공시일	2017-01-20
기준일	2017-01-19

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	2017-01-20
기준일	2017-01-19

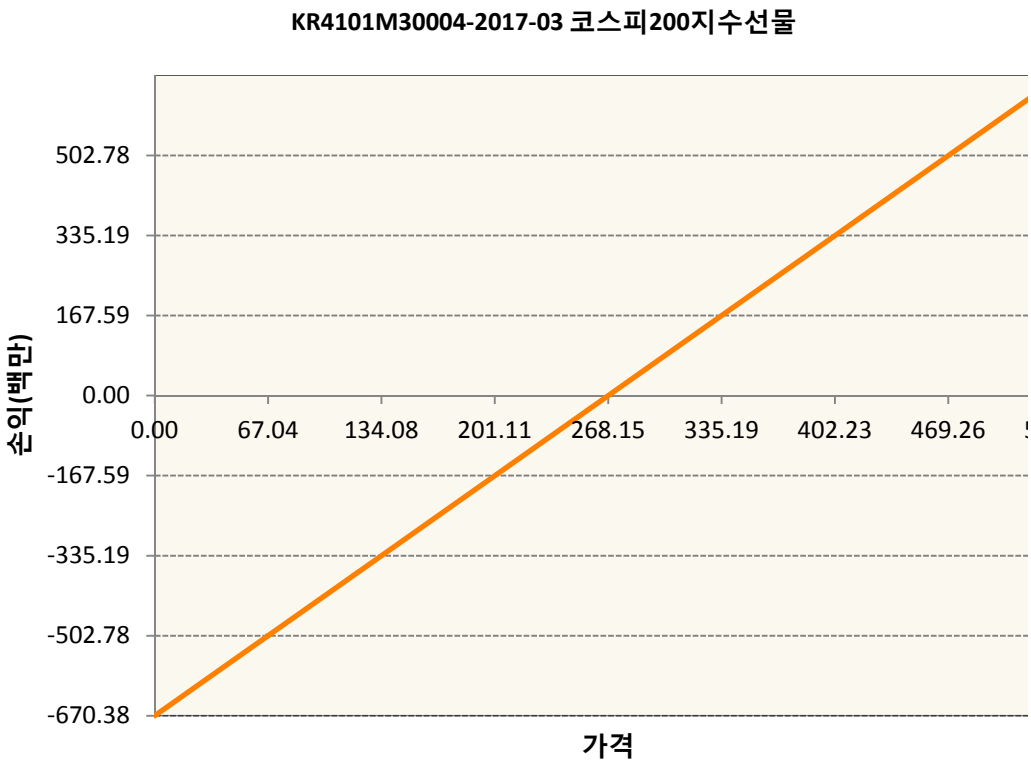
스마트인덱스모

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							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	2017-01-20
기준일	2017-01-19

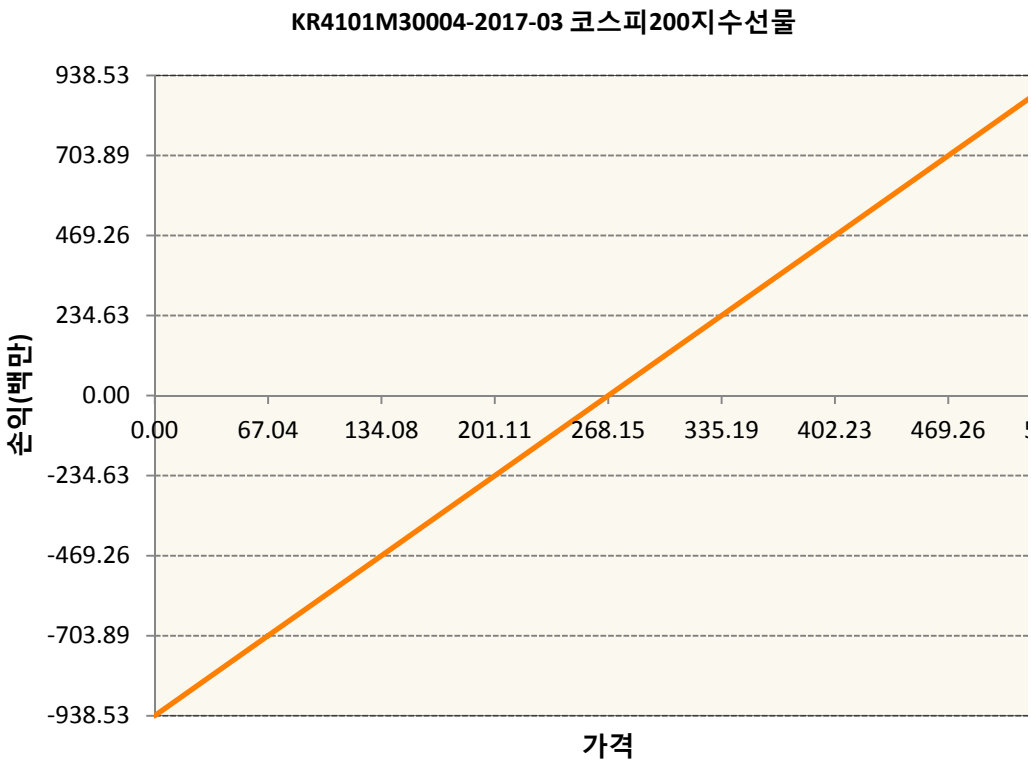
스마트레버리지목표전환형1호

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	939	0	939	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	2017-01-20
기준일	2017-01-19

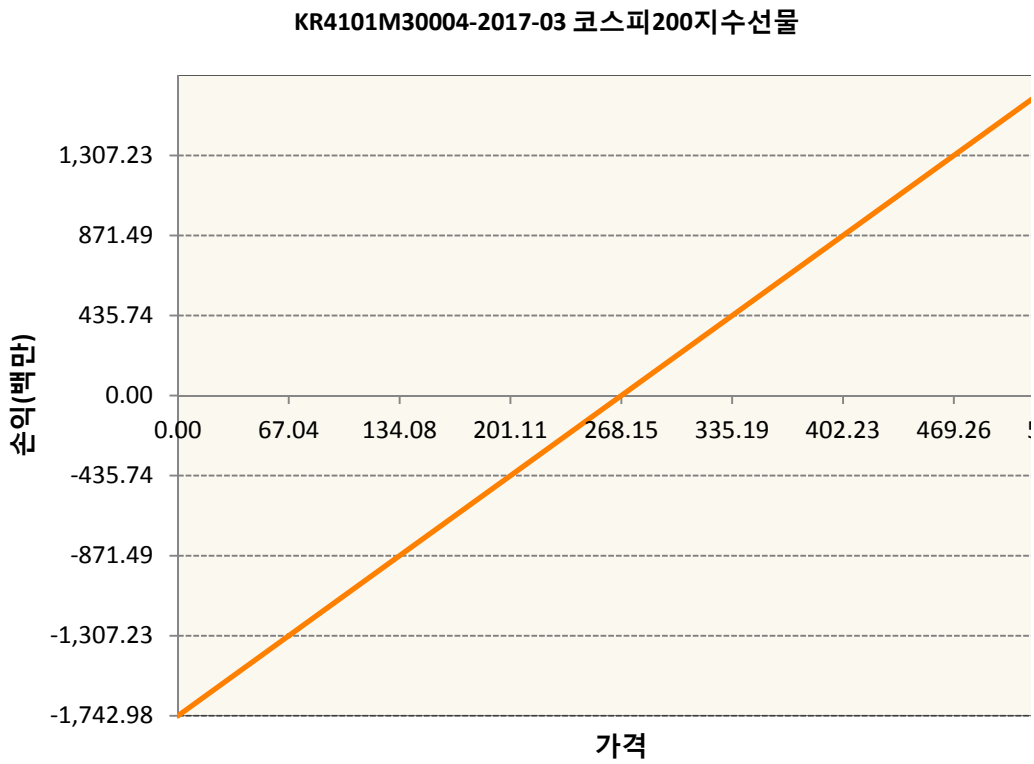
1.3배 레버리지 인덱스(주식-파생형)

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	1,743	0	1,743	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	2017-01-20
기준일	2017-01-19

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	922

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

688

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-01-20
기준일	2017-01-19

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	367

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

578

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-01-20
기준일	2017-01-19

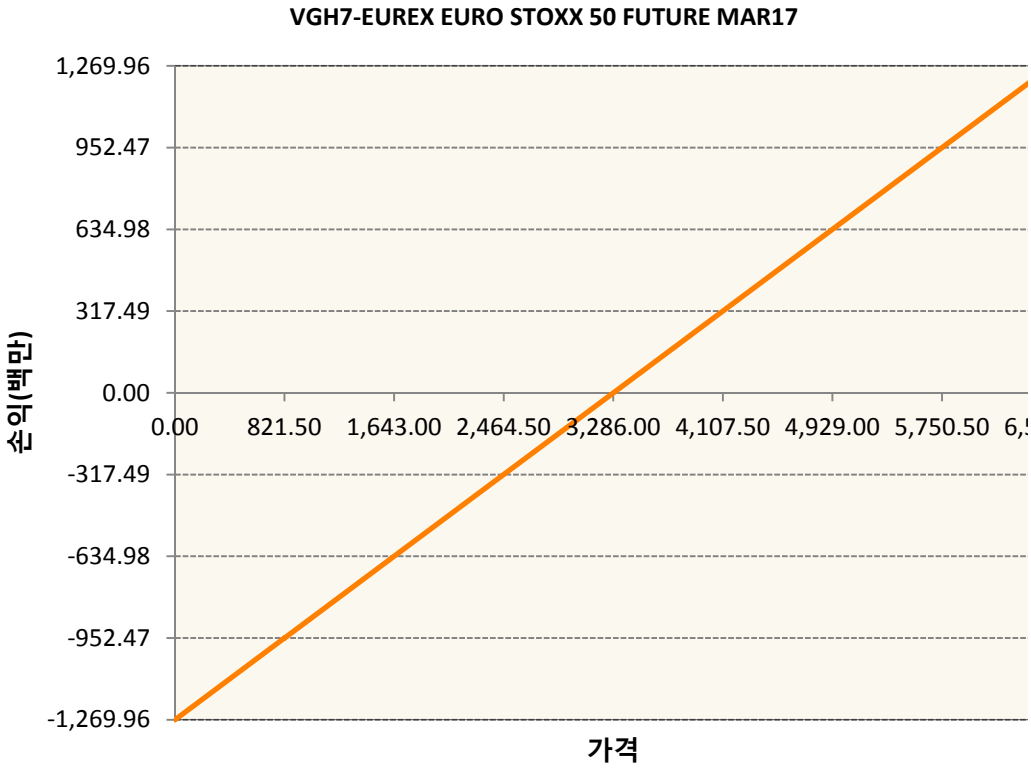
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,270	0	1,270	

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)

110

공시일	2017-01-20
기준일	2017-01-19

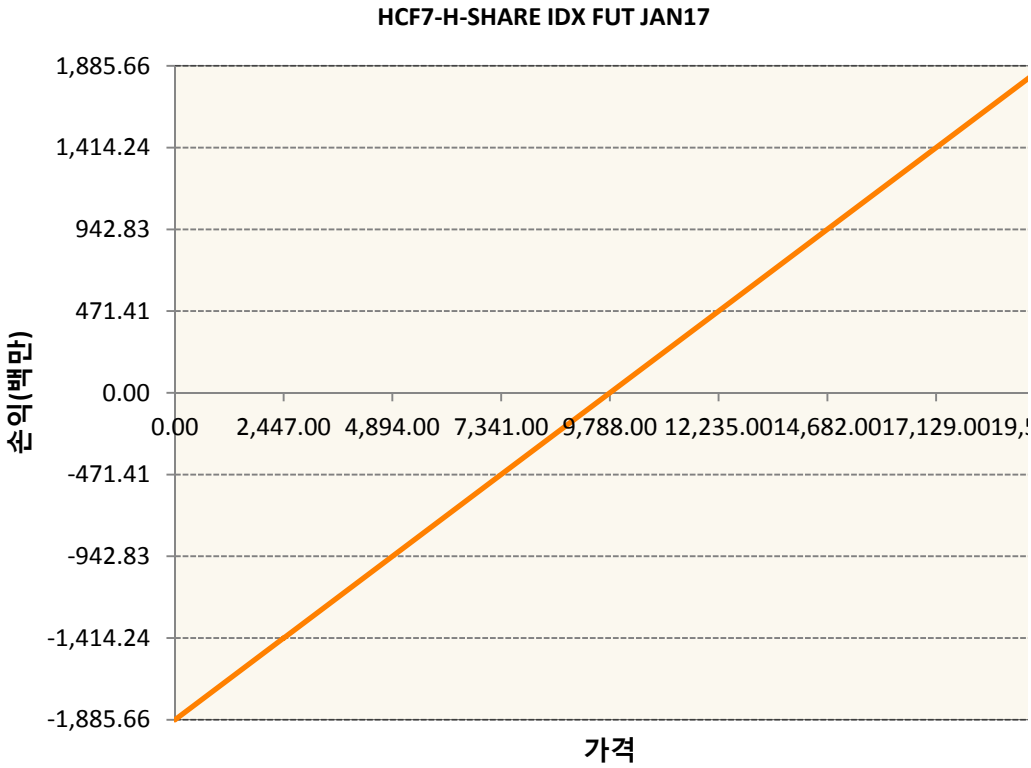
차이나인덱스모(주식-파생형)

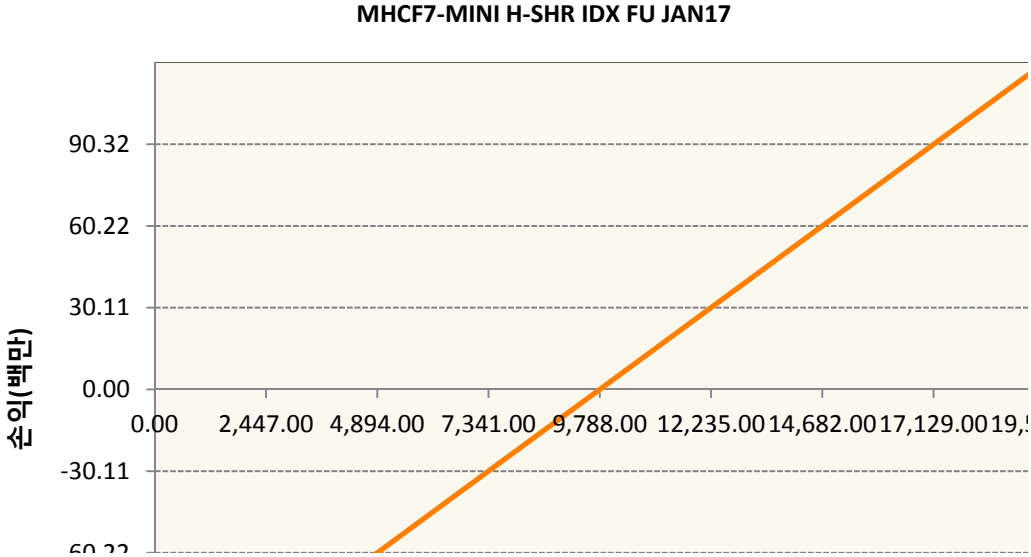
1. 계약금액

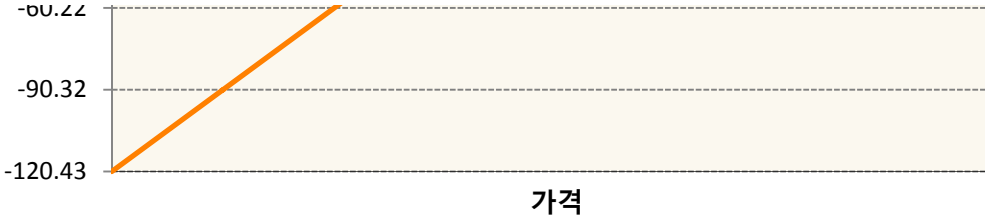
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,006	0	2,006	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCF7	H-SHARE IDX FUT JAN17	151
MHCF7	MINI H-SHR IDX FU JAN17	10

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	195

공시일	2017-01-20
기준일	2017-01-19

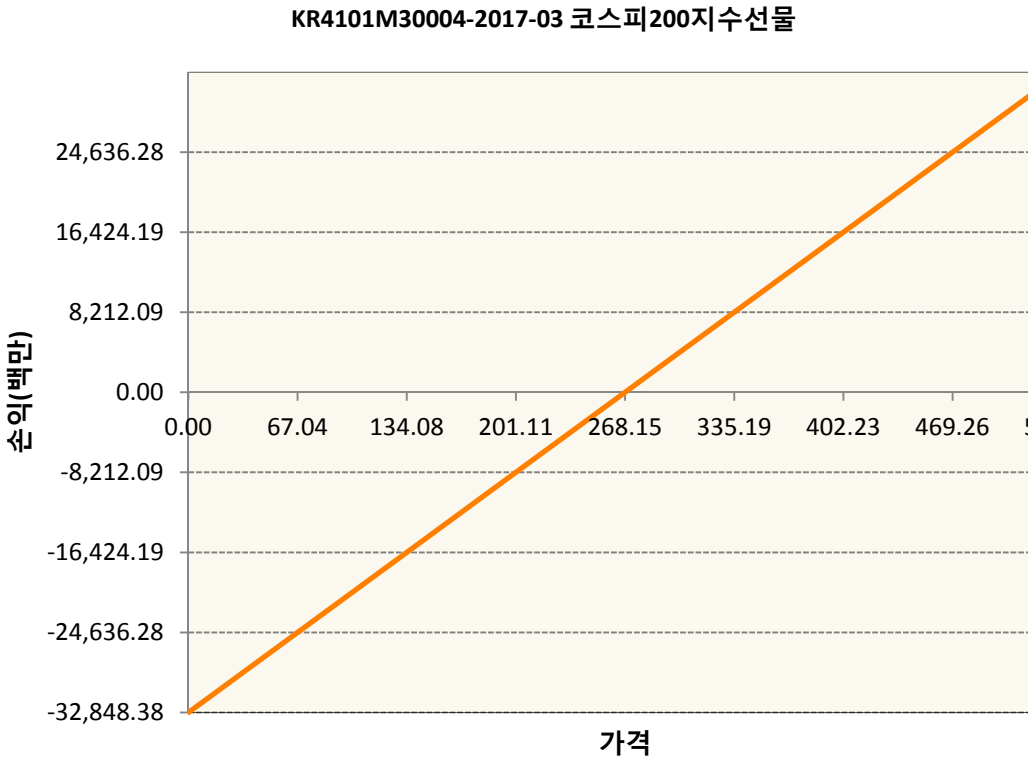
커버드콜(주식혼합-파생형)

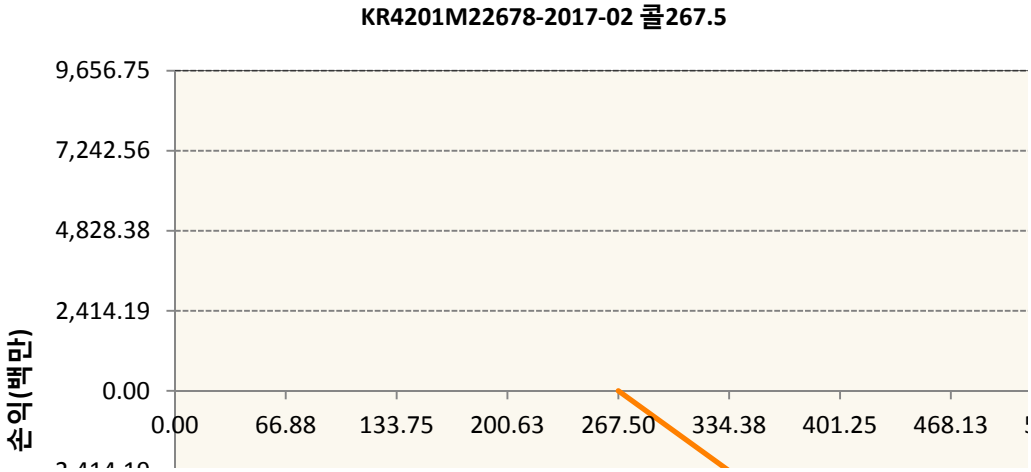
1. 계약금액

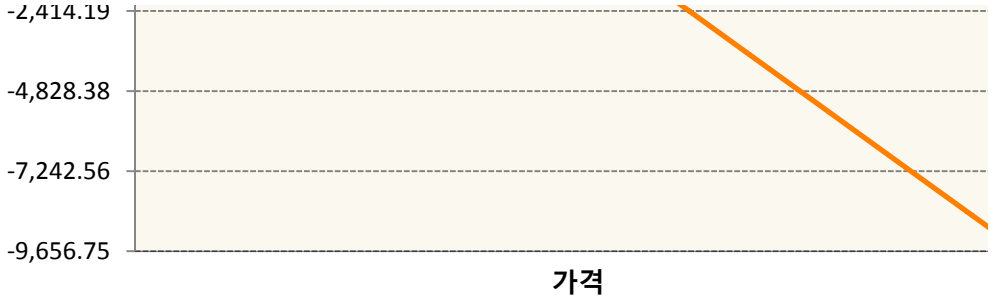
(단위:백만원)

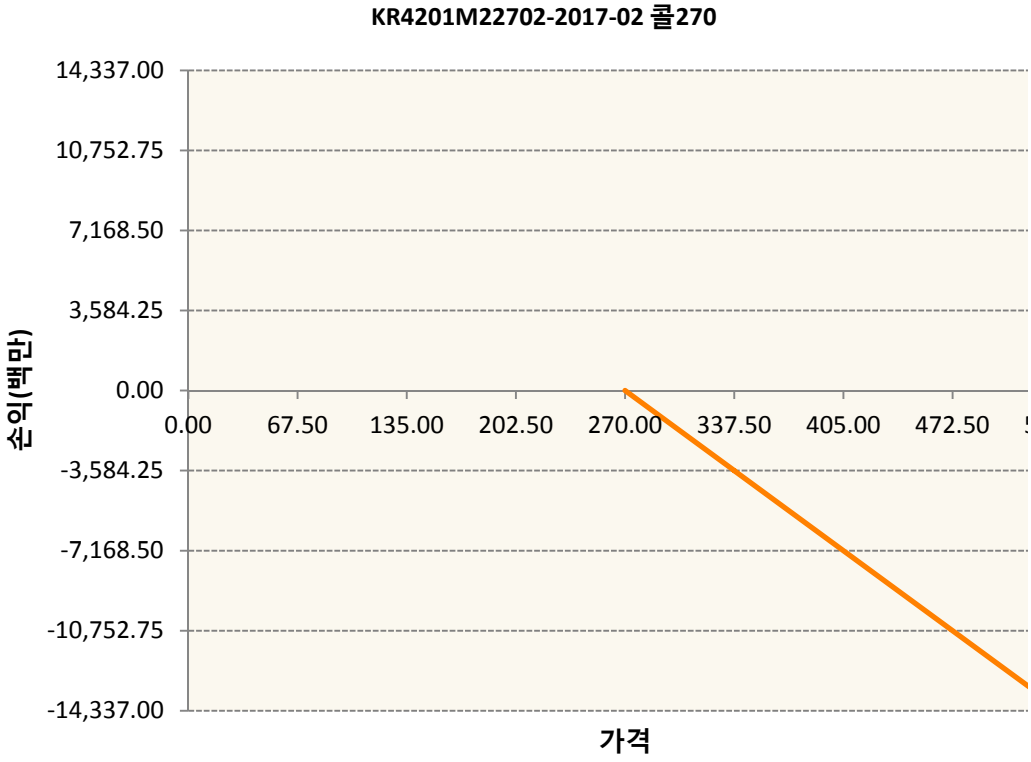
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	2,681	0	2,681	장내
신규	유가증권	옵션	0	543	-543	장내
누계	유가증권	선물	32,848	0	32,848	장내
누계	유가증권	옵션	0	23,994	-23,994	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101M30(2017-03 코스피200지수선물							2,623
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-2,623	-2,623	-2,623	-2,623	-2,623	-2,623	-2,623
-5.33%	-1,749	-1,749	-1,749	-1,749	-1,749	-1,749	-1,749
-2.67%	-874	-874	-874	-874	-874	-874	-874
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	874	874	874	874	874	874	874
5.33%	1,749	1,749	1,749	1,749	1,749	1,749	1,749
8.00%	2,623	2,623	2,623	2,623	2,623	2,623	2,623
KR4201M22(2017-02 콜267.5							3,322
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	586	586	585	585	584	581	578
-5.33%	583	580	575	568	558	545	531
-2.67%	525	500	473	442	410	376	340
0%	142	95	47	0	-47	-95	-142
2.67%	-794	-819	-846	-877	-909	-944	-980
5.33%	-2,026	-2,030	-2,036	-2,045	-2,056	-2,070	-2,086
8.00%	-3,310	-3,311	-3,311	-3,312	-3,314	-3,318	-3,322
	KR4201M22: 2017-02 콜270						4,533

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	569	569	569	569	568	566	564
-5.33%	568	566	563	557	549	538	524
-2.67%	534	512	485	454	419	380	338
0%	199	133	67	0	-67	-135	-203
2.67%	-904	-957	-1,013	-1,071	-1,132	-1,193	-1,256
5.33%	-2,621	-2,633	-2,651	-2,673	-2,700	-2,730	-2,765
8.00%	-4,499	-4,500	-4,502	-4,506	-4,513	-4,521	-4,533

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

10,842

공시일	2017-01-20
기준일	2017-01-19

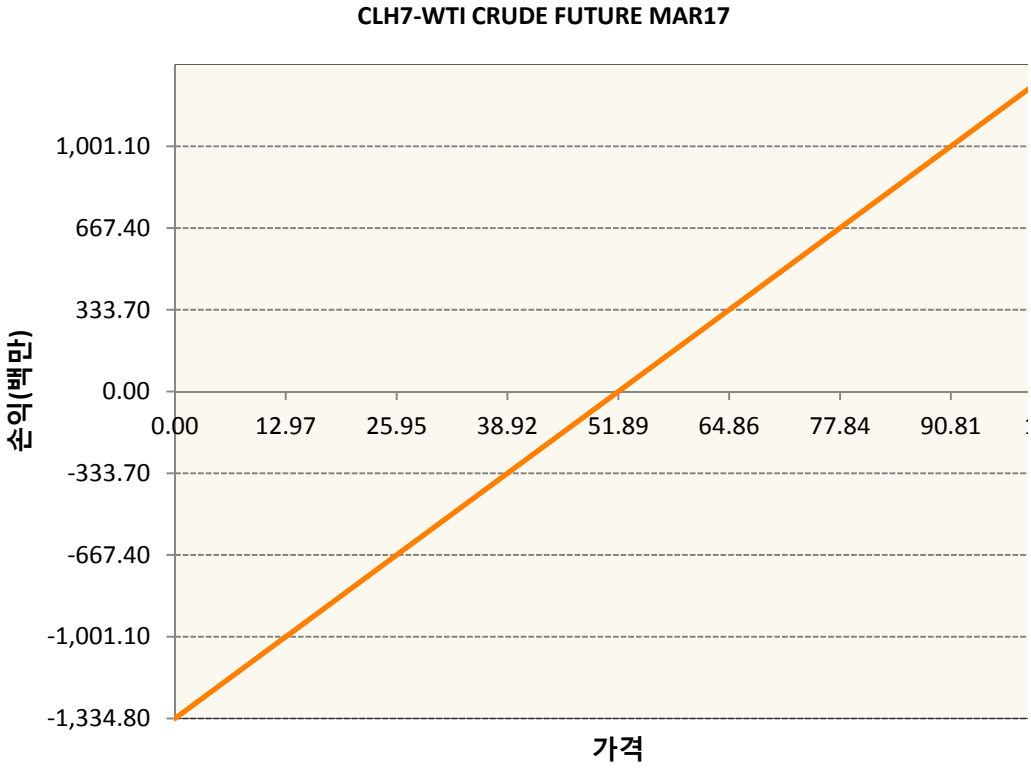
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

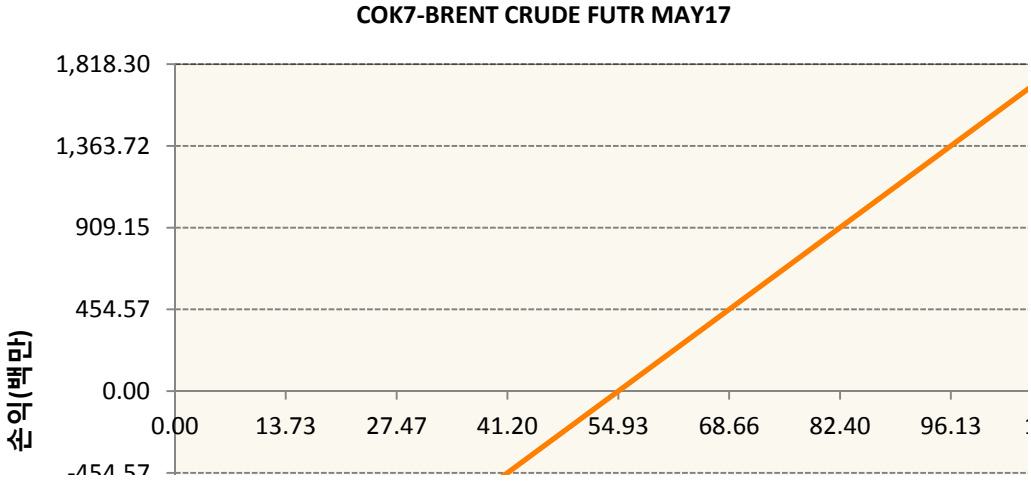
1. 계약금액

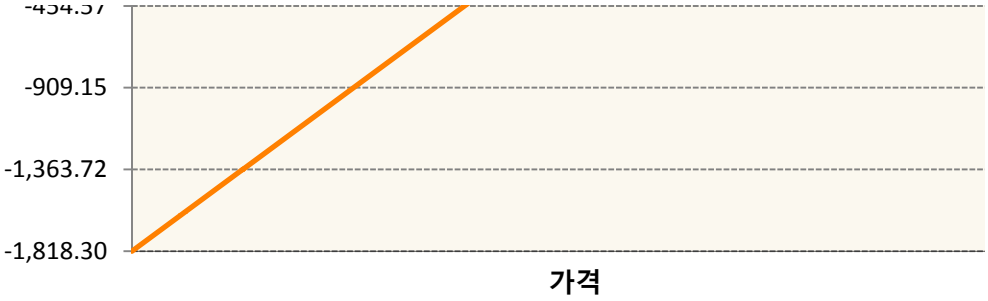
(단위:백만원)

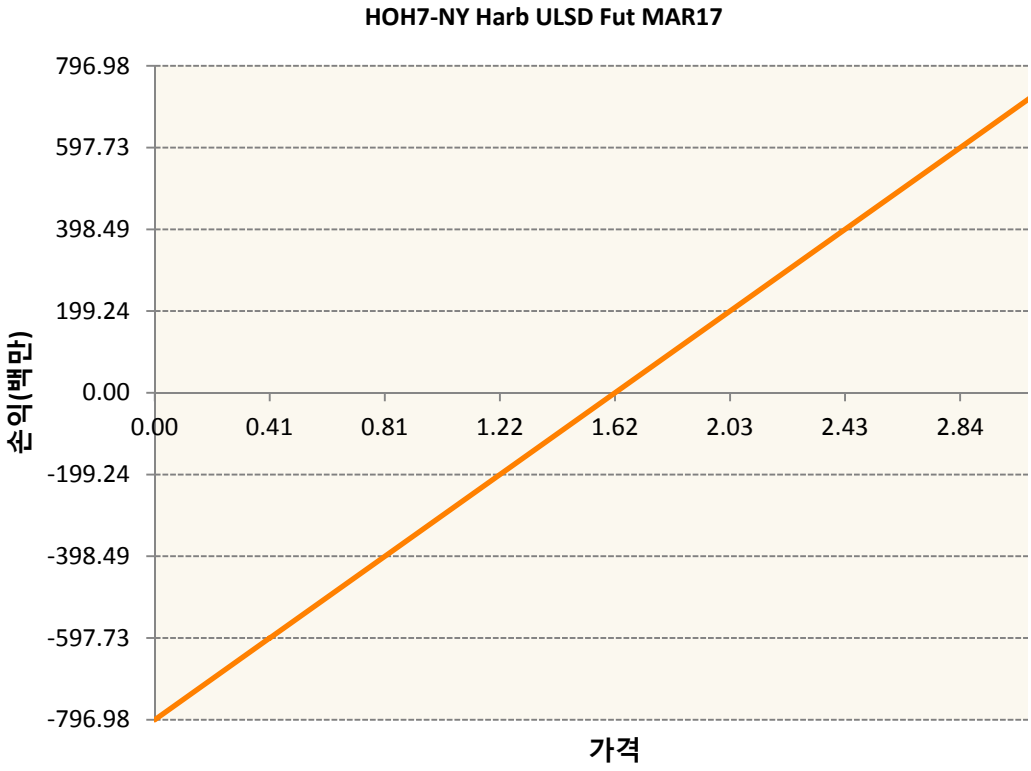
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	선물	유가증권	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	선물	유가증권	1,335	0	1,335	
누계	유가증권	선물	5,007	424	4,584	

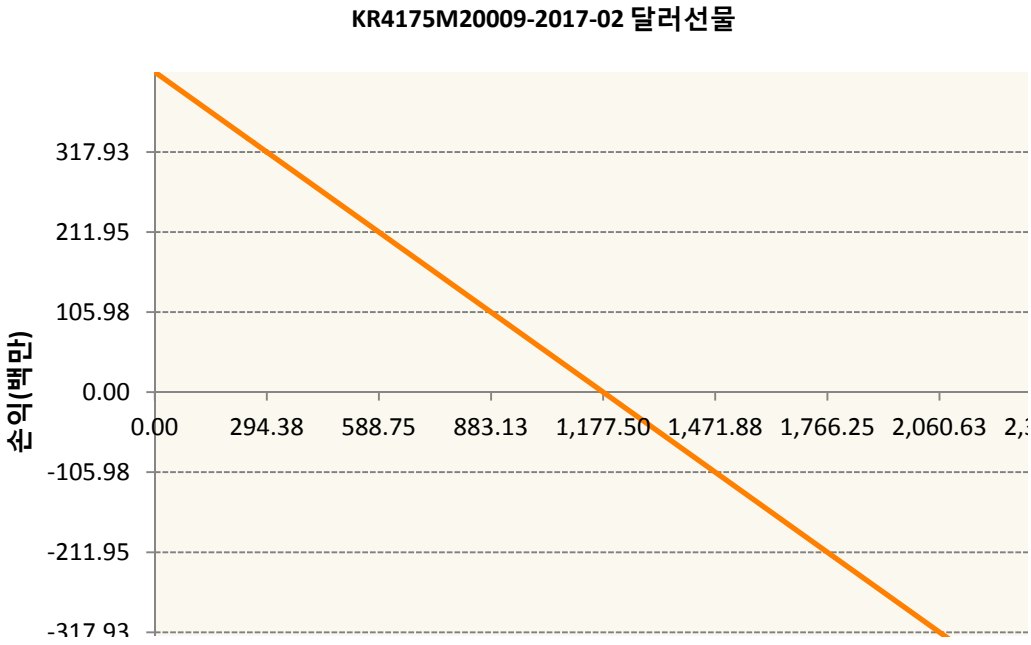
2. 만기시점의 손익구조

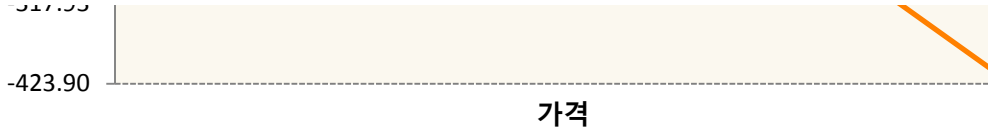


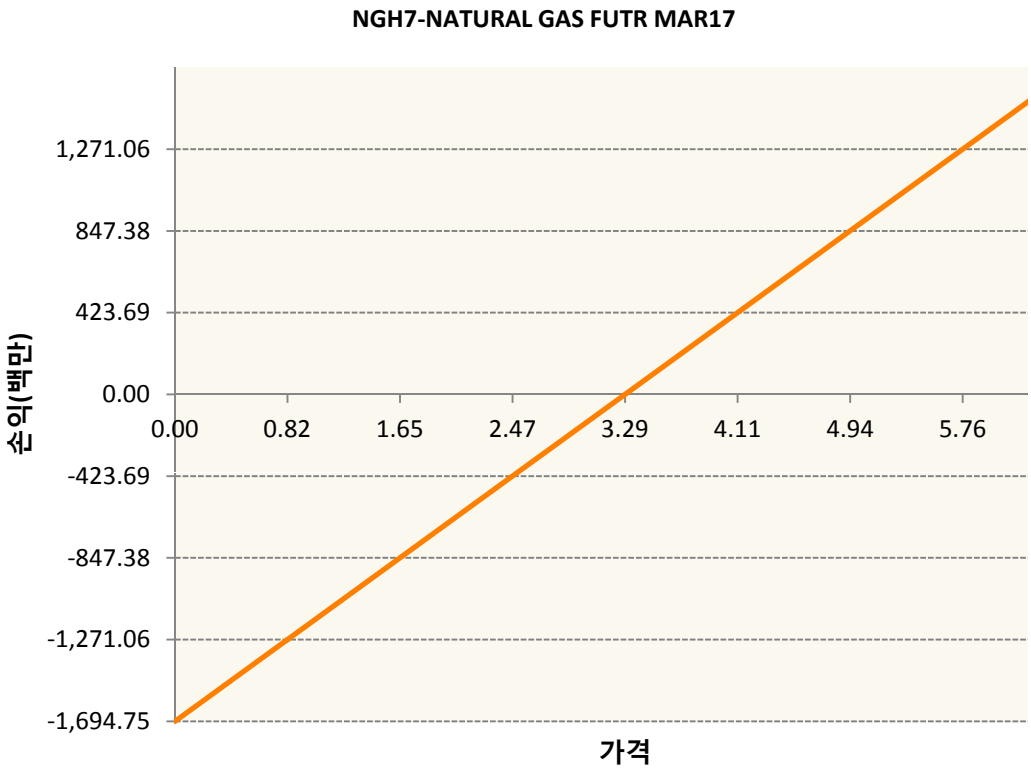


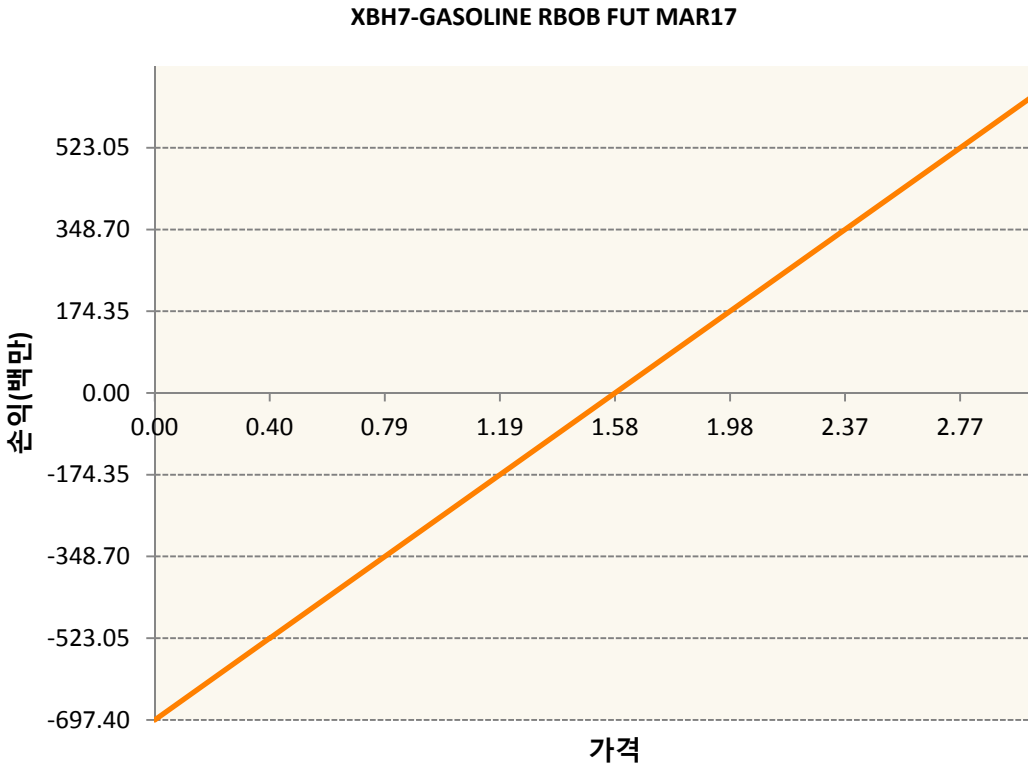

-909.15
-1,363.72
-1,818.30
가격


HOH7-NY Harb ULSD Fut MAR17
796.98
597.73
398.49
199.24
0.00
-199.24
-398.49
-597.73
-796.98
0.00
0.41
0.81
1.22
1.62
2.03
2.43
2.84
순익(백만)
가격


KR4175M20009-2017-02 달러선물
317.93
211.95
105.98
0.00
-105.98
-211.95
0.00
294.38
588.75
883.13
1,177.50
1,471.88
1,766.25
2,060.63
순익(백만)


-423.90
가격


NGH7-NATURAL GAS FUTR MAR17
1,271.06
847.38
423.69
0.00
-423.69
-847.38
-1,271.06
-1,694.75
0.00
0.82
1.65
2.47
3.29
4.11
4.94
5.76
순익(백만)
가격


XBH7-GASOLINE RBOB FUT MAR17
523.05
348.70
174.35
0.00
-174.35
-348.70
-523.05
-697.40
0.00
0.40
0.79
1.19
1.58
1.98
2.37
2.77
순익(백만)
가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLH7	WTI CRUDE FUTURE MAR17	107
COK7	BRENT CRUDE FUTR MAY17	145
HOH7	NY Harb ULSD Fut MAR17	64
KR4175M20(	2017-02 달러선물	34
NGH7	NATURAL GAS FUTR MAR17	136
XBH7	GASOLINE RBOB FUT MAR17	56

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

1,171

공시일	2017-01-20
기준일	2017-01-19

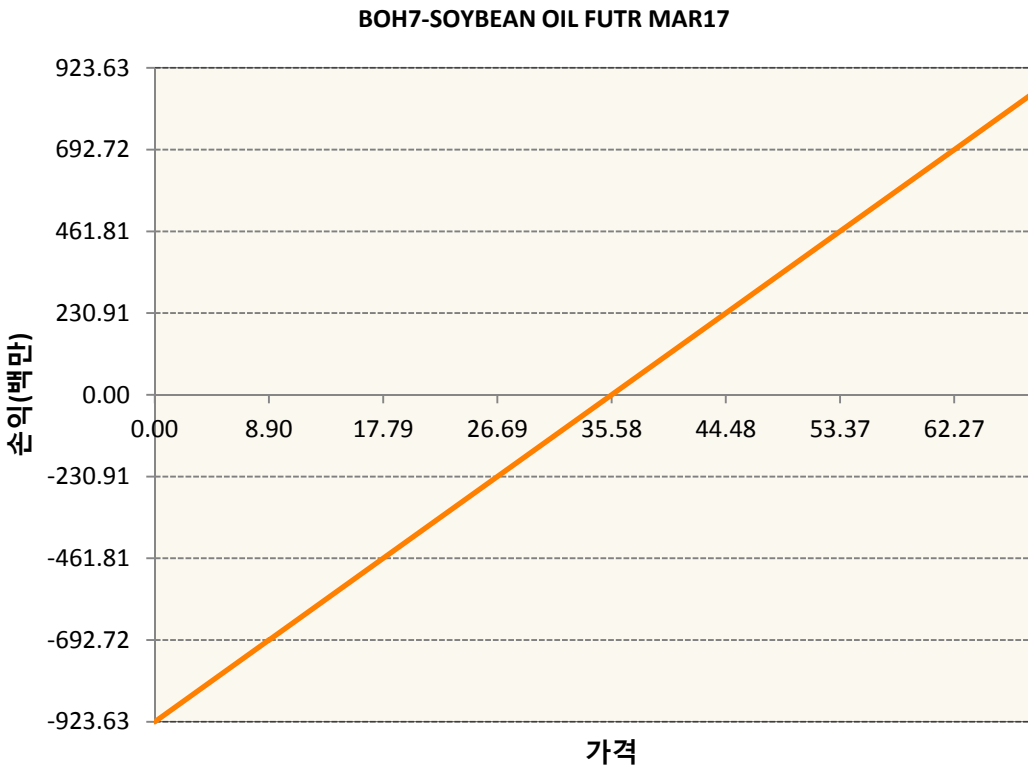
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

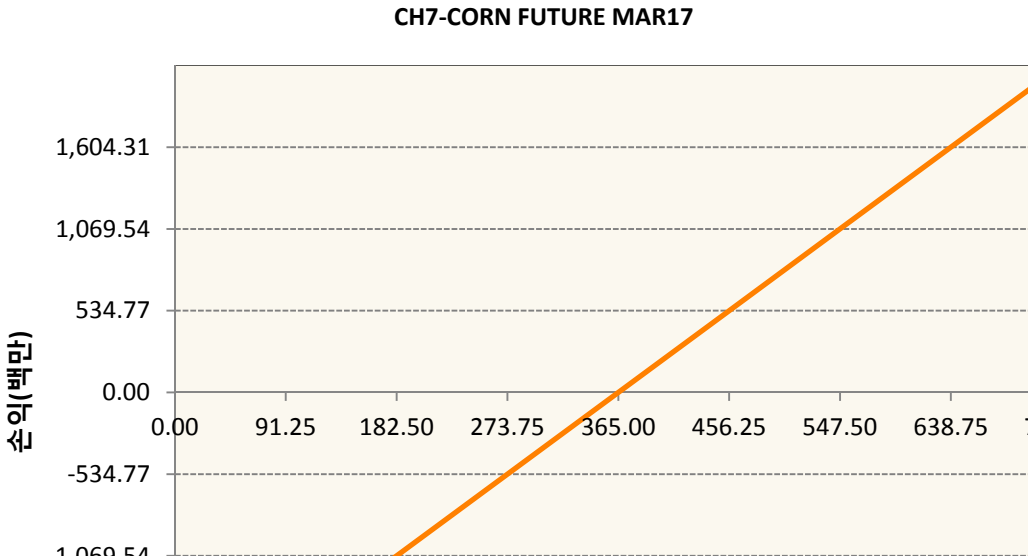
1. 계약금액

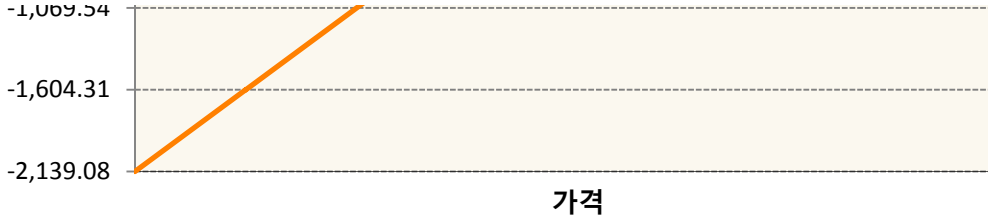
(단위:백만원)

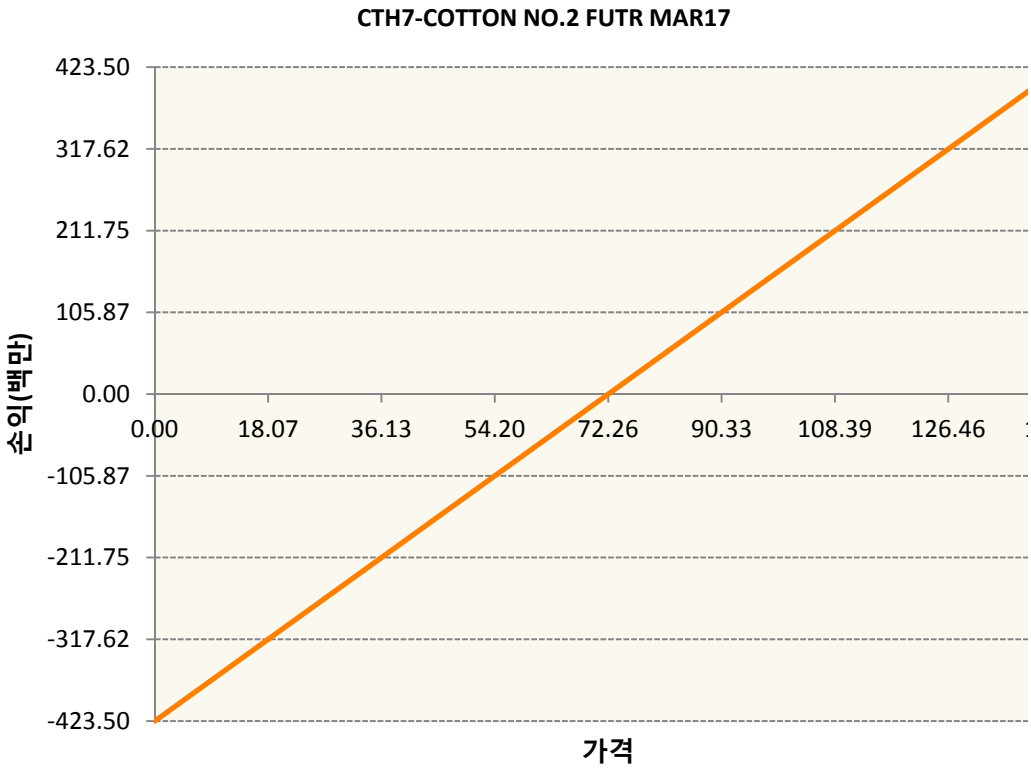
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	9,671	589	9,083	

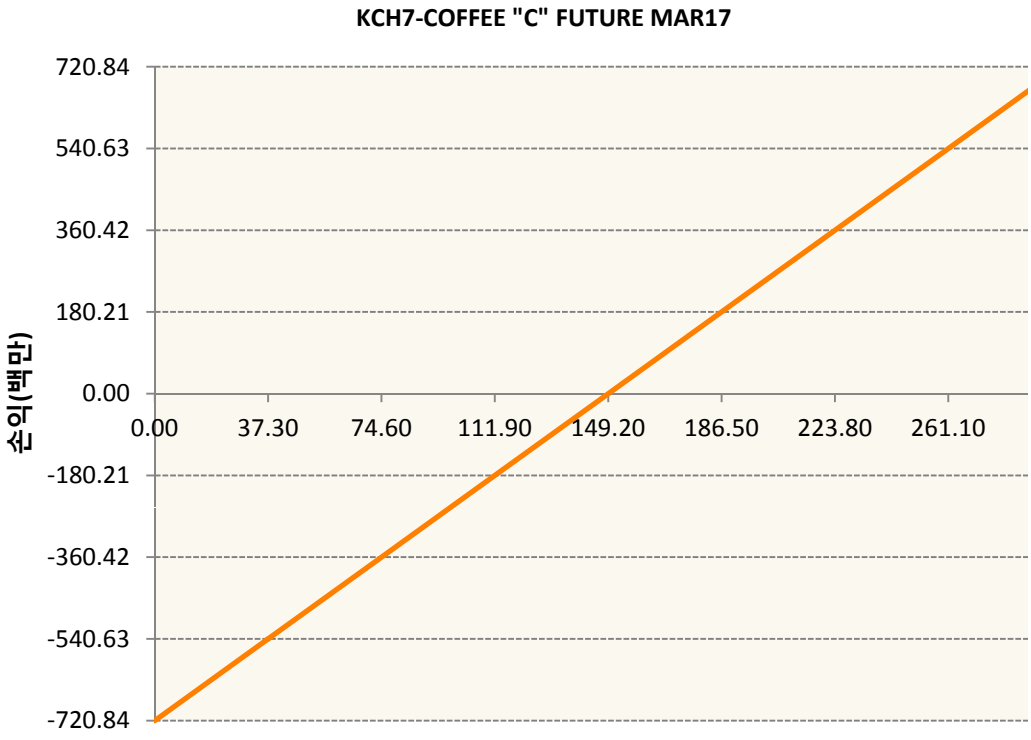
2. 만기시점의 손익구조



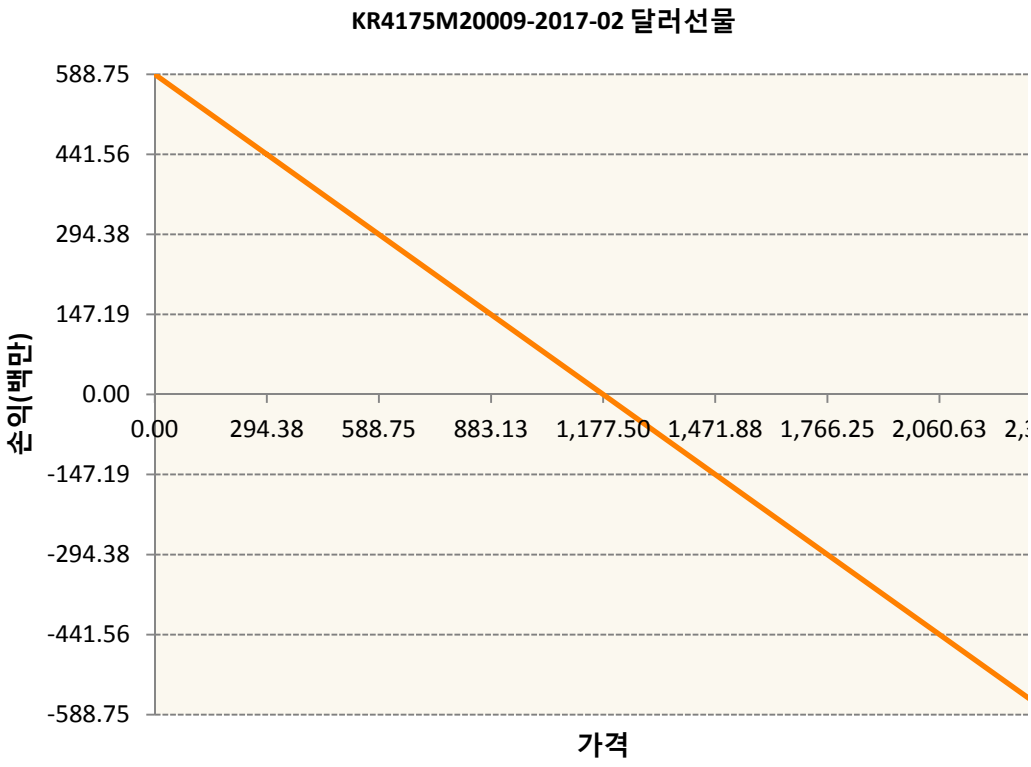


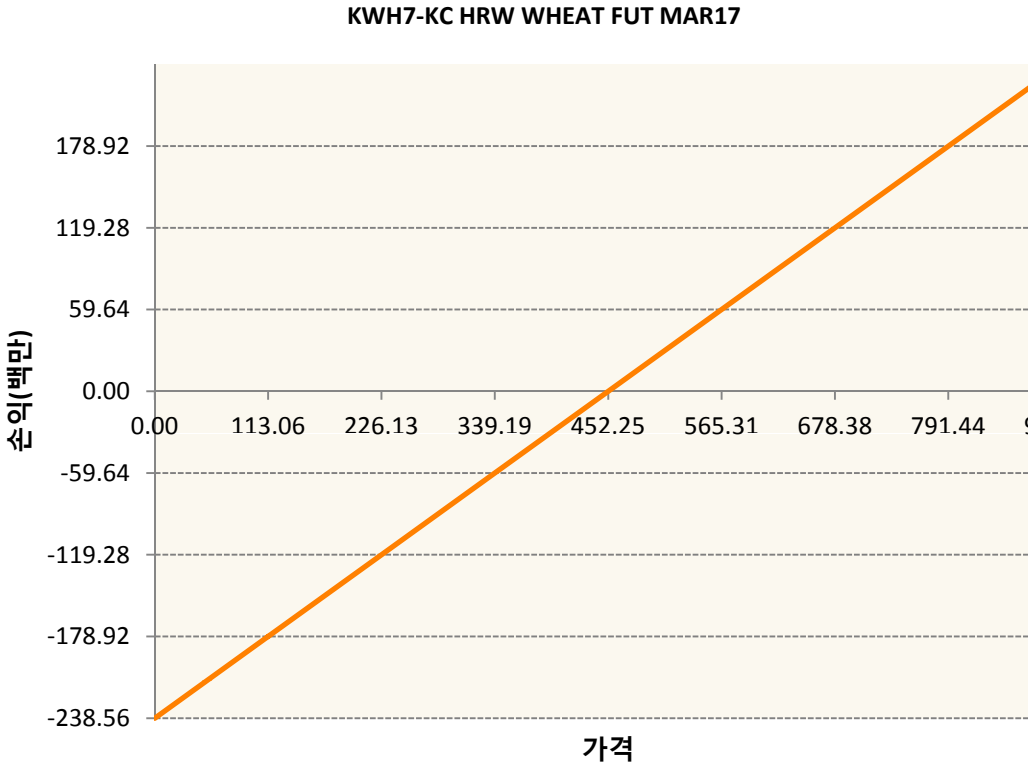

-1,604.31
-2,139.08
가격

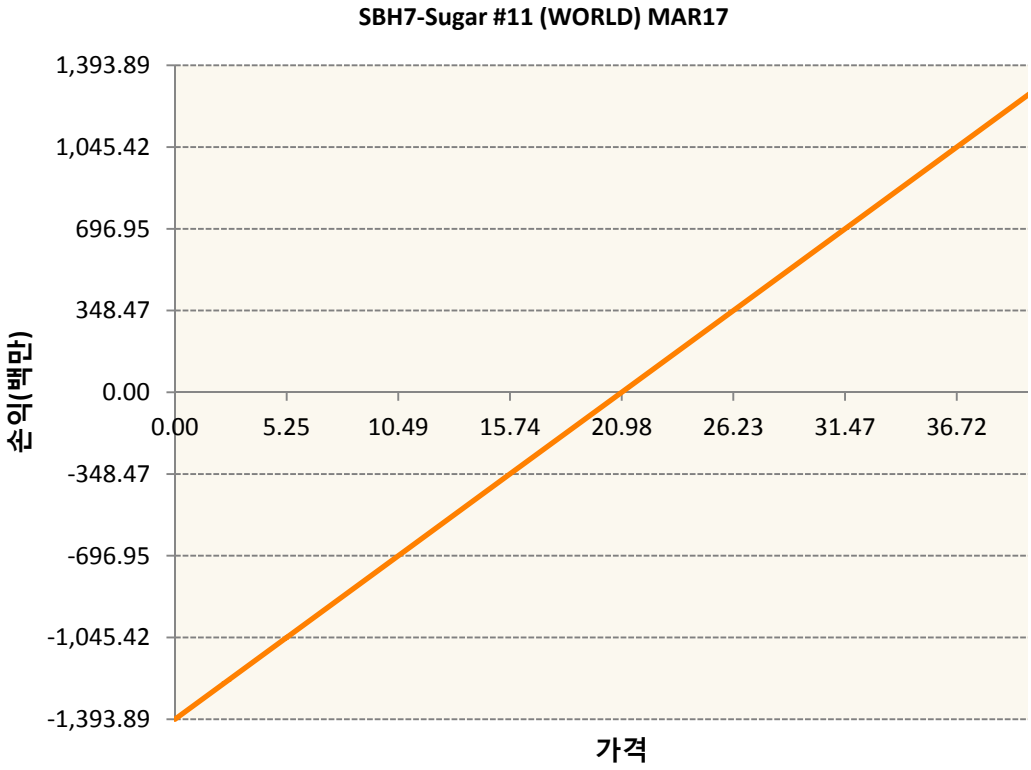

CTH7-COTTON NO.2 FUTR MAR17
423.50
317.62
211.75
105.87
0.00
-105.87
-211.75
-317.62
-423.50
0.00
18.07
36.13
54.20
72.26
90.33
108.39
126.46
손익(백만)
가격

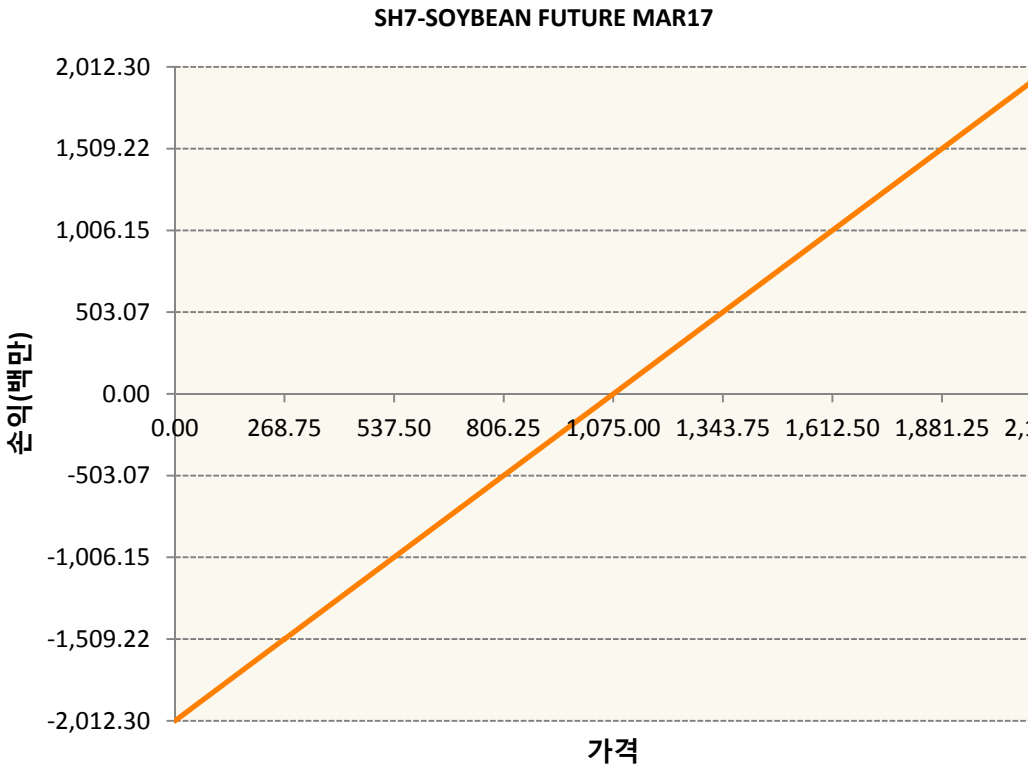

KCH7-COFFEE "C" FUTURE MAR17
720.84
540.63
360.42
180.21
0.00
-180.21
-360.42
-540.63
-720.84
0.00
37.30
74.60
111.90
149.20
186.50
223.80
261.10
손익(백만)

가격

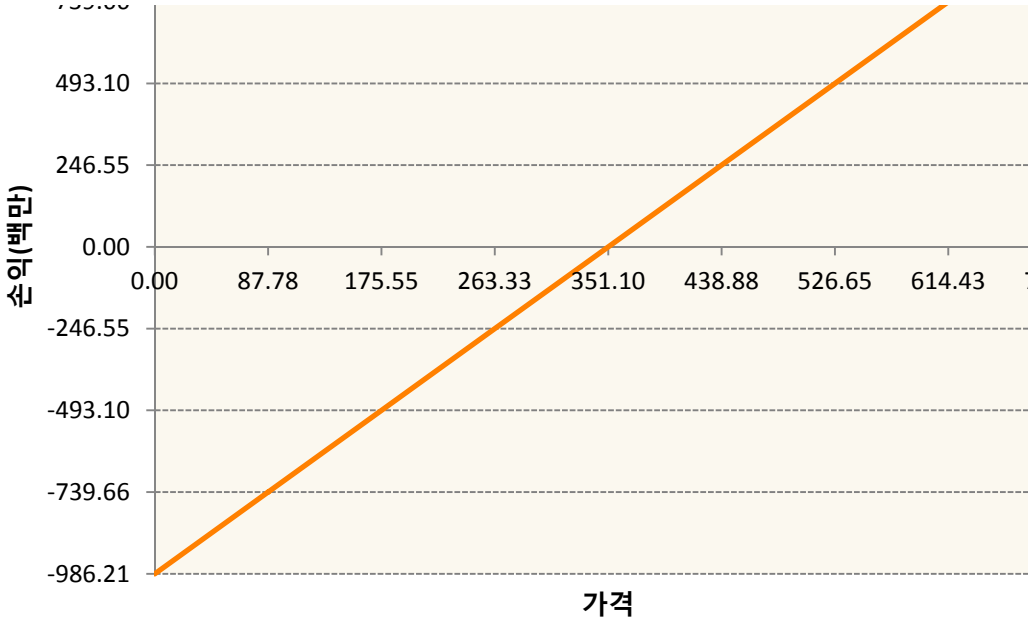

KR4175M20009-2017-02 달러선물
588.75
441.56
294.38
147.19
0.00
-147.19
-294.38
-441.56
-588.75
0.00
294.38
588.75
883.13
1,177.50
1,471.88
1,766.25
2,060.63
손익(백만)
가격


KWH7-KC HRW WHEAT FUT MAR17
178.92
119.28
59.64
0.00
-59.64
-119.28
-178.92
-238.56
0.00
113.06
226.13
339.19
452.25
565.31
678.38
791.44
손익(백만)
가격

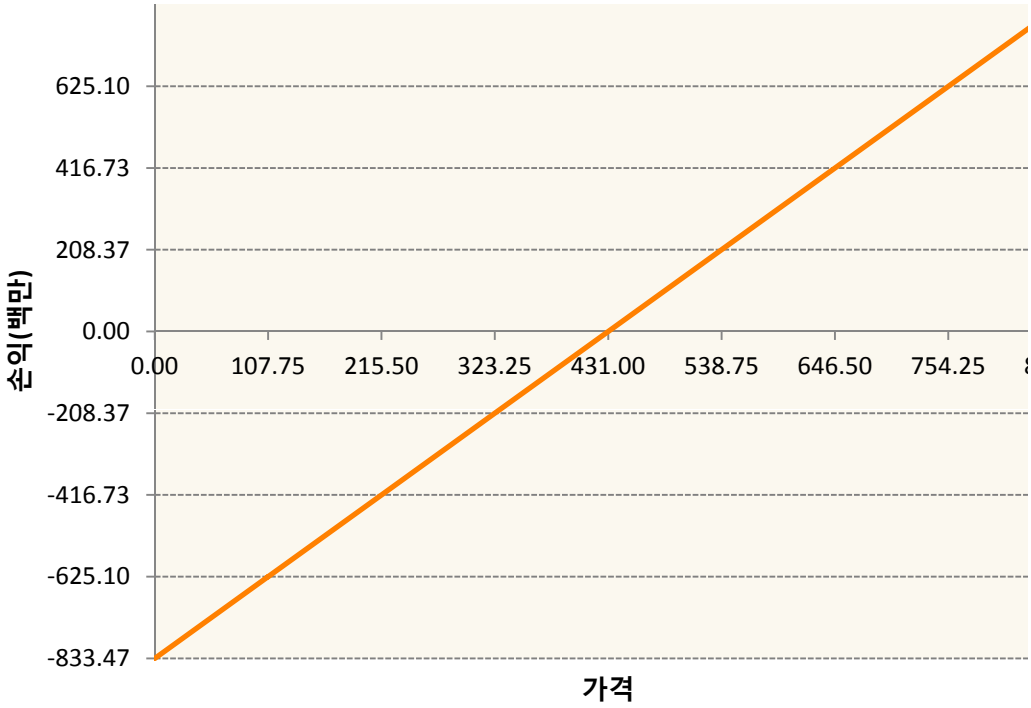

SBH7-Sugar #11 (WORLD) MAR17
1,393.89
1,045.42
696.95
348.47
0.00
-348.47
-696.95
-1,045.42
-1,393.89
0.00
5.25
10.49
15.74
20.98
26.23
31.47
36.72
손익(백만)
가격


SH7-SOYBEAN FUTURE MAR17
2,012.30
1,509.22
1,006.15
503.07
0.00
-503.07
-1,006.15
-1,509.22
-2,012.30
0.00
268.75
537.50
806.25
1,075.00
1,343.75
1,612.50
1,881.25
손익(백만)
가격


SMH7-SOYBEAN MEAL FUTR MAR17
986.21
739.66



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	112
SH7	SOYBEAN FUTURE MAR17	161
SMH7	SOYBEAN MEAL FUTR MAR17	79
WH7	WHEAT FUTURE(CBT) MAR17	67

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

935