공시일	2017-02-03
기준일	2017-02-02

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	2017-02-03
기준일	2017-02-02

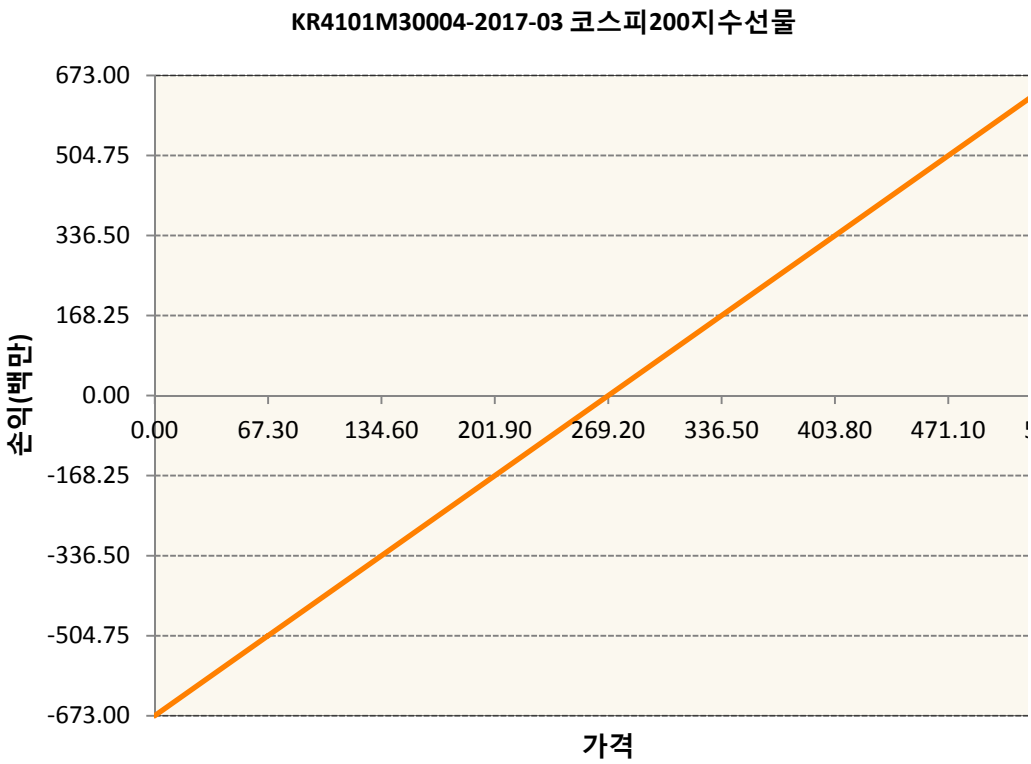
스마트인덱스모

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	2017-02-03
기준일	2017-02-02

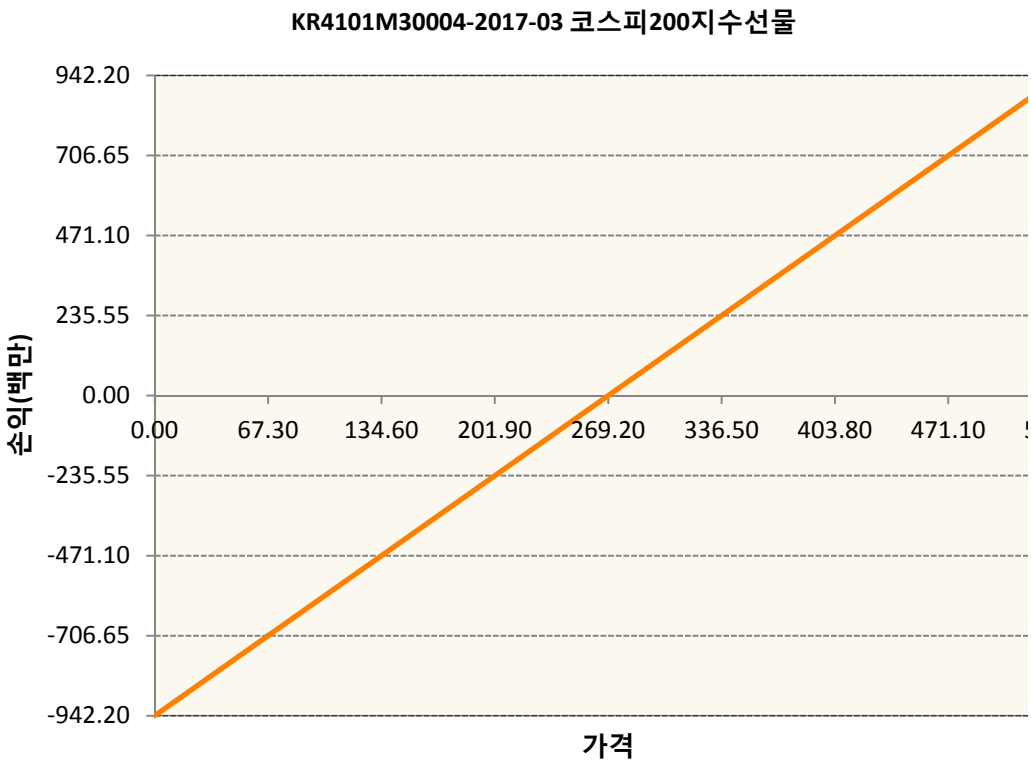
스마트레버리지목표전환형1호

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	2017-02-03
기준일	2017-02-02

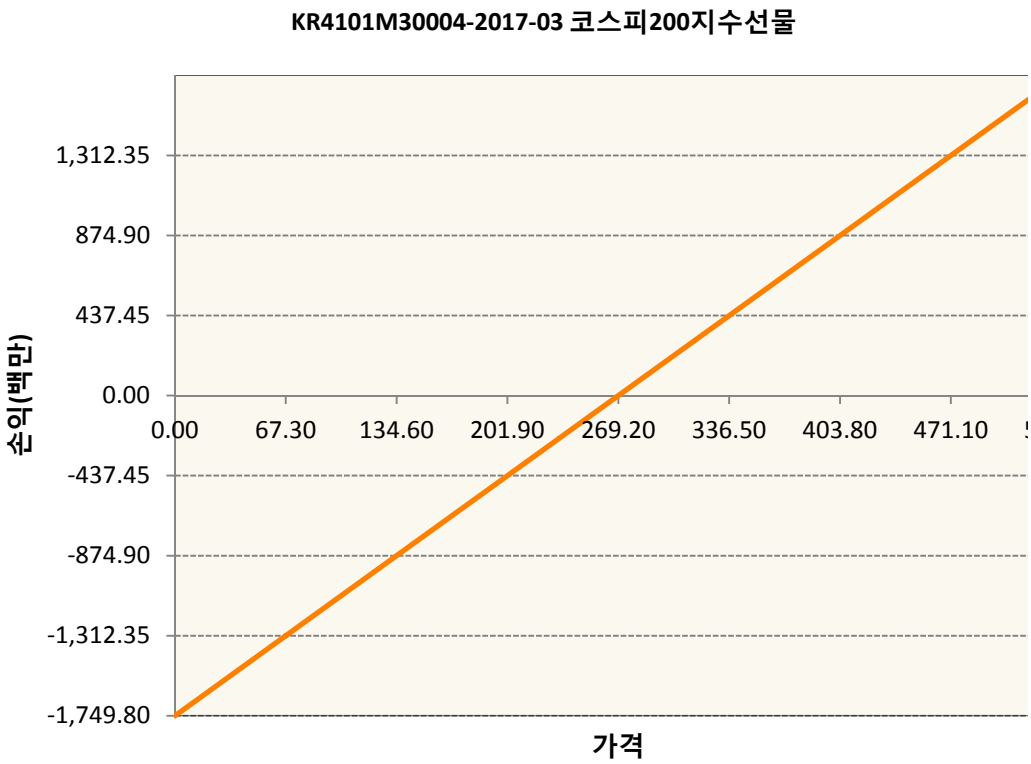
1.3배 레버리지 인덱스(주식-파생형)

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							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)

96

공시일	2017-02-03
기준일	2017-02-02

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	2017-02-03
기준일	2017-02-02

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)

547

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-02-03
기준일	2017-02-02

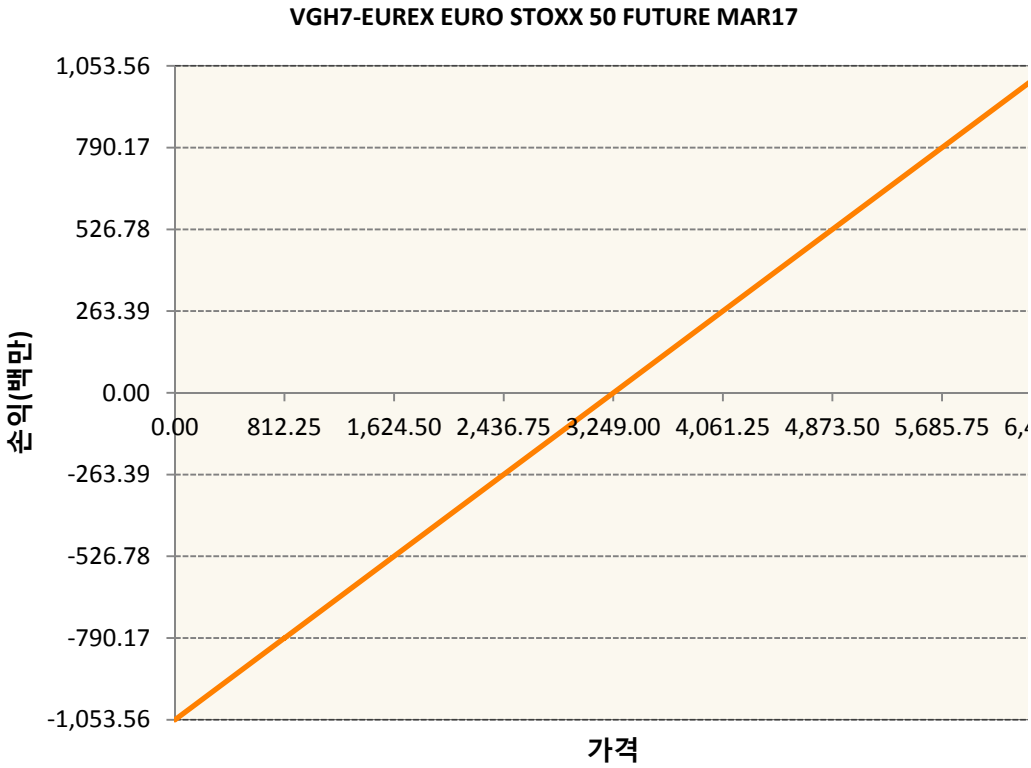
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,054	0	1,054	

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	2017-02-03
기준일	2017-02-02

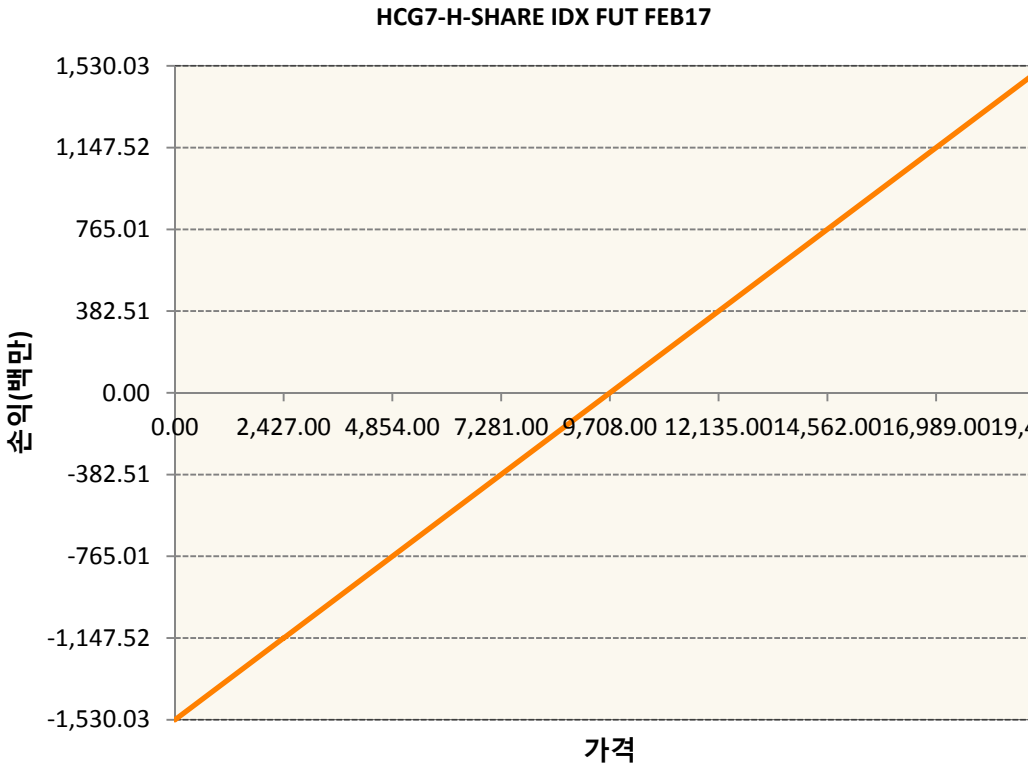
차이나인덱스모(주식-파생형)

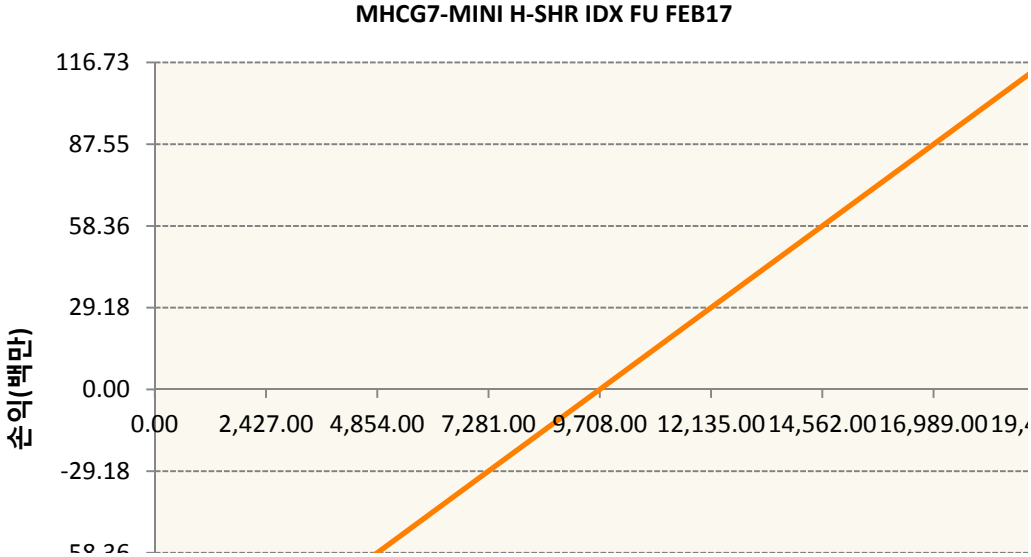
1. 계약금액

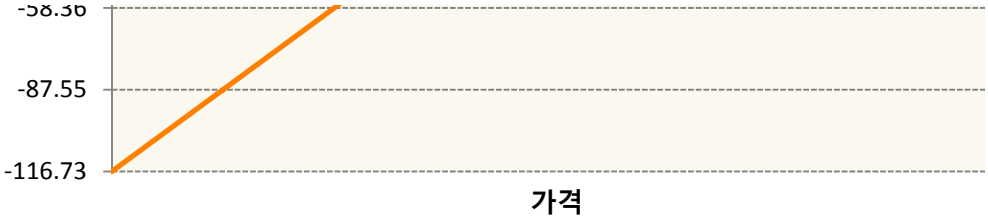
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,647	0	1,647	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCG7	H-SHARE IDX FUT FEB17	122
MHCG7	MINI H-SHR IDX FU FEB17	9

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	159

공시일	2017-02-03
기준일	2017-02-02

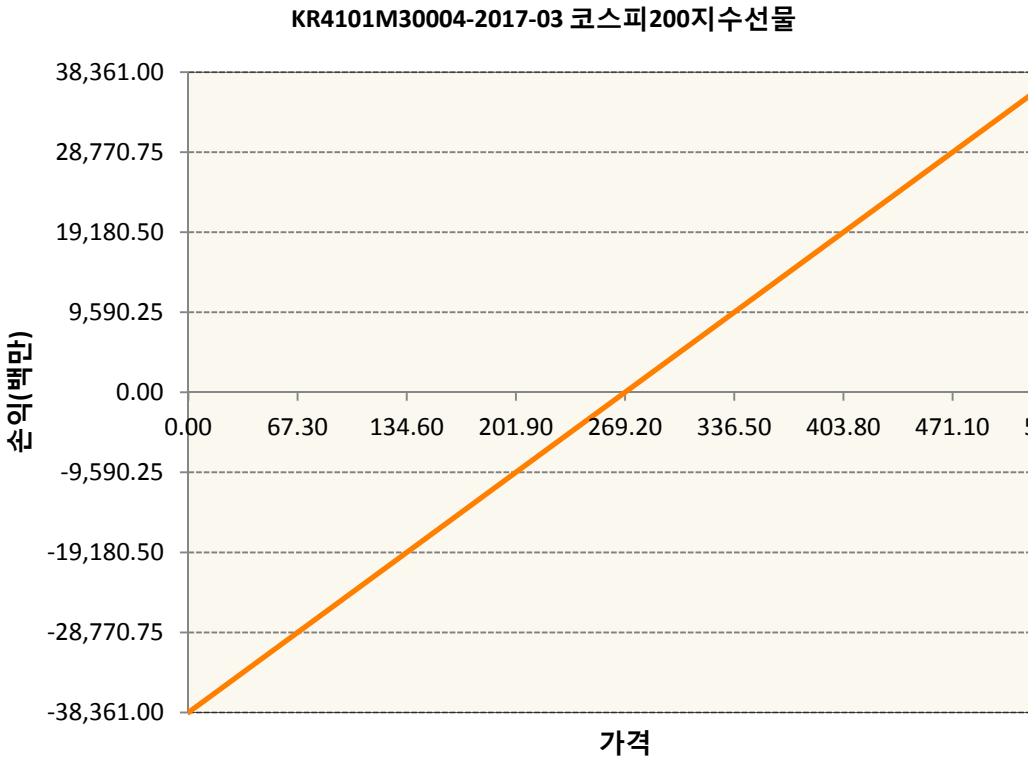
커버드콜(주식혼합-파생형)

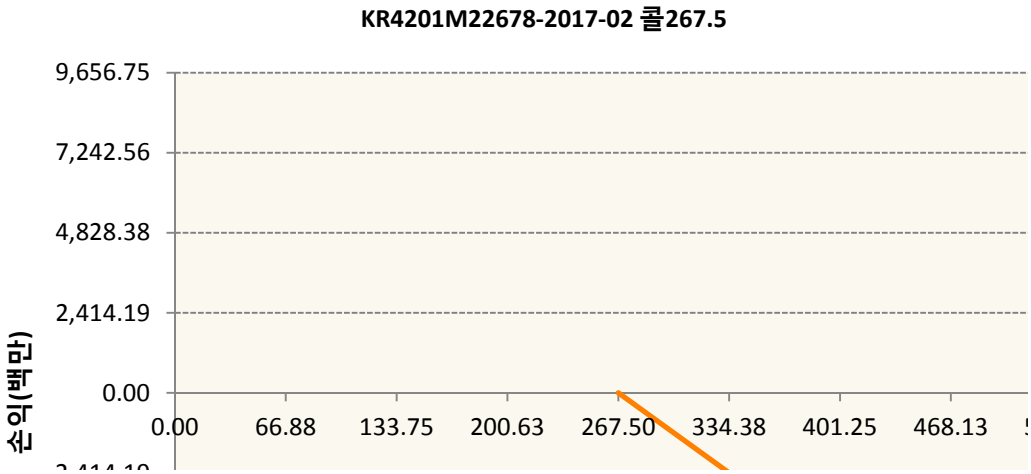
1. 계약금액

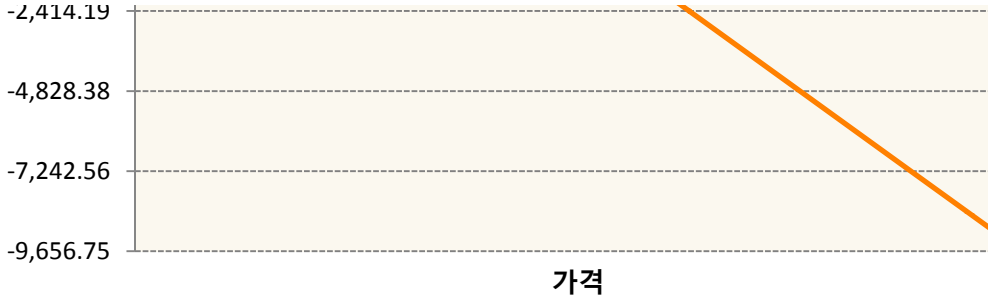
(단위:백만원)

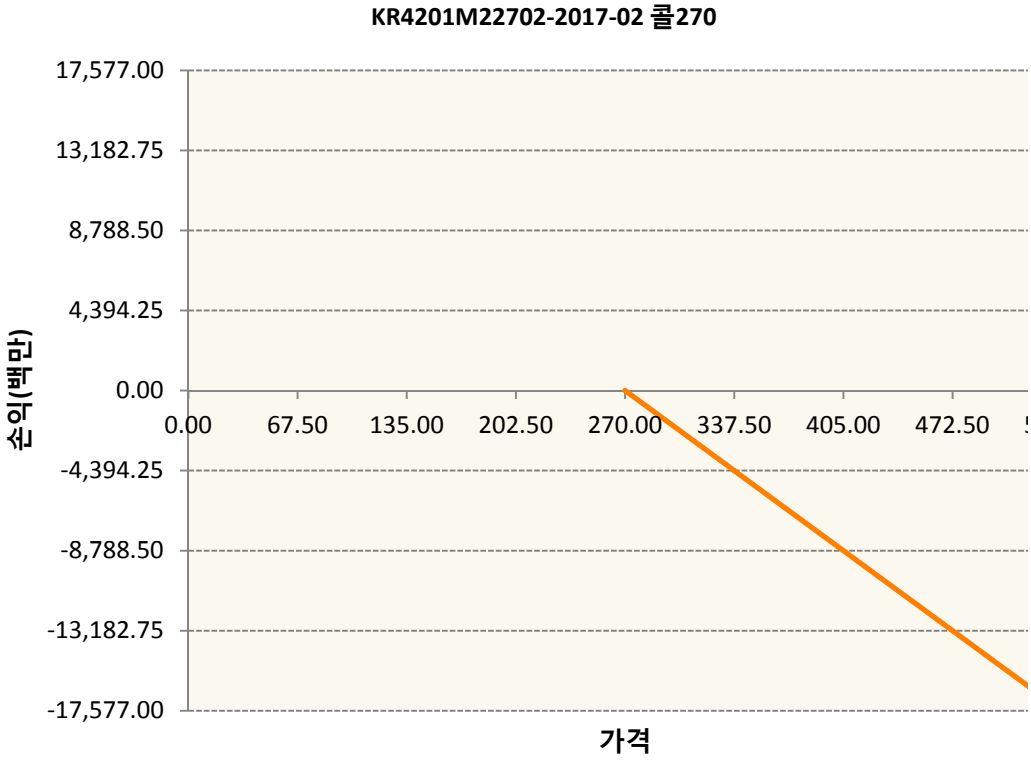
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	2,689	0	2,689	장내
신규	유가증권	옵션	0	542	-542	장내
누계	유가증권	선물	38,361	0	38,361	장내
누계	유가증권	옵션	0	27,234	-27,234	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101M30(2017-03 코스피200지수선물							3,061
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-3,061	-3,061	-3,061	-3,061	-3,061	-3,061	-3,061
-5.33%	-2,041	-2,041	-2,041	-2,041	-2,041	-2,041	-2,041
-2.67%	-1,020	-1,020	-1,020	-1,020	-1,020	-1,020	-1,020
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	1,020	1,020	1,020	1,020	1,020	1,020	1,020
5.33%	2,041	2,041	2,041	2,041	2,041	2,041	2,041
8.00%	3,061	3,061	3,061	3,061	3,061	3,061	3,061
KR4201M22(2017-02 콜267.5							3,639
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	414	414	414	414	414	414	414
-5.33%	414	414	414	414	414	413	412
-2.67%	408	402	395	387	376	365	351
0%	77	51	26	0	-26	-52	-78
2.67%	-1,056	-1,058	-1,061	-1,066	-1,072	-1,079	-1,088
5.33%	-2,347	-2,347	-2,347	-2,347	-2,347	-2,347	-2,348
8.00%	-3,639	-3,639	-3,639	-3,639	-3,639	-3,639	-3,639
KR4201M22 2017-02 콜270							6,133

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	362	362	362	362	362	362	362
-5.33%	362	362	362	362	362	362	362
-2.67%	361	359	355	350	342	332	320
0%	133	89	45	0	-45	-91	-137
2.67%	-1,495	-1,509	-1,526	-1,547	-1,570	-1,596	-1,625
5.33%	-3,803	-3,803	-3,804	-3,804	-3,806	-3,808	-3,811
8.00%	-6,133	-6,133	-6,133	-6,133	-6,133	-6,133	-6,133

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

15,285

공시일	2017-02-03
기준일	2017-02-02

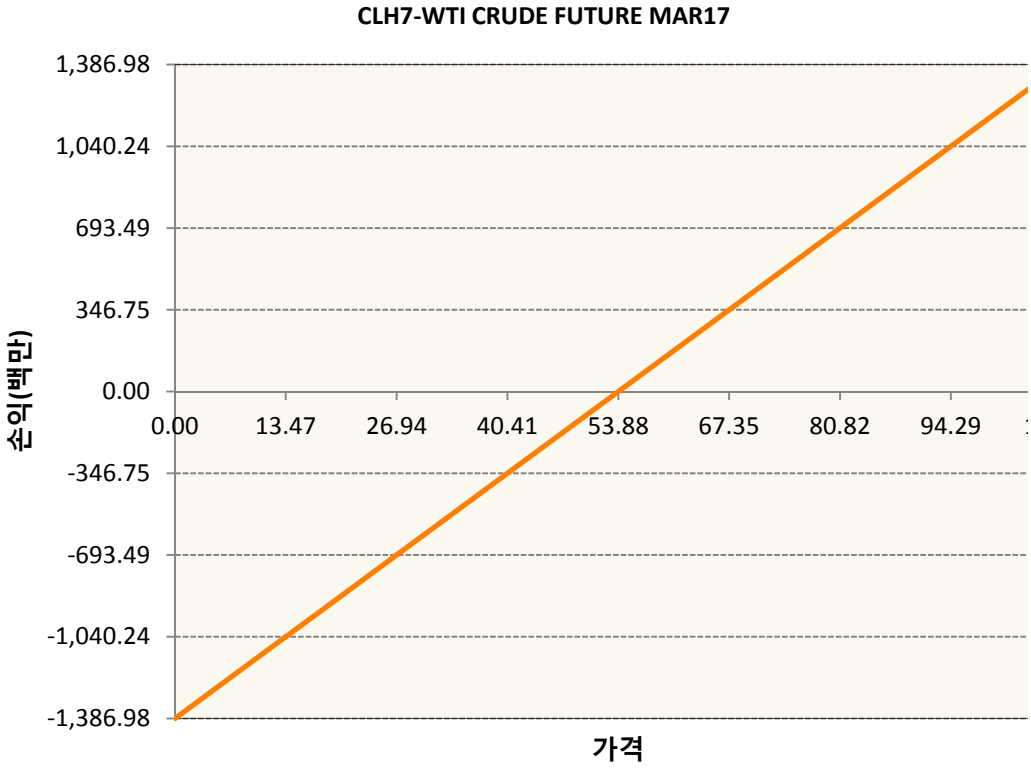
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

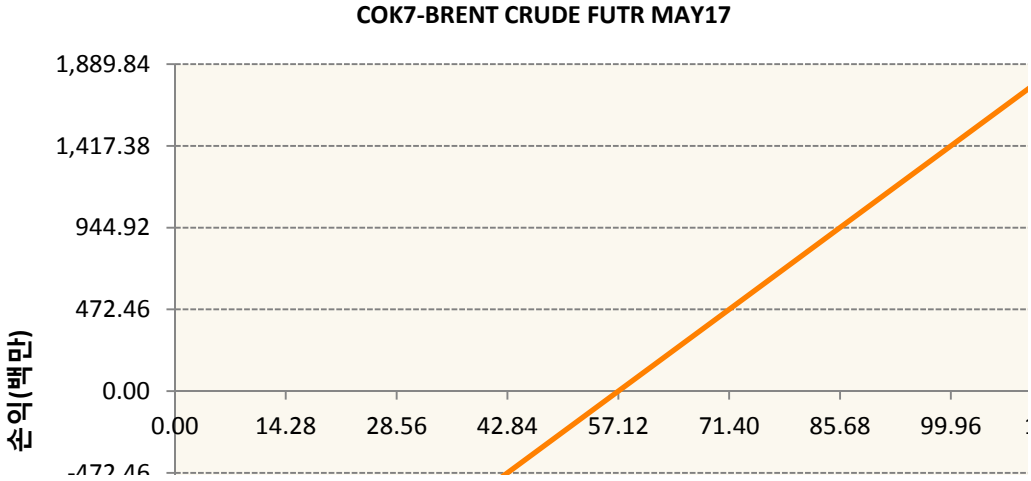
1. 계약금액

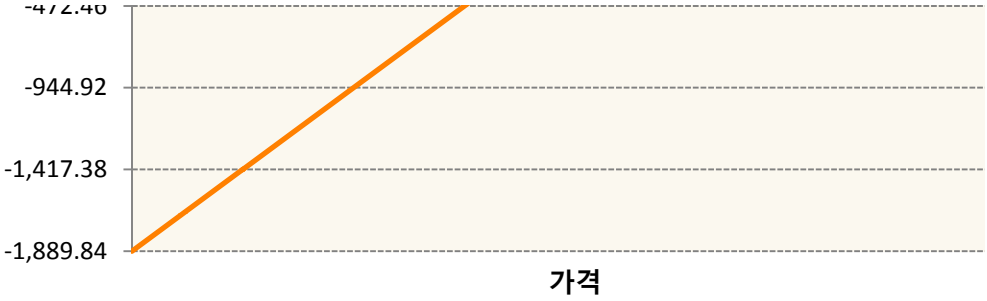
(단위:백만원)

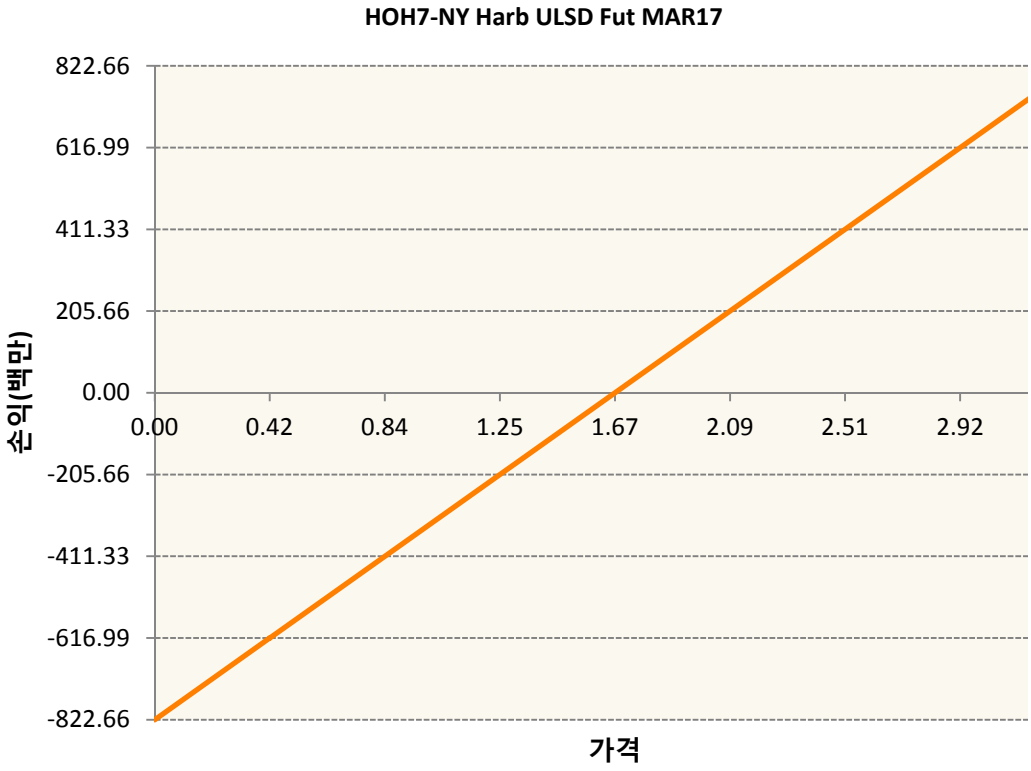
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	선물	유가증권	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	선물	유가증권	1,387	0	1,387	
누계	유가증권	선물	5,044	412	4,632	

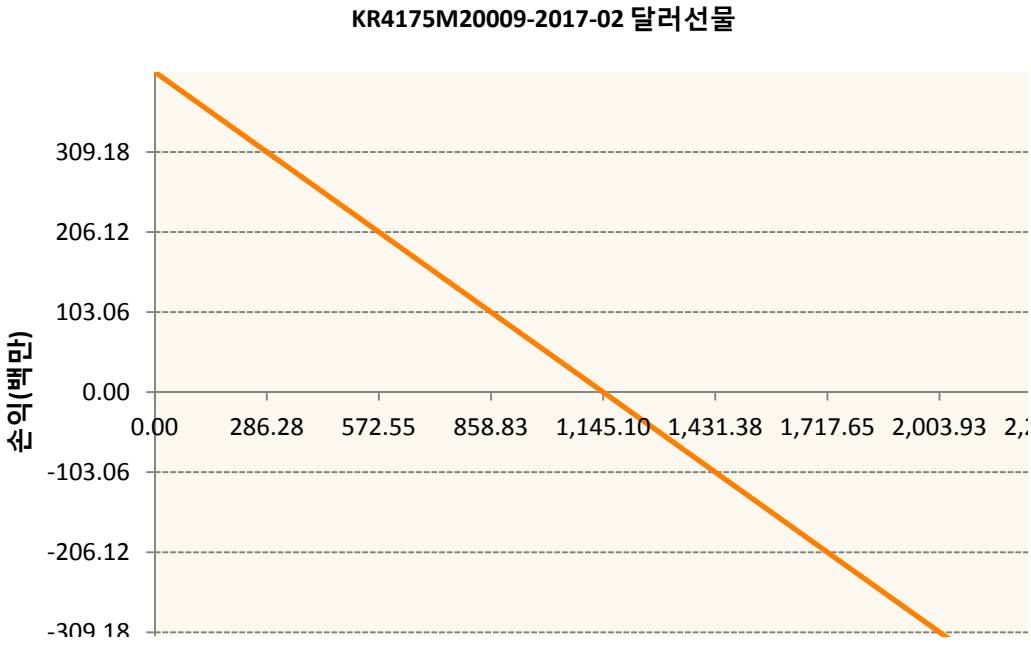
2. 만기시점의 손익구조

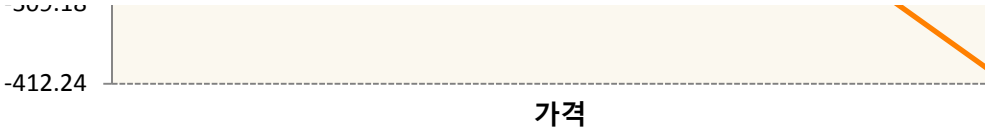


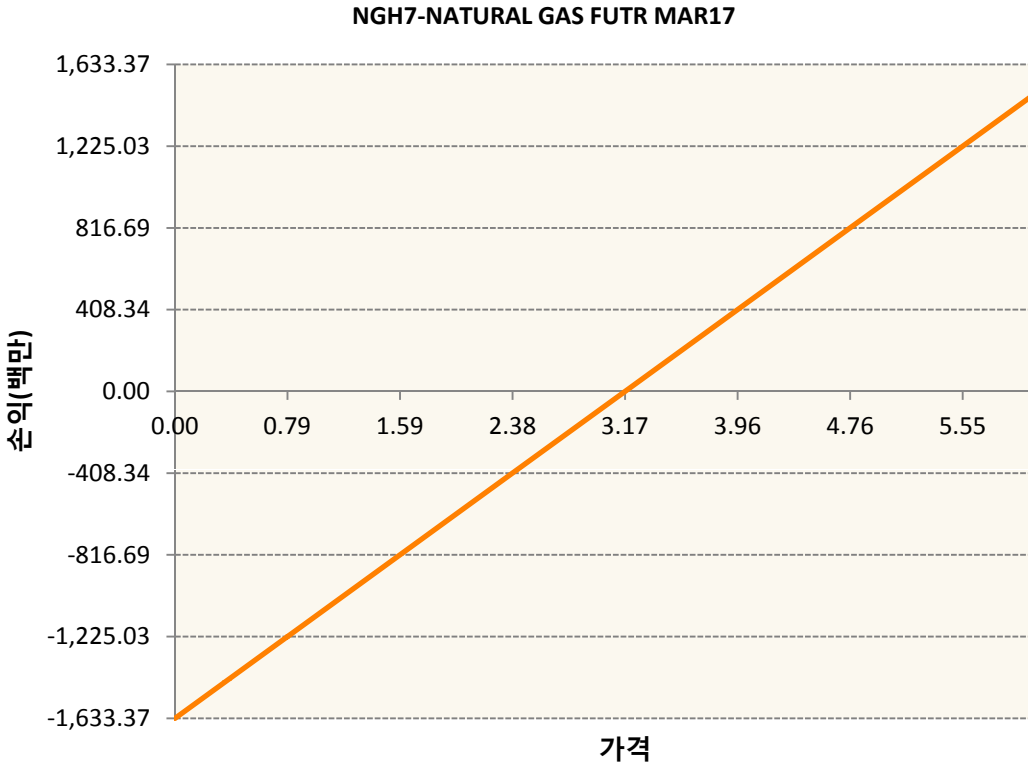


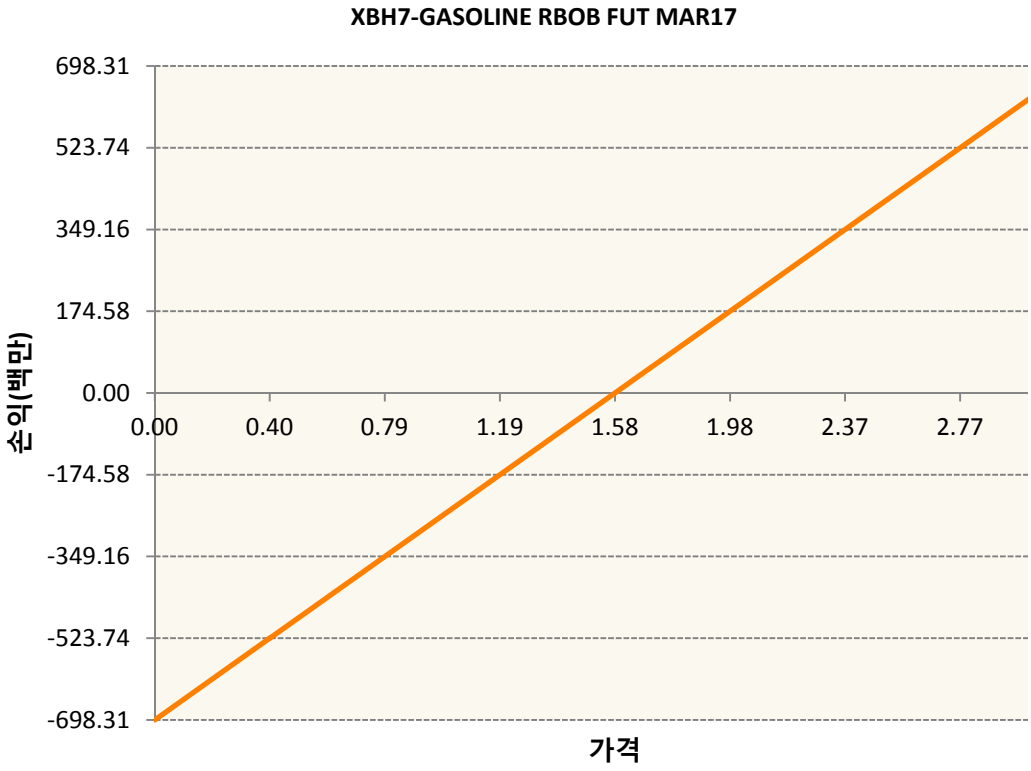

-944.92
-1,417.38
-1,889.84
가격


HOH7-NY Harb ULSD Fut MAR17
822.66
616.99
411.33
205.66
0.00
-205.66
-411.33
-616.99
-822.66
0.00
0.42
0.84
1.25
1.67
2.09
2.51
2.92
순익(백만)
가격


KR4175M20009-2017-02 달러선물
309.18
206.12
103.06
0.00
-103.06
-206.12
0.00
286.28
572.55
858.83
1,145.10
1,431.38
1,717.65
2,003.93
순익(백만)


-412.24
가격


NGH7-NATURAL GAS FUTR MAR17
1,633.37
1,225.03
816.69
408.34
0.00
-408.34
-816.69
-1,225.03
-1,633.37
0.00
0.79
1.59
2.38
3.17
3.96
4.76
5.55
순익(백만)
가격


XBH7-GASOLINE RBOB FUT MAR17
698.31
523.74
349.16
174.58
0.00
-174.58
-349.16
-523.74
-698.31
0.00
0.40
0.79
1.19
1.58
1.98
2.37
2.77
순익(백만)
가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLH7	WTI CRUDE FUTURE MAR17	111
COK7	BRENT CRUDE FUTR MAY17	151
HOH7	NY Harb ULSD Fut MAR17	66
KR4175M20(	2017-02 달러선물	33
NGH7	NATURAL GAS FUTR MAR17	131
XBH7	GASOLINE RBOB FUT MAR17	56

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

1,162

공시일	2017-02-03
기준일	2017-02-02

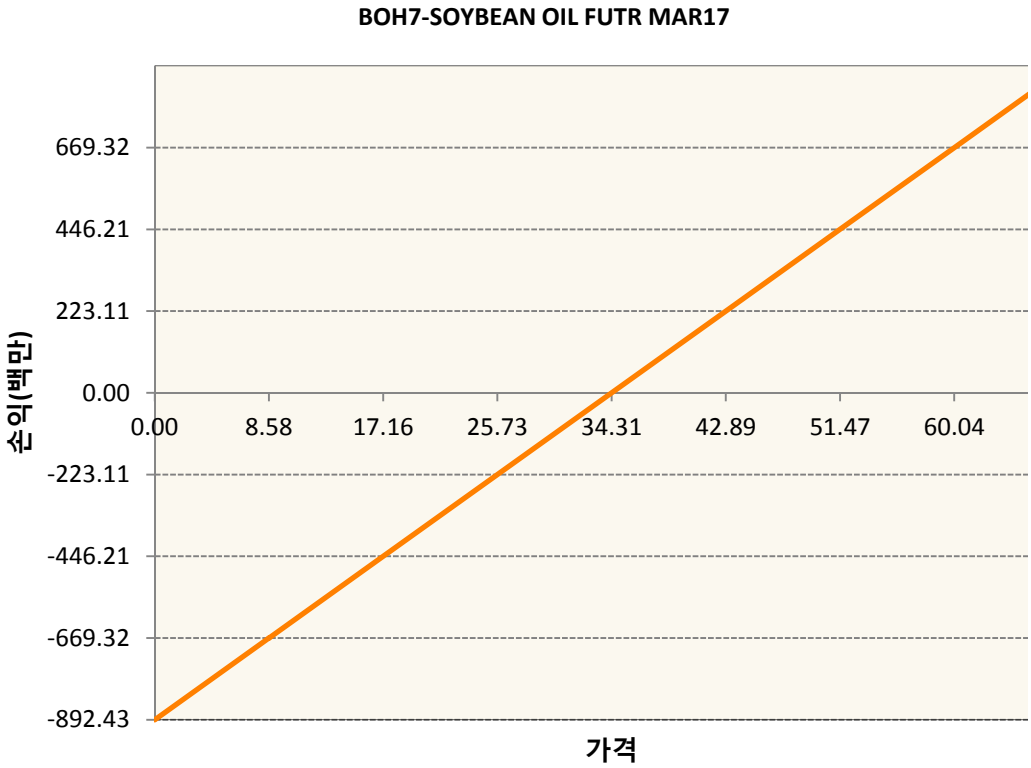
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

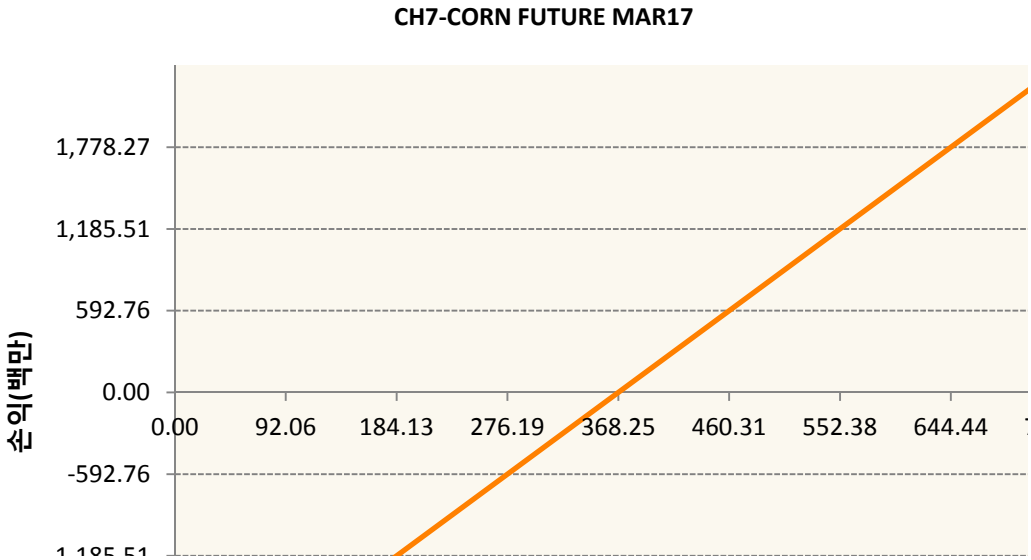
1. 계약금액

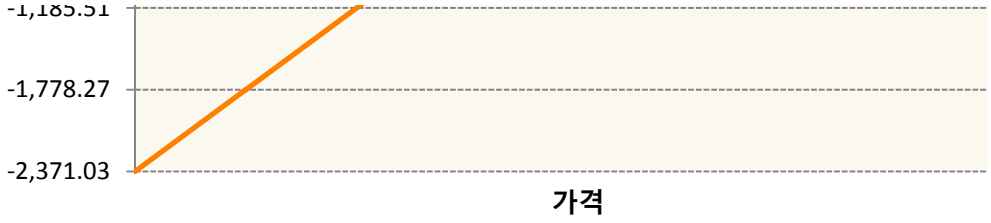
(단위:백만원)

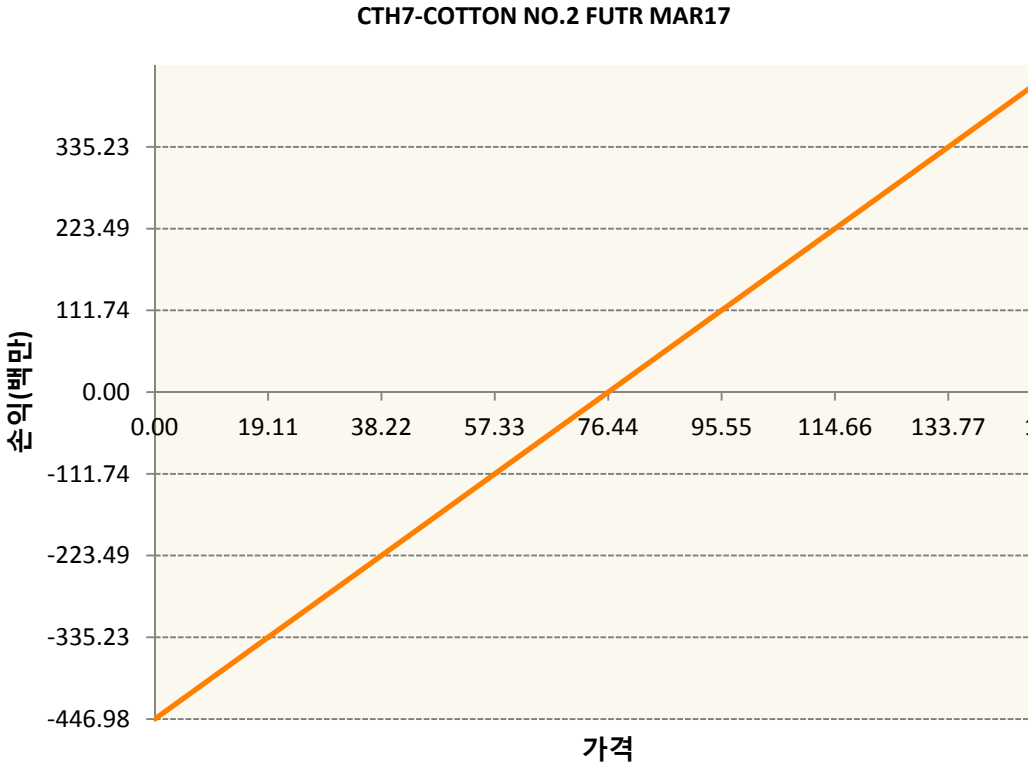
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	9,950	573	9,377	

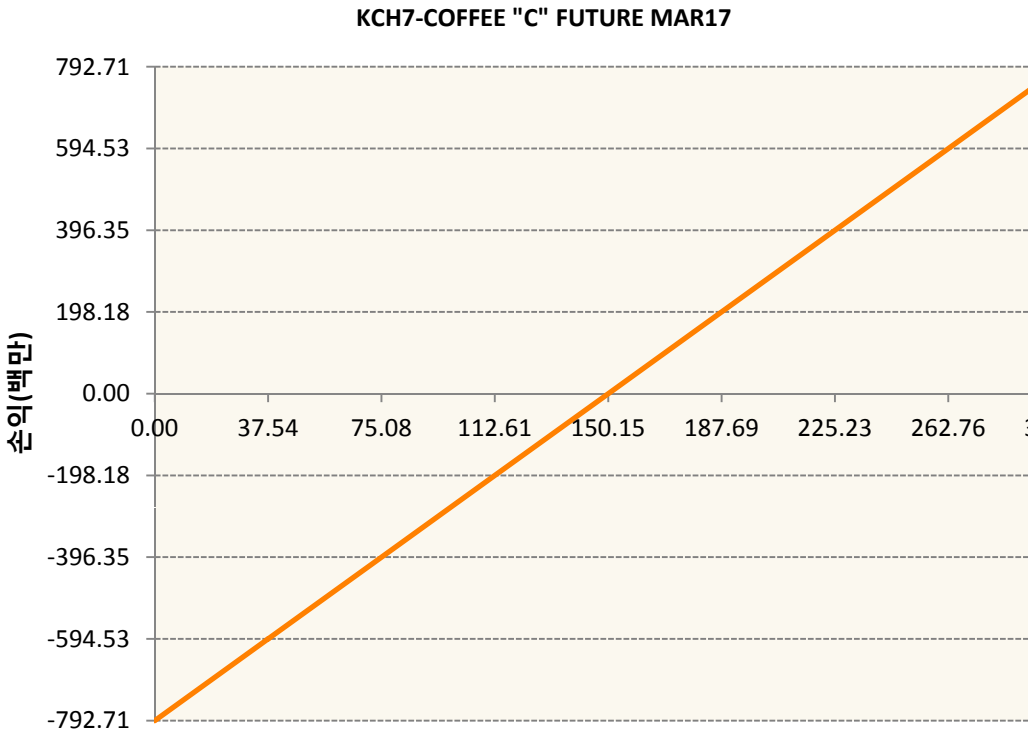
2. 만기시점의 손익구조





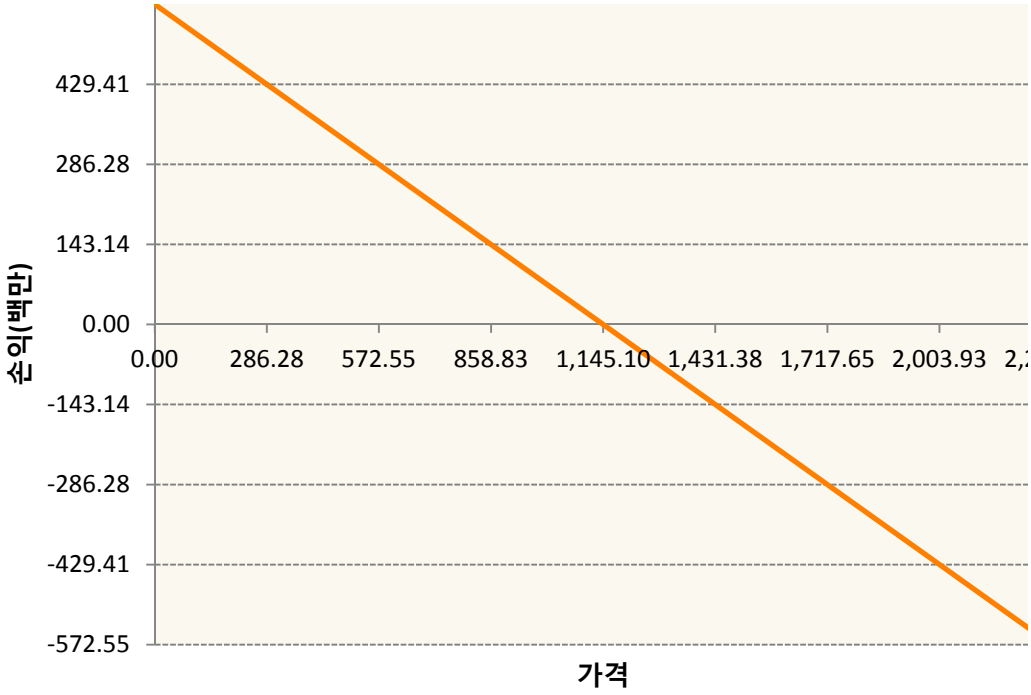

-1,778.27
-2,371.03
가격


CTH7-COTTON NO.2 FUTR MAR17
335.23
223.49
111.74
0.00
-111.74
-223.49
-335.23
-446.98
0.00
19.11
38.22
57.33
76.44
95.55
114.66
133.77
순익(백만)
가격

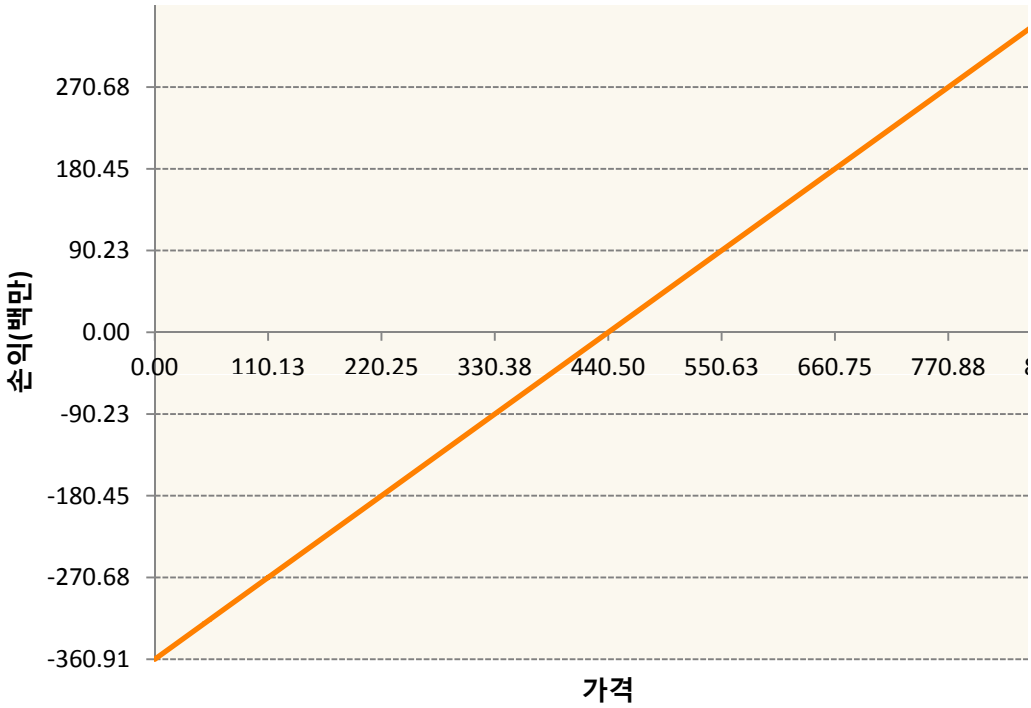

KCH7-COFFEE "C" FUTURE MAR17
792.71
594.53
396.35
198.18
0.00
-198.18
-396.35
-594.53
-792.71
0.00
37.54
75.08
112.61
150.15
187.69
225.23
262.76
순익(백만)

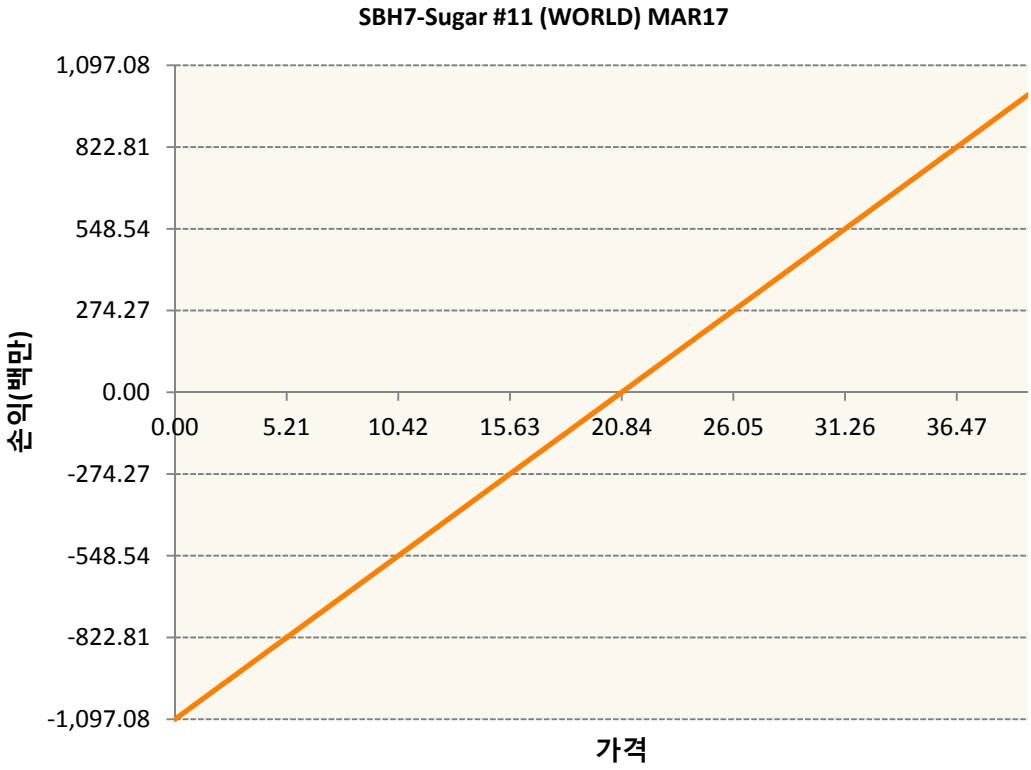
가격

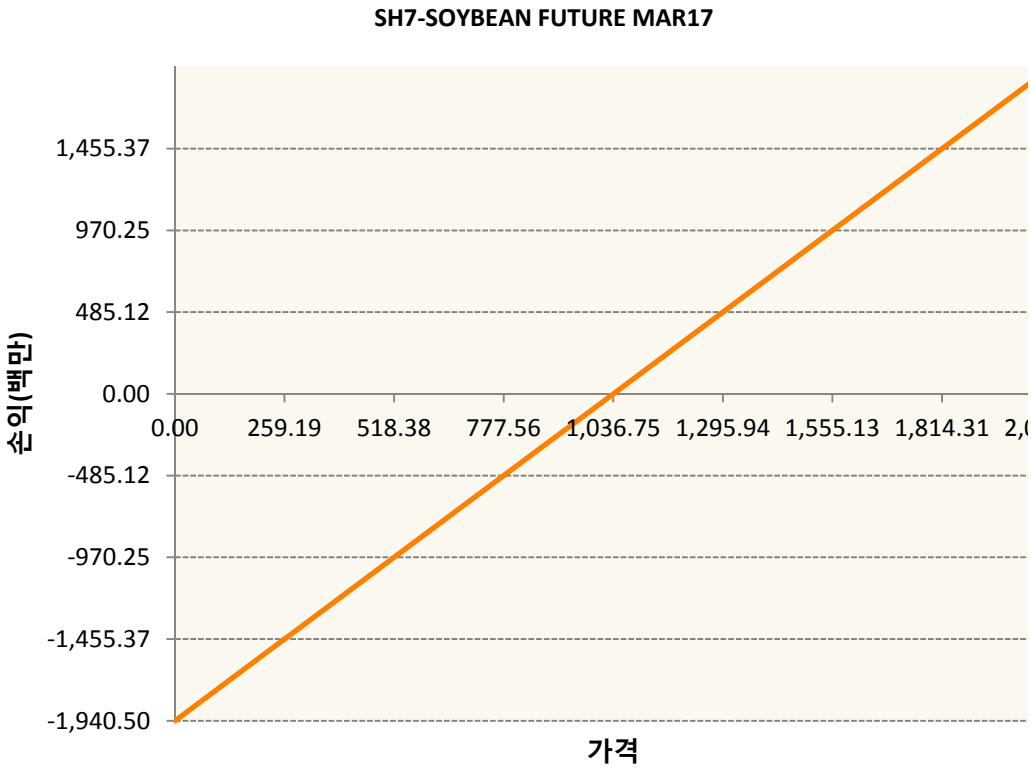
KR4175M20009-2017-02 달러선물

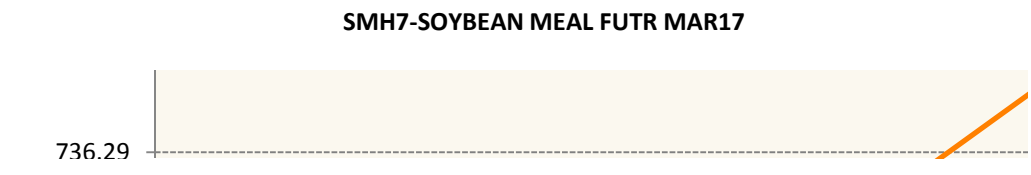


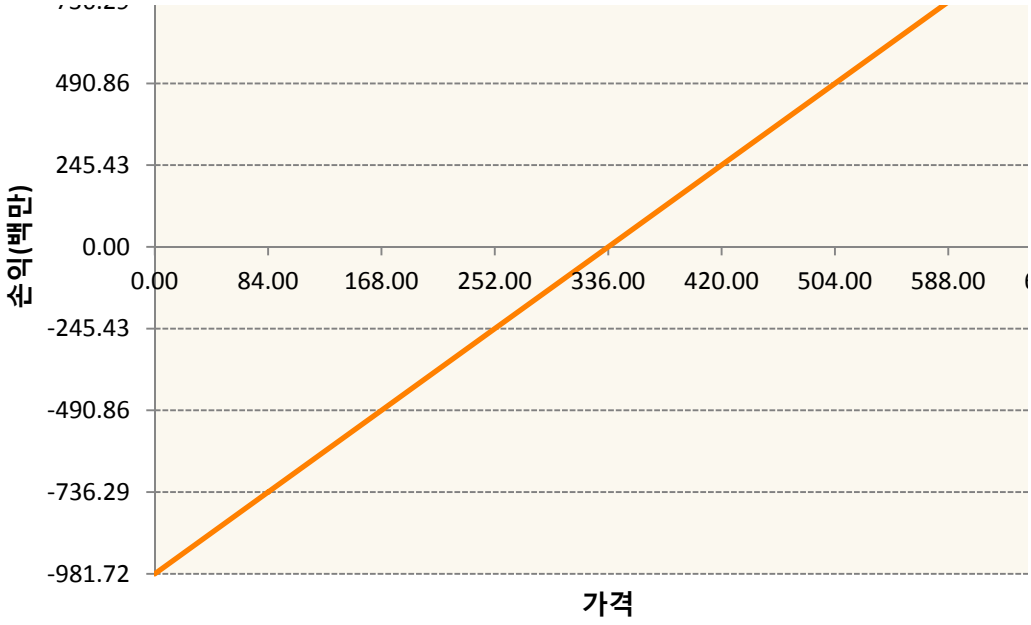
KWH7-KC HRW WHEAT FUT MAR17

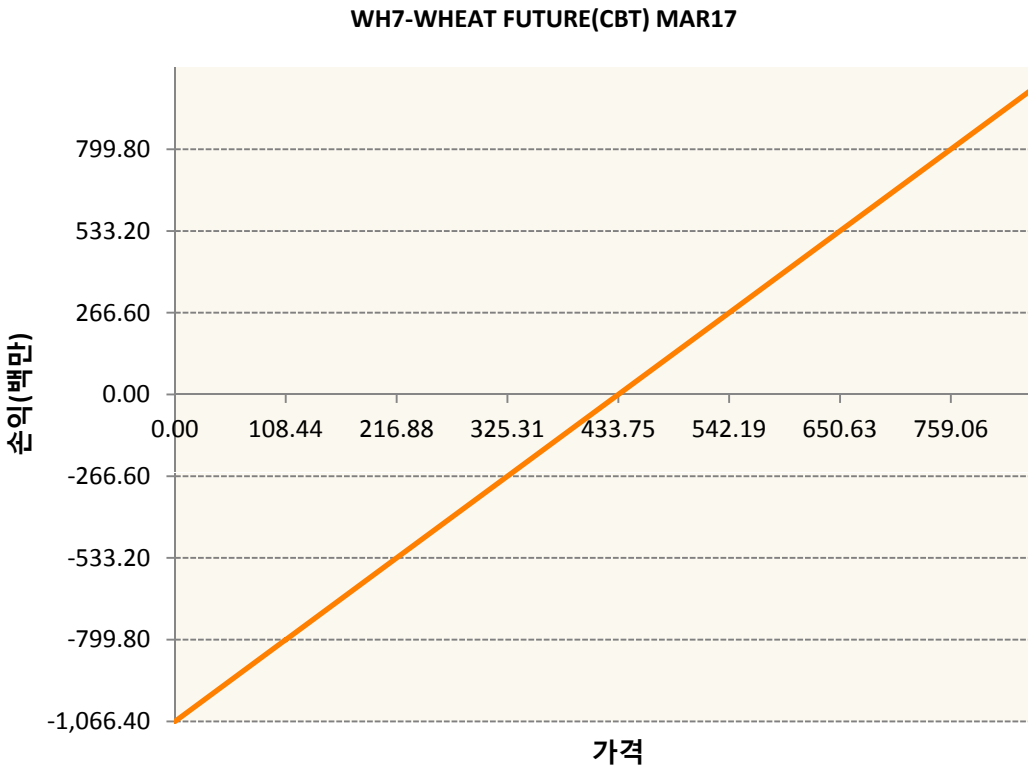



SBH7-Sugar #11 (WORLD) MAR17
1,097.08
822.81
548.54
274.27
0.00
-274.27
-548.54
-822.81
-1,097.08
0.00
5.21
10.42
15.63
20.84
26.05
31.26
36.47
손익(백만)
가격


SH7-SOYBEAN FUTURE MAR17
1,455.37
970.25
485.12
0.00
-485.12
-970.25
-1,455.37
-1,940.50
0.00
259.19
518.38
777.56
1,036.75
1,295.94
1,555.13
1,814.31
손익(백만)
가격


SMH7-SOYBEAN MEAL FUTR MAR17
736.29





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

BOH7	SOYBEAN OIL FUTR MAR17	71
CH7	CORN FUTURE MAR17	190
CTH7	COTTON NO.2 FUTR MAR17	36
KCH7	COFFEE "C" FUTURE MAR17	63
KR4175M20(	2017-02 달러선물	46

KWH7	KC HRW WHEAT FUT MAR17	29
SBH7	Sugar #11 (WORLD) MAR17	88
SH7	SOYBEAN FUTURE MAR17	155
SMH7	SOYBEAN MEAL FUTR MAR17	79
WH7	WHEAT FUTURE(CBT) MAR17	85

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

944