공시일	2017-08-17
기준일	2017-08-16

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	2017-08-17
기준일	2017-08-16

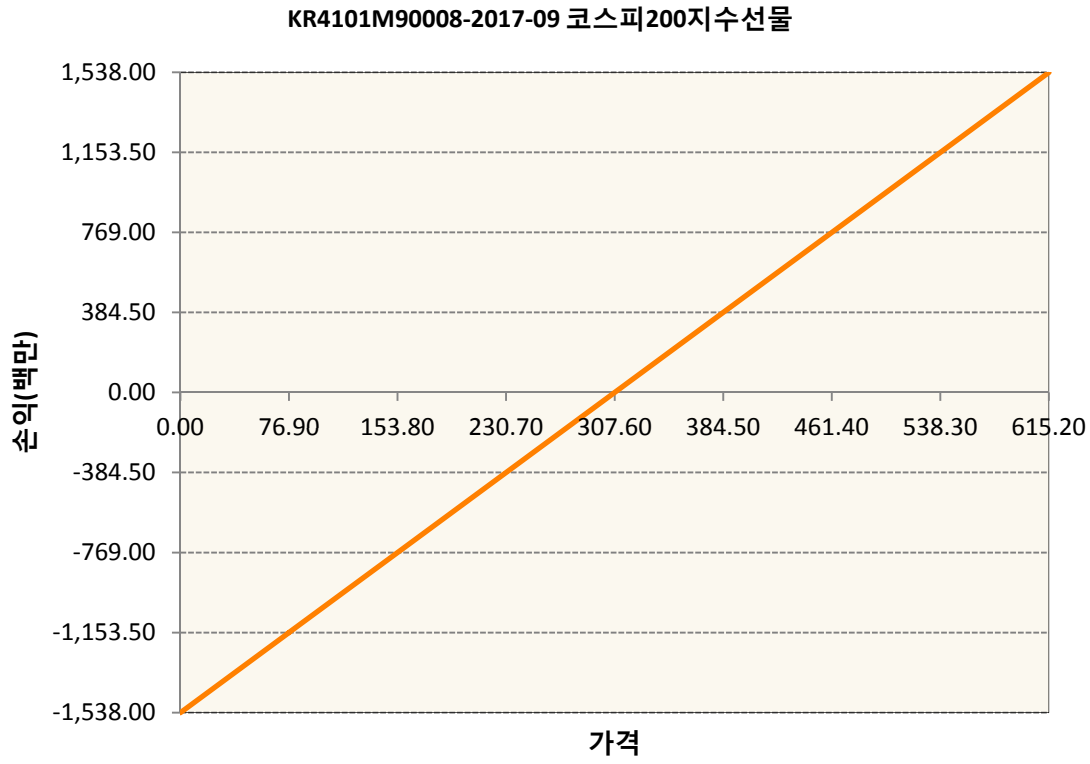
스마트인덱스모

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	77	0	77	장내
누계	유가증권	선물	1,538	0	1,538	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101M90(2017-09 코스피200지수선물							123
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-123	-123	-123	-123	-123	-123	-123
-5.33%	-82	-82	-82	-82	-82	-82	-82
-2.67%	-41	-41	-41	-41	-41	-41	-41
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	41	41	41	41	41	41	41
5.33%	82	82	82	82	82	82	82
8.00%	123	123	123	123	123	123	123

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

77

공시일	2017-08-17
기준일	2017-08-16

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	1,017

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

469

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-08-17
기준일	2017-08-16

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)

346

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-08-17
기준일	2017-08-16

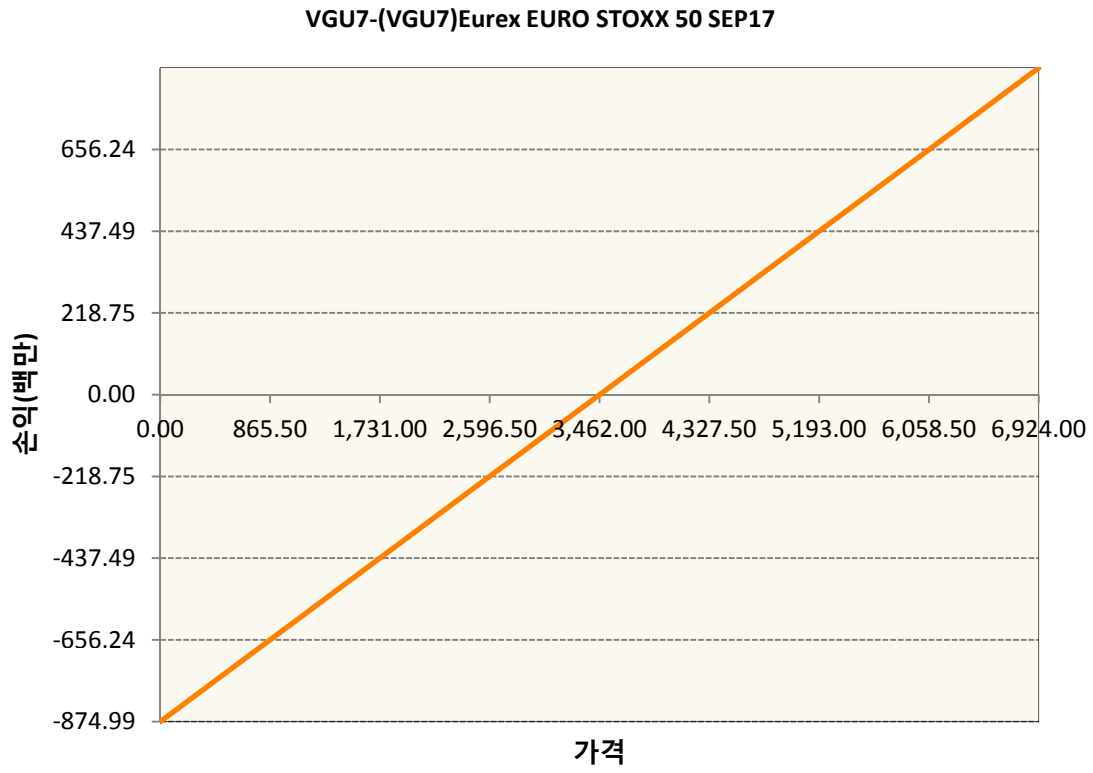
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	875	0	875	

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)

57

공시일	2017-08-17
기준일	2017-08-16

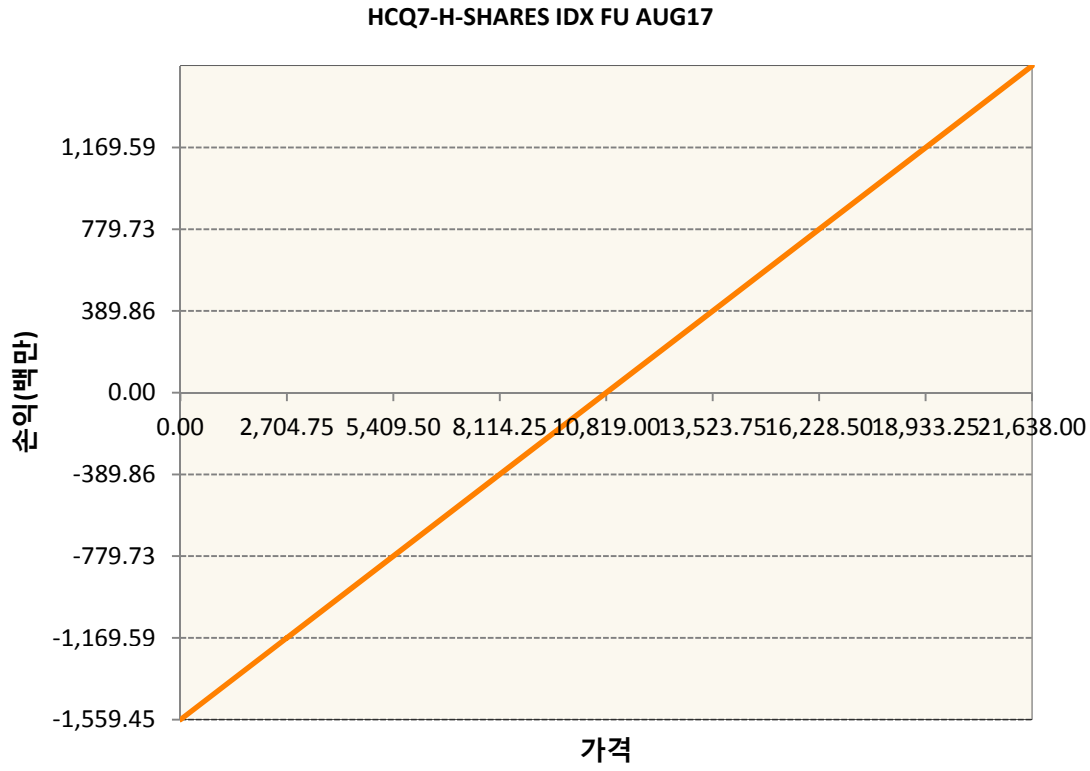
차이나인덱스모(주식-파생형)

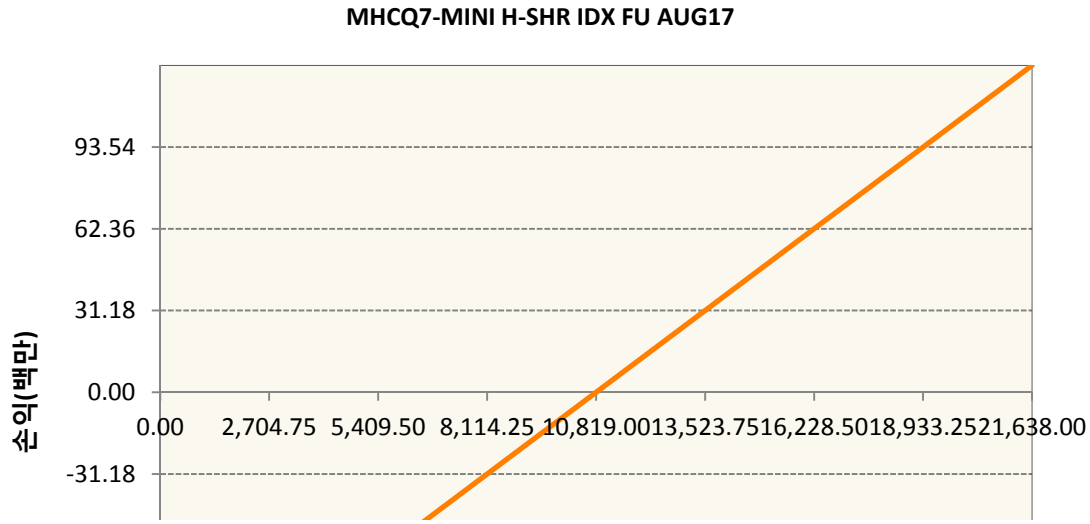
1. 계약금액

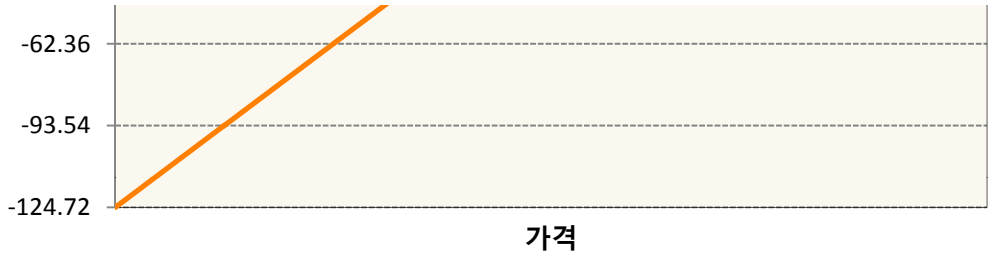
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,684	0	1,684	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCQ7	H-SHARES IDX FU AUG17	125
MHCQ7	MINI H-SHR IDX FU AUG17	10

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

공시일	2017-08-17
기준일	2017-08-16

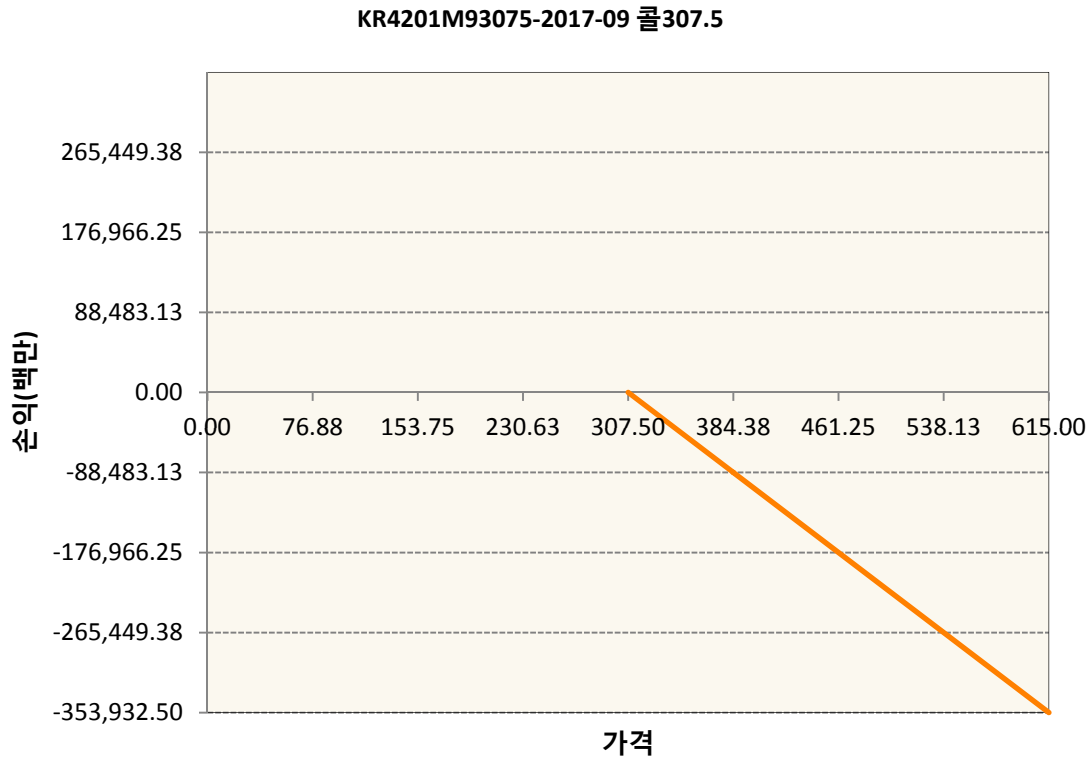
커버드콜모(주식혼합-파생형)

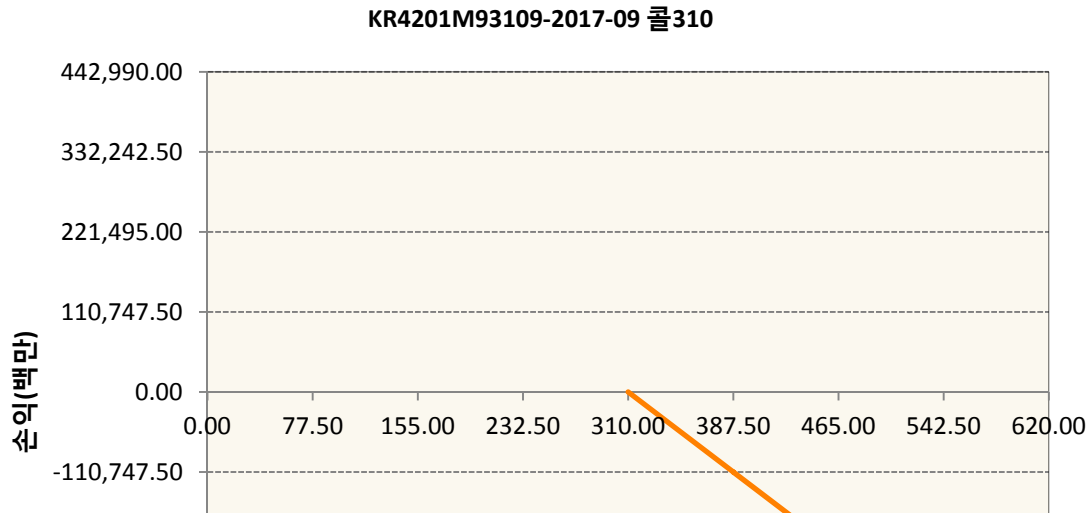
1. 계약금액

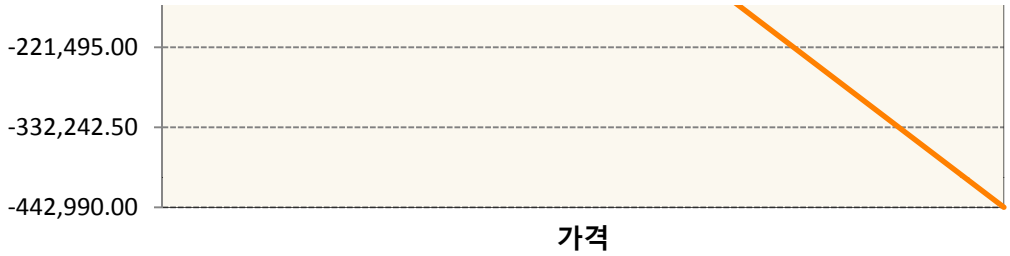
(단위:백만원)

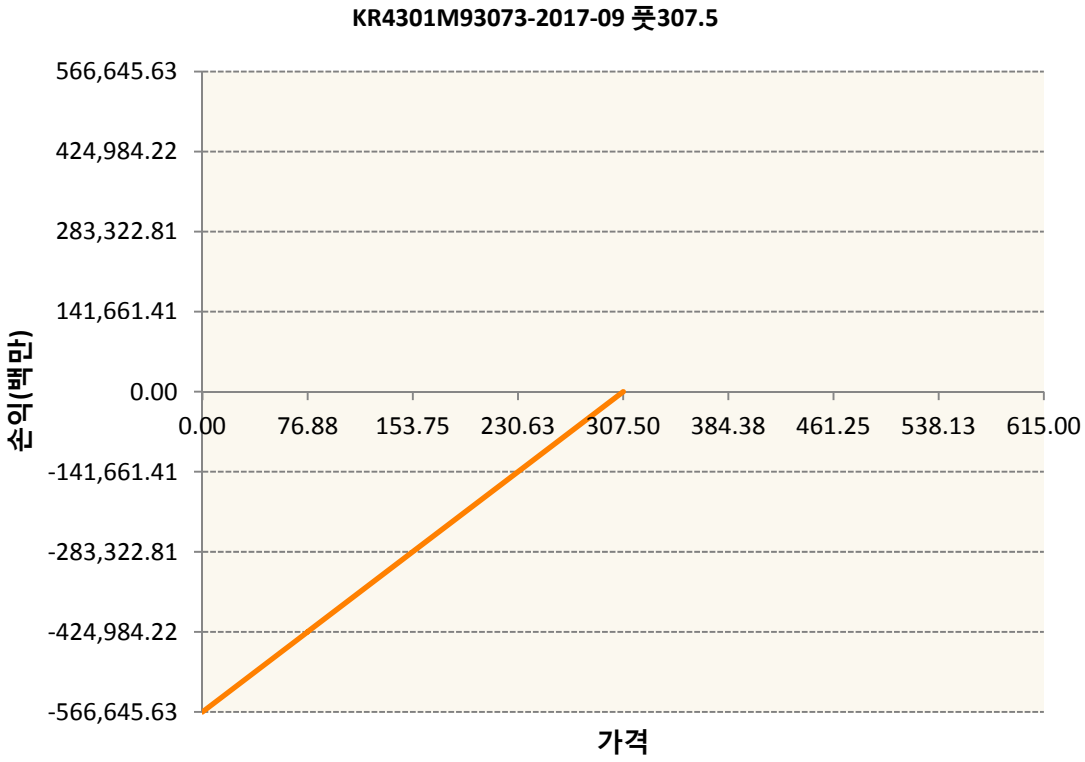
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	23,421	-23,421	장내
누계	유가증권	옵션	0	1,412,316	-1,412,316	장내

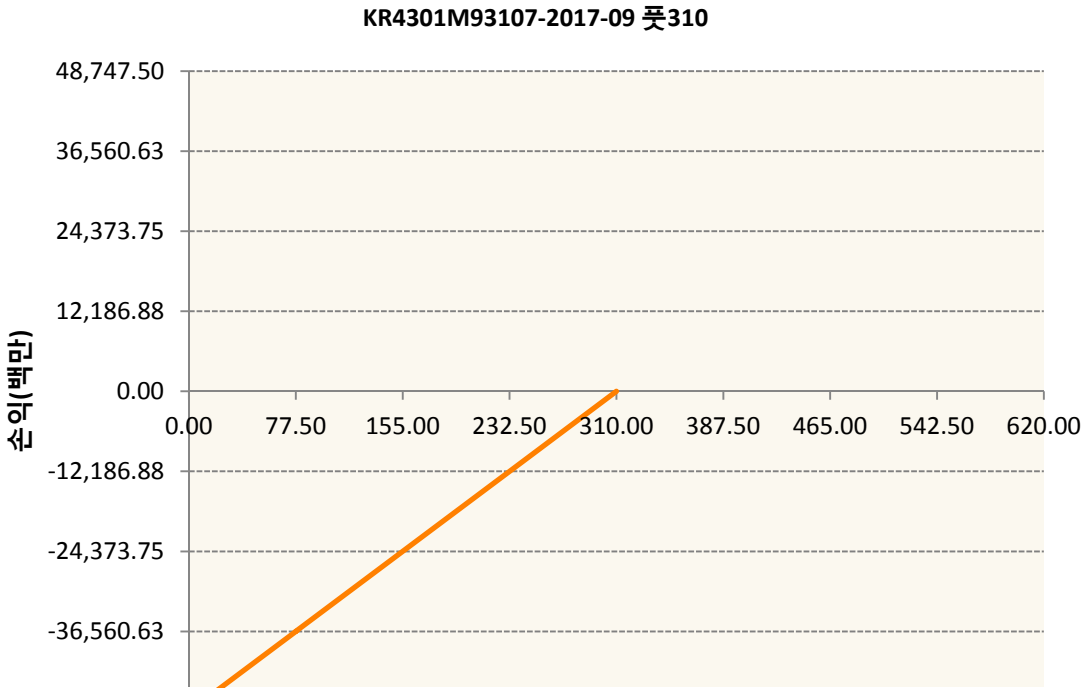
2. 만기시점의 손익구조

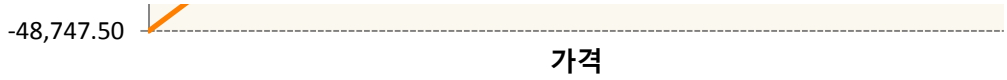





-221,495.00
-332,242.50
-442,990.00
가격


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							21,662
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	8,912	8,701	8,435	8,118	7,757	7,355	6,918
-5.33%	8,085	7,647	7,162	6,640	6,085	5,505	4,903
-2.67%	6,092	5,419	4,728	4,024	3,309	2,586	1,857
0%	2,358	1,572	786	0	-786	-1,572	-2,357
2.67%	-3,326	-4,037	-4,763	-5,500	-6,247	-7,000	-7,758
5.33%	-10,677	-11,186	-11,739	-12,329	-12,947	-13,589	-14,251
8.00%	-19,139	-19,432	-19,786	-20,192	-20,644	-21,136	-21,662
KR4201M93: 2017-09 콜310							25,692
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	9,570	9,366	9,096	8,765	8,376	7,935	7,447
-5.33%	8,808	8,349	7,825	7,246	6,621	5,957	5,261
-2.67%	6,839	6,074	5,276	4,452	3,608	2,747	1,873
0%	2,903	1,938	970	0	-971	-1,944	-2,917
2.67%	-3,423	-4,366	-5,317	-6,275	-7,239	-8,206	-9,177
5.33%	-11,966	-12,692	-13,463	-14,268	-15,101	-15,957	-16,832
8.00%	-22,107	-22,556	-23,078	-23,661	-24,296	-24,976	-25,692
KR4301M93(2017-09 풋307.5							34,150
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-30,958	-31,297	-31,723	-32,229	-32,808	-33,451	-34,150
-5.33%	-17,208	-17,908	-18,684	-19,521	-20,408	-21,337	-22,301
-2.67%	-5,322	-6,400	-7,506	-8,633	-9,777	-10,935	-12,103
0%	3,775	2,517	1,258	0	-1,258	-2,516	-3,774
2.67%	9,751	8,612	7,450	6,269	5,075	3,869	2,655
5.33%	13,057	12,242	11,356	10,413	9,423	8,395	7,335
8.00%	14,585	14,115	13,550	12,899	12,176	11,388	10,546
KR4301M93: 2017-09 풋310							3,040
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-2,806	-2,829	-2,858	-2,895	-2,938	-2,986	-3,040
-5.33%	-1,604	-1,654	-1,712	-1,776	-1,844	-1,917	-1,994
-2.67%	-534	-618	-706	-797	-889	-984	-1,080
0%	319	213	107	0	-107	-214	-321
2.67%	910	806	701	596	490	383	277

5.33%	1,256	1,176	1,091	1,003	911	817	721
8.00%	1,427	1,377	1,320	1,256	1,186	1,111	1,032

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

81,222

공시일	2017-08-17
기준일	2017-08-16

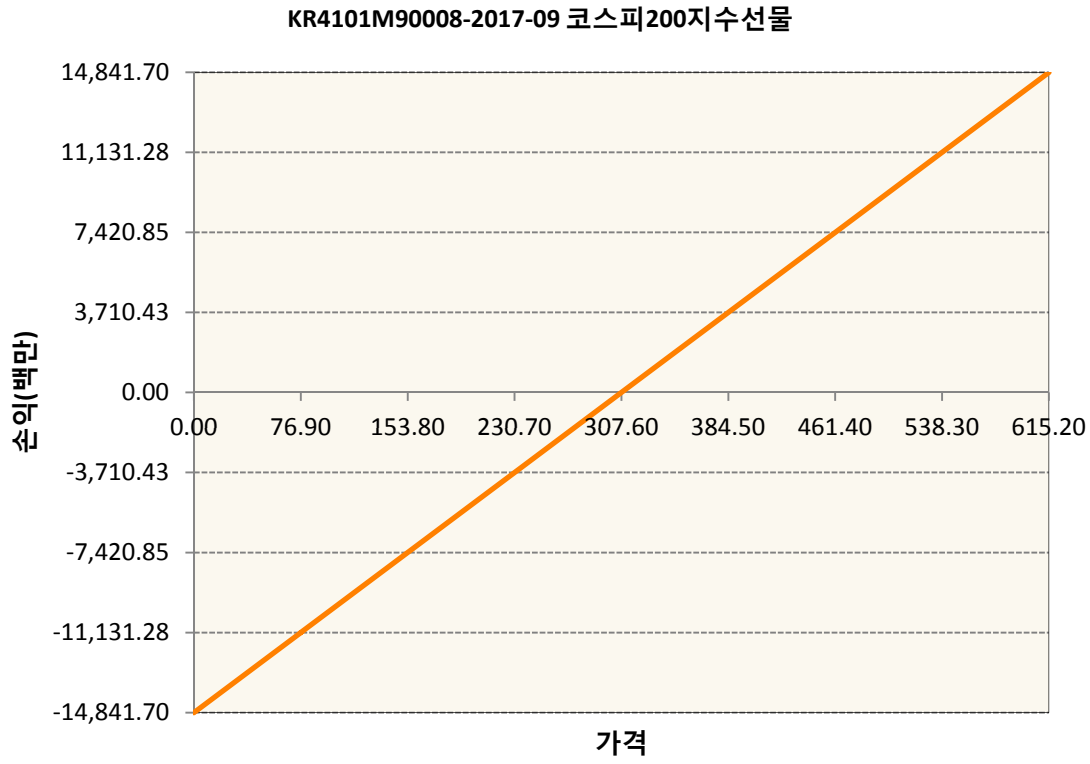
ETF스마트레버리지목표전환형6호

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	14,842	0	14,842	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101M90(2017-09 코스피200지수선물							1,186
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,186	-1,186	-1,186	-1,186	-1,186	-1,186	-1,186
-5.33%	-790	-790	-790	-790	-790	-790	-790
-2.67%	-395	-395	-395	-395	-395	-395	-395
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	395	395	395	395	395	395	395
5.33%	790	790	790	790	790	790	790
8.00%	1,186	1,186	1,186	1,186	1,186	1,186	1,186

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

739

공시일	2017-08-17
기준일	2017-08-16

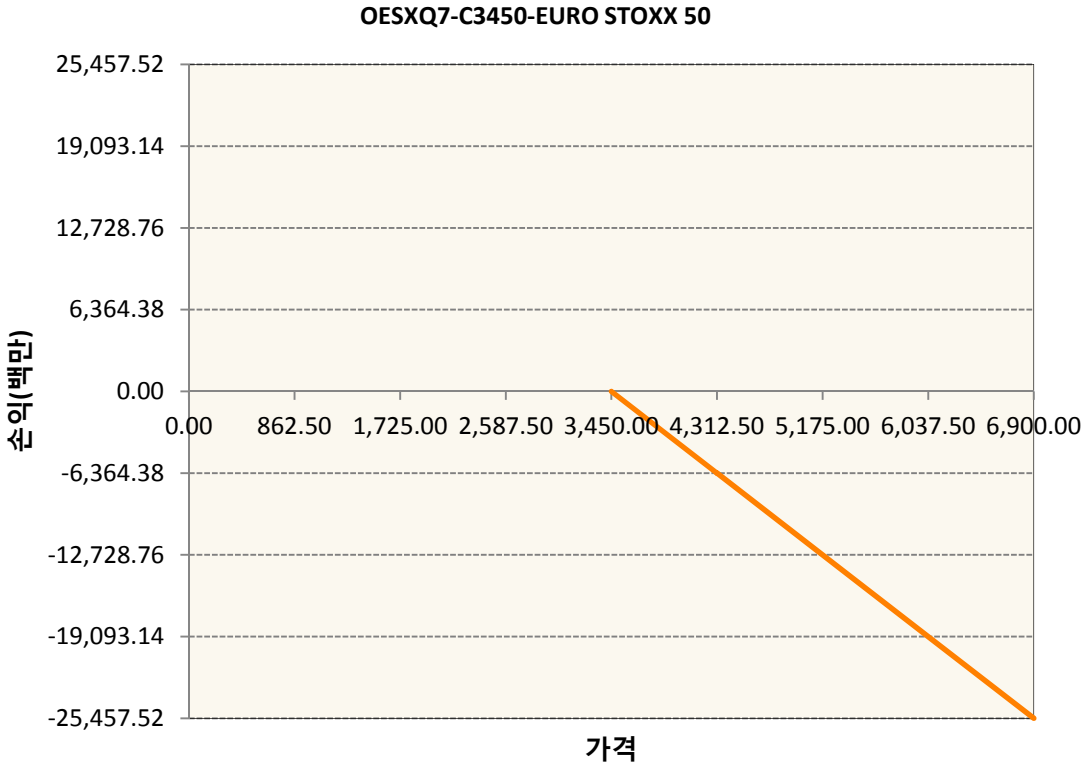
유로커버드콜(주식혼합-파생형)

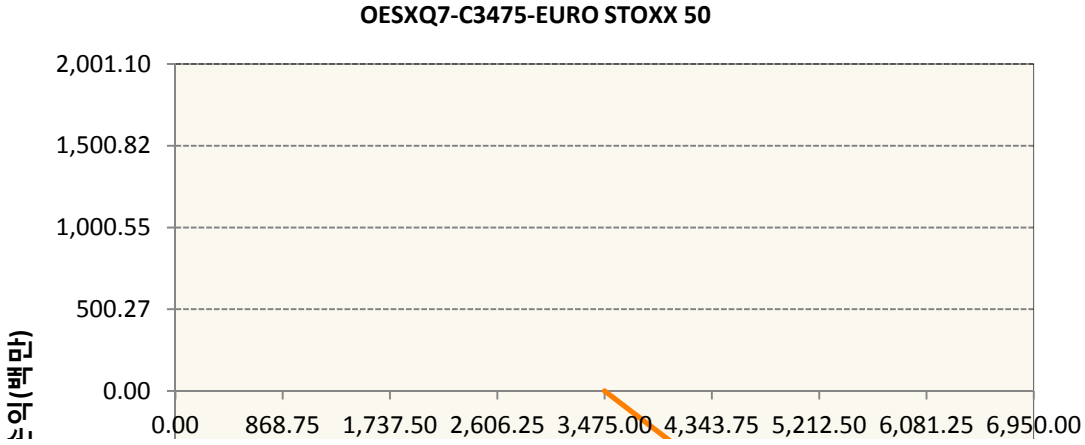
1. 계약금액

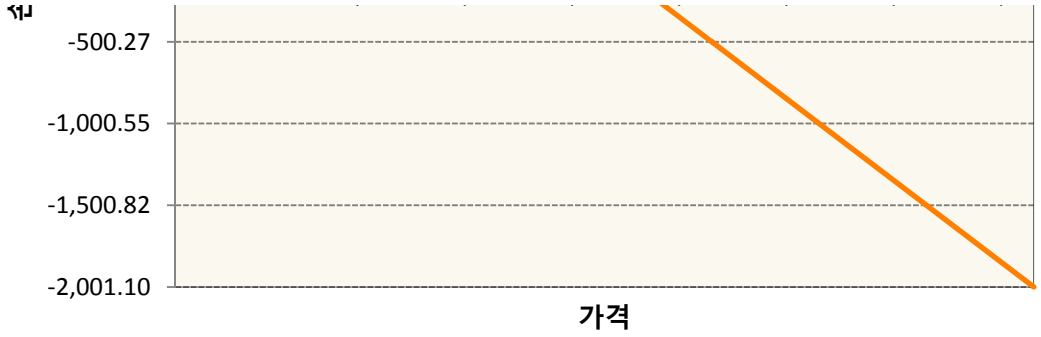
(단위:백만원)

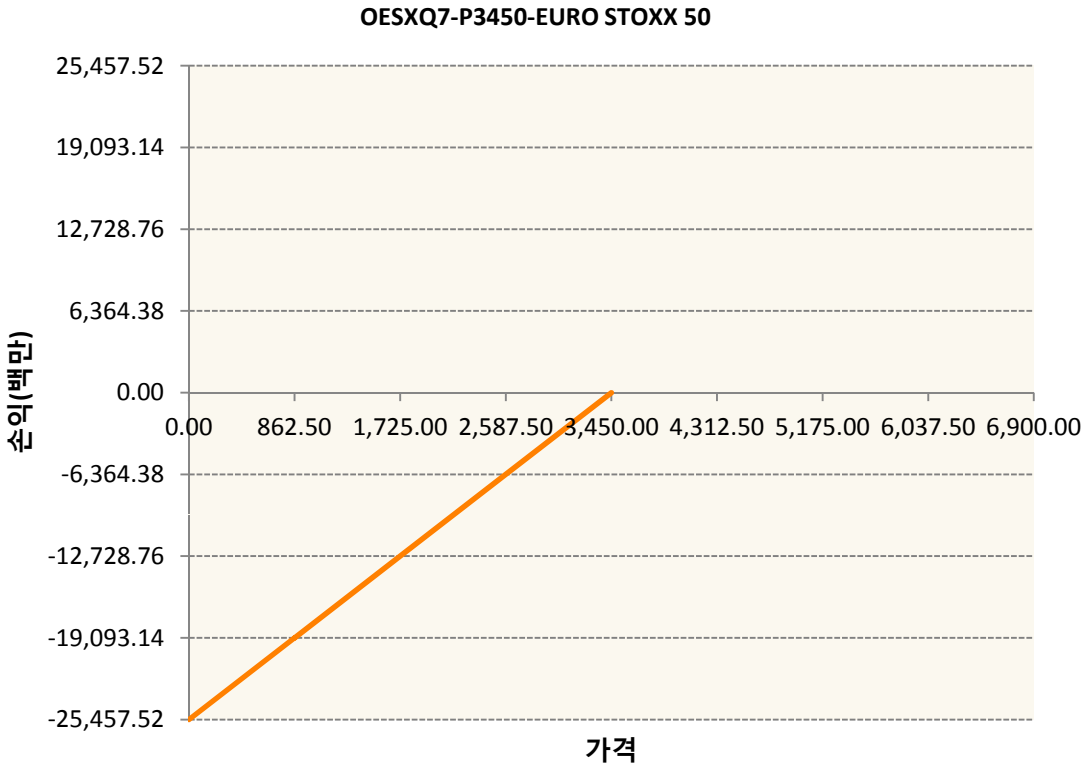
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	24,715	0	24,715	
누계	유가증권	옵션	0	54,917	-54,917	장내

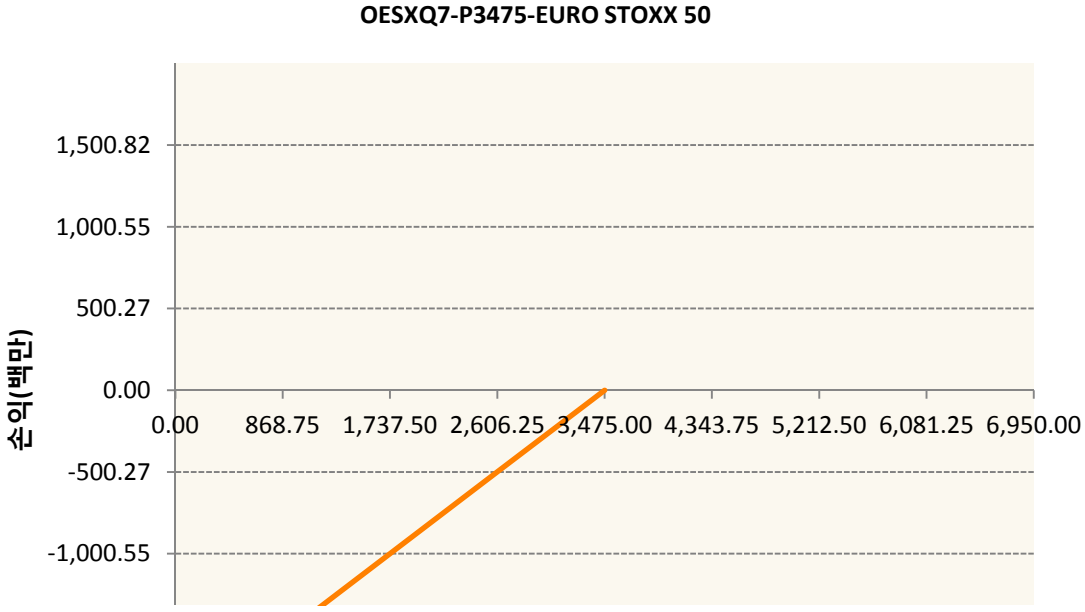
2. 만기시점의 손익구조

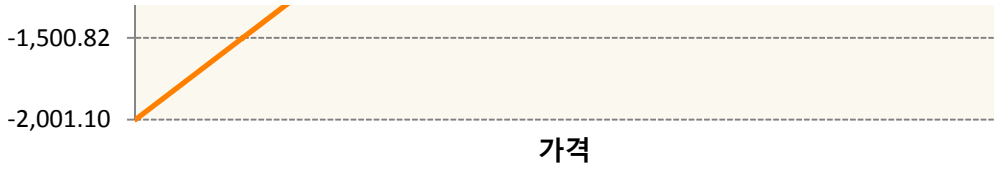


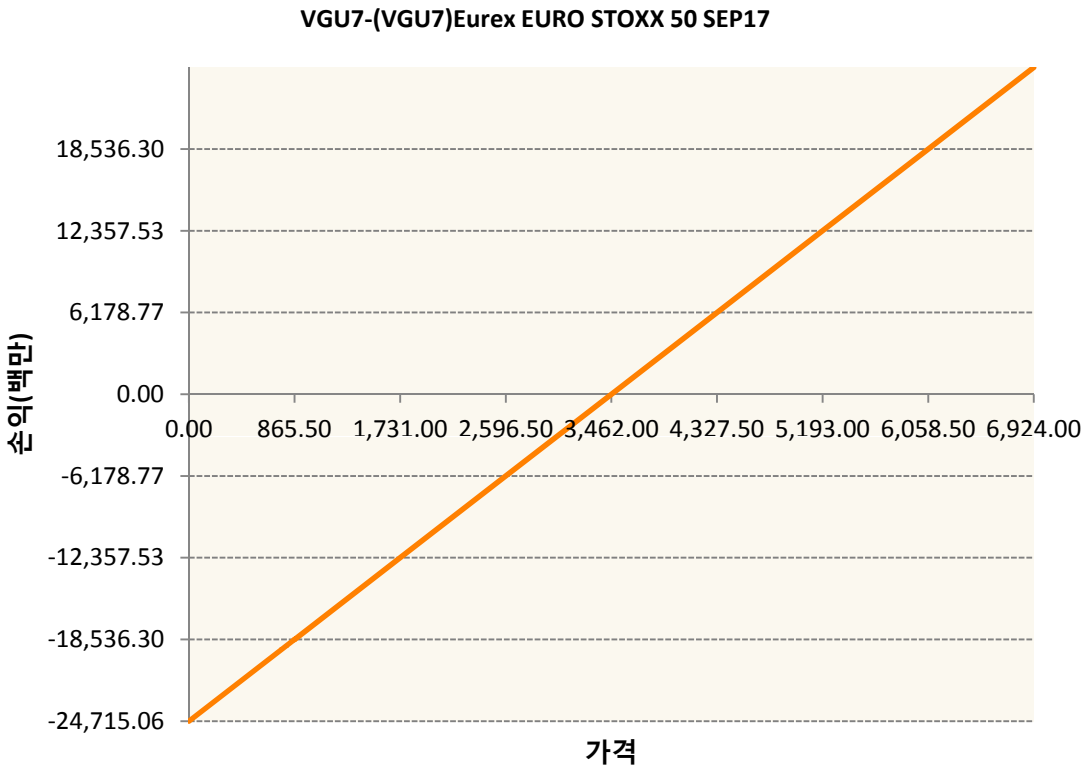



-500.27
-1,000.55
-1,500.82
-2,001.10
가격


OESXQ7-P3450-EURO STOXX 50
25,457.52
19,093.14
12,728.76
6,364.38
0.00
-6,364.38
-12,728.76
-19,093.14
-25,457.52
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
1,500.82
1,000.55
500.27
0.00
-500.27
-1,000.55
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-C34	EURO STOXX 50	2,037
OESXQ7-C34	EURO STOXX 50	160
OESXQ7-P34	EURO STOXX 50	2,037
OESXQ7-P34	EURO STOXX 50	160
VGU7	(VGU7)Eurex EURO STOXX 50 SEP17	1,977

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	5,198

공시일	2017-08-17
기준일	2017-08-16

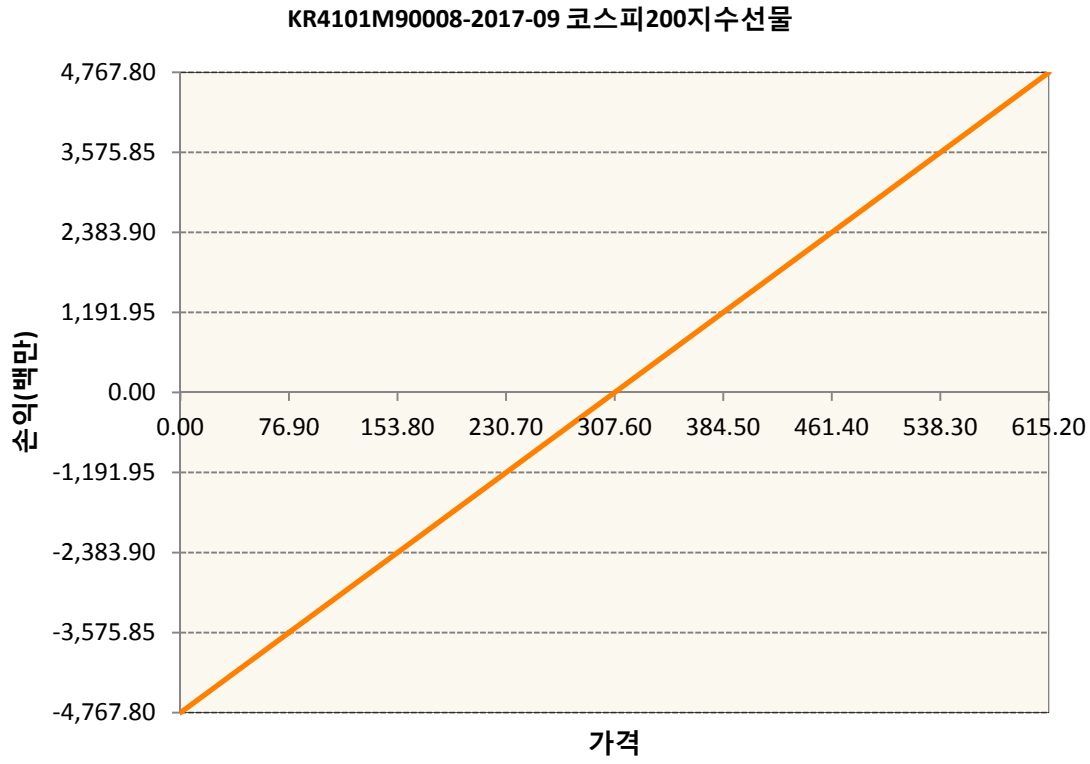
ETF스마트레버리지목표전환형7호

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	4,768	0	4,768	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101M90(2017-09 코스피200지수선물							381
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-381	-381	-381	-381	-381	-381	-381
-5.33%	-254	-254	-254	-254	-254	-254	-254
-2.67%	-127	-127	-127	-127	-127	-127	-127
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	127	127	127	127	127	127	127
5.33%	254	254	254	254	254	254	254
8.00%	381	381	381	381	381	381	381

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

238

공시일	2017-08-17
기준일	2017-08-16

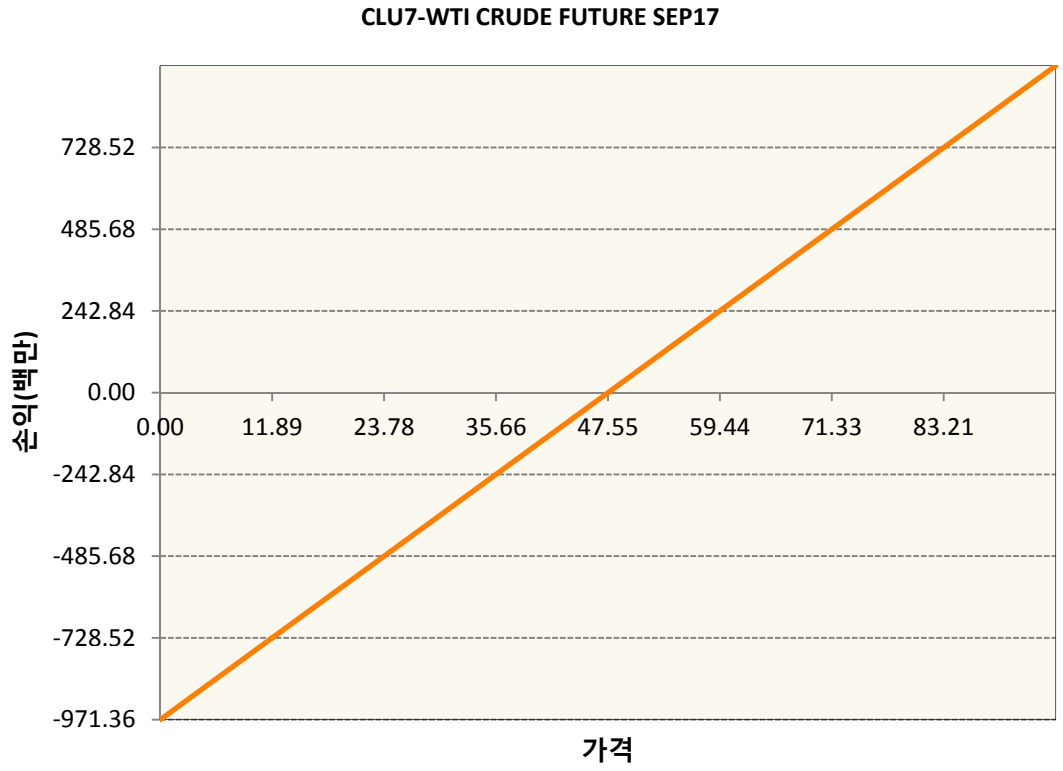
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

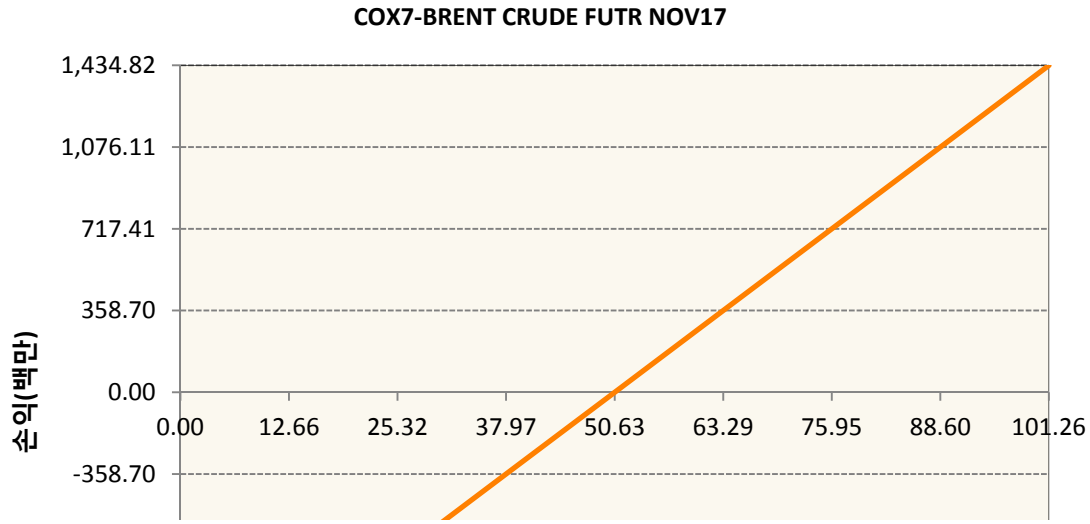
1. 계약금액

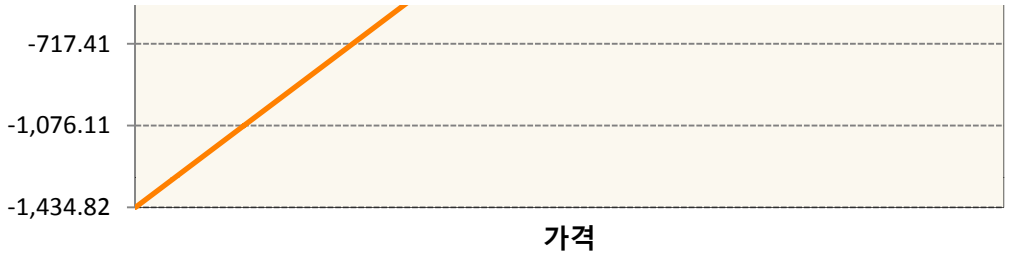
(단위:백만원)

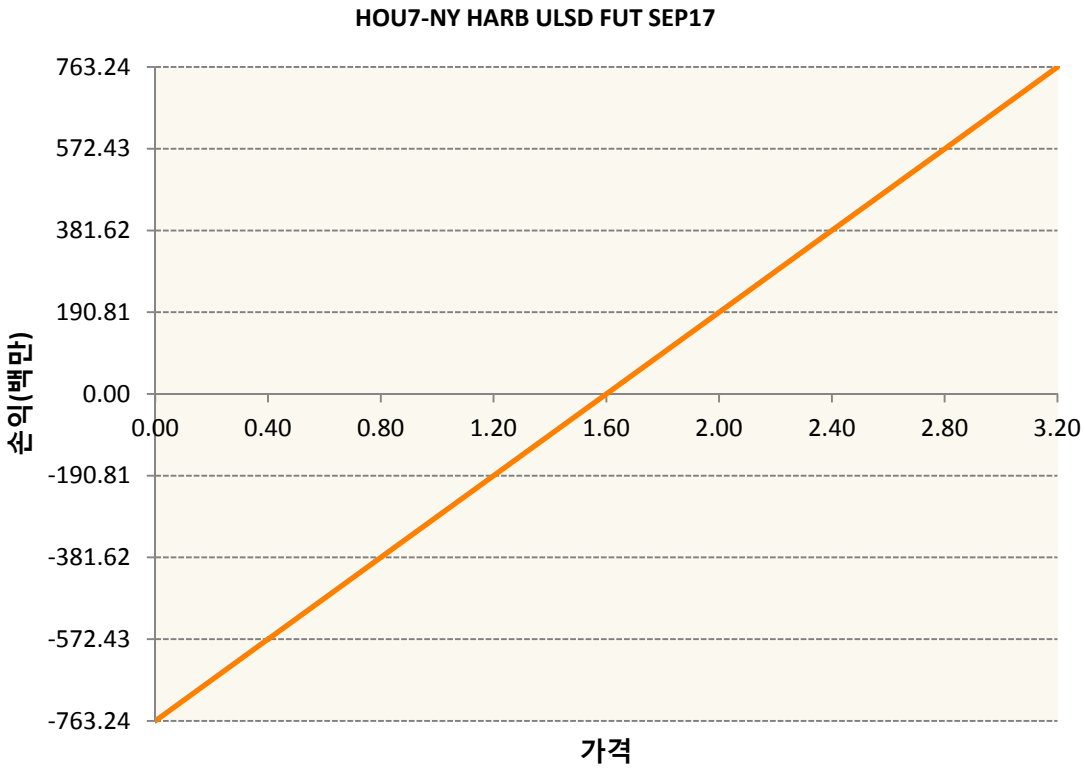
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	5,323	342	4,980	

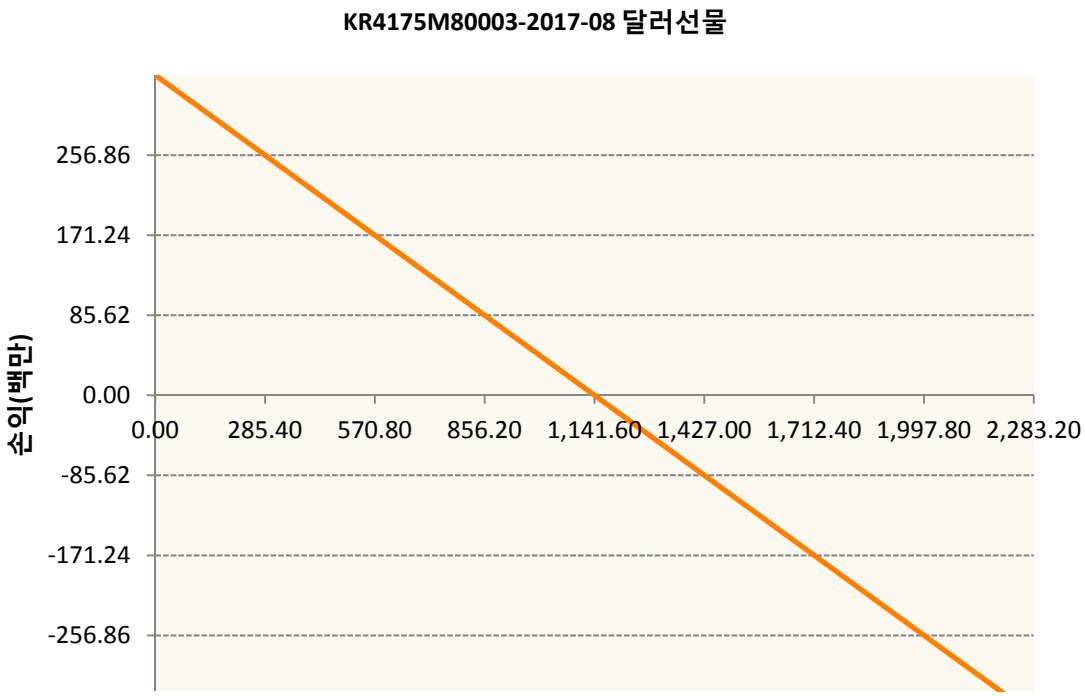
2. 만기시점의 손익구조

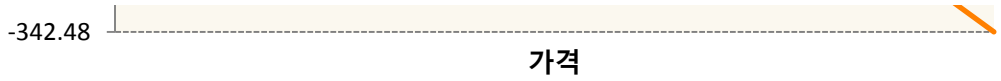


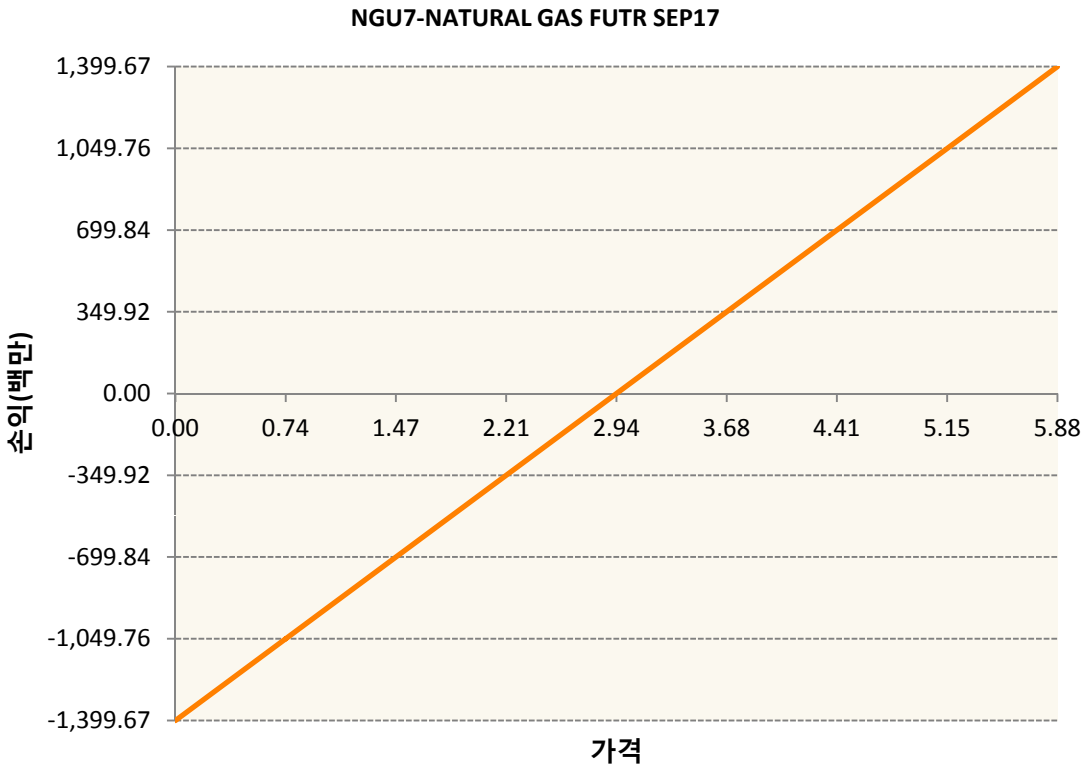


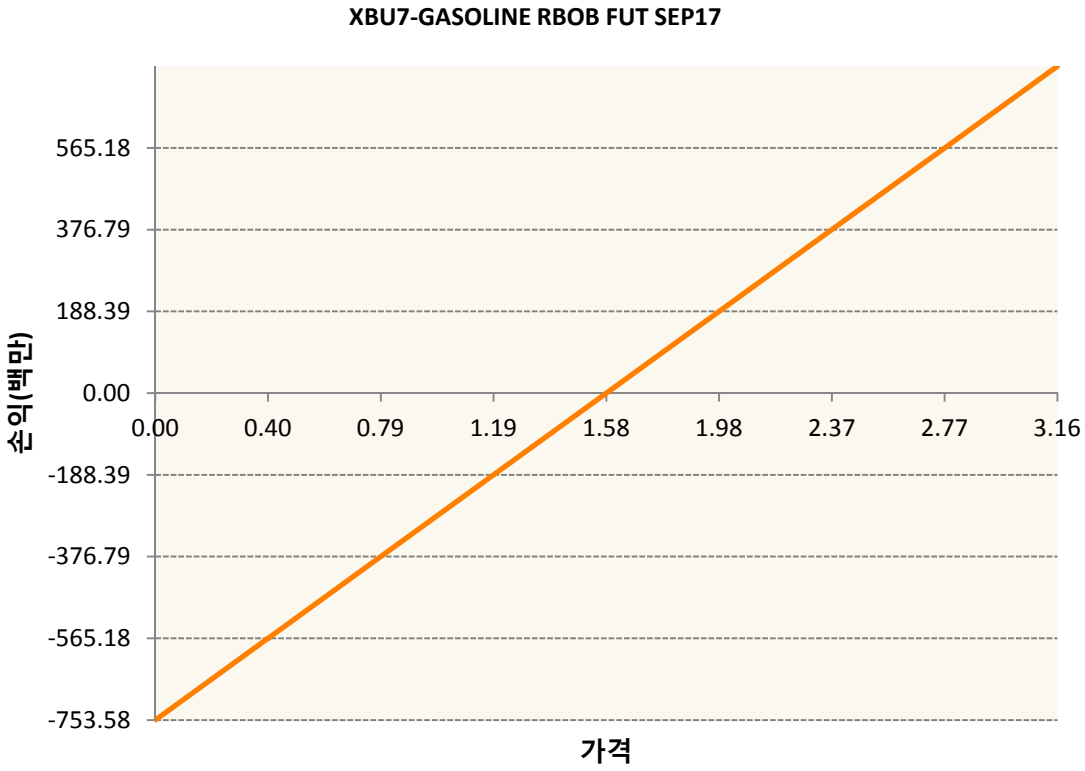

-717.41
-1,076.11
-1,434.82
가격


HOU7-NY HARB ULSD FUT SEP17
763.24
572.43
381.62
190.81
0.00
-190.81
-381.62
-572.43
-763.24
0.00
0.40
0.80
1.20
1.60
2.00
2.40
2.80
3.20
손익(백만)
가격


KR4175M80003-2017-08 달러선물
256.86
171.24
85.62
0.00
-85.62
-171.24
-256.86
0.00
285.40
570.80
856.20
1,141.60
1,427.00
1,712.40
1,997.80
2,283.20
손익(백만)


-342.48
가격


NGU7-NATURAL GAS FUTR SEP17
1,399.67
1,049.76
699.84
349.92
0.00
-349.92
-699.84
-1,049.76
-1,399.67
손익(백만)
0.00
0.74
1.47
2.21
2.94
3.68
4.41
5.15
5.88
가격


XBU7-GASOLINE RBOB FUT SEP17
565.18
376.79
188.39
0.00
-188.39
-376.79
-565.18
-753.58
손익(백만)
0.00
0.40
0.79
1.19
1.58
1.98
2.37
2.77
3.16
가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLU7	WTI CRUDE FUTURE SEP17	78
COX7	BRENT CRUDE FUTR NOV17	115
HOU7	NY HARB ULSD FUT SEP17	61
KR4175M80(	2017-08 달러선물	27
NGU7	NATURAL GAS FUTR SEP17	112
XBU7	GASOLINE RBOB FUT SEP17	60

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

764

공시일	2017-08-17
기준일	2017-08-16

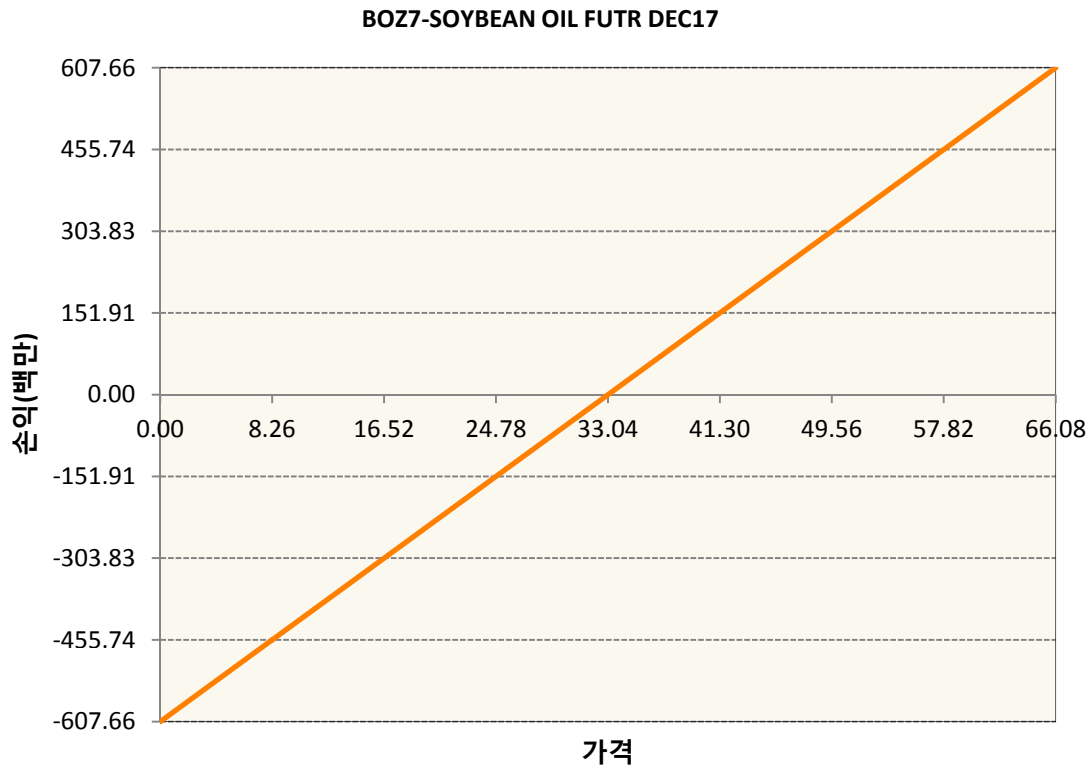
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

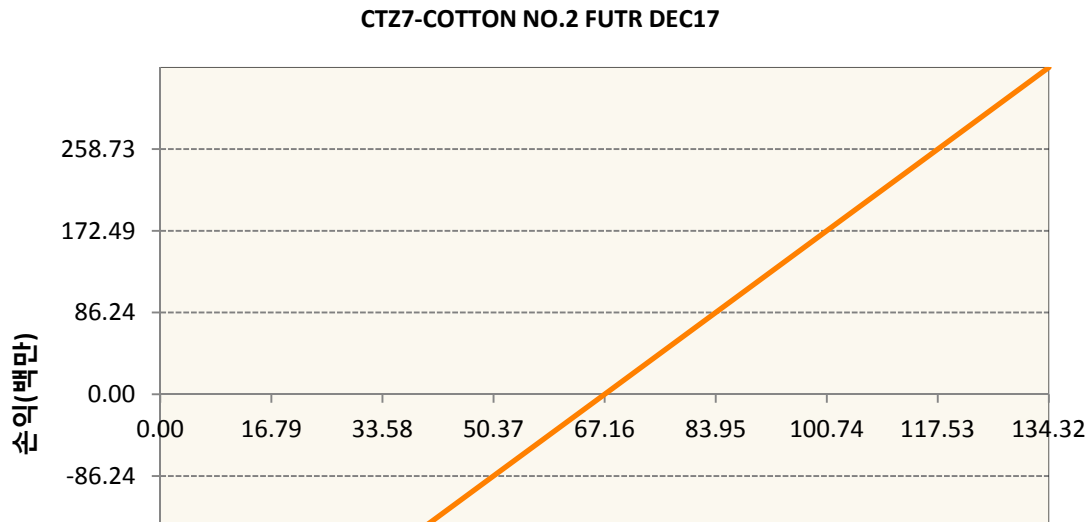
1. 계약금액

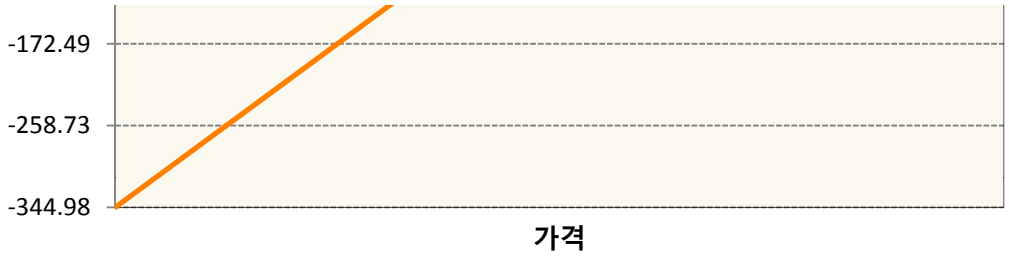
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	6,784	400	6,384	

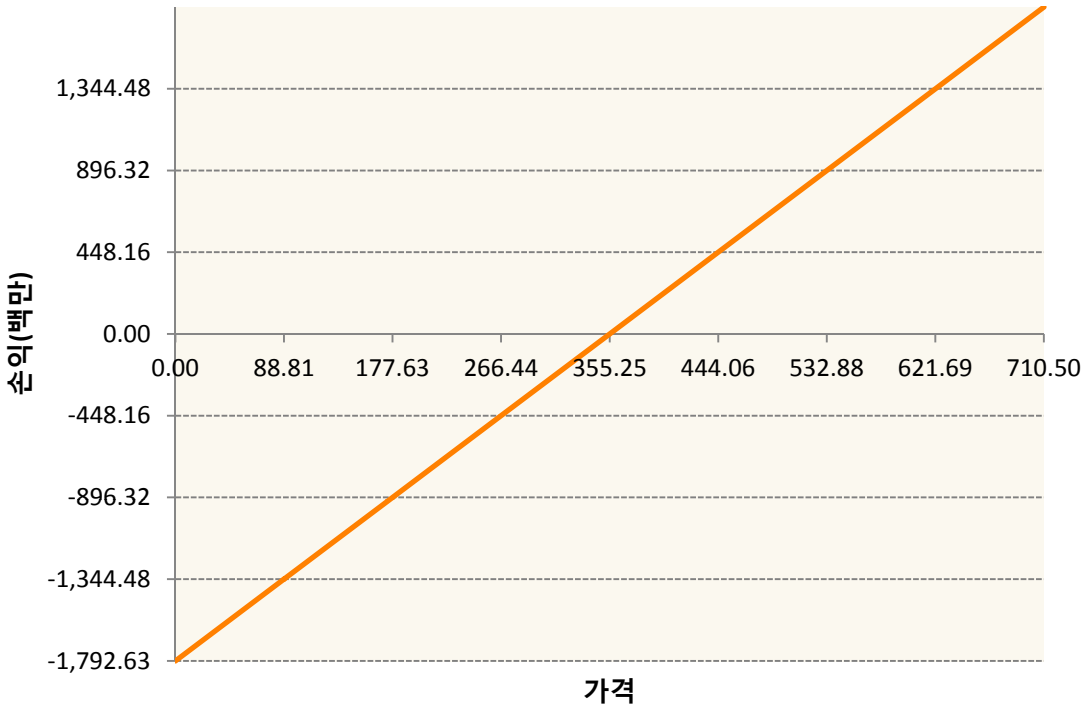
2. 만기시점의 손익구조



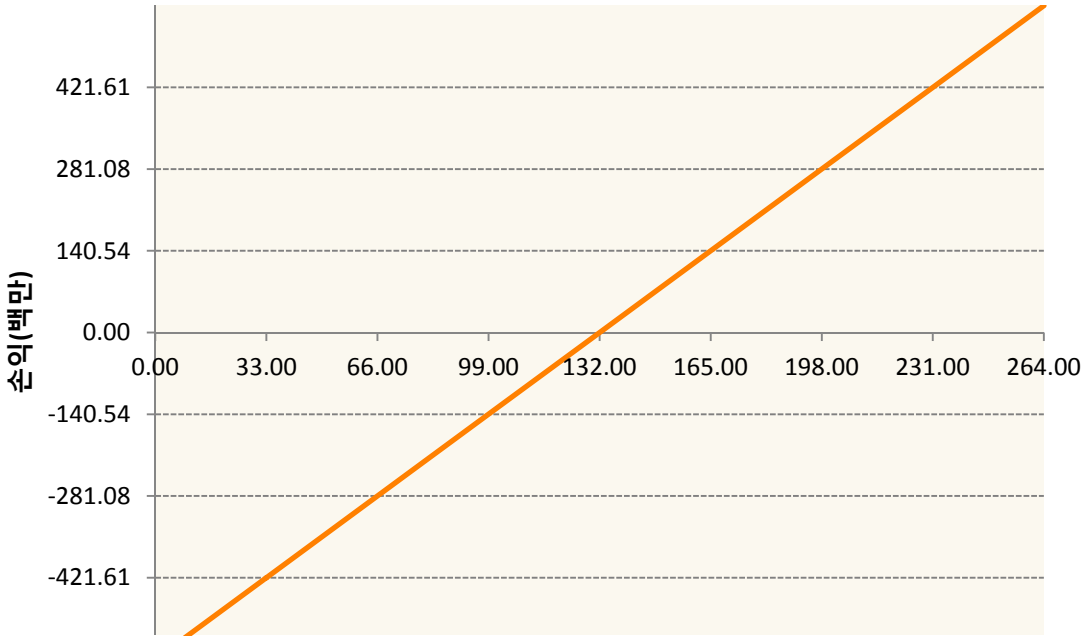


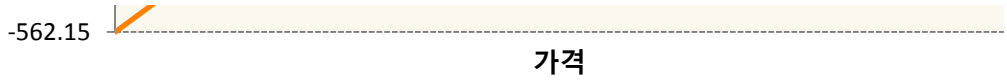


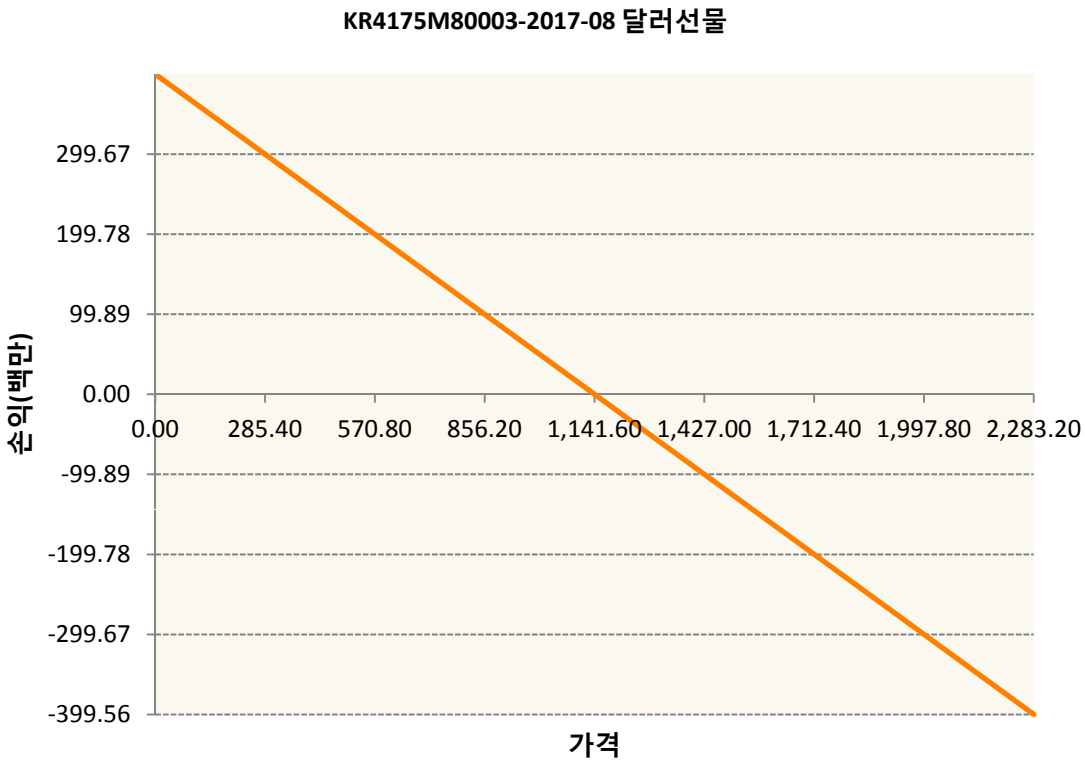
CU7-CORN FUTURE SEP17

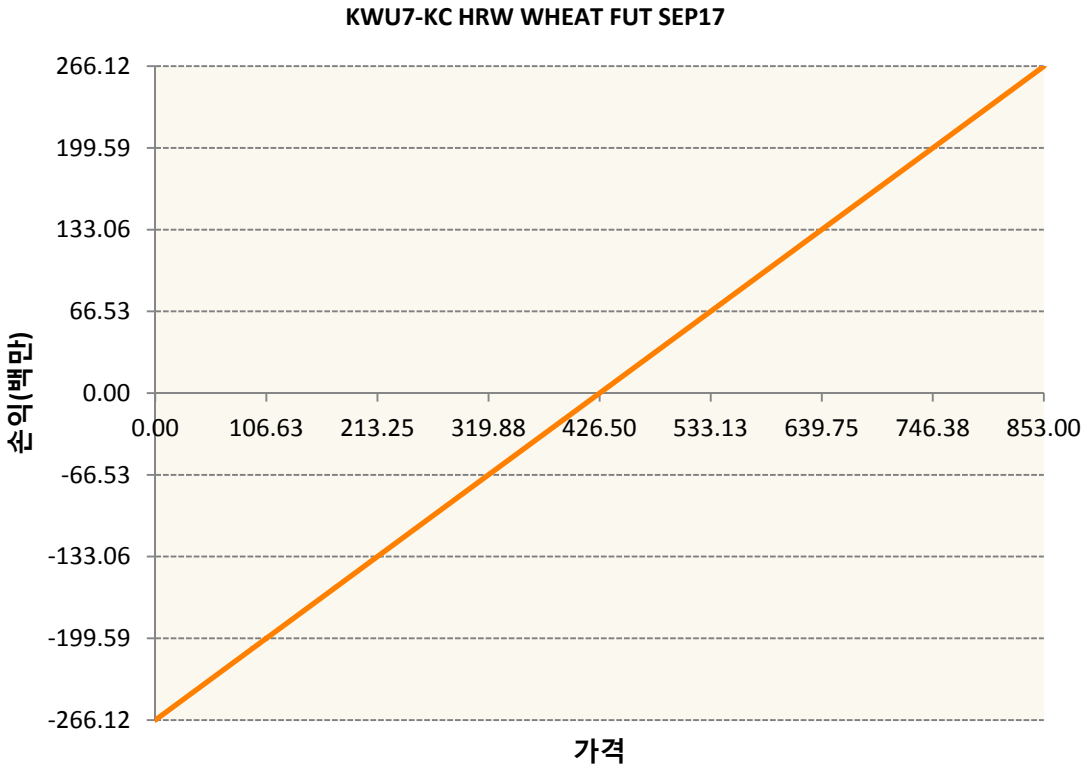


KCU7-COFFEE 'C' FUTURE SEP17

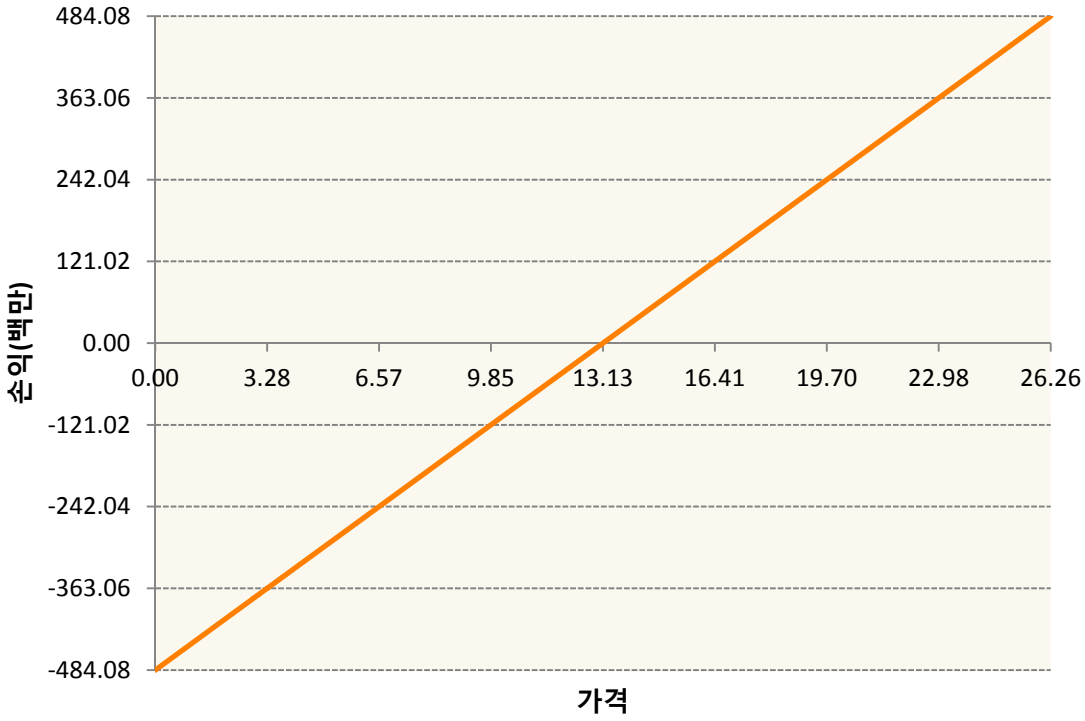



-562.15
가격

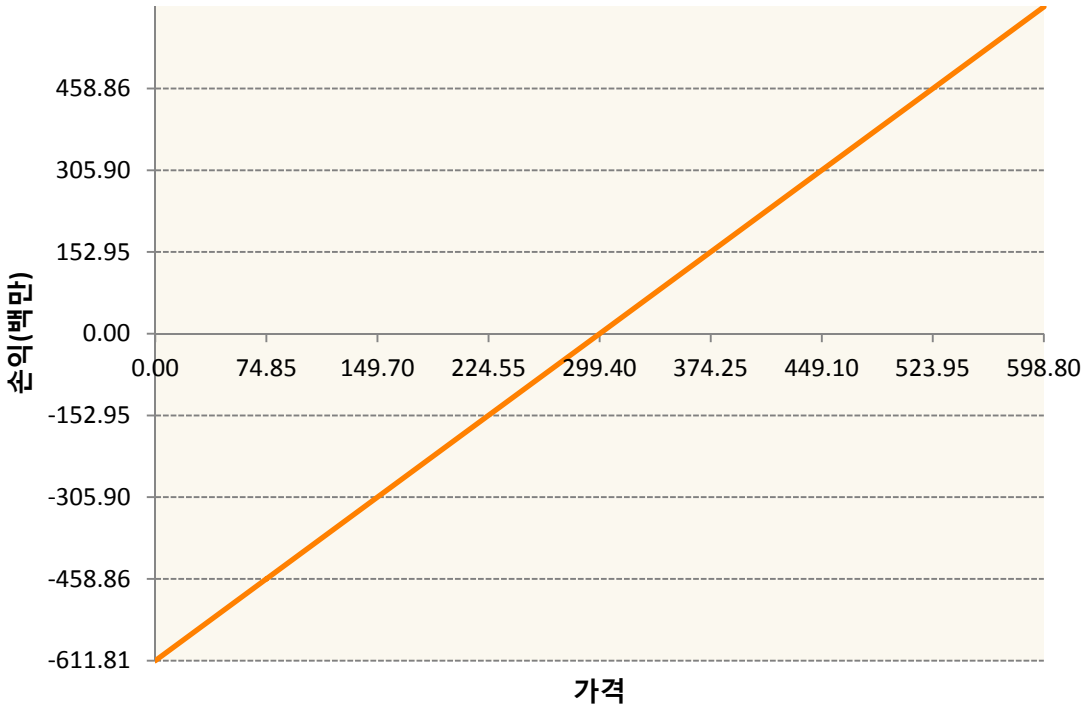

KR4175M80003-2017-08 달러선물
299.67
199.78
99.89
0.00
-99.89
-199.78
-299.67
-399.56
0.00
285.40
570.80
856.20
1,141.60
1,427.00
1,712.40
1,997.80
2,283.20
손익(백만)
가격


KWU7-KC HRW WHEAT FUT SEP17
266.12
199.59
133.06
66.53
0.00
-66.53
-133.06
-199.59
-266.12
0.00
106.63
213.25
319.88
426.50
533.13
639.75
746.38
853.00
손익(백만)
가격

SBV7-SUGAR #11 (WORLD) OCT17

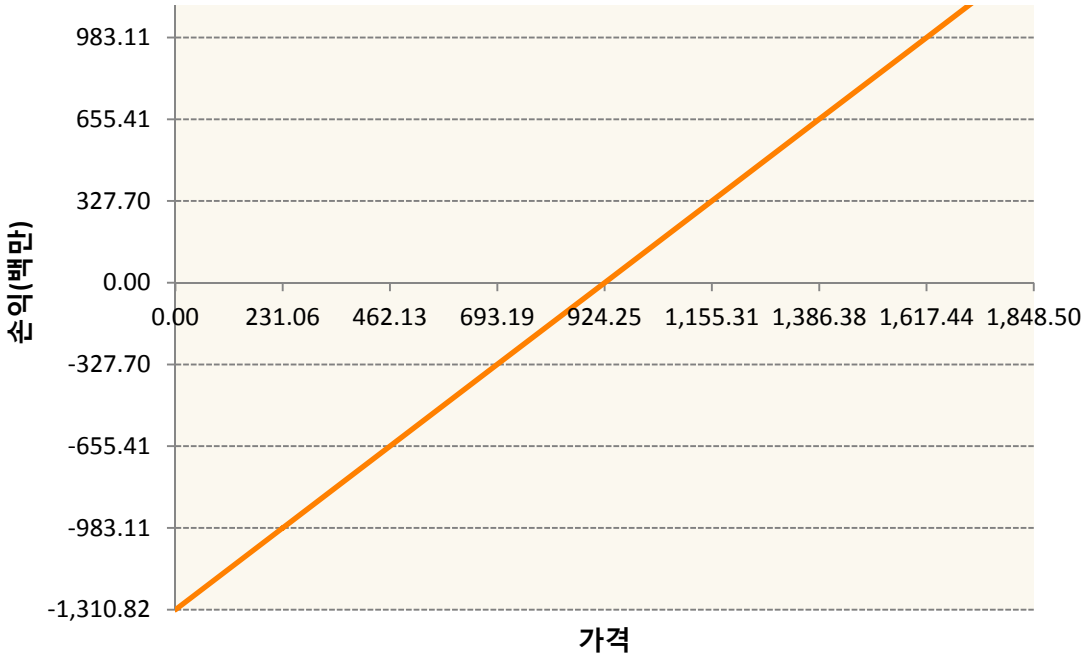


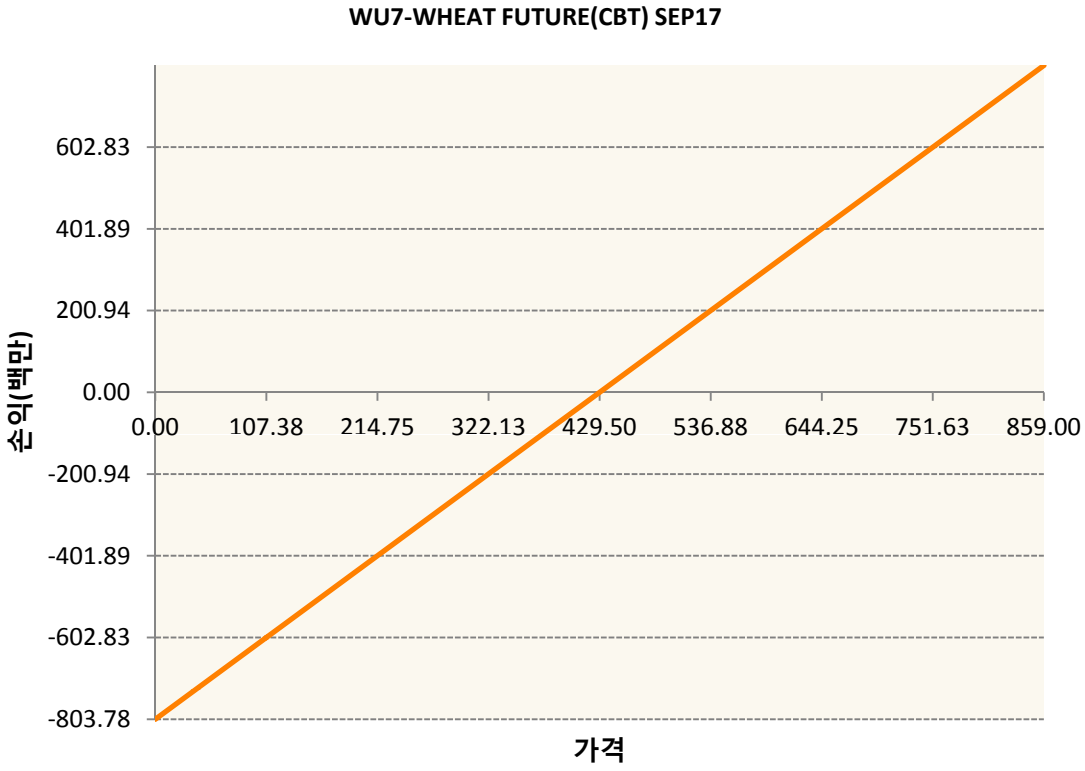
SMZ7-SOYBEAN MEAL FUTR DEC17



SX7-SOYBEAN FUTURE NOV17







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
BOZ7	SOYBEAN OIL FUTR DEC17	49
CTZ7	COTTON NO.2 FUTR DEC17	28
CU7	CORN FUTURE SEP17	143
KCU7	COFFEE 'C' FUTURE SEP17	45
KR4175M80(	2017-08 달러선물	32

KWU7	KC HRW WHEAT FUT SEP17	21
SBV7	SUGAR #11 (WORLD) OCT17	39
SMZ7	SOYBEAN MEAL FUTR DEC17	49
SX7	SOYBEAN FUTURE NOV17	105
WU7	WHEAT FUTURE(CBT) SEP17	64

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

643