공시일	2017-01-19
기준일	2017-01-18

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	2017-01-19
기준일	2017-01-18

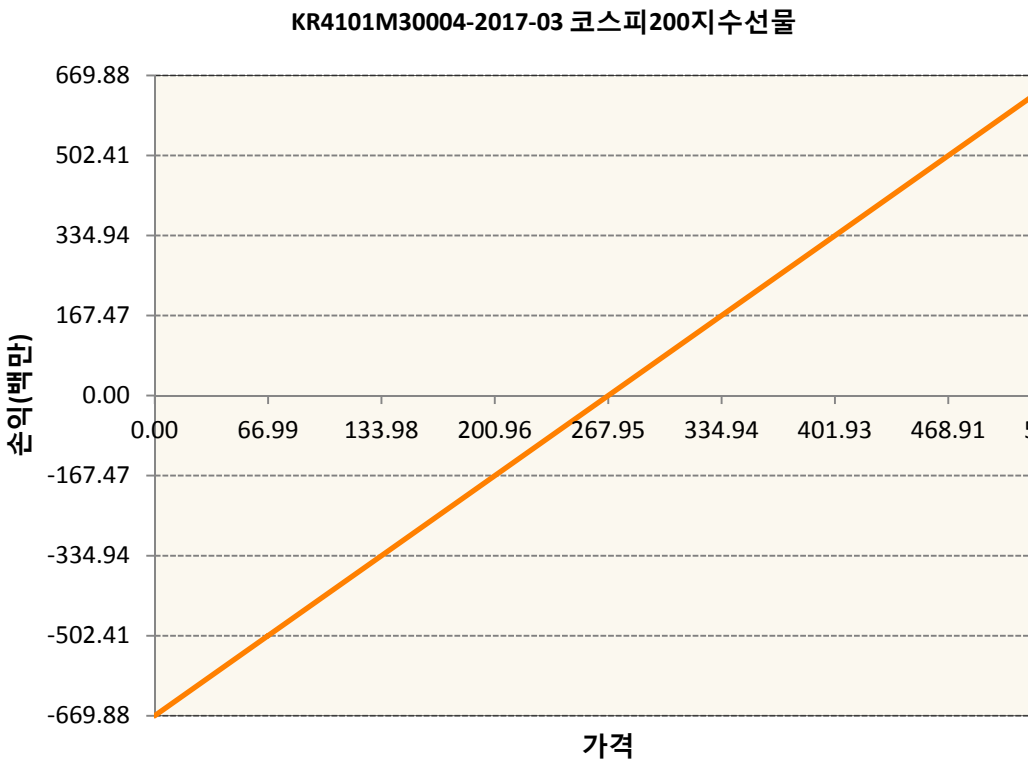
스마트인덱스모

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	670	0	670	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101M30(2017-03 코스피200지수선물							53
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-53	-53	-53	-53	-53	-53	-53
-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%	53	53	53	53	53	53	53

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

39

공시일	2017-01-19
기준일	2017-01-18

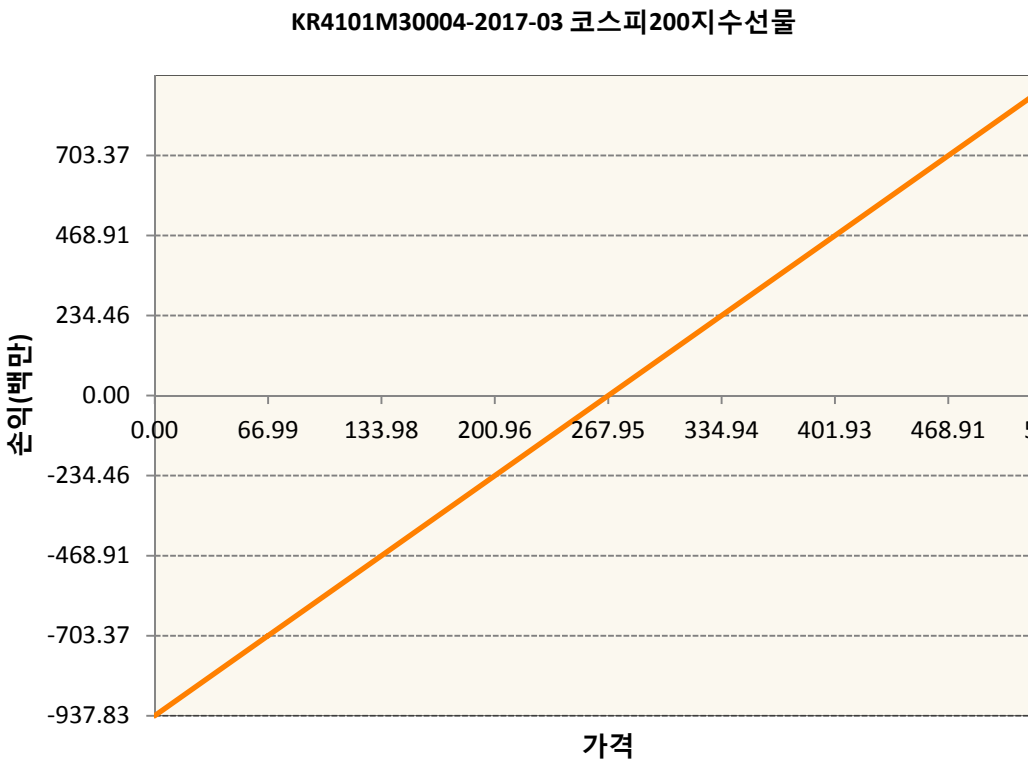
스마트레버리지목표전환형1호

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	938	0	938	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101M30(2017-03 코스피200지수선물							75
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-75	-75	-75	-75	-75	-75	-75
-5.33%	-50	-50	-50	-50	-50	-50	-50
-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%	50	50	50	50	50	50	50
8.00%	75	75	75	75	75	75	75

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

54

공시일	2017-01-19
기준일	2017-01-18

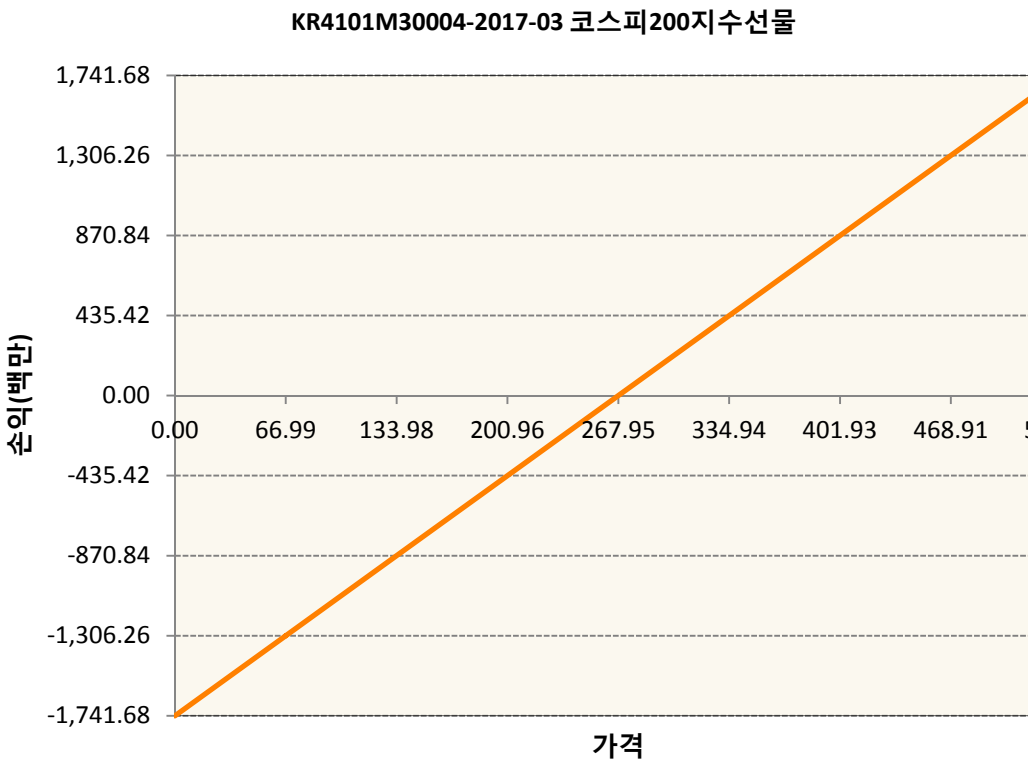
1.3배 레버리지 인덱스(주식-파생형)

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	1,742	0	1,742	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101M30(2017-03 코스피200지수선물							139
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-139	-139	-139	-139	-139	-139	-139
-5.33%	-93	-93	-93	-93	-93	-93	-93
-2.67%	-46	-46	-46	-46	-46	-46	-46
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	46	46	46	46	46	46	46
5.33%	93	93	93	93	93	93	93
8.00%	139	139	139	139	139	139	139

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

101

공시일	2017-01-19
기준일	2017-01-18

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	920

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

687

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-01-19
기준일	2017-01-18

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	369

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

582

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-01-19
기준일	2017-01-18

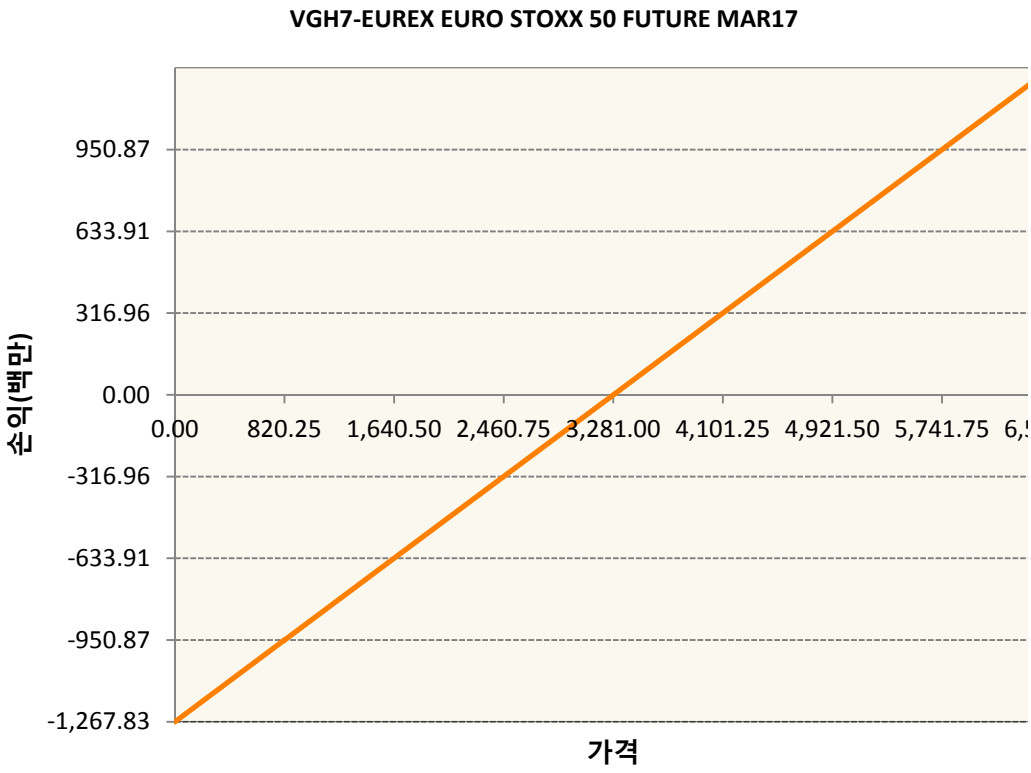
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,268	0	1,268	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGH7	EUREX EURO STOXX 50 FUTURE MAR17	101

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

(단위:백만원)

110

공시일	2017-01-19
기준일	2017-01-18

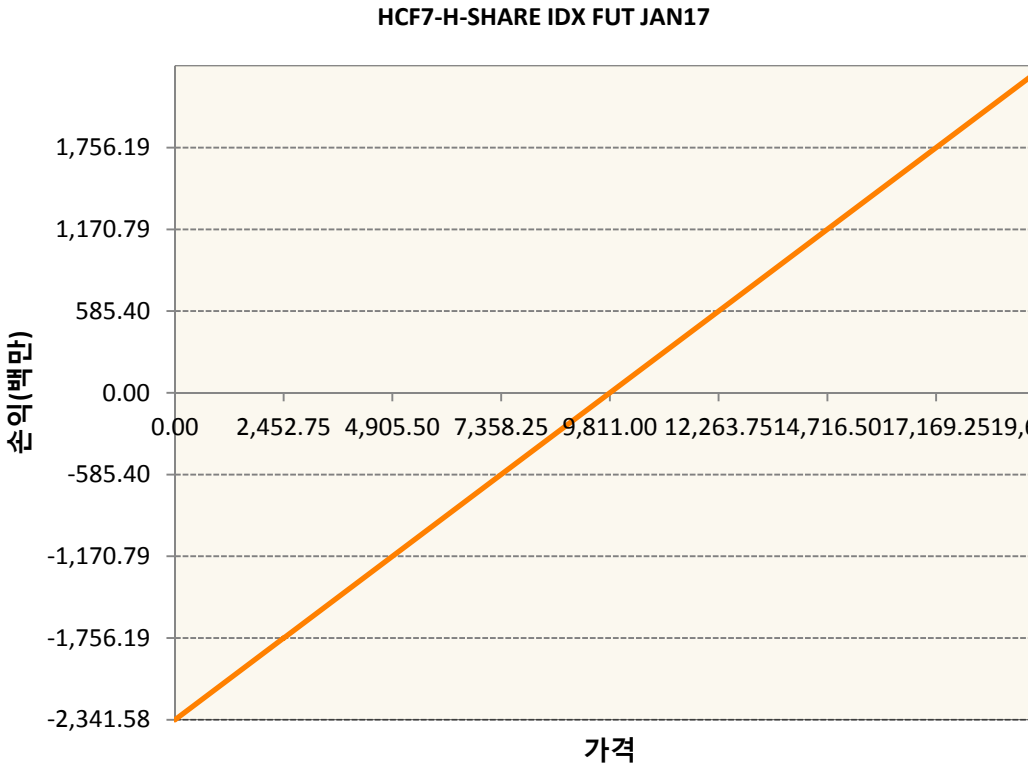
차이나인덱스모(주식-파생형)

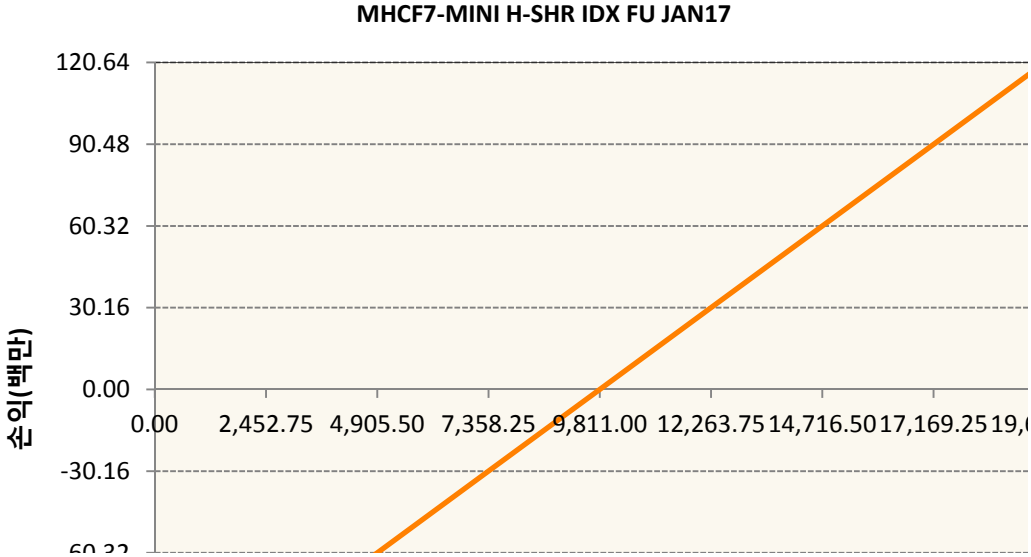
1. 계약금액

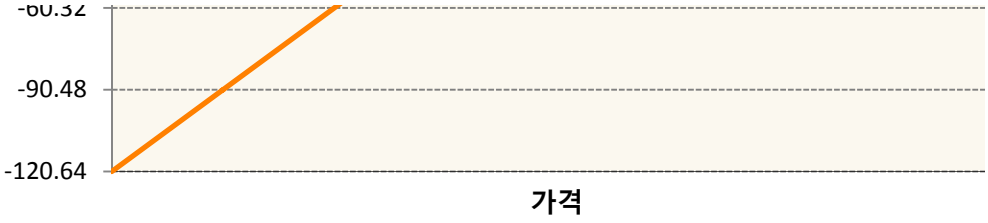
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,462	0	2,462	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCF7	H-SHARE IDX FUT JAN17	187
MHCF7	MINI H-SHR IDX FU JAN17	10

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	240

공시일	2017-01-19
기준일	2017-01-18

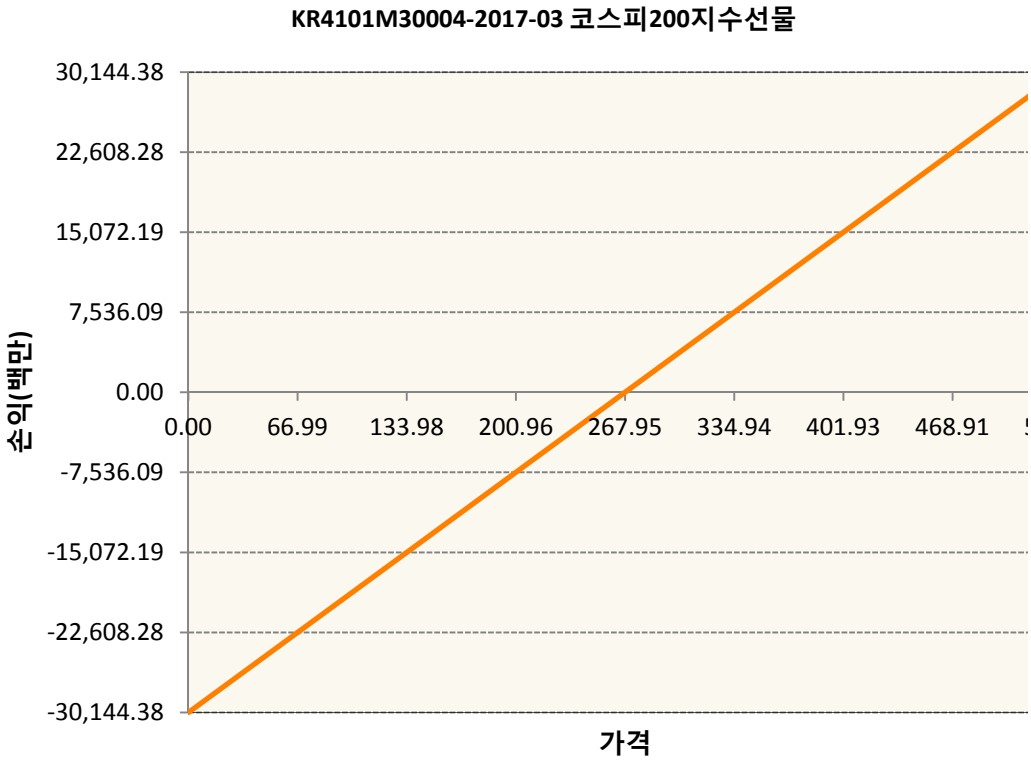
커버드콜(주식혼합-파생형)

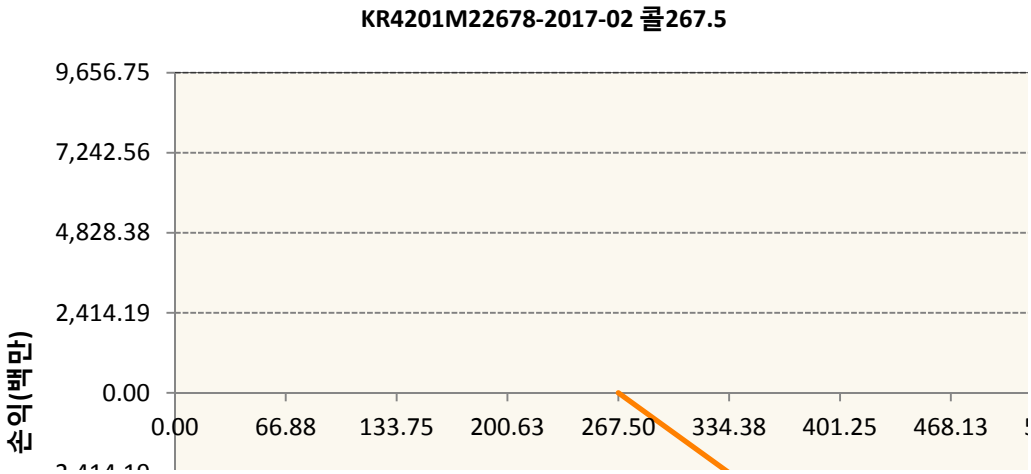
1. 계약금액

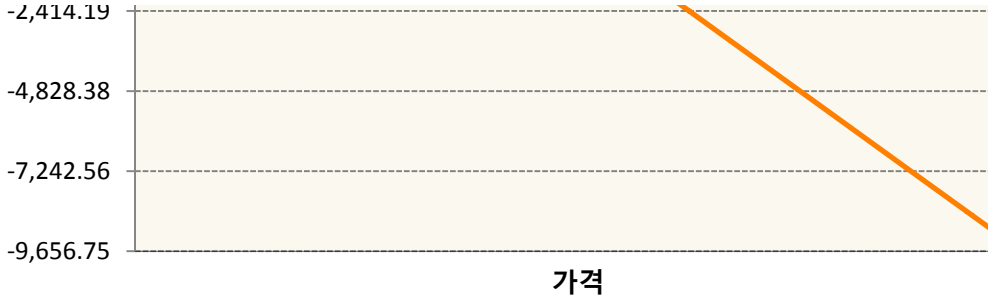
(단위:백만원)

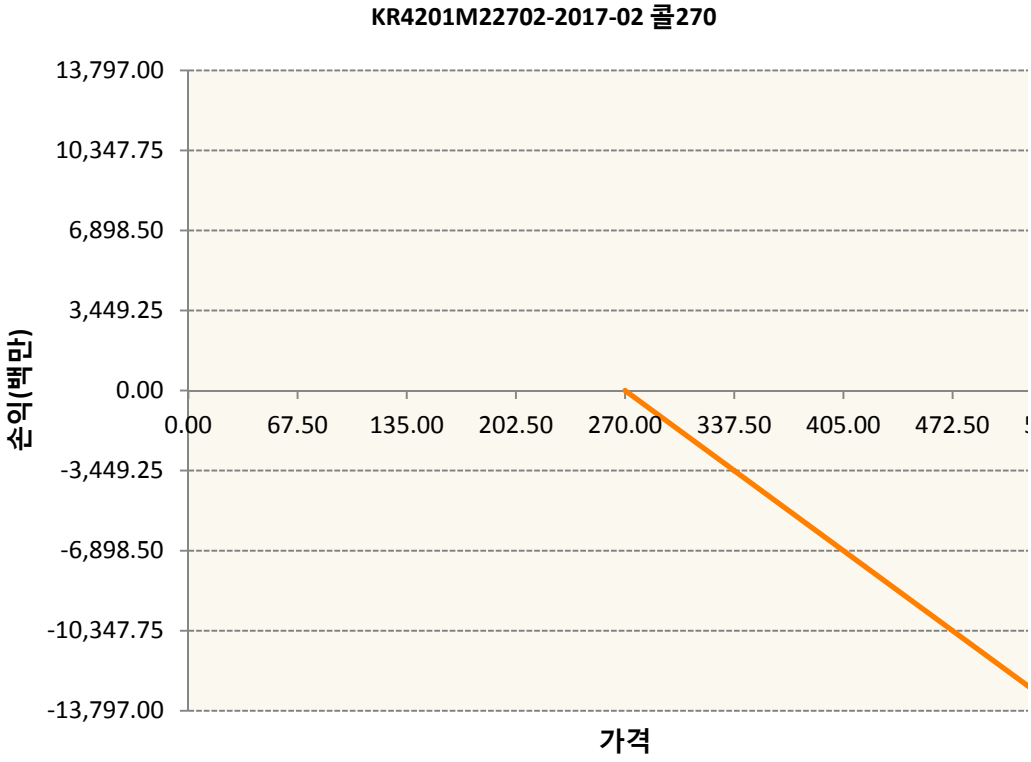
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	30,144	0	30,144	장내
누계	유가증권	옵션	0	23,454	-23,454	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101M30(2017-03 코스피200지수선물							2,404
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-2,404	-2,404	-2,404	-2,404	-2,404	-2,404	-2,404
-5.33%	-1,602	-1,602	-1,602	-1,602	-1,602	-1,602	-1,602
-2.67%	-801	-801	-801	-801	-801	-801	-801
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	801	801	801	801	801	801	801
5.33%	1,602	1,602	1,602	1,602	1,602	1,602	1,602
8.00%	2,404	2,404	2,404	2,404	2,404	2,404	2,404
KR4201M22(2017-02 콜267.5							3,265
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	523	523	523	522	521	520	517
-5.33%	521	519	515	509	501	491	478
-2.67%	477	455	431	403	374	342	309
0%	140	93	47	0	-47	-93	-140
2.67%	-753	-779	-809	-841	-875	-911	-948
5.33%	-1,971	-1,976	-1,983	-1,992	-2,005	-2,019	-2,037
8.00%	-3,252	-3,252	-3,253	-3,254	-3,256	-3,260	-3,265
KR4201M22 2017-02 콜270							4,262

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	479	479	479	479	478	477	475
-5.33%	479	477	475	471	465	456	444
-2.67%	454	437	415	389	359	326	289
0%	182	122	62	0	-62	-125	-189
2.67%	-806	-860	-916	-974	-1,034	-1,094	-1,155
5.33%	-2,426	-2,440	-2,459	-2,482	-2,510	-2,541	-2,576
8.00%	-4,227	-4,228	-4,230	-4,235	-4,241	-4,250	-4,262

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

10,206

공시일	2017-01-19
기준일	2017-01-18

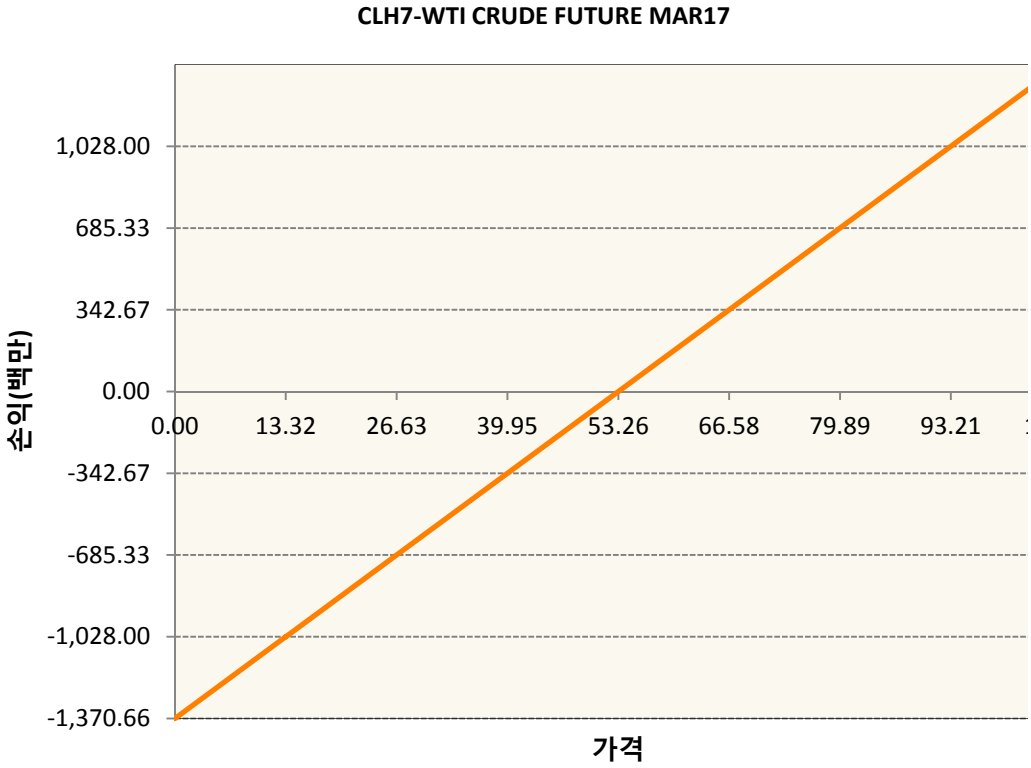
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

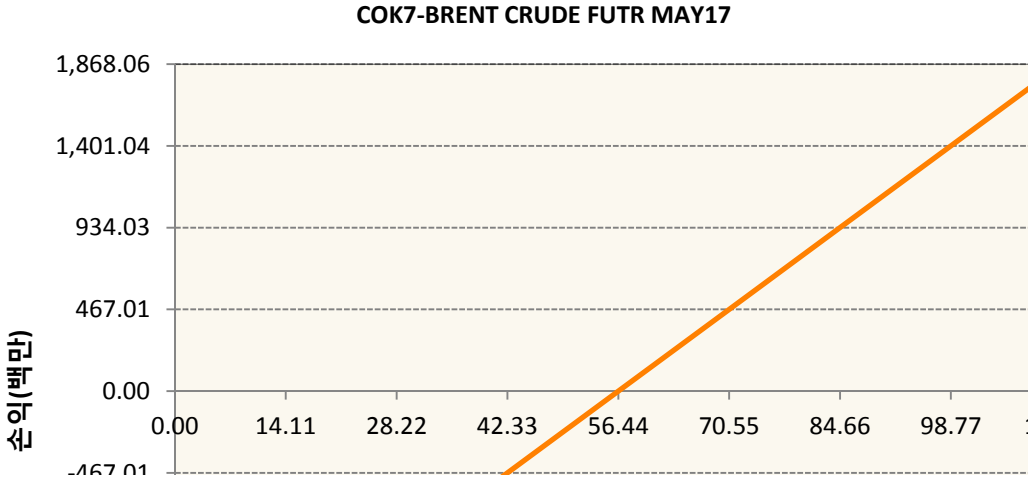
1. 계약금액

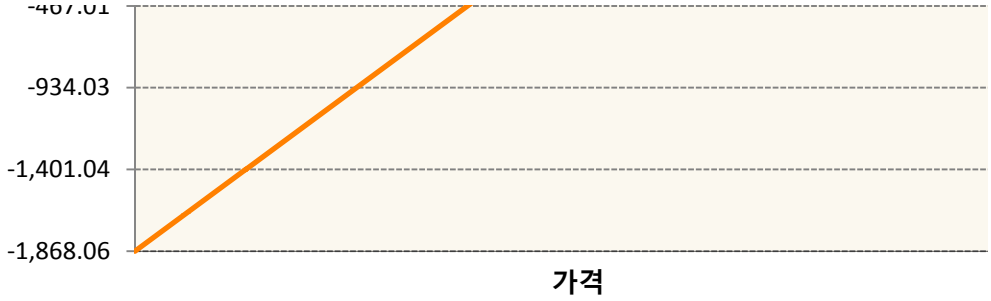
(단위:백만원)

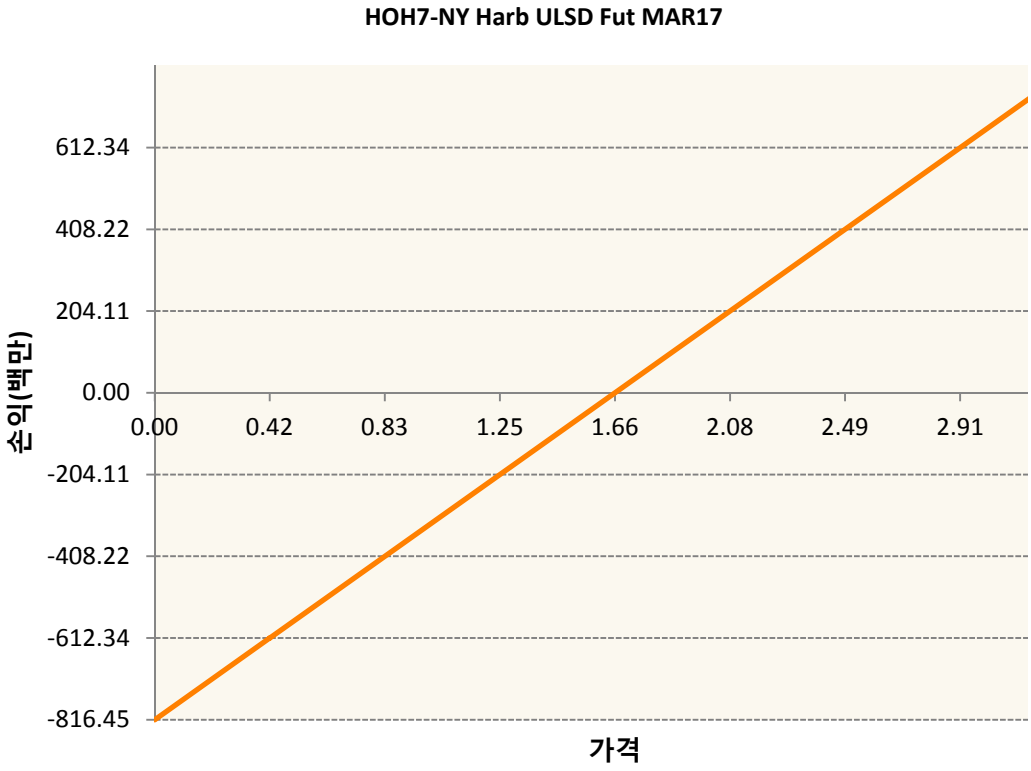
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	선물	유가증권	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	선물	유가증권	1,371	0	1,371	
누계	유가증권	선물	5,157	419	4,737	

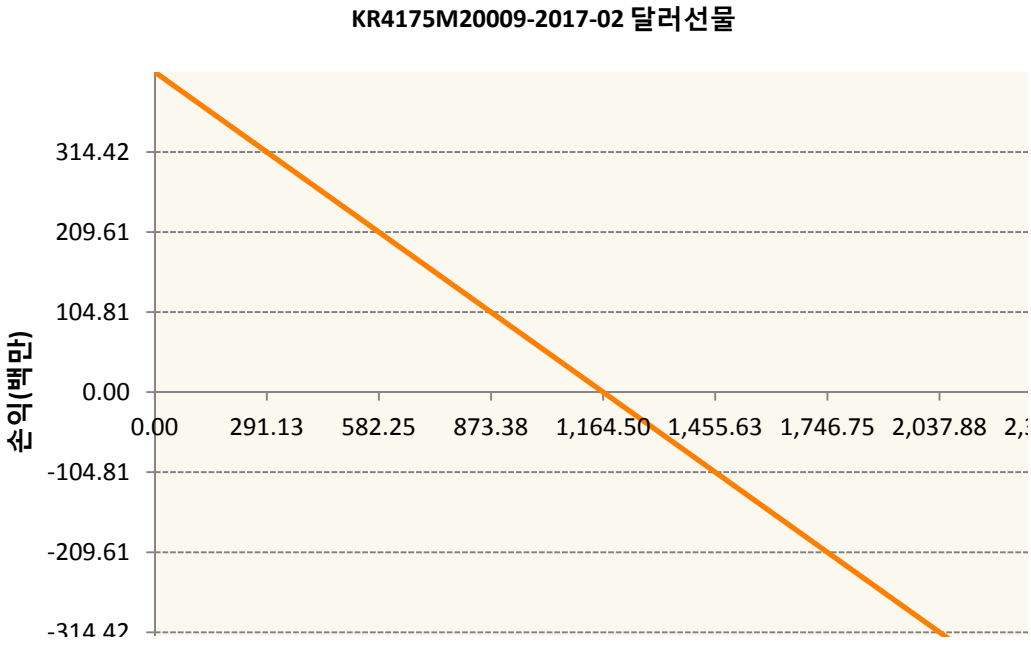
2. 만기시점의 손익구조

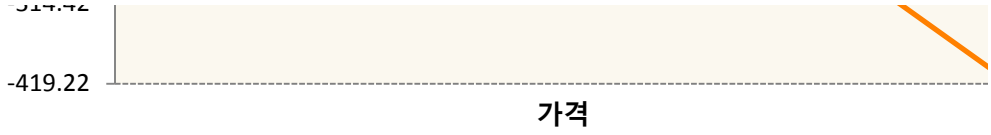


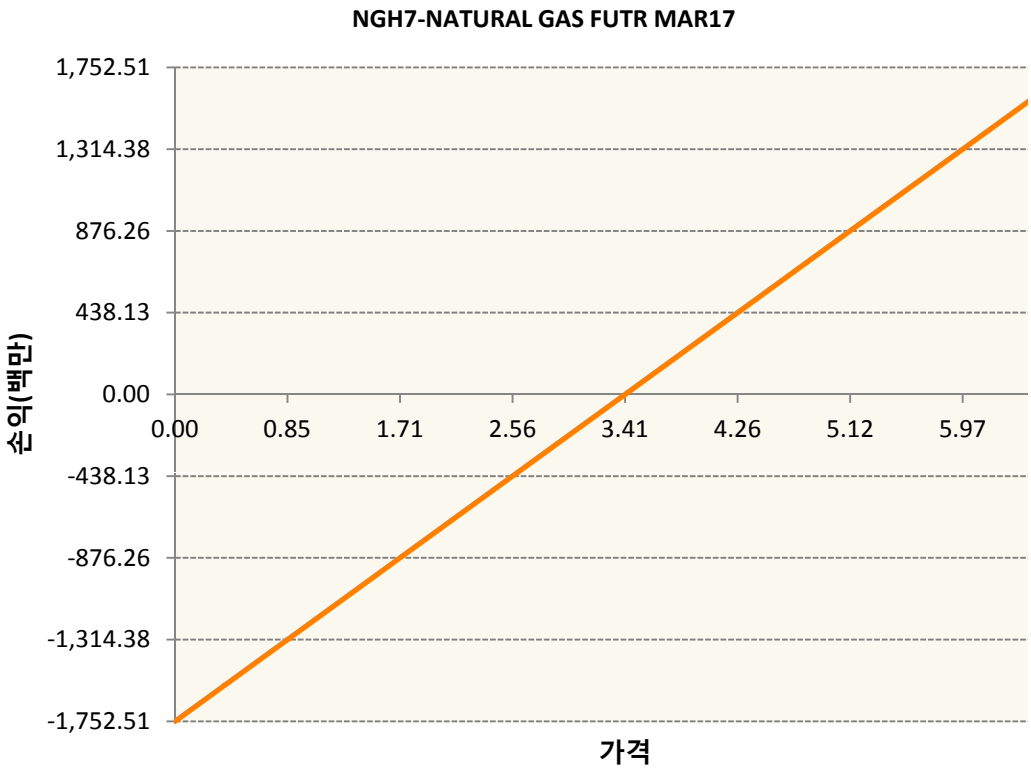


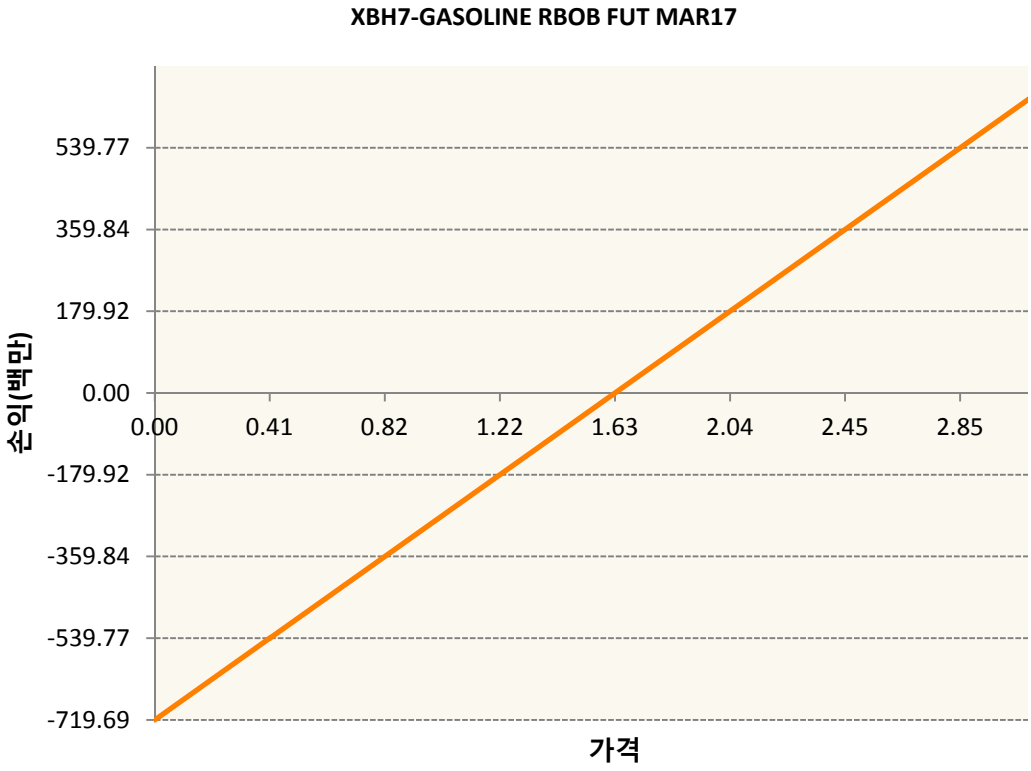

-934.03
-1,401.04
-1,868.06
가격


HOH7-NY Harb ULSD Fut MAR17
612.34
408.22
204.11
0.00
-204.11
-408.22
-612.34
-816.45
0.00
0.42
0.83
1.25
1.66
2.08
2.49
2.91
순익(백만)
가격


KR4175M20009-2017-02 달러선물
314.42
209.61
104.81
0.00
-104.81
-209.61
0.00
291.13
582.25
873.38
1,164.50
1,455.63
1,746.75
2,037.88
순익(백만)


-419.22
가격


NGH7-NATURAL GAS FUTR MAR17
1,752.51
1,314.38
876.26
438.13
0.00
-438.13
-876.26
-1,314.38
-1,752.51
0.00
0.85
1.71
2.56
3.41
4.26
5.12
5.97
순익(백만)
가격


XBH7-GASOLINE RBOB FUT MAR17
539.77
359.84
179.92
0.00
-179.92
-359.84
-539.77
-719.69
0.00
0.41
0.82
1.22
1.63
2.04
2.45
2.85
순익(백만)
가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLH7	WTI CRUDE FUTURE MAR17	110
COK7	BRENT CRUDE FUTR MAY17	149
HOH7	NY Harb ULSD Fut MAR17	65
KR4175M20(	2017-02 달러선물	34
NGH7	NATURAL GAS FUTR MAR17	140
XBH7	GASOLINE RBOB FUT MAR17	58

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

1,185

공시일	2017-01-19
기준일	2017-01-18

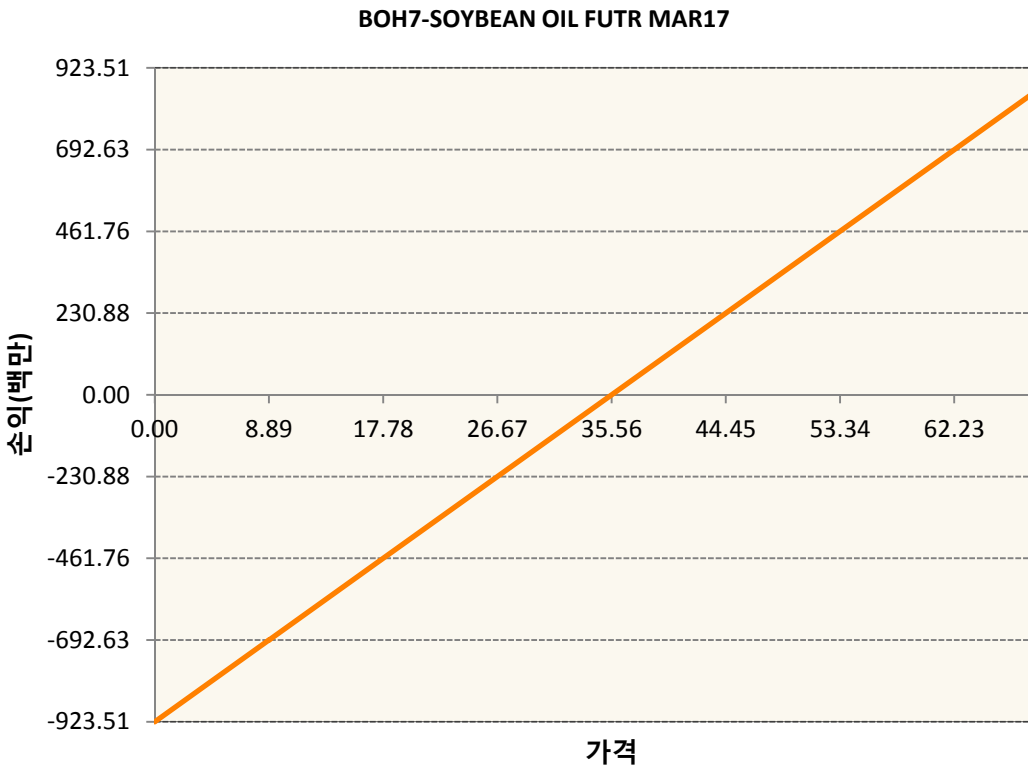
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

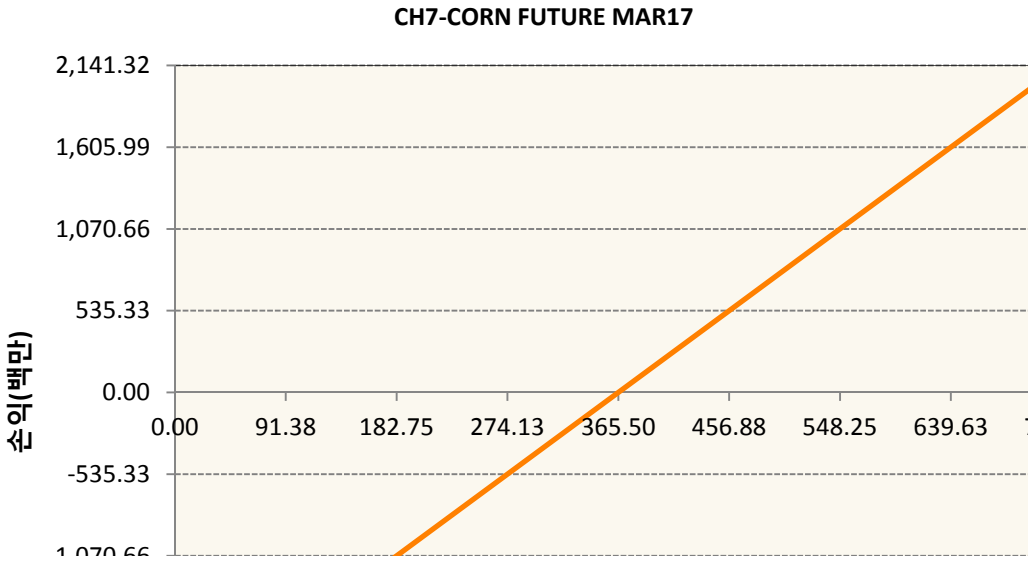
1. 계약금액

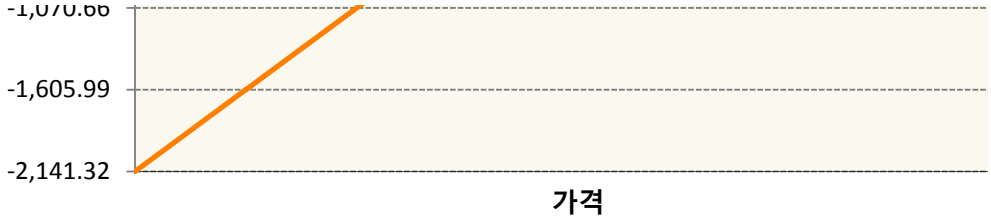
(단위:백만원)

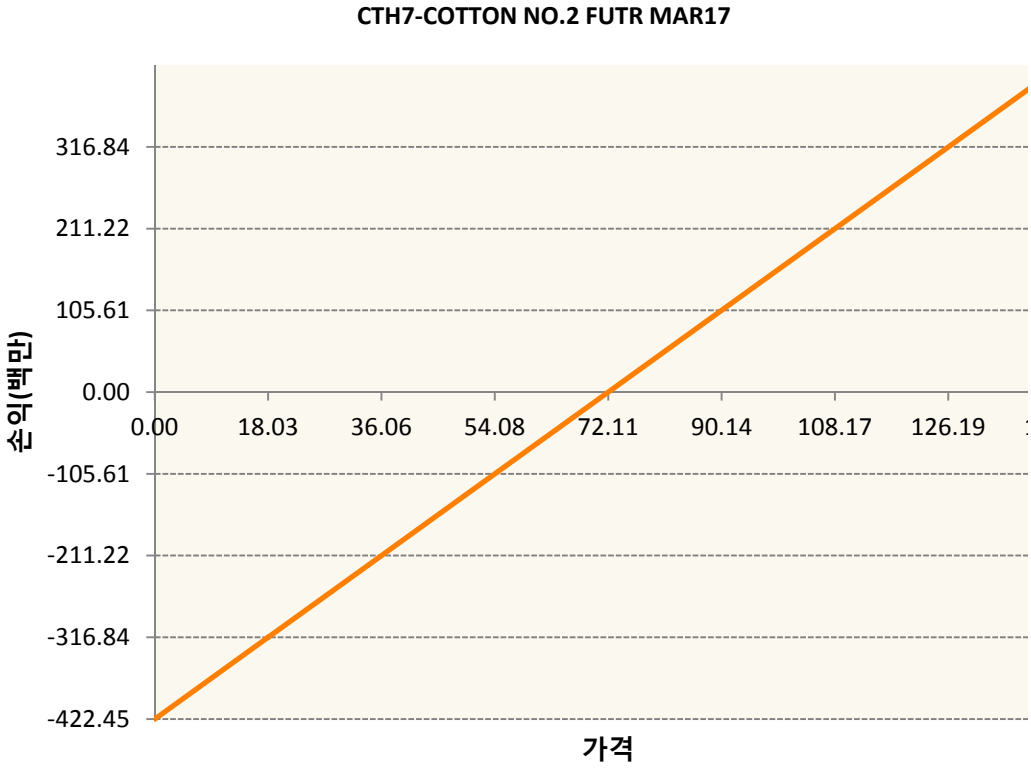
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	9,645	582	9,063	

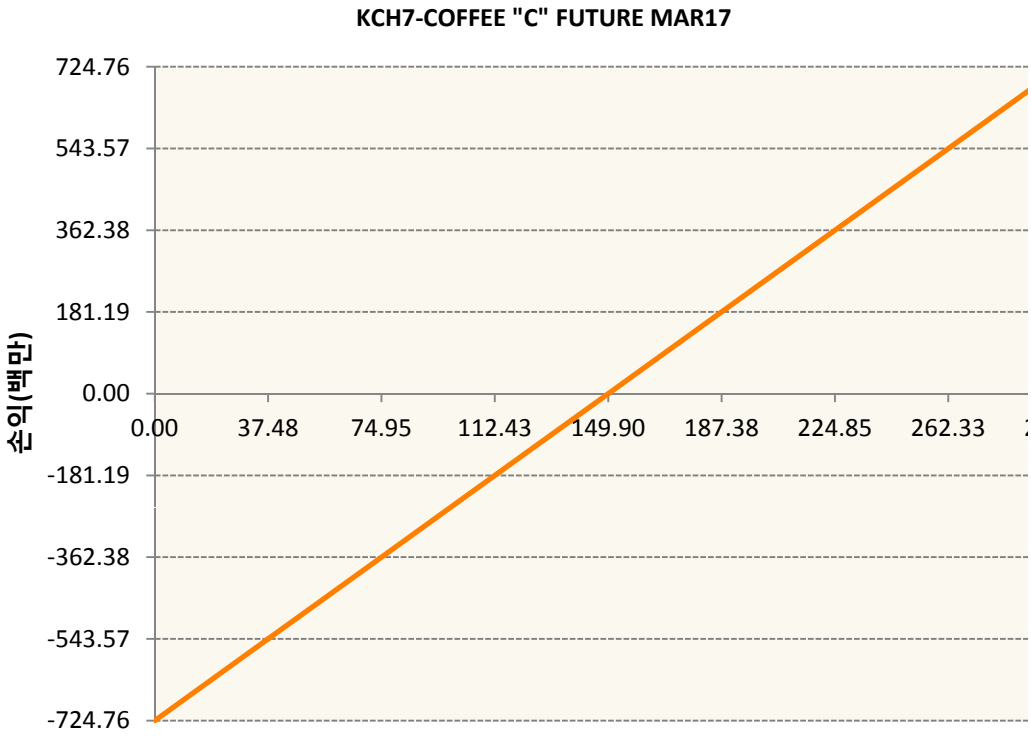
2. 만기시점의 손익구조



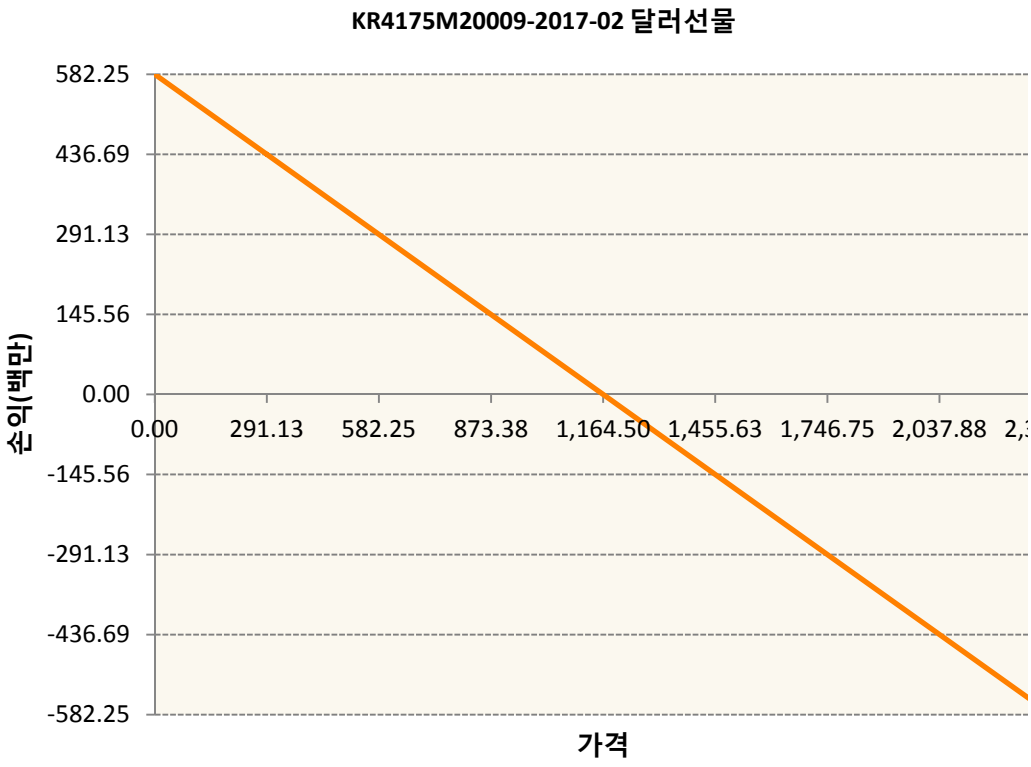


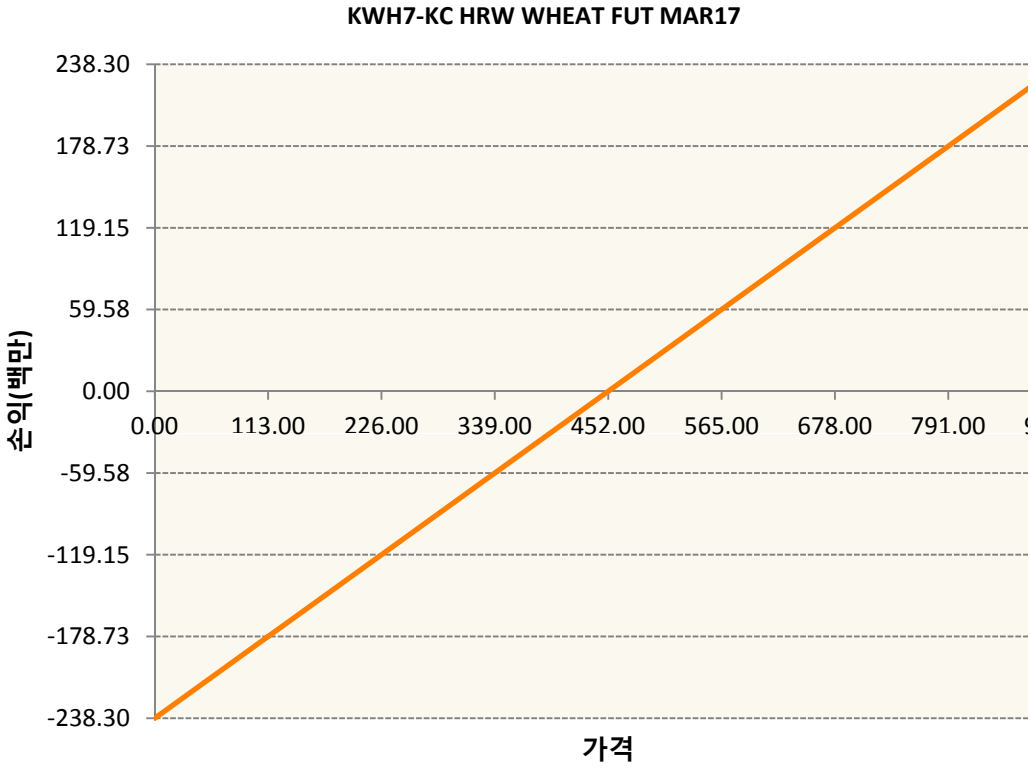

-1,605.99
-2,141.32
가격

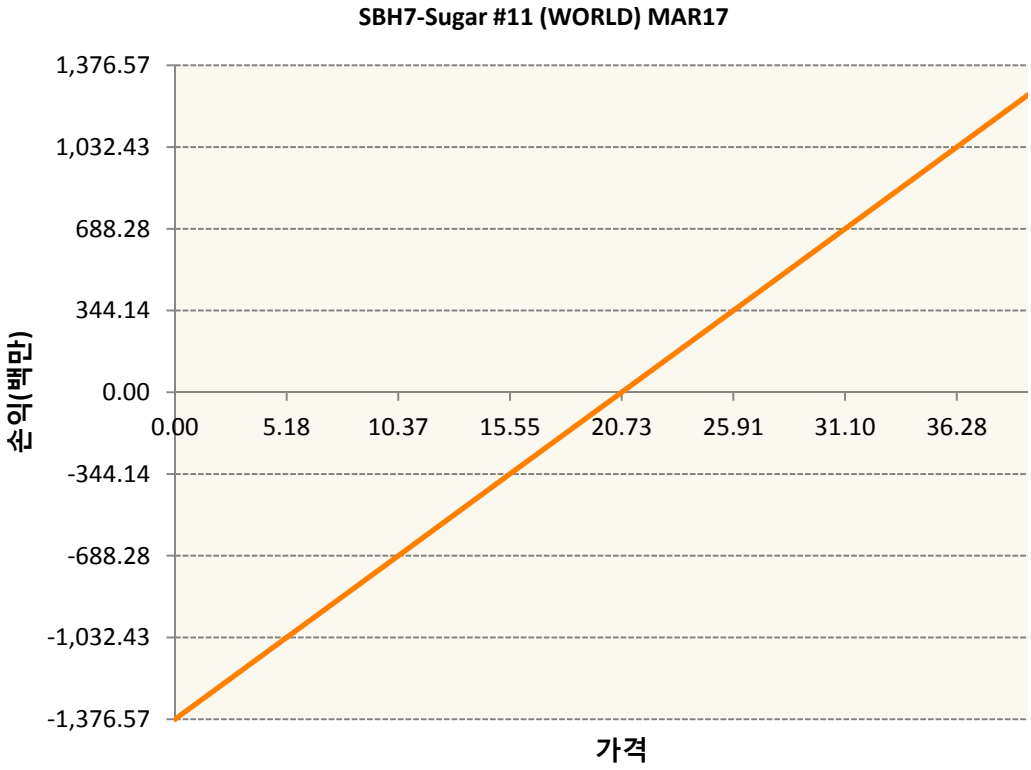

CTH7-COTTON NO.2 FUTR MAR17
316.84
211.22
105.61
0.00
-105.61
-211.22
-316.84
-422.45
0.00
18.03
36.06
54.08
72.11
90.14
108.17
126.19
손익(백만)
가격

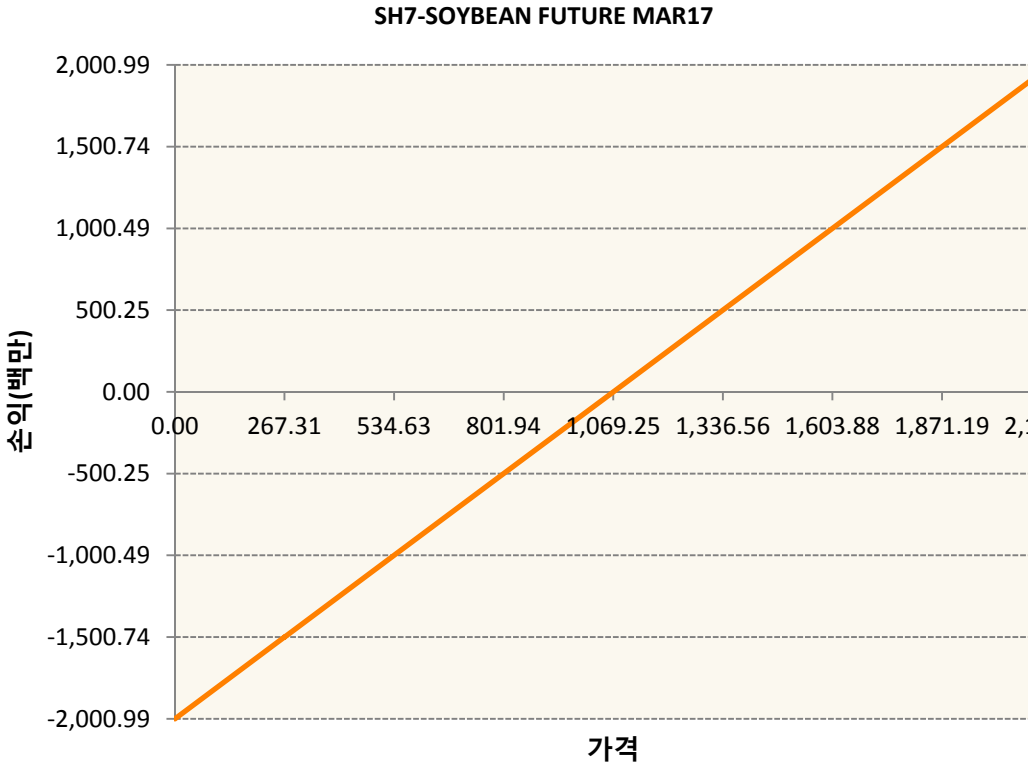

KCH7-COFFEE "C" FUTURE MAR17
724.76
543.57
362.38
181.19
0.00
-181.19
-362.38
-543.57
-724.76
0.00
37.48
74.95
112.43
149.90
187.38
224.85
262.33
손익(백만)

가격

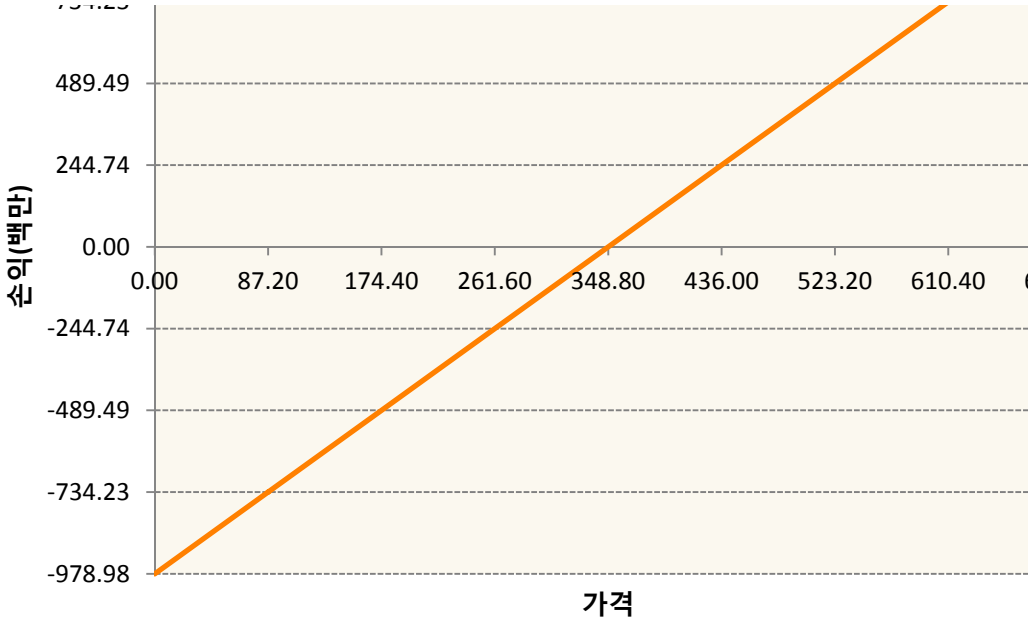

KR4175M20009-2017-02 달러선물
582.25
436.69
291.13
145.56
0.00
-145.56
-291.13
-436.69
-582.25
0.00
291.13
582.25
873.38
1,164.50
1,455.63
1,746.75
2,037.88
손익(백만)
가격


KWH7-KC HRW WHEAT FUT MAR17
238.30
178.73
119.15
59.58
0.00
-59.58
-119.15
-178.73
-238.30
0.00
113.00
226.00
339.00
452.00
565.00
678.00
791.00
손익(백만)
가격

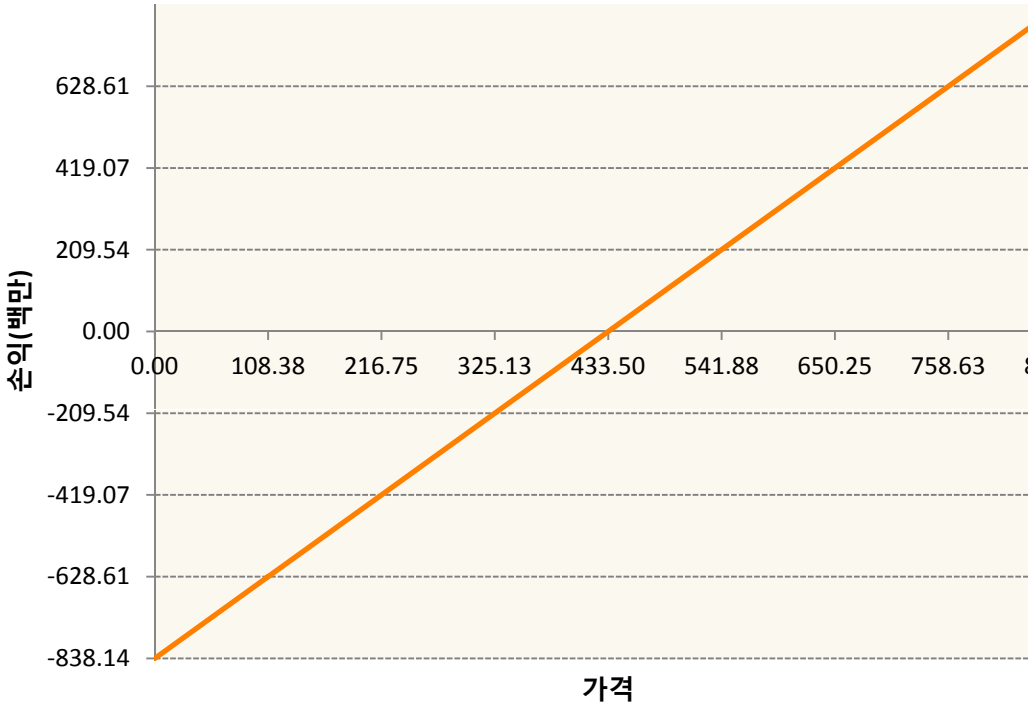

SBH7-Sugar #11 (WORLD) MAR17
1,376.57
1,032.43
688.28
344.14
0.00
-344.14
-688.28
-1,032.43
-1,376.57
0.00
5.18
10.37
15.55
20.73
25.91
31.10
36.28
손익(백만)
가격


SH7-SOYBEAN FUTURE MAR17
2,000.99
1,500.74
1,000.49
500.25
0.00
-500.25
-1,000.49
-1,500.74
-2,000.99
0.00
267.31
534.63
801.94
1,069.25
1,336.56
1,603.88
1,871.19
손익(백만)
가격


SMH7-SOYBEAN MEAL FUTR MAR17
978.98
734.23



WH7-WHEAT FUTURE(CBT) MAR17



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

BOH7	SOYBEAN OIL FUTR MAR17	74
CH7	CORN FUTURE MAR17	171
CTH7	COTTON NO.2 FUTR MAR17	34
KCH7	COFFEE "C" FUTURE MAR17	58
KR4175M20(	2017-02 달러선물	47

KWH7	KC HRW WHEAT FUT MAR17	19
SBH7	Sugar #11 (WORLD) MAR17	110
SH7	SOYBEAN FUTURE MAR17	160
SMH7	SOYBEAN MEAL FUTR MAR17	78
WH7	WHEAT FUTURE(CBT) MAR17	67

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

934