공시일	2017-02-16
기준일	2017-02-15

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	2017-02-16
기준일	2017-02-15

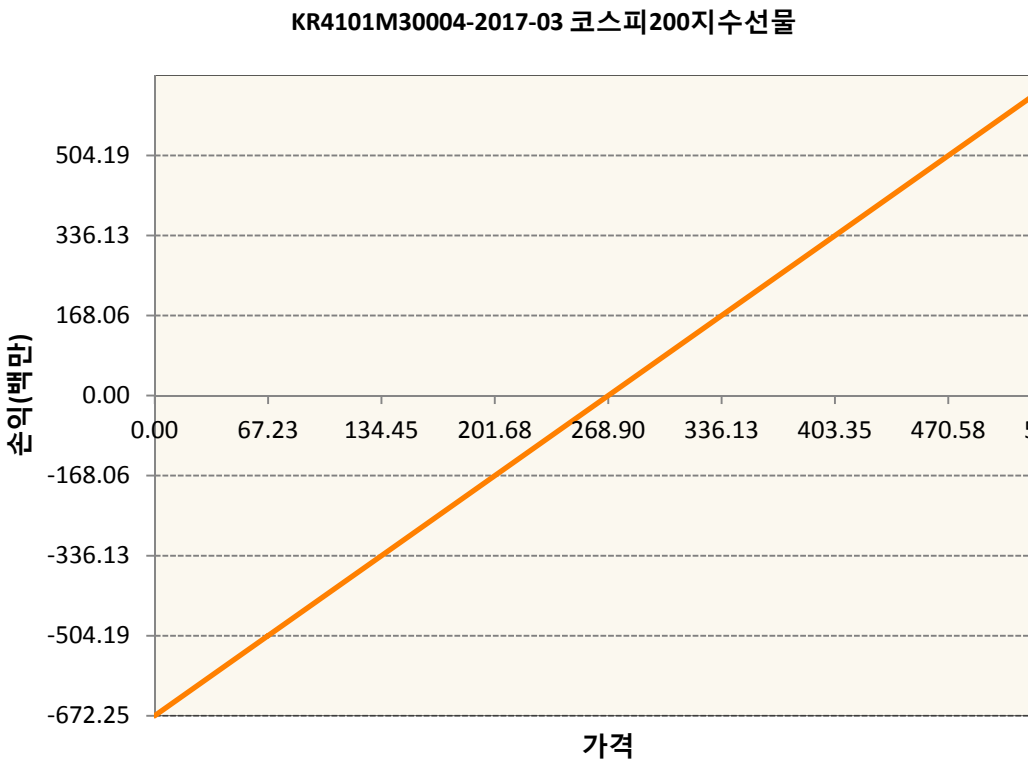
스마트인덱스모

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	2017-02-16
기준일	2017-02-15

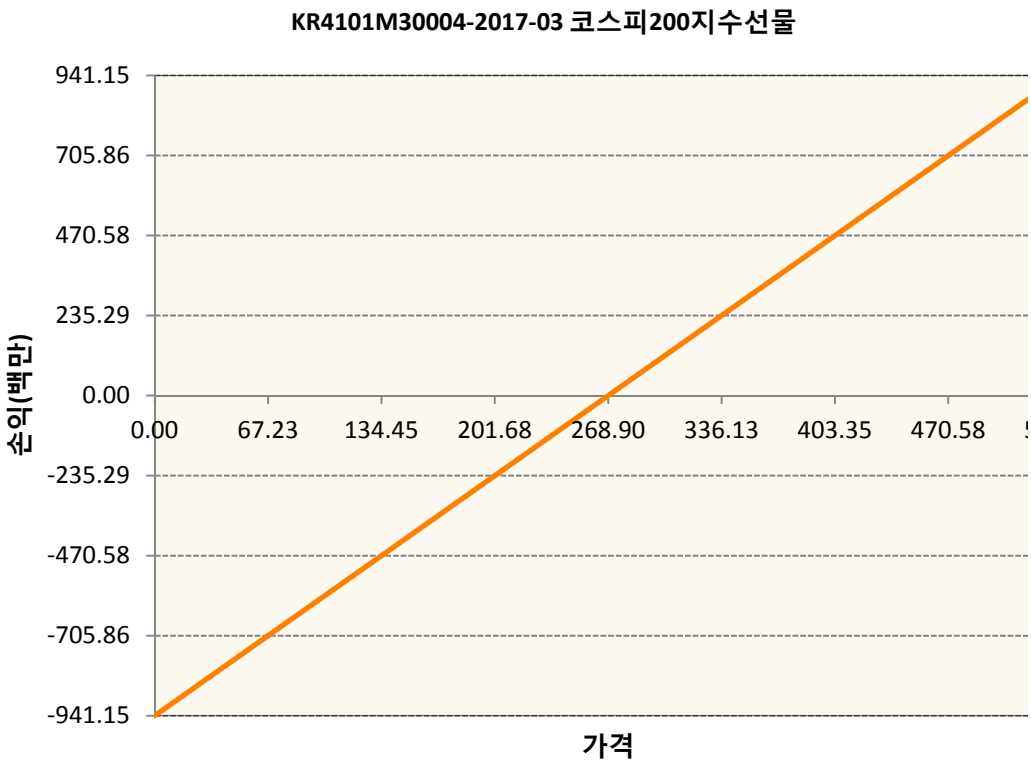
스마트레버리지목표전환형1호

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	2017-02-16
기준일	2017-02-15

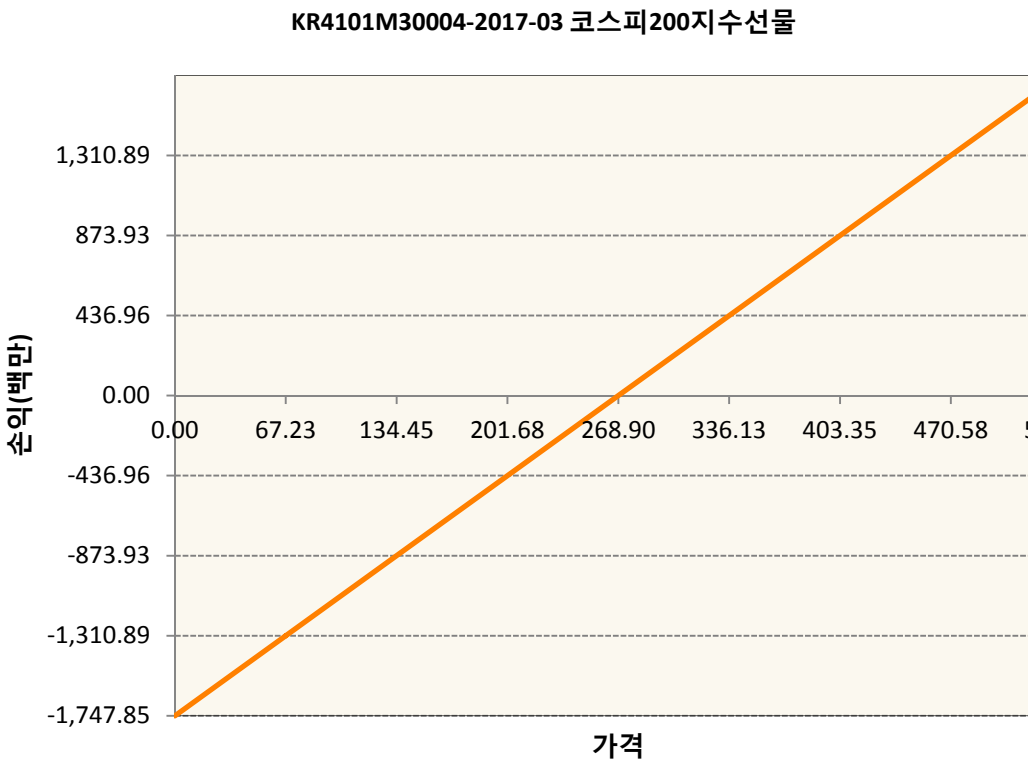
1.3배 레버리지 인덱스(주식-파생형)

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)

91

공시일	2017-02-16
기준일	2017-02-15

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)

620

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-02-16
기준일	2017-02-15

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	384

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

542

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-02-16
기준일	2017-02-15

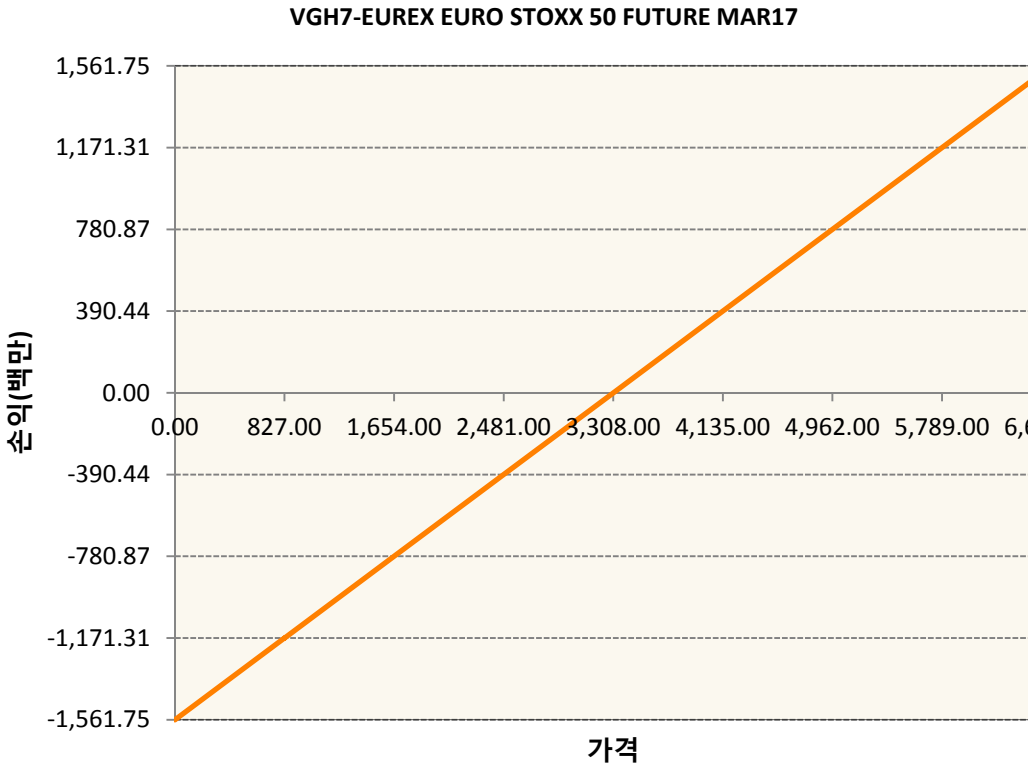
유로인덱스모(주식-파생형)

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	2017-02-16
기준일	2017-02-15

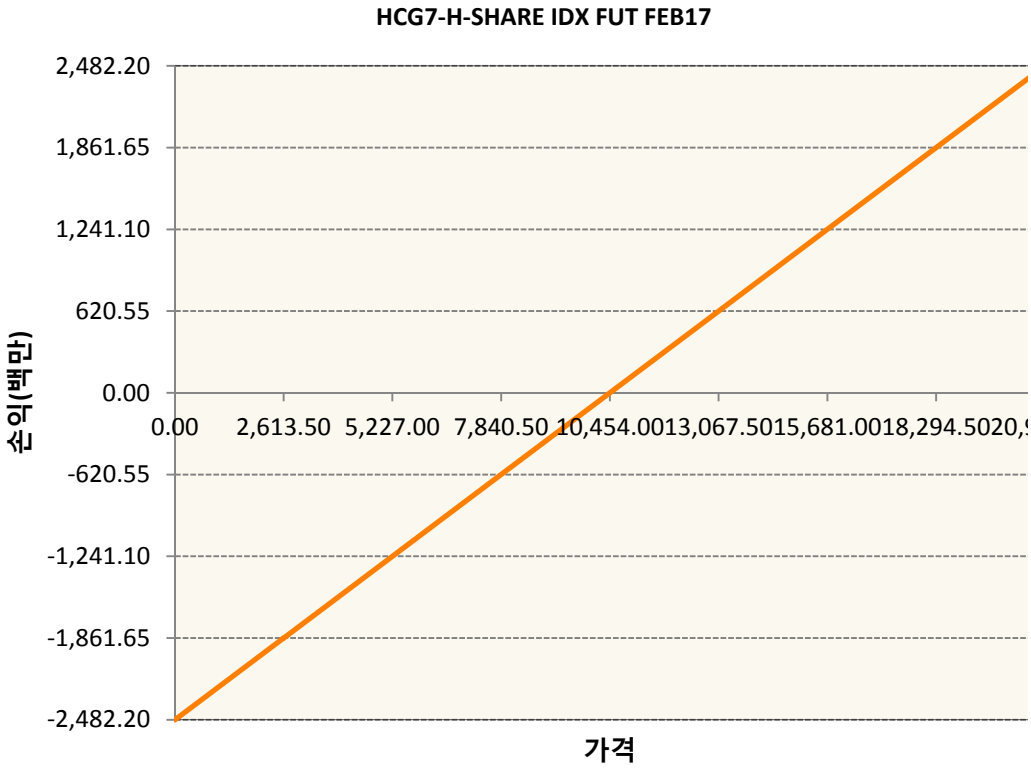
차이나인덱스모(주식-파생형)

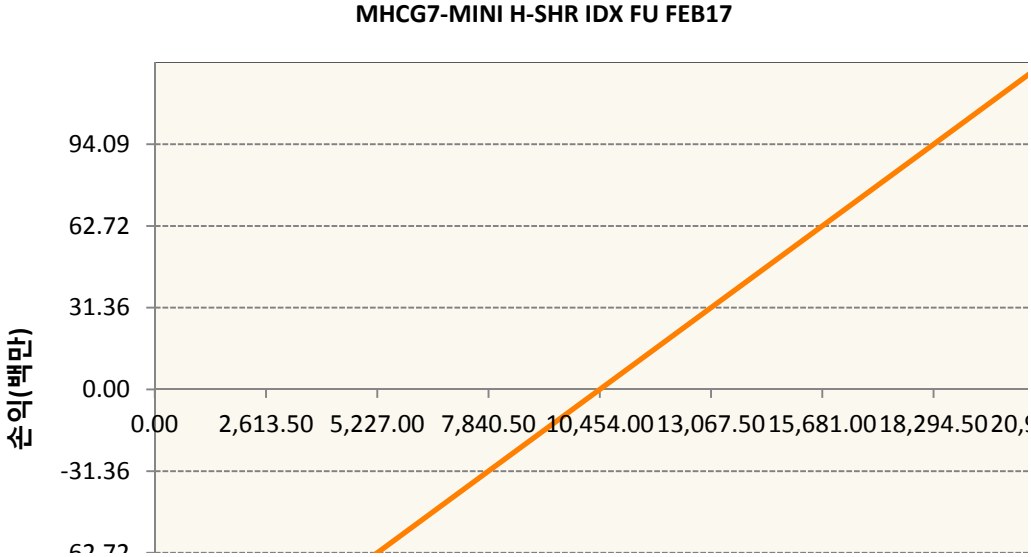
1. 계약금액

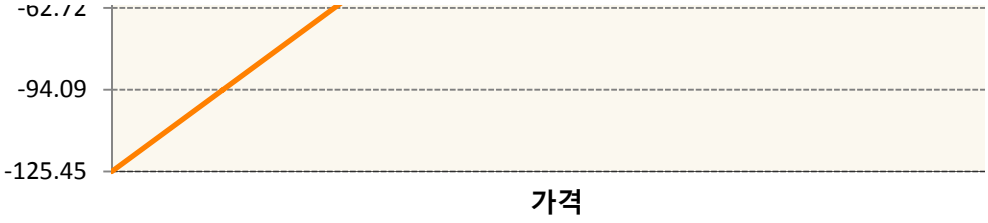
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,608	0	2,608	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCG7	H-SHARE IDX FUT FEB17	199
MHCG7	MINI H-SHR IDX FU FEB17	10

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	243

공시일	2017-02-16
기준일	2017-02-15

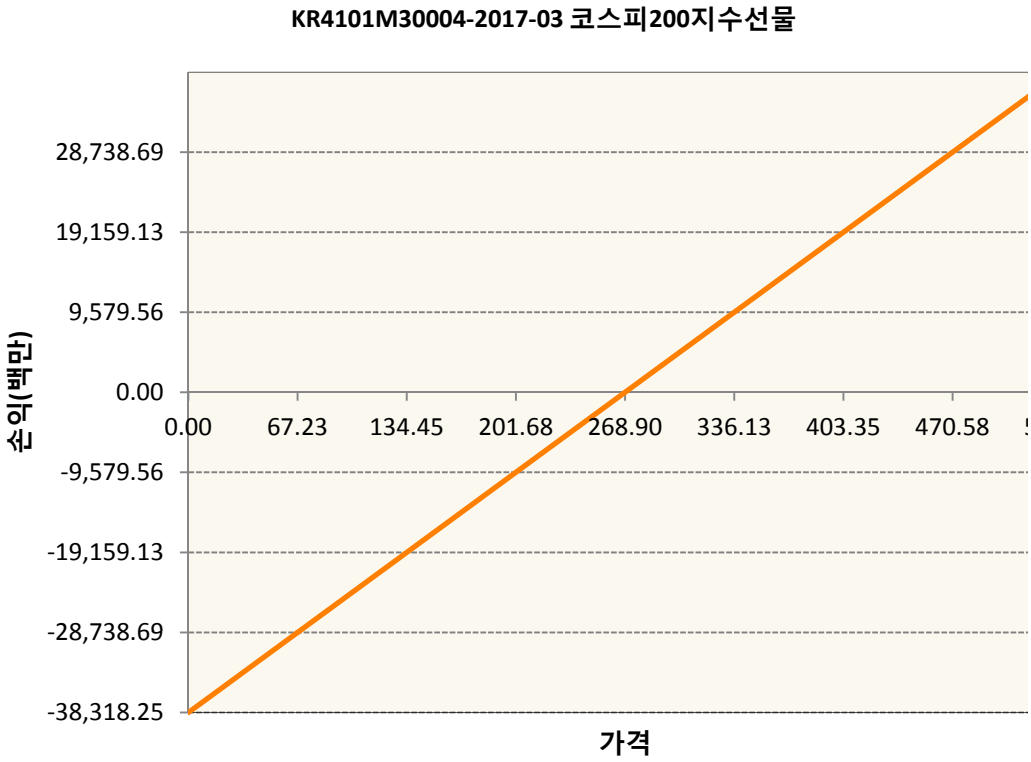
커버드콜모(주식혼합-파생형)

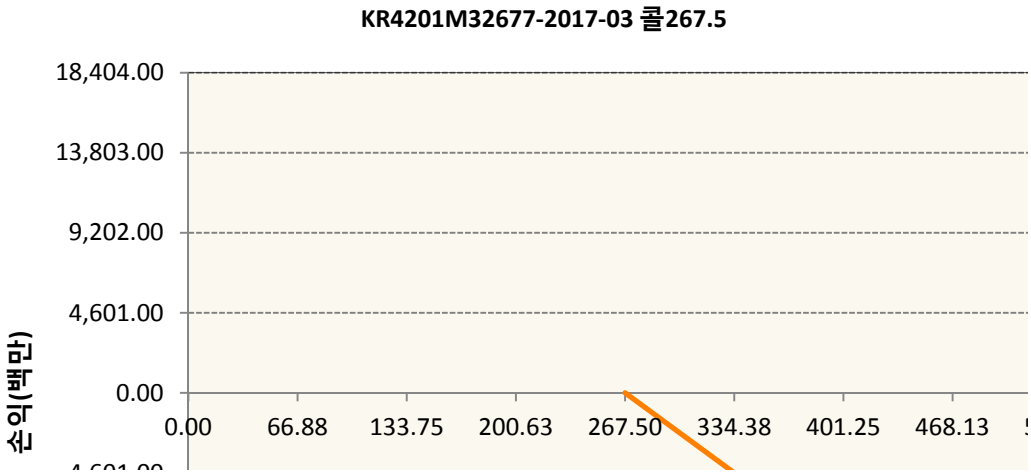
1. 계약금액

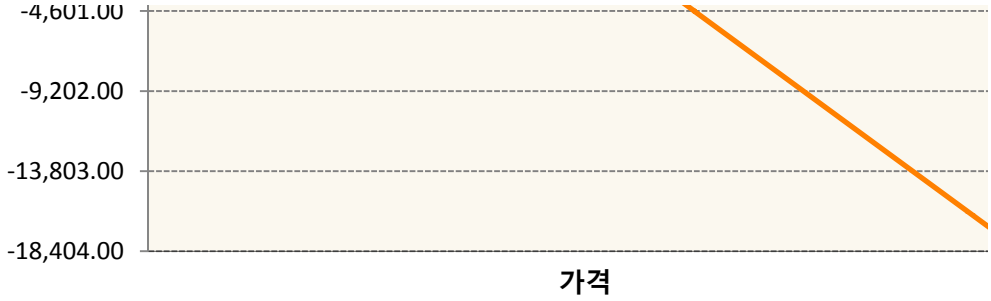
(단위:백만원)

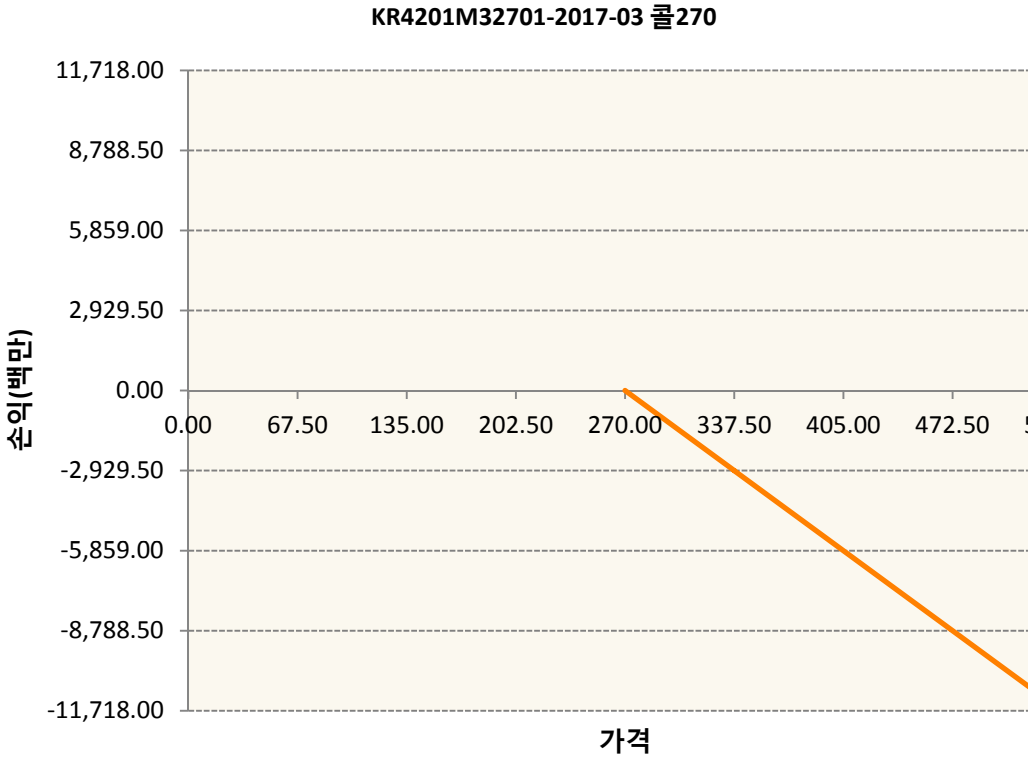
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	38,318	0	38,318	장내
누계	유가증권	옵션	0	30,122	-30,122	장내

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							6,702
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,146	1,146	1,146	1,146	1,145	1,144	1,142
-5.33%	1,145	1,142	1,137	1,129	1,118	1,104	1,086
-2.67%	1,053	1,014	971	923	872	818	762
0%	219	147	73	0	-74	-148	-222
2.67%	-1,802	-1,823	-1,850	-1,881	-1,917	-1,957	-2,001
5.33%	-4,235	-4,236	-4,239	-4,243	-4,249	-4,258	-4,271
8.00%	-6,698	-6,698	-6,699	-6,699	-6,699	-6,700	-6,702
KR4201M32: 2017-03 콜270							3,960
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	452	452	452	452	452	452	451
-5.33%	452	452	451	449	446	441	435
-2.67%	433	421	405	385	363	339	312
0%	140	93	47	0	-47	-94	-141
2.67%	-908	-933	-962	-993	-1,026	-1,061	-1,098
5.33%	-2,402	-2,404	-2,408	-2,415	-2,423	-2,434	-2,448
8.00%	-3,954	-3,954	-3,954	-3,955	-3,956	-3,957	-3,960

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

15,149

공시일	2017-02-16
기준일	2017-02-15

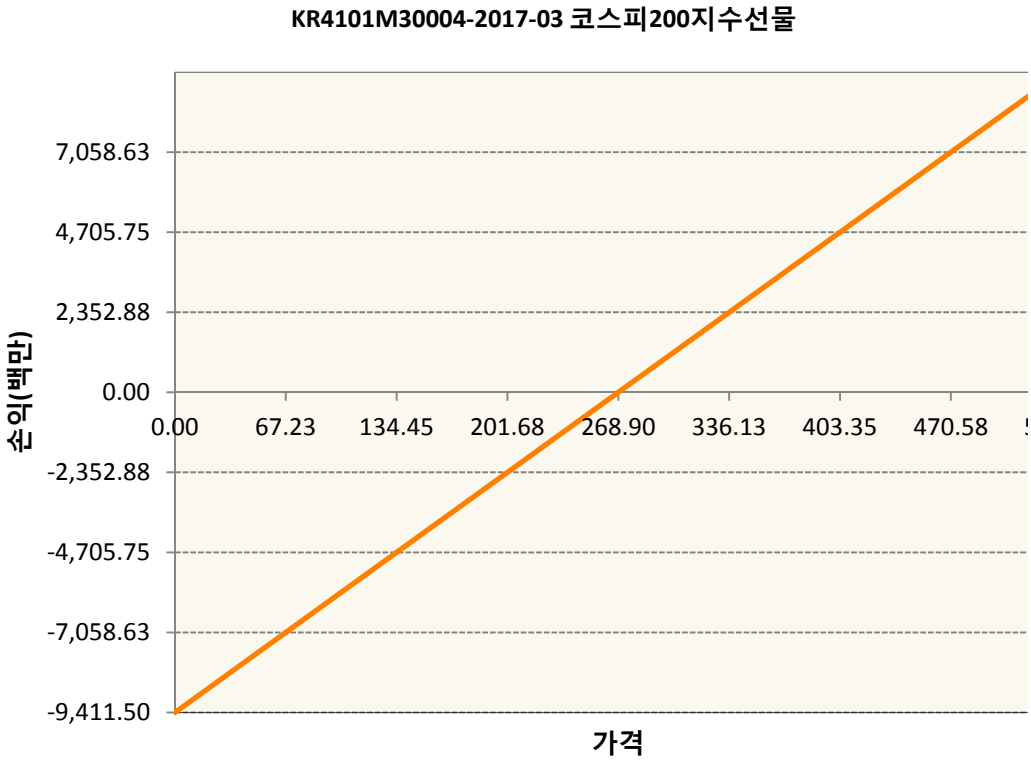
커버드콜목표전환형증권투자신탁

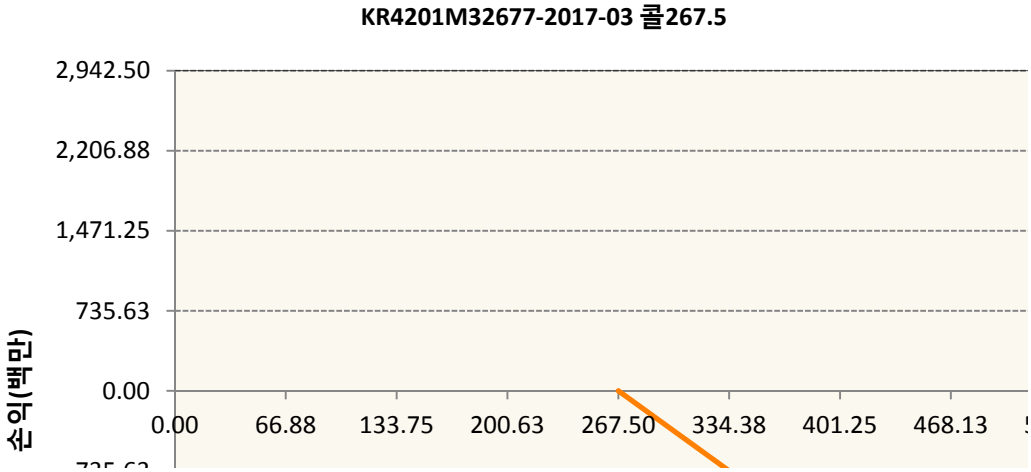
1. 계약금액

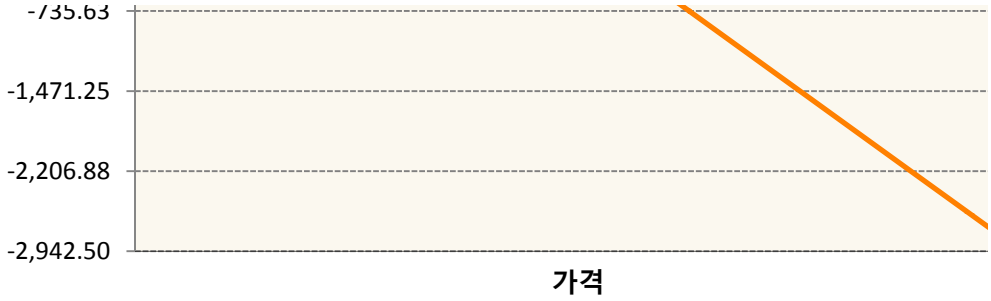
(단위:백만원)

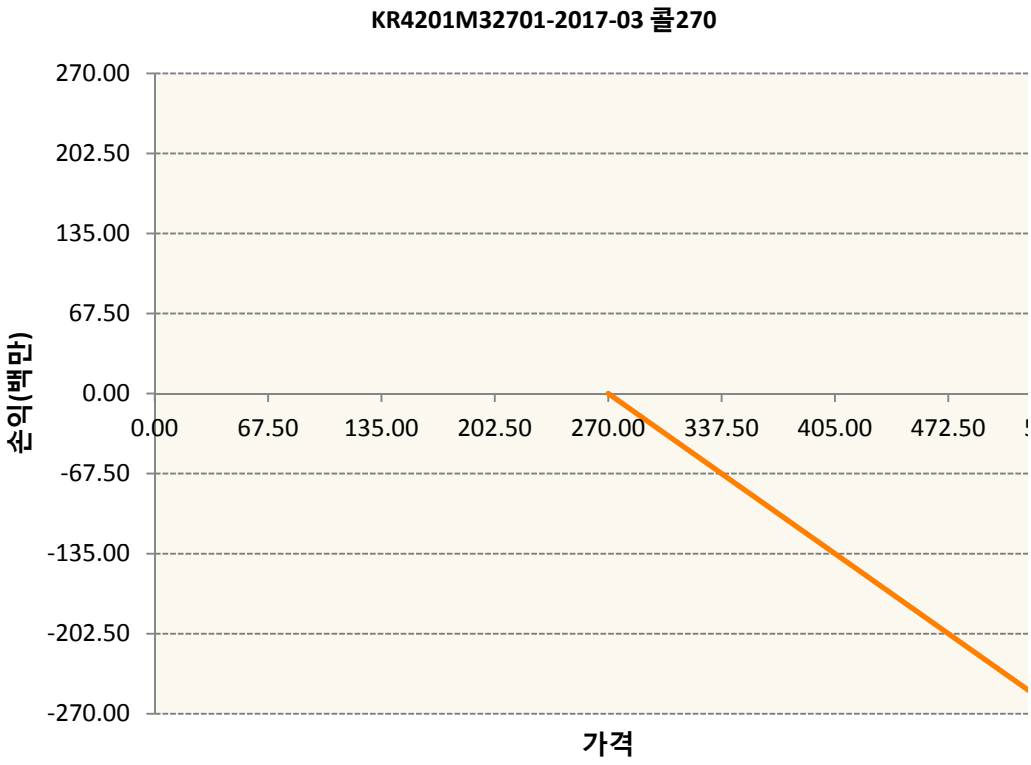
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	9,412	0	9,412	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,213	-3,213	장내

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							1,072
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	183	183	183	183	183	183	183
-5.33%	183	183	182	181	179	177	174
-2.67%	168	162	155	148	139	131	122
0%	35	23	12	0	-12	-24	-35
2.67%	-288	-292	-296	-301	-307	-313	-320
5.33%	-677	-677	-678	-678	-679	-681	-683
8.00%	-1,071	-1,071	-1,071	-1,071	-1,071	-1,071	-1,072
	KR4201M32 2017-03 콜270						91

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	10	10	10	10	10	10	10
-5.33%	10	10	10	10	10	10	10
-2.67%	10	10	9	9	8	8	7
0%	3	2	1	0	-1	-2	-3
2.67%	-21	-22	-22	-23	-24	-24	-25
5.33%	-55	-55	-55	-56	-56	-56	-56
8.00%	-91	-91	-91	-91	-91	-91	-91

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

1,943

공시일	2017-02-16
기준일	2017-02-15

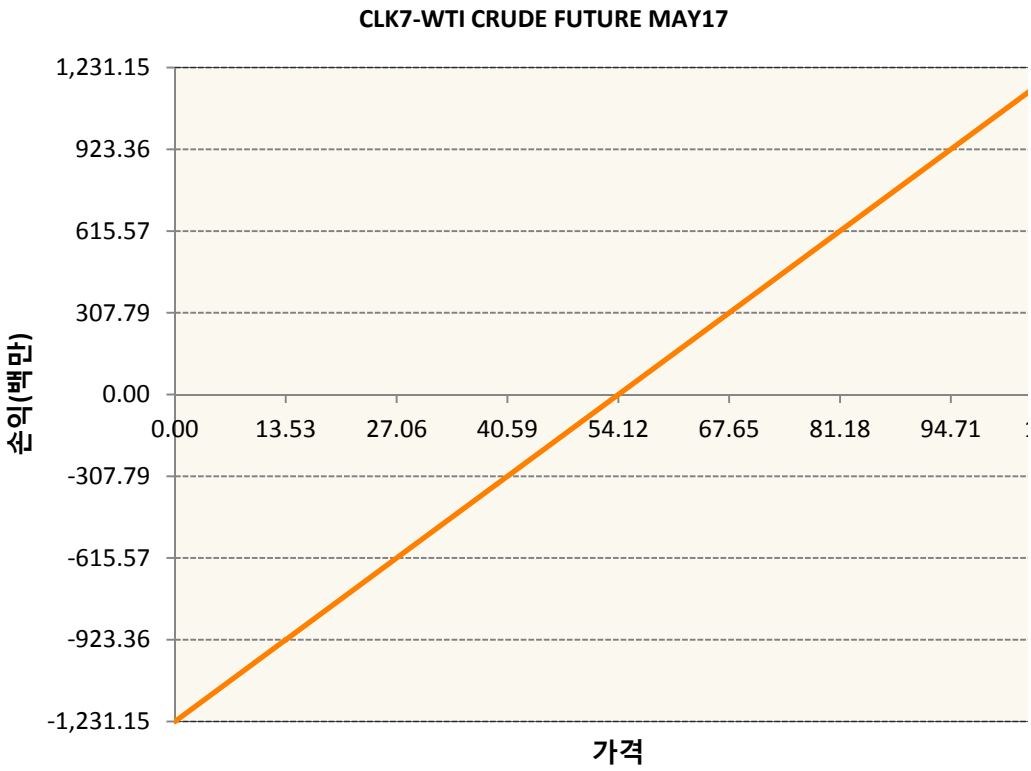
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

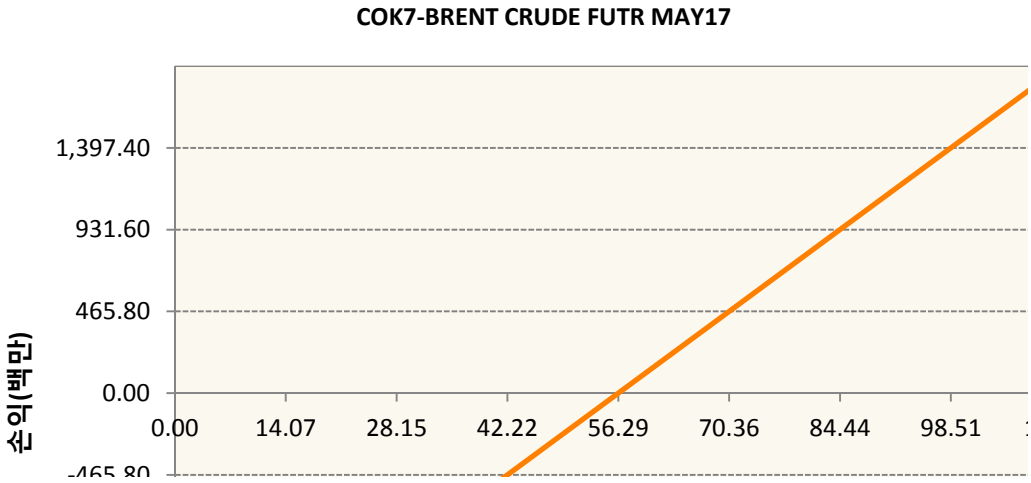
1. 계약금액

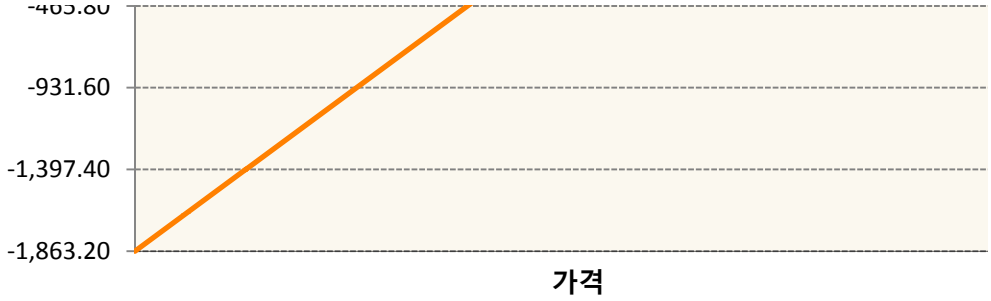
(단위:백만원)

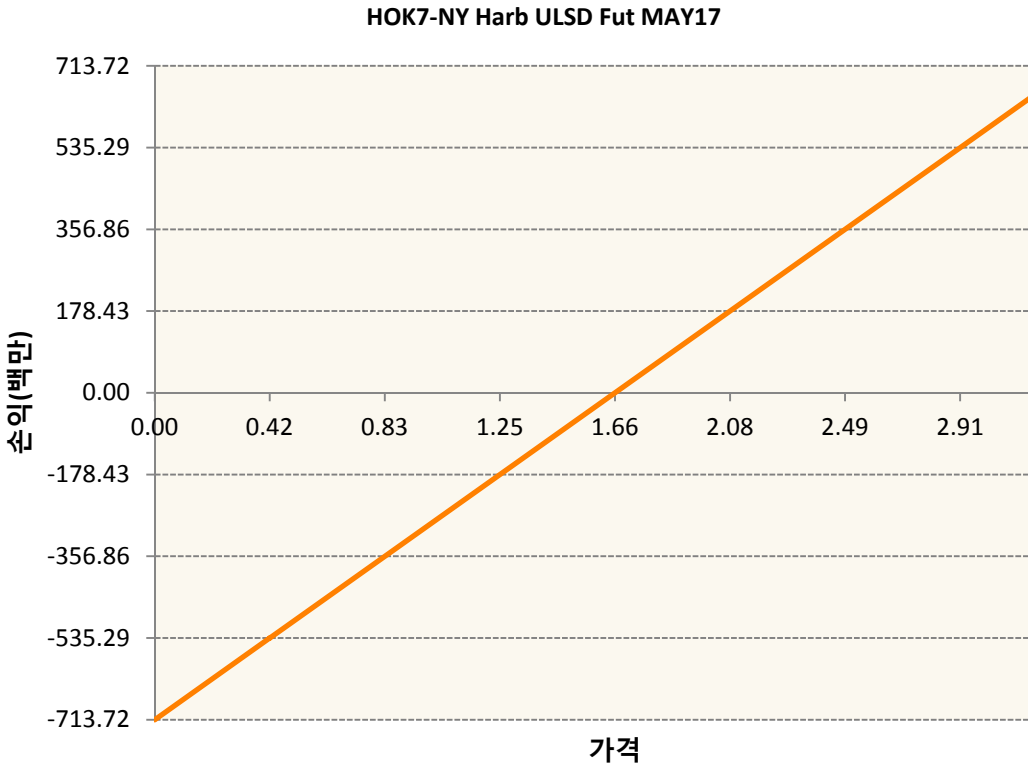
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	선물	유가증권	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	선물	유가증권	1,231	0	1,231	
누계	유가증권	선물	4,783	411	4,372	

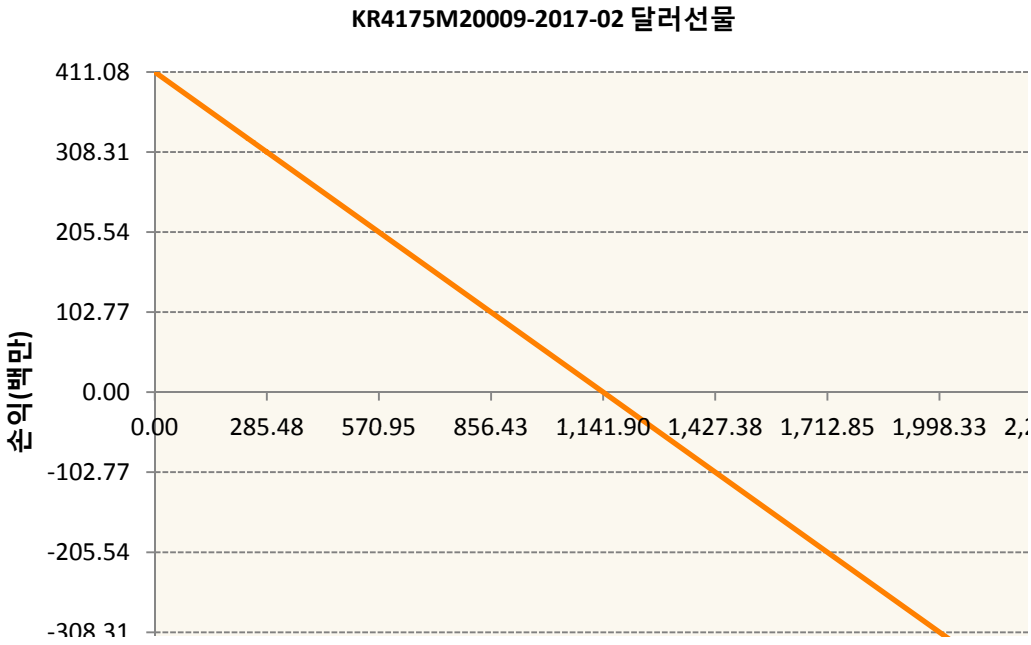
2. 만기시점의 손익구조

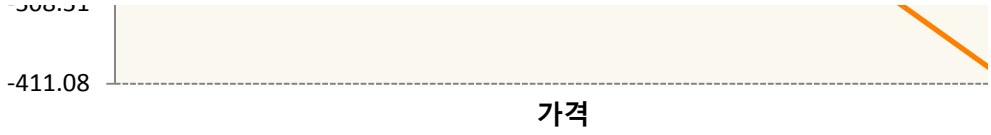


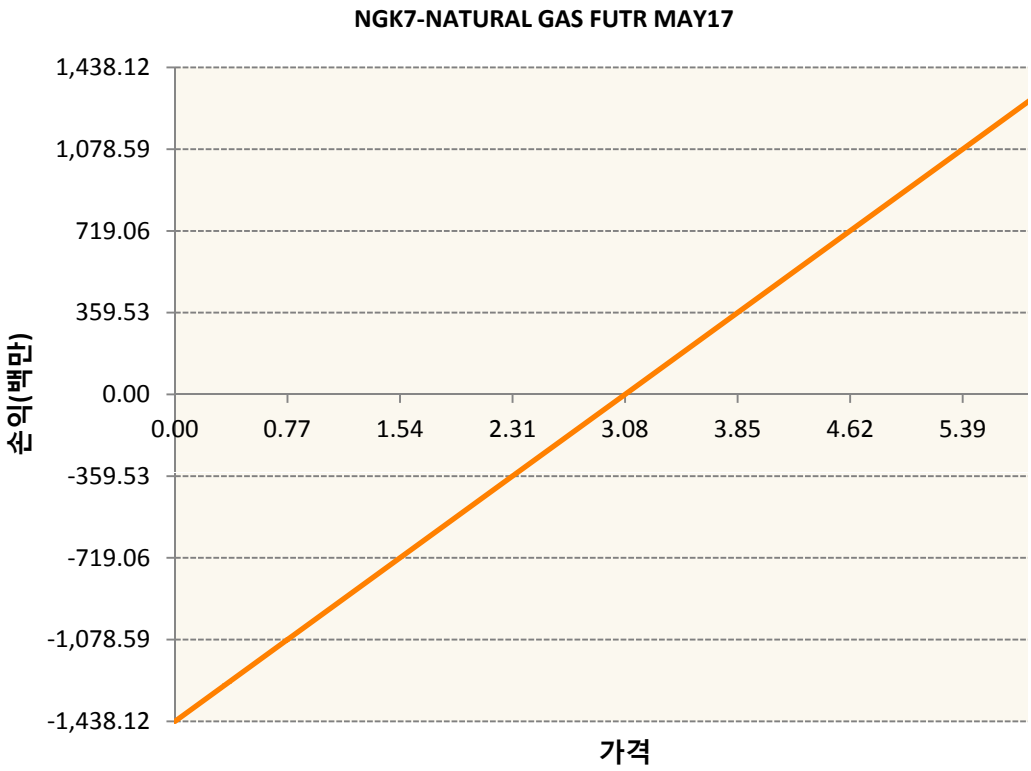


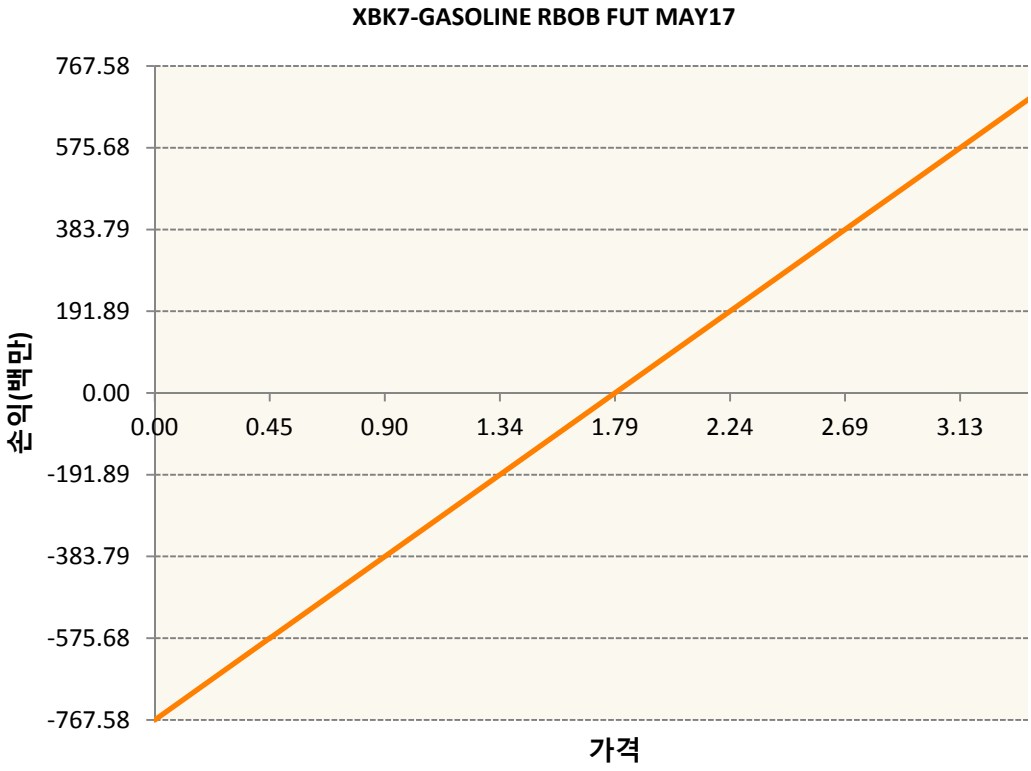

-931.60
-1,397.40
-1,863.20
가격


HOK7-NY Harb ULSD Fut MAY17
713.72
535.29
356.86
178.43
0.00
-178.43
-356.86
-535.29
-713.72
0.00
0.42
0.83
1.25
1.66
2.08
2.49
2.91
순익(백만)
가격


KR4175M20009-2017-02 달러선물
411.08
308.31
205.54
102.77
0.00
-102.77
-205.54
-308.31
0.00
285.48
570.95
856.43
1,141.90
1,427.38
1,712.85
1,998.33
순익(백만)


-411.08
가격


NGK7-NATURAL GAS FUTR MAY17
1,438.12
1,078.59
719.06
359.53
0.00
-359.53
-719.06
-1,078.59
-1,438.12
0.00
0.77
1.54
2.31
3.08
3.85
4.62
5.39
순익(백만)
가격


XBK7-GASOLINE RBOB FUT MAY17
767.58
575.68
383.79
191.89
0.00
-191.89
-383.79
-575.68
-767.58
0.00
0.45
0.90
1.34
1.79
2.24
2.69
3.13
순익(백만)
가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLK7	WTI CRUDE FUTURE MAY17	98
COK7	BRENT CRUDE FUTR MAY17	149
HOK7	NY Harb ULSD Fut MAY17	57
KR4175M20(	2017-02 달러선물	33
NGK7	NATURAL GAS FUTR MAY17	115
XBK7	GASOLINE RBOB FUT MAY17	61

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

1,068

공시일	2017-02-16
기준일	2017-02-15

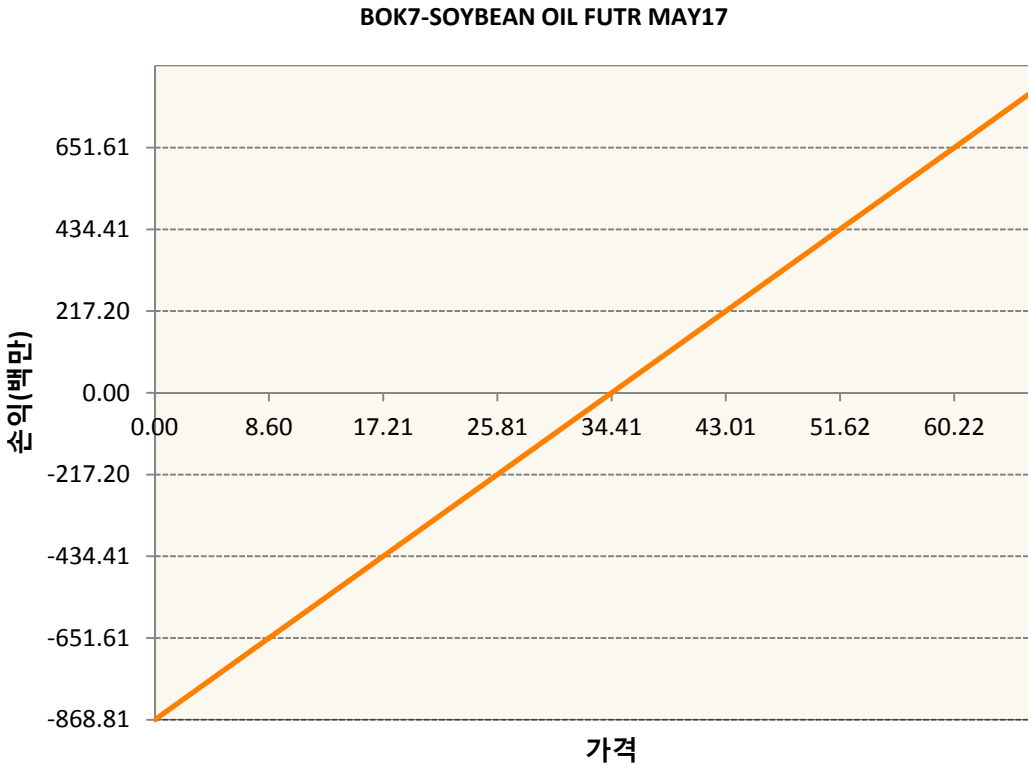
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

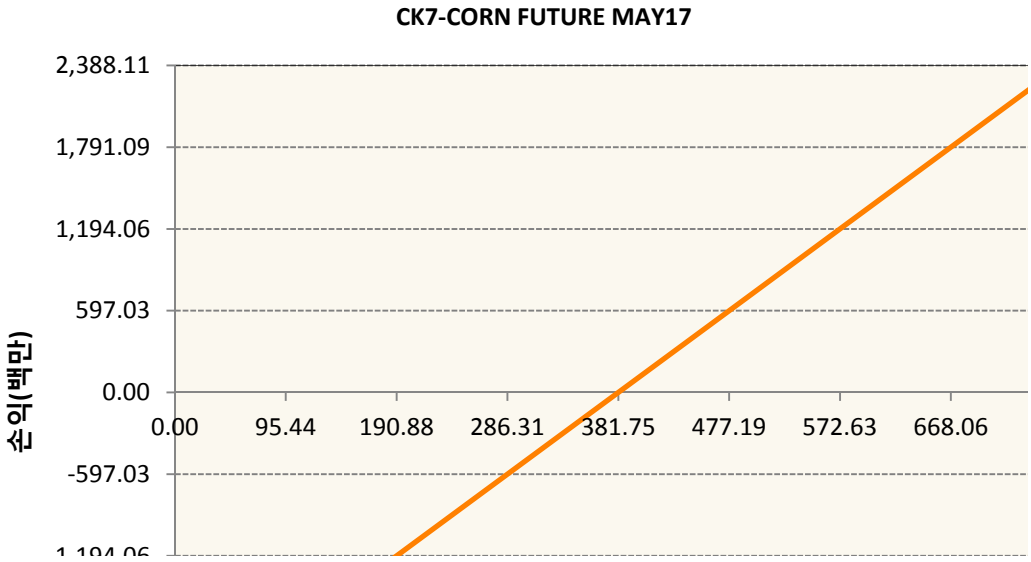
1. 계약금액

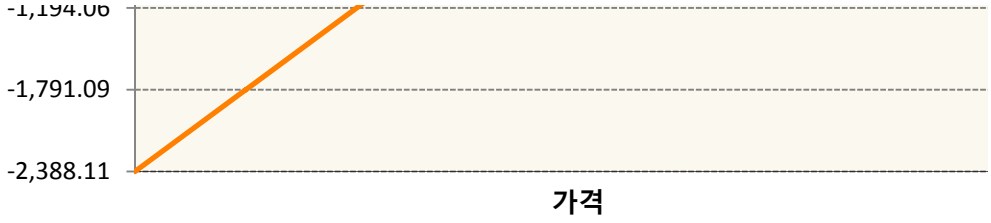
(단위:백만원)

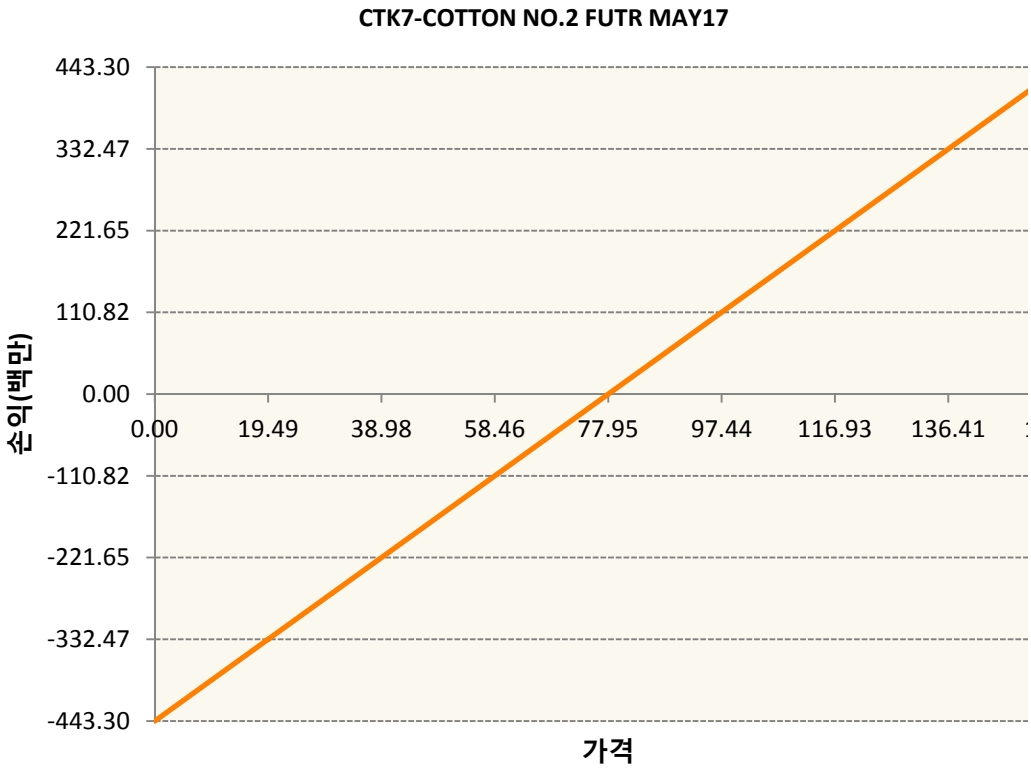
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	9,924	571	9,353	

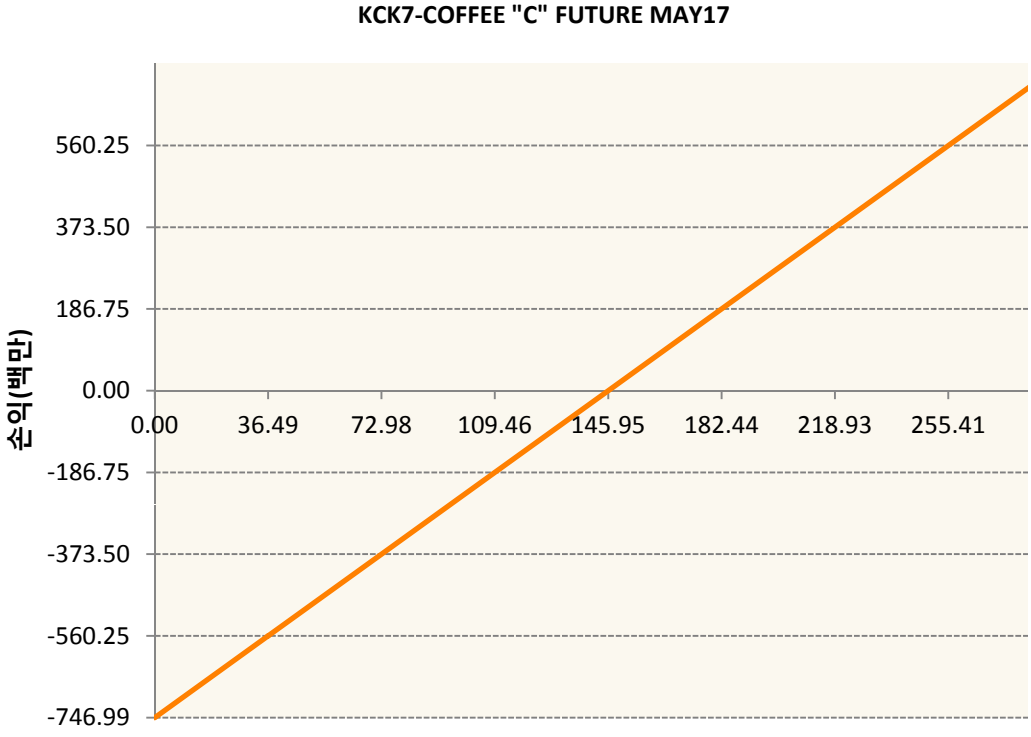
2. 만기시점의 손익구조



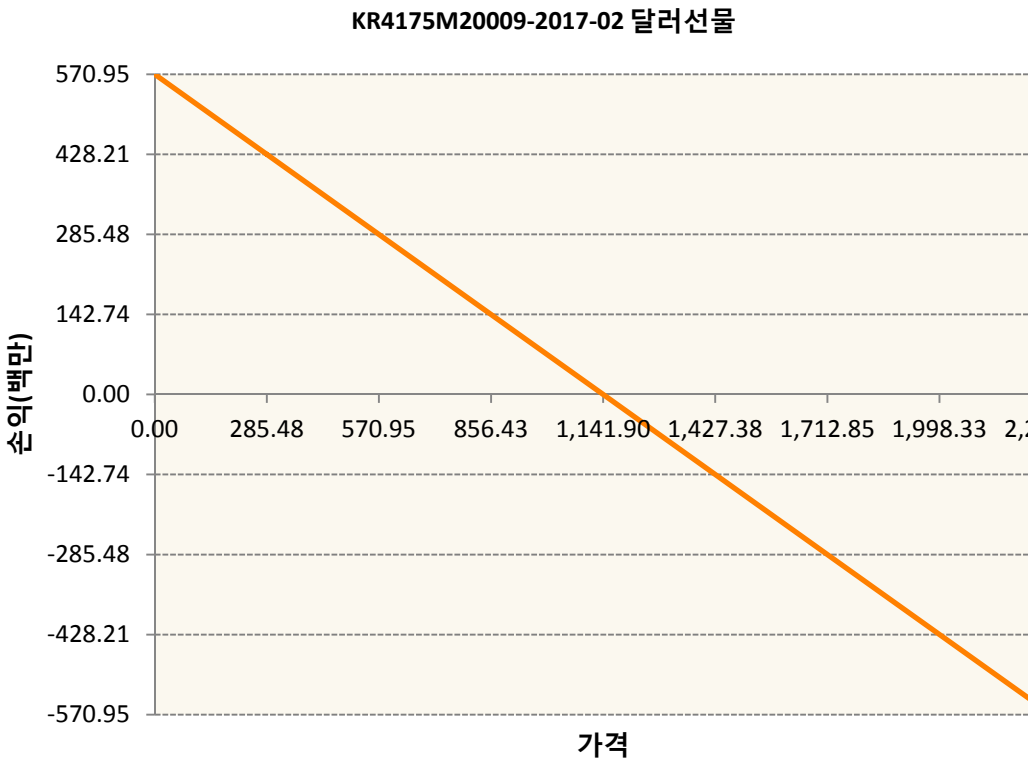


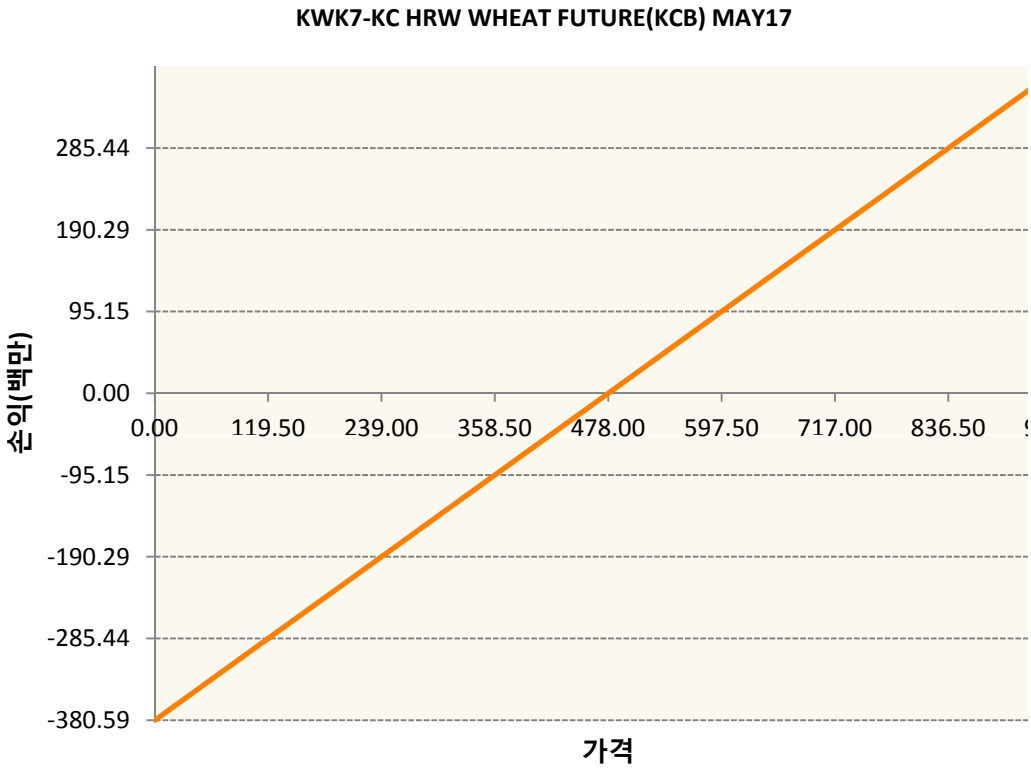

-1,194.06
-1,791.09
-2,388.11
가격

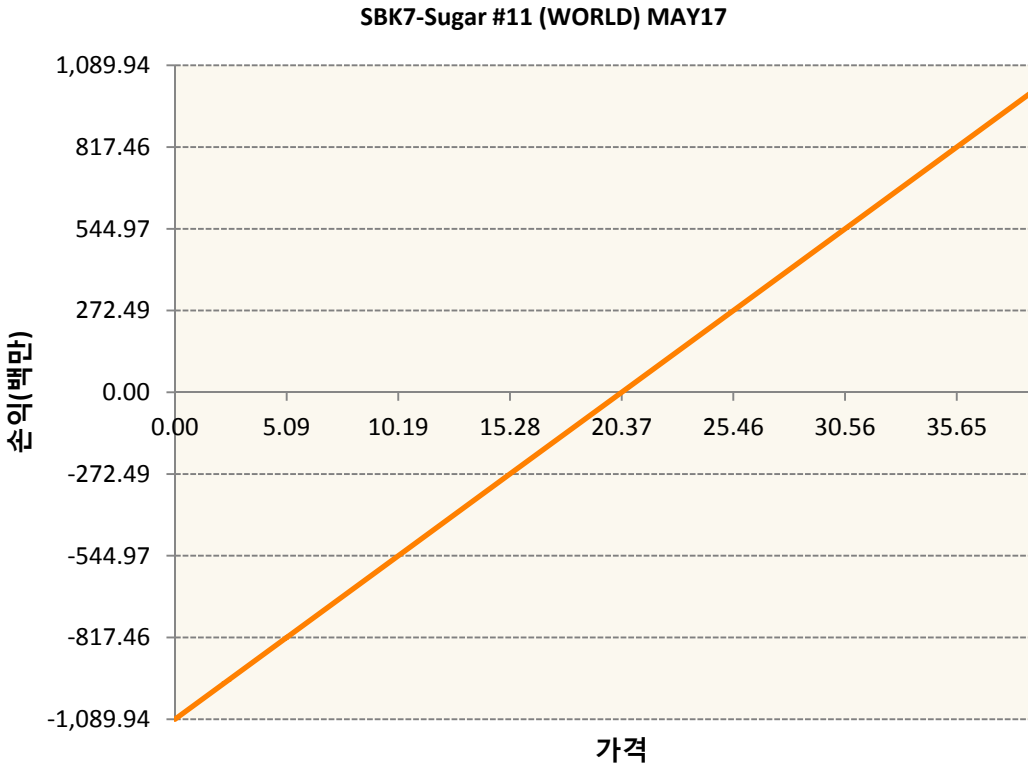

CTK7-COTTON NO.2 FUTR MAY17
443.30
332.47
221.65
110.82
0.00
-110.82
-221.65
-332.47
-443.30
0.00
19.49
38.98
58.46
77.95
97.44
116.93
136.41
순익(백만)
가격

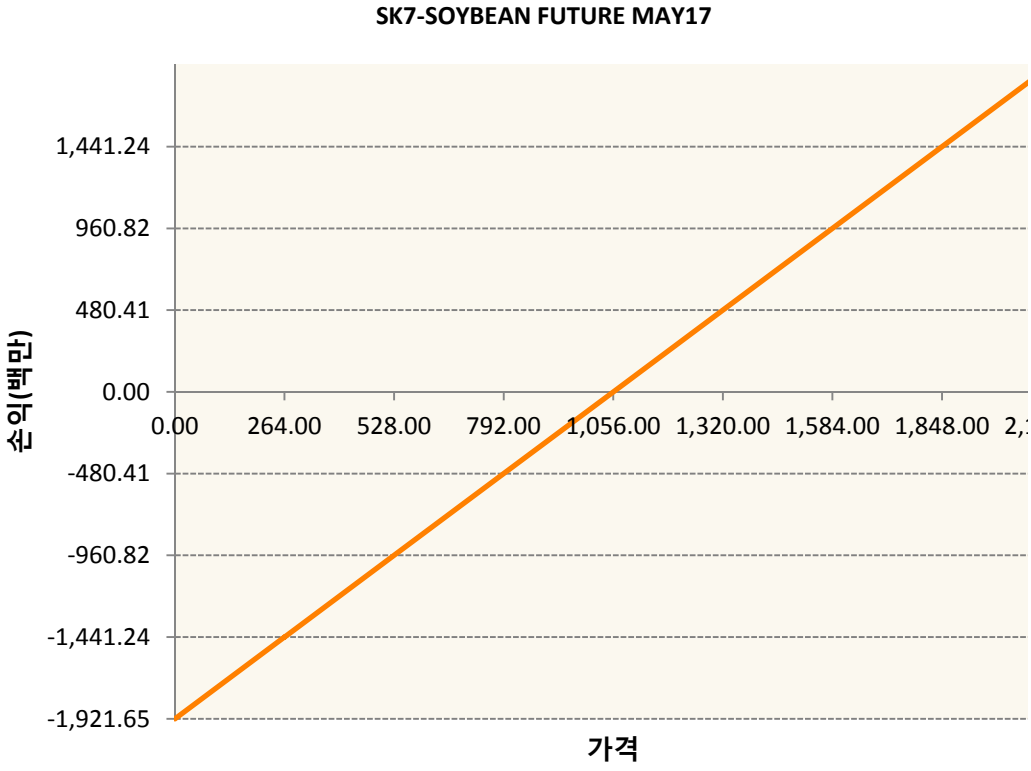

KCK7-COFFEE "C" FUTURE MAY17
560.25
373.50
186.75
0.00
-186.75
-373.50
-560.25
-746.99
0.00
36.49
72.98
109.46
145.95
182.44
218.93
255.41
순익(백만)

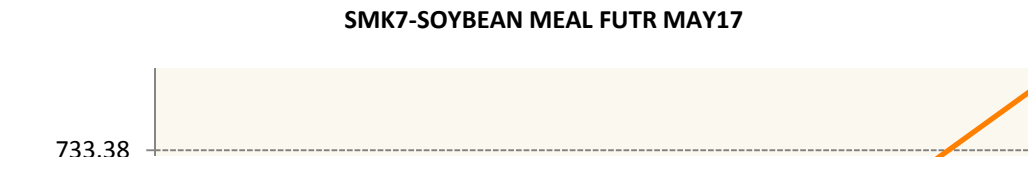
가격

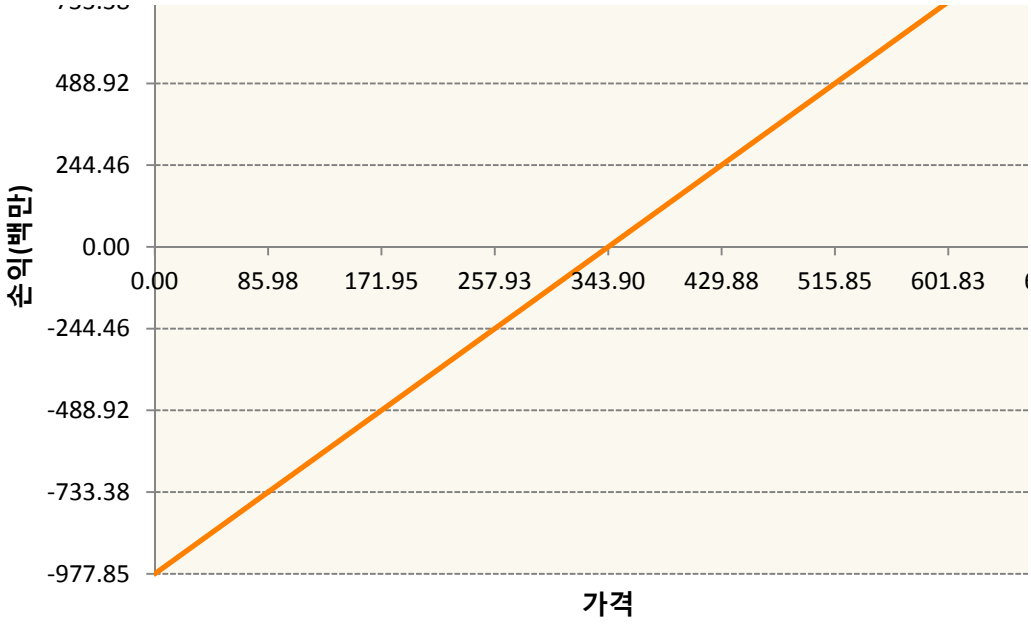

KR4175M20009-2017-02 달러선물
570.95
428.21
285.48
142.74
0.00
-142.74
-285.48
-428.21
-570.95
0.00
285.48
570.95
856.43
1,141.90
1,427.38
1,712.85
1,998.33
손익(백만)
가격

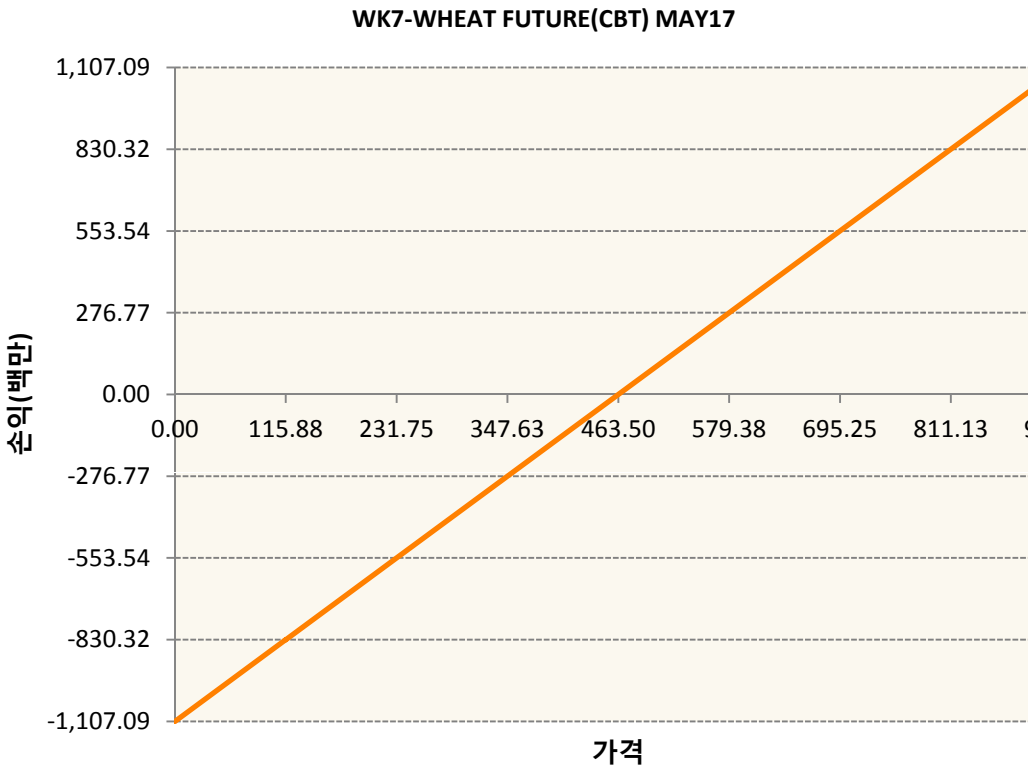

KWK7-KC HRW WHEAT FUTURE(KCB) MAY17
285.44
190.29
95.15
0.00
-95.15
-190.29
-285.44
-380.59
0.00
119.50
239.00
358.50
478.00
597.50
717.00
836.50
손익(백만)
가격


SBK7-Sugar #11 (WORLD) MAY17
1,089.94
817.46
544.97
272.49
0.00
-272.49
-544.97
-817.46
-1,089.94
0.00
5.09
10.19
15.28
20.37
25.46
30.56
35.65
손익(백만)
가격


SK7-SOYBEAN FUTURE MAY17
1,441.24
960.82
480.41
0.00
-480.41
-960.82
-1,441.24
-1,921.65
0.00
264.00
528.00
792.00
1,056.00
1,320.00
1,584.00
1,848.00
손익(백만)
가격


SMK7-SOYBEAN MEAL FUTR MAY17
733.38





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
BOK7	SOYBEAN OIL FUTR MAY17	70
CK7	CORN FUTURE MAY17	191
CTK7	COTTON NO.2 FUTR MAY17	35
KCK7	COFFEE "C" FUTURE MAY17	60
KR4175M20(	2017-02 달러선물	46

KWK7	KC HRW WHEAT FUTURE(KCB) MAY17	30
SBK7	Sugar #11 (WORLD) MAY17	87
SK7	SOYBEAN FUTURE MAY17	154
SMK7	SOYBEAN MEAL FUTR MAY17	78
WK7	WHEAT FUTURE(CBT) MAY17	89

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

934