공시일	2017-03-09
기준일	2017-03-08

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	2017-03-09
기준일	2017-03-08

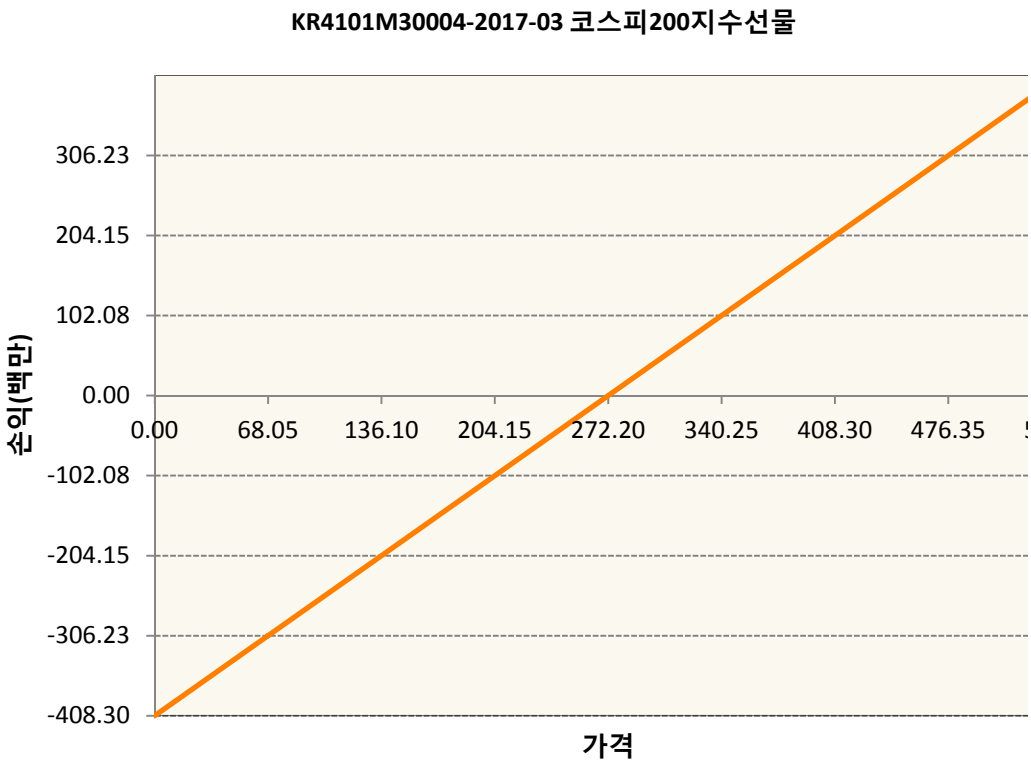
스마트인덱스모

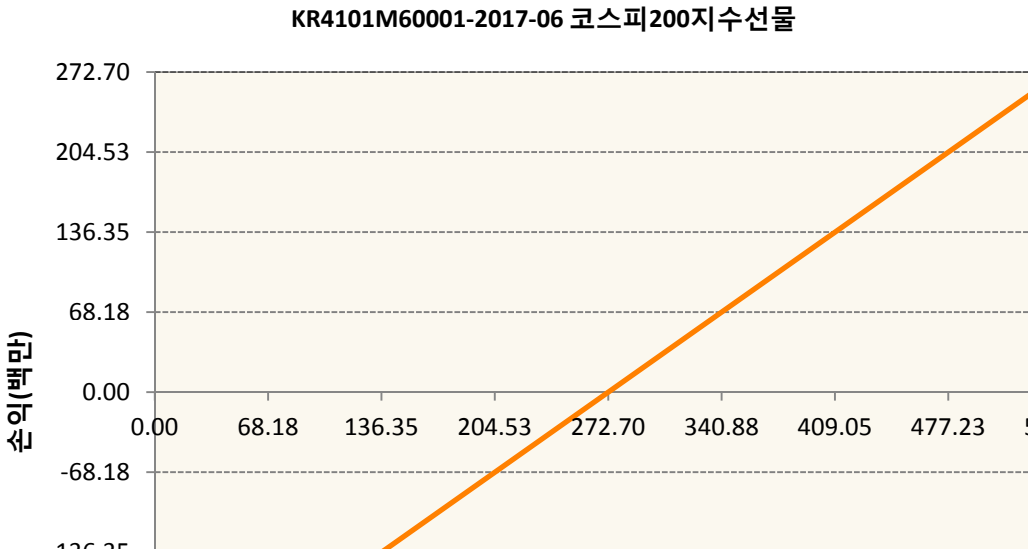
1. 계약금액

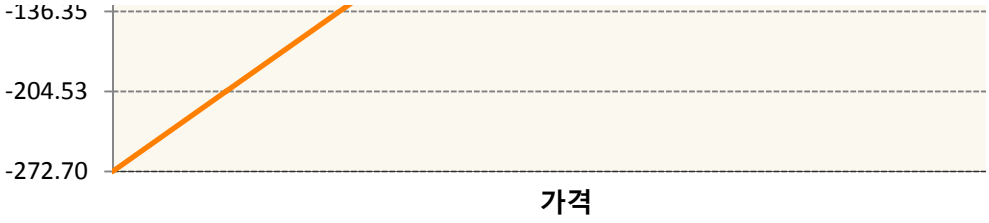
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	273	273	1	장내
누계	유가증권	선물	681	0	681	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101M30(2017-03 코스피200지수선물							33
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-33	-33	-33	-33	-33	-33	-33
-5.33%	-22	-22	-22	-22	-22	-22	-22
-2.67%	-11	-11	-11	-11	-11	-11	-11
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	11	11	11	11	11	11	11
5.33%	22	22	22	22	22	22	22
8.00%	33	33	33	33	33	33	33

KR4101M60(2017-06 코스피200지수선물							22
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-22	-22	-22	-22	-22	-22	-22
-5.33%	-15	-15	-15	-15	-15	-15	-15
-2.67%	-7	-7	-7	-7	-7	-7	-7
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	7	7	7	7	7	7	7
5.33%	15	15	15	15	15	15	15
8.00%	22	22	22	22	22	22	22

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

35

공시일	2017-03-09
기준일	2017-03-08

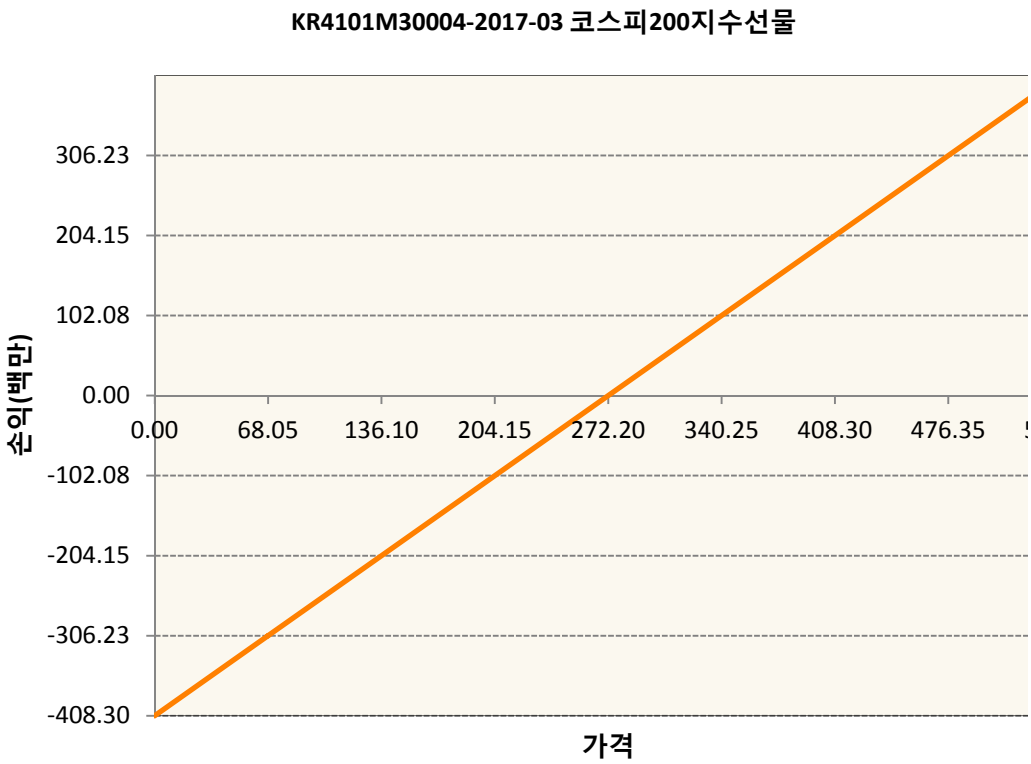
스마트레버리지목표전환형1호

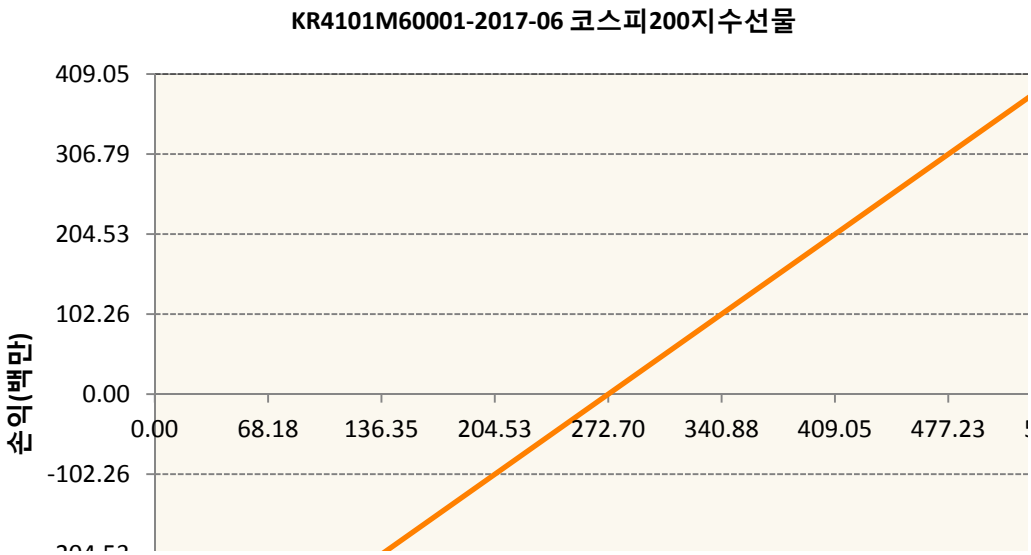
1. 계약금액

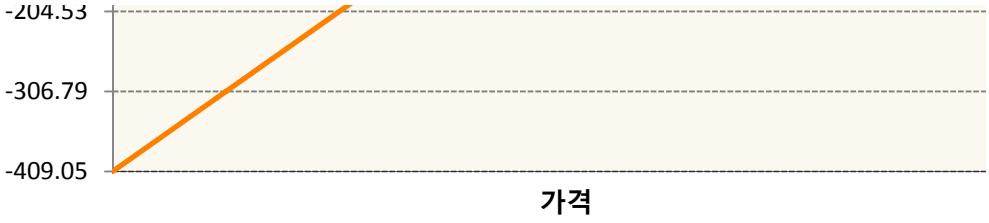
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	409	408	1	장내
누계	유가증권	선물	817	0	817	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101M30(2017-03 코스피200지수선물							33
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-33	-33	-33	-33	-33	-33	-33
-5.33%	-22	-22	-22	-22	-22	-22	-22
-2.67%	-11	-11	-11	-11	-11	-11	-11
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	11	11	11	11	11	11	11
5.33%	22	22	22	22	22	22	22
8.00%	33	33	33	33	33	33	33

KR4101M60(2017-06 코스피200지수선물							33
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-33	-33	-33	-33	-33	-33	-33
-5.33%	-22	-22	-22	-22	-22	-22	-22
-2.67%	-11	-11	-11	-11	-11	-11	-11
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	11	11	11	11	11	11	11
5.33%	22	22	22	22	22	22	22
8.00%	33	33	33	33	33	33	33

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

42

공시일	2017-03-09
기준일	2017-03-08

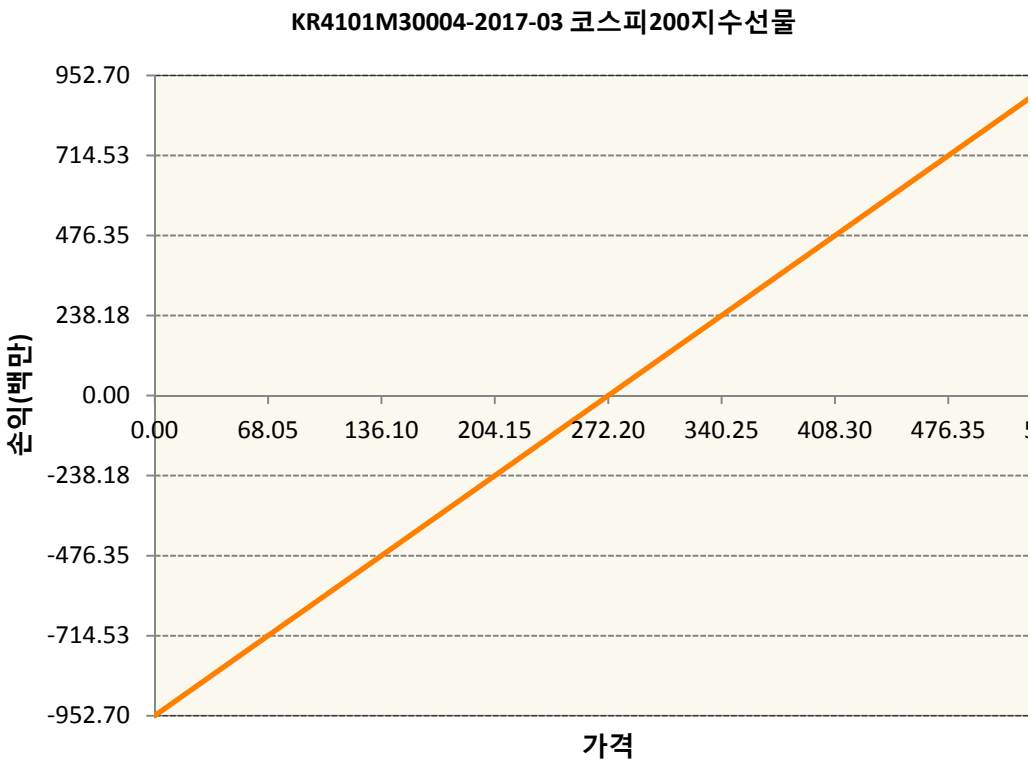
1.3배 레버리지 인덱스(주식-파생형)

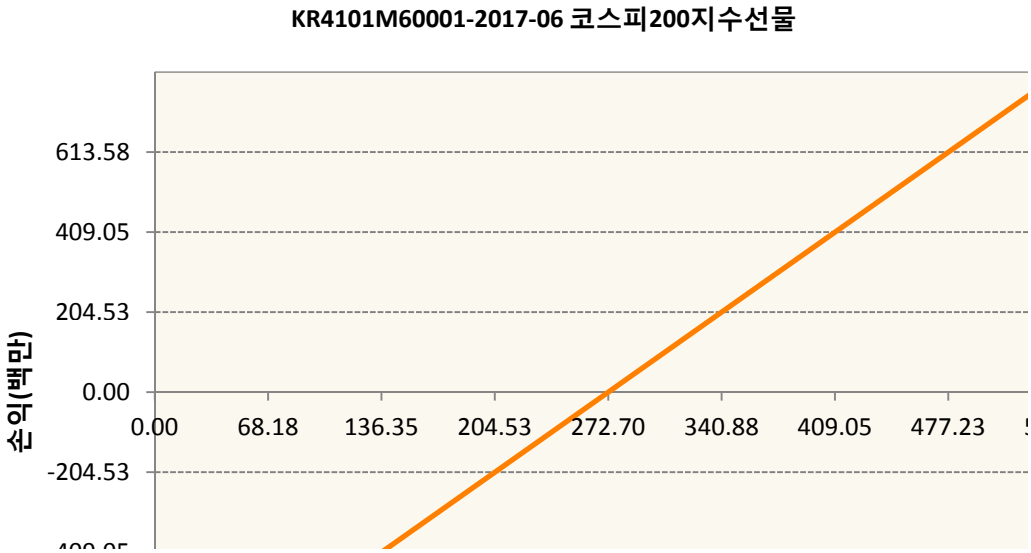
1. 계약금액

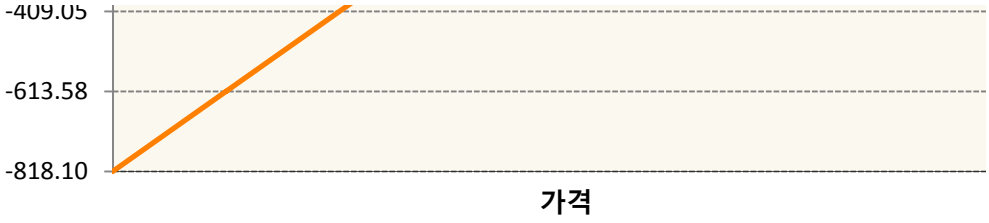
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	819	817	2	장내
누계	유가증권	선물	1,771	0	1,771	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101M30(2017-03 코스피200지수선물							76
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-76	-76	-76	-76	-76	-76	-76
-5.33%	-51	-51	-51	-51	-51	-51	-51
-2.67%	-25	-25	-25	-25	-25	-25	-25
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	25	25	25	25	25	25	25
5.33%	51	51	51	51	51	51	51
8.00%	76	76	76	76	76	76	76
KR4101M60(2017-06 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)

91

공시일	2017-03-09
기준일	2017-03-08

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)

590

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-03-09
기준일	2017-03-08

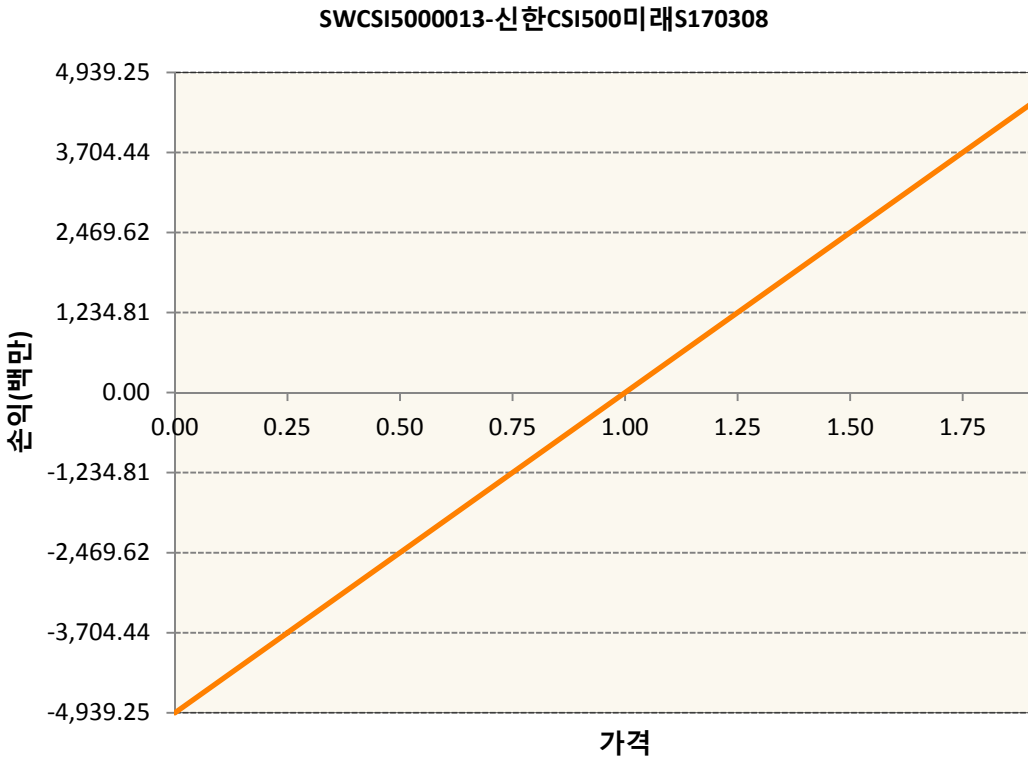
SMART중국본토중소형CSI500상장

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	4,939	0	4,939	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI50000 신한CSI500미래S170308	393

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

463

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-03-09
기준일	2017-03-08

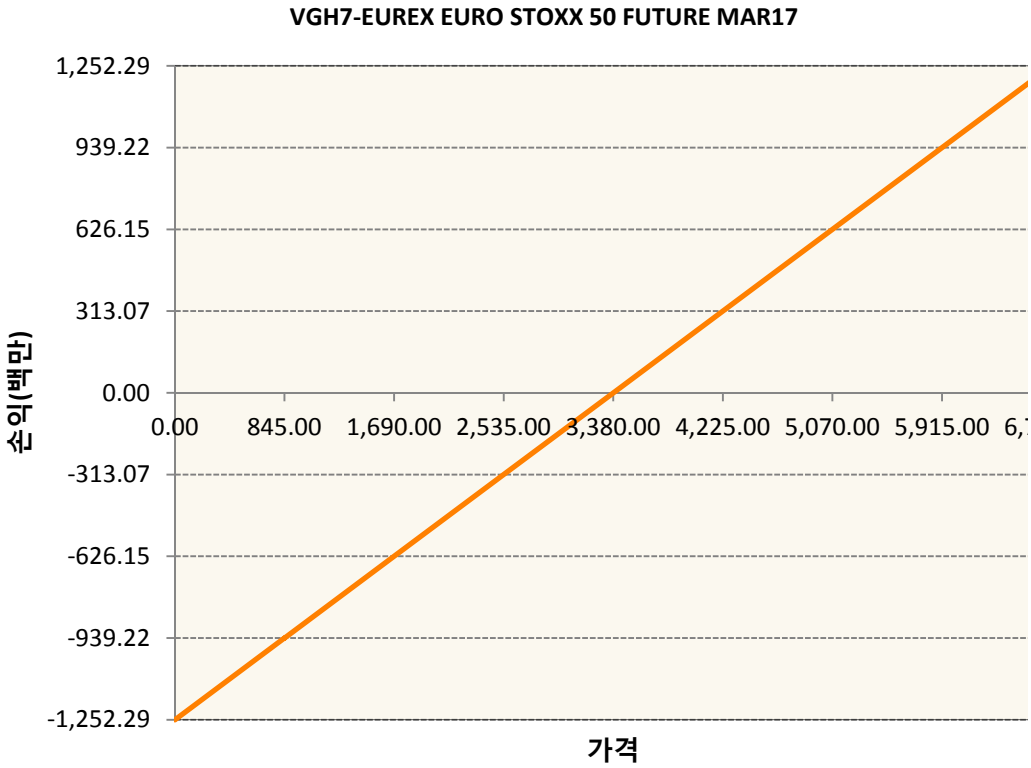
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,252	0	1,252	

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	2017-03-09
기준일	2017-03-08

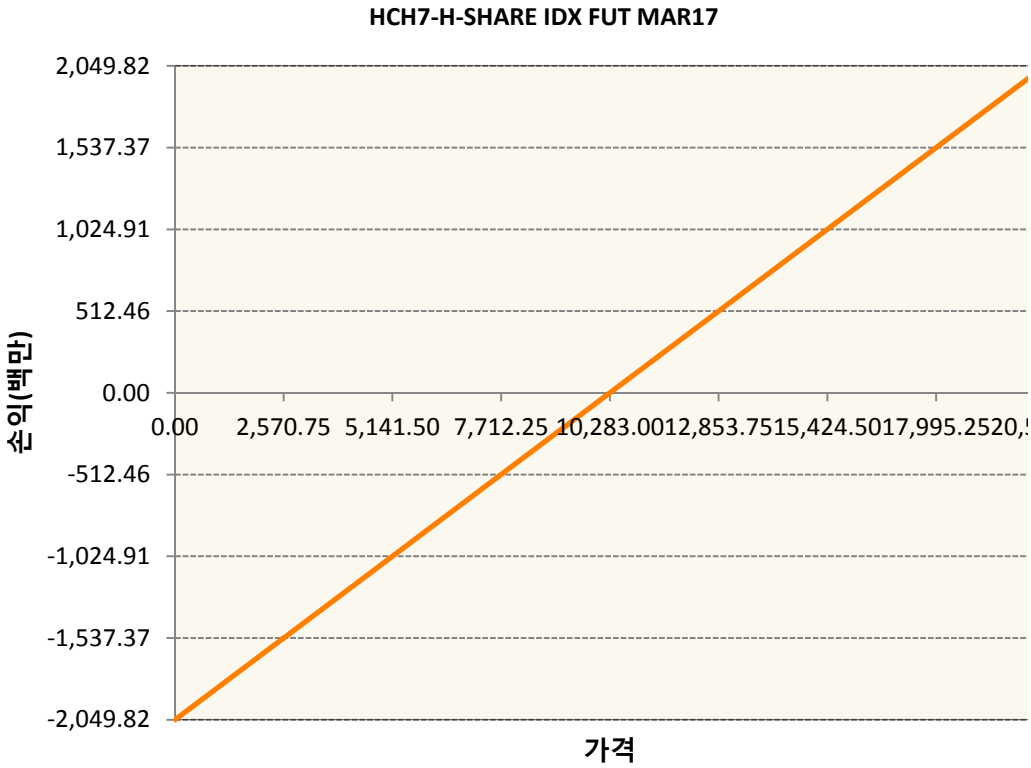
차이나인덱스모(주식-파생형)

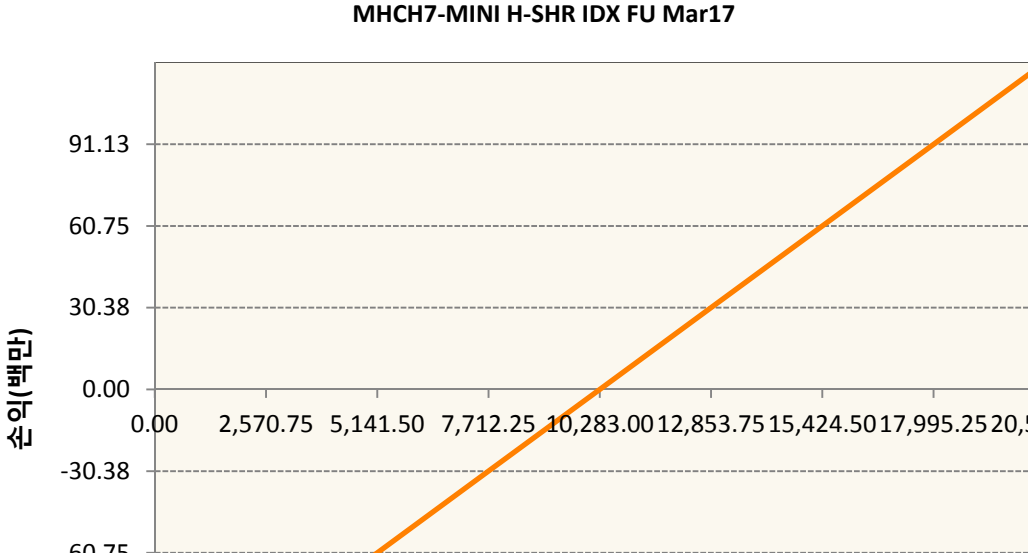
1. 계약금액

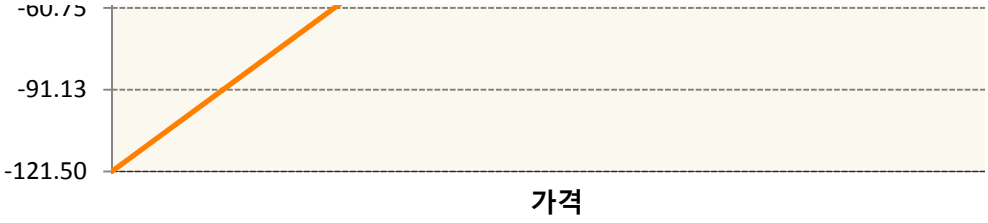
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,171	0	2,171	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCH7	H-SHARE IDX FUT MAR17	164
MHCH7	MINI H-SHR IDX FU Mar17	10

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

공시일	2017-03-09
기준일	2017-03-08

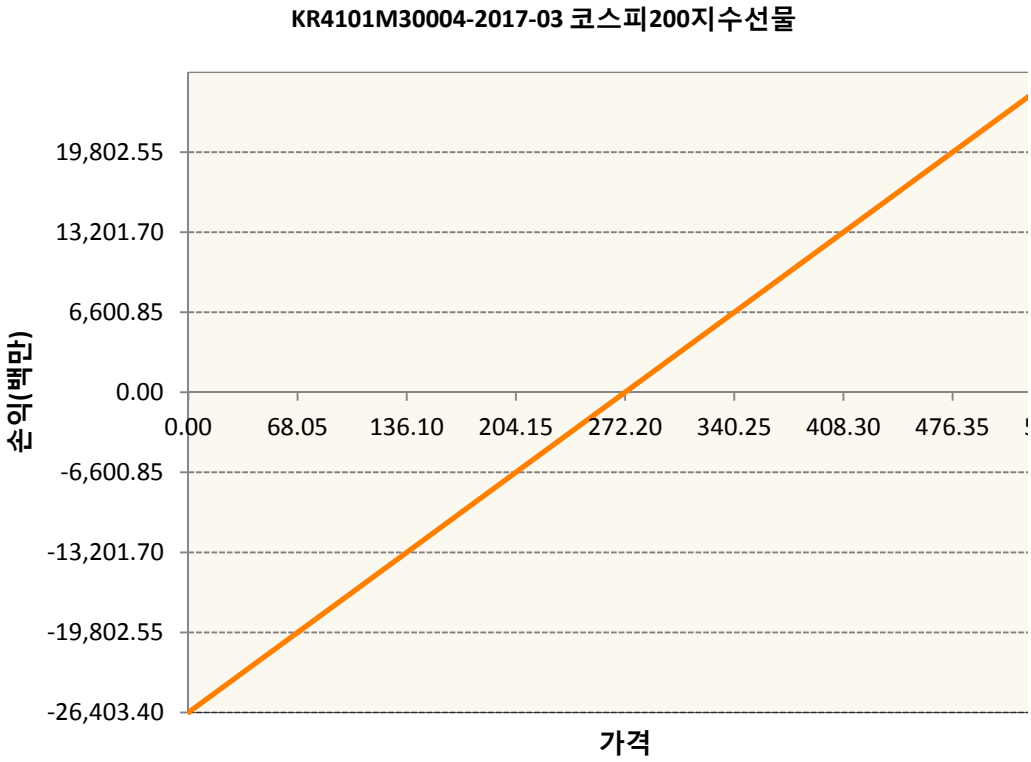
커버드콜모(주식혼합-파생형)

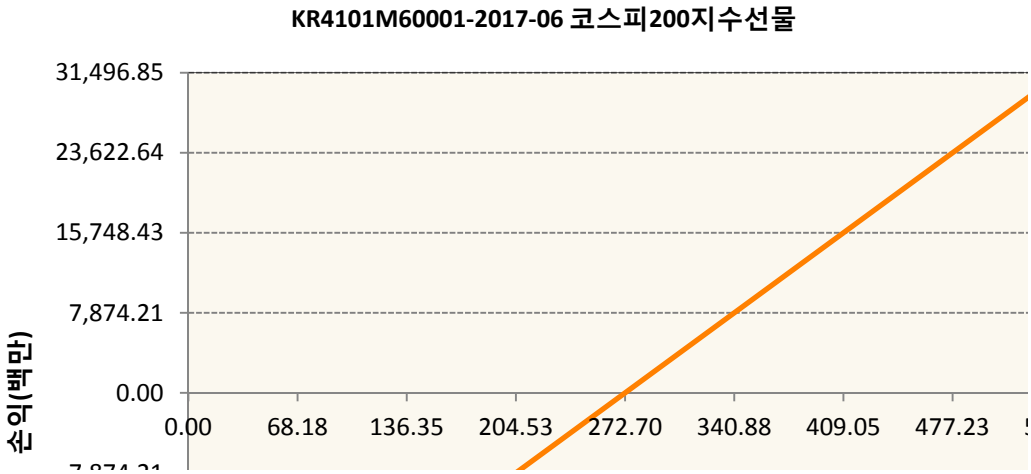
1. 계약금액

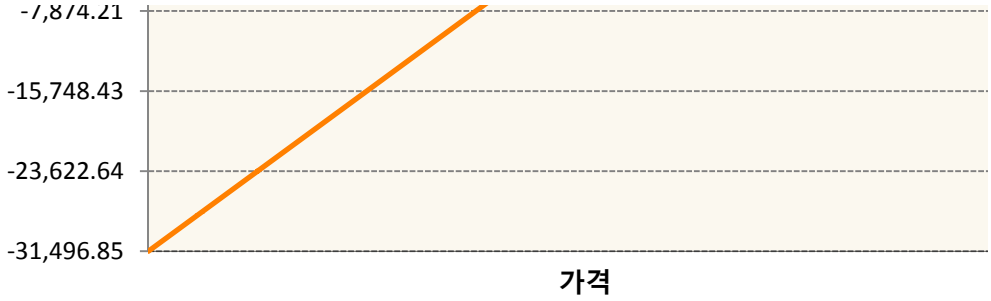
(단위:백만원)

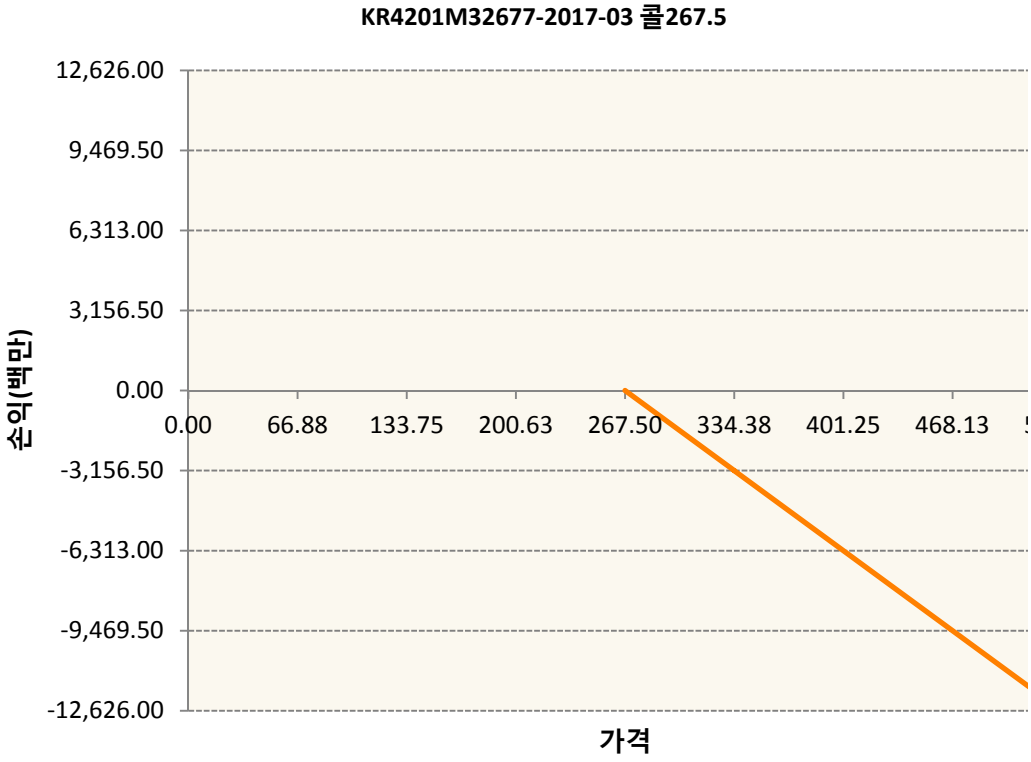
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	31,515	25,993	5,522	장내
신규	유가증권	옵션	17,403	19,166	-1,763	장내
누계	유가증권	선물	57,900	0	57,900	장내
누계	유가증권	옵션	0	40,610	-40,610	장내

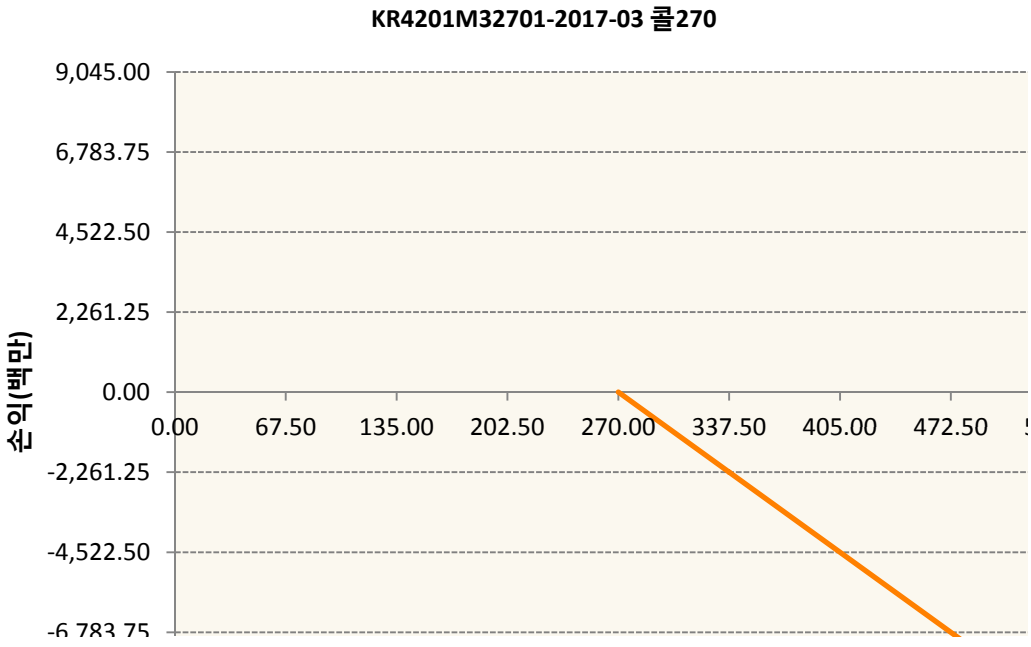
2. 만기시점의 손익구조

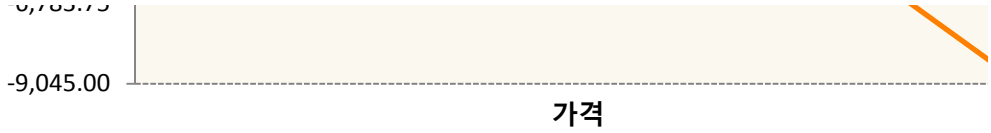


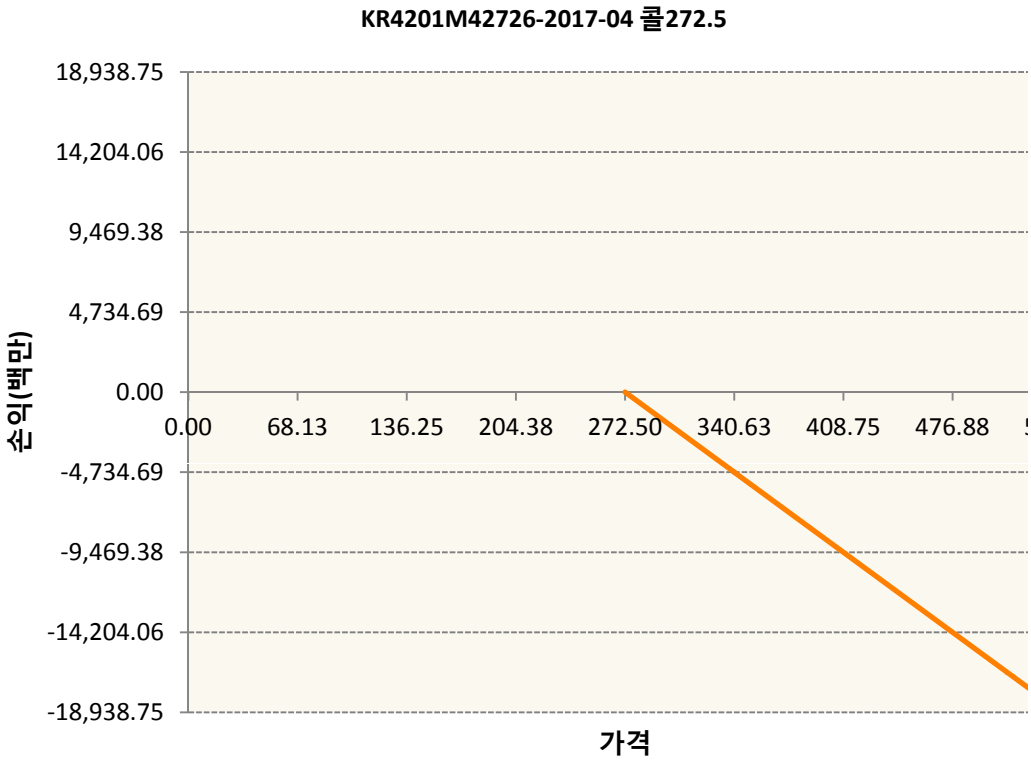



-7,874.21
-15,748.43
-23,622.64
-31,496.85
가격


KR4201M32677-2017-03 콜267.5
12,626.00
9,469.50
6,313.00
3,156.50
0.00
-3,156.50
-6,313.00
-9,469.50
-12,626.00
0.00
66.88
133.75
200.63
267.50
334.38
401.25
468.13
순익(백만)
가격


KR4201M32701-2017-03 콜270
9,045.00
6,783.75
4,522.50
2,261.25
0.00
-2,261.25
-4,522.50
-6,783.75
0.00
67.50
135.00
202.50
270.00
337.50
405.00
472.50
순익(백만)





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101M30(2017-03 코스피200지수선물							2,113
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-2,113	-2,113	-2,113	-2,113	-2,113	-2,113	-2,113
-5.33%	-1,409	-1,409	-1,409	-1,409	-1,409	-1,409	-1,409
-2.67%	-704	-704	-704	-704	-704	-704	-704
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	704	704	704	704	704	704	704
5.33%	1,409	1,409	1,409	1,409	1,409	1,409	1,409
8.00%	2,113	2,113	2,113	2,113	2,113	2,113	2,113
KR4101M60(2017-06 코스피200지수선물							2,516
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-2,516	-2,516	-2,516	-2,516	-2,516	-2,516	-2,516
-5.33%	-1,677	-1,677	-1,677	-1,677	-1,677	-1,677	-1,677
-2.67%	-839	-839	-839	-839	-839	-839	-839

0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	839	839	839	839	839	839	839
5.33%	1,677	1,677	1,677	1,677	1,677	1,677	1,677
8.00%	2,516	2,516	2,516	2,516	2,516	2,516	2,516
	KR4201M32(	2017-03 콜267.5					5,141
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,130	1,130	1,130	1,130	1,130	1,130	1,130
-5.33%	1,130	1,130	1,130	1,130	1,130	1,130	1,130
-2.67%	1,129	1,127	1,125	1,123	1,119	1,115	1,110
0%	0	0	0	0	0	0	-1
2.67%	-1,713	-1,713	-1,713	-1,713	-1,713	-1,713	-1,713
5.33%	-3,427	-3,427	-3,427	-3,427	-3,427	-3,427	-3,427
8.00%	-5,141	-5,141	-5,141	-5,141	-5,141	-5,141	-5,141
	KR4201M32	2017-03 콜270					3,641
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	391	391	391	391	391	391	391
-5.33%	391	391	391	391	391	391	391
-2.67%	391	391	391	391	391	391	391
0%	6	5	3	0	-3	-7	-11
2.67%	-1,208	-1,208	-1,208	-1,208	-1,208	-1,208	-1,208
5.33%	-2,425	-2,425	-2,425	-2,425	-2,425	-2,425	-2,425
8.00%	-3,641	-3,641	-3,641	-3,641	-3,641	-3,641	-3,641
	KR4201M42	2017-04 콜272.5					6,269
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,270	1,269	1,266	1,262	1,255	1,244	1,230
-5.33%	1,256	1,242	1,222	1,195	1,163	1,124	1,080
-2.67%	1,093	1,028	957	881	801	717	631
0%	328	219	109	0	-109	-219	-328
2.67%	-1,381	-1,453	-1,532	-1,615	-1,702	-1,792	-1,884
5.33%	-3,704	-3,724	-3,752	-3,787	-3,829	-3,877	-3,931
8.00%	-6,200	-6,203	-6,208	-6,216	-6,229	-6,246	-6,269

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

22,695

공시일	2017-03-09
기준일	2017-03-08

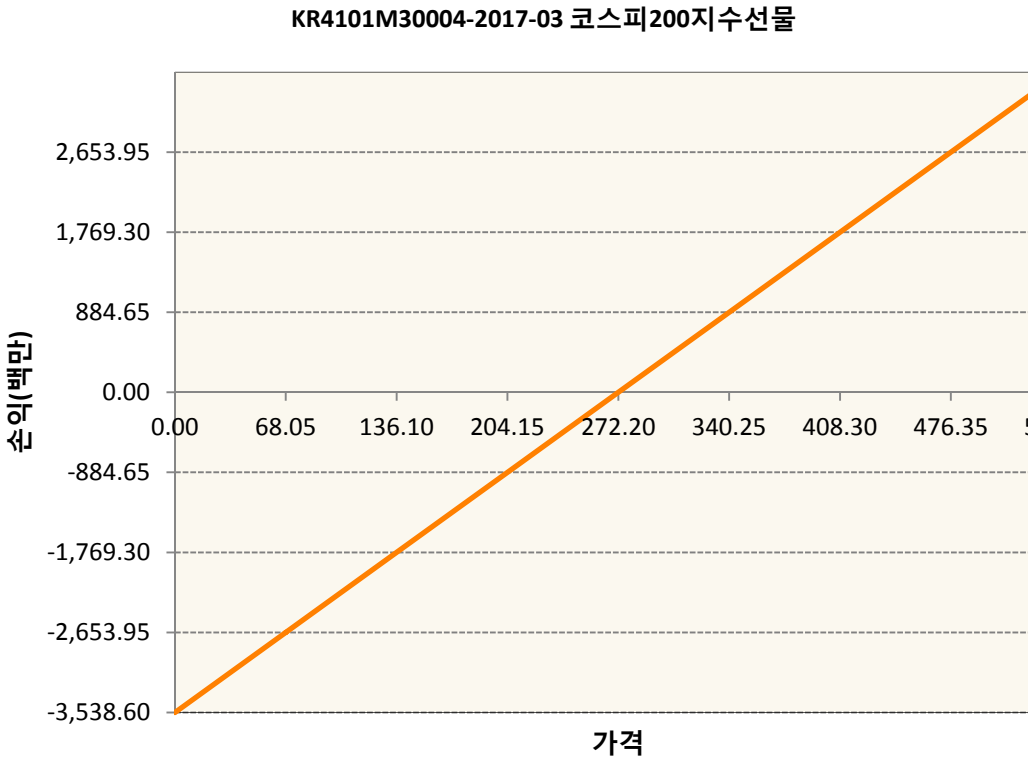
커버드콜목표전환형증권투자신탁

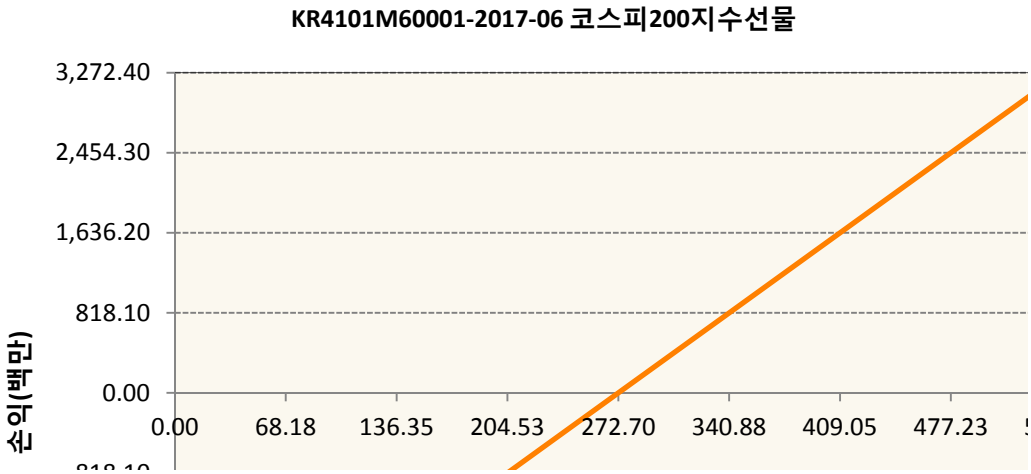
1. 계약금액

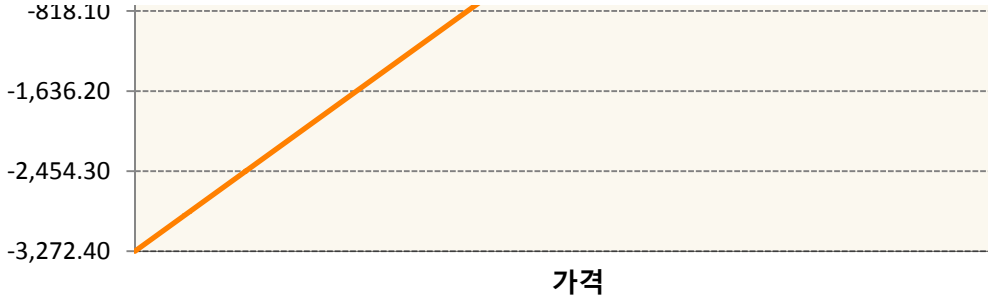
(단위:백만원)

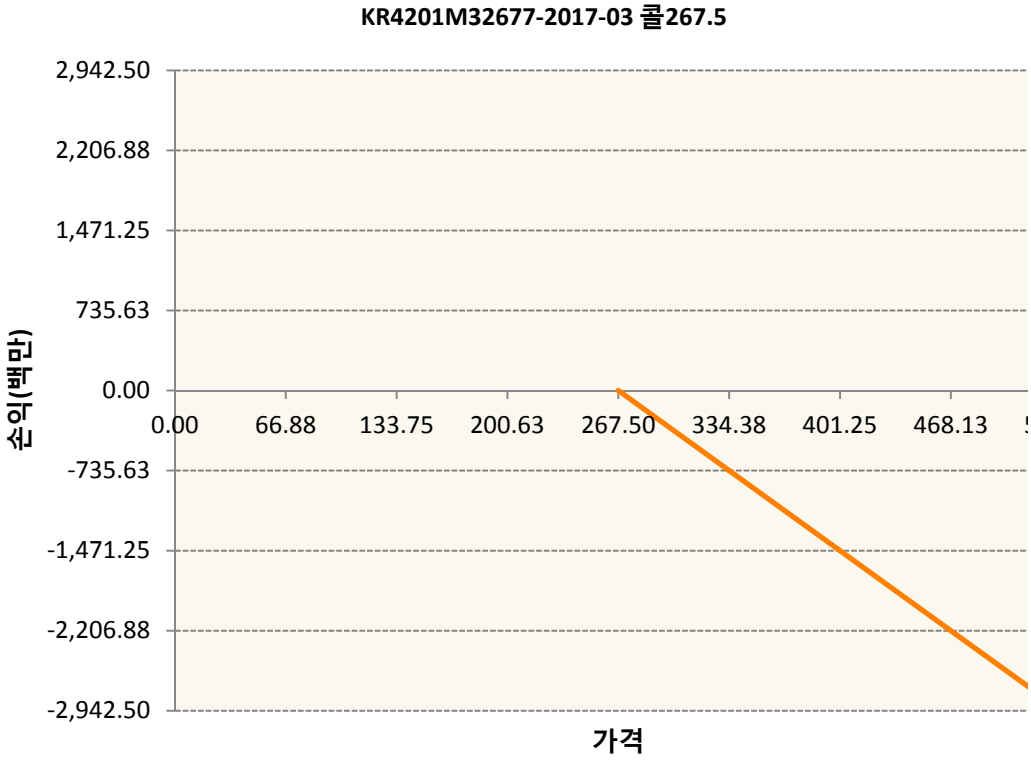
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	3,275	3,266	8	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	6,811	0	6,811	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,213	-3,213	장내

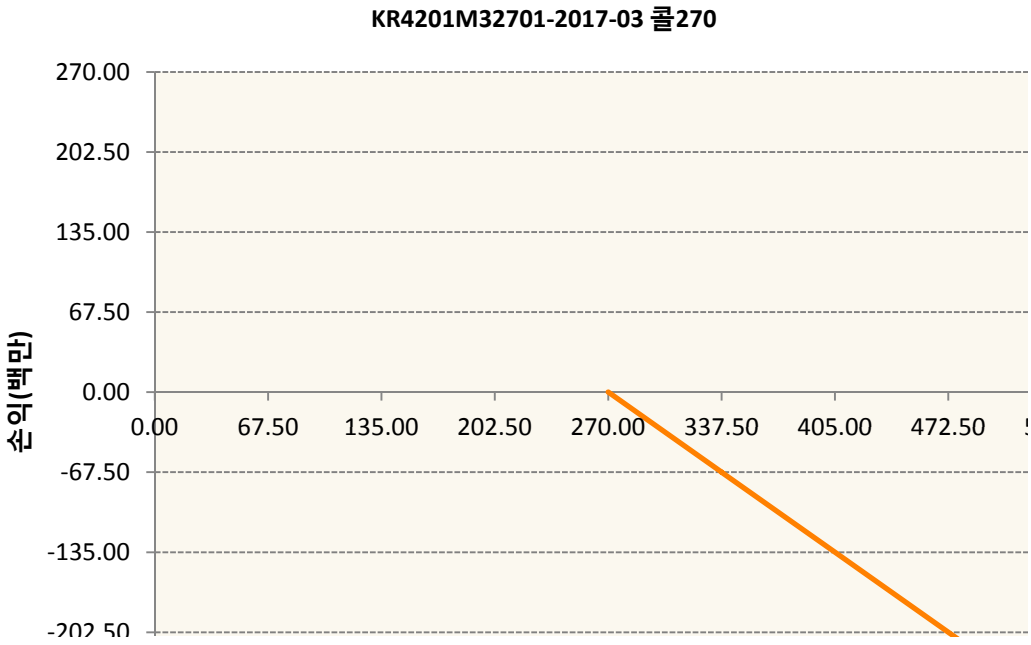
2. 만기시점의 손익구조

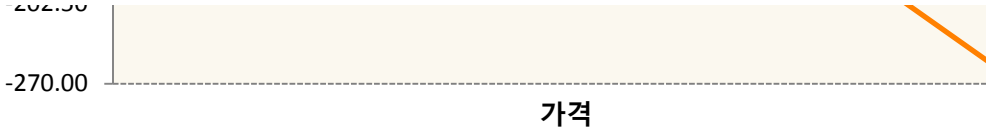





-818.10
-1,636.20
-2,454.30
-3,272.40
가격


KR4201M32677-2017-03 콜267.5
2,942.50
2,206.88
1,471.25
735.63
0.00
-735.63
-1,471.25
-2,206.88
-2,942.50
0.00
66.88
133.75
200.63
267.50
334.38
401.25
468.13
순익(백만)
가격


KR4201M32701-2017-03 콜270
270.00
202.50
135.00
67.50
0.00
-67.50
-135.00
0.00
67.50
135.00
202.50
270.00
337.50
405.00
472.50
순익(백만)



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101M30(2017-03 코스피200지수선물							283
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-283	-283	-283	-283	-283	-283	-283
-5.33%	-189	-189	-189	-189	-189	-189	-189
-2.67%	-94	-94	-94	-94	-94	-94	-94
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	94	94	94	94	94	94	94
5.33%	189	189	189	189	189	189	189
8.00%	283	283	283	283	283	283	283
KR4101M60(2017-06 코스피200지수선물							261
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-261	-261	-261	-261	-261	-261	-261
-5.33%	-174	-174	-174	-174	-174	-174	-174
-2.67%	-87	-87	-87	-87	-87	-87	-87
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	87	87	87	87	87	87	87
5.33%	174	174	174	174	174	174	174
8.00%	261	261	261	261	261	261	261
KR4201M32(2017-03 콜267.5							1,198
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	263	263	263	263	263	263	263
-5.33%	263	263	263	263	263	263	263
-2.67%	263	263	262	262	261	260	259
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-399	-399	-399	-399	-399	-399	-399
5.33%	-799	-799	-799	-799	-799	-799	-799
8.00%	-1,198	-1,198	-1,198	-1,198	-1,198	-1,198	-1,198
KR4201M32 2017-03 콜270							109
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	12	12	12	12	12	12	12
-5.33%	12	12	12	12	12	12	12
-2.67%	12	12	12	12	12	12	12

0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-36	-36	-36	-36	-36	-36	-36
5.33%	-72	-72	-72	-72	-72	-72	-72
8.00%	-109	-109	-109	-109	-109	-109	-109

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

2,136

공시일	2017-03-09
기준일	2017-03-08

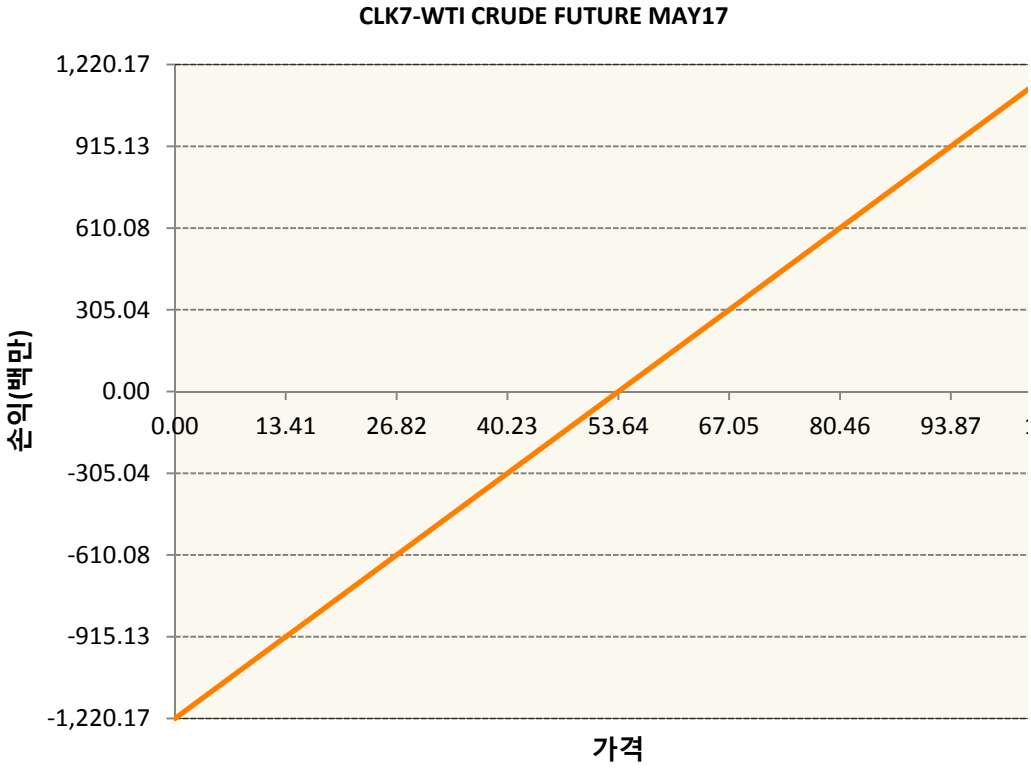
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

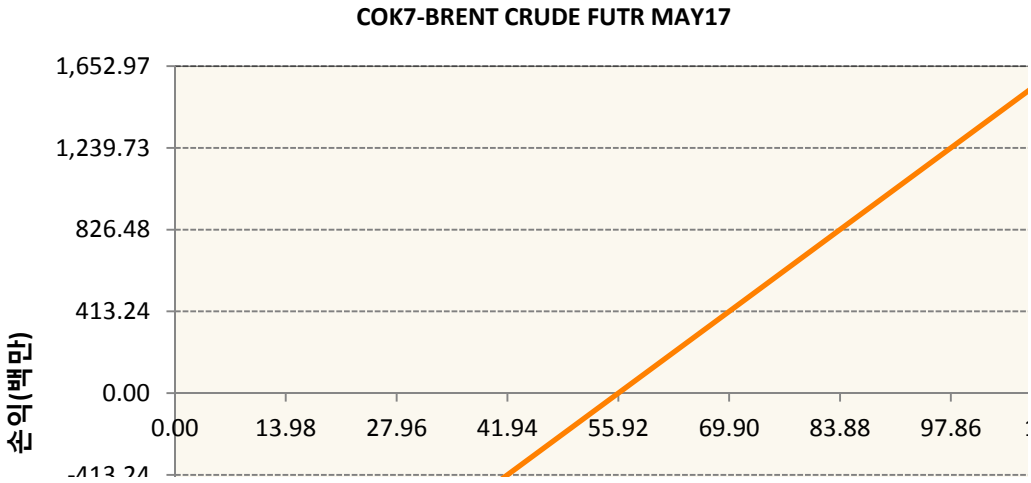
1. 계약금액

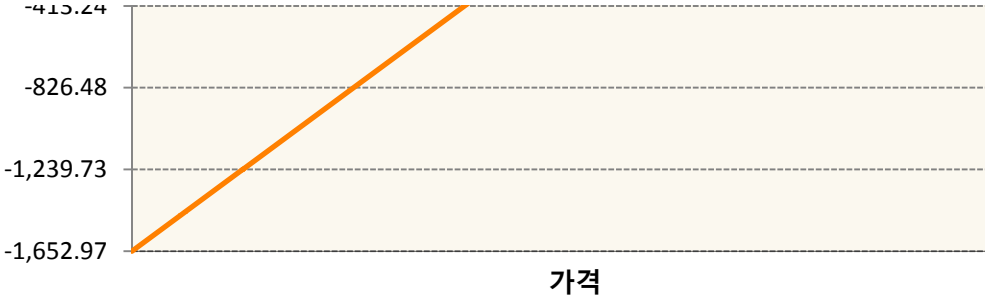
(단위:백만원)

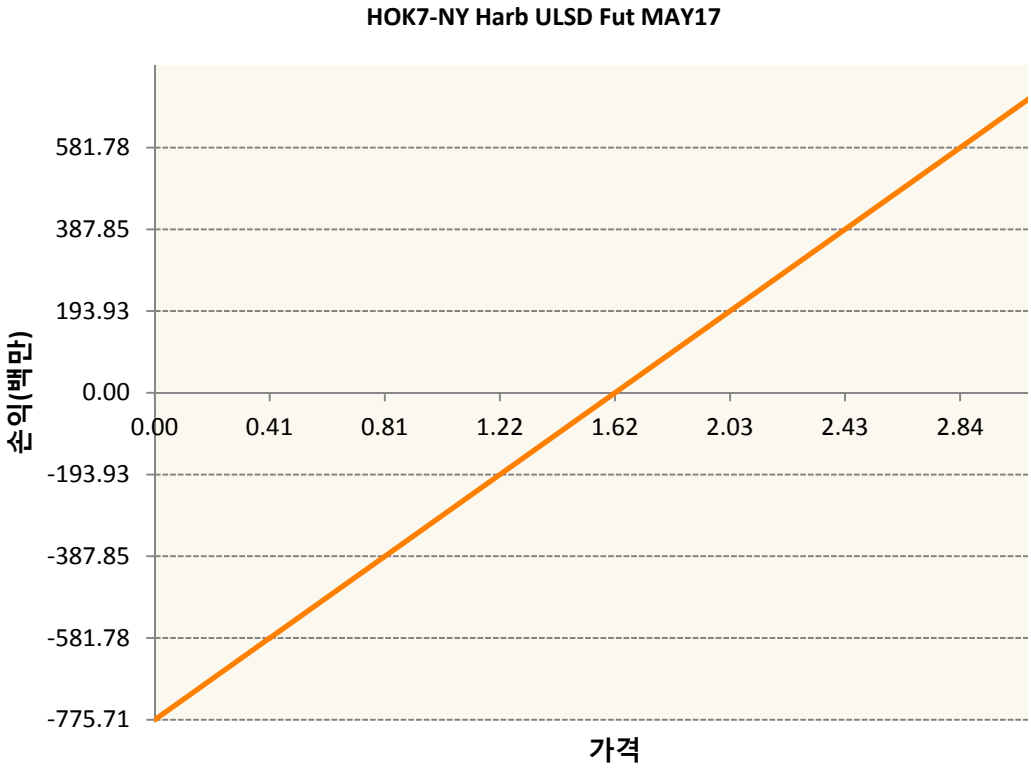
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	선물	유가증권	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	선물	유가증권	1,220	0	1,220	
누계	유가증권	선물	4,591	413	4,178	

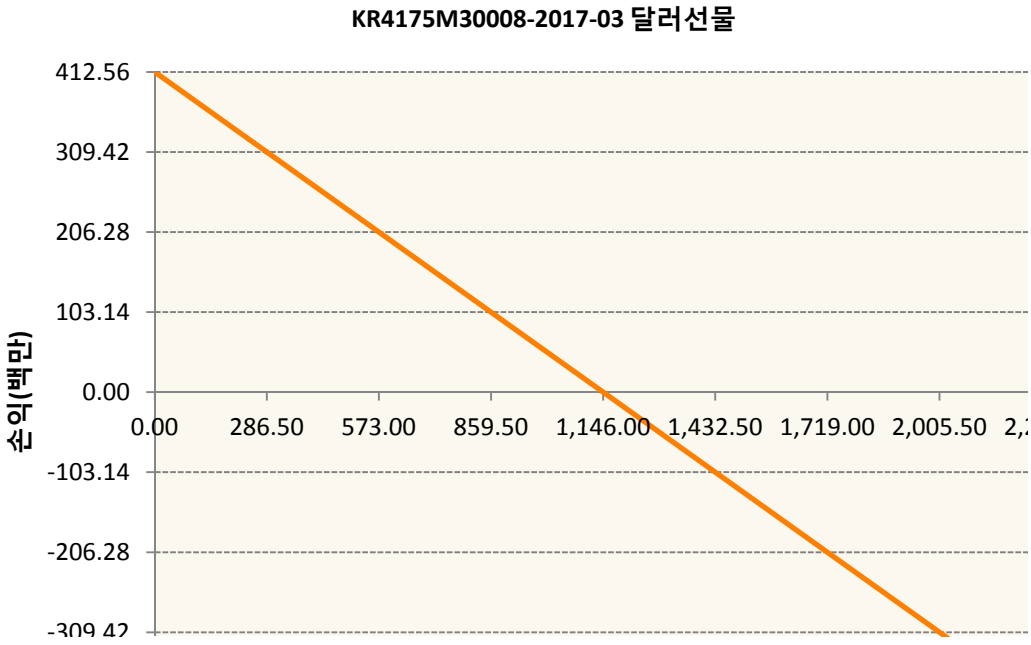
2. 만기시점의 손익구조

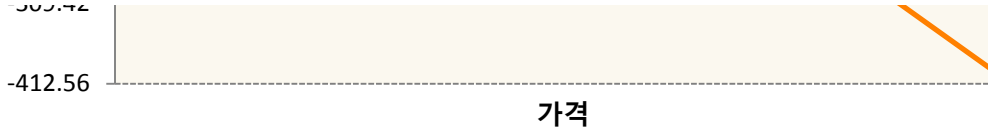


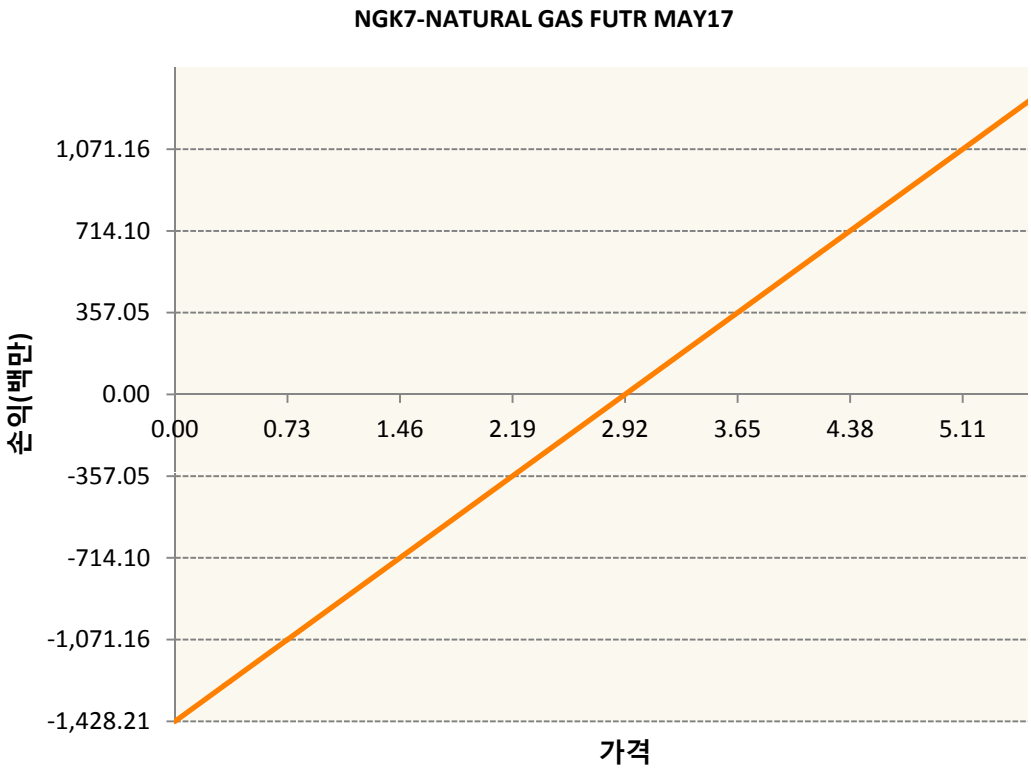


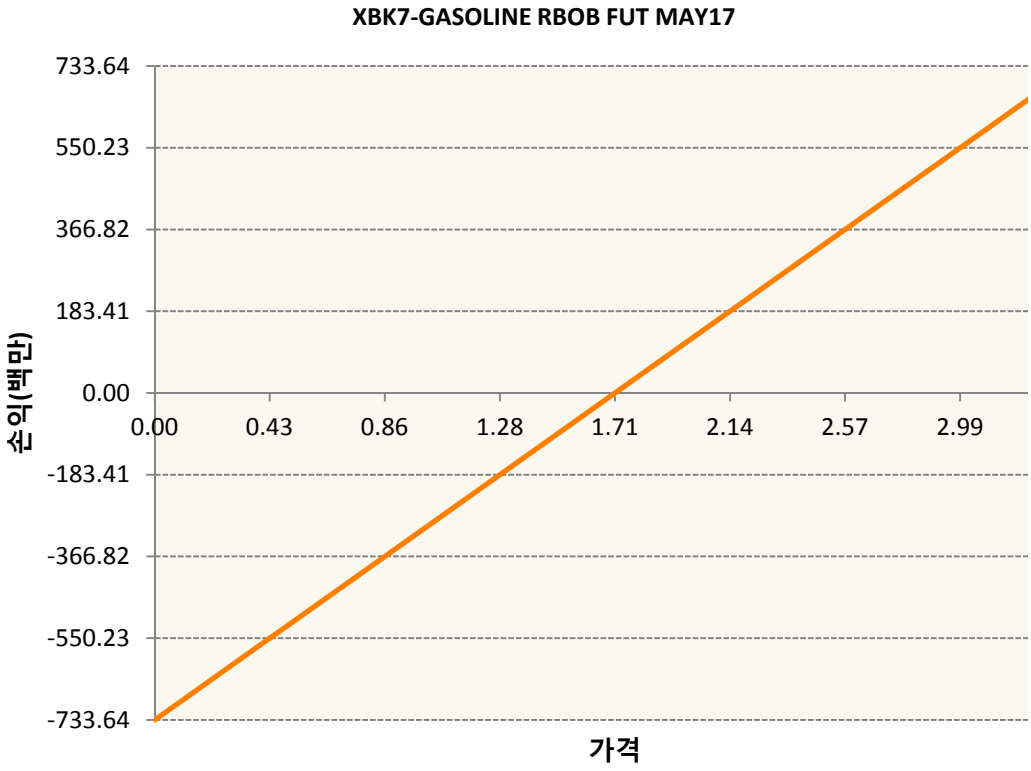

-826.48
-1,239.73
-1,652.97
가격


HOK7-NY Harb ULSD Fut MAY17
581.78
387.85
193.93
0.00
-193.93
-387.85
-581.78
-775.71
0.00
0.41
0.81
1.22
1.62
2.03
2.43
2.84
순익(백만)
가격


KR4175M30008-2017-03 달러선물
412.56
309.42
206.28
103.14
0.00
-103.14
-206.28
0.00
286.50
573.00
859.50
1,146.00
1,432.50
1,719.00
2,005.50
순익(백만)


-412.56
가격


NGK7-NATURAL GAS FUTR MAY17
1,071.16
714.10
357.05
0.00
-357.05
-714.10
-1,071.16
-1,428.21
0.00
0.73
1.46
2.19
2.92
3.65
4.38
5.11
순익(백만)
가격


XBK7-GASOLINE RBOB FUT MAY17
733.64
550.23
366.82
183.41
0.00
-183.41
-366.82
-550.23
-733.64
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	98
COK7	BRENT CRUDE FUTR MAY17	132
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)

1,029

공시일	2017-03-09
기준일	2017-03-08

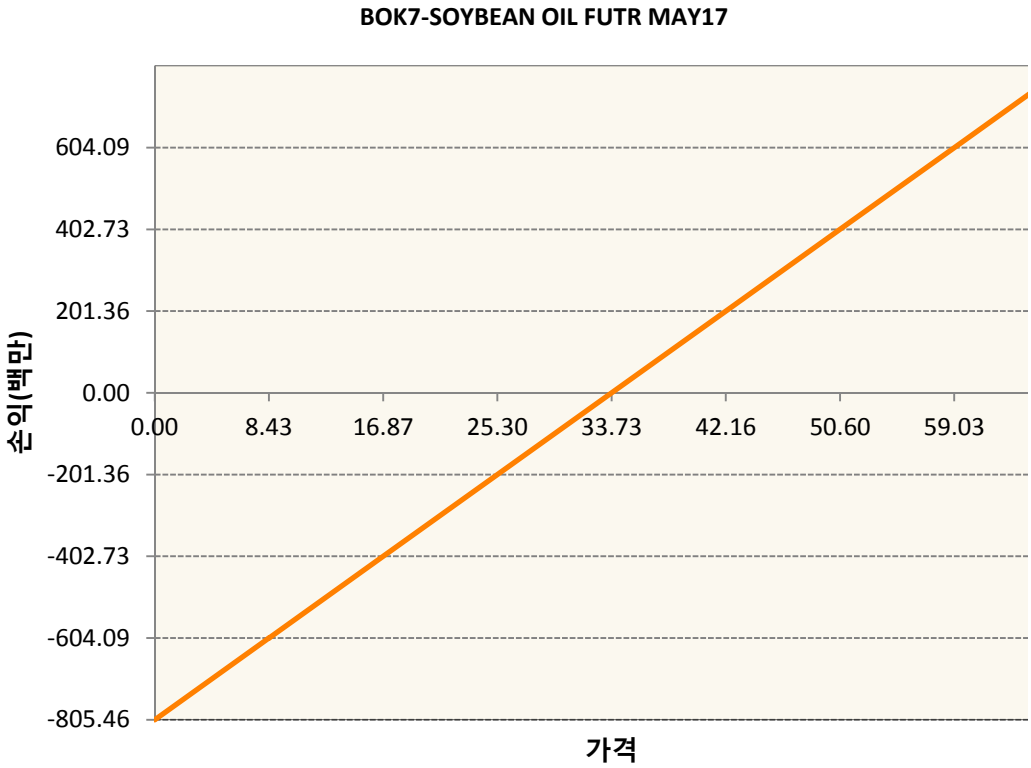
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

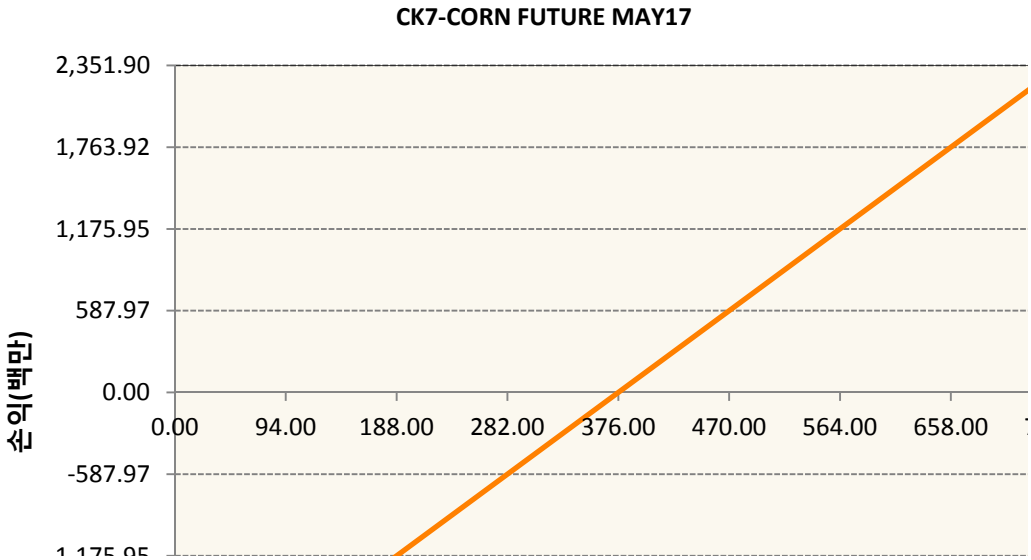
1. 계약금액

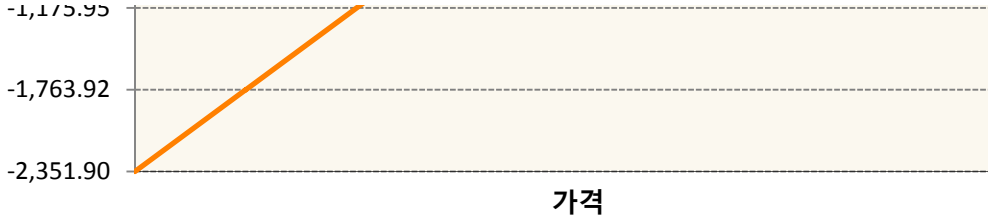
(단위:백만원)

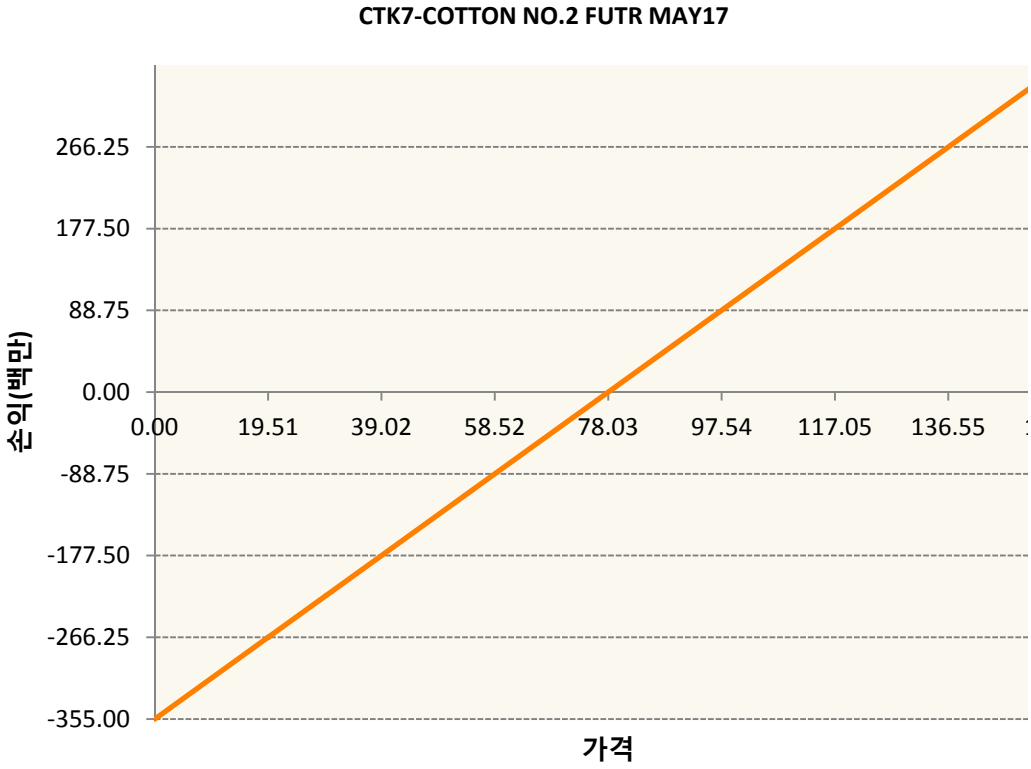
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	9,329	573	8,756	

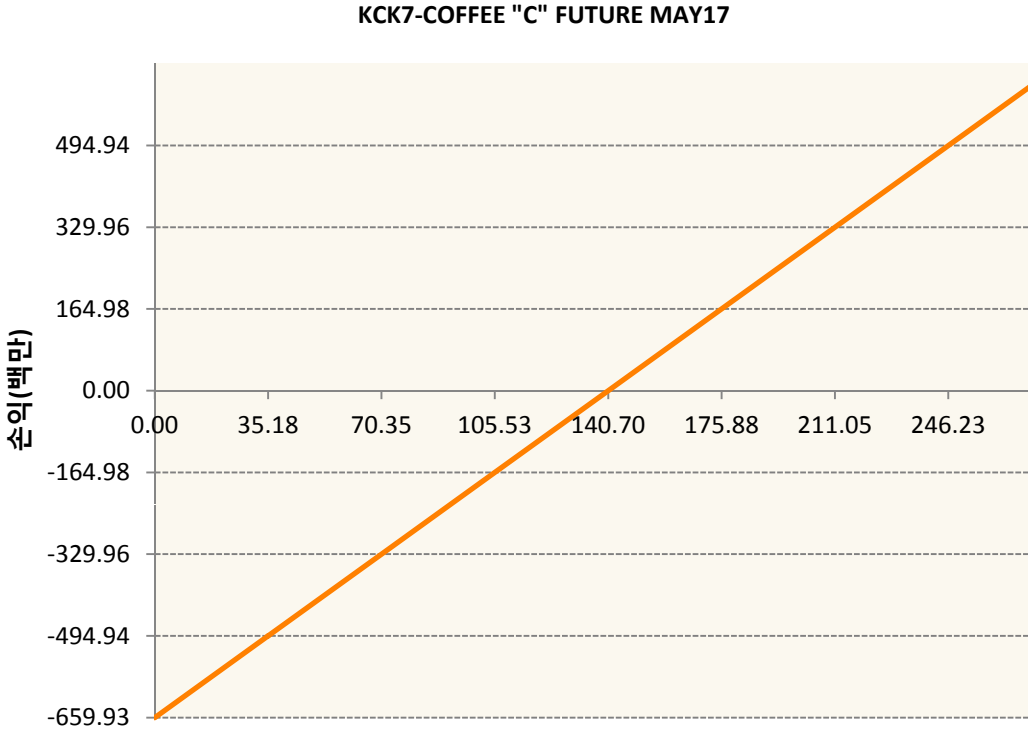
2. 만기시점의 손익구조



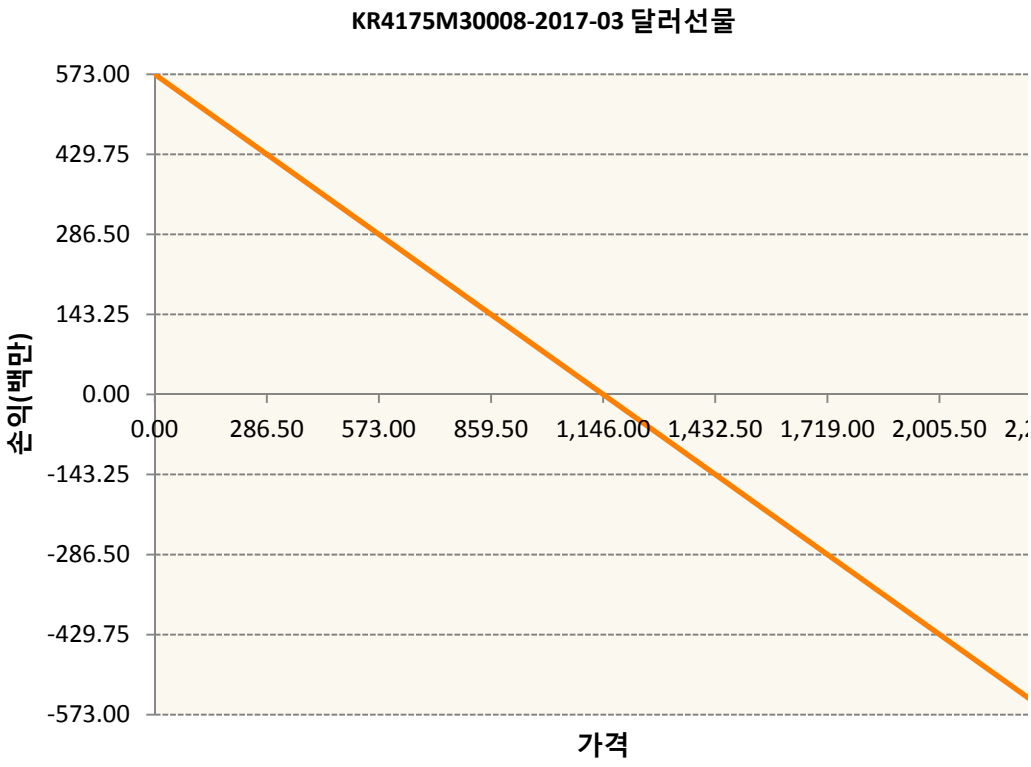


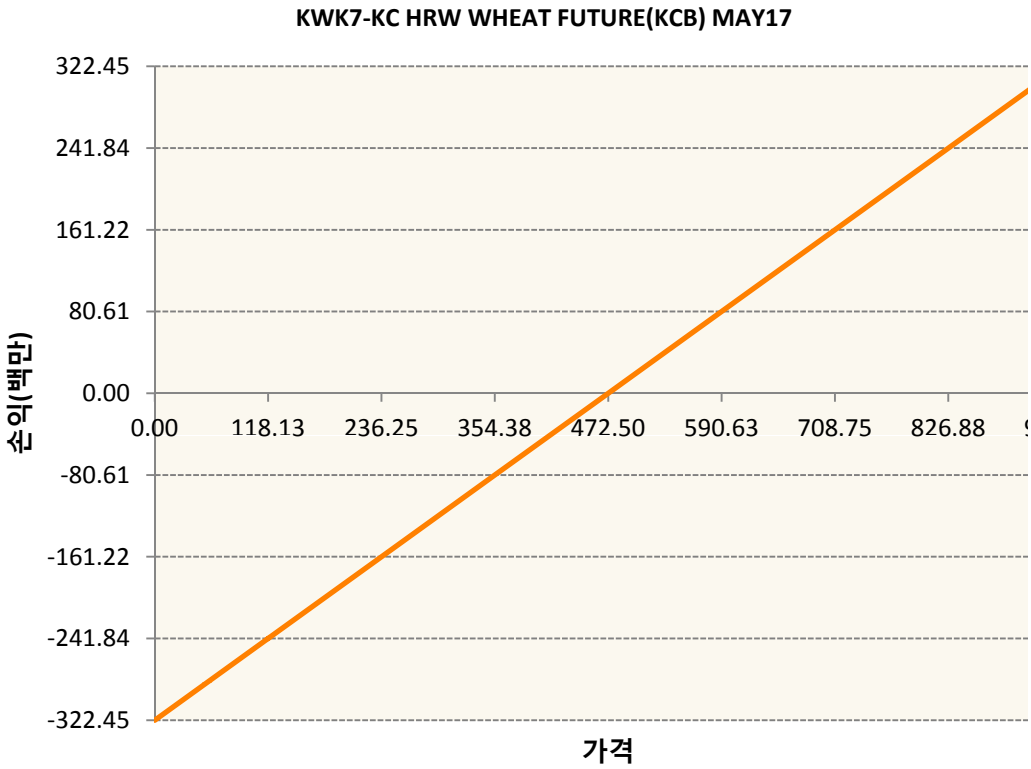

-1,763.92
-2,351.90
가격

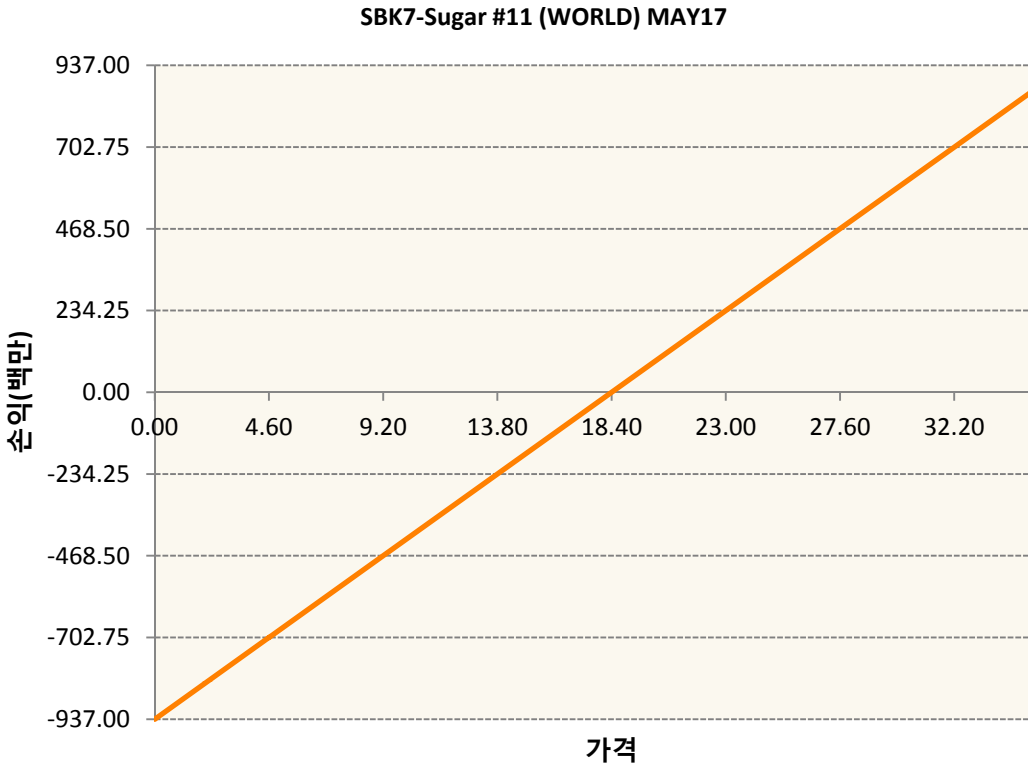

CTK7-COTTON NO.2 FUTR MAY17
266.25
177.50
88.75
0.00
-88.75
-177.50
-266.25
-355.00
0.00
19.51
39.02
58.52
78.03
97.54
117.05
136.55
순익(백만)
가격

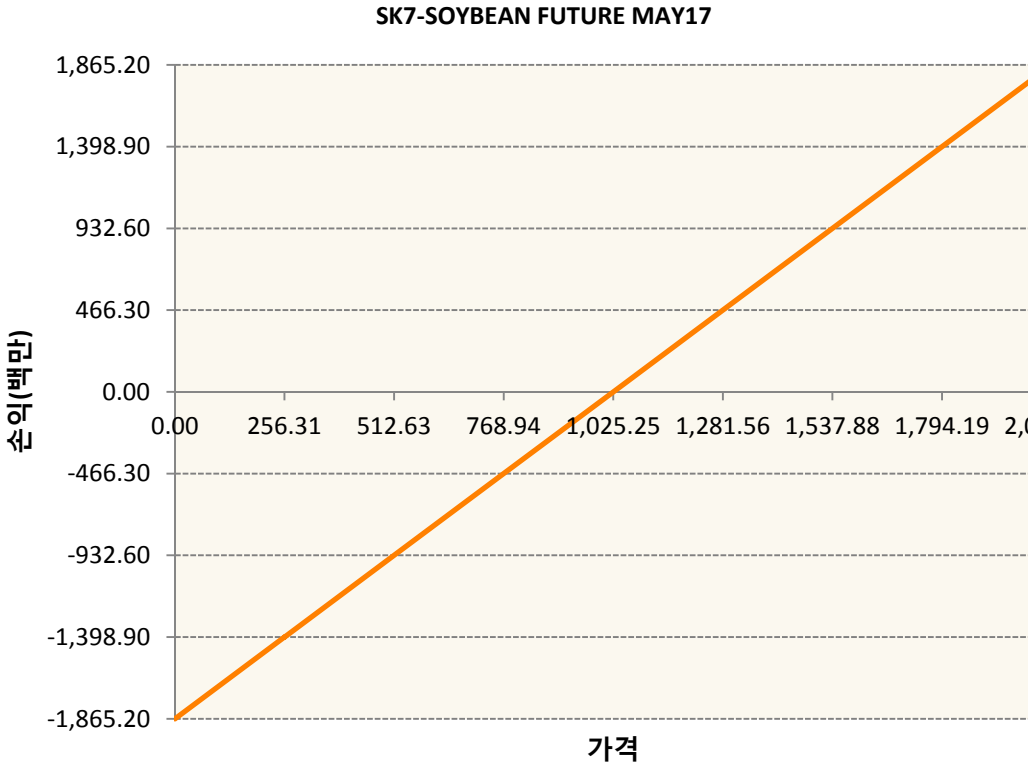

KCK7-COFFEE "C" FUTURE MAY17
494.94
329.96
164.98
0.00
-164.98
-329.96
-494.94
-659.93
0.00
35.18
70.35
105.53
140.70
175.88
211.05
246.23
순익(백만)

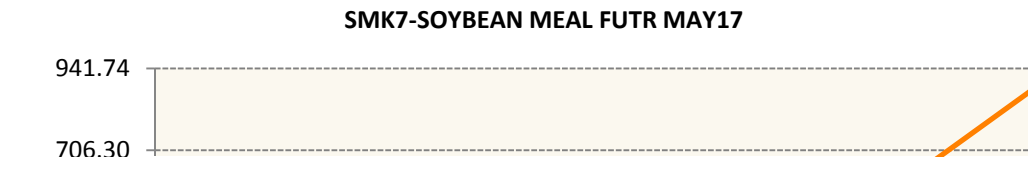
가격

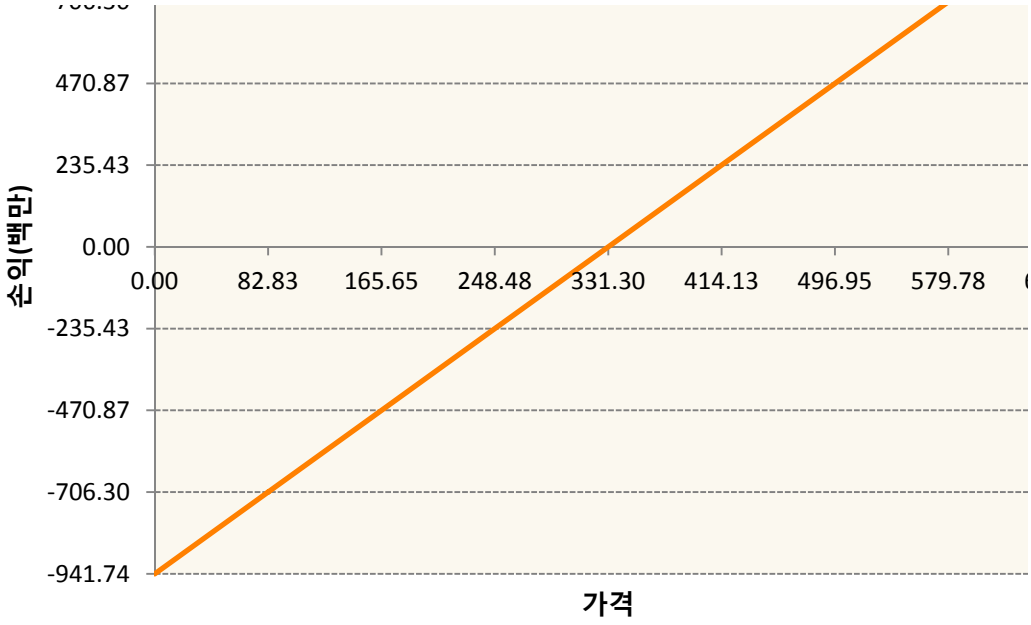

KR4175M30008-2017-03 달러선물
573.00
429.75
286.50
143.25
0.00
-143.25
-286.50
-429.75
-573.00
0.00
286.50
573.00
859.50
1,146.00
1,432.50
1,719.00
2,005.50
손익(백만)
가격

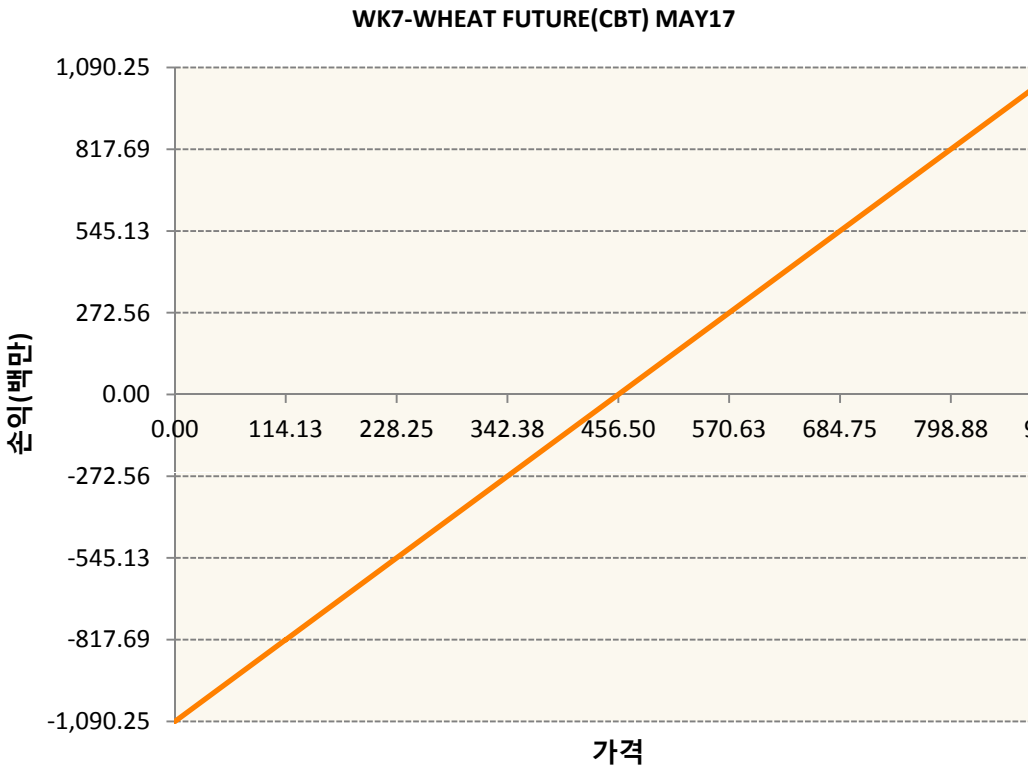

KWK7-KC HRW WHEAT FUTURE(KCB) MAY17
322.45
241.84
161.22
80.61
0.00
-80.61
-161.22
-241.84
-322.45
0.00
118.13
236.25
354.38
472.50
590.63
708.75
826.88
손익(백만)
가격


SBK7-Sugar #11 (WORLD) MAY17
937.00
702.75
468.50
234.25
0.00
-234.25
-468.50
-702.75
-937.00
0.00
4.60
9.20
13.80
18.40
23.00
27.60
32.20
손익(백만)
가격


SK7-SOYBEAN FUTURE MAY17
1,865.20
1,398.90
932.60
466.30
0.00
-466.30
-932.60
-1,398.90
-1,865.20
0.00
256.31
512.63
768.94
1,025.25
1,281.56
1,537.88
1,794.19
손익(백만)
가격


SMK7-SOYBEAN MEAL FUTR MAY17
941.74
706.30





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

BOK7	SOYBEAN OIL FUTR MAY17	64
CK7	CORN FUTURE MAY17	188
CTK7	COTTON NO.2 FUTR MAY17	28
KCK7	COFFEE "C" FUTURE MAY17	53
KR4175M30(	2017-03 달러선물	46

KWK7	KC HRW WHEAT FUTURE(KCB) MAY17	26
SBK7	Sugar #11 (WORLD) MAY17	75
SK7	SOYBEAN FUTURE MAY17	149
SMK7	SOYBEAN MEAL FUTR MAY17	75
WK7	WHEAT FUTURE(CBT) MAY17	87

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

867