공시일	2017-02-07
기준일	2017-02-06

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	2017-02-07
기준일	2017-02-06

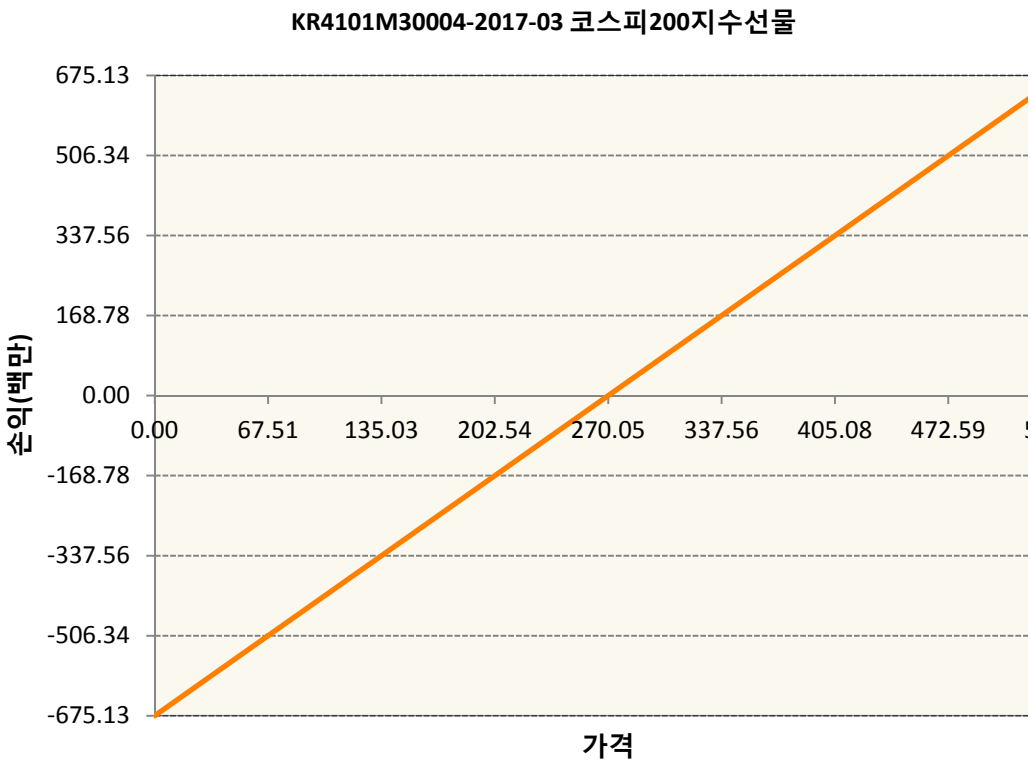
스마트인덱스모

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	2017-02-07
기준일	2017-02-06

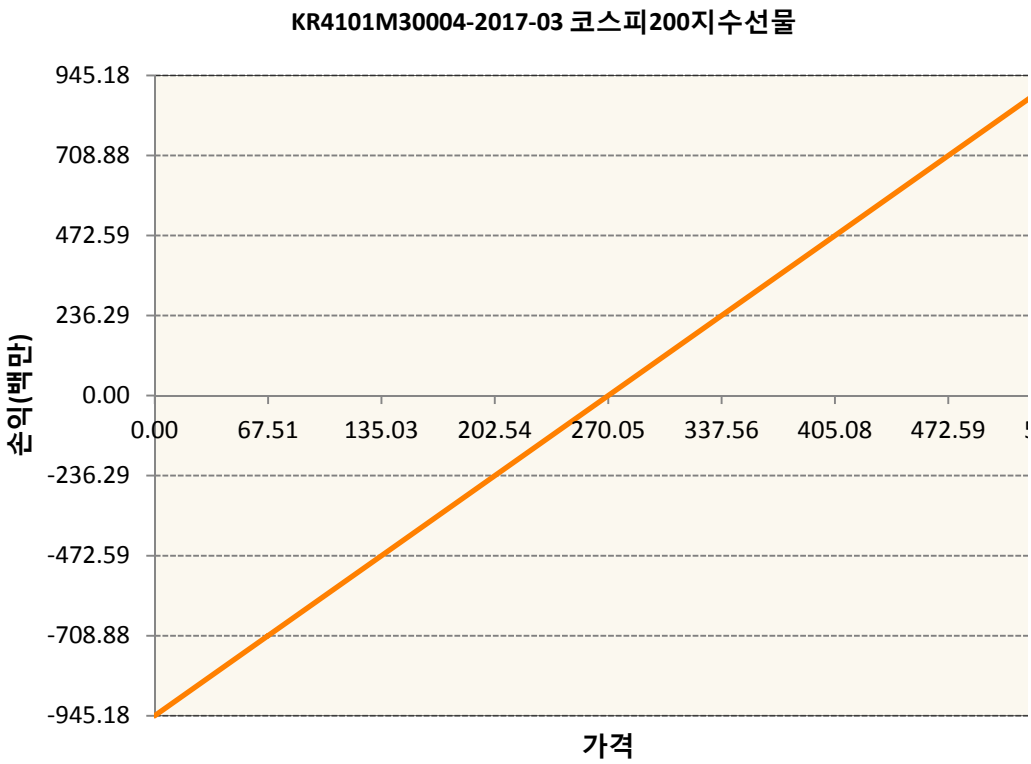
스마트레버리지목표전환형1호

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	945	0	945	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	2017-02-07
기준일	2017-02-06

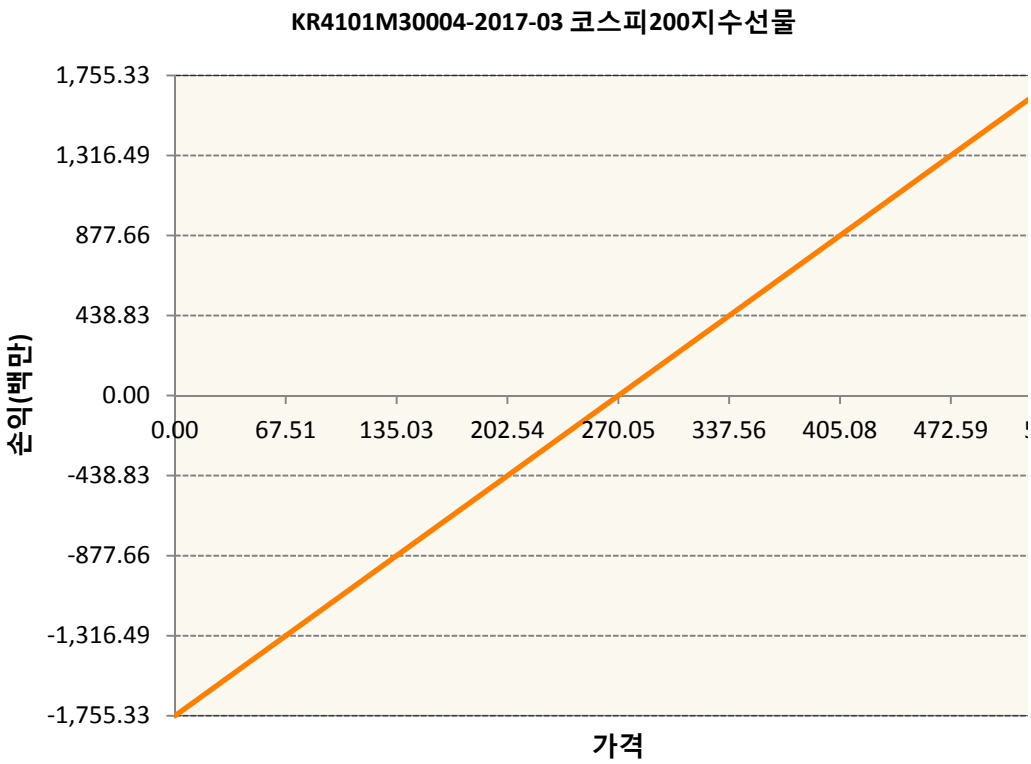
1.3배 레버리지 인덱스(주식-파생형)

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	1,755	0	1,755	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	2017-02-07
기준일	2017-02-06

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	931

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

664

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-02-07
기준일	2017-02-06

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	381

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

545

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-02-07
기준일	2017-02-06

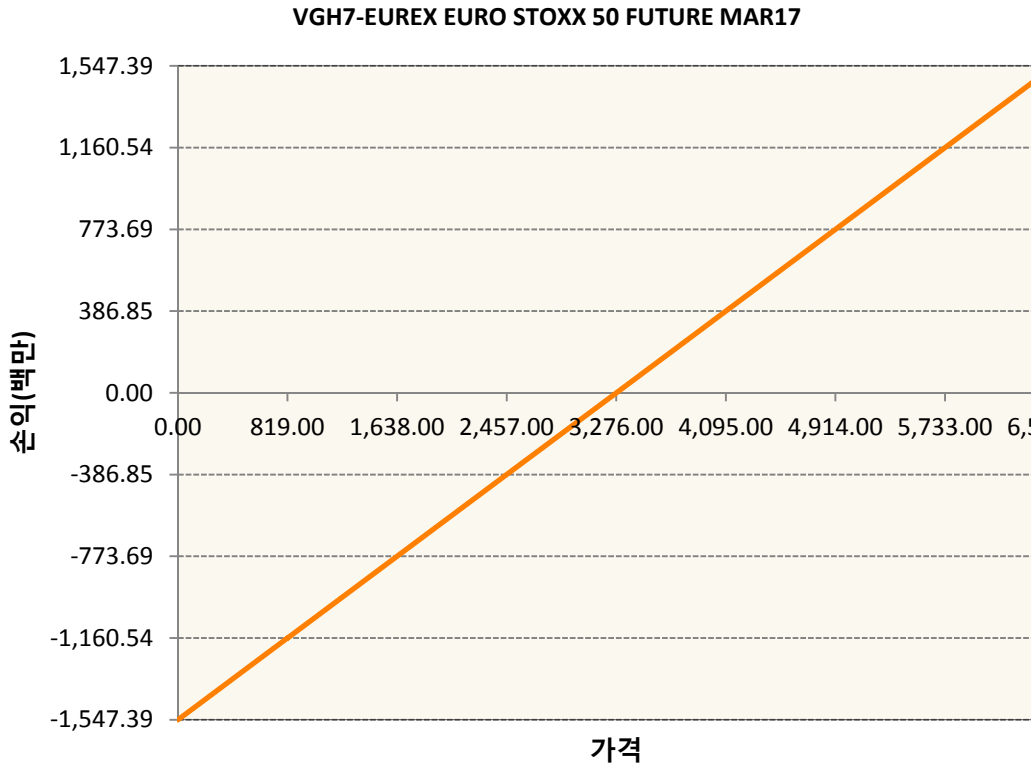
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,547	0	1,547	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGH7	EUREX EURO STOXX 50 FUTURE MAR17	124

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

(단위:백만원)

132

공시일	2017-02-07
기준일	2017-02-06

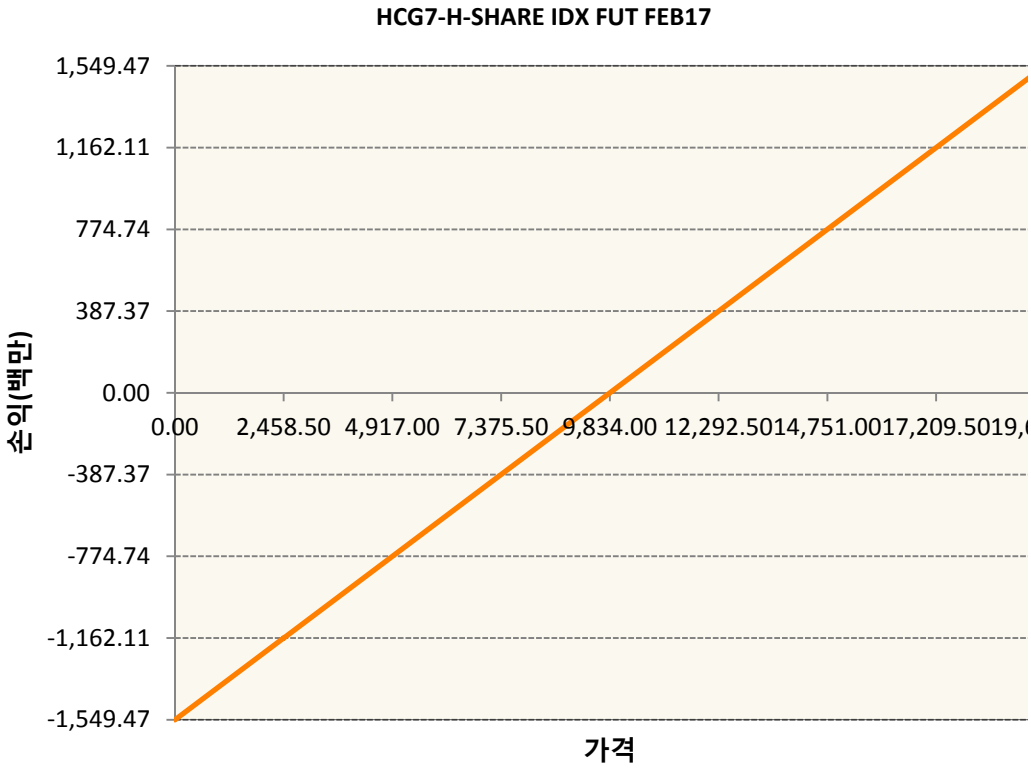
차이나인덱스모(주식-파생형)

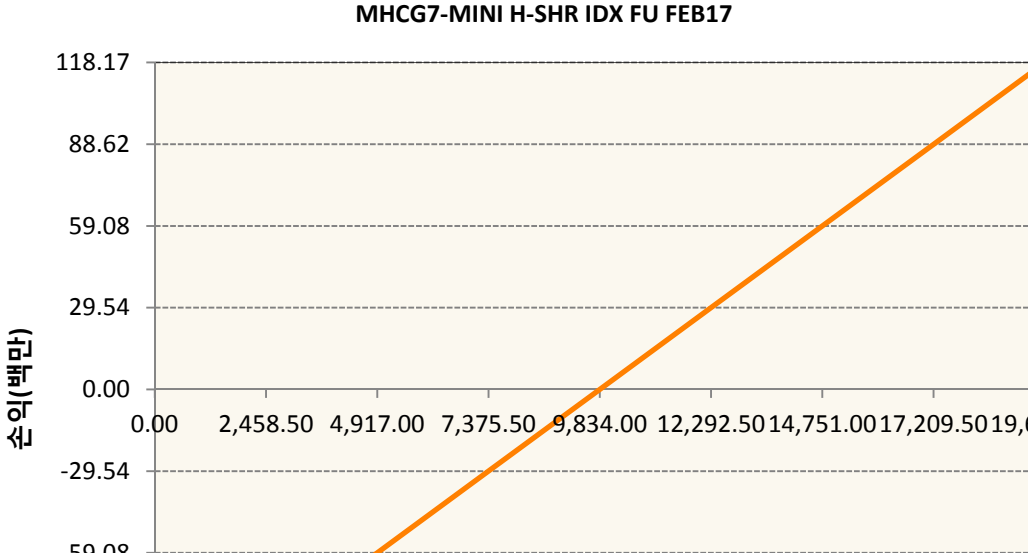
1. 계약금액

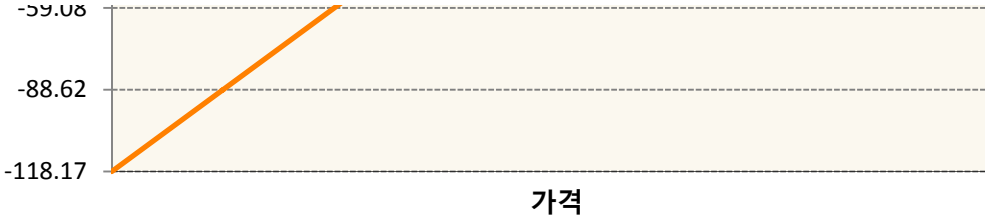
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,668	0	1,668	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)
	160

공시일	2017-02-07
기준일	2017-02-06

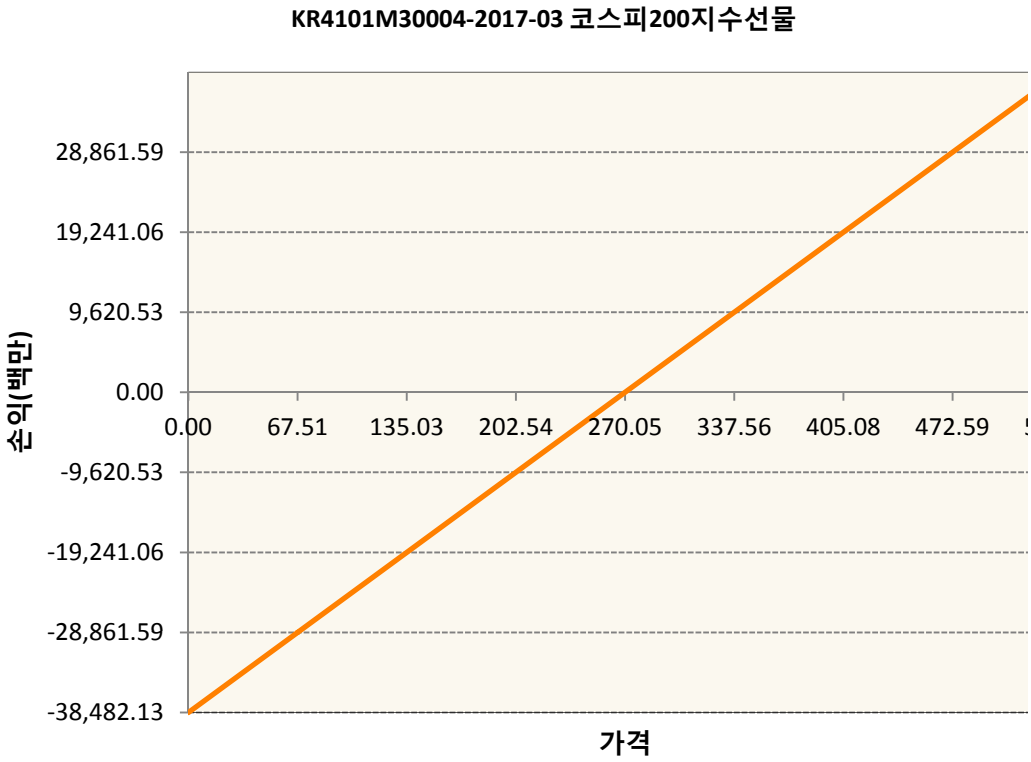
커버드콜모(주식혼합-파생형)

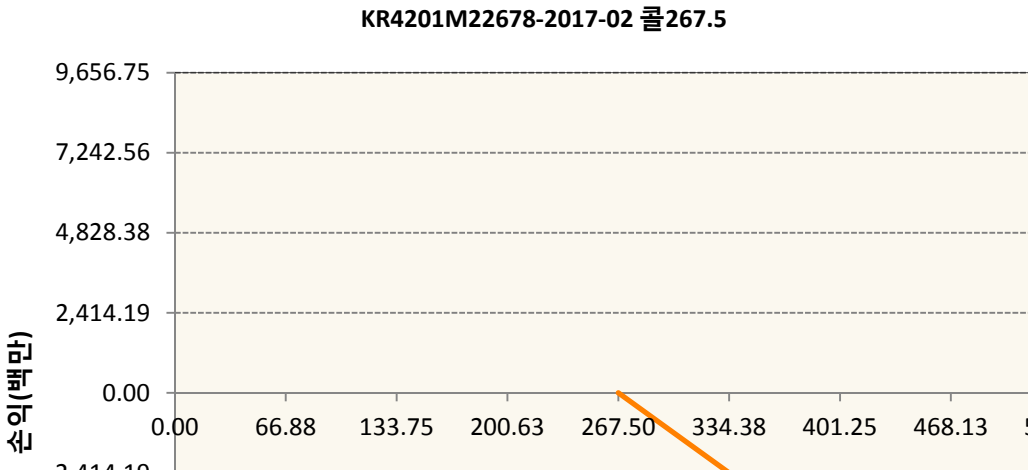
1. 계약금액

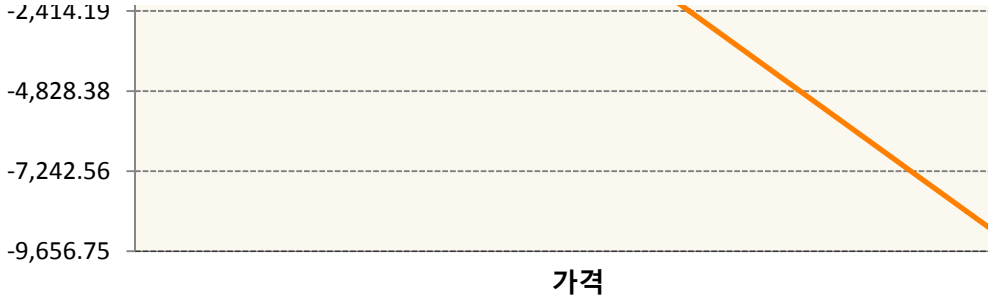
(단위:백만원)

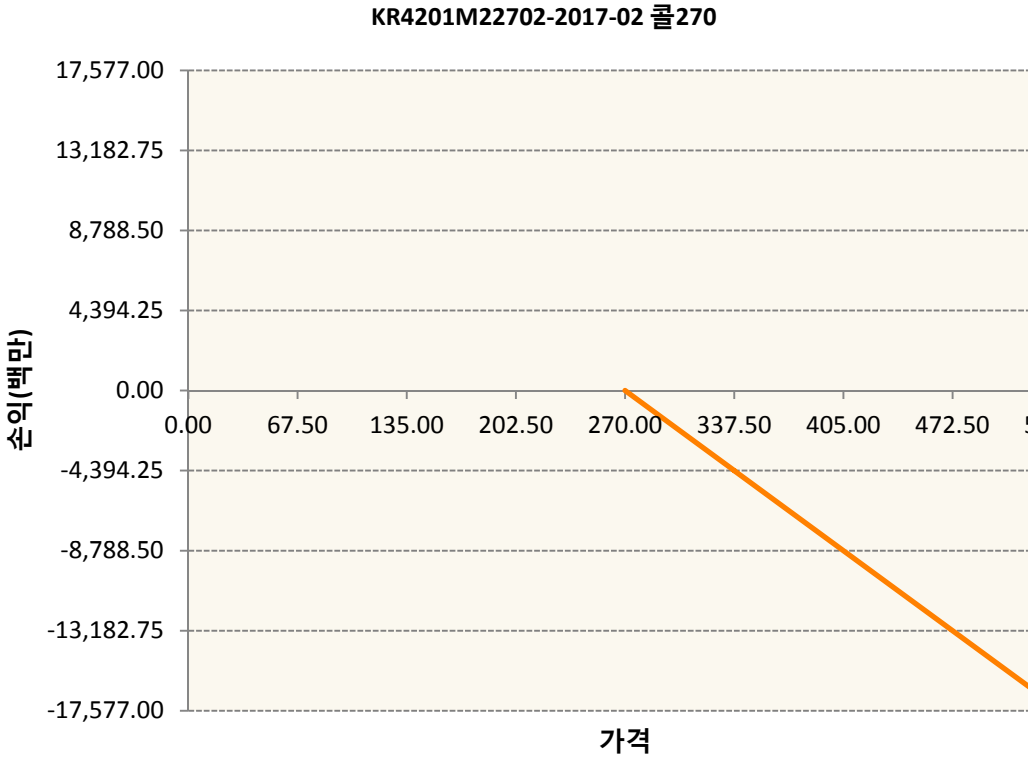
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	38,482	0	38,482	장내
누계	유가증권	옵션	0	27,234	-27,234	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101M30(2017-03 코스피200지수선물							3,072
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-3,072	-3,072	-3,072	-3,072	-3,072	-3,072	-3,072
-5.33%	-2,048	-2,048	-2,048	-2,048	-2,048	-2,048	-2,048
-2.67%	-1,024	-1,024	-1,024	-1,024	-1,024	-1,024	-1,024
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	1,024	1,024	1,024	1,024	1,024	1,024	1,024
5.33%	2,048	2,048	2,048	2,048	2,048	2,048	2,048
8.00%	3,072	3,072	3,072	3,072	3,072	3,072	3,072
KR4201M22(2017-02 콜267.5							3,815
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	434	434	434	434	434	434	434
-5.33%	434	434	434	434	434	434	434
-2.67%	433	432	430	427	424	419	414
0%	38	26	13	0	-14	-28	-43
2.67%	-1,221	-1,221	-1,221	-1,221	-1,221	-1,222	-1,222
5.33%	-2,518	-2,518	-2,518	-2,518	-2,518	-2,518	-2,518
8.00%	-3,815	-3,815	-3,815	-3,815	-3,815	-3,815	-3,815
KR4201M22: 2017-02 콜270							6,550

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	299	299	299	299	299	299	299
-5.33%	299	299	299	299	299	299	299
-2.67%	299	298	298	298	296	295	292
0%	92	62	31	0	-31	-62	-93
2.67%	-1,873	-1,873	-1,874	-1,876	-1,879	-1,883	-1,889
5.33%	-4,211	-4,211	-4,211	-4,211	-4,211	-4,211	-4,211
8.00%	-6,550	-6,550	-6,550	-6,550	-6,550	-6,550	-6,550

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

17,853

공시일	2017-02-07
기준일	2017-02-06

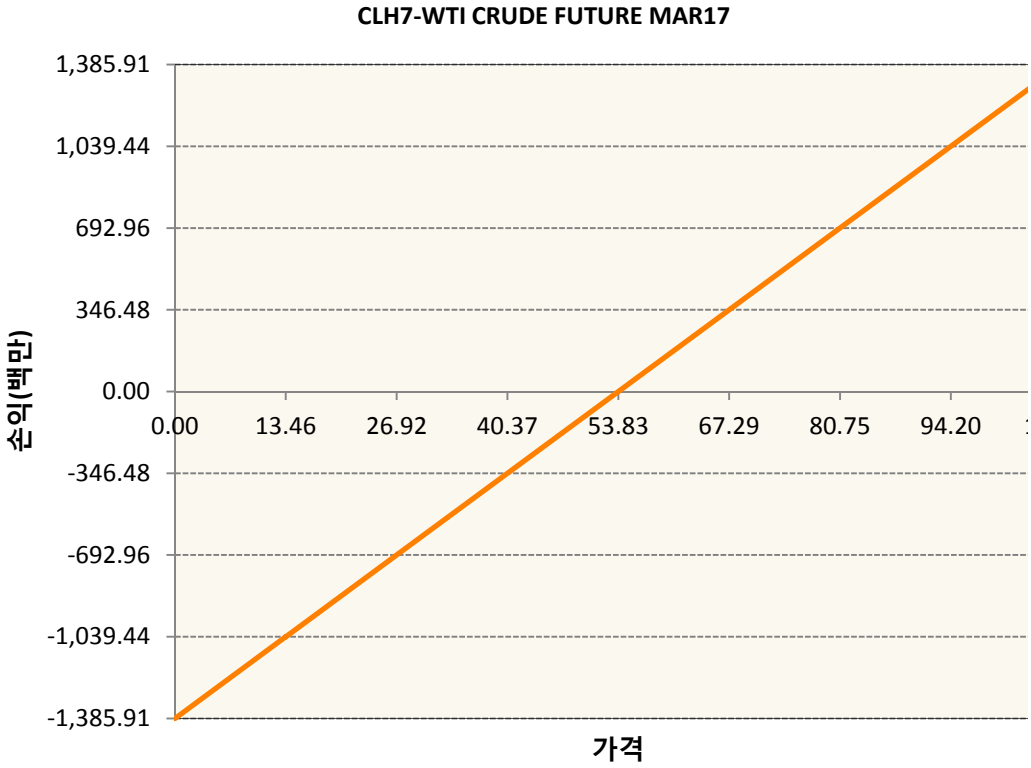
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

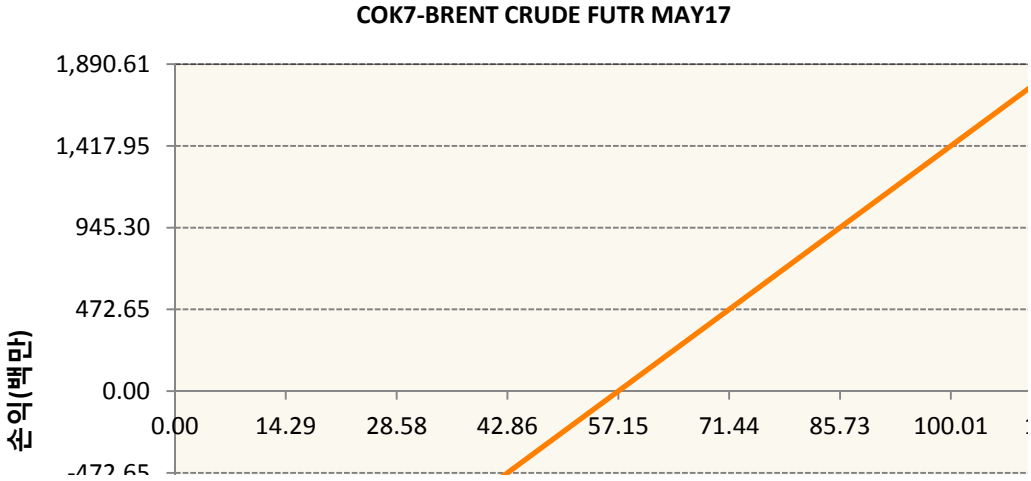
1. 계약금액

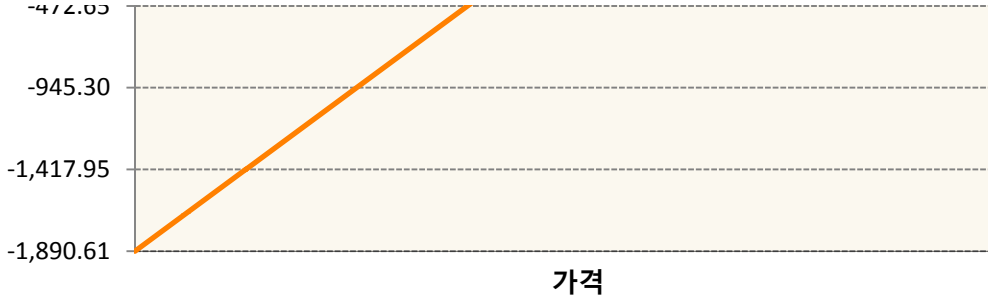
(단위:백만원)

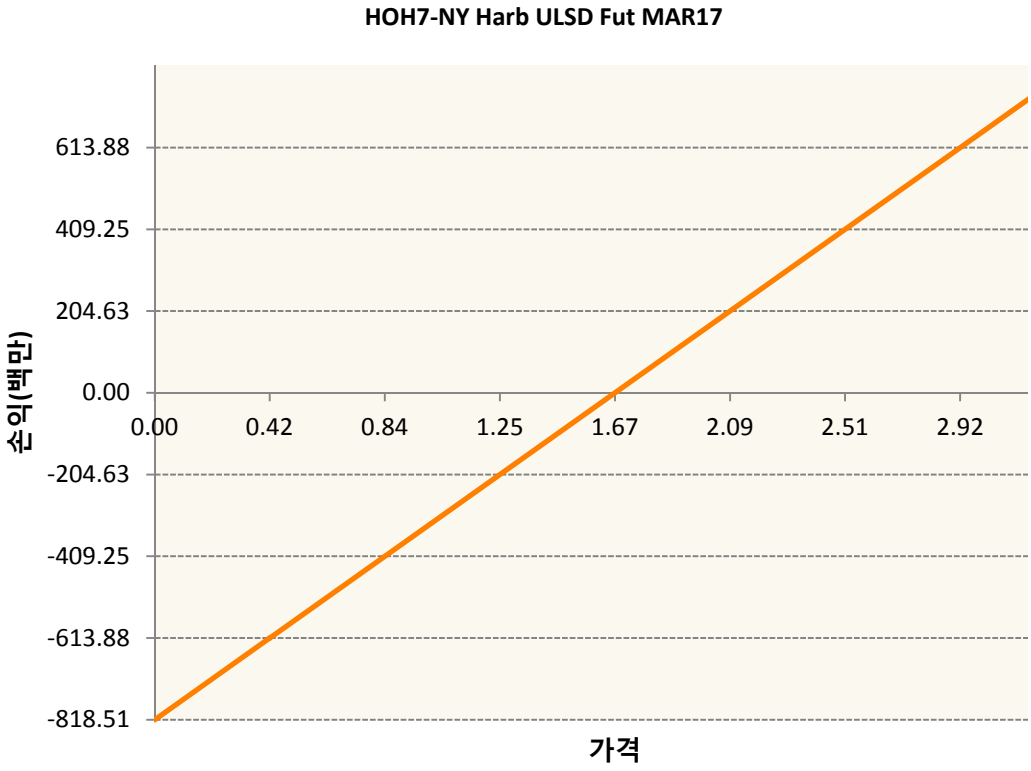
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	선물	유가증권	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	선물	유가증권	1,386	0	1,386	
누계	유가증권	선물	4,978	409	4,569	

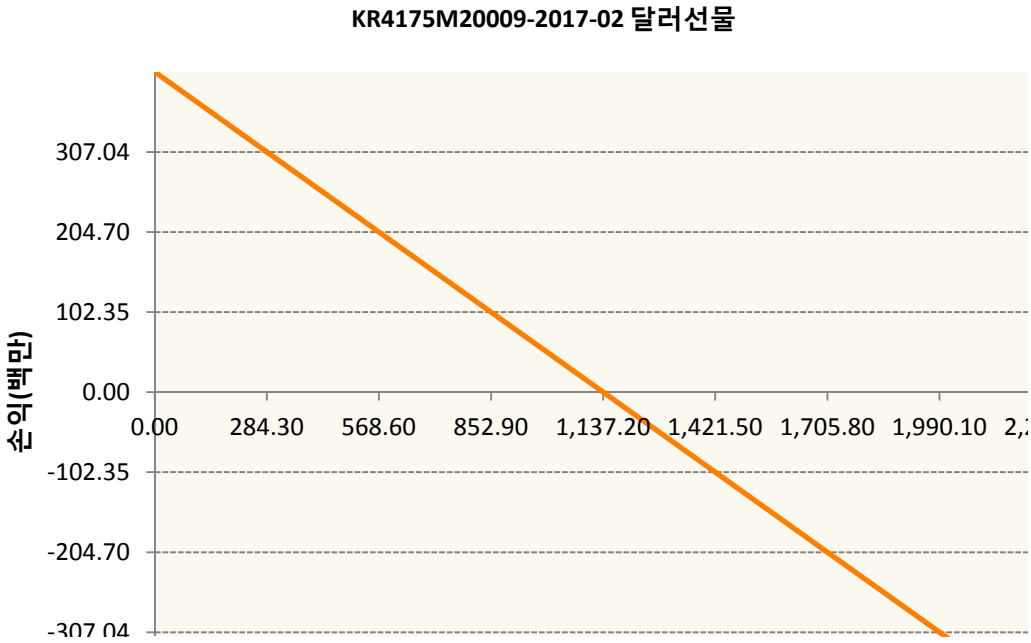
2. 만기시점의 손익구조

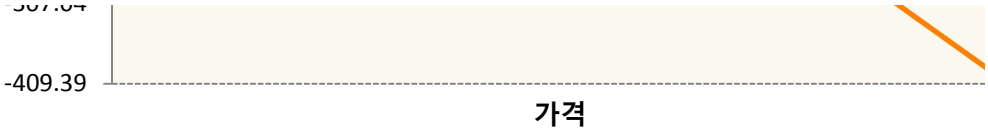


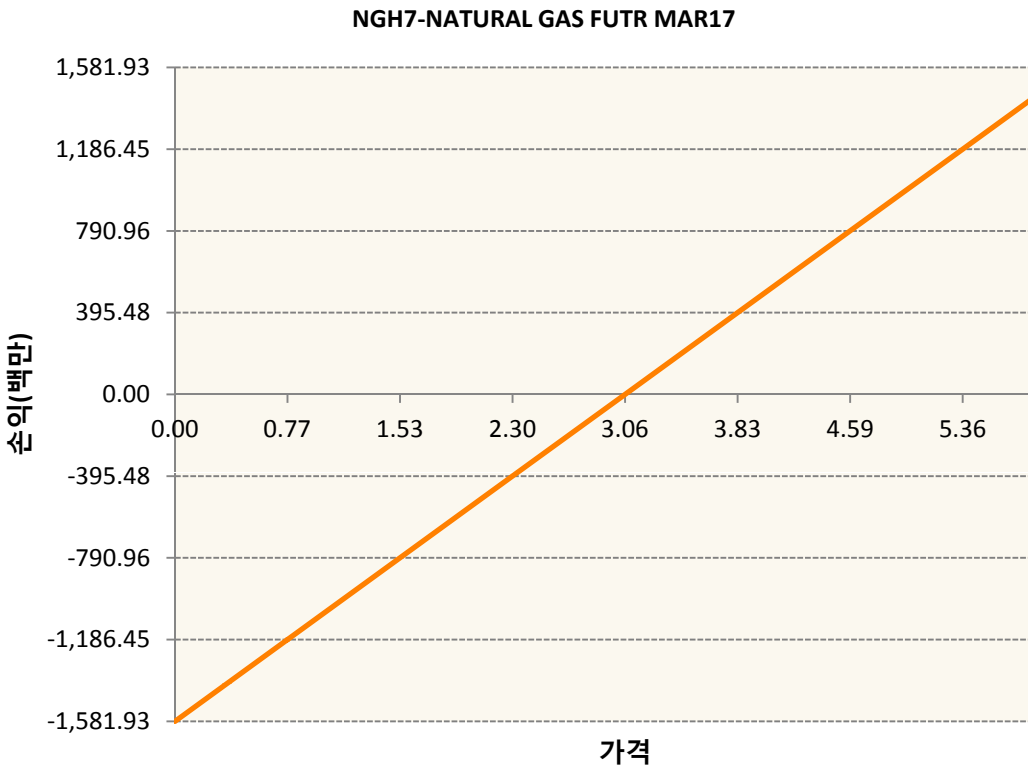


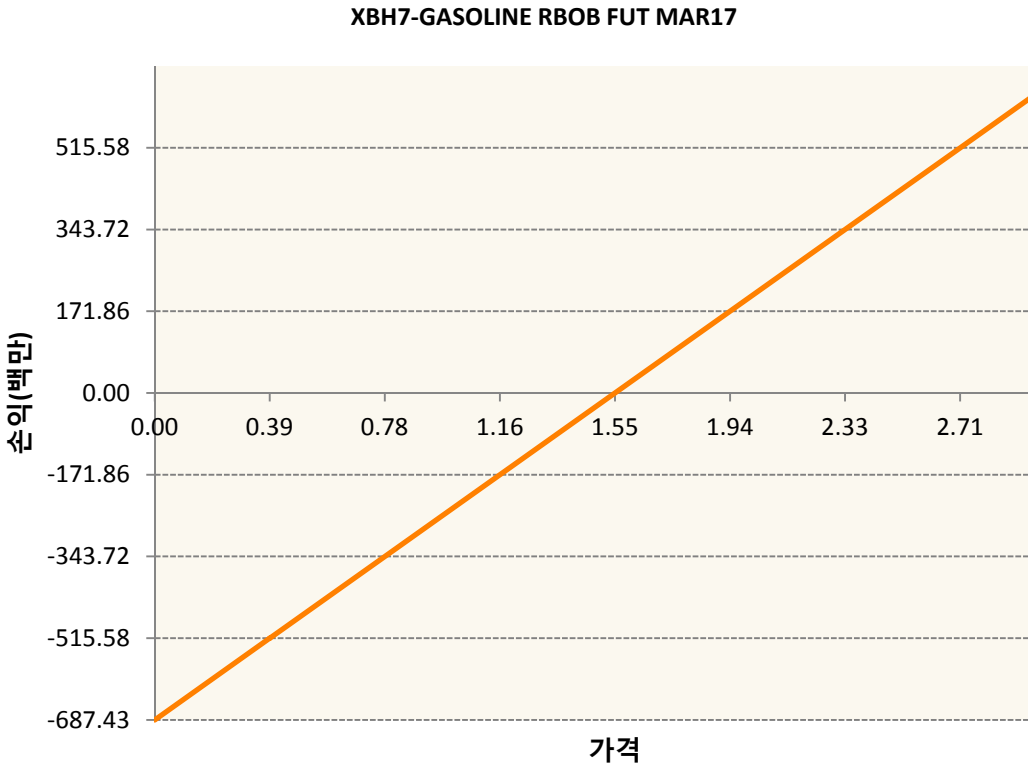

-945.30
-1,417.95
-1,890.61
가격


HOH7-NY Harb ULSD Fut MAR17
613.88
409.25
204.63
0.00
-204.63
-409.25
-613.88
-818.51
0.00
0.42
0.84
1.25
1.67
2.09
2.51
2.92
순익(백만)
가격


KR4175M20009-2017-02 달러선물
307.04
204.70
102.35
0.00
-102.35
-204.70
0.00
284.30
568.60
852.90
1,137.20
1,421.50
1,705.80
1,990.10
순익(백만)


-409.39
가격


NGH7-NATURAL GAS FUTR MAR17
1,581.93
1,186.45
790.96
395.48
0.00
-395.48
-790.96
-1,186.45
-1,581.93
0.00
0.77
1.53
2.30
3.06
3.83
4.59
5.36
순익(백만)
가격


XBH7-GASOLINE RBOB FUT MAR17
515.58
343.72
171.86
0.00
-171.86
-343.72
-515.58
-687.43
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	111
COK7	BRENT CRUDE FUTR MAY17	151
HOH7	NY Harb ULSD Fut MAR17	65
KR4175M20(	2017-02 달러선물	33
NGH7	NATURAL GAS FUTR MAR17	127
XBH7	GASOLINE RBOB FUT MAR17	55

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

1,135

공시일	2017-02-07
기준일	2017-02-06

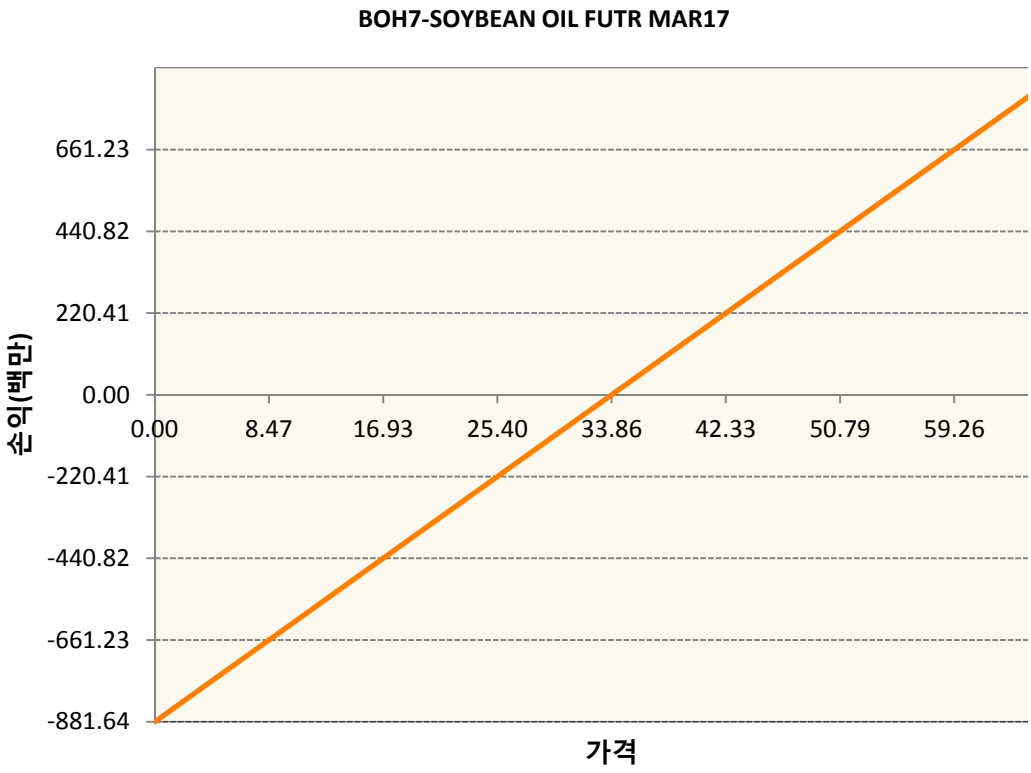
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

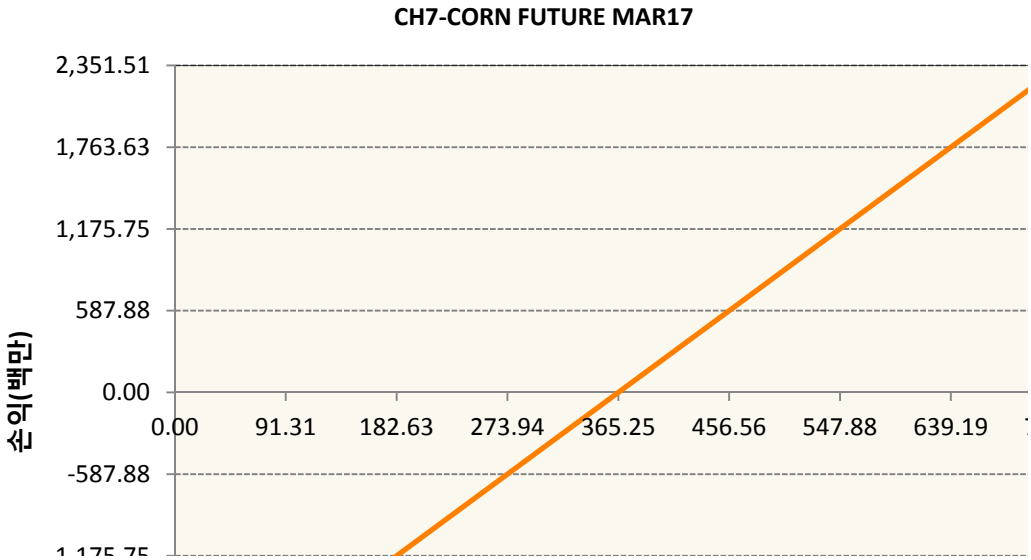
1. 계약금액

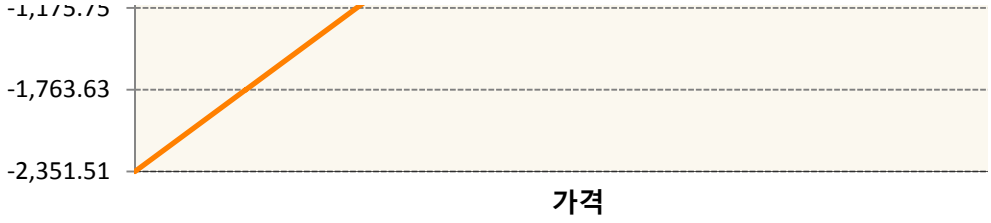
(단위:백만원)

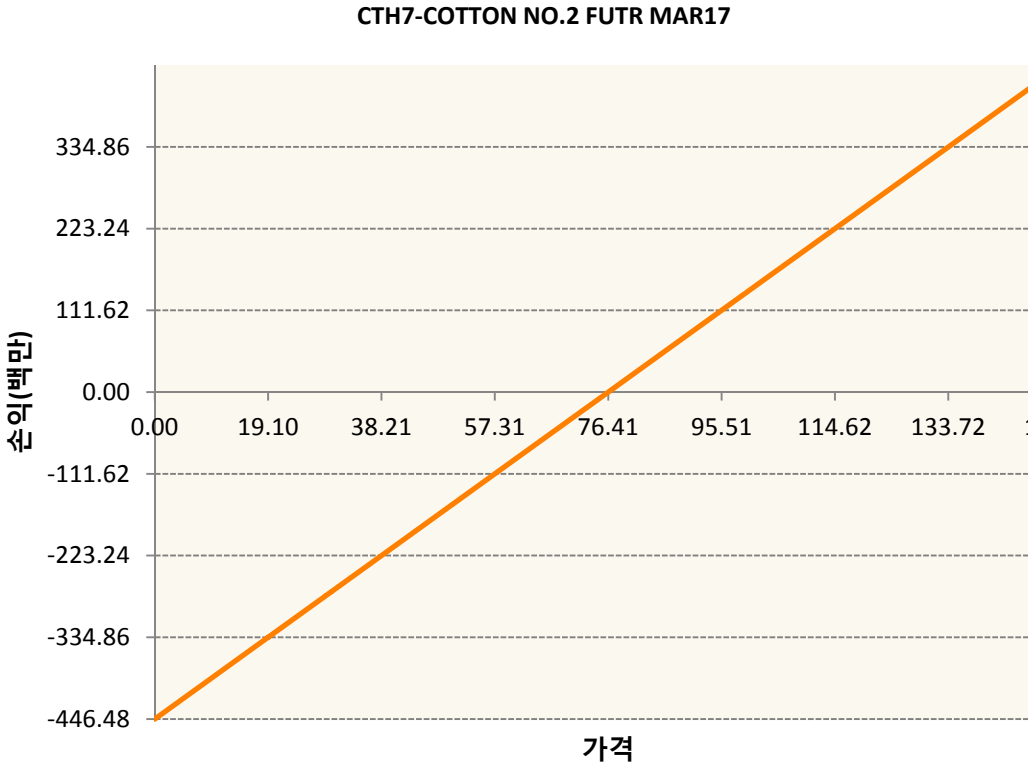
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	9,875	569	9,306	

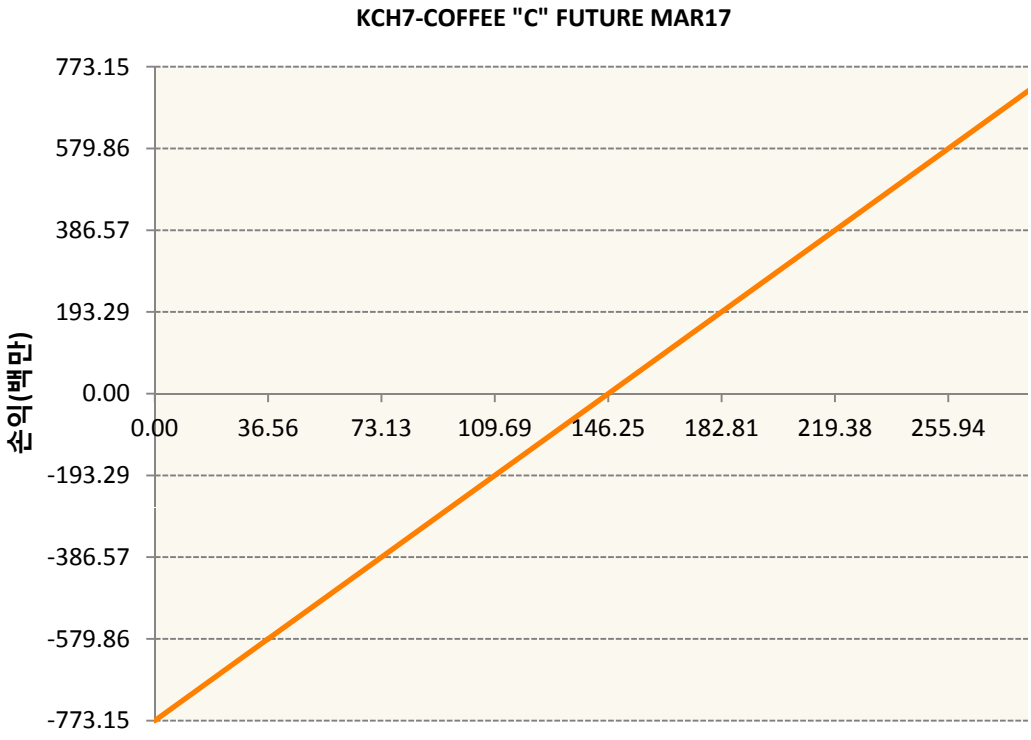
2. 만기시점의 손익구조



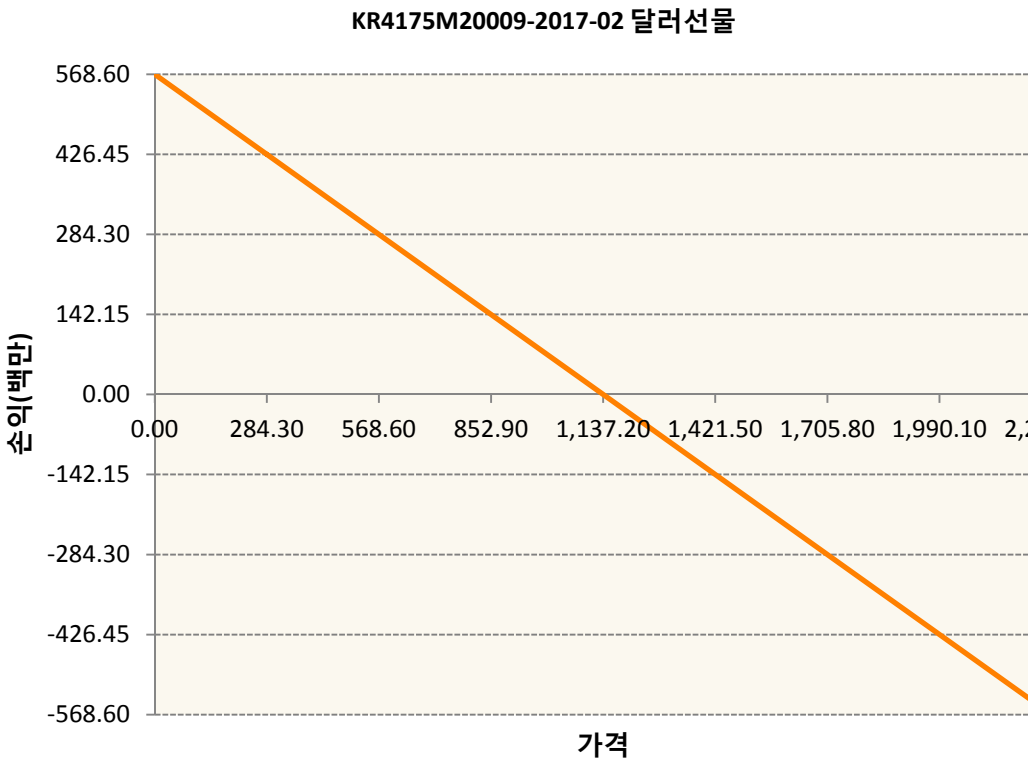


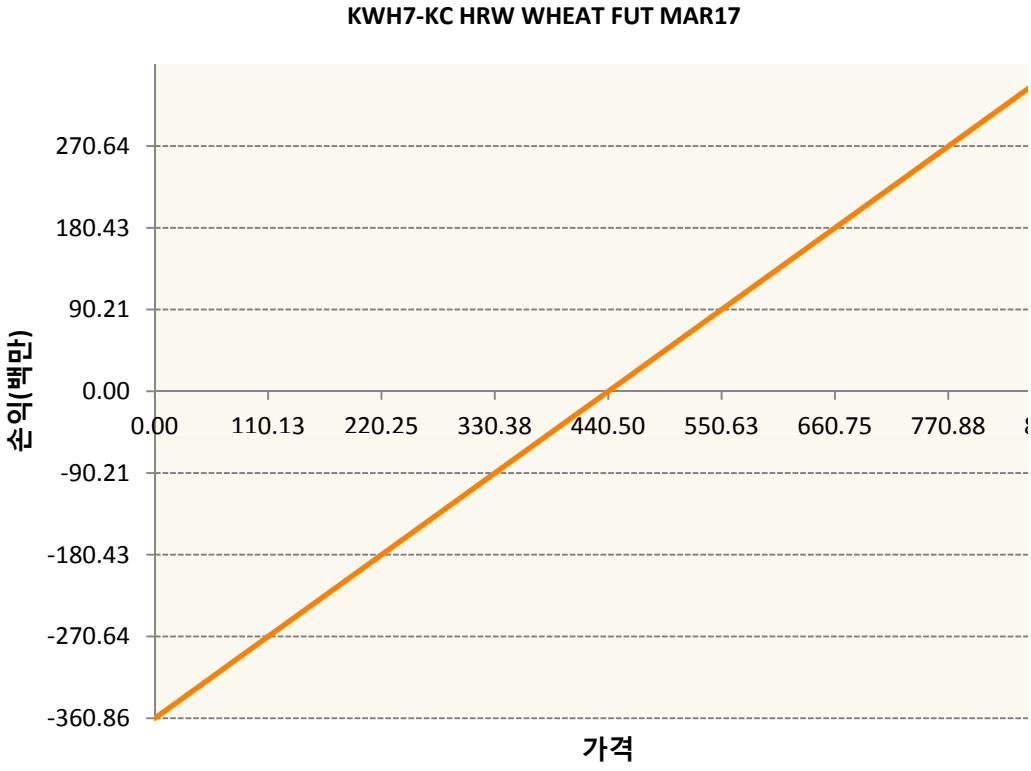

-1,763.63
-2,351.51
가격

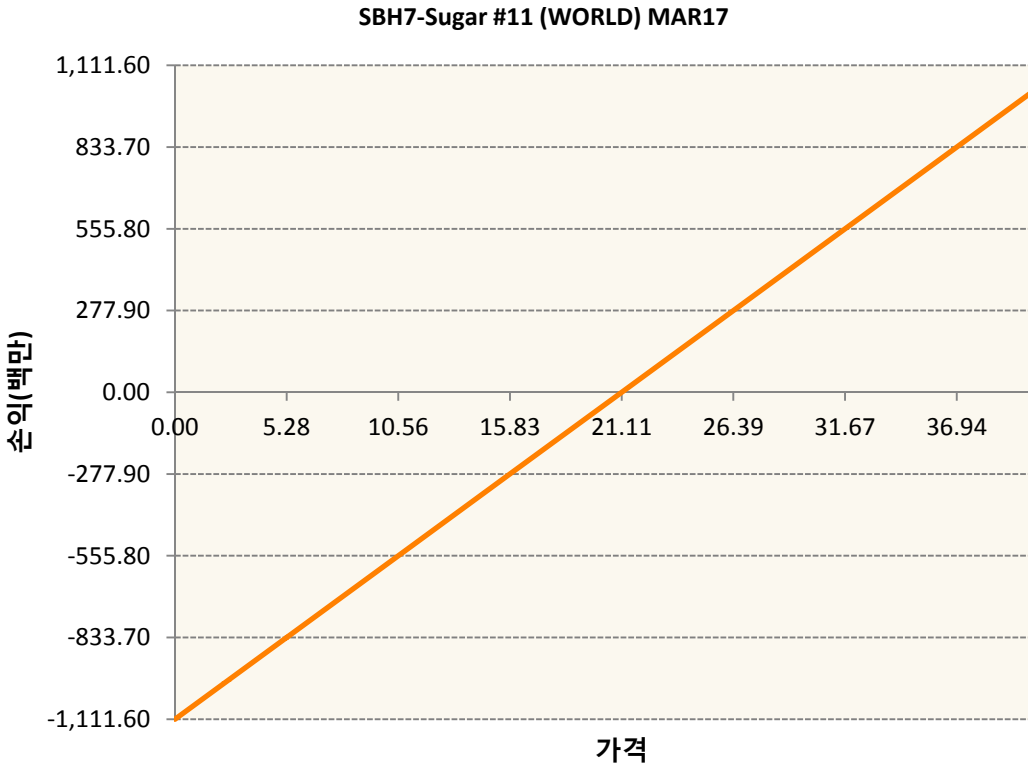

CTH7-COTTON NO.2 FUTR MAR17
334.86
223.24
111.62
0.00
-111.62
-223.24
-334.86
-446.48
0.00
19.10
38.21
57.31
76.41
95.51
114.62
133.72
순익(백만)
가격

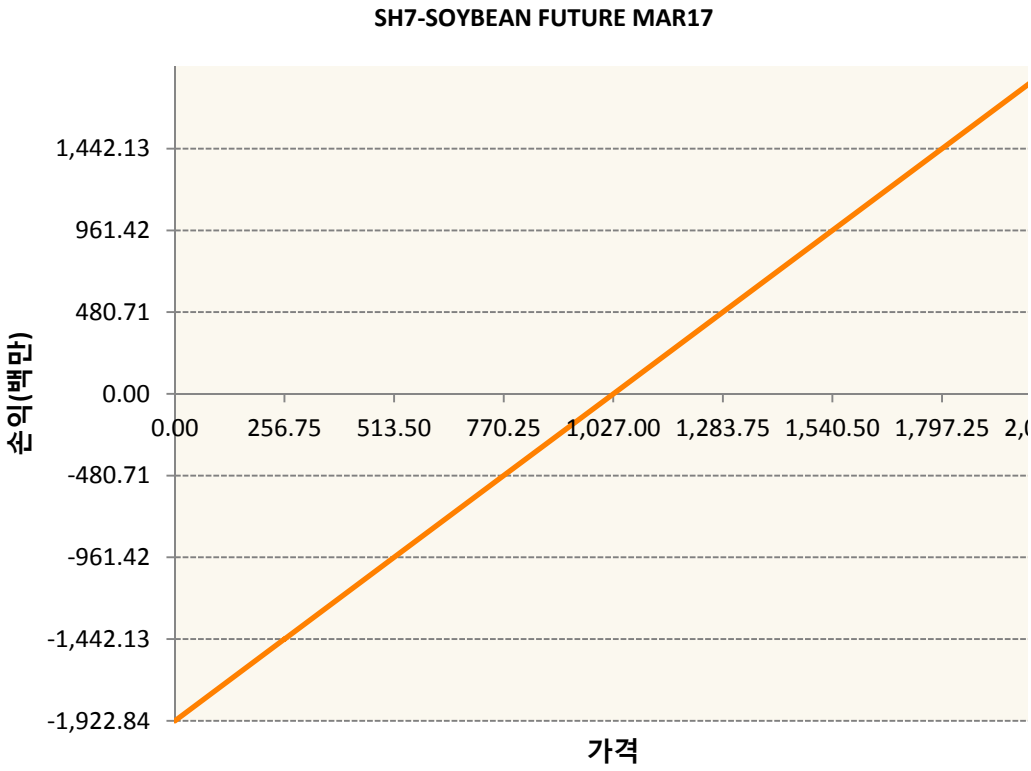

KCH7-COFFEE "C" FUTURE MAR17
773.15
579.86
386.57
193.29
0.00
-193.29
-386.57
-579.86
-773.15
0.00
36.56
73.13
109.69
146.25
182.81
219.38
255.94
순익(백만)

가격

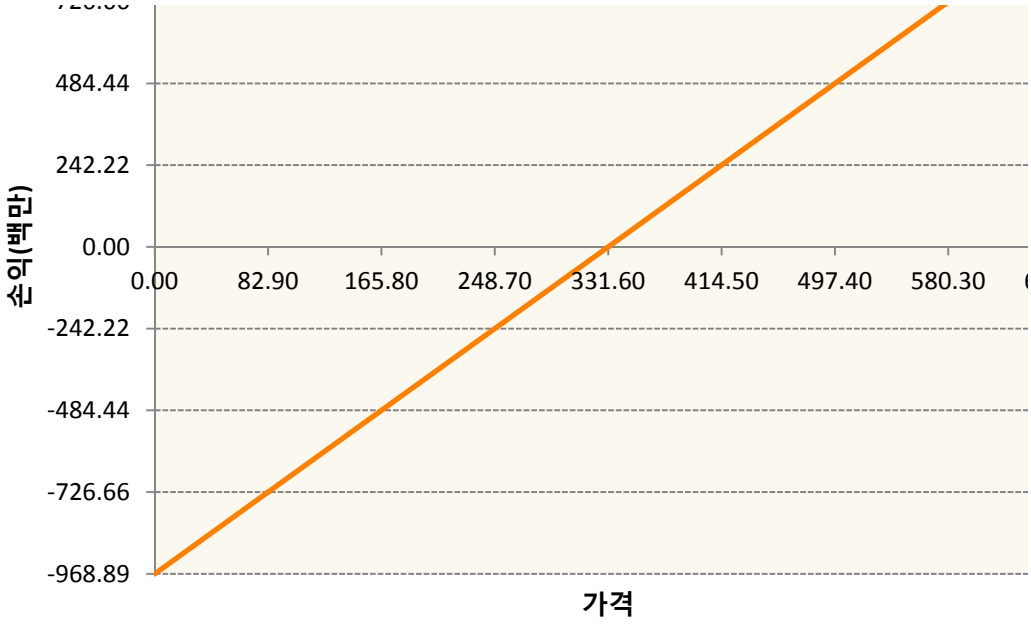

KR4175M20009-2017-02 달러선물
568.60
426.45
284.30
142.15
0.00
-142.15
-284.30
-426.45
-568.60
0.00
284.30
568.60
852.90
1,137.20
1,421.50
1,705.80
1,990.10
손익(백만)
가격

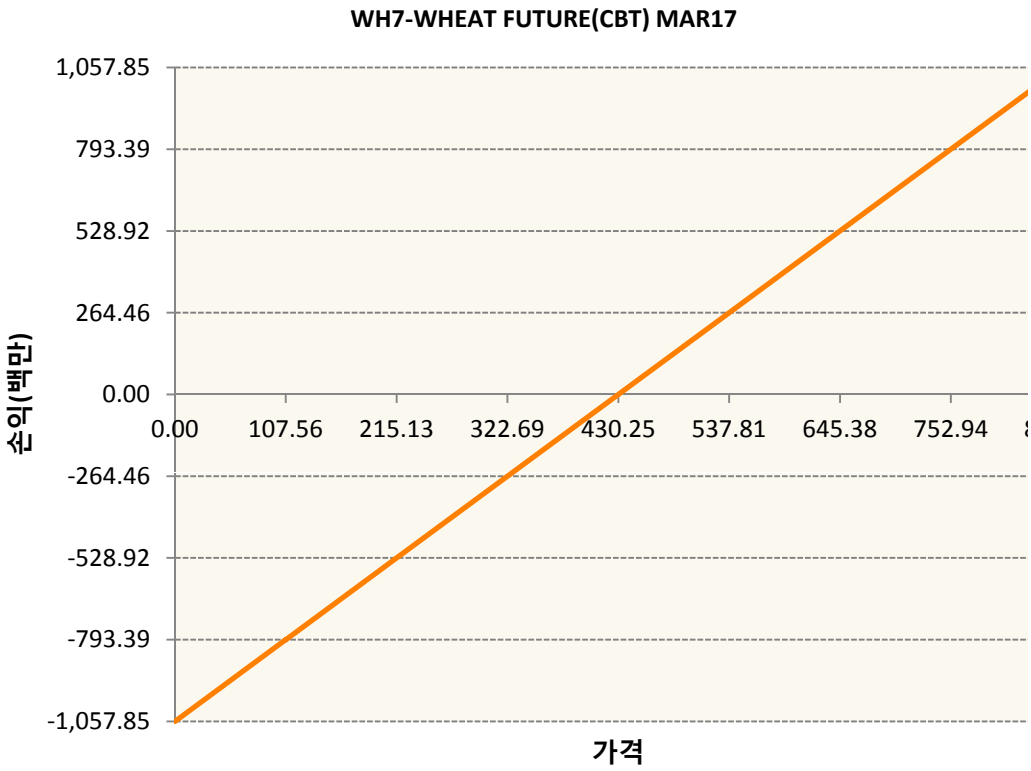

KWH7-KC HRW WHEAT FUT MAR17
270.64
180.43
90.21
0.00
-90.21
-180.43
-270.64
-360.86
0.00
110.13
220.25
330.38
440.50
550.63
660.75
770.88
손익(백만)
가격


SBH7-Sugar #11 (WORLD) MAR17
1,111.60
833.70
555.80
277.90
0.00
-277.90
-555.80
-833.70
-1,111.60
0.00
5.28
10.56
15.83
21.11
26.39
31.67
36.94
손익(백만)
가격


SH7-SOYBEAN FUTURE MAR17
1,442.13
961.42
480.71
0.00
-480.71
-961.42
-1,442.13
-1,922.84
0.00
256.75
513.50
770.25
1,027.00
1,283.75
1,540.50
1,797.25
손익(백만)
가격


SMH7-SOYBEAN MEAL FUTR MAR17
968.89
726.66





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

BOH7	SOYBEAN OIL FUTR MAR17	71
CH7	CORN FUTURE MAR17	188
CTH7	COTTON NO.2 FUTR MAR17	36
KCH7	COFFEE "C" FUTURE MAR17	62
KR4175M20(	2017-02 달러선물	45

KWH7	KC HRW WHEAT FUT MAR17	29
SBH7	Sugar #11 (WORLD) MAR17	89
SH7	SOYBEAN FUTURE MAR17	154
SMH7	SOYBEAN MEAL FUTR MAR17	78
WH7	WHEAT FUTURE(CBT) MAR17	85

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

937