공시일	2017-01-05
기준일	2017-01-04

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	2017-01-05
기준일	2017-01-04

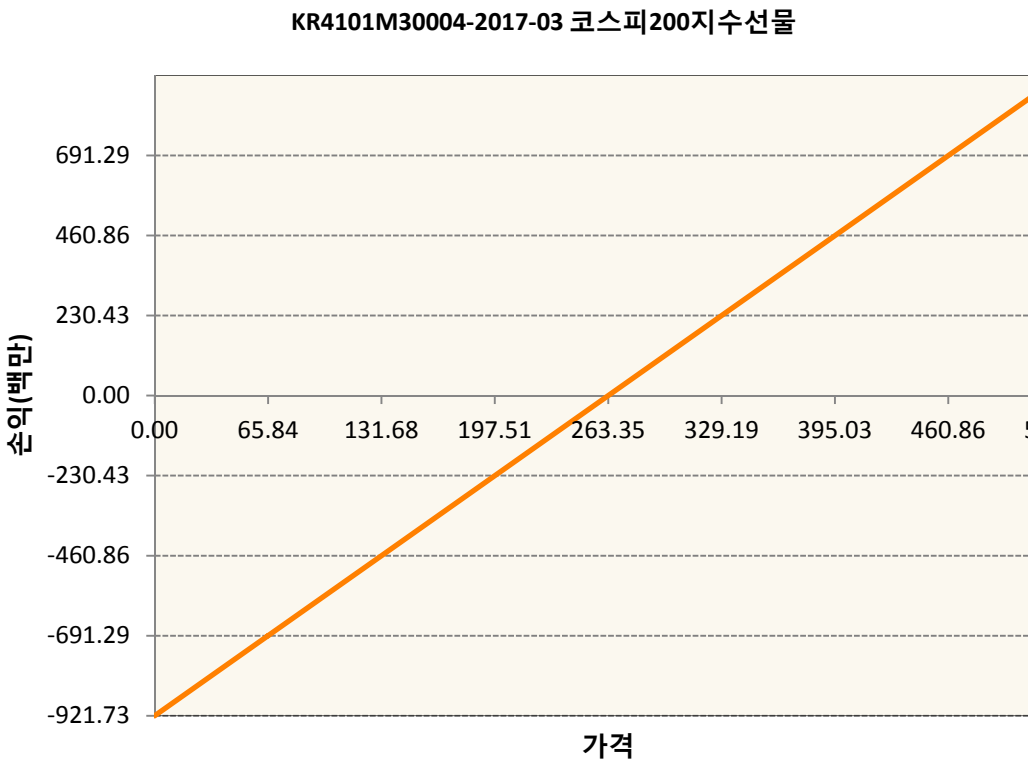
스마트인덱스모

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	922	0	922	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	2017-01-05
기준일	2017-01-04

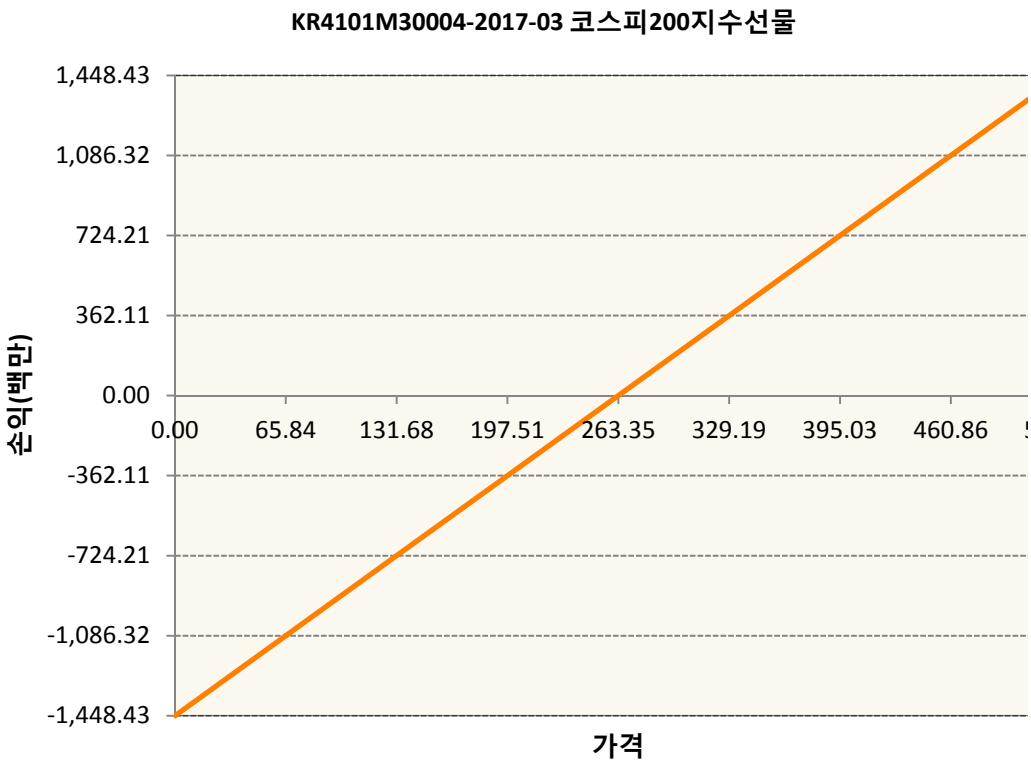
스마트레버리지목표전환형1호

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	2017-01-05
기준일	2017-01-04

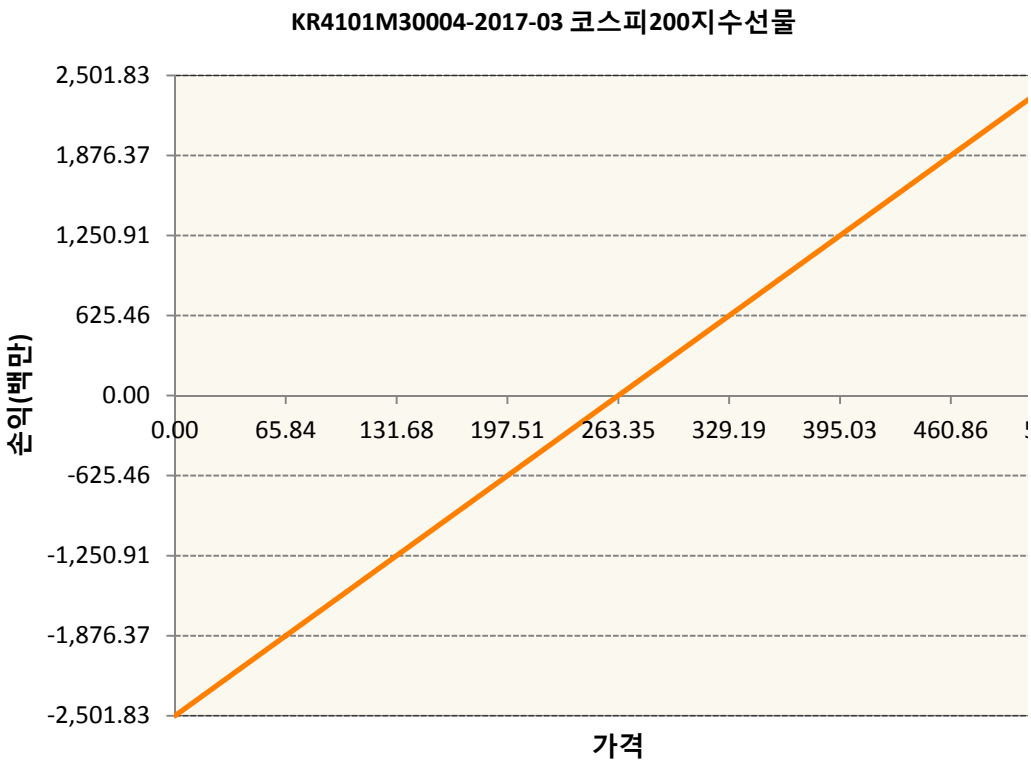
1.3배 레버리지 인덱스(주식-파생형)

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	2,502	0	2,502	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101M30(2017-03 코스피200지수선물							200
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-200	-200	-200	-200	-200	-200	-200
-5.33%	-133	-133	-133	-133	-133	-133	-133
-2.67%	-67	-67	-67	-67	-67	-67	-67
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	67	67	67	67	67	67	67
5.33%	133	133	133	133	133	133	133
8.00%	200	200	200	200	200	200	200

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

149

공시일	2017-01-05
기준일	2017-01-04

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	908

* 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	2017-01-05
기준일	2017-01-04

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)

702

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-01-05
기준일	2017-01-04

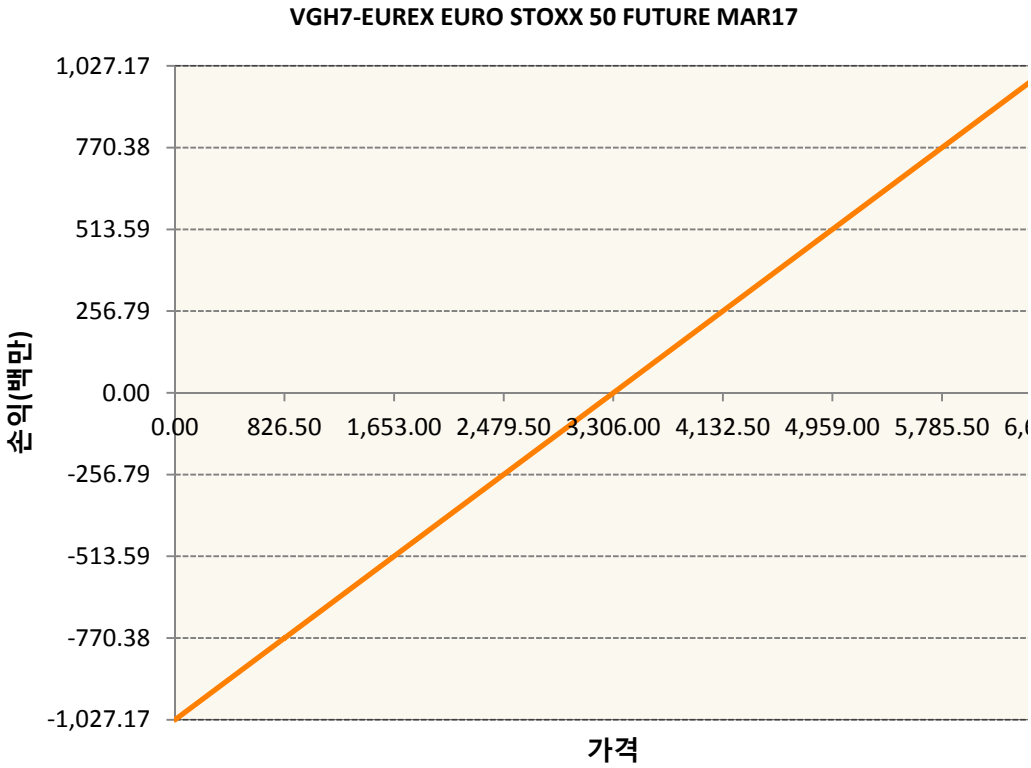
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,027	0	1,027	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGH7	EUREX EURO STOXX 50 FUTURE MAR17	82

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

(단위:백만원)

94

공시일	2017-01-05
기준일	2017-01-04

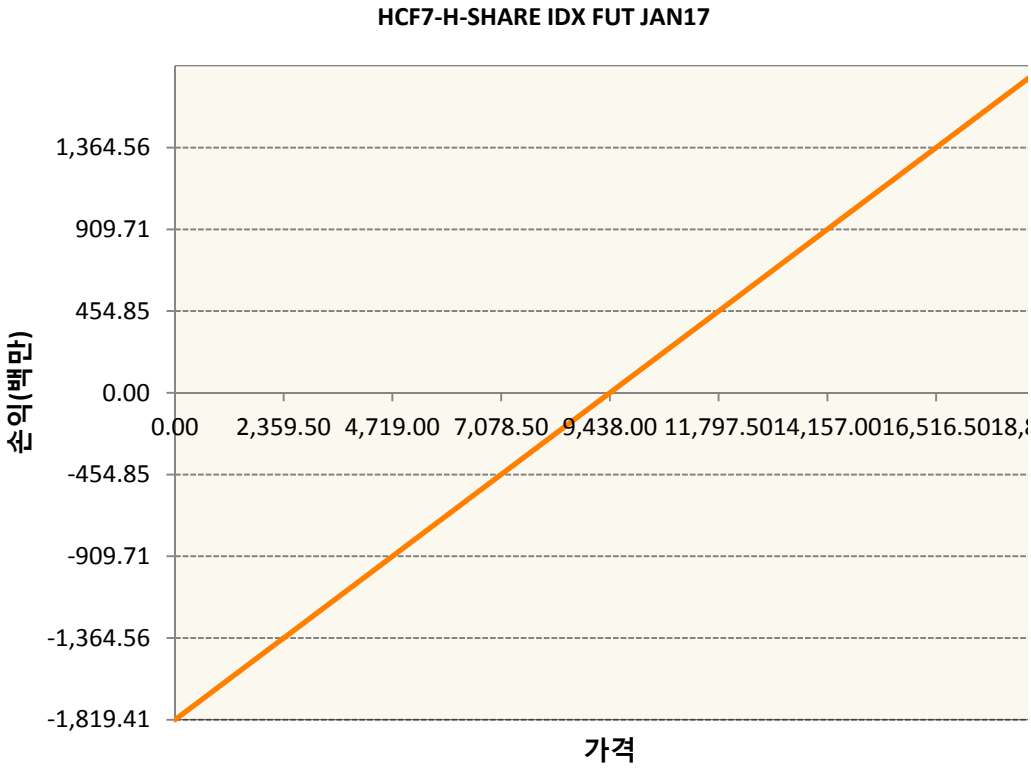
차이나인덱스모(주식-파생형)

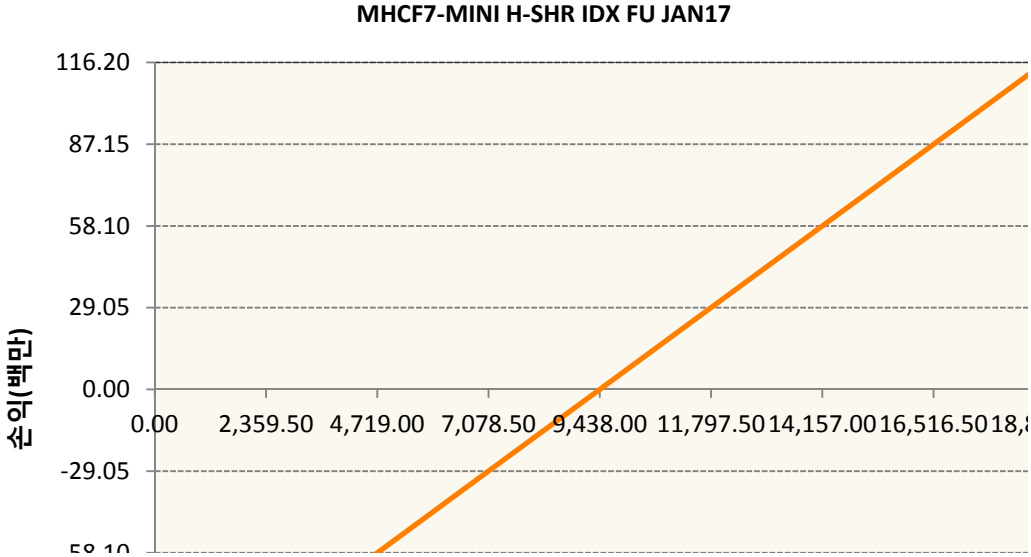
1. 계약금액

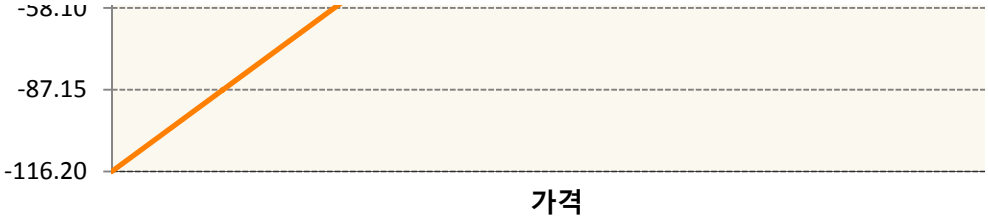
(단위:백만원)

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	2017-01-05
기준일	2017-01-04

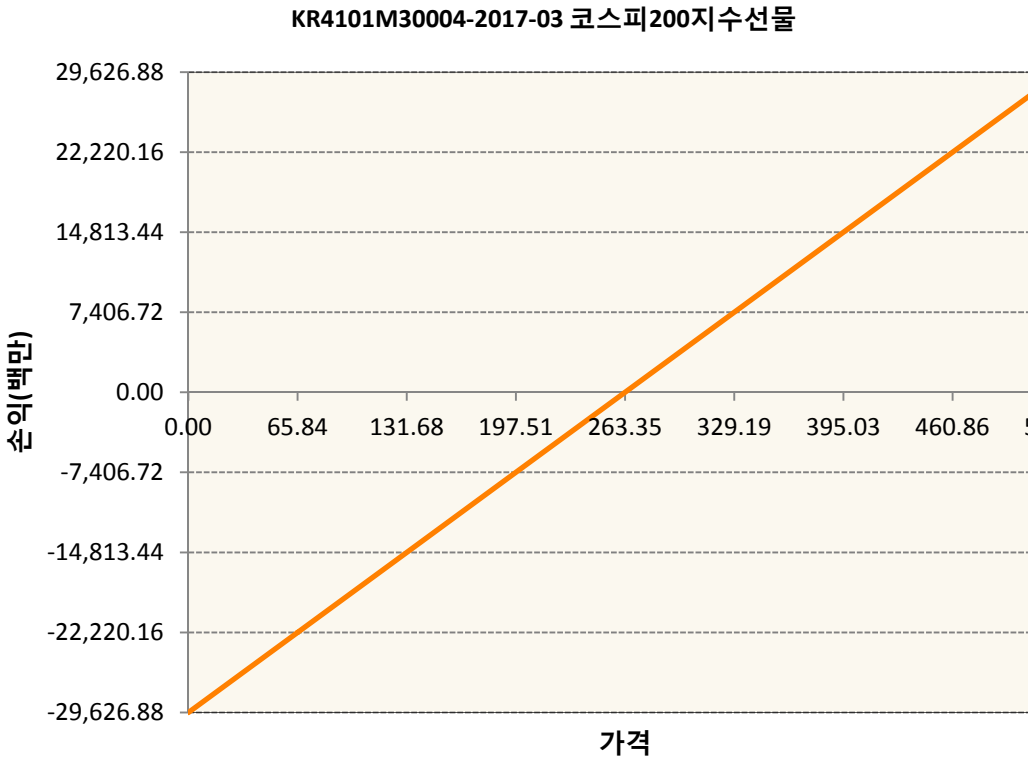
커버드콜(주식혼합-파생형)

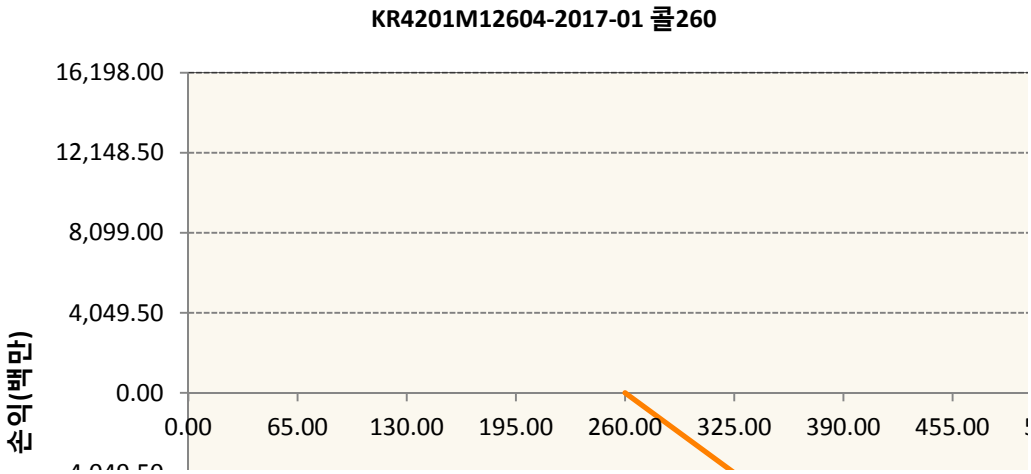
1. 계약금액

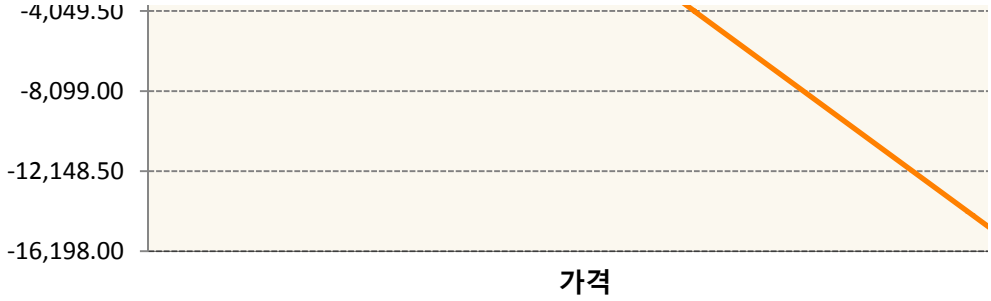
(단위:백만원)

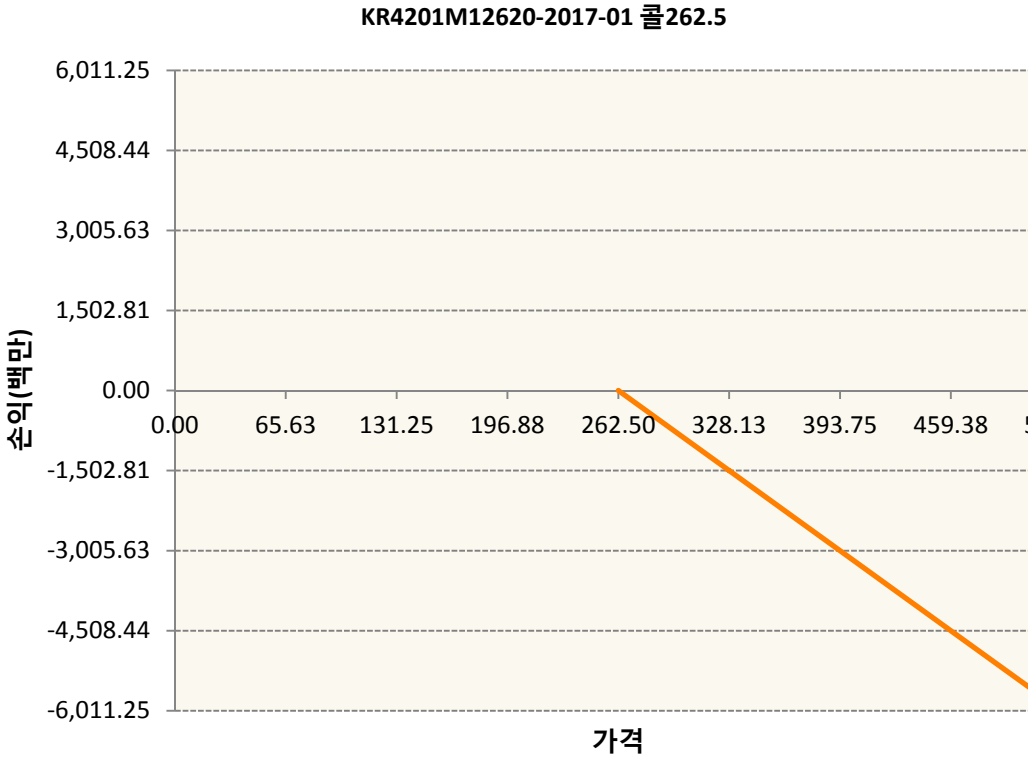
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	29,627	0	29,627	장내
누계	유가증권	옵션	0	22,209	-22,209	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101M30(2017-03 코스피200지수선물							2,368
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-2,368	-2,368	-2,368	-2,368	-2,368	-2,368	-2,368
-5.33%	-1,579	-1,579	-1,579	-1,579	-1,579	-1,579	-1,579
-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%	1,579	1,579	1,579	1,579	1,579	1,579	1,579
8.00%	2,368	2,368	2,368	2,368	2,368	2,368	2,368
KR4201M12(2017-01 콜260							6,379
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,146	1,146	1,146	1,146	1,146	1,146	1,146
-5.33%	1,146	1,146	1,145	1,144	1,143	1,140	1,136
-2.67%	1,097	1,075	1,051	1,024	996	965	933
0%	91	63	32	0	-34	-69	-106
2.67%	-2,009	-2,009	-2,011	-2,013	-2,016	-2,021	-2,027
5.33%	-4,194	-4,194	-4,194	-4,194	-4,194	-4,194	-4,194
8.00%	-6,379	-6,379	-6,379	-6,379	-6,379	-6,379	-6,379
KR4201M12(	2017-01 콜262.5						2,249

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	231	231	231	231	231	231	231
-5.33%	231	231	231	231	231	230	230
-2.67%	228	226	222	218	212	206	199
0%	48	32	16	0	-16	-32	-48
2.67%	-644	-645	-647	-650	-654	-659	-664
5.33%	-1,446	-1,446	-1,446	-1,446	-1,446	-1,446	-1,446
8.00%	-2,249	-2,249	-2,249	-2,249	-2,249	-2,249	-2,249

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

13,725

공시일	2017-01-05
기준일	2017-01-04

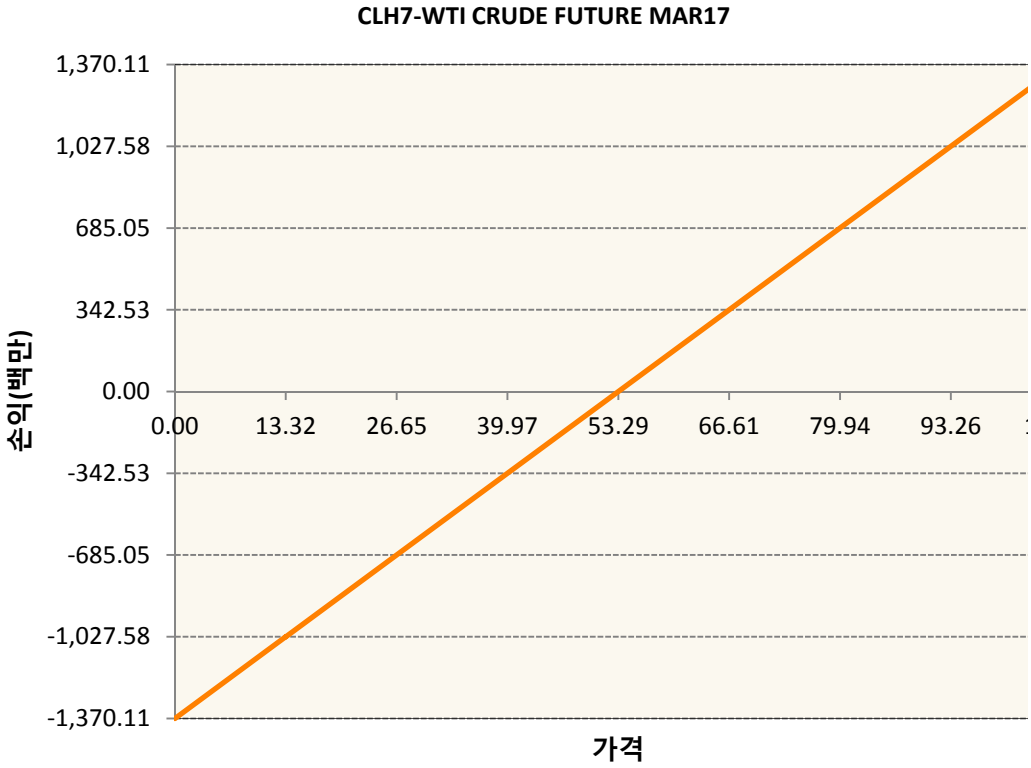
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

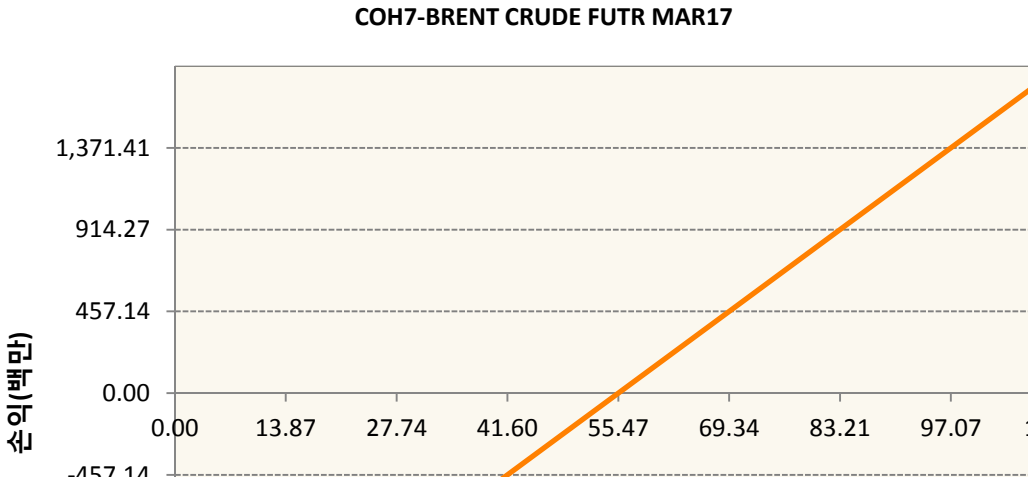
1. 계약금액

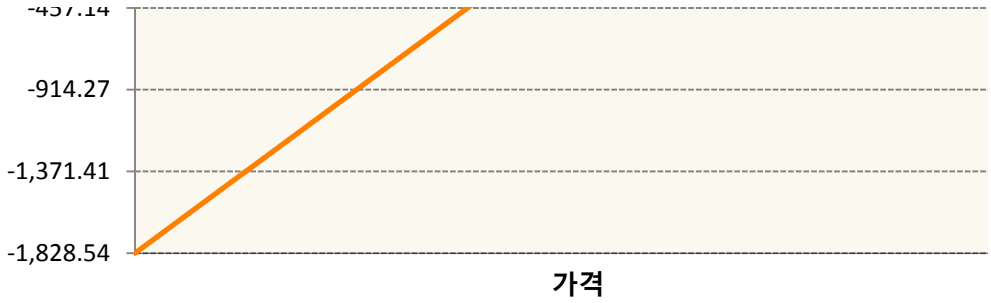
(단위:백만원)

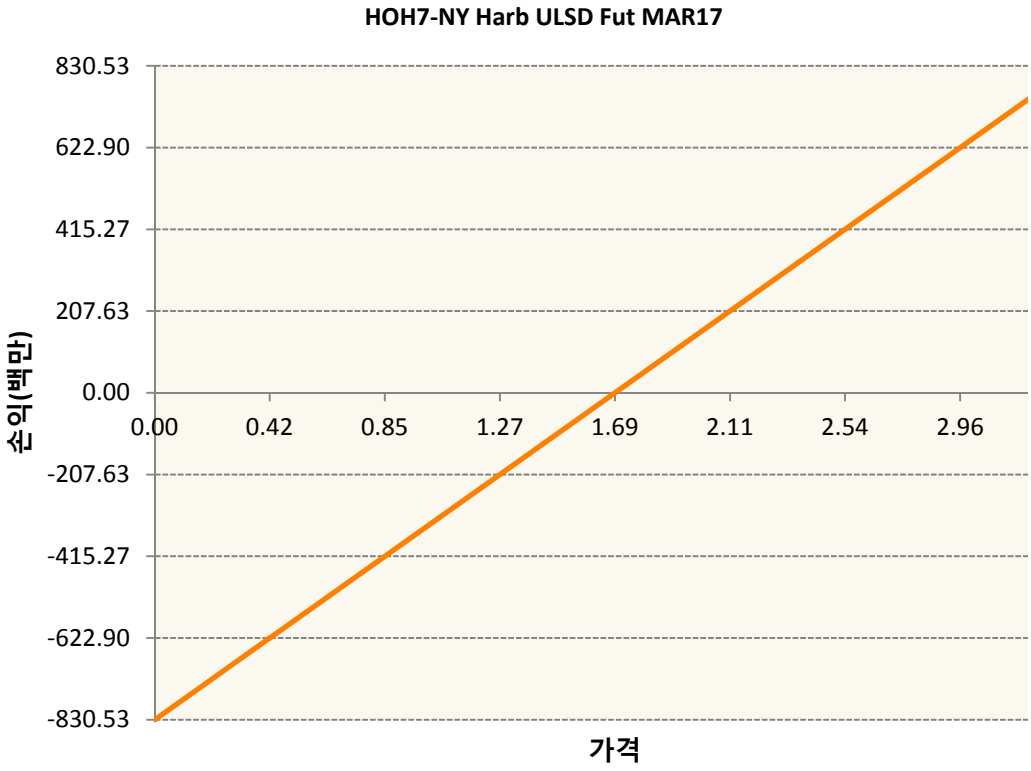
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	선물	유가증권	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	선물	유가증권	1,370	0	1,370	
누계	유가증권	선물	5,090	0	5,090	

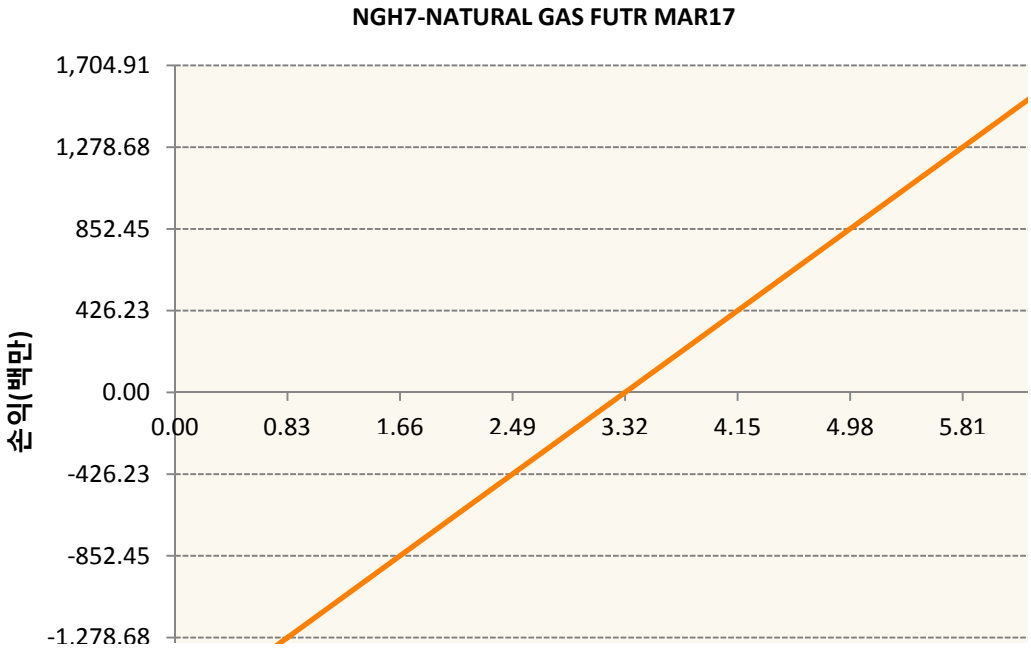
2. 만기시점의 손익구조

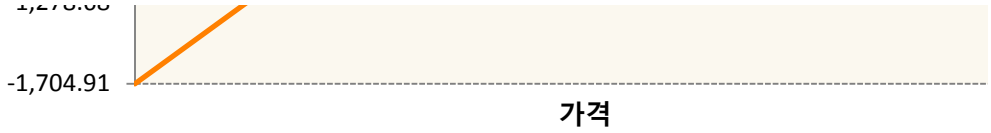


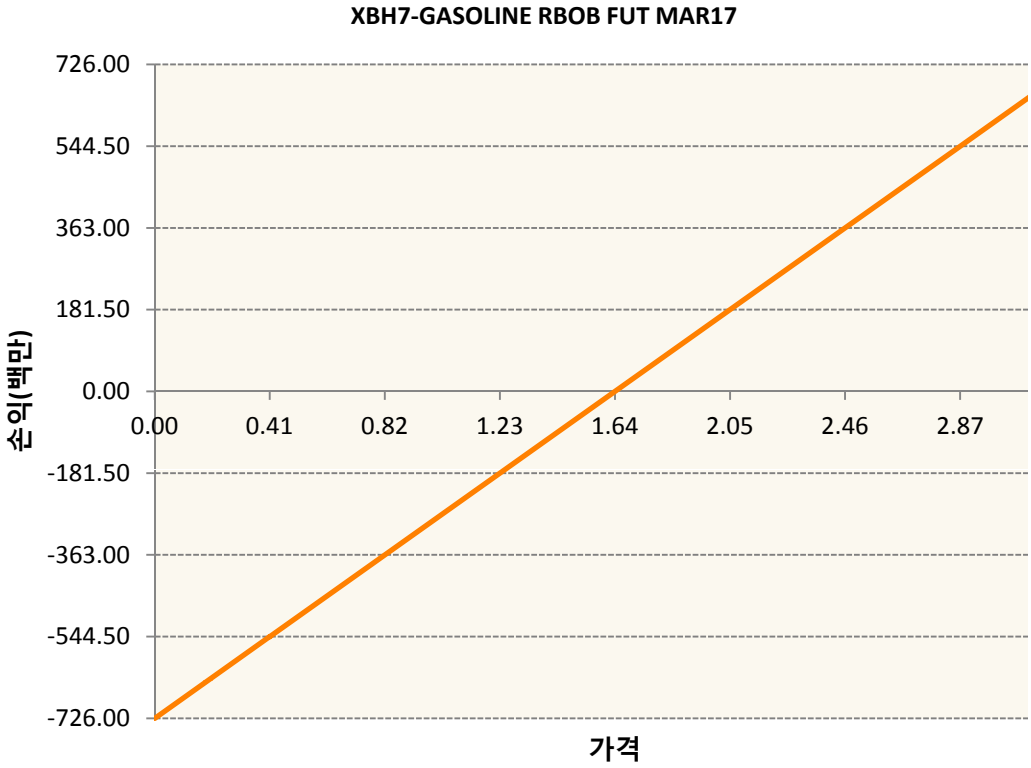



-914.27
-1,371.41
-1,828.54
가격


HOH7-NY Harb ULSD Fut MAR17
830.53
622.90
415.27
207.63
0.00
-207.63
-415.27
-622.90
-830.53
0.00
0.42
0.85
1.27
1.69
2.11
2.54
2.96
손익(백만)
가격


NGH7-NATURAL GAS FUTR MAR17
1,704.91
1,278.68
852.45
426.23
0.00
-426.23
-852.45
-1,278.68
0.00
0.83
1.66
2.49
3.32
4.15
4.98
5.81
손익(백만)





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLH7	WTI CRUDE FUTURE MAR17	110
COH7	BRENT CRUDE FUTR MAR17	146
HOH7	NY Harb ULSD Fut MAR17	66
NGH7	NATURAL GAS FUTR MAR17	136
XBH7	GASOLINE RBOB FUT MAR17	58

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

1,182

공시일	2017-01-05
기준일	2017-01-04

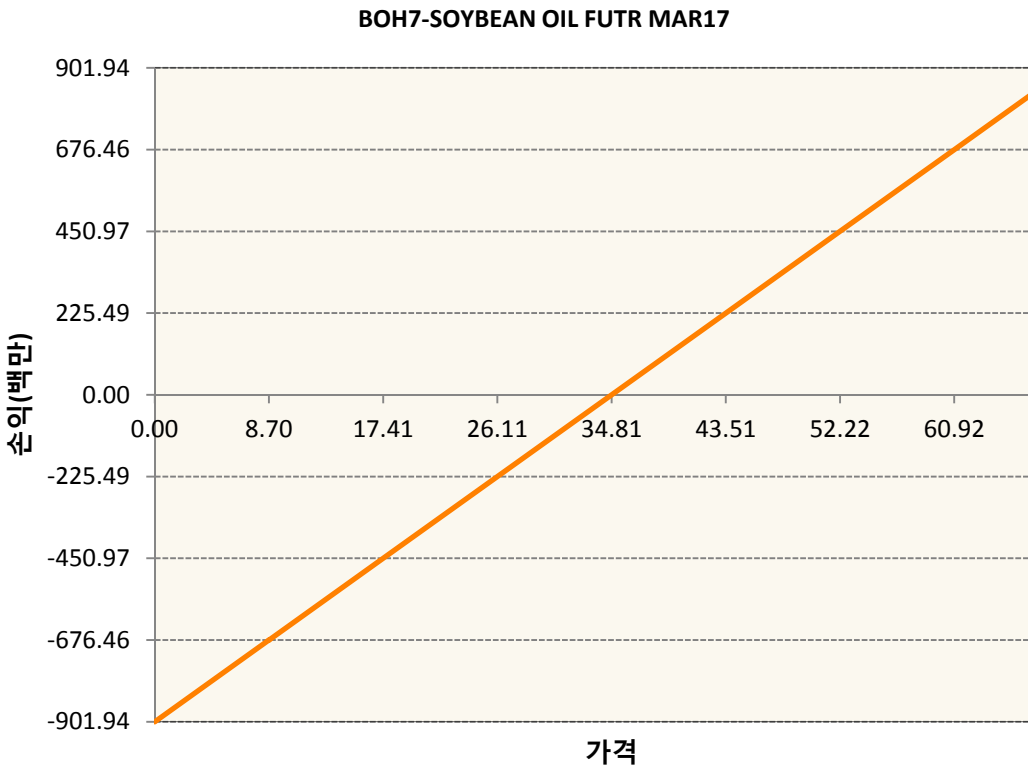
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

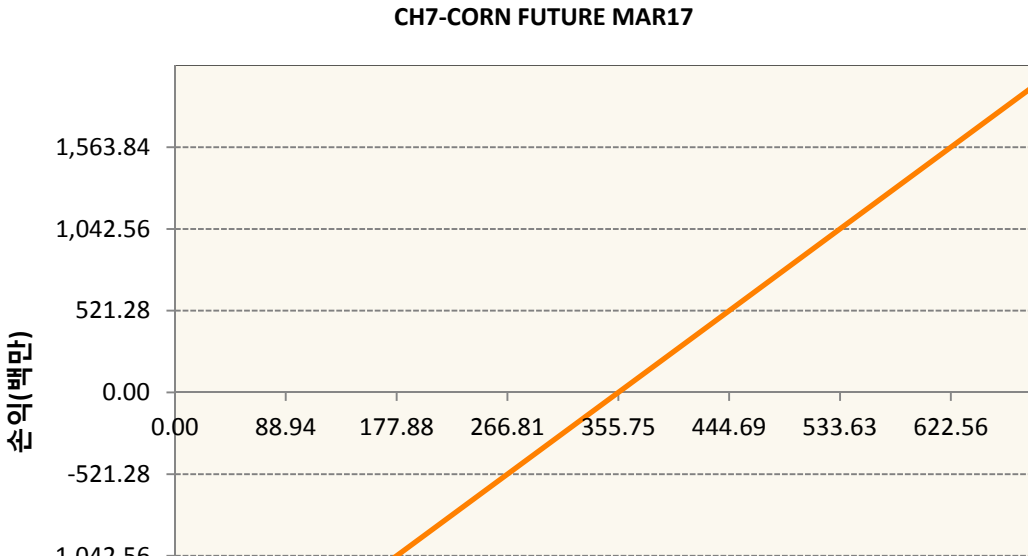
1. 계약금액

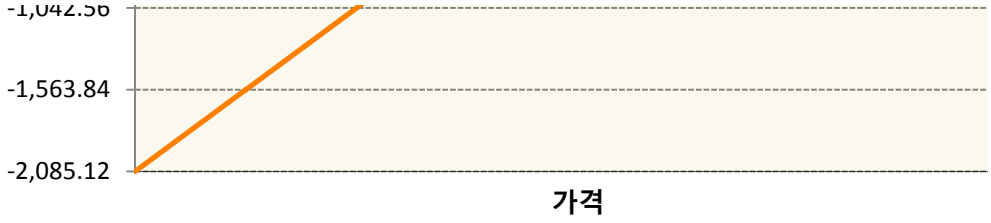
(단위:백만원)

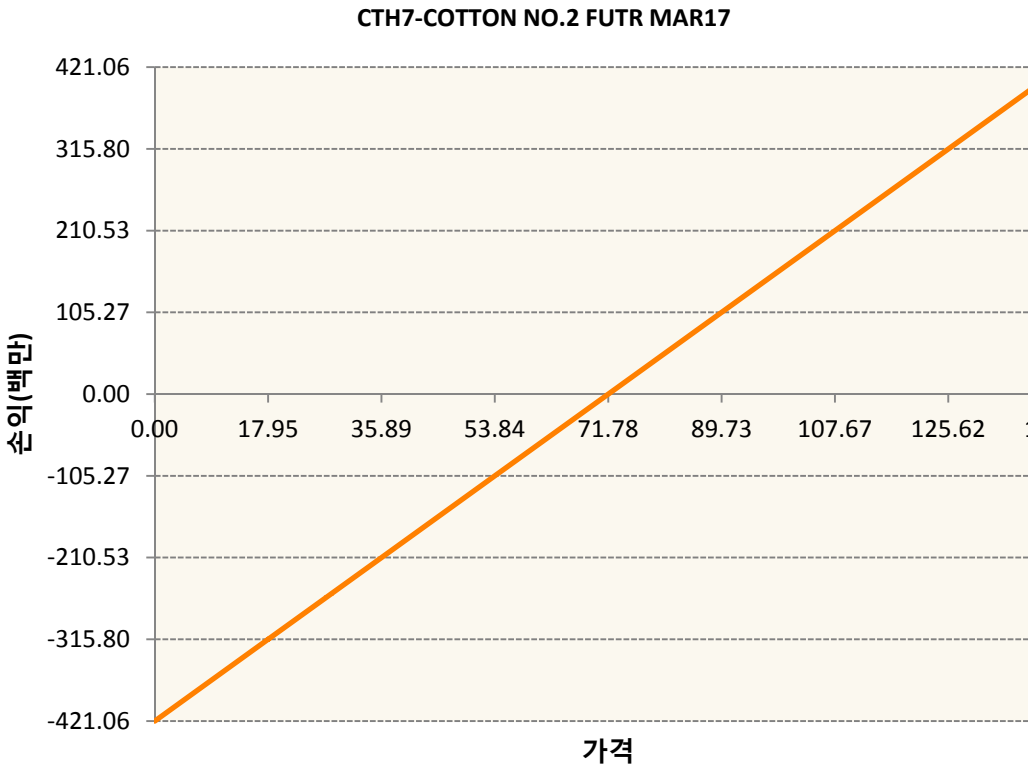
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	9,167	0	9,167	

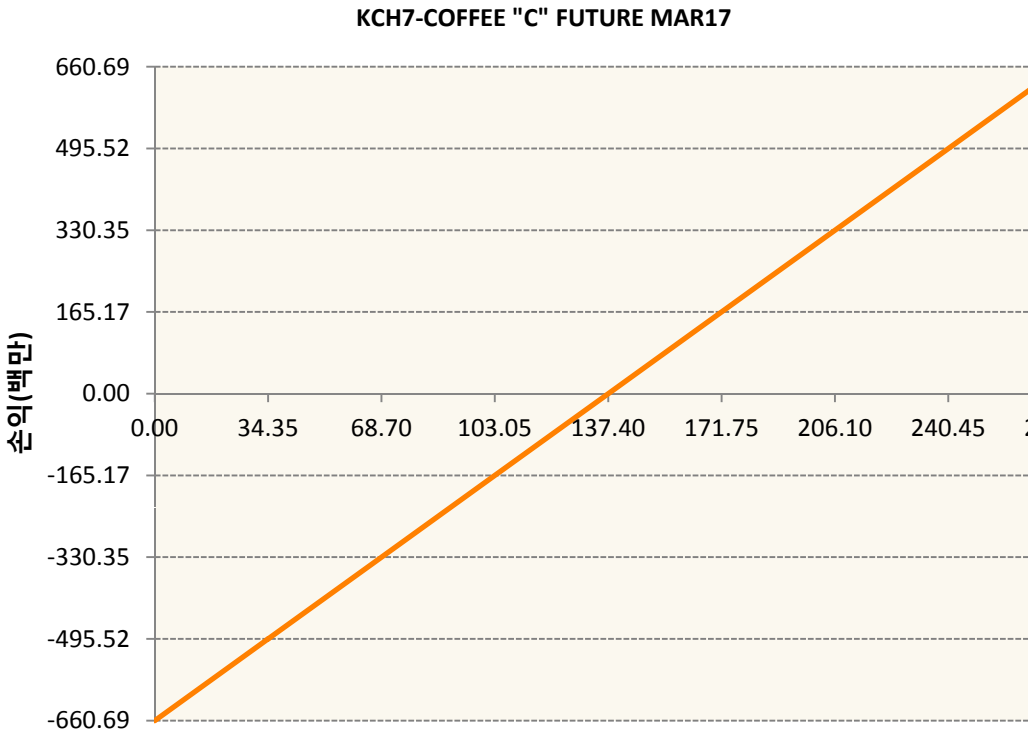
2. 만기시점의 손익구조





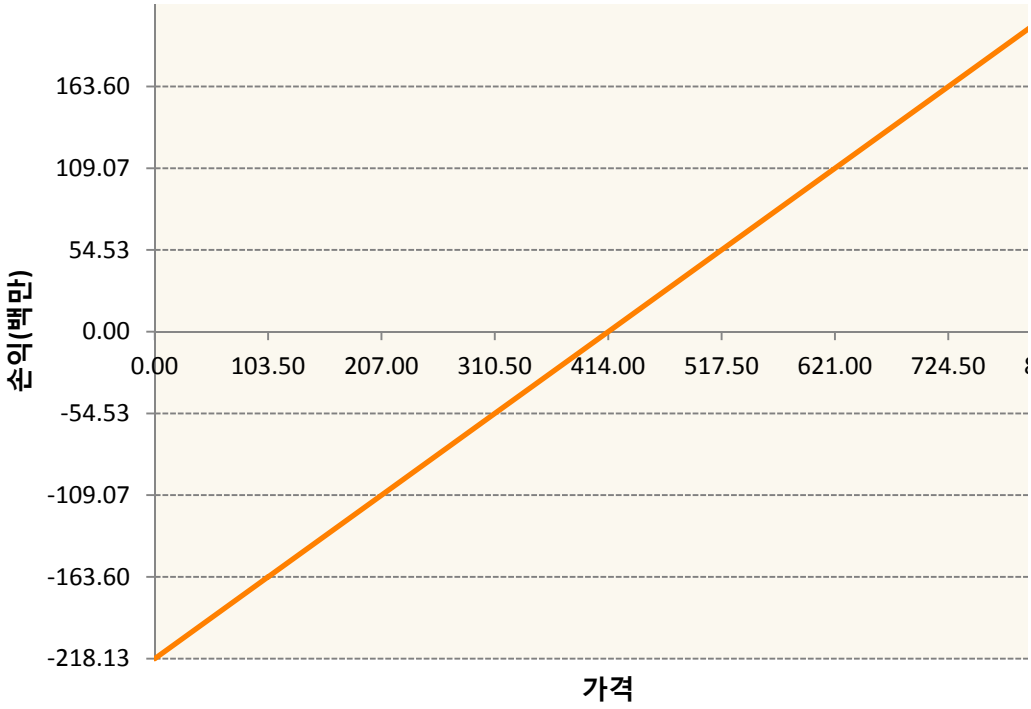

-1,042.56
-1,563.84
-2,085.12
가격


CTH7-COTTON NO.2 FUTR MAR17
421.06
315.80
210.53
105.27
0.00
-105.27
-210.53
-315.80
-421.06
0.00
17.95
35.89
53.84
71.78
89.73
107.67
125.62
손익(백만)
가격

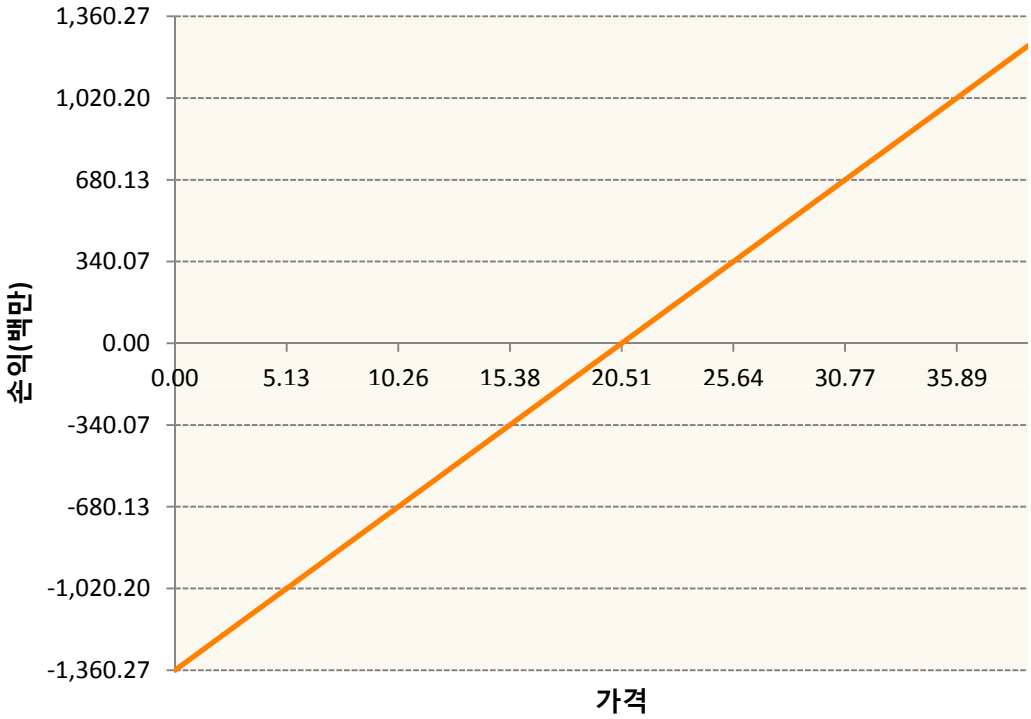

KCH7-COFFEE "C" FUTURE MAR17
660.69
495.52
330.35
165.17
0.00
-165.17
-330.35
-495.52
-660.69
0.00
34.35
68.70
103.05
137.40
171.75
206.10
240.45
손익(백만)

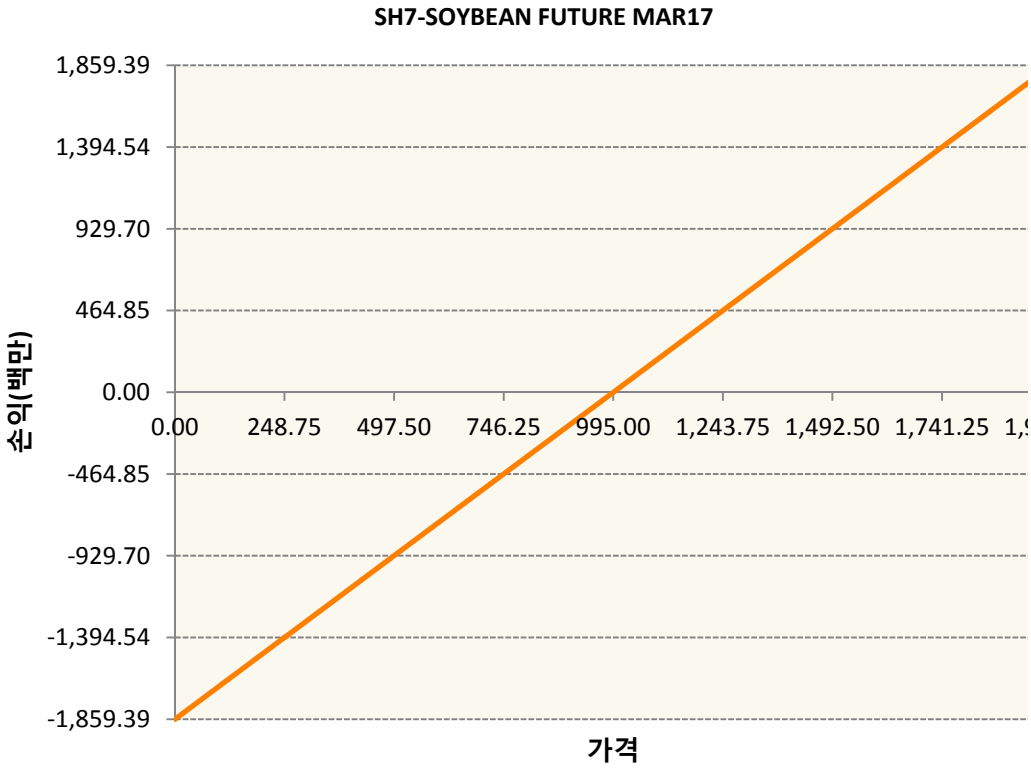
가격

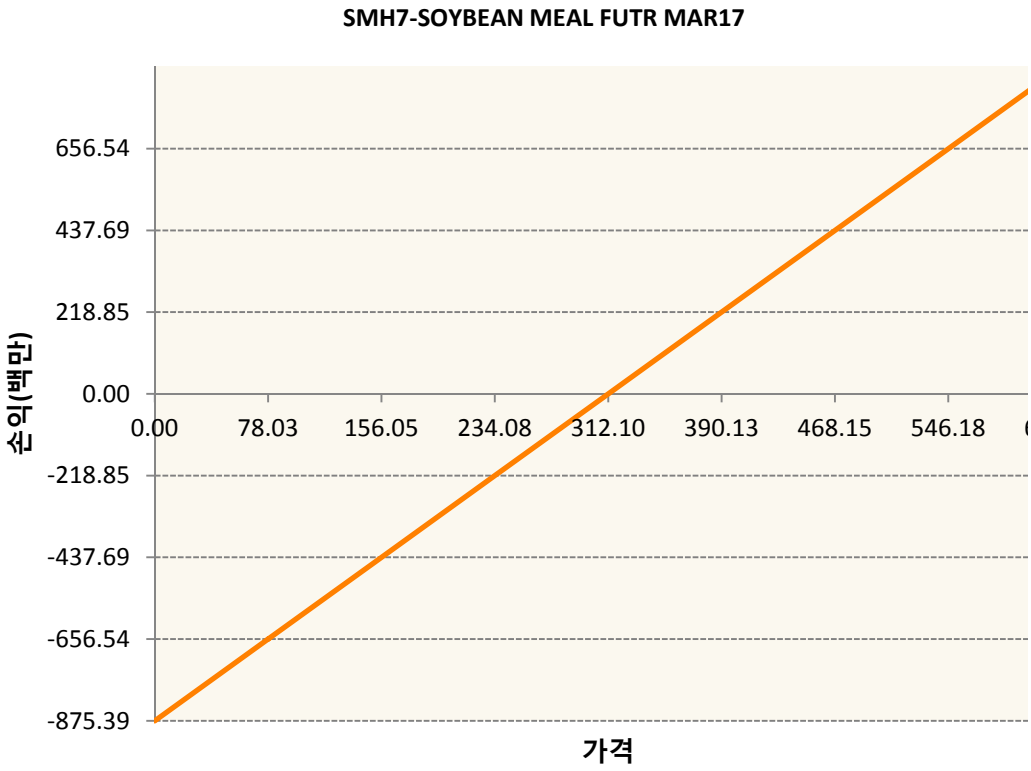
KWH7-KC HRW WHEAT FUT MAR17



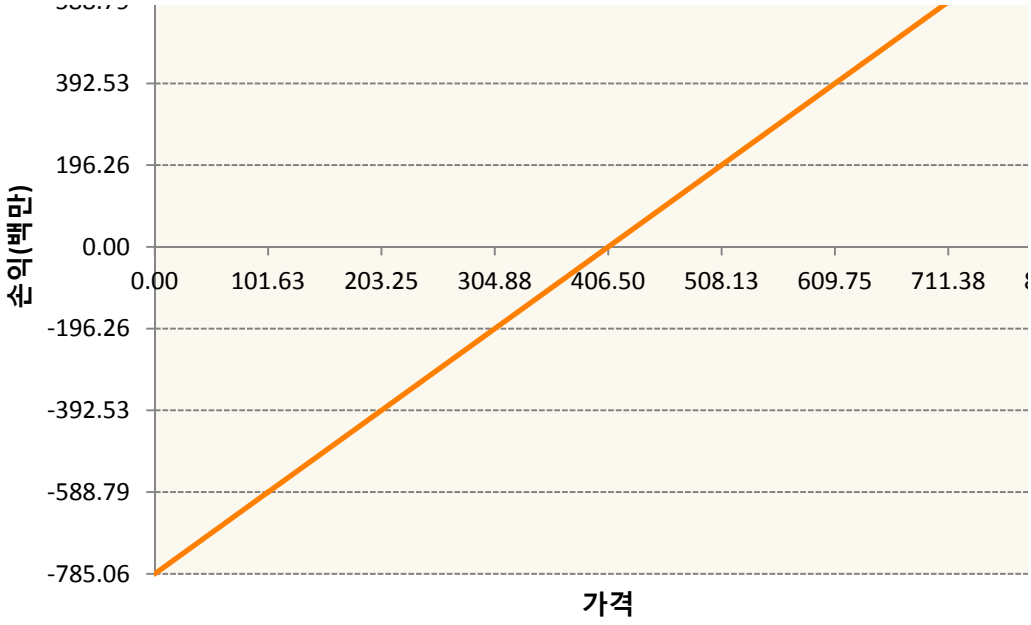
SBH7-Sugar #11 (WORLD) MAR17




SH7-SOYBEAN FUTURE MAR17
1,859.39
1,394.54
929.70
464.85
0.00
-464.85
-929.70
-1,394.54
-1,859.39
0.00
248.75
497.50
746.25
995.00
1,243.75
1,492.50
1,741.25
손익(백만)
가격


SMH7-SOYBEAN MEAL FUTR MAR17
656.54
437.69
218.85
0.00
-218.85
-437.69
-656.54
-875.39
0.00
78.03
156.05
234.08
312.10
390.13
468.15
546.18
손익(백만)
가격


WH7-WHEAT FUTURE(CBT) MAR17
785.06
588.79



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
BOH7	SOYBEAN OIL FUTR MAR17	72
CH7	CORN FUTURE MAR17	167
CTH7	COTTON NO.2 FUTR MAR17	34
KCH7	COFFEE "C" FUTURE MAR17	53
KWH7	KC HRW WHEAT FUT MAR17	17
SBH7	Sugar #11 (WORLD) MAR17	109
SH7	SOYBEAN FUTURE MAR17	149
SMH7	SOYBEAN MEAL FUTR MAR17	70
WH7	WHEAT FUTURE(CBT) MAR17	63

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	889