공시일	2017-02-15
기준일	2017-02-14

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	2017-02-15
기준일	2017-02-14

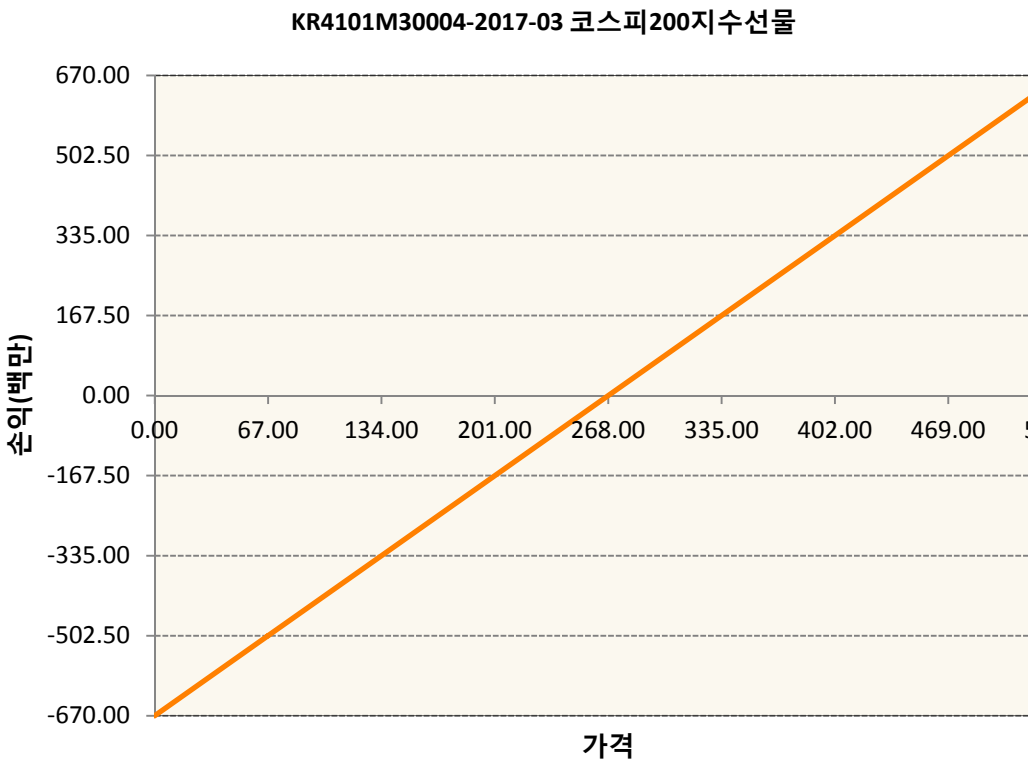
스마트인덱스모

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	670	0	670	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	2017-02-15
기준일	2017-02-14

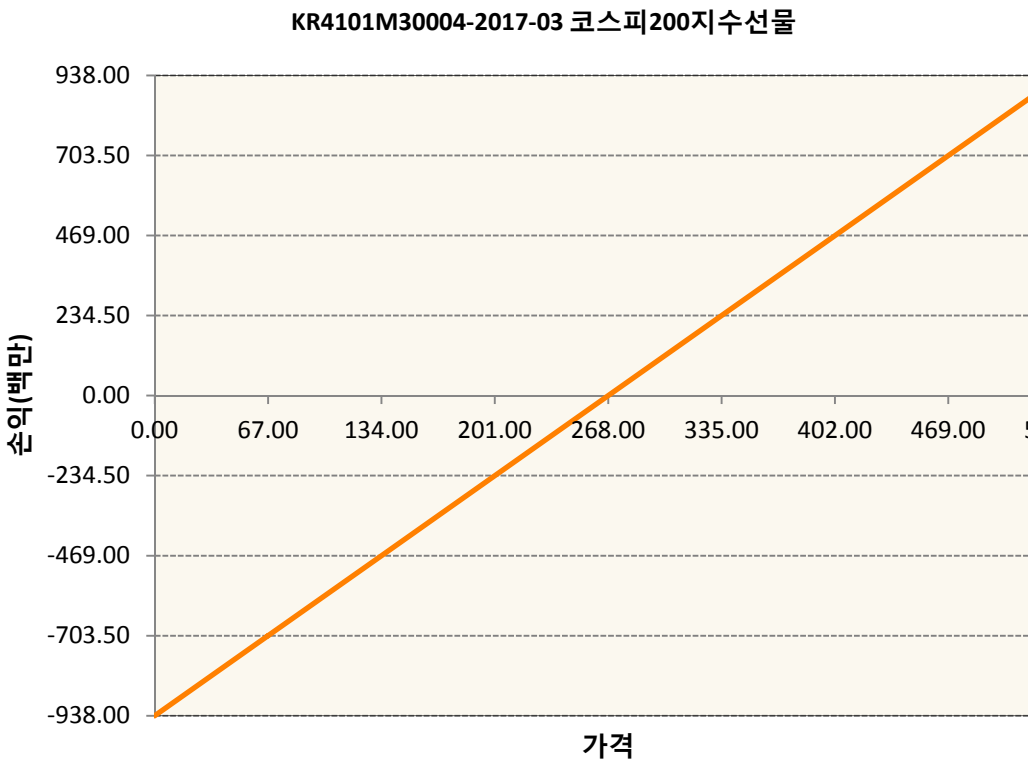
스마트레버리지목표전환형1호

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	938	0	938	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	2017-02-15
기준일	2017-02-14

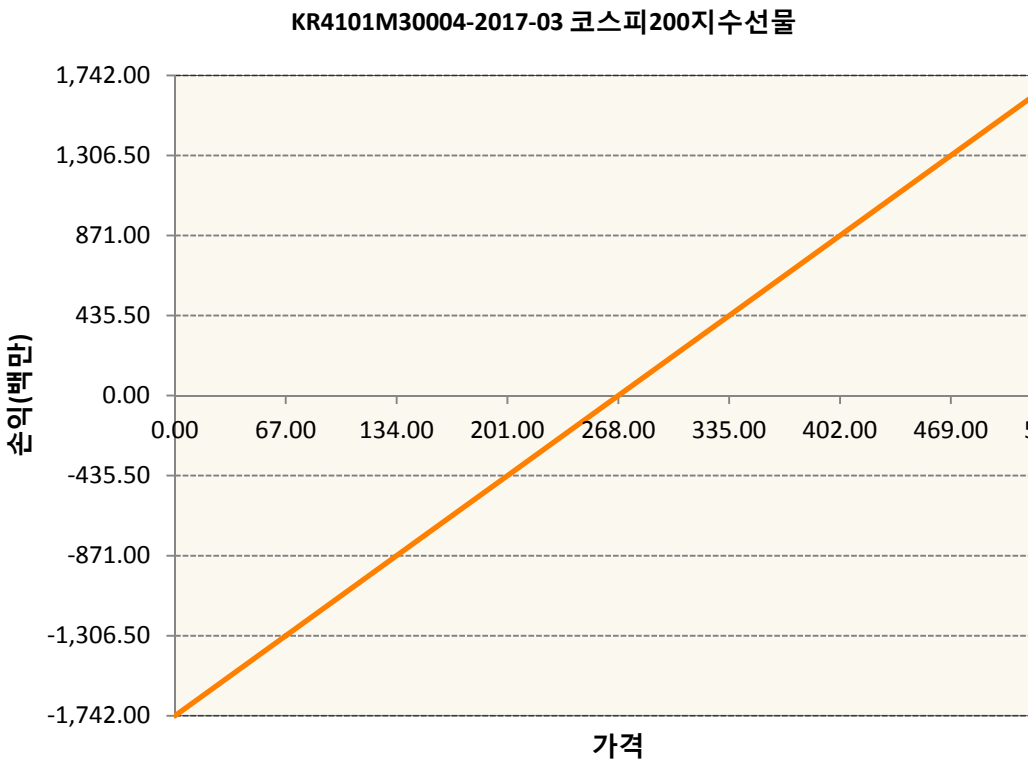
1.3배 레버리지 인덱스(주식-파생형)

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	1,742	0	1,742	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101M30(2017-03 코스피200지수선물							139
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-139	-139	-139	-139	-139	-139	-139
-5.33%	-93	-93	-93	-93	-93	-93	-93
-2.67%	-46	-46	-46	-46	-46	-46	-46
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	46	46	46	46	46	46	46
5.33%	93	93	93	93	93	93	93
8.00%	139	139	139	139	139	139	139

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

91

공시일	2017-02-15
기준일	2017-02-14

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	11,013	0	11,013	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWMXWO0(신한MXWO 미래S161122	941

* 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	2017-02-15
기준일	2017-02-14

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	4,972	0	4,972	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI50000 신한CSI500미래S161208	388

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

548

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-02-15
기준일	2017-02-14

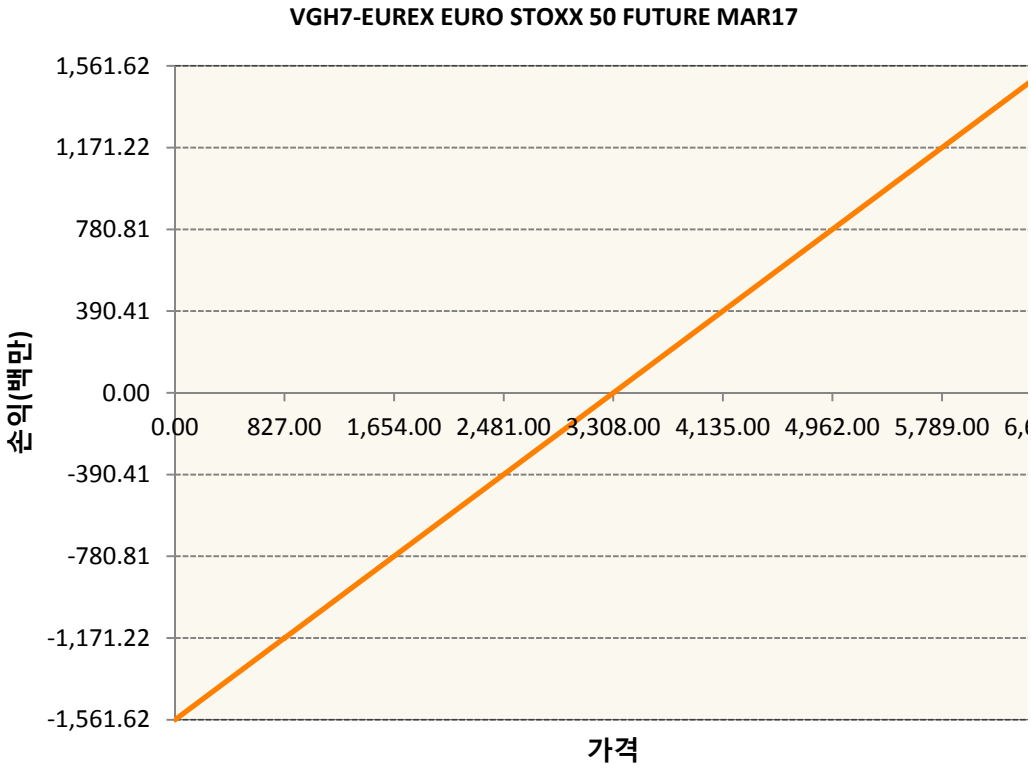
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,562	0	1,562	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGH7	EUREX EURO STOXX 50 FUTURE MAR17	125

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

(단위:백만원)

131

공시일	2017-02-15
기준일	2017-02-14

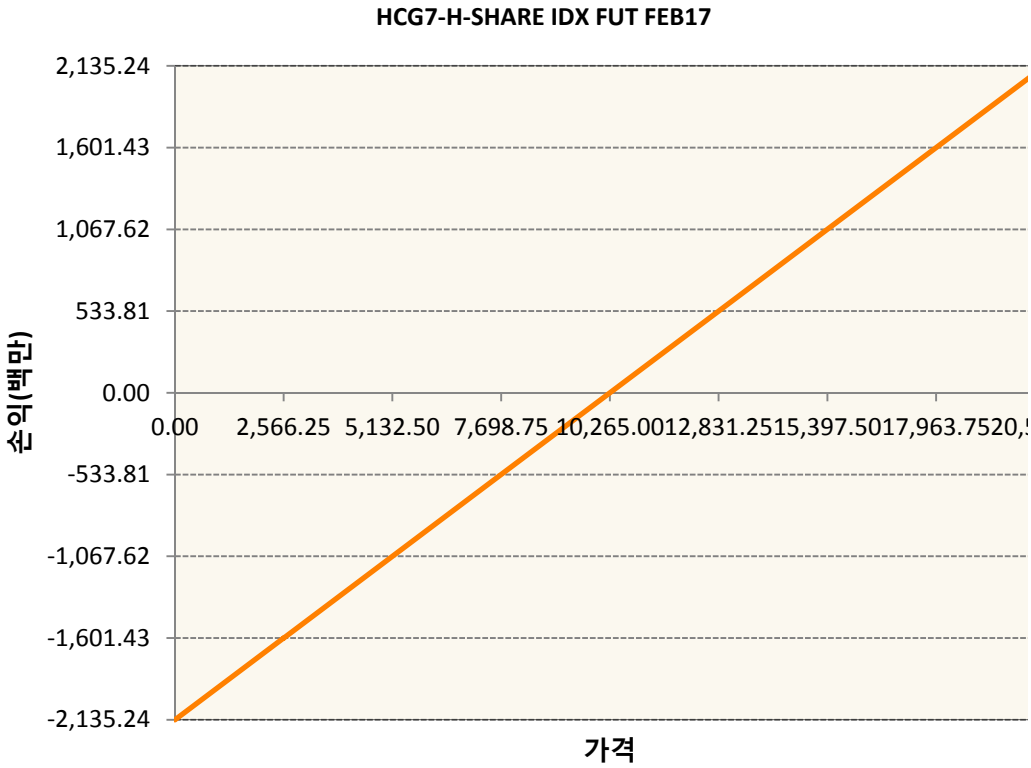
차이나인덱스모(주식-파생형)

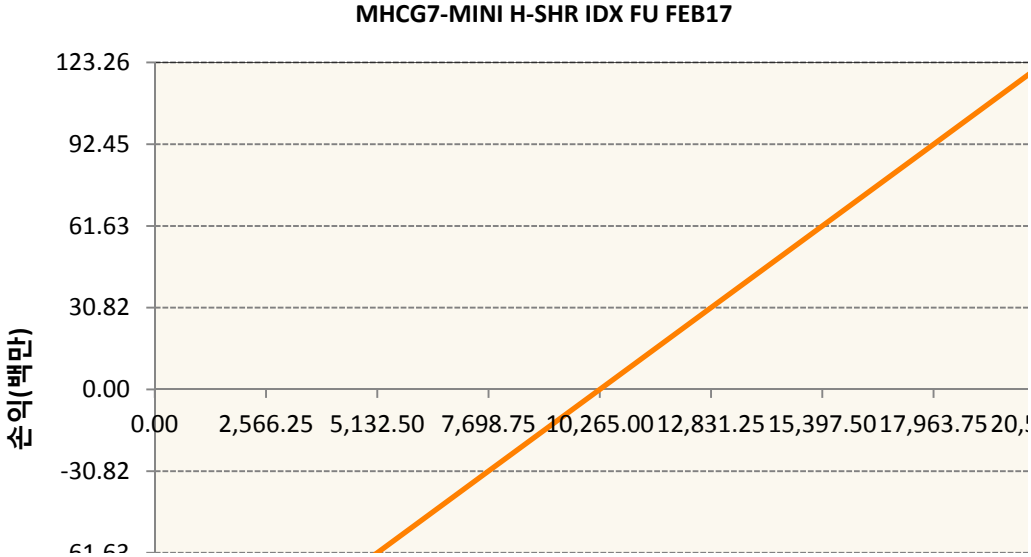
1. 계약금액

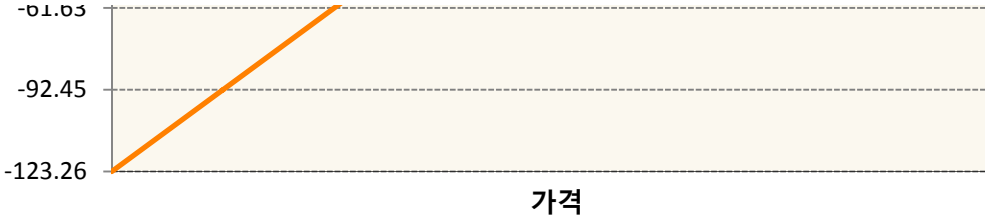
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,259	0	2,259	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCG7	H-SHARE IDX FUT FEB17	171
MHCG7	MINI H-SHR IDX FU FEB17	10

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	211

공시일	2017-02-15
기준일	2017-02-14

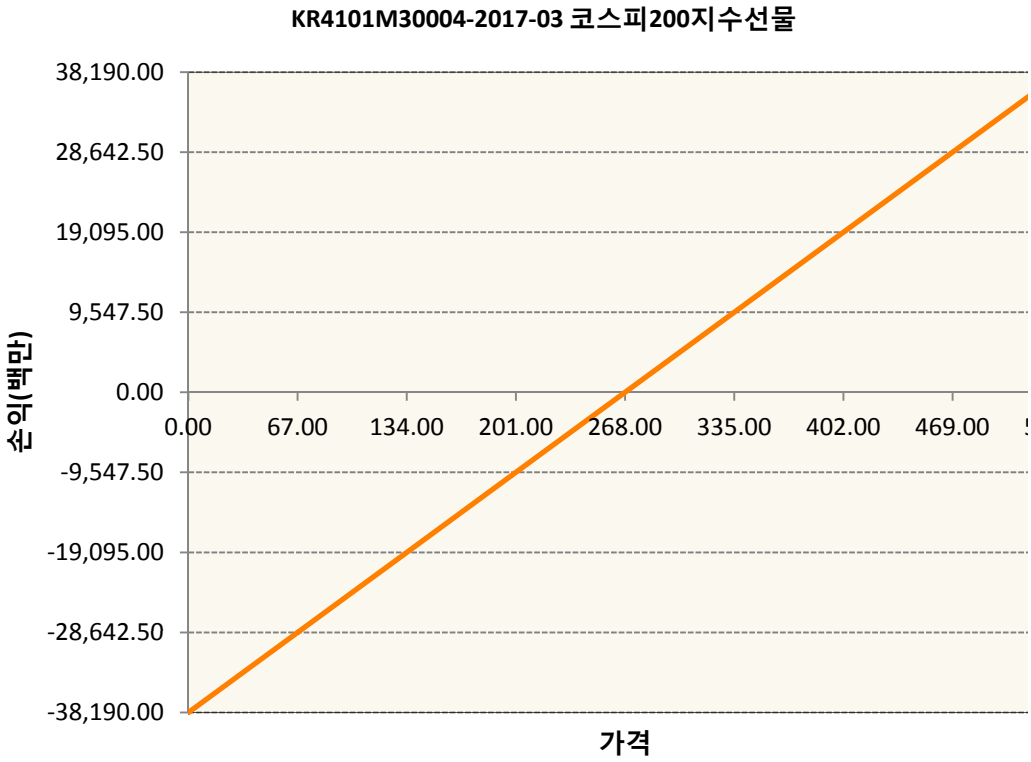
커버드콜모(주식혼합-파생형)

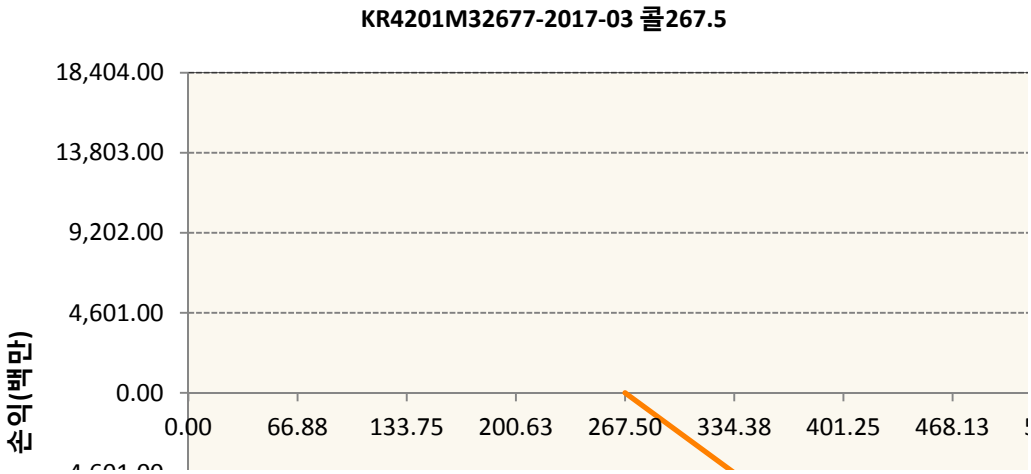
1. 계약금액

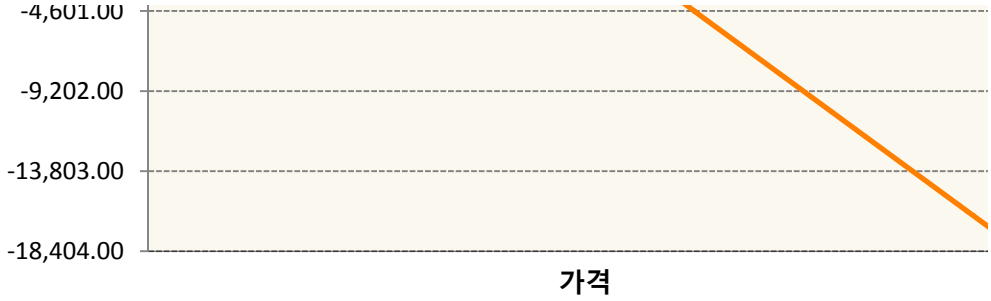
(단위:백만원)

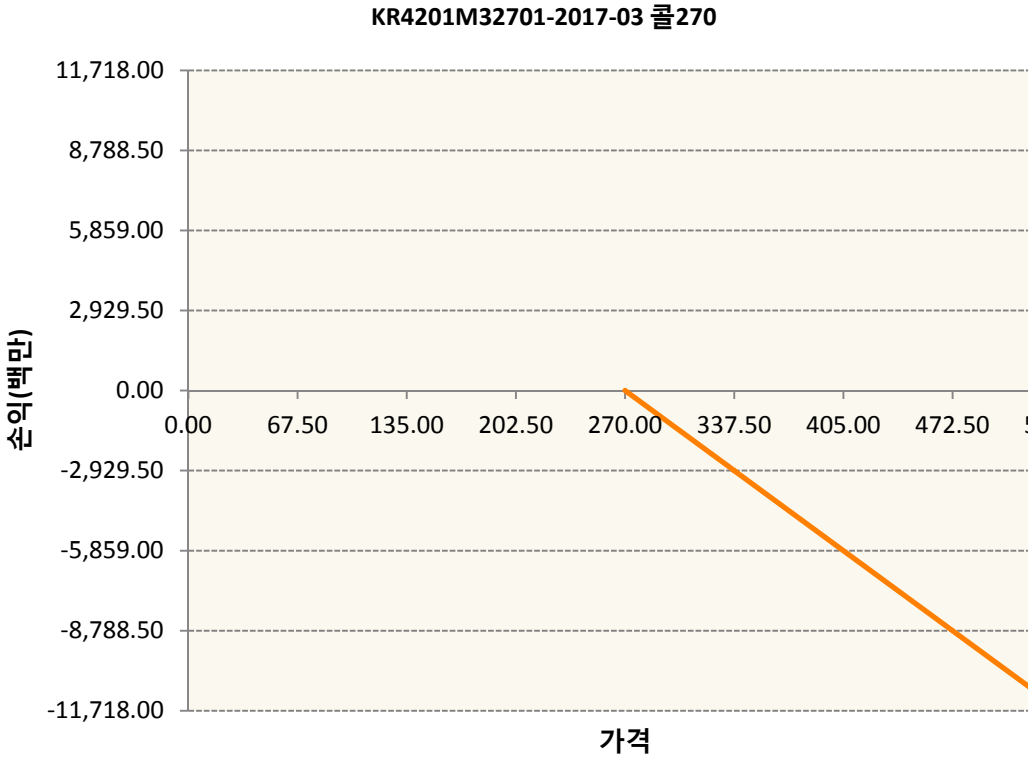
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	811	-811	장내
누계	유가증권	선물	38,190	0	38,190	장내
누계	유가증권	옵션	0	30,122	-30,122	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101M30(2017-03 코스피200지수선물							3,054
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-3,054	-3,054	-3,054	-3,054	-3,054	-3,054	-3,054
-5.33%	-2,036	-2,036	-2,036	-2,036	-2,036	-2,036	-2,036
-2.67%	-1,018	-1,018	-1,018	-1,018	-1,018	-1,018	-1,018
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	1,018	1,018	1,018	1,018	1,018	1,018	1,018
5.33%	2,036	2,036	2,036	2,036	2,036	2,036	2,036
8.00%	3,054	3,054	3,054	3,054	3,054	3,054	3,054
KR4201M32(2017-03 콜267.5							6,503
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,011	1,011	1,011	1,011	1,010	1,008	1,006
-5.33%	1,010	1,007	1,003	995	985	971	954
-2.67%	936	902	861	816	767	715	660
0%	234	156	78	0	-78	-156	-234
2.67%	-1,643	-1,674	-1,711	-1,752	-1,798	-1,848	-1,901
5.33%	-4,042	-4,044	-4,049	-4,056	-4,067	-4,081	-4,099
8.00%	-6,496	-6,496	-6,496	-6,496	-6,497	-6,499	-6,503
	KR4201M32: 2017-03 콜270						3,808
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	396	396	396	396	395	395	395
-5.33%	396	395	394	392	389	385	378
-2.67%	380	369	355	337	316	292	267
0%	140	94	47	0	-48	-95	-143
2.67%	-800	-833	-869	-907	-946	-987	-1,029
5.33%	-2,253	-2,258	-2,265	-2,275	-2,288	-2,303	-2,322
8.00%	-3,798	-3,798	-3,798	-3,799	-3,801	-3,804	-3,808

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

14,372

공시일	2017-02-15
기준일	2017-02-14

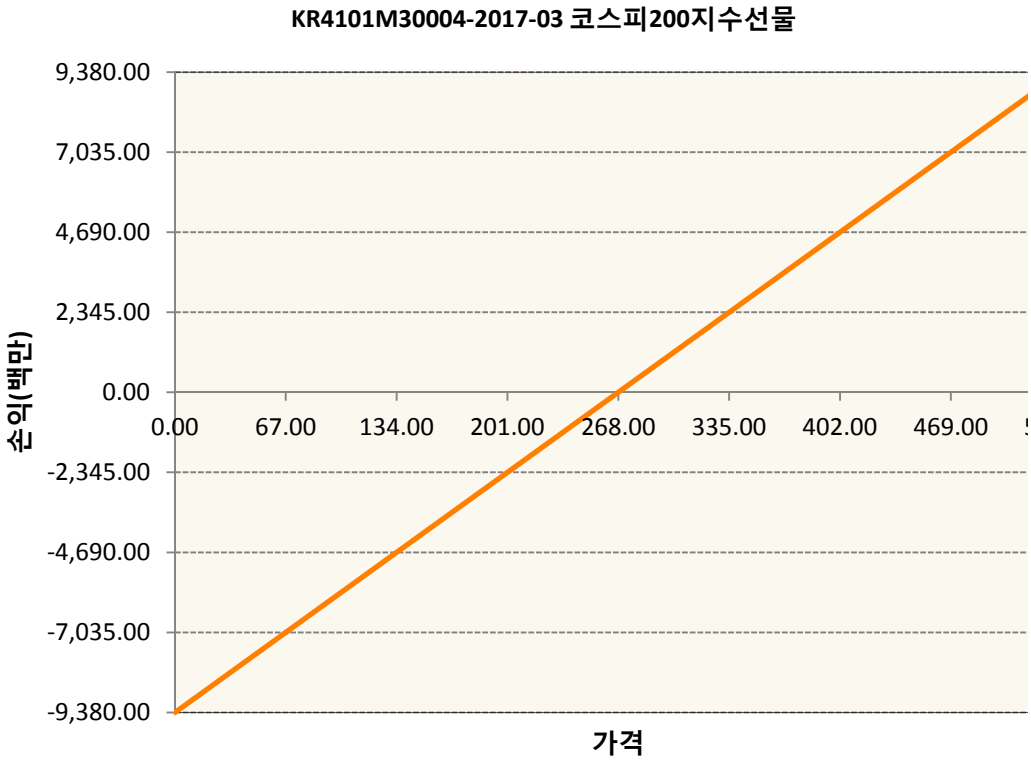
커버드콜목표전환형증권투자신탁

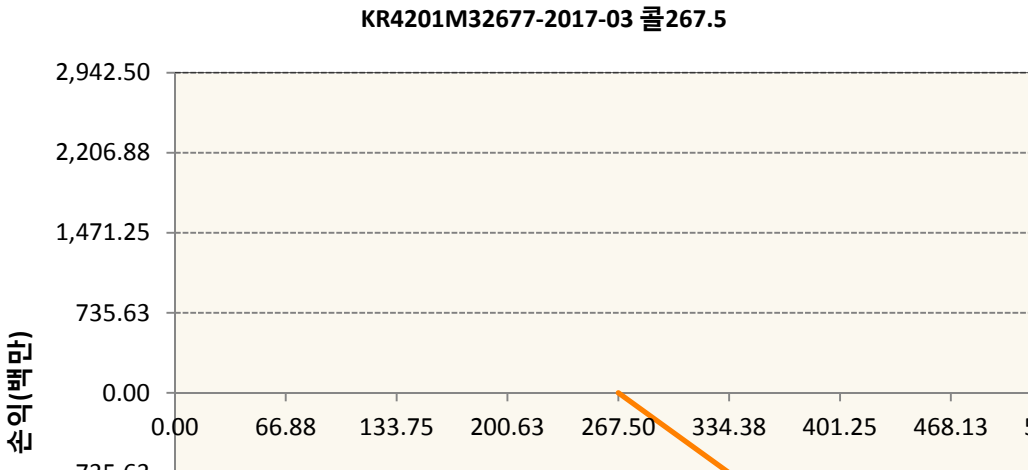
1. 계약금액

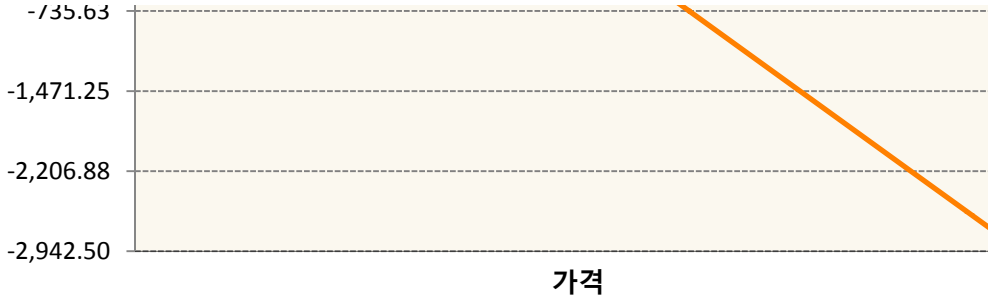
(단위:백만원)

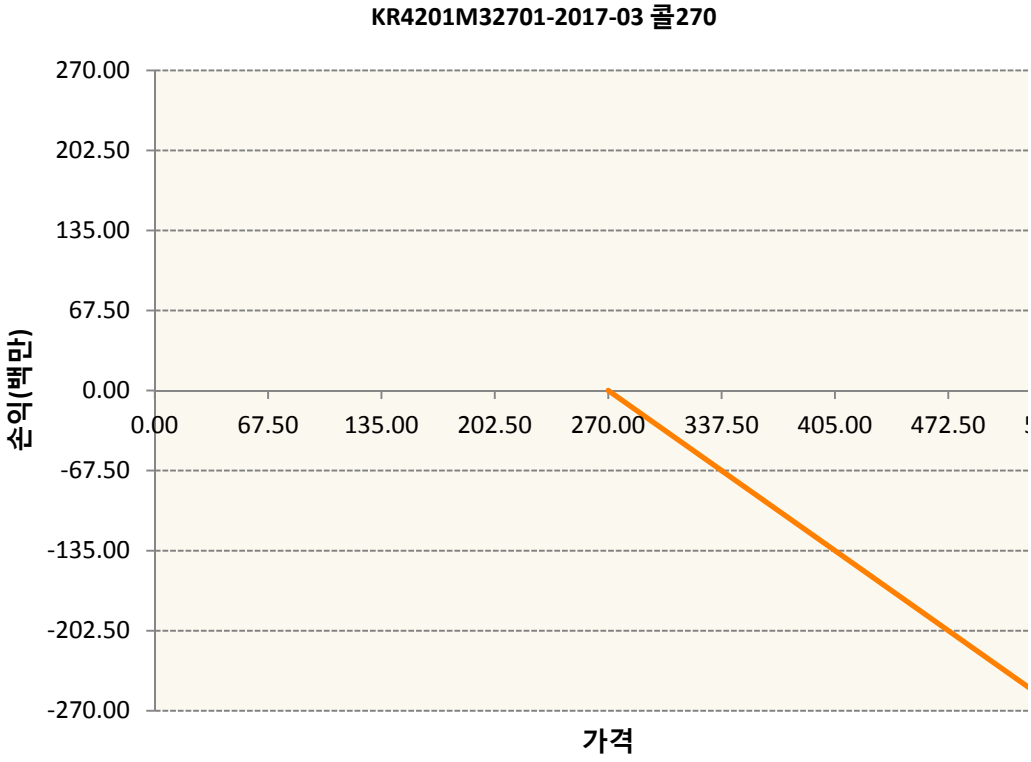
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	9,380	0	9,380	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,213	-3,213	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101M30(2017-03 코스피200지수선물							750
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-750	-750	-750	-750	-750	-750	-750
-5.33%	-500	-500	-500	-500	-500	-500	-500
-2.67%	-250	-250	-250	-250	-250	-250	-250
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	250	250	250	250	250	250	250
5.33%	500	500	500	500	500	500	500
8.00%	750	750	750	750	750	750	750
KR4201M32(2017-03 콜267.5							1,040
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	162	162	162	162	161	161	161
-5.33%	161	161	160	159	157	155	153
-2.67%	150	144	138	131	123	114	106
0%	37	25	12	0	-12	-25	-37
2.67%	-263	-268	-274	-280	-288	-295	-304
5.33%	-646	-647	-647	-649	-650	-653	-655
8.00%	-1,039	-1,039	-1,039	-1,039	-1,039	-1,039	-1,040
KR4201M32: 2017-03 콜270							88

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	9	9	9	9	9	9	9
-5.33%	9	9	9	9	9	9	9
-2.67%	9	9	8	8	7	7	6
0%	3	2	1	0	-1	-2	-3
2.67%	-18	-19	-20	-21	-22	-23	-24
5.33%	-52	-52	-52	-52	-53	-53	-53
8.00%	-88	-88	-88	-88	-88	-88	-88

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

1,868

공시일	2017-02-15
기준일	2017-02-14

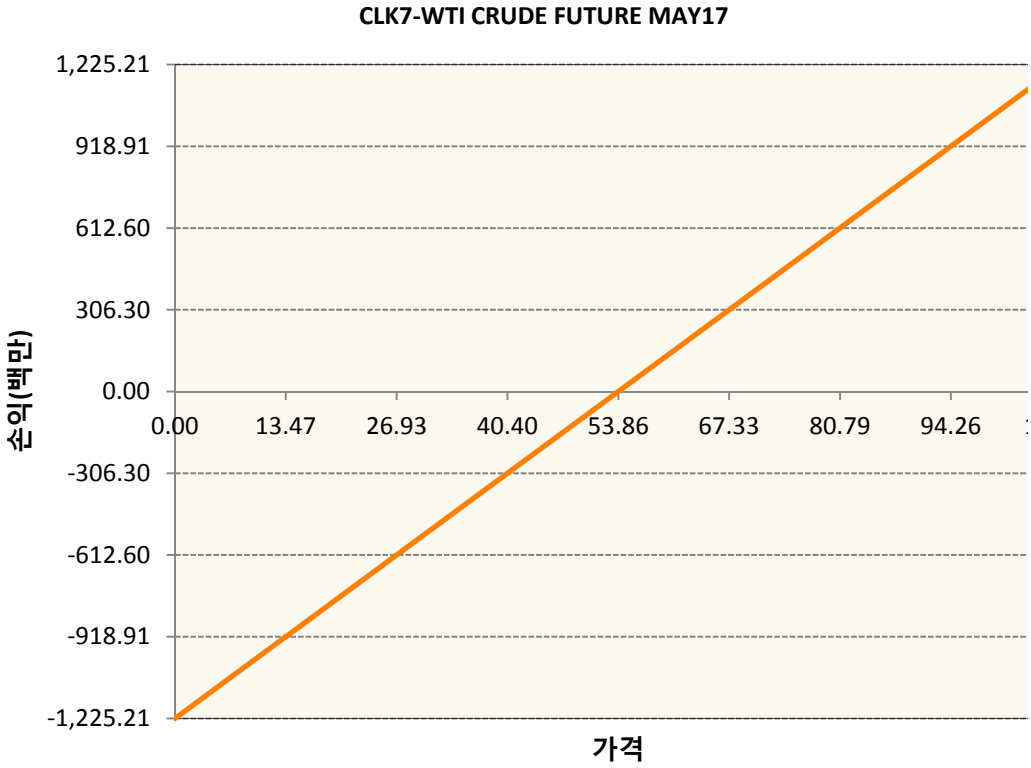
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

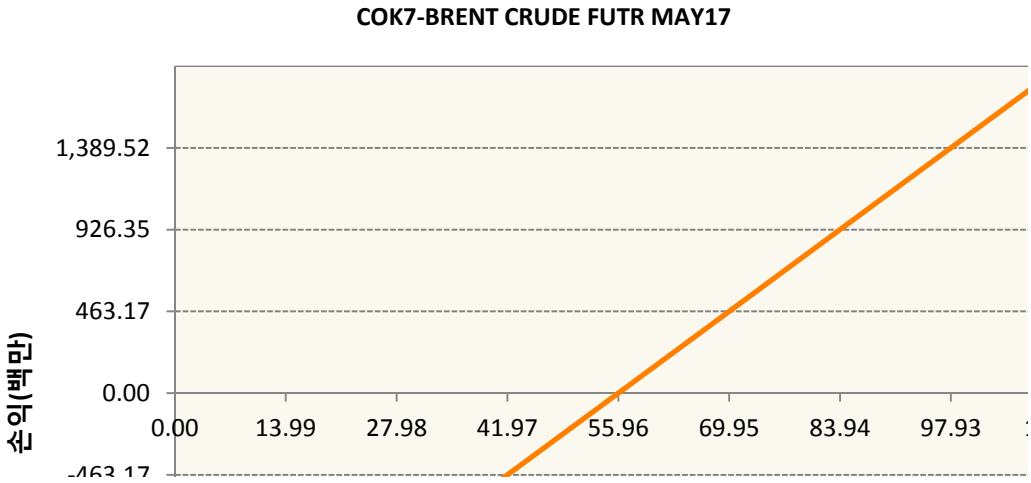
1. 계약금액

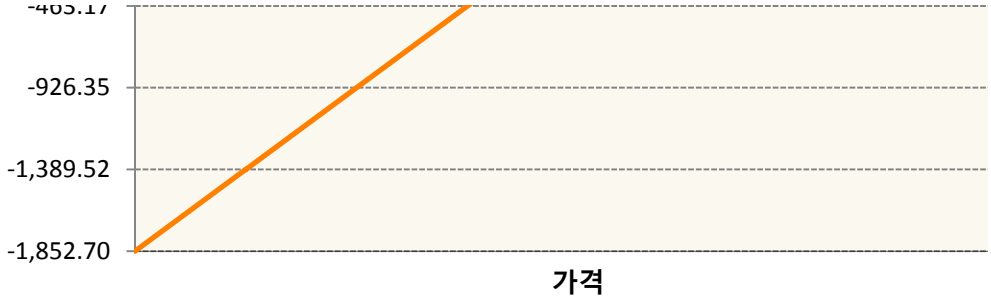
(단위:백만원)

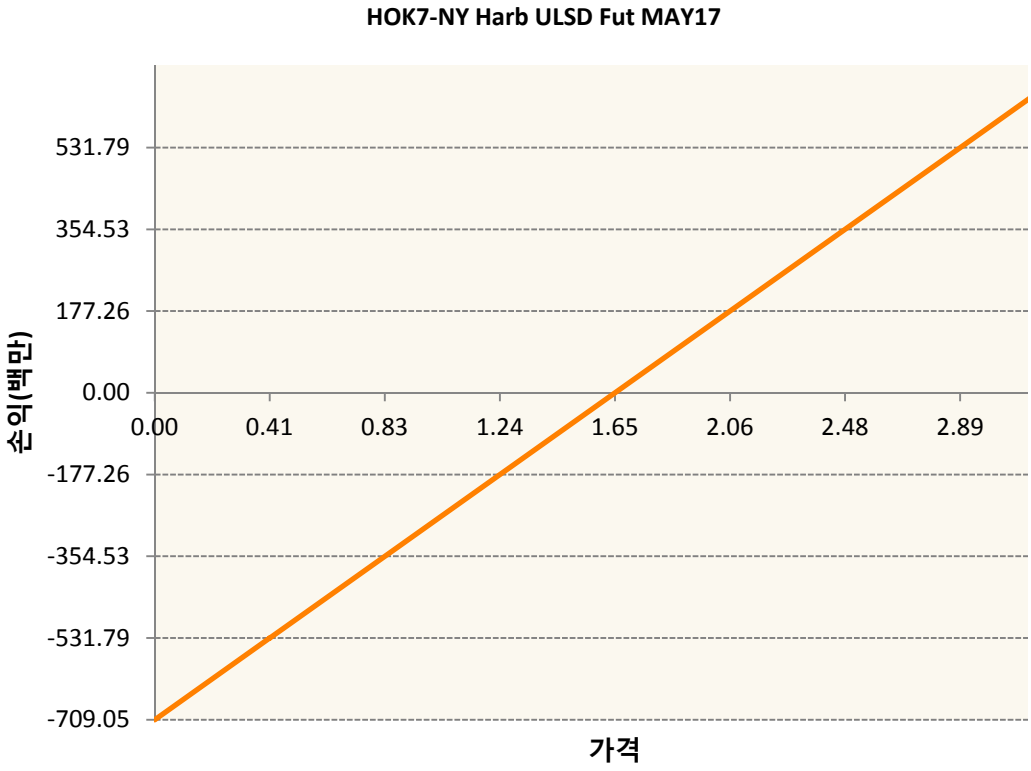
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	선물	유가증권	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	선물	유가증권	1,225	0	1,225	
누계	유가증권	선물	4,776	409	4,367	

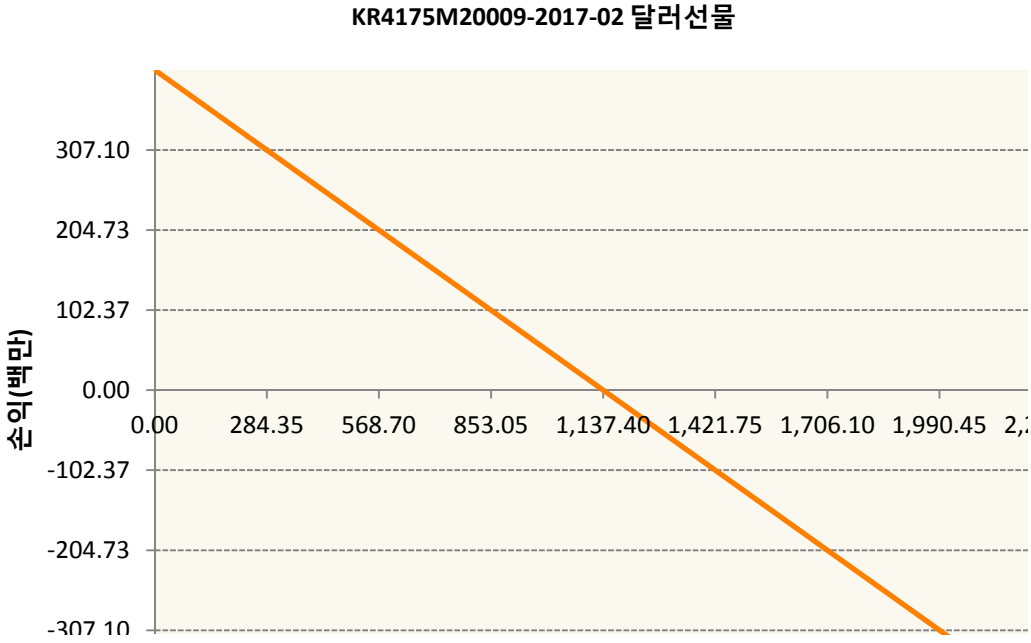
2. 만기시점의 손익구조

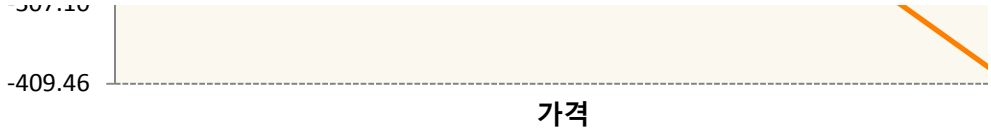


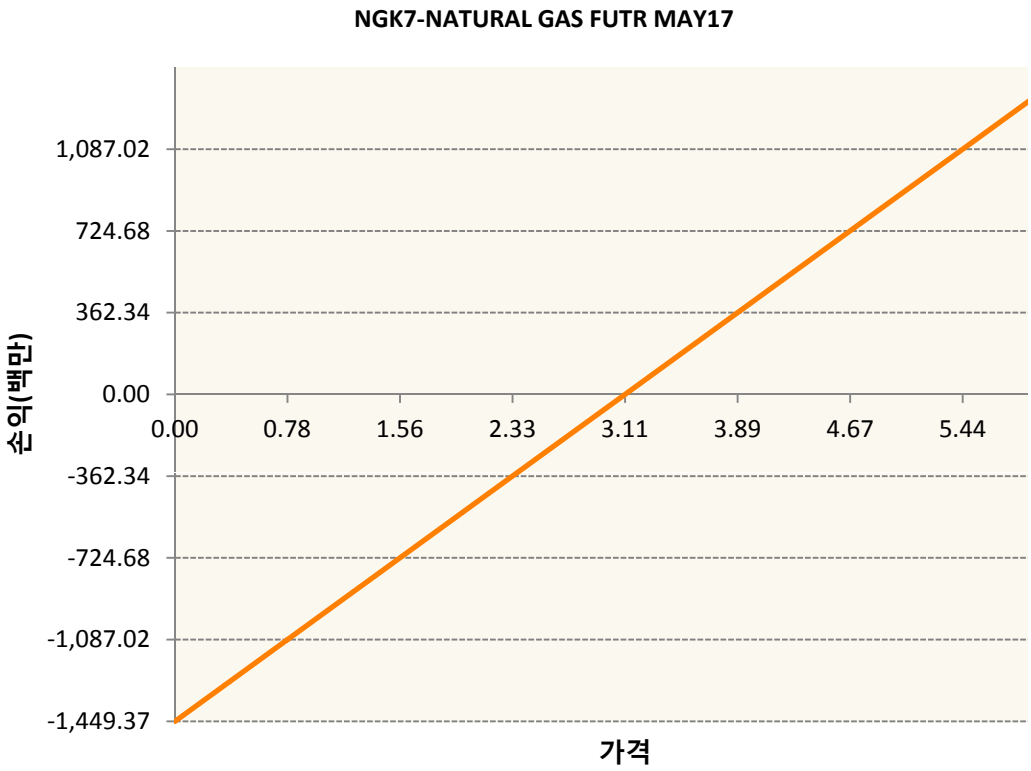


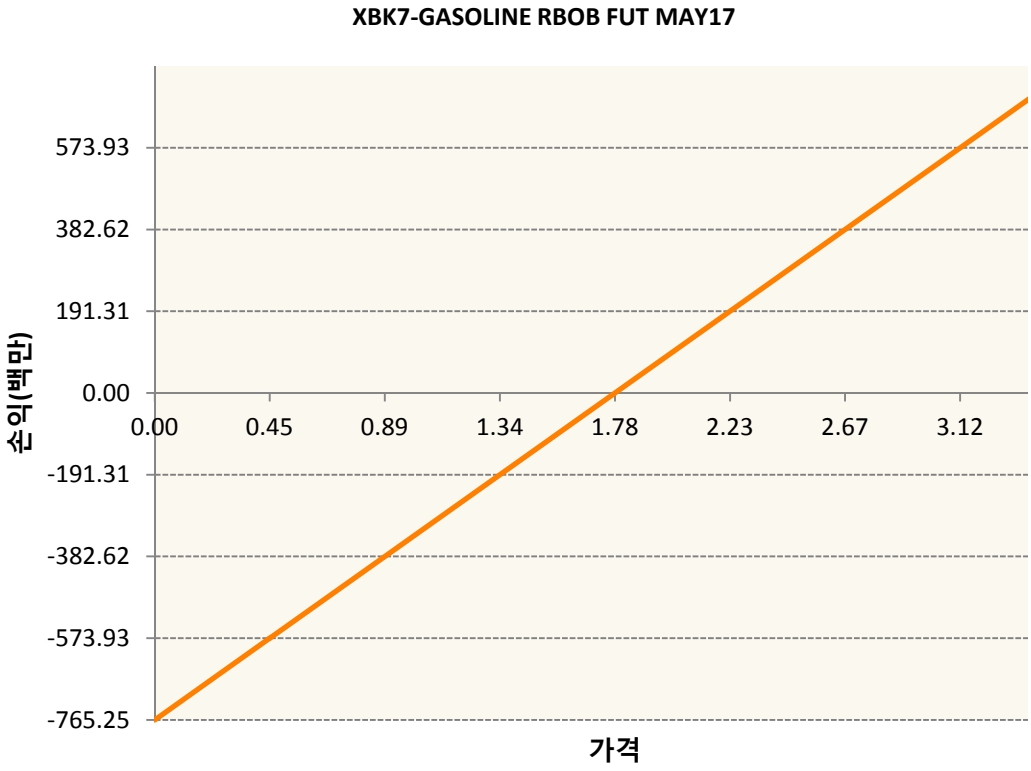

-926.35
-1,389.52
-1,852.70
가격


HOK7-NY Harb ULSD Fut MAY17
531.79
354.53
177.26
0.00
-177.26
-354.53
-531.79
-709.05
0.00
0.41
0.83
1.24
1.65
2.06
2.48
2.89
순익(백만)
가격


KR4175M20009-2017-02 달러선물
307.10
204.73
102.37
0.00
-102.37
-204.73
0.00
284.35
568.70
853.05
1,137.40
1,421.75
1,706.10
1,990.45
순익(백만)


-409.46
가격


NGK7-NATURAL GAS FUTR MAY17
1,087.02
724.68
362.34
0.00
-362.34
-724.68
-1,087.02
-1,449.37
0.00
0.78
1.56
2.33
3.11
3.89
4.67
5.44
순익(백만)
가격


XBK7-GASOLINE RBOB FUT MAY17
573.93
382.62
191.31
0.00
-191.31
-382.62
-573.93
-765.25
0.00
0.45
0.89
1.34
1.78
2.23
2.67
3.12
순익(백만)
가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLK7	WTI CRUDE FUTURE MAY17	98
COK7	BRENT CRUDE FUTR MAY17	148
HOK7	NY Harb ULSD Fut MAY17	57
KR4175M20(	2017-02 달러선물	33
NGK7	NATURAL GAS FUTR MAY17	116
XBK7	GASOLINE RBOB FUT MAY17	61

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

1,067

공시일	2017-02-15
기준일	2017-02-14

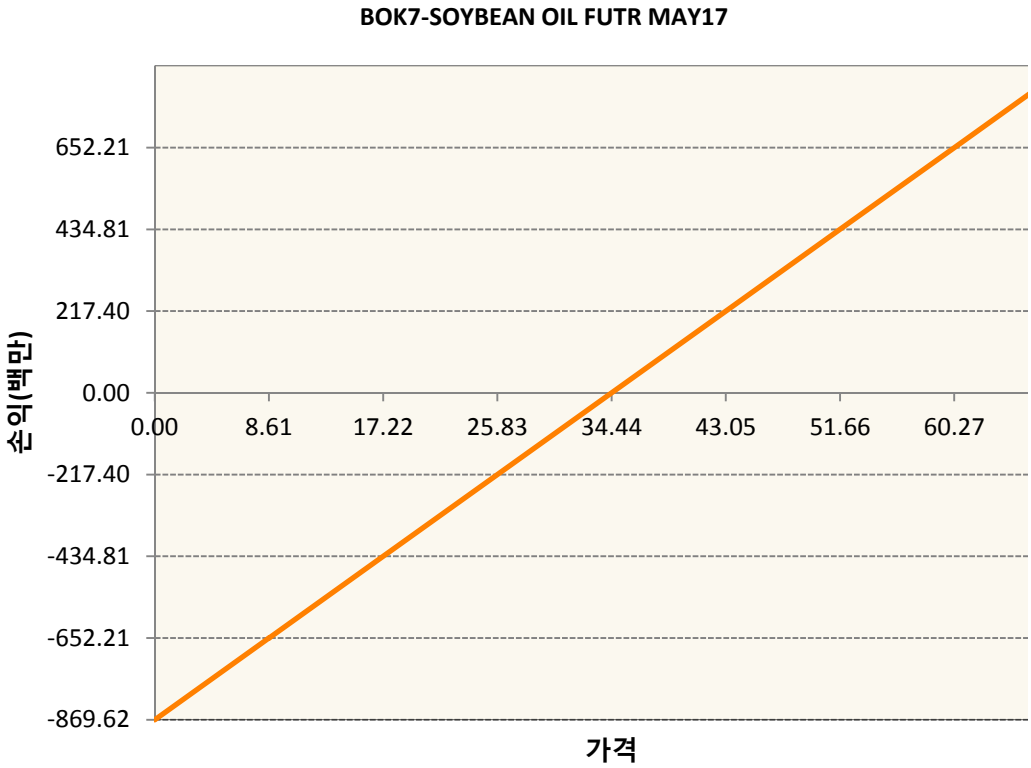
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

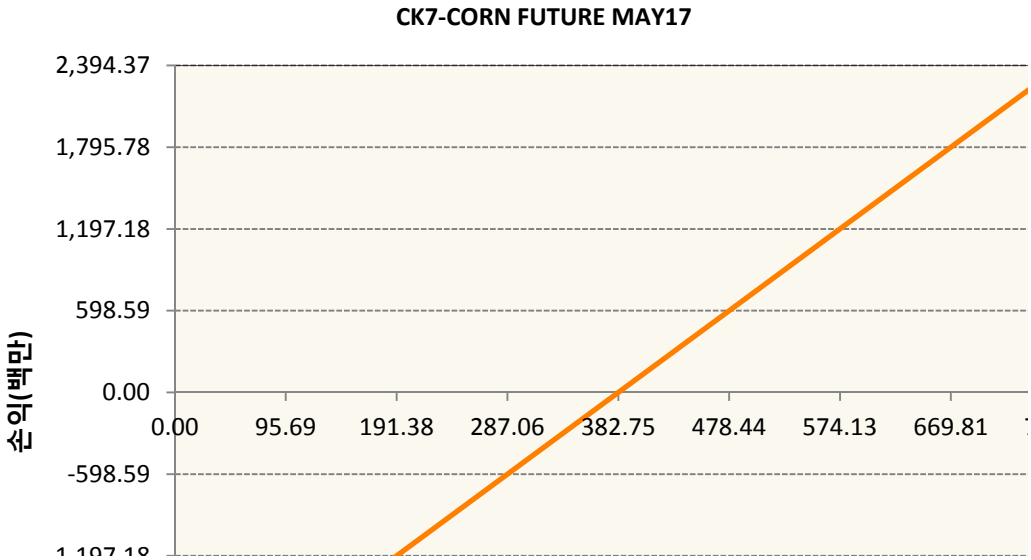
1. 계약금액

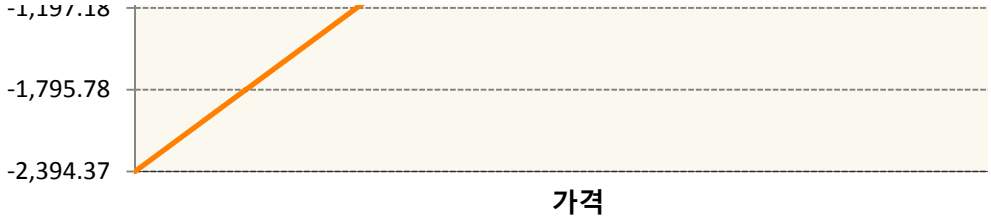
(단위:백만원)

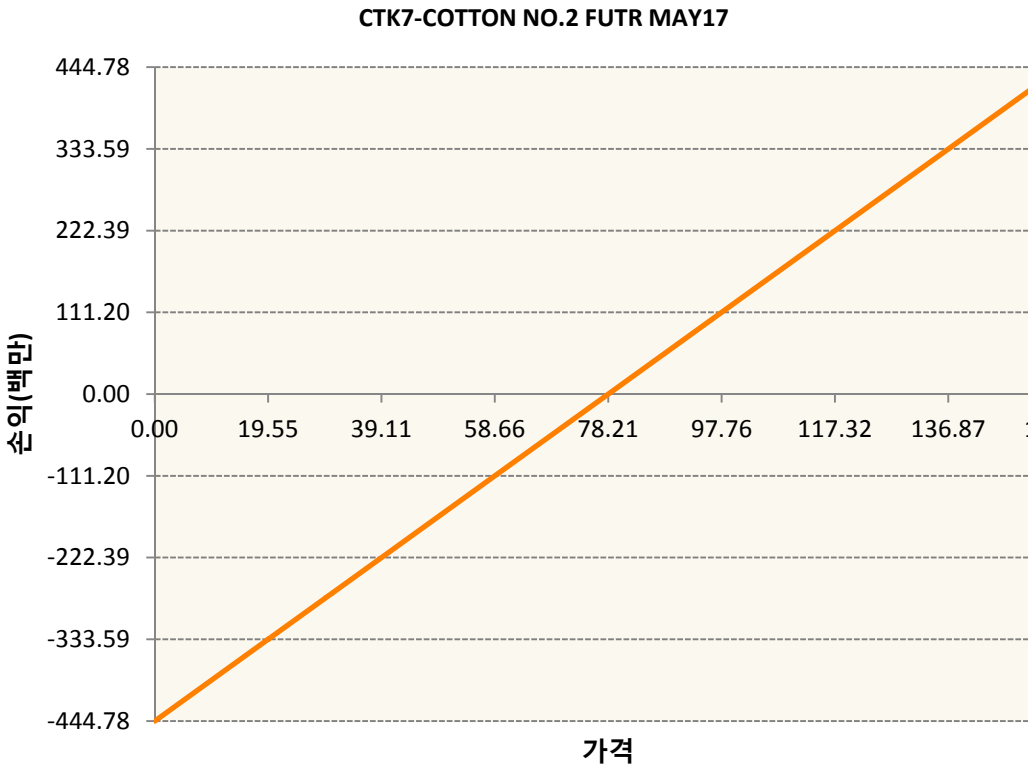
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	9,954	569	9,385	

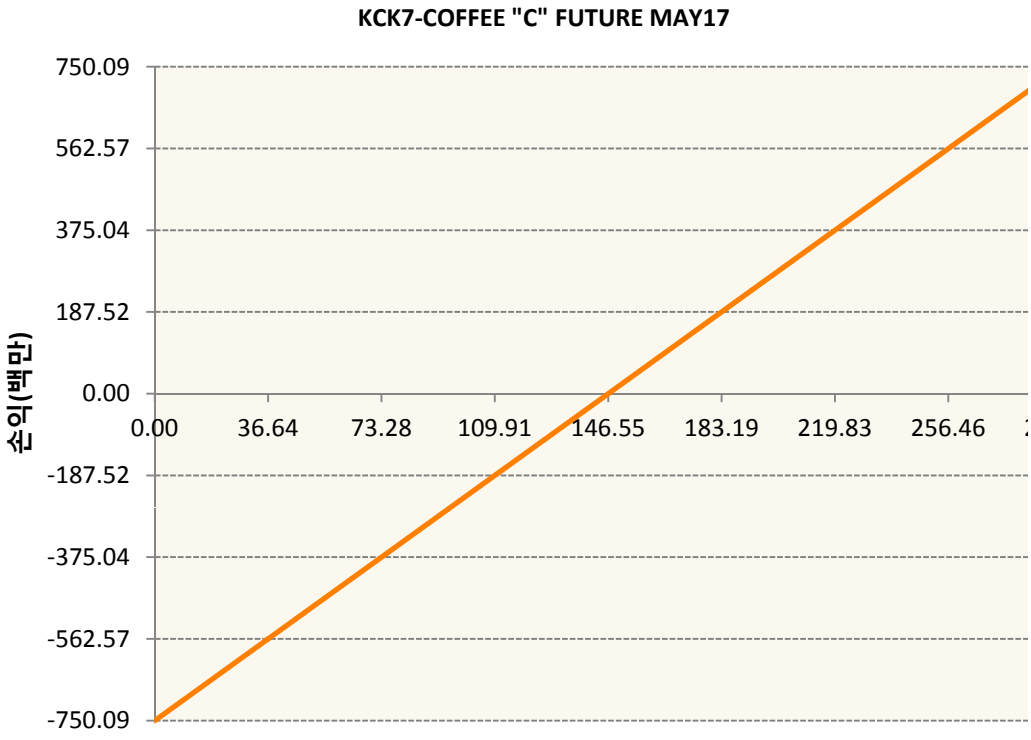
2. 만기시점의 손익구조



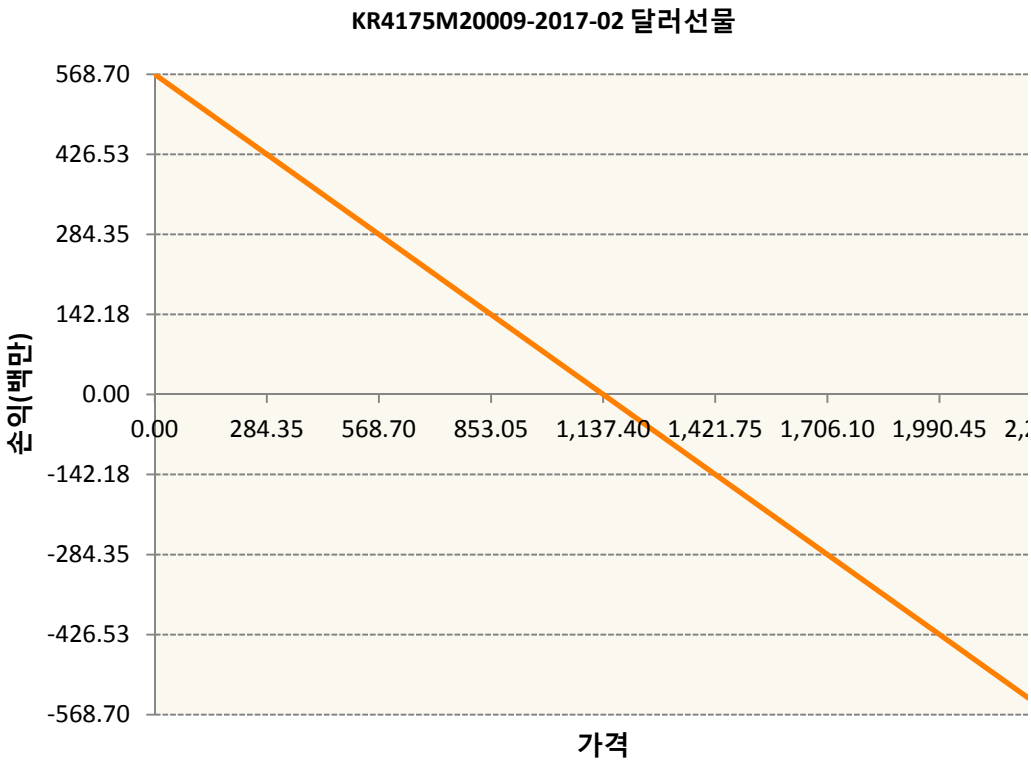


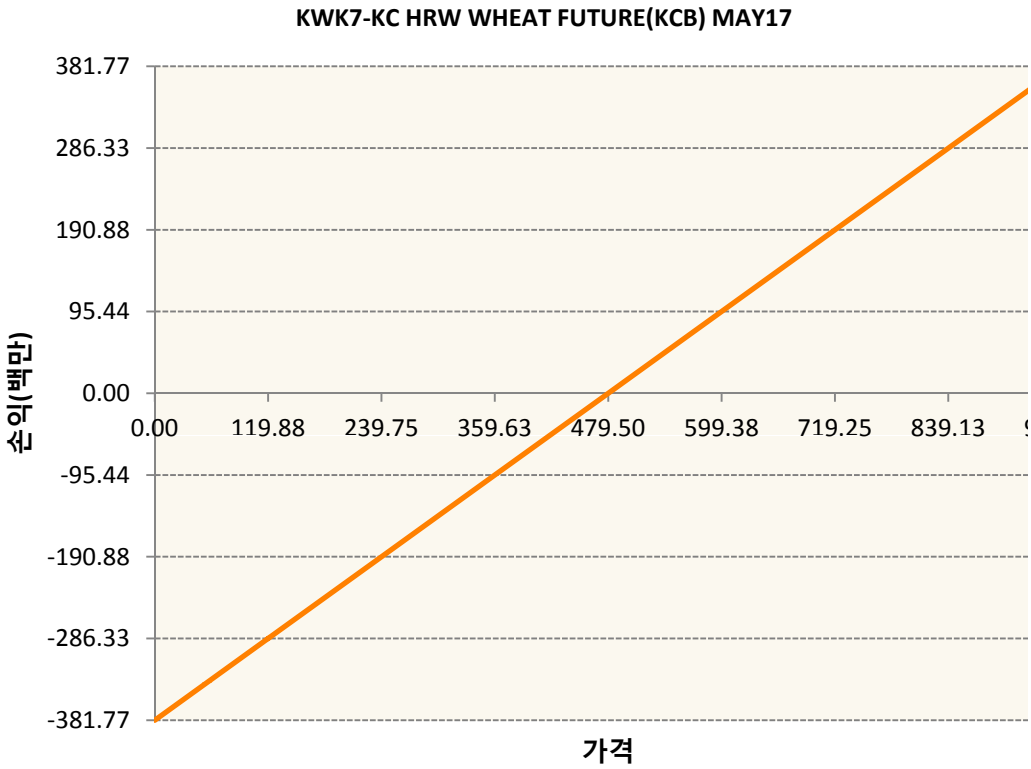

-1,795.78
-2,394.37
가격

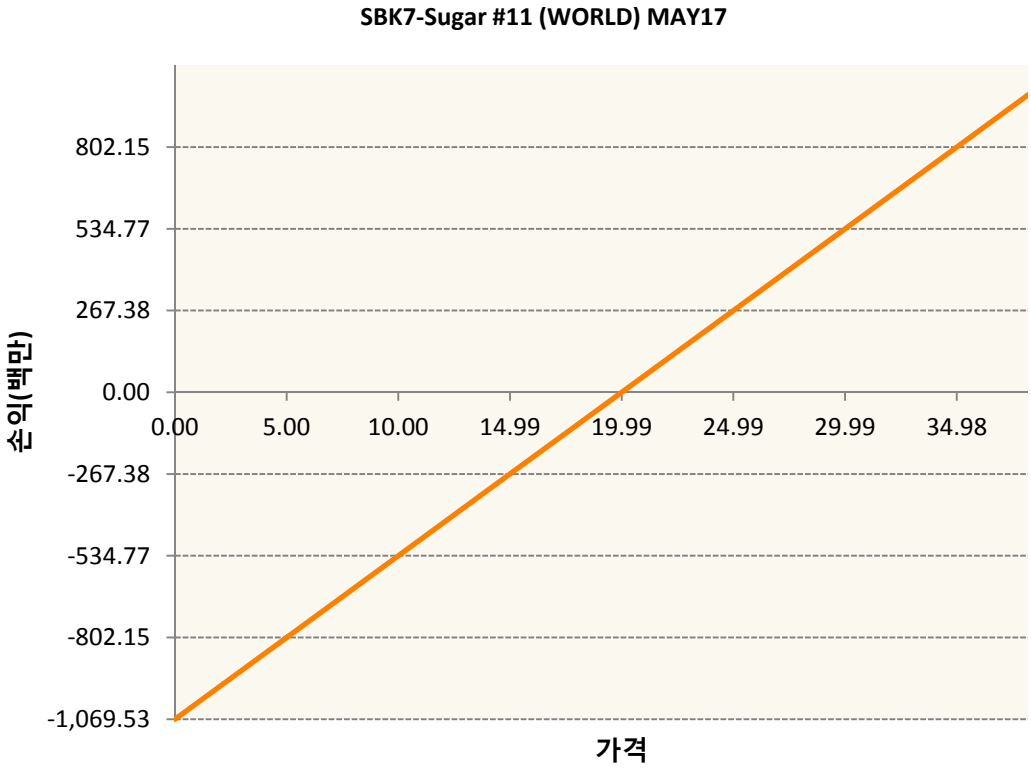

CTK7-COTTON NO.2 FUTR MAY17
444.78
333.59
222.39
111.20
0.00
-111.20
-222.39
-333.59
-444.78
0.00
19.55
39.11
58.66
78.21
97.76
117.32
136.87
순익(백만)
가격

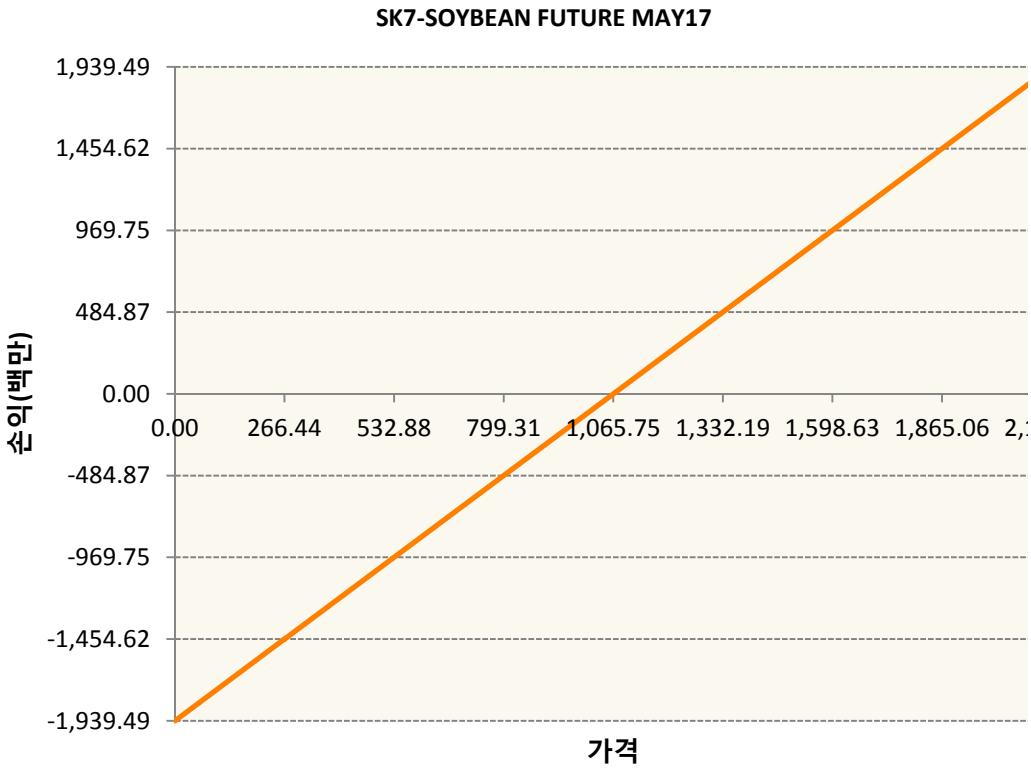

KCK7-COFFEE "C" FUTURE MAY17
750.09
562.57
375.04
187.52
0.00
-187.52
-375.04
-562.57
-750.09
0.00
36.64
73.28
109.91
146.55
183.19
219.83
256.46
순익(백만)

가격

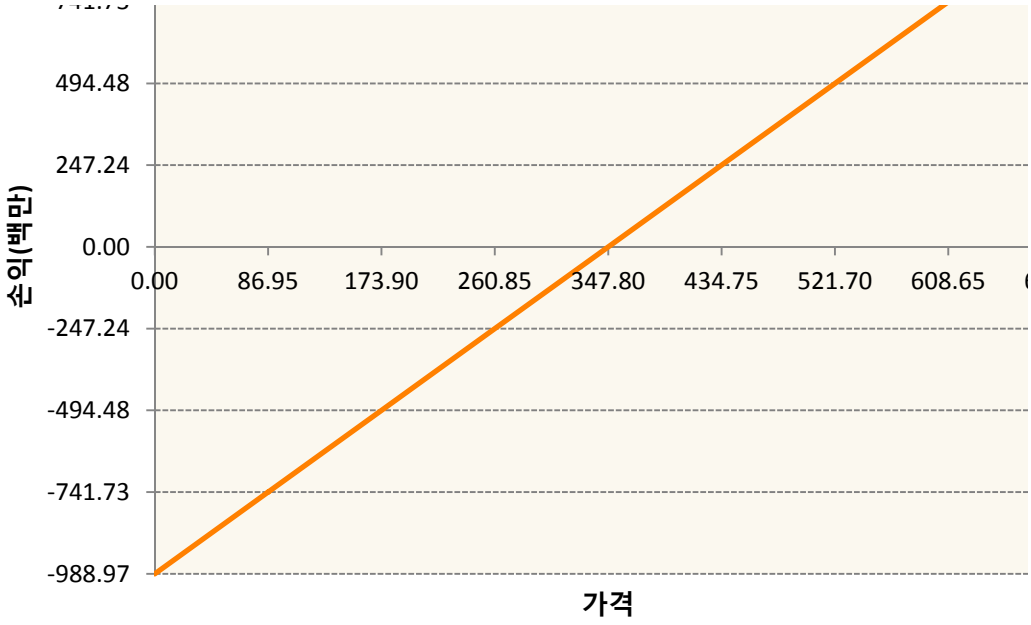

KR4175M20009-2017-02 달러선물
568.70
426.53
284.35
142.18
0.00
-142.18
-284.35
-426.53
-568.70
0.00
284.35
568.70
853.05
1,137.40
1,421.75
1,706.10
1,990.45
손익(백만)
가격

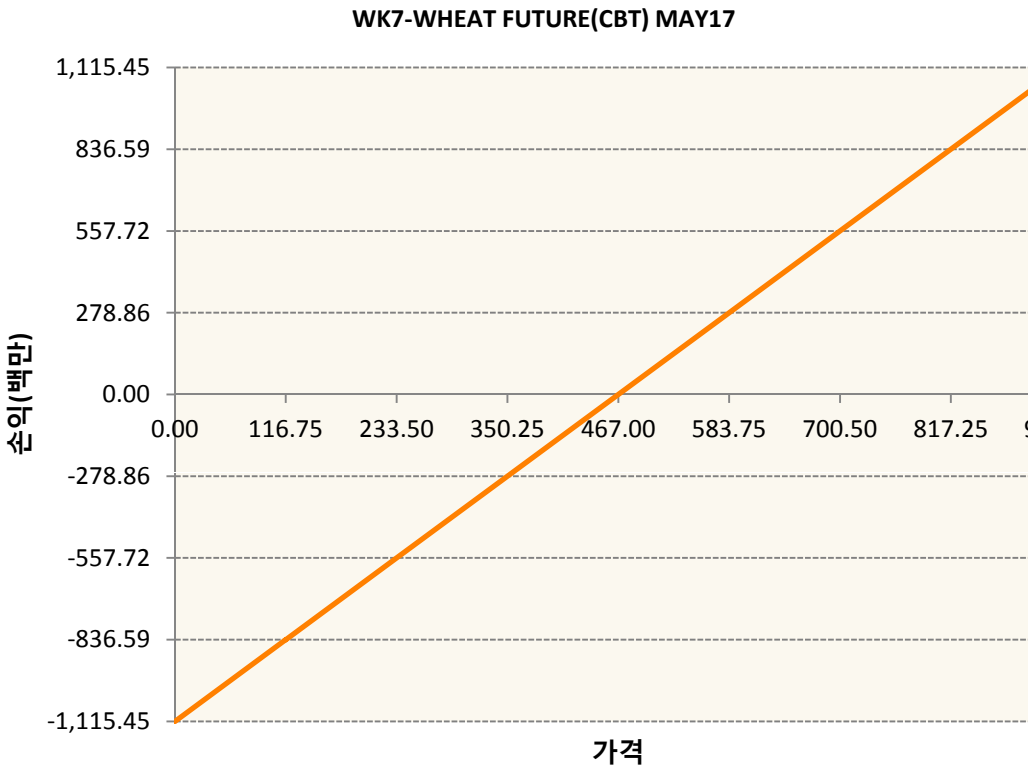

KWK7-KC HRW WHEAT FUTURE(KCB) MAY17
381.77
286.33
190.88
95.44
0.00
-95.44
-190.88
-286.33
-381.77
0.00
119.88
239.75
359.63
479.50
599.38
719.25
839.13
손익(백만)
가격


SBK7-Sugar #11 (WORLD) MAY17
802.15
534.77
267.38
0.00
-267.38
-534.77
-802.15
-1,069.53
손익(백만)
0.00
5.00
10.00
14.99
19.99
24.99
29.99
34.98
가격


SK7-SOYBEAN FUTURE MAY17
1,939.49
1,454.62
969.75
484.87
0.00
-484.87
-969.75
-1,454.62
-1,939.49
손익(백만)
0.00
266.44
532.88
799.31
1,065.75
1,332.19
1,598.63
1,865.06
가격


SMK7-SOYBEAN MEAL FUTR MAY17
988.97
741.73





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

BOK7	SOYBEAN OIL FUTR MAY17	70
CK7	CORN FUTURE MAY17	192
CTK7	COTTON NO.2 FUTR MAY17	36
KCK7	COFFEE "C" FUTURE MAY17	60
KR4175M20(	2017-02 달러선물	45

KWK7	KC HRW WHEAT FUTURE(KCB) MAY17	31
SBK7	Sugar #11 (WORLD) MAY17	86
SK7	SOYBEAN FUTURE MAY17	155
SMK7	SOYBEAN MEAL FUTR MAY17	79
WK7	WHEAT FUTURE(CBT) MAY17	89

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

937