공시일	2017-08-16
기준일	2017-08-14

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	2017-08-16
기준일	2017-08-14

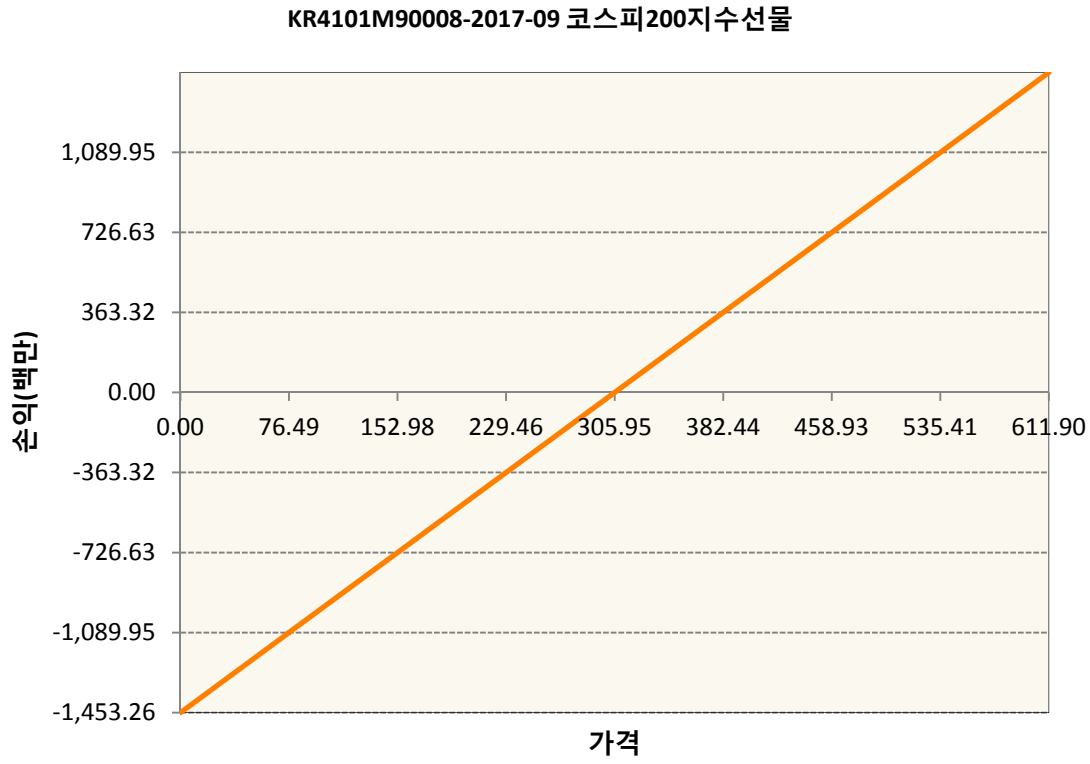
스마트인덱스모

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	1,453	0	1,453	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101M90(2017-09 코스피200지수선물							116
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-116	-116	-116	-116	-116	-116	-116
-5.33%	-77	-77	-77	-77	-77	-77	-77
-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%	77	77	77	77	77	77	77
8.00%	116	116	116	116	116	116	116

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

72

공시일	2017-08-16
기준일	2017-08-14

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	1,010

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

467

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-08-16
기준일	2017-08-14

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)

343

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-08-16
기준일	2017-08-14

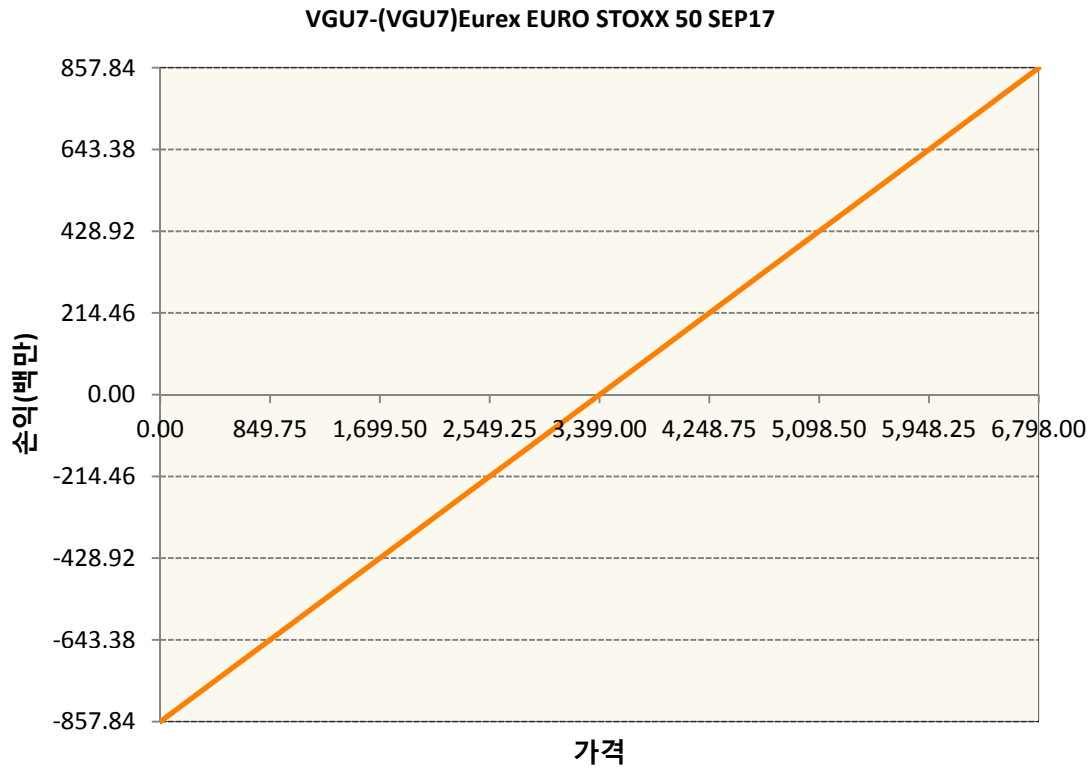
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	858	0	858	

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)

56

공시일	2017-08-16
기준일	2017-08-14

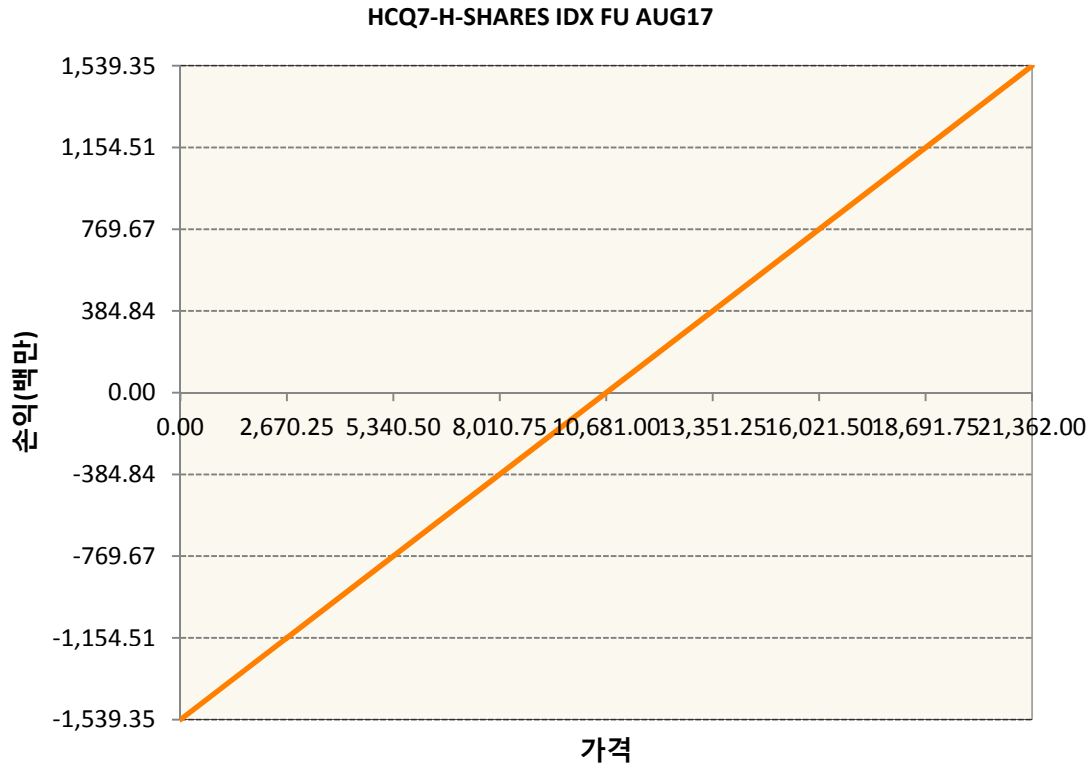
차이나인덱스모(주식-파생형)

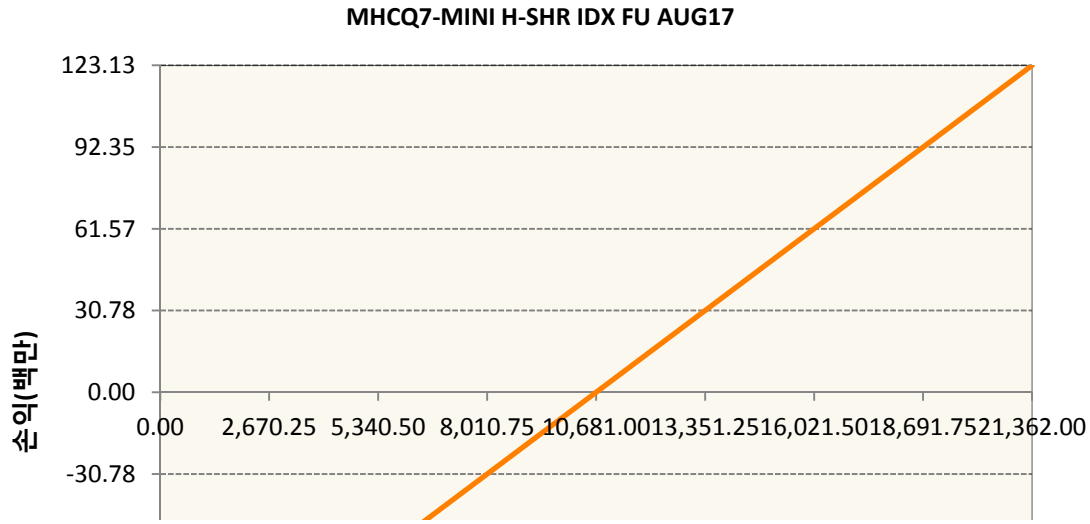
1. 계약금액

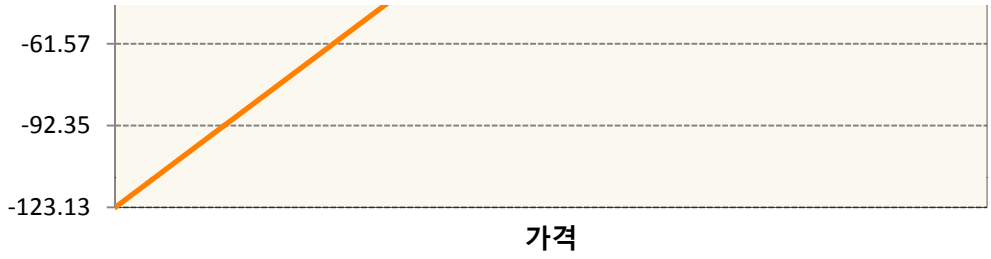
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,662	0	1,662	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCQ7	H-SHARES IDX FU AUG17	123
MHCQ7	MINI H-SHR IDX FU AUG17	10

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

공시일	2017-08-16
기준일	2017-08-14

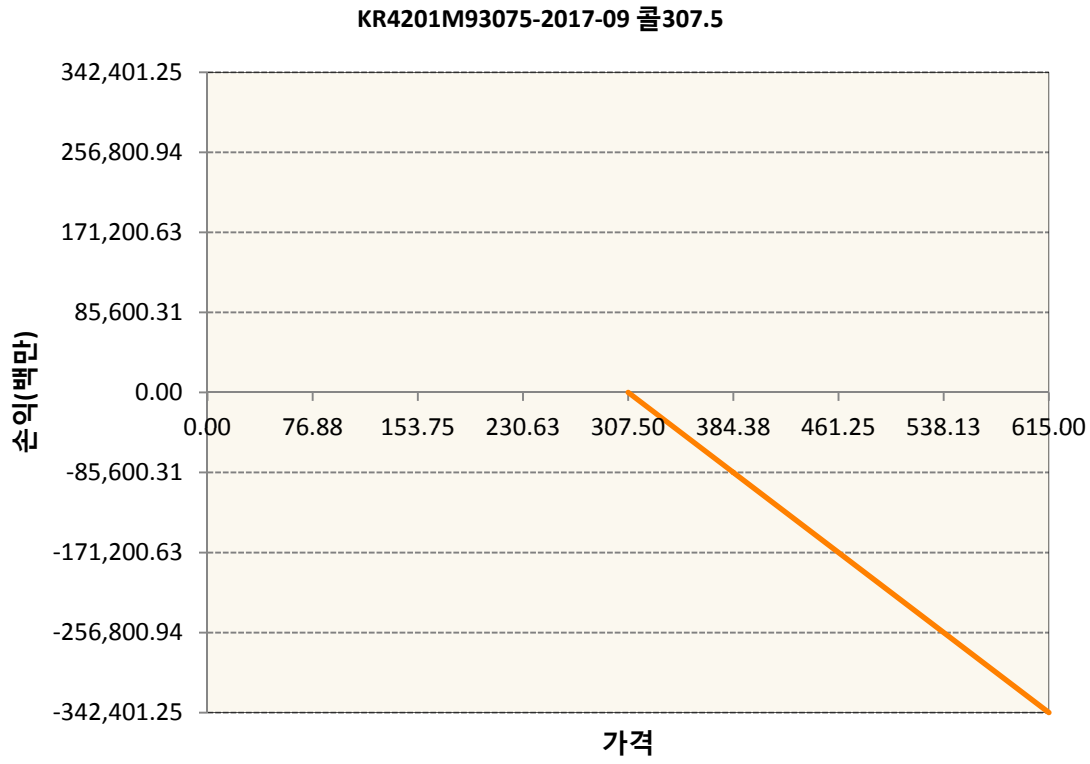
커버드콜모(주식혼합-파생형)

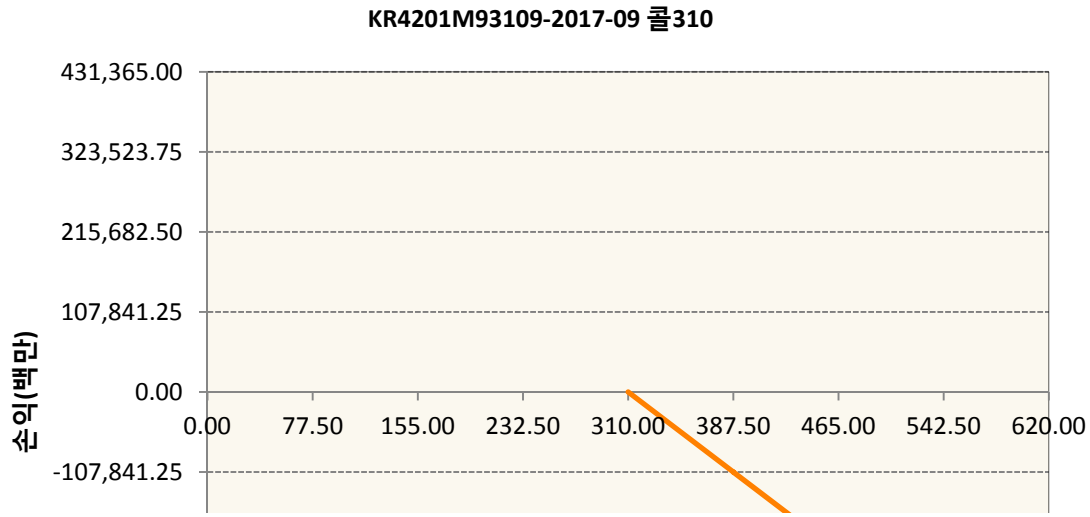
1. 계약금액

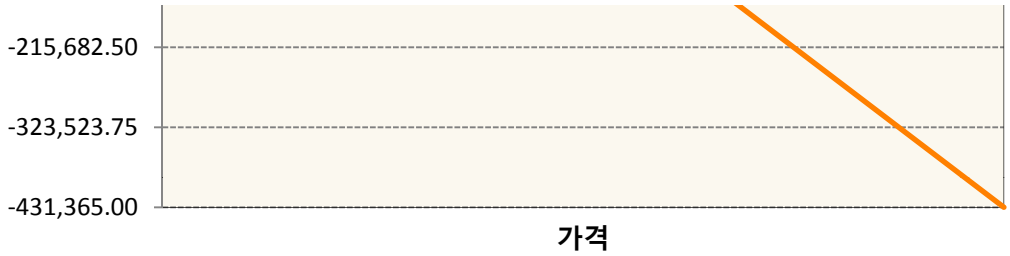
(단위:백만원)

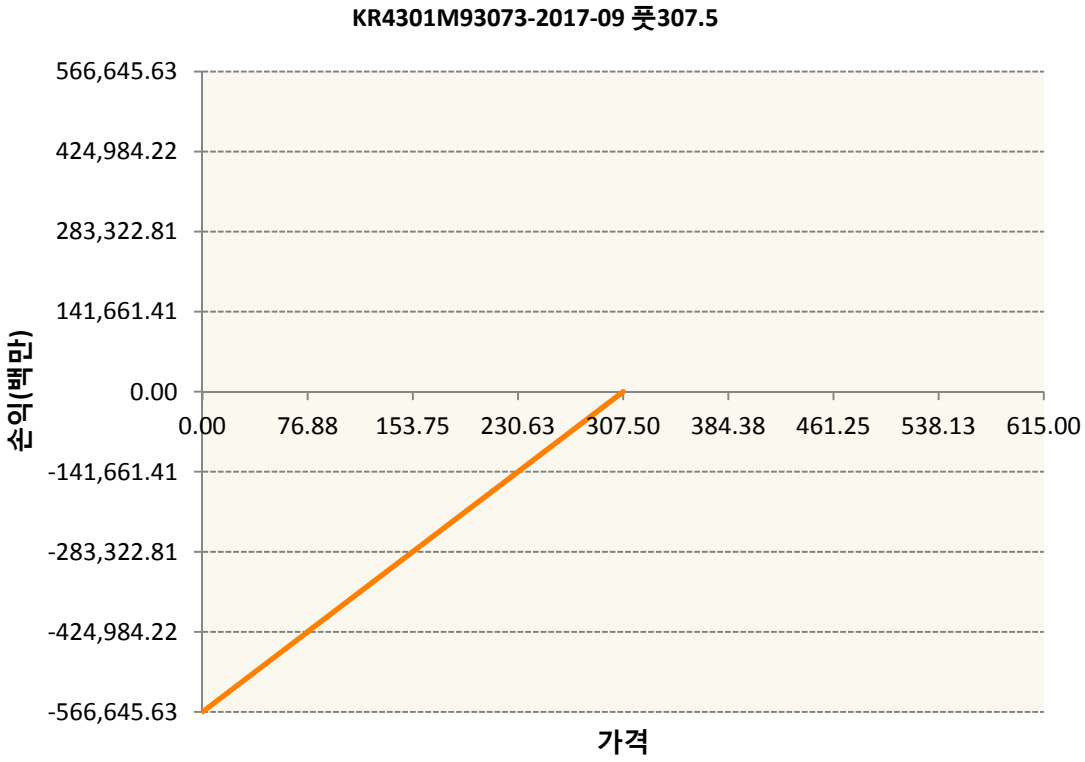
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	23,344	-23,344	장내
누계	유가증권	옵션	0	1,389,159	-1,389,159	장내

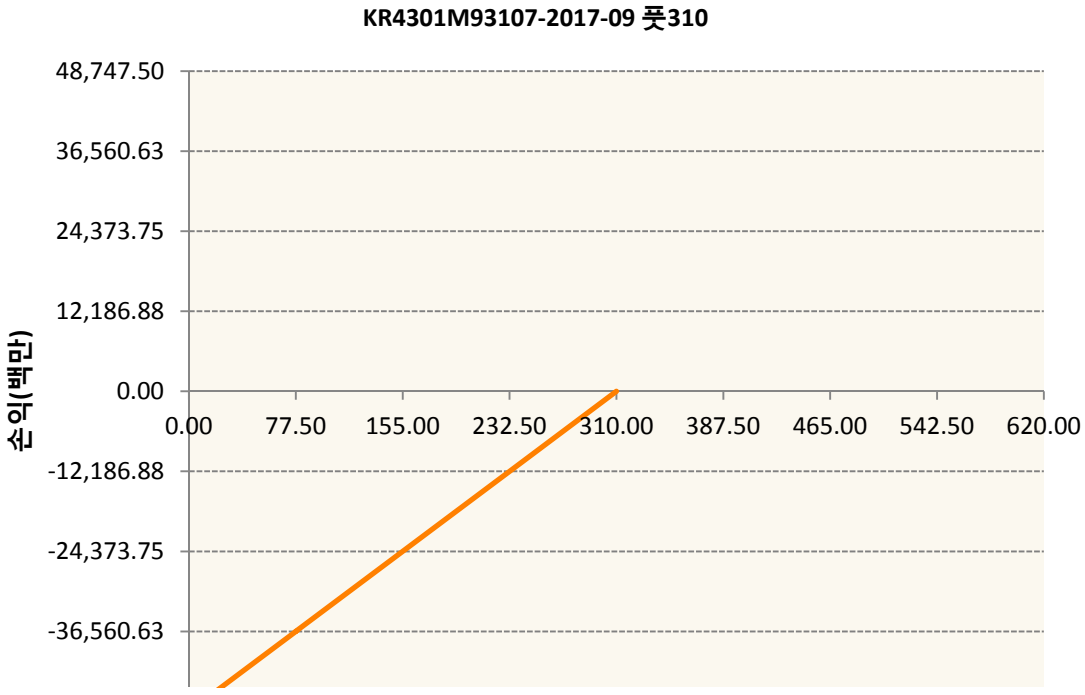
2. 만기시점의 손익구조

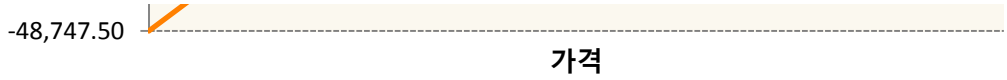





-215,682.50
-323,523.75
-431,365.00
가격


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							19,935
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	8,167	7,946	7,668	7,337	6,958	6,538	6,081
-5.33%	7,406	6,968	6,480	5,950	5,385	4,792	4,174
-2.67%	5,662	4,990	4,295	3,582	2,855	2,116	1,368
0%	2,447	1,633	817	0	-818	-1,636	-2,455
2.67%	-2,483	-3,278	-4,079	-4,886	-5,697	-6,511	-7,327
5.33%	-9,002	-9,636	-10,305	-11,000	-11,715	-12,448	-13,195
8.00%	-16,708	-17,129	-17,608	-18,135	-18,703	-19,305	-19,935
KR4201M93: 2017-09 콜310							23,770
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	8,885	8,666	8,377	8,023	7,608	7,139	6,620
-5.33%	8,165	7,699	7,164	6,569	5,925	5,239	4,517
-2.67%	6,410	5,646	4,840	4,003	3,140	2,256	1,356
0%	2,993	2,002	1,004	0	-1,008	-2,019	-3,033
2.67%	-2,506	-3,538	-4,572	-5,608	-6,645	-7,684	-8,723
5.33%	-10,071	-10,948	-11,856	-12,787	-13,737	-14,701	-15,678
8.00%	-19,288	-19,906	-20,589	-21,326	-22,106	-22,923	-23,770
KR4301M93(2017-09 풋307.5							34,830
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-31,377	-31,743	-32,204	-32,752	-33,379	-34,074	-34,830
-5.33%	-17,673	-18,397	-19,205	-20,082	-21,017	-21,999	-23,021
-2.67%	-5,595	-6,706	-7,856	-9,036	-10,240	-11,462	-12,700
0%	4,049	2,702	1,352	0	-1,353	-2,707	-4,063
2.67%	10,855	9,540	8,213	6,878	5,536	4,189	2,838
5.33%	15,032	13,982	12,876	11,726	10,541	9,328	8,092
8.00%	17,244	16,547	15,755	14,882	13,943	12,946	11,903
KR4301M93: 2017-09 풋310							3,083
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-2,827	-2,852	-2,884	-2,924	-2,971	-3,024	-3,083
-5.33%	-1,631	-1,684	-1,744	-1,812	-1,884	-1,962	-2,044
-2.67%	-553	-639	-730	-825	-922	-1,022	-1,124
0%	338	226	113	0	-114	-228	-343
2.67%	994	877	760	643	526	409	291

5.33%	1,416	1,317	1,214	1,109	1,002	893	782
8.00%	1,651	1,581	1,504	1,421	1,333	1,241	1,145

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

76,847

공시일	2017-08-16
기준일	2017-08-14

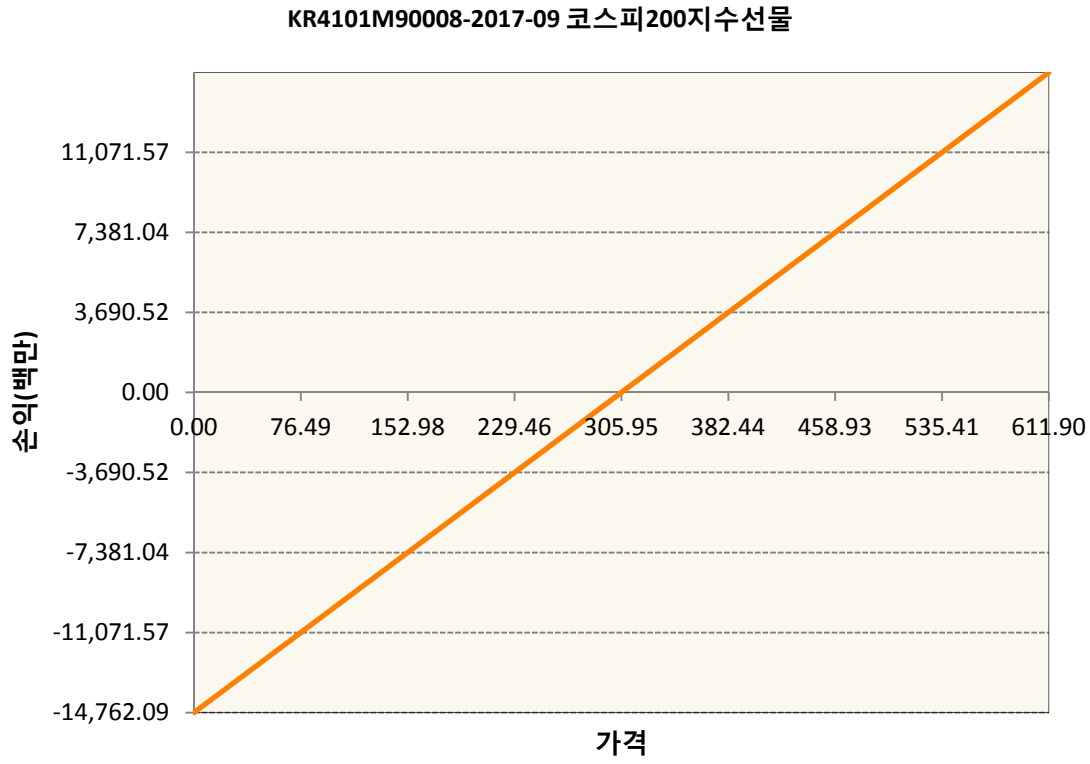
ETF스마트레버리지목표전환형6호

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	14,762	0	14,762	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101M90(2017-09 코스피200지수선물							1,177
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,177	-1,177	-1,177	-1,177	-1,177	-1,177	-1,177
-5.33%	-785	-785	-785	-785	-785	-785	-785
-2.67%	-392	-392	-392	-392	-392	-392	-392
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	392	392	392	392	392	392	392
5.33%	785	785	785	785	785	785	785
8.00%	1,177	1,177	1,177	1,177	1,177	1,177	1,177

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

733

공시일	2017-08-16
기준일	2017-08-14

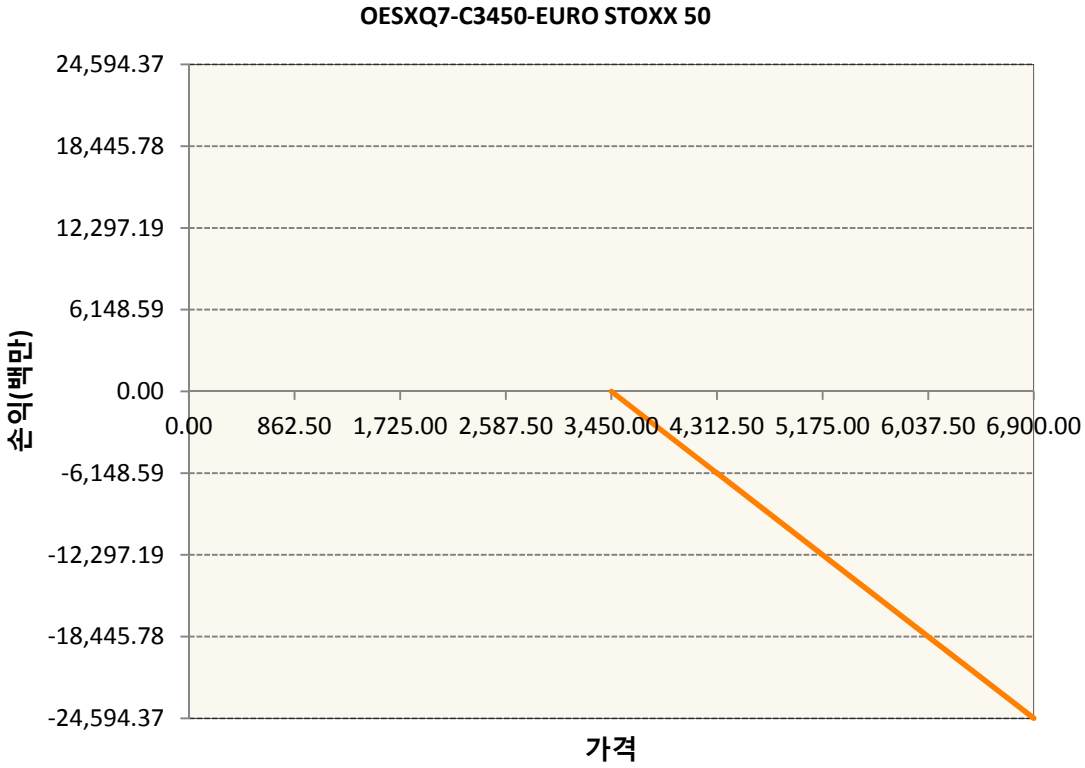
유로커버드콜(주식혼합-파생형)

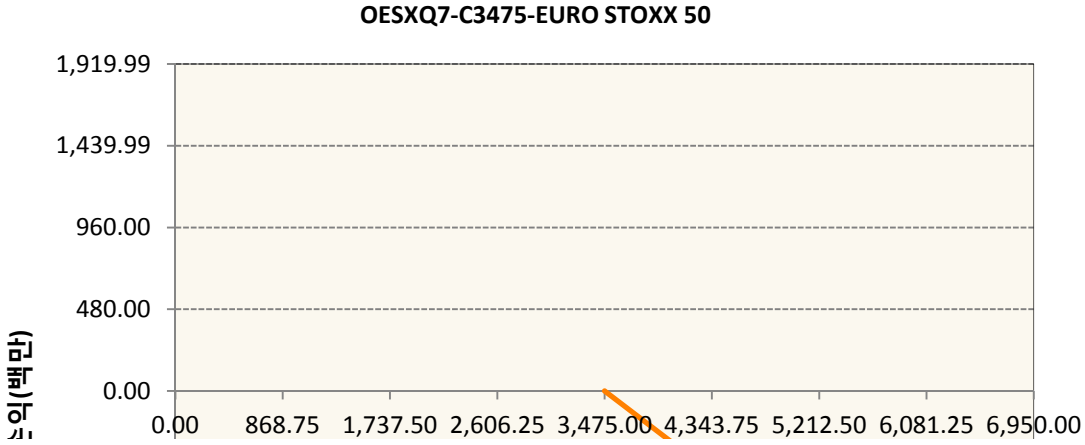
1. 계약금액

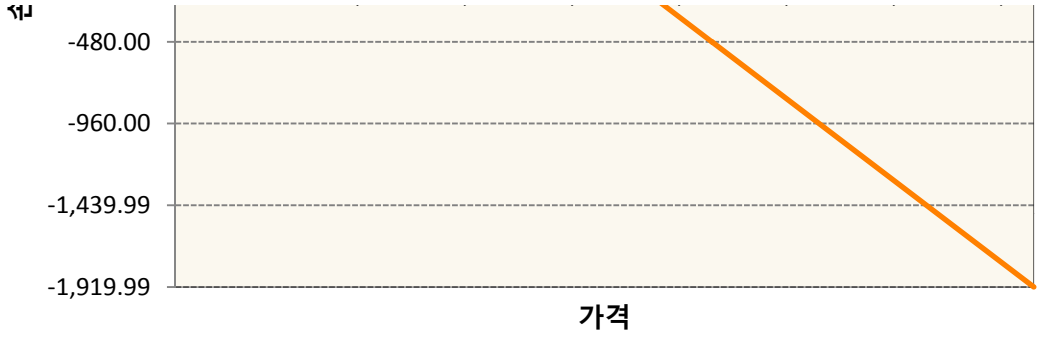
(단위:백만원)

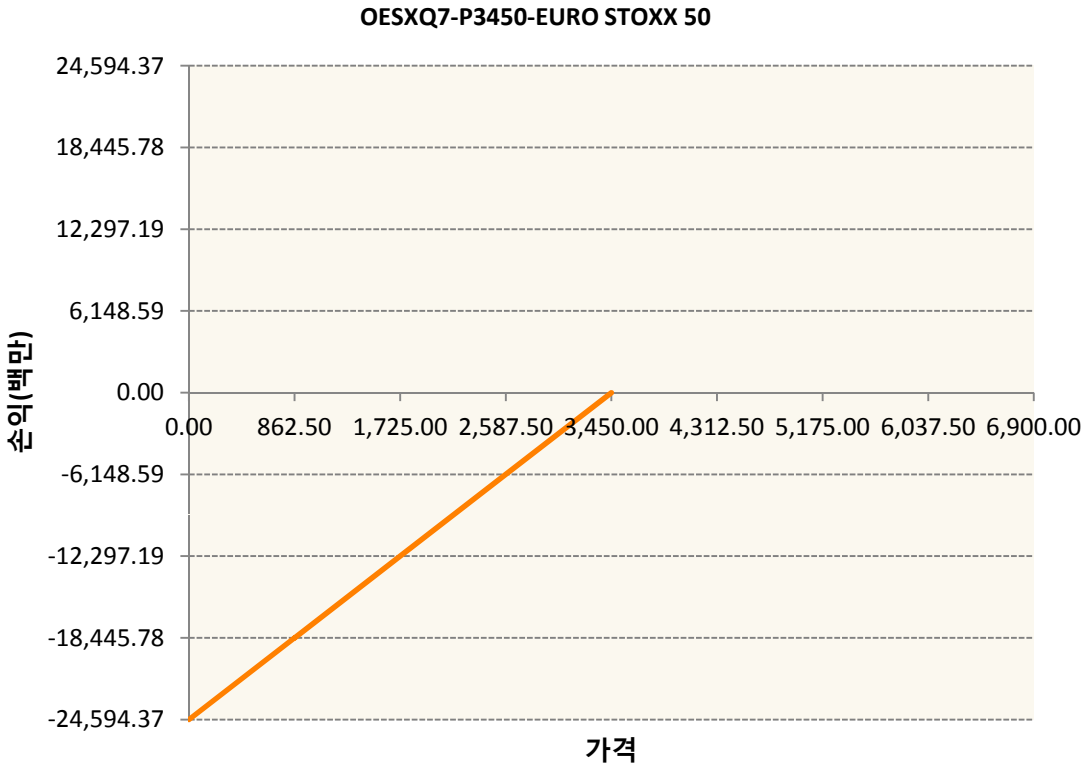
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	24,252	0	24,252	
누계	유가증권	옵션	0	53,029	-53,029	장내

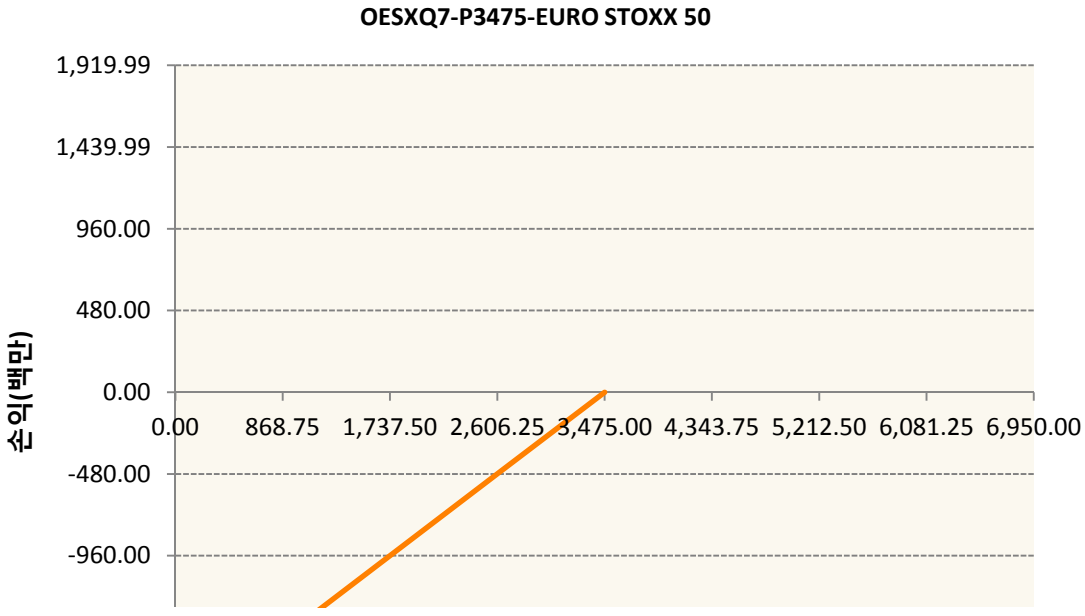
2. 만기시점의 손익구조

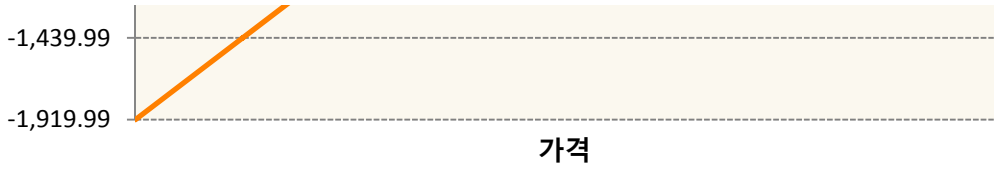


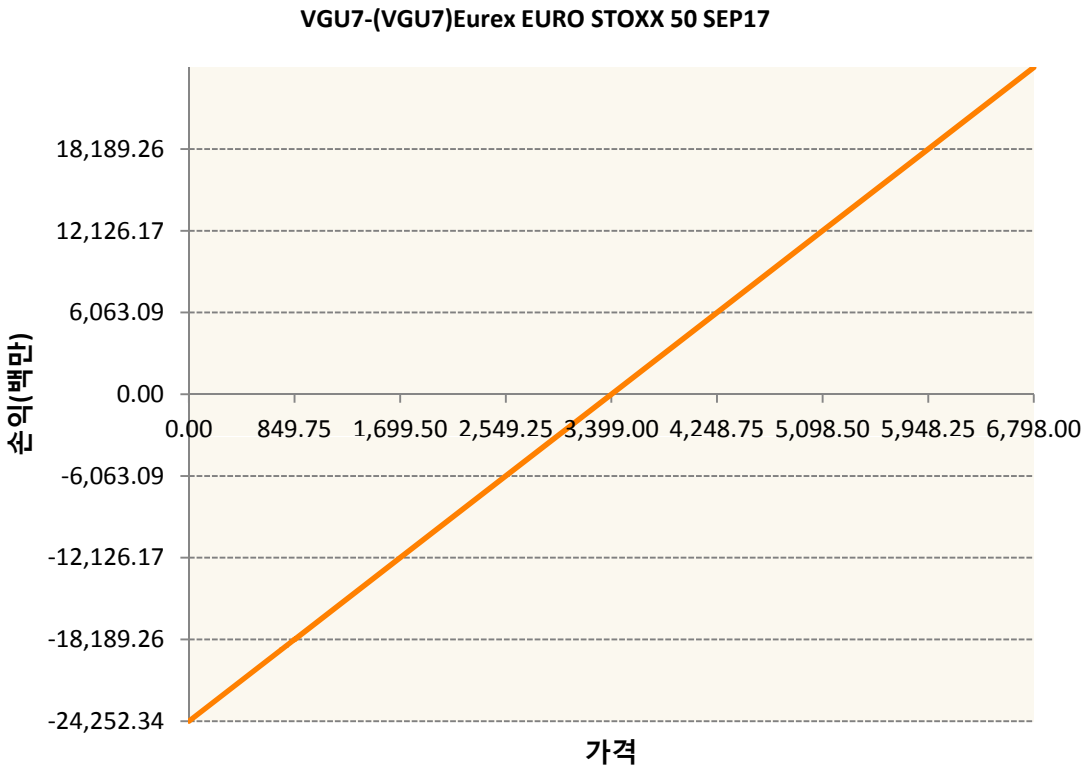



-480.00
-960.00
-1,439.99
-1,919.99
가격


OESXQ7-P3450-EURO STOXX 50
24,594.37
18,445.78
12,297.19
6,148.59
0.00
-6,148.59
-12,297.19
-18,445.78
-24,594.37
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
1,919.99
1,439.99
960.00
480.00
0.00
-480.00
-960.00
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	1,968
OESXQ7-C3	EURO STOXX 50	154
OESXQ7-P3	EURO STOXX 50	1,968
OESXQ7-P3	EURO STOXX 50	154
VGU7	(VGU7)Eurex EURO STOXX 50 SEP17	1,940

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	5,090

공시일	2017-08-16
기준일	2017-08-14

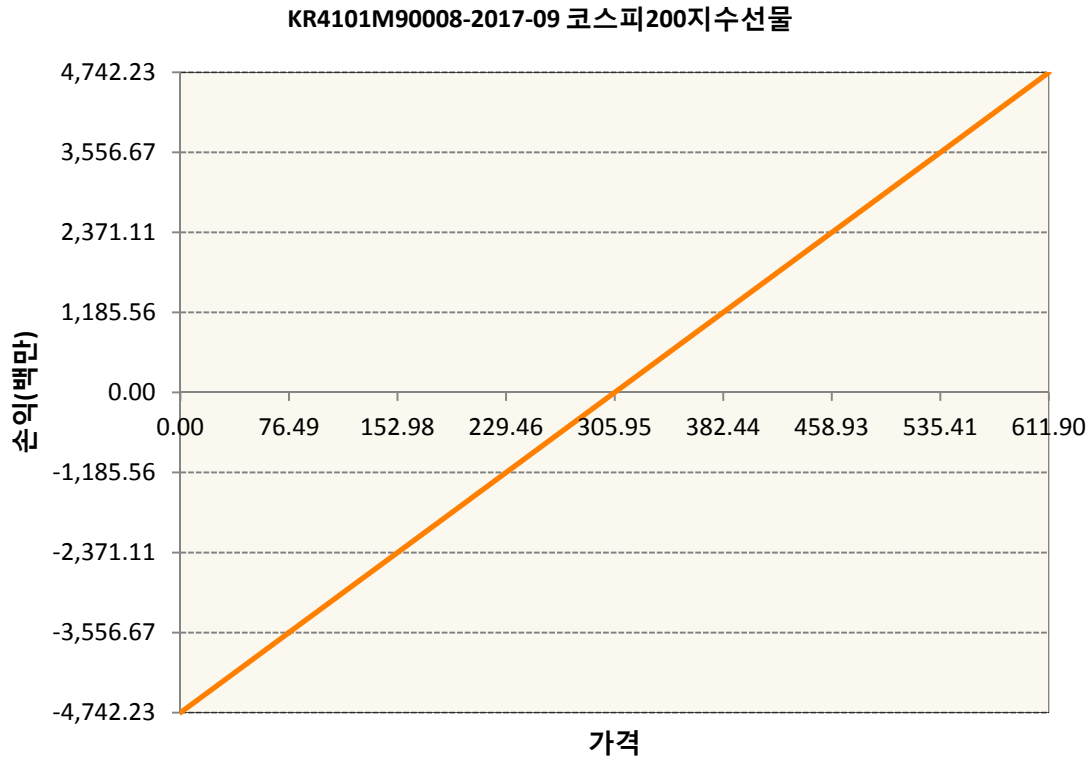
ETF스마트레버리지목표전환형7호

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	4,742	0	4,742	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101M90(2017-09 코스피200지수선물							378
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-378	-378	-378	-378	-378	-378	-378
-5.33%	-252	-252	-252	-252	-252	-252	-252
-2.67%	-126	-126	-126	-126	-126	-126	-126
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	126	126	126	126	126	126	126
5.33%	252	252	252	252	252	252	252
8.00%	378	378	378	378	378	378	378

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

235

공시일	2017-08-16
기준일	2017-08-14

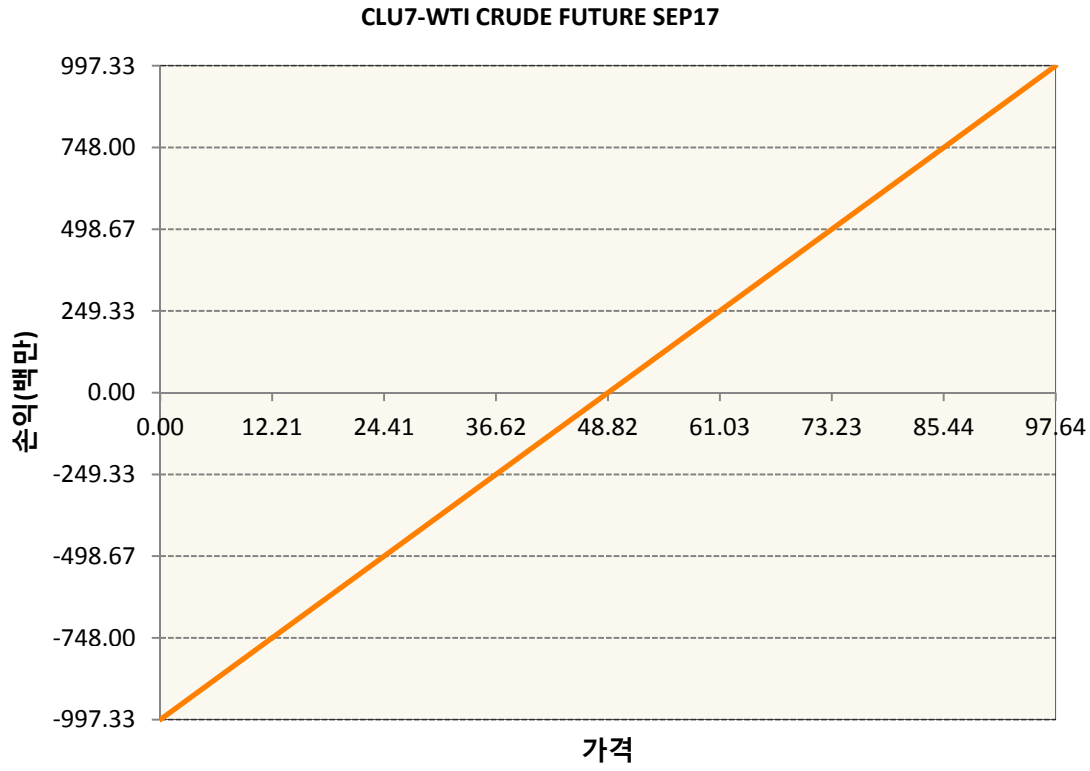
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

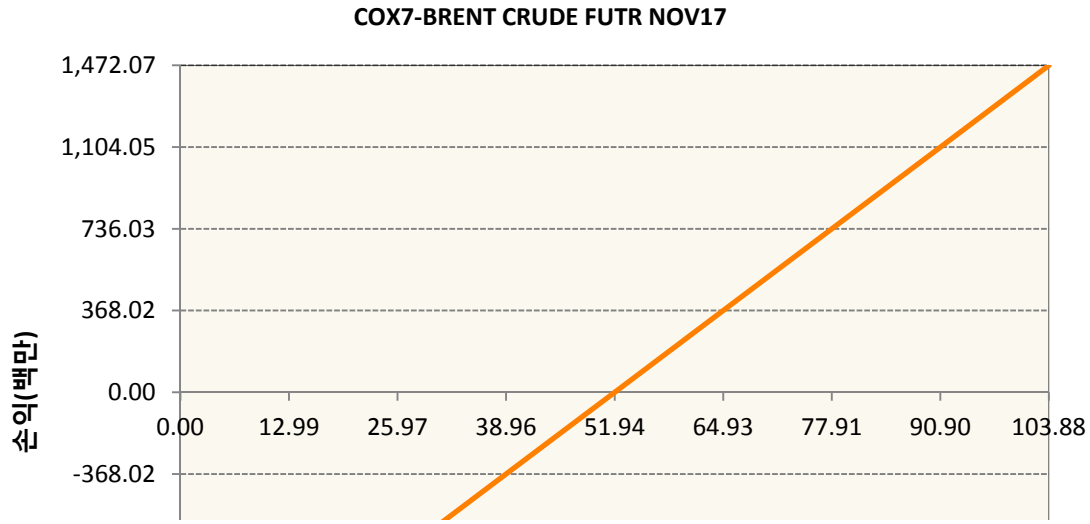
1. 계약금액

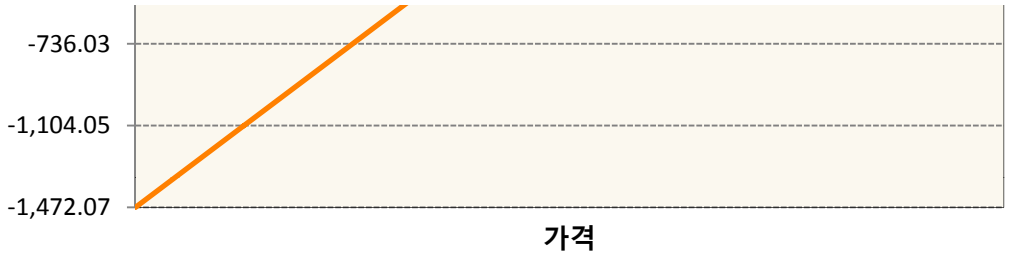
(단위:백만원)

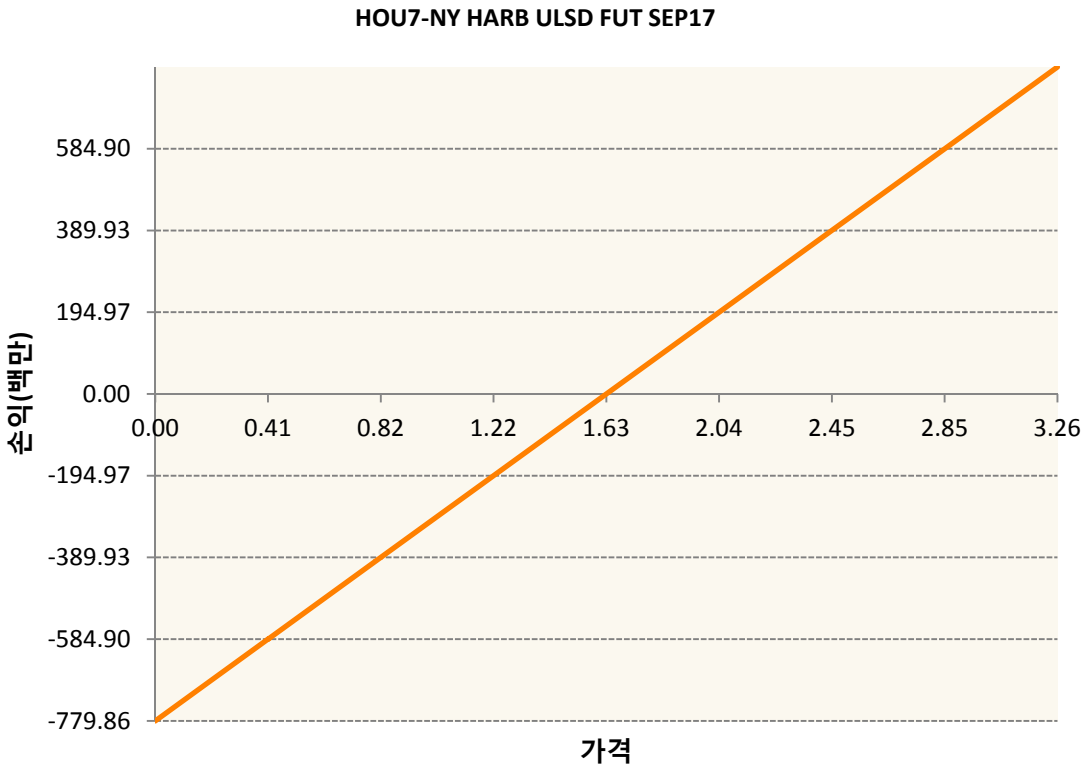
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	5,441	342	5,100	

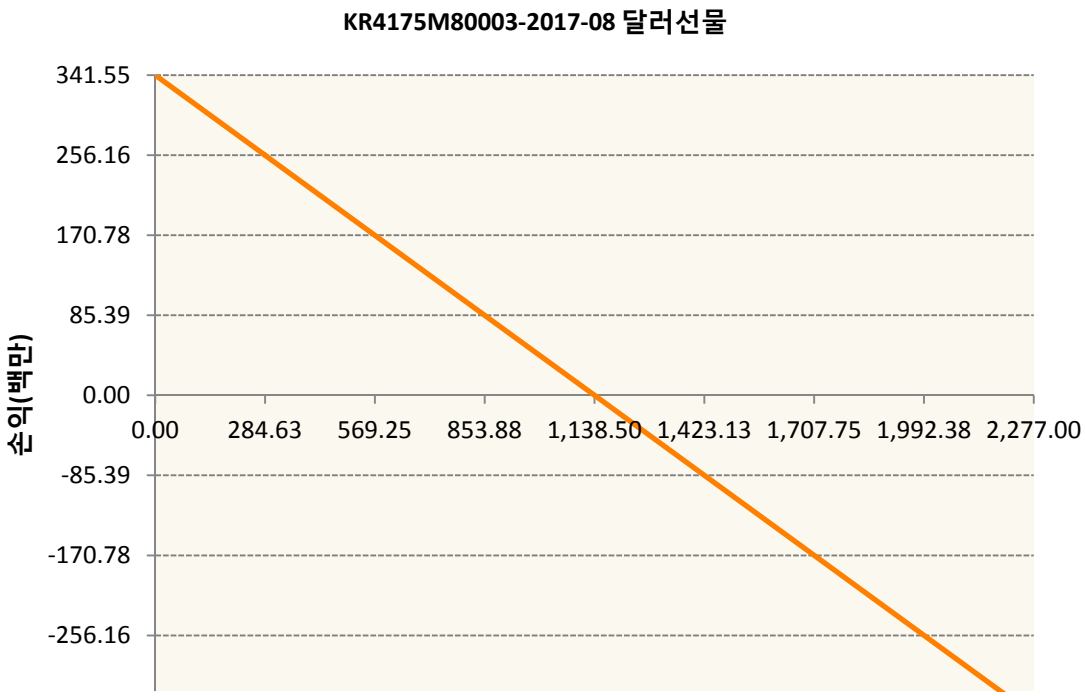
2. 만기시점의 손익구조

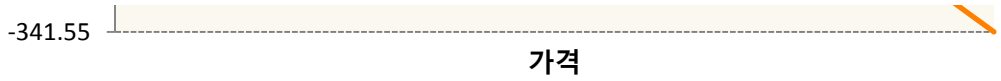


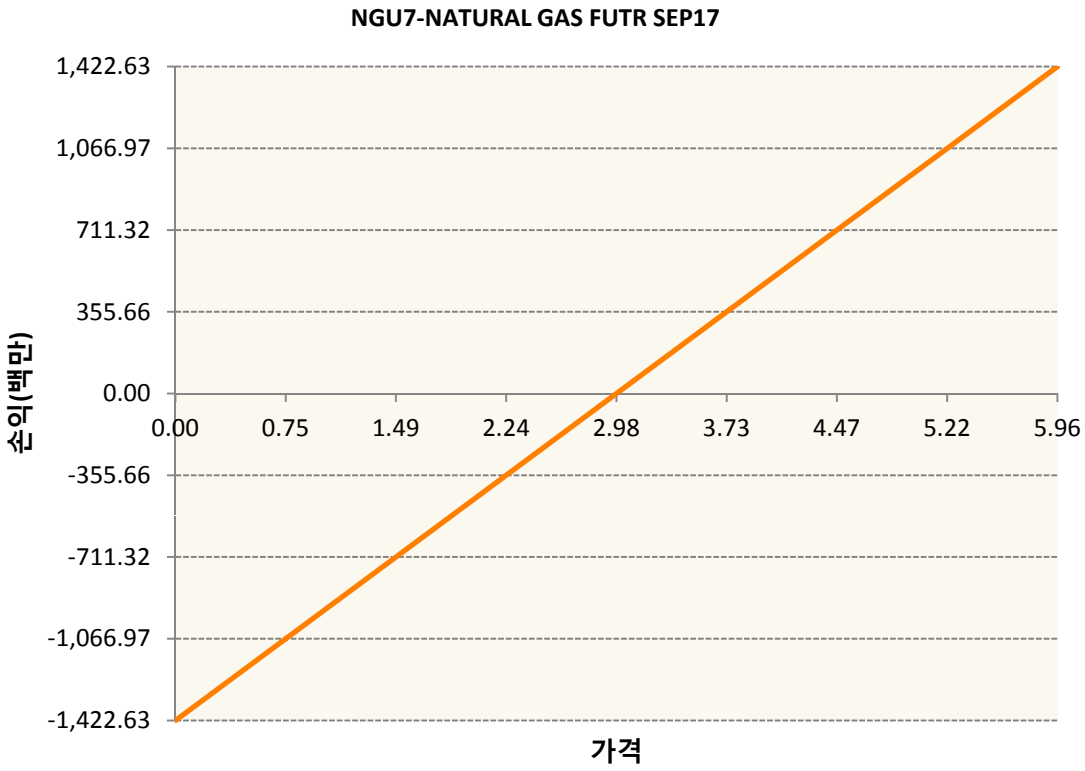


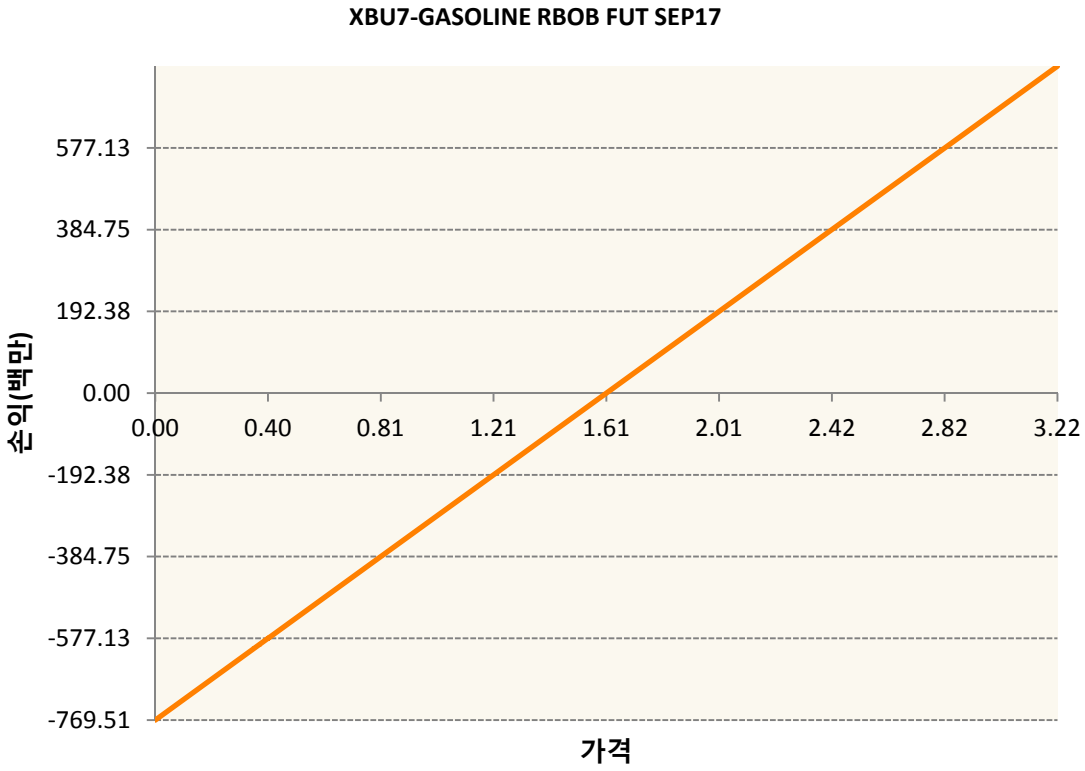

-736.03
-1,104.05
-1,472.07
가격


HOU7-NY HARB ULSD FUT SEP17
584.90
389.93
194.97
0.00
-194.97
-389.93
-584.90
-779.86
0.00
0.41
0.82
1.22
1.63
2.04
2.45
2.85
3.26
손익(백만)
가격


KR4175M80003-2017-08 달러선물
341.55
256.16
170.78
85.39
0.00
-85.39
-170.78
-256.16
0.00
284.63
569.25
853.88
1,138.50
1,423.13
1,707.75
1,992.38
2,277.00
손익(백만)


-341.55
가격


NGU7-NATURAL GAS FUTR SEP17
1,422.63
1,066.97
711.32
355.66
0.00
-355.66
-711.32
-1,066.97
-1,422.63
0.00
0.75
1.49
2.24
2.98
3.73
4.47
5.22
5.96
손익(백만)
가격


XBU7-GASOLINE RBOB FUT SEP17
577.13
384.75
192.38
0.00
-192.38
-384.75
-577.13
-769.51
0.00
0.40
0.81
1.21
1.61
2.01
2.42
2.82
3.22
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	114
XBU7	GASOLINE RBOB FUT SEP17	62

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

780

공시일	2017-08-16
기준일	2017-08-14

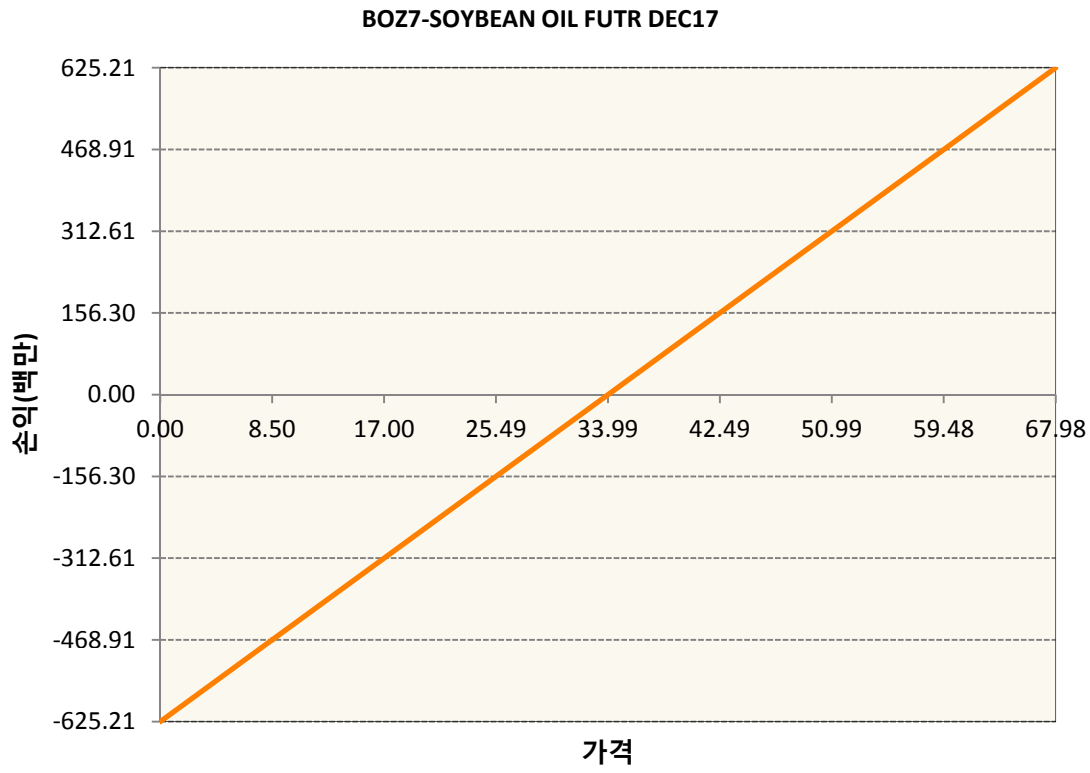
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

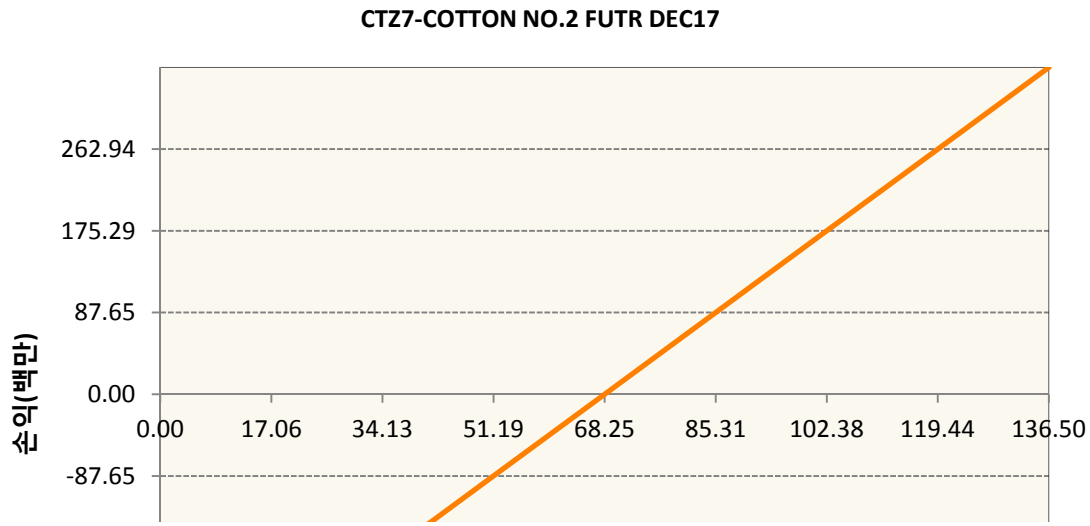
1. 계약금액

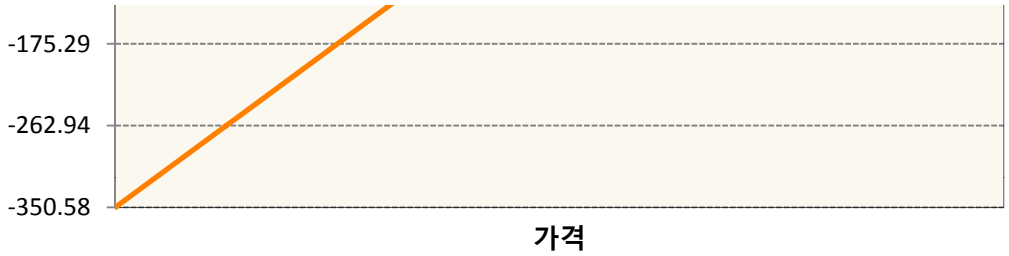
(단위:백만원)

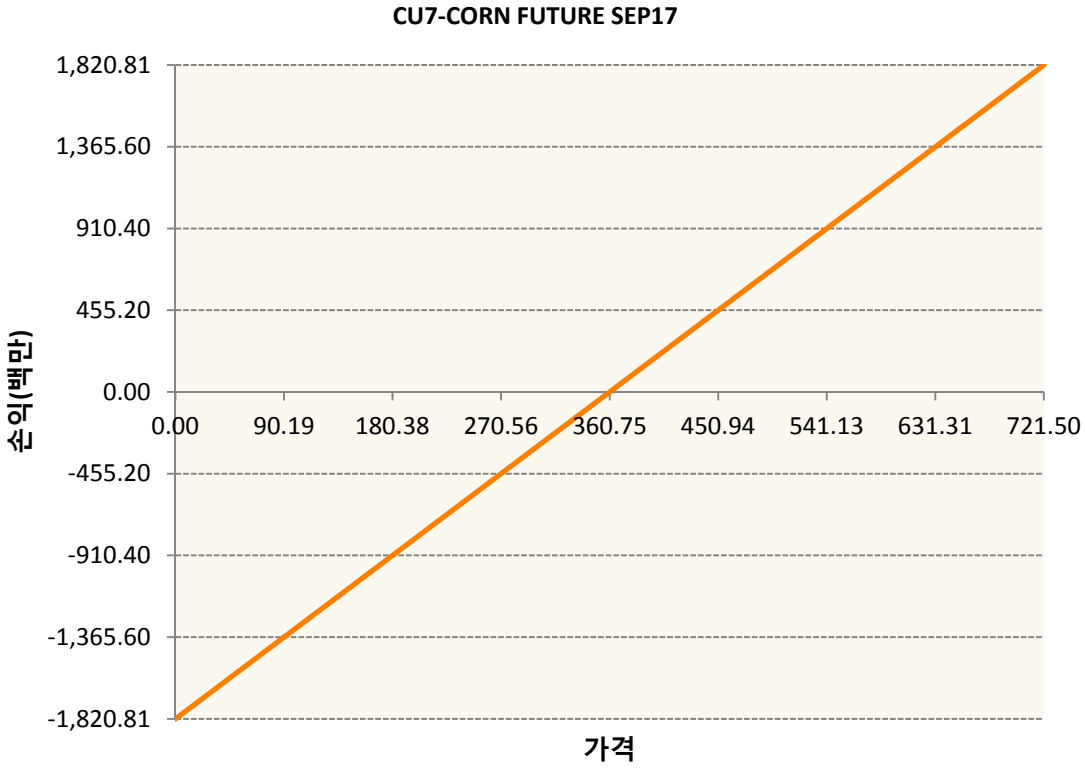
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	6,941	398	6,542	

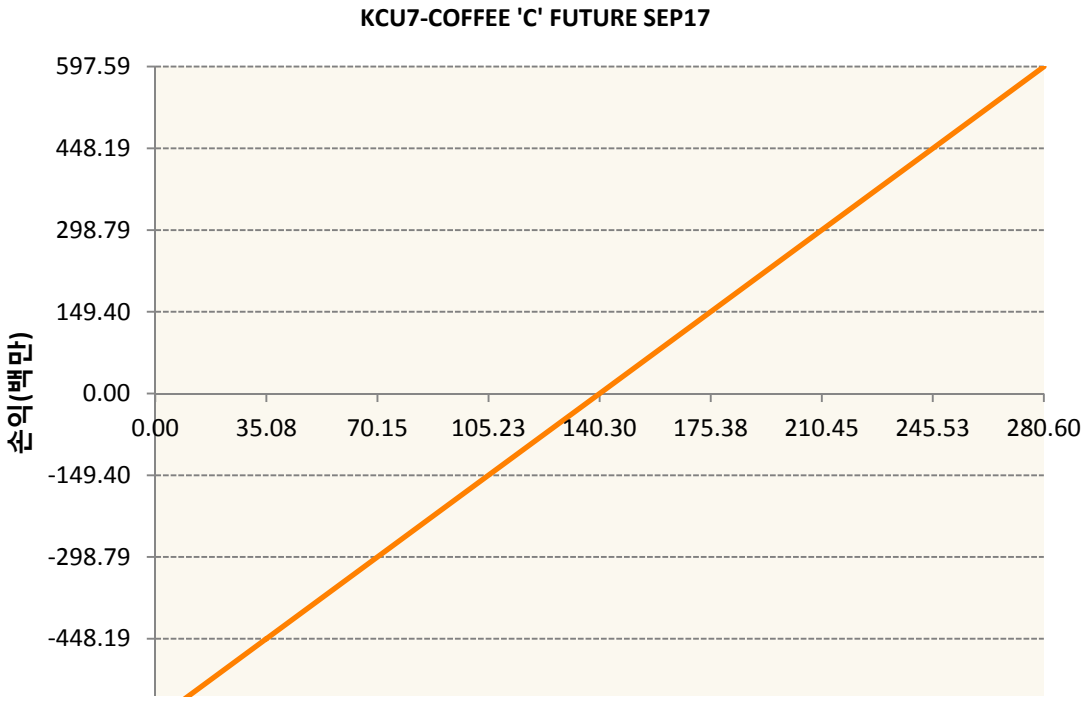
2. 만기시점의 손익구조

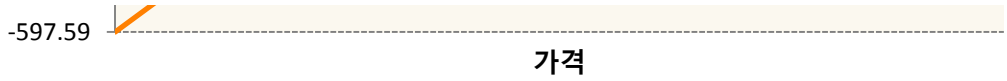


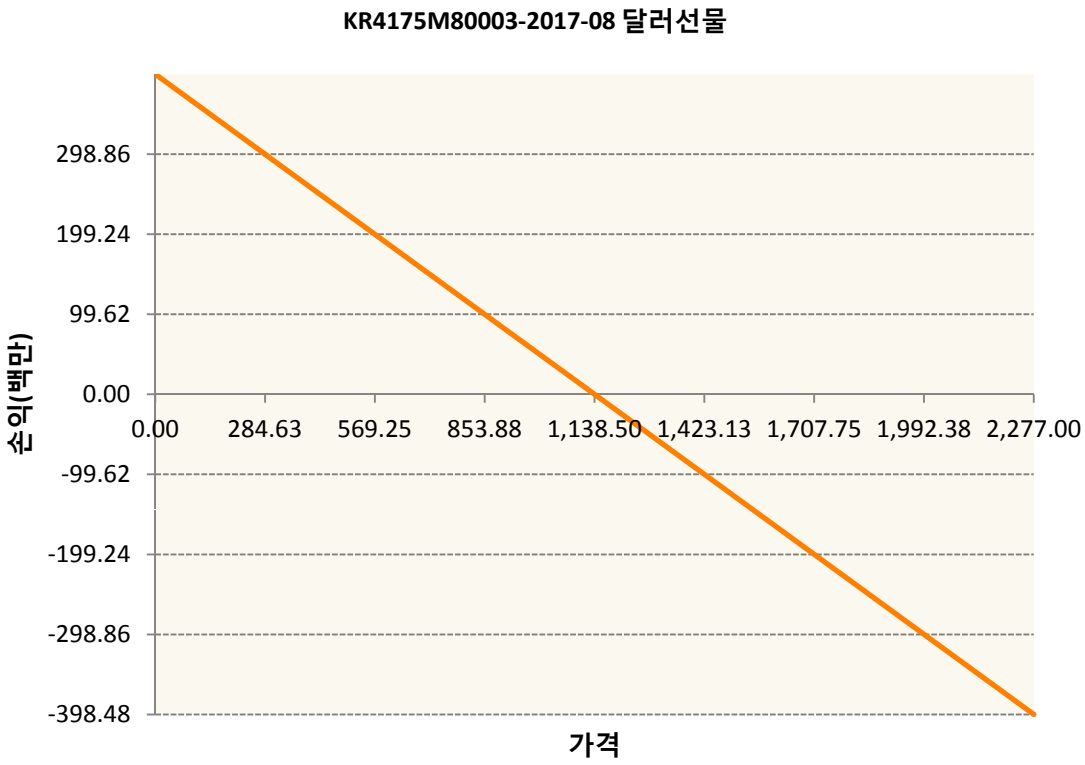


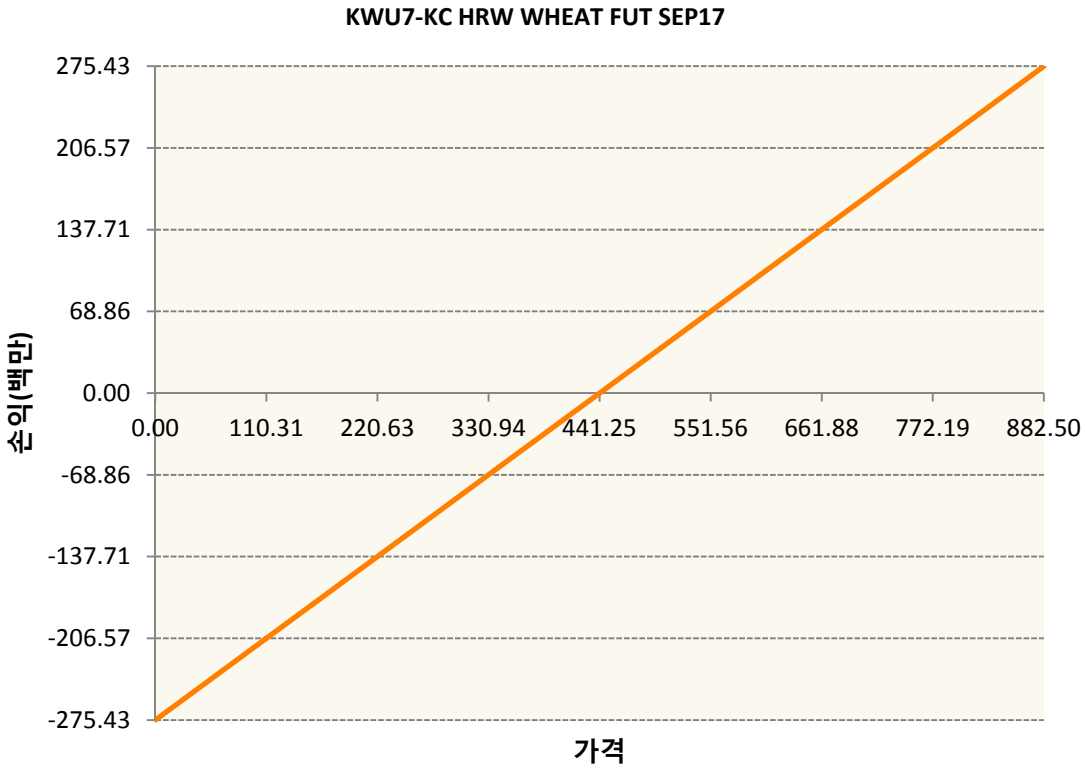

-175.29
-262.94
-350.58
가격


CU7-CORN FUTURE SEP17
1,820.81
1,365.60
910.40
455.20
0.00
-455.20
-910.40
-1,365.60
-1,820.81
0.00
90.19
180.38
270.56
360.75
450.94
541.13
631.31
721.50
손익(백만)
가격

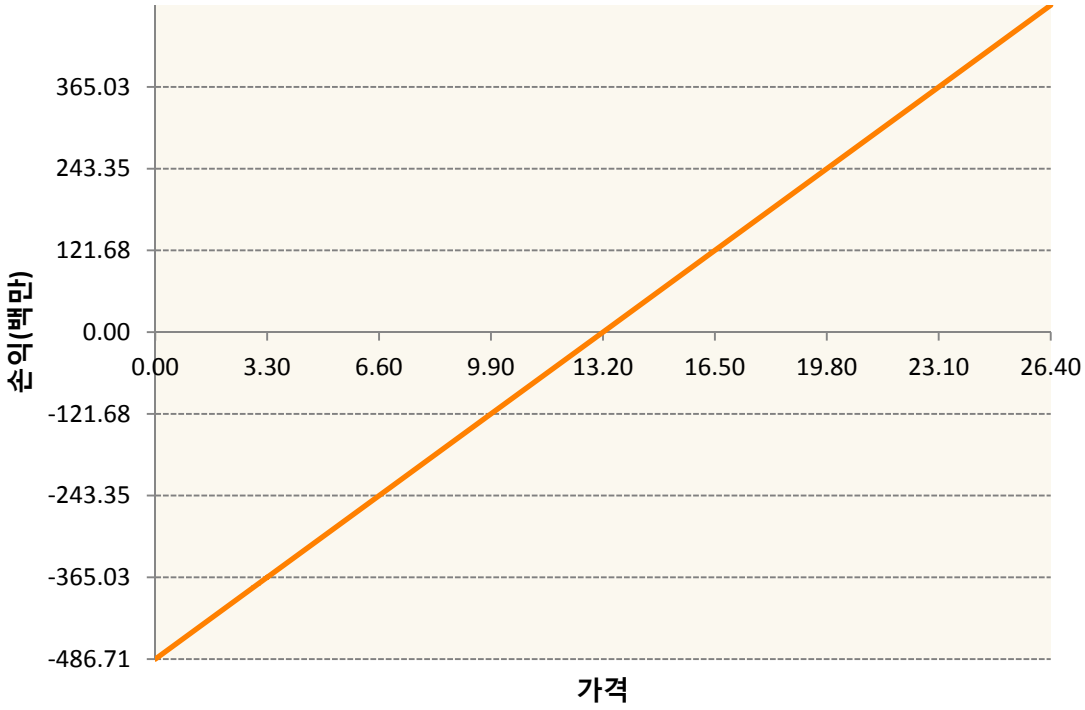

KCU7-COFFEE 'C' FUTURE SEP17
597.59
448.19
298.79
149.40
0.00
-149.40
-298.79
-448.19
0.00
35.08
70.15
105.23
140.30
175.38
210.45
245.53
280.60
손익(백만)


-597.59
가격

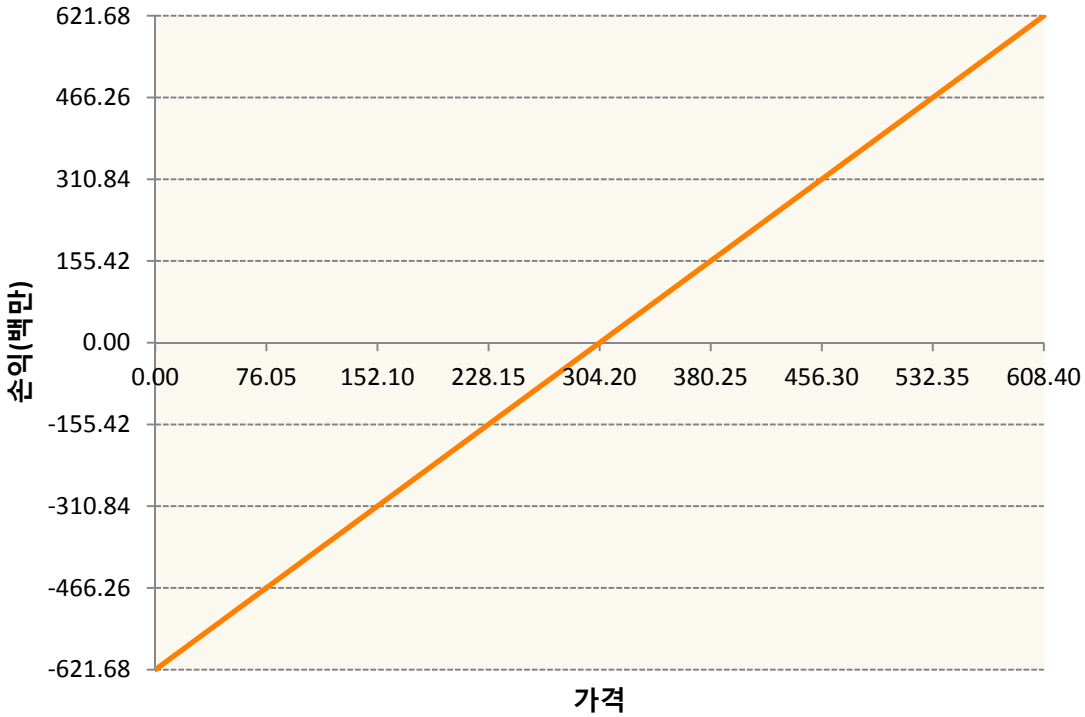

KR4175M80003-2017-08 달러선물
298.86
199.24
99.62
0.00
-99.62
-199.24
-298.86
-398.48
0.00
284.63
569.25
853.88
1,138.50
1,423.13
1,707.75
1,992.38
2,277.00
손익(백만)
가격


KWU7-KC HRW WHEAT FUT SEP17
275.43
206.57
137.71
68.86
0.00
-68.86
-137.71
-206.57
-275.43
0.00
110.31
220.63
330.94
441.25
551.56
661.88
772.19
882.50
손익(백만)
가격

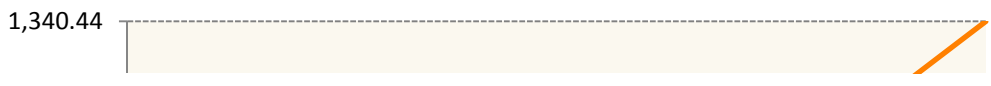
SBV7-SUGAR #11 (WORLD) OCT17

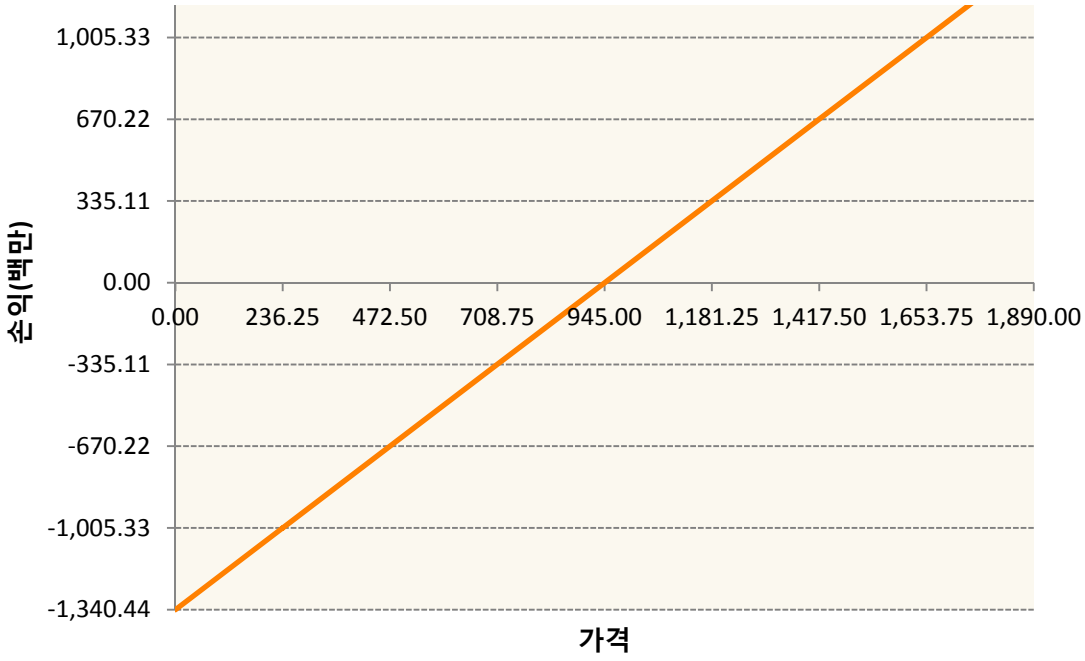


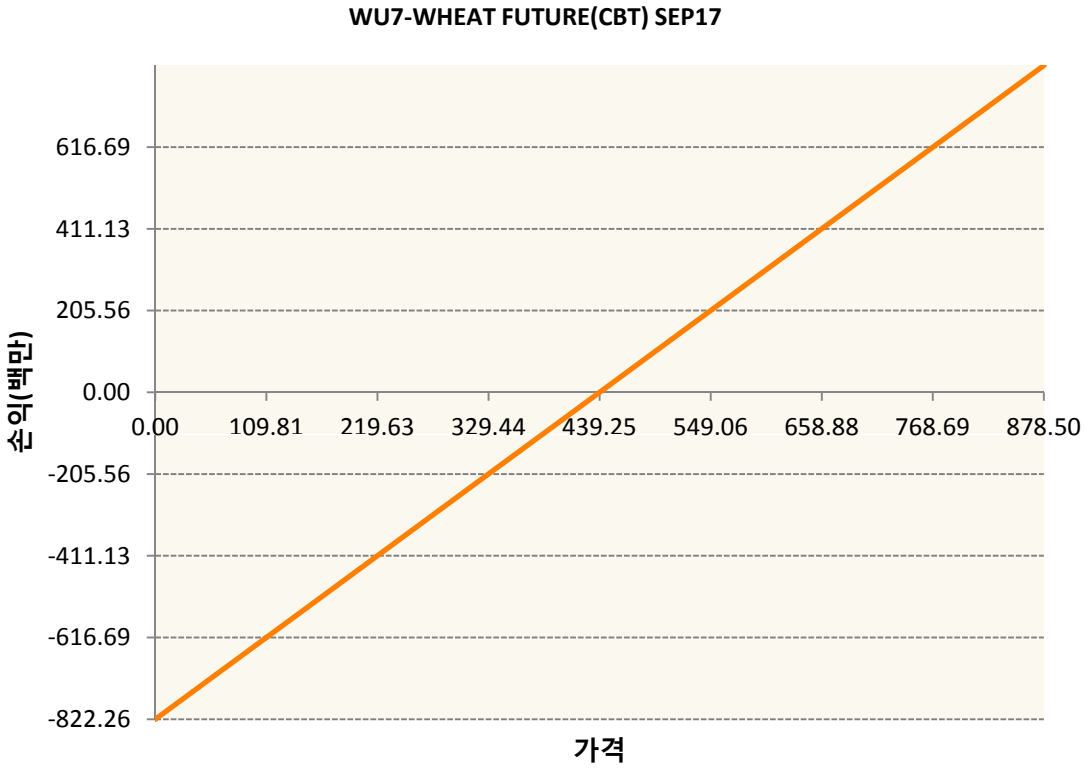
SMZ7-SOYBEAN MEAL FUTR DEC17



SX7-SOYBEAN FUTURE NOV17







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

BOZ7	SOYBEAN OIL FUTR DEC17	50
CTZ7	COTTON NO.2 FUTR DEC17	28
CU7	CORN FUTURE SEP17	146
KCU7	COFFEE 'C' FUTURE SEP17	48
KR4175M80(	2017-08 달러선물	32

KWU7	KC HRW WHEAT FUT SEP17	22
SBV7	SUGAR #11 (WORLD) OCT17	39
SMZ7	SOYBEAN MEAL FUTR DEC17	50
SX7	SOYBEAN FUTURE NOV17	107
WU7	WHEAT FUTURE(CBT) SEP17	66

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

657