공시일	2017-01-11
기준일	2017-01-10

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	2017-01-11
기준일	2017-01-10

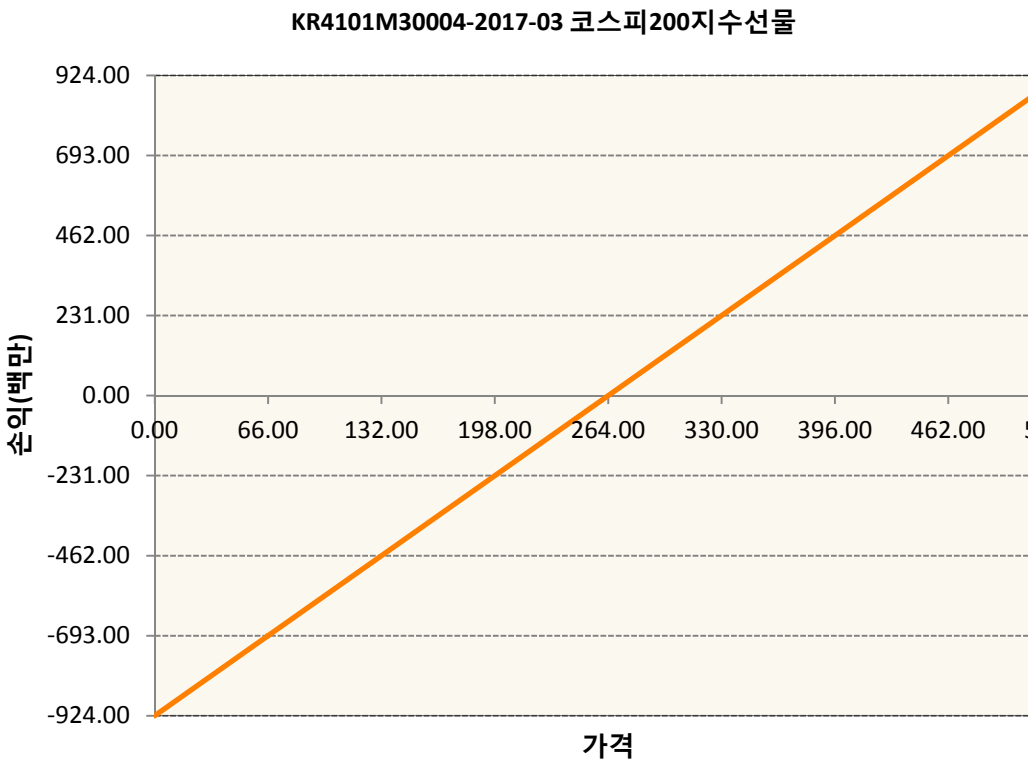
스마트인덱스모

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	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	2017-01-11
기준일	2017-01-10

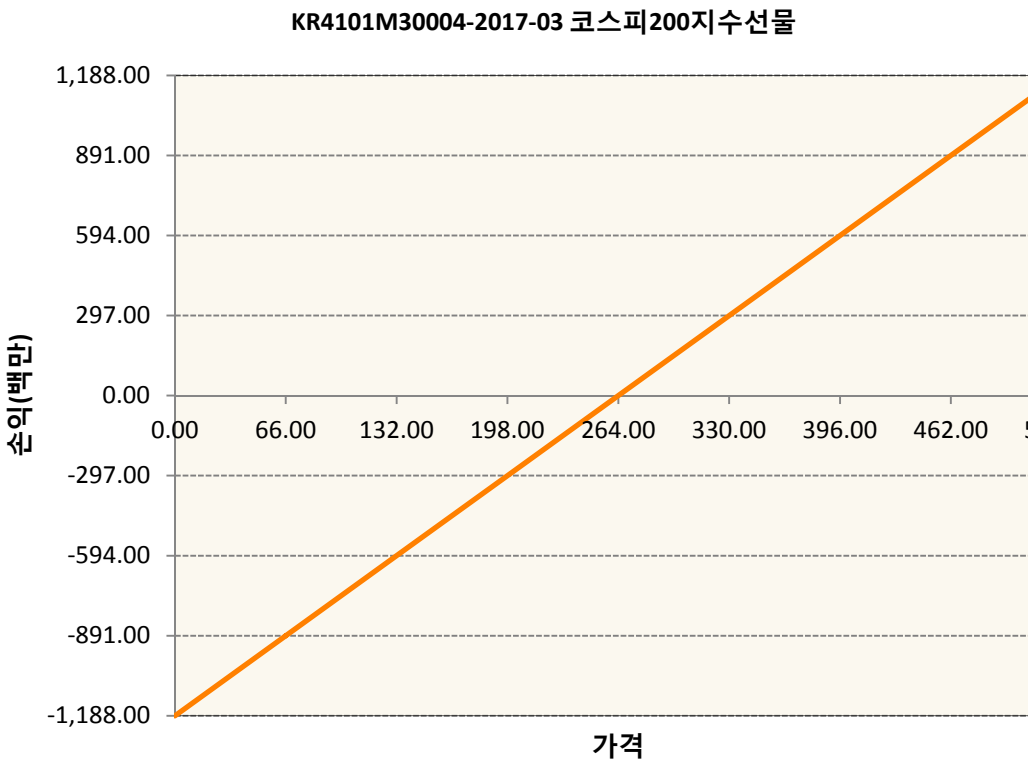
스마트레버리지목표전환형1호

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	1,188	0	1,188	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101M30(2017-03 코스피200지수선물							95
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-95	-95	-95	-95	-95	-95	-95
-5.33%	-63	-63	-63	-63	-63	-63	-63
-2.67%	-32	-32	-32	-32	-32	-32	-32
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	32	32	32	32	32	32	32
5.33%	63	63	63	63	63	63	63
8.00%	95	95	95	95	95	95	95

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

69

공시일	2017-01-11
기준일	2017-01-10

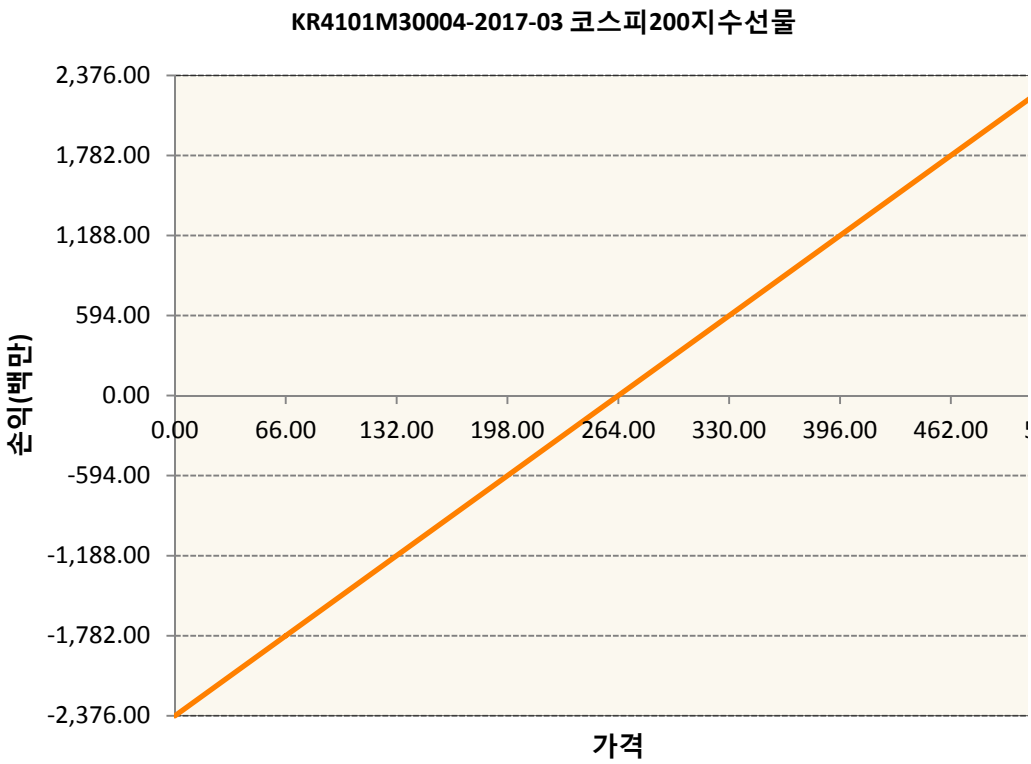
1.3배 레버리지 인덱스(주식-파생형)

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	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)

138

공시일	2017-01-11
기준일	2017-01-10

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	918

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

697

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-01-11
기준일	2017-01-10

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	386

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

640

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-01-11
기준일	2017-01-10

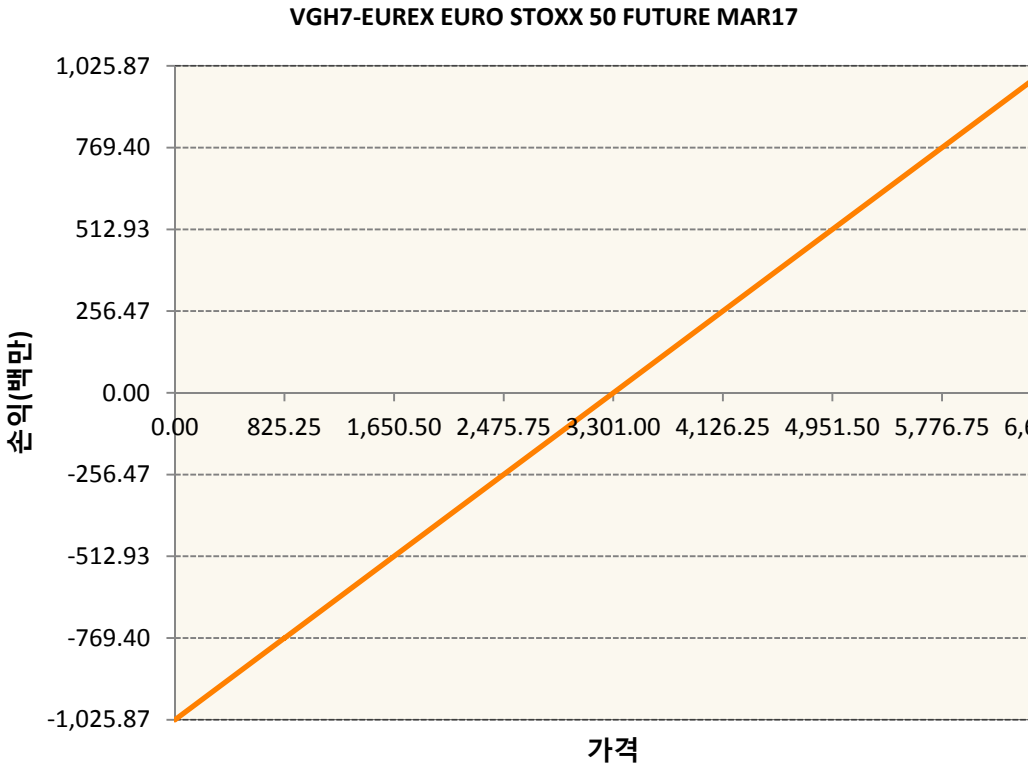
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,026	0	1,026	

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	2017-01-11
기준일	2017-01-10

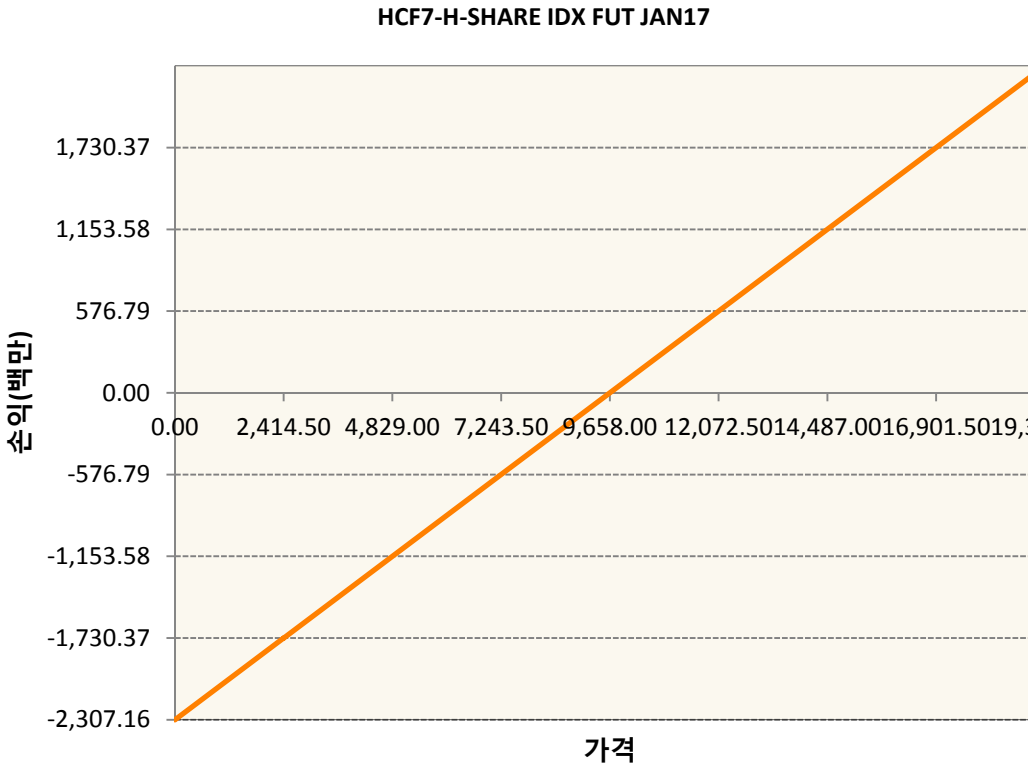
차이나인덱스모(주식-파생형)

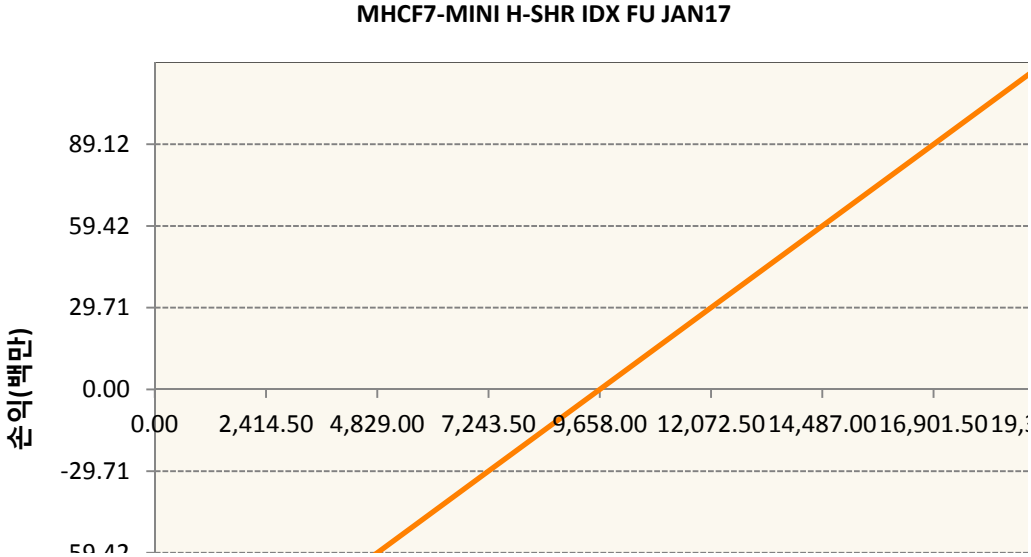
1. 계약금액

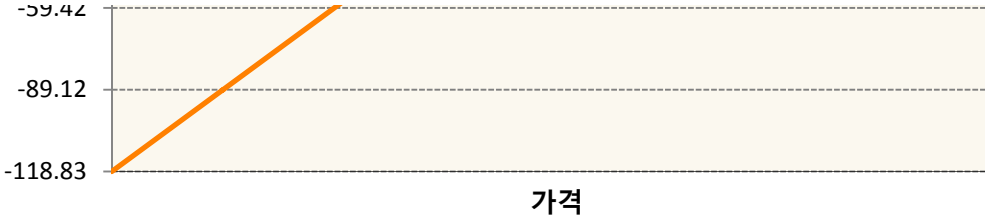
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,426	0	2,426	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCF7	H-SHARE IDX FUT JAN17	185
MHCF7	MINI H-SHR IDX FU JAN17	10

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	236

공시일	2017-01-11
기준일	2017-01-10

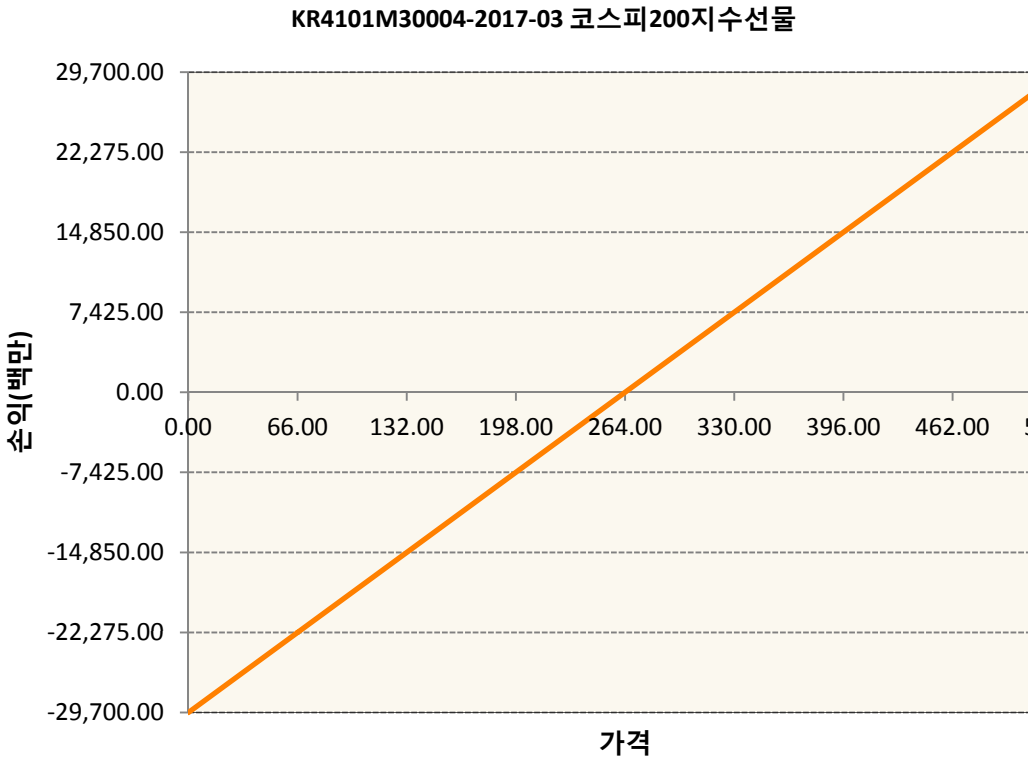
커버드콜(주식혼합-파생형)

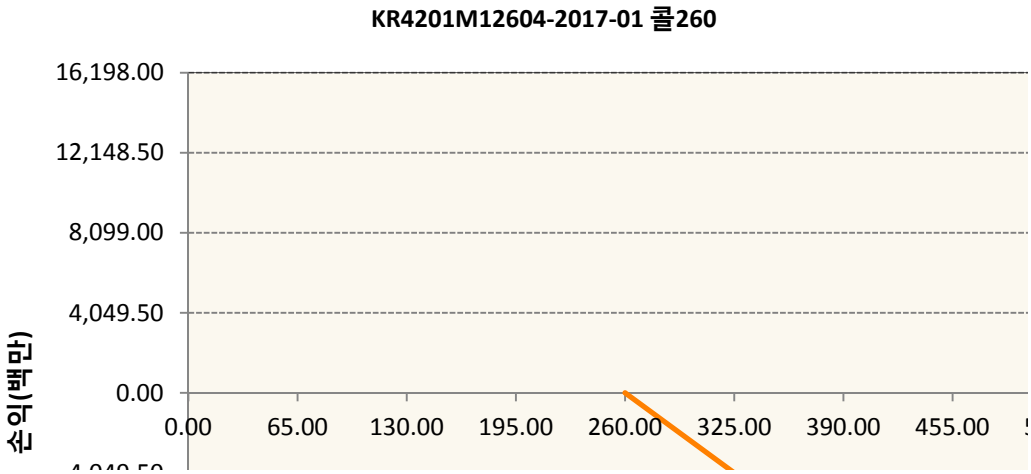
1. 계약금액

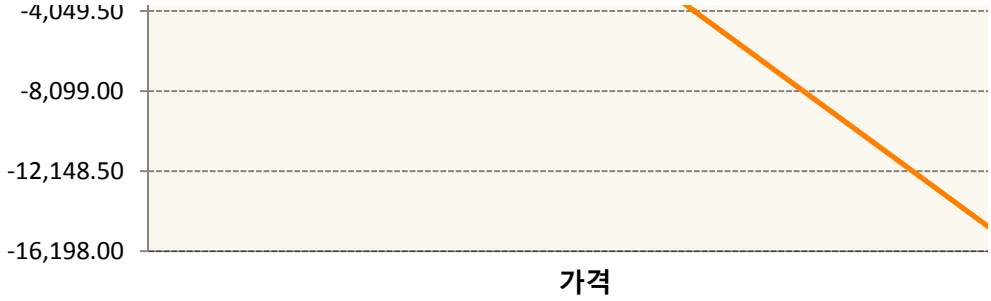
(단위:백만원)

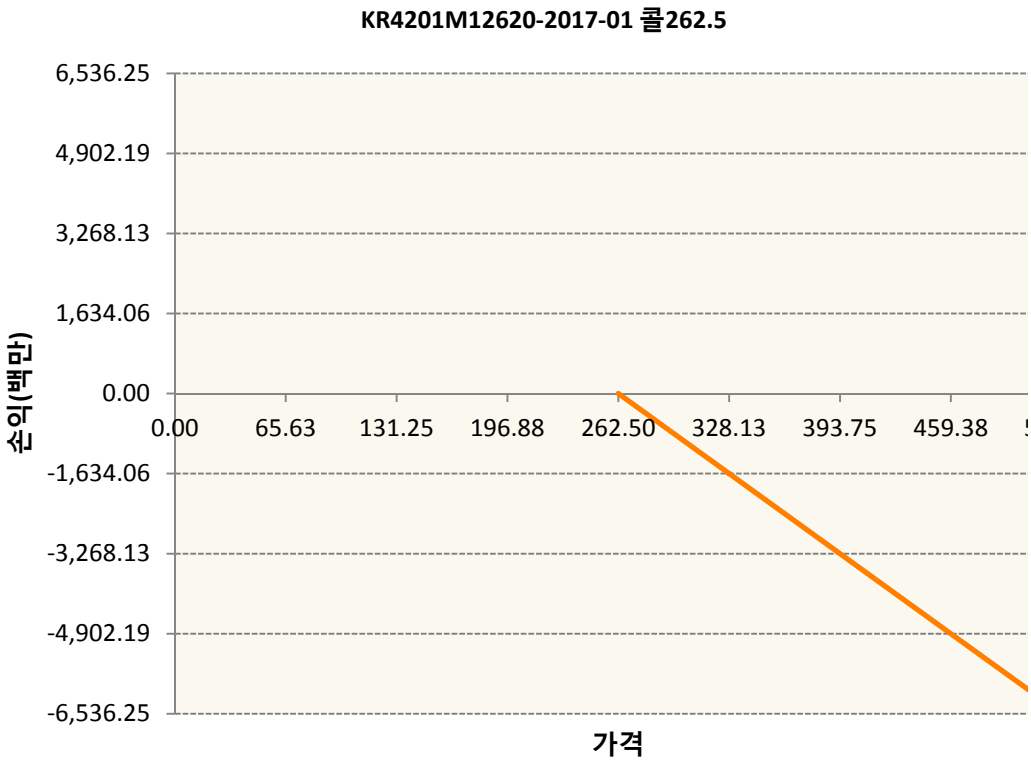
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	29,700	0	29,700	장내
누계	유가증권	옵션	0	22,734	-22,734	장내

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							6,560
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,173	1,173	1,173	1,173	1,173	1,173	1,173
-5.33%	1,173	1,173	1,173	1,173	1,173	1,173	1,173
-2.67%	1,169	1,166	1,162	1,156	1,148	1,140	1,130
0%	10	8	4	0	-6	-13	-21
2.67%	-2,179	-2,179	-2,179	-2,179	-2,179	-2,179	-2,179
5.33%	-4,369	-4,369	-4,369	-4,369	-4,369	-4,369	-4,369
8.00%	-6,560	-6,560	-6,560	-6,560	-6,560	-6,560	-6,560
KR4201M12(	2017-01 콜262.5						2,578

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	201	201	201	201	201	201	201
-5.33%	201	201	201	201	201	201	201
-2.67%	201	201	201	201	201	200	199
0%	22	15	8	0	-8	-16	-24
2.67%	-827	-827	-827	-827	-827	-827	-827
5.33%	-1,703	-1,703	-1,703	-1,703	-1,703	-1,703	-1,703
8.00%	-2,578	-2,578	-2,578	-2,578	-2,578	-2,578	-2,578

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

15,258

공시일	2017-01-11
기준일	2017-01-10

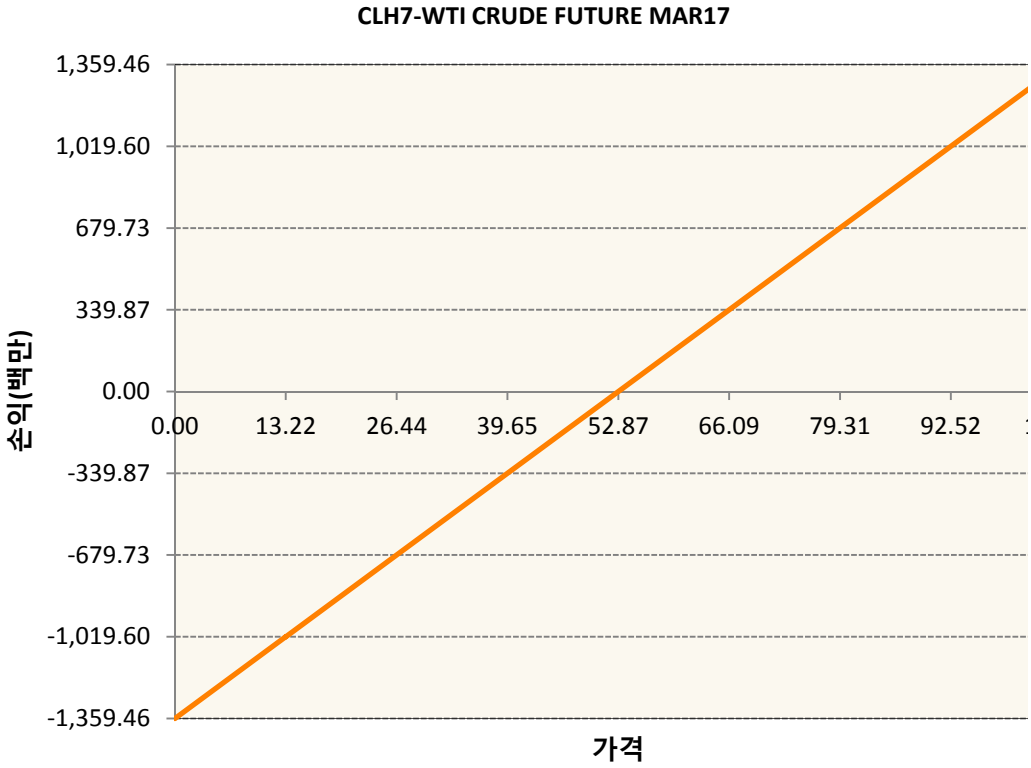
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

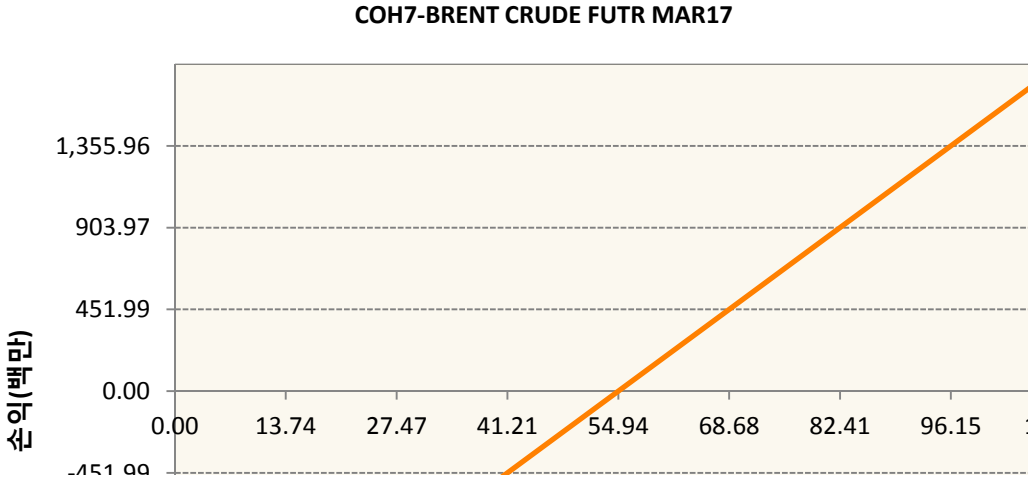
1. 계약금액

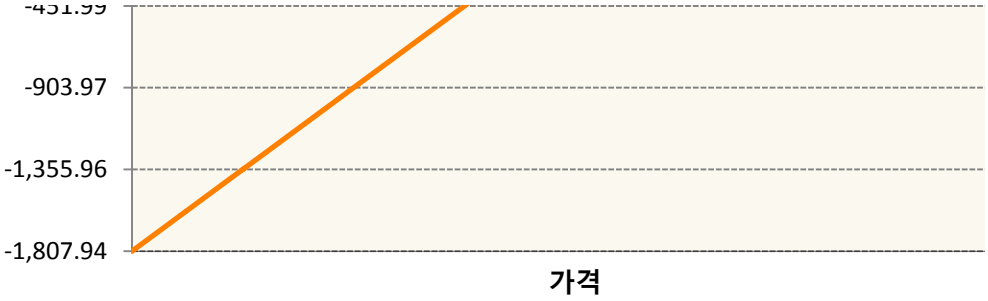
(단위:백만원)

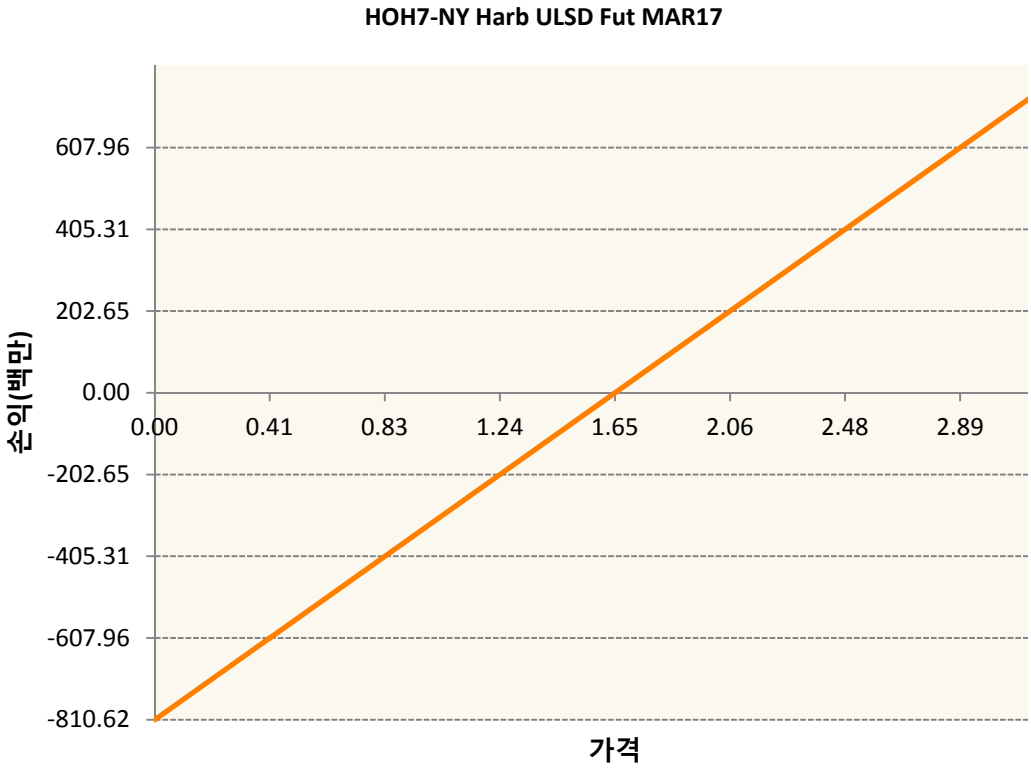
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	선물	유가증권	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	선물	유가증권	1,359	0	1,359	
누계	유가증권	선물	4,923	430	4,493	

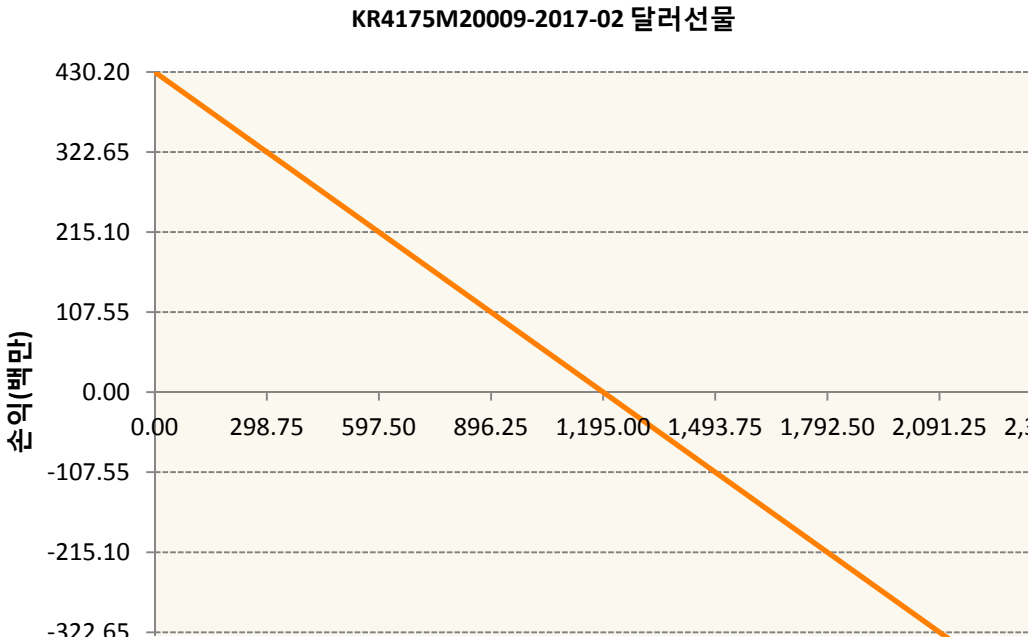
2. 만기시점의 손익구조

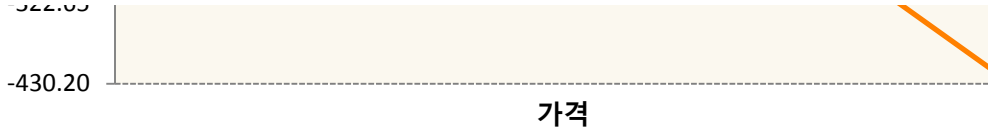


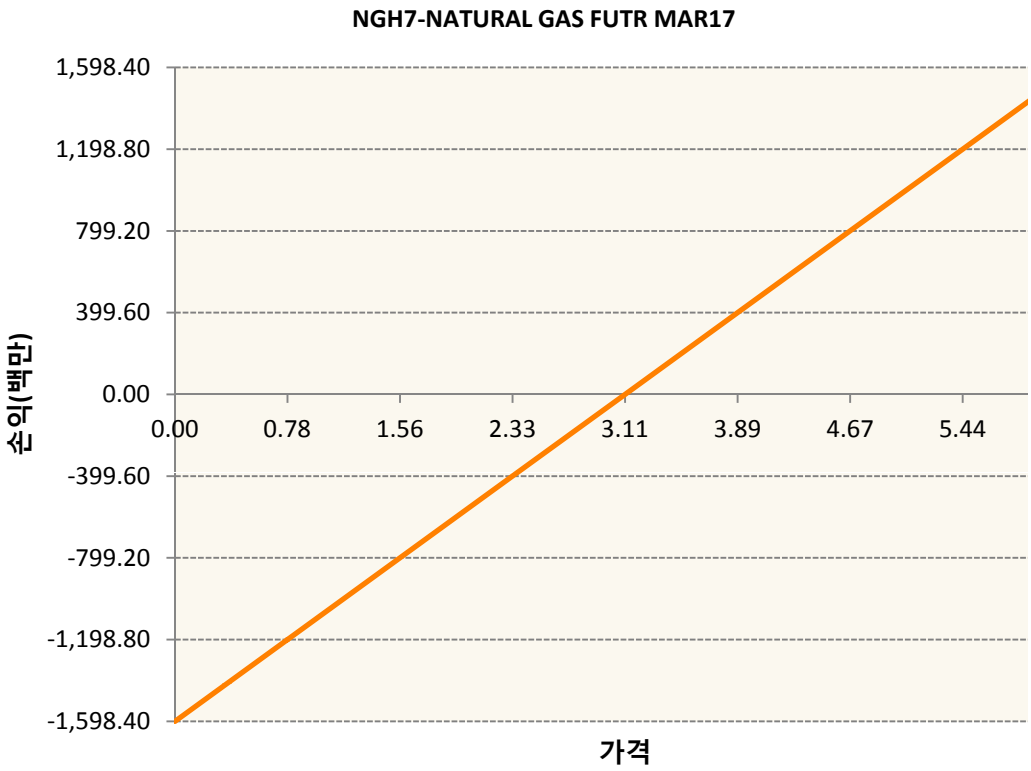


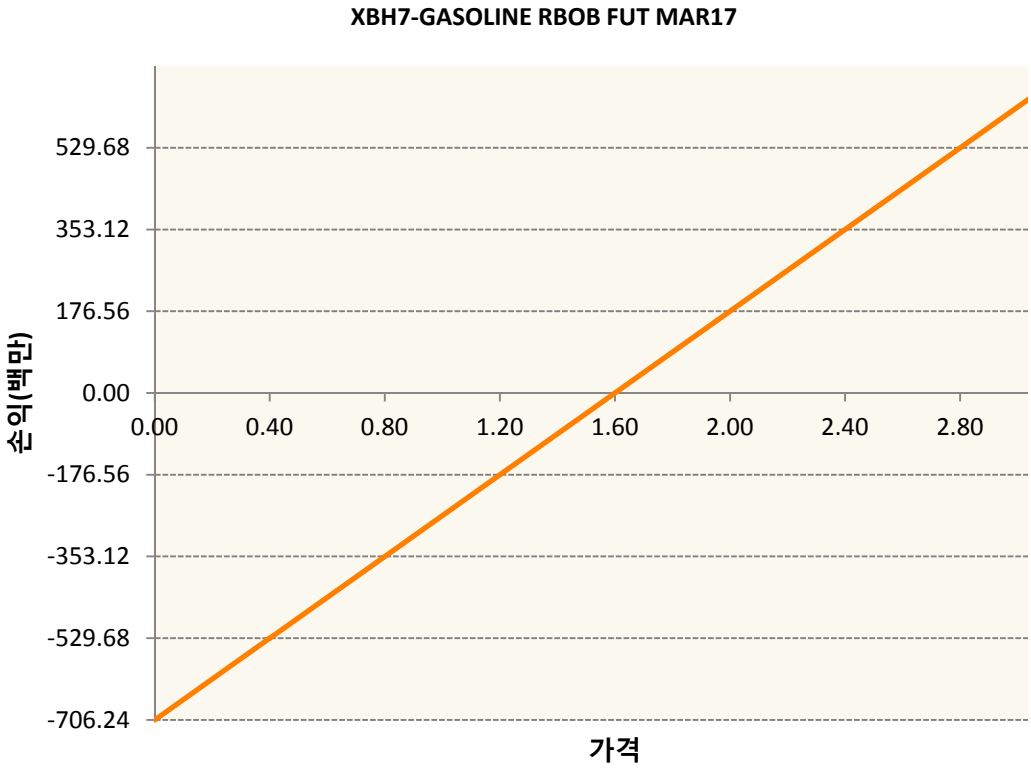

-903.97
-1,355.96
-1,807.94
가격


HOH7-NY Harb ULSD Fut MAR17
607.96
405.31
202.65
0.00
-202.65
-405.31
-607.96
-810.62
0.00
0.41
0.83
1.24
1.65
2.06
2.48
2.89
순익(백만)
가격


KR4175M20009-2017-02 달러선물
430.20
322.65
215.10
107.55
0.00
-107.55
-215.10
-322.65
0.00
298.75
597.50
896.25
1,195.00
1,493.75
1,792.50
2,091.25
순익(백만)


-430.20
가격


NGH7-NATURAL GAS FUTR MAR17
1,598.40
1,198.80
799.20
399.60
0.00
-399.60
-799.20
-1,198.80
-1,598.40
0.00
0.78
1.56
2.33
3.11
3.89
4.67
5.44
순익(백만)
가격


XBH7-GASOLINE RBOB FUT MAR17
529.68
353.12
176.56
0.00
-176.56
-353.12
-529.68
-706.24
0.00
0.40
0.80
1.20
1.60
2.00
2.40
2.80
순익(백만)
가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLH7	WTI CRUDE FUTURE MAR17	109
COH7	BRENT CRUDE FUTR MAR17	145
HOH7	NY Harb ULSD Fut MAR17	65
KR4175M20(	2017-02 달러선물	34
NGH7	NATURAL GAS FUTR MAR17	128
XBH7	GASOLINE RBOB FUT MAR17	56

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

1,167

공시일	2017-01-11
기준일	2017-01-10

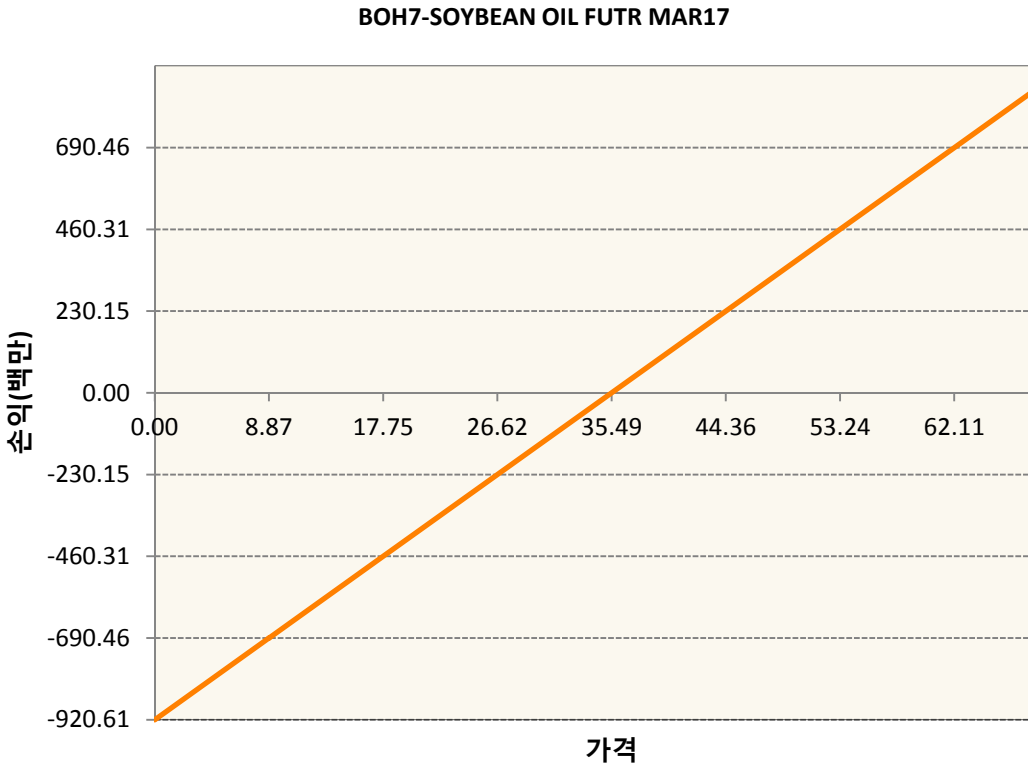
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

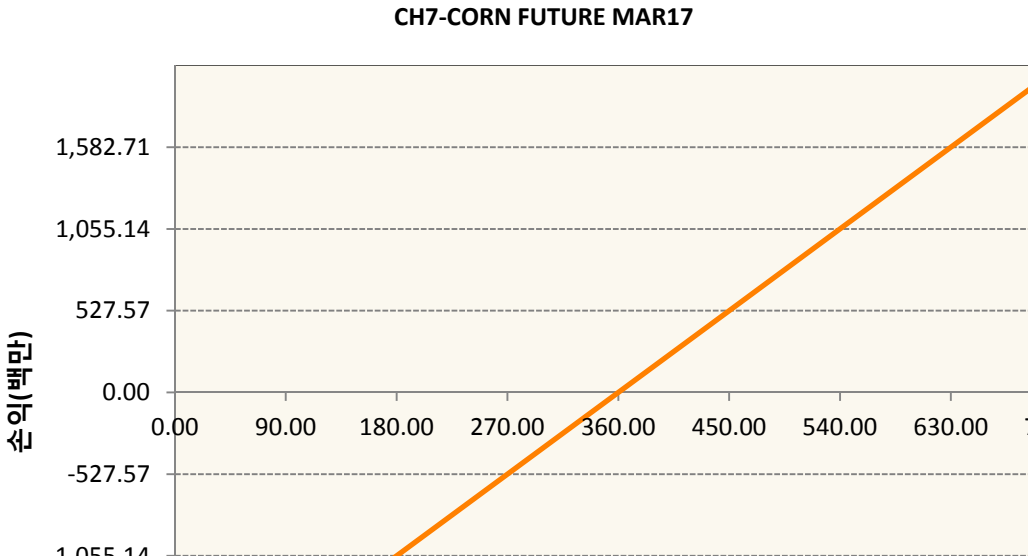
1. 계약금액

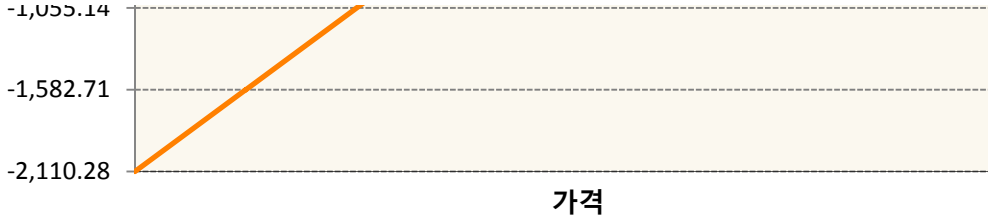
(단위:백만원)

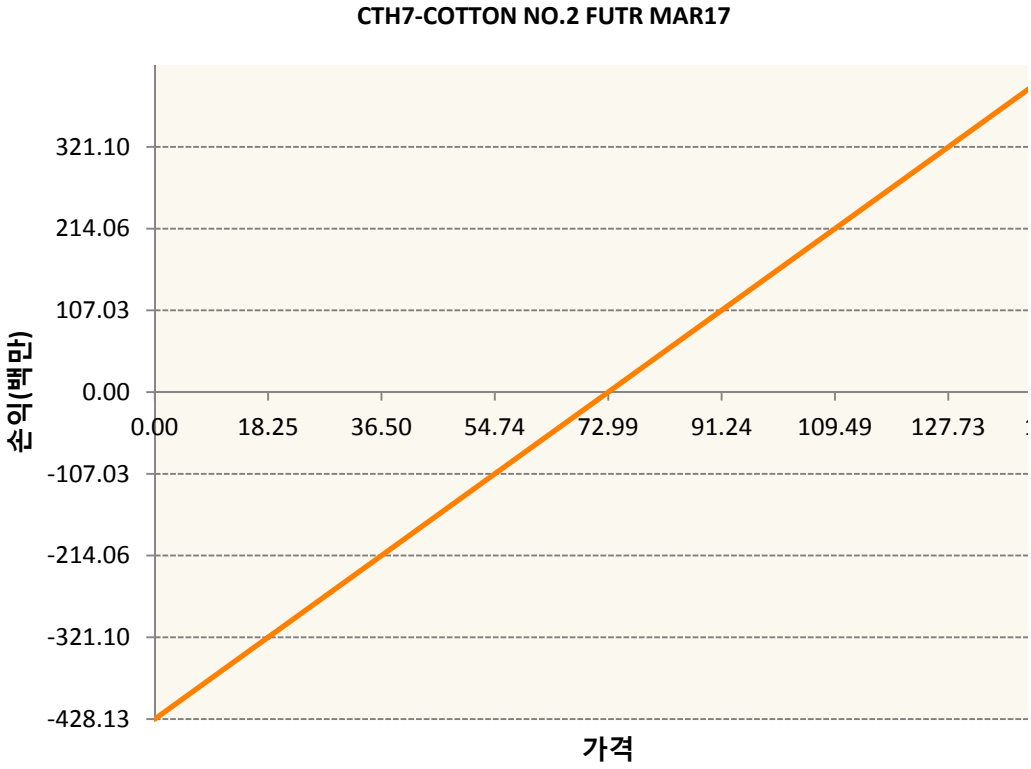
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	9,327	598	8,729	

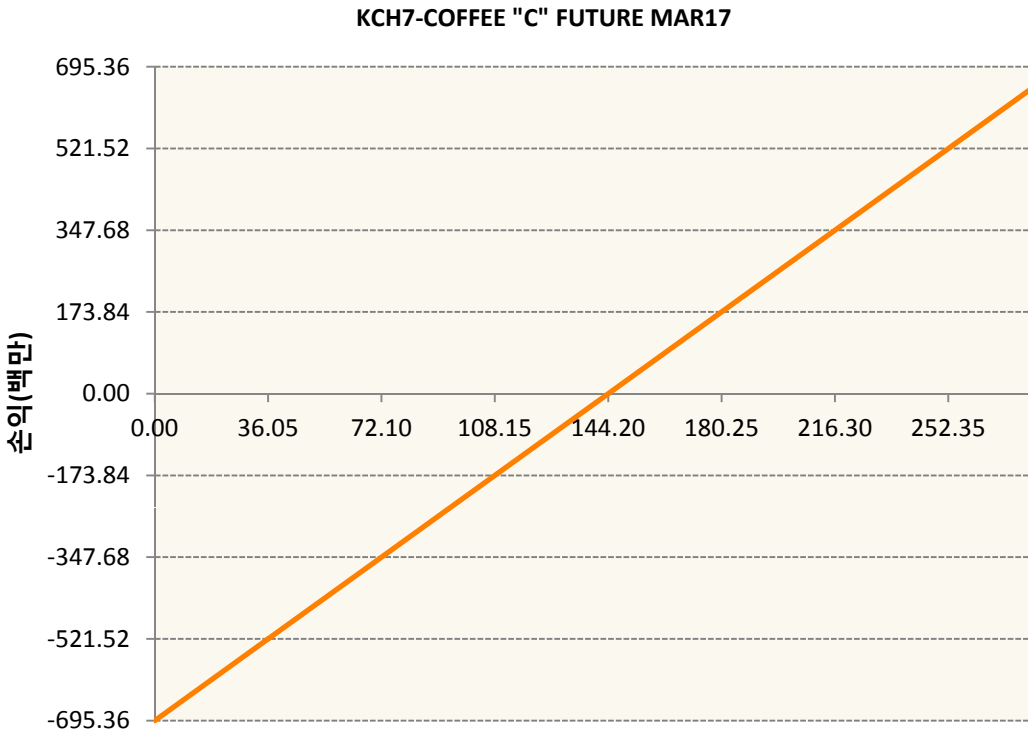
2. 만기시점의 손익구조



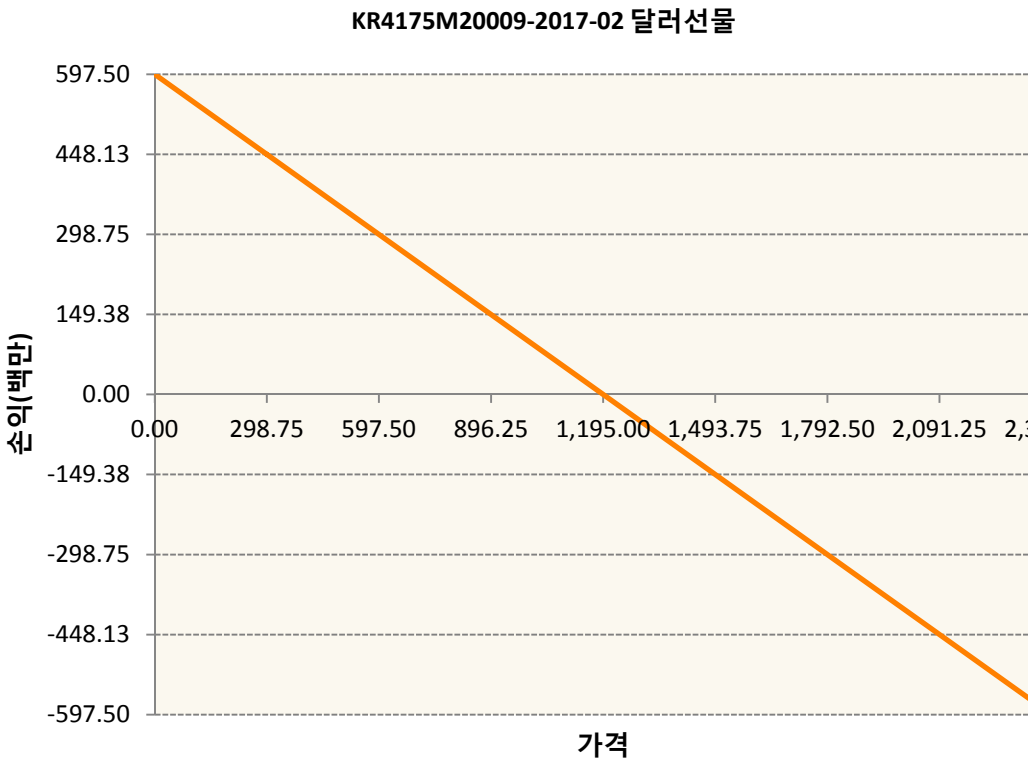


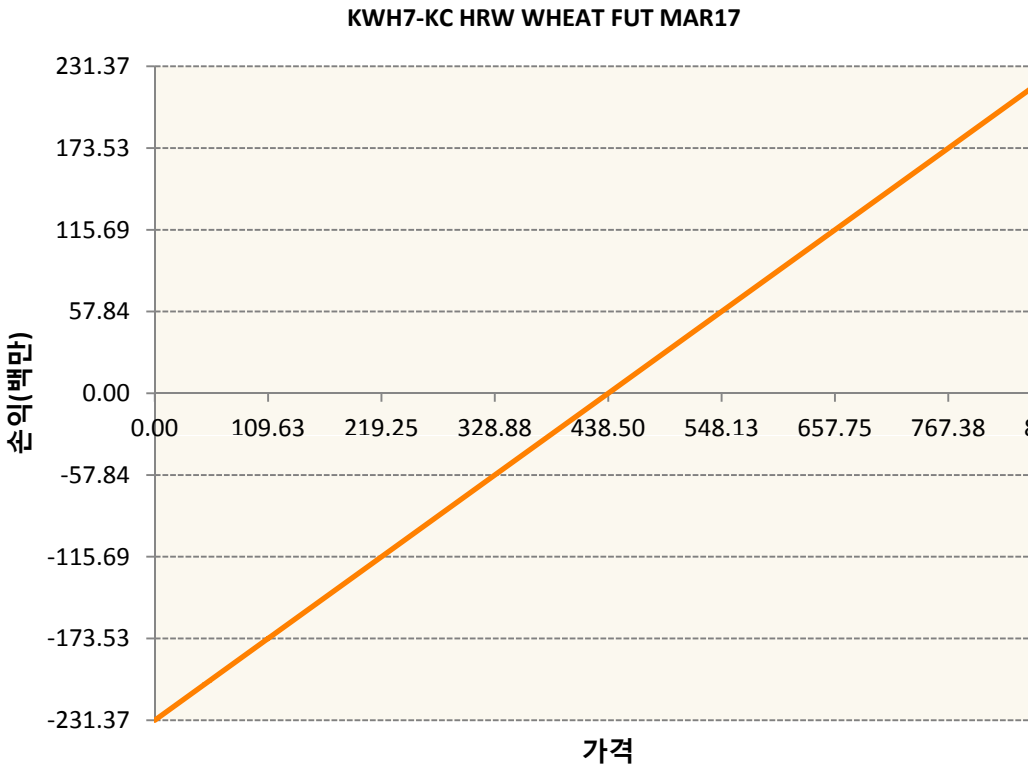

-1,582.71
-2,110.28
가격

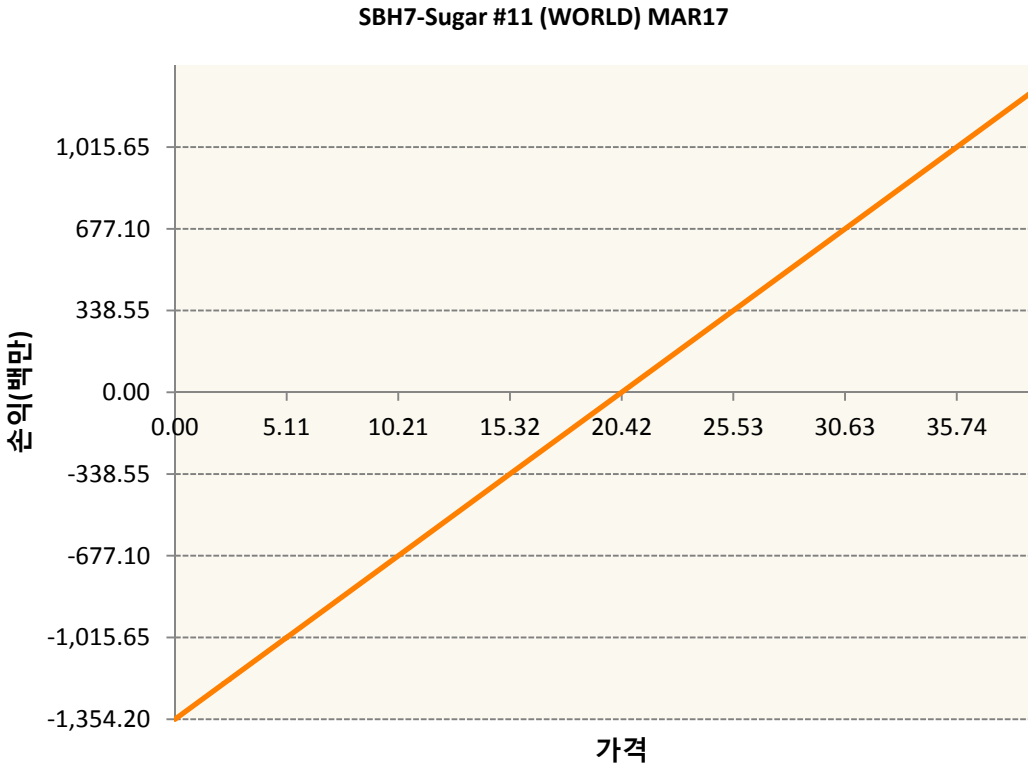

CTH7-COTTON NO.2 FUTR MAR17
321.10
214.06
107.03
0.00
-107.03
-214.06
-321.10
-428.13
0.00
18.25
36.50
54.74
72.99
91.24
109.49
127.73
순익(백만)
가격

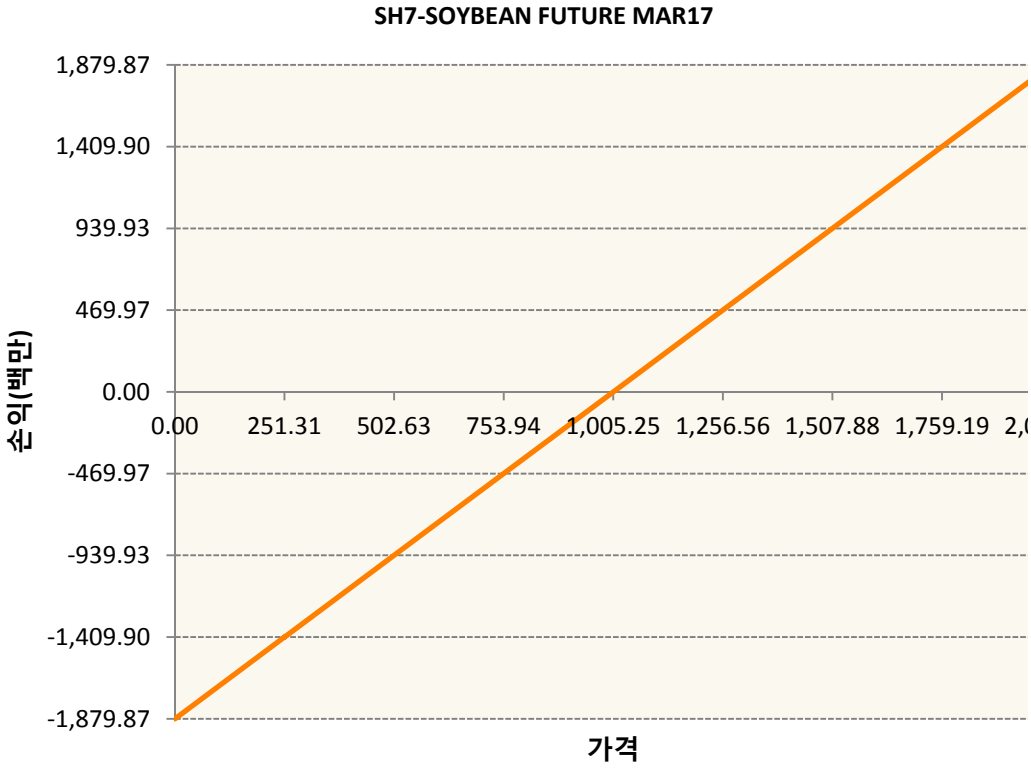

KCH7-COFFEE "C" FUTURE MAR17
695.36
521.52
347.68
173.84
0.00
-173.84
-347.68
-521.52
-695.36
0.00
36.05
72.10
108.15
144.20
180.25
216.30
252.35
순익(백만)

가격

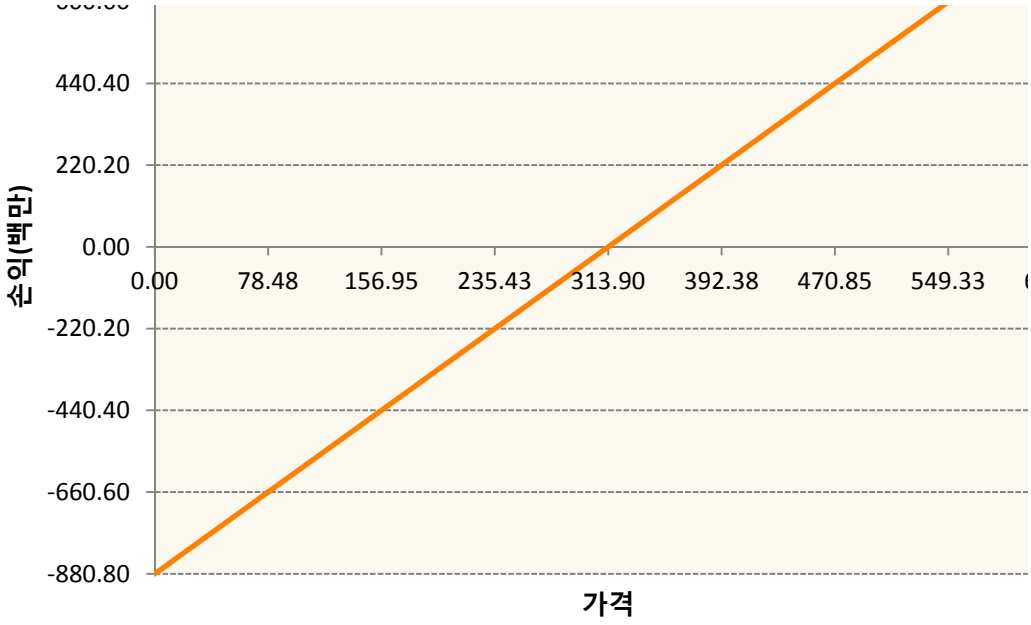

KR4175M20009-2017-02 달러선물
597.50
448.13
298.75
149.38
0.00
-149.38
-298.75
-448.13
-597.50
0.00
298.75
597.50
896.25
1,195.00
1,493.75
1,792.50
2,091.25
손익(만원)
가격

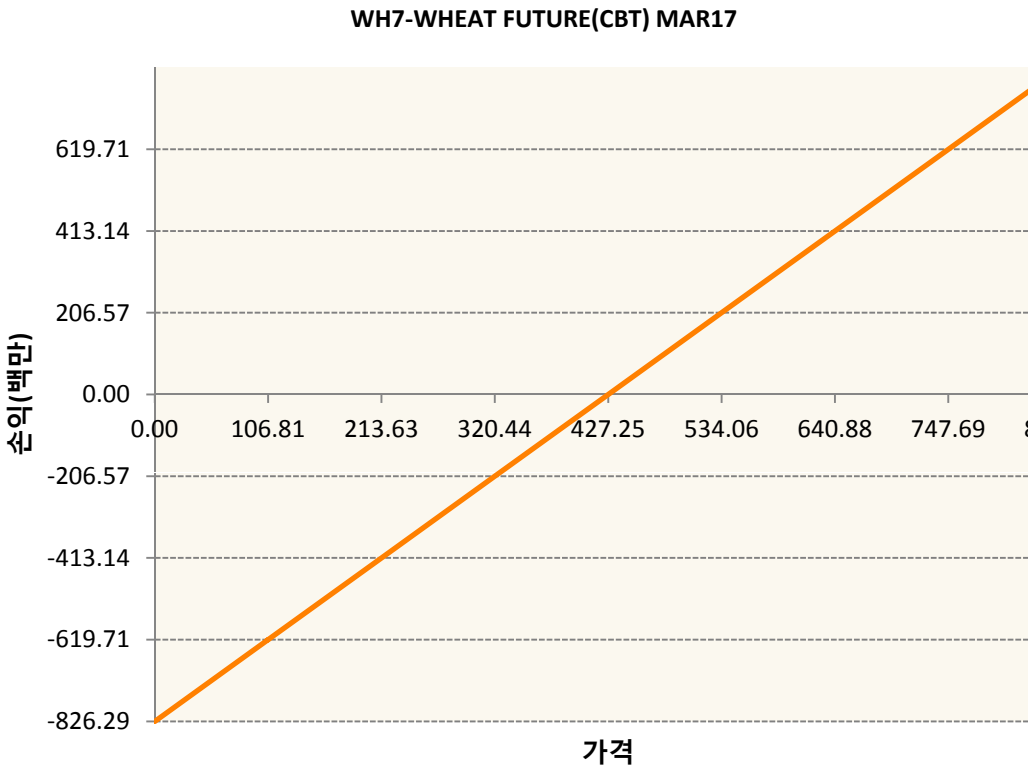

KWH7-KC HRW WHEAT FUT MAR17
231.37
173.53
115.69
57.84
0.00
-57.84
-115.69
-173.53
-231.37
0.00
109.63
219.25
328.88
438.50
548.13
657.75
767.38
손익(만원)
가격


SBH7-Sugar #11 (WORLD) MAR17
1,015.65
677.10
338.55
0.00
-338.55
-677.10
-1,015.65
-1,354.20
0.00
5.11
10.21
15.32
20.42
25.53
30.63
35.74
손익(백만)
가격


SH7-SOYBEAN FUTURE MAR17
1,879.87
1,409.90
939.93
469.97
0.00
-469.97
-939.93
-1,409.90
-1,879.87
0.00
251.31
502.63
753.94
1,005.25
1,256.56
1,507.88
1,759.19
손익(백만)
가격


SMH7-SOYBEAN MEAL FUTR MAR17
880.80
660.60





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

BOH7	SOYBEAN OIL FUTR MAR17	74
CH7	CORN FUTURE MAR17	169
CTH7	COTTON NO.2 FUTR MAR17	34
KCH7	COFFEE "C" FUTURE MAR17	56
KR4175M20(	2017-02 달러선물	48

KWH7	KC HRW WHEAT FUT MAR17	19
SBH7	Sugar #11 (WORLD) MAR17	108
SH7	SOYBEAN FUTURE MAR17	150
SMH7	SOYBEAN MEAL FUTR MAR17	70
WH7	WHEAT FUTURE(CBT) MAR17	66

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

930