공시일	2017-02-23
기준일	2017-02-22

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	2017-02-23
기준일	2017-02-22

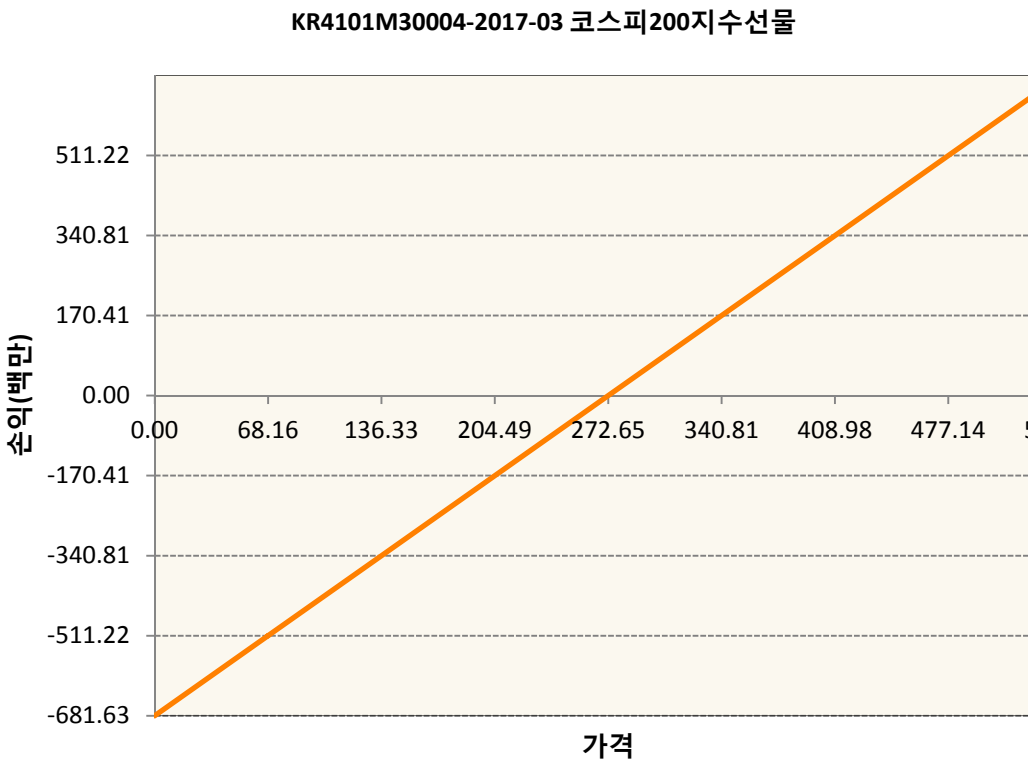
스마트인덱스모

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	682	0	682	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101M30(2017-03 코스피200지수선물							55
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-55	-55	-55	-55	-55	-55	-55
-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%	55	55	55	55	55	55	55

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

35

공시일	2017-02-23
기준일	2017-02-22

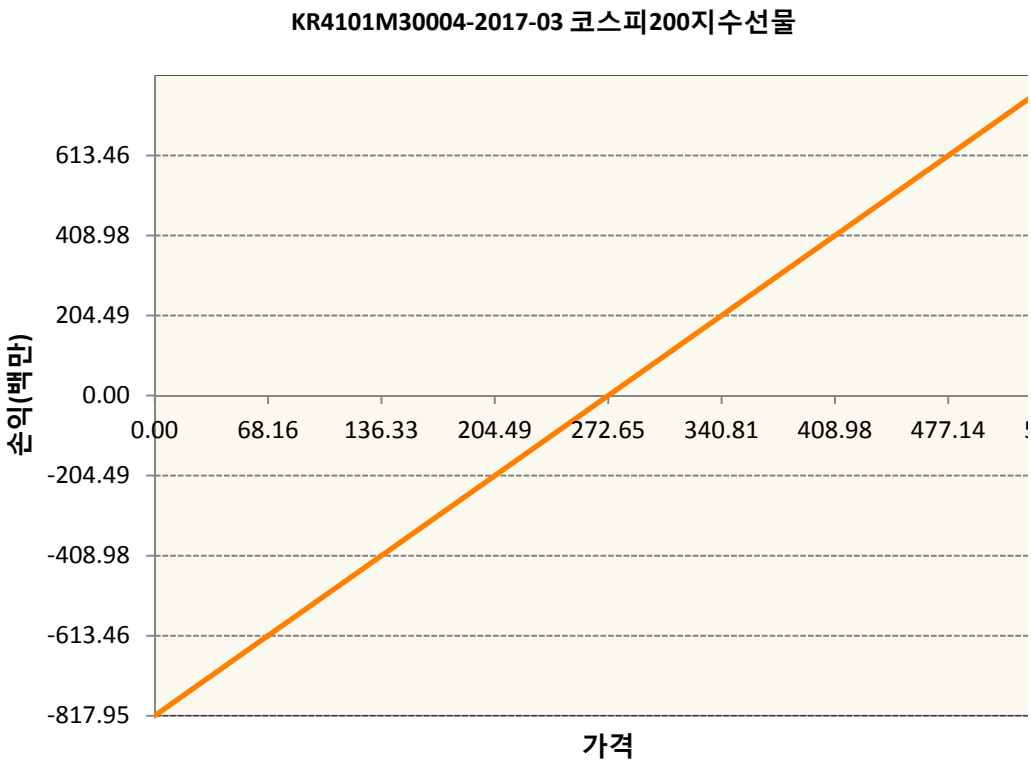
스마트레버리지목표전환형1호

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	136	-136	장내
누계	유가증권	선물	818	0	818	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101M30(2017-03 코스피200지수선물							65
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-65	-65	-65	-65	-65	-65	-65
-5.33%	-44	-44	-44	-44	-44	-44	-44
-2.67%	-22	-22	-22	-22	-22	-22	-22
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	22	22	22	22	22	22	22
5.33%	44	44	44	44	44	44	44
8.00%	65	65	65	65	65	65	65

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

42

공시일	2017-02-23
기준일	2017-02-22

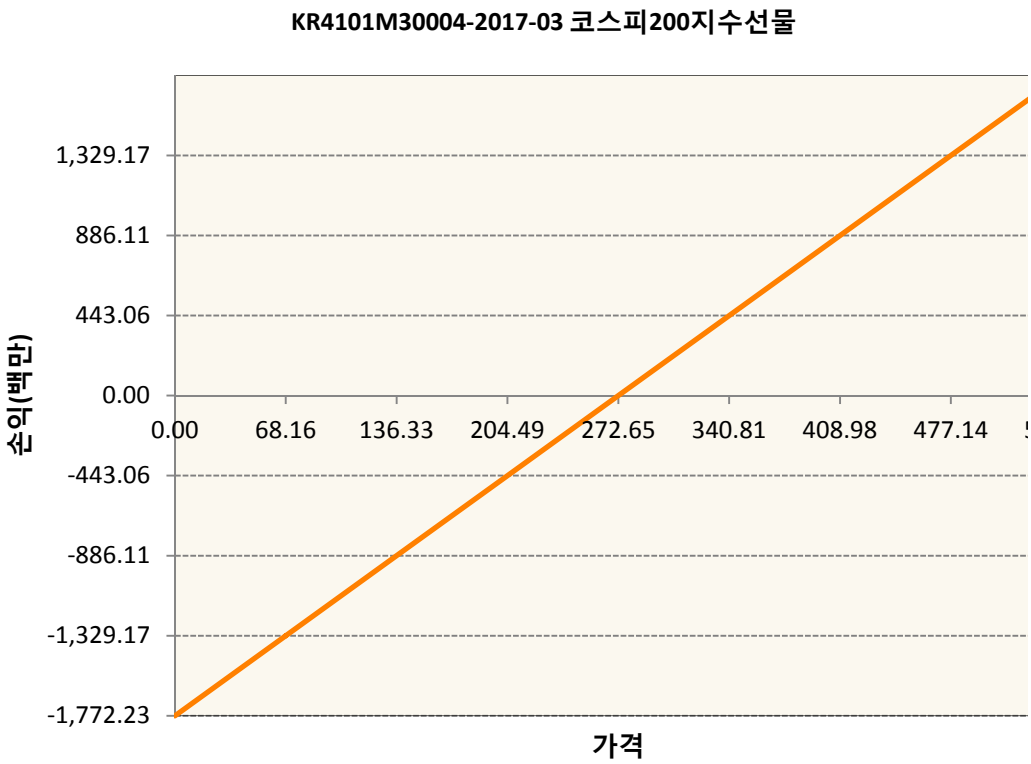
1.3배 레버리지 인덱스(주식-파생형)

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	1,772	0	1,772	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101M30(2017-03 코스피200지수선물							142
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-142	-142	-142	-142	-142	-142	-142
-5.33%	-95	-95	-95	-95	-95	-95	-95
-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%	95	95	95	95	95	95	95
8.00%	142	142	142	142	142	142	142

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

91

공시일	2017-02-23
기준일	2017-02-22

SMART합성-MSCI선진국증권상장지

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	11,879	0	11,879	장외
누계	지수	스왑	11,879	0	11,879	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWMXWO0(신한MXWO 미래S170222	950

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

615

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-02-23
기준일	2017-02-22

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	393

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

548

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-02-23
기준일	2017-02-22

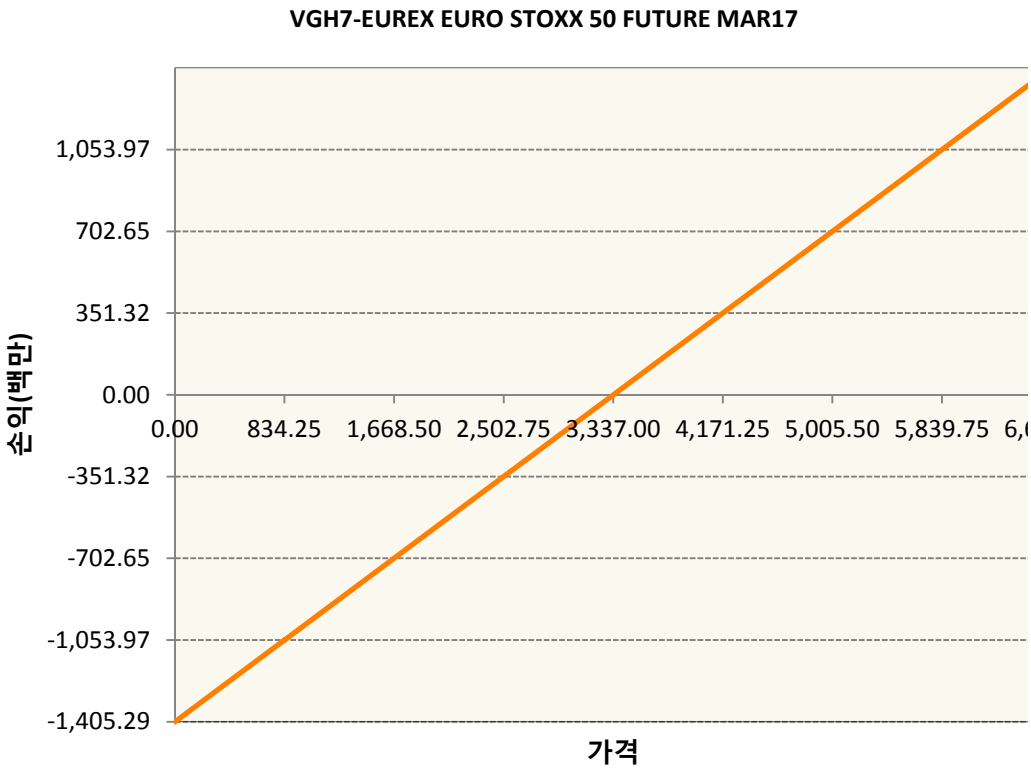
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,405	0	1,405	

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)

116

공시일	2017-02-23
기준일	2017-02-22

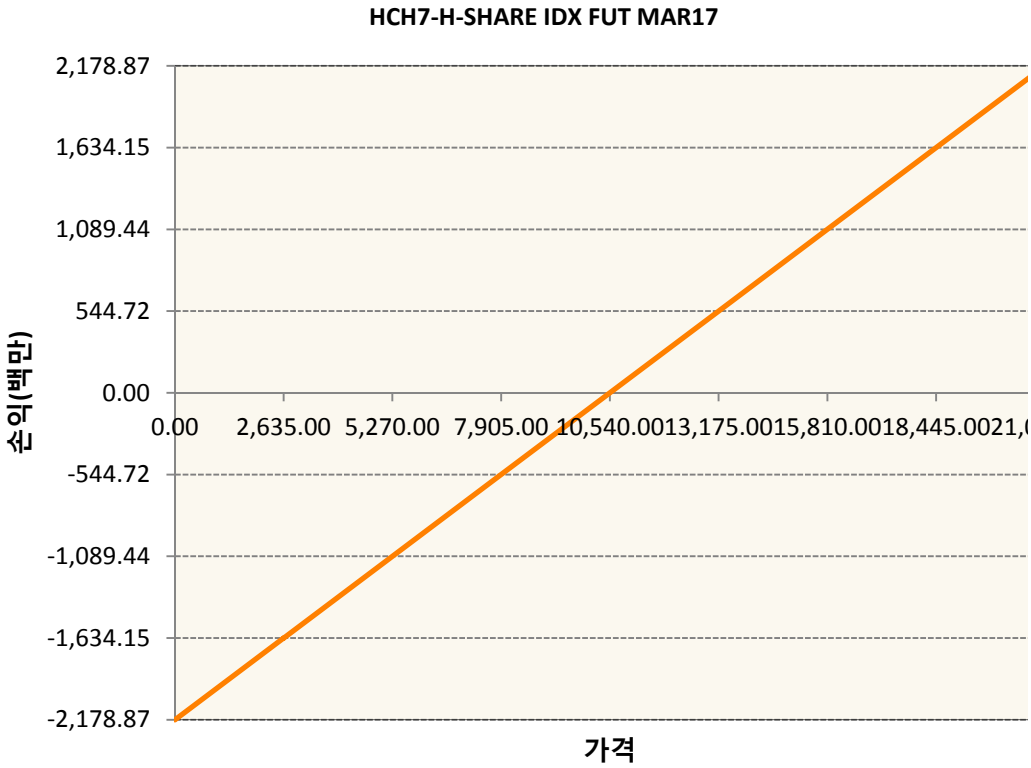
차이나인덱스모(주식-파생형)

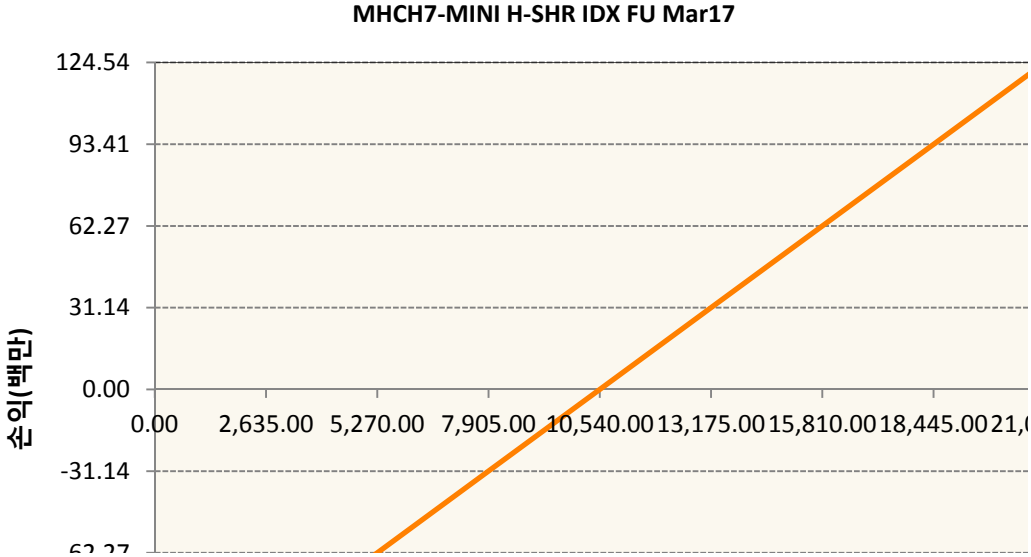
1. 계약금액

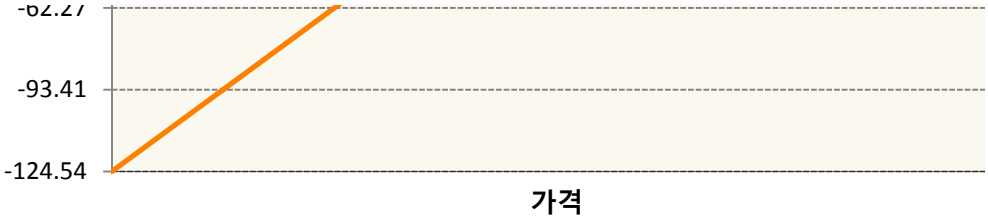
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,303	0	2,303	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCH7	H-SHARE IDX FUT MAR17	174
MHCH7	MINI H-SHR IDX FU Mar17	10

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	209

공시일	2017-02-23
기준일	2017-02-22

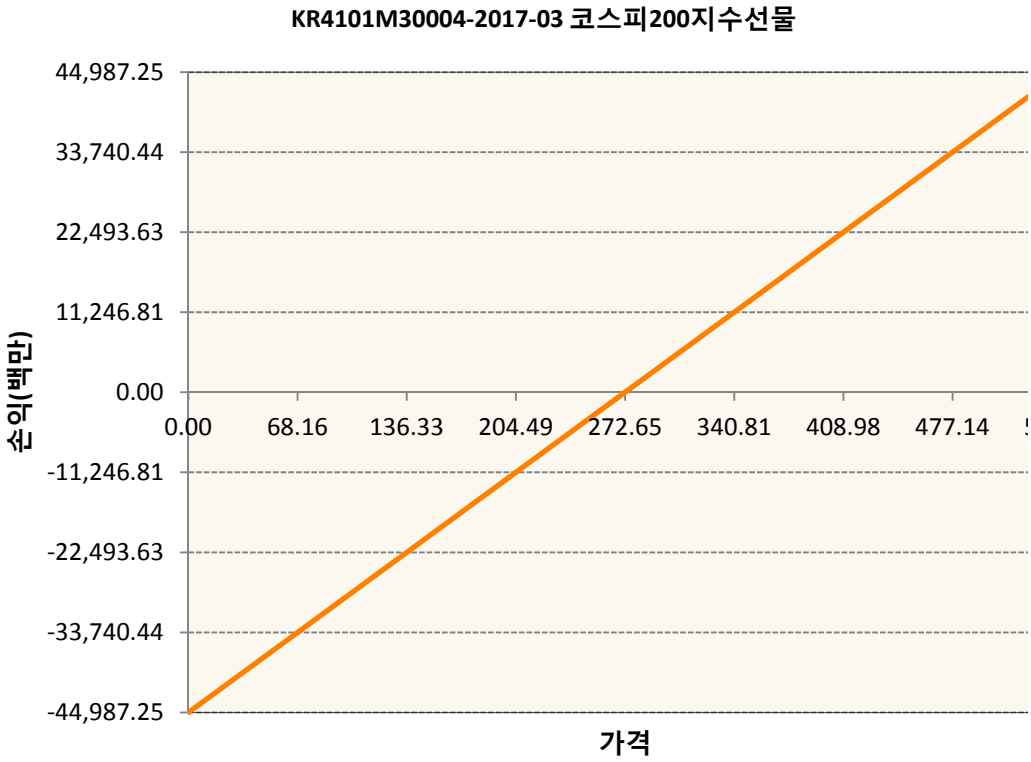
커버드콜모(주식혼합-파생형)

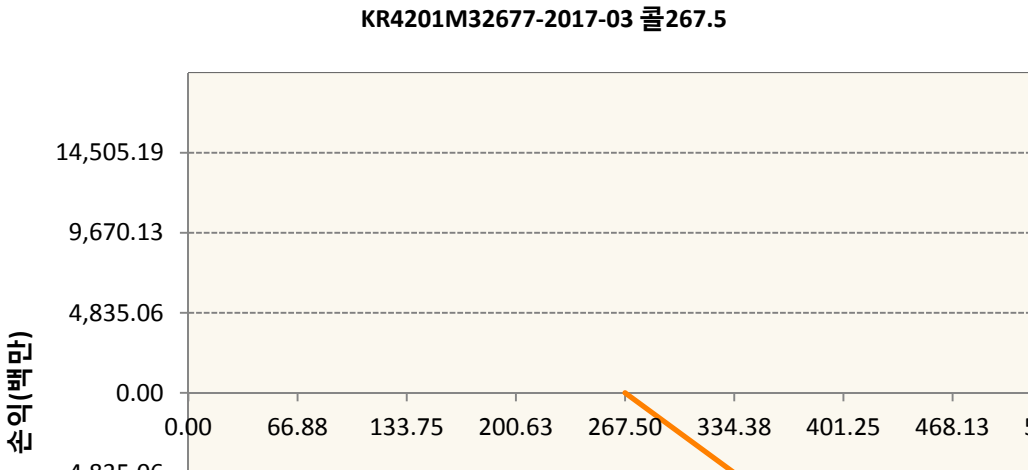
1. 계약금액

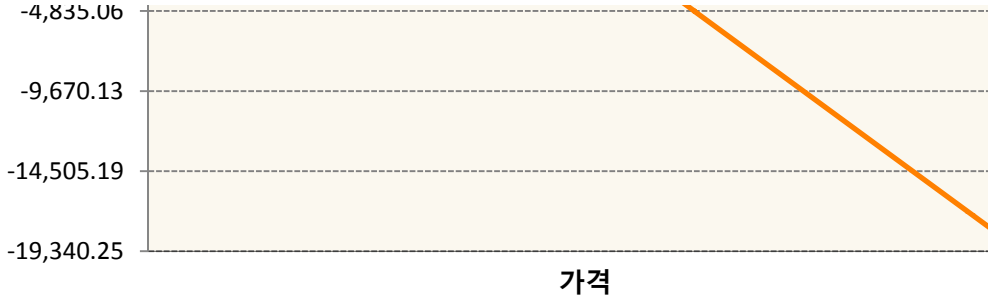
(단위:백만원)

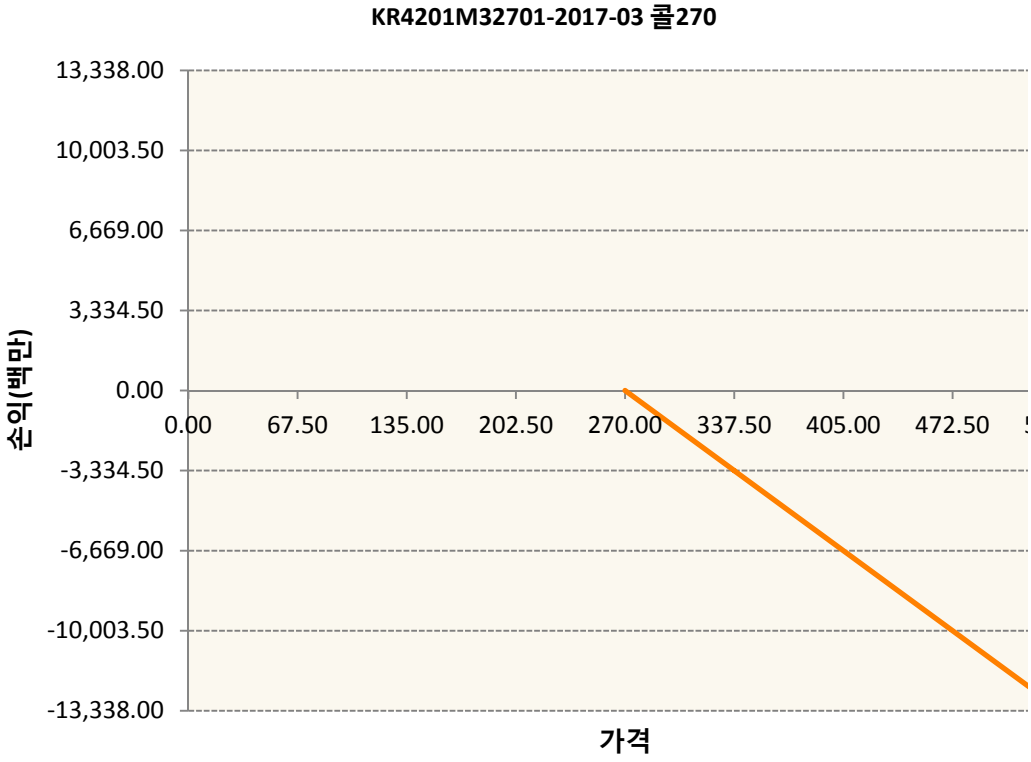
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	44,987	0	44,987	장내
누계	유가증권	옵션	0	32,678	-32,678	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101M30(2017-03 코스피200지수선물							3,602
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-3,602	-3,602	-3,602	-3,602	-3,602	-3,602	-3,602
-5.33%	-2,401	-2,401	-2,401	-2,401	-2,401	-2,401	-2,401
-2.67%	-1,201	-1,201	-1,201	-1,201	-1,201	-1,201	-1,201
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	1,201	1,201	1,201	1,201	1,201	1,201	1,201
5.33%	2,401	2,401	2,401	2,401	2,401	2,401	2,401
8.00%	3,602	3,602	3,602	3,602	3,602	3,602	3,602
KR4201M32(2017-03 콜267.5							7,732
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	2,087	2,087	2,087	2,087	2,086	2,085	2,084
-5.33%	2,083	2,078	2,071	2,060	2,046	2,029	2,009
-2.67%	1,806	1,750	1,693	1,635	1,576	1,517	1,457
0%	96	68	36	0	-39	-81	-126
2.67%	-2,475	-2,476	-2,477	-2,481	-2,485	-2,492	-2,502
5.33%	-5,103	-5,103	-5,103	-5,103	-5,104	-5,104	-5,105
8.00%	-7,732	-7,732	-7,732	-7,732	-7,732	-7,732	-7,732
KR4201M32 2017-03 콜270							5,145
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	947	947	947	947	947	947	946
-5.33%	947	946	944	942	938	932	925
-2.67%	884	860	833	804	774	741	708
0%	107	73	37	0	-38	-77	-116
2.67%	-1,555	-1,557	-1,562	-1,568	-1,576	-1,587	-1,600
5.33%	-3,349	-3,349	-3,349	-3,349	-3,350	-3,350	-3,352
8.00%	-5,145	-5,145	-5,145	-5,145	-5,145	-5,145	-5,145

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

19,033

공시일	2017-02-23
기준일	2017-02-22

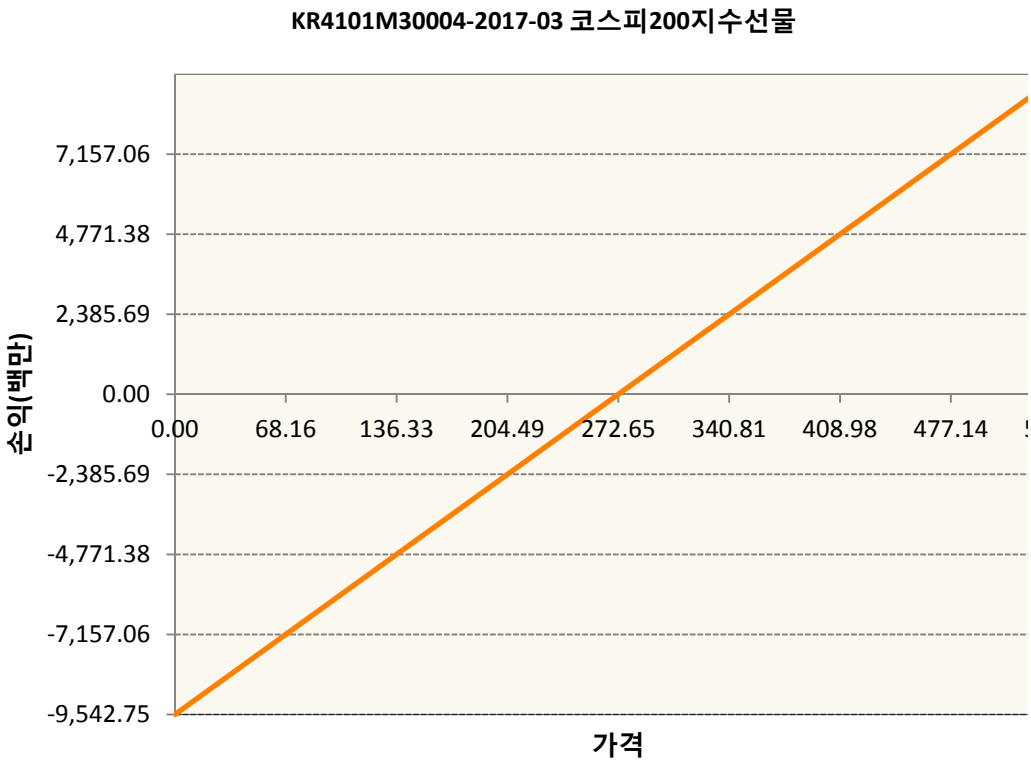
커버드콜목표전환형증권투자신탁

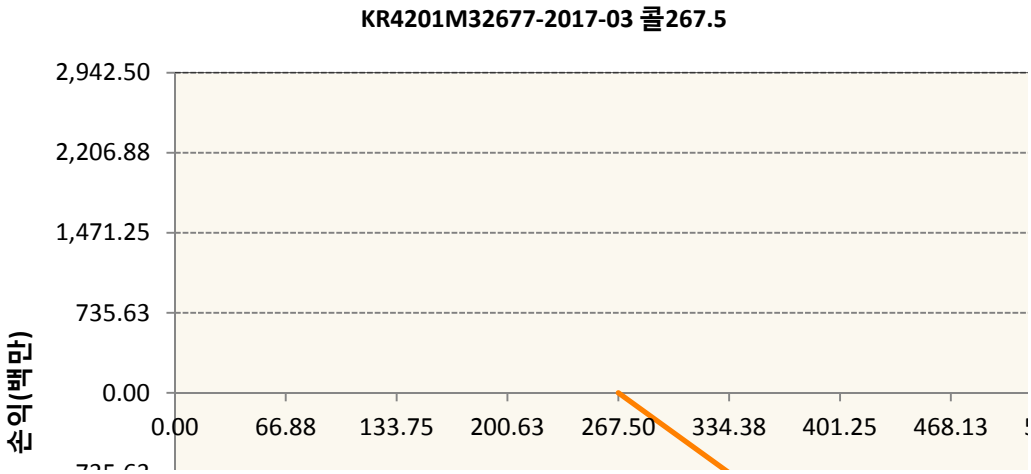
1. 계약금액

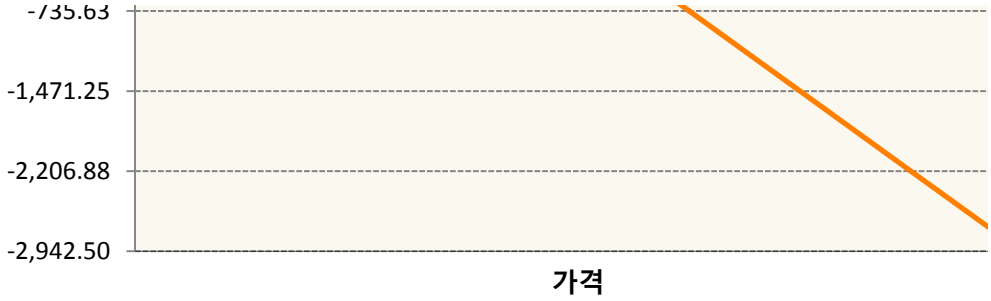
(단위:백만원)

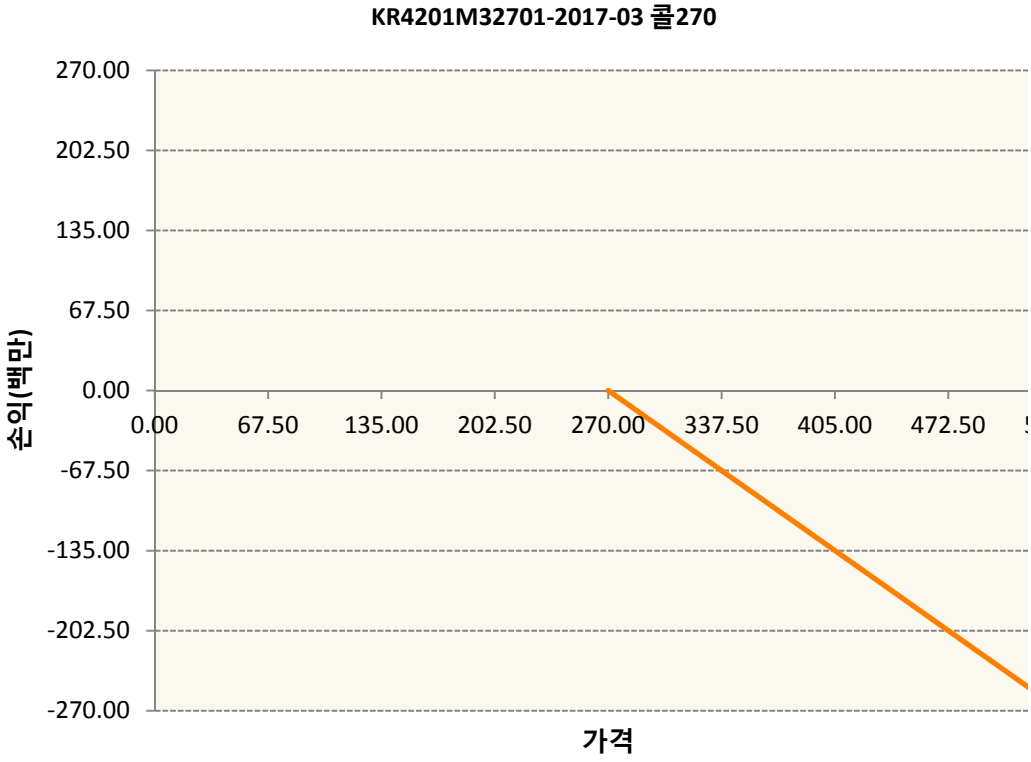
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	9,543	0	9,543	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,213	-3,213	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101M30(2017-03 코스피200지수선물							764
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-764	-764	-764	-764	-764	-764	-764
-5.33%	-509	-509	-509	-509	-509	-509	-509
-2.67%	-255	-255	-255	-255	-255	-255	-255
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	255	255	255	255	255	255	255
5.33%	509	509	509	509	509	509	509
8.00%	764	764	764	764	764	764	764
KR4201M32(2017-03 콜267.5							1,176
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	318	318	318	317	317	317	317
-5.33%	317	316	315	313	311	309	306
-2.67%	275	266	258	249	240	231	222
0%	15	10	5	0	-6	-12	-19
2.67%	-377	-377	-377	-377	-378	-379	-381
5.33%	-776	-776	-776	-776	-776	-777	-777
8.00%	-1,176	-1,176	-1,176	-1,176	-1,176	-1,176	-1,176
KR4201M32 2017-03 콜270							104

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	19	19	19	19	19	19	19
-5.33%	19	19	19	19	19	19	19
-2.67%	18	17	17	16	16	15	14
0%	2	1	1	0	-1	-2	-2
2.67%	-31	-32	-32	-32	-32	-32	-32
5.33%	-68	-68	-68	-68	-68	-68	-68
8.00%	-104	-104	-104	-104	-104	-104	-104

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

2,130

공시일	2017-02-23
기준일	2017-02-22

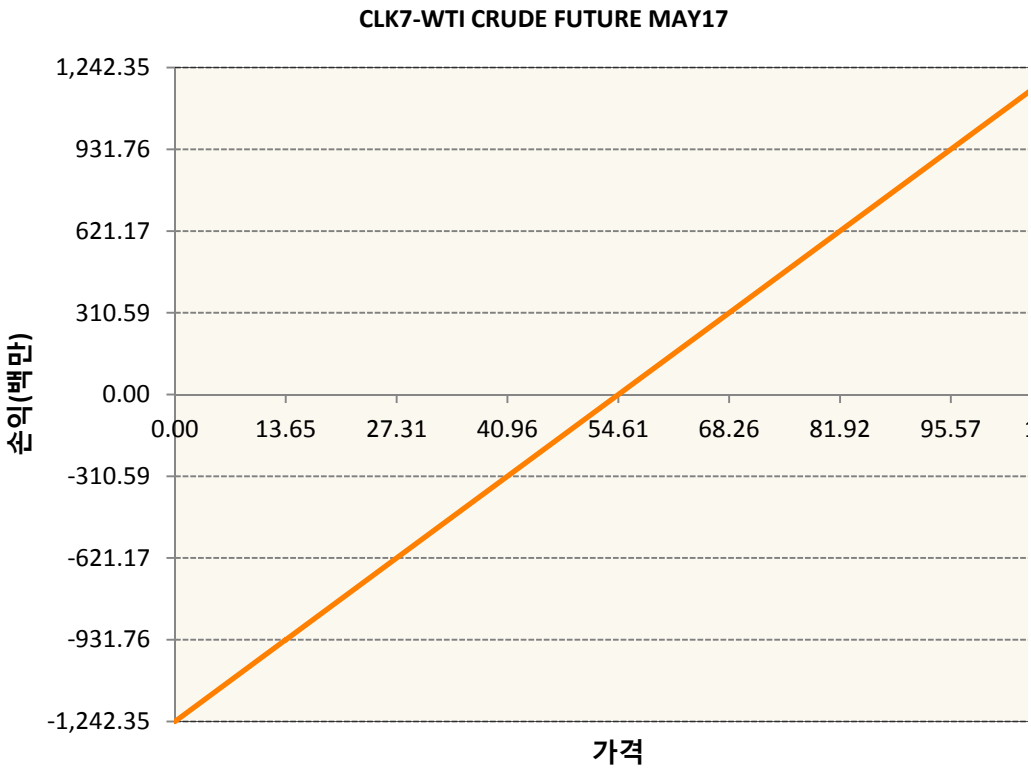
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

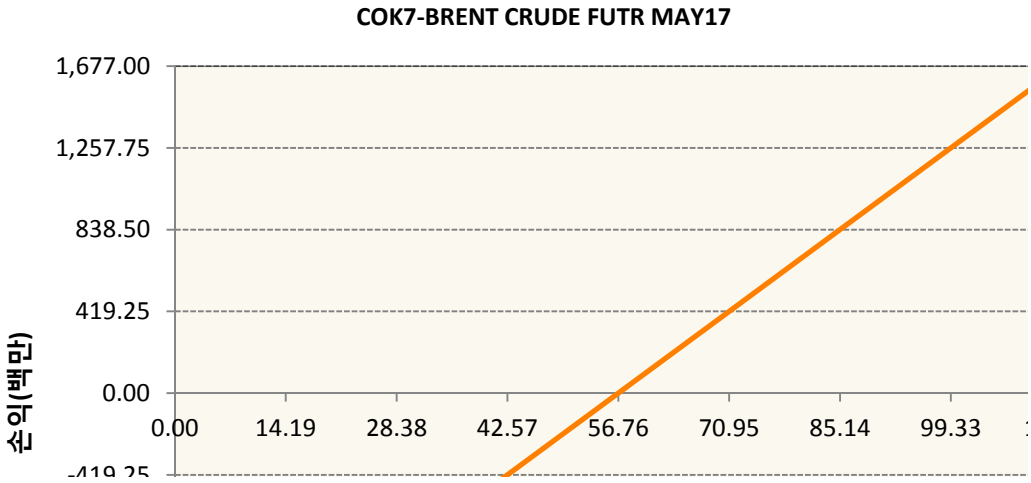
1. 계약금액

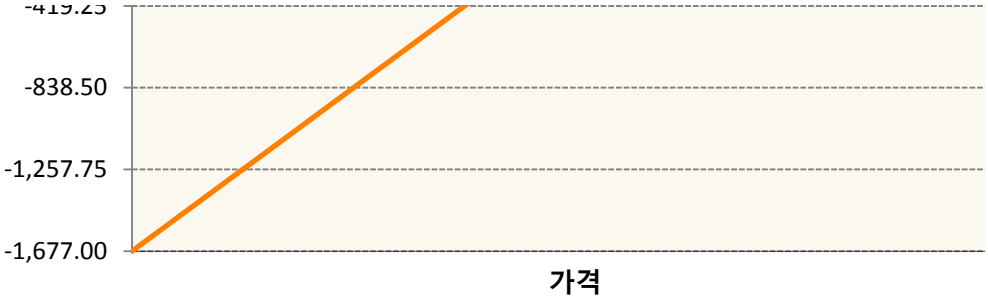
(단위:백만원)

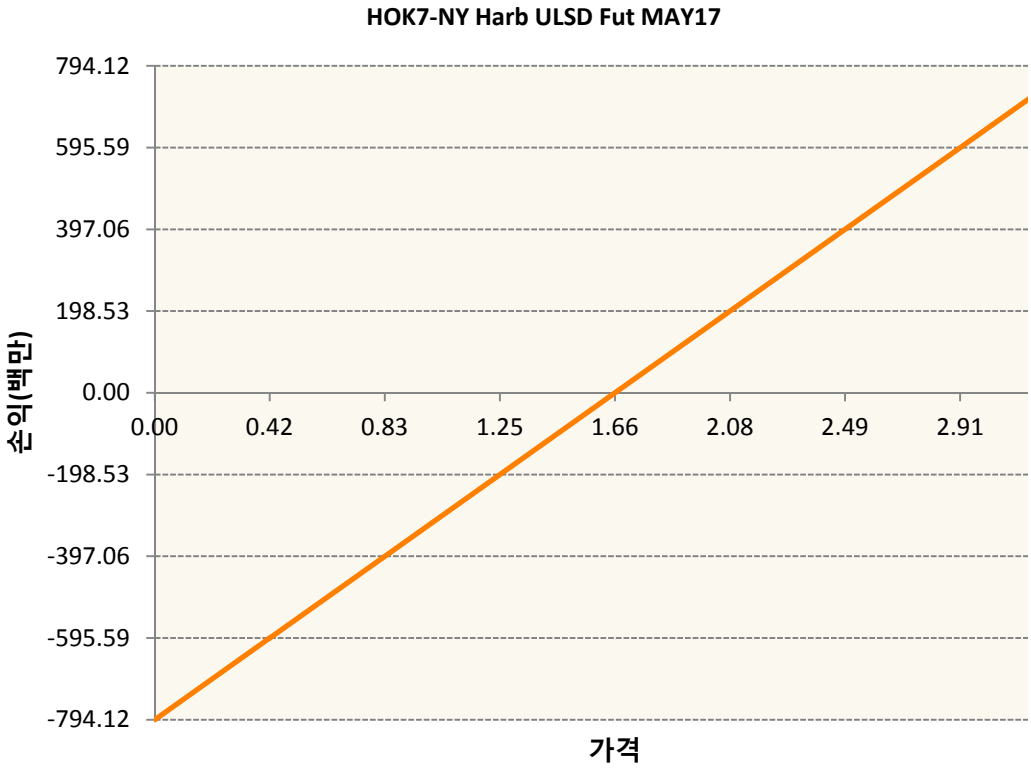
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	선물	유가증권	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	선물	유가증권	1,242	0	1,242	
누계	유가증권	선물	4,584	411	4,173	

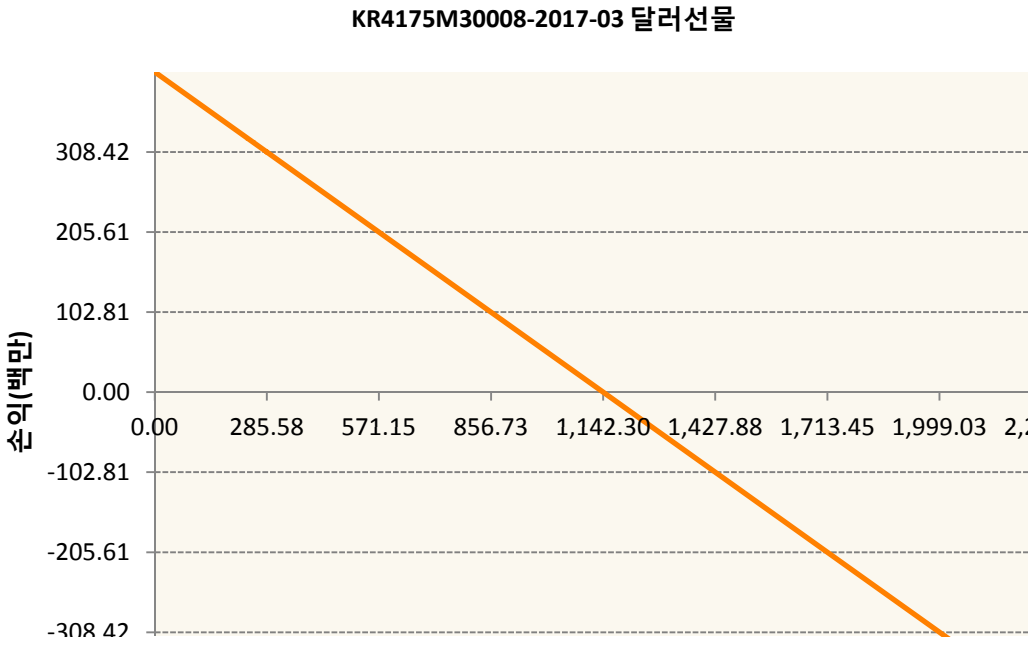
2. 만기시점의 손익구조

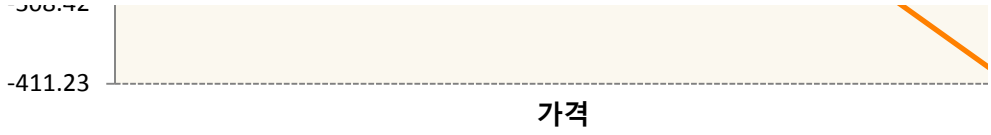


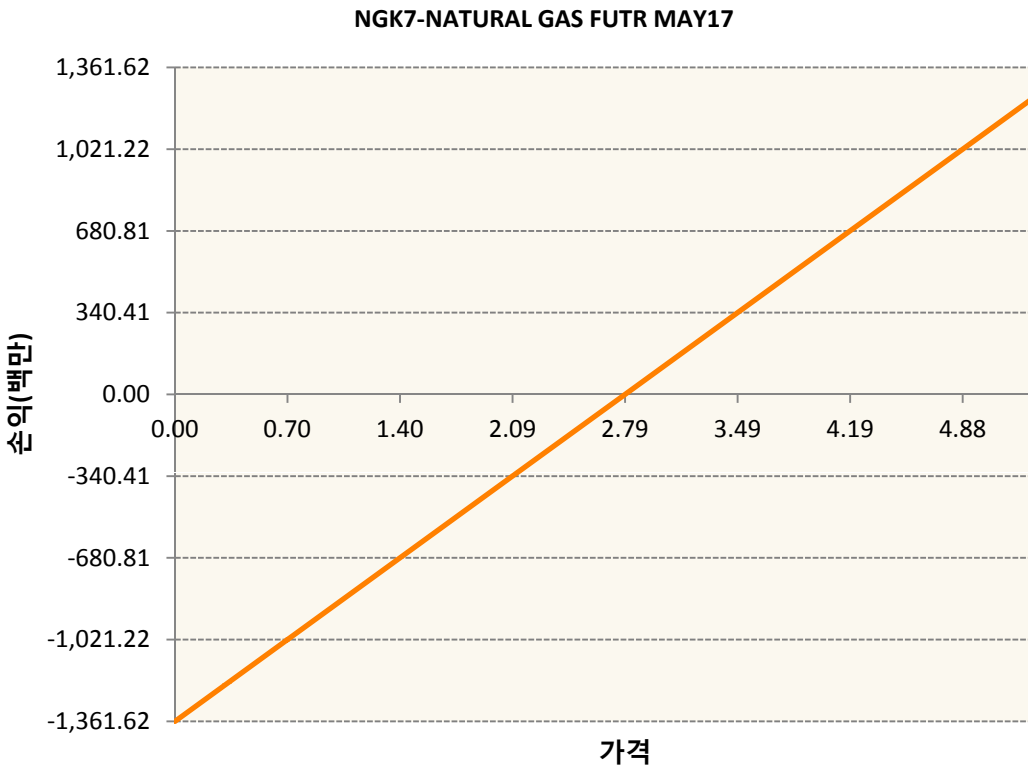


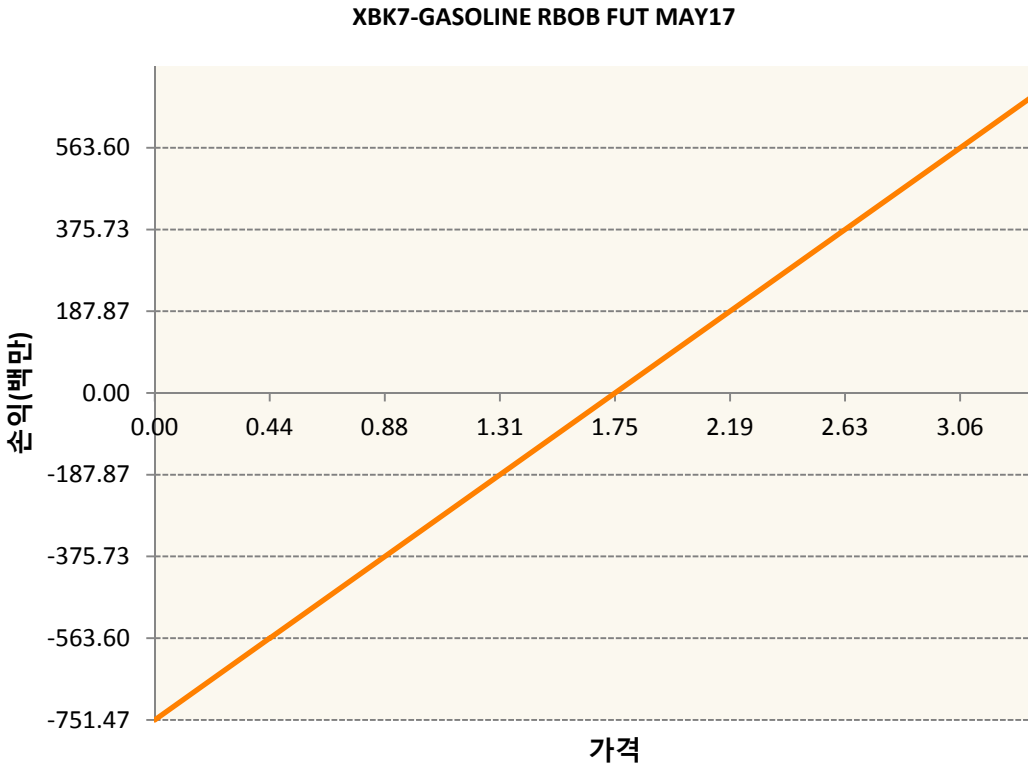

-838.50
-1,257.75
-1,677.00
가격


HOK7-NY Harb ULSD Fut MAY17
794.12
595.59
397.06
198.53
0.00
-198.53
-397.06
-595.59
-794.12
0.00
0.42
0.83
1.25
1.66
2.08
2.49
2.91
순익(백만)
가격


KR4175M30008-2017-03 달러선물
308.42
205.61
102.81
0.00
-102.81
-205.61
0.00
285.58
571.15
856.73
1,142.30
1,427.88
1,713.45
1,999.03
순익(백만)


-411.23
가격


NGK7-NATURAL GAS FUTR MAY17
1,361.62
1,021.22
680.81
340.41
0.00
-340.41
-680.81
-1,021.22
-1,361.62
0.00
0.70
1.40
2.09
2.79
3.49
4.19
4.88
순익(백만)
가격


XBK7-GASOLINE RBOB FUT MAY17
563.60
375.73
187.87
0.00
-187.87
-375.73
-563.60
-751.47
0.00
0.44
0.88
1.31
1.75
2.19
2.63
3.06
순익(백만)
가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLK7	WTI CRUDE FUTURE MAY17	99
COK7	BRENT CRUDE FUTR MAY17	134
HOK7	NY Harb ULSD Fut MAY17	64
KR4175M30(	2017-03 달러선물	33
NGK7	NATURAL GAS FUTR MAY17	109
XBK7	GASOLINE RBOB FUT MAY17	60

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

1,034

공시일	2017-02-23
기준일	2017-02-22

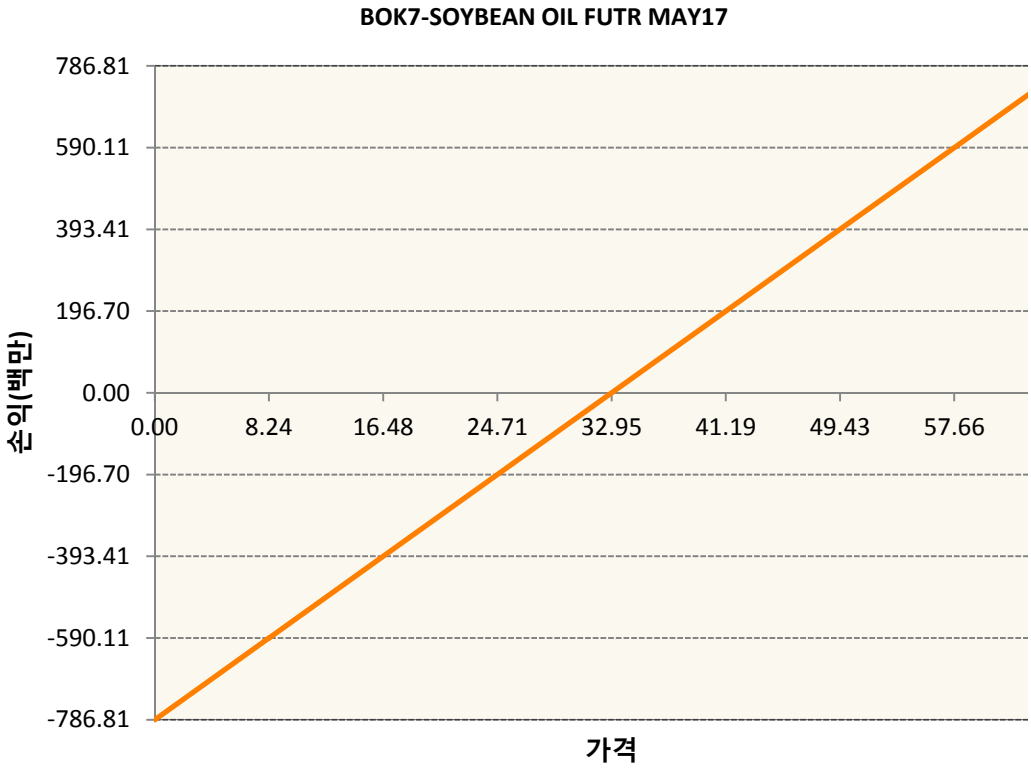
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

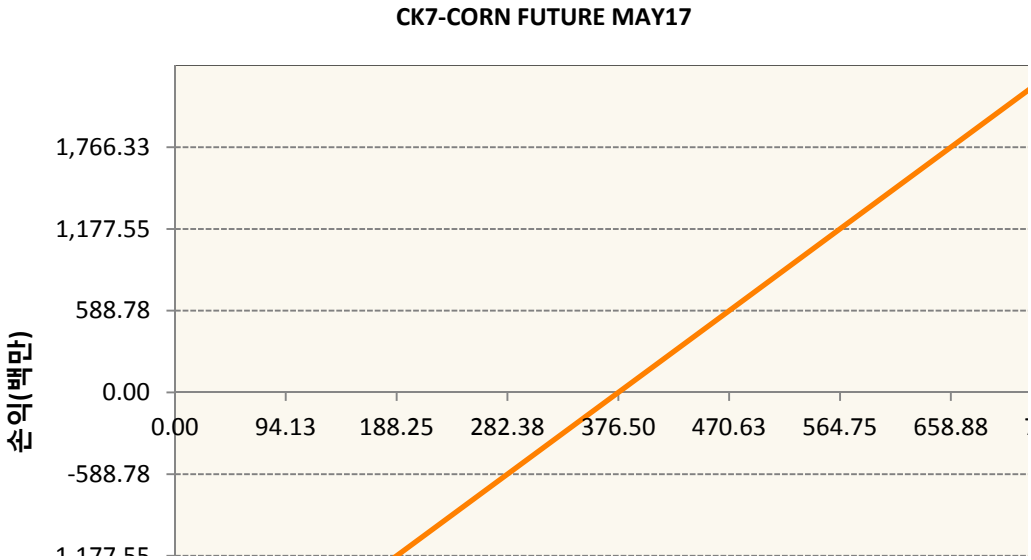
1. 계약금액

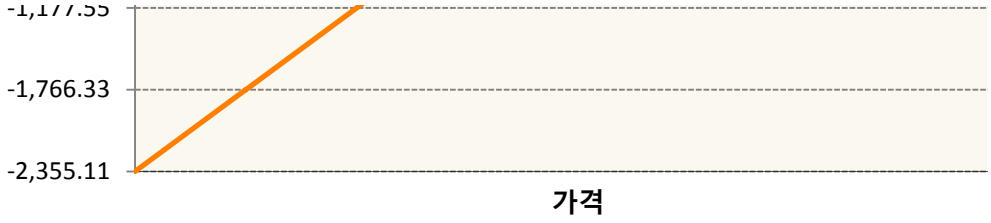
(단위:백만원)

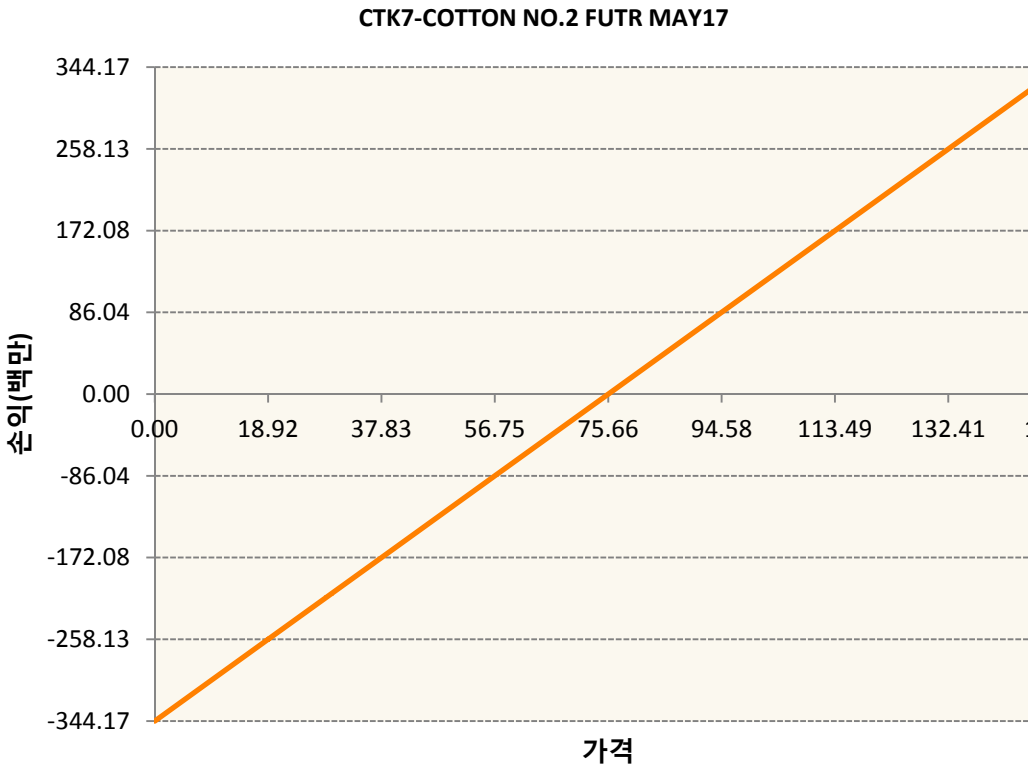
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	9,507	571	8,936	

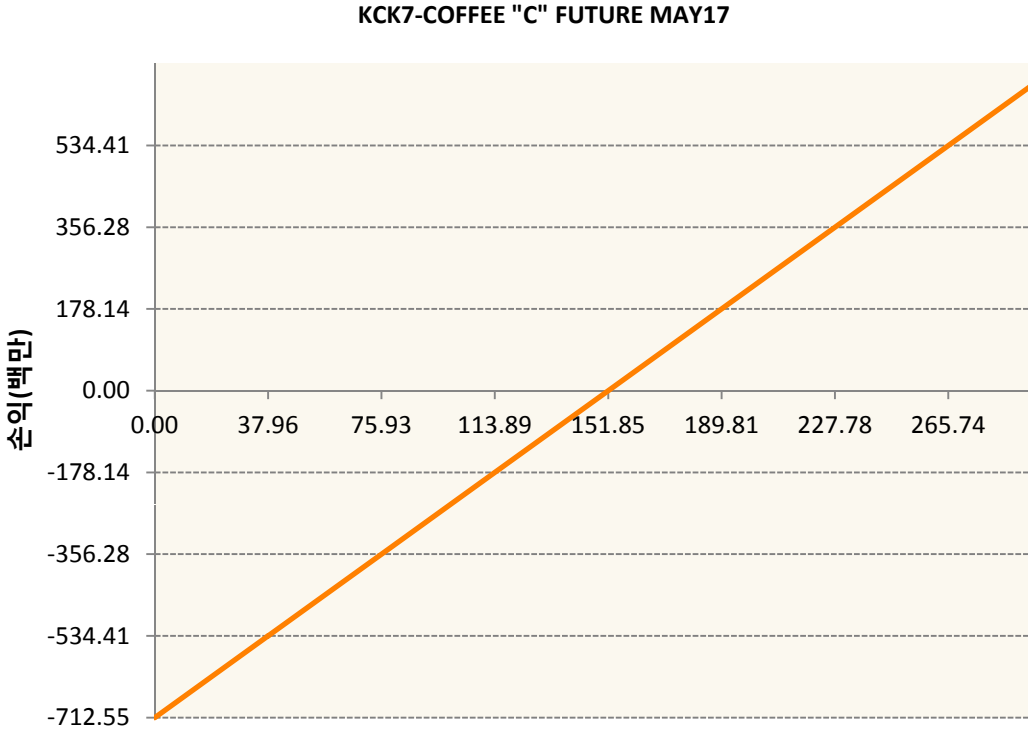
2. 만기시점의 손익구조



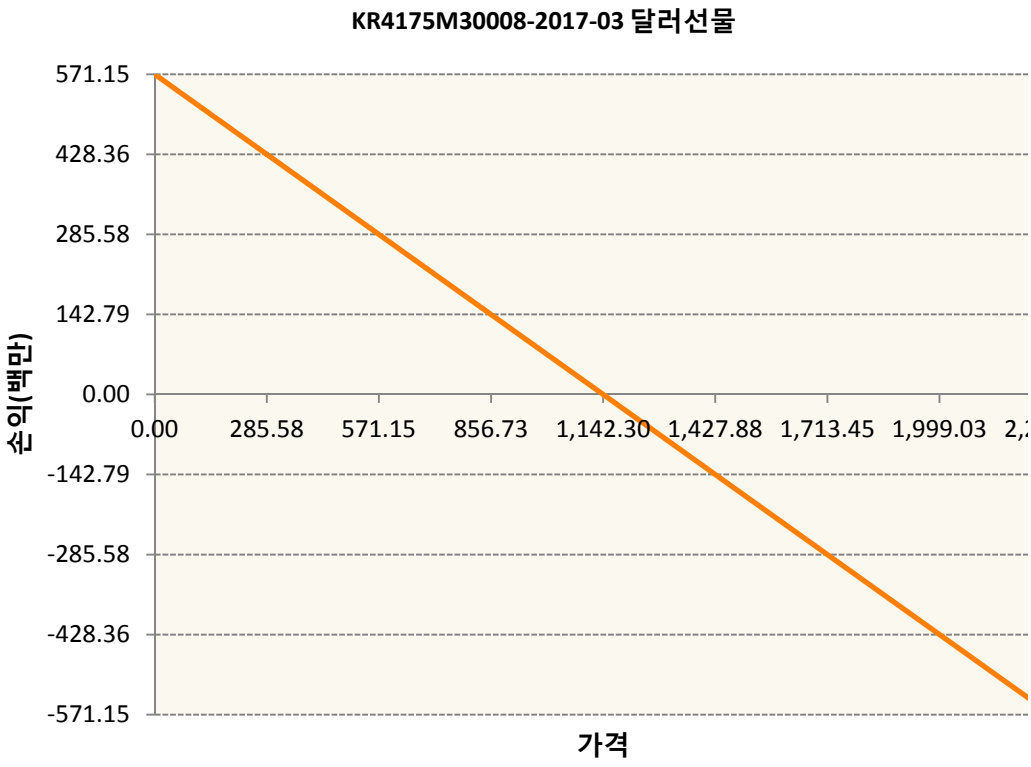


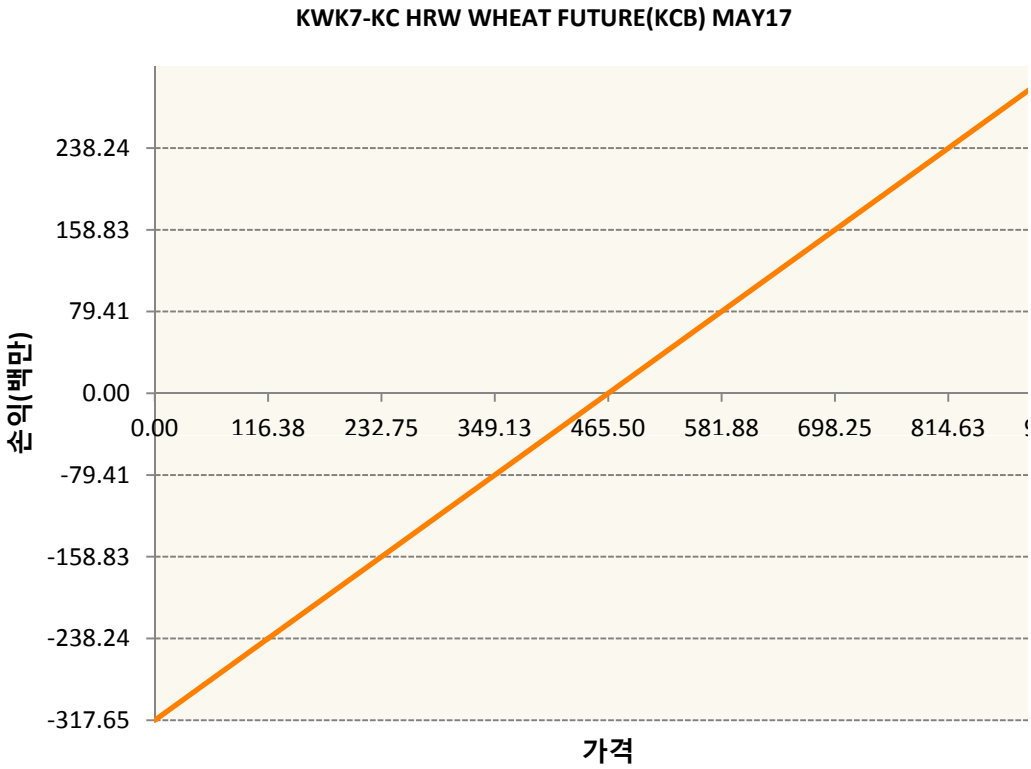

-1,766.33
-2,355.11
가격

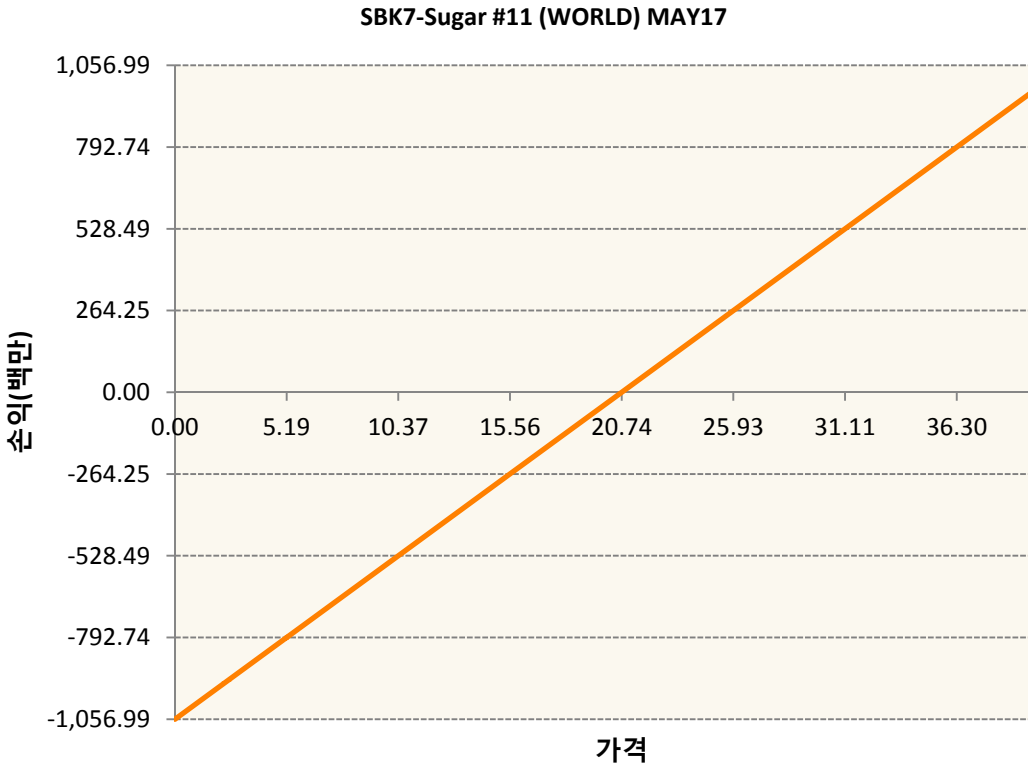

CTK7-COTTON NO.2 FUTR MAY17
344.17
258.13
172.08
86.04
0.00
-86.04
-172.08
-258.13
-344.17
0.00
18.92
37.83
56.75
75.66
94.58
113.49
132.41
손익(백만)
가격

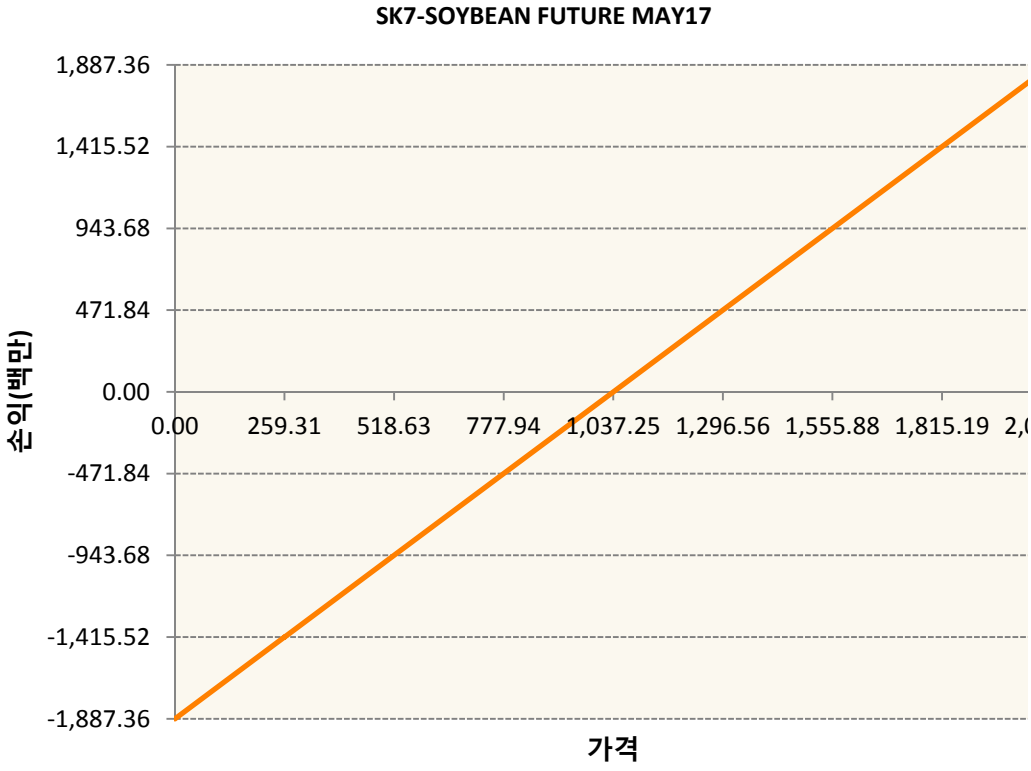

KCK7-COFFEE "C" FUTURE MAY17
534.41
356.28
178.14
0.00
-178.14
-356.28
-534.41
-712.55
0.00
37.96
75.93
113.89
151.85
189.81
227.78
265.74
손익(백만)

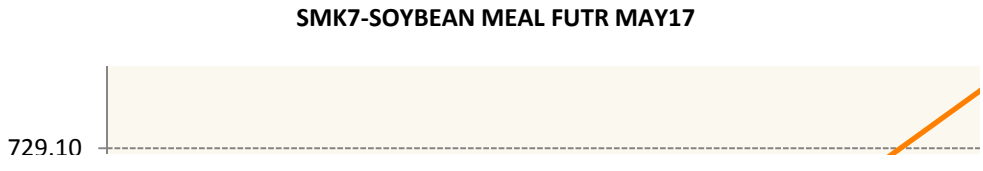
가격

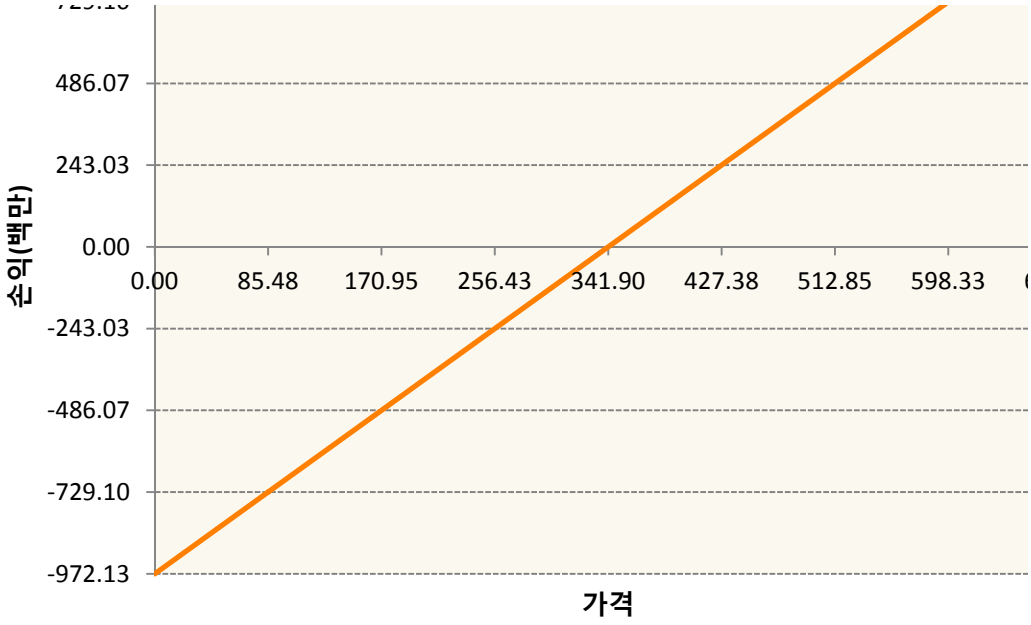

KR4175M30008-2017-03 달러선물
571.15
428.36
285.58
142.79
0.00
-142.79
-285.58
-428.36
-571.15
0.00
285.58
571.15
856.73
1,142.30
1,427.88
1,713.45
1,999.03
손익(백만)
가격

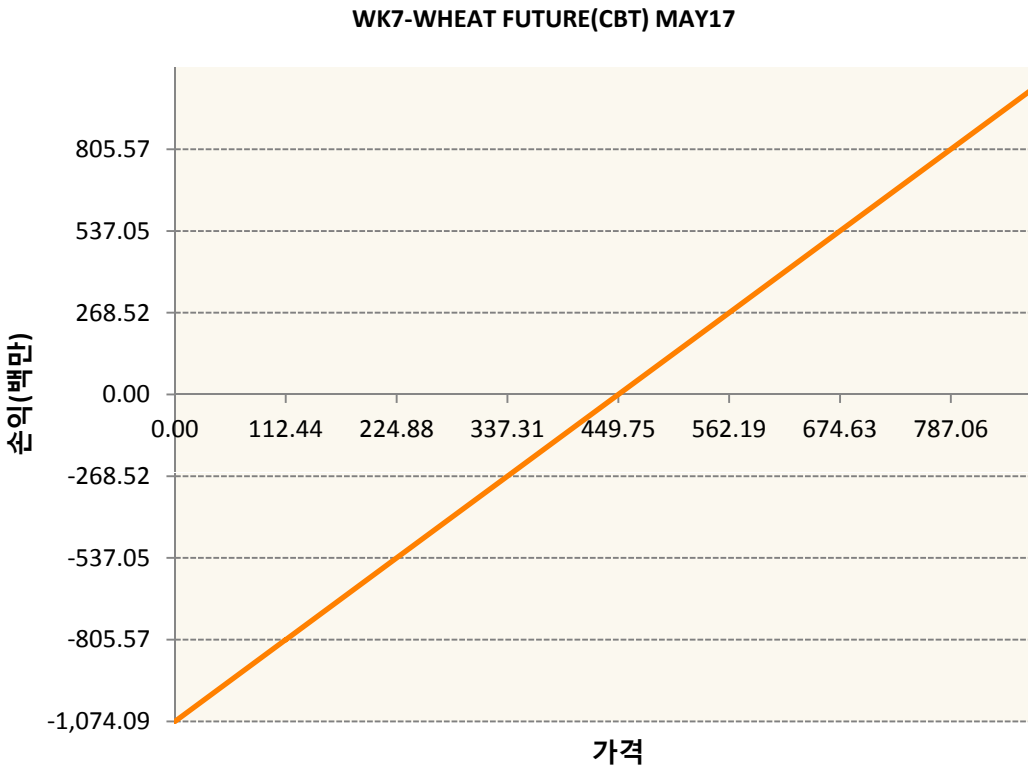

KWK7-KC HRW WHEAT FUTURE(KCB) MAY17
238.24
158.83
79.41
0.00
-79.41
-158.83
-238.24
-317.65
0.00
116.38
232.75
349.13
465.50
581.88
698.25
814.63
손익(백만)
가격


SBK7-Sugar #11 (WORLD) MAY17
1,056.99
792.74
528.49
264.25
0.00
-264.25
-528.49
-792.74
-1,056.99
0.00
5.19
10.37
15.56
20.74
25.93
31.11
36.30
손익(백만)
가격


SK7-SOYBEAN FUTURE MAY17
1,887.36
1,415.52
943.68
471.84
0.00
-471.84
-943.68
-1,415.52
-1,887.36
0.00
259.31
518.63
777.94
1,037.25
1,296.56
1,555.88
1,815.19
손익(백만)
가격


SMK7-SOYBEAN MEAL FUTR MAY17
729.10





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
BOK7	SOYBEAN OIL FUTR MAY17	63
CK7	CORN FUTURE MAY17	188
CTK7	COTTON NO.2 FUTR MAY17	28
KCK7	COFFEE "C" FUTURE MAY17	57
KR4175M30(	2017-03 달러선물	46

KWK7	KC HRW WHEAT FUTURE(KCB) MAY17	25
SBK7	Sugar #11 (WORLD) MAY17	85
SK7	SOYBEAN FUTURE MAY17	151
SMK7	SOYBEAN MEAL FUTR MAY17	78
WK7	WHEAT FUTURE(CBT) MAY17	86

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

893