공시일	2017-02-21
기준일	2017-02-20

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	2017-02-21
기준일	2017-02-20

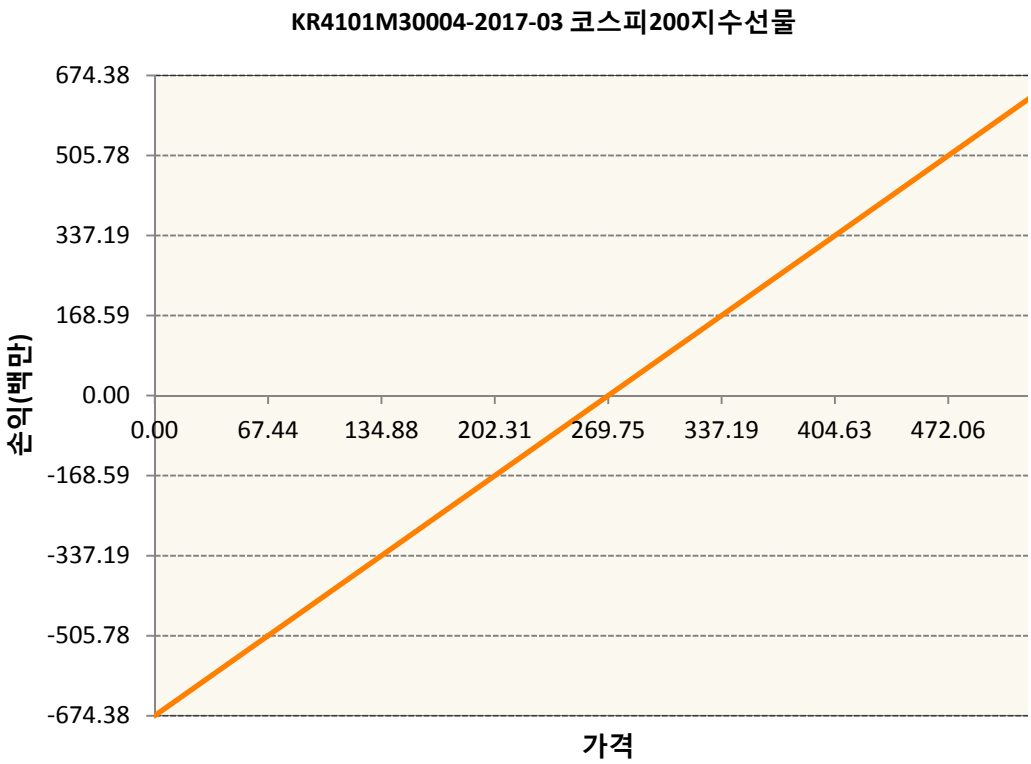
스마트인덱스모

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	674	0	674	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	2017-02-21
기준일	2017-02-20

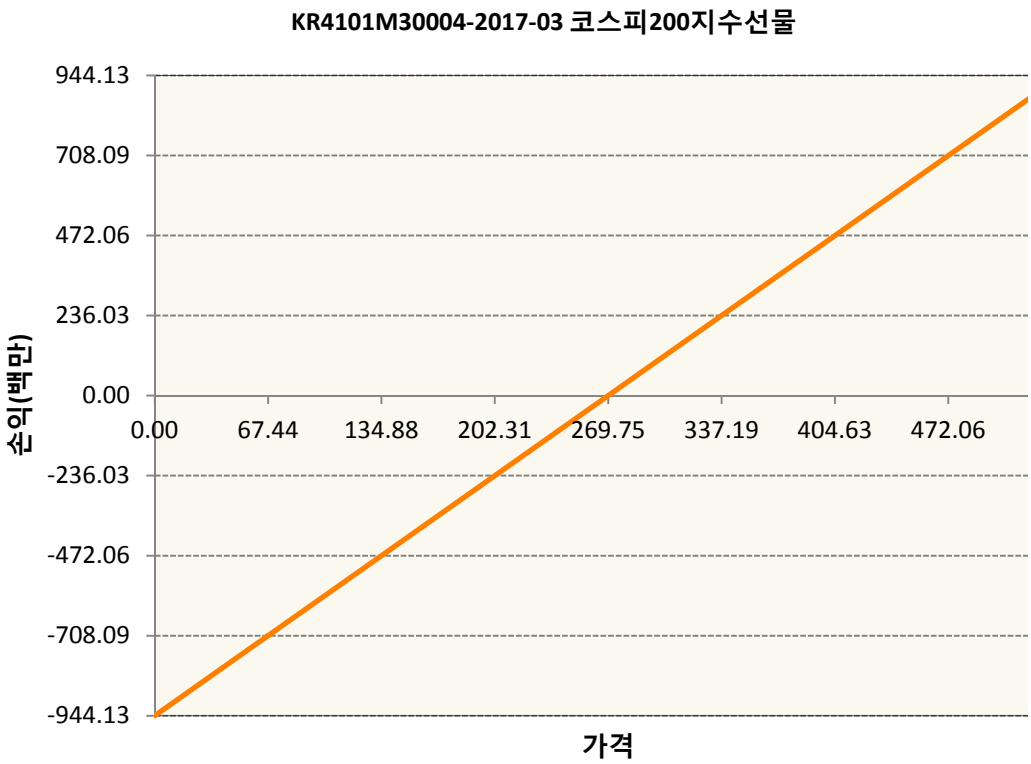
스마트레버리지목표전환형1호

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	944	0	944	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101M30(2017-03 코스피200지수선물							76
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-76	-76	-76	-76	-76	-76	-76
-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%	76	76	76	76	76	76	76

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

49

공시일	2017-02-21
기준일	2017-02-20

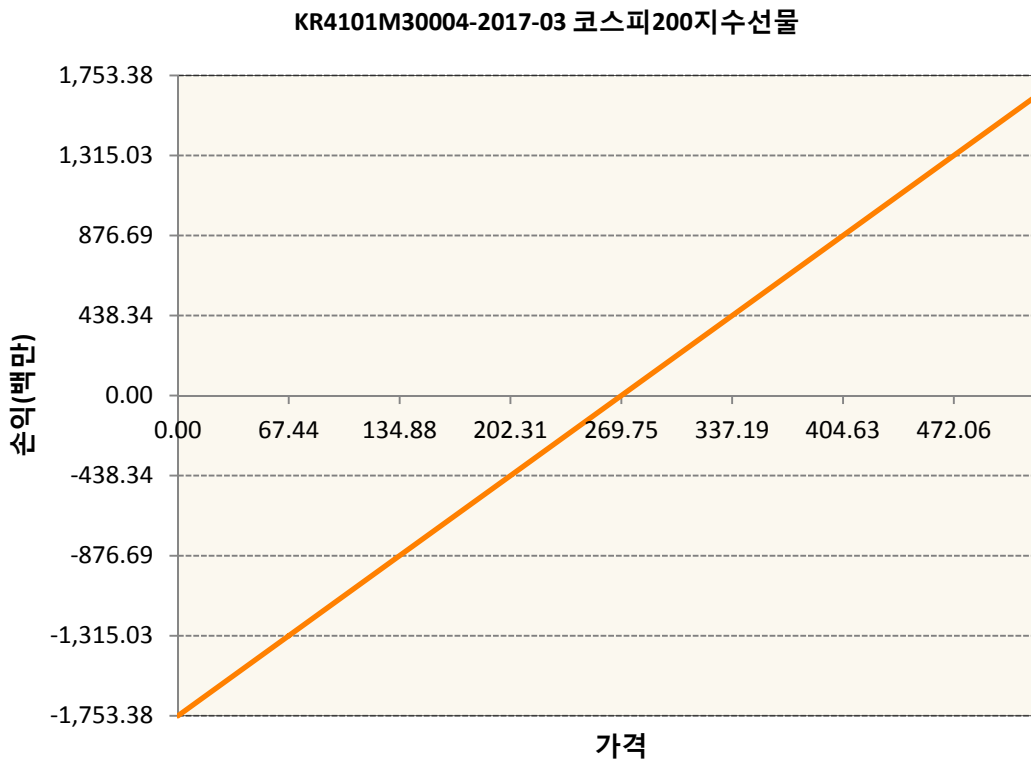
1.3배 레버리지 인덱스(주식-파생형)

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	1,753	0	1,753	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%	-94	-94	-94	-94	-94	-94	-94
-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%	94	94	94	94	94	94	94
8.00%	140	140	140	140	140	140	140

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

90

공시일	2017-02-21
기준일	2017-02-20

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	2017-02-21
기준일	2017-02-20

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	2017-02-21
기준일	2017-02-20

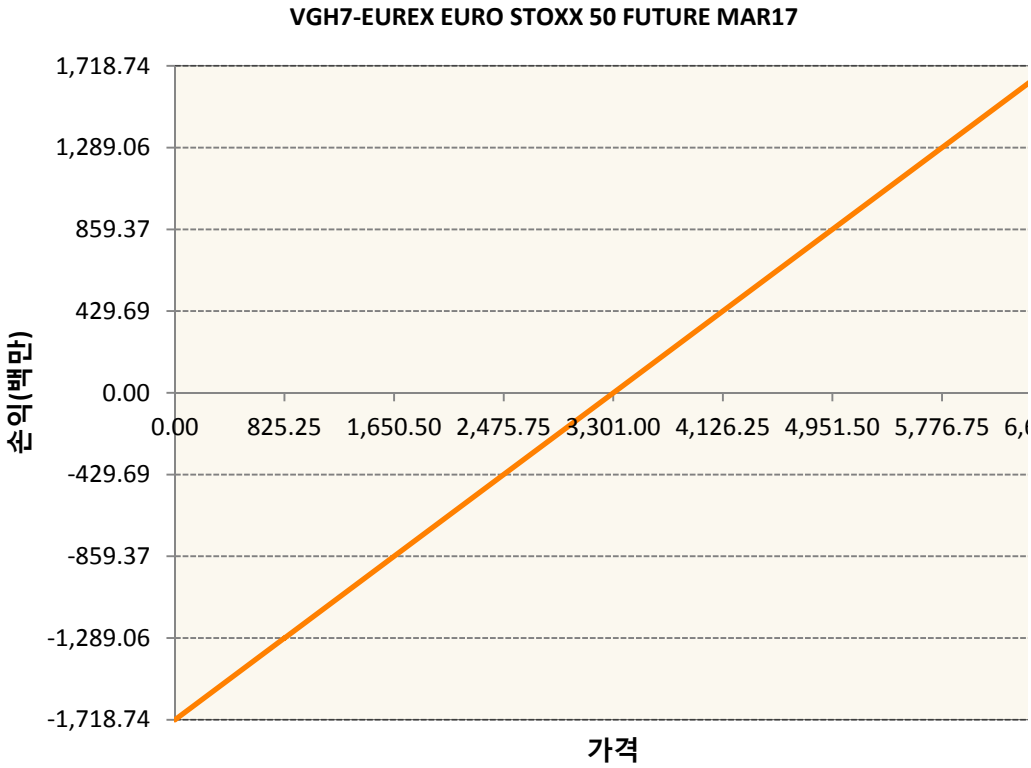
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,719	0	1,719	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGH7	EUREX EURO STOXX 50 FUTURE MAR17	137

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

(단위:백만원)

142

공시일	2017-02-21
기준일	2017-02-20

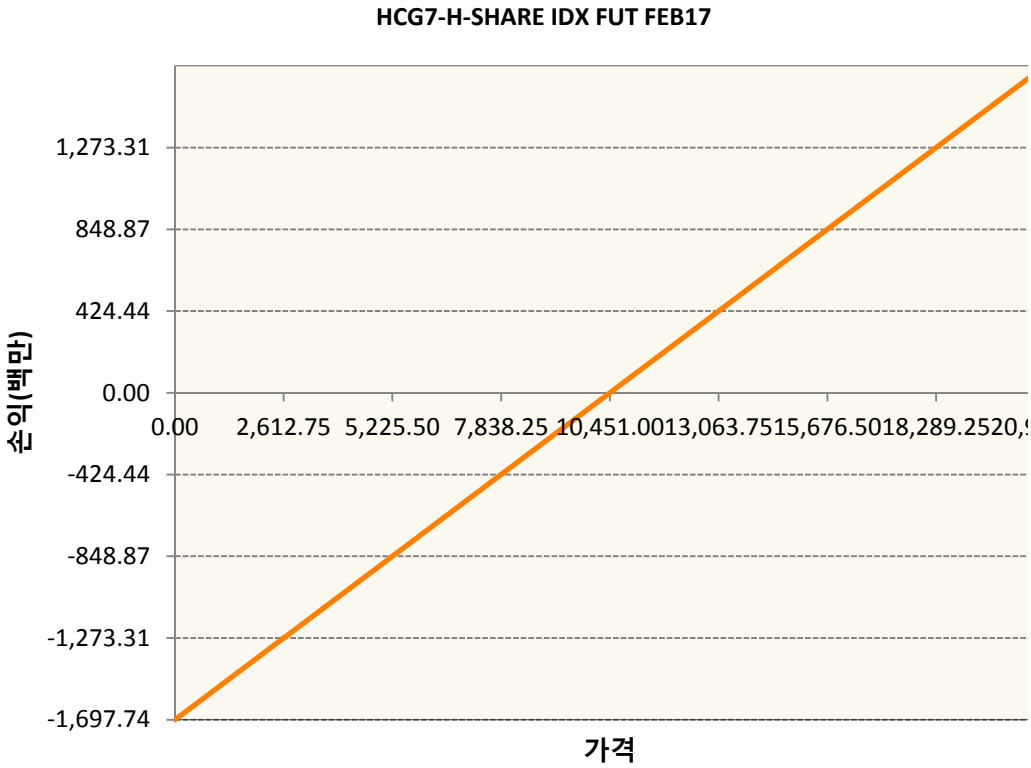
차이나인덱스모(주식-파생형)

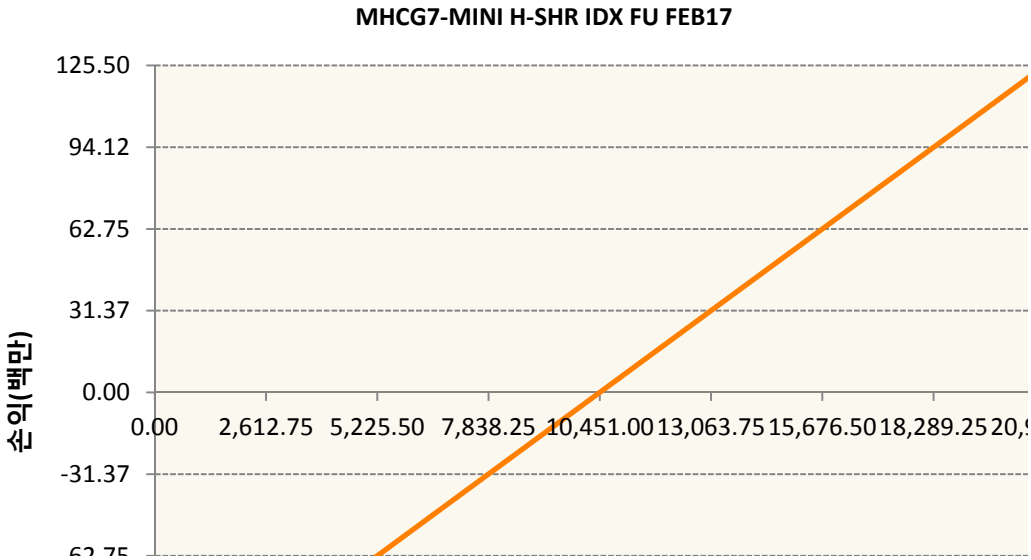
1. 계약금액

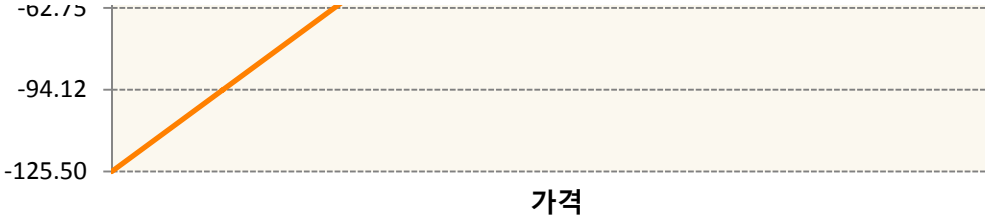
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,823	0	1,823	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCG7	H-SHARE IDX FUT FEB17	136
MHCG7	MINI H-SHR IDX FU FEB17	10

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	168

공시일	2017-02-21
기준일	2017-02-20

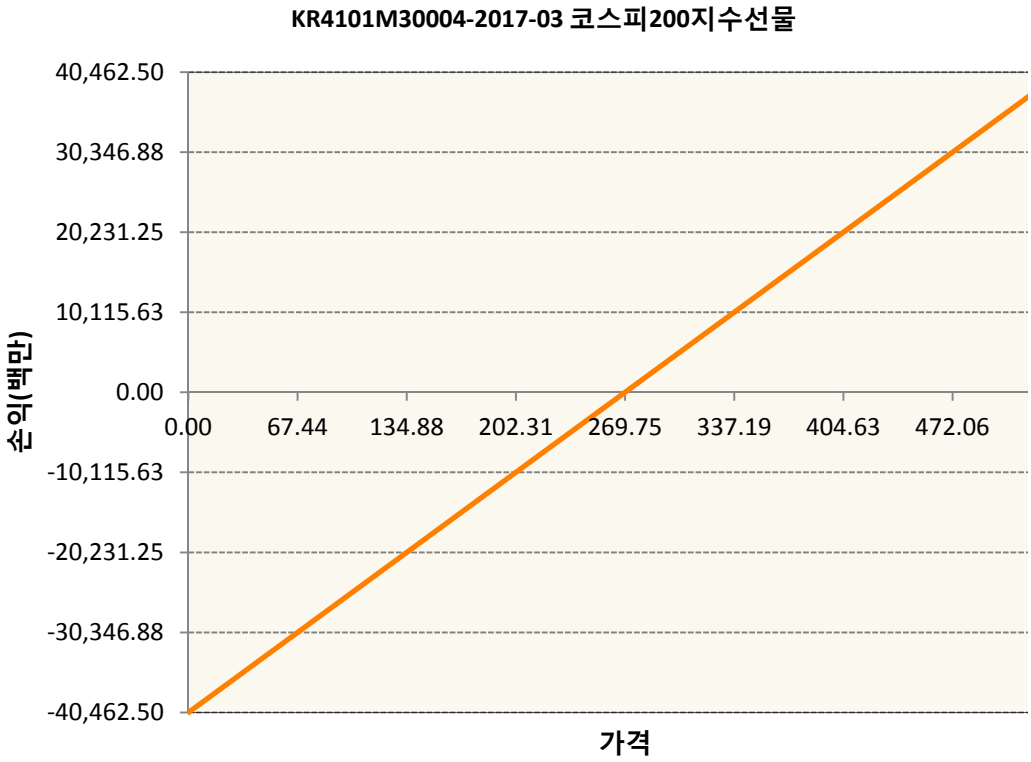
커버드콜모(주식혼합-파생형)

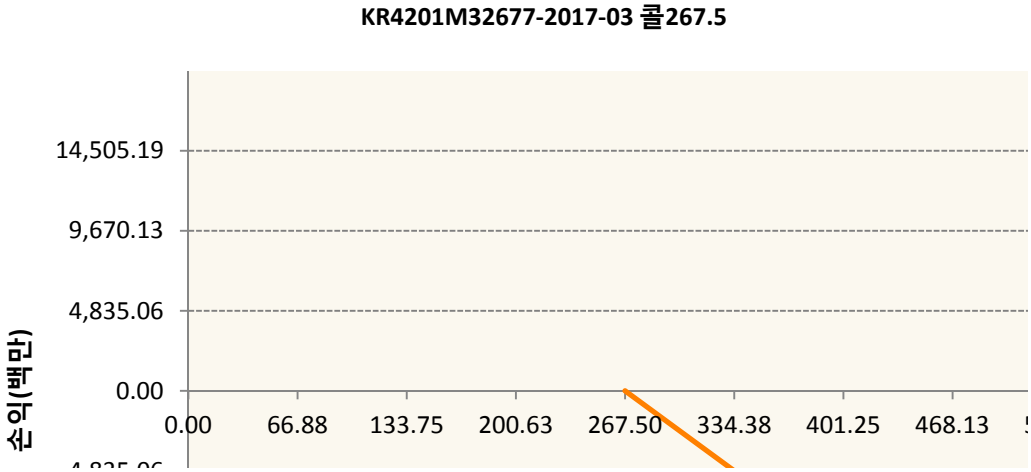
1. 계약금액

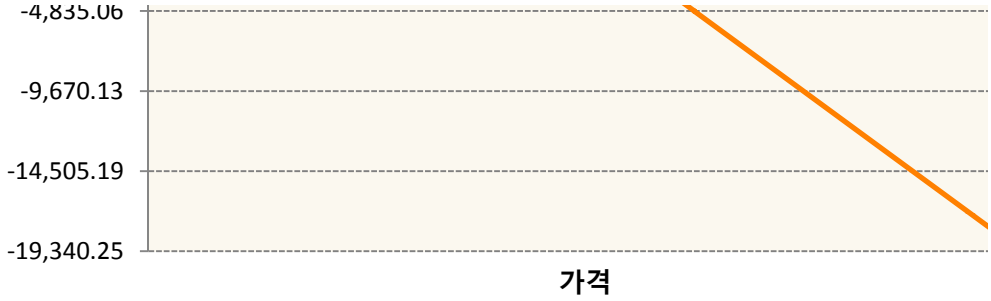
(단위:백만원)

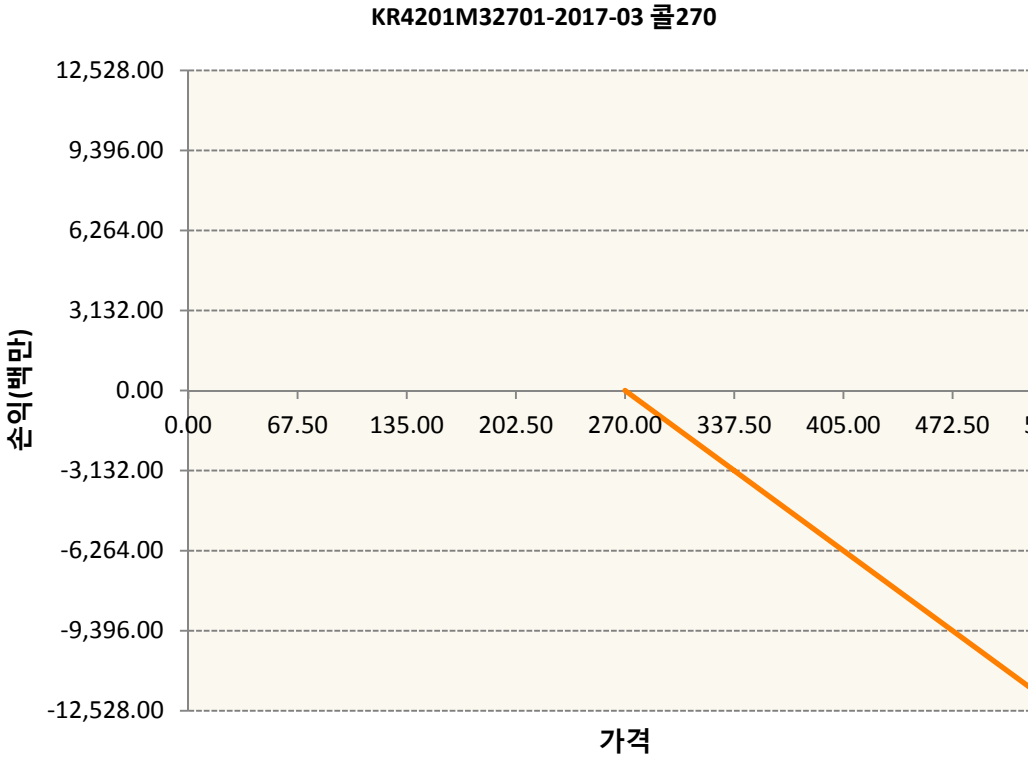
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	541	-541	장내
누계	유가증권	선물	40,463	0	40,463	장내
누계	유가증권	옵션	0	31,868	-31,868	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101M30(2017-03 코스피200지수선물							3,237
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-3,237	-3,237	-3,237	-3,237	-3,237	-3,237	-3,237
-5.33%	-2,158	-2,158	-2,158	-2,158	-2,158	-2,158	-2,158
-2.67%	-1,079	-1,079	-1,079	-1,079	-1,079	-1,079	-1,079
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	1,079	1,079	1,079	1,079	1,079	1,079	1,079
5.33%	2,158	2,158	2,158	2,158	2,158	2,158	2,158
8.00%	3,237	3,237	3,237	3,237	3,237	3,237	3,237
KR4201M32(2017-03 콜267.5							7,315
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,287	1,287	1,287	1,287	1,286	1,286	1,285
-5.33%	1,286	1,284	1,281	1,277	1,269	1,259	1,246
-2.67%	1,197	1,161	1,120	1,076	1,029	979	927
0%	186	125	63	0	-64	-128	-193
2.67%	-2,125	-2,134	-2,146	-2,162	-2,183	-2,207	-2,235
5.33%	-4,716	-4,716	-4,716	-4,717	-4,719	-4,722	-4,726
8.00%	-7,314	-7,314	-7,314	-7,314	-7,314	-7,314	-7,315
	KR4201M32 2017-03 콜270						4,442

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	499	499	499	499	499	499	499
-5.33%	499	499	498	497	496	493	489
-2.67%	484	473	459	442	423	401	377
0%	132	88	44	0	-44	-88	-132
2.67%	-1,130	-1,144	-1,162	-1,182	-1,206	-1,231	-1,259
5.33%	-2,774	-2,774	-2,775	-2,777	-2,780	-2,785	-2,791
8.00%	-4,441	-4,441	-4,441	-4,441	-4,441	-4,441	-4,442

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

17,337

공시일	2017-02-21
기준일	2017-02-20

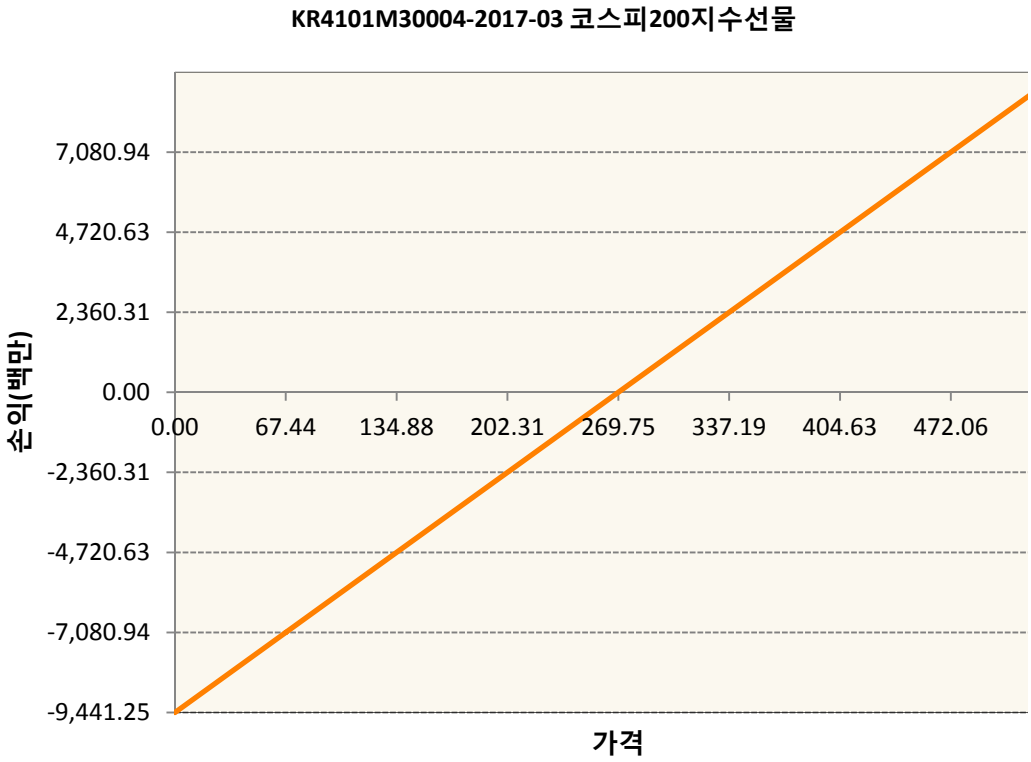
커버드콜목표전환형증권투자신탁

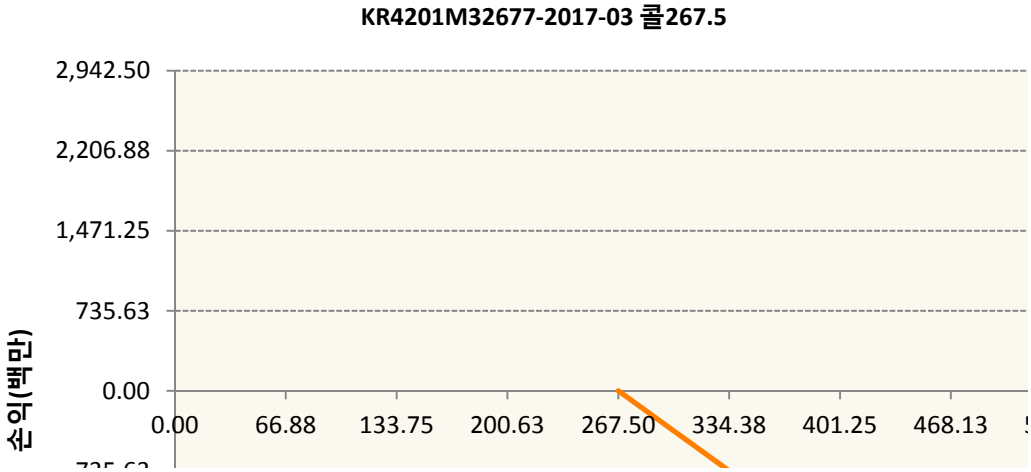
1. 계약금액

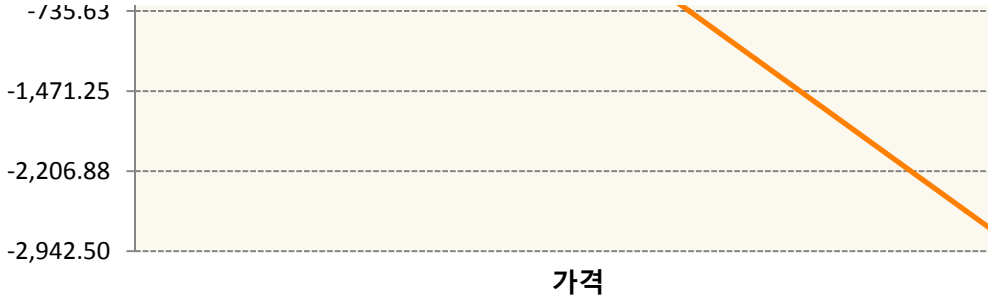
(단위:백만원)

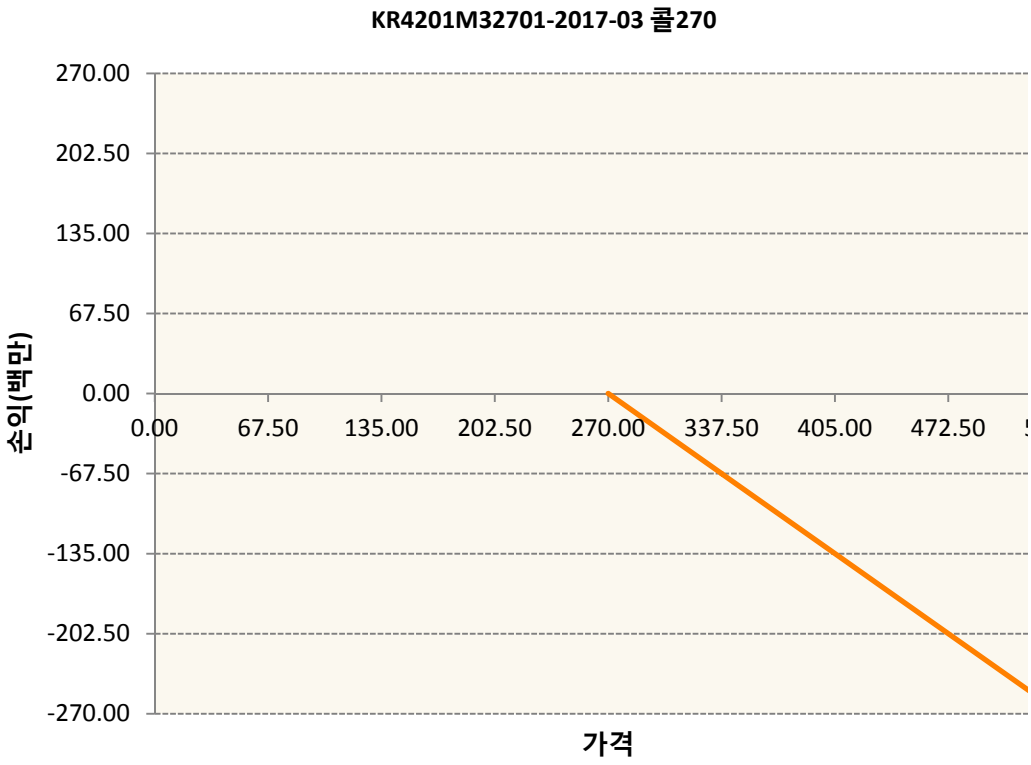
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	9,441	0	9,441	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,213	-3,213	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101M30(2017-03 코스피200지수선물							755
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-755	-755	-755	-755	-755	-755	-755
-5.33%	-503	-503	-503	-503	-503	-503	-503
-2.67%	-252	-252	-252	-252	-252	-252	-252
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	252	252	252	252	252	252	252
5.33%	503	503	503	503	503	503	503
8.00%	755	755	755	755	755	755	755
KR4201M32(2017-03 콜267.5							1,113
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	196	196	196	196	196	196	195
-5.33%	196	195	195	194	193	192	190
-2.67%	182	177	170	164	156	149	141
0%	28	19	10	0	-10	-20	-29
2.67%	-323	-325	-327	-329	-332	-336	-340
5.33%	-717	-717	-718	-718	-718	-718	-719
8.00%	-1,113	-1,113	-1,113	-1,113	-1,113	-1,113	-1,113
KR4201M32 2017-03 콜270							96

	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%	10	10	10	10	9	9	8
0%	3	2	1	0	-1	-2	-3
2.67%	-24	-25	-25	-25	-26	-27	-27
5.33%	-60	-60	-60	-60	-60	-60	-60
8.00%	-96	-96	-96	-96	-96	-96	-96

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

2,065

공시일	2017-02-21
기준일	2017-02-20

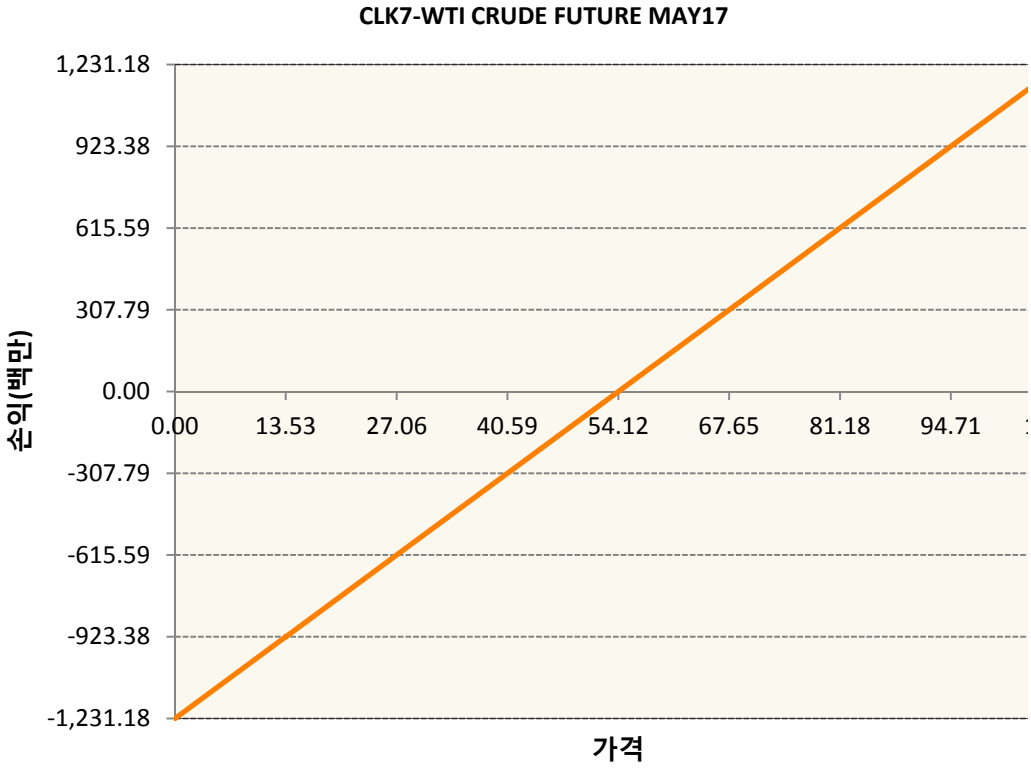
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

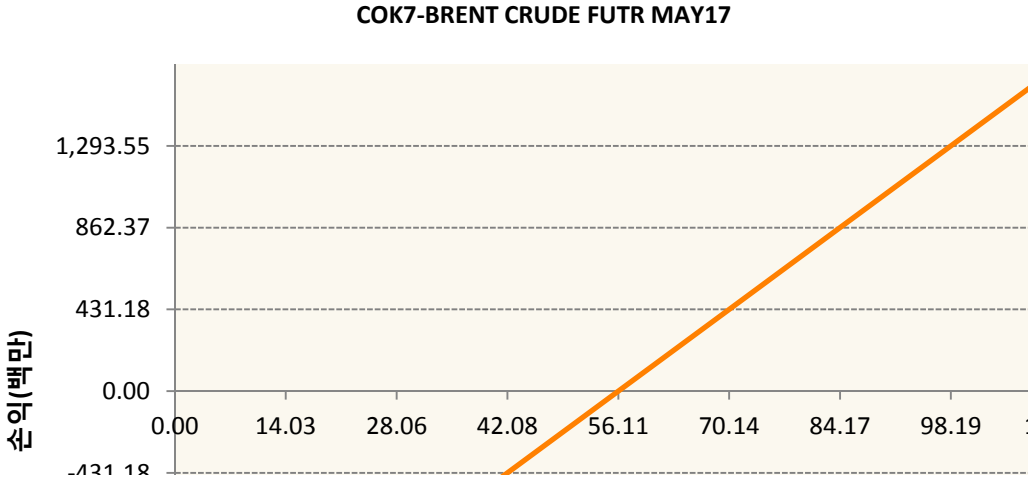
1. 계약금액

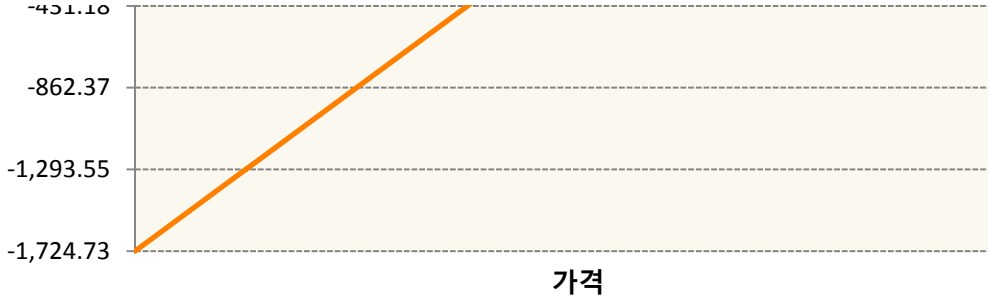
(단위:백만원)

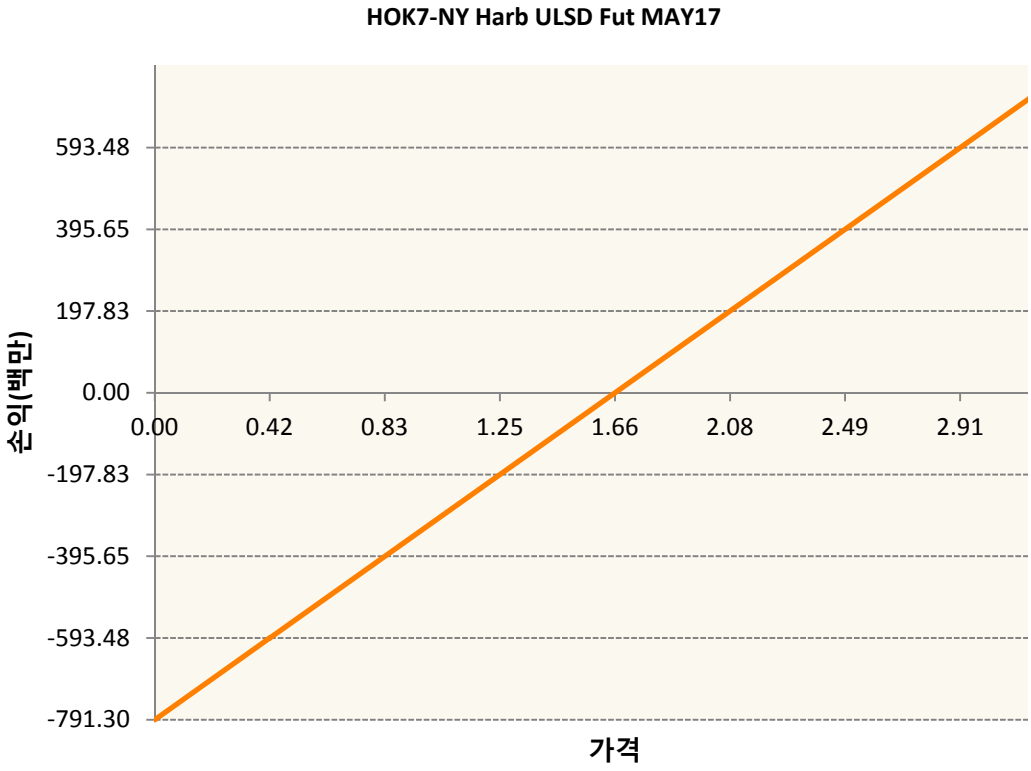
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	선물	유가증권	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	선물	유가증권	1,231	0	1,231	
누계	유가증권	선물	4,751	413	4,338	

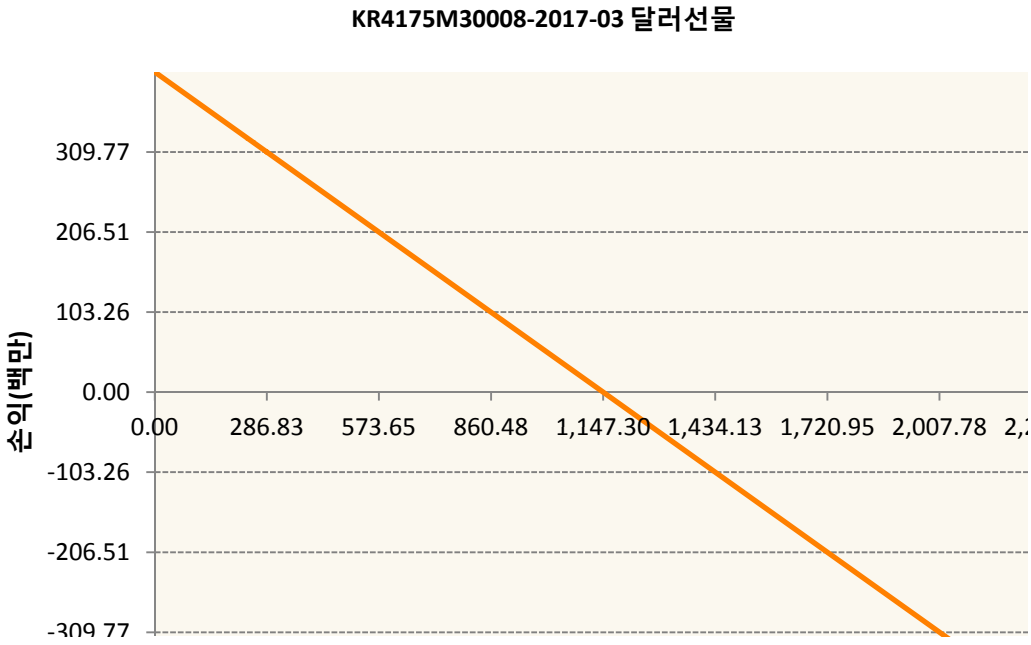
2. 만기시점의 손익구조

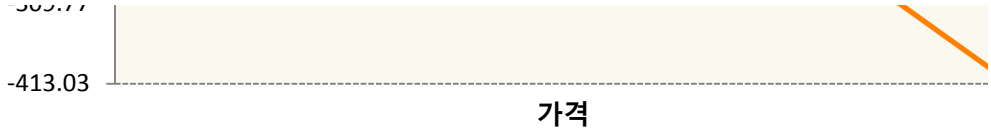


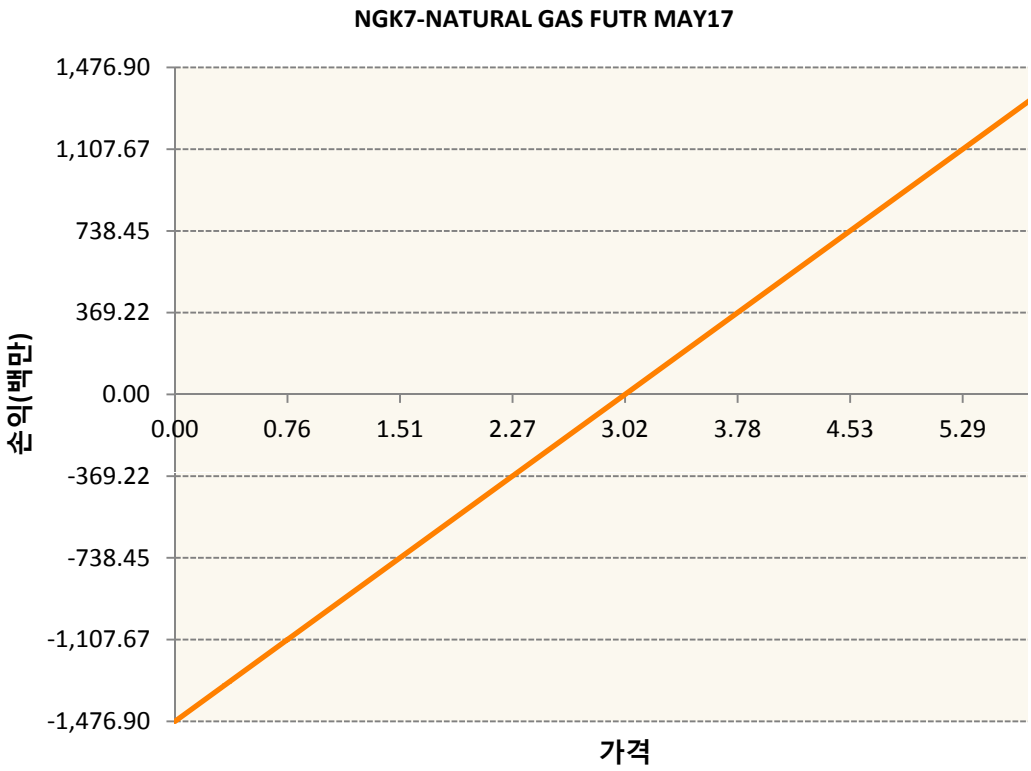


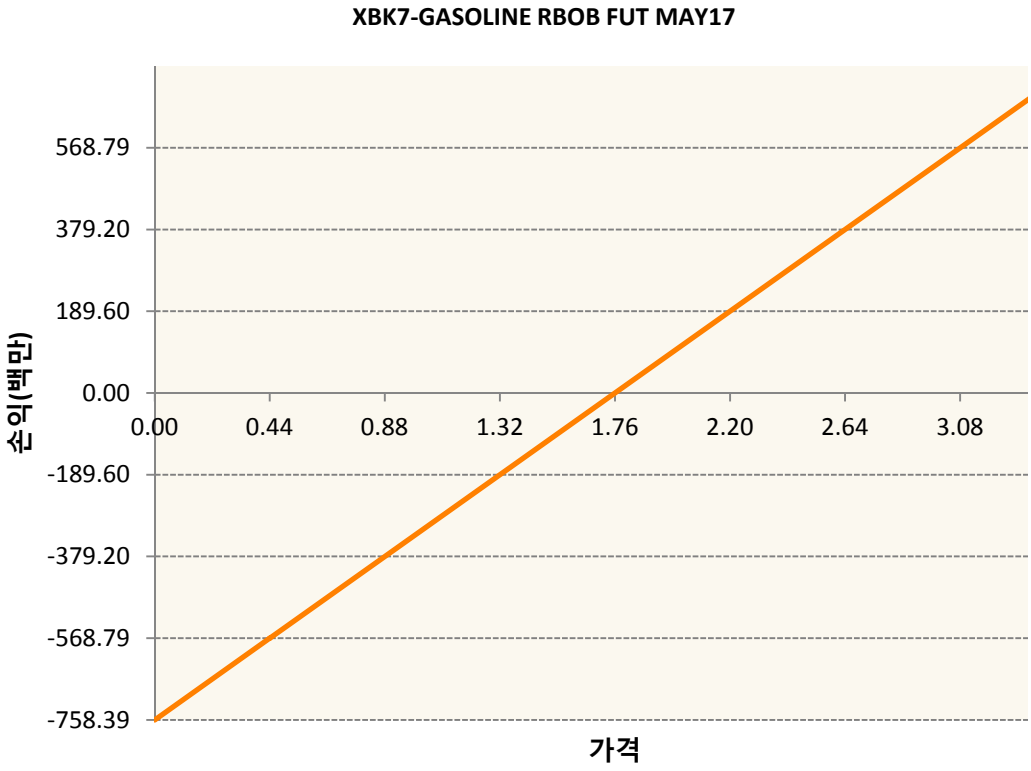

-862.37
-1,293.55
-1,724.73
가격


HOK7-NY Harb ULSD Fut MAY17
593.48
395.65
197.83
0.00
-197.83
-395.65
-593.48
-791.30
0.00
0.42
0.83
1.25
1.66
2.08
2.49
2.91
순익(백만)
가격


KR4175M30008-2017-03 달러선물
309.77
206.51
103.26
0.00
-103.26
-206.51
0.00
286.83
573.65
860.48
1,147.30
1,434.13
1,720.95
2,007.78
순익(백만)


-413.03
가격


NGK7-NATURAL GAS FUTR MAY17
1,476.90
1,107.67
738.45
369.22
0.00
-369.22
-738.45
-1,107.67
-1,476.90
0.00
0.76
1.51
2.27
3.02
3.78
4.53
5.29
순익(백만)
가격


XBK7-GASOLINE RBOB FUT MAY17
568.79
379.20
189.60
0.00
-189.60
-379.20
-568.79
-758.39
0.00
0.44
0.88
1.32
1.76
2.20
2.64
3.08
순익(백만)
가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLK7	WTI CRUDE FUTURE MAY17	98
COK7	BRENT CRUDE FUTR MAY17	138
HOK7	NY Harb ULSD Fut MAY17	63
KR4175M30(	2017-03 달러선물	33
NGK7	NATURAL GAS FUTR MAY17	118
XBK7	GASOLINE RBOB FUT MAY17	61

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

1,060

공시일	2017-02-21
기준일	2017-02-20

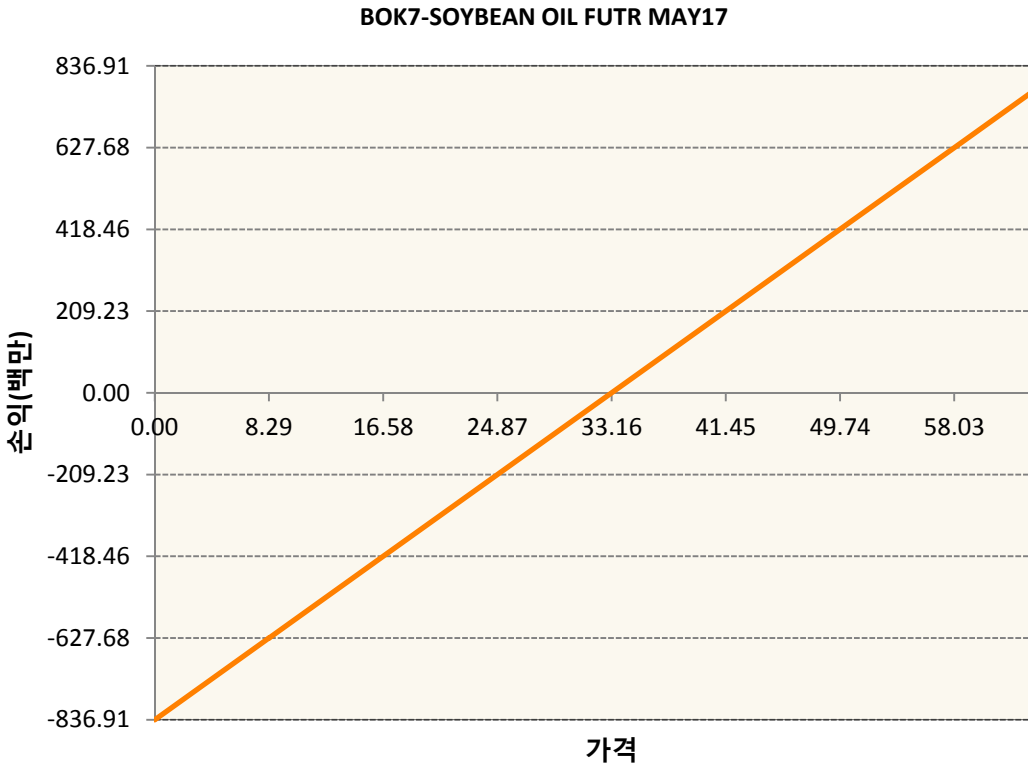
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

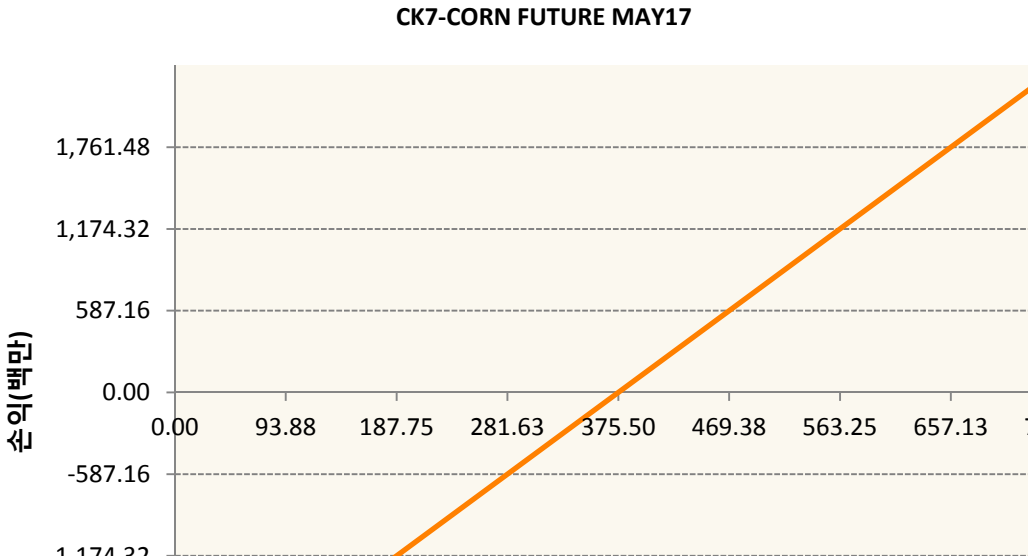
1. 계약금액

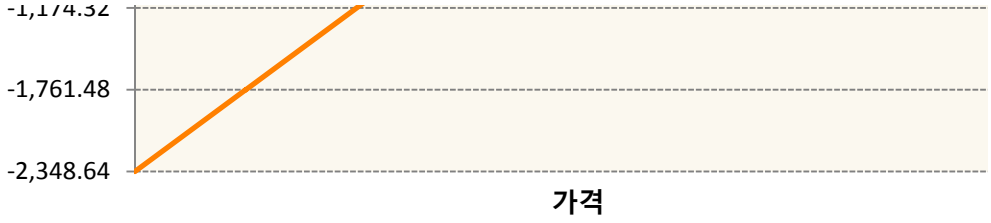
(단위:백만원)

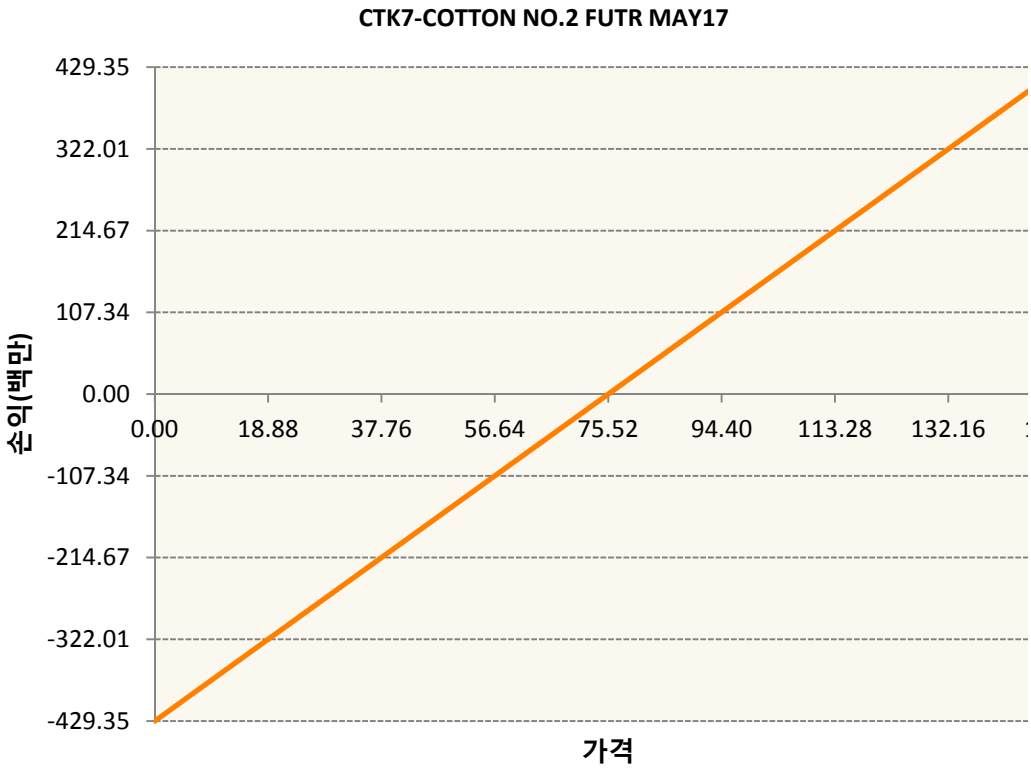
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	9,723	574	9,149	

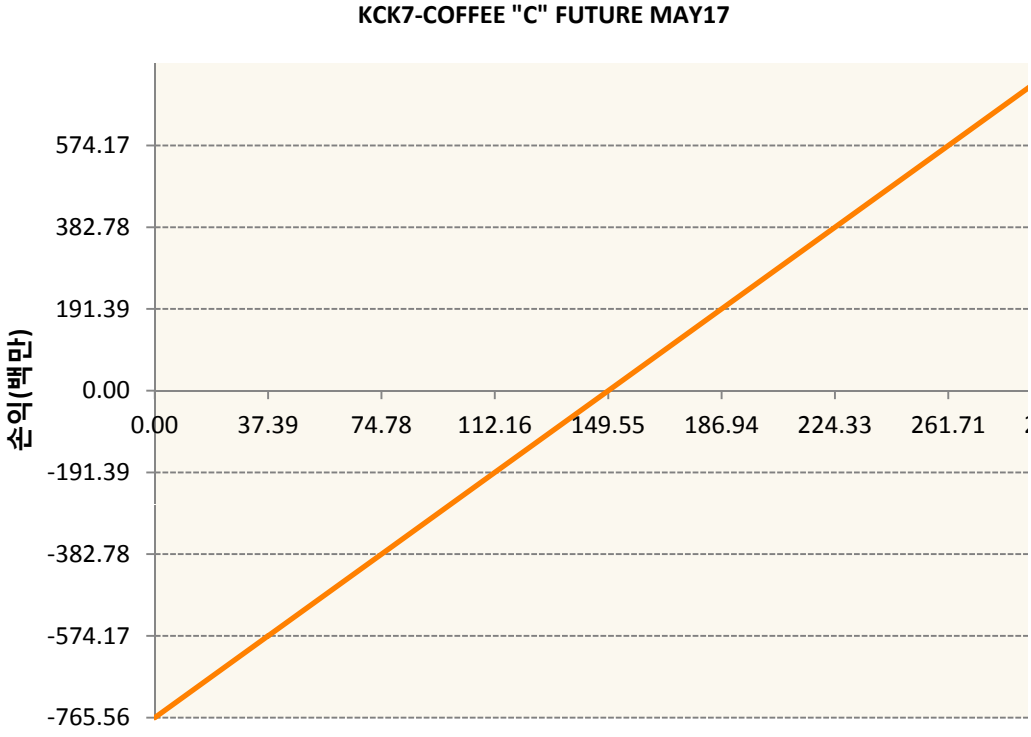
2. 만기시점의 손익구조



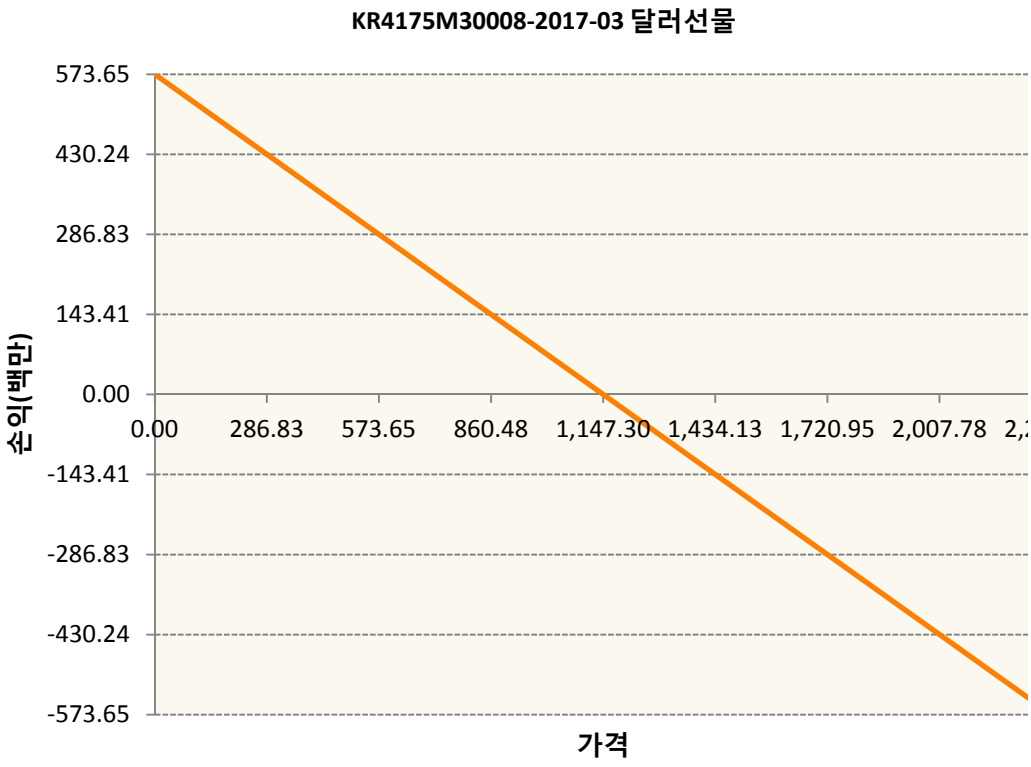


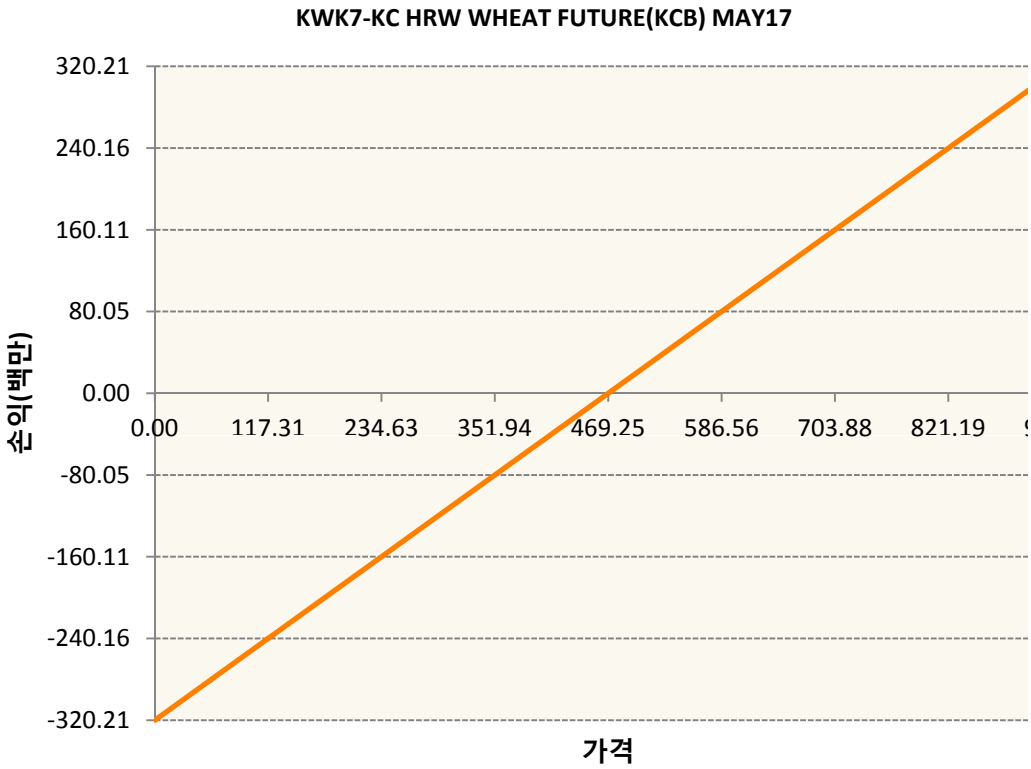

-1,761.48
-2,348.64
가격

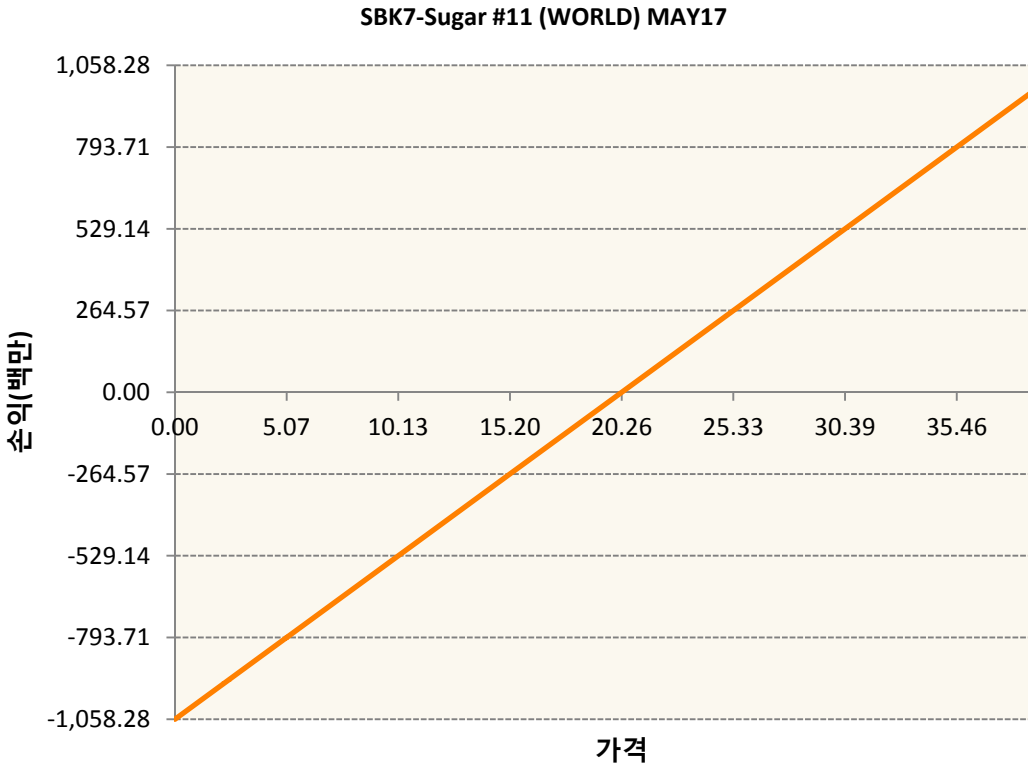

CTK7-COTTON NO.2 FUTR MAY17
429.35
322.01
214.67
107.34
0.00
-107.34
-214.67
-322.01
-429.35
0.00
18.88
37.76
56.64
75.52
94.40
113.28
132.16
순익(백만)
가격

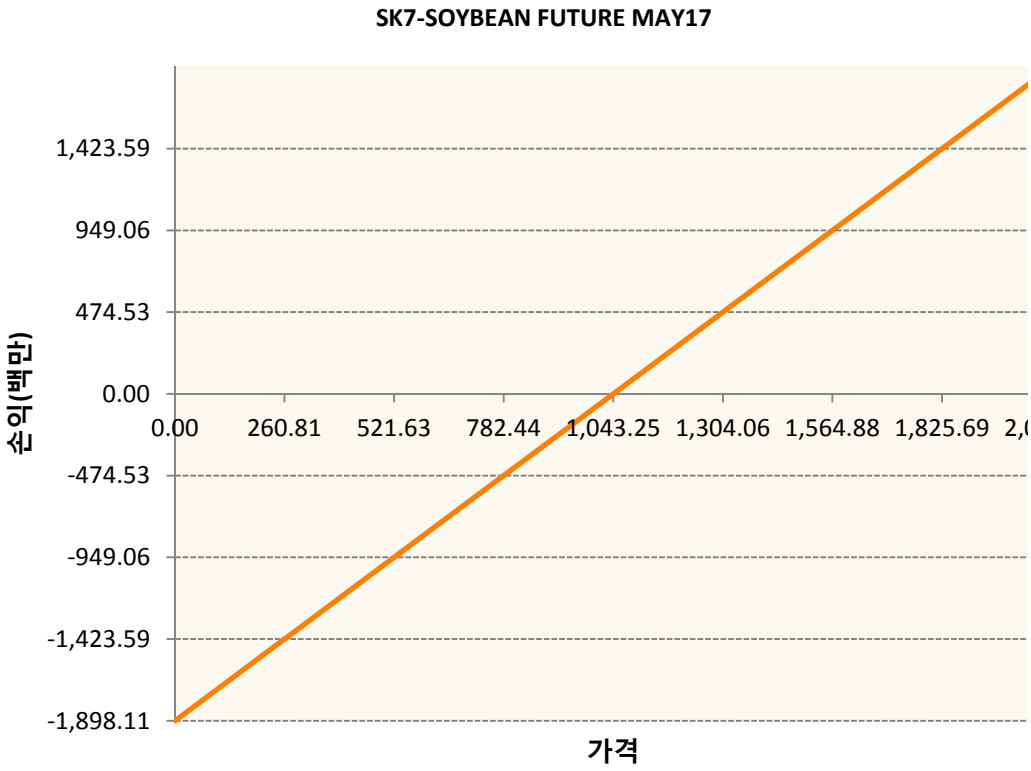

KCK7-COFFEE "C" FUTURE MAY17
574.17
382.78
191.39
0.00
-191.39
-382.78
-574.17
-765.56
0.00
37.39
74.78
112.16
149.55
186.94
224.33
261.71
순익(백만)

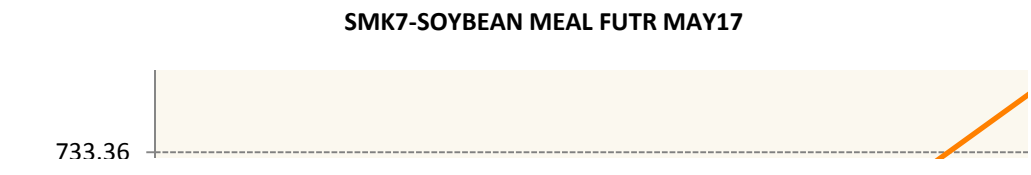
가격

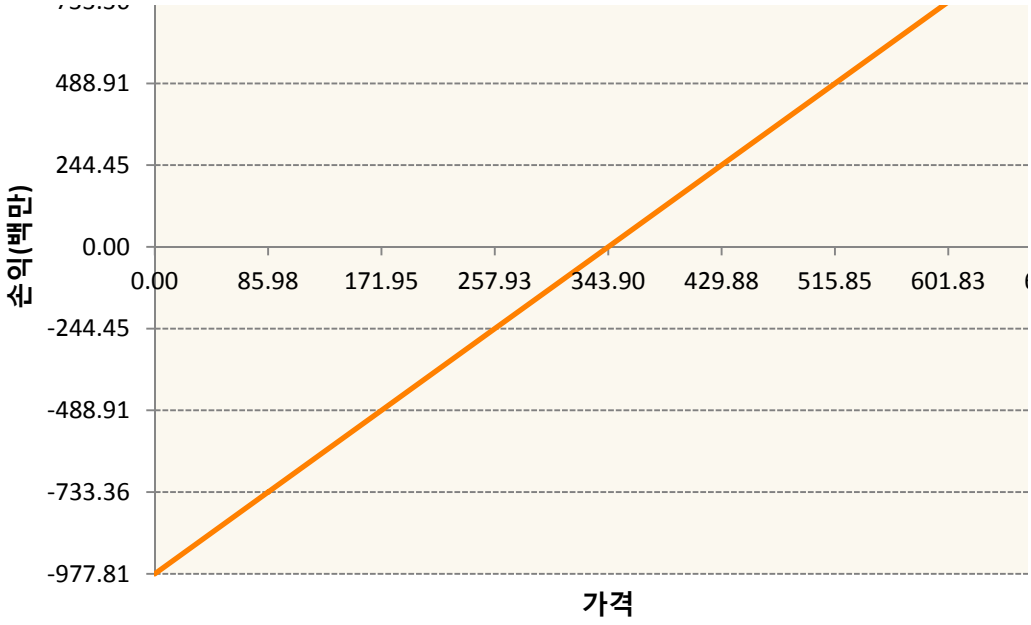

KR4175M30008-2017-03 달러선물
573.65
430.24
286.83
143.41
0.00
-143.41
-286.83
-430.24
-573.65
0.00
286.83
573.65
860.48
1,147.30
1,434.13
1,720.95
2,007.78
손익(백만)
가격

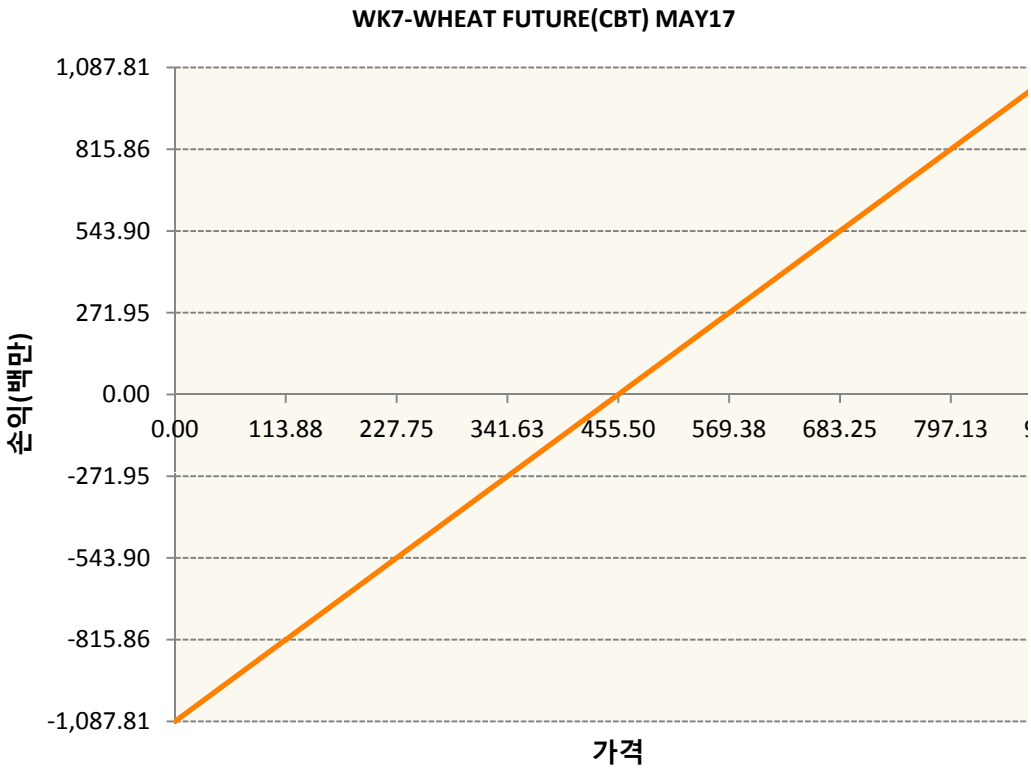

KWK7-KC HRW WHEAT FUTURE(KCB) MAY17
320.21
240.16
160.11
80.05
0.00
-80.05
-160.11
-240.16
-320.21
0.00
117.31
234.63
351.94
469.25
586.56
703.88
821.19
손익(백만)
가격


SBK7-Sugar #11 (WORLD) MAY17
1,058.28
793.71
529.14
264.57
0.00
-264.57
-529.14
-793.71
-1,058.28
0.00
5.07
10.13
15.20
20.26
25.33
30.39
35.46
손익(백만)
가격


SK7-SOYBEAN FUTURE MAY17
1,423.59
949.06
474.53
0.00
-474.53
-949.06
-1,423.59
-1,898.11
0.00
260.81
521.63
782.44
1,043.25
1,304.06
1,564.88
1,825.69
손익(백만)
가격


SMK7-SOYBEAN MEAL FUTR MAY17
733.36





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
BOK7	SOYBEAN OIL FUTR MAY17	67
CK7	CORN FUTURE MAY17	188
CTK7	COTTON NO.2 FUTR MAY17	34
KCK7	COFFEE "C" FUTURE MAY17	61
KR4175M30(	2017-03 달러선물	46

KWK7	KC HRW WHEAT FUTURE(KCB) MAY17	26
SBK7	Sugar #11 (WORLD) MAY17	85
SK7	SOYBEAN FUTURE MAY17	152
SMK7	SOYBEAN MEAL FUTR MAY17	78
WK7	WHEAT FUTURE(CBT) MAY17	87

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

913