공시일	2017-02-27
기준일	2017-02-24

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	10	0	10	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	2017-02-27
기준일	2017-02-24

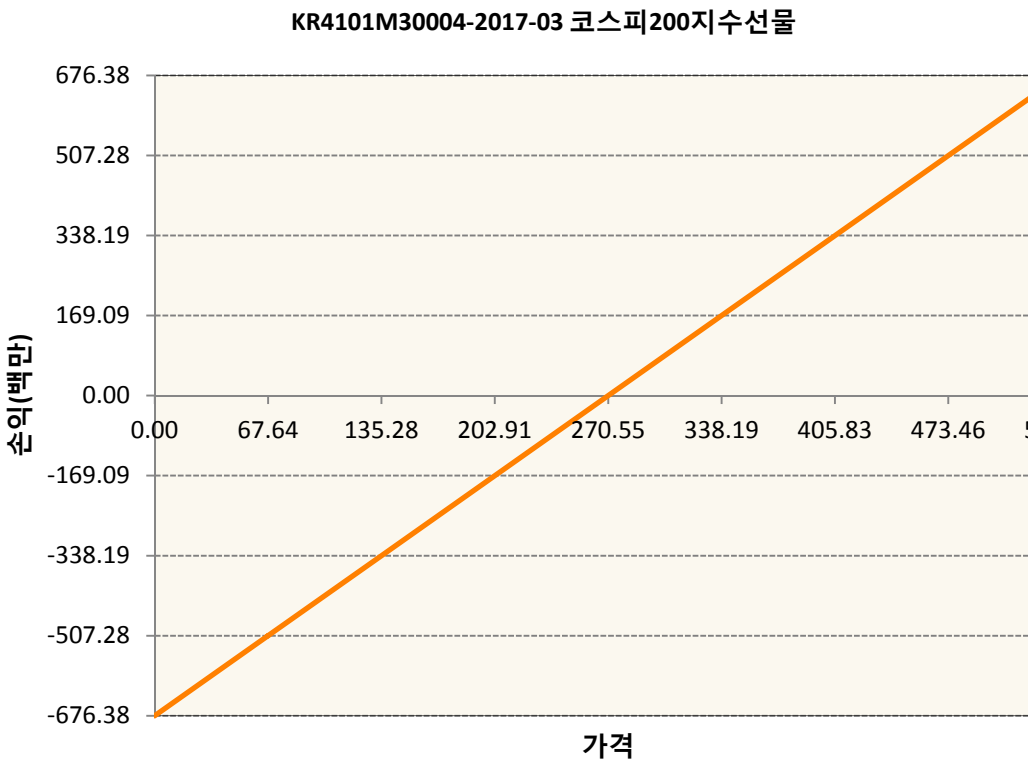
스마트인덱스모

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	676	0	676	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101M30(2017-03 코스피200지수선물							54
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-54	-54	-54	-54	-54	-54	-54
-5.33%	-36	-36	-36	-36	-36	-36	-36
-2.67%	-18	-18	-18	-18	-18	-18	-18
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	18	18	18	18	18	18	18
5.33%	36	36	36	36	36	36	36
8.00%	54	54	54	54	54	54	54

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

35

공시일	2017-02-27
기준일	2017-02-24

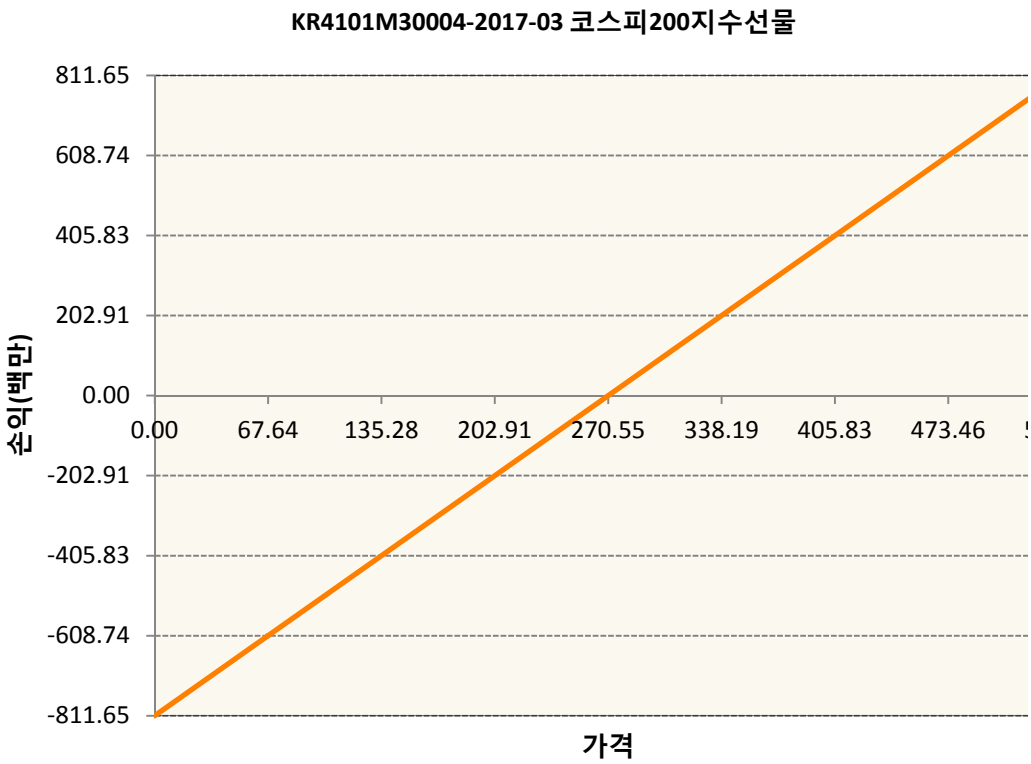
스마트레버리지목표전환형1호

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	812	0	812	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101M30(2017-03 코스피200지수선물							65
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-65	-65	-65	-65	-65	-65	-65
-5.33%	-43	-43	-43	-43	-43	-43	-43
-2.67%	-22	-22	-22	-22	-22	-22	-22
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	22	22	22	22	22	22	22
5.33%	43	43	43	43	43	43	43
8.00%	65	65	65	65	65	65	65

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

42

공시일	2017-02-27
기준일	2017-02-24

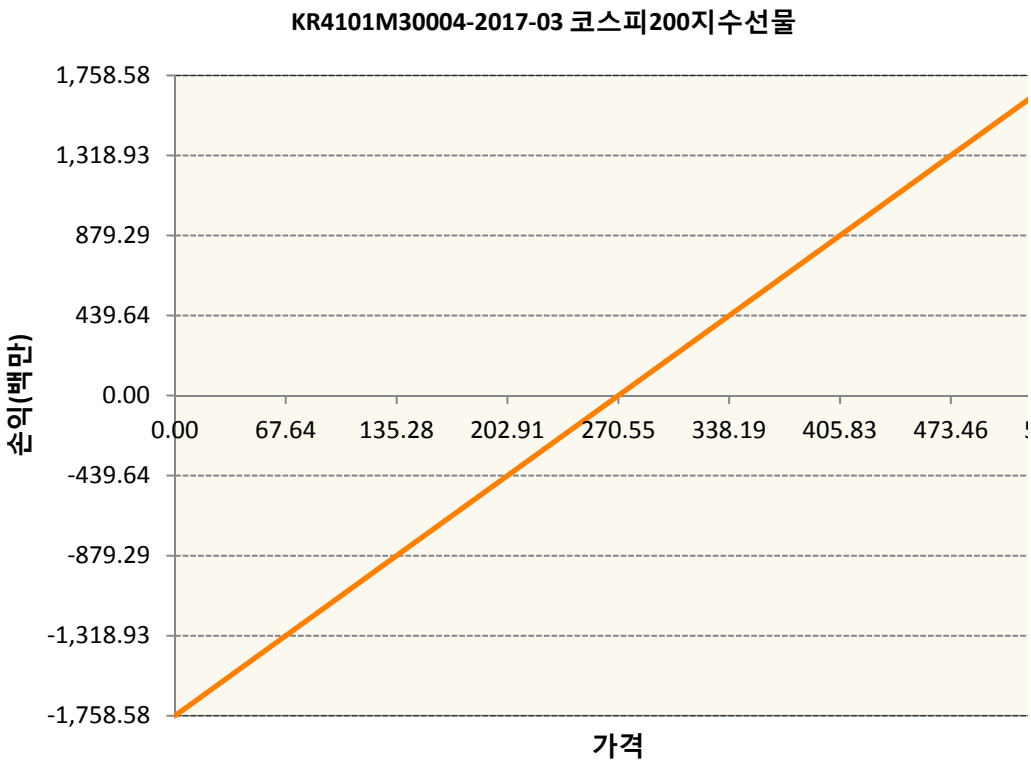
1.3배 레버리지 인덱스(주식-파생형)

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	1,759	0	1,759	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101M30(2017-03 코스피200지수선물							141
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-141	-141	-141	-141	-141	-141	-141
-5.33%	-94	-94	-94	-94	-94	-94	-94
-2.67%	-47	-47	-47	-47	-47	-47	-47
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	47	47	47	47	47	47	47
5.33%	94	94	94	94	94	94	94
8.00%	141	141	141	141	141	141	141

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

91

공시일	2017-02-27
기준일	2017-02-24

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	11,879	0	11,879	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWMXWO0(신한MXWO 미래S170222	952

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

612

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-02-27
기준일	2017-02-24

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	4,972	0	4,972	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI50000 신한CSI500미래S161208	393

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

547

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-02-27
기준일	2017-02-24

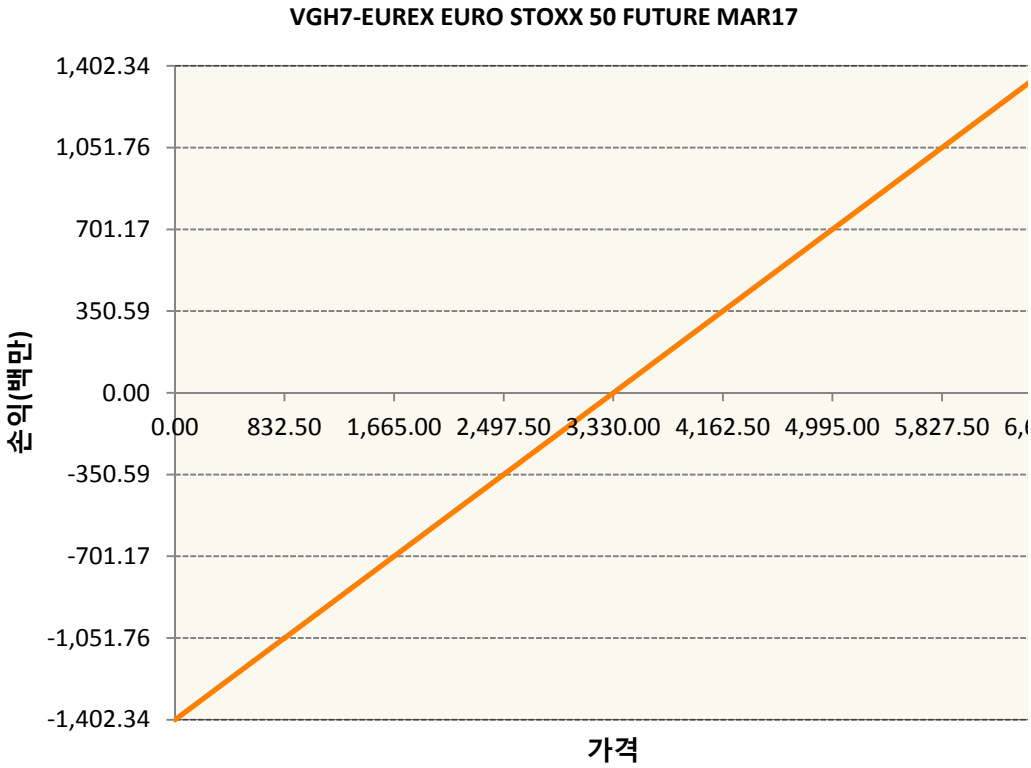
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,402	0	1,402	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGH7	EUREX EURO STOXX 50 FUTURE MAR17	112

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

(단위:백만원)

115

공시일	2017-02-27
기준일	2017-02-24

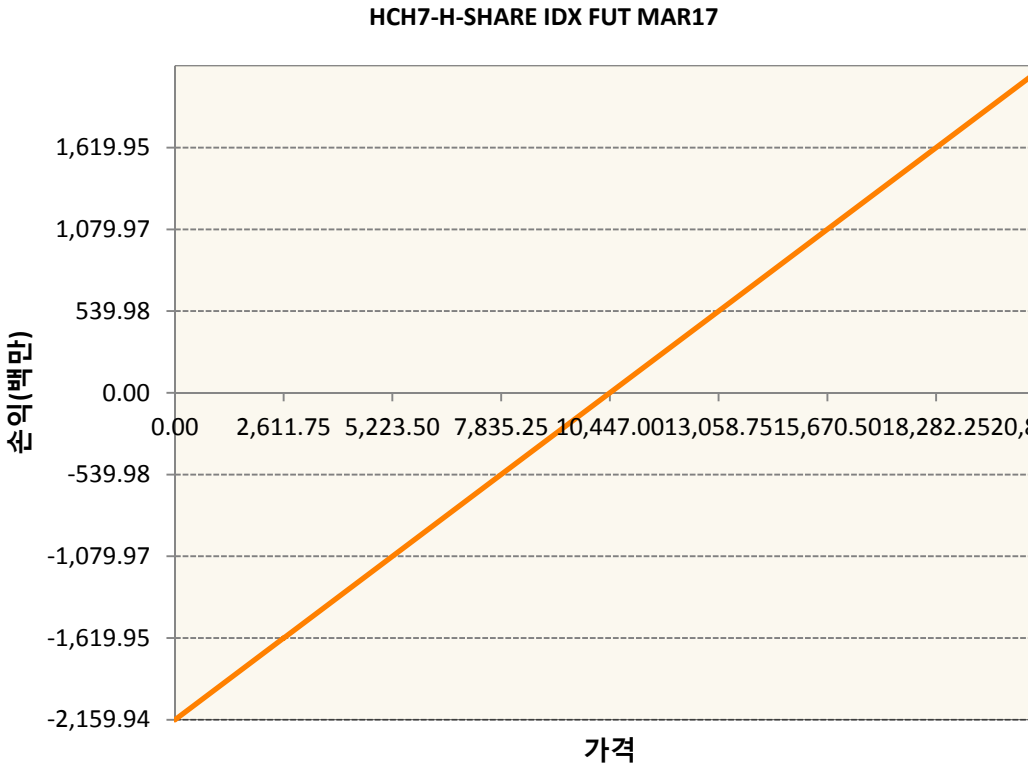
차이나인덱스모(주식-파생형)

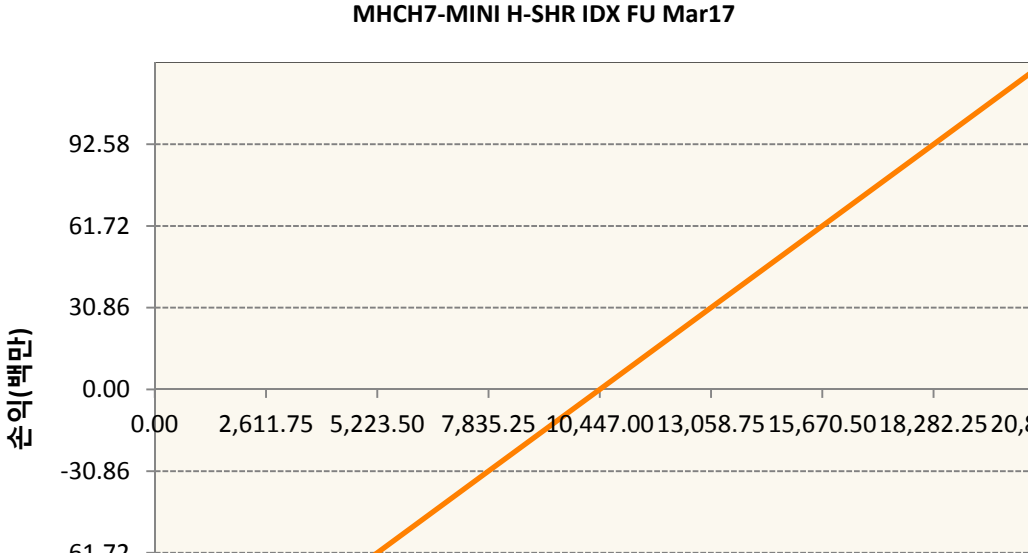
1. 계약금액

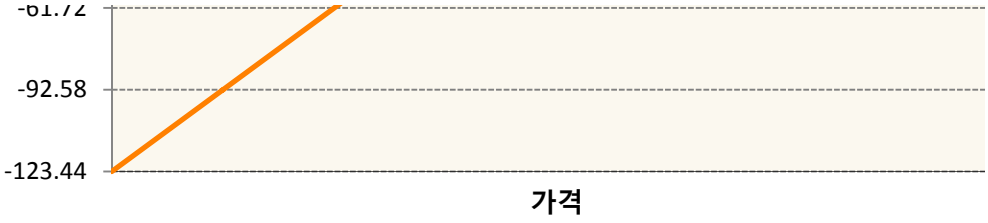
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,283	0	2,283	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCH7	H-SHARE IDX FUT MAR17	173
MHCH7	MINI H-SHR IDX FU Mar17	10

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	205

공시일	2017-02-27
기준일	2017-02-24

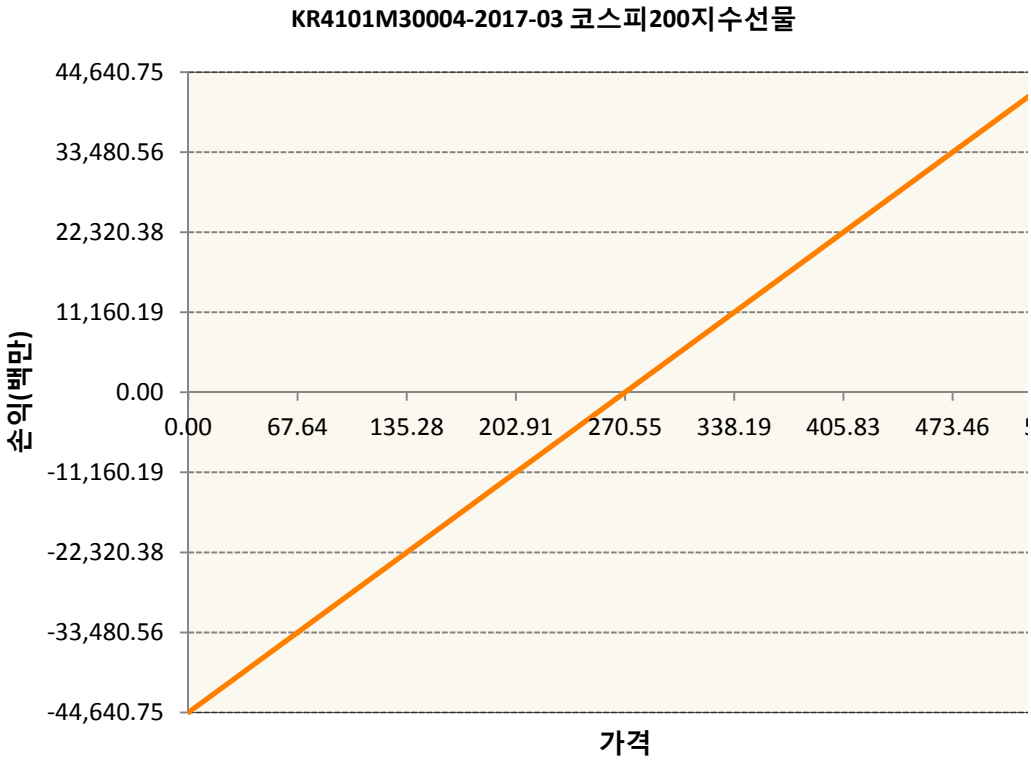
커버드콜모(주식혼합-파생형)

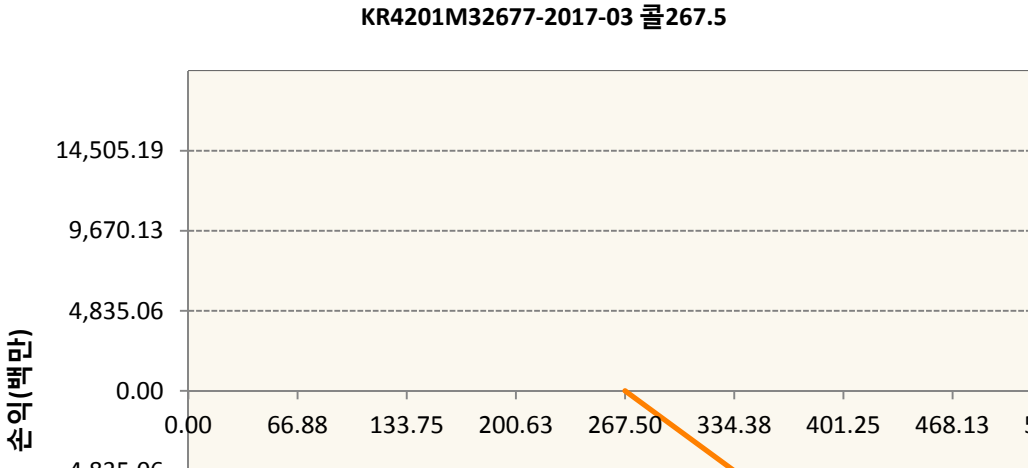
1. 계약금액

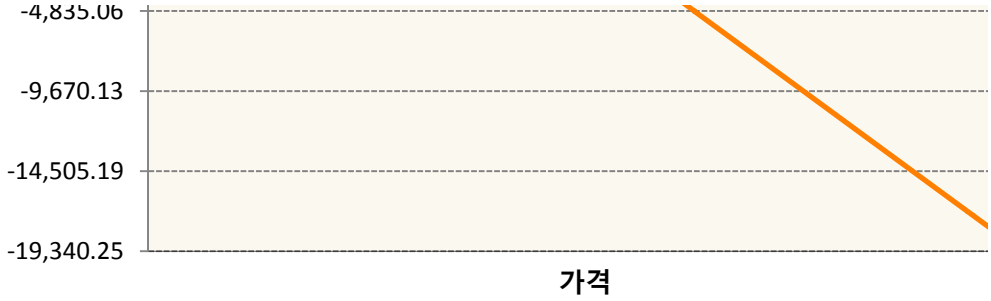
(단위:백만원)

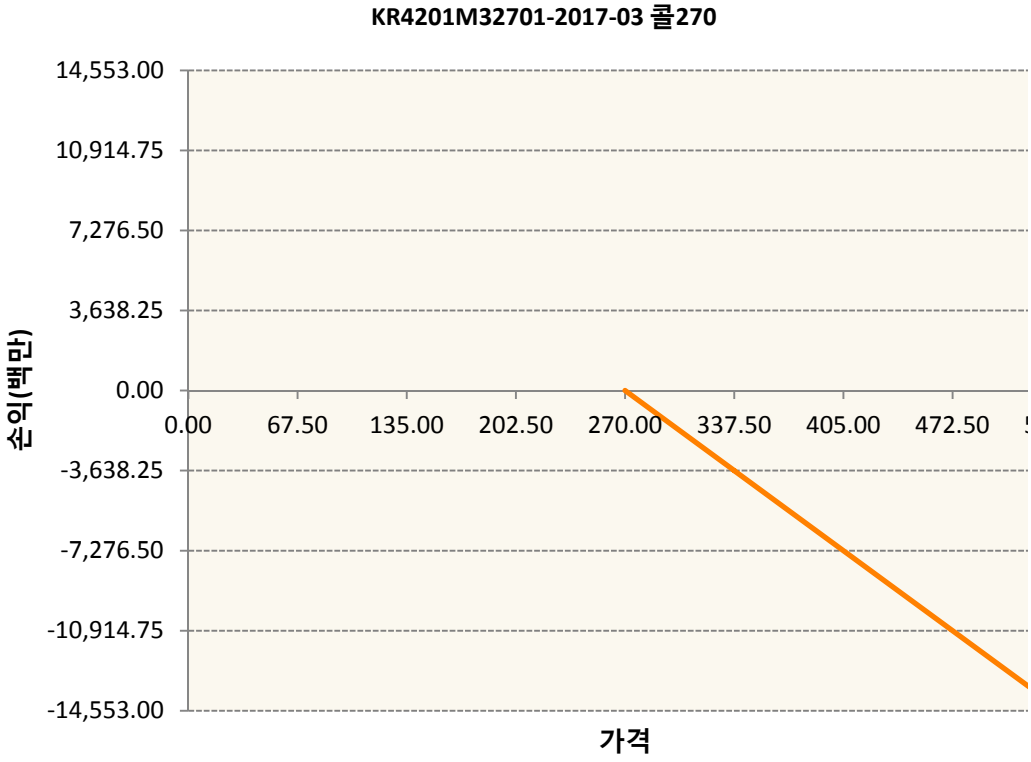
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	681	-681	장내
누계	유가증권	선물	44,641	0	44,641	장내
누계	유가증권	옵션	0	33,893	-33,893	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101M30(2017-03 코스피200지수선물							3,569
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-3,569	-3,569	-3,569	-3,569	-3,569	-3,569	-3,569
-5.33%	-2,379	-2,379	-2,379	-2,379	-2,379	-2,379	-2,379
-2.67%	-1,190	-1,190	-1,190	-1,190	-1,190	-1,190	-1,190
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	1,190	1,190	1,190	1,190	1,190	1,190	1,190
5.33%	2,379	2,379	2,379	2,379	2,379	2,379	2,379
8.00%	3,569	3,569	3,569	3,569	3,569	3,569	3,569
KR4201M32(2017-03 콜267.5							7,497
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,357	1,357	1,357	1,357	1,357	1,357	1,357
-5.33%	1,357	1,357	1,355	1,352	1,348	1,341	1,333
-2.67%	1,278	1,245	1,210	1,171	1,129	1,085	1,040
0%	145	99	50	0	-52	-104	-158
2.67%	-2,289	-2,291	-2,296	-2,303	-2,313	-2,326	-2,342
5.33%	-4,892	-4,892	-4,892	-4,892	-4,893	-4,893	-4,895
8.00%	-7,497	-7,497	-7,497	-7,497	-7,497	-7,497	-7,497
KR4201M32 2017-03 콜270							5,335
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	593	593	593	593	593	593	593
-5.33%	593	593	593	592	591	589	587
-2.67%	580	570	557	541	523	502	479
0%	135	90	45	0	-45	-90	-135
2.67%	-1,460	-1,468	-1,478	-1,492	-1,509	-1,528	-1,549
5.33%	-3,393	-3,393	-3,393	-3,394	-3,395	-3,397	-3,399
8.00%	-5,335	-5,335	-5,335	-5,335	-5,335	-5,335	-5,335

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

19,582

공시일	2017-02-27
기준일	2017-02-24

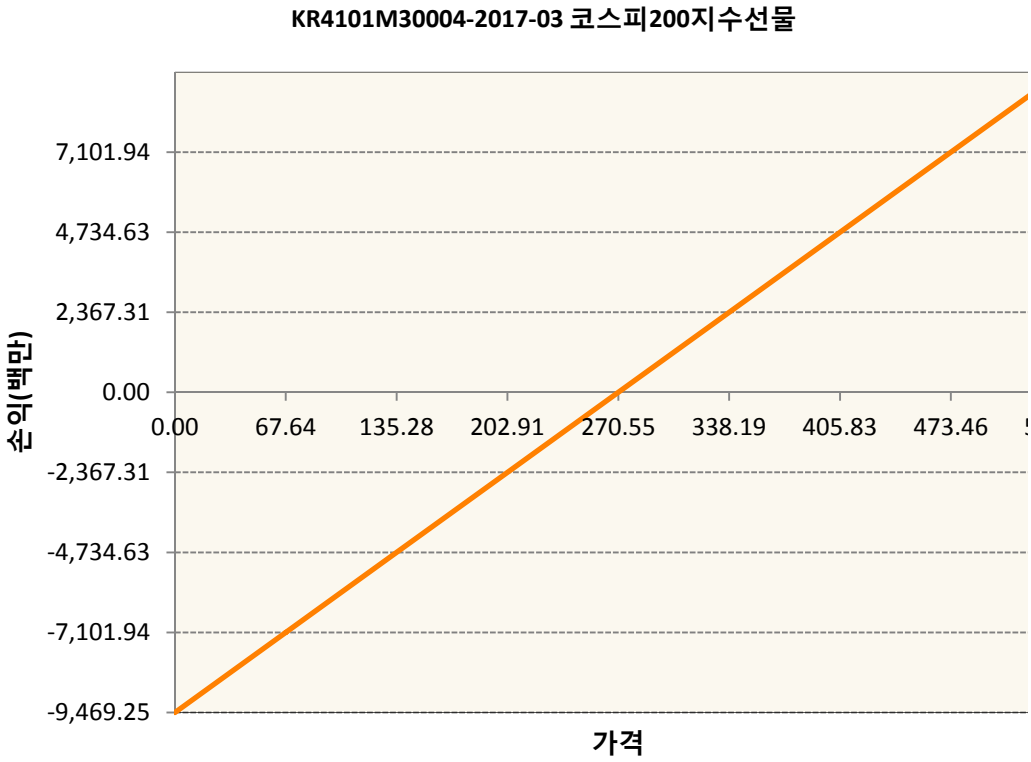
커버드콜목표전환형증권투자신탁

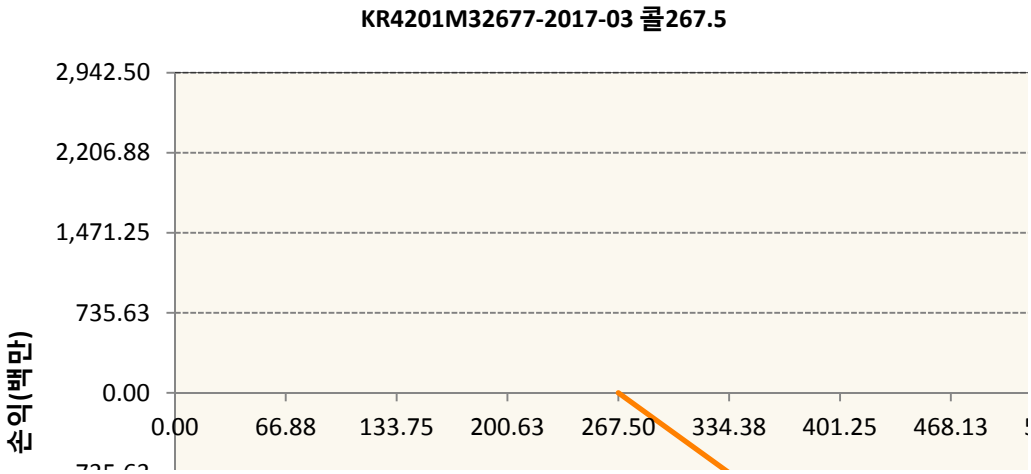
1. 계약금액

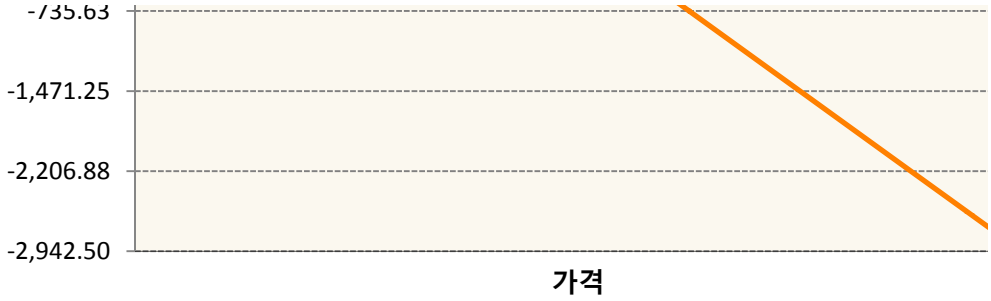
(단위:백만원)

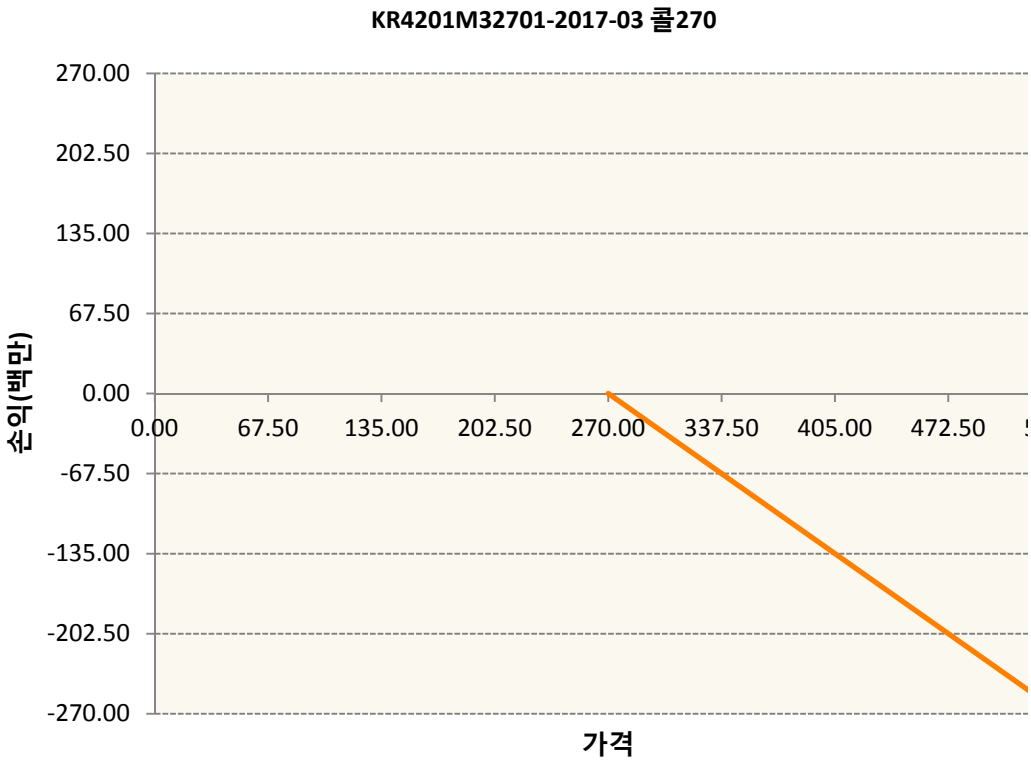
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	9,469	0	9,469	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,213	-3,213	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101M30(2017-03 코스피200지수선물							757
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-757	-757	-757	-757	-757	-757	-757
-5.33%	-505	-505	-505	-505	-505	-505	-505
-2.67%	-252	-252	-252	-252	-252	-252	-252
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	252	252	252	252	252	252	252
5.33%	505	505	505	505	505	505	505
8.00%	757	757	757	757	757	757	757
KR4201M32(2017-03 콜267.5							1,141
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	207	207	207	207	207	206	206
-5.33%	206	206	206	206	205	204	203
-2.67%	194	189	184	178	172	165	158
0%	22	15	8	0	-8	-16	-24
2.67%	-348	-349	-349	-350	-352	-354	-356
5.33%	-744	-744	-744	-744	-744	-745	-745
8.00%	-1,141	-1,141	-1,141	-1,141	-1,141	-1,141	-1,141
KR4201M32 2017-03 콜270							99

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	11	11	11	11	11	11	11
-5.33%	11	11	11	11	11	11	11
-2.67%	11	11	10	10	10	9	9
0%	2	2	1	0	-1	-2	-3
2.67%	-27	-27	-27	-28	-28	-28	-29
5.33%	-63	-63	-63	-63	-63	-63	-63
8.00%	-99	-99	-99	-99	-99	-99	-99

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

2,159

공시일	2017-02-27
기준일	2017-02-24

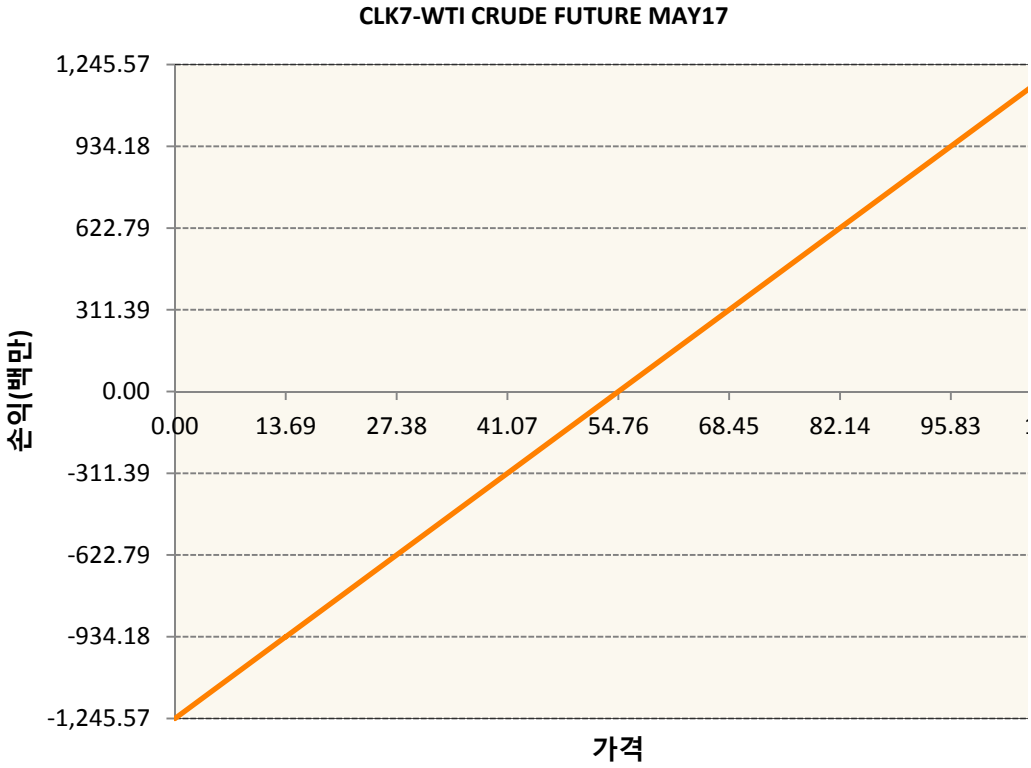
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

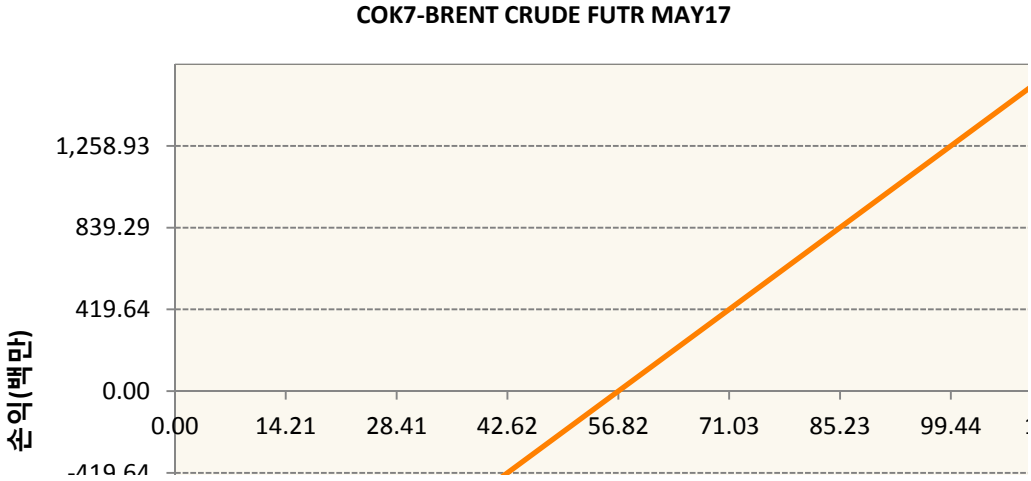
1. 계약금액

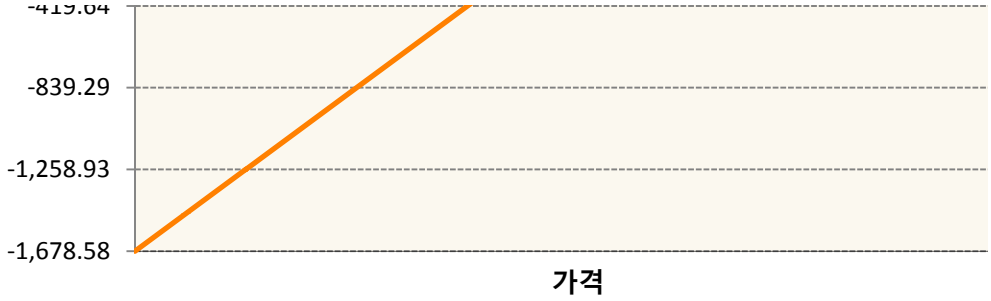
(단위:백만원)

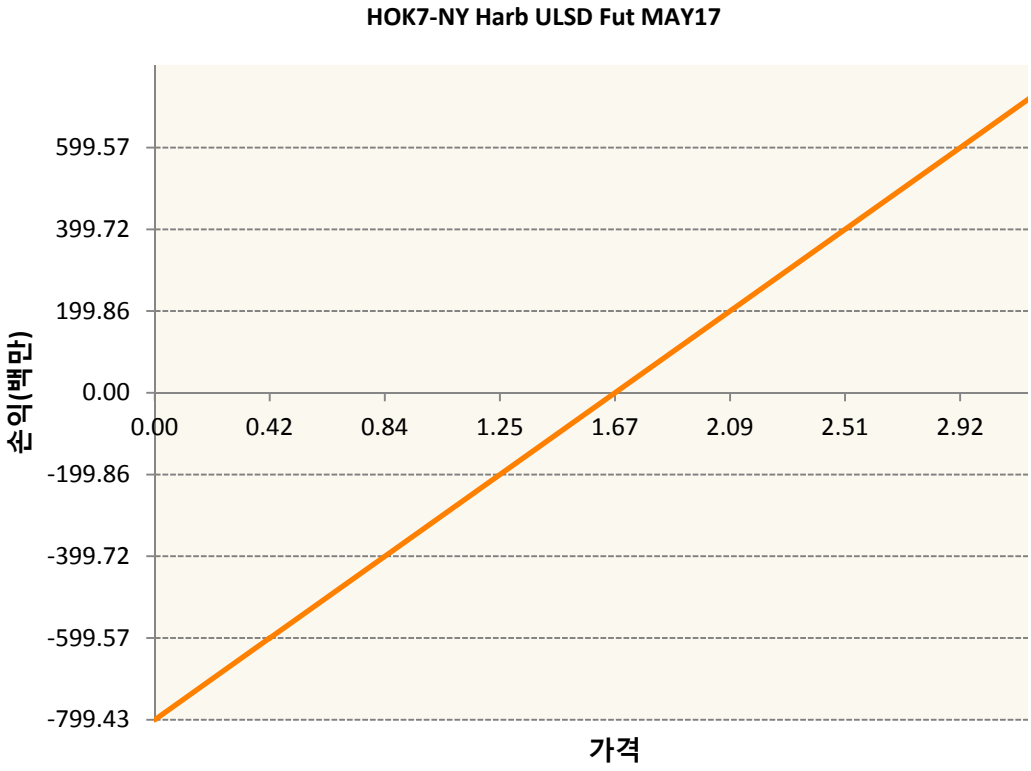
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	선물	유가증권	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	선물	유가증권	1,246	0	1,246	
누계	유가증권	선물	4,621	407	4,213	

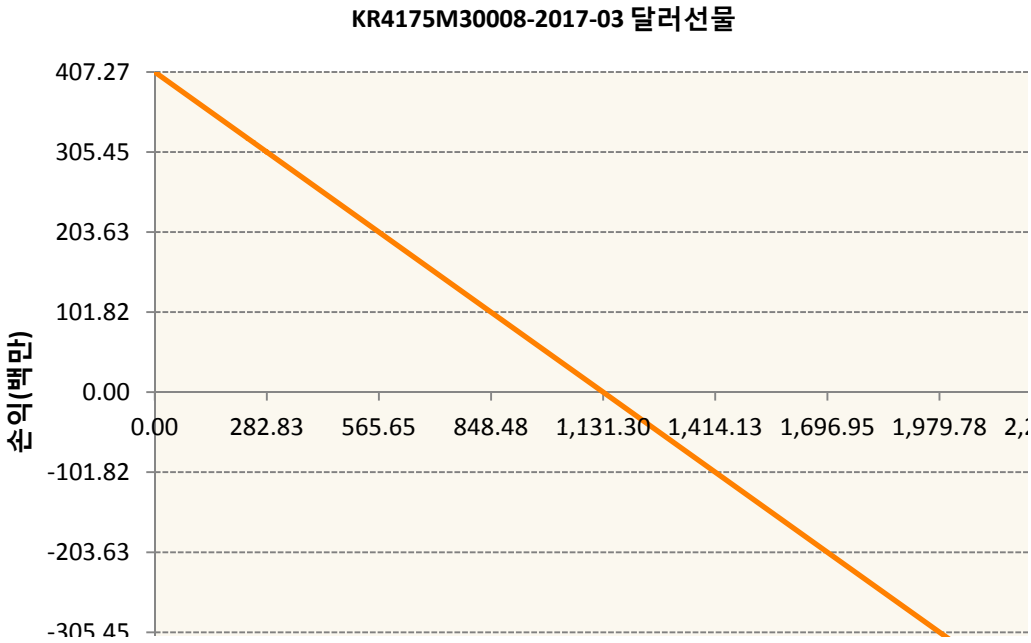
2. 만기시점의 손익구조

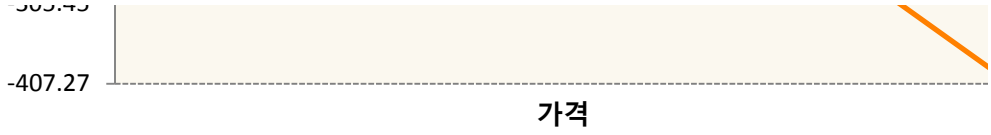


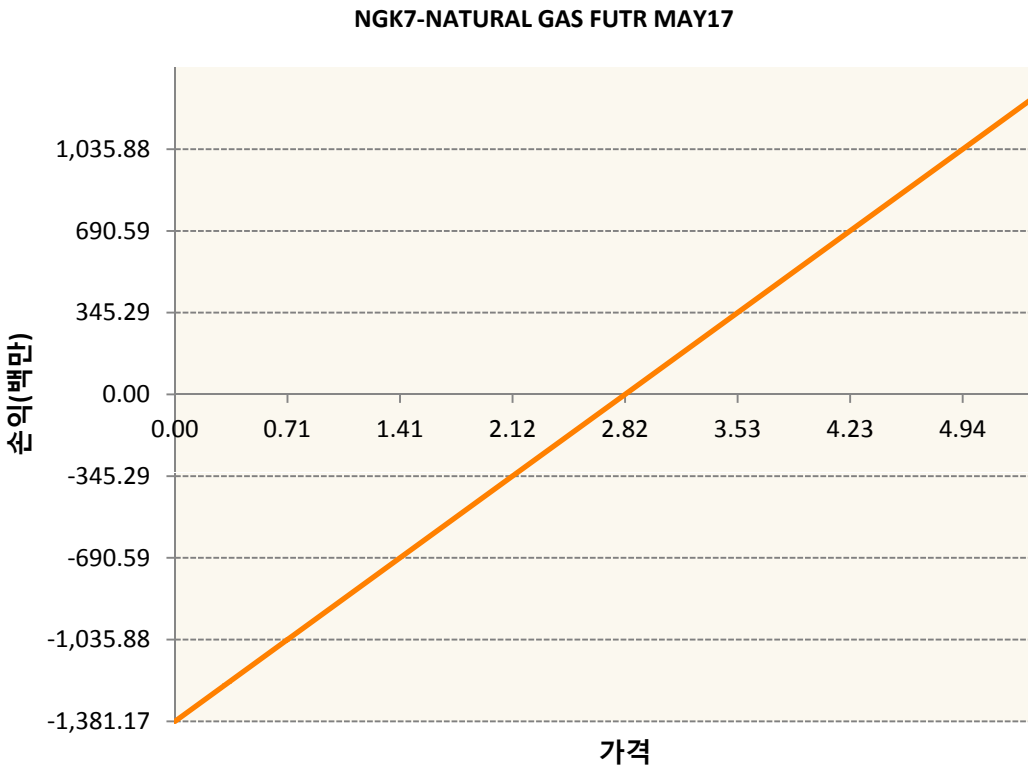


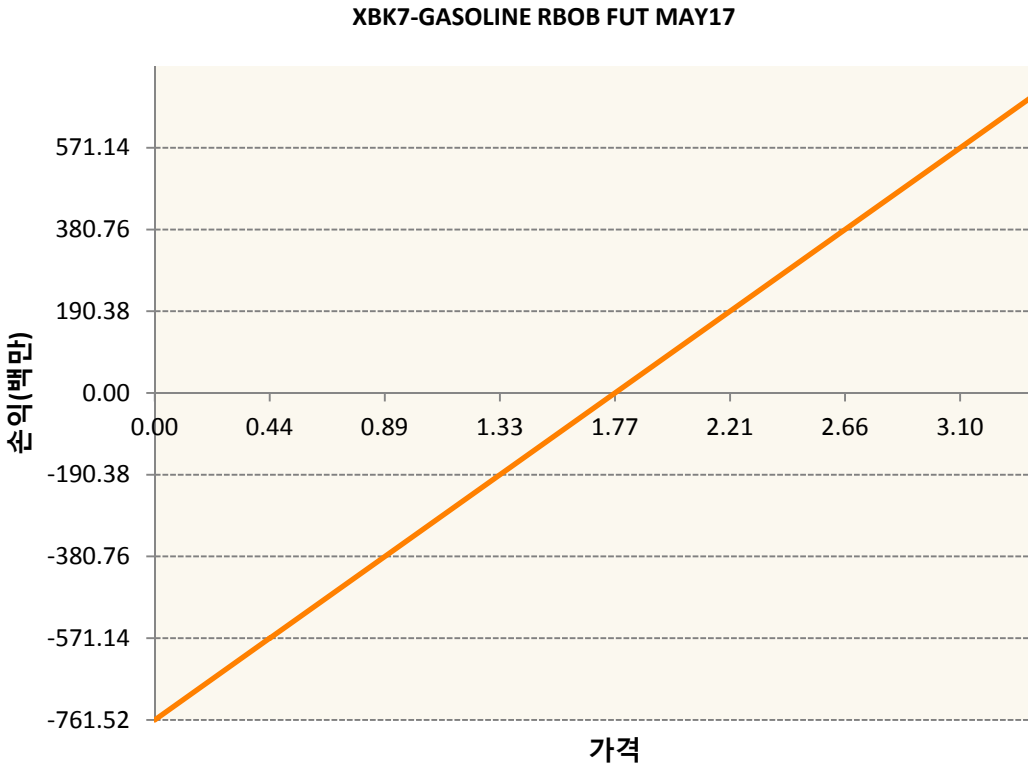

-839.29
-1,258.93
-1,678.58
가격


HOK7-NY Harb ULSD Fut MAY17
599.57
399.72
199.86
0.00
-199.86
-399.72
-599.57
-799.43
0.00
0.42
0.84
1.25
1.67
2.09
2.51
2.92
순익(백만)
가격


KR4175M30008-2017-03 달러선물
407.27
305.45
203.63
101.82
0.00
-101.82
-203.63
0.00
282.83
565.65
848.48
1,131.30
1,414.13
1,696.95
1,979.78
순익(백만)


-407.27
가격


NGK7-NATURAL GAS FUTR MAY17
1,035.88
690.59
345.29
0.00
-345.29
-690.59
-1,035.88
-1,381.17
0.00
0.71
1.41
2.12
2.82
3.53
4.23
4.94
순익(백만)
가격


XBK7-GASOLINE RBOB FUT MAY17
571.14
380.76
190.38
0.00
-190.38
-380.76
-571.14
-761.52
0.00
0.44
0.89
1.33
1.77
2.21
2.66
3.10
순익(백만)
가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLK7	WTI CRUDE FUTURE MAY17	100
COK7	BRENT CRUDE FUTR MAY17	134
HOK7	NY Harb ULSD Fut MAY17	64
KR4175M30(	2017-03 달러선물	33
NGK7	NATURAL GAS FUTR MAY17	110
XBK7	GASOLINE RBOB FUT MAY17	61

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

1,039

공시일	2017-02-27
기준일	2017-02-24

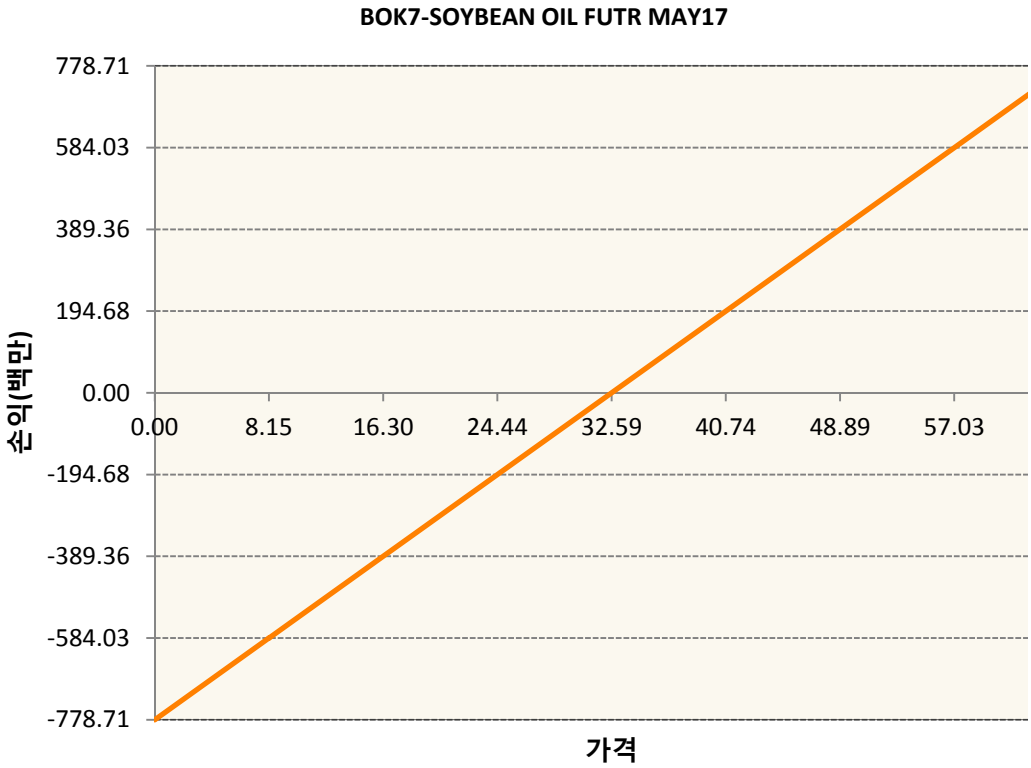
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

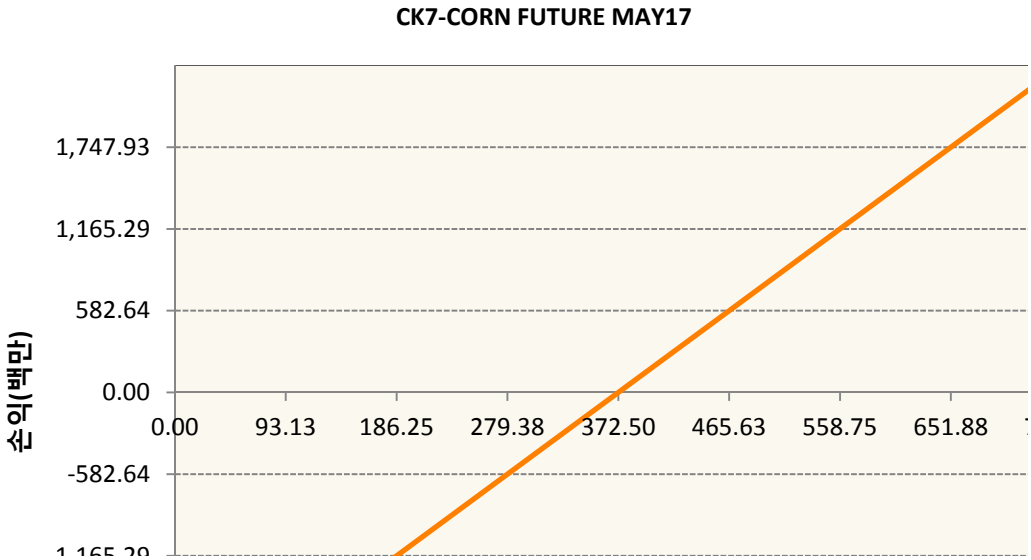
1. 계약금액

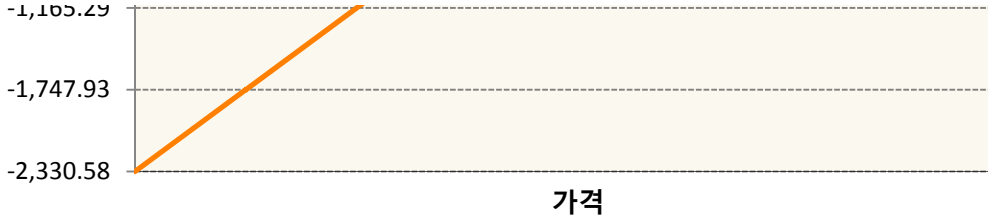
(단위:백만원)

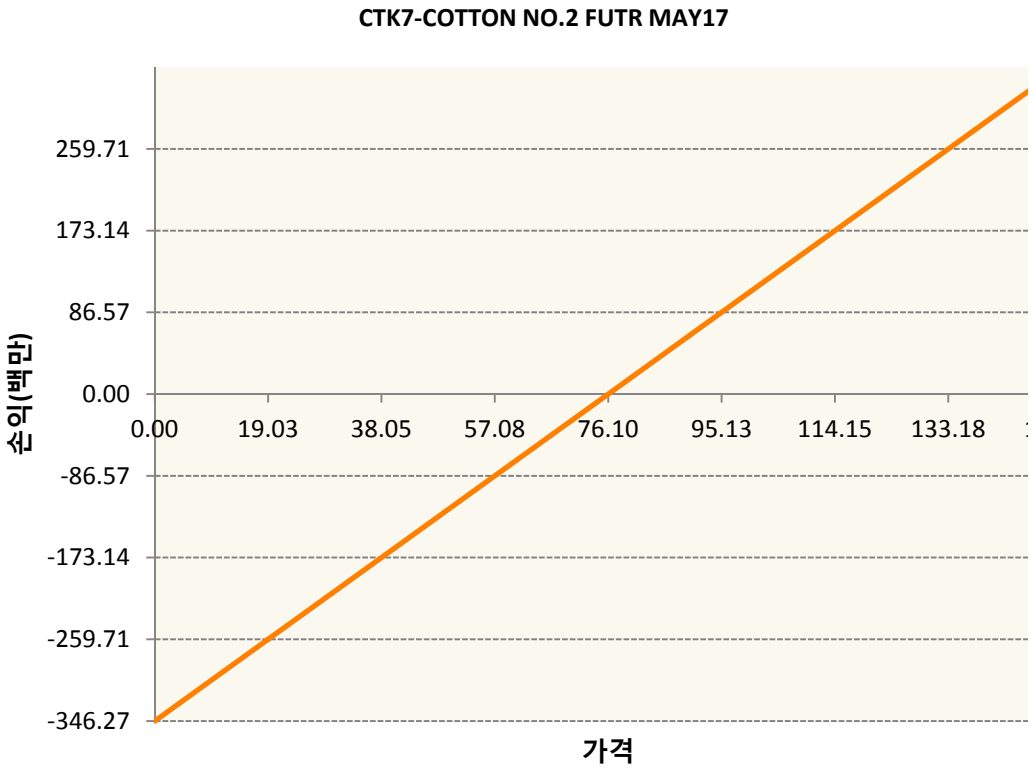
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	9,404	566	8,839	

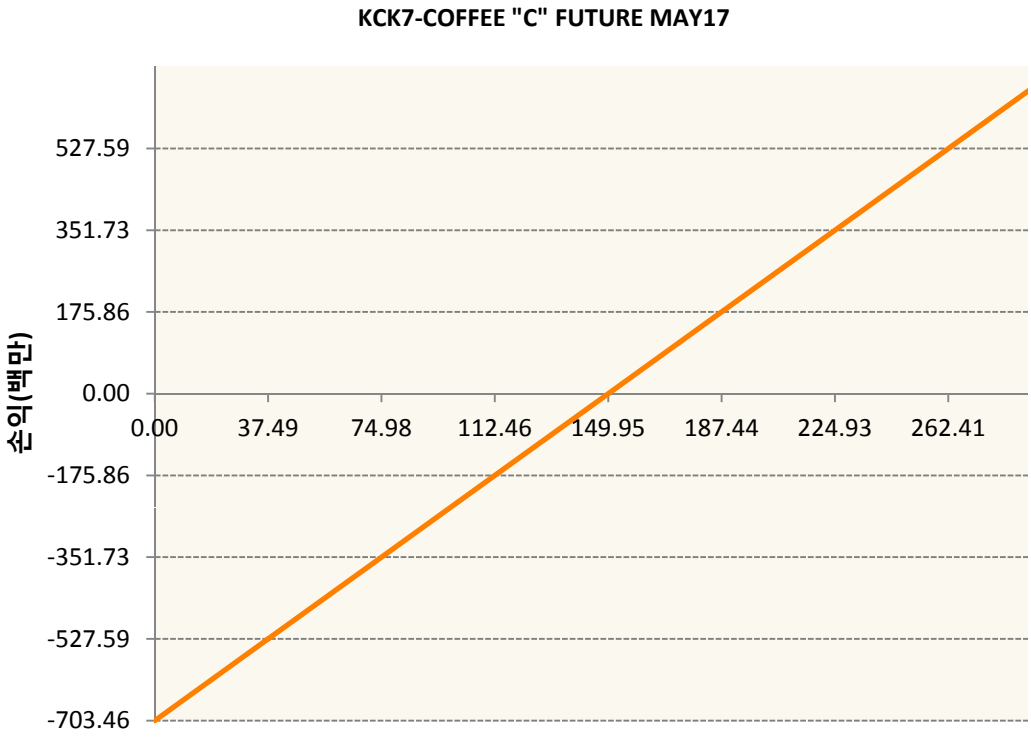
2. 만기시점의 손익구조



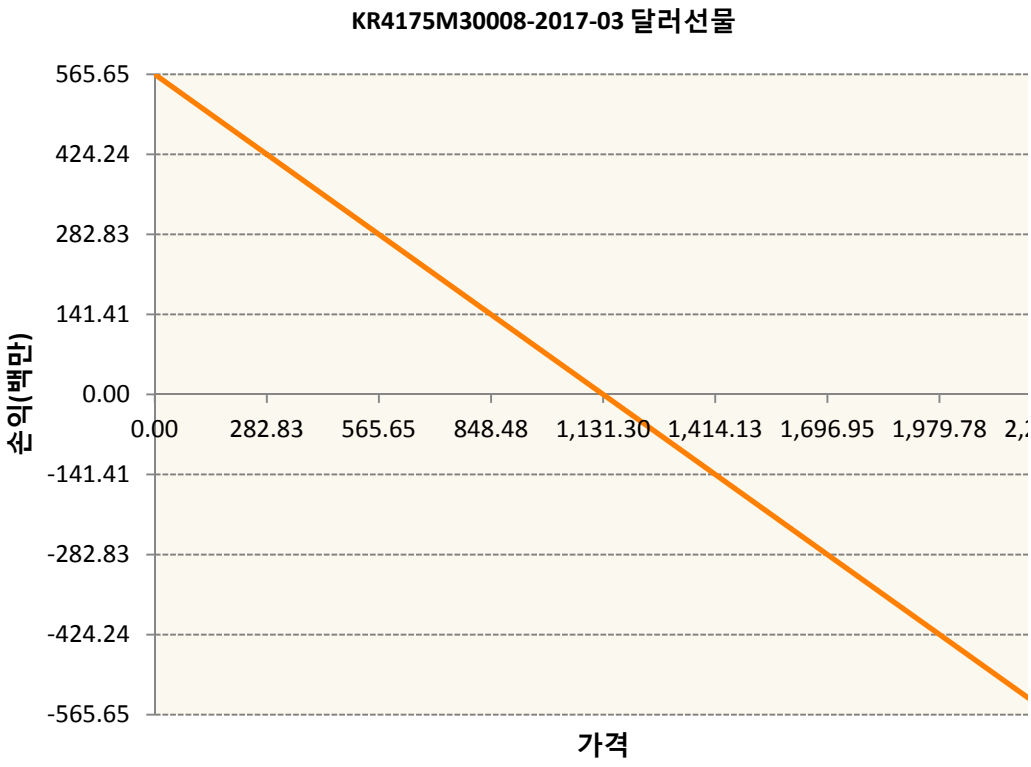


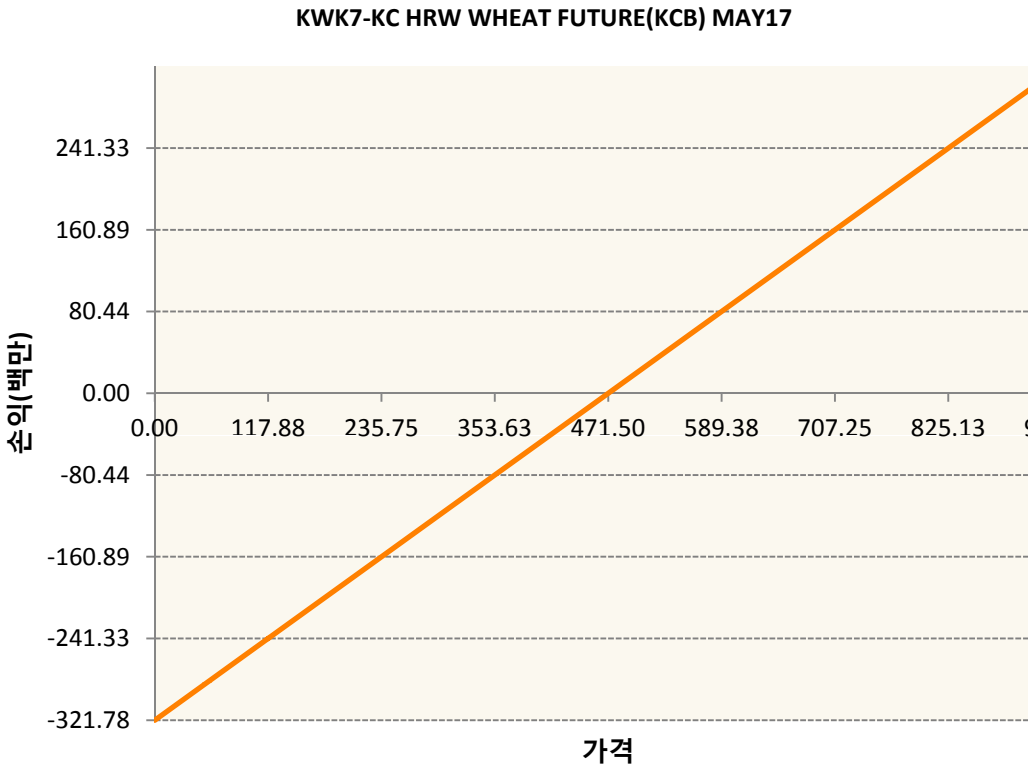

-1,747.93
-2,330.58
가격

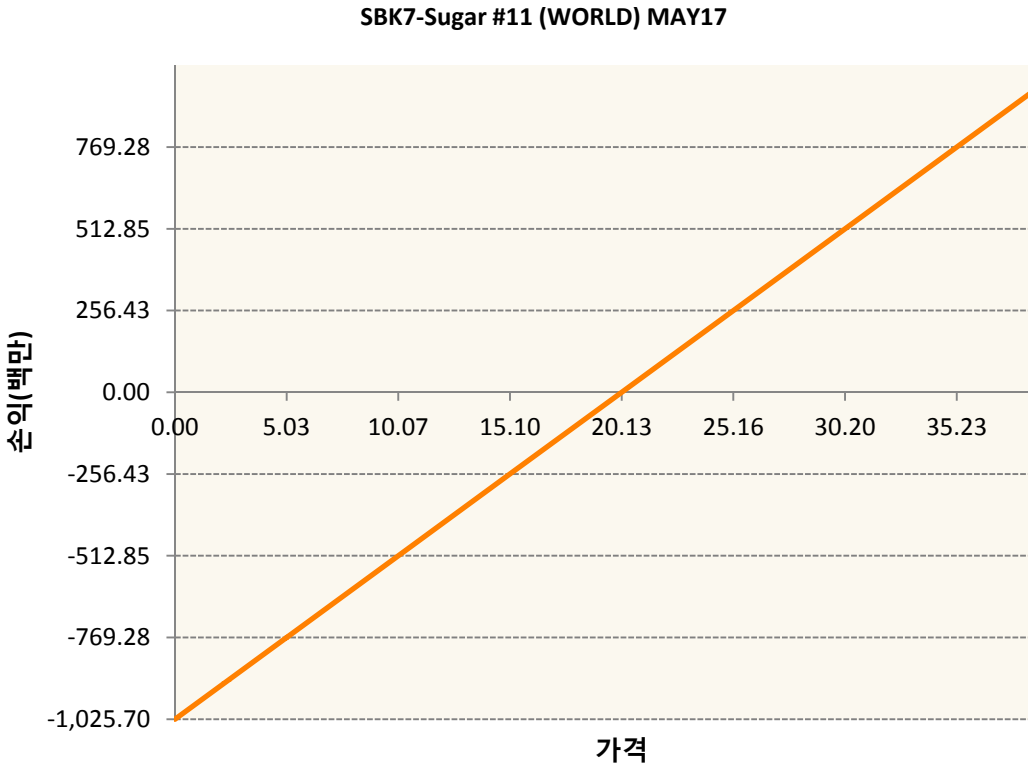

CTK7-COTTON NO.2 FUTR MAY17
259.71
173.14
86.57
0.00
-86.57
-173.14
-259.71
-346.27
0.00
19.03
38.05
57.08
76.10
95.13
114.15
133.18
순익(백만)
가격

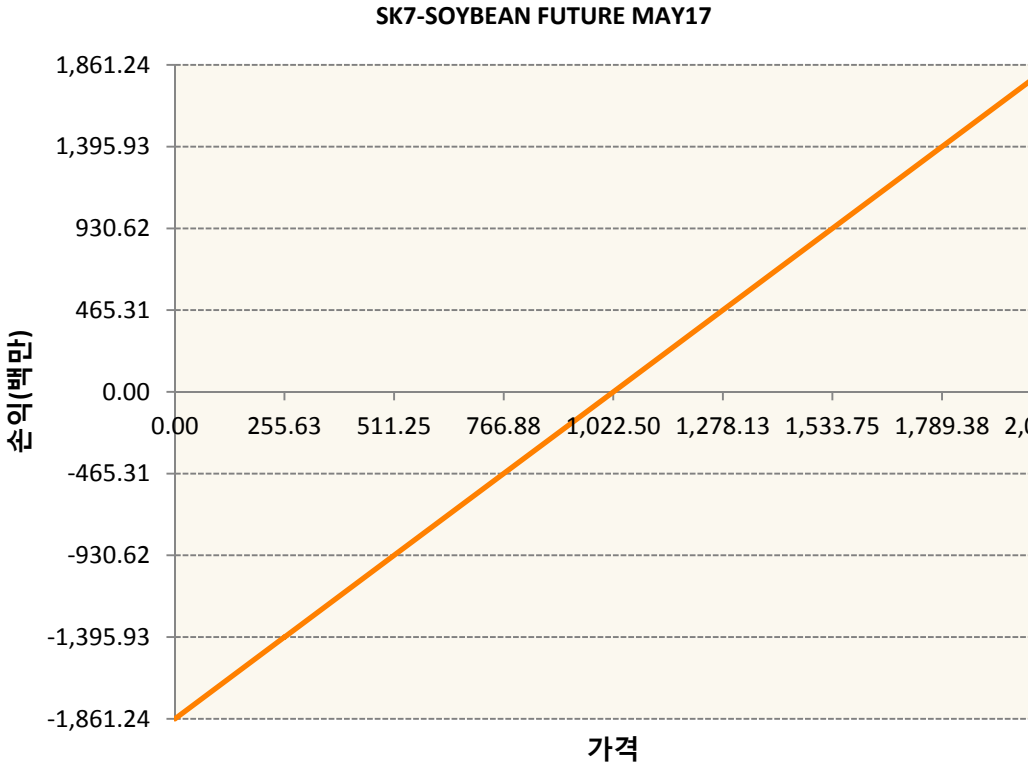

KCK7-COFFEE "C" FUTURE MAY17
527.59
351.73
175.86
0.00
-175.86
-351.73
-527.59
-703.46
0.00
37.49
74.98
112.46
149.95
187.44
224.93
262.41
순익(백만)

가격

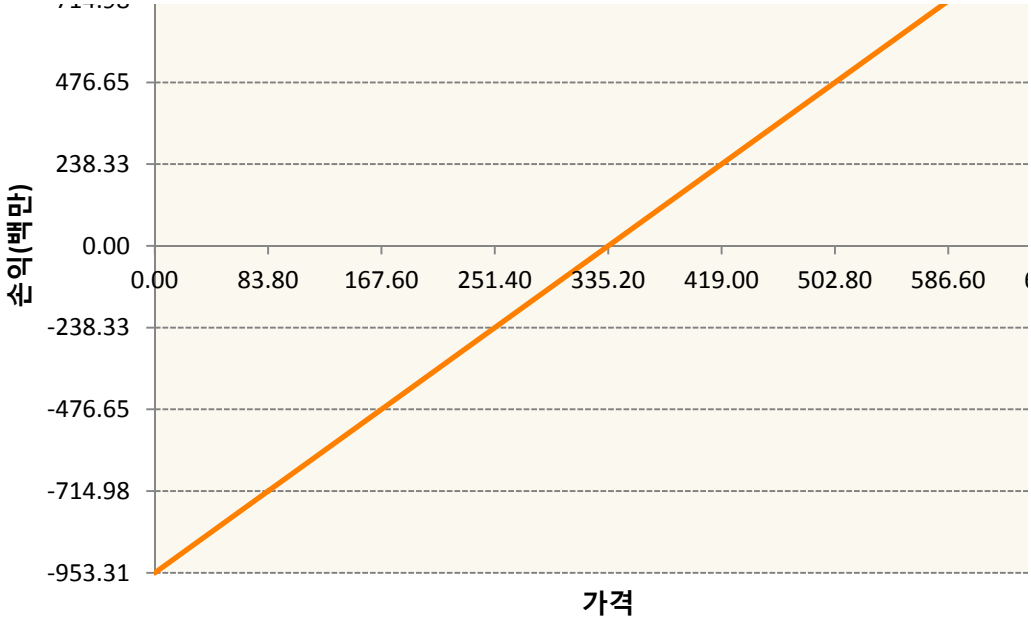

KR4175M30008-2017-03 달러선물
565.65
424.24
282.83
141.41
0.00
-141.41
-282.83
-424.24
-565.65
0.00
282.83
565.65
848.48
1,131.30
1,414.13
1,696.95
1,979.78
손익(백만)
가격

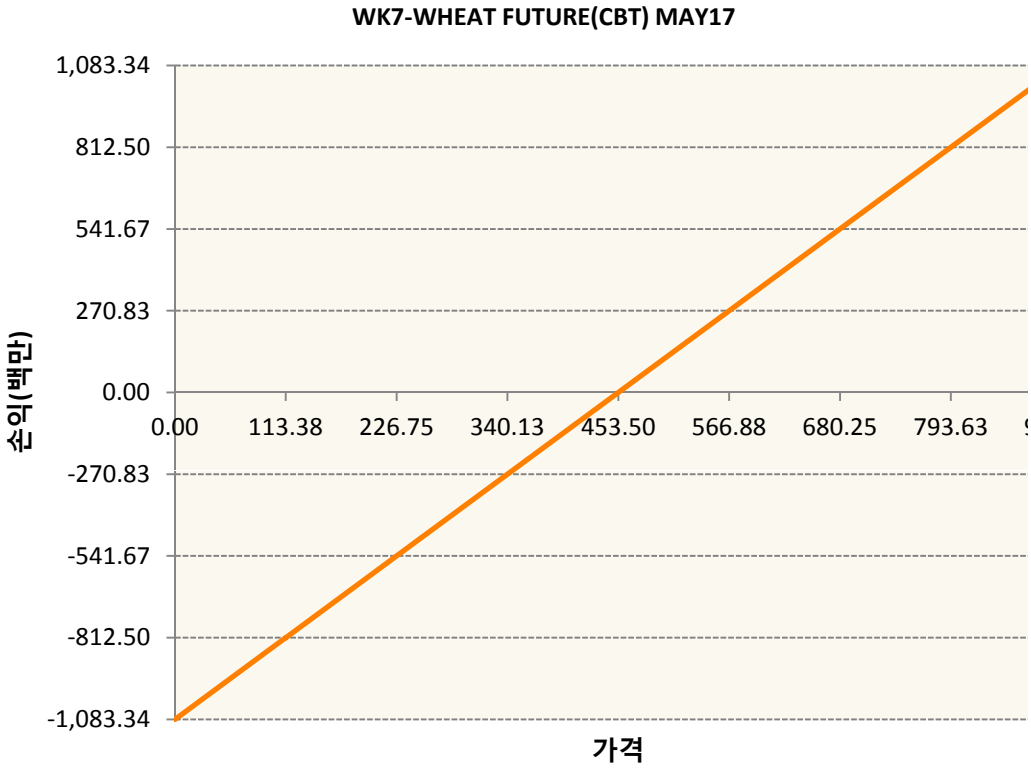

KWK7-KC HRW WHEAT FUTURE(KCB) MAY17
241.33
160.89
80.44
0.00
-80.44
-160.89
-241.33
-321.78
0.00
117.88
235.75
353.63
471.50
589.38
707.25
825.13
손익(백만)
가격


SBK7-Sugar #11 (WORLD) MAY17
769.28
512.85
256.43
0.00
-256.43
-512.85
-769.28
-1,025.70
0.00
5.03
10.07
15.10
20.13
25.16
30.20
35.23
손익(백만)
가격


SK7-SOYBEAN FUTURE MAY17
1,861.24
1,395.93
930.62
465.31
0.00
-465.31
-930.62
-1,395.93
-1,861.24
0.00
255.63
511.25
766.88
1,022.50
1,278.13
1,533.75
1,789.38
손익(백만)
가격


SMK7-SOYBEAN MEAL FUTR MAY17
714.98





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

BOK7	SOYBEAN OIL FUTR MAY17	62
CK7	CORN FUTURE MAY17	186
CTK7	COTTON NO.2 FUTR MAY17	28
KCK7	COFFEE "C" FUTURE MAY17	56
KR4175M30(	2017-03 달러선물	45

KWK7	KC HRW WHEAT FUTURE(KCB) MAY17	26
SBK7	Sugar #11 (WORLD) MAY17	82
SK7	SOYBEAN FUTURE MAY17	149
SMK7	SOYBEAN MEAL FUTR MAY17	76
WK7	WHEAT FUTURE(CBT) MAY17	87

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

880