공시일	2017-03-07
기준일	2017-03-06

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	2017-03-07
기준일	2017-03-06

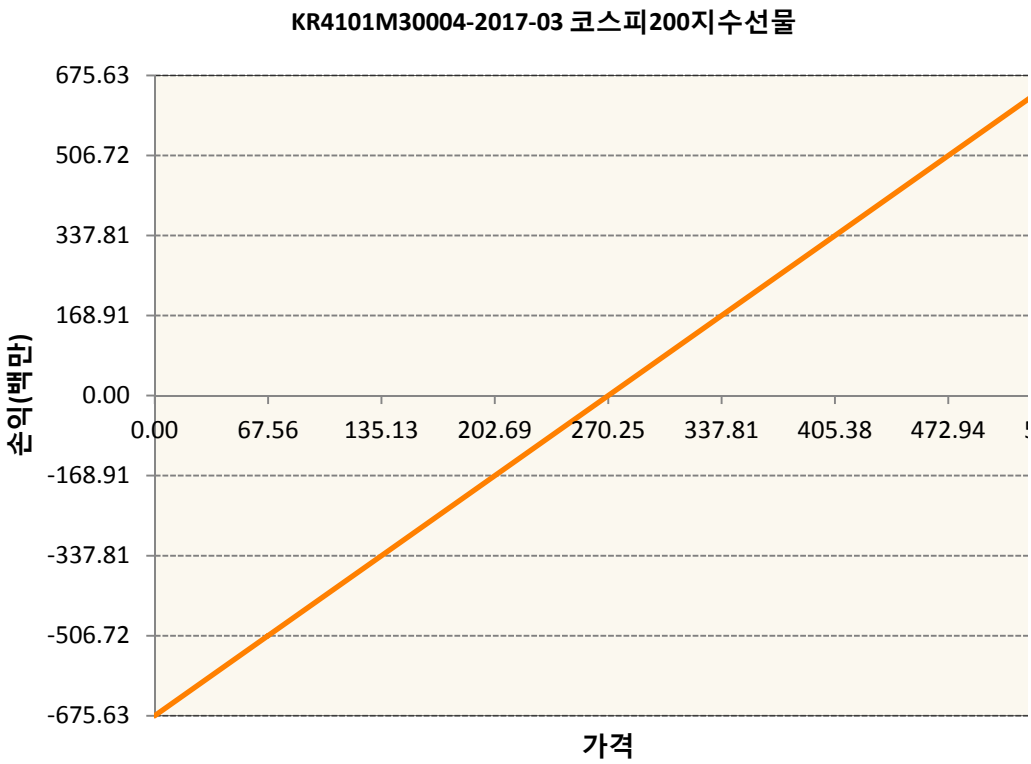
스마트인덱스모

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	2017-03-07
기준일	2017-03-06

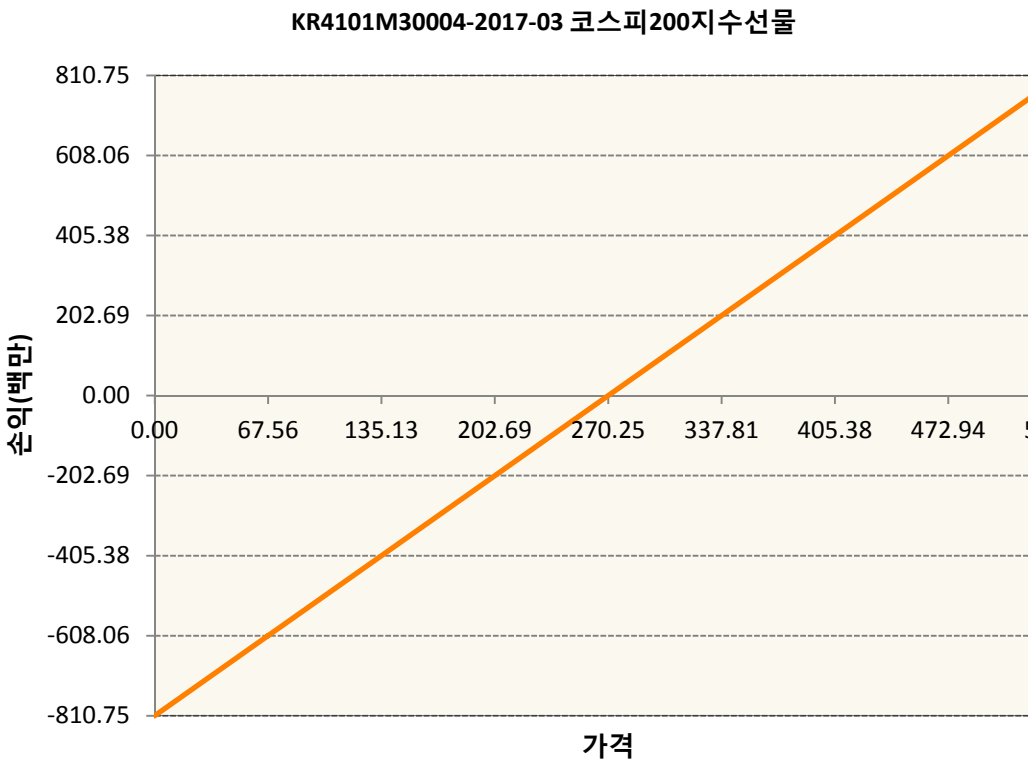
스마트레버리지목표전환형1호

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	811	0	811	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	2017-03-07
기준일	2017-03-06

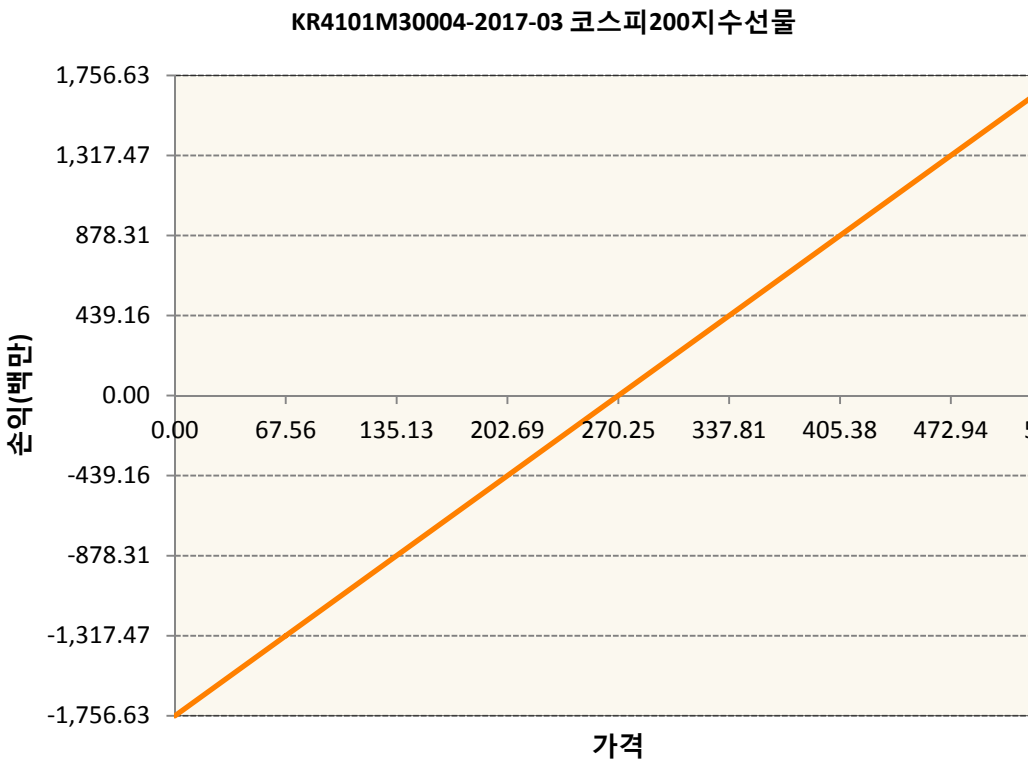
1.3배 레버리지 인덱스(주식-파생형)

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	1,757	0	1,757	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	2017-03-07
기준일	2017-03-06

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	955

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

593

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-03-07
기준일	2017-03-06

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	395

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

471

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-03-07
기준일	2017-03-06

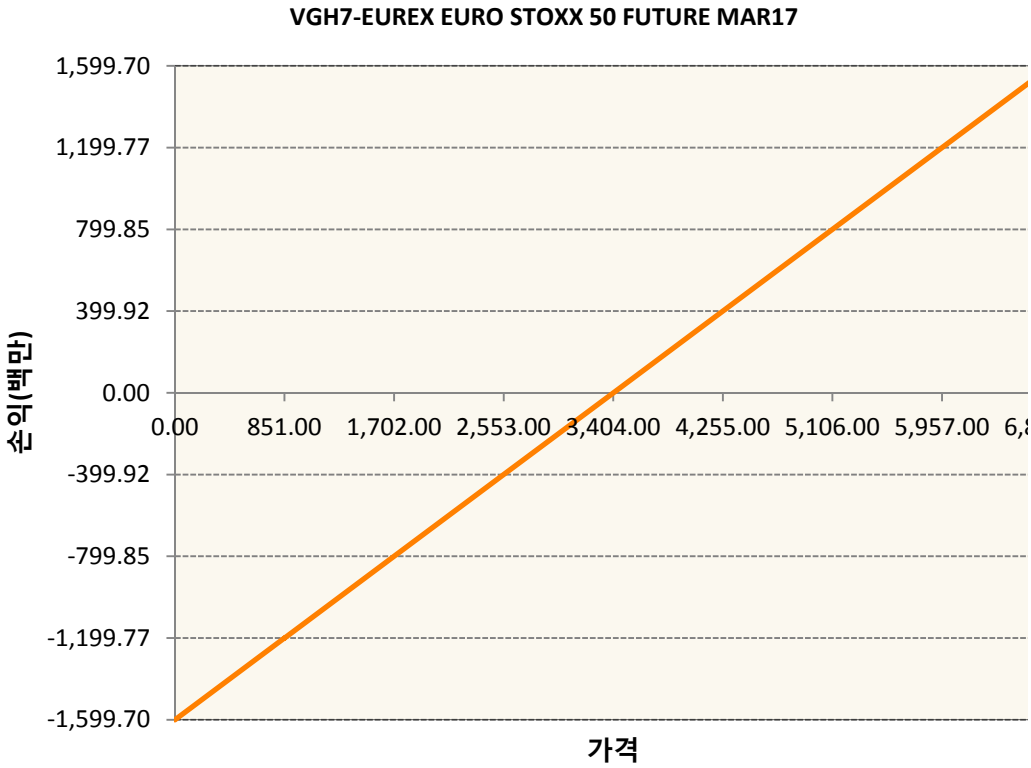
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,600	0	1,600	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGH7	EUREX EURO STOXX 50 FUTURE MAR17	128

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

(단위:백만원)

131

공시일	2017-03-07
기준일	2017-03-06

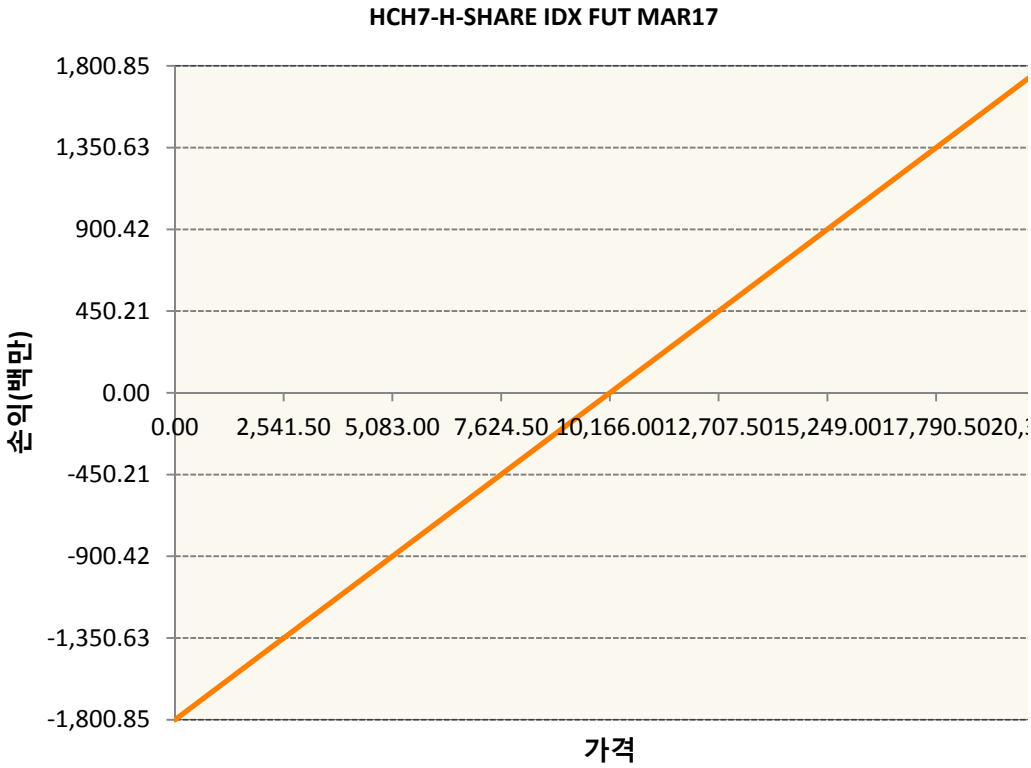
차이나인덱스모(주식-파생형)

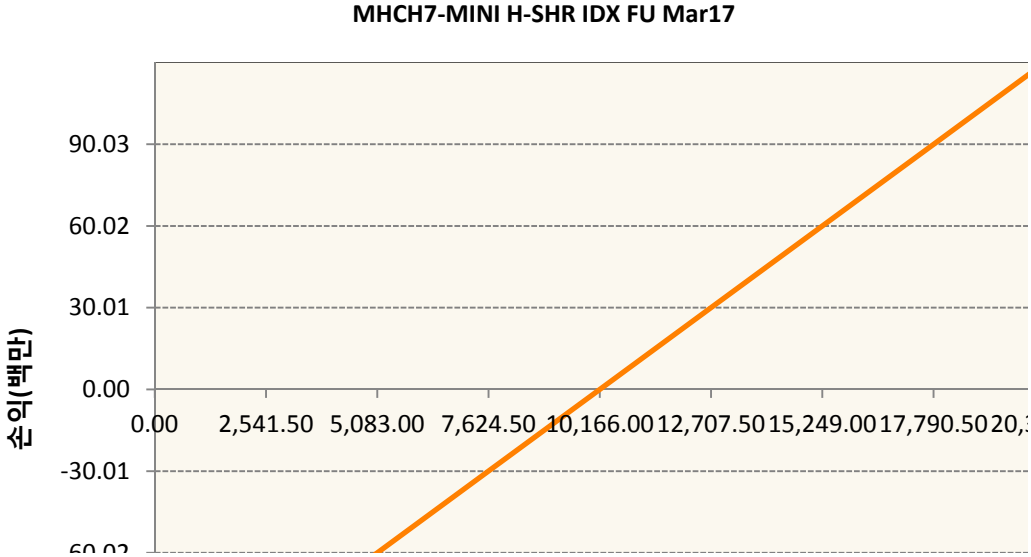
1. 계약금액

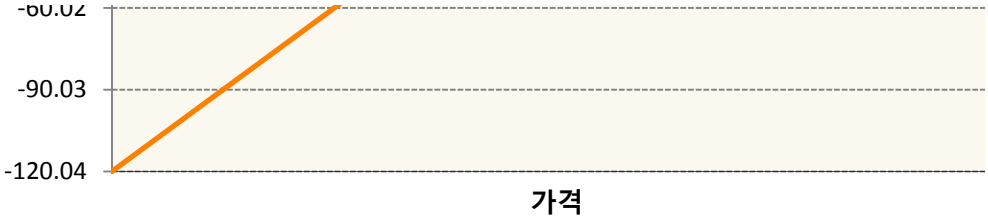
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,921	0	1,921	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

HCH7	H-SHARE IDX FUT MAR17	144
MHCH7	MINI H-SHR IDX FU Mar17	10

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

172

공시일	2017-03-07
기준일	2017-03-06

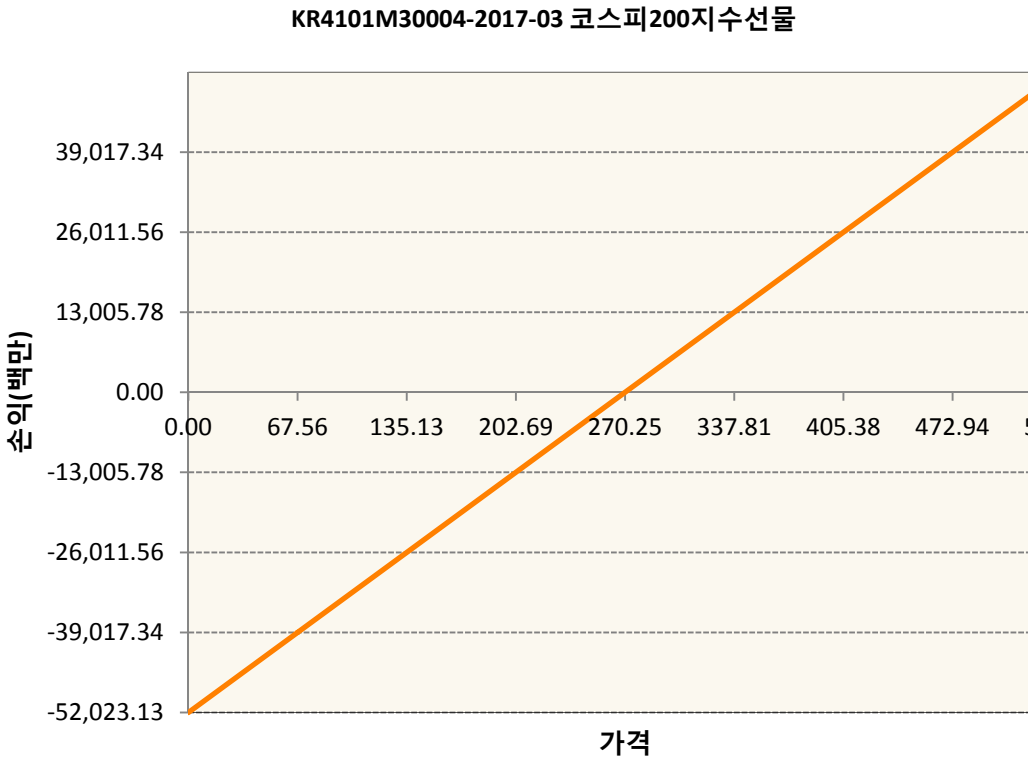
커버드콜모(주식혼합-파생형)

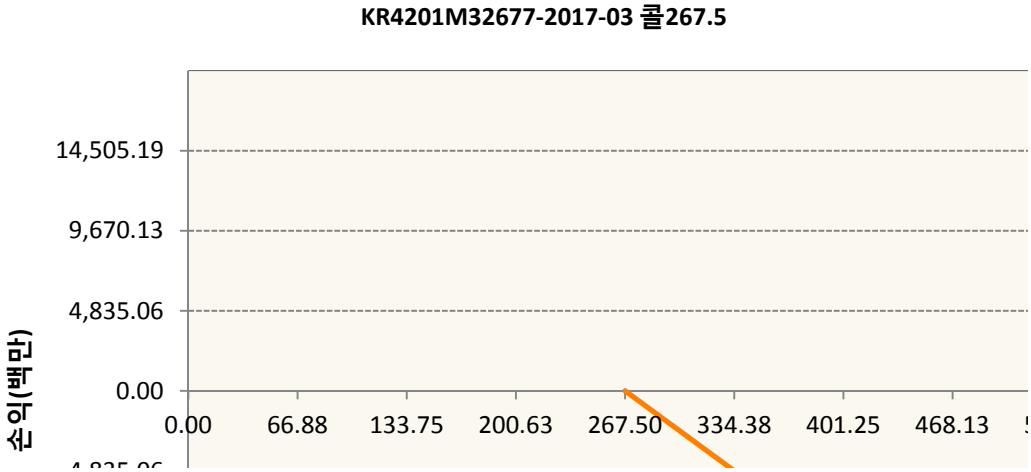
1. 계약금액

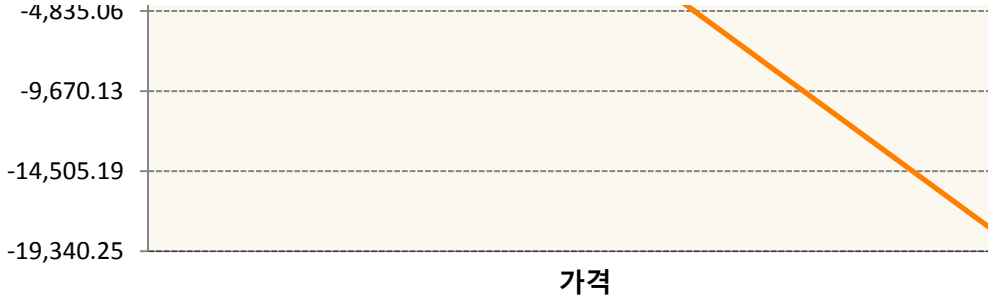
(단위:백만원)

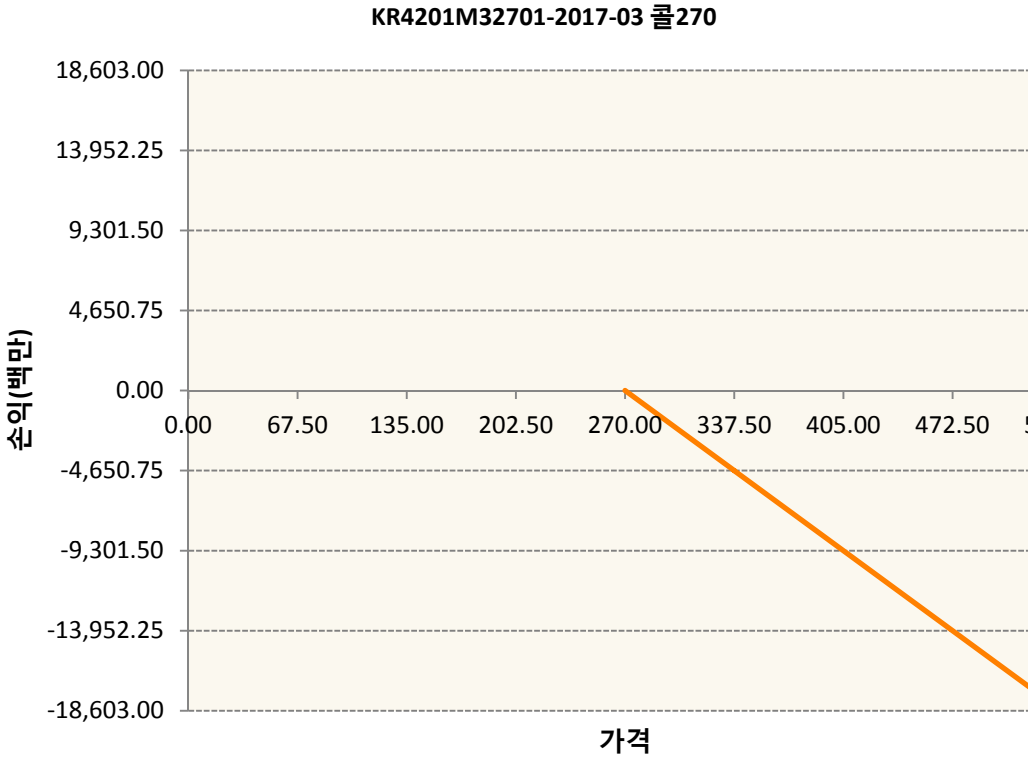
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	814	-814	장내
누계	유가증권	선물	52,023	0	52,023	장내
누계	유가증권	옵션	0	37,943	-37,943	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101M30(2017-03 코스피200지수선물							4,164
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-4,164	-4,164	-4,164	-4,164	-4,164	-4,164	-4,164
-5.33%	-2,776	-2,776	-2,776	-2,776	-2,776	-2,776	-2,776
-2.67%	-1,388	-1,388	-1,388	-1,388	-1,388	-1,388	-1,388
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	1,388	1,388	1,388	1,388	1,388	1,388	1,388
5.33%	2,776	2,776	2,776	2,776	2,776	2,776	2,776
8.00%	4,164	4,164	4,164	4,164	4,164	4,164	4,164
KR4201M32(2017-03 콜267.5							7,754
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,116	1,116	1,116	1,116	1,116	1,116	1,116
-5.33%	1,116	1,116	1,116	1,116	1,116	1,116	1,116
-2.67%	1,112	1,109	1,103	1,096	1,088	1,077	1,065
0%	43	31	16	0	-18	-38	-59
2.67%	-2,541	-2,541	-2,541	-2,541	-2,541	-2,541	-2,541
5.33%	-5,147	-5,147	-5,147	-5,147	-5,147	-5,147	-5,147
8.00%	-7,754	-7,754	-7,754	-7,754	-7,754	-7,754	-7,754
KR4201M32 : 2017-03 콜270							7,153

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	439	439	439	439	439	439	439
-5.33%	439	439	439	439	439	439	439
-2.67%	439	438	438	437	436	434	431
0%	90	60	30	0	-30	-60	-90
2.67%	-2,185	-2,185	-2,185	-2,186	-2,186	-2,188	-2,190
5.33%	-4,669	-4,669	-4,669	-4,669	-4,669	-4,669	-4,669
8.00%	-7,153	-7,153	-7,153	-7,153	-7,153	-7,153	-7,153

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

25,469

공시일	2017-03-07
기준일	2017-03-06

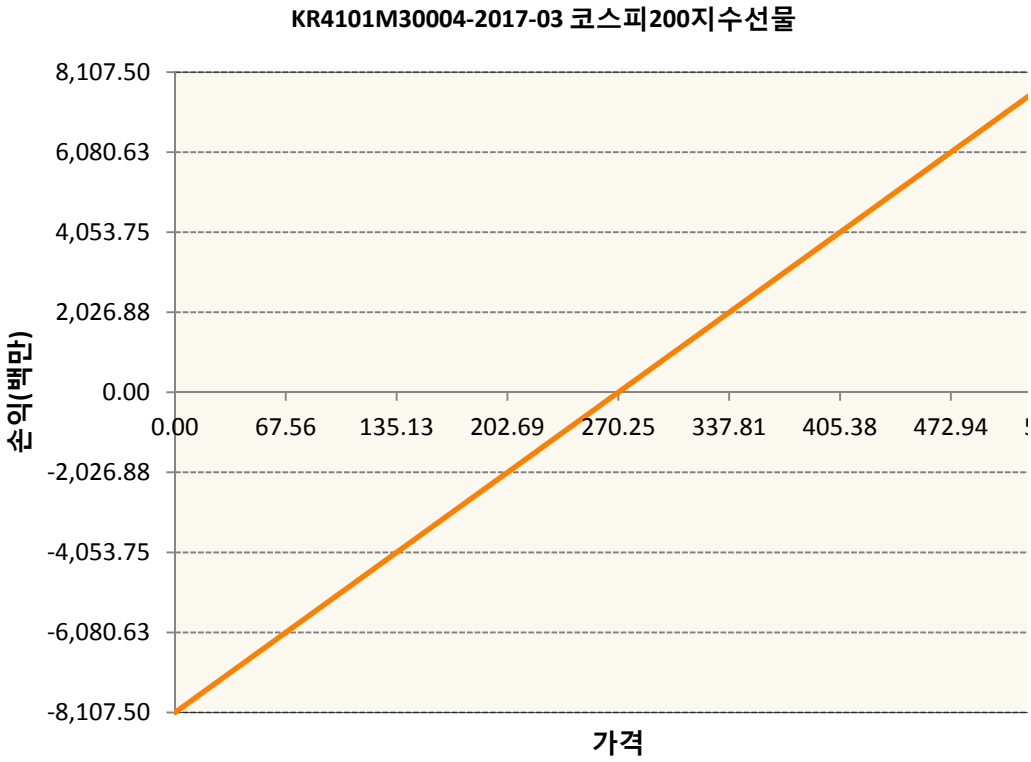
커버드콜목표전환형증권투자신탁

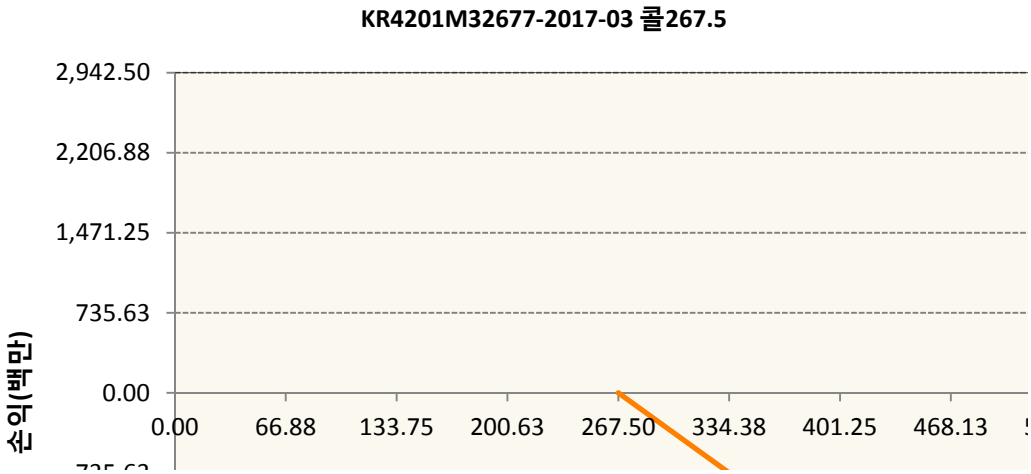
1. 계약금액

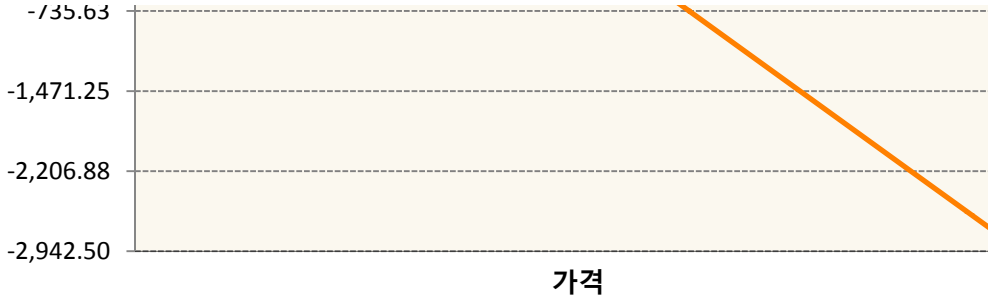
(단위:백만원)

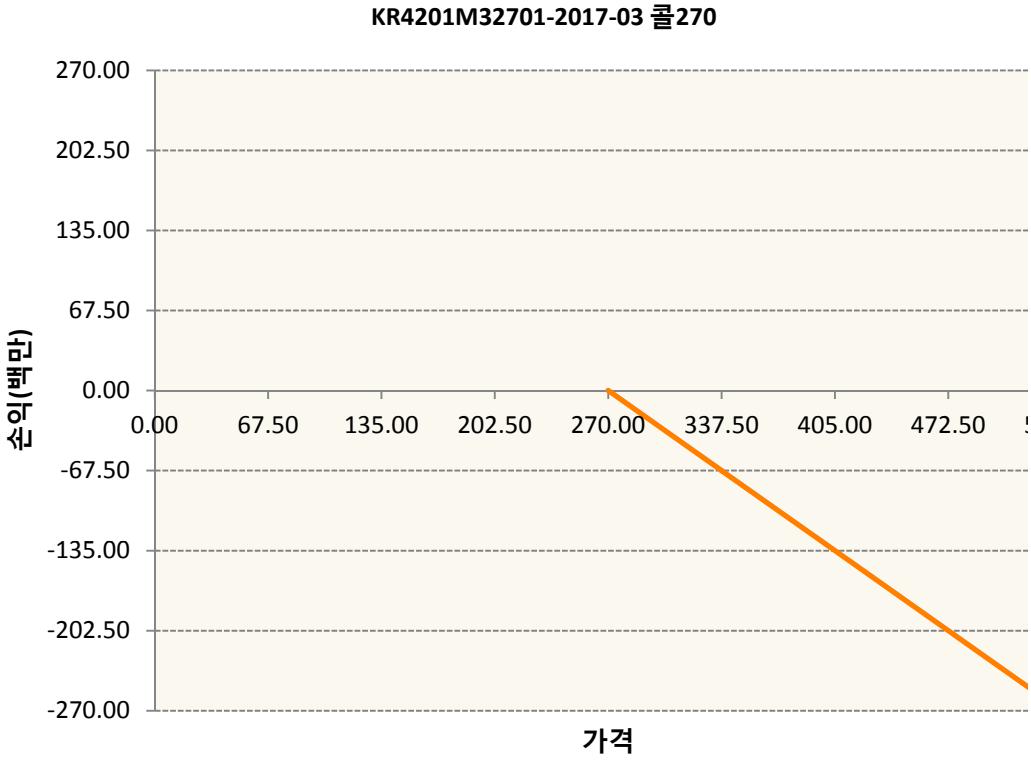
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	1,351	-1,351	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	8,108	0	8,108	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,213	-3,213	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101M30(2017-03 코스피200지수선물							649
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-649	-649	-649	-649	-649	-649	-649
-5.33%	-433	-433	-433	-433	-433	-433	-433
-2.67%	-216	-216	-216	-216	-216	-216	-216
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	216	216	216	216	216	216	216
5.33%	433	433	433	433	433	433	433
8.00%	649	649	649	649	649	649	649
KR4201M32(2017-03 콜267.5							1,180
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	170	170	170	170	170	170	170
-5.33%	170	170	170	170	170	170	170
-2.67%	169	169	168	167	165	164	162
0%	7	5	2	0	-3	-6	-9
2.67%	-387	-387	-387	-387	-387	-387	-387
5.33%	-783	-783	-783	-783	-783	-783	-783
8.00%	-1,180	-1,180	-1,180	-1,180	-1,180	-1,180	-1,180
	KR4201M32 : 2017-03 콜270						104

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	6	6	6	6	6	6	6
-5.33%	6	6	6	6	6	6	6
-2.67%	6	6	6	6	6	6	6
0%	1	1	0	0	0	-1	-1
2.67%	-32	-32	-32	-32	-32	-32	-32
5.33%	-68	-68	-68	-68	-68	-68	-68
8.00%	-104	-104	-104	-104	-104	-104	-104

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

2,340

공시일	2017-03-07
기준일	2017-03-06

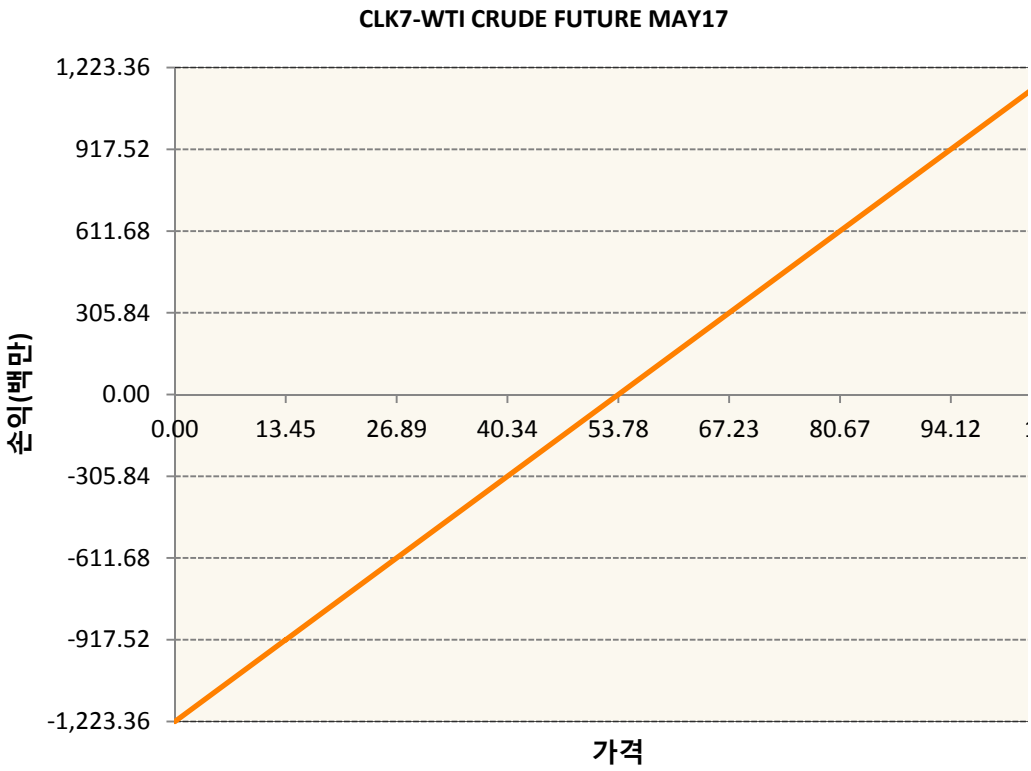
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

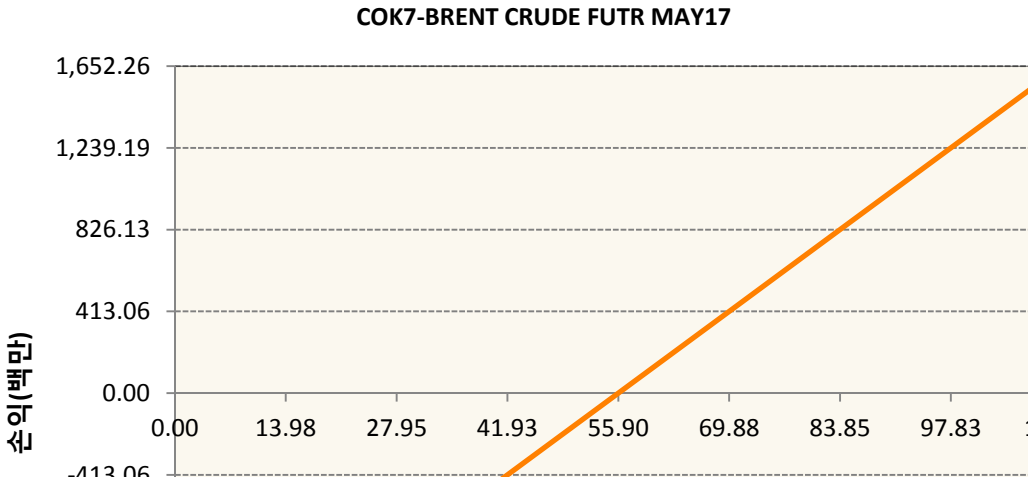
1. 계약금액

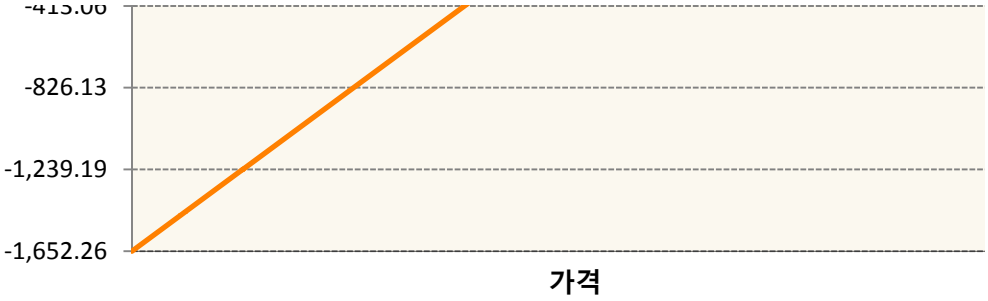
(단위:백만원)

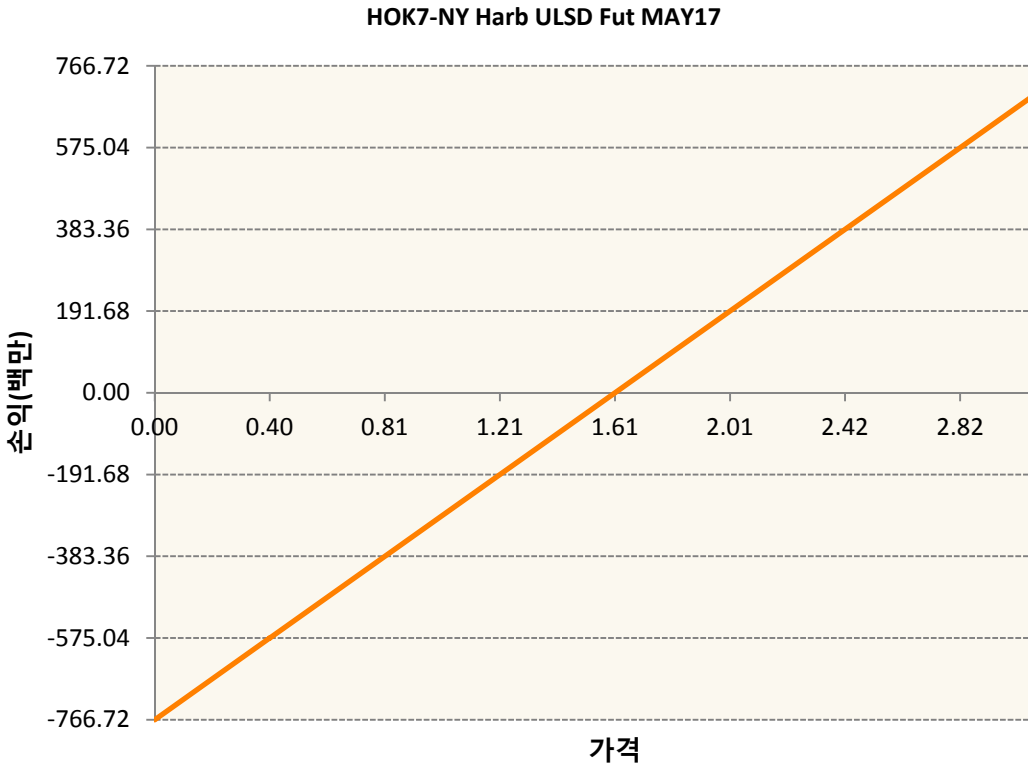
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	선물	유가증권	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	선물	유가증권	1,223	0	1,223	
누계	유가증권	선물	4,578	416	4,161	

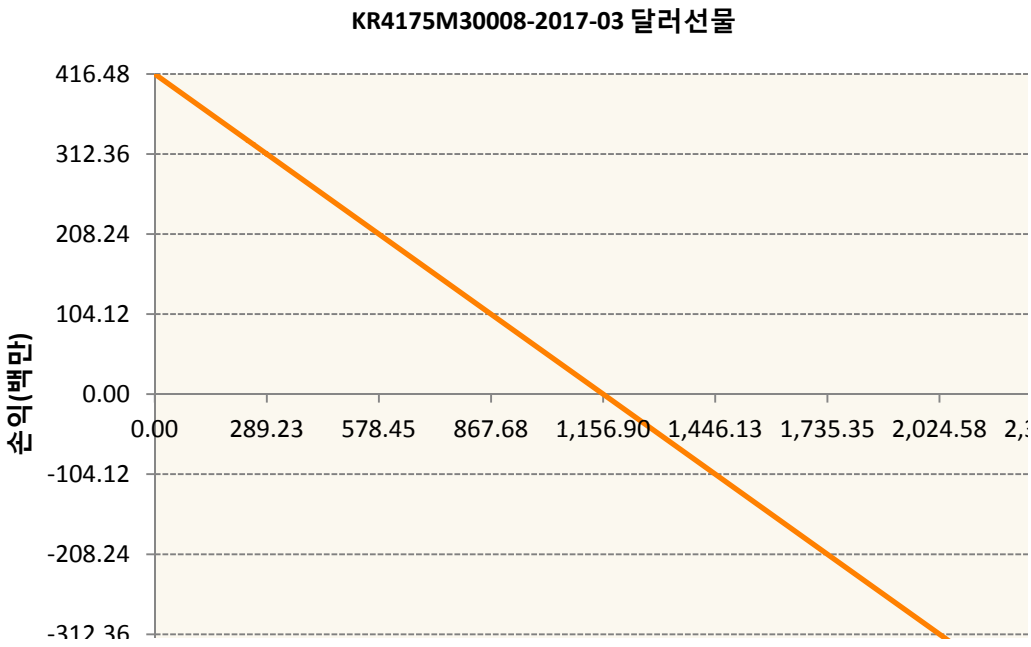
2. 만기시점의 손익구조

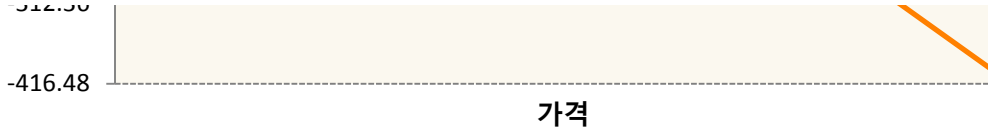


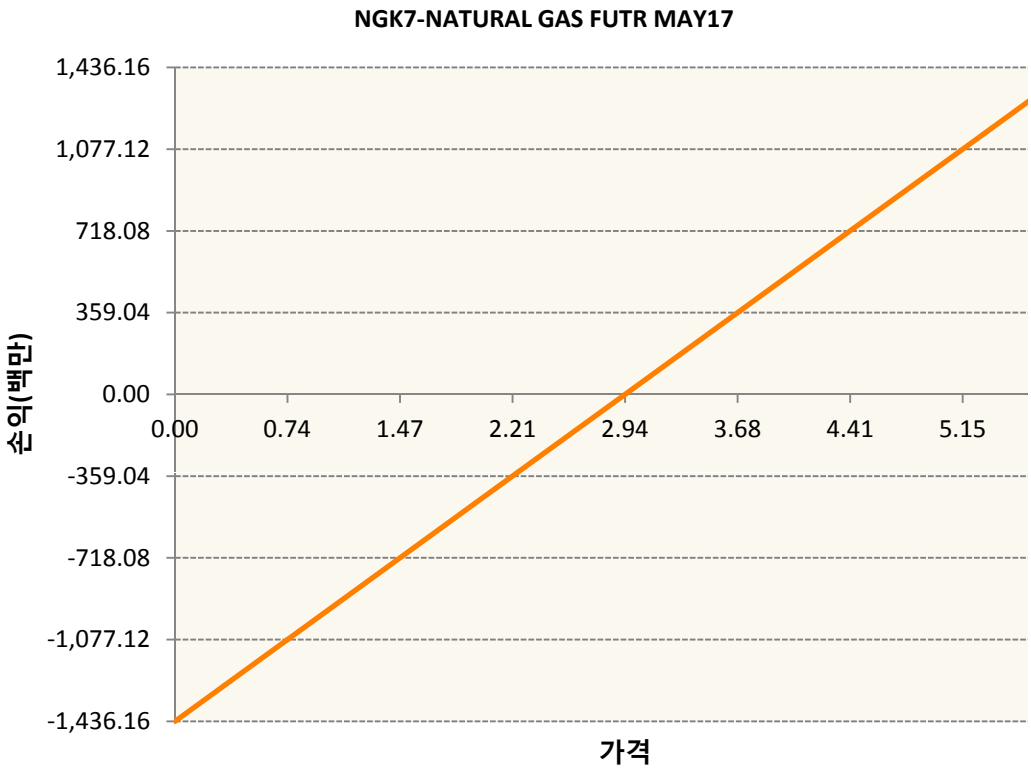


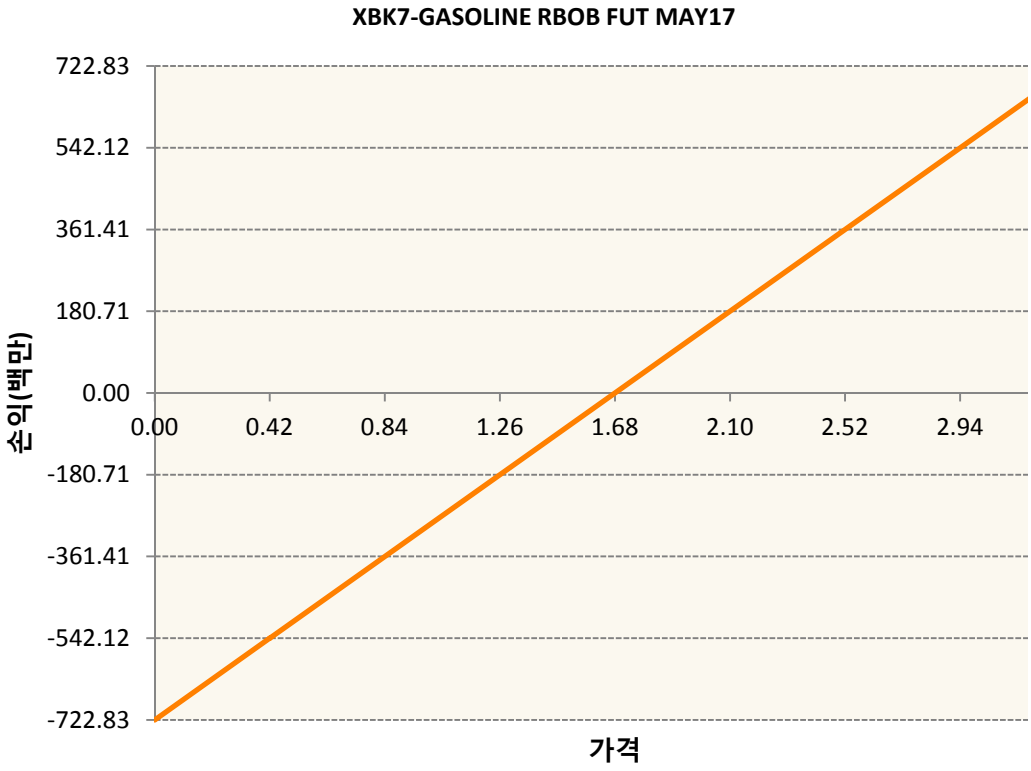

-826.13
-1,239.19
-1,652.26
가격


HOK7-NY Harb ULSD Fut MAY17
766.72
575.04
383.36
191.68
0.00
-191.68
-383.36
-575.04
-766.72
0.00
0.40
0.81
1.21
1.61
2.01
2.42
2.82
순익(백만)
가격


KR4175M30008-2017-03 달러선물
416.48
312.36
208.24
104.12
0.00
-104.12
-208.24
0.00
289.23
578.45
867.68
1,156.90
1,446.13
1,735.35
2,024.58
순익(백만)


-416.48
가격


NGK7-NATURAL GAS FUTR MAY17
1,436.16
1,077.12
718.08
359.04
0.00
-359.04
-718.08
-1,077.12
-1,436.16
0.00
0.74
1.47
2.21
2.94
3.68
4.41
5.15
순익(백만)
가격


XBK7-GASOLINE RBOB FUT MAY17
722.83
542.12
361.41
180.71
0.00
-180.71
-361.41
-542.12
-722.83
0.00
0.42
0.84
1.26
1.68
2.10
2.52
2.94
순익(백만)
가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLK7	WTI CRUDE FUTURE MAY17	98
COK7	BRENT CRUDE FUTR MAY17	132
HOK7	NY Harb ULSD Fut MAY17	61
KR4175M30(	2017-03 달러선물	33
NGK7	NATURAL GAS FUTR MAY17	115
XBK7	GASOLINE RBOB FUT MAY17	58

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

1,029

공시일	2017-03-07
기준일	2017-03-06

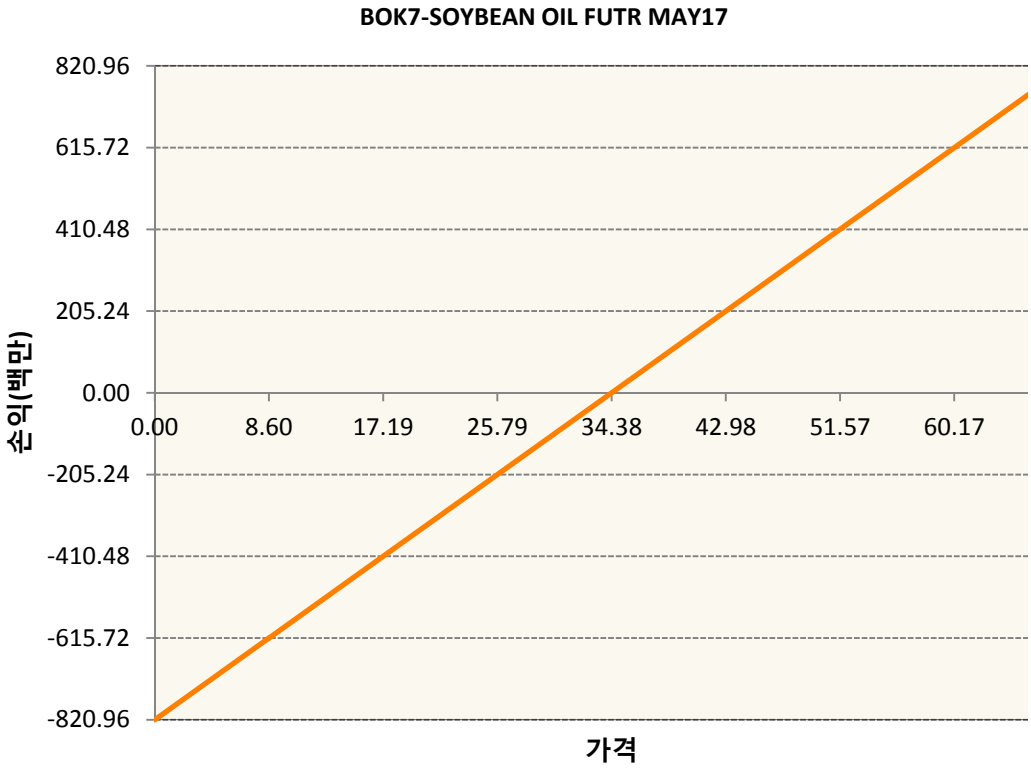
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

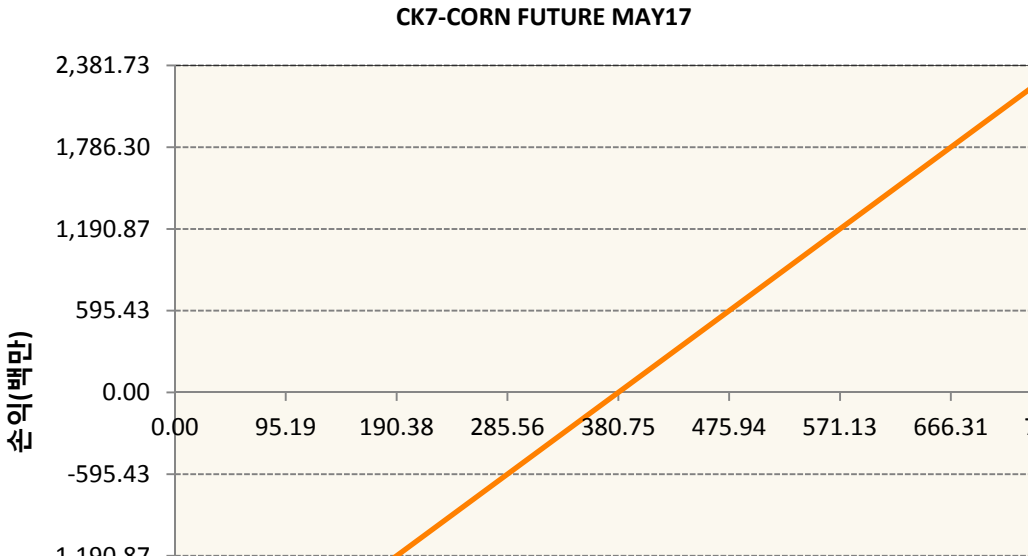
1. 계약금액

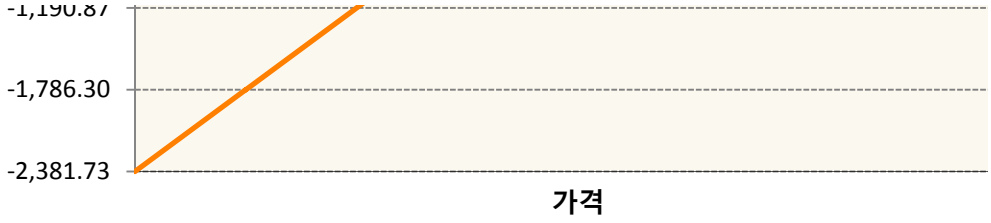
(단위:백만원)

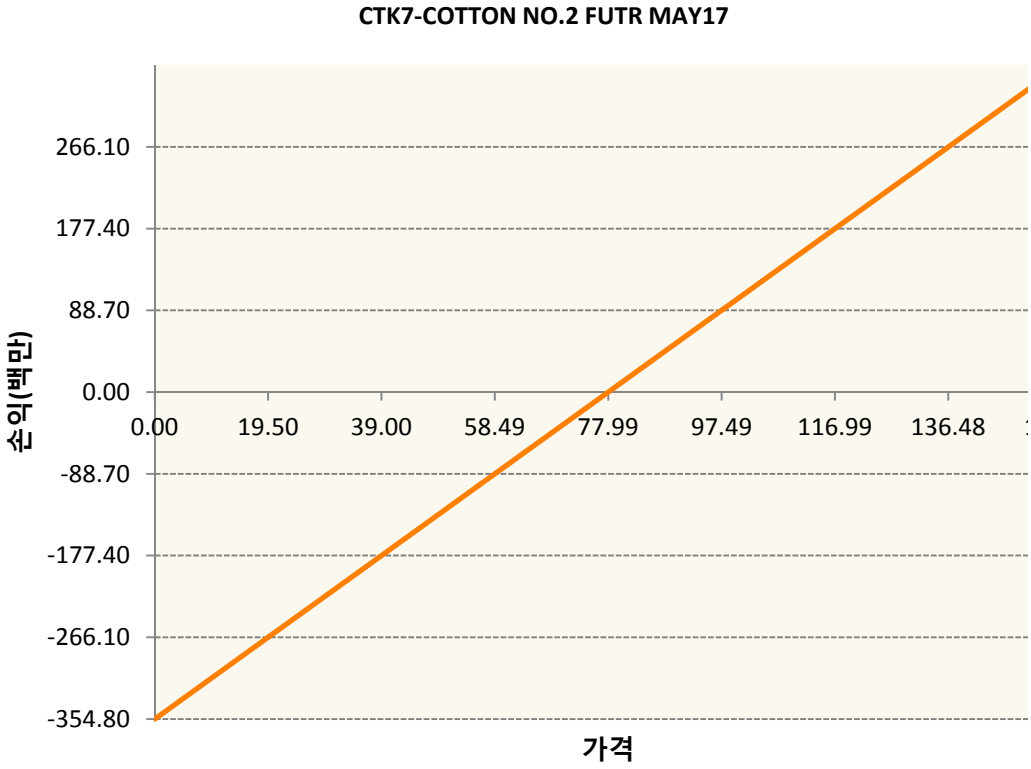
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	9,462	578	8,883	

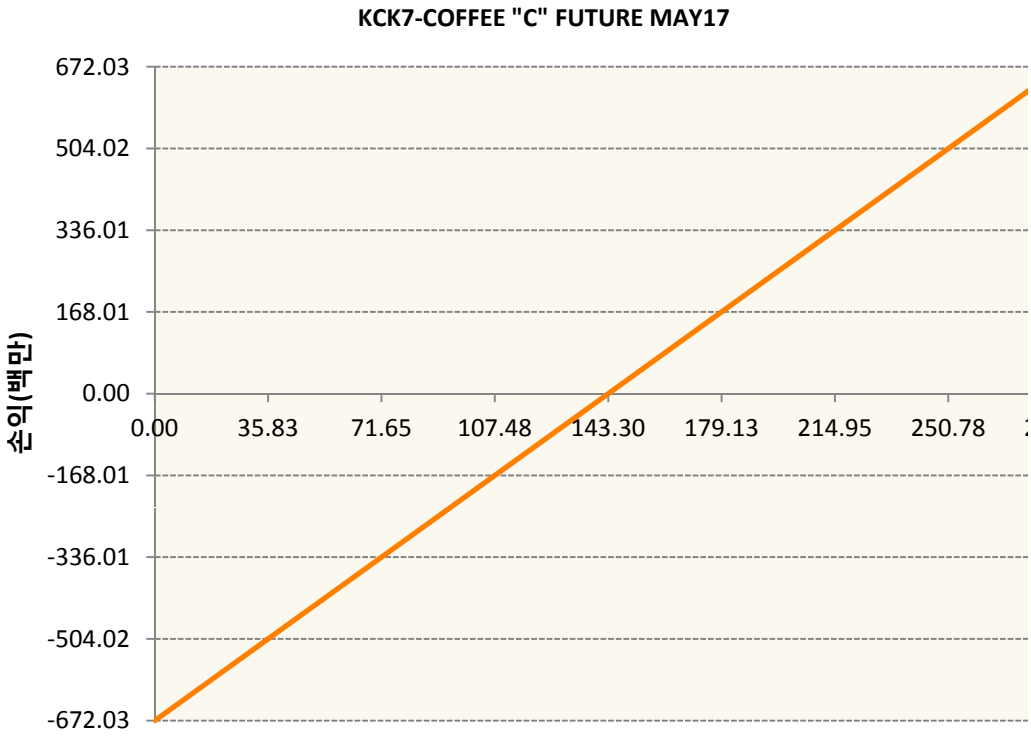
2. 만기시점의 손익구조



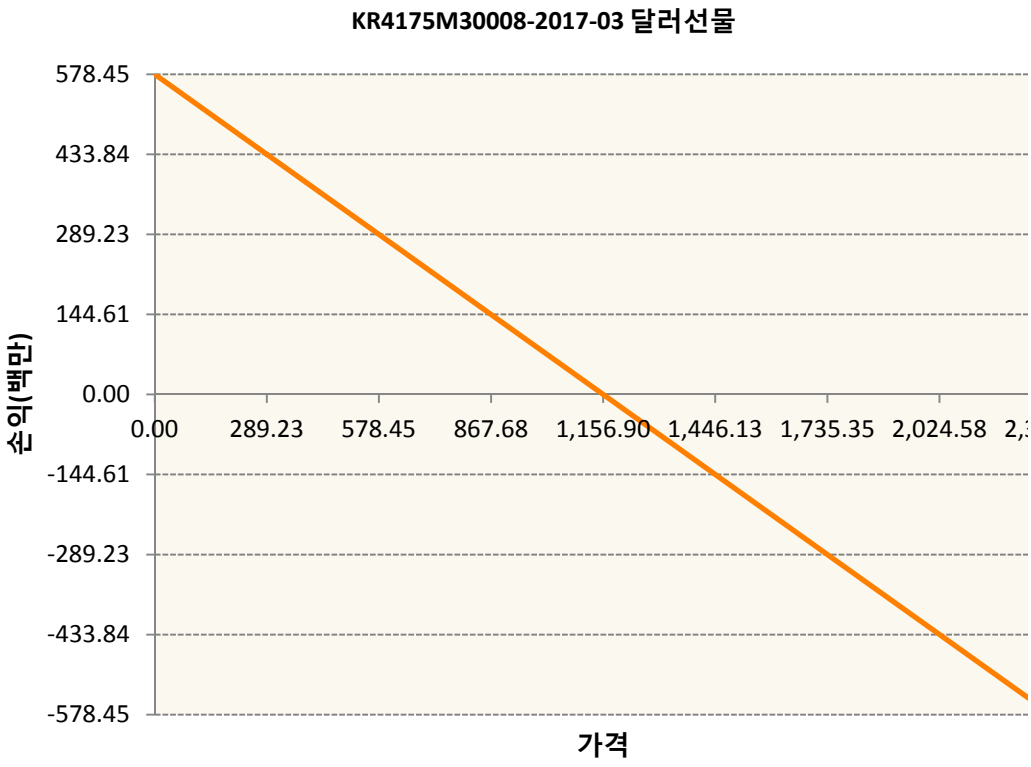


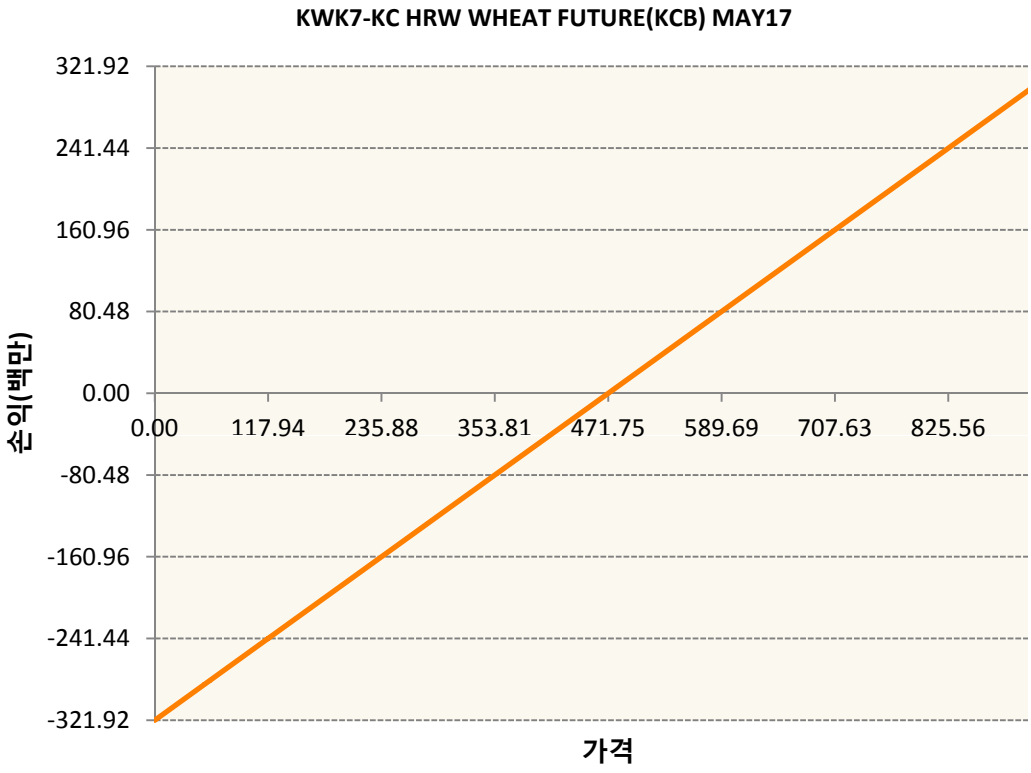

-1,786.30
-2,381.73
가격

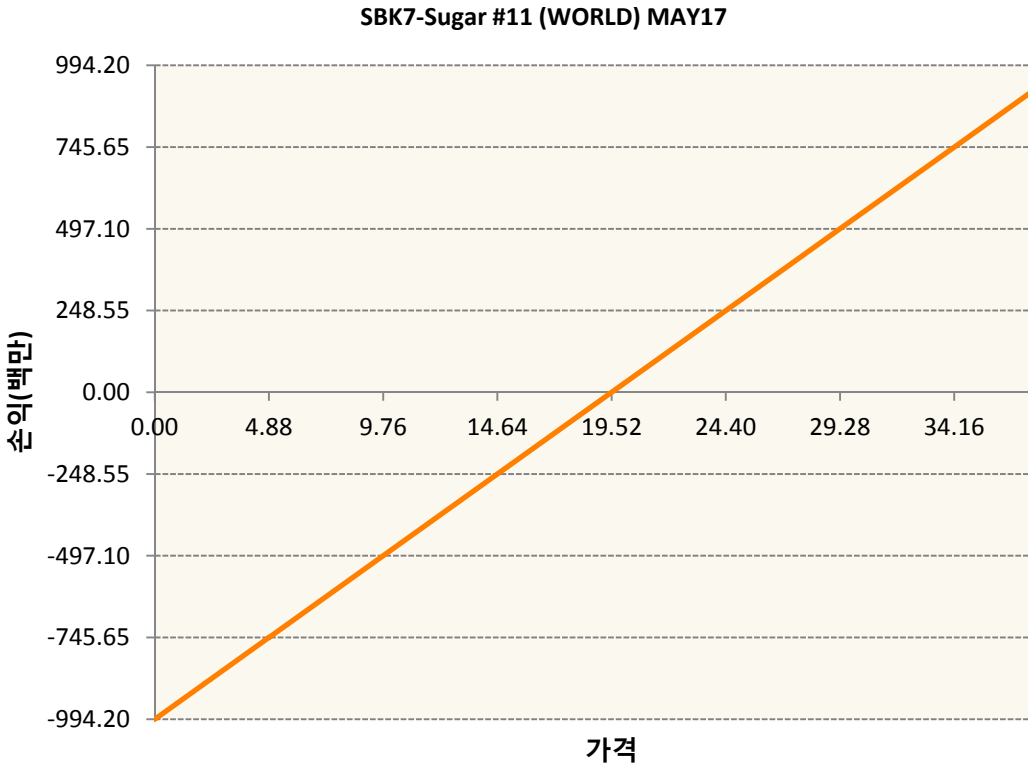

CTK7-COTTON NO.2 FUTR MAY17
266.10
177.40
88.70
0.00
-88.70
-177.40
-266.10
-354.80
0.00
19.50
39.00
58.49
77.99
97.49
116.99
136.48
순익(백만)
가격

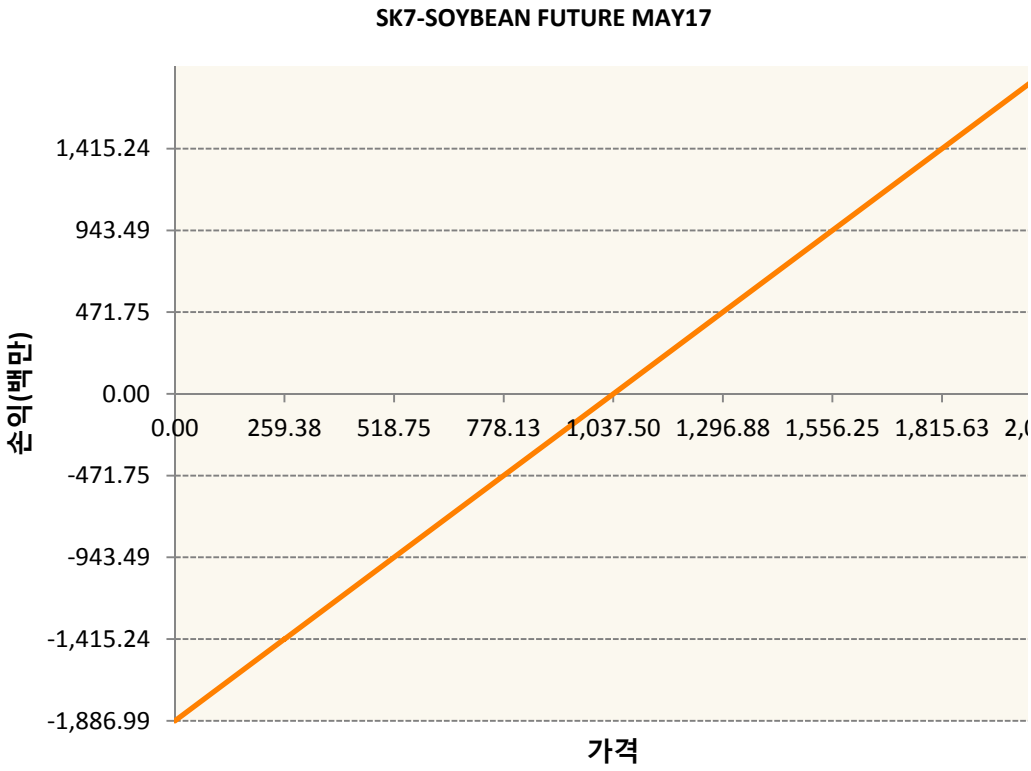

KCK7-COFFEE "C" FUTURE MAY17
672.03
504.02
336.01
168.01
0.00
-168.01
-336.01
-504.02
-672.03
0.00
35.83
71.65
107.48
143.30
179.13
214.95
250.78
순익(백만)

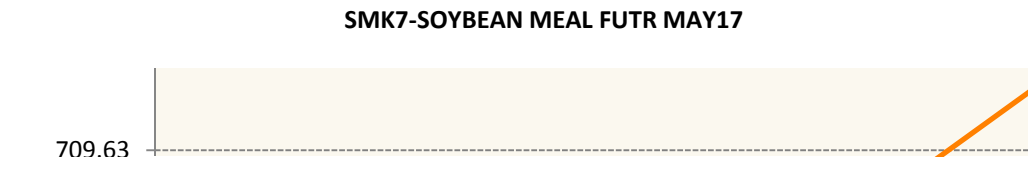
가격

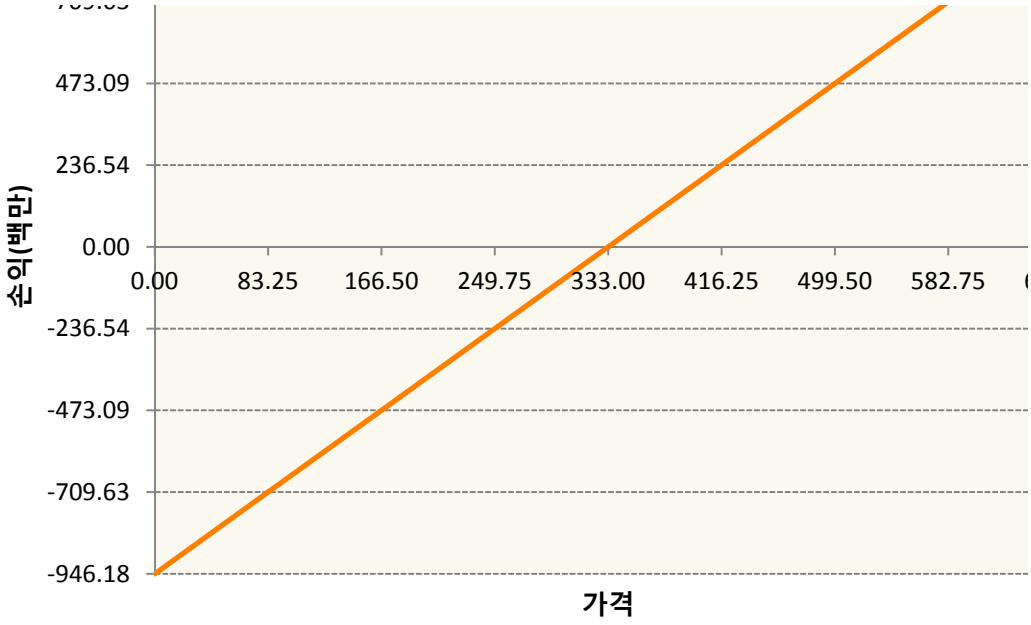

KR4175M30008-2017-03 달러선물
578.45
433.84
289.23
144.61
0.00
-144.61
-289.23
-433.84
-578.45
0.00
289.23
578.45
867.68
1,156.90
1,446.13
1,735.35
2,024.58
손익(만원)
가격

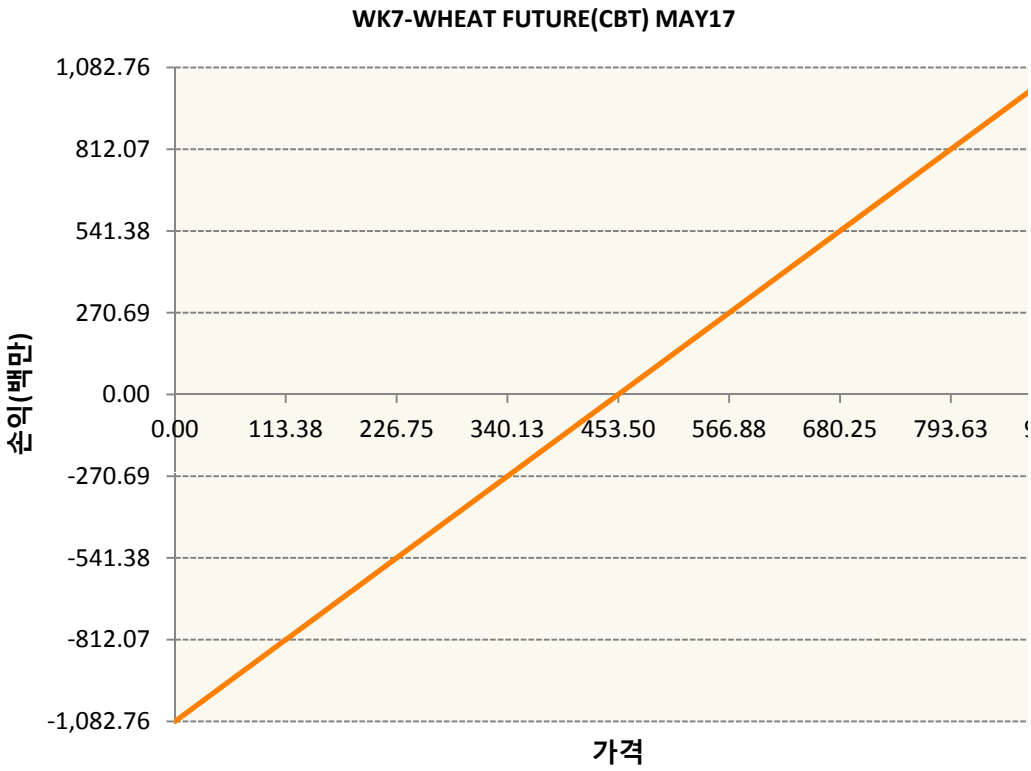

KWK7-KC HRW WHEAT FUTURE(KCB) MAY17
321.92
241.44
160.96
80.48
0.00
-80.48
-160.96
-241.44
-321.92
0.00
117.94
235.88
353.81
471.75
589.69
707.63
825.56
손익(만원)
가격


SBK7-Sugar #11 (WORLD) MAY17
994.20
745.65
497.10
248.55
0.00
-248.55
-497.10
-745.65
-994.20
0.00
4.88
9.76
14.64
19.52
24.40
29.28
34.16
손익(백만)
가격


SK7-SOYBEAN FUTURE MAY17
1,415.24
943.49
471.75
0.00
-471.75
-943.49
-1,415.24
-1,886.99
0.00
259.38
518.75
778.13
1,037.50
1,296.88
1,556.25
1,815.63
손익(백만)
가격


SMK7-SOYBEAN MEAL FUTR MAY17
709.63





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	80
SK7	SOYBEAN FUTURE MAY17	151
SMK7	SOYBEAN MEAL FUTR MAY17	76
WK7	WHEAT FUTURE(CBT) MAY17	87

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

884