공시일	2017-03-14
기준일	2017-03-13

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	2017-03-14
기준일	2017-03-13

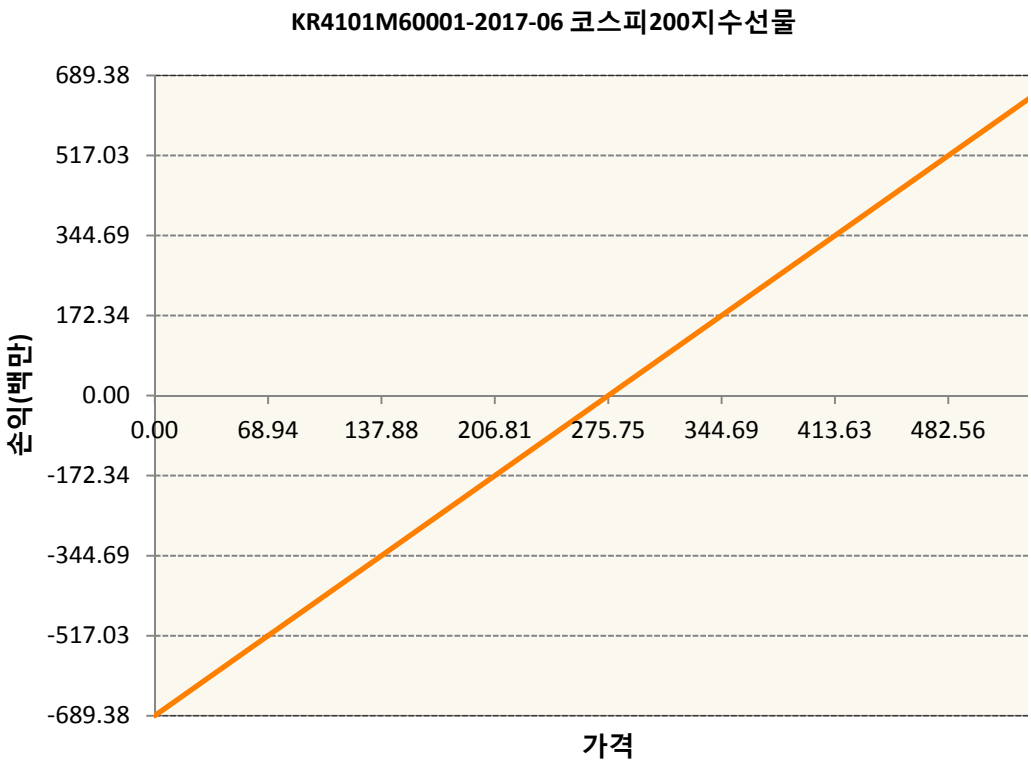
스마트인덱스모

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	689	0	689	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101M60(2017-06 코스피200지수선물							55
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-55	-55	-55	-55	-55	-55	-55
-5.33%	-37	-37	-37	-37	-37	-37	-37
-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%	37	37	37	37	37	37	37
8.00%	55	55	55	55	55	55	55

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

36

공시일	2017-03-14
기준일	2017-03-13

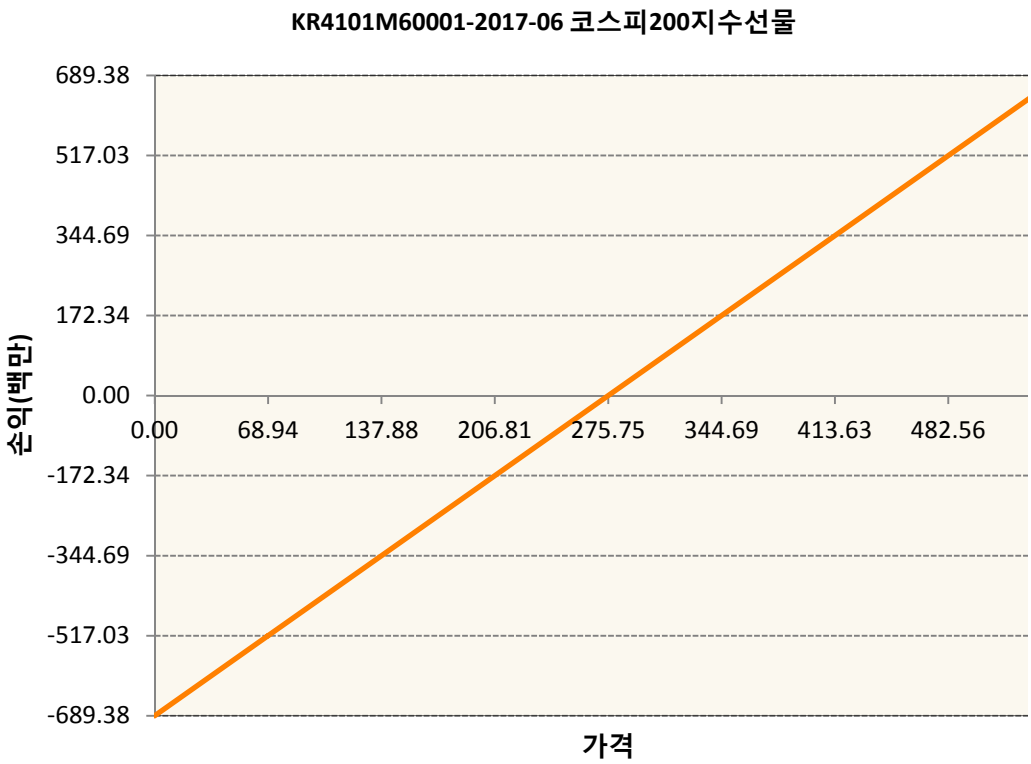
스마트레버리지목표전환형1호

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	689	0	689	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101M60(2017-06 코스피200지수선물							55
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-55	-55	-55	-55	-55	-55	-55
-5.33%	-37	-37	-37	-37	-37	-37	-37
-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%	37	37	37	37	37	37	37
8.00%	55	55	55	55	55	55	55

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

36

공시일	2017-03-14
기준일	2017-03-13

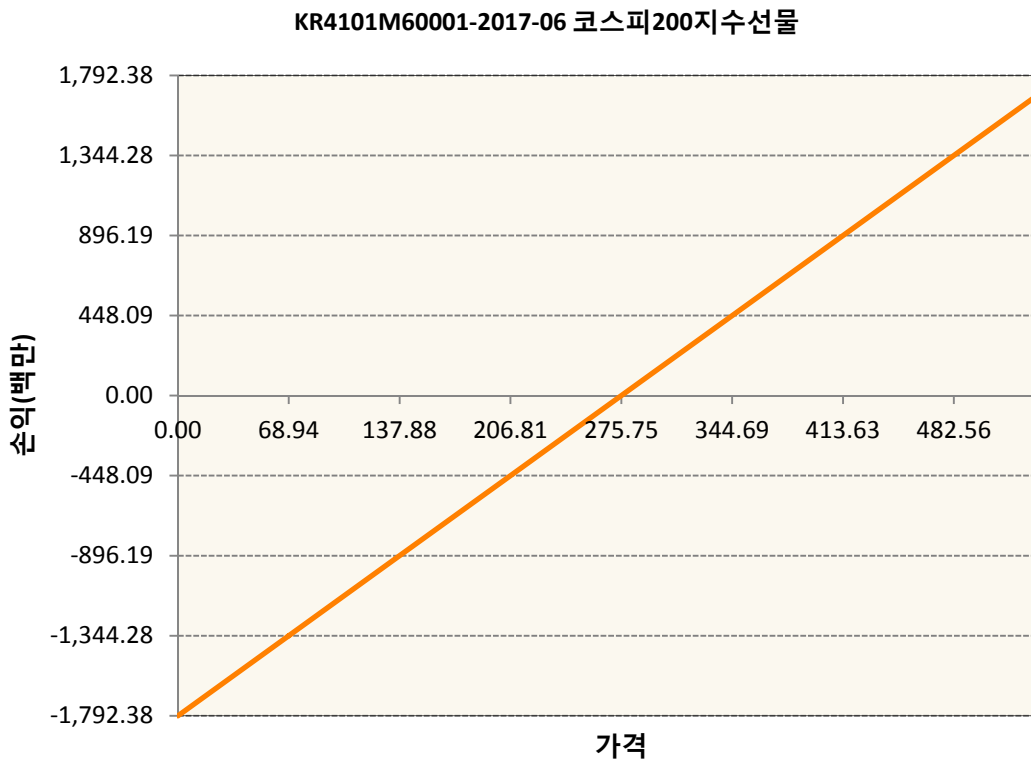
1.3배 레버리지 인덱스(주식-파생형)

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	1,792	0	1,792	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101M60(2017-06 코스피200지수선물							143
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-143	-143	-143	-143	-143	-143	-143
-5.33%	-95	-95	-95	-95	-95	-95	-95
-2.67%	-48	-48	-48	-48	-48	-48	-48
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	48	48	48	48	48	48	48
5.33%	95	95	95	95	95	95	95
8.00%	143	143	143	143	143	143	143

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

92

공시일	2017-03-14
기준일	2017-03-13

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)

590

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-03-14
기준일	2017-03-13

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)

458

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-03-14
기준일	2017-03-13

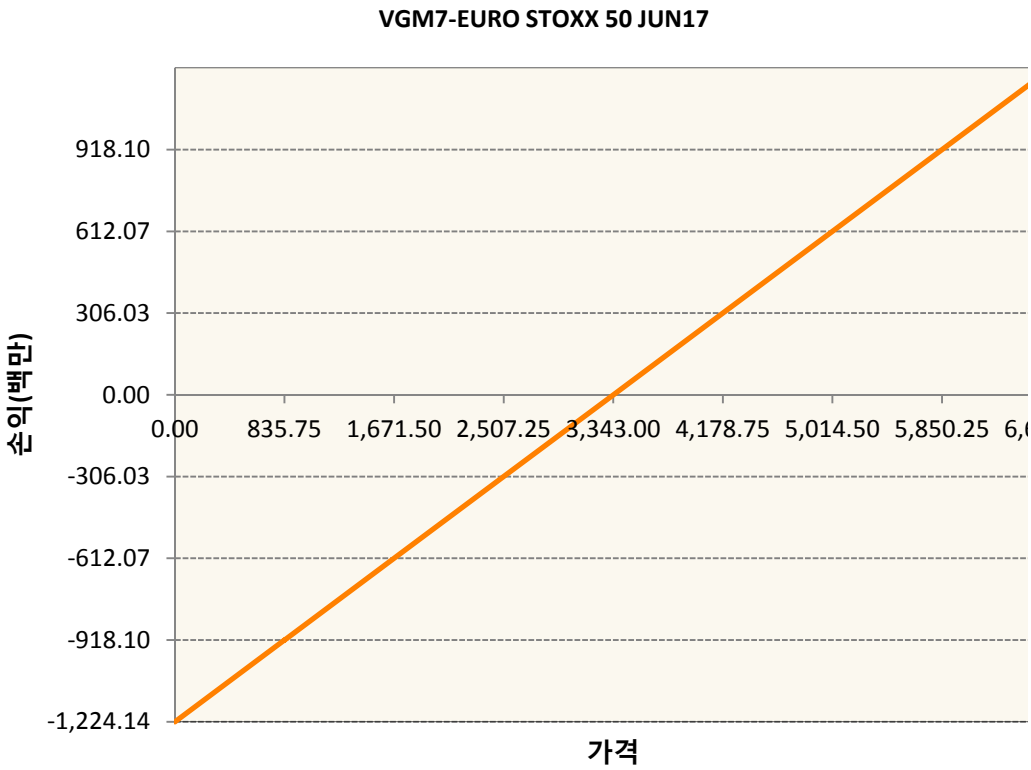
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,224	0	1,224	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGM7	EURO STOXX 50 JUN17	98

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

(단위:백만원)

100

공시일	2017-03-14
기준일	2017-03-13

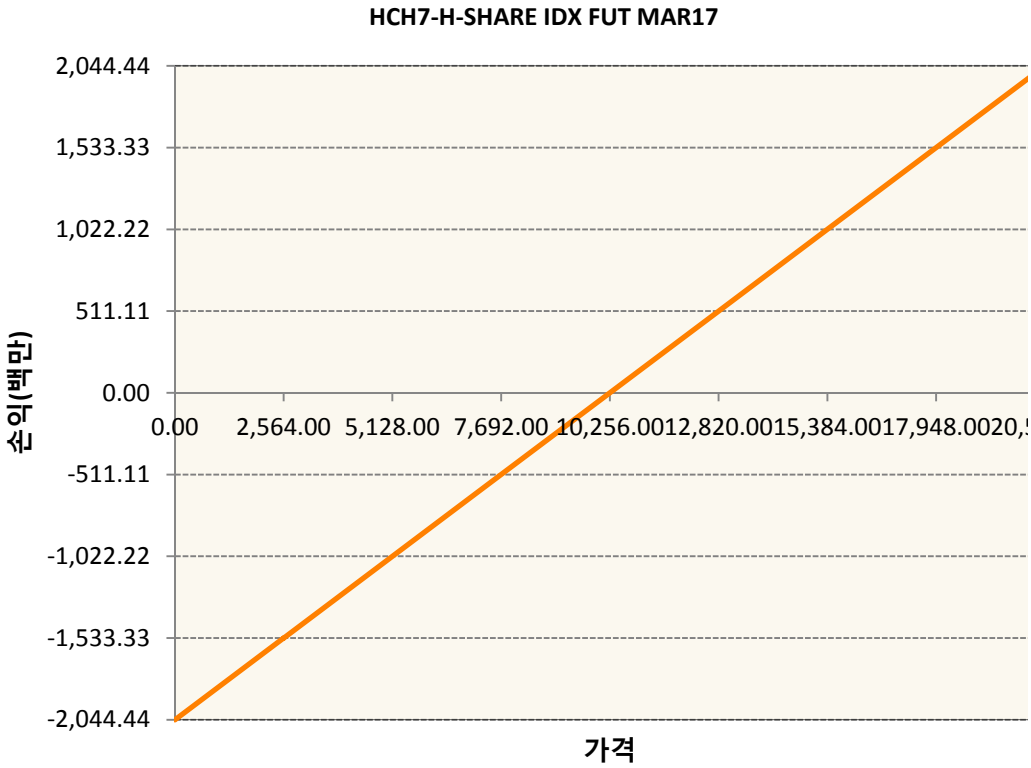
차이나인덱스모(주식-파생형)

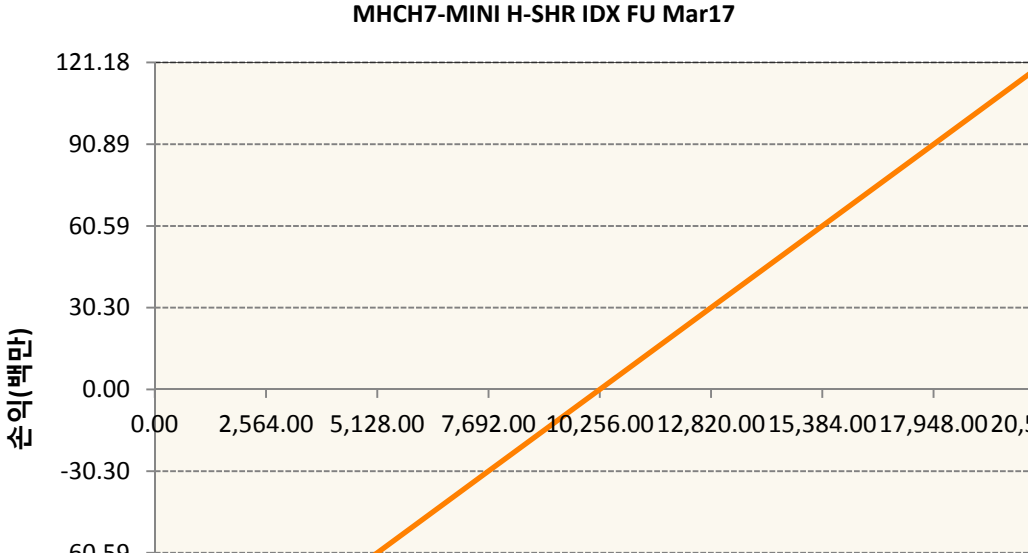
1. 계약금액

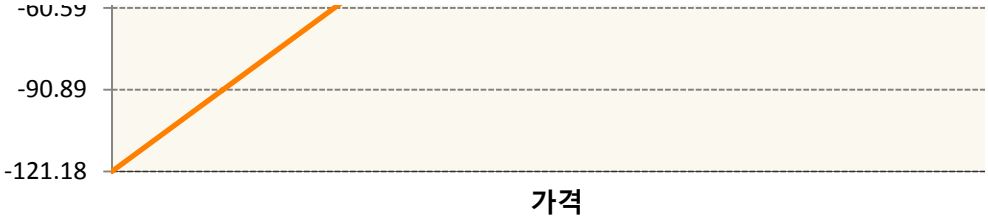
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,166	0	2,166	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	2017-03-14
기준일	2017-03-13

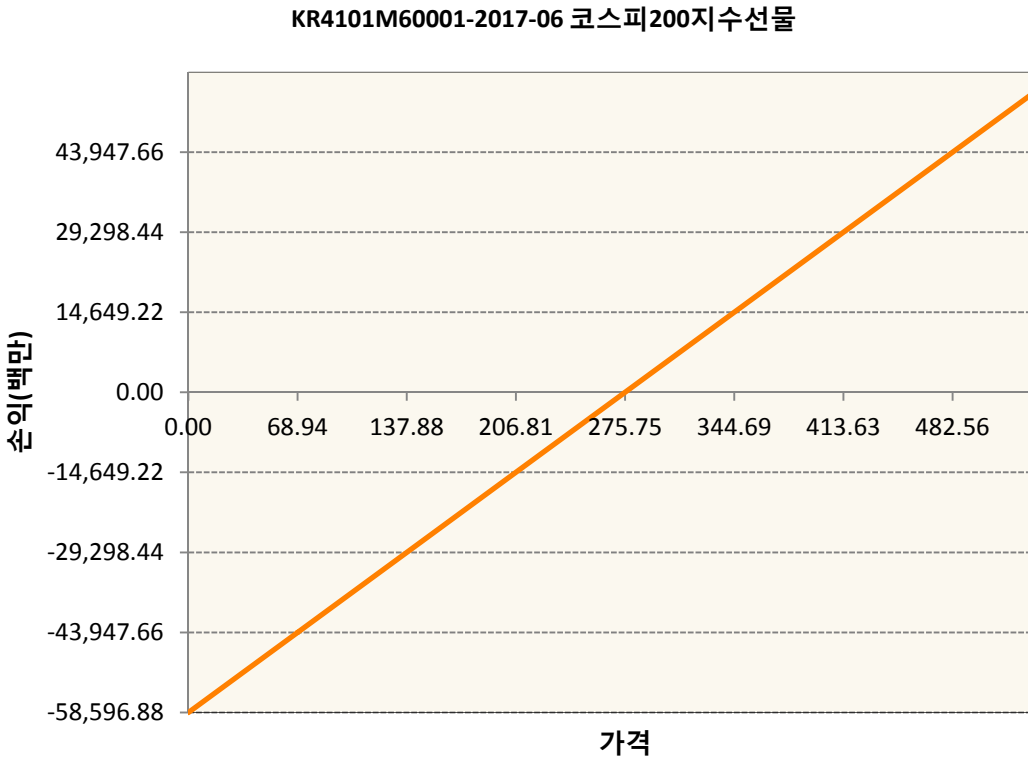
커버드콜모(주식혼합-파생형)

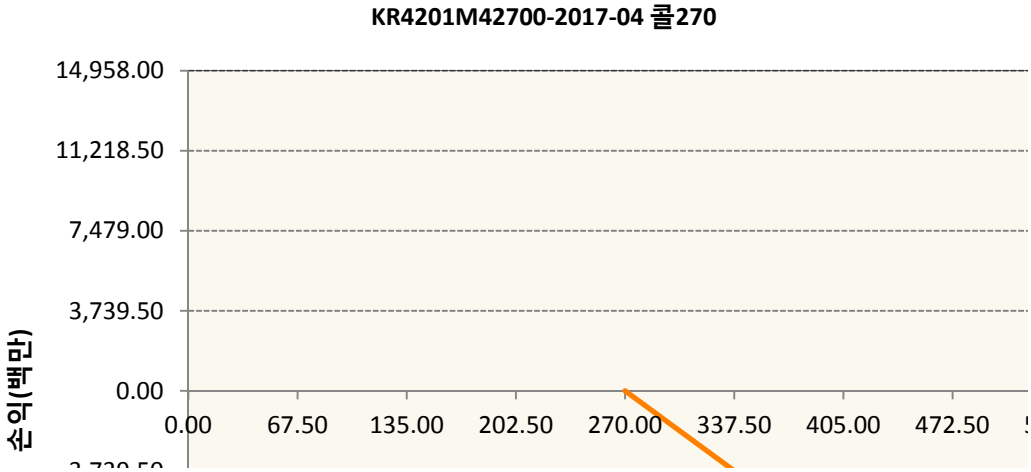
1. 계약금액

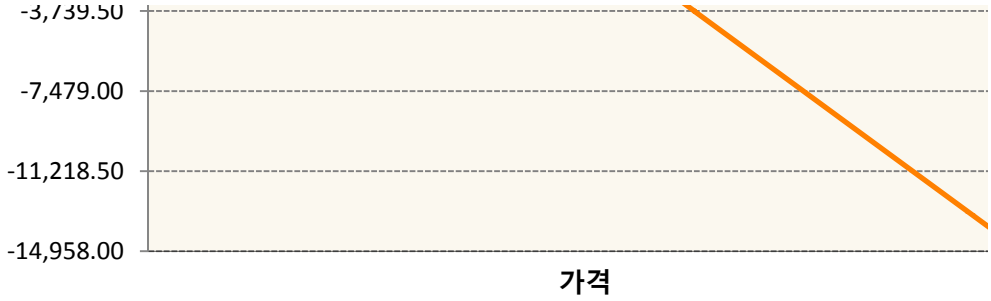
(단위:백만원)

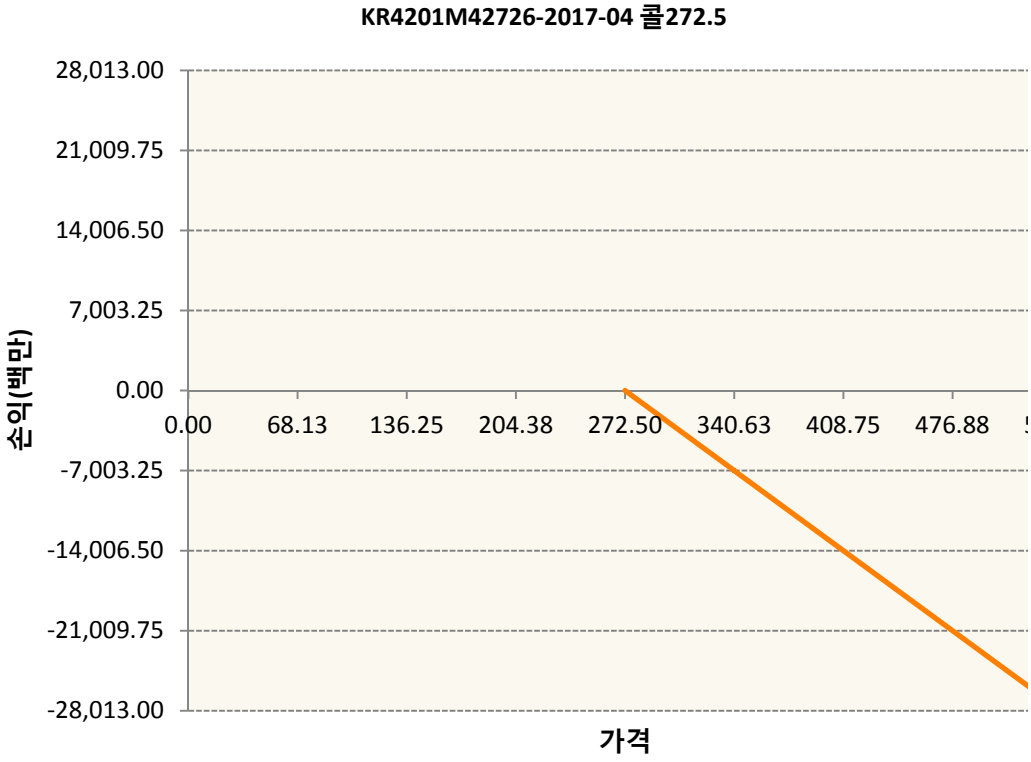
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	1,108	-1,108	장내
누계	유가증권	선물	58,597	0	58,597	장내
누계	유가증권	옵션	0	42,971	-42,971	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101M60(2017-06 코스피200지수선물							4,682
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-4,682	-4,682	-4,682	-4,682	-4,682	-4,682	-4,682
-5.33%	-3,121	-3,121	-3,121	-3,121	-3,121	-3,121	-3,121
-2.67%	-1,561	-1,561	-1,561	-1,561	-1,561	-1,561	-1,561
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	1,561	1,561	1,561	1,561	1,561	1,561	1,561
5.33%	3,121	3,121	3,121	3,121	3,121	3,121	3,121
8.00%	4,682	4,682	4,682	4,682	4,682	4,682	4,682
KR4201M42 2017-04 콜270							5,722
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,857	1,854	1,849	1,842	1,831	1,816	1,798
-5.33%	1,809	1,781	1,748	1,710	1,668	1,622	1,572
-2.67%	1,405	1,331	1,257	1,182	1,107	1,031	955
0%	181	124	63	0	-65	-132	-201
2.67%	-1,669	-1,683	-1,703	-1,727	-1,756	-1,790	-1,828
5.33%	-3,684	-3,686	-3,688	-3,693	-3,700	-3,710	-3,723
8.00%	-5,715	-5,715	-5,715	-5,716	-5,717	-5,719	-5,722
KR4201M42: 2017-04 콜272.5							10,217

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	2,578	2,576	2,572	2,565	2,553	2,537	2,516
-5.33%	2,543	2,514	2,477	2,430	2,374	2,310	2,239
-2.67%	2,123	2,008	1,888	1,765	1,639	1,510	1,379
0%	406	273	137	0	-139	-278	-419
2.67%	-2,737	-2,786	-2,846	-2,915	-2,993	-3,079	-3,171
5.33%	-6,427	-6,433	-6,444	-6,461	-6,485	-6,516	-6,554
8.00%	-10,192	-10,193	-10,193	-10,196	-10,200	-10,207	-10,217

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

21,877

공시일	2017-03-14
기준일	2017-03-13

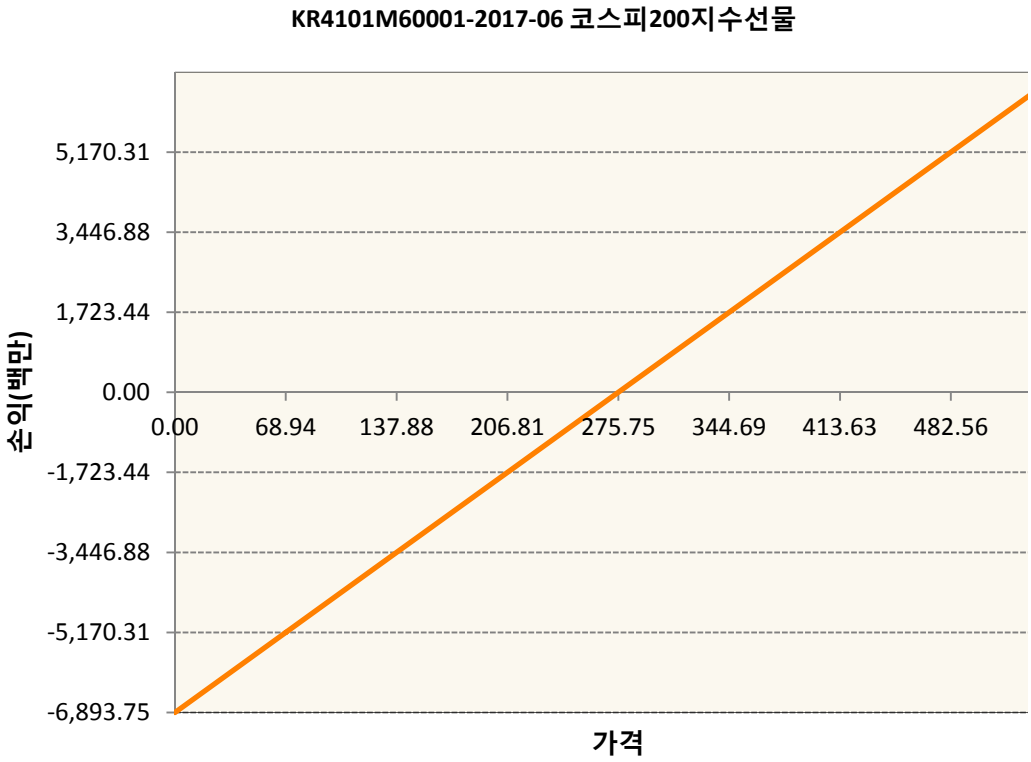
커버드콜목표전환형증권투자신탁

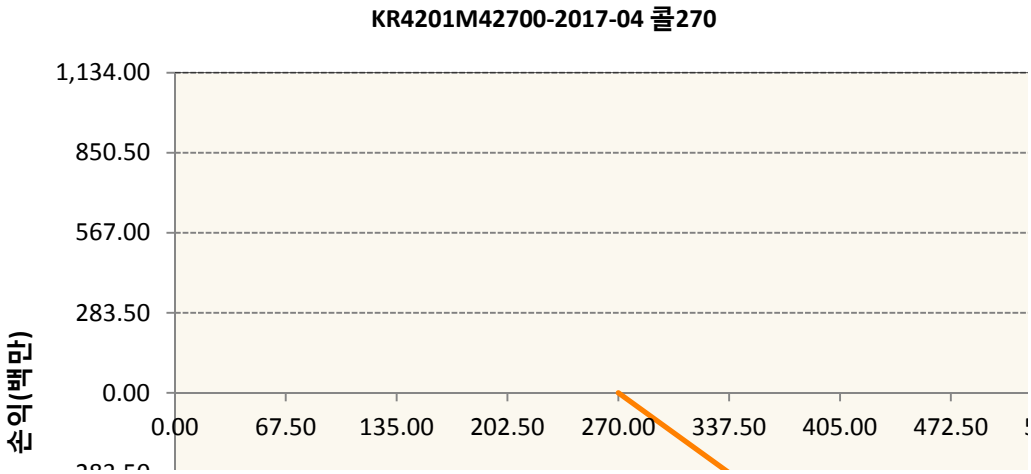
1. 계약금액

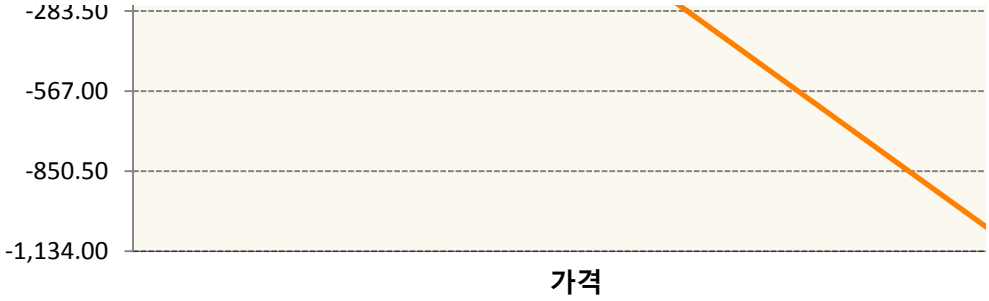
(단위:백만원)

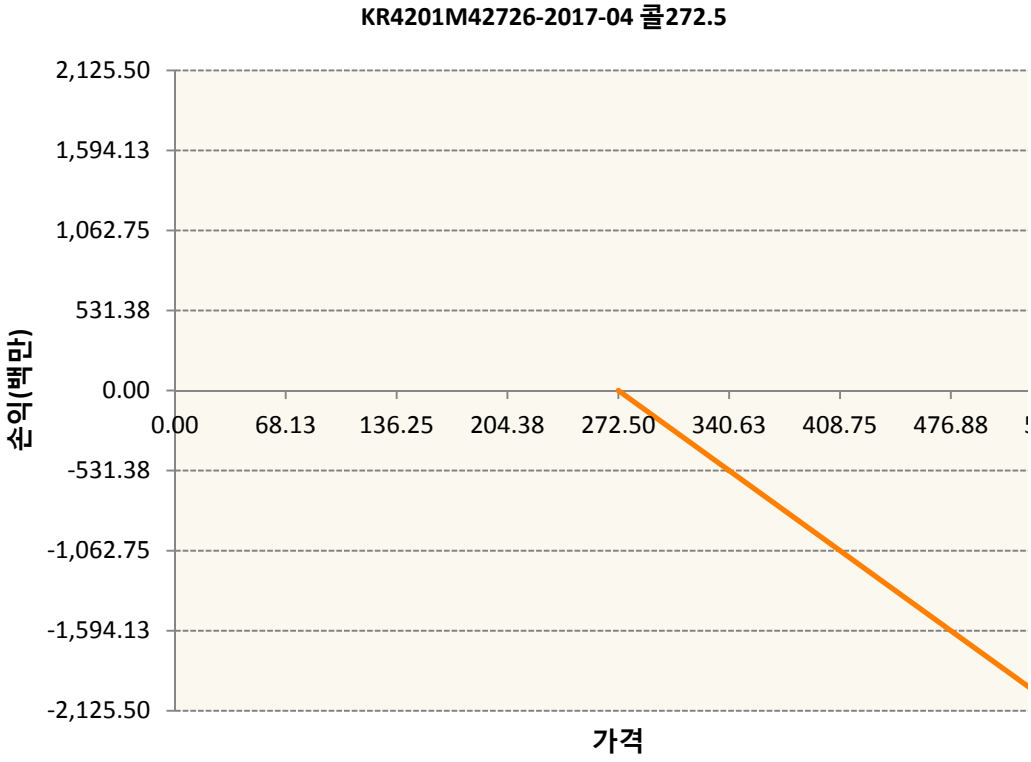
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	6,894	0	6,894	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,260	-3,260	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101M60(2017-06 코스피200지수선물							551
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-551	-551	-551	-551	-551	-551	-551
-5.33%	-367	-367	-367	-367	-367	-367	-367
-2.67%	-184	-184	-184	-184	-184	-184	-184
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	184	184	184	184	184	184	184
5.33%	367	367	367	367	367	367	367
8.00%	551	551	551	551	551	551	551
KR4201M42 2017-04 콜270							434
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	141	141	140	140	139	138	136
-5.33%	137	135	133	130	126	123	119
-2.67%	107	101	95	90	84	78	72
0%	14	9	5	0	-5	-10	-15
2.67%	-127	-128	-129	-131	-133	-136	-139
5.33%	-279	-279	-280	-280	-280	-281	-282
8.00%	-433	-433	-433	-433	-433	-434	-434
KR4201M42 2017-04 콜272.5							775

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	196	195	195	195	194	193	191
-5.33%	193	191	188	184	180	175	170
-2.67%	161	152	143	134	124	115	105
0%	31	21	10	0	-11	-21	-32
2.67%	-208	-211	-216	-221	-227	-234	-241
5.33%	-488	-488	-489	-490	-492	-494	-497
8.00%	-773	-773	-773	-774	-774	-774	-775

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

1,786

공시일	2017-03-14
기준일	2017-03-13

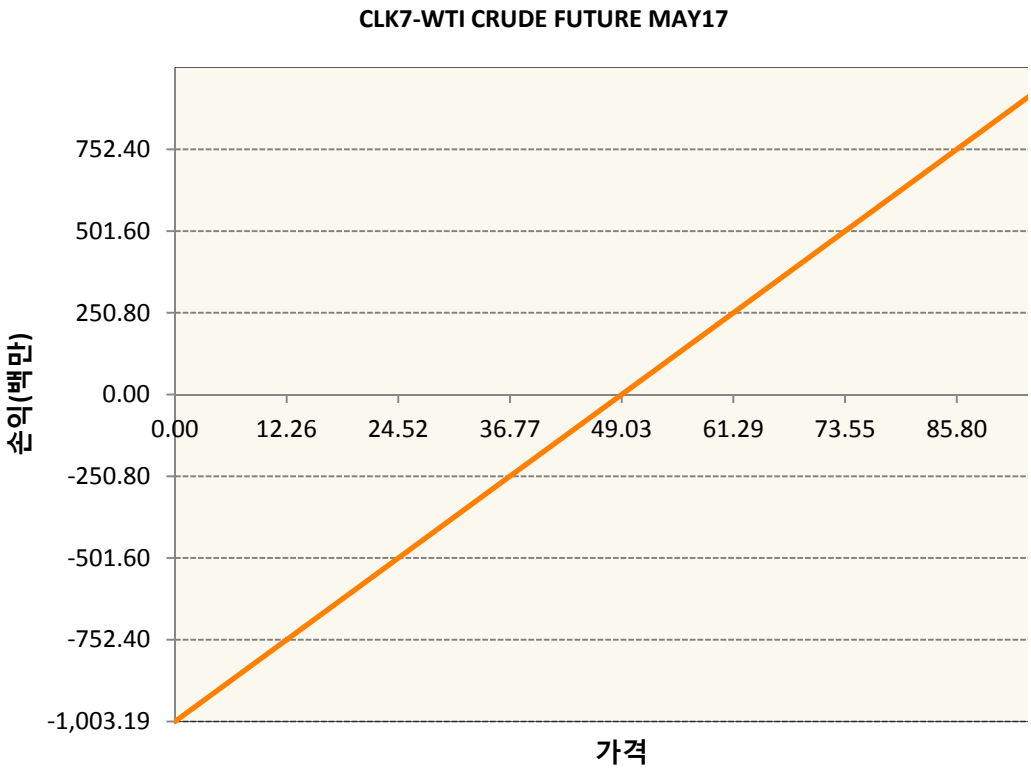
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

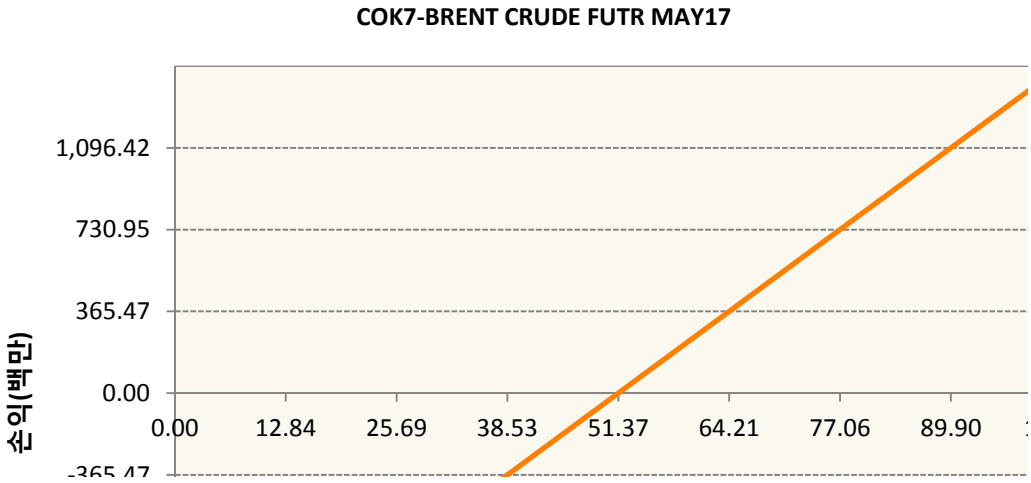
1. 계약금액

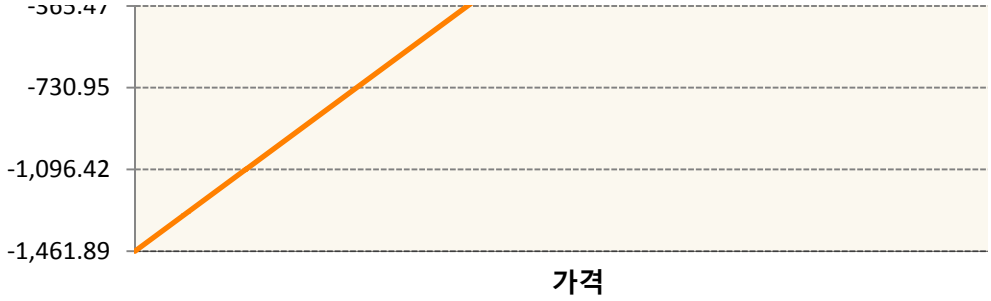
(단위:백만원)

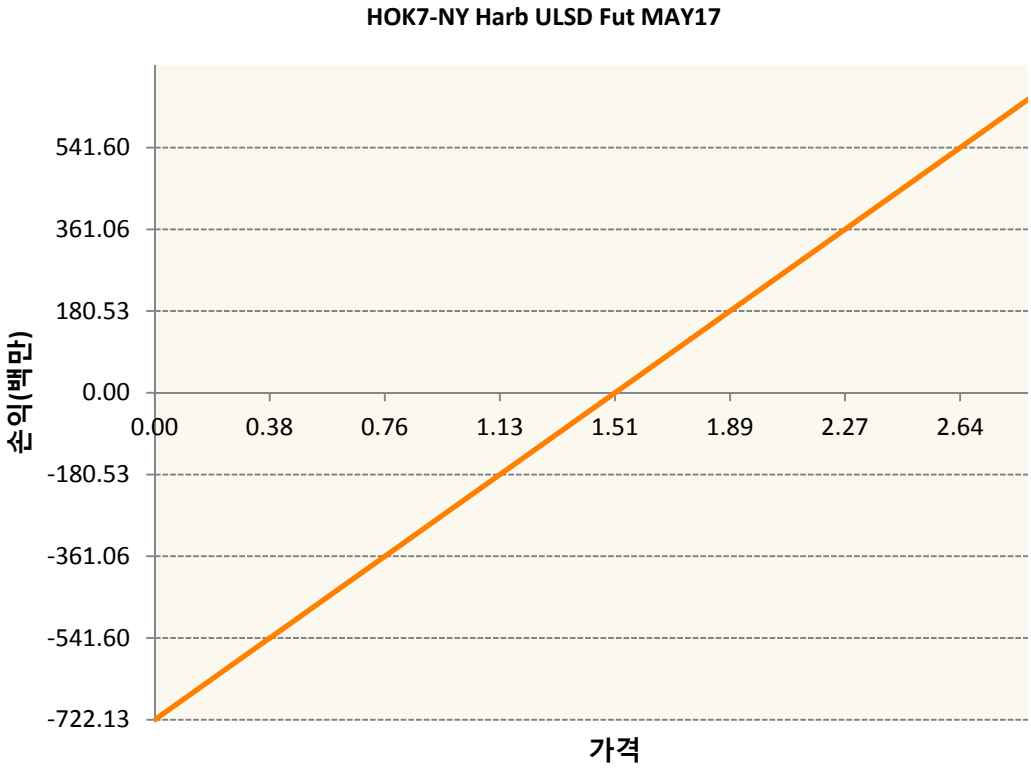
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	선물	유가증권	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	선물	유가증권	1,003	0	1,003	
누계	유가증권	선물	4,383	412	3,971	

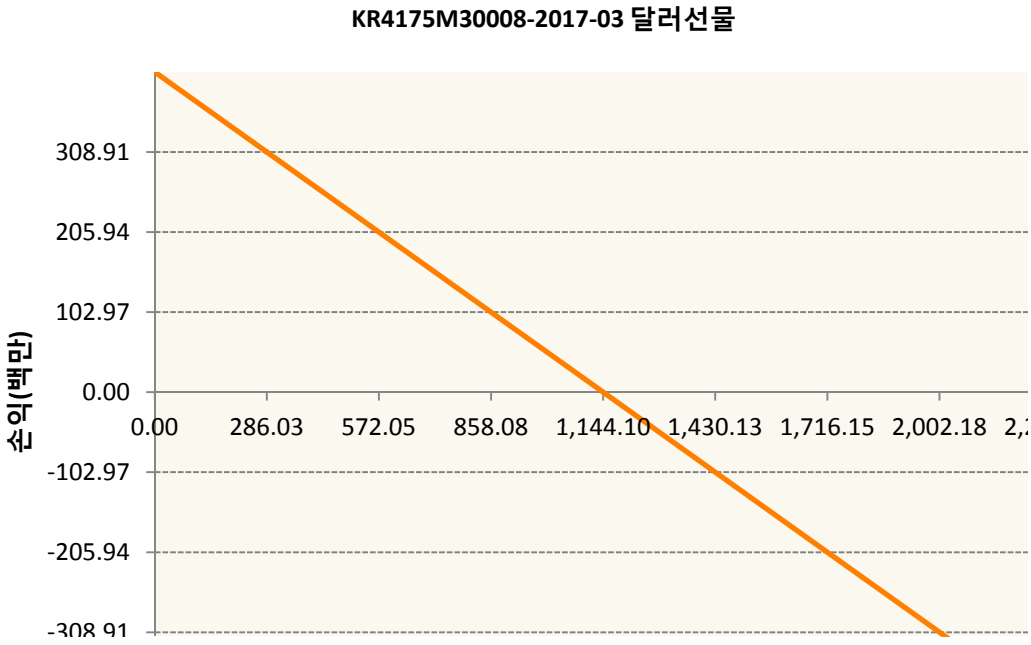
2. 만기시점의 손익구조

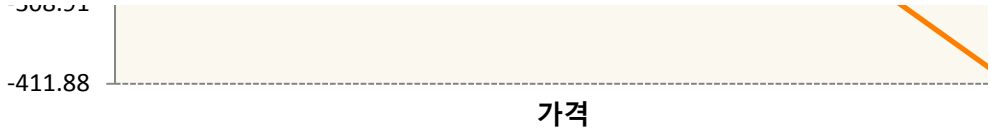


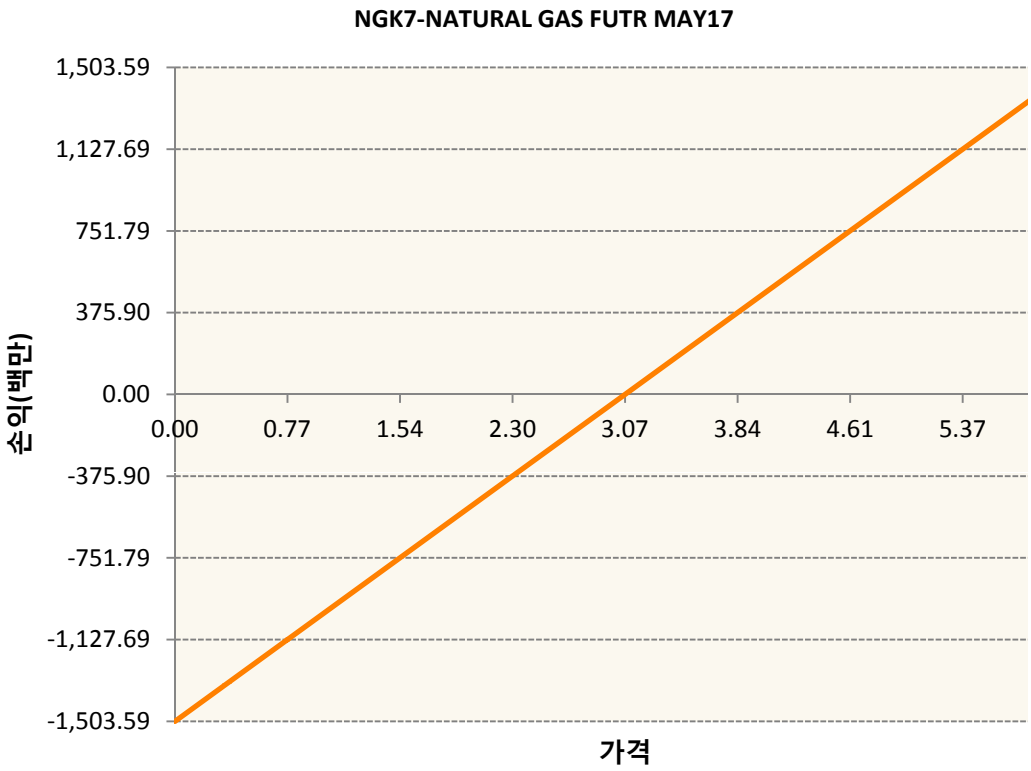


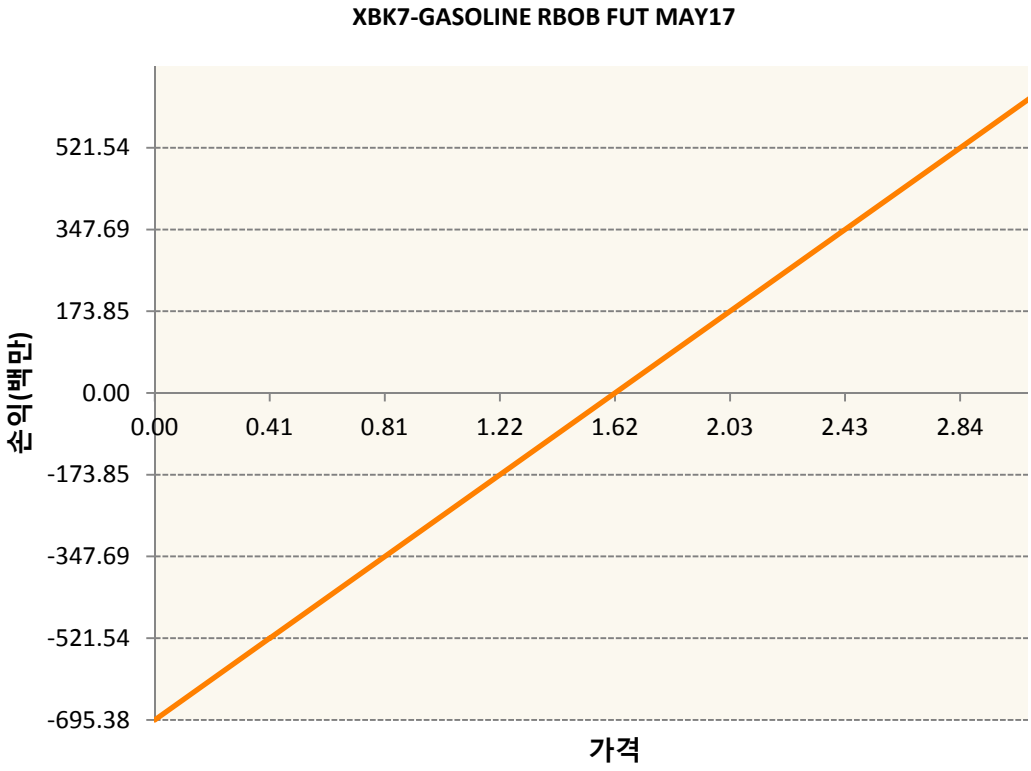

-730.95
-1,096.42
-1,461.89
가격


HOK7-NY Harb ULSD Fut MAY17
541.60
361.06
180.53
0.00
-180.53
-361.06
-541.60
-722.13
0.00
0.38
0.76
1.13
1.51
1.89
2.27
2.64
순익(백만)
가격


KR4175M30008-2017-03 달러선물
308.91
205.94
102.97
0.00
-102.97
-205.94
-308.91
0.00
286.03
572.05
858.08
1,144.10
1,430.13
1,716.15
2,002.18
순익(백만)


-411.88
가격


NGK7-NATURAL GAS FUTR MAY17
1,503.59
1,127.69
751.79
375.90
0.00
-375.90
-751.79
-1,127.69
-1,503.59
0.00
0.77
1.54
2.30
3.07
3.84
4.61
5.37
순익(백만)
가격


XBK7-GASOLINE RBOB FUT MAY17
521.54
347.69
173.85
0.00
-173.85
-347.69
-521.54
-695.38
0.00
0.41
0.81
1.22
1.62
2.03
2.43
2.84
순익(백만)
가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLK7	WTI CRUDE FUTURE MAY17	80
COK7	BRENT CRUDE FUTR MAY17	117
HOK7	NY Harb ULSD Fut MAY17	58
KR4175M30(	2017-03 달러선물	33
NGK7	NATURAL GAS FUTR MAY17	120
XBK7	GASOLINE RBOB FUT MAY17	56

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

961

공시일	2017-03-14
기준일	2017-03-13

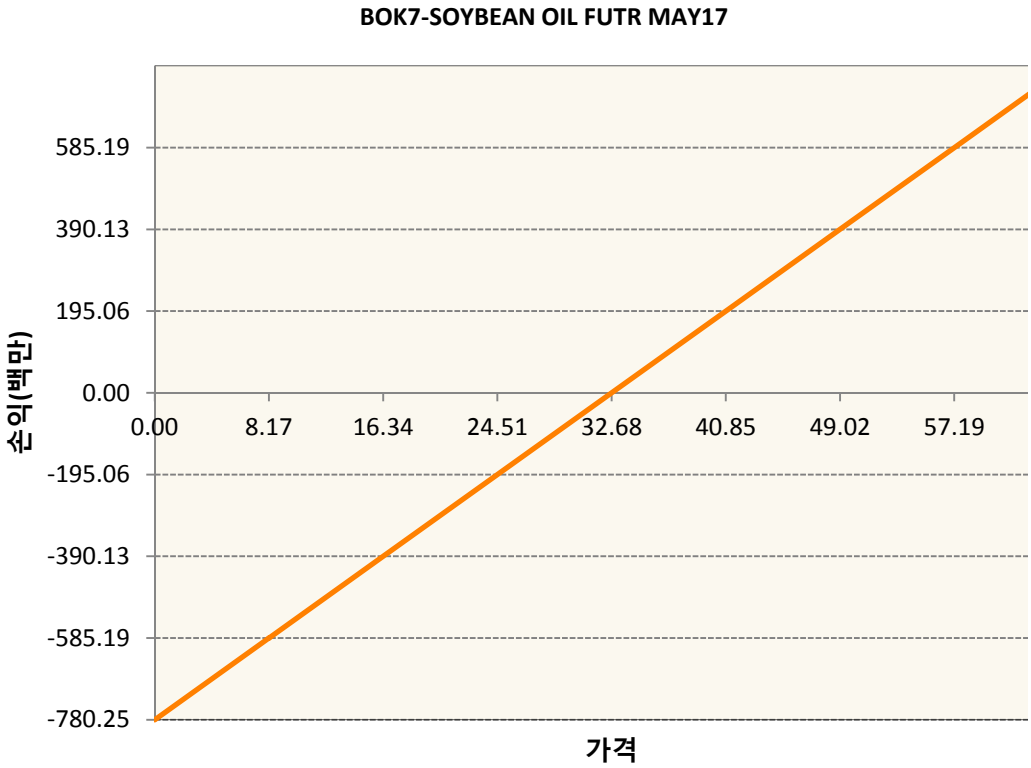
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

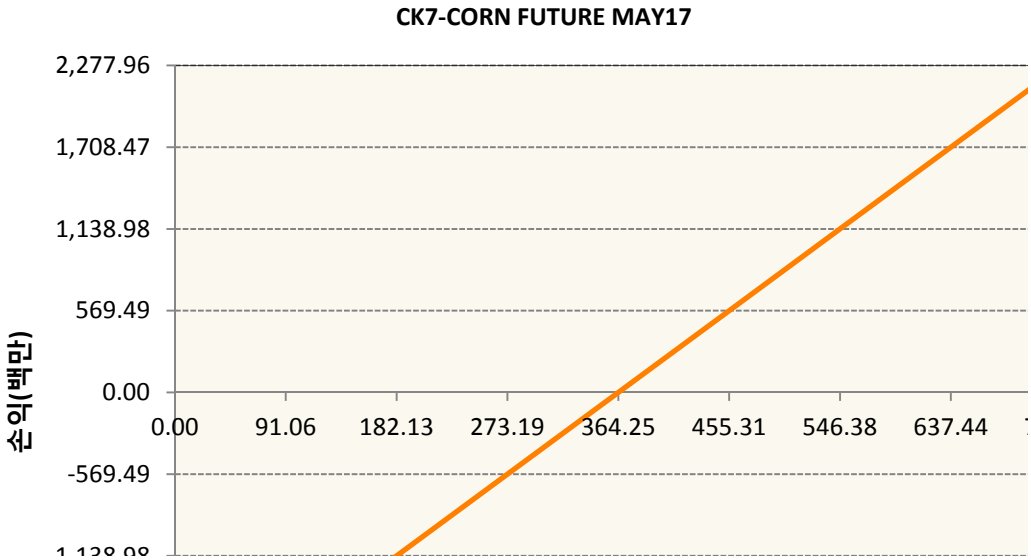
1. 계약금액

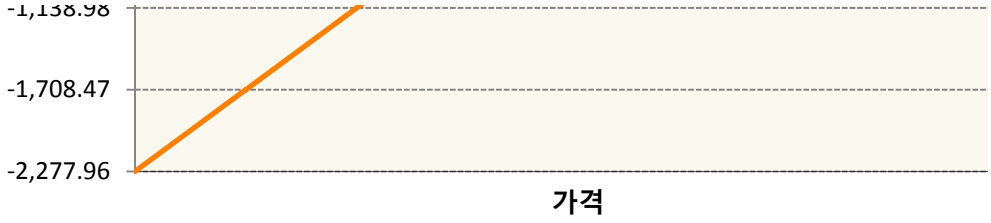
(단위:백만원)

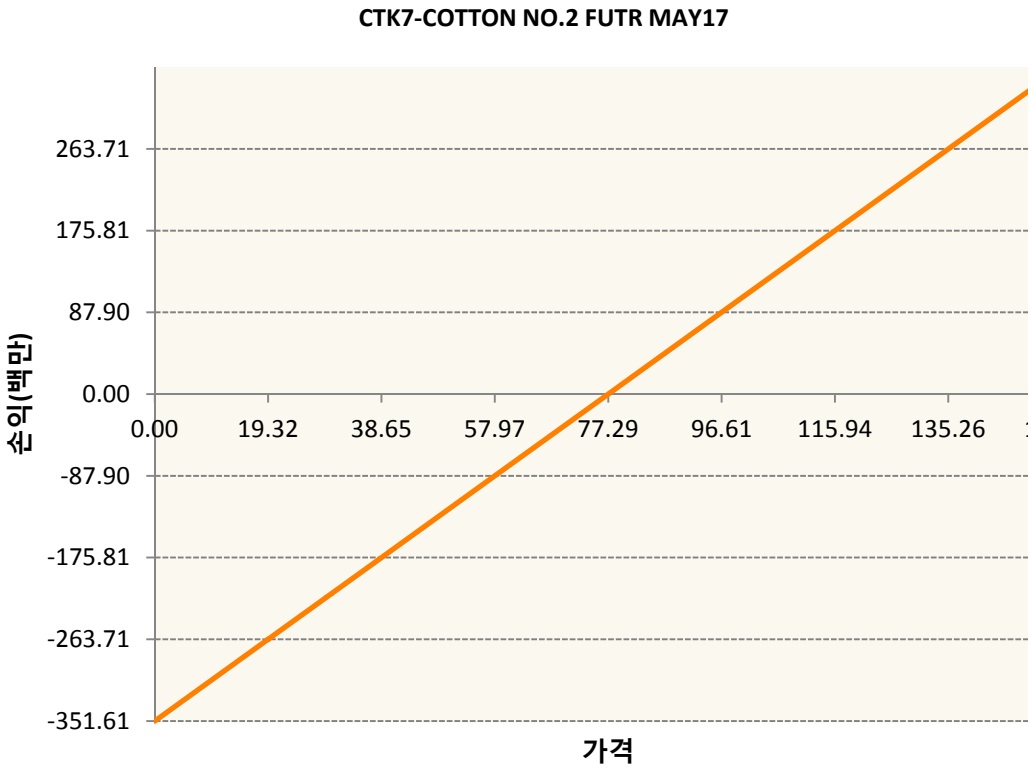
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	9,129	572	8,557	

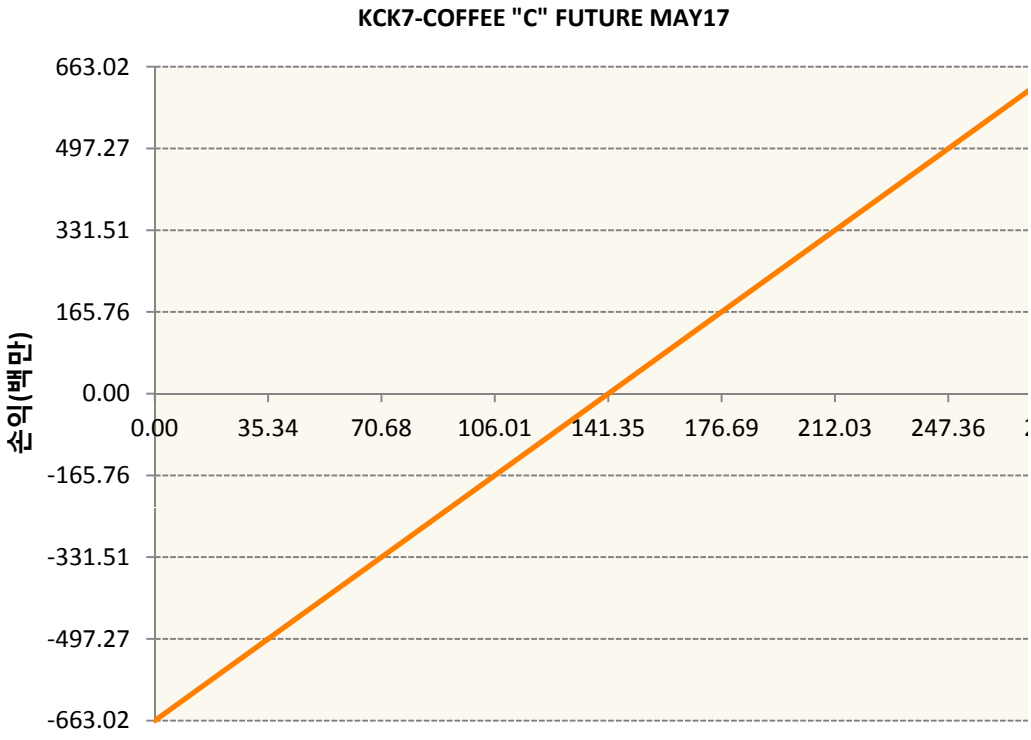
2. 만기시점의 손익구조



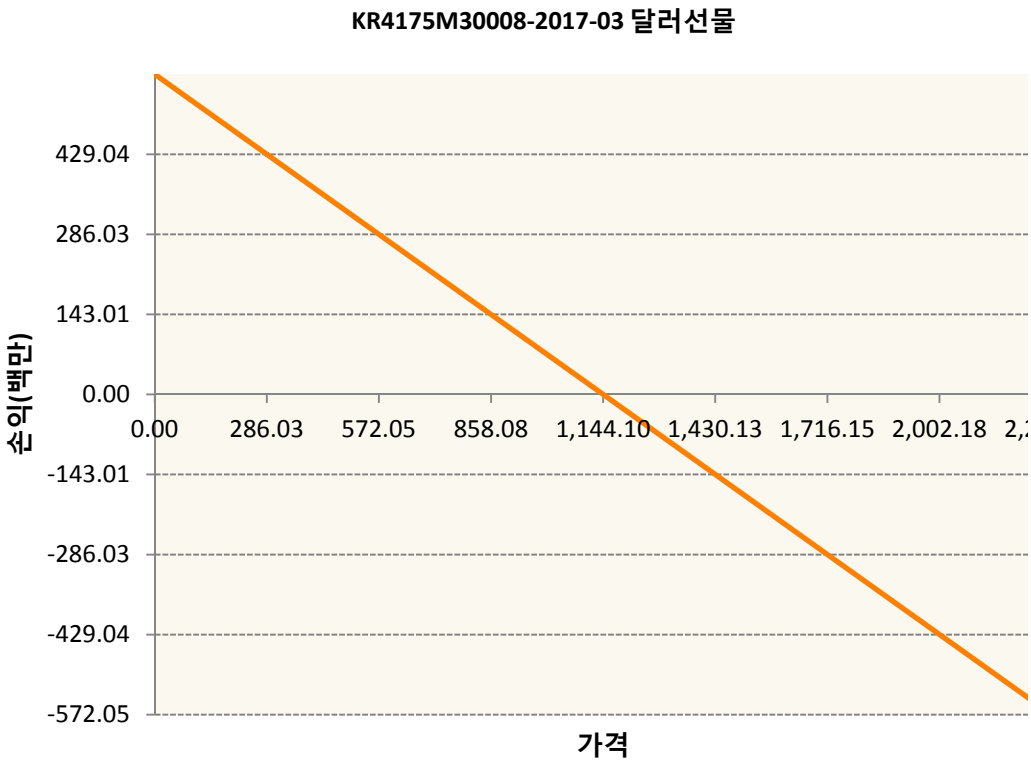


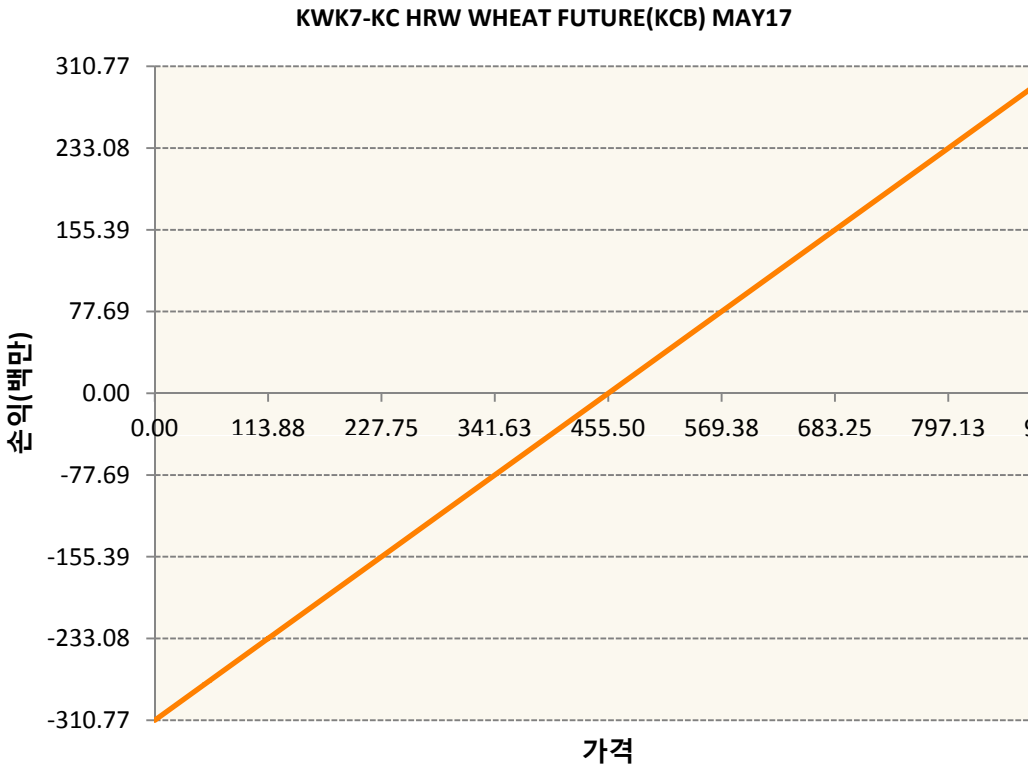

-1,138.98
-1,708.47
-2,277.96
가격

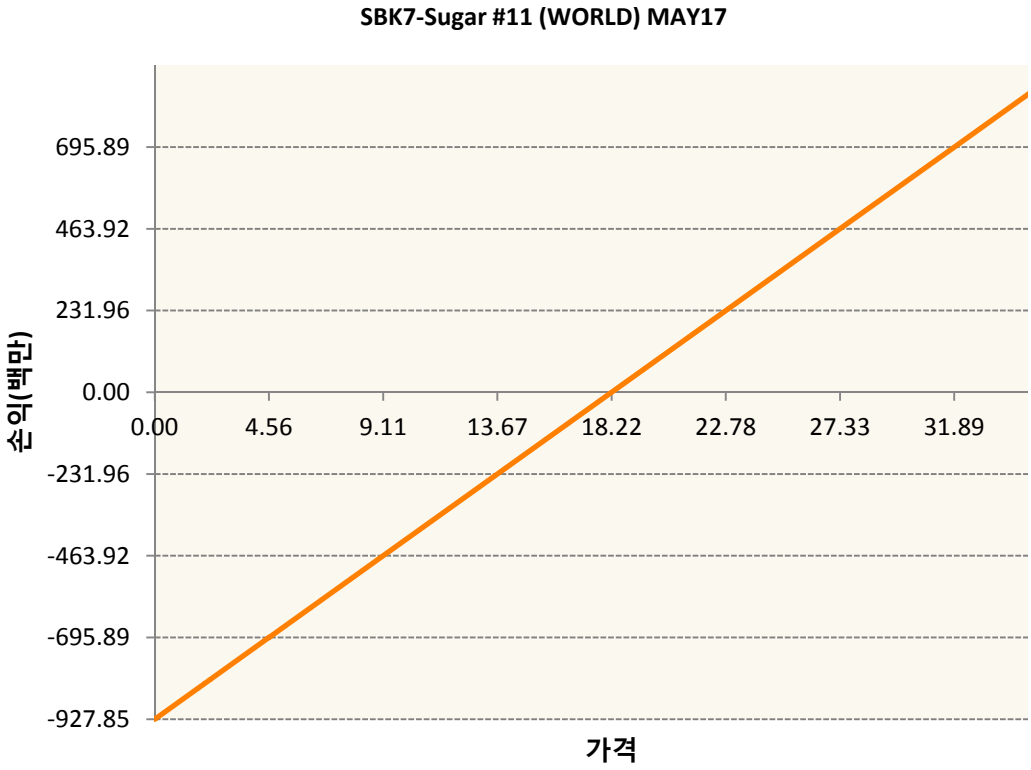

CTK7-COTTON NO.2 FUTR MAY17
263.71
175.81
87.90
0.00
-87.90
-175.81
-263.71
-351.61
0.00
19.32
38.65
57.97
77.29
96.61
115.94
135.26
순익(백만)
가격

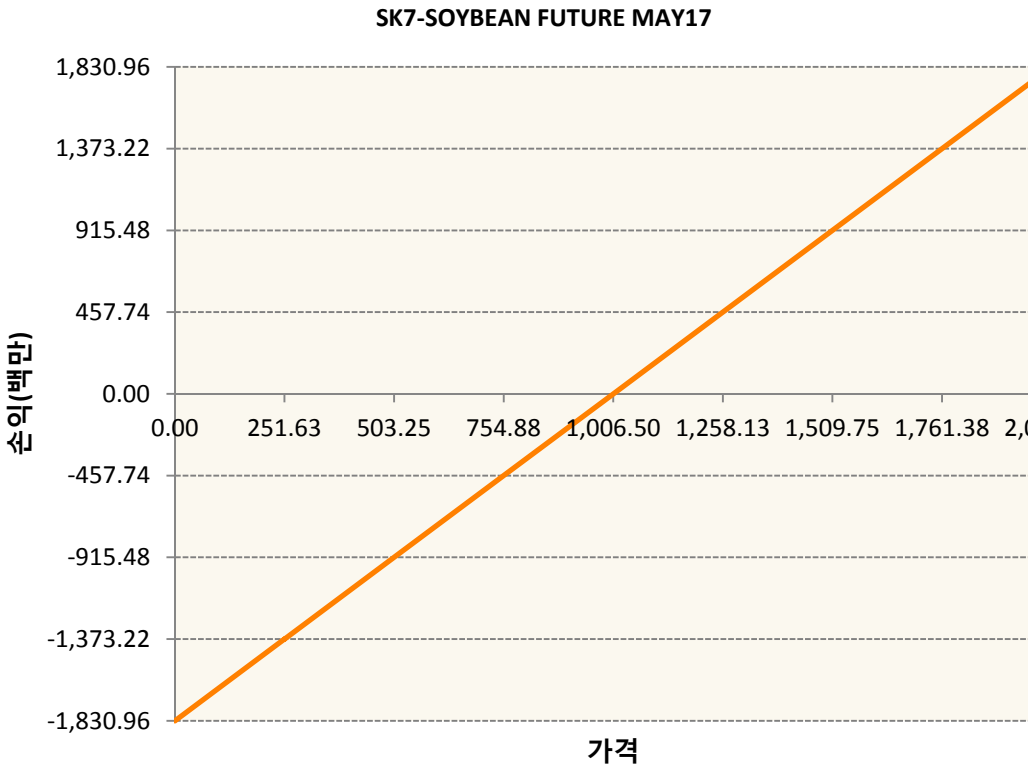

KCK7-COFFEE "C" FUTURE MAY17
663.02
497.27
331.51
165.76
0.00
-165.76
-331.51
-497.27
-663.02
0.00
35.34
70.68
106.01
141.35
176.69
212.03
247.36
순익(백만)

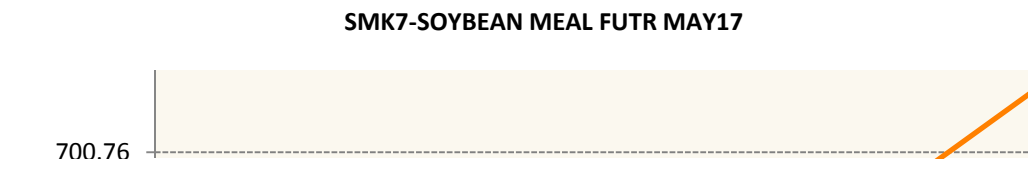
가격

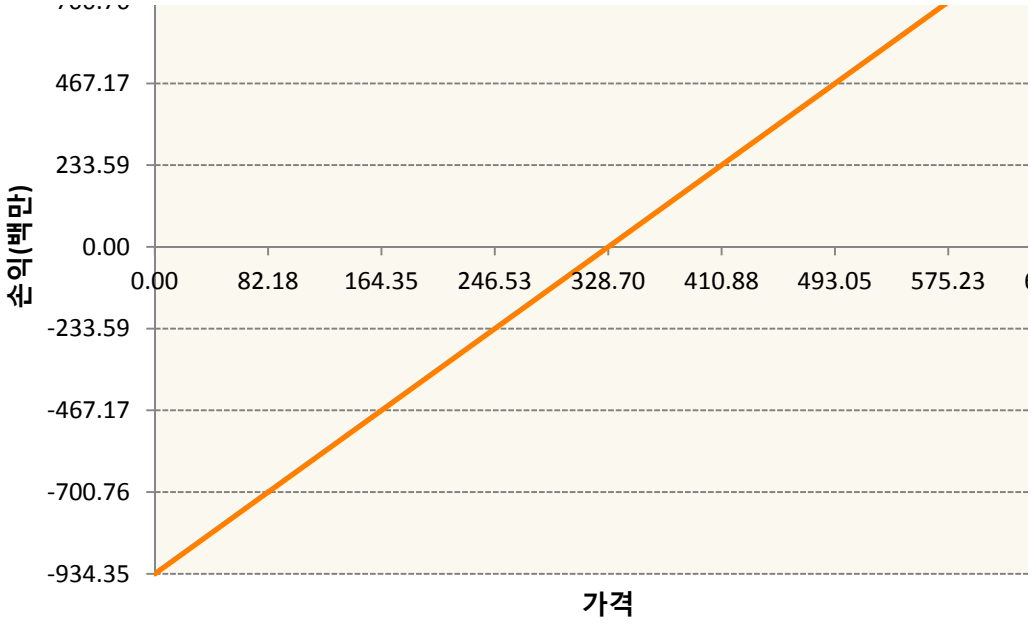

KR4175M30008-2017-03 달러선물
429.04
286.03
143.01
0.00
-143.01
-286.03
-429.04
-572.05
0.00
286.03
572.05
858.08
1,144.10
1,430.13
1,716.15
2,002.18
손익(백만)
가격

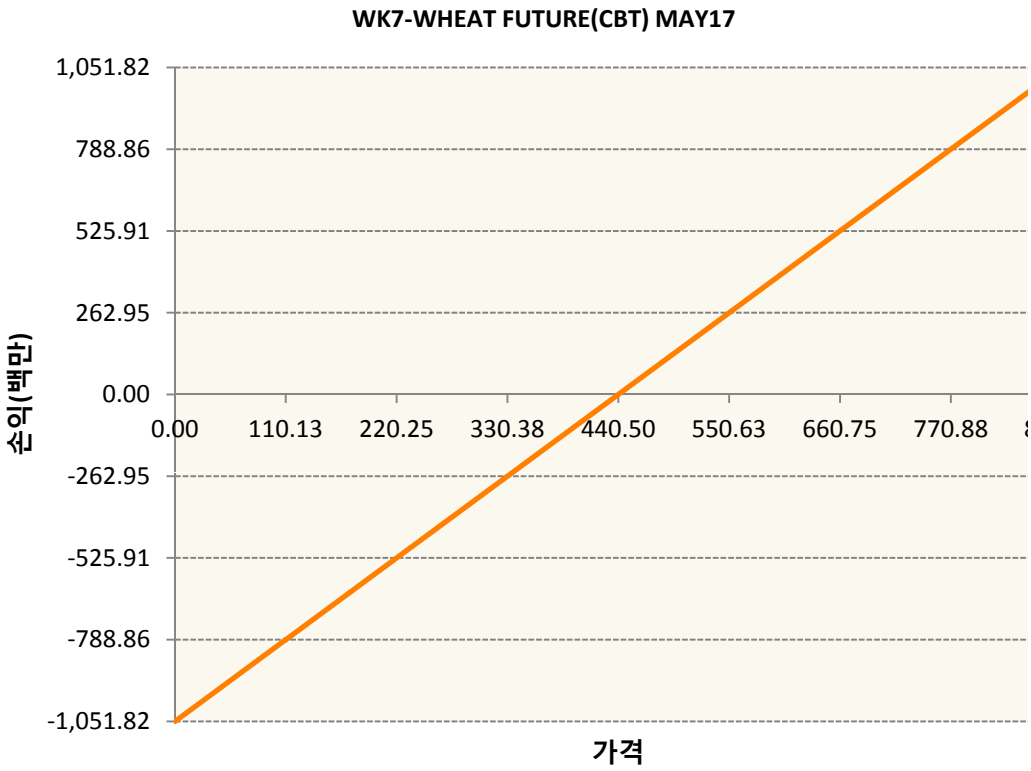

KWK7-KC HRW WHEAT FUTURE(KCB) MAY17
310.77
233.08
155.39
77.69
0.00
-77.69
-155.39
-233.08
-310.77
0.00
113.88
227.75
341.63
455.50
569.38
683.25
797.13
손익(백만)
가격


SBK7-Sugar #11 (WORLD) MAY17
695.89
463.92
231.96
0.00
-231.96
-463.92
-695.89
-927.85
0.00
4.56
9.11
13.67
18.22
22.78
27.33
31.89
손익(백만)
가격


SK7-SOYBEAN FUTURE MAY17
1,830.96
1,373.22
915.48
457.74
0.00
-457.74
-915.48
-1,373.22
-1,830.96
0.00
251.63
503.25
754.88
1,006.50
1,258.13
1,509.75
1,761.38
손익(백만)
가격


SMK7-SOYBEAN MEAL FUTR MAY17
700.76





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

BOK7	SOYBEAN OIL FUTR MAY17	62
CK7	CORN FUTURE MAY17	182
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	74
SK7	SOYBEAN FUTURE MAY17	146
SMK7	SOYBEAN MEAL FUTR MAY17	75
WK7	WHEAT FUTURE(CBT) MAY17	84

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

848