공시일	2017-01-02
기준일	2016-12-30

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	2017-01-02
기준일	2016-12-30

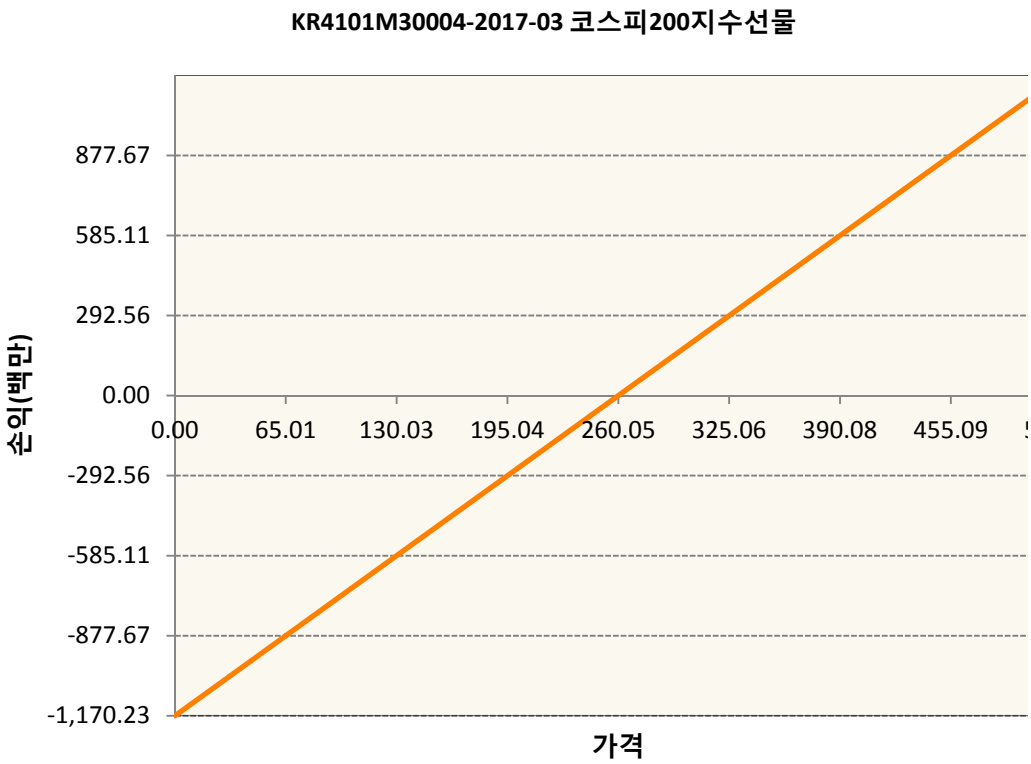
스마트인덱스모

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	1,170	0	1,170	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101M30(2017-03 코스피200지수선물							94
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-94	-94	-94	-94	-94	-94	-94
-5.33%	-62	-62	-62	-62	-62	-62	-62
-2.67%	-31	-31	-31	-31	-31	-31	-31
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	31	31	31	31	31	31	31
5.33%	62	62	62	62	62	62	62
8.00%	94	94	94	94	94	94	94

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

70

공시일	2017-01-02
기준일	2016-12-30

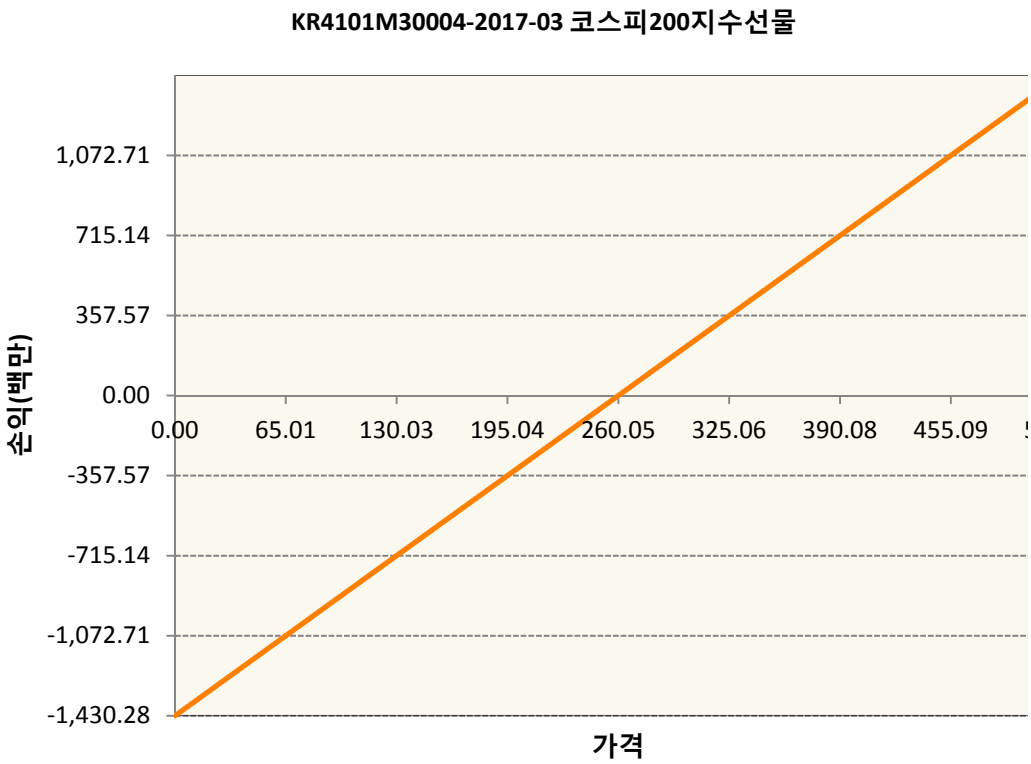
스마트레버리지목표전환형1호

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	1,430	0	1,430	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101M30(2017-03 코스피200지수선물							114
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-114	-114	-114	-114	-114	-114	-114
-5.33%	-76	-76	-76	-76	-76	-76	-76
-2.67%	-38	-38	-38	-38	-38	-38	-38
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	38	38	38	38	38	38	38
5.33%	76	76	76	76	76	76	76
8.00%	114	114	114	114	114	114	114

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

85

공시일	2017-01-02
기준일	2016-12-30

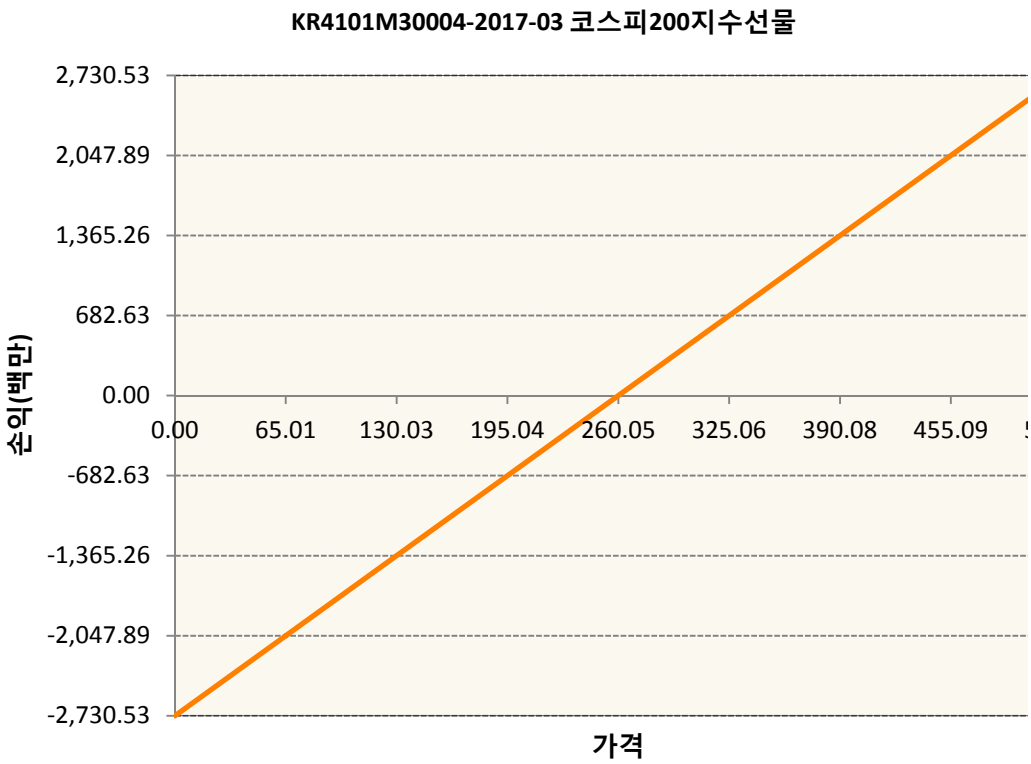
1.3배 레버리지 인덱스(주식-파생형)

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	2,731	0	2,731	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101M30(2017-03 코스피200지수선물							218
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-218	-218	-218	-218	-218	-218	-218
-5.33%	-146	-146	-146	-146	-146	-146	-146
-2.67%	-73	-73	-73	-73	-73	-73	-73
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	73	73	73	73	73	73	73
5.33%	146	146	146	146	146	146	146
8.00%	218	218	218	218	218	218	218

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

163

공시일	2017-01-02
기준일	2016-12-30

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	904

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

708

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-01-02
기준일	2016-12-30

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	375

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

686

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-01-02
기준일	2016-12-30

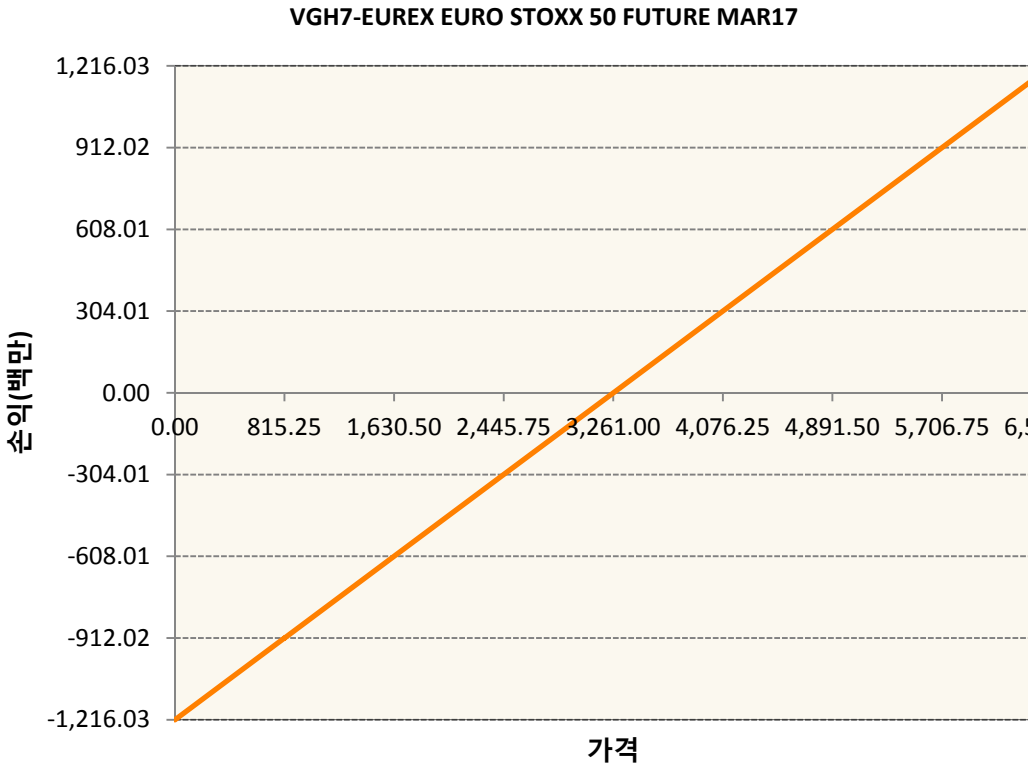
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,216	0	1,216	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGH7	EUREX EURO STOXX 50 FUTURE MAR17	97

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

(단위:백만원)

113

공시일	2017-01-02
기준일	2016-12-30

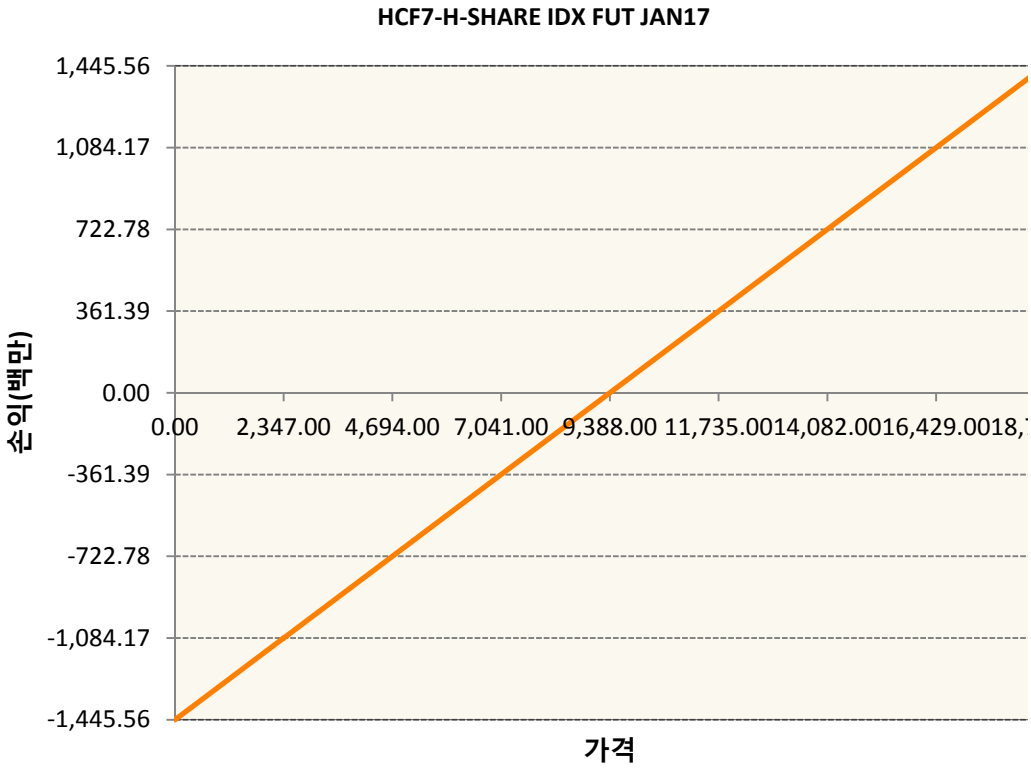
차이나인덱스모(주식-파생형)

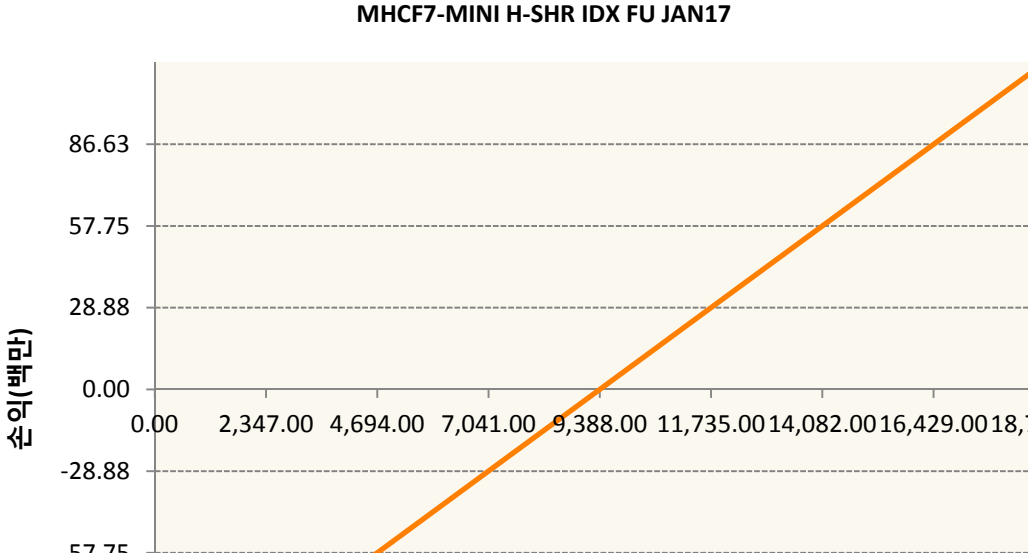
1. 계약금액

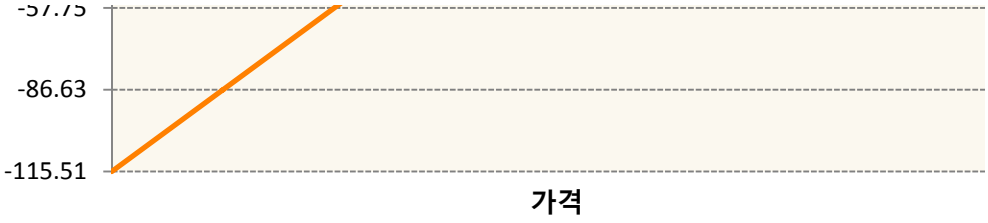
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,561	0	1,561	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

HCF7	H-SHARE IDX FUT JAN17	116
MHCF7	MINI H-SHR IDX FU JAN17	9

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

153

공시일	2017-01-02
기준일	2016-12-30

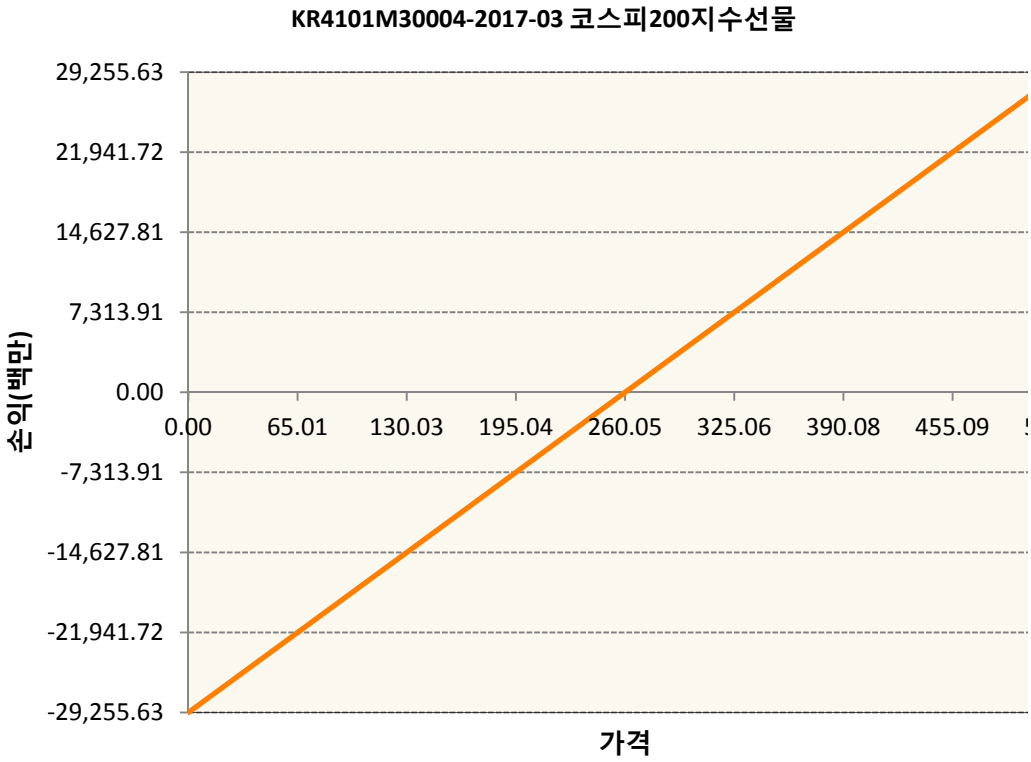
커버드콜(주식혼합-파생형)

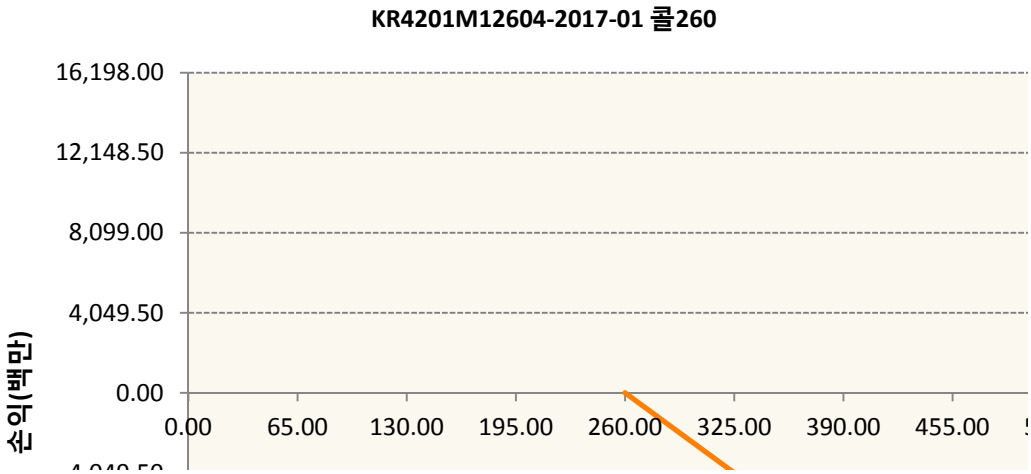
1. 계약금액

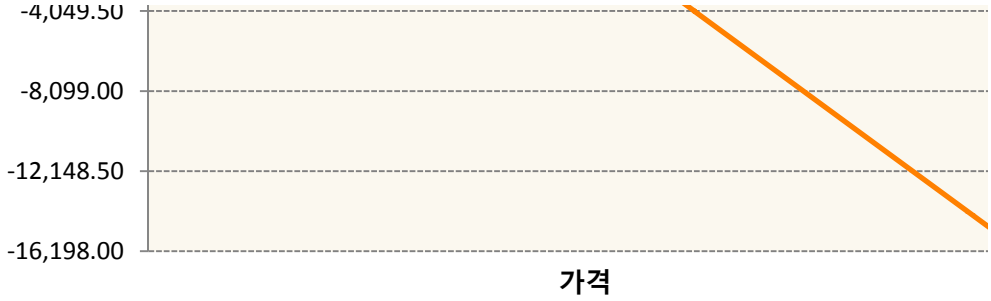
(단위:백만원)

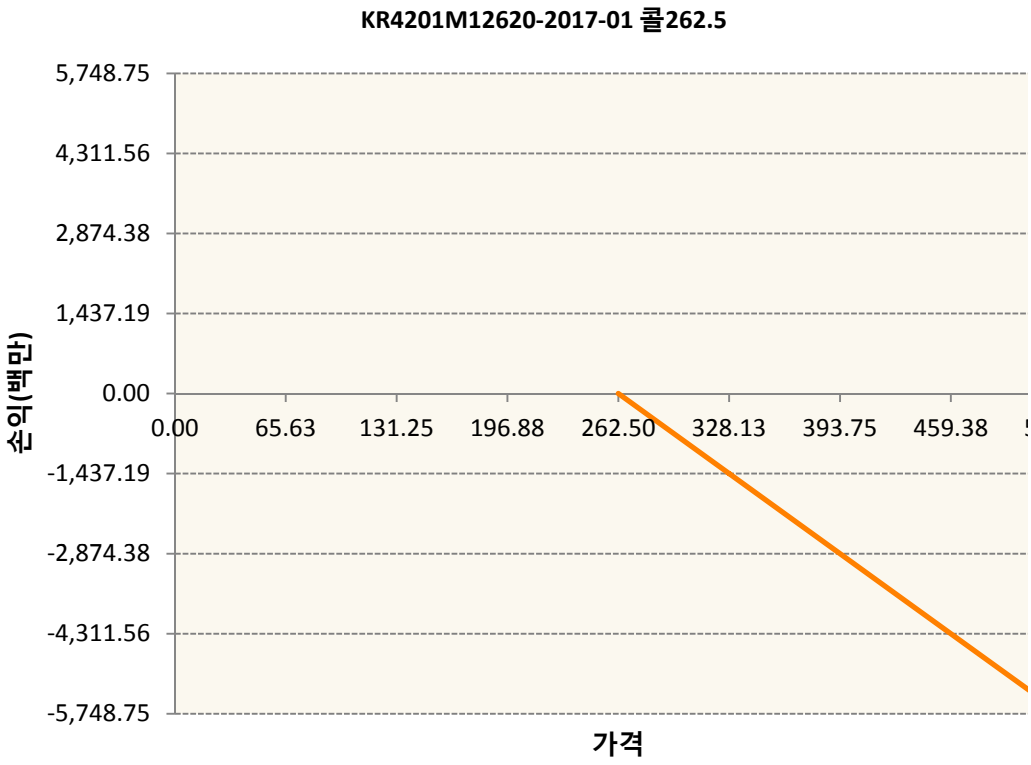
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	29,256	0	29,256	장내
누계	유가증권	옵션	0	21,947	-21,947	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101M30(2017-03 코스피200지수선물							2,340
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-2,340	-2,340	-2,340	-2,340	-2,340	-2,340	-2,340
-5.33%	-1,560	-1,560	-1,560	-1,560	-1,560	-1,560	-1,560
-2.67%	-780	-780	-780	-780	-780	-780	-780
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	780	780	780	780	780	780	780
5.33%	1,560	1,560	1,560	1,560	1,560	1,560	1,560
8.00%	2,340	2,340	2,340	2,340	2,340	2,340	2,340
KR4201M12(2017-01 콜260							5,782
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	697	697	697	697	696	696	696
-5.33%	696	696	695	694	691	686	680
-2.67%	671	655	634	610	582	552	518
0%	174	116	58	0	-58	-116	-174
2.67%	-1,493	-1,510	-1,532	-1,558	-1,588	-1,620	-1,656
5.33%	-3,623	-3,623	-3,625	-3,627	-3,631	-3,637	-3,645
8.00%	-5,781	-5,781	-5,781	-5,781	-5,781	-5,782	-5,782
KR4201M12(	2017-01 콜262.5						1,872

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	133	133	133	133	133	133	133
-5.33%	133	133	133	133	132	132	131
-2.67%	131	129	126	122	116	110	102
0%	54	36	18	0	-19	-38	-57
2.67%	-389	-402	-416	-431	-446	-463	-480
5.33%	-1,112	-1,113	-1,115	-1,117	-1,121	-1,126	-1,131
8.00%	-1,870	-1,870	-1,870	-1,871	-1,871	-1,871	-1,872

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

11,345

공시일	2017-01-02
기준일	2016-12-30

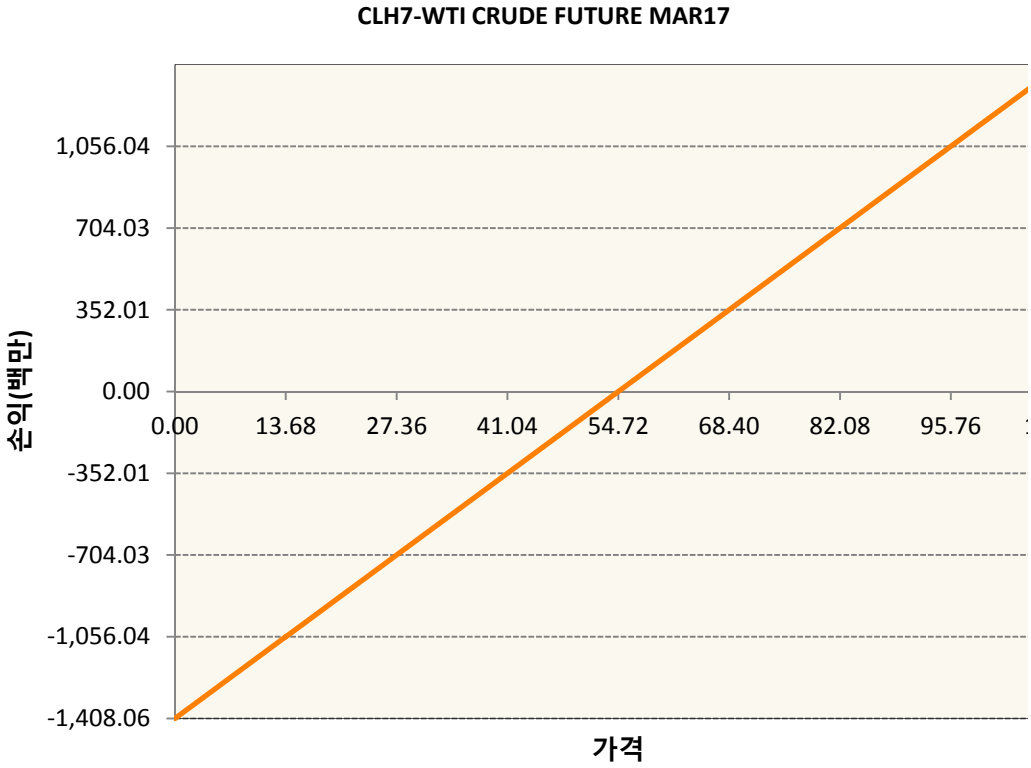
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

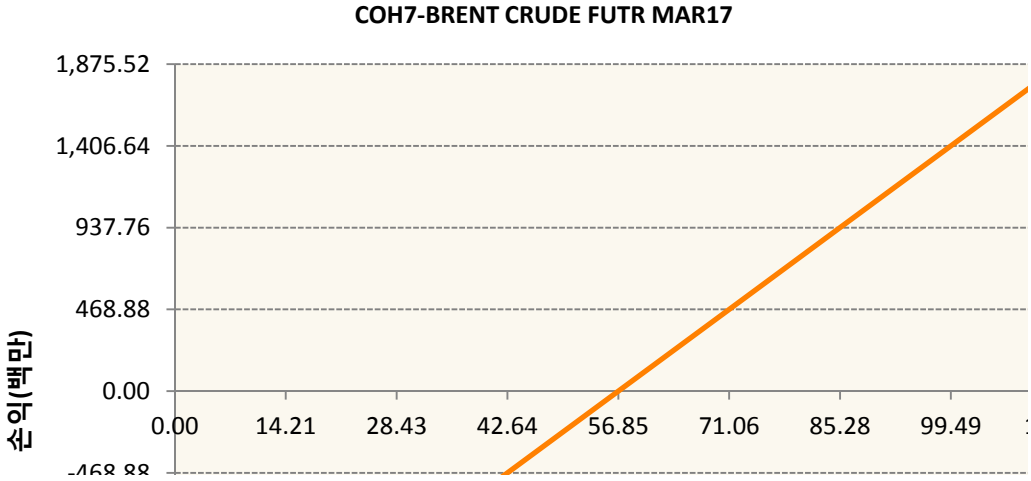
1. 계약금액

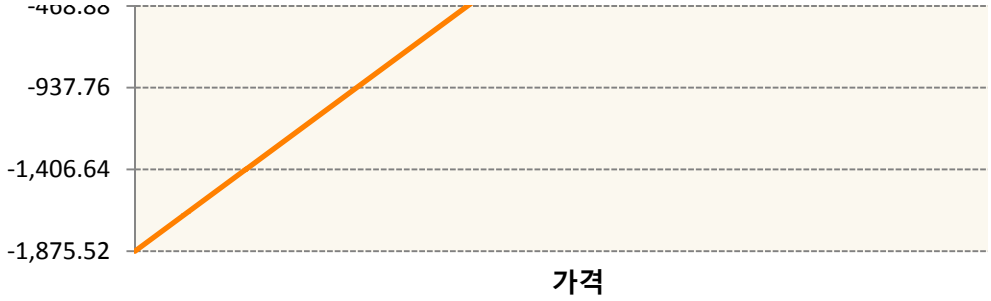
(단위:백만원)

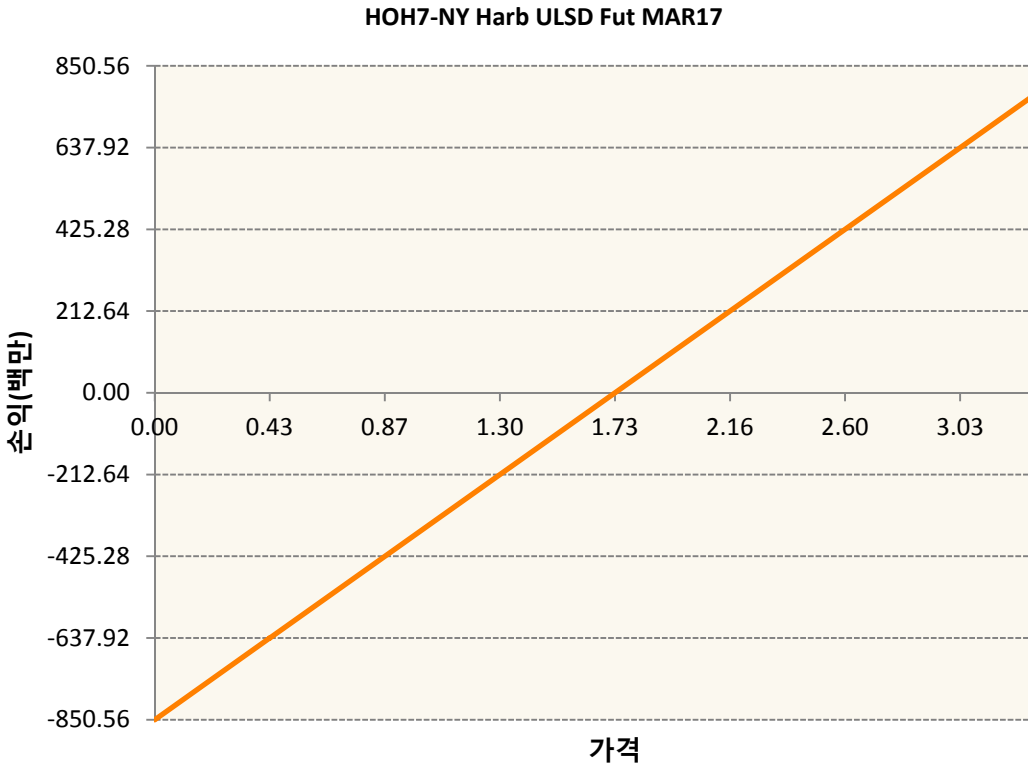
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	선물	유가증권	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	선물	유가증권	1,408	0	1,408	
누계	유가증권	선물	5,413	0	5,413	

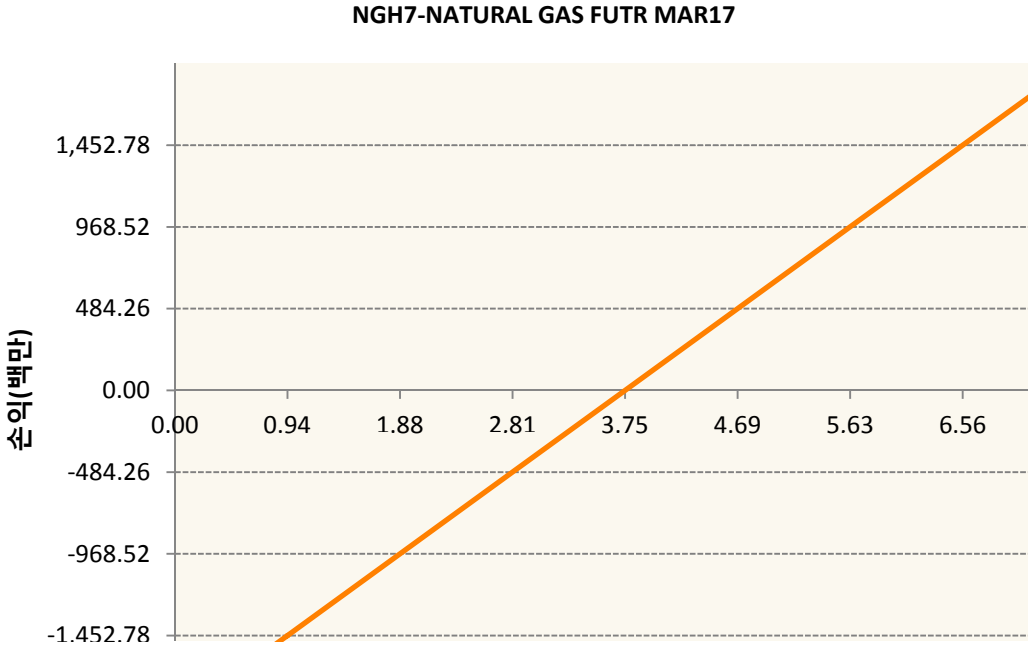
2. 만기시점의 손익구조

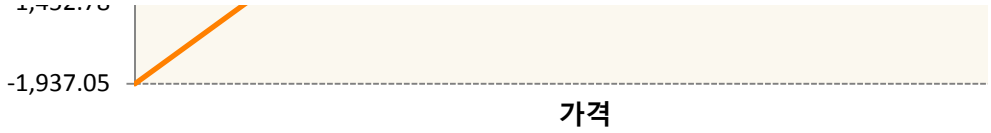


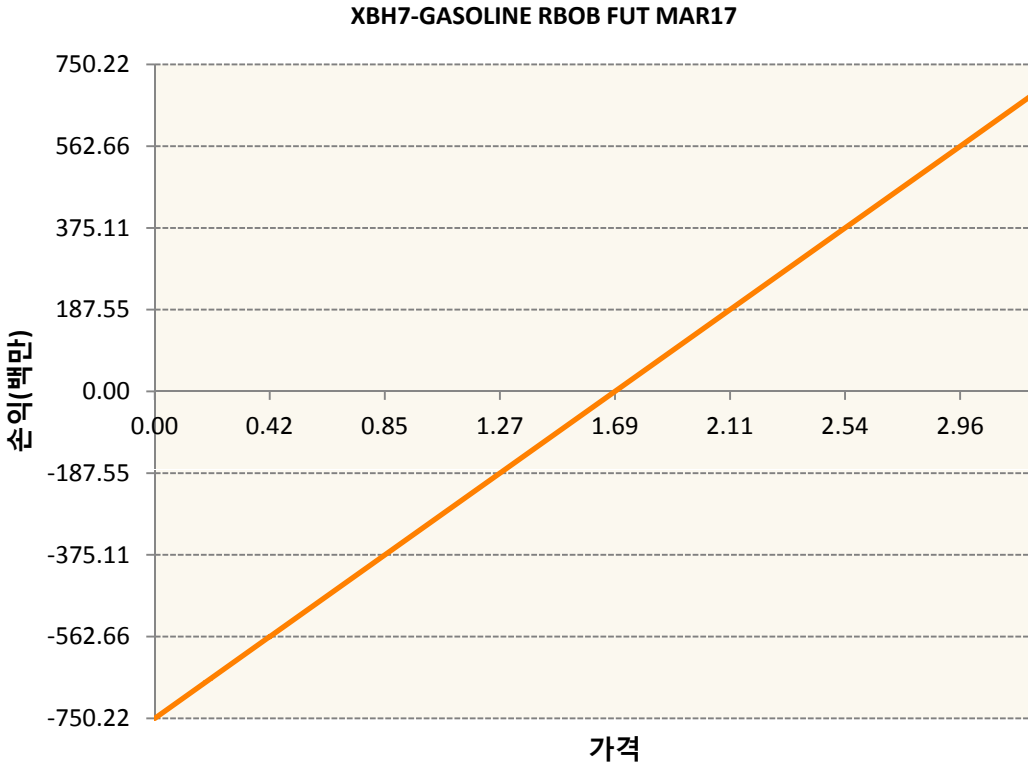



-937.76
-1,406.64
-1,875.52
가격


HOH7-NY Harb ULSD Fut MAR17
850.56
637.92
425.28
212.64
0.00
-212.64
-425.28
-637.92
-850.56
0.00
0.43
0.87
1.30
1.73
2.16
2.60
3.03
순익(백만)
가격


NGH7-NATURAL GAS FUTR MAR17
1,452.78
968.52
484.26
0.00
-484.26
-968.52
-1,452.78
0.00
0.94
1.88
2.81
3.75
4.69
5.63
6.56
순익(백만)





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLH7	WTI CRUDE FUTURE MAR17	113
COH7	BRENT CRUDE FUTR MAR17	150
HOH7	NY Harb ULSD Fut MAR17	68
NGH7	NATURAL GAS FUTR MAR17	155
XBH7	GASOLINE RBOB FUT MAR17	60

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

1,244

공시일	2017-01-02
기준일	2016-12-30

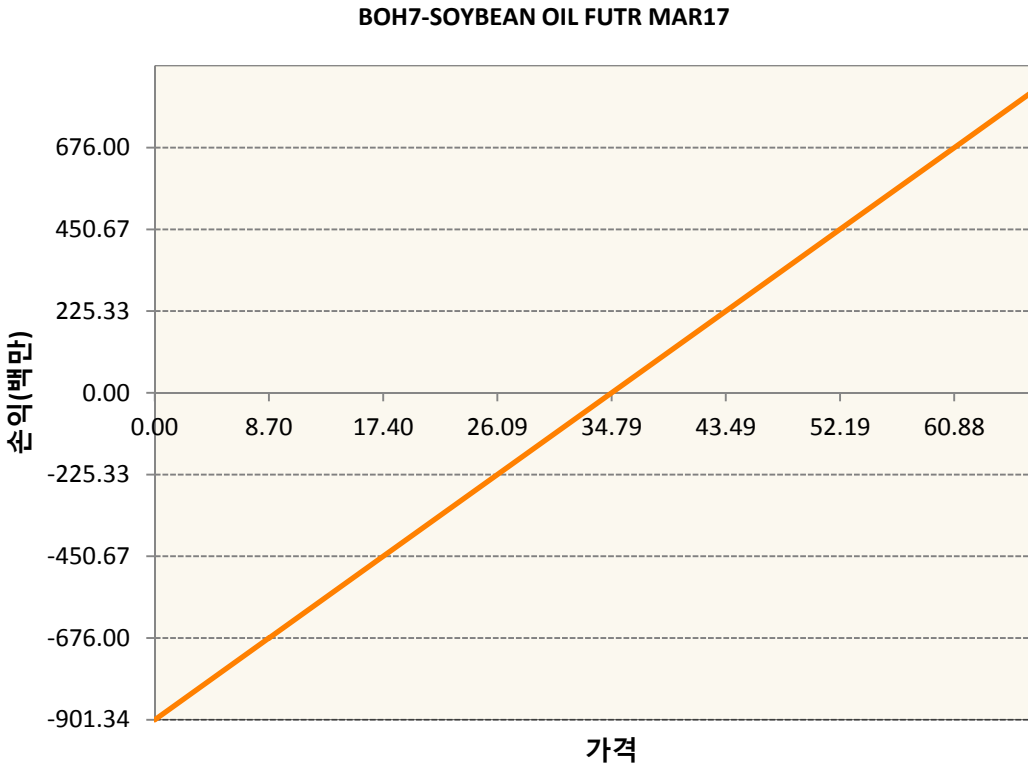
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

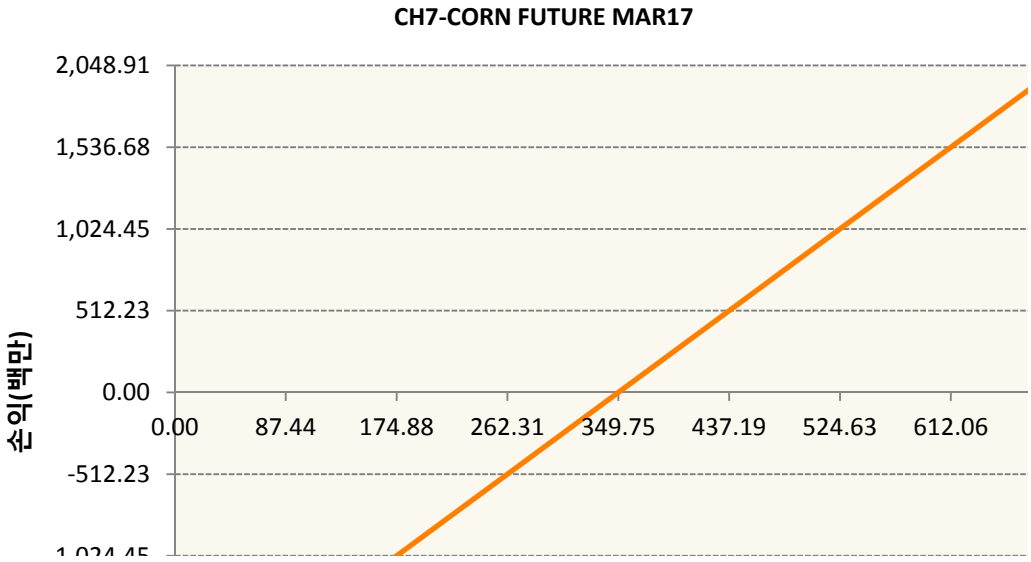
1. 계약금액

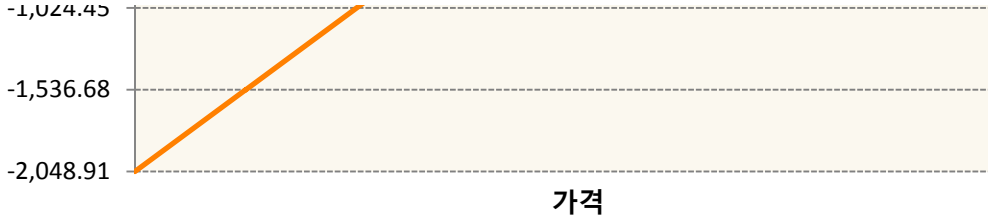
(단위:백만원)

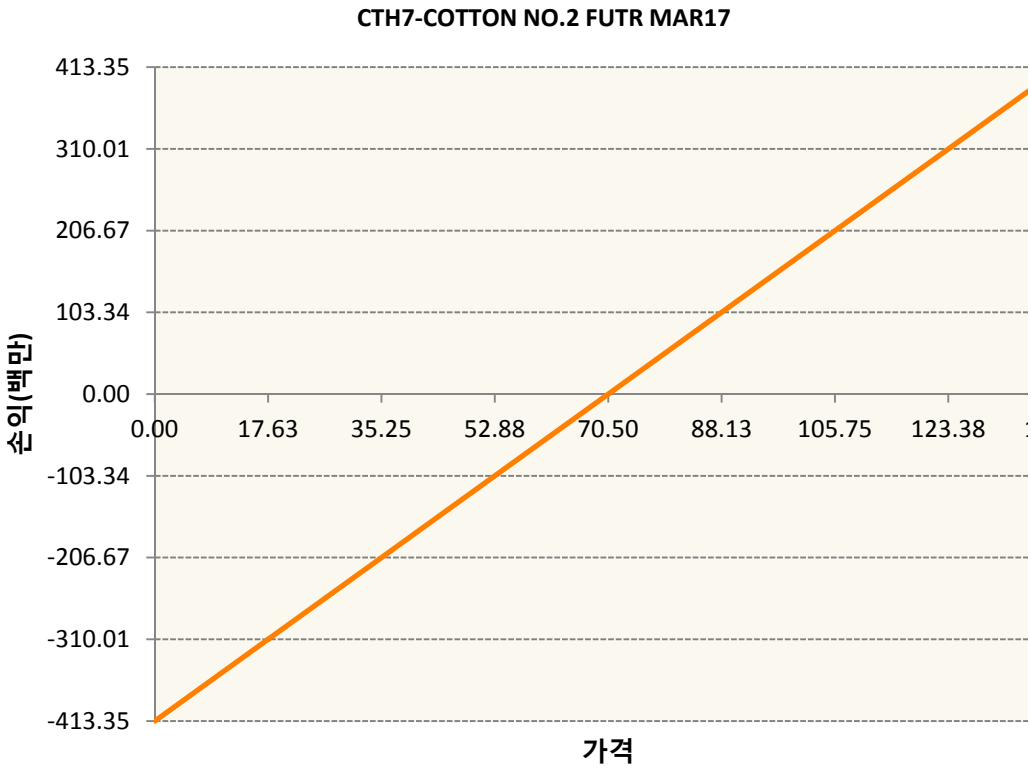
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	9,091	0	9,091	

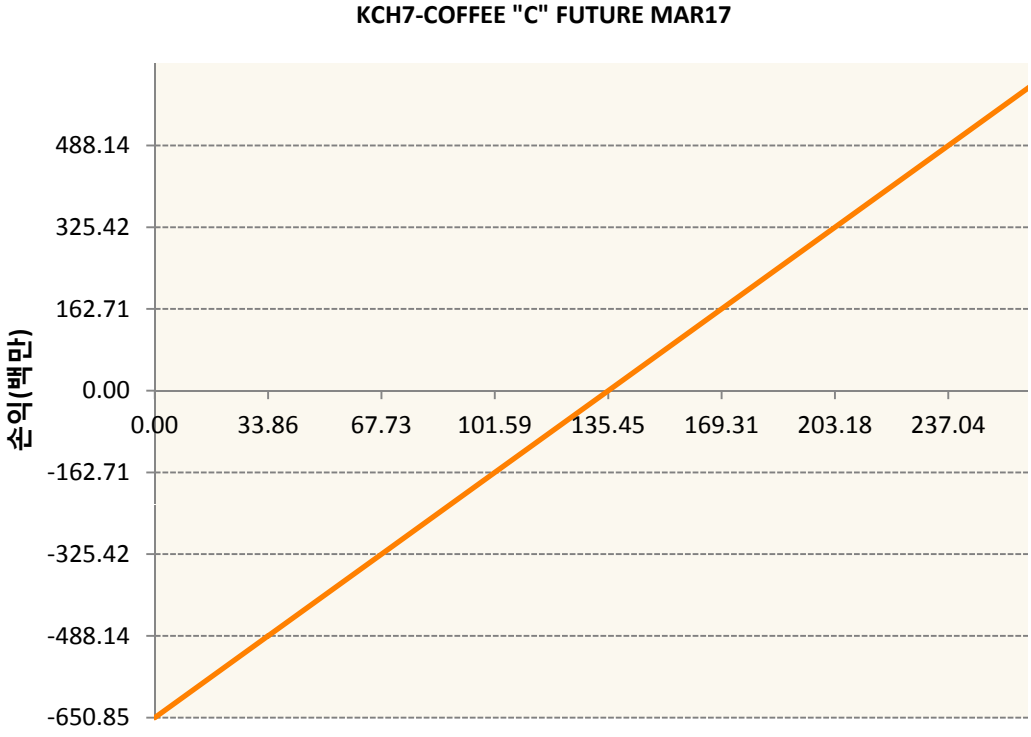
2. 만기시점의 손익구조



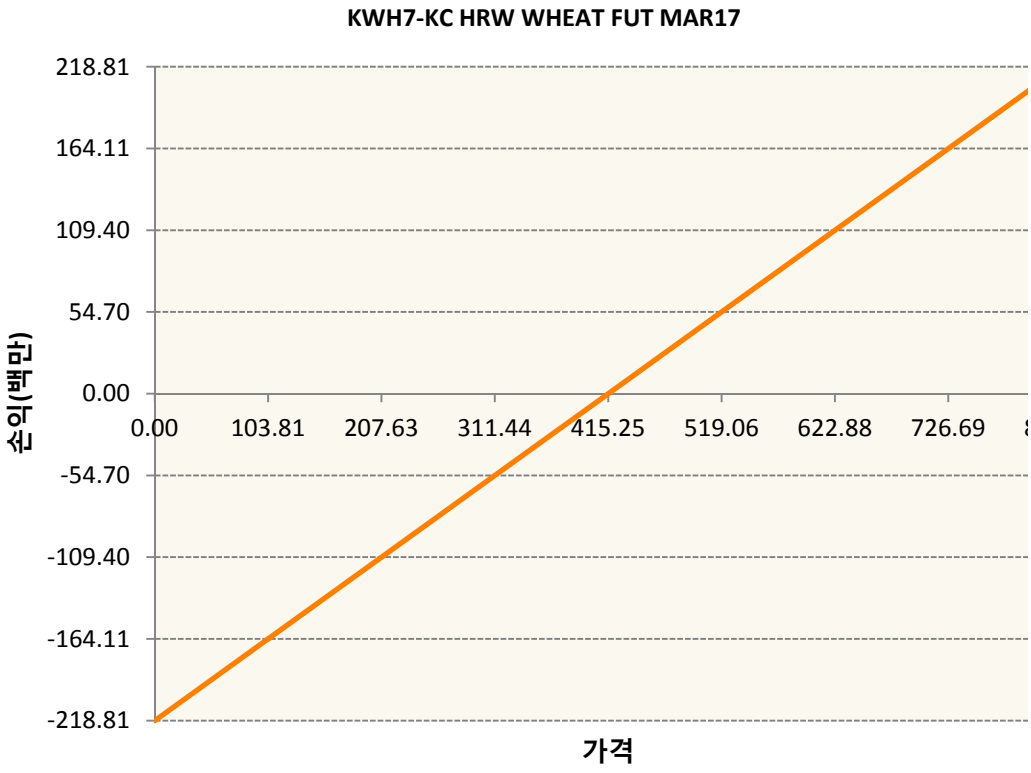


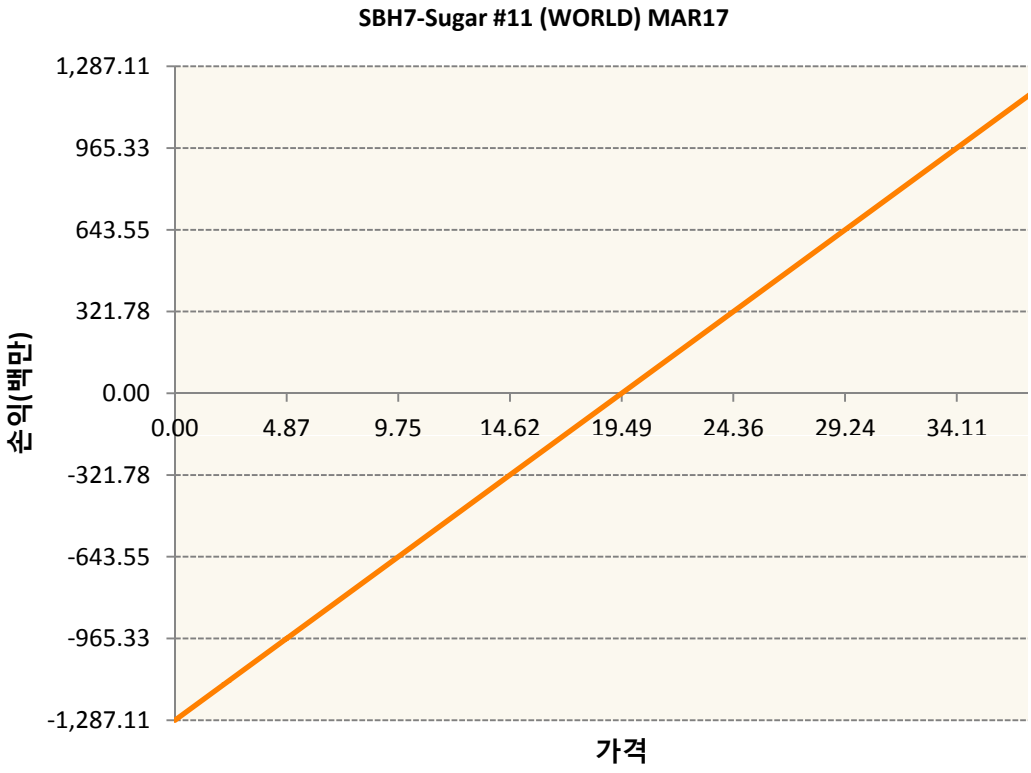

-1,536.68
-2,048.91
가격

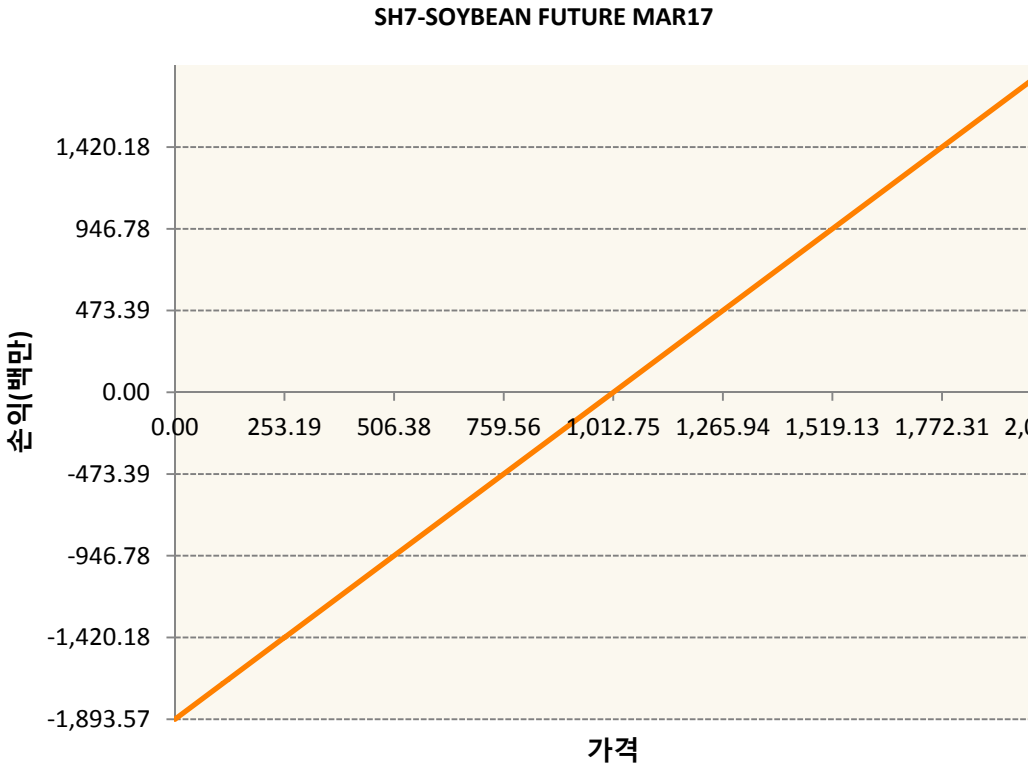

CTH7-COTTON NO.2 FUTR MAR17
413.35
310.01
206.67
103.34
0.00
-103.34
-206.67
-310.01
-413.35
0.00
17.63
35.25
52.88
70.50
88.13
105.75
123.38
손익(백만)
가격

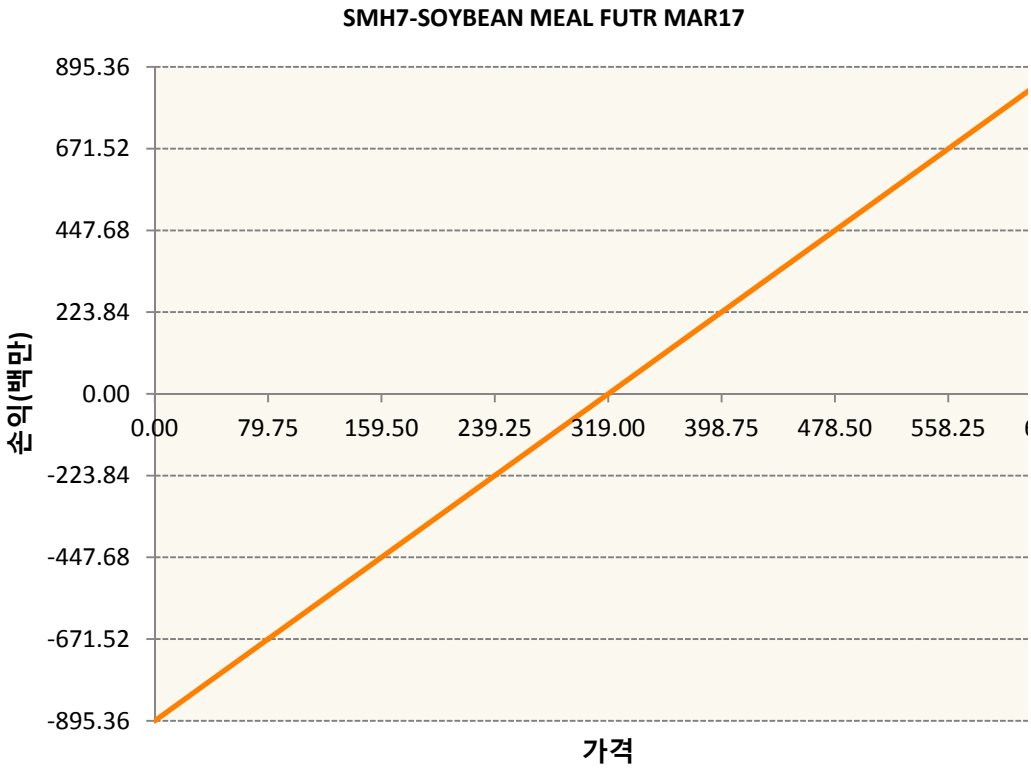

KCH7-COFFEE "C" FUTURE MAR17
488.14
325.42
162.71
0.00
-162.71
-325.42
-488.14
-650.85
0.00
33.86
67.73
101.59
135.45
169.31
203.18
237.04
손익(백만)

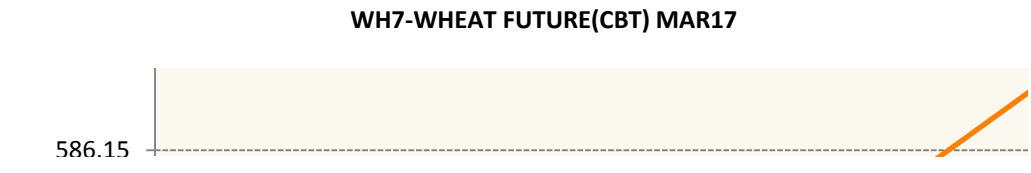
가격

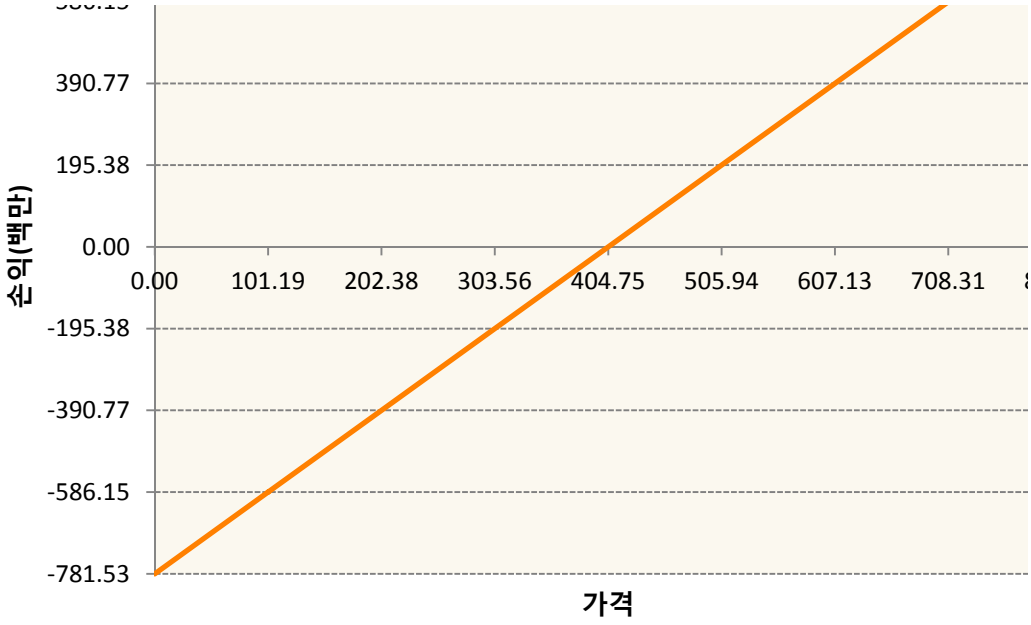

KWH7-KC HRW WHEAT FUT MAR17
218.81
164.11
109.40
54.70
0.00
-54.70
-109.40
-164.11
-218.81
0.00
103.81
207.63
311.44
415.25
519.06
622.88
726.69
손익(백만)
가격


SBH7-Sugar #11 (WORLD) MAR17
1,287.11
965.33
643.55
321.78
0.00
-321.78
-643.55
-965.33
-1,287.11
0.00
4.87
9.75
14.62
19.49
24.36
29.24
34.11
손익(백만)
가격


SH7-SOYBEAN FUTURE MAR17
1,420.18
946.78
473.39
0.00
-473.39
-946.78
-1,420.18
-1,893.57
0.00
253.19
506.38
759.56
1,012.75
1,265.94
1,519.13
1,772.31
손익(백만)
가격


SMH7-SOYBEAN MEAL FUTR MAR17
895.36
671.52
447.68
223.84
0.00
-223.84
-447.68
-671.52
-895.36
0.00
79.75
159.50
239.25
319.00
398.75
478.50
558.25
손익(백만)
가격


WH7-WHEAT FUTURE(CBT) MAR17
586.15



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
BOH7	SOYBEAN OIL FUTR MAR17	72
CH7	CORN FUTURE MAR17	164
CTH7	COTTON NO.2 FUTR MAR17	33
KCH7	COFFEE "C" FUTURE MAR17	52
KWH7	KC HRW WHEAT FUT MAR17	18
SBH7	Sugar #11 (WORLD) MAR17	103
SH7	SOYBEAN FUTURE MAR17	151
SMH7	SOYBEAN MEAL FUTR MAR17	72
WH7	WHEAT FUTURE(CBT) MAR17	63

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	878