공시일	2017-02-22
기준일	2017-02-21

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	2017-02-22
기준일	2017-02-21

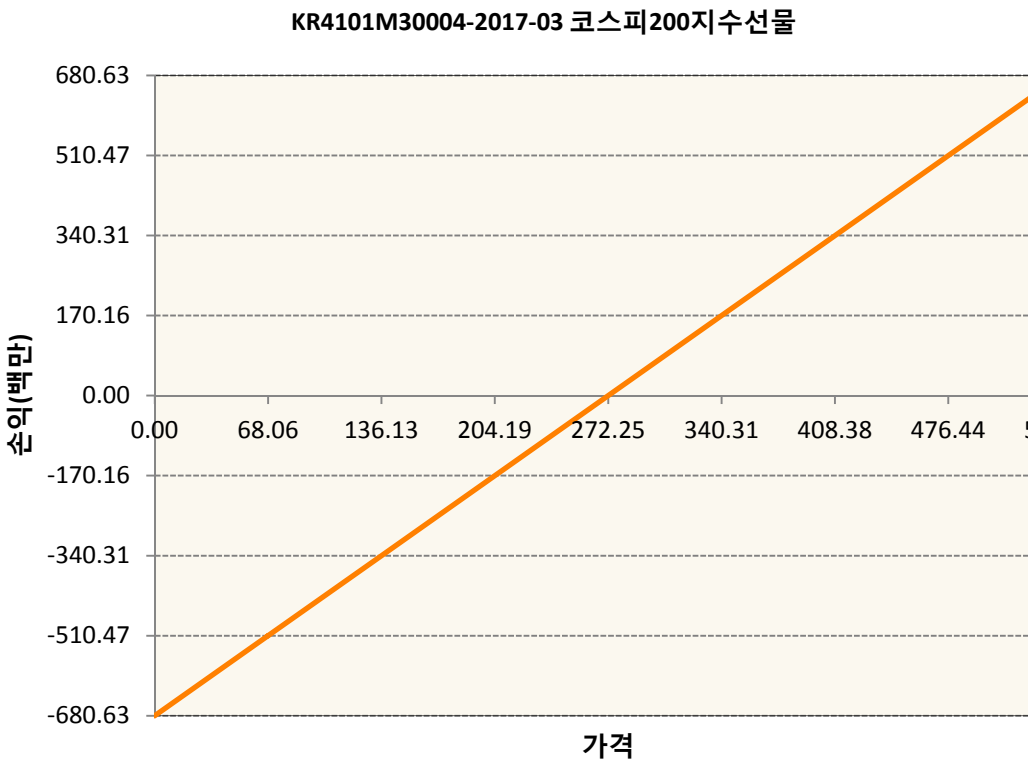
스마트인덱스모

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	681	0	681	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	2017-02-22
기준일	2017-02-21

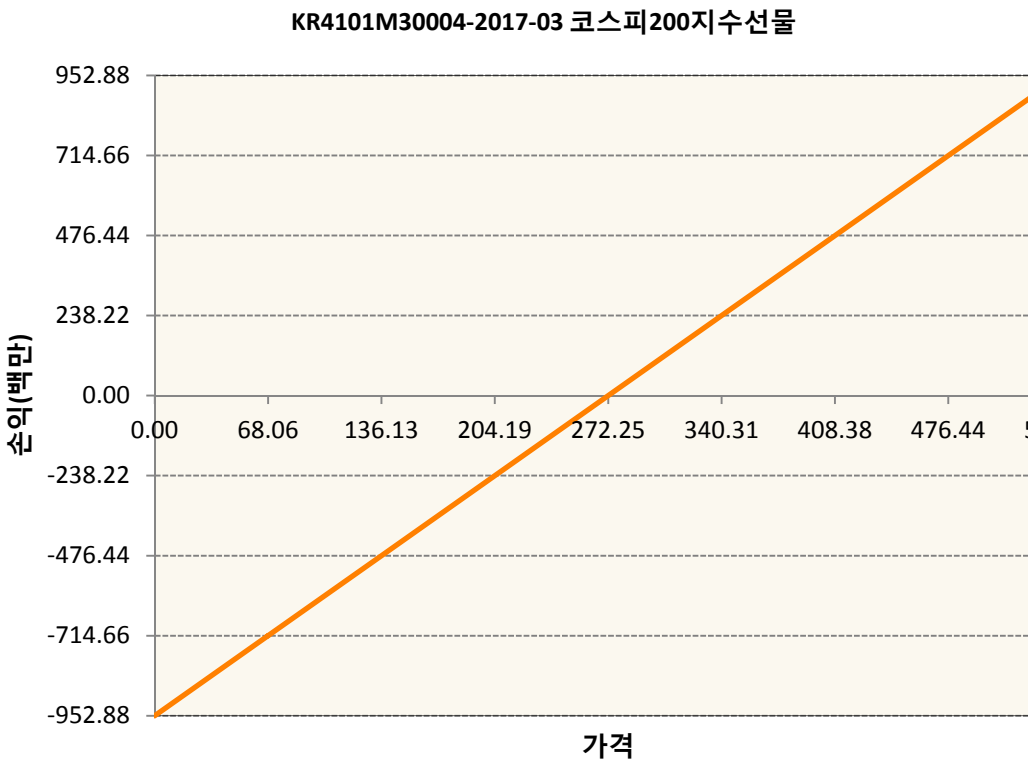
스마트레버리지목표전환형1호

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	953	0	953	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%	-51	-51	-51	-51	-51	-51	-51
-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%	51	51	51	51	51	51	51
8.00%	76	76	76	76	76	76	76

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

49

공시일	2017-02-22
기준일	2017-02-21

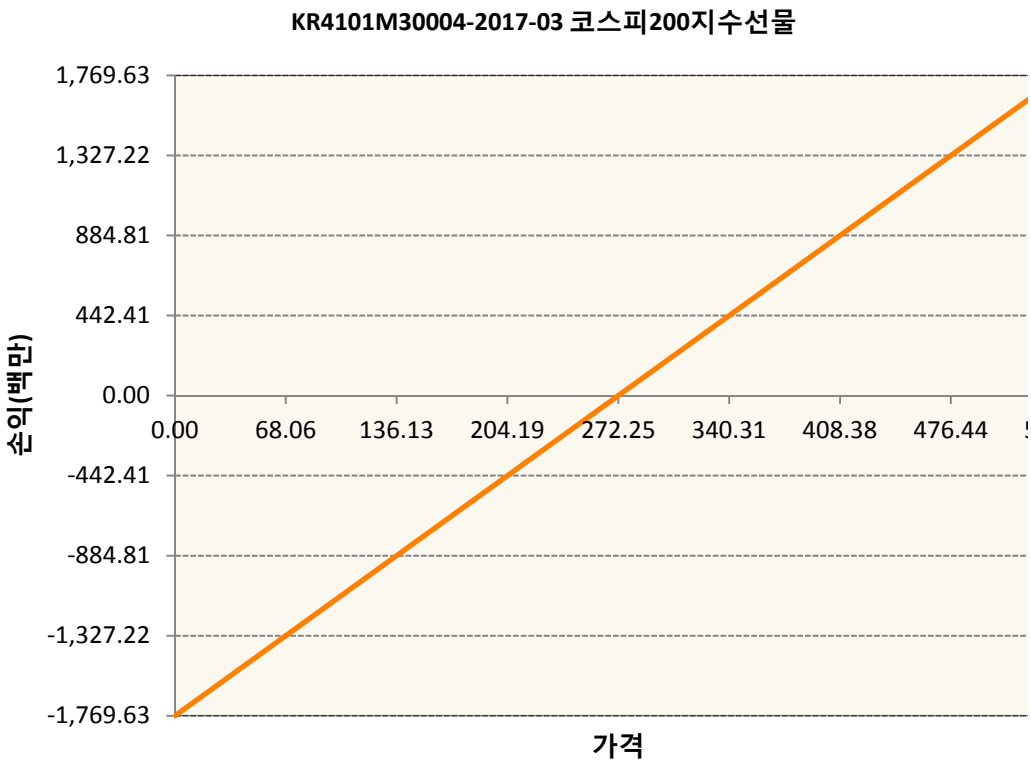
1.3배 레버리지 인덱스(주식-파생형)

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	1,770	0	1,770	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101M30(2017-03 코스피200지수선물							141
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-141	-141	-141	-141	-141	-141	-141
-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%	141	141	141	141	141	141	141

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

91

공시일	2017-02-22
기준일	2017-02-21

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	2017-02-22
기준일	2017-02-21

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	391

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

546

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-02-22
기준일	2017-02-21

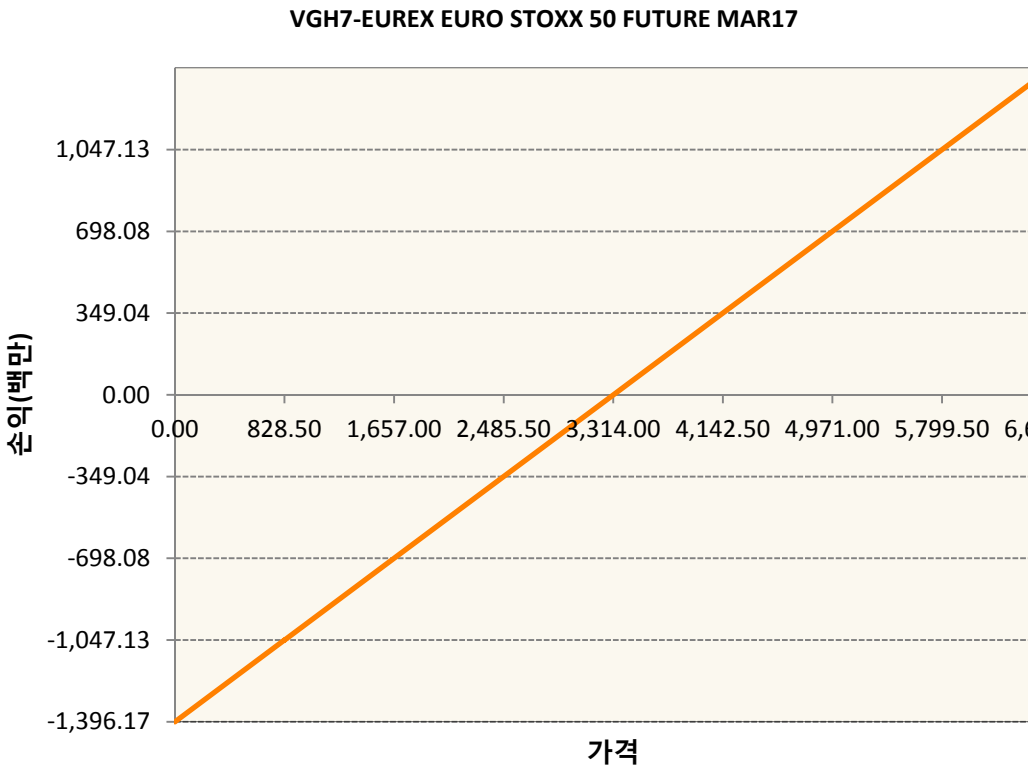
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,396	0	1,396	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGH7	EUREX EURO STOXX 50 FUTURE MAR17	112

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

(단위:백만원)

115

공시일	2017-02-22
기준일	2017-02-21

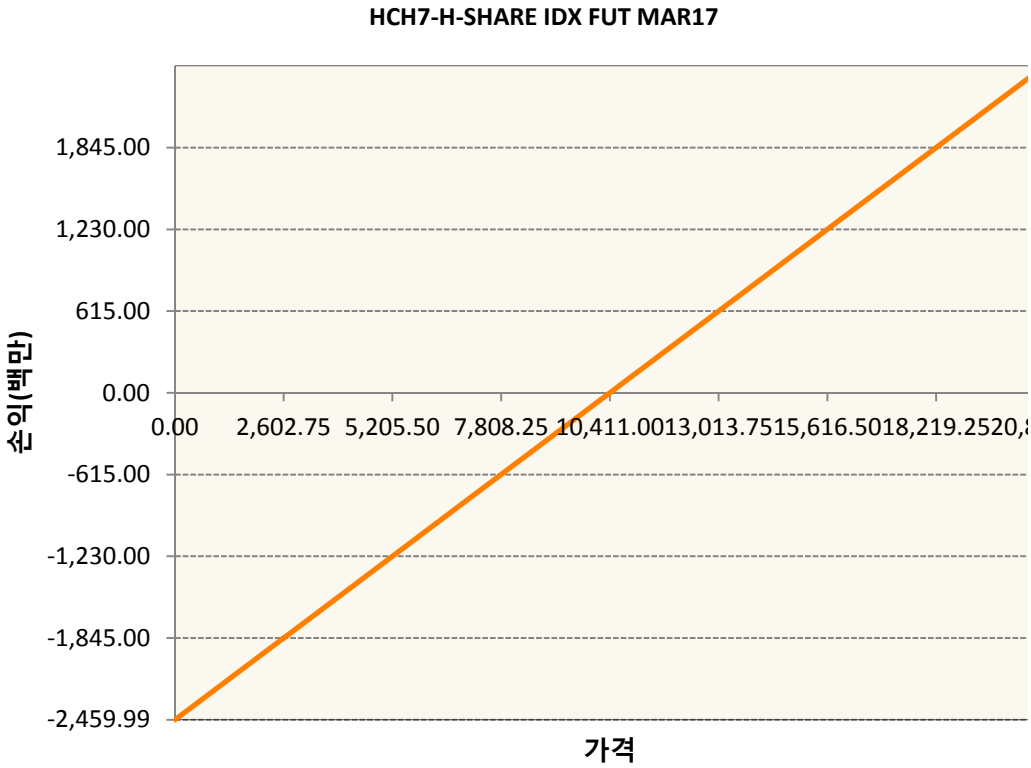
차이나인덱스모(주식-파생형)

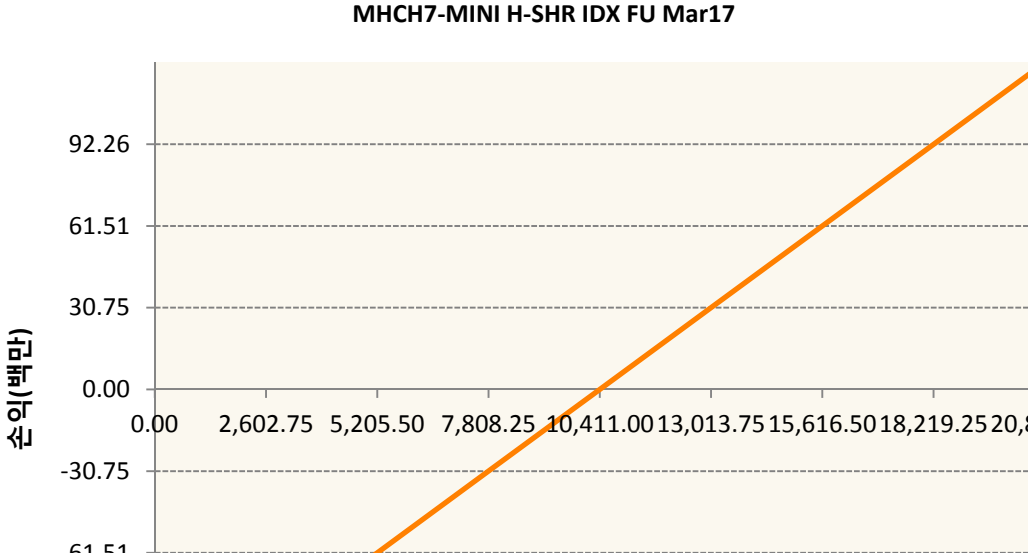
1. 계약금액

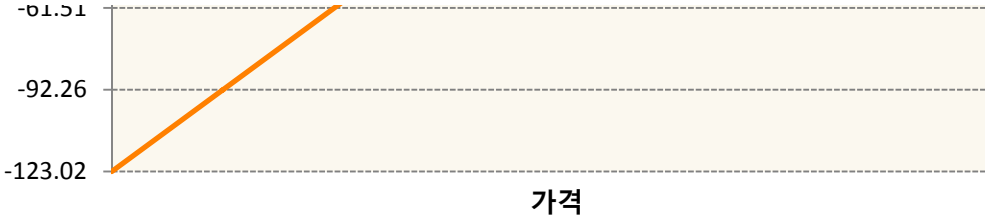
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,583	0	2,583	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCH7	H-SHARE IDX FUT MAR17	197
MHCH7	MINI H-SHR IDX FU Mar17	10

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	239

공시일	2017-02-22
기준일	2017-02-21

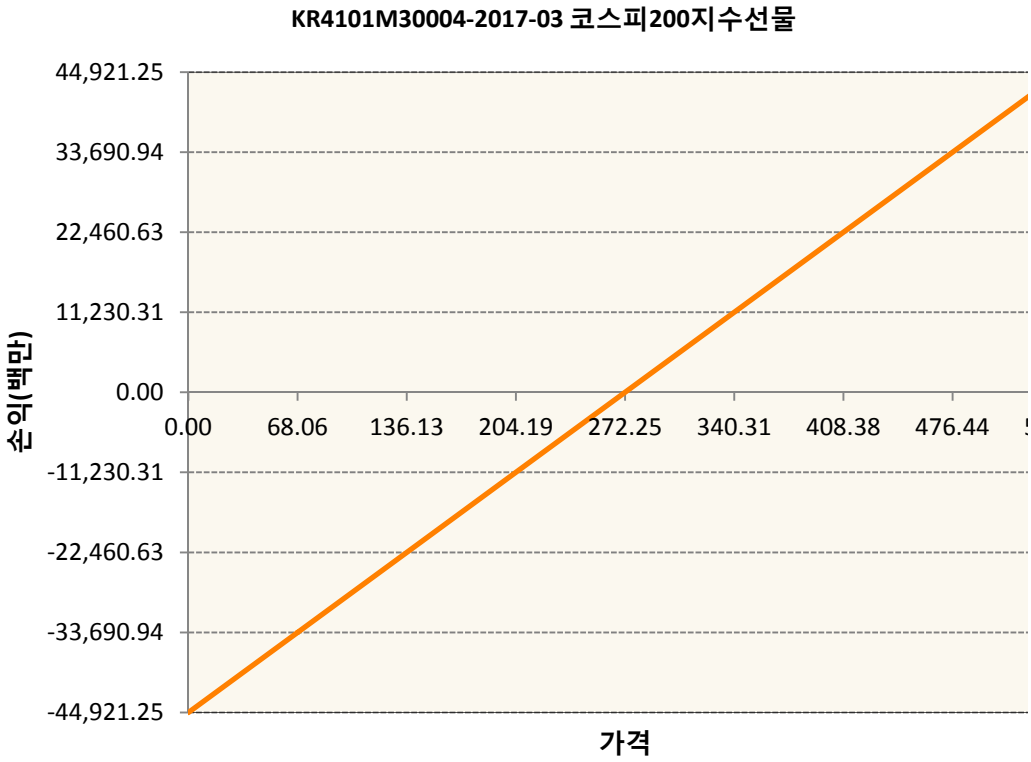
커버드콜모(주식혼합-파생형)

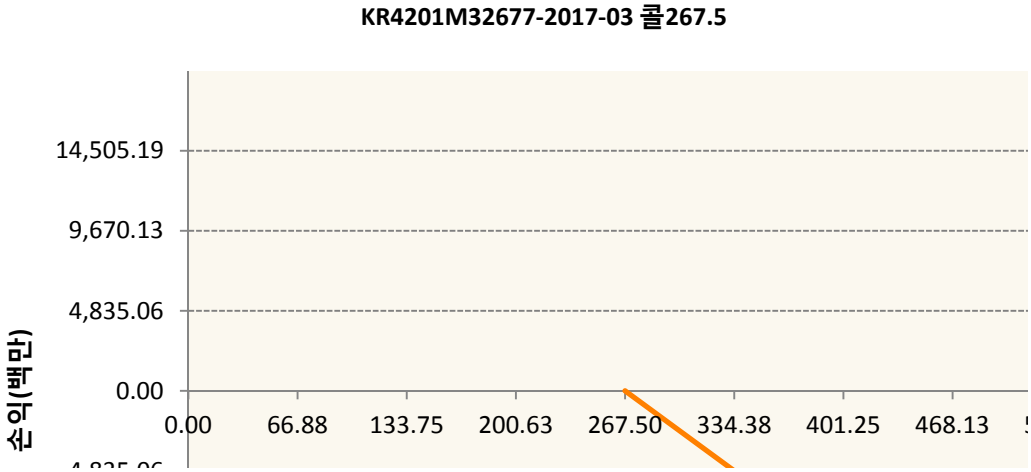
1. 계약금액

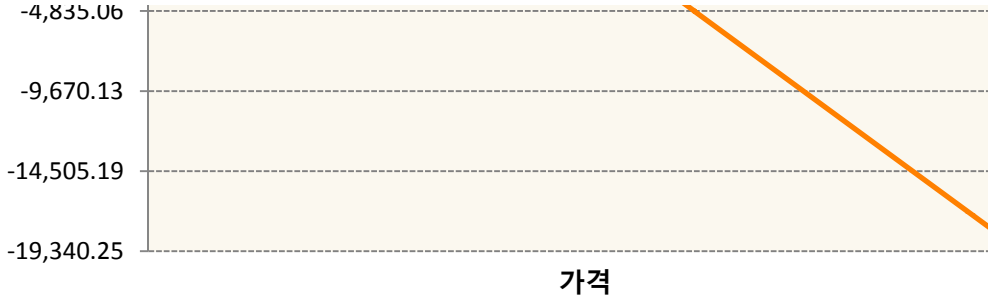
(단위:백만원)

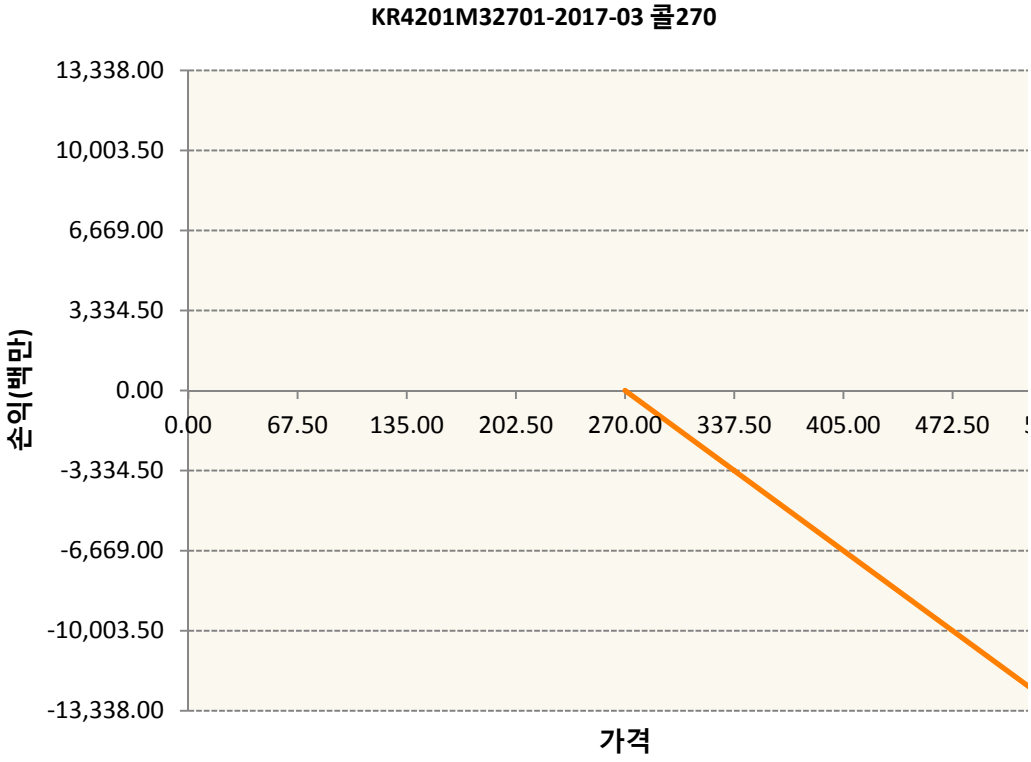
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	4,087	0	4,087	장내
신규	유가증권	옵션	0	820	-820	장내
누계	유가증권	선물	44,921	0	44,921	장내
누계	유가증권	옵션	0	32,678	-32,678	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101M30(2017-03 코스피200지수선물							3,592
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-3,592	-3,592	-3,592	-3,592	-3,592	-3,592	-3,592
-5.33%	-2,395	-2,395	-2,395	-2,395	-2,395	-2,395	-2,395
-2.67%	-1,197	-1,197	-1,197	-1,197	-1,197	-1,197	-1,197
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	1,197	1,197	1,197	1,197	1,197	1,197	1,197
5.33%	2,395	2,395	2,395	2,395	2,395	2,395	2,395
8.00%	3,592	3,592	3,592	3,592	3,592	3,592	3,592
KR4201M32(2017-03 콜267.5							7,649
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,880	1,880	1,880	1,880	1,880	1,879	1,877
-5.33%	1,878	1,874	1,867	1,858	1,846	1,830	1,811
-2.67%	1,659	1,606	1,552	1,495	1,438	1,380	1,321
0%	121	84	44	0	-47	-95	-146
2.67%	-2,407	-2,409	-2,412	-2,417	-2,425	-2,435	-2,449
5.33%	-5,028	-5,028	-5,028	-5,028	-5,028	-5,029	-5,030
8.00%	-7,649	-7,649	-7,649	-7,649	-7,649	-7,649	-7,649
KR4201M32: 2017-03 콜270							5,058

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	836	836	836	836	836	836	836
-5.33%	836	835	834	832	829	824	817
-2.67%	789	768	743	717	688	657	625
0%	121	82	41	0	-42	-84	-126
2.67%	-1,480	-1,484	-1,491	-1,501	-1,513	-1,527	-1,544
5.33%	-3,267	-3,267	-3,267	-3,267	-3,268	-3,270	-3,272
8.00%	-5,058	-5,058	-5,058	-5,058	-5,058	-5,058	-5,058

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

18,910

공시일	2017-02-22
기준일	2017-02-21

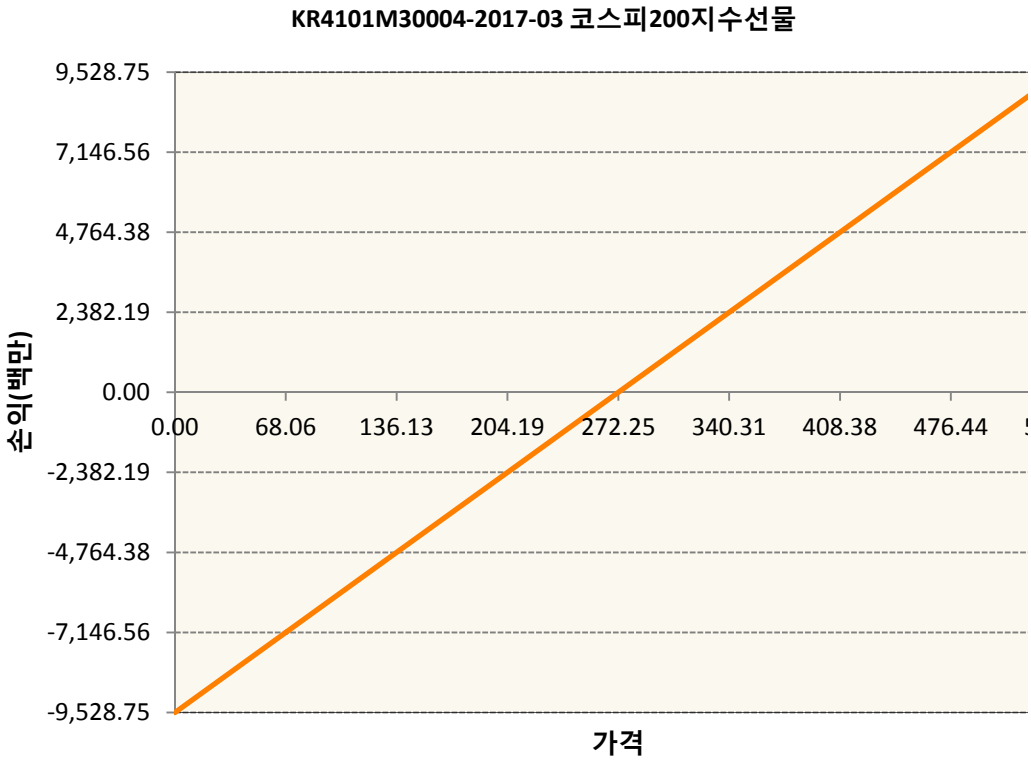
커버드콜목표전환형증권투자신탁

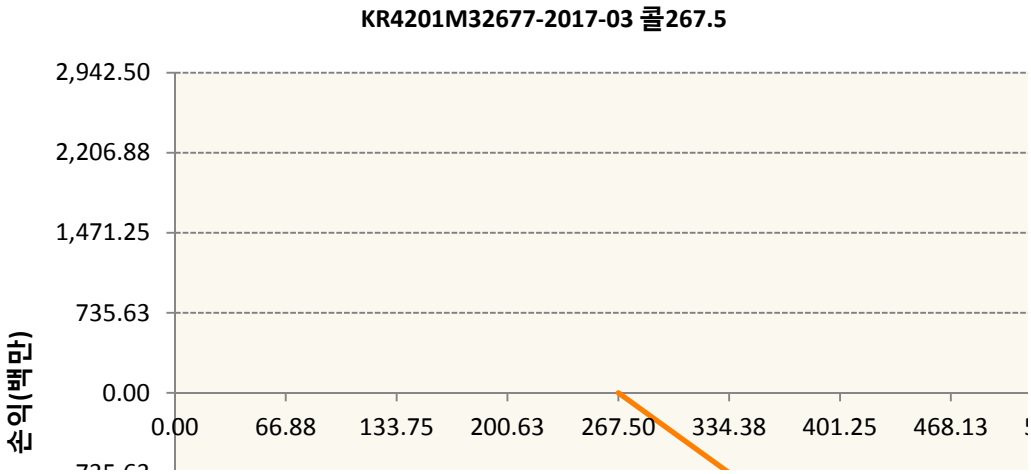
1. 계약금액

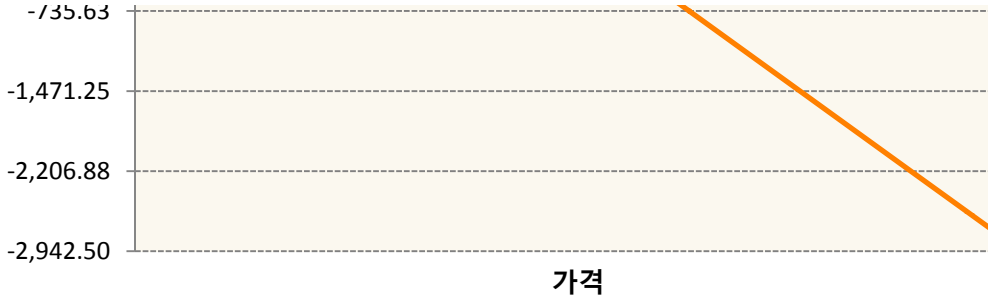
(단위:백만원)

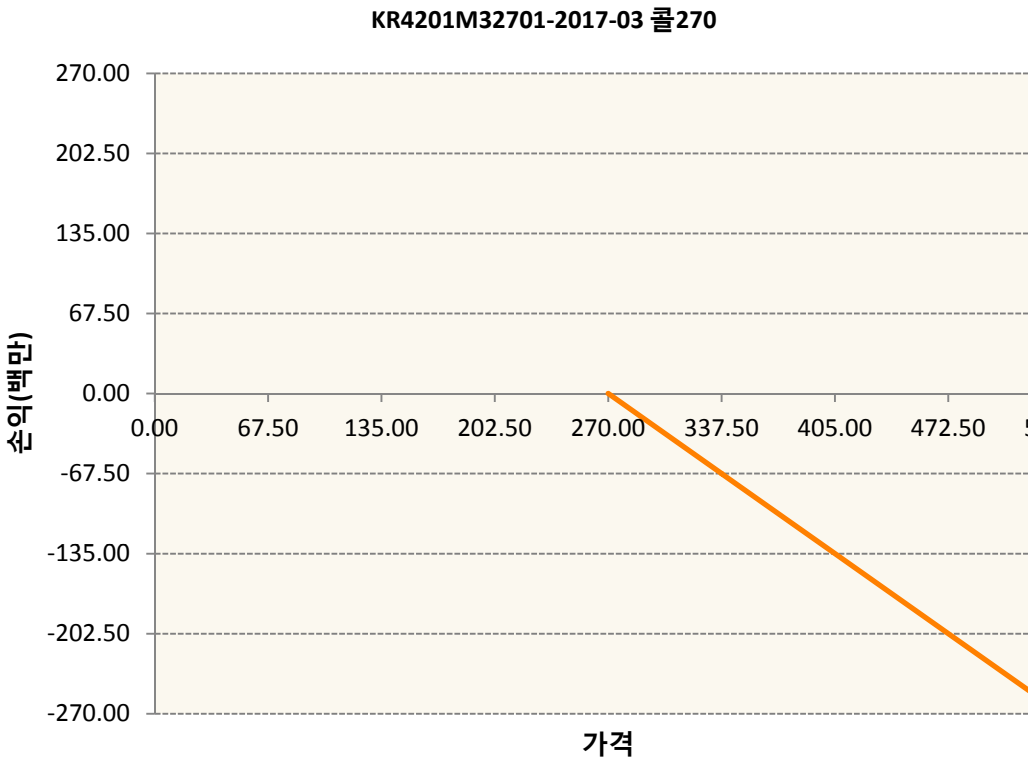
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	9,529	0	9,529	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,213	-3,213	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101M30(2017-03 코스피200지수선물							762
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-762	-762	-762	-762	-762	-762	-762
-5.33%	-508	-508	-508	-508	-508	-508	-508
-2.67%	-254	-254	-254	-254	-254	-254	-254
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	254	254	254	254	254	254	254
5.33%	508	508	508	508	508	508	508
8.00%	762	762	762	762	762	762	762
KR4201M32(2017-03 콜267.5							1,164
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	286	286	286	286	286	286	286
-5.33%	286	285	284	283	281	278	276
-2.67%	252	244	236	228	219	210	201
0%	18	13	7	0	-7	-15	-22
2.67%	-366	-367	-367	-368	-369	-371	-373
5.33%	-765	-765	-765	-765	-765	-765	-765
8.00%	-1,164	-1,164	-1,164	-1,164	-1,164	-1,164	-1,164
KR4201M32 2017-03 콜270							102

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	17	17	17	17	17	17	17
-5.33%	17	17	17	17	17	17	17
-2.67%	16	16	15	15	14	13	13
0%	2	2	1	0	-1	-2	-3
2.67%	-30	-30	-30	-30	-31	-31	-31
5.33%	-66	-66	-66	-66	-66	-66	-66
8.00%	-102	-102	-102	-102	-102	-102	-102

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

2,129

공시일	2017-02-22
기준일	2017-02-21

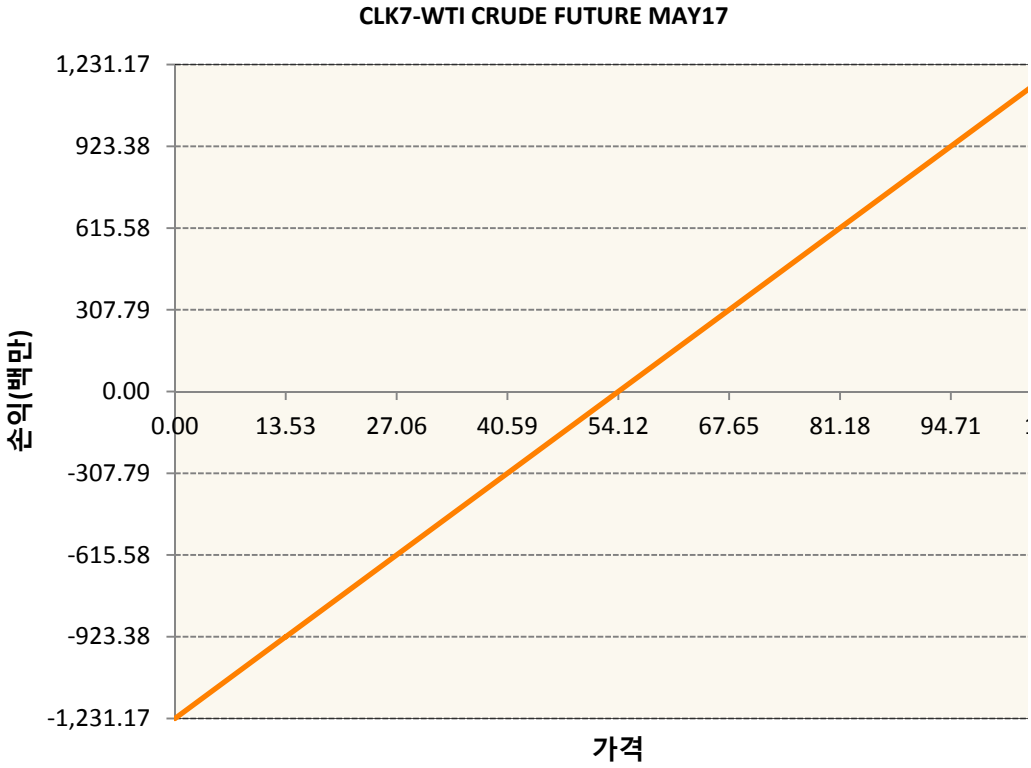
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

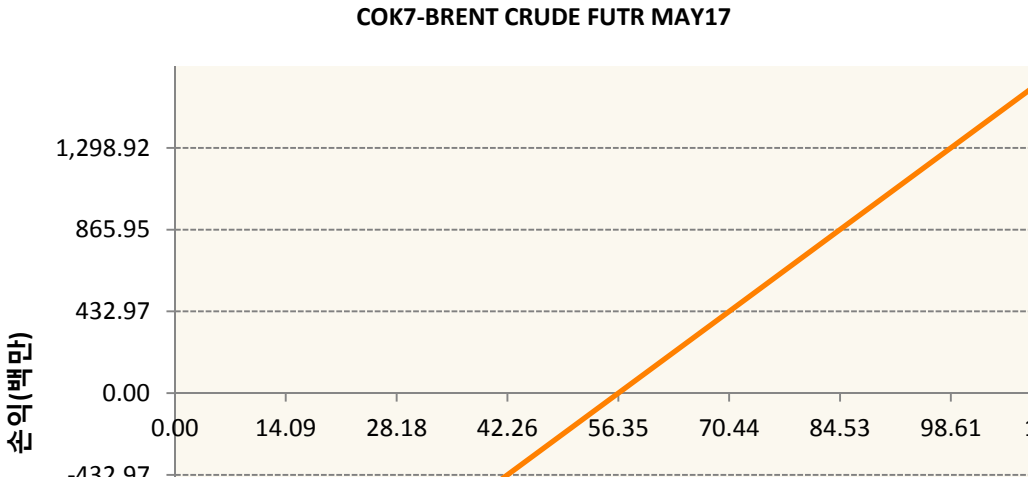
1. 계약금액

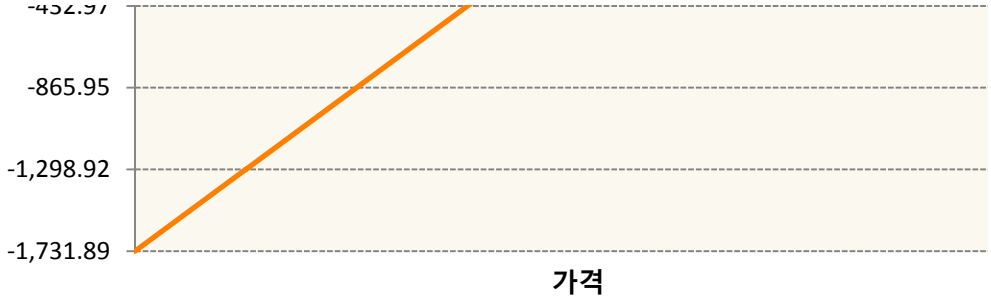
(단위:백만원)

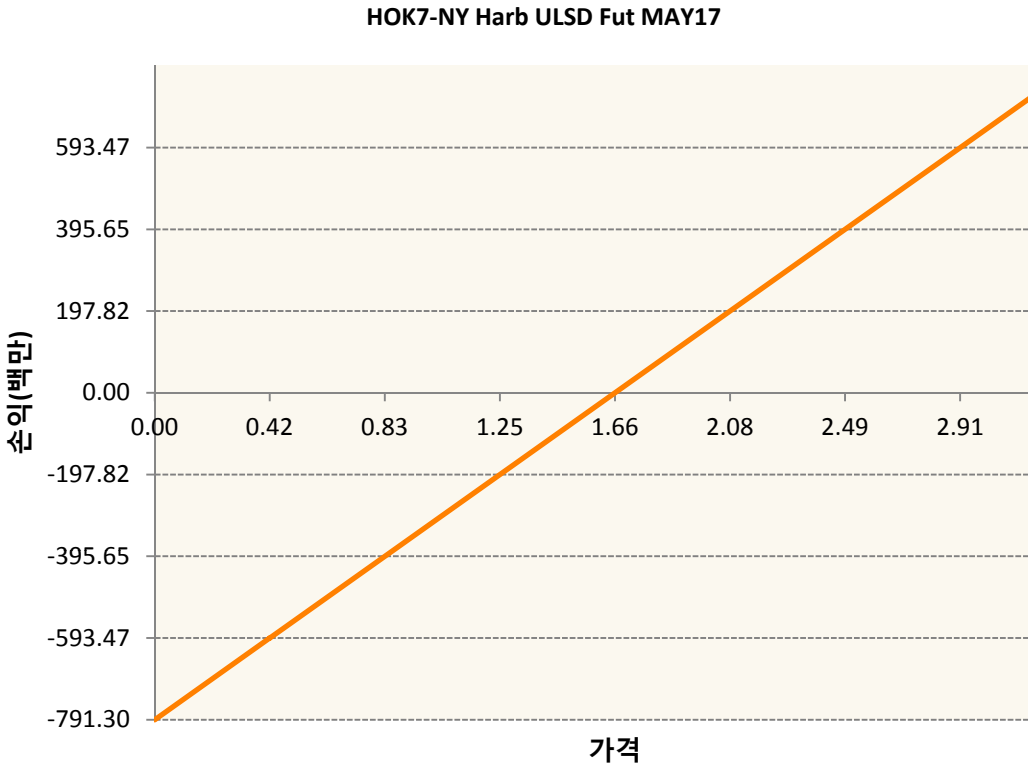
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	선물	유가증권	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	선물	유가증권	1,231	0	1,231	
누계	유가증권	선물	4,759	412	4,346	

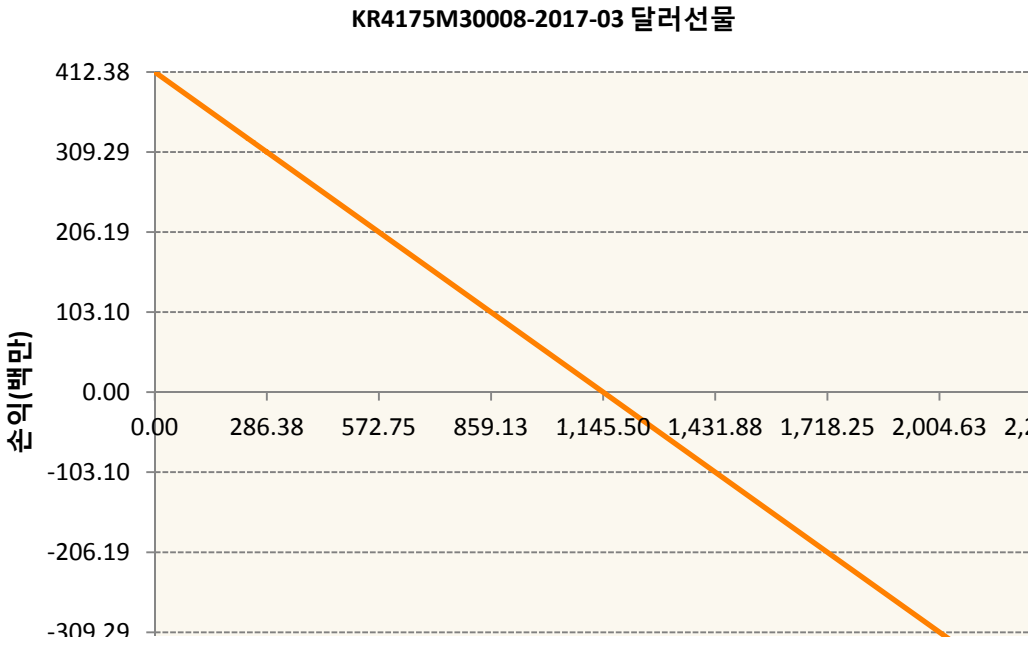
2. 만기시점의 손익구조

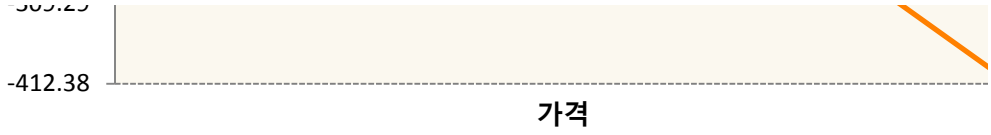


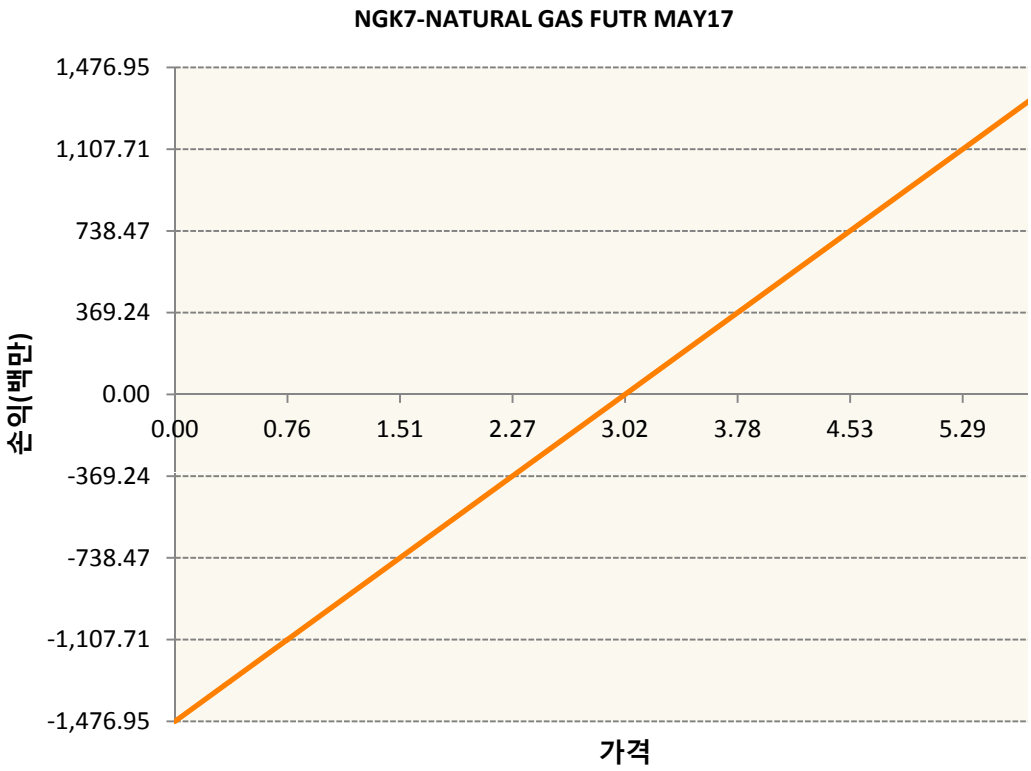


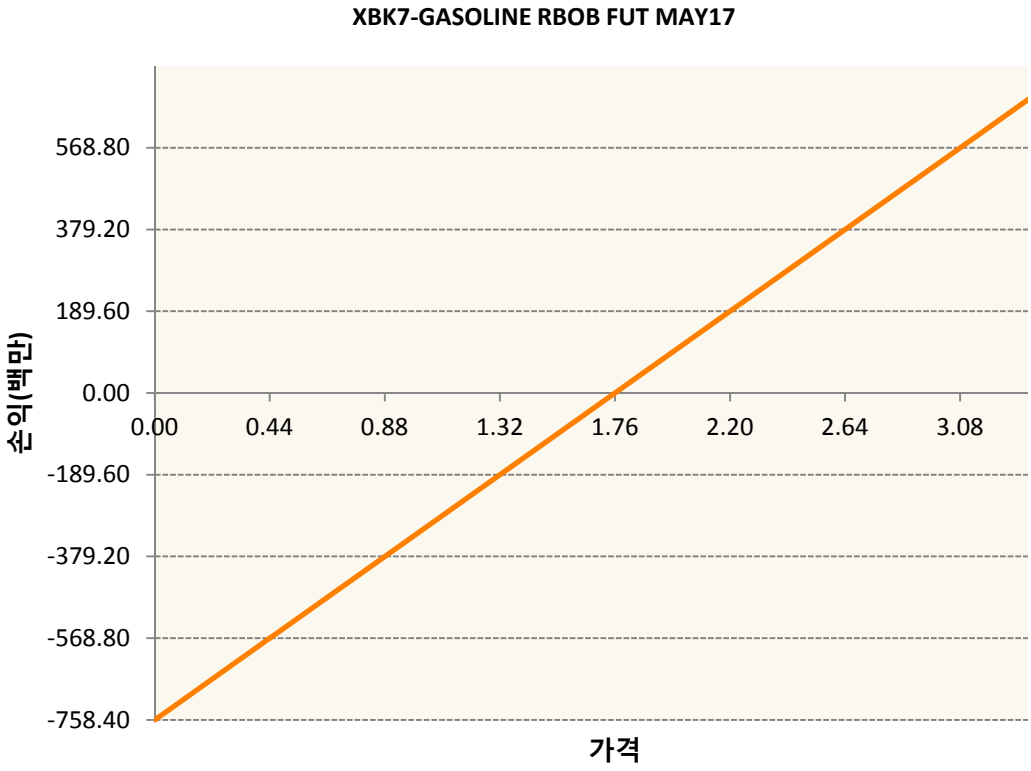

-865.95
-1,298.92
-1,731.89
가격


HOK7-NY Harb ULSD Fut MAY17
593.47
395.65
197.82
0.00
-197.82
-395.65
-593.47
-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
412.38
309.29
206.19
103.10
0.00
-103.10
-206.19
-309.29
0.00
286.38
572.75
859.13
1,145.50
1,431.88
1,718.25
2,004.63
순익(백만)


-412.38
가격


NGK7-NATURAL GAS FUTR MAY17
1,476.95
1,107.71
738.47
369.24
0.00
-369.24
-738.47
-1,107.71
-1,476.95
0.00
0.76
1.51
2.27
3.02
3.78
4.53
5.29
순익(백만)
가격


XBK7-GASOLINE RBOB FUT MAY17
568.80
379.20
189.60
0.00
-189.60
-379.20
-568.80
-758.40
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	139
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)

1,056

공시일	2017-02-22
기준일	2017-02-21

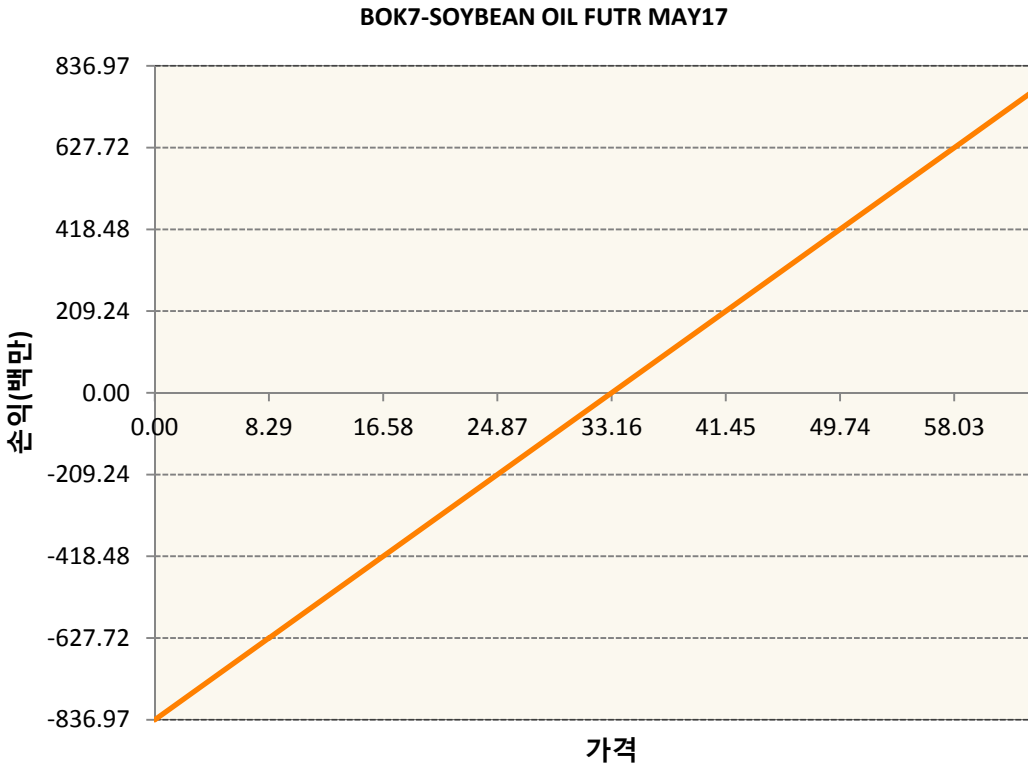
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

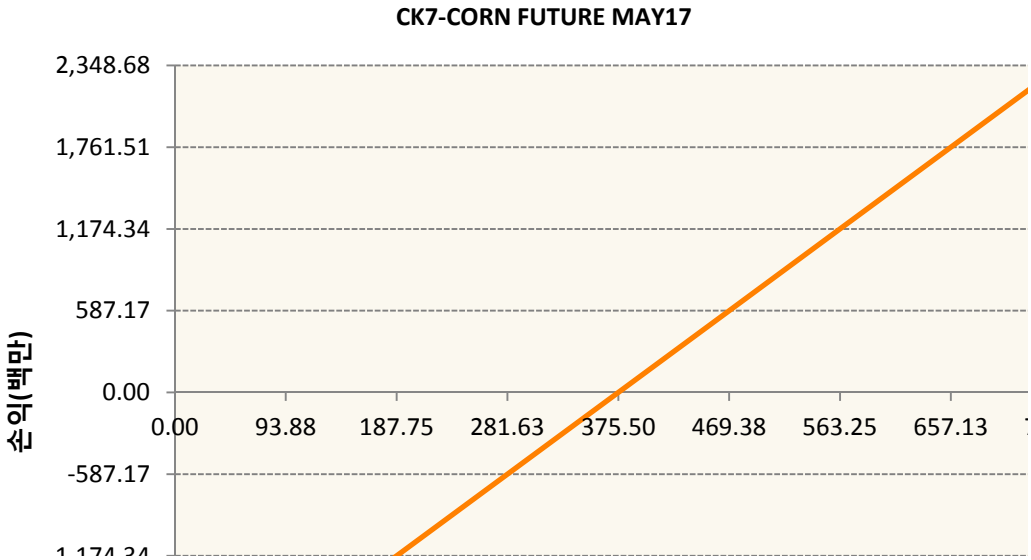
1. 계약금액

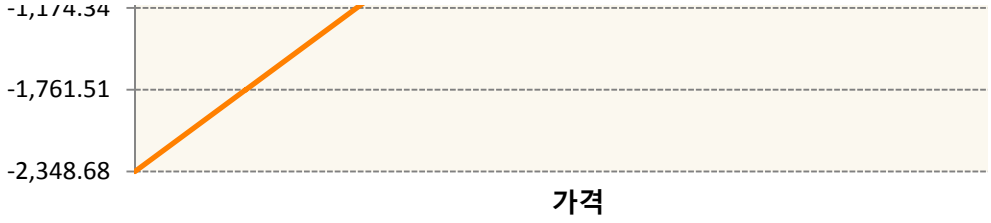
(단위:백만원)

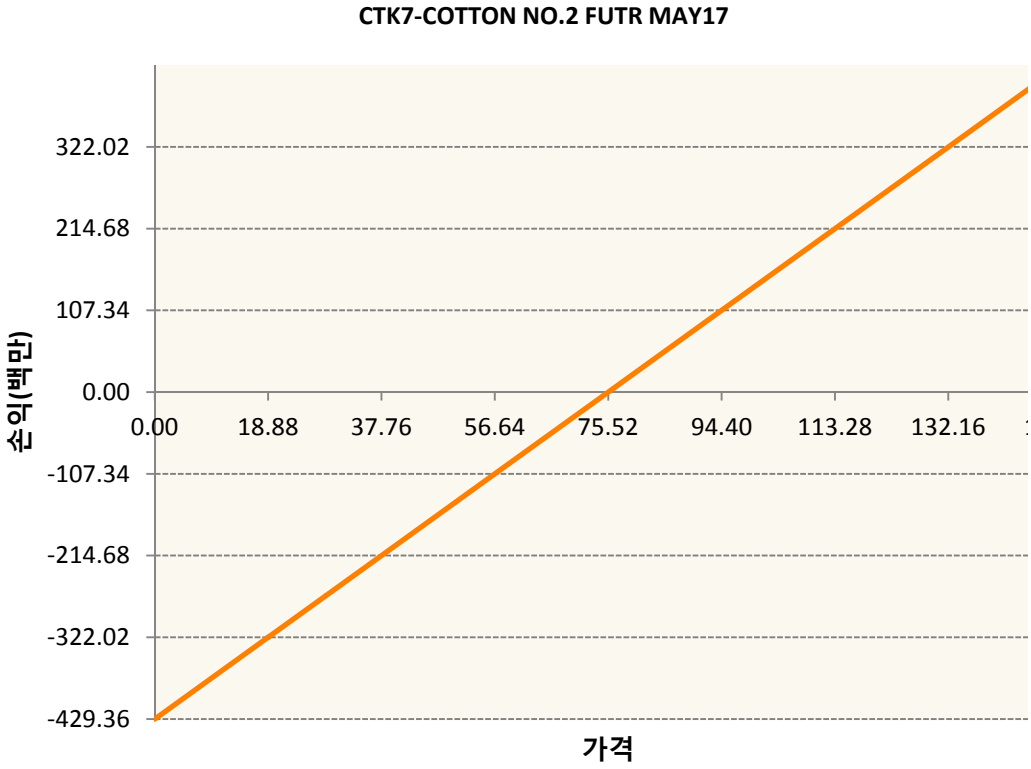
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	9,723	573	9,150	

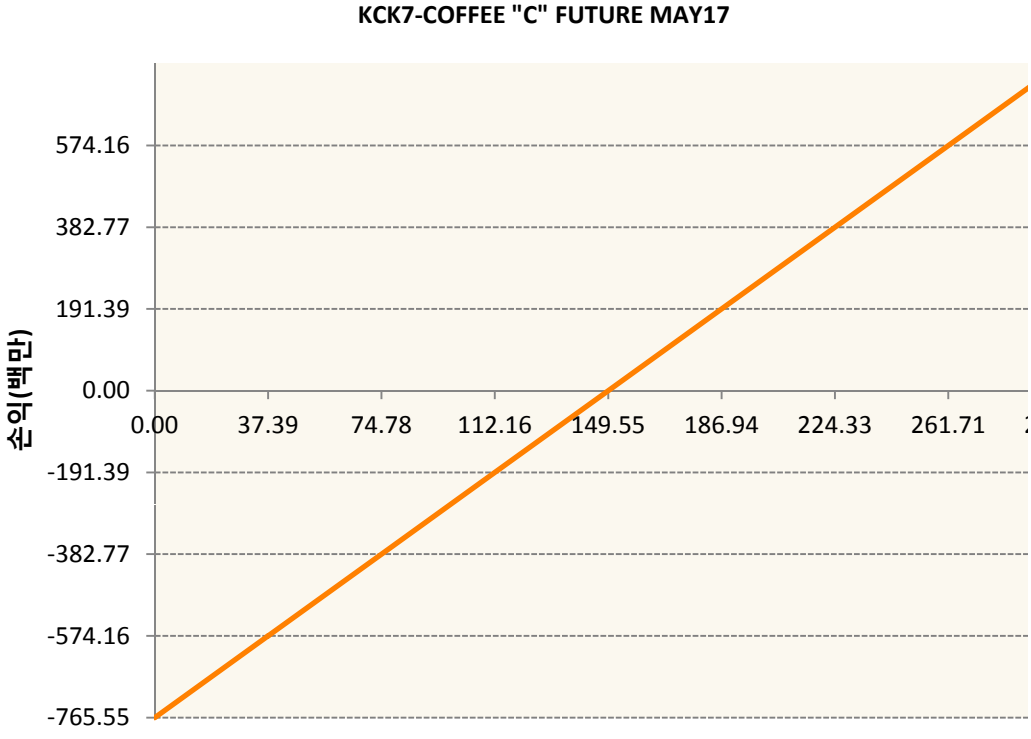
2. 만기시점의 손익구조



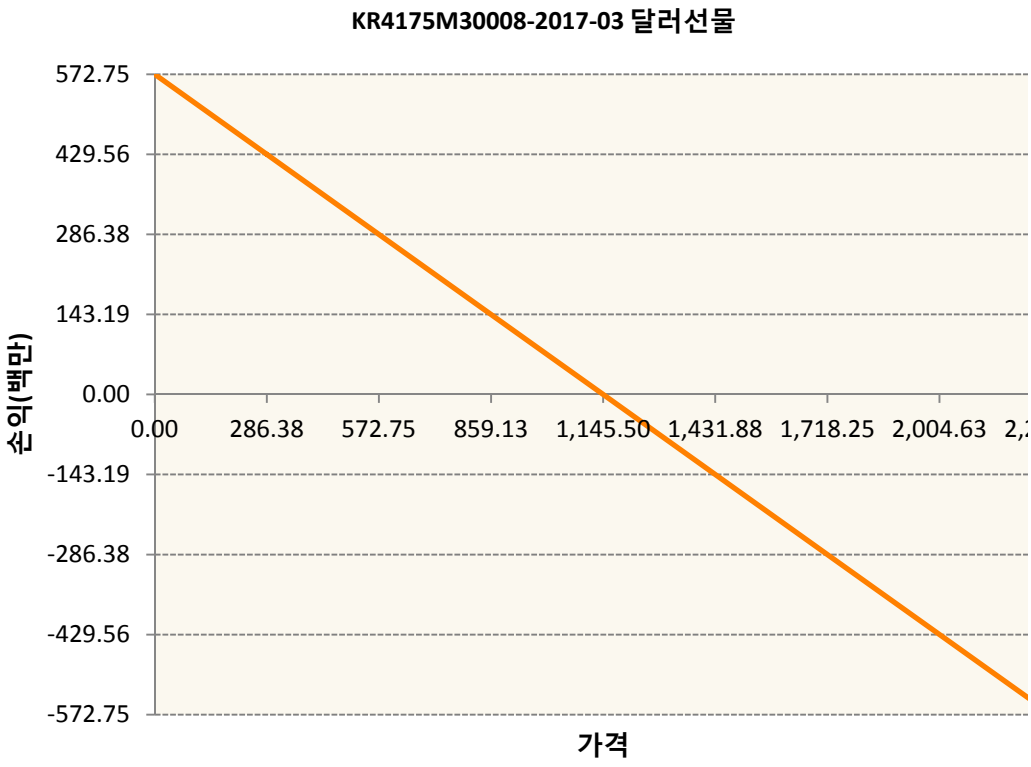


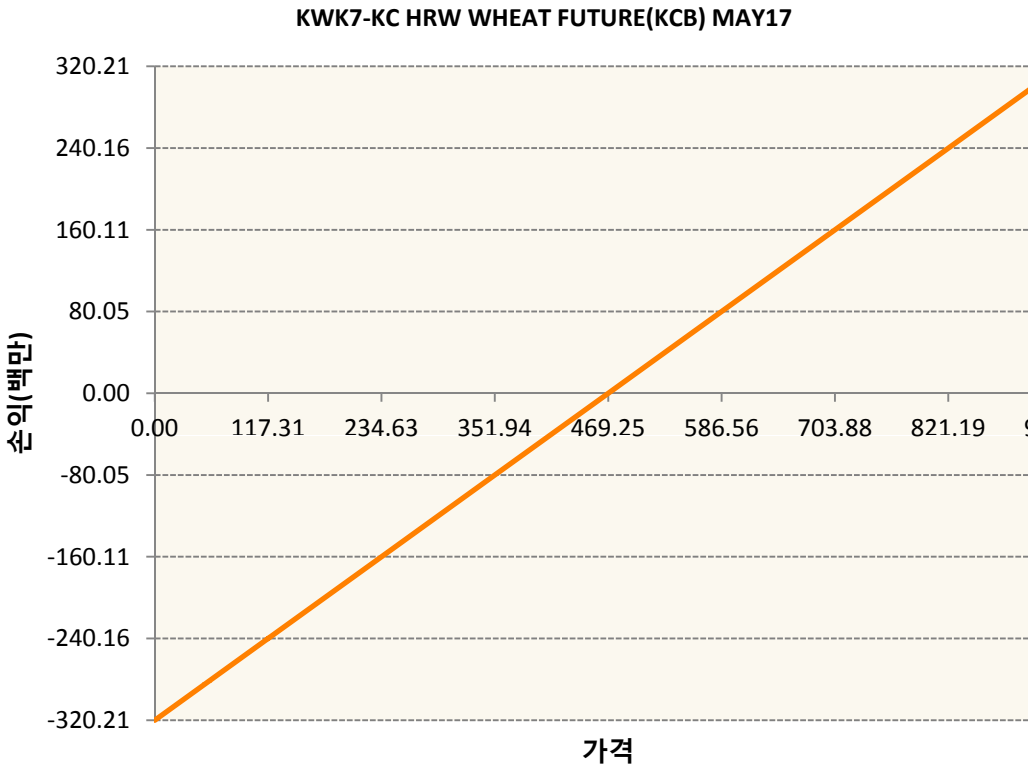

-1,761.51
-2,348.68
가격

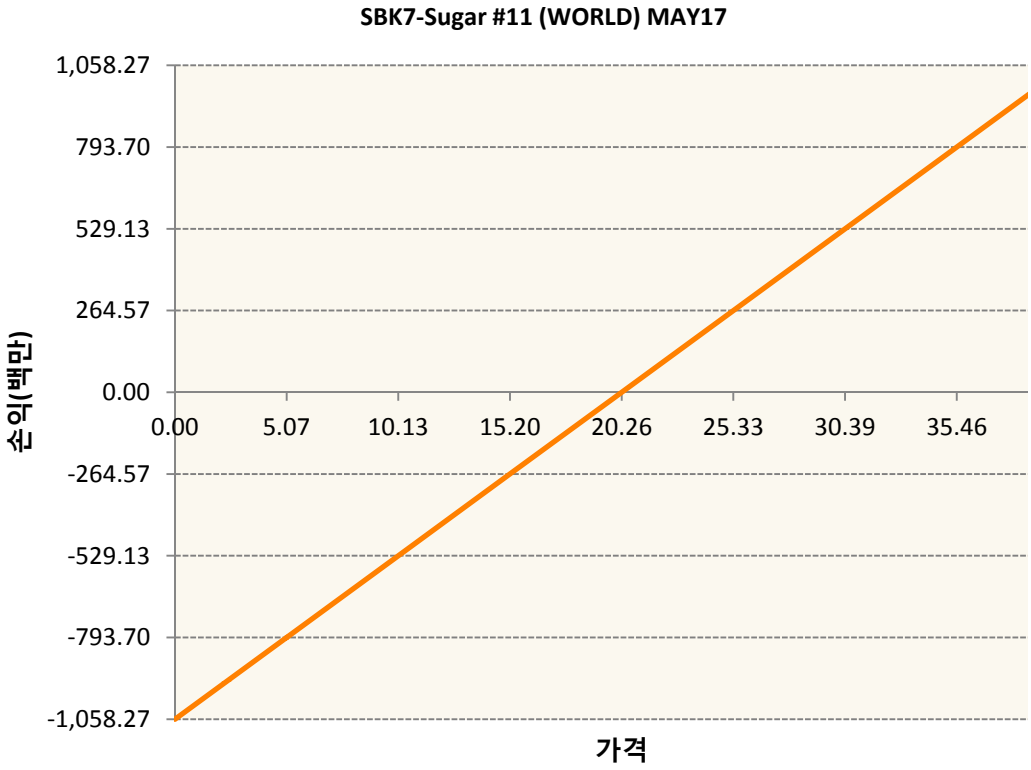

CTK7-COTTON NO.2 FUTR MAY17
322.02
214.68
107.34
0.00
-107.34
-214.68
-322.02
-429.36
0.00
18.88
37.76
56.64
75.52
94.40
113.28
132.16
순익(백만)
가격

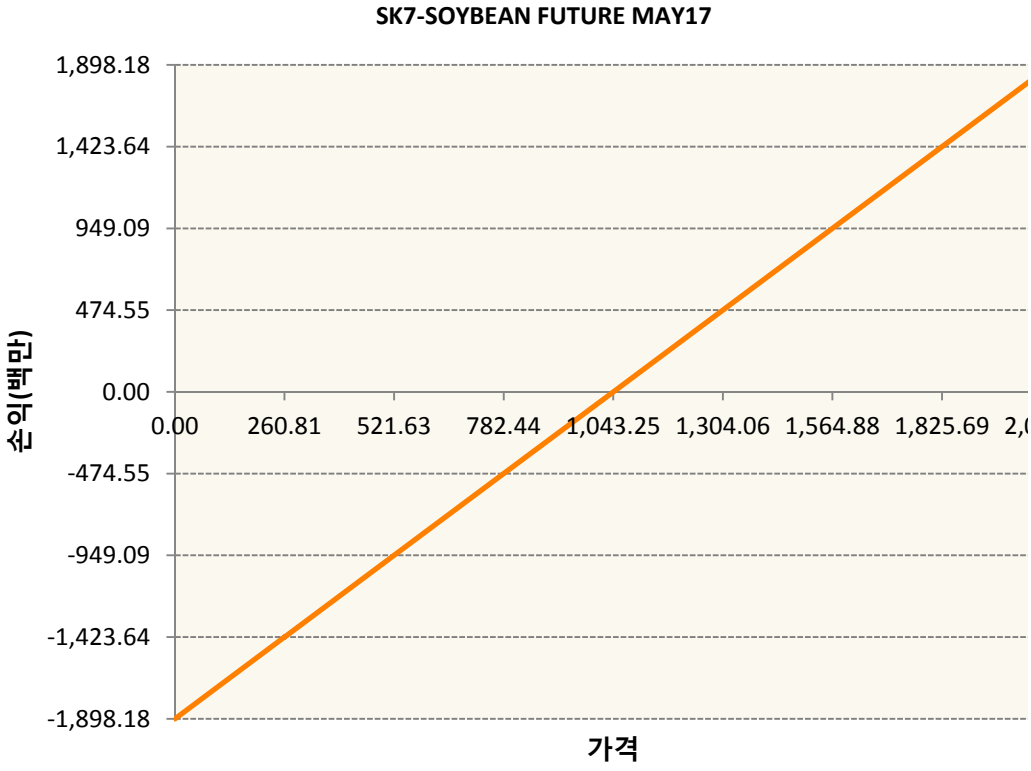

KCK7-COFFEE "C" FUTURE MAY17
574.16
382.77
191.39
0.00
-191.39
-382.77
-574.16
-765.55
0.00
37.39
74.78
112.16
149.55
186.94
224.33
261.71
순익(백만)

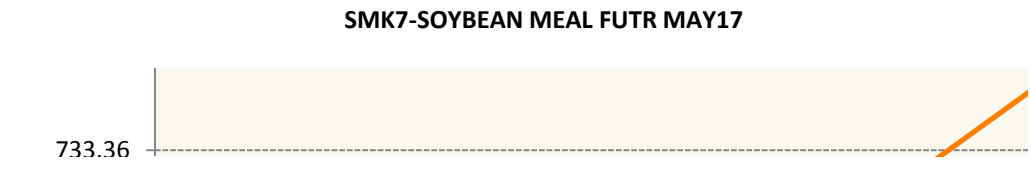
가격

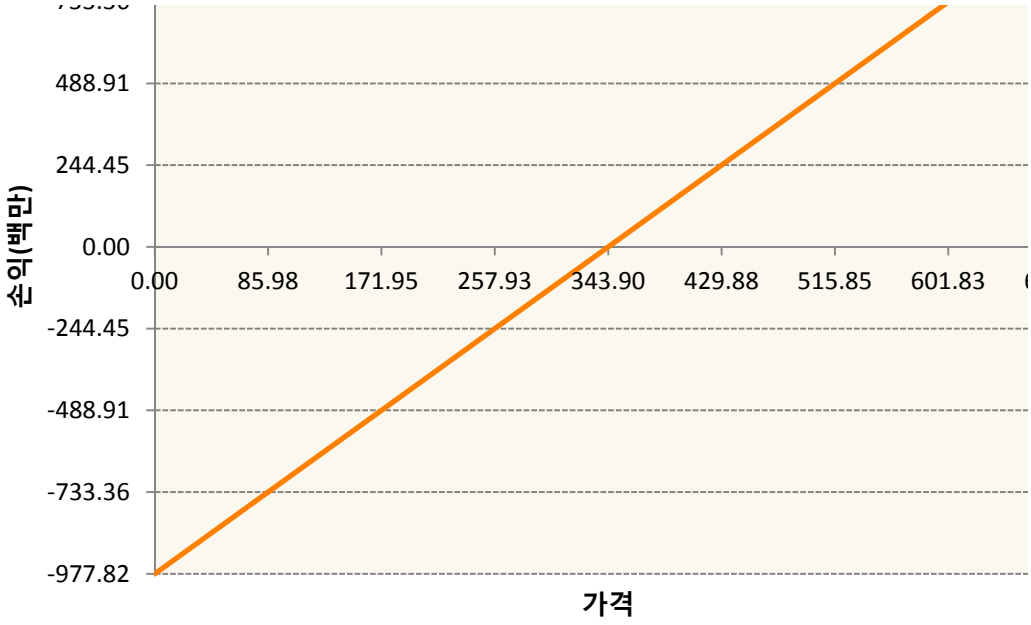

KR4175M30008-2017-03 달러선물
572.75
429.56
286.38
143.19
0.00
-143.19
-286.38
-429.56
-572.75
0.00
286.38
572.75
859.13
1,145.50
1,431.88
1,718.25
2,004.63
손익(백만)
가격

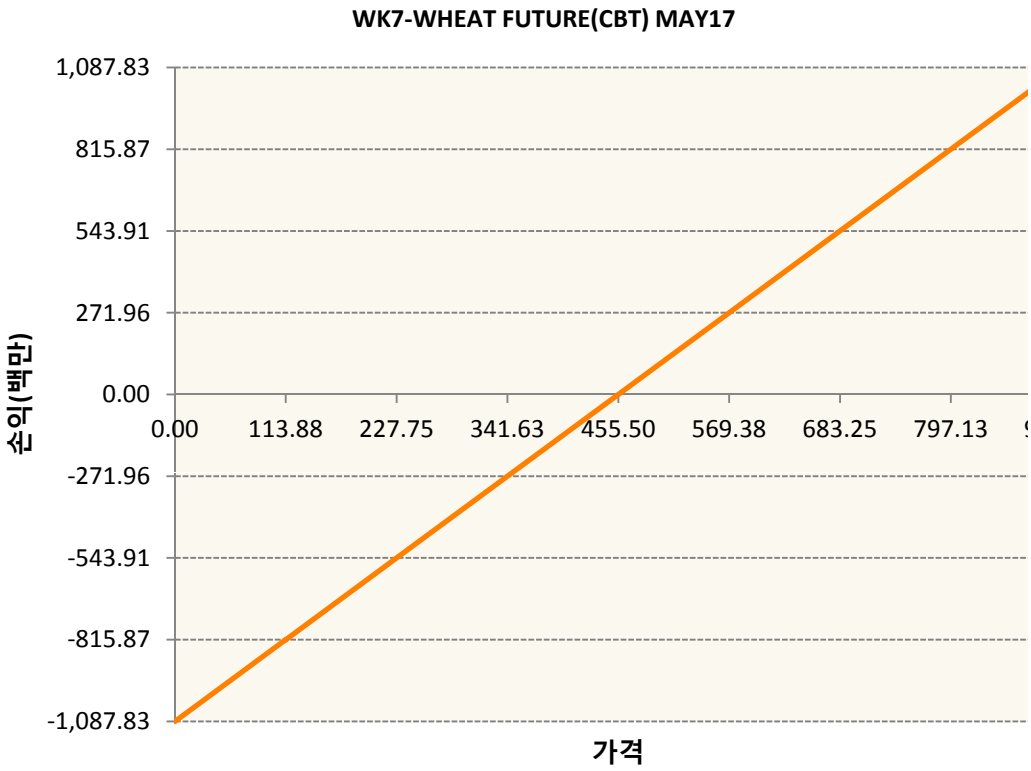

KWK7-KC HRW WHEAT FUTURE(KCB) MAY17
320.21
240.16
160.11
80.05
0.00
-80.05
-160.11
-240.16
-320.21
0.00
117.31
234.63
351.94
469.25
586.56
703.88
821.19
손익(백만)
가격


SBK7-Sugar #11 (WORLD) MAY17
1,058.27
793.70
529.13
264.57
0.00
-264.57
-529.13
-793.70
-1,058.27
0.00
5.07
10.13
15.20
20.26
25.33
30.39
35.46
손익(백만)
가격


SK7-SOYBEAN FUTURE MAY17
1,898.18
1,423.64
949.09
474.55
0.00
-474.55
-949.09
-1,423.64
-1,898.18
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)

912