공시일	2017-01-10
기준일	2017-01-09

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	2017-01-10
기준일	2017-01-09

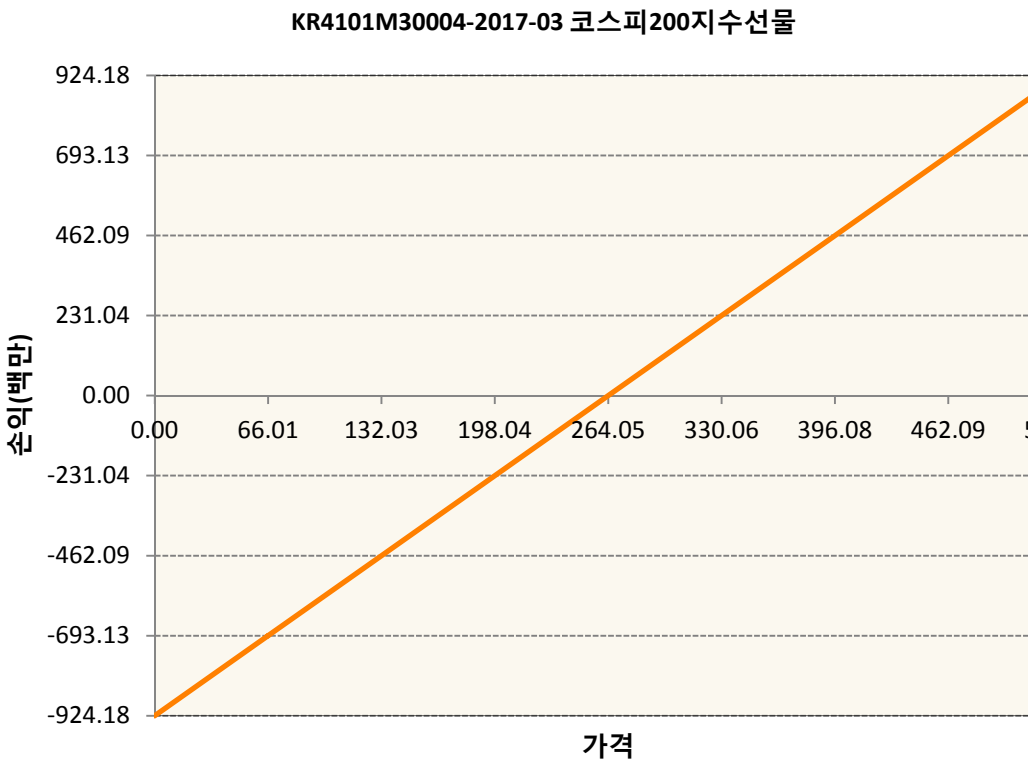
스마트인덱스모

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	924	0	924	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)

54

공시일	2017-01-10
기준일	2017-01-09

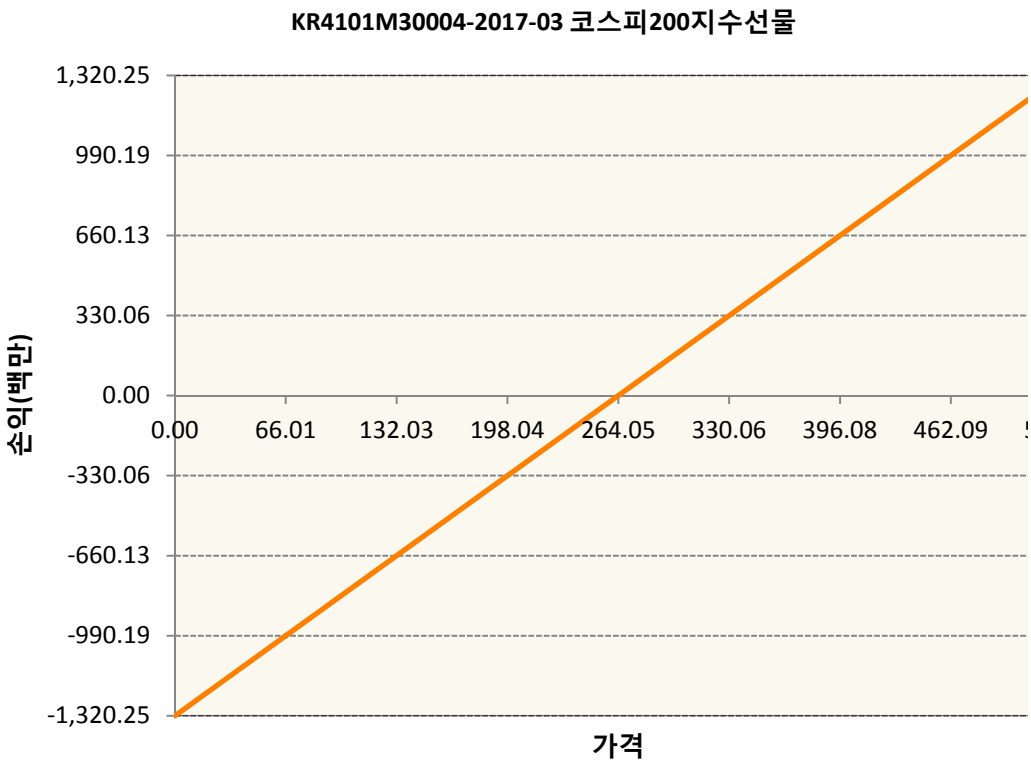
스마트레버리지목표전환형1호

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	1,320	0	1,320	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101M30(2017-03 코스피200지수선물							105
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-105	-105	-105	-105	-105	-105	-105
-5.33%	-70	-70	-70	-70	-70	-70	-70
-2.67%	-35	-35	-35	-35	-35	-35	-35
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	35	35	35	35	35	35	35
5.33%	70	70	70	70	70	70	70
8.00%	105	105	105	105	105	105	105

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

77

공시일	2017-01-10
기준일	2017-01-09

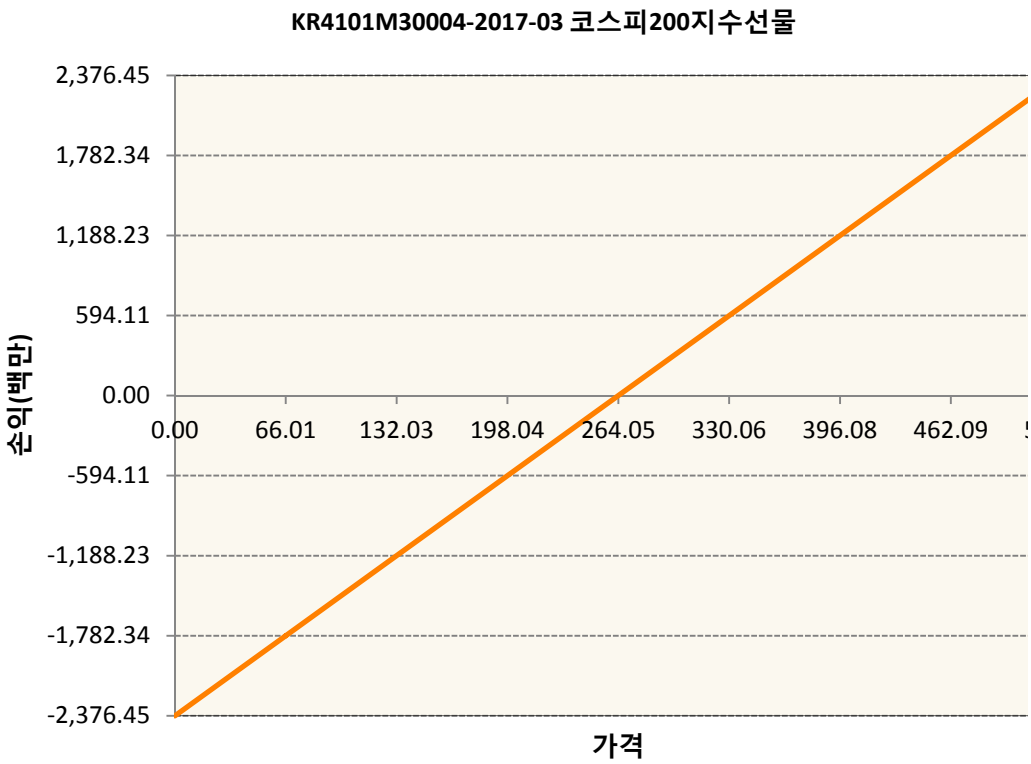
1.3배 레버리지 인덱스(주식-파생형)

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	2,376	0	2,376	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101M30(2017-03 코스피200지수선물							190
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-190	-190	-190	-190	-190	-190	-190
-5.33%	-127	-127	-127	-127	-127	-127	-127
-2.67%	-63	-63	-63	-63	-63	-63	-63
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	63	63	63	63	63	63	63
5.33%	127	127	127	127	127	127	127
8.00%	190	190	190	190	190	190	190

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

139

공시일	2017-01-10
기준일	2017-01-09

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	921

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

709

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-01-10
기준일	2017-01-09

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	386

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

674

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-01-10
기준일	2017-01-09

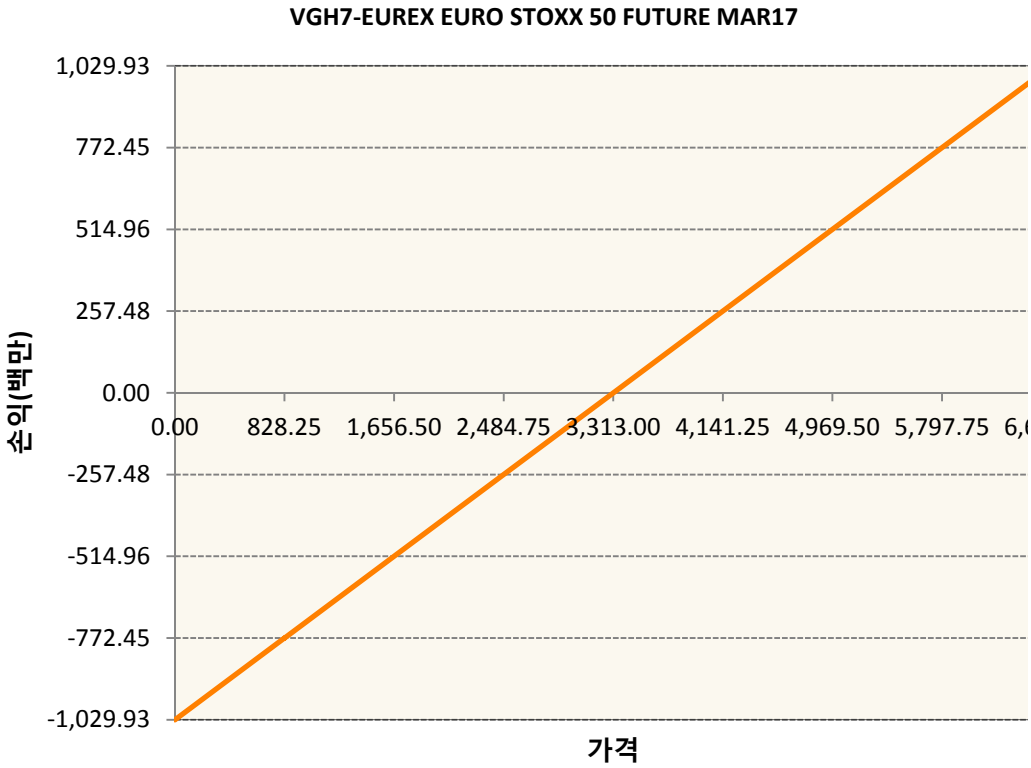
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,030	0	1,030	

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)

95

공시일	2017-01-10
기준일	2017-01-09

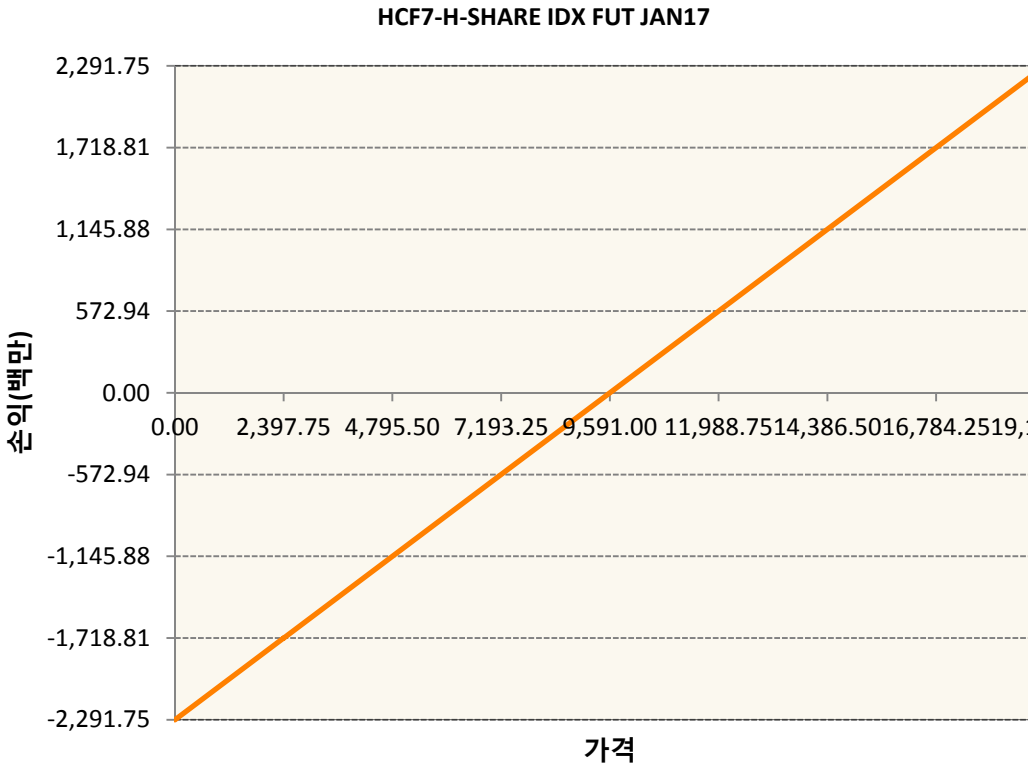
차이나인덱스모(주식-파생형)

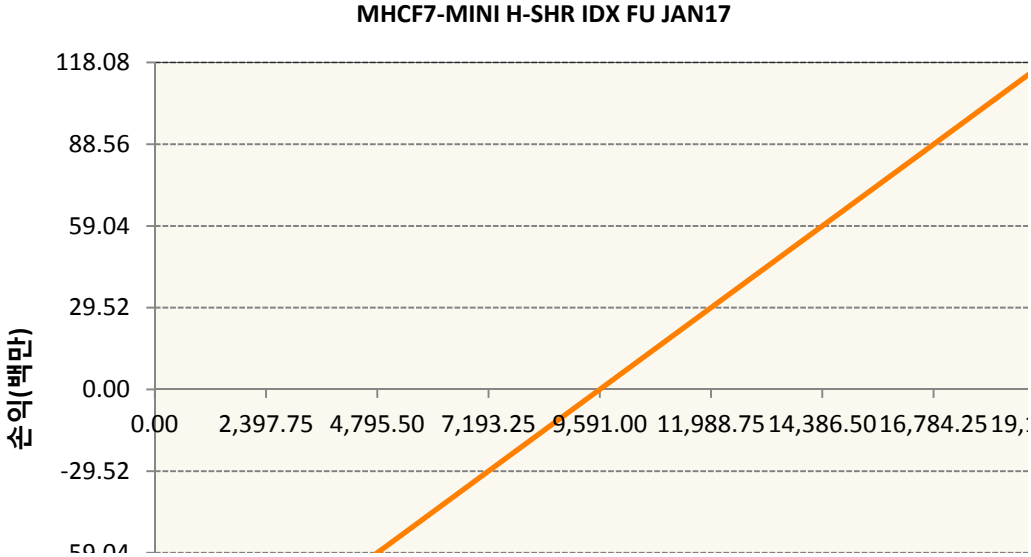
1. 계약금액

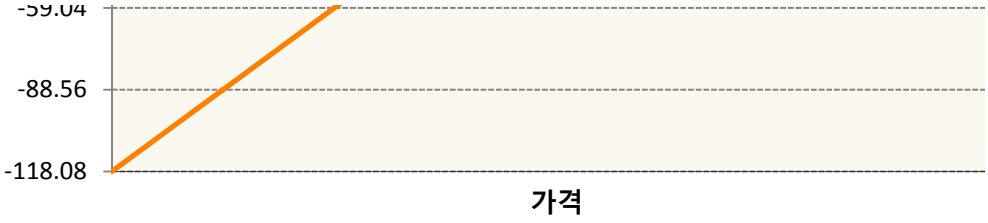
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,410	0	2,410	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCF7	H-SHARE IDX FUT JAN17	183
MHCF7	MINI H-SHR IDX FU JAN17	9

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	235

공시일	2017-01-10
기준일	2017-01-09

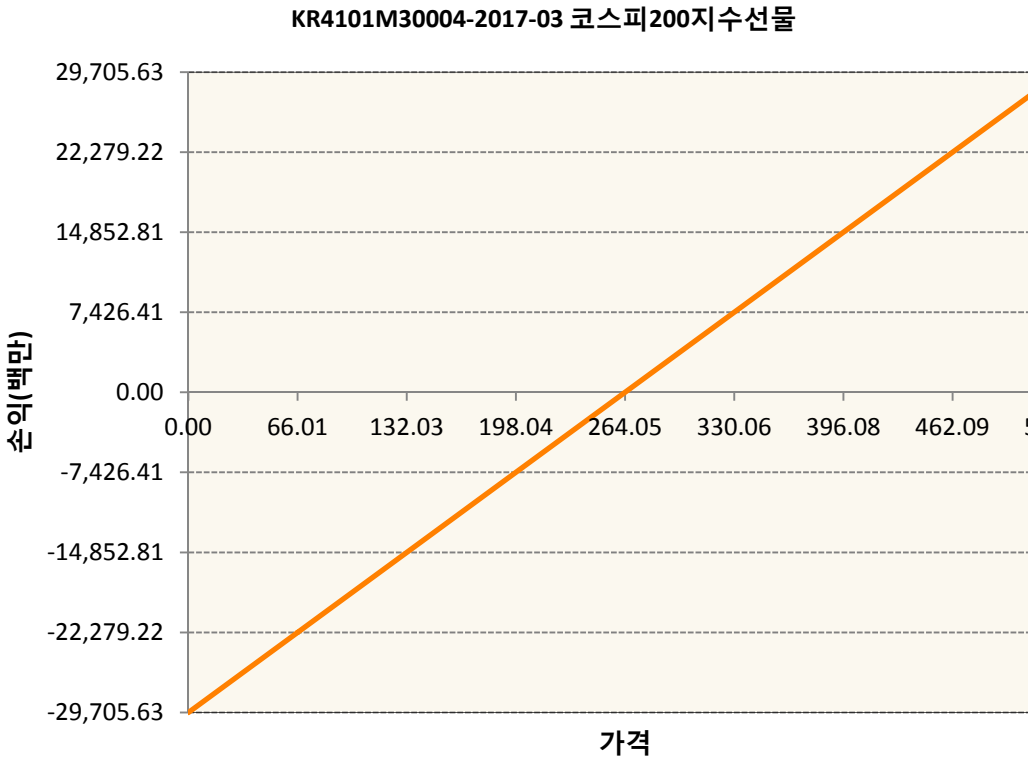
커버드콜(주식혼합-파생형)

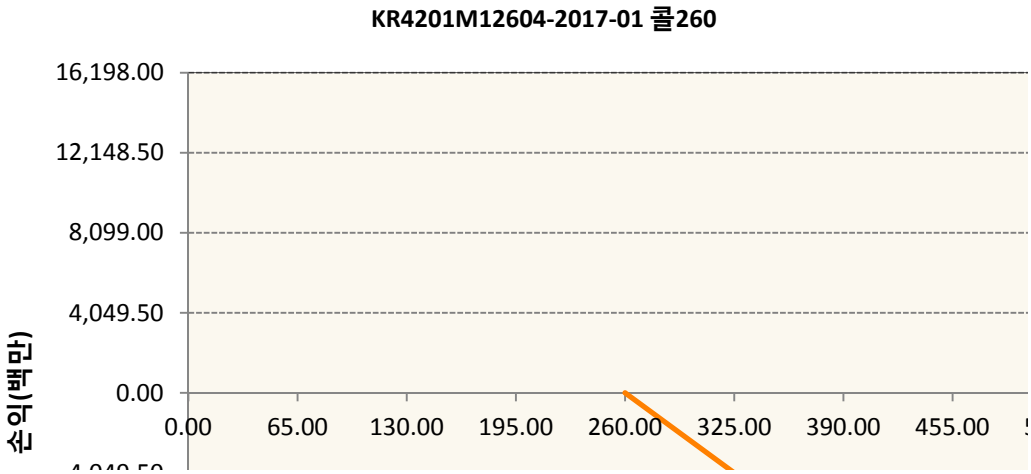
1. 계약금액

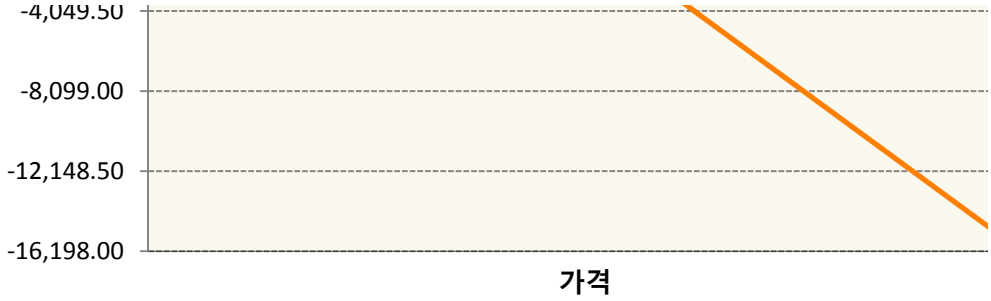
(단위:백만원)

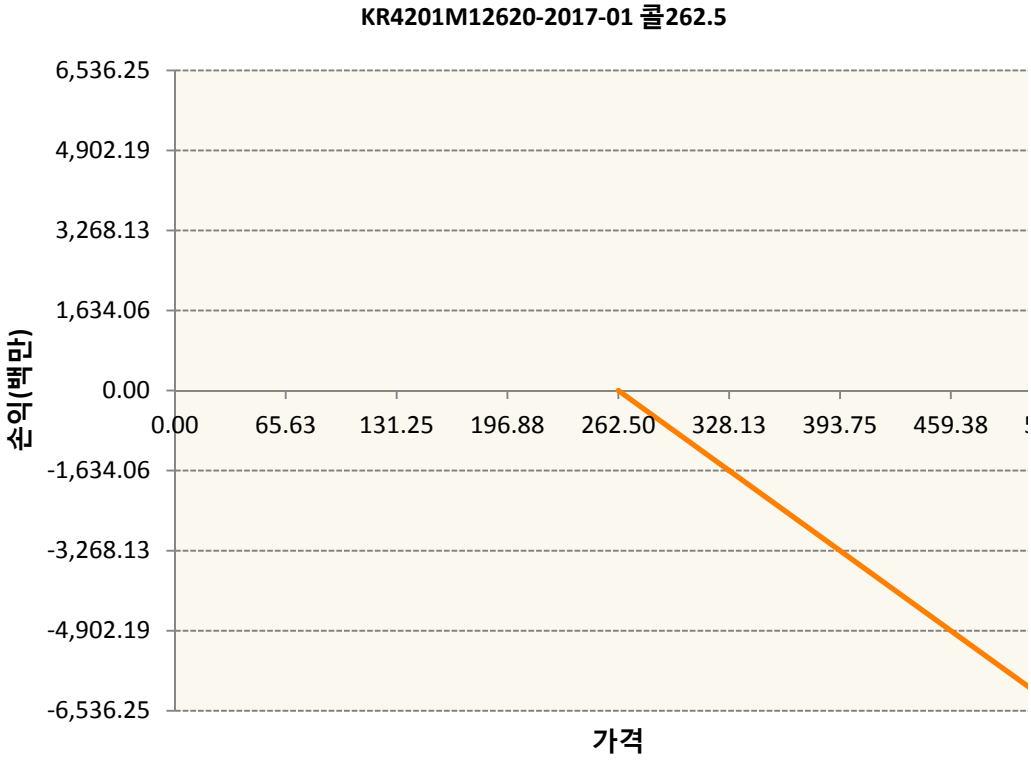
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	264	-264	장내
누계	유가증권	선물	29,706	0	29,706	장내
누계	유가증권	옵션	0	22,734	-22,734	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101M30(2017-03 코스피200지수선물							2,374
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-2,374	-2,374	-2,374	-2,374	-2,374	-2,374	-2,374
-5.33%	-1,582	-1,582	-1,582	-1,582	-1,582	-1,582	-1,582
-2.67%	-791	-791	-791	-791	-791	-791	-791
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	791	791	791	791	791	791	791
5.33%	1,582	1,582	1,582	1,582	1,582	1,582	1,582
8.00%	2,374	2,374	2,374	2,374	2,374	2,374	2,374
KR4201M12(2017-01 콜260							6,544
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,192	1,192	1,192	1,192	1,192	1,192	1,192
-5.33%	1,192	1,192	1,192	1,192	1,192	1,192	1,192
-2.67%	1,181	1,174	1,165	1,154	1,141	1,127	1,112
0%	21	16	9	0	-11	-23	-36
2.67%	-2,162	-2,162	-2,162	-2,162	-2,162	-2,163	-2,163
5.33%	-4,353	-4,353	-4,353	-4,353	-4,353	-4,353	-4,353
8.00%	-6,544	-6,544	-6,544	-6,544	-6,544	-6,544	-6,544
KR4201M12(	2017-01 콜262.5						2,559

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	222	222	222	222	222	222	222
-5.33%	222	222	222	222	222	222	222
-2.67%	222	222	221	220	219	218	216
0%	28	19	10	0	-10	-20	-30
2.67%	-808	-808	-808	-808	-808	-808	-809
5.33%	-1,683	-1,683	-1,683	-1,683	-1,683	-1,683	-1,683
8.00%	-2,559	-2,559	-2,559	-2,559	-2,559	-2,559	-2,559

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

15,029

공시일	2017-01-10
기준일	2017-01-09

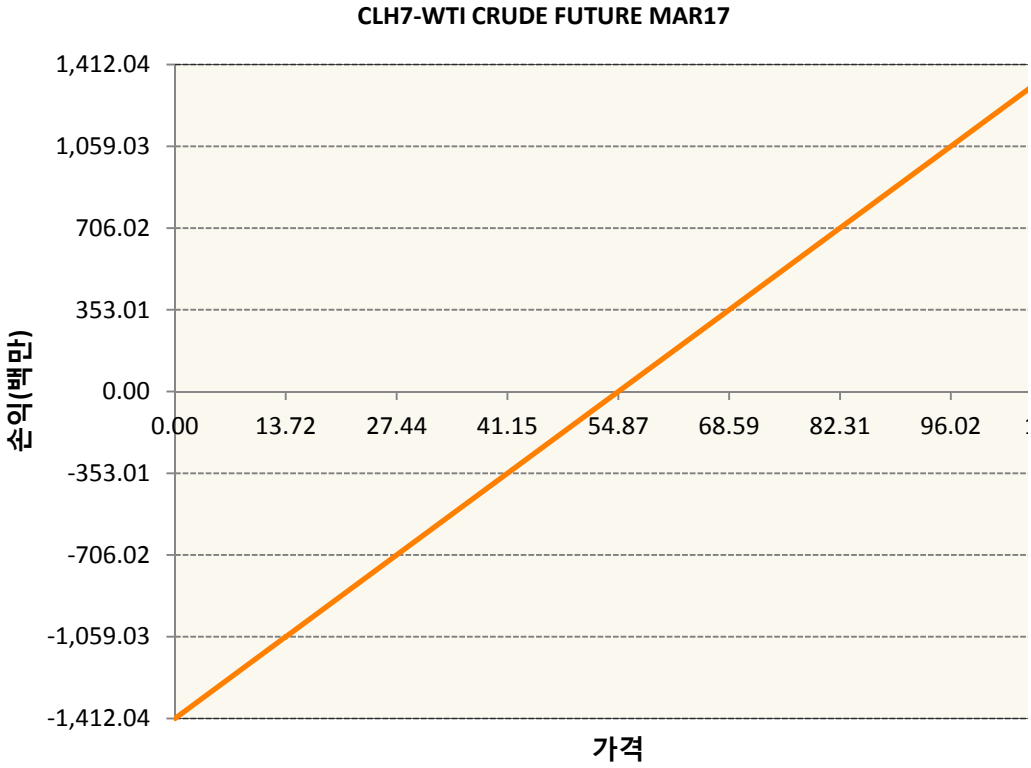
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

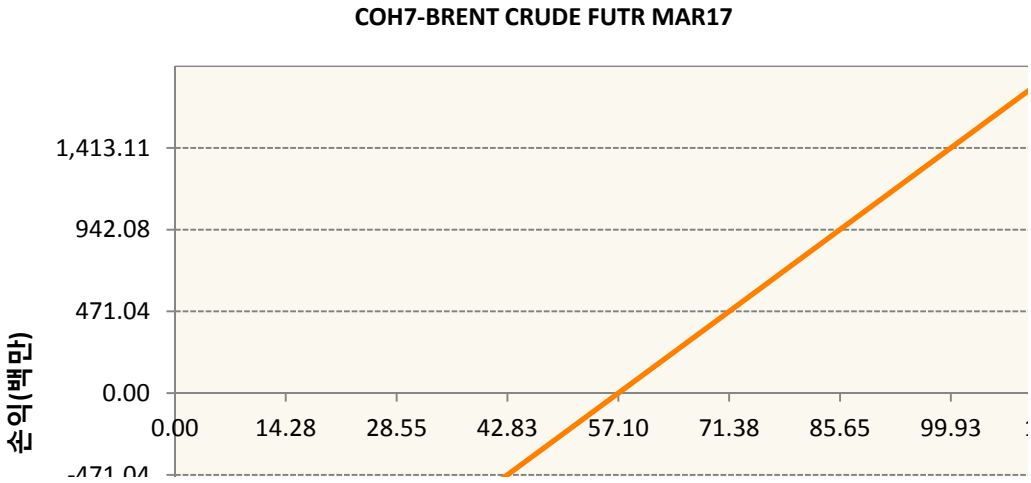
1. 계약금액

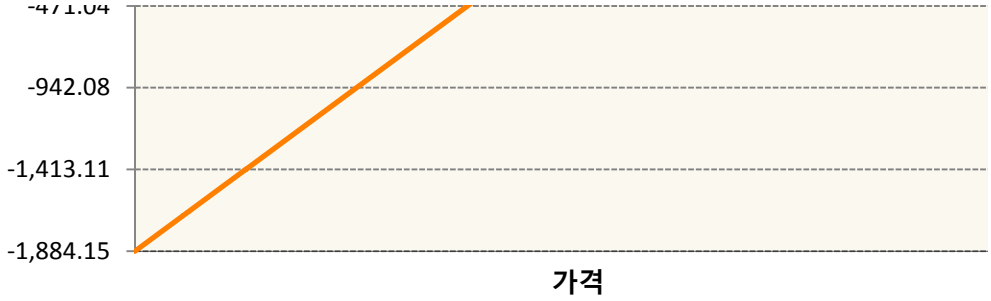
(단위:백만원)

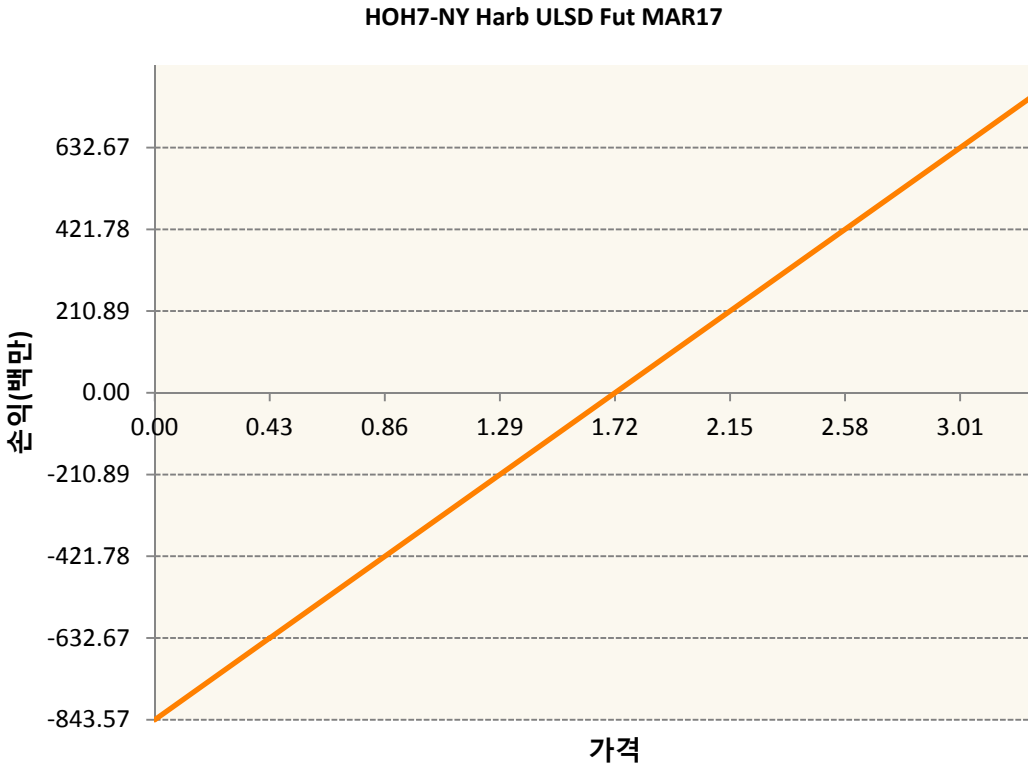
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	선물	유가증권	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	선물	유가증권	1,412	0	1,412	
누계	유가증권	선물	5,151	435	4,716	

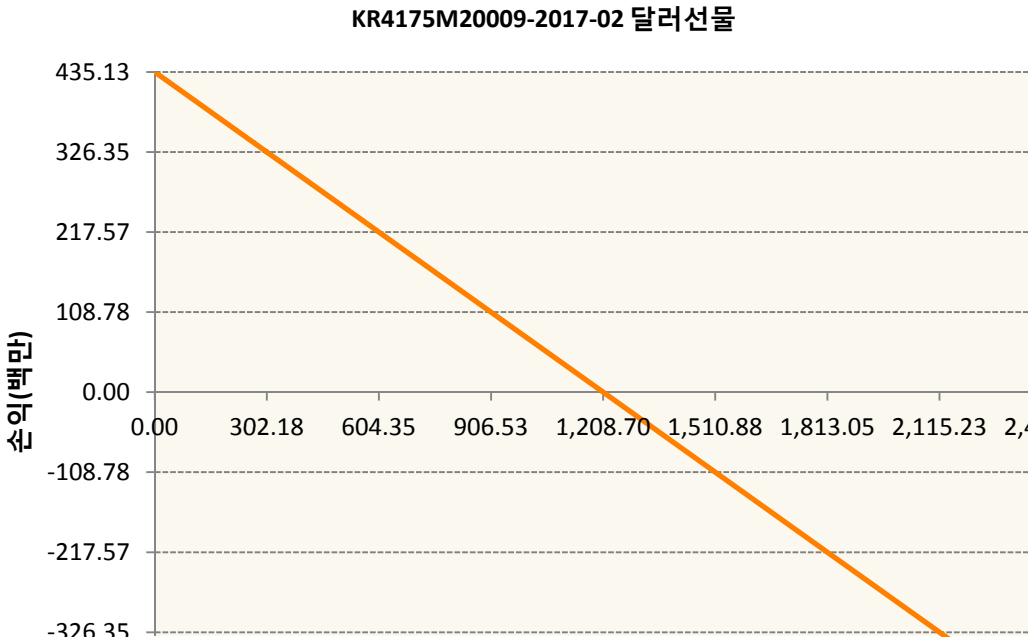
2. 만기시점의 손익구조

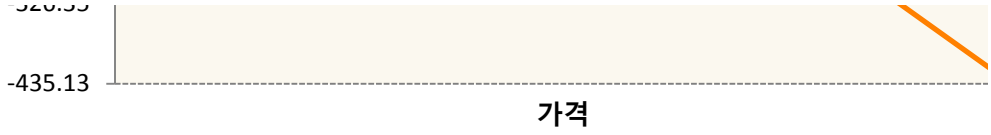


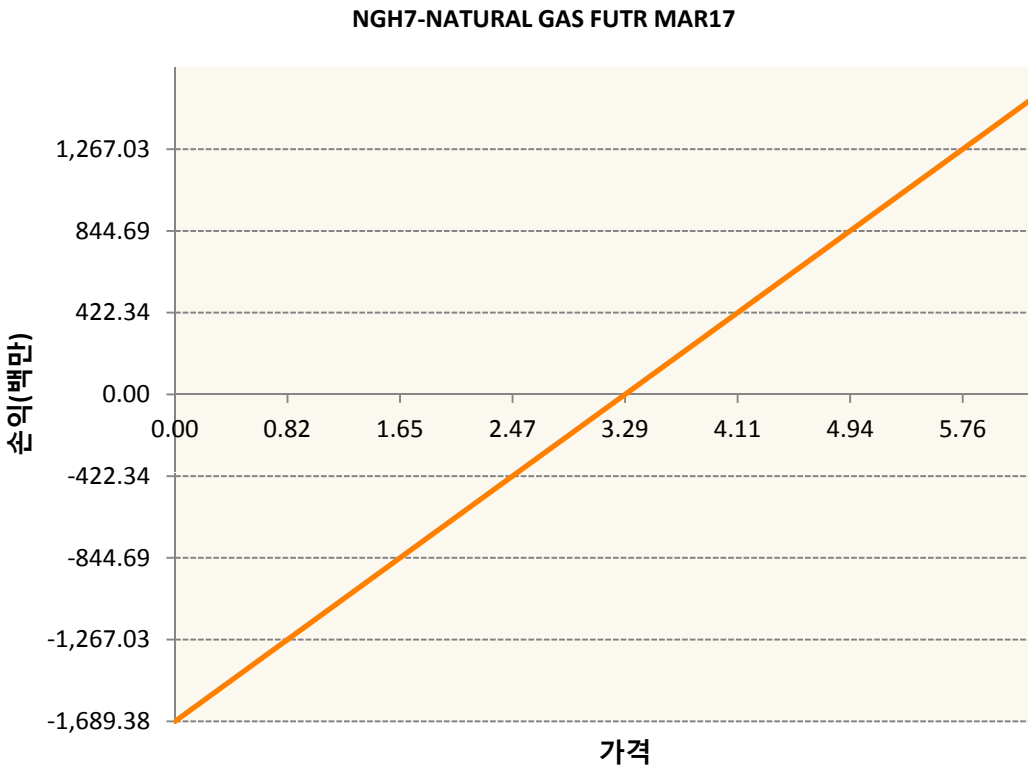


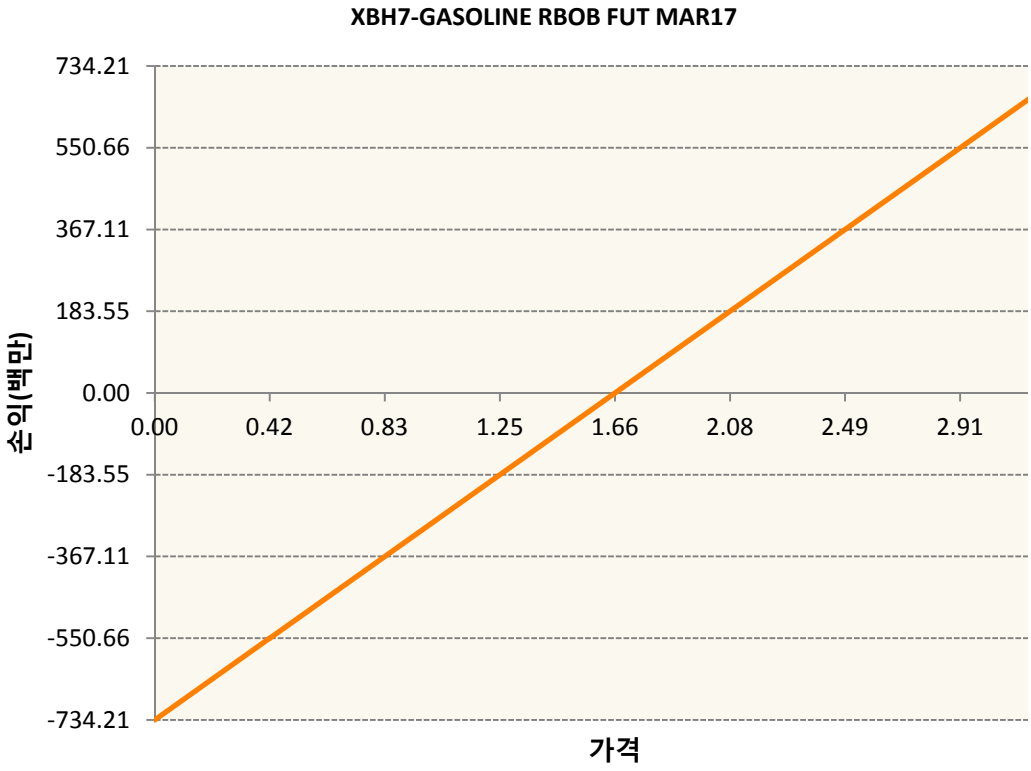

-942.08
-1,413.11
-1,884.15
가격


HOH7-NY Harb ULSD Fut MAR17
632.67
421.78
210.89
0.00
-210.89
-421.78
-632.67
-843.57
0.00
0.43
0.86
1.29
1.72
2.15
2.58
3.01
순익(백만)
가격


KR4175M20009-2017-02 달러선물
435.13
326.35
217.57
108.78
0.00
-108.78
-217.57
-326.35
0.00
302.18
604.35
906.53
1,208.70
1,510.88
1,813.05
2,115.23
순익(백만)


-435.13
가격


NGH7-NATURAL GAS FUTR MAR17
1,267.03
844.69
422.34
0.00
-422.34
-844.69
-1,267.03
-1,689.38
0.00
0.82
1.65
2.47
3.29
4.11
4.94
5.76
순익(백만)
가격


XBH7-GASOLINE RBOB FUT MAR17
734.21
550.66
367.11
183.55
0.00
-183.55
-367.11
-550.66
-734.21
0.00
0.42
0.83
1.25
1.66
2.08
2.49
2.91
순익(백만)
가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLH7	WTI CRUDE FUTURE MAR17	113
COH7	BRENT CRUDE FUTR MAR17	151
HOH7	NY Harb ULSD Fut MAR17	67
KR4175M20(	2017-02 달러선물	35
NGH7	NATURAL GAS FUTR MAR17	135
XBH7	GASOLINE RBOB FUT MAR17	59

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

1,216

공시일	2017-01-10
기준일	2017-01-09

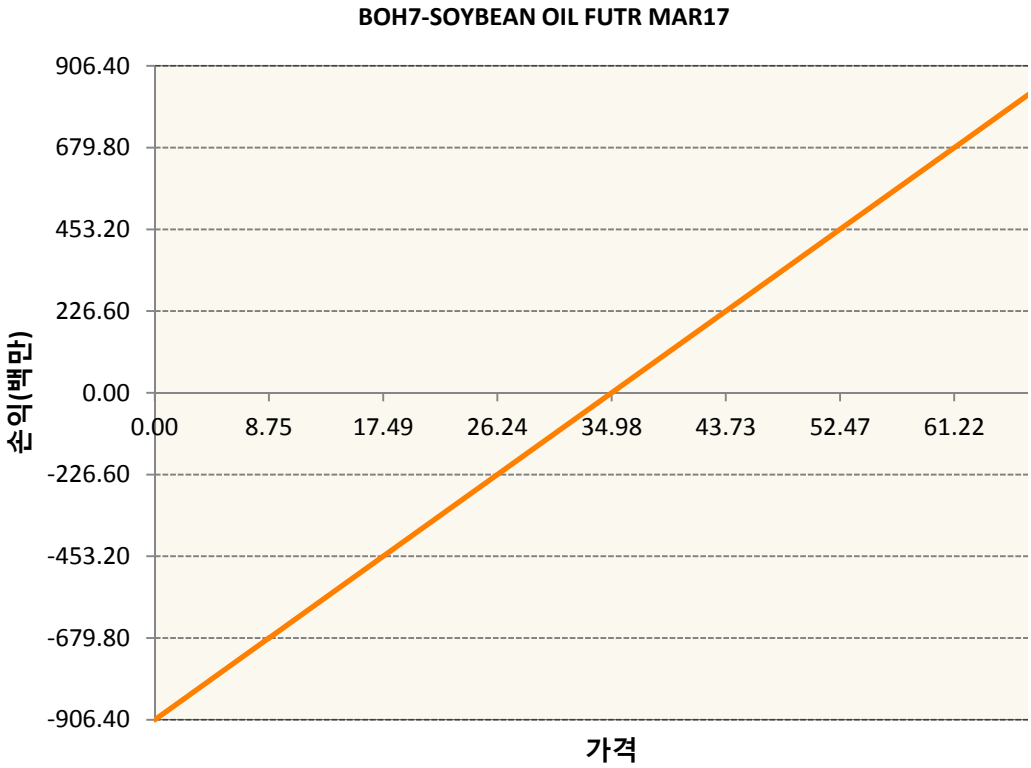
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

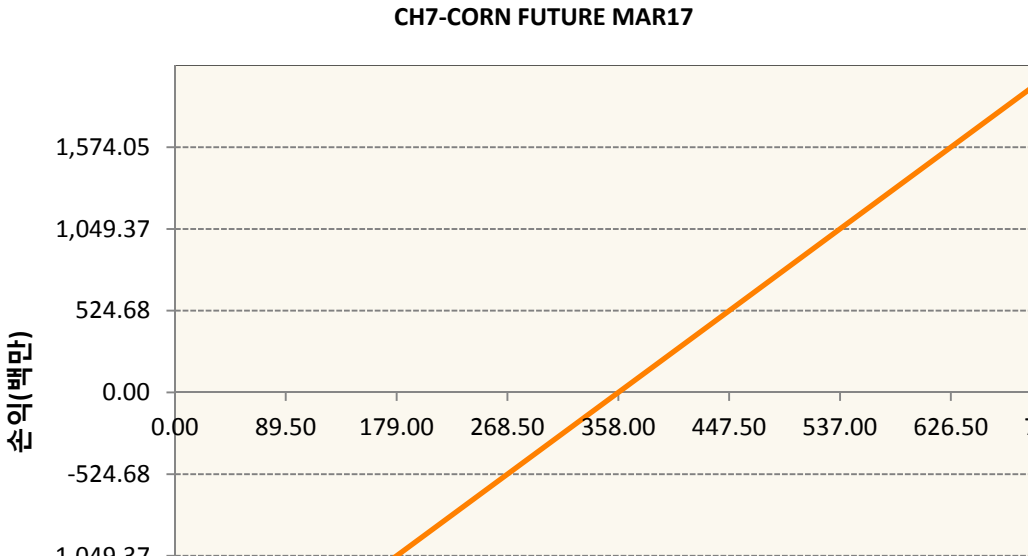
1. 계약금액

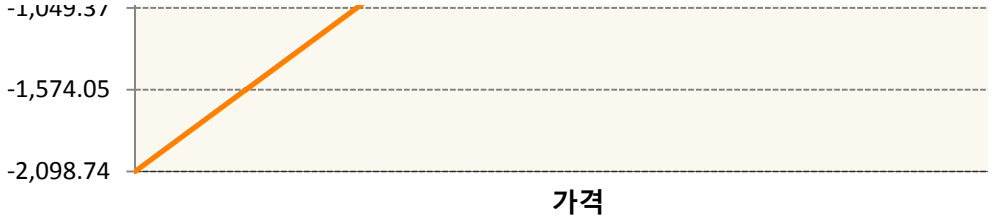
(단위:백만원)

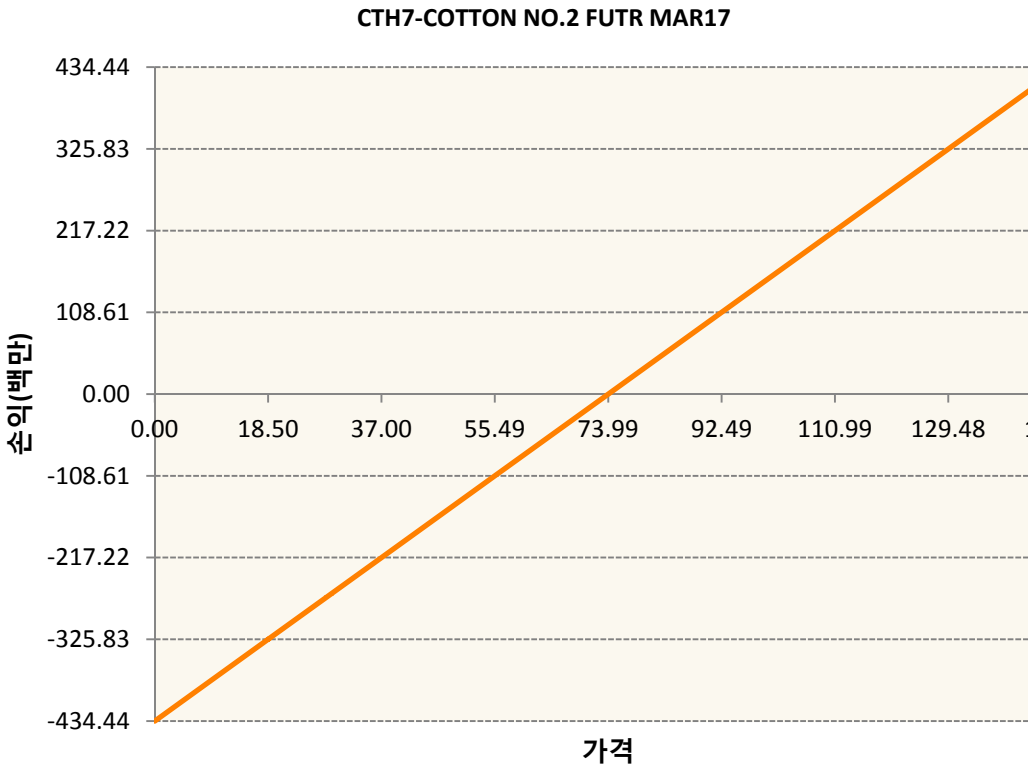
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	9,284	604	8,679	

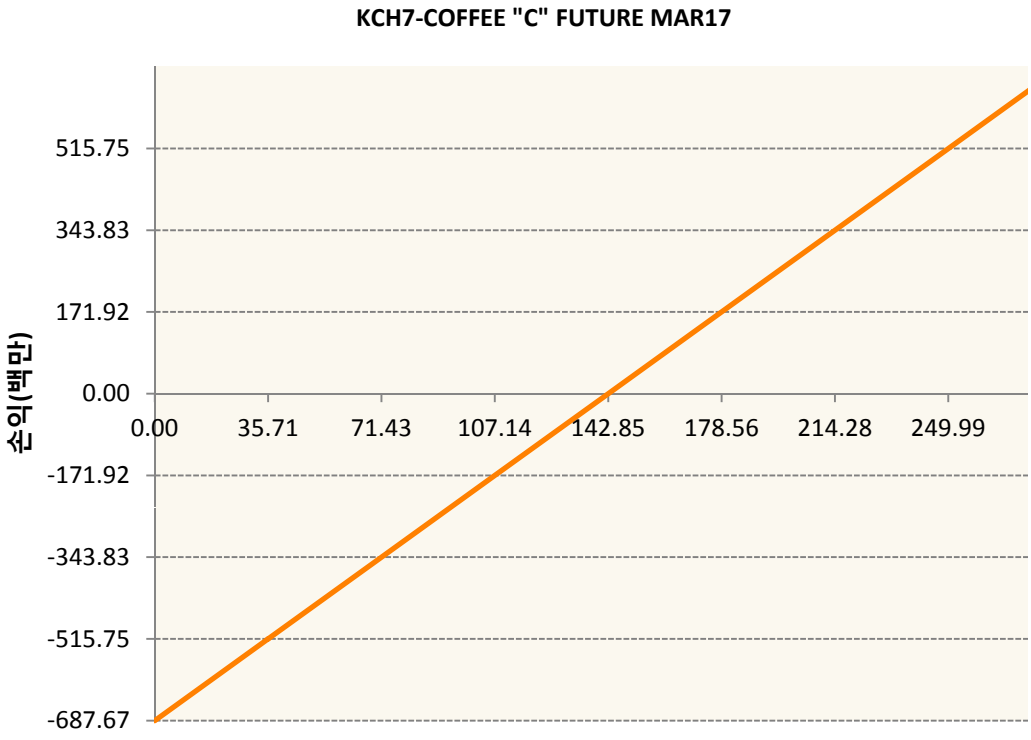
2. 만기시점의 손익구조



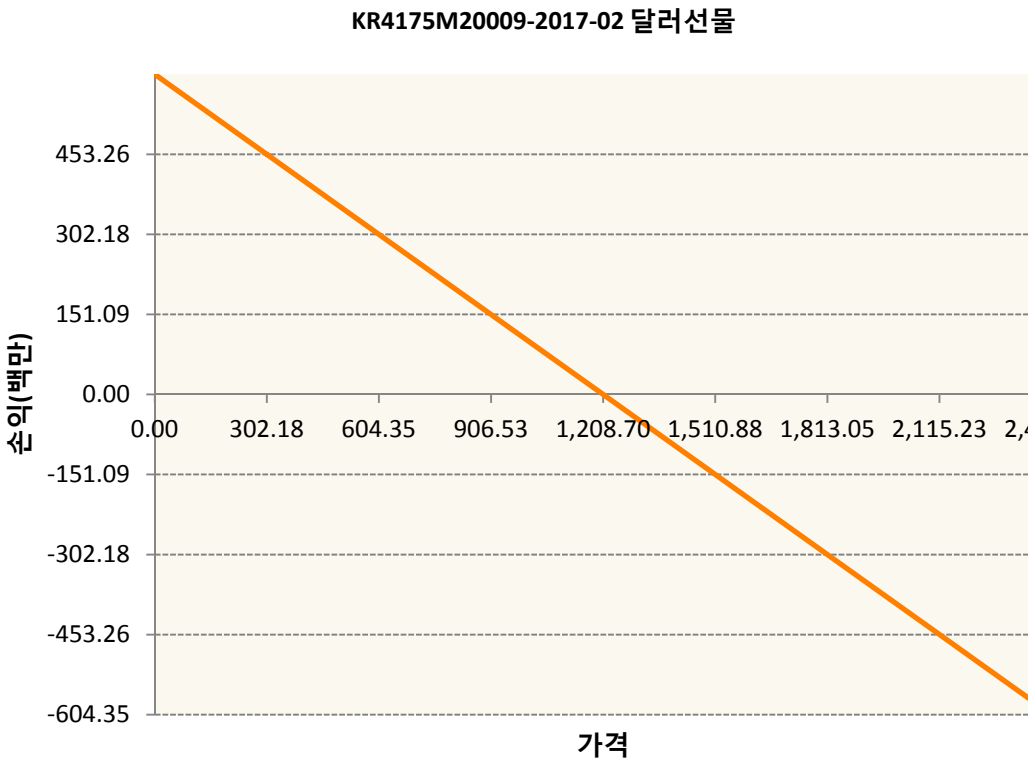


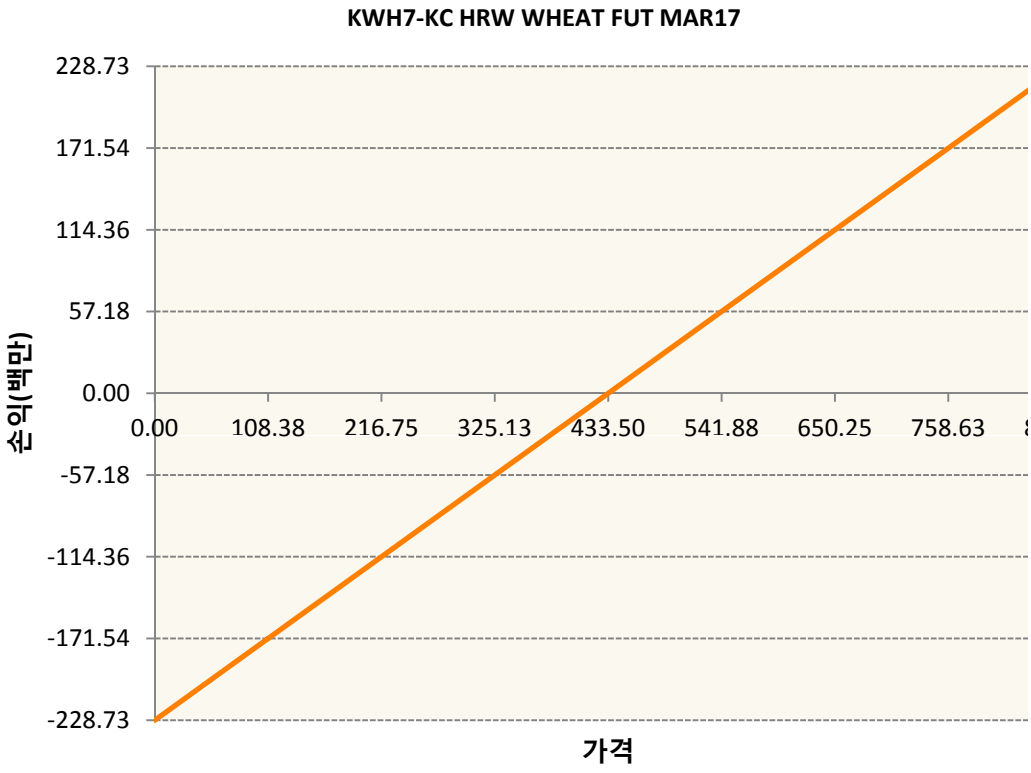

-1,574.05
-2,098.74
가격

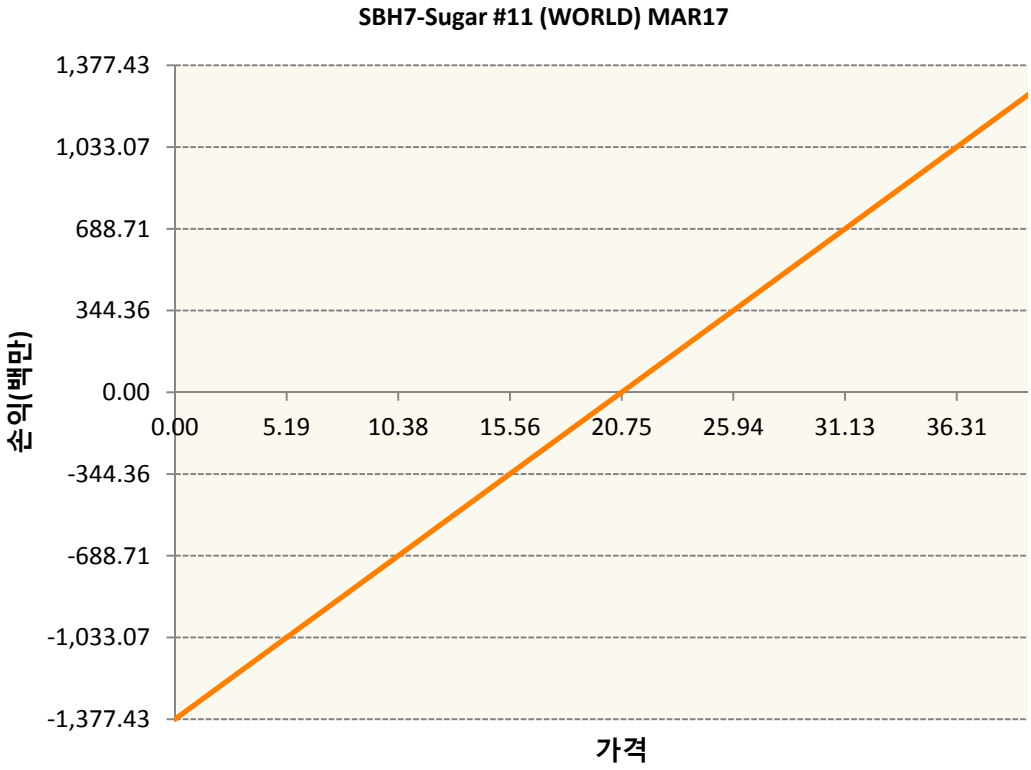

CTH7-COTTON NO.2 FUTR MAR17
434.44
325.83
217.22
108.61
0.00
-108.61
-217.22
-325.83
-434.44
0.00
18.50
37.00
55.49
73.99
92.49
110.99
129.48
순익(백만)
가격

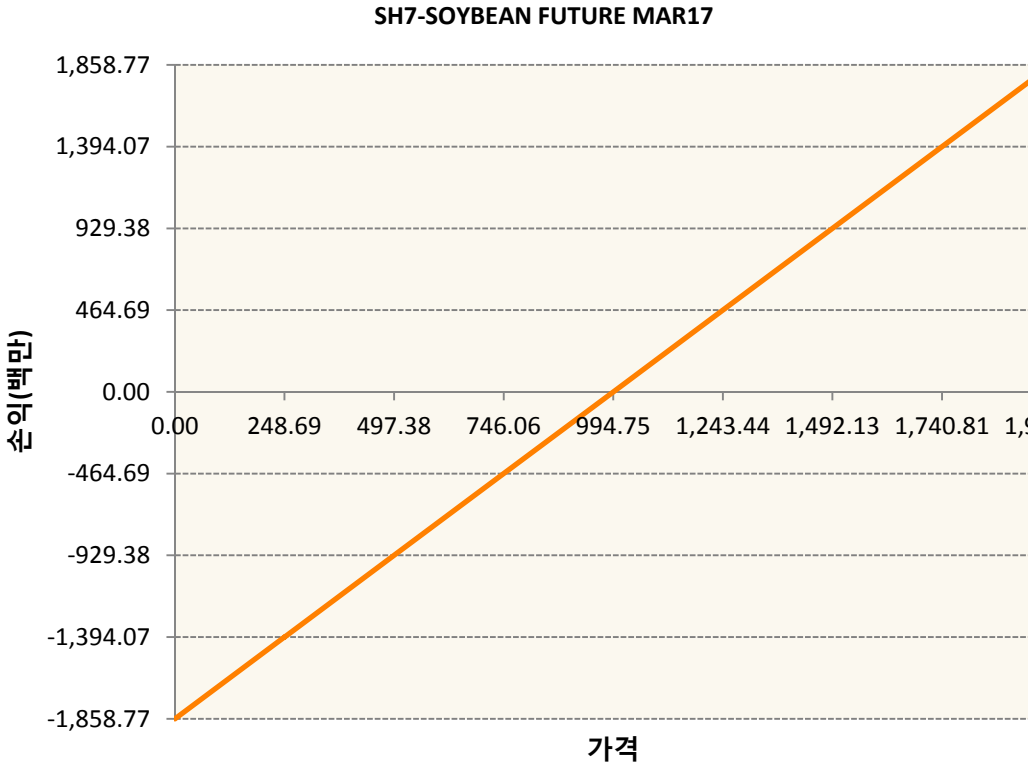

KCH7-COFFEE "C" FUTURE MAR17
515.75
343.83
171.92
0.00
-171.92
-343.83
-515.75
-687.67
0.00
35.71
71.43
107.14
142.85
178.56
214.28
249.99
순익(백만)

가격

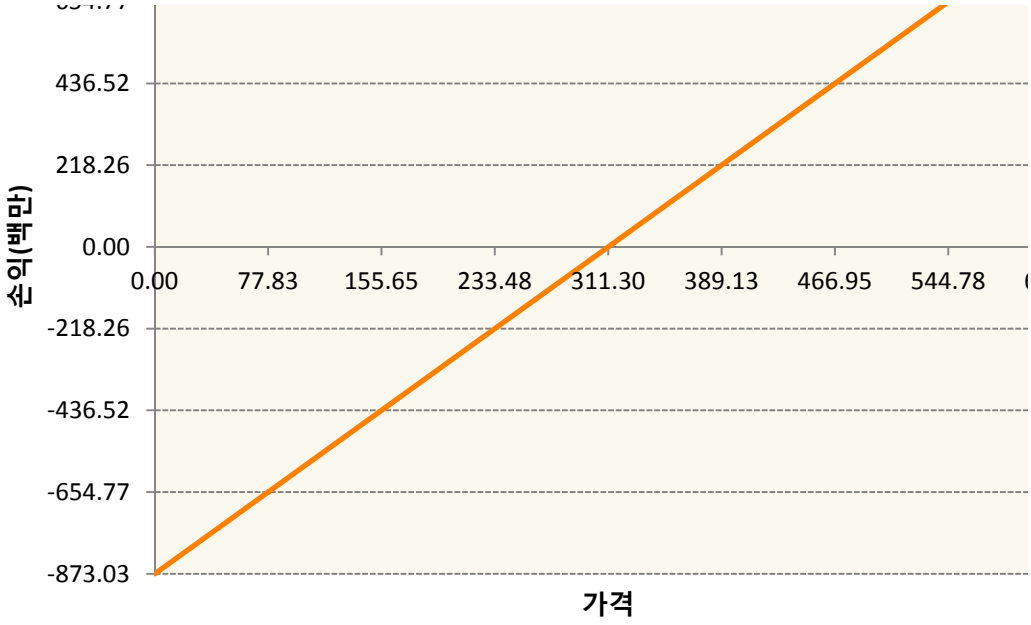

KR4175M20009-2017-02 달러선물
453.26
302.18
151.09
0.00
-151.09
-302.18
-453.26
-604.35
0.00
302.18
604.35
906.53
1,208.70
1,510.88
1,813.05
2,115.23
순이(백만)
가격

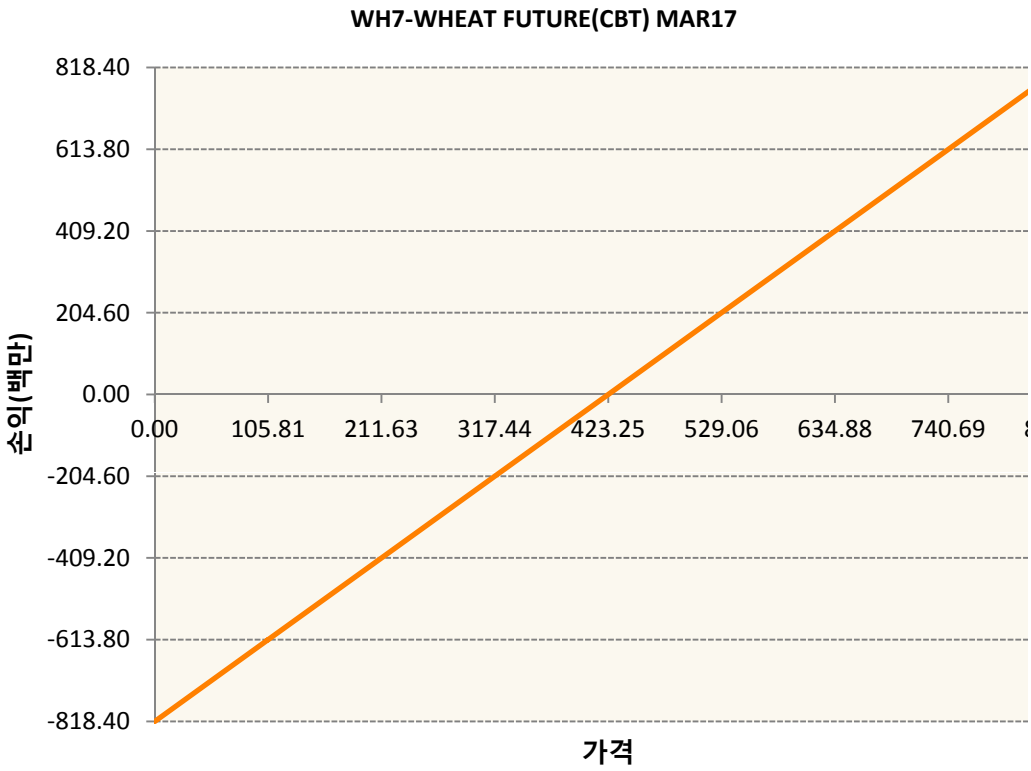

KWH7-KC HRW WHEAT FUT MAR17
228.73
171.54
114.36
57.18
0.00
-57.18
-114.36
-171.54
-228.73
0.00
108.38
216.75
325.13
433.50
541.88
650.25
758.63
순이(백만)
가격


SBH7-Sugar #11 (WORLD) MAR17
1,377.43
1,033.07
688.71
344.36
0.00
-344.36
-688.71
-1,033.07
-1,377.43
0.00
5.19
10.38
15.56
20.75
25.94
31.13
36.31
손익(백만)
가격


SH7-SOYBEAN FUTURE MAR17
1,858.77
1,394.07
929.38
464.69
0.00
-464.69
-929.38
-1,394.07
-1,858.77
0.00
248.69
497.38
746.06
994.75
1,243.44
1,492.13
1,740.81
손익(백만)
가격


SMH7-SOYBEAN MEAL FUTR MAR17
654.77





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

BOH7	SOYBEAN OIL FUTR MAR17	73
CH7	CORN FUTURE MAR17	168
CTH7	COTTON NO.2 FUTR MAR17	35
KCH7	COFFEE "C" FUTURE MAR17	55
KR4175M20(	2017-02 달러선물	48

KWH7	KC HRW WHEAT FUT MAR17	18
SBH7	Sugar #11 (WORLD) MAR17	110
SH7	SOYBEAN FUTURE MAR17	149
SMH7	SOYBEAN MEAL FUTR MAR17	70
WH7	WHEAT FUTURE(CBT) MAR17	65

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

927