공시일	2017-08-22
기준일	2017-08-21

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	2017-08-22
기준일	2017-08-21

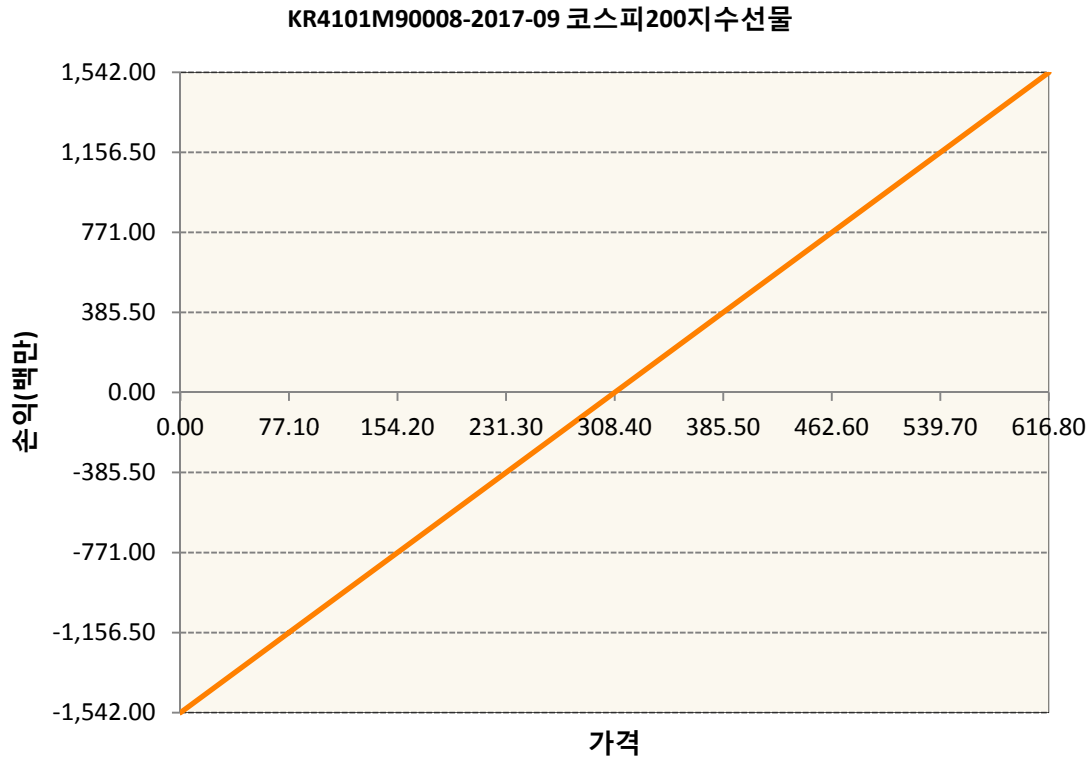
스마트인덱스모

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	1,542	0	1,542	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	2017-08-22
기준일	2017-08-21

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	1,007

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

465

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-08-22
기준일	2017-08-21

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	404

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

345

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-08-22
기준일	2017-08-21

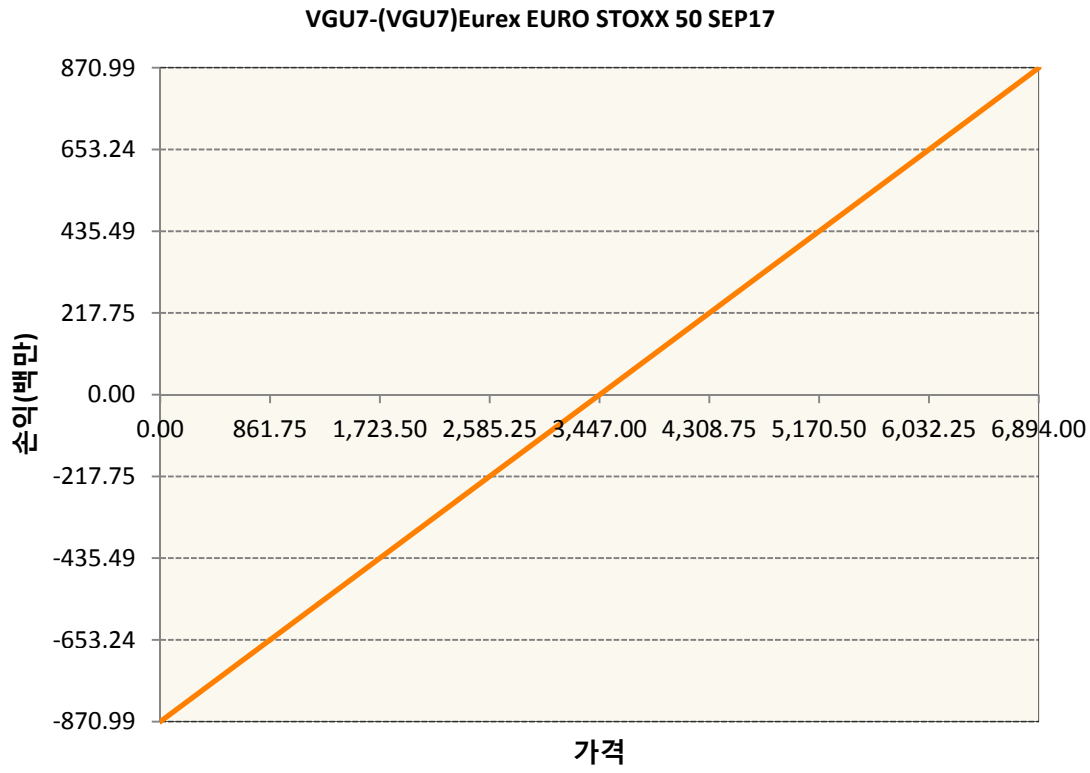
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	871	0	871	

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	2017-08-22
기준일	2017-08-21

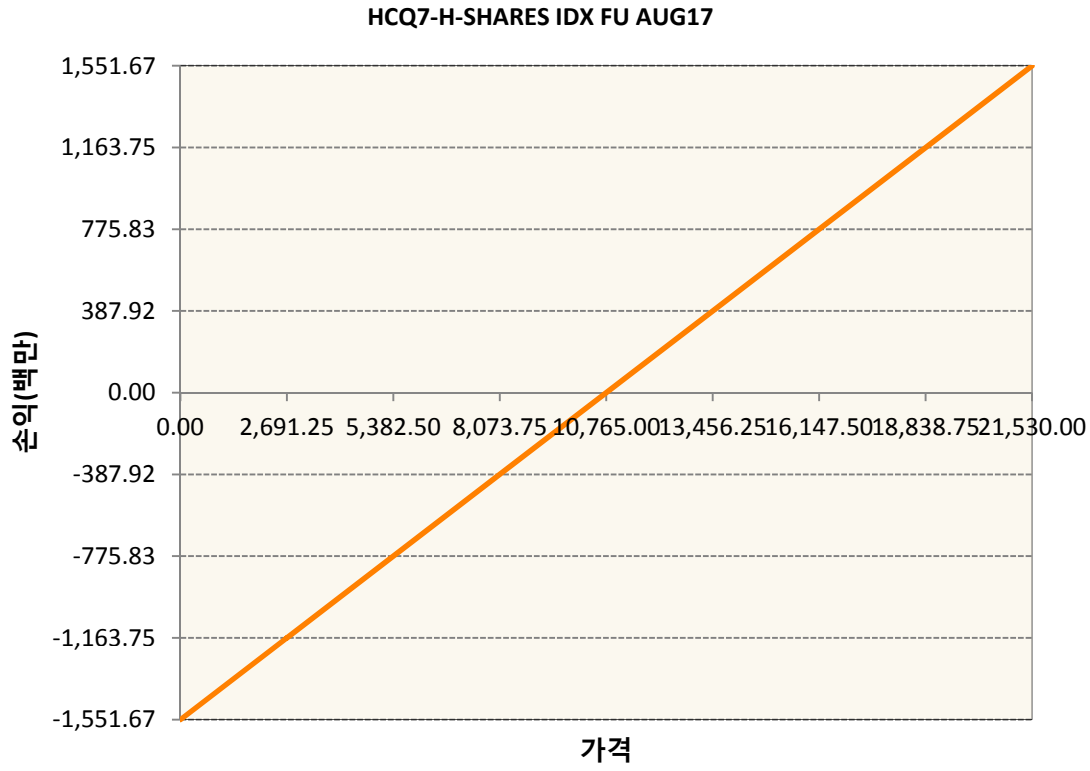
차이나인덱스모(주식-파생형)

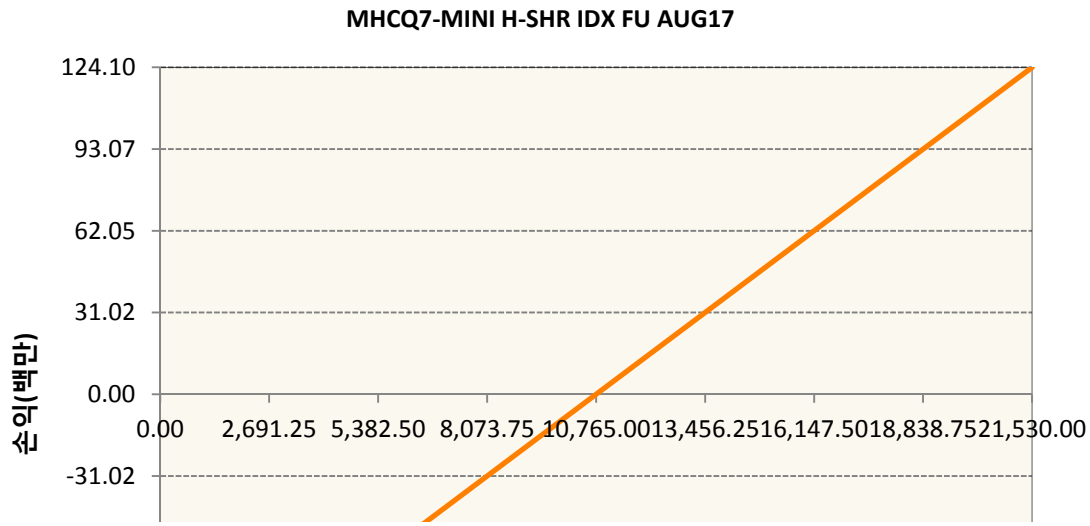
1. 계약금액

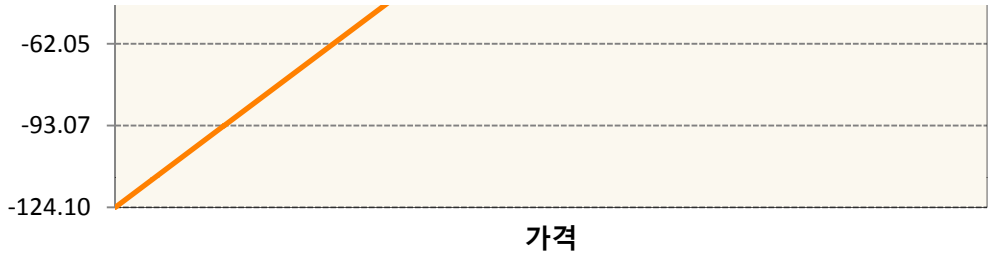
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,676	0	1,676	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)
	115

공시일	2017-08-22
기준일	2017-08-21

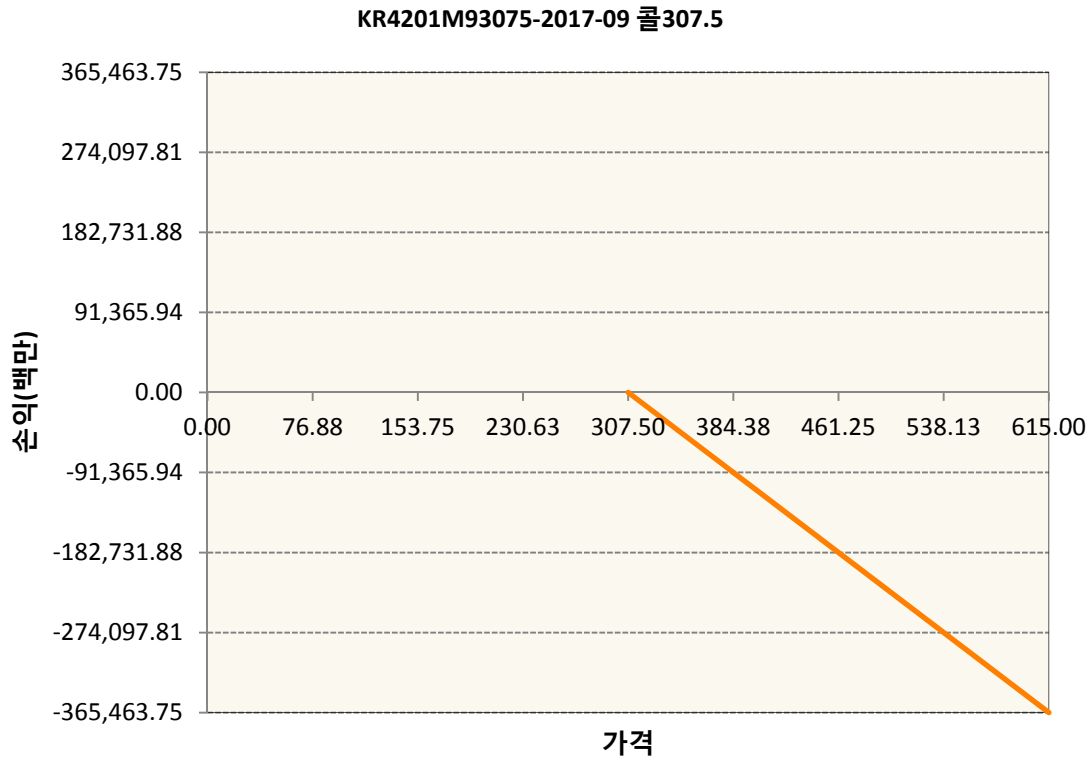
커버드콜모(주식혼합-파생형)

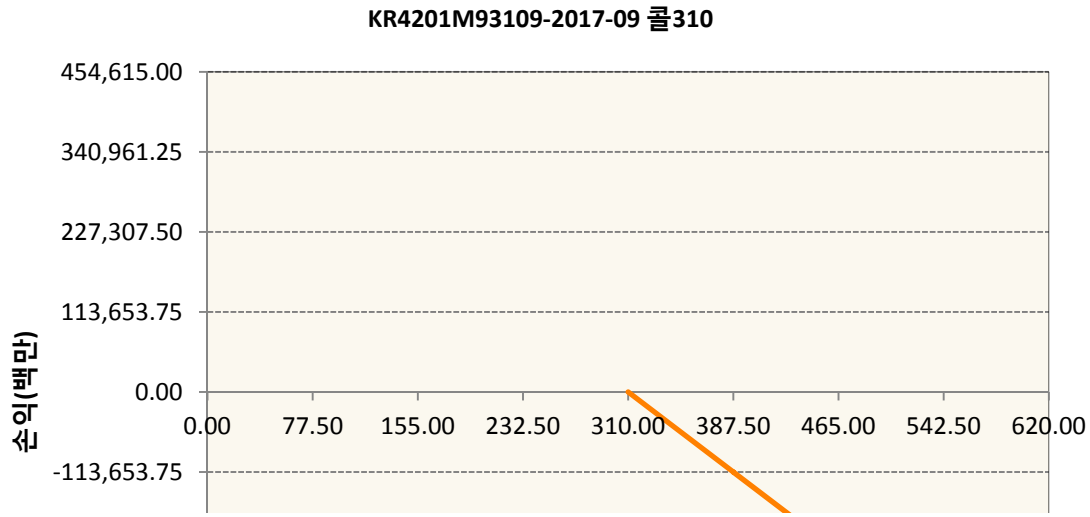
1. 계약금액

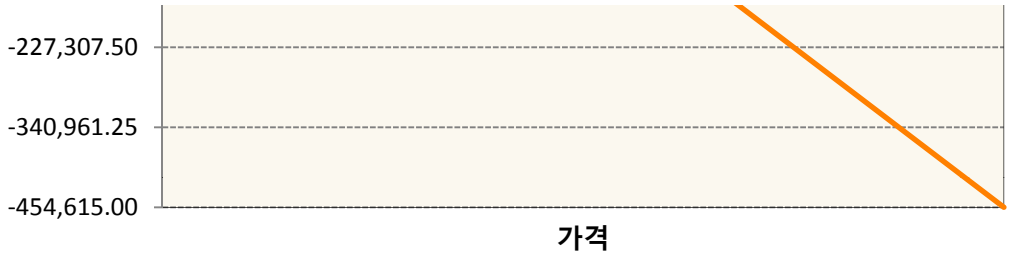
(단위:백만원)

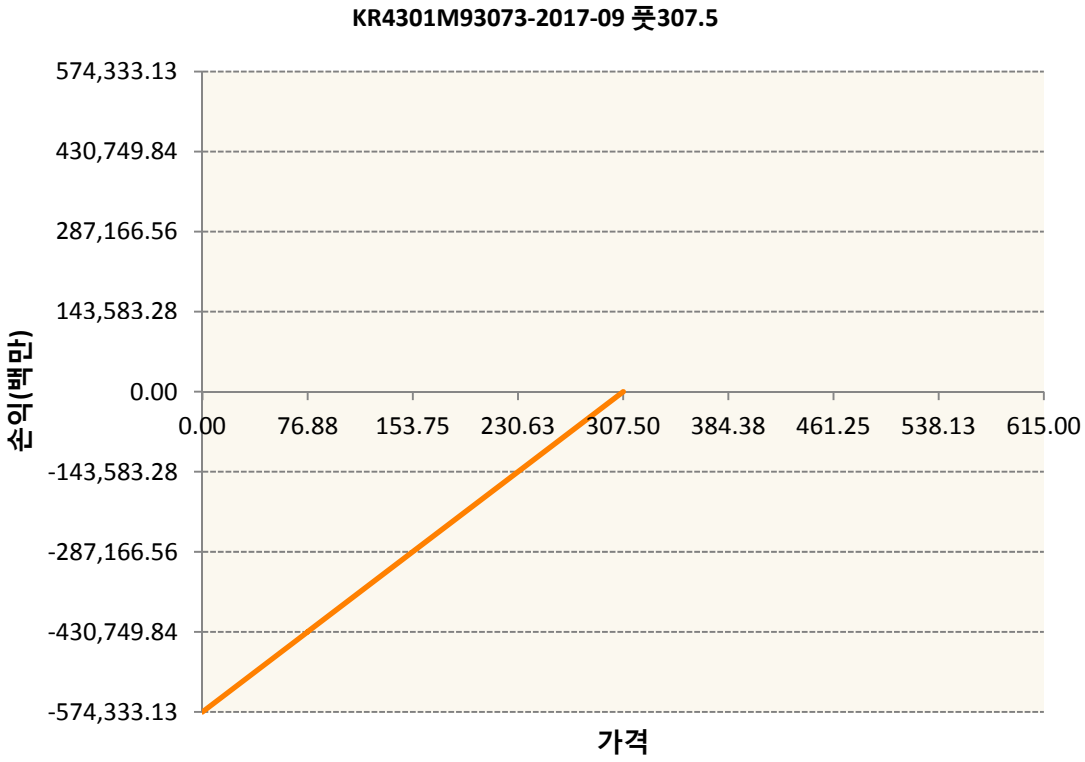
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	1,450,909	-1,450,909	장내

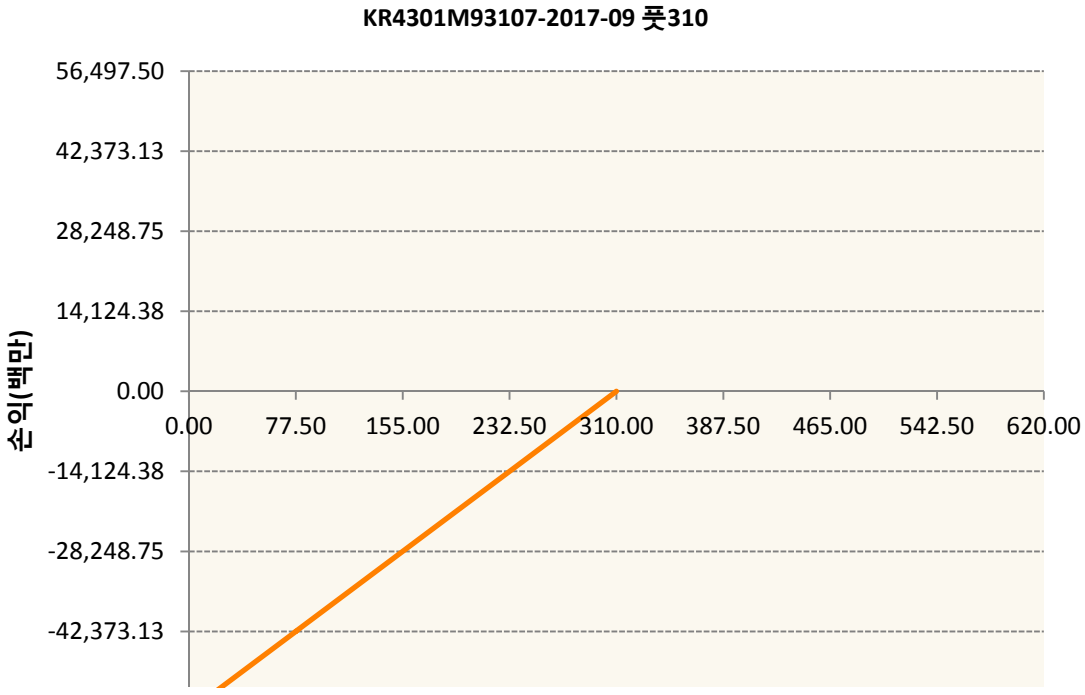
2. 만기시점의 손익구조

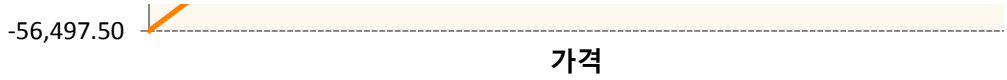





-227,307.50
-340,961.25
-454,615.00
가격


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							23,058
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	8,820	8,666	8,464	8,215	7,925	7,597	7,234
-5.33%	8,114	7,742	7,324	6,868	6,382	5,869	5,335
-2.67%	6,149	5,532	4,899	4,254	3,599	2,936	2,268
0%	2,159	1,440	720	0	-720	-1,440	-2,160
2.67%	-4,091	-4,699	-5,328	-5,972	-6,628	-7,295	-7,970
5.33%	-12,145	-12,526	-12,956	-13,426	-13,931	-14,463	-15,019
8.00%	-21,248	-21,430	-21,665	-21,949	-22,280	-22,651	-23,058
KR4201M93: 2017-09 콜310							27,133
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	9,240	9,101	8,907	8,658	8,358	8,010	7,617
-5.33%	8,629	8,255	7,818	7,329	6,795	6,222	5,617
-2.67%	6,764	6,077	5,359	4,616	3,853	3,075	2,283
0%	2,659	1,774	887	0	-888	-1,777	-2,666
2.67%	-4,224	-5,048	-5,886	-6,734	-7,591	-8,454	-9,323
5.33%	-13,560	-14,127	-14,746	-15,406	-16,101	-16,824	-17,569
8.00%	-24,472	-24,768	-25,133	-25,558	-26,038	-26,565	-27,133
KR4301M93(2017-09 풋307.5							34,628
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-32,135	-32,377	-32,695	-33,085	-33,541	-34,058	-34,628
-5.33%	-17,913	-18,498	-19,155	-19,870	-20,635	-21,440	-22,280
-2.67%	-5,669	-6,639	-7,633	-8,647	-9,676	-10,717	-11,768
0%	3,394	2,263	1,131	0	-1,131	-2,263	-3,394
2.67%	8,903	7,947	6,960	5,947	4,915	3,868	2,807
5.33%	11,578	10,979	10,303	9,564	8,772	7,935	7,061
8.00%	12,604	12,318	11,949	11,502	10,983	10,400	9,760
KR4301M93: 2017-09 풋310							3,542
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-3,340	-3,357	-3,381	-3,412	-3,449	-3,493	-3,542
-5.33%	-1,920	-1,966	-2,020	-2,081	-2,148	-2,219	-2,294
-2.67%	-655	-741	-830	-922	-1,017	-1,114	-1,212
0%	330	220	110	0	-110	-221	-331
2.67%	971	869	765	659	553	445	337

5.33%	1,307	1,236	1,160	1,077	991	901	809
8.00%	1,447	1,410	1,365	1,312	1,252	1,187	1,116

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

87,188

공시일	2017-08-22
기준일	2017-08-21

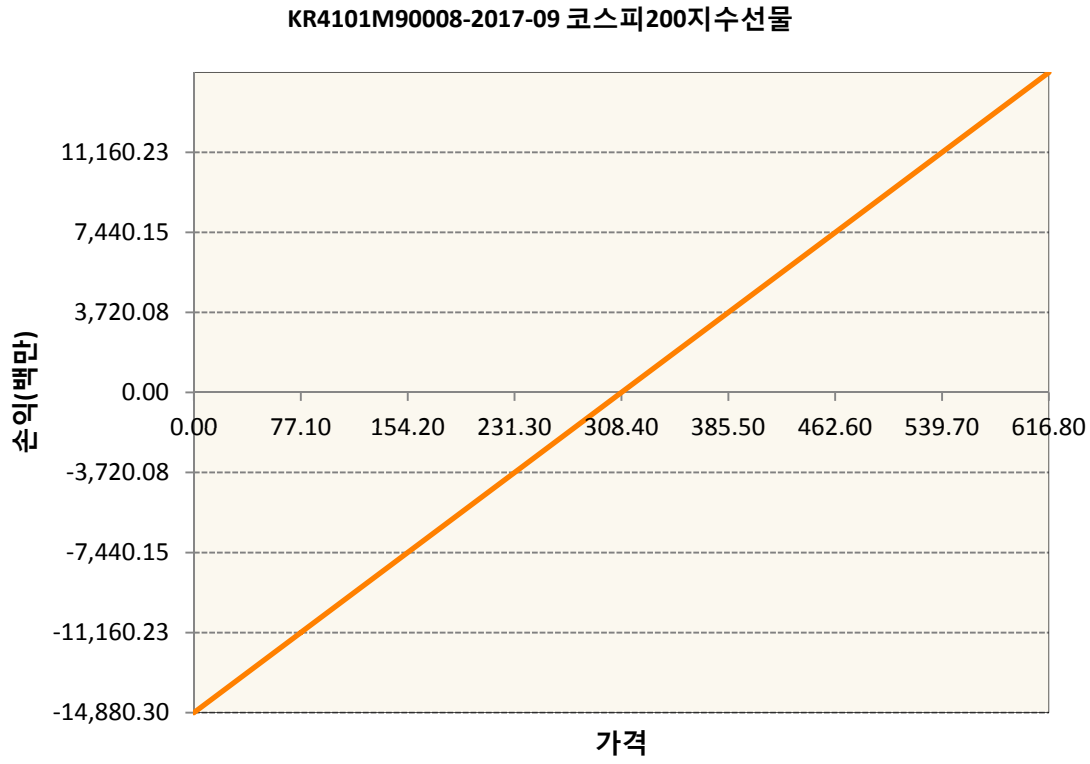
ETF스마트레버리지목표전환형6호

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	14,880	0	14,880	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101M90(2017-09 코스피200지수선물							1,189
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,189	-1,189	-1,189	-1,189	-1,189	-1,189	-1,189
-5.33%	-793	-793	-793	-793	-793	-793	-793
-2.67%	-396	-396	-396	-396	-396	-396	-396
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	396	396	396	396	396	396	396
5.33%	793	793	793	793	793	793	793
8.00%	1,189	1,189	1,189	1,189	1,189	1,189	1,189

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

743

공시일	2017-08-22
기준일	2017-08-21

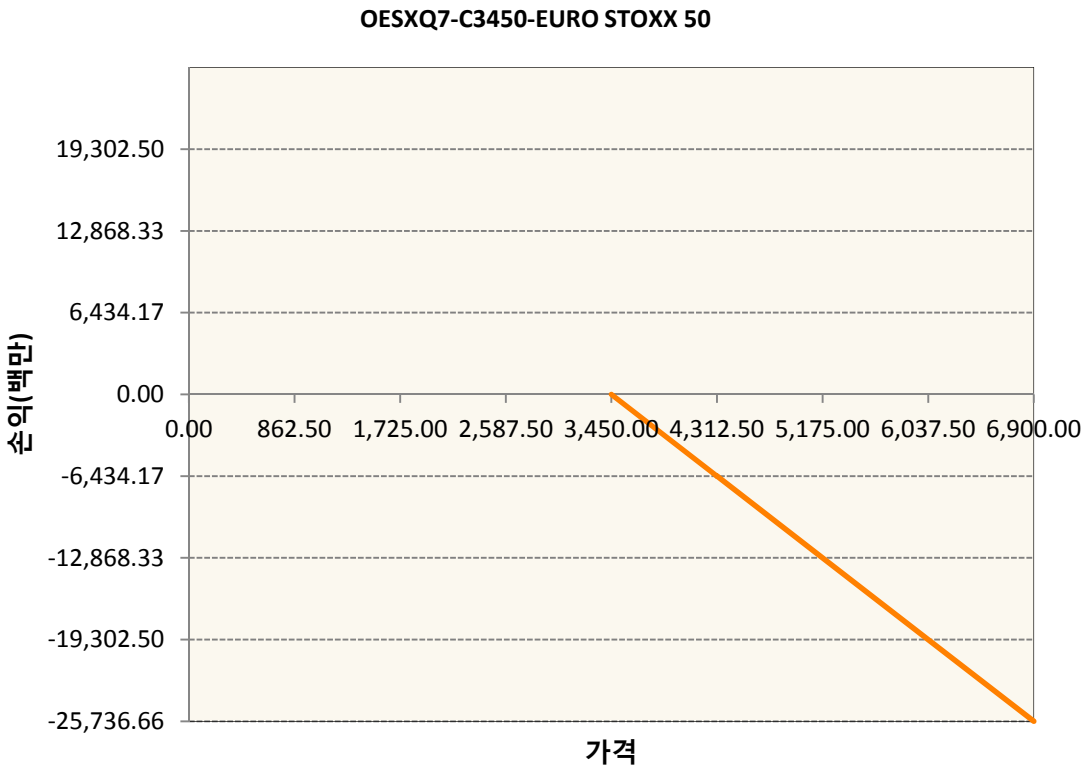
유로커버드콜(주식혼합-파생형)

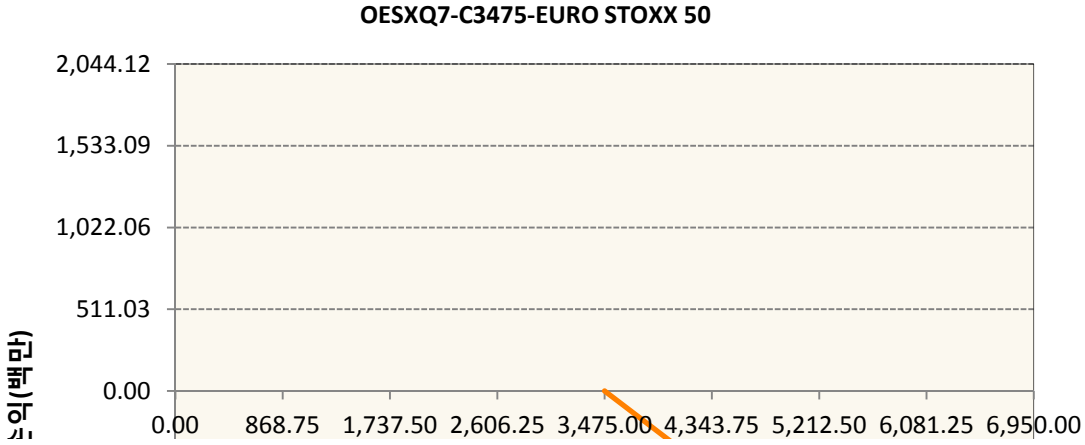
1. 계약금액

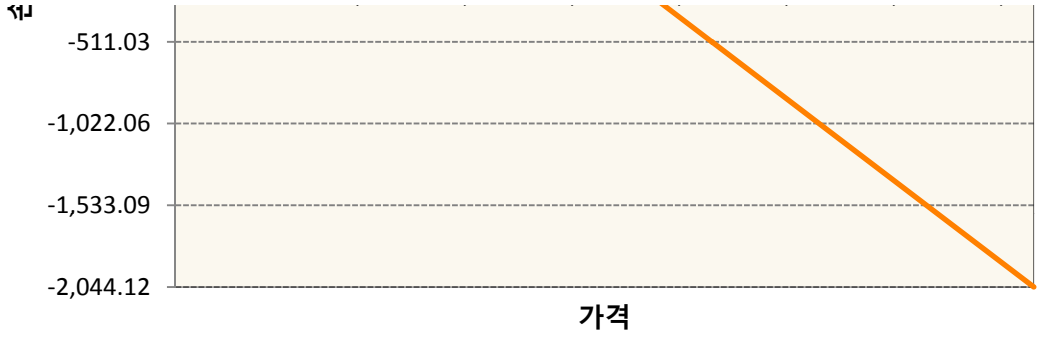
(단위:백만원)

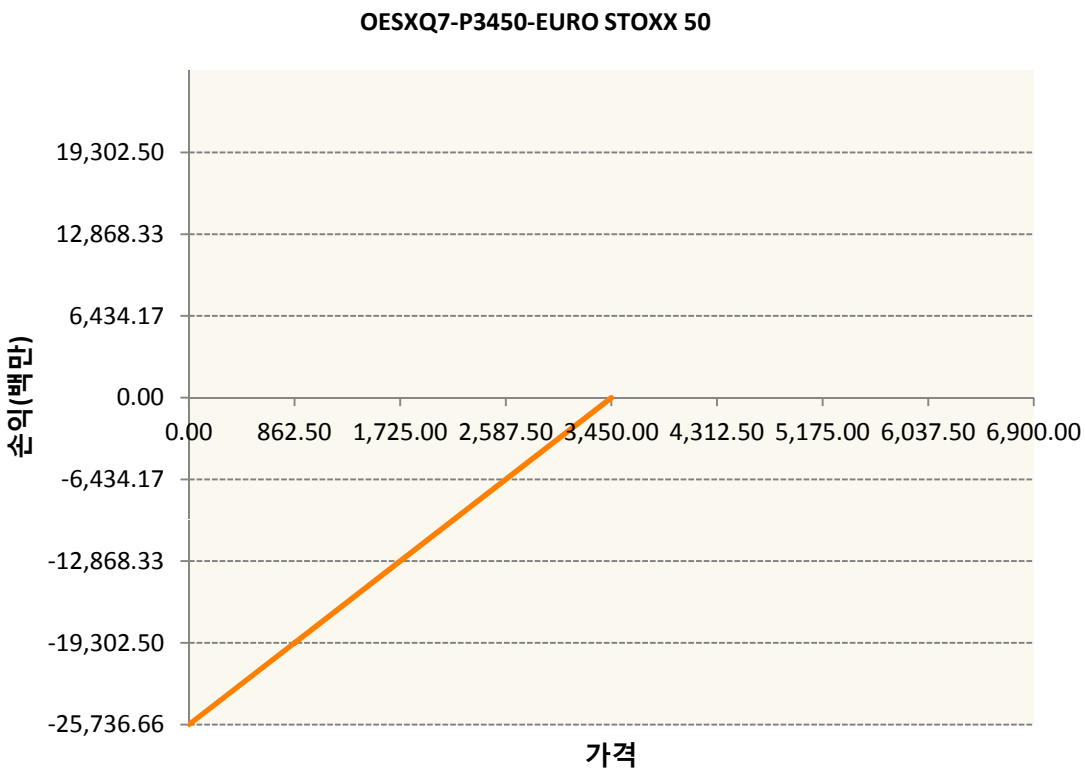
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	24,606	0	24,606	
누계	유가증권	옵션	0	55,562	-55,562	장내

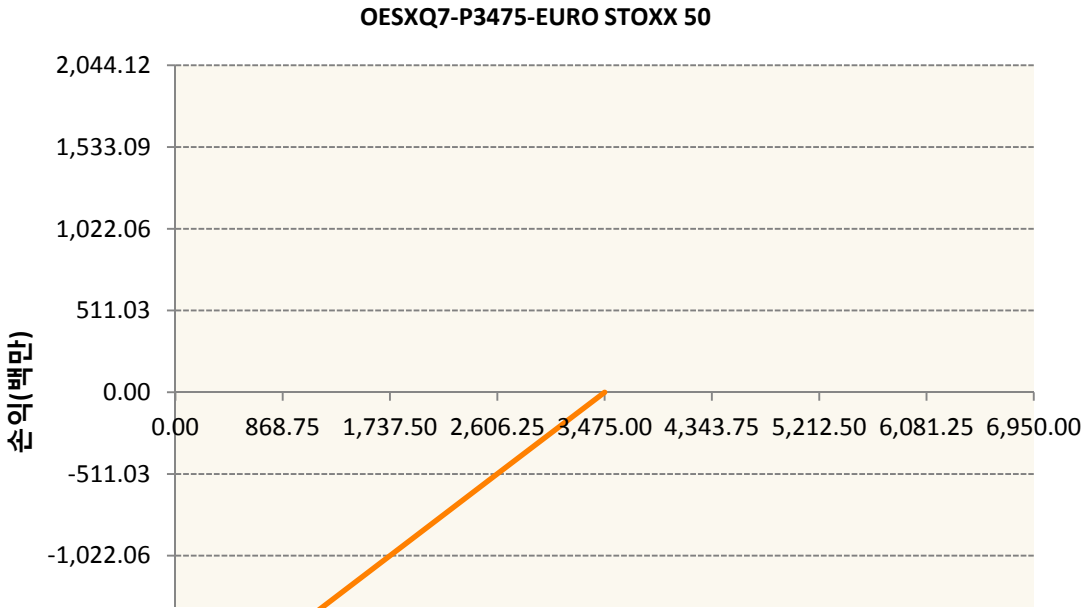
2. 만기시점의 손익구조

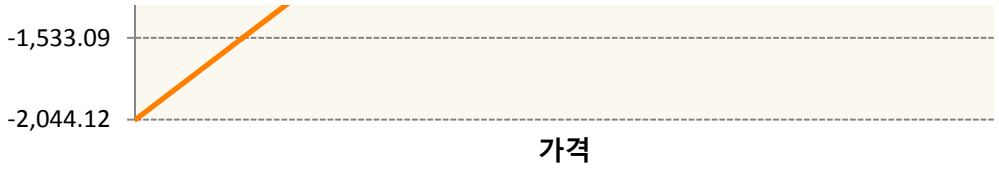


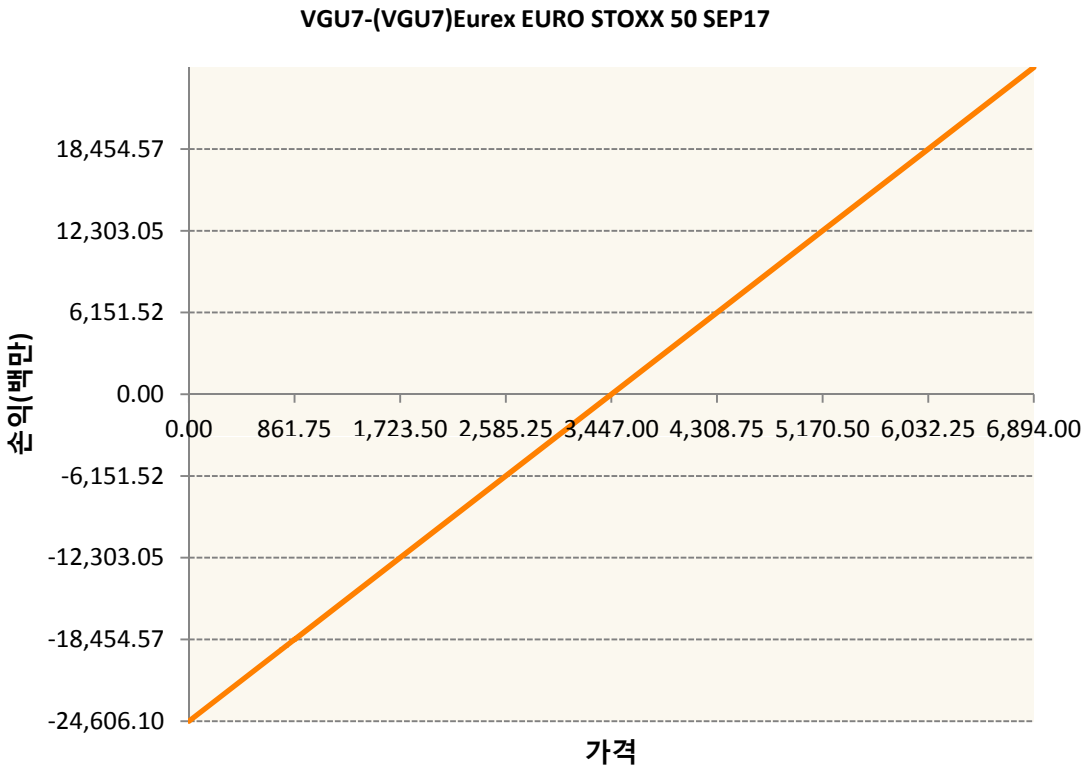



-511.03
-1,022.06
-1,533.09
-2,044.12
가격


OESXQ7-P3450-EURO STOXX 50
19,302.50
12,868.33
6,434.17
0.00
-6,434.17
-12,868.33
-19,302.50
-25,736.66
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
2,044.12
1,533.09
1,022.06
511.03
0.00
-511.03
-1,022.06
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	2,059
OESXQ7-C3	EURO STOXX 50	164
OESXQ7-P3	EURO STOXX 50	2,059
OESXQ7-P3	EURO STOXX 50	164
VGU7	(VGU7)Eurex EURO STOXX 50 SEP17	1,969

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	5,221

공시일	2017-08-22
기준일	2017-08-21

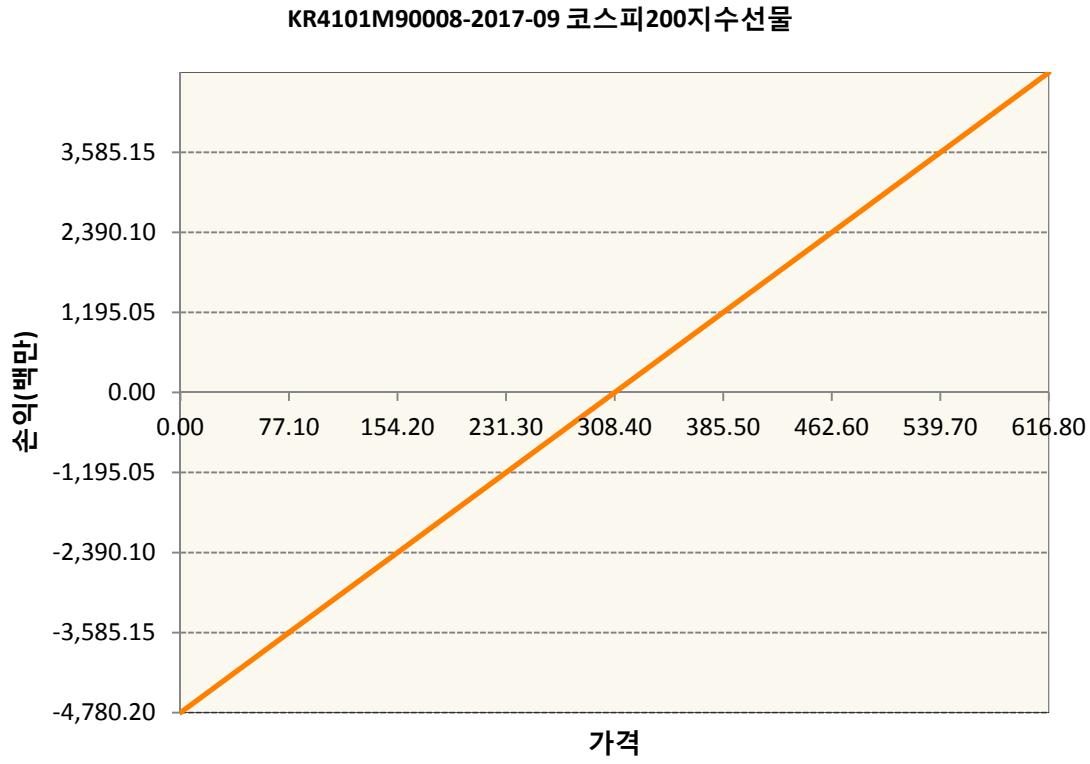
ETF스마트레버리지목표전환형7호

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	4,780	0	4,780	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	2017-08-22
기준일	2017-08-21

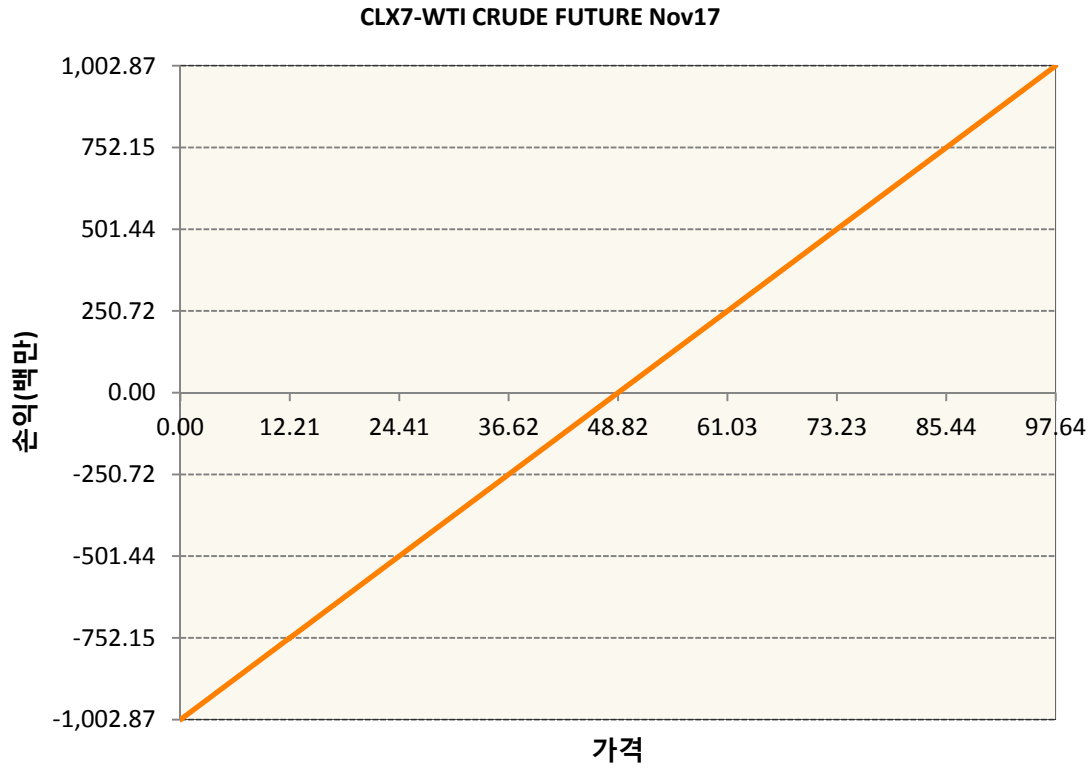
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

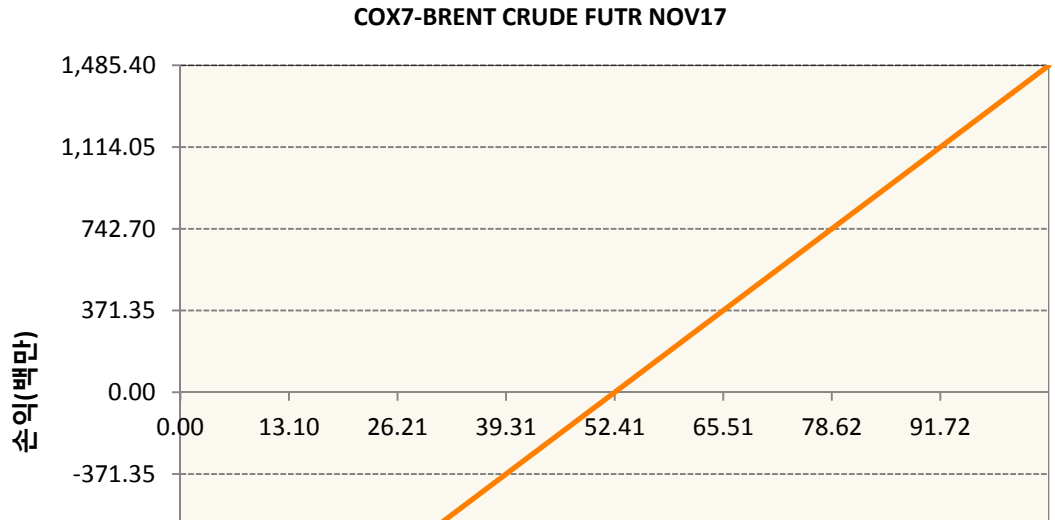
1. 계약금액

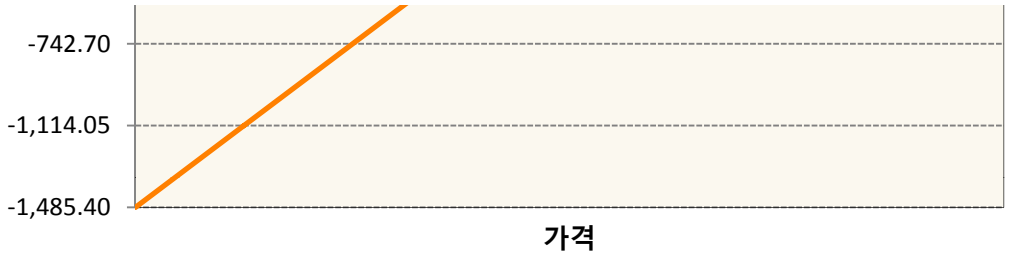
(단위:백만원)

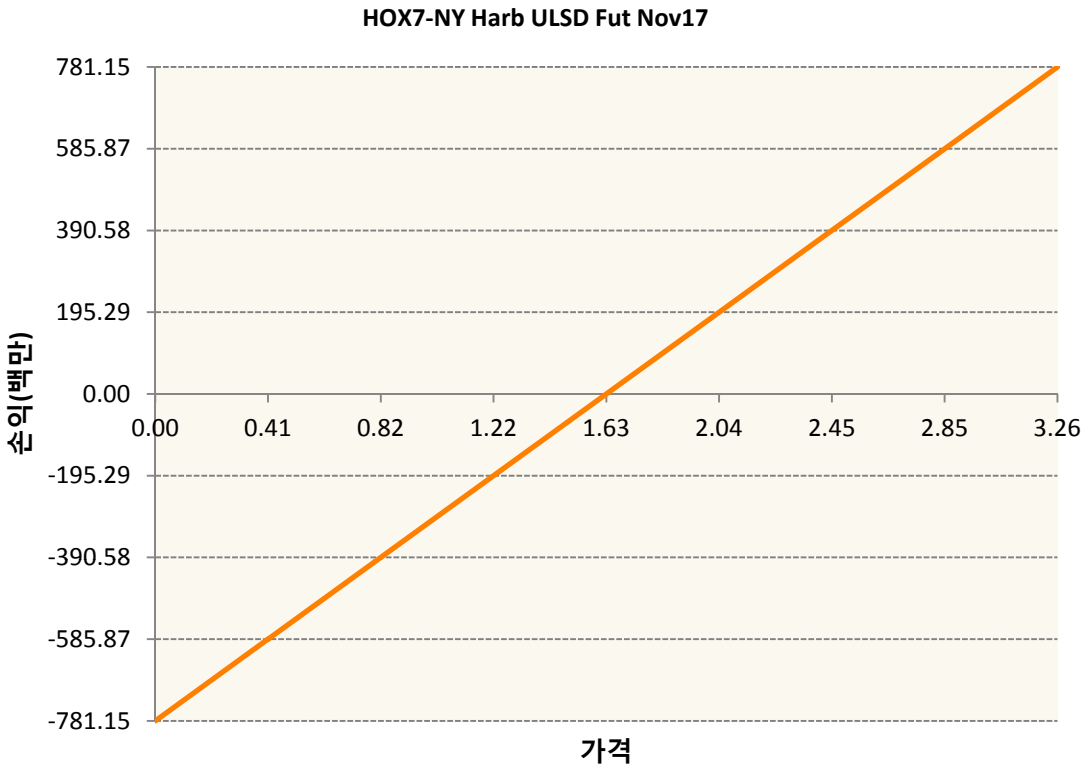
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	5,430	399	5,032	

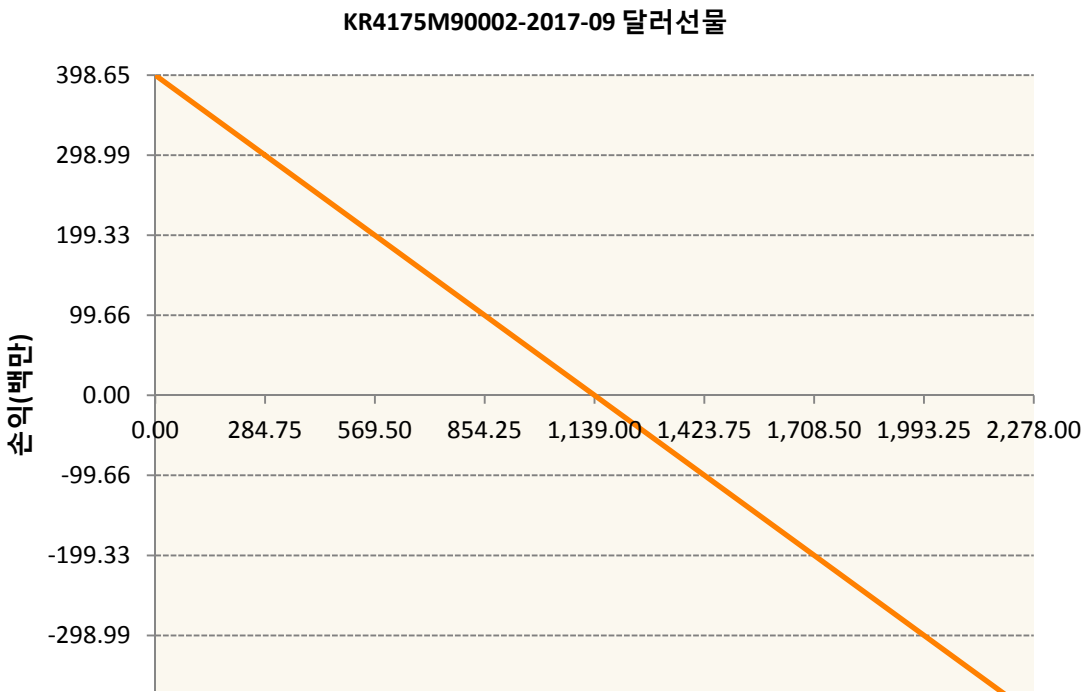
2. 만기시점의 손익구조

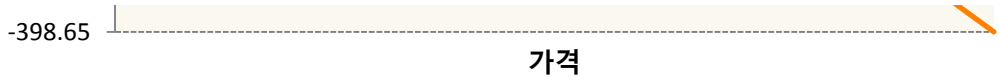


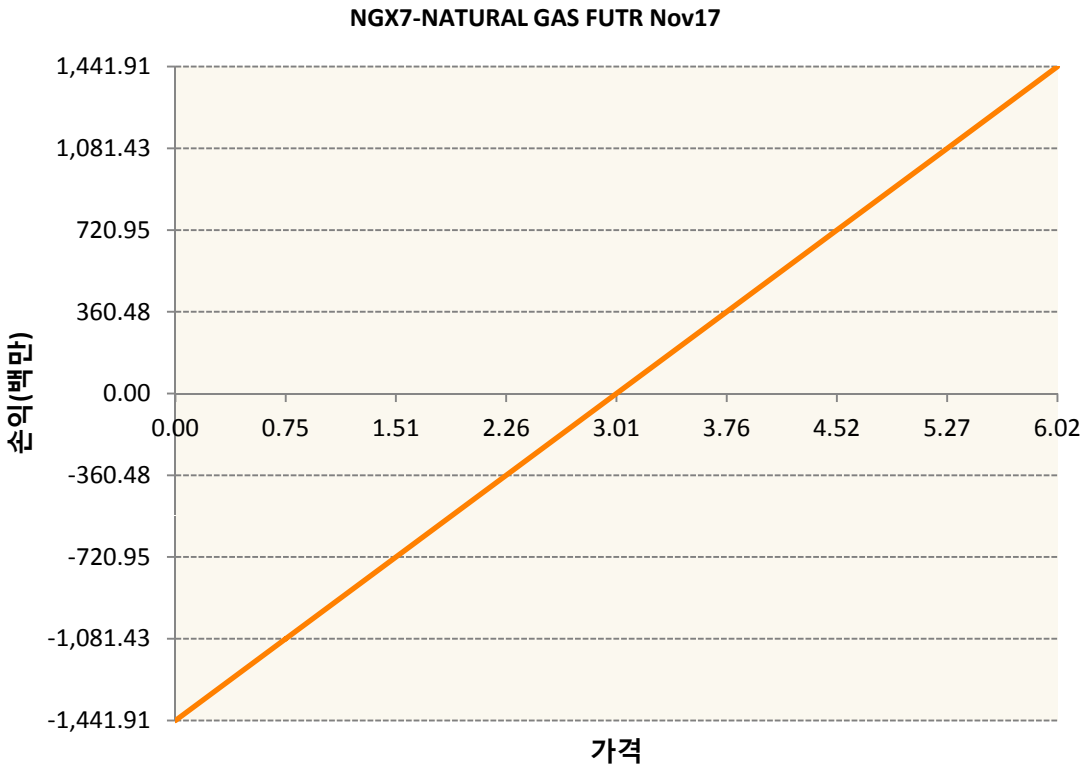


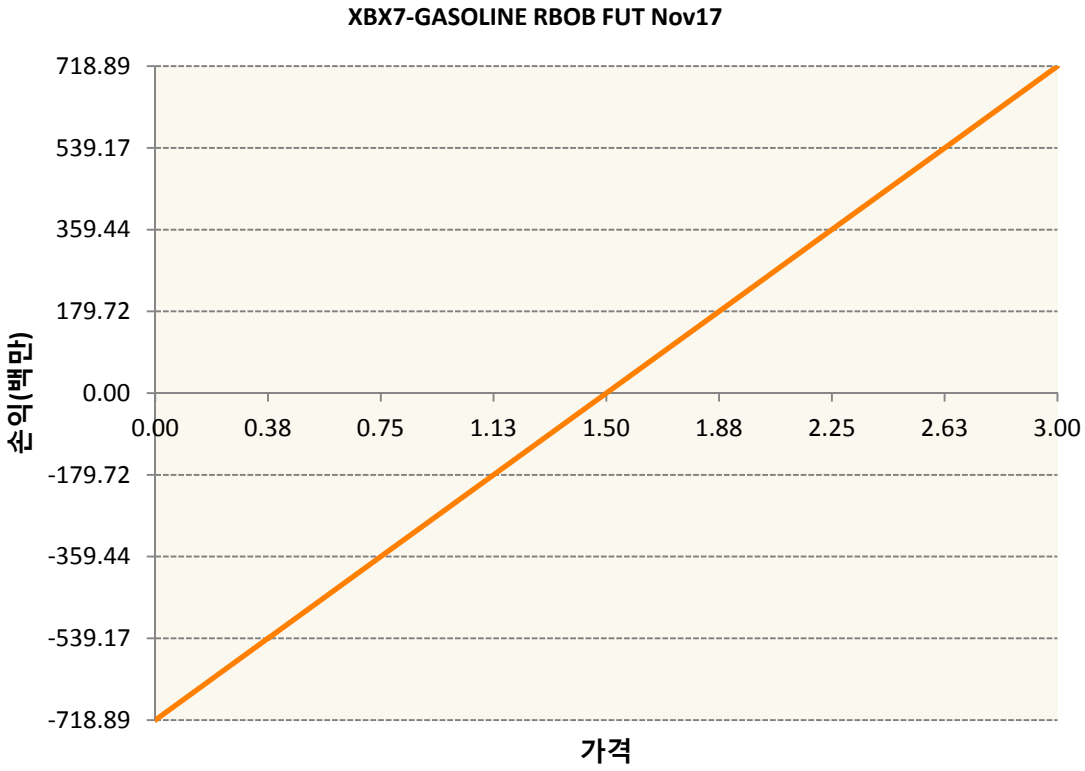

-742.70
-1,114.05
-1,485.40
가격


HOX7-NY Harb ULSD Fut Nov17
781.15
585.87
390.58
195.29
0.00
-195.29
-390.58
-585.87
-781.15
0.00
0.41
0.82
1.22
1.63
2.04
2.45
2.85
3.26
손익(백만)
가격


KR4175M90002-2017-09 달러선물
398.65
298.99
199.33
99.66
0.00
-99.66
-199.33
-298.99
0.00
284.75
569.50
854.25
1,139.00
1,423.75
1,708.50
1,993.25
2,278.00
손익(백만)


-398.65
가격


NGX7-NATURAL GAS FUTR Nov17
1,441.91
1,081.43
720.95
360.48
0.00
-360.48
-720.95
-1,081.43
-1,441.91
0.00
0.75
1.51
2.26
3.01
3.76
4.52
5.27
6.02
손익(백만)
가격


XBX7-GASOLINE RBOB FUT Nov17
718.89
539.17
359.44
179.72
0.00
-179.72
-359.44
-539.17
-718.89
0.00
0.38
0.75
1.13
1.50
1.88
2.25
2.63
3.00
손익(백만)
가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLX7	WTI CRUDE FUTURE Nov17	80
COX7	BRENT CRUDE FUTR NOV17	119
HOX7	NY Harb ULSD Fut Nov17	62
KR4175M90(	2017-09 달러선물	32
NGX7	NATURAL GAS FUTR Nov17	115
XBX7	GASOLINE RBOB FUT Nov17	58

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

779

공시일	2017-08-22
기준일	2017-08-21

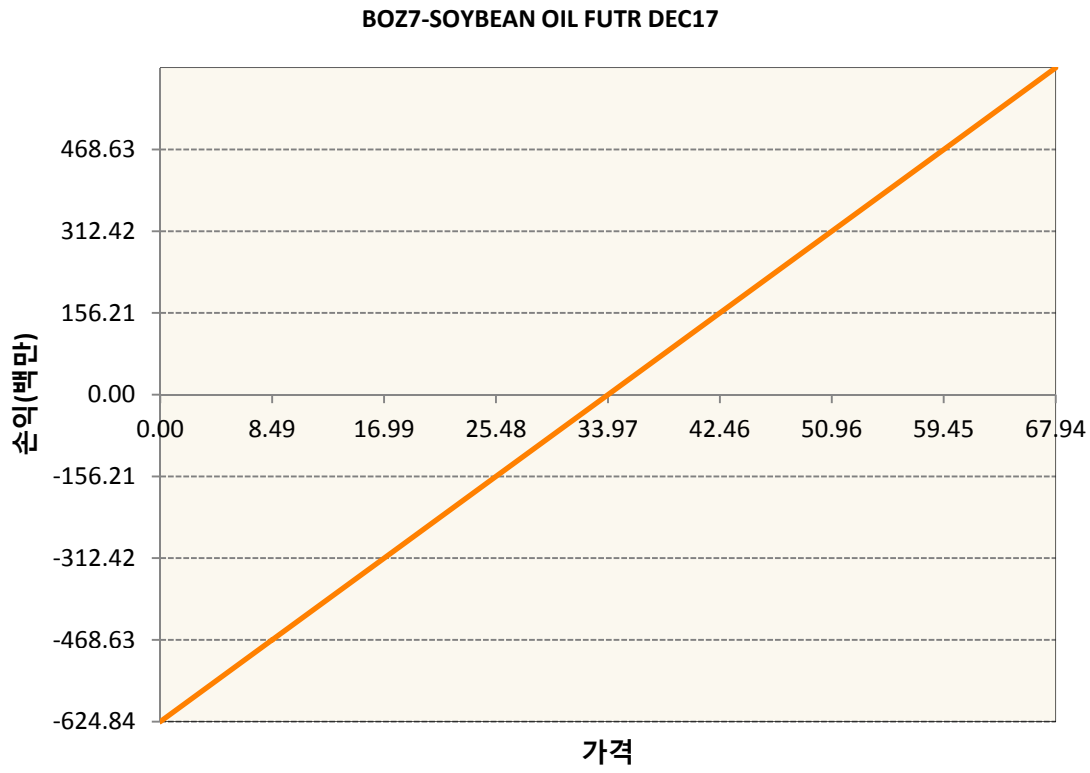
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

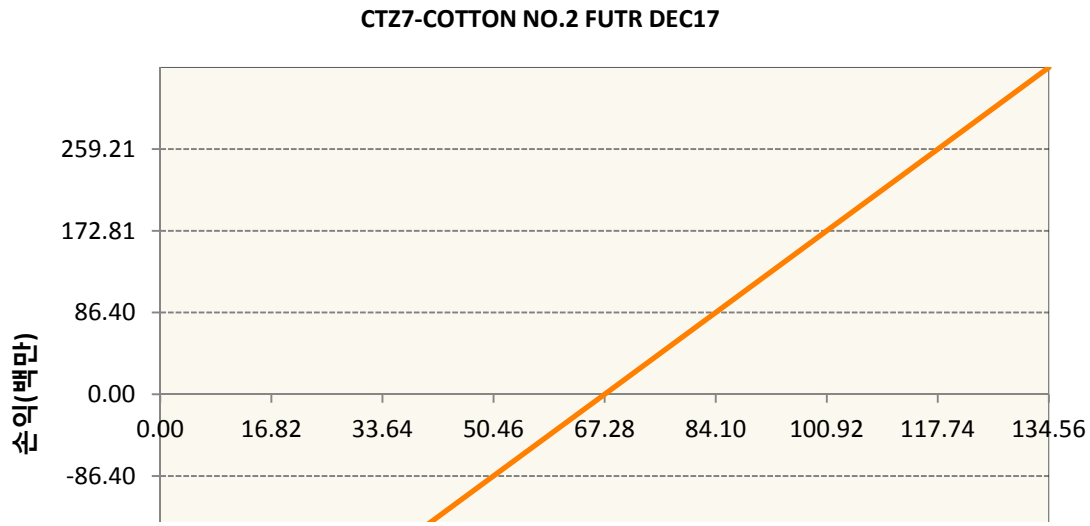
1. 계약금액

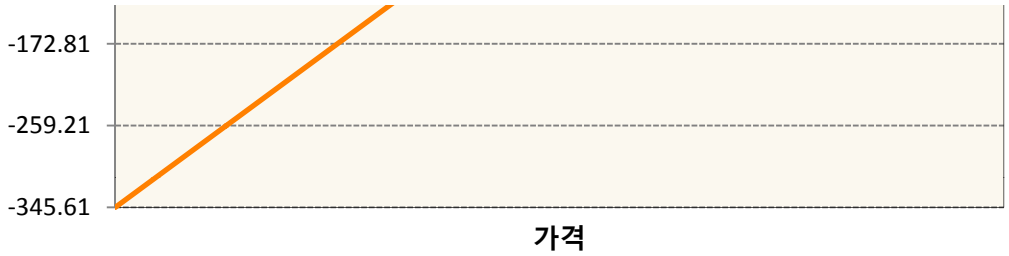
(단위:백만원)

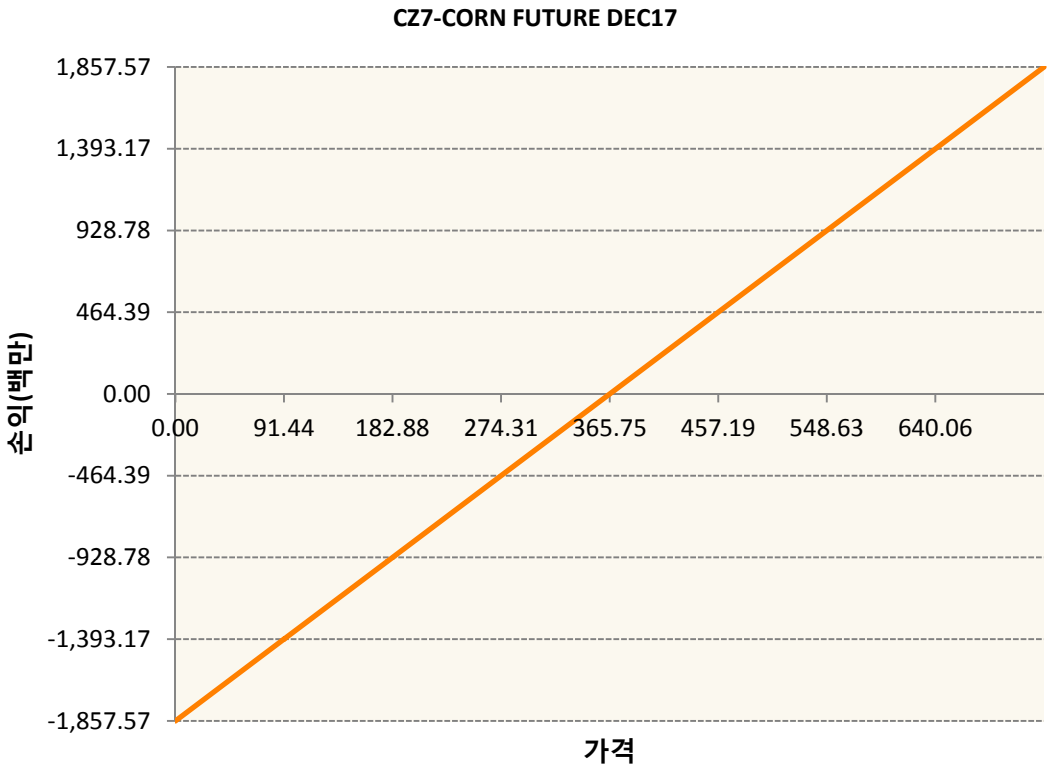
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	6,941	342	6,600	

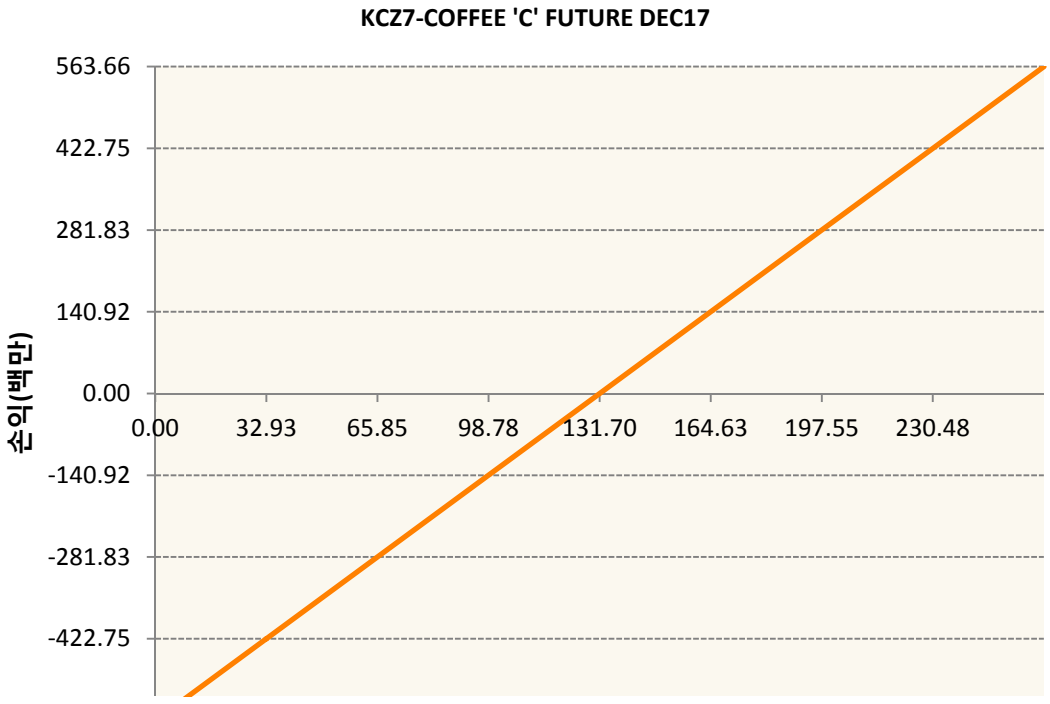
2. 만기시점의 손익구조

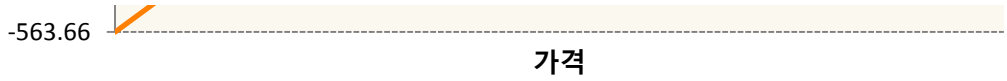


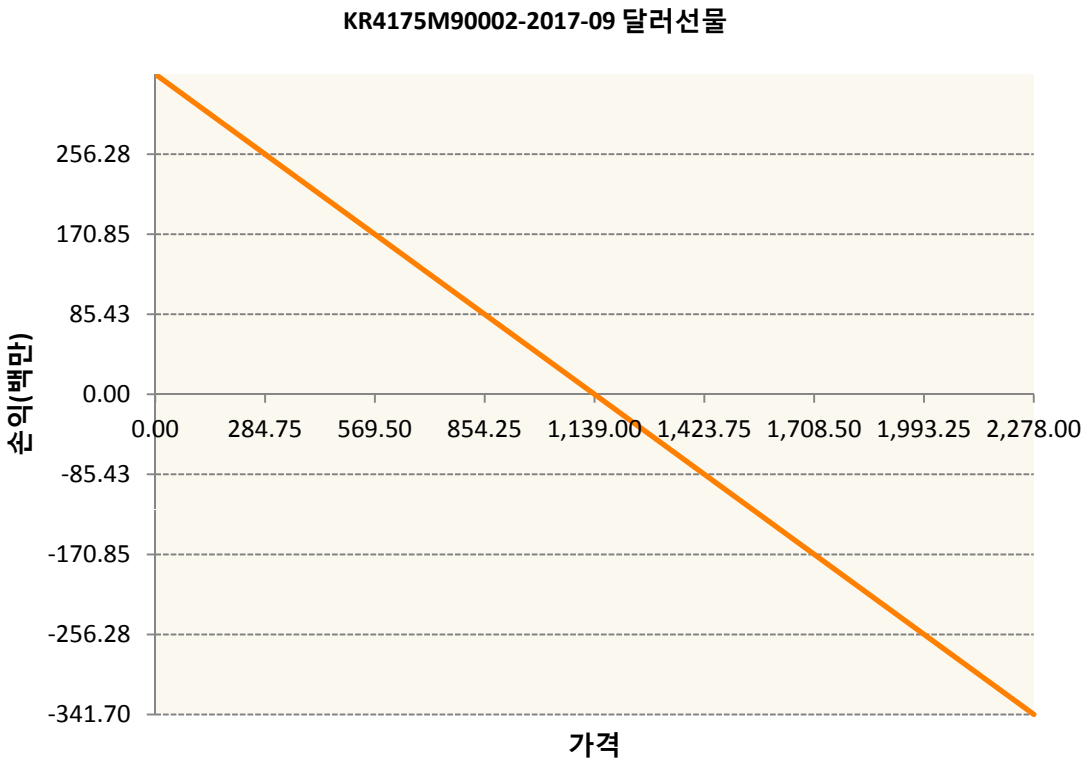


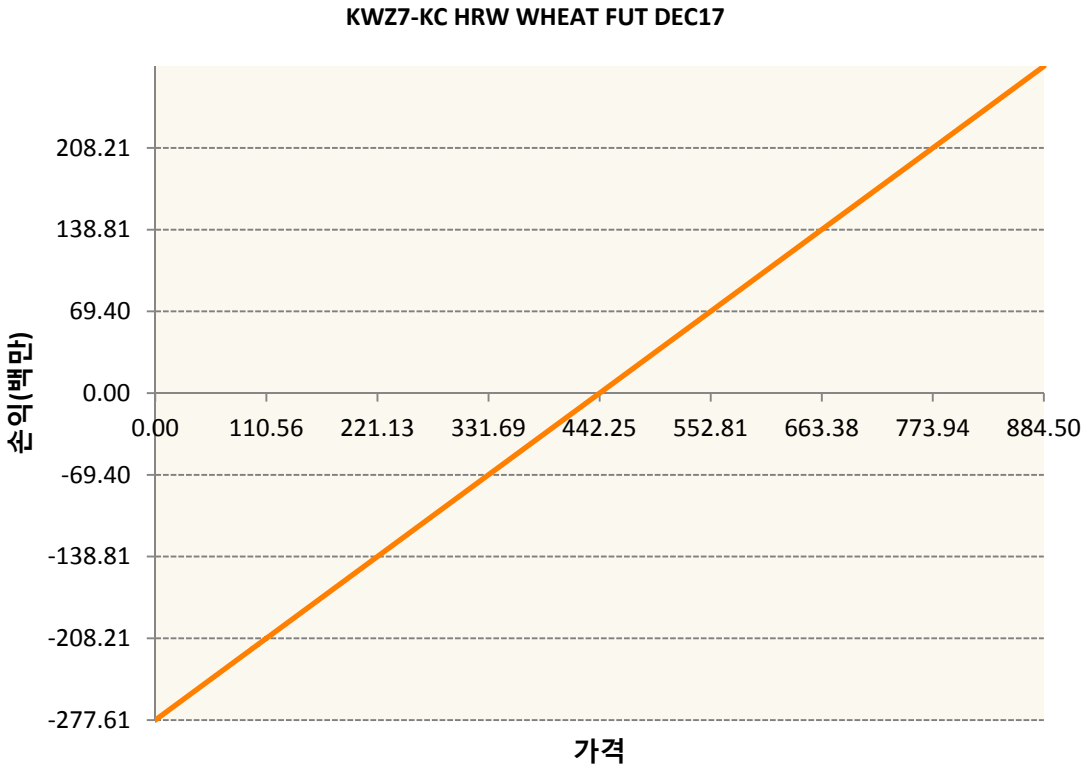

-172.81
-259.21
-345.61
가격

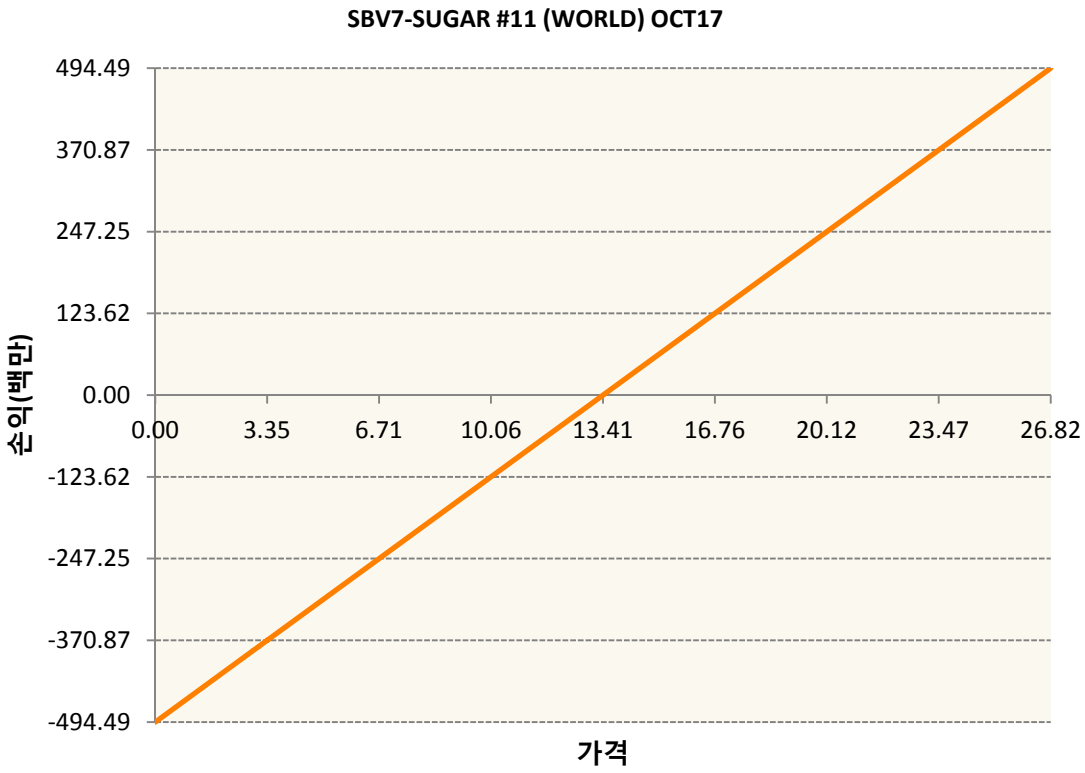

CZ7-CORN FUTURE DEC17
1,857.57
1,393.17
928.78
464.39
0.00
-464.39
-928.78
-1,393.17
-1,857.57
0.00
91.44
182.88
274.31
365.75
457.19
548.63
640.06
손익(백만)
가격

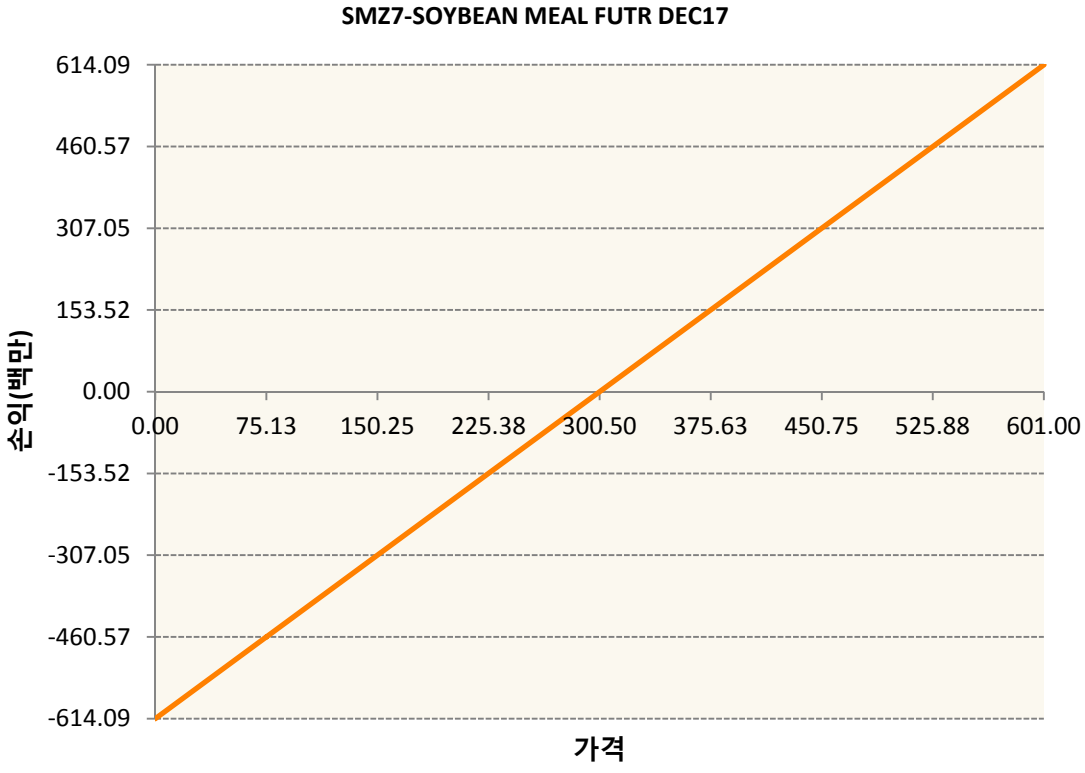

KCZ7-COFFEE 'C' FUTURE DEC17
563.66
422.75
281.83
140.92
0.00
-140.92
-281.83
-422.75
0.00
32.93
65.85
98.78
131.70
164.63
197.55
230.48
손익(백만)

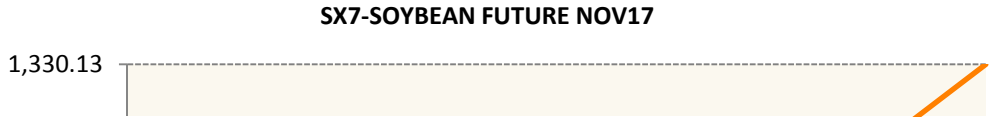

-563.66
가격

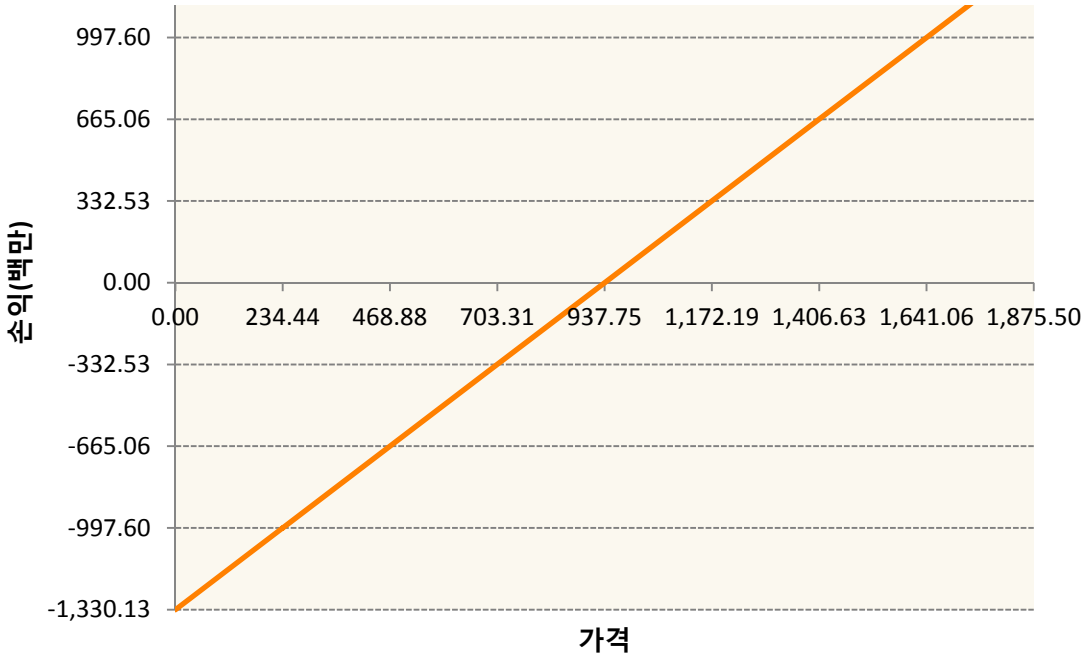

KR4175M90002-2017-09 달러선물
256.28
170.85
85.43
0.00
-85.43
-170.85
-256.28
-341.70
0.00
284.75
569.50
854.25
1,139.00
1,423.75
1,708.50
1,993.25
2,278.00
손익(백만)
가격

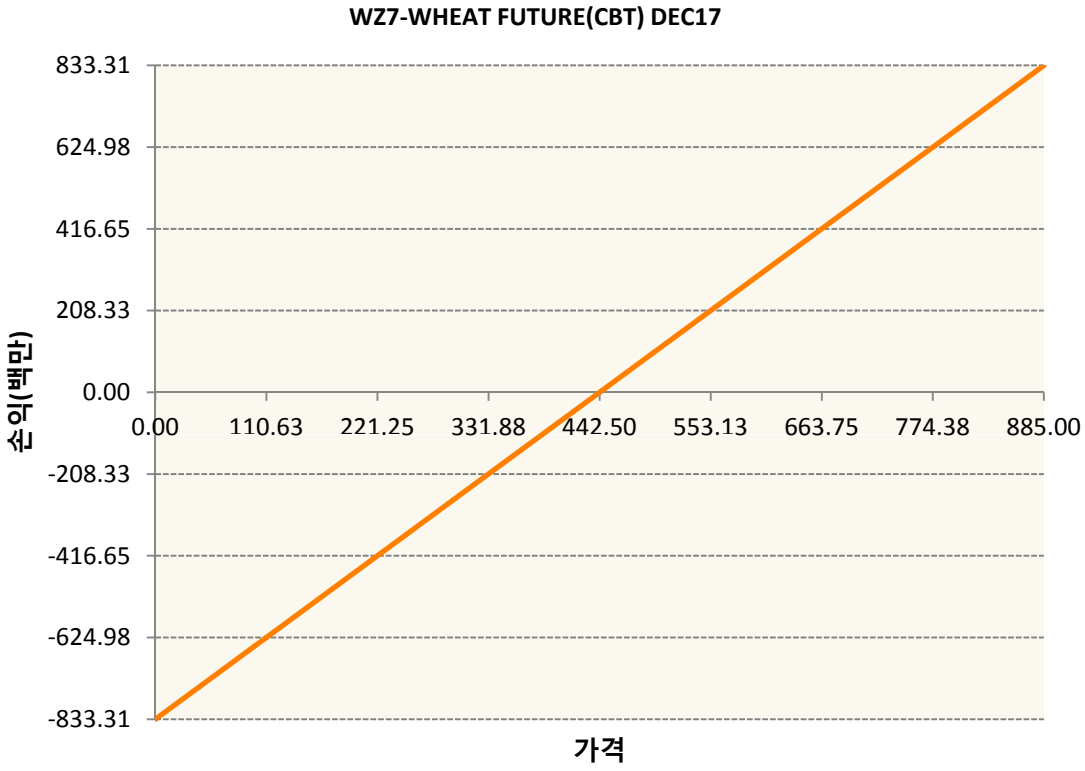

KWZ7-KC HRW WHEAT FUT DEC17
208.21
138.81
69.40
0.00
-69.40
-138.81
-208.21
-277.61
0.00
110.56
221.13
331.69
442.25
552.81
663.38
773.94
884.50
손익(백만)
가격


SBV7-SUGAR #11 (WORLD) OCT17
494.49
370.87
247.25
123.62
0.00
-123.62
-247.25
-370.87
-494.49
0.00
3.35
6.71
10.06
13.41
16.76
20.12
23.47
26.82
손익(백만)
가격


SMZ7-SOYBEAN MEAL FUTR DEC17
614.09
460.57
307.05
153.52
0.00
-153.52
-307.05
-460.57
-614.09
0.00
75.13
150.25
225.38
300.50
375.63
450.75
525.88
601.00
손익(백만)
가격


SX7-SOYBEAN FUTURE NOV17
1,330.13





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
BOZ7	SOYBEAN OIL FUTR DEC17	50
CTZ7	COTTON NO.2 FUTR DEC17	28
CZ7	CORN FUTURE DEC17	149
KCZ7	COFFEE 'C' FUTURE DEC17	45
KR4175M90(	2017-09 달러선물	27

KWZ7	KC HRW WHEAT FUT DEC17	22
SBV7	SUGAR #11 (WORLD) OCT17	40
SMZ7	SOYBEAN MEAL FUTR DEC17	49
SX7	SOYBEAN FUTURE NOV17	106
WZ7	WHEAT FUTURE(CBT) DEC17	67

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

656