공시일	2017-02-06
기준일	2017-02-03

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	2017-02-06
기준일	2017-02-03

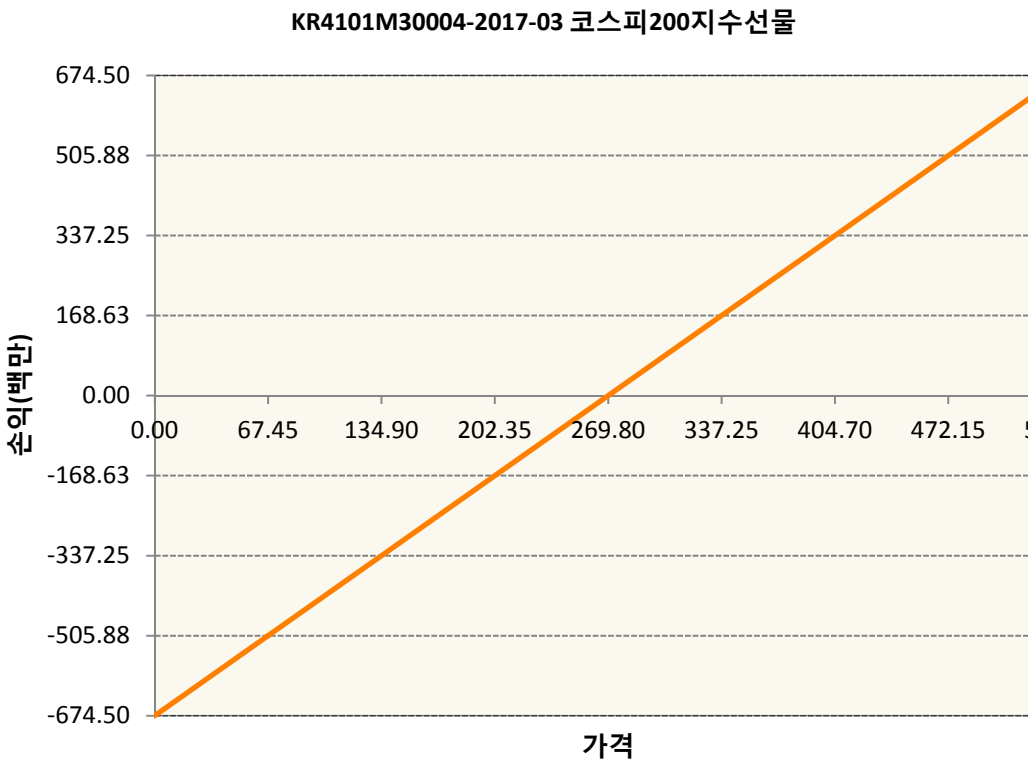
스마트인덱스모

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	675	0	675	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	2017-02-06
기준일	2017-02-03

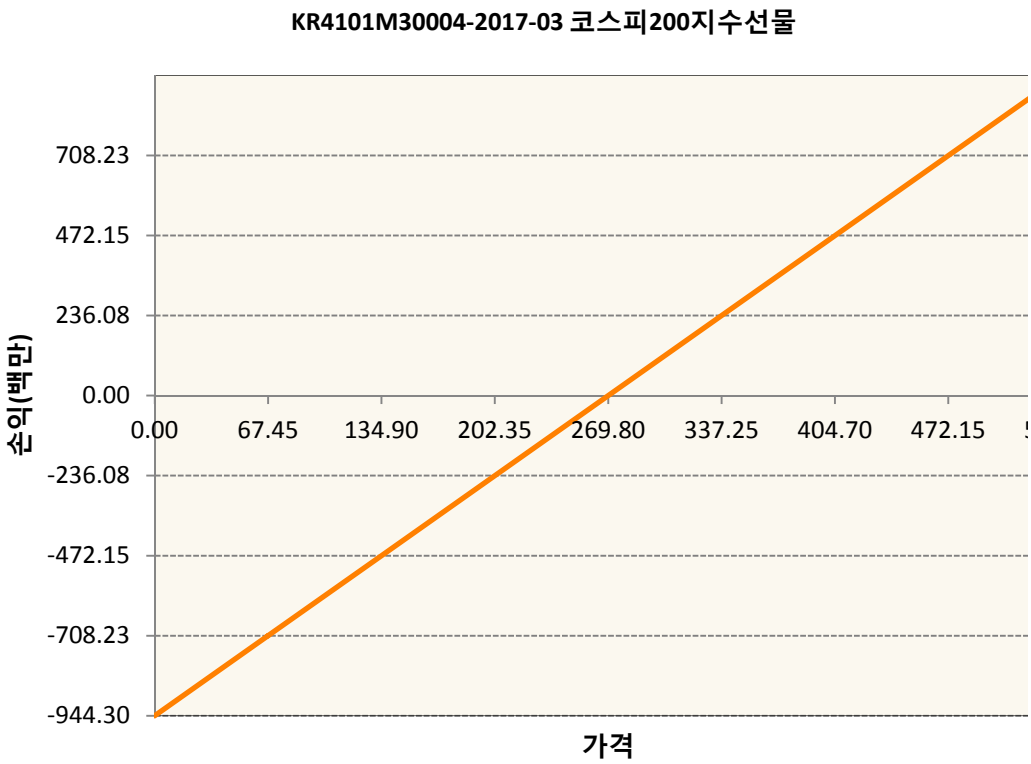
스마트레버리지목표전환형1호

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	944	0	944	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	2017-02-06
기준일	2017-02-03

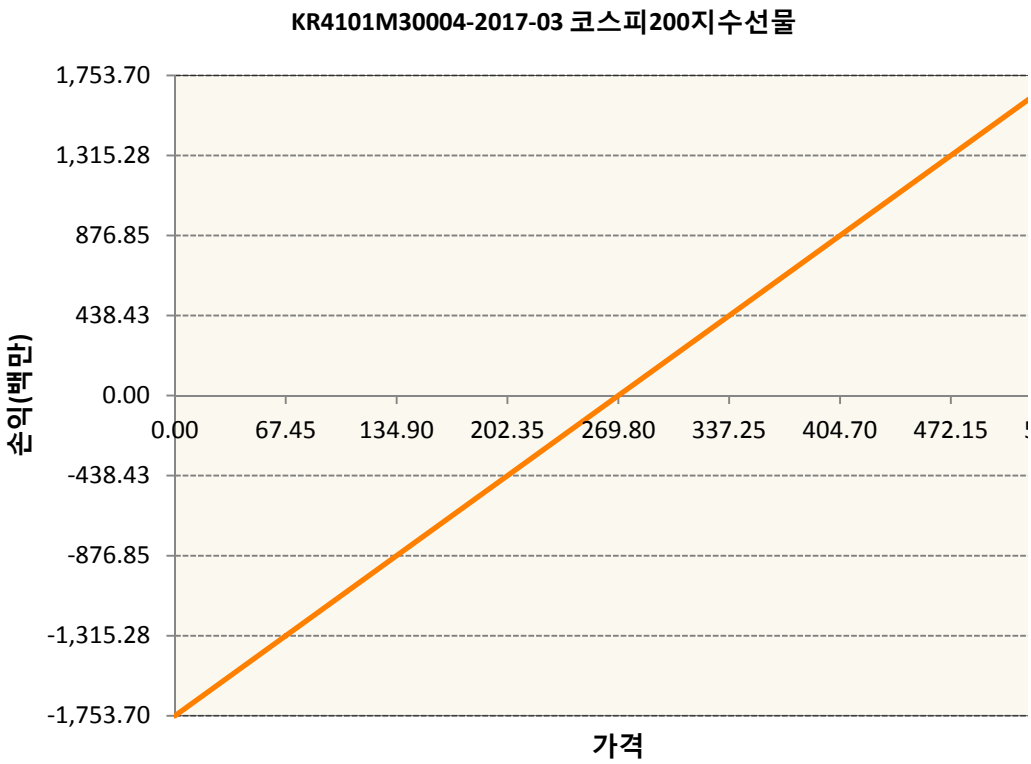
1.3배 레버리지 인덱스(주식-파생형)

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	1,754	0	1,754	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	2017-02-06
기준일	2017-02-03

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	926

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

661

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-02-06
기준일	2017-02-03

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)

541

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-02-06
기준일	2017-02-03

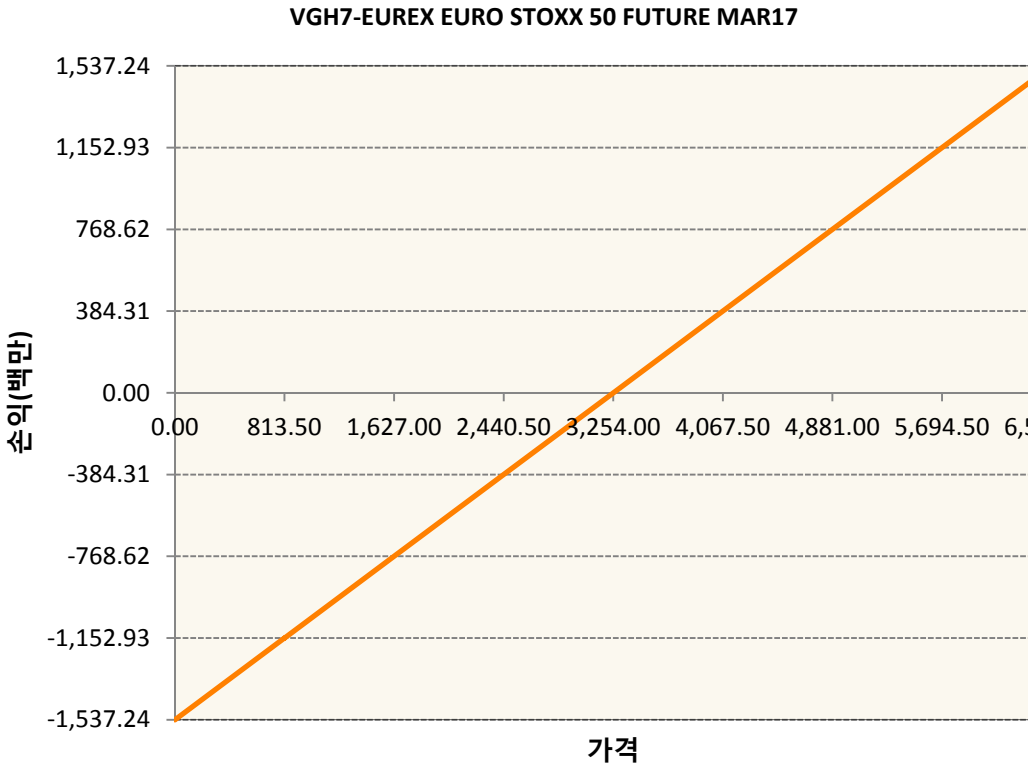
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,537	0	1,537	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGH7	EUREX EURO STOXX 50 FUTURE MAR17	123

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

(단위:백만원)

131

공시일	2017-02-06
기준일	2017-02-03

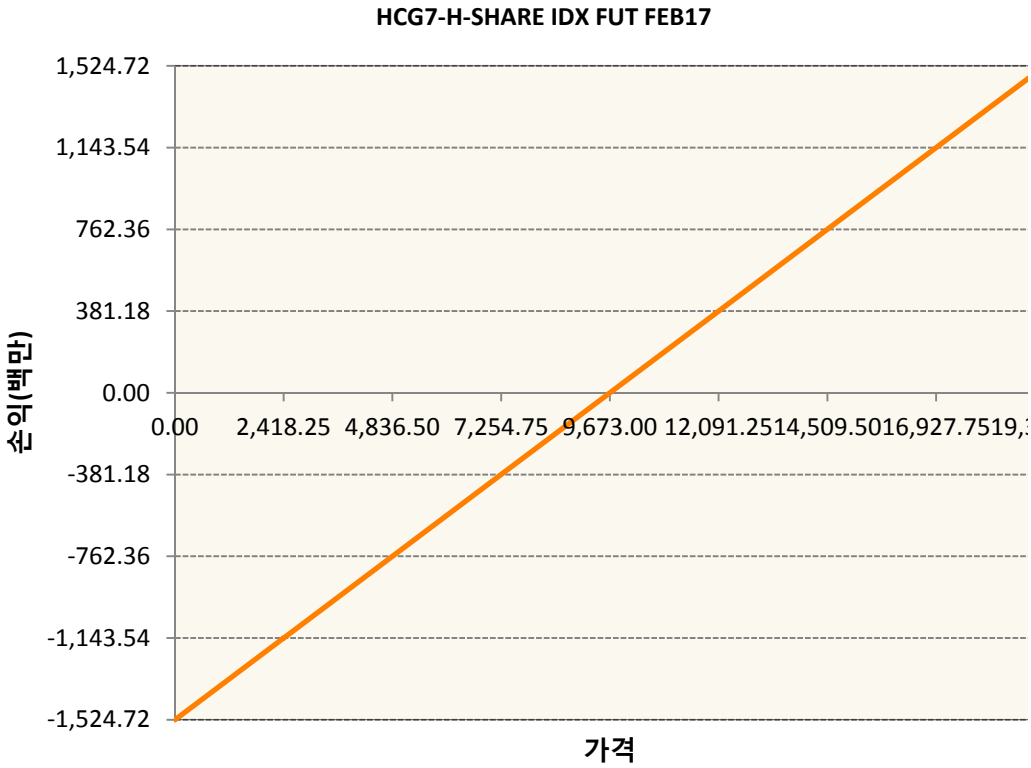
차이나인덱스모(주식-파생형)

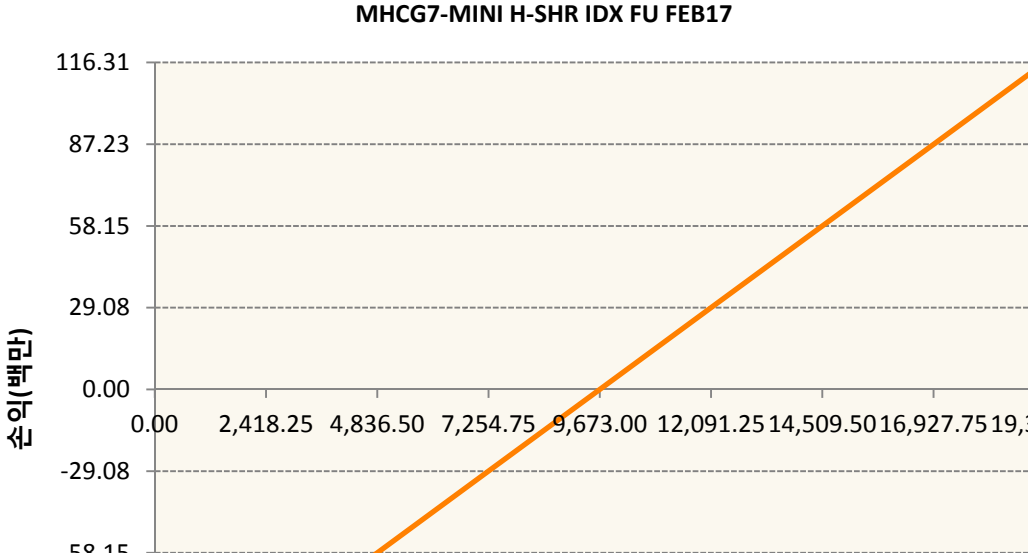
1. 계약금액

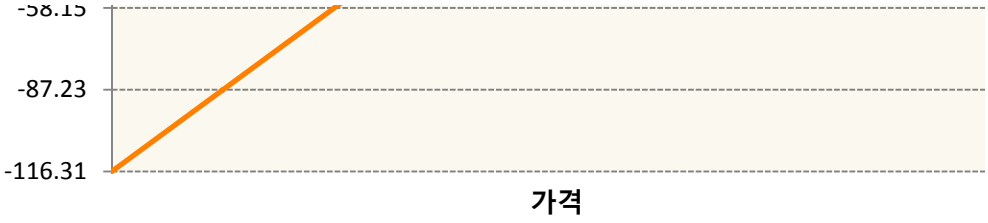
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,641	0	1,641	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)

158

공시일	2017-02-06
기준일	2017-02-03

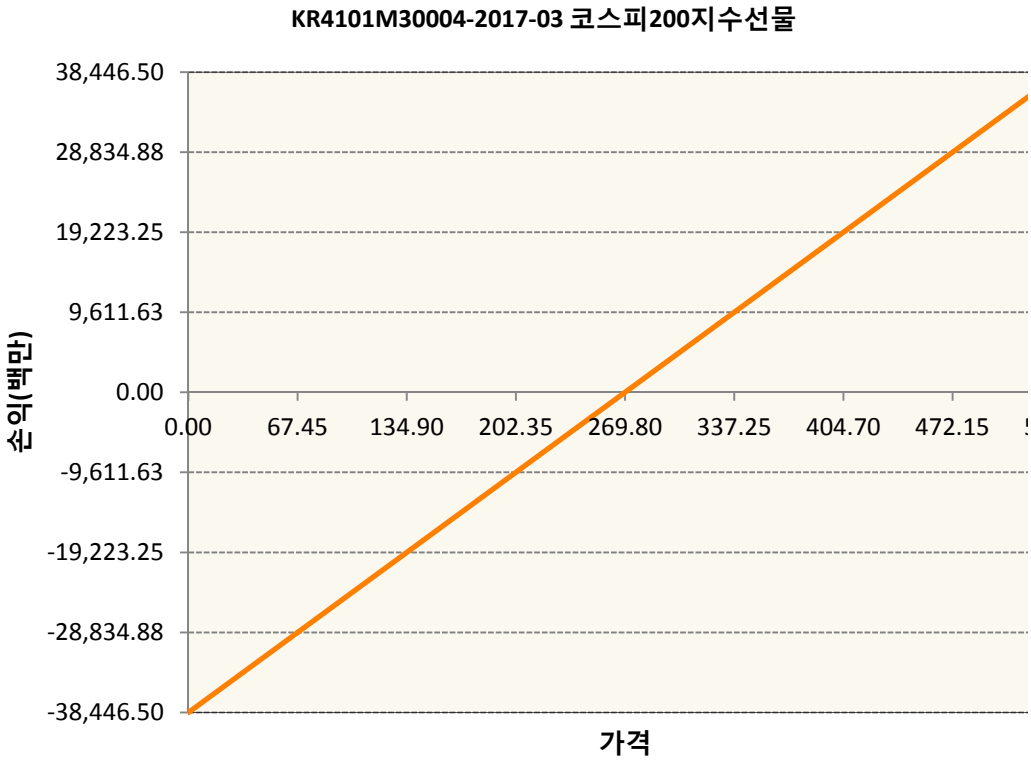
커버드콜모(주식혼합-파생형)

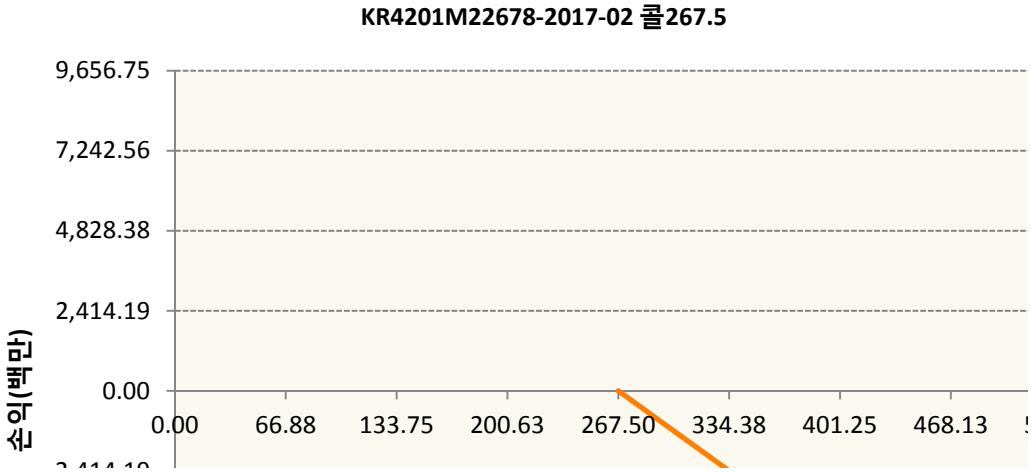
1. 계약금액

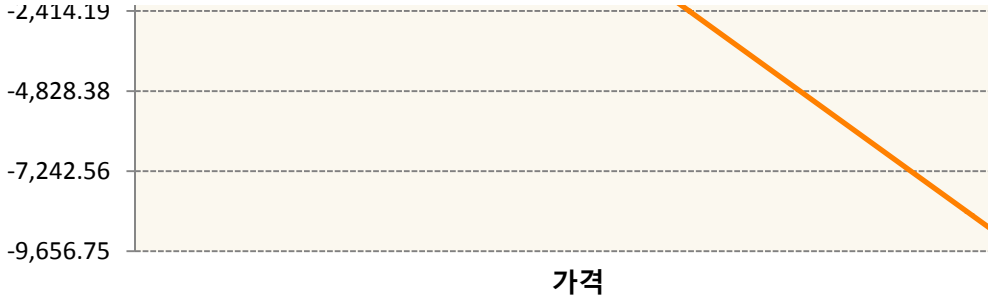
(단위:백만원)

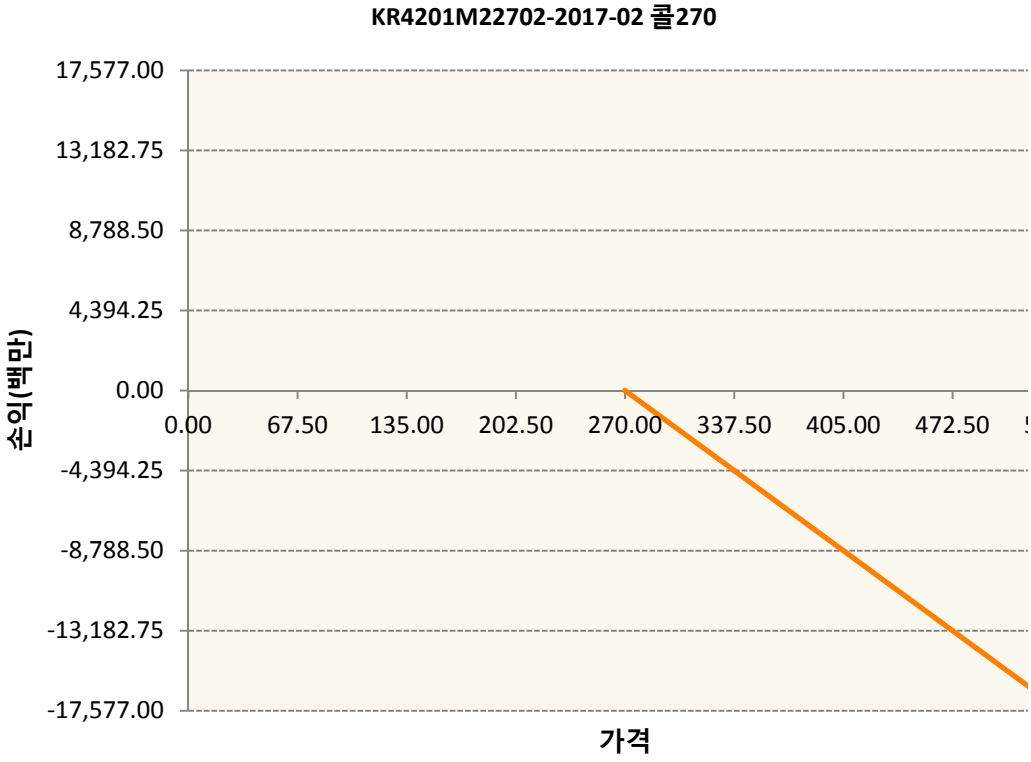
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	38,447	0	38,447	장내
누계	유가증권	옵션	0	27,234	-27,234	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101M30(2017-03 코스피200지수선물							3,065
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-3,065	-3,065	-3,065	-3,065	-3,065	-3,065	-3,065
-5.33%	-2,043	-2,043	-2,043	-2,043	-2,043	-2,043	-2,043
-2.67%	-1,022	-1,022	-1,022	-1,022	-1,022	-1,022	-1,022
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	1,022	1,022	1,022	1,022	1,022	1,022	1,022
5.33%	2,043	2,043	2,043	2,043	2,043	2,043	2,043
8.00%	3,065	3,065	3,065	3,065	3,065	3,065	3,065
KR4201M22(2017-02 콜267.5							3,696
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	427	427	427	427	427	427	427
-5.33%	427	427	427	427	427	427	426
-2.67%	422	418	412	405	396	385	374
0%	67	45	23	0	-23	-46	-69
2.67%	-1,109	-1,110	-1,112	-1,114	-1,117	-1,122	-1,127
5.33%	-2,403	-2,403	-2,403	-2,403	-2,403	-2,403	-2,403
8.00%	-3,696	-3,696	-3,696	-3,696	-3,696	-3,696	-3,696
KR4201M22 2017-02 콜270							6,264

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	359	359	359	359	359	359	359
-5.33%	359	359	359	359	359	358	358
-2.67%	358	356	354	350	344	336	327
0%	124	83	42	0	-42	-85	-127
2.67%	-1,608	-1,616	-1,626	-1,640	-1,657	-1,676	-1,697
5.33%	-3,931	-3,931	-3,931	-3,931	-3,932	-3,932	-3,934
8.00%	-6,264	-6,264	-6,264	-6,264	-6,264	-6,264	-6,264

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

16,000

공시일	2017-02-06
기준일	2017-02-03

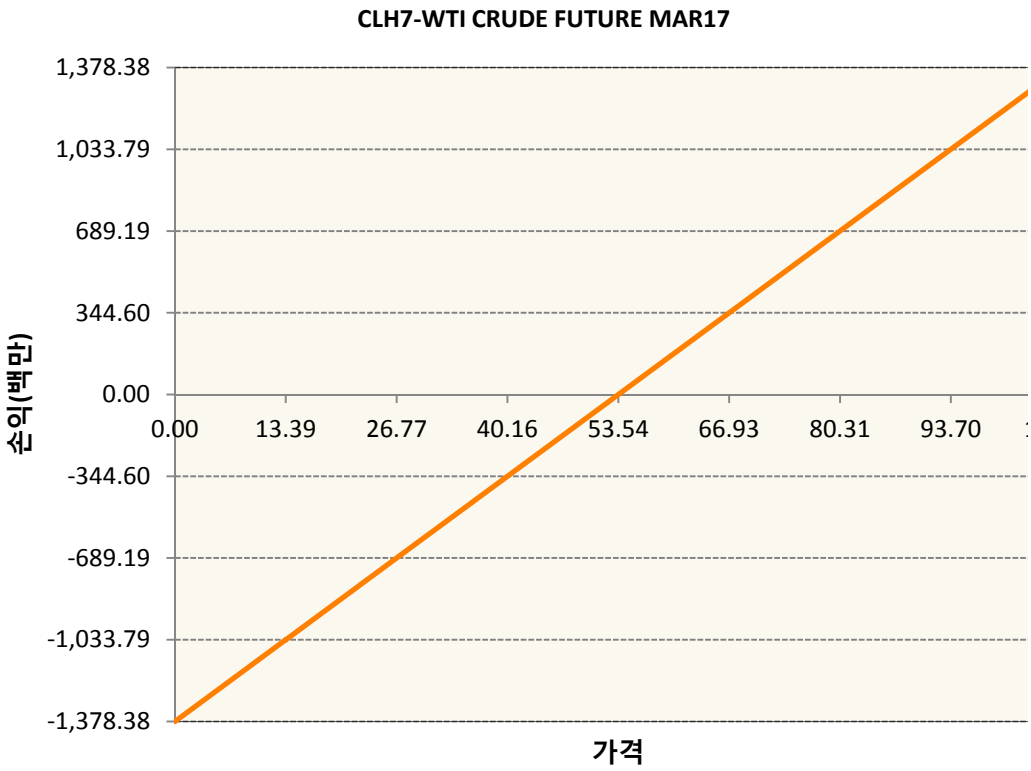
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

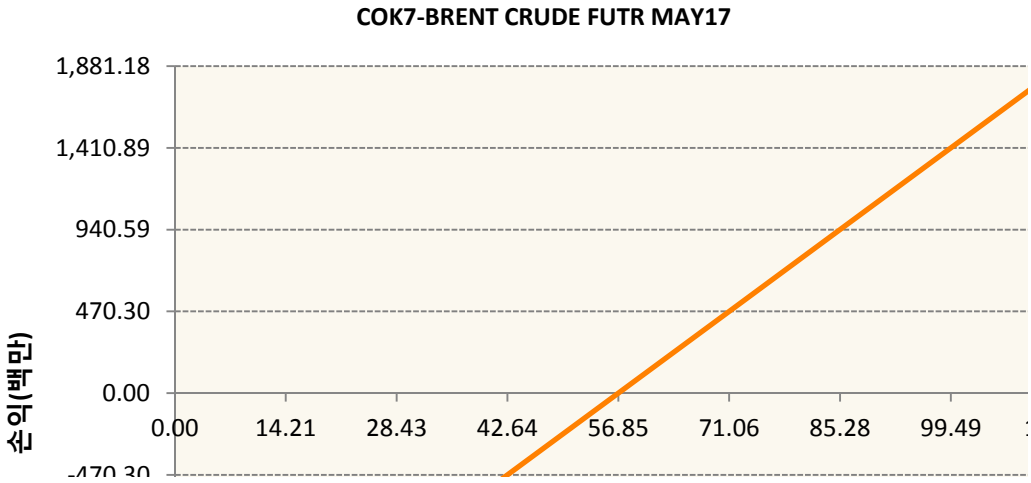
1. 계약금액

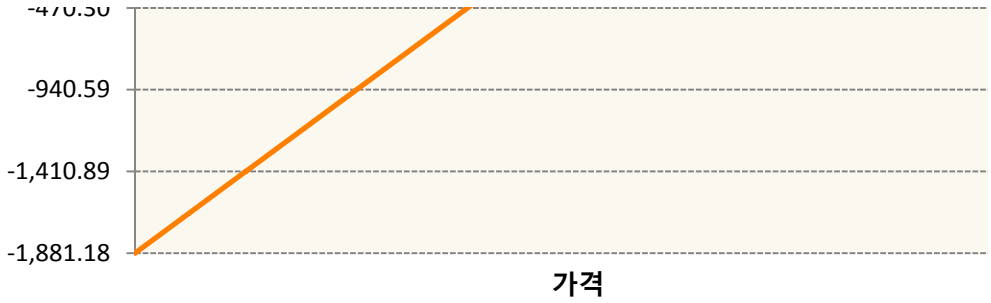
(단위:백만원)

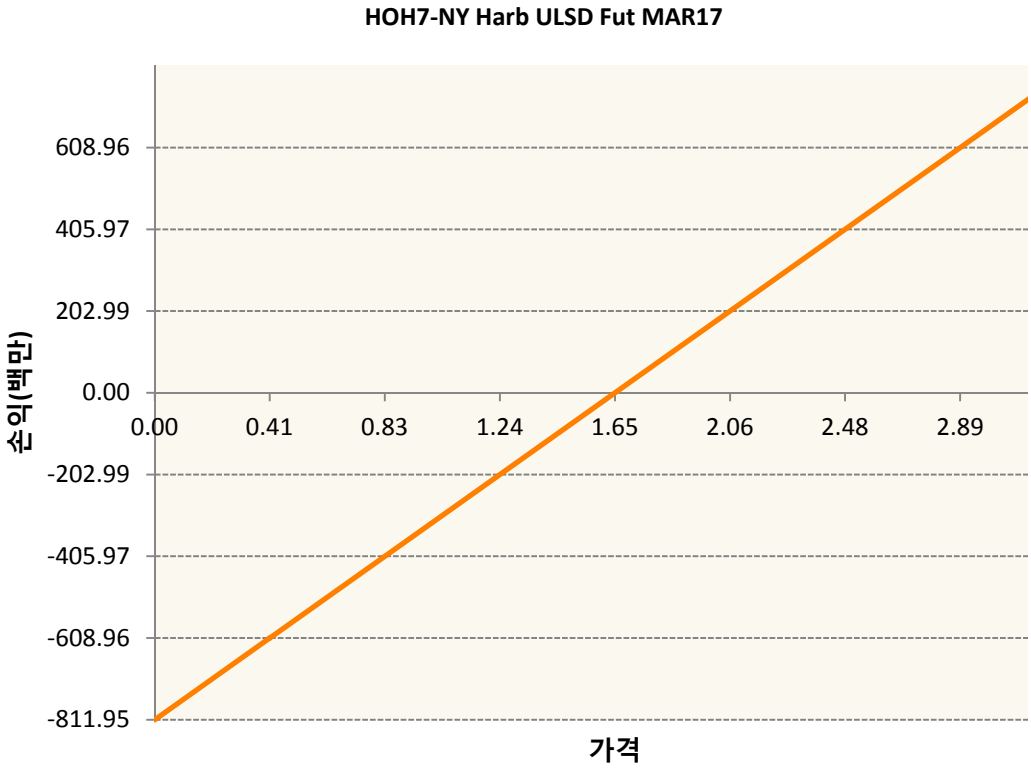
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	선물	유가증권	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	선물	유가증권	1,378	0	1,378	
누계	유가증권	선물	5,014	413	4,601	

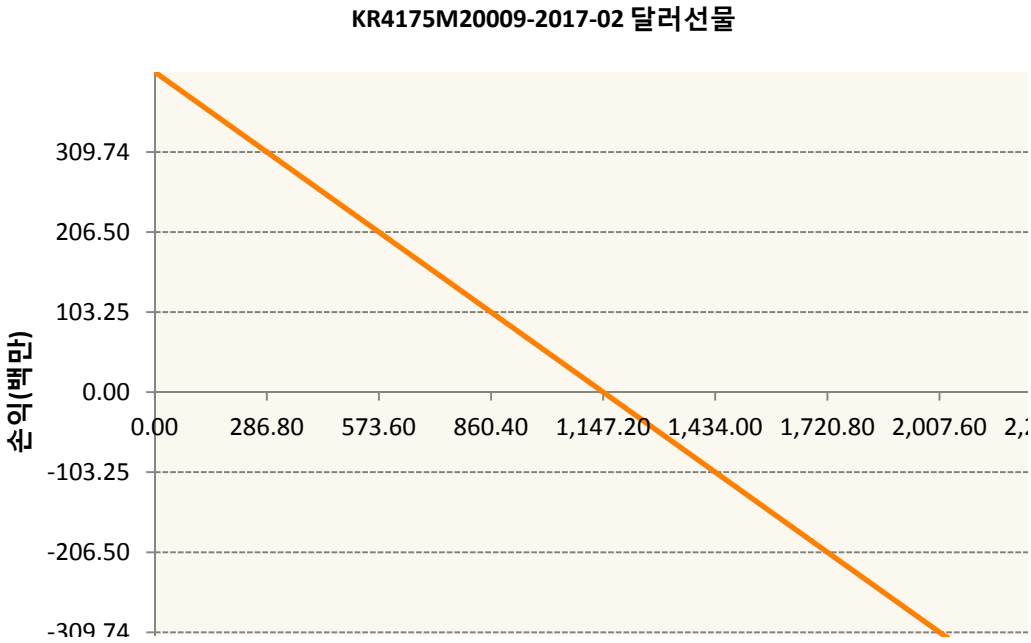
2. 만기시점의 손익구조

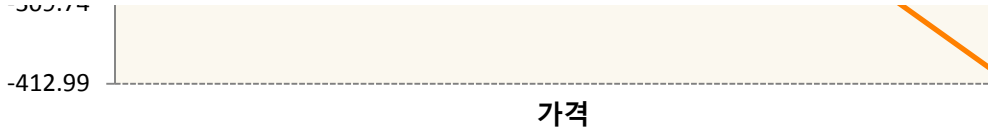


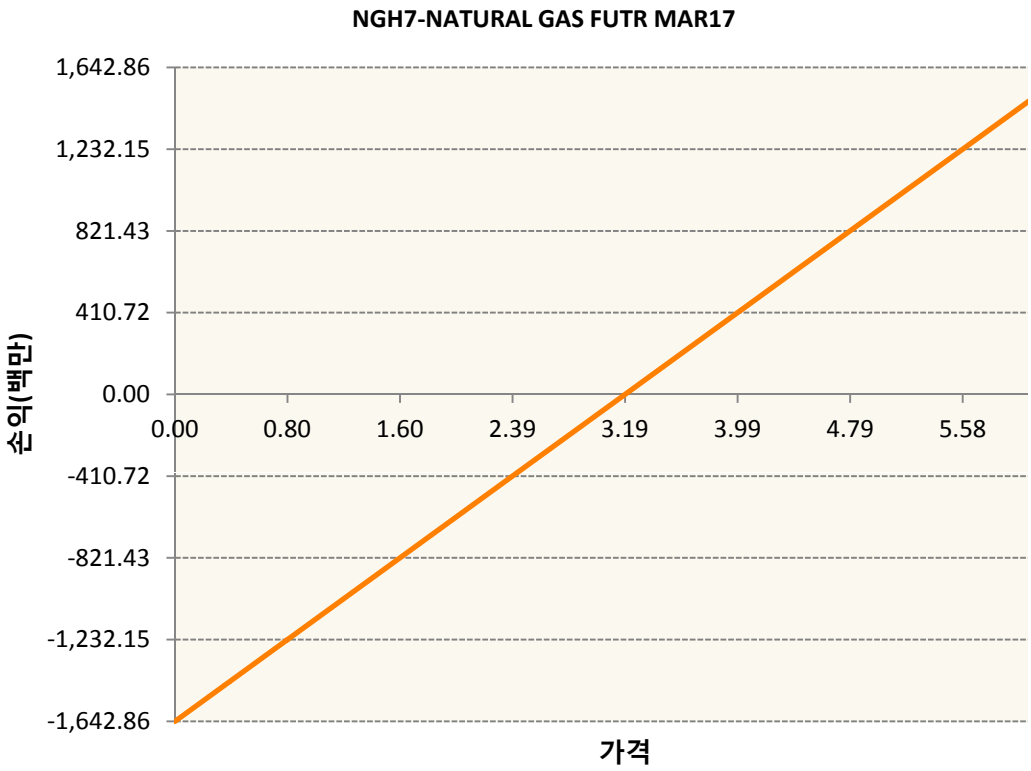


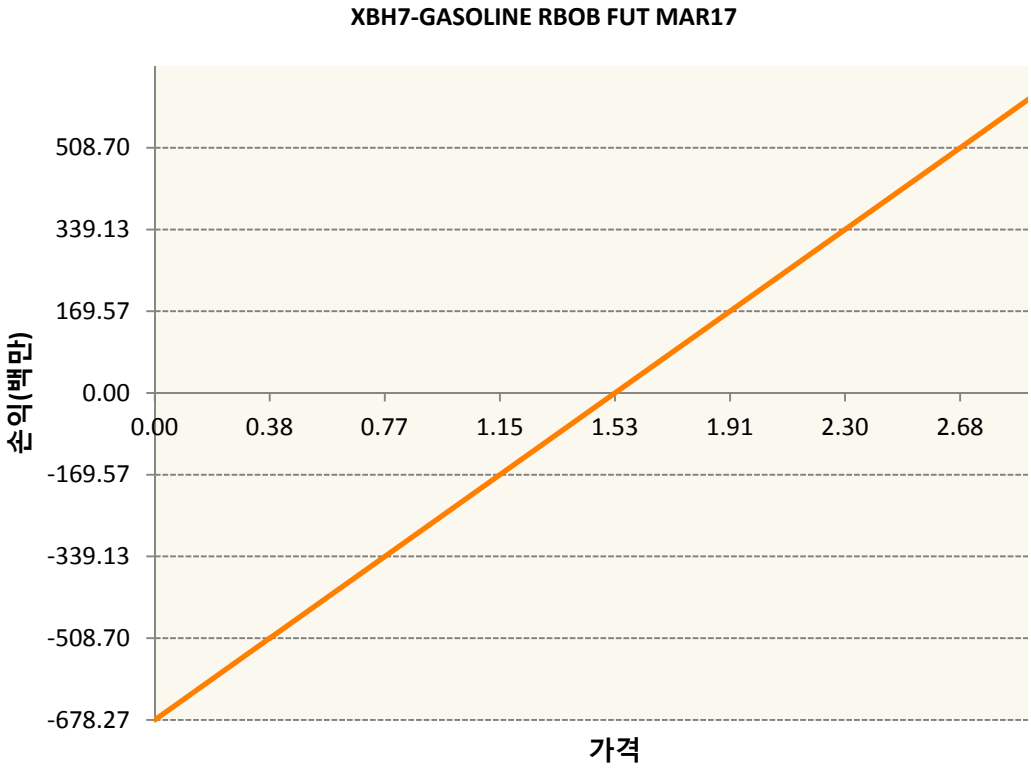

-940.59
-1,410.89
-1,881.18
가격


HOH7-NY Harb ULSD Fut MAR17
608.96
405.97
202.99
0.00
-202.99
-405.97
-608.96
-811.95
0.00
0.41
0.83
1.24
1.65
2.06
2.48
2.89
순익(백만)
가격


KR4175M20009-2017-02 달러선물
309.74
206.50
103.25
0.00
-103.25
-206.50
0.00
286.80
573.60
860.40
1,147.20
1,434.00
1,720.80
2,007.60
순익(백만)


-412.99
가격


NGH7-NATURAL GAS FUTR MAR17
1,642.86
1,232.15
821.43
410.72
0.00
-410.72
-821.43
-1,232.15
-1,642.86
0.00
0.80
1.60
2.39
3.19
3.99
4.79
5.58
순익(백만)
가격


XBH7-GASOLINE RBOB FUT MAR17
508.70
339.13
169.57
0.00
-169.57
-339.13
-508.70
-678.27
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	110
COK7	BRENT CRUDE FUTR MAY17	150
HOH7	NY Harb ULSD Fut MAR17	65
KR4175M20(	2017-02 달러선물	33
NGH7	NATURAL GAS FUTR MAR17	131
XBH7	GASOLINE RBOB FUT MAR17	54

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

1,150

공시일	2017-02-06
기준일	2017-02-03

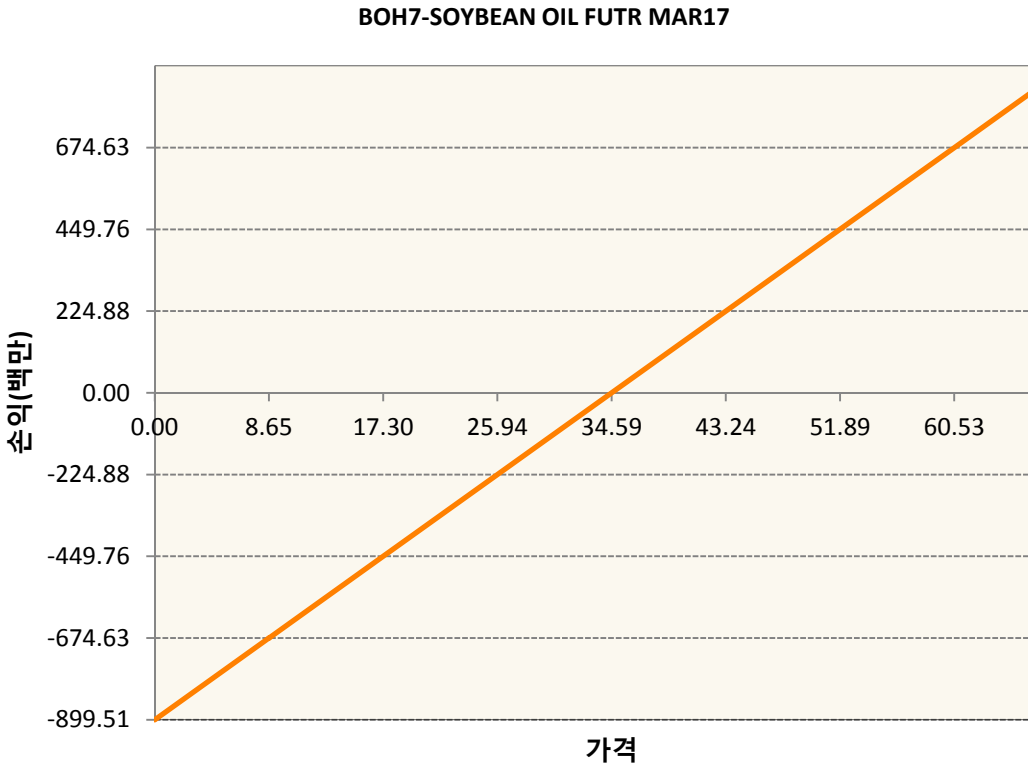
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

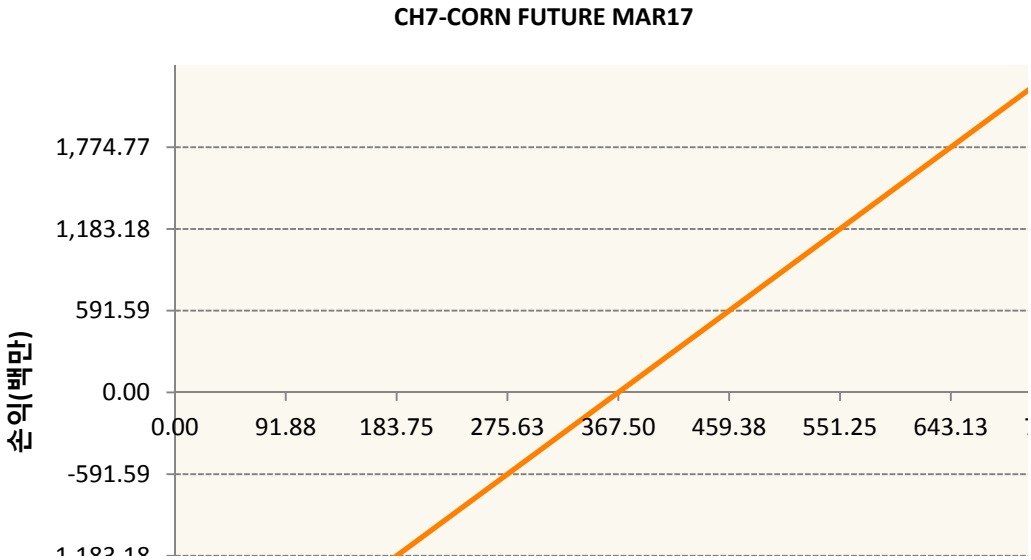
1. 계약금액

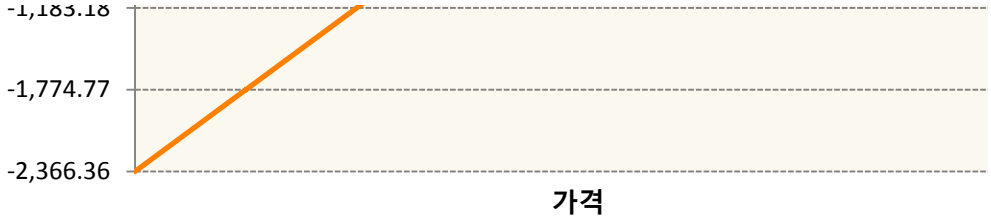
(단위:백만원)

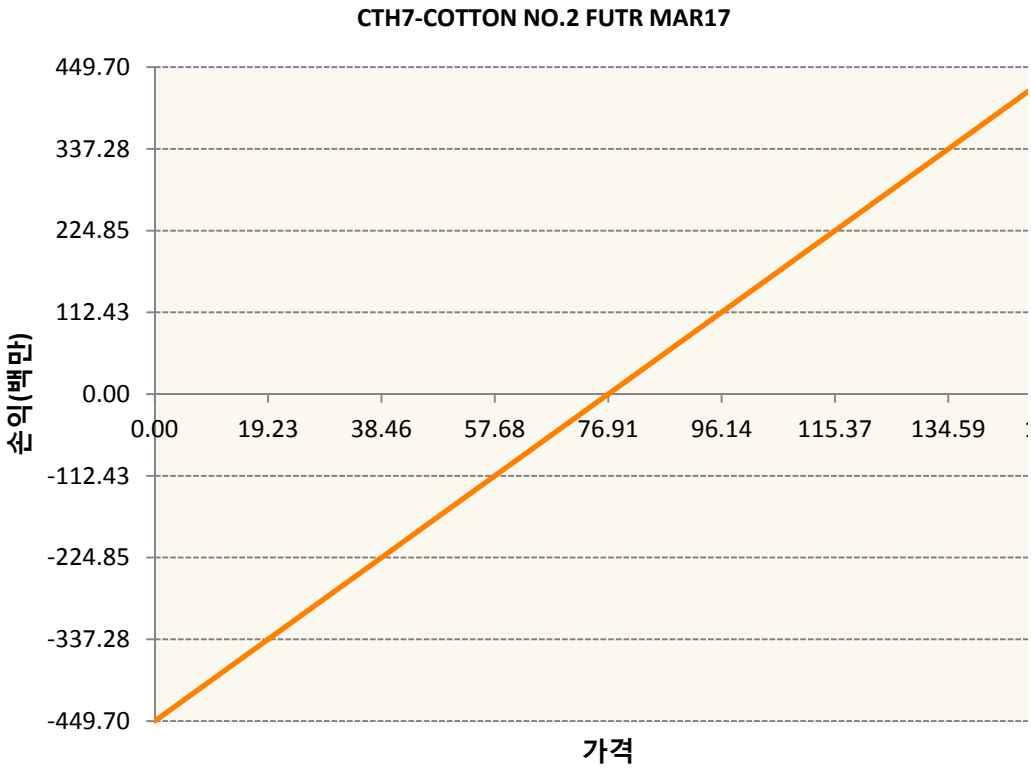
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	9,916	574	9,343	

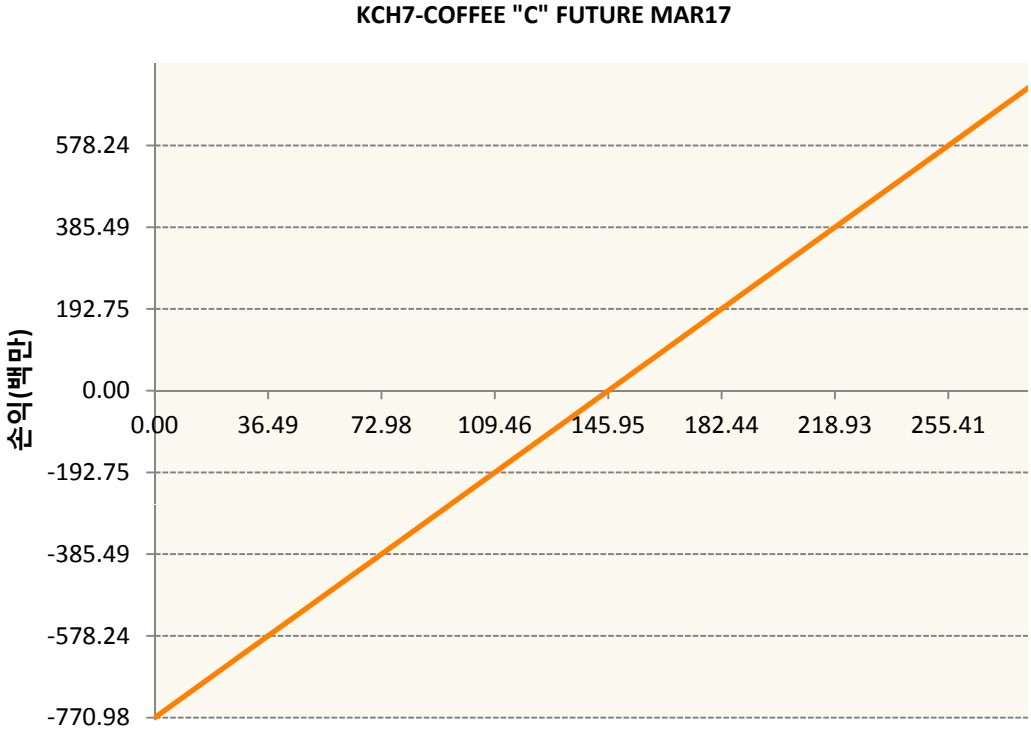
2. 만기시점의 손익구조



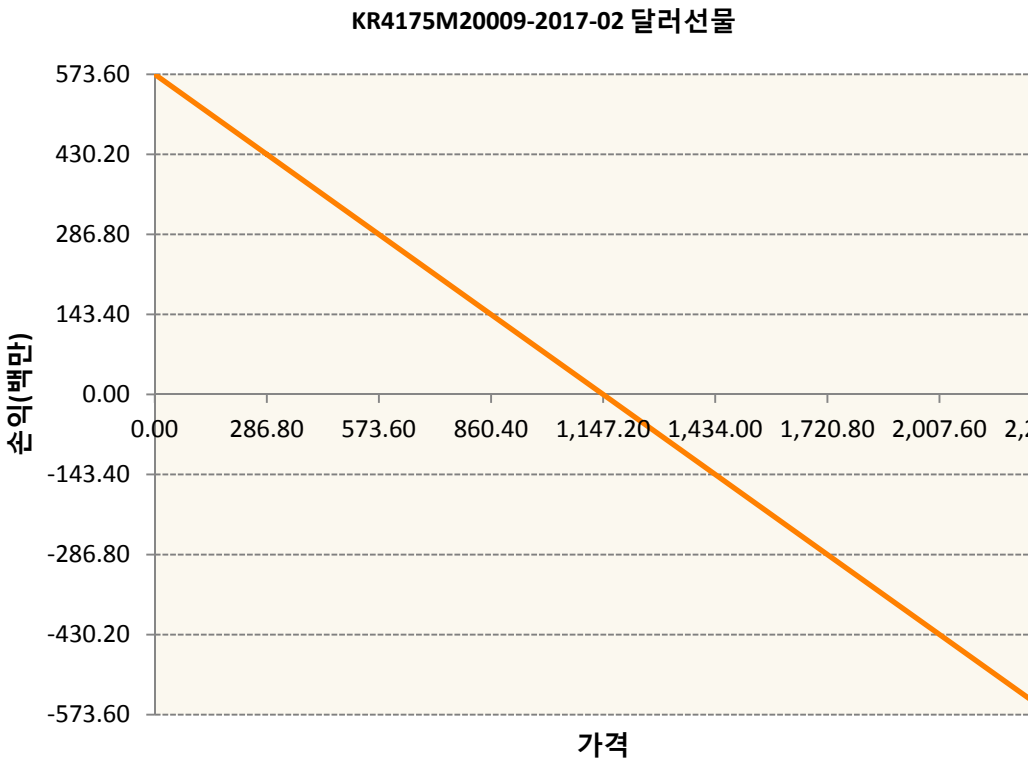


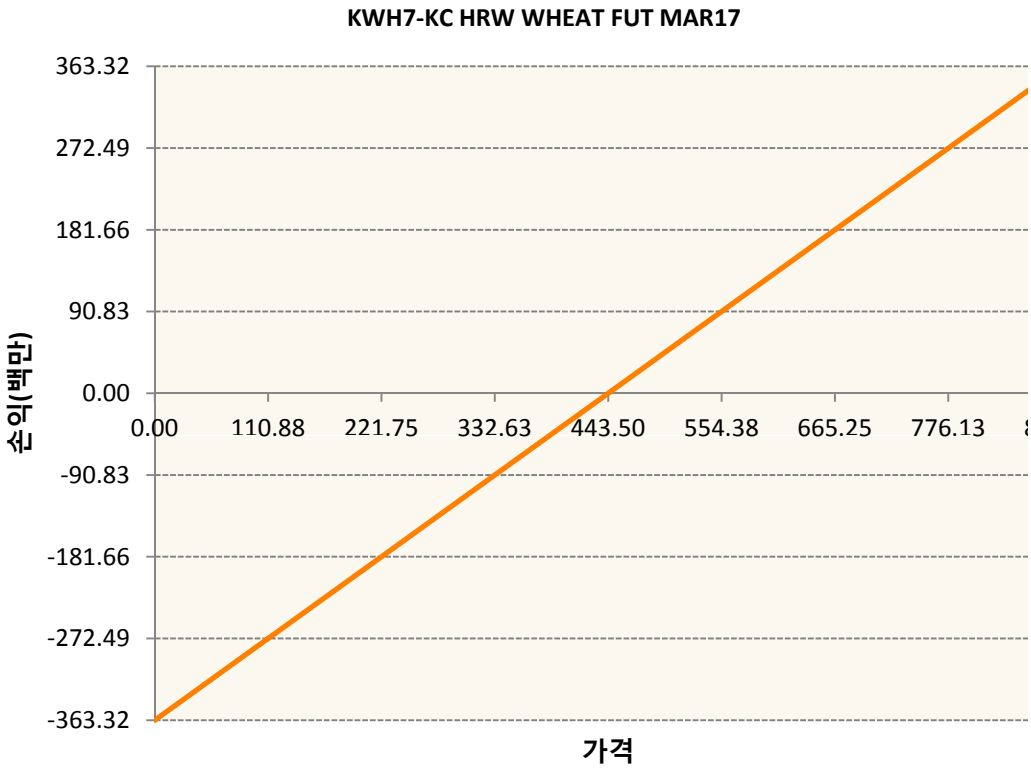

-1,774.77
-2,366.36
가격

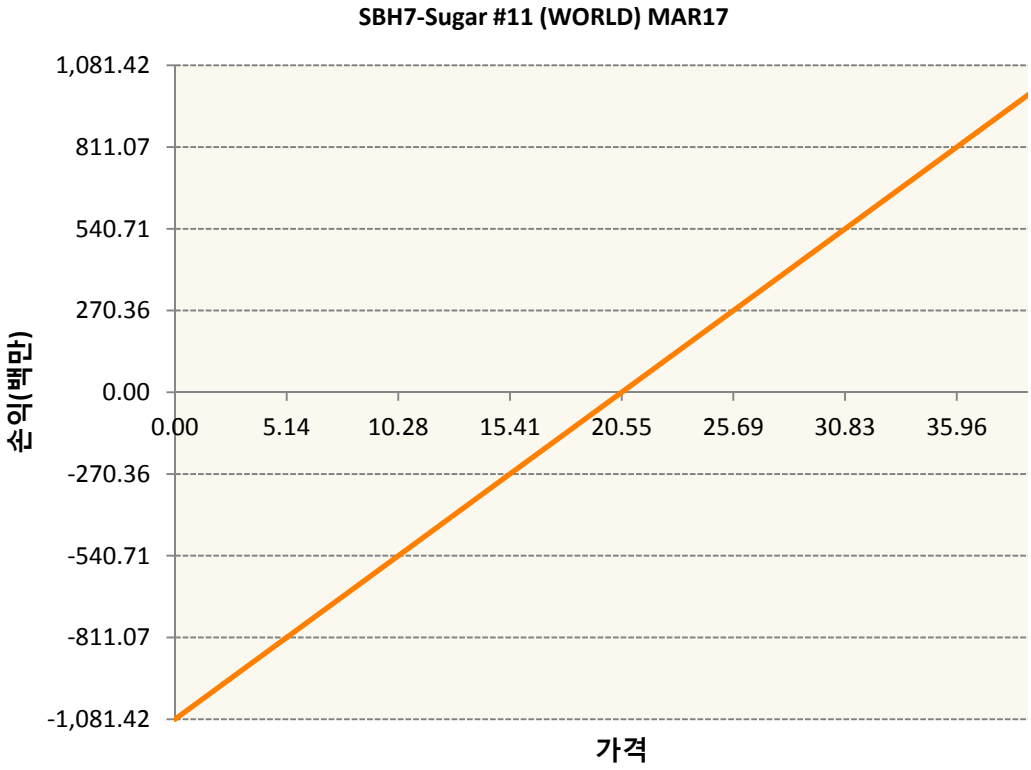

CTH7-COTTON NO.2 FUTR MAR17
449.70
337.28
224.85
112.43
0.00
-112.43
-224.85
-337.28
-449.70
0.00
19.23
38.46
57.68
76.91
96.14
115.37
134.59
손익(백만)
가격

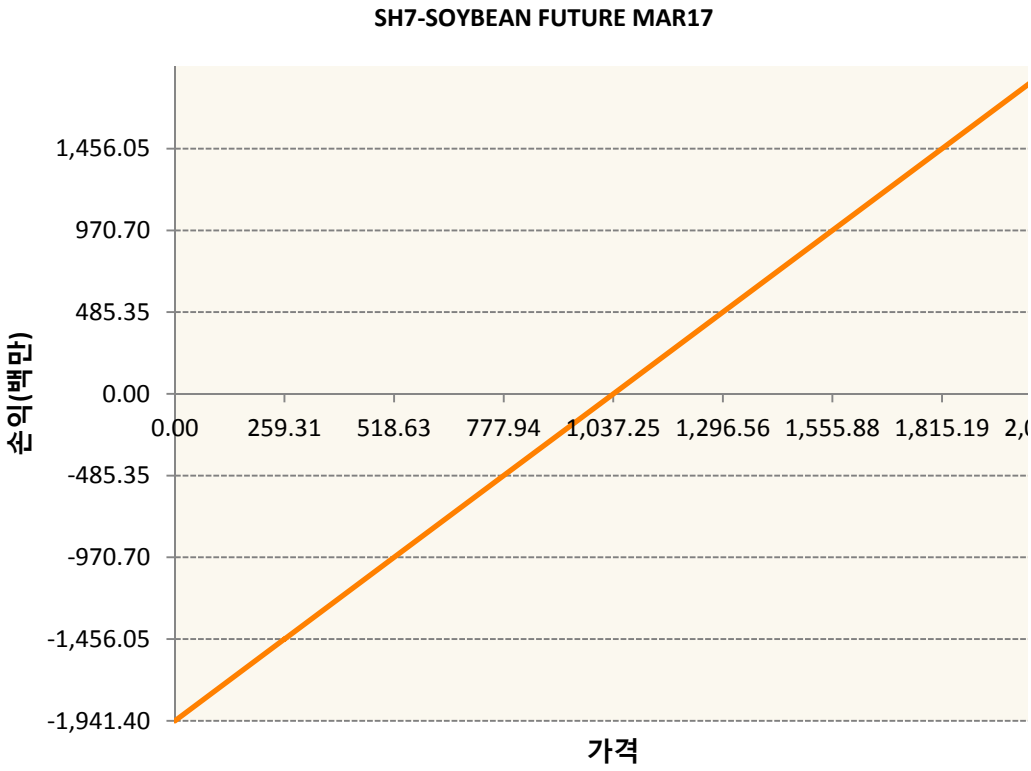

KCH7-COFFEE "C" FUTURE MAR17
578.24
385.49
192.75
0.00
-192.75
-385.49
-578.24
-770.98
0.00
36.49
72.98
109.46
145.95
182.44
218.93
255.41
손익(백만)

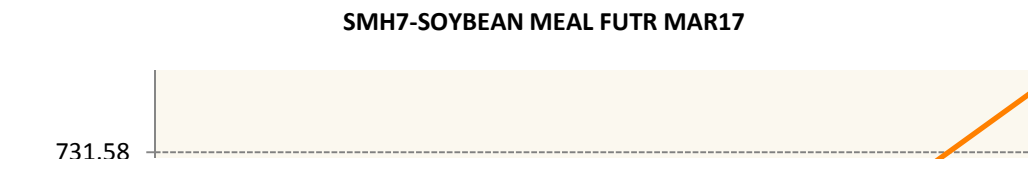
가격

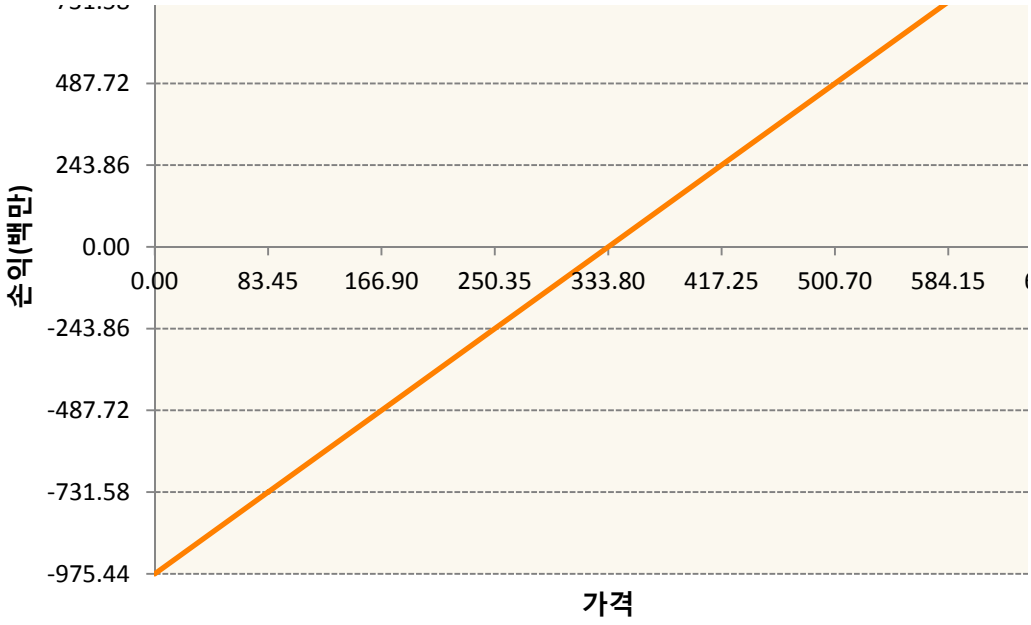

KR4175M20009-2017-02 달러선물
573.60
430.20
286.80
143.40
0.00
-143.40
-286.80
-430.20
-573.60
0.00
286.80
573.60
860.40
1,147.20
1,434.00
1,720.80
2,007.60
손익(백만)
가격

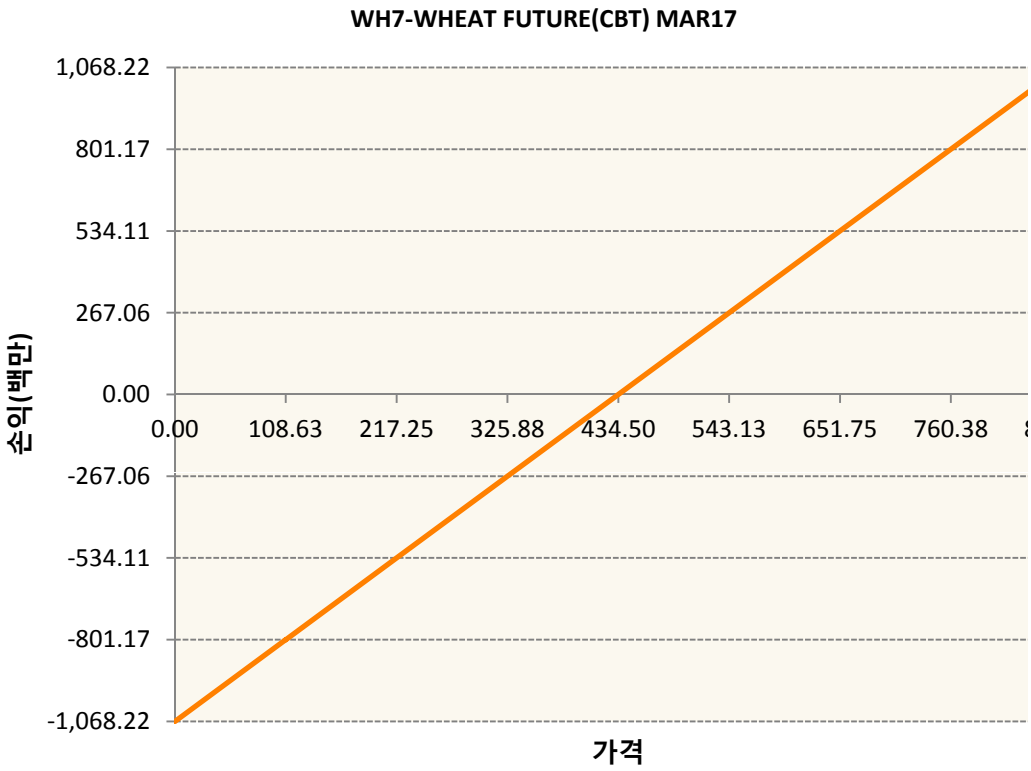

KWH7-KC HRW WHEAT FUT MAR17
363.32
272.49
181.66
90.83
0.00
-90.83
-181.66
-272.49
-363.32
0.00
110.88
221.75
332.63
443.50
554.38
665.25
776.13
손익(백만)
가격


SBH7-Sugar #11 (WORLD) MAR17
1,081.42
811.07
540.71
270.36
0.00
-270.36
-540.71
-811.07
-1,081.42
0.00
5.14
10.28
15.41
20.55
25.69
30.83
35.96
손익(백만)
가격


SH7-SOYBEAN FUTURE MAR17
1,456.05
970.70
485.35
0.00
-485.35
-970.70
-1,456.05
-1,941.40
0.00
259.31
518.63
777.94
1,037.25
1,296.56
1,555.88
1,815.19
손익(백만)
가격


SMH7-SOYBEAN MEAL FUTR MAR17
731.58





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

BOH7	SOYBEAN OIL FUTR MAR17	72
CH7	CORN FUTURE MAR17	189
CTH7	COTTON NO.2 FUTR MAR17	36
KCH7	COFFEE "C" FUTURE MAR17	62
KR4175M20(	2017-02 달러선물	46

KWH7	KC HRW WHEAT FUT MAR17	29
SBH7	Sugar #11 (WORLD) MAR17	87
SH7	SOYBEAN FUTURE MAR17	155
SMH7	SOYBEAN MEAL FUTR MAR17	78
WH7	WHEAT FUTURE(CBT) MAR17	85

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

940