공시일	2017-03-02
기준일	2017-02-28

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	2017-03-02
기준일	2017-02-28

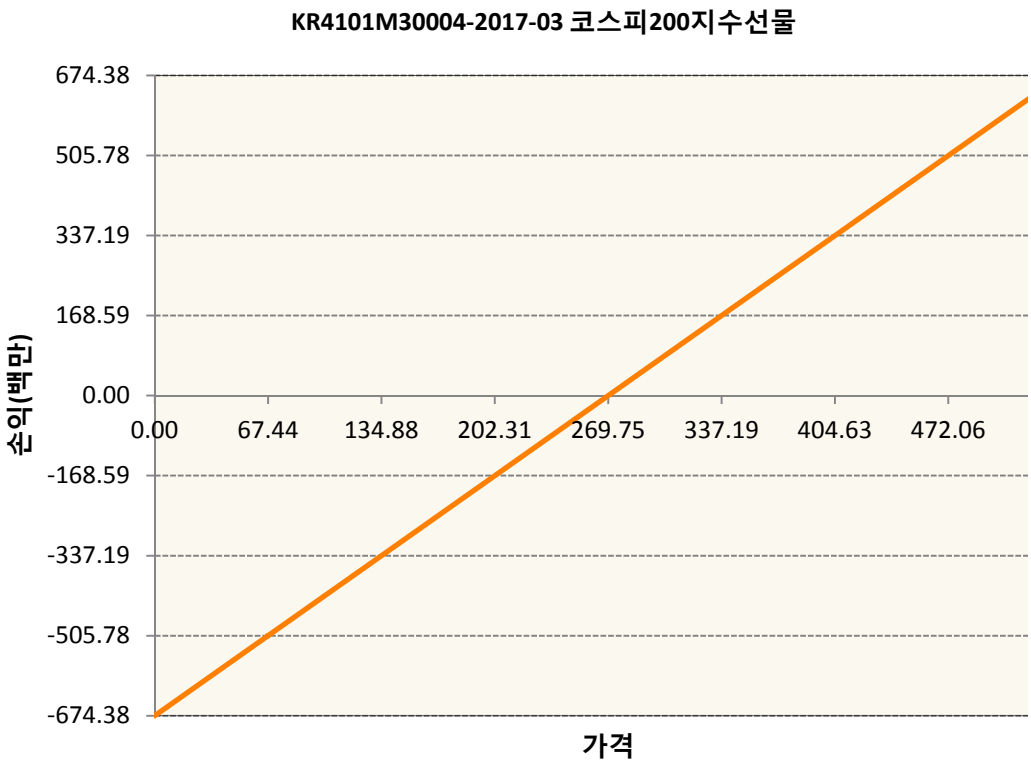
스마트인덱스모

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	2017-03-02
기준일	2017-02-28

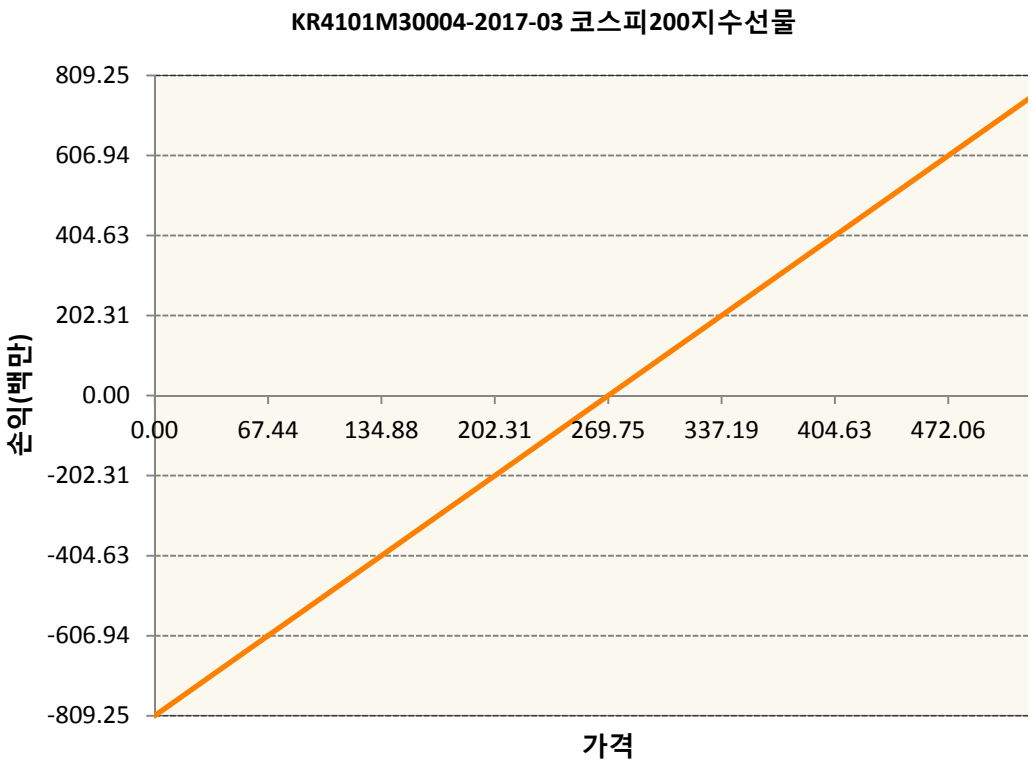
스마트레버리지목표전환형1호

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	2017-03-02
기준일	2017-02-28

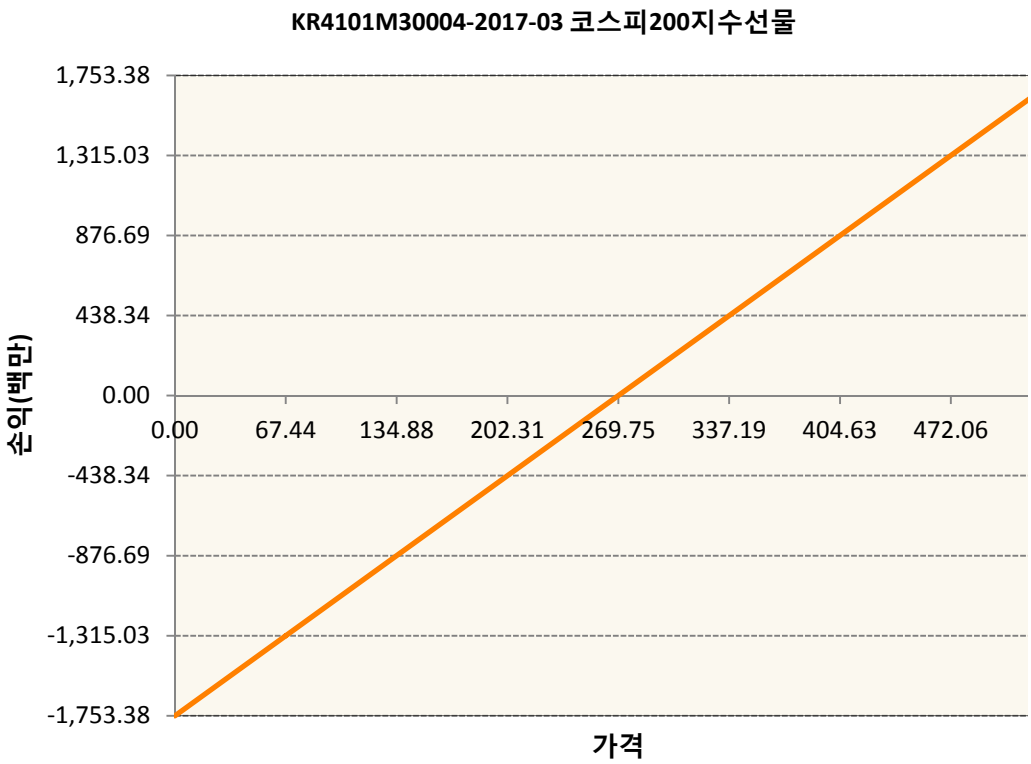
1.3배 레버리지 인덱스(주식-파생형)

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	1,753	0	1,753	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%	-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%	140	140	140	140	140	140	140

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

91

공시일	2017-03-02
기준일	2017-02-28

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	2017-03-02
기준일	2017-02-28

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	392

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

512

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-03-02
기준일	2017-02-28

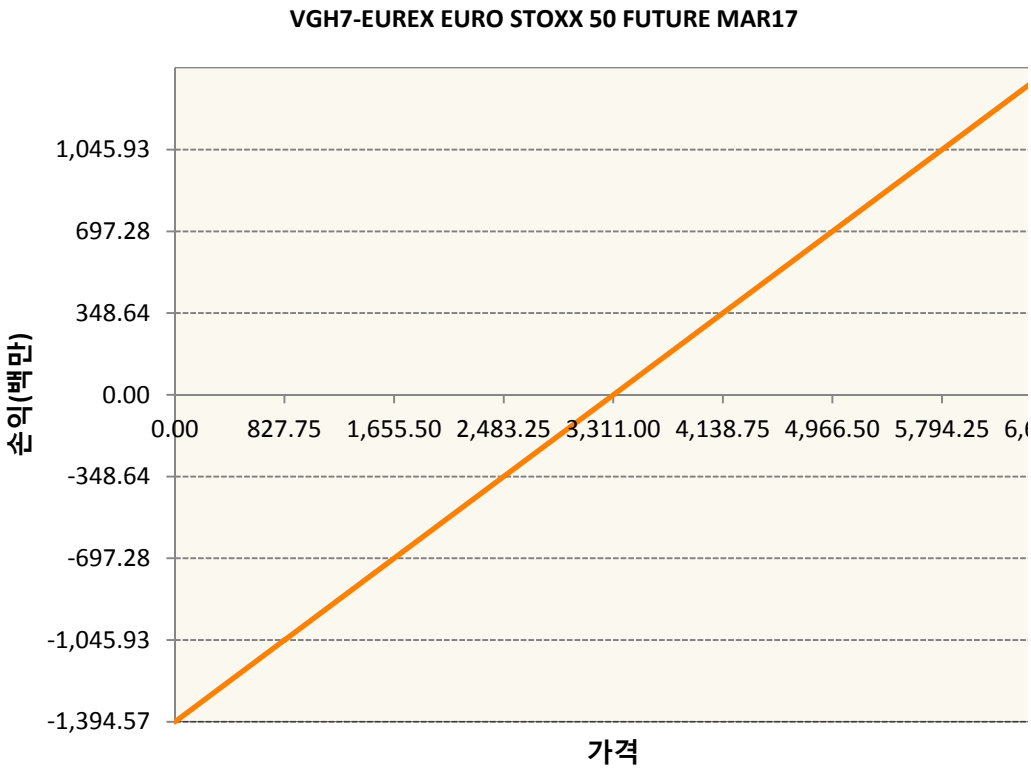
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,395	0	1,395	

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)

114

공시일	2017-03-02
기준일	2017-02-28

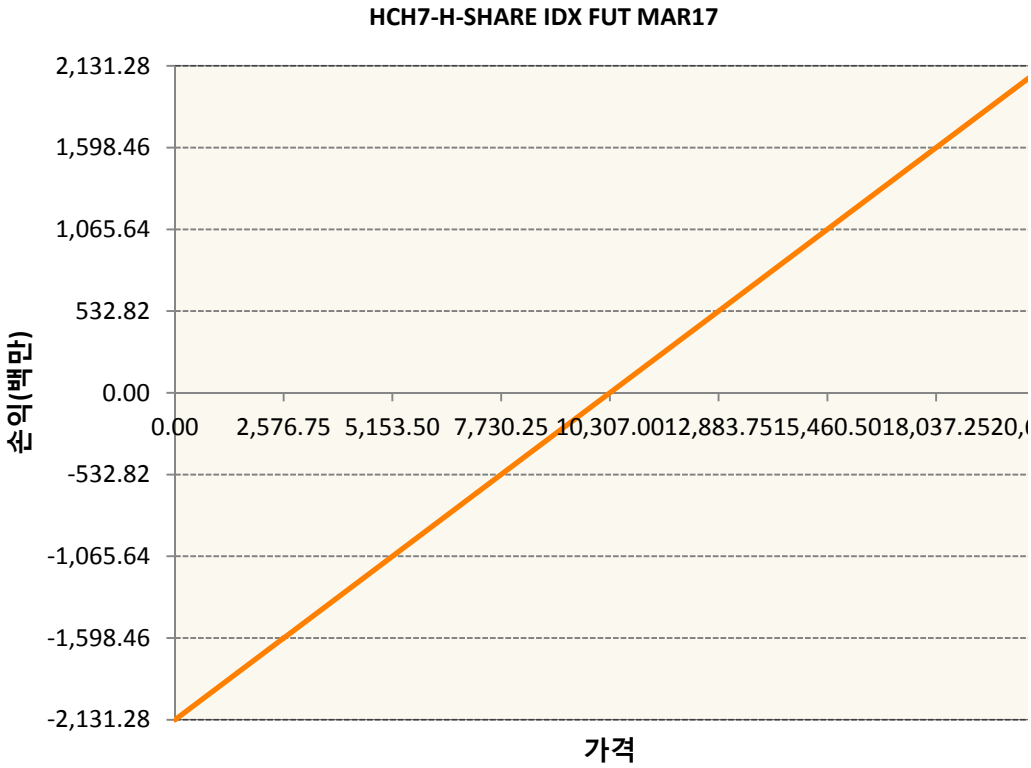
차이나인덱스모(주식-파생형)

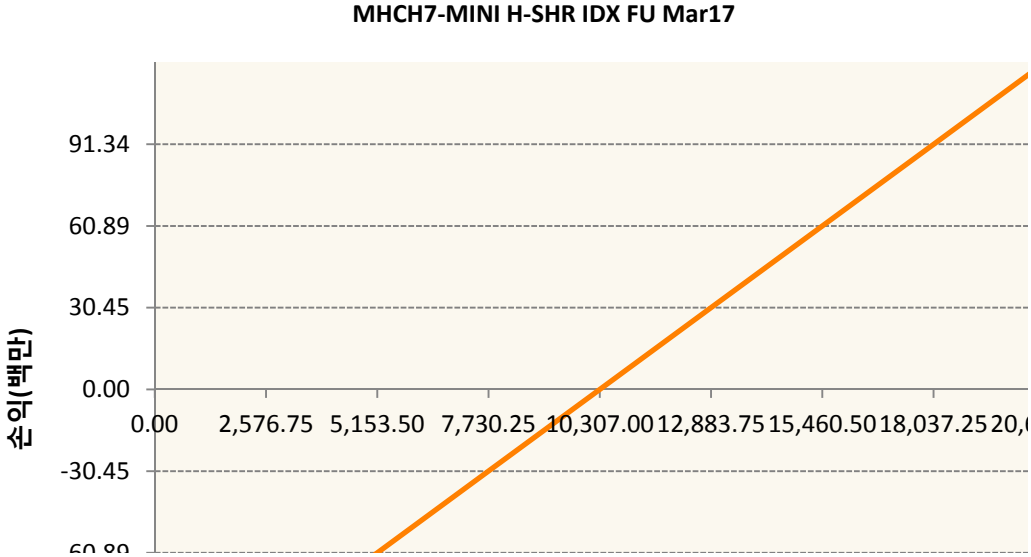
1. 계약금액

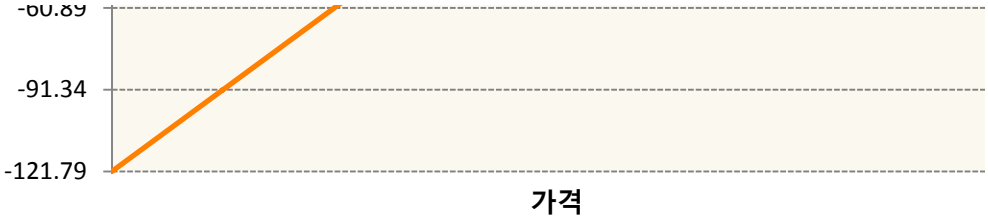
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,253	0	2,253	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	2017-03-02
기준일	2017-02-28

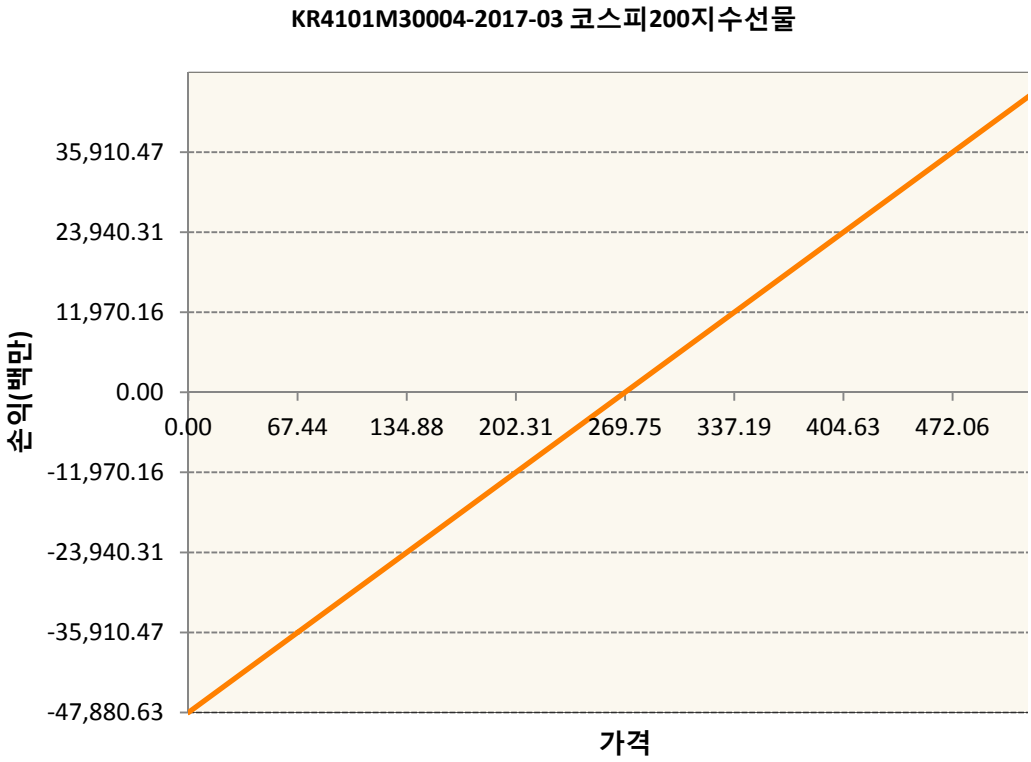
커버드콜모(주식혼합-파생형)

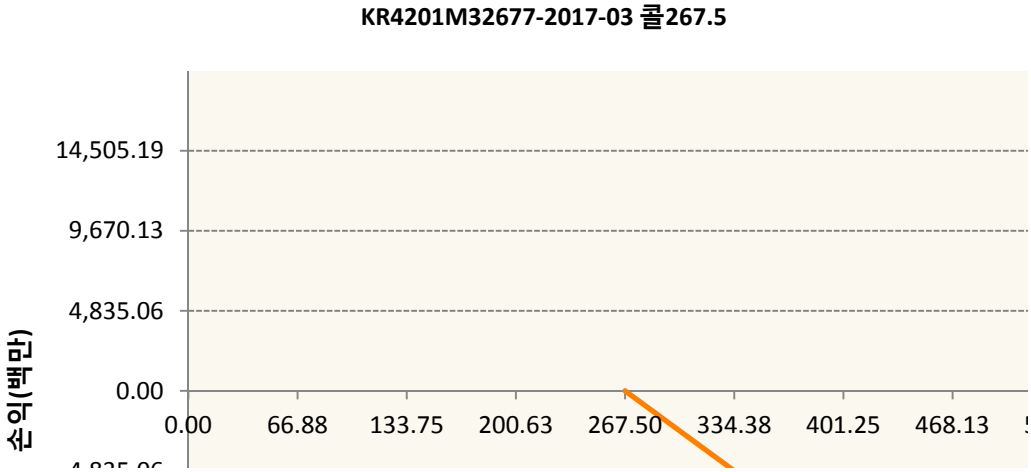
1. 계약금액

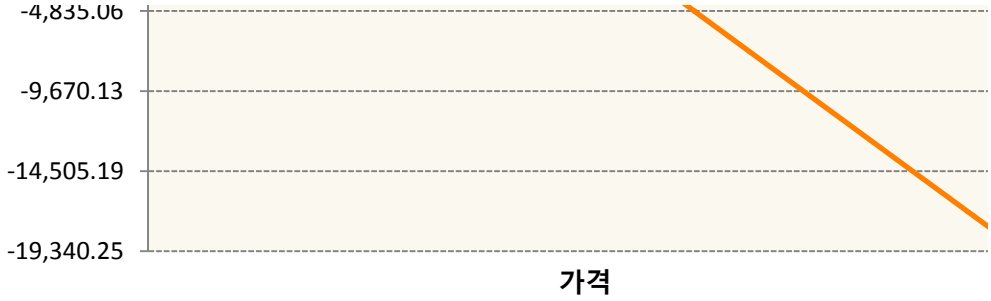
(단위:백만원)

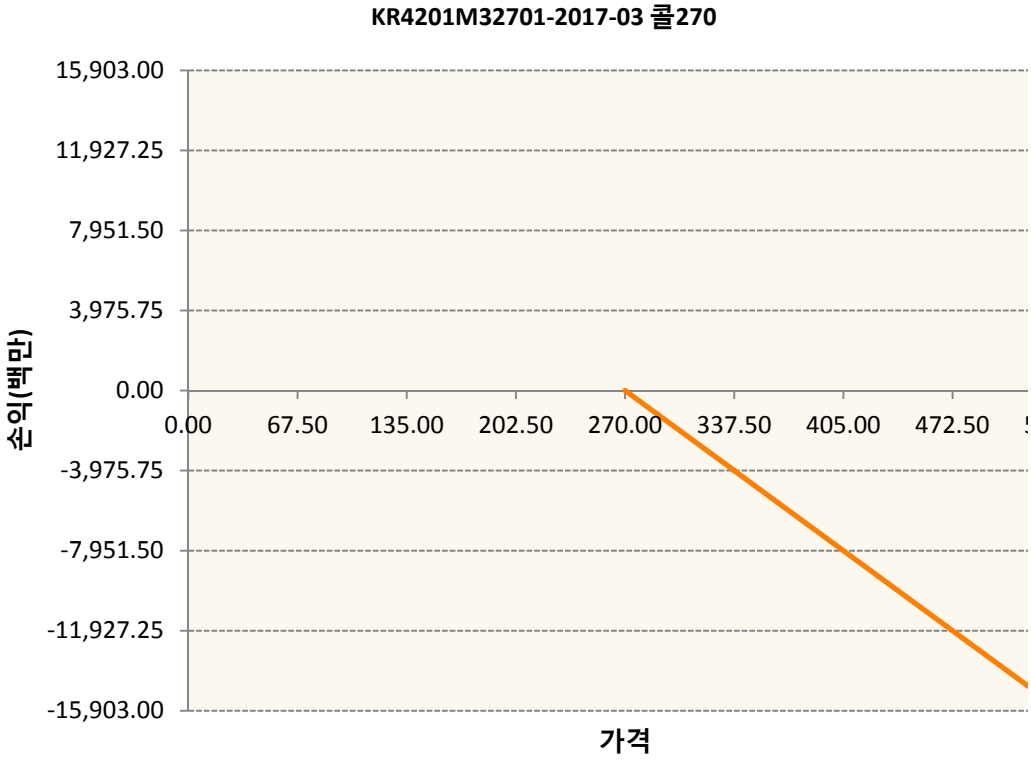
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	3,379	0	3,379	장내
신규	유가증권	옵션	0	679	-679	장내
누계	유가증권	선물	47,881	0	47,881	장내
누계	유가증권	옵션	0	35,243	-35,243	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101M30(2017-03 코스피200지수선물							3,835
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-3,835	-3,835	-3,835	-3,835	-3,835	-3,835	-3,835
-5.33%	-2,557	-2,557	-2,557	-2,557	-2,557	-2,557	-2,557
-2.67%	-1,278	-1,278	-1,278	-1,278	-1,278	-1,278	-1,278
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	1,278	1,278	1,278	1,278	1,278	1,278	1,278
5.33%	2,557	2,557	2,557	2,557	2,557	2,557	2,557
8.00%	3,835	3,835	3,835	3,835	3,835	3,835	3,835
KR4201M32(2017-03 콜267.5							7,505
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,226	1,226	1,226	1,226	1,226	1,226	1,226
-5.33%	1,226	1,226	1,226	1,224	1,222	1,219	1,214
-2.67%	1,177	1,153	1,126	1,095	1,061	1,025	987
0%	136	92	47	0	-48	-97	-147
2.67%	-2,301	-2,303	-2,306	-2,311	-2,319	-2,329	-2,341
5.33%	-4,902	-4,902	-4,902	-4,902	-4,902	-4,903	-4,904
8.00%	-7,505	-7,505	-7,505	-7,505	-7,505	-7,505	-7,505
KR4201M32 2017-03 콜270							5,824

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	553	553	553	553	553	553	552
-5.33%	553	552	552	552	552	551	550
-2.67%	546	539	530	518	504	487	467
0%	136	91	45	0	-45	-91	-136
2.67%	-1,592	-1,598	-1,608	-1,621	-1,636	-1,654	-1,674
5.33%	-3,704	-3,704	-3,704	-3,705	-3,705	-3,707	-3,709
8.00%	-5,824	-5,824	-5,824	-5,824	-5,824	-5,824	-5,824

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

20,797

공시일	2017-03-02
기준일	2017-02-28

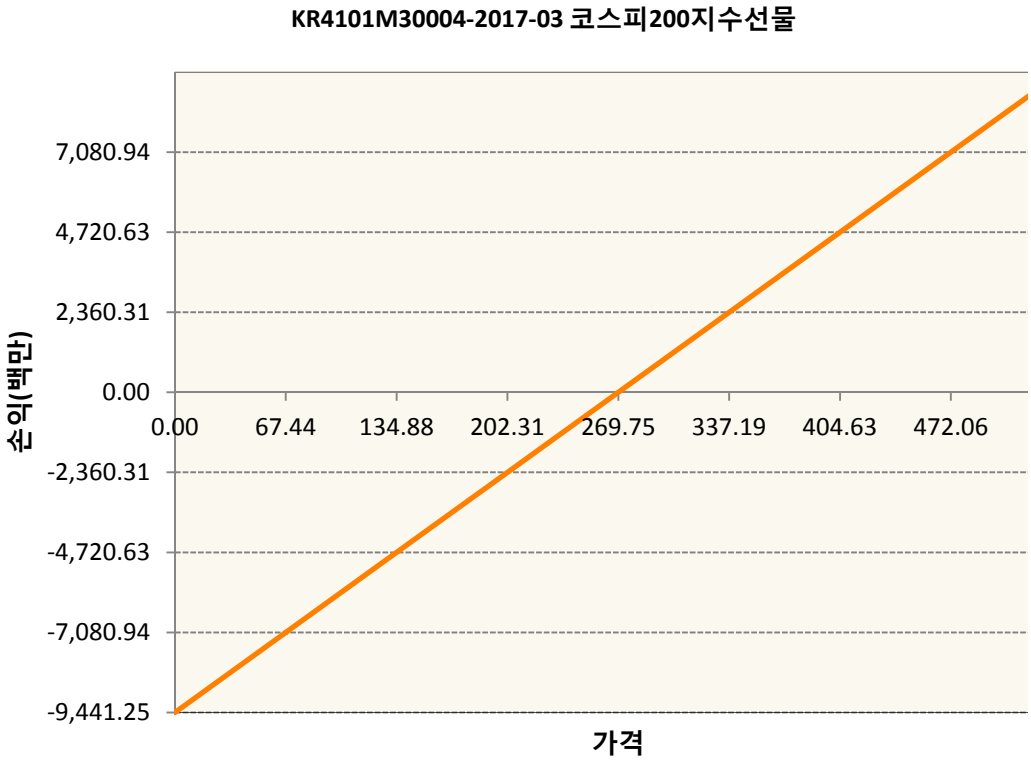
커버드콜목표전환형증권투자신탁

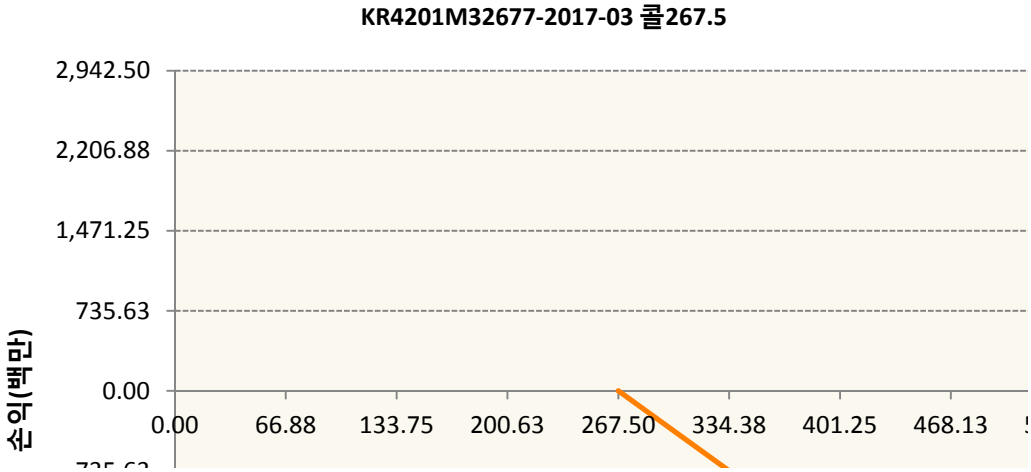
1. 계약금액

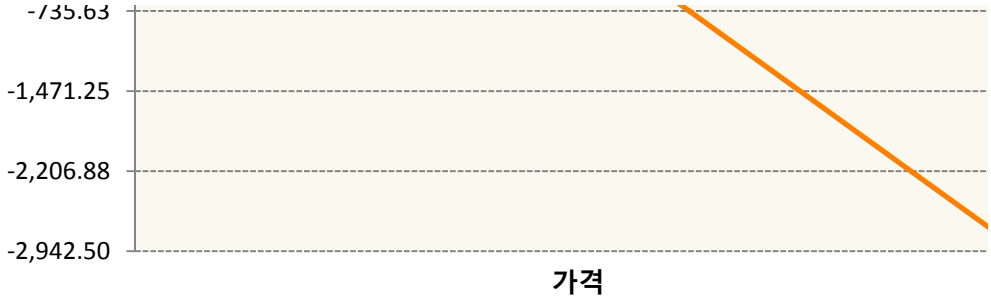
(단위:백만원)

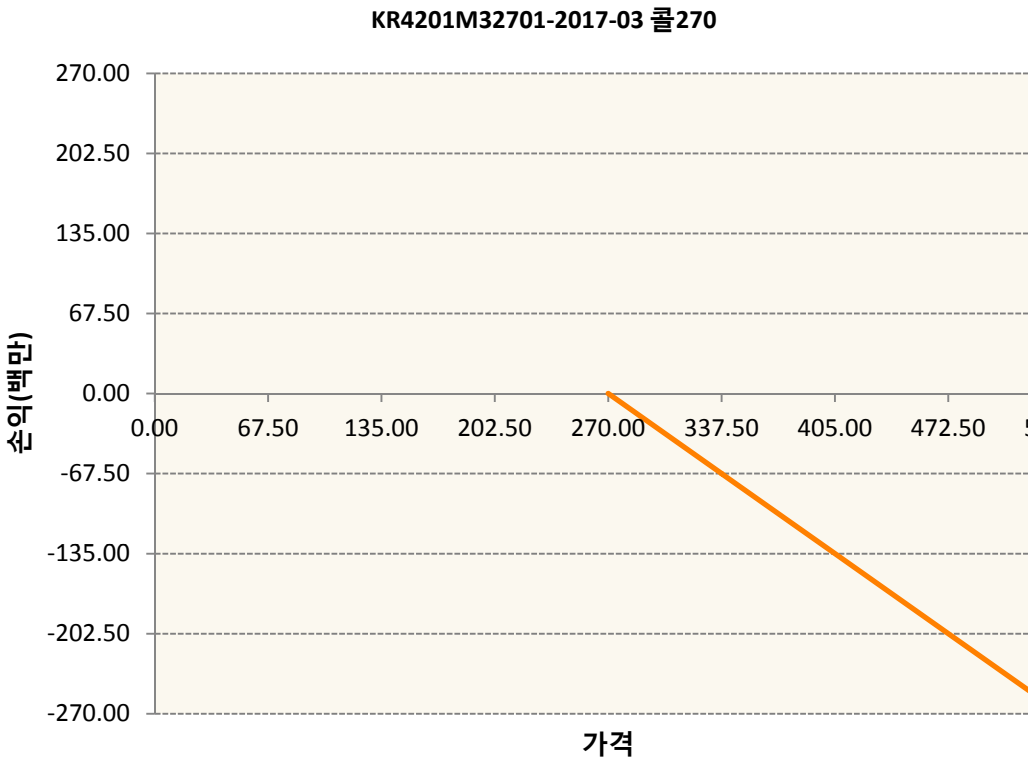
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	9,441	0	9,441	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,213	-3,213	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101M30(2017-03 코스피200지수선물							756
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-756	-756	-756	-756	-756	-756	-756
-5.33%	-504	-504	-504	-504	-504	-504	-504
-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%	504	504	504	504	504	504	504
8.00%	756	756	756	756	756	756	756
KR4201M32(2017-03 콜267.5							1,142
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	187	187	187	187	187	187	187
-5.33%	187	187	186	186	186	185	185
-2.67%	179	175	171	167	161	156	150
0%	21	14	7	0	-7	-15	-22
2.67%	-350	-350	-351	-352	-353	-354	-356
5.33%	-746	-746	-746	-746	-746	-746	-746
8.00%	-1,142	-1,142	-1,142	-1,142	-1,142	-1,142	-1,142
KR4201M32 2017-03 콜270							99

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	9	9	9	9	9	9	9
-5.33%	9	9	9	9	9	9	9
-2.67%	9	9	9	9	9	8	8
0%	2	2	1	0	-1	-2	-2
2.67%	-27	-27	-27	-28	-28	-28	-28
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)

2,198

공시일	2017-03-02
기준일	2017-02-28

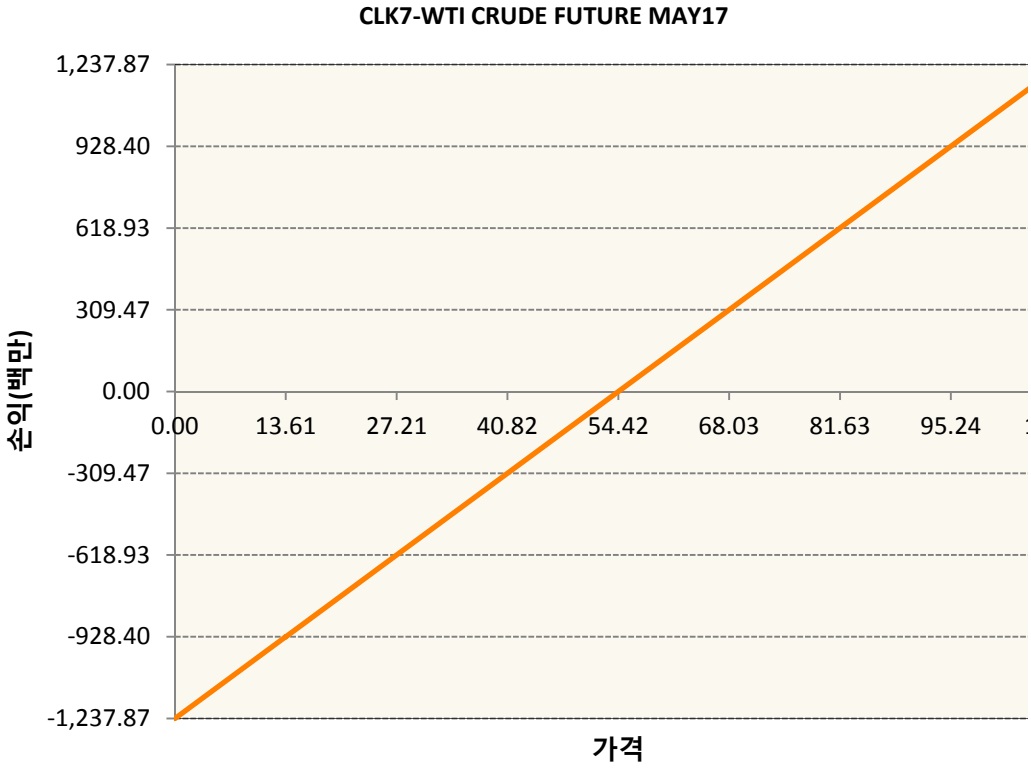
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

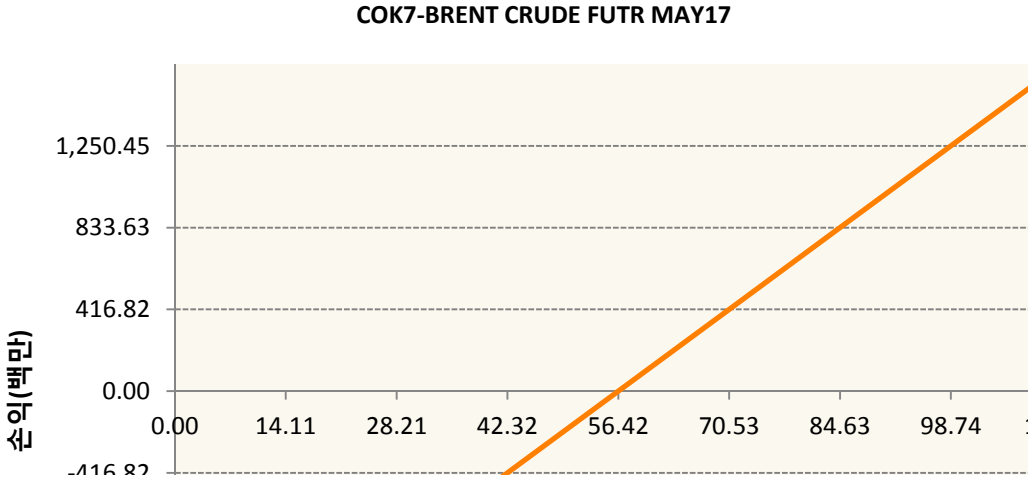
1. 계약금액

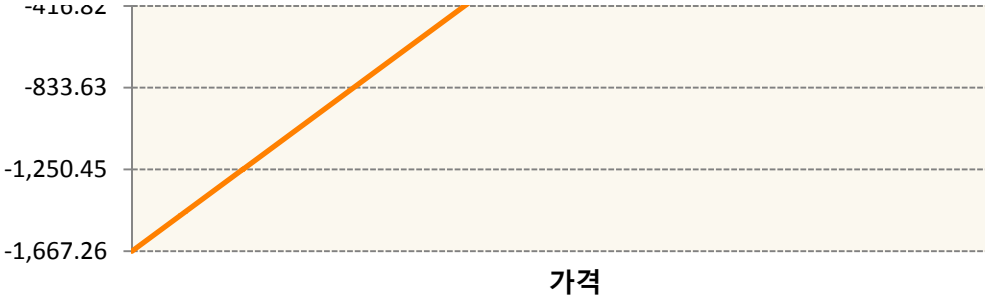
(단위:백만원)

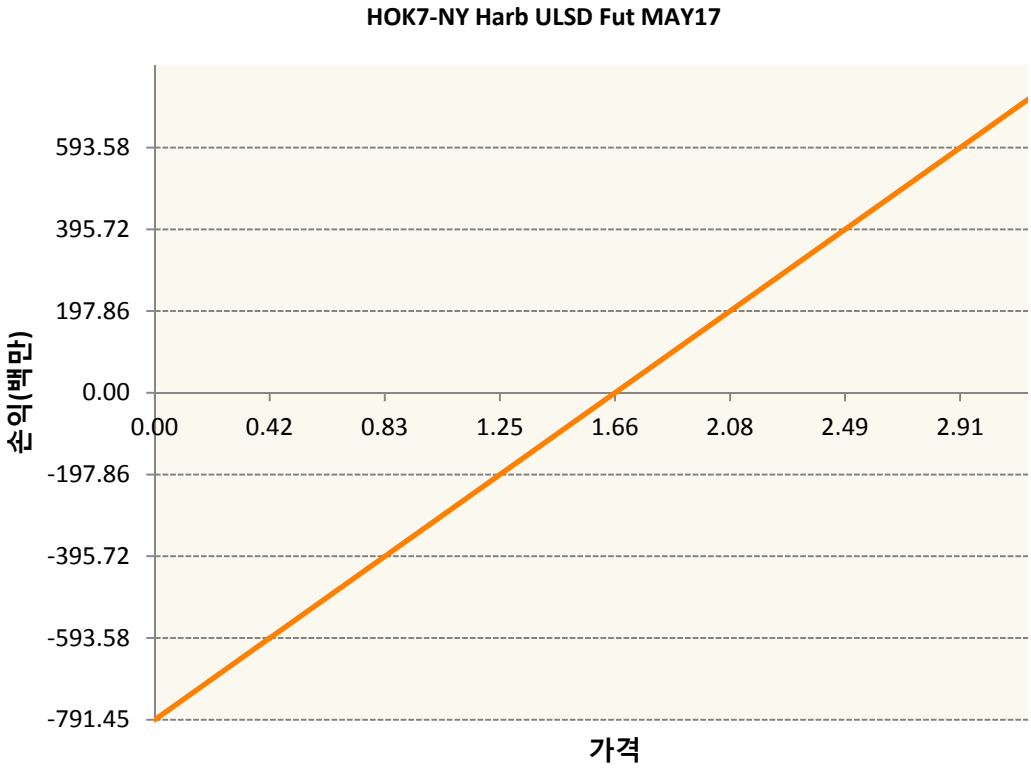
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	선물	유가증권	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	선물	유가증권	1,238	0	1,238	
누계	유가증권	선물	4,578	407	4,171	

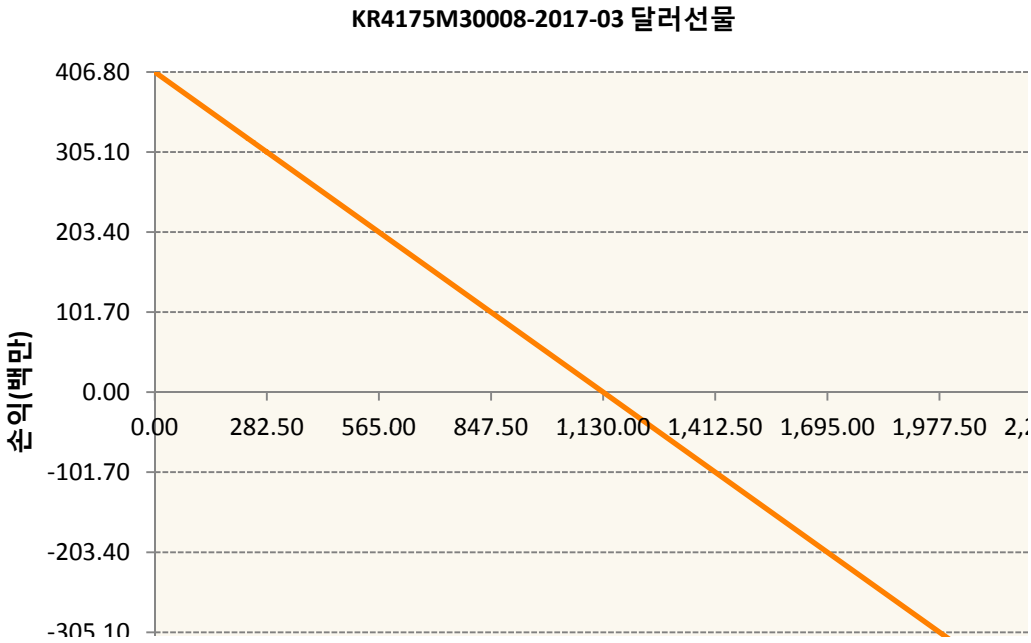
2. 만기시점의 손익구조

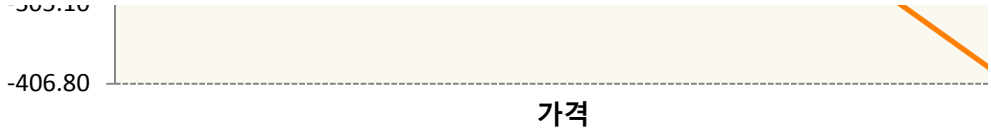


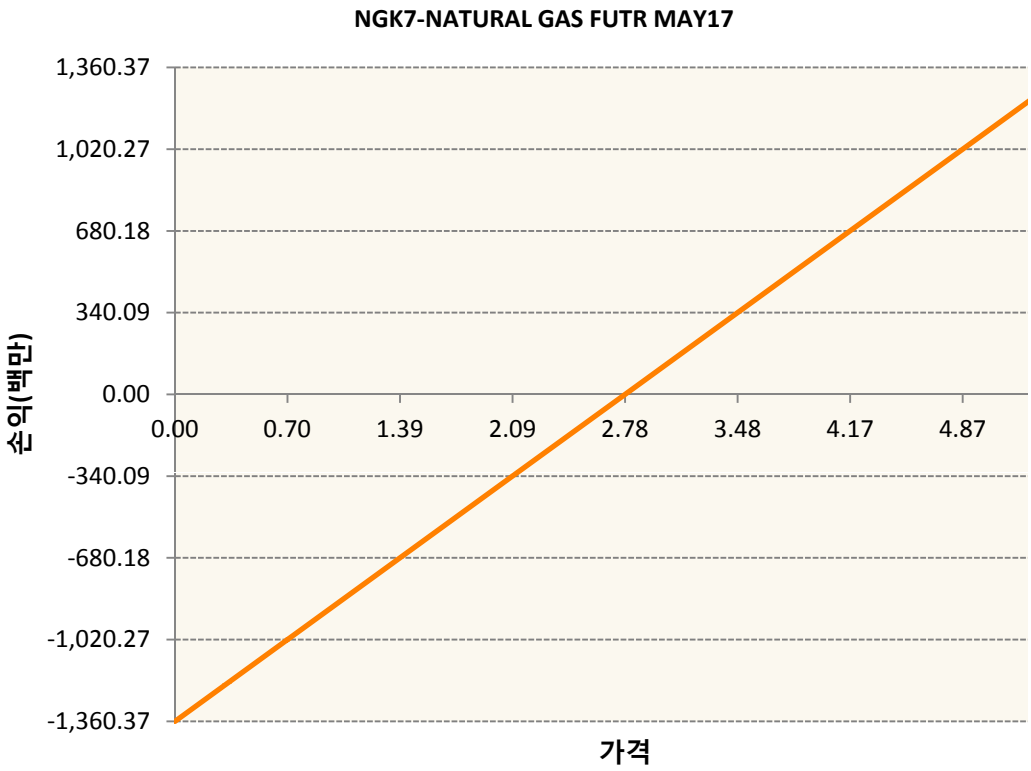


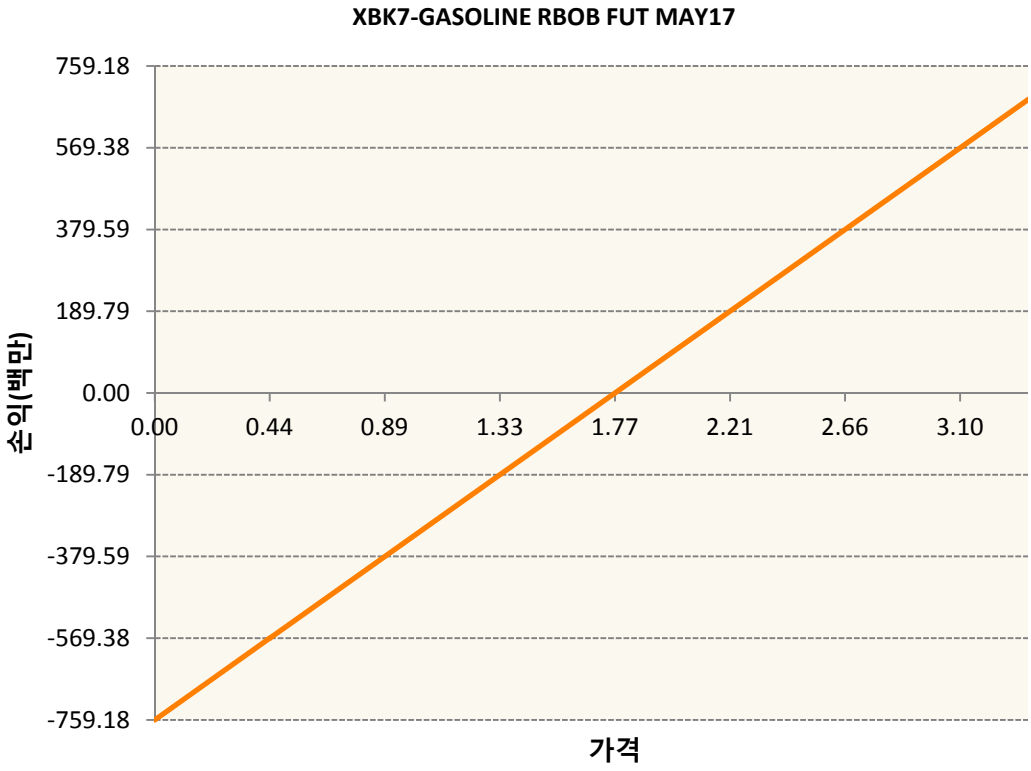

-833.63
-1,250.45
-1,667.26
가격


HOK7-NY Harb ULSD Fut MAY17
593.58
395.72
197.86
0.00
-197.86
-395.72
-593.58
-791.45
0.00
0.42
0.83
1.25
1.66
2.08
2.49
2.91
순익(백만)
가격


KR4175M30008-2017-03 달러선물
406.80
305.10
203.40
101.70
0.00
-101.70
-203.40
0.00
282.50
565.00
847.50
1,130.00
1,412.50
1,695.00
1,977.50
순익(백만)


-406.80
가격


NGK7-NATURAL GAS FUTR MAY17
1,360.37
1,020.27
680.18
340.09
0.00
-340.09
-680.18
-1,020.27
-1,360.37
0.00
0.70
1.39
2.09
2.78
3.48
4.17
4.87
순익(백만)
가격


XBK7-GASOLINE RBOB FUT MAY17
759.18
569.38
379.59
189.79
0.00
-189.79
-379.59
-569.38
-759.18
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	99
COK7	BRENT CRUDE FUTR MAY17	133
HOK7	NY Harb ULSD Fut MAY17	63
KR4175M30(	2017-03 달러선물	33
NGK7	NATURAL GAS FUTR MAY17	109
XBK7	GASOLINE RBOB FUT MAY17	61

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

1,028

공시일	2017-03-02
기준일	2017-02-28

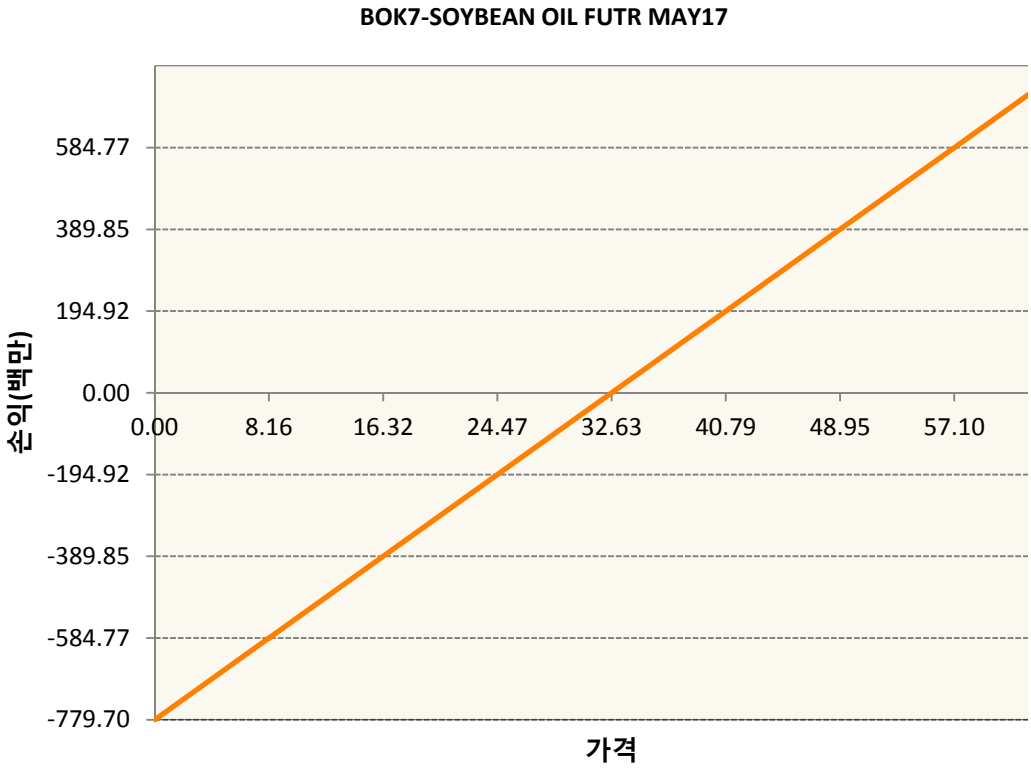
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

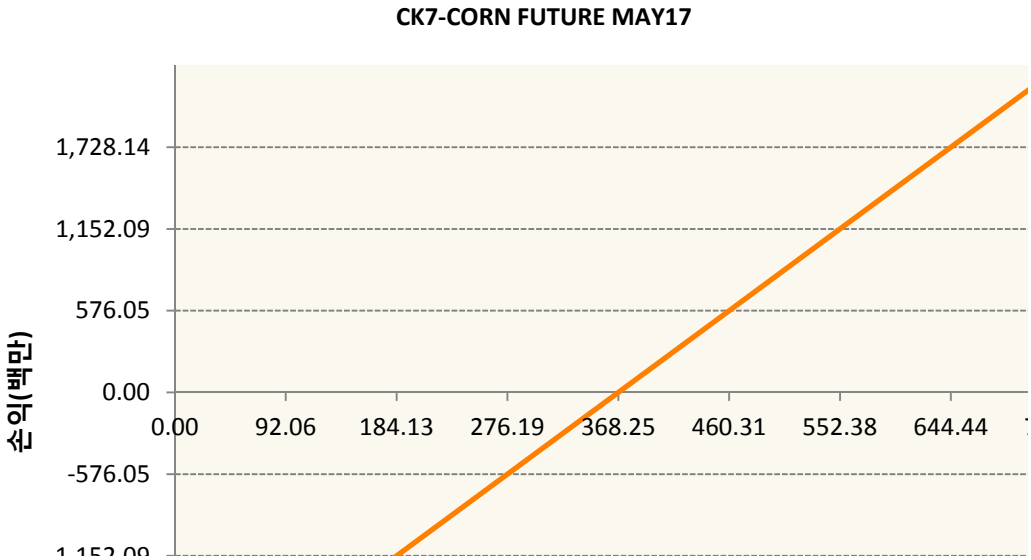
1. 계약금액

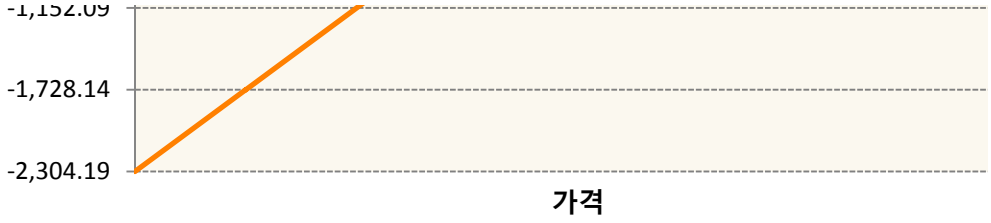
(단위:백만원)

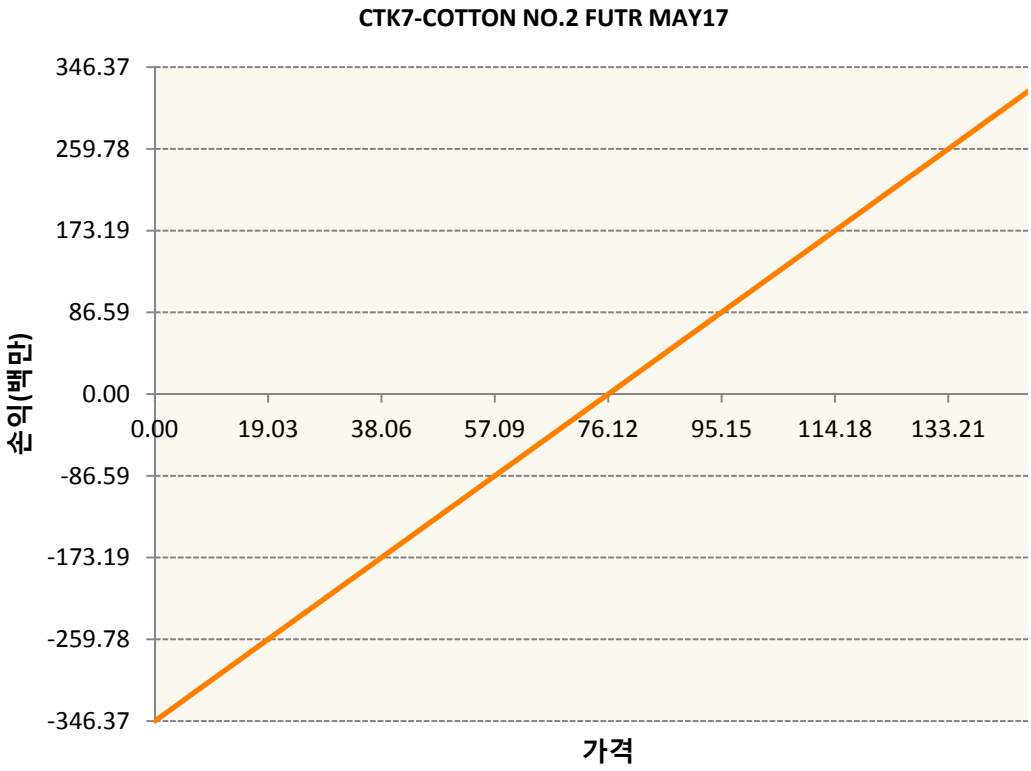
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	9,244	565	8,679	

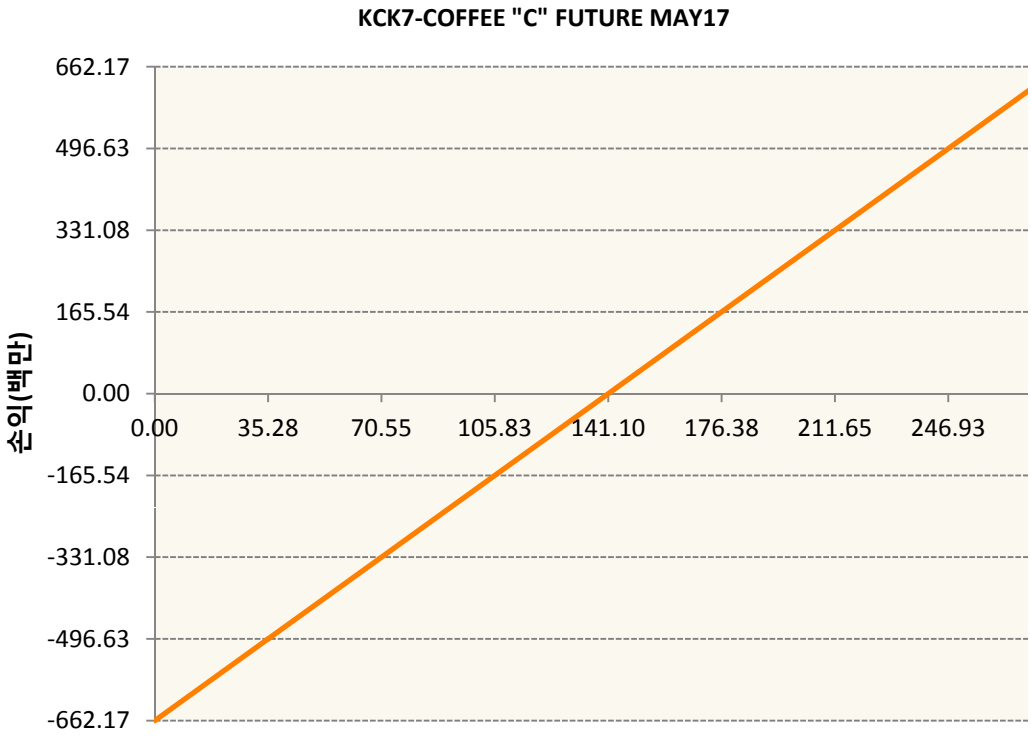
2. 만기시점의 손익구조



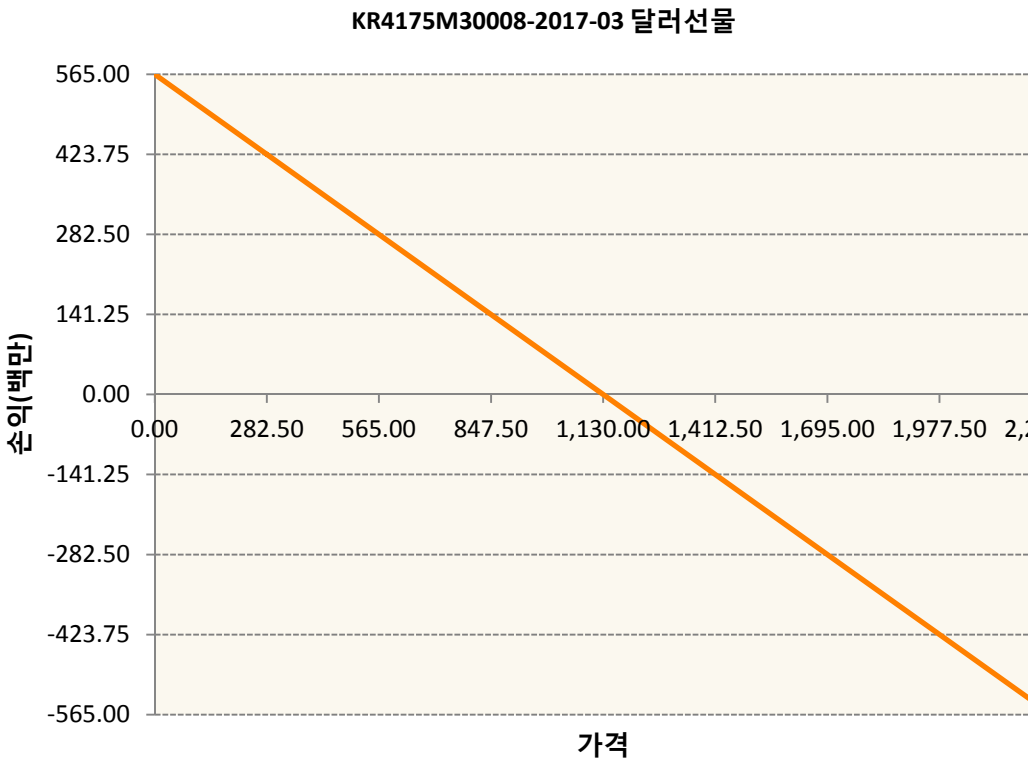


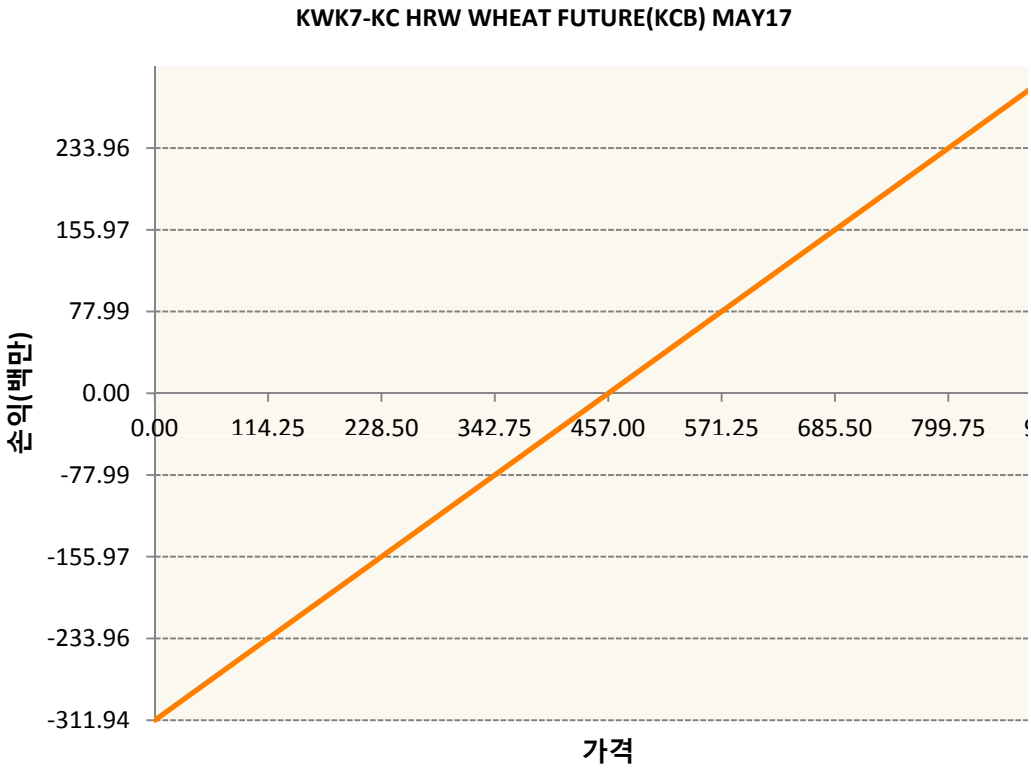

-1,728.14
-2,304.19
가격

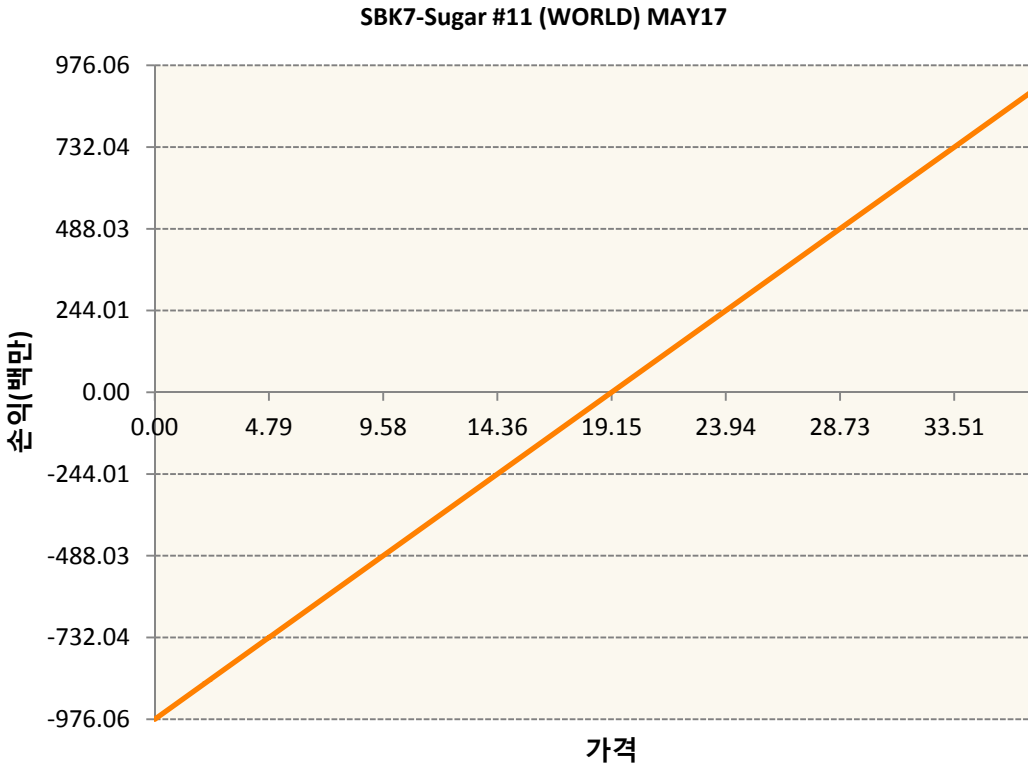

CTK7-COTTON NO.2 FUTR MAY17
346.37
259.78
173.19
86.59
0.00
-86.59
-173.19
-259.78
-346.37
0.00
19.03
38.06
57.09
76.12
95.15
114.18
133.21
순익(백만)
가격

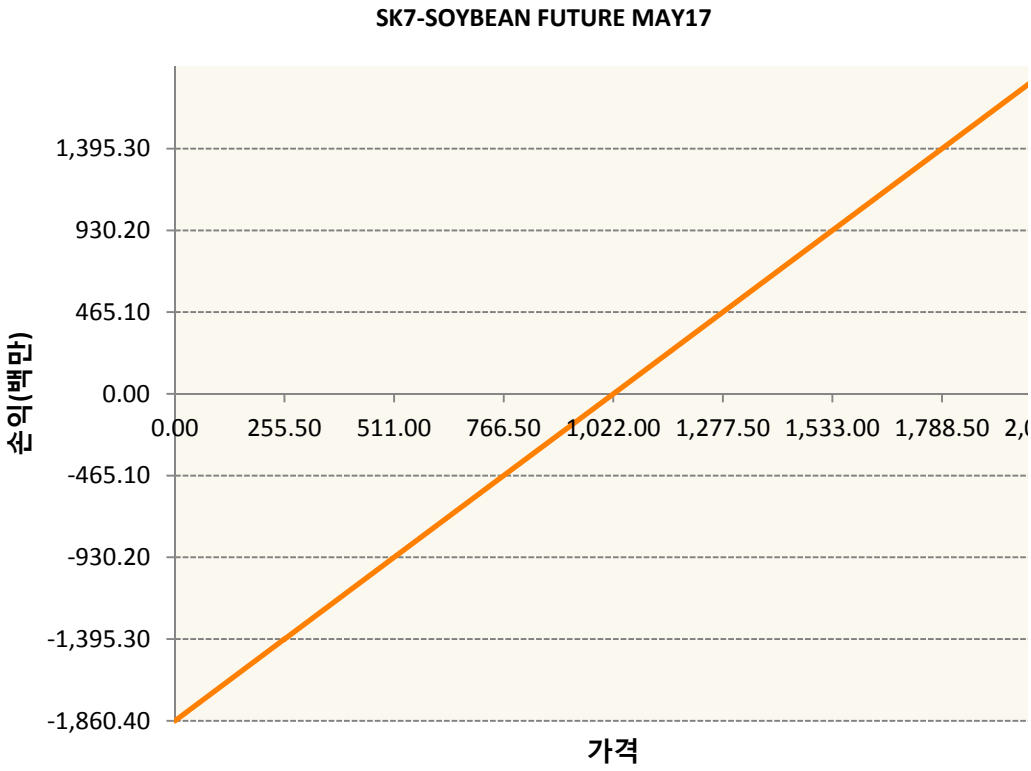

KCK7-COFFEE "C" FUTURE MAY17
662.17
496.63
331.08
165.54
0.00
-165.54
-331.08
-496.63
-662.17
0.00
35.28
70.55
105.83
141.10
176.38
211.65
246.93
순익(백만)

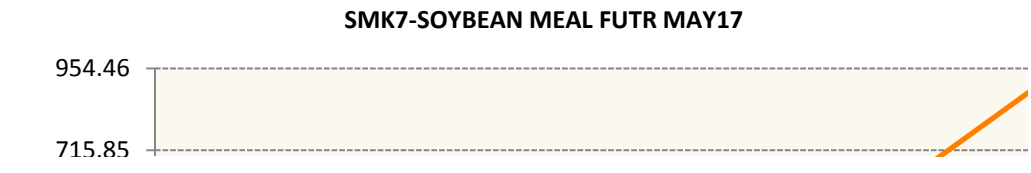
가격

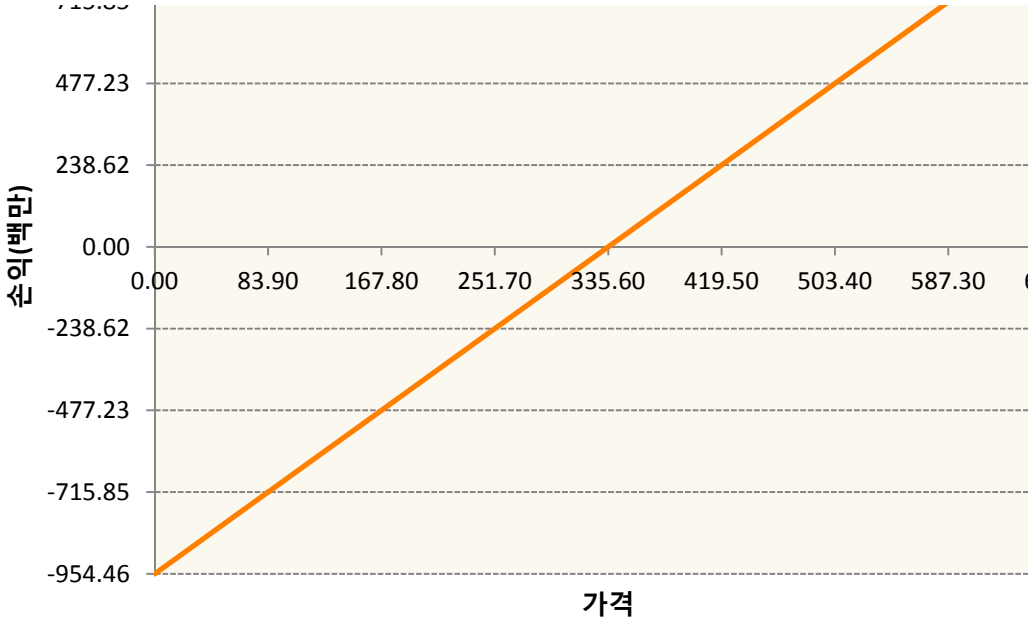

KR4175M30008-2017-03 달러선물
565.00
423.75
282.50
141.25
0.00
-141.25
-282.50
-423.75
-565.00
0.00
282.50
565.00
847.50
1,130.00
1,412.50
1,695.00
1,977.50
손익(백만)
가격

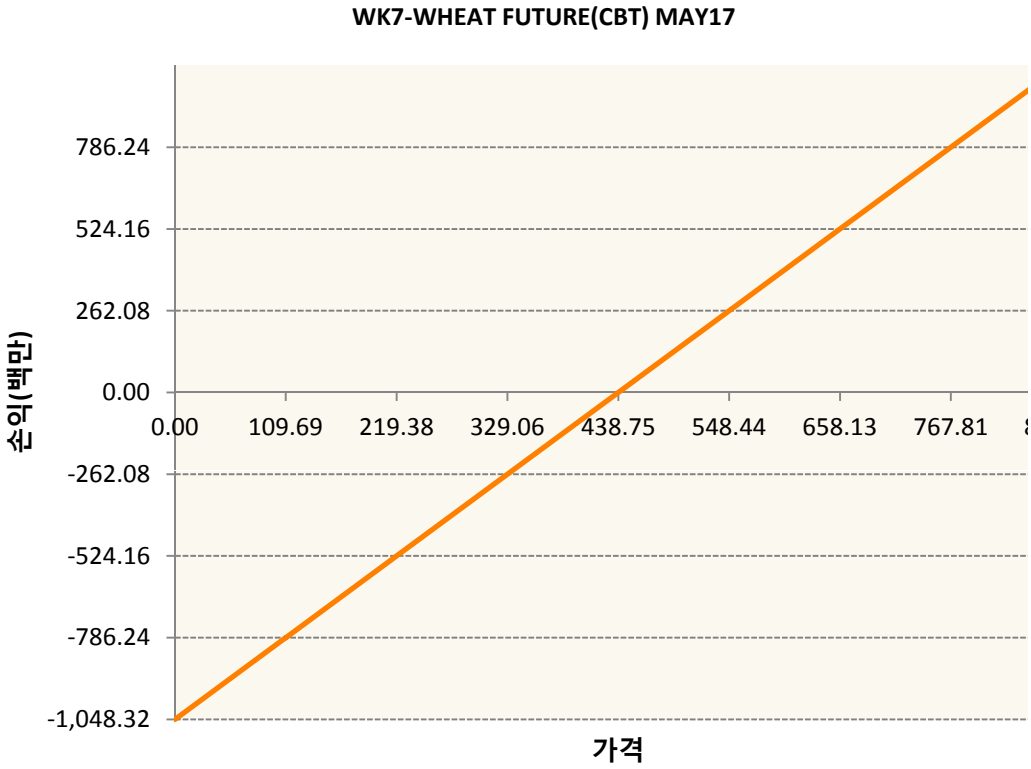

KWK7-KC HRW WHEAT FUTURE(KCB) MAY17
233.96
155.97
77.99
0.00
-77.99
-155.97
-233.96
-311.94
0.00
114.25
228.50
342.75
457.00
571.25
685.50
799.75
손익(백만)
가격


SBK7-Sugar #11 (WORLD) MAY17
976.06
732.04
488.03
244.01
0.00
-244.01
-488.03
-732.04
-976.06
0.00
4.79
9.58
14.36
19.15
23.94
28.73
33.51
손익(백만)
가격


SK7-SOYBEAN FUTURE MAY17
1,395.30
930.20
465.10
0.00
-465.10
-930.20
-1,395.30
-1,860.40
0.00
255.50
511.00
766.50
1,022.00
1,277.50
1,533.00
1,788.50
손익(백만)
가격


SMK7-SOYBEAN MEAL FUTR MAY17
954.46
715.85





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
BOK7	SOYBEAN OIL FUTR MAY17	62
CK7	CORN FUTURE MAY17	184
CTK7	COTTON NO.2 FUTR MAY17	28
KCK7	COFFEE "C" FUTURE MAY17	53
KR4175M30(	2017-03 달러선물	45

KWK7	KC HRW WHEAT FUTURE(KCB) MAY17	25
SBK7	Sugar #11 (WORLD) MAY17	78
SK7	SOYBEAN FUTURE MAY17	149
SMK7	SOYBEAN MEAL FUTR MAY17	76
WK7	WHEAT FUTURE(CBT) MAY17	84

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

863