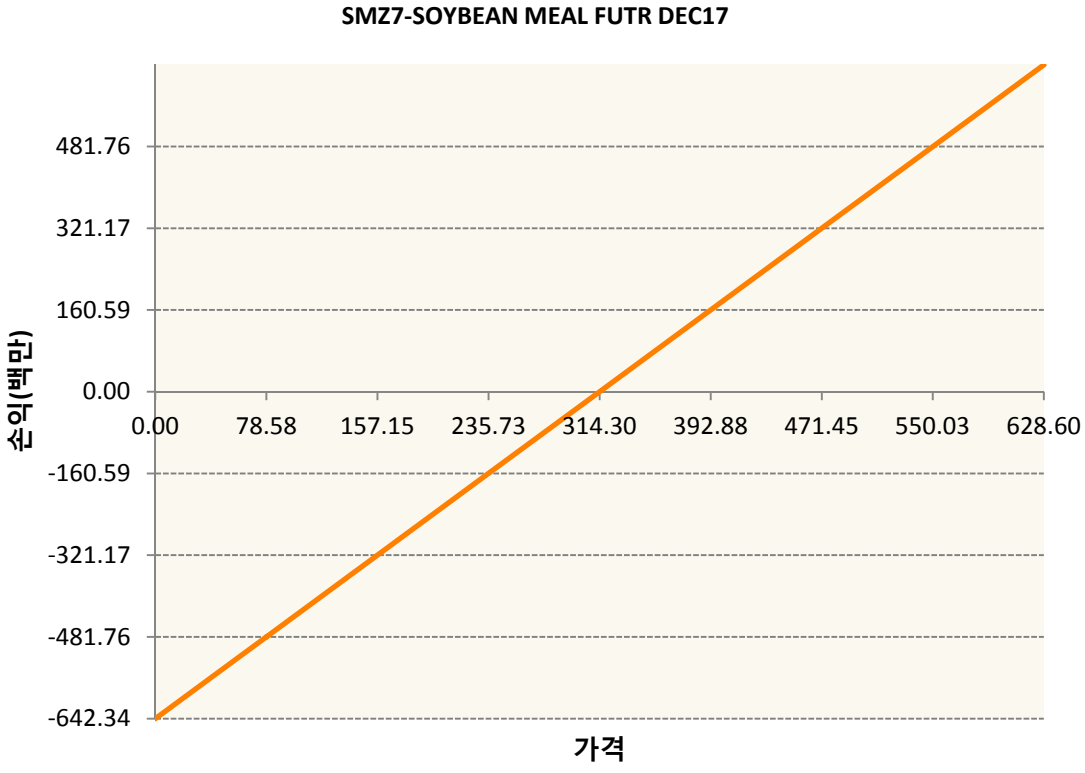

KCU7-COFFEE 'C' FUTURE SEP17
607.78
455.84
303.89
151.95
0.00
-151.95
-303.89
-455.84
0.00
35.69
71.38
107.06
142.75
178.44
214.13
249.81
285.50
손익(백만)


-607.78
가격

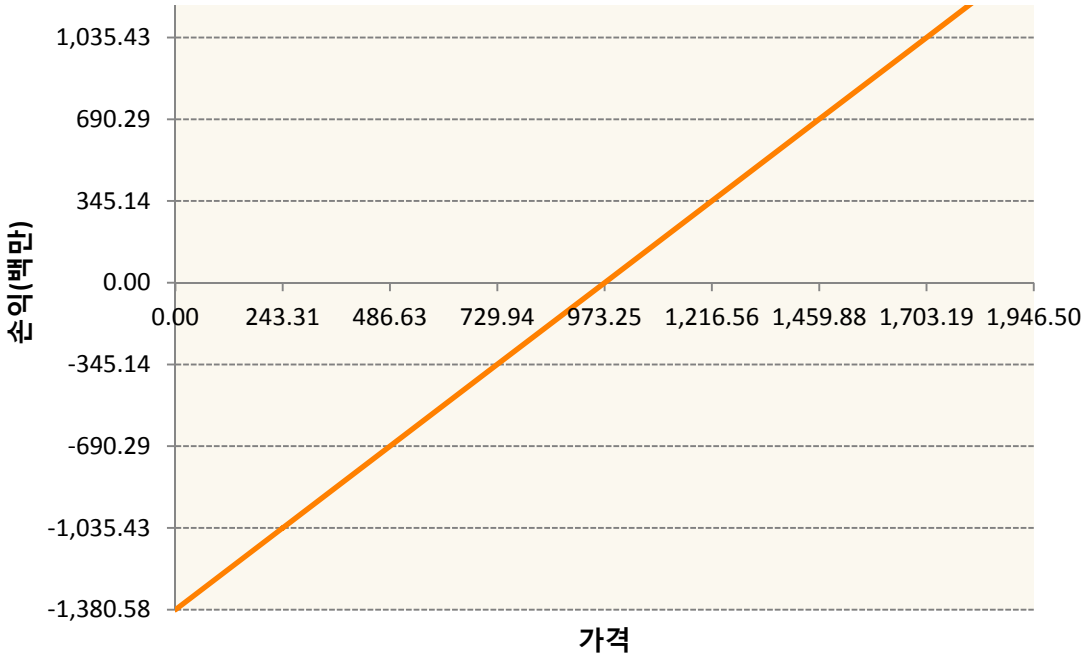

KR4175M80003-2017-08 달러선물
397.08
297.81
198.54
99.27
0.00
-99.27
-198.54
-297.81
-397.08
0.00
283.63
567.25
850.88
1,134.50
1,418.13
1,701.75
1,985.38
2,269.00
손익(백만)
가격

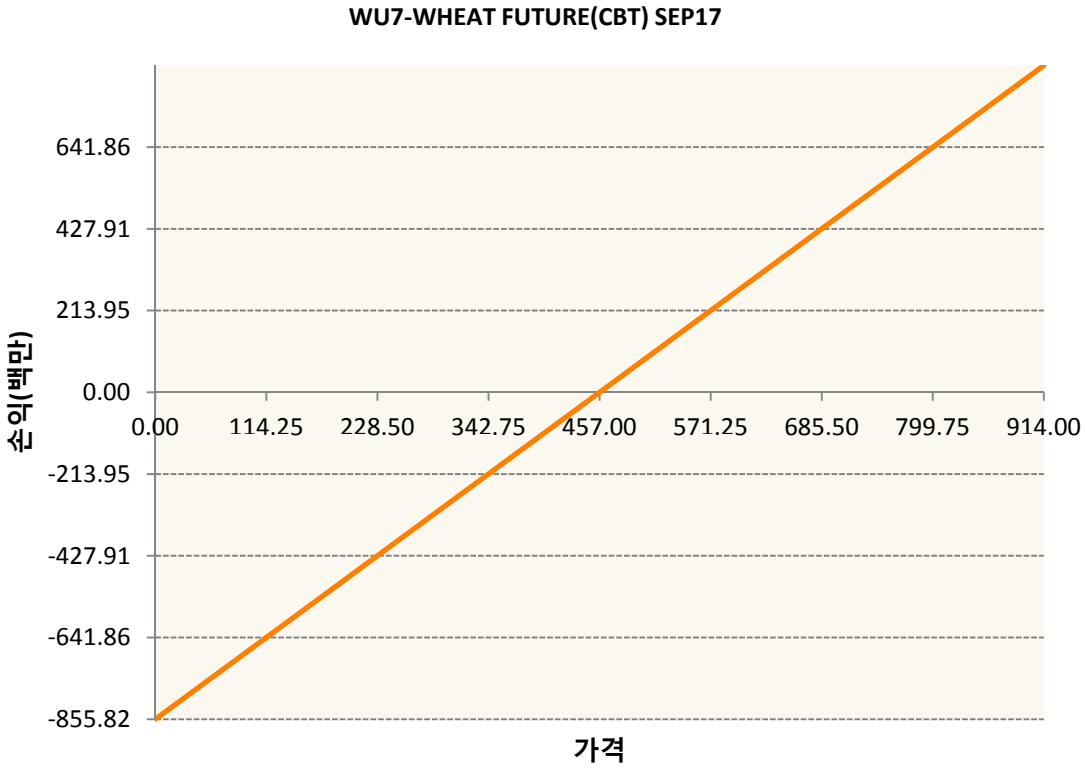

KWU7-KC HRW WHEAT FUT SEP17
287.57
215.68
143.79
71.89
0.00
-71.89
-143.79
-215.68
-287.57
0.00
115.13
230.25
345.38
460.50
575.63
690.75
805.88
921.00
손익(백만)
가격


SBV7-SUGAR #11 (WORLD) OCT17
508.18
381.13
254.09
127.04
0.00
-127.04
-254.09
-381.13
-508.18
손익(백만)
0.00
3.45
6.89
10.34
13.78
17.23
20.67
24.12
27.56
가격


SMZ7-SOYBEAN MEAL FUTR DEC17
481.76
321.17
160.59
0.00
-160.59
-321.17
-481.76
-642.34
손익(백만)
0.00
78.58
157.15
235.73
314.30
392.88
471.45
550.03
628.60
가격


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	149
KCU7	COFFEE 'C' FUTURE SEP17	49
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	68

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

672