공시일	2017-02-28
기준일	2017-02-27

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	2017-02-28
기준일	2017-02-27

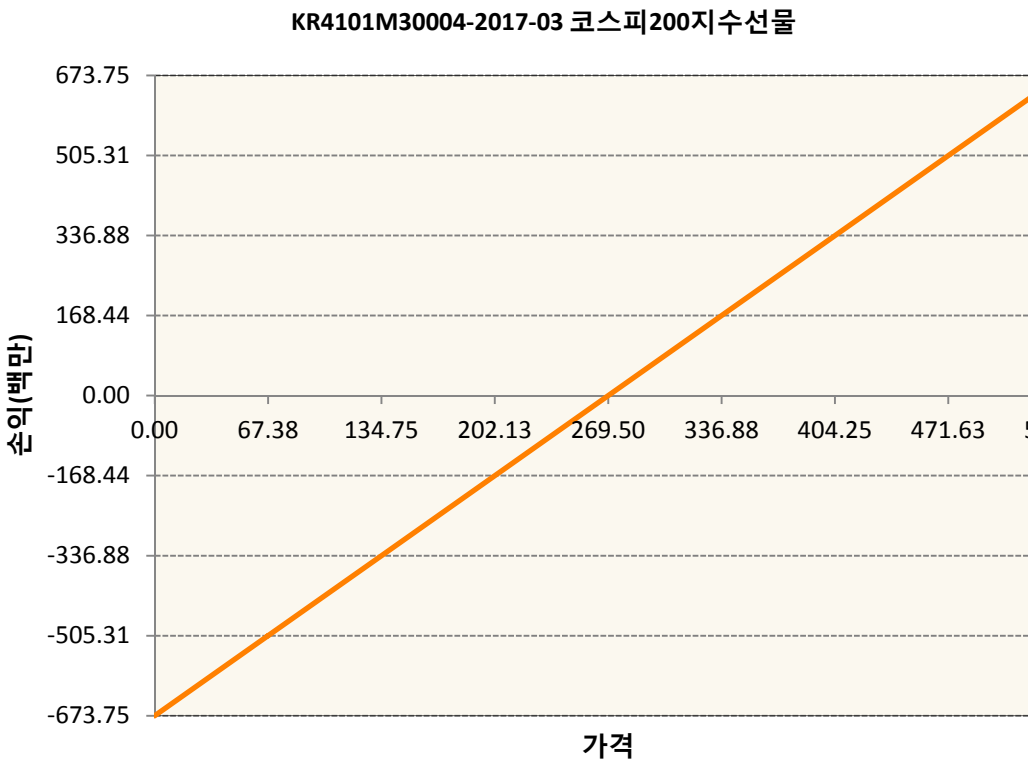
스마트인덱스모

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	674	0	674	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	2017-02-28
기준일	2017-02-27

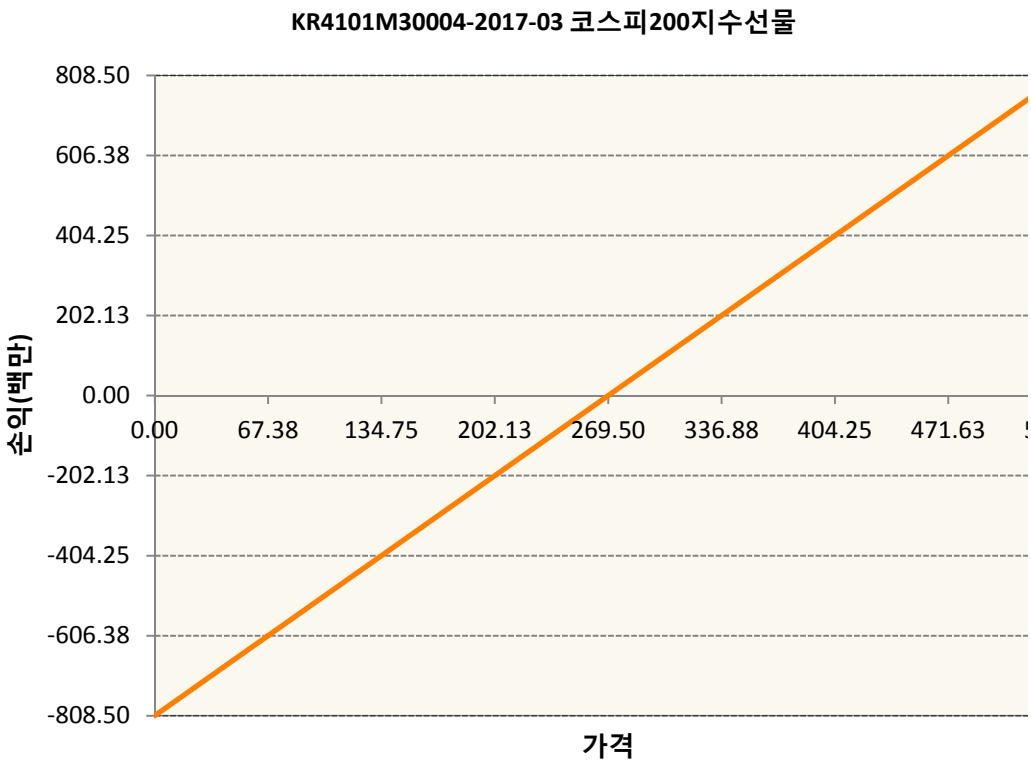
스마트레버리지목표전환형1호

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	809	0	809	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	2017-02-28
기준일	2017-02-27

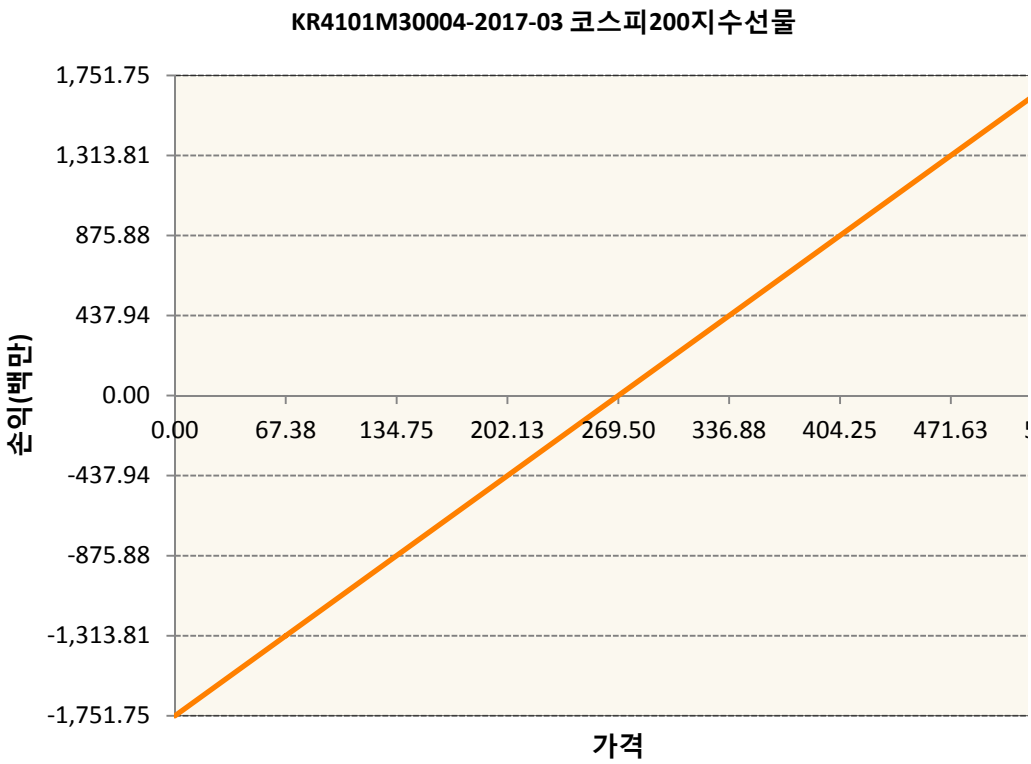
1.3배 레버리지 인덱스(주식-파생형)

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	1,752	0	1,752	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101M30(2017-03 코스피200지수선물							140
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-140	-140	-140	-140	-140	-140	-140
-5.33%	-93	-93	-93	-93	-93	-93	-93
-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%	93	93	93	93	93	93	93
8.00%	140	140	140	140	140	140	140

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

91

공시일	2017-02-28
기준일	2017-02-27

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	950

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

607

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-02-28
기준일	2017-02-27

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	391

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

510

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-02-28
기준일	2017-02-27

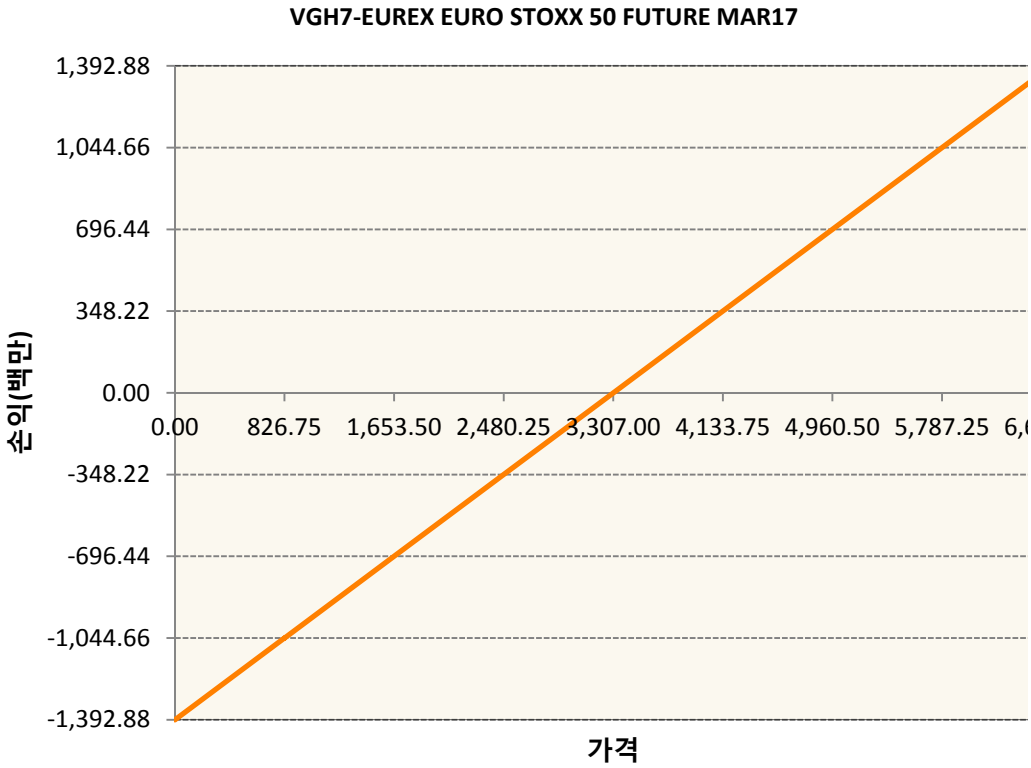
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,393	0	1,393	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGH7	EUREX EURO STOXX 50 FUTURE MAR17	111

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

(단위:백만원)

114

공시일	2017-02-28
기준일	2017-02-27

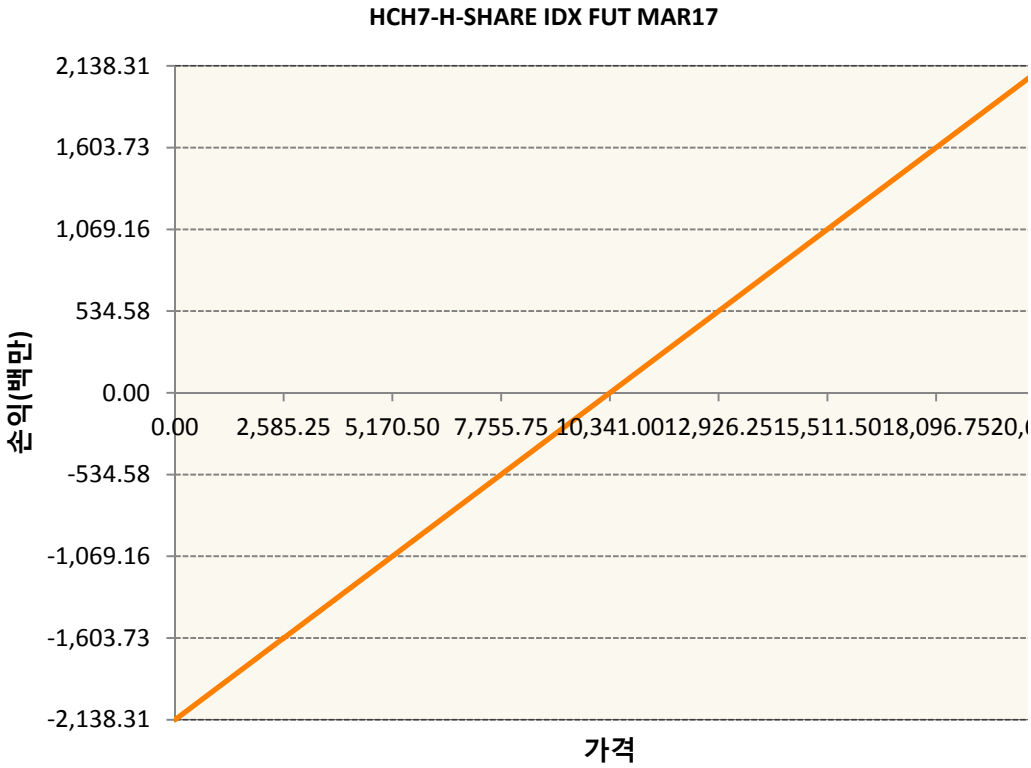
차이나인덱스모(주식-파생형)

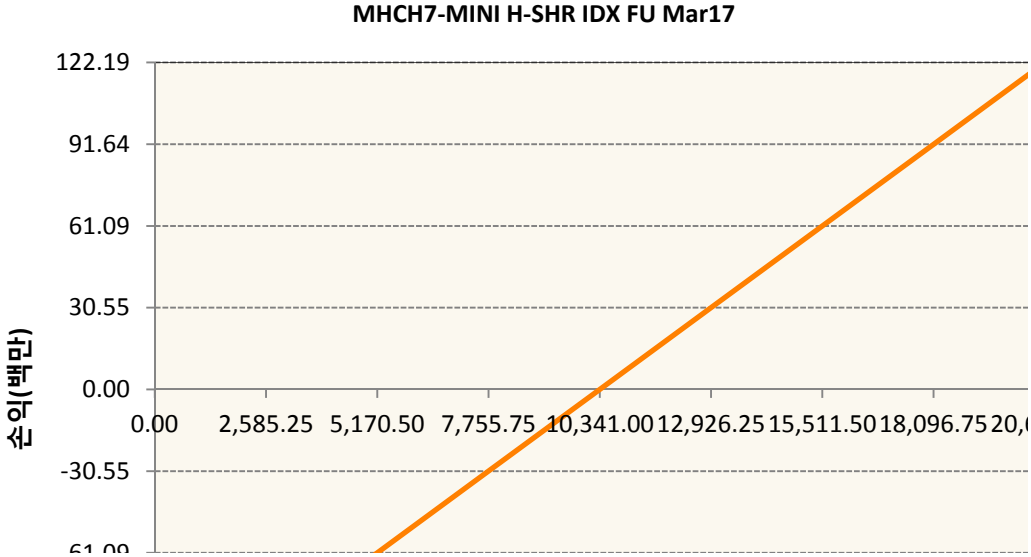
1. 계약금액

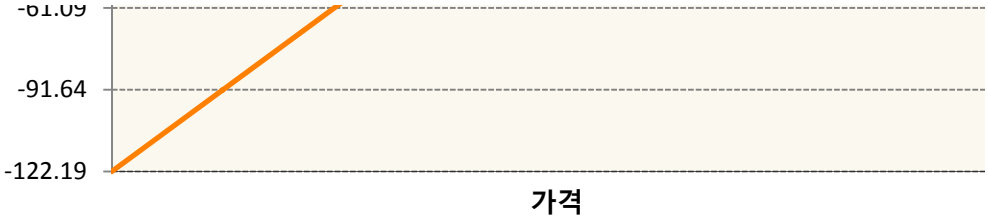
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,261	0	2,261	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCH7	H-SHARE IDX FUT MAR17	171
MHCH7	MINI H-SHR IDX FU Mar17	10

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	203

공시일	2017-02-28
기준일	2017-02-27

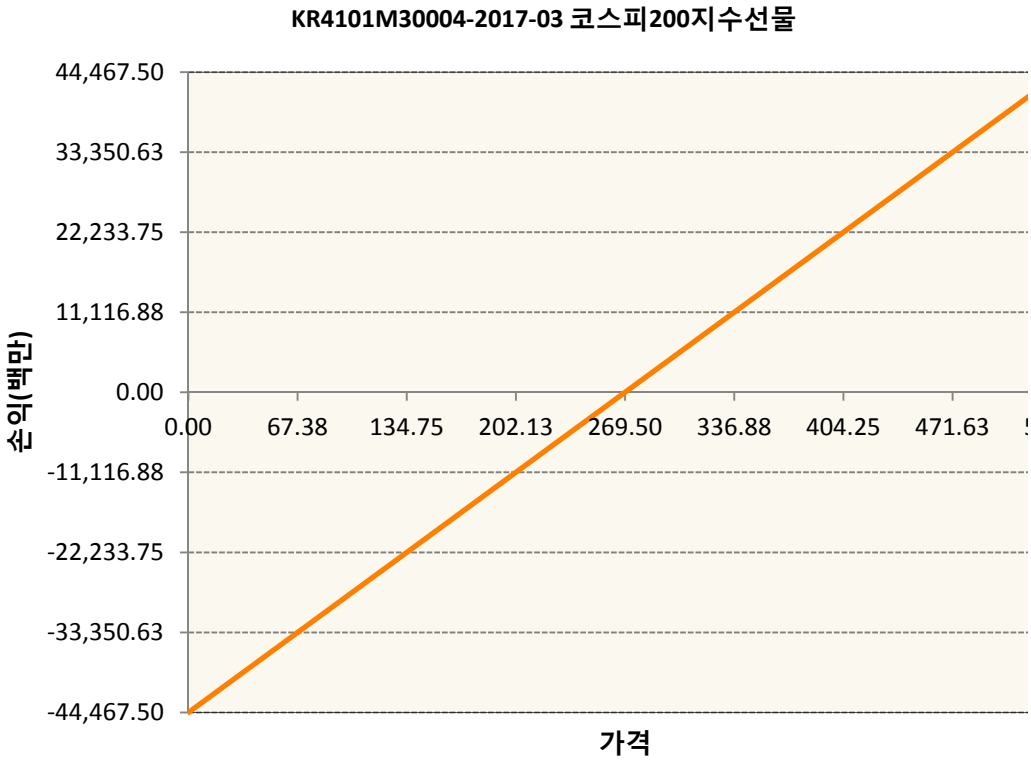
커버드콜모(주식혼합-파생형)

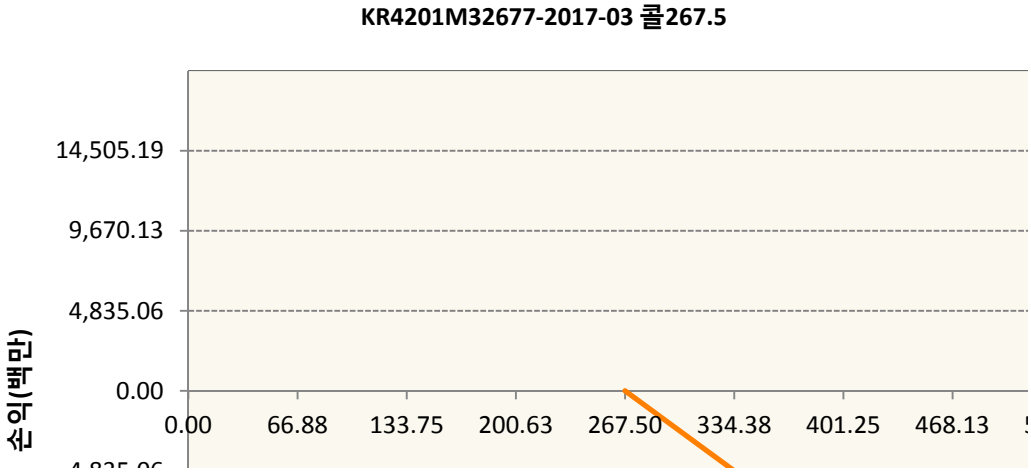
1. 계약금액

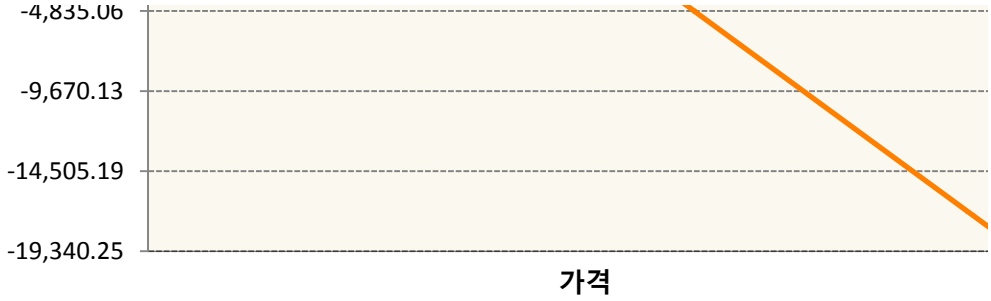
(단위:백만원)

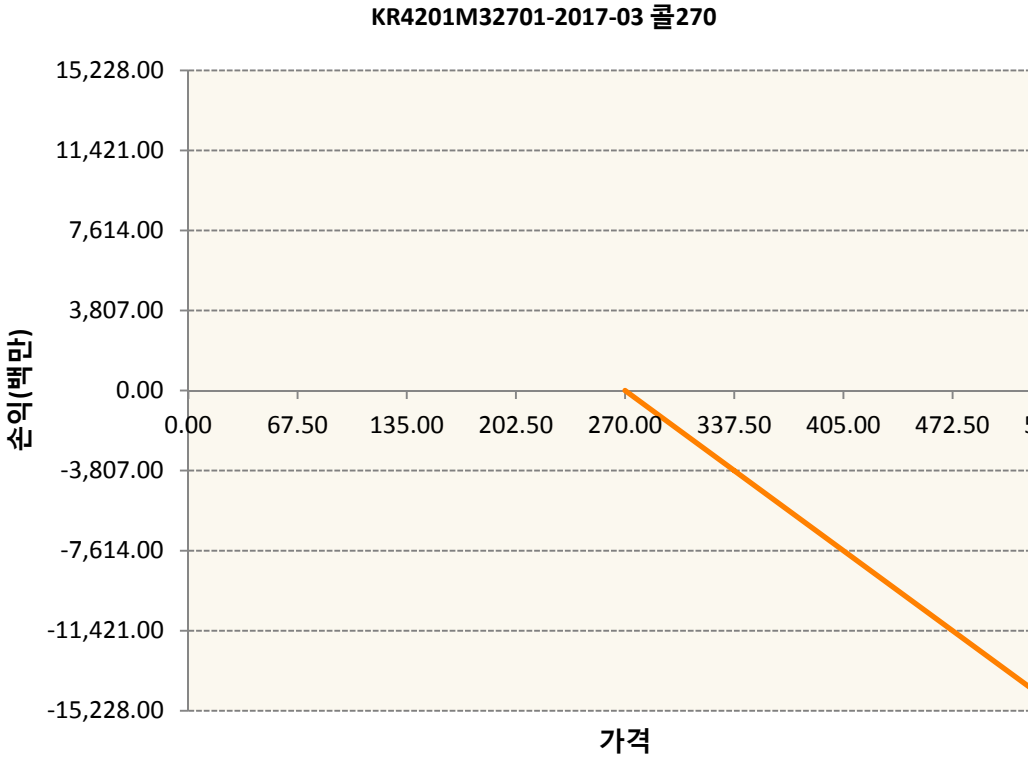
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	679	-679	장내
누계	유가증권	선물	44,468	0	44,468	장내
누계	유가증권	옵션	0	34,568	-34,568	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101M30(2017-03 코스피200지수선물							3,550
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-3,550	-3,550	-3,550	-3,550	-3,550	-3,550	-3,550
-5.33%	-2,367	-2,367	-2,367	-2,367	-2,367	-2,367	-2,367
-2.67%	-1,183	-1,183	-1,183	-1,183	-1,183	-1,183	-1,183
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	1,183	1,183	1,183	1,183	1,183	1,183	1,183
5.33%	2,367	2,367	2,367	2,367	2,367	2,367	2,367
8.00%	3,550	3,550	3,550	3,550	3,550	3,550	3,550
KR4201M32(2017-03 콜267.5							7,319
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	986	986	986	986	986	986	986
-5.33%	986	986	985	985	983	980	976
-2.67%	957	940	918	892	864	832	798
0%	162	109	55	0	-55	-110	-166
2.67%	-2,139	-2,144	-2,151	-2,161	-2,175	-2,191	-2,211
5.33%	-4,727	-4,727	-4,727	-4,727	-4,728	-4,729	-4,731
8.00%	-7,319	-7,319	-7,319	-7,319	-7,319	-7,319	-7,319
KR4201M32: 2017-03 콜270							5,367

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	407	407	407	407	407	407	407
-5.33%	407	407	407	407	406	406	405
-2.67%	403	399	393	384	373	359	344
0%	131	88	44	0	-44	-88	-133
2.67%	-1,343	-1,356	-1,372	-1,391	-1,413	-1,437	-1,464
5.33%	-3,345	-3,346	-3,346	-3,347	-3,348	-3,351	-3,355
8.00%	-5,367	-5,367	-5,367	-5,367	-5,367	-5,367	-5,367

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

19,409

공시일	2017-02-28
기준일	2017-02-27

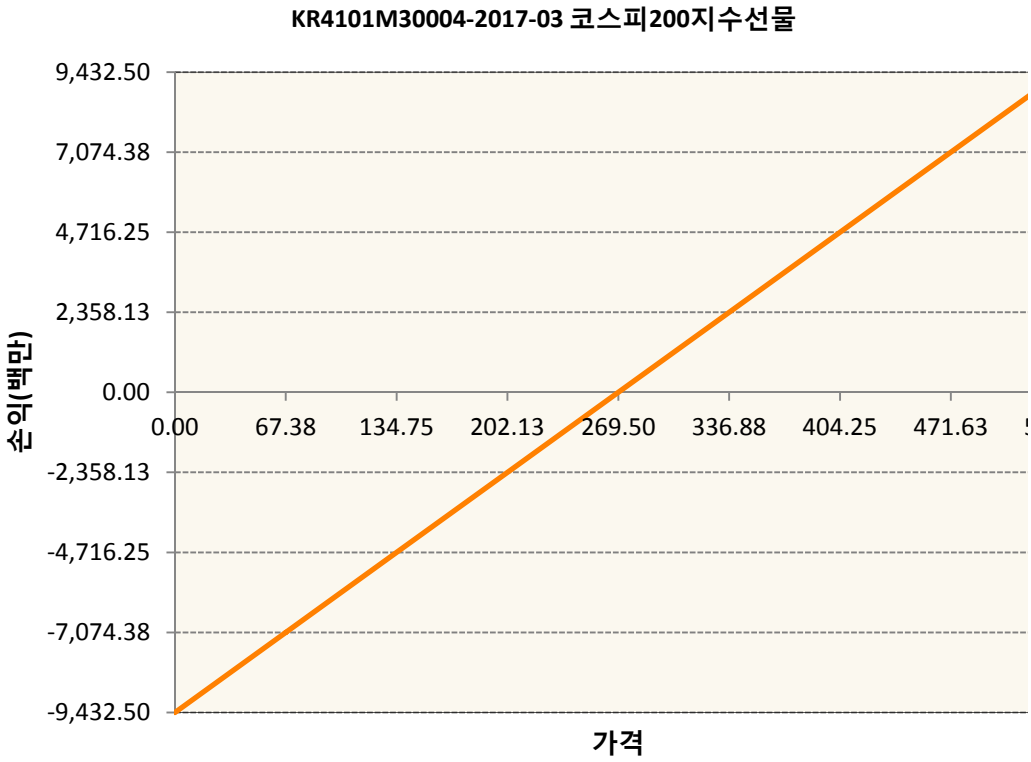
커버드콜목표전환형증권투자신탁

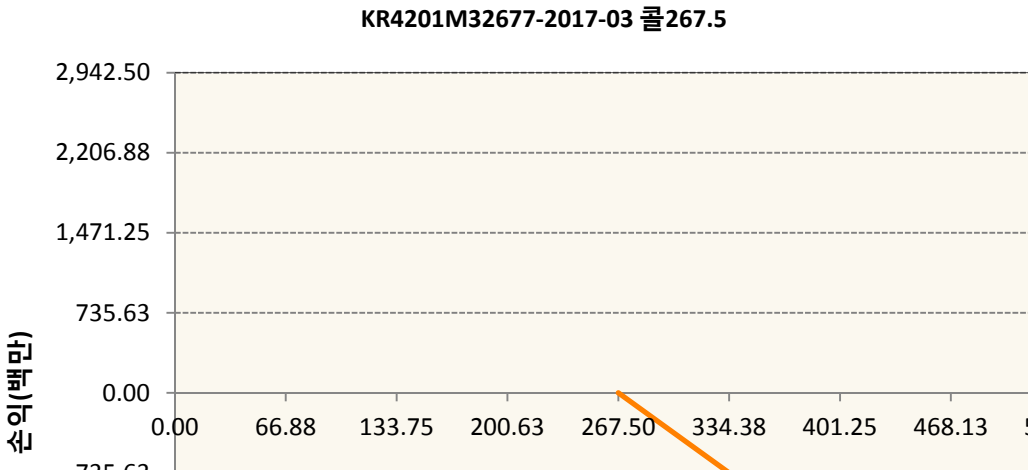
1. 계약금액

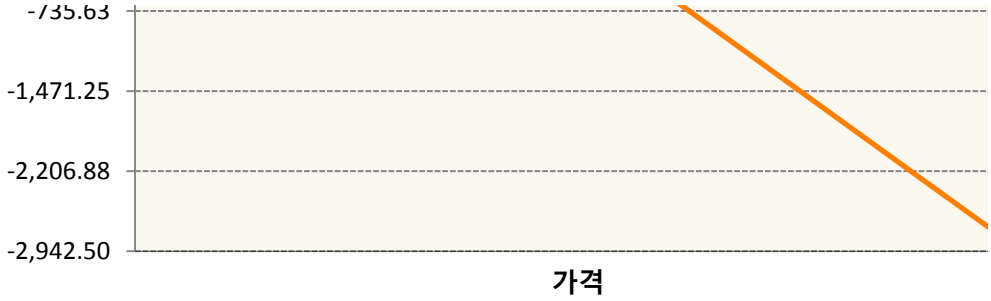
(단위:백만원)

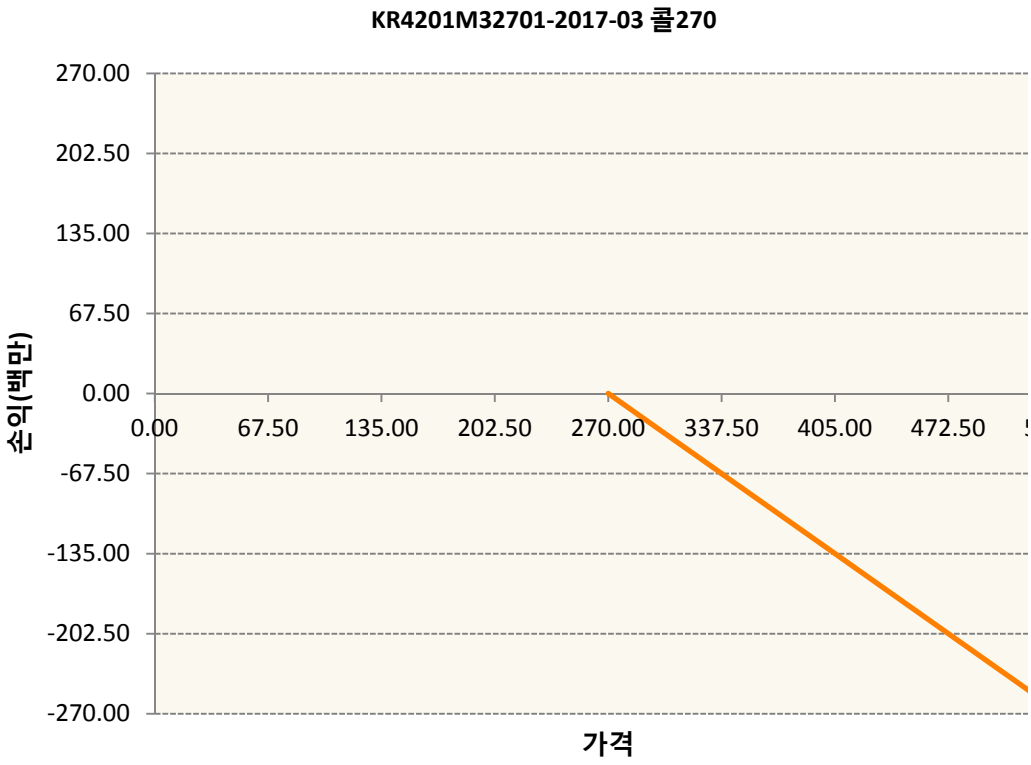
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	9,433	0	9,433	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,213	-3,213	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101M30(2017-03 코스피200지수선물							753
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-753	-753	-753	-753	-753	-753	-753
-5.33%	-502	-502	-502	-502	-502	-502	-502
-2.67%	-251	-251	-251	-251	-251	-251	-251
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	251	251	251	251	251	251	251
5.33%	502	502	502	502	502	502	502
8.00%	753	753	753	753	753	753	753
KR4201M32(2017-03 콜267.5							1,114
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	150	150	150	150	150	150	150
-5.33%	150	150	150	150	150	149	149
-2.67%	146	143	140	136	131	127	121
0%	25	17	8	0	-8	-17	-25
2.67%	-325	-326	-327	-329	-331	-333	-336
5.33%	-719	-719	-719	-719	-719	-719	-720
8.00%	-1,114	-1,114	-1,114	-1,114	-1,114	-1,114	-1,114
	KR4201M32: 2017-03 콜270						95

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	7	7	7	7	7	7	7
-5.33%	7	7	7	7	7	7	7
-2.67%	7	7	7	7	7	6	6
0%	2	2	1	0	-1	-2	-2
2.67%	-24	-24	-24	-25	-25	-25	-26
5.33%	-59	-59	-59	-59	-59	-59	-59
8.00%	-95	-95	-95	-95	-95	-95	-95

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

2,142

공시일	2017-02-28
기준일	2017-02-27

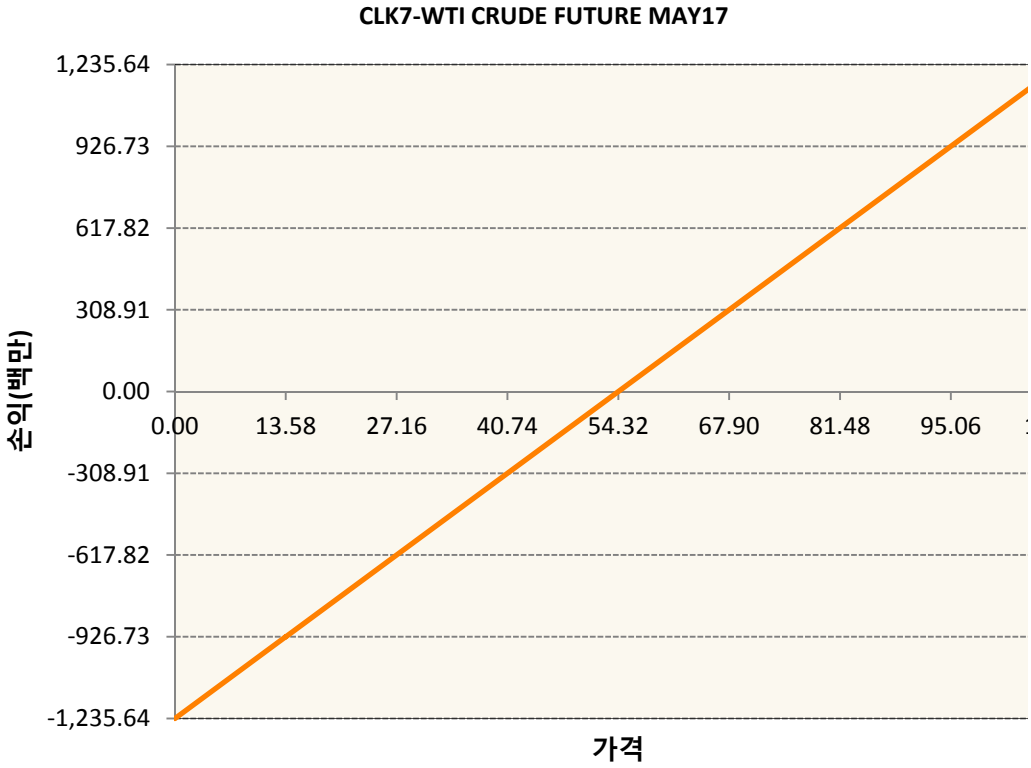
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

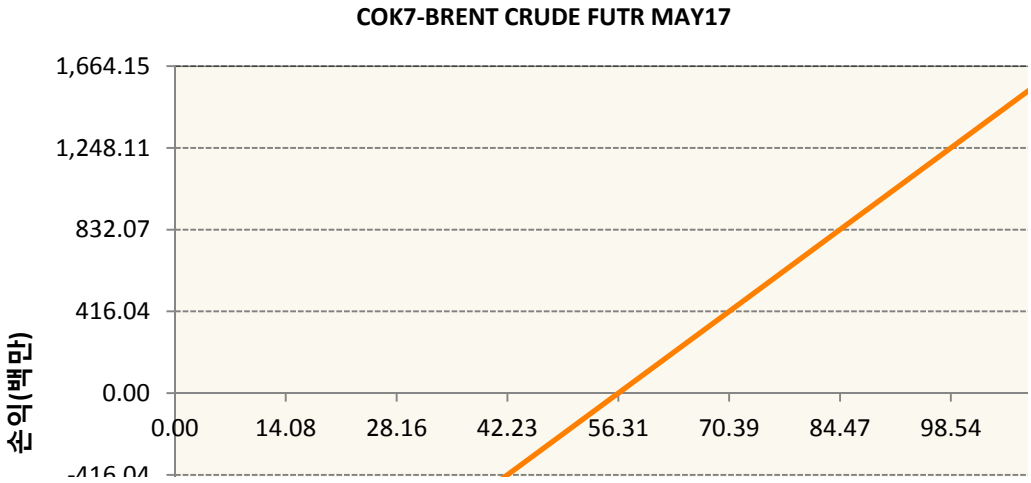
1. 계약금액

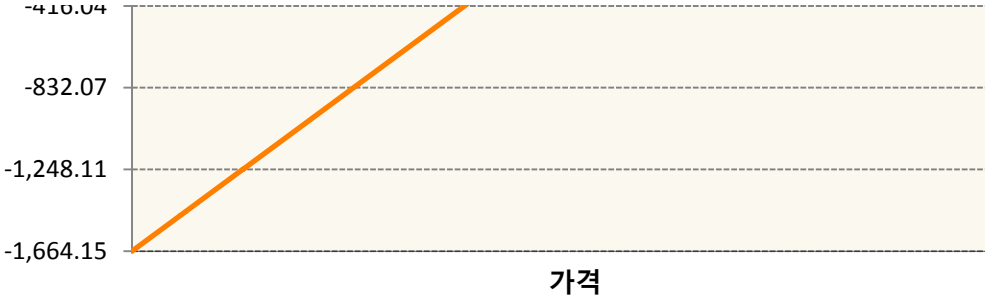
(단위:백만원)

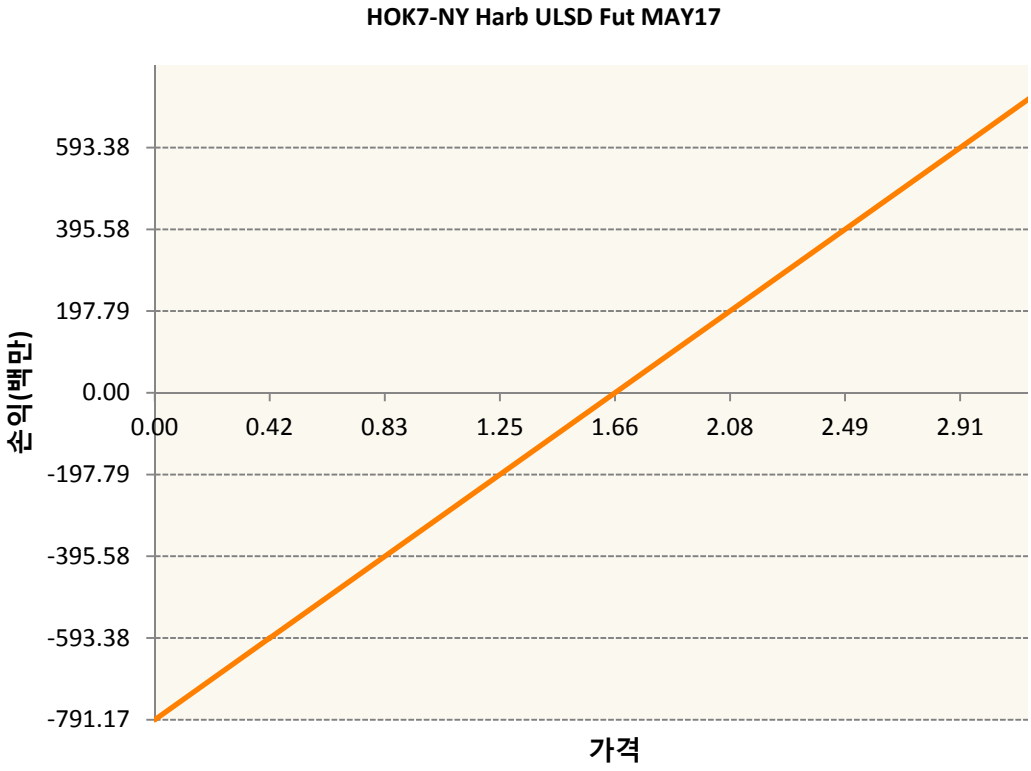
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	선물	유가증권	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	선물	유가증권	1,236	0	1,236	
누계	유가증권	선물	4,616	408	4,208	

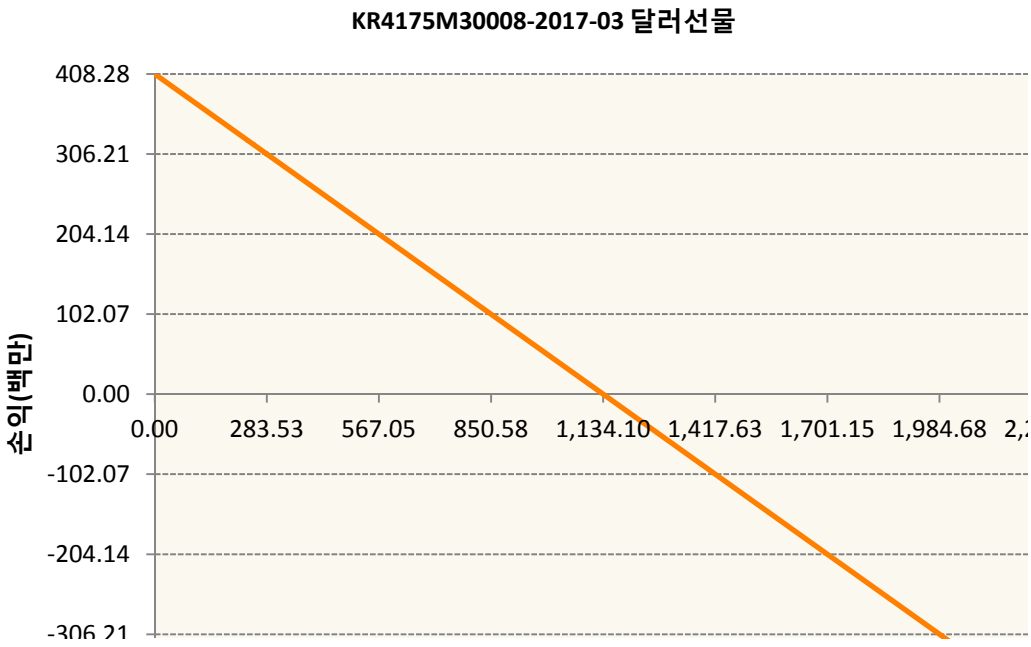
2. 만기시점의 손익구조

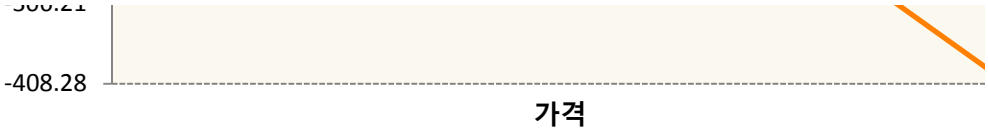


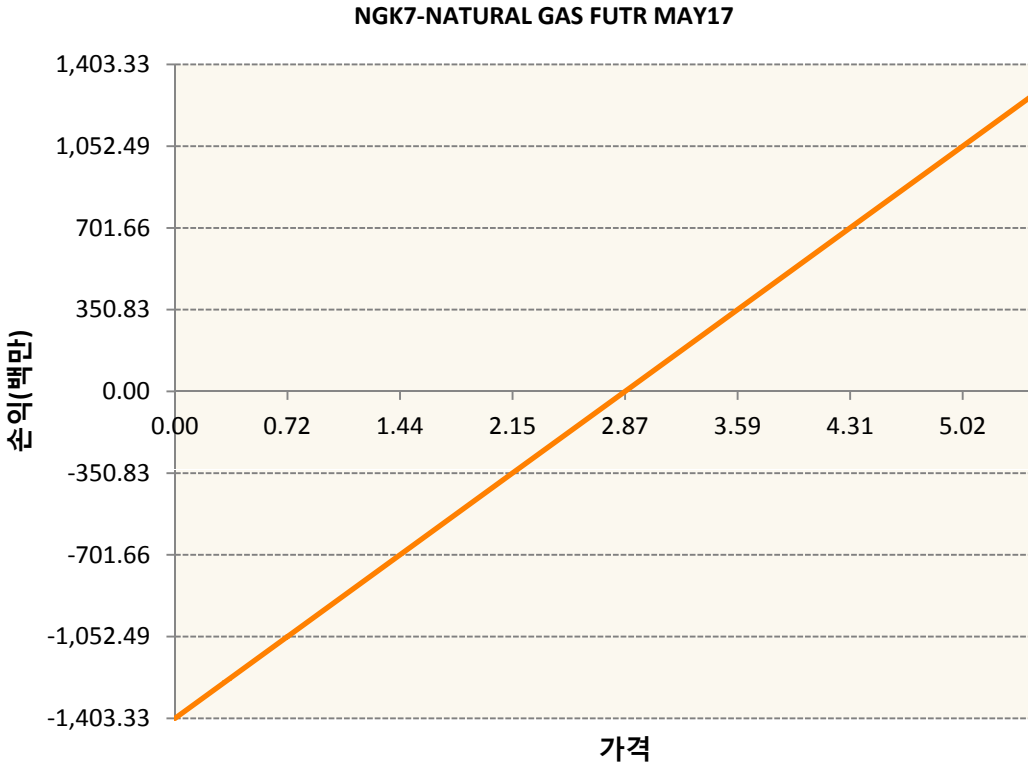


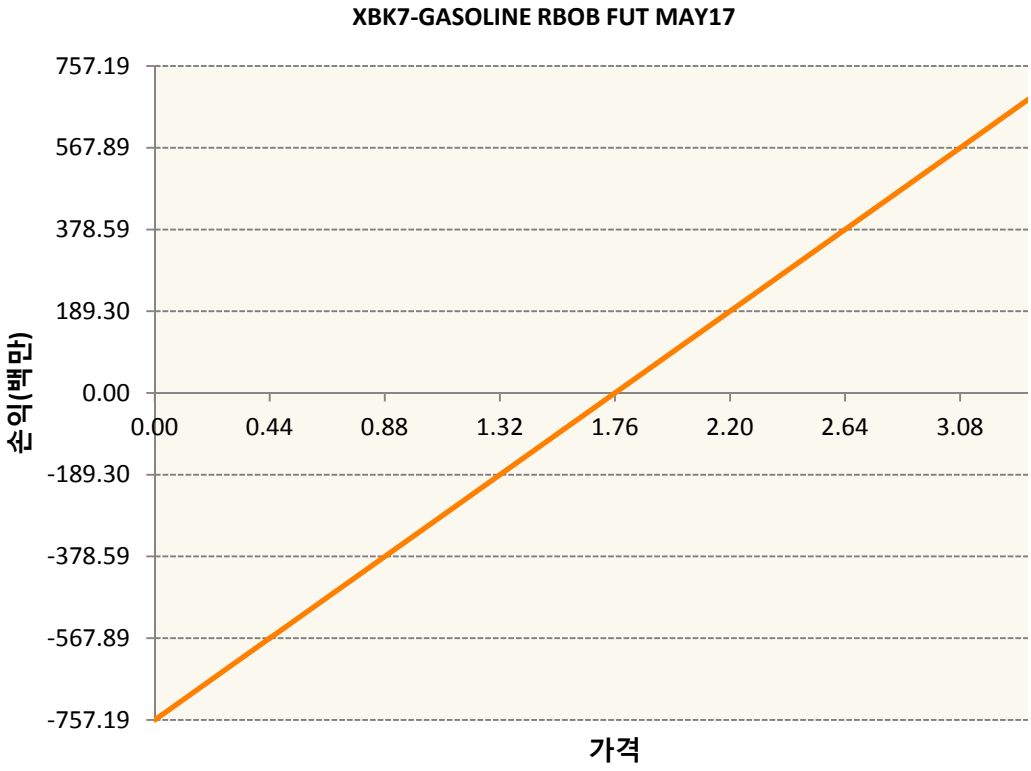

-832.07
-1,248.11
-1,664.15
가격


HOK7-NY Harb ULSD Fut MAY17
593.38
395.58
197.79
0.00
-197.79
-395.58
-593.38
-791.17
0.00
0.42
0.83
1.25
1.66
2.08
2.49
2.91
순익(백만)
가격


KR4175M30008-2017-03 달러선물
408.28
306.21
204.14
102.07
0.00
-102.07
-204.14
-306.21
0.00
283.53
567.05
850.58
1,134.10
1,417.63
1,701.15
1,984.68
순익(백만)


-408.28
가격


NGK7-NATURAL GAS FUTR MAY17
1,403.33
1,052.49
701.66
350.83
0.00
-350.83
-701.66
-1,052.49
-1,403.33
0.00
0.72
1.44
2.15
2.87
3.59
4.31
5.02
순익(백만)
가격


XBK7-GASOLINE RBOB FUT MAY17
757.19
567.89
378.59
189.30
0.00
-189.30
-378.59
-567.89
-757.19
0.00
0.44
0.88
1.32
1.76
2.20
2.64
3.08
순익(백만)
가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLK7	WTI CRUDE FUTURE MAY17	99
COK7	BRENT CRUDE FUTR MAY17	133
HOK7	NY Harb ULSD Fut MAY17	63
KR4175M30(	2017-03 달러선물	33
NGK7	NATURAL GAS FUTR MAY17	112
XBK7	GASOLINE RBOB FUT MAY17	61

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

1,036

공시일	2017-02-28
기준일	2017-02-27

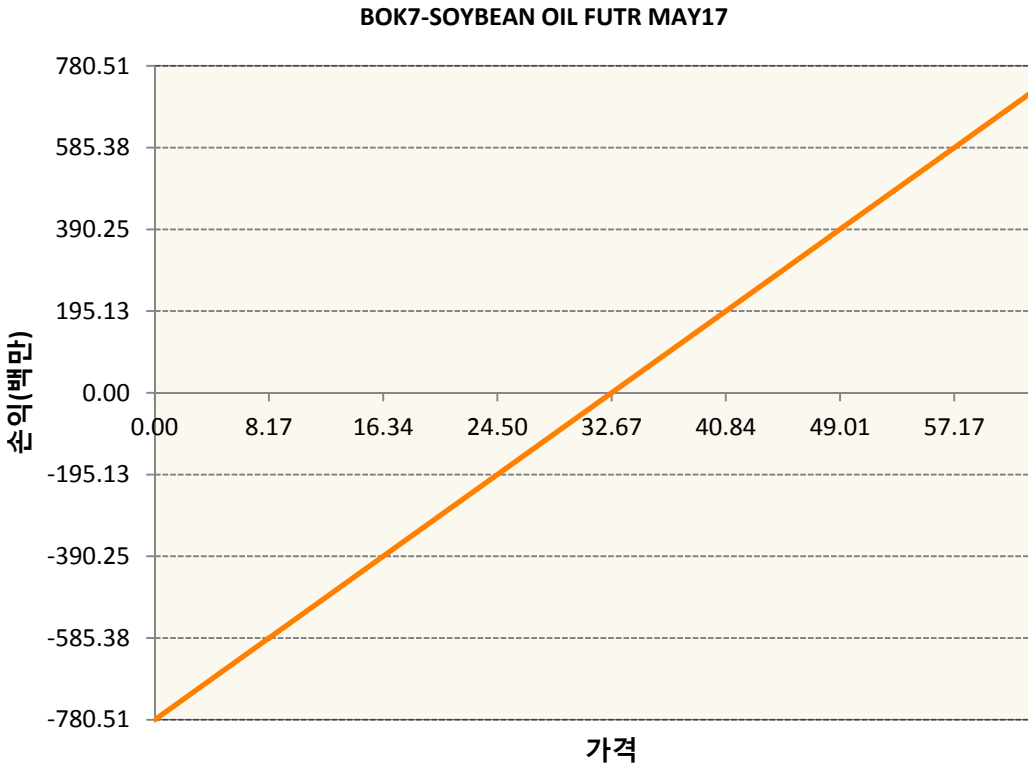
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

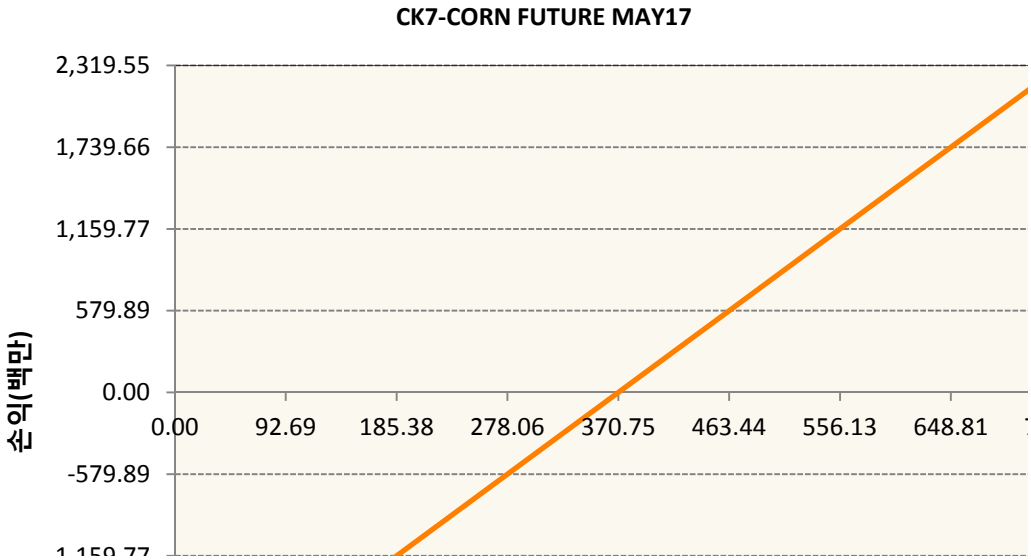
1. 계약금액

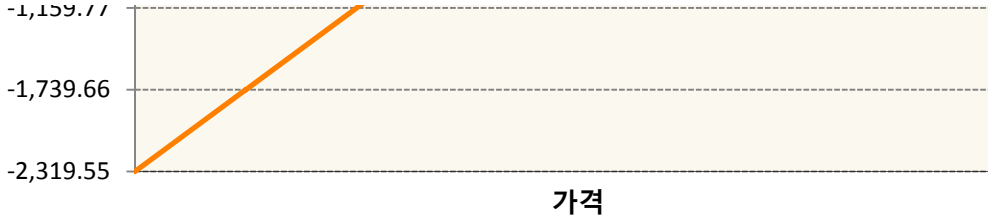
(단위:백만원)

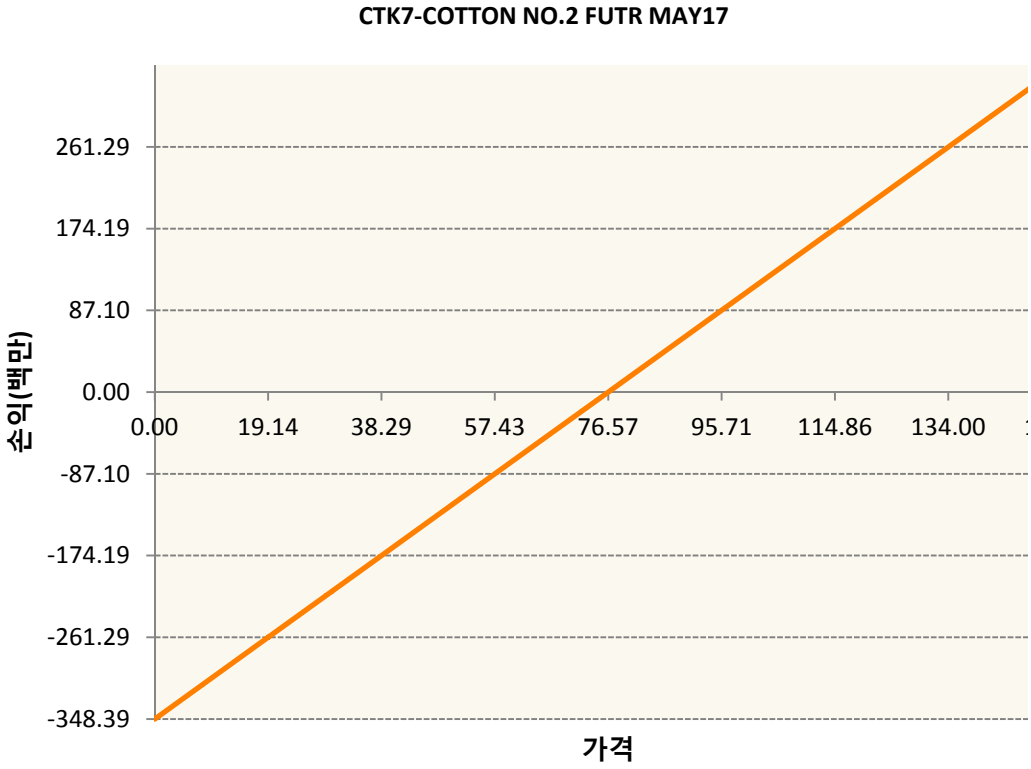
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	9,352	567	8,785	

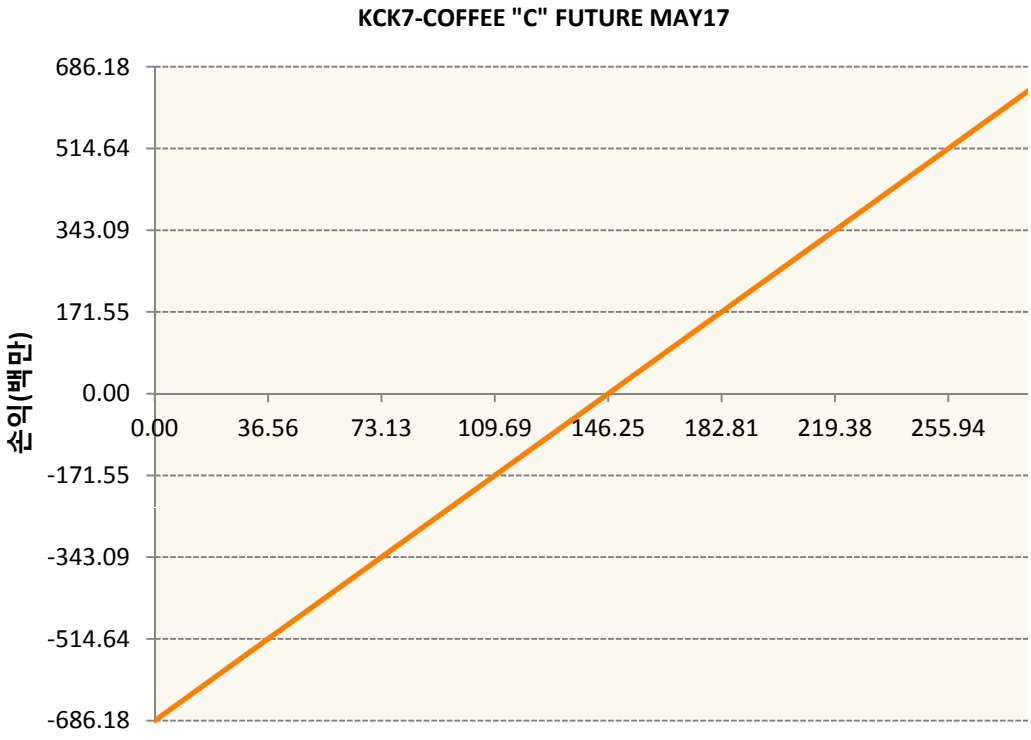
2. 만기시점의 손익구조



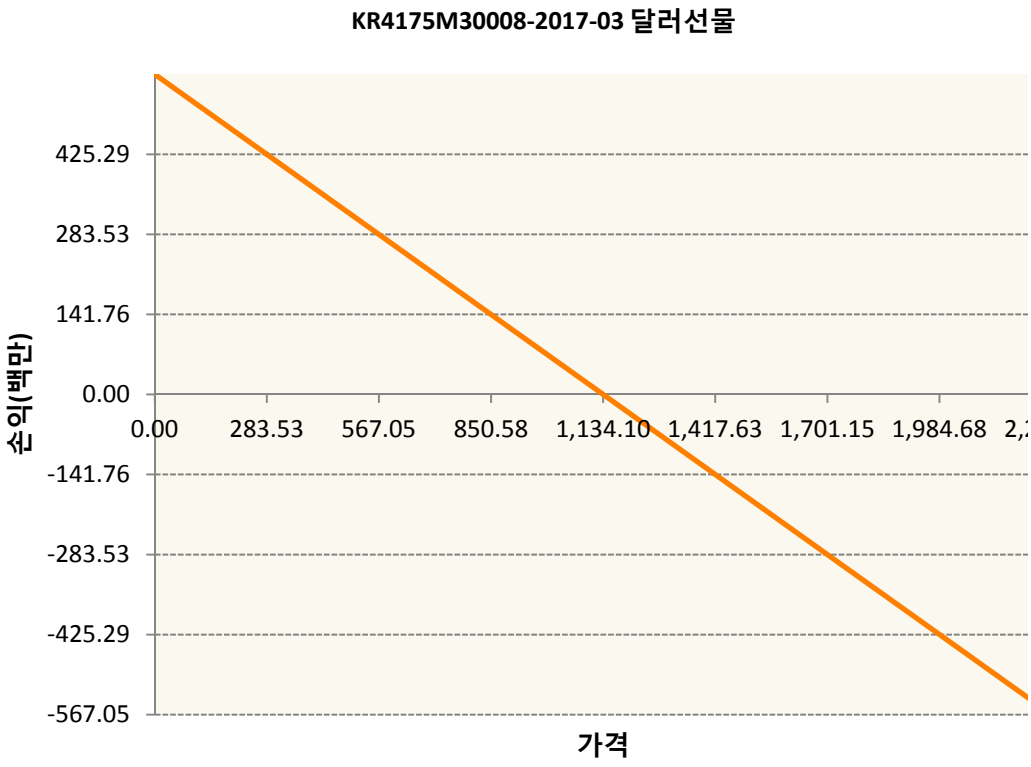


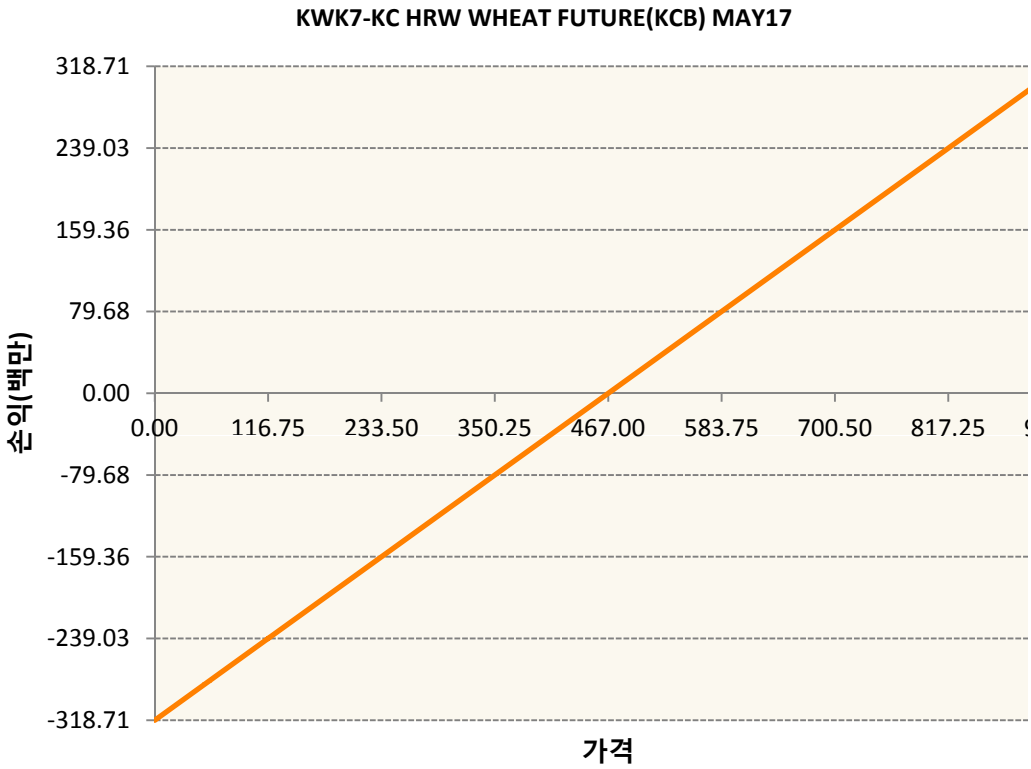

-1,739.66
-2,319.55
가격


CTK7-COTTON NO.2 FUTR MAY17
261.29
174.19
87.10
0.00
-87.10
-174.19
-261.29
-348.39
0.00
19.14
38.29
57.43
76.57
95.71
114.86
134.00
순익(백만)
가격

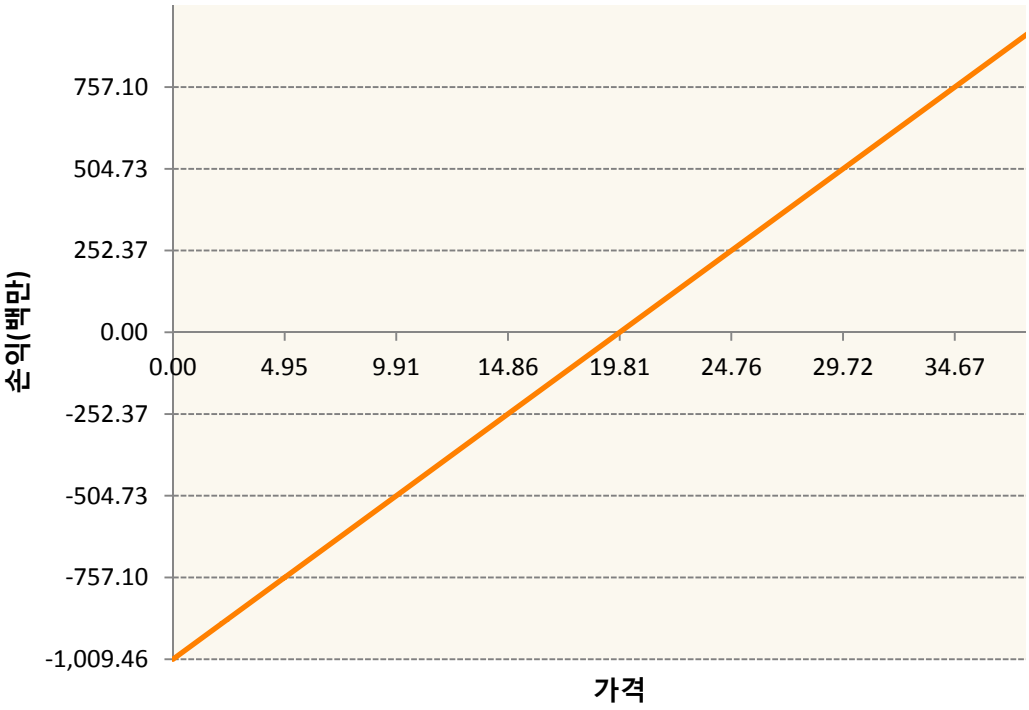

KCK7-COFFEE "C" FUTURE MAY17
686.18
514.64
343.09
171.55
0.00
-171.55
-343.09
-514.64
-686.18
0.00
36.56
73.13
109.69
146.25
182.81
219.38
255.94
순익(백만)

가격

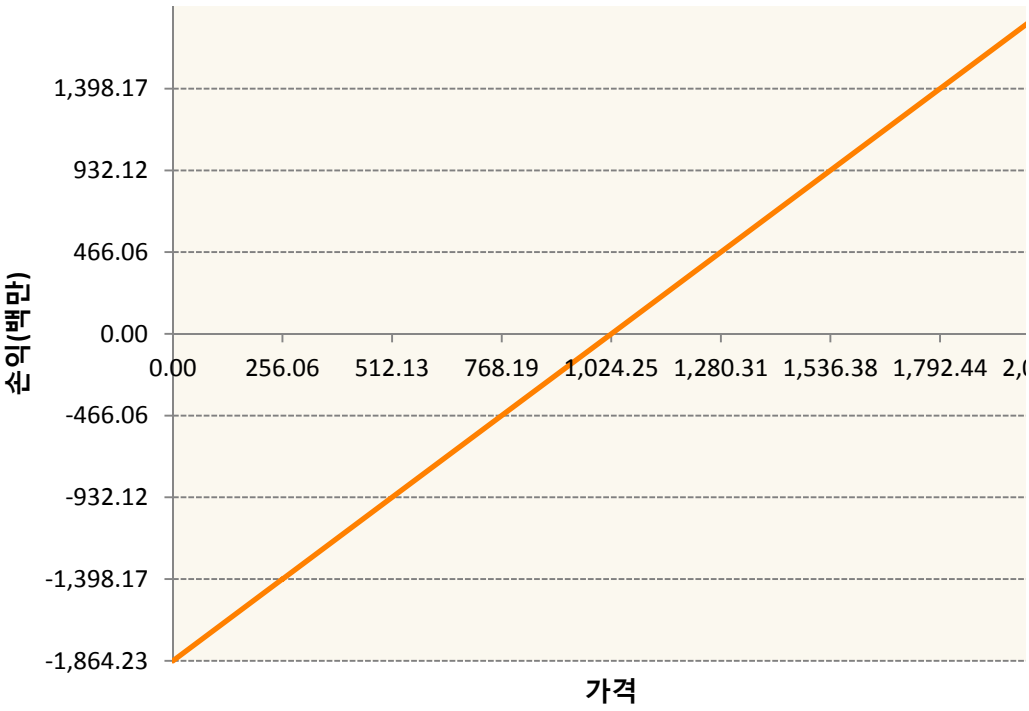

KR4175M30008-2017-03 달러선물
425.29
283.53
141.76
0.00
-141.76
-283.53
-425.29
-567.05
0.00
283.53
567.05
850.58
1,134.10
1,417.63
1,701.15
1,984.68
손익(백만)
가격


KWK7-KC HRW WHEAT FUTURE(KCB) MAY17
318.71
239.03
159.36
79.68
0.00
-79.68
-159.36
-239.03
-318.71
0.00
116.75
233.50
350.25
467.00
583.75
700.50
817.25
손익(백만)
가격

SBK7-Sugar #11 (WORLD) MAY17

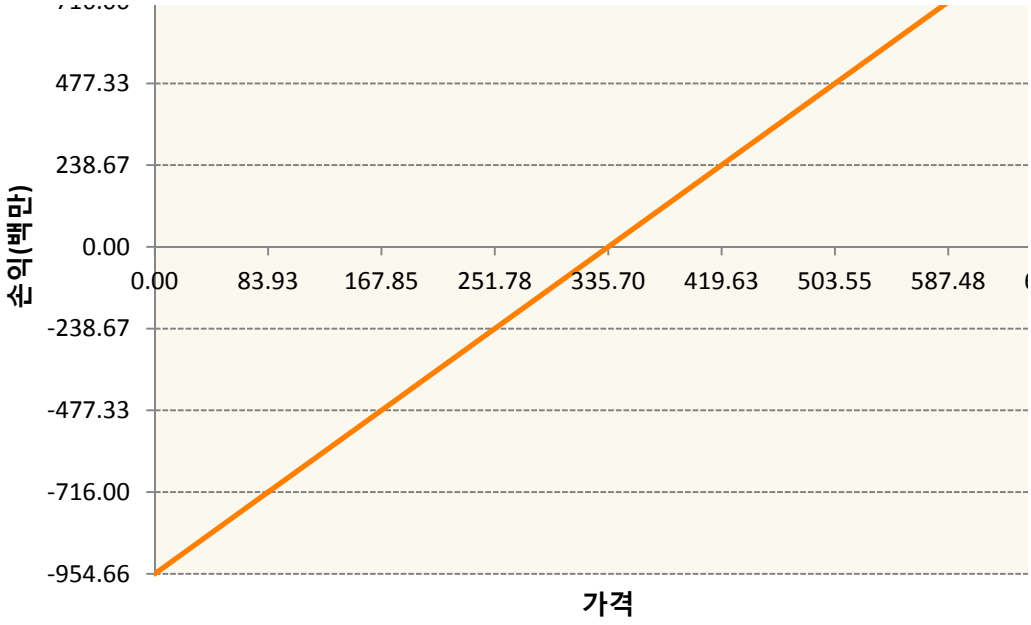


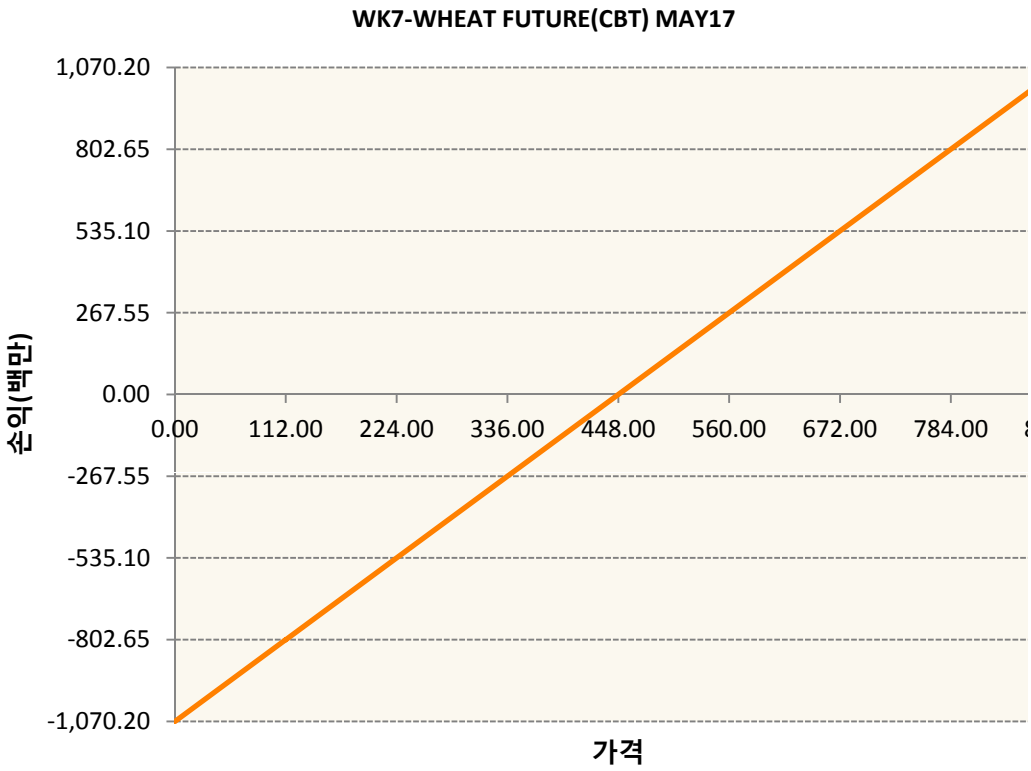
SK7-SOYBEAN FUTURE MAY17



SMK7-SOYBEAN MEAL FUTR MAY17







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	55
KR4175M30(	2017-03 달러선물	45

KWK7	KC HRW WHEAT FUTURE(KCB) MAY17	25
SBK7	Sugar #11 (WORLD) MAY17	81
SK7	SOYBEAN FUTURE MAY17	149
SMK7	SOYBEAN MEAL FUTR MAY17	76
WK7	WHEAT FUTURE(CBT) MAY17	86

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

874