공시일	2017-03-13
기준일	2017-03-10

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	2017-03-13
기준일	2017-03-10

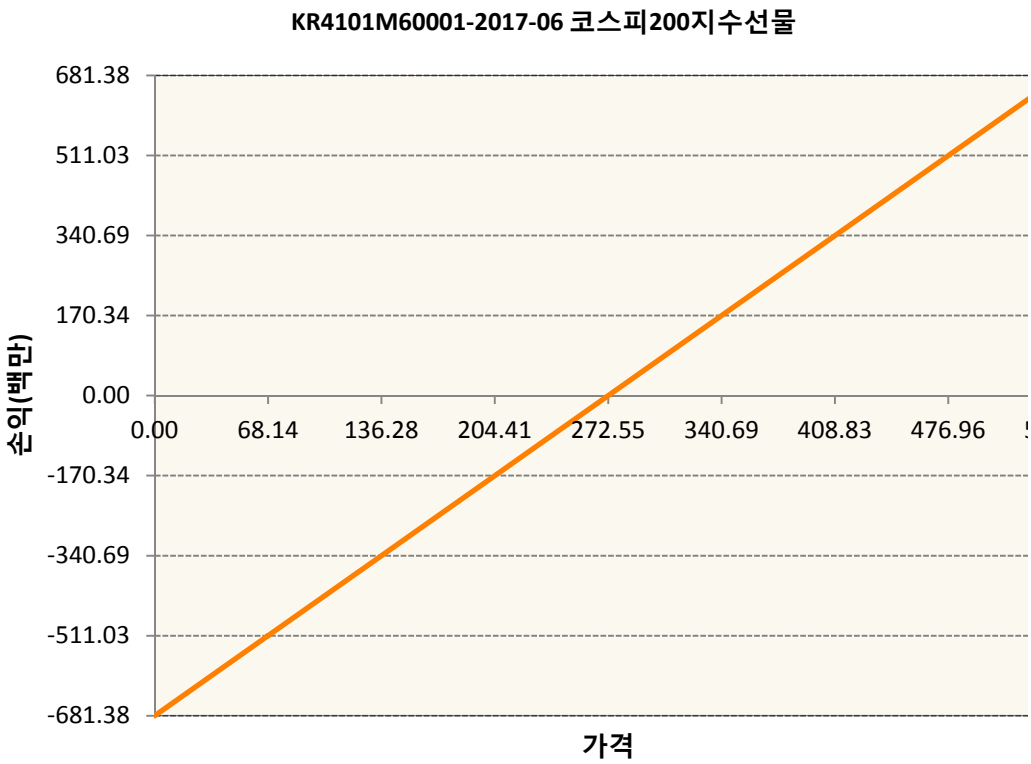
스마트인덱스모

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	681	0	681	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	2017-03-13
기준일	2017-03-10

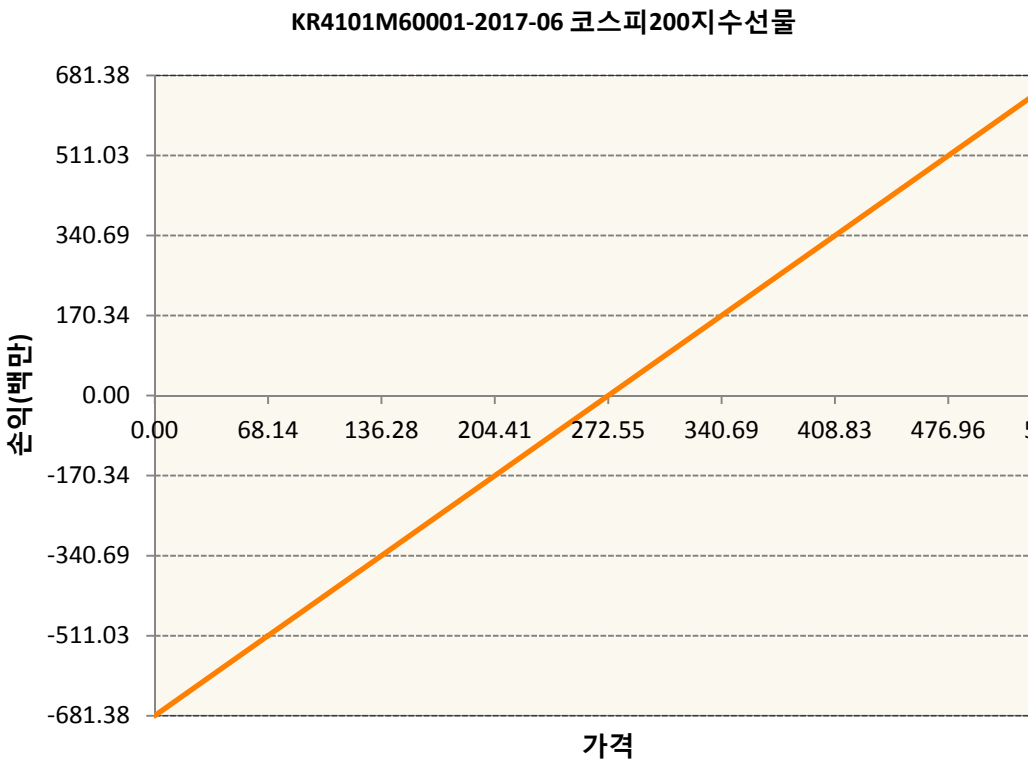
스마트레버리지목표전환형1호

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	136	-136	장내
누계	유가증권	선물	681	0	681	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	2017-03-13
기준일	2017-03-10

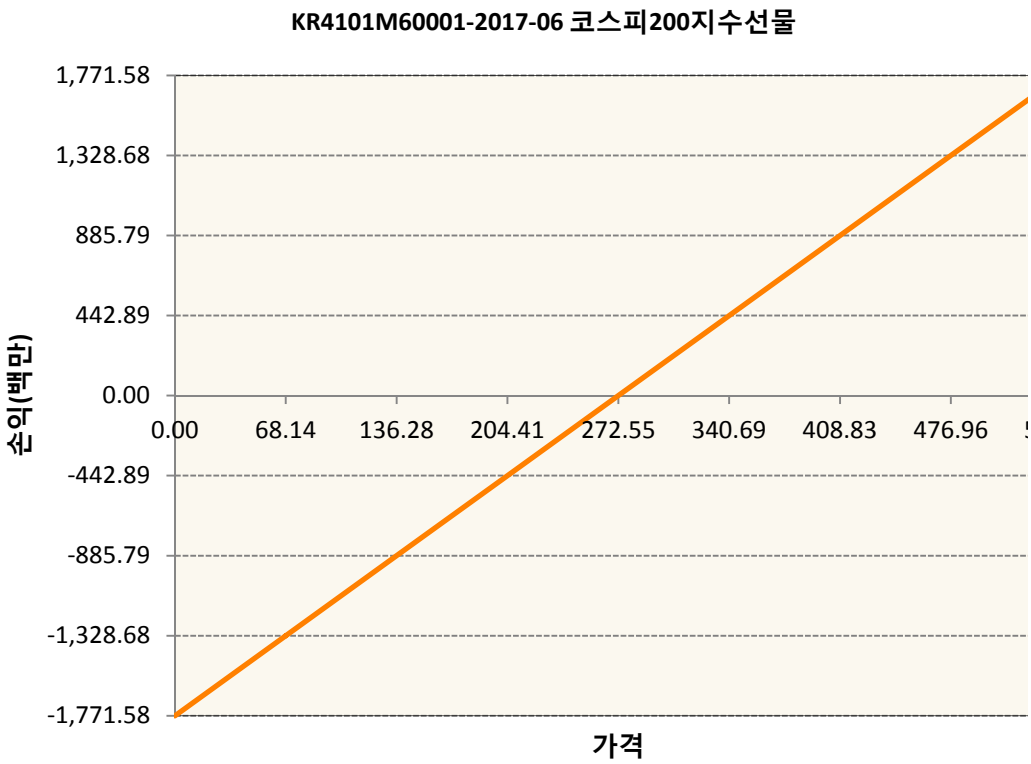
1.3배 레버리지 인덱스(주식-파생형)

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	1,772	0	1,772	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101M60(2017-06 코스피200지수선물							142
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-142	-142	-142	-142	-142	-142	-142
-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%	142	142	142	142	142	142	142

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

91

공시일	2017-03-13
기준일	2017-03-10

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	948

* 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	2017-03-13
기준일	2017-03-10

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	389

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

455

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-03-13
기준일	2017-03-10

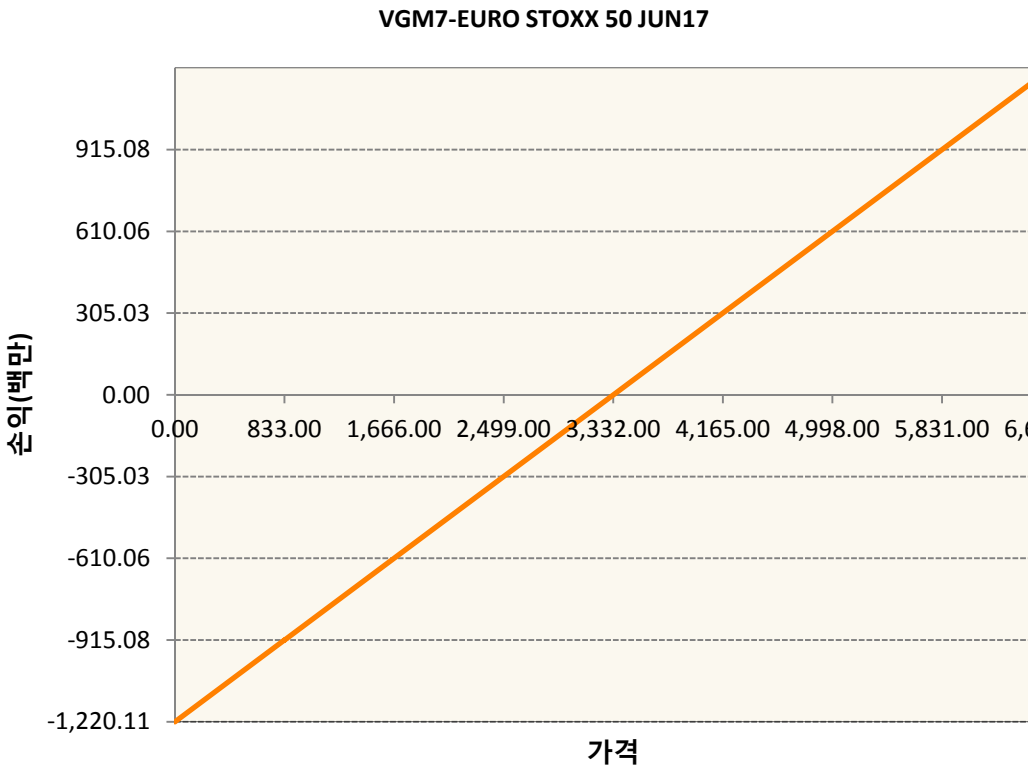
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

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

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGM7	EURO STOXX 50 JUN17	98

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

(단위:백만원)

99

공시일	2017-03-13
기준일	2017-03-10

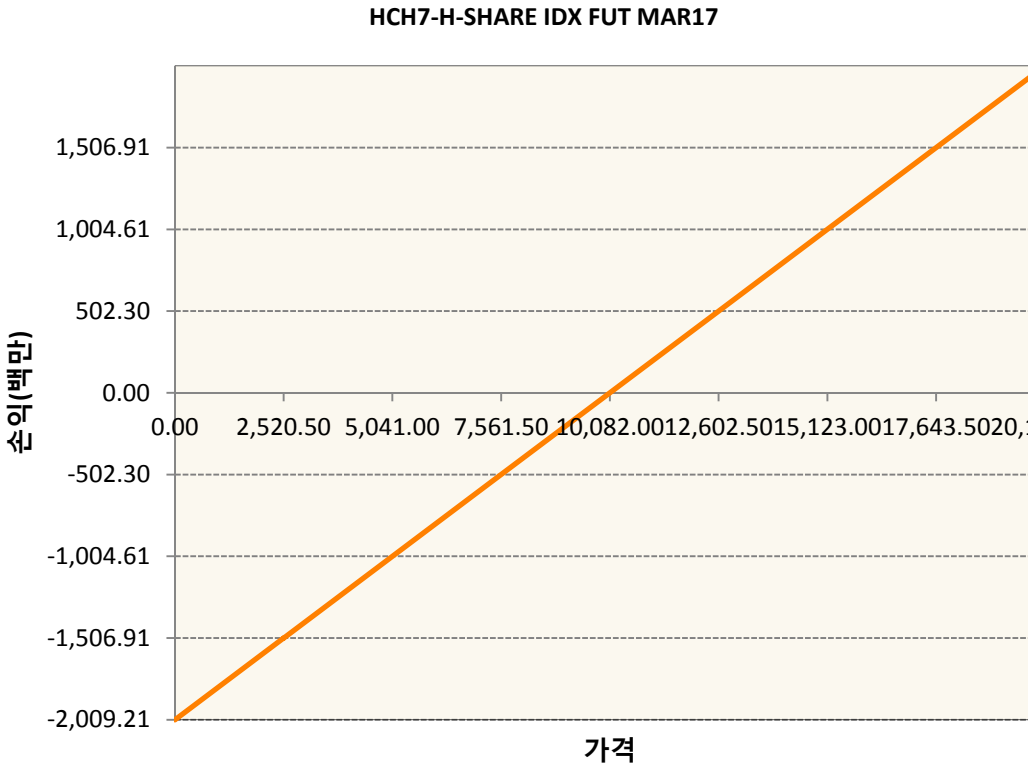
차이나인덱스모(주식-파생형)

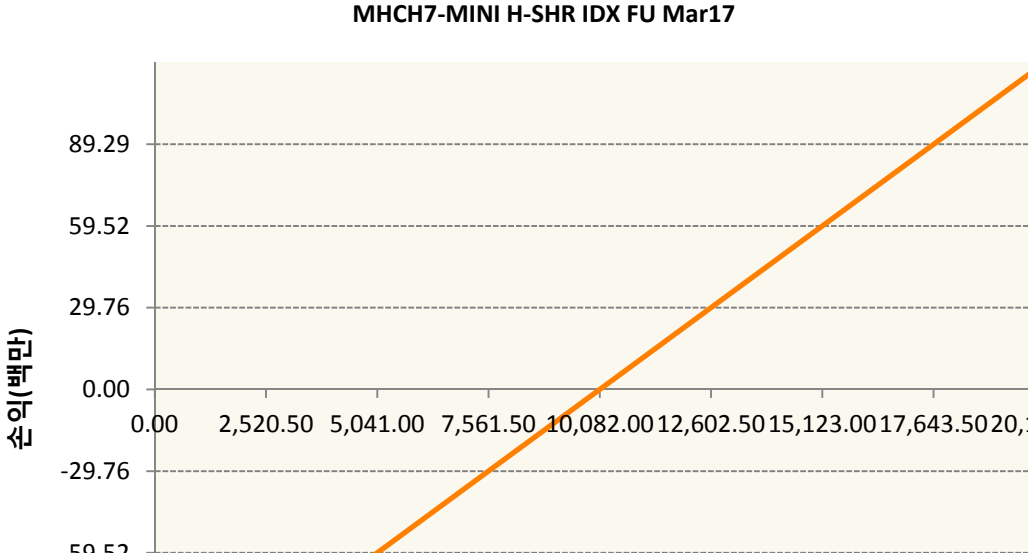
1. 계약금액

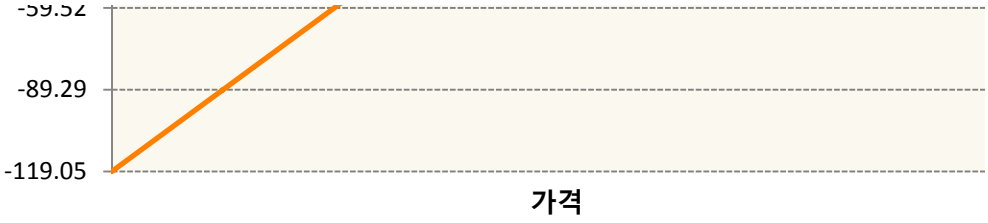
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,128	0	2,128	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	2017-03-13
기준일	2017-03-10

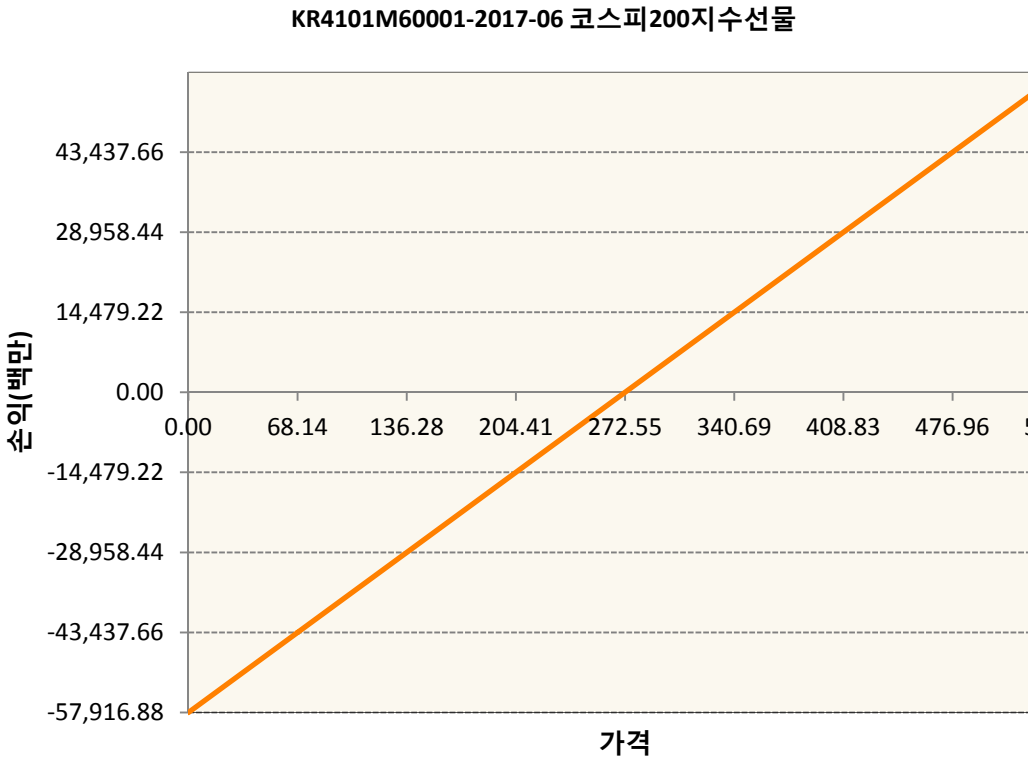
커버드콜모(주식혼합-파생형)

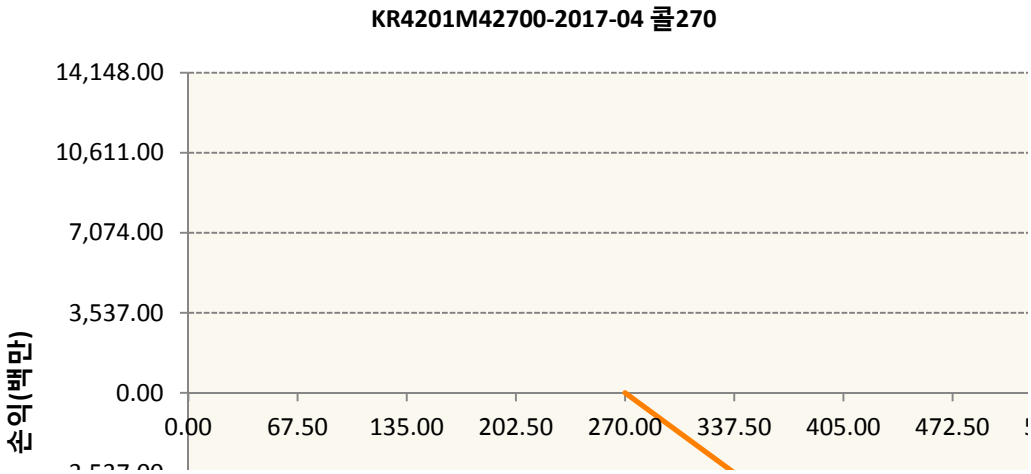
1. 계약금액

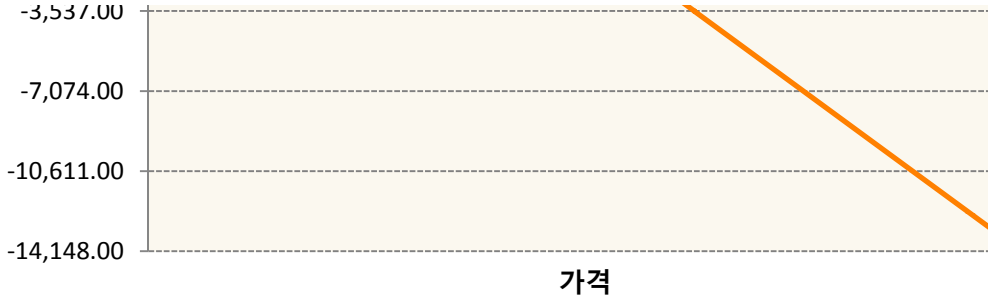
(단위:백만원)

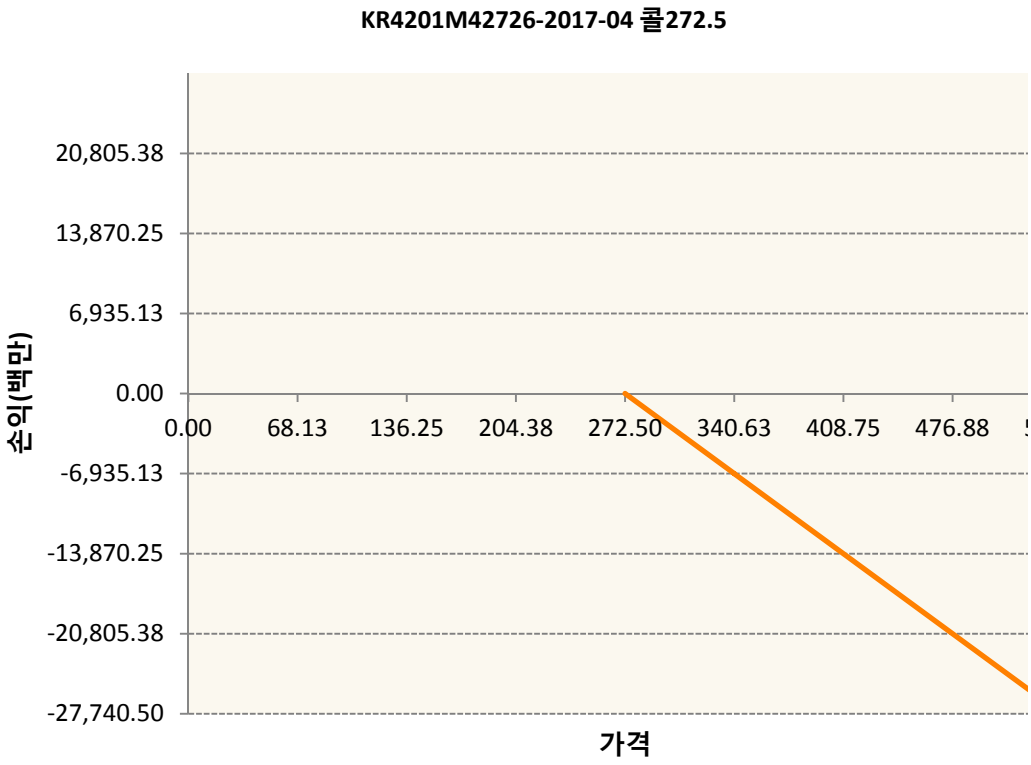
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	8,735	9,985	-1,250	장내
누계	유가증권	선물	57,917	0	57,917	장내
누계	유가증권	옵션	0	41,889	-41,889	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101M60(2017-06 코스피200지수선물							4,629
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-4,629	-4,629	-4,629	-4,629	-4,629	-4,629	-4,629
-5.33%	-3,086	-3,086	-3,086	-3,086	-3,086	-3,086	-3,086
-2.67%	-1,543	-1,543	-1,543	-1,543	-1,543	-1,543	-1,543
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	1,543	1,543	1,543	1,543	1,543	1,543	1,543
5.33%	3,086	3,086	3,086	3,086	3,086	3,086	3,086
8.00%	4,629	4,629	4,629	4,629	4,629	4,629	4,629
KR4201M42 2017-04 콜270							5,025
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,283	1,281	1,278	1,273	1,265	1,253	1,239
-5.33%	1,260	1,243	1,219	1,191	1,158	1,121	1,080
-2.67%	1,044	981	916	849	780	710	639
0%	232	155	78	0	-78	-157	-235
2.67%	-1,274	-1,310	-1,351	-1,398	-1,448	-1,503	-1,560
5.33%	-3,104	-3,111	-3,122	-3,137	-3,157	-3,181	-3,209
8.00%	-4,998	-4,999	-5,000	-5,003	-5,008	-5,015	-5,025
KR4201M42 2017-04 콜272.5							9,210
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,813	1,812	1,810	1,804	1,795	1,782	1,763
-5.33%	1,796	1,778	1,752	1,716	1,672	1,619	1,558
-2.67%	1,573	1,483	1,383	1,276	1,163	1,045	922
0%	470	313	157	0	-157	-313	-470
2.67%	-2,043	-2,145	-2,256	-2,373	-2,496	-2,624	-2,755
5.33%	-5,461	-5,488	-5,525	-5,572	-5,630	-5,696	-5,771
8.00%	-9,121	-9,124	-9,130	-9,141	-9,158	-9,181	-9,210

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

19,133

공시일	2017-03-13
기준일	2017-03-10

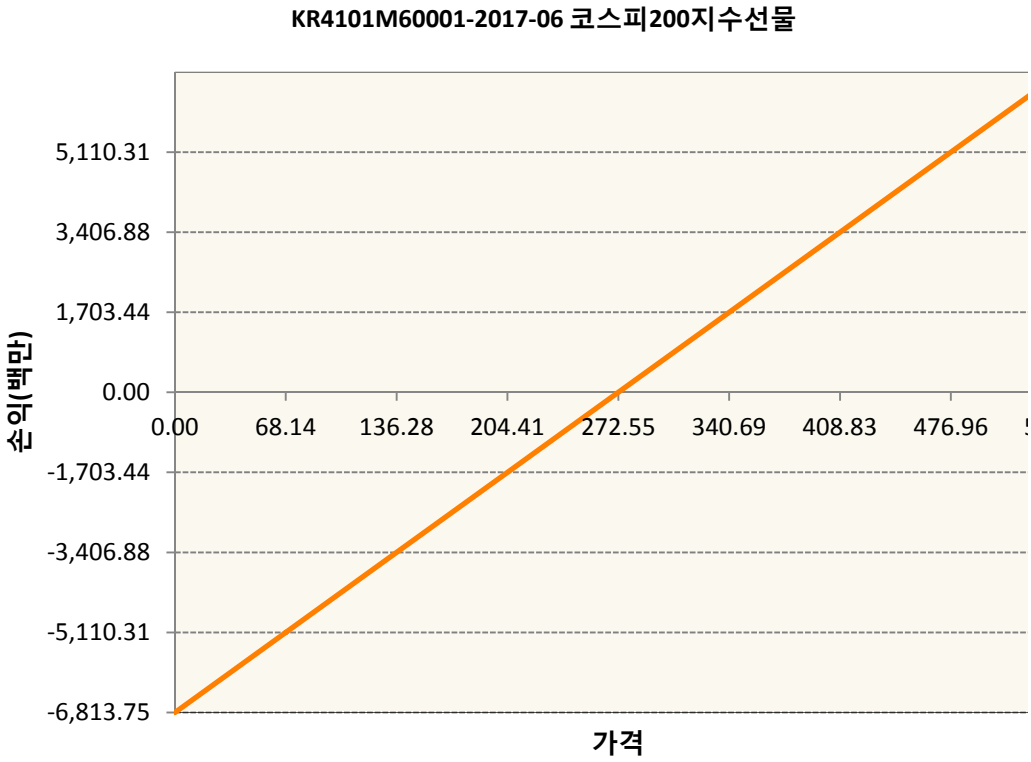
커버드콜목표전환형증권투자신탁

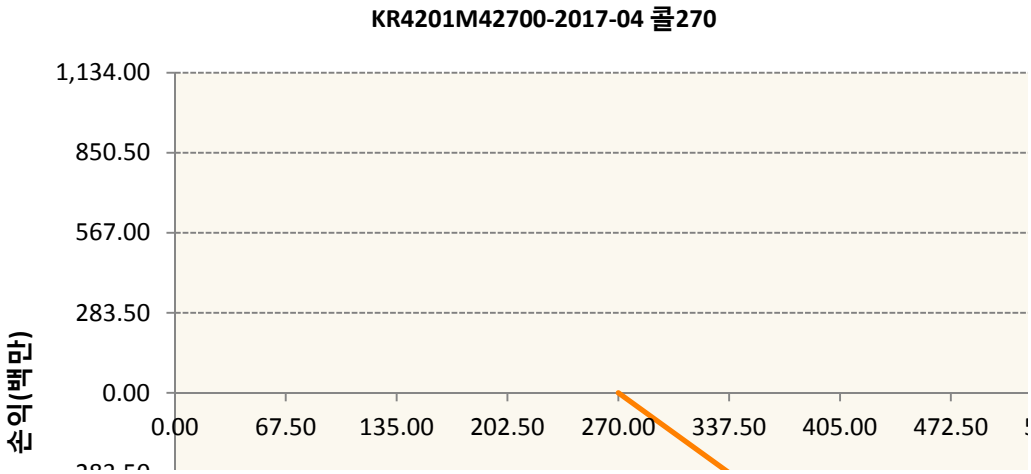
1. 계약금액

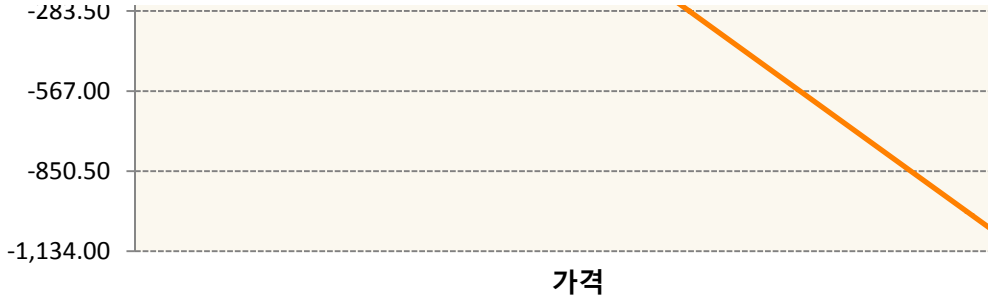
(단위:백만원)

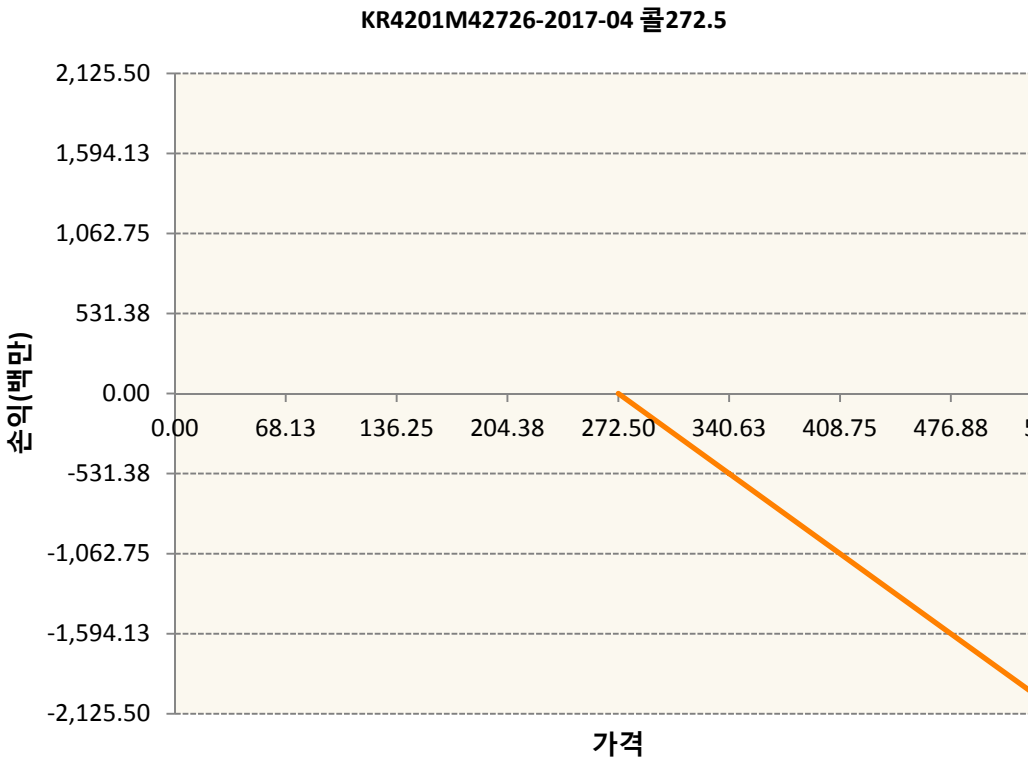
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	1,132	1,152	-20	장내
누계	유가증권	선물	6,814	0	6,814	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,260	-3,260	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101M60(2017-06 코스피200지수선물							545
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-545	-545	-545	-545	-545	-545	-545
-5.33%	-363	-363	-363	-363	-363	-363	-363
-2.67%	-182	-182	-182	-182	-182	-182	-182
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	182	182	182	182	182	182	182
5.33%	363	363	363	363	363	363	363
8.00%	545	545	545	545	545	545	545
KR4201M42 2017-04 콜270							403
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	103	103	102	102	101	100	99
-5.33%	101	100	98	95	93	90	87
-2.67%	84	79	73	68	63	57	51
0%	19	12	6	0	-6	-13	-19
2.67%	-102	-105	-108	-112	-116	-120	-125
5.33%	-249	-249	-250	-251	-253	-255	-257
8.00%	-401	-401	-401	-401	-401	-402	-403
KR4201M42 2017-04 콜272.5							706

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	139	139	139	138	138	137	135
-5.33%	138	136	134	132	128	124	119
-2.67%	121	114	106	98	89	80	71
0%	36	24	12	0	-12	-24	-36
2.67%	-157	-164	-173	-182	-191	-201	-211
5.33%	-418	-420	-423	-427	-431	-436	-442
8.00%	-699	-699	-700	-700	-702	-703	-706

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

1,609

공시일	2017-03-13
기준일	2017-03-10

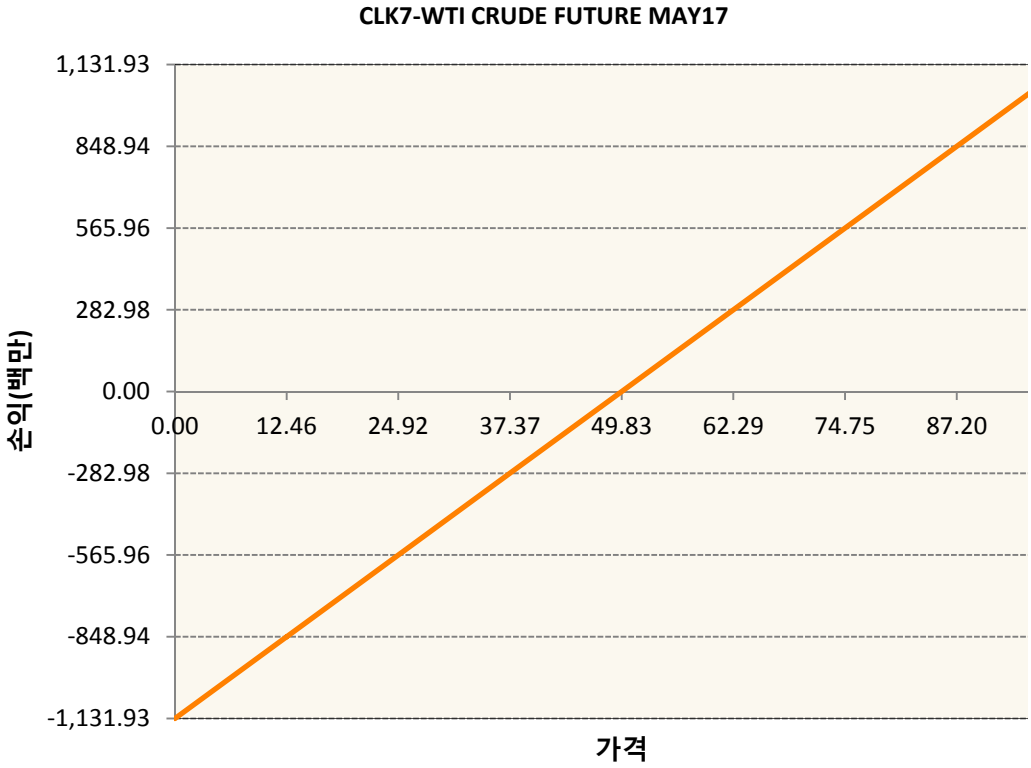
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

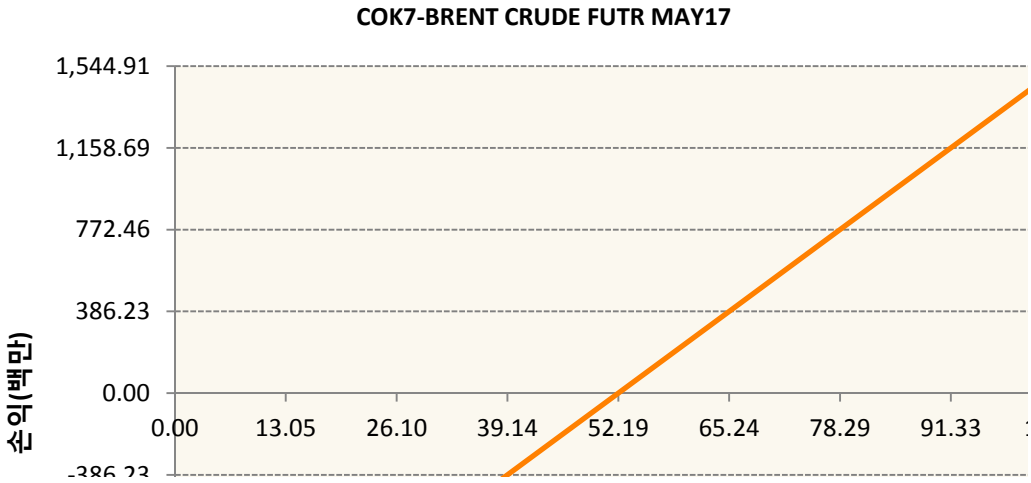
1. 계약금액

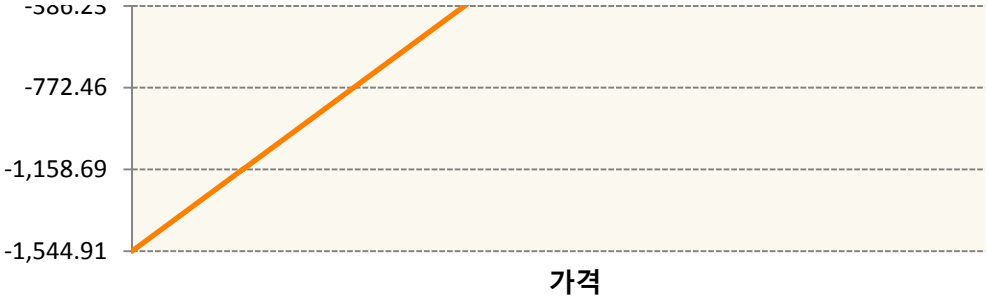
(단위:백만원)

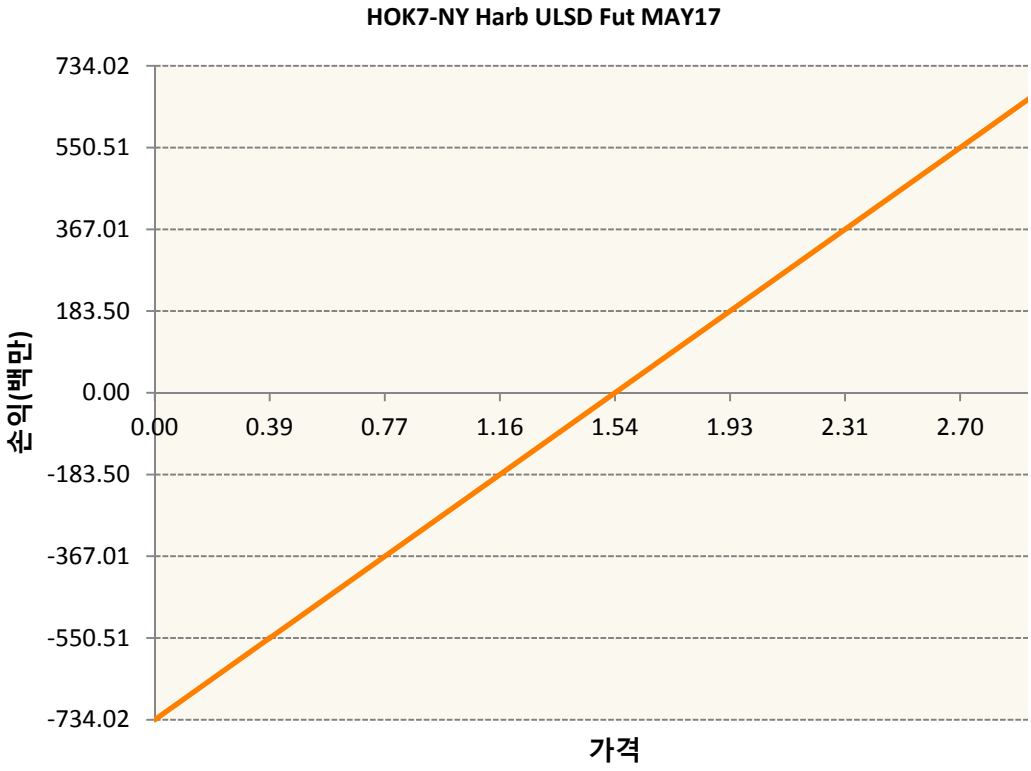
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	선물	유가증권	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	선물	유가증권	1,132	0	1,132	
누계	유가증권	선물	4,473	417	4,057	

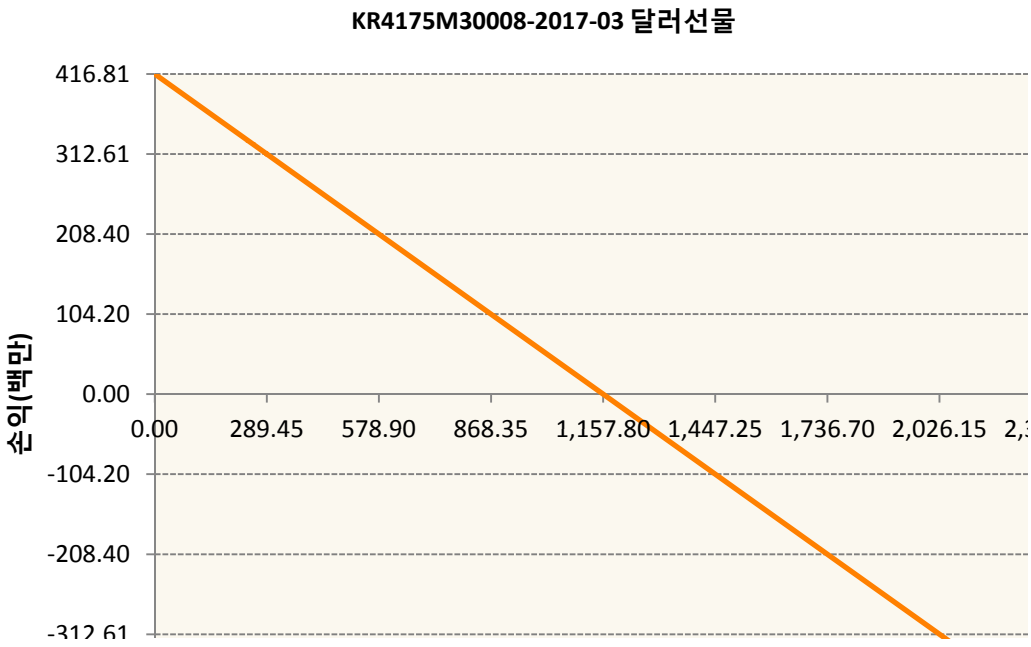
2. 만기시점의 손익구조

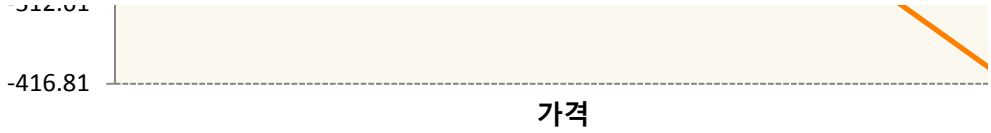


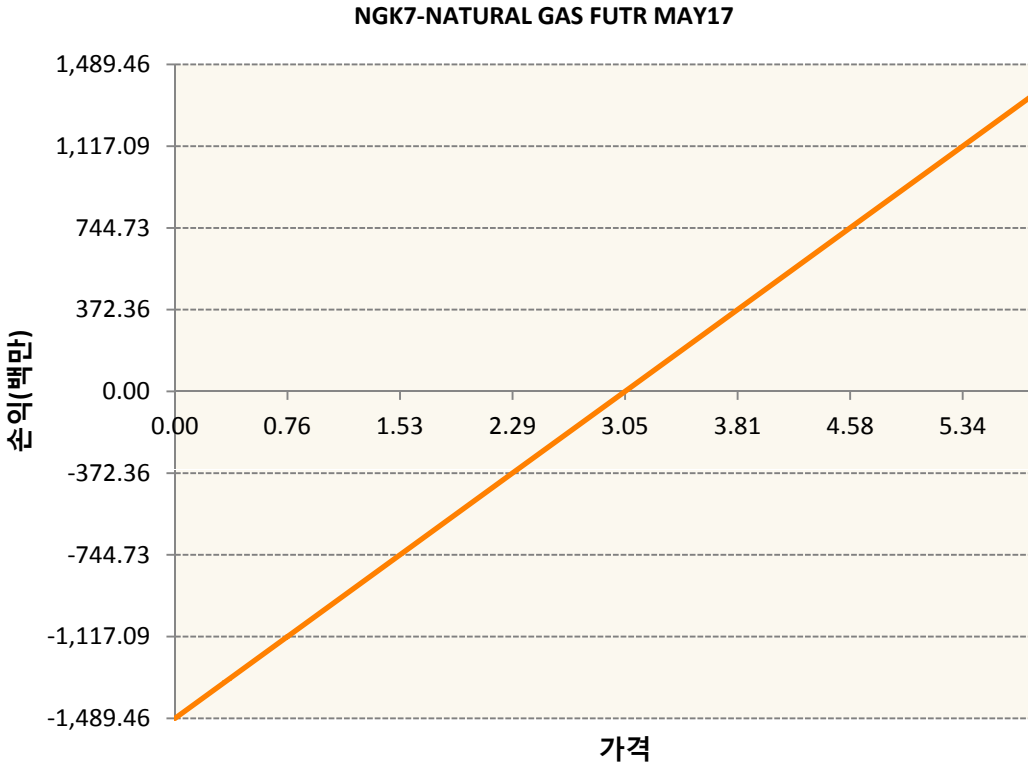


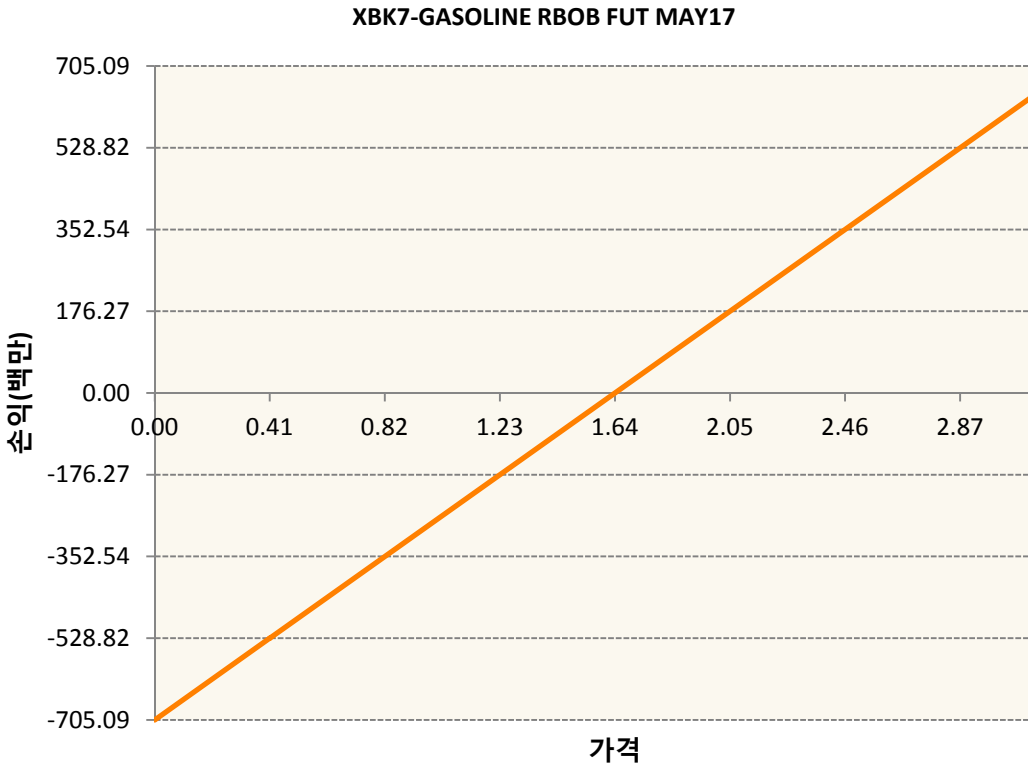

-772.46
-1,158.69
-1,544.91
가격


HOK7-NY Harb ULSD Fut MAY17
734.02
550.51
367.01
183.50
0.00
-183.50
-367.01
-550.51
-734.02
0.00
0.39
0.77
1.16
1.54
1.93
2.31
2.70
순익(백만)
가격


KR4175M30008-2017-03 달러선물
416.81
312.61
208.40
104.20
0.00
-104.20
-208.40
-312.61
0.00
289.45
578.90
868.35
1,157.80
1,447.25
1,736.70
2,026.15
순익(백만)


-416.81
가격


NGK7-NATURAL GAS FUTR MAY17
1,489.46
1,117.09
744.73
372.36
0.00
-372.36
-744.73
-1,117.09
-1,489.46
0.00
0.76
1.53
2.29
3.05
3.81
4.58
5.34
순익(백만)
가격


XBK7-GASOLINE RBOB FUT MAY17
705.09
528.82
352.54
176.27
0.00
-176.27
-352.54
-528.82
-705.09
0.00
0.41
0.82
1.23
1.64
2.05
2.46
2.87
순익(백만)
가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLK7	WTI CRUDE FUTURE MAY17	91
COK7	BRENT CRUDE FUTR MAY17	124
HOK7	NY Harb ULSD Fut MAY17	59
KR4175M30(	2017-03 달러선물	33
NGK7	NATURAL GAS FUTR MAY17	119
XBK7	GASOLINE RBOB FUT MAY17	56

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

999

공시일	2017-03-13
기준일	2017-03-10

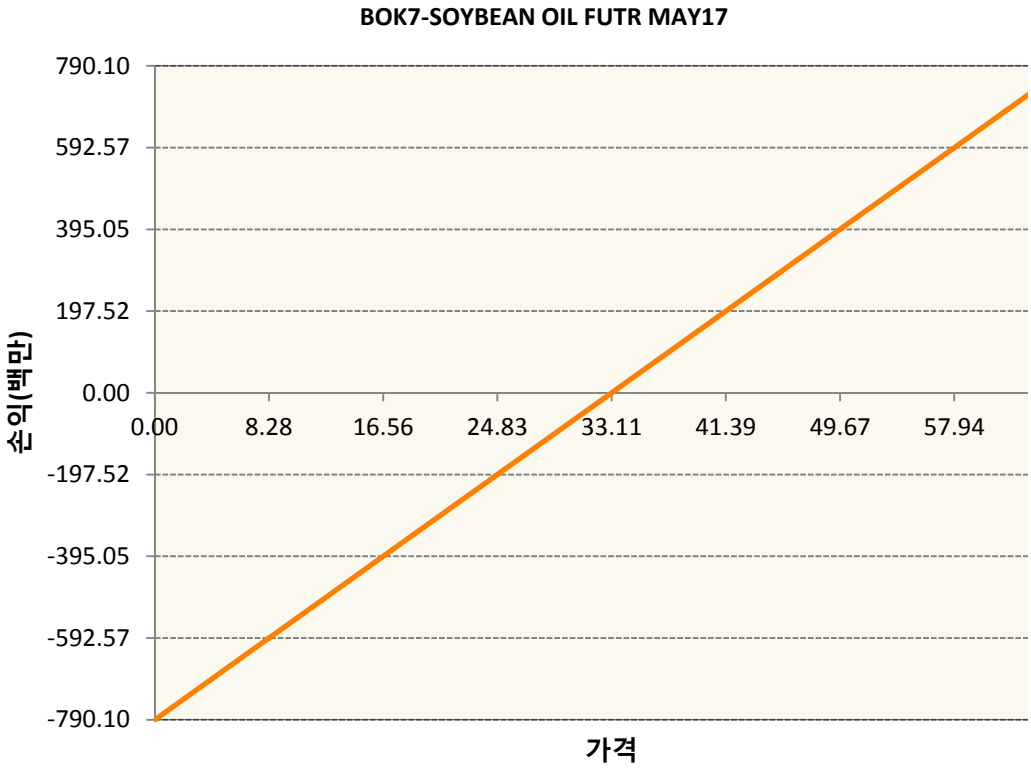
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

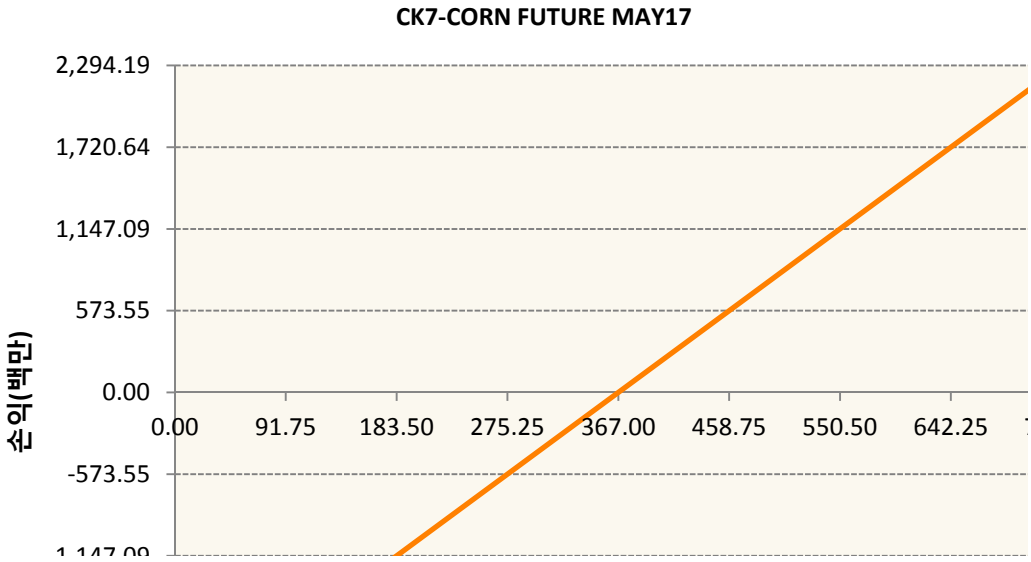
1. 계약금액

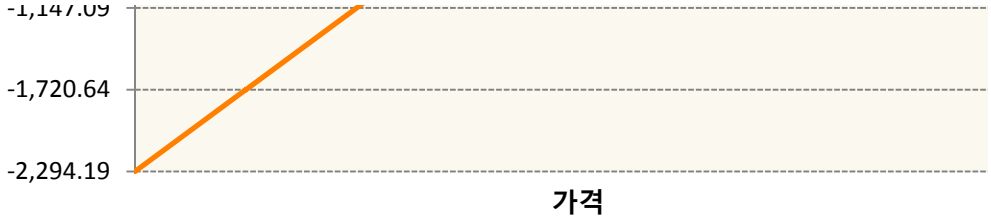
(단위:백만원)

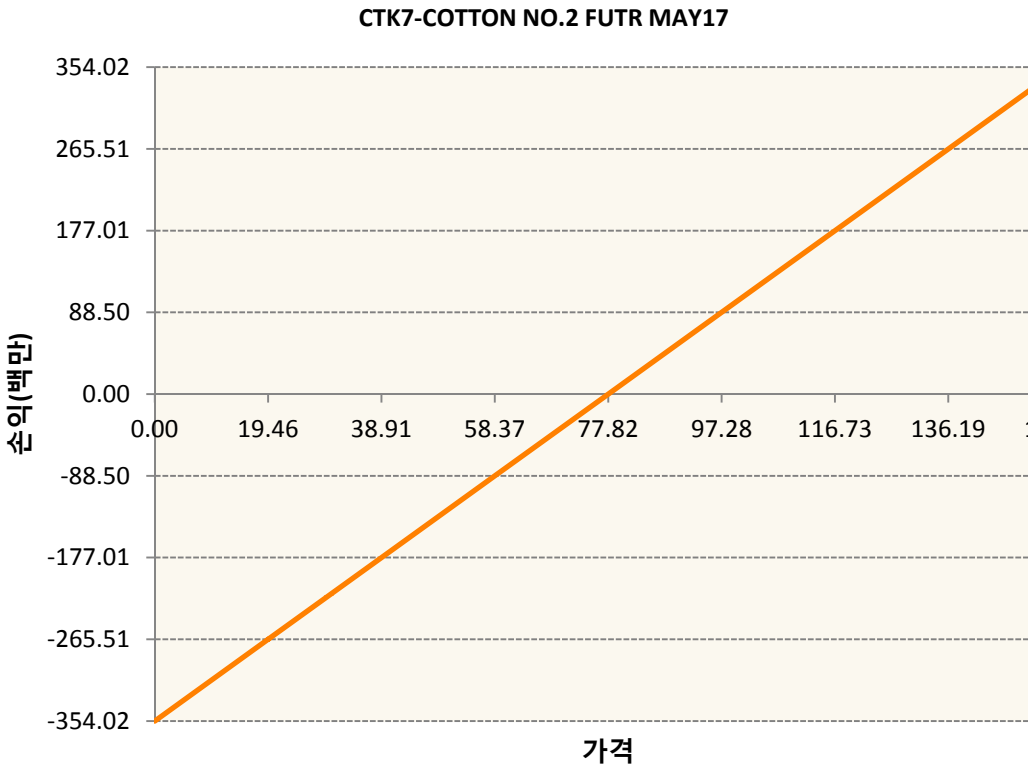
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	9,158	579	8,580	

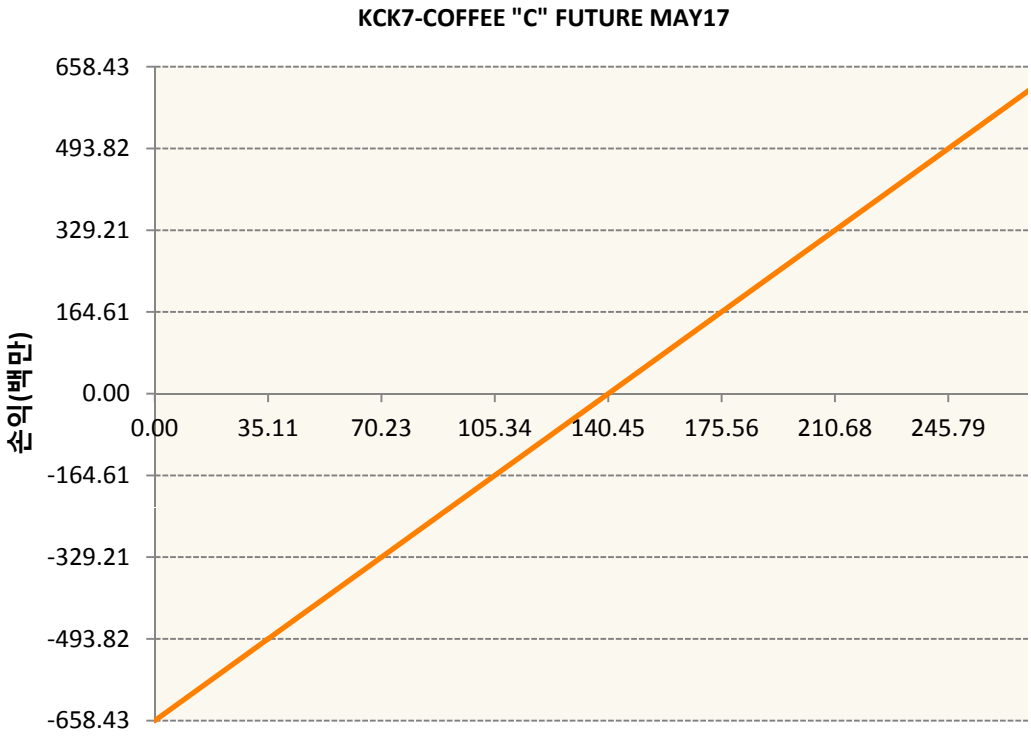
2. 만기시점의 손익구조



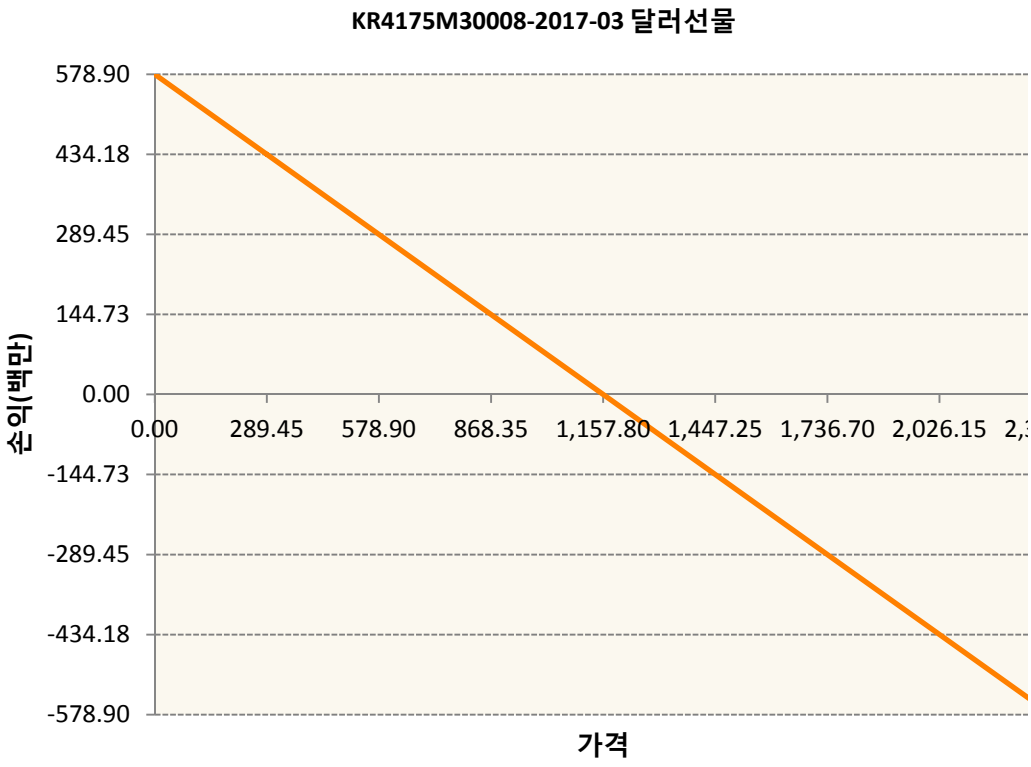


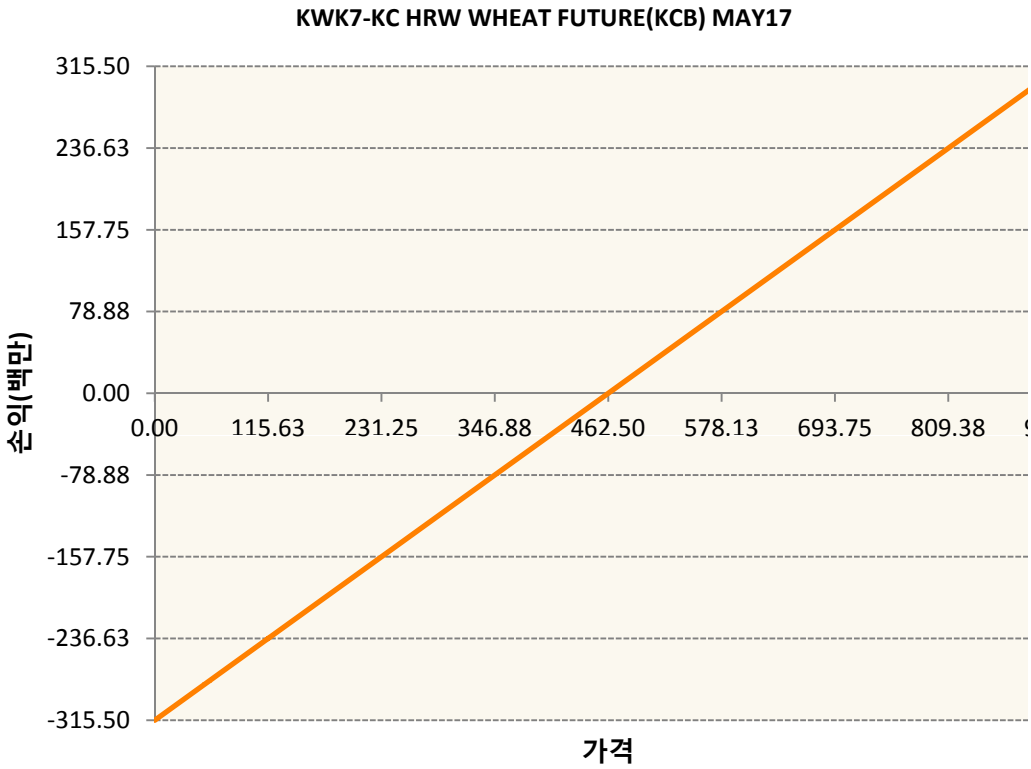

-1,720.64
-2,294.19
가격

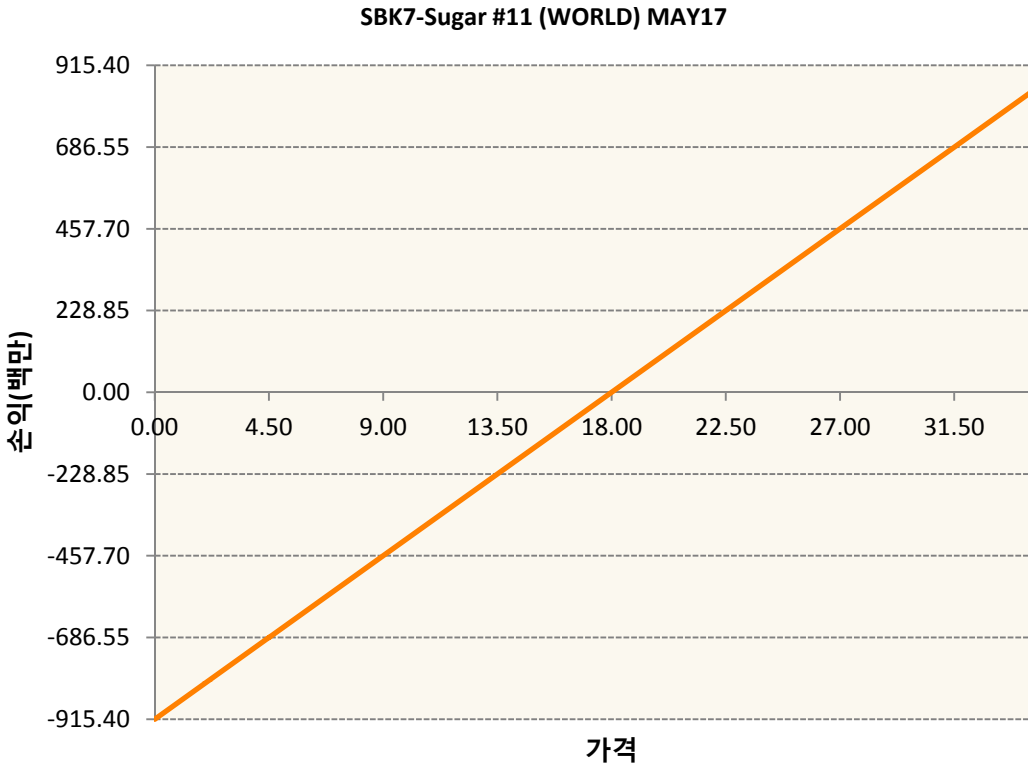

CTK7-COTTON NO.2 FUTR MAY17
354.02
265.51
177.01
88.50
0.00
-88.50
-177.01
-265.51
-354.02
0.00
19.46
38.91
58.37
77.82
97.28
116.73
136.19
순익(백만)
가격

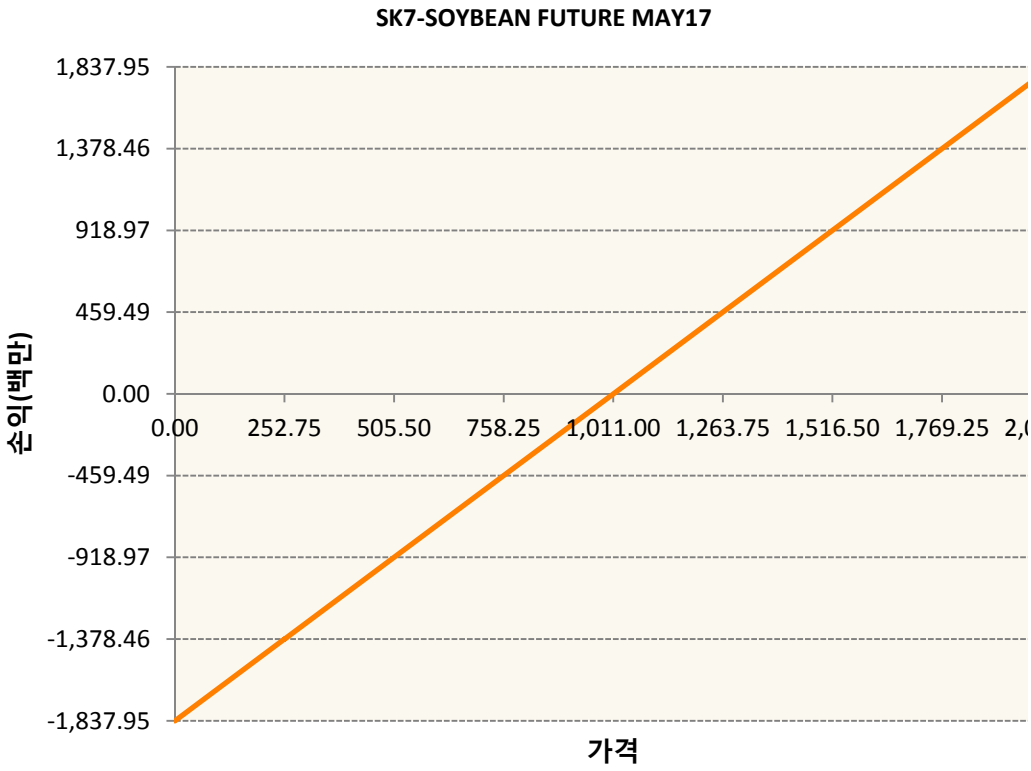

KCK7-COFFEE "C" FUTURE MAY17
658.43
493.82
329.21
164.61
0.00
-164.61
-329.21
-493.82
-658.43
0.00
35.11
70.23
105.34
140.45
175.56
210.68
245.79
순익(백만)

가격

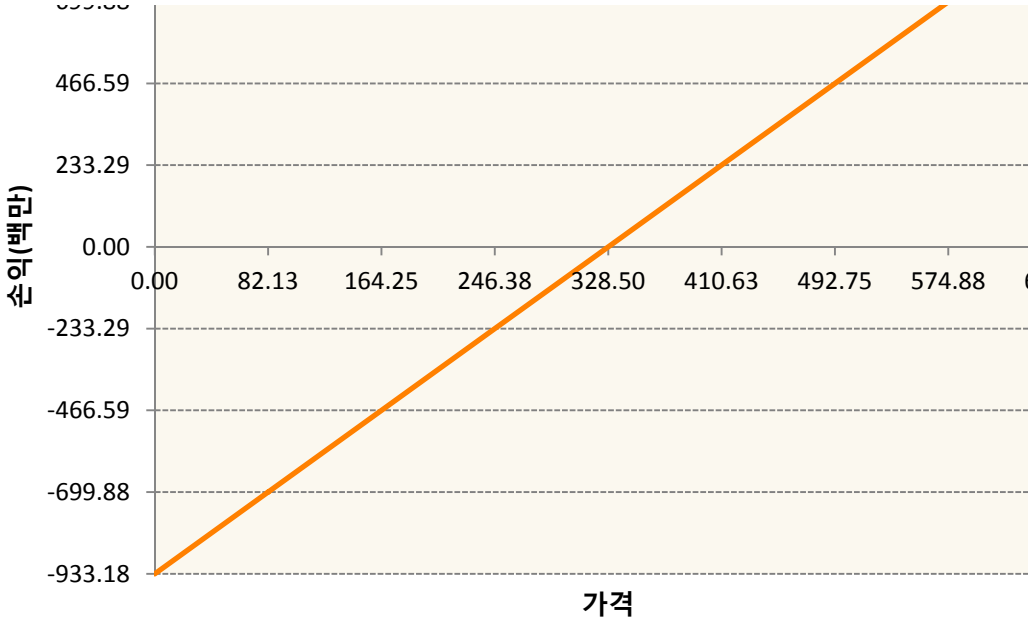

KR4175M30008-2017-03 달러선물
578.90
434.18
289.45
144.73
0.00
-144.73
-289.45
-434.18
-578.90
0.00
289.45
578.90
868.35
1,157.80
1,447.25
1,736.70
2,026.15
손익(백만)
가격

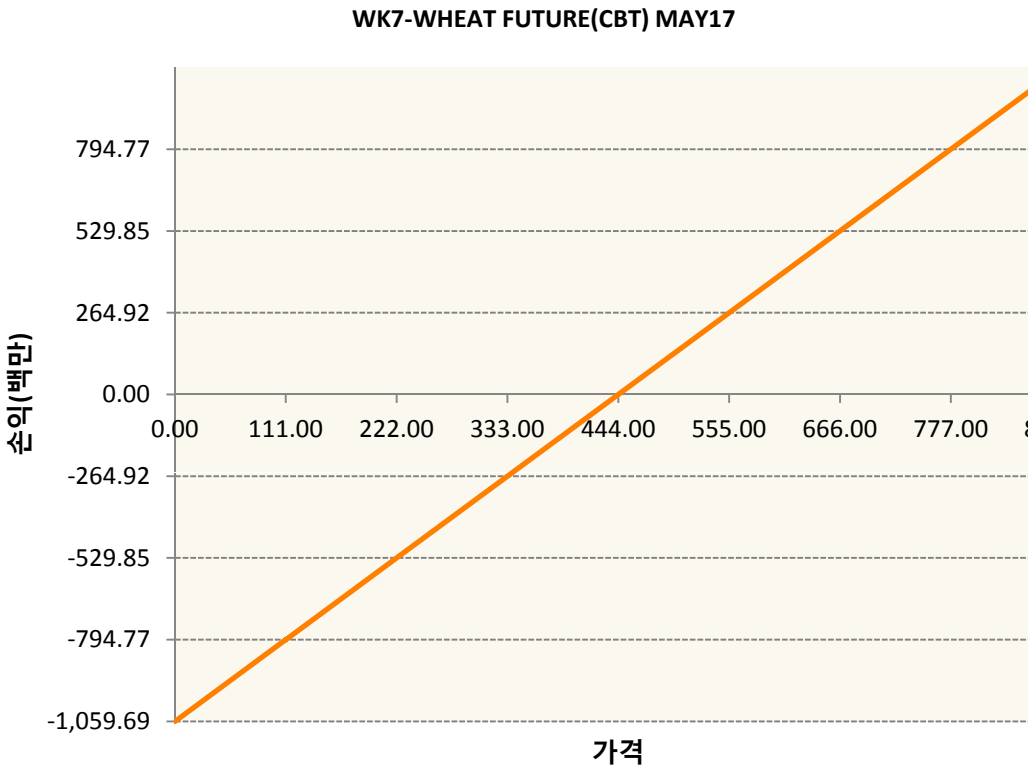

KWK7-KC HRW WHEAT FUTURE(KCB) MAY17
315.50
236.63
157.75
78.88
0.00
-78.88
-157.75
-236.63
-315.50
0.00
115.63
231.25
346.88
462.50
578.13
693.75
809.38
손익(백만)
가격


SBK7-Sugar #11 (WORLD) MAY17
915.40
686.55
457.70
228.85
0.00
-228.85
-457.70
-686.55
-915.40
0.00
4.50
9.00
13.50
18.00
22.50
27.00
31.50
손익(백만)
가격


SK7-SOYBEAN FUTURE MAY17
1,837.95
1,378.46
918.97
459.49
0.00
-459.49
-918.97
-1,378.46
-1,837.95
0.00
252.75
505.50
758.25
1,011.00
1,263.75
1,516.50
1,769.25
손익(백만)
가격


SMK7-SOYBEAN MEAL FUTR MAY17
933.18
699.88





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
BOK7	SOYBEAN OIL FUTR MAY17	63
CK7	CORN FUTURE MAY17	184
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	73
SK7	SOYBEAN FUTURE MAY17	147
SMK7	SOYBEAN MEAL FUTR MAY17	75
WK7	WHEAT FUTURE(CBT) MAY17	85

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

850