공시일	2017-03-06
기준일	2017-03-03

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	2017-03-06
기준일	2017-03-03

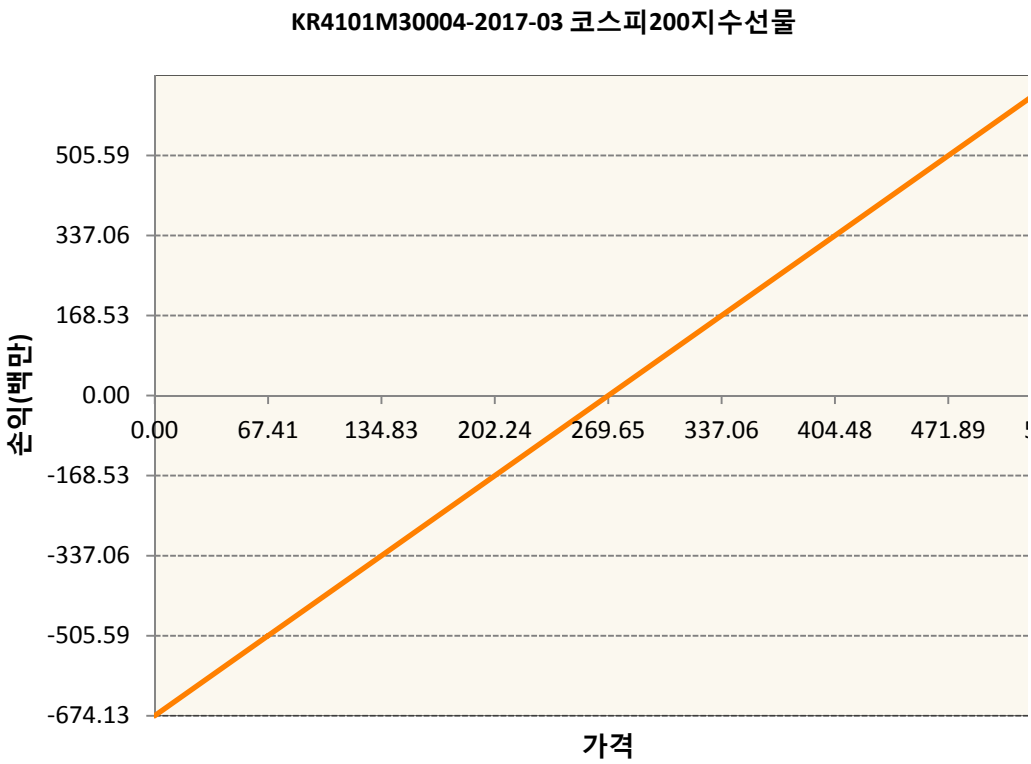
스마트인덱스모

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	2017-03-06
기준일	2017-03-03

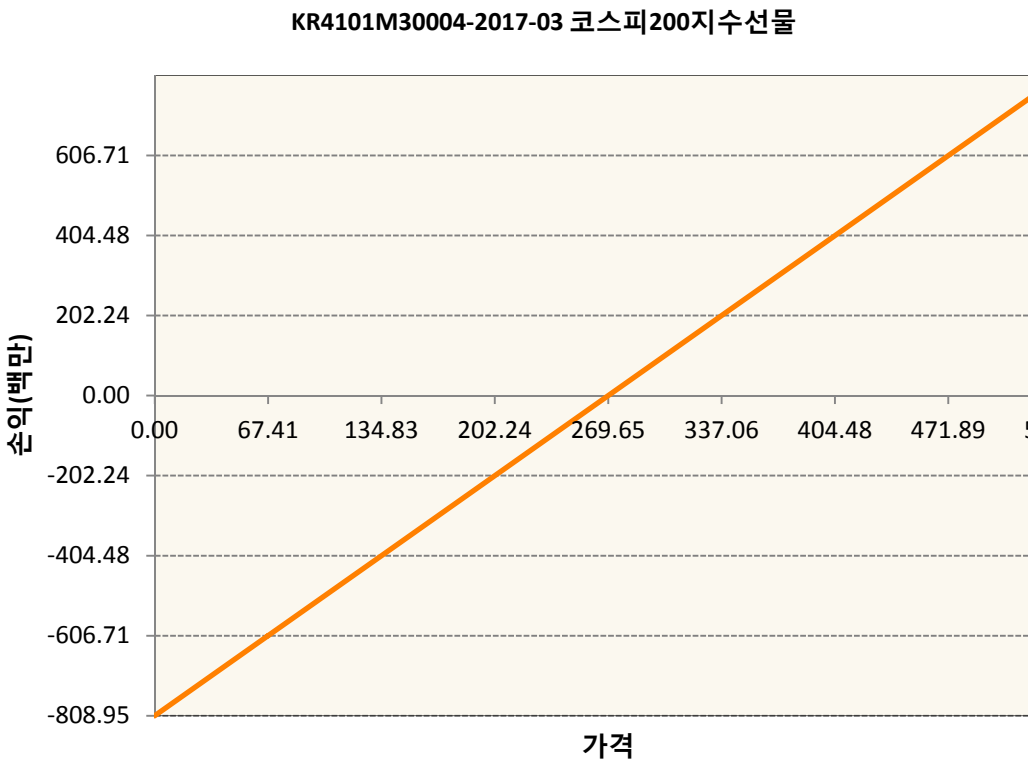
스마트레버리지목표전환형1호

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	2017-03-06
기준일	2017-03-03

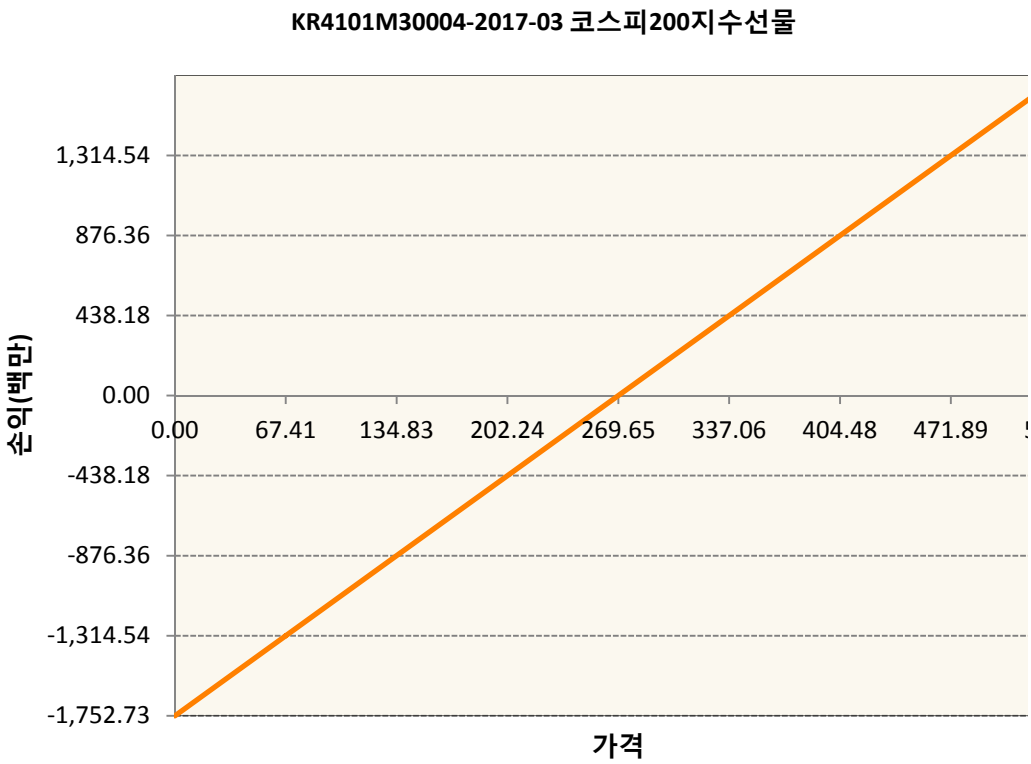
1.3배 레버리지 인덱스(주식-파생형)

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	2017-03-06
기준일	2017-03-03

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	954

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

594

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-03-06
기준일	2017-03-03

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)

467

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-03-06
기준일	2017-03-03

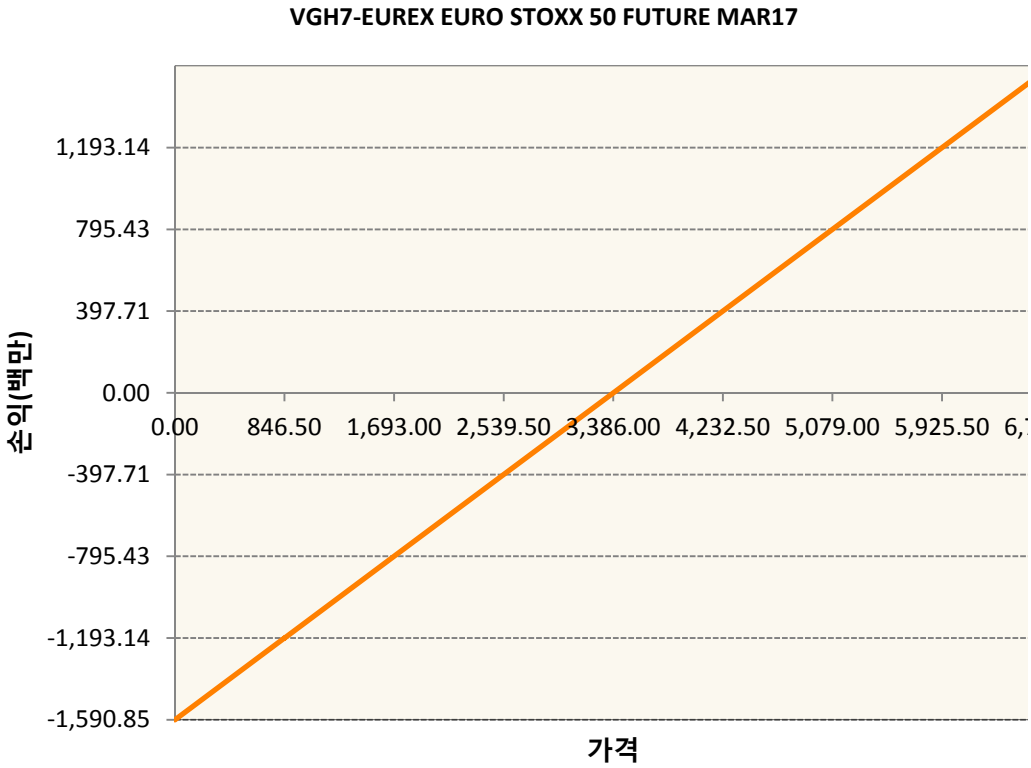
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,591	0	1,591	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGH7	EUREX EURO STOXX 50 FUTURE MAR17	127

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

(단위:백만원)

130

공시일	2017-03-06
기준일	2017-03-03

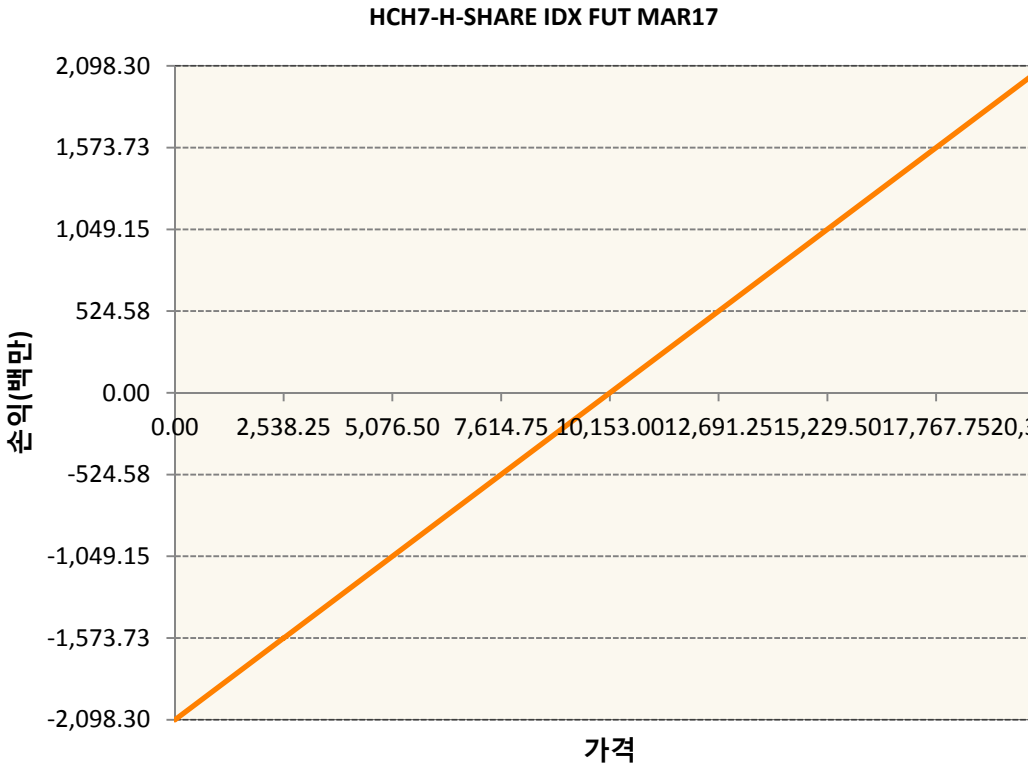
차이나인덱스모(주식-파생형)

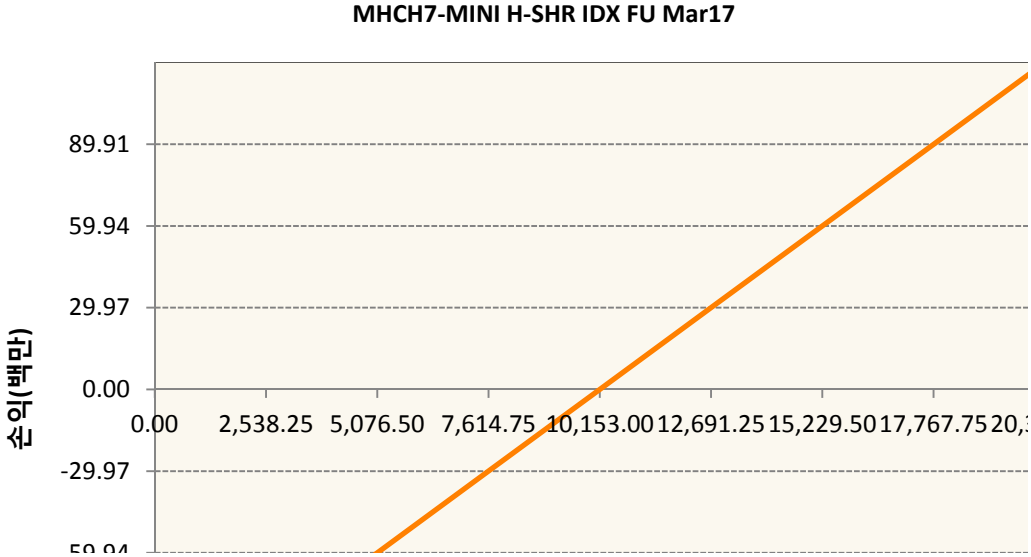
1. 계약금액

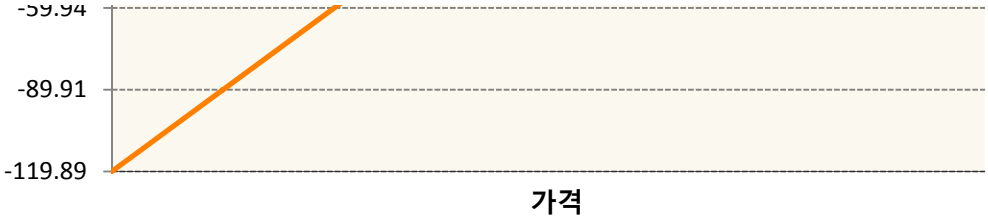
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,218	0	2,218	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

HCH7	H-SHARE IDX FUT MAR17	168
MHCH7	MINI H-SHR IDX FU Mar17	10

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

199

공시일	2017-03-06
기준일	2017-03-03

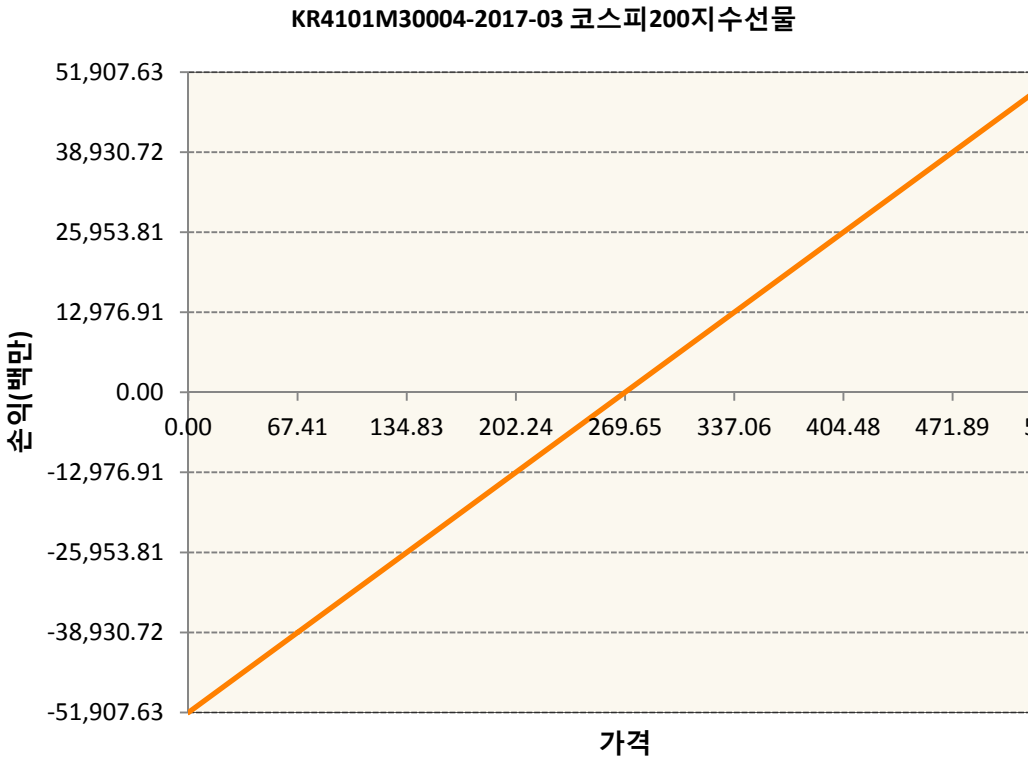
커버드콜모(주식혼합-파생형)

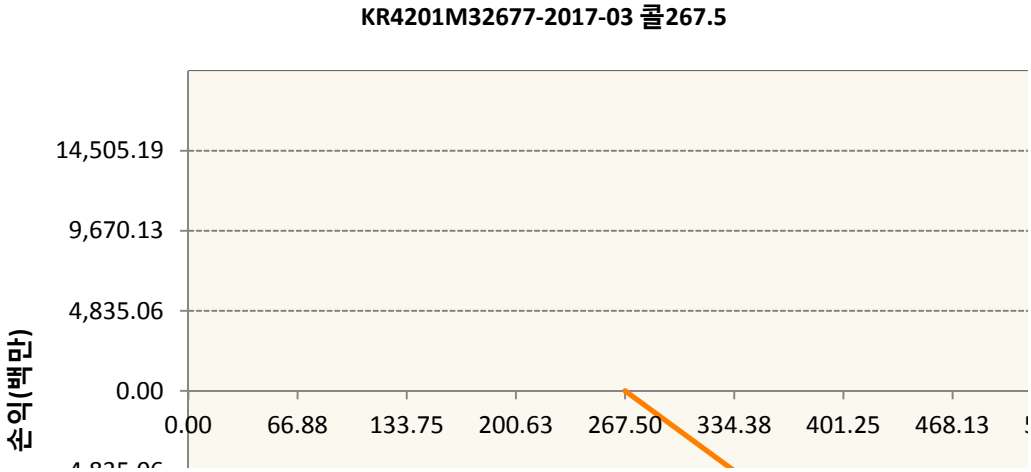
1. 계약금액

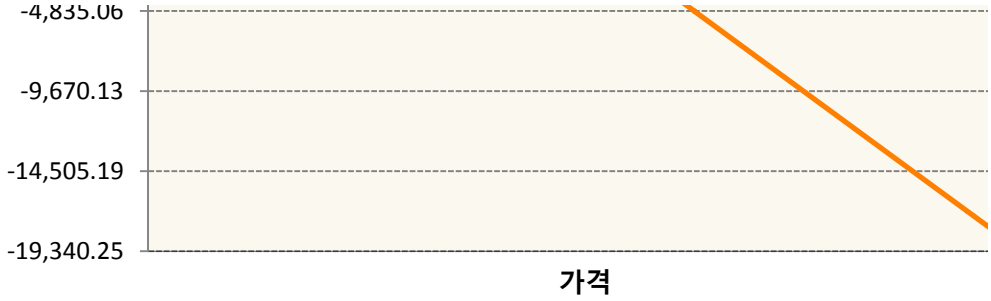
(단위:백만원)

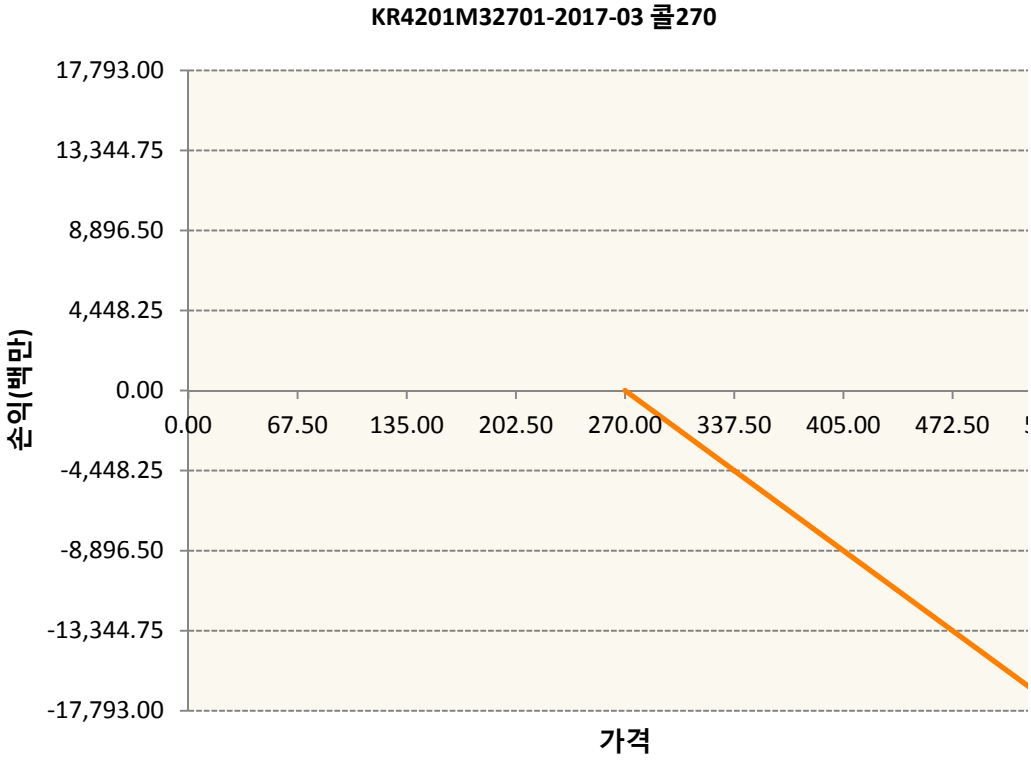
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	1,085	-1,085	장내
누계	유가증권	선물	51,908	0	51,908	장내
누계	유가증권	옵션	0	37,133	-37,133	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101M30(2017-03 코스피200지수선물							4,154
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-4,154	-4,154	-4,154	-4,154	-4,154	-4,154	-4,154
-5.33%	-2,770	-2,770	-2,770	-2,770	-2,770	-2,770	-2,770
-2.67%	-1,385	-1,385	-1,385	-1,385	-1,385	-1,385	-1,385
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	1,385	1,385	1,385	1,385	1,385	1,385	1,385
5.33%	2,770	2,770	2,770	2,770	2,770	2,770	2,770
8.00%	4,154	4,154	4,154	4,154	4,154	4,154	4,154
KR4201M32(2017-03 콜267.5							7,559
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,061	1,061	1,061	1,061	1,061	1,061	1,061
-5.33%	1,061	1,061	1,061	1,060	1,060	1,059	1,058
-2.67%	1,043	1,031	1,015	997	975	952	926
0%	111	76	39	0	-40	-80	-122
2.67%	-2,359	-2,359	-2,360	-2,362	-2,366	-2,370	-2,377
5.33%	-4,959	-4,959	-4,959	-4,959	-4,959	-4,959	-4,959
8.00%	-7,559	-7,559	-7,559	-7,559	-7,559	-7,559	-7,559
KR4201M32 2017-03 콜270							6,559

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	473	473	473	473	473	473	473
-5.33%	473	473	473	473	473	473	473
-2.67%	472	470	466	461	453	444	432
0%	127	85	42	0	-42	-85	-128
2.67%	-1,823	-1,826	-1,832	-1,840	-1,850	-1,863	-1,877
5.33%	-4,189	-4,189	-4,190	-4,190	-4,190	-4,190	-4,191
8.00%	-6,559	-6,559	-6,559	-6,559	-6,559	-6,559	-6,559

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

22,904

공시일	2017-03-06
기준일	2017-03-03

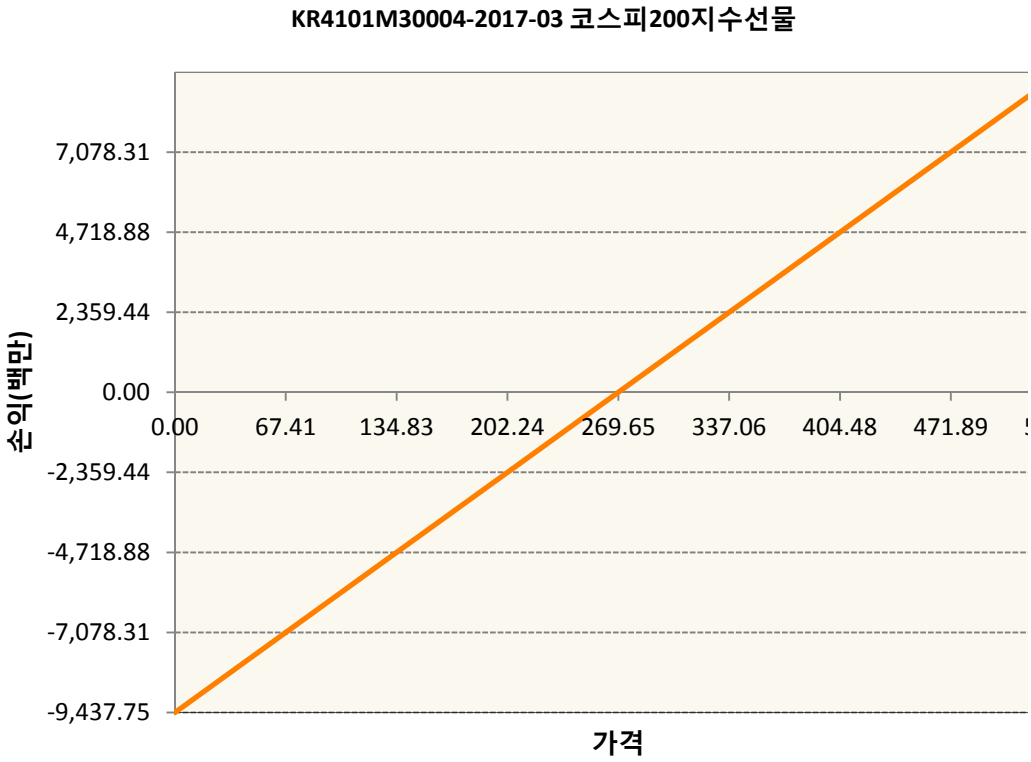
커버드콜목표전환형증권투자신탁

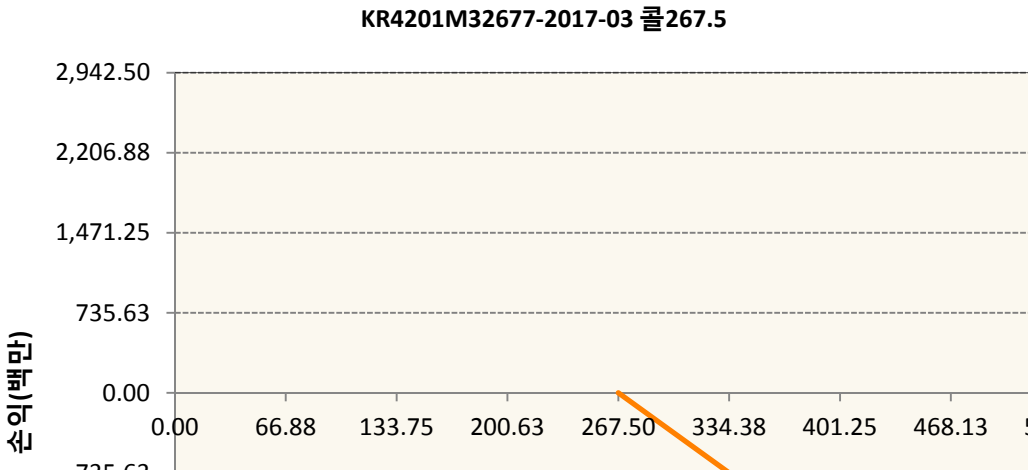
1. 계약금액

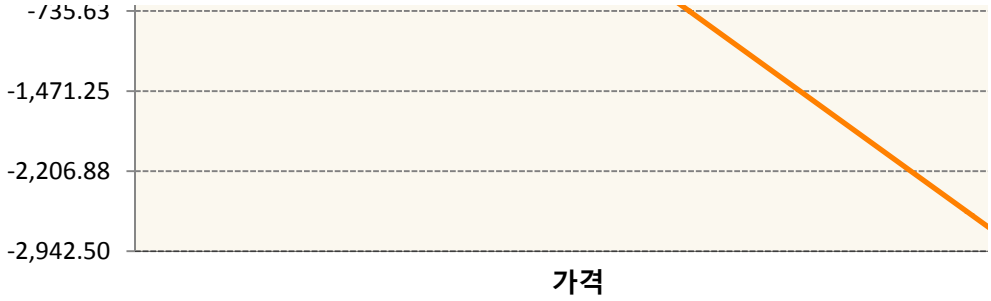
(단위:백만원)

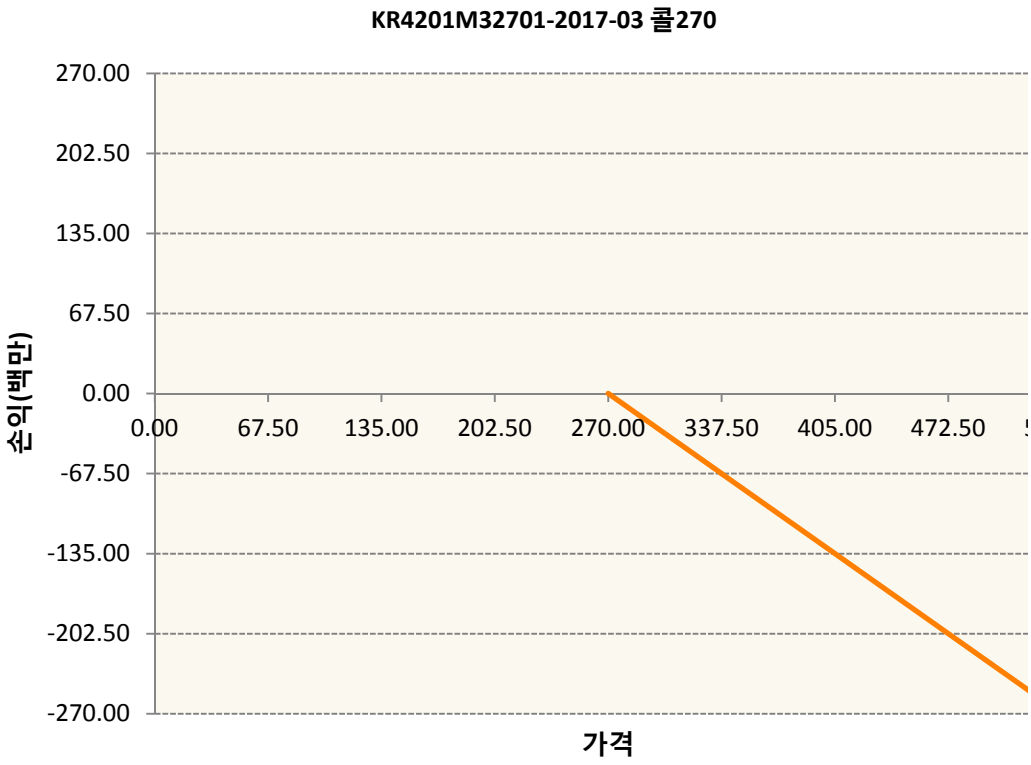
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	9,438	0	9,438	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,213	-3,213	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101M30(2017-03 코스피200지수선물							755
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-755	-755	-755	-755	-755	-755	-755
-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%	755	755	755	755	755	755	755
KR4201M32(2017-03 콜267.5							1,150
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	161	161	161	161	161	161	161
-5.33%	161	161	161	161	161	161	161
-2.67%	159	157	154	152	148	145	141
0%	17	12	6	0	-6	-12	-18
2.67%	-359	-359	-359	-359	-360	-361	-362
5.33%	-754	-754	-754	-754	-754	-754	-754
8.00%	-1,150	-1,150	-1,150	-1,150	-1,150	-1,150	-1,150
	KR4201M32: 2017-03 콜270						100

	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	7	7
0%	2	1	1	0	-1	-1	-2
2.67%	-28	-28	-28	-28	-28	-28	-28
5.33%	-64	-64	-64	-64	-64	-64	-64
8.00%	-100	-100	-100	-100	-100	-100	-100

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

2,282

공시일	2017-03-06
기준일	2017-03-03

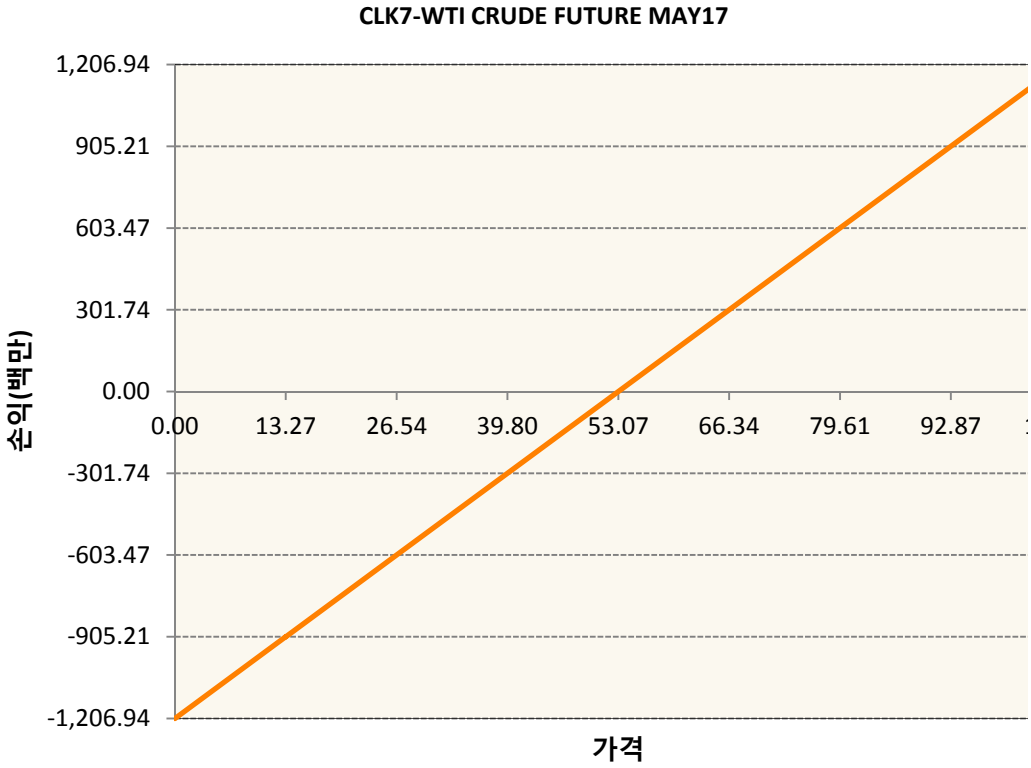
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

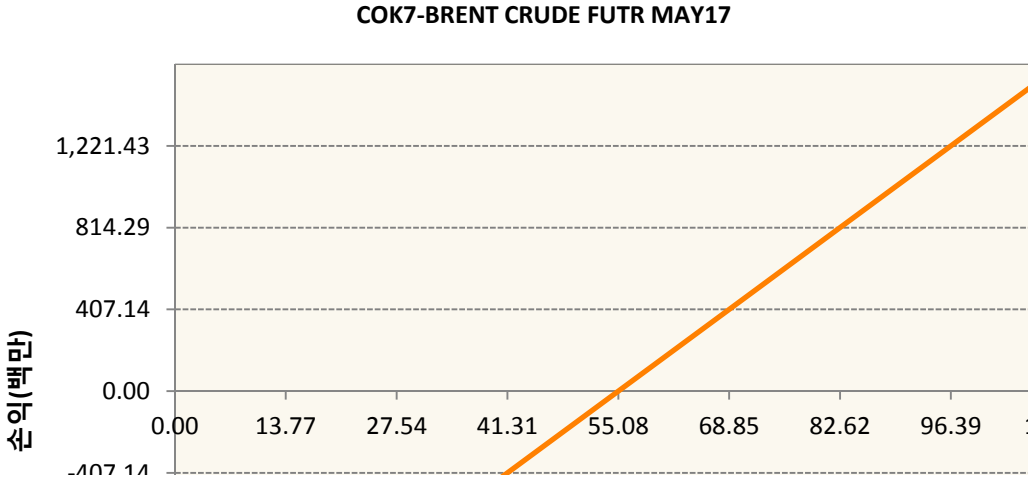
1. 계약금액

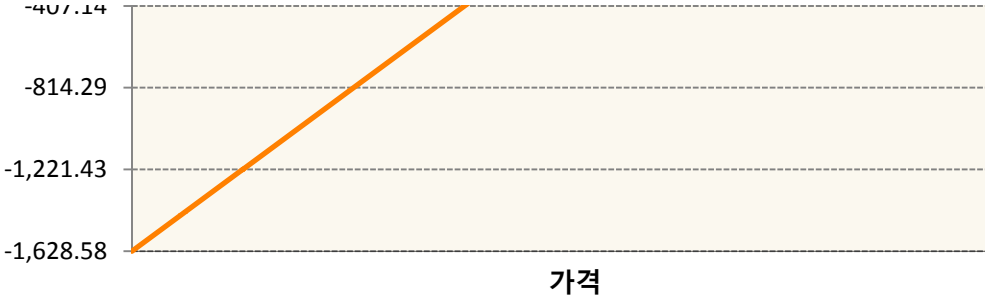
(단위:백만원)

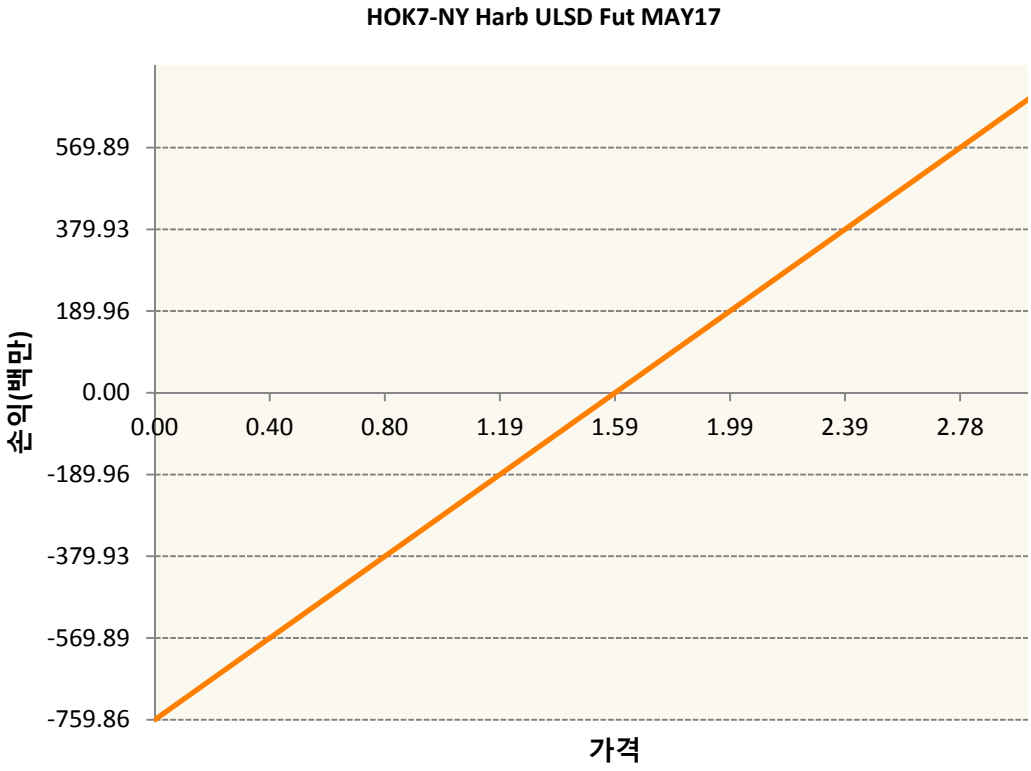
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	선물	유가증권	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	선물	유가증권	1,207	0	1,207	
누계	유가증권	선물	4,531	416	4,115	

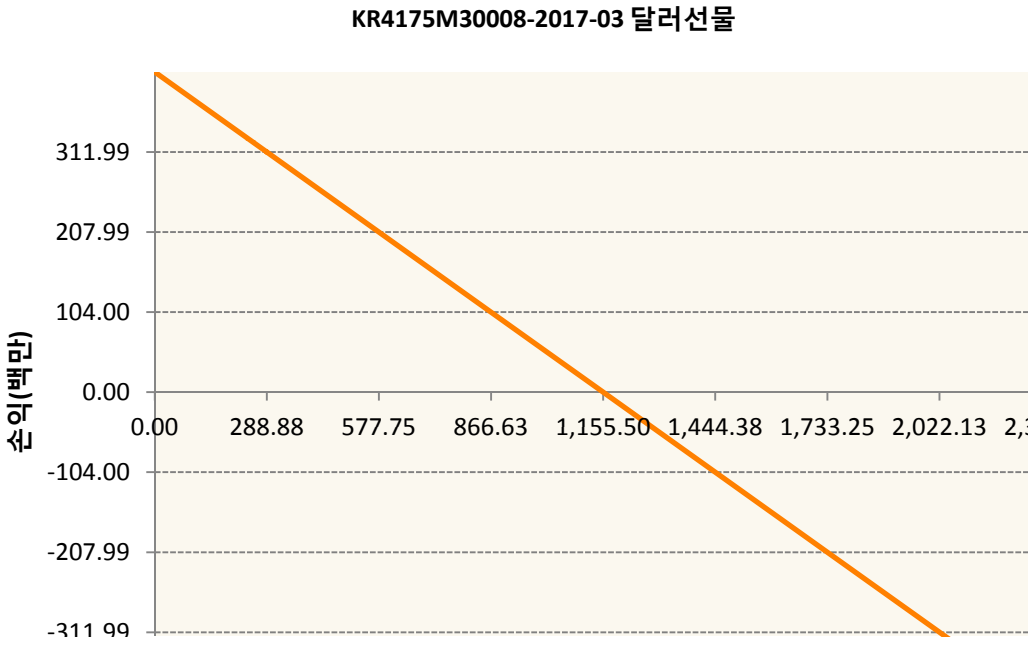
2. 만기시점의 손익구조

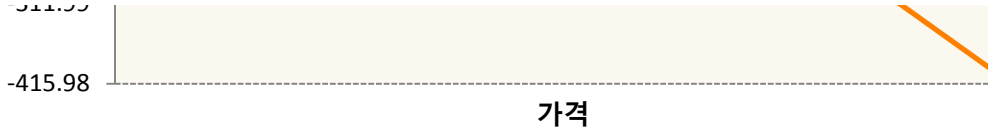


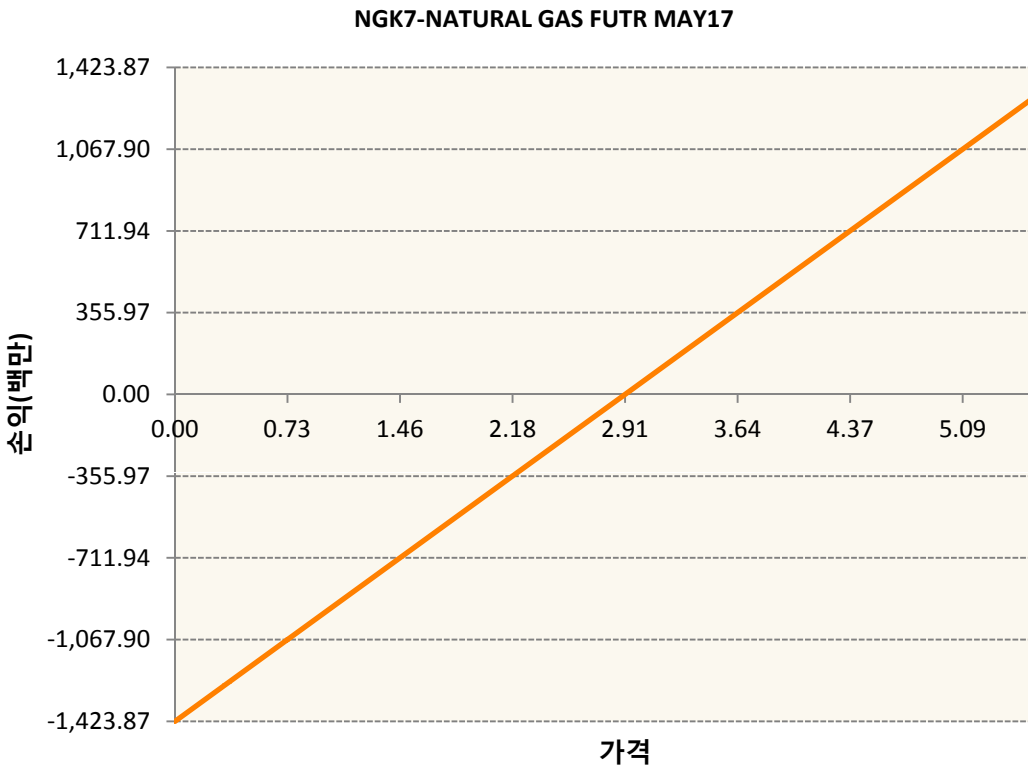


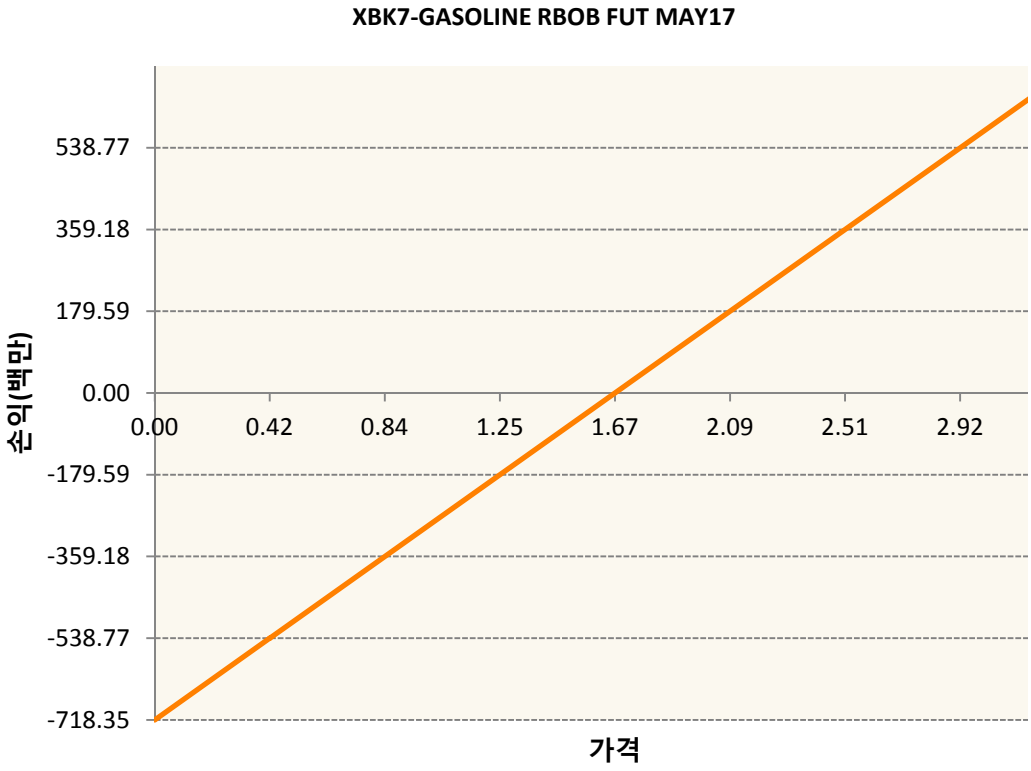

-814.29
-1,221.43
-1,628.58
가격


HOK7-NY Harb ULSD Fut MAY17
569.89
379.93
189.96
0.00
-189.96
-379.93
-569.89
-759.86
0.00
0.40
0.80
1.19
1.59
1.99
2.39
2.78
순익(백만)
가격


KR4175M30008-2017-03 달러선물
311.99
207.99
104.00
0.00
-104.00
-207.99
0.00
288.88
577.75
866.63
1,155.50
1,444.38
1,733.25
2,022.13
순익(백만)


-415.98
가격


NGK7-NATURAL GAS FUTR MAY17
1,423.87
1,067.90
711.94
355.97
0.00
-355.97
-711.94
-1,067.90
-1,423.87
0.00
0.73
1.46
2.18
2.91
3.64
4.37
5.09
순익(백만)
가격


XBK7-GASOLINE RBOB FUT MAY17
538.77
359.18
179.59
0.00
-179.59
-359.18
-538.77
-718.35
0.00
0.42
0.84
1.25
1.67
2.09
2.51
2.92
순익(백만)
가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLK7	WTI CRUDE FUTURE MAY17	97
COK7	BRENT CRUDE FUTR MAY17	130
HOK7	NY Harb ULSD Fut MAY17	61
KR4175M30(	2017-03 달러선물	33
NGK7	NATURAL GAS FUTR MAY17	114
XBK7	GASOLINE RBOB FUT MAY17	57

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

1,018

공시일	2017-03-06
기준일	2017-03-03

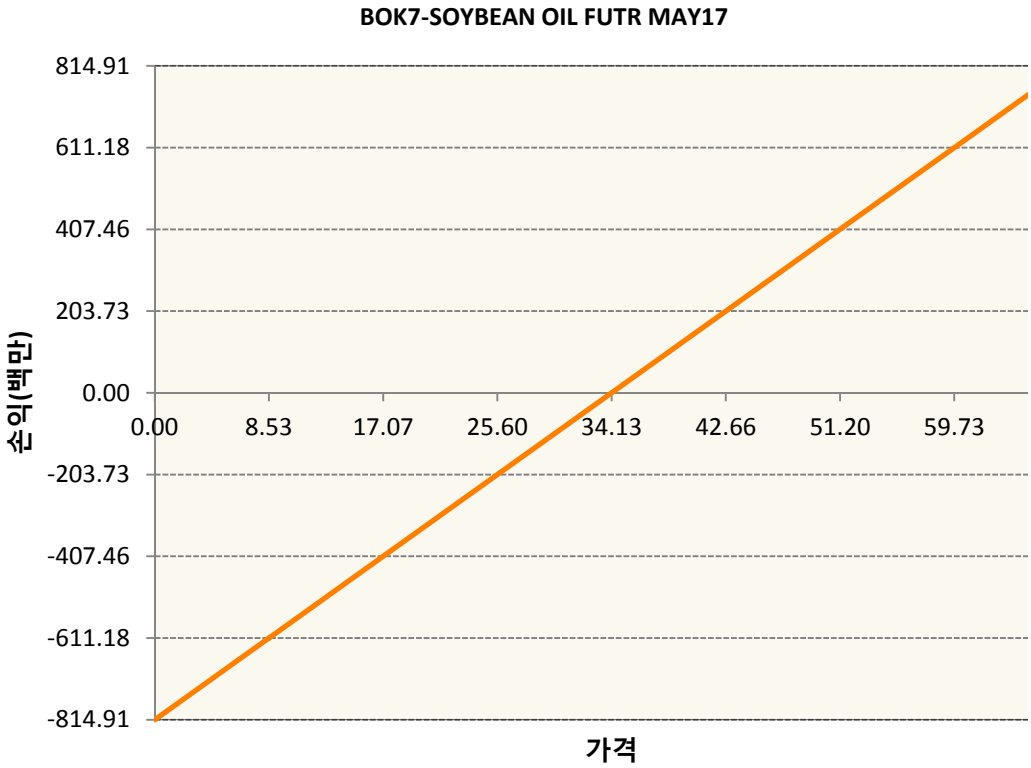
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

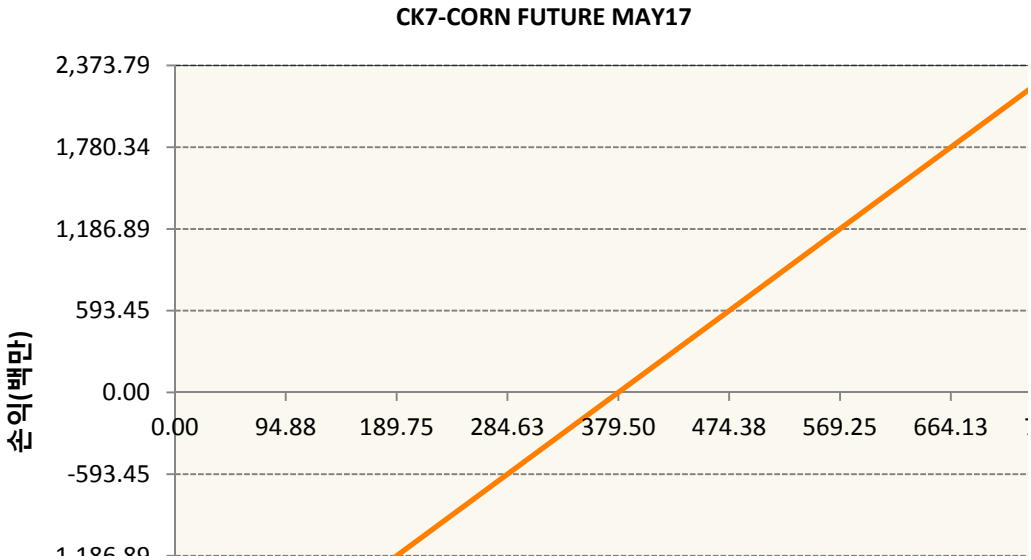
1. 계약금액

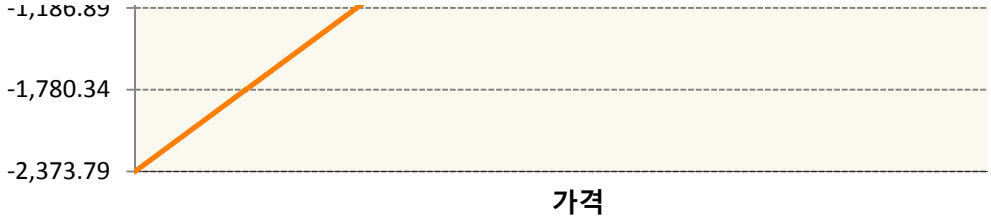
(단위:백만원)

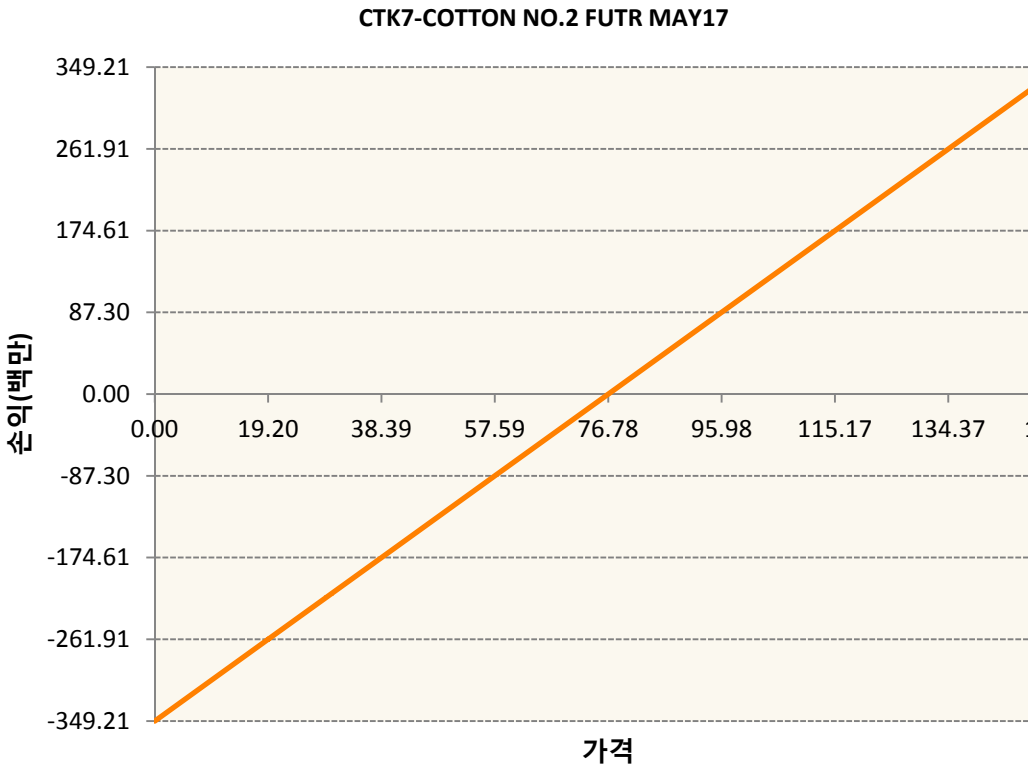
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	9,456	578	8,879	

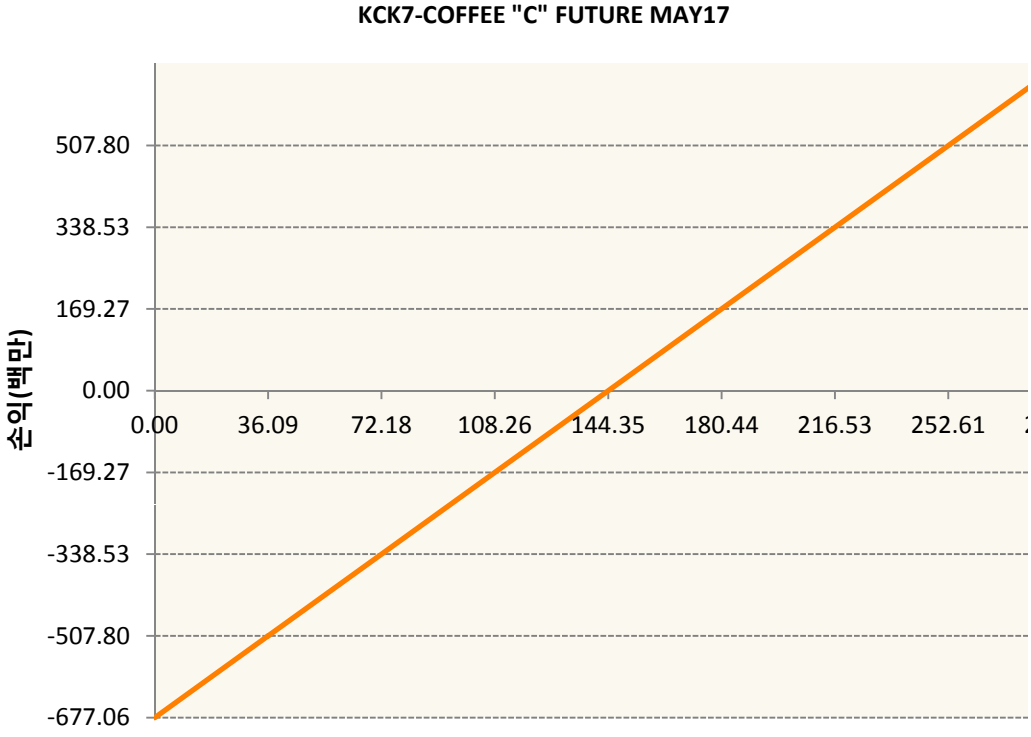
2. 만기시점의 손익구조



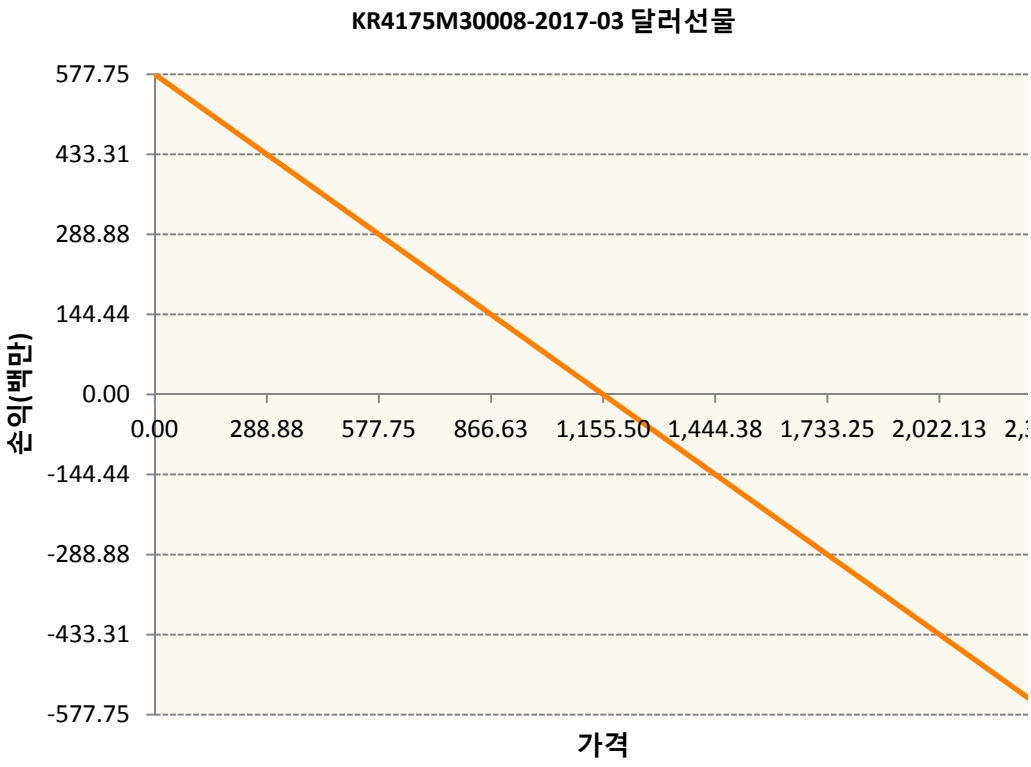


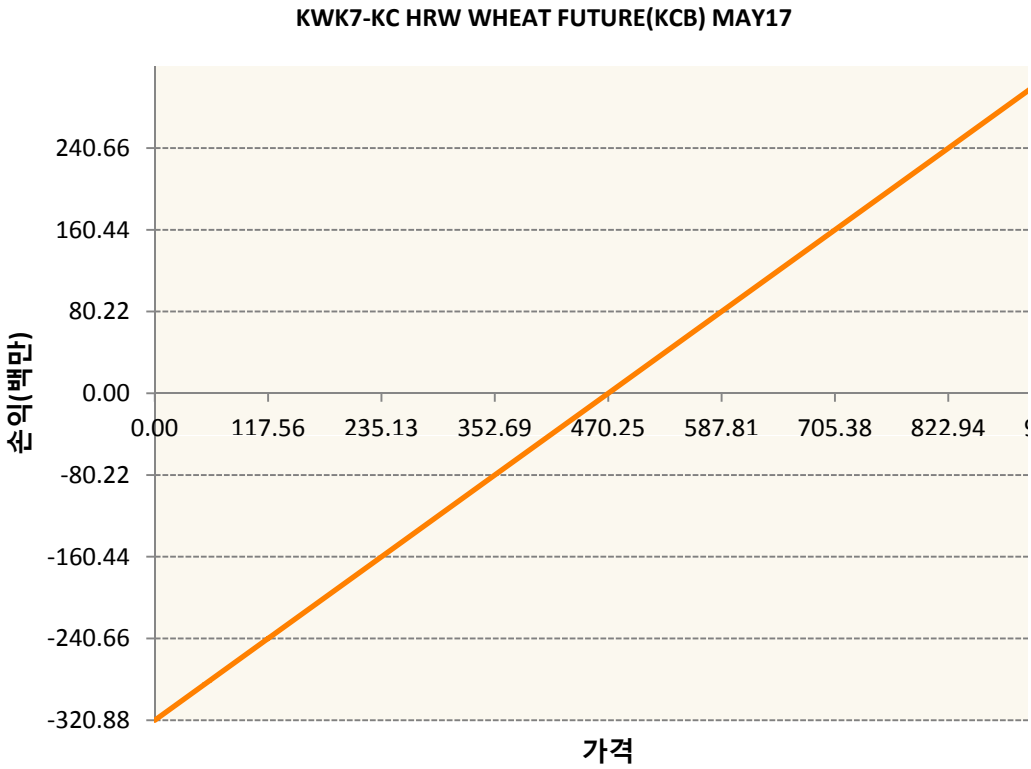

-1,780.34
-2,373.79
가격

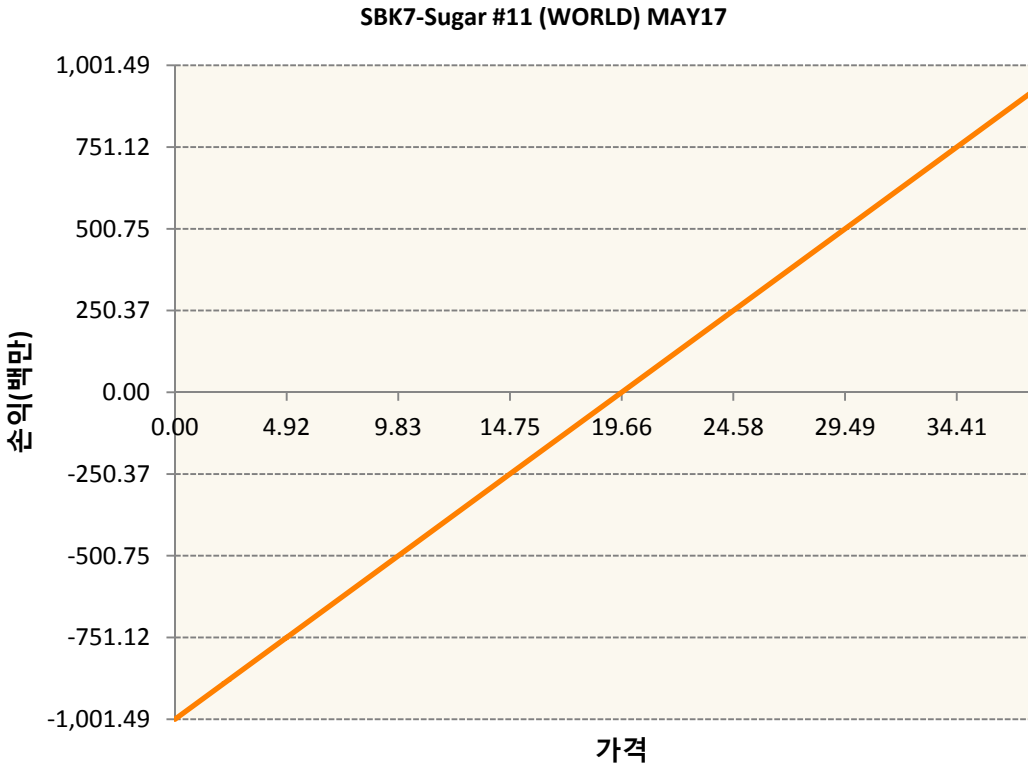

CTK7-COTTON NO.2 FUTR MAY17
349.21
261.91
174.61
87.30
0.00
-87.30
-174.61
-261.91
-349.21
0.00
19.20
38.39
57.59
76.78
95.98
115.17
134.37
손익(백만)
가격

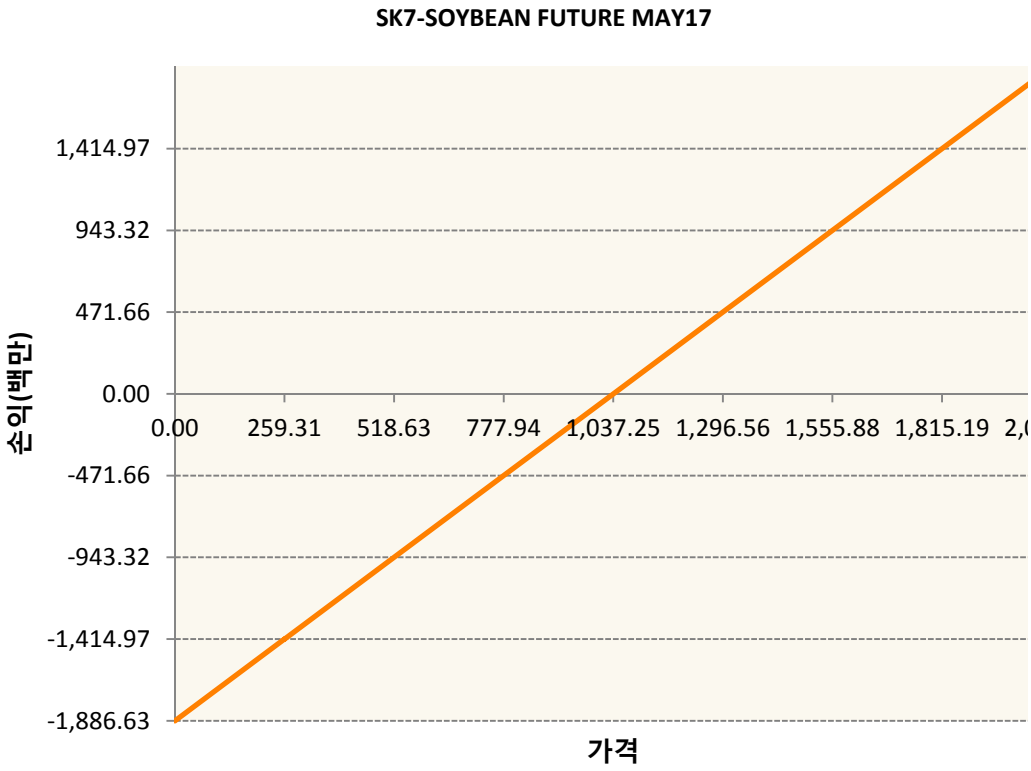

KCK7-COFFEE "C" FUTURE MAY17
507.80
338.53
169.27
0.00
-169.27
-338.53
-507.80
-677.06
0.00
36.09
72.18
108.26
144.35
180.44
216.53
252.61
손익(백만)

가격

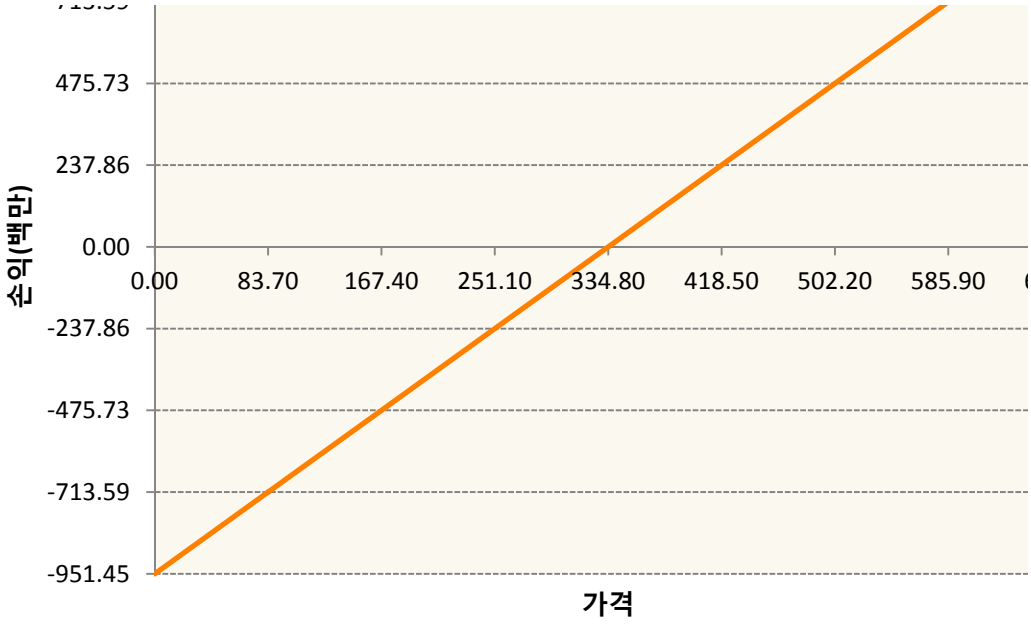

KR4175M30008-2017-03 달러선물
577.75
433.31
288.88
144.44
0.00
-144.44
-288.88
-433.31
-577.75
0.00
288.88
577.75
866.63
1,155.50
1,444.38
1,733.25
2,022.13
손익(백만)
가격

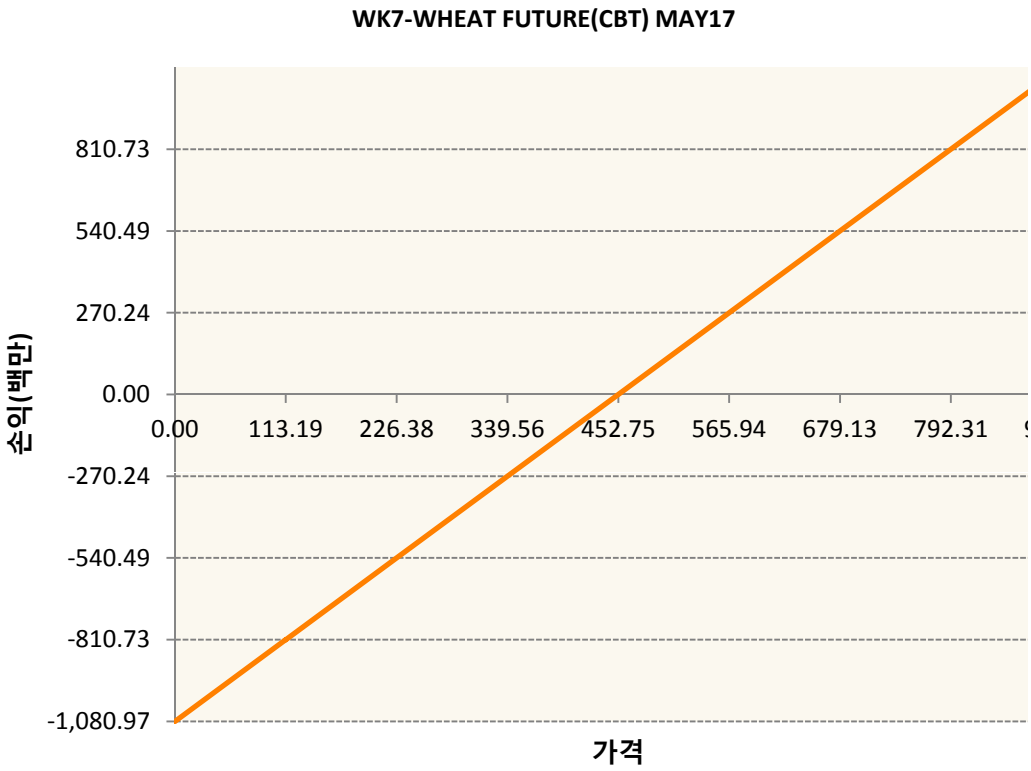

KWK7-KC HRW WHEAT FUTURE(KCB) MAY17
240.66
160.44
80.22
0.00
-80.22
-160.44
-240.66
-320.88
0.00
117.56
235.13
352.69
470.25
587.81
705.38
822.94
손익(백만)
가격


SBK7-Sugar #11 (WORLD) MAY17
1,001.49
751.12
500.75
250.37
0.00
-250.37
-500.75
-751.12
-1,001.49
0.00
4.92
9.83
14.75
19.66
24.58
29.49
34.41
손익(백만)
가격


SK7-SOYBEAN FUTURE MAY17
1,414.97
943.32
471.66
0.00
-471.66
-943.32
-1,414.97
-1,886.63
0.00
259.31
518.63
777.94
1,037.25
1,296.56
1,555.88
1,815.19
손익(백만)
가격


SMK7-SOYBEAN MEAL FUTR MAY17
951.45
713.59





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

BOK7	SOYBEAN OIL FUTR MAY17	65
CK7	CORN FUTURE MAY17	190
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	80
SK7	SOYBEAN FUTURE MAY17	151
SMK7	SOYBEAN MEAL FUTR MAY17	76
WK7	WHEAT FUTURE(CBT) MAY17	86

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

883