공시일	2017-01-23
기준일	2017-01-20

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	2017-01-23
기준일	2017-01-20

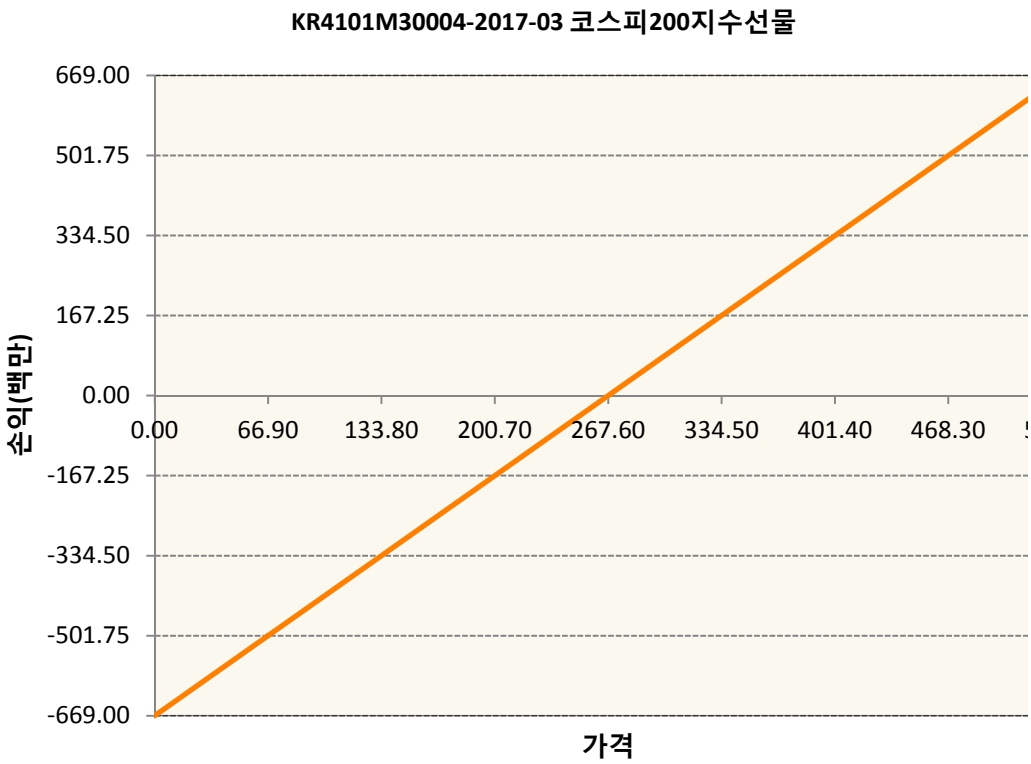
스마트인덱스모

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	669	0	669	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	2017-01-23
기준일	2017-01-20

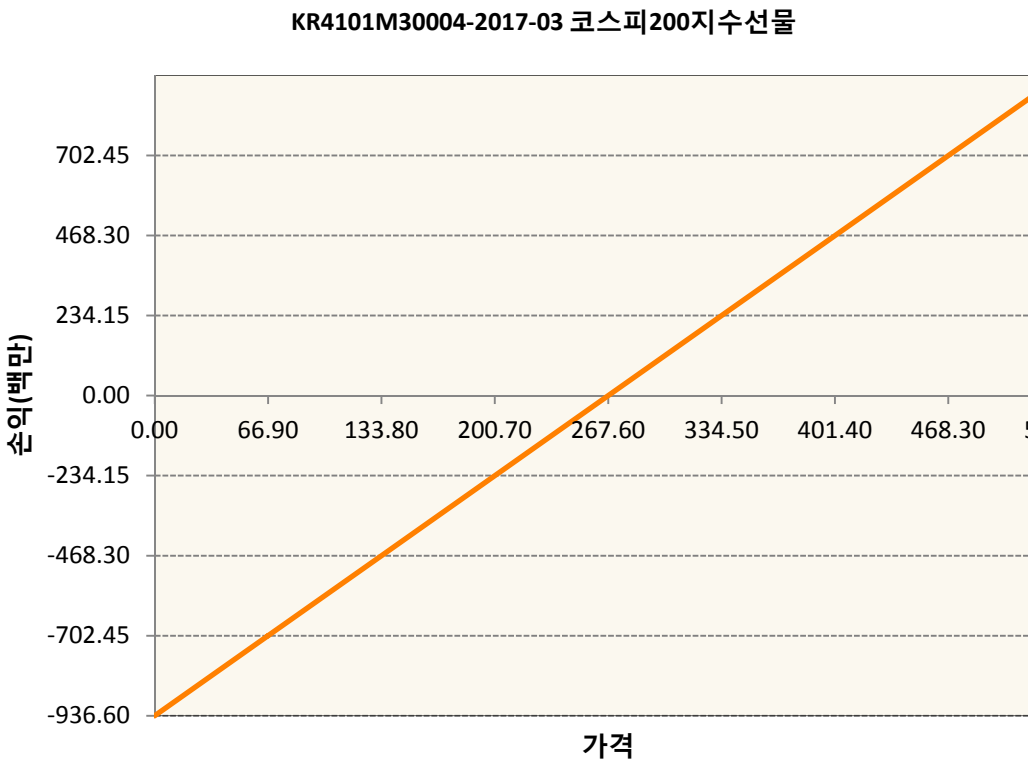
스마트레버리지목표전환형1호

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	937	0	937	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	2017-01-23
기준일	2017-01-20

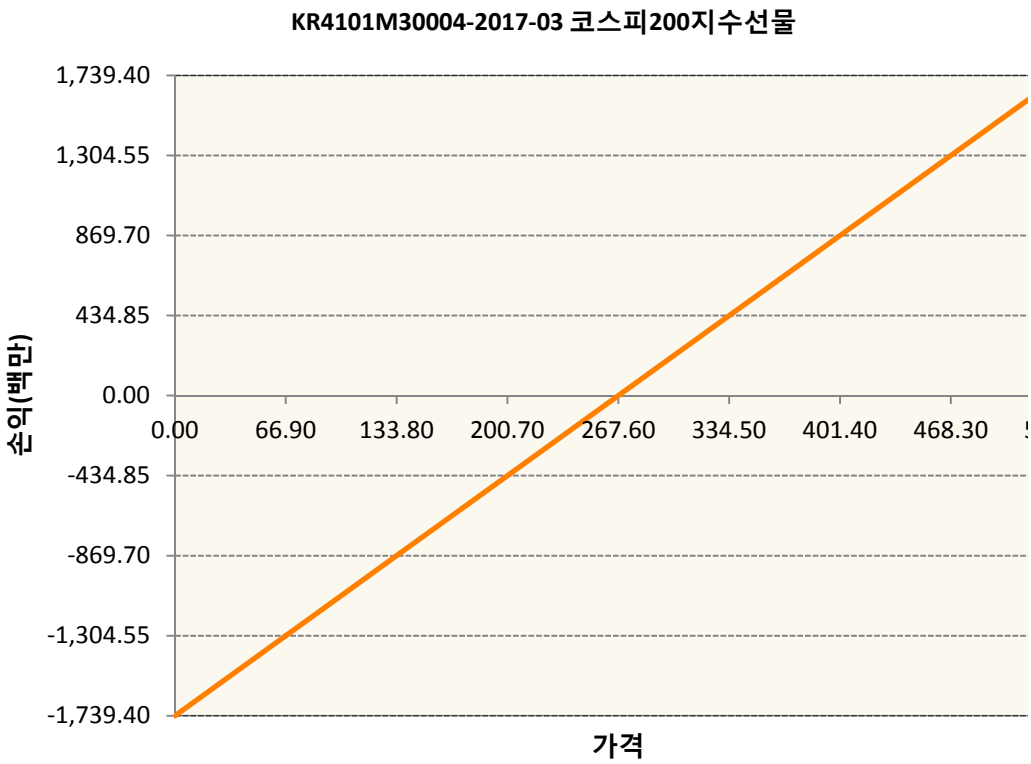
1.3배 레버리지 인덱스(주식-파생형)

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	1,739	0	1,739	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%	-92	-92	-92	-92	-92	-92	-92
-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%	92	92	92	92	92	92	92
8.00%	139	139	139	139	139	139	139

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

100

공시일	2017-01-23
기준일	2017-01-20

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	917

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

684

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-01-23
기준일	2017-01-20

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	372

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

581

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-01-23
기준일	2017-01-20

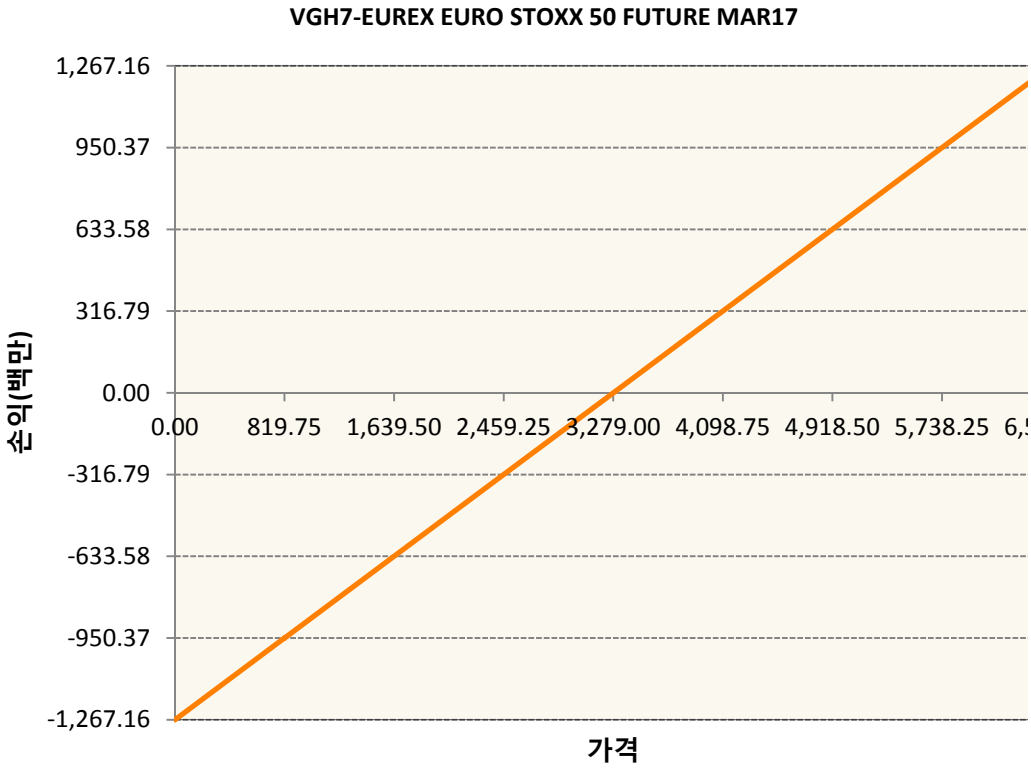
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,267	0	1,267	

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)

109

공시일	2017-01-23
기준일	2017-01-20

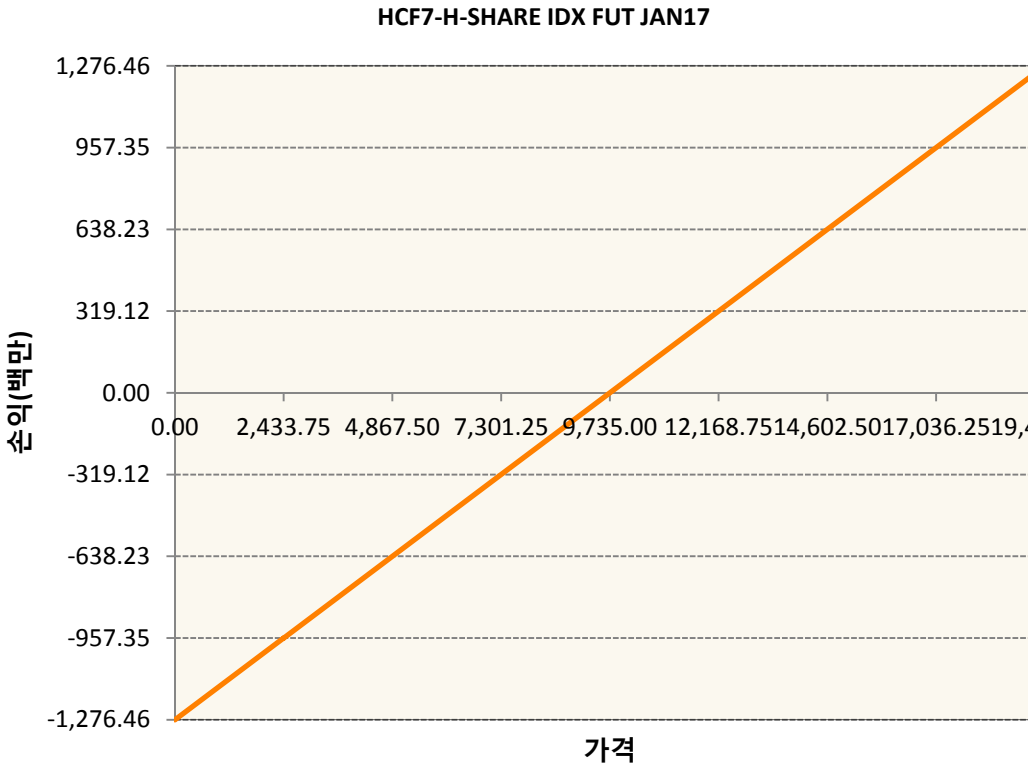
차이나인덱스모(주식-파생형)

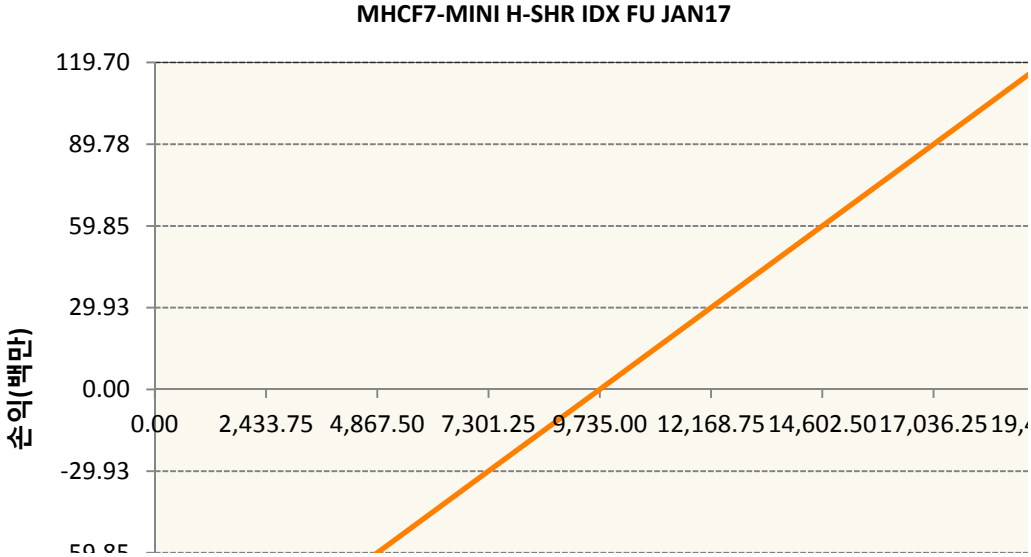
1. 계약금액

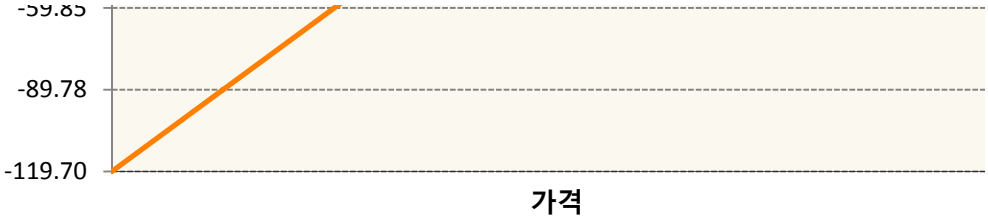
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,396	0	1,396	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

HCF7	H-SHARE IDX FUT JAN17	102
MHCF7	MINI H-SHR IDX FU JAN17	10

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

136

공시일	2017-01-23
기준일	2017-01-20

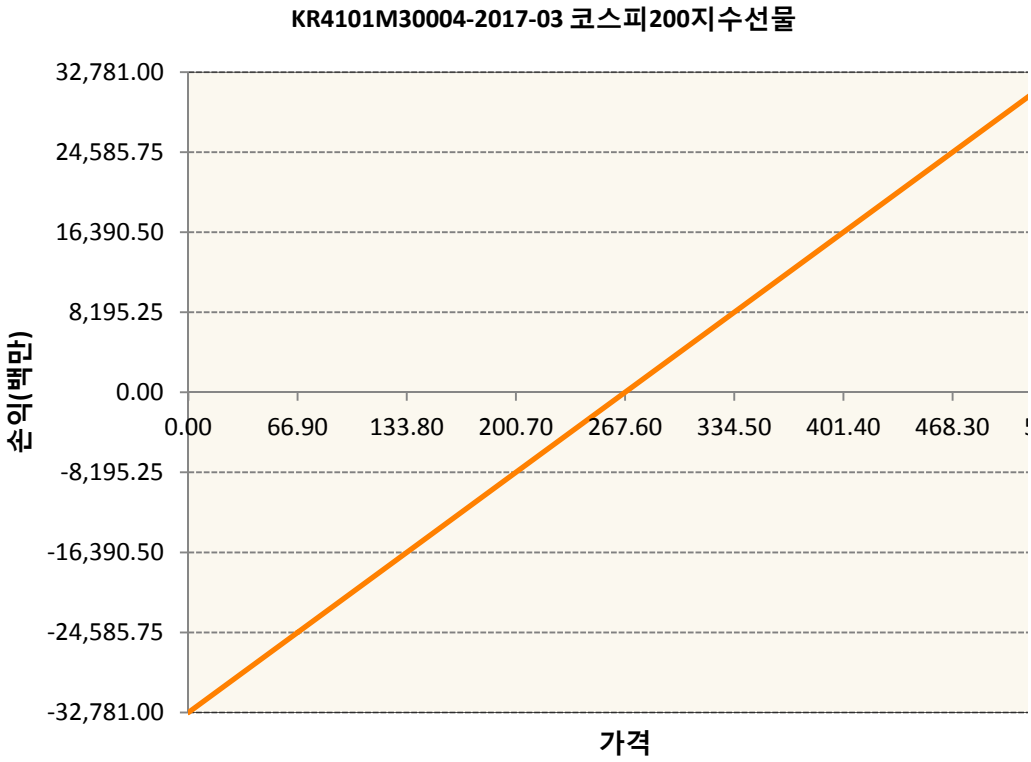
커버드콜(주식혼합-파생형)

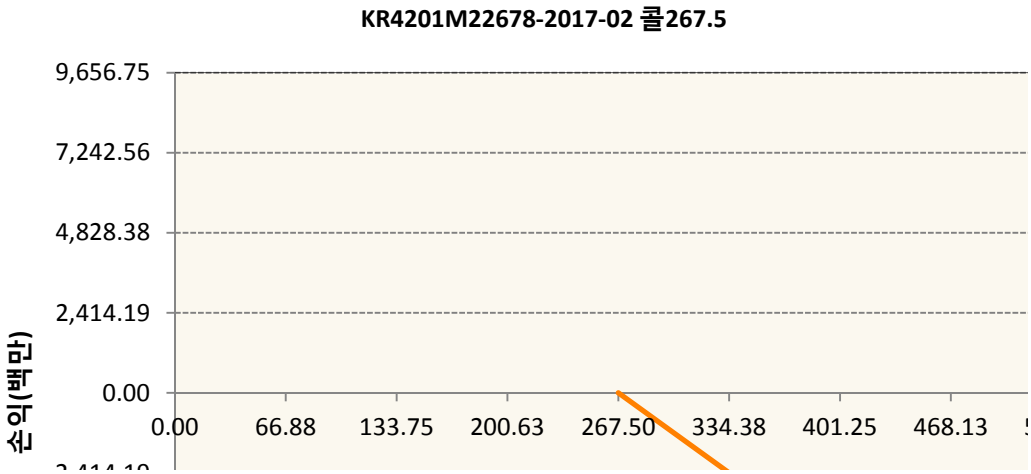
1. 계약금액

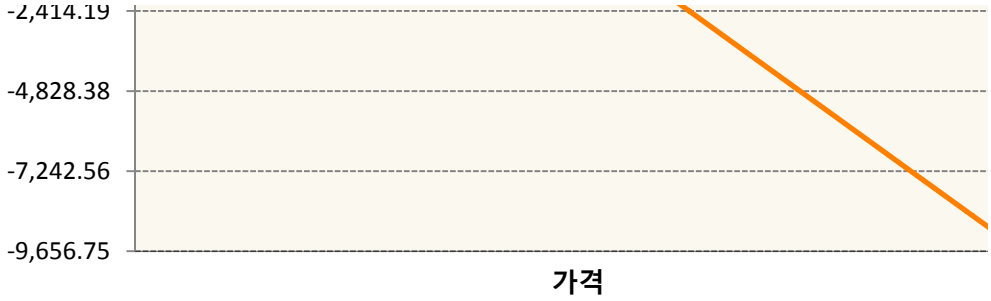
(단위:백만원)

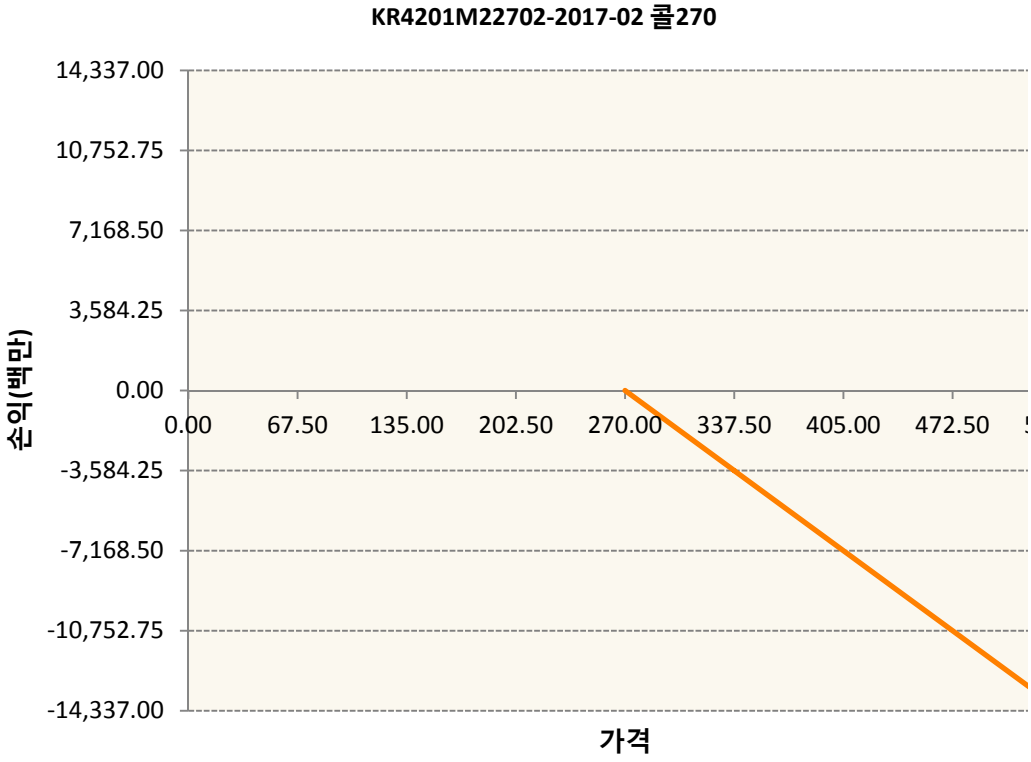
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	32,781	0	32,781	장내
누계	유가증권	옵션	0	23,994	-23,994	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101M30(2017-03 코스피200지수선물							2,612
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-2,612	-2,612	-2,612	-2,612	-2,612	-2,612	-2,612
-5.33%	-1,741	-1,741	-1,741	-1,741	-1,741	-1,741	-1,741
-2.67%	-871	-871	-871	-871	-871	-871	-871
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	871	871	871	871	871	871	871
5.33%	1,741	1,741	1,741	1,741	1,741	1,741	1,741
8.00%	2,612	2,612	2,612	2,612	2,612	2,612	2,612
KR4201M22(2017-02 콜267.5							3,200
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	482	482	482	482	481	479	477
-5.33%	481	479	475	470	462	453	441
-2.67%	443	423	400	374	346	316	283
0%	140	94	47	0	-47	-94	-141
2.67%	-707	-737	-770	-805	-841	-879	-918
5.33%	-1,908	-1,914	-1,922	-1,934	-1,948	-1,965	-1,984
8.00%	-3,184	-3,185	-3,185	-3,187	-3,190	-3,194	-3,200
KR4201M22 2017-02 콜270							4,320
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	455	455	455	455	454	453	452
-5.33%	455	454	451	448	442	433	422
-2.67%	433	418	397	372	342	309	272
0%	184	124	63	0	-64	-129	-194
2.67%	-773	-833	-895	-958	-1,023	-1,088	-1,154
5.33%	-2,415	-2,432	-2,455	-2,483	-2,515	-2,551	-2,591
8.00%	-4,275	-4,277	-4,280	-4,286	-4,294	-4,306	-4,320

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

10,192

공시일	2017-01-23
기준일	2017-01-20

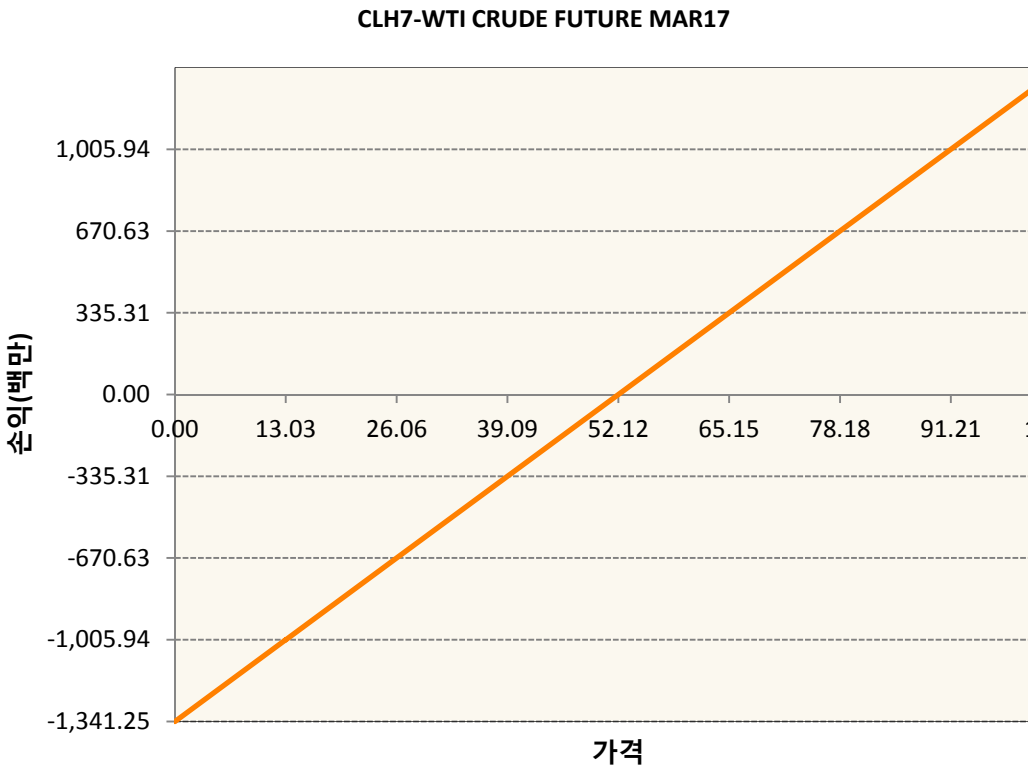
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

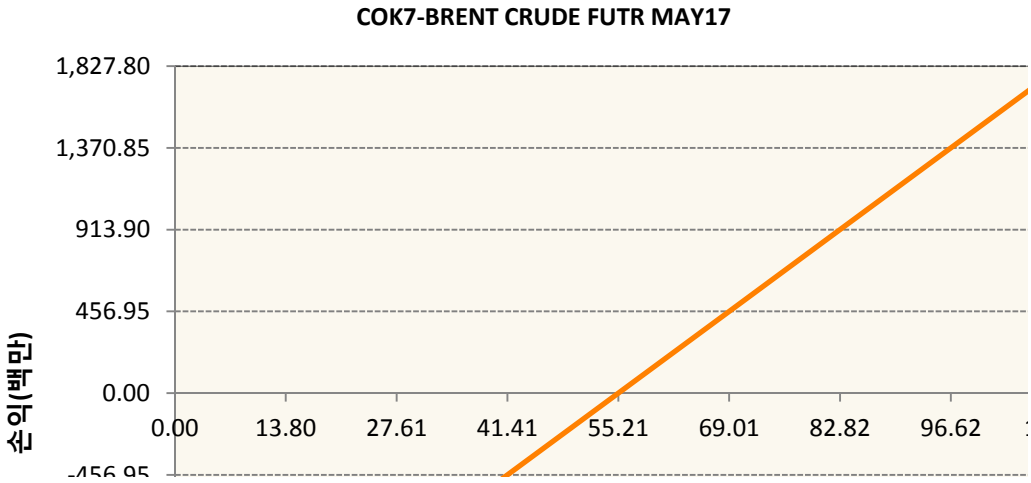
1. 계약금액

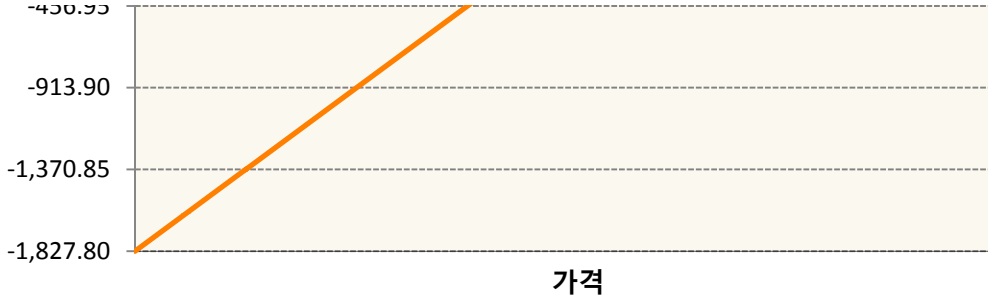
(단위:백만원)

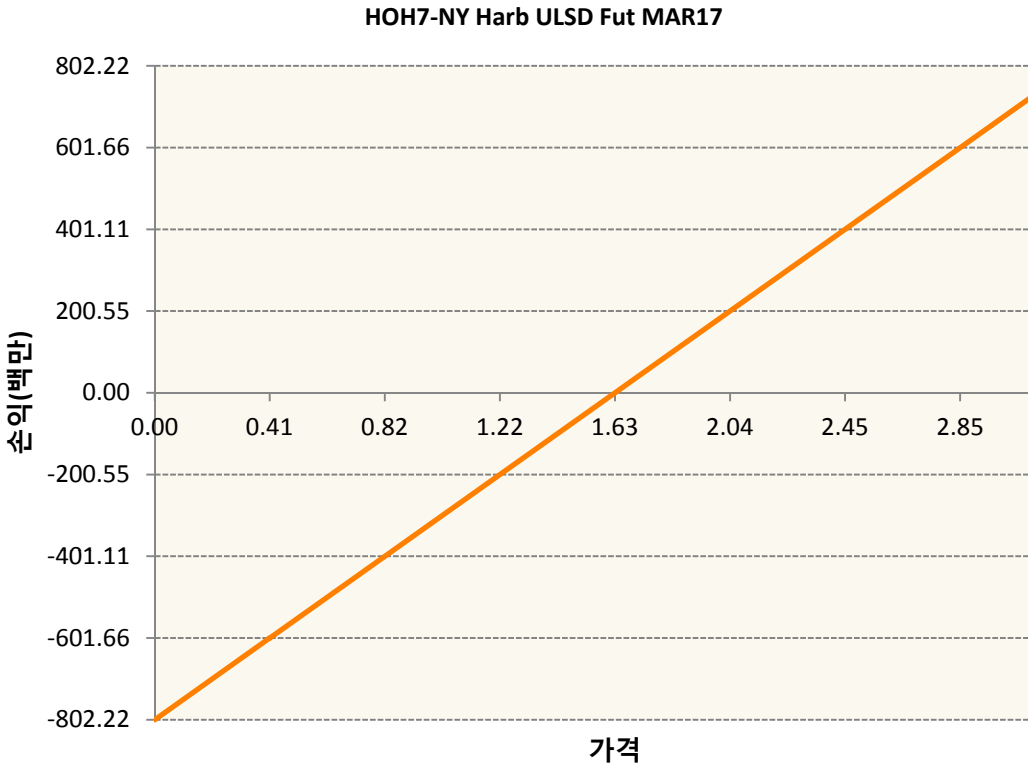
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	선물	유가증권	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	선물	유가증권	1,341	0	1,341	
누계	유가증권	선물	5,051	421	4,630	

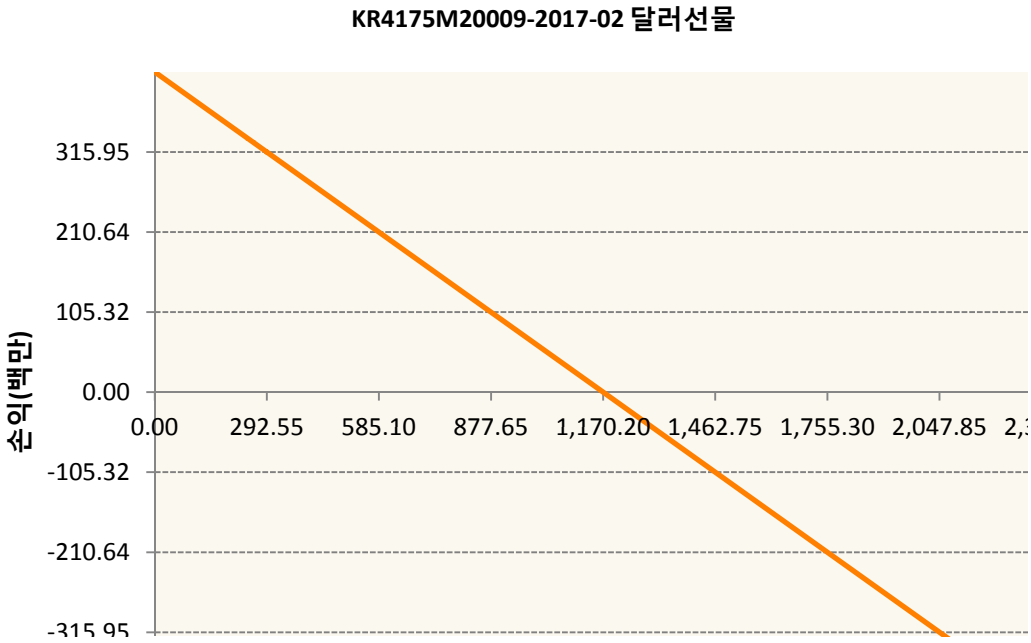
2. 만기시점의 손익구조

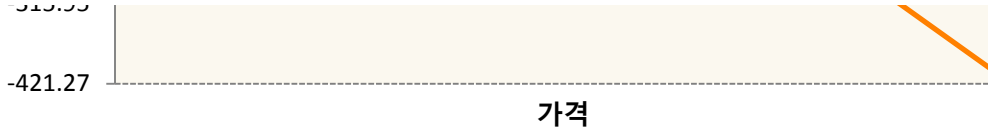


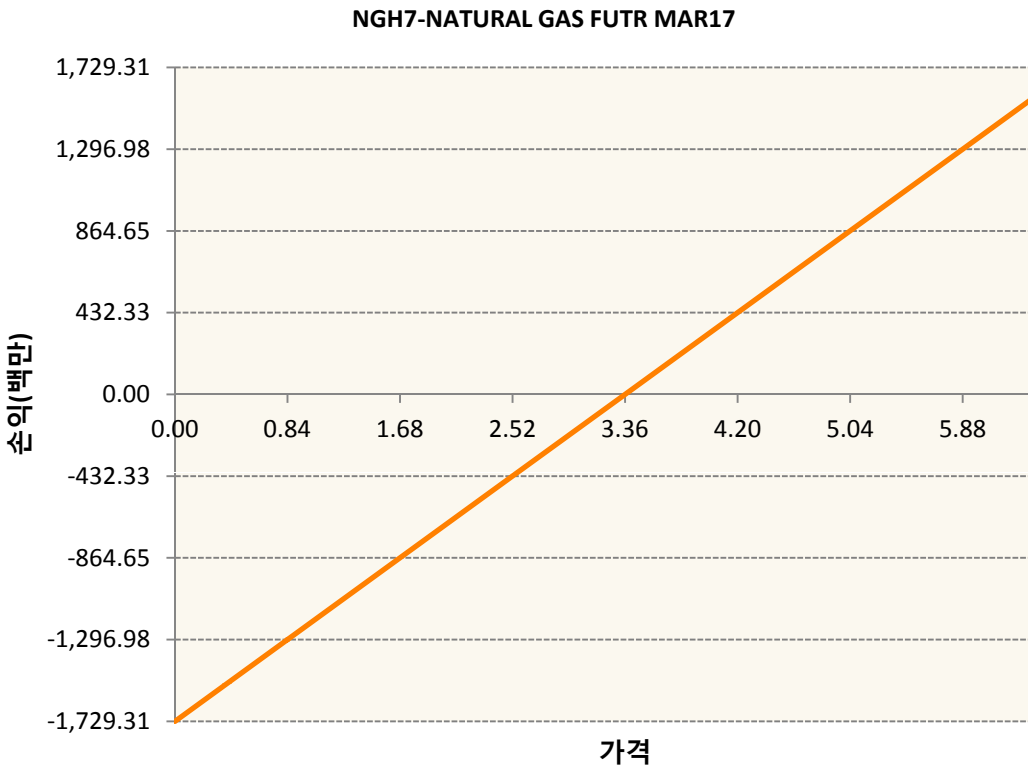


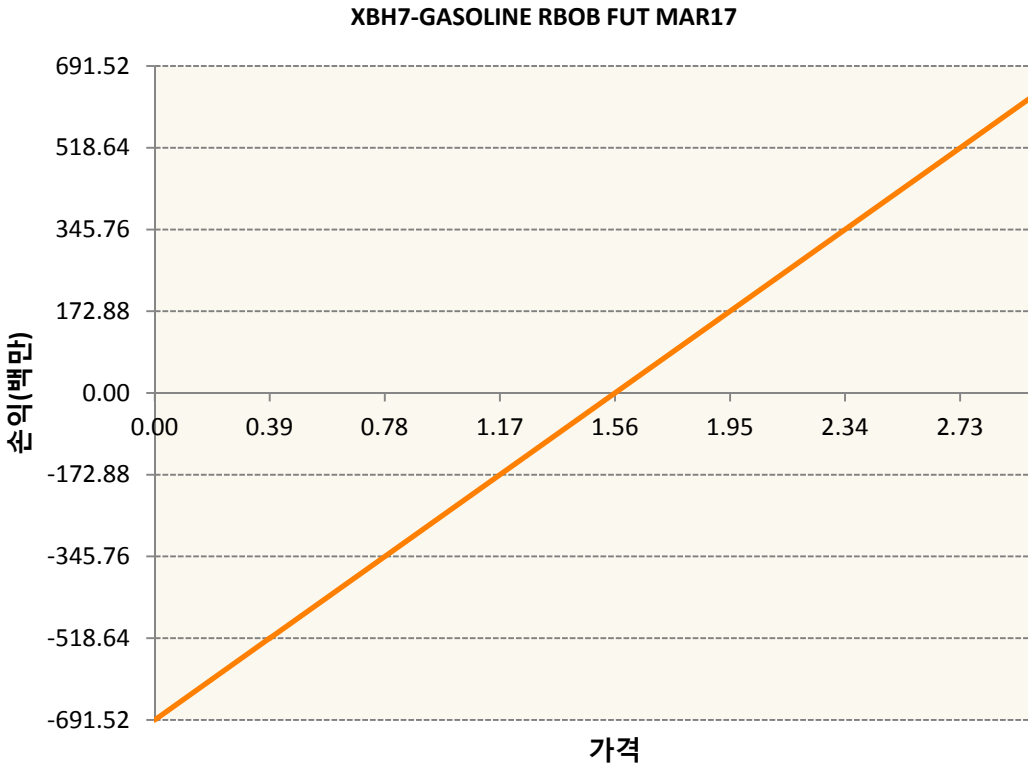

-913.90
-1,370.85
-1,827.80
가격


HOH7-NY Harb ULSD Fut MAR17
802.22
601.66
401.11
200.55
0.00
-200.55
-401.11
-601.66
-802.22
0.00
0.41
0.82
1.22
1.63
2.04
2.45
2.85
순익(백만)
가격


KR4175M20009-2017-02 달러선물
315.95
210.64
105.32
0.00
-105.32
-210.64
0.00
292.55
585.10
877.65
1,170.20
1,462.75
1,755.30
2,047.85
순익(백만)


-421.27
가격


NGH7-NATURAL GAS FUTR MAR17
1,729.31
1,296.98
864.65
432.33
0.00
-432.33
-864.65
-1,296.98
-1,729.31
0.00
0.84
1.68
2.52
3.36
4.20
5.04
5.88
순익(백만)
가격


XBH7-GASOLINE RBOB FUT MAR17
691.52
518.64
345.76
172.88
0.00
-172.88
-345.76
-518.64
-691.52
0.00
0.39
0.78
1.17
1.56
1.95
2.34
2.73
순익(백만)
가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLH7	WTI CRUDE FUTURE MAR17	107
COK7	BRENT CRUDE FUTR MAY17	146
HOH7	NY Harb ULSD Fut MAR17	64
KR4175M20(	2017-02 달러선물	34
NGH7	NATURAL GAS FUTR MAR17	138
XBH7	GASOLINE RBOB FUT MAR17	55

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

1,177

공시일	2017-01-23
기준일	2017-01-20

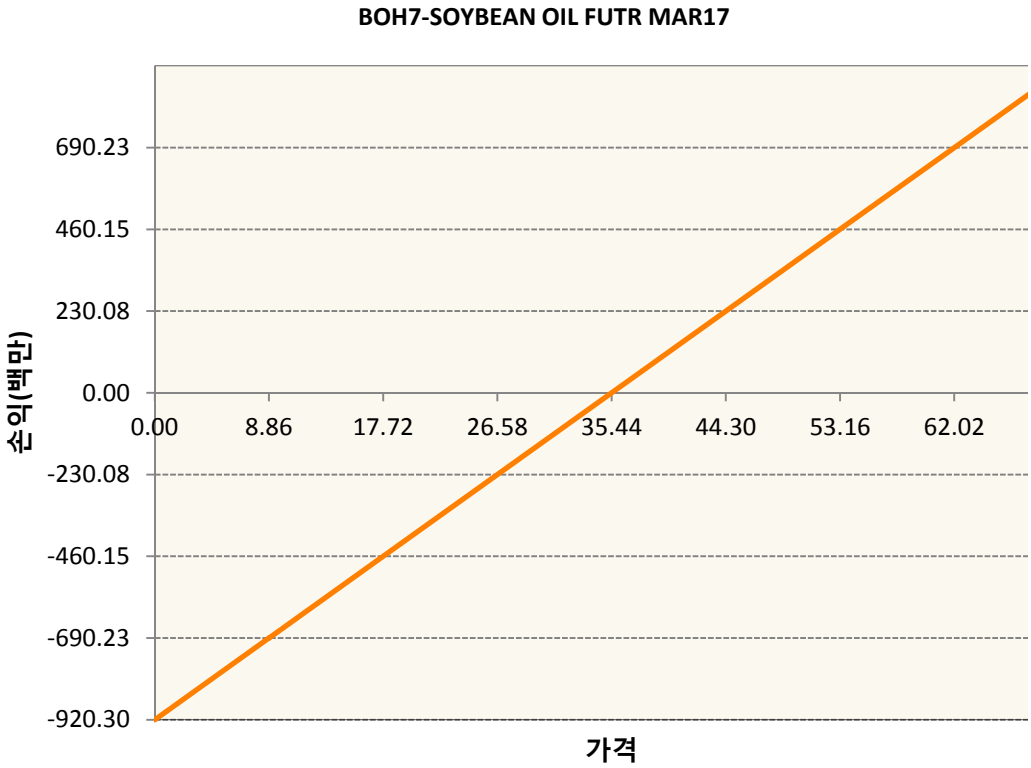
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

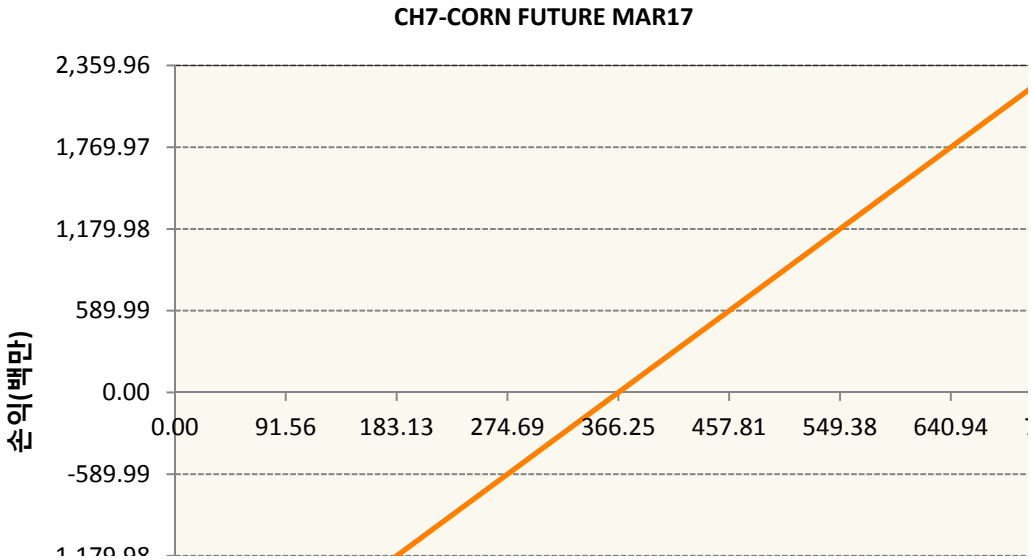
1. 계약금액

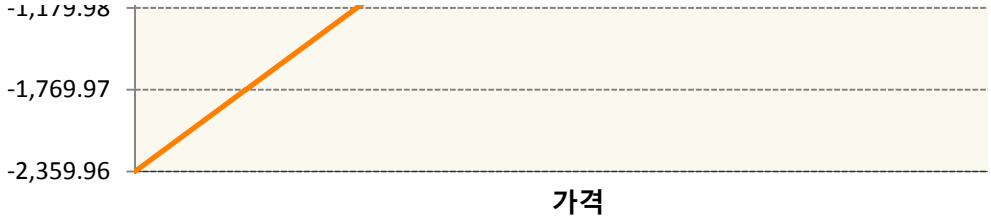
(단위:백만원)

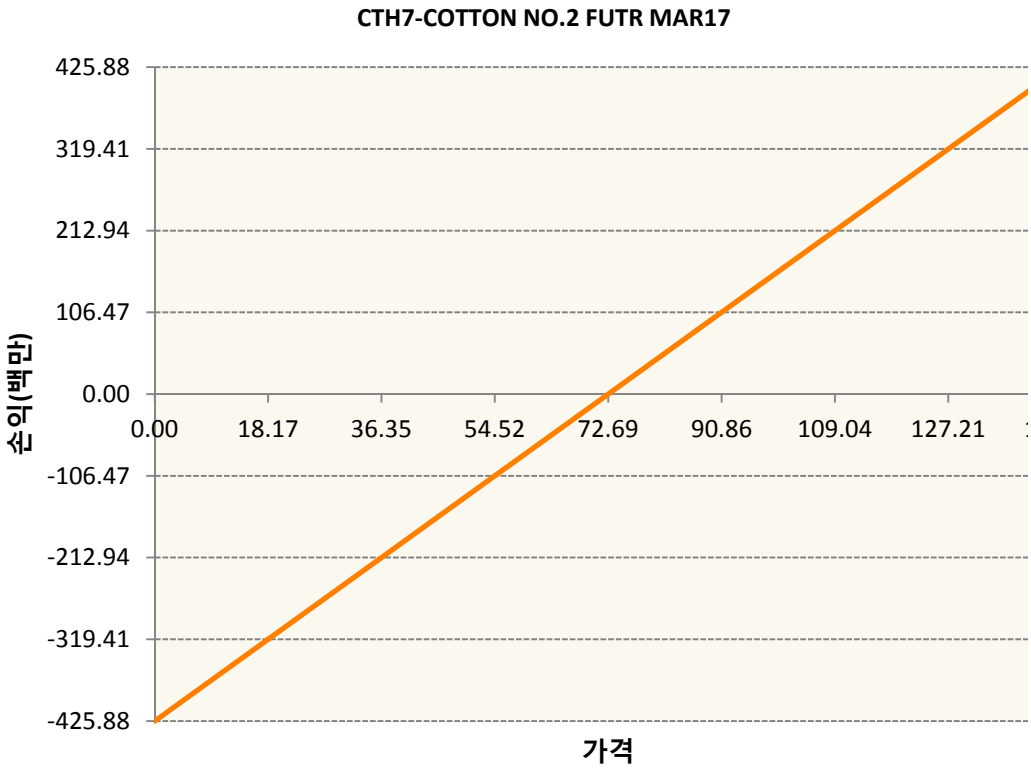
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	9,987	585	9,402	

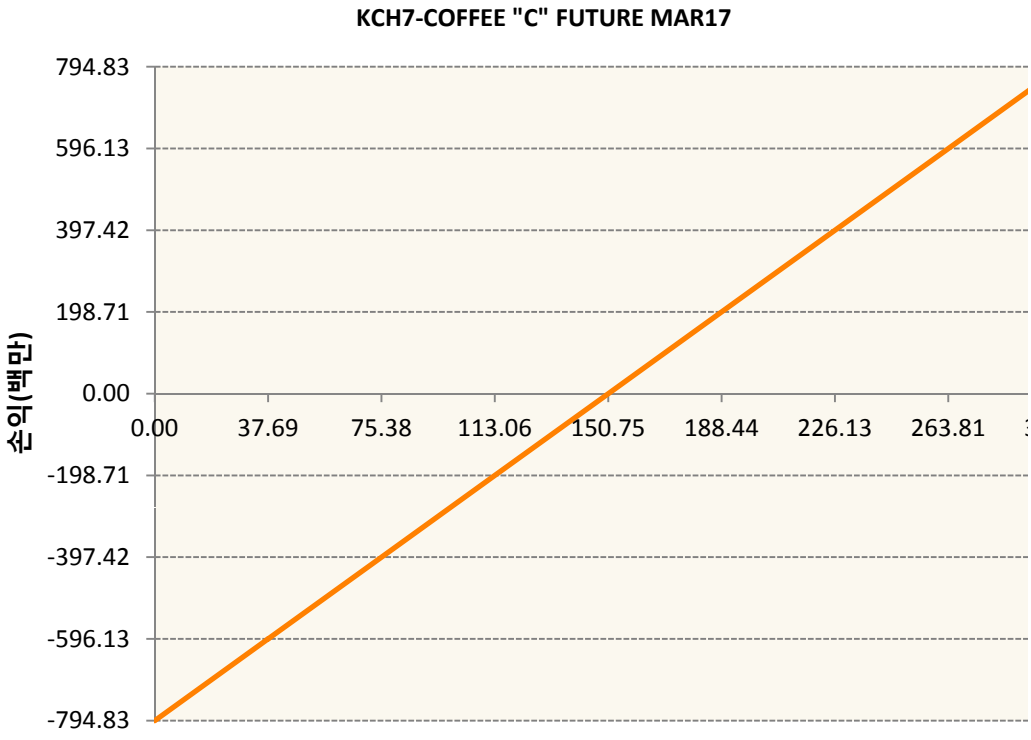
2. 만기시점의 손익구조



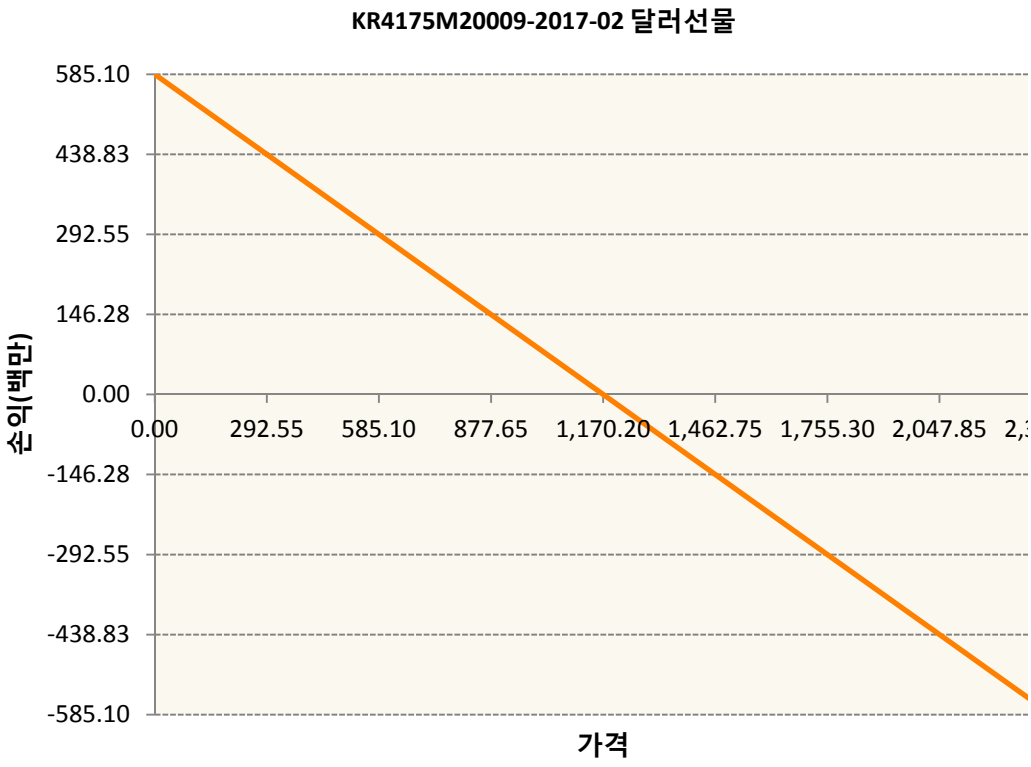


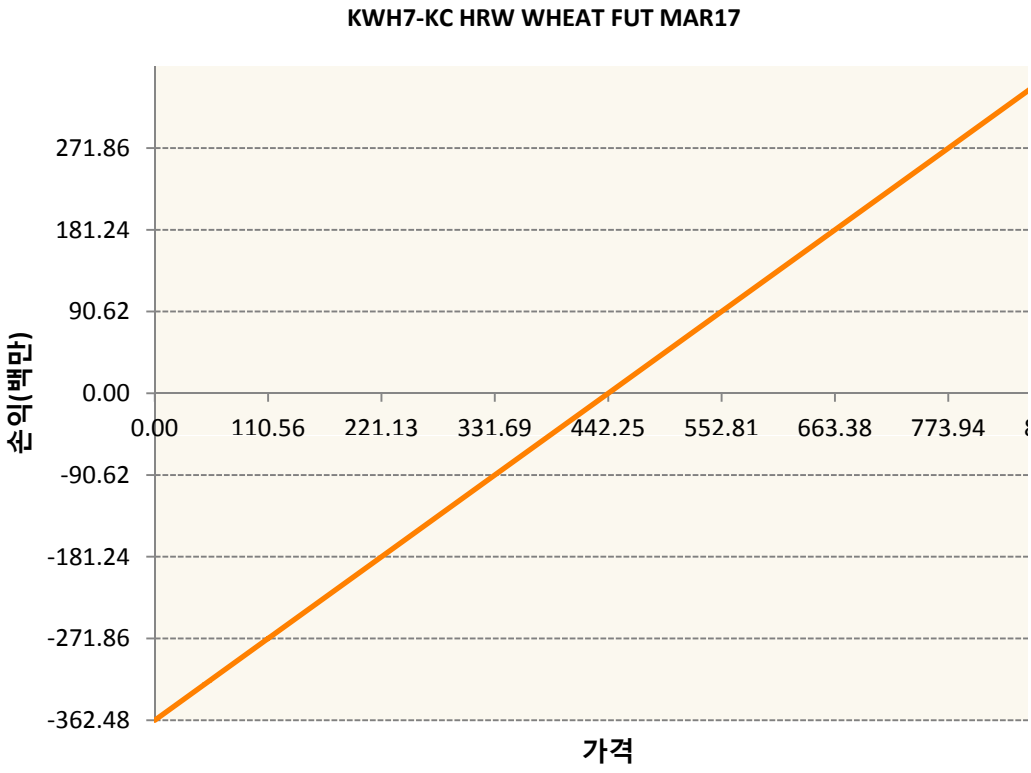

-1,769.97
-2,359.96
가격

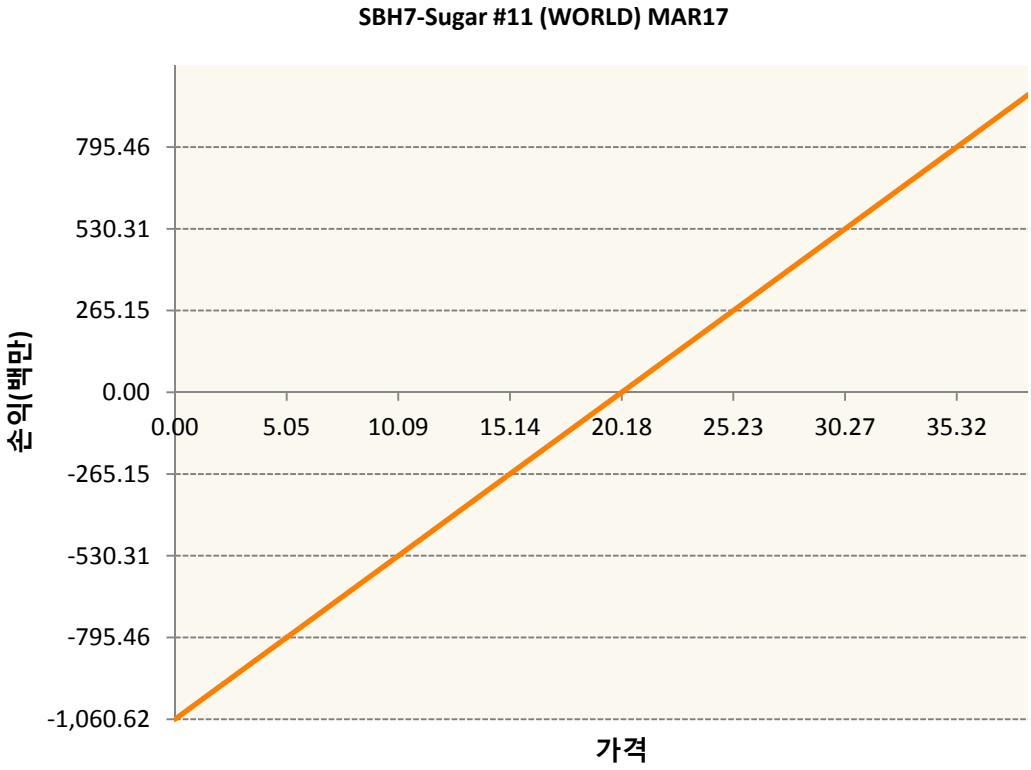

CTH7-COTTON NO.2 FUTR MAR17
425.88
319.41
212.94
106.47
0.00
-106.47
-212.94
-319.41
-425.88
0.00
18.17
36.35
54.52
72.69
90.86
109.04
127.21
손익(백만)
가격

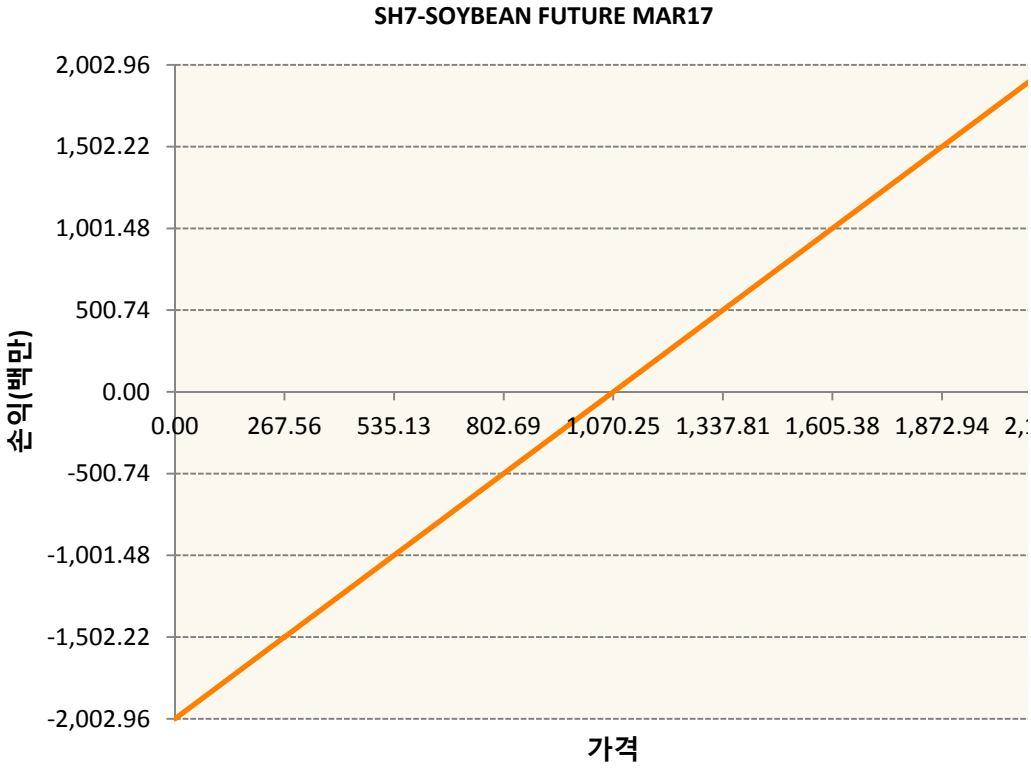

KCH7-COFFEE "C" FUTURE MAR17
794.83
596.13
397.42
198.71
0.00
-198.71
-397.42
-596.13
-794.83
0.00
37.69
75.38
113.06
150.75
188.44
226.13
263.81
손익(백만)

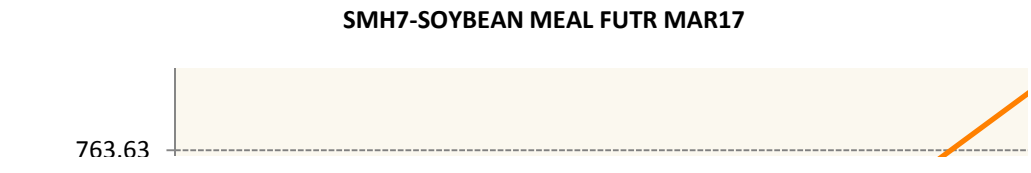
가격

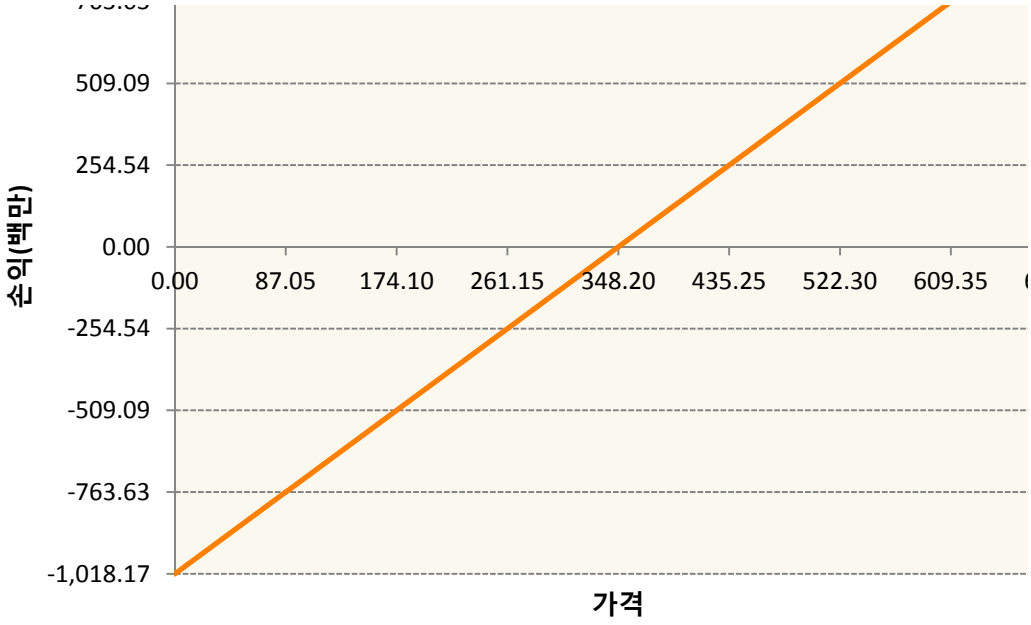

KR4175M20009-2017-02 달러선물
585.10
438.83
292.55
146.28
0.00
-146.28
-292.55
-438.83
-585.10
0.00
292.55
585.10
877.65
1,170.20
1,462.75
1,755.30
2,047.85
순이(백만)
가격

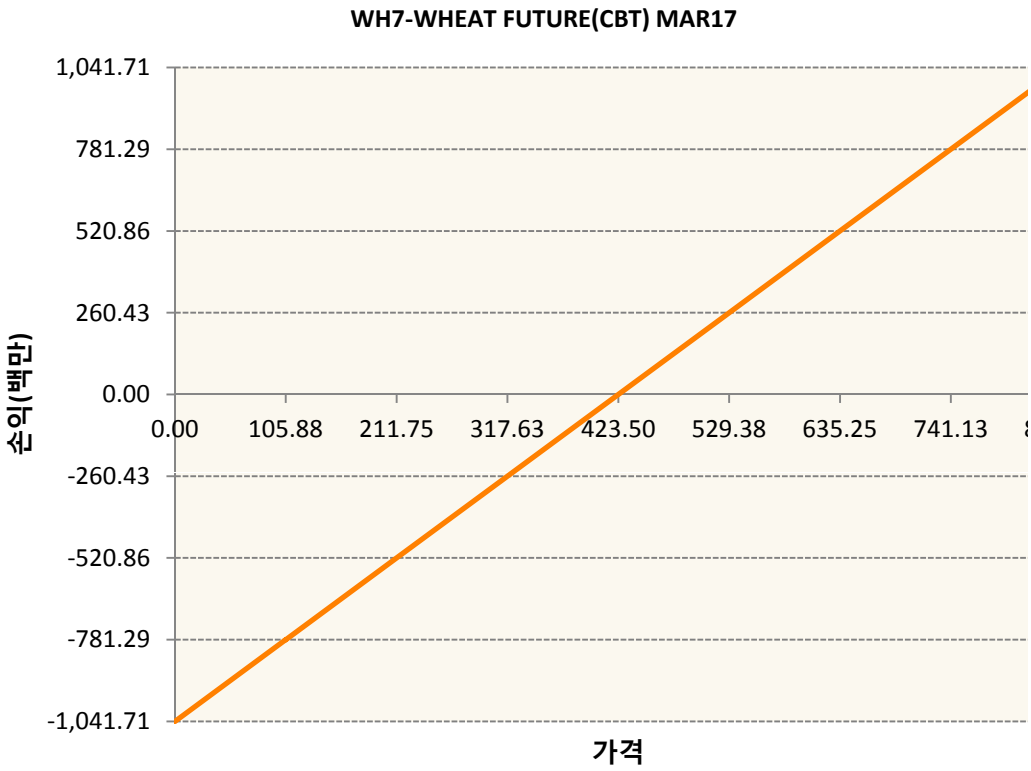

KWH7-KC HRW WHEAT FUT MAR17
271.86
181.24
90.62
0.00
-90.62
-181.24
-271.86
-362.48
0.00
110.56
221.13
331.69
442.25
552.81
663.38
773.94
순이(백만)
가격


SBH7-Sugar #11 (WORLD) MAR17
795.46
530.31
265.15
0.00
-265.15
-530.31
-795.46
-1,060.62
0.00
5.05
10.09
15.14
20.18
25.23
30.27
35.32
손익(백만)
가격


SH7-SOYBEAN FUTURE MAR17
2,002.96
1,502.22
1,001.48
500.74
0.00
-500.74
-1,001.48
-1,502.22
-2,002.96
0.00
267.56
535.13
802.69
1,070.25
1,337.81
1,605.38
1,872.94
손익(백만)
가격


SMH7-SOYBEAN MEAL FUTR MAR17
763.63





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
BOH7	SOYBEAN OIL FUTR MAR17	74
CH7	CORN FUTURE MAR17	189
CTH7	COTTON NO.2 FUTR MAR17	34
KCH7	COFFEE "C" FUTURE MAR17	64
KR4175M20(	2017-02 달러선물	47

KWH7	KC HRW WHEAT FUT MAR17	29
SBH7	Sugar #11 (WORLD) MAR17	85
SH7	SOYBEAN FUTURE MAR17	160
SMH7	SOYBEAN MEAL FUTR MAR17	81
WH7	WHEAT FUTURE(CBT) MAR17	83

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

951