공시일	2017-02-14
기준일	2017-02-13

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	2017-02-14
기준일	2017-02-13

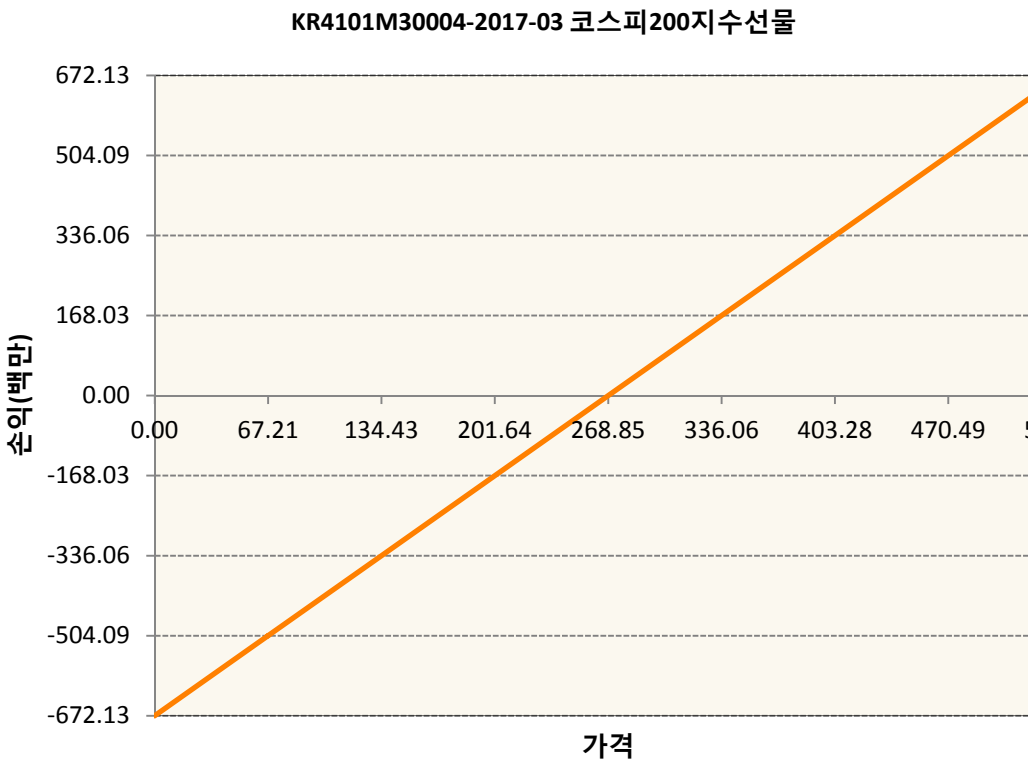
스마트인덱스모

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	672	0	672	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101M30(2017-03 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	2017-02-14
기준일	2017-02-13

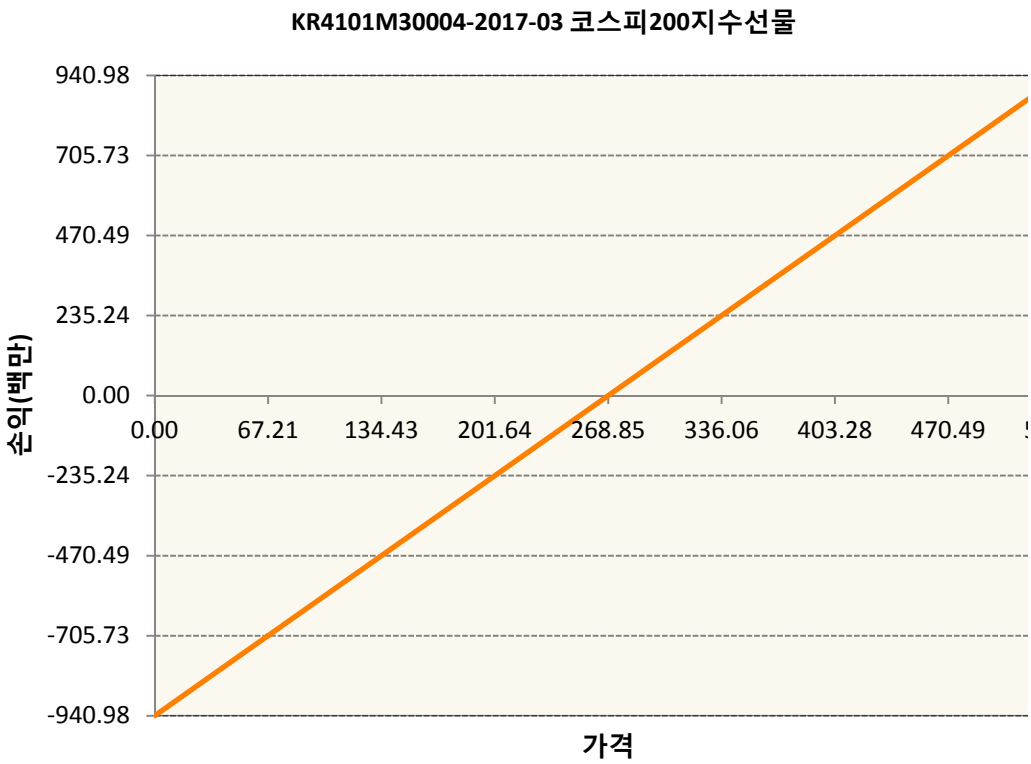
스마트레버리지목표전환형1호

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	941	0	941	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101M30(2017-03 코스피200지수선물							75
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-75	-75	-75	-75	-75	-75	-75
-5.33%	-50	-50	-50	-50	-50	-50	-50
-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%	50	50	50	50	50	50	50
8.00%	75	75	75	75	75	75	75

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

49

공시일	2017-02-14
기준일	2017-02-13

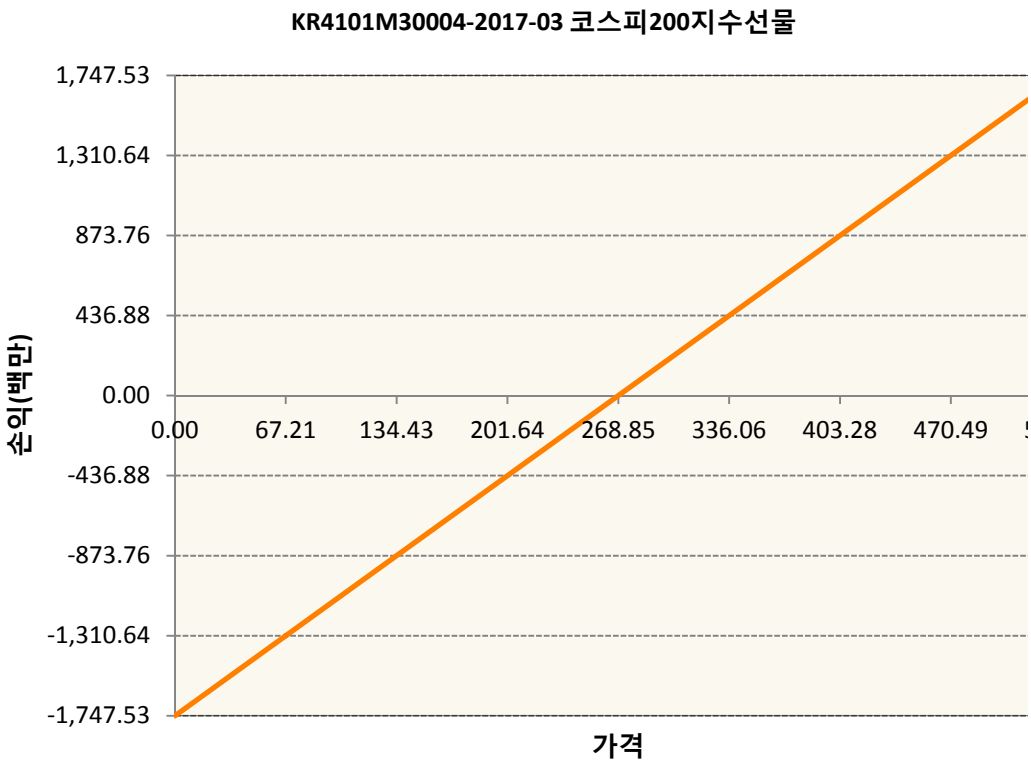
1.3배 레버리지 인덱스(주식-파생형)

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	1,748	0	1,748	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101M30(2017-03 코스피200지수선물							140
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-140	-140	-140	-140	-140	-140	-140
-5.33%	-93	-93	-93	-93	-93	-93	-93
-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%	93	93	93	93	93	93	93
8.00%	140	140	140	140	140	140	140

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

92

공시일	2017-02-14
기준일	2017-02-13

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	11,013	0	11,013	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWMXWO0(신한MXWO 미래S161122	937

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

623

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-02-14
기준일	2017-02-13

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	4,972	0	4,972	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI50000 신한CSI500미래S161208	387

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

547

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-02-14
기준일	2017-02-13

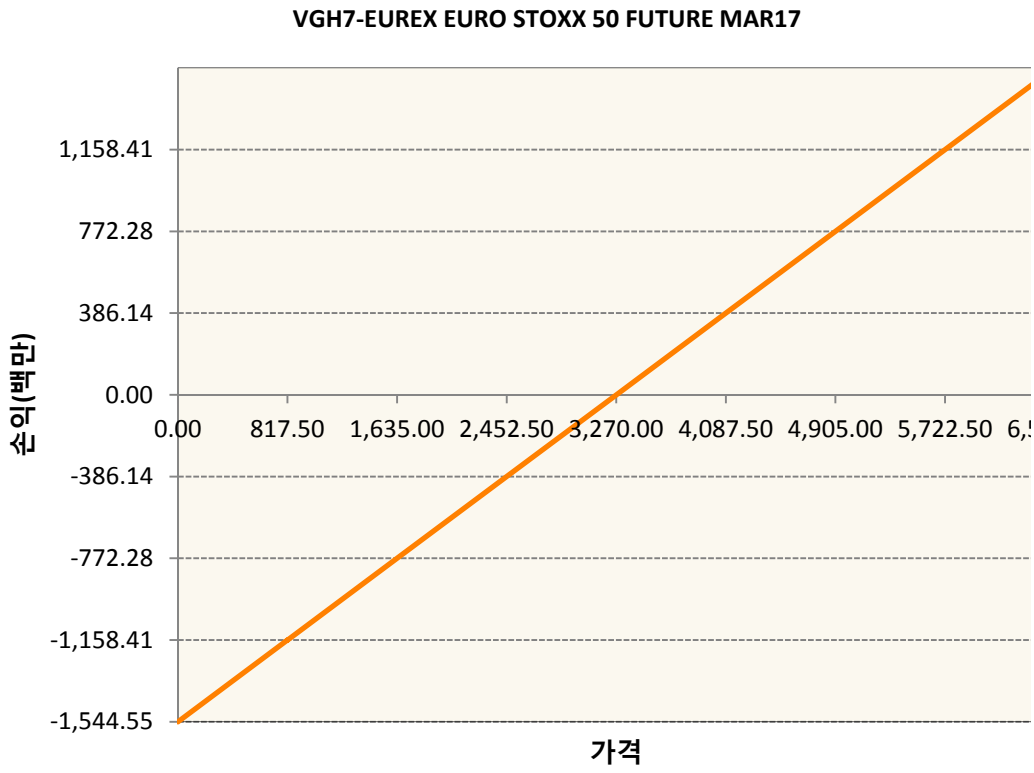
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,545	0	1,545	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGH7	EUREX EURO STOXX 50 FUTURE MAR17	124

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

(단위:백만원)

131

공시일	2017-02-14
기준일	2017-02-13

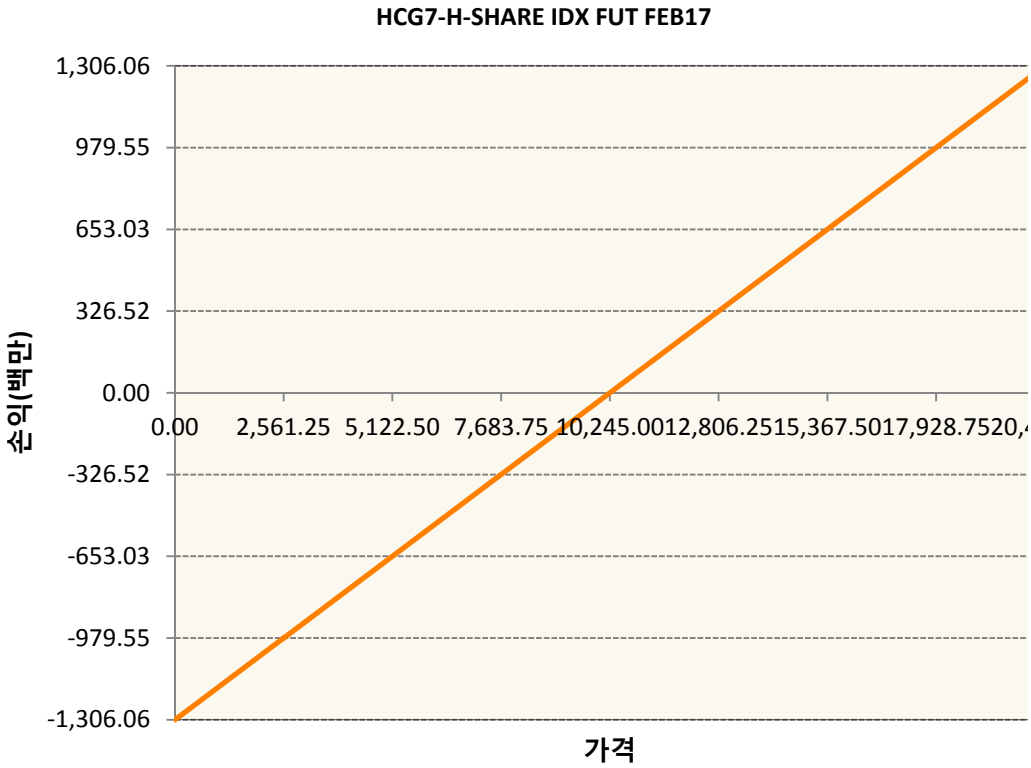
차이나인덱스모(주식-파생형)

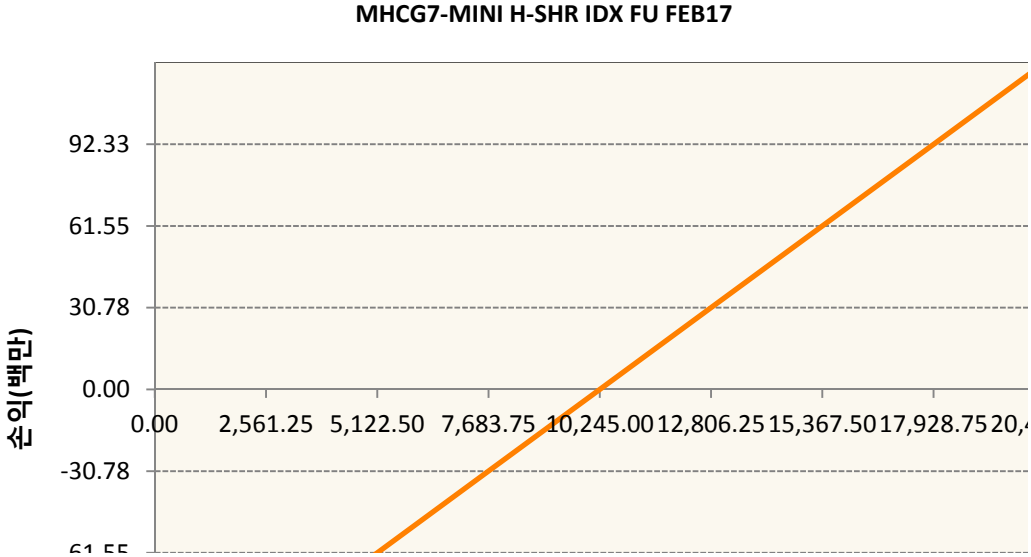
1. 계약금액

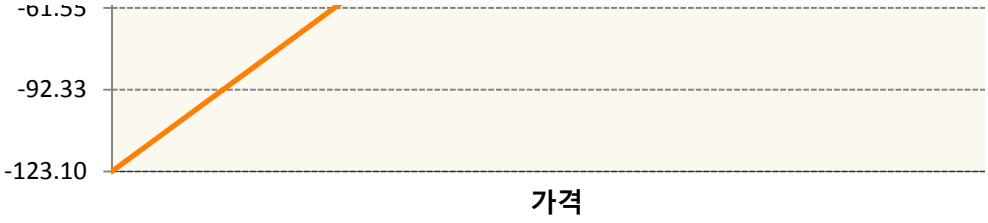
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,429	0	1,429	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCG7	H-SHARE IDX FUT FEB17	104
MHCG7	MINI H-SHR IDX FU FEB17	10

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	133

공시일	2017-02-14
기준일	2017-02-13

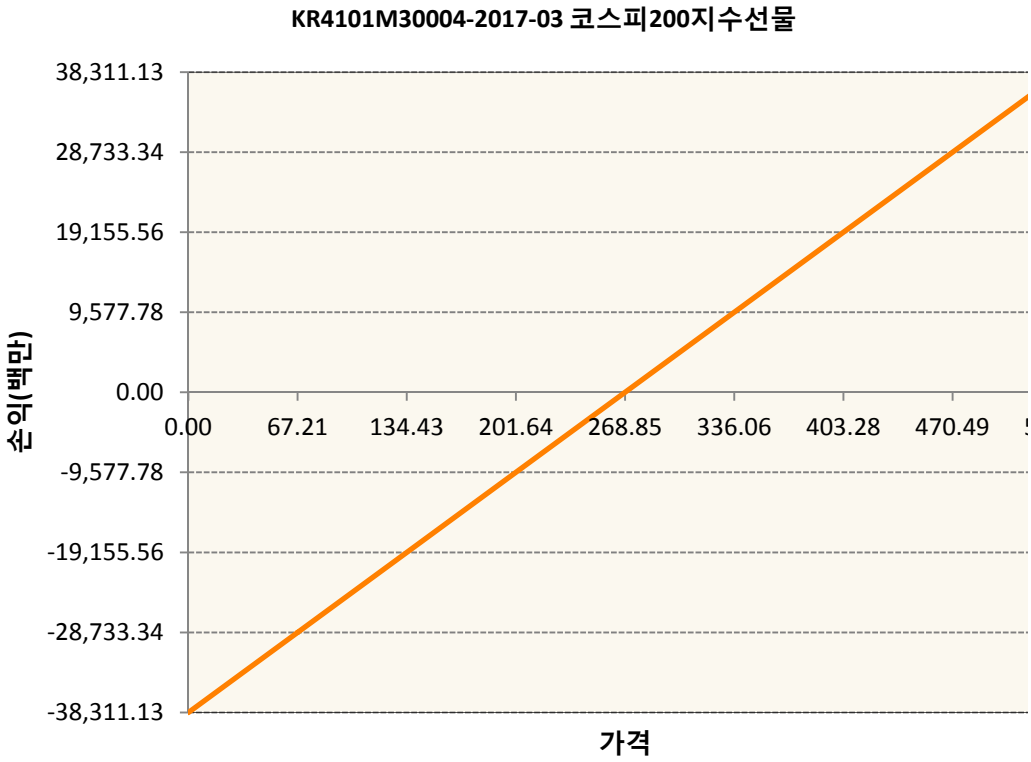
커버드콜모(주식혼합-파생형)

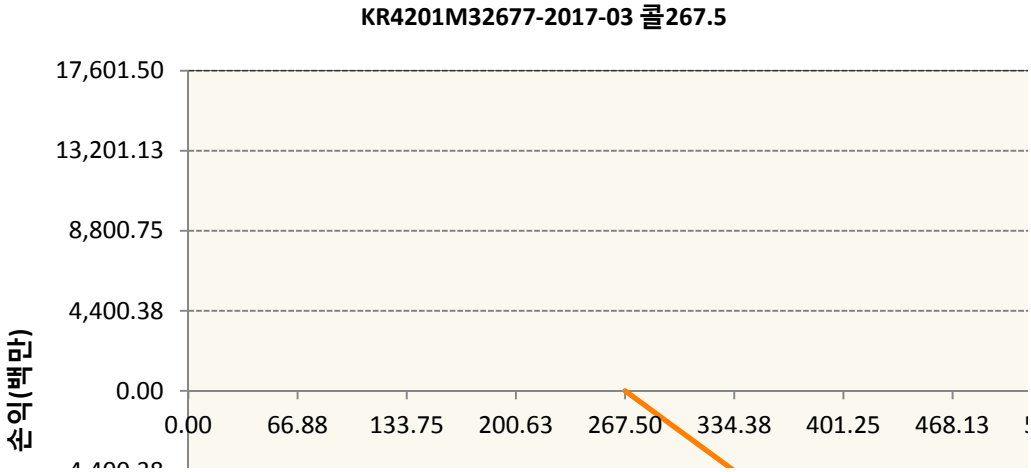
1. 계약금액

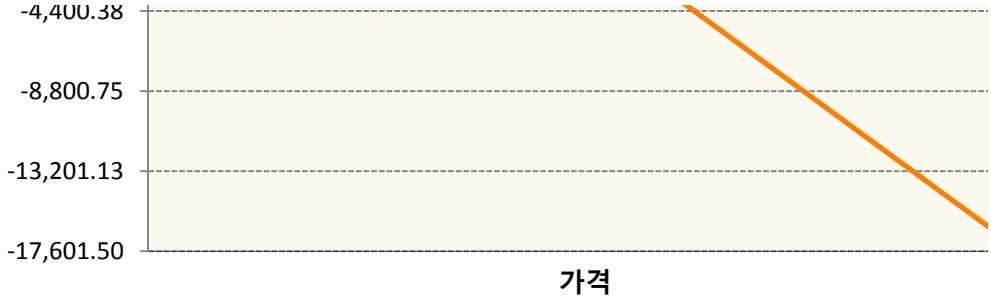
(단위:백만원)

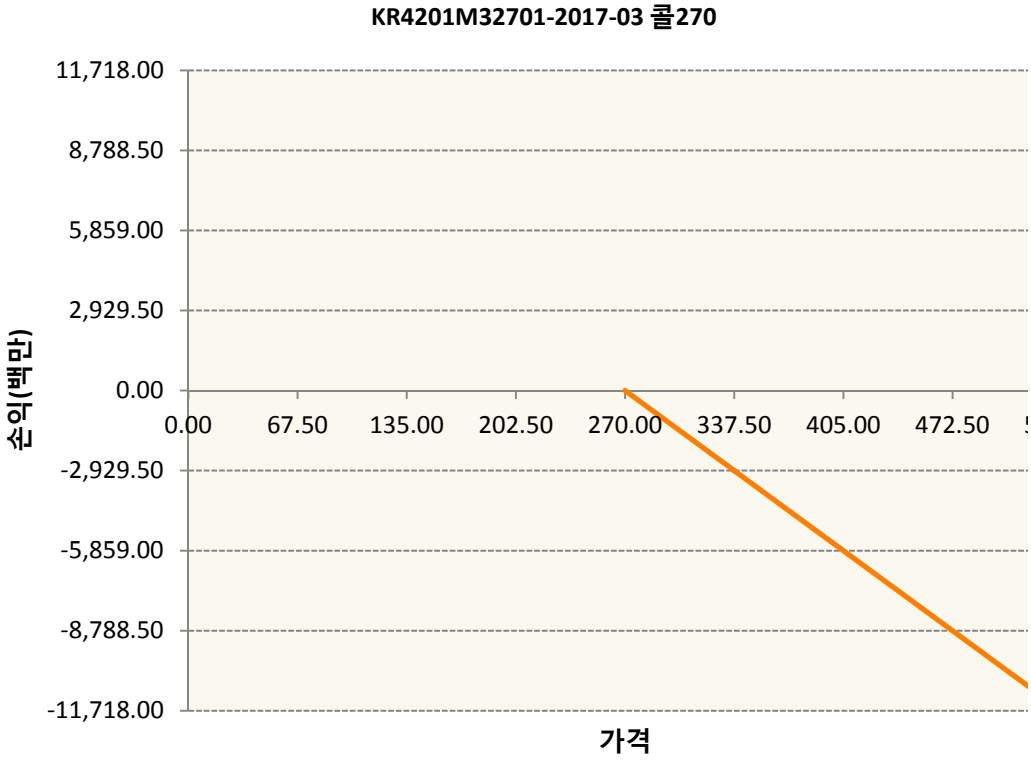
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	406	-406	장내
누계	유가증권	선물	38,311	0	38,311	장내
누계	유가증권	옵션	0	29,320	-29,320	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101M30(2017-03 코스피200지수선물							3,064
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-3,064	-3,064	-3,064	-3,064	-3,064	-3,064	-3,064
-5.33%	-2,043	-2,043	-2,043	-2,043	-2,043	-2,043	-2,043
-2.67%	-1,021	-1,021	-1,021	-1,021	-1,021	-1,021	-1,021
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	1,021	1,021	1,021	1,021	1,021	1,021	1,021
5.33%	2,043	2,043	2,043	2,043	2,043	2,043	2,043
8.00%	3,064	3,064	3,064	3,064	3,064	3,064	3,064
KR4201M32(2017-03 콜267.5							6,358
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,152	1,152	1,151	1,151	1,150	1,148	1,144
-5.33%	1,149	1,145	1,138	1,128	1,114	1,096	1,075
-2.67%	1,041	999	952	901	846	789	730
0%	224	150	75	0	-75	-151	-226
2.67%	-1,681	-1,705	-1,736	-1,771	-1,811	-1,855	-1,902
5.33%	-3,997	-3,999	-4,002	-4,008	-4,017	-4,029	-4,044
8.00%	-6,352	-6,352	-6,352	-6,353	-6,354	-6,355	-6,358
KR4201M32 2017-03 콜270							3,927

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	489	489	489	489	489	488	487
-5.33%	489	488	486	483	479	472	464
-2.67%	463	447	428	405	380	351	321
0%	149	100	50	0	-50	-100	-150
2.67%	-886	-915	-948	-983	-1,020	-1,058	-1,099
5.33%	-2,367	-2,371	-2,377	-2,385	-2,396	-2,410	-2,427
8.00%	-3,918	-3,918	-3,919	-3,920	-3,921	-3,924	-3,927

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

14,484

공시일	2017-02-14
기준일	2017-02-13

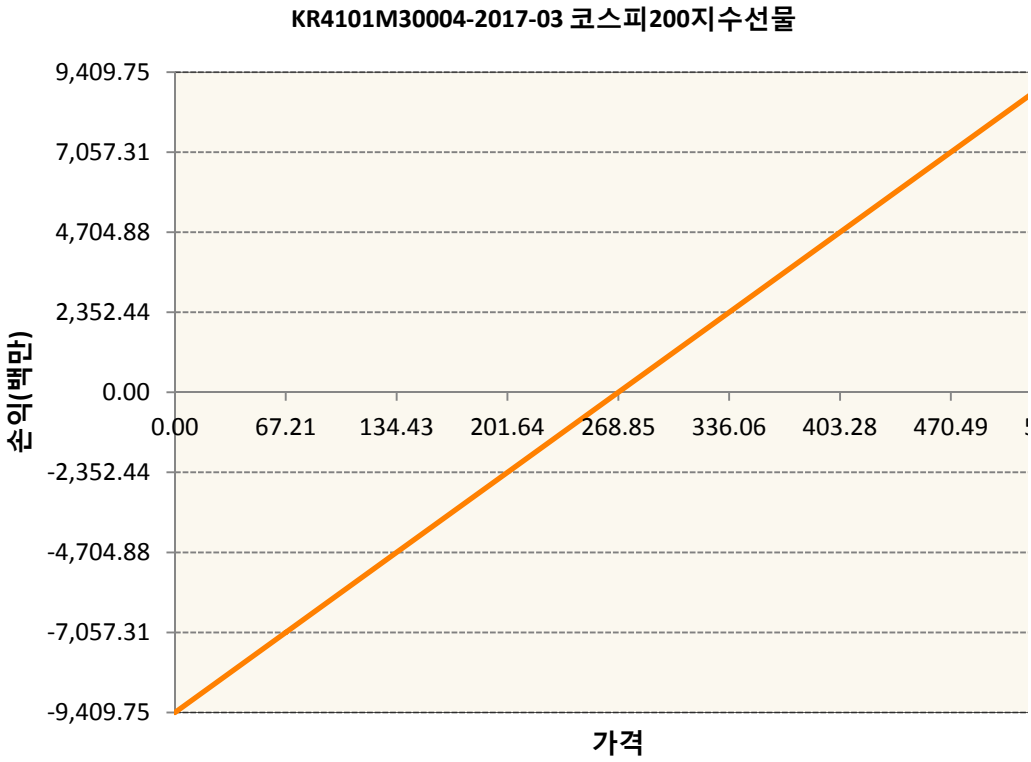
커버드콜목표전환형증권투자신탁

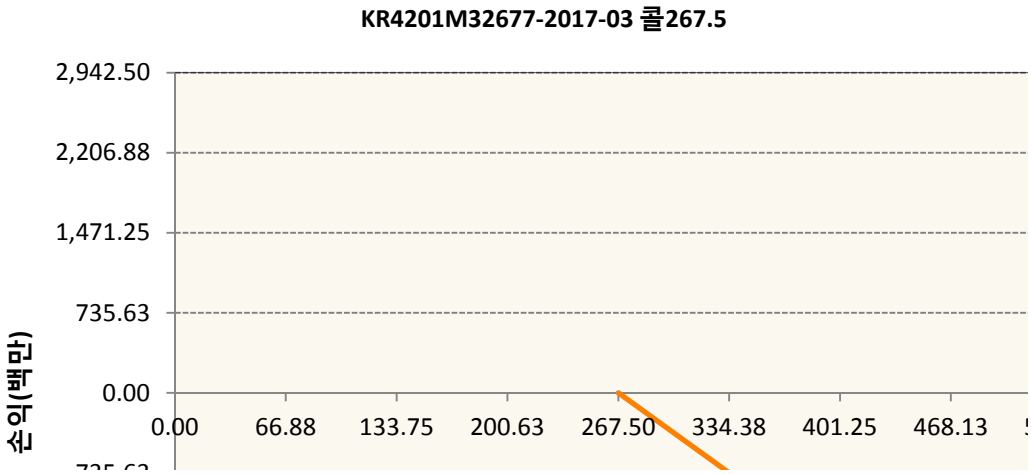
1. 계약금액

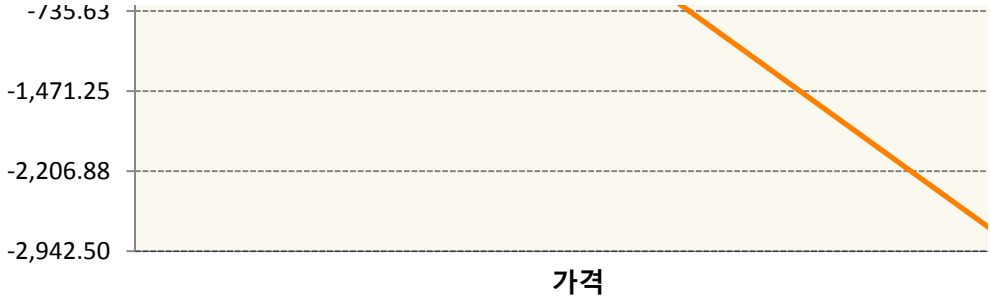
(단위:백만원)

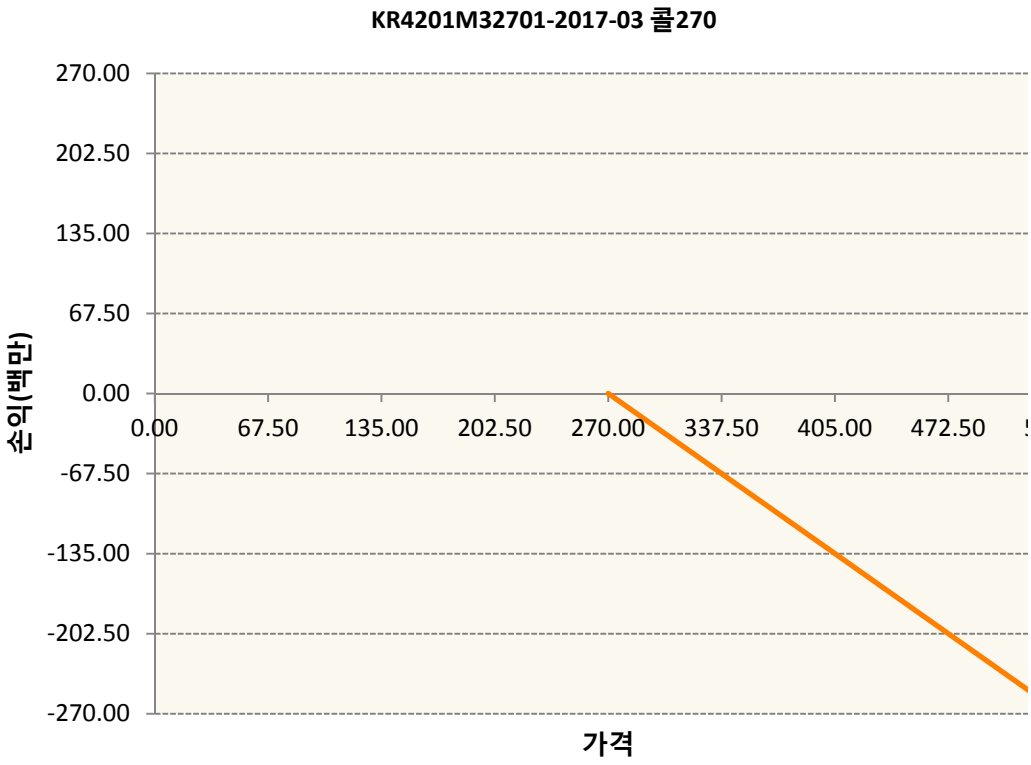
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	9,410	0	9,410	장내
신규	유가증권	옵션	0	3,251	-3,251	장내
누계	유가증권	선물	9,410	0	9,410	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,213	-3,213	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101M30(2017-03 코스피200지수선물							753
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-753	-753	-753	-753	-753	-753	-753
-5.33%	-502	-502	-502	-502	-502	-502	-502
-2.67%	-251	-251	-251	-251	-251	-251	-251
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	251	251	251	251	251	251	251
5.33%	502	502	502	502	502	502	502
8.00%	753	753	753	753	753	753	753
KR4201M32(2017-03 콜267.5							1,063
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	193	193	192	192	192	192	191
-5.33%	192	191	190	189	186	183	180
-2.67%	174	167	159	151	141	132	122
0%	37	25	13	0	-13	-25	-38
2.67%	-281	-285	-290	-296	-303	-310	-318
5.33%	-668	-668	-669	-670	-672	-674	-676
8.00%	-1,062	-1,062	-1,062	-1,062	-1,062	-1,062	-1,063
KR4201M32 2017-03 콜270							90

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	11	11	11	11	11	11	11
-5.33%	11	11	11	11	11	11	11
-2.67%	11	10	10	9	9	8	7
0%	3	2	1	0	-1	-2	-3
2.67%	-20	-21	-22	-23	-23	-24	-25
5.33%	-55	-55	-55	-55	-55	-56	-56
8.00%	-90	-90	-90	-90	-90	-90	-90

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

1,911

공시일	2017-02-14
기준일	2017-02-13

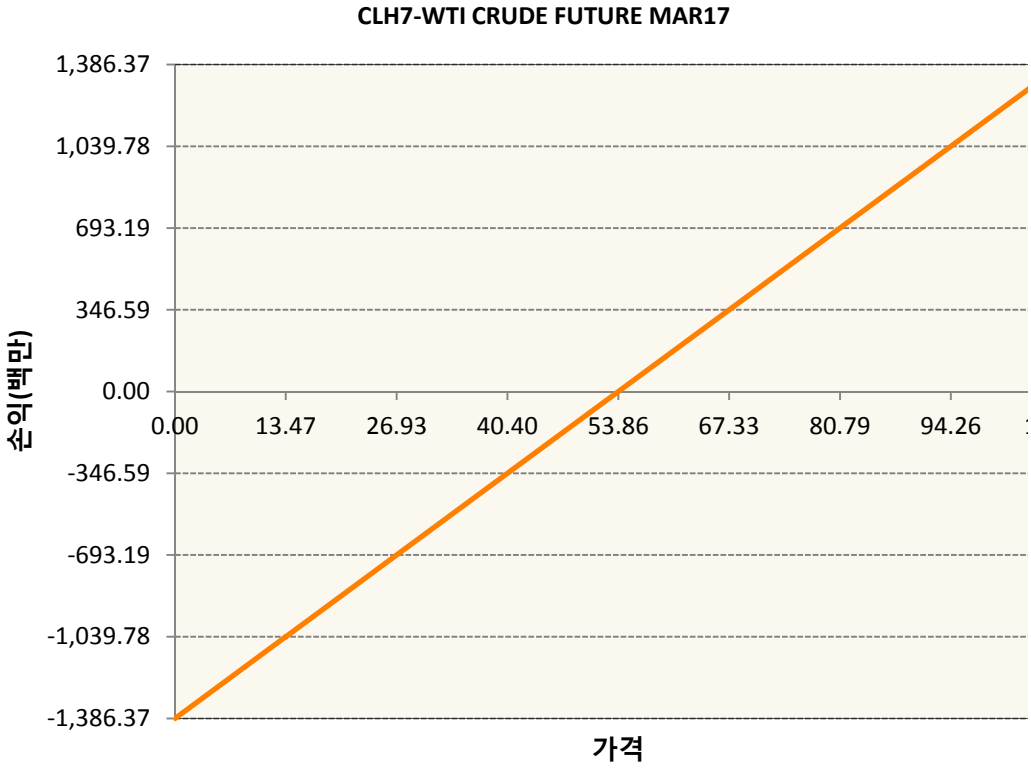
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

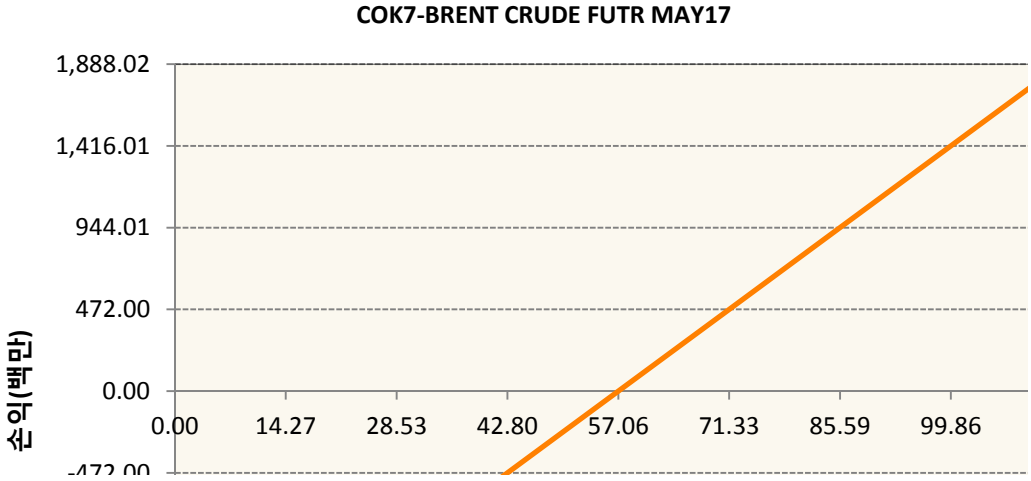
1. 계약금액

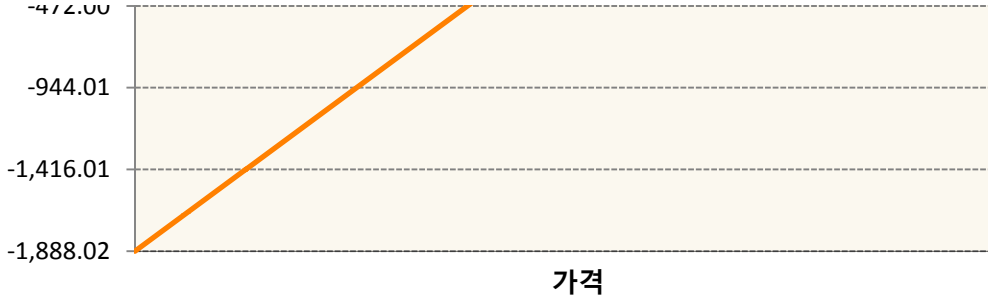
(단위:백만원)

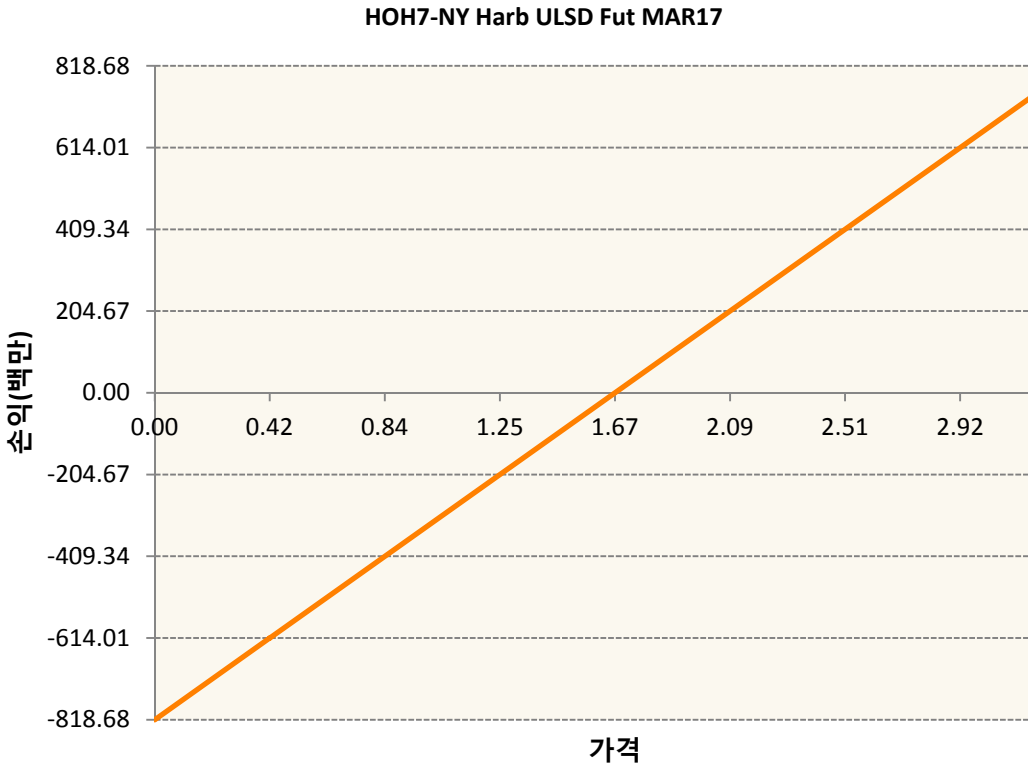
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	선물	유가증권	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	선물	유가증권	1,386	0	1,386	
누계	유가증권	선물	4,974	414	4,560	

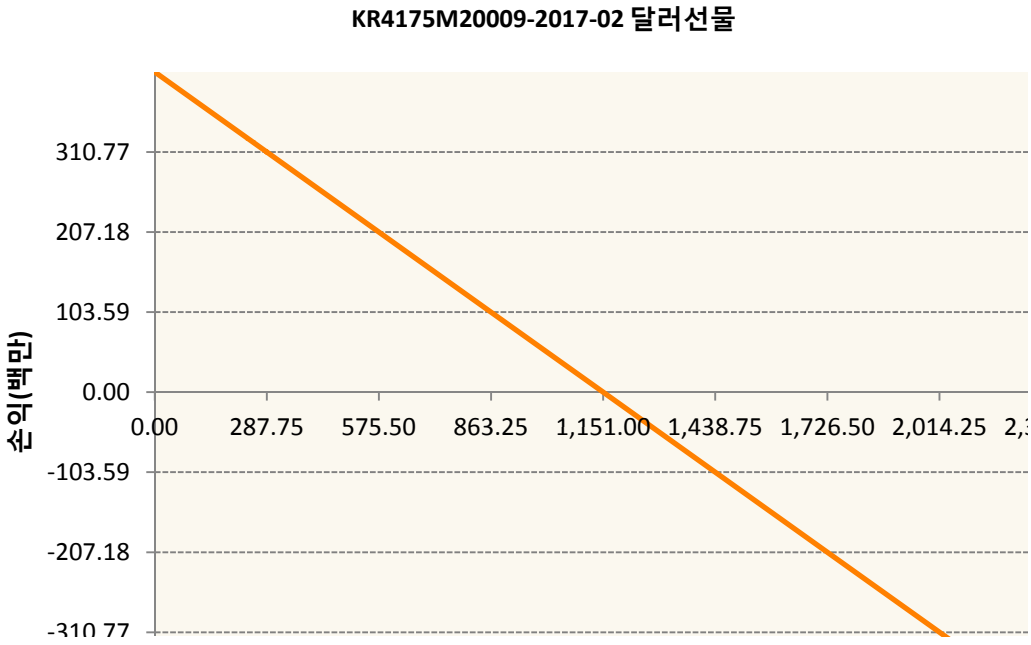
2. 만기시점의 손익구조

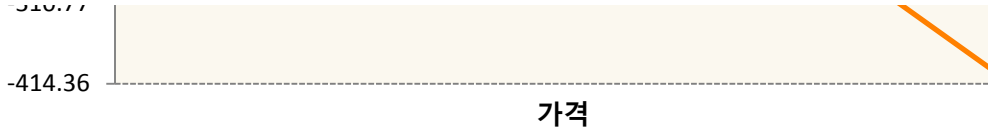


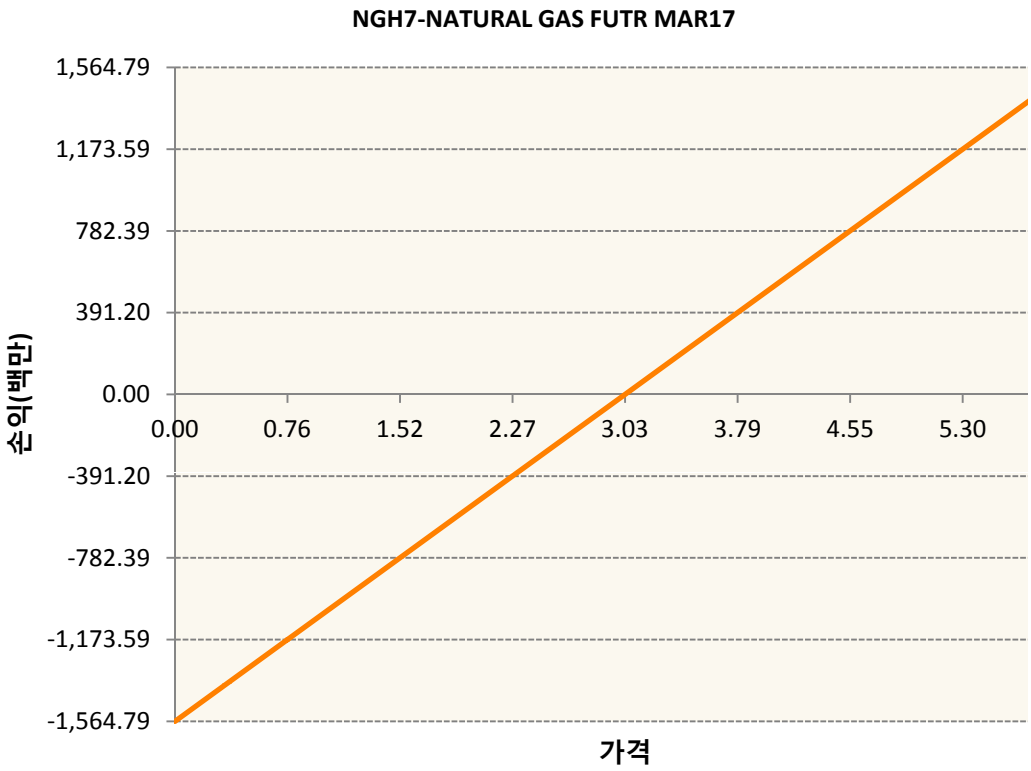


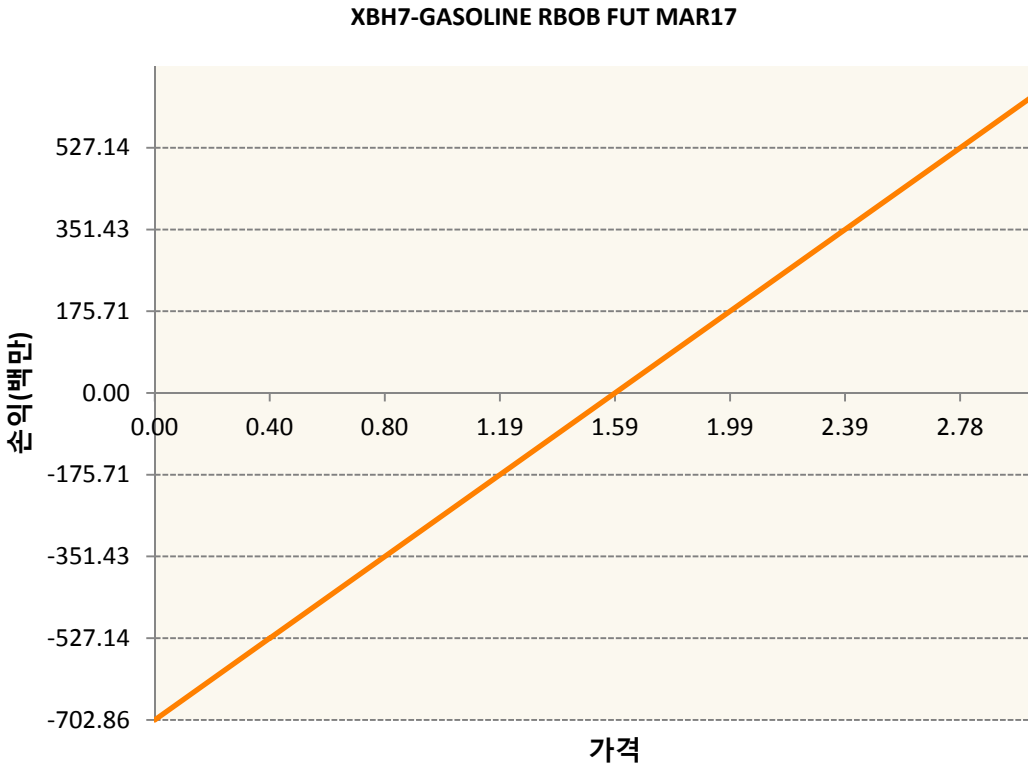

-944.01
-1,416.01
-1,888.02
가격


HOH7-NY Harb ULSD Fut MAR17
818.68
614.01
409.34
204.67
0.00
-204.67
-409.34
-614.01
-818.68
0.00
0.42
0.84
1.25
1.67
2.09
2.51
2.92
순익(백만)
가격


KR4175M20009-2017-02 달러선물
310.77
207.18
103.59
0.00
-103.59
-207.18
0.00
287.75
575.50
863.25
1,151.00
1,438.75
1,726.50
2,014.25
순익(백만)


-414.36
가격


NGH7-NATURAL GAS FUTR MAR17
1,564.79
1,173.59
782.39
391.20
0.00
-391.20
-782.39
-1,173.59
-1,564.79
0.00
0.76
1.52
2.27
3.03
3.79
4.55
5.30
순익(백만)
가격


XBH7-GASOLINE RBOB FUT MAR17
527.14
351.43
175.71
0.00
-175.71
-351.43
-527.14
-702.86
0.00
0.40
0.80
1.19
1.59
1.99
2.39
2.78
순익(백만)
가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLH7	WTI CRUDE FUTURE MAR17	111
COK7	BRENT CRUDE FUTR MAY17	151
HOH7	NY Harb ULSD Fut MAR17	65
KR4175M20(	2017-02 달러선물	33
NGH7	NATURAL GAS FUTR MAR17	125
XBH7	GASOLINE RBOB FUT MAR17	56

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

1,130

공시일	2017-02-14
기준일	2017-02-13

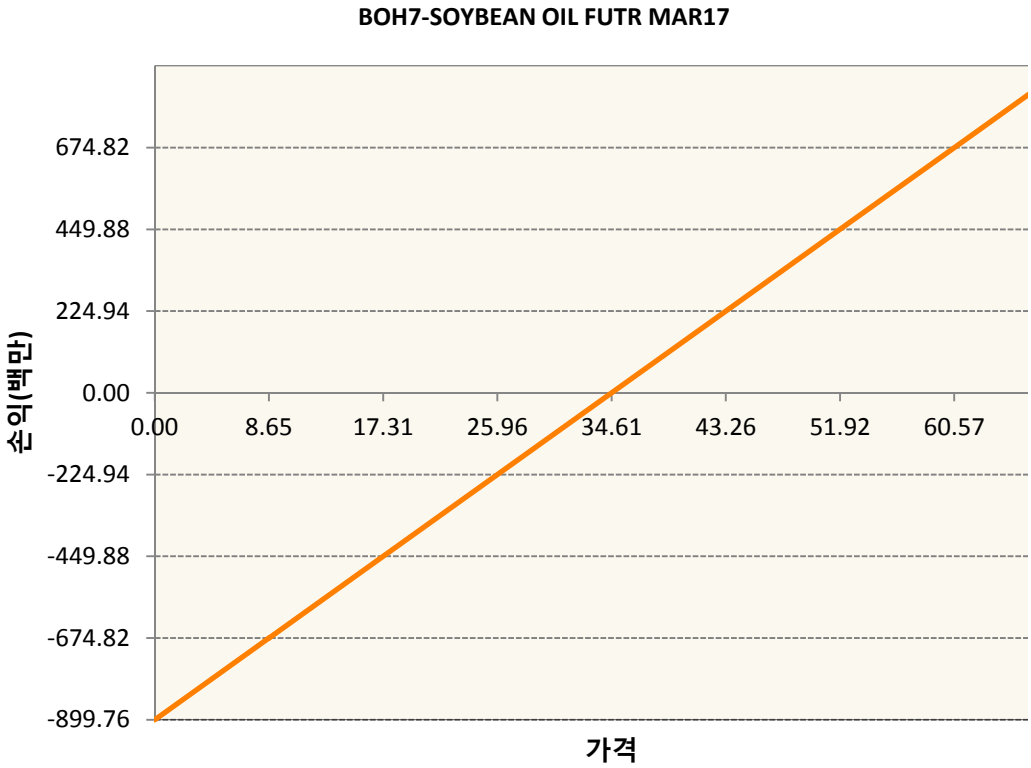
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

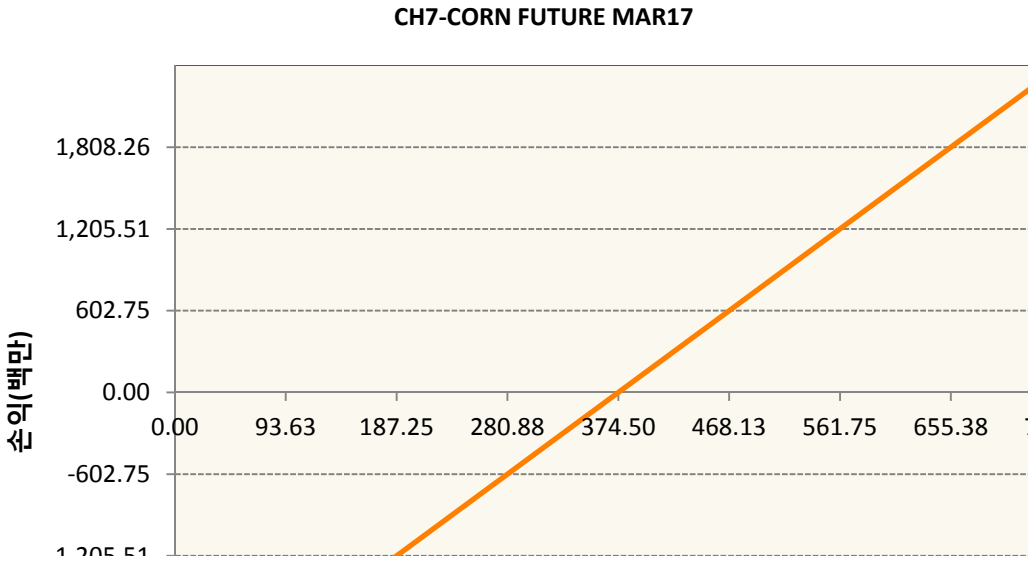
1. 계약금액

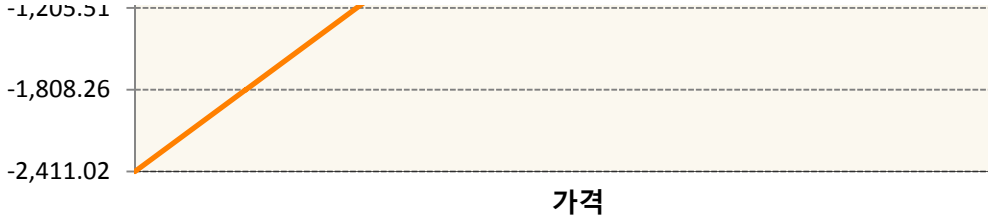
(단위:백만원)

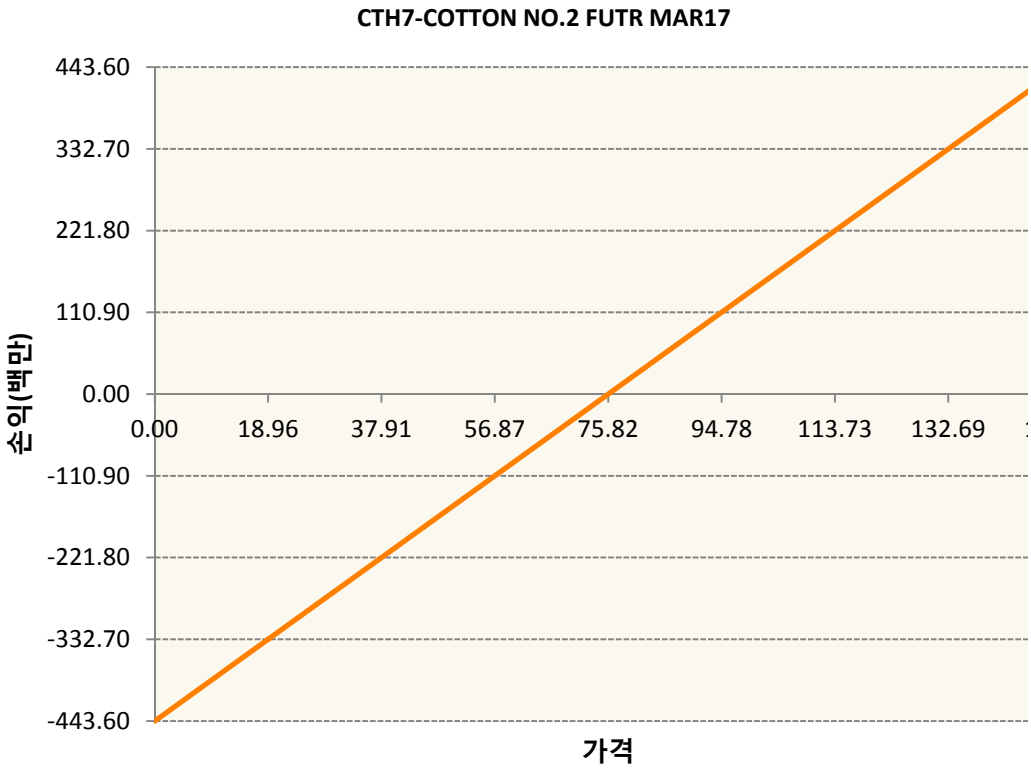
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	10,060	576	9,484	

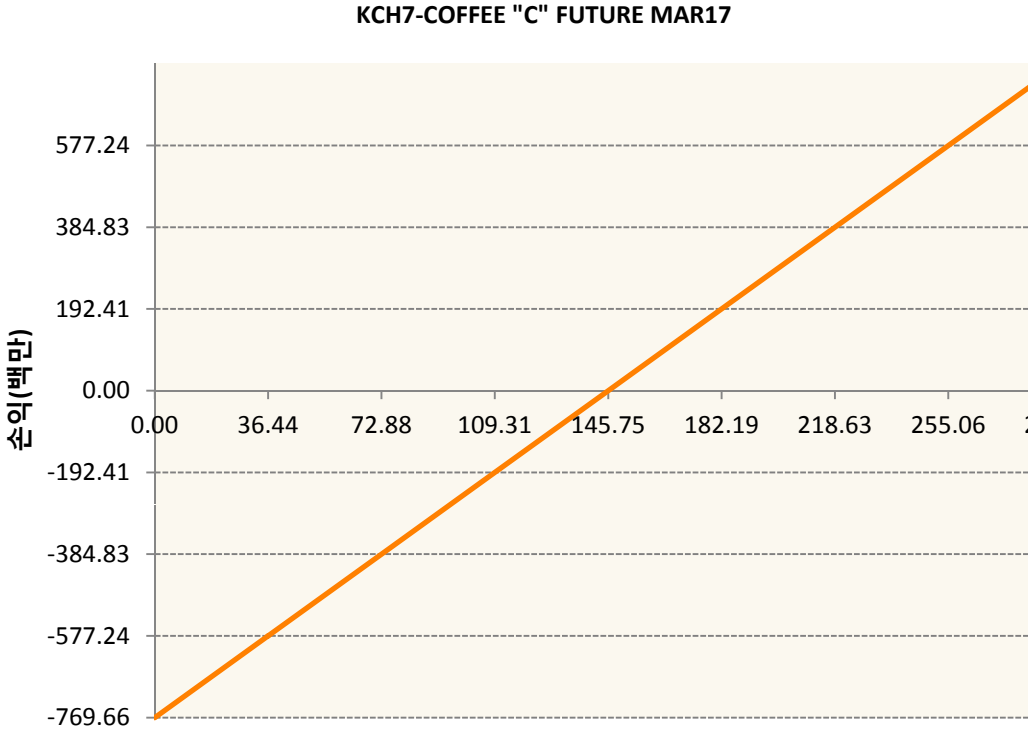
2. 만기시점의 손익구조



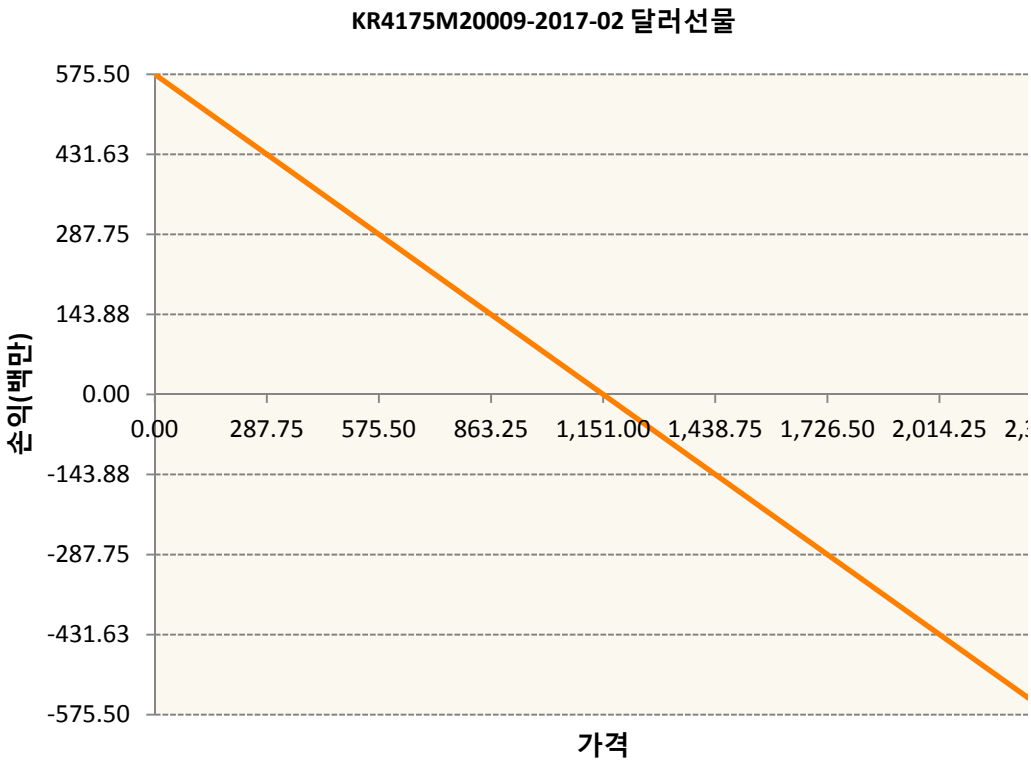


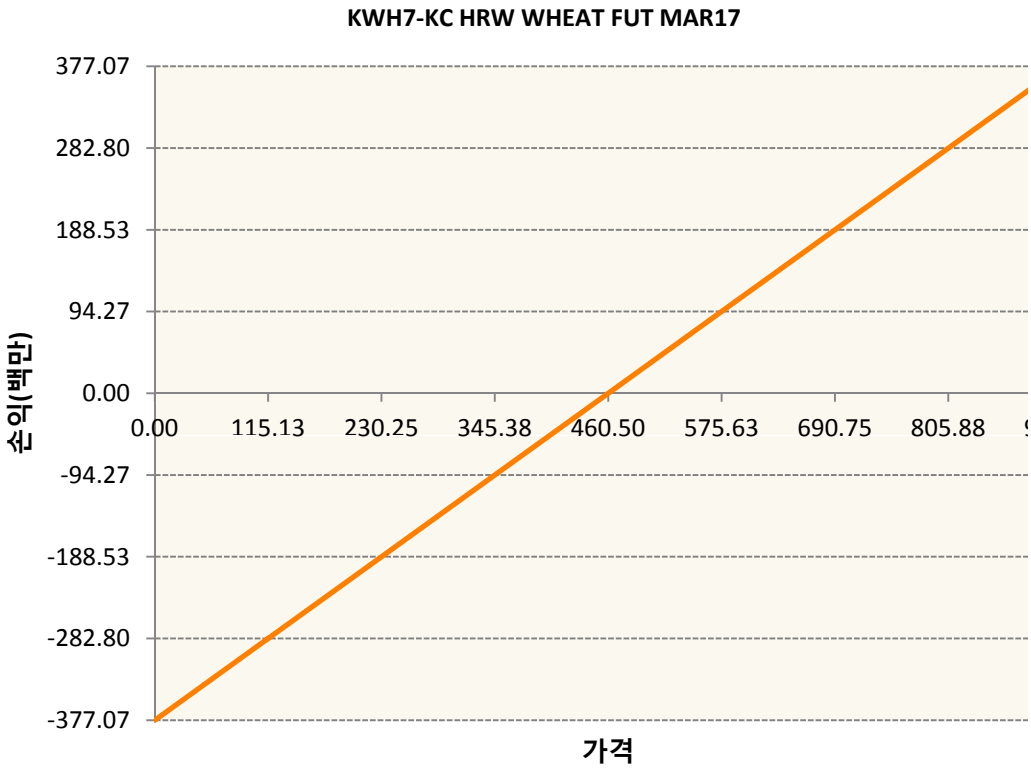

-1,808.26
-2,411.02
가격

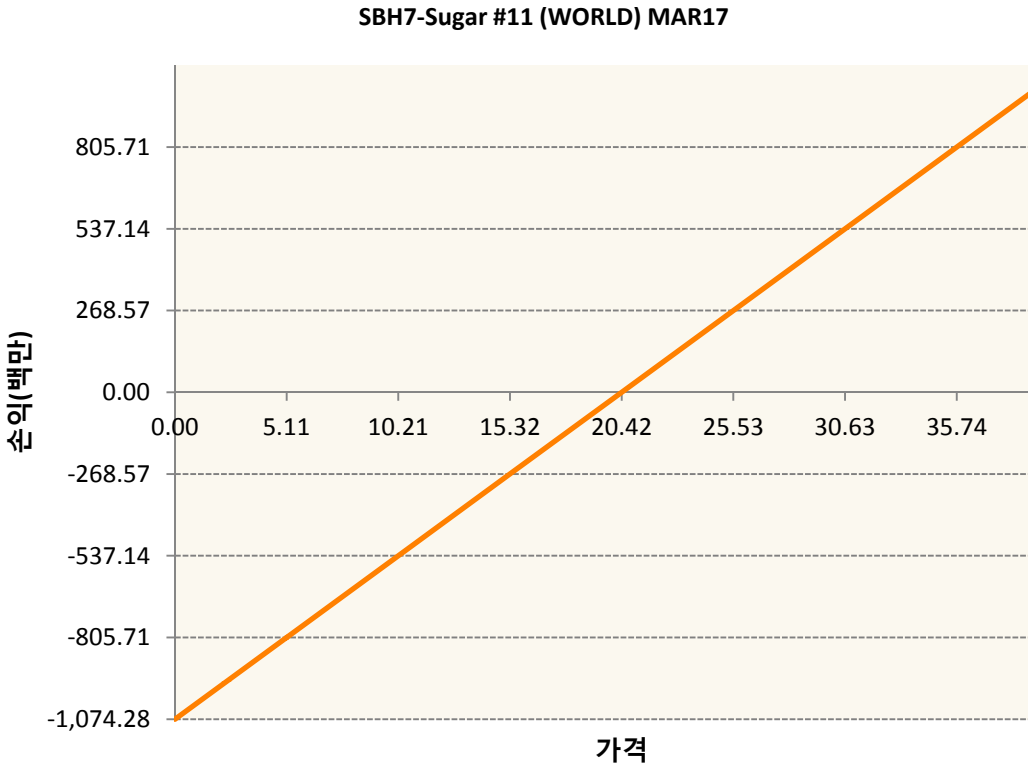

CTH7-COTTON NO.2 FUTR MAR17
443.60
332.70
221.80
110.90
0.00
-110.90
-221.80
-332.70
-443.60
0.00
18.96
37.91
56.87
75.82
94.78
113.73
132.69
손익(백만)
가격

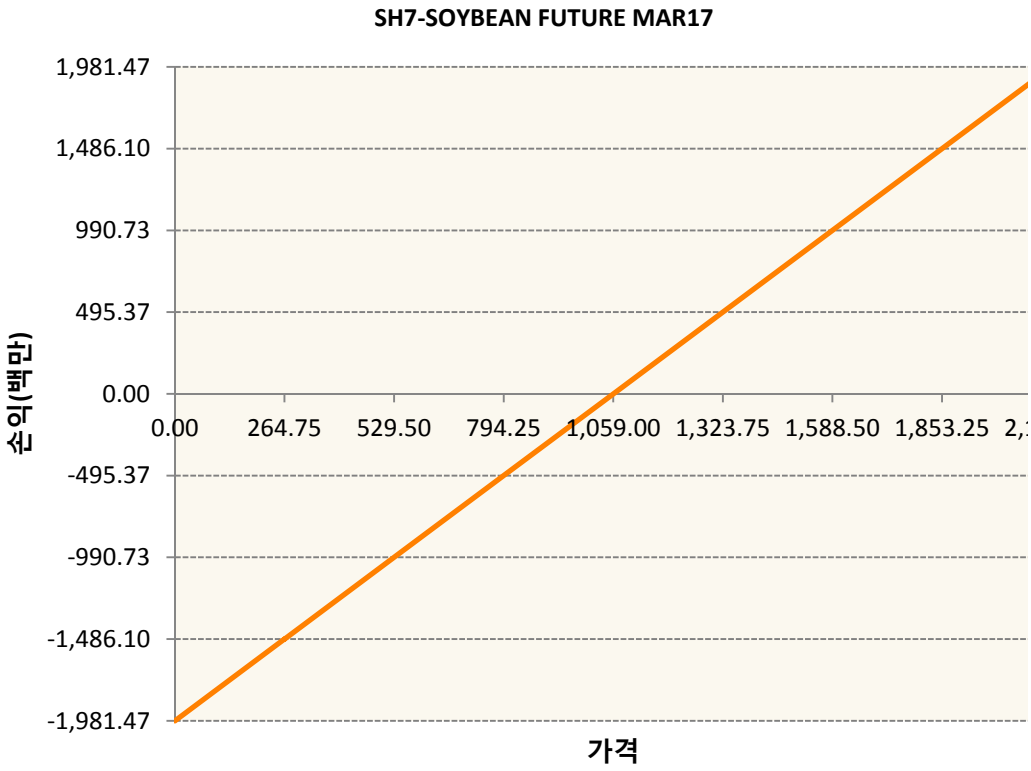

KCH7-COFFEE "C" FUTURE MAR17
577.24
384.83
192.41
0.00
-192.41
-384.83
-577.24
-769.66
0.00
36.44
72.88
109.31
145.75
182.19
218.63
255.06
손익(백만)

가격

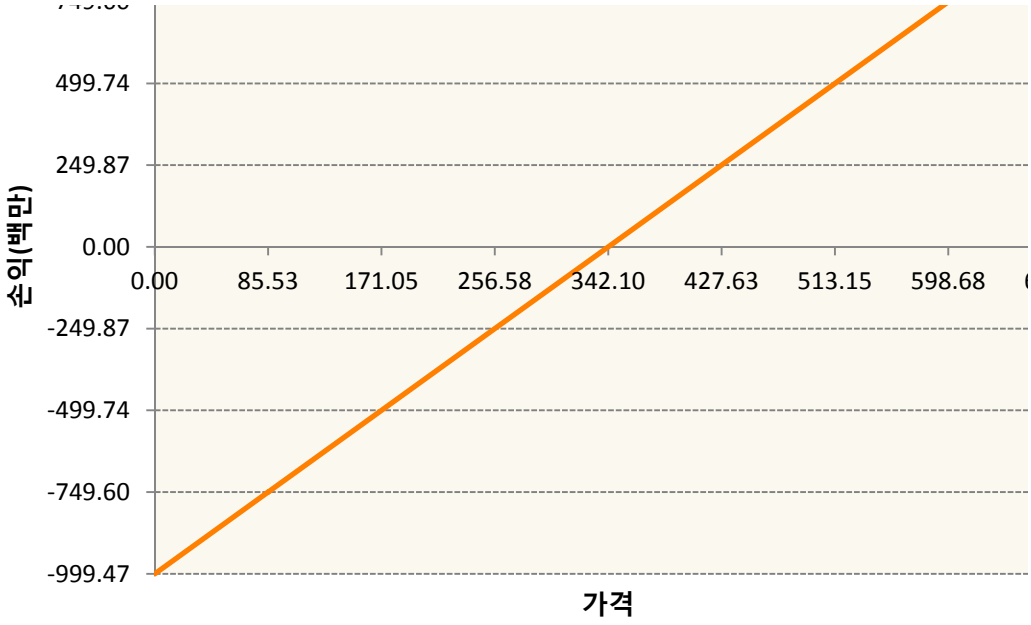

KR4175M20009-2017-02 달러선물
575.50
431.63
287.75
143.88
0.00
-143.88
-287.75
-431.63
-575.50
0.00
287.75
575.50
863.25
1,151.00
1,438.75
1,726.50
2,014.25
손익(백만)
가격

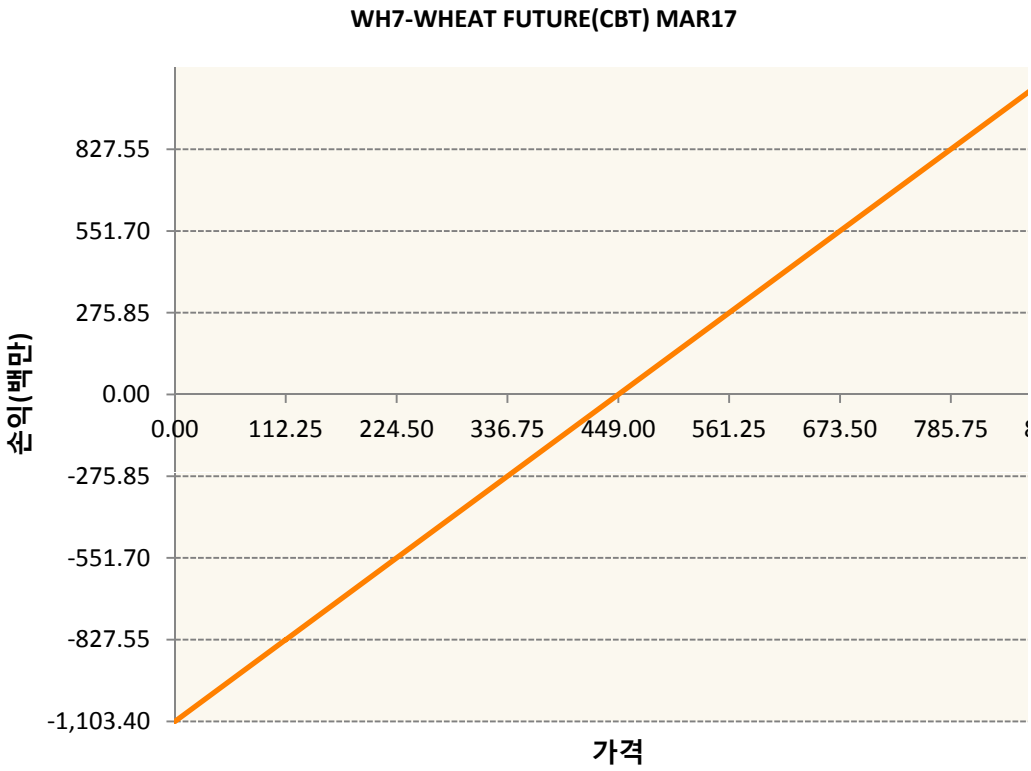

KWH7-KC HRW WHEAT FUT MAR17
377.07
282.80
188.53
94.27
0.00
-94.27
-188.53
-282.80
-377.07
0.00
115.13
230.25
345.38
460.50
575.63
690.75
805.88
손익(백만)
가격


SBH7-Sugar #11 (WORLD) MAR17
805.71
537.14
268.57
0.00
-268.57
-537.14
-805.71
-1,074.28
0.00
5.11
10.21
15.32
20.42
25.53
30.63
35.74
손익(백만)
가격


SH7-SOYBEAN FUTURE MAR17
1,981.47
1,486.10
990.73
495.37
0.00
-495.37
-990.73
-1,486.10
-1,981.47
0.00
264.75
529.50
794.25
1,059.00
1,323.75
1,588.50
1,853.25
손익(백만)
가격


SMH7-SOYBEAN MEAL FUTR MAR17
999.47
749.60





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

BOH7	SOYBEAN OIL FUTR MAR17	72
CH7	CORN FUTURE MAR17	193
CTH7	COTTON NO.2 FUTR MAR17	35
KCH7	COFFEE "C" FUTURE MAR17	62
KR4175M20(	2017-02 달러선물	46

KWH7	KC HRW WHEAT FUT MAR17	30
SBH7	Sugar #11 (WORLD) MAR17	86
SH7	SOYBEAN FUTURE MAR17	159
SMH7	SOYBEAN MEAL FUTR MAR17	80
WH7	WHEAT FUTURE(CBT) MAR17	88

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

949