공시일	2017-08-21
기준일	2017-08-18

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	2017-08-21
기준일	2017-08-18

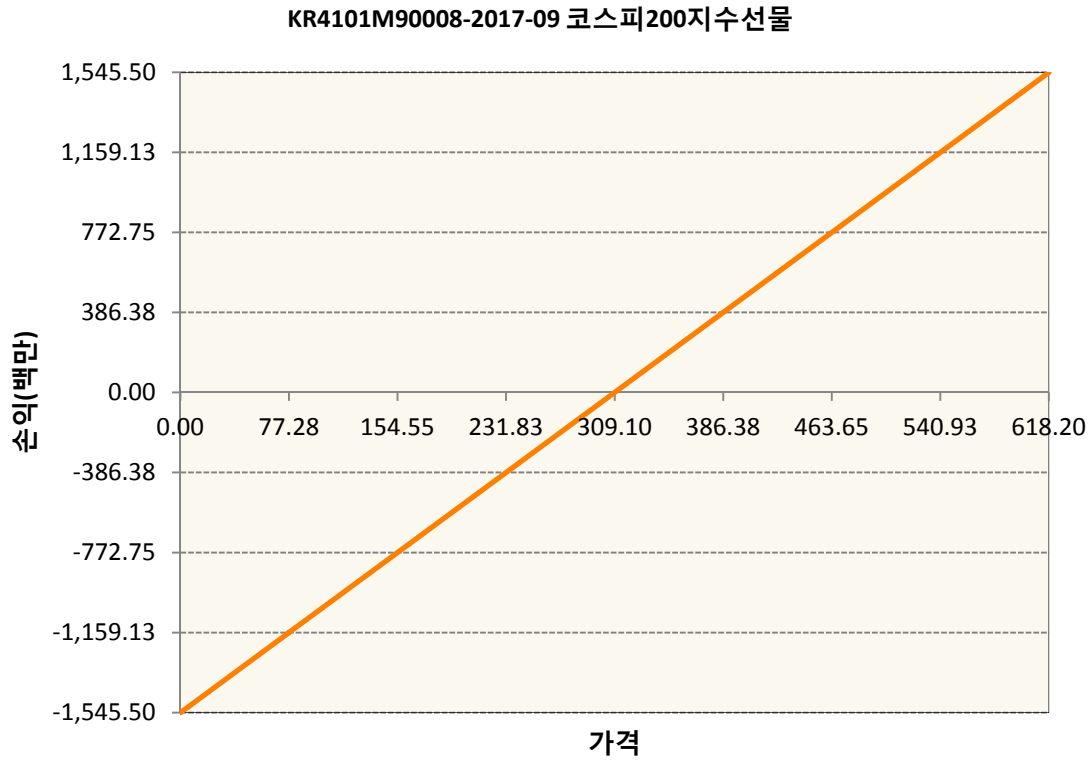
스마트인덱스모

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	1,546	0	1,546	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	2017-08-21
기준일	2017-08-18

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	2017-08-21
기준일	2017-08-18

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	401

* 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	2017-08-21
기준일	2017-08-18

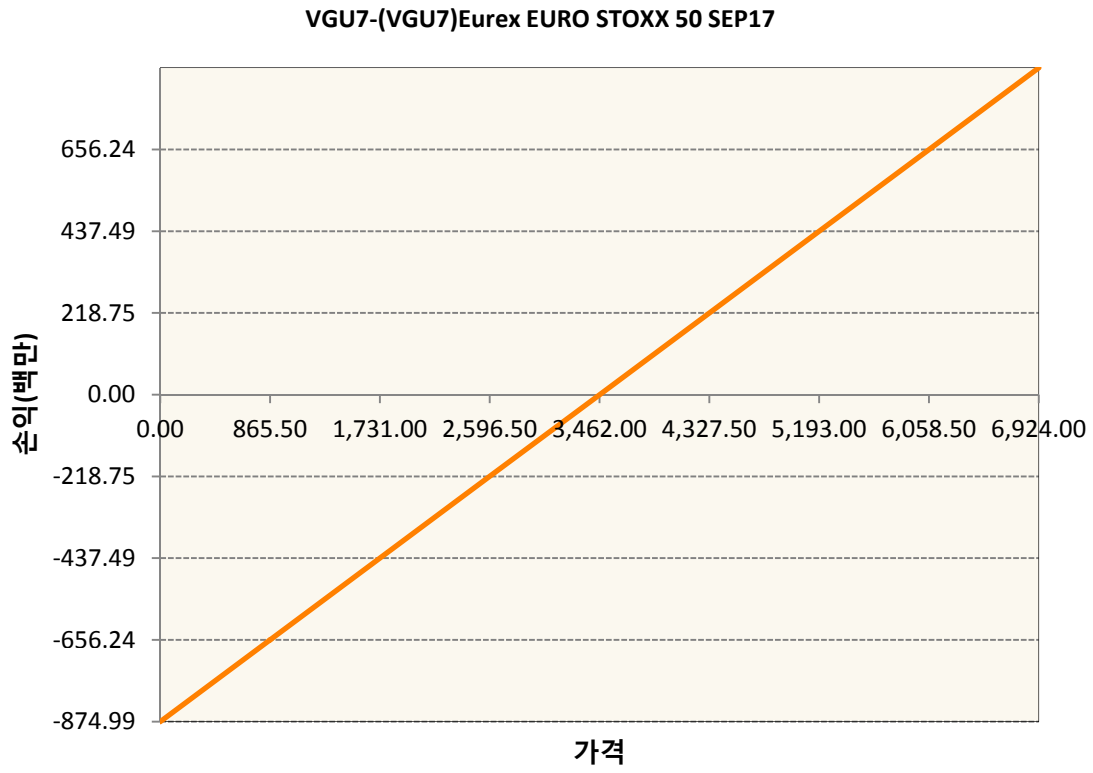
유로인덱스모(주식-파생형)

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	2017-08-21
기준일	2017-08-18

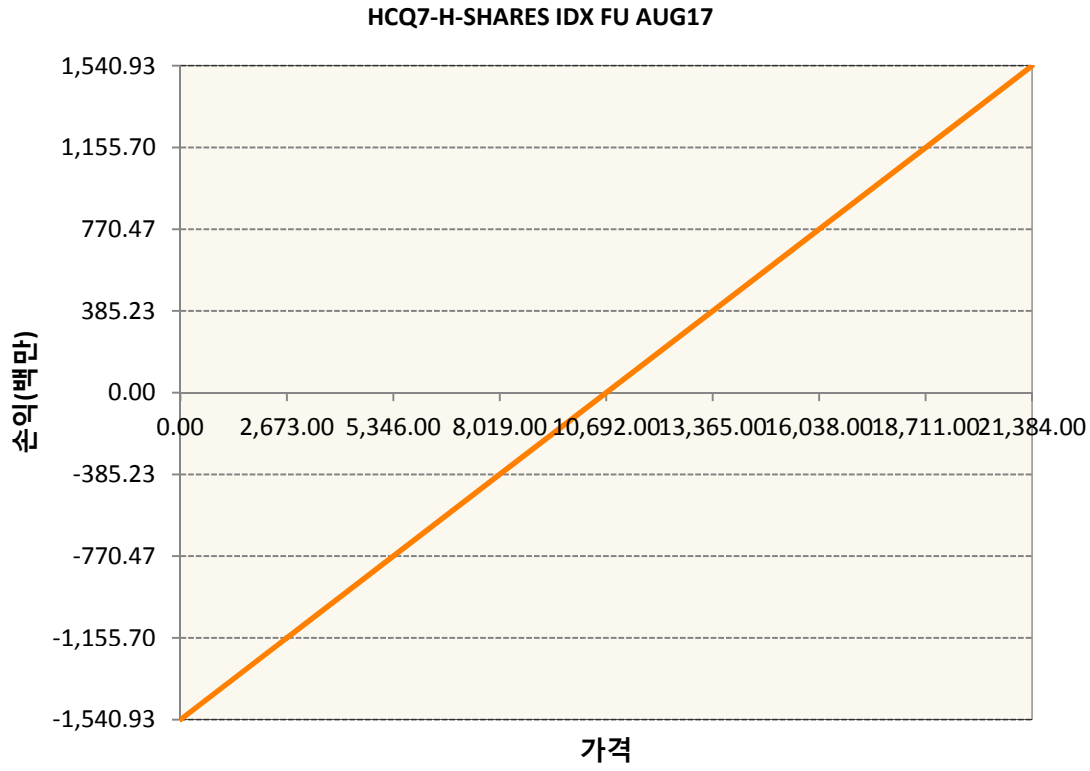
차이나인덱스모(주식-파생형)

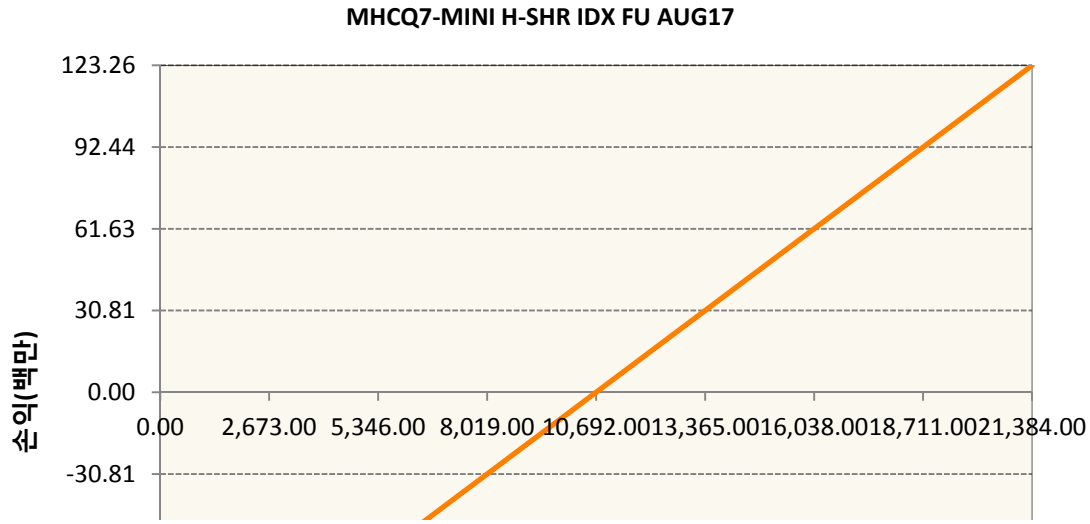
1. 계약금액

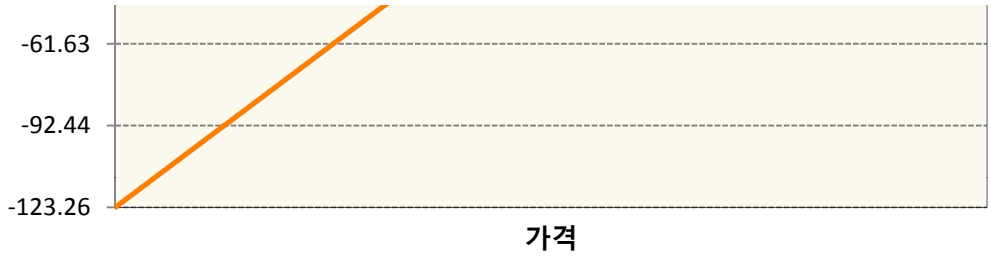
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,664	0	1,664	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)
	115

공시일	2017-08-21
기준일	2017-08-18

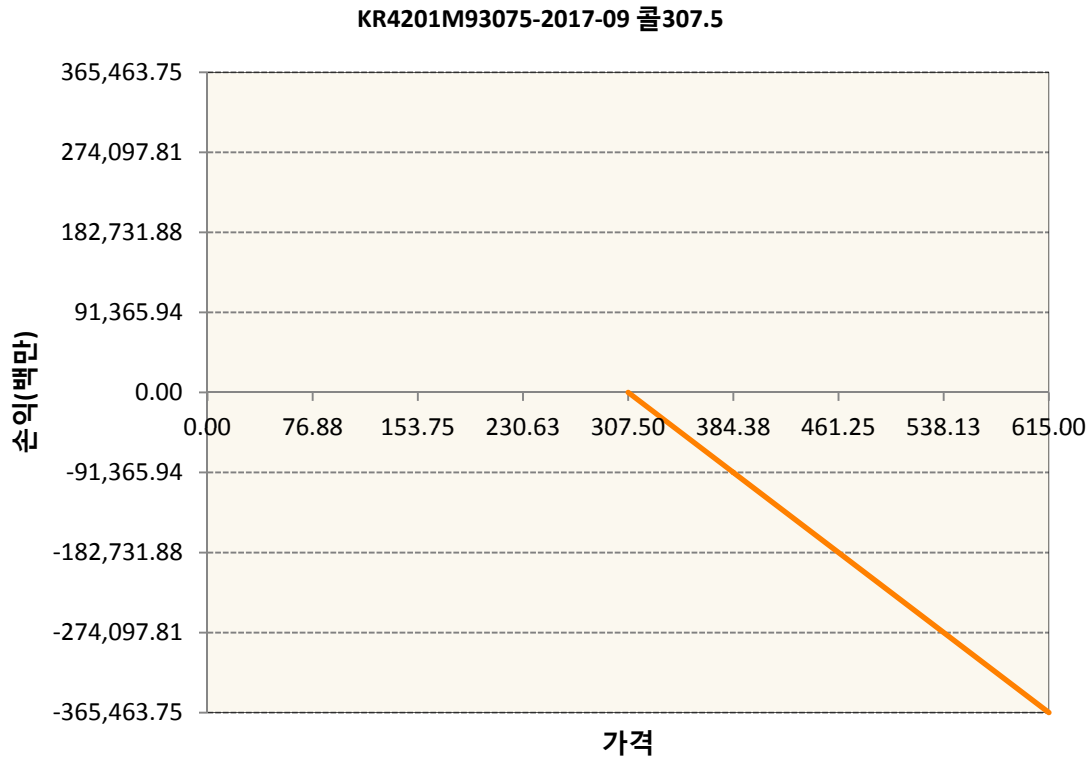
커버드콜모(주식혼합-파생형)

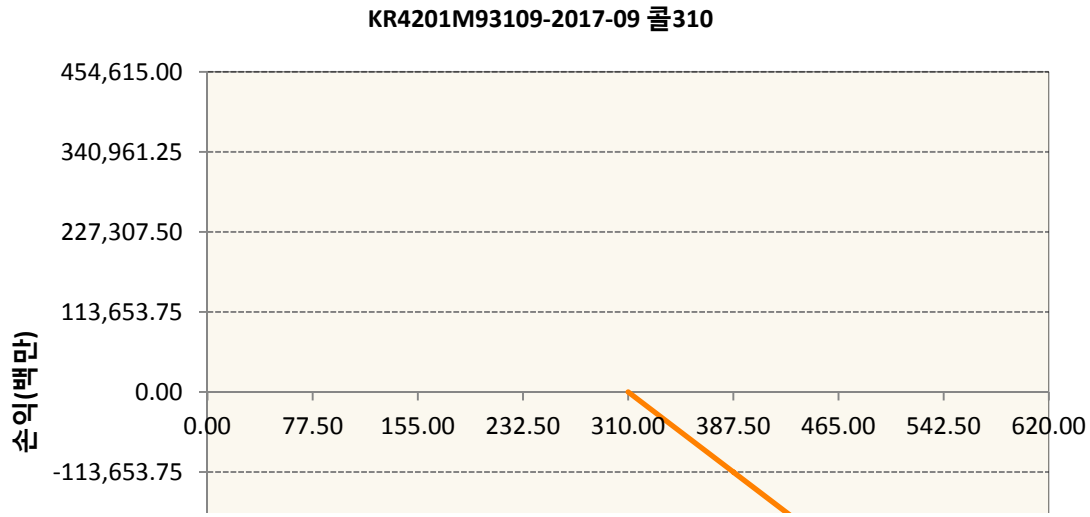
1. 계약금액

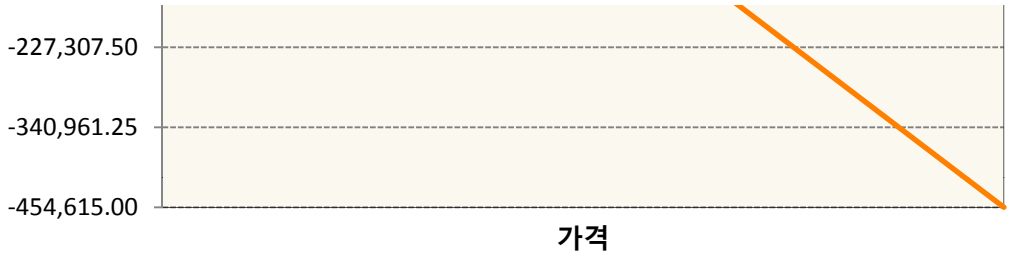
(단위:백만원)

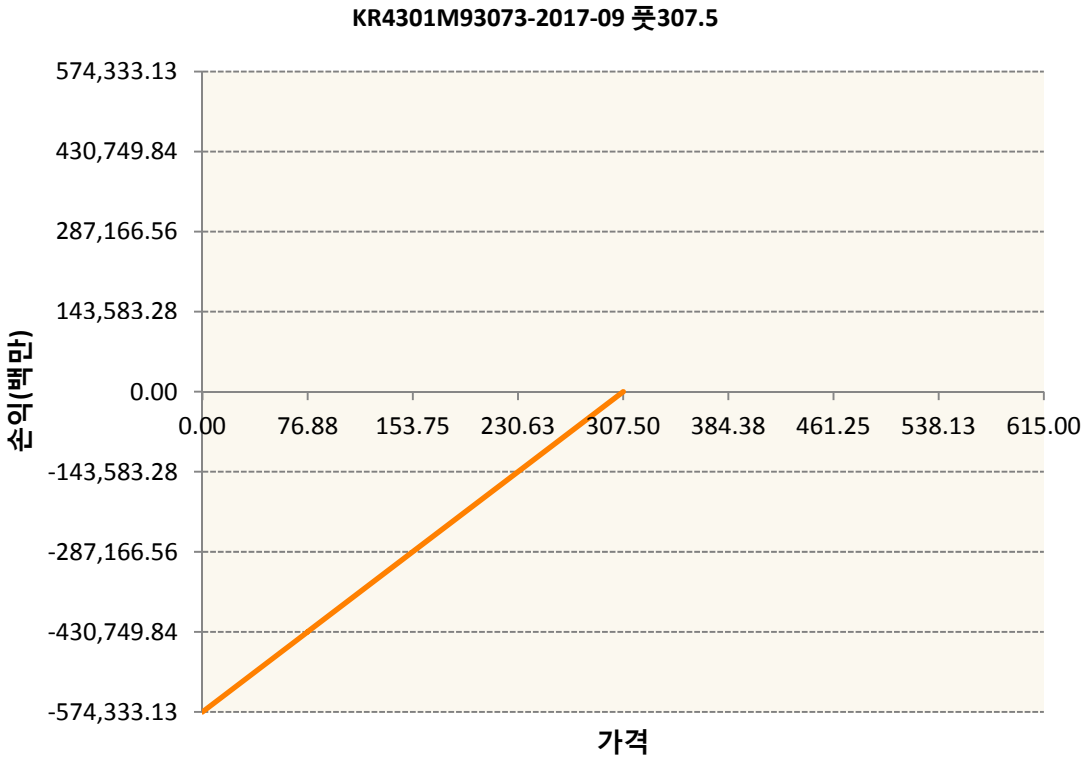
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	15,635	-15,635	장내
누계	유가증권	옵션	0	1,450,909	-1,450,909	장내

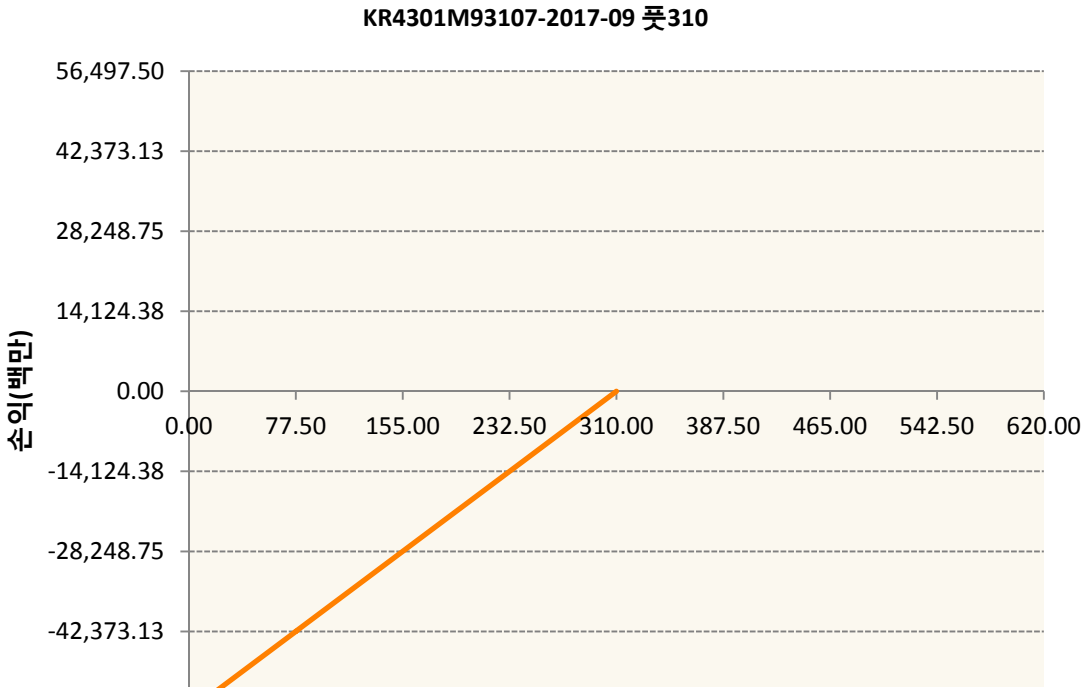
2. 만기시점의 손익구조

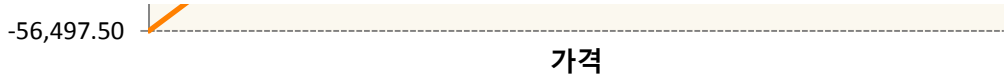





-227,307.50
-340,961.25
-454,615.00
가격


KR4301M93073-2017-09 풋307.5
574,333.13
430,749.84
287,166.56
143,583.28
0.00
-143,583.28
-287,166.56
-430,749.84
-574,333.13
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
56,497.50
42,373.13
28,248.75
14,124.38
0.00
-14,124.38
-28,248.75
-42,373.13
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							23,044
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	9,415	9,216	8,964	8,663	8,318	7,934	7,515
-5.33%	8,562	8,130	7,653	7,139	6,596	6,027	5,438
-2.67%	6,407	5,736	5,051	4,354	3,649	2,938	2,220
0%	2,292	1,528	764	0	-764	-1,528	-2,293
2.67%	-3,960	-4,613	-5,286	-5,976	-6,677	-7,389	-8,109
5.33%	-11,933	-12,362	-12,840	-13,359	-13,913	-14,494	-15,100
8.00%	-20,956	-21,176	-21,454	-21,786	-22,164	-22,585	-23,044
KR4201M93: 2017-09 콜310							27,181
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	9,988	9,801	9,552	9,243	8,878	8,463	8,002
-5.33%	9,223	8,777	8,268	7,706	7,100	6,457	5,782
-2.67%	7,128	6,370	5,582	4,772	3,944	3,101	2,247
0%	2,830	1,888	944	0	-945	-1,890	-2,835
2.67%	-4,101	-4,979	-5,872	-6,775	-7,687	-8,605	-9,529
5.33%	-13,358	-13,984	-14,663	-15,383	-16,138	-16,920	-17,725
8.00%	-24,162	-24,512	-24,933	-25,419	-25,960	-26,550	-27,181
KR4301M93(2017-09 풋307.5							34,218
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-31,231	-31,544	-31,940	-32,413	-32,956	-33,559	-34,218
-5.33%	-17,230	-17,909	-18,658	-19,465	-20,320	-21,213	-22,139
-2.67%	-5,274	-6,328	-7,405	-8,499	-9,607	-10,726	-11,853
0%	3,602	2,401	1,201	0	-1,201	-2,402	-3,603
2.67%	9,120	8,094	7,035	5,952	4,849	3,730	2,599
5.33%	11,932	11,258	10,507	9,690	8,821	7,907	6,955
8.00%	13,095	12,749	12,312	11,791	11,196	10,534	9,814
KR4301M93: 2017-09 풋310							3,497
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-3,250	-3,273	-3,304	-3,343	-3,388	-3,440	-3,497
-5.33%	-1,848	-1,903	-1,967	-2,036	-2,112	-2,192	-2,276
-2.67%	-611	-705	-803	-904	-1,007	-1,112	-1,218
0%	352	235	117	0	-117	-235	-352
2.67%	987	878	767	655	542	428	313

5.33%	1,334	1,256	1,172	1,082	989	891	791
8.00%	1,488	1,445	1,393	1,332	1,265	1,192	1,113

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

85,709

공시일	2017-08-21
기준일	2017-08-18

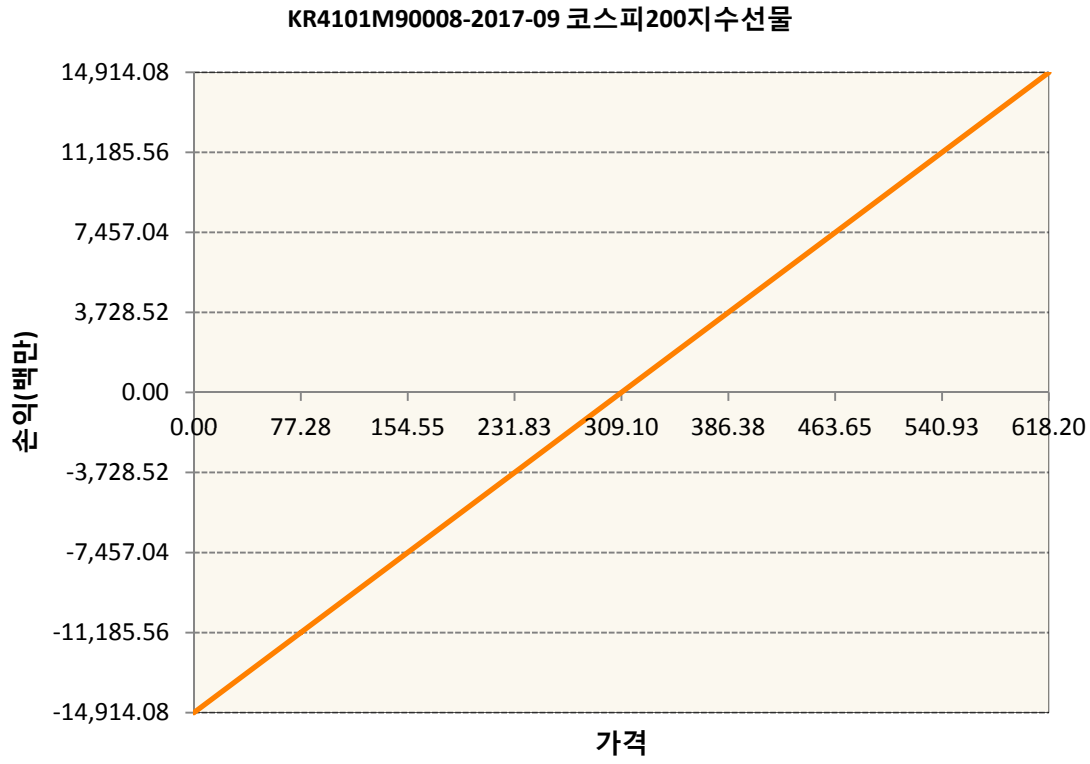
ETF스마트레버리지목표전환형6호

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	14,914	0	14,914	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101M90(2017-09 코스피200지수선물							1,190
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,190	-1,190	-1,190	-1,190	-1,190	-1,190	-1,190
-5.33%	-794	-794	-794	-794	-794	-794	-794
-2.67%	-397	-397	-397	-397	-397	-397	-397
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	397	397	397	397	397	397	397
5.33%	794	794	794	794	794	794	794
8.00%	1,190	1,190	1,190	1,190	1,190	1,190	1,190

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

744

공시일	2017-08-21
기준일	2017-08-18

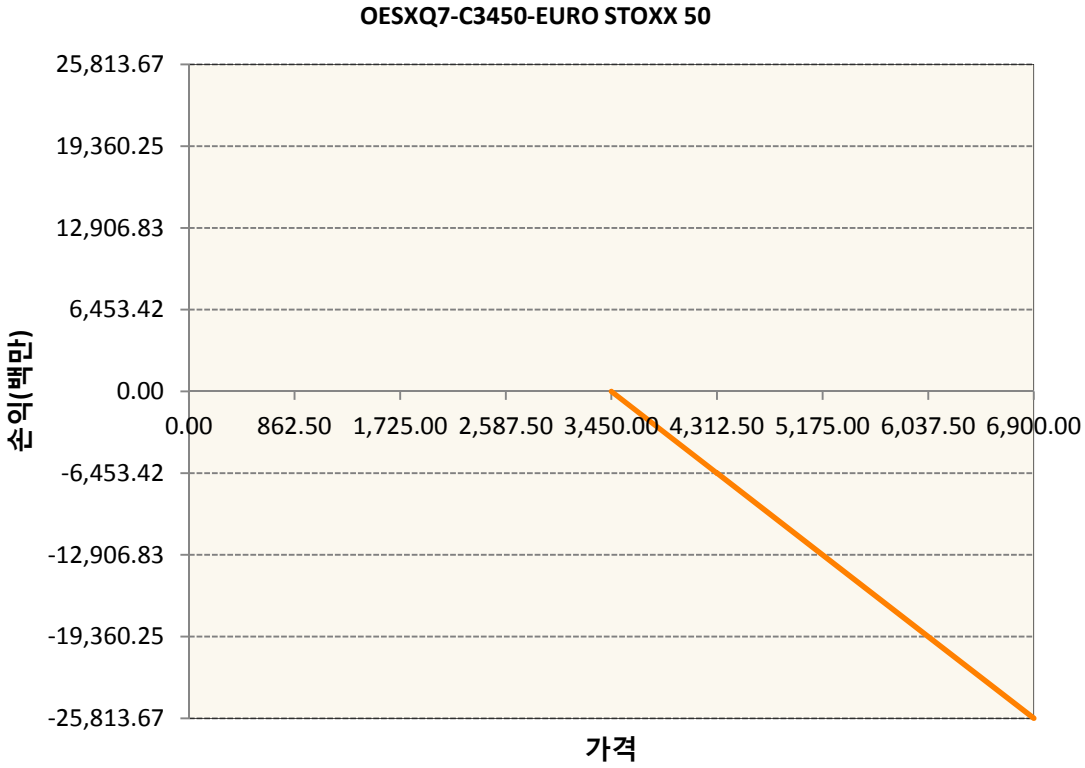
유로커버드콜(주식혼합-파생형)

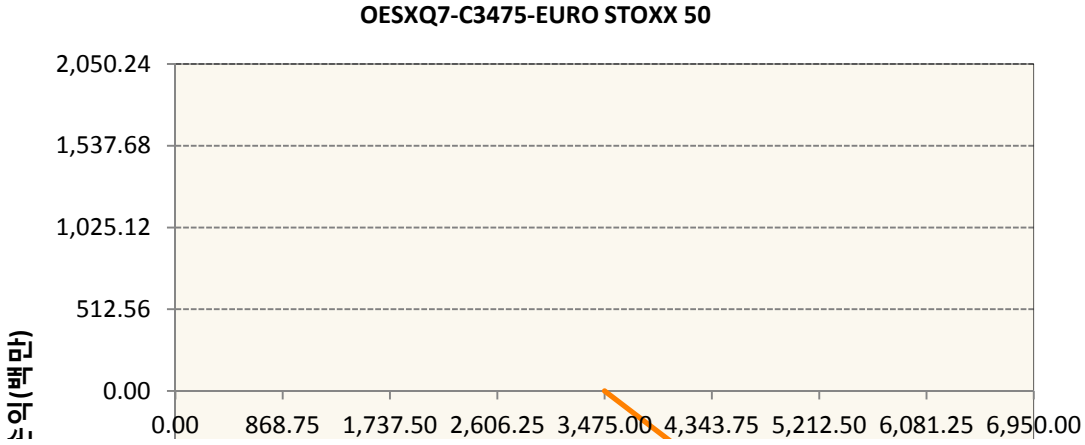
1. 계약금액

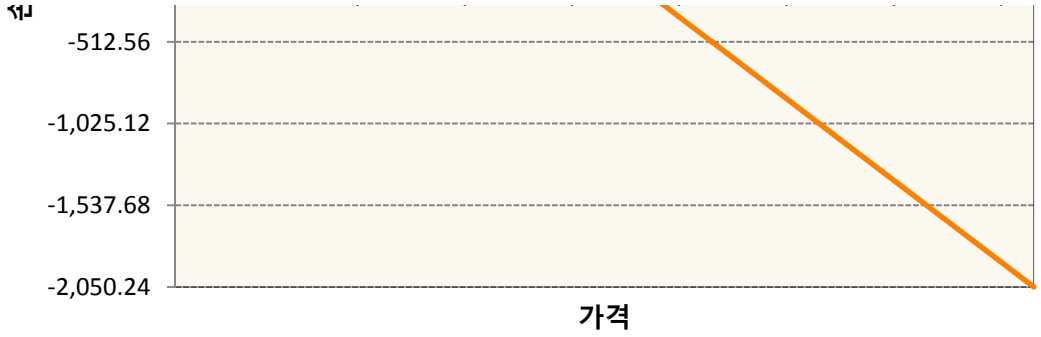
(단위:백만원)

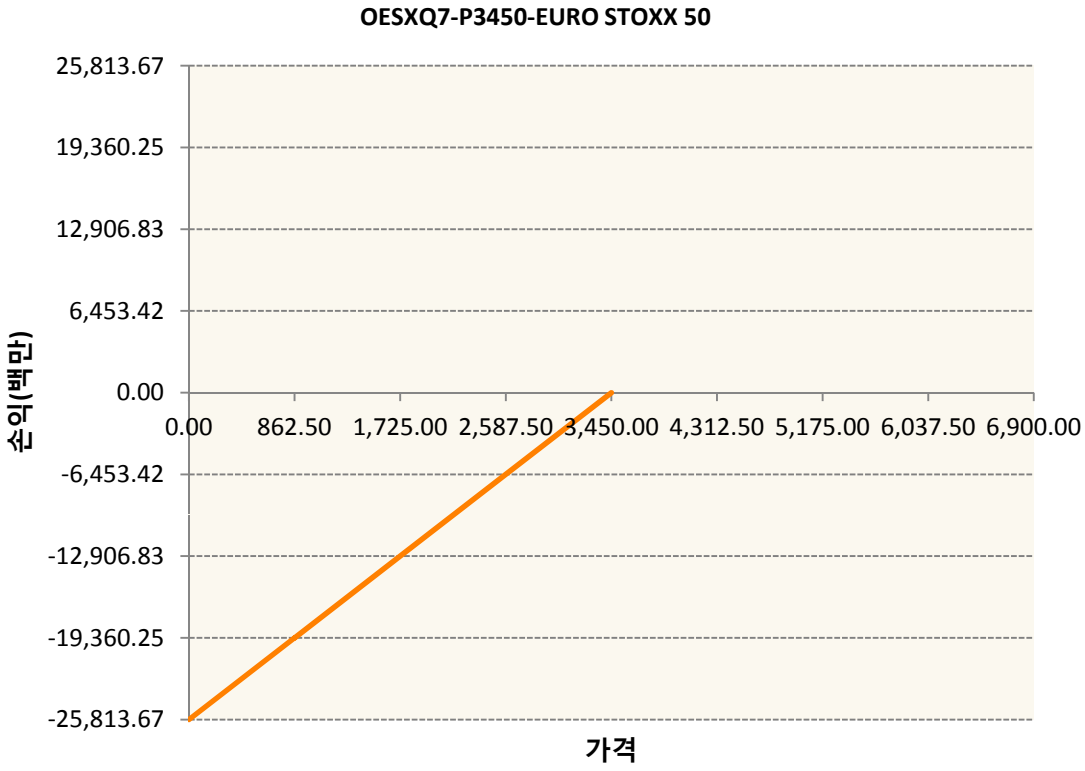
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	24,715	0	24,715	
누계	유가증권	옵션	0	55,728	-55,728	장내

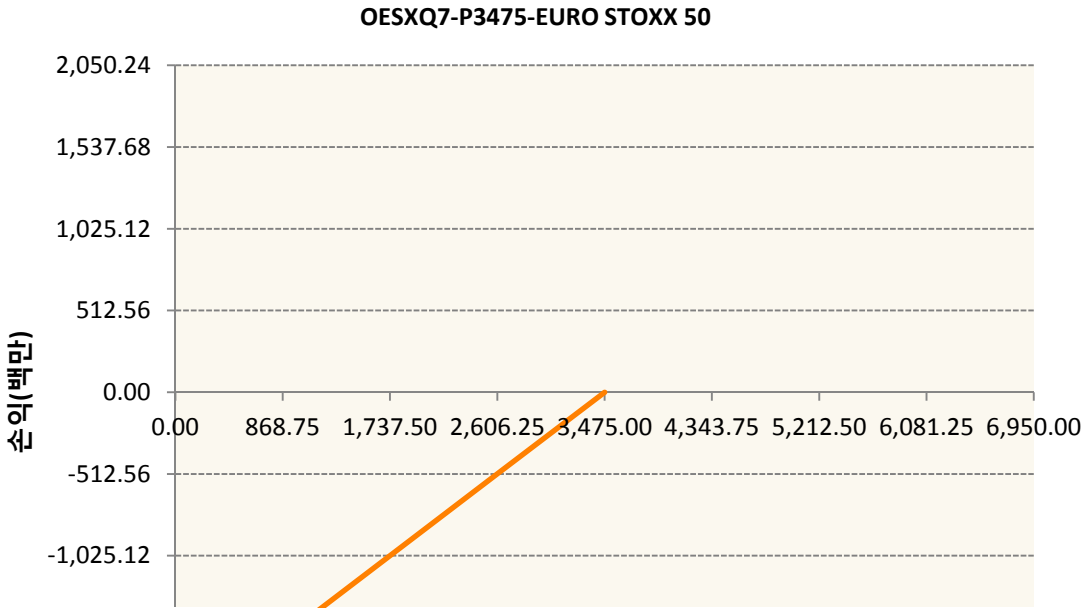
2. 만기시점의 손익구조

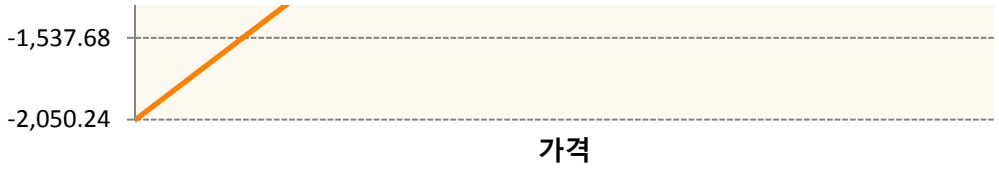


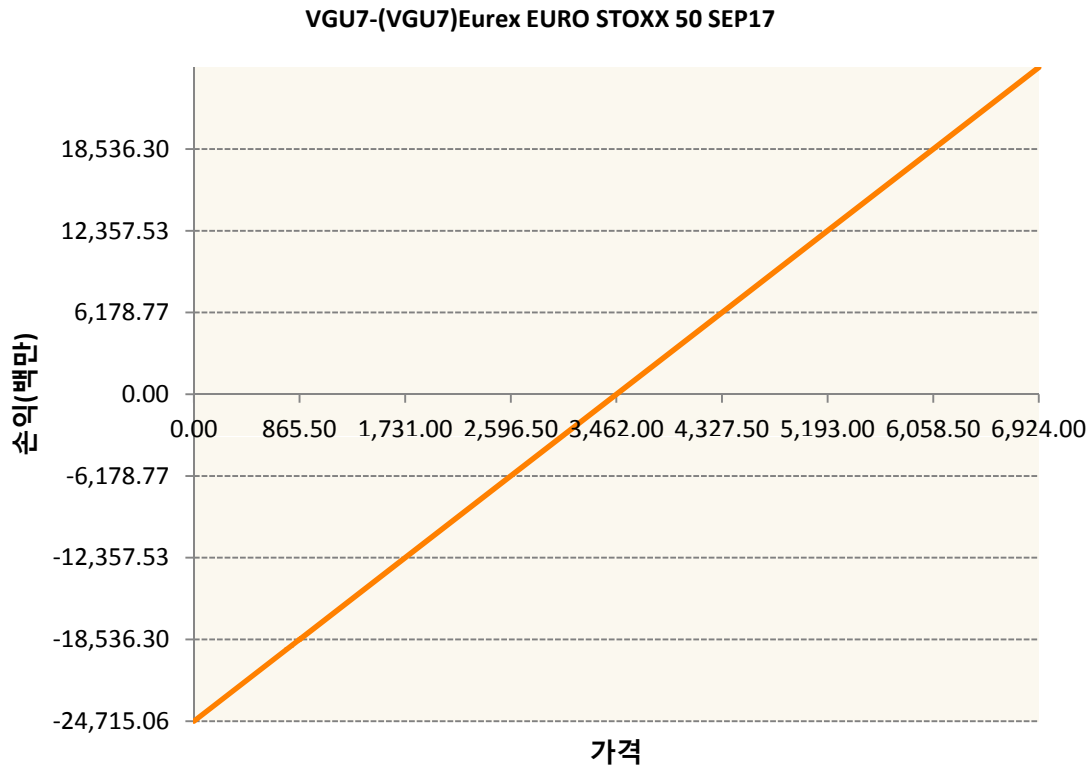



-512.56
-1,025.12
-1,537.68
-2,050.24
가격


OESXQ7-P3450-EURO STOXX 50
25,813.67
19,360.25
12,906.83
6,453.42
0.00
-6,453.42
-12,906.83
-19,360.25
-25,813.67
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
2,050.24
1,537.68
1,025.12
512.56
0.00
-512.56
-1,025.12
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	2,065
OESXQ7-C3	EURO STOXX 50	164
OESXQ7-P3	EURO STOXX 50	2,065
OESXQ7-P3	EURO STOXX 50	164
VGU7	(VGU7)Eurex EURO STOXX 50 SEP17	1,977

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	5,236

공시일	2017-08-21
기준일	2017-08-18

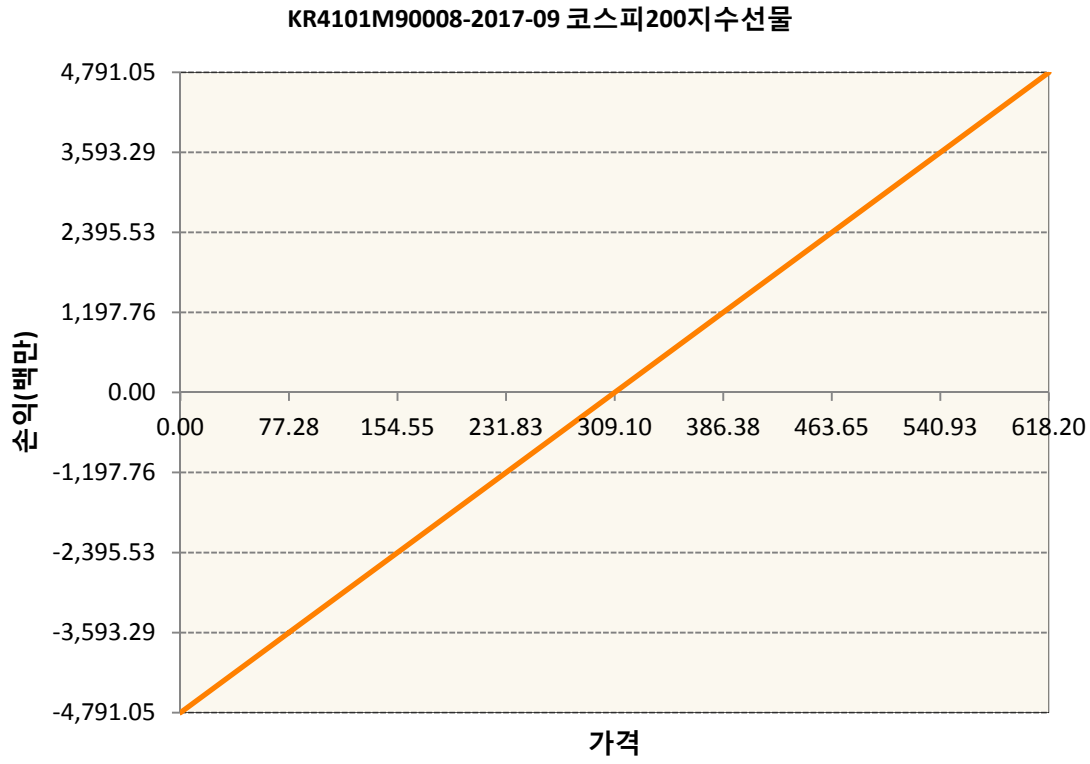
ETF스마트레버리지목표전환형7호

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	4,791	0	4,791	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101M90(2017-09 코스피200지수선물							382
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-382	-382	-382	-382	-382	-382	-382
-5.33%	-255	-255	-255	-255	-255	-255	-255
-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%	255	255	255	255	255	255	255
8.00%	382	382	382	382	382	382	382

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

239

공시일	2017-08-21
기준일	2017-08-18

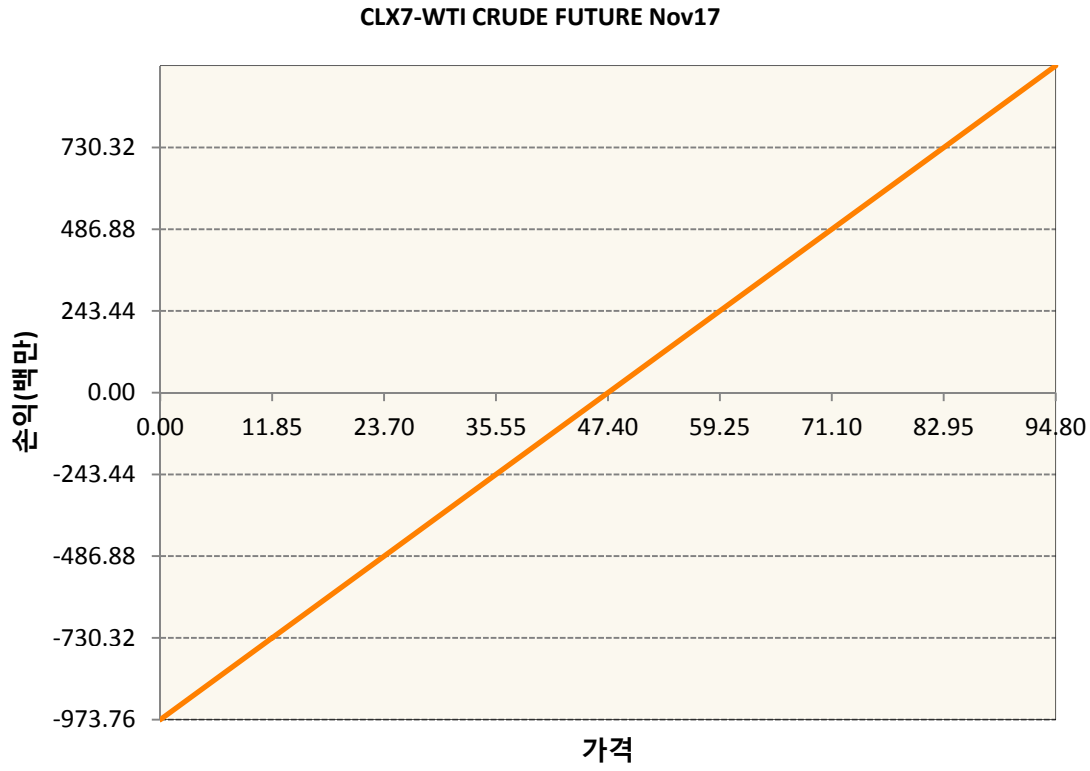
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

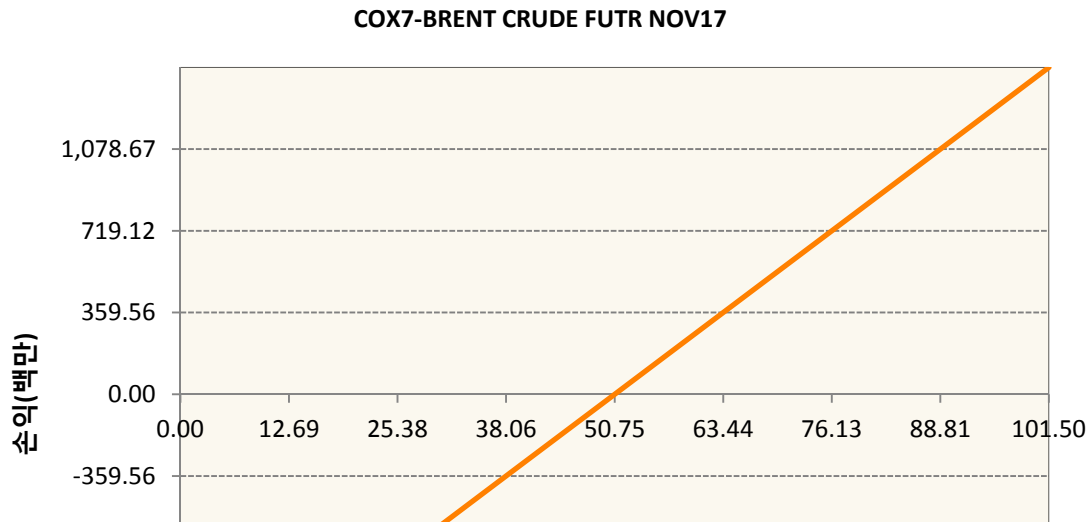
1. 계약금액

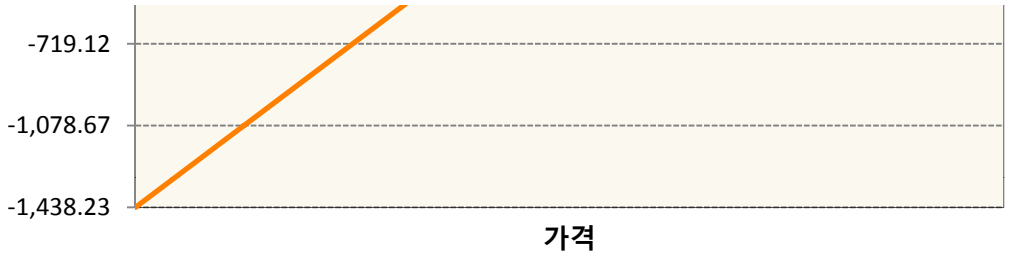
(단위:백만원)

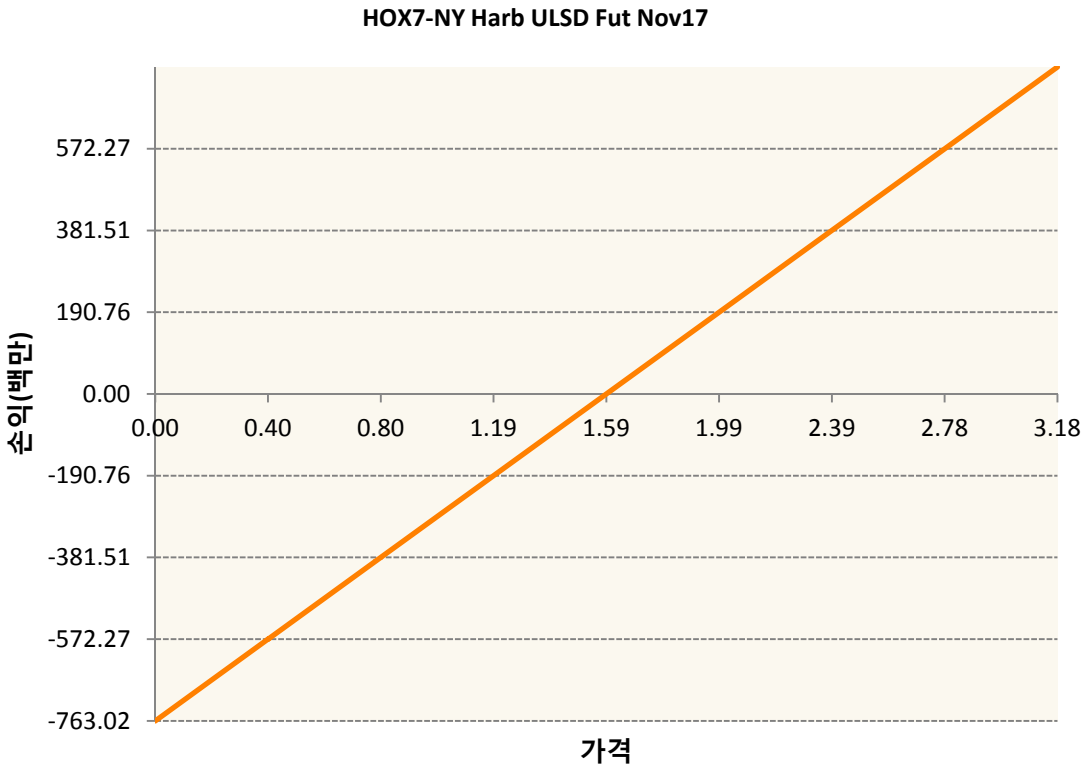
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	5,336	399	4,936	

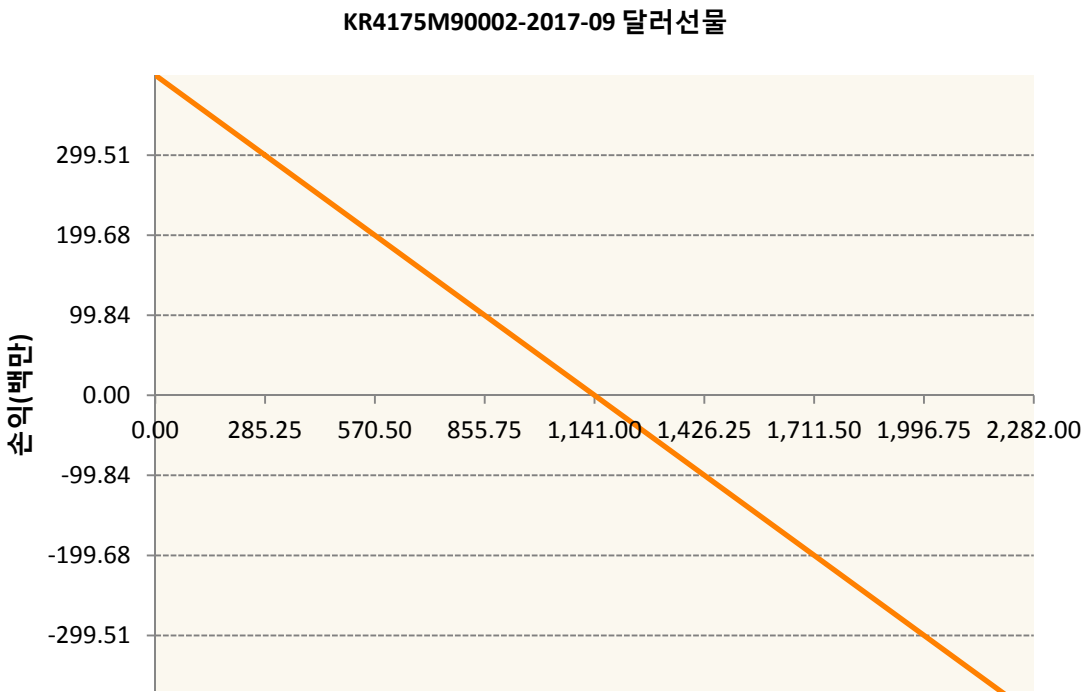
2. 만기시점의 손익구조

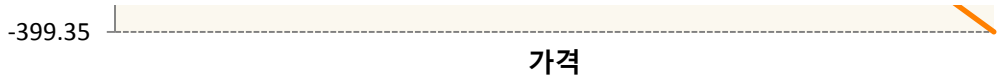


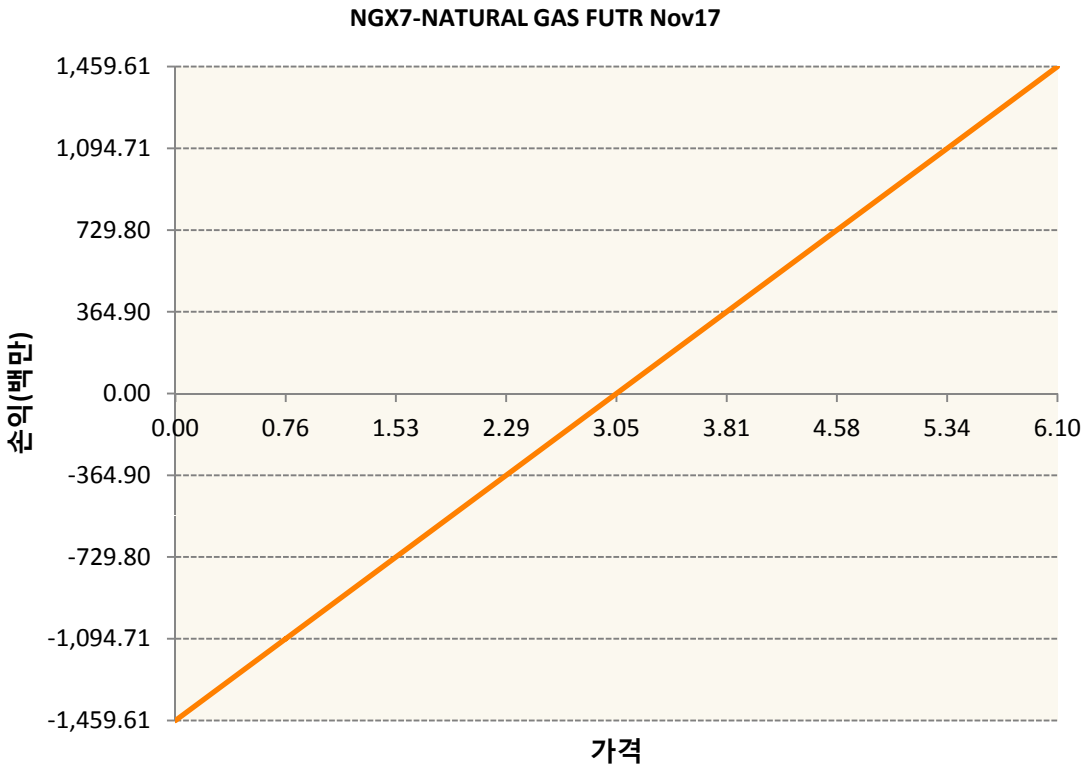


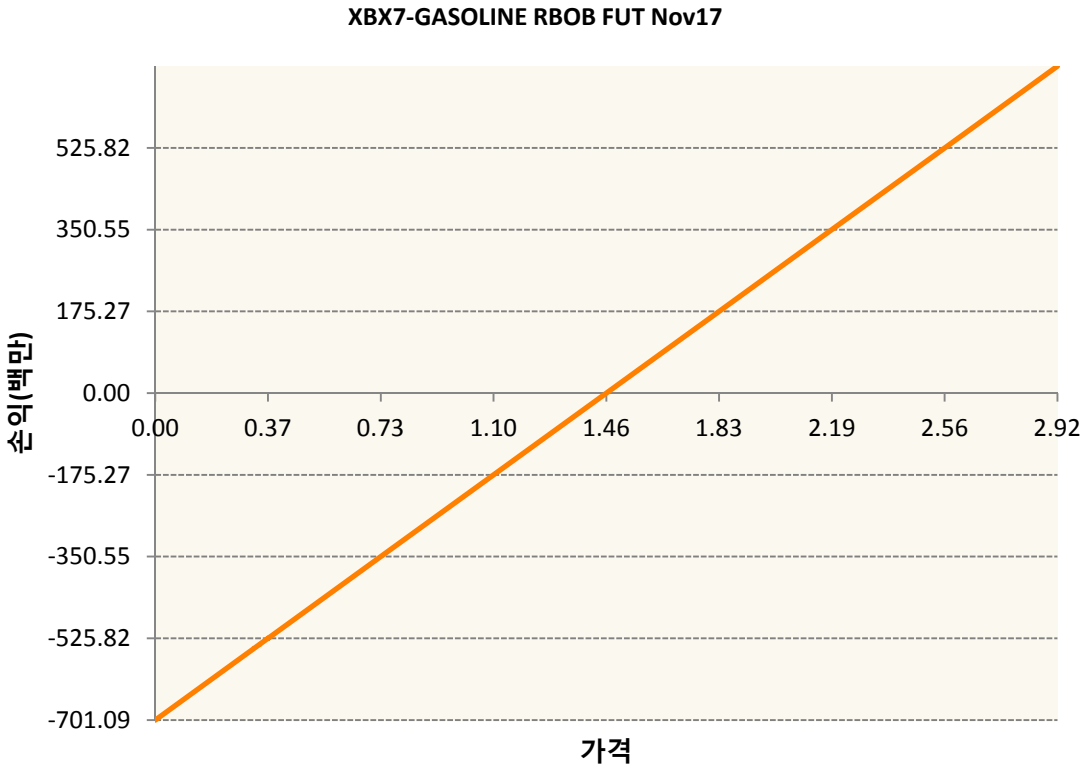

-719.12
-1,078.67
-1,438.23
가격


HOX7-NY Harb ULSD Fut Nov17
572.27
381.51
190.76
0.00
-190.76
-381.51
-572.27
-763.02
0.00
0.40
0.80
1.19
1.59
1.99
2.39
2.78
3.18
손익(백만)
가격


KR4175M90002-2017-09 달러선물
299.51
199.68
99.84
0.00
-99.84
-199.68
-299.51
0.00
285.25
570.50
855.75
1,141.00
1,426.25
1,711.50
1,996.75
2,282.00
손익(백만)


-399.35
가격


NGX7-NATURAL GAS FUTR Nov17
1,459.61
1,094.71
729.80
364.90
0.00
-364.90
-729.80
-1,094.71
-1,459.61
0.00
0.76
1.53
2.29
3.05
3.81
4.58
5.34
6.10
손익(백만)
가격


XBX7-GASOLINE RBOB FUT Nov17
525.82
350.55
175.27
0.00
-175.27
-350.55
-525.82
-701.09
0.00
0.37
0.73
1.10
1.46
1.83
2.19
2.56
2.92
손익(백만)
가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLX7	WTI CRUDE FUTURE Nov17	78
COX7	BRENT CRUDE FUTR NOV17	115
HOX7	NY Harb ULSD Fut Nov17	61
KR4175M90(	2017-09 달러선물	32
NGX7	NATURAL GAS FUTR Nov17	117
XBX7	GASOLINE RBOB FUT Nov17	56

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

768

공시일	2017-08-21
기준일	2017-08-18

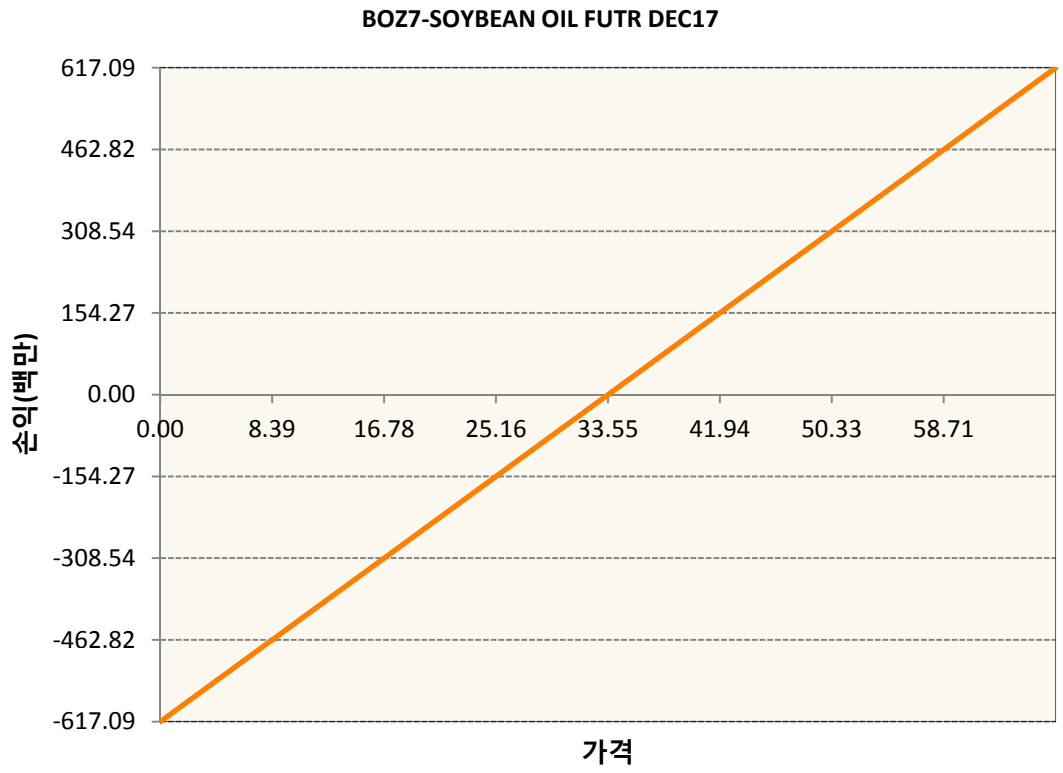
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

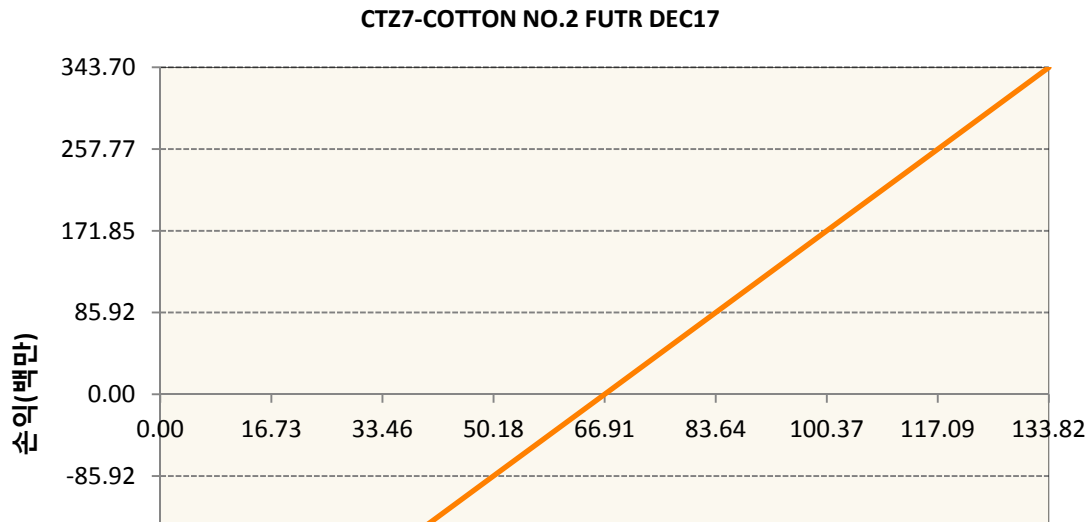
1. 계약금액

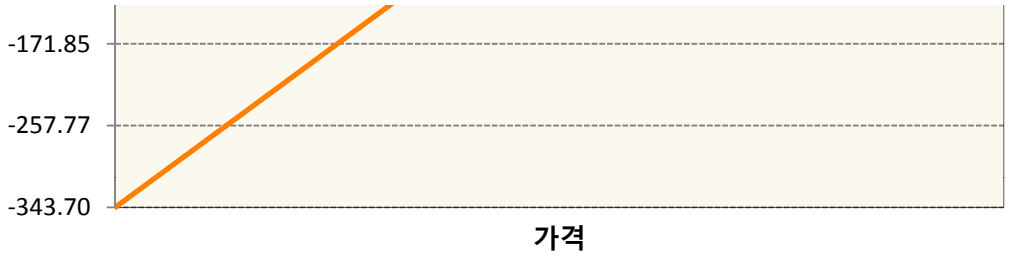
(단위:백만원)

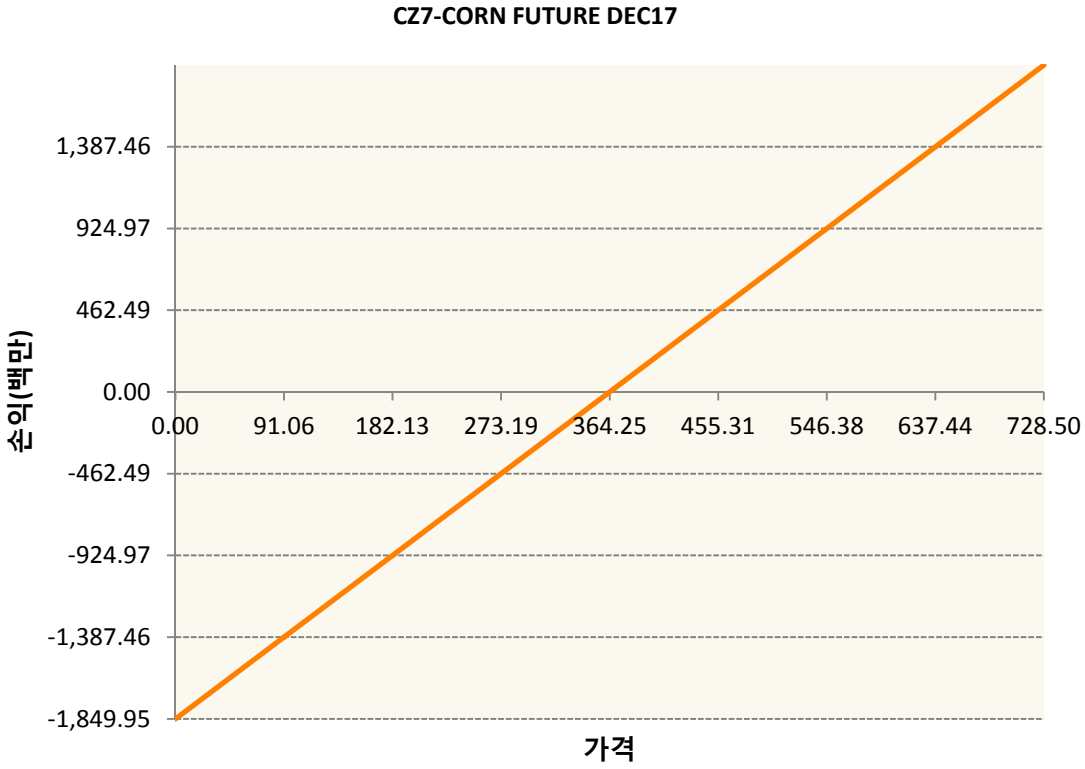
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	6,910	342	6,567	

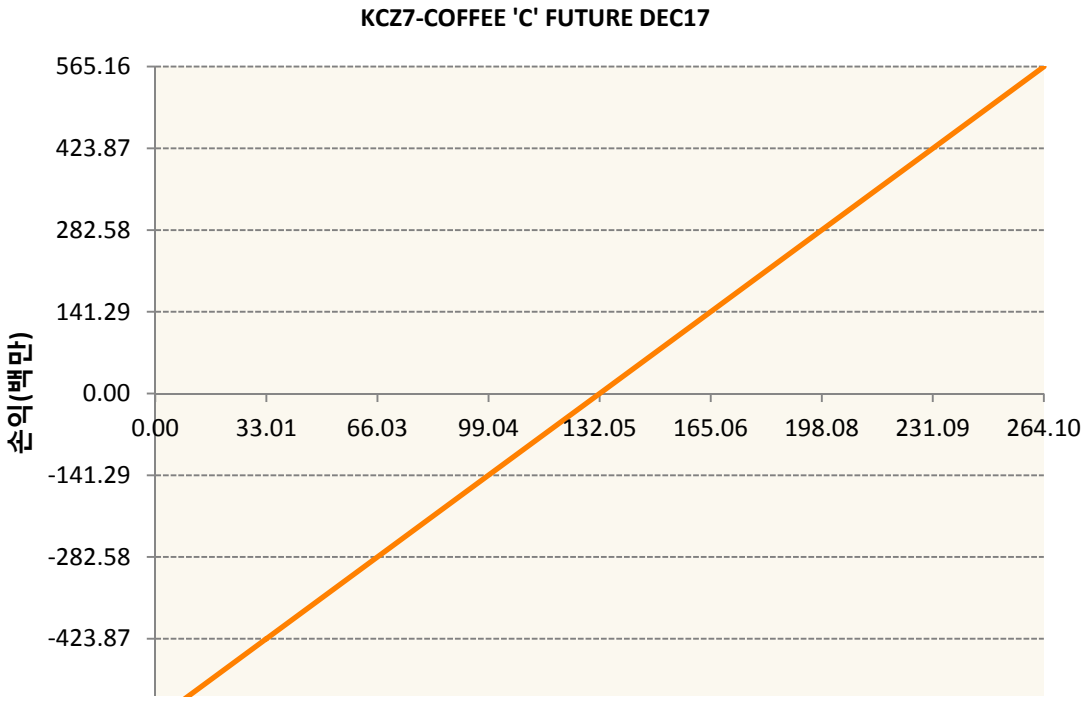
2. 만기시점의 손익구조

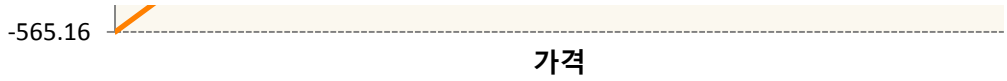


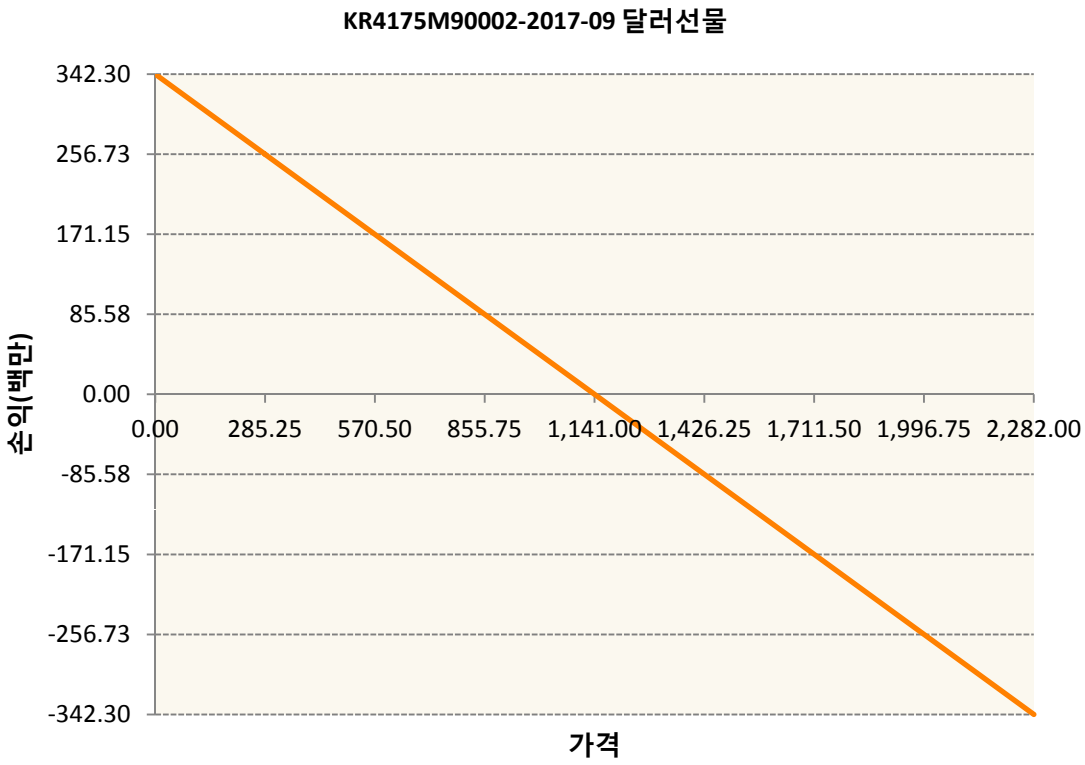


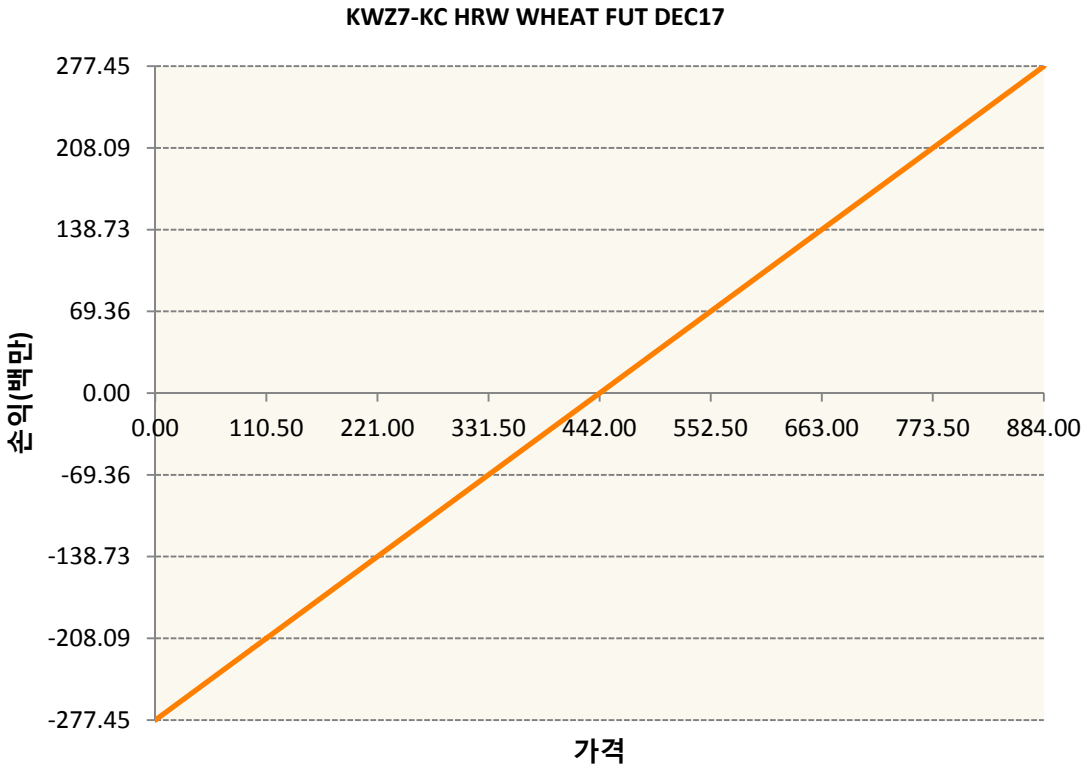

-171.85
-257.77
-343.70
가격

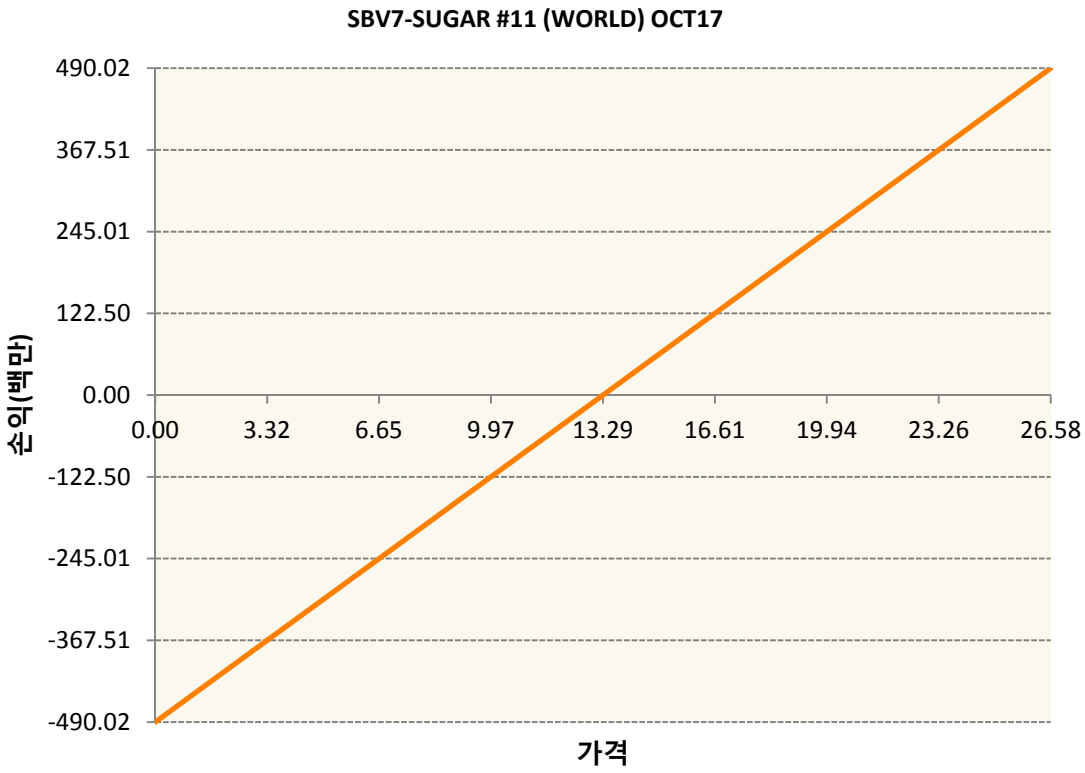

CZ7-CORN FUTURE DEC17
1,387.46
924.97
462.49
0.00
-462.49
-924.97
-1,387.46
-1,849.95
0.00
91.06
182.13
273.19
364.25
455.31
546.38
637.44
728.50
손익(백만)
가격

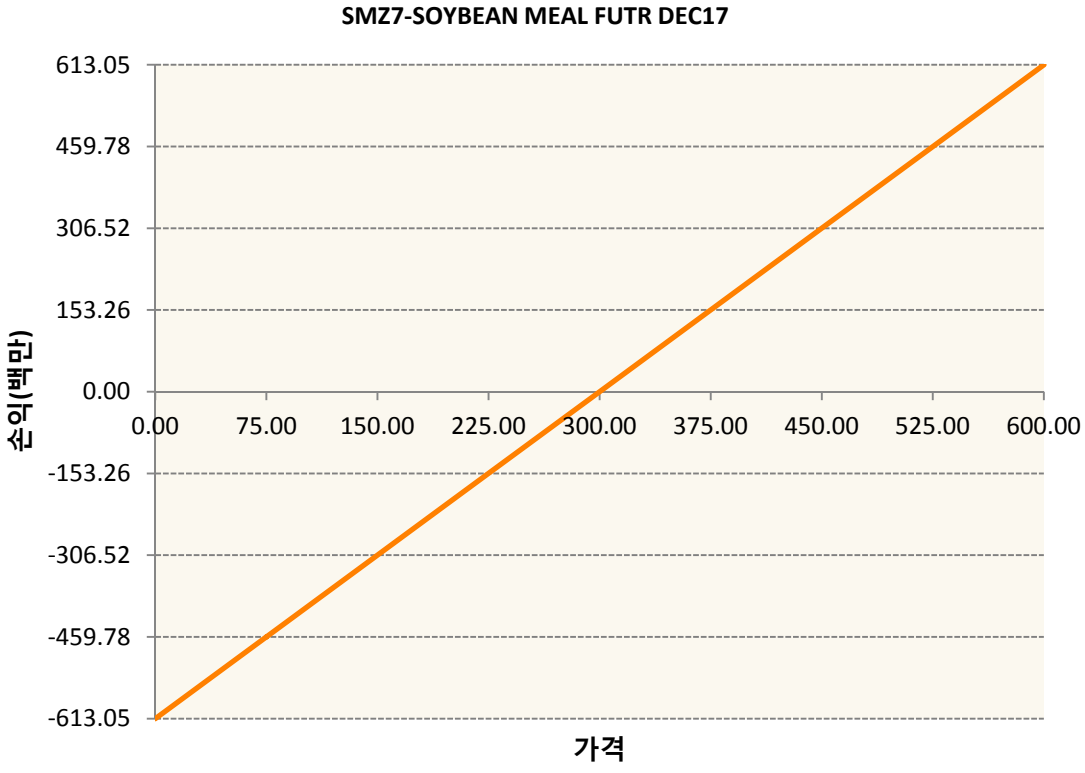

KCZ7-COFFEE 'C' FUTURE DEC17
565.16
423.87
282.58
141.29
0.00
-141.29
-282.58
-423.87
0.00
33.01
66.03
99.04
132.05
165.06
198.08
231.09
264.10
손익(백만)

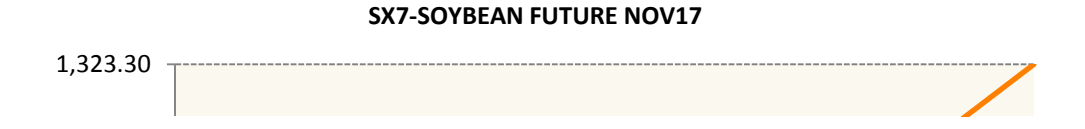

-565.16
가격

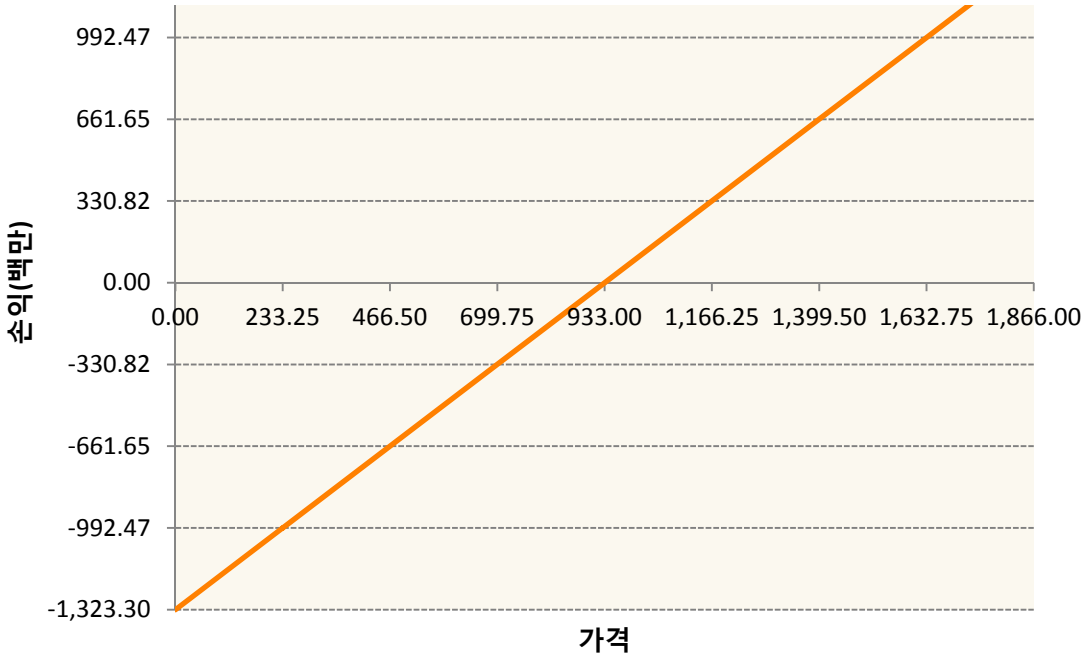

KR4175M90002-2017-09 달러선물
342.30
256.73
171.15
85.58
0.00
-85.58
-171.15
-256.73
-342.30
0.00
285.25
570.50
855.75
1,141.00
1,426.25
1,711.50
1,996.75
2,282.00
손익(백만)
가격

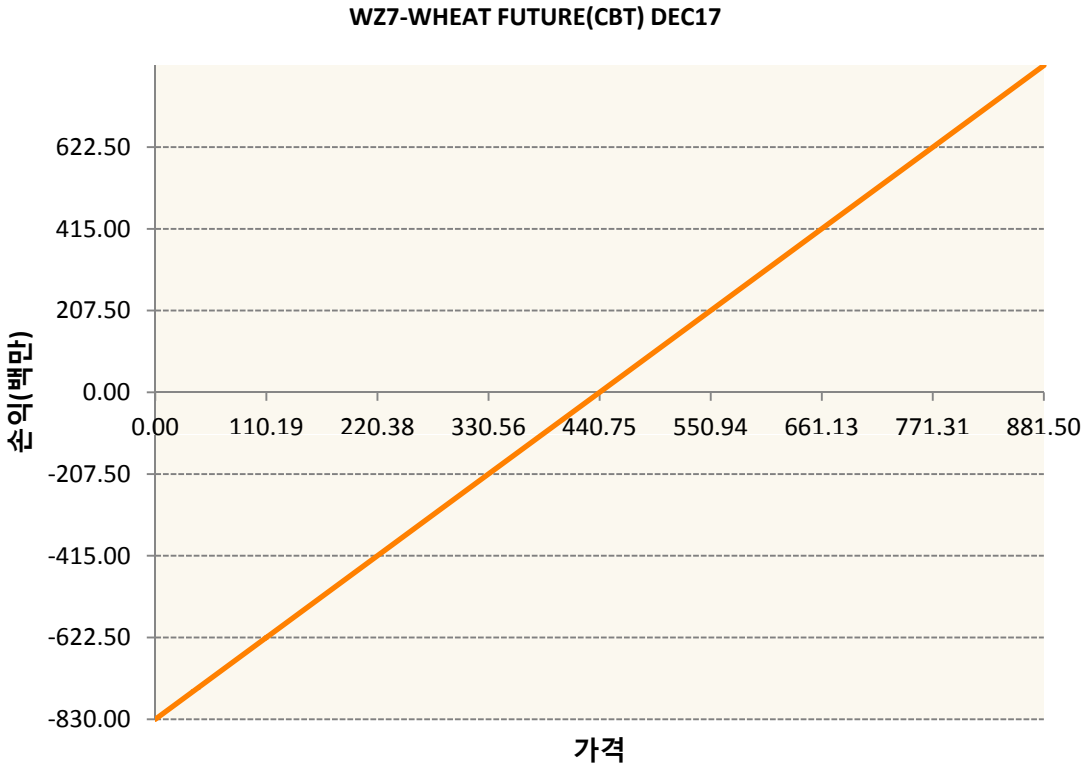

KWZ7-KC HRW WHEAT FUT DEC17
277.45
208.09
138.73
69.36
0.00
-69.36
-138.73
-208.09
-277.45
0.00
110.50
221.00
331.50
442.00
552.50
663.00
773.50
884.00
손익(백만)
가격


SBV7-SUGAR #11 (WORLD) OCT17
490.02
367.51
245.01
122.50
0.00
-122.50
-245.01
-367.51
-490.02
0.00
3.32
6.65
9.97
13.29
16.61
19.94
23.26
26.58
손익(백만)
가격


SMZ7-SOYBEAN MEAL FUTR DEC17
613.05
459.78
306.52
153.26
0.00
-153.26
-306.52
-459.78
-613.05
0.00
75.00
150.00
225.00
300.00
375.00
450.00
525.00
600.00
손익(백만)
가격


SX7-SOYBEAN FUTURE NOV17
1,323.30





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
BOZ7	SOYBEAN OIL FUTR DEC17	49
CTZ7	COTTON NO.2 FUTR DEC17	27
CZ7	CORN FUTURE DEC17	148
KCZ7	COFFEE 'C' FUTURE DEC17	45
KR4175M90(	2017-09 달러선물	27

KWZ7	KC HRW WHEAT FUT DEC17	22
SBV7	SUGAR #11 (WORLD) OCT17	39
SMZ7	SOYBEAN MEAL FUTR DEC17	49
SX7	SOYBEAN FUTURE NOV17	106
WZ7	WHEAT FUTURE(CBT) DEC17	66

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

653