공시일	2017-03-08
기준일	2017-03-07

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	2017-03-08
기준일	2017-03-07

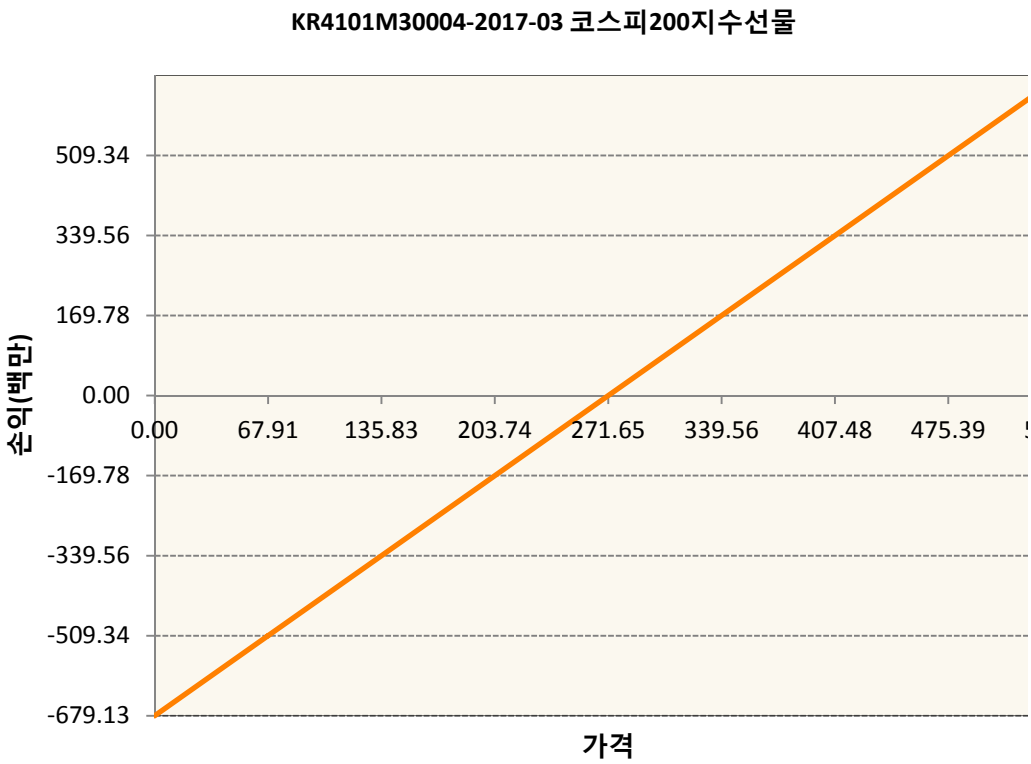
스마트인덱스모

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	679	0	679	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	2017-03-08
기준일	2017-03-07

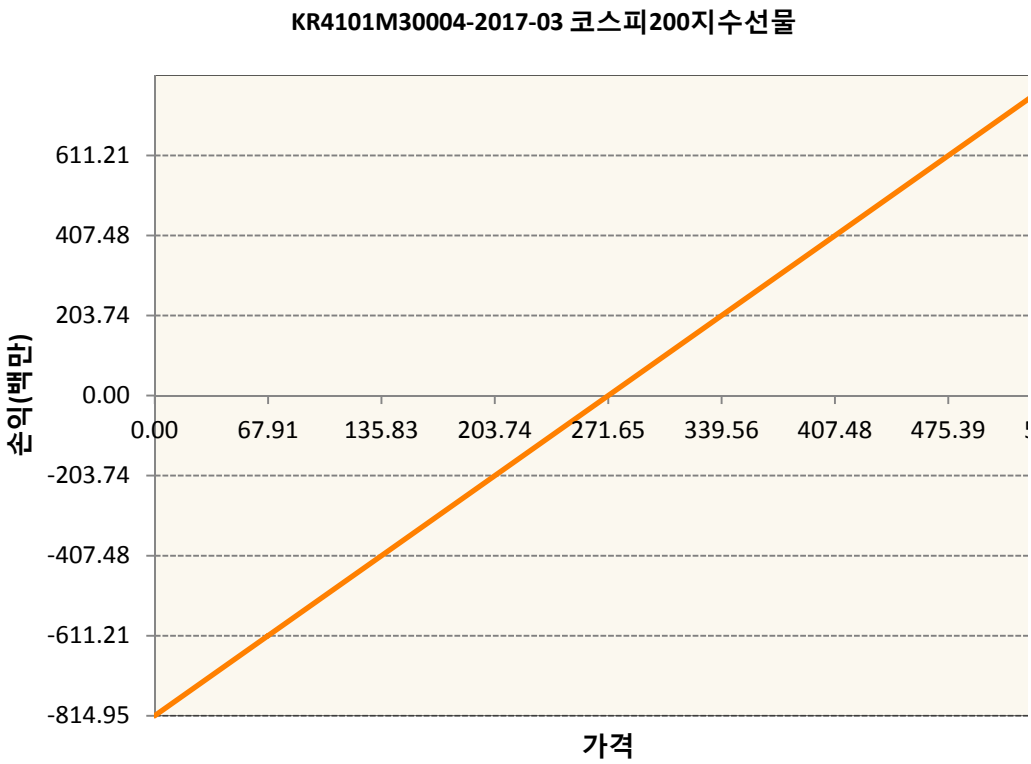
스마트레버리지목표전환형1호

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	815	0	815	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	2017-03-08
기준일	2017-03-07

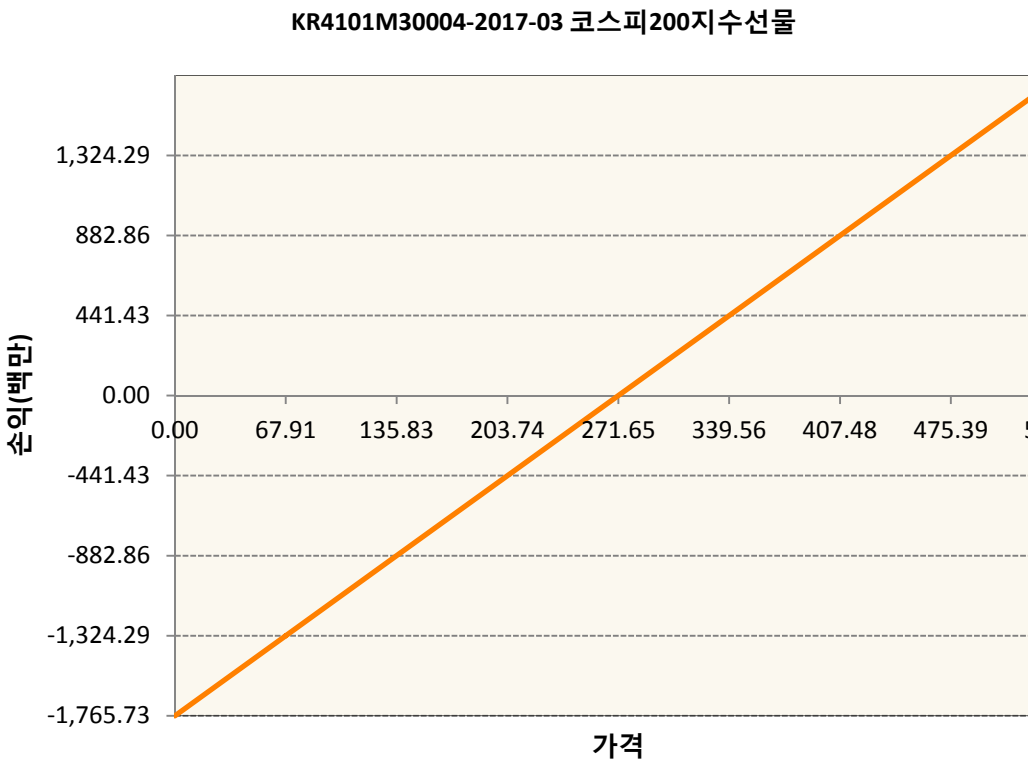
1.3배 레버리지 인덱스(주식-파생형)

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	1,766	0	1,766	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	2017-03-08
기준일	2017-03-07

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	953

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

591

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-03-08
기준일	2017-03-07

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)

469

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-03-08
기준일	2017-03-07

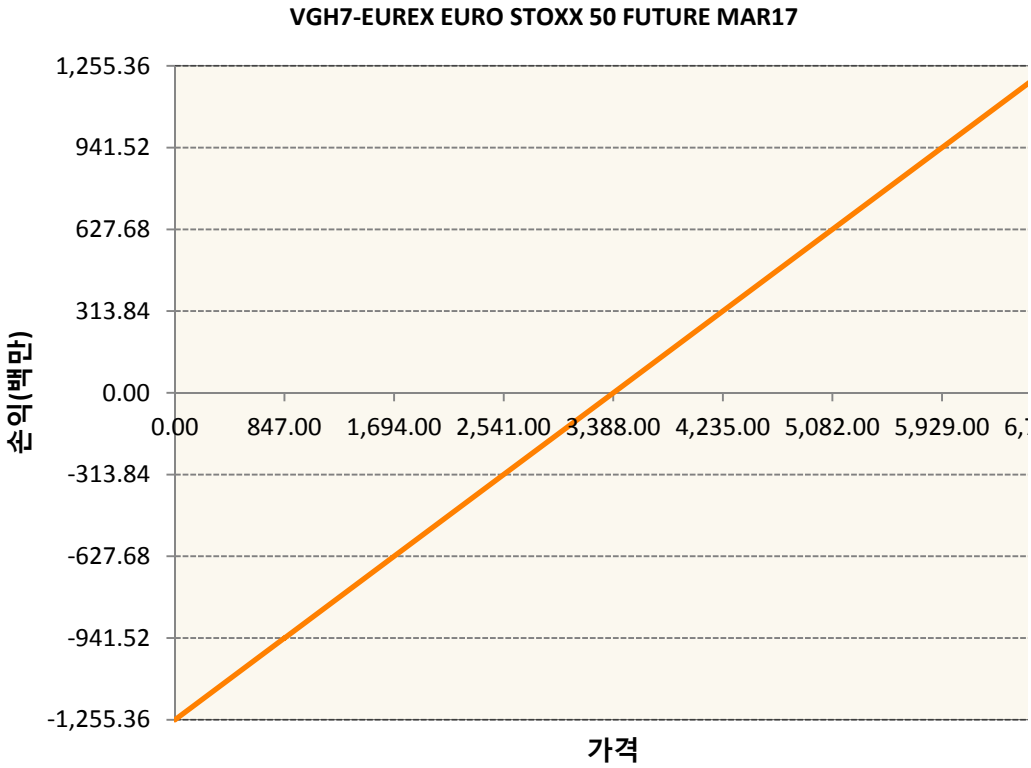
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,255	0	1,255	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGH7	EUREX EURO STOXX 50 FUTURE MAR17	100

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

(단위:백만원)

102

공시일	2017-03-08
기준일	2017-03-07

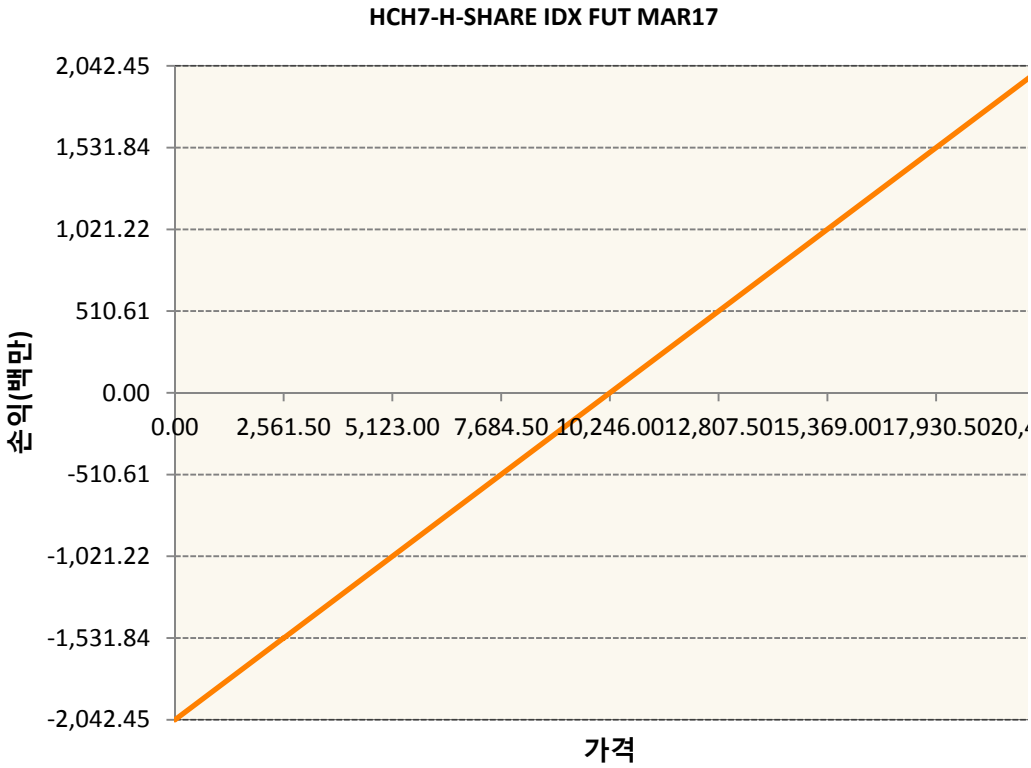
차이나인덱스모(주식-파생형)

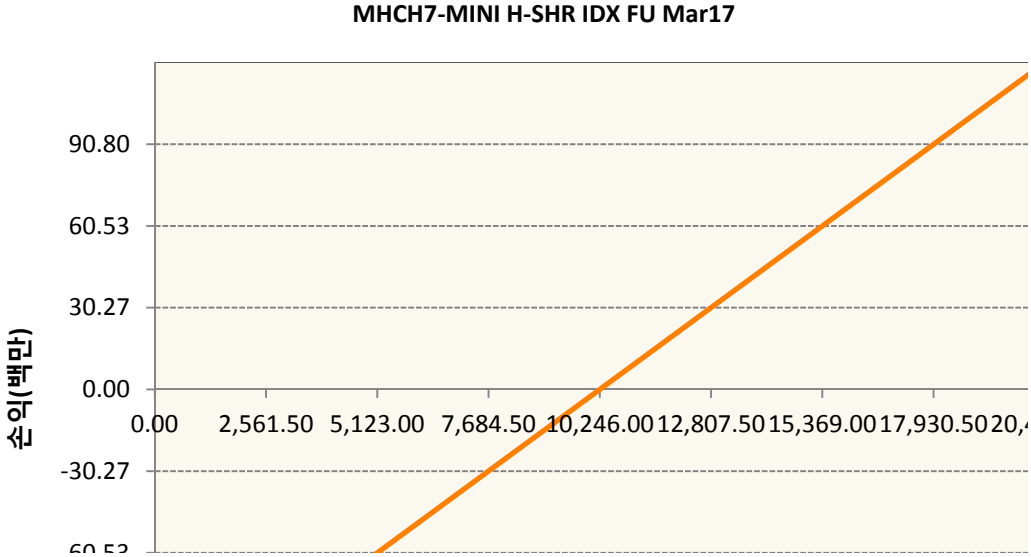
1. 계약금액

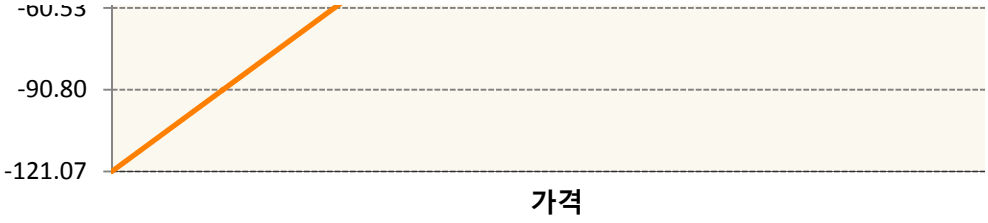
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,164	0	2,164	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCH7	H-SHARE IDX FUT MAR17	163
MHCH7	MINI H-SHR IDX FU Mar17	10

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	193

공시일	2017-03-08
기준일	2017-03-07

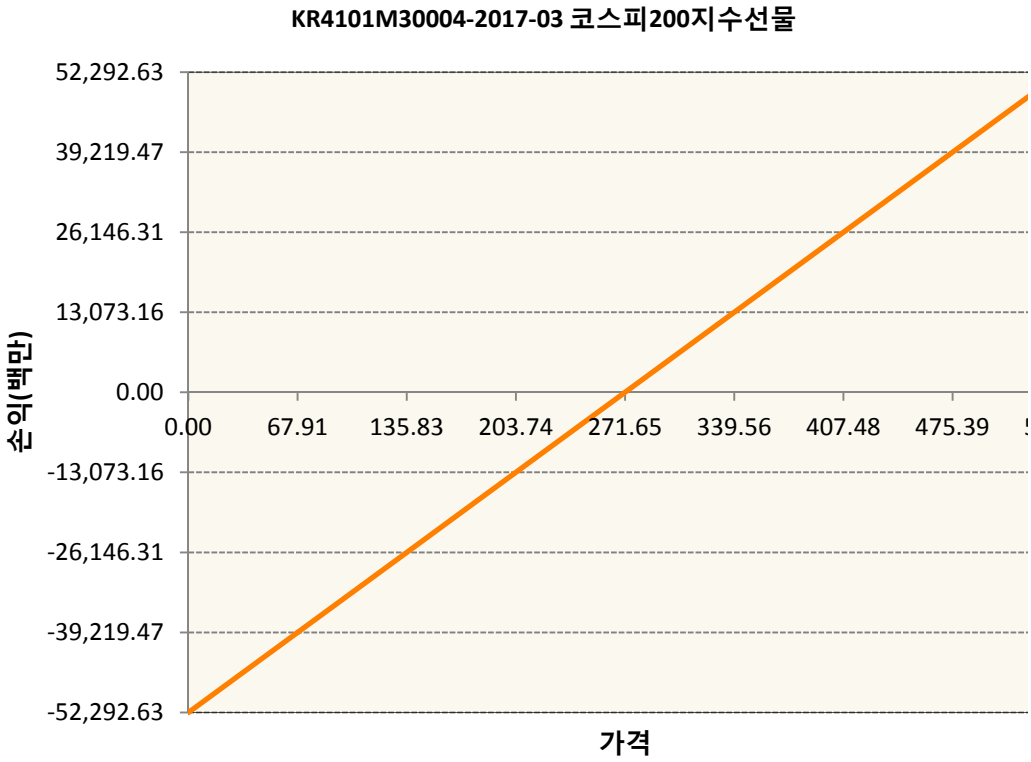
커버드콜모(주식혼합-파생형)

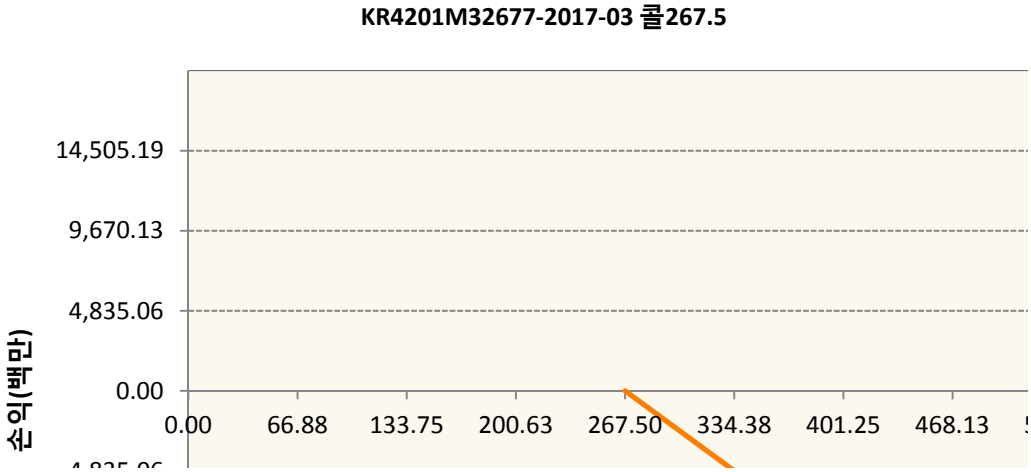
1. 계약금액

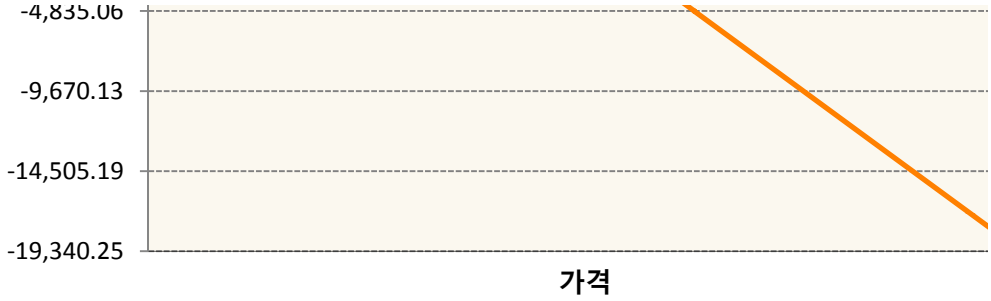
(단위:백만원)

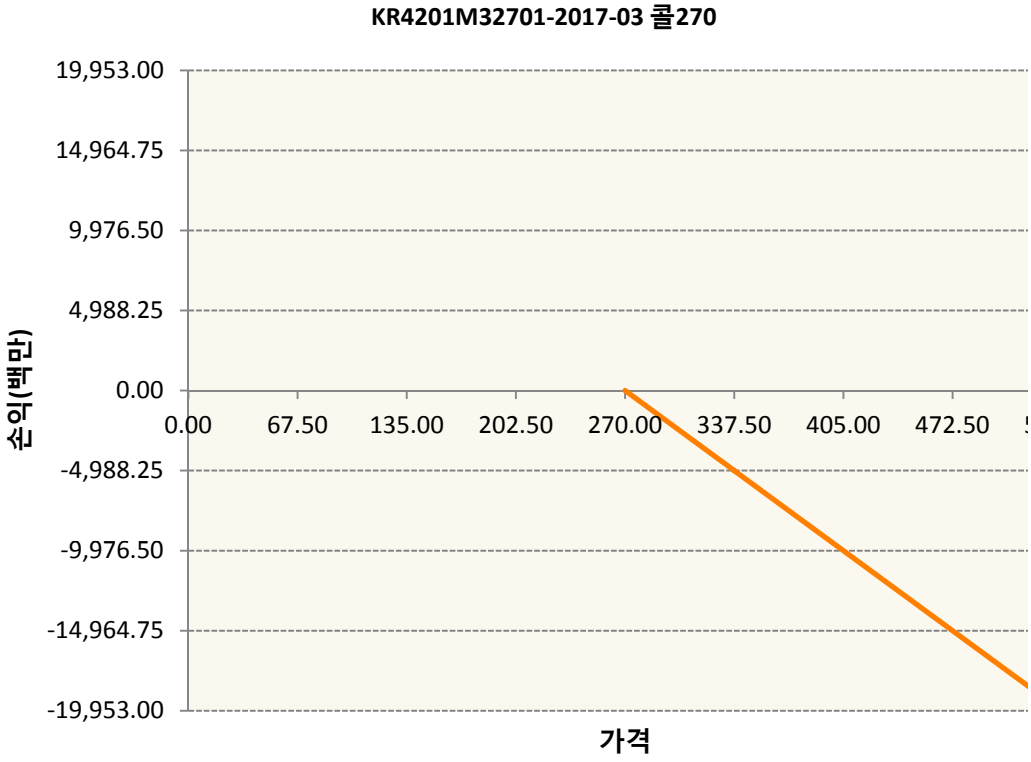
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	1,362	-1,362	장내
누계	유가증권	선물	52,293	0	52,293	장내
누계	유가증권	옵션	0	39,293	-39,293	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101M30(2017-03 코스피200지수선물							4,187
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-4,187	-4,187	-4,187	-4,187	-4,187	-4,187	-4,187
-5.33%	-2,791	-2,791	-2,791	-2,791	-2,791	-2,791	-2,791
-2.67%	-1,396	-1,396	-1,396	-1,396	-1,396	-1,396	-1,396
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	1,396	1,396	1,396	1,396	1,396	1,396	1,396
5.33%	2,791	2,791	2,791	2,791	2,791	2,791	2,791
8.00%	4,187	4,187	4,187	4,187	4,187	4,187	4,187
KR4201M32(2017-03 콜267.5							7,856
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,585	1,585	1,585	1,585	1,585	1,585	1,585
-5.33%	1,585	1,585	1,585	1,585	1,585	1,585	1,585
-2.67%	1,577	1,571	1,564	1,554	1,544	1,532	1,518
0%	5	4	3	0	-4	-9	-15
2.67%	-2,615	-2,615	-2,615	-2,615	-2,615	-2,615	-2,615
5.33%	-5,235	-5,235	-5,235	-5,235	-5,235	-5,235	-5,235
8.00%	-7,856	-7,856	-7,856	-7,856	-7,856	-7,856	-7,856
KR4201M32: 2017-03 콜270							7,951

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	774	774	774	774	774	774	774
-5.33%	774	774	774	774	774	774	774
-2.67%	774	774	774	773	772	770	767
0%	48	34	18	0	-19	-38	-59
2.67%	-2,594	-2,594	-2,594	-2,594	-2,594	-2,594	-2,594
5.33%	-5,273	-5,273	-5,273	-5,273	-5,273	-5,273	-5,273
8.00%	-7,951	-7,951	-7,951	-7,951	-7,951	-7,951	-7,951

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

26,191

공시일	2017-03-08
기준일	2017-03-07

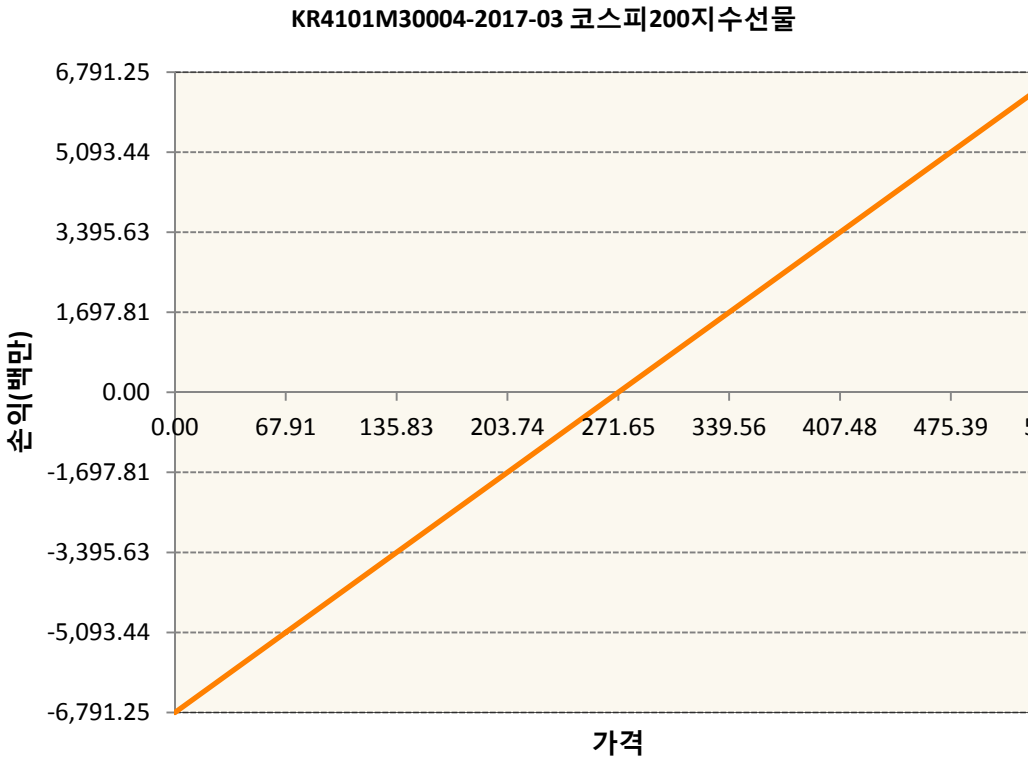
커버드콜목표전환형증권투자신탁

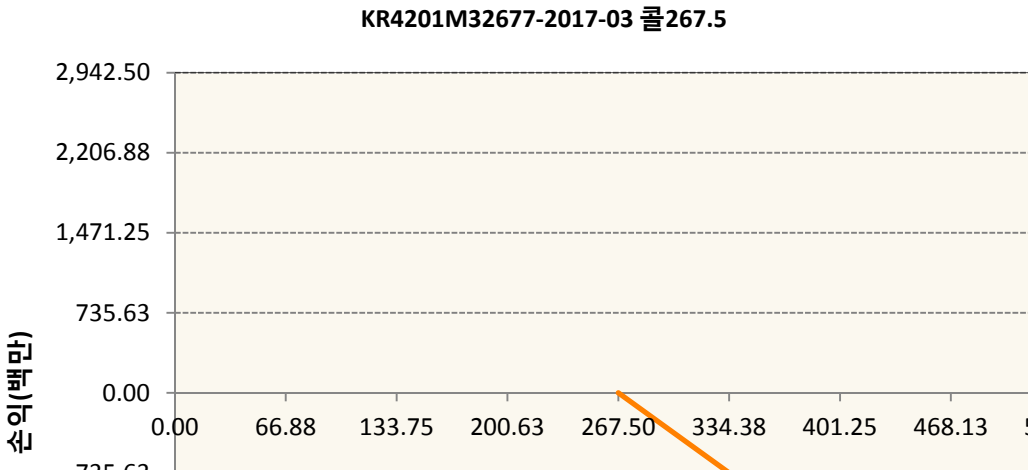
1. 계약금액

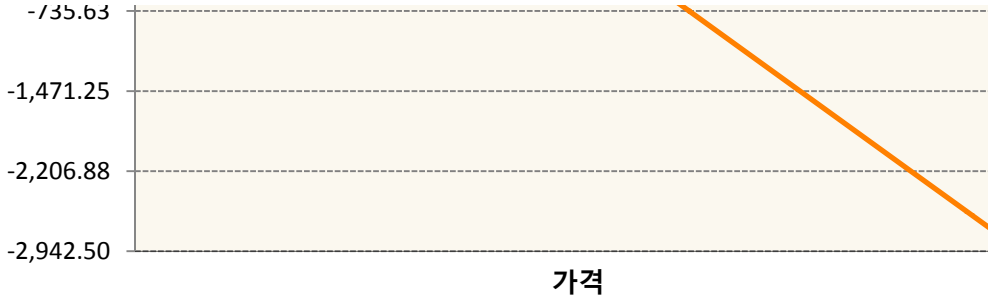
(단위:백만원)

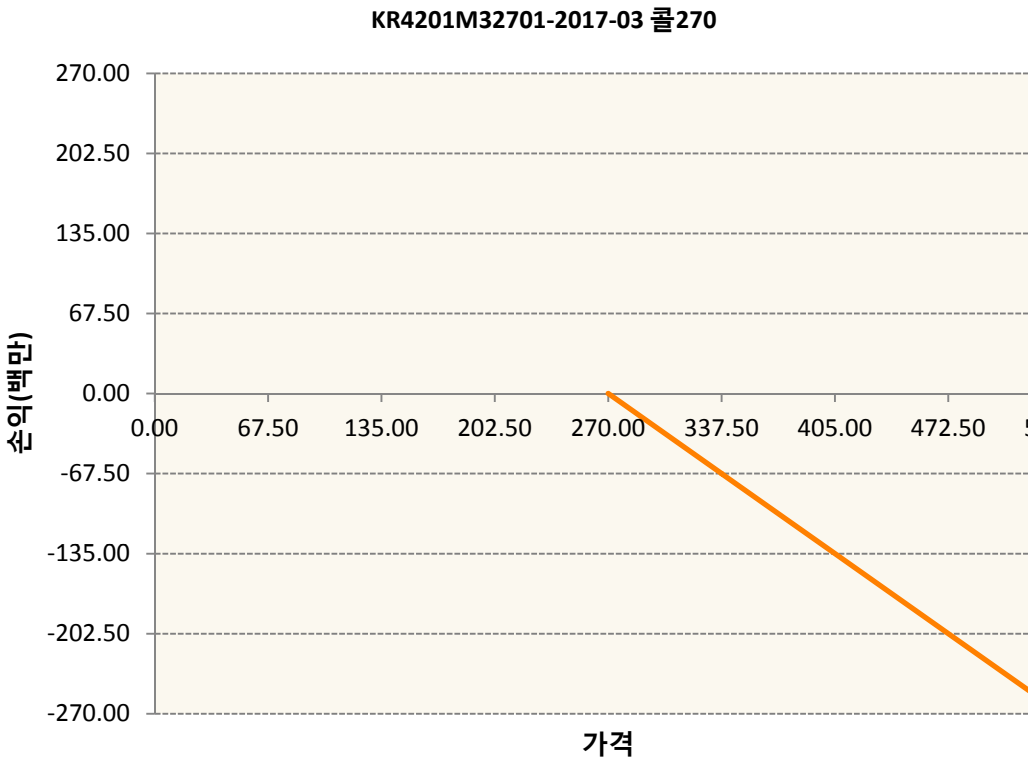
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	1,358	-1,358	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	6,791	0	6,791	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,213	-3,213	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101M30(2017-03 코스피200지수선물							544
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-544	-544	-544	-544	-544	-544	-544
-5.33%	-362	-362	-362	-362	-362	-362	-362
-2.67%	-181	-181	-181	-181	-181	-181	-181
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	181	181	181	181	181	181	181
5.33%	362	362	362	362	362	362	362
8.00%	544	544	544	544	544	544	544
KR4201M32(2017-03 콜267.5							1,195
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	241	241	241	241	241	241	241
-5.33%	241	241	241	241	241	241	241
-2.67%	240	239	238	236	235	233	231
0%	1	1	0	0	-1	-1	-2
2.67%	-398	-398	-398	-398	-398	-398	-398
5.33%	-797	-797	-797	-797	-797	-797	-797
8.00%	-1,195	-1,195	-1,195	-1,195	-1,195	-1,195	-1,195
KR4201M32 2017-03 콜270							108

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	10	10	10	10	10	10	10
-5.33%	10	10	10	10	10	10	10
-2.67%	10	10	10	10	10	10	10
0%	1	0	0	0	0	-1	-1
2.67%	-35	-35	-35	-35	-35	-35	-35
5.33%	-71	-71	-71	-71	-71	-71	-71
8.00%	-108	-108	-108	-108	-108	-108	-108

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

2,178

공시일	2017-03-08
기준일	2017-03-07

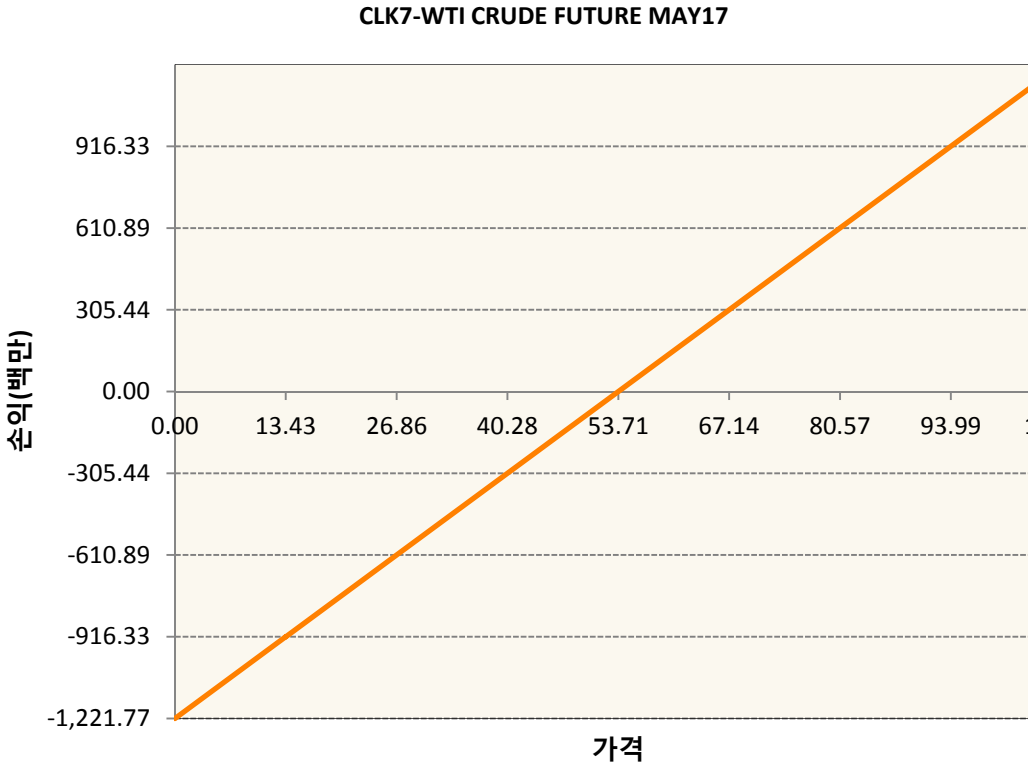
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

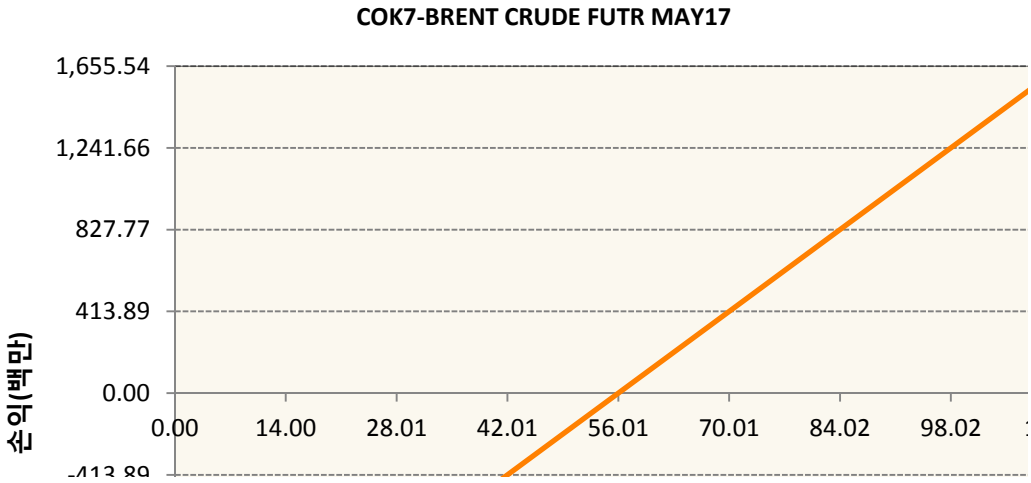
1. 계약금액

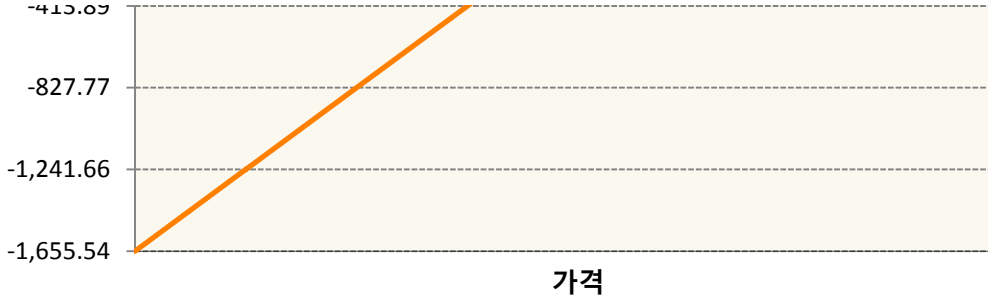
(단위:백만원)

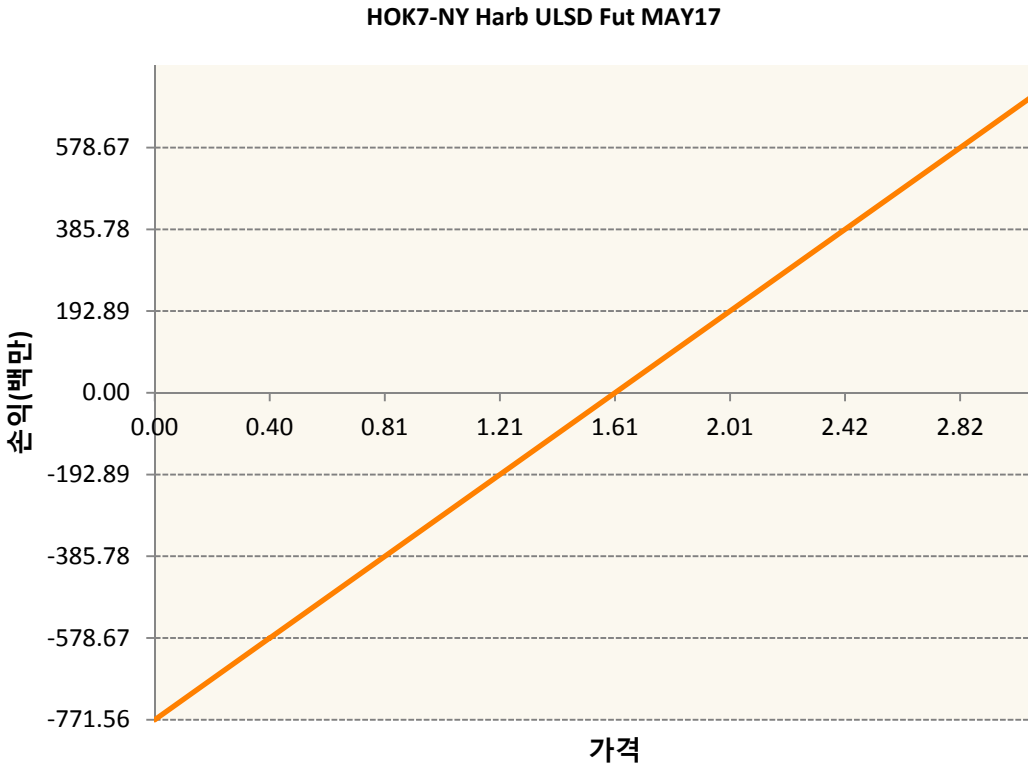
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	선물	유가증권	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	선물	유가증권	1,222	0	1,222	
누계	유가증권	선물	4,617	413	4,204	

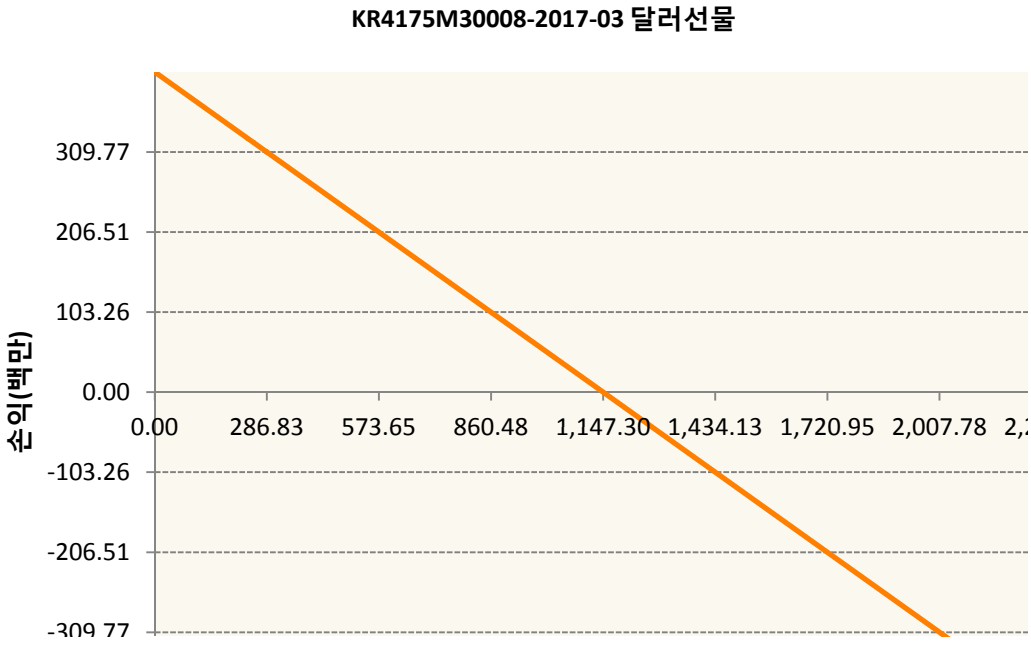
2. 만기시점의 손익구조

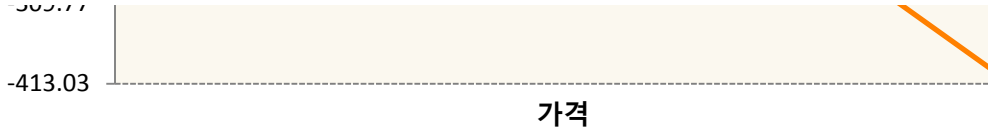


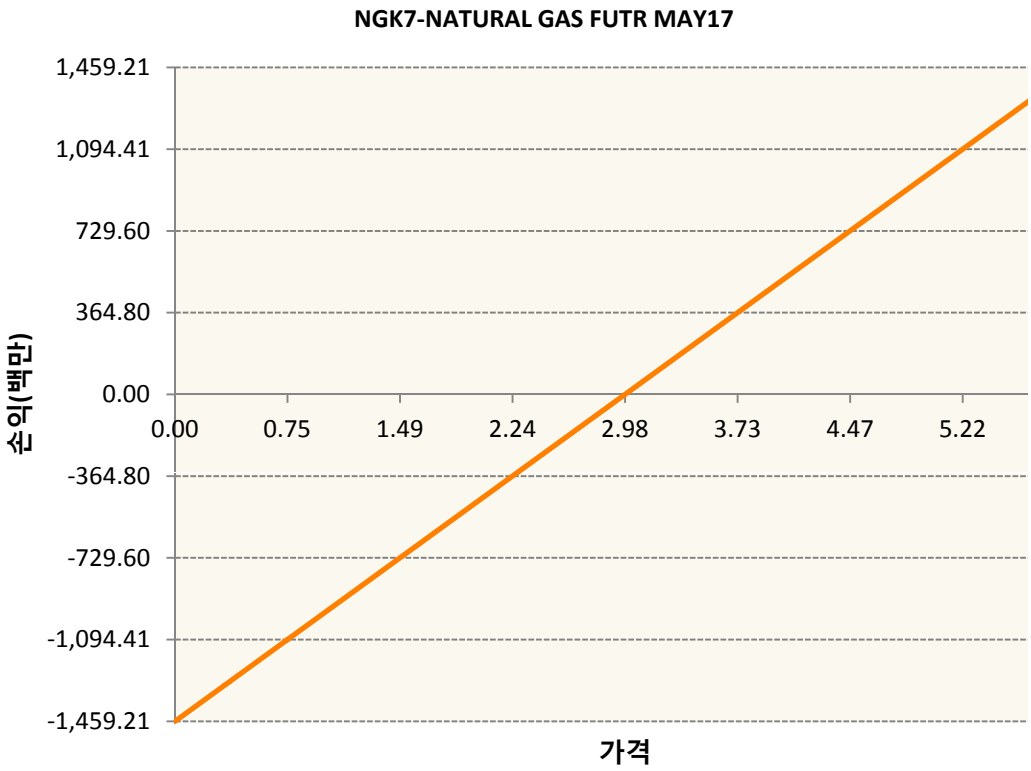


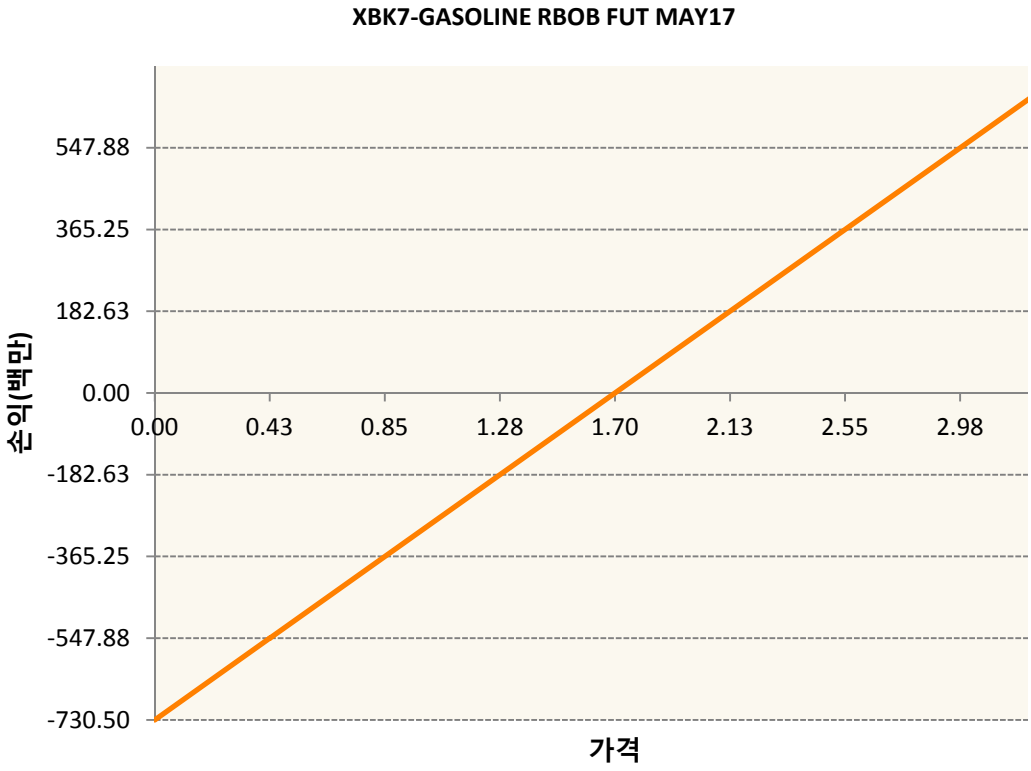

-827.77
-1,241.66
-1,655.54
가격


HOK7-NY Harb ULSD Fut MAY17
578.67
385.78
192.89
0.00
-192.89
-385.78
-578.67
-771.56
0.00
0.40
0.81
1.21
1.61
2.01
2.42
2.82
순익(백만)
가격


KR4175M30008-2017-03 달러선물
309.77
206.51
103.26
0.00
-103.26
-206.51
0.00
286.83
573.65
860.48
1,147.30
1,434.13
1,720.95
2,007.78
순익(백만)


-413.03
가격


NGK7-NATURAL GAS FUTR MAY17
1,459.21
1,094.41
729.60
364.80
0.00
-364.80
-729.60
-1,094.41
-1,459.21
0.00
0.75
1.49
2.24
2.98
3.73
4.47
5.22
순익(백만)
가격


XBK7-GASOLINE RBOB FUT MAY17
547.88
365.25
182.63
0.00
-182.63
-365.25
-547.88
-730.50
0.00
0.43
0.85
1.28
1.70
2.13
2.55
2.98
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	62
KR4175M30(	2017-03 달러선물	33
NGK7	NATURAL GAS FUTR MAY17	117
XBK7	GASOLINE RBOB FUT MAY17	58

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

1,035

공시일	2017-03-08
기준일	2017-03-07

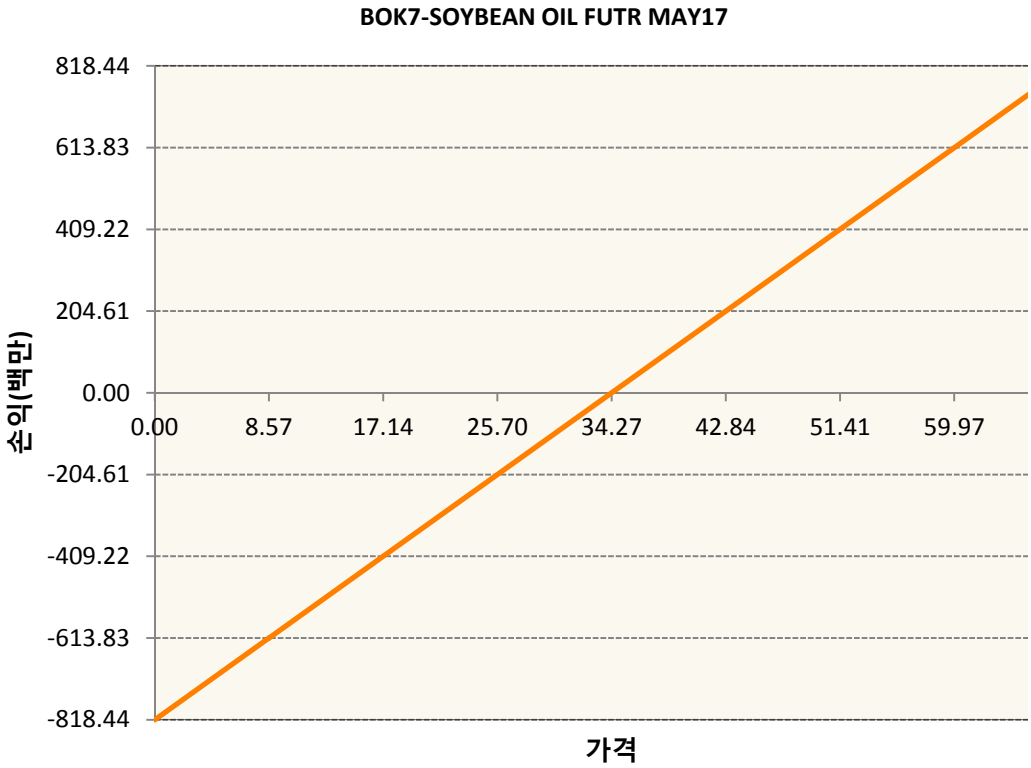
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

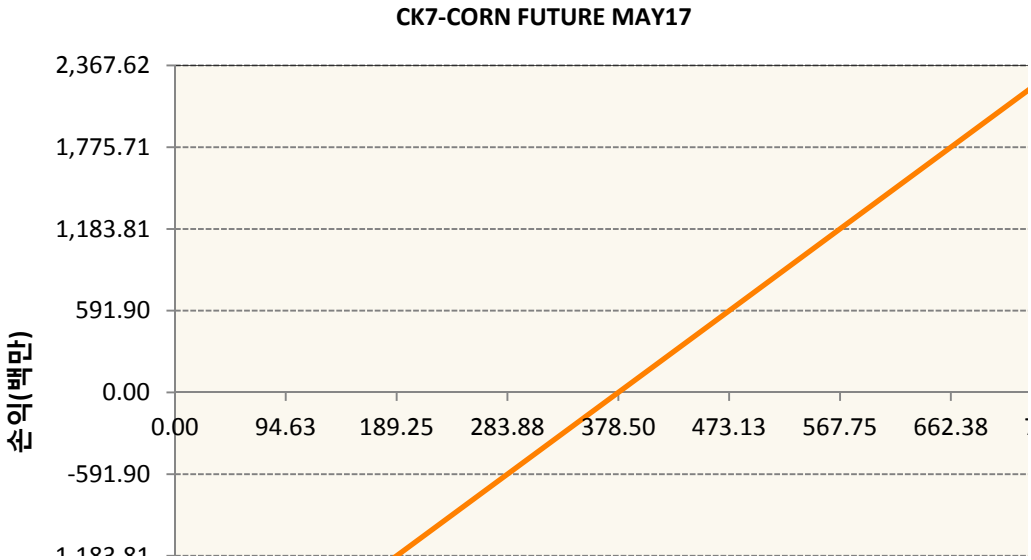
1. 계약금액

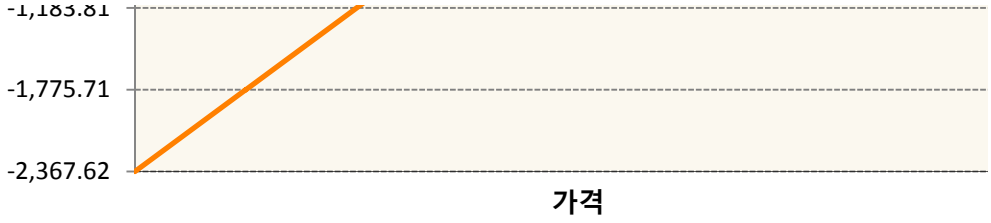
(단위:백만원)

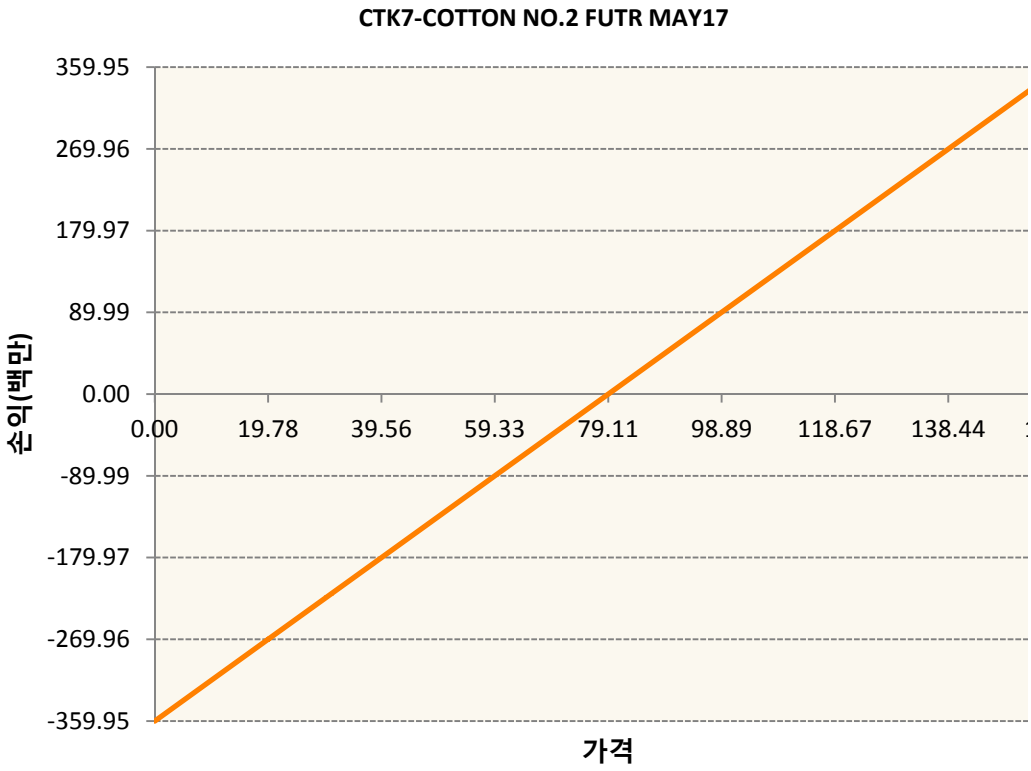
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	9,439	574	8,866	

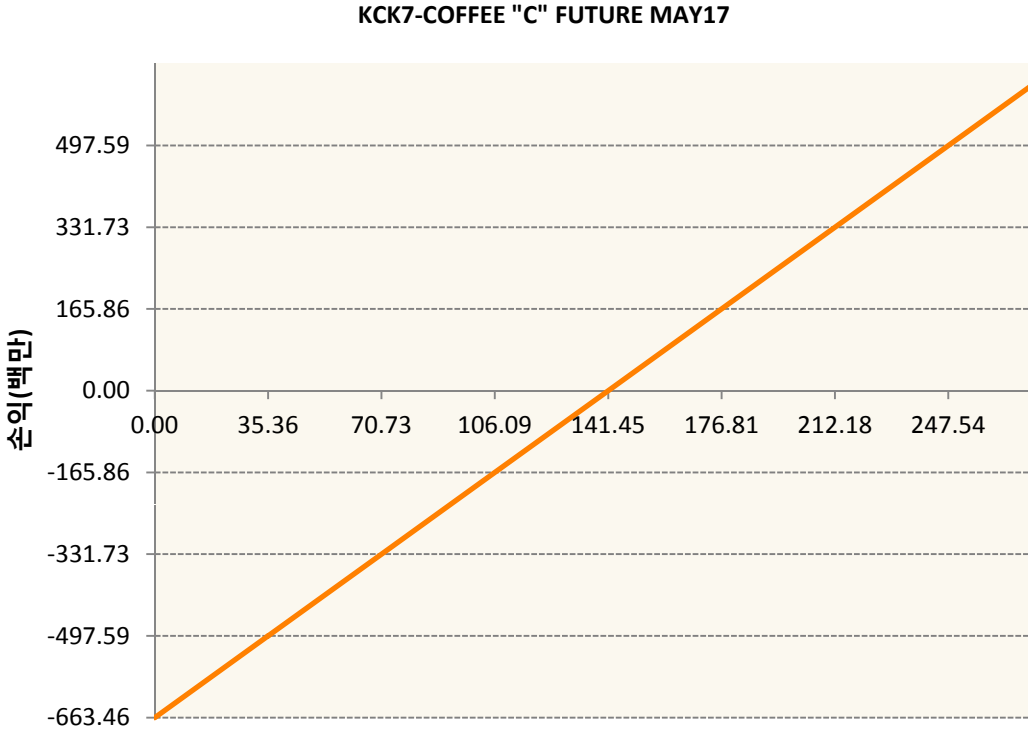
2. 만기시점의 손익구조



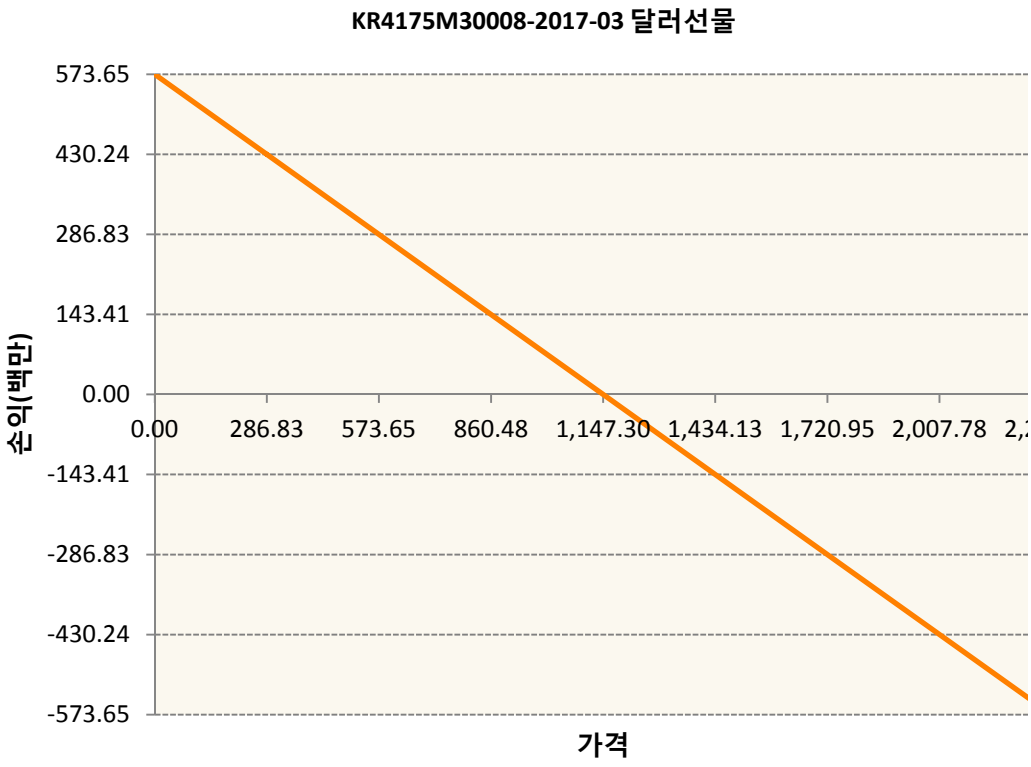


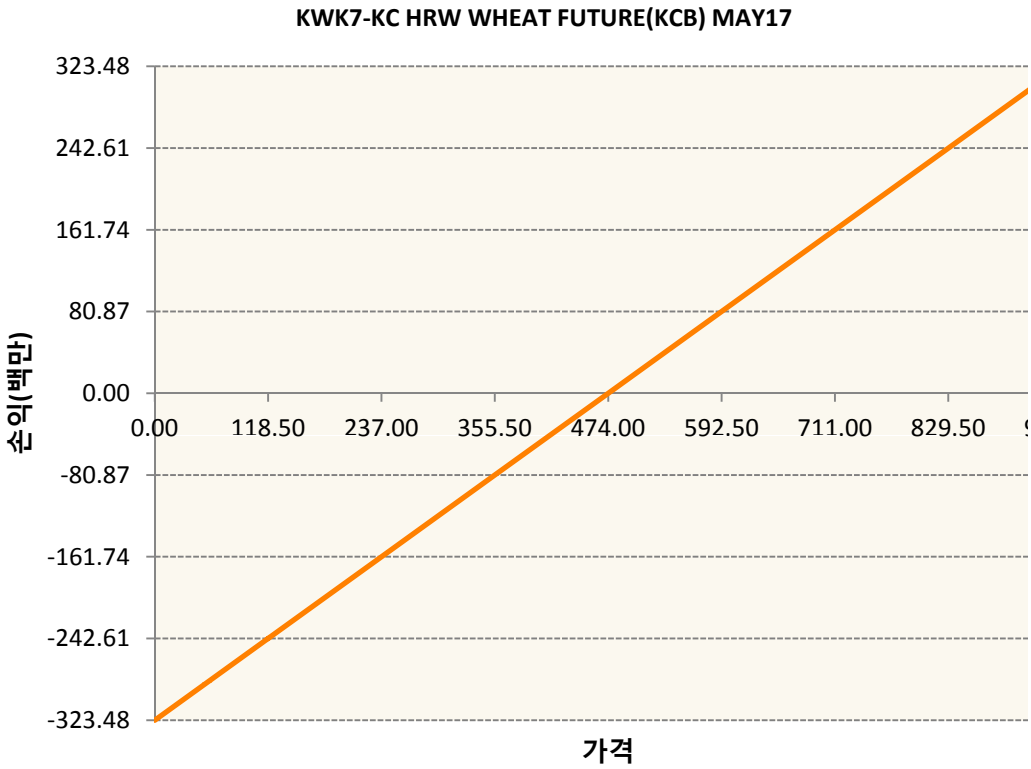

-1,775.71
-2,367.62
가격


CTK7-COTTON NO.2 FUTR MAY17
359.95
269.96
179.97
89.99
0.00
-89.99
-179.97
-269.96
-359.95
0.00
19.78
39.56
59.33
79.11
98.89
118.67
138.44
순익(백만)
가격

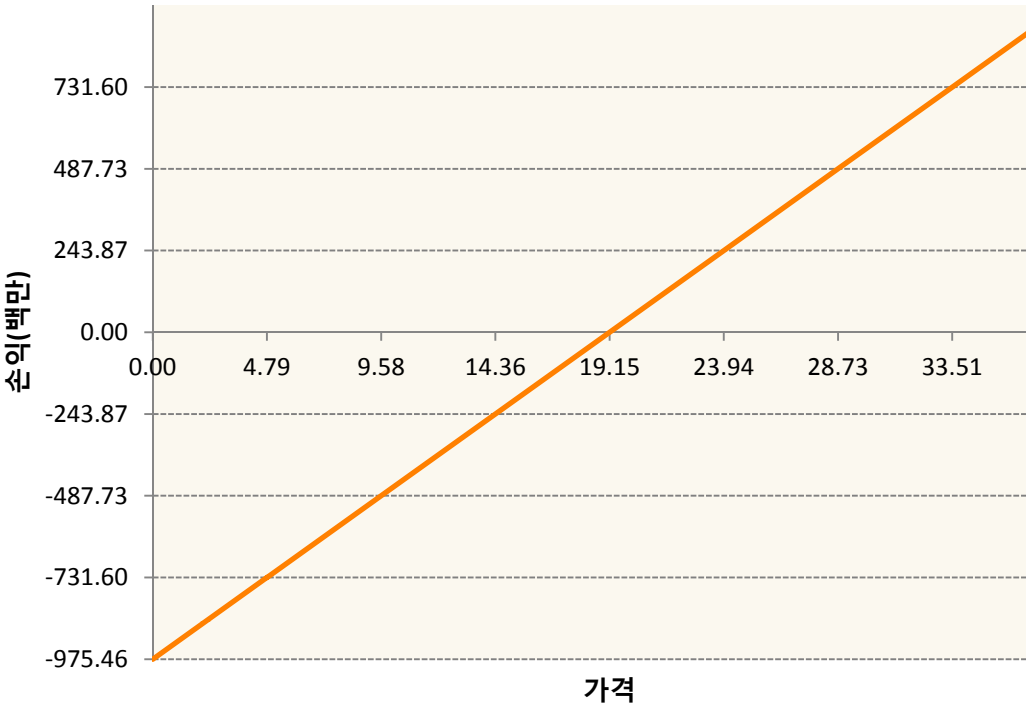

KCK7-COFFEE "C" FUTURE MAY17
497.59
331.73
165.86
0.00
-165.86
-331.73
-497.59
-663.46
0.00
35.36
70.73
106.09
141.45
176.81
212.18
247.54
순익(백만)

가격

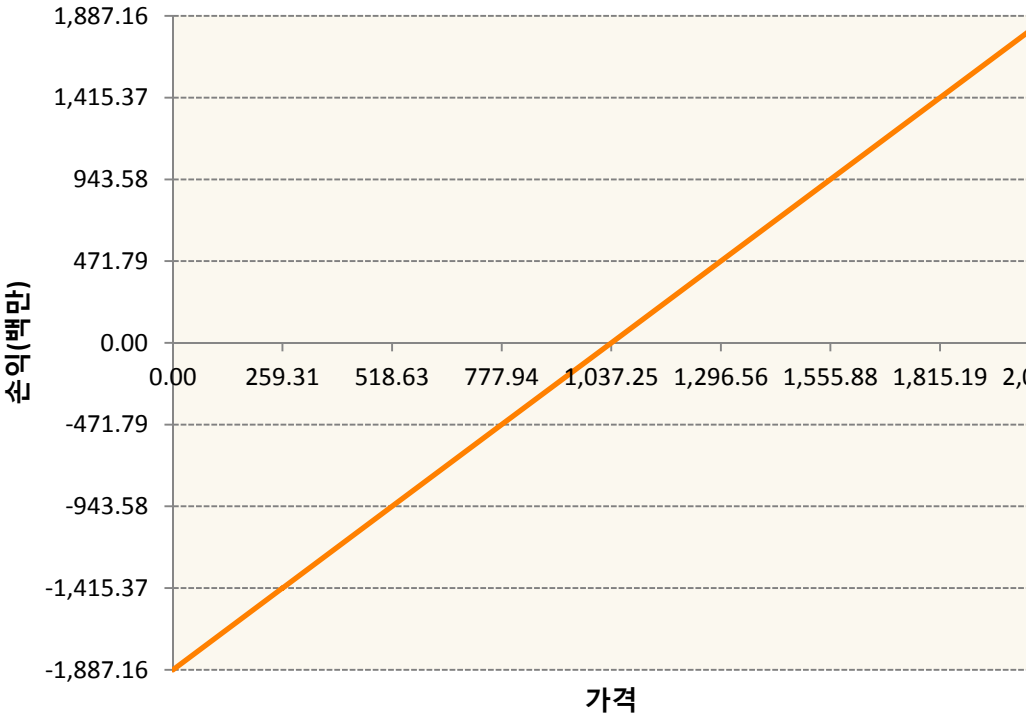

KR4175M30008-2017-03 달러선물
573.65
430.24
286.83
143.41
0.00
-143.41
-286.83
-430.24
-573.65
0.00
286.83
573.65
860.48
1,147.30
1,434.13
1,720.95
2,007.78
순이(백만)
가격


KWK7-KC HRW WHEAT FUTURE(KCB) MAY17
323.48
242.61
161.74
80.87
0.00
-80.87
-161.74
-242.61
-323.48
0.00
118.50
237.00
355.50
474.00
592.50
711.00
829.50
순이(백만)
가격

SBK7-Sugar #11 (WORLD) MAY17

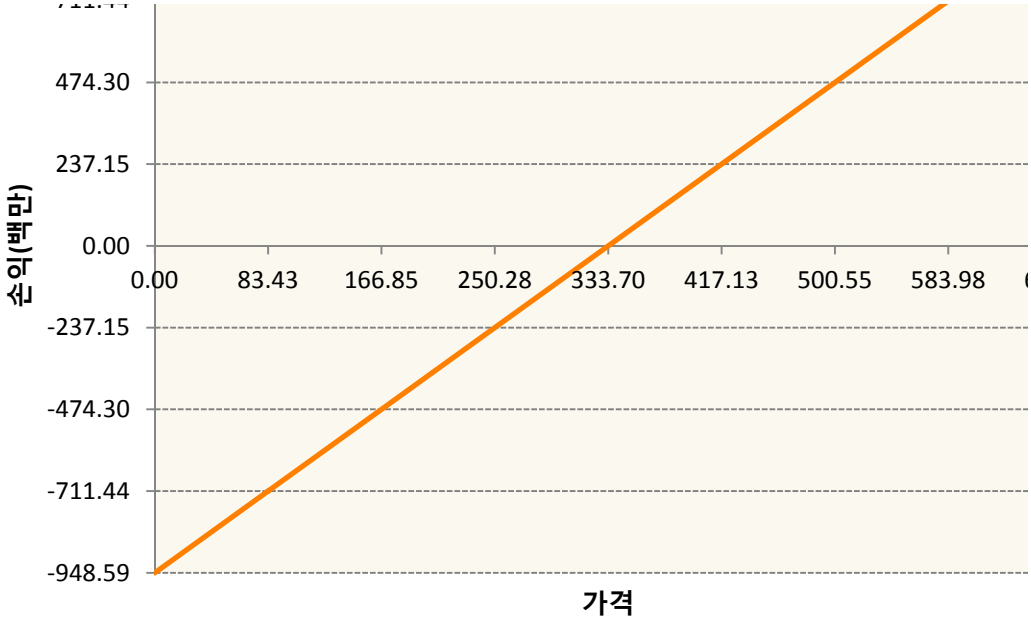


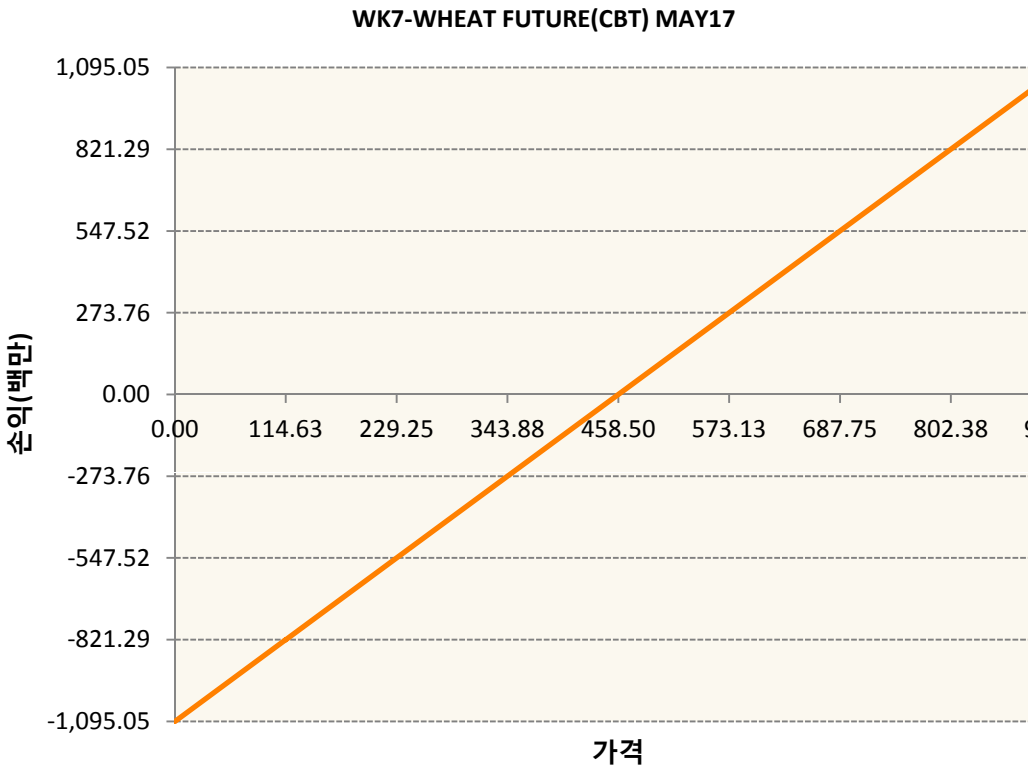
SK7-SOYBEAN FUTURE MAY17



SMK7-SOYBEAN MEAL FUTR MAY17







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

BOK7	SOYBEAN OIL FUTR MAY17	65
CK7	CORN FUTURE MAY17	189
CTK7	COTTON NO.2 FUTR MAY17	29
KCK7	COFFEE "C" FUTURE MAY17	53
KR4175M30(	2017-03 달러선물	46

KWK7	KC HRW WHEAT FUTURE(KCB) MAY17	26
SBK7	Sugar #11 (WORLD) MAY17	78
SK7	SOYBEAN FUTURE MAY17	151
SMK7	SOYBEAN MEAL FUTR MAY17	76
WK7	WHEAT FUTURE(CBT) MAY17	88

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

880