공시일	2017-02-02
기준일	2017-02-01

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	2017-02-02
기준일	2017-02-01

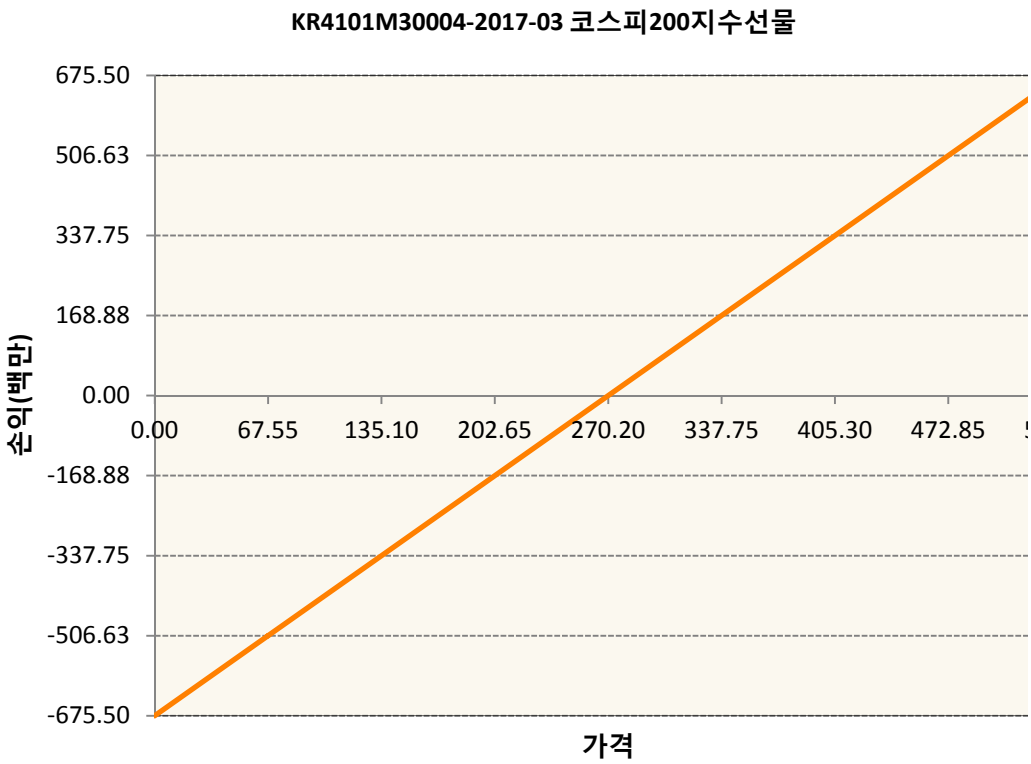
스마트인덱스모

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	676	0	676	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	2017-02-02
기준일	2017-02-01

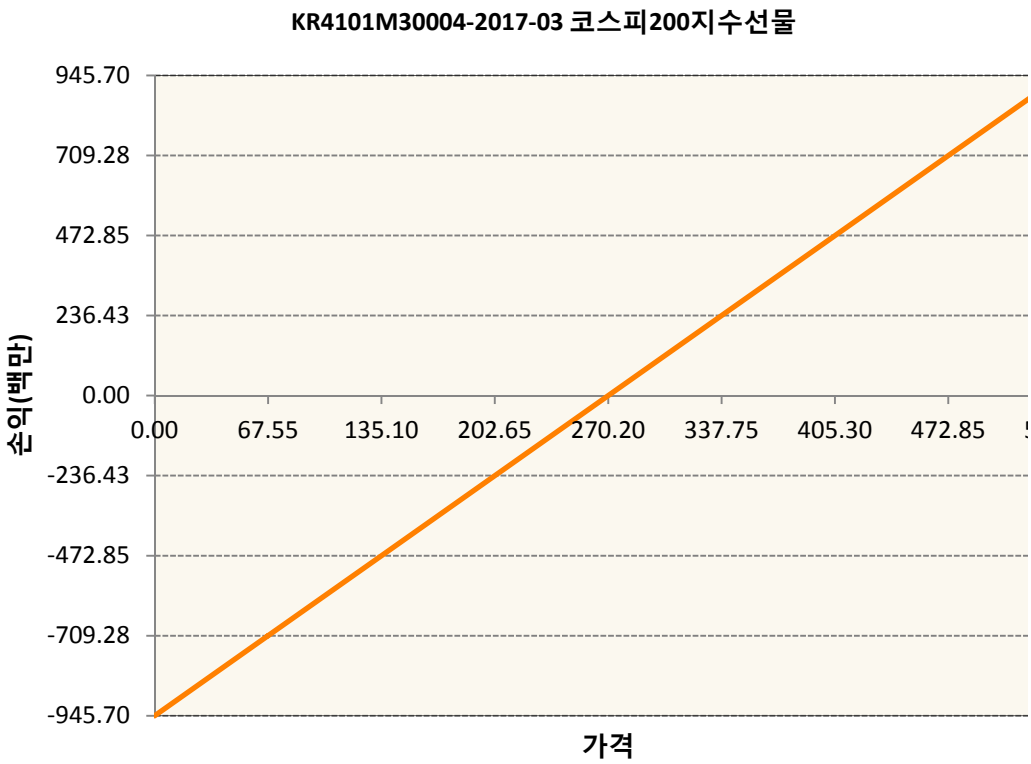
스마트레버리지목표전환형1호

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	946	0	946	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	2017-02-02
기준일	2017-02-01

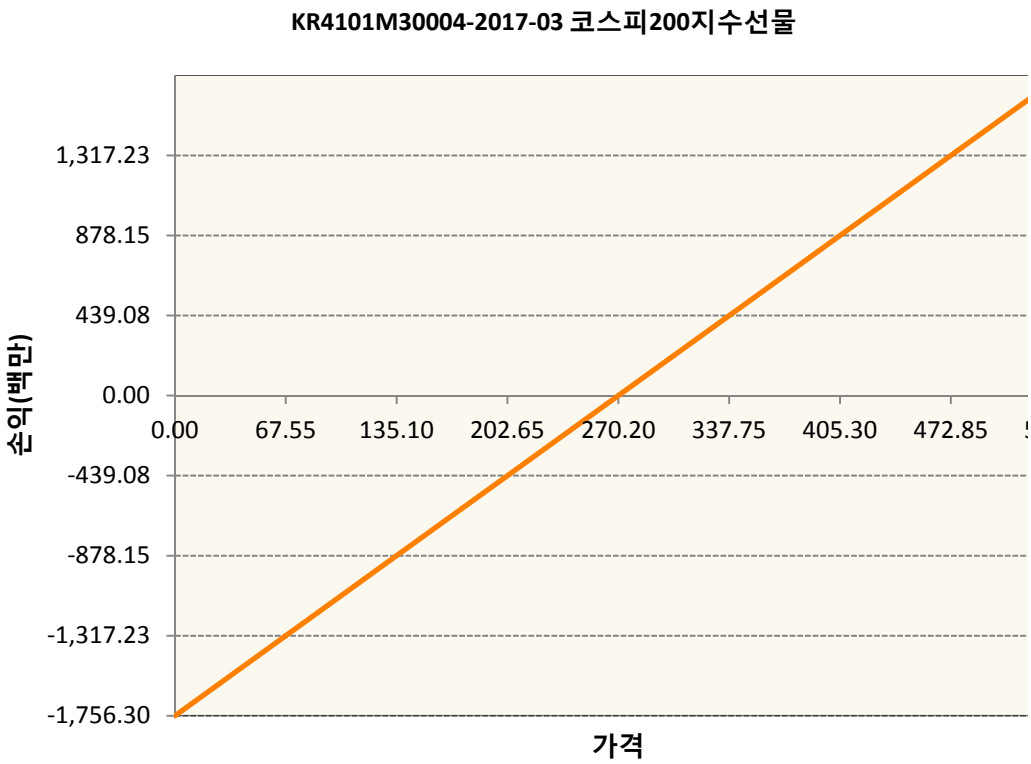
1.3배 레버리지 인덱스(주식-파생형)

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	1,756	0	1,756	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%	-93	-93	-93	-93	-93	-93	-93
-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%	93	93	93	93	93	93	93
8.00%	140	140	140	140	140	140	140

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

97

공시일	2017-02-02
기준일	2017-02-01

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)

667

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-02-02
기준일	2017-02-01

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)

556

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-02-02
기준일	2017-02-01

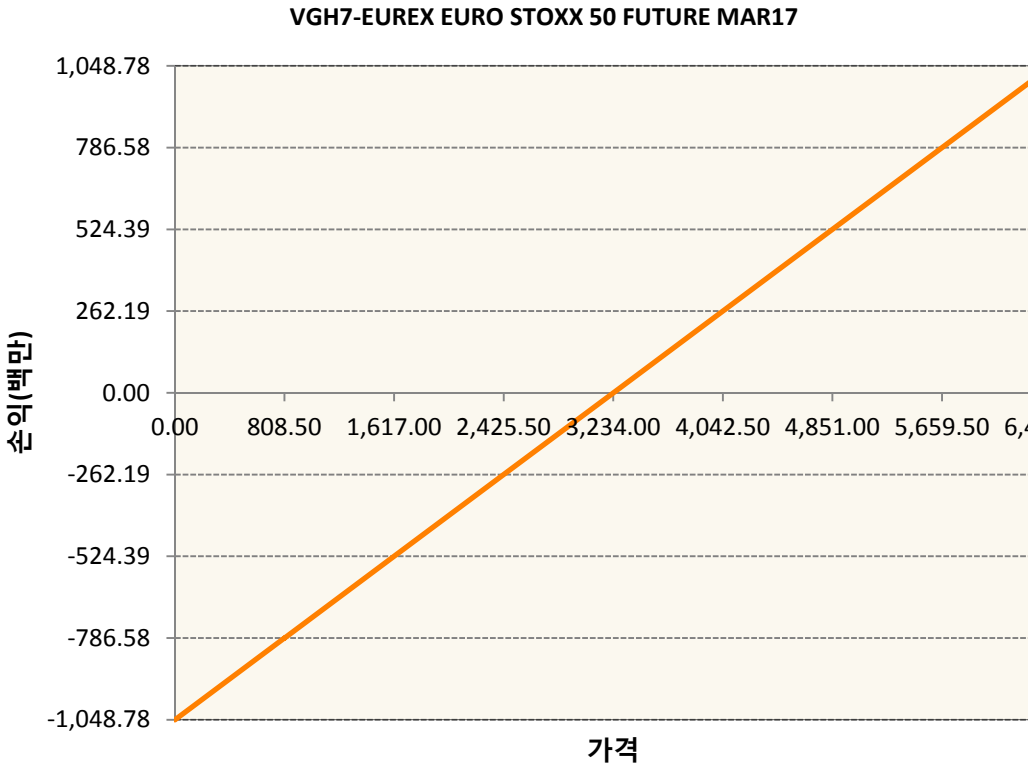
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,049	0	1,049	

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)

89

공시일	2017-02-02
기준일	2017-02-01

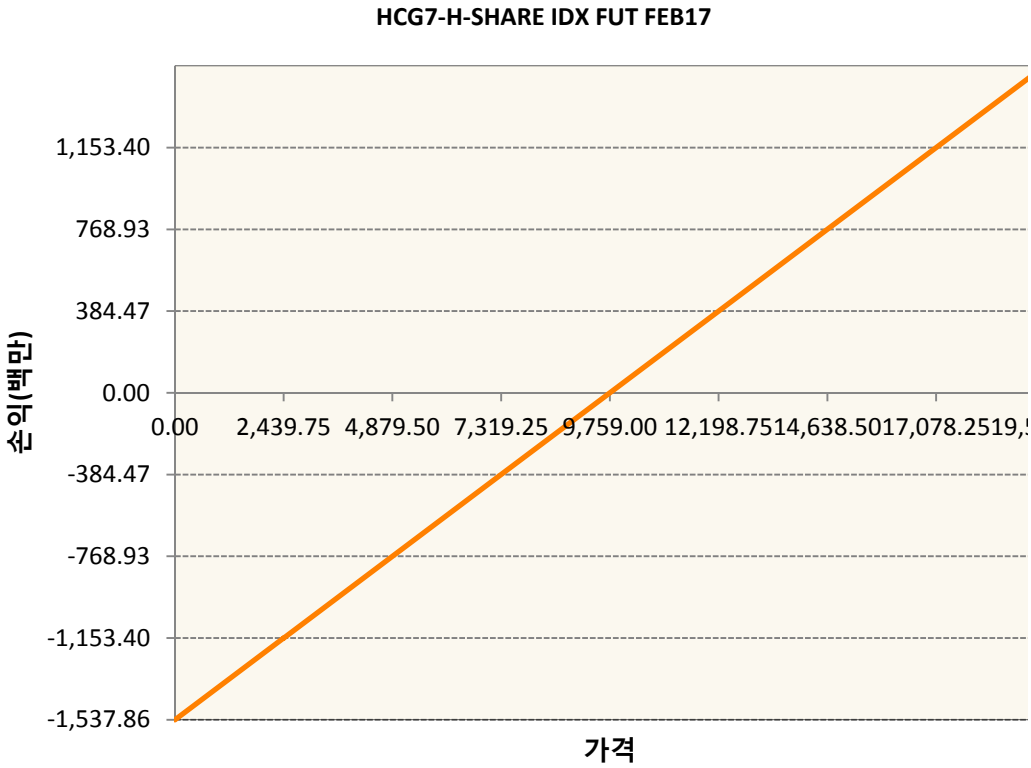
차이나인덱스모(주식-파생형)

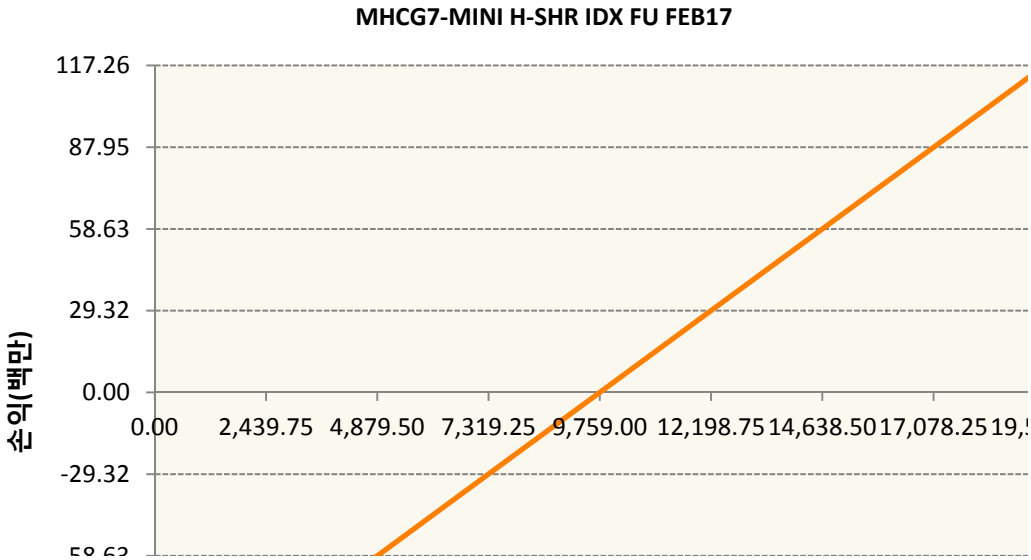
1. 계약금액

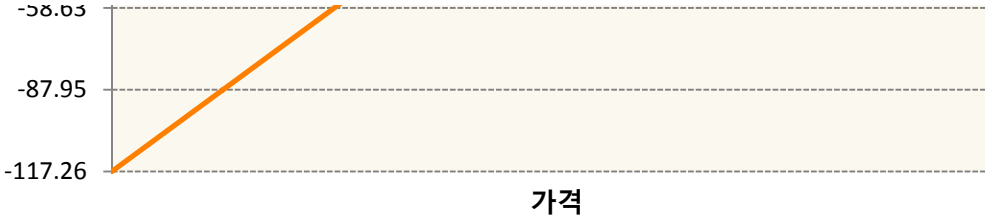
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,655	0	1,655	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCG7	H-SHARE IDX FUT FEB17	123
MHCG7	MINI H-SHR IDX FU FEB17	9

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	160

공시일	2017-02-02
기준일	2017-02-01

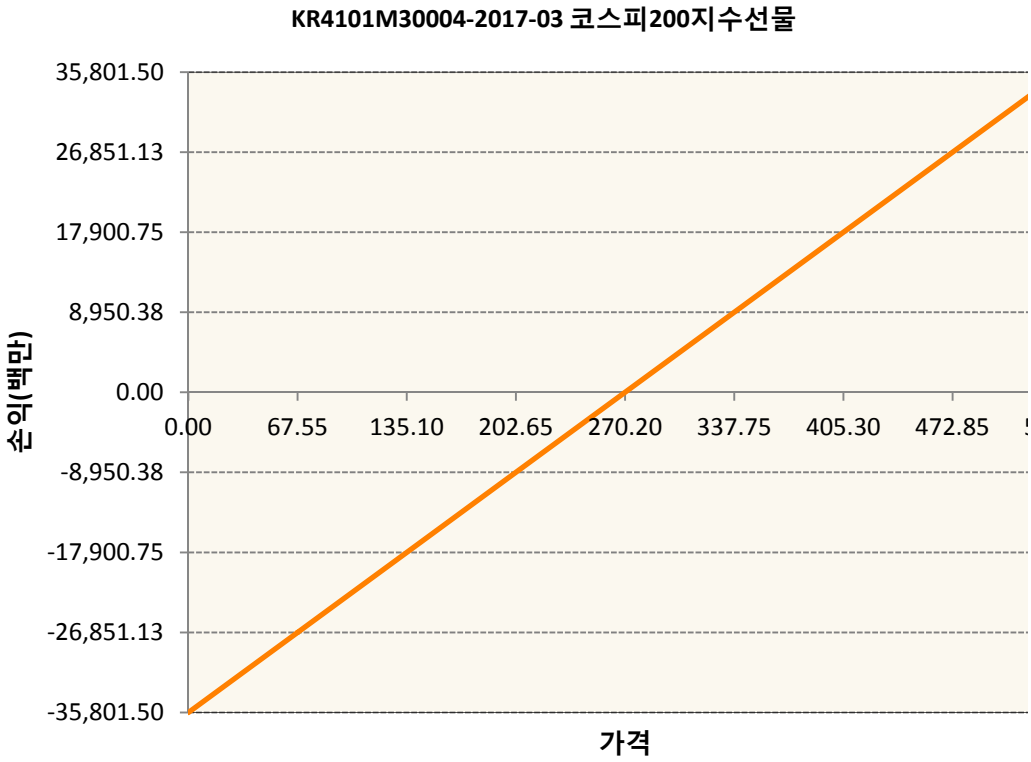
커버드콜(주식혼합-파생형)

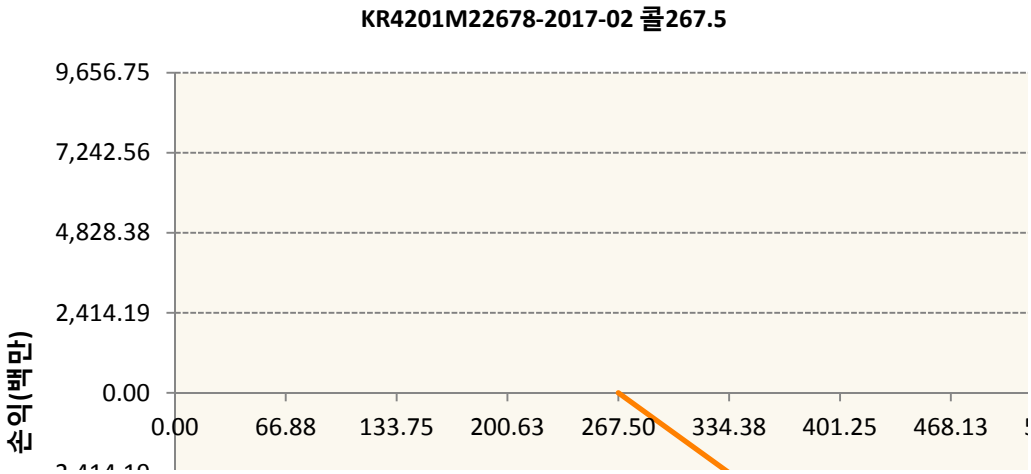
1. 계약금액

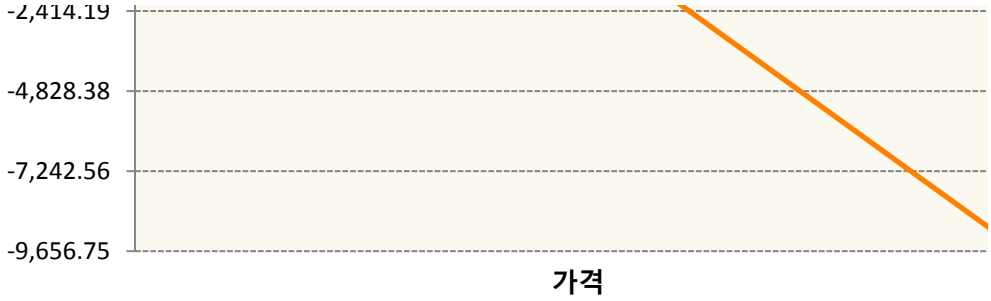
(단위:백만원)

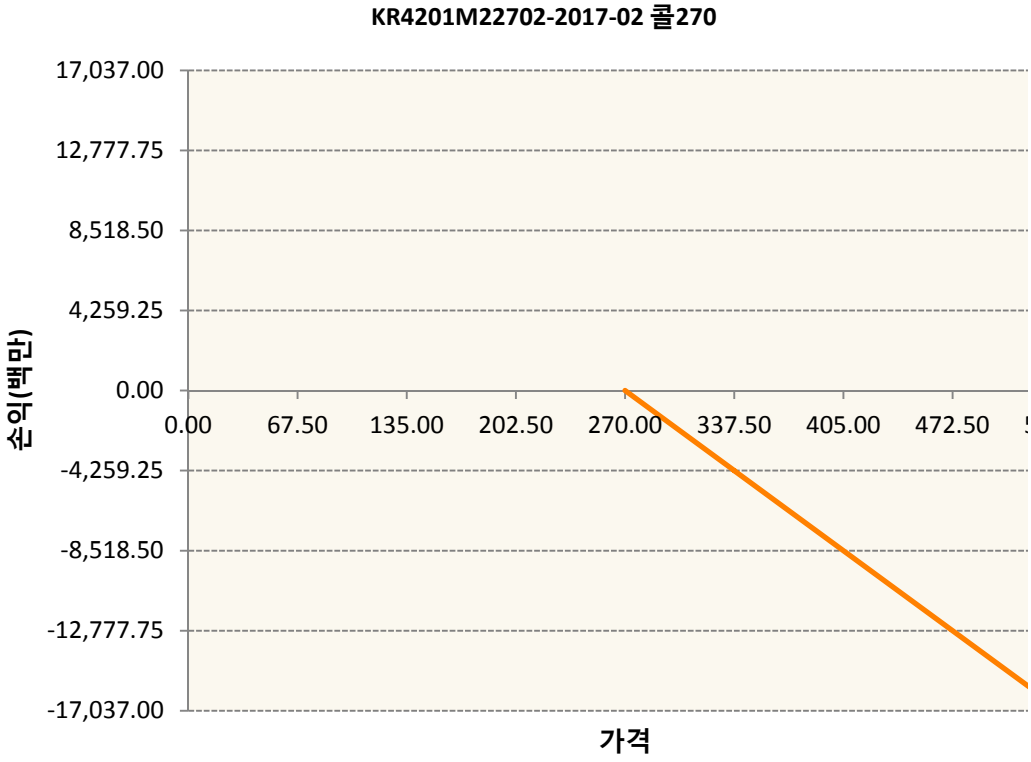
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	1,351	0	1,351	장내
신규	유가증권	옵션	0	272	-272	장내
누계	유가증권	선물	35,802	0	35,802	장내
누계	유가증권	옵션	0	26,694	-26,694	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101M30(2017-03 코스피200지수선물							2,857
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-2,857	-2,857	-2,857	-2,857	-2,857	-2,857	-2,857
-5.33%	-1,905	-1,905	-1,905	-1,905	-1,905	-1,905	-1,905
-2.67%	-952	-952	-952	-952	-952	-952	-952
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	952	952	952	952	952	952	952
5.33%	1,905	1,905	1,905	1,905	1,905	1,905	1,905
8.00%	2,857	2,857	2,857	2,857	2,857	2,857	2,857
KR4201M22(2017-02 콜267.5							3,702
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	559	559	559	559	559	559	559
-5.33%	559	559	558	558	557	555	553
-2.67%	538	527	515	500	484	466	447
0%	76	51	26	0	-26	-53	-80
2.67%	-1,109	-1,110	-1,113	-1,117	-1,122	-1,129	-1,137
5.33%	-2,405	-2,405	-2,405	-2,405	-2,405	-2,405	-2,406
8.00%	-3,702	-3,702	-3,702	-3,702	-3,702	-3,702	-3,702
KR4201M22: 2017-02 콜270							6,125
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	534	534	534	534	534	534	533
-5.33%	534	533	533	533	533	532	530
-2.67%	527	521	512	500	486	468	448
0%	150	100	50	0	-50	-100	-150
2.67%	-1,605	-1,616	-1,630	-1,648	-1,669	-1,693	-1,719
5.33%	-3,858	-3,858	-3,858	-3,859	-3,860	-3,862	-3,865
8.00%	-6,125	-6,125	-6,125	-6,125	-6,125	-6,125	-6,125

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

15,265

공시일	2017-02-02
기준일	2017-02-01

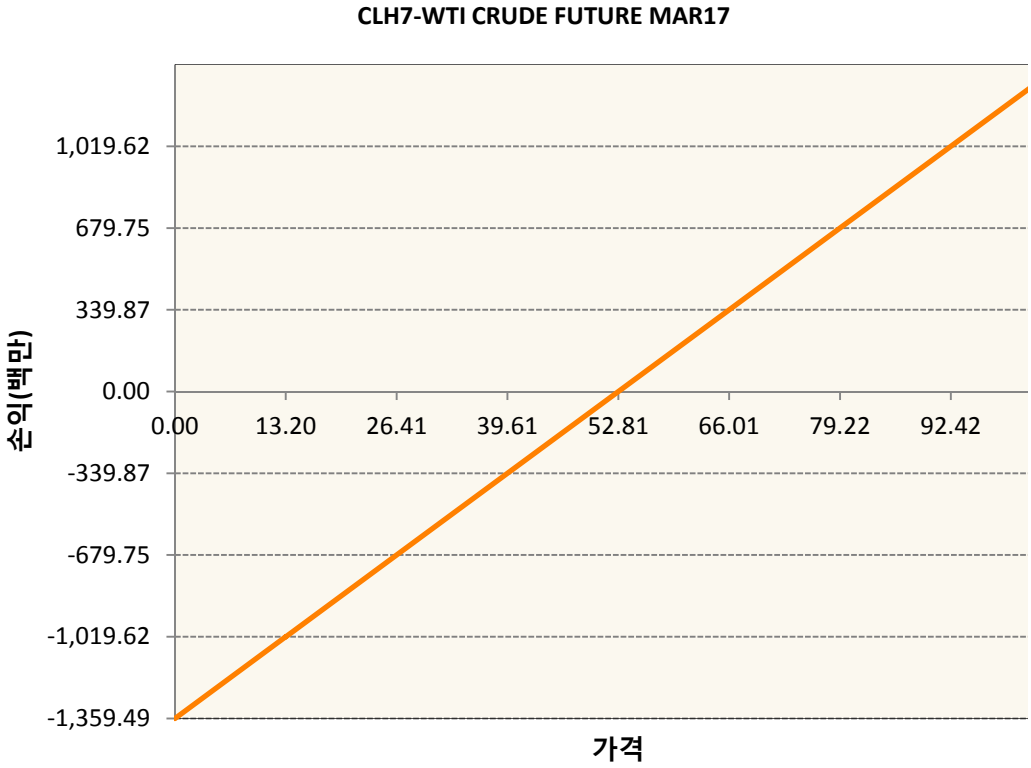
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

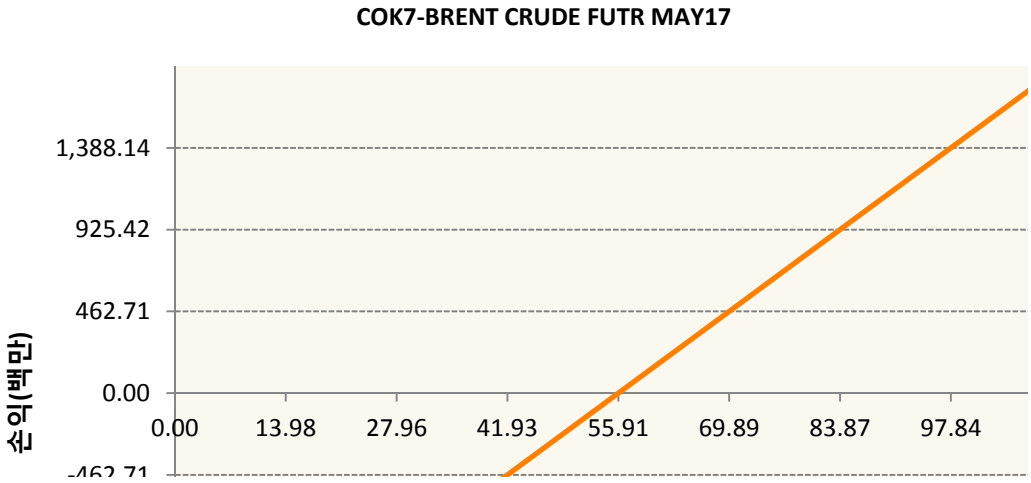
1. 계약금액

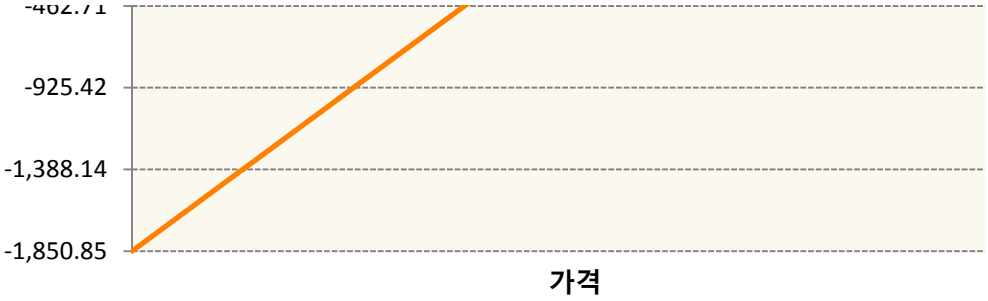
(단위:백만원)

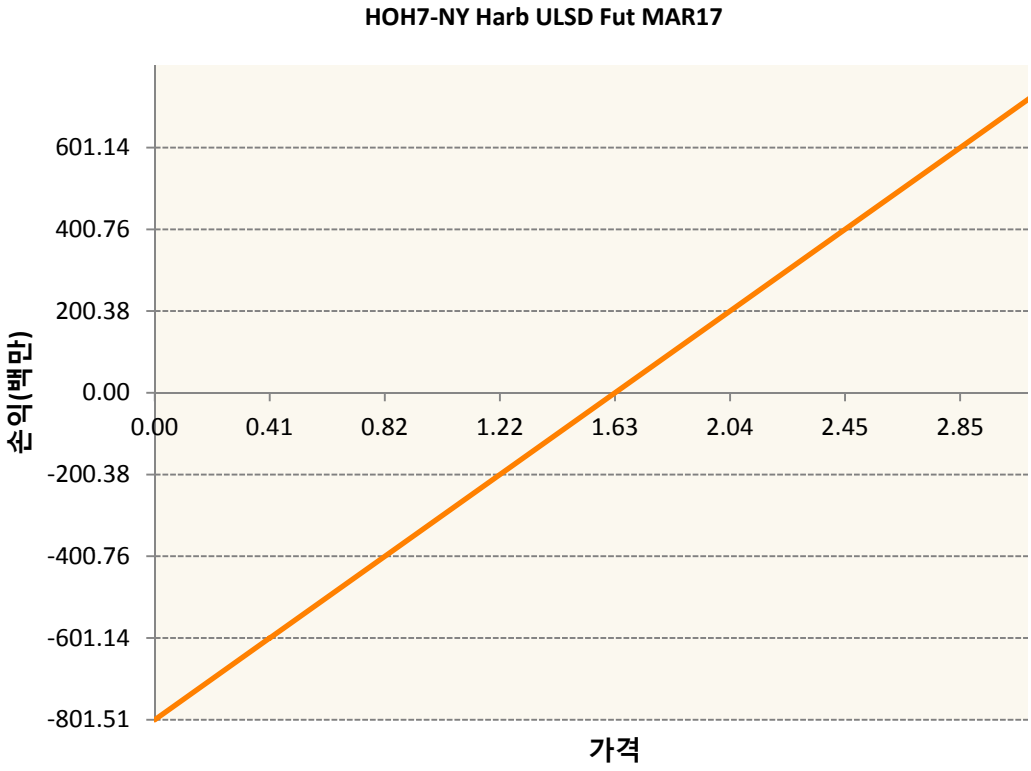
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	선물	유가증권	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	선물	유가증권	1,359	0	1,359	
누계	유가증권	선물	4,944	417	4,527	

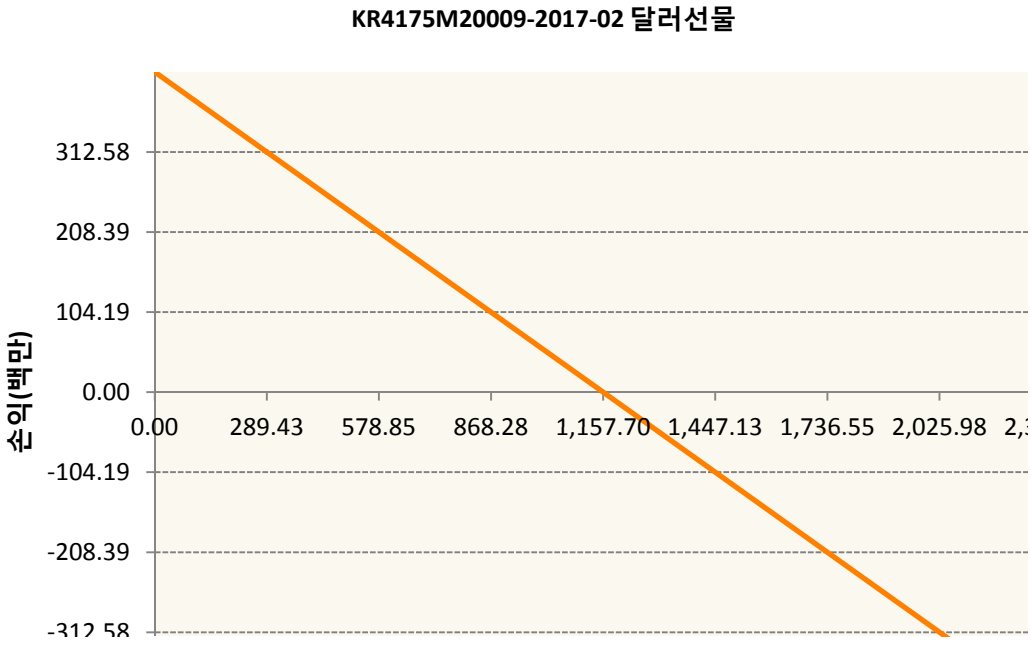
2. 만기시점의 손익구조

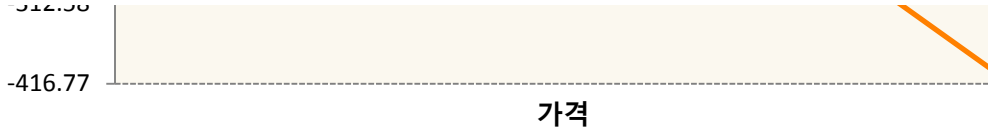


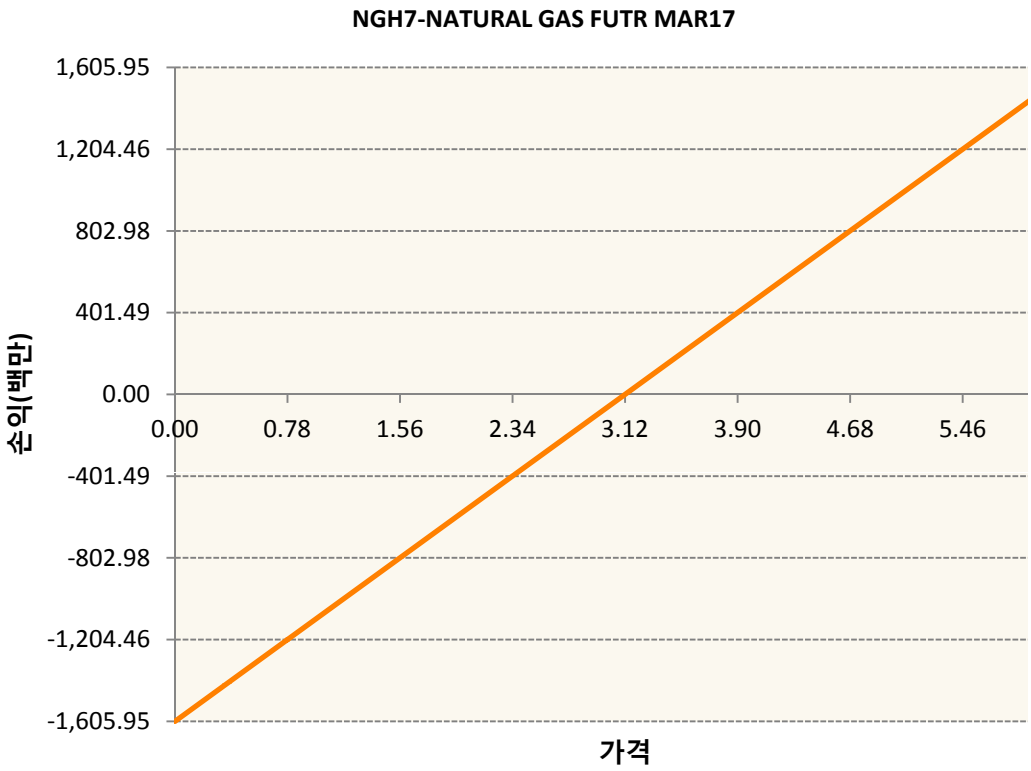


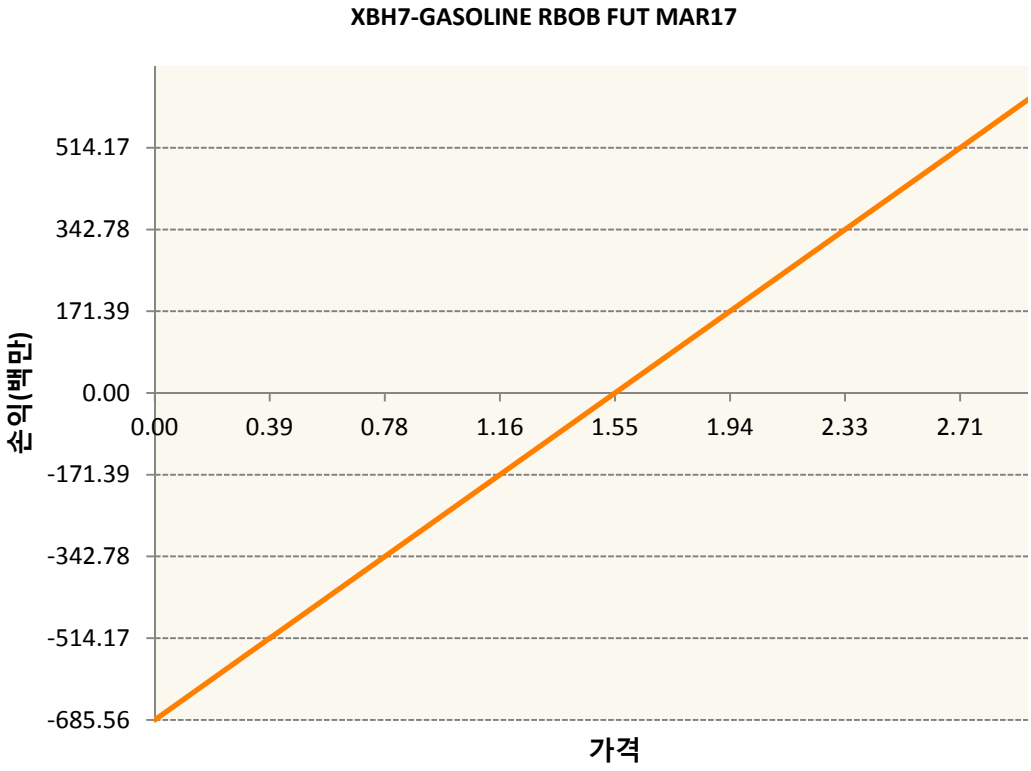

-925.42
-1,388.14
-1,850.85
가격


HOH7-NY Harb ULSD Fut MAR17
601.14
400.76
200.38
0.00
-200.38
-400.76
-601.14
-801.51
0.00
0.41
0.82
1.22
1.63
2.04
2.45
2.85
순익(백만)
가격


KR4175M20009-2017-02 달러선물
312.58
208.39
104.19
0.00
-104.19
-208.39
0.00
289.43
578.85
868.28
1,157.70
1,447.13
1,736.55
2,025.98
순익(백만)


-416.77
가격


NGH7-NATURAL GAS FUTR MAR17
1,605.95
1,204.46
802.98
401.49
0.00
-401.49
-802.98
-1,204.46
-1,605.95
0.00
0.78
1.56
2.34
3.12
3.90
4.68
5.46
순익(백만)
가격


XBH7-GASOLINE RBOB FUT MAR17
514.17
342.78
171.39
0.00
-171.39
-342.78
-514.17
-685.56
0.00
0.39
0.78
1.16
1.55
1.94
2.33
2.71
순익(백만)
가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLH7	WTI CRUDE FUTURE MAR17	109
COK7	BRENT CRUDE FUTR MAY17	148
HOH7	NY Harb ULSD Fut MAR17	64
KR4175M20(	2017-02 달러선물	33
NGH7	NATURAL GAS FUTR MAR17	128
XBH7	GASOLINE RBOB FUT MAR17	55

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

1,142

공시일	2017-02-02
기준일	2017-02-01

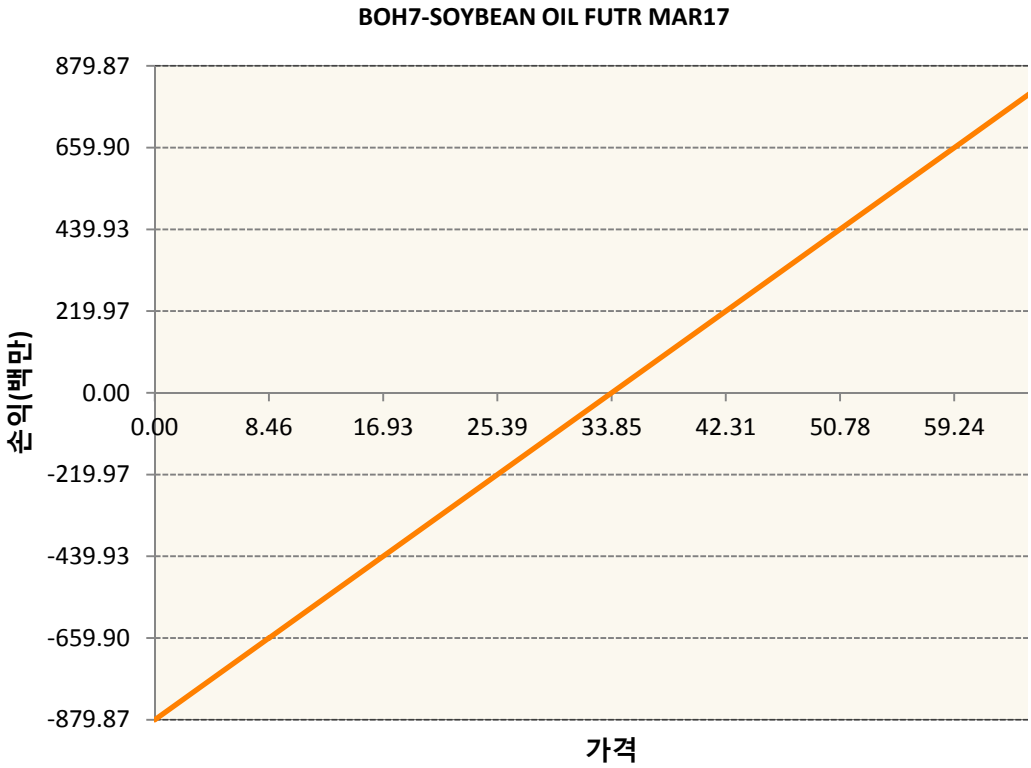
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

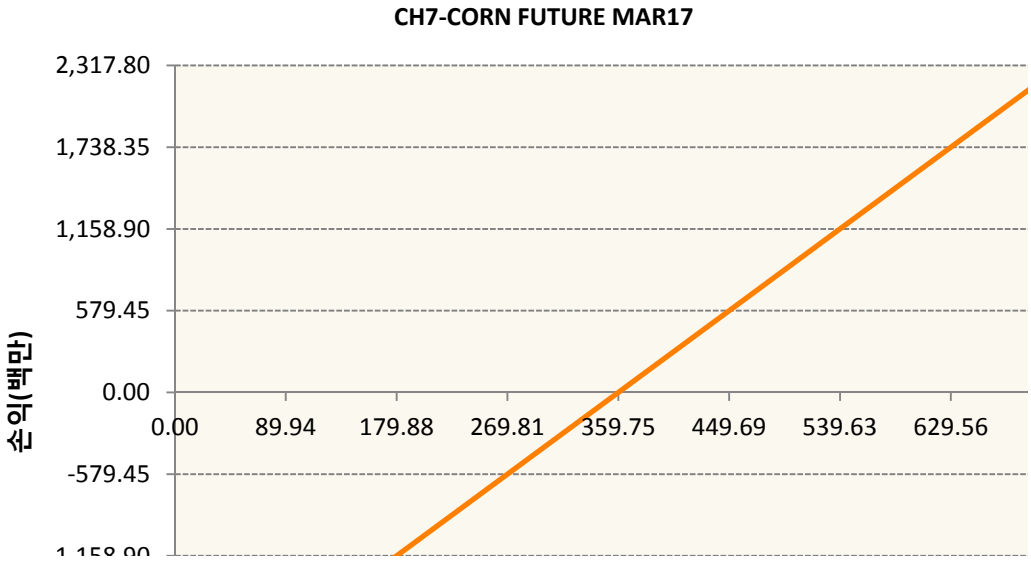
1. 계약금액

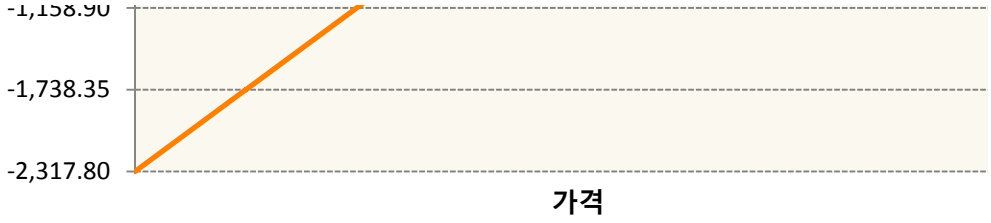
(단위:백만원)

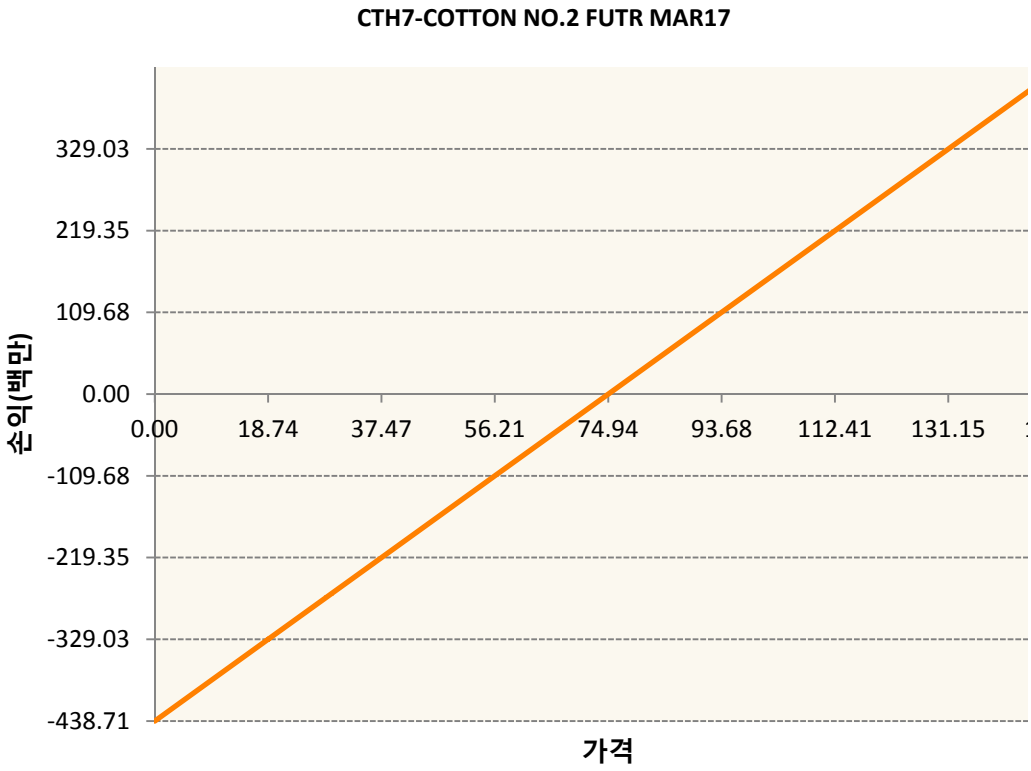
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	9,784	579	9,205	

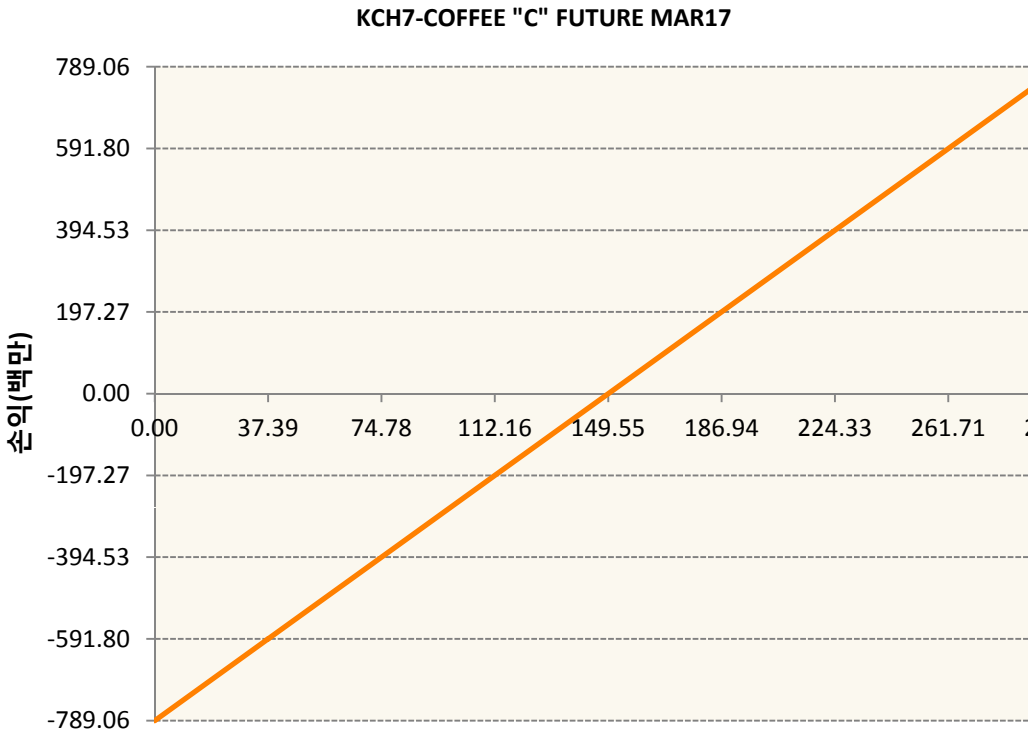
2. 만기시점의 손익구조





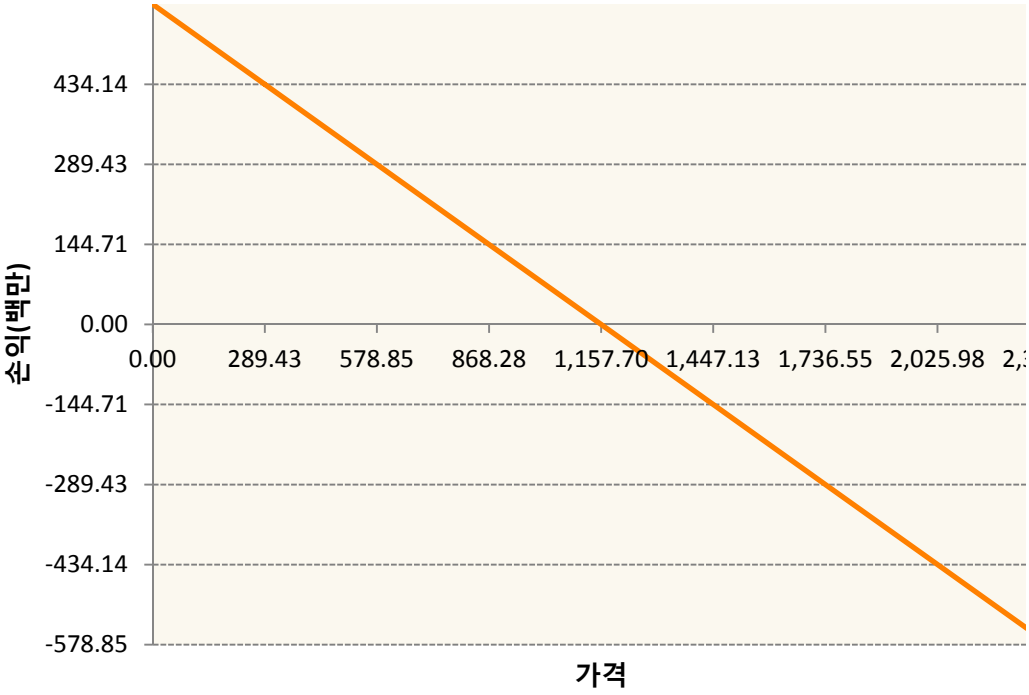

-1,158.90
-1,738.35
-2,317.80
가격


CTH7-COTTON NO.2 FUTR MAR17
329.03
219.35
109.68
0.00
-109.68
-219.35
-329.03
-438.71
0.00
18.74
37.47
56.21
74.94
93.68
112.41
131.15
순익(백만)
가격

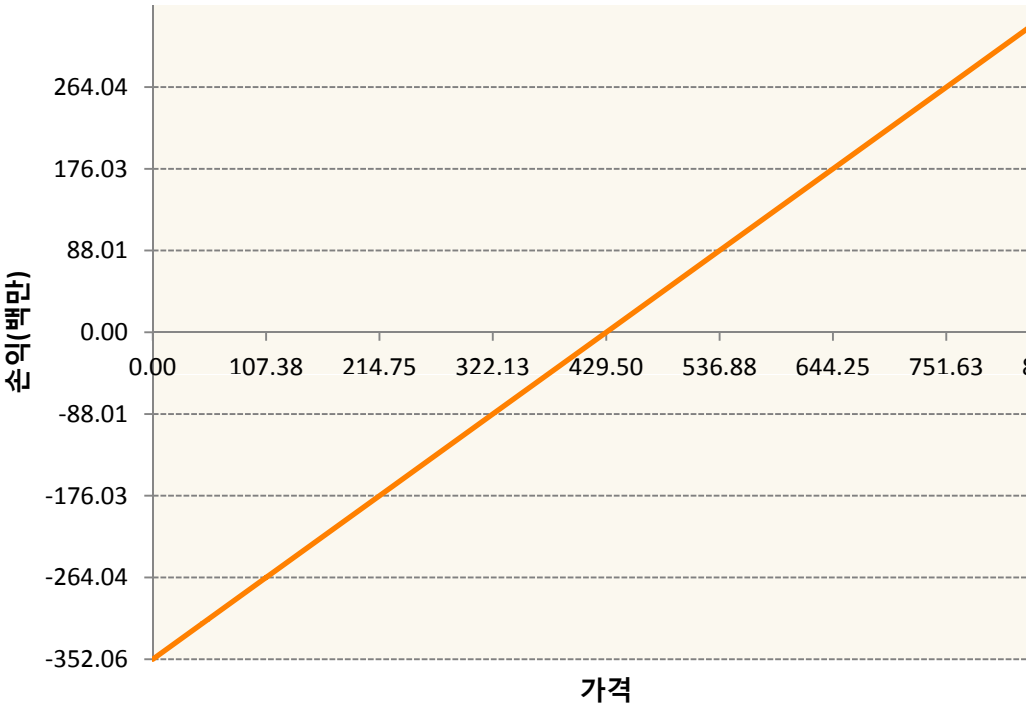

KCH7-COFFEE "C" FUTURE MAR17
789.06
591.80
394.53
197.27
0.00
-197.27
-394.53
-591.80
-789.06
0.00
37.39
74.78
112.16
149.55
186.94
224.33
261.71
순익(백만)

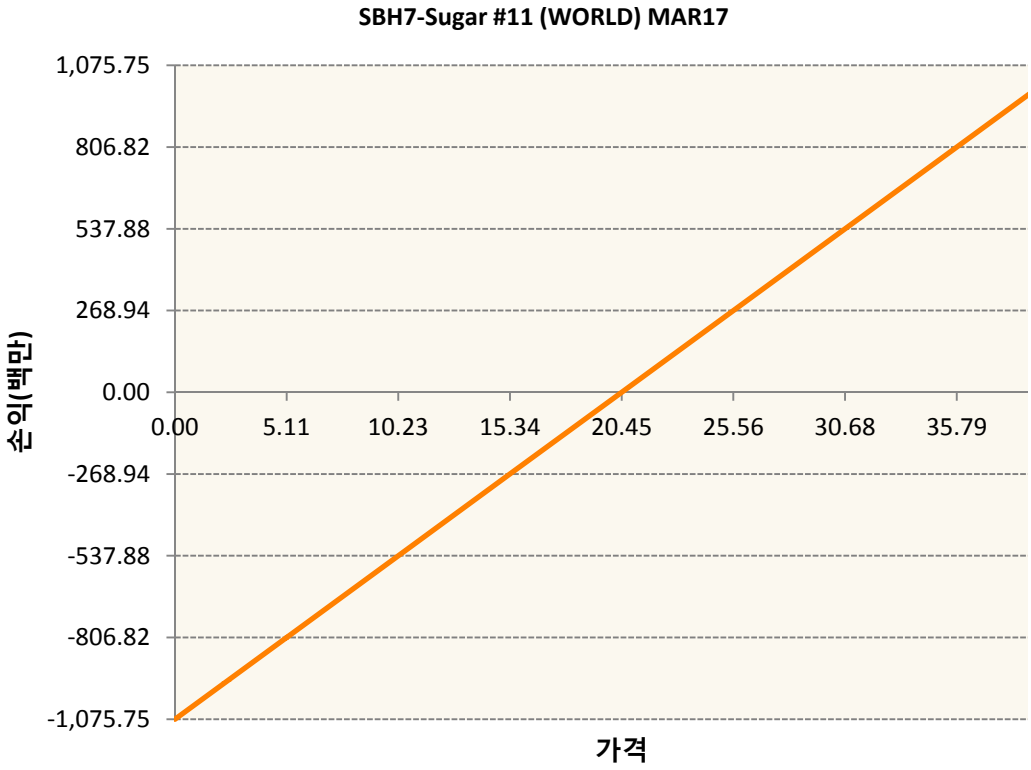
가격

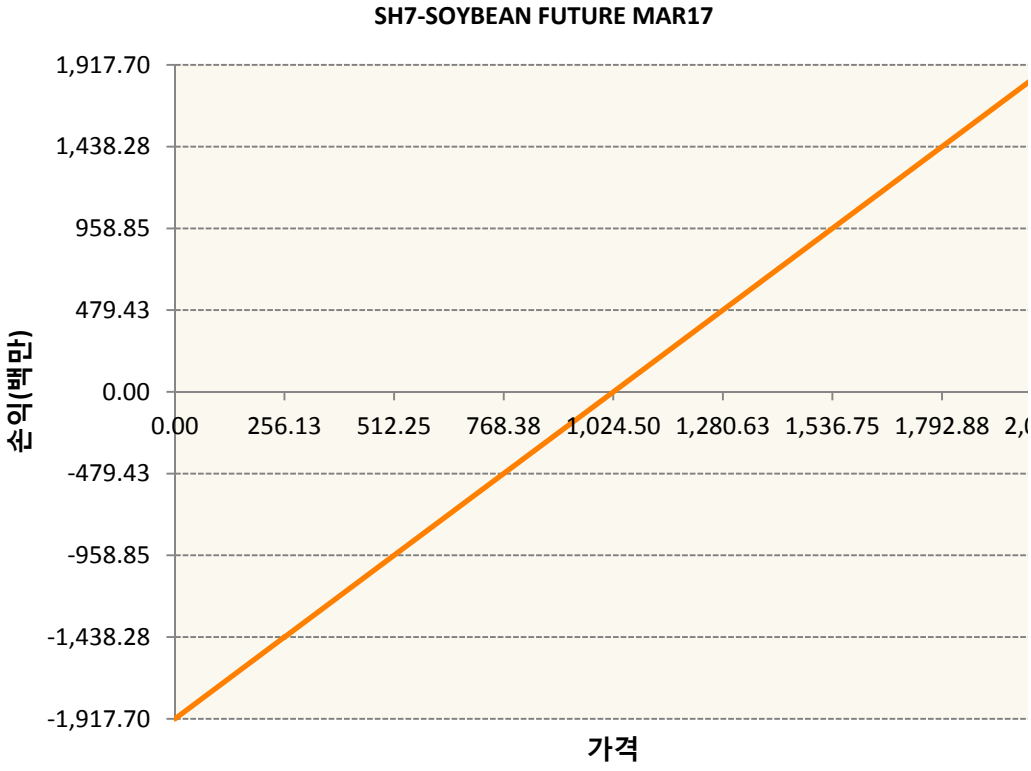
KR4175M20009-2017-02 달러선물



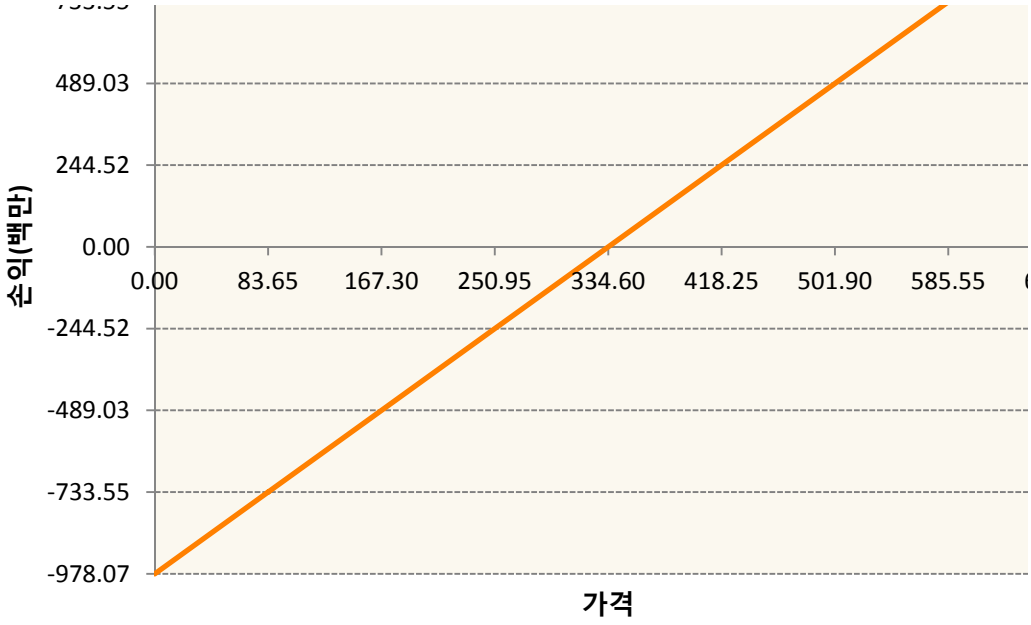
KWH7-KC HRW WHEAT FUT MAR17

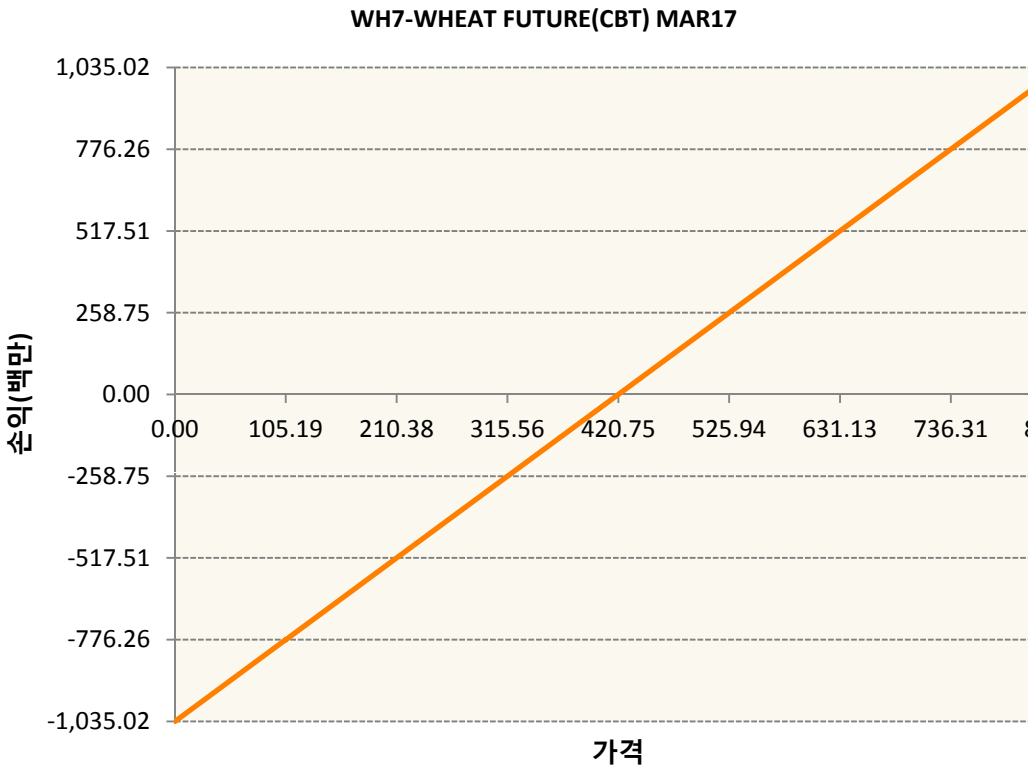



SBH7-Sugar #11 (WORLD) MAR17
1,075.75
806.82
537.88
268.94
0.00
-268.94
-537.88
-806.82
-1,075.75
0.00
5.11
10.23
15.34
20.45
25.56
30.68
35.79
손익(백만)
가격


SH7-SOYBEAN FUTURE MAR17
1,917.70
1,438.28
958.85
479.43
0.00
-479.43
-958.85
-1,438.28
-1,917.70
0.00
256.13
512.25
768.38
1,024.50
1,280.63
1,536.75
1,792.88
손익(백만)
가격


SMH7-SOYBEAN MEAL FUTR MAR17
733.55





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

BOH7	SOYBEAN OIL FUTR MAR17	70
CH7	CORN FUTURE MAR17	185
CTH7	COTTON NO.2 FUTR MAR17	35
KCH7	COFFEE "C" FUTURE MAR17	63
KR4175M20(	2017-02 달러선물	46

KWH7	KC HRW WHEAT FUT MAR17	28
SBH7	Sugar #11 (WORLD) MAR17	86
SH7	SOYBEAN FUTURE MAR17	153
SMH7	SOYBEAN MEAL FUTR MAR17	78
WH7	WHEAT FUTURE(CBT) MAR17	83

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

927