공시일	2017-01-12
기준일	2017-01-11

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	2017-01-12
기준일	2017-01-11

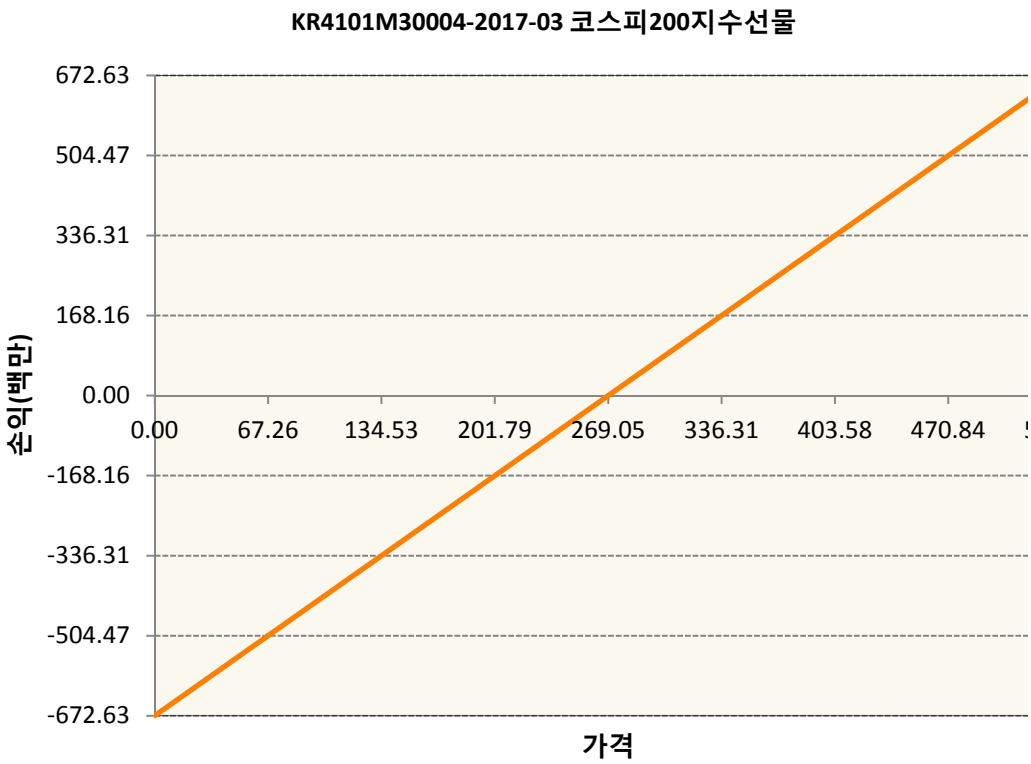
스마트인덱스모

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	266	-266	장내
누계	유가증권	선물	673	0	673	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101M30(2017-03 코스피200지수선물							54
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-54	-54	-54	-54	-54	-54	-54
-5.33%	-36	-36	-36	-36	-36	-36	-36
-2.67%	-18	-18	-18	-18	-18	-18	-18
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	18	18	18	18	18	18	18
5.33%	36	36	36	36	36	36	36
8.00%	54	54	54	54	54	54	54

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

39

공시일	2017-01-12
기준일	2017-01-11

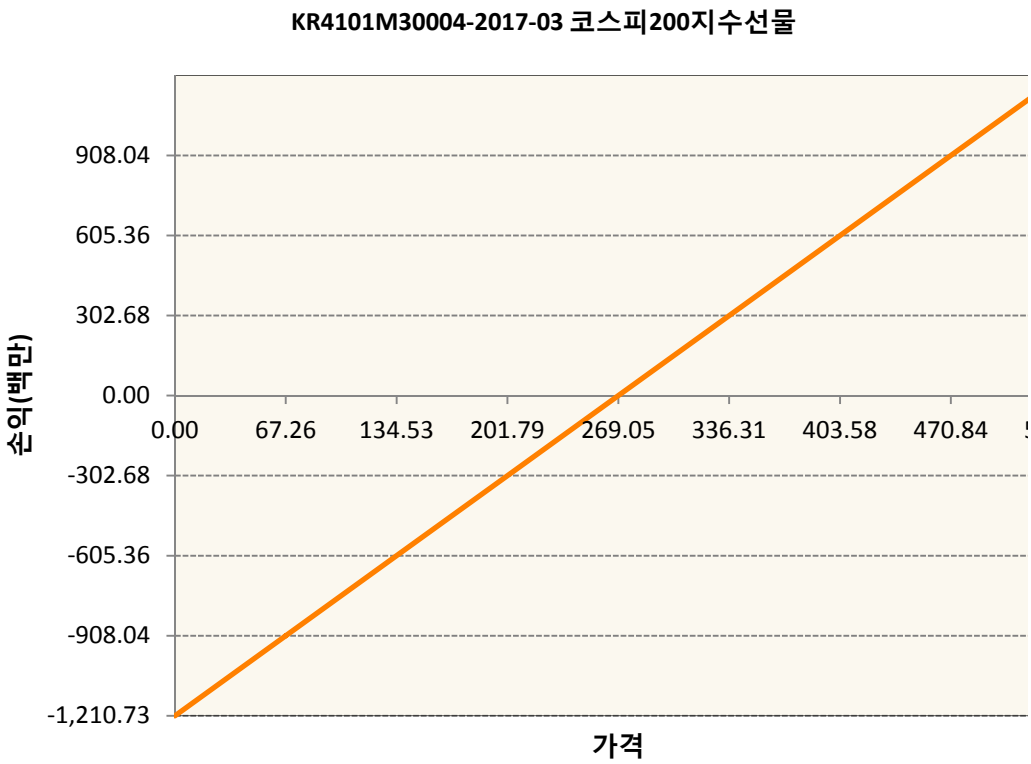
스마트레버리지목표전환형1호

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	1,211	0	1,211	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101M30(2017-03 코스피200지수선물							97
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-97	-97	-97	-97	-97	-97	-97
-5.33%	-64	-64	-64	-64	-64	-64	-64
-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%	64	64	64	64	64	64	64
8.00%	97	97	97	97	97	97	97

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

71

공시일	2017-01-12
기준일	2017-01-11

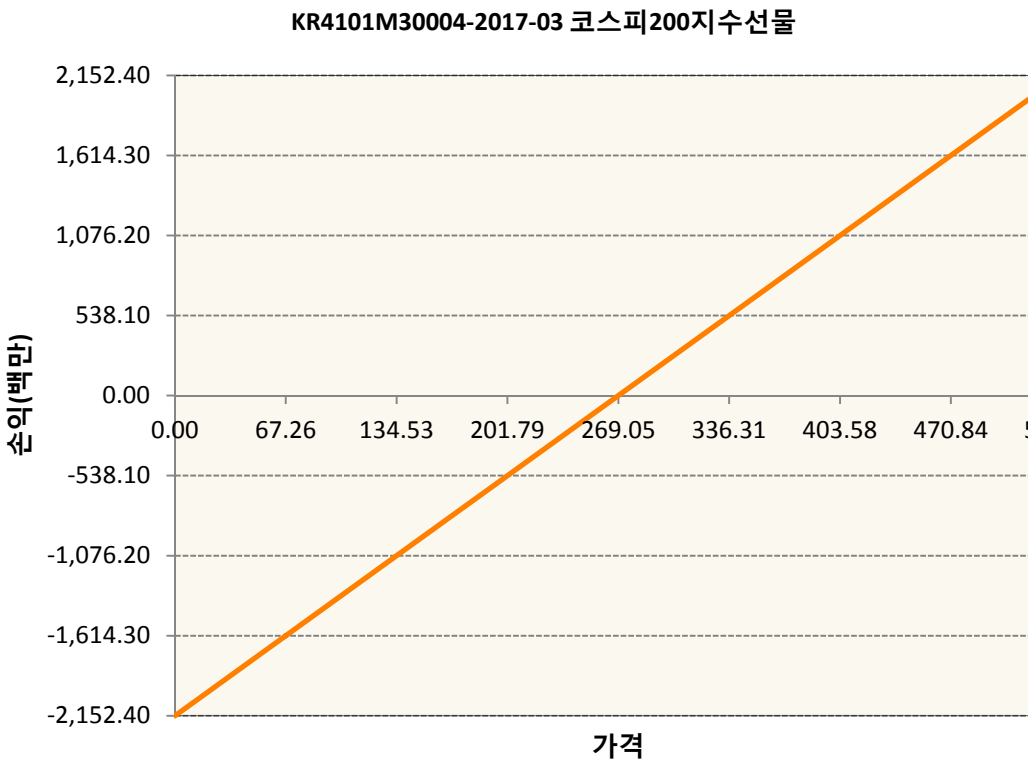
1.3배 레버리지 인덱스(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	269	-269	장내
누계	유가증권	선물	2,152	0	2,152	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101M30(2017-03 코스피200지수선물							172
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-172	-172	-172	-172	-172	-172	-172
-5.33%	-114	-114	-114	-114	-114	-114	-114
-2.67%	-57	-57	-57	-57	-57	-57	-57
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	57	57	57	57	57	57	57
5.33%	114	114	114	114	114	114	114
8.00%	172	172	172	172	172	172	172

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

126

공시일	2017-01-12
기준일	2017-01-11

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	919

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

696

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-01-12
기준일	2017-01-11

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	381

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

631

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-01-12
기준일	2017-01-11

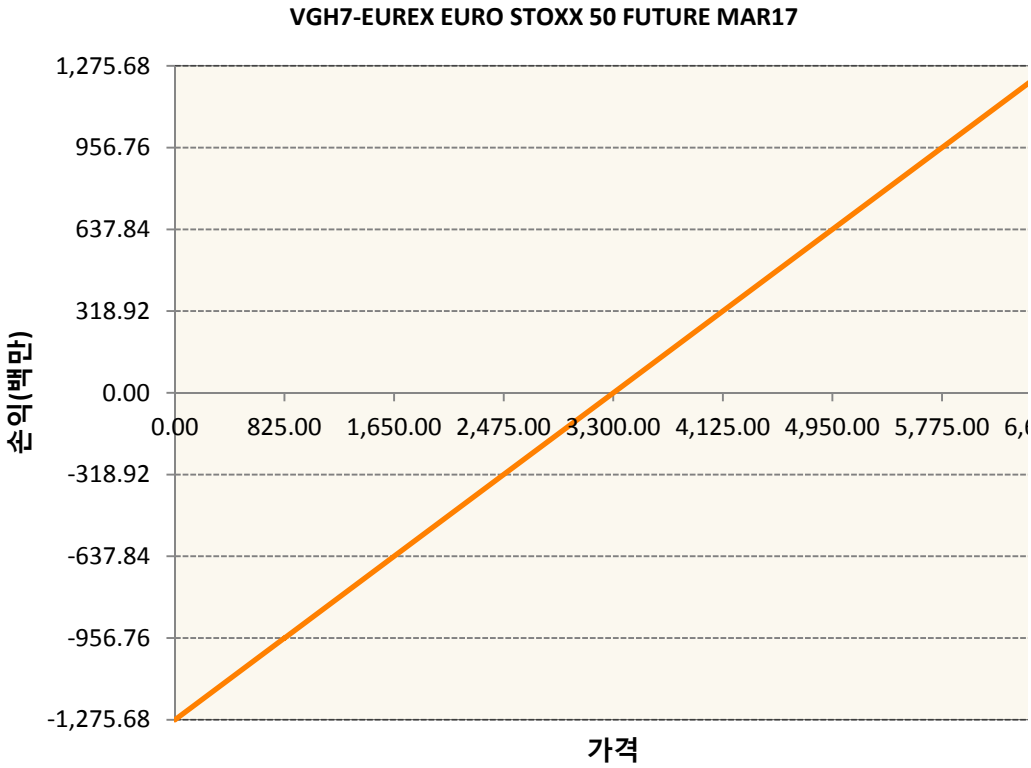
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,276	0	1,276	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGH7	EUREX EURO STOXX 50 FUTURE MAR17	102

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

(단위:백만원)

117

공시일	2017-01-12
기준일	2017-01-11

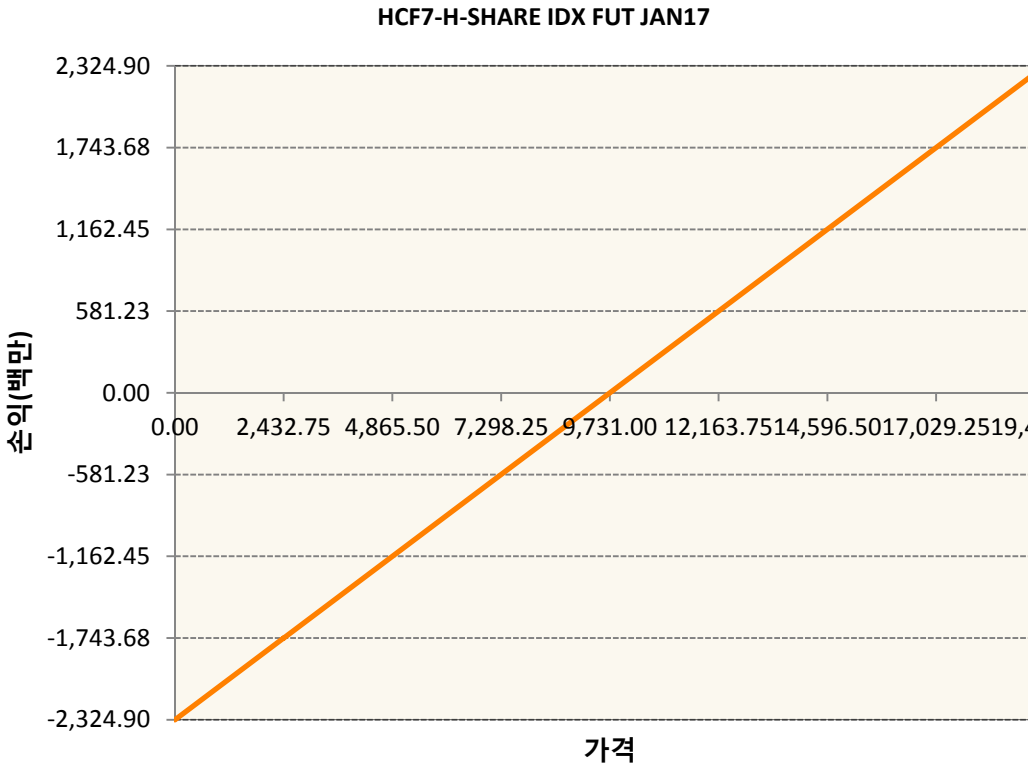
차이나인덱스모(주식-파생형)

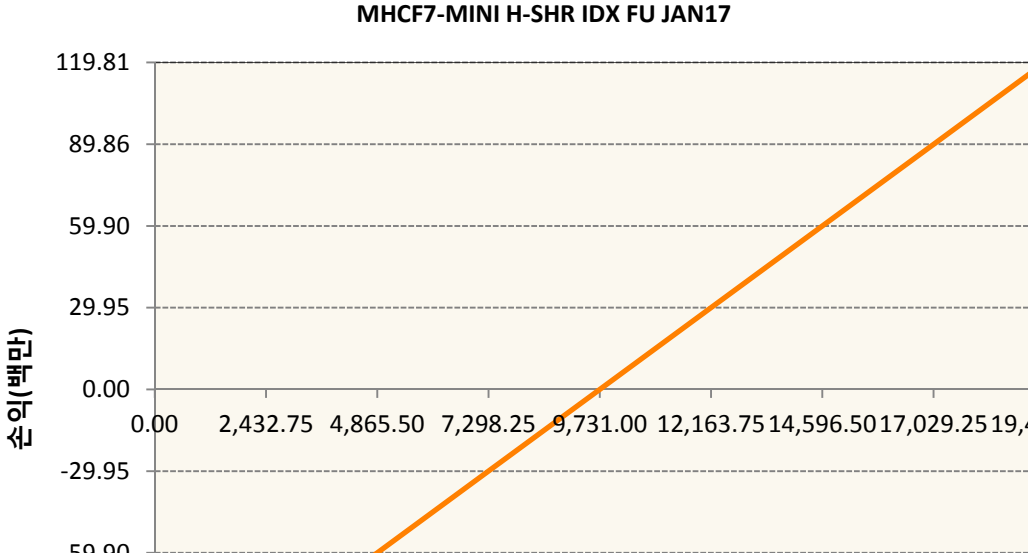
1. 계약금액

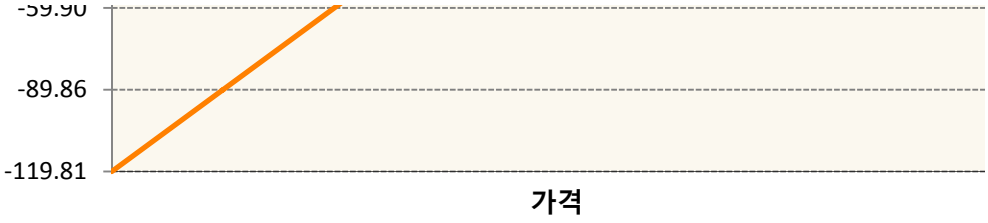
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,445	0	2,445	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

HCF7	H-SHARE IDX FUT JAN17	186
MHCF7	MINI H-SHR IDX FU JAN17	10

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

238

공시일	2017-01-12
기준일	2017-01-11

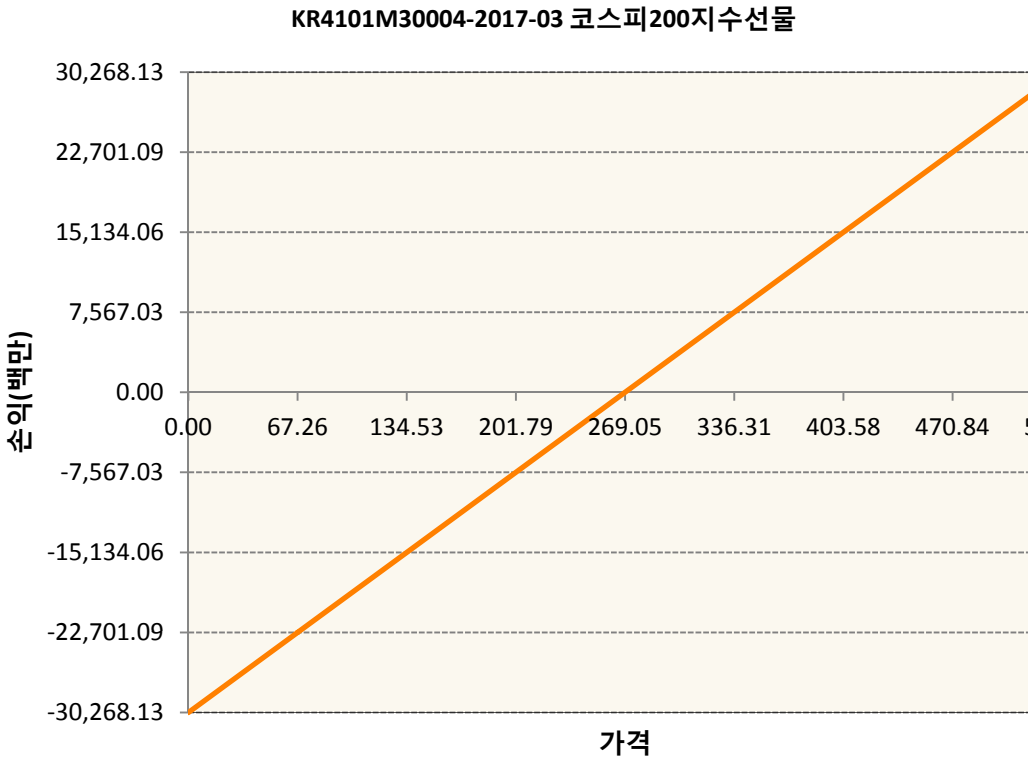
커버드콜(주식혼합-파생형)

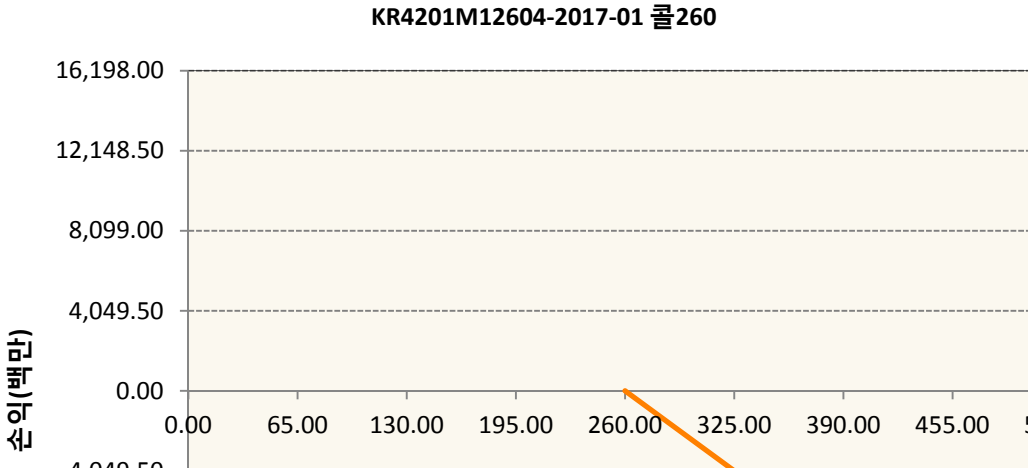
1. 계약금액

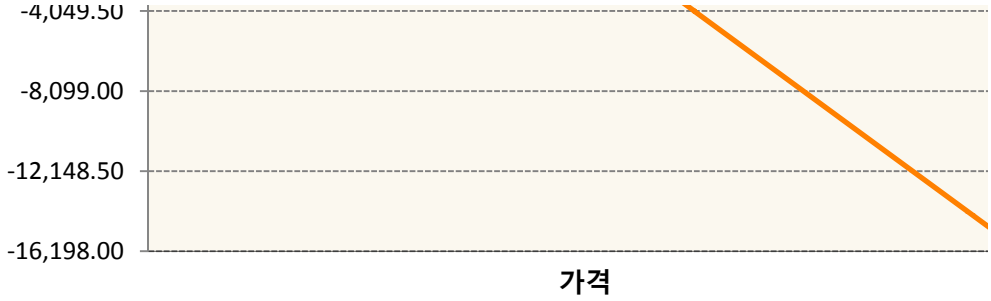
(단위:백만원)

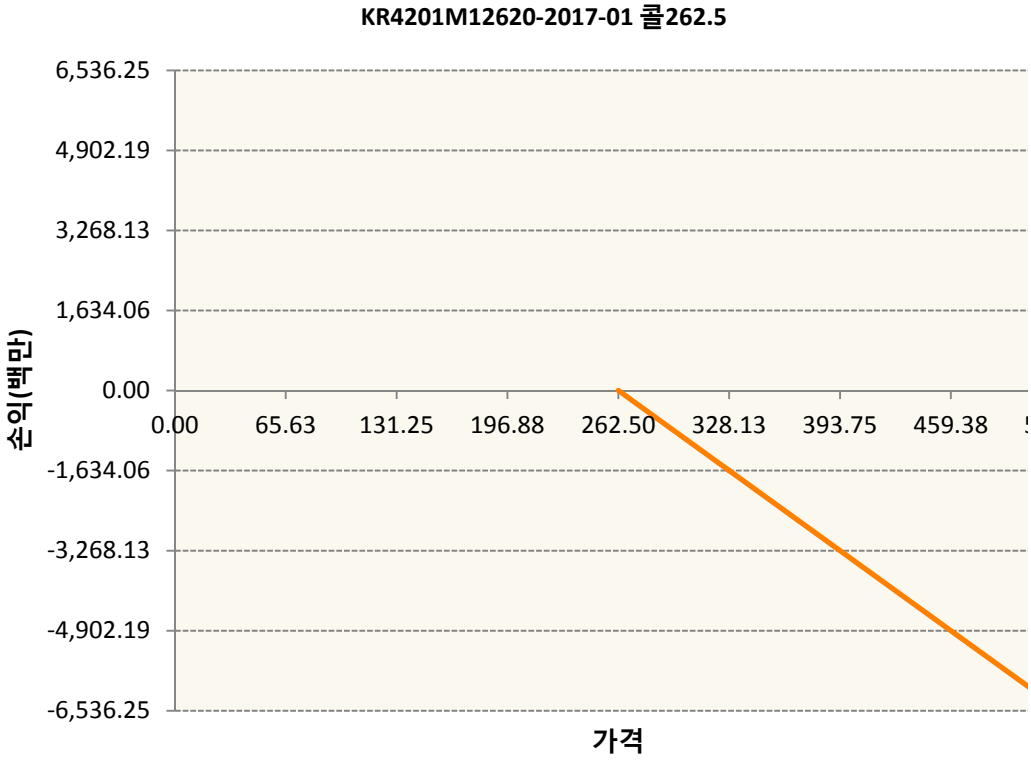
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	30,268	0	30,268	장내
누계	유가증권	옵션	0	22,734	-22,734	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101M30(2017-03 코스피200지수선물							2,413
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-2,413	-2,413	-2,413	-2,413	-2,413	-2,413	-2,413
-5.33%	-1,609	-1,609	-1,609	-1,609	-1,609	-1,609	-1,609
-2.67%	-804	-804	-804	-804	-804	-804	-804
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	804	804	804	804	804	804	804
5.33%	1,609	1,609	1,609	1,609	1,609	1,609	1,609
8.00%	2,413	2,413	2,413	2,413	2,413	2,413	2,413
KR4201M12(2017-01 콜260							6,682
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	2,538	2,538	2,538	2,538	2,538	2,538	2,538
-5.33%	2,538	2,538	2,538	2,538	2,538	2,538	2,538
-2.67%	2,188	2,176	2,164	2,151	2,138	2,124	2,110
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-2,227	-2,227	-2,227	-2,227	-2,227	-2,227	-2,227
5.33%	-4,455	-4,455	-4,455	-4,455	-4,455	-4,455	-4,455
8.00%	-6,682	-6,682	-6,682	-6,682	-6,682	-6,682	-6,682
KR4201M12(	2017-01 콜262.5						2,671

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	703	703	703	703	703	703	703
-5.33%	703	703	703	703	703	703	703
-2.67%	696	693	690	686	682	677	672
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-890	-890	-890	-890	-890	-890	-890
5.33%	-1,780	-1,780	-1,780	-1,780	-1,780	-1,780	-1,780
8.00%	-2,671	-2,671	-2,671	-2,671	-2,671	-2,671	-2,671

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

12,189

공시일	2017-01-12
기준일	2017-01-11

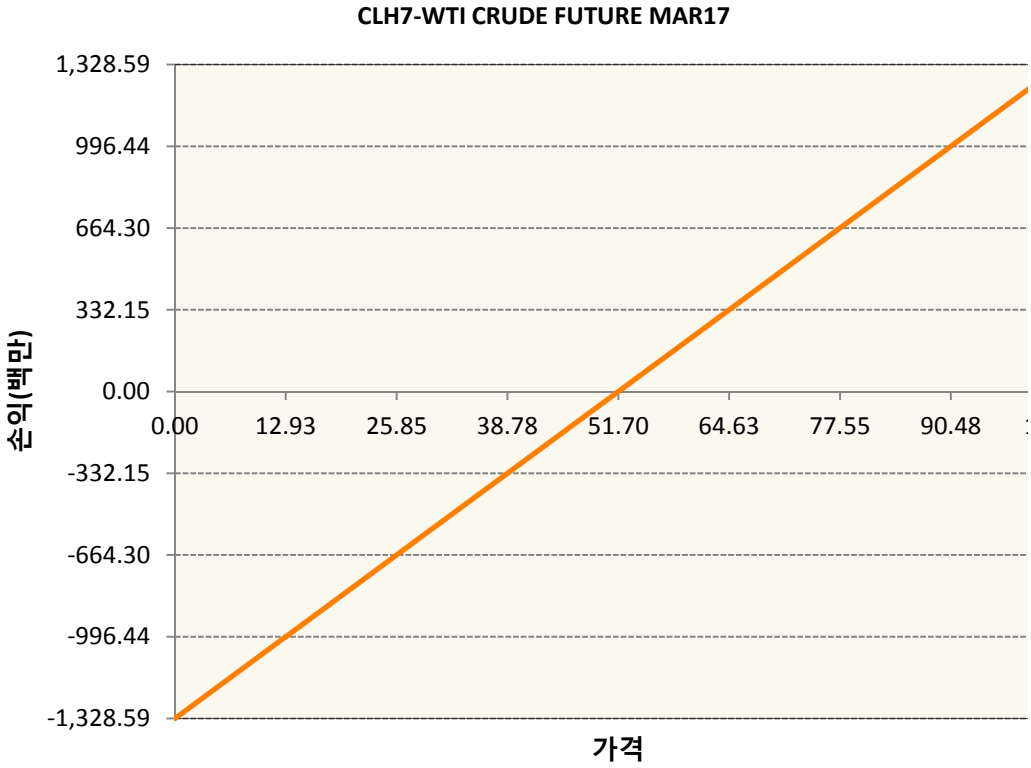
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

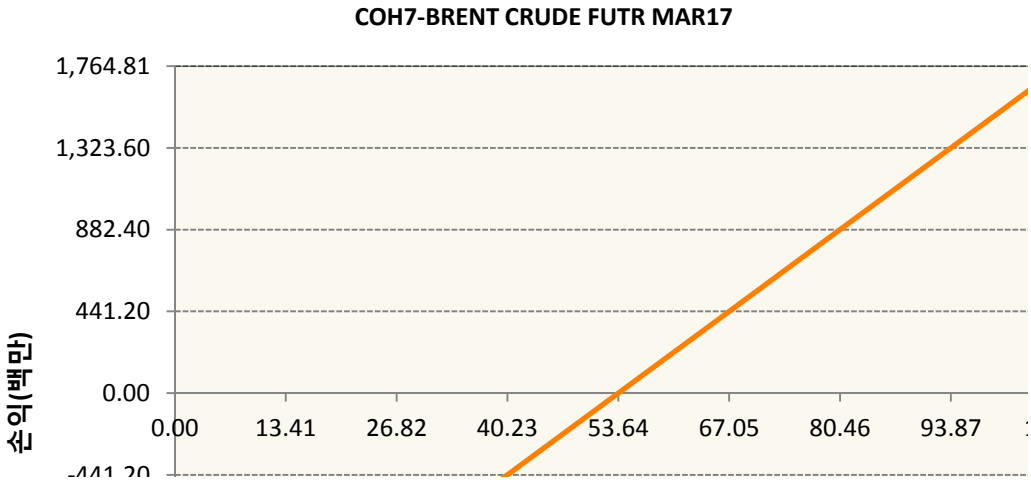
1. 계약금액

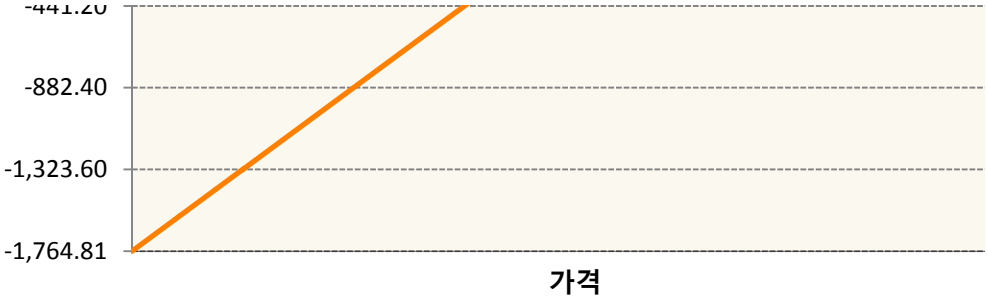
(단위:백만원)

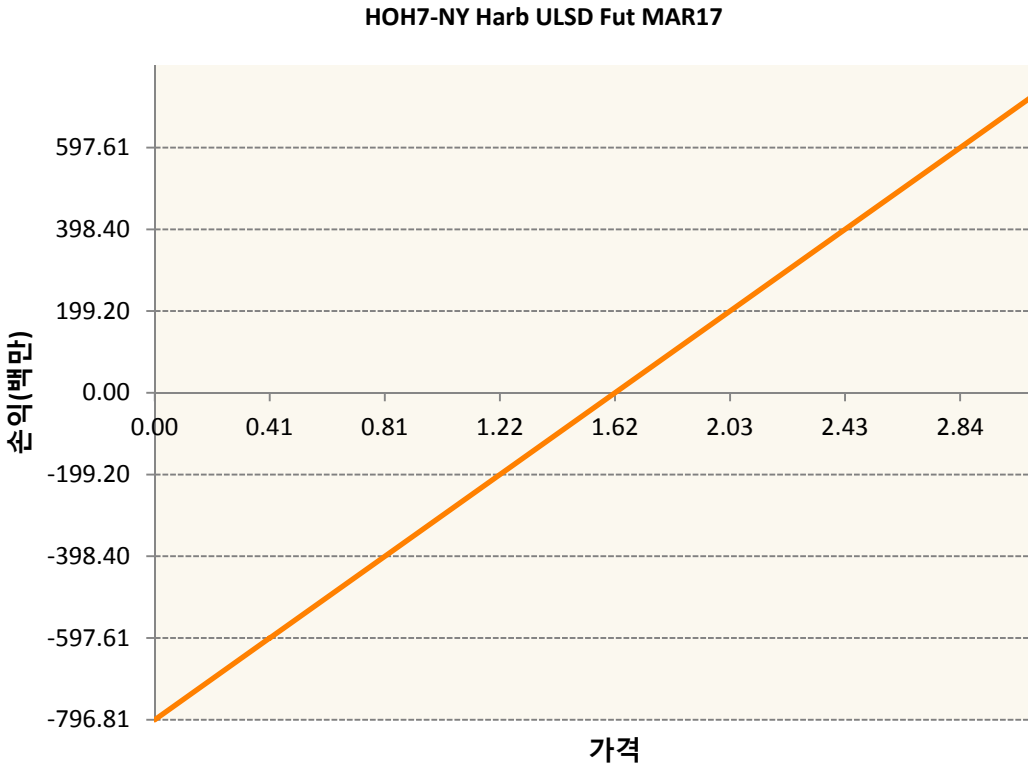
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	선물	유가증권	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	선물	유가증권	1,329	0	1,329	
누계	유가증권	선물	4,941	431	4,510	

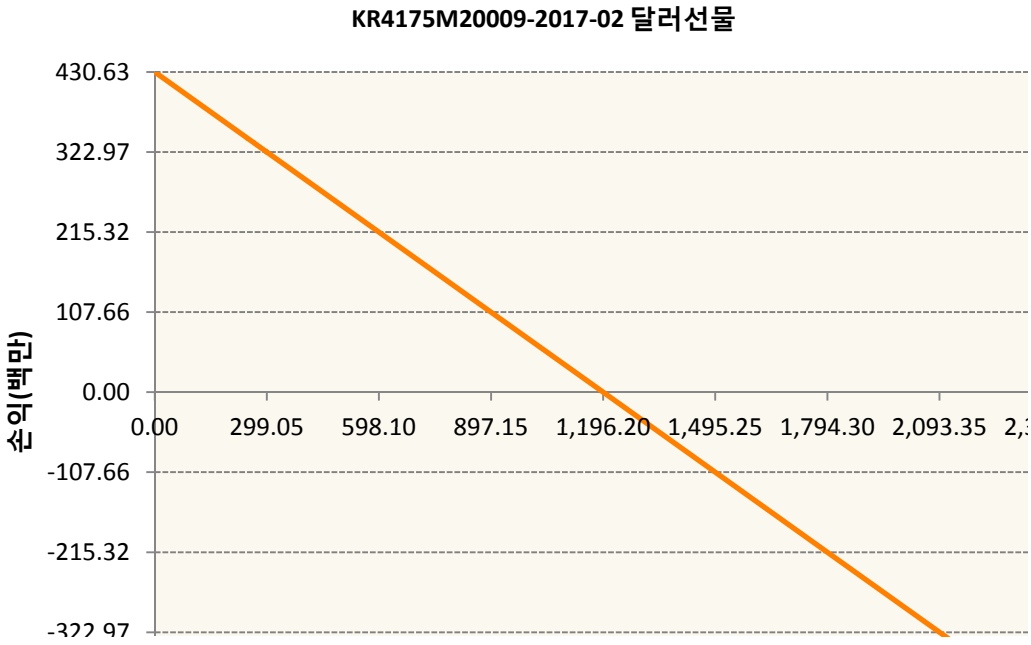
2. 만기시점의 손익구조

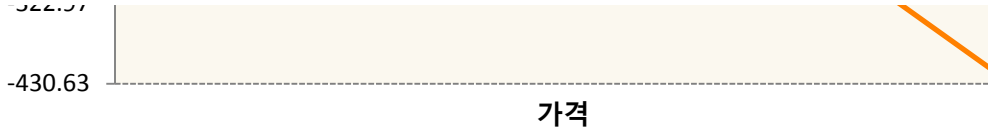


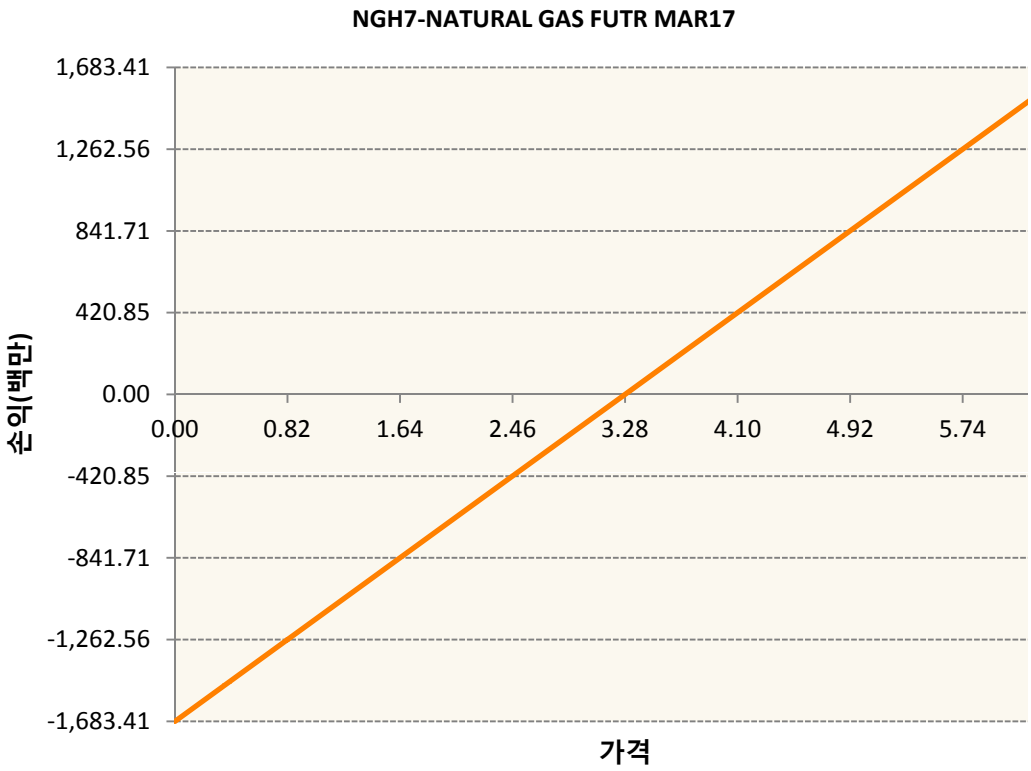


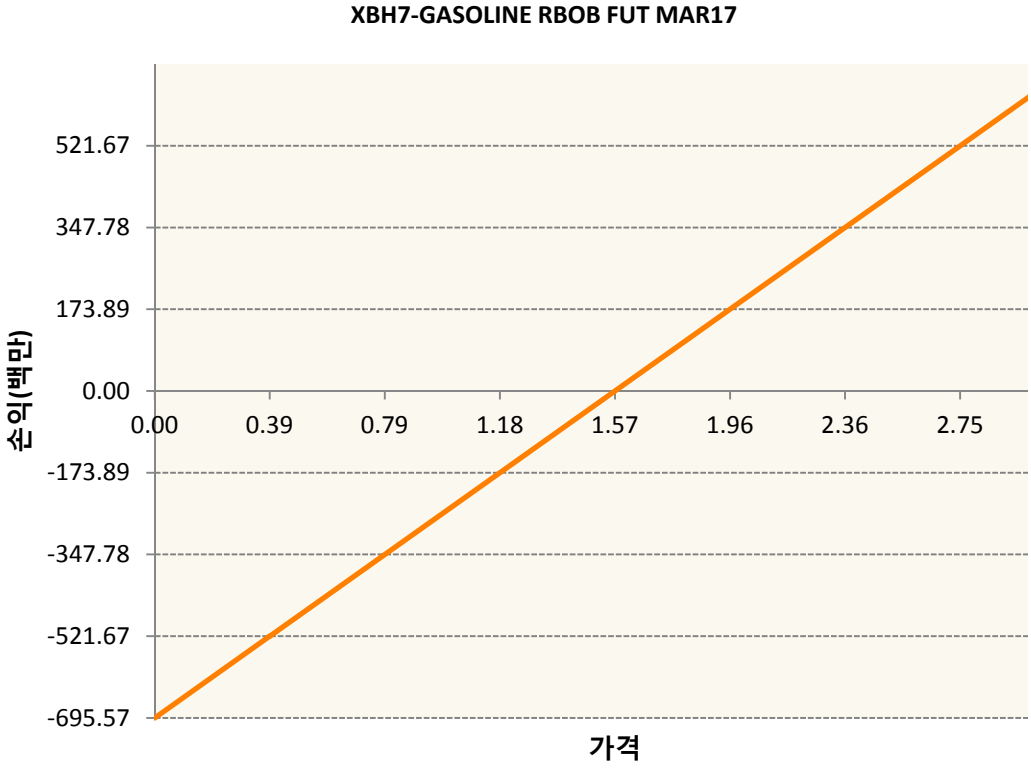

-882.40
-1,323.60
-1,764.81
가격


HOH7-NY Harb ULSD Fut MAR17
597.61
398.40
199.20
0.00
-199.20
-398.40
-597.61
-796.81
0.00
0.41
0.81
1.22
1.62
2.03
2.43
2.84
순익(백만)
가격


KR4175M20009-2017-02 달러선물
430.63
322.97
215.32
107.66
0.00
-107.66
-215.32
0.00
299.05
598.10
897.15
1,196.20
1,495.25
1,794.30
2,093.35
순익(백만)


-430.63
가격


NGH7-NATURAL GAS FUTR MAR17
1,683.41
1,262.56
841.71
420.85
0.00
-420.85
-841.71
-1,262.56
-1,683.41
0.00
0.82
1.64
2.46
3.28
4.10
4.92
5.74
순익(백만)
가격


XBH7-GASOLINE RBOB FUT MAR17
521.67
347.78
173.89
0.00
-173.89
-347.78
-521.67
-695.57
0.00
0.39
0.79
1.18
1.57
1.96
2.36
2.75
순익(백만)
가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLH7	WTI CRUDE FUTURE MAR17	106
COH7	BRENT CRUDE FUTR MAR17	141
HOH7	NY Harb ULSD Fut MAR17	64
KR4175M20(	2017-02 달러선물	34
NGH7	NATURAL GAS FUTR MAR17	135
XBH7	GASOLINE RBOB FUT MAR17	56

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

1,167

공시일	2017-01-12
기준일	2017-01-11

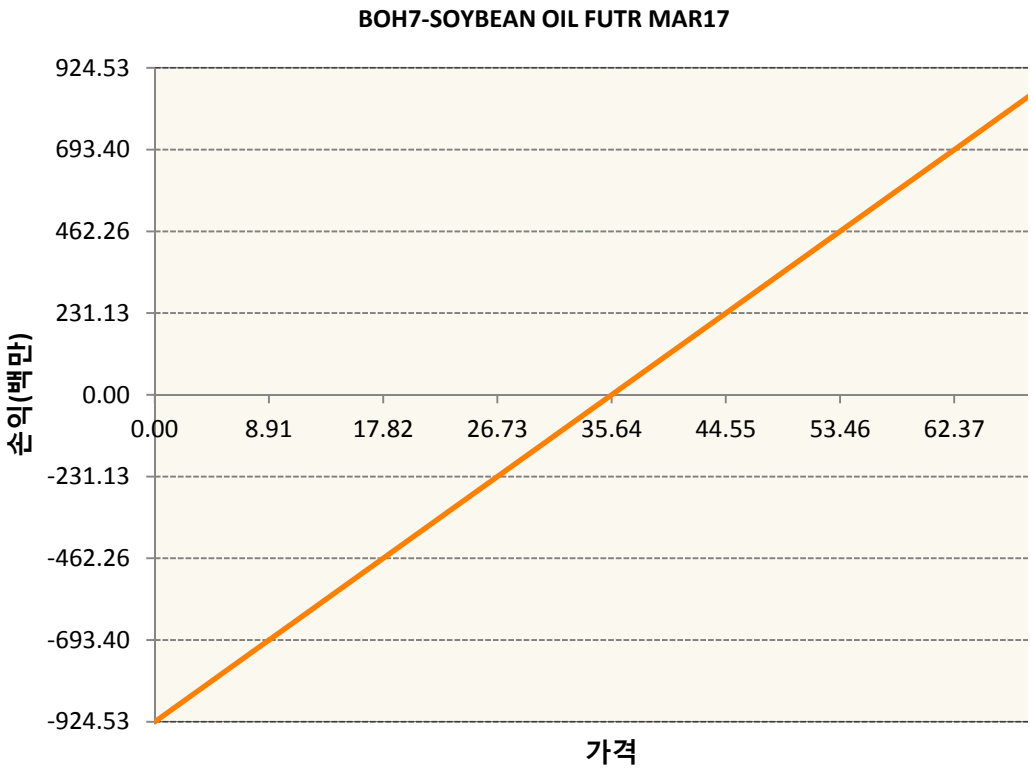
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

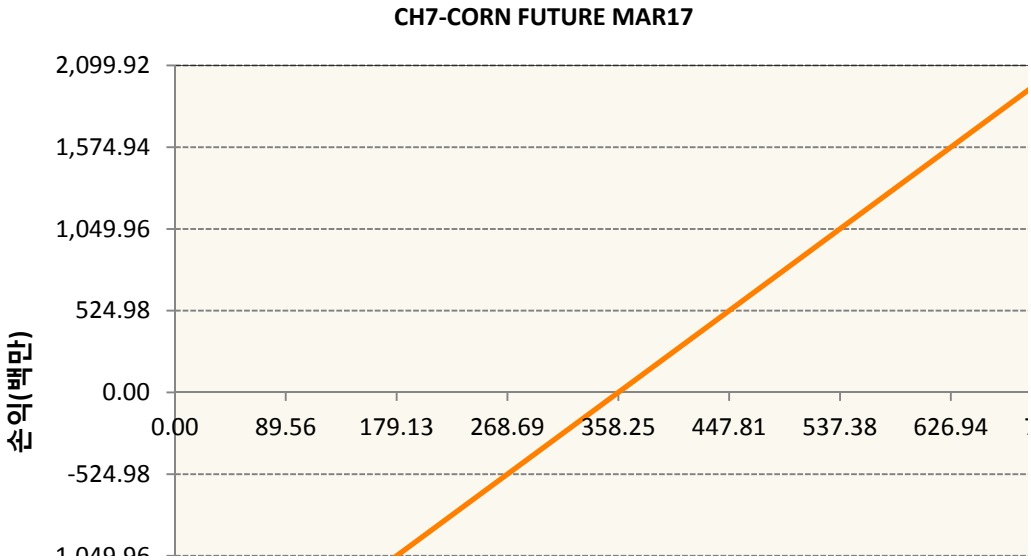
1. 계약금액

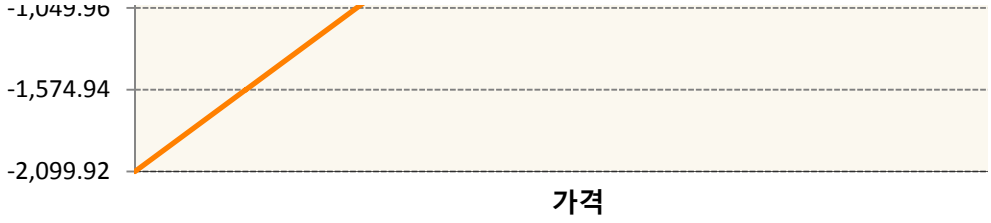
(단위:백만원)

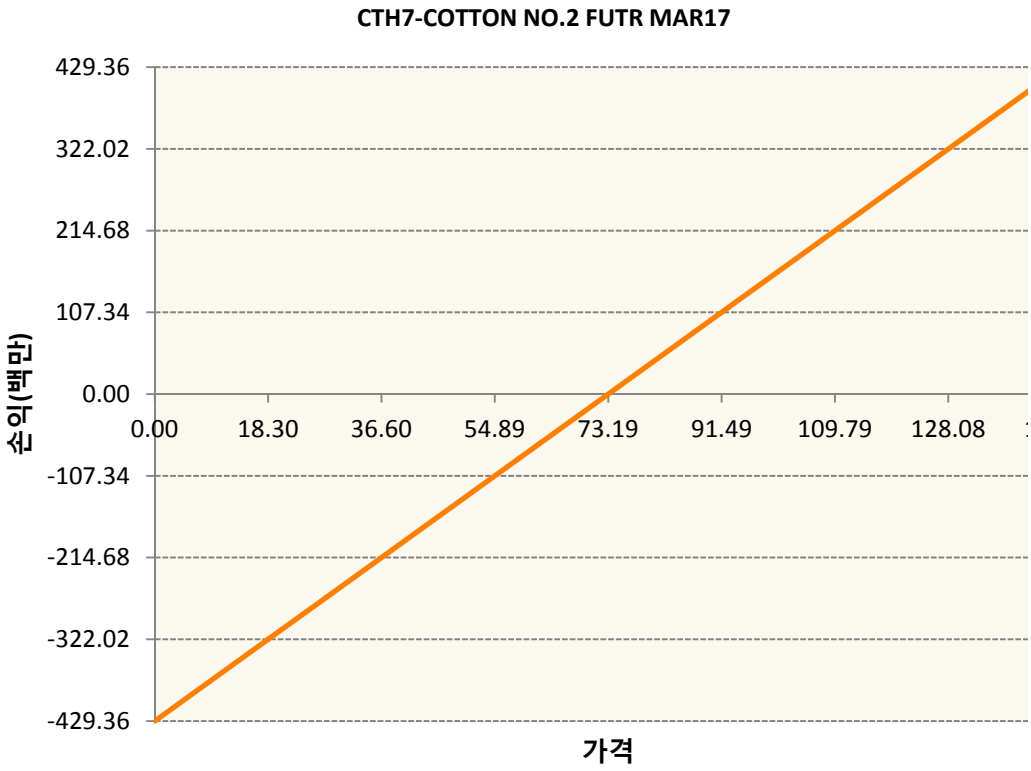
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	9,368	598	8,770	

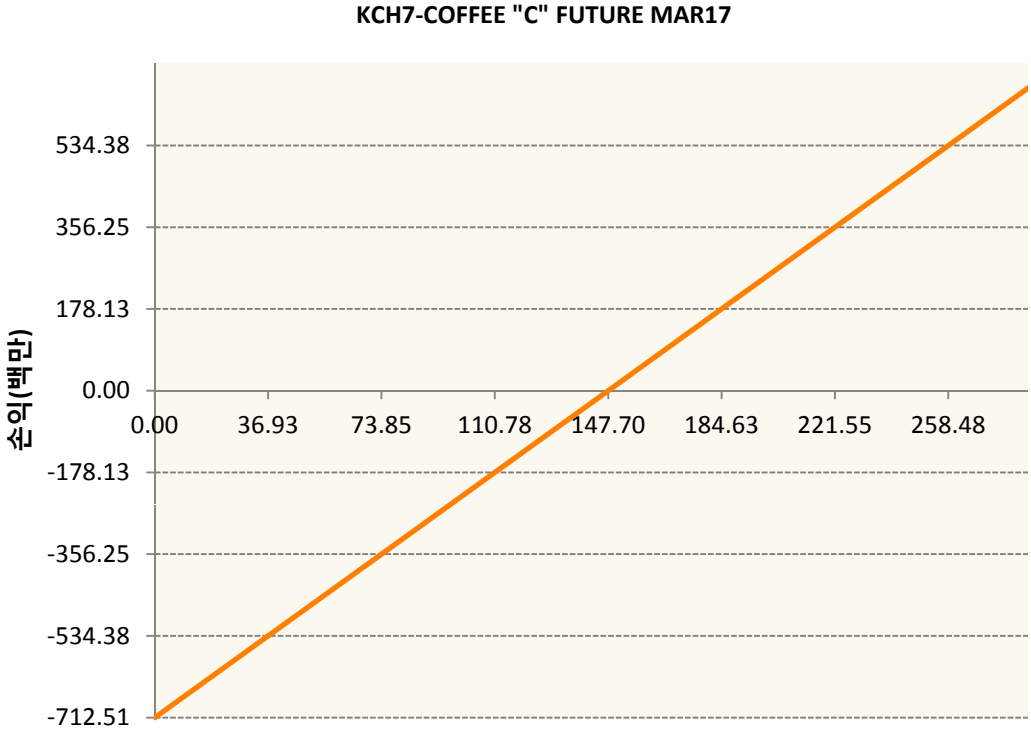
2. 만기시점의 손익구조



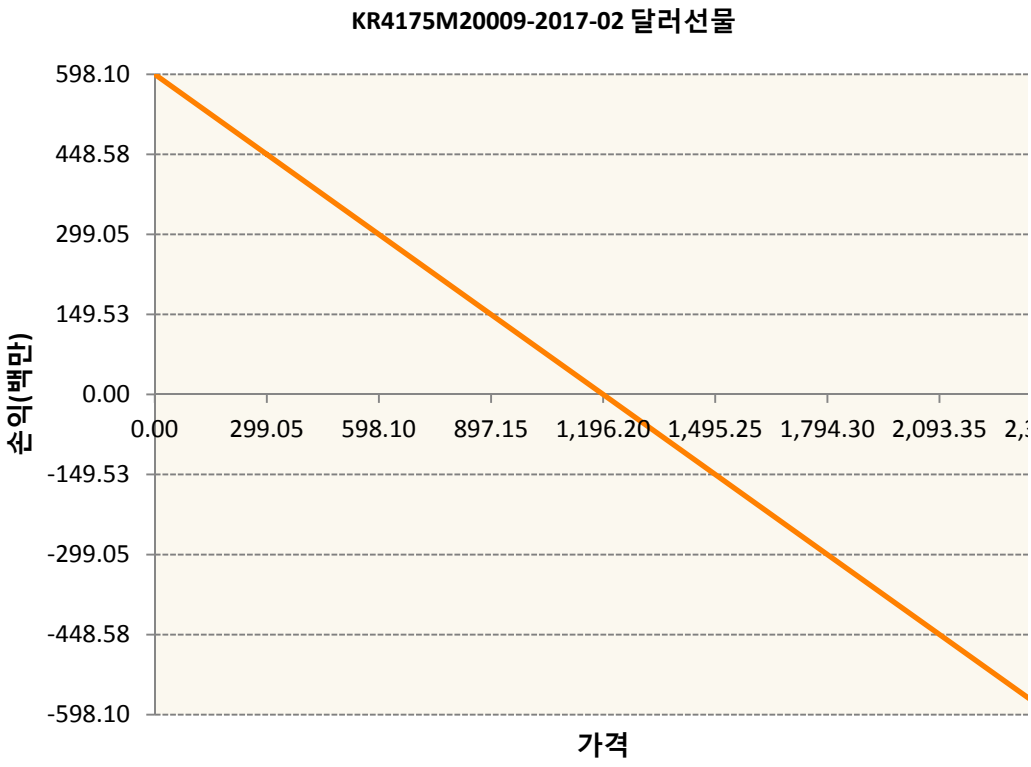


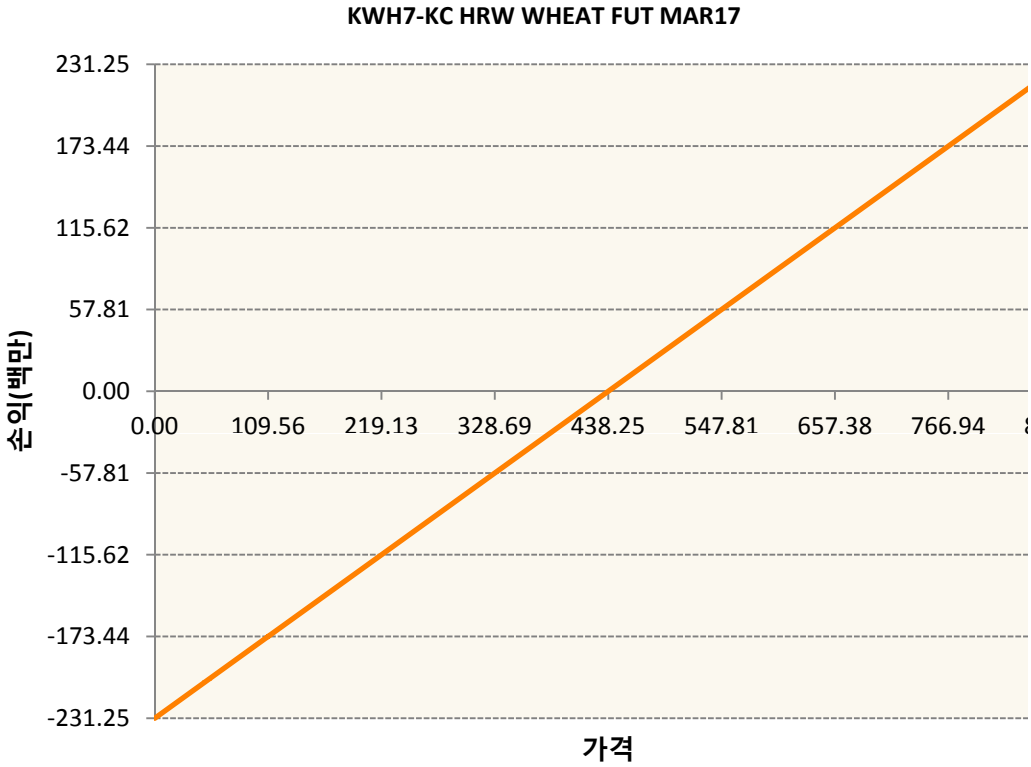

-1,049.96
-1,574.94
-2,099.92
가격


CTH7-COTTON NO.2 FUTR MAR17
429.36
322.02
214.68
107.34
0.00
-107.34
-214.68
-322.02
-429.36
0.00
18.30
36.60
54.89
73.19
91.49
109.79
128.08
순익(백만)
가격

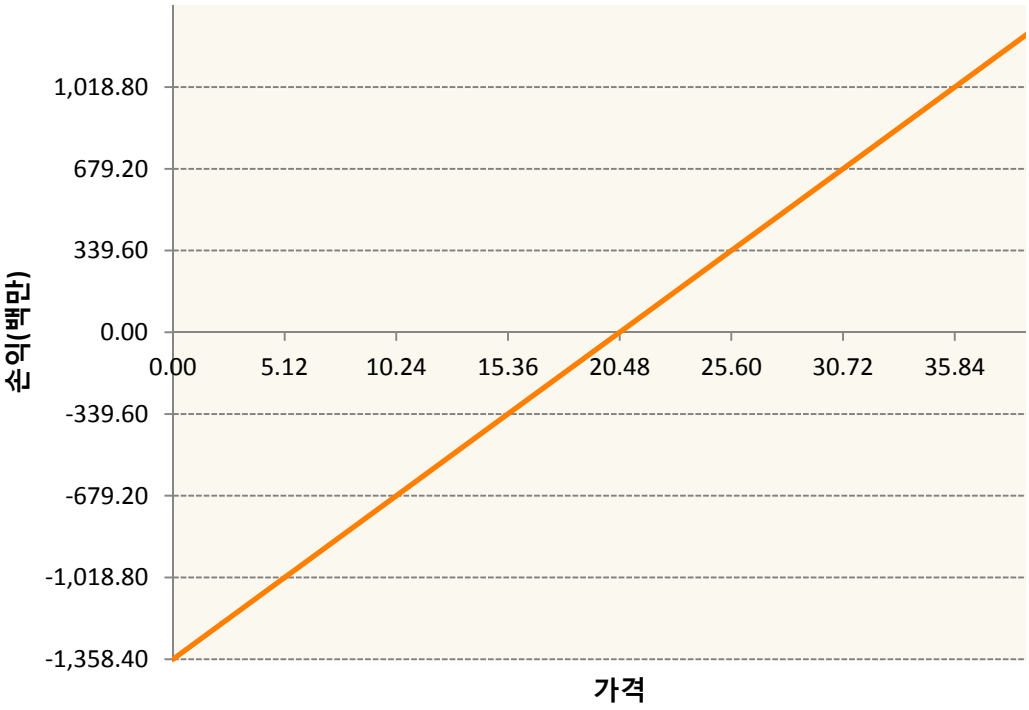

KCH7-COFFEE "C" FUTURE MAR17
534.38
356.25
178.13
0.00
-178.13
-356.25
-534.38
-712.51
0.00
36.93
73.85
110.78
147.70
184.63
221.55
258.48
순익(백만)

가격

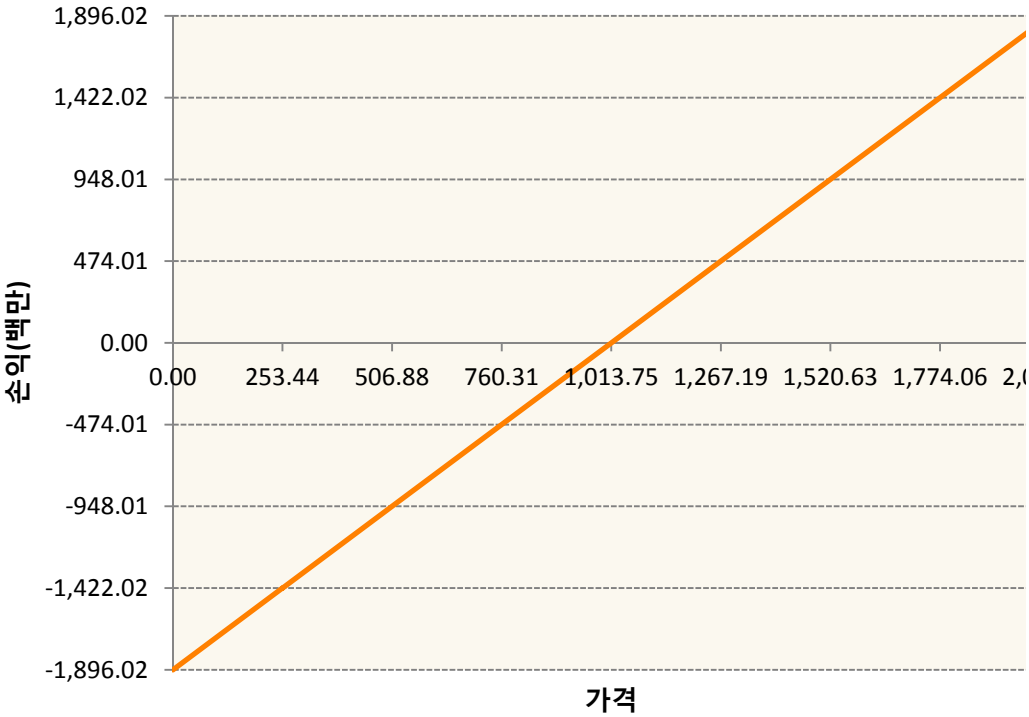

KR4175M20009-2017-02 달러선물
598.10
448.58
299.05
149.53
0.00
-149.53
-299.05
-448.58
-598.10
0.00
299.05
598.10
897.15
1,196.20
1,495.25
1,794.30
2,093.35
손익(백만)
가격


KWH7-KC HRW WHEAT FUT MAR17
231.25
173.44
115.62
57.81
0.00
-57.81
-115.62
-173.44
-231.25
0.00
109.56
219.13
328.69
438.25
547.81
657.38
766.94
손익(백만)
가격

SBH7-Sugar #11 (WORLD) MAR17

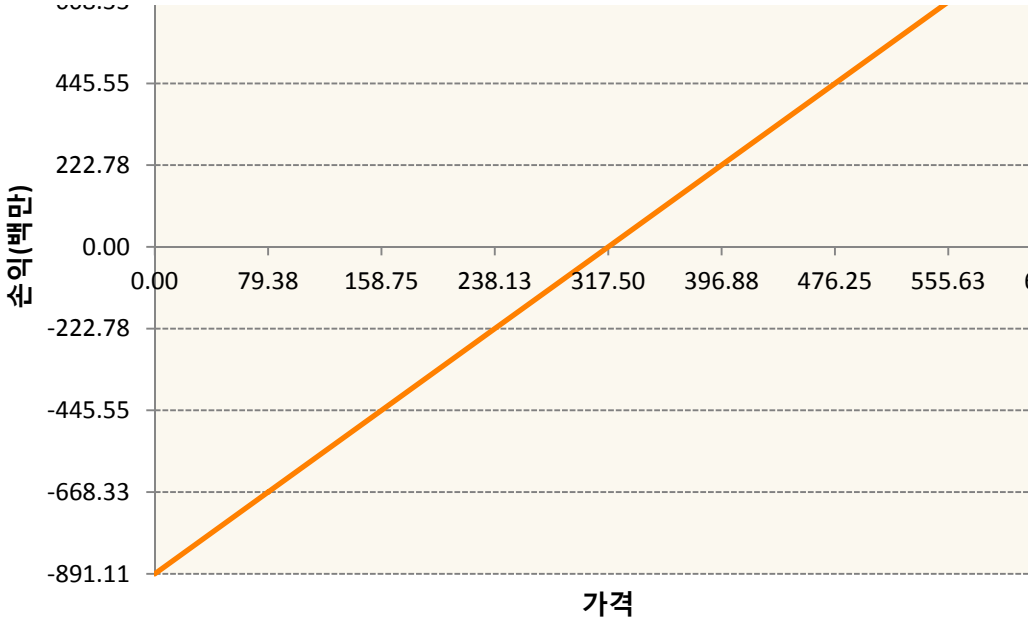


SH7-SOYBEAN FUTURE MAR17

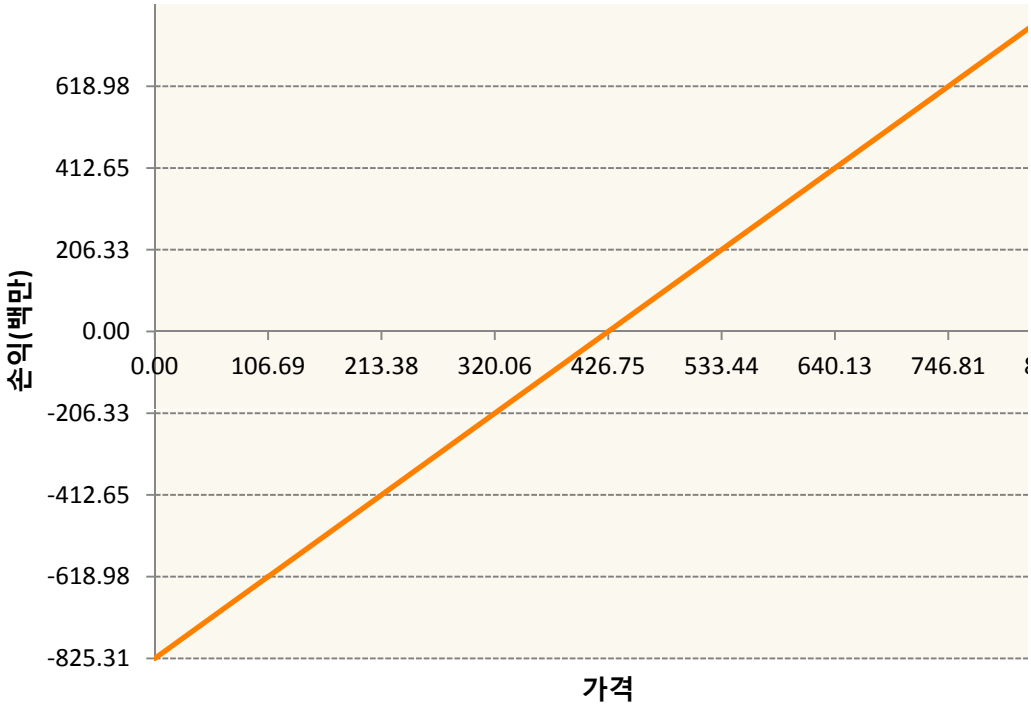


SMH7-SOYBEAN MEAL FUTR MAR17





WH7-WHEAT FUTURE(CBT) MAR17



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

BOH7	SOYBEAN OIL FUTR MAR17	74
CH7	CORN FUTURE MAR17	168
CTH7	COTTON NO.2 FUTR MAR17	34
KCH7	COFFEE "C" FUTURE MAR17	57
KR4175M20(	2017-02 달러선물	48

KWH7	KC HRW WHEAT FUT MAR17	18
SBH7	Sugar #11 (WORLD) MAR17	109
SH7	SOYBEAN FUTURE MAR17	152
SMH7	SOYBEAN MEAL FUTR MAR17	71
WH7	WHEAT FUTURE(CBT) MAR17	66

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

934