공시일	2017-08-11
기준일	2017-08-10

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	2017-08-11
기준일	2017-08-10

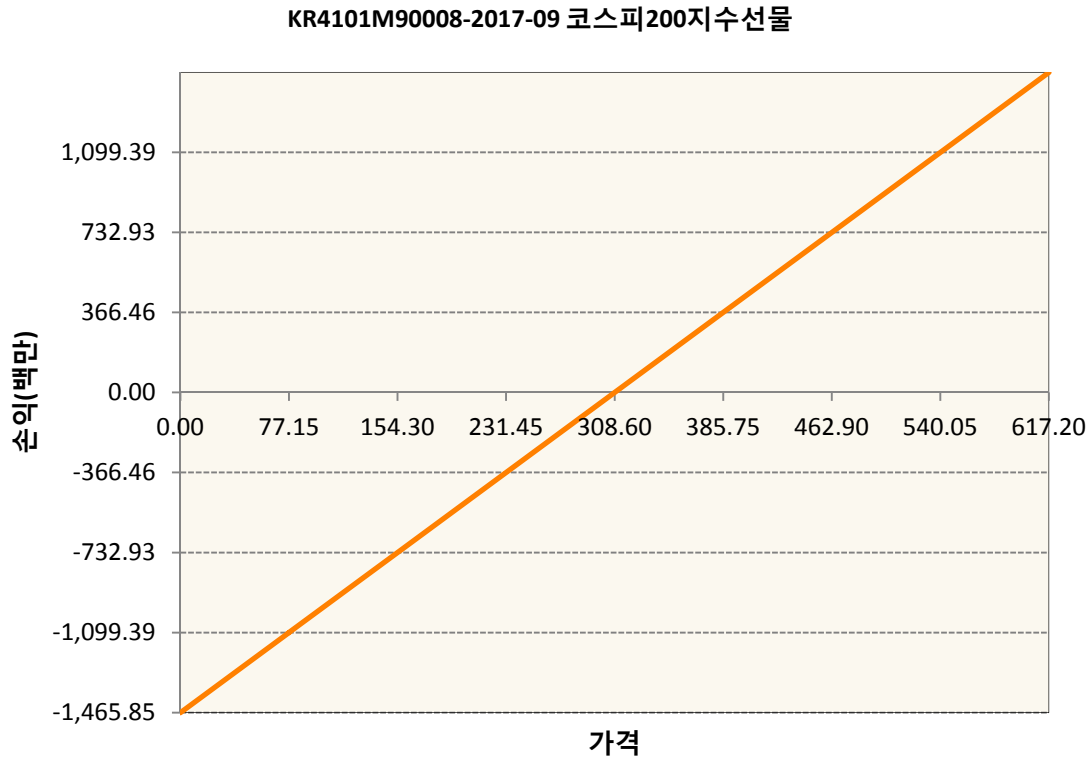
스마트인덱스모

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	1,466	0	1,466	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101M90(2017-09 코스피200지수선물							117
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-117	-117	-117	-117	-117	-117	-117
-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%	117	117	117	117	117	117	117

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

72

공시일	2017-08-11
기준일	2017-08-10

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	1,023

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

471

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-08-11
기준일	2017-08-10

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	398

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

340

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-08-11
기준일	2017-08-10

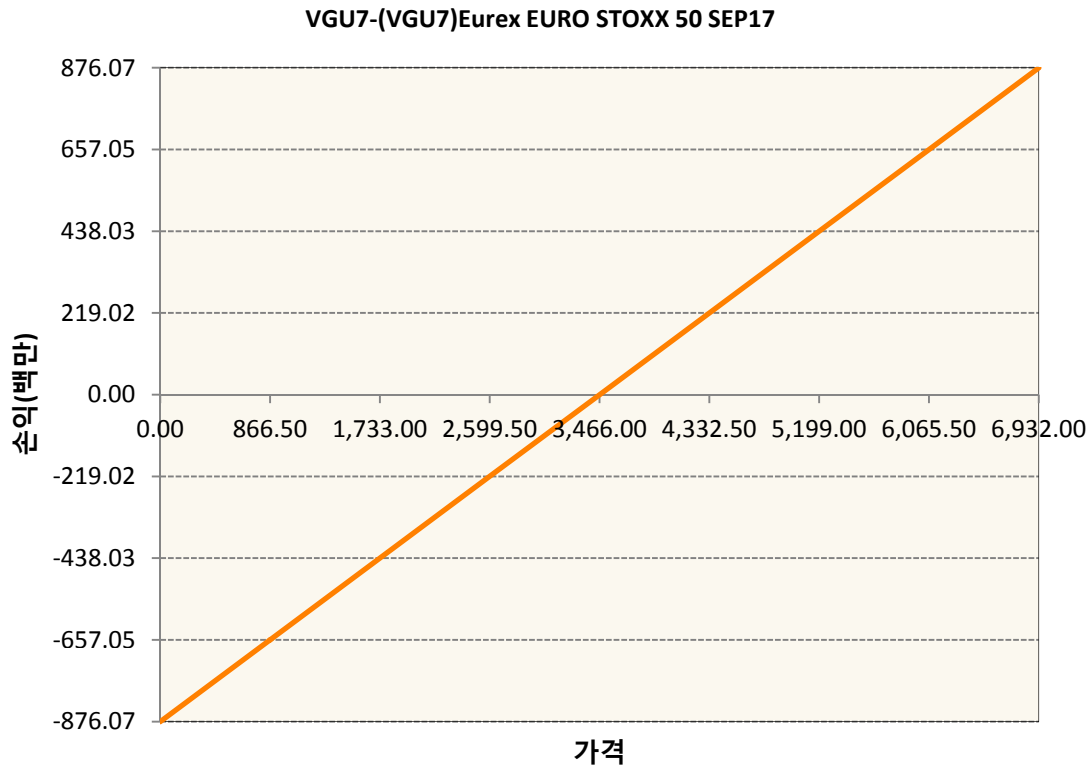
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	876	0	876	

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	2017-08-11
기준일	2017-08-10

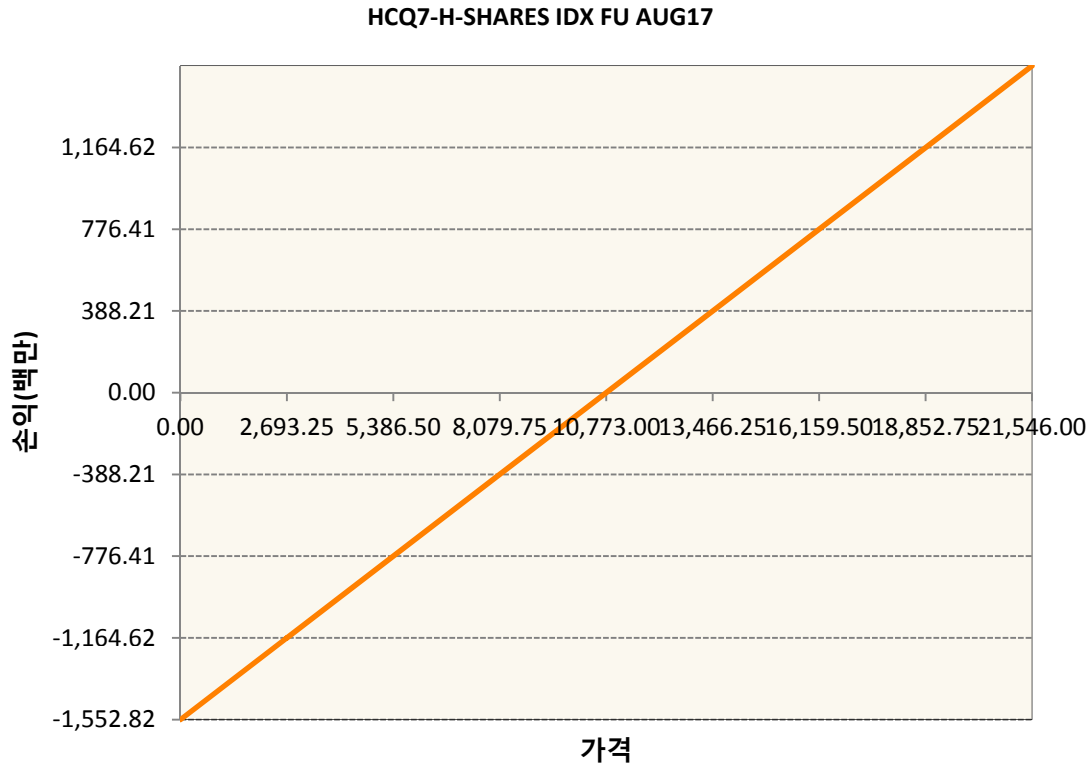
차이나인덱스모(주식-파생형)

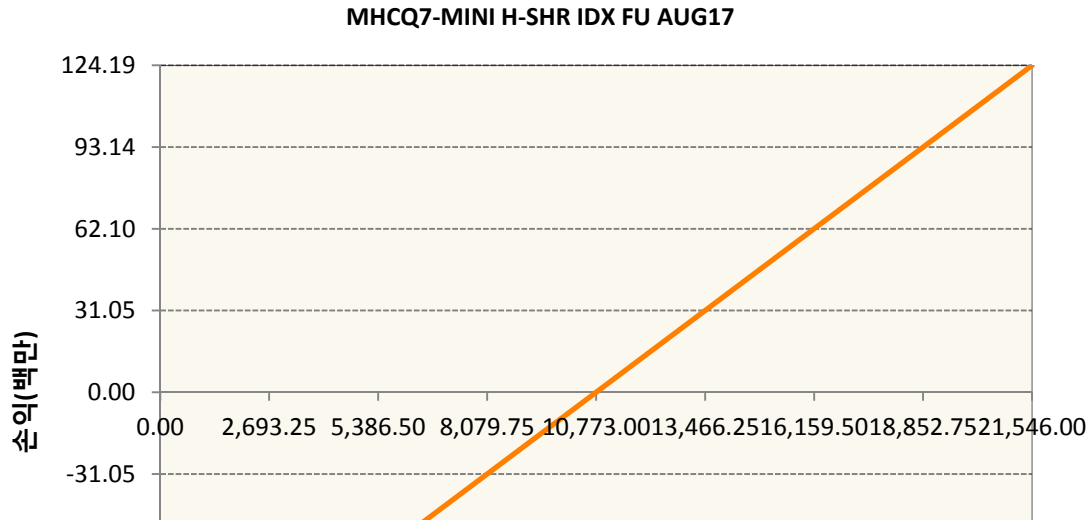
1. 계약금액

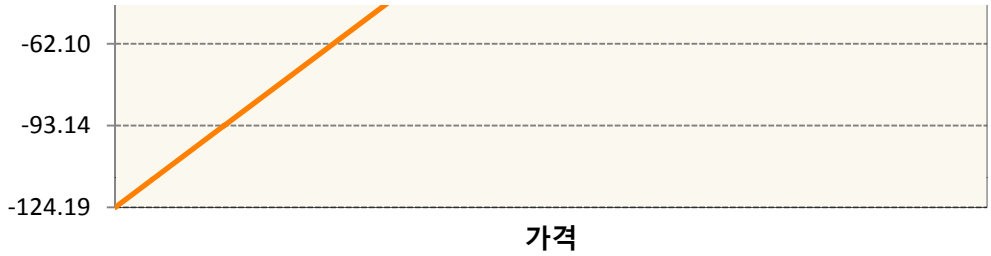
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,677	0	1,677	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCQ7	H-SHARES IDX FU AUG17	124
MHCQ7	MINI H-SHR IDX FU AUG17	10

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	117

공시일	2017-08-11
기준일	2017-08-10

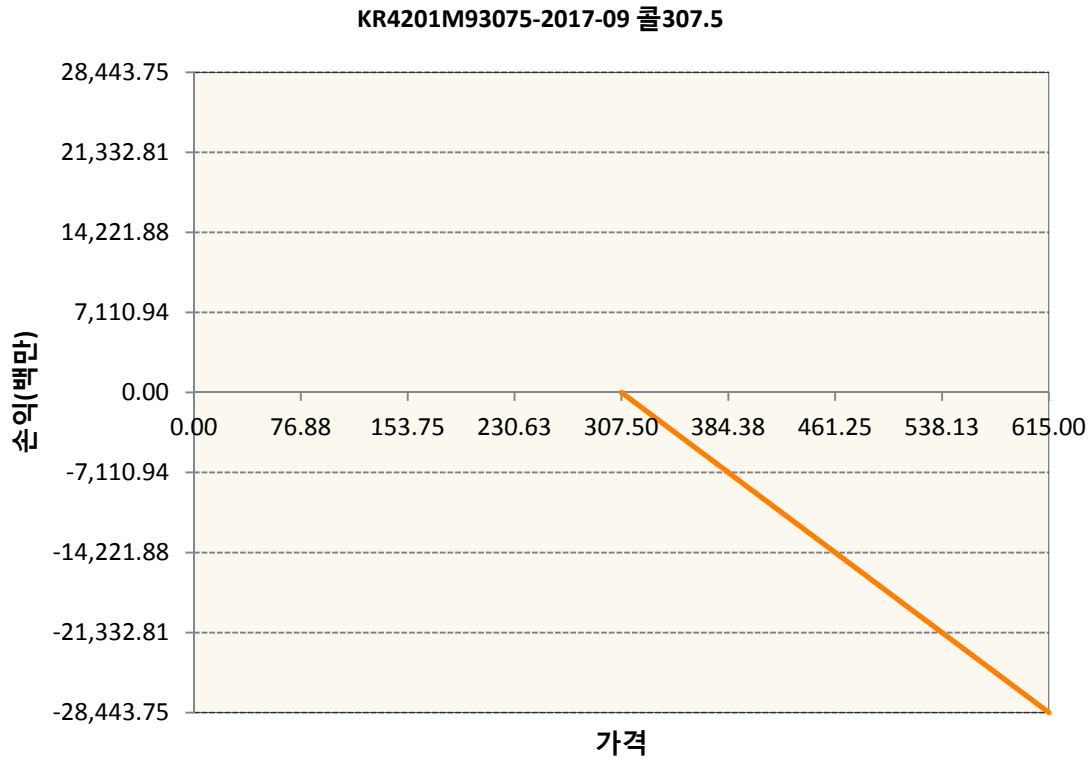
커버드콜모(주식혼합-파생형)

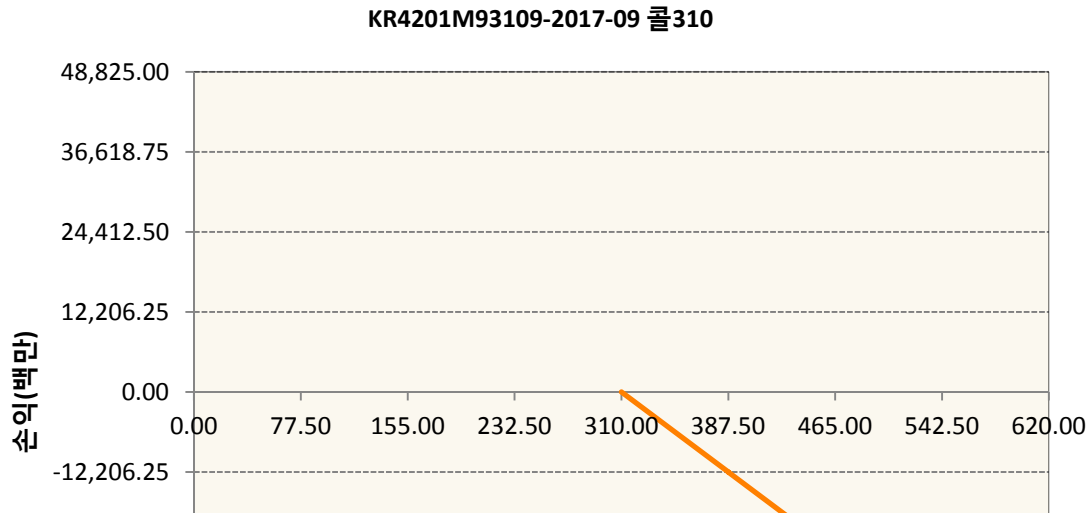
1. 계약금액

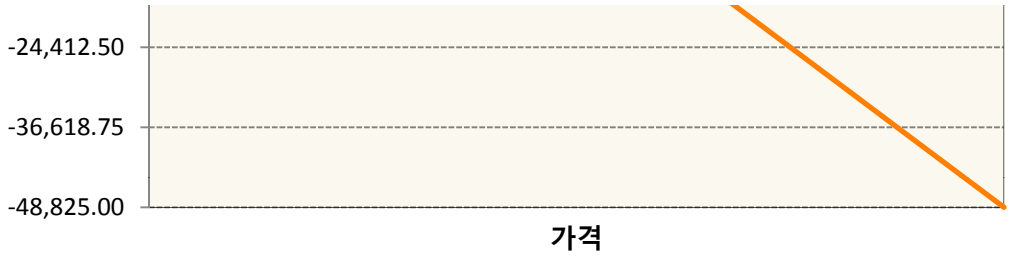
(단위:백만원)

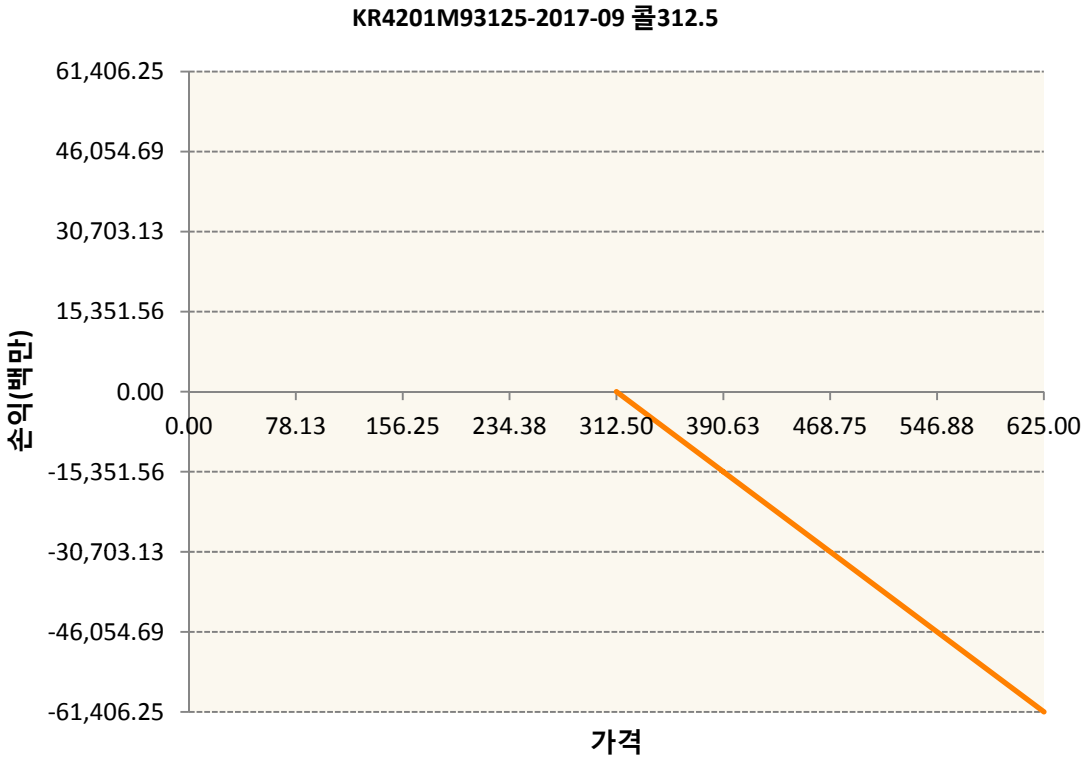
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	157,178	-157,178	장내
누계	유가증권	옵션	0	215,943	-215,943	장내

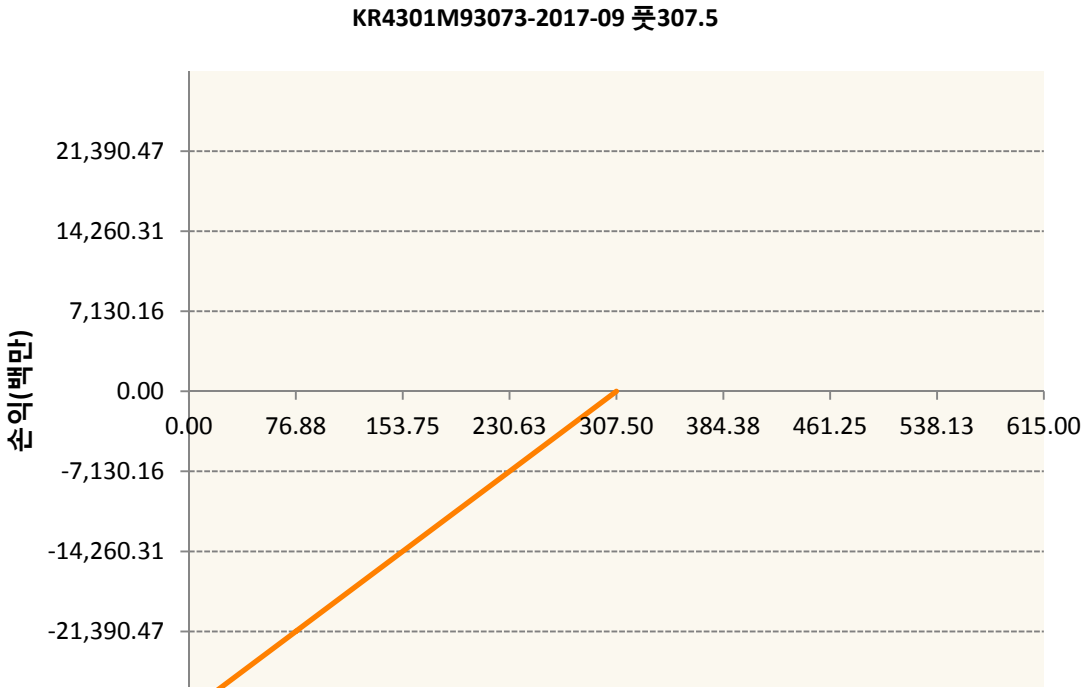
2. 만기시점의 손익구조

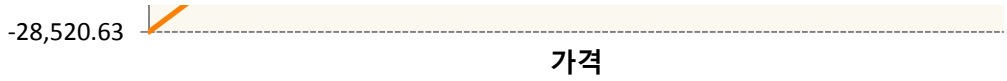


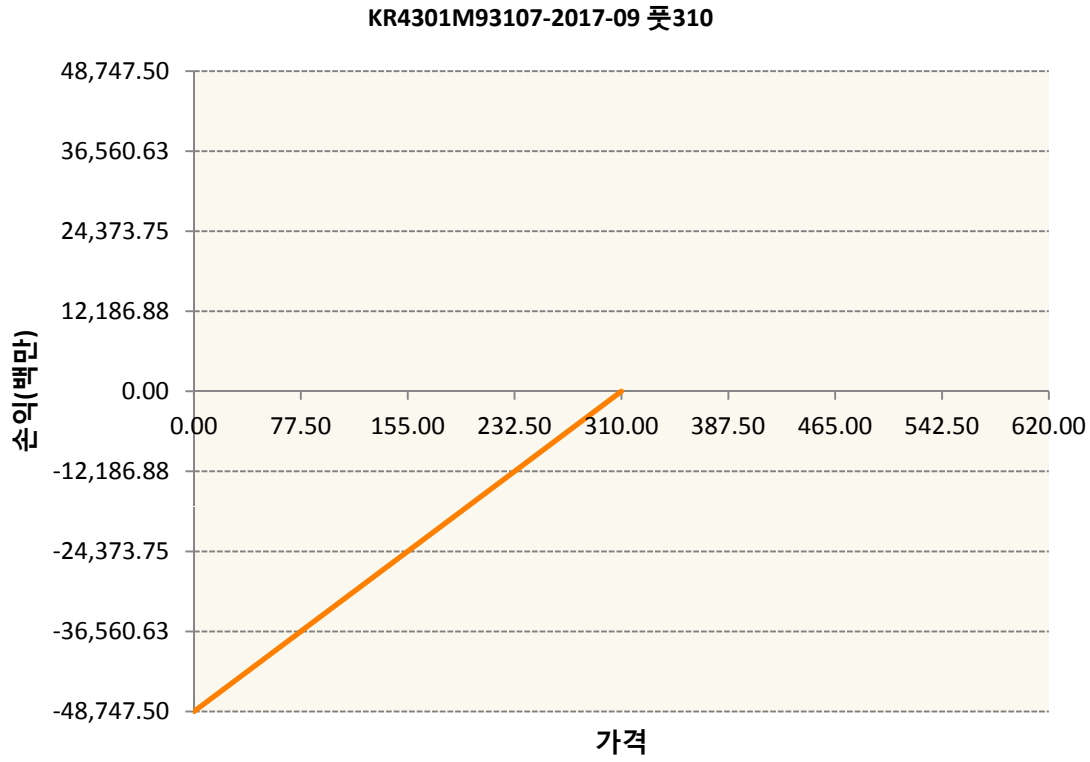



-24,412.50
-36,618.75
-48,825.00
가격


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


KR4301M93073-2017-09 풋307.5
21,390.47
14,260.31
7,130.16
0.00
-7,130.16
-14,260.31
-21,390.47
손익(백만)
0.00
76.88
153.75
230.63
307.50
384.38
461.25
538.13
615.00





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201M93(2017-09 콜307.5							1,770
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	849	820	787	750	708	664	617
-5.33%	749	701	649	594	538	480	420
-2.67%	548	483	416	349	281	213	144
0%	216	144	72	0	-72	-144	-216
2.67%	-255	-320	-386	-454	-522	-591	-660
5.33%	-844	-893	-945	-1,001	-1,060	-1,120	-1,182
8.00%	-1,515	-1,546	-1,583	-1,624	-1,670	-1,718	-1,770
KR4201M93: 2017-09 콜310							2,897
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,283	1,243	1,194	1,138	1,075	1,005	931
-5.33%	1,149	1,076	996	911	821	727	630
-2.67%	864	759	651	540	429	316	201
0%	368	246	123	0	-123	-246	-369
2.67%	-363	-481	-599	-719	-840	-961	-1,082

5.33%	-1,308	-1,402	-1,501	-1,604	-1,710	-1,819	-1,931
8.00%	-2,413	-2,476	-2,548	-2,627	-2,713	-2,803	-2,897
	KR4201M93: 2017-09 콜312.5						3,463
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,411	1,370	1,319	1,257	1,187	1,108	1,023
-5.33%	1,280	1,201	1,112	1,015	911	802	688
-2.67%	988	866	740	609	475	339	201
0%	453	303	152	0	-152	-304	-457
2.67%	-370	-523	-676	-830	-984	-1,139	-1,293
5.33%	-1,472	-1,601	-1,735	-1,873	-2,013	-2,156	-2,301
8.00%	-2,795	-2,887	-2,989	-3,099	-3,215	-3,337	-3,463
	KR4301M93(2017-09 풋307.5						1,666
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,434	-1,462	-1,495	-1,533	-1,574	-1,619	-1,666
-5.33%	-772	-821	-873	-927	-984	-1,042	-1,102
-2.67%	-212	-277	-344	-412	-480	-548	-617
0%	217	144	72	0	-72	-144	-217
2.67%	506	441	374	307	238	169	100
5.33%	677	628	575	519	461	400	338
8.00%	765	734	697	656	611	562	510
	KR4301M93: 2017-09 풋310						2,944
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-2,593	-2,633	-2,681	-2,738	-2,801	-2,870	-2,944
-5.33%	-1,436	-1,508	-1,588	-1,673	-1,763	-1,857	-1,953
-2.67%	-429	-534	-642	-752	-863	-976	-1,090
0%	368	245	123	0	-123	-245	-368
2.67%	929	811	693	573	453	332	211
5.33%	1,276	1,183	1,084	981	875	766	655
8.00%	1,464	1,401	1,329	1,250	1,165	1,075	981

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

11,867

공시일	2017-08-11
기준일	2017-08-10

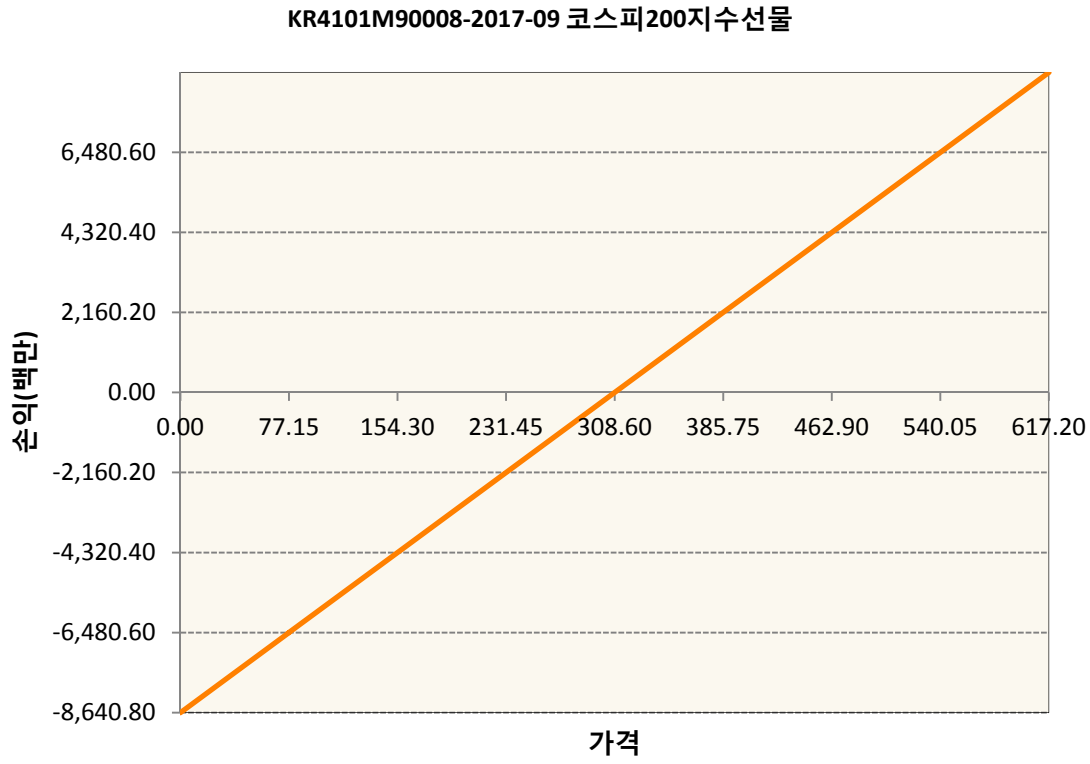
ETF스마트레버리지목표전환형6호

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	8,641	0	8,641	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101M90(2017-09 코스피200지수선물							691
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-691	-691	-691	-691	-691	-691	-691
-5.33%	-460	-460	-460	-460	-460	-460	-460
-2.67%	-230	-230	-230	-230	-230	-230	-230
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	230	230	230	230	230	230	230
5.33%	460	460	460	460	460	460	460
8.00%	691	691	691	691	691	691	691

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

423

공시일	2017-08-11
기준일	2017-08-10

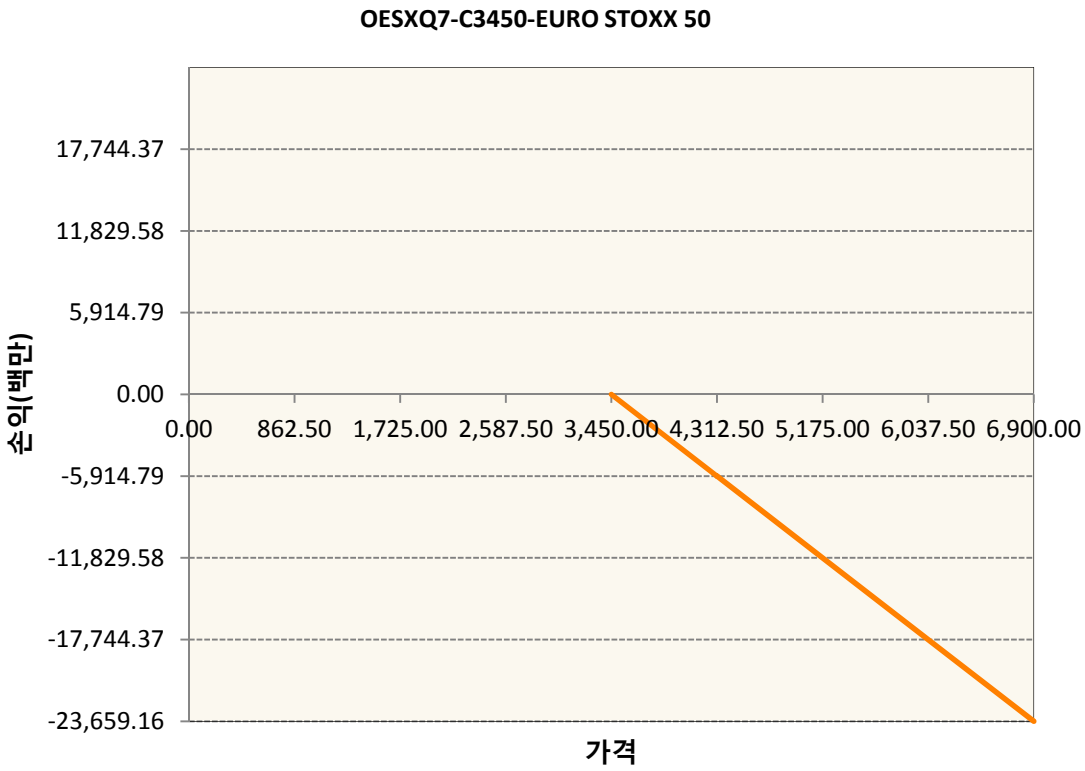
유로커버드콜(주식혼합-파생형)

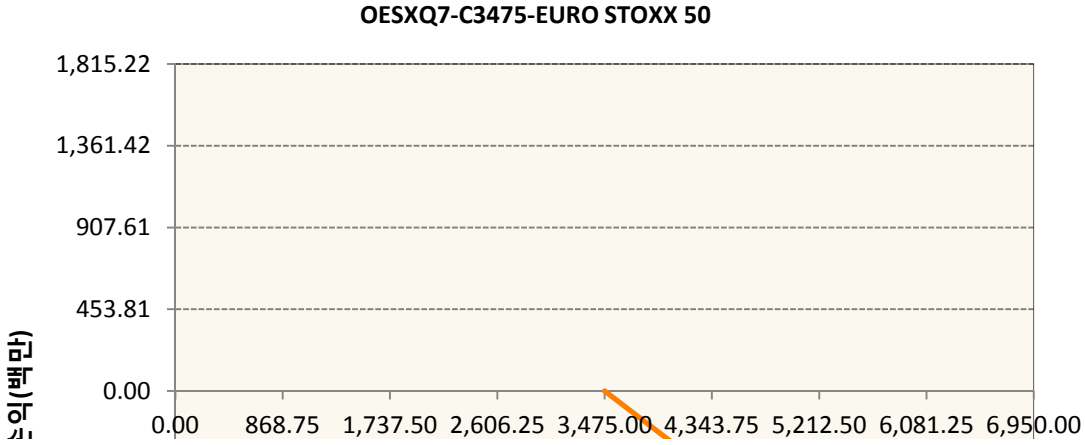
1. 계약금액

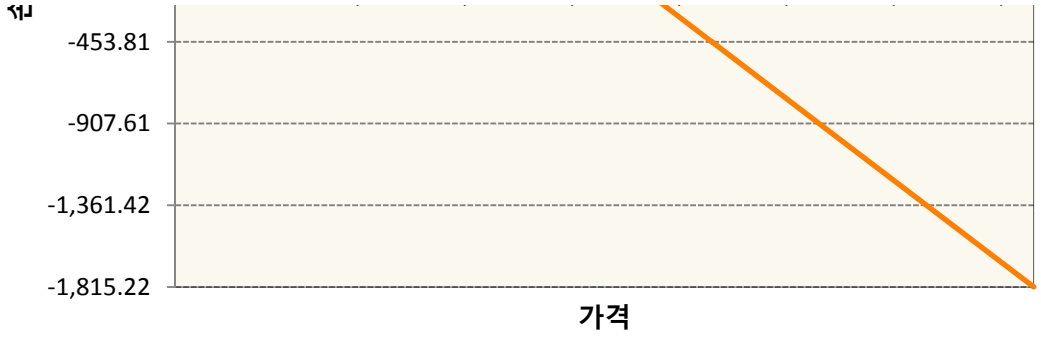
(단위:백만원)

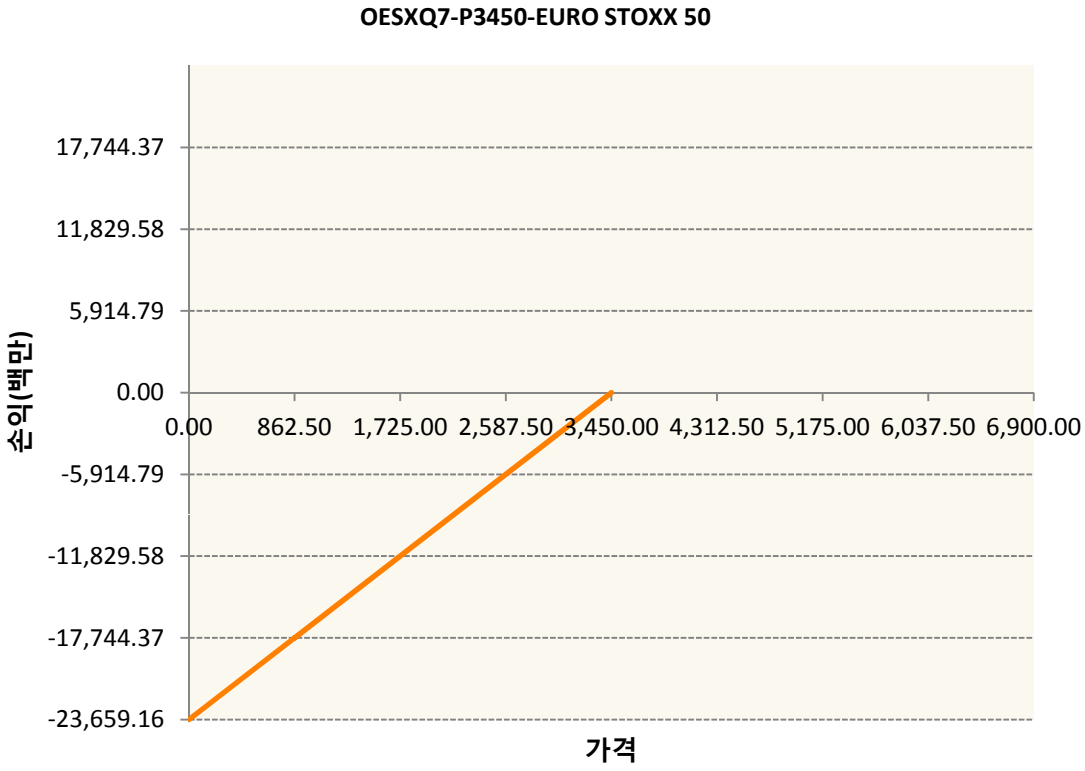
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	24,233	0	24,233	
누계	유가증권	옵션	0	50,949	-50,949	장내

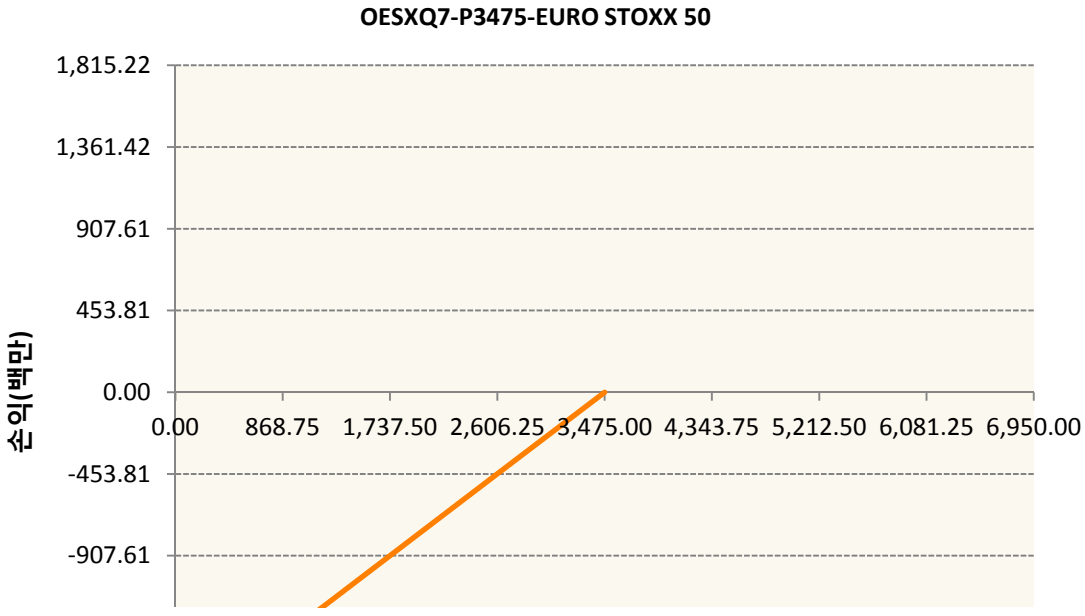
2. 만기시점의 손익구조

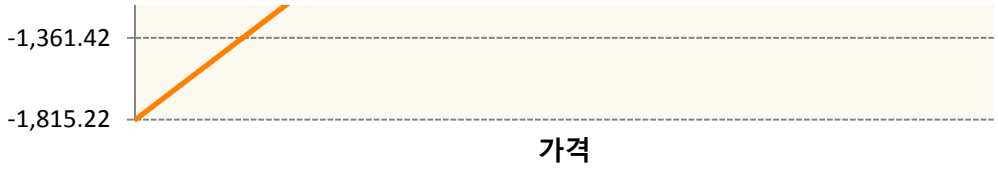


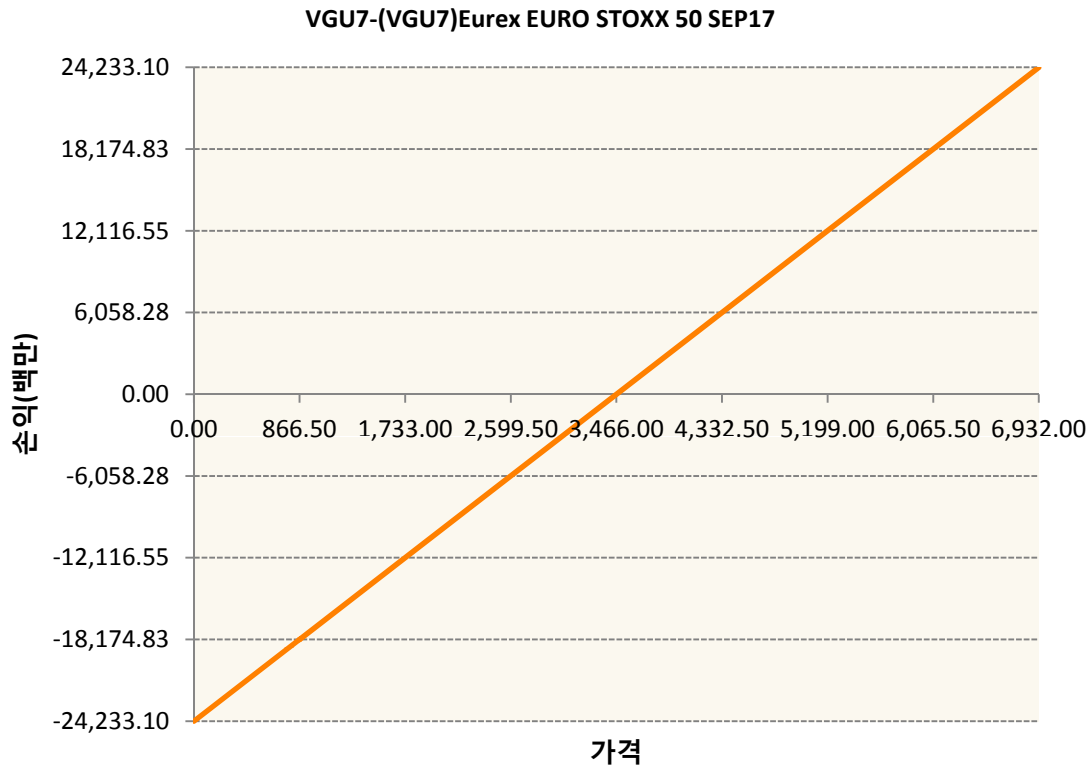



-453.81
-907.61
-1,361.42
-1,815.22
가격


OESXQ7-P3450-EURO STOXX 50
17,744.37
11,829.58
5,914.79
0.00
-5,914.79
-11,829.58
-17,744.37
-23,659.16
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
1,815.22
1,361.42
907.61
453.81
0.00
-453.81
-907.61
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	1,893
OESXQ7-C3	EURO STOXX 50	145
OESXQ7-P3	EURO STOXX 50	1,893
OESXQ7-P3	EURO STOXX 50	145
VGU7	(VGU7)Eurex EURO STOXX 50 SEP17	1,939

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	4,949

공시일	2017-08-11
기준일	2017-08-10

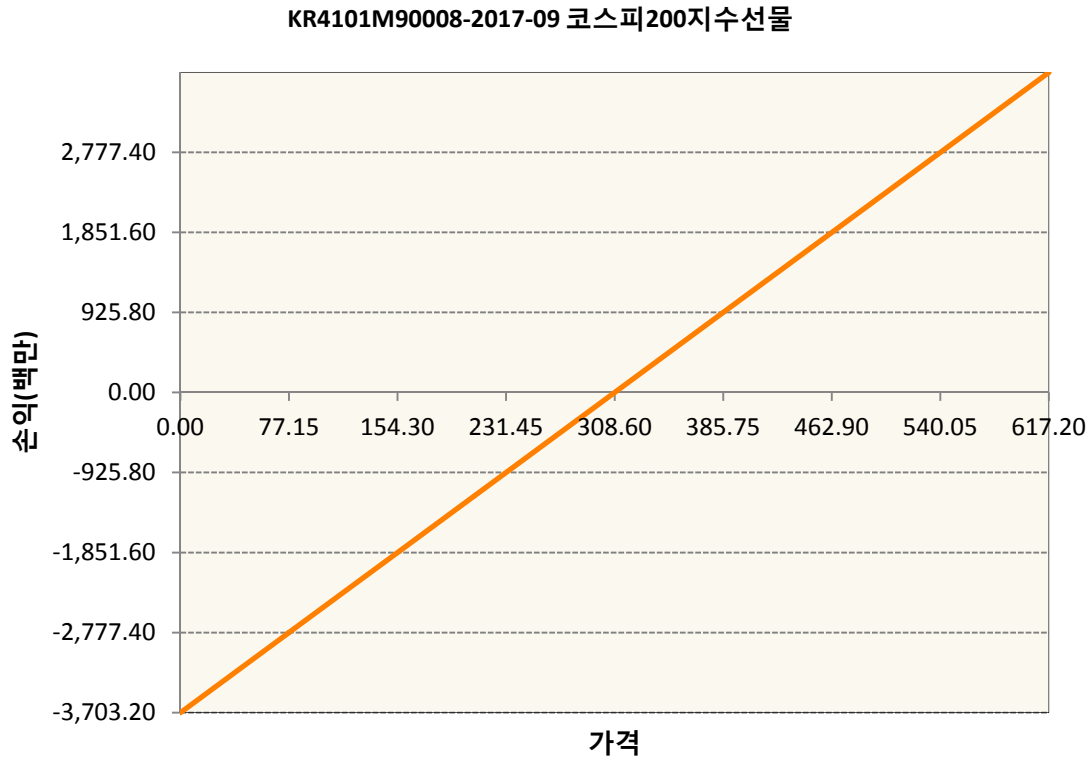
ETF스마트레버리지목표전환형7호

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	3,703	0	3,703	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101M90(2017-09 코스피200지수선물							296
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-296	-296	-296	-296	-296	-296	-296
-5.33%	-197	-197	-197	-197	-197	-197	-197
-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%	197	197	197	197	197	197	197
8.00%	296	296	296	296	296	296	296

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

181

공시일	2017-08-11
기준일	2017-08-10

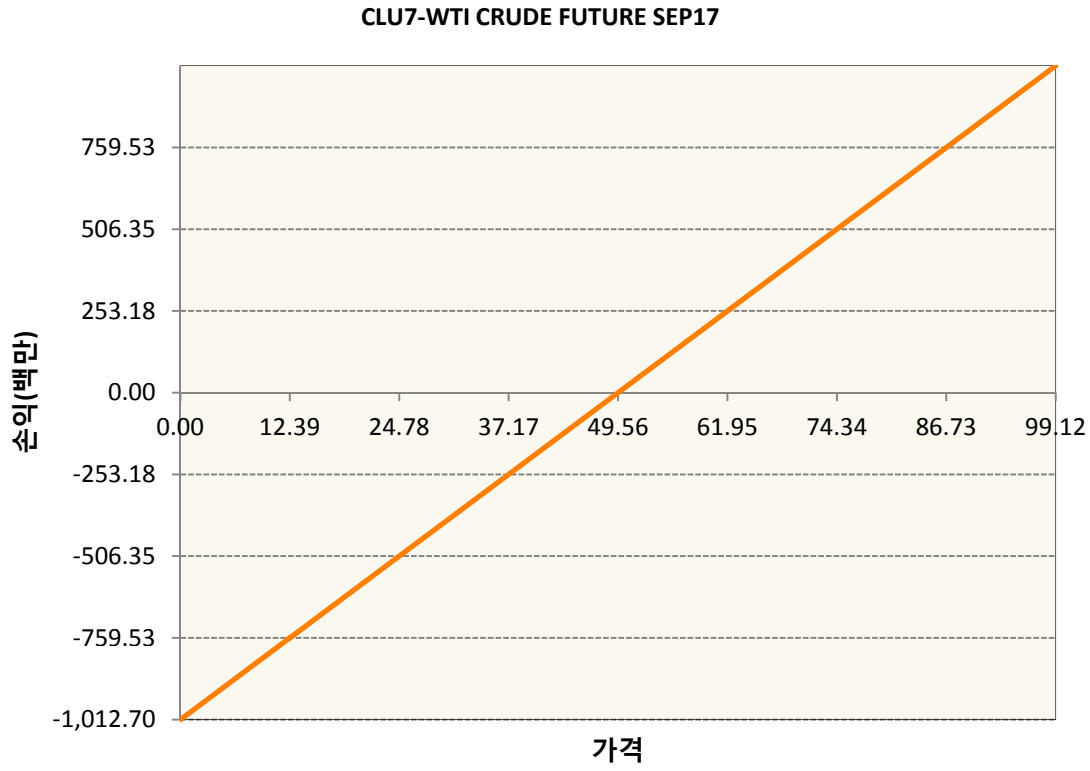
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

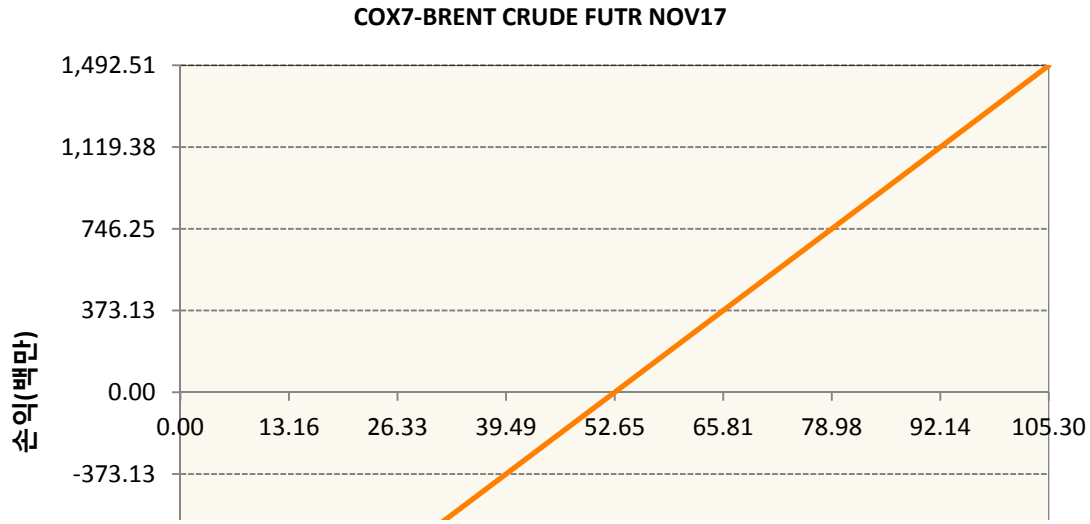
1. 계약금액

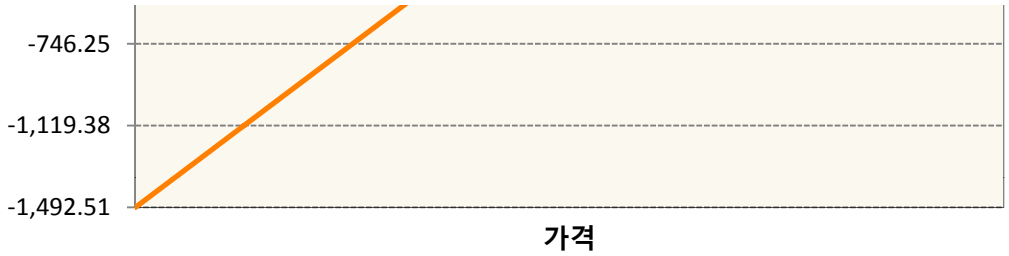
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	5,442	343	5,099	

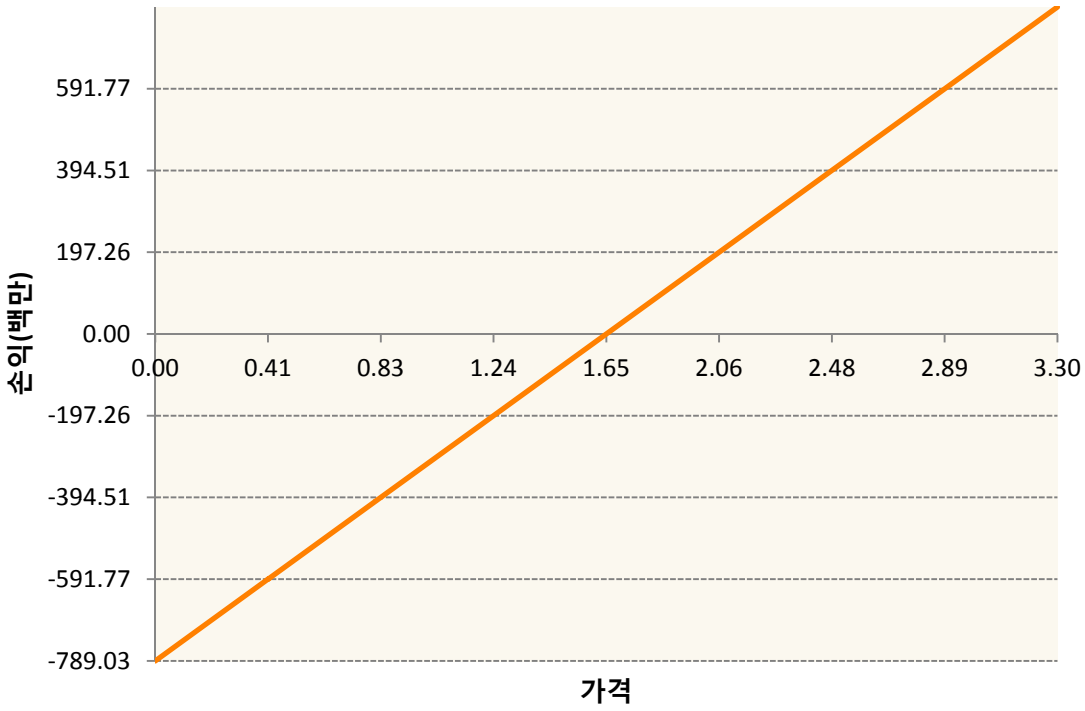
2. 만기시점의 손익구조



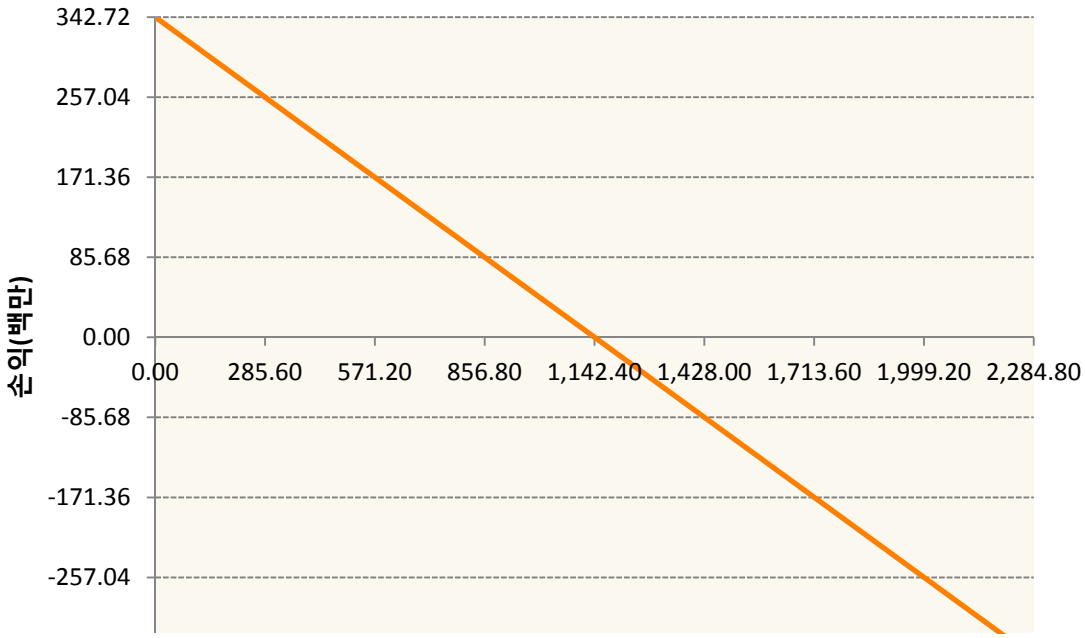


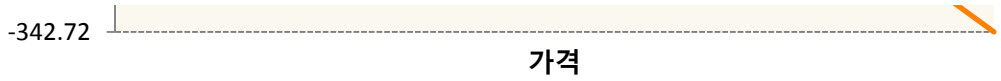


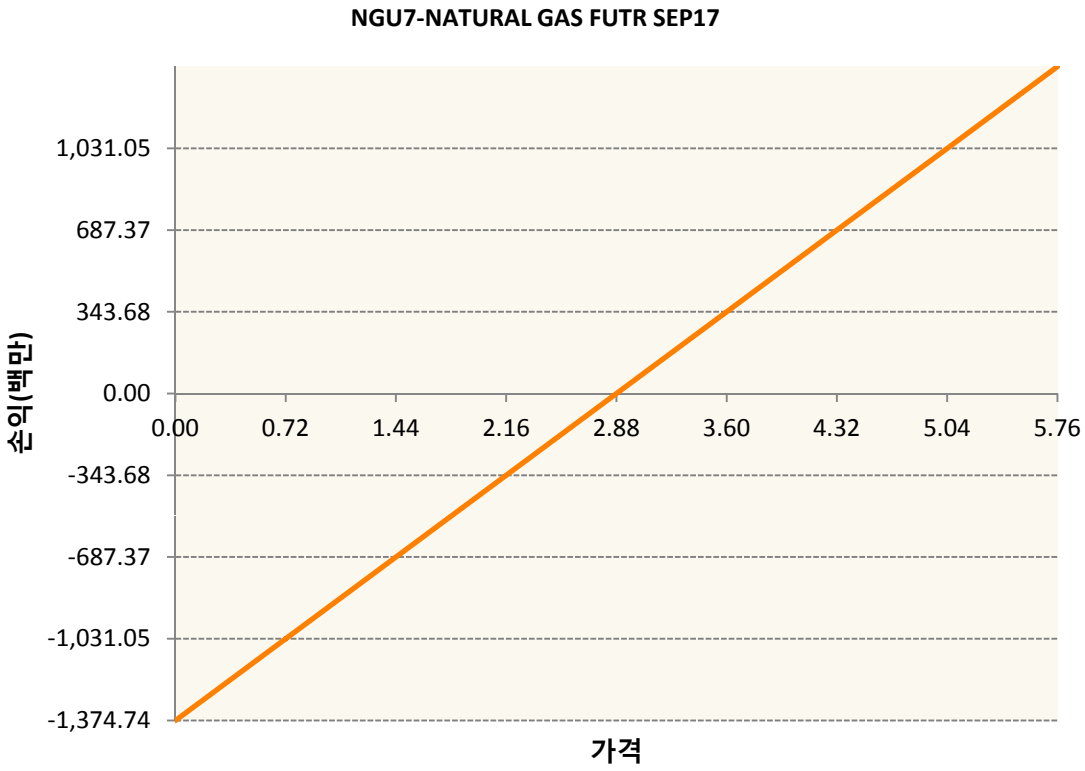
HOU7-NY HARB ULSD FUT SEP17

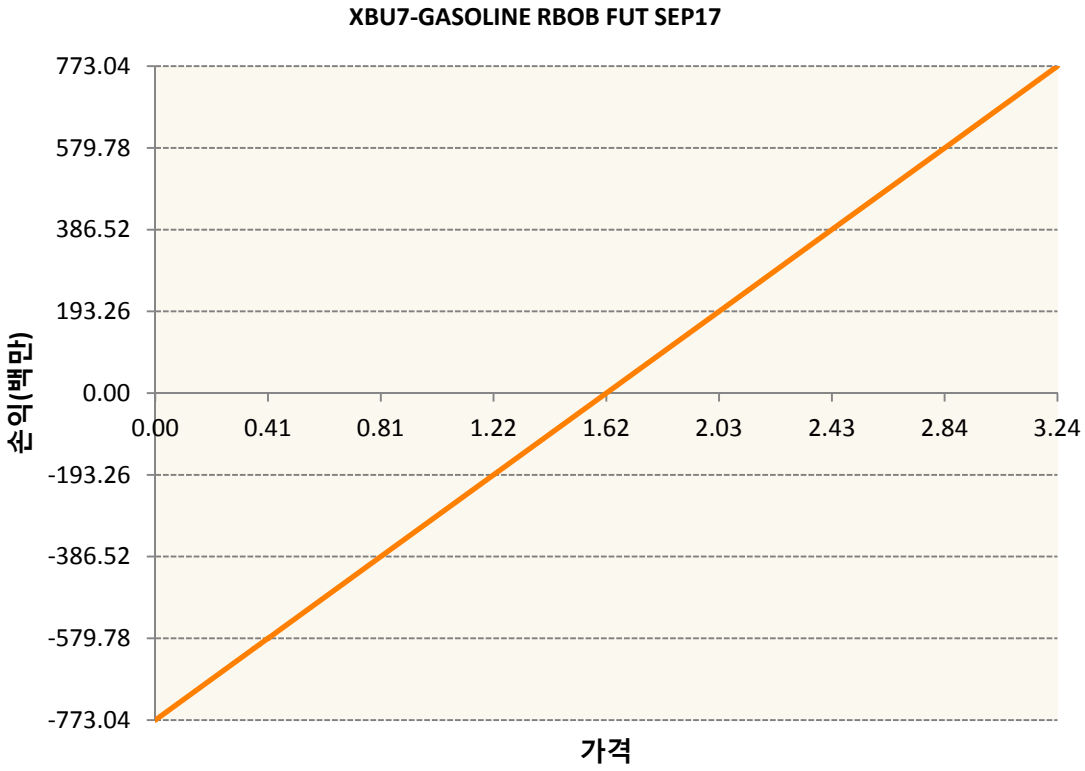


KR4175M80003-2017-08 달러선물




-342.72
가격


NGU7-NATURAL GAS FUTR SEP17
손익(백만)
1,031.05
687.37
343.68
0.00
-343.68
-687.37
-1,031.05
-1,374.74
0.00
0.72
1.44
2.16
2.88
3.60
4.32
5.04
5.76
가격


XBU7-GASOLINE RBOB FUT SEP17
손익(백만)
773.04
579.78
386.52
193.26
0.00
-193.26
-386.52
-579.78
-773.04
0.00
0.41
0.81
1.22
1.62
2.03
2.43
2.84
3.24
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	110
XBU7	GASOLINE RBOB FUT SEP17	62

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

781

공시일	2017-08-11
기준일	2017-08-10

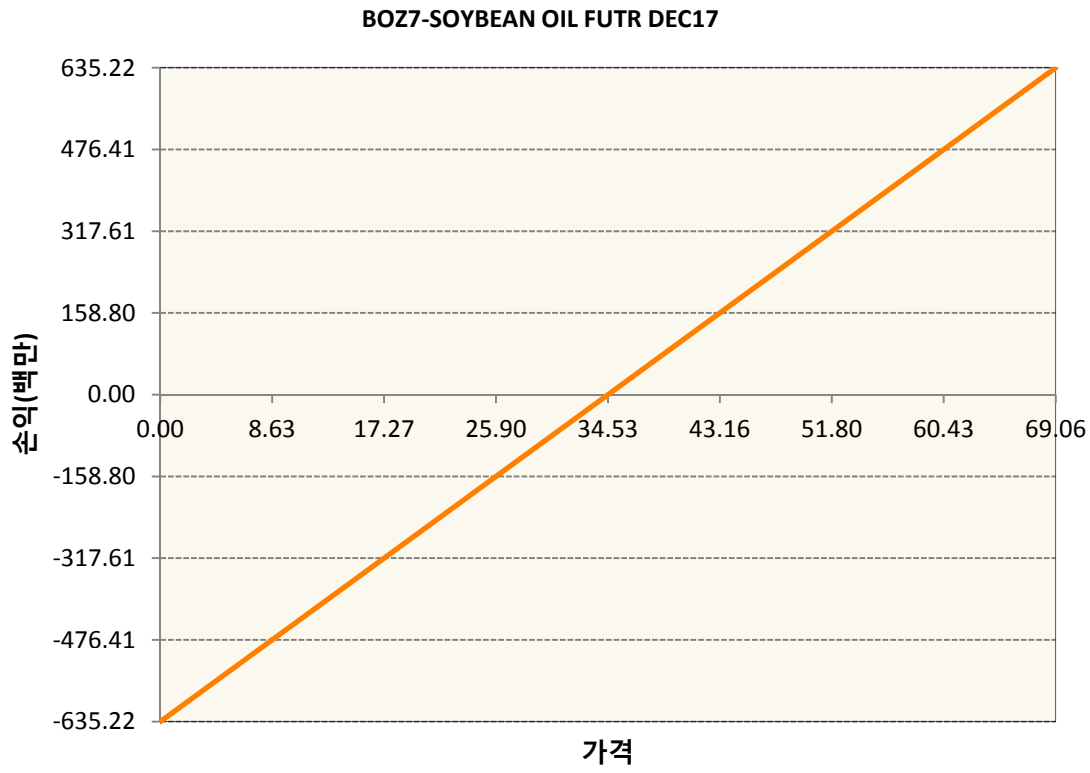
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

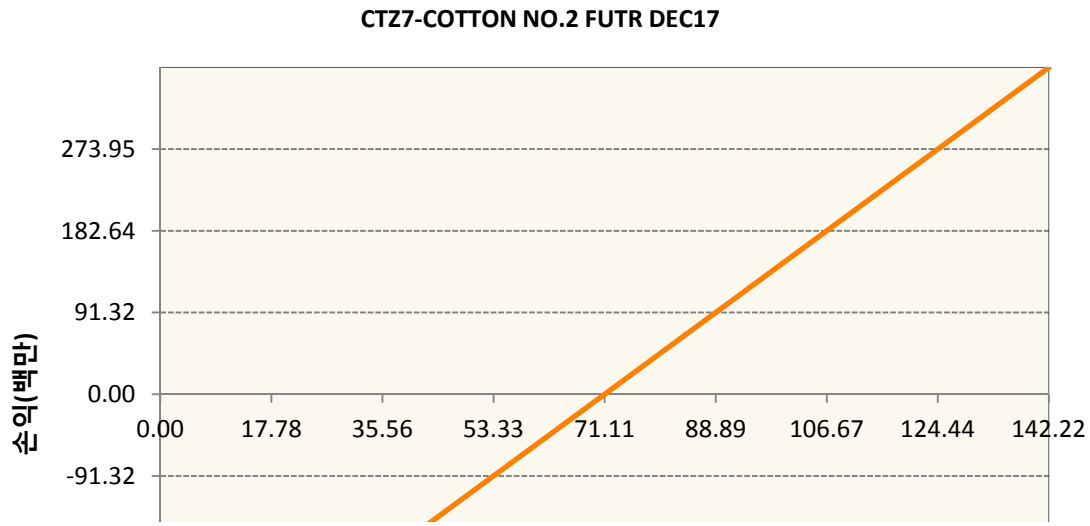
1. 계약금액

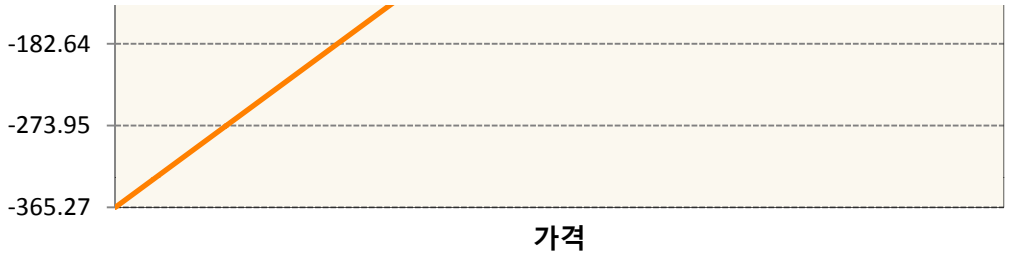
(단위:백만원)

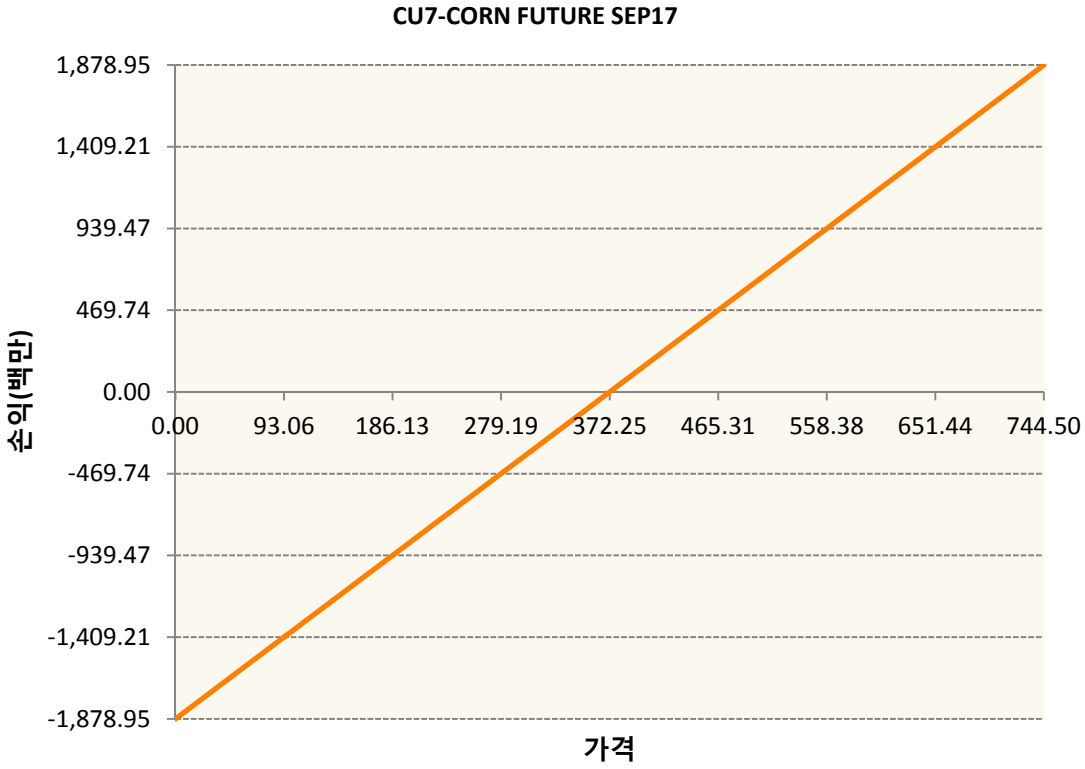
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	7,160	400	6,760	

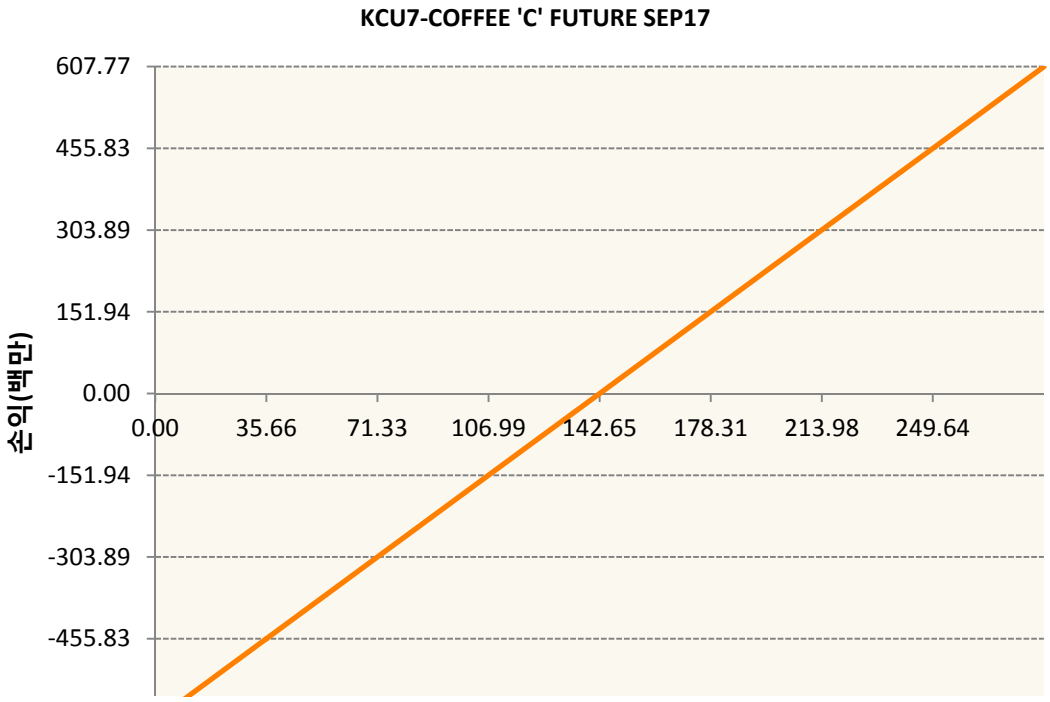
2. 만기시점의 손익구조

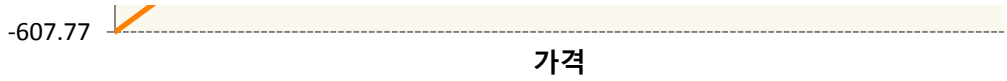


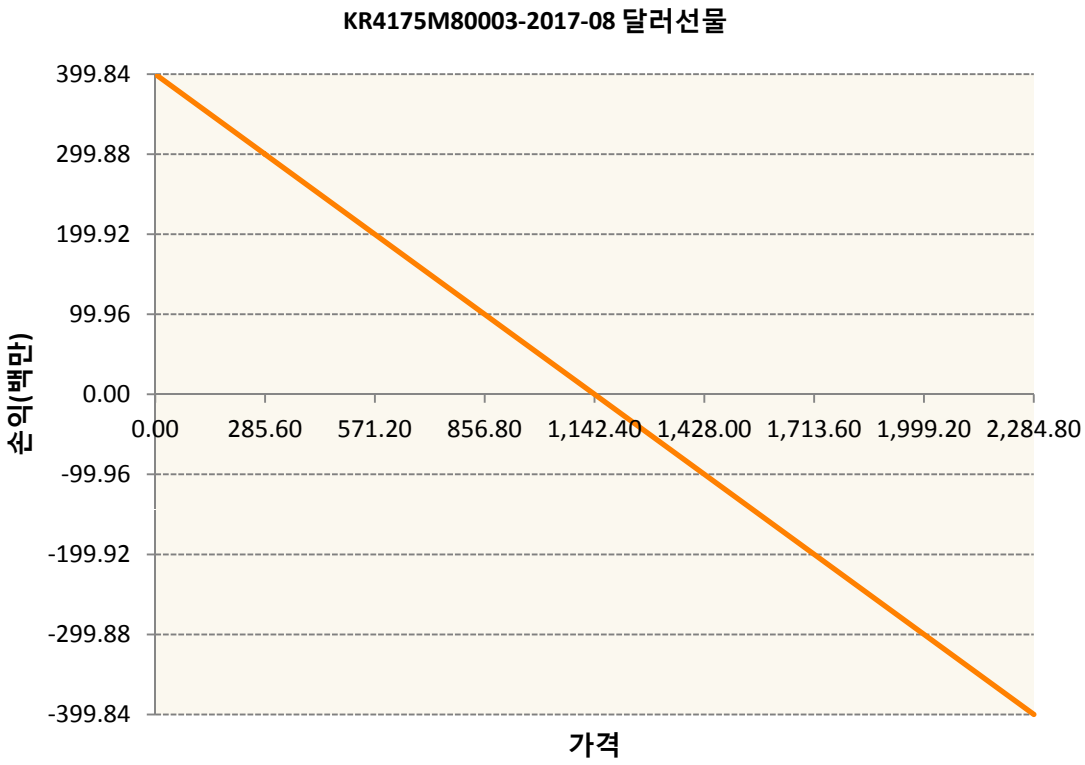


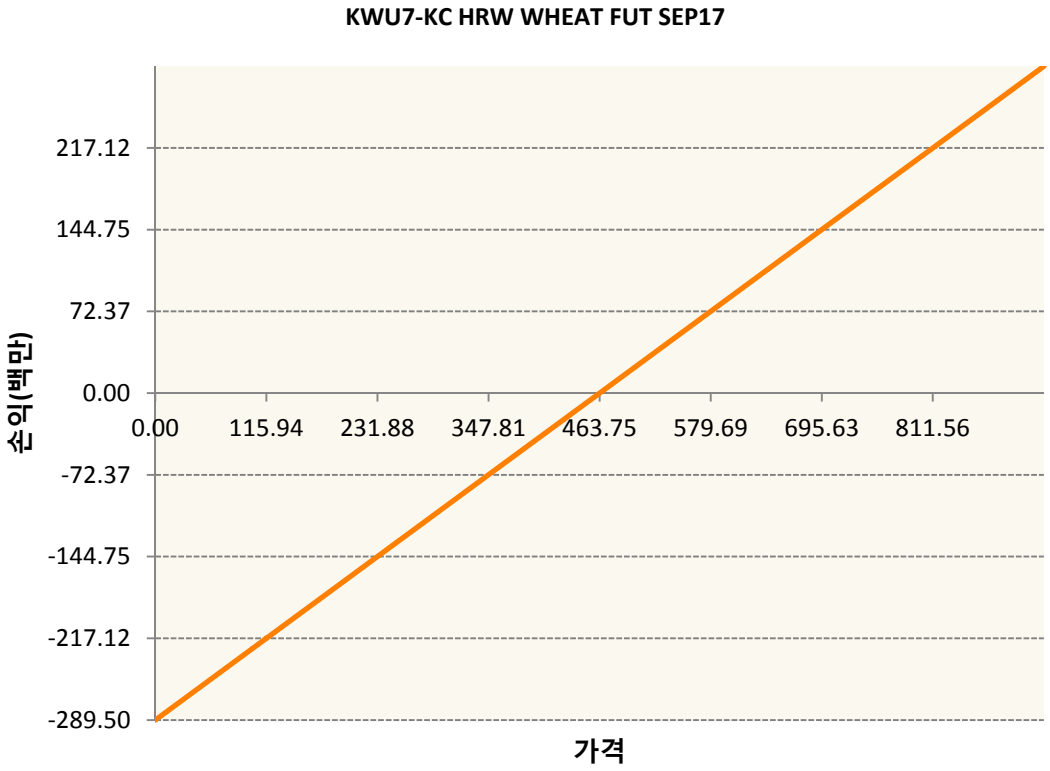

-182.64
-273.95
-365.27
가격

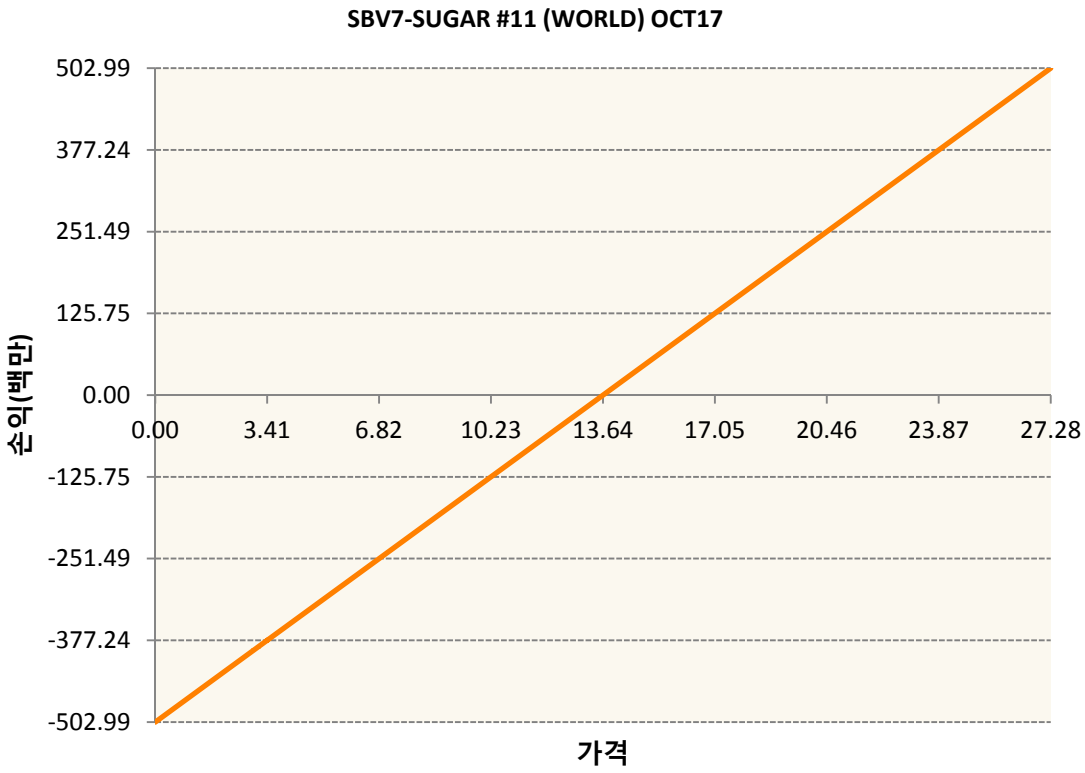

CU7-CORN FUTURE SEP17
1,878.95
1,409.21
939.47
469.74
0.00
-469.74
-939.47
-1,409.21
-1,878.95
0.00
93.06
186.13
279.19
372.25
465.31
558.38
651.44
744.50
손익(백만)
가격

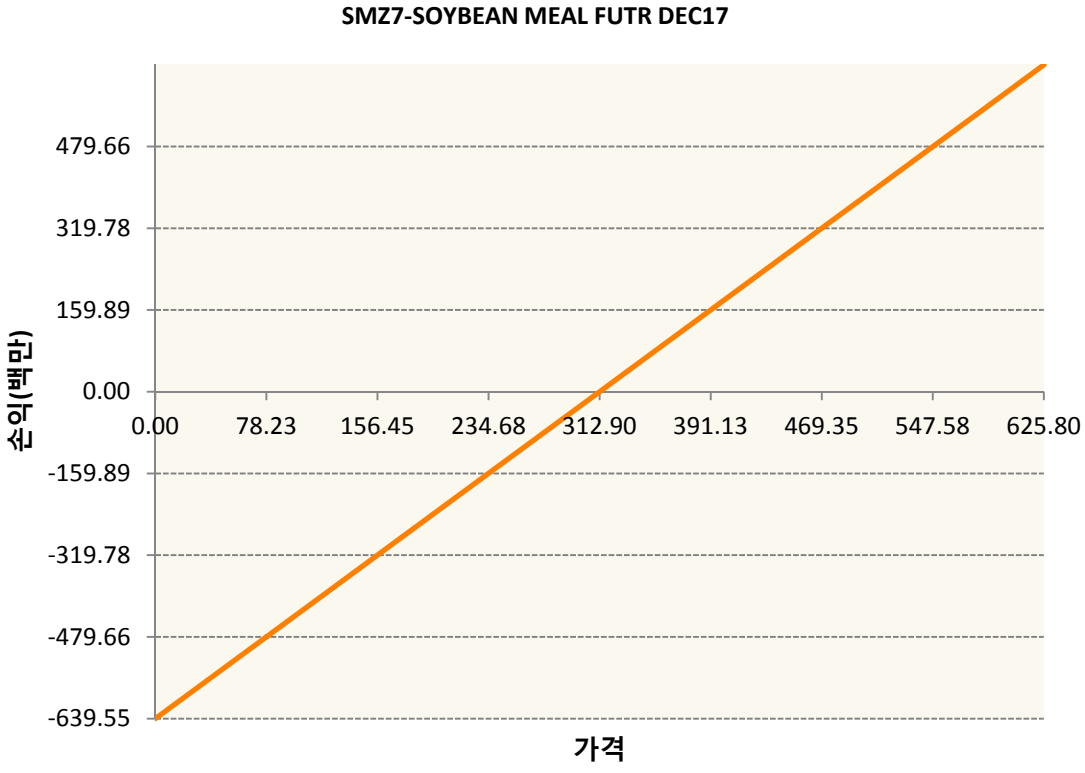

KCU7-COFFEE 'C' FUTURE SEP17
607.77
455.83
303.89
151.94
0.00
-151.94
-303.89
-455.83
0.00
35.66
71.33
106.99
142.65
178.31
213.98
249.64
손익(백만)

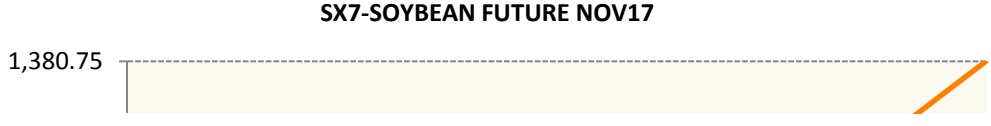

-607.77
가격

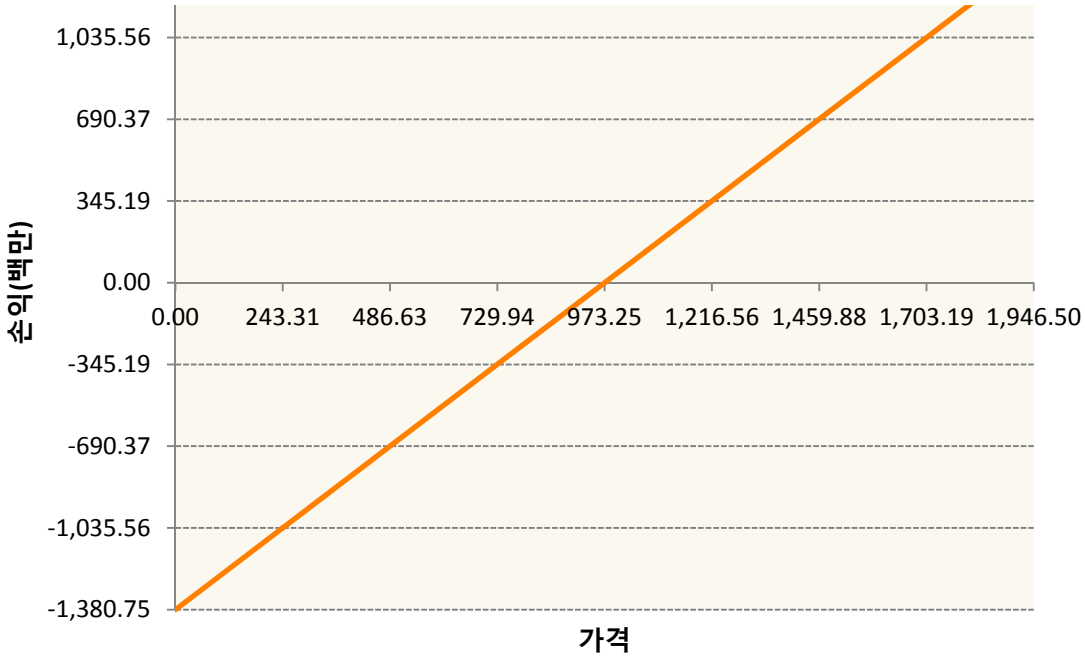

KR4175M80003-2017-08 달러선물
399.84
299.88
199.92
99.96
0.00
-99.96
-199.92
-299.88
-399.84
0.00
285.60
571.20
856.80
1,142.40
1,428.00
1,713.60
1,999.20
2,284.80
손익(백만)
가격

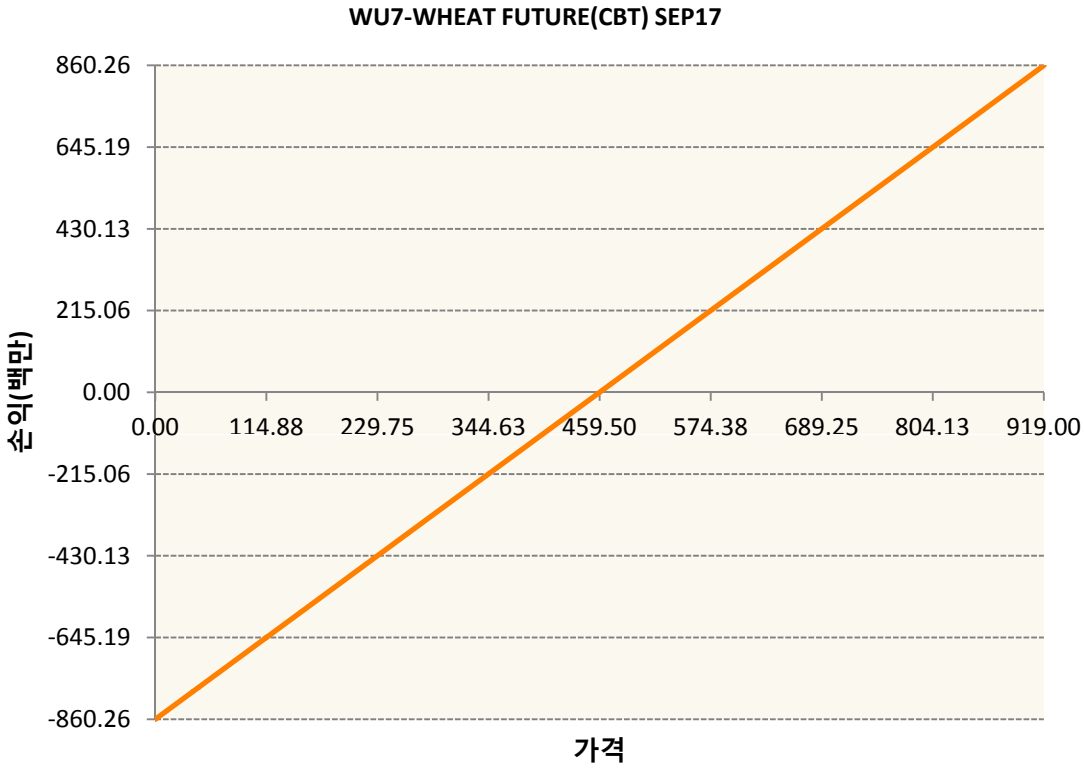

KWU7-KC HRW WHEAT FUT SEP17
217.12
144.75
72.37
0.00
-72.37
-144.75
-217.12
-289.50
0.00
115.94
231.88
347.81
463.75
579.69
695.63
811.56
손익(백만)
가격


SBV7-SUGAR #11 (WORLD) OCT17
502.99
377.24
251.49
125.75
0.00
-125.75
-251.49
-377.24
-502.99
0.00
3.41
6.82
10.23
13.64
17.05
20.46
23.87
27.28
손익(백만)
가격


SMZ7-SOYBEAN MEAL FUTR DEC17
479.66
319.78
159.89
0.00
-159.89
-319.78
-479.66
-639.55
0.00
78.23
156.45
234.68
312.90
391.13
469.35
547.58
625.80
손익(백만)
가격


SX7-SOYBEAN FUTURE NOV17
1,380.75





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
BOZ7	SOYBEAN OIL FUTR DEC17	51
CTZ7	COTTON NO.2 FUTR DEC17	29
CU7	CORN FUTURE SEP17	150
KCU7	COFFEE 'C' FUTURE SEP17	49
KR4175M80(	2017-08 달러선물	32

KWU7	KC HRW WHEAT FUT SEP17	23
SBV7	SUGAR #11 (WORLD) OCT17	40
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)

674