공시일	2017-01-04
기준일	2017-01-03

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	2017-01-04
기준일	2017-01-03

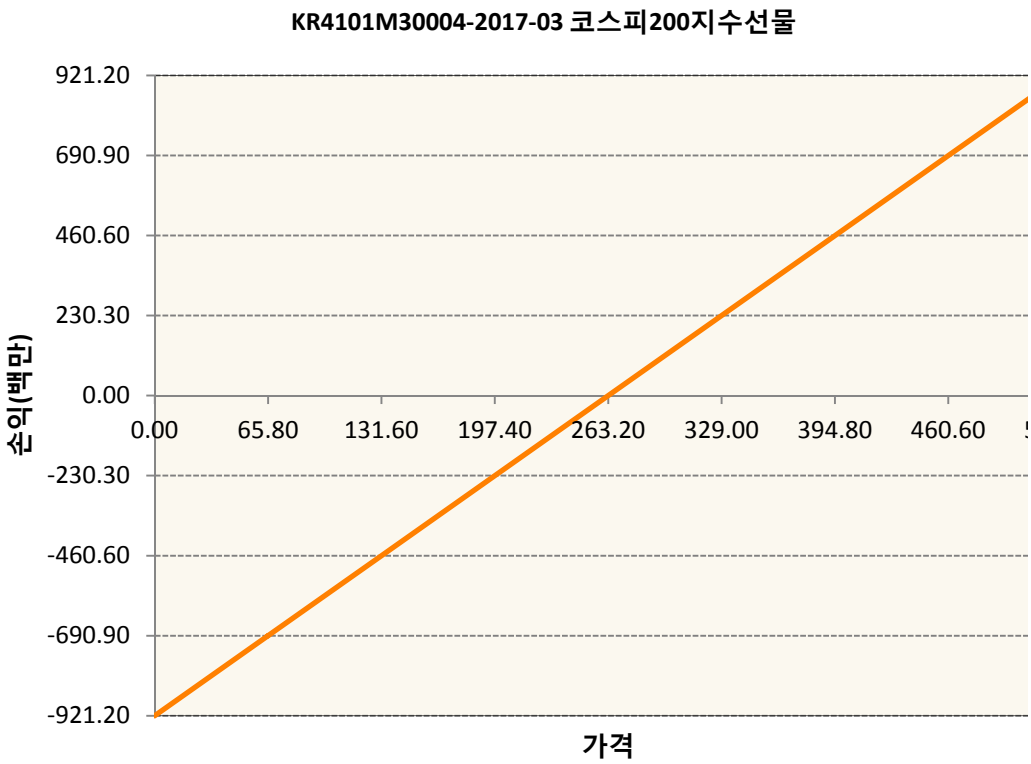
스마트인덱스모

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	921	0	921	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101M30(2017-03 코스피200지수선물							74
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-74	-74	-74	-74	-74	-74	-74
-5.33%	-49	-49	-49	-49	-49	-49	-49
-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%	49	49	49	49	49	49	49
8.00%	74	74	74	74	74	74	74

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

55

공시일	2017-01-04
기준일	2017-01-03

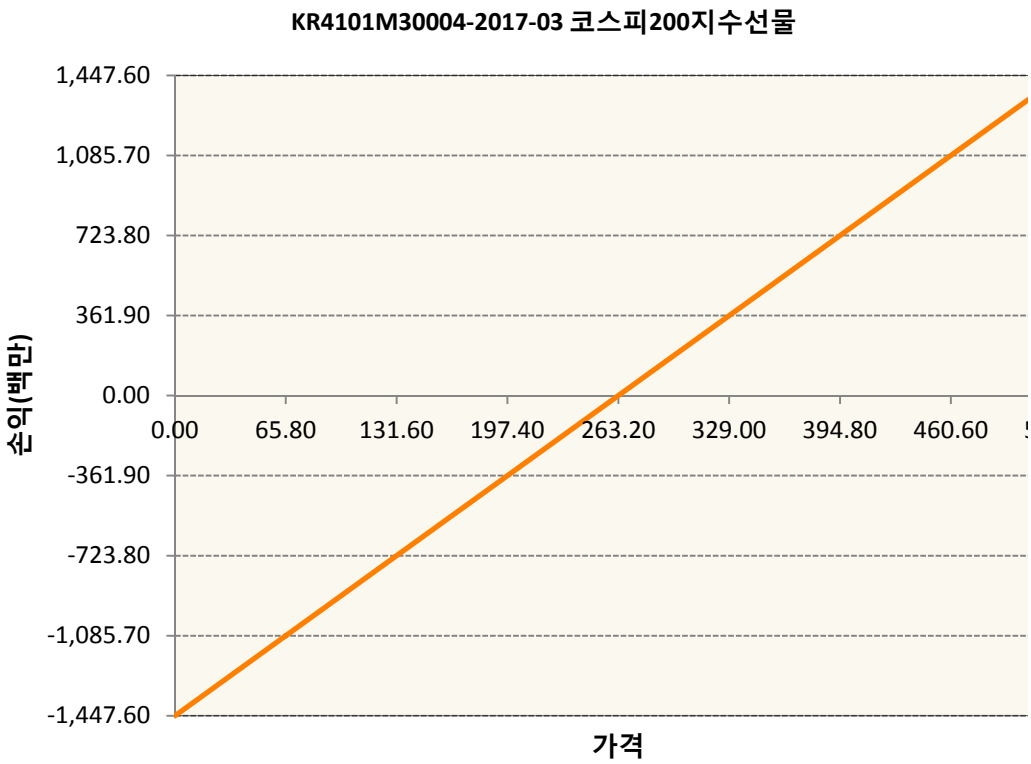
스마트레버리지목표전환형1호

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	1,448	0	1,448	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101M30(2017-03 코스피200지수선물							116
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-116	-116	-116	-116	-116	-116	-116
-5.33%	-77	-77	-77	-77	-77	-77	-77
-2.67%	-39	-39	-39	-39	-39	-39	-39
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	39	39	39	39	39	39	39
5.33%	77	77	77	77	77	77	77
8.00%	116	116	116	116	116	116	116

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

86

공시일	2017-01-04
기준일	2017-01-03

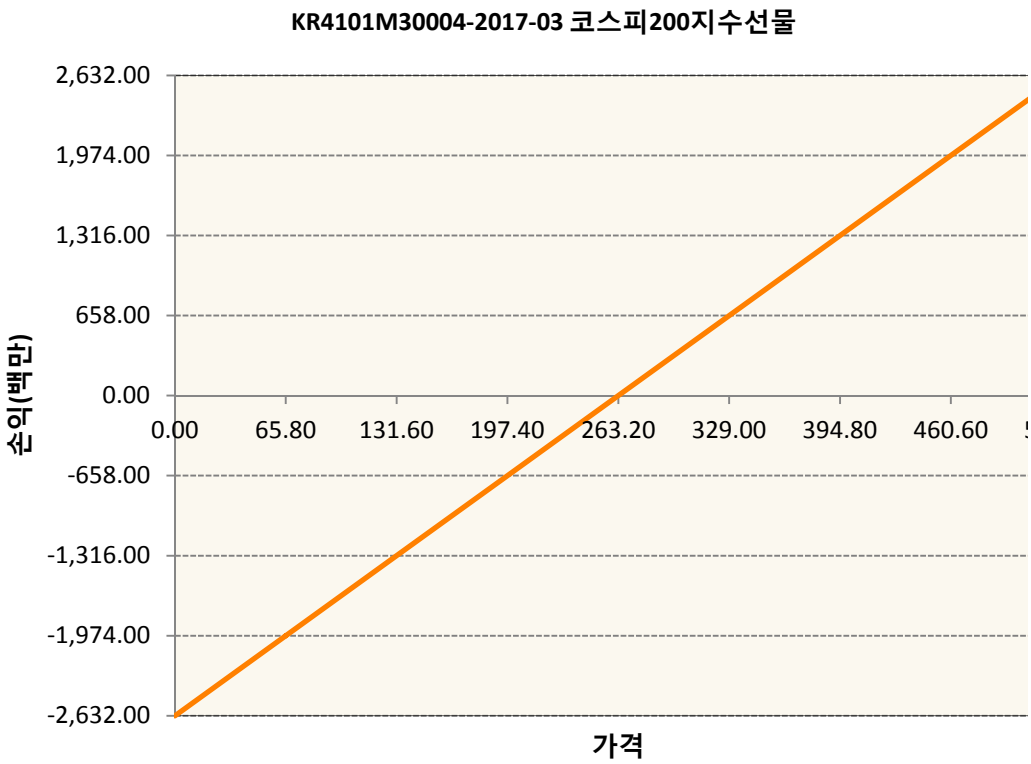
1.3배 레버리지 인덱스(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	132	-132	장내
누계	유가증권	선물	2,632	0	2,632	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101M30(2017-03 코스피200지수선물							210
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-210	-210	-210	-210	-210	-210	-210
-5.33%	-140	-140	-140	-140	-140	-140	-140
-2.67%	-70	-70	-70	-70	-70	-70	-70
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	70	70	70	70	70	70	70
5.33%	140	140	140	140	140	140	140
8.00%	210	210	210	210	210	210	210

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

157

공시일	2017-01-04
기준일	2017-01-03

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	905

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

707

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-01-04
기준일	2017-01-03

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	379

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

692

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-01-04
기준일	2017-01-03

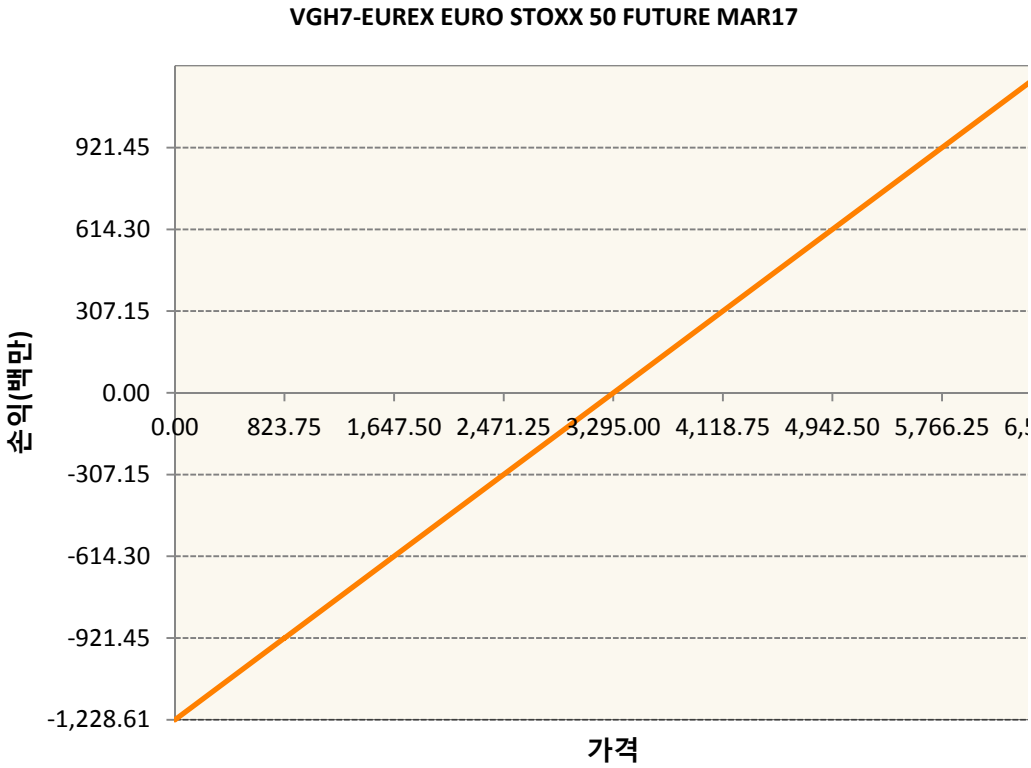
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,229	0	1,229	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGH7	EUREX EURO STOXX 50 FUTURE MAR17	98

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

(단위:백만원)

114

공시일	2017-01-04
기준일	2017-01-03

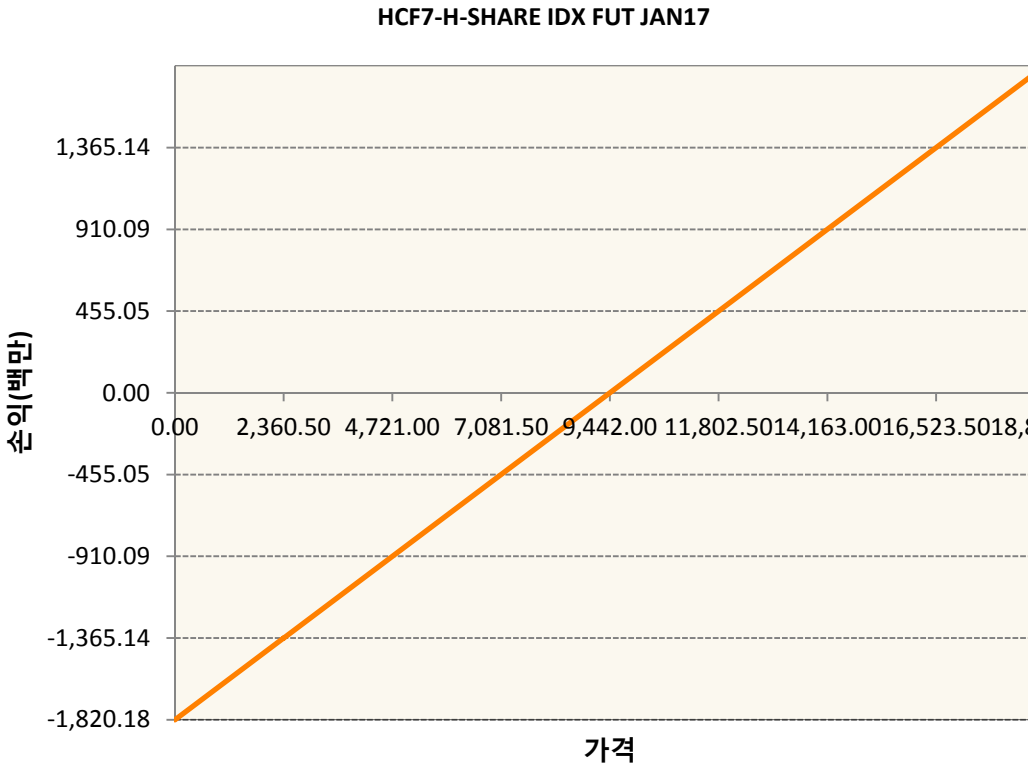
차이나인덱스모(주식-파생형)

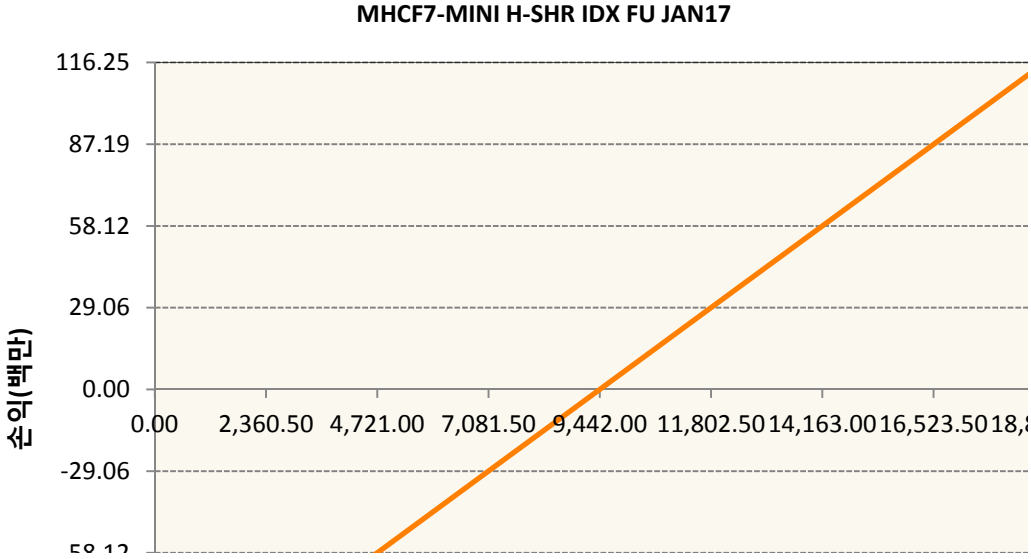
1. 계약금액

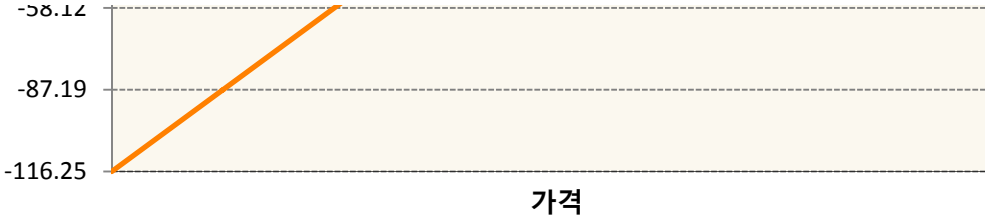
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,936	0	1,936	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCF7	H-SHARE IDX FUT JAN17	146
MHCF7	MINI H-SHR IDX FU JAN17	9

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	190

공시일	2017-01-04
기준일	2017-01-03

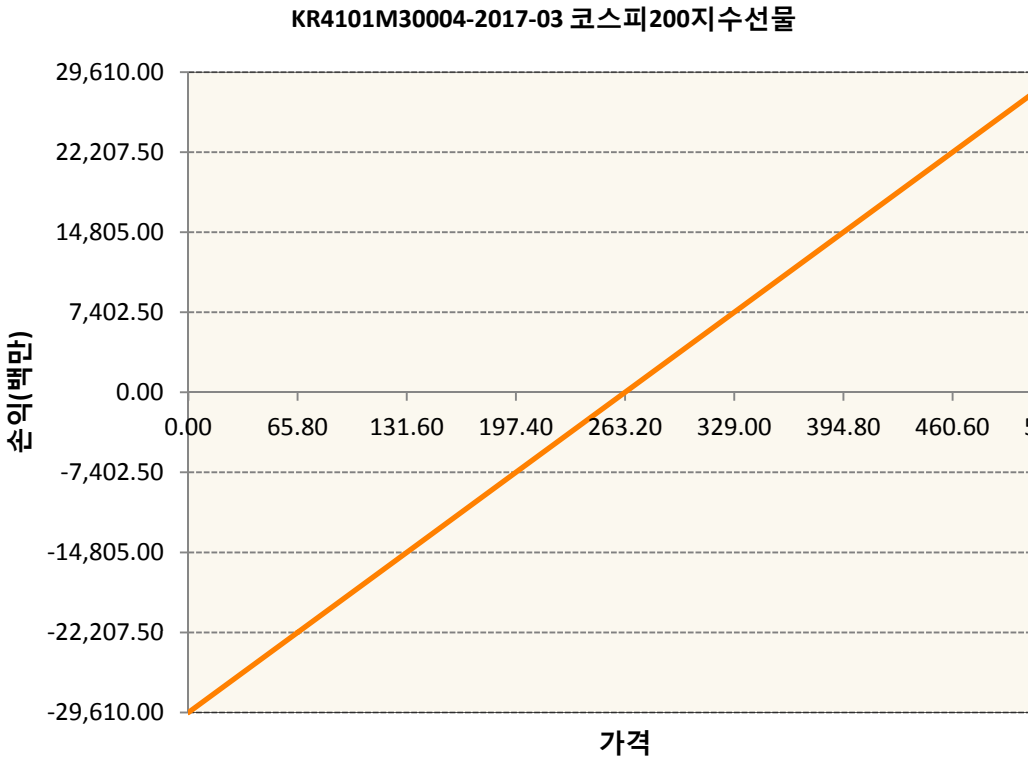
커버드콜(주식혼합-파생형)

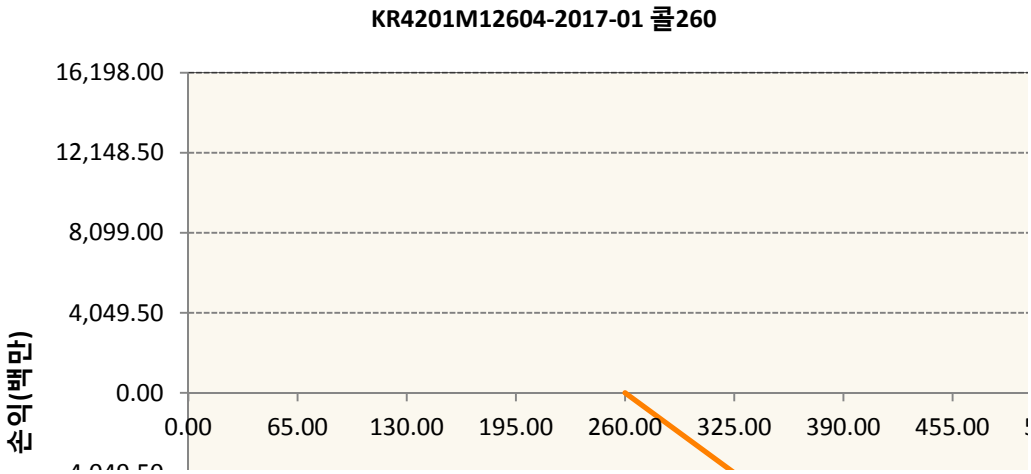
1. 계약금액

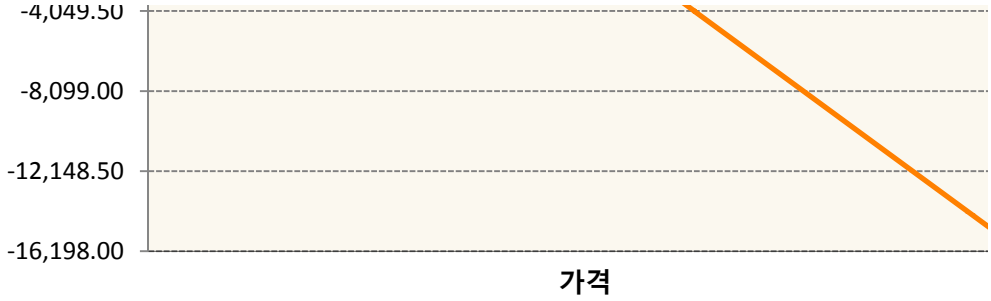
(단위:백만원)

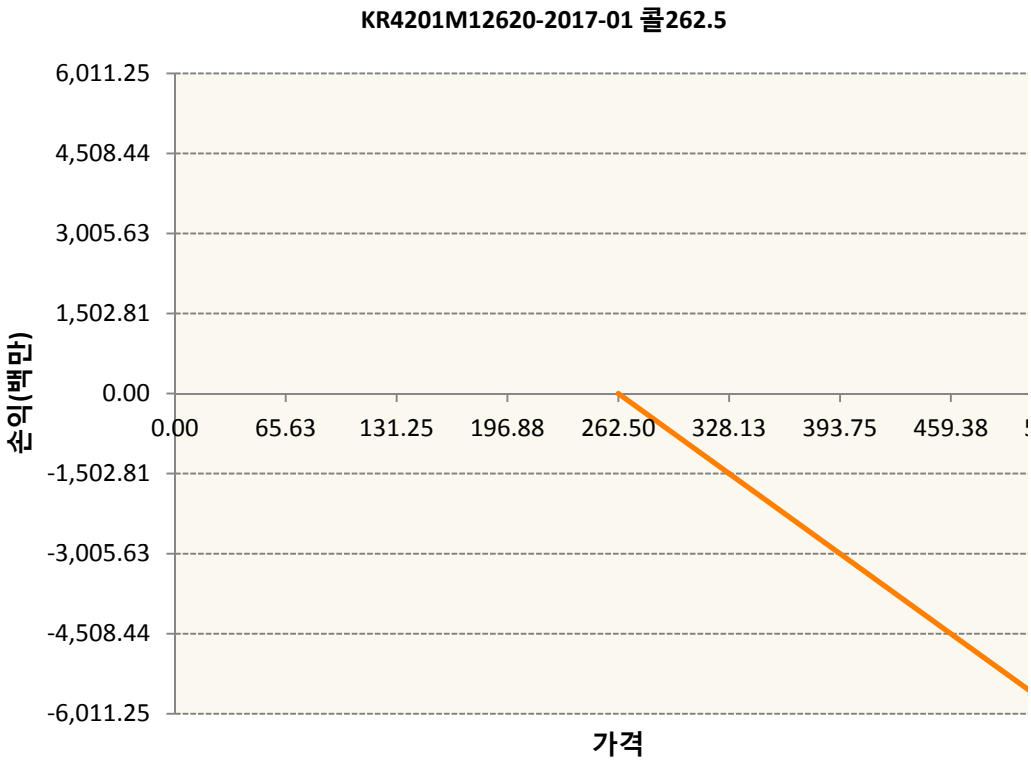
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	264	-264	장내
누계	유가증권	선물	29,610	0	29,610	장내
누계	유가증권	옵션	0	22,209	-22,209	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101M30(2017-03 코스피200지수선물							2,367
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-2,367	-2,367	-2,367	-2,367	-2,367	-2,367	-2,367
-5.33%	-1,578	-1,578	-1,578	-1,578	-1,578	-1,578	-1,578
-2.67%	-789	-789	-789	-789	-789	-789	-789
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	789	789	789	789	789	789	789
5.33%	1,578	1,578	1,578	1,578	1,578	1,578	1,578
8.00%	2,367	2,367	2,367	2,367	2,367	2,367	2,367
KR4201M12(2017-01 콜260							6,330
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,144	1,144	1,144	1,144	1,144	1,143	1,143
-5.33%	1,143	1,143	1,142	1,141	1,138	1,134	1,129
-2.67%	1,085	1,060	1,033	1,003	971	937	902
0%	107	73	37	0	-39	-79	-120
2.67%	-1,964	-1,965	-1,967	-1,971	-1,977	-1,984	-1,994
5.33%	-4,147	-4,147	-4,147	-4,147	-4,147	-4,147	-4,148
8.00%	-6,330	-6,330	-6,330	-6,330	-6,330	-6,330	-6,330
KR4201M12(	2017-01 콜262.5						2,224

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	237	237	237	237	237	237	237
-5.33%	237	237	237	237	236	236	235
-2.67%	233	230	225	220	213	206	197
0%	52	35	17	0	-17	-35	-52
2.67%	-621	-624	-627	-631	-636	-643	-650
5.33%	-1,422	-1,422	-1,422	-1,422	-1,422	-1,422	-1,423
8.00%	-2,224	-2,224	-2,224	-2,224	-2,224	-2,224	-2,224

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

13,448

공시일	2017-01-04
기준일	2017-01-03

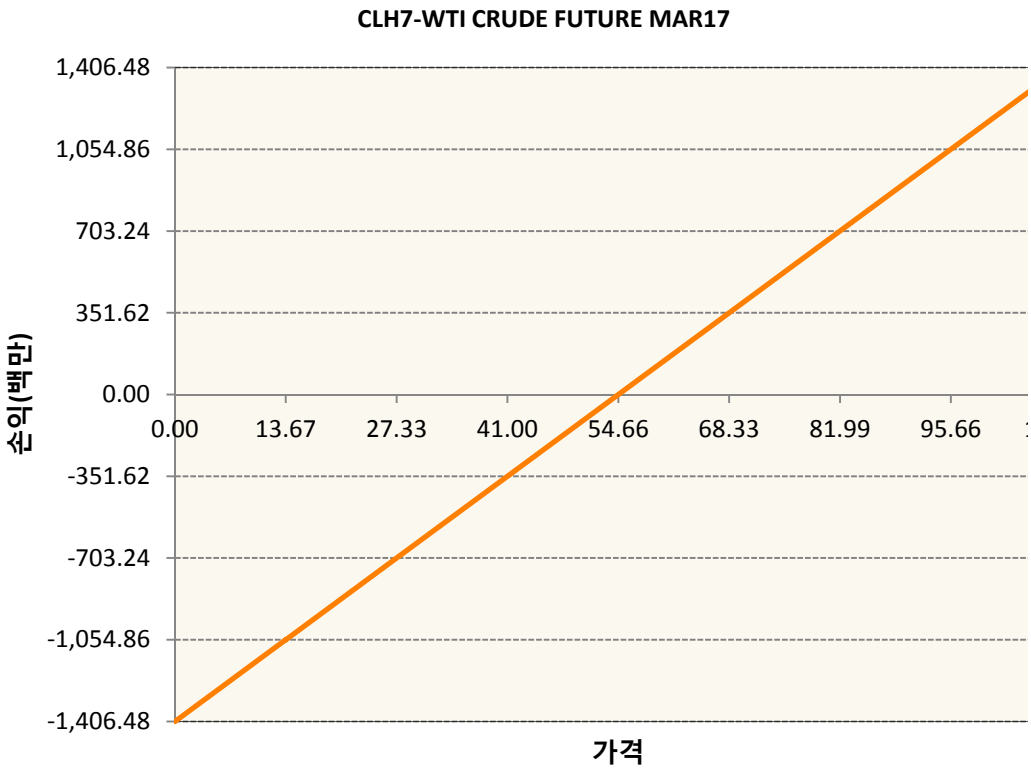
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

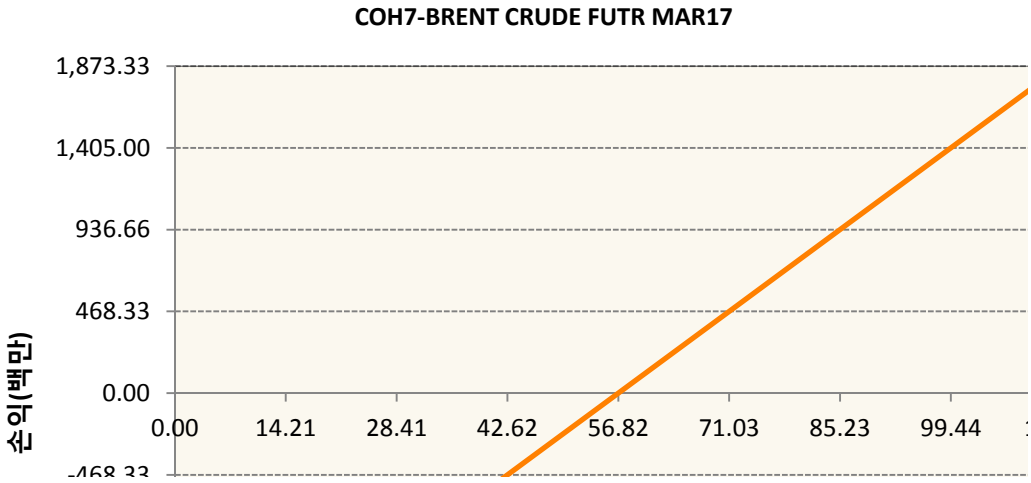
1. 계약금액

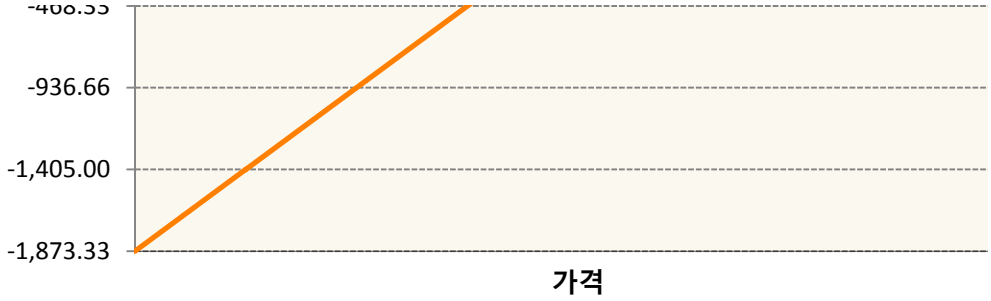
(단위:백만원)

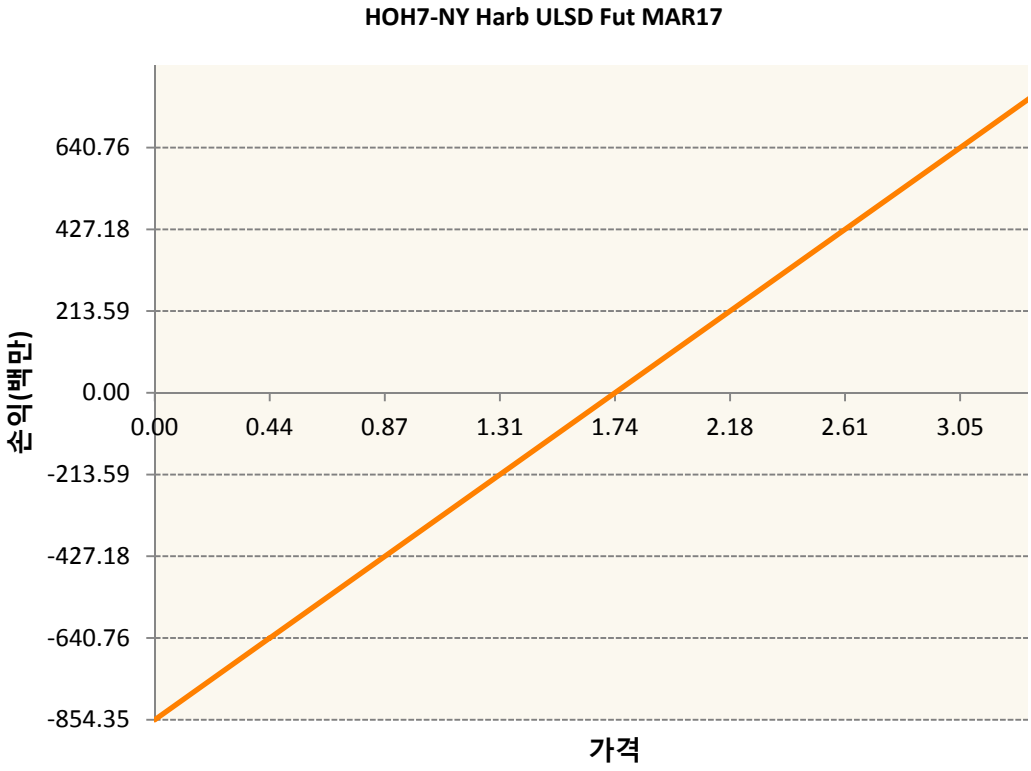
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	선물	유가증권	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	선물	유가증권	1,406	0	1,406	
누계	유가증권	선물	5,374	0	5,374	

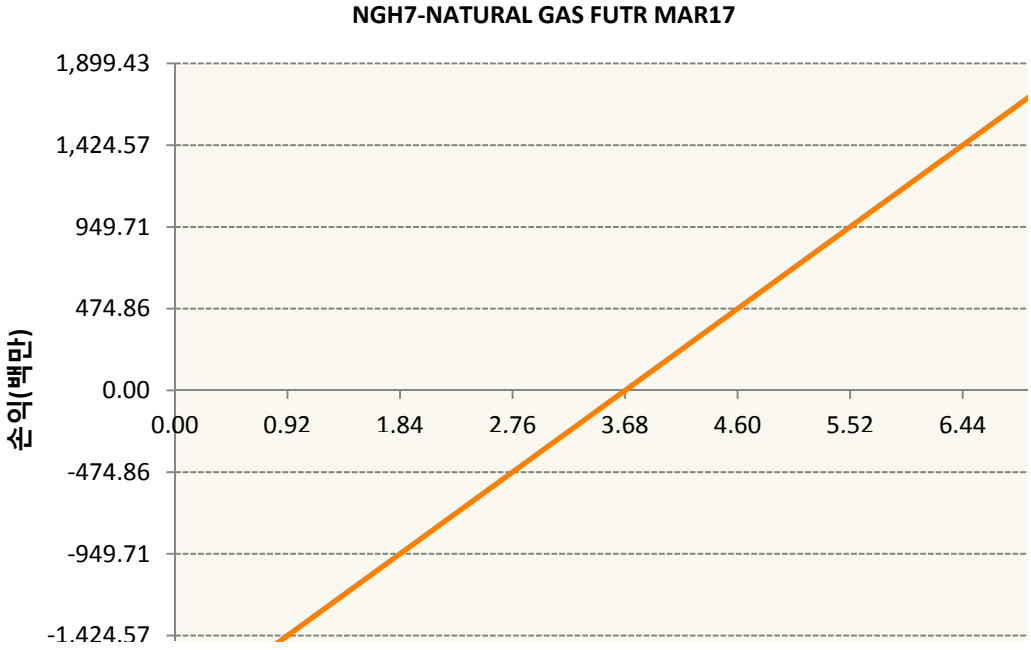
2. 만기시점의 손익구조

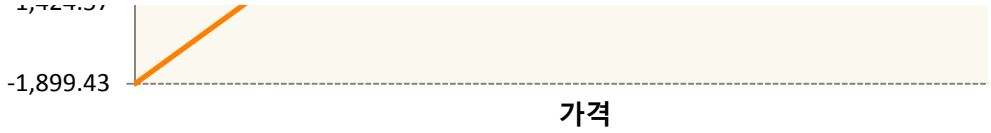


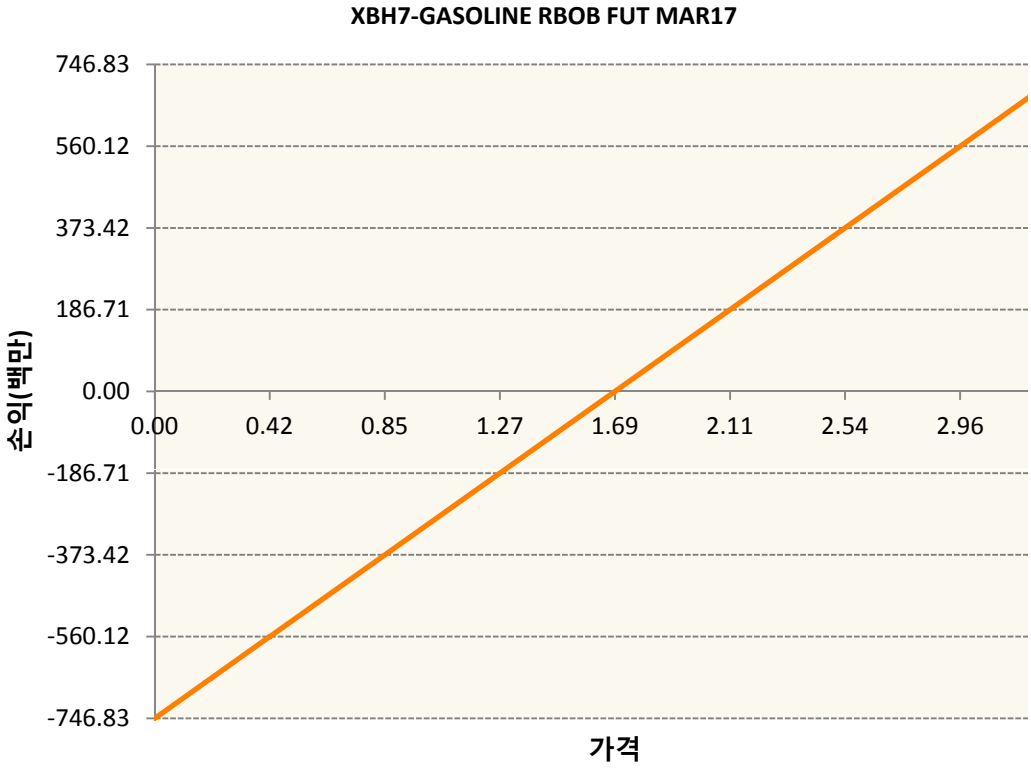



-936.66
-1,405.00
-1,873.33
가격


HOH7-NY Harb ULSD Fut MAR17
640.76
427.18
213.59
0.00
-213.59
-427.18
-640.76
-854.35
0.00
0.44
0.87
1.31
1.74
2.18
2.61
3.05
순익(백만)
가격


NGH7-NATURAL GAS FUTR MAR17
1,899.43
1,424.57
949.71
474.86
0.00
-474.86
-949.71
-1.424.57
0.00
0.92
1.84
2.76
3.68
4.60
5.52
6.44
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	152
XBH7	GASOLINE RBOB FUT MAR17	60

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

1,217

공시일	2017-01-04
기준일	2017-01-03

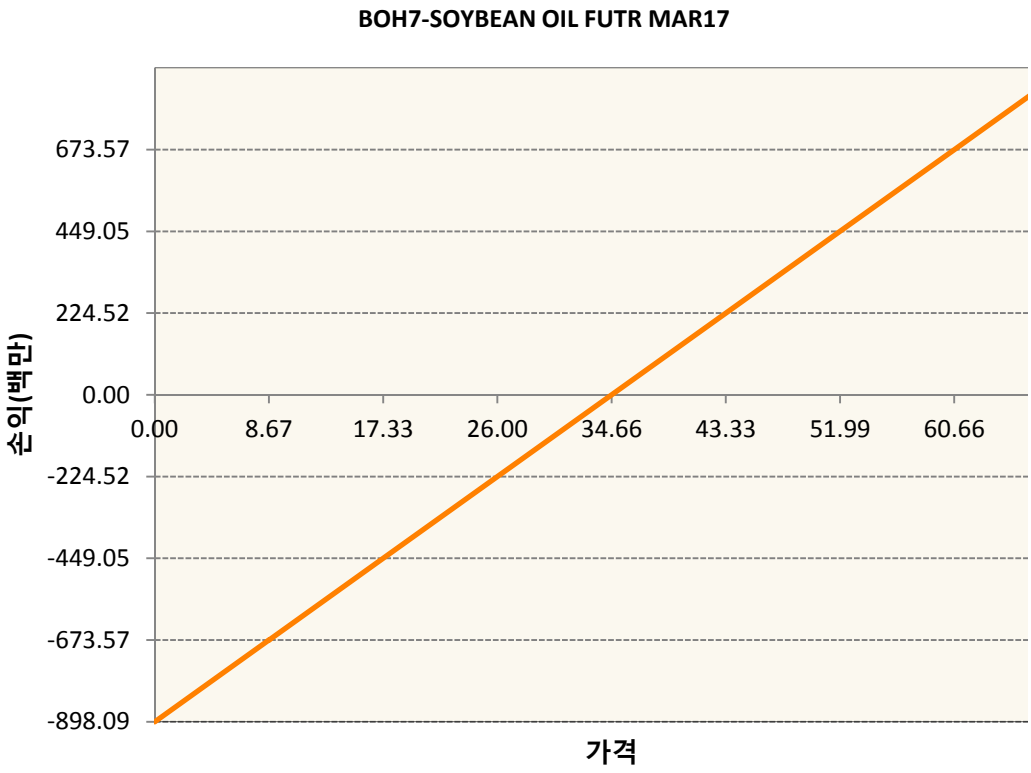
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

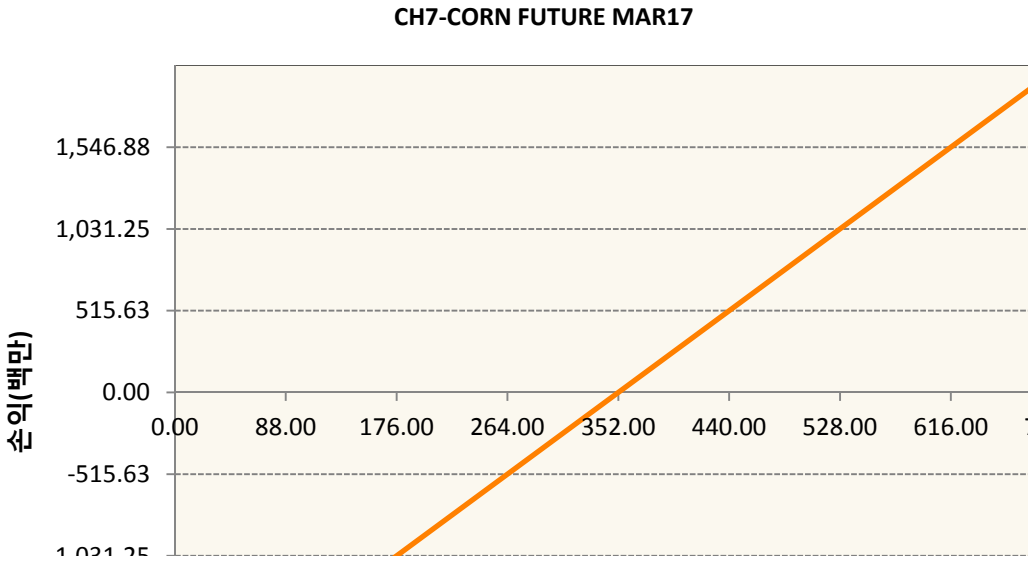
1. 계약금액

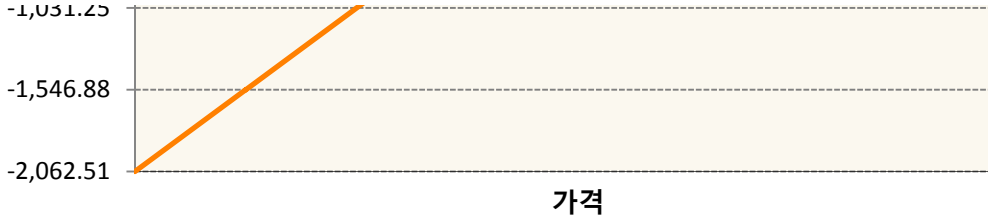
(단위:백만원)

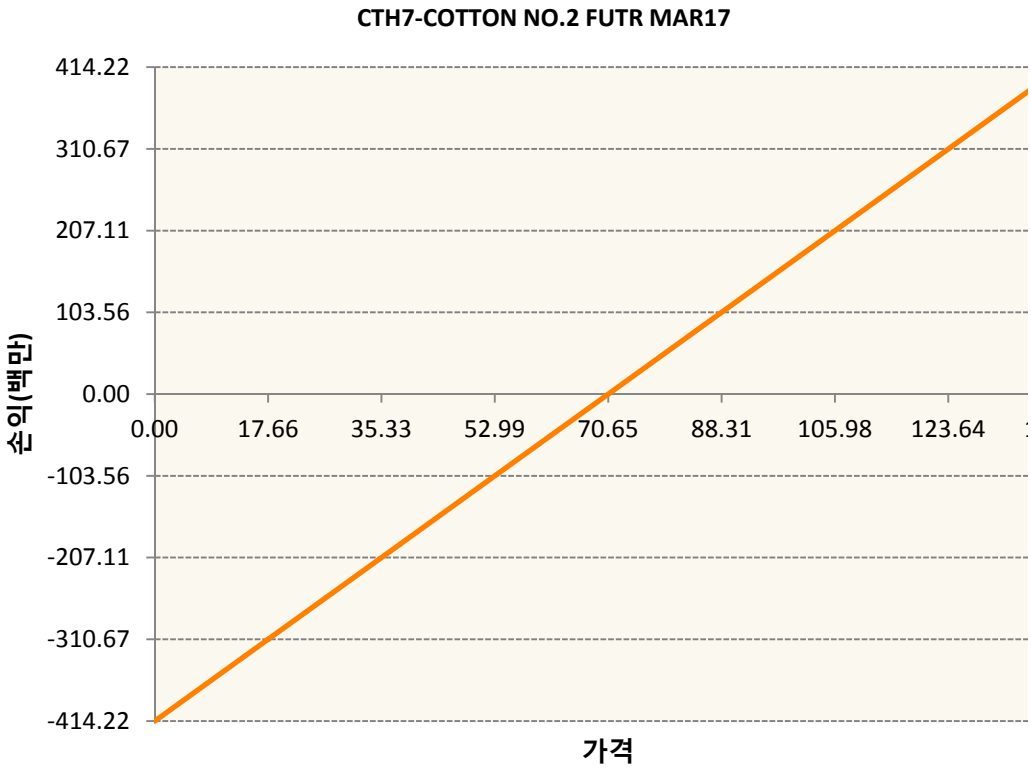
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	9,097	0	9,097	

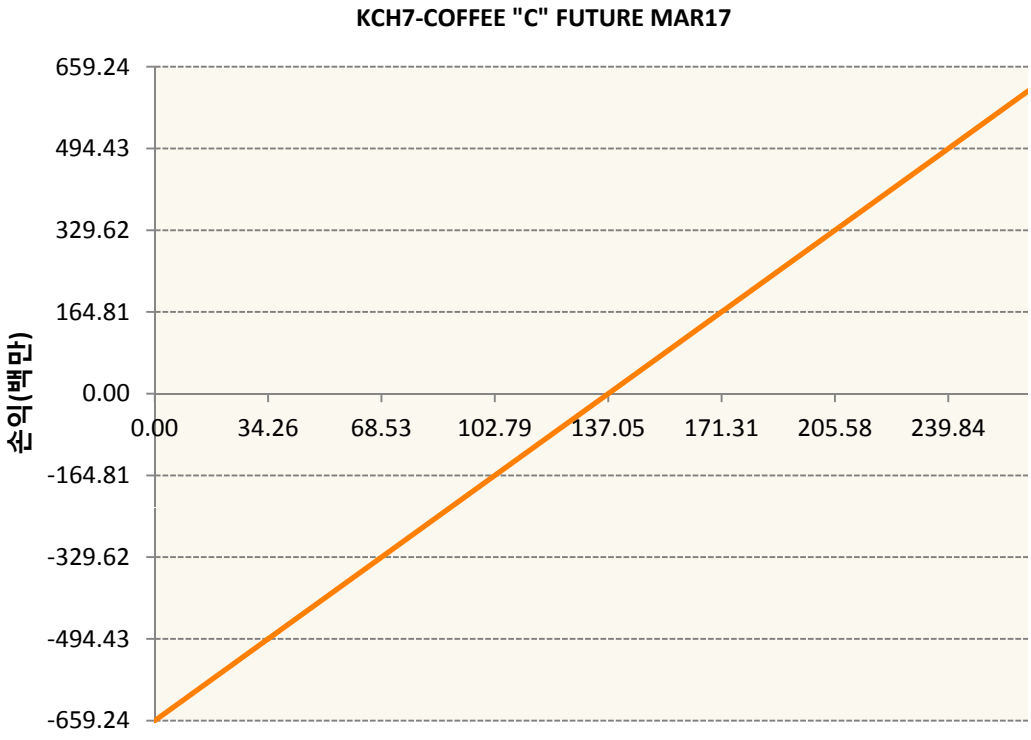
2. 만기시점의 손익구조



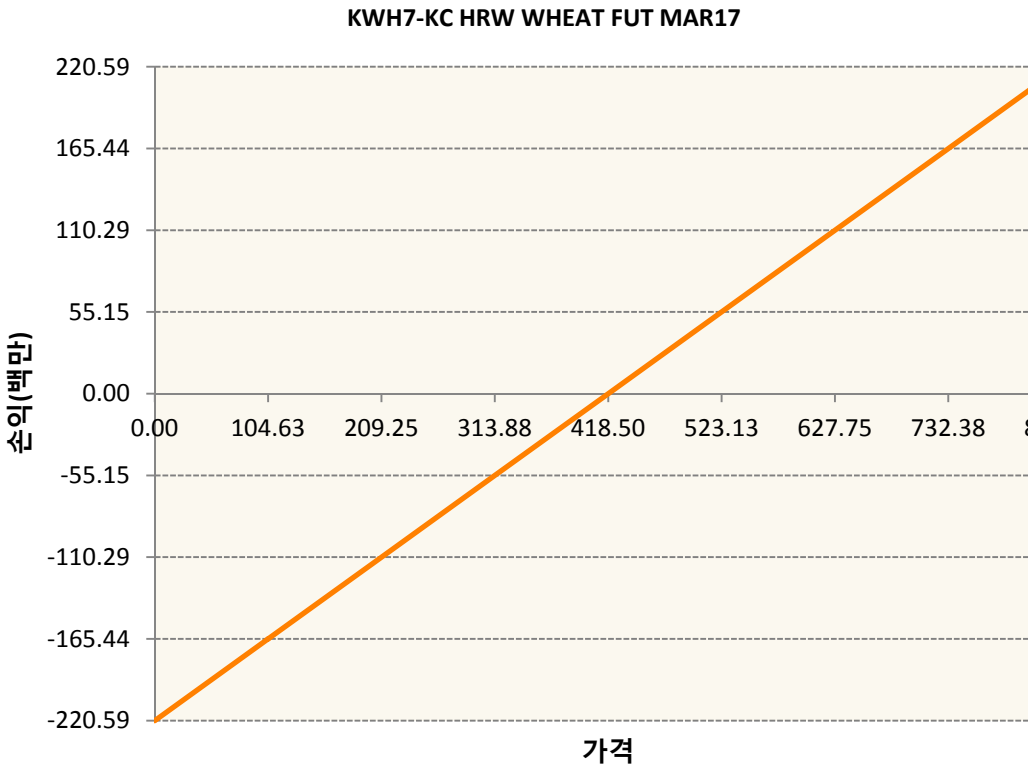


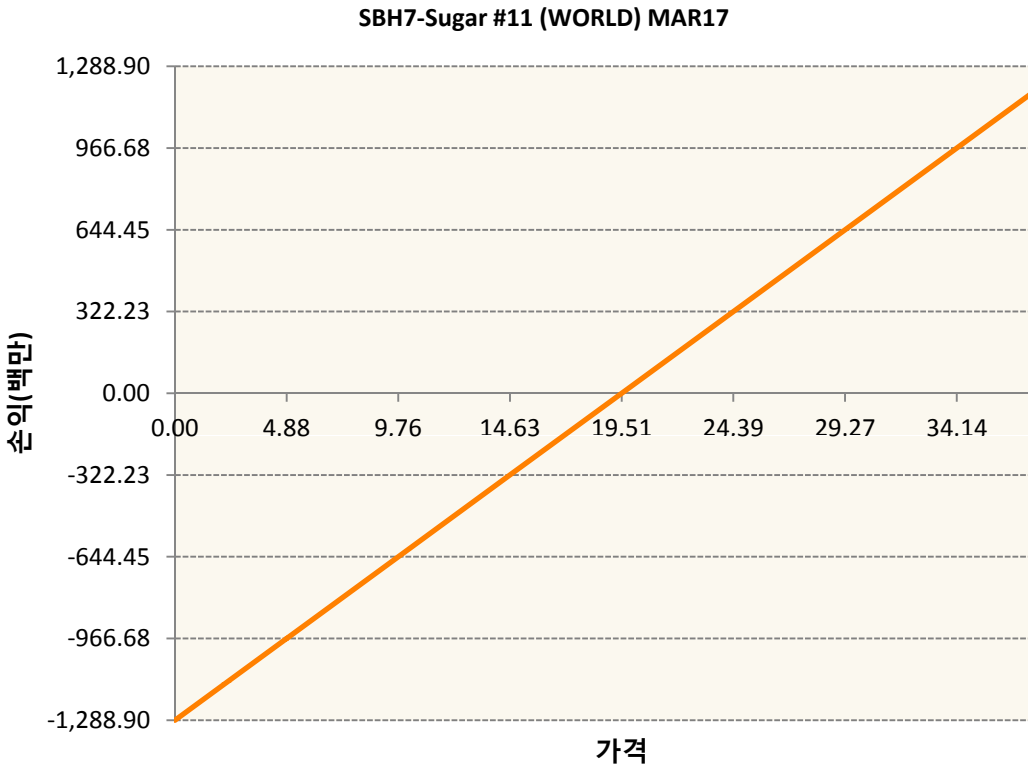

-1,546.88
-2,062.51
가격

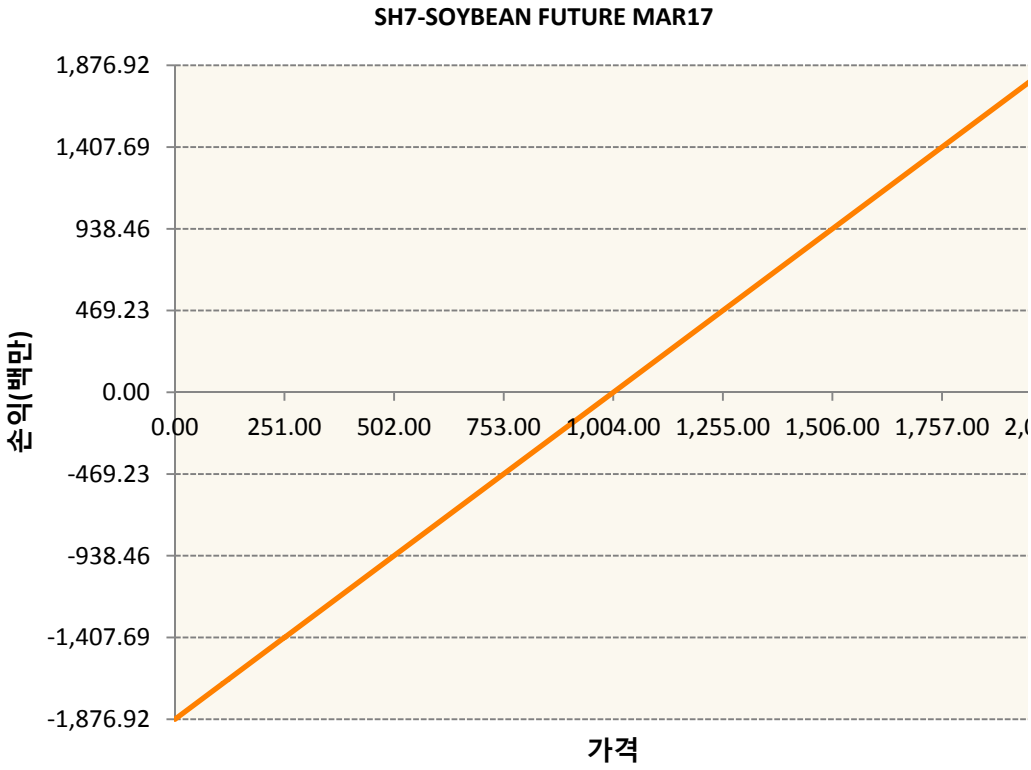

CTH7-COTTON NO.2 FUTR MAR17
414.22
310.67
207.11
103.56
0.00
-103.56
-207.11
-310.67
-414.22
0.00
17.66
35.33
52.99
70.65
88.31
105.98
123.64
손익(백만)
가격

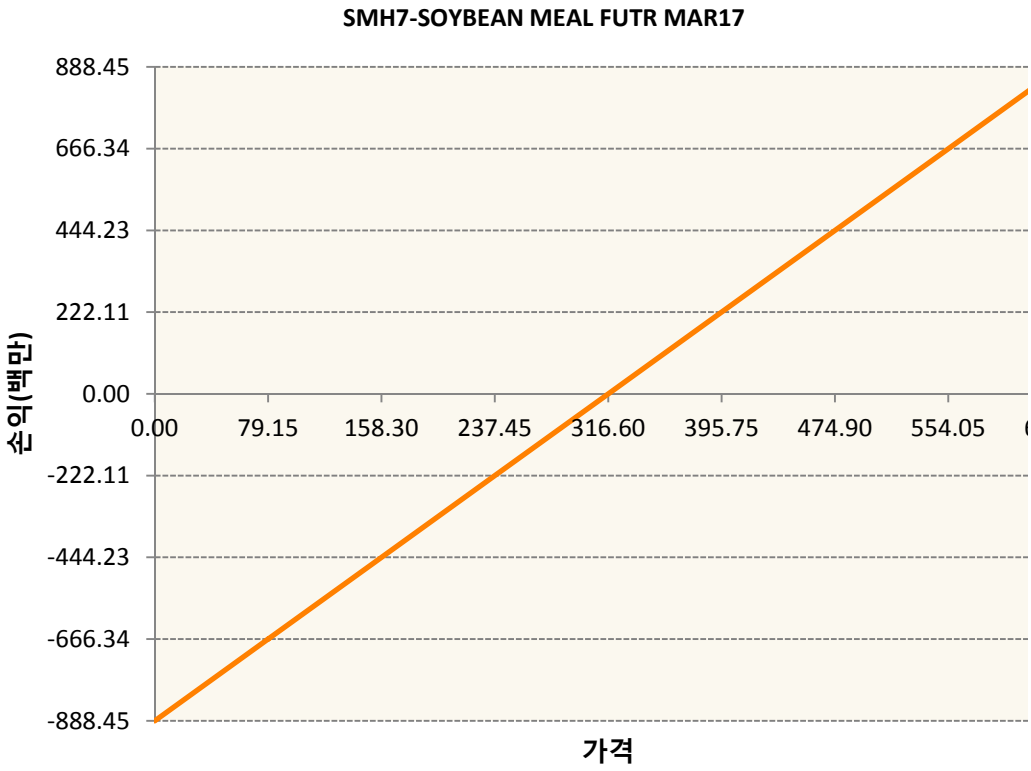

KCH7-COFFEE "C" FUTURE MAR17
659.24
494.43
329.62
164.81
0.00
-164.81
-329.62
-494.43
-659.24
0.00
34.26
68.53
102.79
137.05
171.31
205.58
239.84
손익(백만)

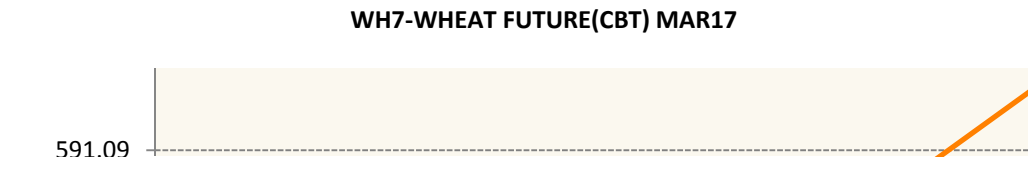
가격

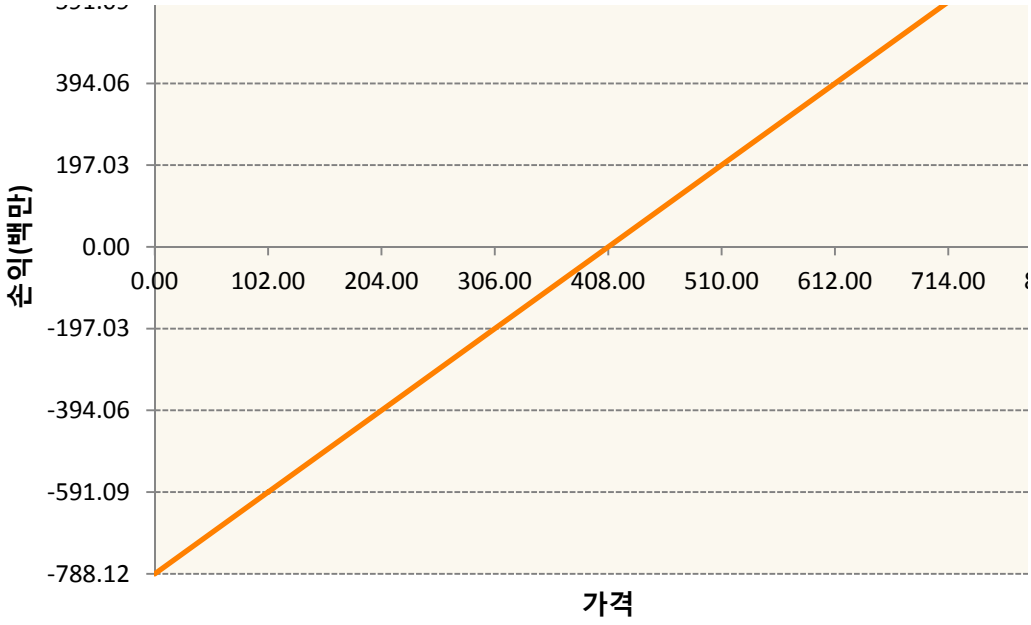

KWH7-KC HRW WHEAT FUT MAR17
220.59
165.44
110.29
55.15
0.00
-55.15
-110.29
-165.44
-220.59
0.00
104.63
209.25
313.88
418.50
523.13
627.75
732.38
손익(백만)
가격


SBH7-Sugar #11 (WORLD) MAR17
1,288.90
966.68
644.45
322.23
0.00
-322.23
-644.45
-966.68
-1,288.90
0.00
4.88
9.76
14.63
19.51
24.39
29.27
34.14
손익(백만)
가격


SH7-SOYBEAN FUTURE MAR17
1,876.92
1,407.69
938.46
469.23
0.00
-469.23
-938.46
-1,407.69
-1,876.92
0.00
251.00
502.00
753.00
1,004.00
1,255.00
1,506.00
1,757.00
손익(백만)
가격


SMH7-SOYBEAN MEAL FUTR MAR17
888.45
666.34
444.23
222.11
0.00
-222.11
-444.23
-666.34
-888.45
0.00
79.15
158.30
237.45
316.60
395.75
474.90
554.05
손익(백만)
가격


WH7-WHEAT FUTURE(CBT) MAR17
591.09



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

BOH7	SOYBEAN OIL FUTR MAR17	72
CH7	CORN FUTURE MAR17	165
CTH7	COTTON NO.2 FUTR MAR17	33
KCH7	COFFEE "C" FUTURE MAR17	53
KWH7	KC HRW WHEAT FUT MAR17	18
SBH7	Sugar #11 (WORLD) MAR17	103
SH7	SOYBEAN FUTURE MAR17	150
SMH7	SOYBEAN MEAL FUTR MAR17	71
WH7	WHEAT FUTURE(CBT) MAR17	63

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

879