공시일	2017-02-09
기준일	2017-02-08

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	2017-02-09
기준일	2017-02-08

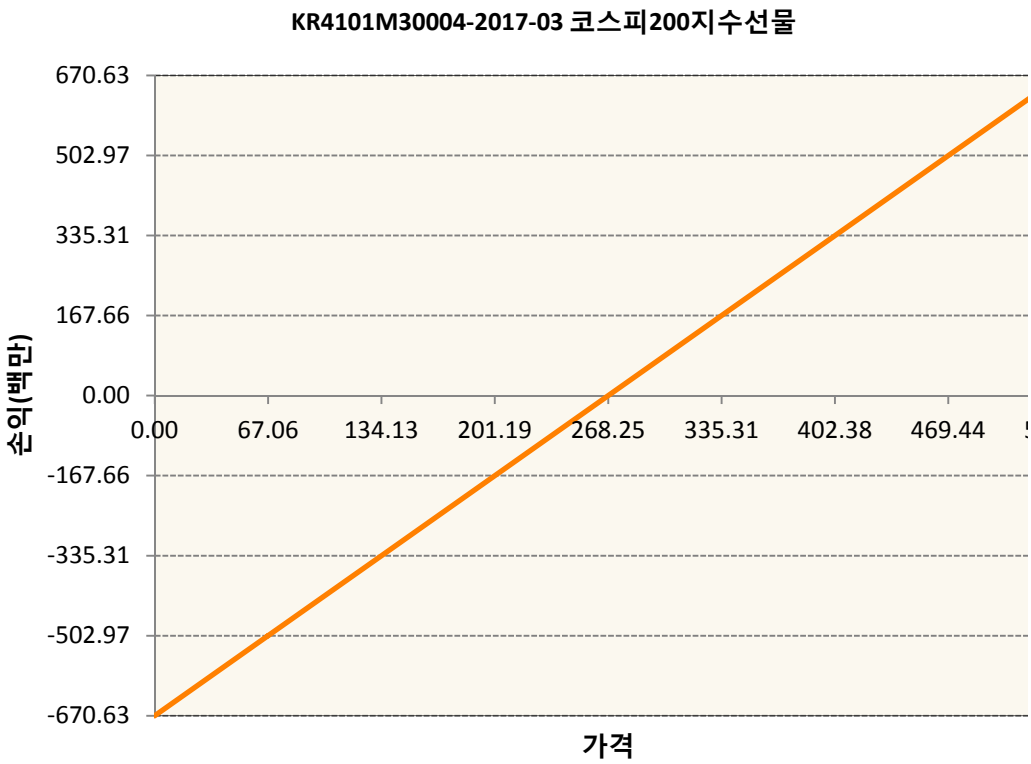
스마트인덱스모

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	671	0	671	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	2017-02-09
기준일	2017-02-08

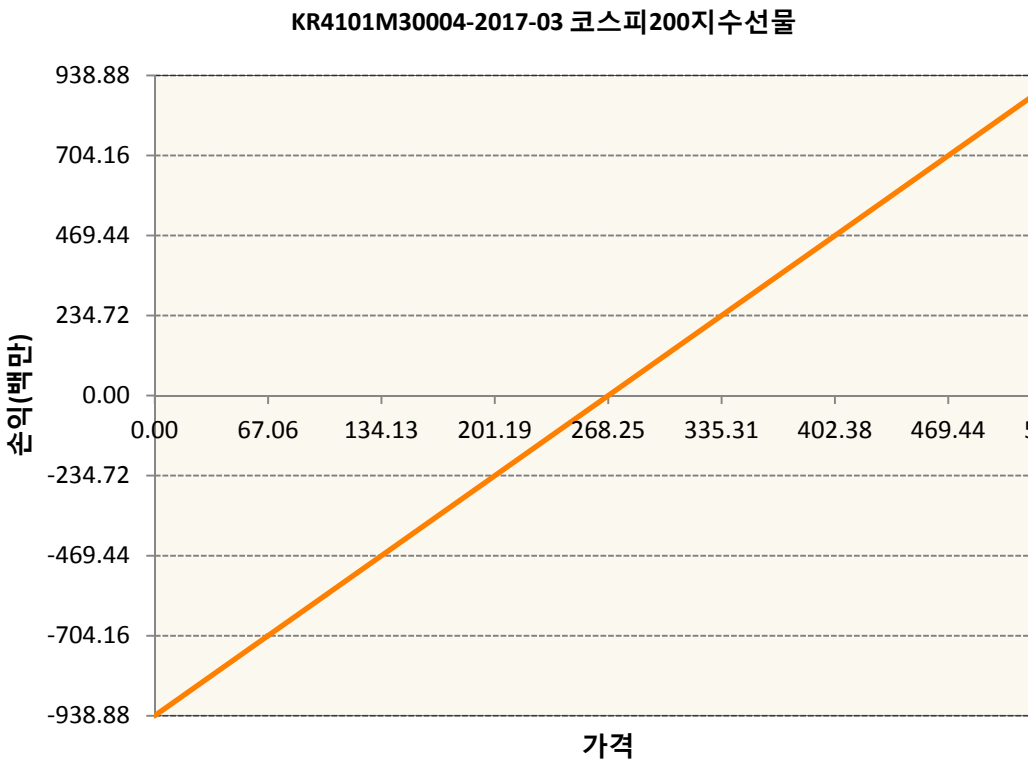
스마트레버리지목표전환형1호

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	939	0	939	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)

51

공시일	2017-02-09
기준일	2017-02-08

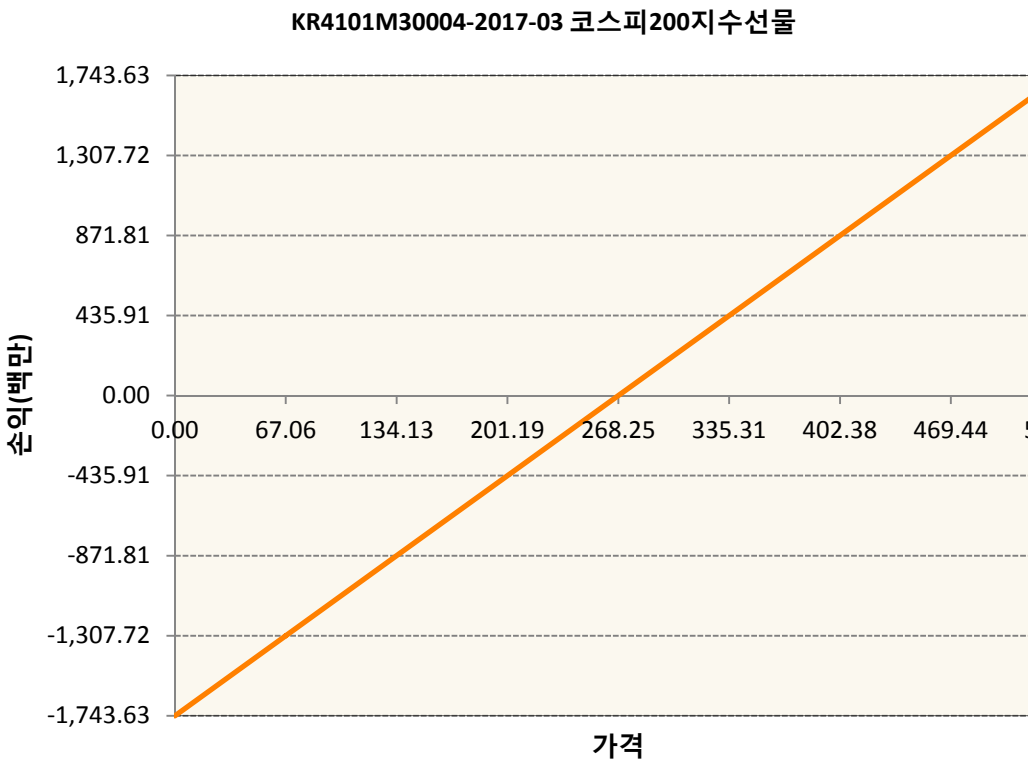
1.3배 레버리지 인덱스(주식-파생형)

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	1,744	0	1,744	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101M30(2017-03 코스피200지수선물							139
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-139	-139	-139	-139	-139	-139	-139
-5.33%	-93	-93	-93	-93	-93	-93	-93
-2.67%	-46	-46	-46	-46	-46	-46	-46
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	46	46	46	46	46	46	46
5.33%	93	93	93	93	93	93	93
8.00%	139	139	139	139	139	139	139

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

95

공시일	2017-02-09
기준일	2017-02-08

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	927

* 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	2017-02-09
기준일	2017-02-08

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	383

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

542

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-02-09
기준일	2017-02-08

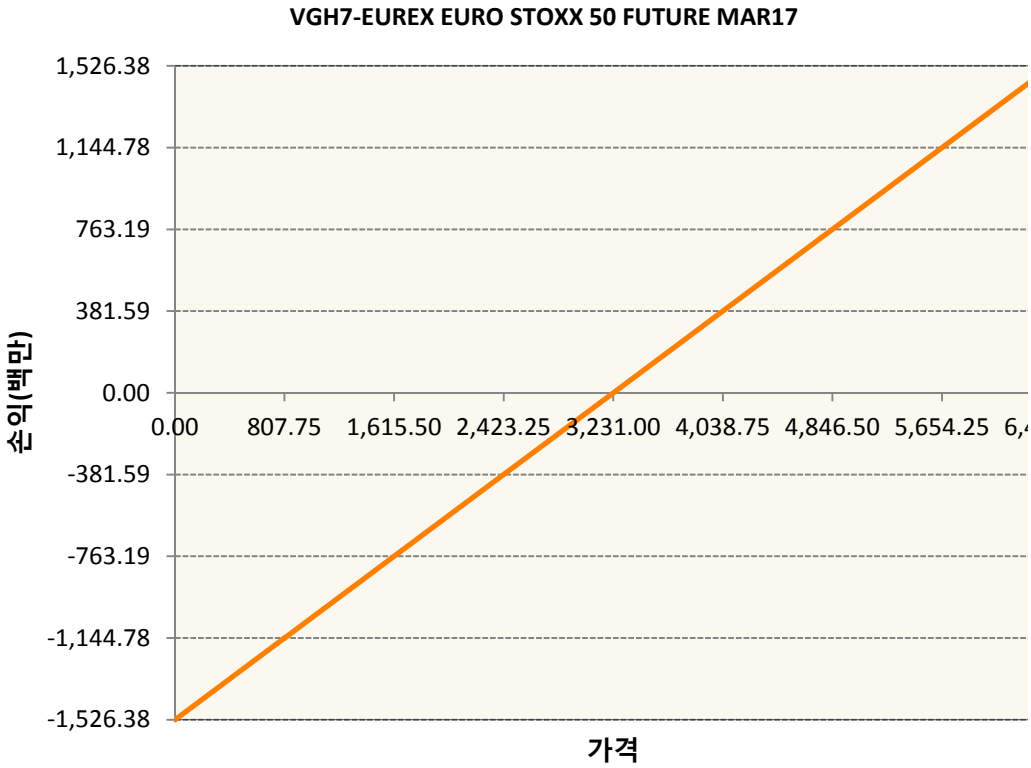
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,526	0	1,526	

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	2017-02-09
기준일	2017-02-08

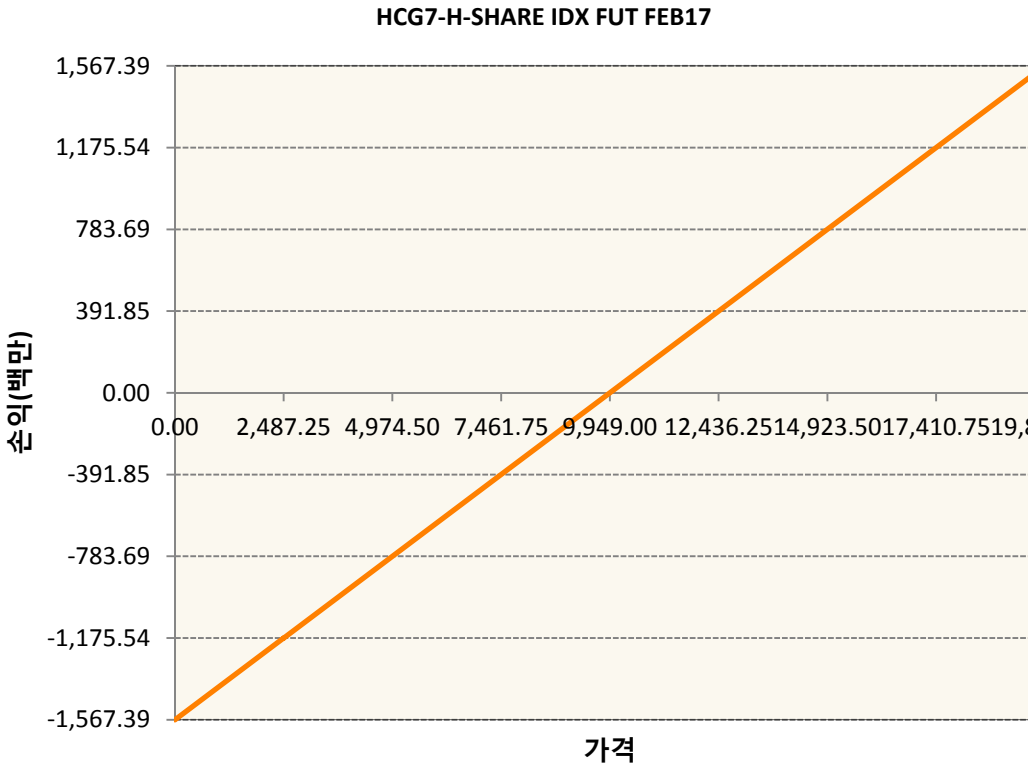
차이나인덱스모(주식-파생형)

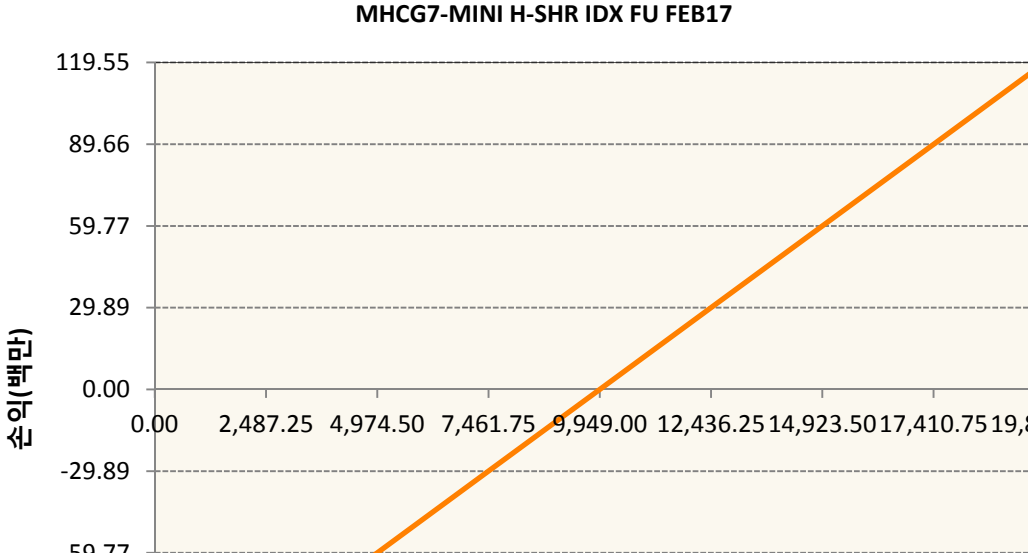
1. 계약금액

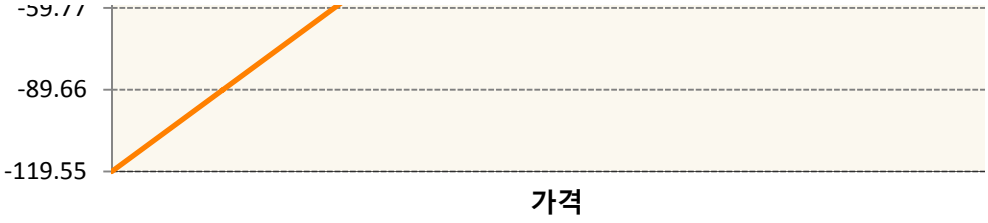
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,687	0	1,687	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCG7	H-SHARE IDX FUT FEB17	125
MHCG7	MINI H-SHR IDX FU FEB17	10

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	158

공시일	2017-02-09
기준일	2017-02-08

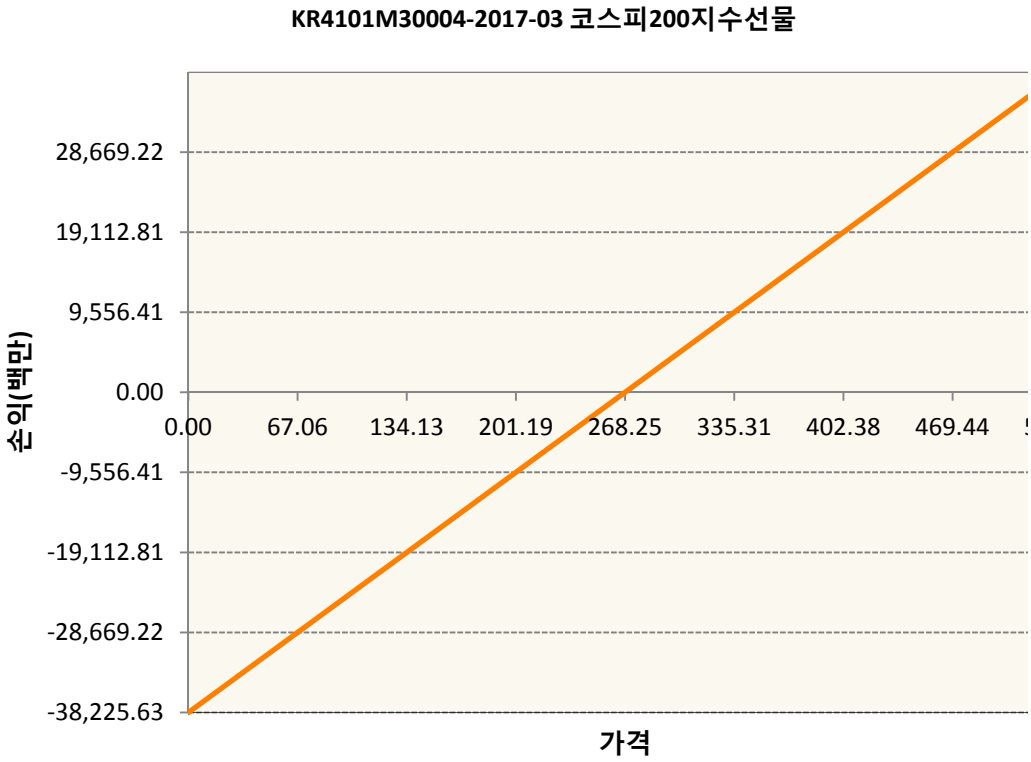
커버드콜모(주식혼합-파생형)

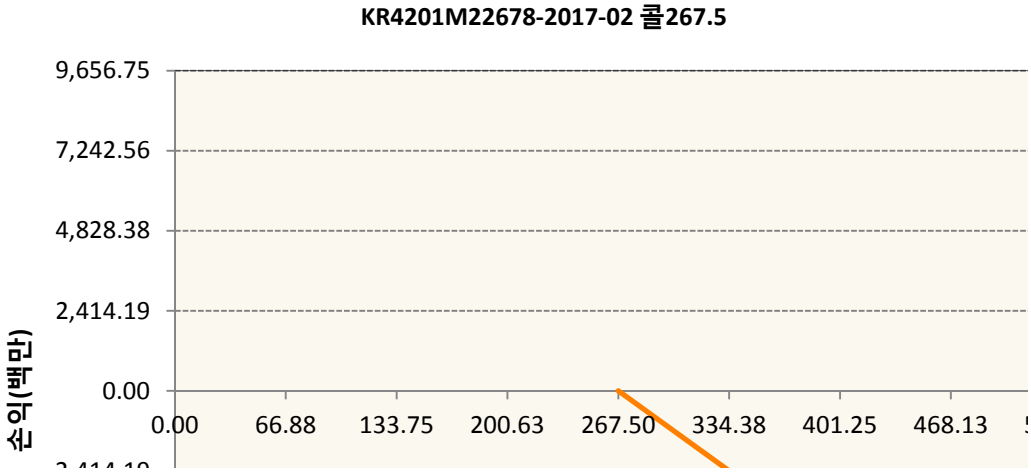
1. 계약금액

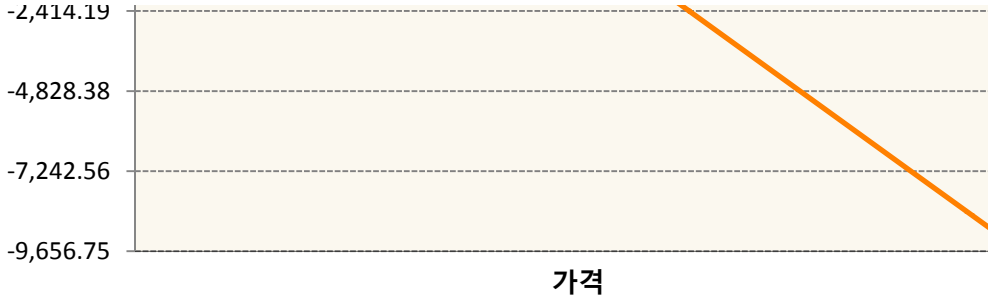
(단위:백만원)

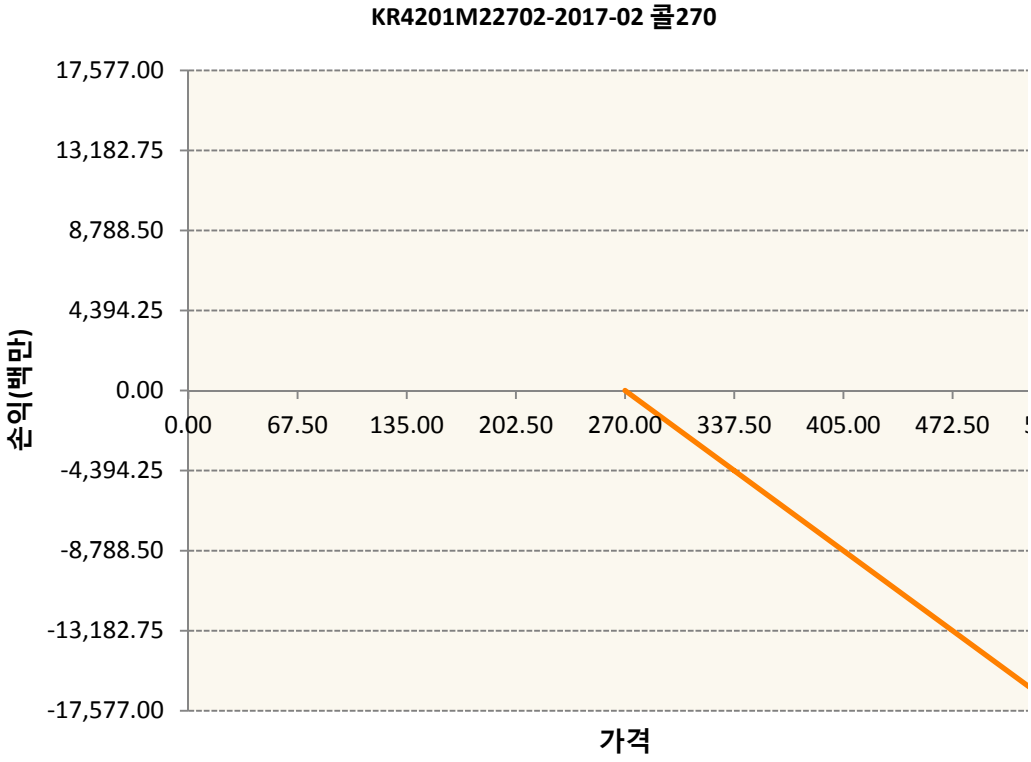
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	38,226	0	38,226	장내
누계	유가증권	옵션	0	27,234	-27,234	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101M30(2017-03 코스피200지수선물							3,052
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-3,052	-3,052	-3,052	-3,052	-3,052	-3,052	-3,052
-5.33%	-2,035	-2,035	-2,035	-2,035	-2,035	-2,035	-2,035
-2.67%	-1,017	-1,017	-1,017	-1,017	-1,017	-1,017	-1,017
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	1,017	1,017	1,017	1,017	1,017	1,017	1,017
5.33%	2,035	2,035	2,035	2,035	2,035	2,035	2,035
8.00%	3,052	3,052	3,052	3,052	3,052	3,052	3,052
KR4201M22(2017-02 콜267.5							3,771
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	135	135	135	135	135	135	135
-5.33%	135	135	135	135	135	135	135
-2.67%	135	135	135	135	135	135	135
0%	28	19	9	0	-9	-19	-28
2.67%	-1,194	-1,194	-1,194	-1,194	-1,194	-1,194	-1,194
5.33%	-2,482	-2,482	-2,482	-2,482	-2,482	-2,482	-2,482
8.00%	-3,771	-3,771	-3,771	-3,771	-3,771	-3,771	-3,771
	KR4201M22 2017-02 콜270						6,212

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	18	18	18	18	18	18	18
-5.33%	18	18	18	18	18	18	18
-2.67%	18	18	18	18	18	18	18
0%	14	10	6	0	-7	-14	-23
2.67%	-1,565	-1,565	-1,565	-1,565	-1,565	-1,566	-1,566
5.33%	-3,888	-3,888	-3,888	-3,888	-3,888	-3,888	-3,888
8.00%	-6,212	-6,212	-6,212	-6,212	-6,212	-6,212	-6,212

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

17,444

공시일	2017-02-09
기준일	2017-02-08

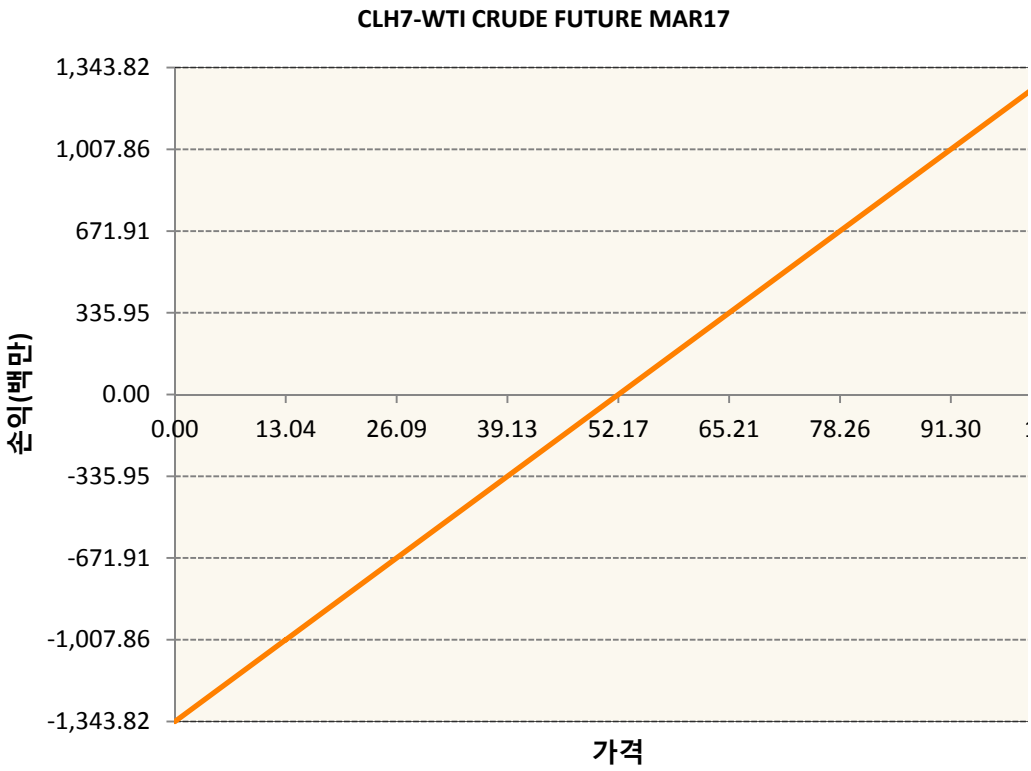
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

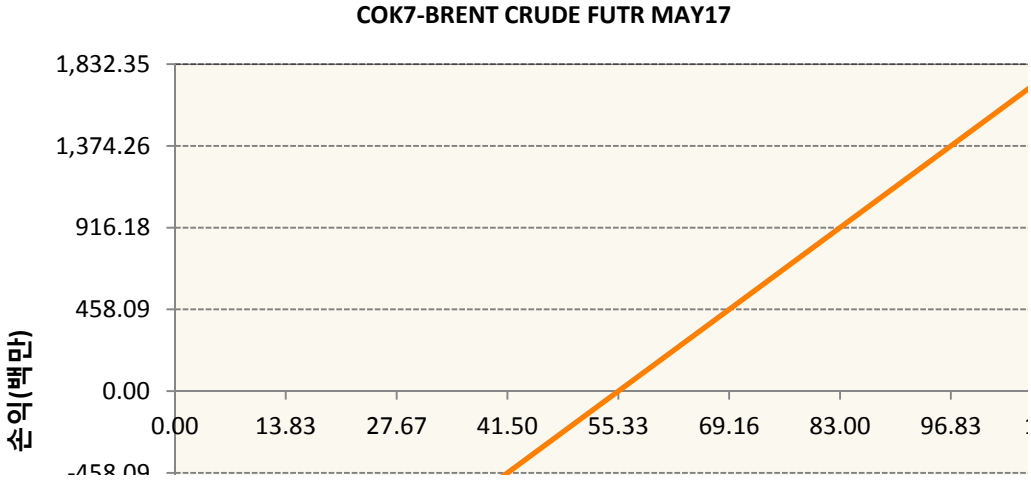
1. 계약금액

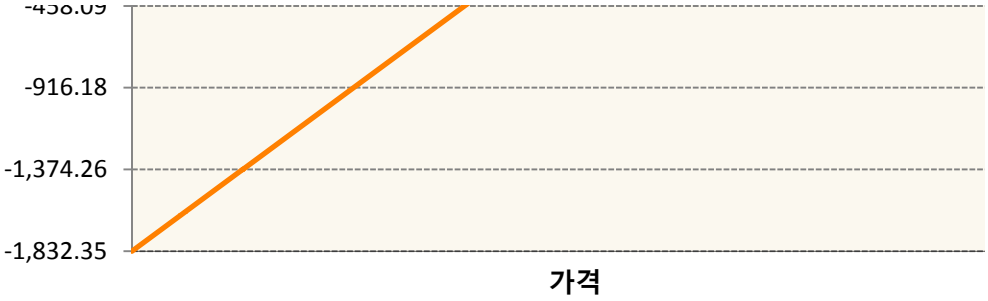
(단위:백만원)

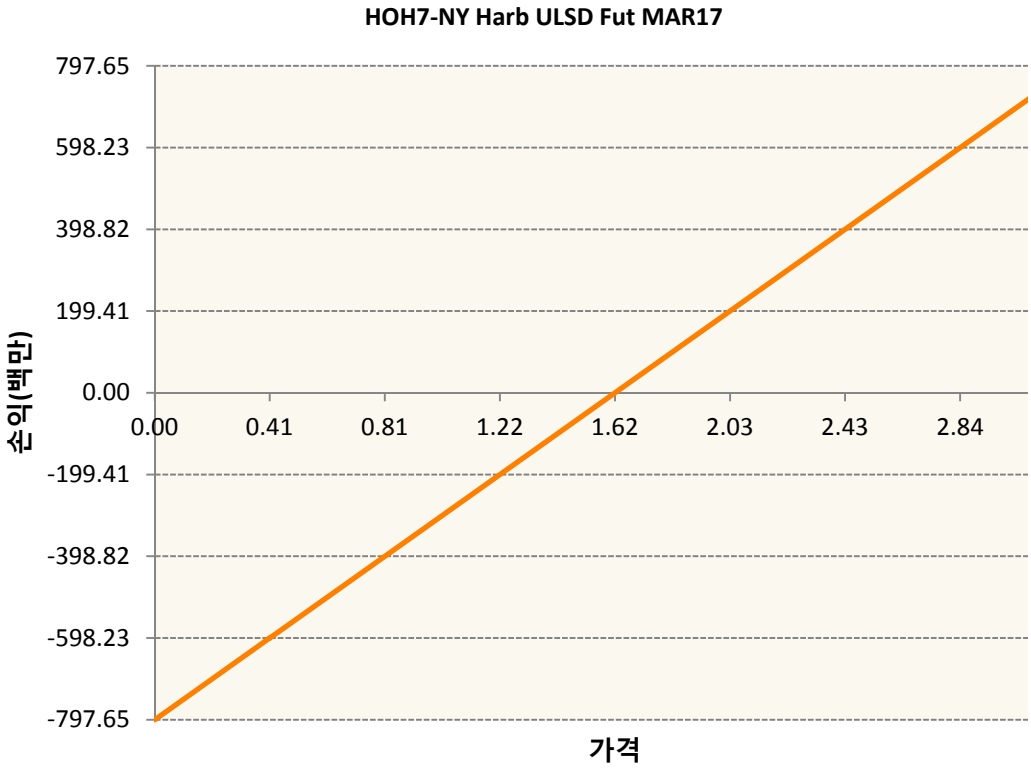
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	선물	유가증권	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	선물	유가증권	1,344	0	1,344	
누계	유가증권	선물	4,903	413	4,490	

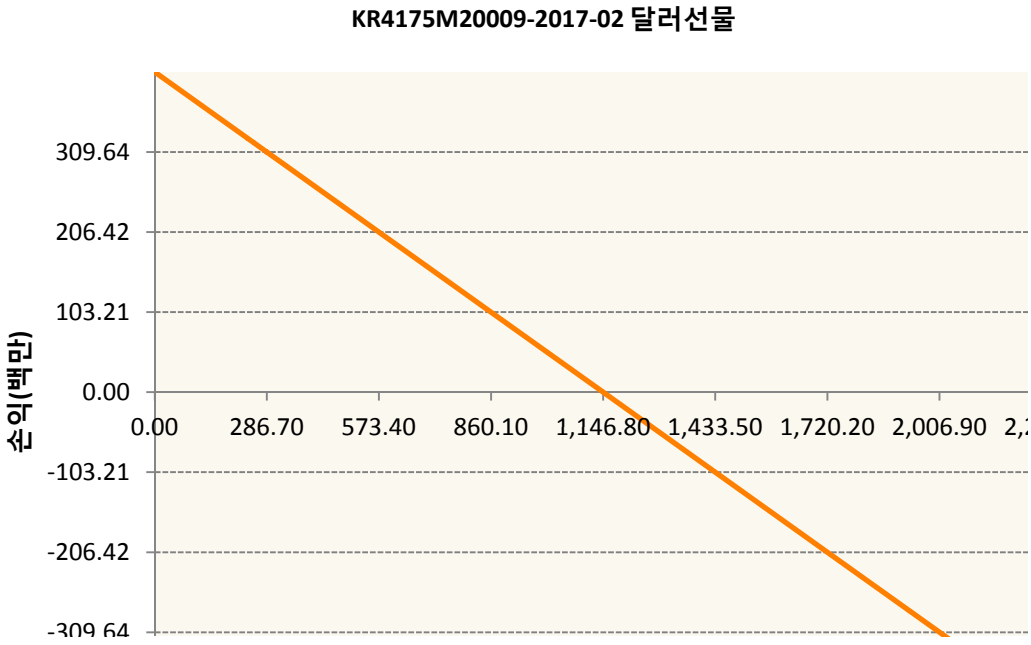
2. 만기시점의 손익구조

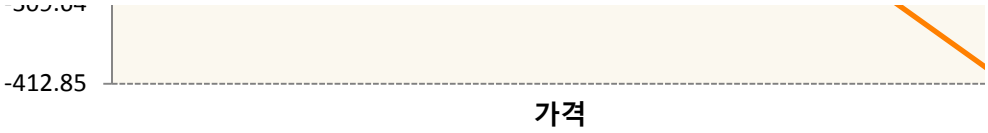


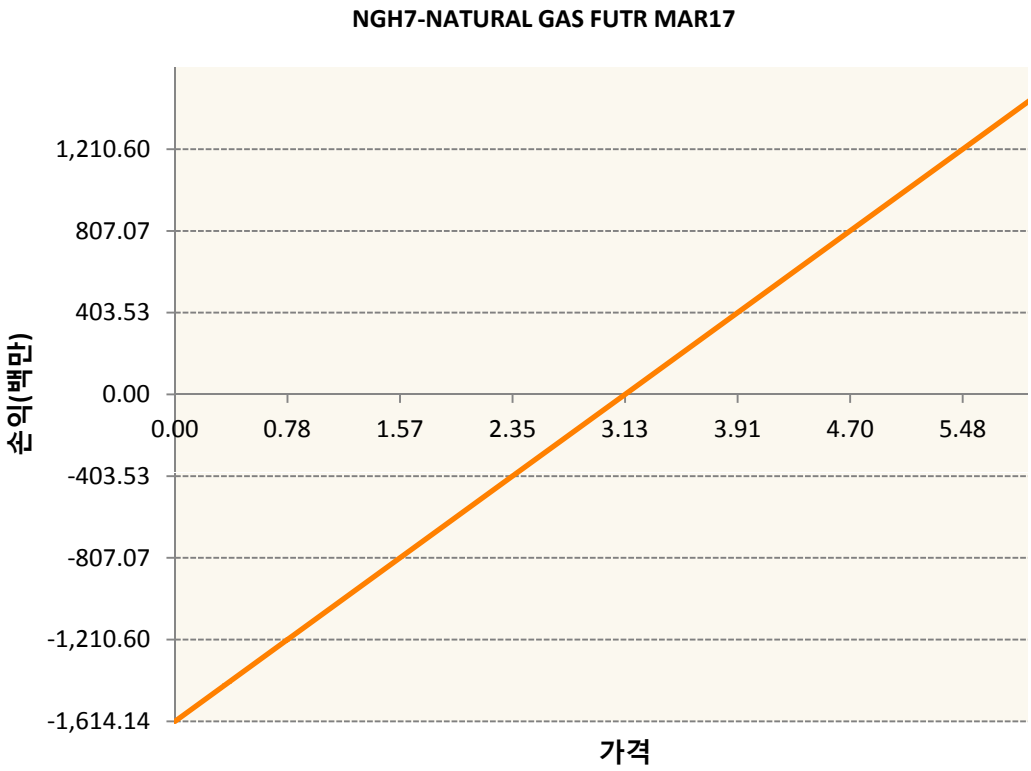


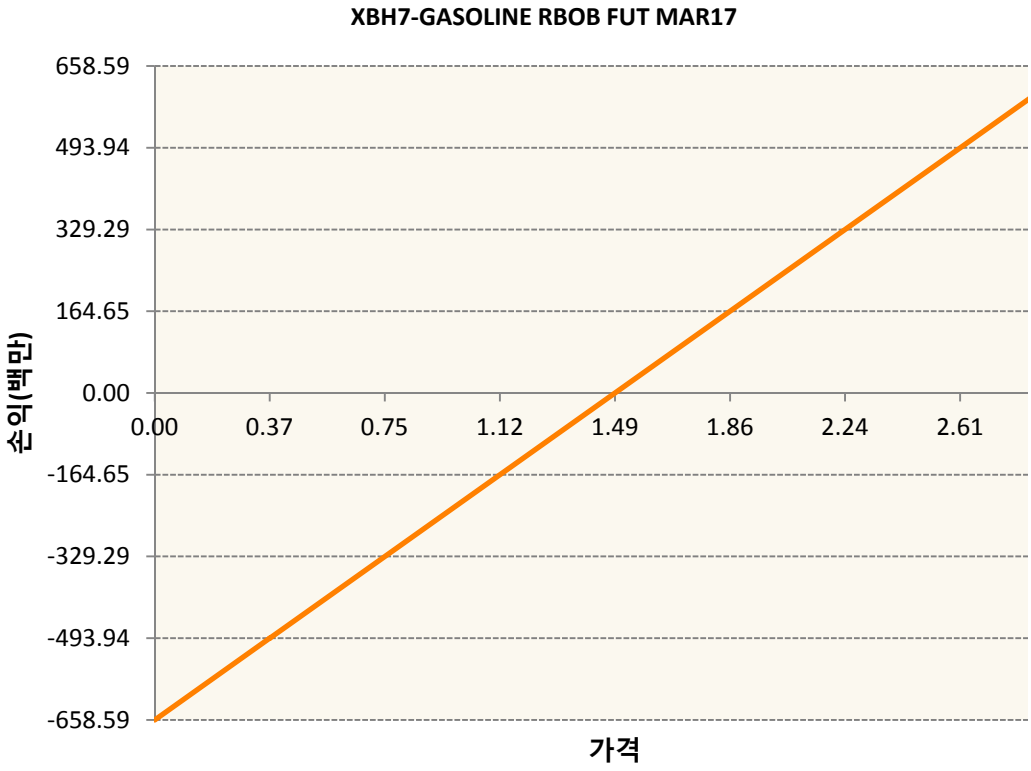

-916.18
-1,374.26
-1,832.35
가격


HOH7-NY Harb ULSD Fut MAR17
797.65
598.23
398.82
199.41
0.00
-199.41
-398.82
-598.23
-797.65
0.00
0.41
0.81
1.22
1.62
2.03
2.43
2.84
순익(백만)
가격


KR4175M20009-2017-02 달러선물
309.64
206.42
103.21
0.00
-103.21
-206.42
-309.64
0.00
286.70
573.40
860.10
1,146.80
1,433.50
1,720.20
2,006.90
순익(백만)


-412.85
가격


NGH7-NATURAL GAS FUTR MAR17
1,210.60
807.07
403.53
0.00
-403.53
-807.07
-1,210.60
-1,614.14
0.00
0.78
1.57
2.35
3.13
3.91
4.70
5.48
순익(백만)
가격


XBH7-GASOLINE RBOB FUT MAR17
658.59
493.94
329.29
164.65
0.00
-164.65
-329.29
-493.94
-658.59
0.00
0.37
0.75
1.12
1.49
1.86
2.24
2.61
순익(백만)
가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLH7	WTI CRUDE FUTURE MAR17	108
COK7	BRENT CRUDE FUTR MAY17	147
HOH7	NY Harb ULSD Fut MAR17	64
KR4175M20(	2017-02 달러선물	33
NGH7	NATURAL GAS FUTR MAR17	129
XBH7	GASOLINE RBOB FUT MAR17	53

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

1,113

공시일	2017-02-09
기준일	2017-02-08

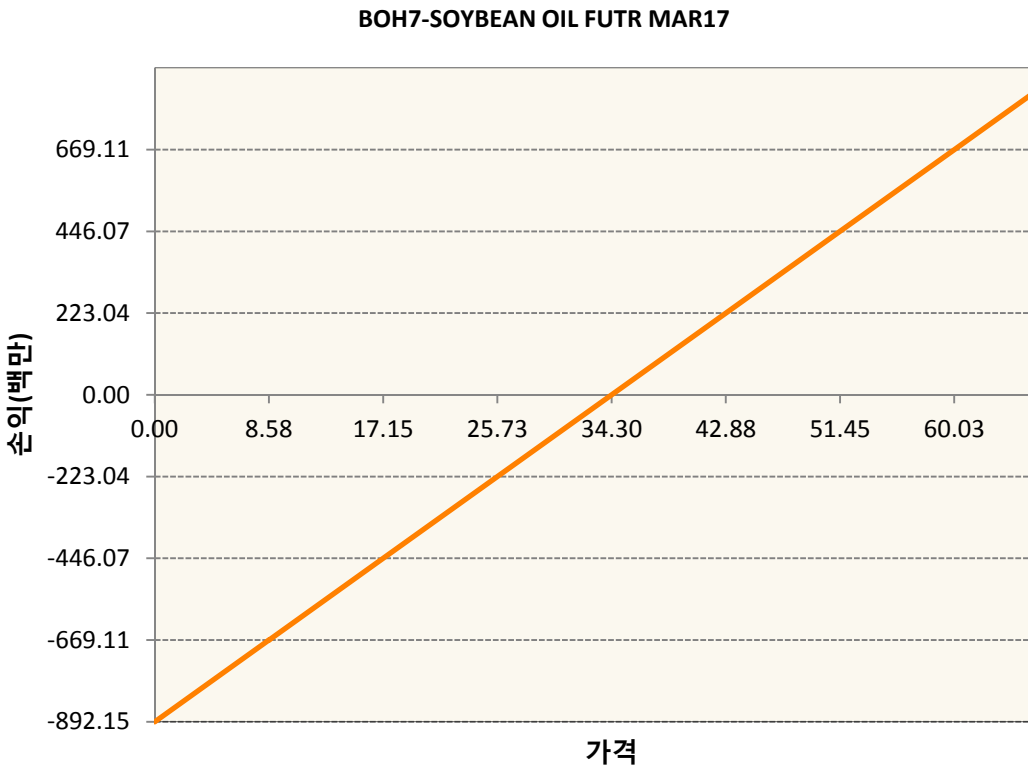
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

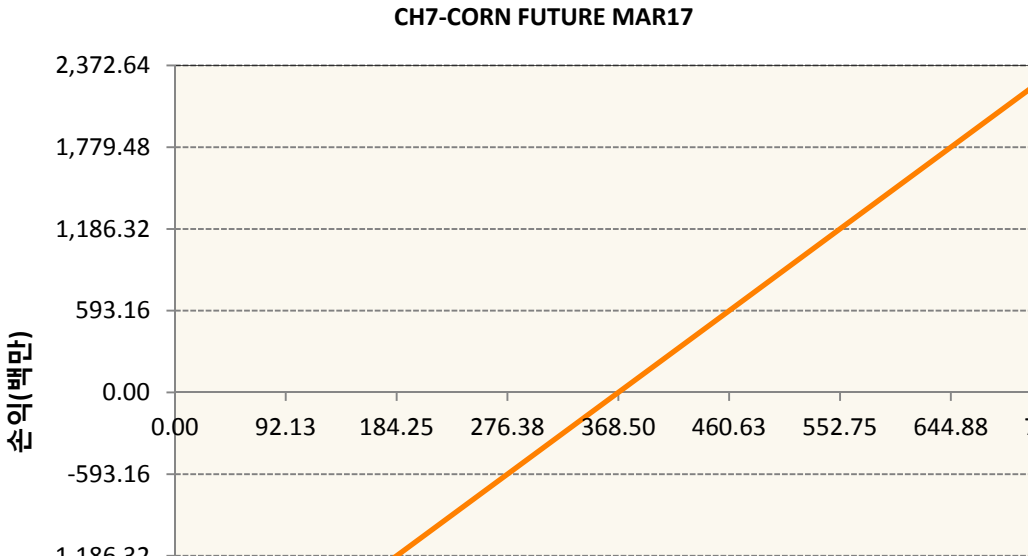
1. 계약금액

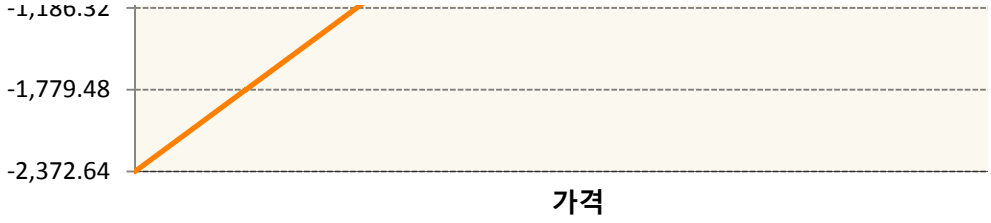
(단위:백만원)

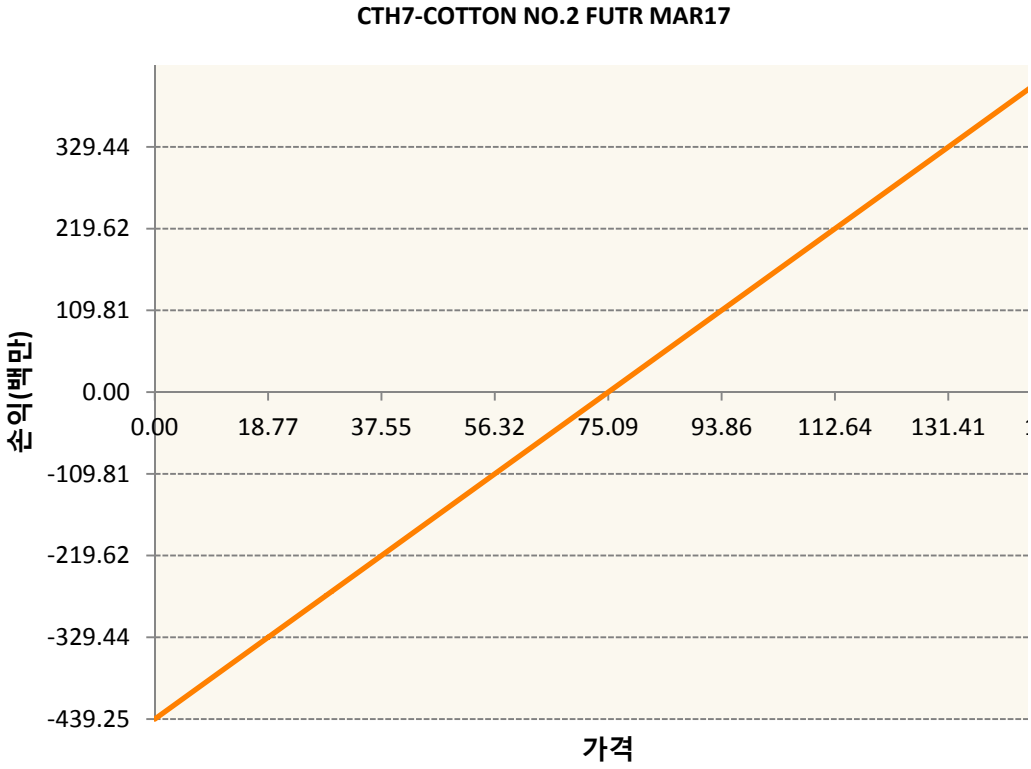
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	9,901	573	9,327	

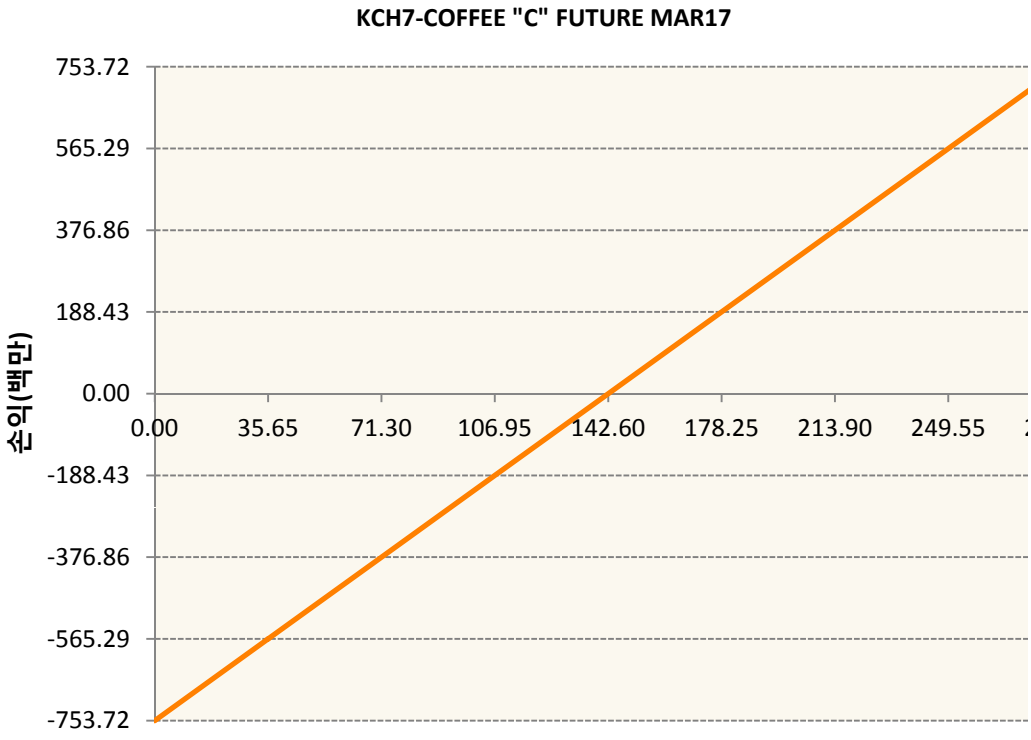
2. 만기시점의 손익구조



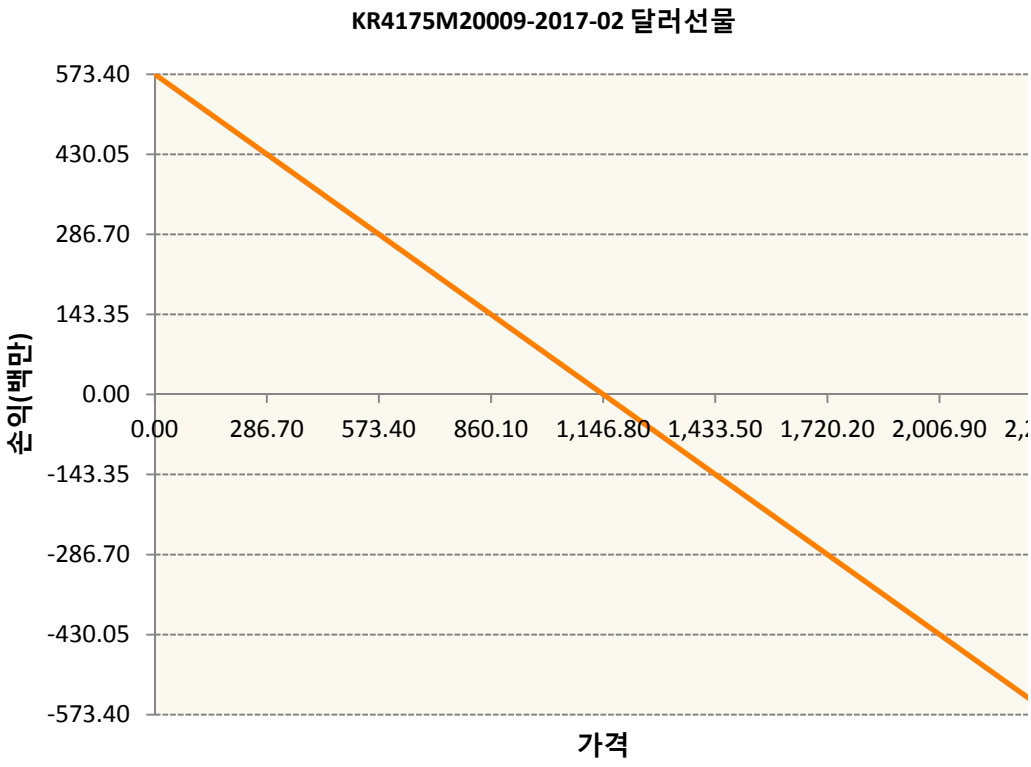


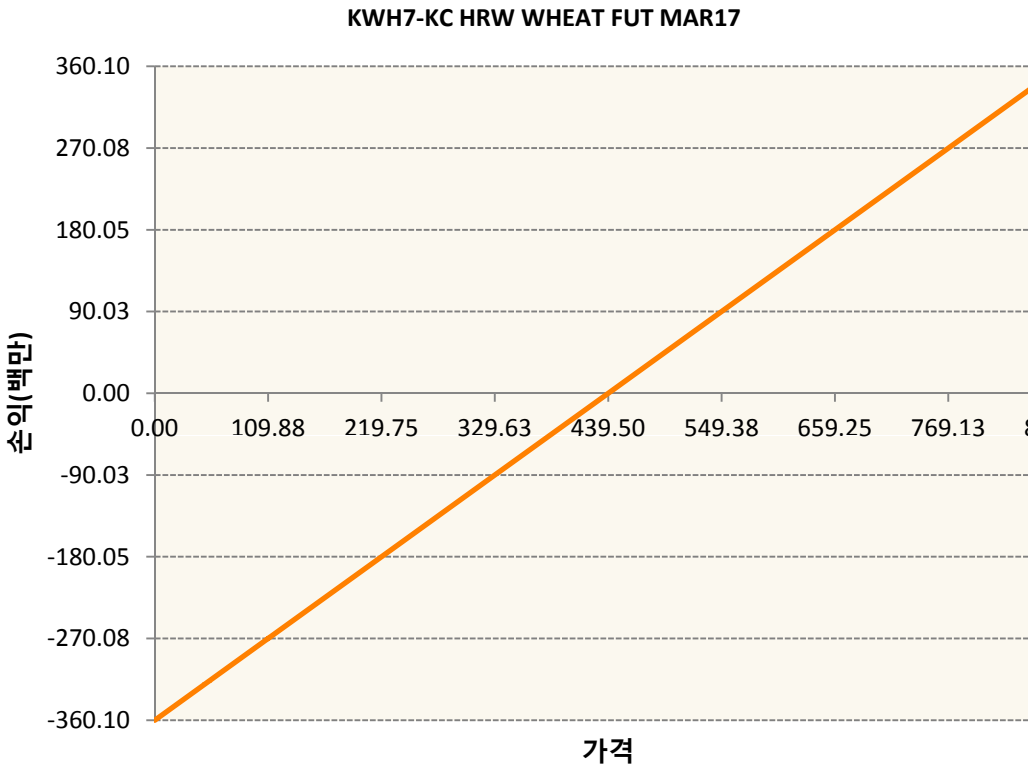

-1,779.48
-2,372.64
가격

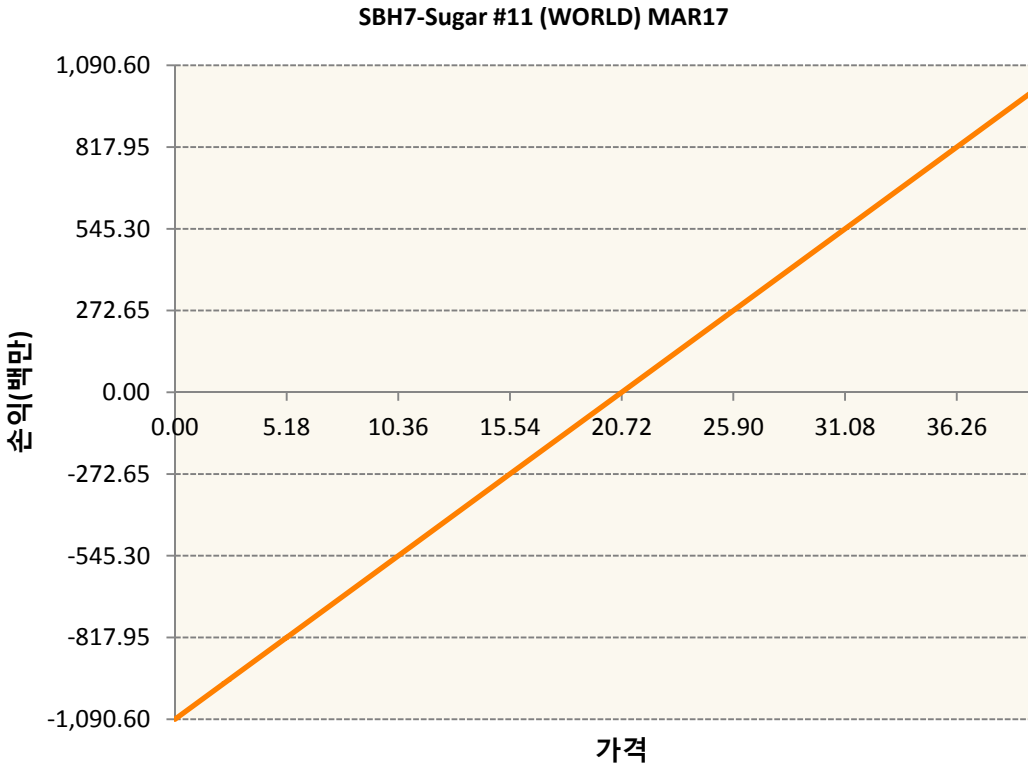

CTH7-COTTON NO.2 FUTR MAR17
329.44
219.62
109.81
0.00
-109.81
-219.62
-329.44
-439.25
0.00
18.77
37.55
56.32
75.09
93.86
112.64
131.41
손익(백만)
가격

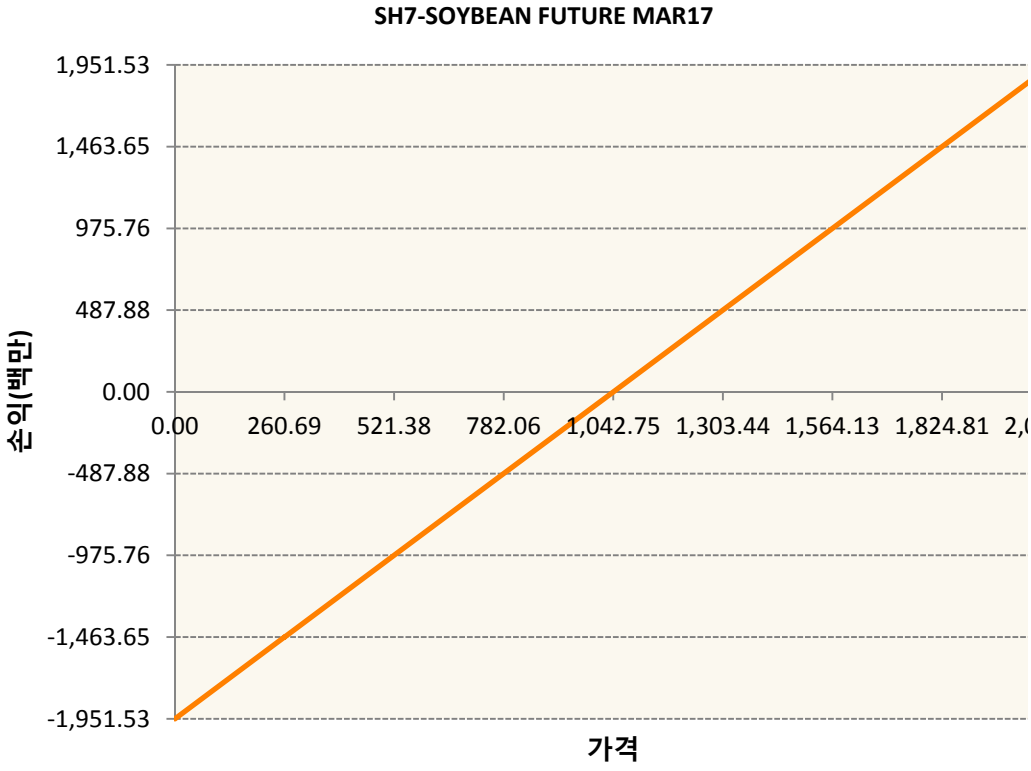

KCH7-COFFEE "C" FUTURE MAR17
753.72
565.29
376.86
188.43
0.00
-188.43
-376.86
-565.29
-753.72
0.00
35.65
71.30
106.95
142.60
178.25
213.90
249.55
손익(백만)

가격

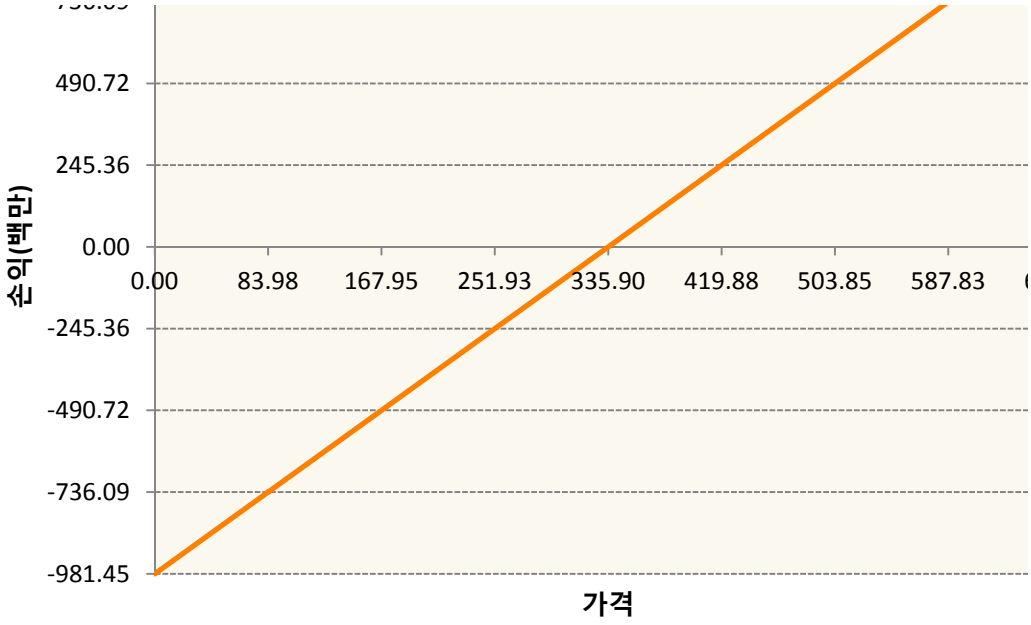

KR4175M20009-2017-02 달러선물
573.40
430.05
286.70
143.35
0.00
-143.35
-286.70
-430.05
-573.40
0.00
286.70
573.40
860.10
1,146.80
1,433.50
1,720.20
2,006.90
손익(만)
가격

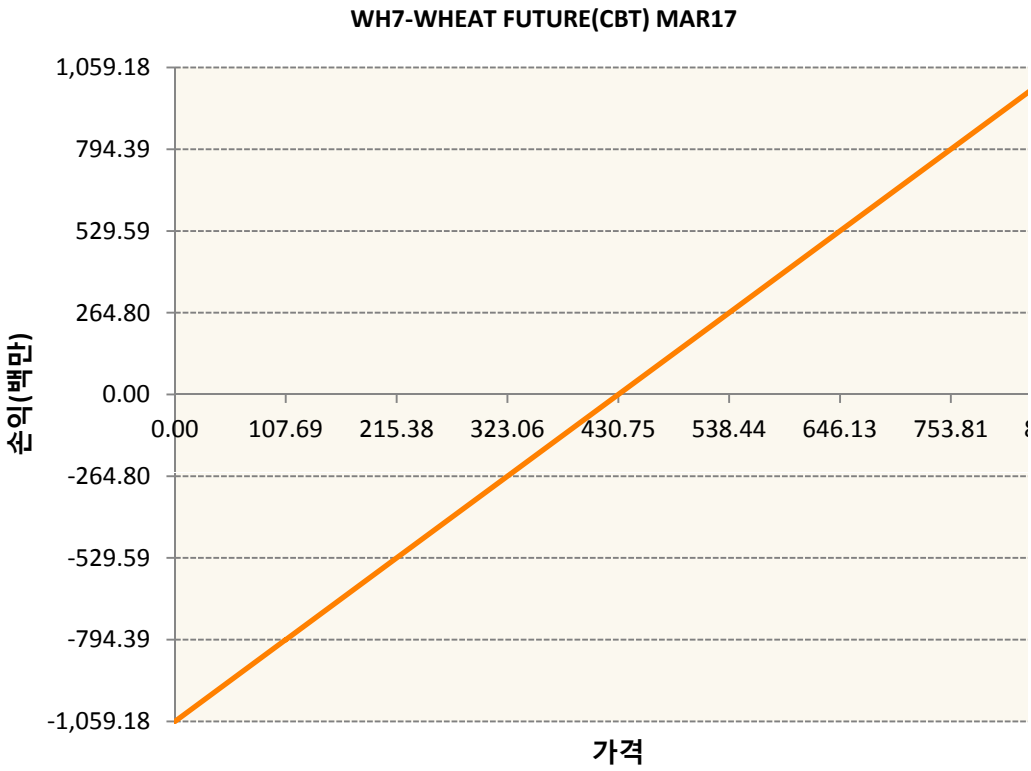

KWH7-KC HRW WHEAT FUT MAR17
360.10
270.08
180.05
90.03
0.00
-90.03
-180.05
-270.08
-360.10
0.00
109.88
219.75
329.63
439.50
549.38
659.25
769.13
손익(만)
가격


SBH7-Sugar #11 (WORLD) MAR17
1,090.60
817.95
545.30
272.65
0.00
-272.65
-545.30
-817.95
-1,090.60
0.00
5.18
10.36
15.54
20.72
25.90
31.08
36.26
손익(백만)
가격


SH7-SOYBEAN FUTURE MAR17
1,951.53
1,463.65
975.76
487.88
0.00
-487.88
-975.76
-1,463.65
-1,951.53
0.00
260.69
521.38
782.06
1,042.75
1,303.44
1,564.13
1,824.81
손익(백만)
가격


SMH7-SOYBEAN MEAL FUTR MAR17
981.45
736.09





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

BOH7	SOYBEAN OIL FUTR MAR17	71
CH7	CORN FUTURE MAR17	190
CTH7	COTTON NO.2 FUTR MAR17	35
KCH7	COFFEE "C" FUTURE MAR17	60
KR4175M20(	2017-02 달러선물	46

KWH7	KC HRW WHEAT FUT MAR17	29
SBH7	Sugar #11 (WORLD) MAR17	87
SH7	SOYBEAN FUTURE MAR17	156
SMH7	SOYBEAN MEAL FUTR MAR17	79
WH7	WHEAT FUTURE(CBT) MAR17	85

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

935