공시일	2017-03-15
기준일	2017-03-14

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	2017-03-15
기준일	2017-03-14

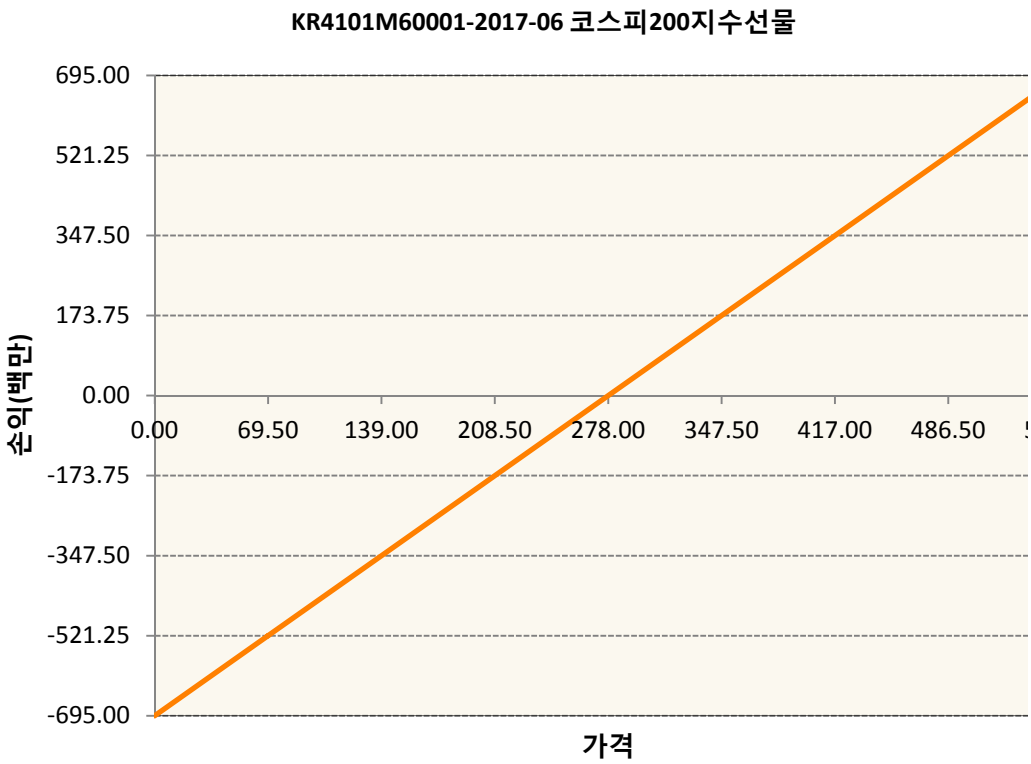
스마트인덱스모

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	695	0	695	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101M60(2017-06 코스피200지수선물							56
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-56	-56	-56	-56	-56	-56	-56
-5.33%	-37	-37	-37	-37	-37	-37	-37
-2.67%	-19	-19	-19	-19	-19	-19	-19
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	19	19	19	19	19	19	19
5.33%	37	37	37	37	37	37	37
8.00%	56	56	56	56	56	56	56

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

36

공시일	2017-03-15
기준일	2017-03-14

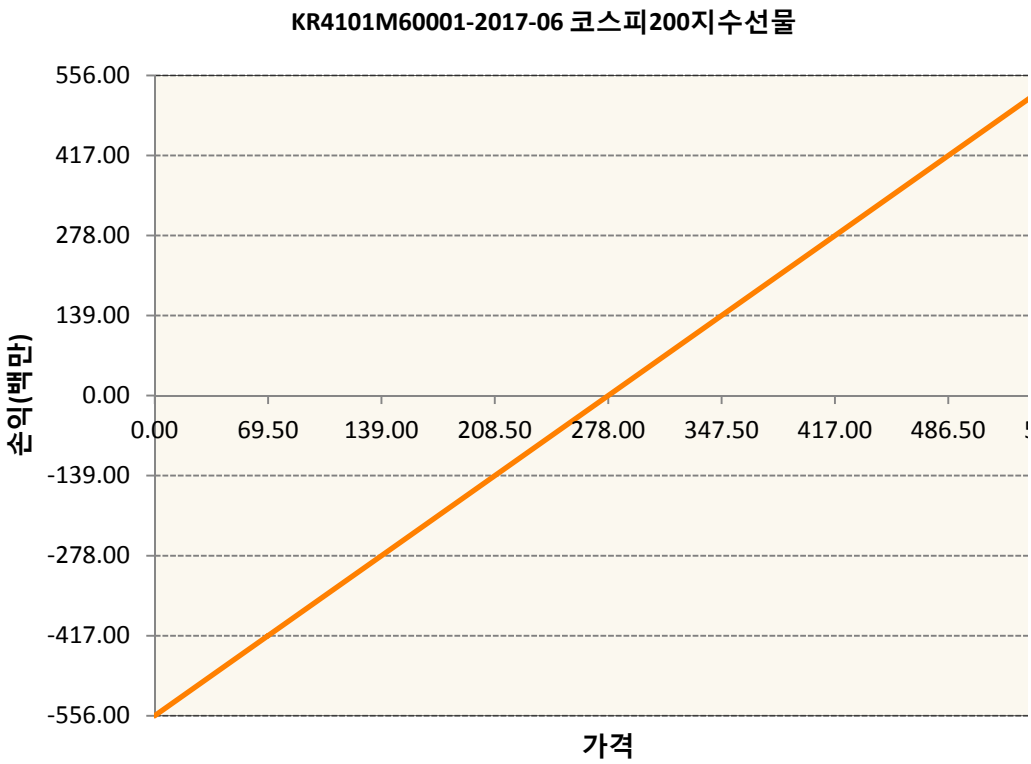
스마트레버리지목표전환형1호

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	139	-139	장내
누계	유가증권	선물	556	0	556	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101M60(2017-06 코스피200지수선물							44
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-44	-44	-44	-44	-44	-44	-44
-5.33%	-30	-30	-30	-30	-30	-30	-30
-2.67%	-15	-15	-15	-15	-15	-15	-15
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	15	15	15	15	15	15	15
5.33%	30	30	30	30	30	30	30
8.00%	44	44	44	44	44	44	44

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

29

공시일	2017-03-15
기준일	2017-03-14

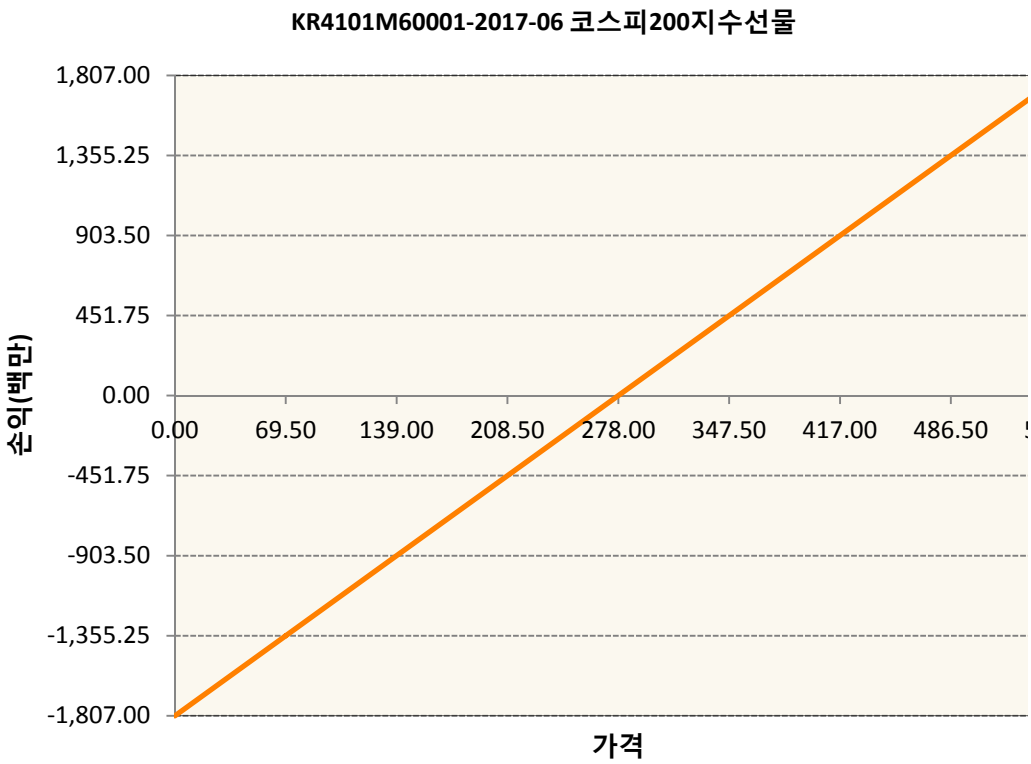
1.3배 레버리지 인덱스(주식-파생형)

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	1,807	0	1,807	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101M60(2017-06 코스피200지수선물							145
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-145	-145	-145	-145	-145	-145	-145
-5.33%	-96	-96	-96	-96	-96	-96	-96
-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%	96	96	96	96	96	96	96
8.00%	145	145	145	145	145	145	145

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

93

공시일	2017-03-15
기준일	2017-03-14

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	956

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

583

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-03-15
기준일	2017-03-14

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	2017-03-15
기준일	2017-03-14

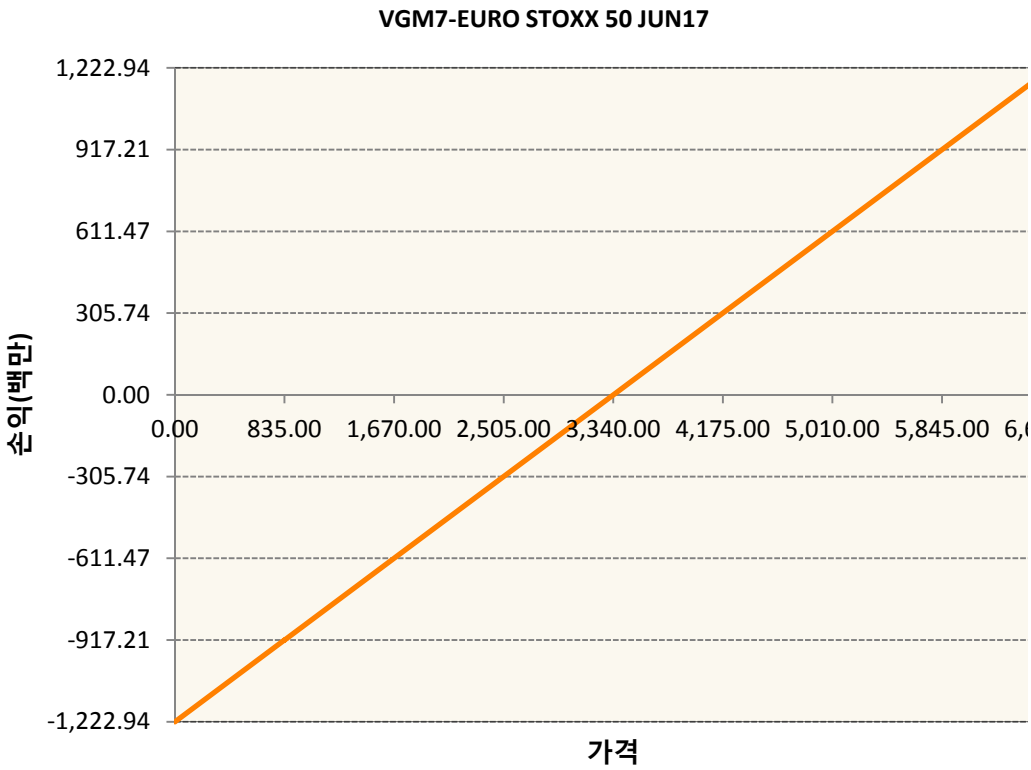
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,223	0	1,223	

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	2017-03-15
기준일	2017-03-14

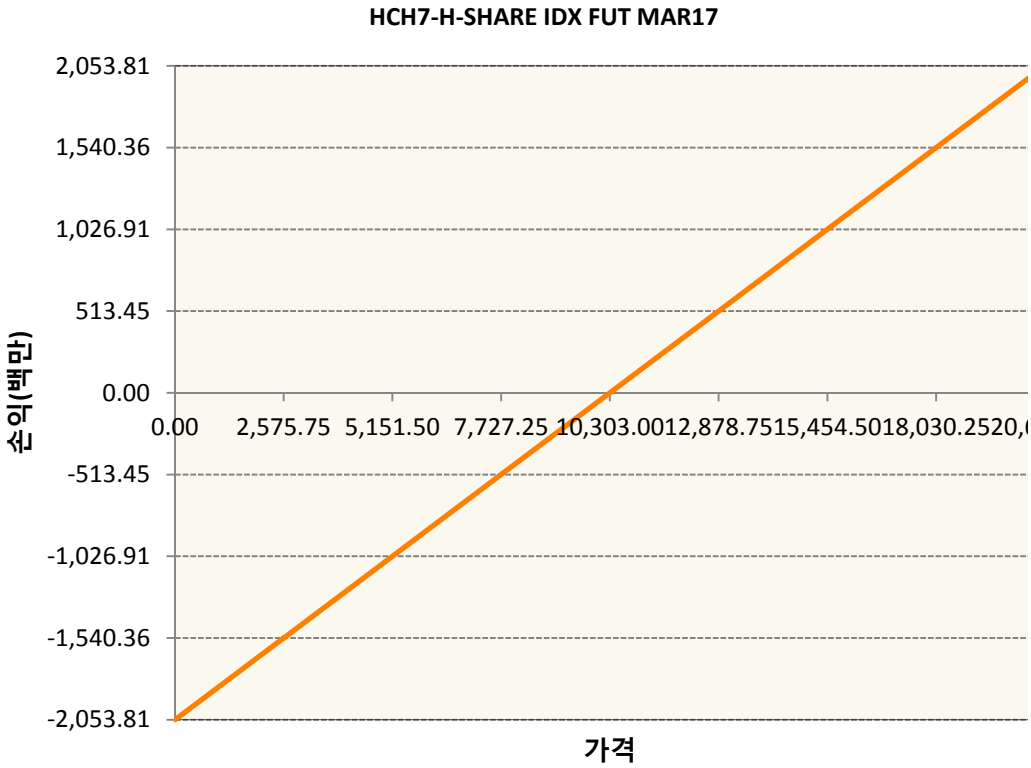
차이나인덱스모(주식-파생형)

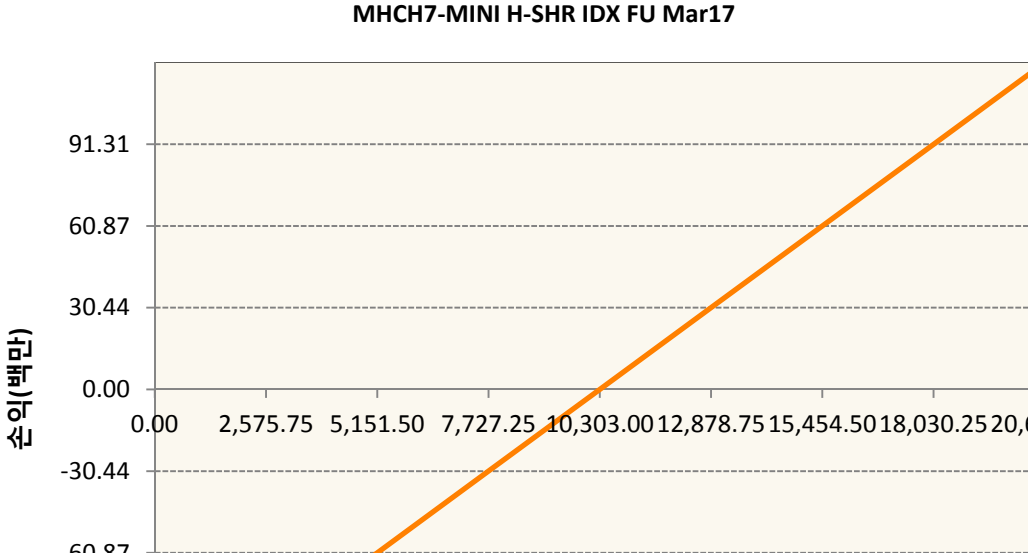
1. 계약금액

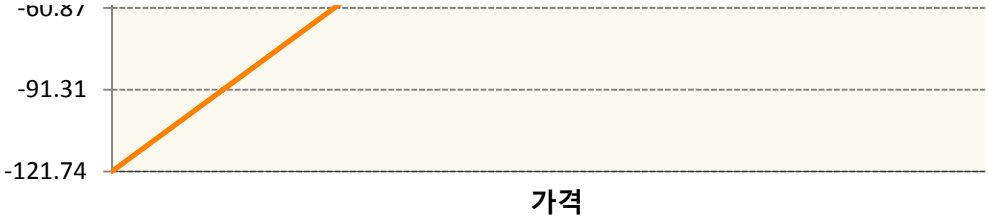
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,176	0	2,176	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)
	192

공시일	2017-03-15
기준일	2017-03-14

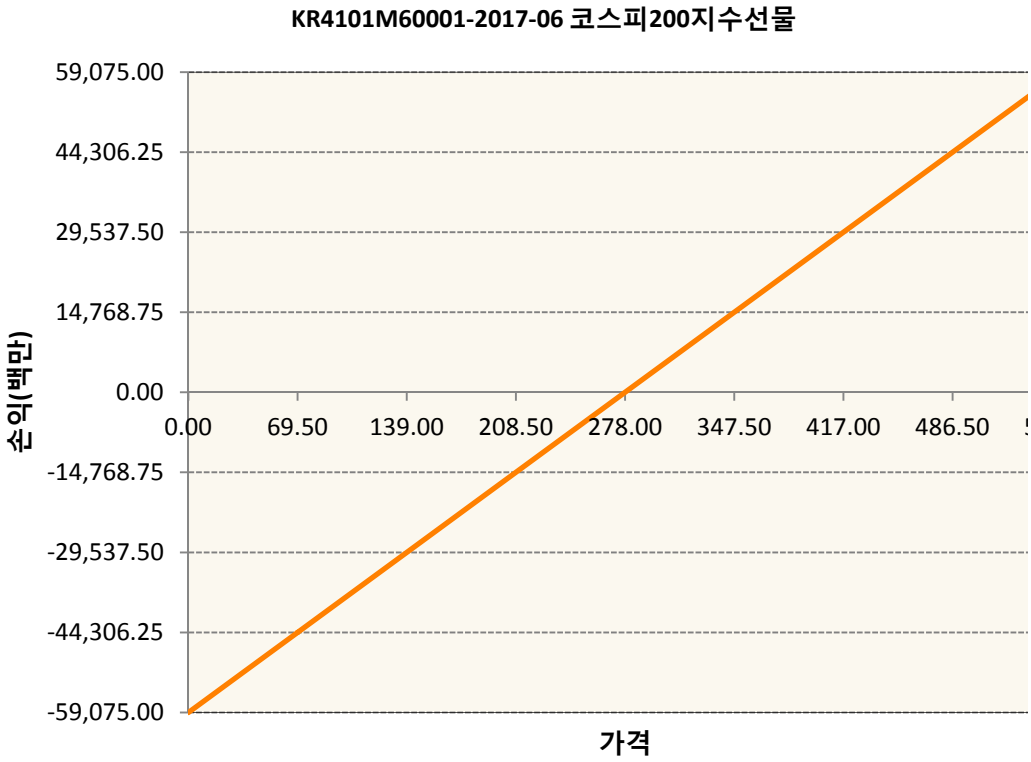
커버드콜모(주식혼합-파생형)

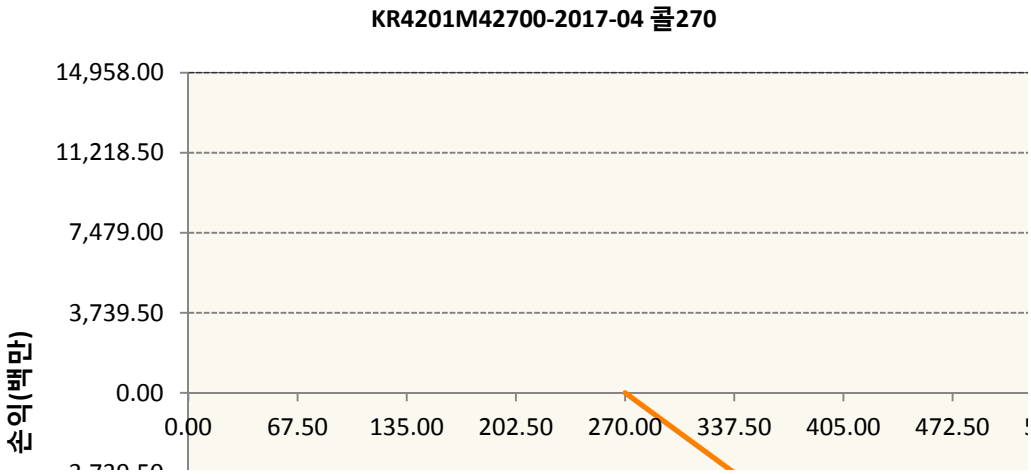
1. 계약금액

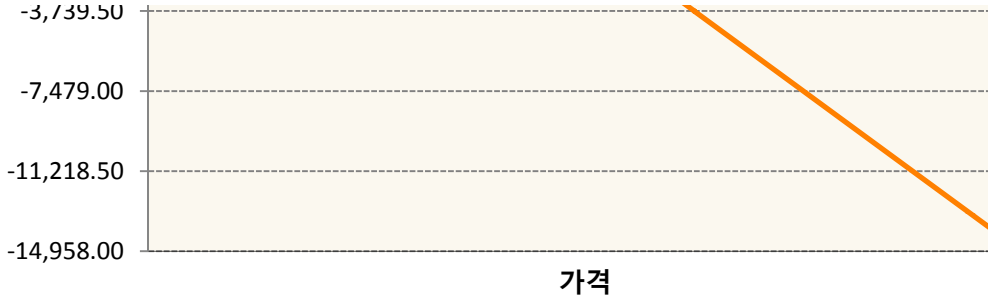
(단위:백만원)

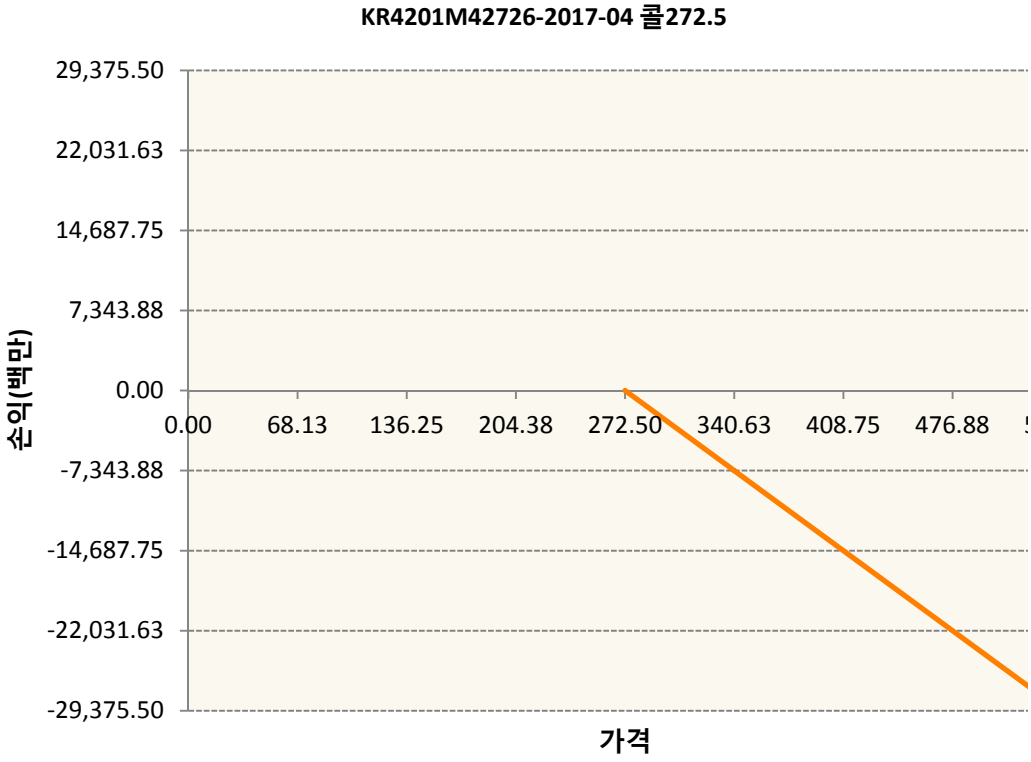
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	1,392	-1,392	장내
누계	유가증권	선물	59,075	0	59,075	장내
누계	유가증권	옵션	0	44,334	-44,334	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101M60(2017-06 코스피200지수선물							4,724
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-4,724	-4,724	-4,724	-4,724	-4,724	-4,724	-4,724
-5.33%	-3,149	-3,149	-3,149	-3,149	-3,149	-3,149	-3,149
-2.67%	-1,575	-1,575	-1,575	-1,575	-1,575	-1,575	-1,575
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	1,575	1,575	1,575	1,575	1,575	1,575	1,575
5.33%	3,149	3,149	3,149	3,149	3,149	3,149	3,149
8.00%	4,724	4,724	4,724	4,724	4,724	4,724	4,724
KR4201M42 2017-04 콜270							5,911
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	2,403	2,396	2,385	2,369	2,350	2,326	2,298
-5.33%	2,289	2,243	2,193	2,140	2,083	2,023	1,961
-2.67%	1,638	1,559	1,480	1,401	1,323	1,244	1,165
0%	141	99	51	0	-55	-113	-174
2.67%	-1,815	-1,822	-1,834	-1,850	-1,870	-1,895	-1,924
5.33%	-3,858	-3,858	-3,860	-3,862	-3,866	-3,873	-3,882
8.00%	-5,907	-5,907	-5,908	-5,908	-5,908	-5,909	-5,911
KR4201M42 2017-04 콜272.5							11,200

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	3,649	3,643	3,632	3,616	3,593	3,562	3,525
-5.33%	3,549	3,492	3,425	3,347	3,262	3,168	3,069
-2.67%	2,751	2,603	2,455	2,305	2,155	2,004	1,853
0%	367	250	128	0	-132	-267	-405
2.67%	-3,245	-3,276	-3,317	-3,368	-3,429	-3,499	-3,577
5.33%	-7,197	-7,200	-7,206	-7,217	-7,232	-7,254	-7,283
8.00%	-11,184	-11,184	-11,185	-11,186	-11,188	-11,193	-11,200

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

23,097

공시일	2017-03-15
기준일	2017-03-14

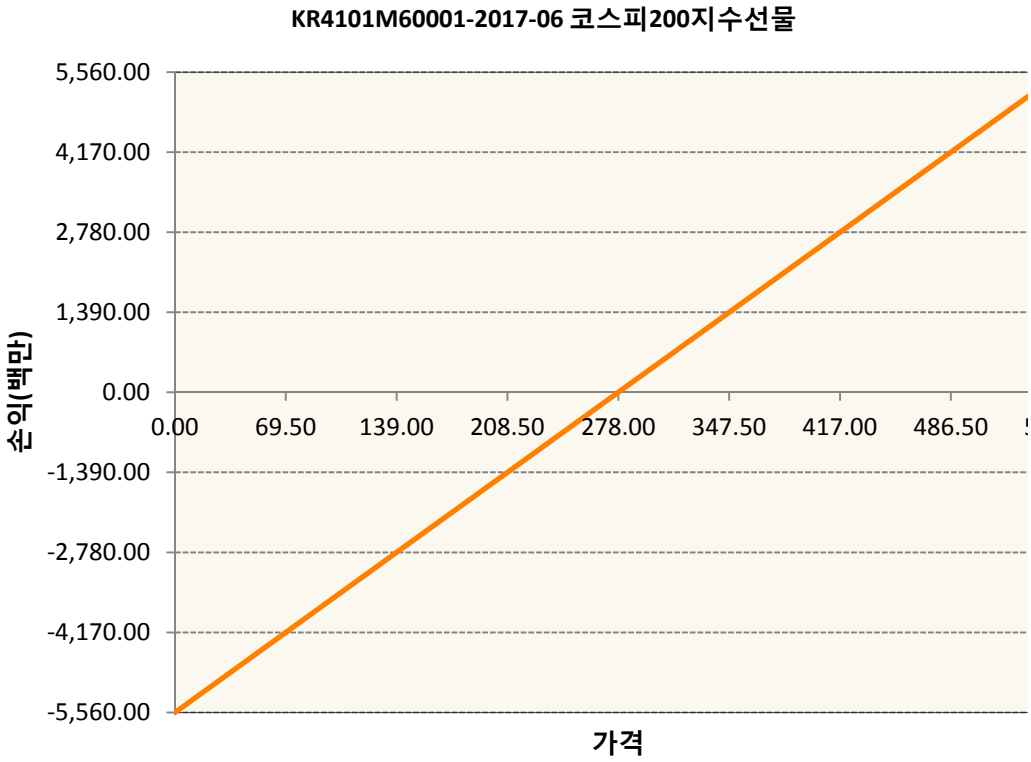
커버드콜목표전환형증권투자신탁

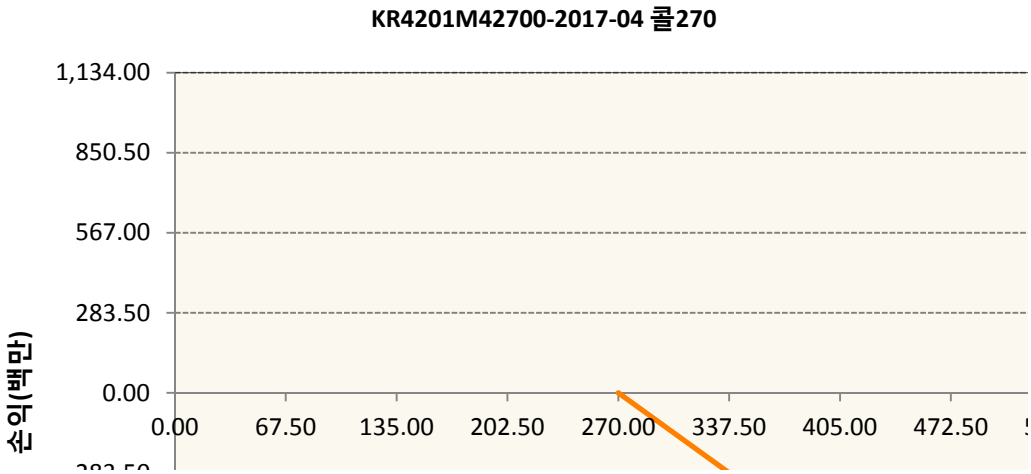
1. 계약금액

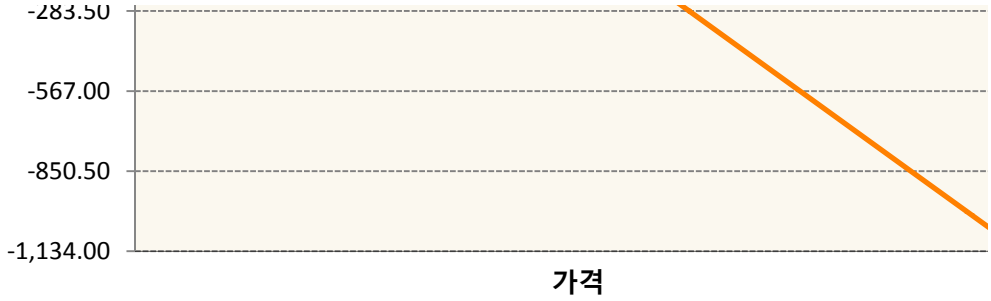
(단위:백만원)

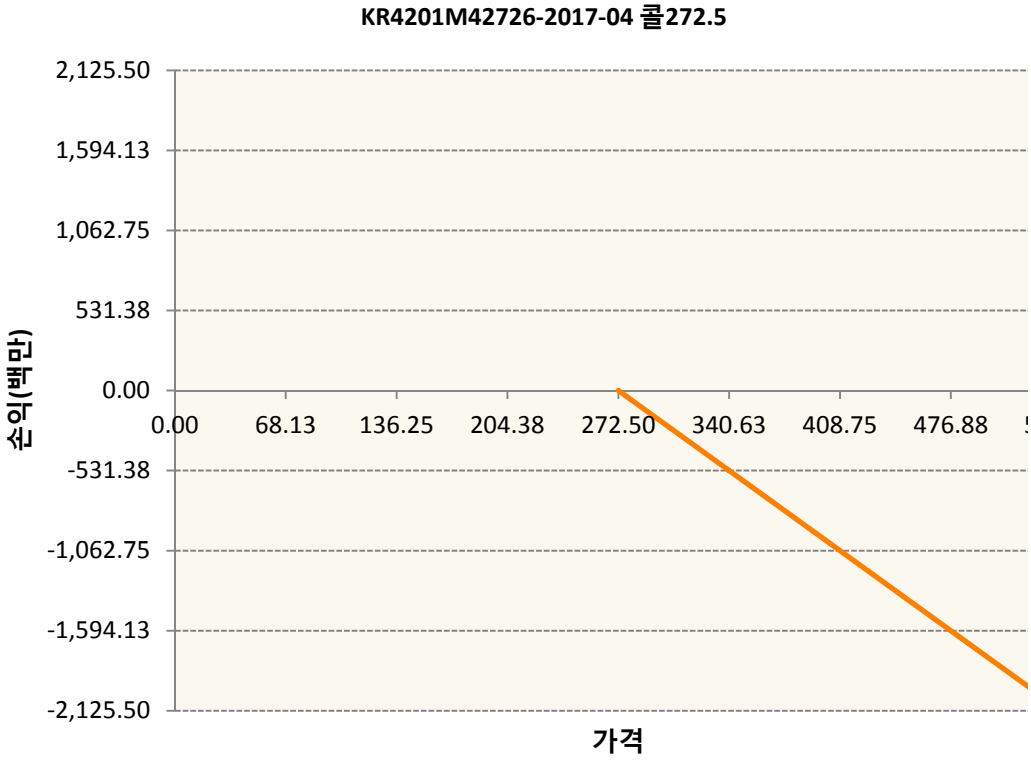
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	1,385	-1,385	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	5,560	0	5,560	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,260	-3,260	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101M60(2017-06 코스피200지수선물							445
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-445	-445	-445	-445	-445	-445	-445
-5.33%	-296	-296	-296	-296	-296	-296	-296
-2.67%	-148	-148	-148	-148	-148	-148	-148
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	148	148	148	148	148	148	148
5.33%	296	296	296	296	296	296	296
8.00%	445	445	445	445	445	445	445
KR4201M42 2017-04 콜270							448
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	182	182	181	180	178	176	174
-5.33%	173	170	166	162	158	153	149
-2.67%	124	118	112	106	100	94	88
0%	11	7	4	0	-4	-9	-13
2.67%	-138	-138	-139	-140	-142	-144	-146
5.33%	-292	-293	-293	-293	-293	-294	-294
8.00%	-448	-448	-448	-448	-448	-448	-448
KR4201M42 2017-04 콜272.5							810

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	264	264	263	262	260	258	255
-5.33%	257	253	248	242	236	229	222
-2.67%	199	188	178	167	156	145	134
0%	27	18	9	0	-10	-19	-29
2.67%	-235	-237	-240	-244	-248	-253	-259
5.33%	-521	-521	-521	-522	-523	-525	-527
8.00%	-809	-809	-809	-809	-810	-810	-810

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

1,761

공시일	2017-03-15
기준일	2017-03-14

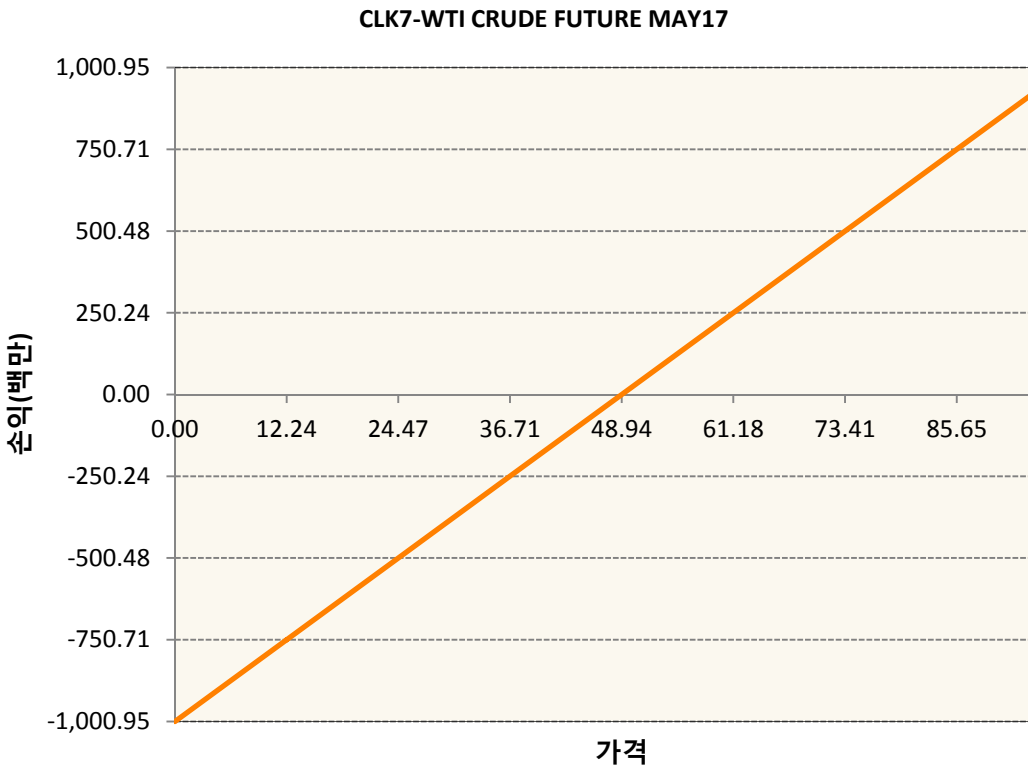
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

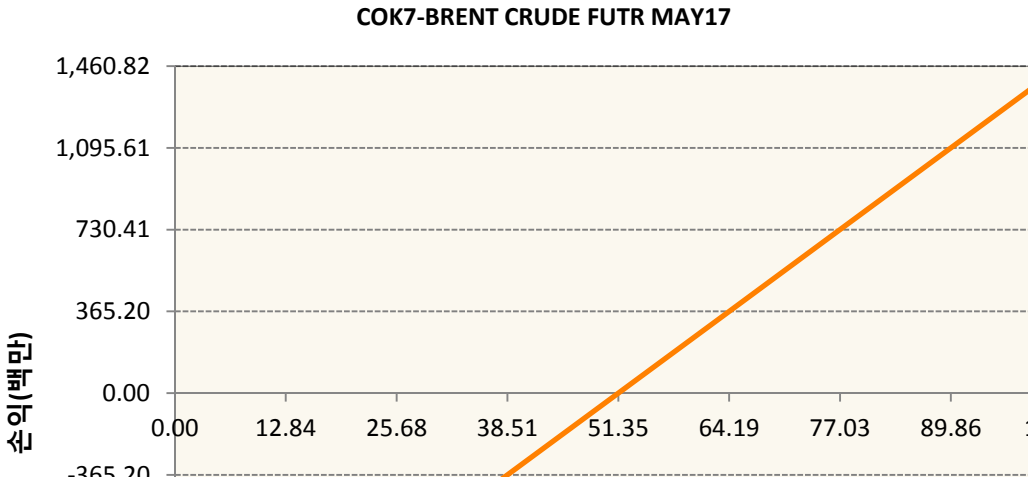
1. 계약금액

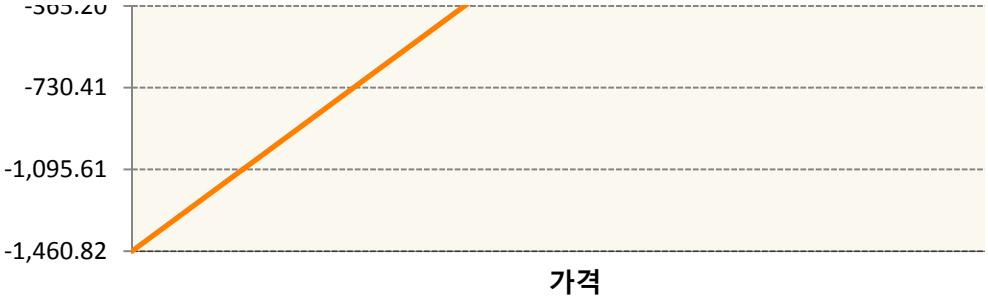
(단위:백만원)

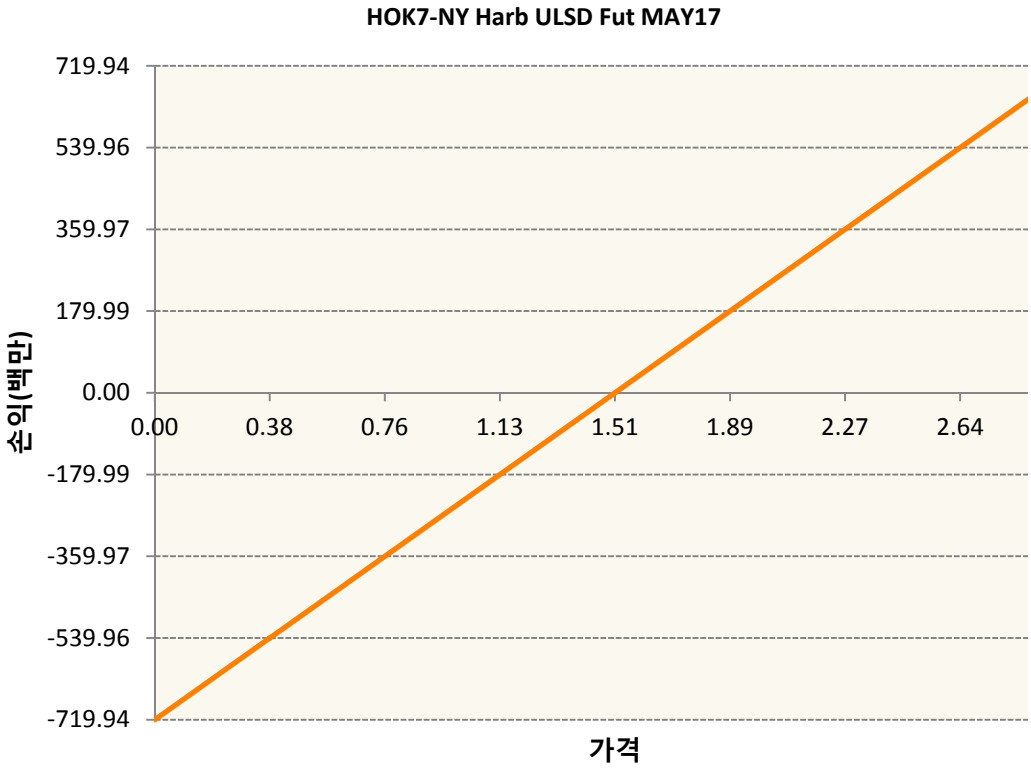
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	선물	유가증권	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	선물	유가증권	1,001	0	1,001	
누계	유가증권	선물	4,389	414	3,975	

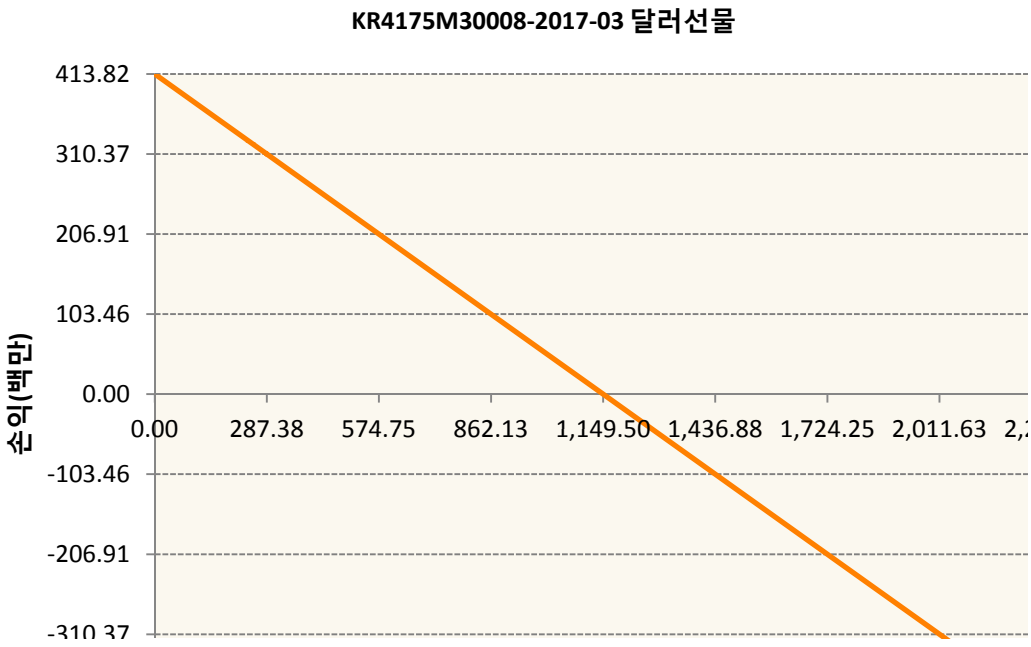
2. 만기시점의 손익구조

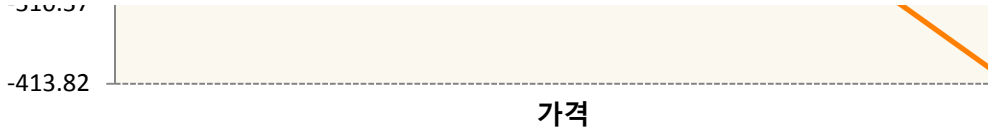


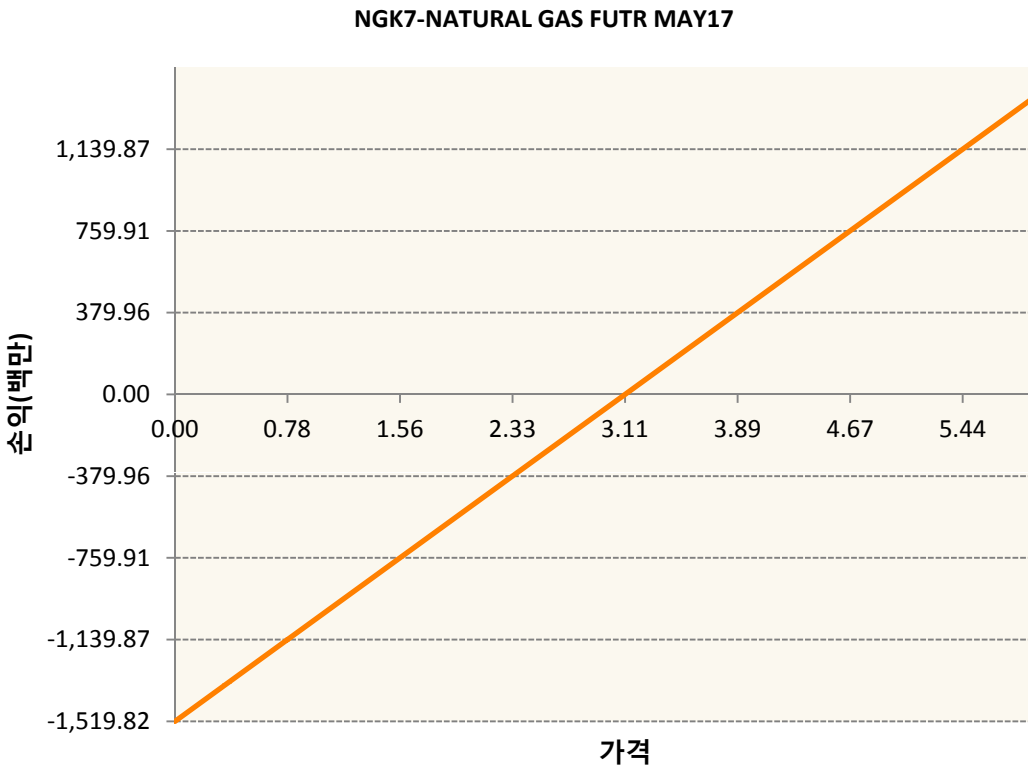


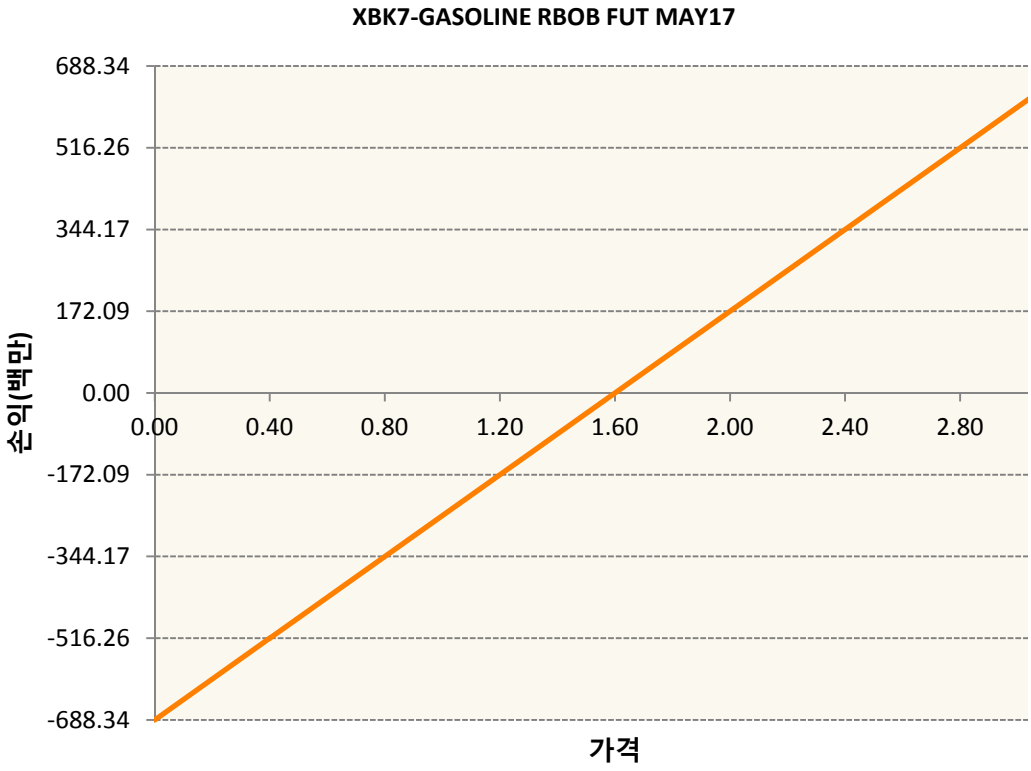

-730.41
-1,095.61
-1,460.82
가격


HOK7-NY Harb ULSD Fut MAY17
719.94
539.96
359.97
179.99
0.00
-179.99
-359.97
-539.96
-719.94
0.00
0.38
0.76
1.13
1.51
1.89
2.27
2.64
순익(백만)
가격


KR4175M30008-2017-03 달러선물
413.82
310.37
206.91
103.46
0.00
-103.46
-206.91
0.00
287.38
574.75
862.13
1,149.50
1,436.88
1,724.25
2,011.63
순익(백만)


-413.82
가격


NGK7-NATURAL GAS FUTR MAY17
1,139.87
759.91
379.96
0.00
-379.96
-759.91
-1,139.87
-1,519.82
0.00
0.78
1.56
2.33
3.11
3.89
4.67
5.44
순익(백만)
가격


XBK7-GASOLINE RBOB FUT MAY17
688.34
516.26
344.17
172.09
0.00
-172.09
-344.17
-516.26
-688.34
0.00
0.40
0.80
1.20
1.60
2.00
2.40
2.80
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	122
XBK7	GASOLINE RBOB FUT MAY17	55

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

962

공시일	2017-03-15
기준일	2017-03-14

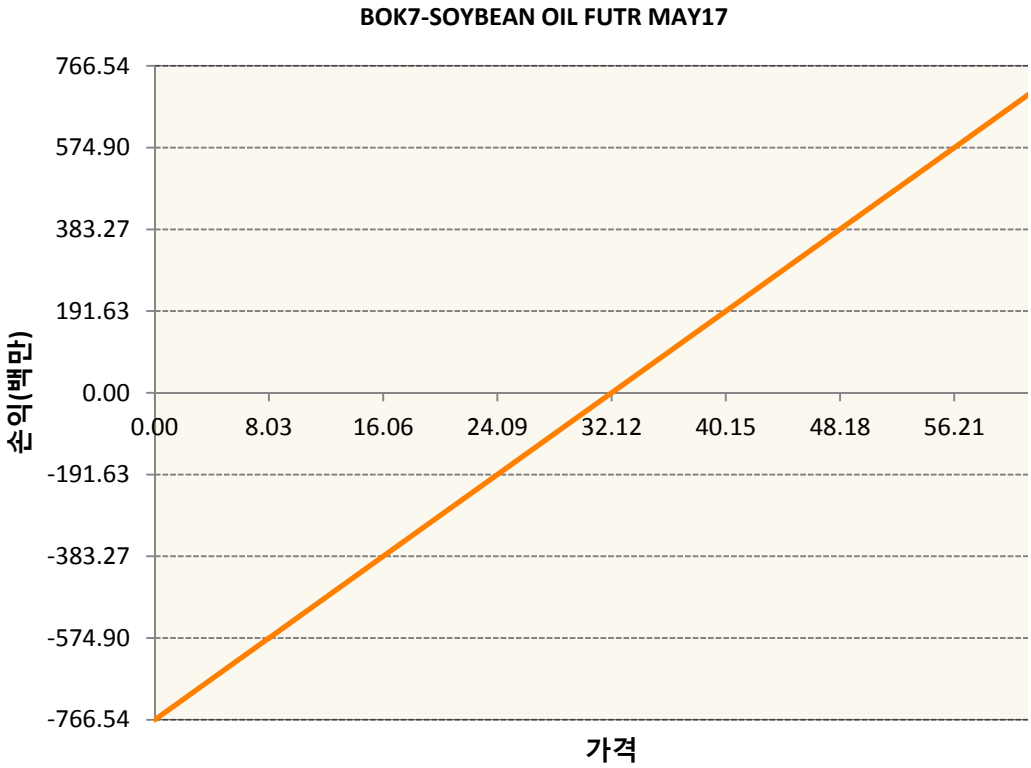
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

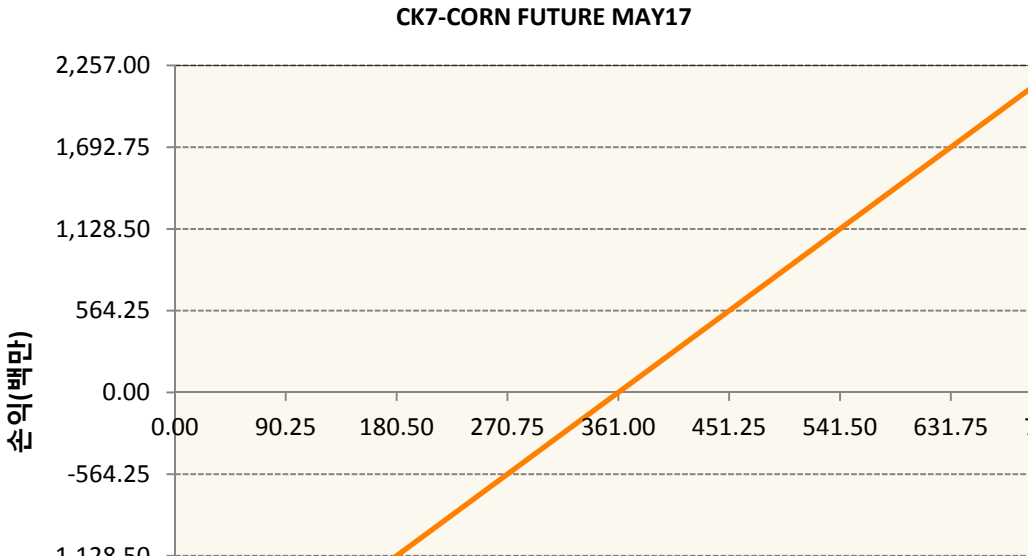
1. 계약금액

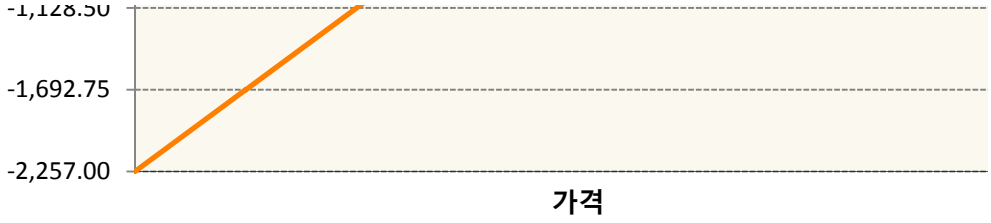
(단위:백만원)

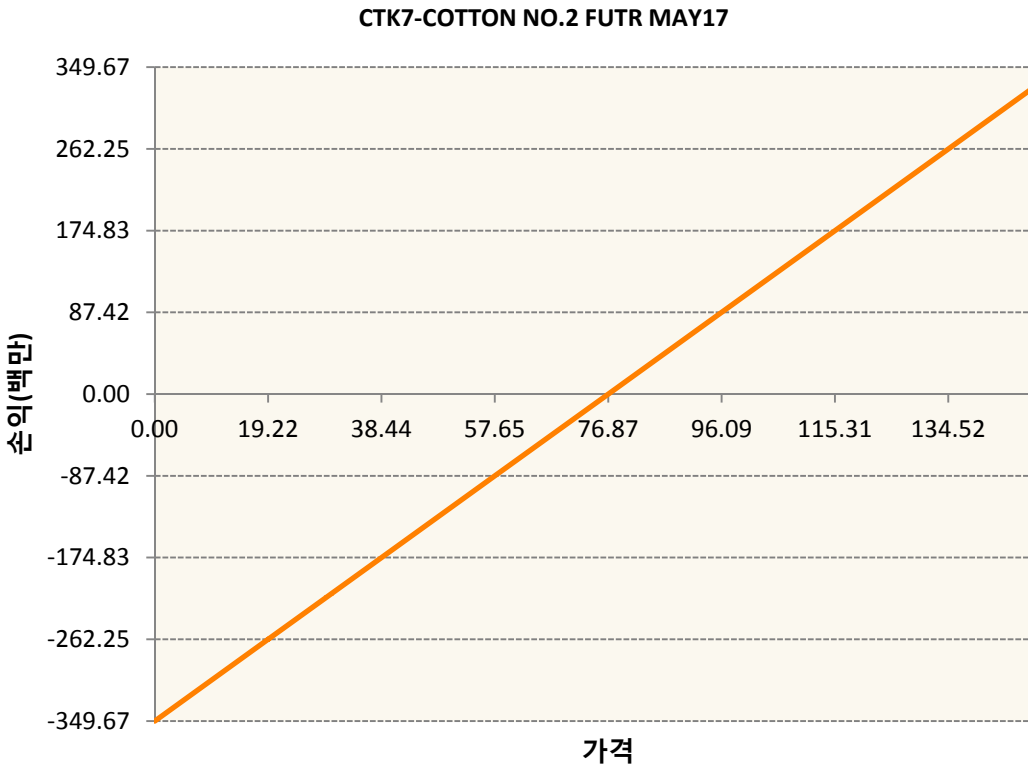
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	9,066	575	8,491	

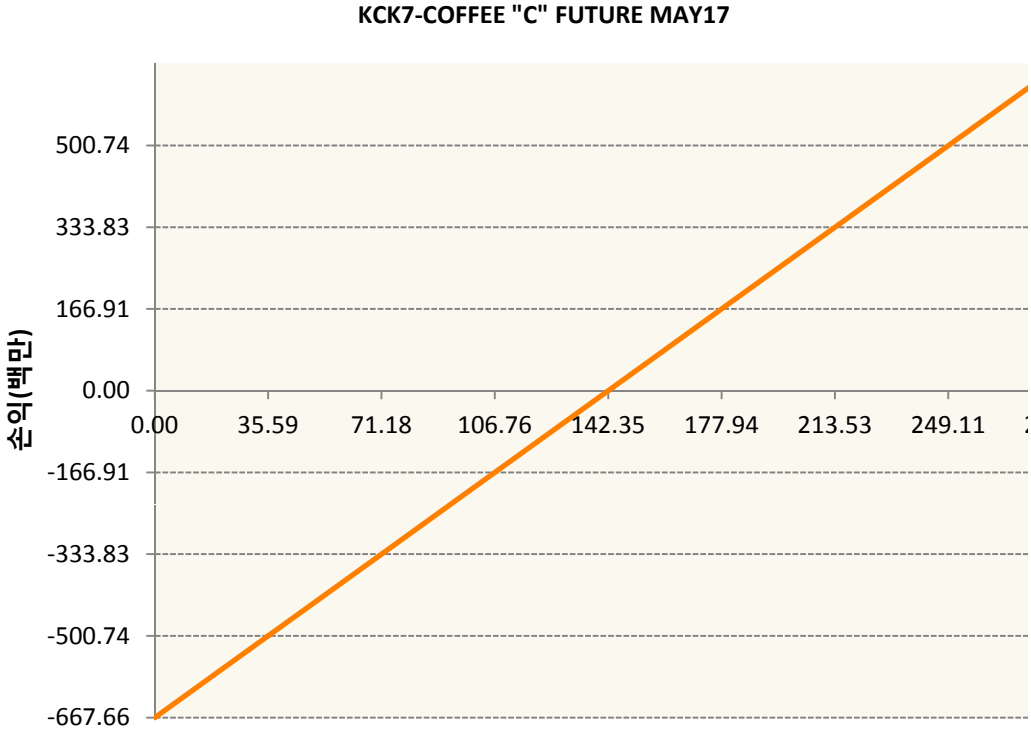
2. 만기시점의 손익구조



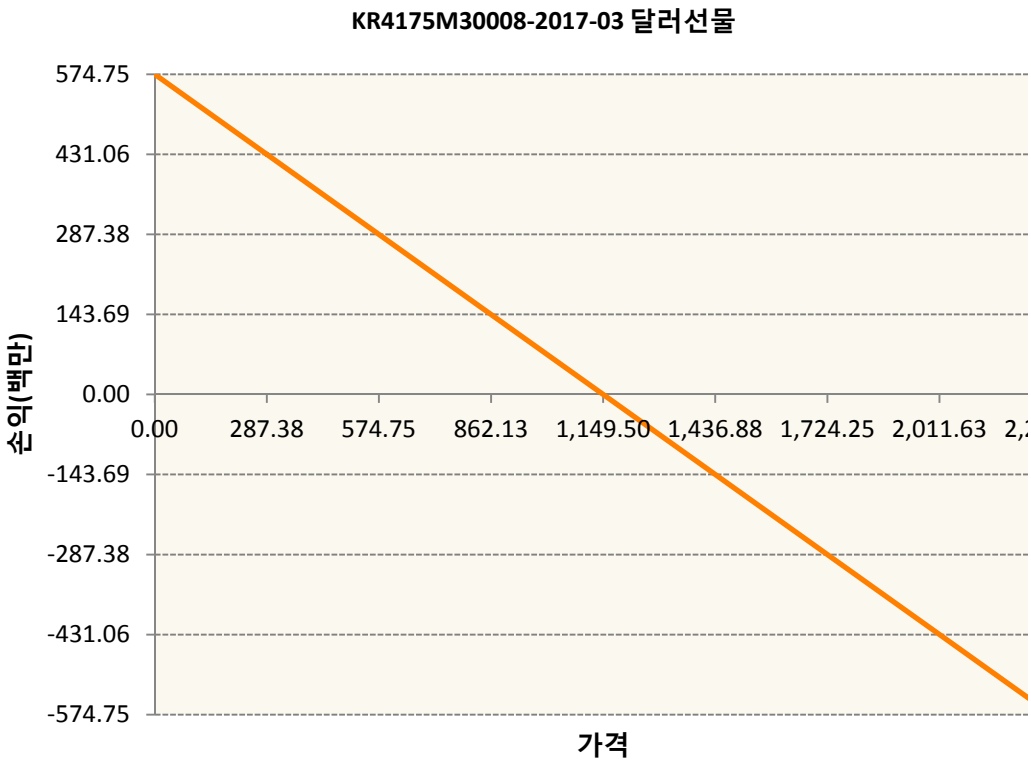


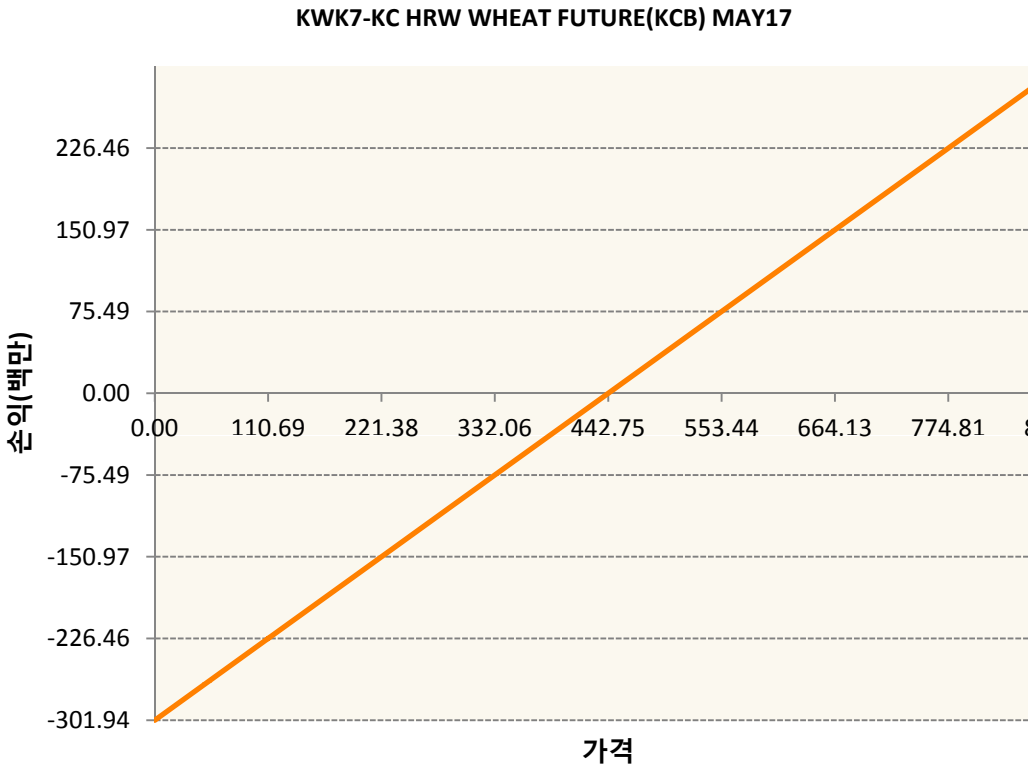

-1,692.75
-2,257.00
가격


CTK7-COTTON NO.2 FUTR MAY17
349.67
262.25
174.83
87.42
0.00
-87.42
-174.83
-262.25
-349.67
0.00
19.22
38.44
57.65
76.87
96.09
115.31
134.52
손익(백만)
가격

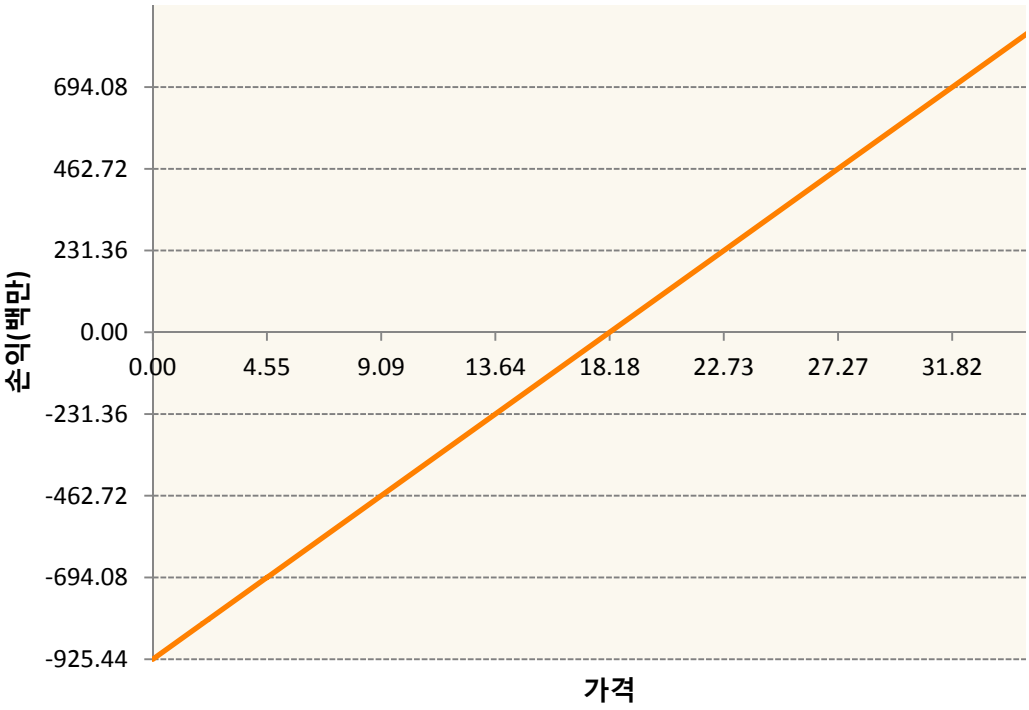

KCK7-COFFEE "C" FUTURE MAY17
500.74
333.83
166.91
0.00
-166.91
-333.83
-500.74
-667.66
0.00
35.59
71.18
106.76
142.35
177.94
213.53
249.11
손익(백만)

가격

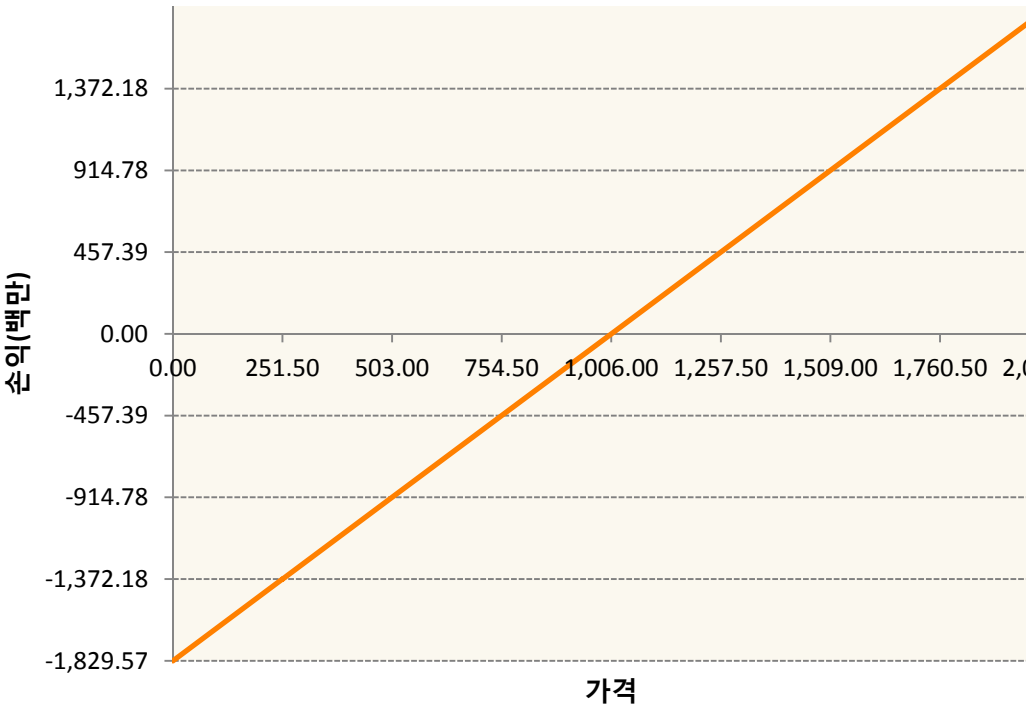

KR4175M30008-2017-03 달러선물
574.75
431.06
287.38
143.69
0.00
-143.69
-287.38
-431.06
-574.75
0.00
287.38
574.75
862.13
1,149.50
1,436.88
1,724.25
2,011.63
손익(백만)
가격


KWK7-KC HRW WHEAT FUTURE(KCB) MAY17
226.46
150.97
75.49
0.00
-75.49
-150.97
-226.46
-301.94
0.00
110.69
221.38
332.06
442.75
553.44
664.13
774.81
손익(백만)
가격

SBK7-Sugar #11 (WORLD) MAY17

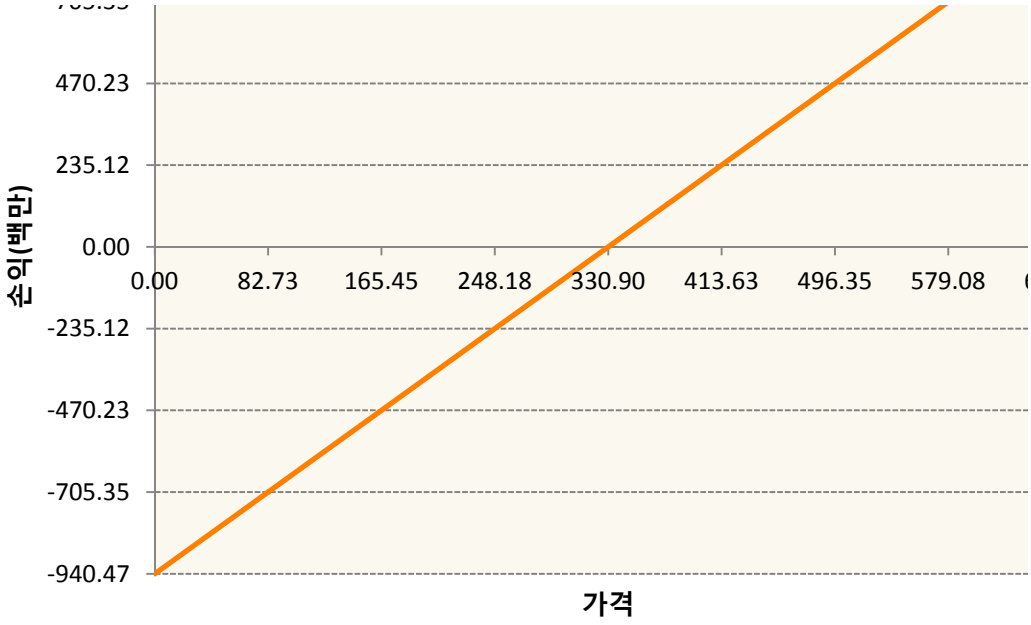


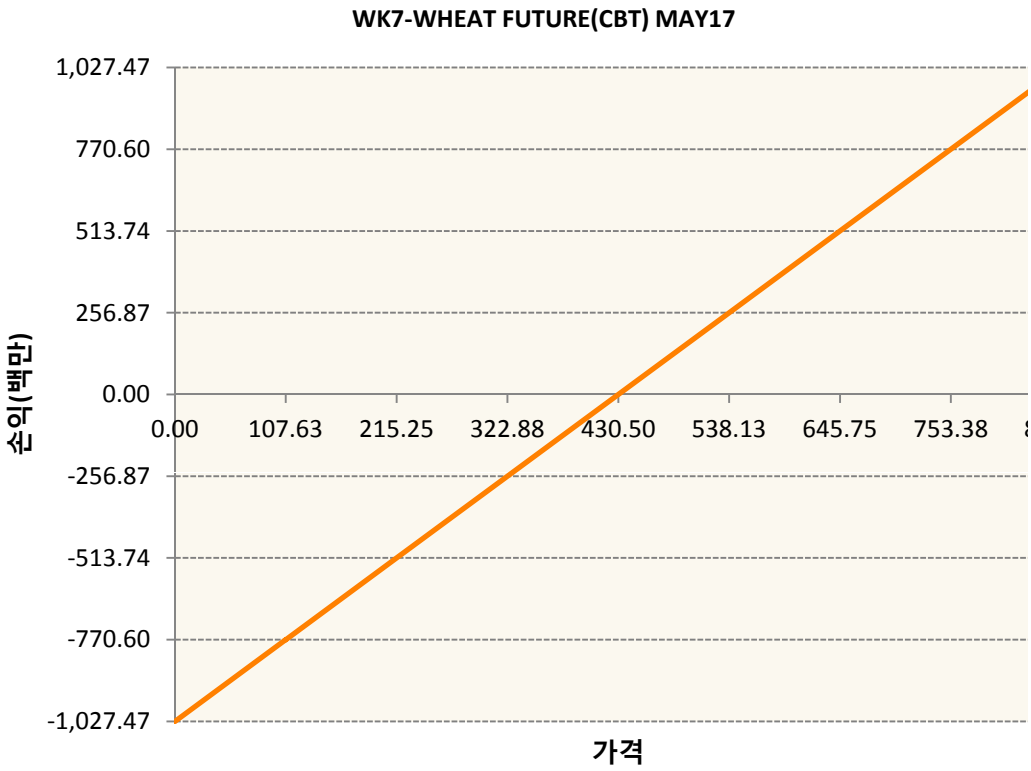
SK7-SOYBEAN FUTURE MAY17



SMK7-SOYBEAN MEAL FUTR MAY17







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
BOK7	SOYBEAN OIL FUTR MAY17	61
CK7	CORN FUTURE MAY17	181
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	24
SBK7	Sugar #11 (WORLD) MAY17	74
SK7	SOYBEAN FUTURE MAY17	146
SMK7	SOYBEAN MEAL FUTR MAY17	75
WK7	WHEAT FUTURE(CBT) MAY17	82

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

842