공시일	2017-02-24
기준일	2017-02-23

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	2017-02-24
기준일	2017-02-23

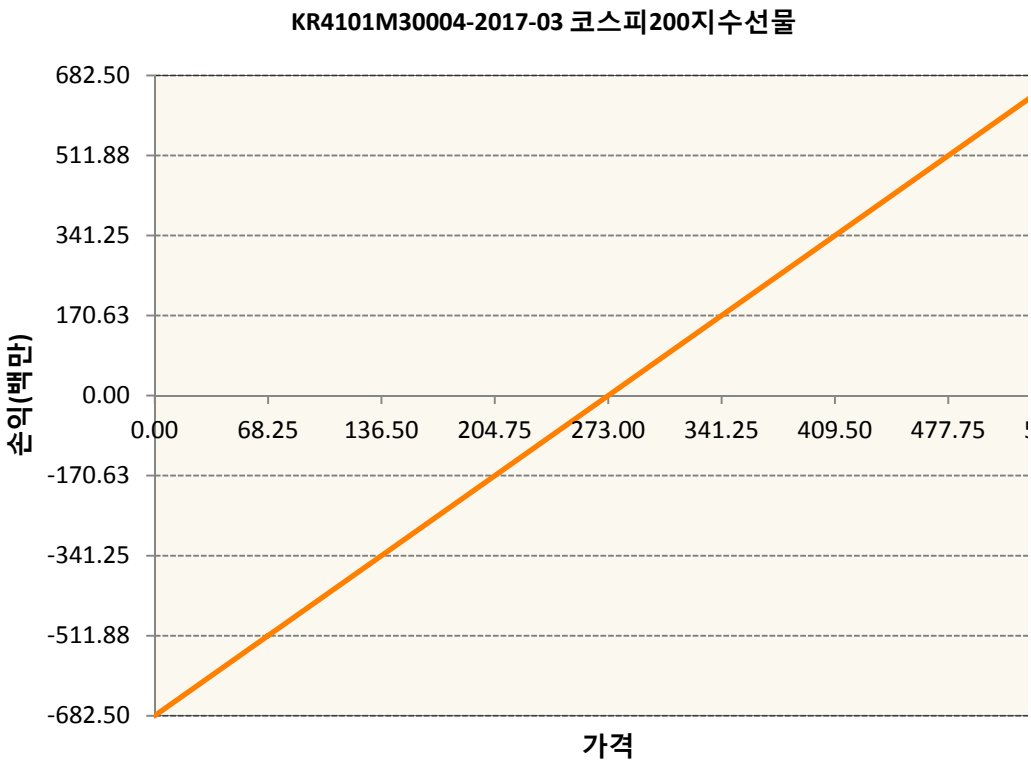
스마트인덱스모

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	683	0	683	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	2017-02-24
기준일	2017-02-23

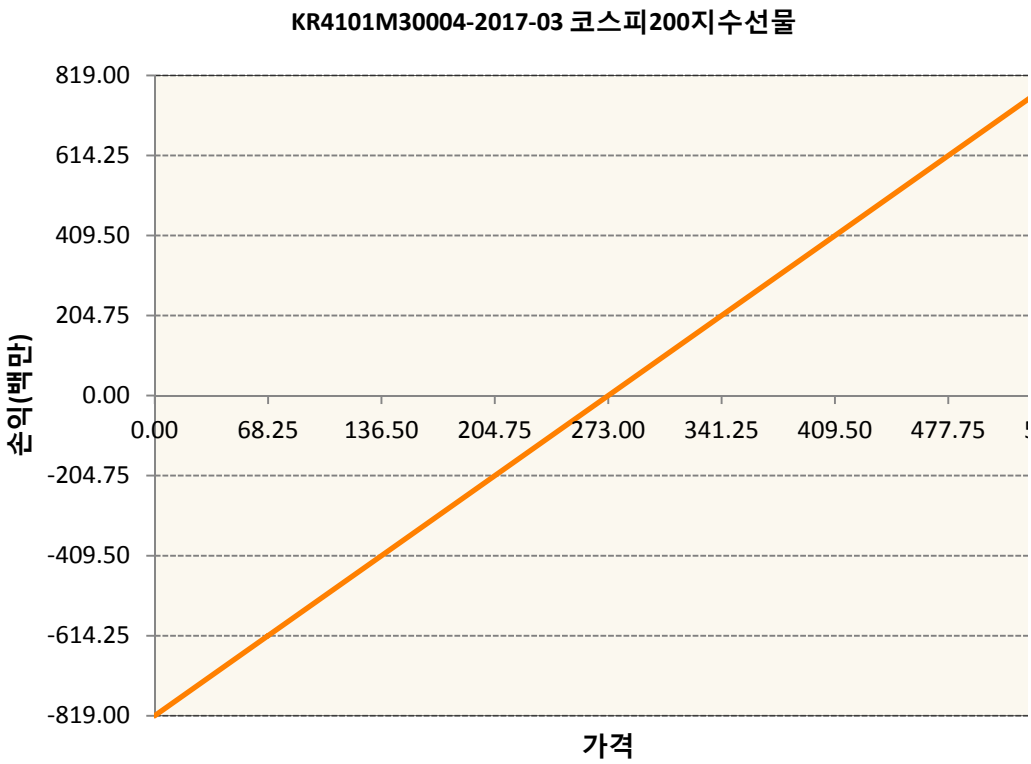
스마트레버리지목표전환형1호

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	819	0	819	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	2017-02-24
기준일	2017-02-23

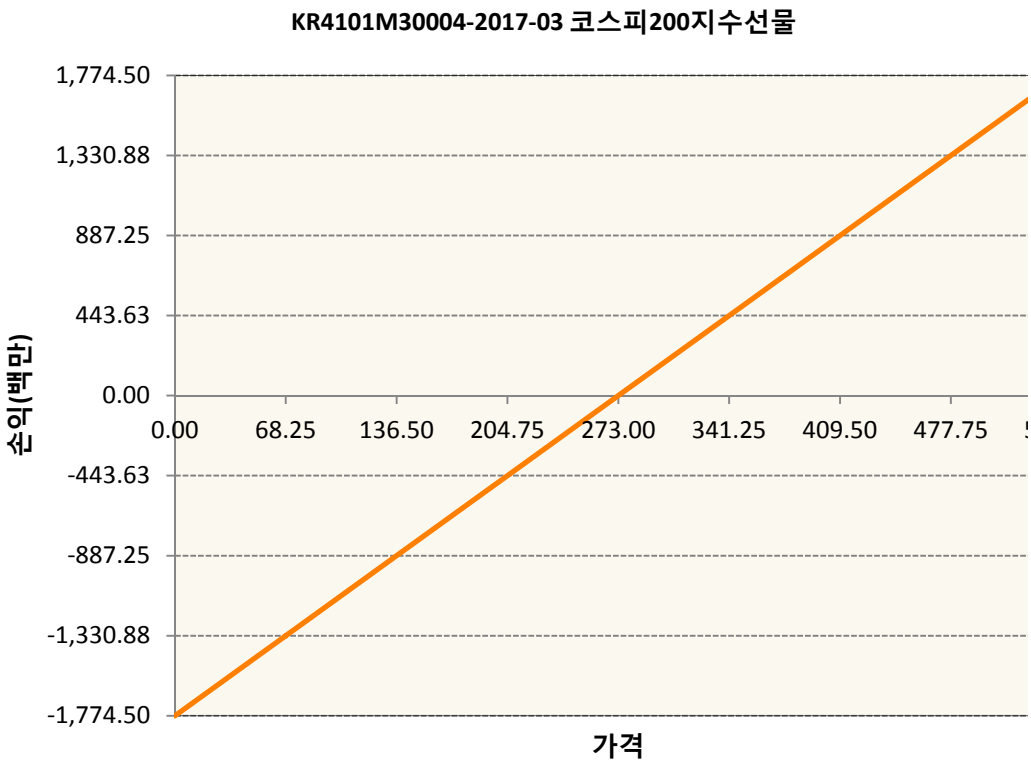
1.3배 레버리지 인덱스(주식-파생형)

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	1,775	0	1,775	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	2017-02-24
기준일	2017-02-23

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	11,879	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)

611

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-02-24
기준일	2017-02-23

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)

547

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-02-24
기준일	2017-02-23

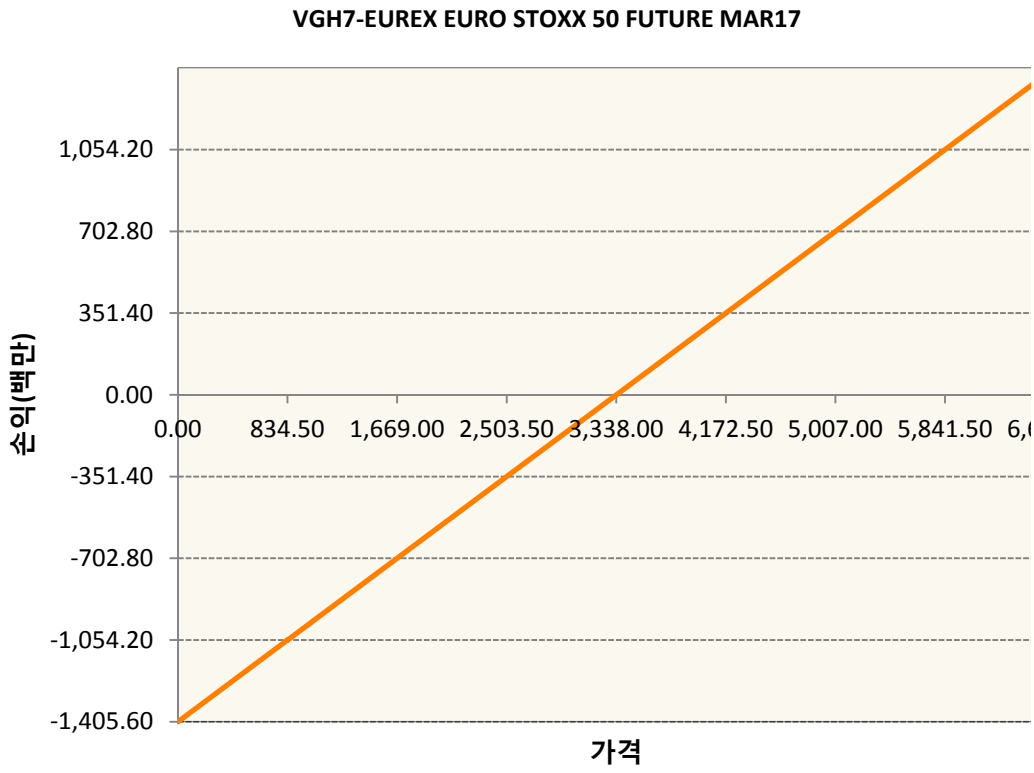
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,406	0	1,406	

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	2017-02-24
기준일	2017-02-23

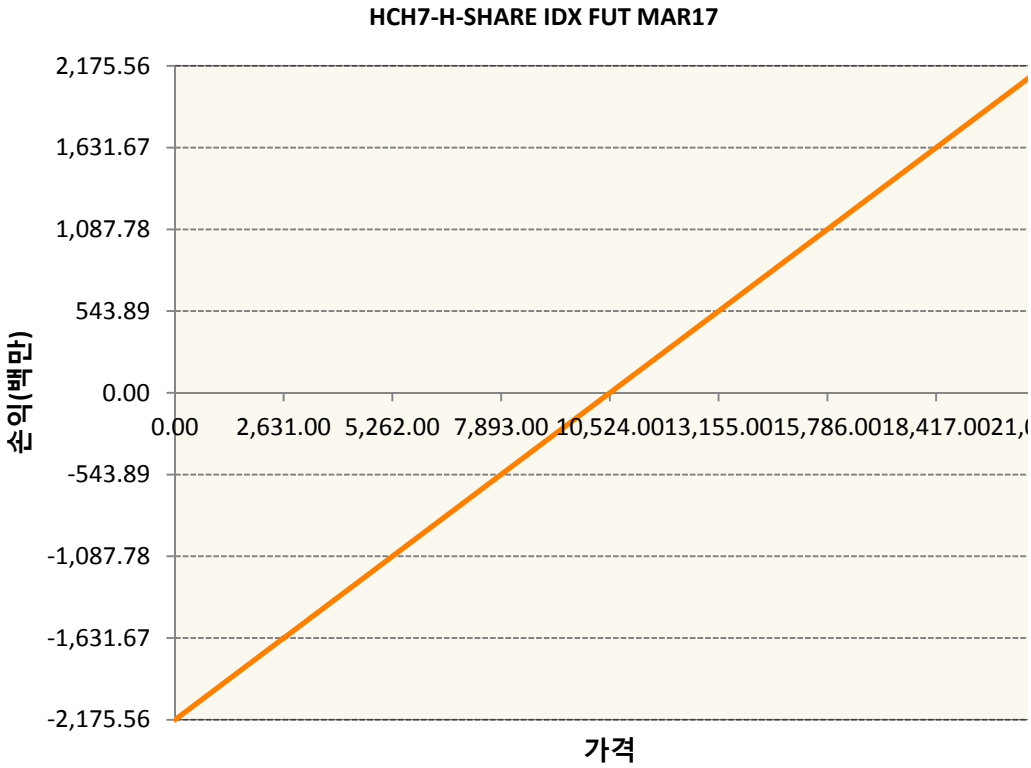
차이나인덱스모(주식-파생형)

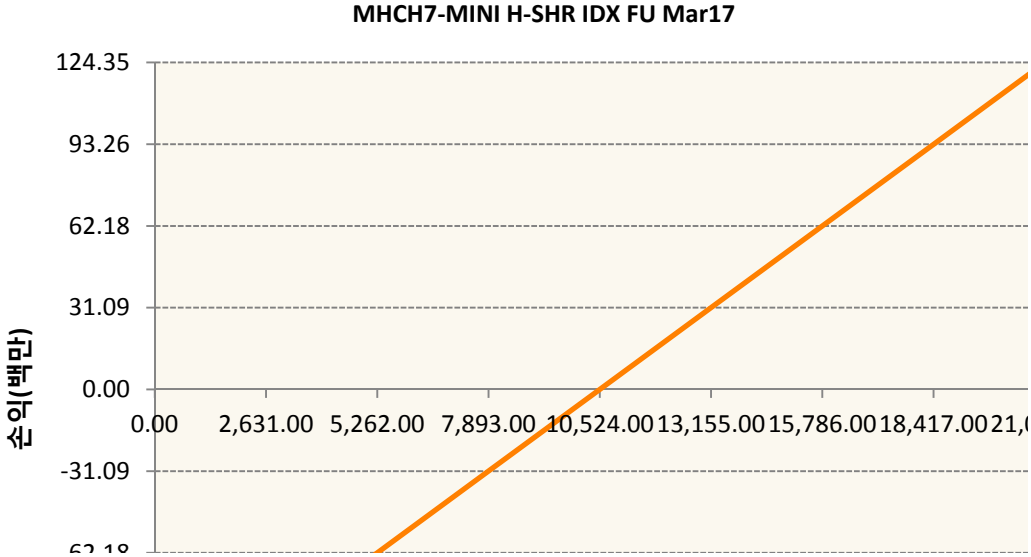
1. 계약금액

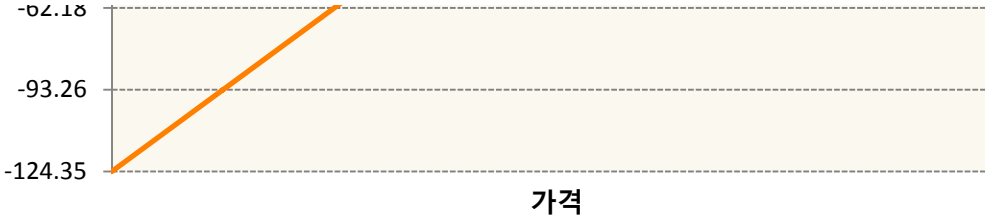
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,300	0	2,300	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)
	207

공시일	2017-02-24
기준일	2017-02-23

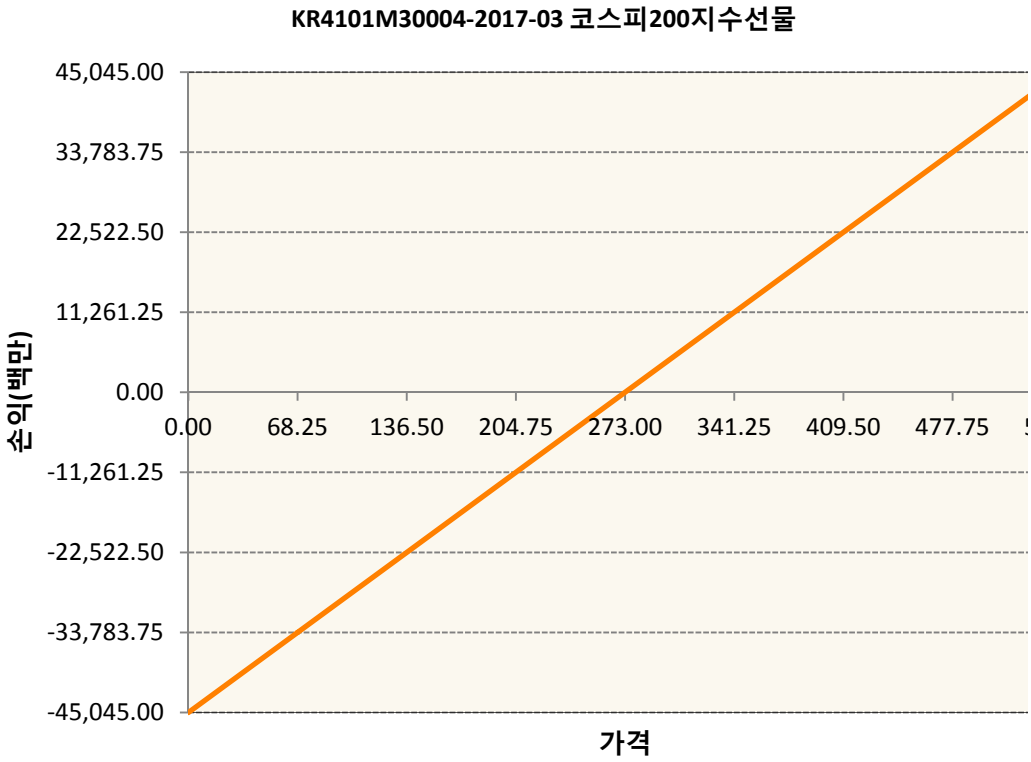
커버드콜모(주식혼합-파생형)

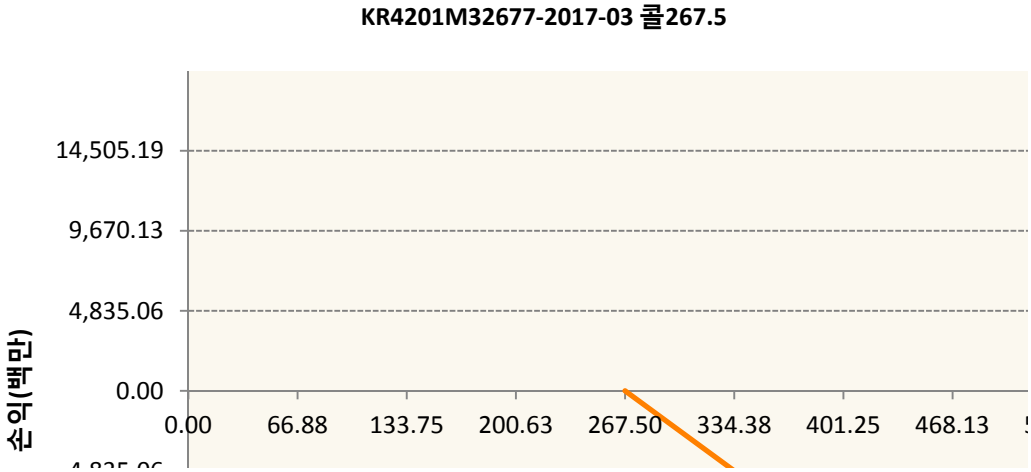
1. 계약금액

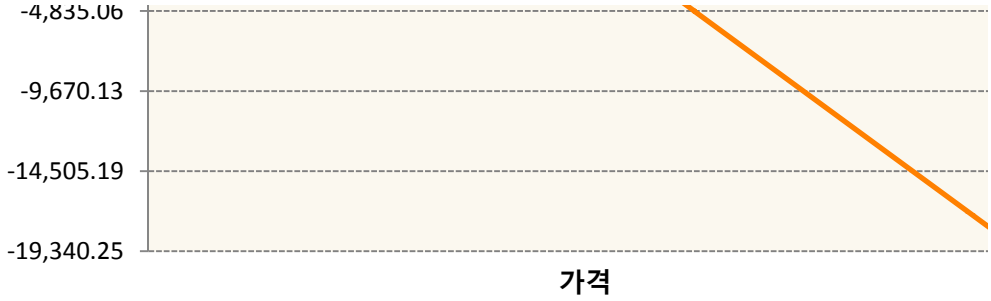
(단위:백만원)

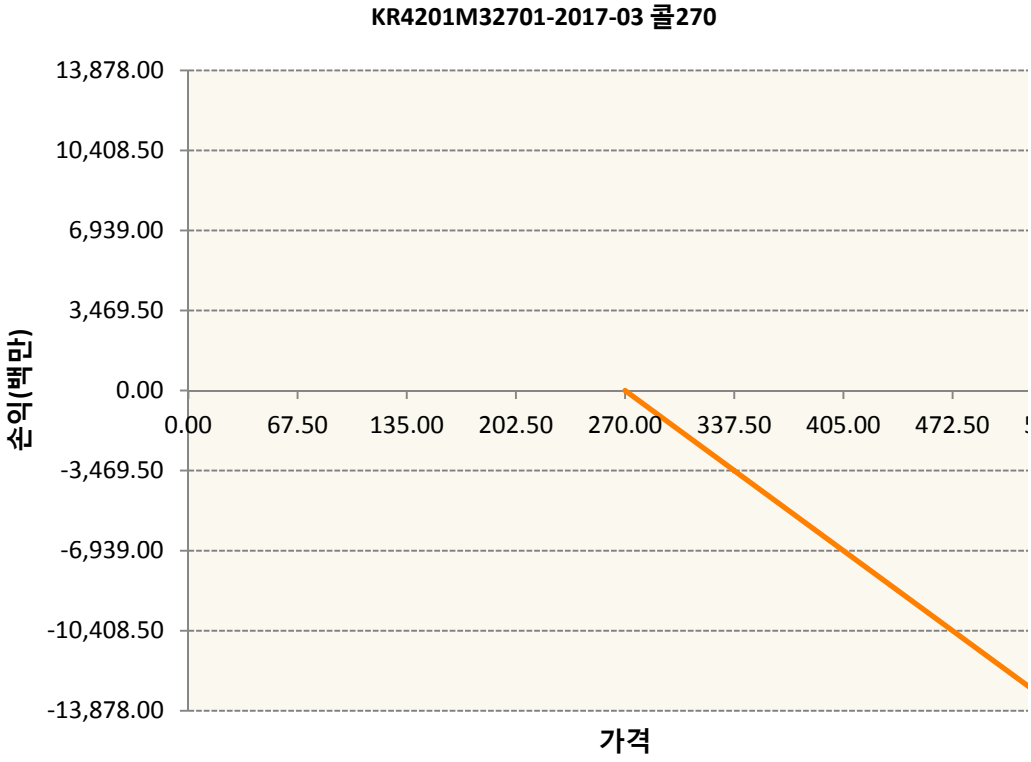
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	547	-547	장내
누계	유가증권	선물	45,045	0	45,045	장내
누계	유가증권	옵션	0	33,218	-33,218	장내

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							7,756
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	2,079	2,079	2,079	2,079	2,078	2,078	2,077
-5.33%	2,076	2,072	2,067	2,058	2,046	2,031	2,014
-2.67%	1,816	1,763	1,709	1,654	1,598	1,542	1,485
0%	85	61	32	0	-36	-74	-115
2.67%	-2,498	-2,498	-2,499	-2,501	-2,505	-2,510	-2,518
5.33%	-5,127	-5,127	-5,127	-5,127	-5,127	-5,127	-5,127
8.00%	-7,756	-7,756	-7,756	-7,756	-7,756	-7,756	-7,756
KR4201M32 2017-03 콜270							5,379

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	971	971	971	971	971	971	971
-5.33%	971	970	969	967	964	960	954
-2.67%	914	891	866	838	808	777	744
0%	104	71	36	0	-37	-75	-114
2.67%	-1,641	-1,643	-1,647	-1,652	-1,659	-1,668	-1,679
5.33%	-3,509	-3,509	-3,509	-3,509	-3,510	-3,510	-3,511
8.00%	-5,378	-5,378	-5,378	-5,378	-5,378	-5,378	-5,379

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

19,487

공시일	2017-02-24
기준일	2017-02-23

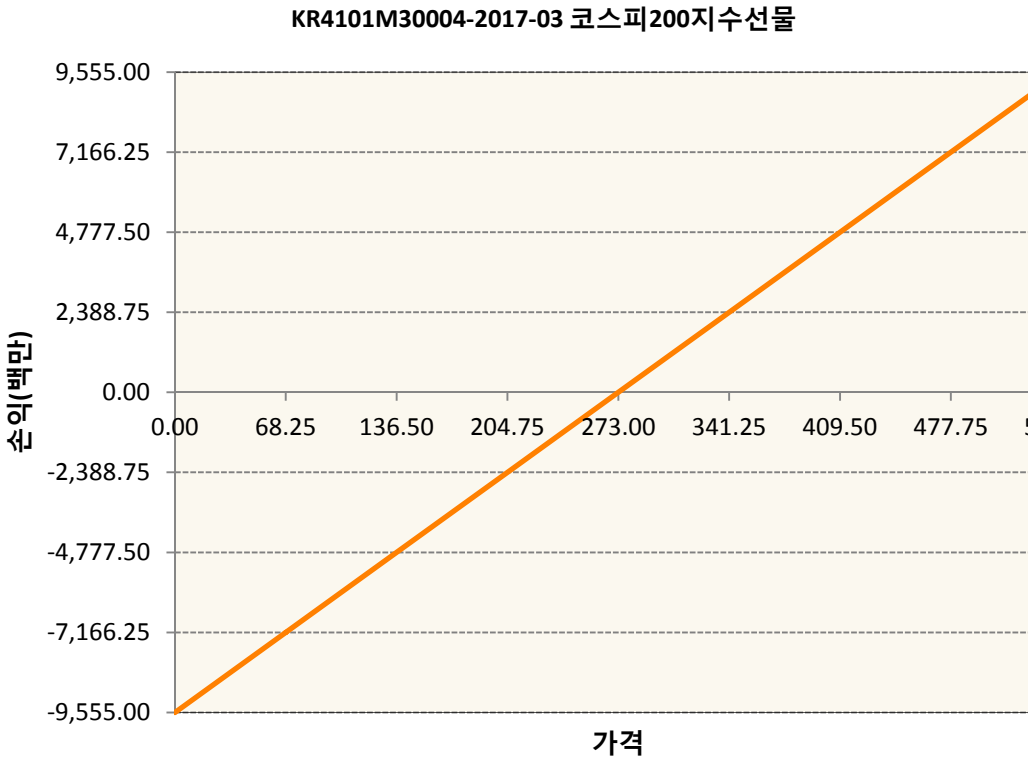
커버드콜목표전환형증권투자신탁

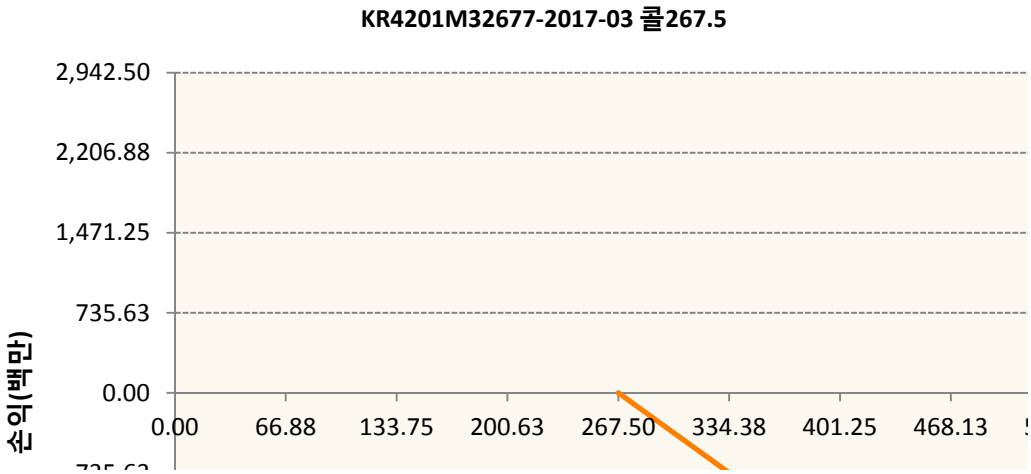
1. 계약금액

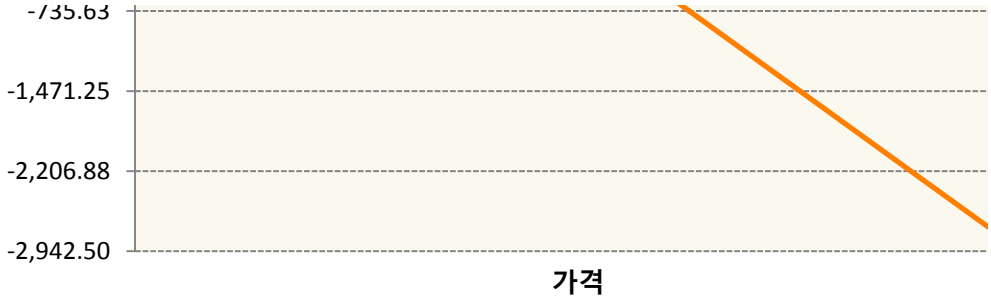
(단위:백만원)

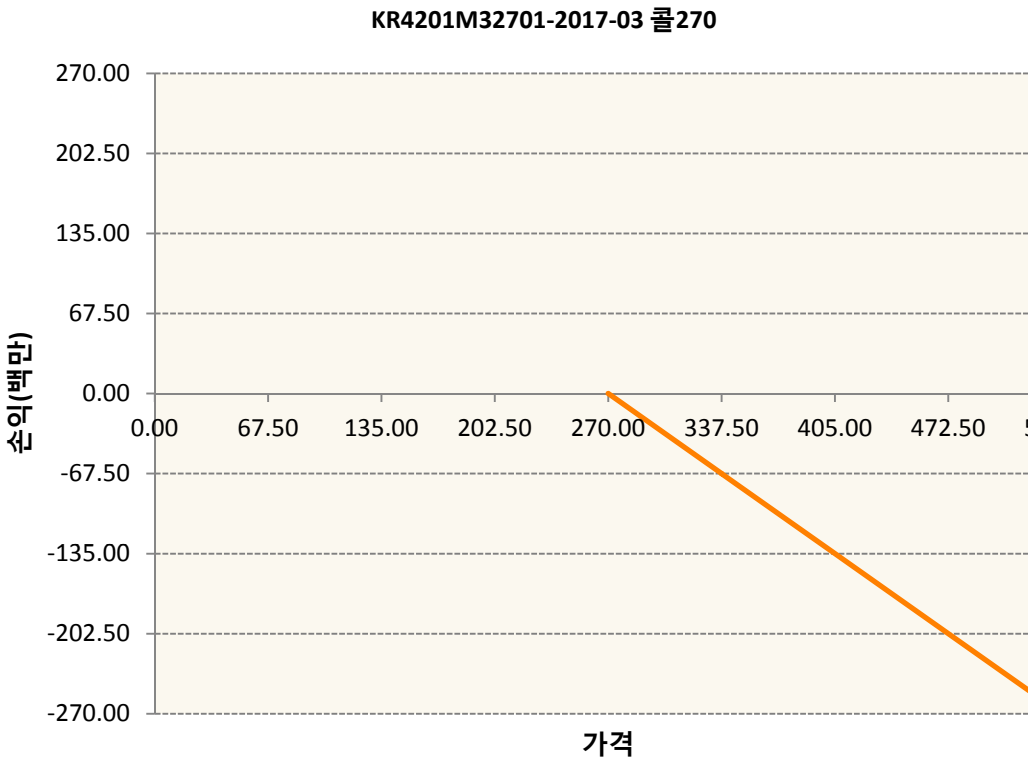
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	9,555	0	9,555	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,213	-3,213	장내

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							1,180
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	316	316	316	316	316	316	316
-5.33%	316	315	314	313	311	309	306
-2.67%	276	268	260	252	243	235	226
0%	13	9	5	0	-5	-11	-17
2.67%	-380	-380	-380	-381	-381	-382	-383
5.33%	-780	-780	-780	-780	-780	-780	-780
8.00%	-1,180	-1,180	-1,180	-1,180	-1,180	-1,180	-1,180
KR4201M32 : 2017-03 콜270							105

	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	-1	-2
2.67%	-32	-32	-32	-32	-32	-32	-33
5.33%	-68	-68	-68	-68	-68	-68	-68
8.00%	-105	-105	-105	-105	-105	-105	-105

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

2,142

공시일	2017-02-24
기준일	2017-02-23

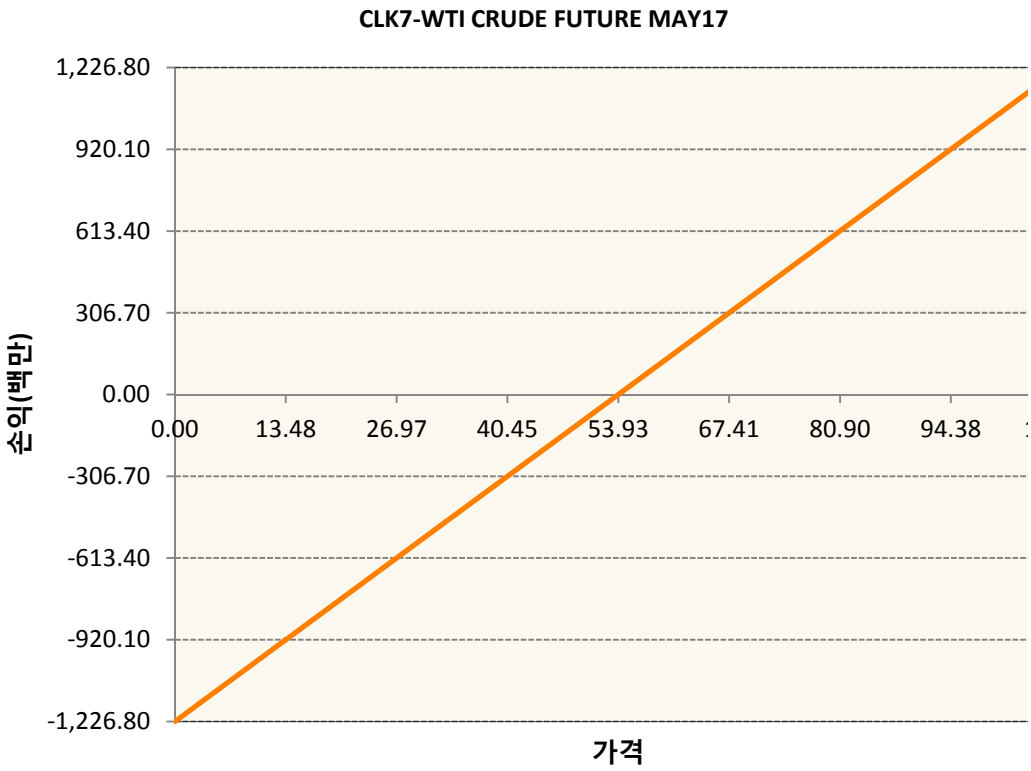
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

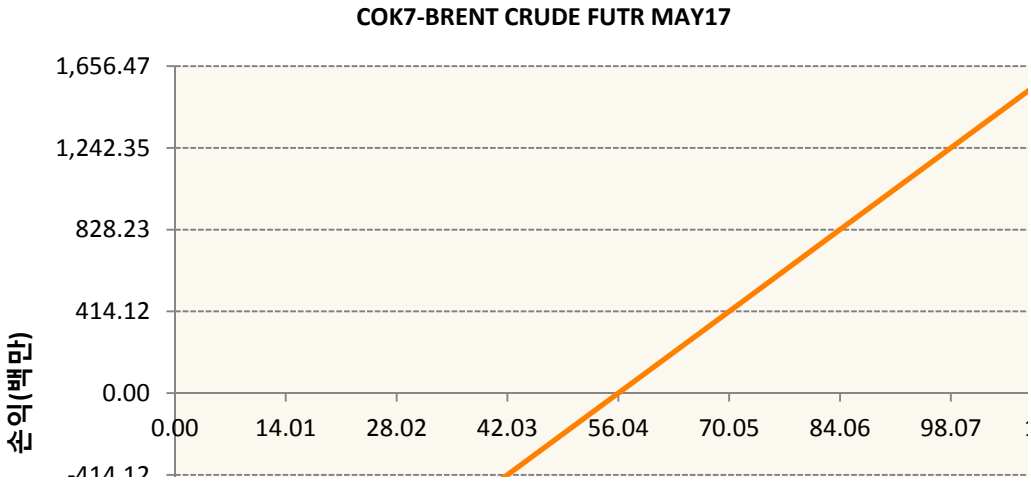
1. 계약금액

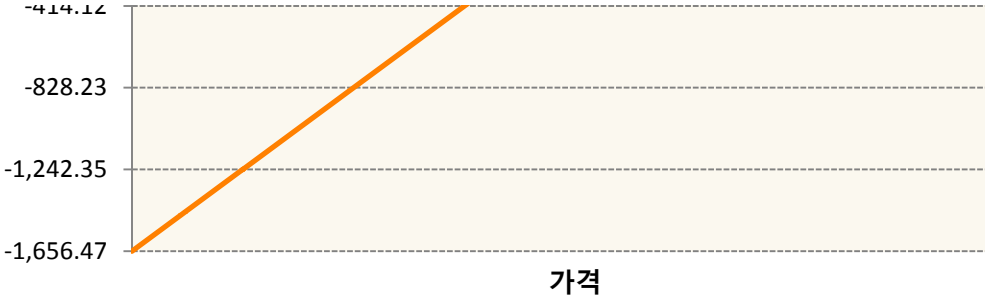
(단위:백만원)

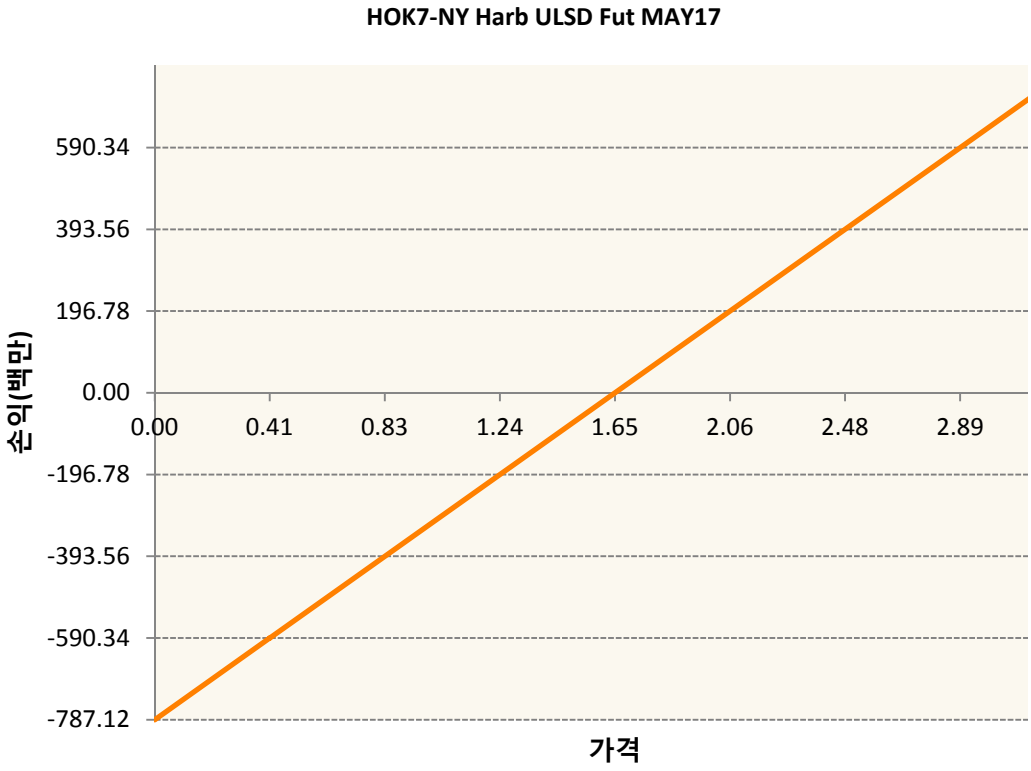
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	선물	유가증권	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	선물	유가증권	1,227	0	1,227	
누계	유가증권	선물	4,559	410	4,149	

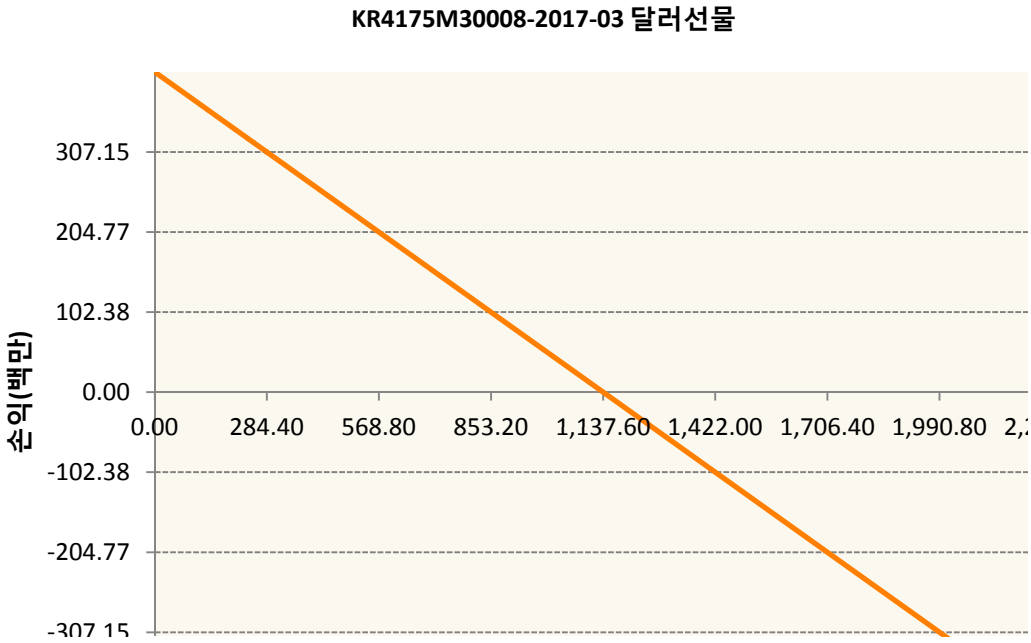
2. 만기시점의 손익구조

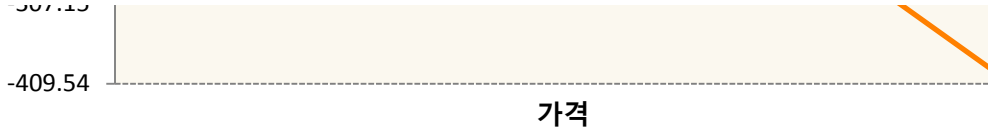


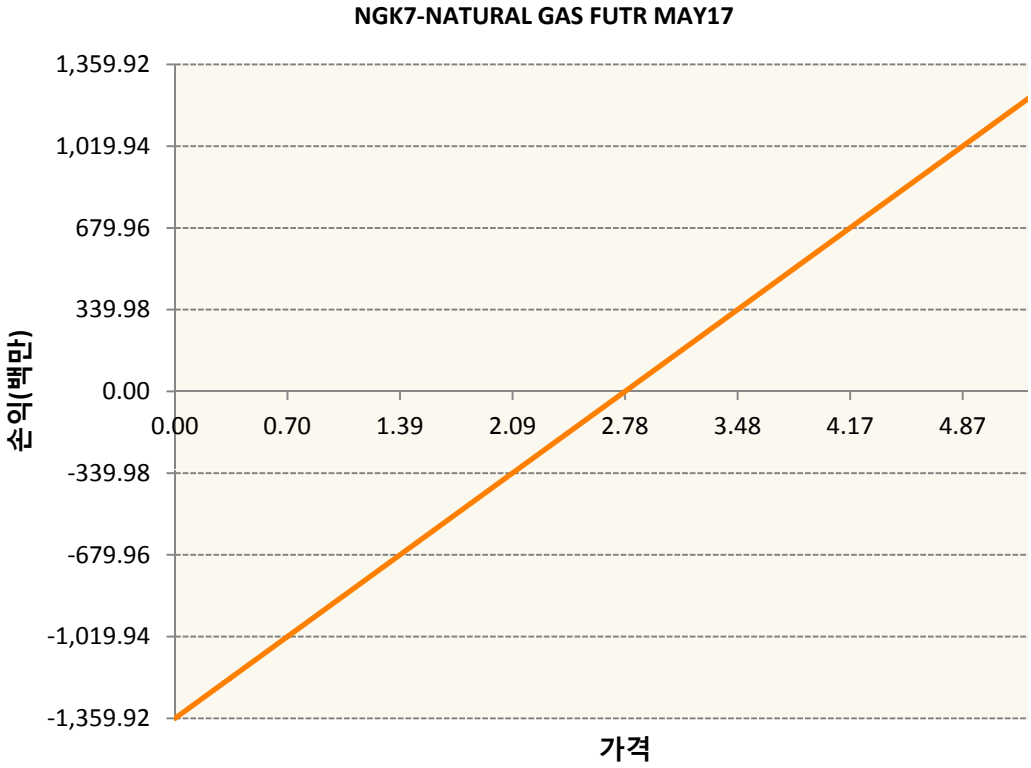


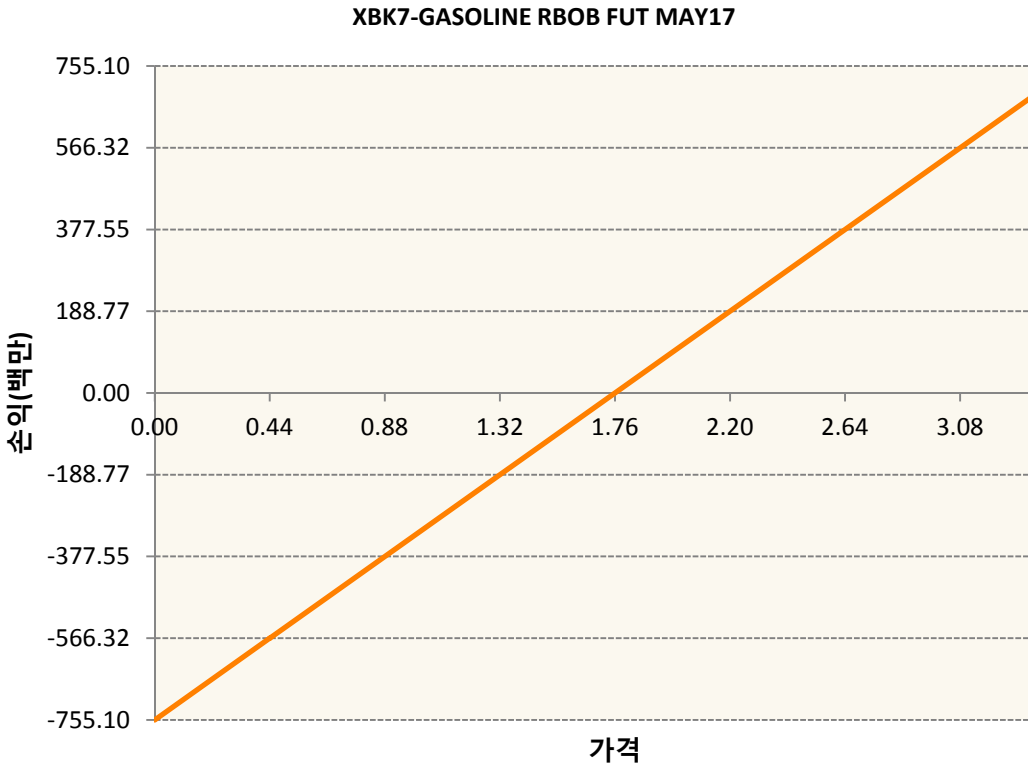

-828.23
-1,242.35
-1,656.47
가격


HOK7-NY Harb ULSD Fut MAY17
590.34
393.56
196.78
0.00
-196.78
-393.56
-590.34
-787.12
0.00
0.41
0.83
1.24
1.65
2.06
2.48
2.89
순익(백만)
가격


KR4175M30008-2017-03 달러선물
307.15
204.77
102.38
0.00
-102.38
-204.77
-307.15
0.00
284.40
568.80
853.20
1,137.60
1,422.00
1,706.40
1,990.80
순익(백만)


-409.54
가격


NGK7-NATURAL GAS FUTR MAY17
1,359.92
1,019.94
679.96
339.98
0.00
-339.98
-679.96
-1,019.94
-1,359.92
0.00
0.70
1.39
2.09
2.78
3.48
4.17
4.87
순익(백만)
가격


XBK7-GASOLINE RBOB FUT MAY17
755.10
566.32
377.55
188.77
0.00
-188.77
-377.55
-566.32
-755.10
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	133
HOK7	NY Harb ULSD Fut MAY17	63
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)

1,026

공시일	2017-02-24
기준일	2017-02-23

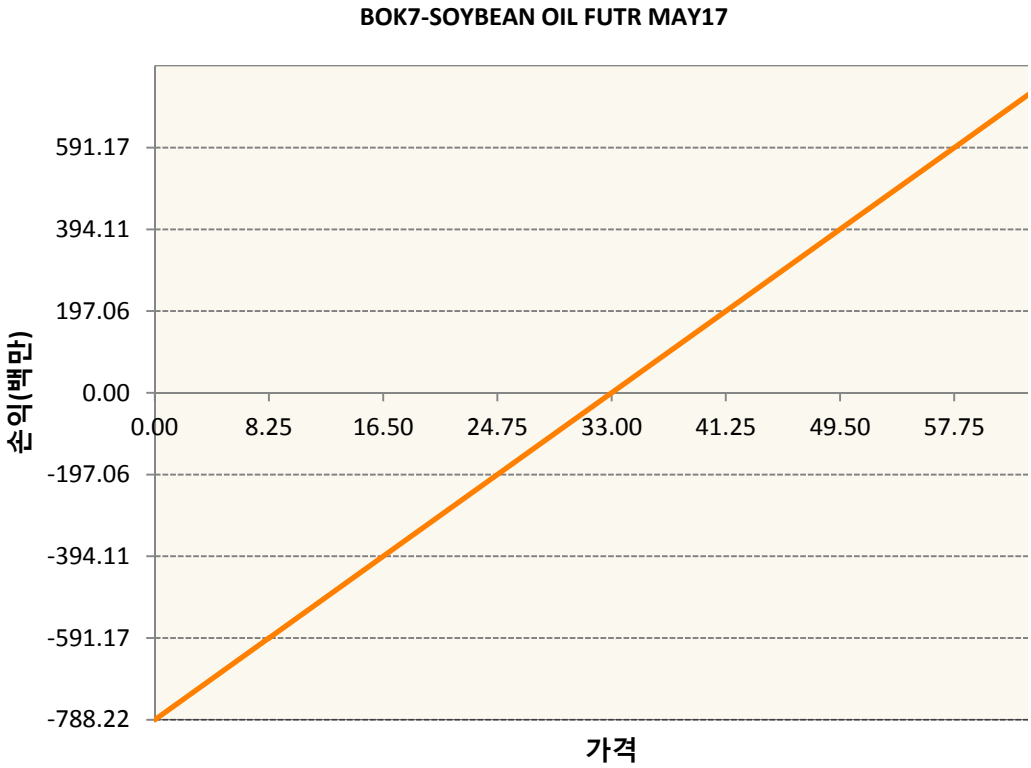
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

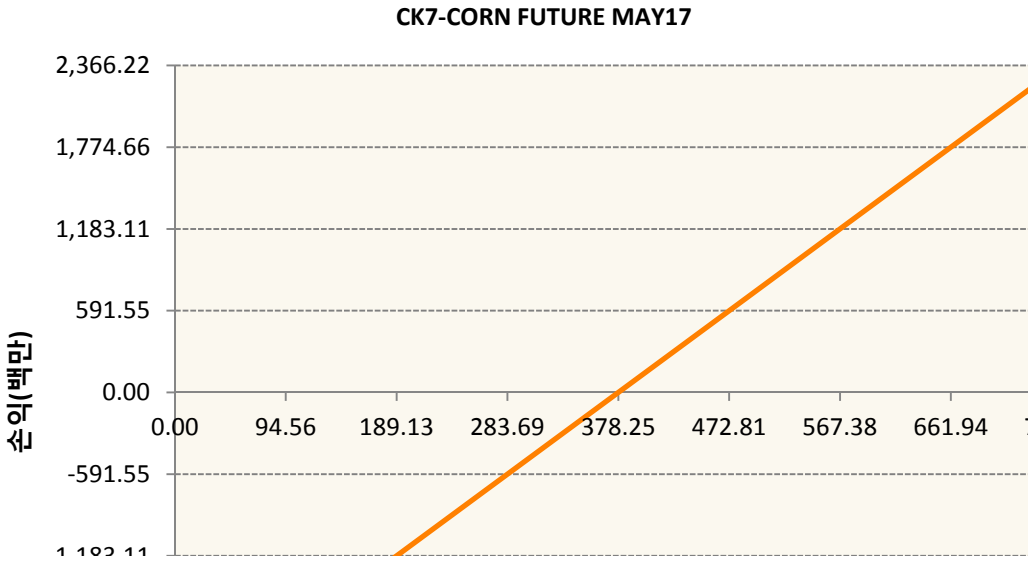
1. 계약금액

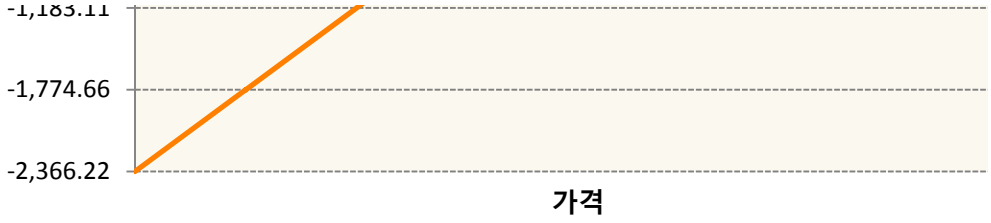
(단위:백만원)

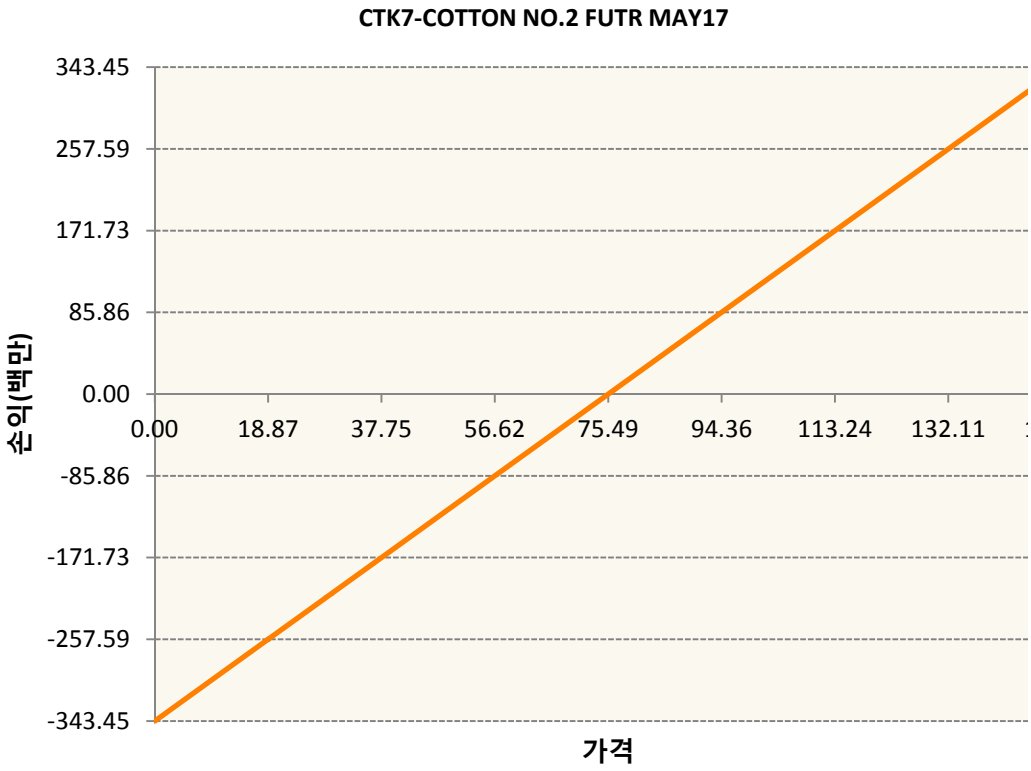
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	9,517	569	8,948	

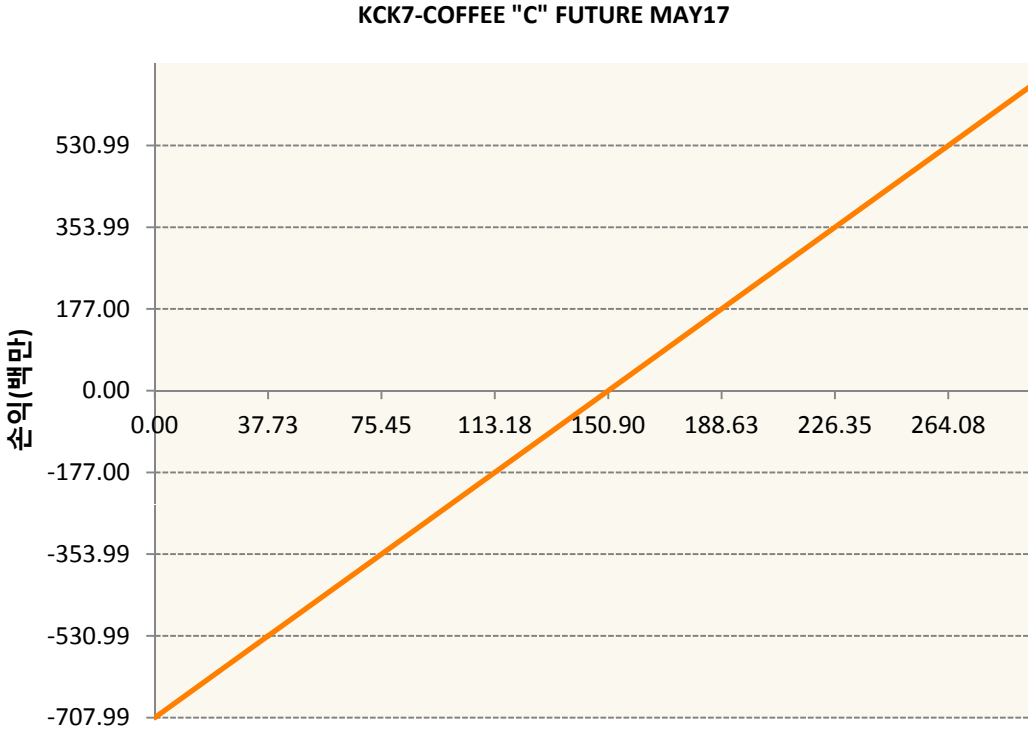
2. 만기시점의 손익구조



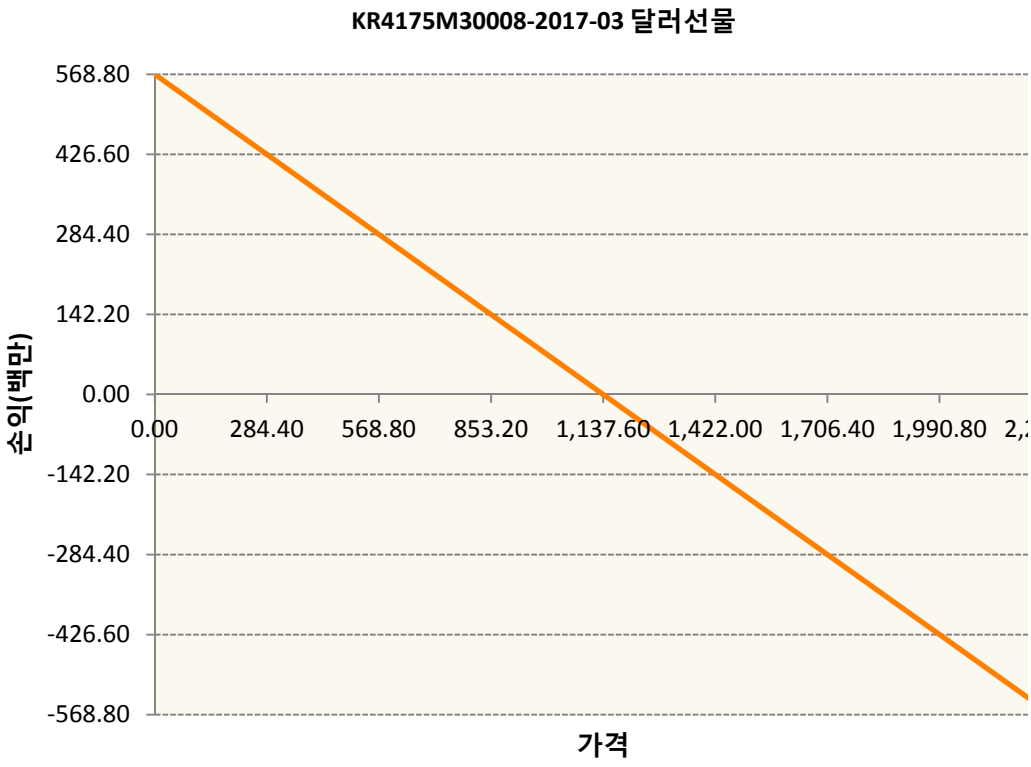


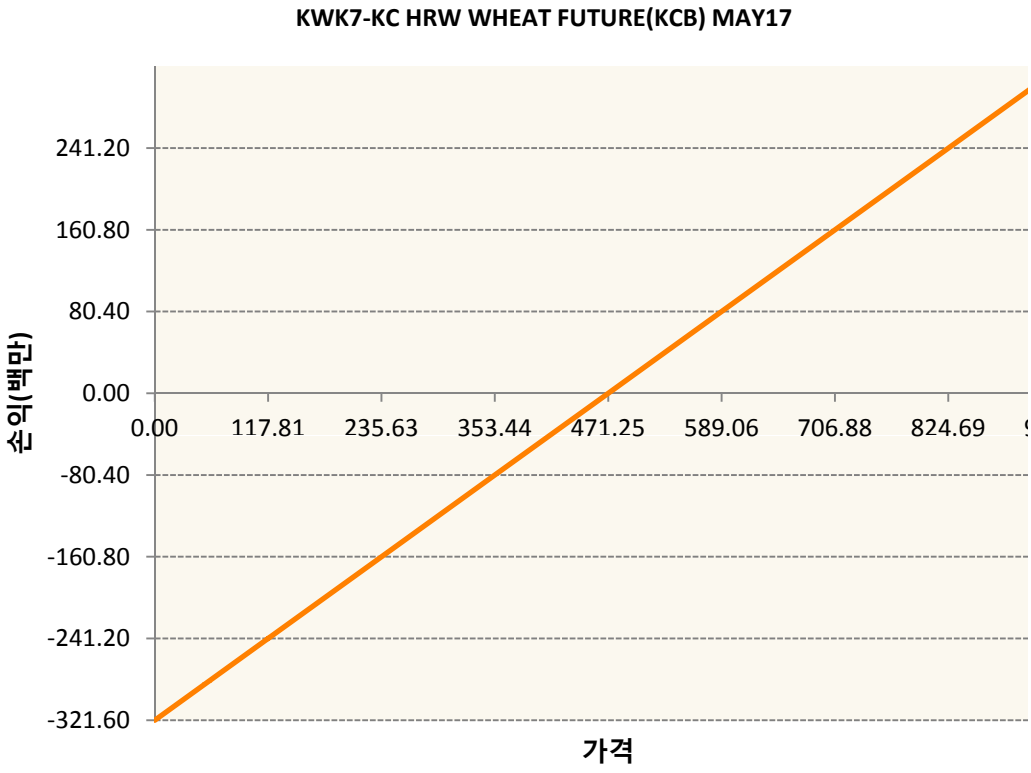

-1,774.66
-2,366.22
가격

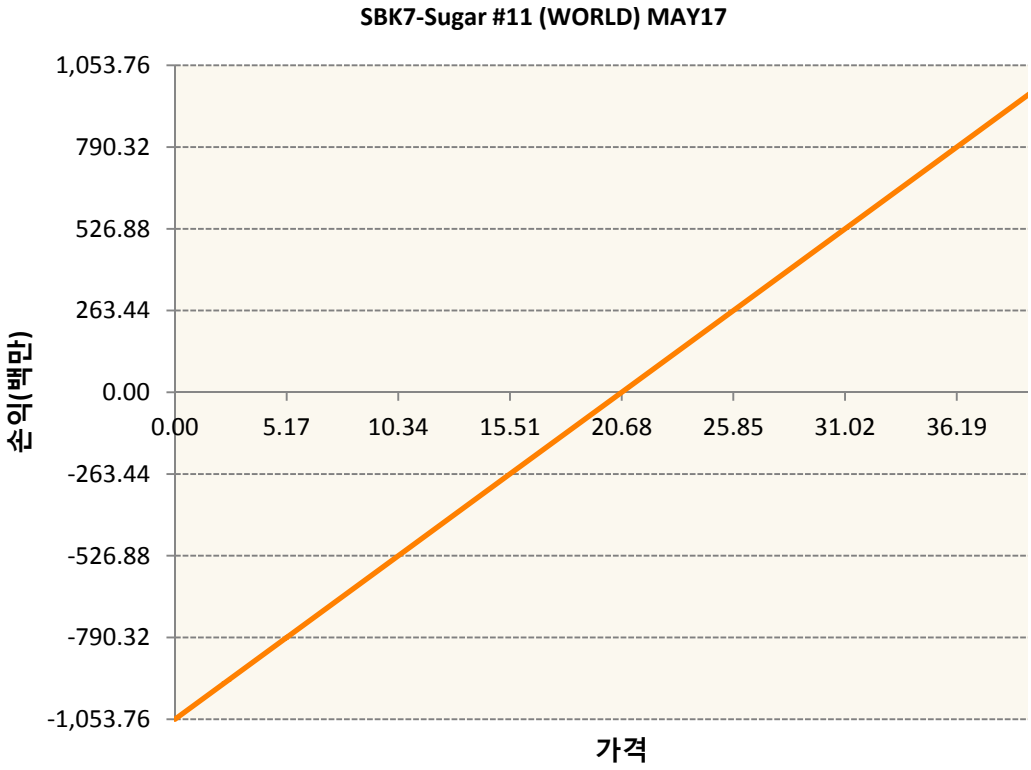

CTK7-COTTON NO.2 FUTR MAY17
343.45
257.59
171.73
85.86
0.00
-85.86
-171.73
-257.59
-343.45
0.00
18.87
37.75
56.62
75.49
94.36
113.24
132.11
순익(백만)
가격

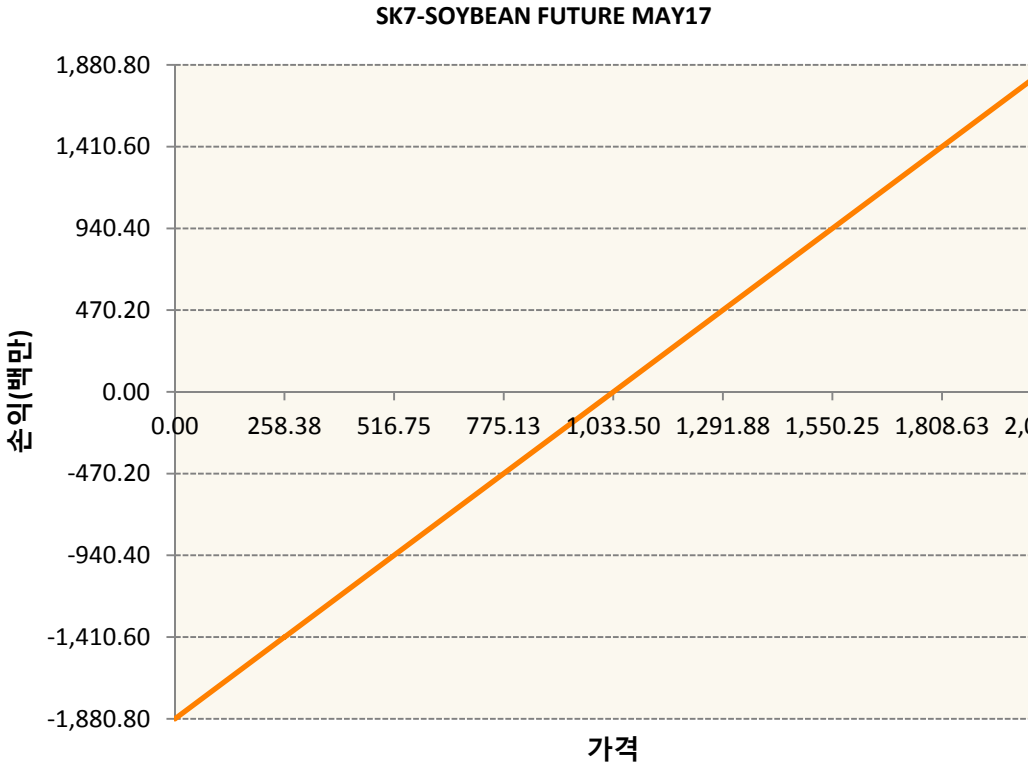

KCK7-COFFEE "C" FUTURE MAY17
530.99
353.99
177.00
0.00
-177.00
-353.99
-530.99
-707.99
0.00
37.73
75.45
113.18
150.90
188.63
226.35
264.08
순익(백만)

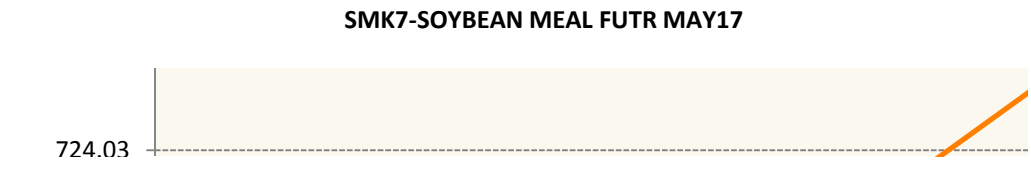
가격

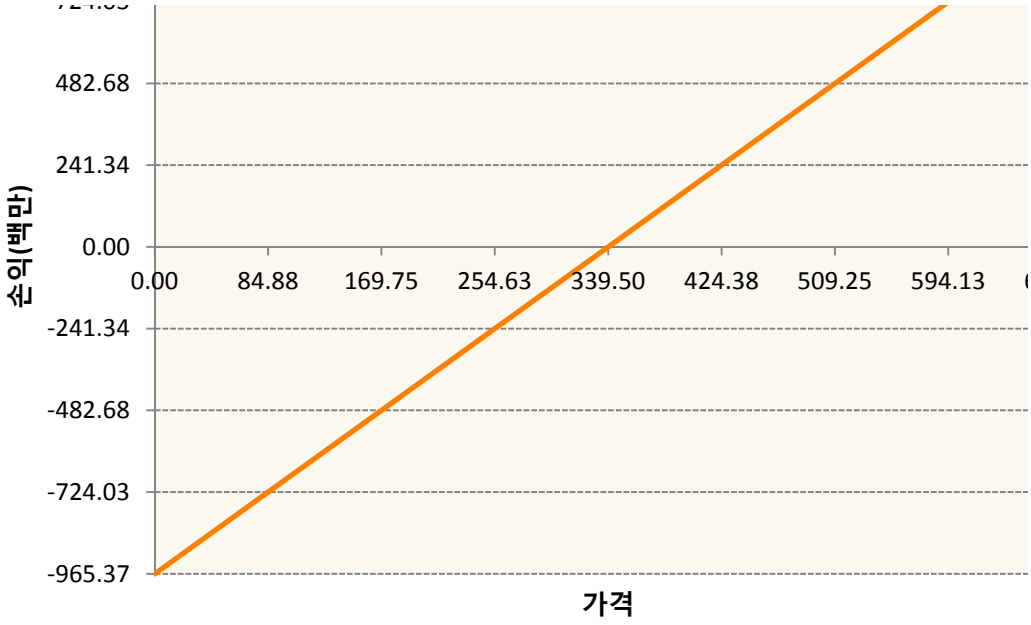

KR4175M30008-2017-03 달러선물
568.80
426.60
284.40
142.20
0.00
-142.20
-284.40
-426.60
-568.80
0.00
284.40
568.80
853.20
1,137.60
1,422.00
1,706.40
1,990.80
순이(백만)
가격

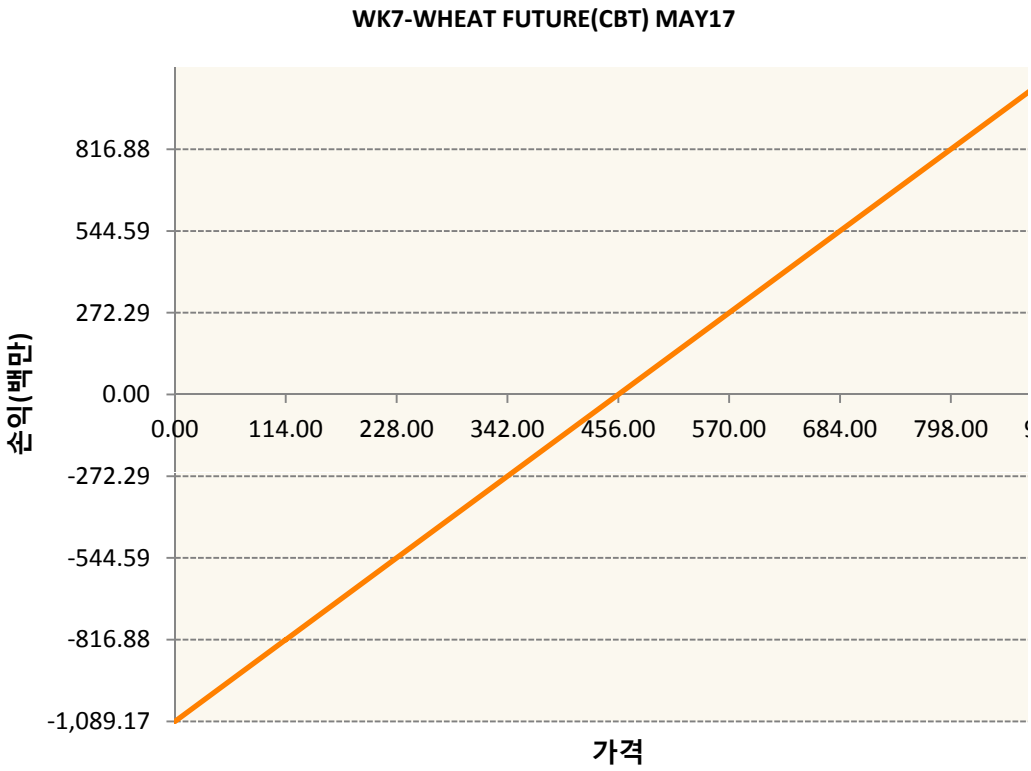

KWK7-KC HRW WHEAT FUTURE(KCB) MAY17
241.20
160.80
80.40
0.00
-80.40
-160.80
-241.20
-321.60
0.00
117.81
235.63
353.44
471.25
589.06
706.88
824.69
순이(백만)
가격


SBK7-Sugar #11 (WORLD) MAY17
1,053.76
790.32
526.88
263.44
0.00
-263.44
-526.88
-790.32
-1,053.76
0.00
5.17
10.34
15.51
20.68
25.85
31.02
36.19
손익(백만)
가격


SK7-SOYBEAN FUTURE MAY17
1,880.80
1,410.60
940.40
470.20
0.00
-470.20
-940.40
-1,410.60
-1,880.80
0.00
258.38
516.75
775.13
1,033.50
1,291.88
1,550.25
1,808.63
손익(백만)
가격


SMK7-SOYBEAN MEAL FUTR MAY17
724.03





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
BOK7	SOYBEAN OIL FUTR MAY17	63
CK7	CORN FUTURE MAY17	189
CTK7	COTTON NO.2 FUTR MAY17	27
KCK7	COFFEE "C" FUTURE MAY17	57
KR4175M30(	2017-03 달러선물	46

KWK7	KC HRW WHEAT FUTURE(KCB) MAY17	26
SBK7	Sugar #11 (WORLD) MAY17	84
SK7	SOYBEAN FUTURE MAY17	150
SMK7	SOYBEAN MEAL FUTR MAY17	77
WK7	WHEAT FUTURE(CBT) MAY17	87

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

892