공시일	2017-02-01
기준일	2017-01-31

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	2017-02-01
기준일	2017-01-31

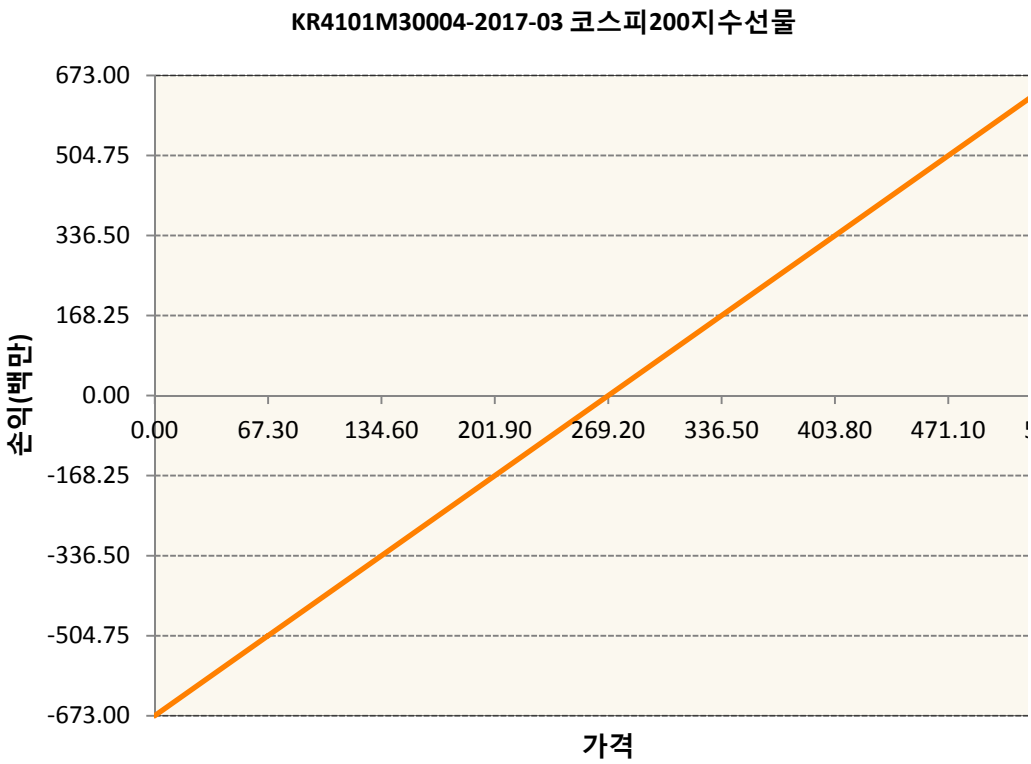
스마트인덱스모

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)

37

공시일	2017-02-01
기준일	2017-01-31

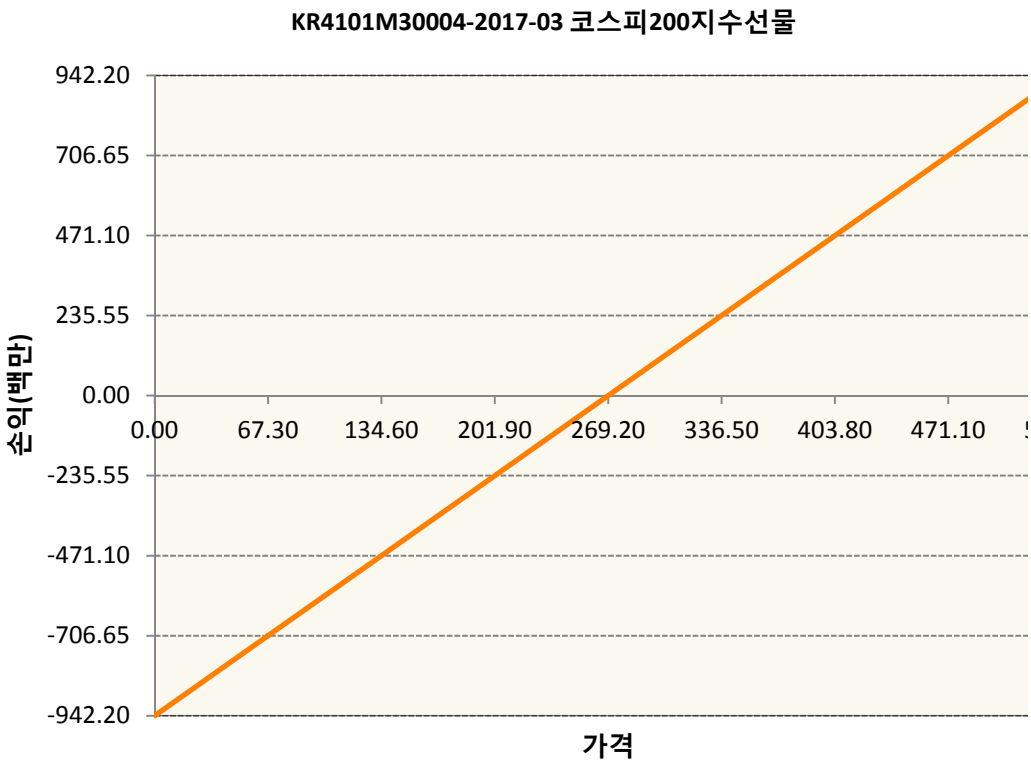
스마트레버리지목표전환형1호

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)

52

공시일	2017-02-01
기준일	2017-01-31

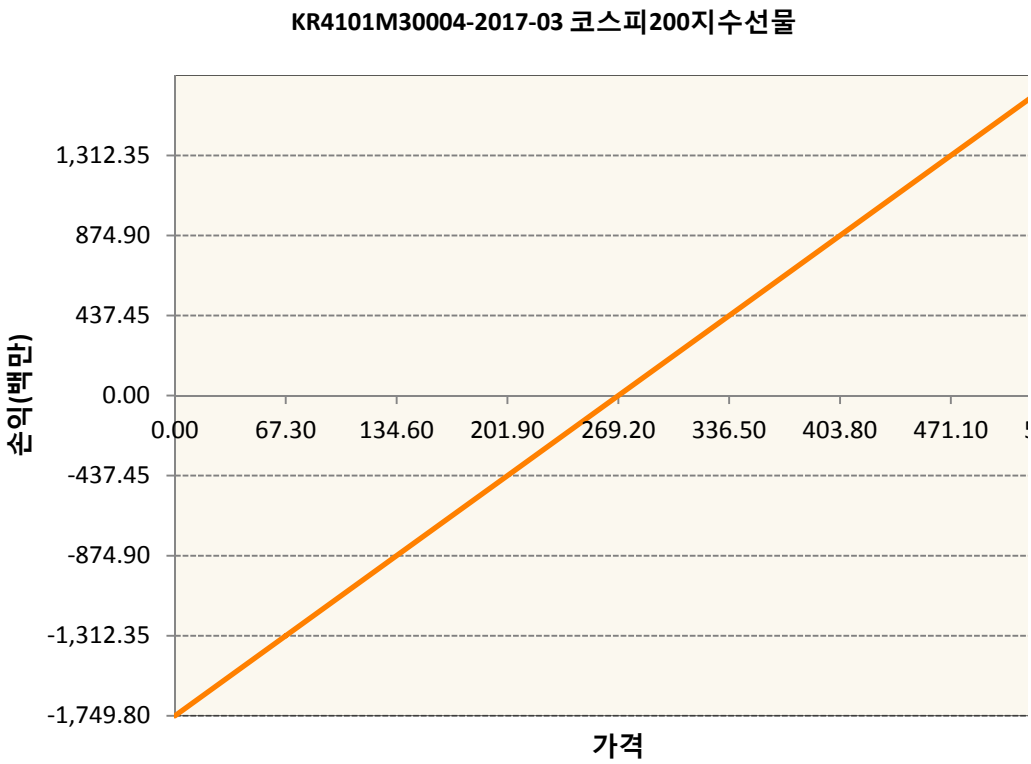
1.3배 레버리지 인덱스(주식-파생형)

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	1,750	0	1,750	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101M30(2017-03 코스피200지수선물							139
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-139	-139	-139	-139	-139	-139	-139
-5.33%	-93	-93	-93	-93	-93	-93	-93
-2.67%	-46	-46	-46	-46	-46	-46	-46
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	46	46	46	46	46	46	46
5.33%	93	93	93	93	93	93	93
8.00%	139	139	139	139	139	139	139

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

97

공시일	2017-02-01
기준일	2017-01-31

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	925

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

666

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-02-01
기준일	2017-01-31

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	378

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

557

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-02-01
기준일	2017-01-31

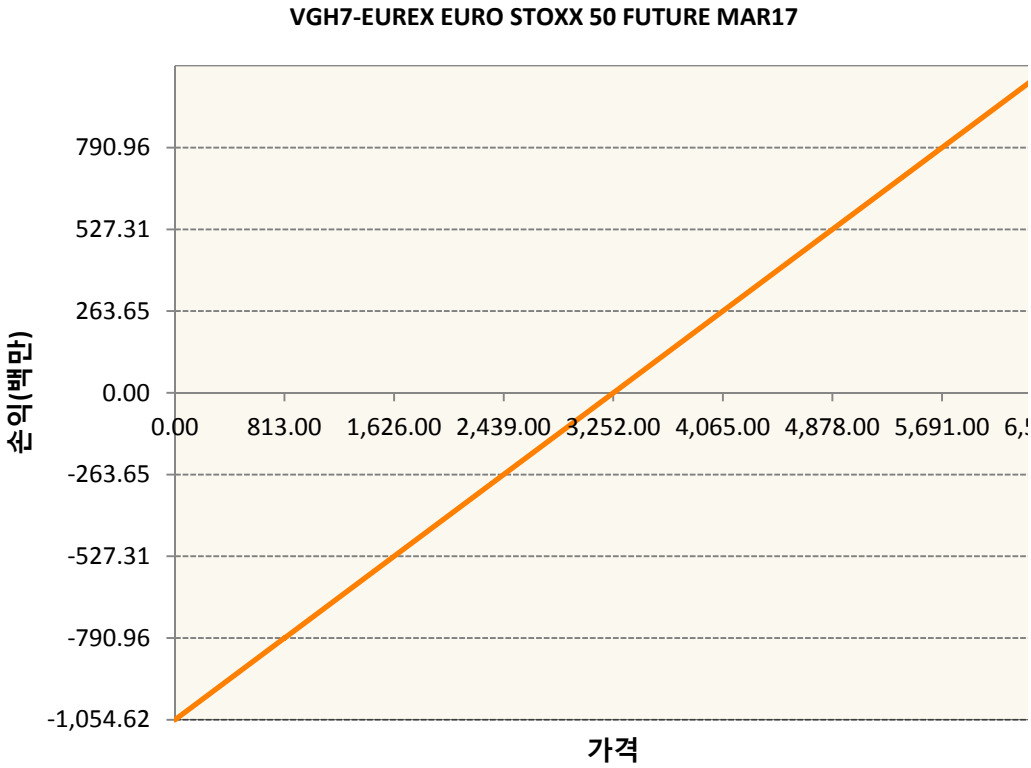
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,055	0	1,055	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGH7	EUREX EURO STOXX 50 FUTURE MAR17	84

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

(단위:백만원)

90

공시일	2017-02-01
기준일	2017-01-31

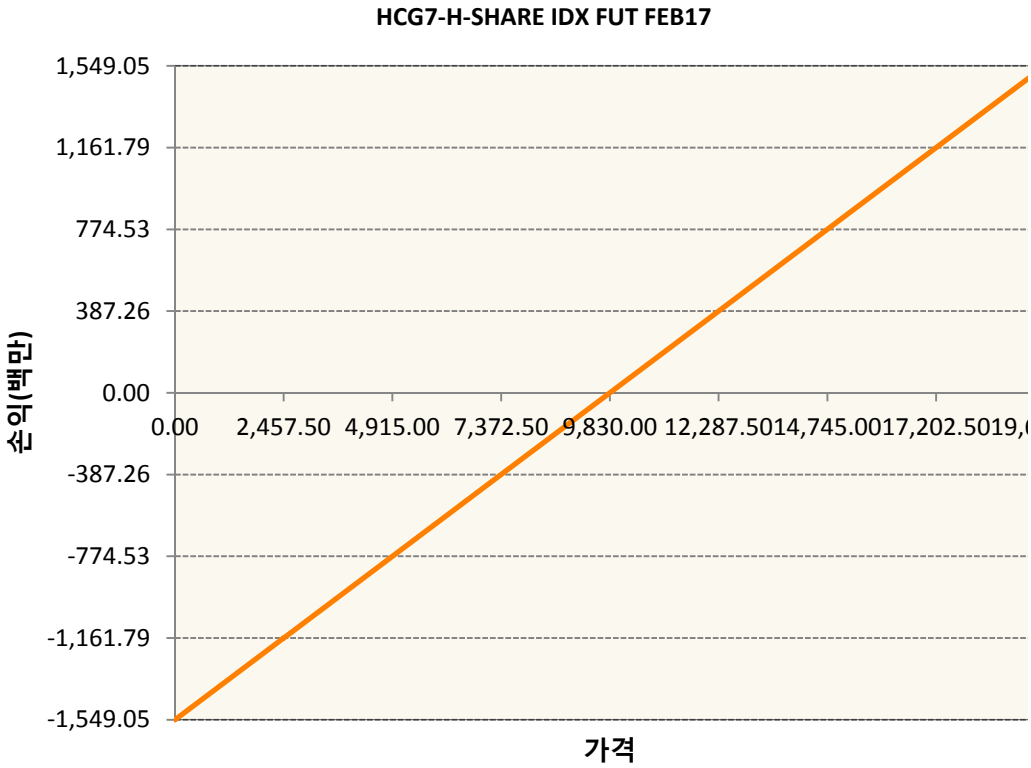
차이나인덱스모(주식-파생형)

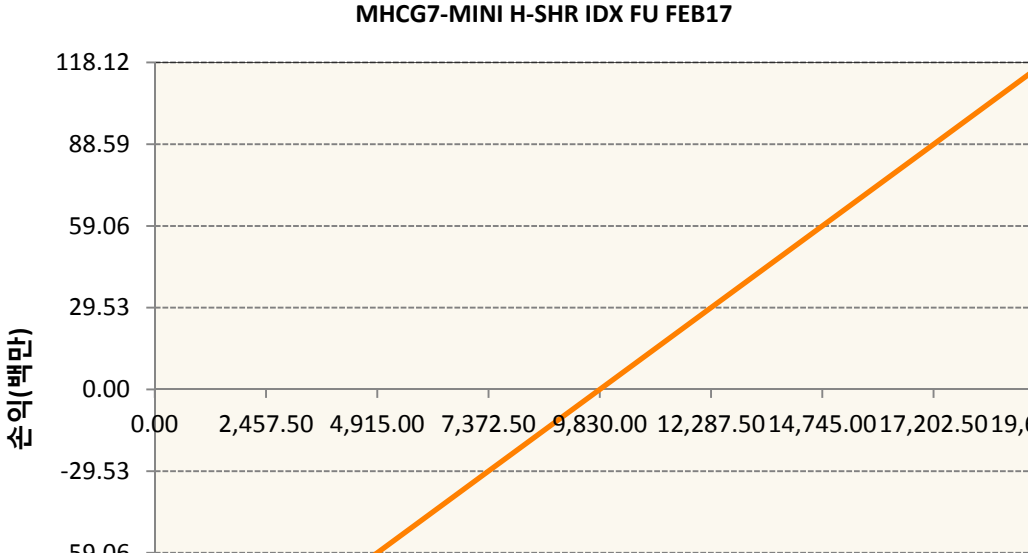
1. 계약금액

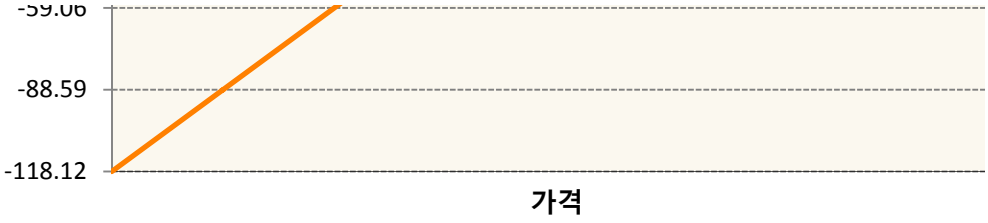
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,667	0	1,667	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

HCG7	H-SHARE IDX FUT FEB17	124
MHCG7	MINI H-SHR IDX FU FEB17	9

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

161

공시일	2017-02-01
기준일	2017-01-31

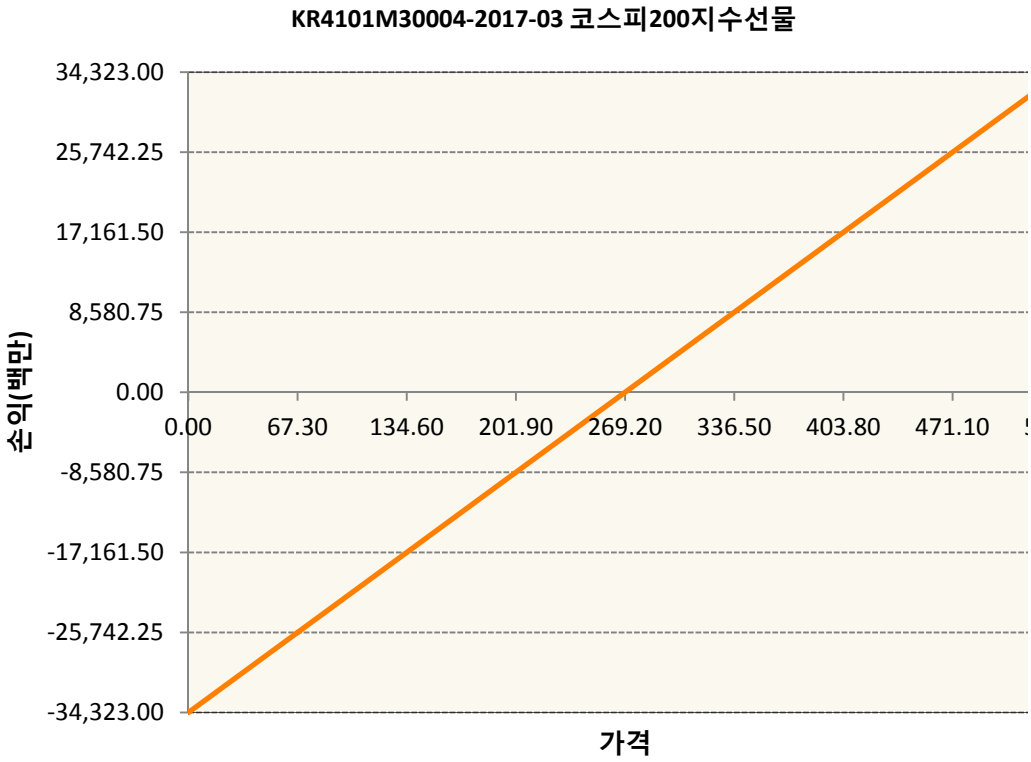
커버드콜(주식혼합-파생형)

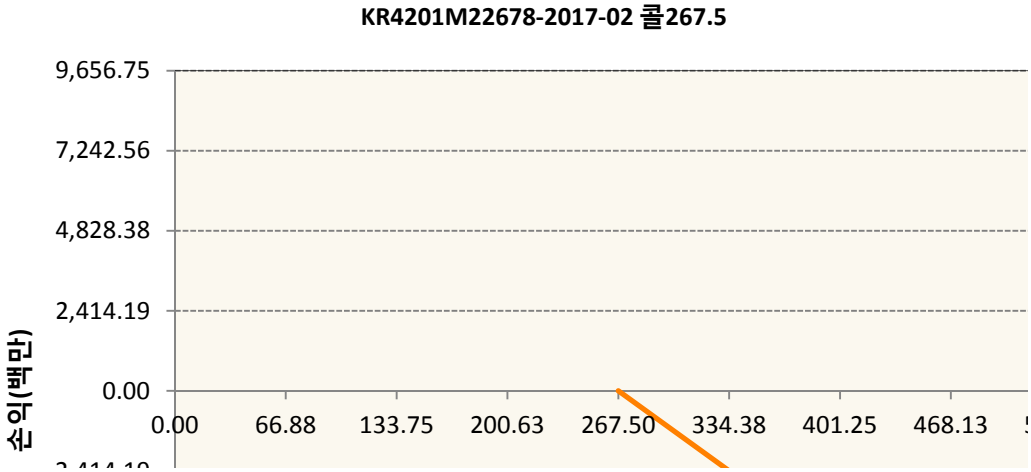
1. 계약금액

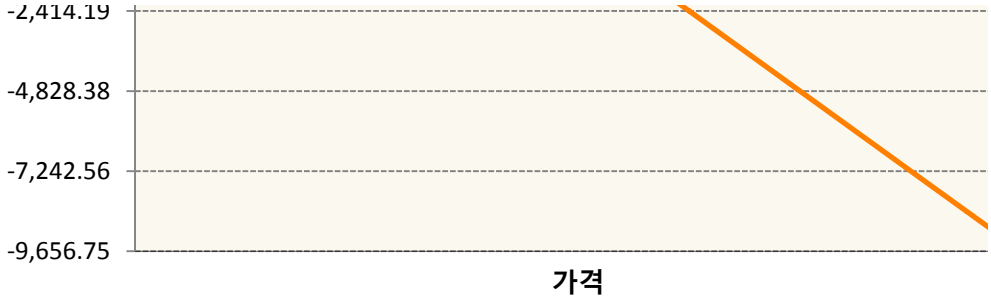
(단위:백만원)

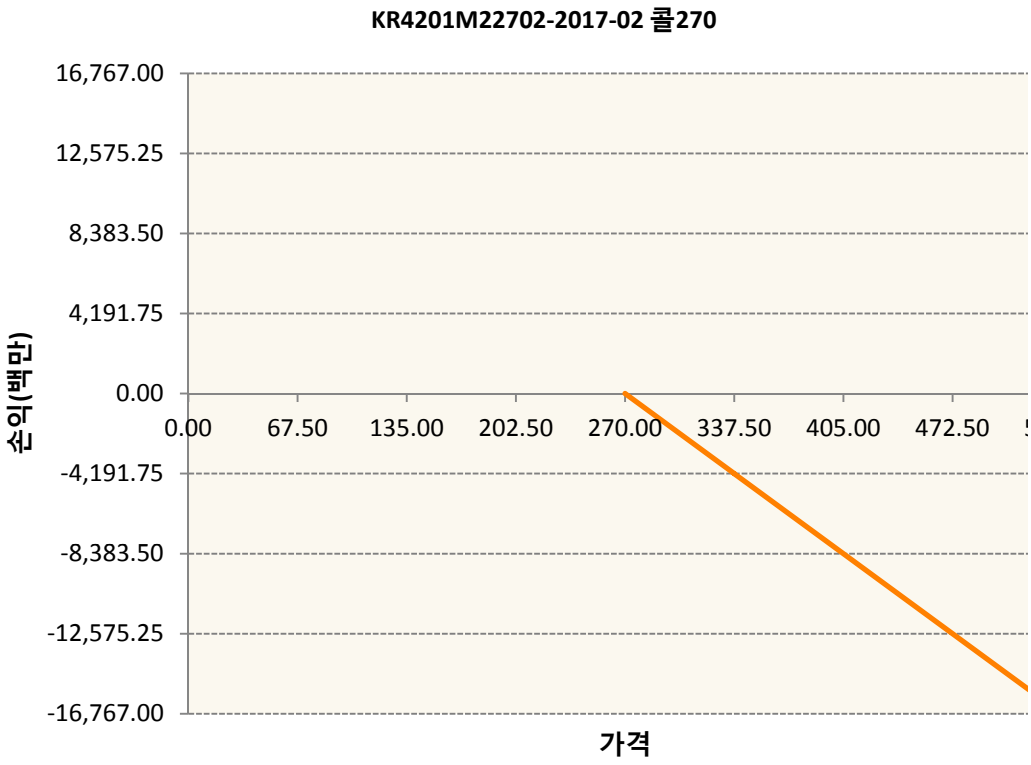
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	34,323	0	34,323	장내
누계	유가증권	옵션	0	26,424	-26,424	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101M30(2017-03 코스피200지수선물							2,735
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-2,735	-2,735	-2,735	-2,735	-2,735	-2,735	-2,735
-5.33%	-1,823	-1,823	-1,823	-1,823	-1,823	-1,823	-1,823
-2.67%	-912	-912	-912	-912	-912	-912	-912
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	912	912	912	912	912	912	912
5.33%	1,823	1,823	1,823	1,823	1,823	1,823	1,823
8.00%	2,735	2,735	2,735	2,735	2,735	2,735	2,735
KR4201M22(2017-02 콜267.5							3,552
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	422	422	422	422	422	422	422
-5.33%	422	422	421	421	420	419	416
-2.67%	410	403	393	381	367	352	335
0%	91	61	30	0	-30	-61	-91
2.67%	-978	-983	-991	-1,000	-1,011	-1,024	-1,038
5.33%	-2,262	-2,262	-2,262	-2,262	-2,263	-2,265	-2,267
8.00%	-3,552	-3,552	-3,552	-3,552	-3,552	-3,552	-3,552
KR4201M22: 2017-02 콜270							5,680

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	381	381	381	381	381	381	380
-5.33%	381	380	380	380	380	379	378
-2.67%	377	373	367	358	346	331	314
0%	145	97	49	0	-50	-100	-150
2.67%	-1,291	-1,315	-1,343	-1,374	-1,408	-1,443	-1,481
5.33%	-3,460	-3,461	-3,462	-3,465	-3,469	-3,475	-3,483
8.00%	-5,678	-5,678	-5,679	-5,679	-5,679	-5,679	-5,680

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

13,736

공시일	2017-02-01
기준일	2017-01-31

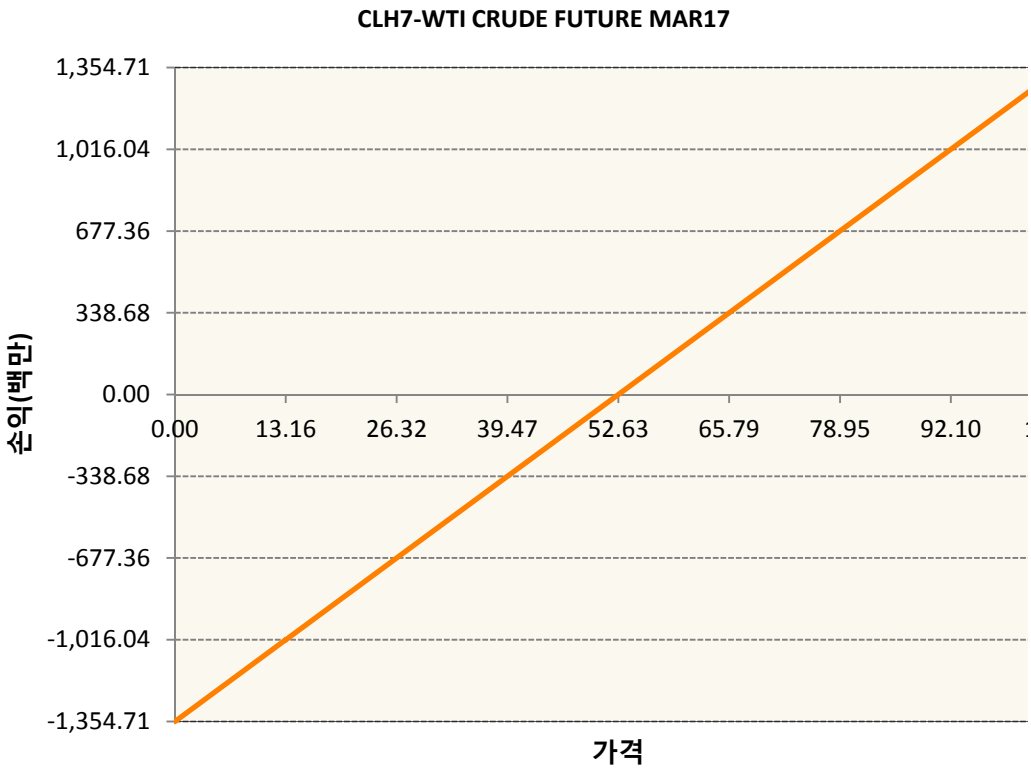
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

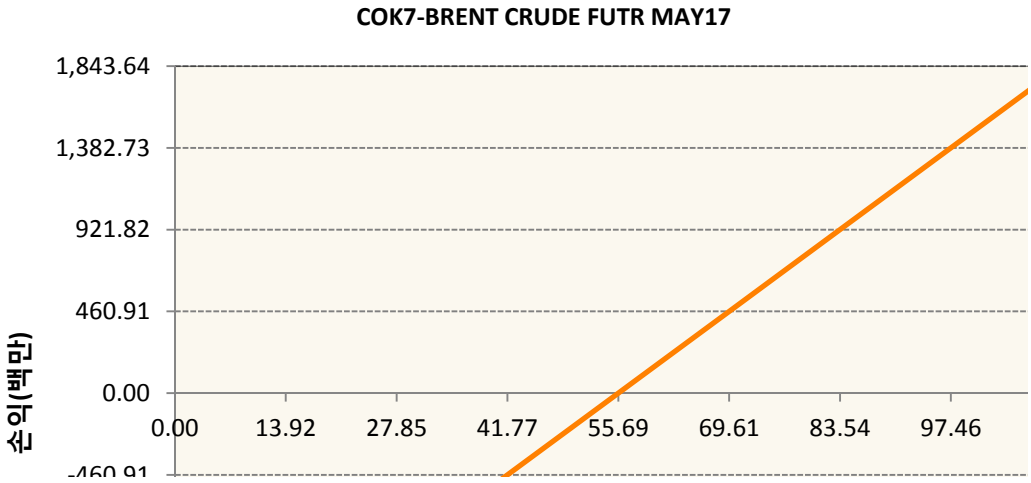
1. 계약금액

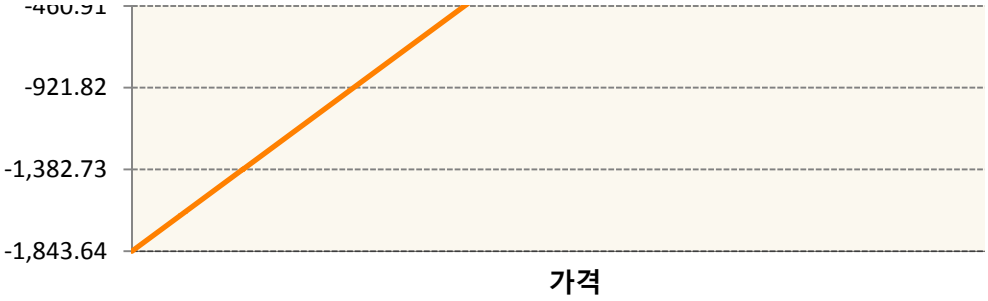
(단위:백만원)

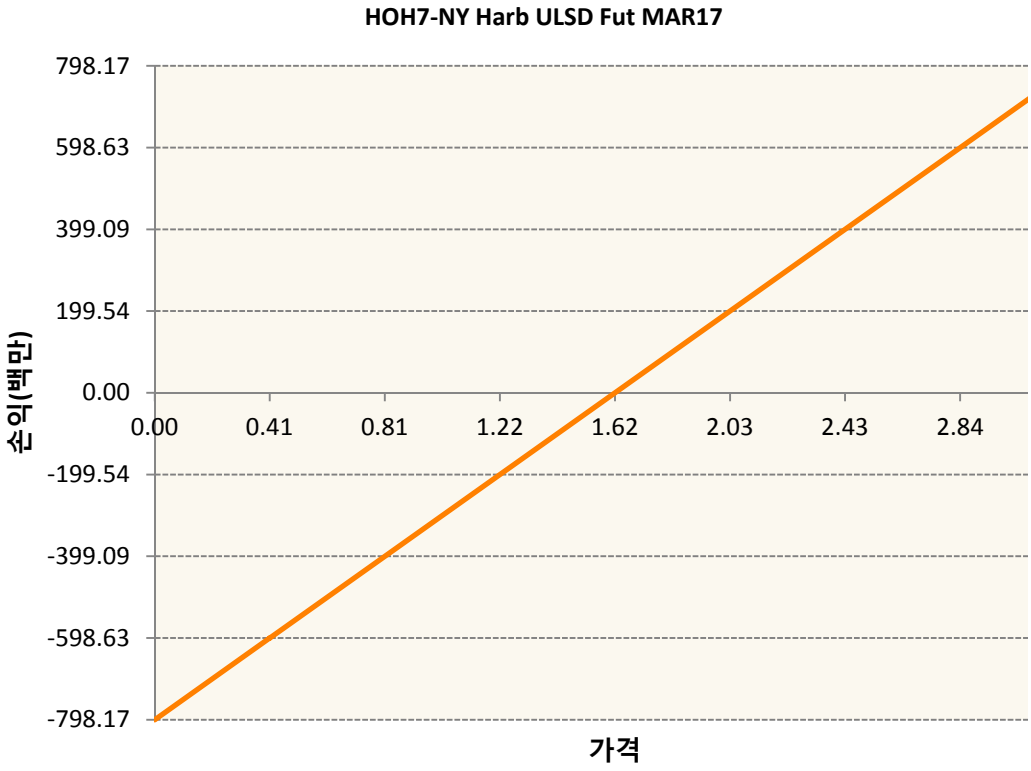
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	선물	유가증권	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	선물	유가증권	1,355	0	1,355	
누계	유가증권	선물	4,984	418	4,566	

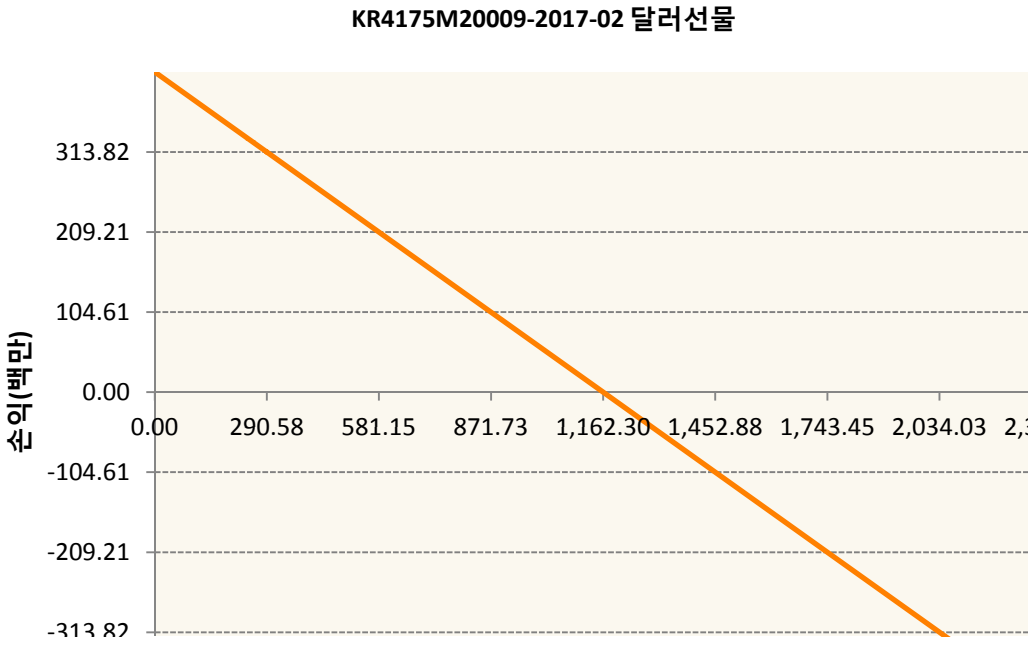
2. 만기시점의 손익구조

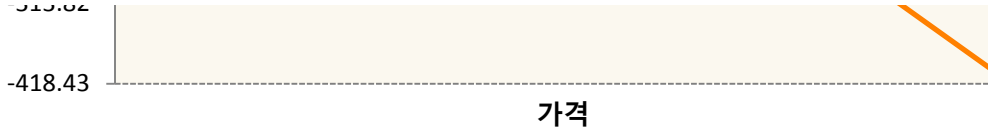


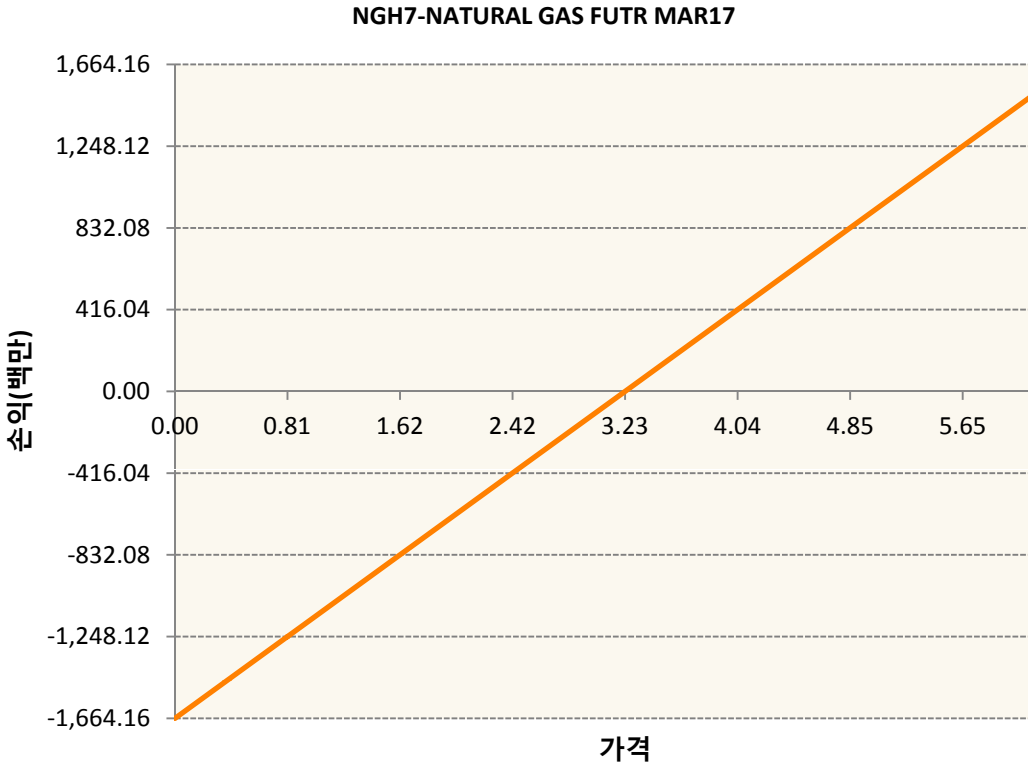


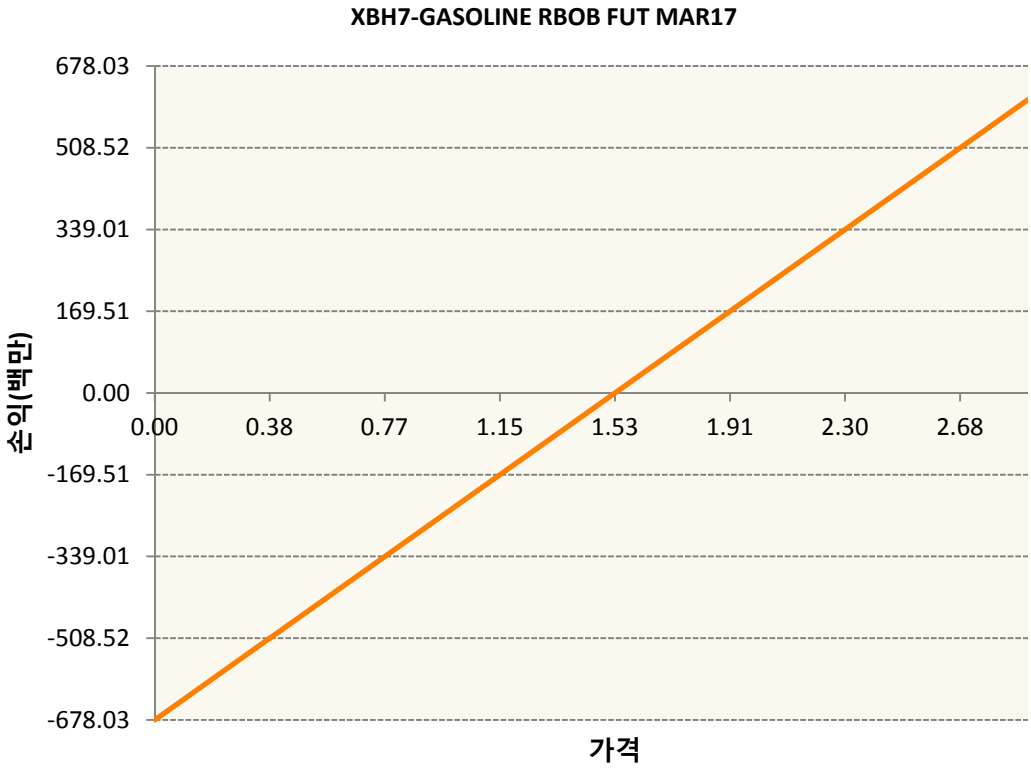

-921.82
-1,382.73
-1,843.64
가격


HOH7-NY Harb ULSD Fut MAR17
798.17
598.63
399.09
199.54
0.00
-199.54
-399.09
-598.63
-798.17
0.00
0.41
0.81
1.22
1.62
2.03
2.43
2.84
순익(백만)
가격


KR4175M20009-2017-02 달러선물
313.82
209.21
104.61
0.00
-104.61
-209.21
0.00
290.58
581.15
871.73
1,162.30
1,452.88
1,743.45
2,034.03
순익(백만)


-418.43
가격


NGH7-NATURAL GAS FUTR MAR17
1,664.16
1,248.12
832.08
416.04
0.00
-416.04
-832.08
-1,248.12
-1,664.16
0.00
0.81
1.62
2.42
3.23
4.04
4.85
5.65
순익(백만)
가격


XBH7-GASOLINE RBOB FUT MAR17
678.03
508.52
339.01
169.51
0.00
-169.51
-339.01
-508.52
-678.03
0.00
0.38
0.77
1.15
1.53
1.91
2.30
2.68
순익(백만)
가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLH7	WTI CRUDE FUTURE MAR17	108
COK7	BRENT CRUDE FUTR MAY17	147
HOH7	NY Harb ULSD Fut MAR17	64
KR4175M20(	2017-02 달러선물	33
NGH7	NATURAL GAS FUTR MAR17	133
XBH7	GASOLINE RBOB FUT MAR17	54

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

1,155

공시일	2017-02-01
기준일	2017-01-31

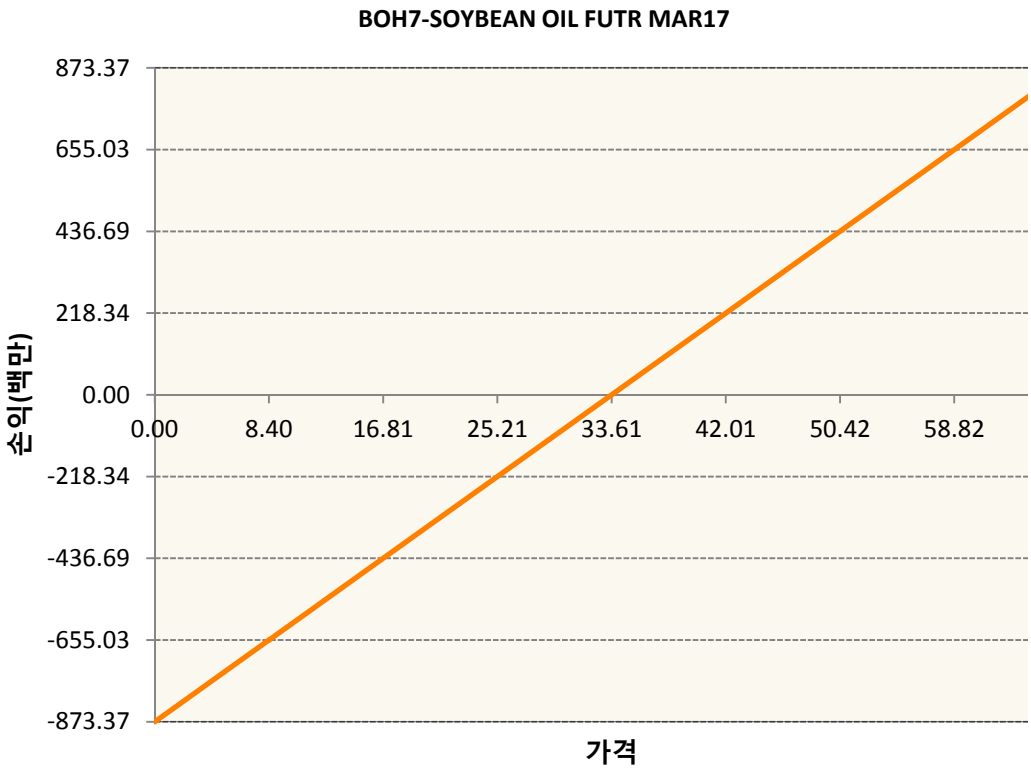
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

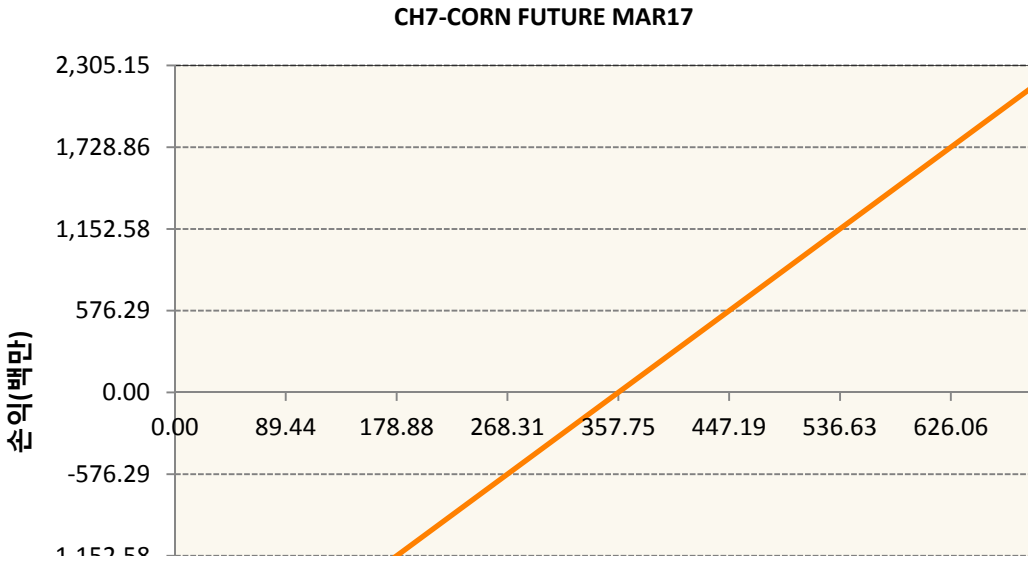
1. 계약금액

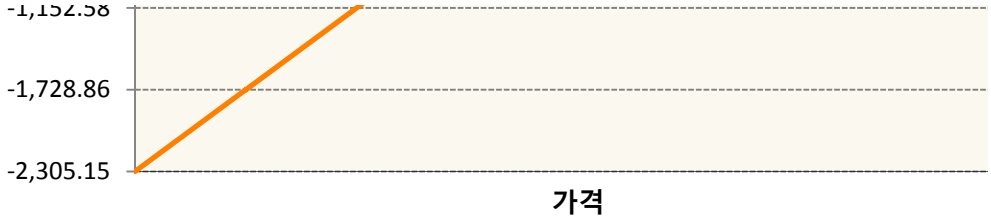
(단위:백만원)

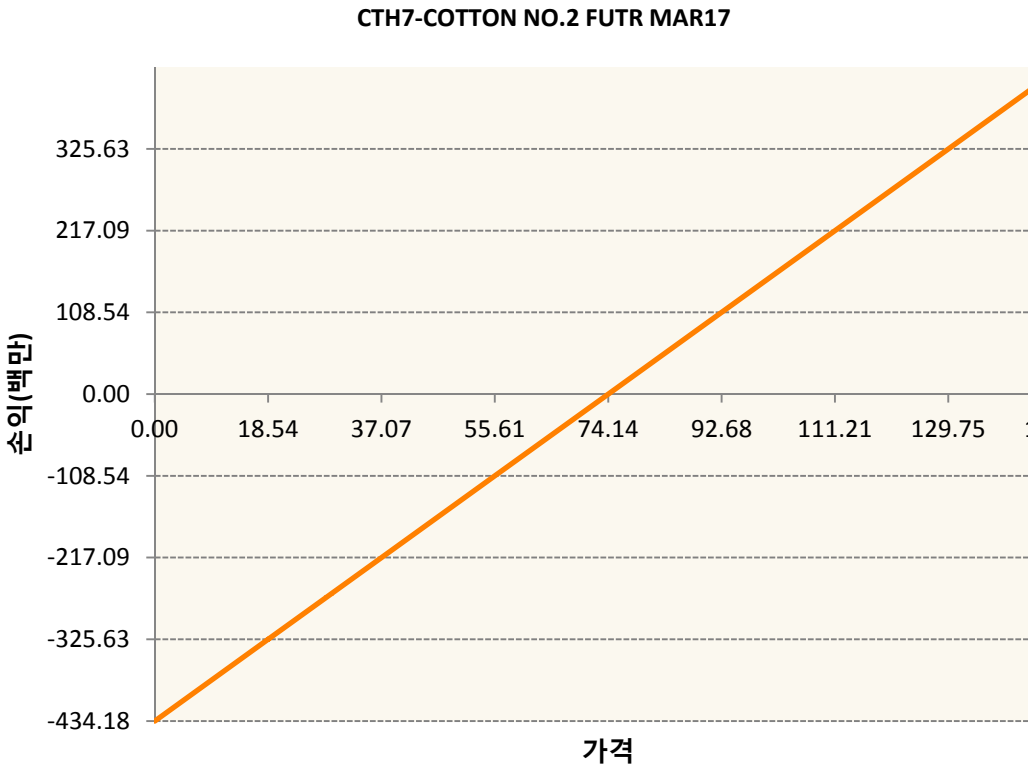
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	9,737	581	9,156	

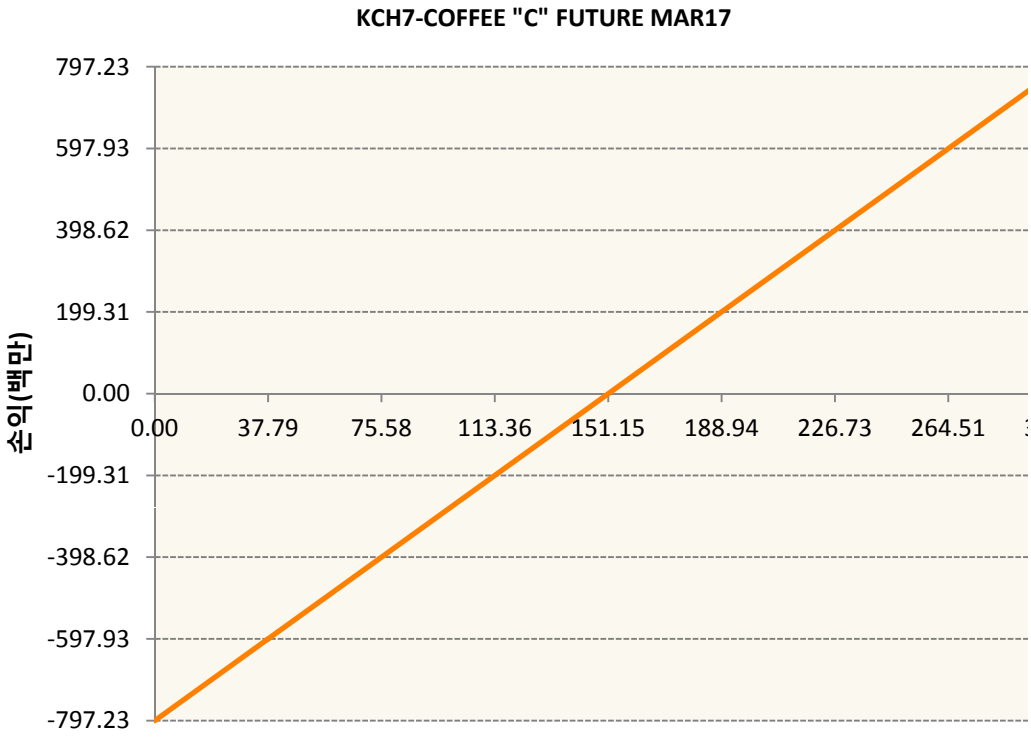
2. 만기시점의 손익구조



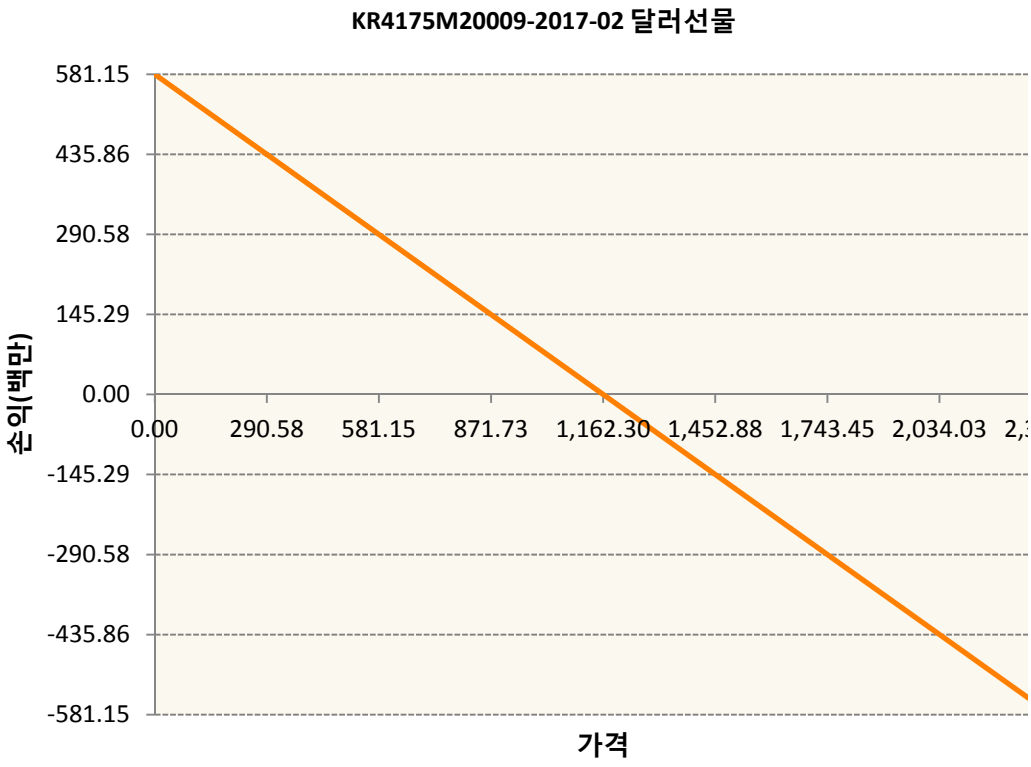


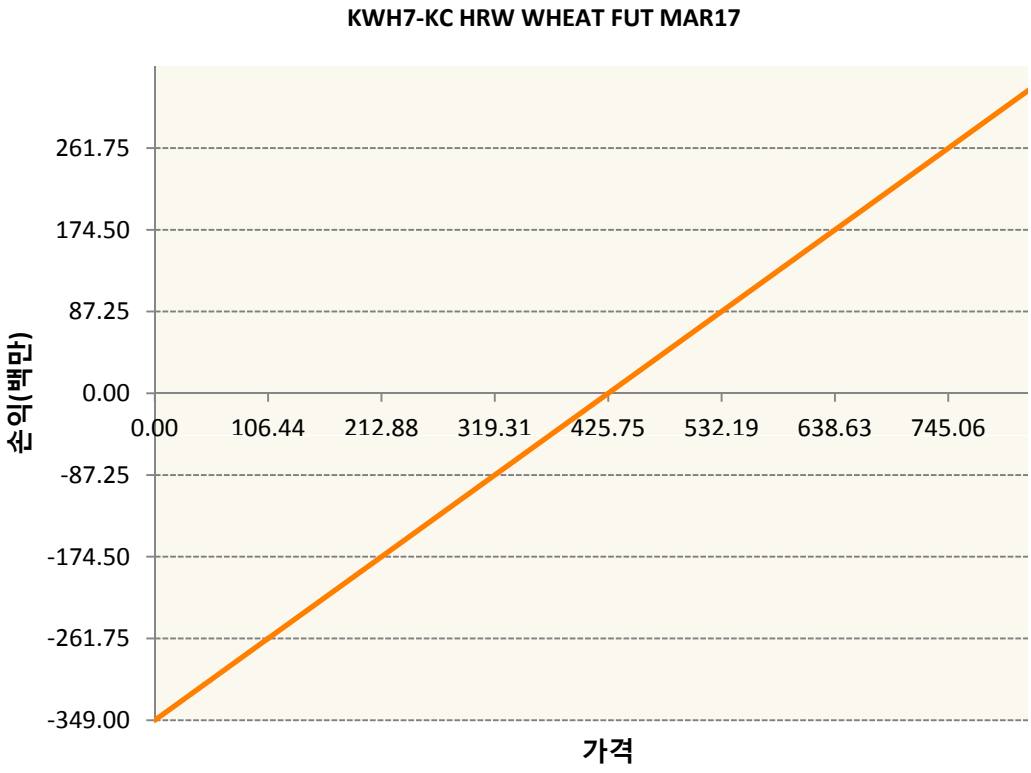

-1,728.86
-2,305.15
가격

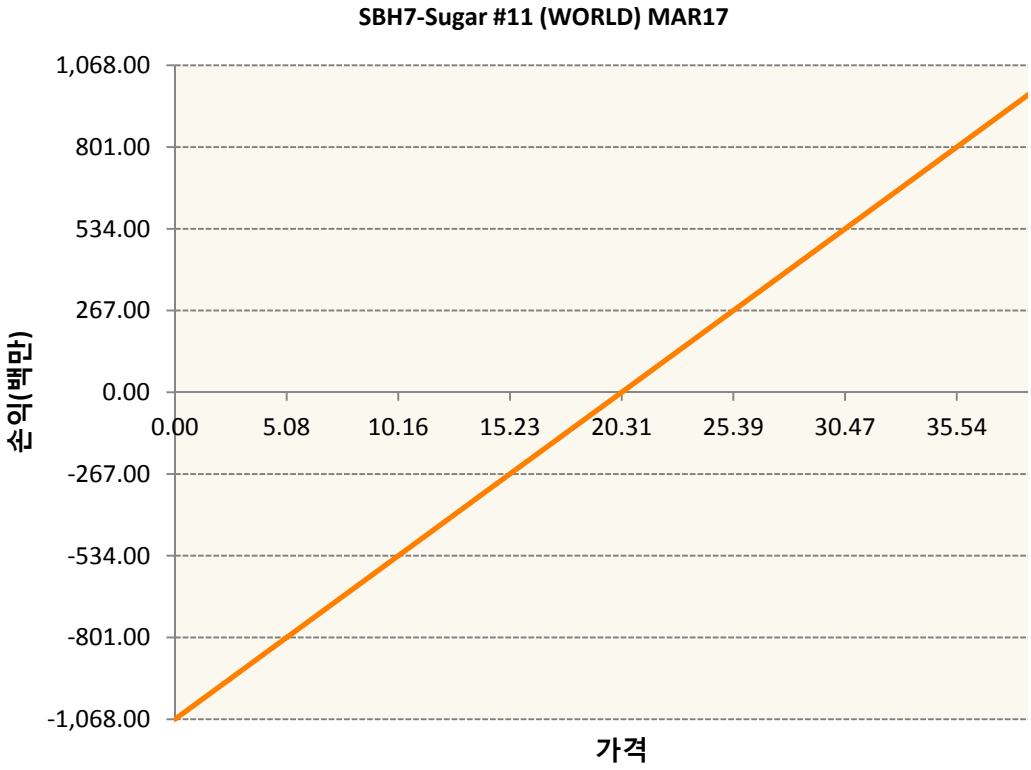

CTH7-COTTON NO.2 FUTR MAR17
325.63
217.09
108.54
0.00
-108.54
-217.09
-325.63
-434.18
0.00
18.54
37.07
55.61
74.14
92.68
111.21
129.75
순익(백만)
가격

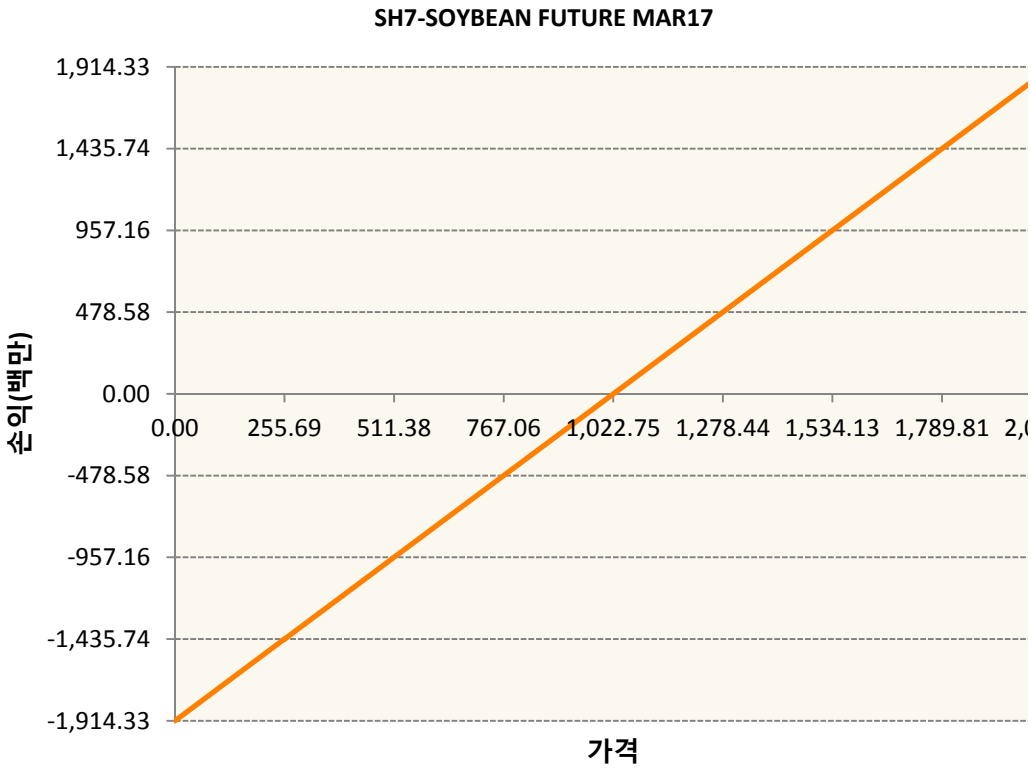

KCH7-COFFEE "C" FUTURE MAR17
797.23
597.93
398.62
199.31
0.00
-199.31
-398.62
-597.93
-797.23
0.00
37.79
75.58
113.36
151.15
188.94
226.73
264.51
순익(백만)

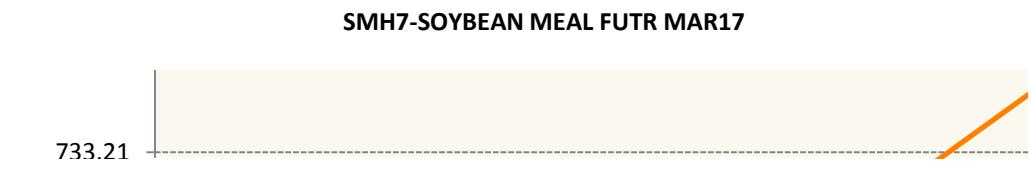
가격

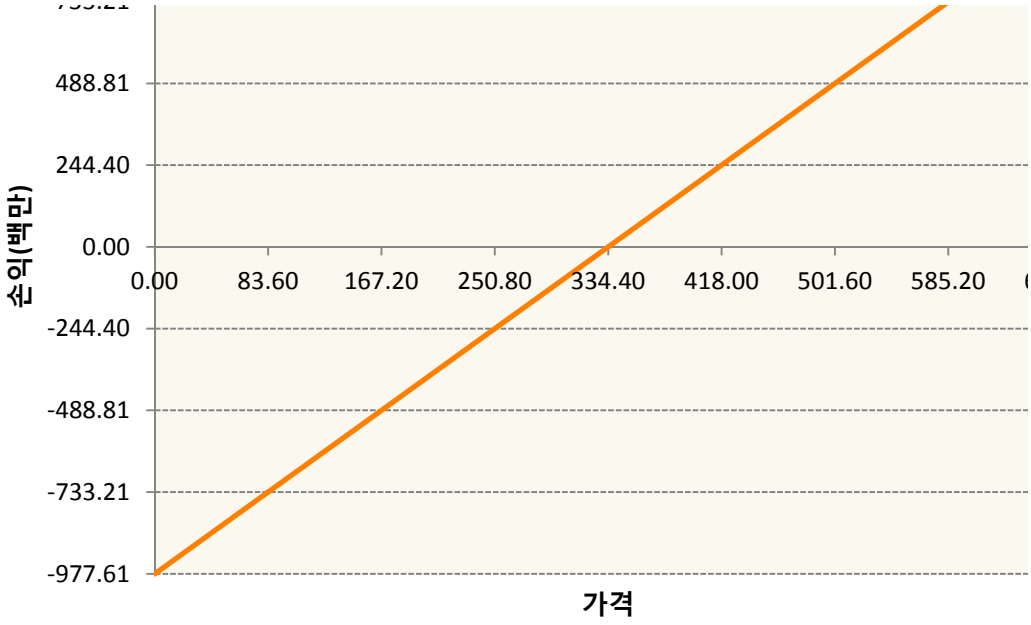

KR4175M20009-2017-02 달러선물
581.15
435.86
290.58
145.29
0.00
-145.29
-290.58
-435.86
-581.15
0.00
290.58
581.15
871.73
1,162.30
1,452.88
1,743.45
2,034.03
손익(백만)
가격

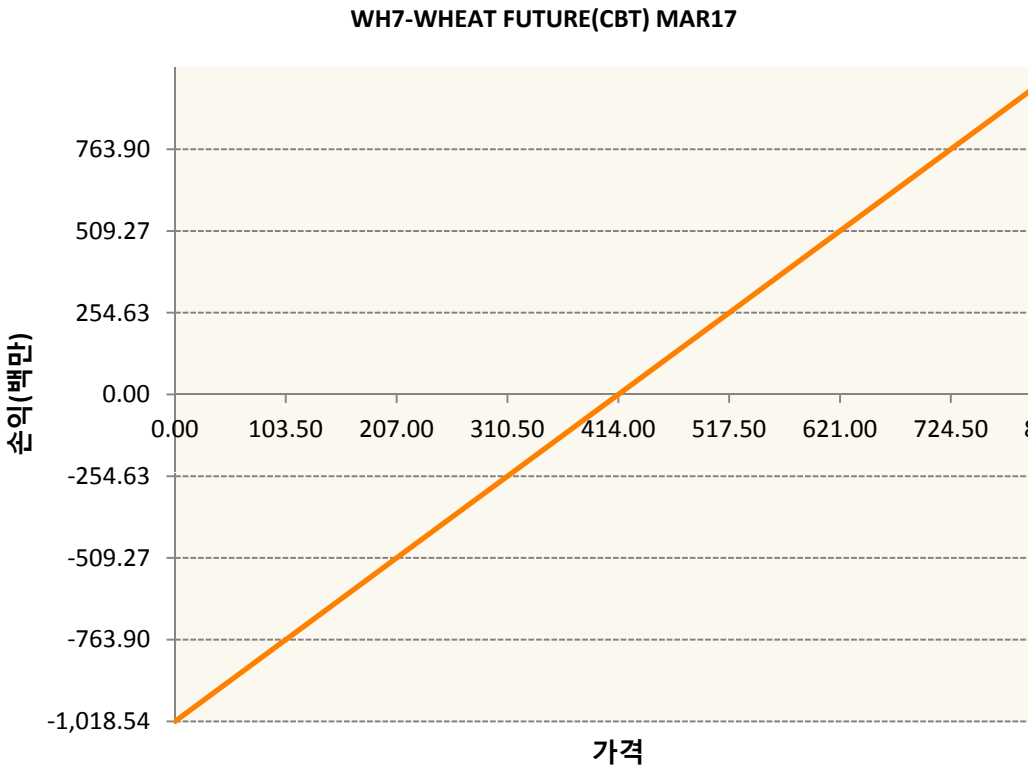

KWH7-KC HRW WHEAT FUT MAR17
261.75
174.50
87.25
0.00
-87.25
-174.50
-261.75
-349.00
0.00
106.44
212.88
319.31
425.75
532.19
638.63
745.06
손익(백만)
가격


SBH7-Sugar #11 (WORLD) MAR17
1,068.00
801.00
534.00
267.00
0.00
-267.00
-534.00
-801.00
-1,068.00
0.00
5.08
10.16
15.23
20.31
25.39
30.47
35.54
손익(백만)
가격


SH7-SOYBEAN FUTURE MAR17
1,914.33
1,435.74
957.16
478.58
0.00
-478.58
-957.16
-1,435.74
-1,914.33
0.00
255.69
511.38
767.06
1,022.75
1,278.44
1,534.13
1,789.81
손익(백만)
가격


SMH7-SOYBEAN MEAL FUTR MAR17
733.21





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

BOH7	SOYBEAN OIL FUTR MAR17	70
CH7	CORN FUTURE MAR17	184
CTH7	COTTON NO.2 FUTR MAR17	35
KCH7	COFFEE "C" FUTURE MAR17	64
KR4175M20(	2017-02 달러선물	46

KWH7	KC HRW WHEAT FUT MAR17	28
SBH7	Sugar #11 (WORLD) MAR17	85
SH7	SOYBEAN FUTURE MAR17	153
SMH7	SOYBEAN MEAL FUTR MAR17	78
WH7	WHEAT FUTURE(CBT) MAR17	81

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

924