공시일	2017-02-08
기준일	2017-02-07

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	2017-02-08
기준일	2017-02-07

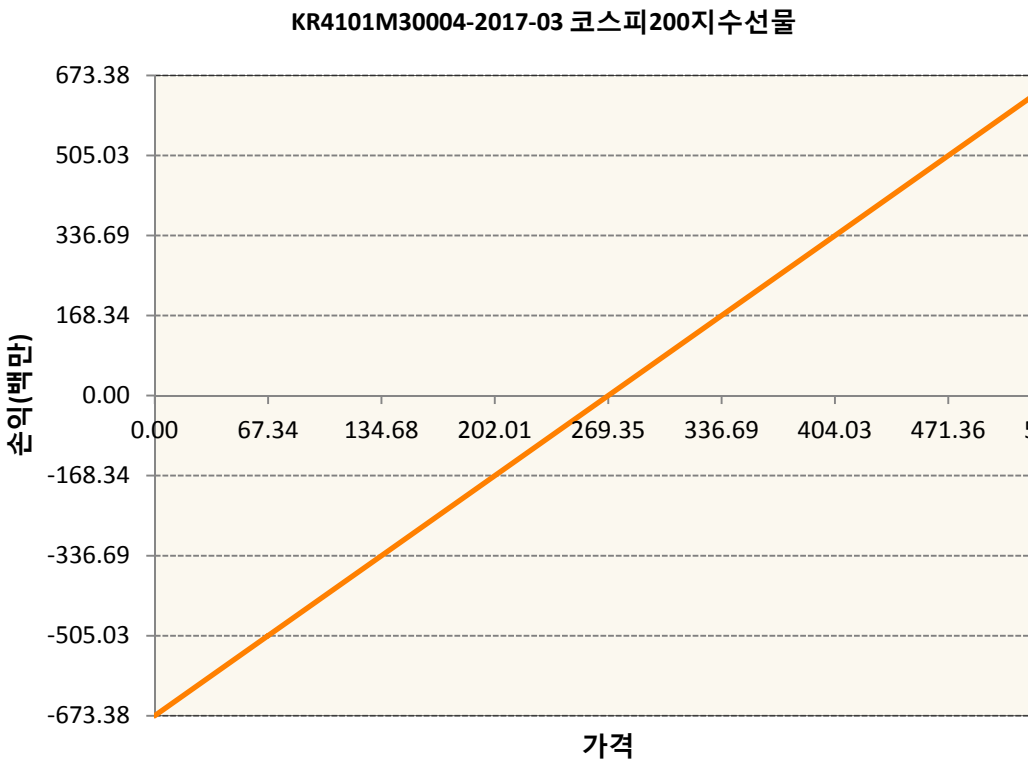
스마트인덱스모

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	2017-02-08
기준일	2017-02-07

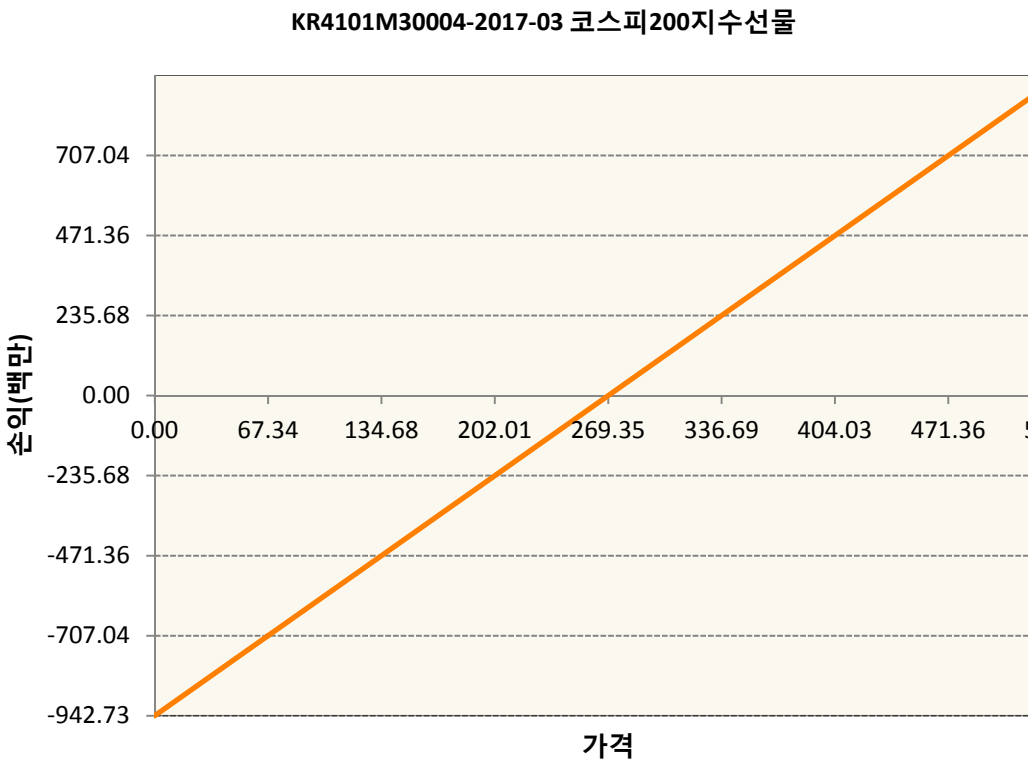
스마트레버리지목표전환형1호

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	943	0	943	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	2017-02-08
기준일	2017-02-07

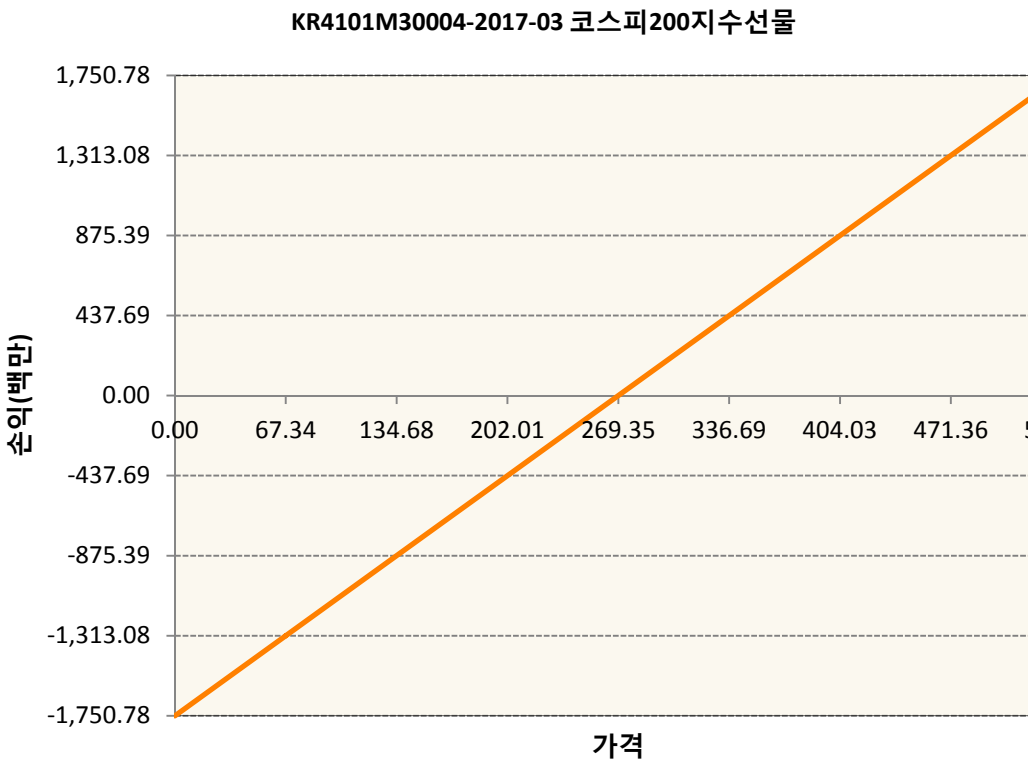
1.3배 레버리지 인덱스(주식-파생형)

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	1,751	0	1,751	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	2017-02-08
기준일	2017-02-07

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	928

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

655

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-02-08
기준일	2017-02-07

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	380

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

539

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-02-08
기준일	2017-02-07

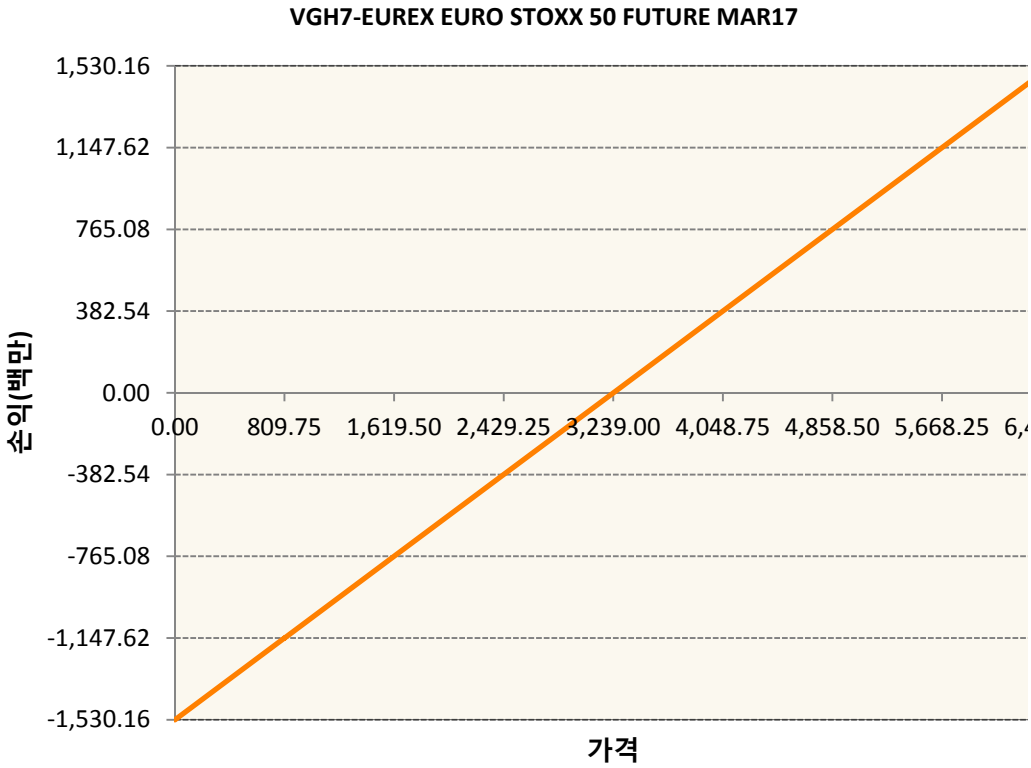
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,530	0	1,530	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGH7	EUREX EURO STOXX 50 FUTURE MAR17	122

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

(단위:백만원)

130

공시일	2017-02-08
기준일	2017-02-07

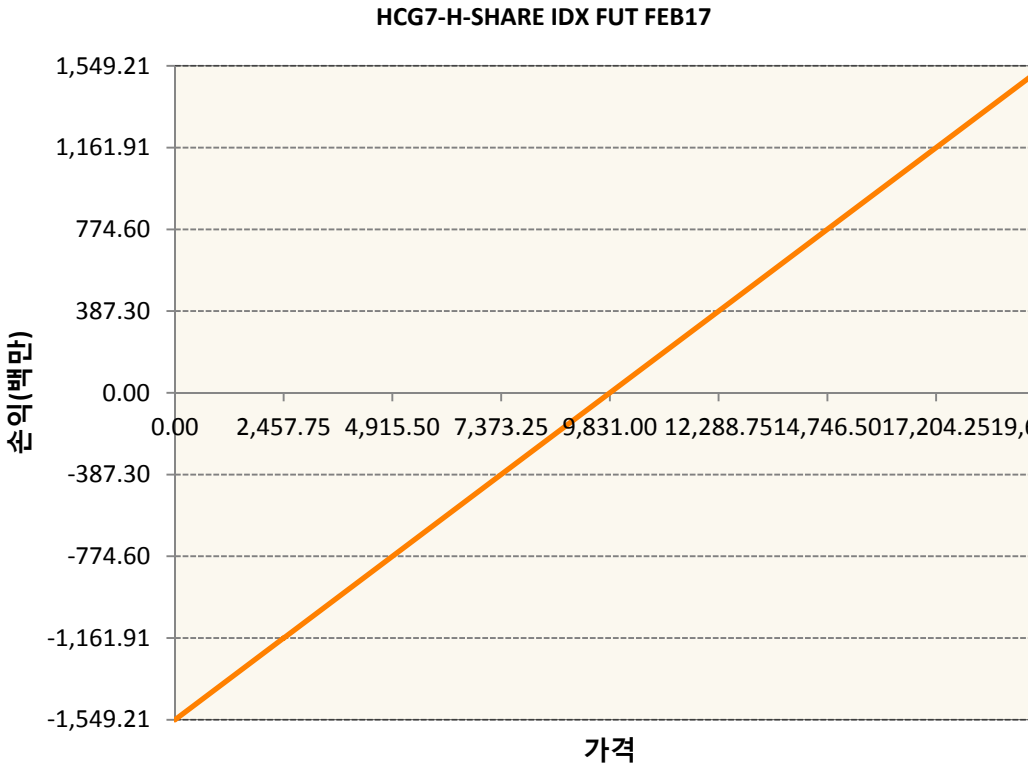
차이나인덱스모(주식-파생형)

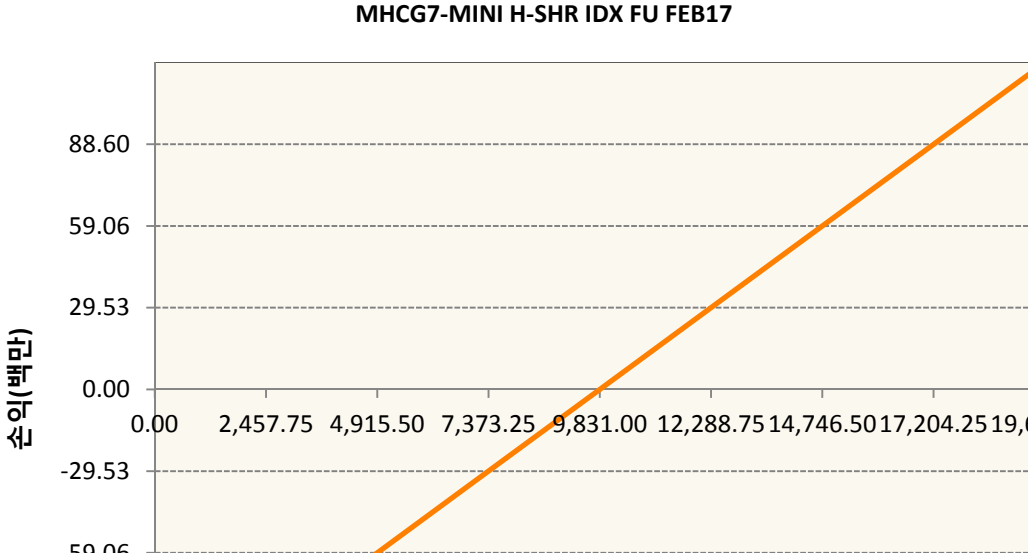
1. 계약금액

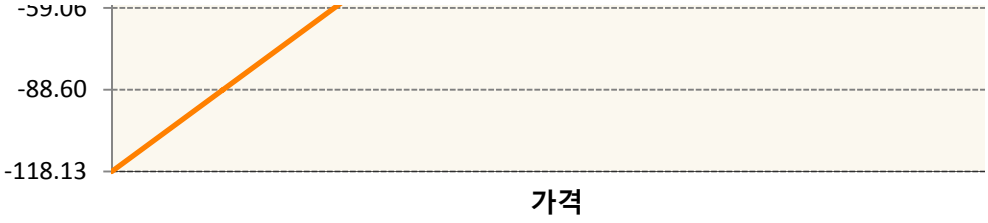
(단위:백만원)

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)
	160

공시일	2017-02-08
기준일	2017-02-07

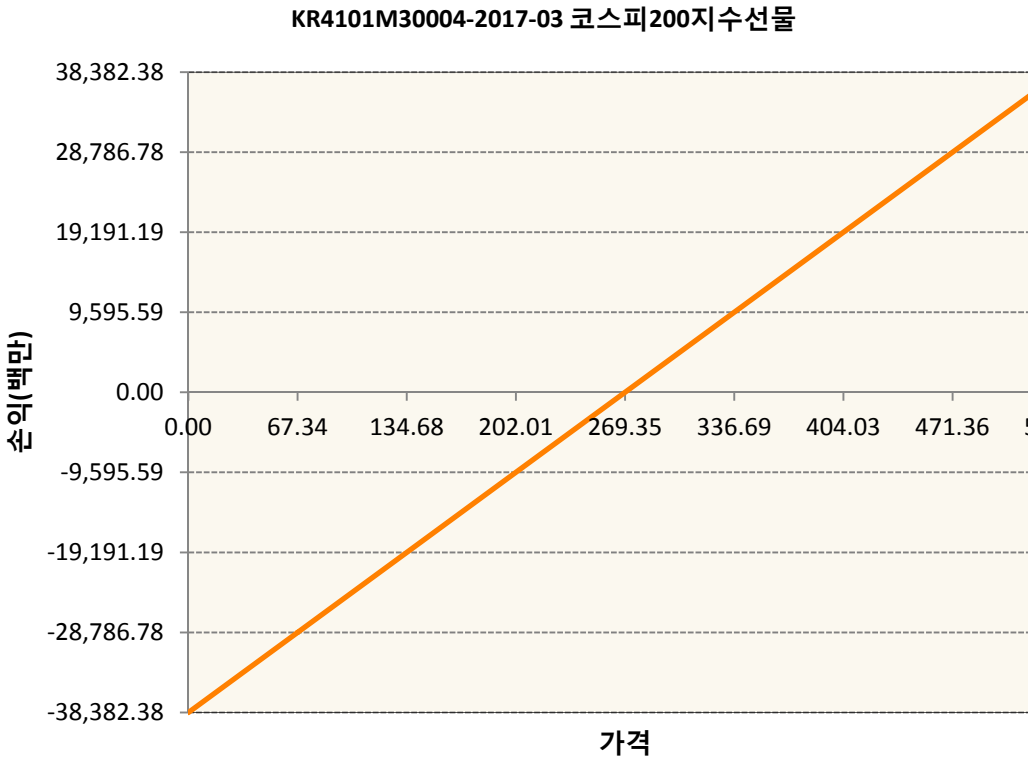
커버드콜모(주식혼합-파생형)

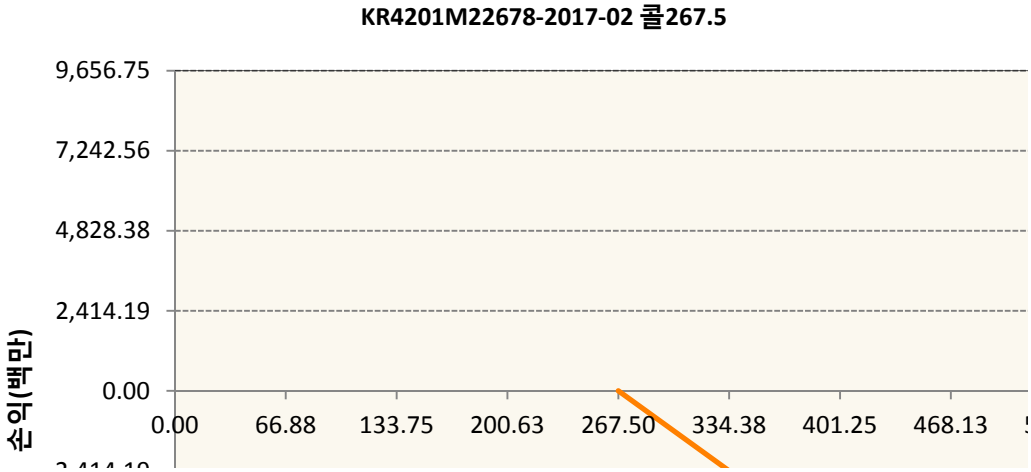
1. 계약금액

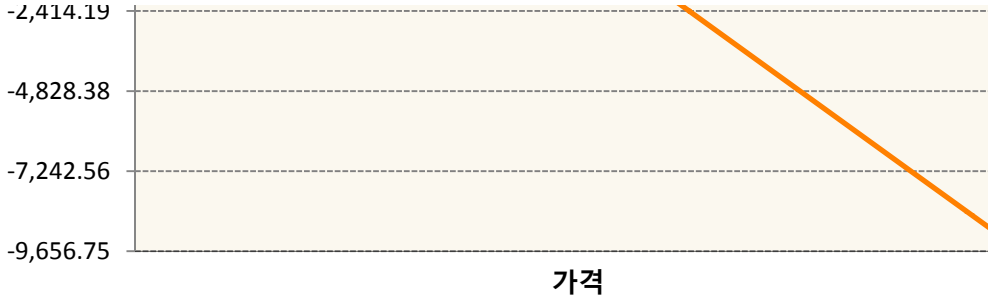
(단위:백만원)

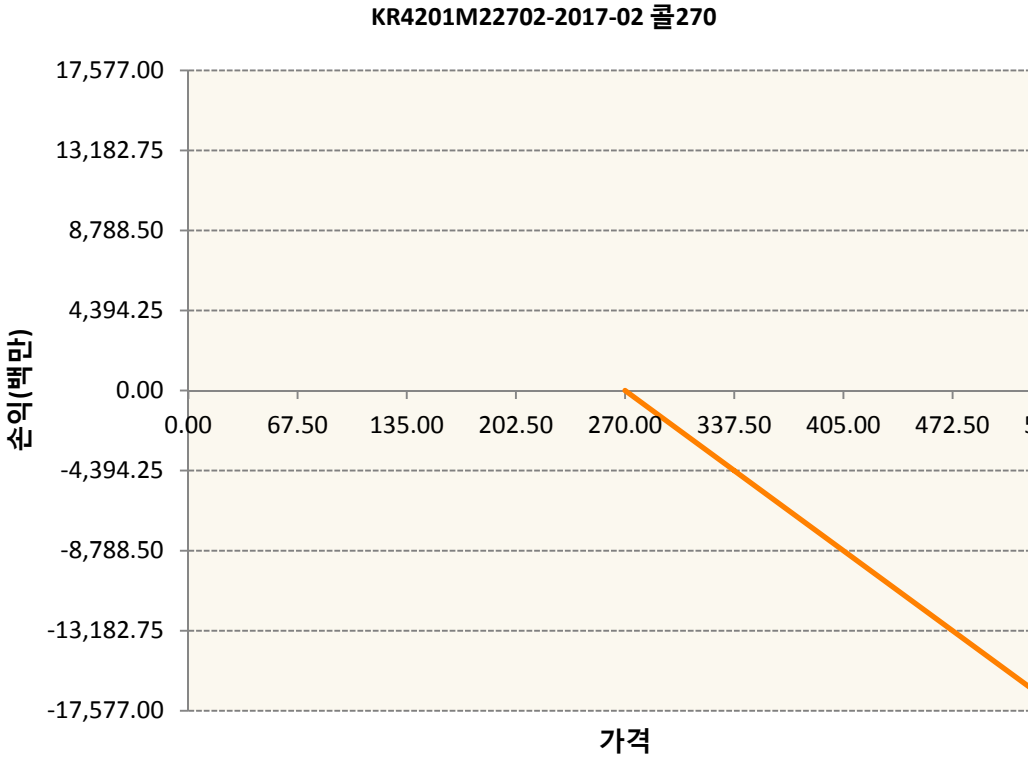
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	38,382	0	38,382	장내
누계	유가증권	옵션	0	27,234	-27,234	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101M30(2017-03 코스피200지수선물							3,066
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-3,066	-3,066	-3,066	-3,066	-3,066	-3,066	-3,066
-5.33%	-2,044	-2,044	-2,044	-2,044	-2,044	-2,044	-2,044
-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%	2,044	2,044	2,044	2,044	2,044	2,044	2,044
8.00%	3,066	3,066	3,066	3,066	3,066	3,066	3,066
KR4201M22(2017-02 콜267.5							3,816
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	334	334	334	334	334	334	334
-5.33%	334	334	334	334	334	334	334
-2.67%	334	334	334	333	332	331	329
0%	32	22	11	0	-12	-24	-36
2.67%	-1,227	-1,227	-1,227	-1,227	-1,227	-1,227	-1,227
5.33%	-2,521	-2,521	-2,521	-2,521	-2,521	-2,521	-2,521
8.00%	-3,816	-3,816	-3,816	-3,816	-3,816	-3,816	-3,816
KR4201M22 2017-02 콜270							6,503

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	167	167	167	167	167	167	167
-5.33%	167	167	167	167	167	167	167
-2.67%	167	167	167	167	167	167	166
0%	67	45	23	0	-23	-47	-71
2.67%	-1,834	-1,834	-1,834	-1,835	-1,836	-1,838	-1,841
5.33%	-4,168	-4,168	-4,168	-4,168	-4,168	-4,168	-4,168
8.00%	-6,503	-6,503	-6,503	-6,503	-6,503	-6,503	-6,503

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

18,177

공시일	2017-02-08
기준일	2017-02-07

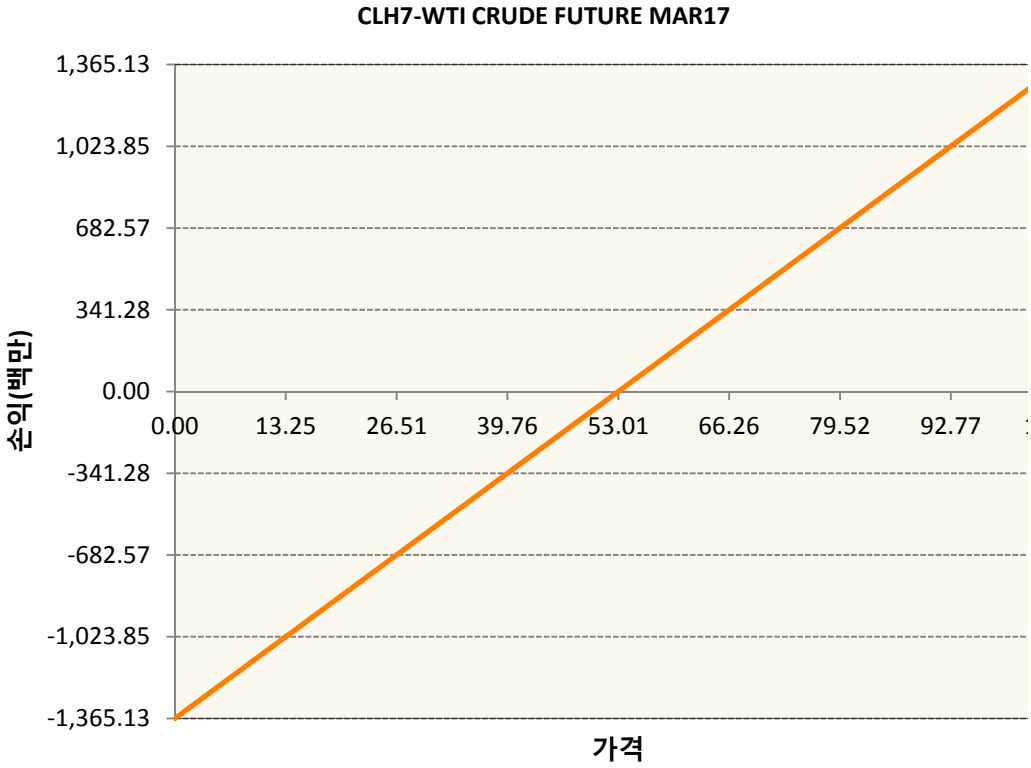
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

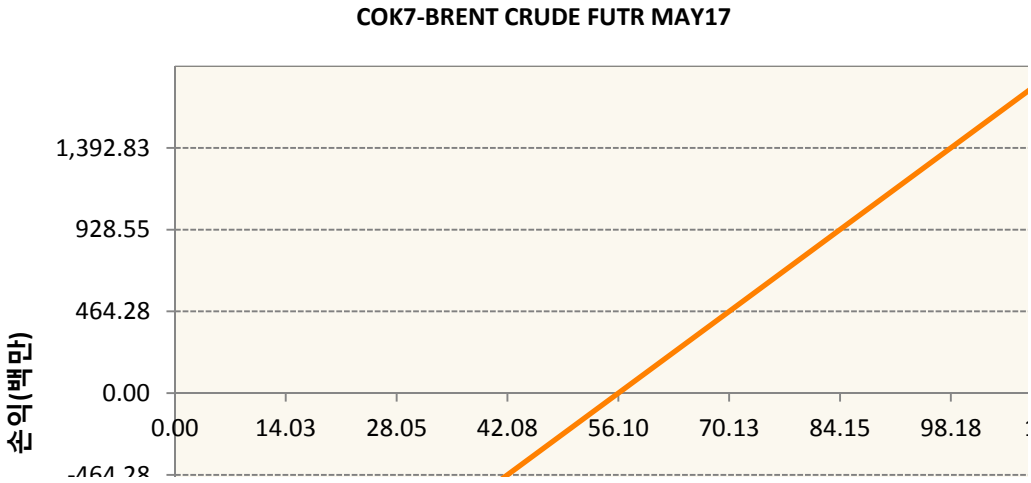
1. 계약금액

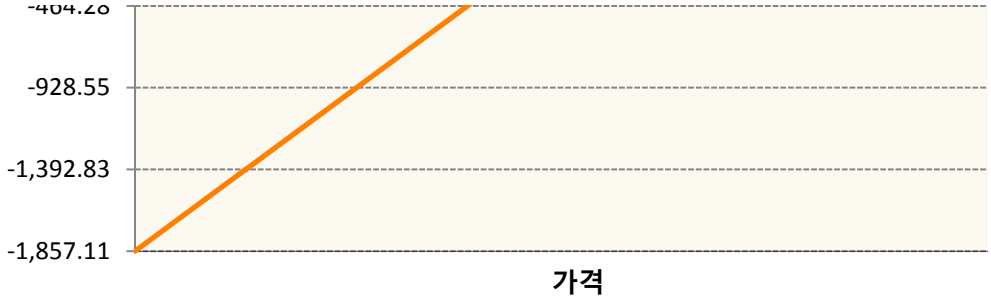
(단위:백만원)

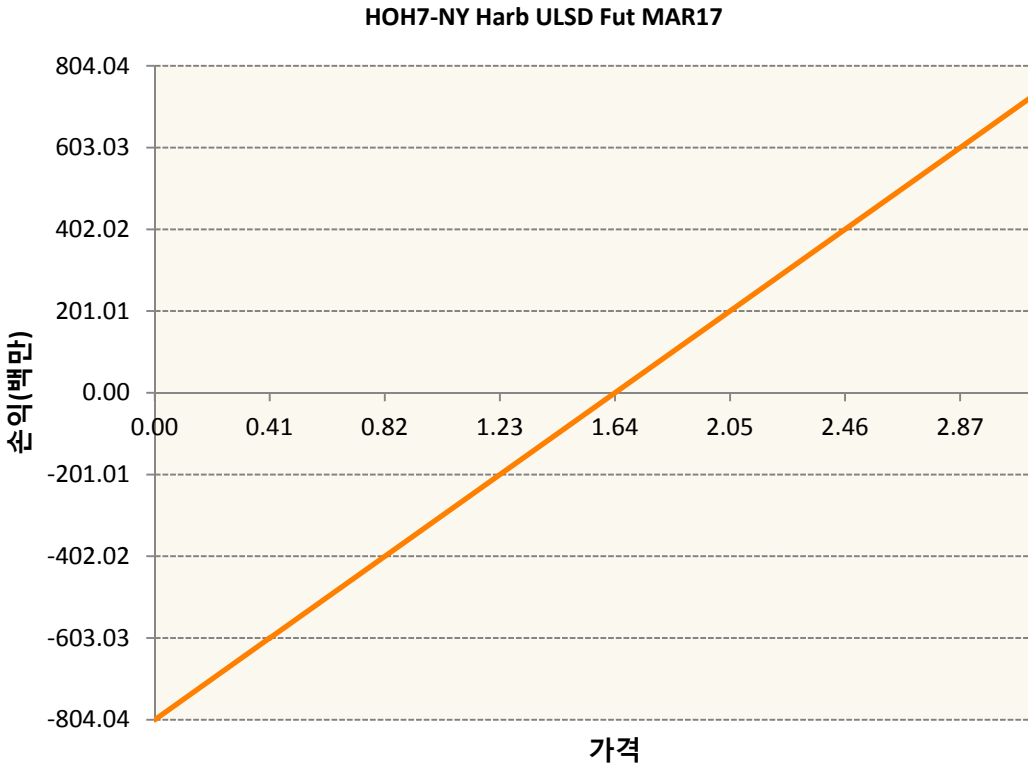
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	선물	유가증권	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	선물	유가증권	1,365	0	1,365	
누계	유가증권	선물	4,904	412	4,492	

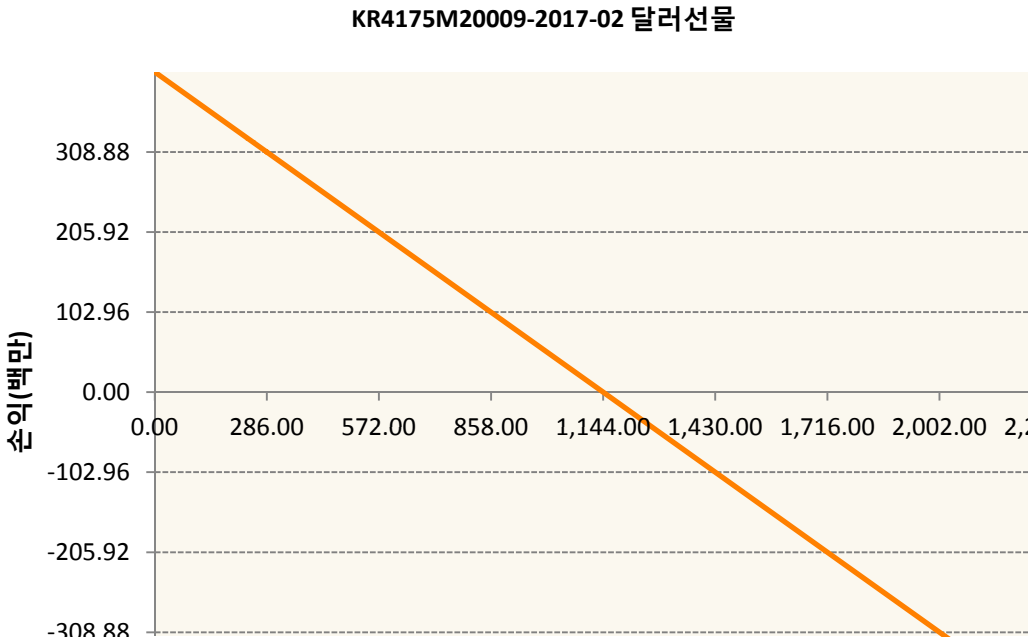
2. 만기시점의 손익구조

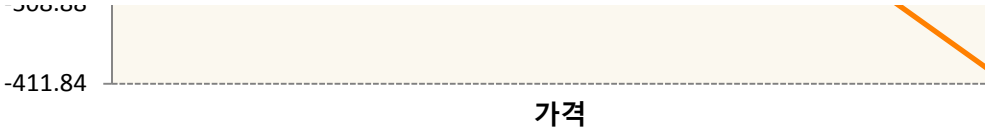


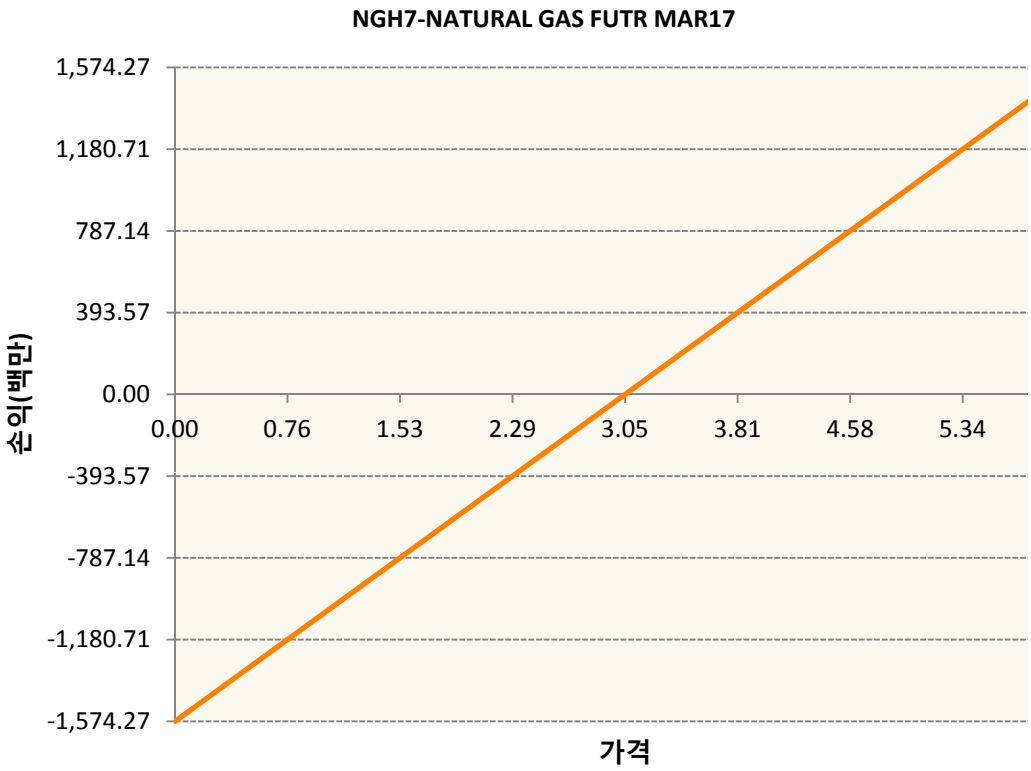


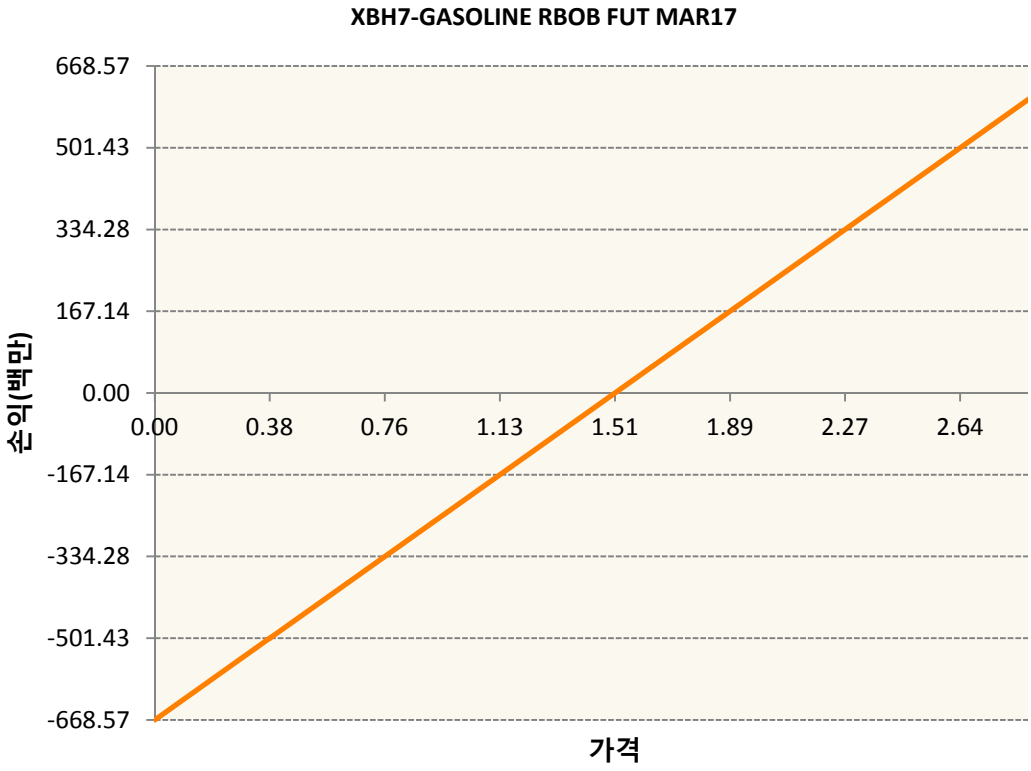

-928.55
-1,392.83
-1,857.11
가격


HOH7-NY Harb ULSD Fut MAR17
804.04
603.03
402.02
201.01
0.00
-201.01
-402.02
-603.03
-804.04
0.00
0.41
0.82
1.23
1.64
2.05
2.46
2.87
순익(백만)
가격


KR4175M20009-2017-02 달러선물
308.88
205.92
102.96
0.00
-102.96
-205.92
-308.88
0.00
286.00
572.00
858.00
1,144.00
1,430.00
1,716.00
2,002.00
순익(백만)


-411.84
가격


NGH7-NATURAL GAS FUTR MAR17
1,574.27
1,180.71
787.14
393.57
0.00
-393.57
-787.14
-1,180.71
-1,574.27
0.00
0.76
1.53
2.29
3.05
3.81
4.58
5.34
순익(백만)
가격


XBH7-GASOLINE RBOB FUT MAR17
668.57
501.43
334.28
167.14
0.00
-167.14
-334.28
-501.43
-668.57
0.00
0.38
0.76
1.13
1.51
1.89
2.27
2.64
순익(백만)
가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLH7	WTI CRUDE FUTURE MAR17	109
COK7	BRENT CRUDE FUTR MAY17	149
HOH7	NY Harb ULSD Fut MAR17	64
KR4175M20(	2017-02 달러선물	33
NGH7	NATURAL GAS FUTR MAR17	126
XBH7	GASOLINE RBOB FUT MAR17	53

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

1,116

공시일	2017-02-08
기준일	2017-02-07

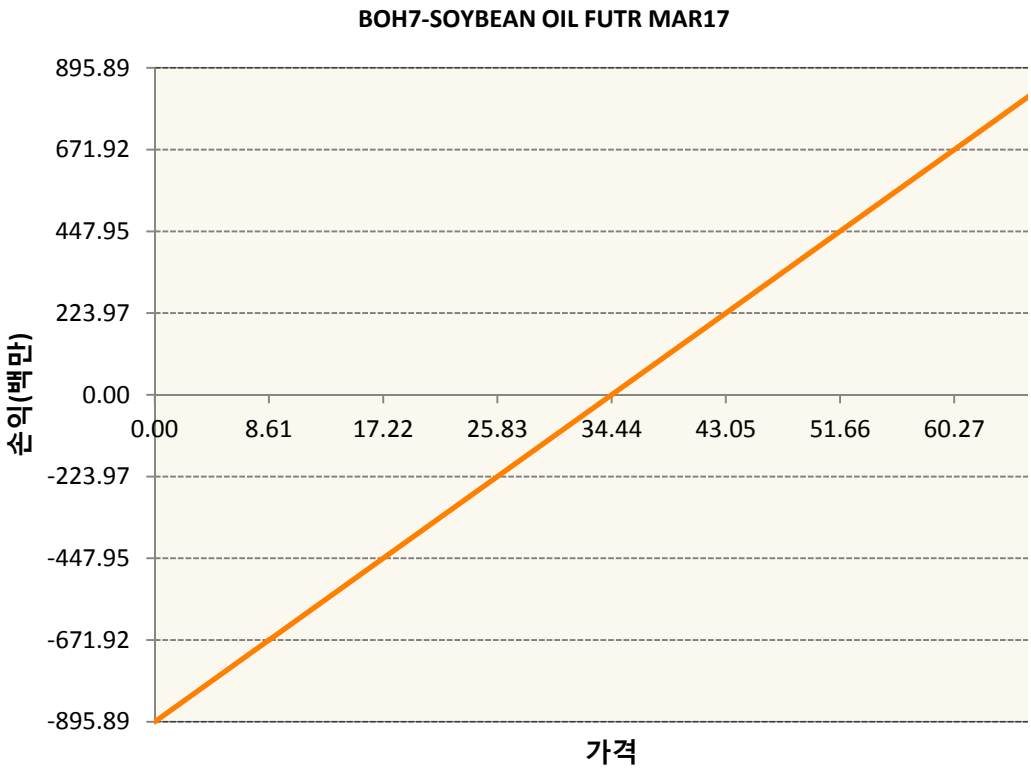
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

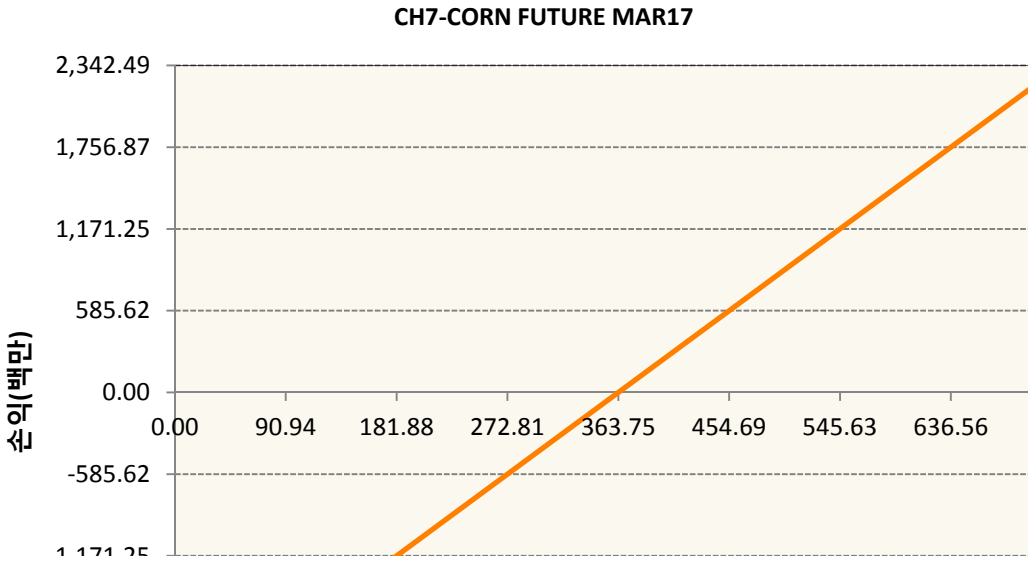
1. 계약금액

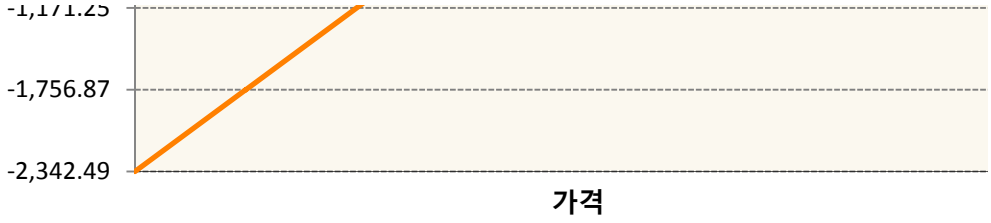
(단위:백만원)

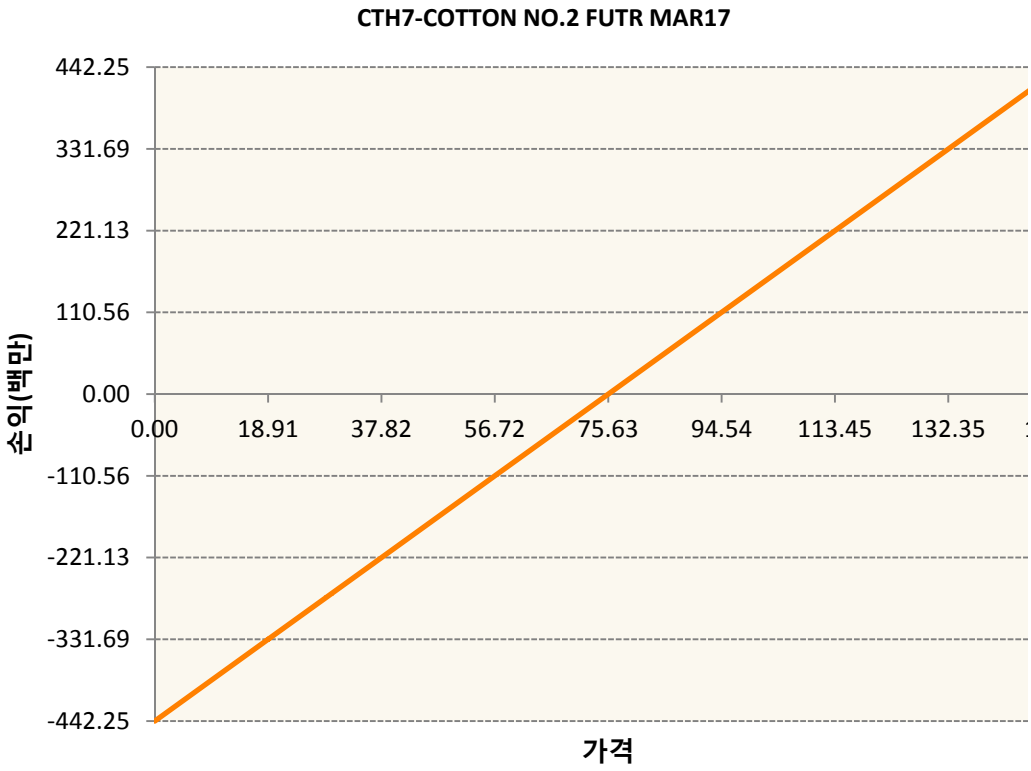
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	9,866	572	9,294	

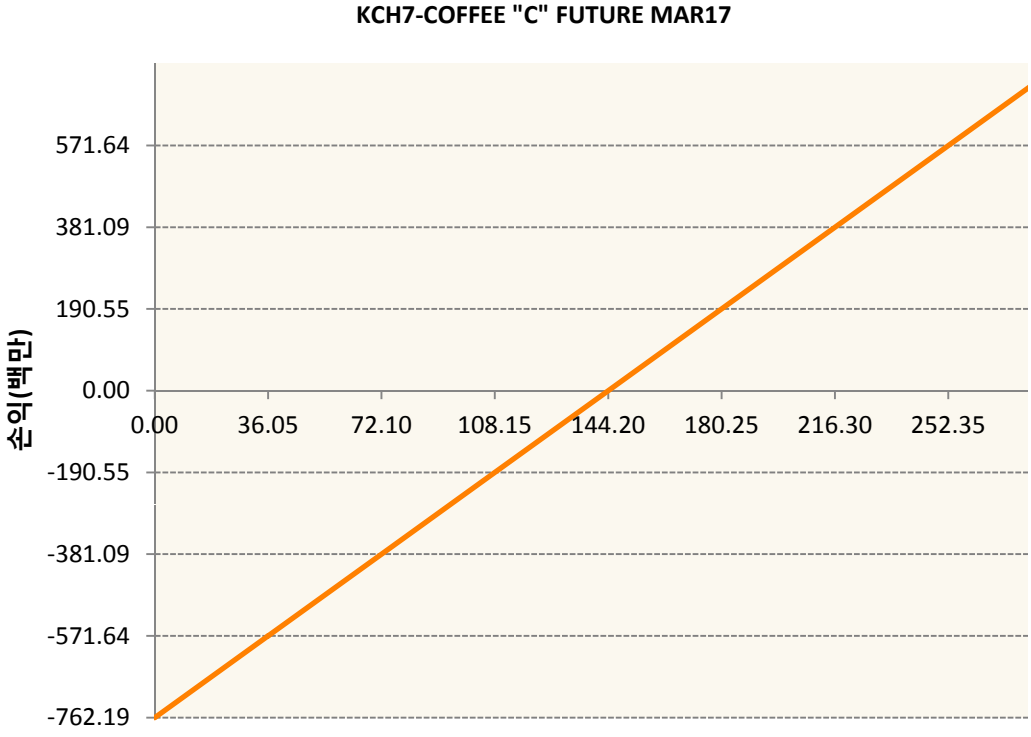
2. 만기시점의 손익구조



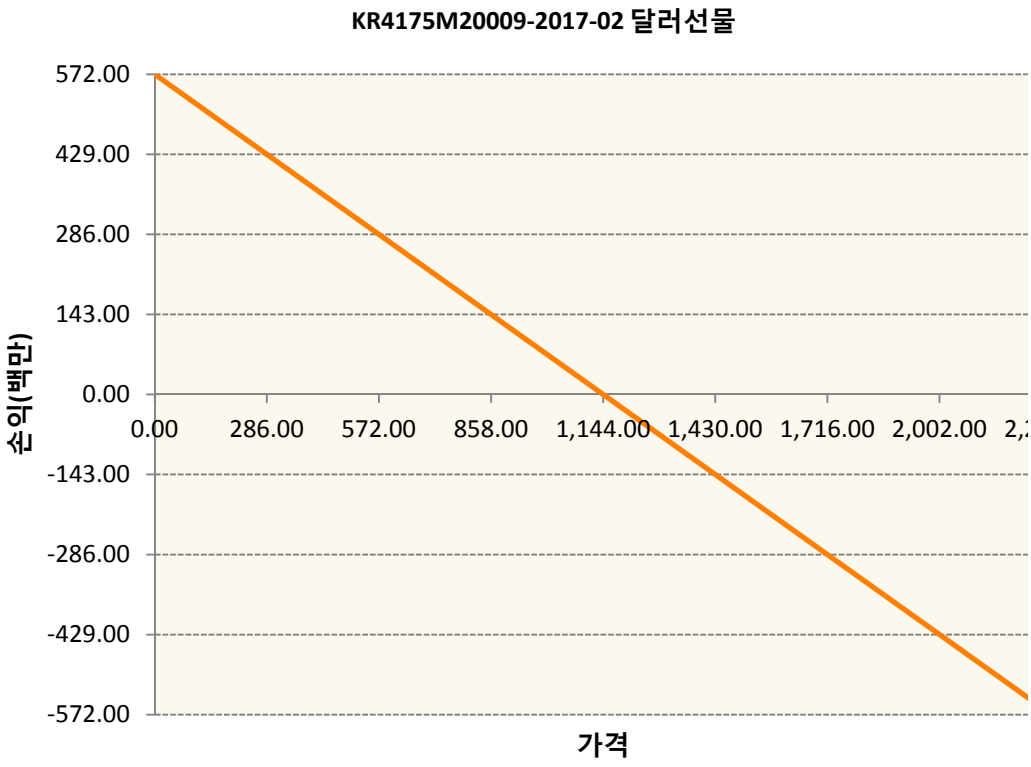


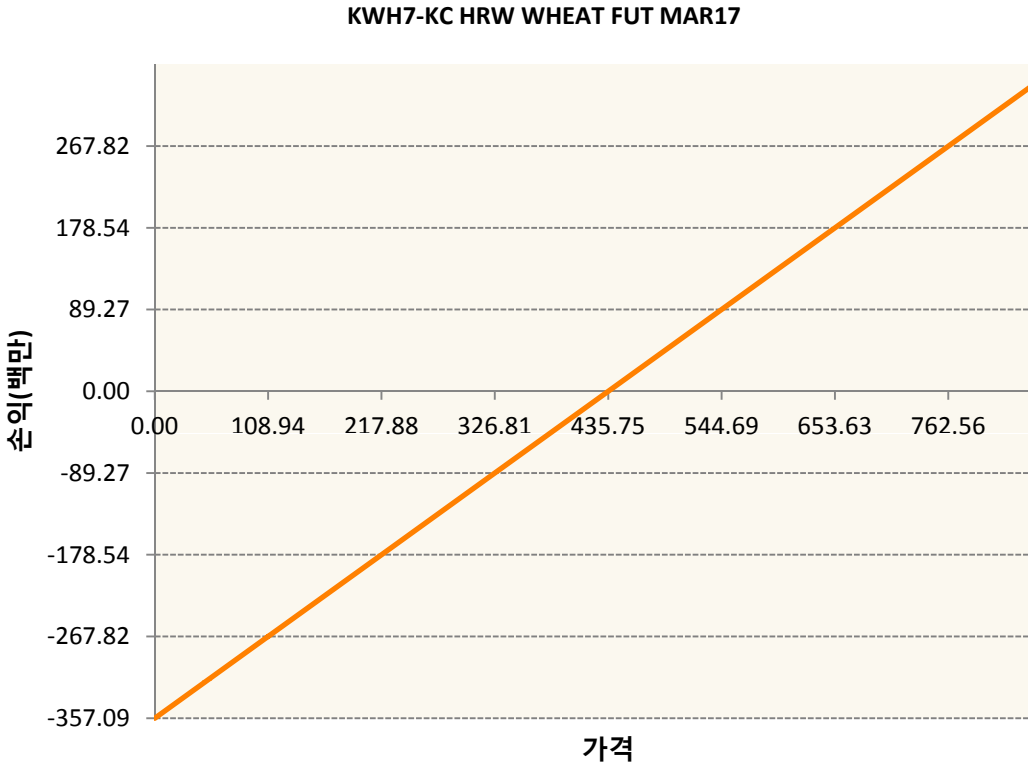

-1,171.25
-1,756.87
-2,342.49
가격

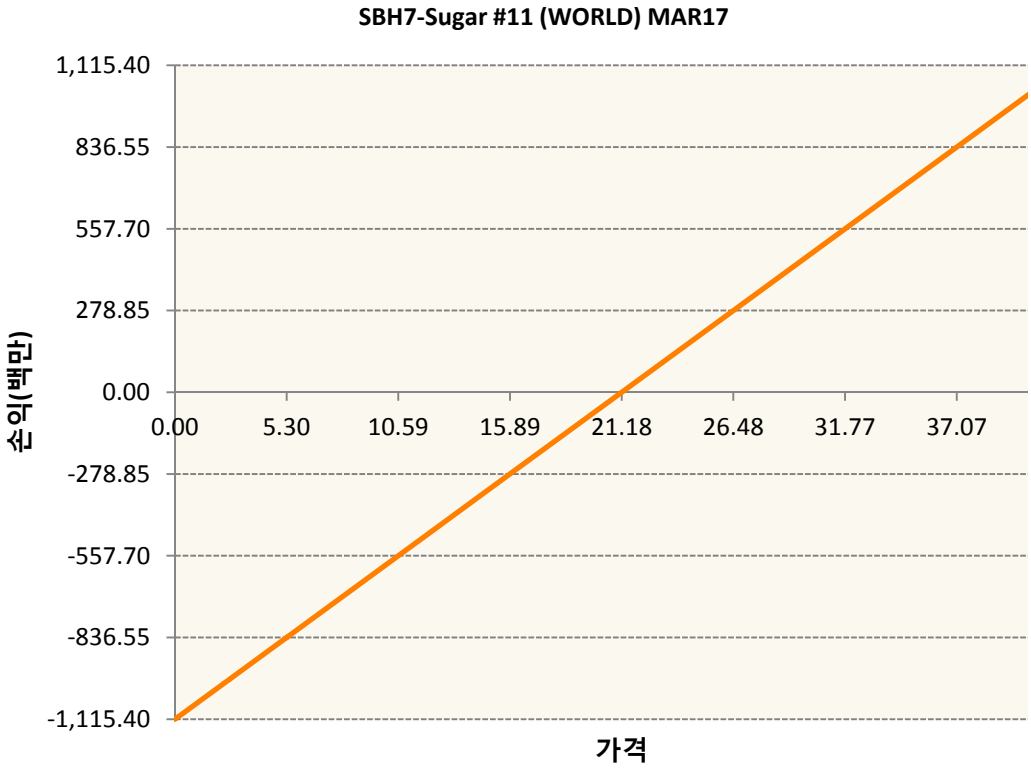

CTH7-COTTON NO.2 FUTR MAR17
442.25
331.69
221.13
110.56
0.00
-110.56
-221.13
-331.69
-442.25
0.00
18.91
37.82
56.72
75.63
94.54
113.45
132.35
손익(백만)
가격

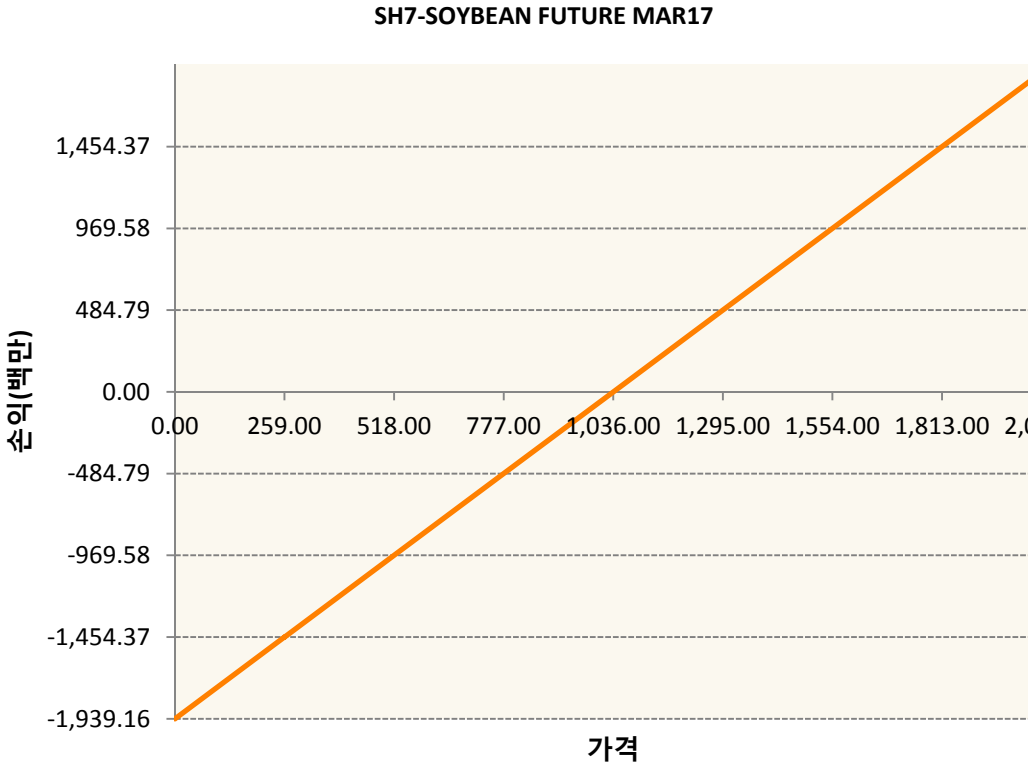

KCH7-COFFEE "C" FUTURE MAR17
571.64
381.09
190.55
0.00
-190.55
-381.09
-571.64
-762.19
0.00
36.05
72.10
108.15
144.20
180.25
216.30
252.35
손익(백만)

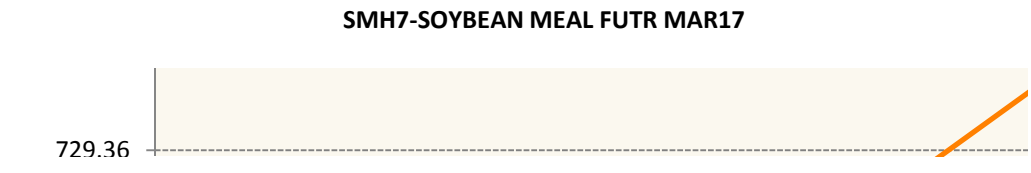
가격

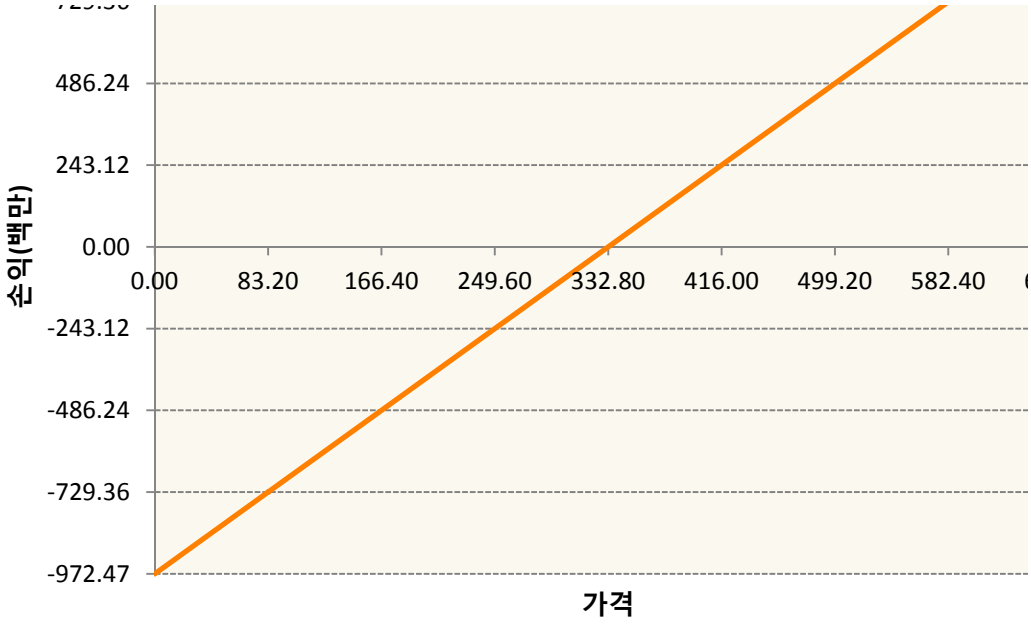

KR4175M20009-2017-02 달러선물
572.00
429.00
286.00
143.00
0.00
-143.00
-286.00
-429.00
-572.00
0.00
286.00
572.00
858.00
1,144.00
1,430.00
1,716.00
2,002.00
손익(백만)
가격

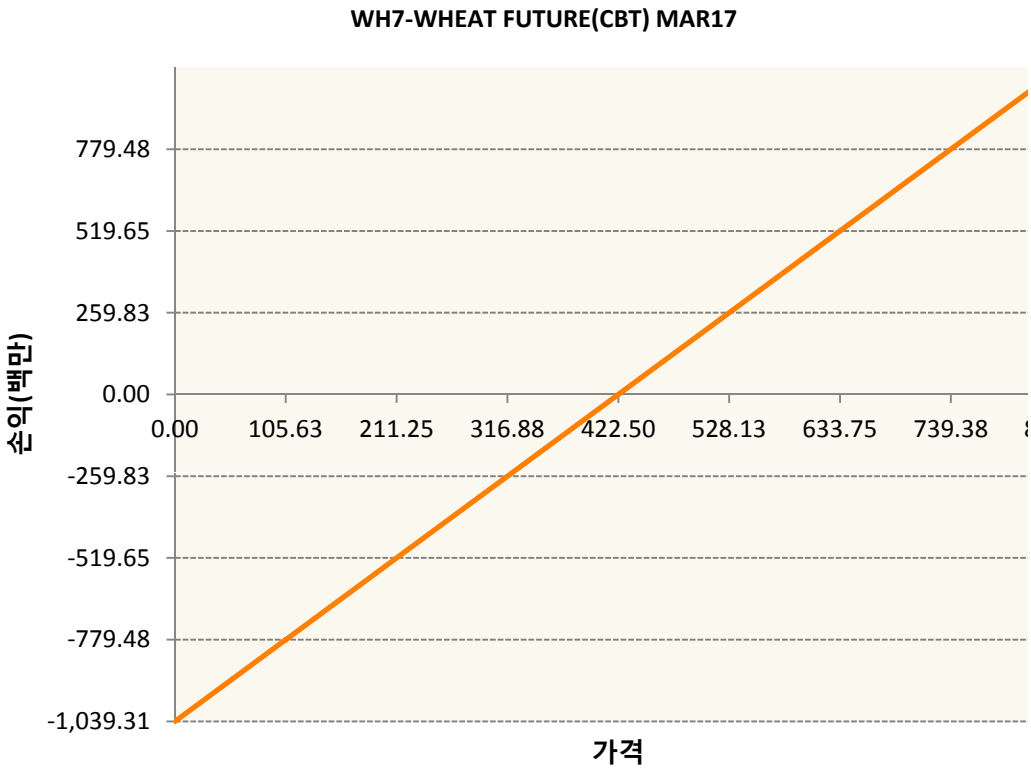

KWH7-KC HRW WHEAT FUT MAR17
267.82
178.54
89.27
0.00
-89.27
-178.54
-267.82
-357.09
0.00
108.94
217.88
326.81
435.75
544.69
653.63
762.56
손익(백만)
가격


SBH7-Sugar #11 (WORLD) MAR17
1,115.40
836.55
557.70
278.85
0.00
-278.85
-557.70
-836.55
-1,115.40
0.00
5.30
10.59
15.89
21.18
26.48
31.77
37.07
손익(백만)
가격


SH7-SOYBEAN FUTURE MAR17
1,454.37
969.58
484.79
0.00
-484.79
-969.58
-1,454.37
-1,939.16
0.00
259.00
518.00
777.00
1,036.00
1,295.00
1,554.00
1,813.00
손익(백만)
가격


SMH7-SOYBEAN MEAL FUTR MAR17
729.36





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

BOH7	SOYBEAN OIL FUTR MAR17	72
CH7	CORN FUTURE MAR17	187
CTH7	COTTON NO.2 FUTR MAR17	35
KCH7	COFFEE "C" FUTURE MAR17	61
KR4175M20(	2017-02 달러선물	46

KWH7	KC HRW WHEAT FUT MAR17	29
SBH7	Sugar #11 (WORLD) MAR17	89
SH7	SOYBEAN FUTURE MAR17	155
SMH7	SOYBEAN MEAL FUTR MAR17	78
WH7	WHEAT FUTURE(CBT) MAR17	83

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

935