공시일	2017-03-03
기준일	2017-03-02

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	2017-03-03
기준일	2017-03-02

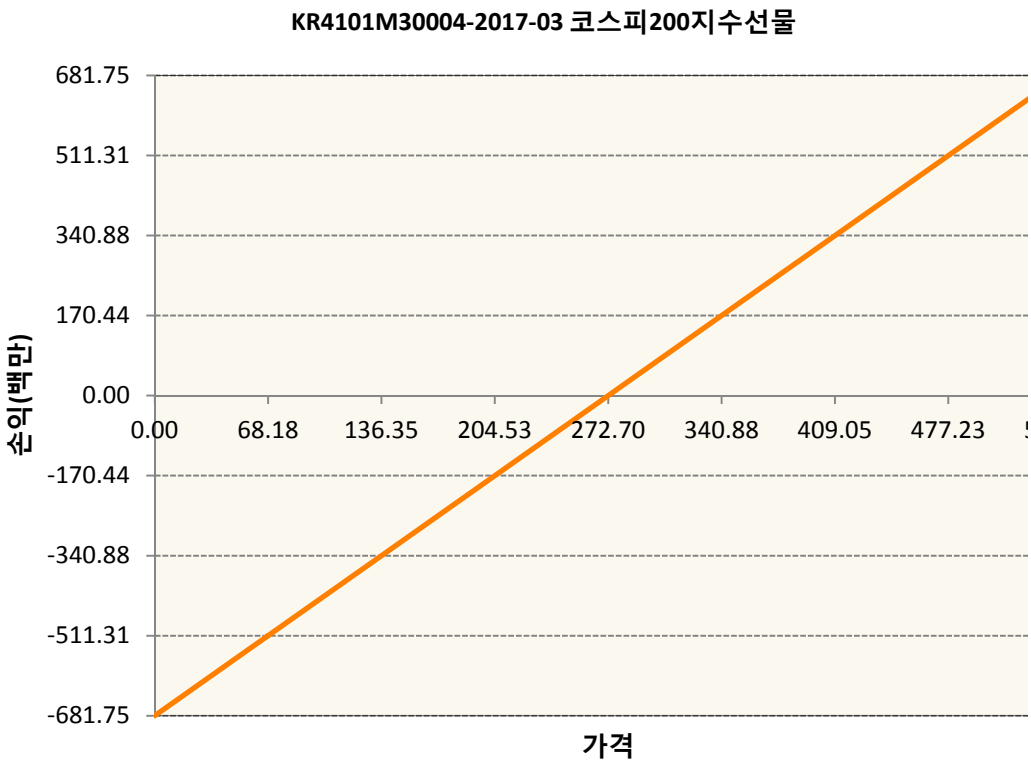
스마트인덱스모

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	682	0	682	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101M30(2017-03 코스피200지수선물							55
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-55	-55	-55	-55	-55	-55	-55
-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%	55	55	55	55	55	55	55

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

35

공시일	2017-03-03
기준일	2017-03-02

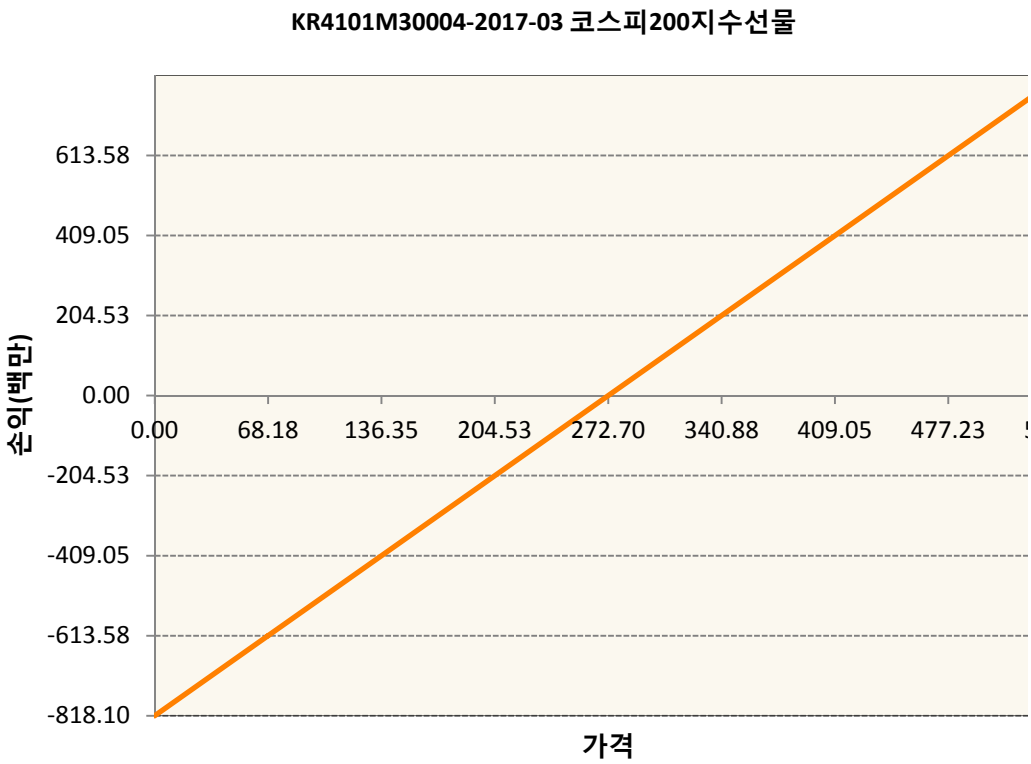
스마트레버리지목표전환형1호

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	818	0	818	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%	-44	-44	-44	-44	-44	-44	-44
-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%	44	44	44	44	44	44	44
8.00%	65	65	65	65	65	65	65

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

43

공시일	2017-03-03
기준일	2017-03-02

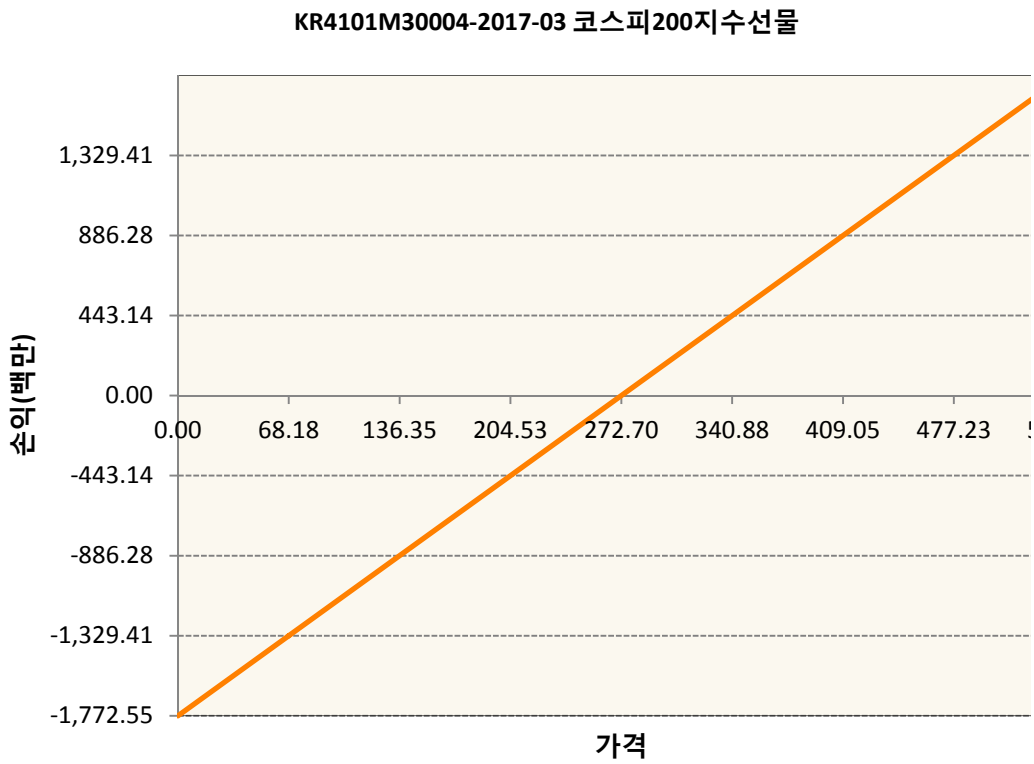
1.3배 레버리지 인덱스(주식-파생형)

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	1,773	0	1,773	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101M30(2017-03 코스피200지수선물							142
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-142	-142	-142	-142	-142	-142	-142
-5.33%	-95	-95	-95	-95	-95	-95	-95
-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%	95	95	95	95	95	95	95
8.00%	142	142	142	142	142	142	142

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

92

공시일	2017-03-03
기준일	2017-03-02

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	958

* 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	2017-03-03
기준일	2017-03-02

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)

494

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-03-03
기준일	2017-03-02

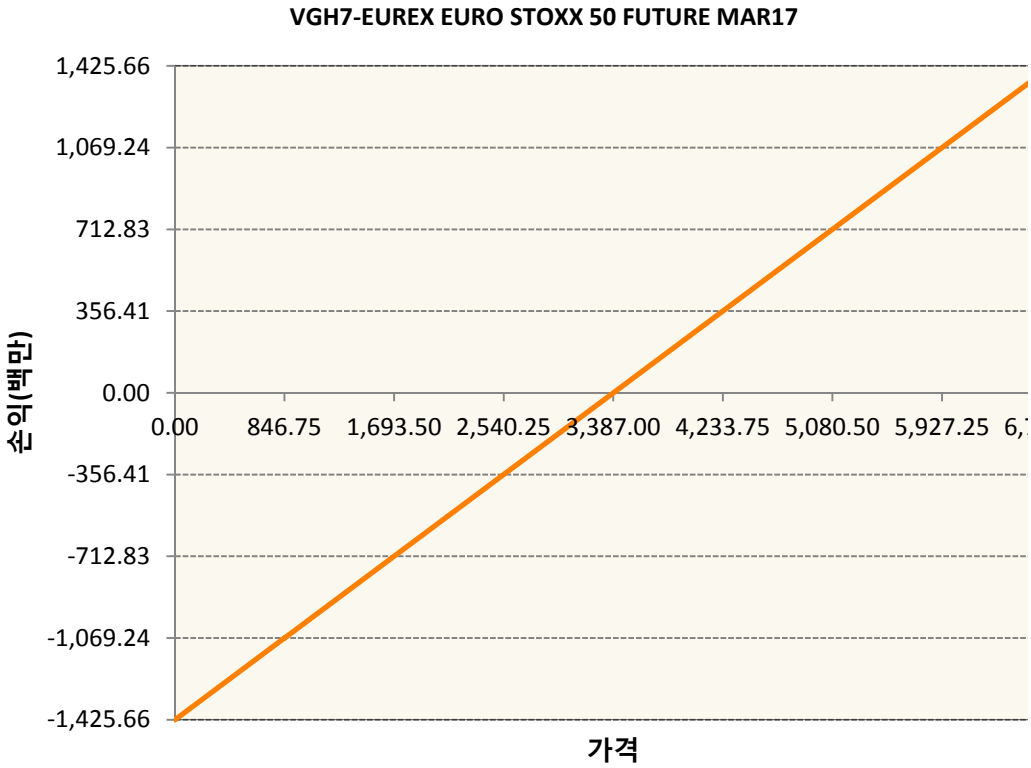
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,426	0	1,426	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGH7	EUREX EURO STOXX 50 FUTURE MAR17	114

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

(단위:백만원)

116

공시일	2017-03-03
기준일	2017-03-02

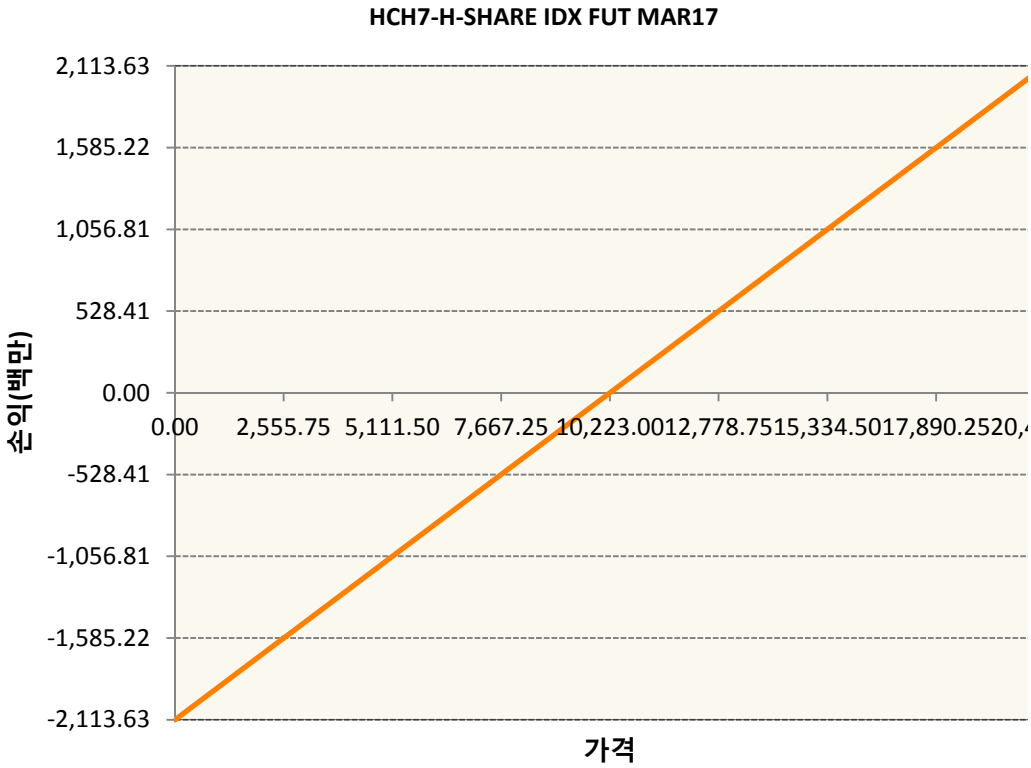
차이나인덱스모(주식-파생형)

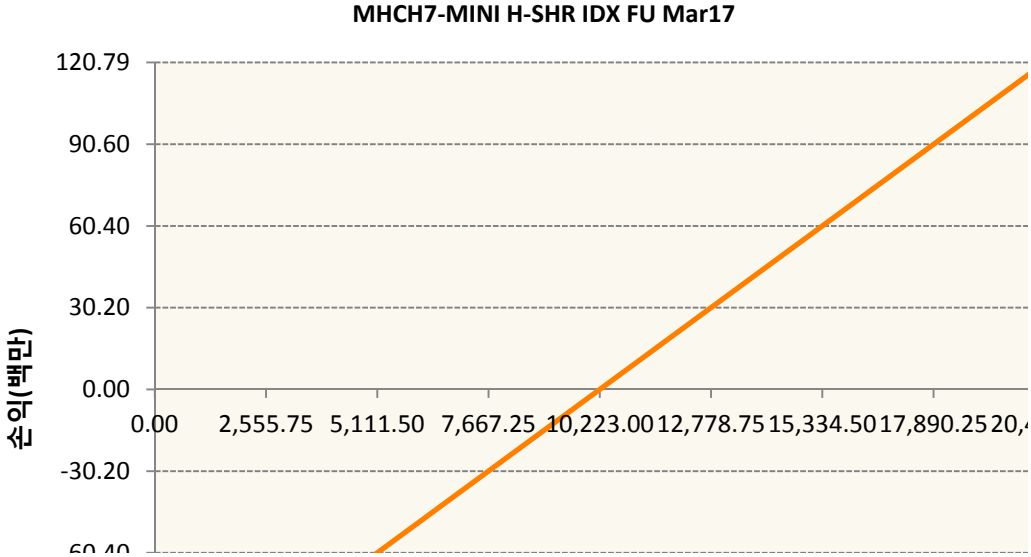
1. 계약금액

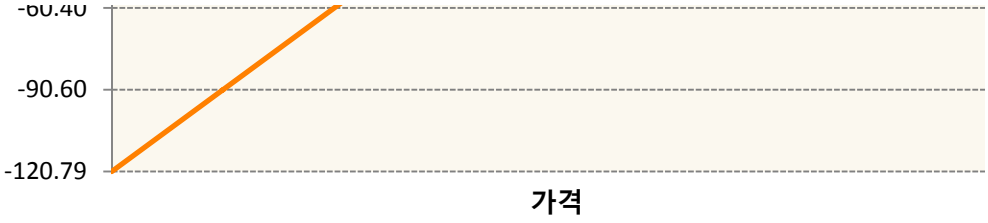
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,234	0	2,234	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

HCH7	H-SHARE IDX FUT MAR17	169
MHCH7	MINI H-SHR IDX FU Mar17	10

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

200

공시일	2017-03-03
기준일	2017-03-02

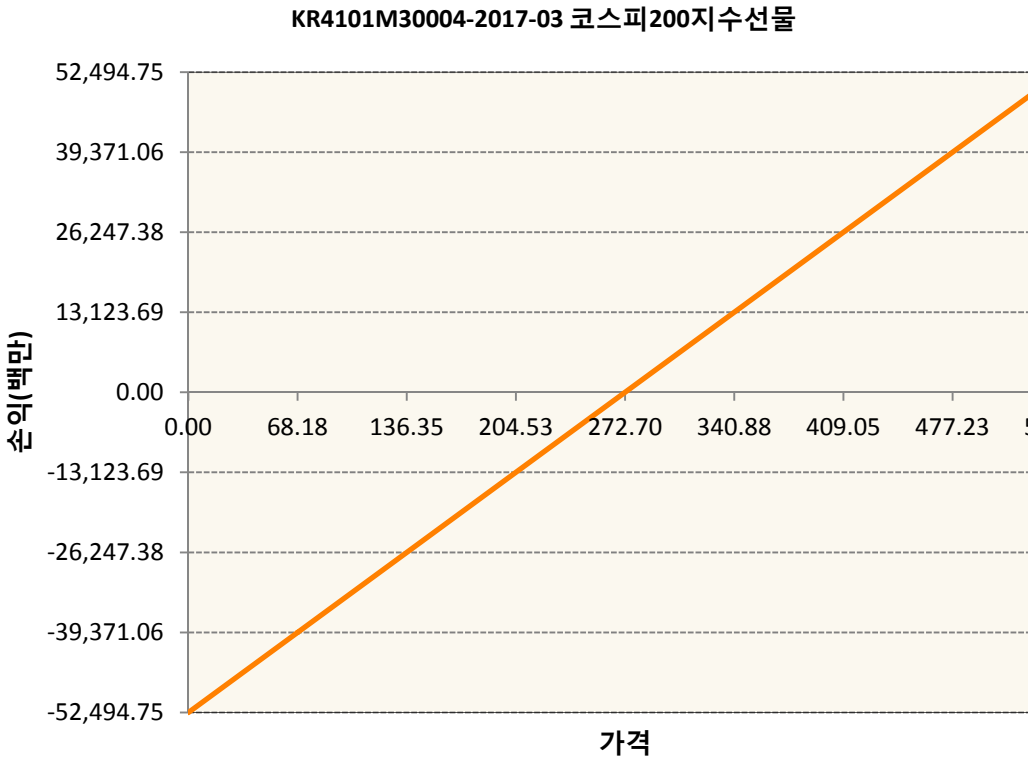
커버드콜모(주식혼합-파생형)

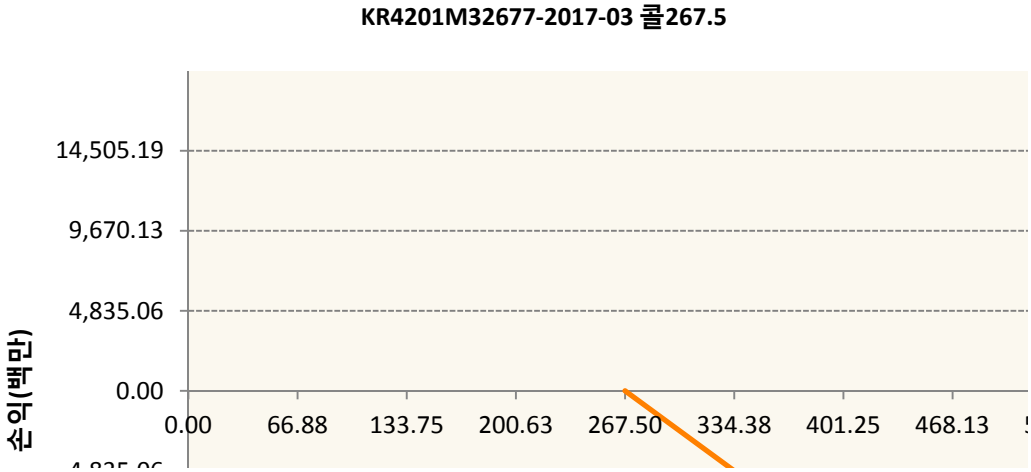
1. 계약금액

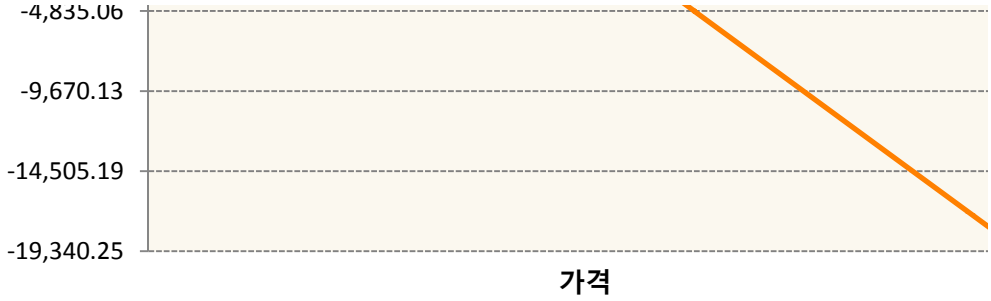
(단위:백만원)

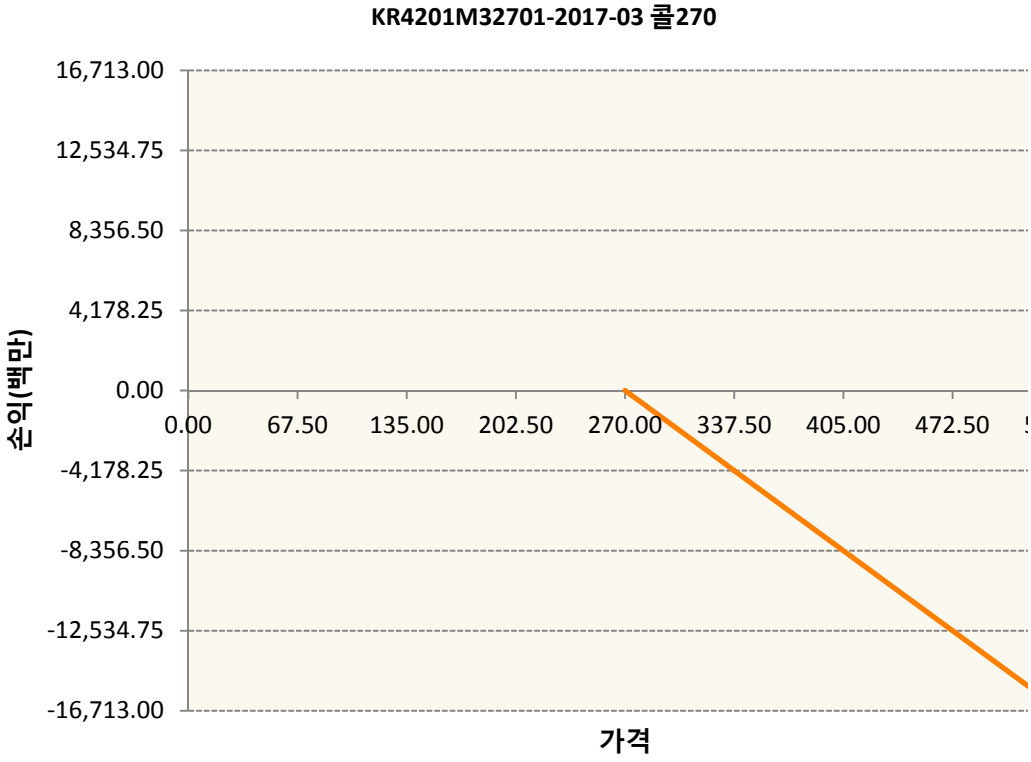
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	4,090	0	4,090	장내
신규	유가증권	옵션	0	820	-820	장내
누계	유가증권	선물	52,495	0	52,495	장내
누계	유가증권	옵션	0	36,053	-36,053	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101M30(2017-03 코스피200지수선물							4,199
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-4,199	-4,199	-4,199	-4,199	-4,199	-4,199	-4,199
-5.33%	-2,799	-2,799	-2,799	-2,799	-2,799	-2,799	-2,799
-2.67%	-1,400	-1,400	-1,400	-1,400	-1,400	-1,400	-1,400
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	1,400	1,400	1,400	1,400	1,400	1,400	1,400
5.33%	2,799	2,799	2,799	2,799	2,799	2,799	2,799
8.00%	4,199	4,199	4,199	4,199	4,199	4,199	4,199
KR4201M32(2017-03 콜267.5							7,815
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,929	1,929	1,929	1,929	1,929	1,929	1,929
-5.33%	1,929	1,928	1,927	1,925	1,922	1,917	1,911
-2.67%	1,780	1,742	1,703	1,662	1,620	1,578	1,535
0%	49	36	20	0	-23	-48	-75
2.67%	-2,559	-2,559	-2,560	-2,560	-2,561	-2,562	-2,564
5.33%	-5,187	-5,187	-5,187	-5,187	-5,187	-5,187	-5,187
8.00%	-7,815	-7,815	-7,815	-7,815	-7,815	-7,815	-7,815
KR4201M32: 2017-03 콜270							6,558

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,011	1,011	1,011	1,011	1,011	1,011	1,011
-5.33%	1,011	1,011	1,011	1,010	1,010	1,009	1,007
-2.67%	987	973	956	936	914	891	865
0%	93	64	33	0	-34	-69	-105
2.67%	-2,059	-2,059	-2,060	-2,062	-2,064	-2,068	-2,074
5.33%	-4,308	-4,308	-4,308	-4,308	-4,308	-4,308	-4,308
8.00%	-6,558	-6,558	-6,558	-6,558	-6,558	-6,558	-6,558

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

22,267

공시일	2017-03-03
기준일	2017-03-02

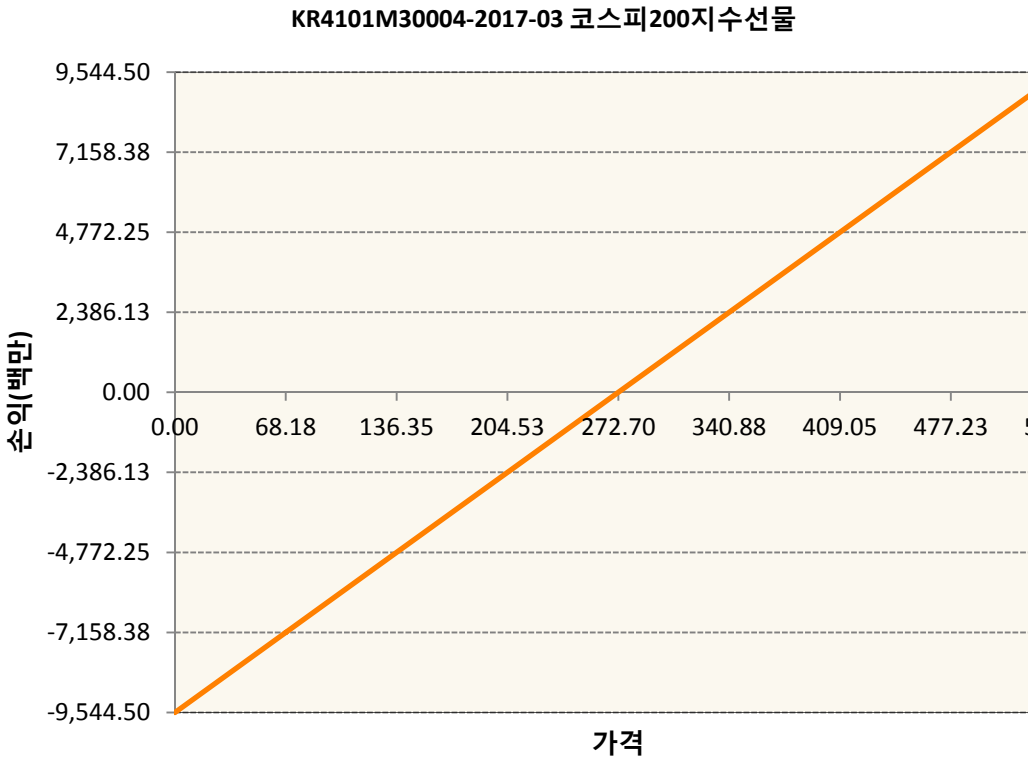
커버드콜목표전환형증권투자신탁

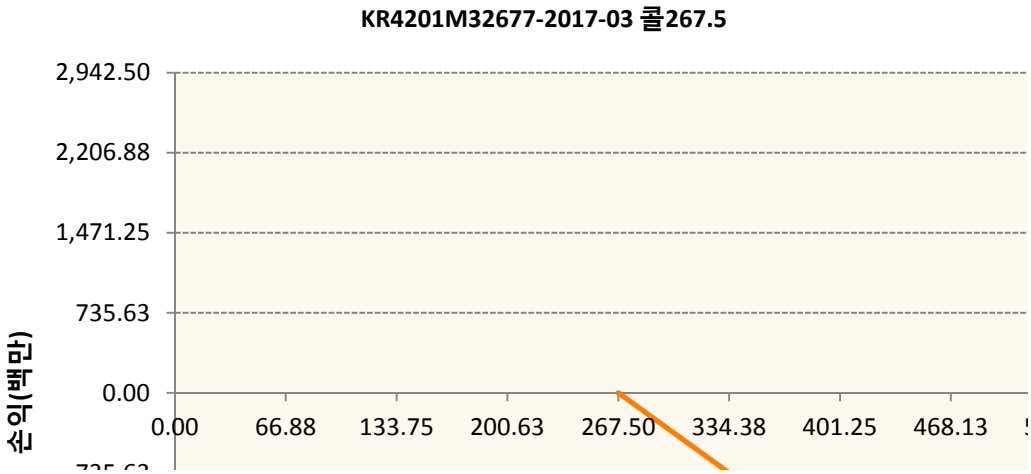
1. 계약금액

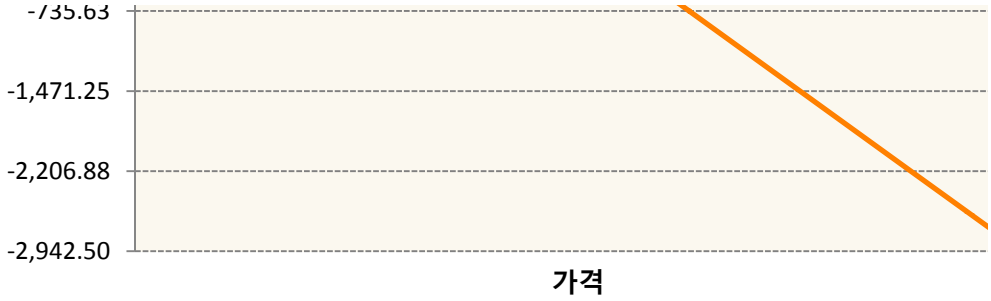
(단위:백만원)

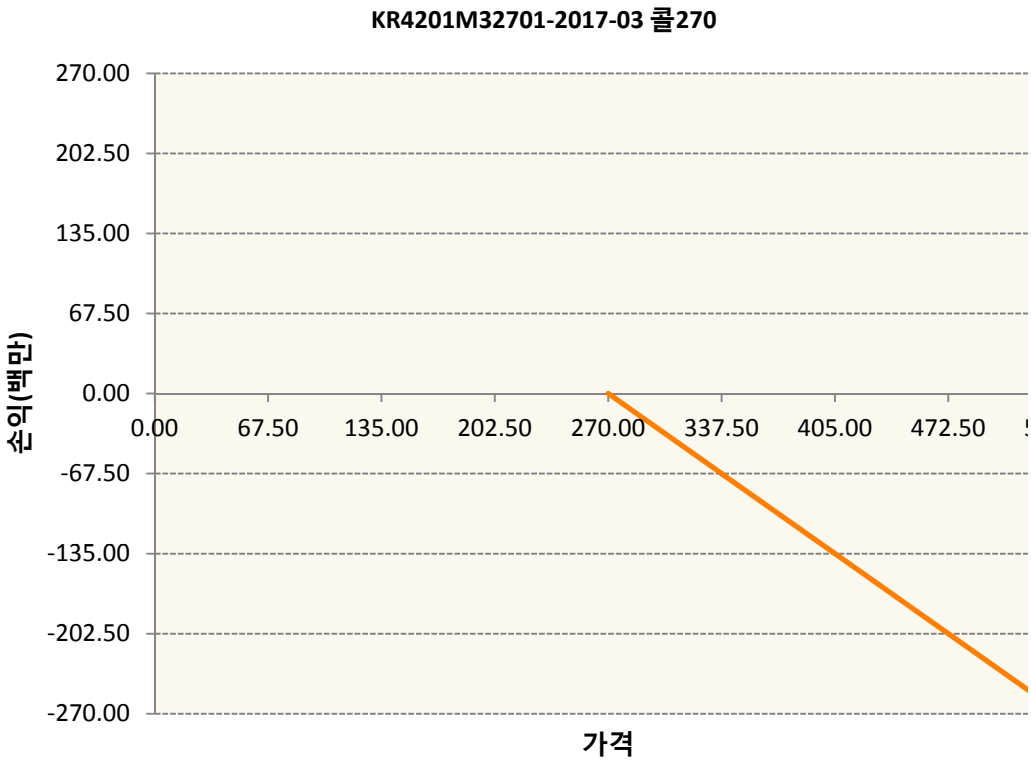
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	9,545	0	9,545	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,213	-3,213	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101M30(2017-03 코스피200지수선물							763
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-763	-763	-763	-763	-763	-763	-763
-5.33%	-509	-509	-509	-509	-509	-509	-509
-2.67%	-254	-254	-254	-254	-254	-254	-254
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	254	254	254	254	254	254	254
5.33%	509	509	509	509	509	509	509
8.00%	763	763	763	763	763	763	763
KR4201M32(2017-03 콜267.5							1,189
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	293	293	293	293	293	293	293
-5.33%	293	293	293	293	292	292	291
-2.67%	271	265	259	253	247	240	234
0%	7	5	3	0	-3	-7	-11
2.67%	-389	-389	-389	-389	-390	-390	-390
5.33%	-789	-789	-789	-789	-789	-789	-789
8.00%	-1,189	-1,189	-1,189	-1,189	-1,189	-1,189	-1,189
	KR4201M32: 2017-03 콜270						106

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	16	16	16	16	16	16	16
-5.33%	16	16	16	16	16	16	16
-2.67%	16	16	15	15	15	14	14
0%	2	1	1	0	-1	-1	-2
2.67%	-33	-33	-33	-33	-33	-33	-34
5.33%	-70	-70	-70	-70	-70	-70	-70
8.00%	-106	-106	-106	-106	-106	-106	-106

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

2,204

공시일	2017-03-03
기준일	2017-03-02

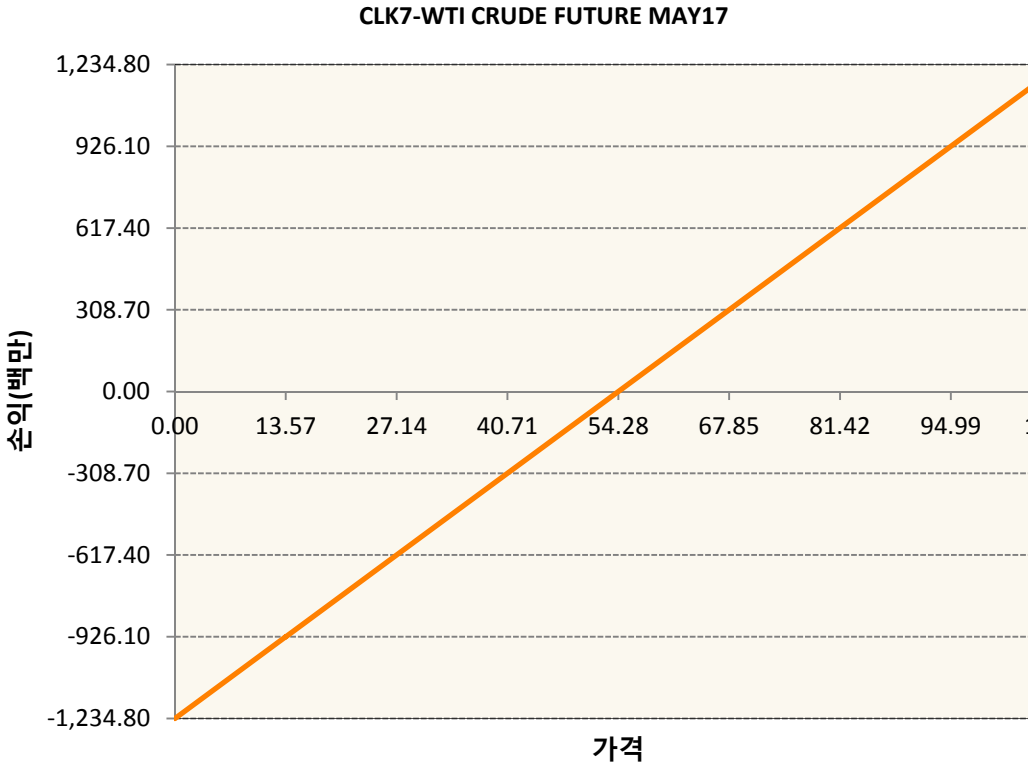
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

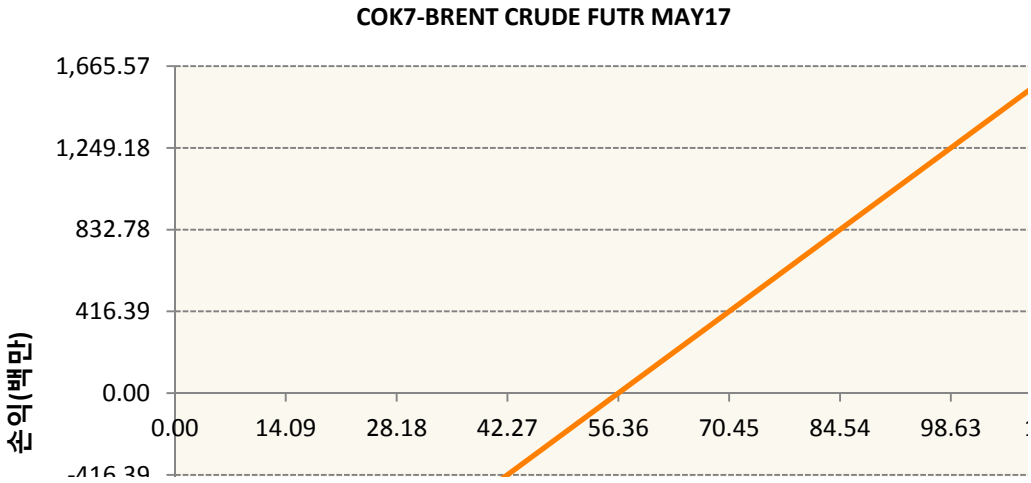
1. 계약금액

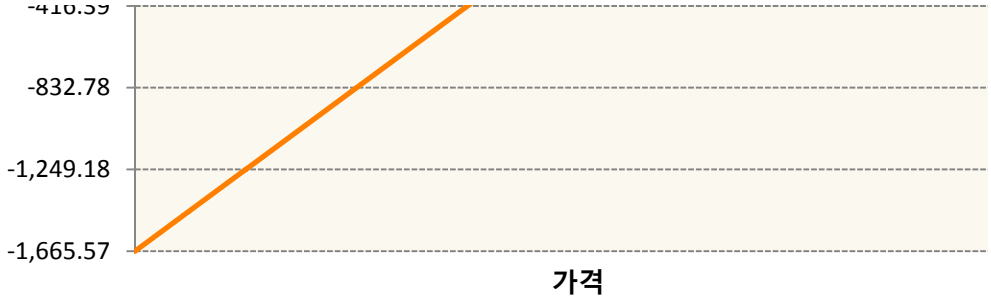
(단위:백만원)

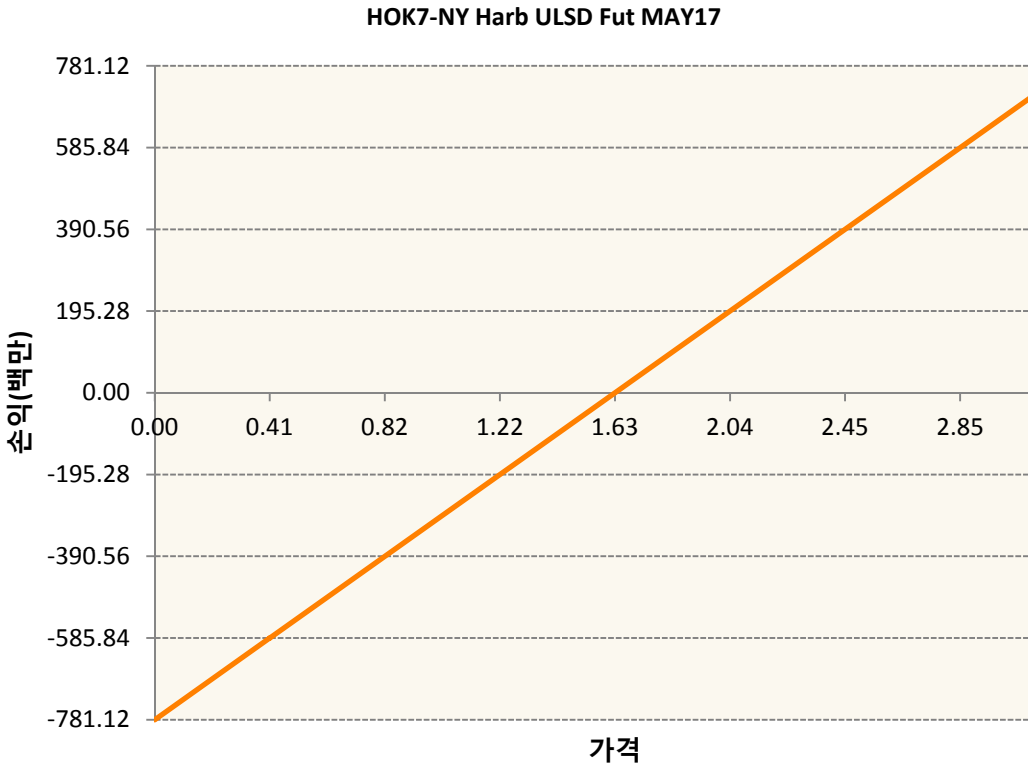
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	선물	유가증권	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	선물	유가증권	1,235	0	1,235	
누계	유가증권	선물	4,603	411	4,192	

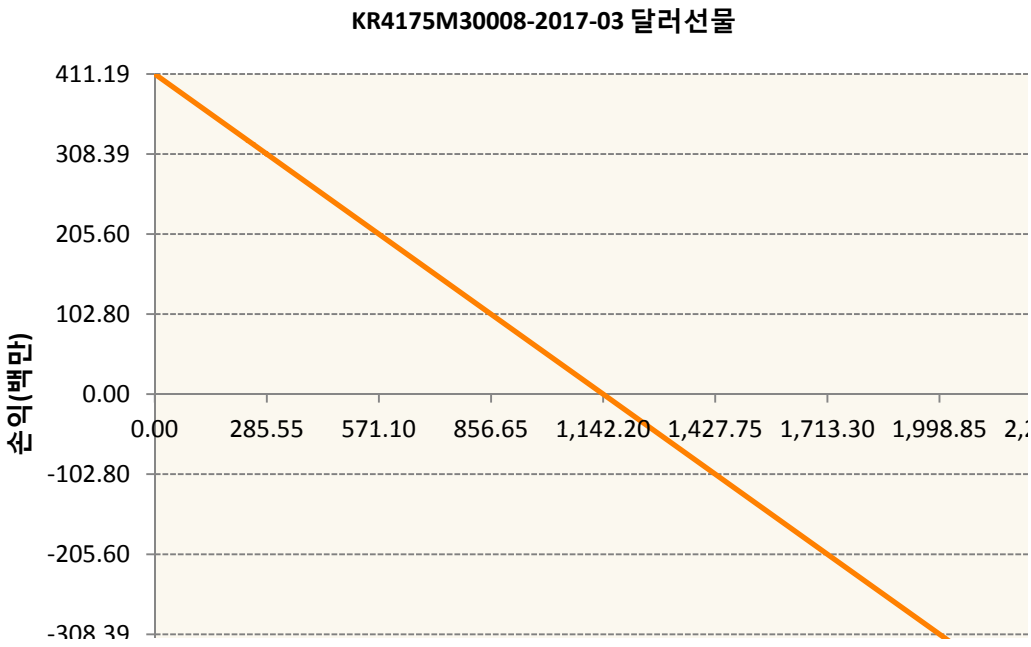
2. 만기시점의 손익구조

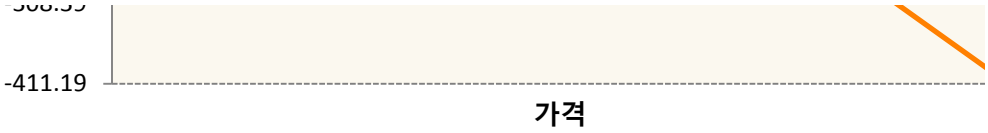


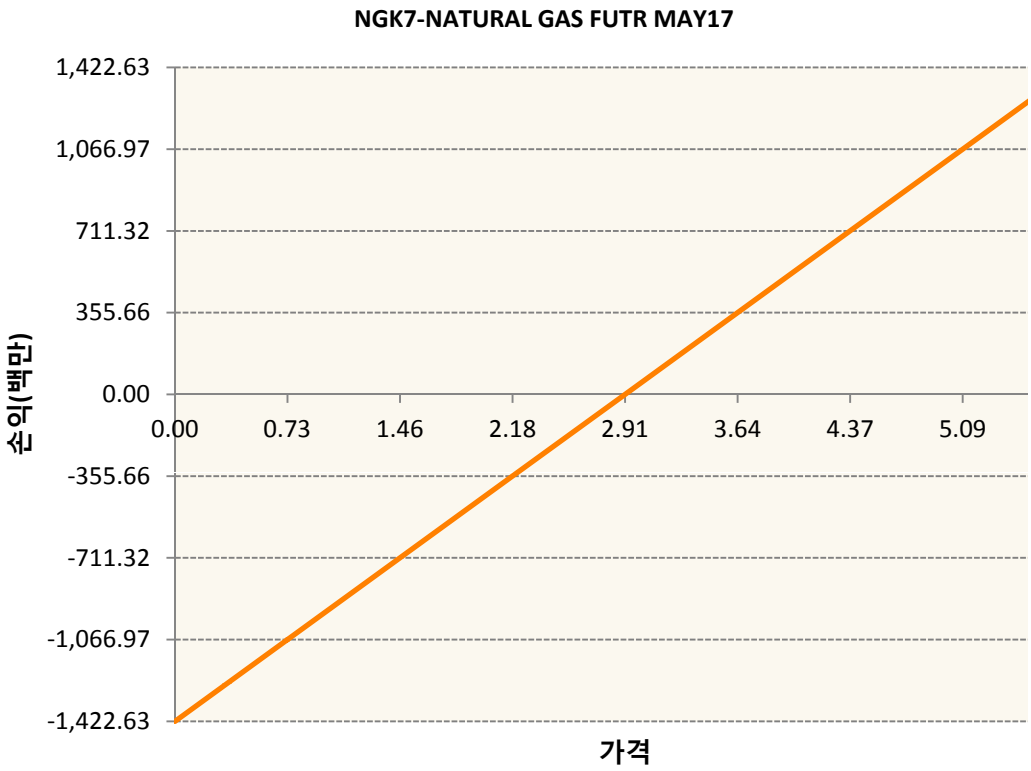


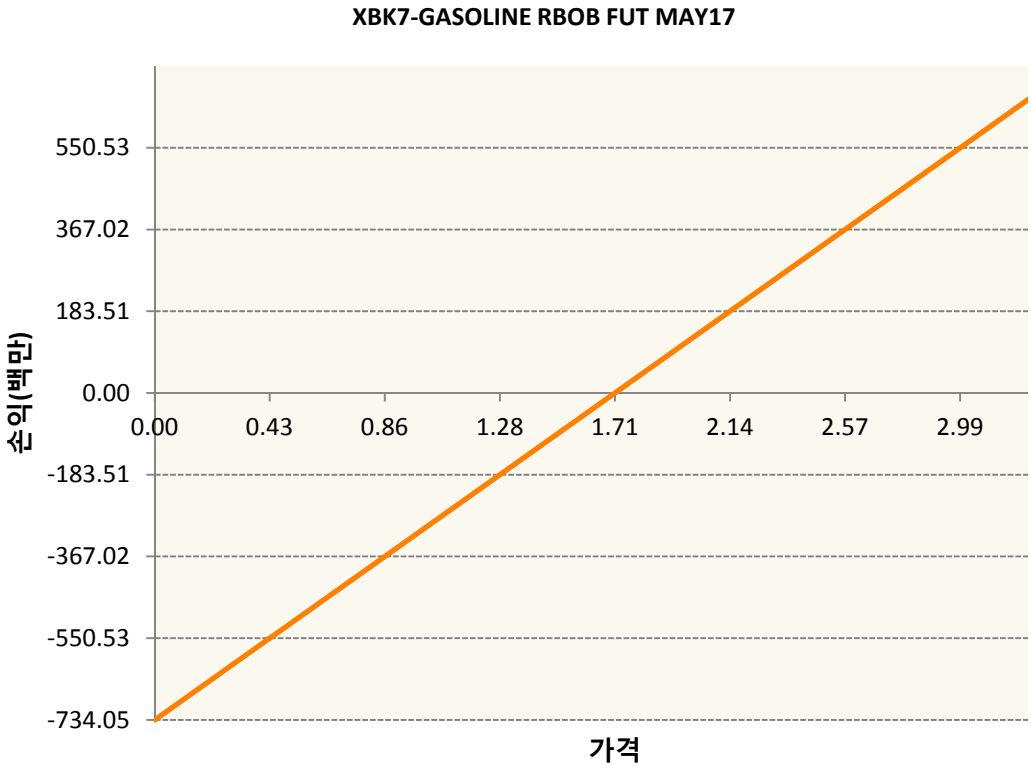

-832.78
-1,249.18
-1,665.57
가격


HOK7-NY Harb ULSD Fut MAY17
781.12
585.84
390.56
195.28
0.00
-195.28
-390.56
-585.84
-781.12
0.00
0.41
0.82
1.22
1.63
2.04
2.45
2.85
순익(백만)
가격


KR4175M30008-2017-03 달러선물
411.19
308.39
205.60
102.80
0.00
-102.80
-205.60
0.00
285.55
571.10
856.65
1,142.20
1,427.75
1,713.30
1,998.85
순익(백만)


-411.19
가격


NGK7-NATURAL GAS FUTR MAY17
1,422.63
1,066.97
711.32
355.66
0.00
-355.66
-711.32
-1,066.97
-1,422.63
0.00
0.73
1.46
2.18
2.91
3.64
4.37
5.09
순익(백만)
가격


XBK7-GASOLINE RBOB FUT MAY17
550.53
367.02
183.51
0.00
-183.51
-367.02
-550.53
-734.05
0.00
0.43
0.86
1.28
1.71
2.14
2.57
2.99
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	62
KR4175M30(	2017-03 달러선물	33
NGK7	NATURAL GAS FUTR MAY17	114
XBK7	GASOLINE RBOB FUT MAY17	59

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

1,036

공시일	2017-03-03
기준일	2017-03-02

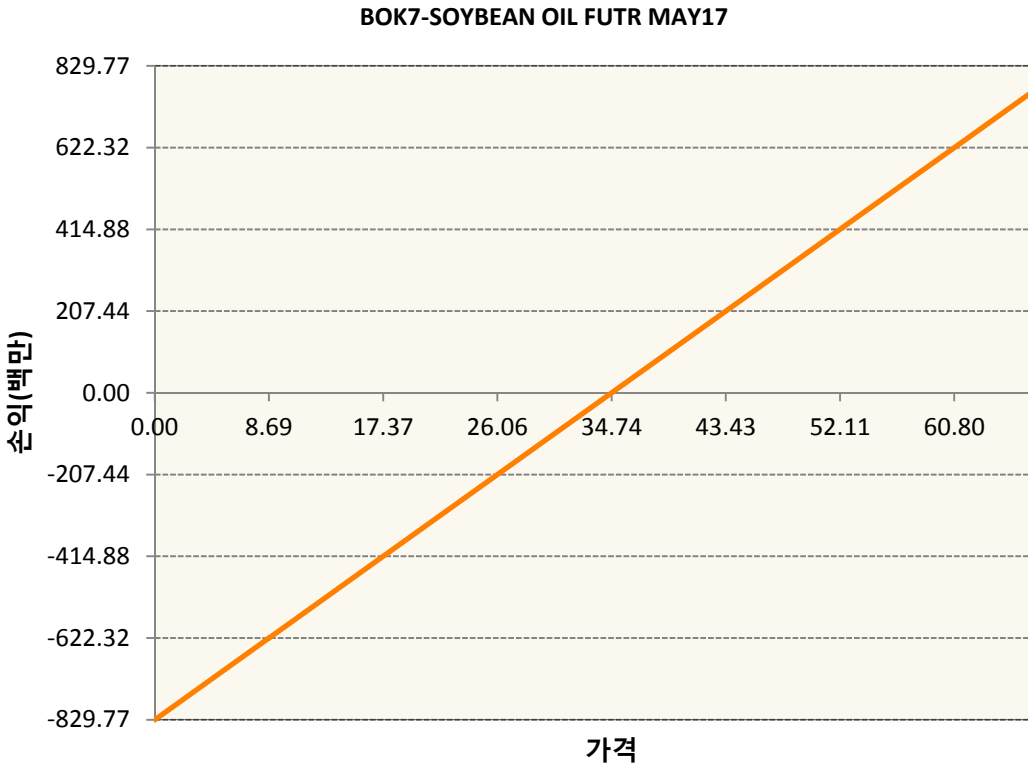
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

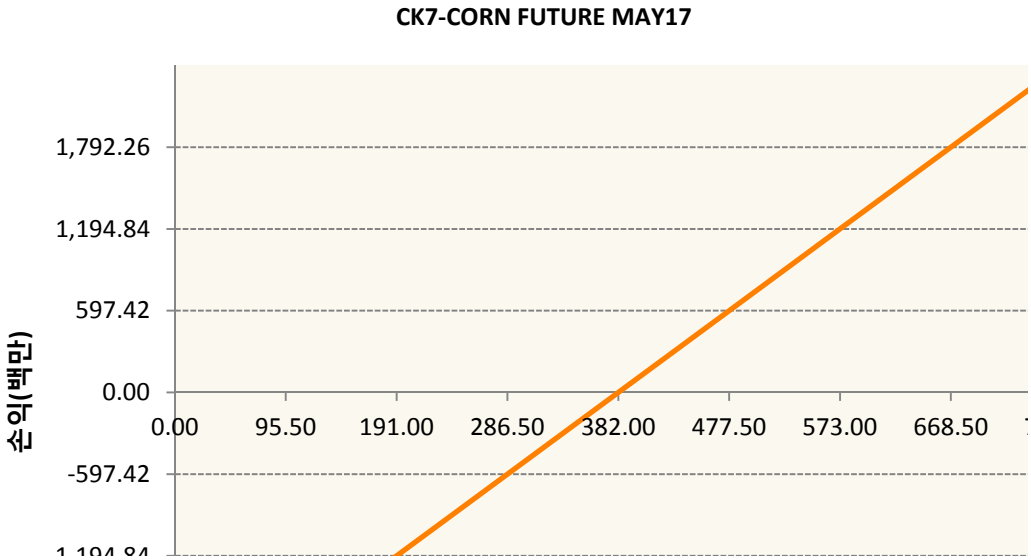
1. 계약금액

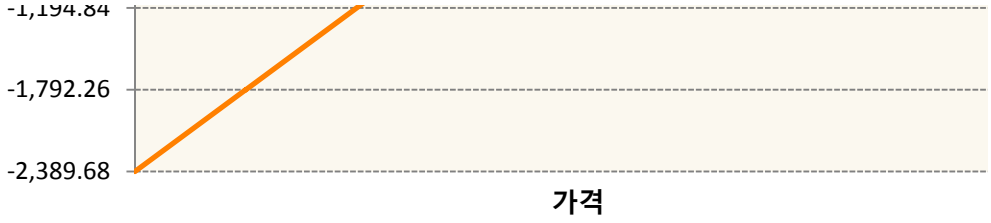
(단위:백만원)

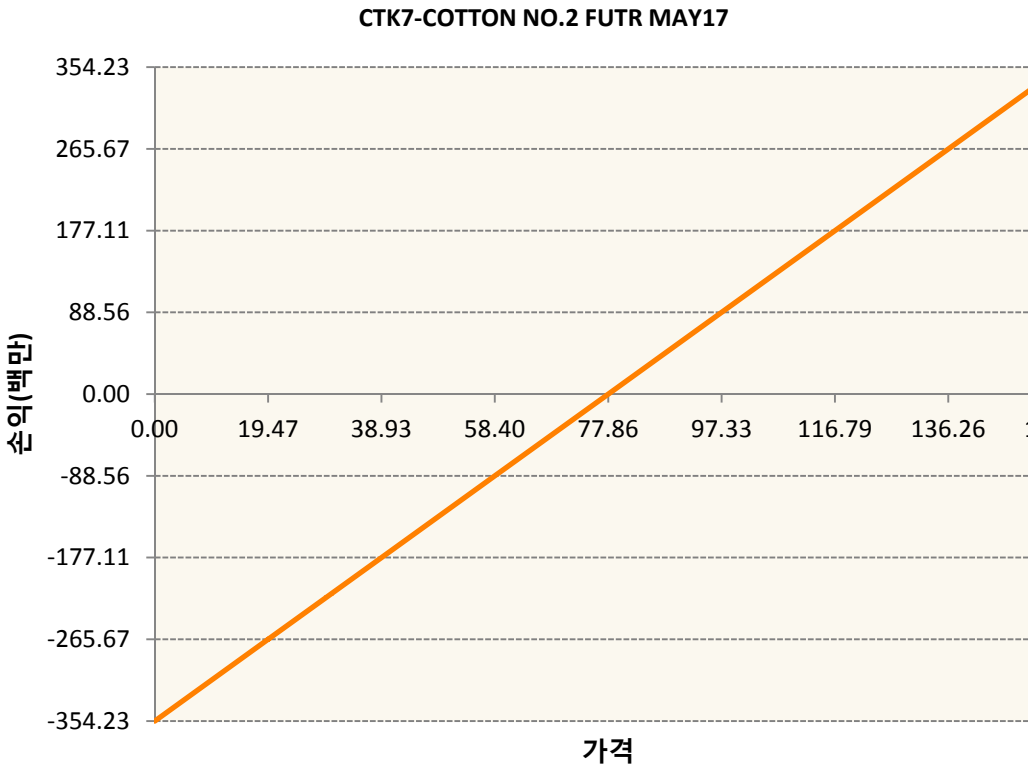
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	9,541	571	8,970	

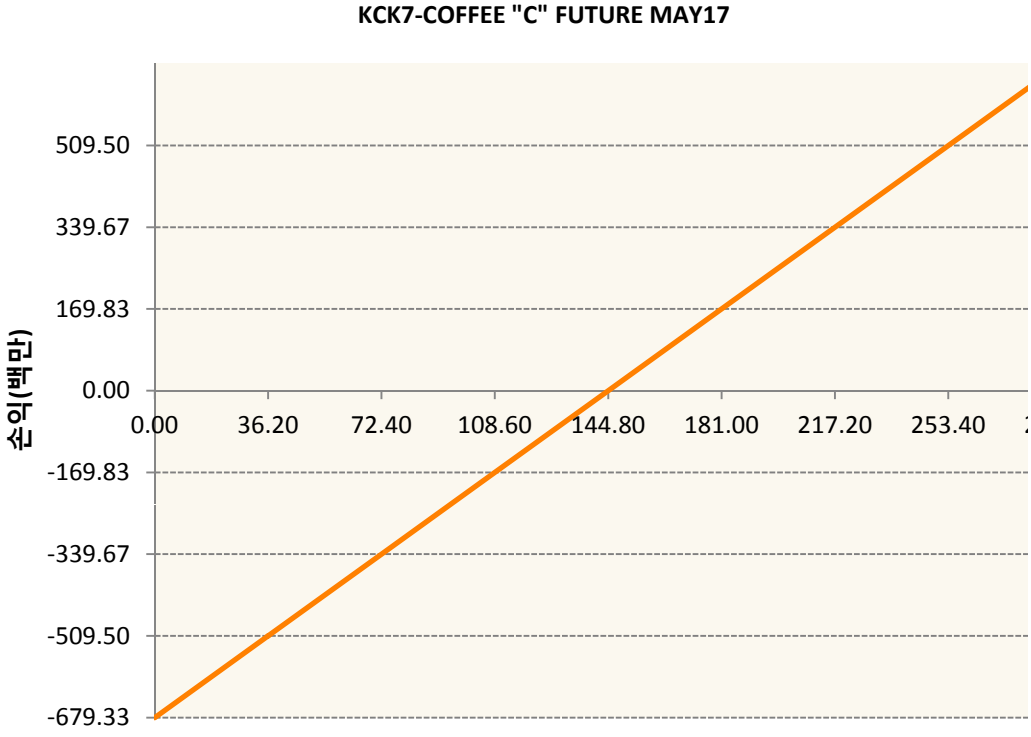
2. 만기시점의 손익구조



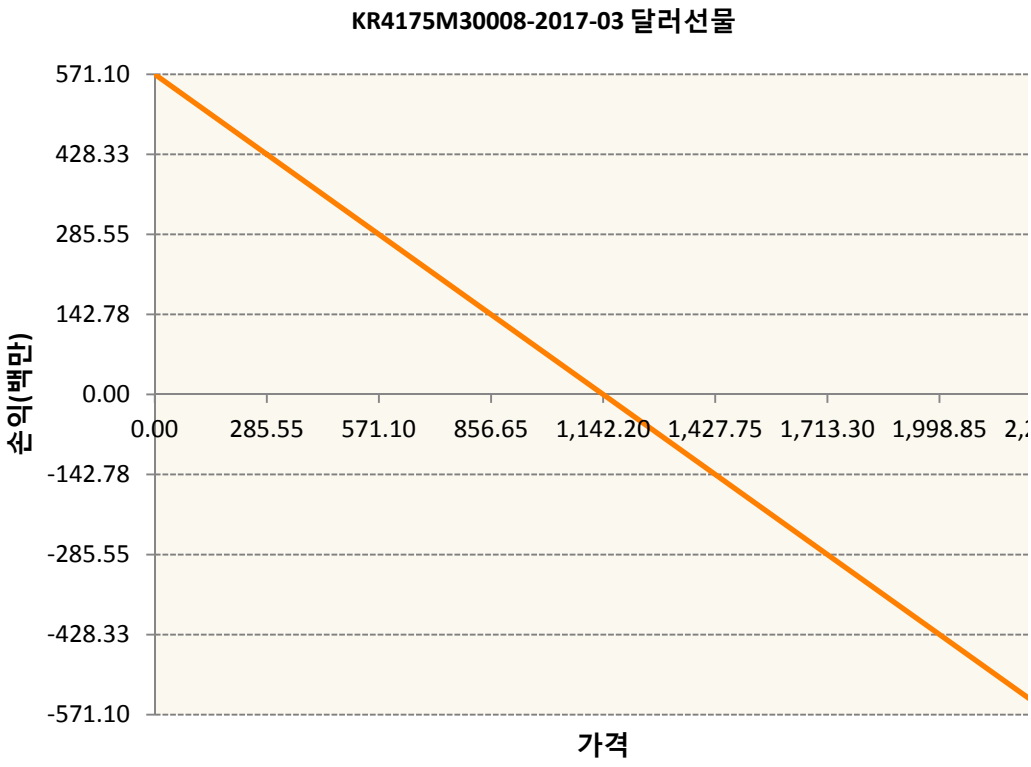


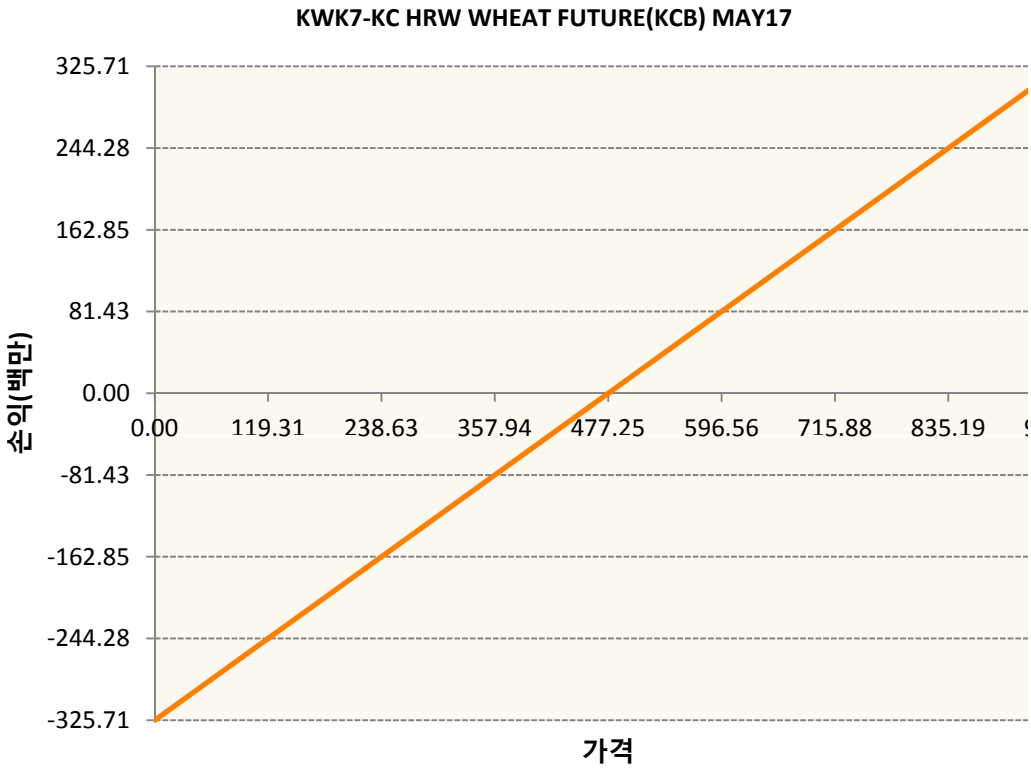

-1,792.26
-2,389.68
가격


CTK7-COTTON NO.2 FUTR MAY17
354.23
265.67
177.11
88.56
0.00
-88.56
-177.11
-265.67
-354.23
0.00
19.47
38.93
58.40
77.86
97.33
116.79
136.26
순익(백만)
가격

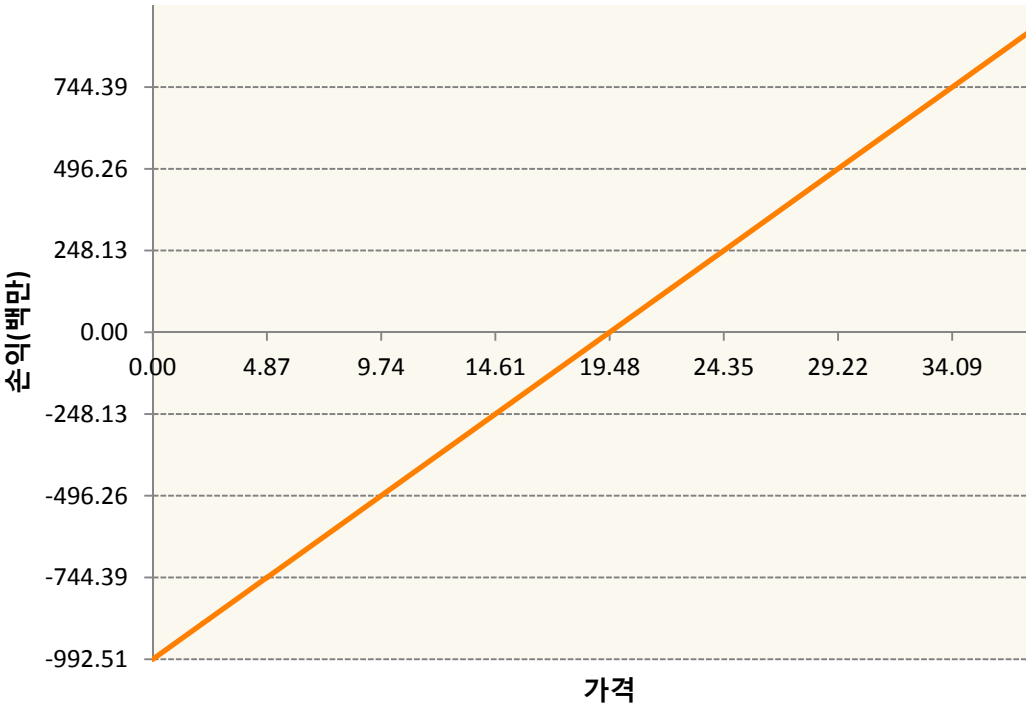

KCK7-COFFEE "C" FUTURE MAY17
509.50
339.67
169.83
0.00
-169.83
-339.67
-509.50
-679.33
0.00
36.20
72.40
108.60
144.80
181.00
217.20
253.40
순익(백만)

가격

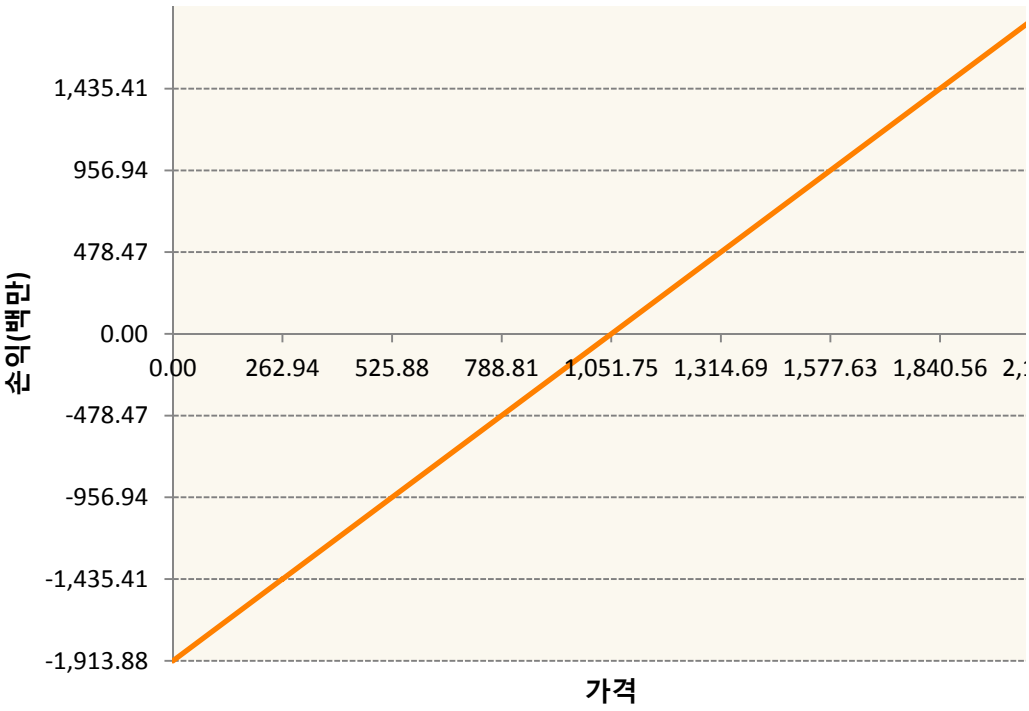

KR4175M30008-2017-03 달러선물
571.10
428.33
285.55
142.78
0.00
-142.78
-285.55
-428.33
-571.10
0.00
285.55
571.10
856.65
1,142.20
1,427.75
1,713.30
1,998.85
손익(백만)
가격


KWK7-KC HRW WHEAT FUTURE(KCB) MAY17
325.71
244.28
162.85
81.43
0.00
-81.43
-162.85
-244.28
-325.71
0.00
119.31
238.63
357.94
477.25
596.56
715.88
835.19
손익(백만)
가격

SBK7-Sugar #11 (WORLD) MAY17

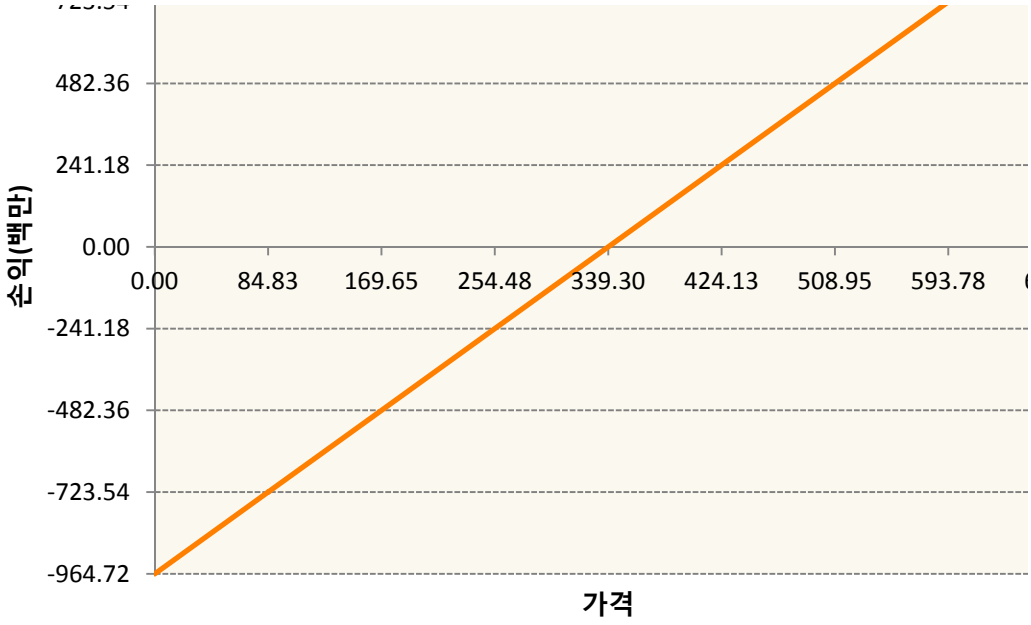


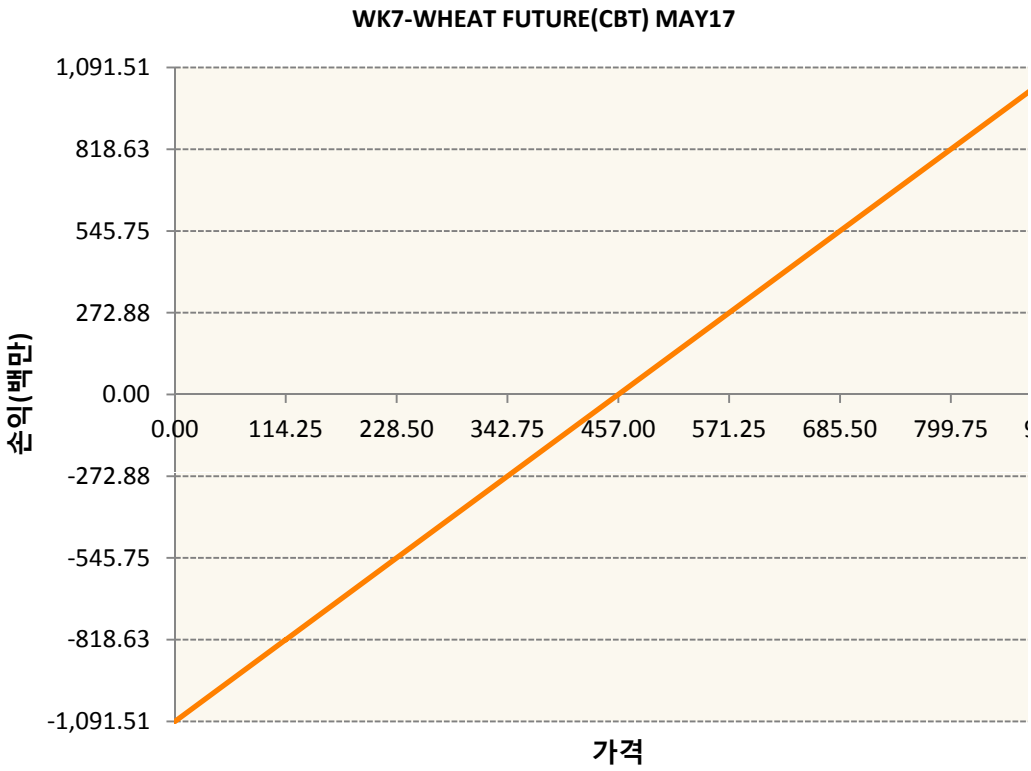
SK7-SOYBEAN FUTURE MAY17



SMK7-SOYBEAN MEAL FUTR MAY17







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
BOK7	SOYBEAN OIL FUTR MAY17	66
CK7	CORN FUTURE MAY17	191
CTK7	COTTON NO.2 FUTR MAY17	28
KCK7	COFFEE "C" FUTURE MAY17	54
KR4175M30(	2017-03 달러선물	46

KWK7	KC HRW WHEAT FUTURE(KCB) MAY17	26
SBK7	Sugar #11 (WORLD) MAY17	79
SK7	SOYBEAN FUTURE MAY17	153
SMK7	SOYBEAN MEAL FUTR MAY17	77
WK7	WHEAT FUTURE(CBT) MAY17	87

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

890