공시일	2017-03-10
기준일	2017-03-09

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	2017-03-10
기준일	2017-03-09

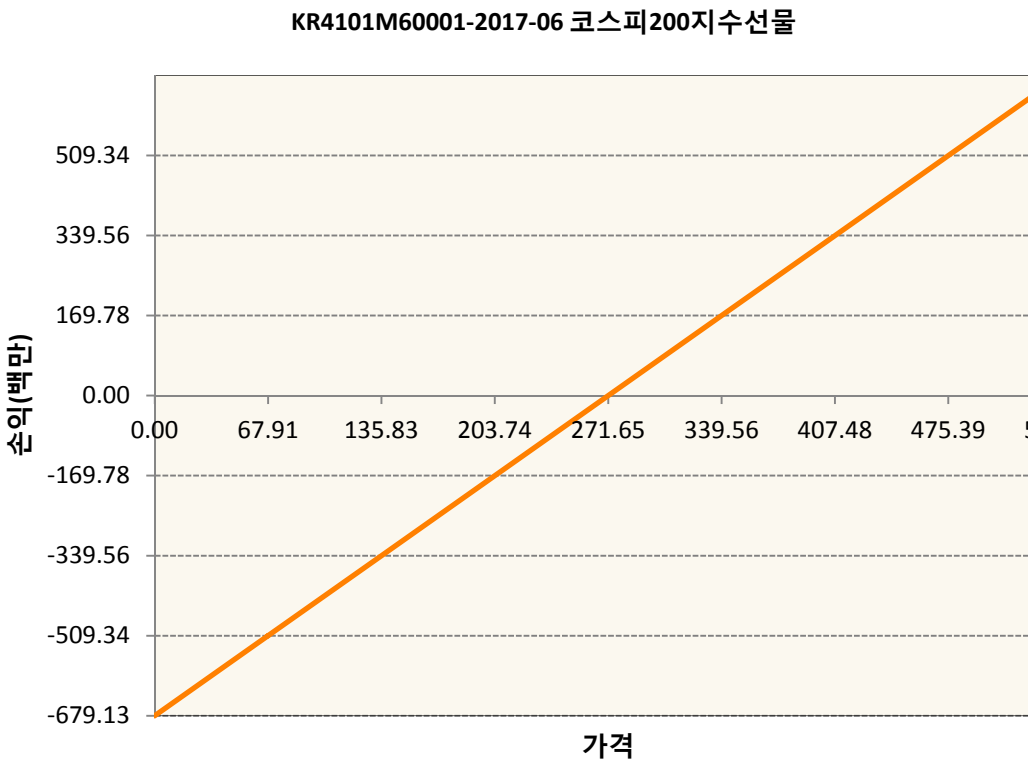
스마트인덱스모

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	409	0	409	장내
누계	유가증권	선물	679	0	679	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101M60(2017-06 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	2017-03-10
기준일	2017-03-09

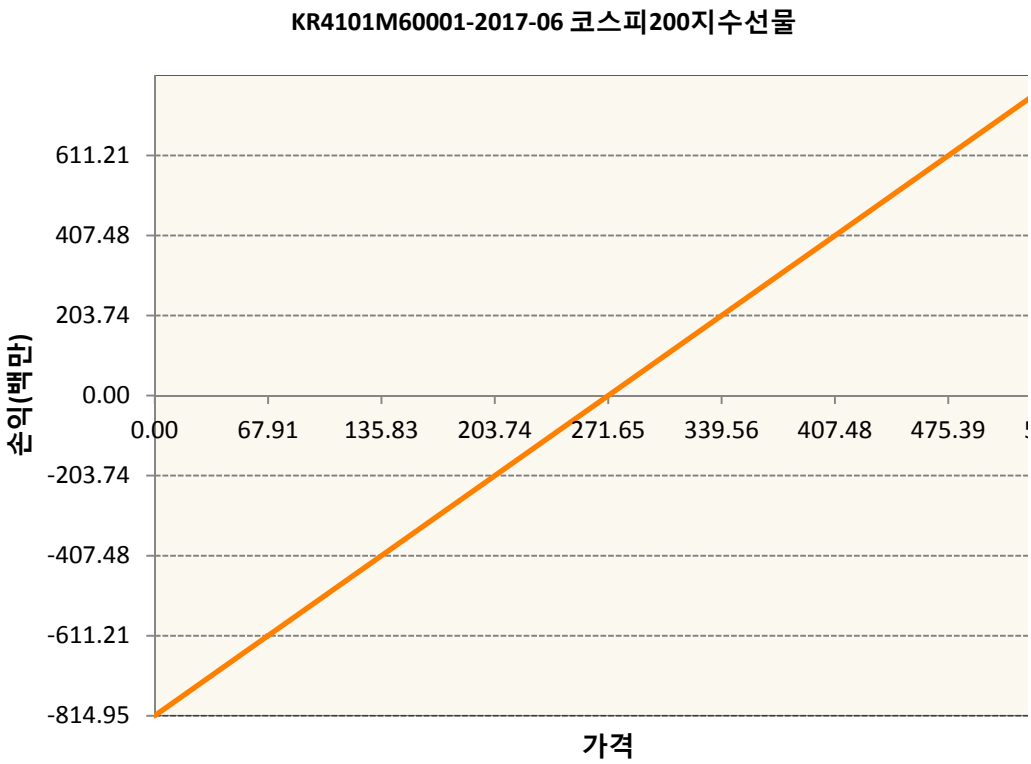
스마트레버리지목표전환형1호

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	409	0	409	장내
누계	유가증권	선물	815	0	815	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

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%	-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	2017-03-10
기준일	2017-03-09

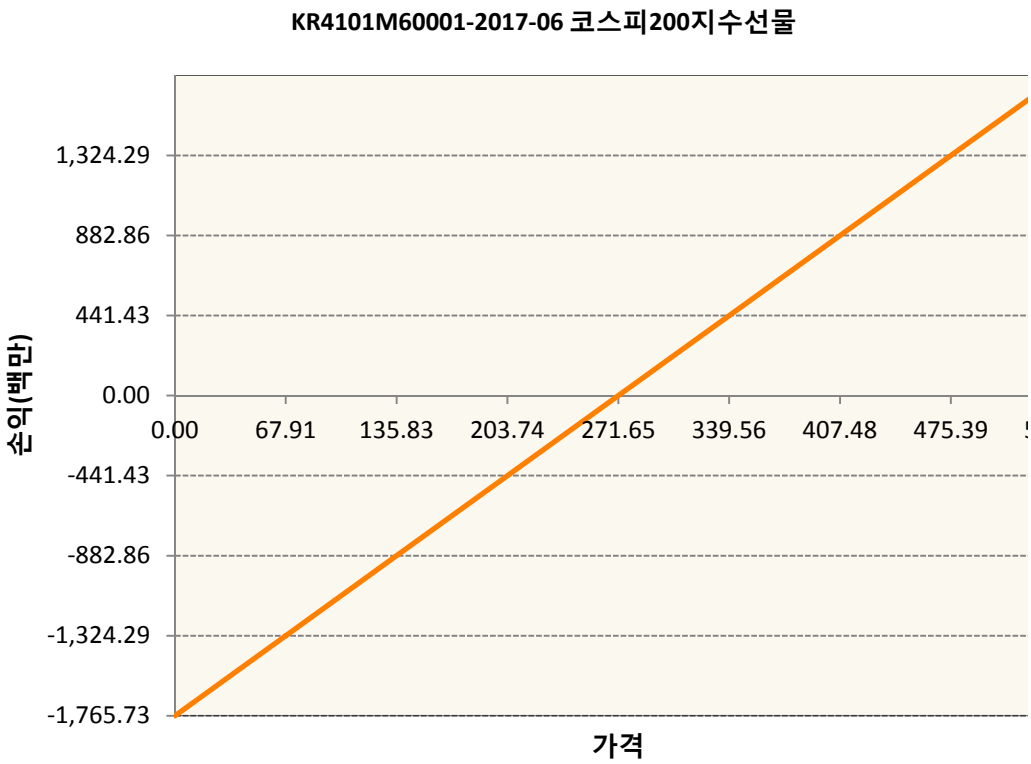
1.3배 레버리지 인덱스(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	954	0	954	장내
누계	유가증권	선물	1,766	0	1,766	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101M60(2017-06 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	2017-03-10
기준일	2017-03-09

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	947

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

586

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-03-10
기준일	2017-03-09

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	390

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

460

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-03-10
기준일	2017-03-09

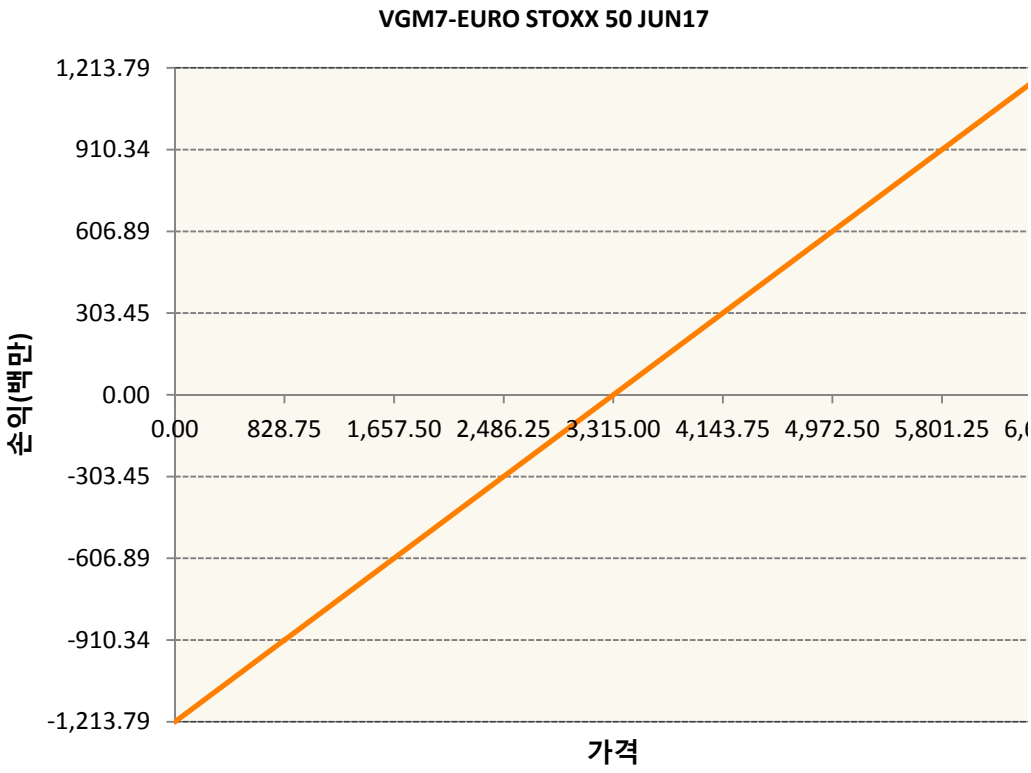
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,214	0	1,214	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGM7	EURO STOXX 50 JUN17	97

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

(단위:백만원)

99

공시일	2017-03-10
기준일	2017-03-09

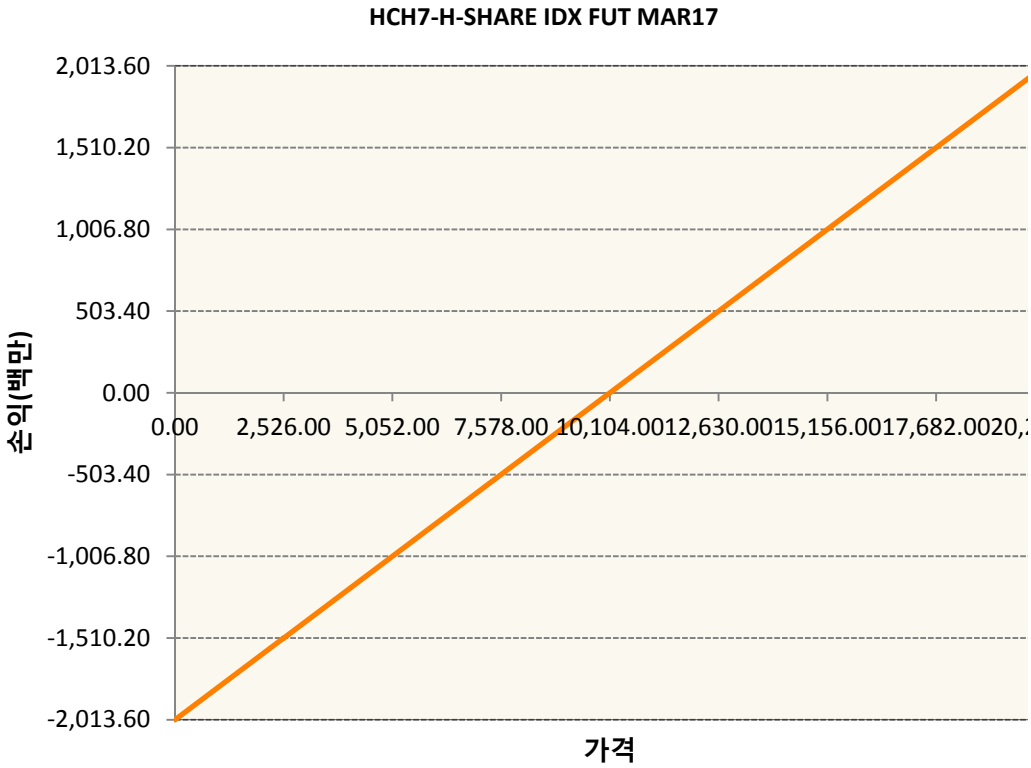
차이나인덱스모(주식-파생형)

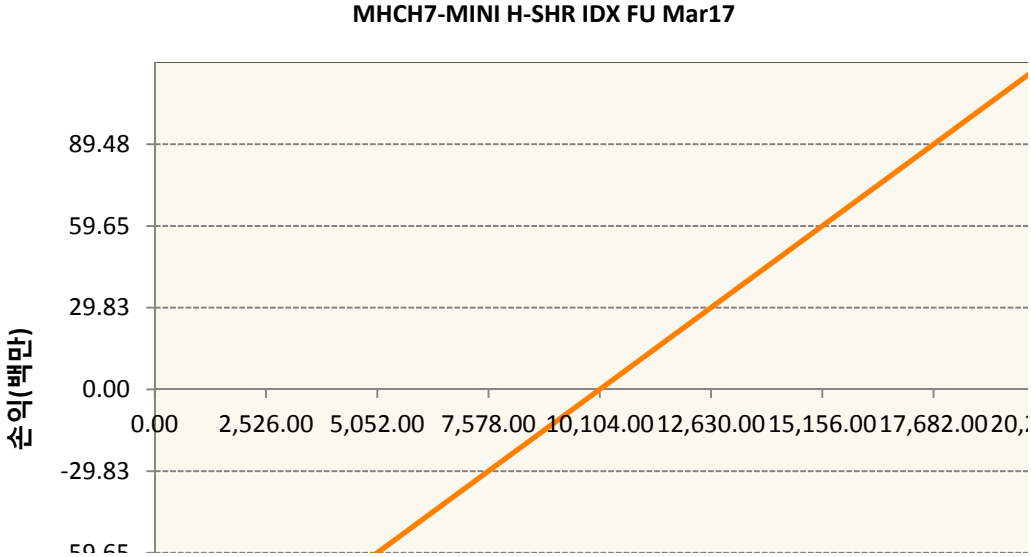
1. 계약금액

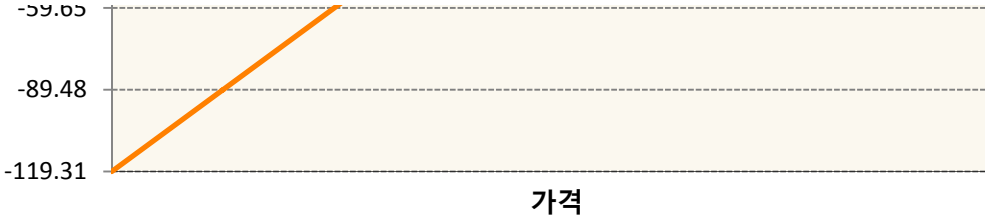
(단위:백만원)

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

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCH7	H-SHARE IDX FUT MAR17	161
MHCH7	MINI H-SHR IDX FU Mar17	10

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	190

공시일	2017-03-10
기준일	2017-03-09

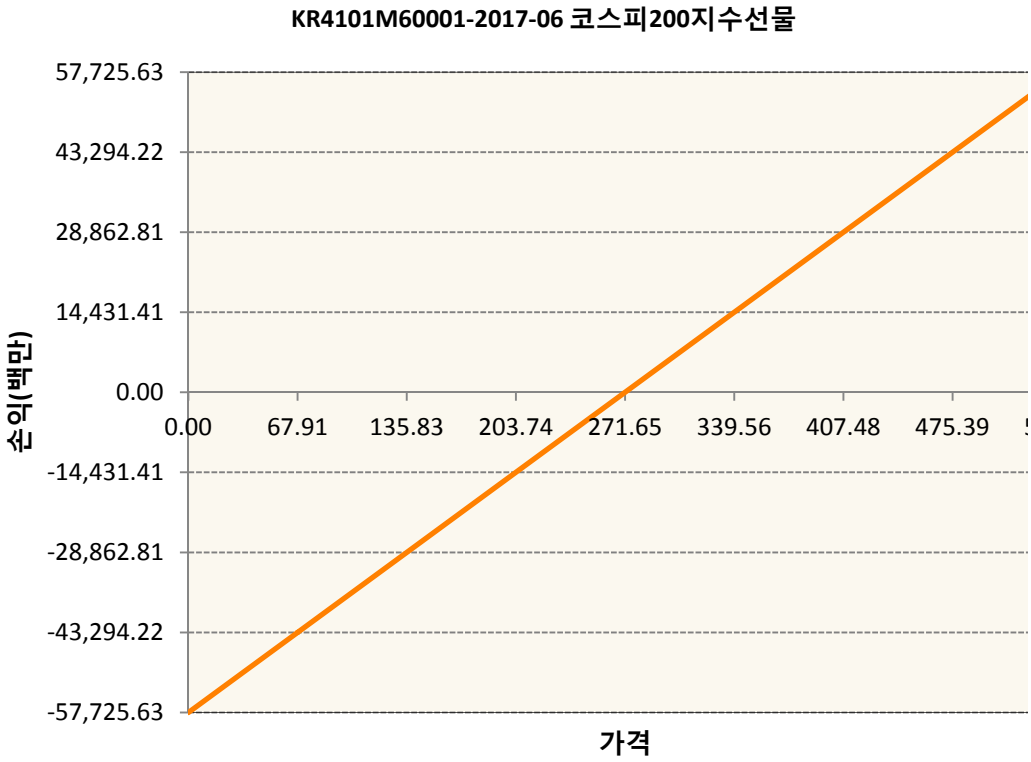
커버드콜모(주식혼합-파생형)

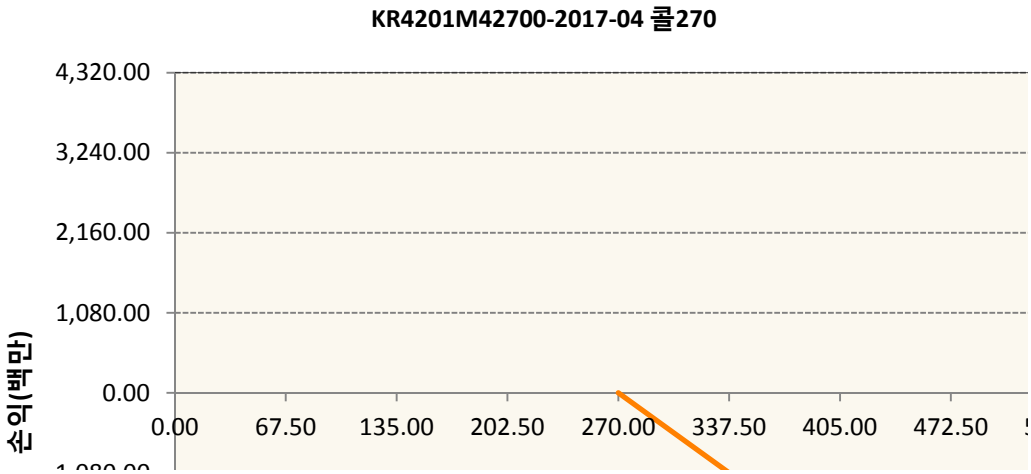
1. 계약금액

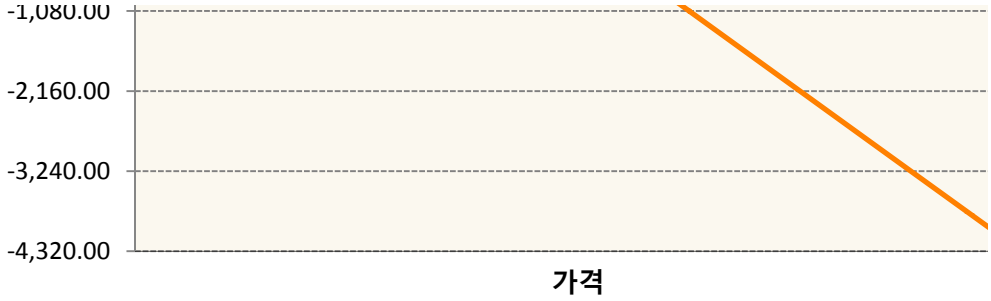
(단위:백만원)

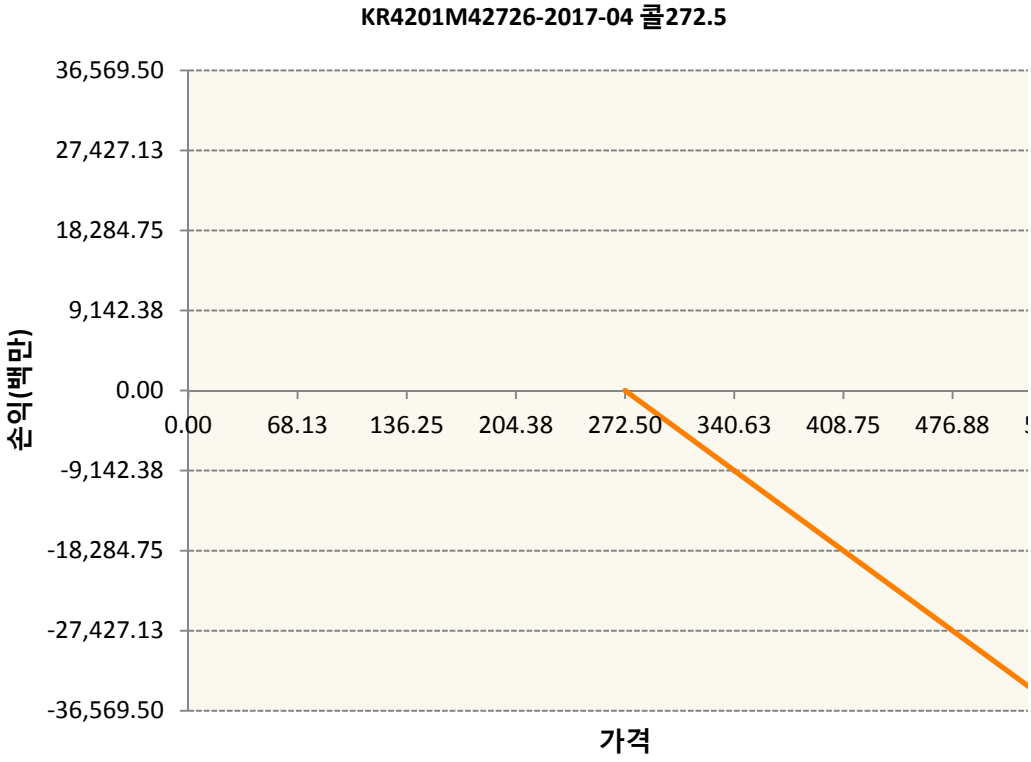
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	26,437	0	26,437	장내
신규	유가증권	옵션	0	22,225	-22,225	장내
누계	유가증권	선물	57,726	0	57,726	장내
누계	유가증권	옵션	0	40,890	-40,890	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101M60(2017-06 코스피200지수선물							4,618
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-4,618	-4,618	-4,618	-4,618	-4,618	-4,618	-4,618
-5.33%	-3,078	-3,078	-3,078	-3,078	-3,078	-3,078	-3,078
-2.67%	-1,539	-1,539	-1,539	-1,539	-1,539	-1,539	-1,539
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	1,539	1,539	1,539	1,539	1,539	1,539	1,539
5.33%	3,078	3,078	3,078	3,078	3,078	3,078	3,078
8.00%	4,618	4,618	4,618	4,618	4,618	4,618	4,618
KR4201M42 2017-04 콜270							1,497
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	376	375	374	372	369	365	360
-5.33%	369	363	355	346	336	324	311
-2.67%	306	287	266	245	224	202	179
0%	76	51	25	0	-25	-51	-77
2.67%	-361	-375	-390	-407	-425	-444	-464
5.33%	-909	-913	-918	-924	-932	-942	-952
8.00%	-1,485	-1,485	-1,486	-1,487	-1,490	-1,493	-1,497
KR4201M42: 2017-04 콜272.5							11,802

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	2,307	2,305	2,301	2,292	2,278	2,257	2,229
-5.33%	2,282	2,256	2,218	2,168	2,105	2,031	1,945
-2.67%	1,996	1,876	1,742	1,597	1,443	1,282	1,115
0%	648	432	216	0	-216	-433	-650
2.67%	-2,464	-2,623	-2,792	-2,969	-3,151	-3,339	-3,531
5.33%	-6,841	-6,893	-6,961	-7,043	-7,139	-7,248	-7,367
8.00%	-11,627	-11,635	-11,650	-11,673	-11,706	-11,749	-11,802

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

17,636

공시일	2017-03-10
기준일	2017-03-09

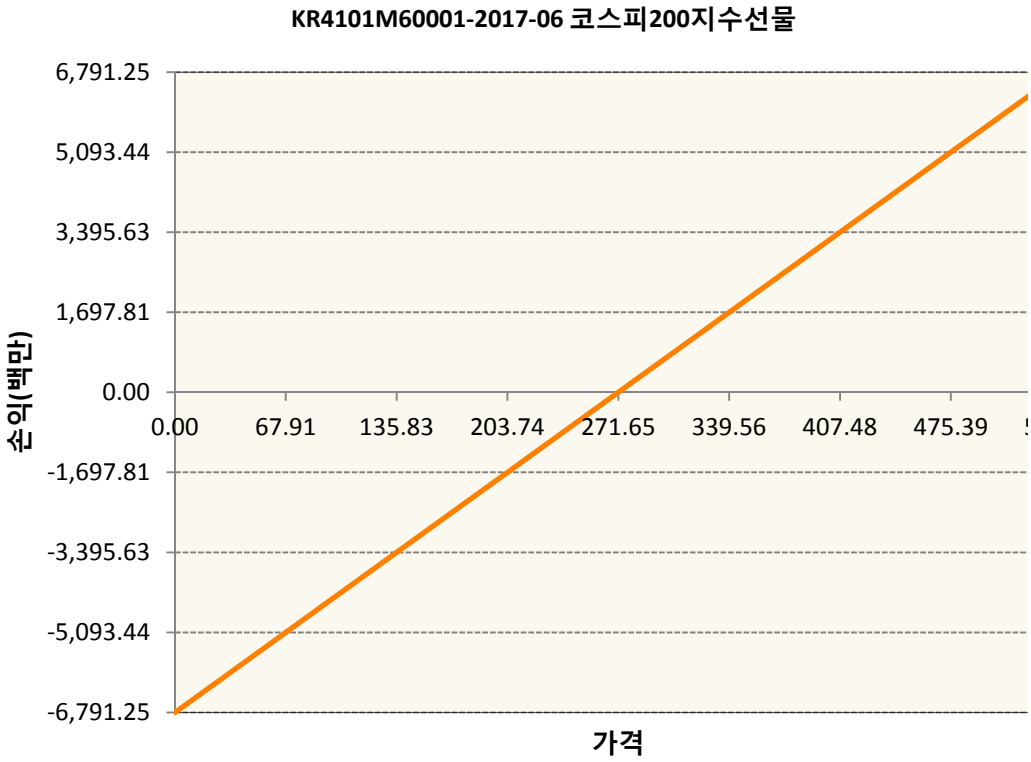
커버드콜목표전환형증권투자신탁

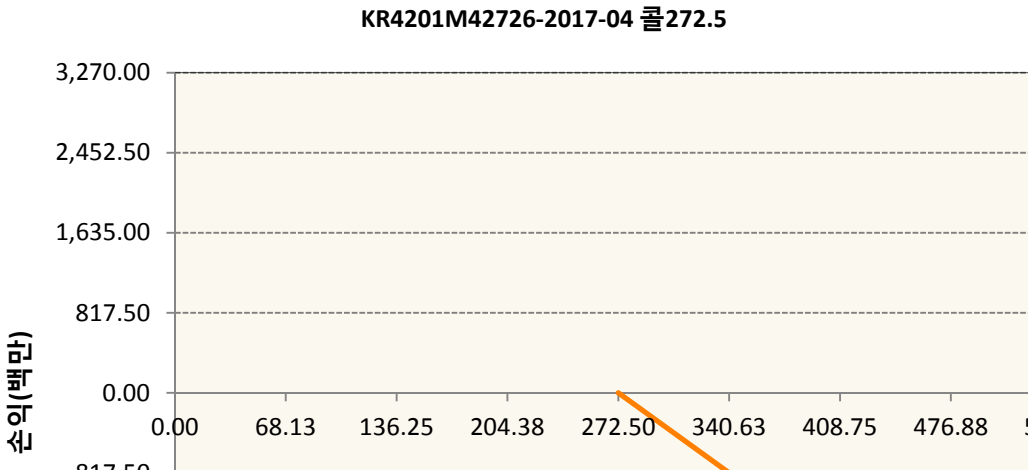
1. 계약금액

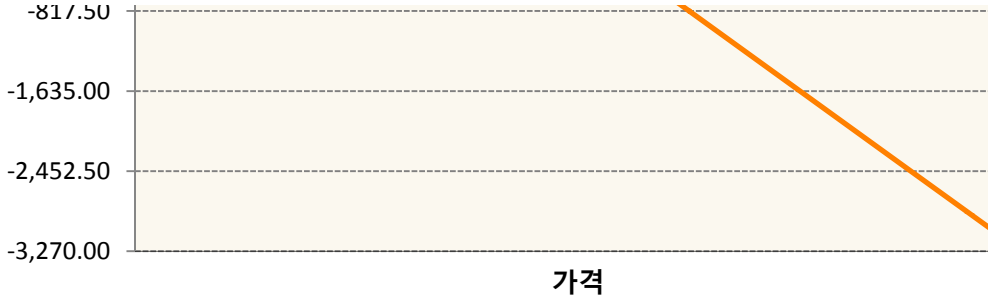
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	3,543	0	3,543	장내
신규	유가증권	옵션	0	3,307	-3,307	장내
누계	유가증권	선물	6,791	0	6,791	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,270	-3,270	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101M60(2017-06 코스피200지수선물							543
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-543	-543	-543	-543	-543	-543	-543
-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%	543	543	543	543	543	543	543
KR4201M42 2017-04 콜272.5							1,055
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	206	206	206	205	204	202	199
-5.33%	204	202	198	194	188	182	174
-2.67%	179	168	156	143	129	115	100
0%	58	39	19	0	-19	-39	-58
2.67%	-220	-235	-250	-265	-282	-299	-316
5.33%	-612	-616	-622	-630	-638	-648	-659
8.00%	-1,040	-1,040	-1,042	-1,044	-1,047	-1,051	-1,055

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

1,509

공시일	2017-03-10
기준일	2017-03-09

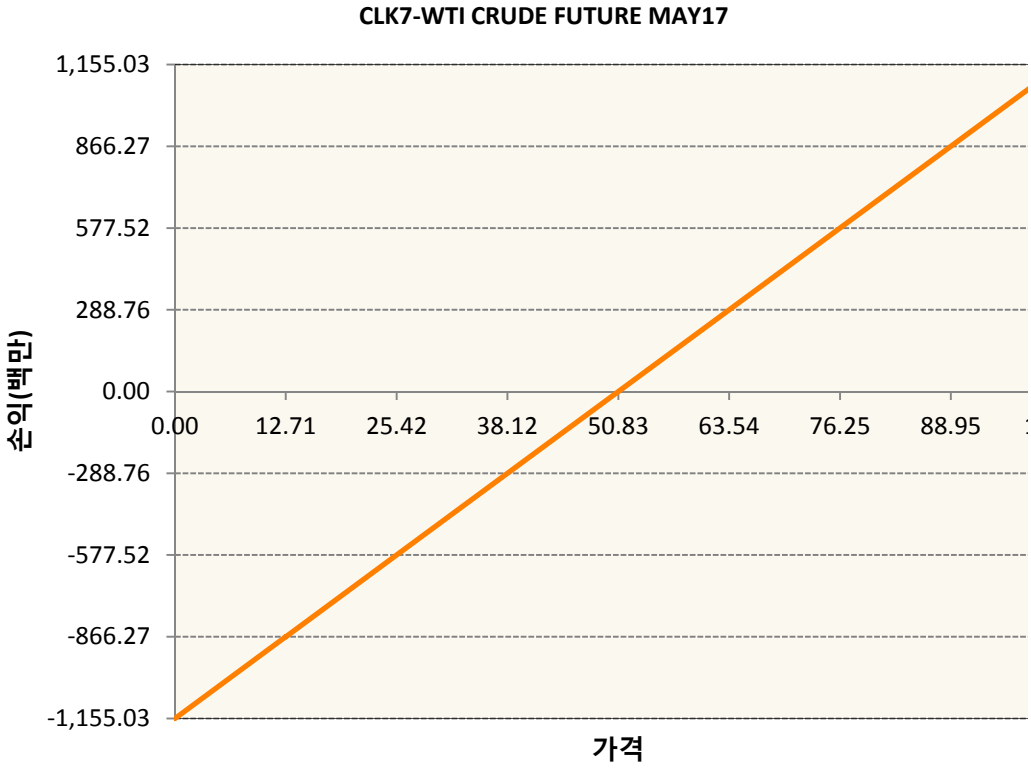
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

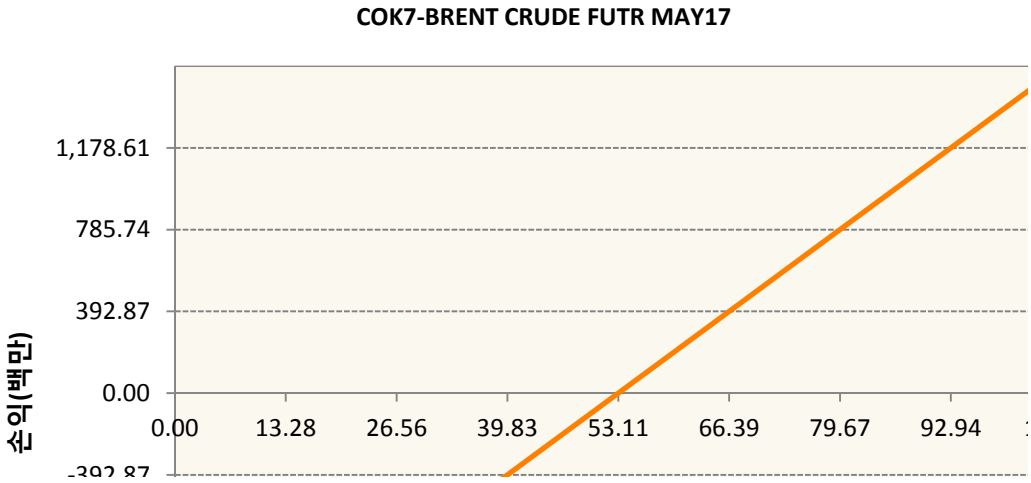
1. 계약금액

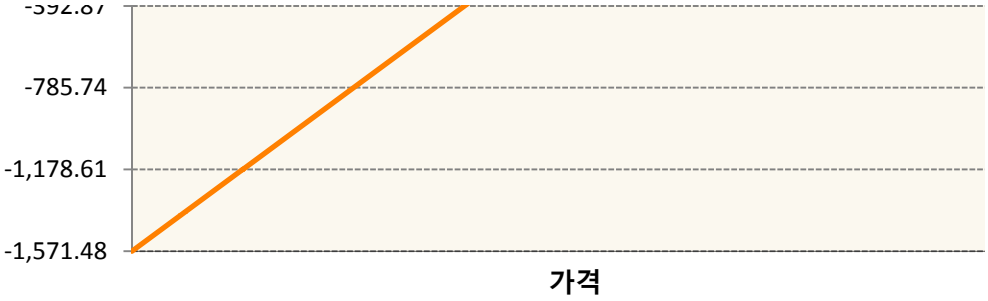
(단위:백만원)

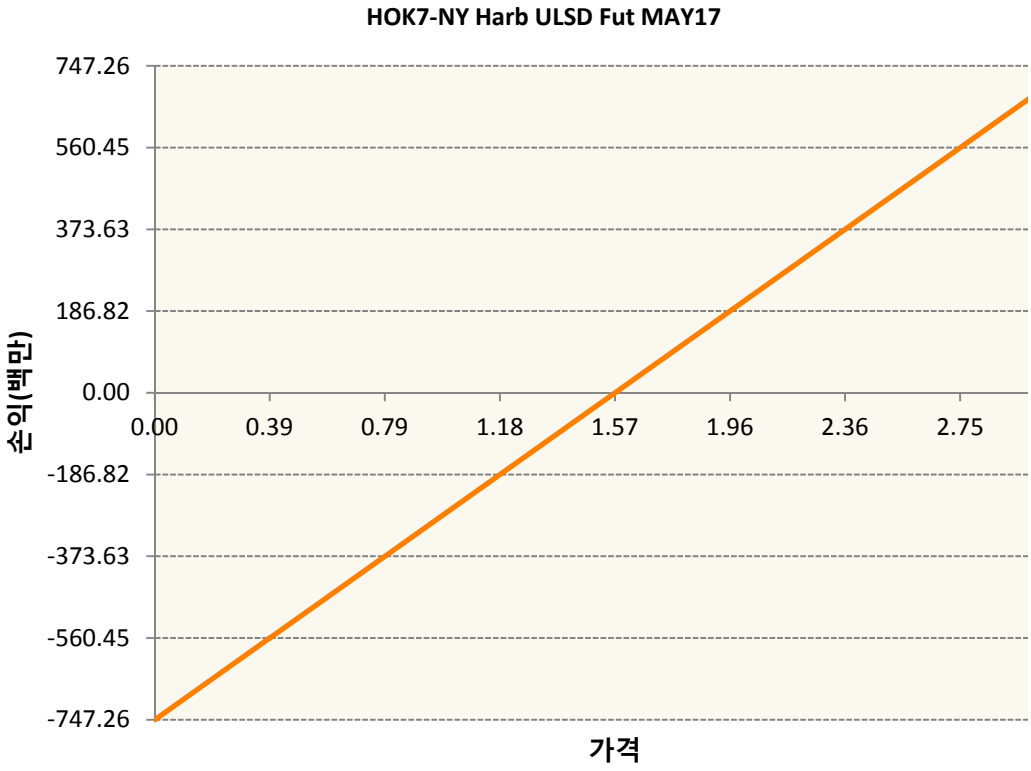
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	선물	유가증권	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	선물	유가증권	1,155	0	1,155	
누계	유가증권	선물	4,494	417	4,077	

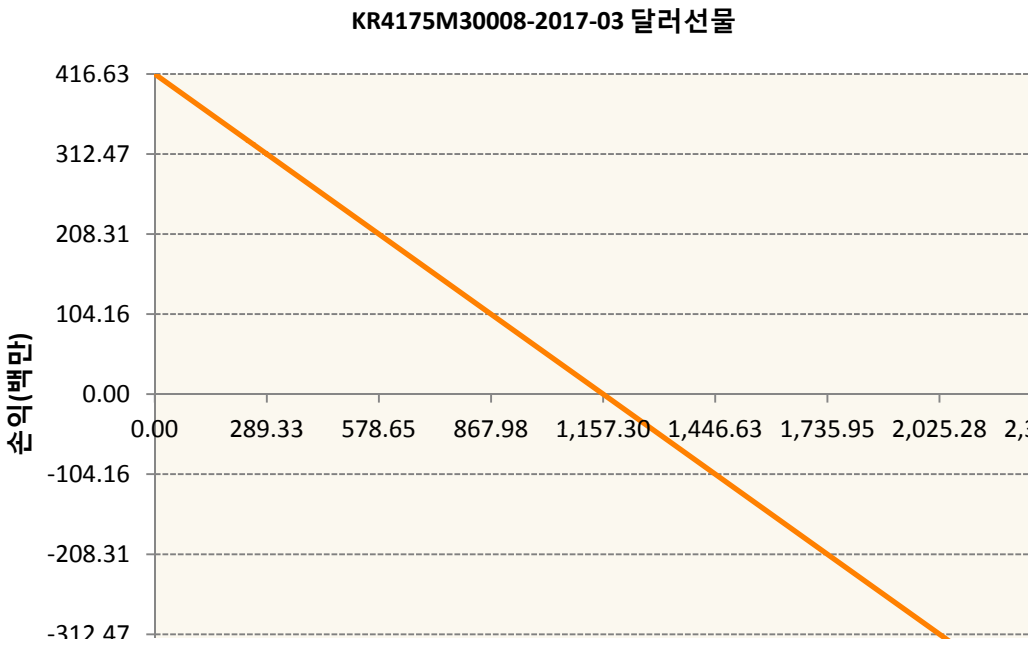
2. 만기시점의 손익구조

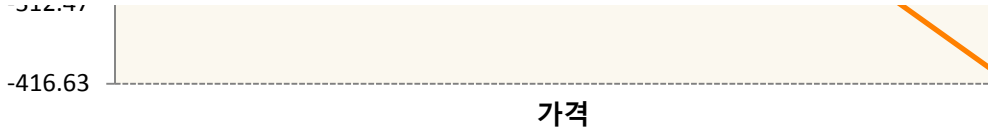


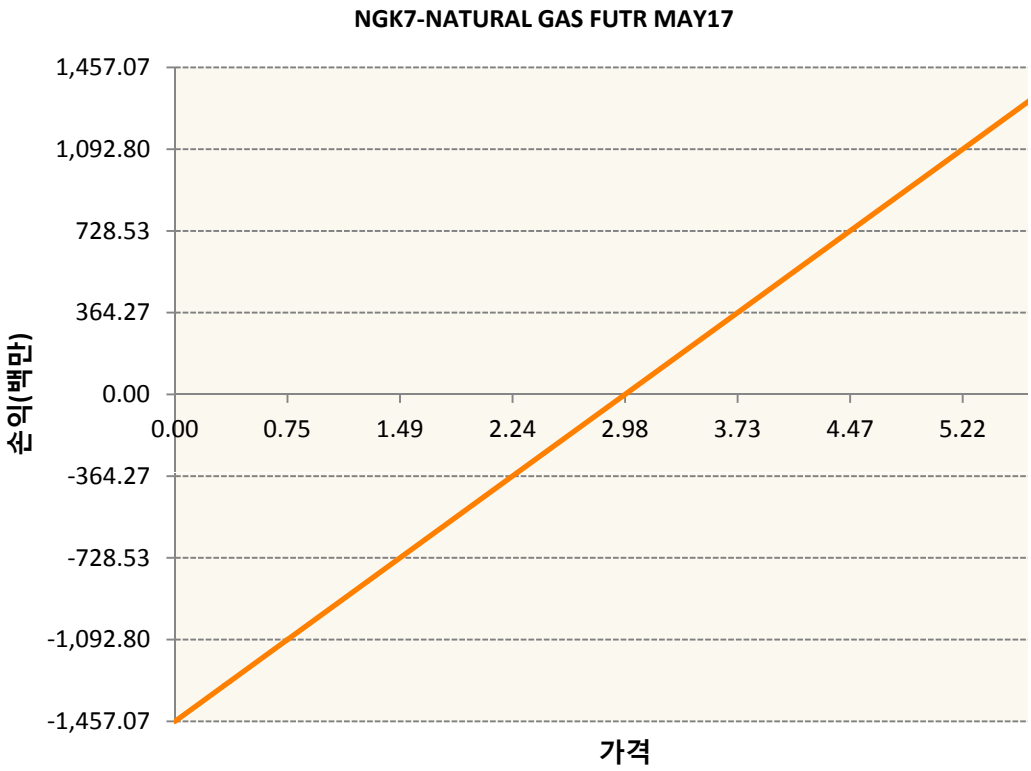


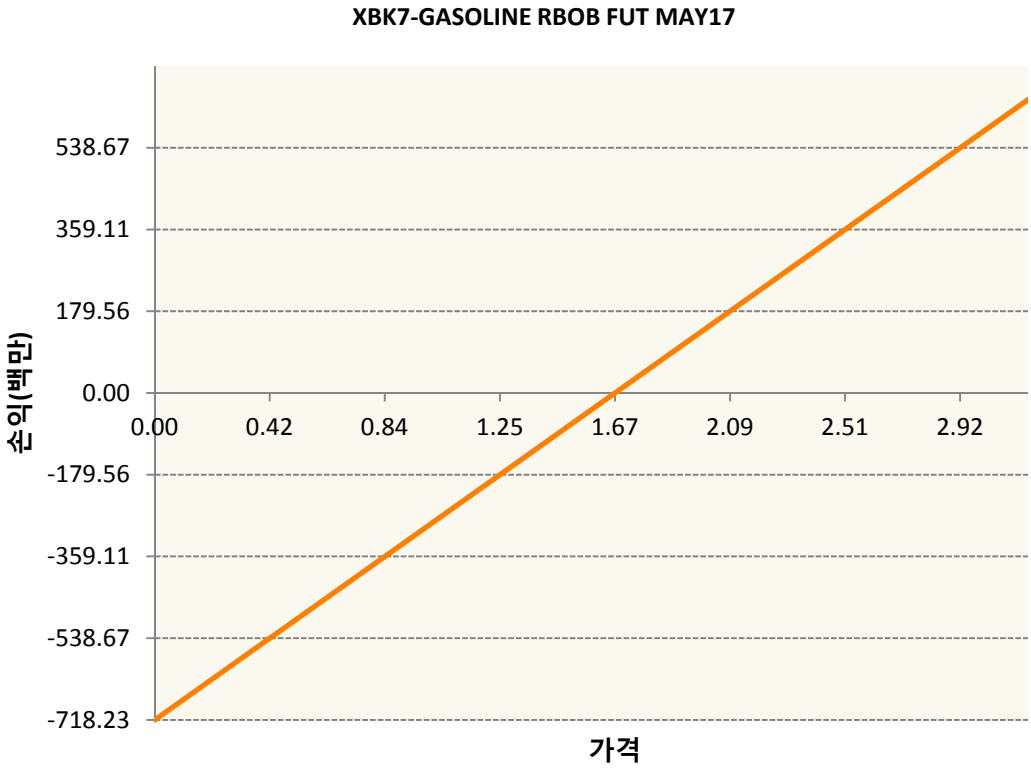

-785.74
-1,178.61
-1,571.48
가격


HOK7-NY Harb ULSD Fut MAY17
747.26
560.45
373.63
186.82
0.00
-186.82
-373.63
-560.45
-747.26
0.00
0.39
0.79
1.18
1.57
1.96
2.36
2.75
순익(백만)
가격


KR4175M30008-2017-03 달러선물
416.63
312.47
208.31
104.16
0.00
-104.16
-208.31
0.00
289.33
578.65
867.98
1,157.30
1,446.63
1,735.95
2,025.28
순익(백만)


-416.63
가격


NGK7-NATURAL GAS FUTR MAY17
1,457.07
1,092.80
728.53
364.27
0.00
-364.27
-728.53
-1,092.80
-1,457.07
0.00
0.75
1.49
2.24
2.98
3.73
4.47
5.22
순익(백만)
가격


XBK7-GASOLINE RBOB FUT MAY17
538.67
359.11
179.56
0.00
-179.56
-359.11
-538.67
-718.23
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	92
COK7	BRENT CRUDE FUTR MAY17	126
HOK7	NY Harb ULSD Fut MAY17	60
KR4175M30(	2017-03 달러선물	33
NGK7	NATURAL GAS FUTR MAY17	117
XBK7	GASOLINE RBOB FUT MAY17	57

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

1,006

공시일	2017-03-10
기준일	2017-03-09

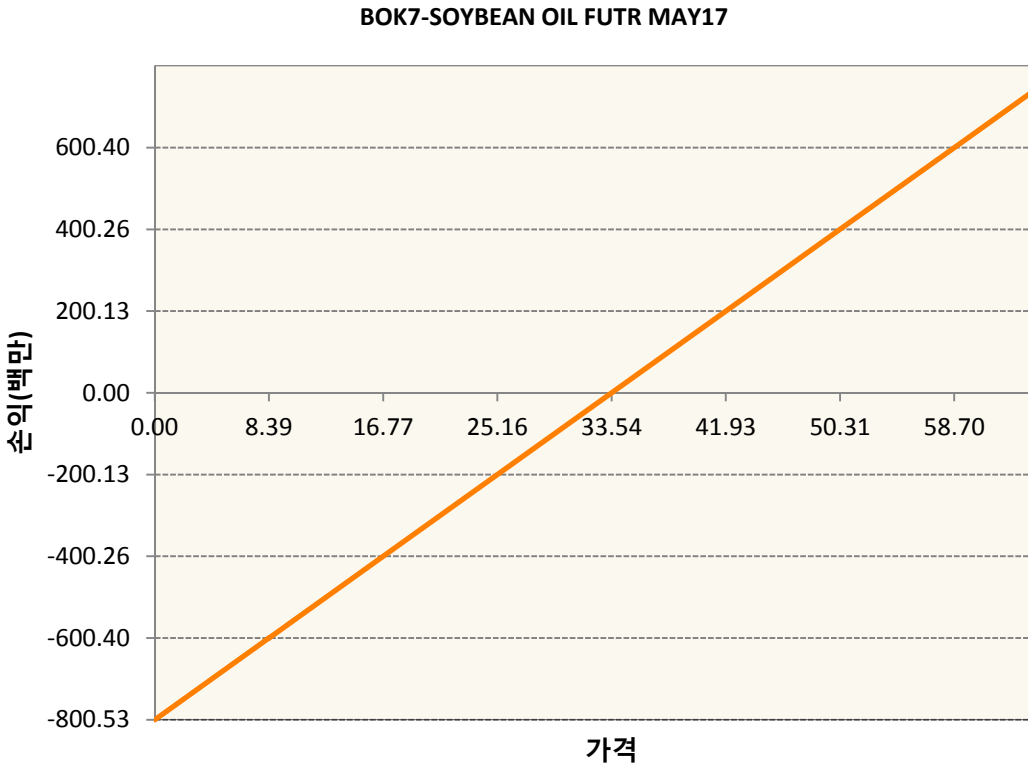
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

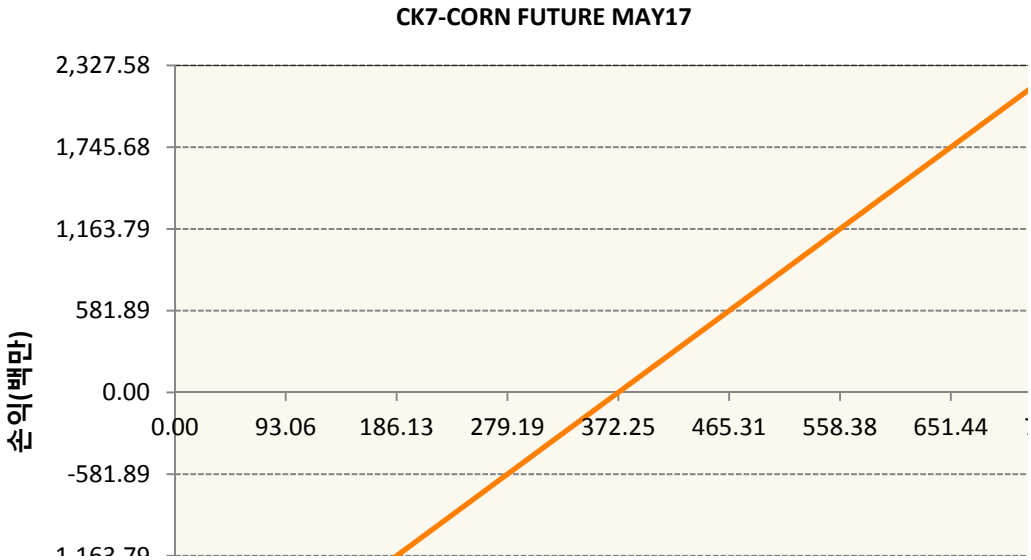
1. 계약금액

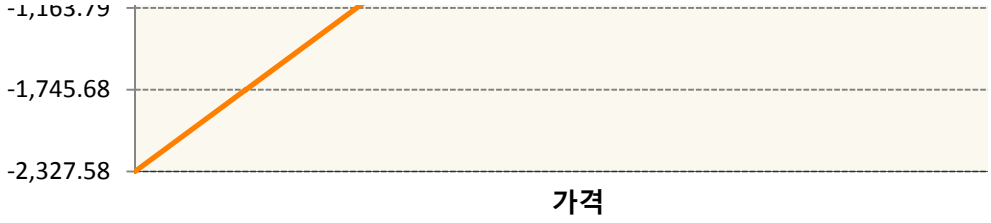
(단위:백만원)

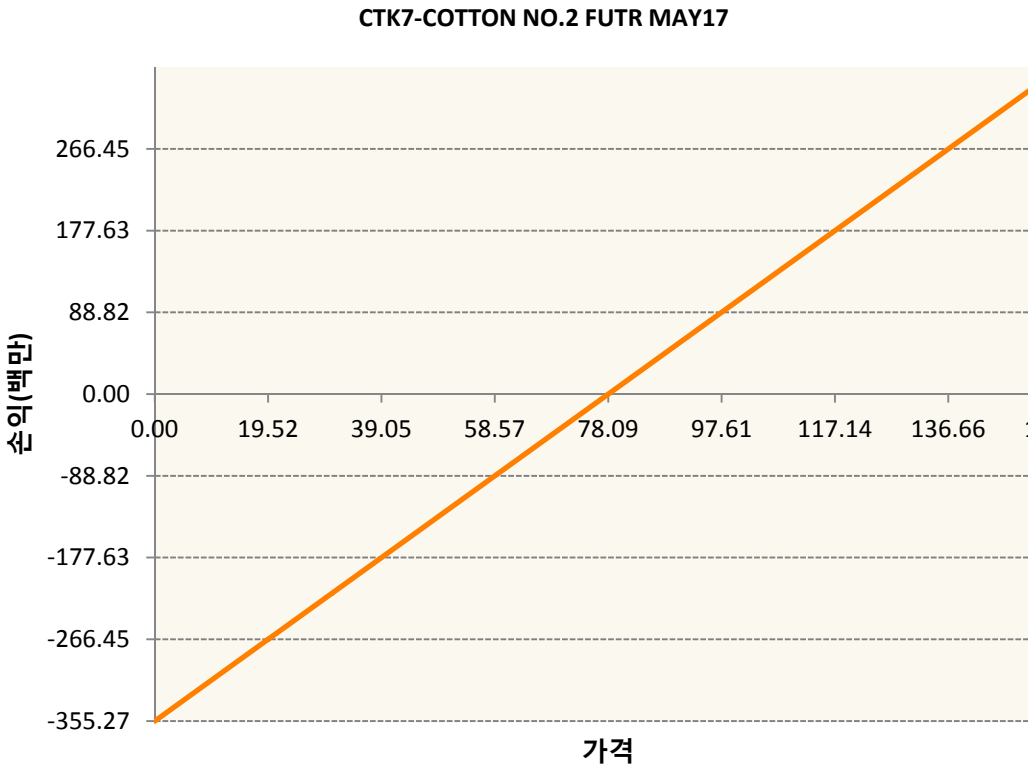
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	9,267	579	8,689	

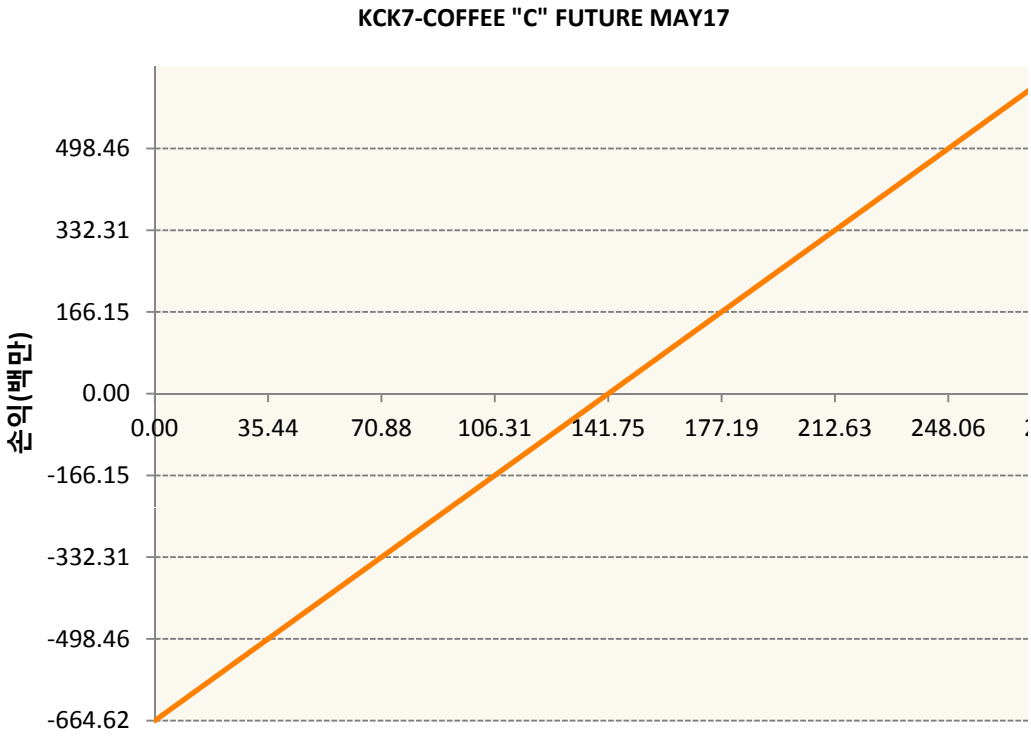
2. 만기시점의 손익구조



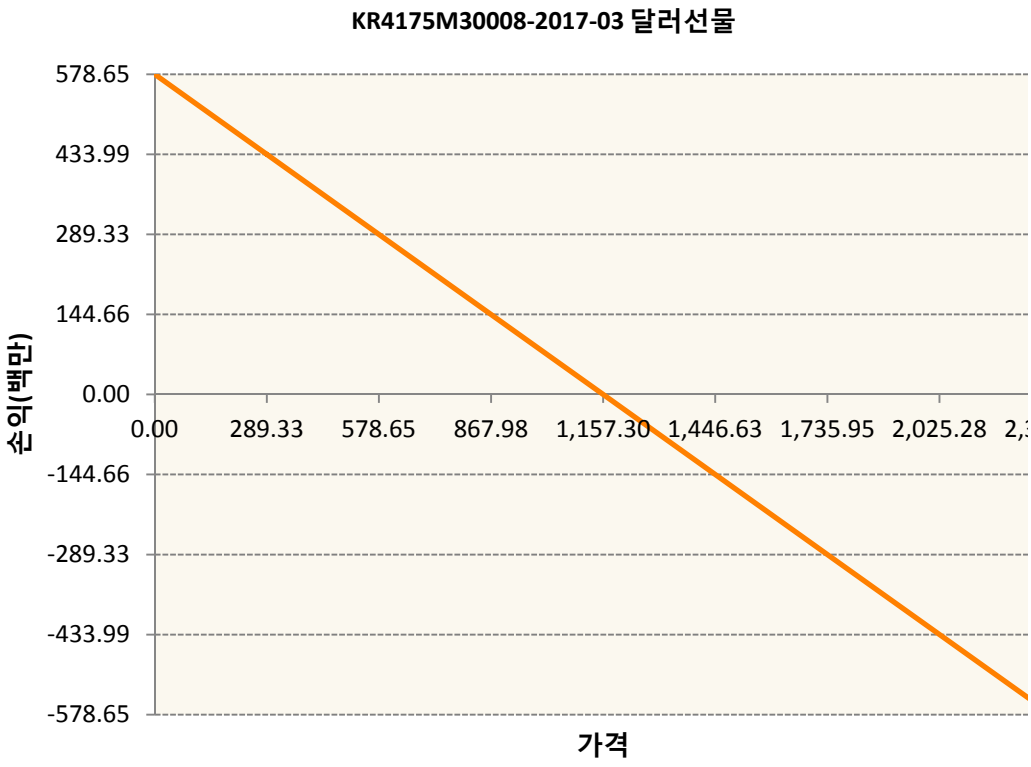


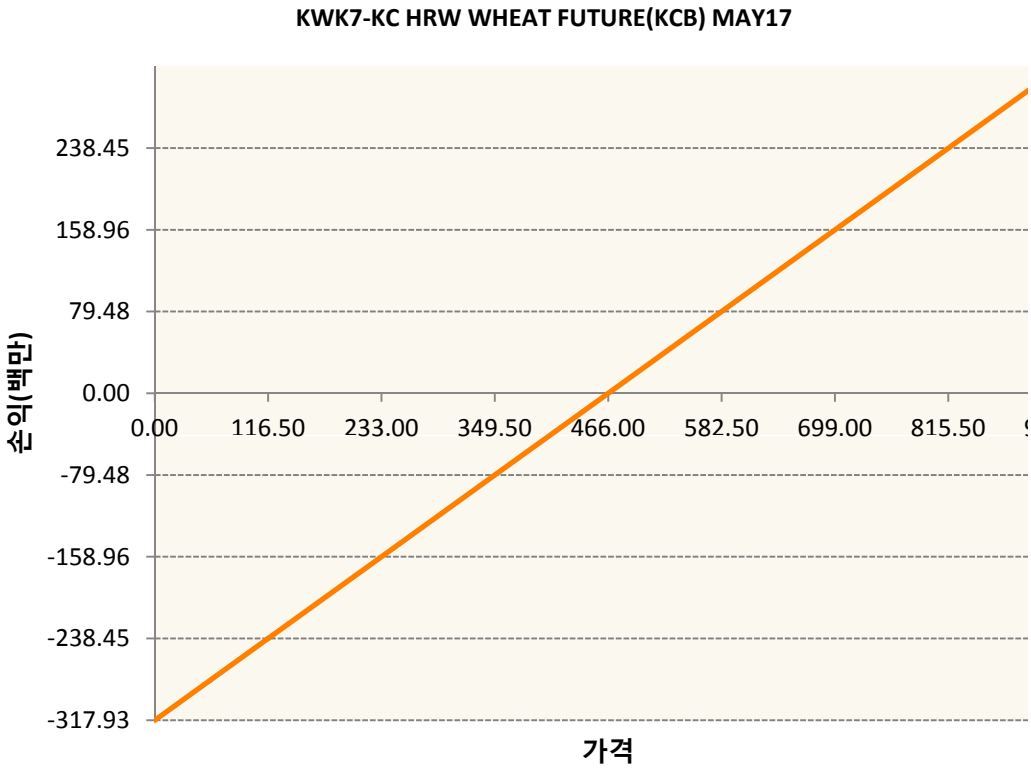

-1,745.68
-2,327.58
가격


CTK7-COTTON NO.2 FUTR MAY17
266.45
177.63
88.82
0.00
-88.82
-177.63
-266.45
-355.27
0.00
19.52
39.05
58.57
78.09
97.61
117.14
136.66
순익(백만)
가격

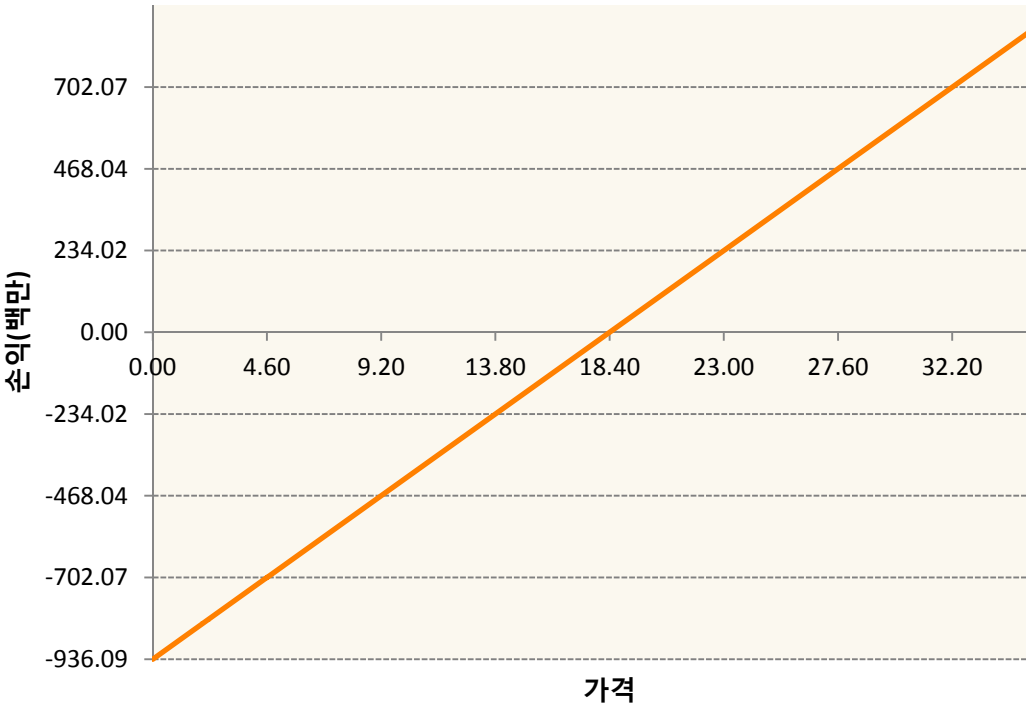

KCK7-COFFEE "C" FUTURE MAY17
498.46
332.31
166.15
0.00
-166.15
-332.31
-498.46
-664.62
0.00
35.44
70.88
106.31
141.75
177.19
212.63
248.06
순익(백만)

가격

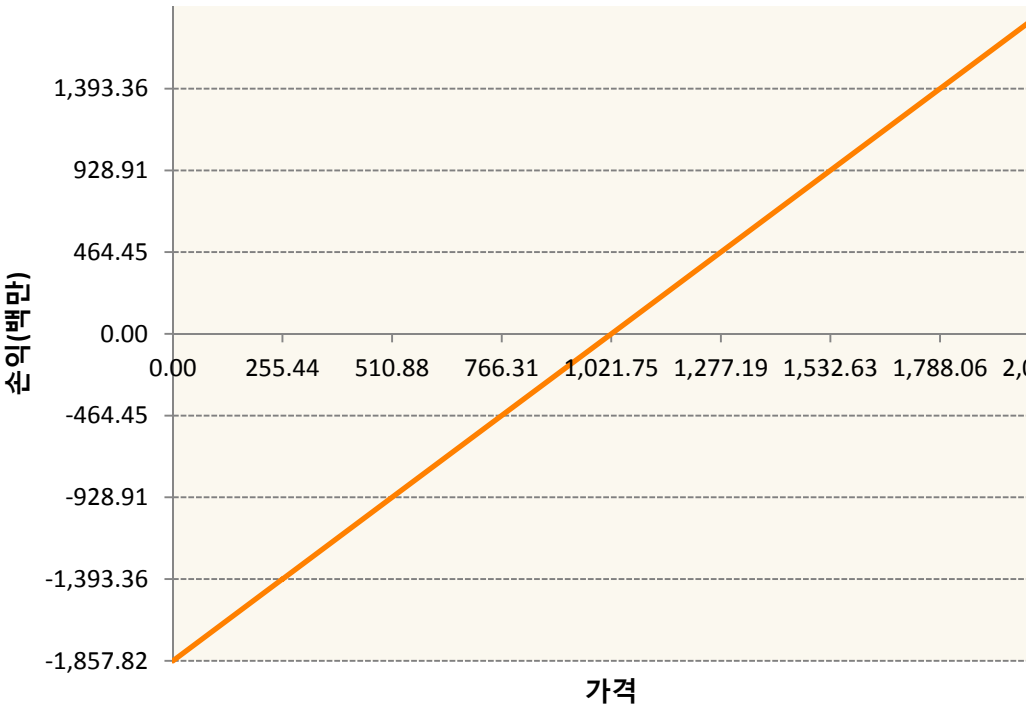

KR4175M30008-2017-03 달러선물
578.65
433.99
289.33
144.66
0.00
-144.66
-289.33
-433.99
-578.65
0.00
289.33
578.65
867.98
1,157.30
1,446.63
1,735.95
2,025.28
순이(백만)
가격


KWK7-KC HRW WHEAT FUTURE(KCB) MAY17
238.45
158.96
79.48
0.00
-79.48
-158.96
-238.45
-317.93
0.00
116.50
233.00
349.50
466.00
582.50
699.00
815.50
순이(백만)
가격

SBK7-Sugar #11 (WORLD) MAY17

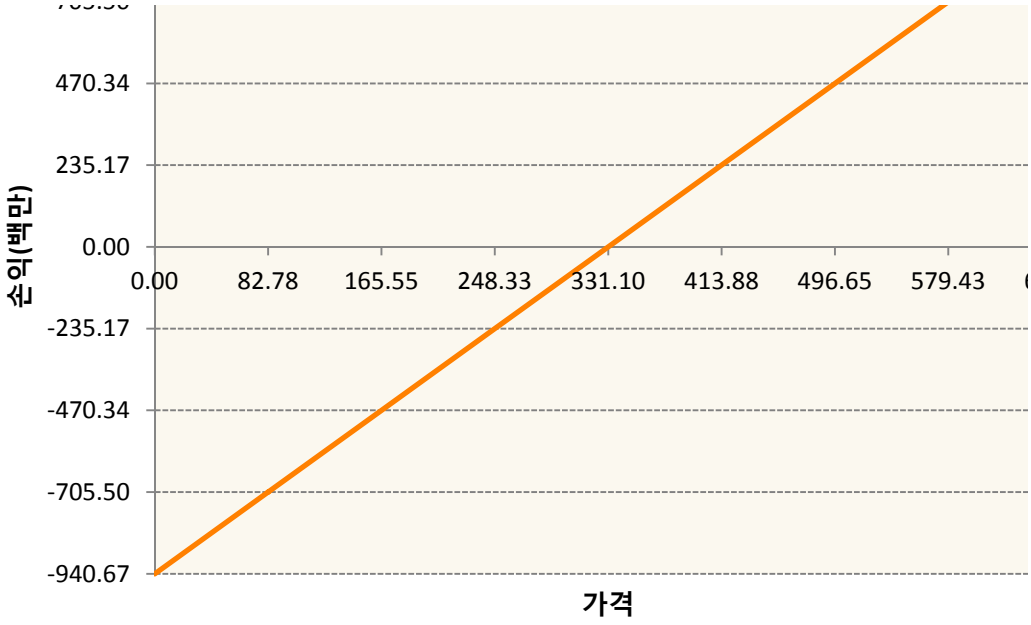


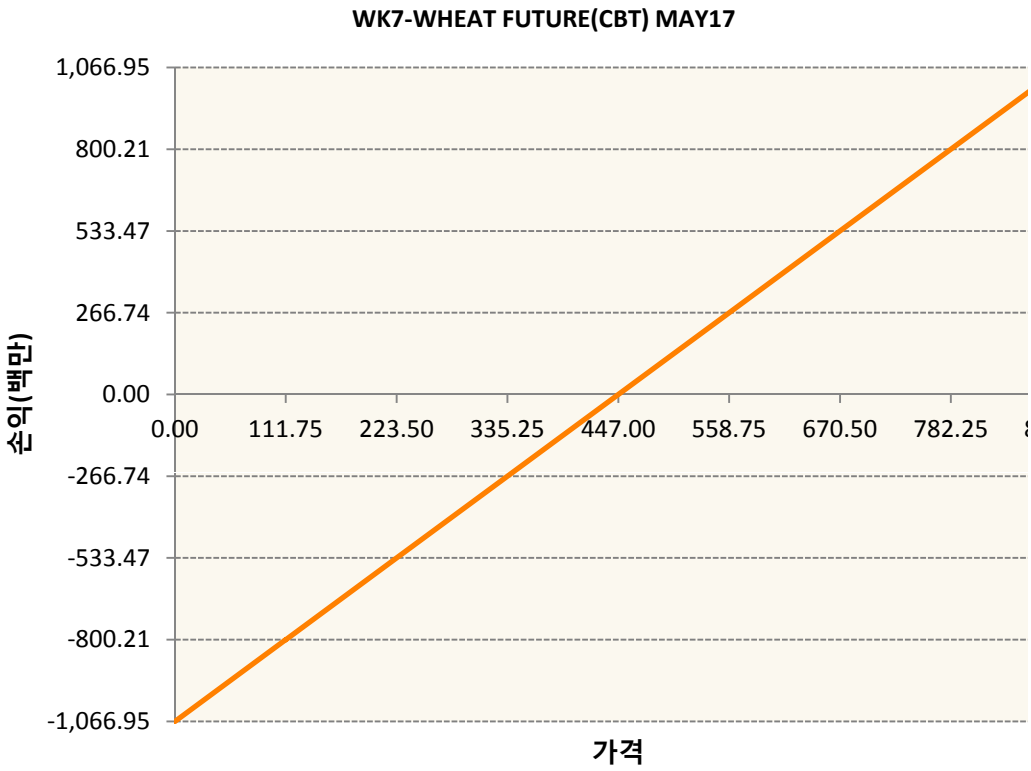
SK7-SOYBEAN FUTURE MAY17



SMK7-SOYBEAN MEAL FUTR MAY17







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
BOK7	SOYBEAN OIL FUTR MAY17	64
CK7	CORN FUTURE MAY17	186
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	25
SBK7	Sugar #11 (WORLD) MAY17	75
SK7	SOYBEAN FUTURE MAY17	149
SMK7	SOYBEAN MEAL FUTR MAY17	75
WK7	WHEAT FUTURE(CBT) MAY17	85

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

861