공시일	2017-02-13
기준일	2017-02-10

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	2017-02-13
기준일	2017-02-10

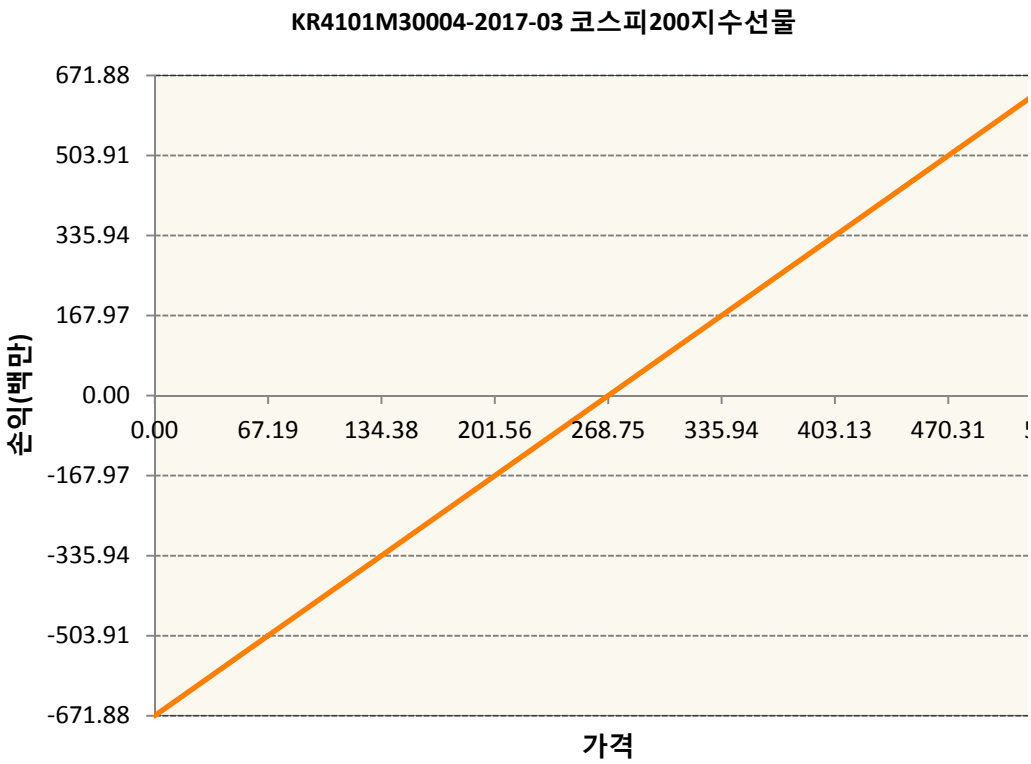
스마트인덱스모

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	672	0	672	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)

36

공시일	2017-02-13
기준일	2017-02-10

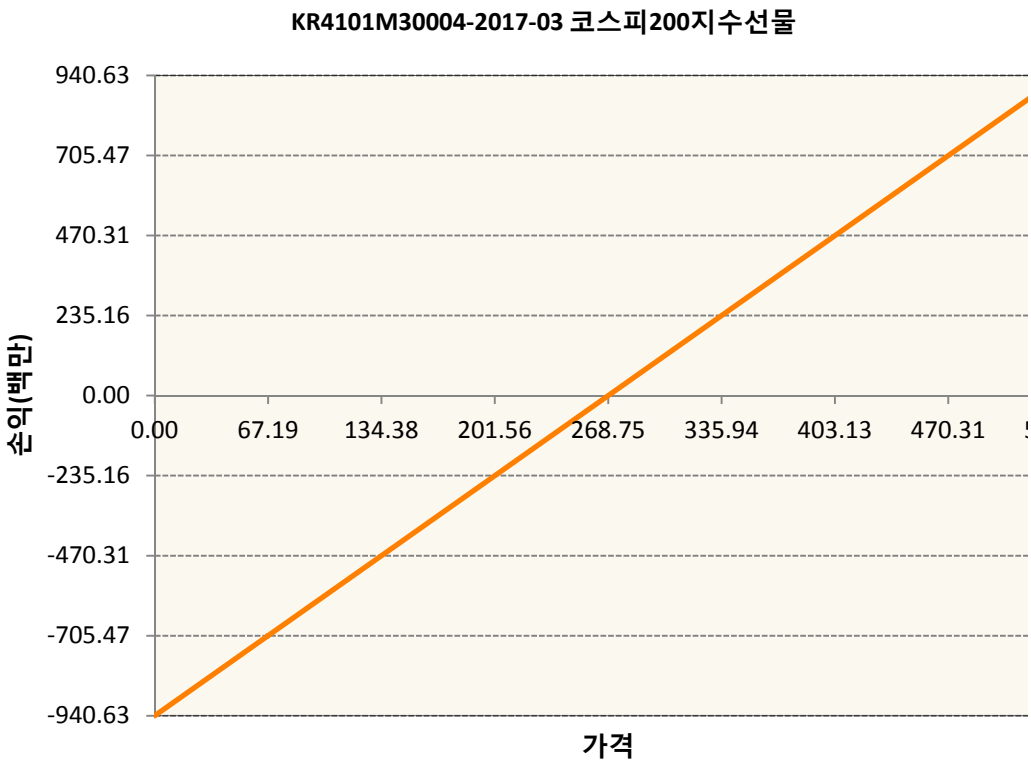
스마트레버리지목표전환형1호

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	941	0	941	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	2017-02-13
기준일	2017-02-10

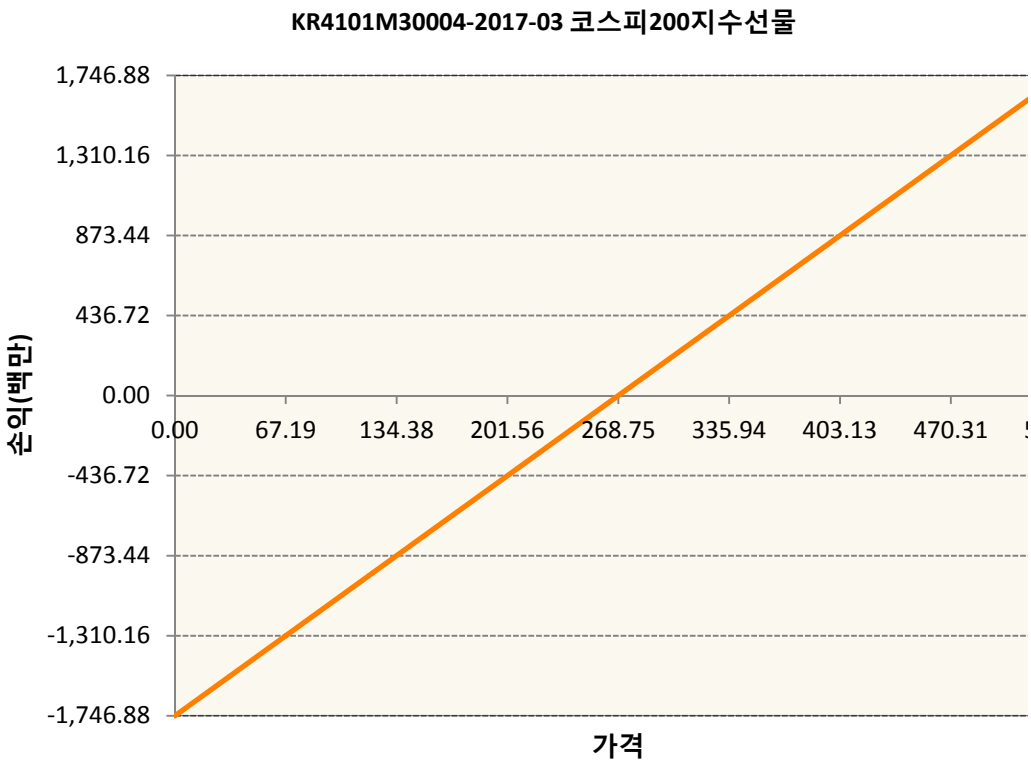
1.3배 레버리지 인덱스(주식-파생형)

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	1,747	0	1,747	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)

95

공시일	2017-02-13
기준일	2017-02-10

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	933

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

652

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-02-13
기준일	2017-02-10

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	385

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

543

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-02-13
기준일	2017-02-10

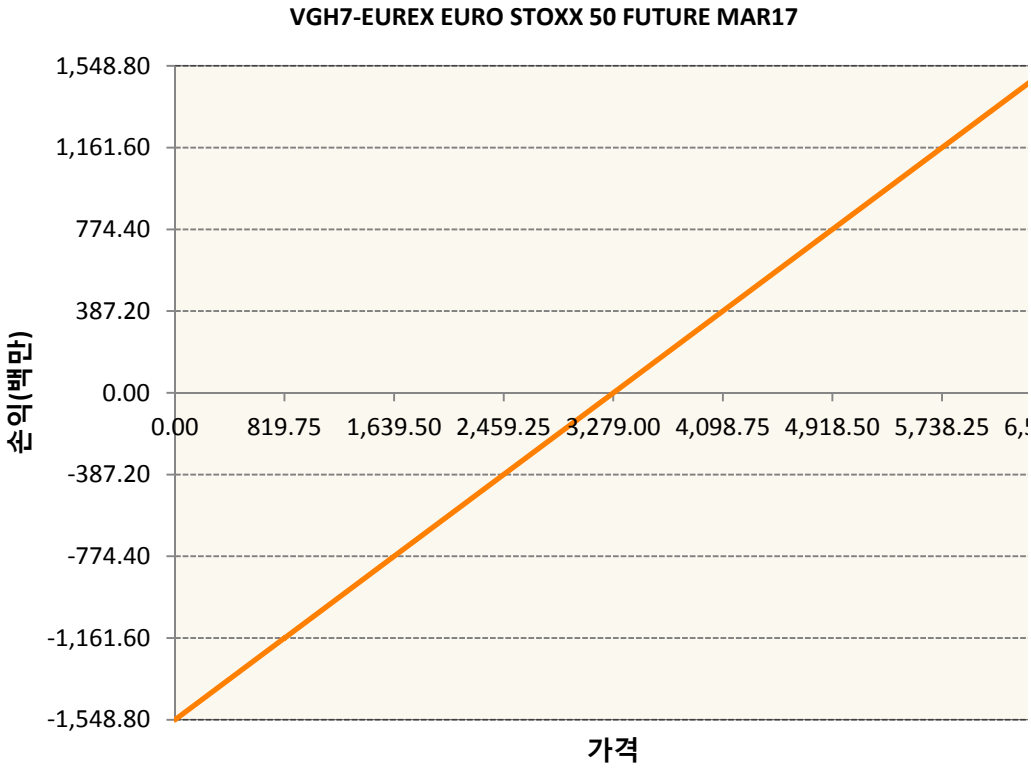
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,549	0	1,549	

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)

131

공시일	2017-02-13
기준일	2017-02-10

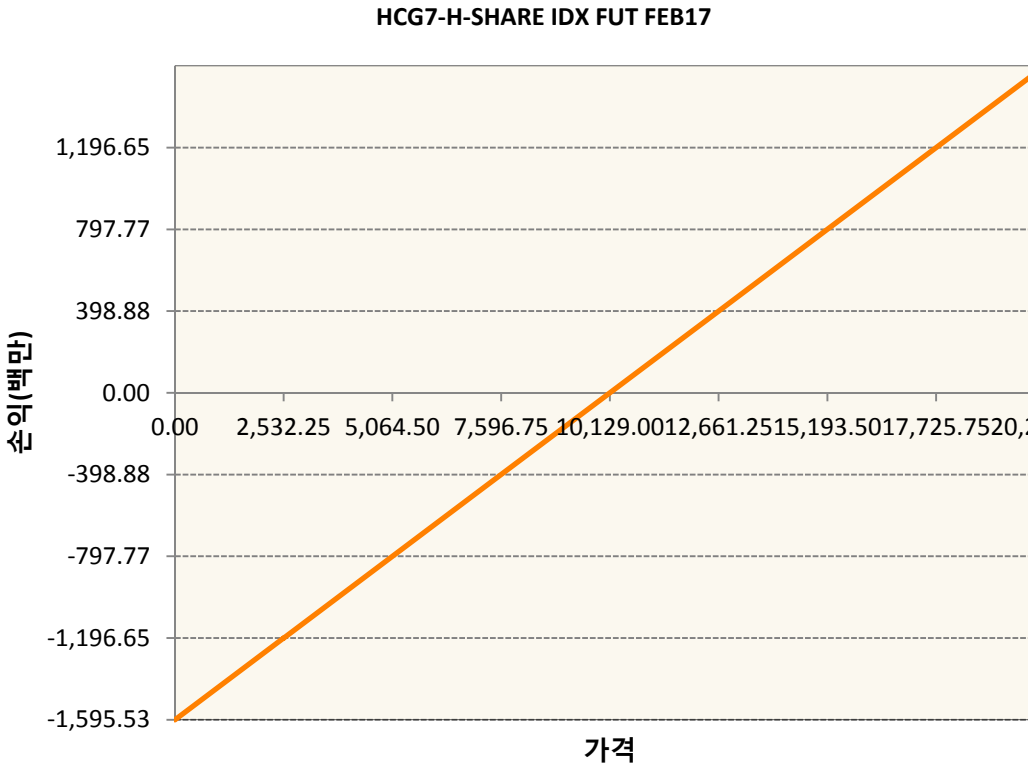
차이나인덱스모(주식-파생형)

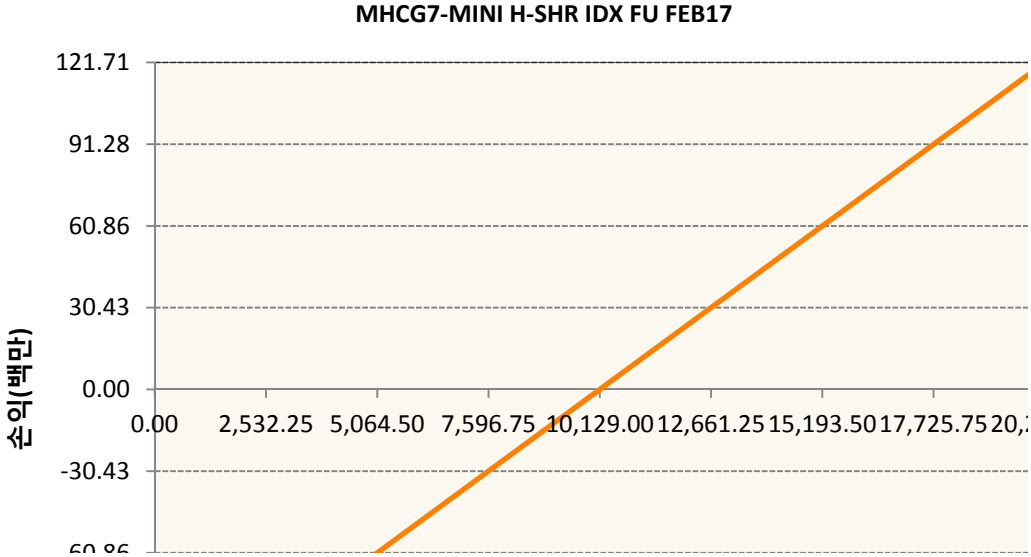
1. 계약금액

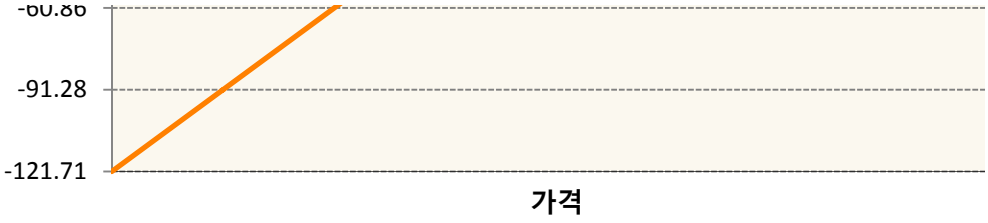
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,717	0	1,717	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCG7	H-SHARE IDX FUT FEB17	128
MHCG7	MINI H-SHR IDX FU FEB17	10

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	161

공시일	2017-02-13
기준일	2017-02-10

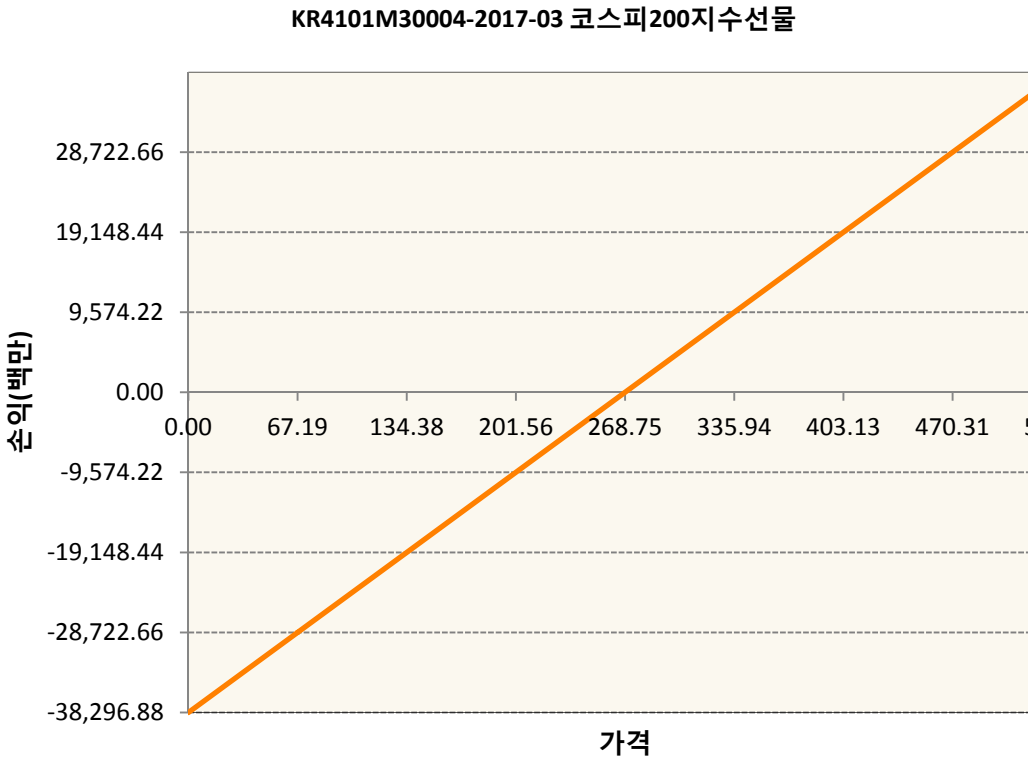
커버드콜모(주식혼합-파생형)

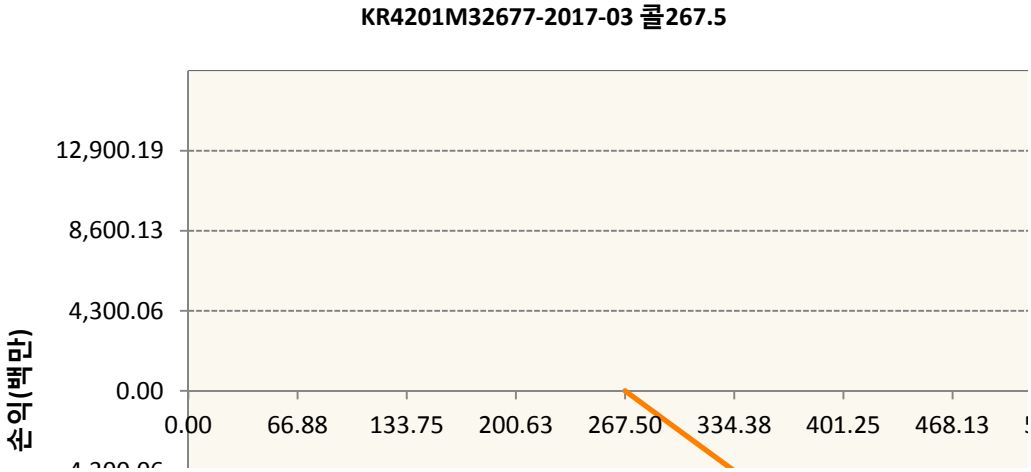
1. 계약금액

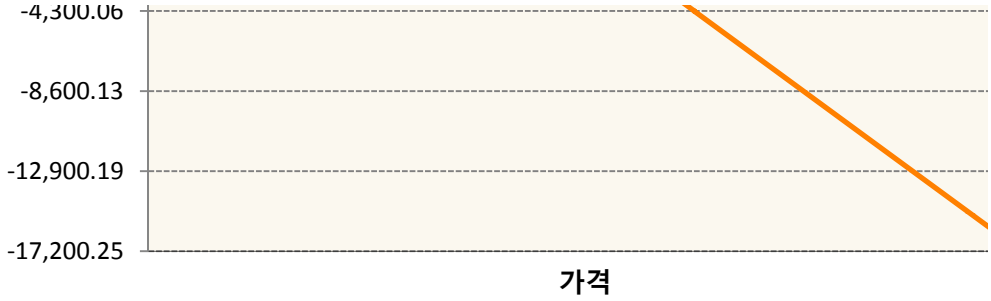
(단위:백만원)

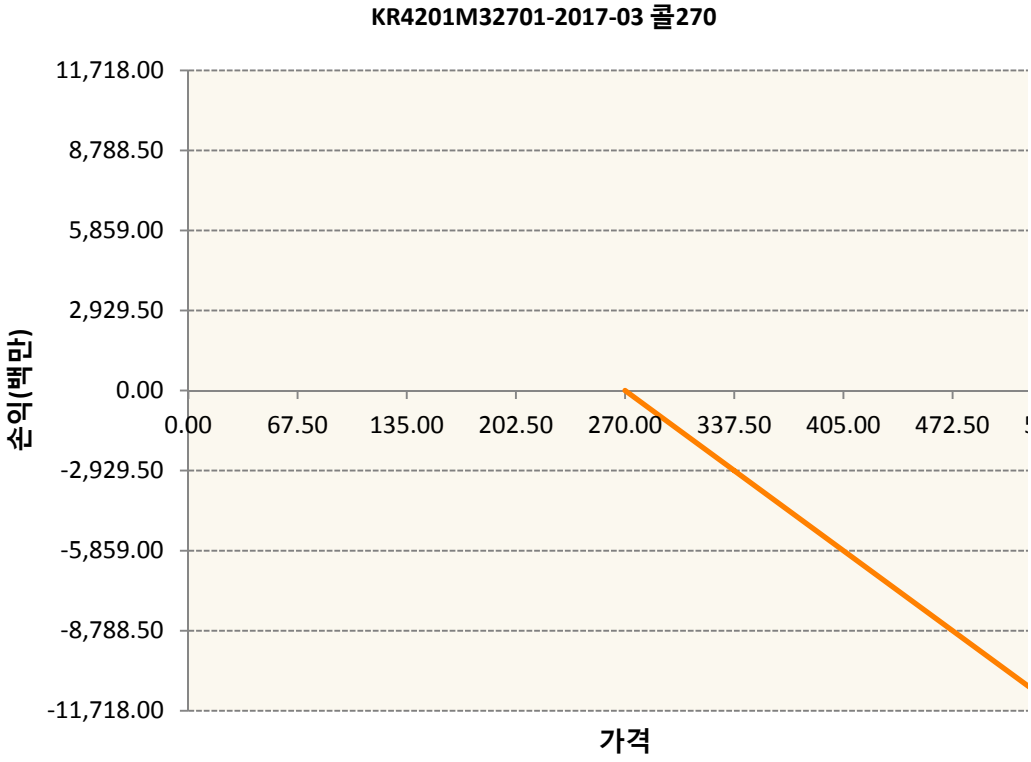
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	407	-407	장내
누계	유가증권	선물	38,297	0	38,297	장내
누계	유가증권	옵션	0	28,918	-28,918	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101M30(2017-03 코스피200지수선물							3,063
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-3,063	-3,063	-3,063	-3,063	-3,063	-3,063	-3,063
-5.33%	-2,042	-2,042	-2,042	-2,042	-2,042	-2,042	-2,042
-2.67%	-1,021	-1,021	-1,021	-1,021	-1,021	-1,021	-1,021
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	1,021	1,021	1,021	1,021	1,021	1,021	1,021
5.33%	2,042	2,042	2,042	2,042	2,042	2,042	2,042
8.00%	3,063	3,063	3,063	3,063	3,063	3,063	3,063
KR4201M32(2017-03 콜267.5							6,129
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,172	1,172	1,172	1,170	1,168	1,165	1,160
-5.33%	1,167	1,161	1,151	1,138	1,120	1,097	1,071
-2.67%	1,041	994	941	885	826	765	701
0%	238	159	79	0	-80	-159	-239
2.67%	-1,575	-1,606	-1,644	-1,686	-1,733	-1,784	-1,838
5.33%	-3,819	-3,823	-3,829	-3,838	-3,851	-3,868	-3,888
8.00%	-6,118	-6,118	-6,119	-6,120	-6,121	-6,125	-6,129
KR4201M32 2017-03 콜270							3,870

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	524	524	524	524	524	522	521
-5.33%	524	522	519	515	508	499	488
-2.67%	490	470	447	420	390	358	323
0%	161	107	54	0	-54	-108	-162
2.67%	-848	-883	-921	-961	-1,003	-1,047	-1,092
5.33%	-2,307	-2,313	-2,322	-2,334	-2,349	-2,368	-2,389
8.00%	-3,854	-3,855	-3,856	-3,857	-3,860	-3,864	-3,870

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

13,936

공시일	2017-02-13
기준일	2017-02-10

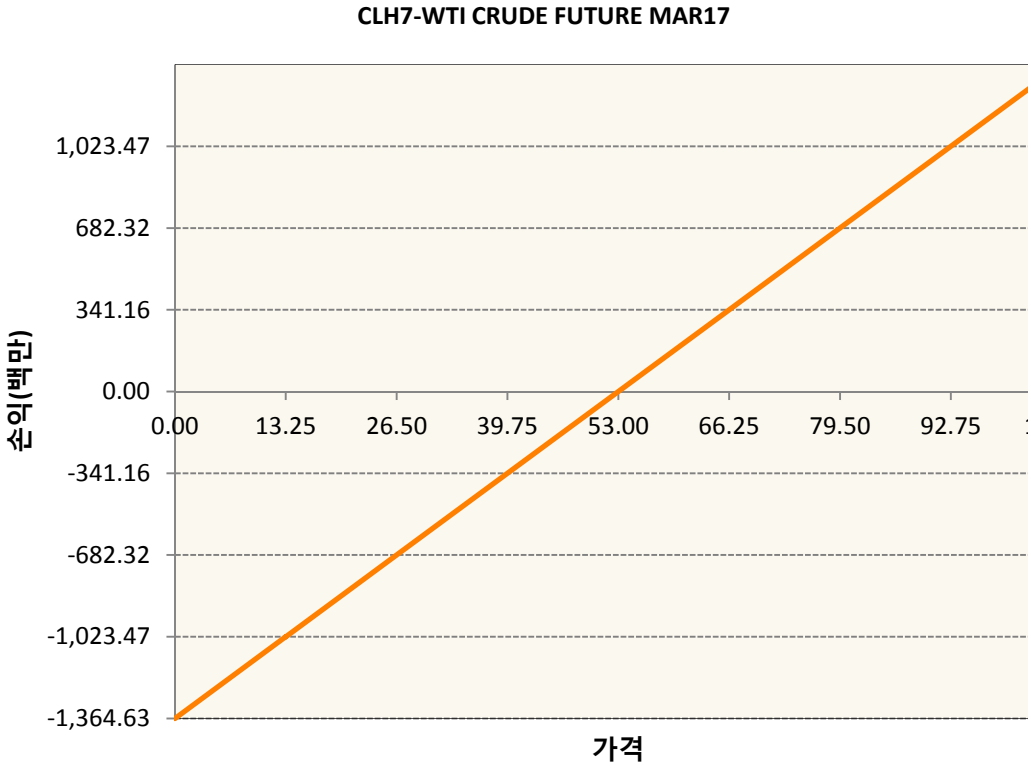
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

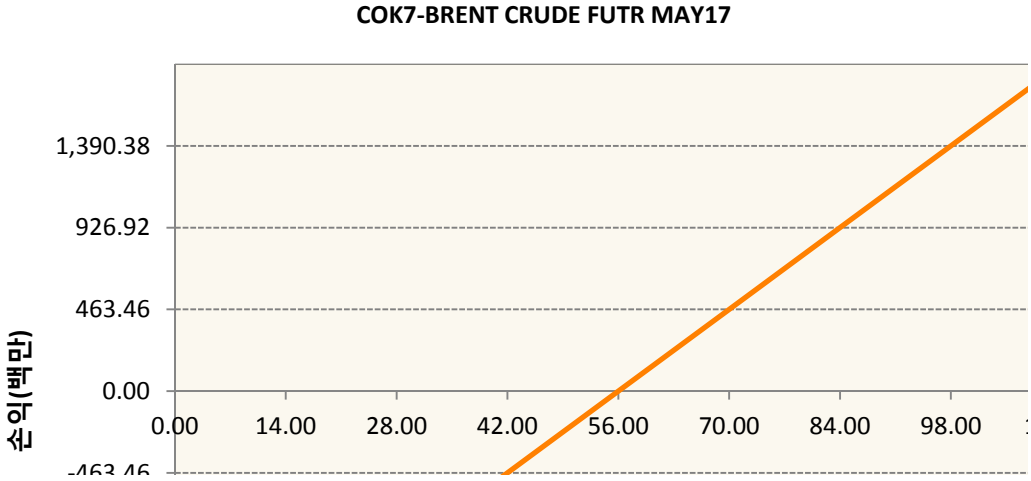
1. 계약금액

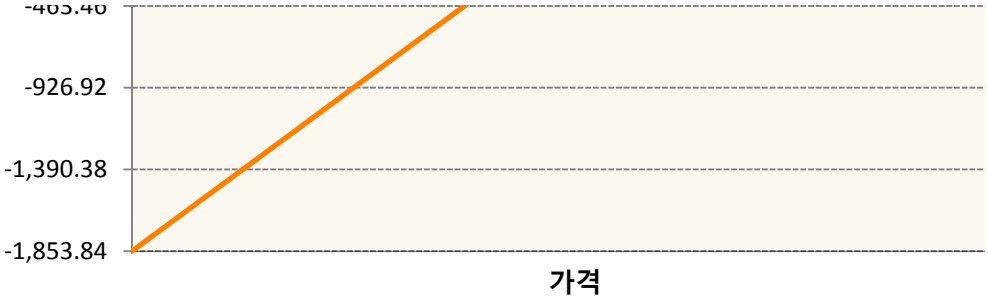
(단위:백만원)

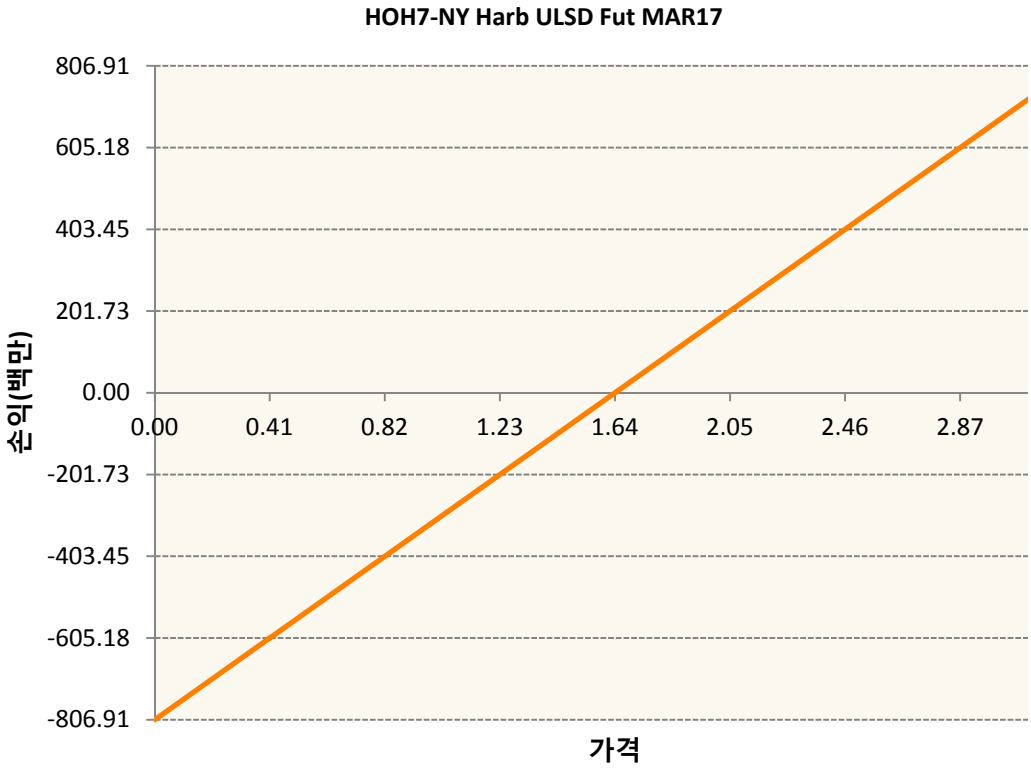
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	선물	유가증권	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	선물	유가증권	1,365	0	1,365	
누계	유가증권	선물	4,974	414	4,560	

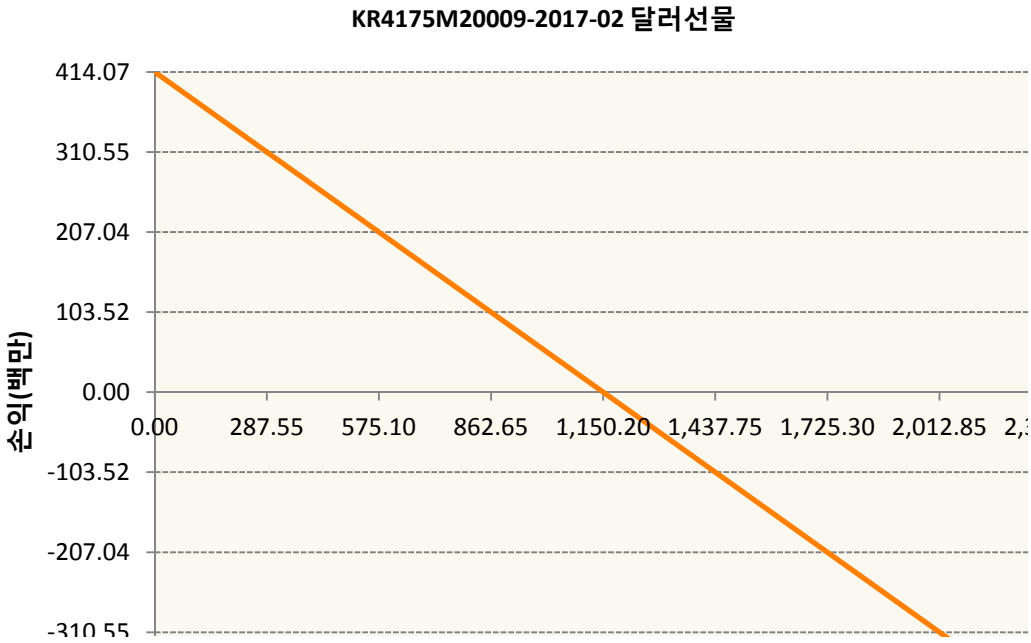
2. 만기시점의 손익구조

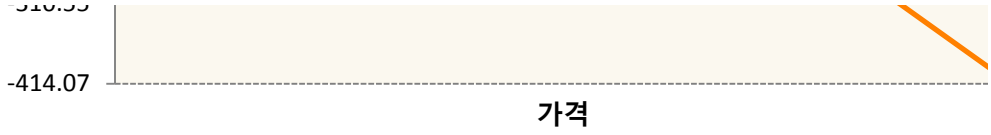


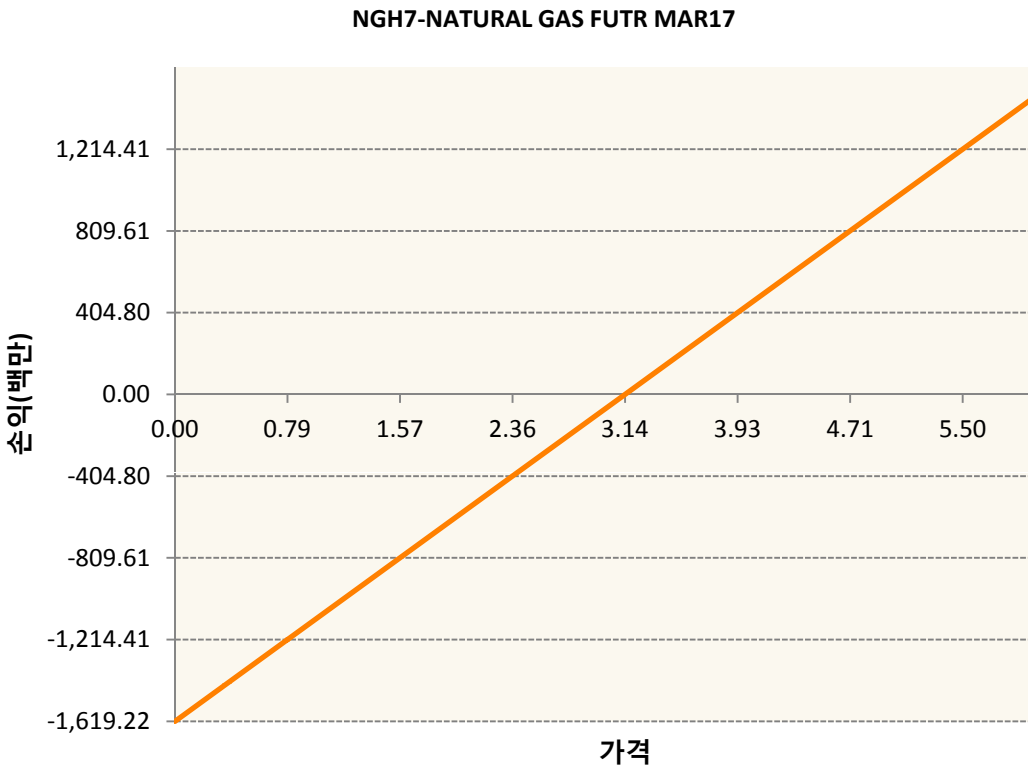


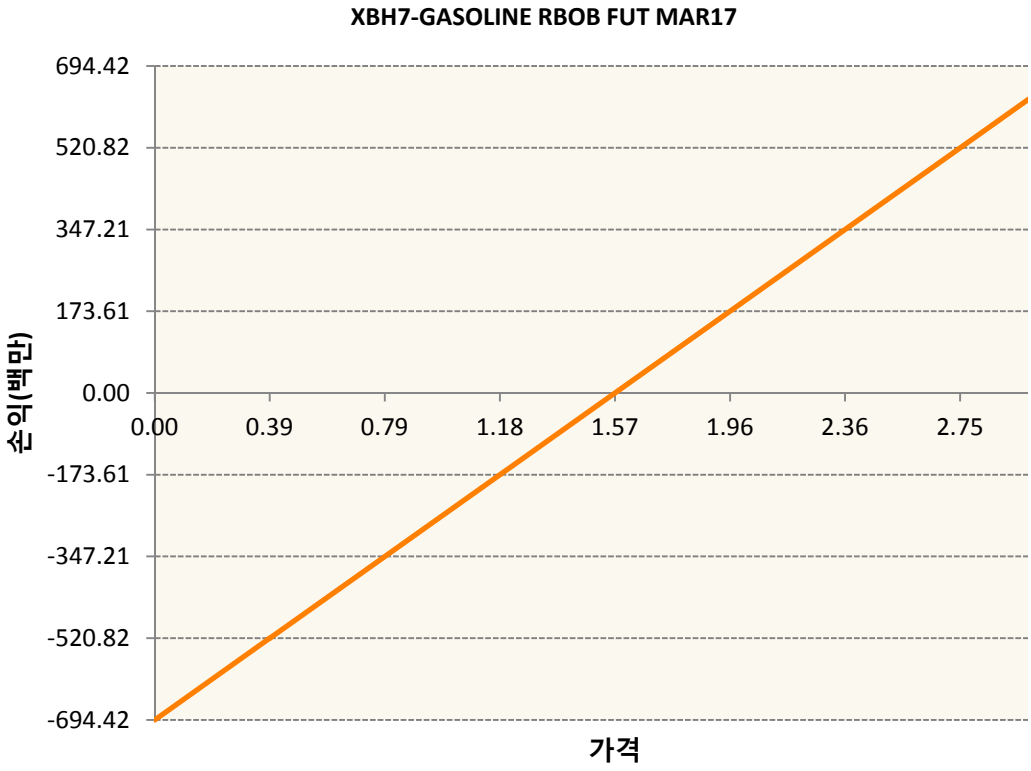

-926.92
-1,390.38
-1,853.84
가격


HOH7-NY Harb ULSD Fut MAR17
806.91
605.18
403.45
201.73
0.00
-201.73
-403.45
-605.18
-806.91
0.00
0.41
0.82
1.23
1.64
2.05
2.46
2.87
순익(백만)
가격


KR4175M20009-2017-02 달러선물
414.07
310.55
207.04
103.52
0.00
-103.52
-207.04
-310.55
0.00
287.55
575.10
862.65
1,150.20
1,437.75
1,725.30
2,012.85
순익(백만)


-414.07
가격


NGH7-NATURAL GAS FUTR MAR17
1,214.41
809.61
404.80
0.00
-404.80
-809.61
-1,214.41
-1,619.22
0.00
0.79
1.57
2.36
3.14
3.93
4.71
5.50
순익(백만)
가격


XBH7-GASOLINE RBOB FUT MAR17
694.42
520.82
347.21
173.61
0.00
-173.61
-347.21
-520.82
-694.42
0.00
0.39
0.79
1.18
1.57
1.96
2.36
2.75
순익(백만)
가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLH7	WTI CRUDE FUTURE MAR17	109
COK7	BRENT CRUDE FUTR MAY17	148
HOH7	NY Harb ULSD Fut MAR17	65
KR4175M20(	2017-02 달러선물	33
NGH7	NATURAL GAS FUTR MAR17	130
XBH7	GASOLINE RBOB FUT MAR17	56

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

1,128

공시일	2017-02-13
기준일	2017-02-10

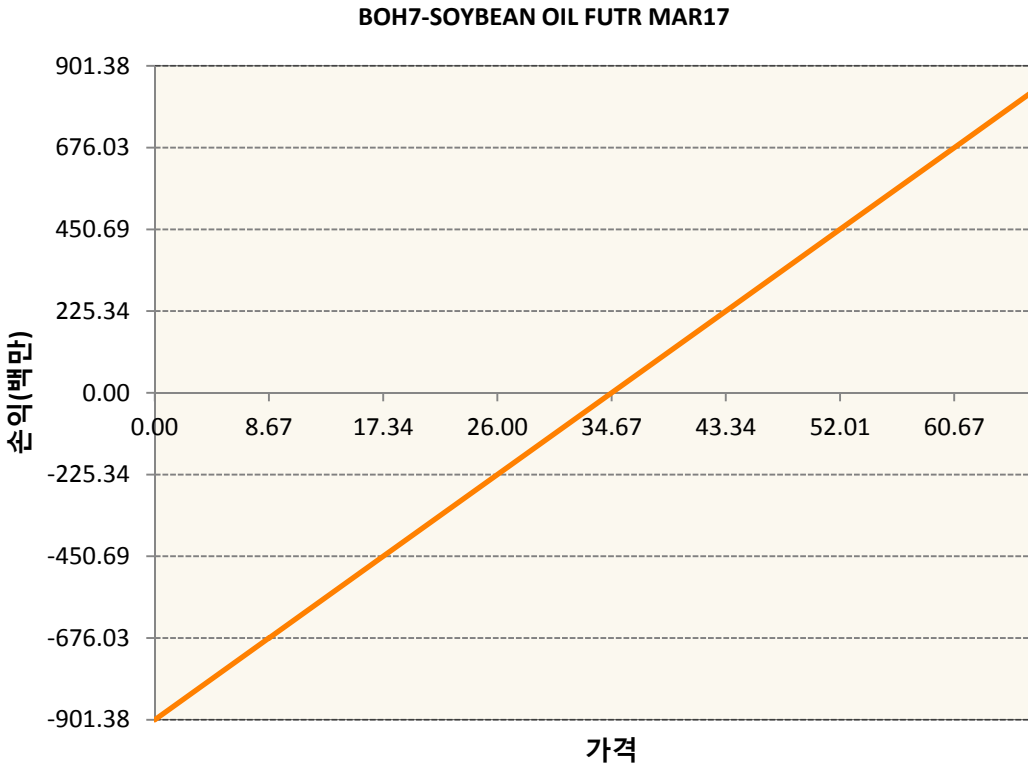
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

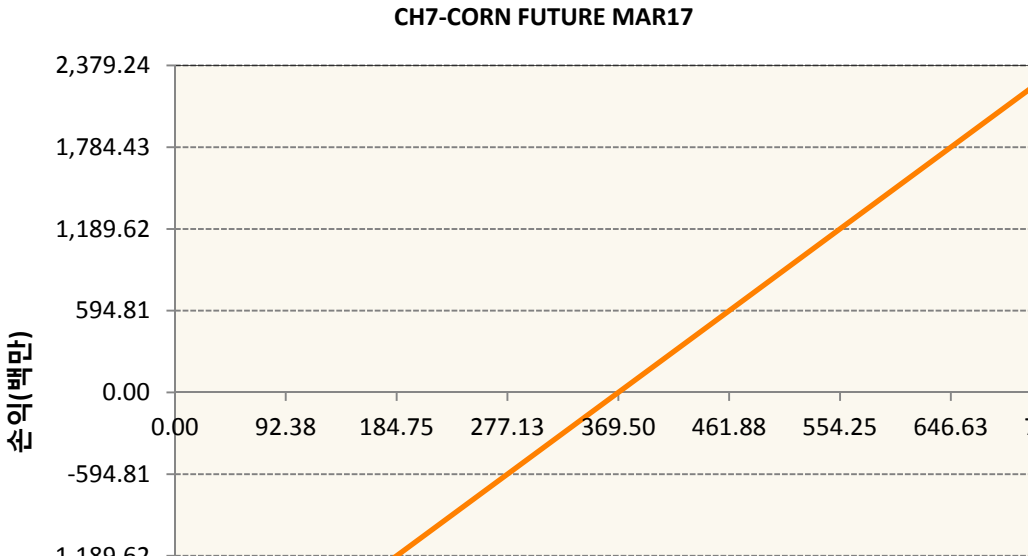
1. 계약금액

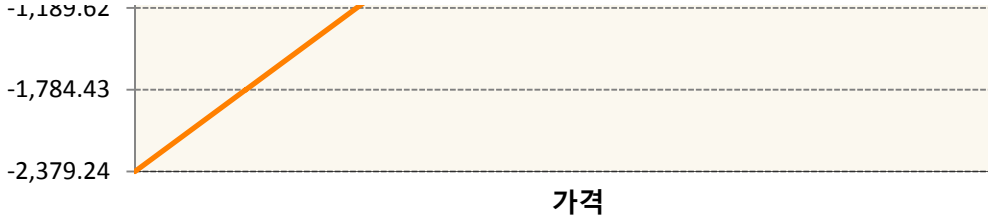
(단위:백만원)

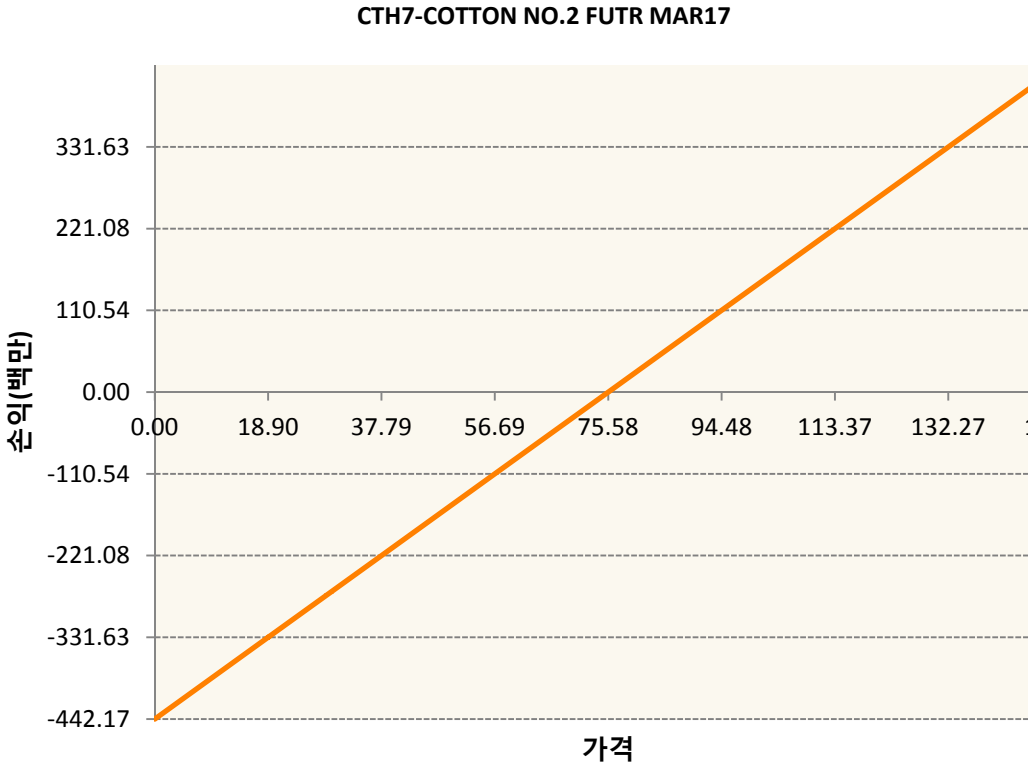
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	9,991	575	9,416	

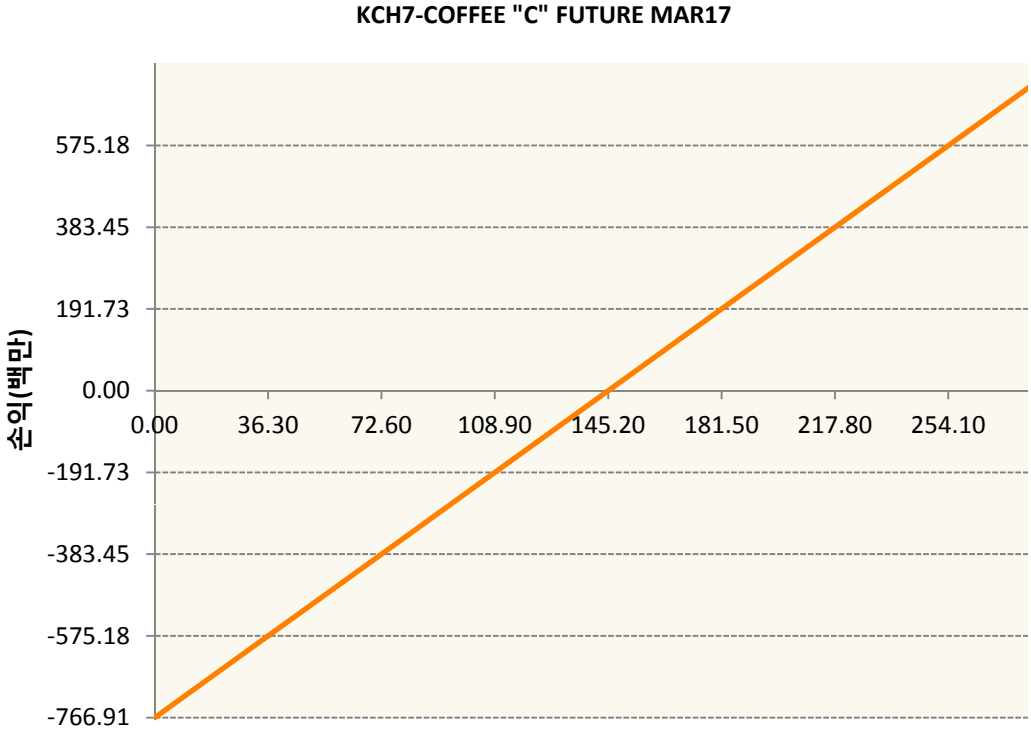
2. 만기시점의 손익구조



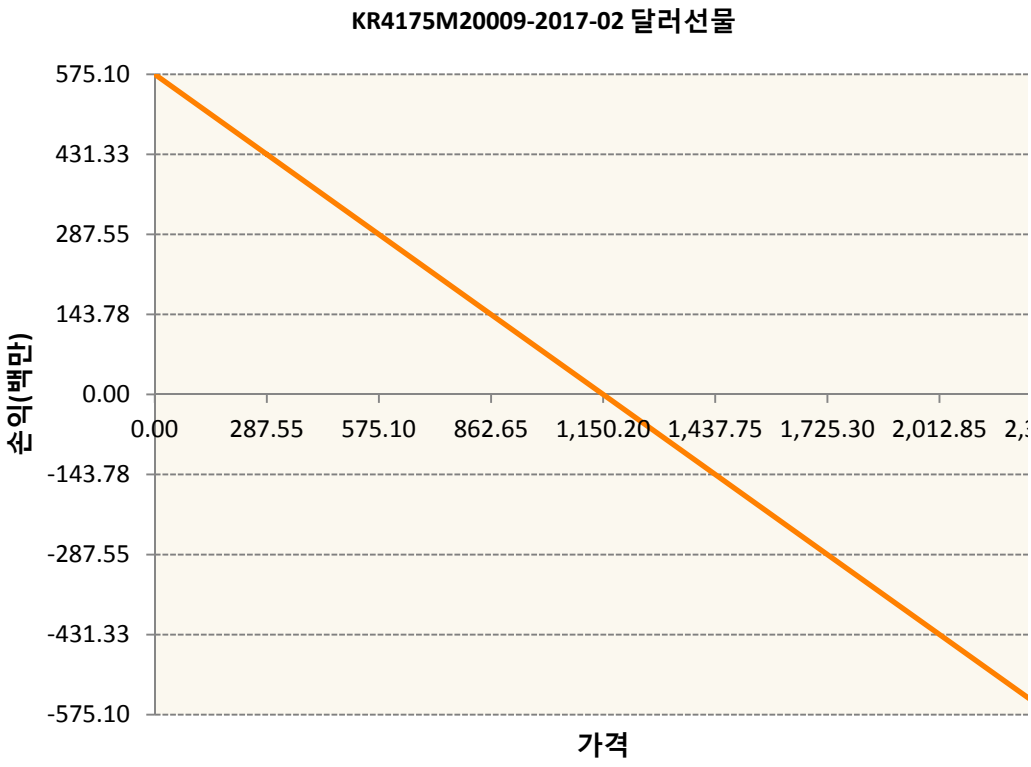


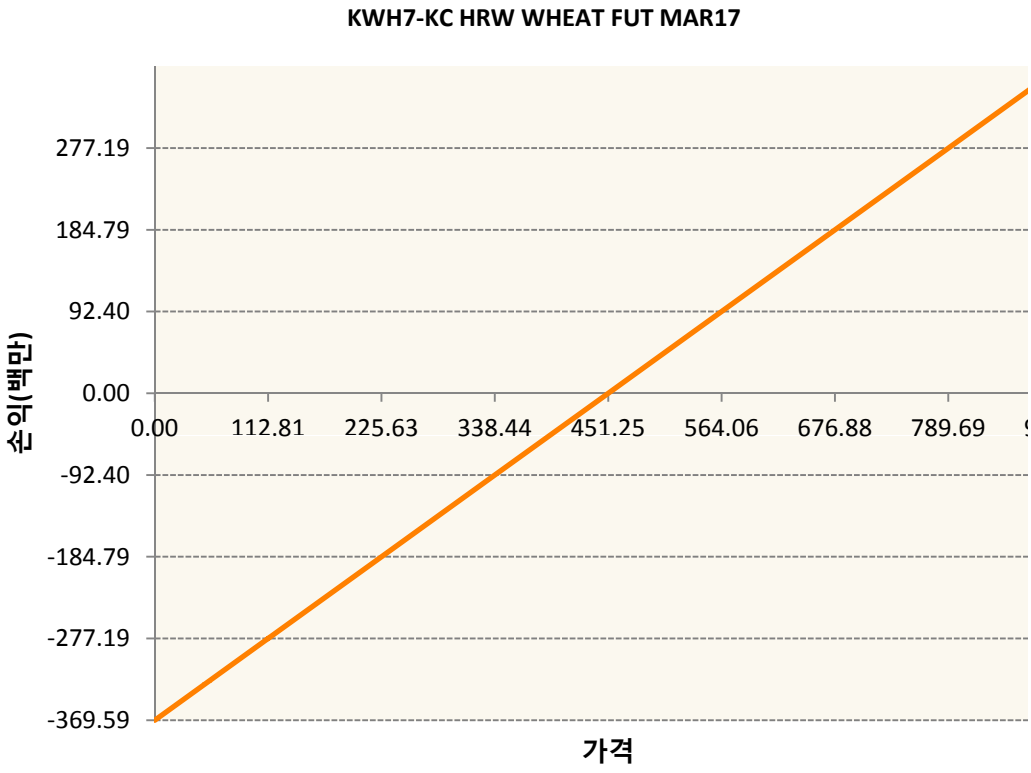

-1,784.43
-2,379.24
가격

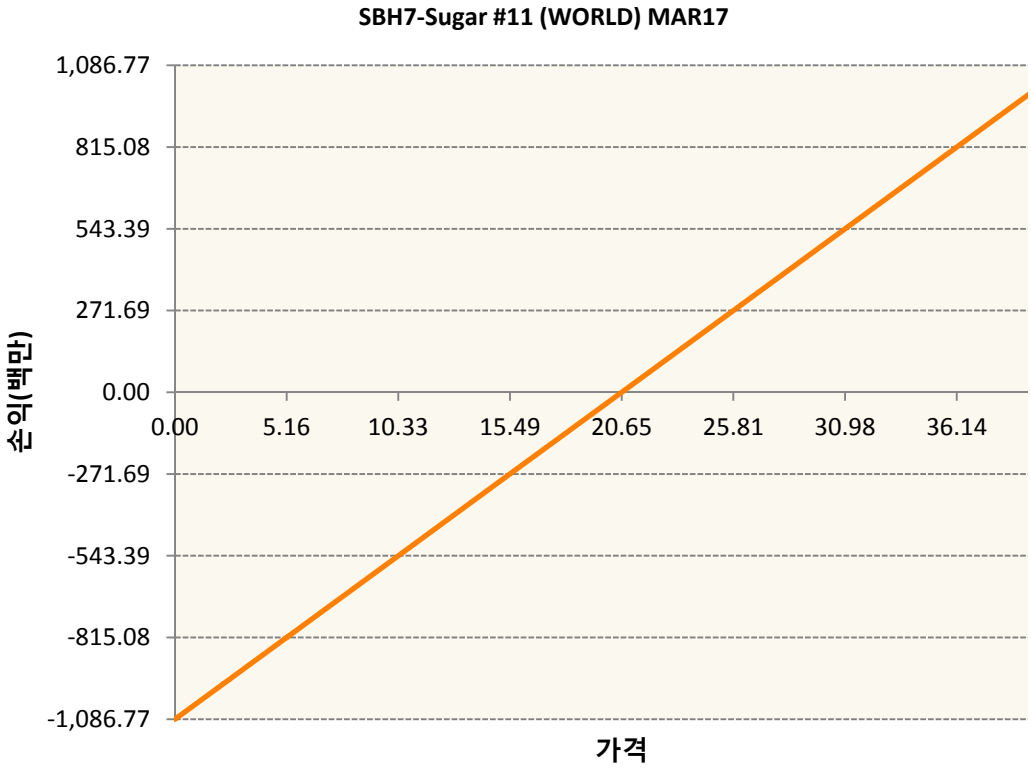

CTH7-COTTON NO.2 FUTR MAR17
331.63
221.08
110.54
0.00
-110.54
-221.08
-331.63
-442.17
0.00
18.90
37.79
56.69
75.58
94.48
113.37
132.27
순익(백만)
가격

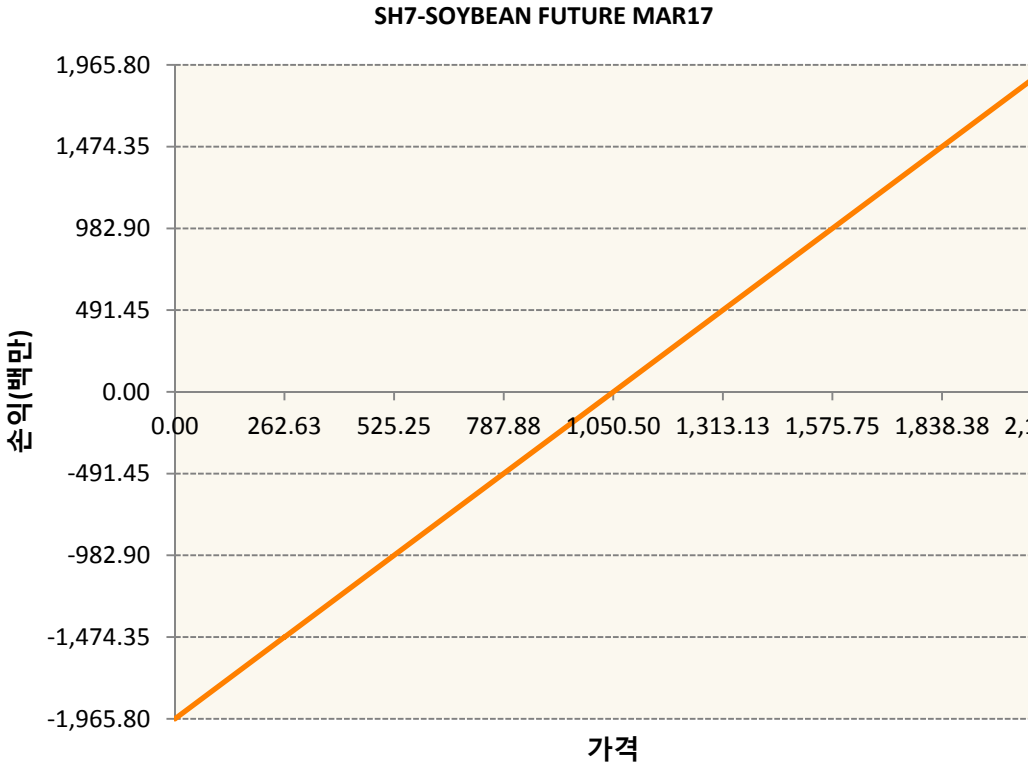

KCH7-COFFEE "C" FUTURE MAR17
575.18
383.45
191.73
0.00
-191.73
-383.45
-575.18
-766.91
0.00
36.30
72.60
108.90
145.20
181.50
217.80
254.10
순익(백만)

가격

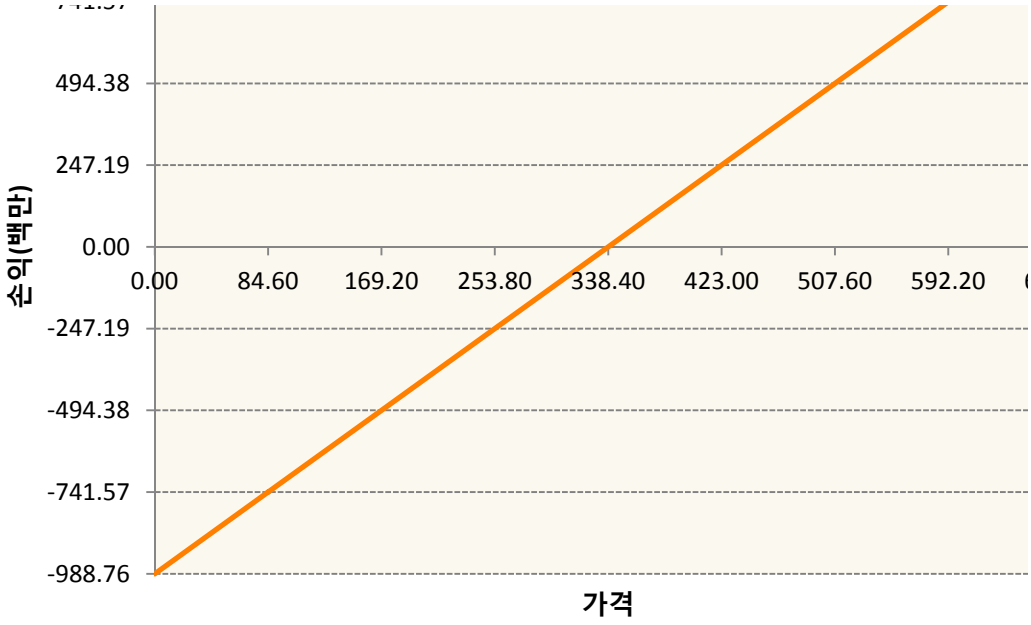

KR4175M20009-2017-02 달러선물
575.10
431.33
287.55
143.78
0.00
-143.78
-287.55
-431.33
-575.10
0.00
287.55
575.10
862.65
1,150.20
1,437.75
1,725.30
2,012.85
순이(백만)
가격

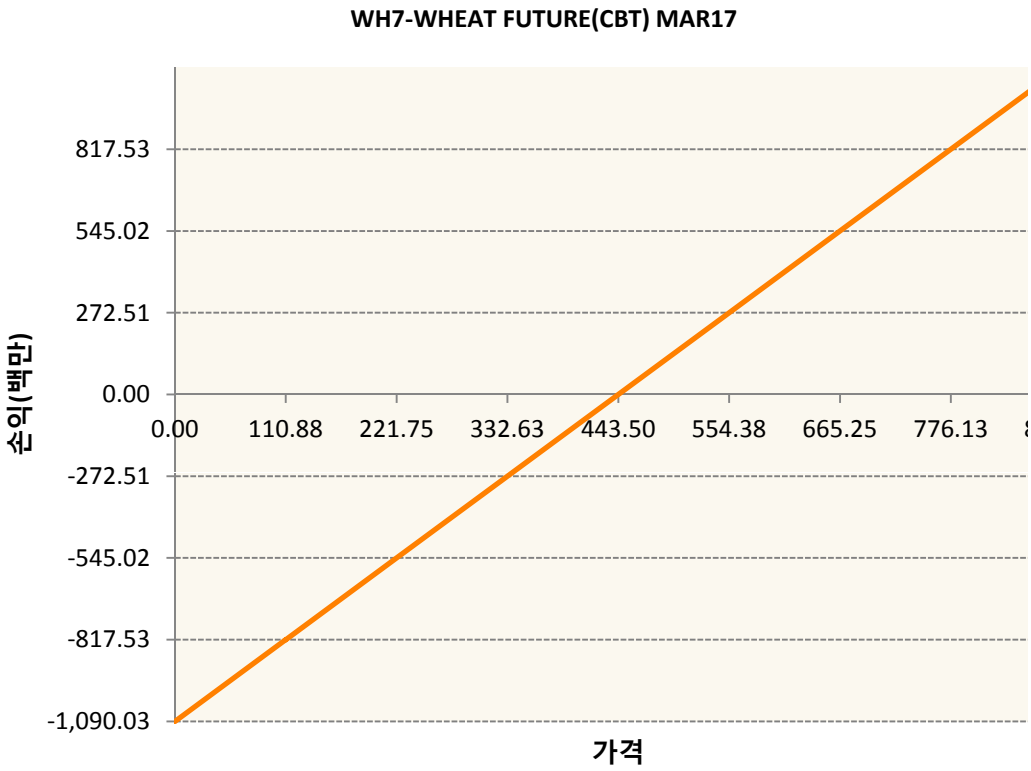

KWH7-KC HRW WHEAT FUT MAR17
277.19
184.79
92.40
0.00
-92.40
-184.79
-277.19
-369.59
0.00
112.81
225.63
338.44
451.25
564.06
676.88
789.69
순이(백만)
가격


SBH7-Sugar #11 (WORLD) MAR17
1,086.77
815.08
543.39
271.69
0.00
-271.69
-543.39
-815.08
-1,086.77
0.00
5.16
10.33
15.49
20.65
25.81
30.98
36.14
손익(백만)
가격


SH7-SOYBEAN FUTURE MAR17
1,965.80
1,474.35
982.90
491.45
0.00
-491.45
-982.90
-1,474.35
-1,965.80
0.00
262.63
525.25
787.88
1,050.50
1,313.13
1,575.75
1,838.38
손익(백만)
가격


SMH7-SOYBEAN MEAL FUTR MAR17
741.57





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

BOH7	SOYBEAN OIL FUTR MAR17	72
CH7	CORN FUTURE MAR17	190
CTH7	COTTON NO.2 FUTR MAR17	35
KCH7	COFFEE "C" FUTURE MAR17	61
KR4175M20(	2017-02 달러선물	46

KWH7	KC HRW WHEAT FUT MAR17	30
SBH7	Sugar #11 (WORLD) MAR17	87
SH7	SOYBEAN FUTURE MAR17	157
SMH7	SOYBEAN MEAL FUTR MAR17	79
WH7	WHEAT FUTURE(CBT) MAR17	87

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

943