공시일	2017-02-17
기준일	2017-02-16

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	2017-02-17
기준일	2017-02-16

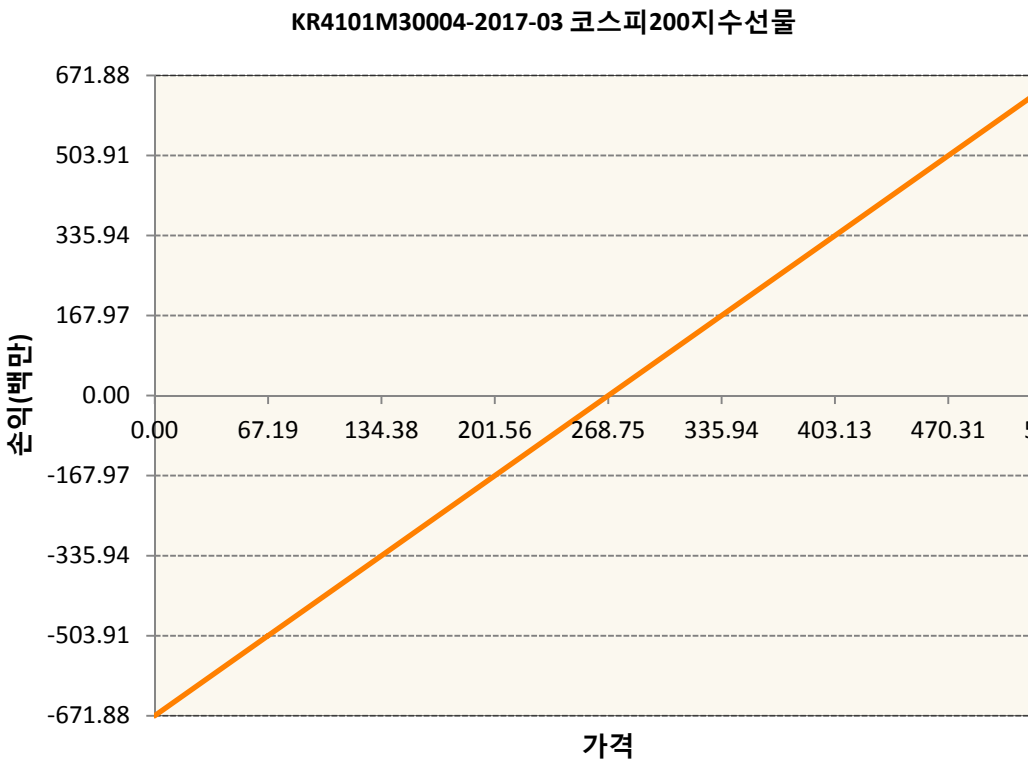
스마트인덱스모

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	2017-02-17
기준일	2017-02-16

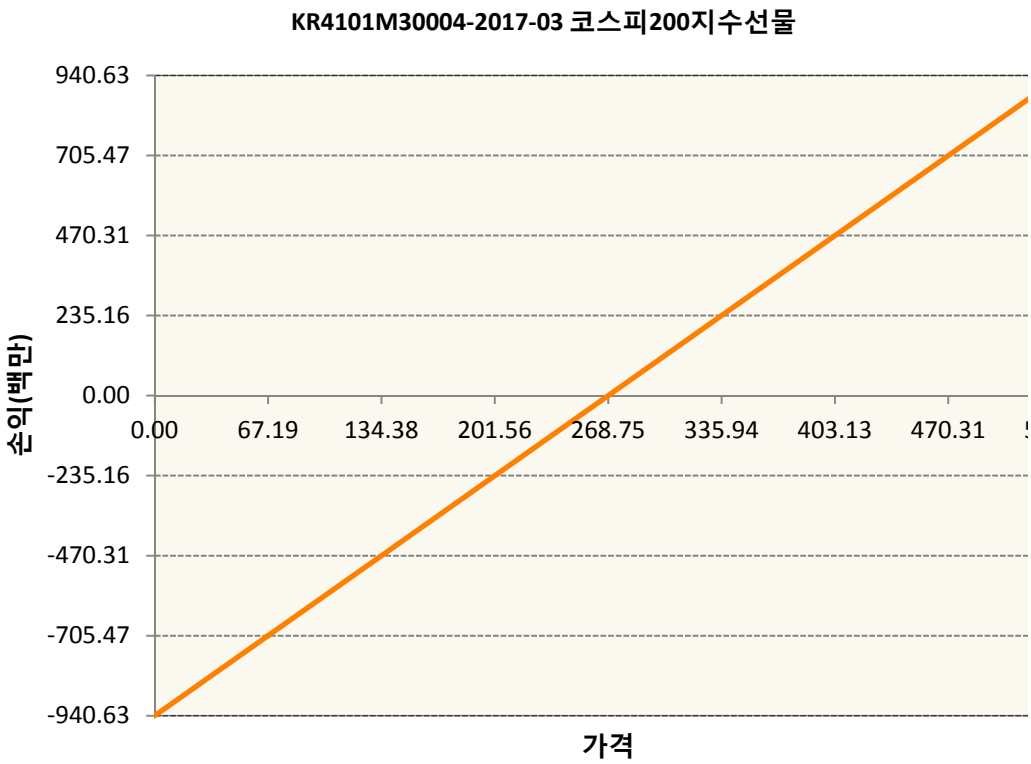
스마트레버리지목표전환형1호

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	2017-02-17
기준일	2017-02-16

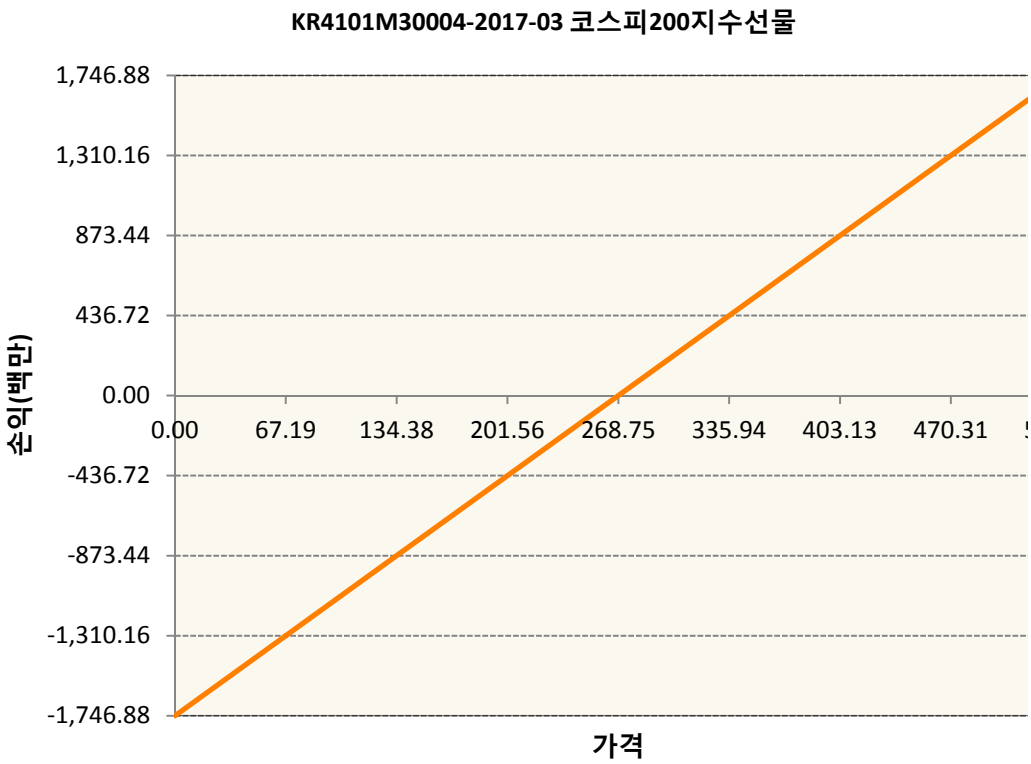
1.3배 레버리지 인덱스(주식-파생형)

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	1,747	0	1,747	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)

90

공시일	2017-02-17
기준일	2017-02-16

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	946

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

621

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-02-17
기준일	2017-02-16

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)

541

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-02-17
기준일	2017-02-16

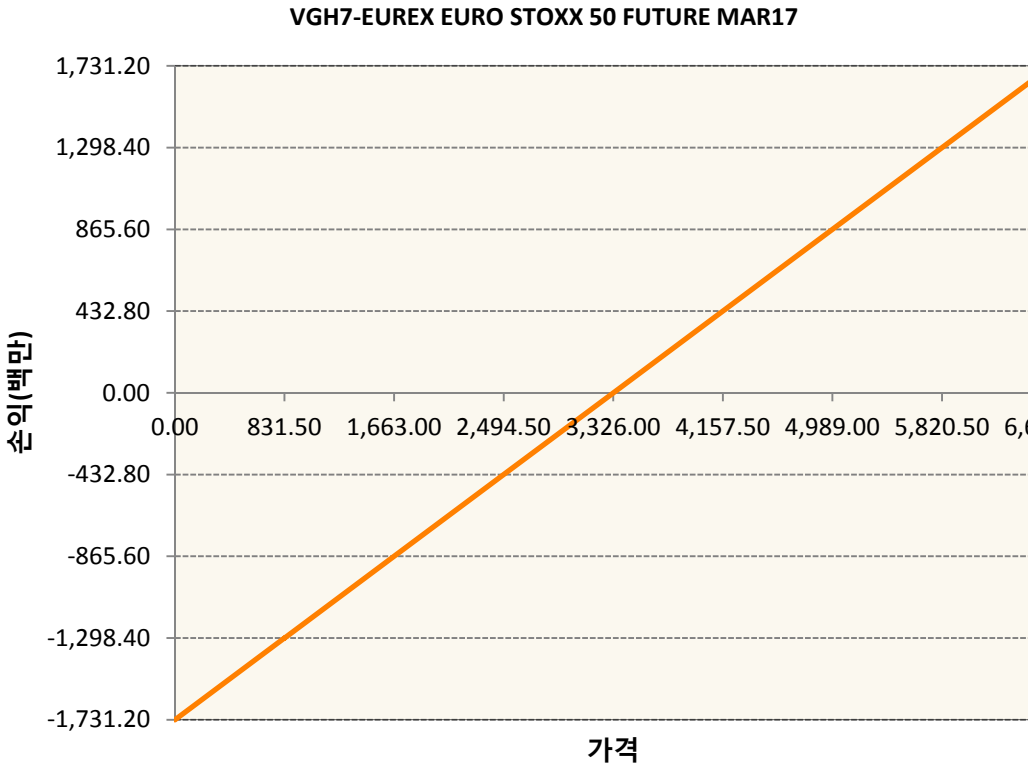
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,731	0	1,731	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGH7	EUREX EURO STOXX 50 FUTURE MAR17	138

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

(단위:백만원)

145

공시일	2017-02-17
기준일	2017-02-16

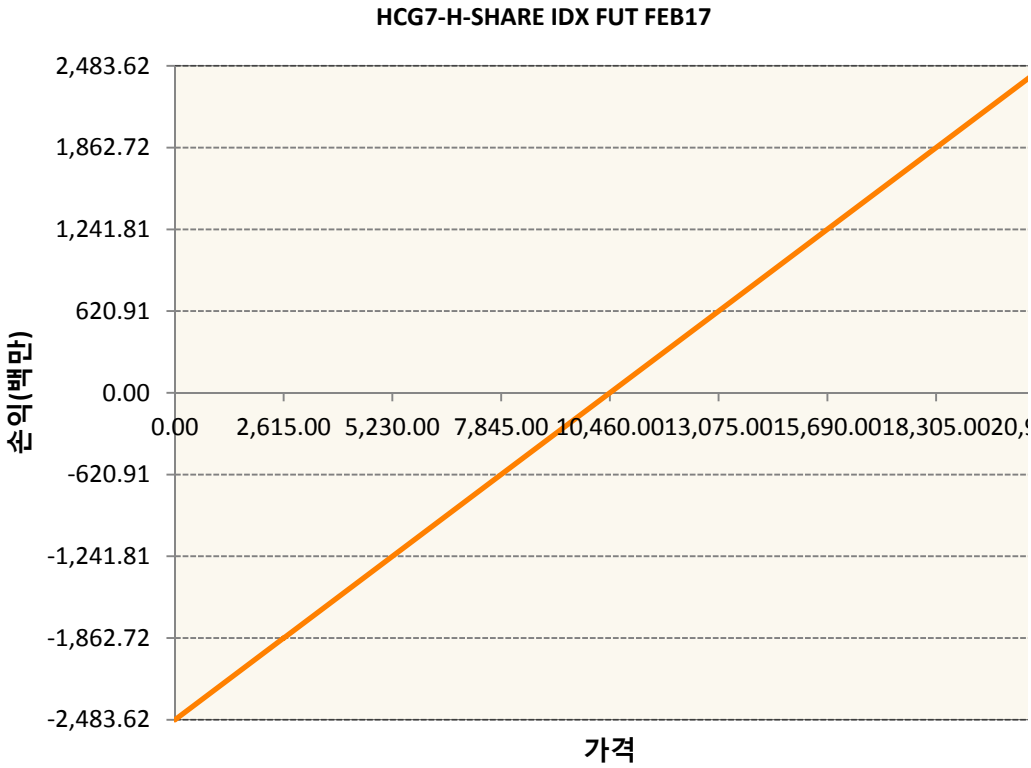
차이나인덱스모(주식-파생형)

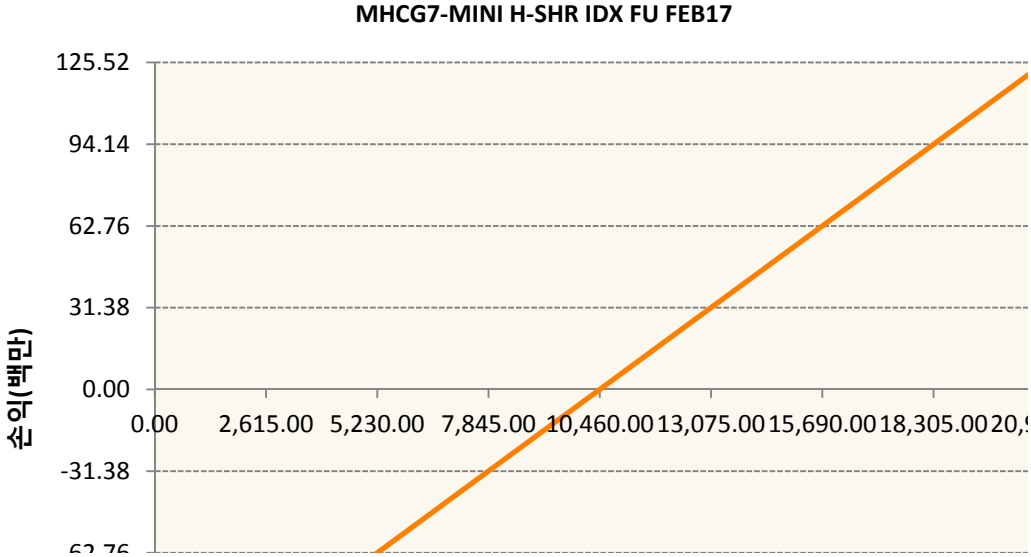
1. 계약금액

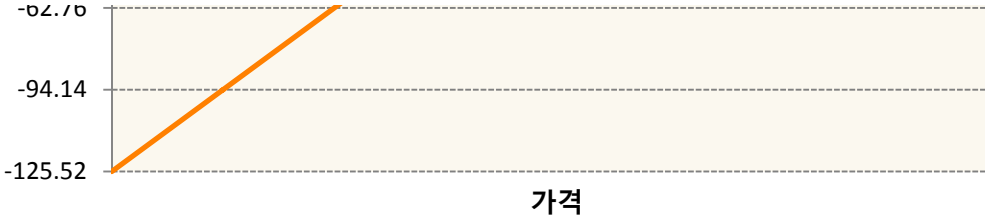
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,609	0	2,609	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)
	241

공시일	2017-02-17
기준일	2017-02-16

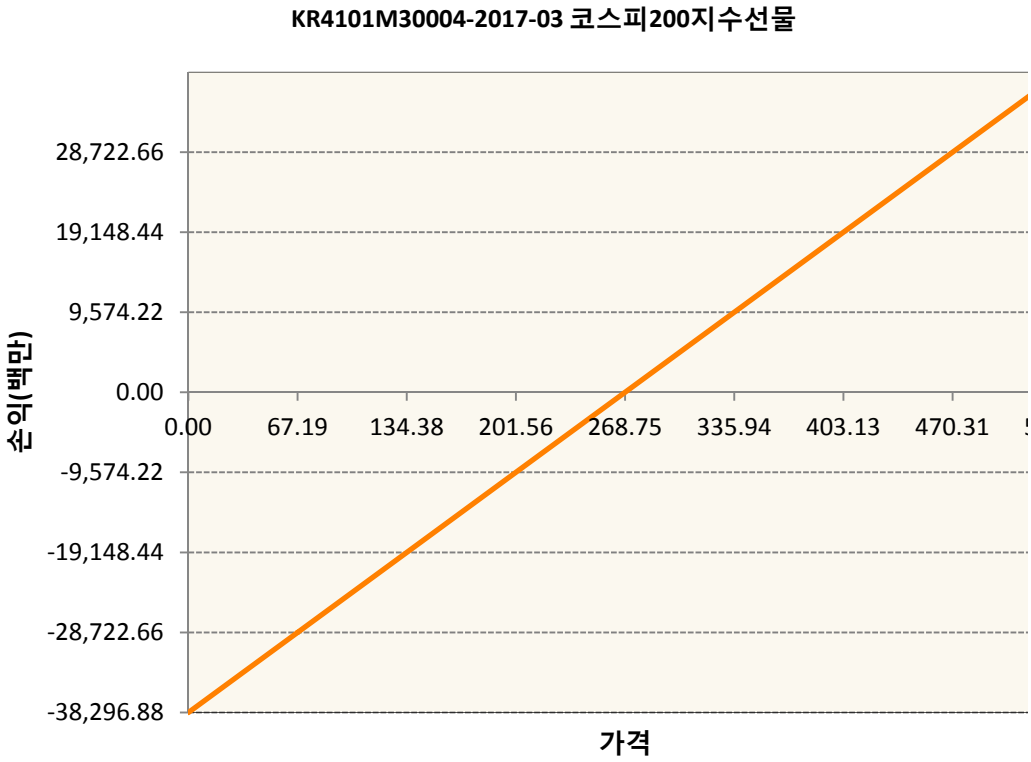
커버드콜모(주식혼합-파생형)

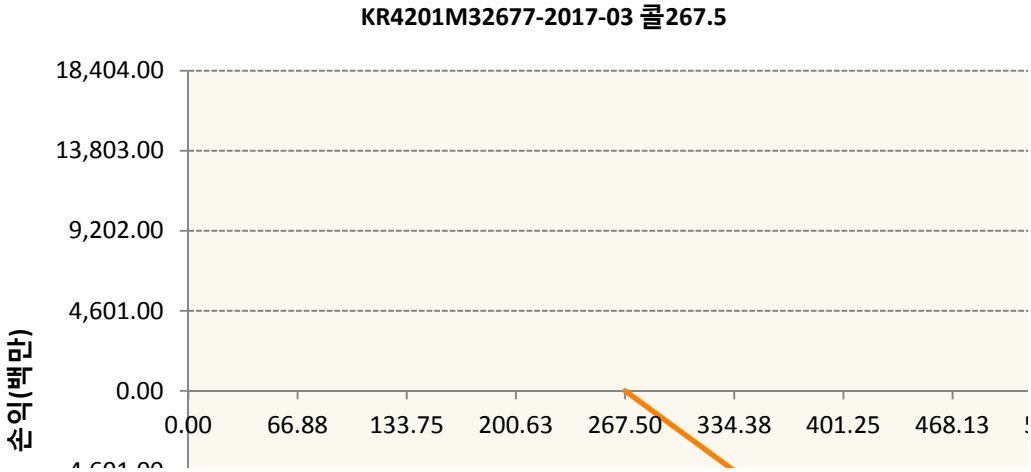
1. 계약금액

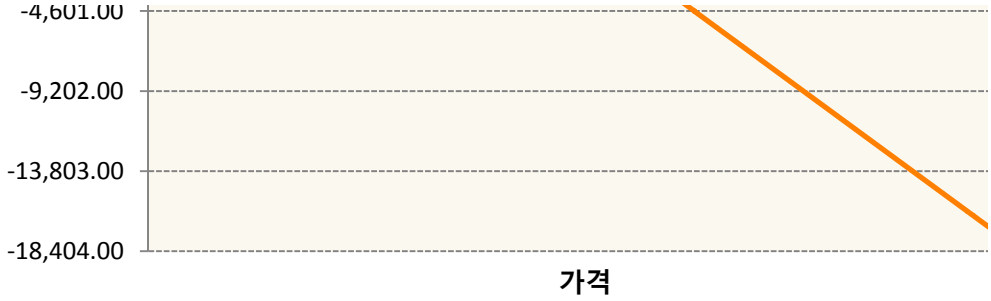
(단위:백만원)

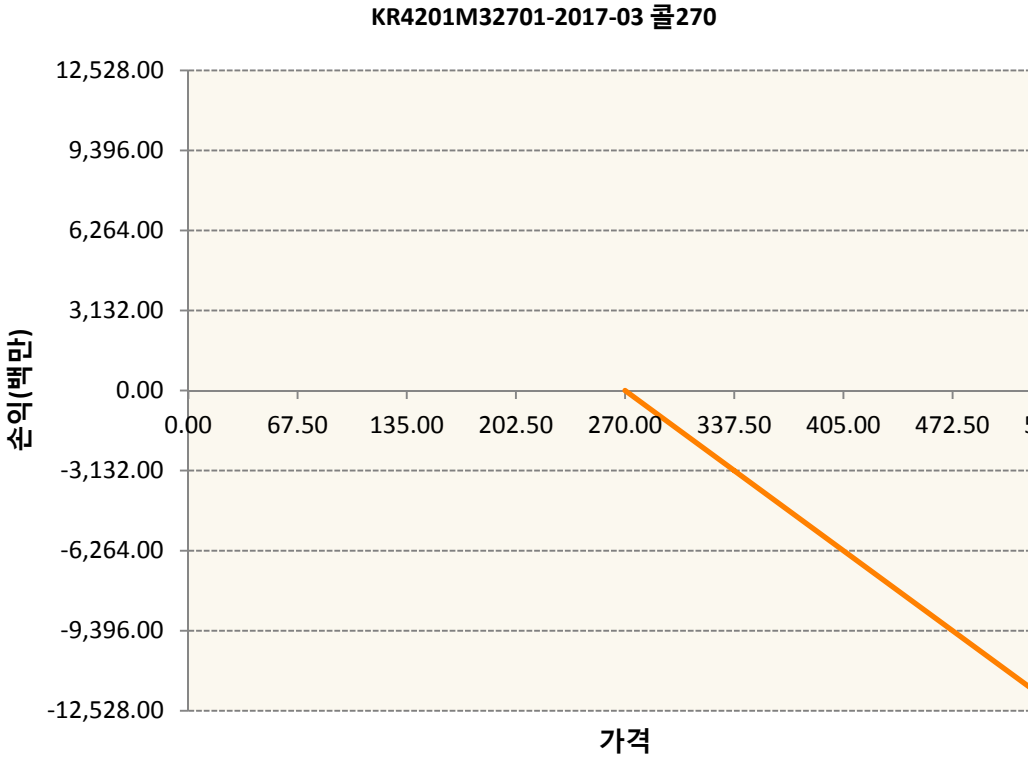
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	815	-815	장내
누계	유가증권	선물	38,297	0	38,297	장내
누계	유가증권	옵션	0	30,932	-30,932	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101M30(2017-03 코스피200지수선물							3,066
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-3,066	-3,066	-3,066	-3,066	-3,066	-3,066	-3,066
-5.33%	-2,044	-2,044	-2,044	-2,044	-2,044	-2,044	-2,044
-2.67%	-1,022	-1,022	-1,022	-1,022	-1,022	-1,022	-1,022
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	1,022	1,022	1,022	1,022	1,022	1,022	1,022
5.33%	2,044	2,044	2,044	2,044	2,044	2,044	2,044
8.00%	3,066	3,066	3,066	3,066	3,066	3,066	3,066
KR4201M32(2017-03 콜267.5							6,765
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,126	1,126	1,126	1,126	1,125	1,125	1,123
-5.33%	1,125	1,123	1,119	1,113	1,105	1,093	1,078
-2.67%	1,044	1,009	969	925	878	828	776
0%	207	138	69	0	-70	-140	-210
2.67%	-1,856	-1,872	-1,894	-1,920	-1,951	-1,986	-2,024
5.33%	-4,298	-4,299	-4,300	-4,303	-4,308	-4,314	-4,324
8.00%	-6,763	-6,763	-6,763	-6,763	-6,763	-6,764	-6,765
KR4201M32 2017-03 콜270							4,279

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	465	465	465	465	465	465	465
-5.33%	465	465	464	463	460	456	451
-2.67%	449	437	422	404	383	359	333
0%	142	95	48	0	-48	-96	-143
2.67%	-1,003	-1,027	-1,053	-1,083	-1,115	-1,149	-1,185
5.33%	-2,614	-2,616	-2,619	-2,624	-2,631	-2,640	-2,652
8.00%	-4,276	-4,276	-4,276	-4,276	-4,277	-4,278	-4,279

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

15,822

공시일	2017-02-17
기준일	2017-02-16

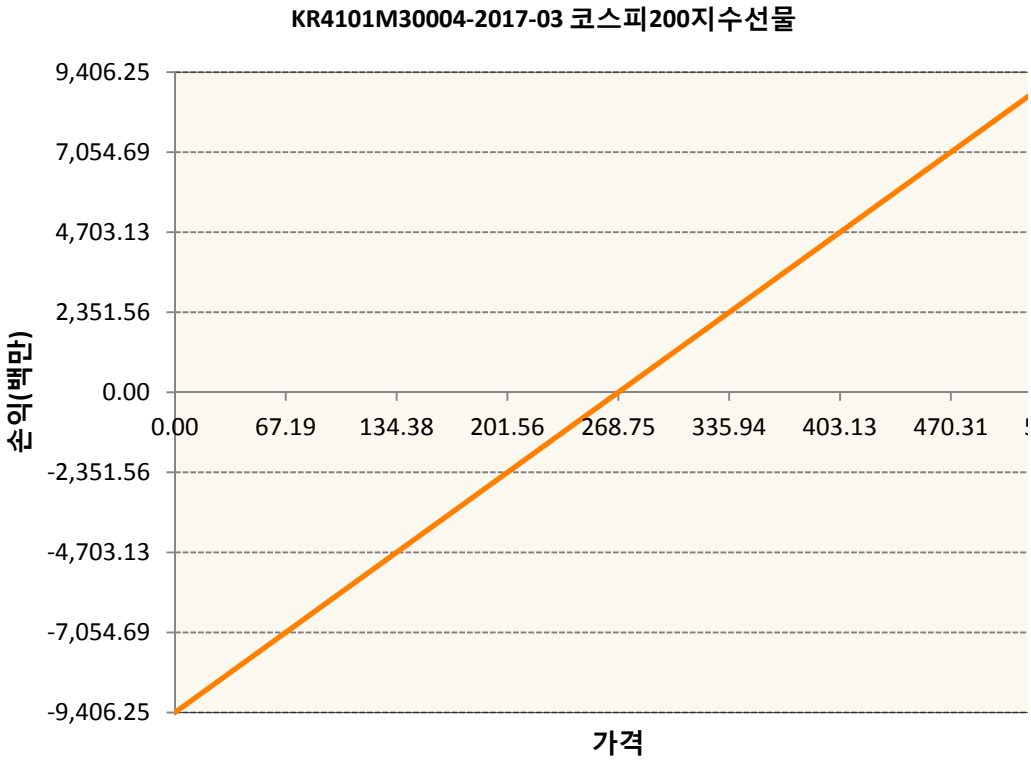
커버드콜목표전환형증권투자신탁

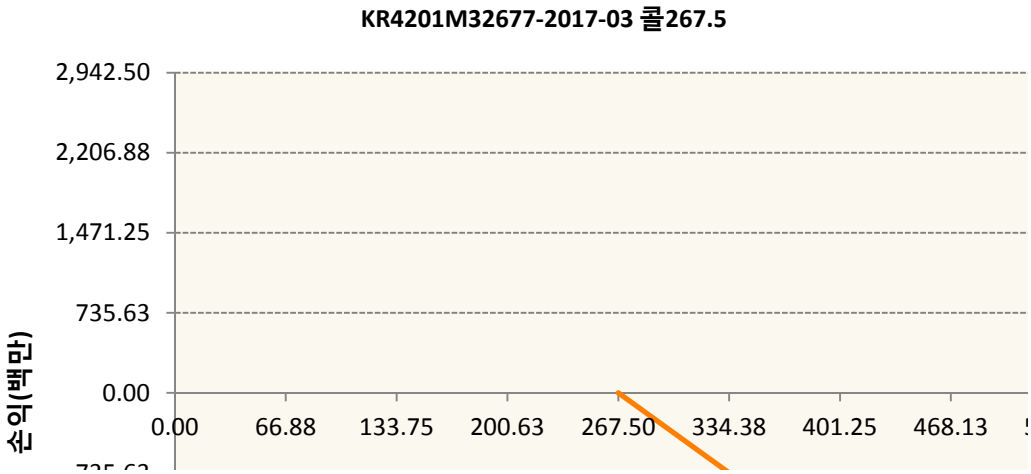
1. 계약금액

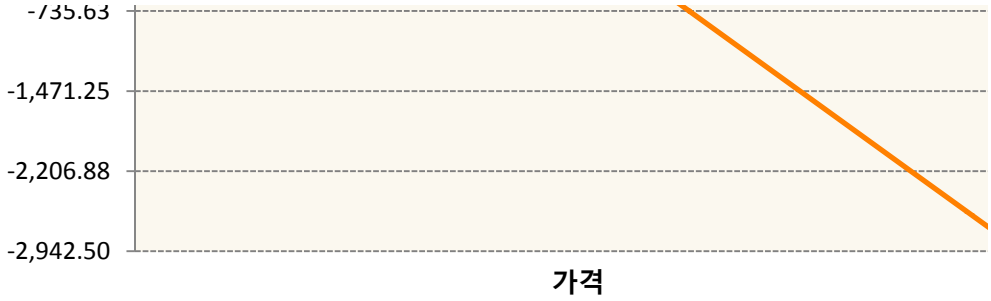
(단위:백만원)

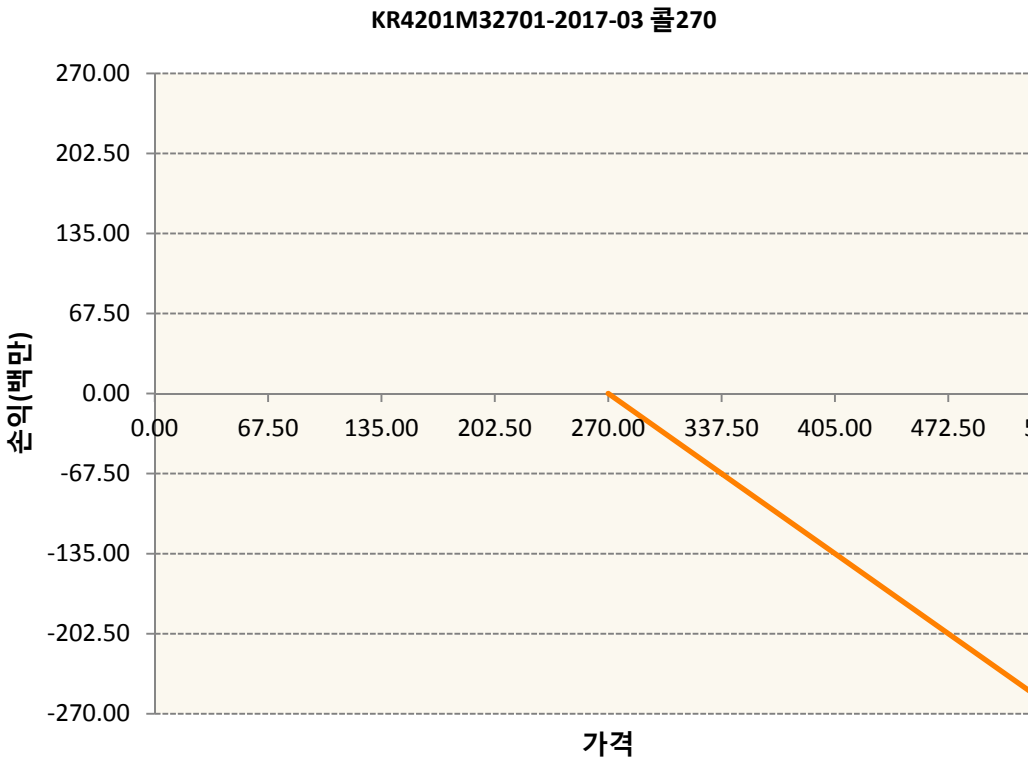
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	9,406	0	9,406	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,213	-3,213	장내

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							1,082
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	180	180	180	180	180	180	180
-5.33%	180	180	179	178	177	175	172
-2.67%	167	161	155	148	140	132	124
0%	33	22	11	0	-11	-22	-34
2.67%	-297	-299	-303	-307	-312	-317	-324
5.33%	-687	-687	-688	-688	-689	-690	-691
8.00%	-1,081	-1,081	-1,081	-1,081	-1,081	-1,081	-1,082
KR4201M32 2017-03 콜270							92

	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	9	9	9	8	8	7
0%	3	2	1	0	-1	-2	-3
2.67%	-22	-22	-23	-23	-24	-25	-26
5.33%	-56	-56	-56	-57	-57	-57	-57
8.00%	-92	-92	-92	-92	-92	-92	-92

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

1,977

공시일	2017-02-17
기준일	2017-02-16

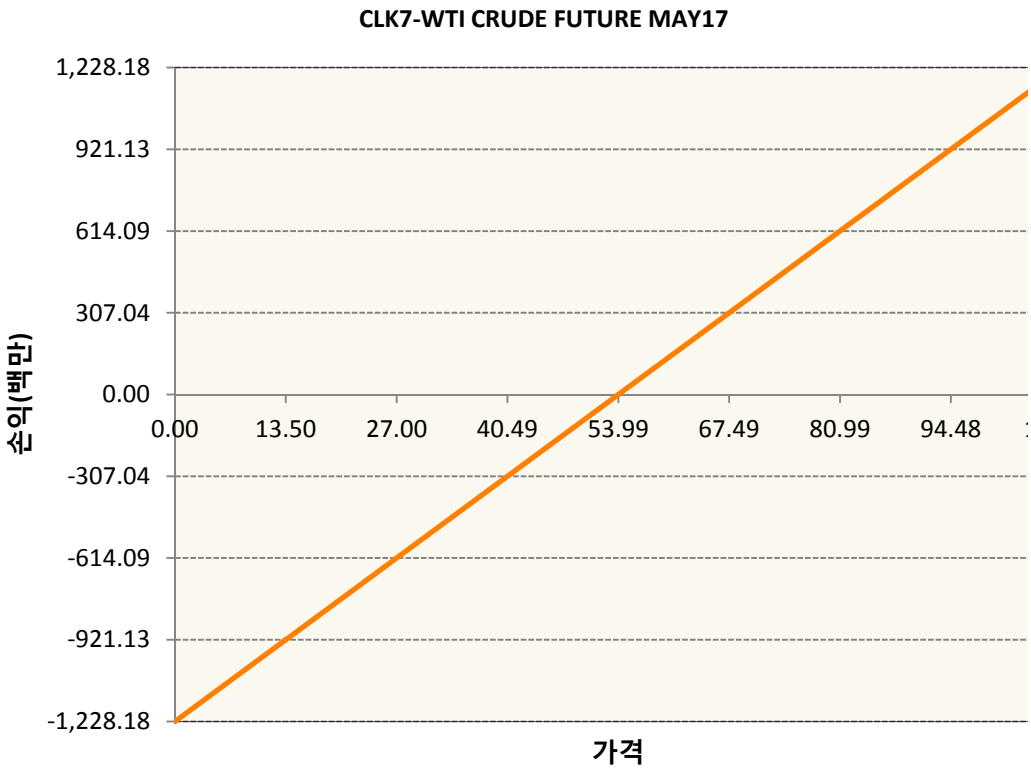
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

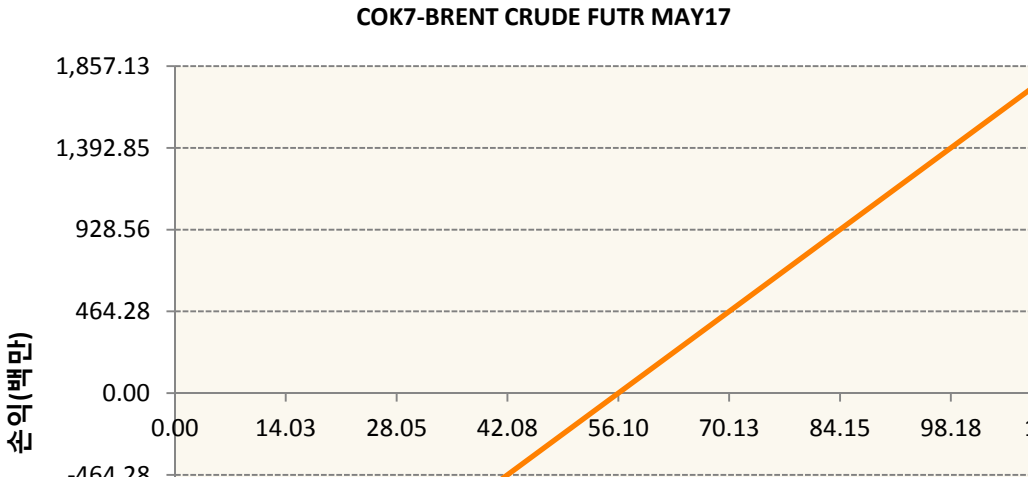
1. 계약금액

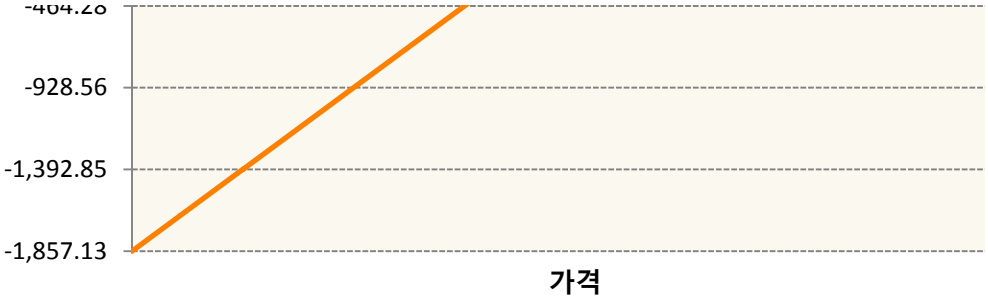
(단위:백만원)

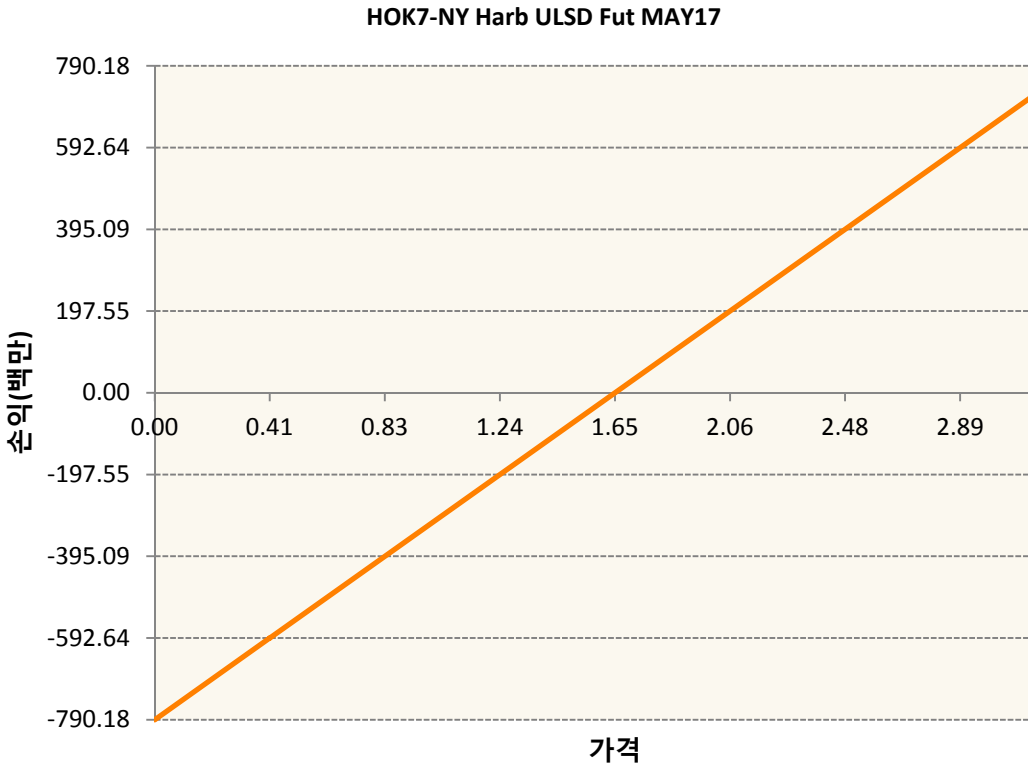
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	선물	유가증권	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	선물	유가증권	1,228	0	1,228	
누계	유가증권	선물	4,938	411	4,527	

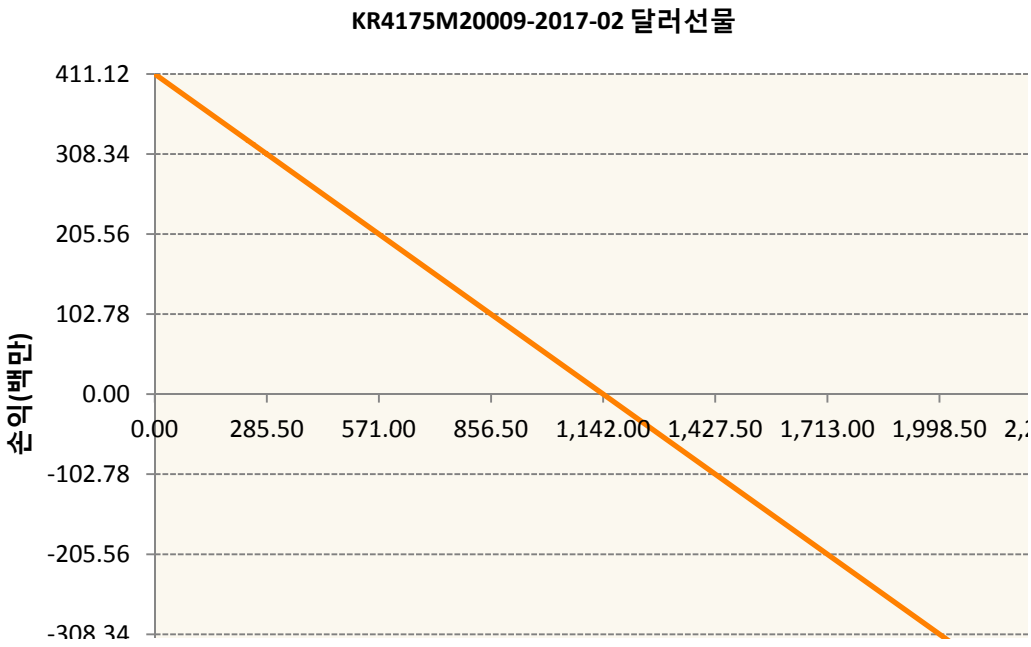
2. 만기시점의 손익구조

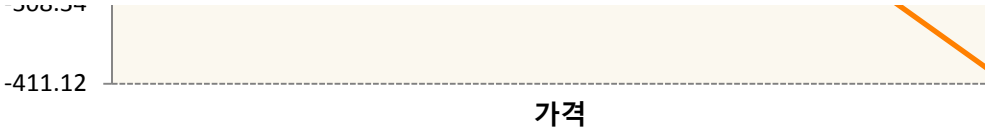


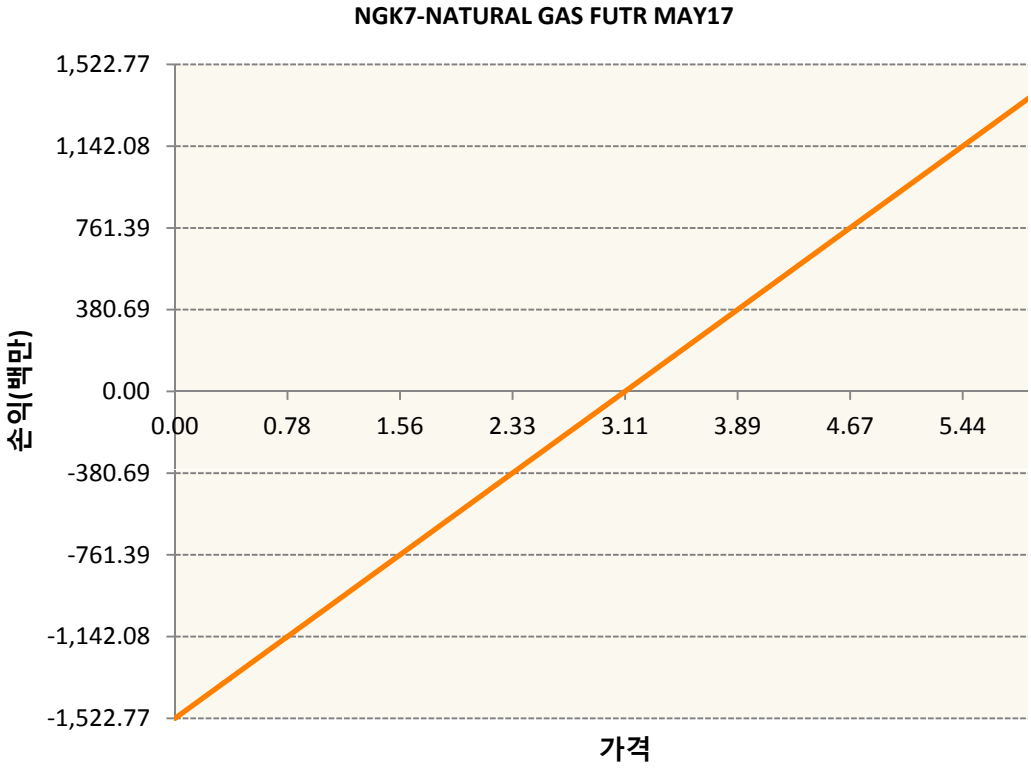


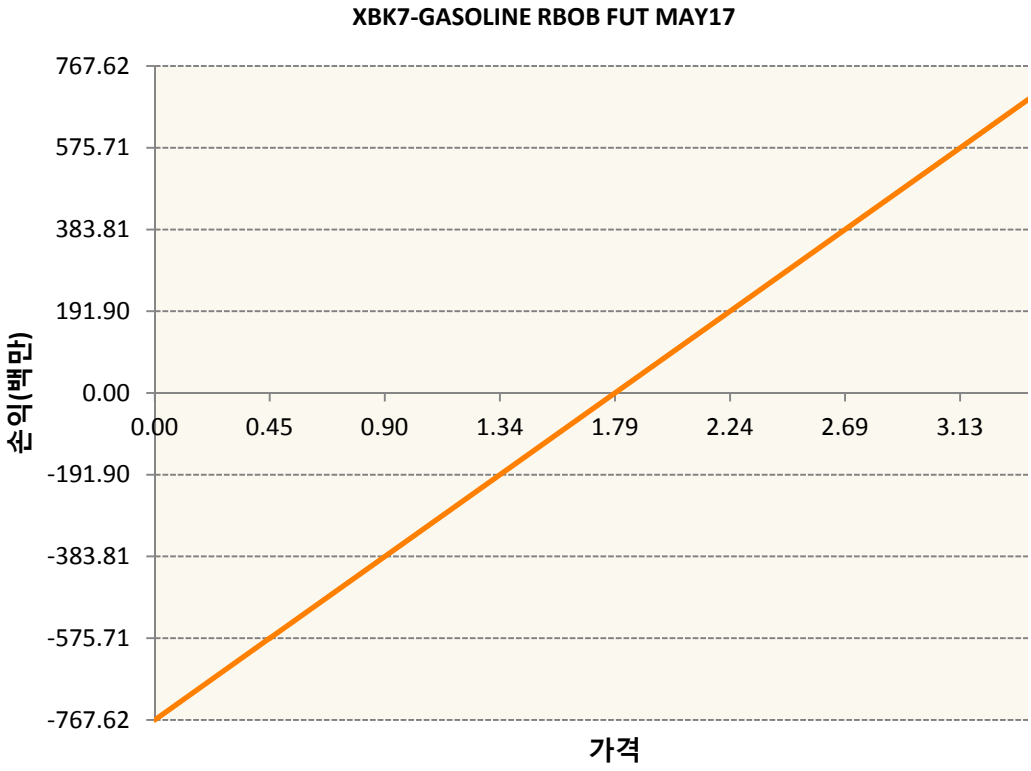

-928.56
-1,392.85
-1,857.13
가격


HOK7-NY Harb ULSD Fut MAY17
790.18
592.64
395.09
197.55
0.00
-197.55
-395.09
-592.64
-790.18
0.00
0.41
0.83
1.24
1.65
2.06
2.48
2.89
순익(백만)
가격


KR4175M20009-2017-02 달러선물
411.12
308.34
205.56
102.78
0.00
-102.78
-205.56
-308.34
0.00
285.50
571.00
856.50
1,142.00
1,427.50
1,713.00
1,998.50
순익(백만)


-411.12
가격


NGK7-NATURAL GAS FUTR MAY17
1,522.77
1,142.08
761.39
380.69
0.00
-380.69
-761.39
-1,142.08
-1,522.77
0.00
0.78
1.56
2.33
3.11
3.89
4.67
5.44
순익(백만)
가격


XBK7-GASOLINE RBOB FUT MAY17
767.62
575.71
383.81
191.90
0.00
-191.90
-383.81
-575.71
-767.62
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	63
KR4175M20(	2017-02 달러선물	33
NGK7	NATURAL GAS FUTR MAY17	122
XBK7	GASOLINE RBOB FUT MAY17	61

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

1,094

공시일	2017-02-17
기준일	2017-02-16

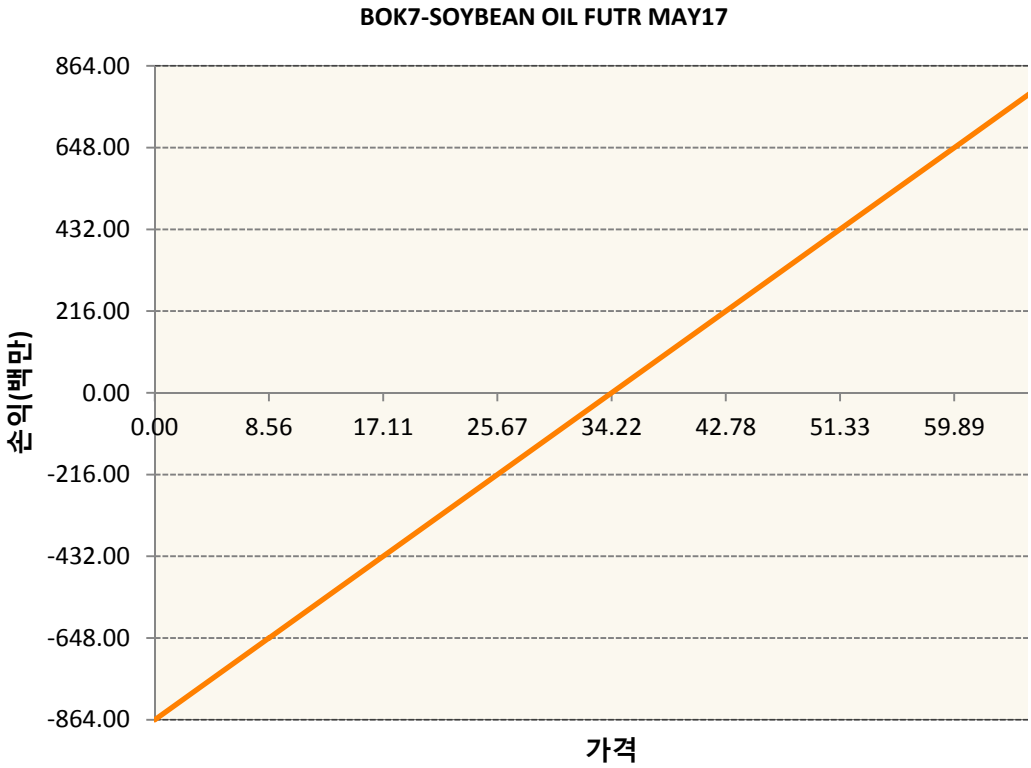
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

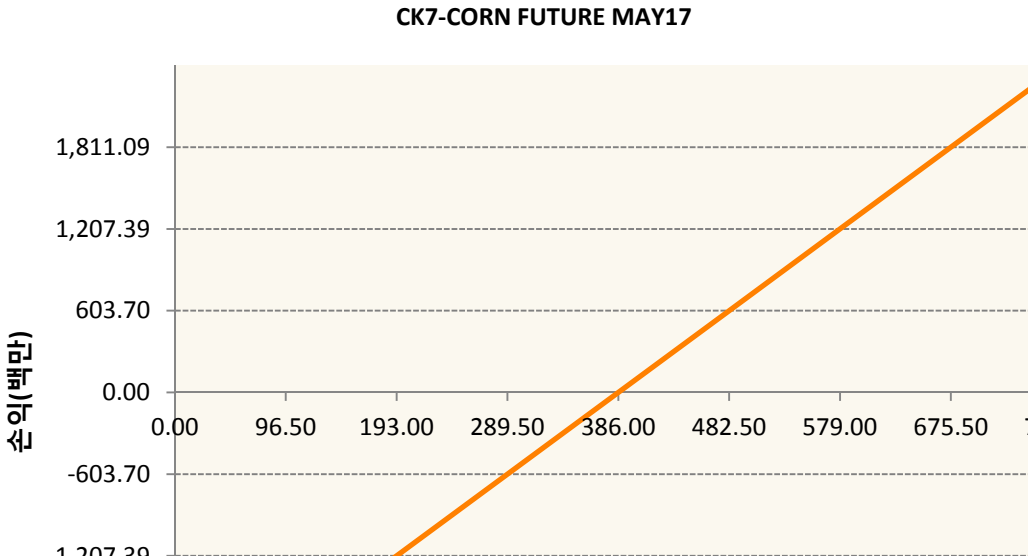
1. 계약금액

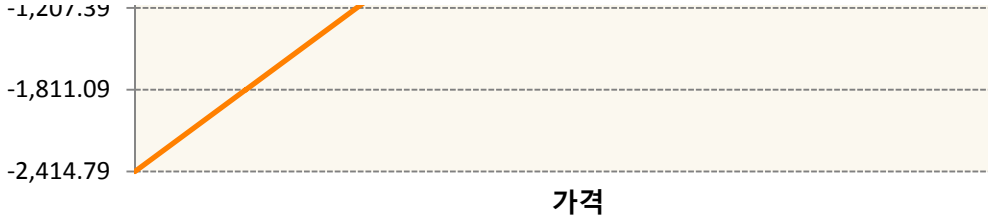
(단위:백만원)

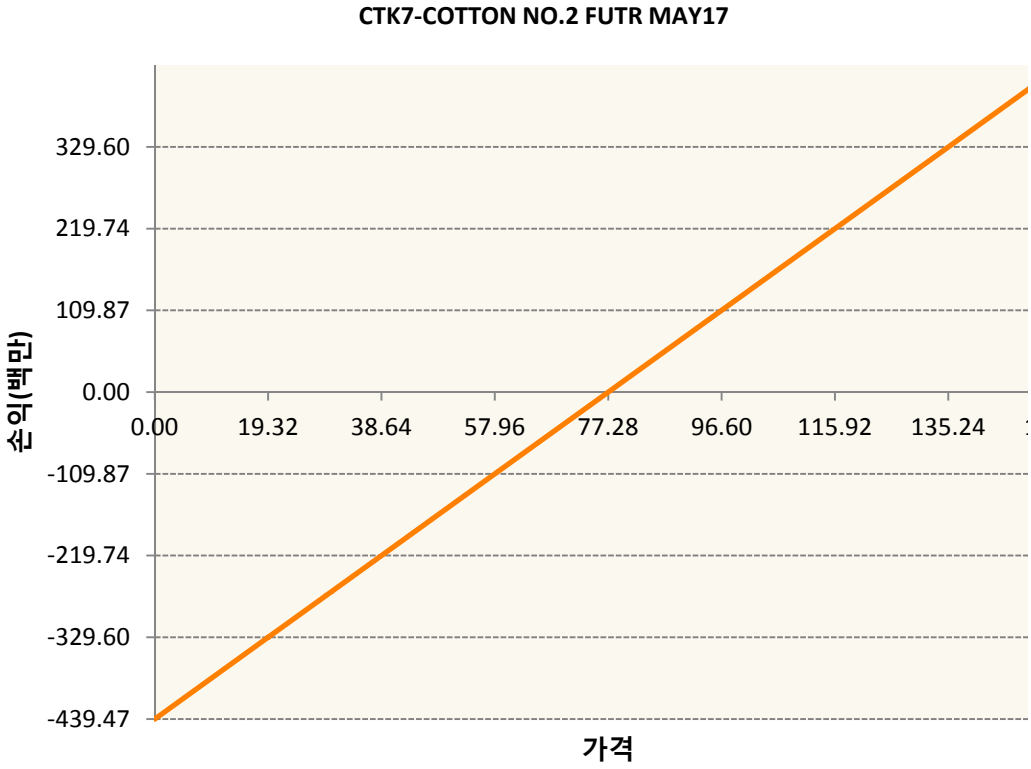
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	10,015	571	9,444	

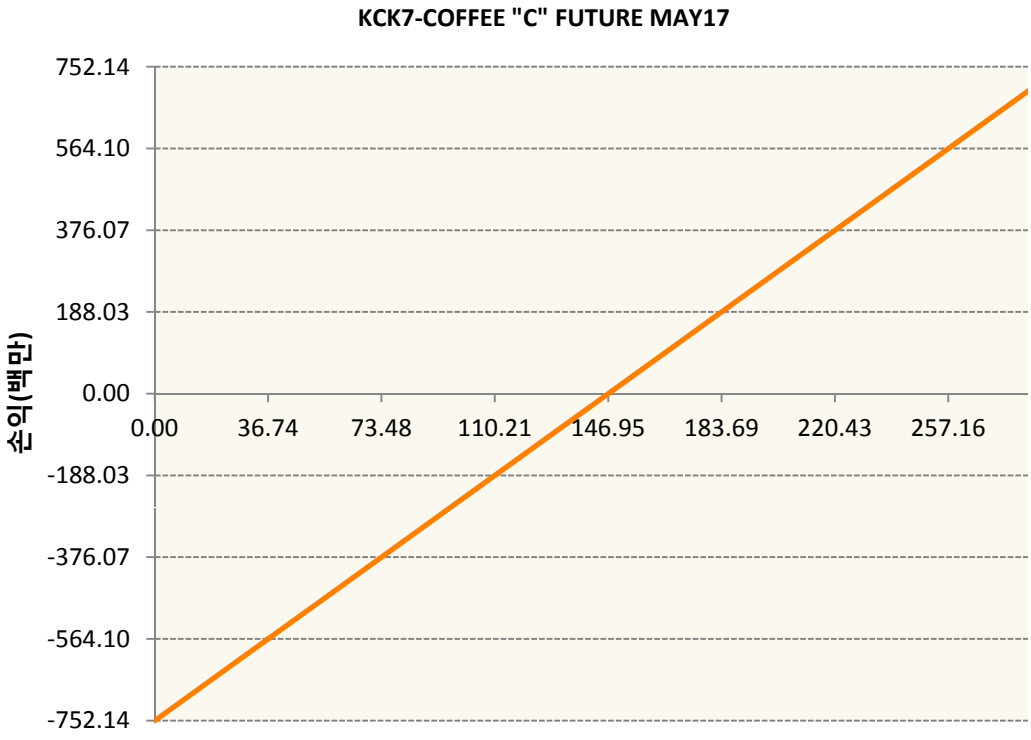
2. 만기시점의 손익구조



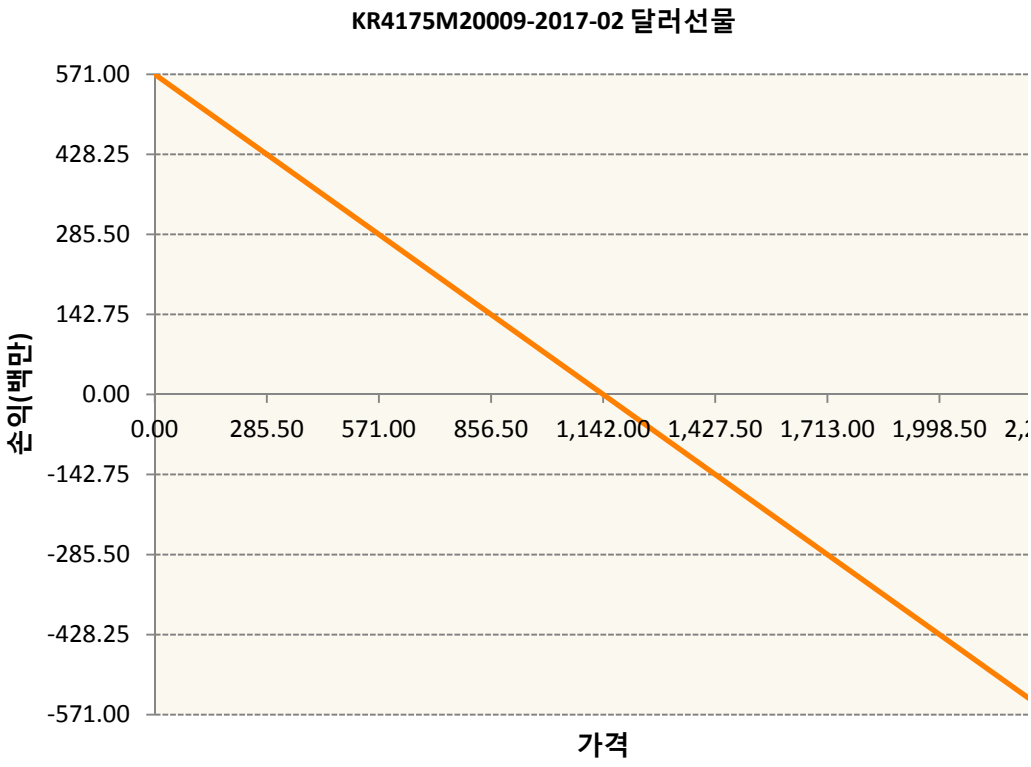


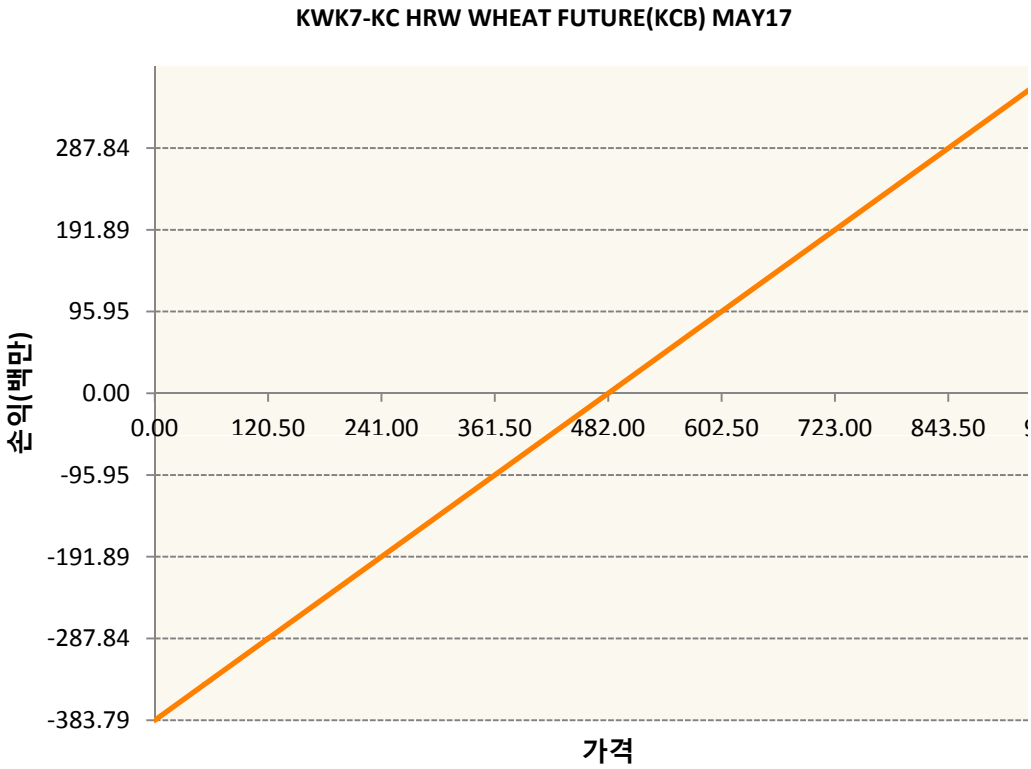

-1,811.09
-2,414.79
가격

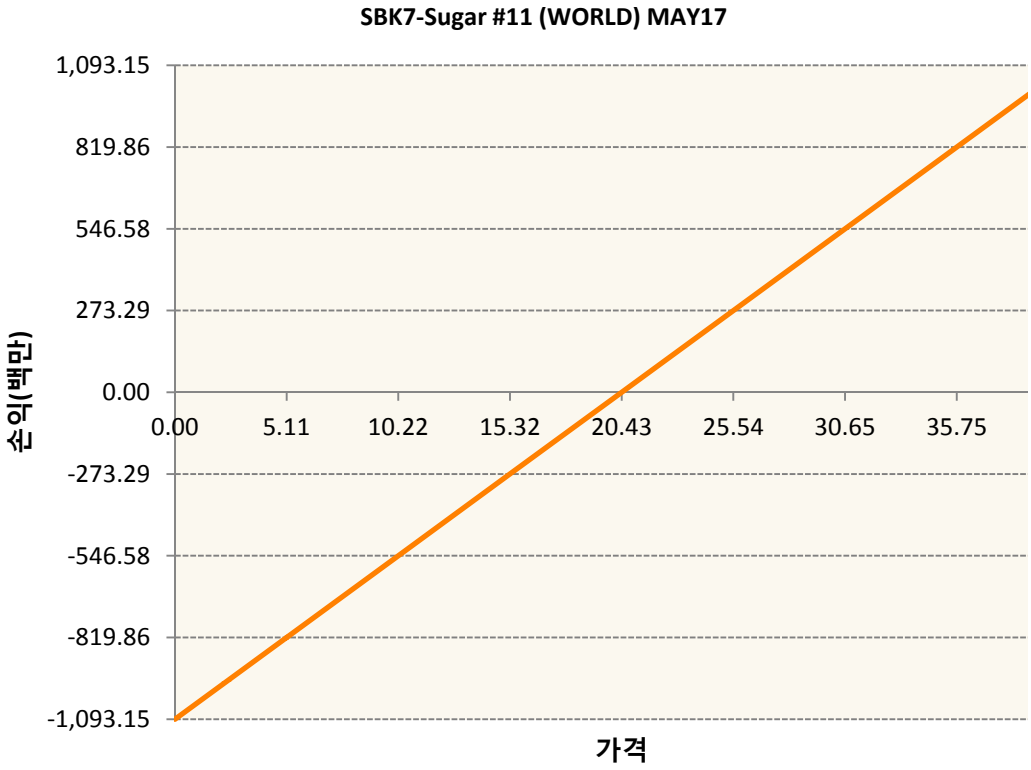

CTK7-COTTON NO.2 FUTR MAY17
329.60
219.74
109.87
0.00
-109.87
-219.74
-329.60
-439.47
0.00
19.32
38.64
57.96
77.28
96.60
115.92
135.24
순익(백만)
가격

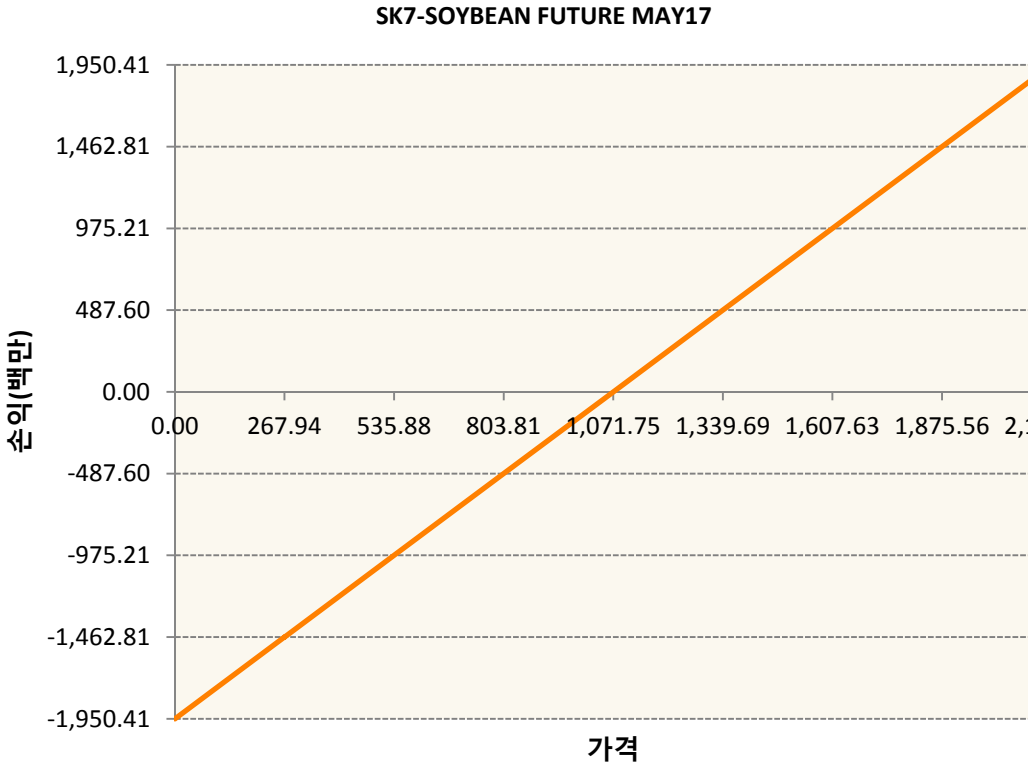

KCK7-COFFEE "C" FUTURE MAY17
752.14
564.10
376.07
188.03
0.00
-188.03
-376.07
-564.10
-752.14
0.00
36.74
73.48
110.21
146.95
183.69
220.43
257.16
순익(백만)

가격

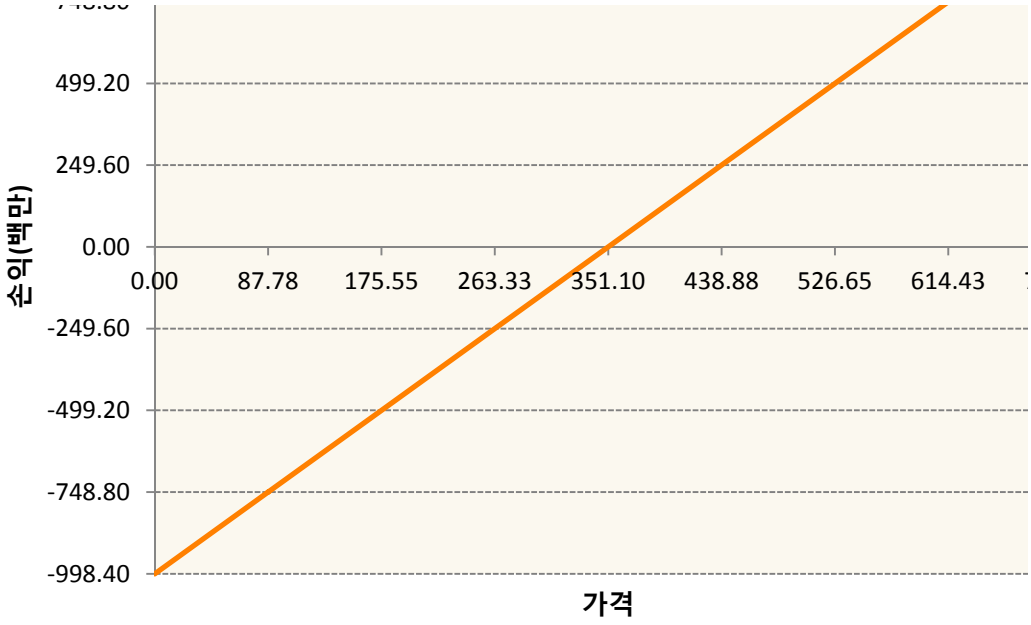

KR4175M20009-2017-02 달러선물
571.00
428.25
285.50
142.75
0.00
-142.75
-285.50
-428.25
-571.00
0.00
285.50
571.00
856.50
1,142.00
1,427.50
1,713.00
1,998.50
손익(백만)
가격

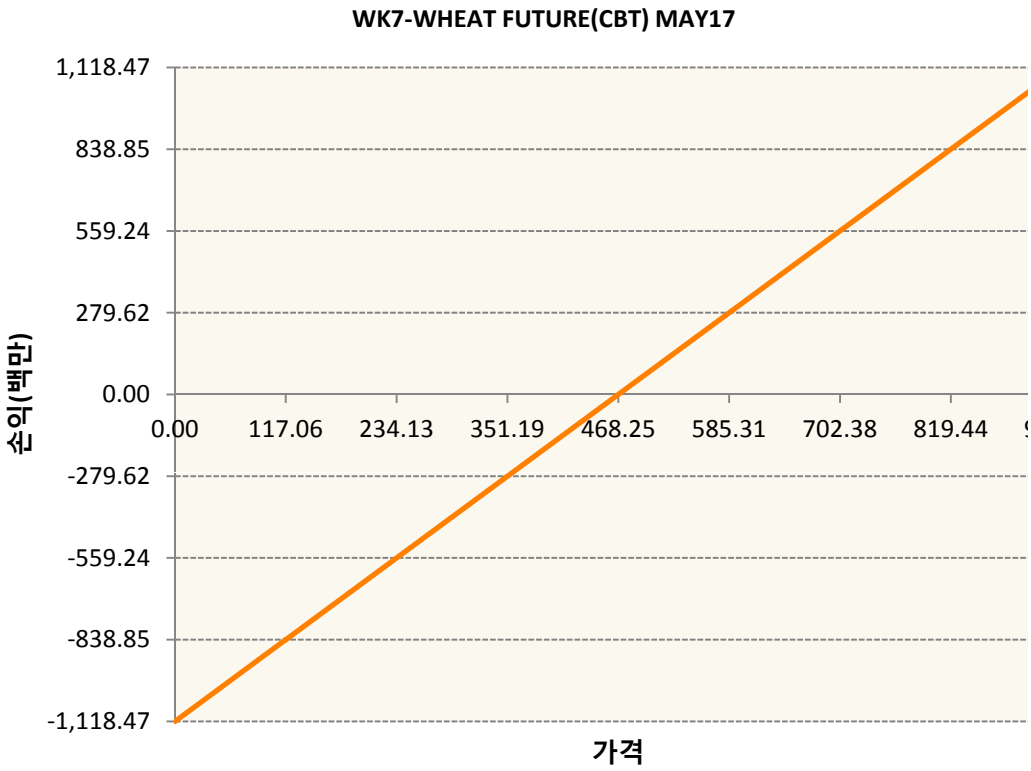

KWK7-KC HRW WHEAT FUTURE(KCB) MAY17
287.84
191.89
95.95
0.00
-95.95
-191.89
-287.84
-383.79
0.00
120.50
241.00
361.50
482.00
602.50
723.00
843.50
손익(백만)
가격


SBK7-Sugar #11 (WORLD) MAY17
1,093.15
819.86
546.58
273.29
0.00
-273.29
-546.58
-819.86
-1,093.15
0.00
5.11
10.22
15.32
20.43
25.54
30.65
35.75
손익(백만)
가격


SK7-SOYBEAN FUTURE MAY17
1,950.41
1,462.81
975.21
487.60
0.00
-487.60
-975.21
-1,462.81
-1,950.41
0.00
267.94
535.88
803.81
1,071.75
1,339.69
1,607.63
1,875.56
손익(백만)
가격


SMK7-SOYBEAN MEAL FUTR MAY17
998.40
748.80





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
BOK7	SOYBEAN OIL FUTR MAY17	69
CK7	CORN FUTURE MAY17	193
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	31
SBK7	Sugar #11 (WORLD) MAY17	87
SK7	SOYBEAN FUTURE MAY17	156
SMK7	SOYBEAN MEAL FUTR MAY17	80
WK7	WHEAT FUTURE(CBT) MAY17	89

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

941