공시일	2017-08-14
기준일	2017-08-11

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	2017-08-14
기준일	2017-08-11

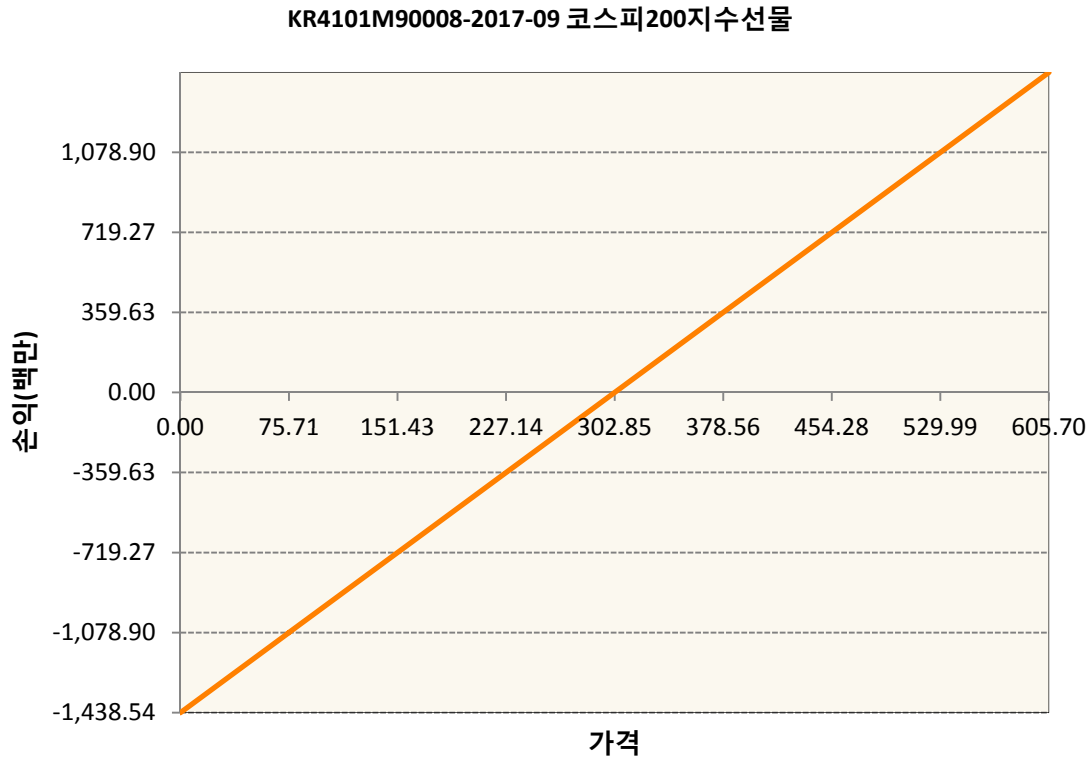
스마트인덱스모

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	1,439	0	1,439	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101M90(2017-09 코스피200지수선물							115
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-115	-115	-115	-115	-115	-115	-115
-5.33%	-77	-77	-77	-77	-77	-77	-77
-2.67%	-38	-38	-38	-38	-38	-38	-38
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	38	38	38	38	38	38	38
5.33%	77	77	77	77	77	77	77
8.00%	115	115	115	115	115	115	115

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

72

공시일	2017-08-14
기준일	2017-08-11

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	1,012

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

468

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-08-14
기준일	2017-08-11

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	389

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

332

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-08-14
기준일	2017-08-11

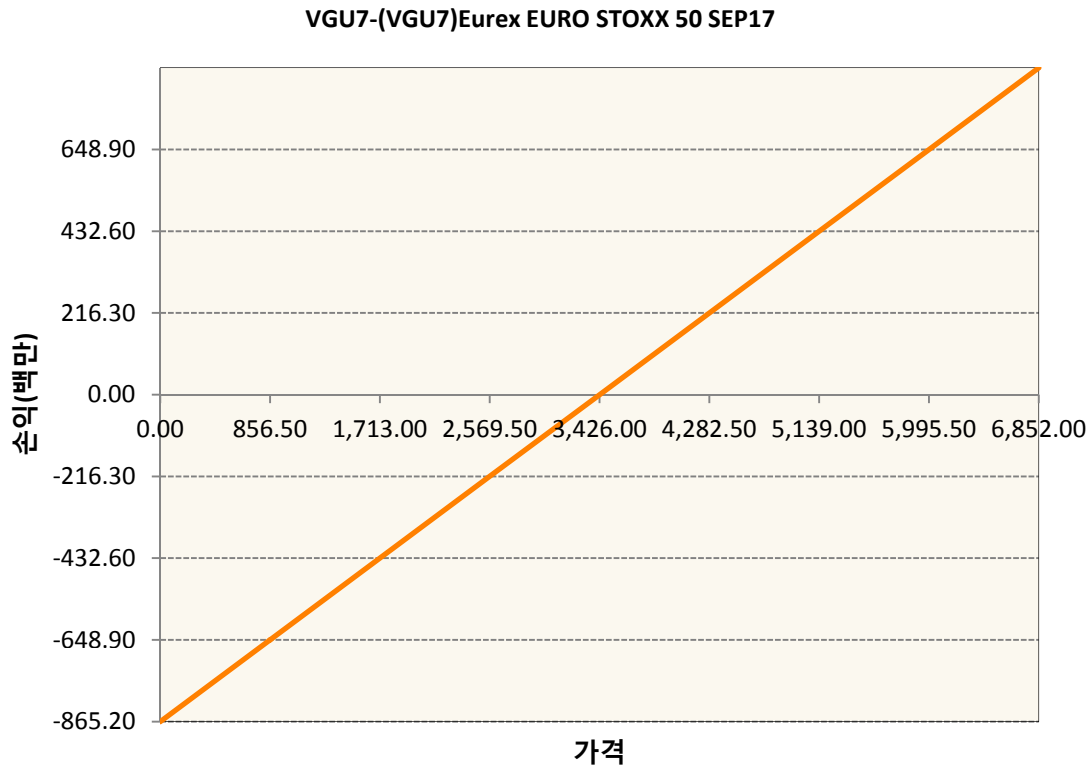
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	865	0	865	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGU7	(VGU7)Eurex EURO STOXX 50 SEP17	69

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

(단위:백만원)

57

공시일	2017-08-14
기준일	2017-08-11

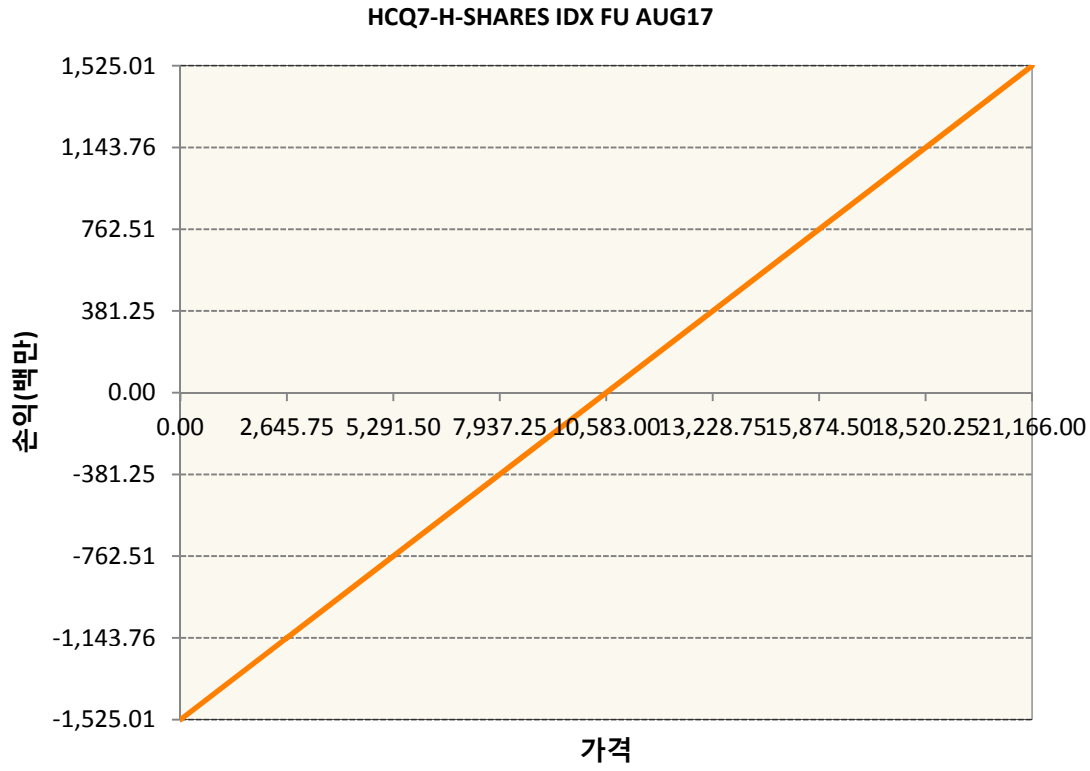
차이나인덱스모(주식-파생형)

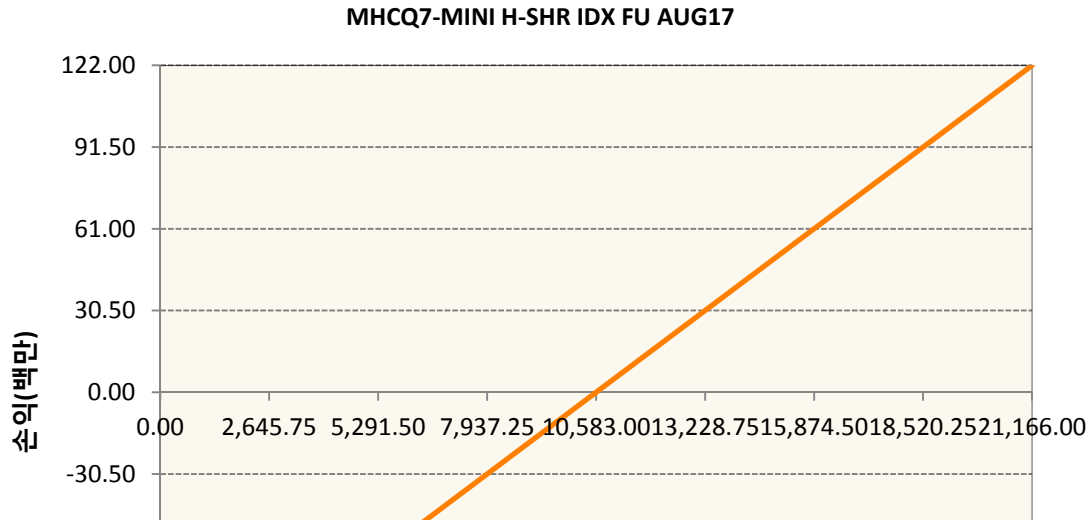
1. 계약금액

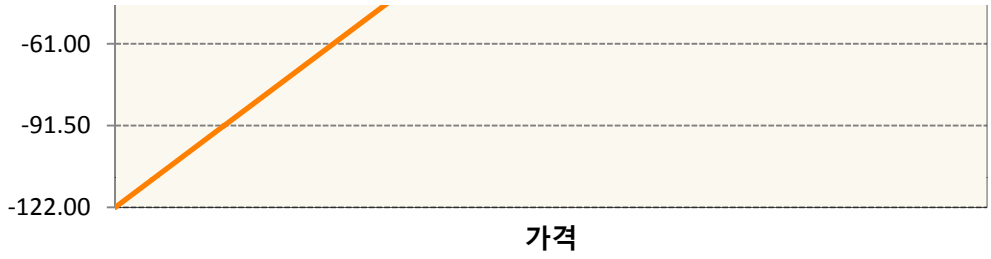
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,647	0	1,647	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCQ7	H-SHARES IDX FU AUG17	122
MHCQ7	MINI H-SHR IDX FU AUG17	10

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	115

공시일	2017-08-14
기준일	2017-08-11

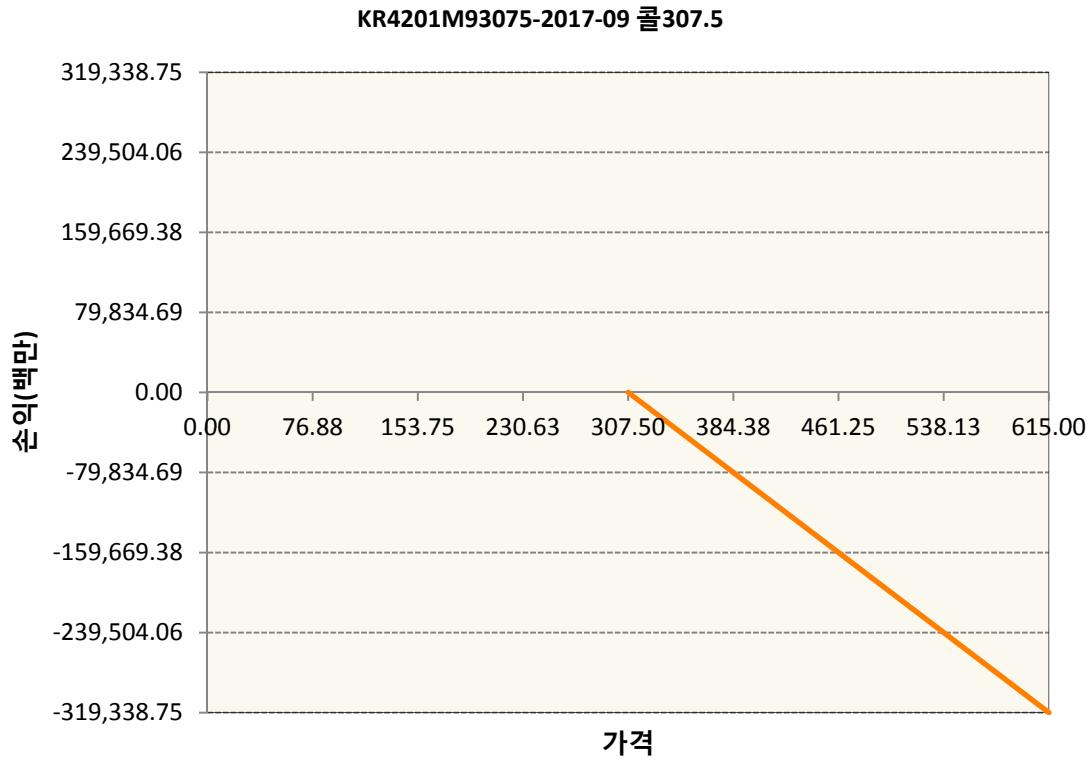
커버드콜모(주식혼합-파생형)

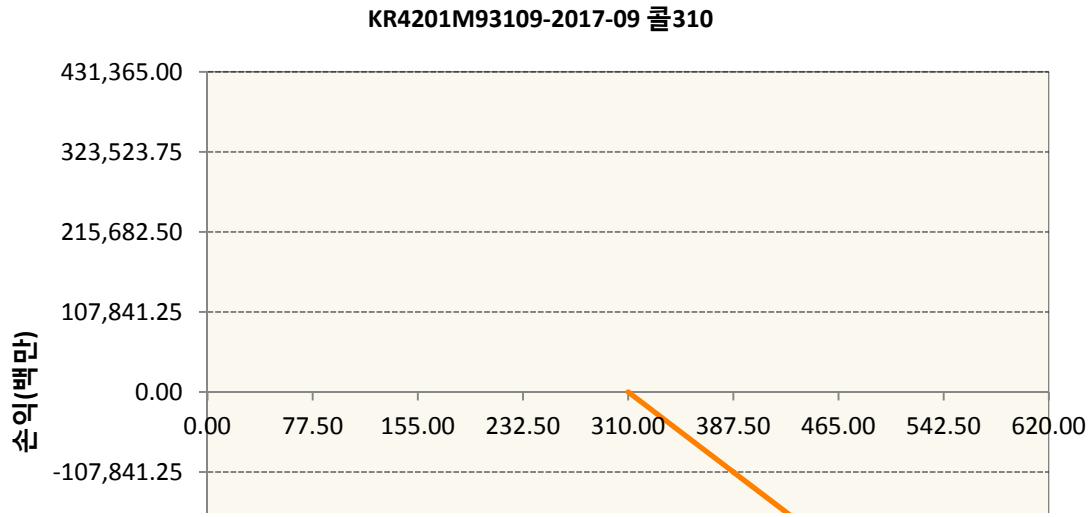
1. 계약금액

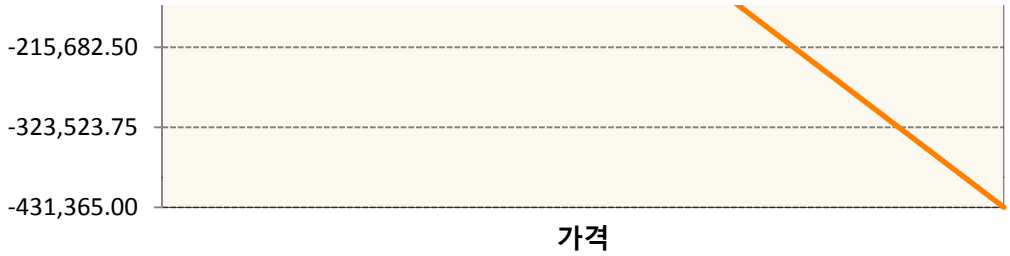
(단위:백만원)

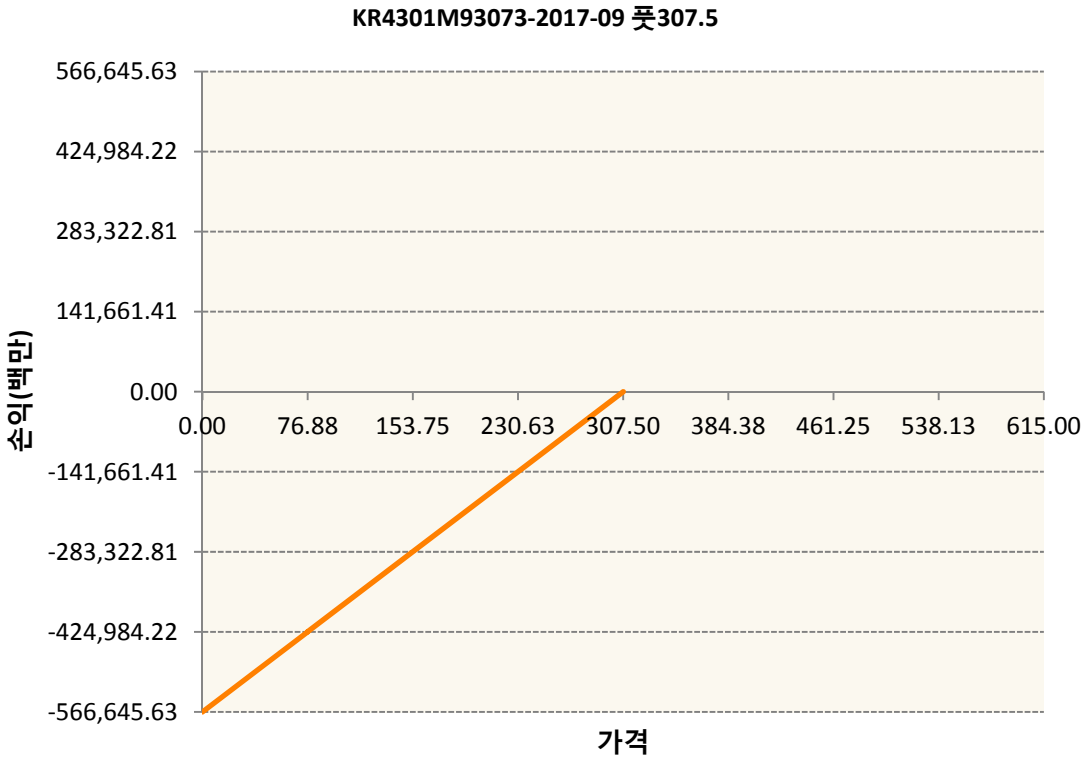
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	1,231,748	-1,231,748	장내
누계	유가증권	옵션	0	1,366,097	-1,366,097	장내

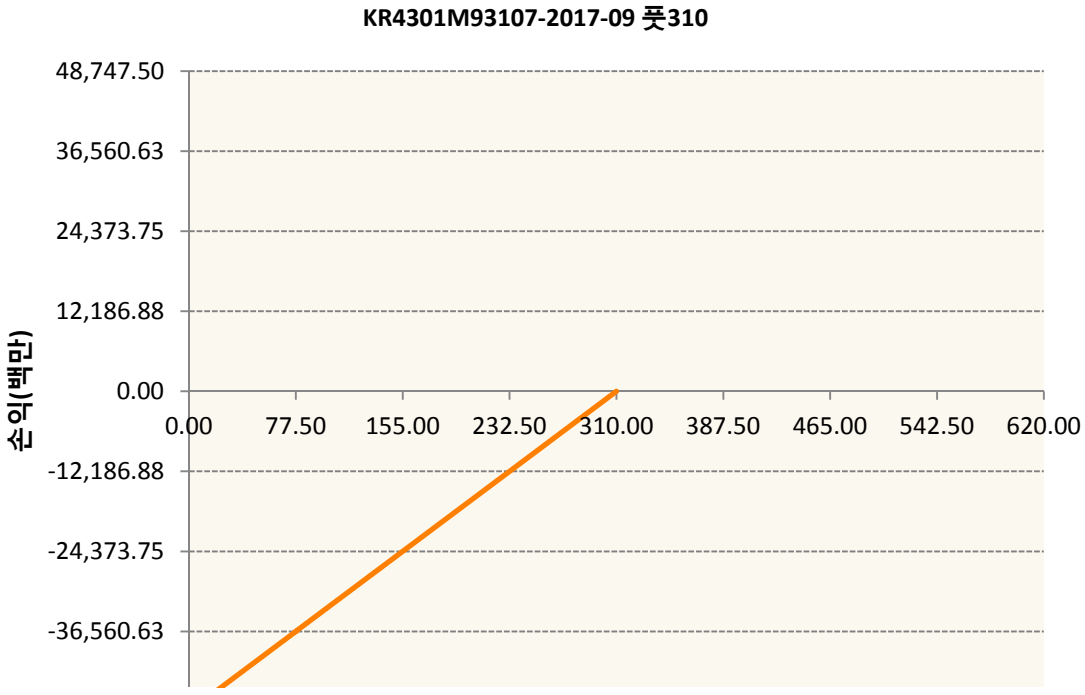
2. 만기시점의 손익구조

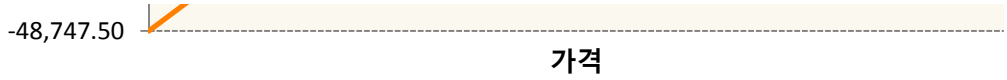





-215,682.50
-323,523.75
-431,365.00
가격


KR4301M93073-2017-09 풋307.5
566,645.63
424,984.22
283,322.81
141,661.41
0.00
-141,661.41
-283,322.81
-424,984.22
-566,645.63
0.00
76.88
153.75
230.63
307.50
384.38
461.25
538.13
615.00
손익(백만)
가격


KR4301M93107-2017-09 풋310
48,747.50
36,560.63
24,373.75
12,186.88
0.00
-12,186.88
-24,373.75
-36,560.63
0.00
77.50
155.00
232.50
310.00
387.50
465.00
542.50
620.00
손익(백만)



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4201M93(2017-09 콜307.5							17,757
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	7,353	7,124	6,836	6,495	6,106	5,676	5,208
-5.33%	6,655	6,225	5,741	5,215	4,652	4,060	3,442
-2.67%	5,145	4,494	3,814	3,112	2,394	1,661	917
0%	2,435	1,628	816	0	-818	-1,638	-2,460
2.67%	-1,708	-2,540	-3,375	-4,211	-5,049	-5,887	-6,726
5.33%	-7,258	-7,982	-8,729	-9,492	-10,268	-11,056	-11,852
8.00%	-13,960	-14,498	-15,084	-15,710	-16,368	-17,052	-17,757
KR4201M93: 2017-09 콜310							22,700
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	8,646	8,396	8,071	7,674	7,211	6,690	6,115
-5.33%	7,922	7,425	6,852	6,214	5,521	4,782	4,004
-2.67%	6,272	5,476	4,631	3,747	2,833	1,893	933
0%	3,167	2,124	1,067	0	-1,075	-2,157	-3,243
2.67%	-1,782	-2,918	-4,053	-5,189	-6,324	-7,459	-8,594
5.33%	-8,652	-9,693	-10,753	-11,827	-12,912	-14,007	-15,108
8.00%	-17,184	-17,998	-18,867	-19,779	-20,726	-21,701	-22,700
KR4301M93(2017-09 풋307.5							35,321
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-31,515	-31,922	-32,433	-33,038	-33,727	-34,491	-35,321
-5.33%	-17,899	-18,663	-19,520	-20,455	-21,453	-22,504	-23,601
-2.67%	-5,724	-6,881	-8,087	-9,331	-10,607	-11,906	-13,226
0%	4,321	2,888	1,447	0	-1,452	-2,907	-4,365
2.67%	11,824	10,346	8,865	7,381	5,896	4,408	2,920
5.33%	16,829	15,544	14,220	12,866	11,487	10,091	8,678
8.00%	19,791	18,837	17,796	16,686	15,519	14,305	13,053
KR4301M93: 2017-09 풋310							3,112
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-2,826	-2,854	-2,891	-2,936	-2,988	-3,047	-3,112
-5.33%	-1,640	-1,696	-1,761	-1,833	-1,911	-1,995	-2,083
-2.67%	-559	-649	-744	-844	-947	-1,054	-1,162
0%	358	240	121	0	-121	-244	-366
2.67%	1,066	938	810	681	553	425	296

5.33%	1,557	1,440	1,320	1,199	1,076	952	828
8.00%	1,861	1,769	1,671	1,568	1,461	1,350	1,237

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

72,745

공시일	2017-08-14
기준일	2017-08-11

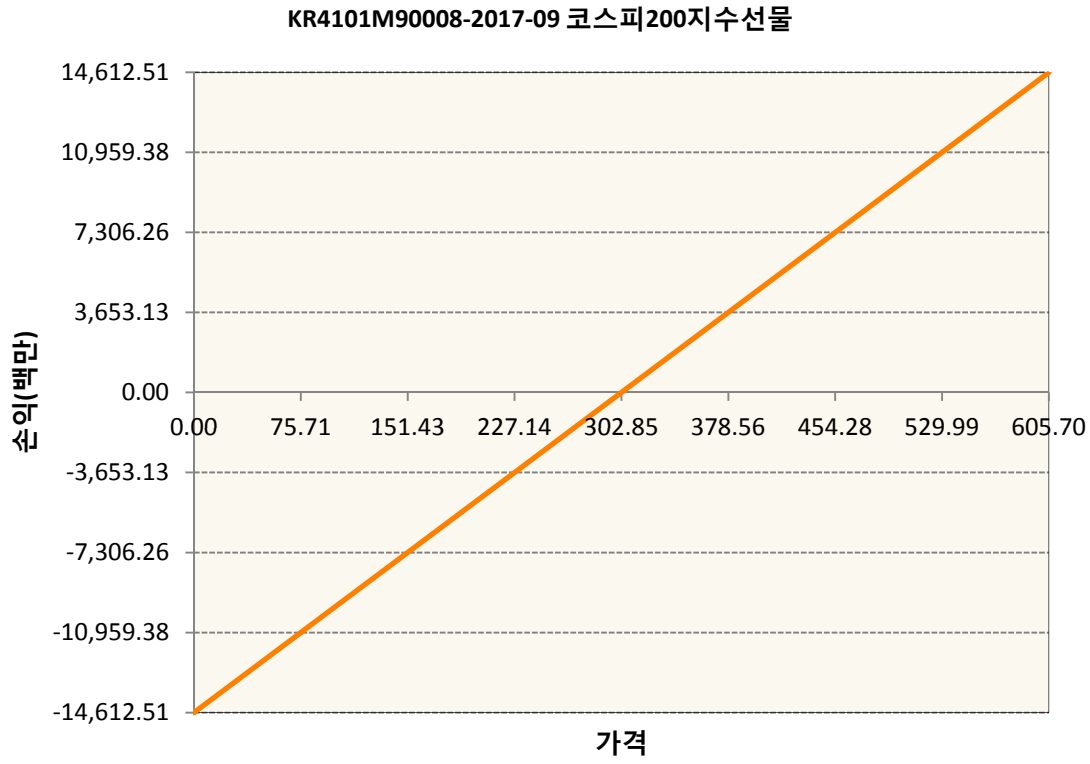
ETF스마트레버리지목표전환형6호

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	6,133	0	6,133	장내
누계	유가증권	선물	14,613	0	14,613	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101M90(2017-09 코스피200지수선물							1,168
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,168	-1,168	-1,168	-1,168	-1,168	-1,168	-1,168
-5.33%	-779	-779	-779	-779	-779	-779	-779
-2.67%	-389	-389	-389	-389	-389	-389	-389
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	389	389	389	389	389	389	389
5.33%	779	779	779	779	779	779	779
8.00%	1,168	1,168	1,168	1,168	1,168	1,168	1,168

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

726

공시일	2017-08-14
기준일	2017-08-11

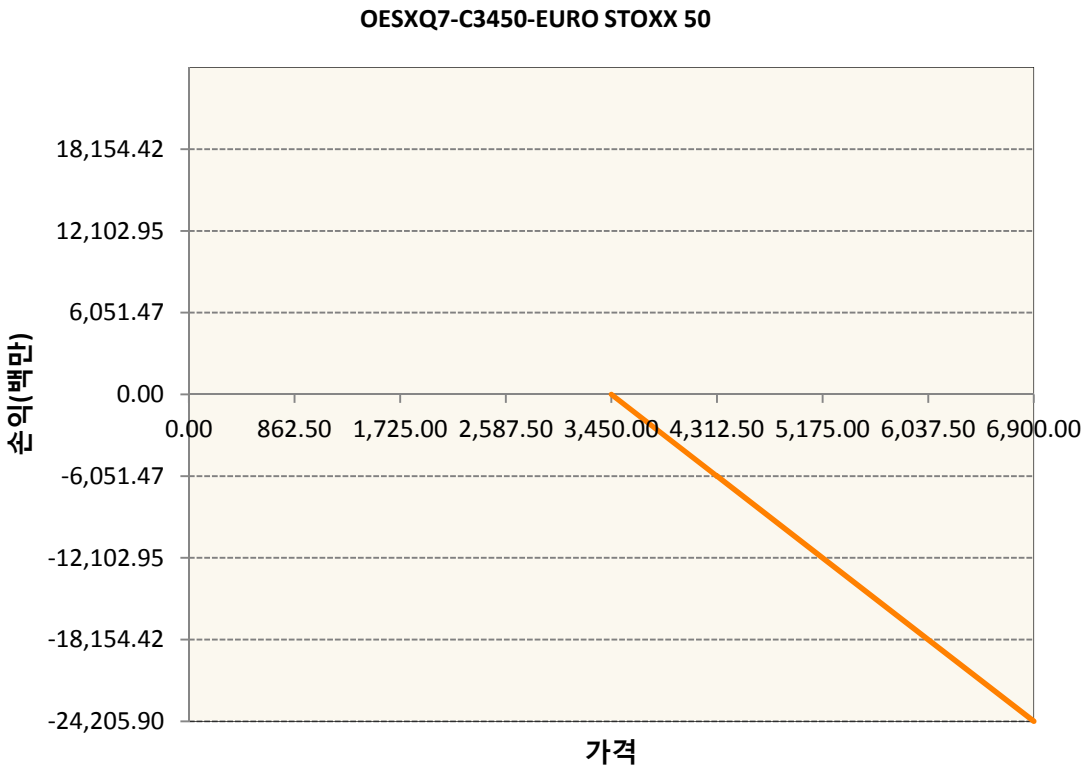
유로커버드콜(주식혼합-파생형)

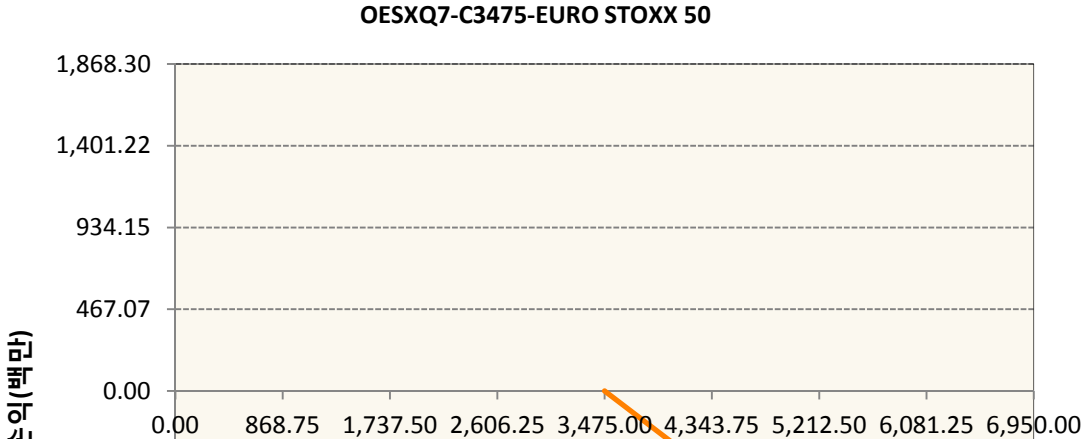
1. 계약금액

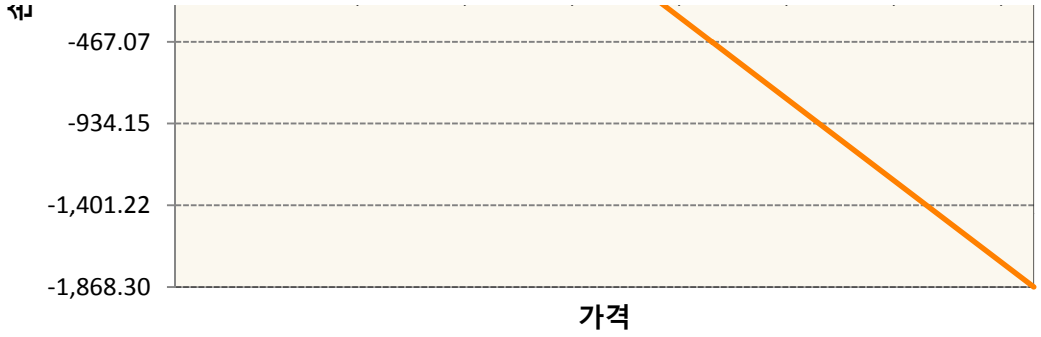
(단위:백만원)

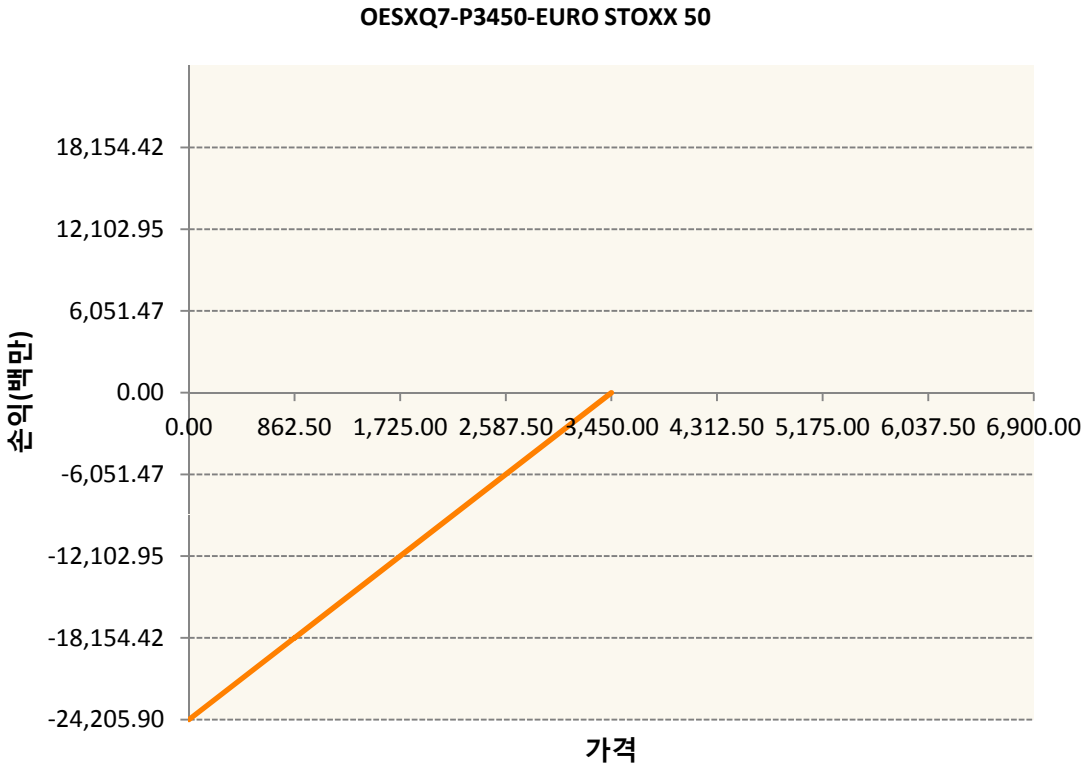
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	24,451	0	24,451	
누계	유가증권	옵션	0	52,148	-52,148	장내

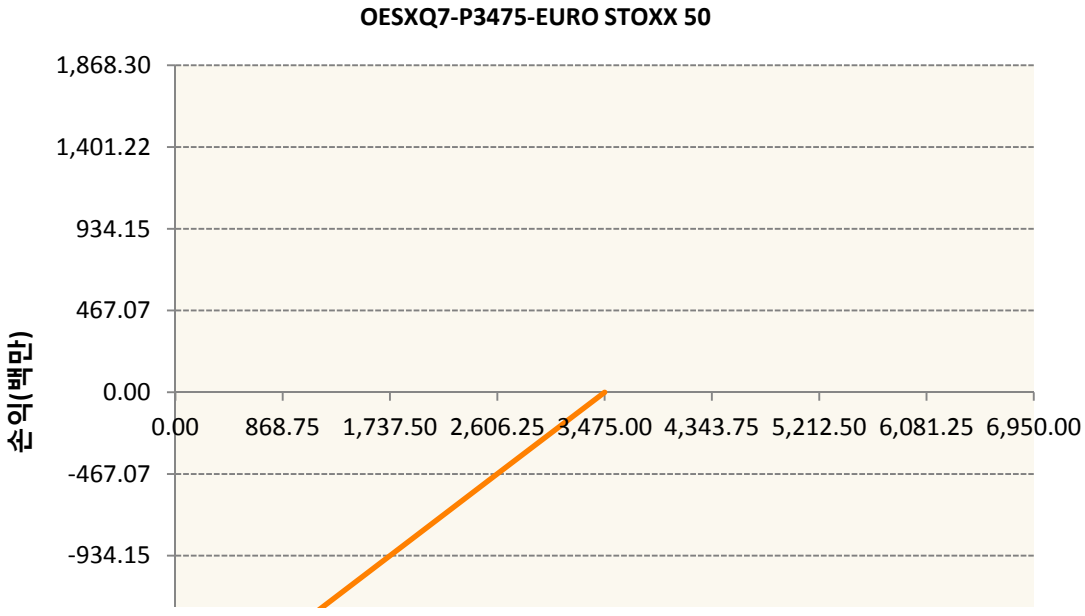
2. 만기시점의 손익구조

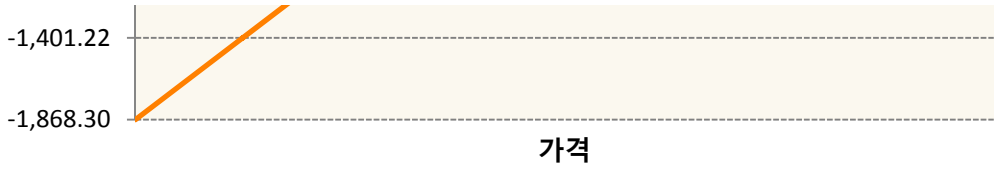


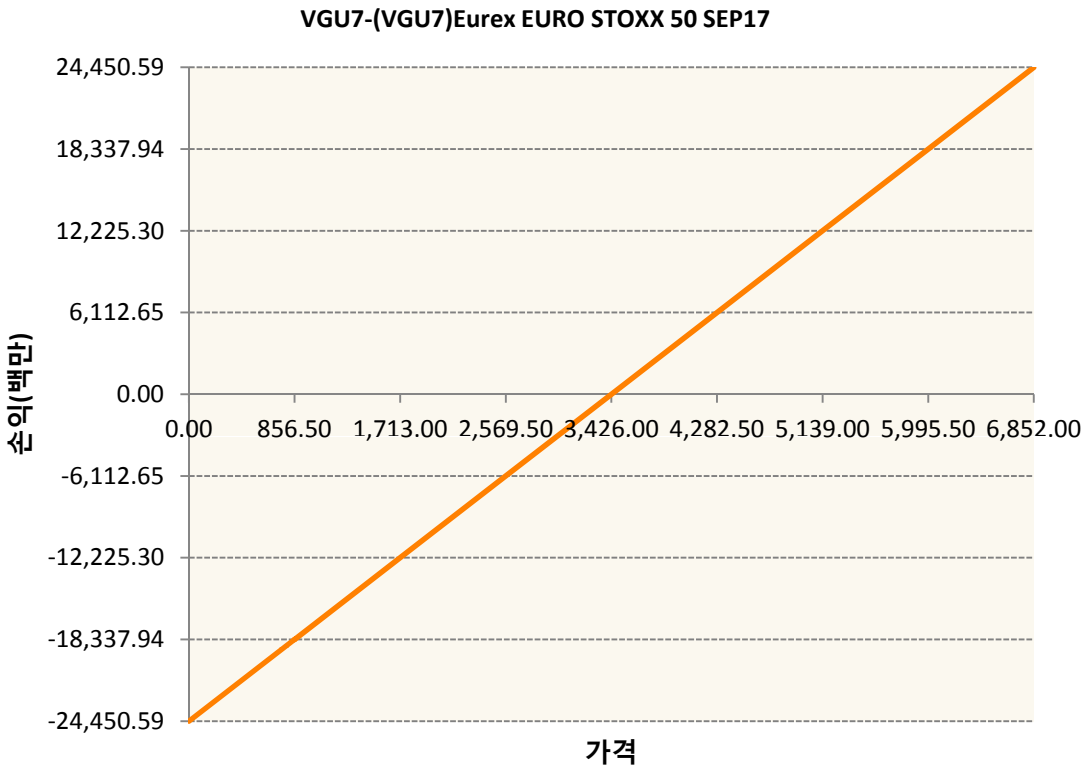



-467.07
-934.15
-1,401.22
-1,868.30
가격


OESXQ7-P3450-EURO STOXX 50
18,154.42
12,102.95
6,051.47
0.00
-6,051.47
-12,102.95
-18,154.42
-24,205.90
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
1,868.30
1,401.22
934.15
467.07
0.00
-467.07
-934.15
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	1,936
OESXQ7-C3	EURO STOXX 50	149
OESXQ7-P3	EURO STOXX 50	1,936
OESXQ7-P3	EURO STOXX 50	149
VGU7	(VGU7)Eurex EURO STOXX 50 SEP17	1,956

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	5,045

공시일	2017-08-14
기준일	2017-08-11

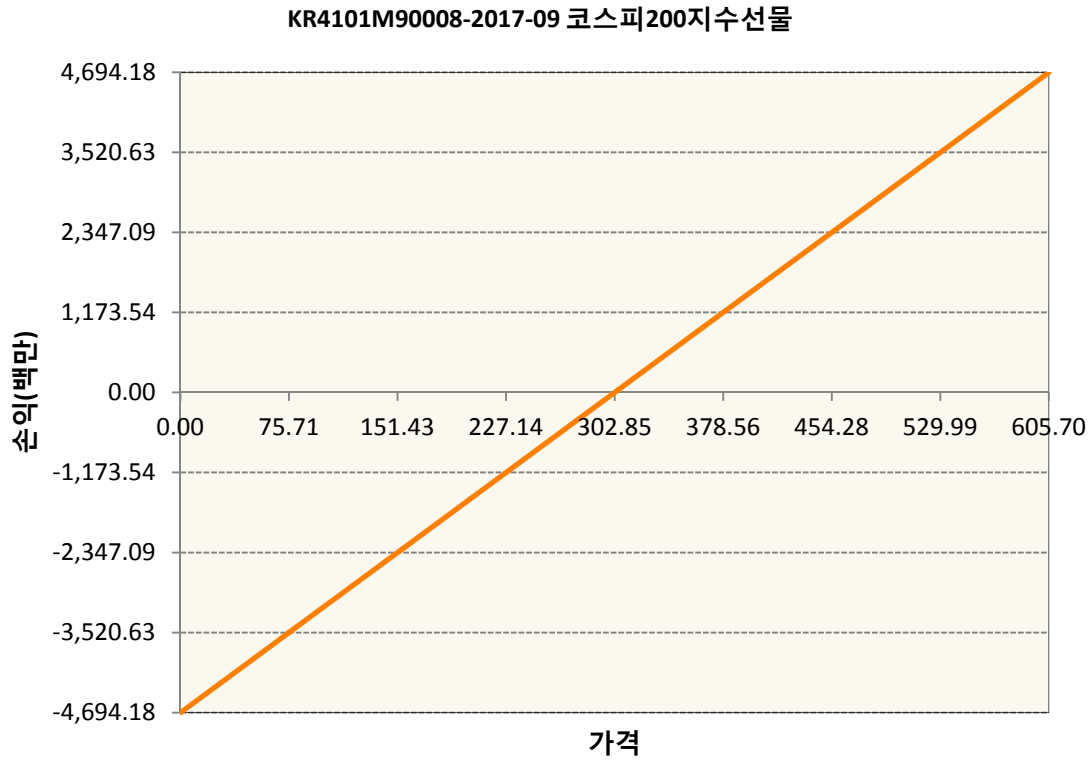
ETF스마트레버리지목표전환형7호

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	1,060	0	1,060	장내
누계	유가증권	선물	4,694	0	4,694	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101M90(2017-09 코스피200지수선물							375
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-375	-375	-375	-375	-375	-375	-375
-5.33%	-250	-250	-250	-250	-250	-250	-250
-2.67%	-125	-125	-125	-125	-125	-125	-125
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	125	125	125	125	125	125	125
5.33%	250	250	250	250	250	250	250
8.00%	375	375	375	375	375	375	375

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

233

공시일	2017-08-14
기준일	2017-08-11

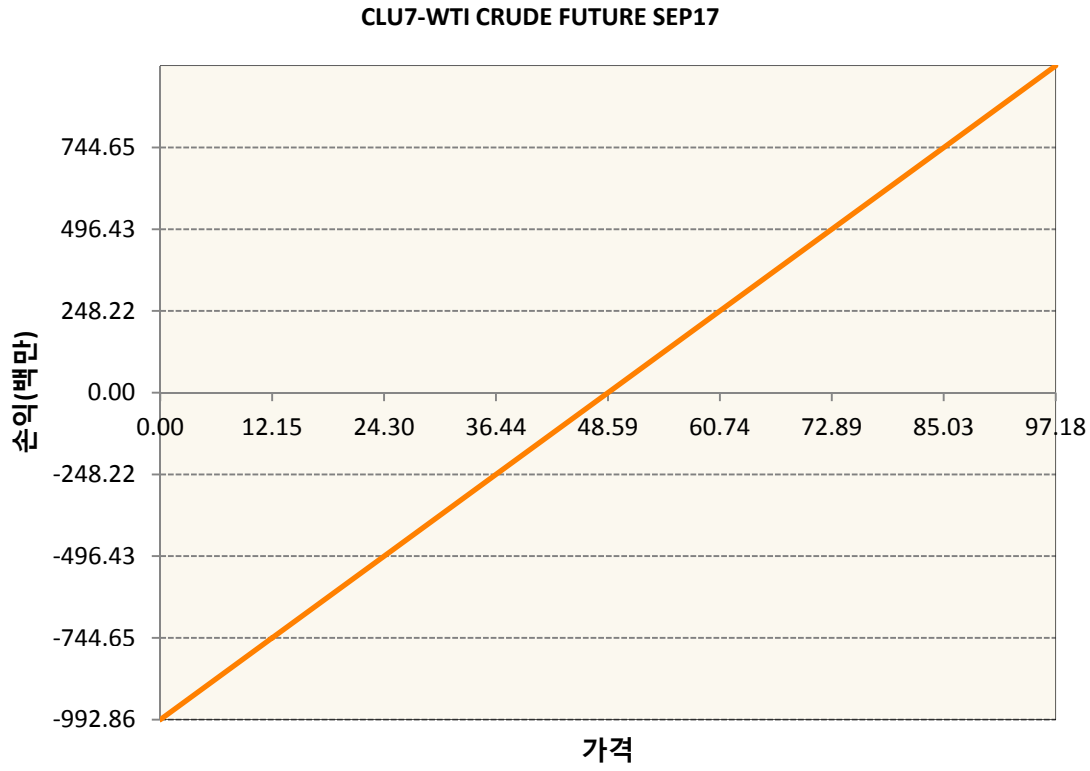
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

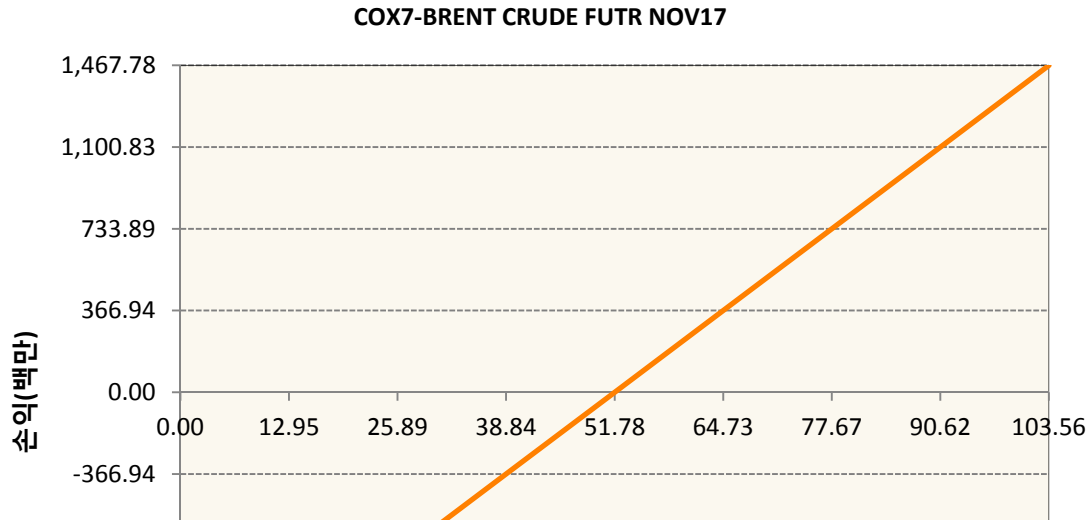
1. 계약금액

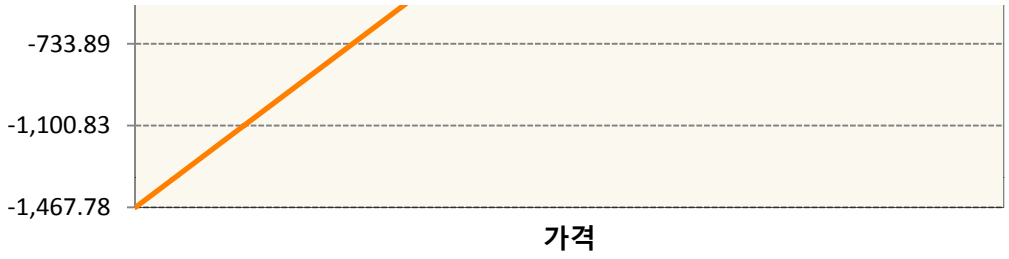
(단위:백만원)

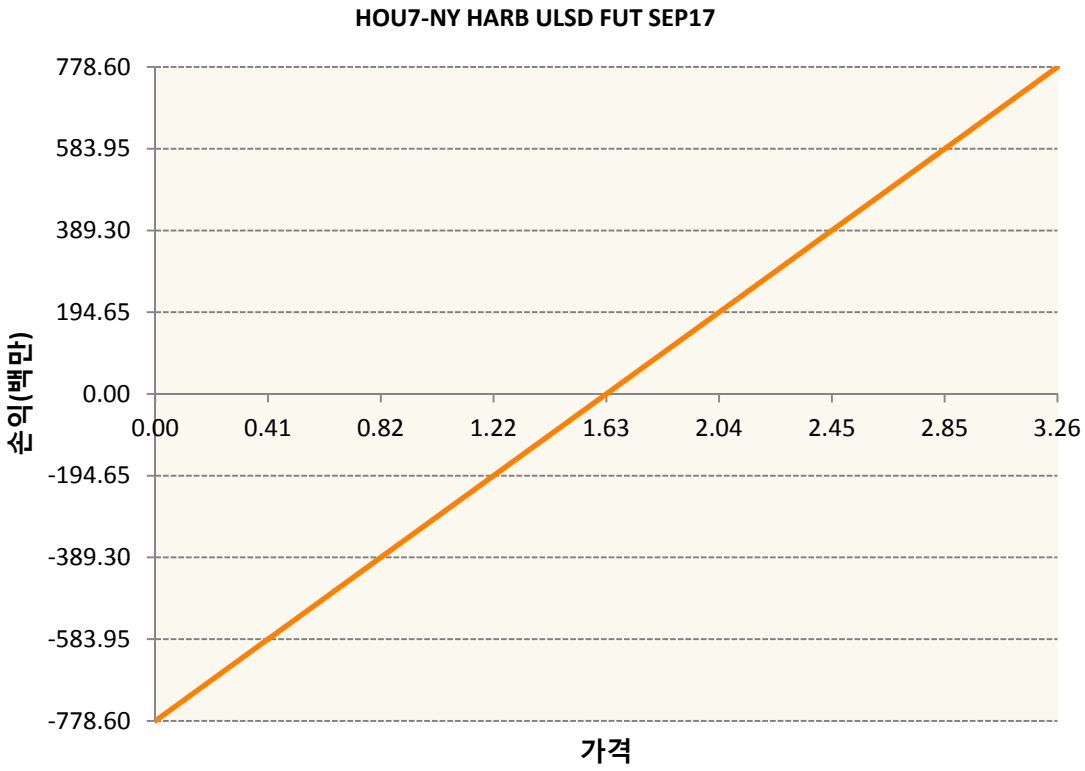
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	5,428	343	5,085	

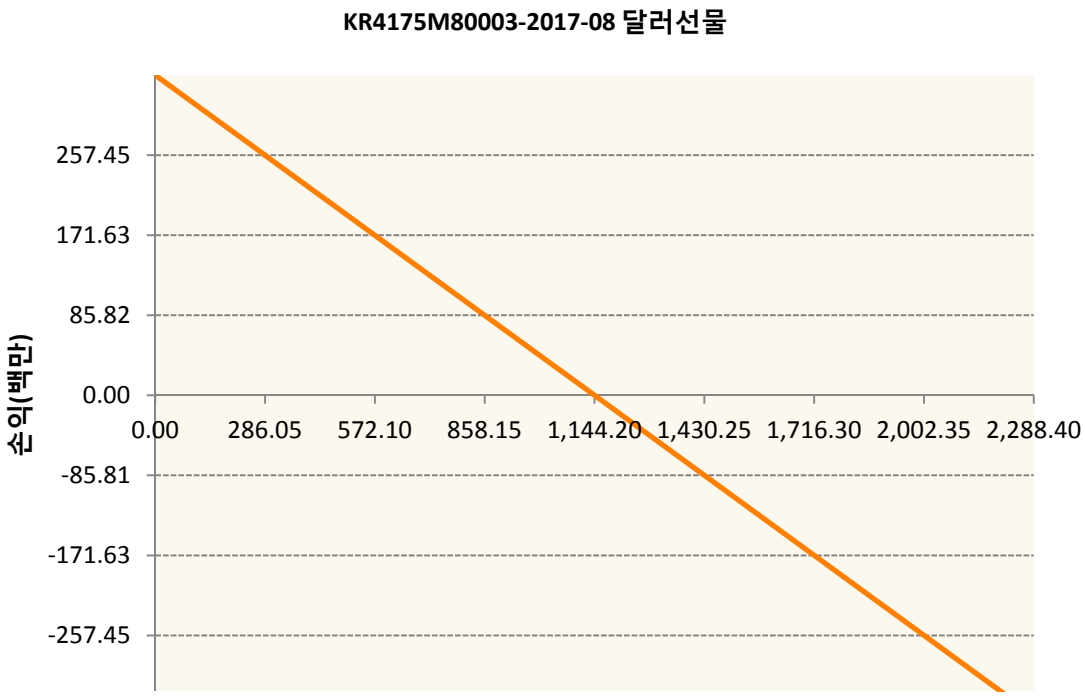
2. 만기시점의 손익구조

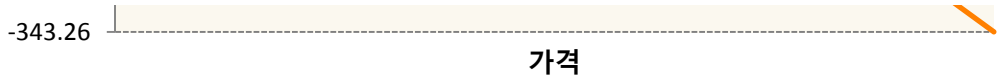


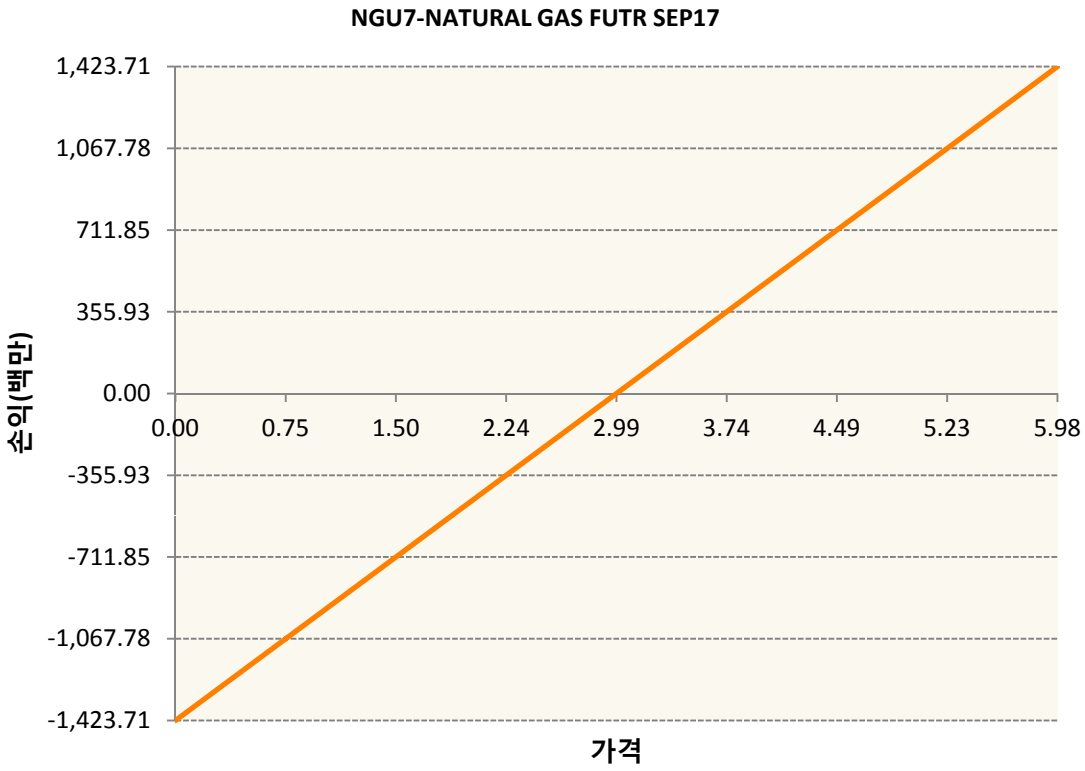


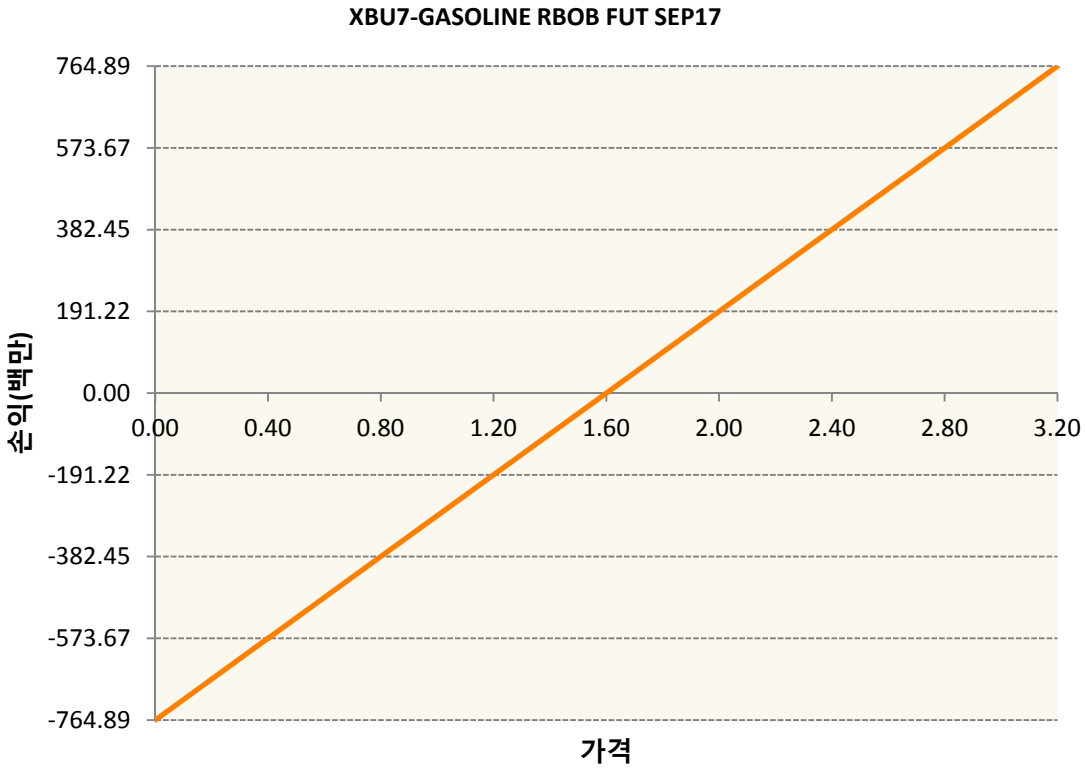

-733.89
-1,100.83
-1,467.78
가격


HOU7-NY HARB ULSD FUT SEP17
778.60
583.95
389.30
194.65
0.00
-194.65
-389.30
-583.95
-778.60
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
257.45
171.63
85.82
0.00
-85.81
-171.63
-257.45
0.00
286.05
572.10
858.15
1,144.20
1,430.25
1,716.30
2,002.35
2,288.40
손익(만)


-343.26
가격


NGU7-NATURAL GAS FUTR SEP17
1,423.71
1,067.78
711.85
355.93
0.00
-355.93
-711.85
-1,067.78
-1,423.71
0.00
0.75
1.50
2.24
2.99
3.74
4.49
5.23
5.98
손익(백만)
가격


XBU7-GASOLINE RBOB FUT SEP17
764.89
573.67
382.45
191.22
0.00
-191.22
-382.45
-573.67
-764.89
0.00
0.40
0.80
1.20
1.60
2.00
2.40
2.80
3.20
손익(백만)
가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLU7	WTI CRUDE FUTURE SEP17	79
COX7	BRENT CRUDE FUTR NOV17	117
HOU7	NY HARB ULSD FUT SEP17	62
KR4175M80(	2017-08 달러선물	27
NGU7	NATURAL GAS FUTR SEP17	114
XBU7	GASOLINE RBOB FUT SEP17	61

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

780

공시일	2017-08-14
기준일	2017-08-11

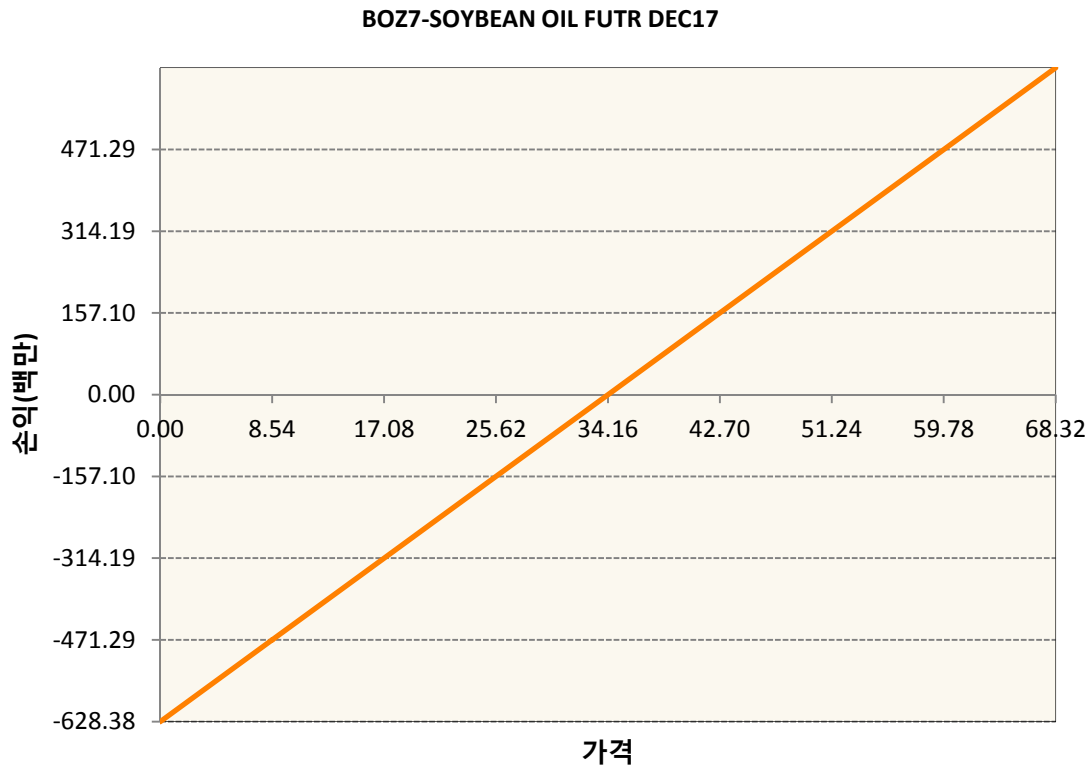
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

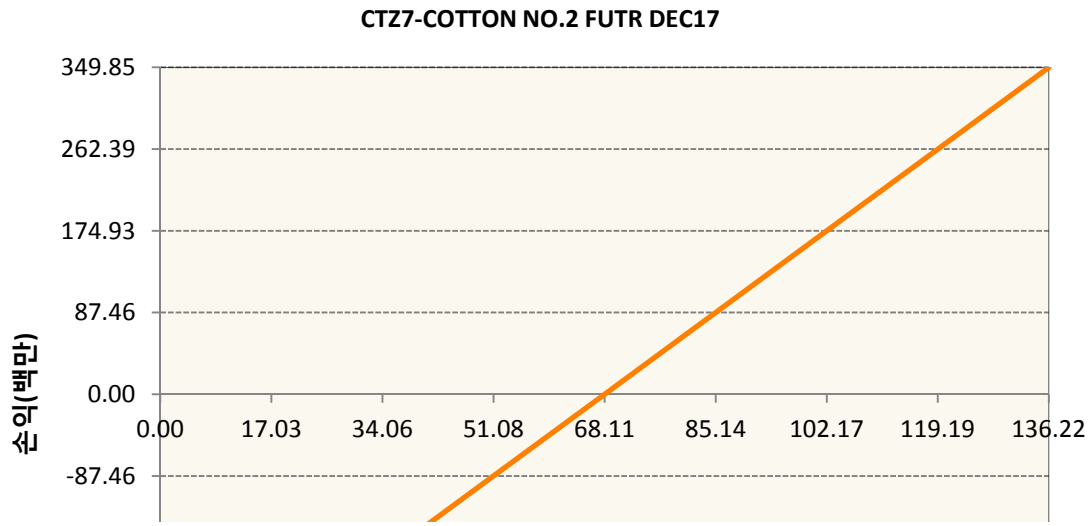
1. 계약금액

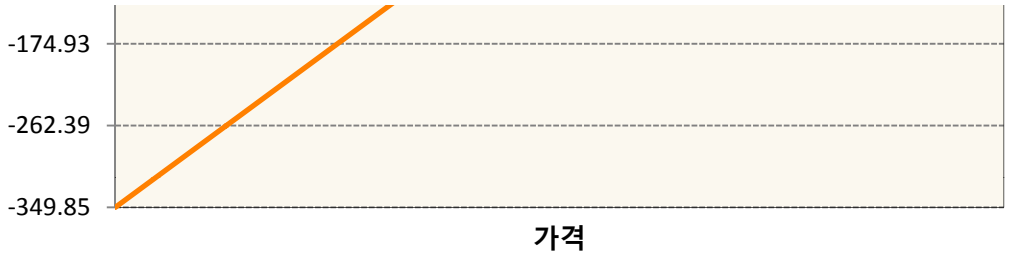
(단위:백만원)

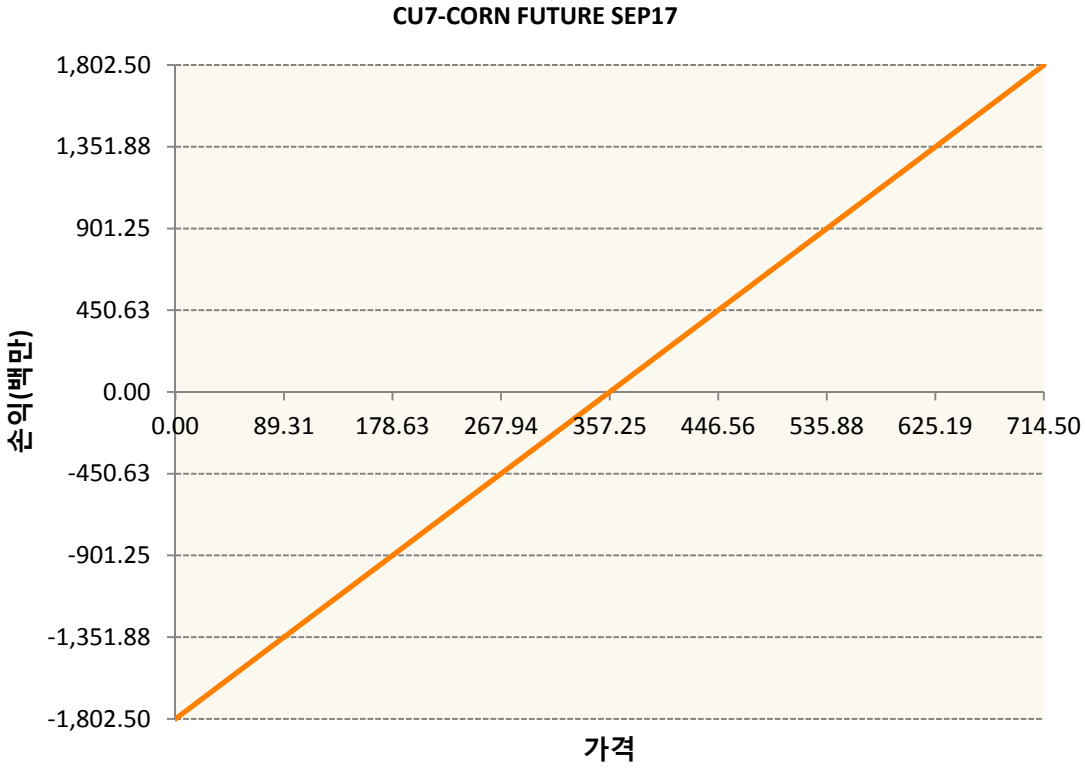
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	6,910	400	6,510	

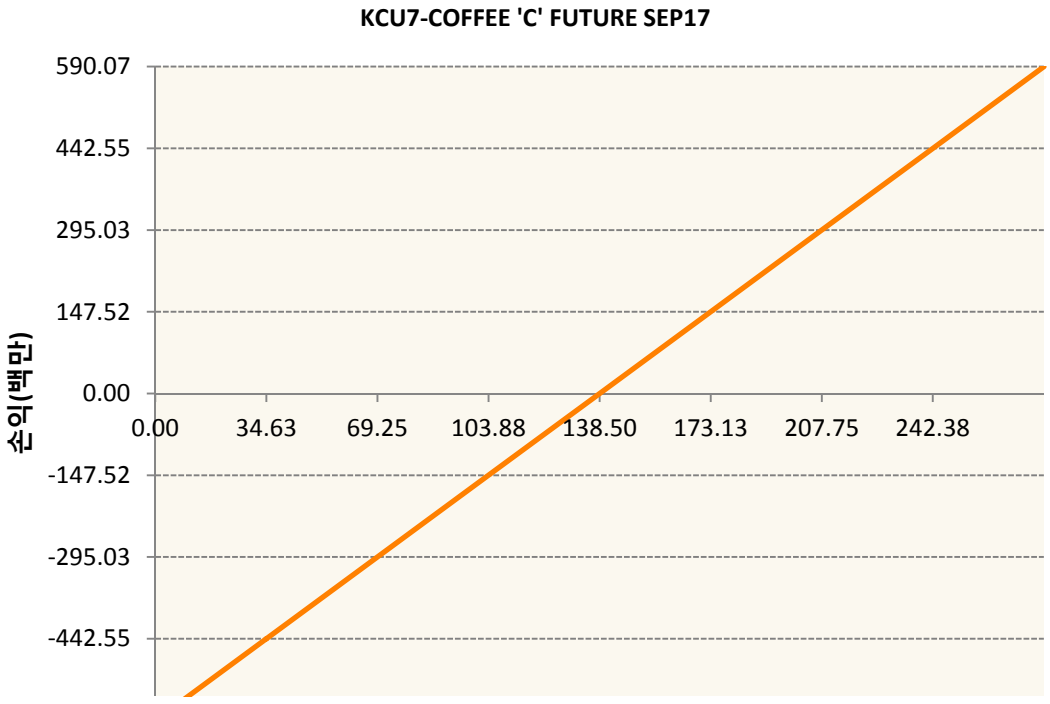
2. 만기시점의 손익구조

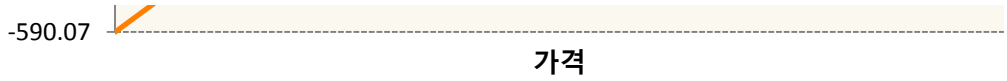


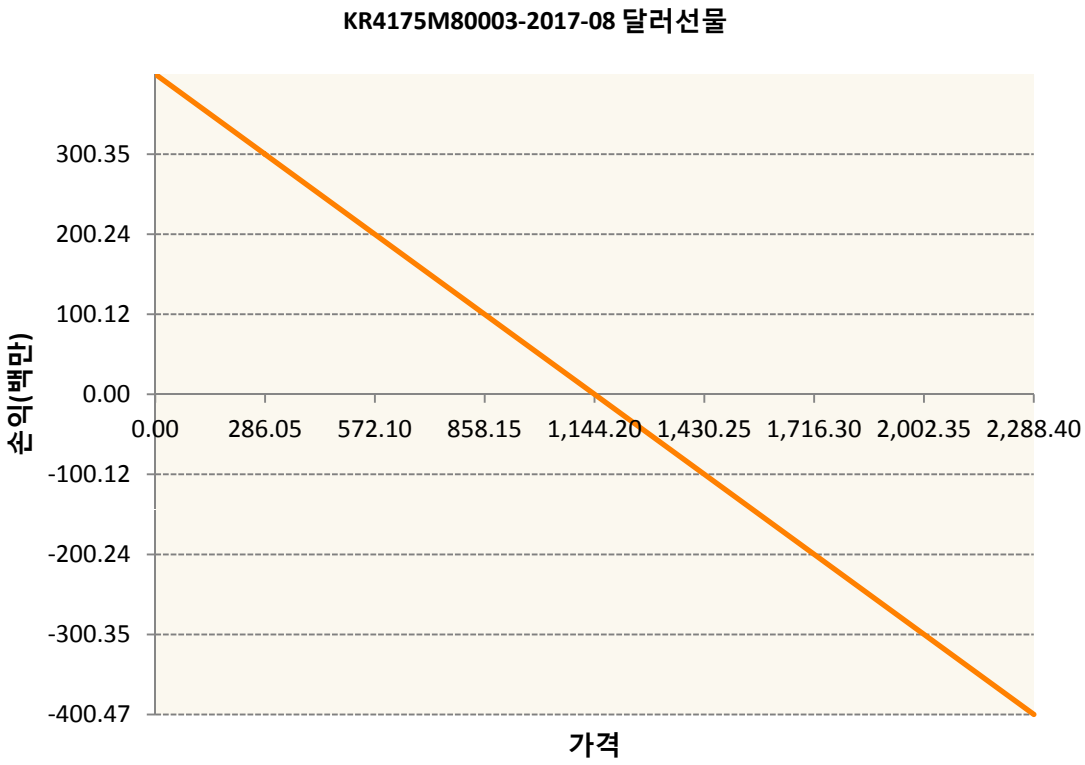


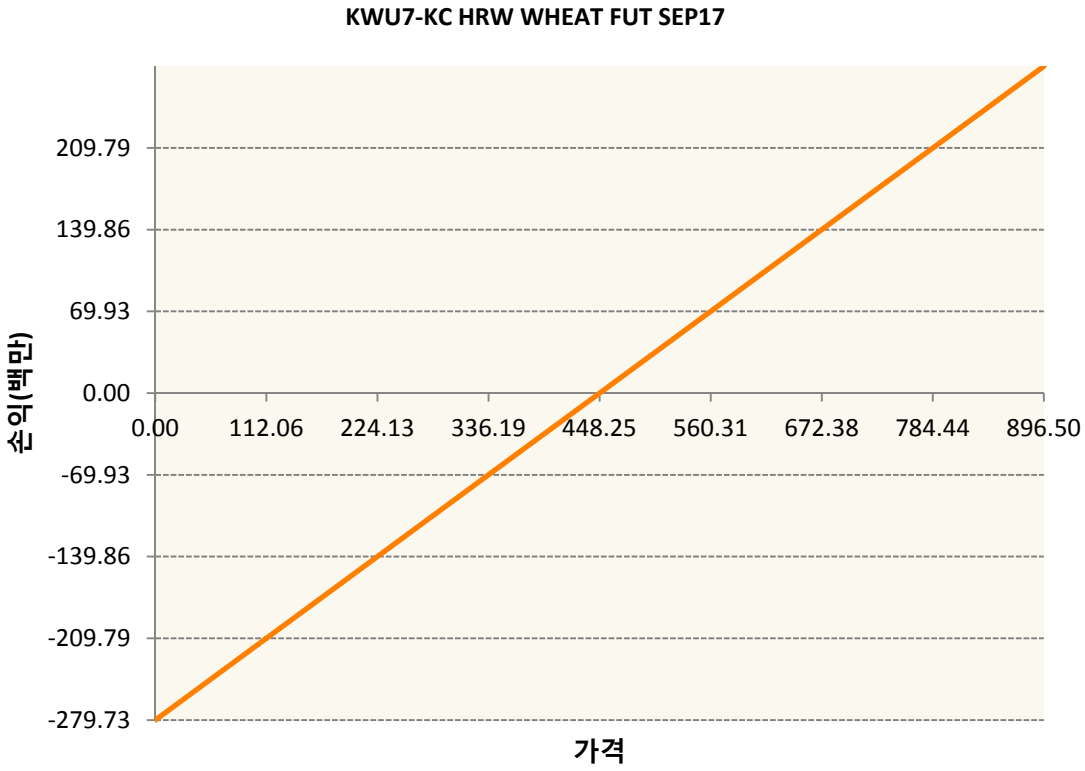

-174.93
-262.39
-349.85
가격

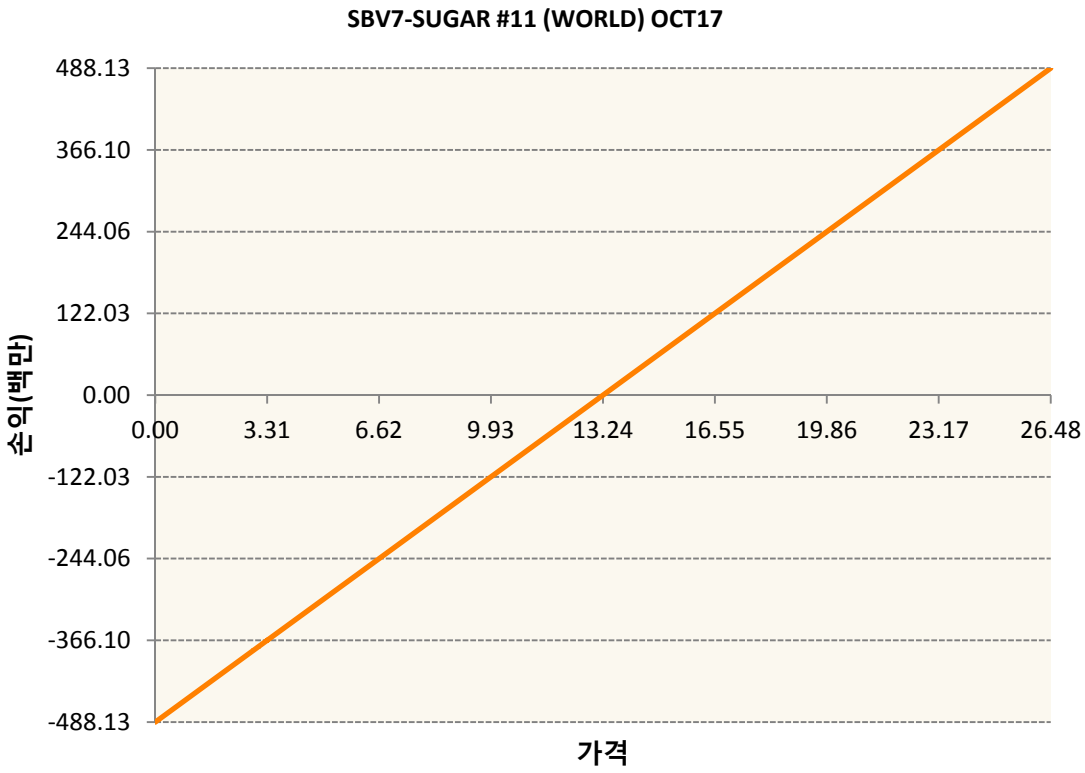

CU7-CORN FUTURE SEP17
1,802.50
1,351.88
901.25
450.63
0.00
-450.63
-901.25
-1,351.88
-1,802.50
0.00
89.31
178.63
267.94
357.25
446.56
535.88
625.19
714.50
손익(백만)
가격

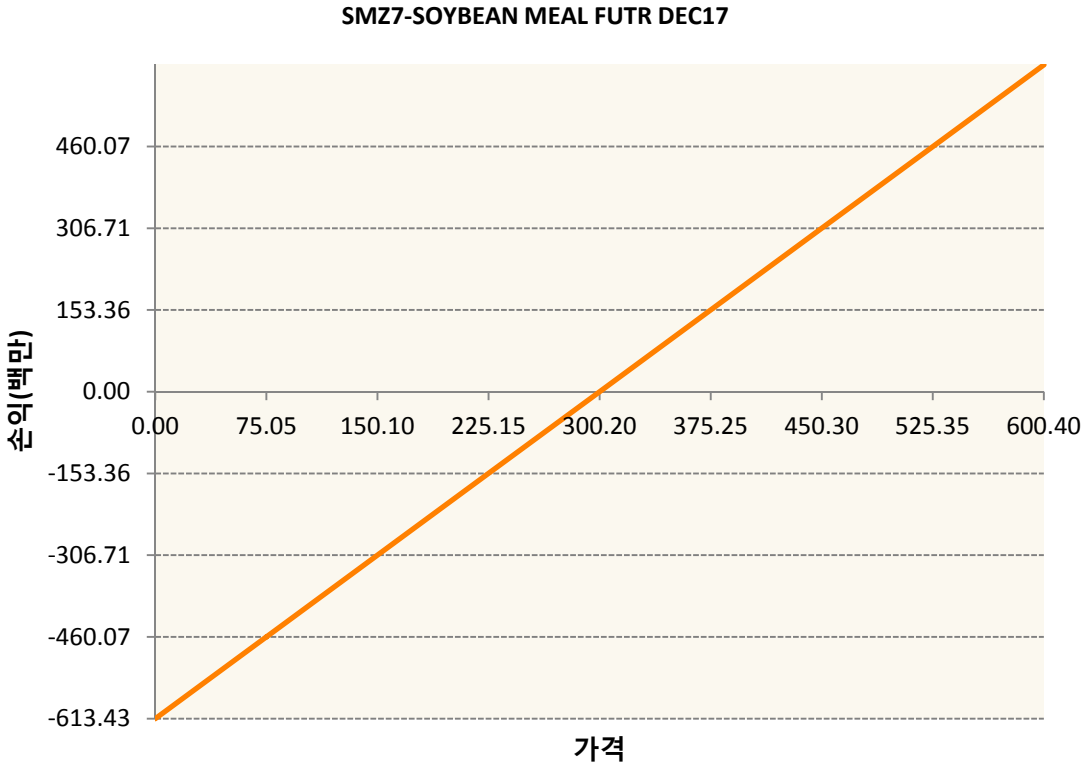

KCU7-COFFEE 'C' FUTURE SEP17
590.07
442.55
295.03
147.52
0.00
-147.52
-295.03
-442.55
0.00
34.63
69.25
103.88
138.50
173.13
207.75
242.38
손익(백만)

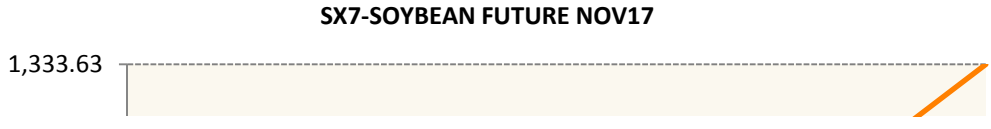

-590.07
가격

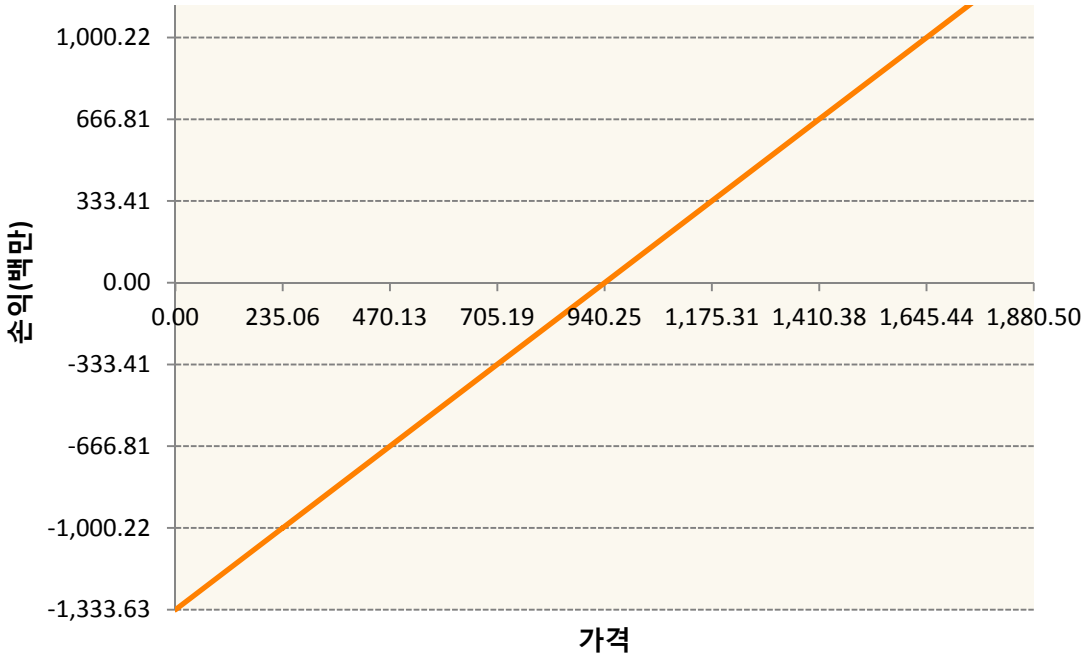

KR4175M80003-2017-08 달러선물
300.35
200.24
100.12
0.00
-100.12
-200.24
-300.35
-400.47
0.00
286.05
572.10
858.15
1,144.20
1,430.25
1,716.30
2,002.35
2,288.40
손익(백만)
가격

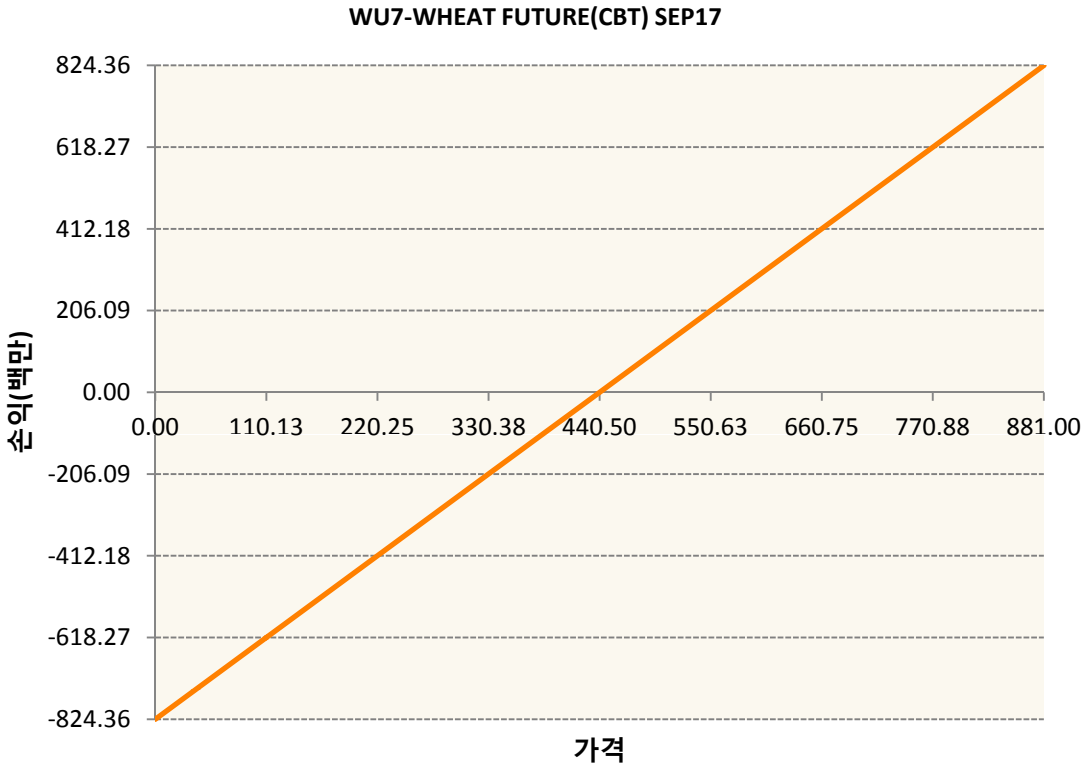

KWU7-KC HRW WHEAT FUT SEP17
209.79
139.86
69.93
0.00
-69.93
-139.86
-209.79
-279.73
0.00
112.06
224.13
336.19
448.25
560.31
672.38
784.44
896.50
손익(백만)
가격


SBV7-SUGAR #11 (WORLD) OCT17
488.13
366.10
244.06
122.03
0.00
-122.03
-244.06
-366.10
-488.13
0.00
3.31
6.62
9.93
13.24
16.55
19.86
23.17
26.48
손익(백만)
가격


SMZ7-SOYBEAN MEAL FUTR DEC17
460.07
306.71
153.36
0.00
-153.36
-306.71
-460.07
-613.43
0.00
75.05
150.10
225.15
300.20
375.25
450.30
525.35
600.40
손익(백만)
가격


SX7-SOYBEAN FUTURE NOV17
1,333.63





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
BOZ7	SOYBEAN OIL FUTR DEC17	50
CTZ7	COTTON NO.2 FUTR DEC17	28
CU7	CORN FUTURE SEP17	144
KCU7	COFFEE 'C' FUTURE SEP17	47
KR4175M80(	2017-08 달러선물	32

KWU7	KC HRW WHEAT FUT SEP17	22
SBV7	SUGAR #11 (WORLD) OCT17	39
SMZ7	SOYBEAN MEAL FUTR DEC17	49
SX7	SOYBEAN FUTURE NOV17	107
WU7	WHEAT FUTURE(CBT) SEP17	66

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

655