공시일	2017-08-01
기준일	2017-07-31

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	2017-08-01
기준일	2017-07-31

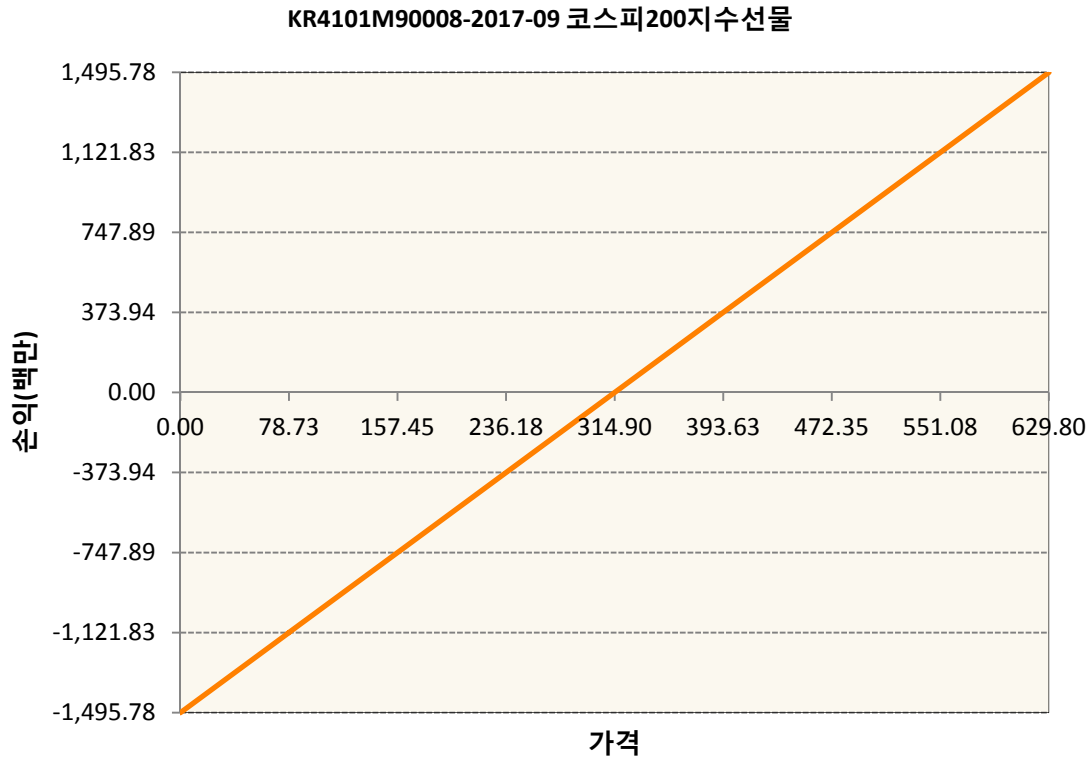
스마트인덱스모

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	1,496	0	1,496	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101M90(2017-09 코스피200지수선물							120
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-120	-120	-120	-120	-120	-120	-120
-5.33%	-80	-80	-80	-80	-80	-80	-80
-2.67%	-40	-40	-40	-40	-40	-40	-40
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	40	40	40	40	40	40	40
5.33%	80	80	80	80	80	80	80
8.00%	120	120	120	120	120	120	120

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

73

공시일	2017-08-01
기준일	2017-07-31

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	1,021

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

475

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-08-01
기준일	2017-07-31

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	394

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

336

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-08-01
기준일	2017-07-31

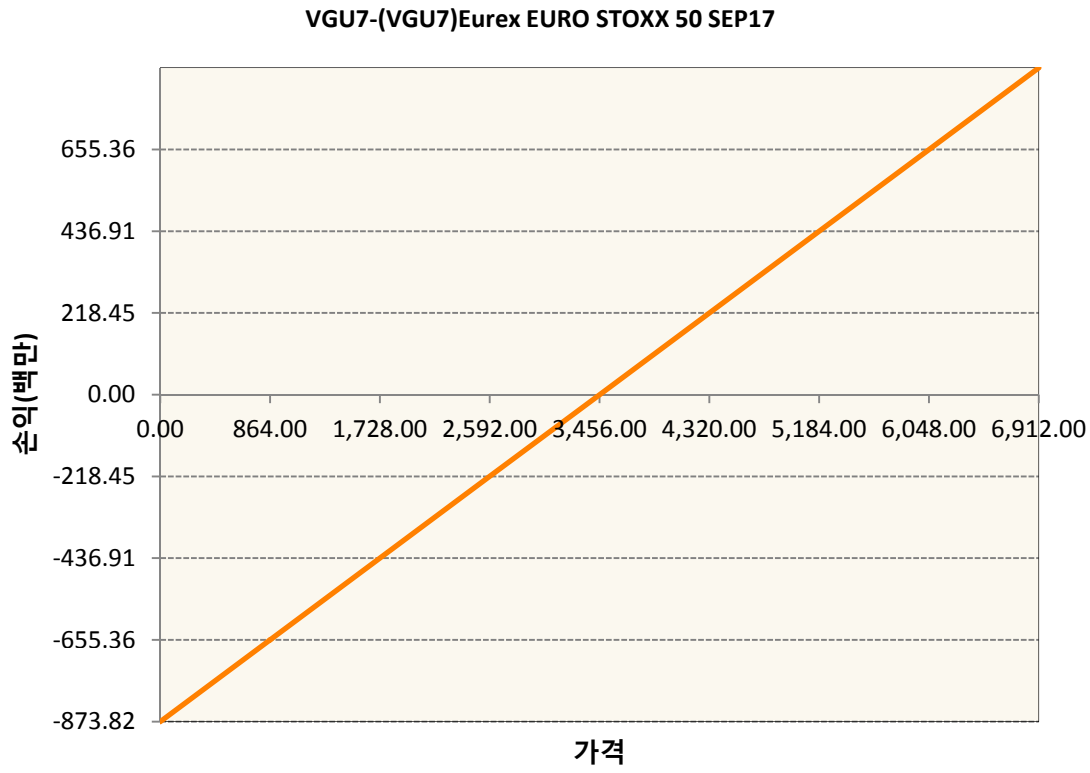
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	874	0	874	

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)

58

공시일	2017-08-01
기준일	2017-07-31

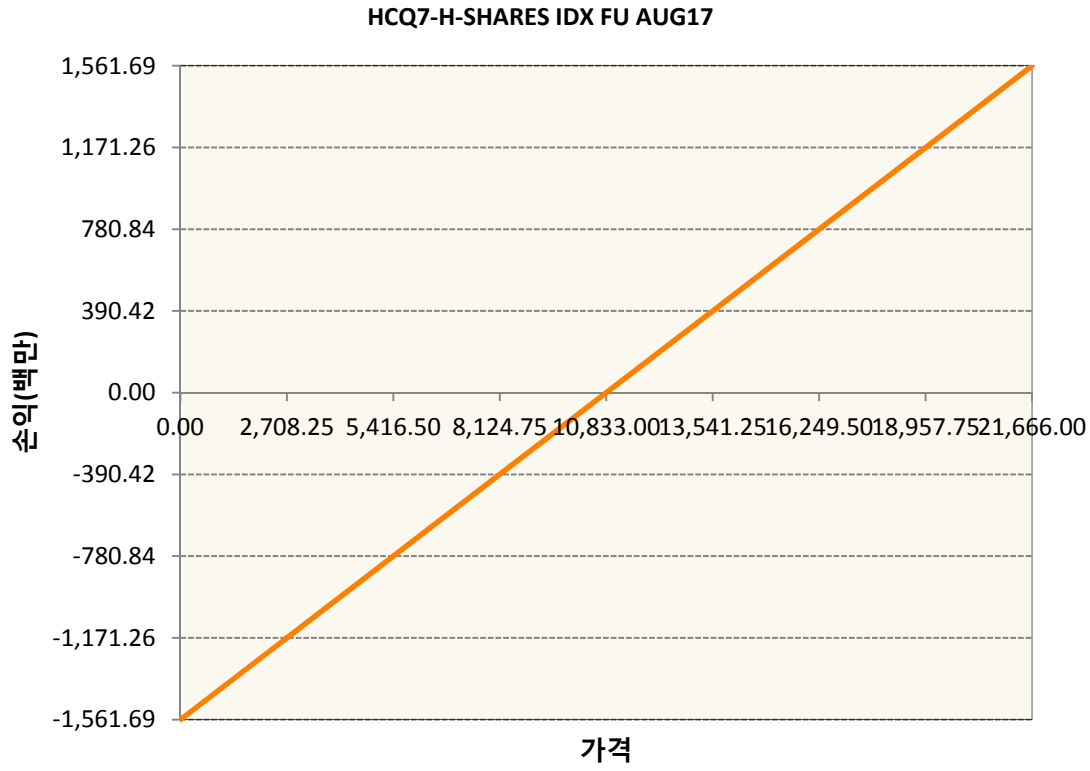
차이나인덱스모(주식-파생형)

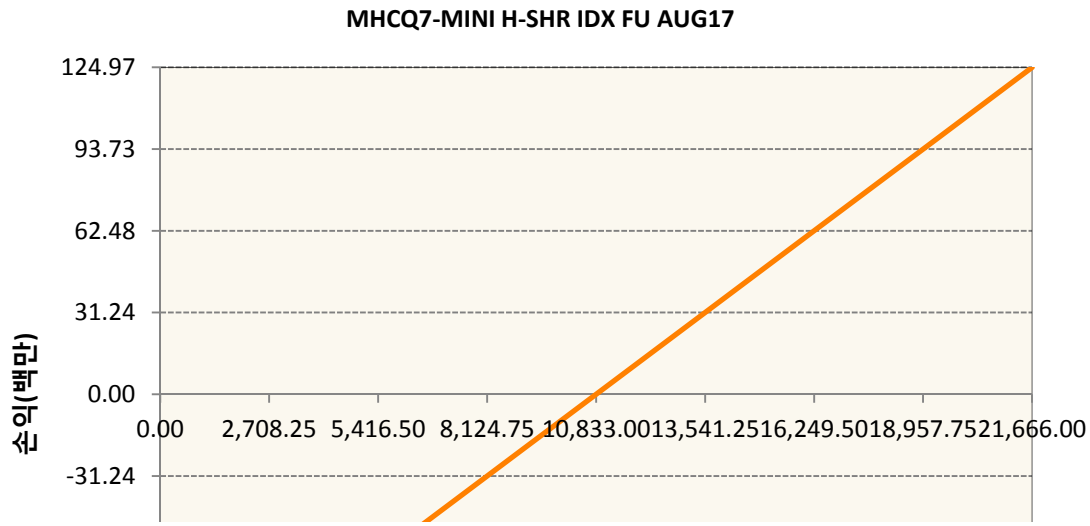
1. 계약금액

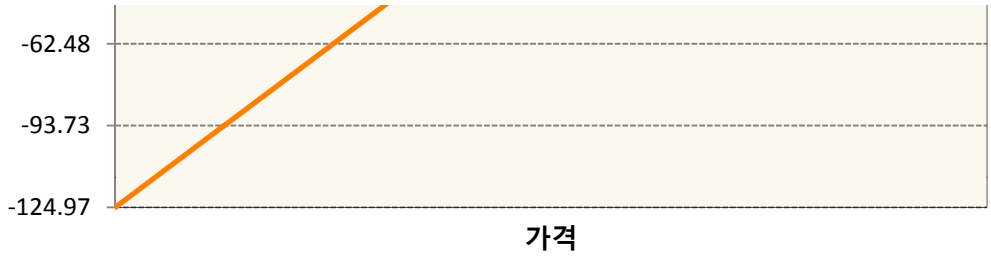
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,687	0	1,687	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)
	120

공시일	2017-08-01
기준일	2017-07-31

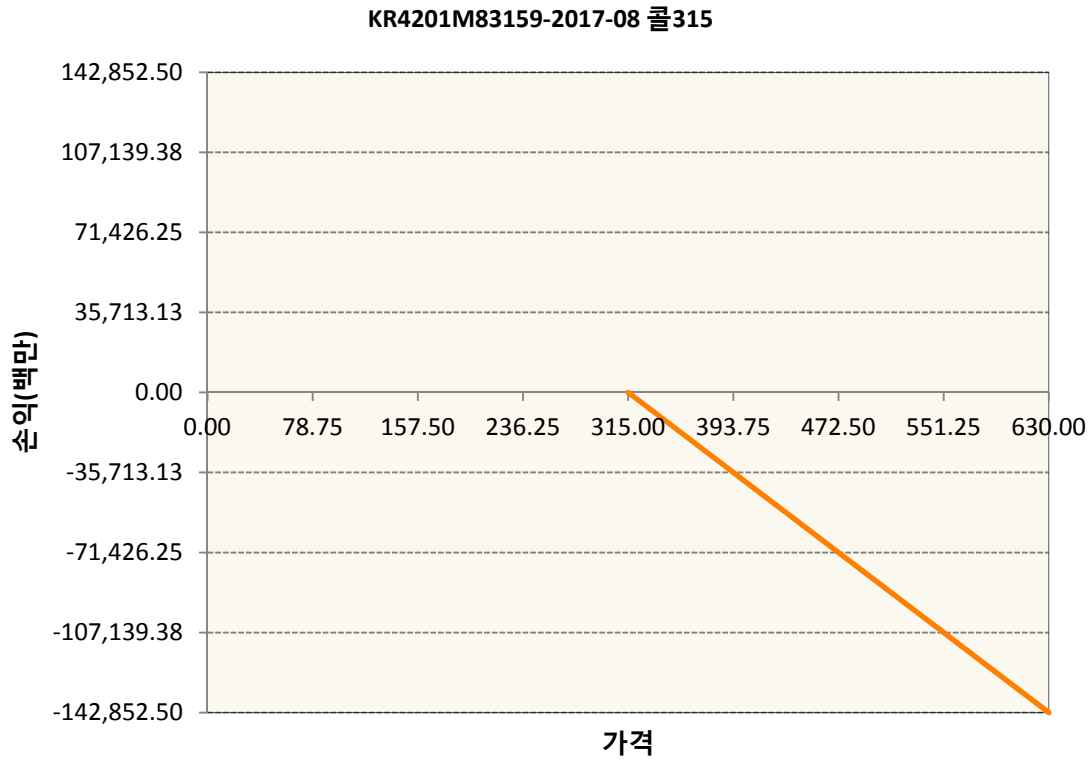
커버드콜모(주식혼합-파생형)

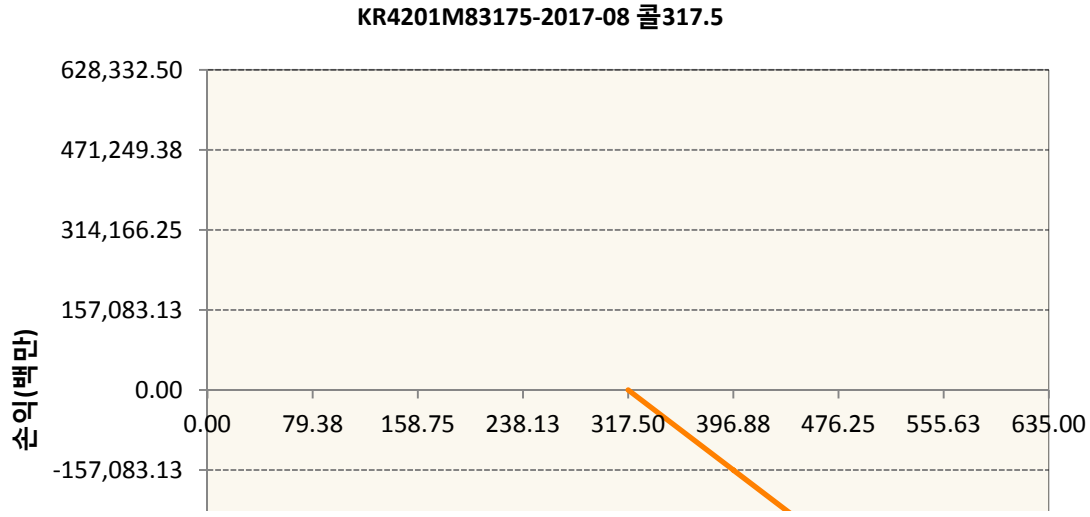
1. 계약금액

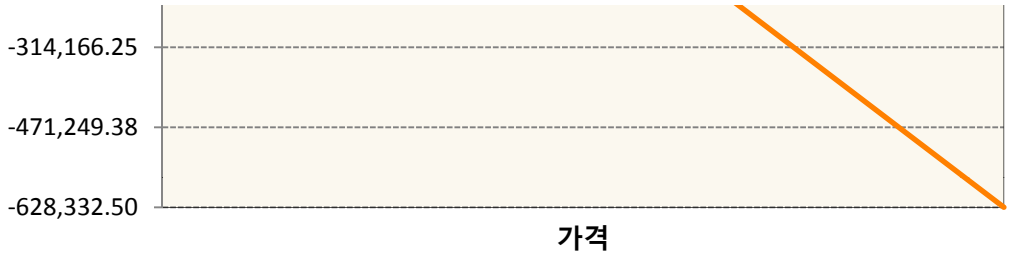
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	1,339,364	-1,339,364	장내

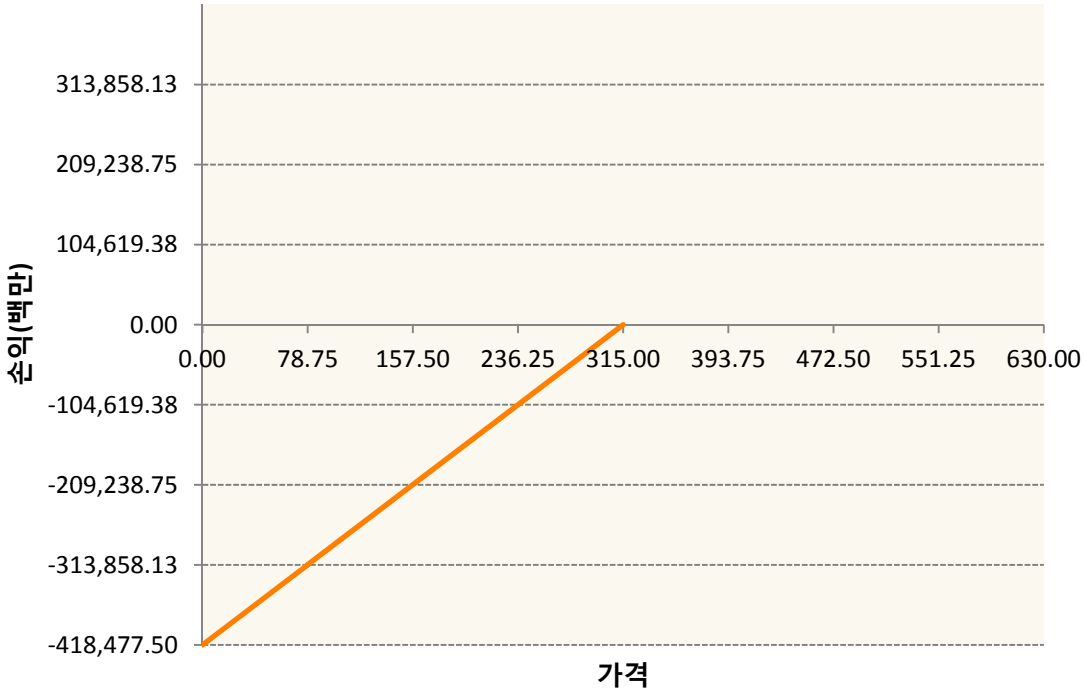
2. 만기시점의 손익구조



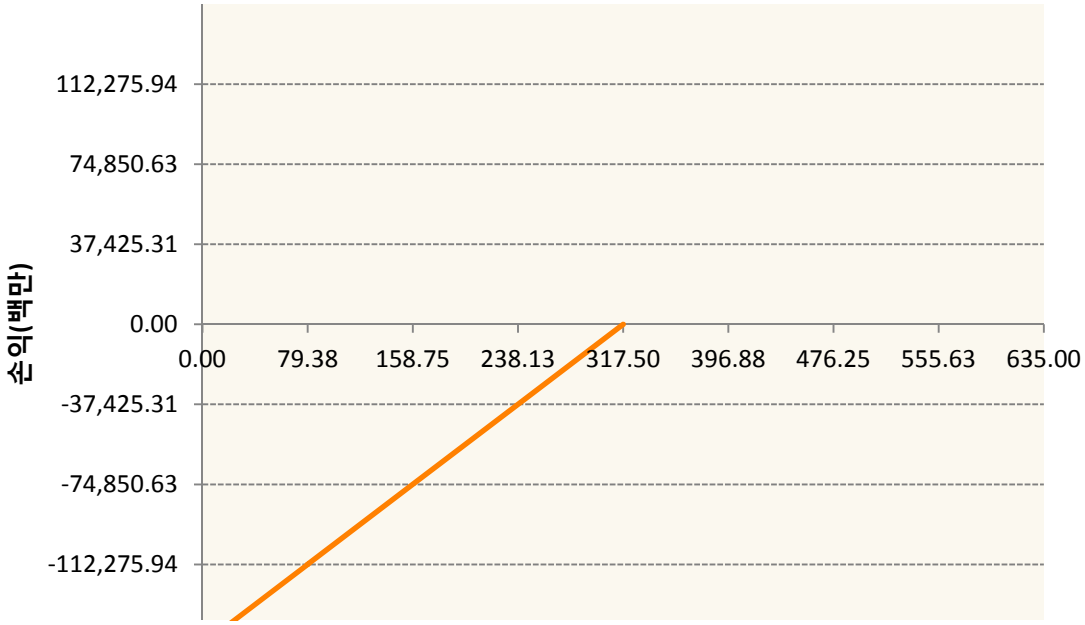




KR4301M83157-2017-08 풋315



KR4301M83173-2017-08 풋317.5





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201M83: 2017-08 콜315							9,293
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	2,110	2,106	2,099	2,085	2,066	2,039	2,005
-5.33%	2,071	2,038	1,993	1,936	1,868	1,790	1,703
-2.67%	1,756	1,638	1,510	1,375	1,233	1,087	936
0%	551	367	184	0	-184	-367	-551
2.67%	-1,957	-2,090	-2,232	-2,380	-2,534	-2,691	-2,853
5.33%	-5,378	-5,426	-5,487	-5,561	-5,647	-5,743	-5,848
8.00%	-9,117	-9,126	-9,142	-9,166	-9,199	-9,241	-9,293
KR4201M83: 2017-08 콜317.5							38,134
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	7,046	7,038	7,019	6,985	6,929	6,849	6,740
-5.33%	6,964	6,876	6,744	6,568	6,346	6,080	5,773
-2.67%	6,140	5,745	5,298	4,805	4,276	3,714	3,127
0%	2,324	1,555	780	0	-784	-1,570	-2,359
2.67%	-6,947	-7,644	-8,362	-9,095	-9,839	-10,594	-11,356
5.33%	-20,967	-21,279	-21,651	-22,076	-22,546	-23,056	-23,600
8.00%	-37,044	-37,117	-37,231	-37,388	-37,592	-37,841	-38,134
KR4301M83: 2017-08 풋315							27,548
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-27,240	-27,251	-27,274	-27,313	-27,370	-27,448	-27,548
-5.33%	-16,213	-16,311	-16,444	-16,611	-16,809	-17,038	-17,292
-2.67%	-5,997	-6,343	-6,717	-7,114	-7,528	-7,958	-8,399
0%	1,613	1,075	538	0	-538	-1,075	-1,613
2.67%	5,407	5,017	4,602	4,168	3,718	3,256	2,784
5.33%	6,528	6,387	6,206	5,989	5,739	5,458	5,151
8.00%	6,714	6,687	6,640	6,570	6,474	6,351	6,200
KR4301M83: 2017-08 풋317.5							10,256
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-10,183	-10,185	-10,189	-10,198	-10,211	-10,230	-10,256
-5.33%	-6,249	-6,270	-6,301	-6,343	-6,396	-6,459	-6,532
-2.67%	-2,491	-2,585	-2,692	-2,809	-2,935	-3,069	-3,209
0%	554	371	186	0	-187	-374	-562
2.67%	2,299	2,133	1,962	1,787	1,610	1,430	1,248

5.33%	2,912	2,838	2,749	2,648	2,536	2,415	2,285
8.00%	3,036	3,019	2,992	2,954	2,905	2,846	2,776

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

91,679

공시일	2017-08-01
기준일	2017-07-31

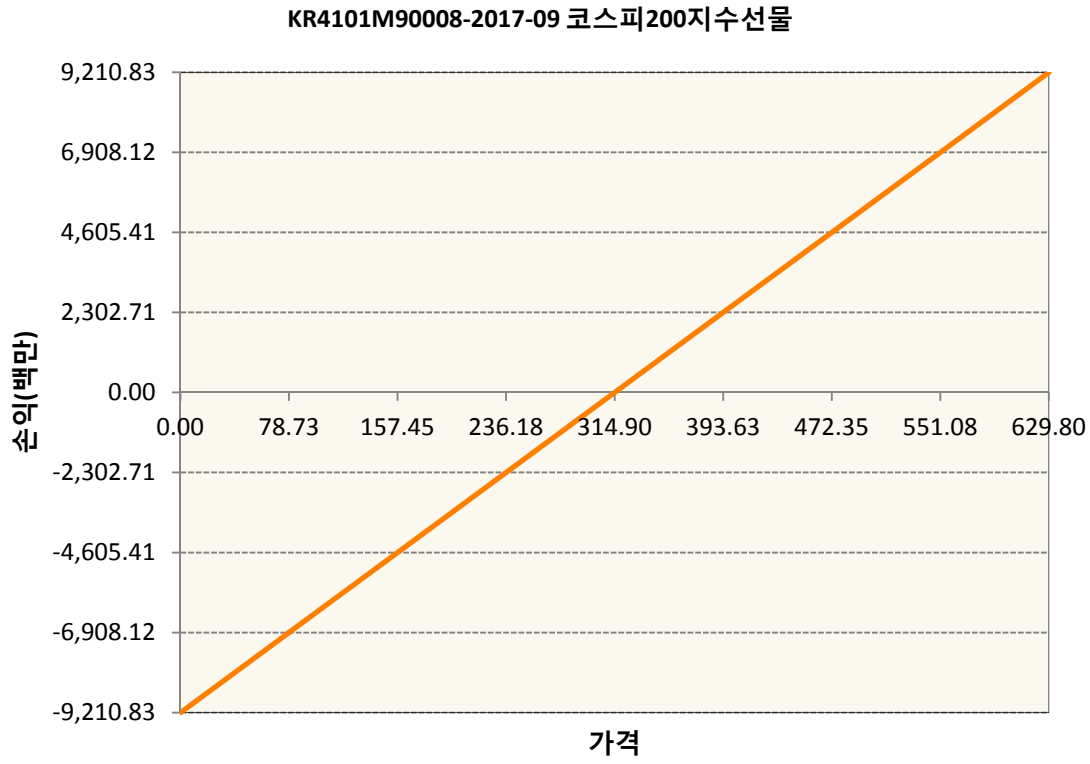
ETF스마트레버리지목표전환형6호

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	9,211	0	9,211	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101M90(2017-09 코스피200지수선물							736
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-736	-736	-736	-736	-736	-736	-736
-5.33%	-491	-491	-491	-491	-491	-491	-491
-2.67%	-245	-245	-245	-245	-245	-245	-245
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	245	245	245	245	245	245	245
5.33%	491	491	491	491	491	491	491
8.00%	736	736	736	736	736	736	736

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

450

공시일	2017-08-01
기준일	2017-07-31

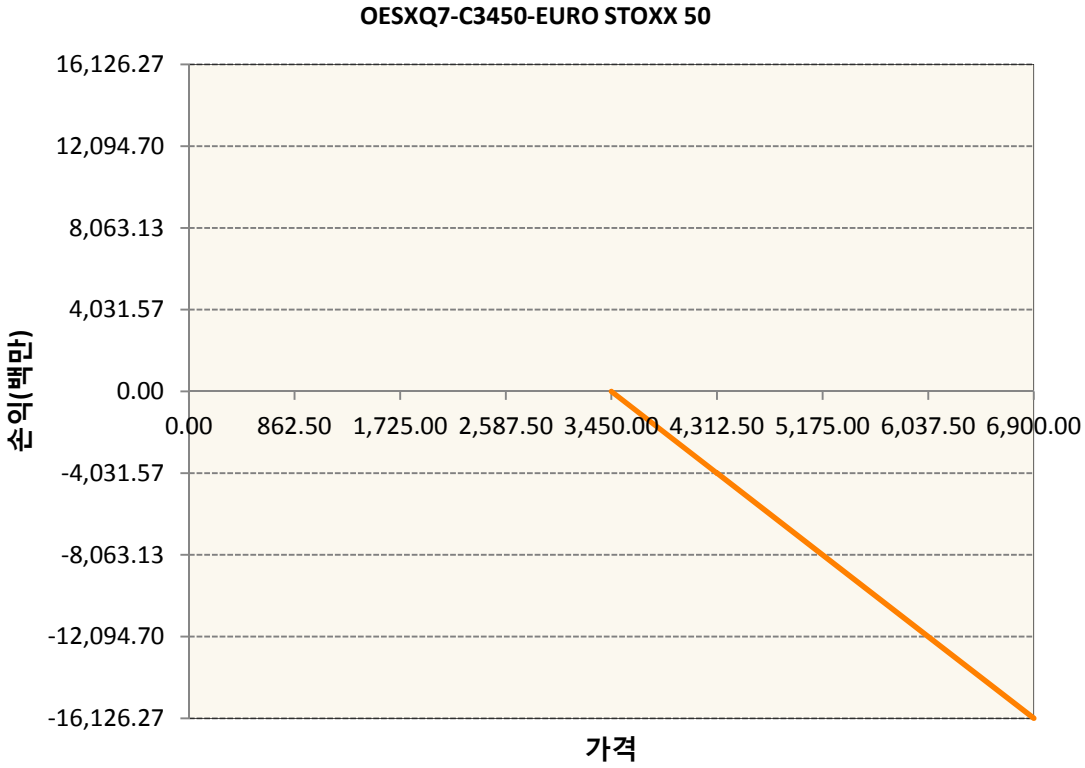
유로커버드콜(주식혼합-파생형)

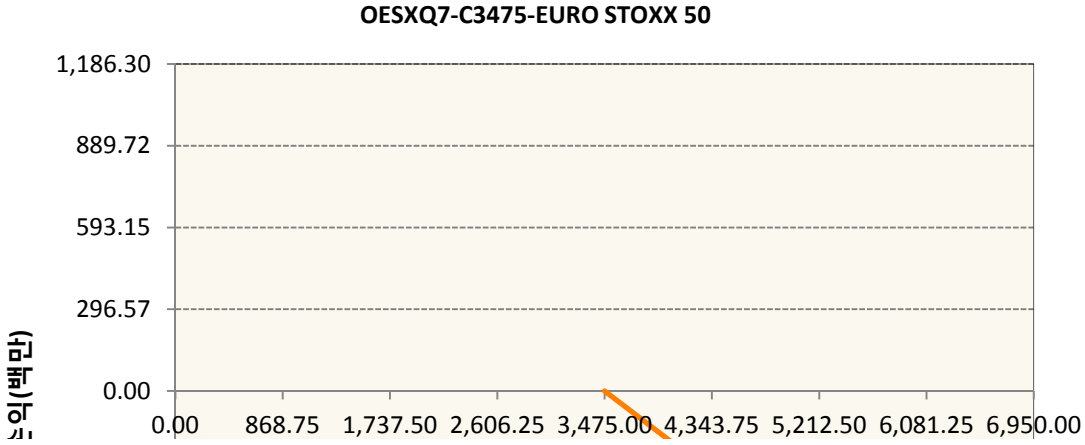
1. 계약금액

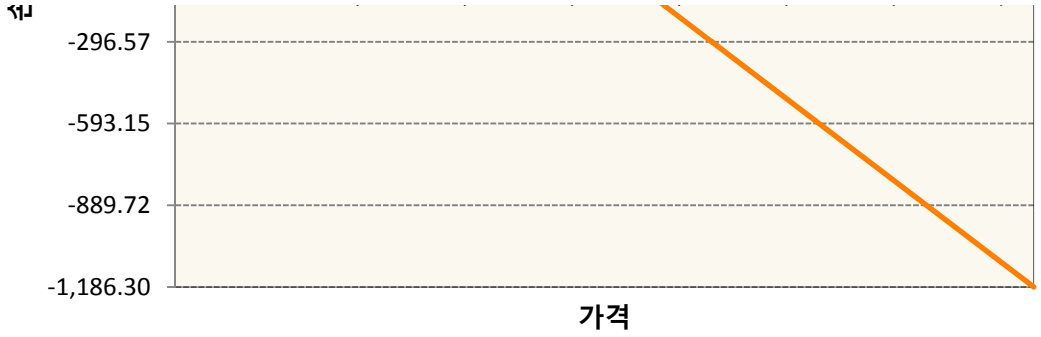
(단위:백만원)

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	17,180	0	17,180	
누계	유가증권	옵션	0	34,625	-34,625	장내

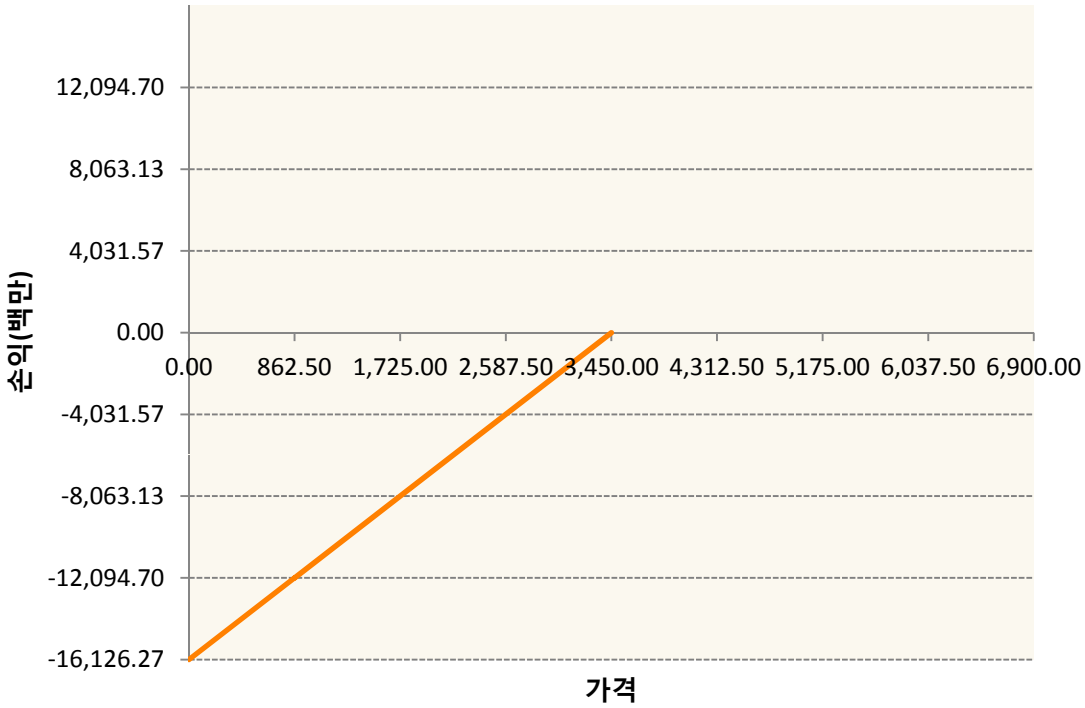
2. 만기시점의 손익구조



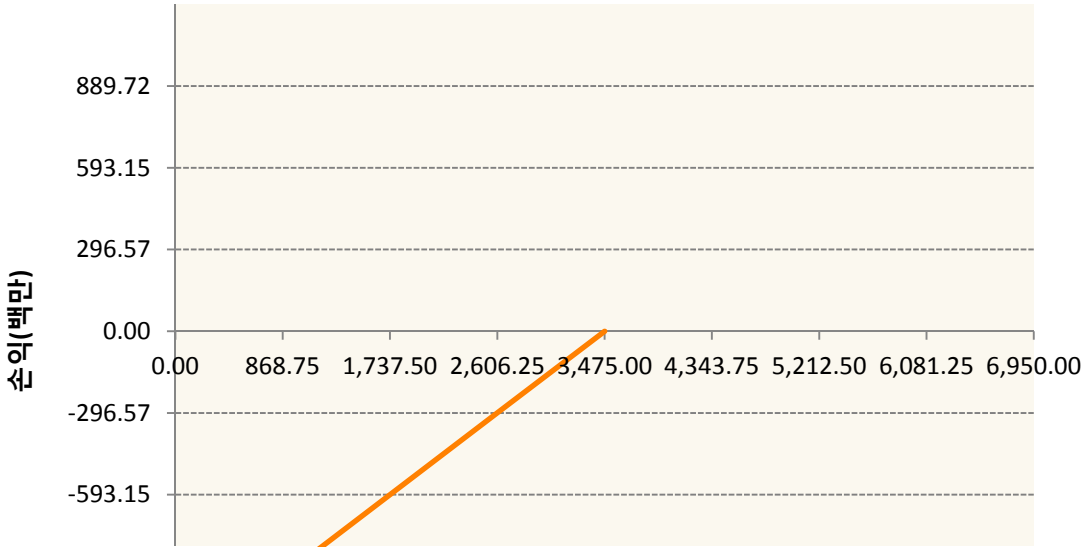


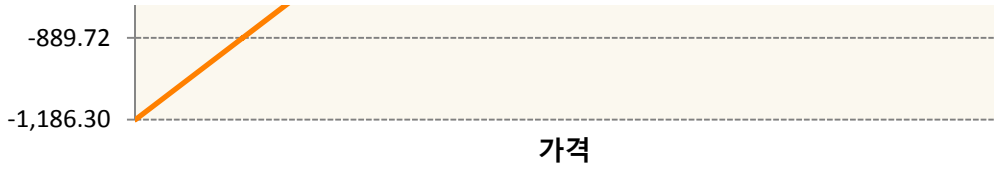


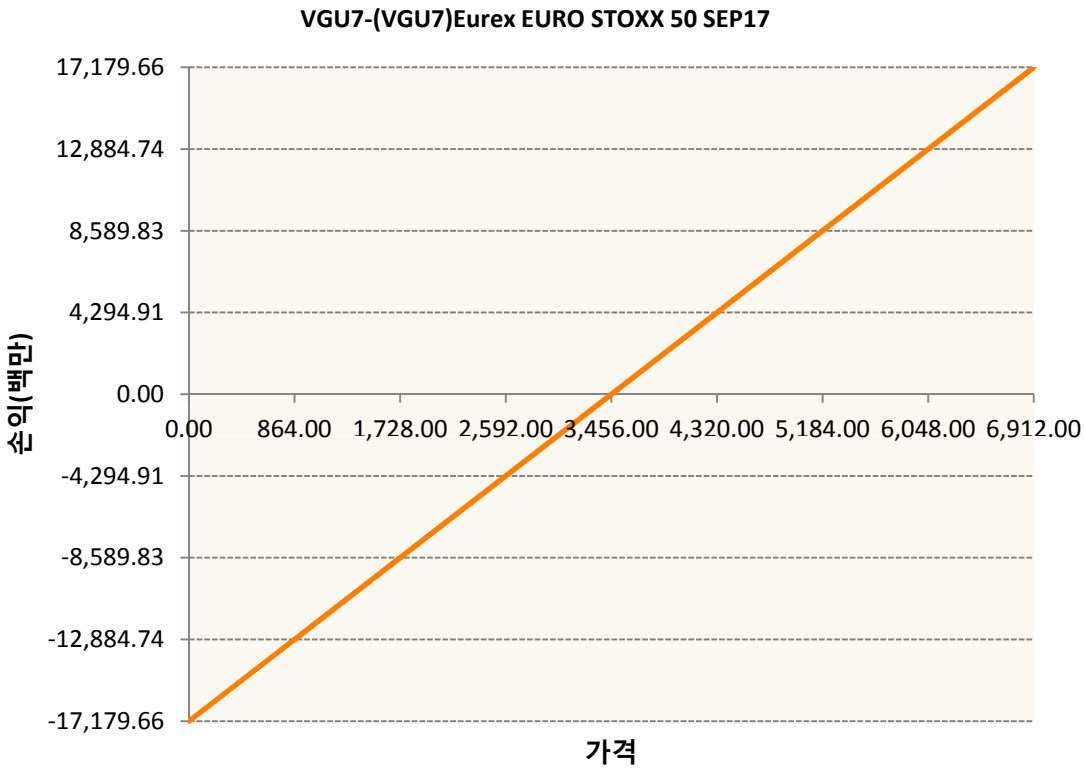
OESXQ7-P3450-EURO STOXX 50



OESXQ7-P3475-EURO STOXX 50







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

OESXQ7-C3	EURO STOXX 50	1,290
OESXQ7-C3	EURO STOXX 50	95
OESXQ7-P3	EURO STOXX 50	1,290
OESXQ7-P3	EURO STOXX 50	95
VGU7	(VGU7)Eurex EURO STOXX 50 SEP17	1,374

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

3,446

공시일	2017-08-01
기준일	2017-07-31

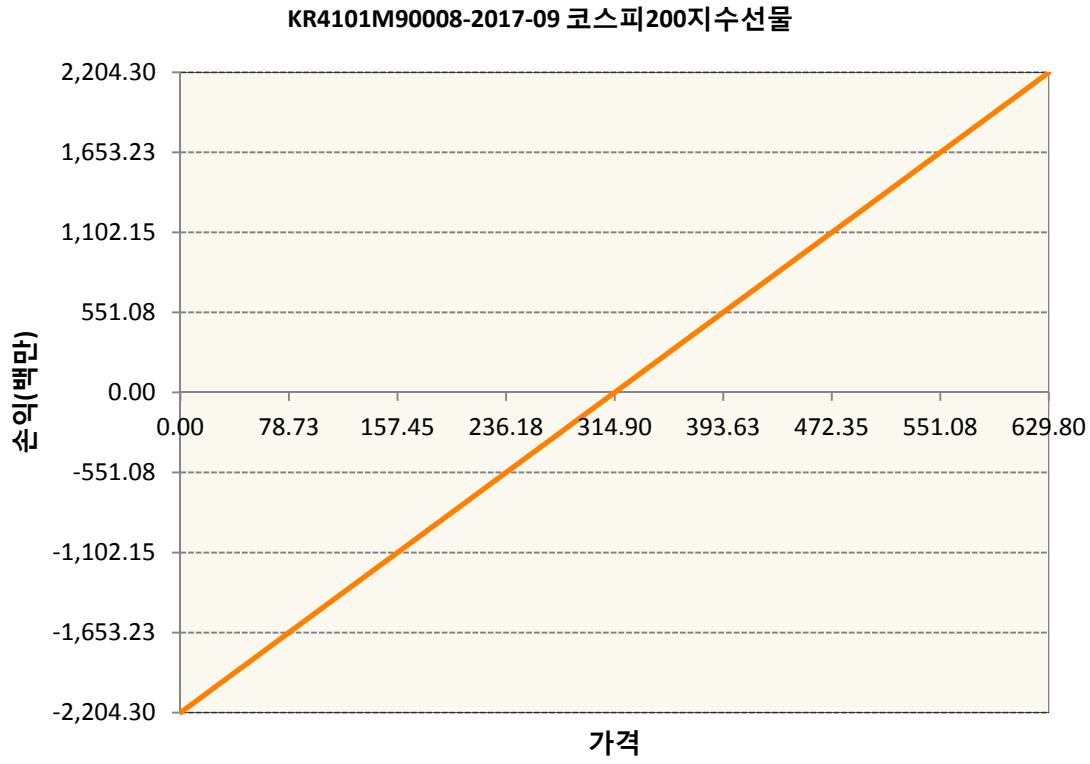
ETF스마트레버리지목표전환형7호

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	2,204	0	2,204	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101M90(2017-09 코스피200지수선물							176
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-176	-176	-176	-176	-176	-176	-176
-5.33%	-117	-117	-117	-117	-117	-117	-117
-2.67%	-59	-59	-59	-59	-59	-59	-59
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	59	59	59	59	59	59	59
5.33%	117	117	117	117	117	117	117
8.00%	176	176	176	176	176	176	176

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

108

공시일	2017-08-01
기준일	2017-07-31

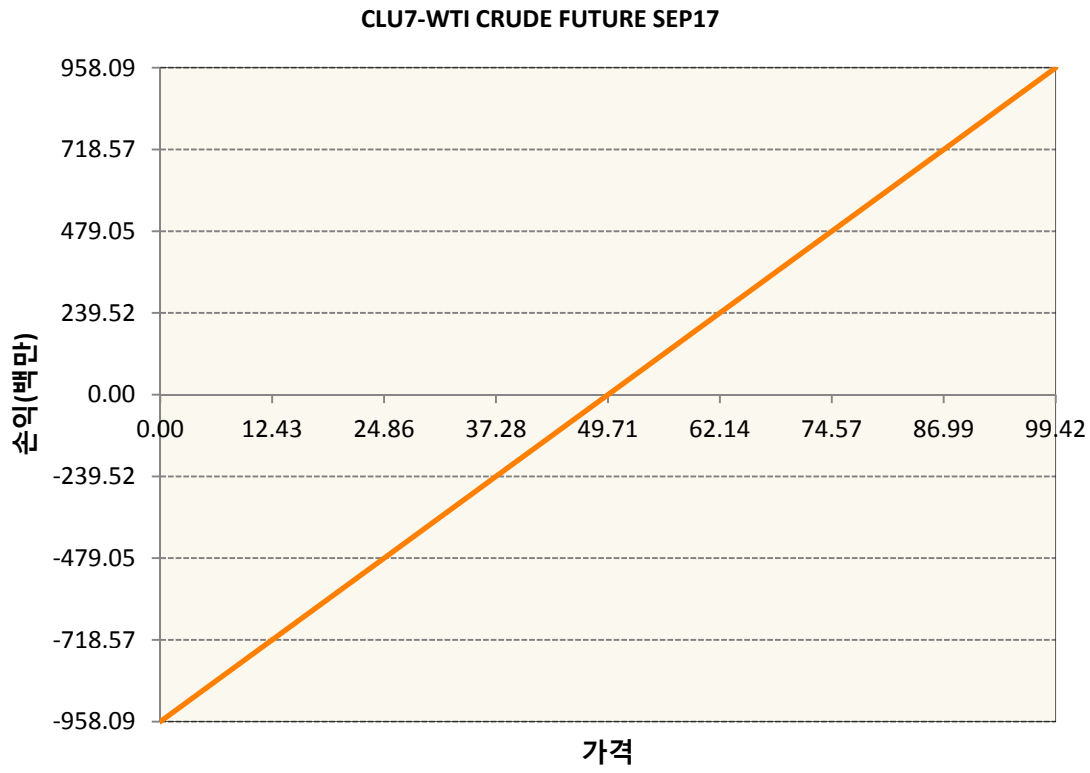
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

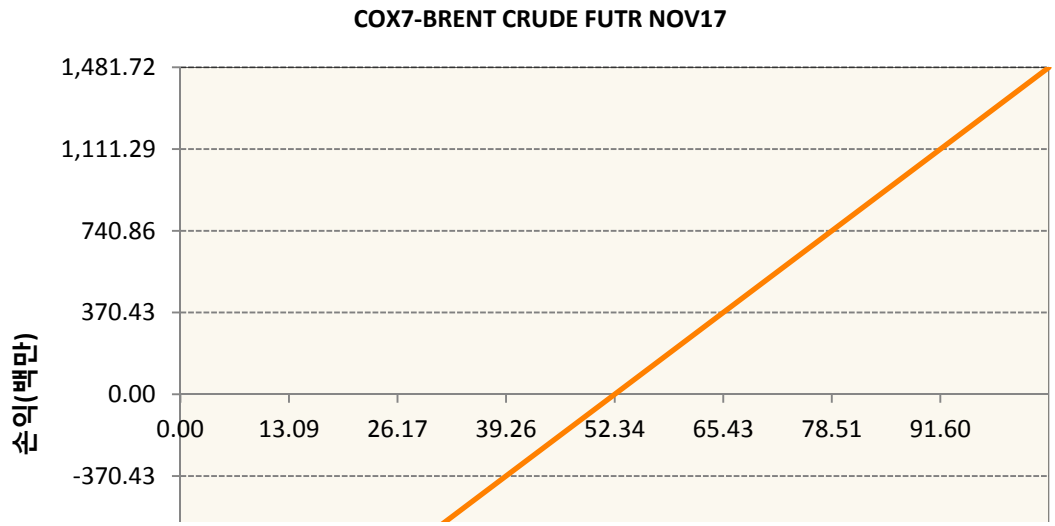
1. 계약금액

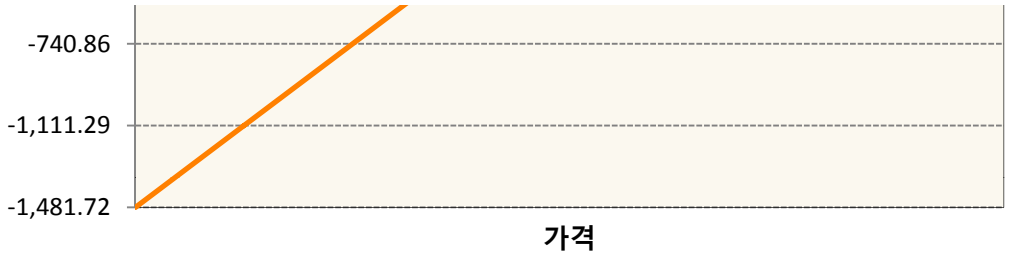
(단위:백만원)

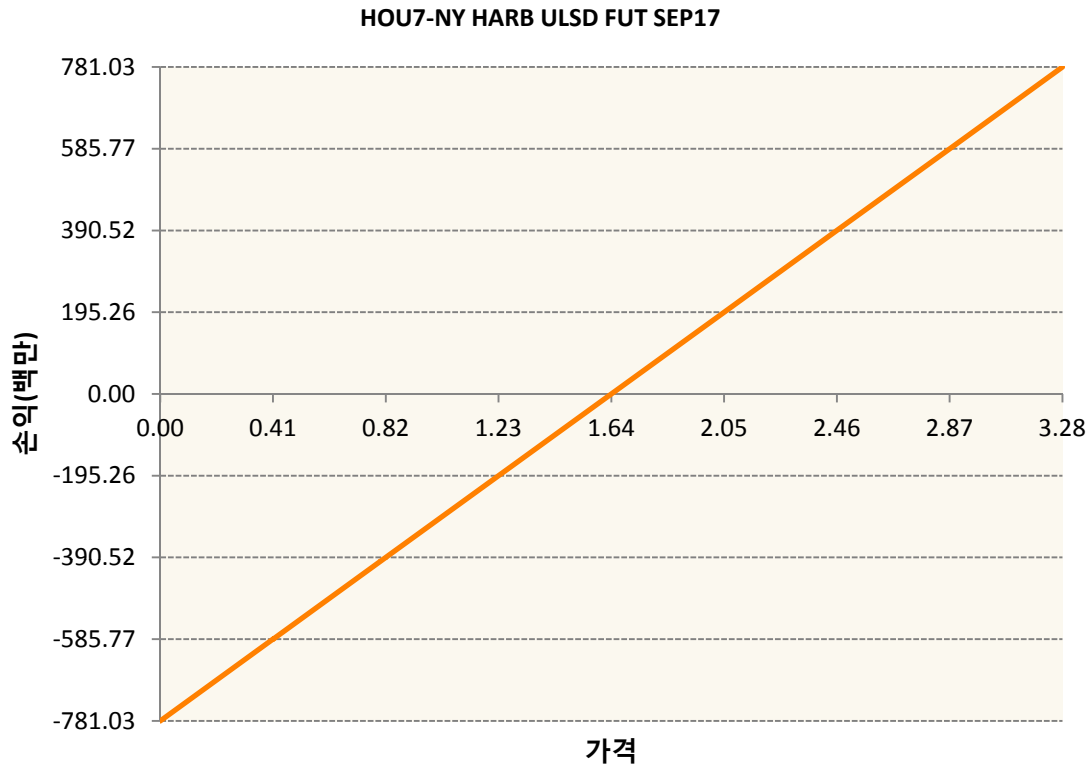
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	5,406	224	5,183	

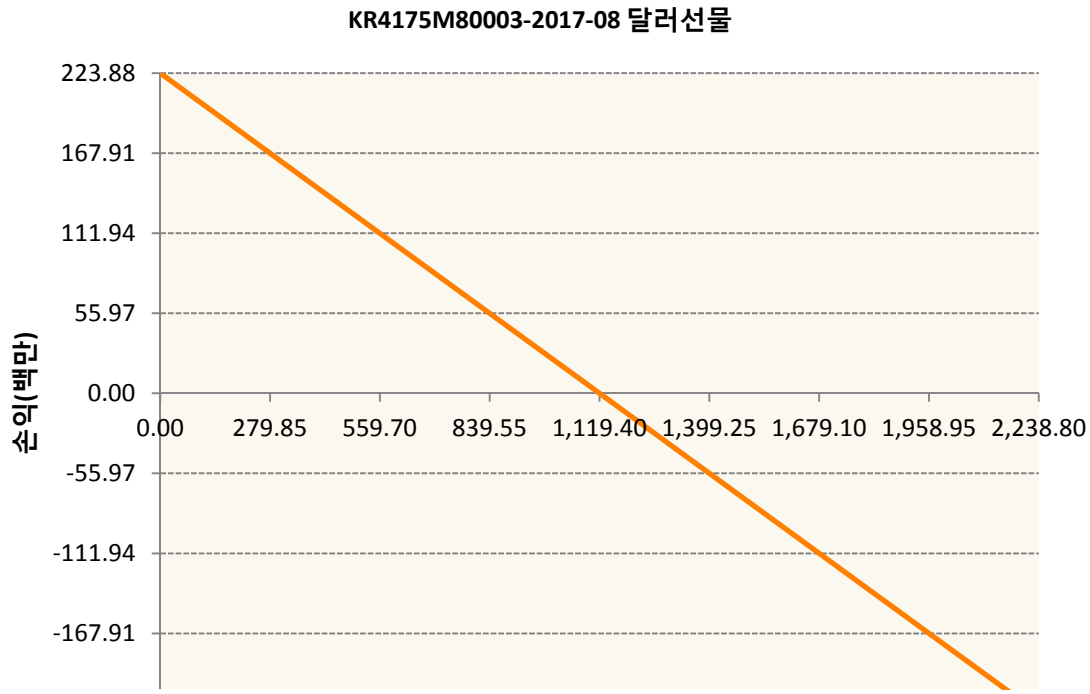
2. 만기시점의 손익구조

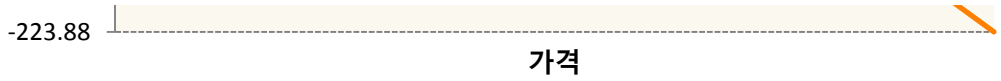


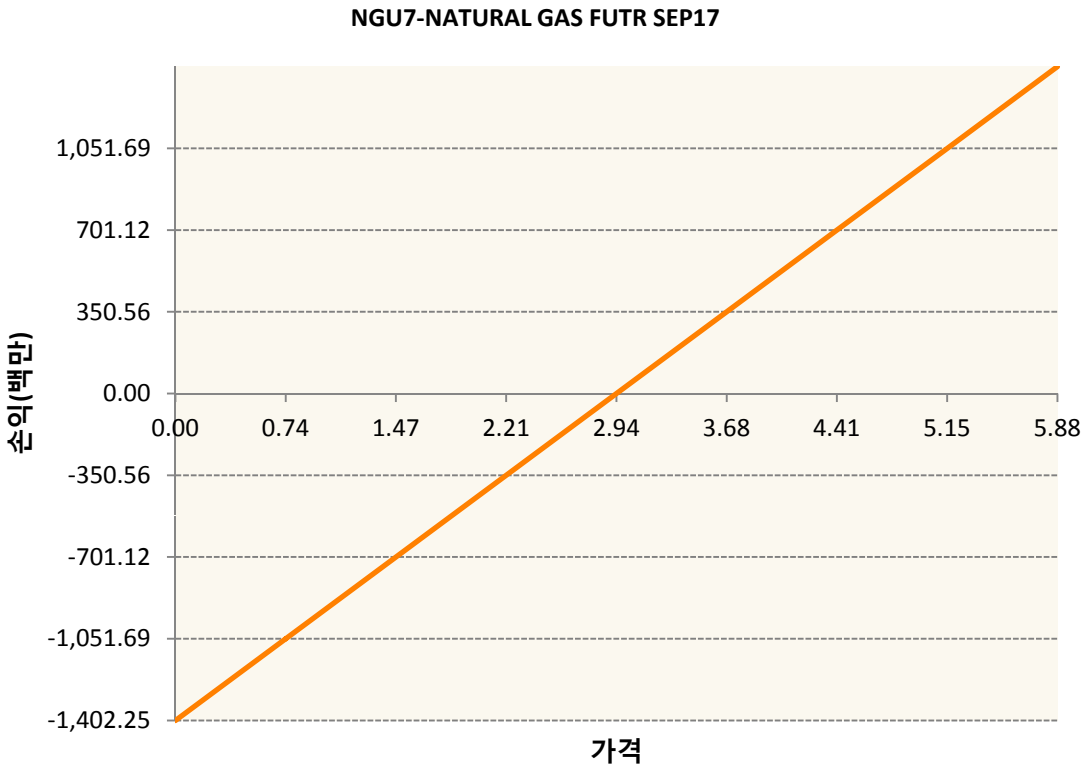


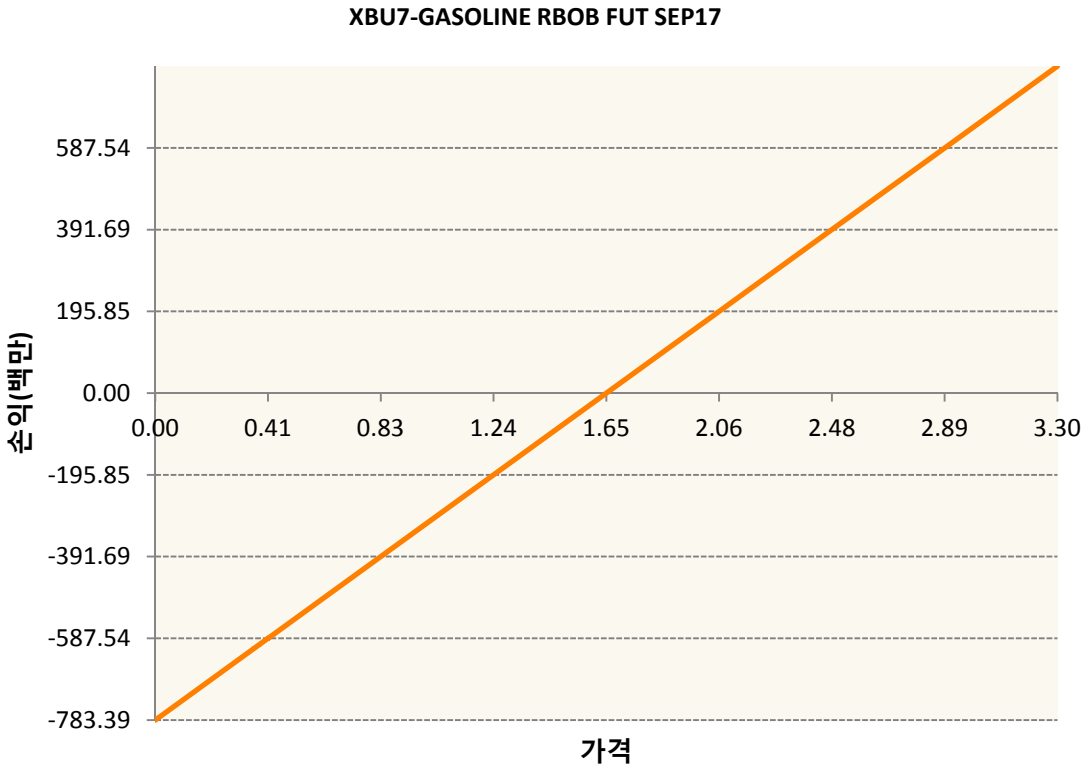

-740.86
-1,111.29
-1,481.72
가격


HOU7-NY HARB ULSD FUT SEP17
781.03
585.77
390.52
195.26
0.00
-195.26
-390.52
-585.77
-781.03
0.00
0.41
0.82
1.23
1.64
2.05
2.46
2.87
3.28
손익(백만)
가격


KR4175M80003-2017-08 달러선물
223.88
167.91
111.94
55.97
0.00
-55.97
-111.94
-167.91
0.00
279.85
559.70
839.55
1,119.40
1,399.25
1,679.10
1,958.95
2,238.80
손익(백만)


-223.88
가격


NGU7-NATURAL GAS FUTR SEP17
손익(백만)
1,051.69
701.12
350.56
0.00
-350.56
-701.12
-1,051.69
-1,402.25
0.00
0.74
1.47
2.21
2.94
3.68
4.41
5.15
5.88
가격


XBU7-GASOLINE RBOB FUT SEP17
손익(백만)
587.54
391.69
195.85
0.00
-195.85
-391.69
-587.54
-783.39
0.00
0.41
0.83
1.24
1.65
2.06
2.48
2.89
3.30
가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLU7	WTI CRUDE FUTURE SEP17	77
COX7	BRENT CRUDE FUTR NOV17	119
HOU7	NY HARB ULSD FUT SEP17	62
KR4175M80(	2017-08 달러선물	18
NGU7	NATURAL GAS FUTR SEP17	112
XBU7	GASOLINE RBOB FUT SEP17	63

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

796

공시일	2017-08-01
기준일	2017-07-31

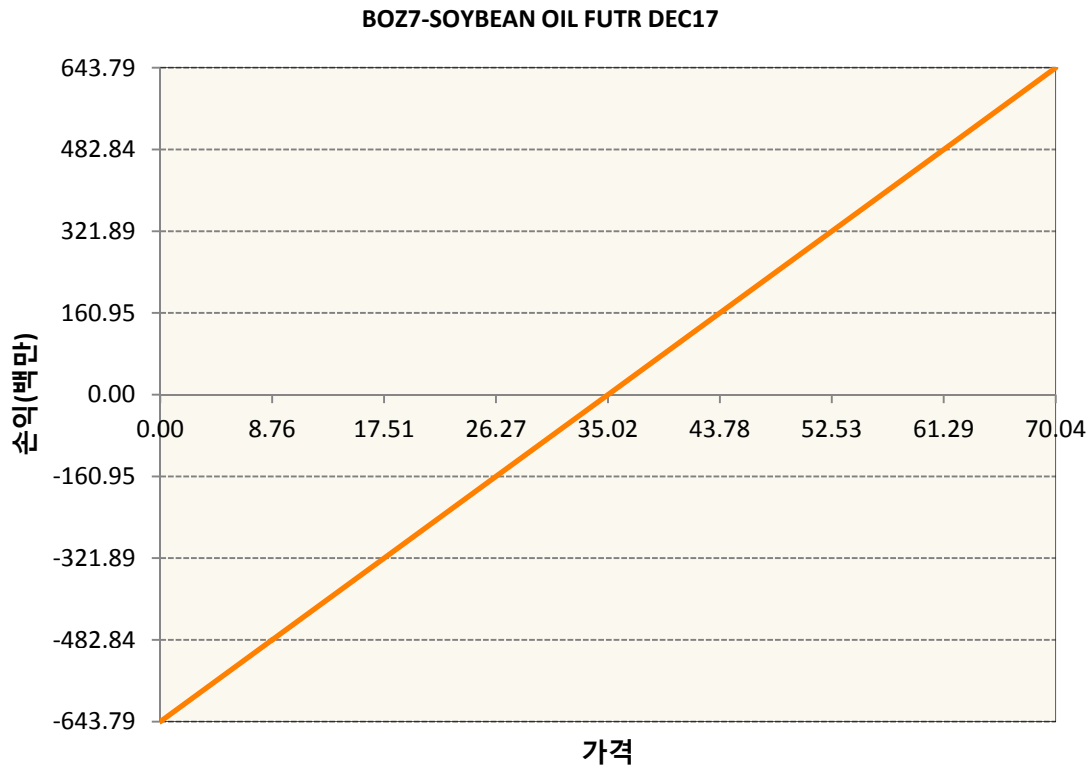
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

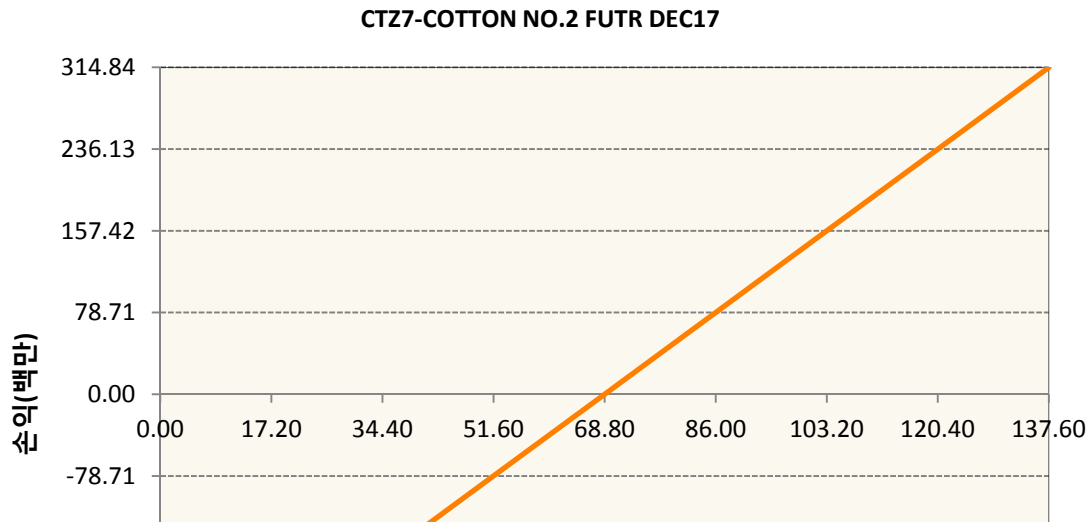
1. 계약금액

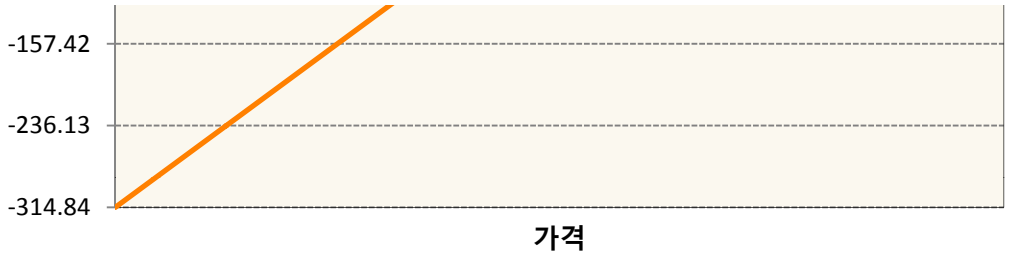
(단위:백만원)

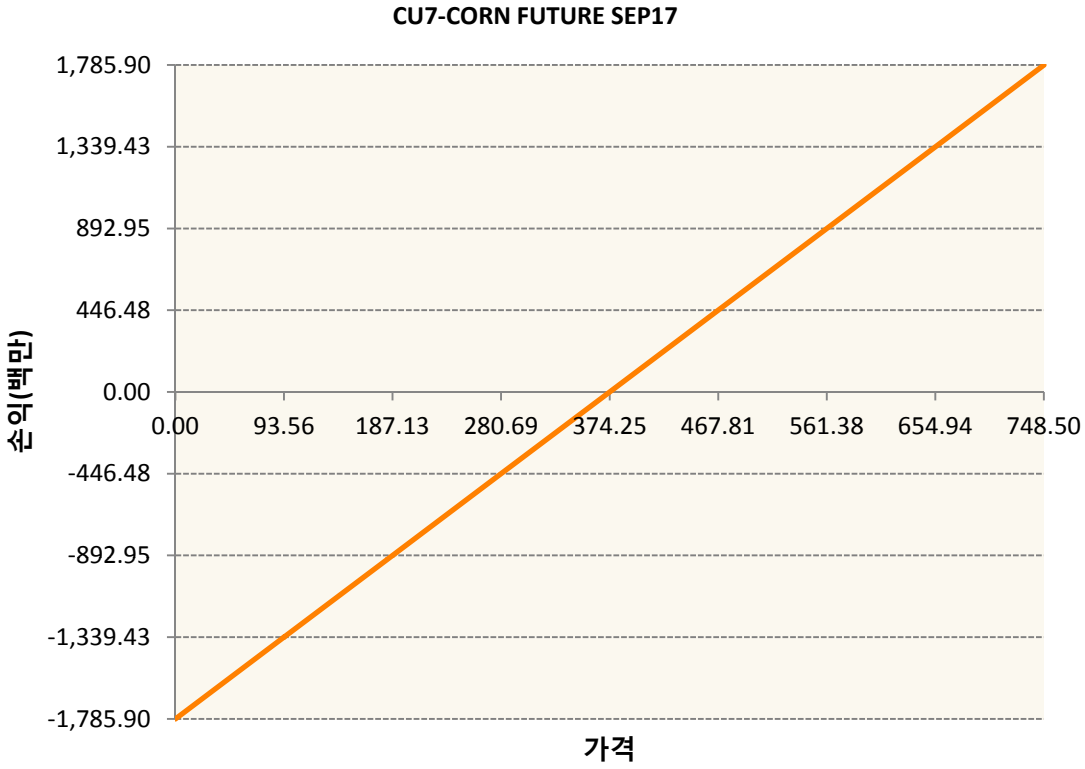
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	7,084	392	6,693	

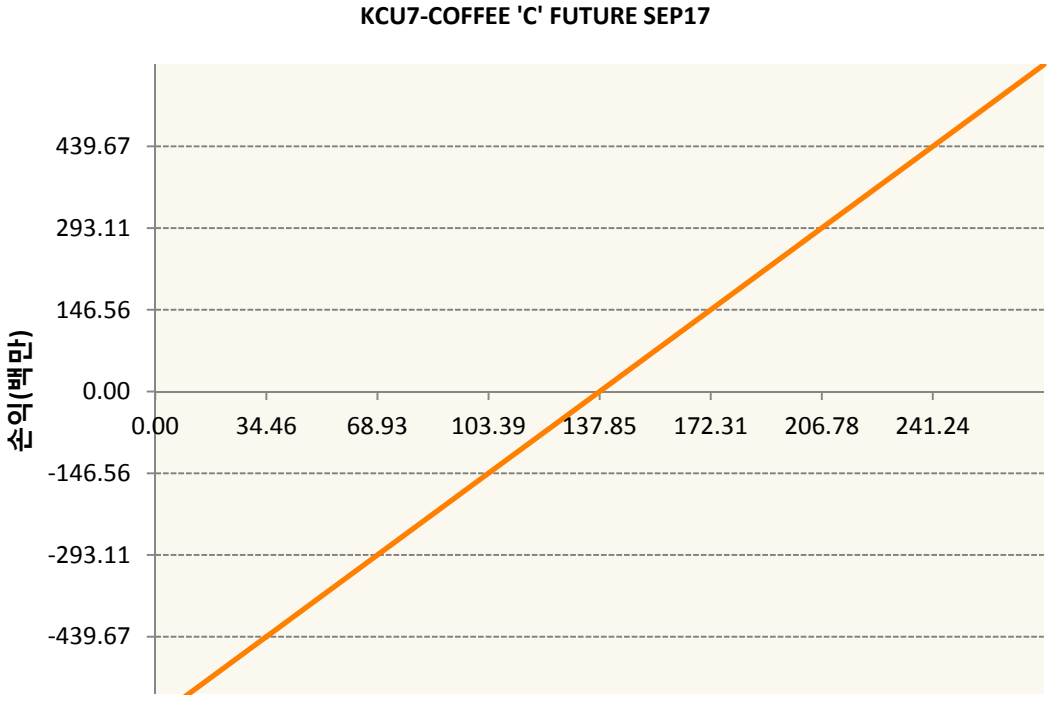
2. 만기시점의 손익구조

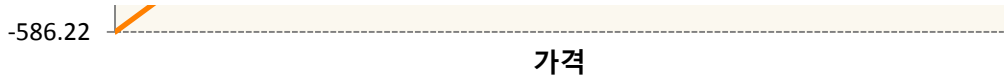


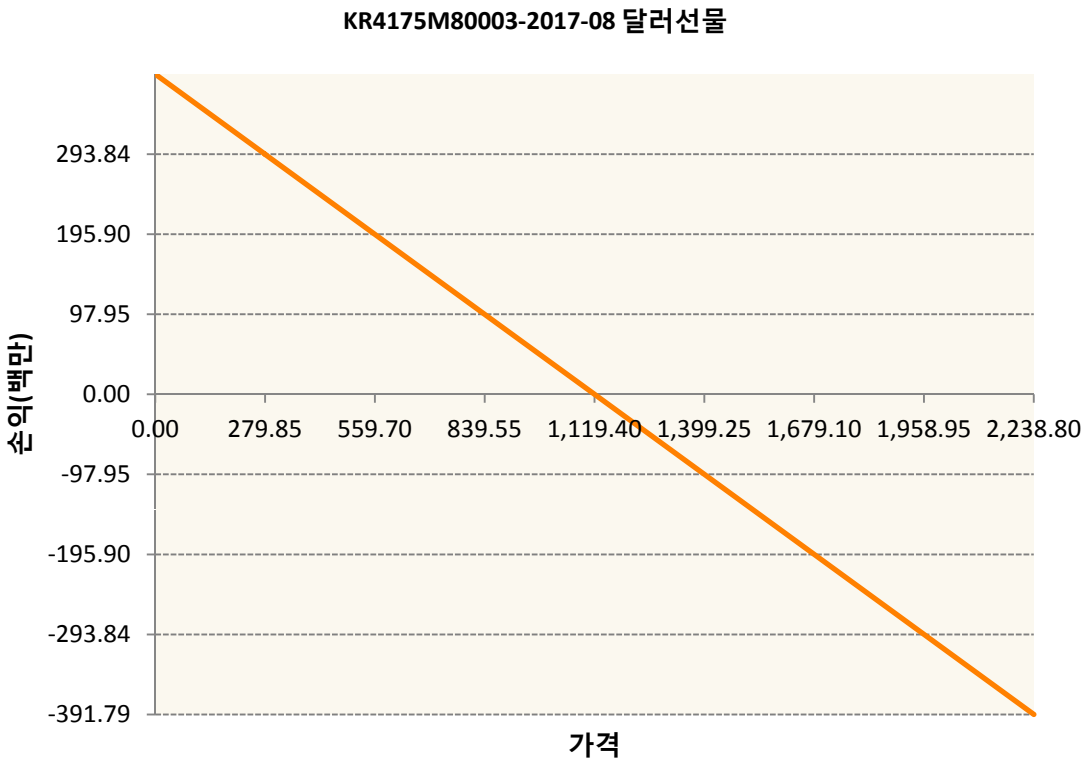


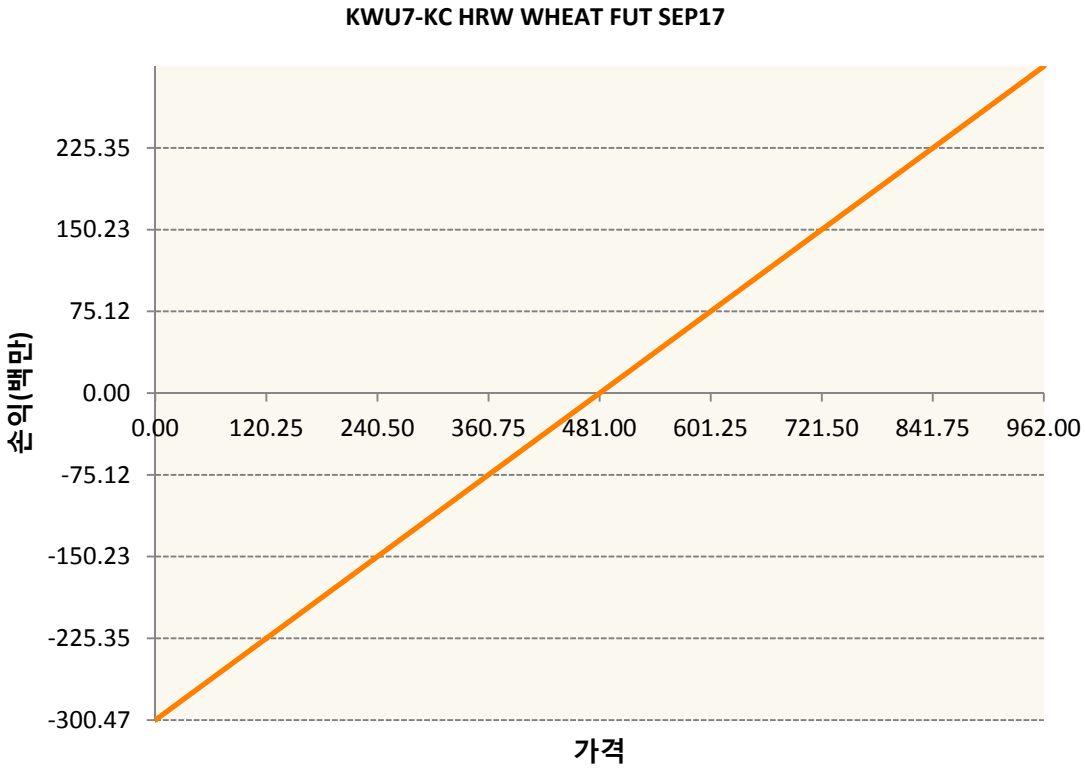

-157.42
-236.13
-314.84
가격

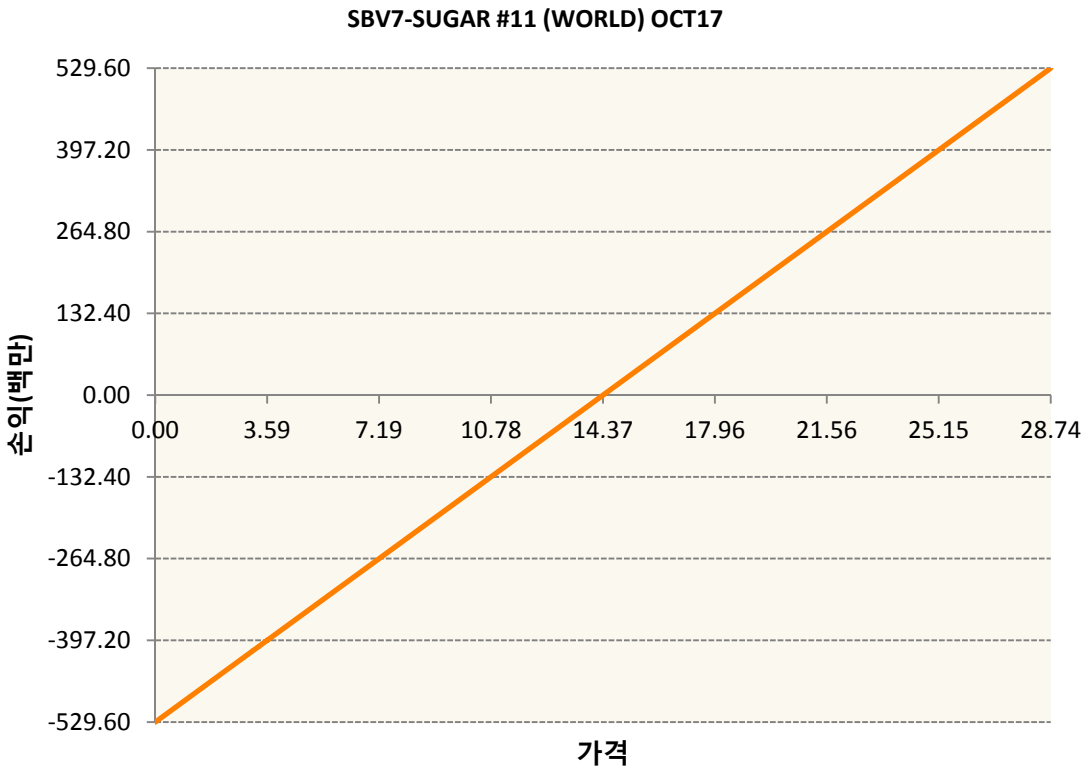

CU7-CORN FUTURE SEP17
1,785.90
1,339.43
892.95
446.48
0.00
-446.48
-892.95
-1,339.43
-1,785.90
0.00
93.56
187.13
280.69
374.25
467.81
561.38
654.94
748.50
손익(백만)
가격

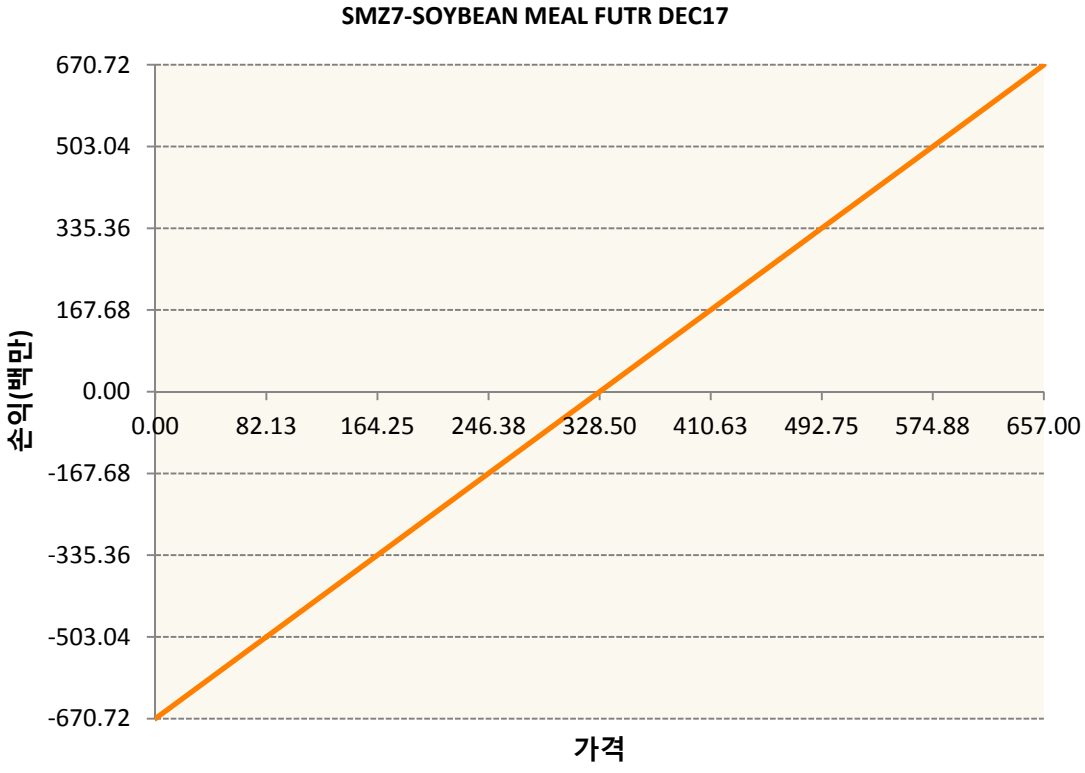

KCU7-COFFEE 'C' FUTURE SEP17
439.67
293.11
146.56
0.00
-146.56
-293.11
-439.67
0.00
34.46
68.93
103.39
137.85
172.31
206.78
241.24
손익(백만)

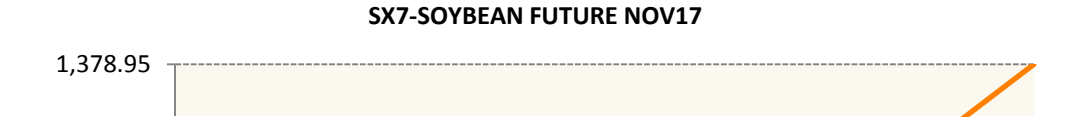

-586.22
가격

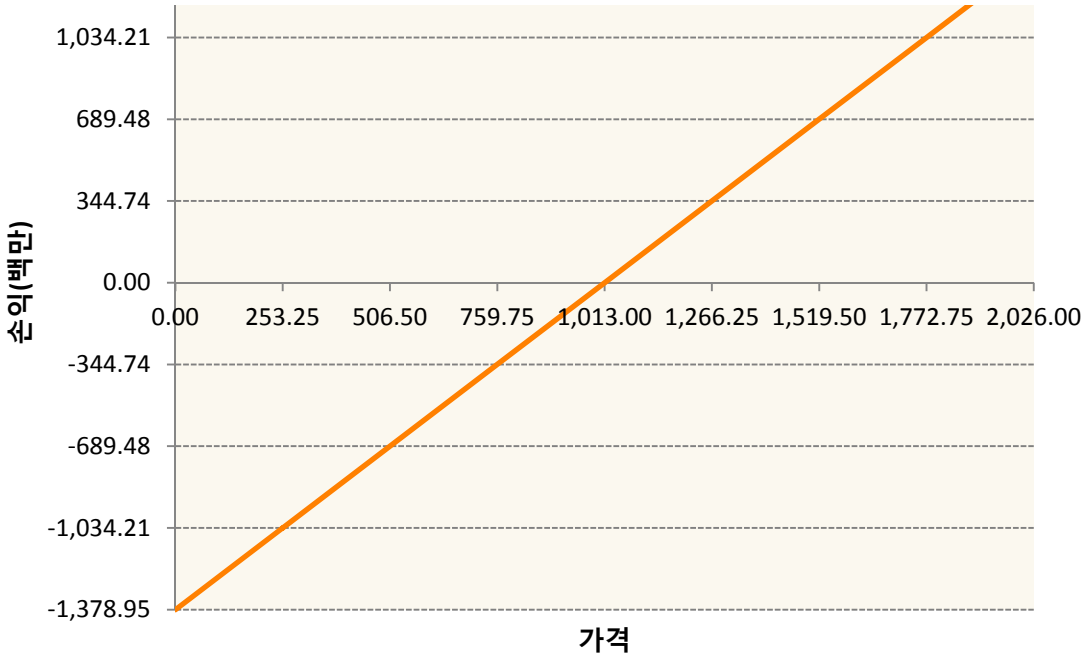

KR4175M80003-2017-08 달러선물
293.84
195.90
97.95
0.00
-97.95
-195.90
-293.84
-391.79
0.00
279.85
559.70
839.55
1,119.40
1,399.25
1,679.10
1,958.95
2,238.80
손익(백만)
가격

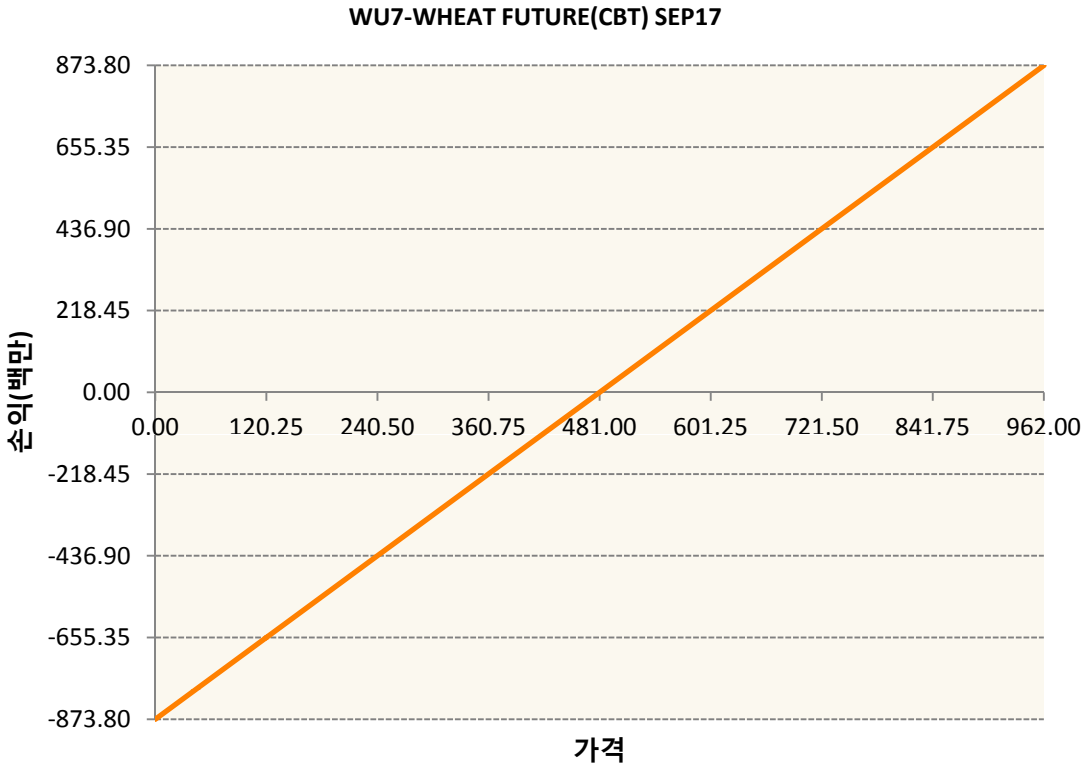

KWU7-KC HRW WHEAT FUT SEP17
225.35
150.23
75.12
0.00
-75.12
-150.23
-225.35
-300.47
0.00
120.25
240.50
360.75
481.00
601.25
721.50
841.75
962.00
손익(백만)
가격


SBV7-SUGAR #11 (WORLD) OCT17
529.60
397.20
264.80
132.40
0.00
-132.40
-264.80
-397.20
-529.60
손익(백만)
0.00
3.59
7.19
10.78
14.37
17.96
21.56
25.15
28.74
가격


SMZ7-SOYBEAN MEAL FUTR DEC17
670.72
503.04
335.36
167.68
0.00
-167.68
-335.36
-503.04
-670.72
손익(백만)
0.00
82.13
164.25
246.38
328.50
410.63
492.75
574.88
657.00
가격


SX7-SOYBEAN FUTURE NOV17
1,378.95





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
BOZ7	SOYBEAN OIL FUTR DEC17	52
CTZ7	COTTON NO.2 FUTR DEC17	25
CU7	CORN FUTURE SEP17	143
KCU7	COFFEE 'C' FUTURE SEP17	47
KR4175M80(	2017-08 달러선물	31

KWU7	KC HRW WHEAT FUT SEP17	24
SBV7	SUGAR #11 (WORLD) OCT17	42
SMZ7	SOYBEAN MEAL FUTR DEC17	54
SX7	SOYBEAN FUTURE NOV17	110
WU7	WHEAT FUTURE(CBT) SEP17	70

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

663