공시일	2017-02-20
기준일	2017-02-17

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	2017-02-20
기준일	2017-02-17

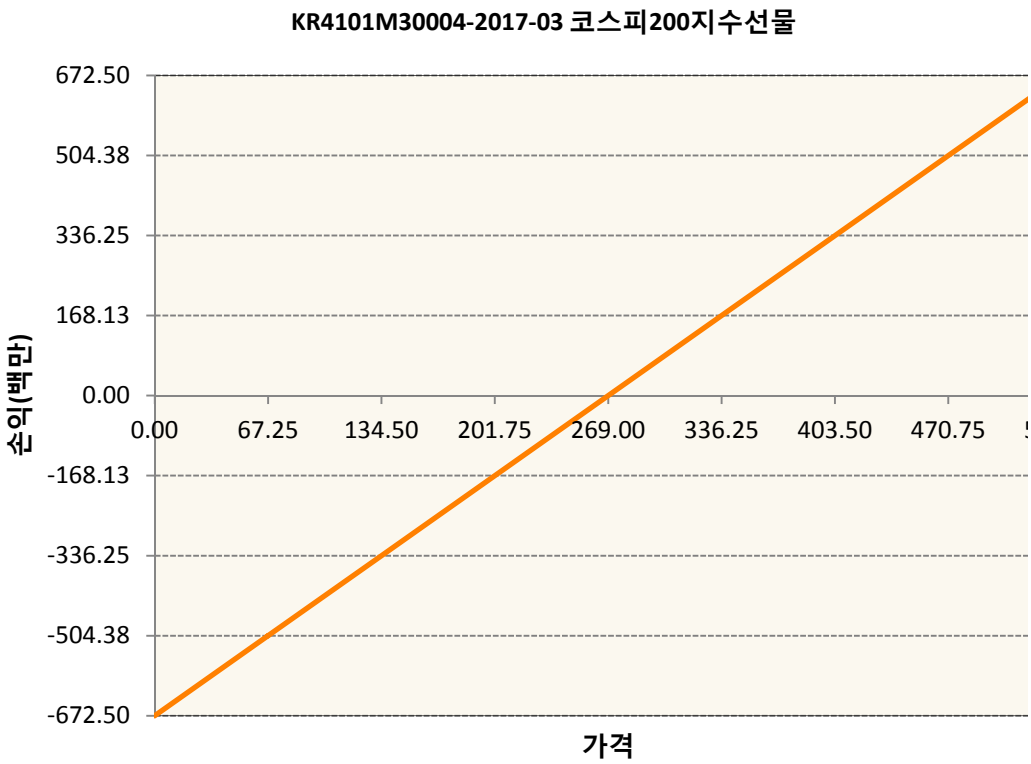
스마트인덱스모

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	673	0	673	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	2017-02-20
기준일	2017-02-17

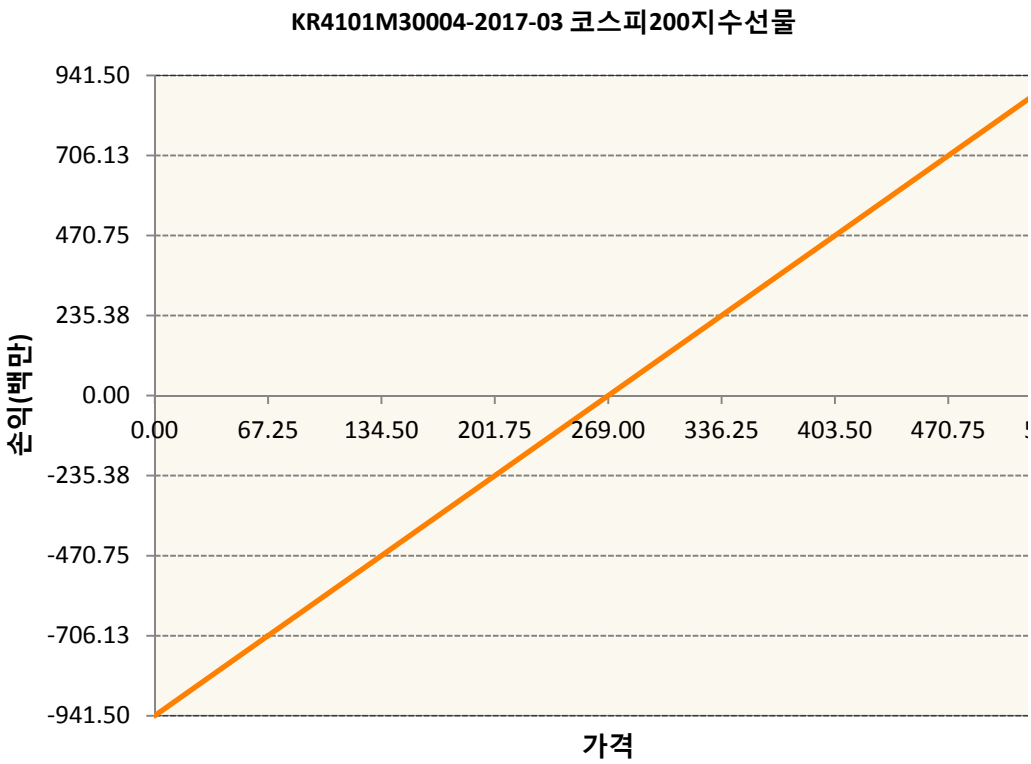
스마트레버리지목표전환형1호

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	942	0	942	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	2017-02-20
기준일	2017-02-17

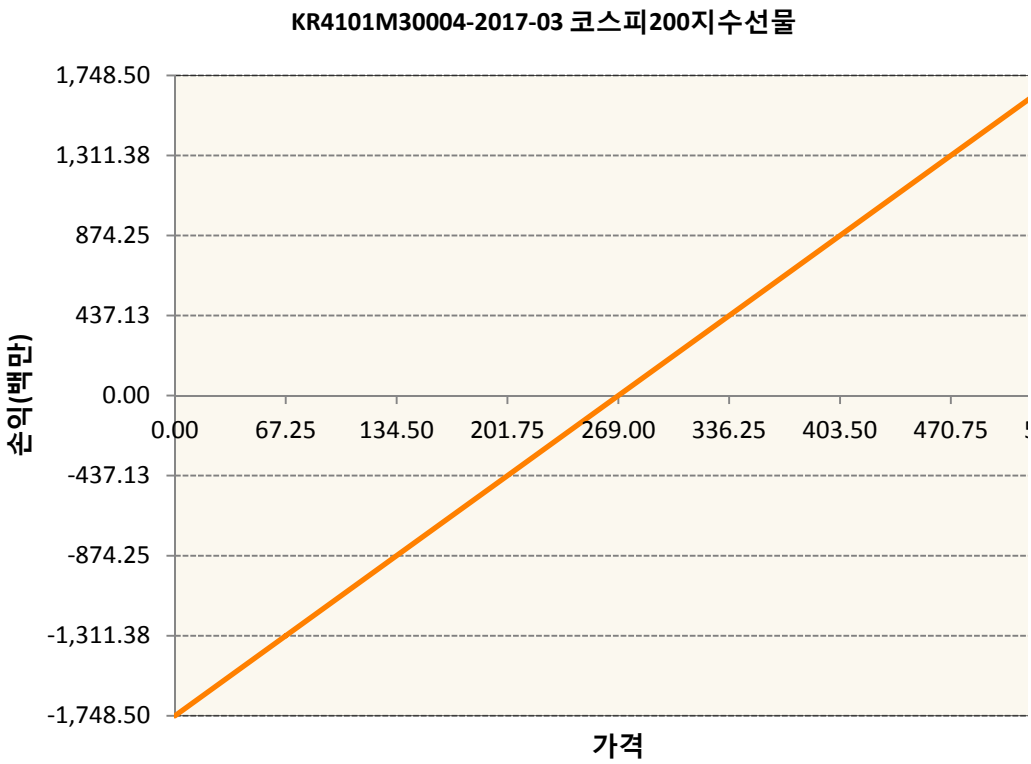
1.3배 레버리지 인덱스(주식-파생형)

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	1,749	0	1,749	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	2017-02-20
기준일	2017-02-17

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	948

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

617

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-02-20
기준일	2017-02-17

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	383

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

534

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-02-20
기준일	2017-02-17

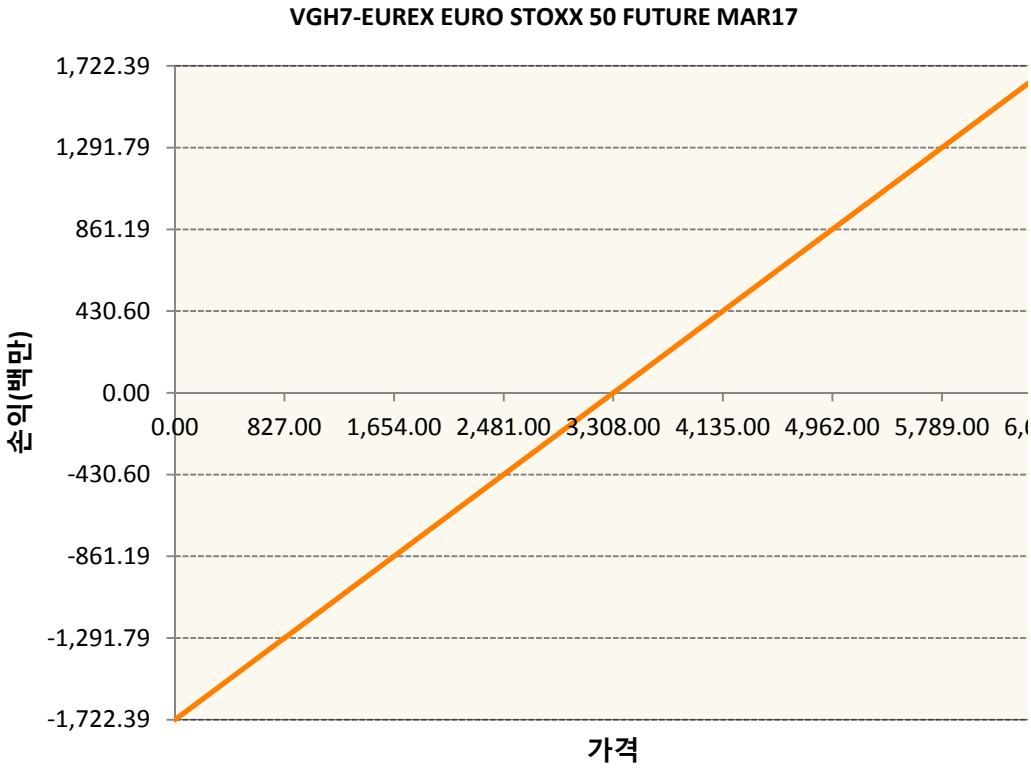
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,722	0	1,722	

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)

143

공시일	2017-02-20
기준일	2017-02-17

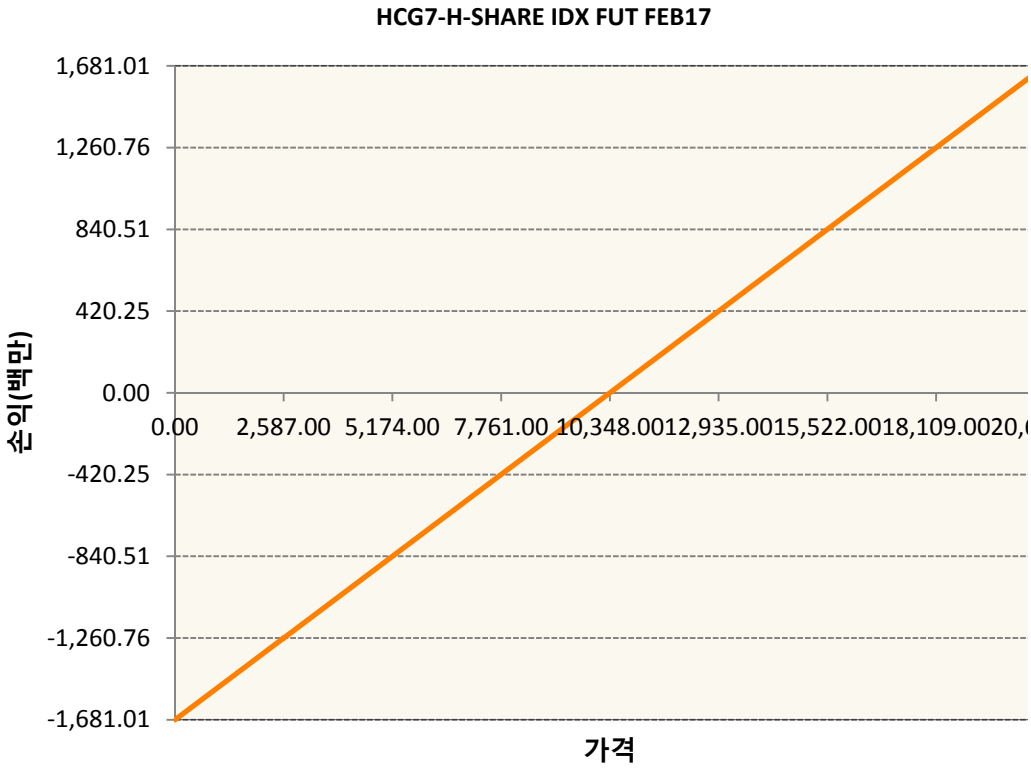
차이나인덱스모(주식-파생형)

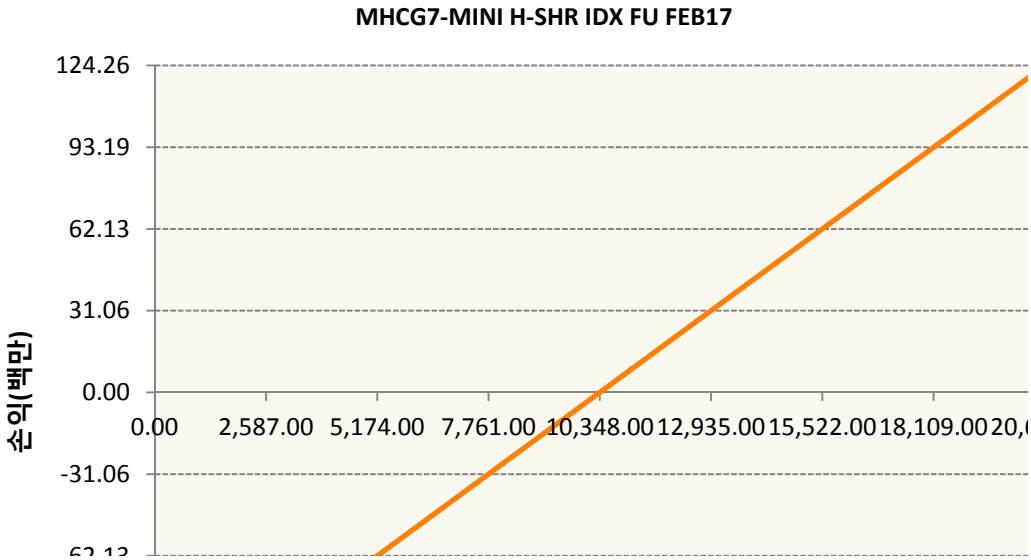
1. 계약금액

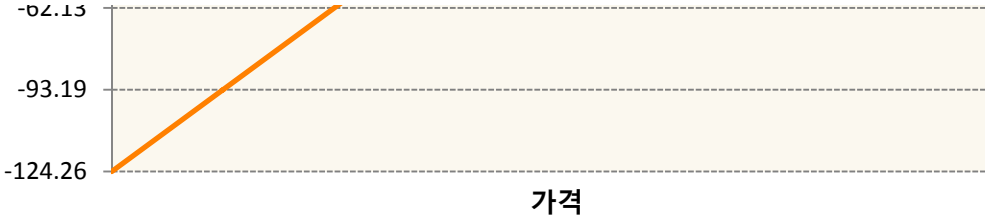
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,805	0	1,805	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

HCG7	H-SHARE IDX FUT FEB17	134
MHCG7	MINI H-SHR IDX FU FEB17	10

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

167

공시일	2017-02-20
기준일	2017-02-17

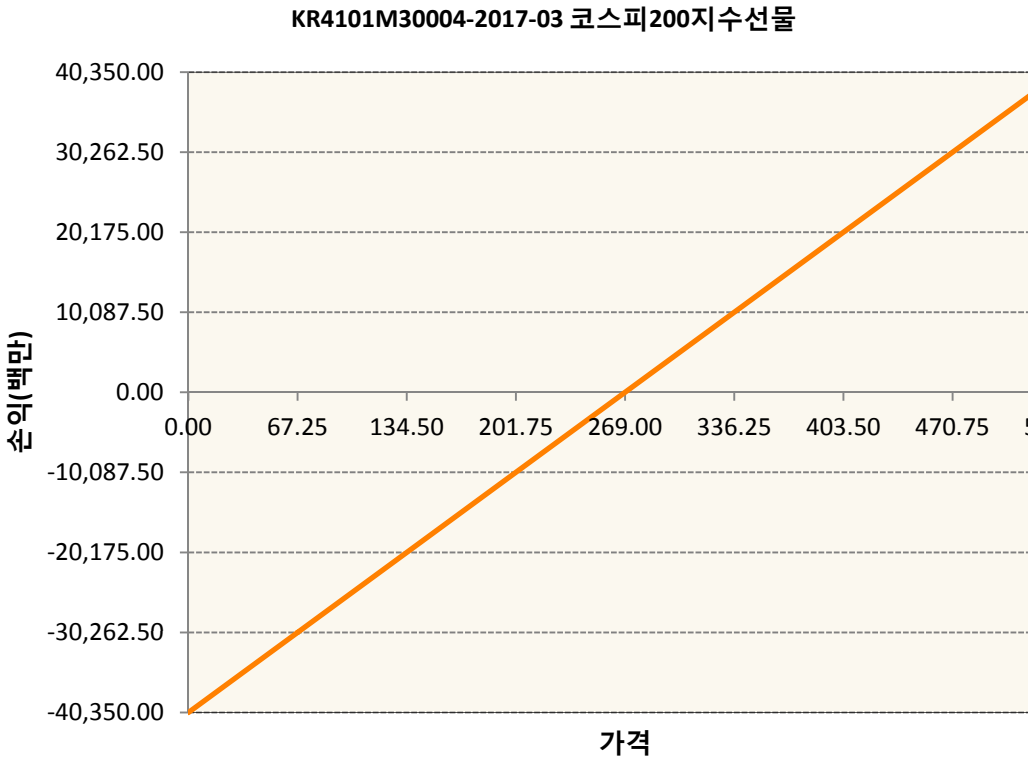
커버드콜모(주식혼합-파생형)

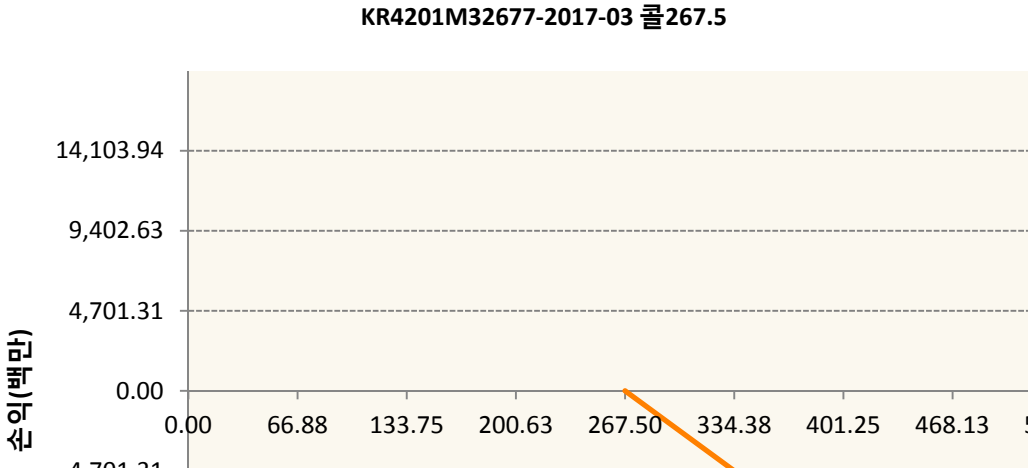
1. 계약금액

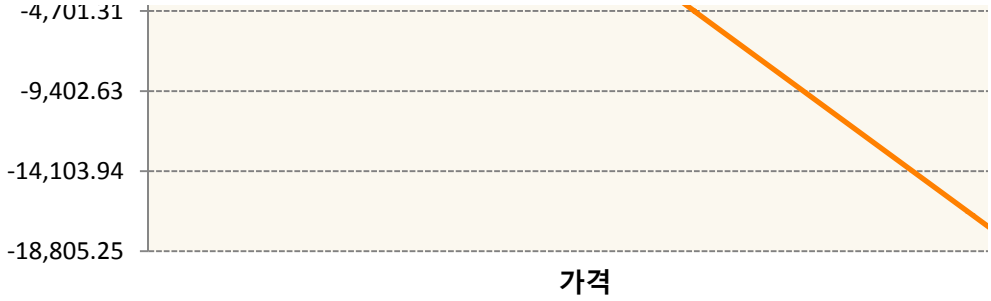
(단위:백만원)

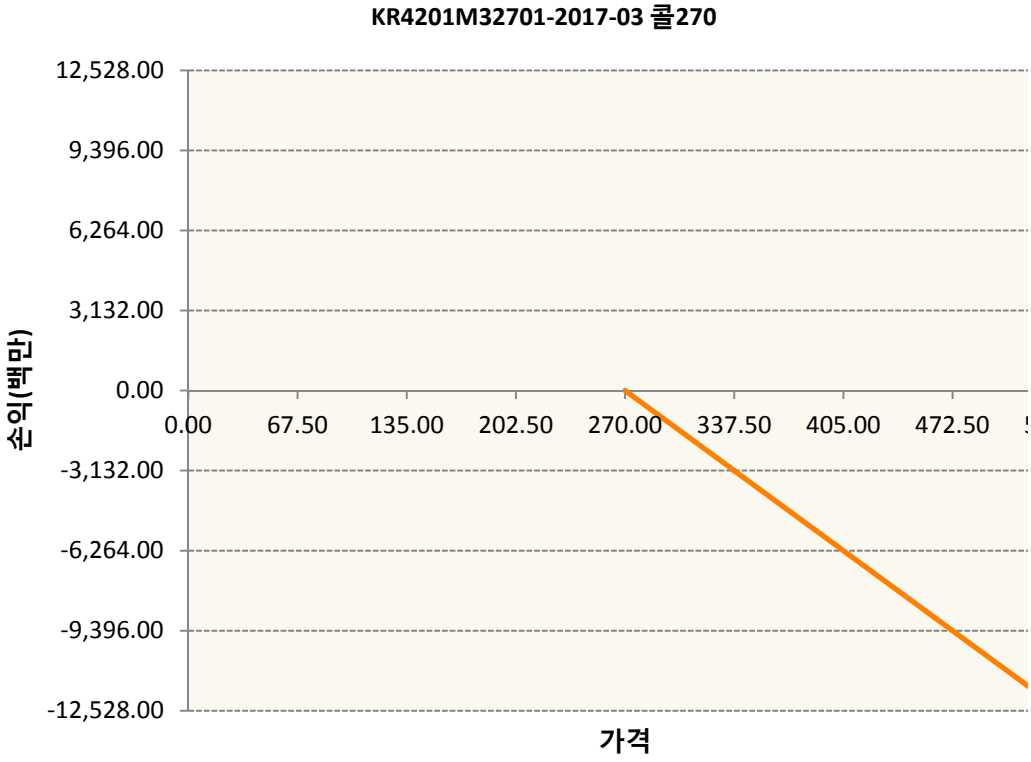
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	2,017	0	2,017	장내
신규	유가증권	옵션	0	406	-406	장내
누계	유가증권	선물	40,350	0	40,350	장내
누계	유가증권	옵션	0	31,333	-31,333	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101M30(2017-03 코스피200지수선물							3,226
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-3,226	-3,226	-3,226	-3,226	-3,226	-3,226	-3,226
-5.33%	-2,151	-2,151	-2,151	-2,151	-2,151	-2,151	-2,151
-2.67%	-1,075	-1,075	-1,075	-1,075	-1,075	-1,075	-1,075
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	1,075	1,075	1,075	1,075	1,075	1,075	1,075
5.33%	2,151	2,151	2,151	2,151	2,151	2,151	2,151
8.00%	3,226	3,226	3,226	3,226	3,226	3,226	3,226
KR4201M32(2017-03 콜267.5							6,914
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,115	1,115	1,115	1,115	1,114	1,114	1,113
-5.33%	1,114	1,113	1,109	1,104	1,096	1,086	1,072
-2.67%	1,040	1,007	968	926	880	831	780
0%	208	139	70	0	-70	-140	-210
2.67%	-1,898	-1,914	-1,935	-1,961	-1,991	-2,026	-2,064
5.33%	-4,394	-4,395	-4,396	-4,399	-4,403	-4,409	-4,418
8.00%	-6,912	-6,912	-6,912	-6,912	-6,912	-6,913	-6,914
KR4201M32 2017-03 콜270							4,277

	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%	445	445	444	443	441	438	433
-2.67%	431	421	407	390	371	348	324
0%	139	93	46	0	-47	-93	-140
2.67%	-1,000	-1,023	-1,049	-1,078	-1,109	-1,143	-1,177
5.33%	-2,612	-2,614	-2,617	-2,621	-2,628	-2,636	-2,647
8.00%	-4,273	-4,273	-4,274	-4,274	-4,274	-4,275	-4,277

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

16,170

공시일	2017-02-20
기준일	2017-02-17

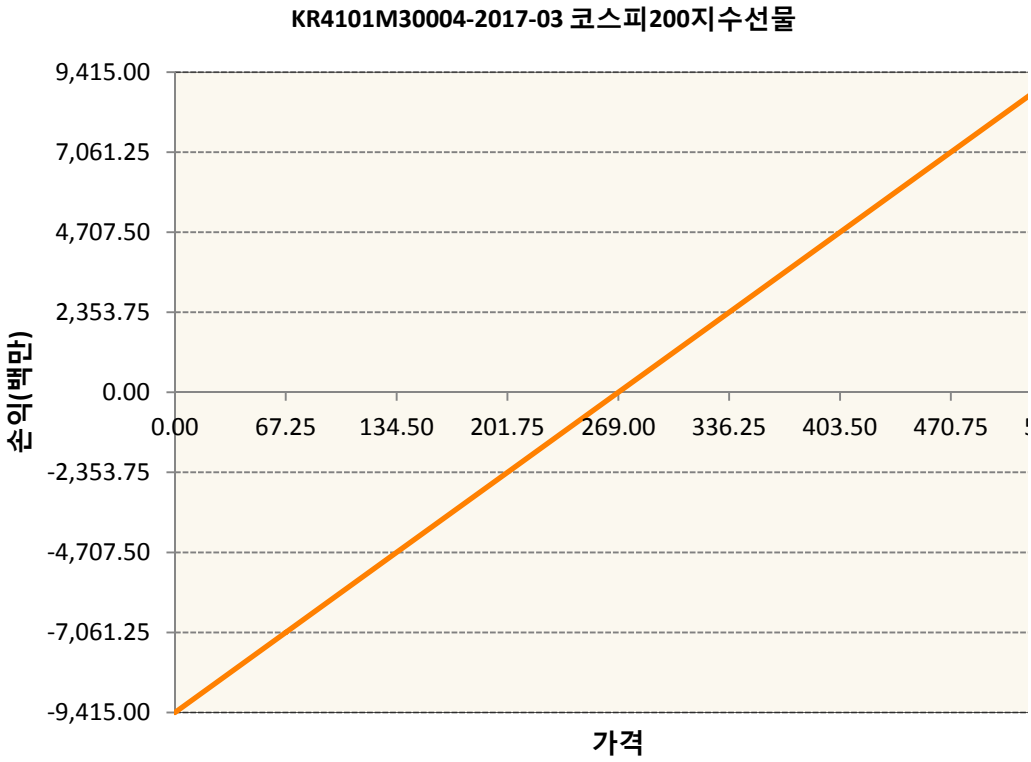
커버드콜목표전환형증권투자신탁

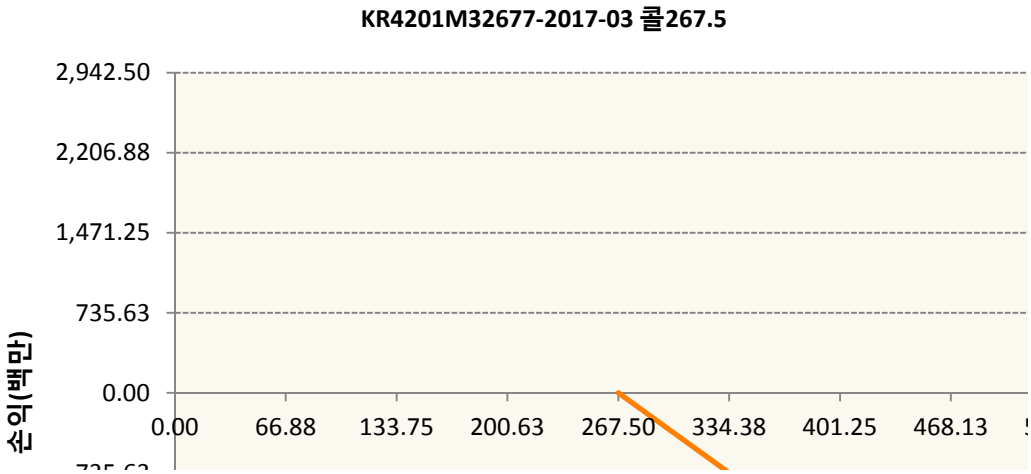
1. 계약금액

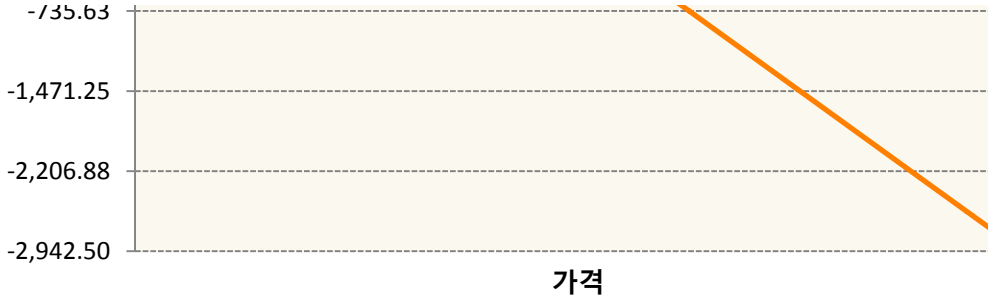
(단위:백만원)

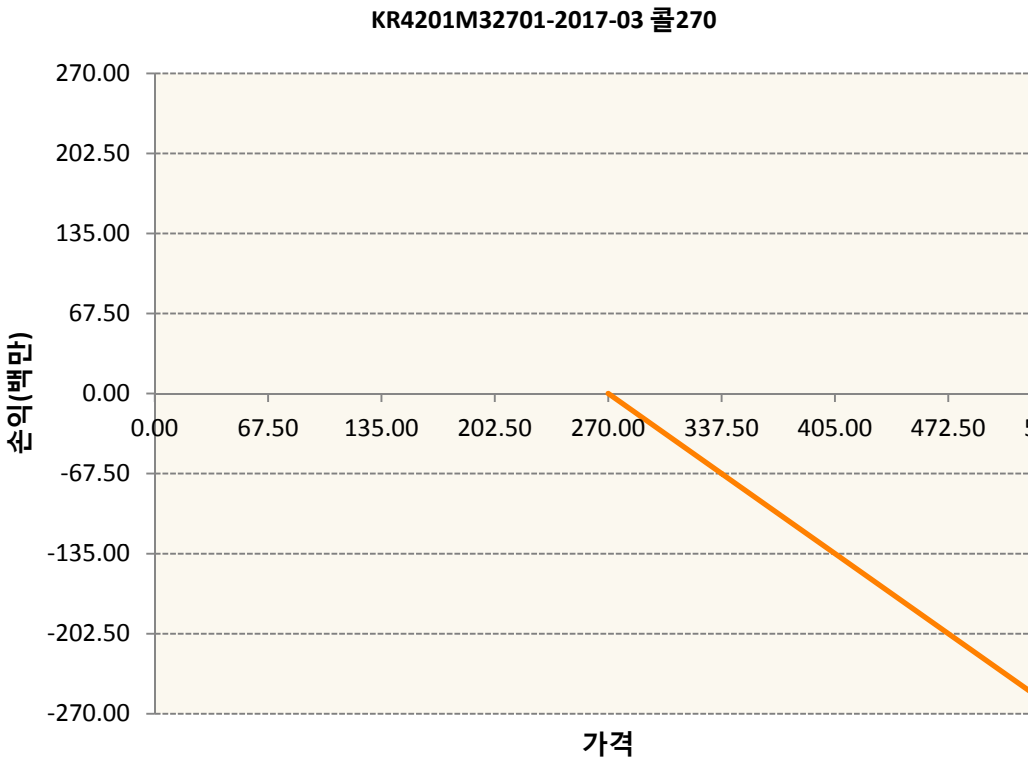
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	9,415	0	9,415	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,213	-3,213	장내

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%	174	174	174	174	174	174	174
-5.33%	174	174	174	173	172	170	168
-2.67%	163	158	152	145	138	130	122
0%	32	22	11	0	-11	-22	-33
2.67%	-297	-299	-303	-307	-312	-317	-323
5.33%	-688	-688	-688	-688	-689	-690	-691
8.00%	-1,082	-1,082	-1,082	-1,082	-1,082	-1,082	-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	9	9
-2.67%	9	9	9	8	8	8	7
0%	3	2	1	0	-1	-2	-3
2.67%	-22	-22	-23	-23	-24	-25	-25
5.33%	-56	-56	-56	-56	-57	-57	-57
8.00%	-92	-92	-92	-92	-92	-92	-92

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

1,984

공시일	2017-02-20
기준일	2017-02-17

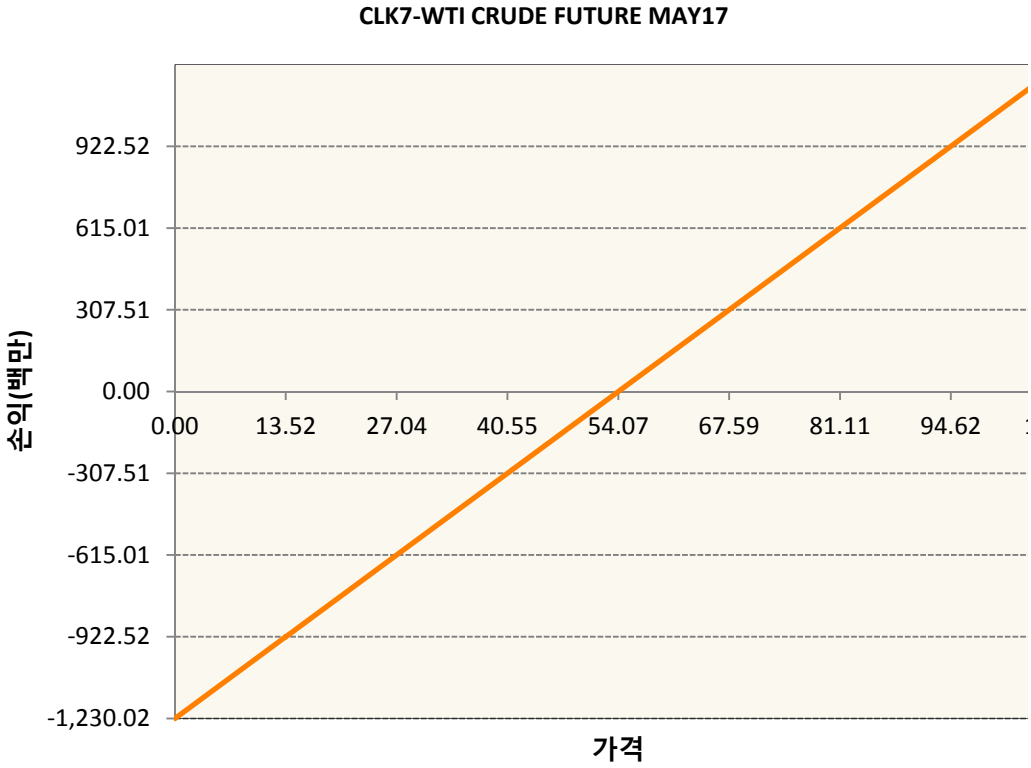
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

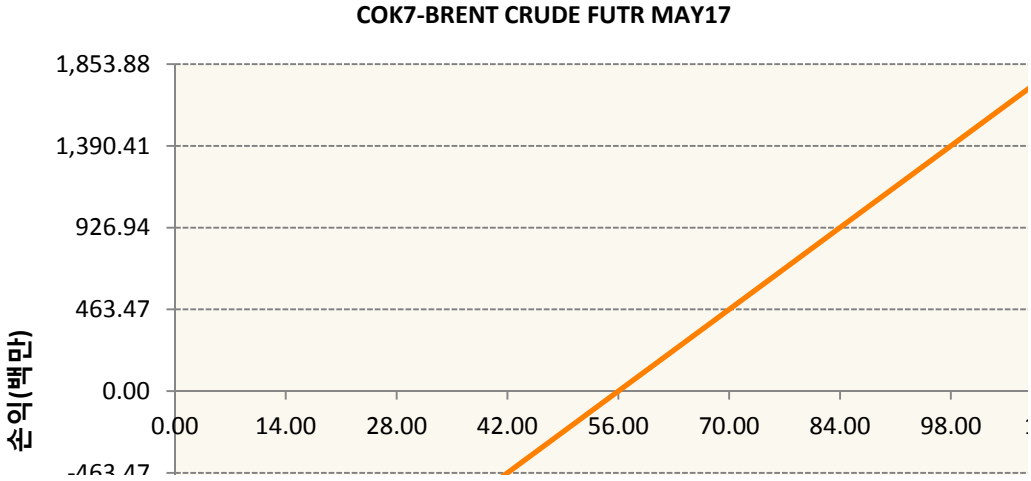
1. 계약금액

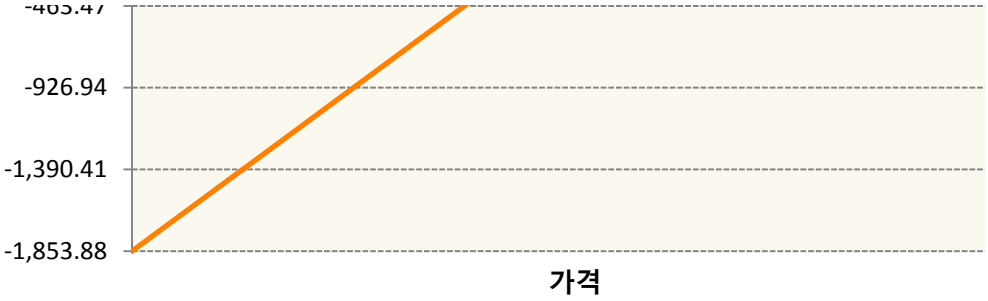
(단위:백만원)

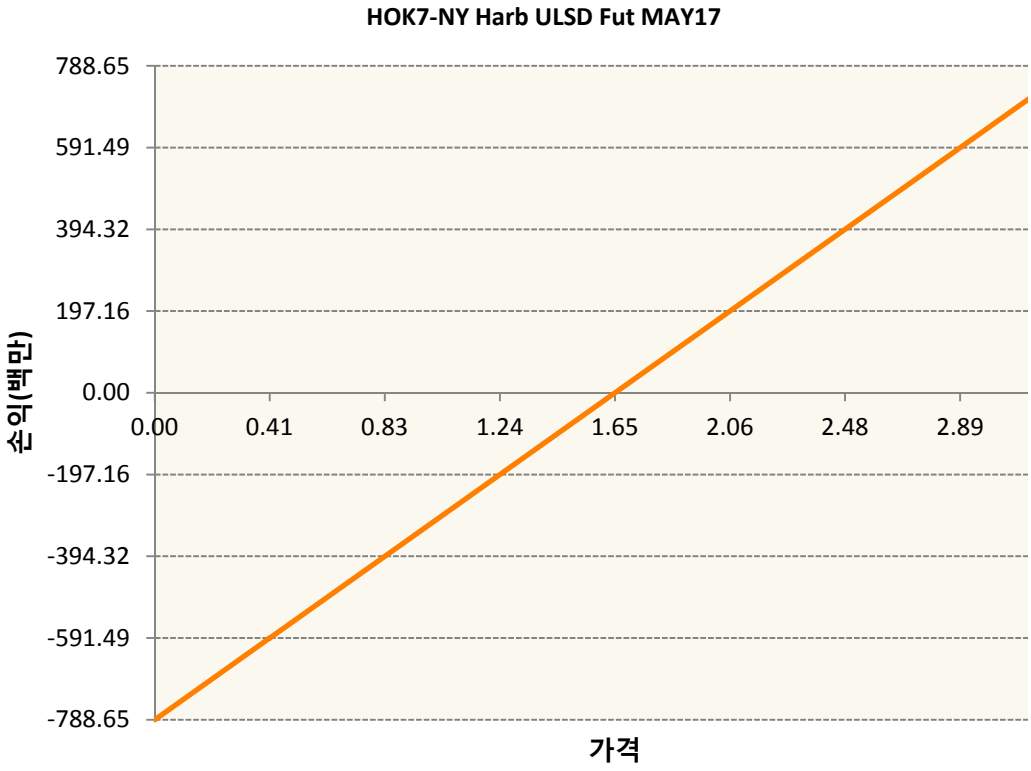
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	선물	유가증권	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	선물	유가증권	1,230	0	1,230	
누계	유가증권	선물	4,890	413	4,477	

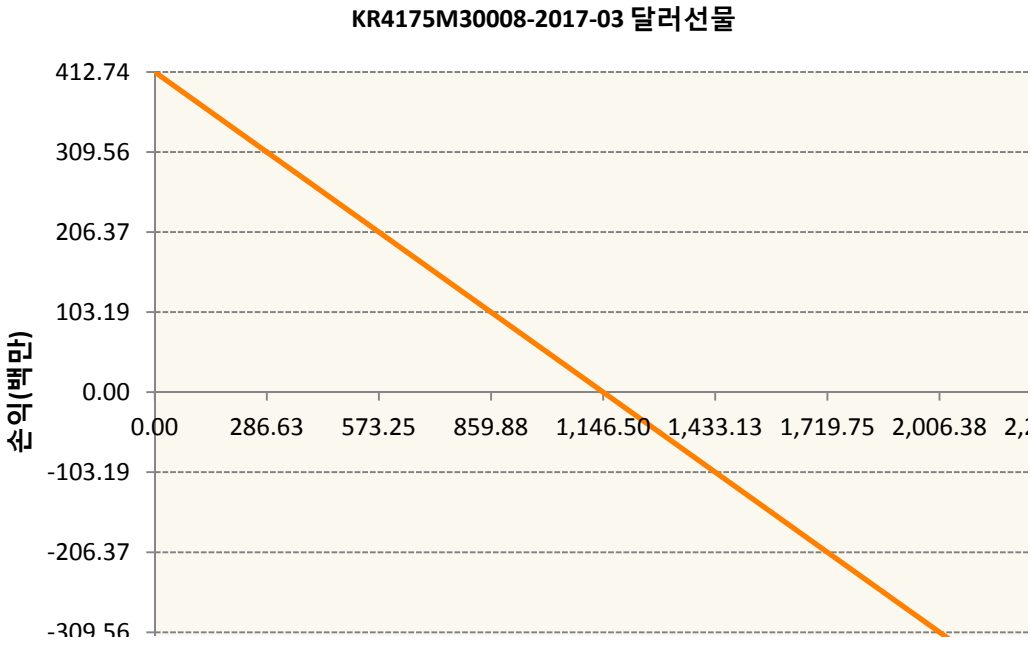
2. 만기시점의 손익구조

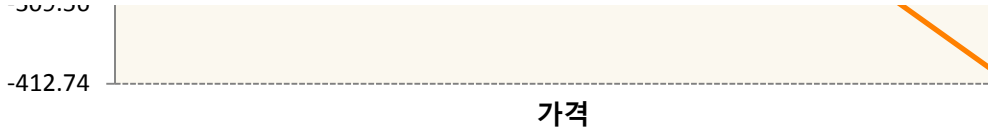


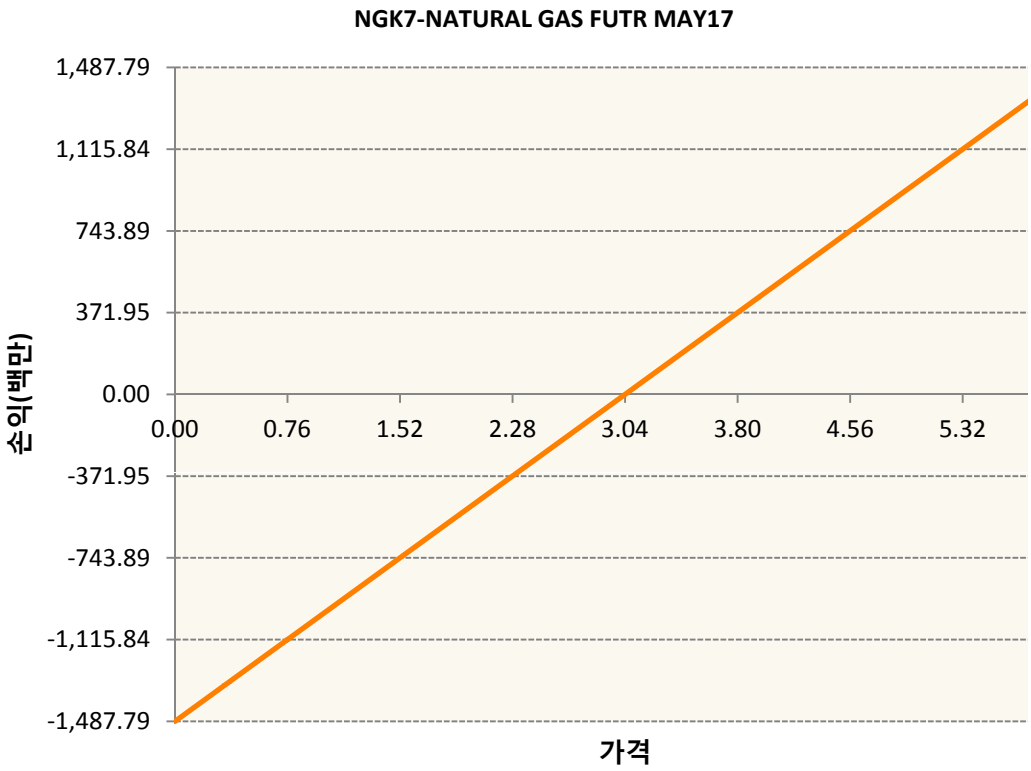


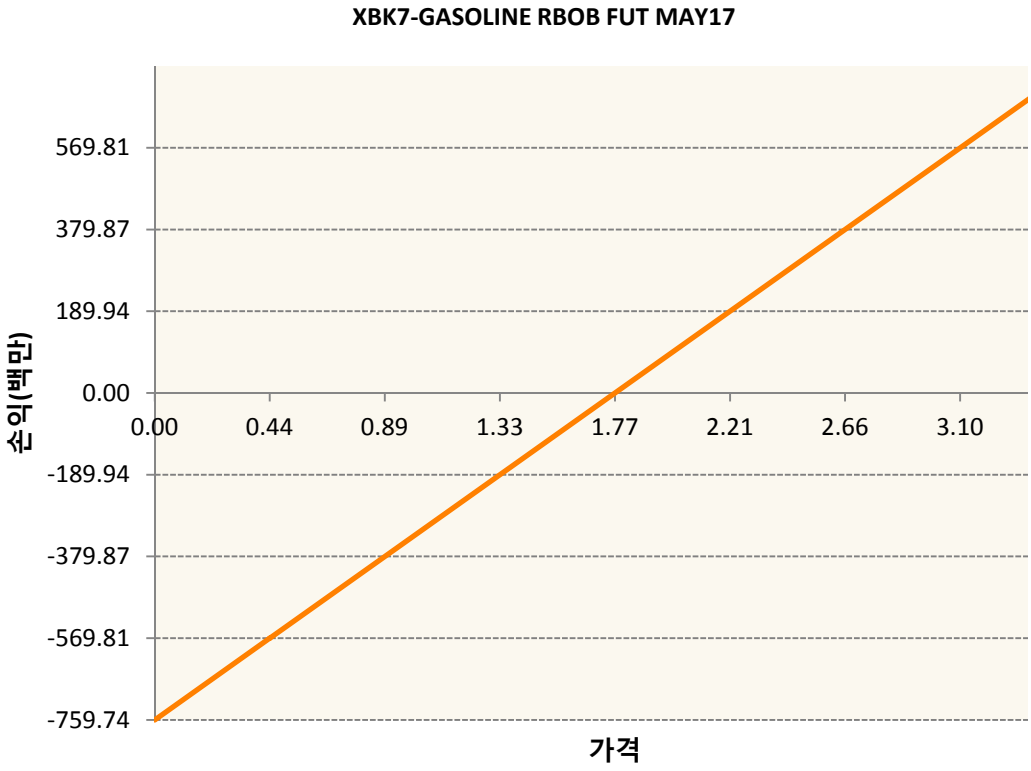

-926.94
-1,390.41
-1,853.88
가격


HOK7-NY Harb ULSD Fut MAY17
788.65
591.49
394.32
197.16
0.00
-197.16
-394.32
-591.49
-788.65
0.00
0.41
0.83
1.24
1.65
2.06
2.48
2.89
순익(백만)
가격


KR4175M30008-2017-03 달러선물
412.74
309.56
206.37
103.19
0.00
-103.19
-206.37
-309.56
0.00
286.63
573.25
859.88
1,146.50
1,433.13
1,719.75
2,006.38
순익(백만)


-412.74
가격


NGK7-NATURAL GAS FUTR MAY17
1,487.79
1,115.84
743.89
371.95
0.00
-371.95
-743.89
-1,115.84
-1,487.79
0.00
0.76
1.52
2.28
3.04
3.80
4.56
5.32
순익(백만)
가격


XBK7-GASOLINE RBOB FUT MAY17
569.81
379.87
189.94
0.00
-189.94
-379.87
-569.81
-759.74
0.00
0.44
0.89
1.33
1.77
2.21
2.66
3.10
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	63
KR4175M30(	2017-03 달러선물	33
NGK7	NATURAL GAS FUTR MAY17	119
XBK7	GASOLINE RBOB FUT MAY17	61

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

1,085

공시일	2017-02-20
기준일	2017-02-17

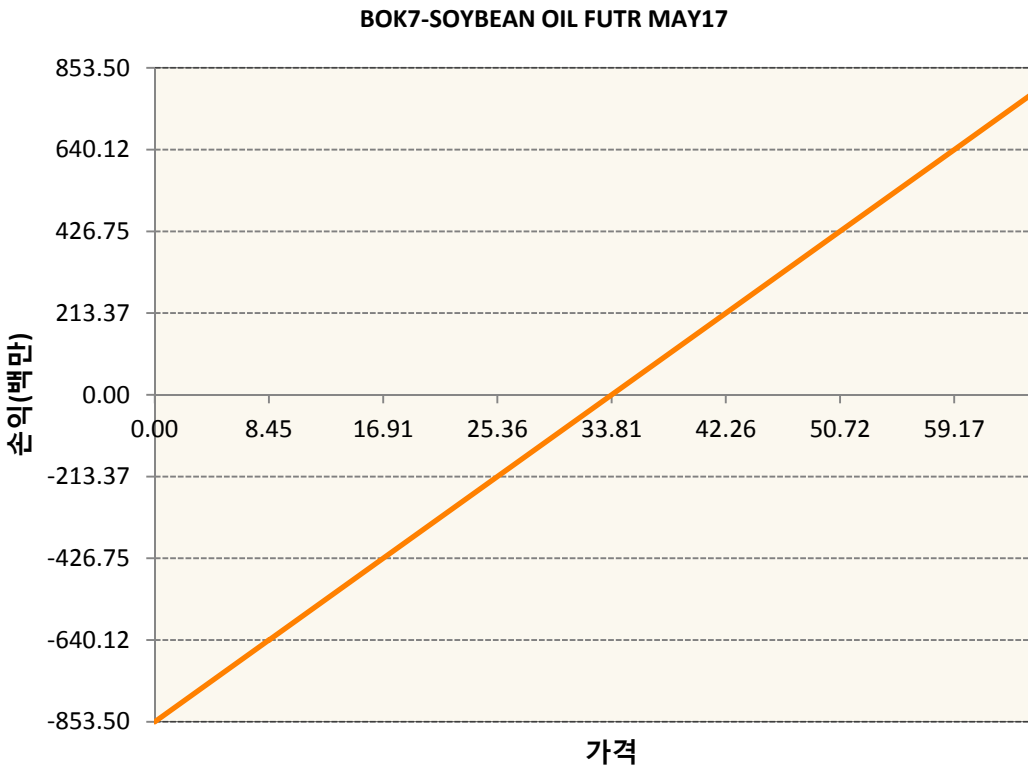
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

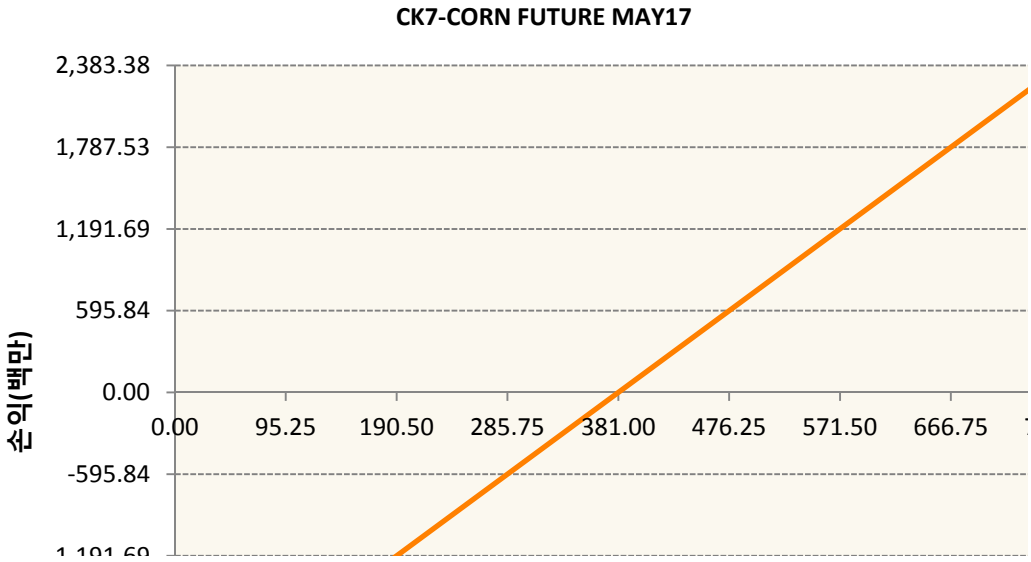
1. 계약금액

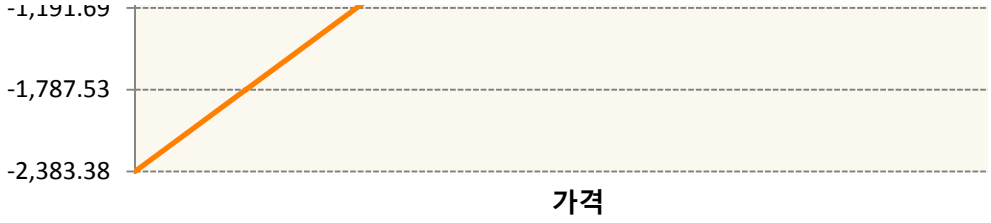
(단위:백만원)

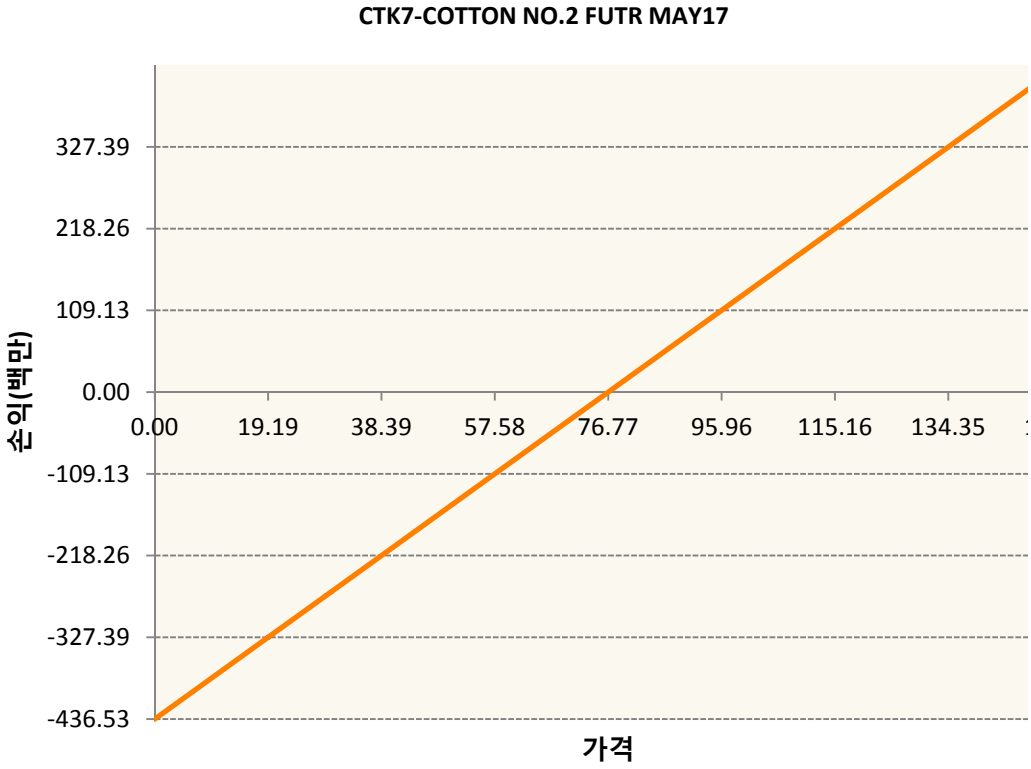
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	9,900	573	9,326	

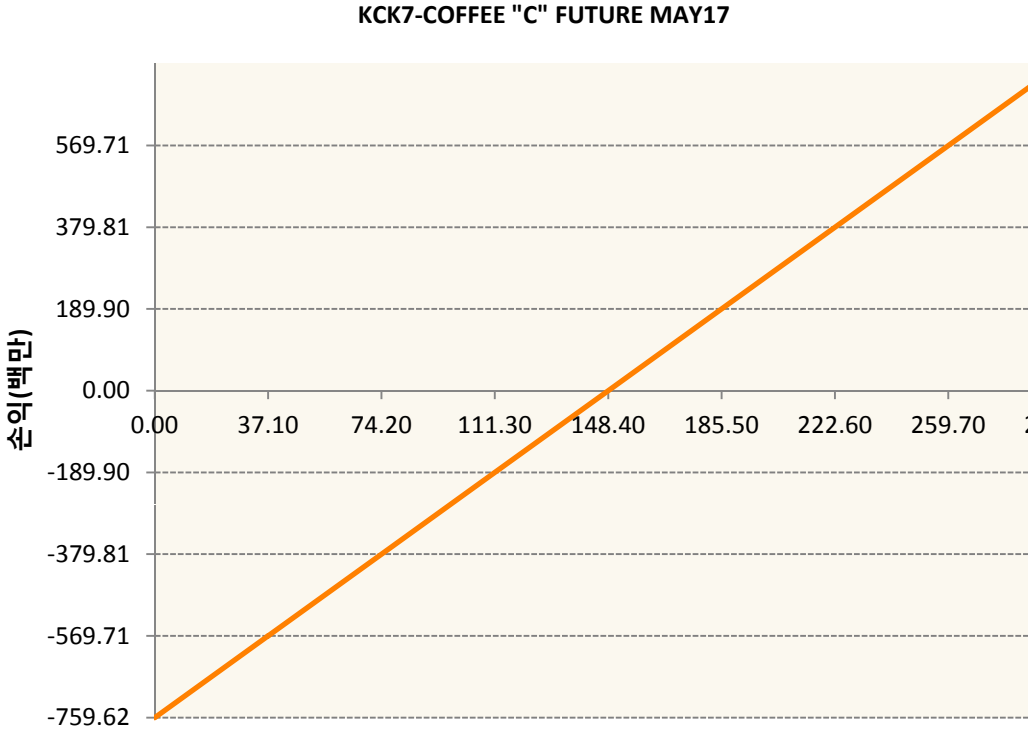
2. 만기시점의 손익구조



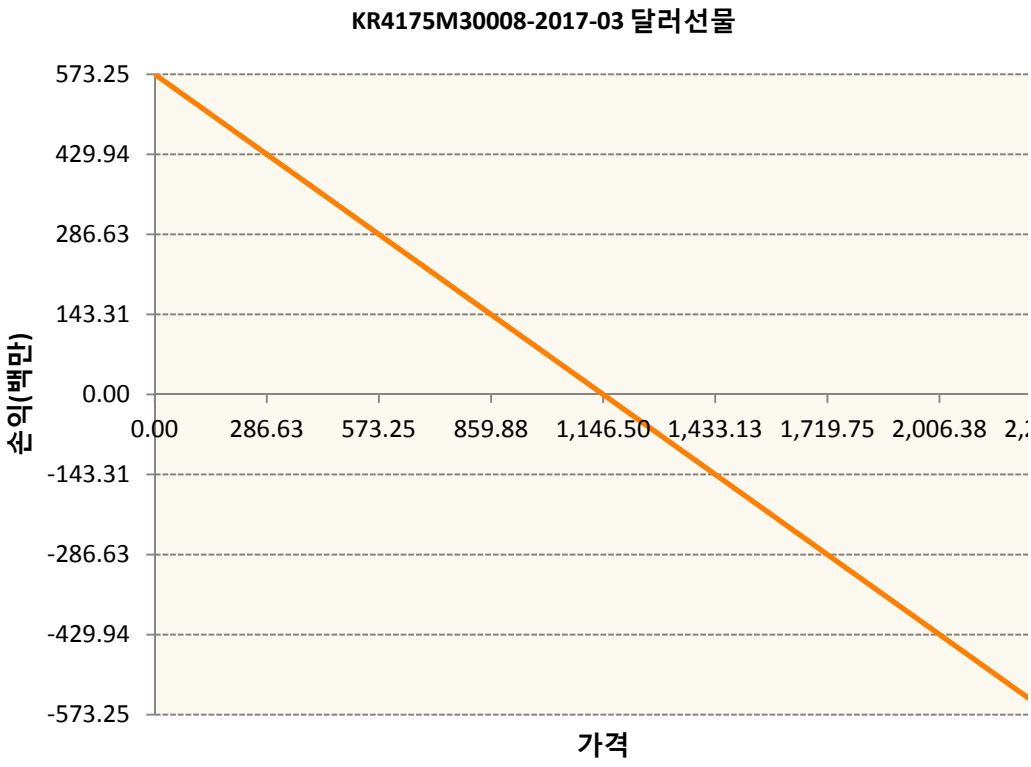


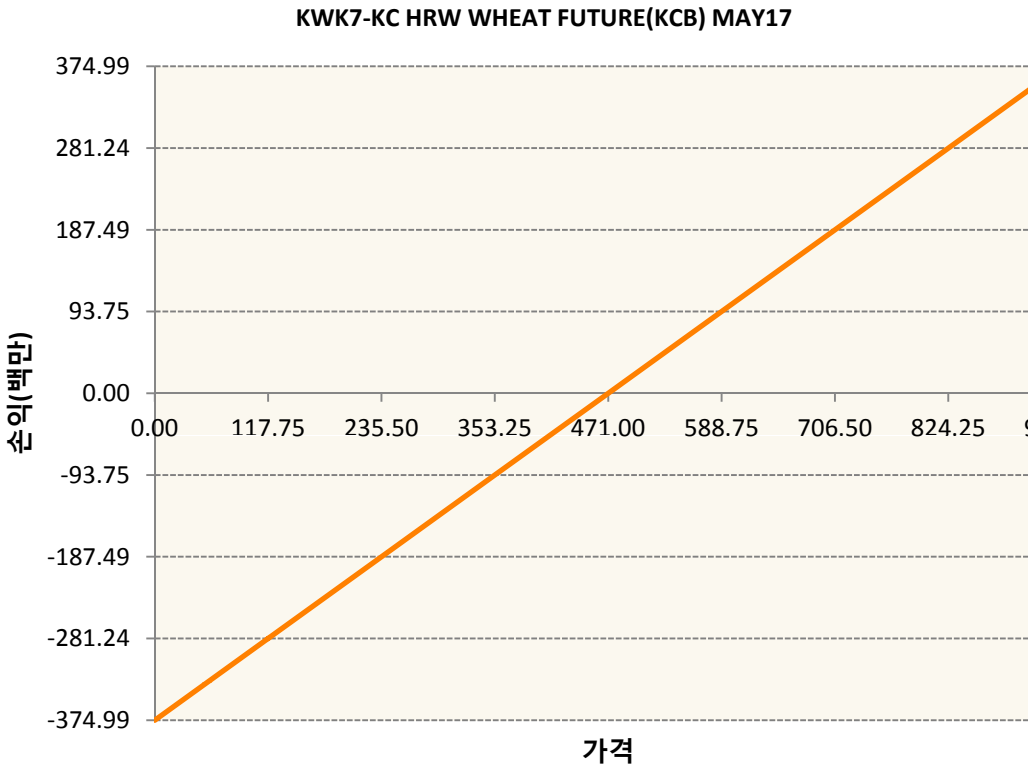

-1,787.53
-2,383.38
가격

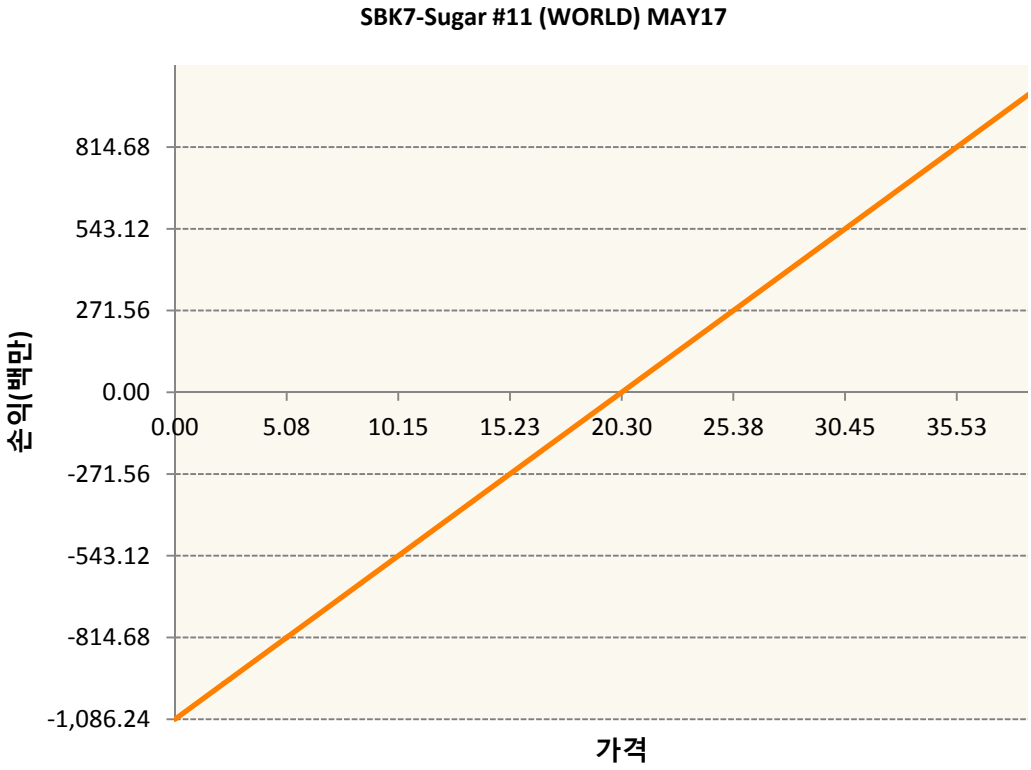

CTK7-COTTON NO.2 FUTR MAY17
327.39
218.26
109.13
0.00
-109.13
-218.26
-327.39
-436.53
0.00
19.19
38.39
57.58
76.77
95.96
115.16
134.35
순익(백만)
가격

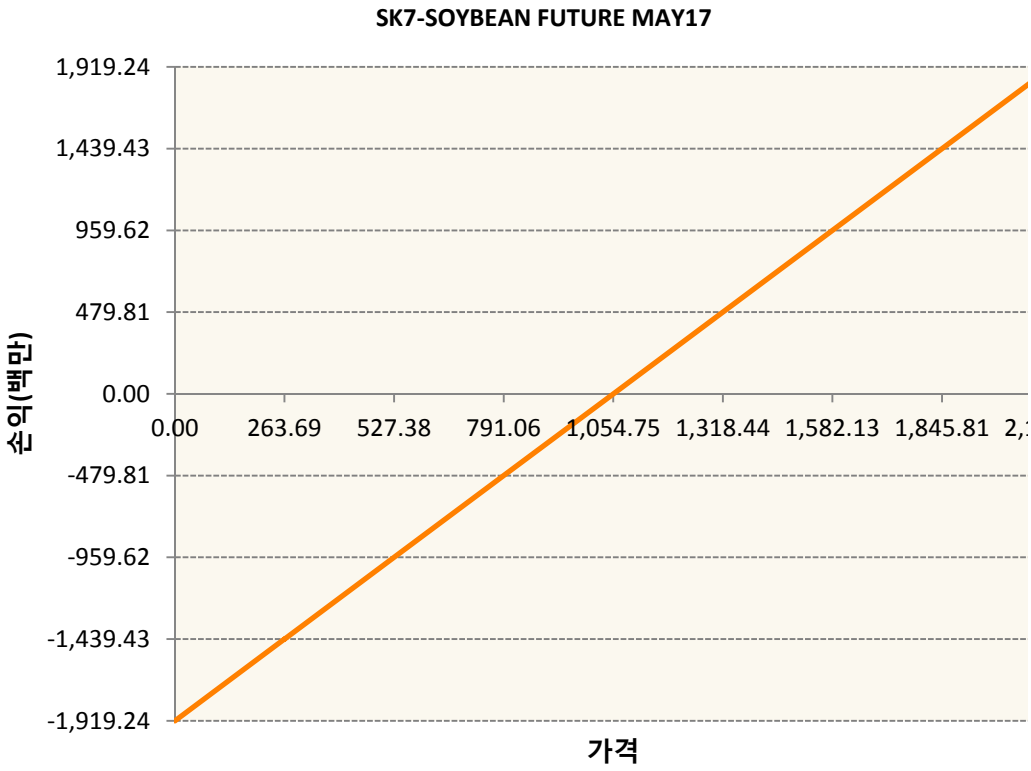

KCK7-COFFEE "C" FUTURE MAY17
569.71
379.81
189.90
0.00
-189.90
-379.81
-569.71
-759.62
0.00
37.10
74.20
111.30
148.40
185.50
222.60
259.70
순익(백만)

가격

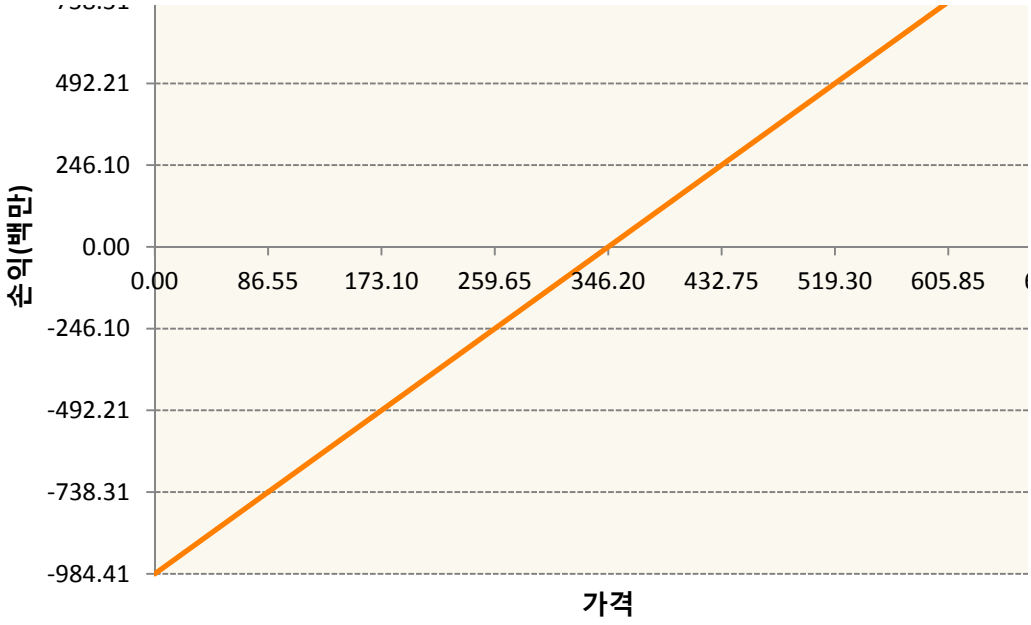

KR4175M30008-2017-03 달러선물
573.25
429.94
286.63
143.31
0.00
-143.31
-286.63
-429.94
-573.25
0.00
286.63
573.25
859.88
1,146.50
1,433.13
1,719.75
2,006.38
손익(백만)
가격

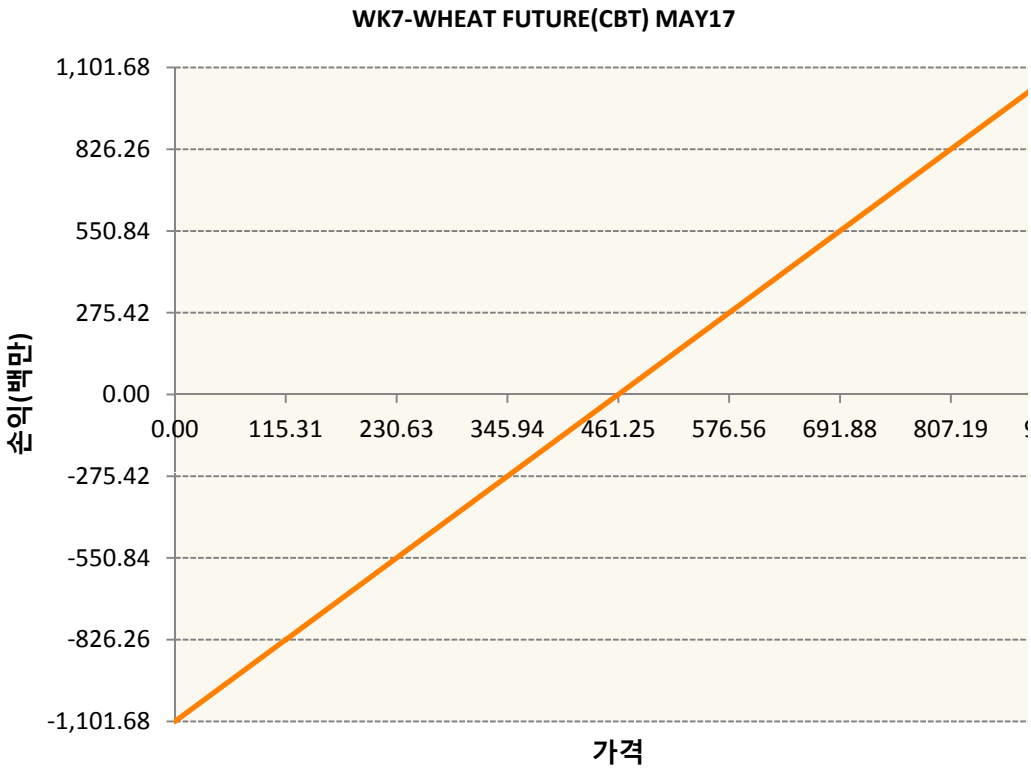

KWK7-KC HRW WHEAT FUTURE(KCB) MAY17
374.99
281.24
187.49
93.75
0.00
-93.75
-187.49
-281.24
-374.99
0.00
117.75
235.50
353.25
471.00
588.75
706.50
824.25
손익(백만)
가격


SBK7-Sugar #11 (WORLD) MAY17
814.68
543.12
271.56
0.00
-271.56
-543.12
-814.68
-1,086.24
손익(백만)
0.00
5.08
10.15
15.23
20.30
25.38
30.45
35.53
가격


SK7-SOYBEAN FUTURE MAY17
1,919.24
1,439.43
959.62
479.81
0.00
-479.81
-959.62
-1,439.43
-1,919.24
손익(백만)
0.00
263.69
527.38
791.06
1,054.75
1,318.44
1,582.13
1,845.81
가격


SMK7-SOYBEAN MEAL FUTR MAY17
738.31





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

BOK7	SOYBEAN OIL FUTR MAY17	68
CK7	CORN FUTURE MAY17	191
CTK7	COTTON NO.2 FUTR MAY17	35
KCK7	COFFEE "C" FUTURE MAY17	61
KR4175M30(	2017-03 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	79
WK7	WHEAT FUTURE(CBT) MAY17	88

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

929