공시일	2017-01-24
기준일	2017-01-23

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	2017-01-24
기준일	2017-01-23

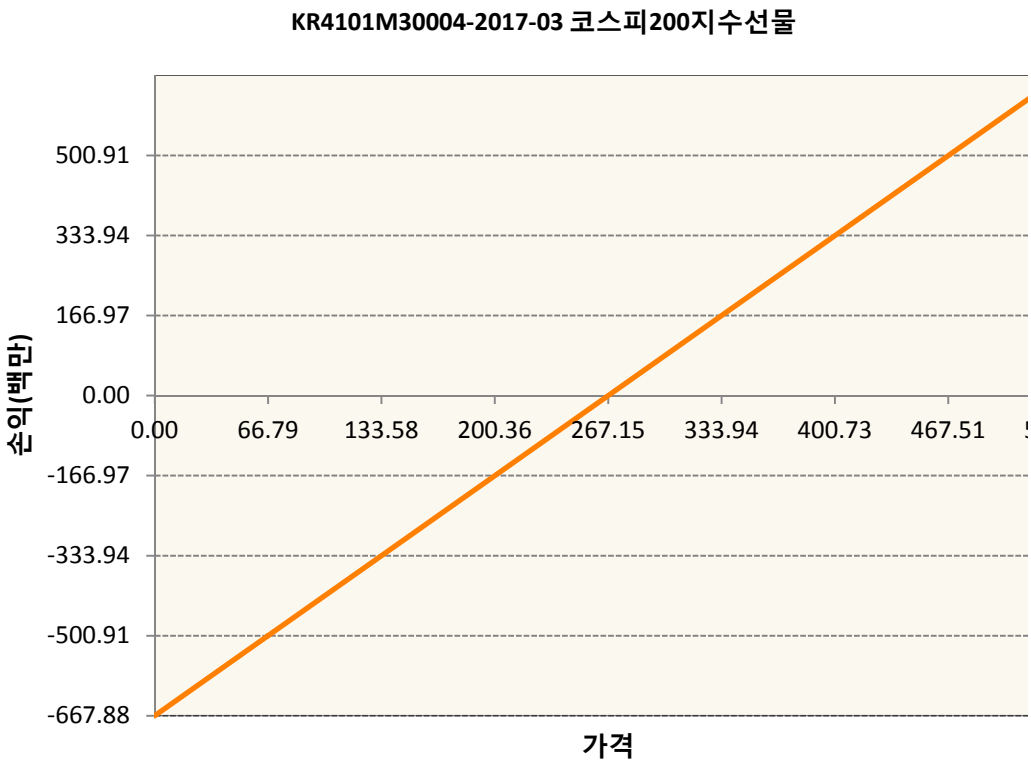
스마트인덱스모

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	668	0	668	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)

38

공시일	2017-01-24
기준일	2017-01-23

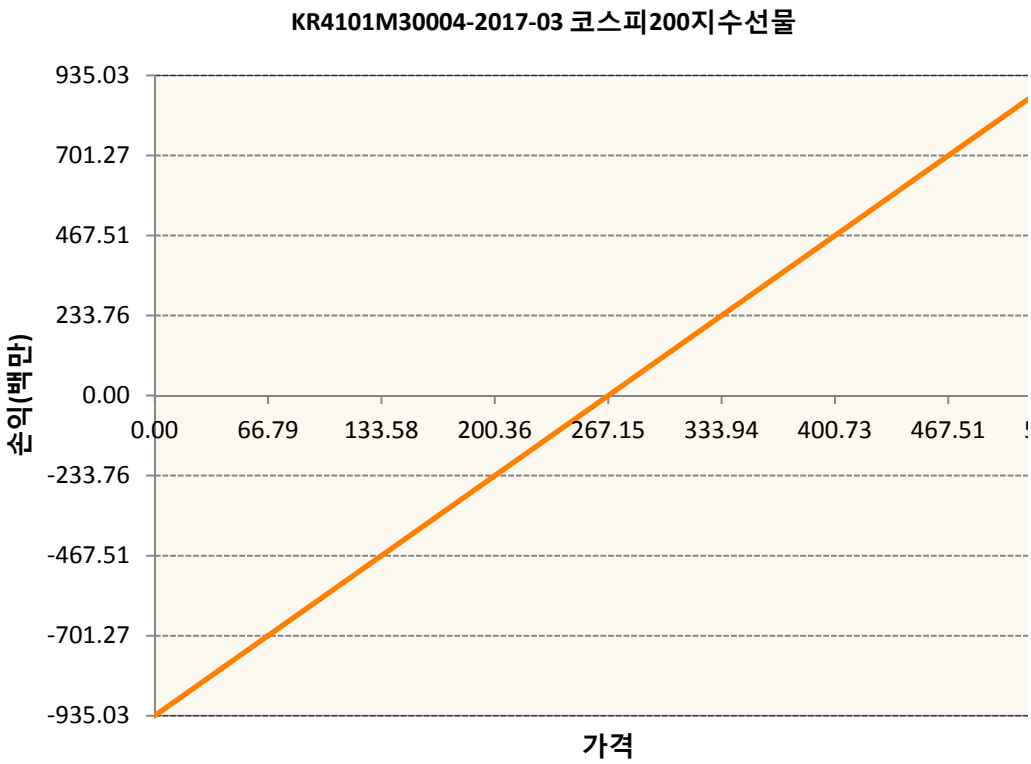
스마트레버리지목표전환형1호

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	935	0	935	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)

53

공시일	2017-01-24
기준일	2017-01-23

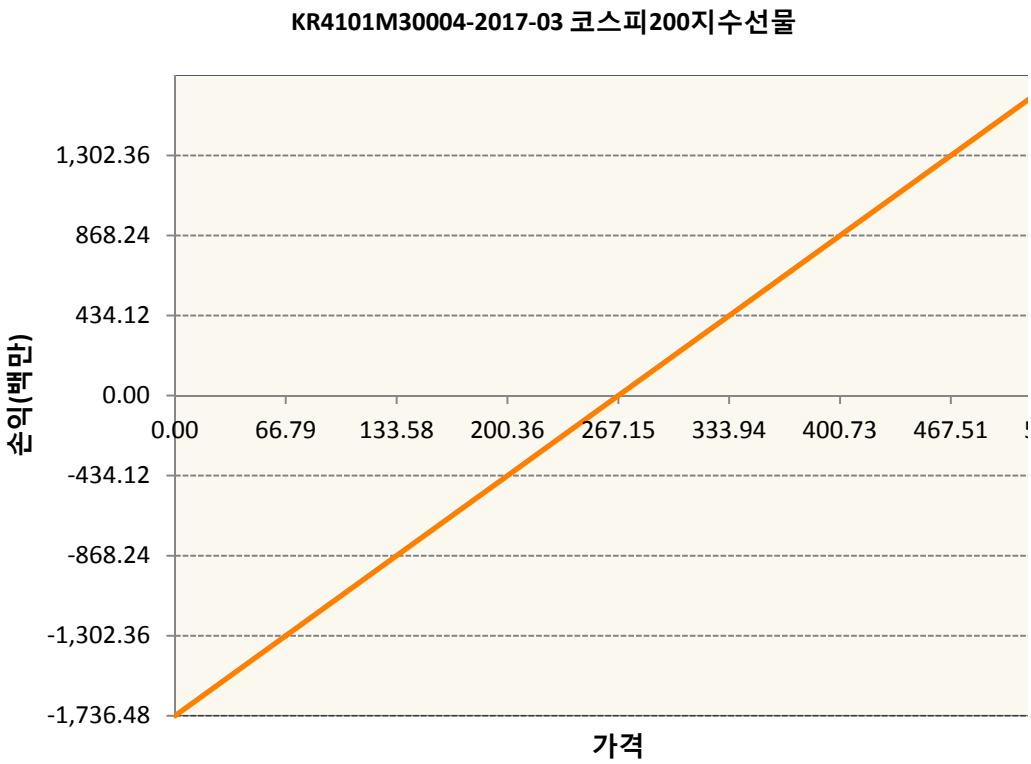
1.3배 레버리지 인덱스(주식-파생형)

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	1,736	0	1,736	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)

98

공시일	2017-01-24
기준일	2017-01-23

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)

679

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-01-24
기준일	2017-01-23

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	376

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

588

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-01-24
기준일	2017-01-23

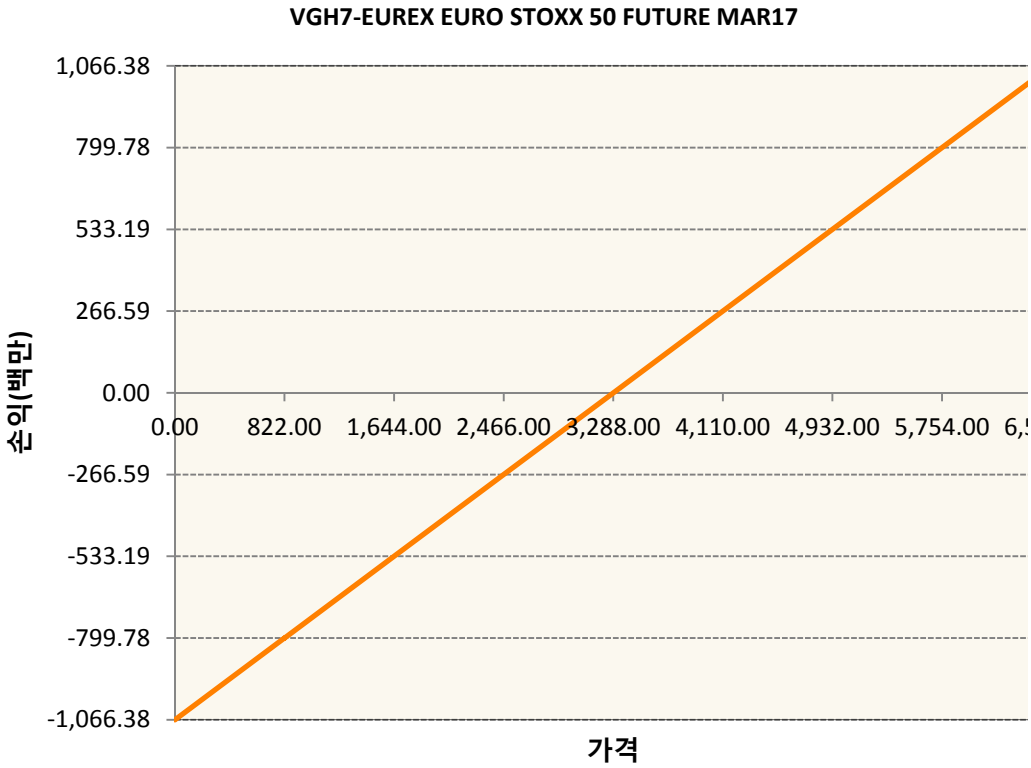
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,066	0	1,066	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGH7	EUREX EURO STOXX 50 FUTURE MAR17	85

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

(단위:백만원)

92

공시일	2017-01-24
기준일	2017-01-23

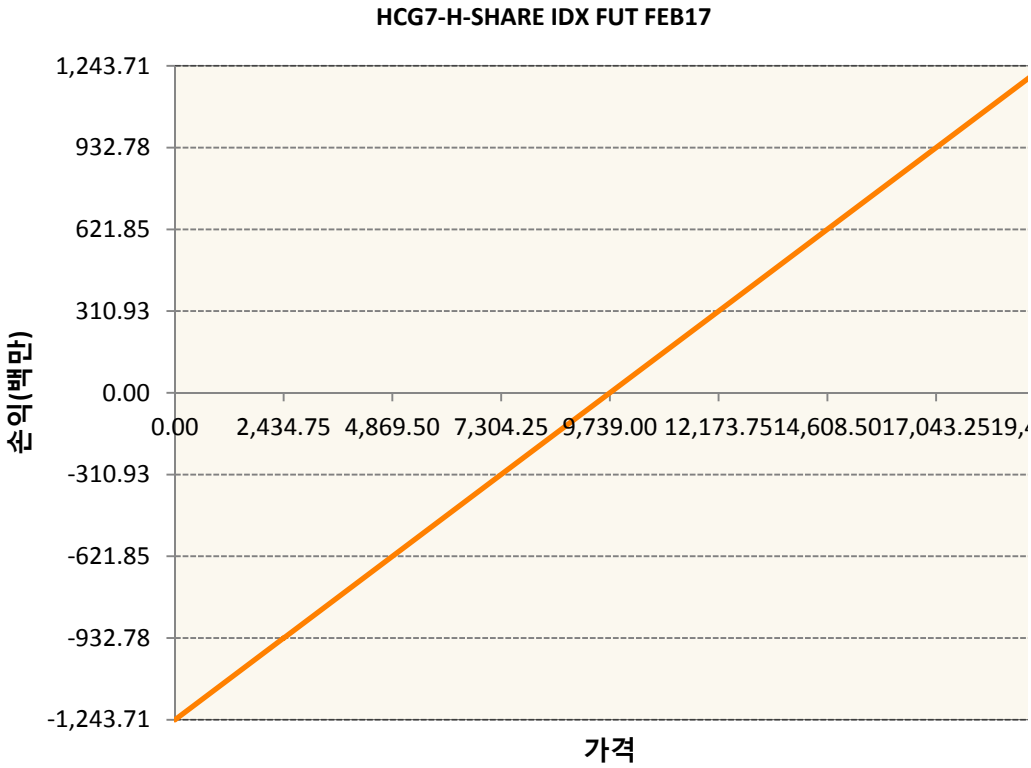
차이나인덱스모(주식-파생형)

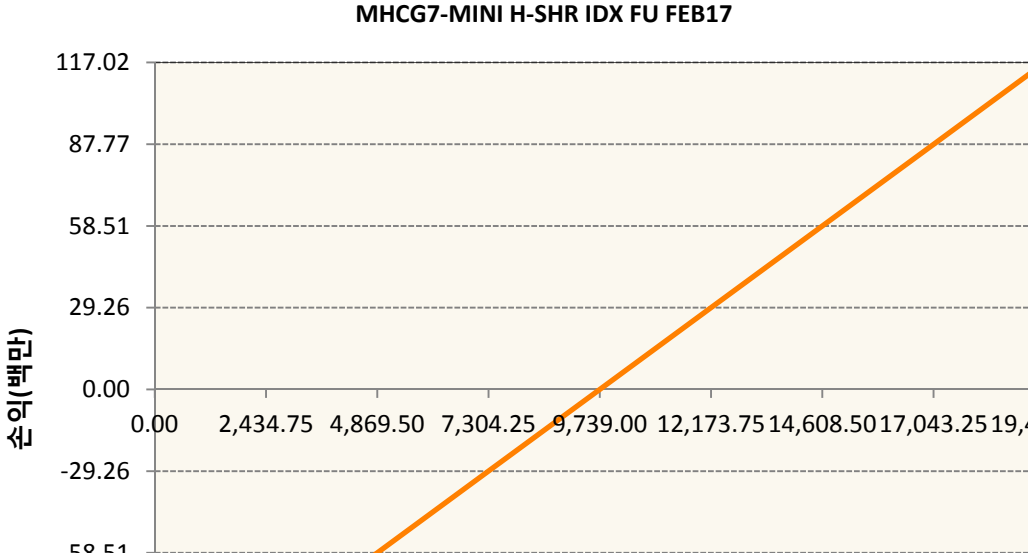
1. 계약금액

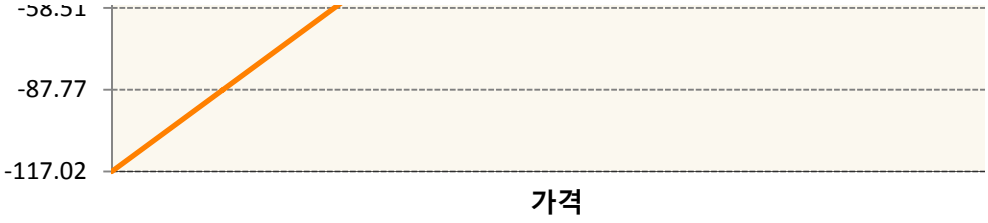
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,361	0	1,361	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCG7	H-SHARE IDX FUT FEB17	99
MHCG7	MINI H-SHR IDX FU FEB17	9

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	132

공시일	2017-01-24
기준일	2017-01-23

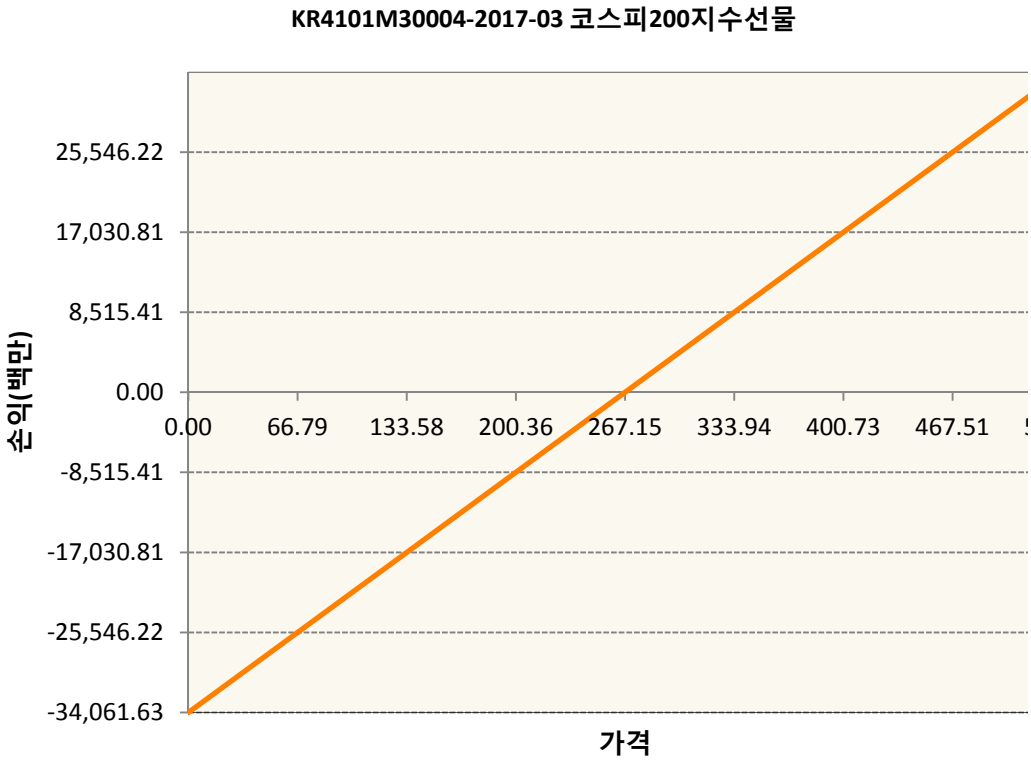
커버드콜(주식혼합-파생형)

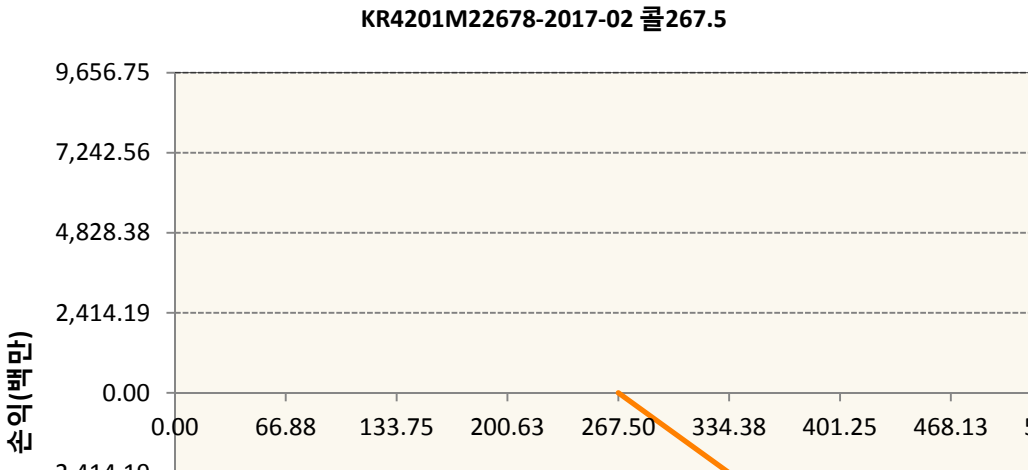
1. 계약금액

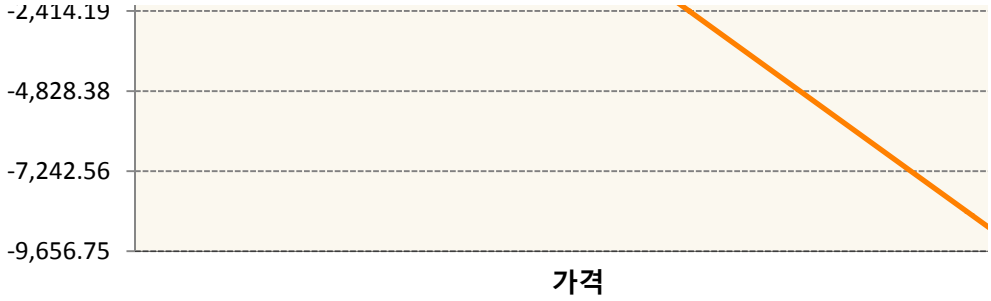
(단위:백만원)

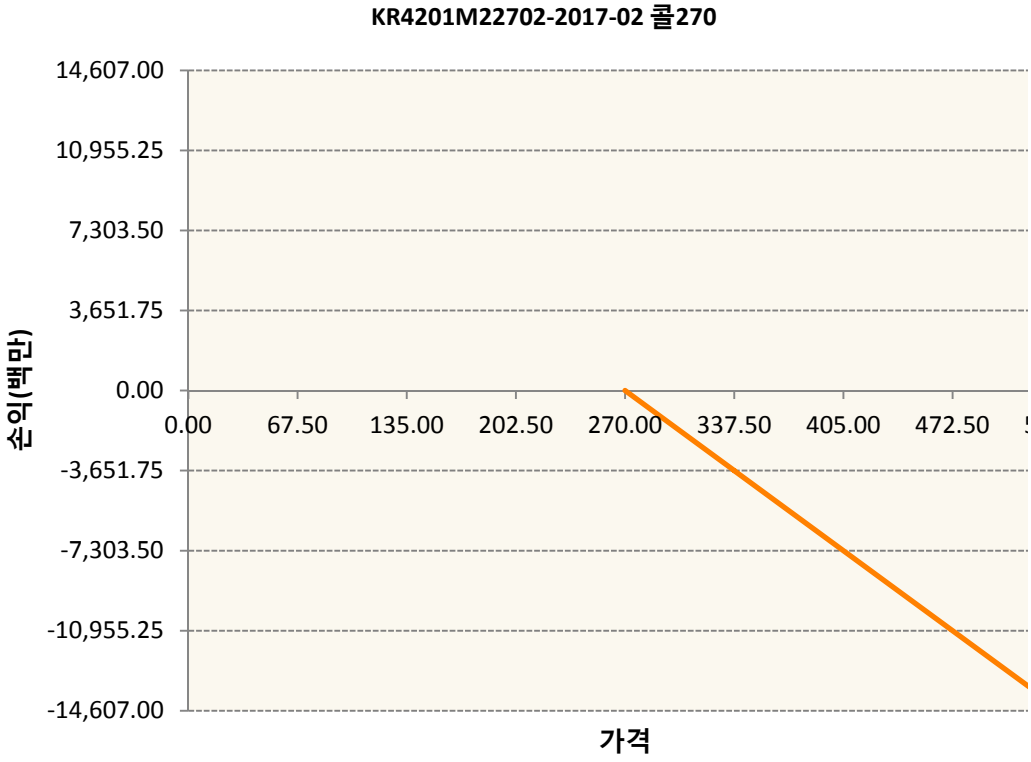
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	1,338	0	1,338	장내
신규	유가증권	옵션	0	271	-271	장내
누계	유가증권	선물	34,062	0	34,062	장내
누계	유가증권	옵션	0	24,264	-24,264	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101M30(2017-03 코스피200지수선물							2,725
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-2,725	-2,725	-2,725	-2,725	-2,725	-2,725	-2,725
-5.33%	-1,816	-1,816	-1,816	-1,816	-1,816	-1,816	-1,816
-2.67%	-908	-908	-908	-908	-908	-908	-908
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	908	908	908	908	908	908	908
5.33%	1,816	1,816	1,816	1,816	1,816	1,816	1,816
8.00%	2,725	2,725	2,725	2,725	2,725	2,725	2,725
KR4201M22(2017-02 콜267.5							3,297
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	495	495	495	495	494	493	492
-5.33%	494	493	490	485	479	471	461
-2.67%	457	439	417	393	366	338	308
0%	132	88	44	0	-44	-88	-132
2.67%	-775	-799	-825	-854	-884	-917	-951
5.33%	-2,006	-2,010	-2,015	-2,022	-2,031	-2,043	-2,058
8.00%	-3,289	-3,289	-3,289	-3,290	-3,292	-3,294	-3,297
KR4201M22: 2017-02 콜270							4,555

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	467	467	467	467	466	466	465
-5.33%	467	466	464	461	457	450	440
-2.67%	447	433	414	390	363	331	297
0%	180	121	61	0	-62	-124	-188
2.67%	-875	-928	-982	-1,039	-1,097	-1,156	-1,217
5.33%	-2,616	-2,627	-2,643	-2,663	-2,688	-2,716	-2,747
8.00%	-4,528	-4,529	-4,531	-4,534	-4,538	-4,545	-4,555

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

10,878

공시일	2017-01-24
기준일	2017-01-23

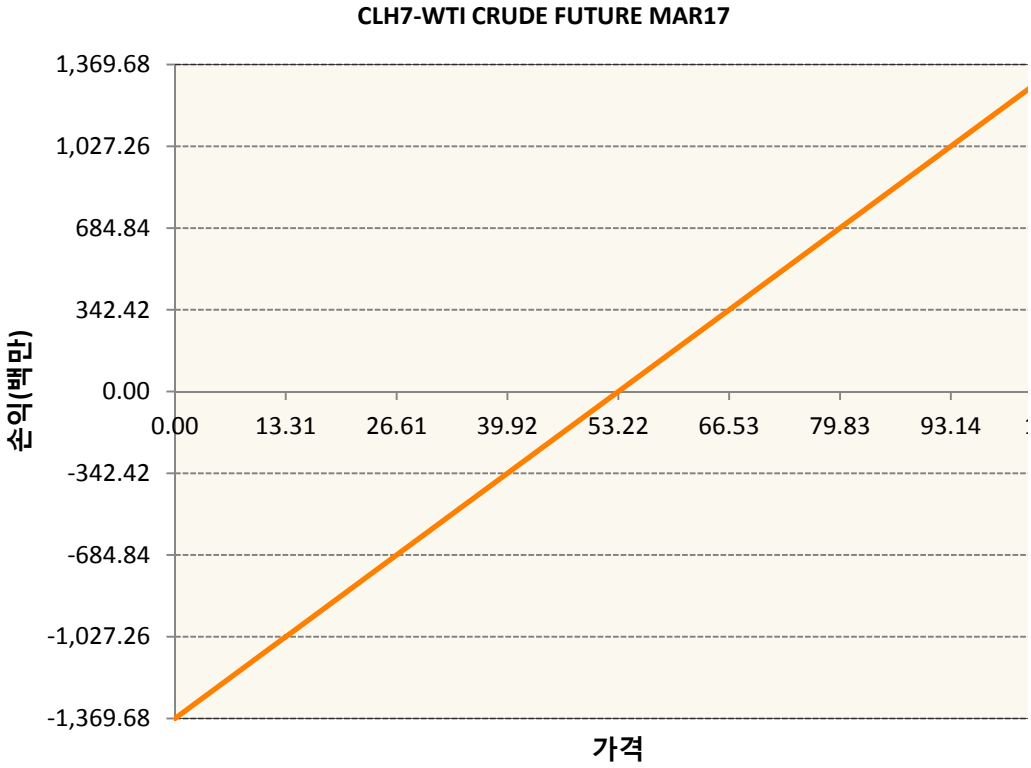
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

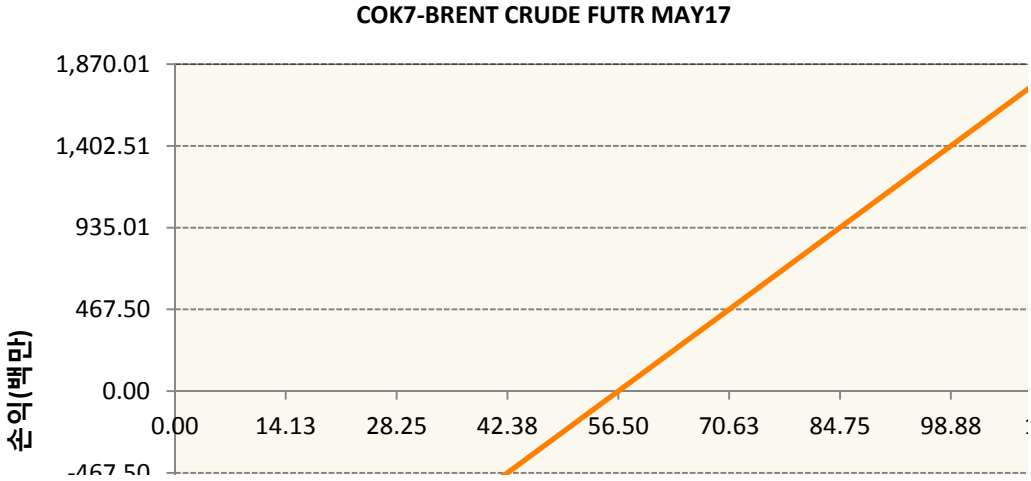
1. 계약금액

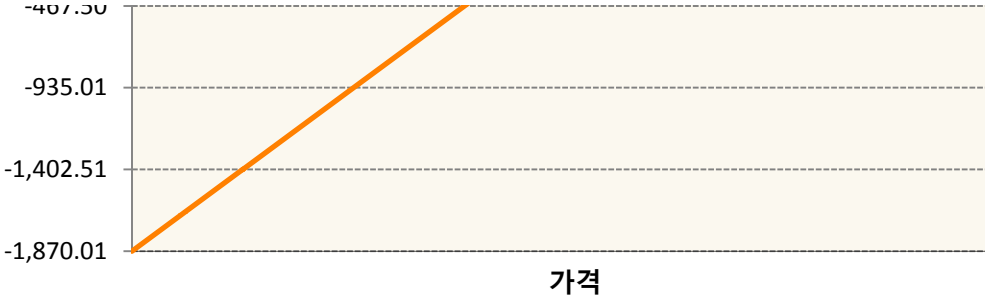
(단위:백만원)

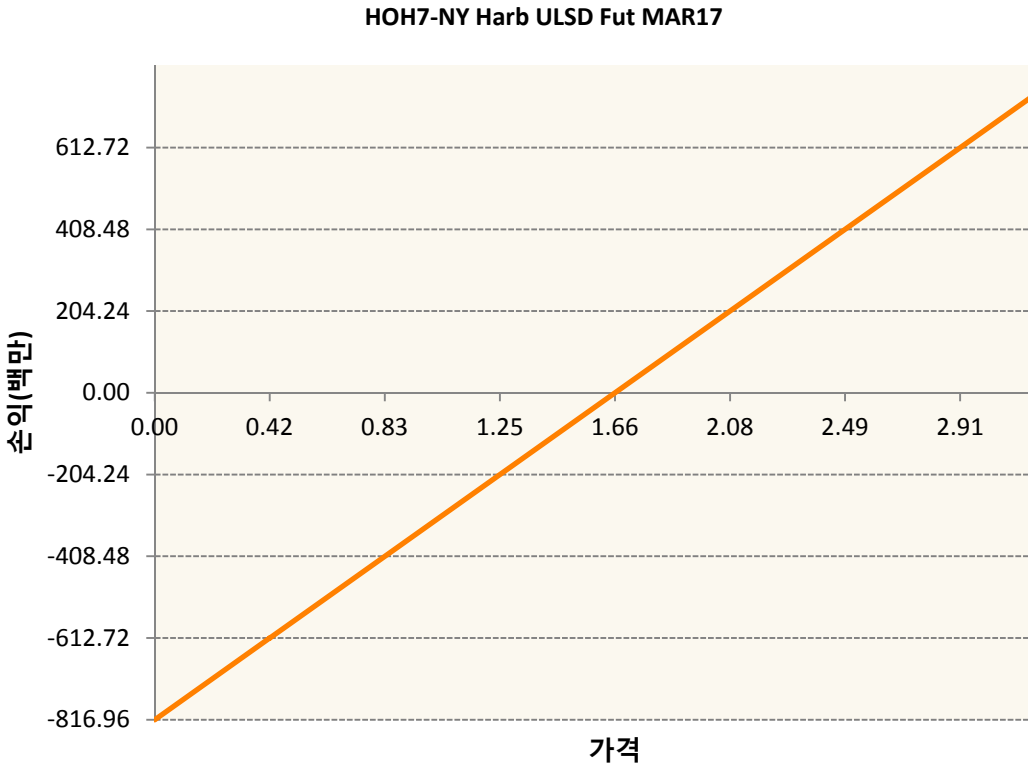
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	선물	유가증권	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	선물	유가증권	1,370	0	1,370	
누계	유가증권	선물	5,045	419	4,626	

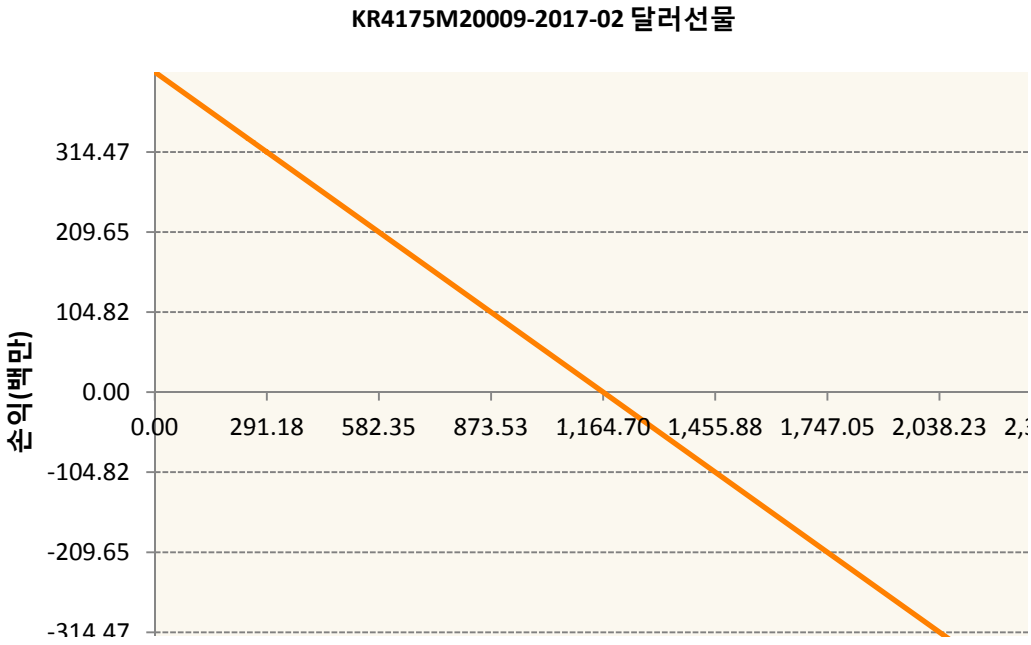
2. 만기시점의 손익구조

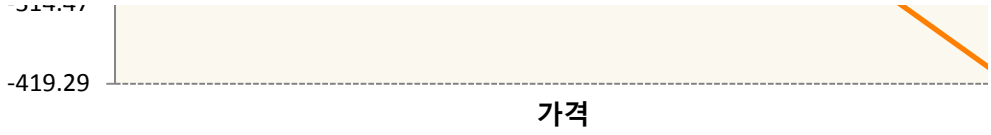


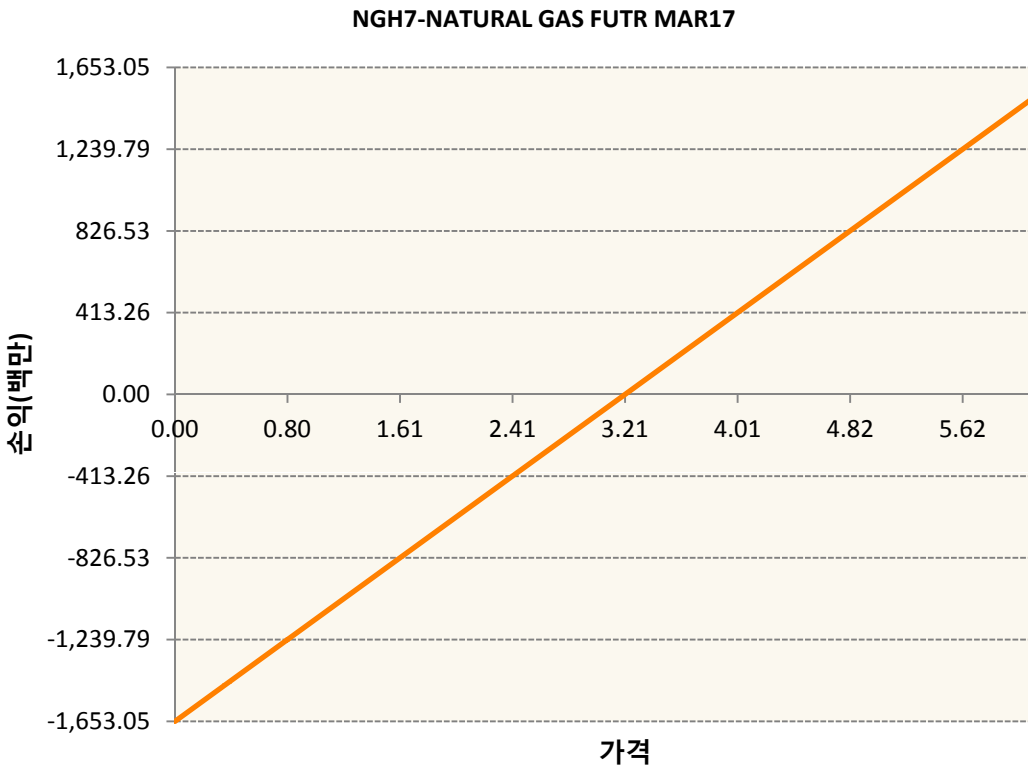


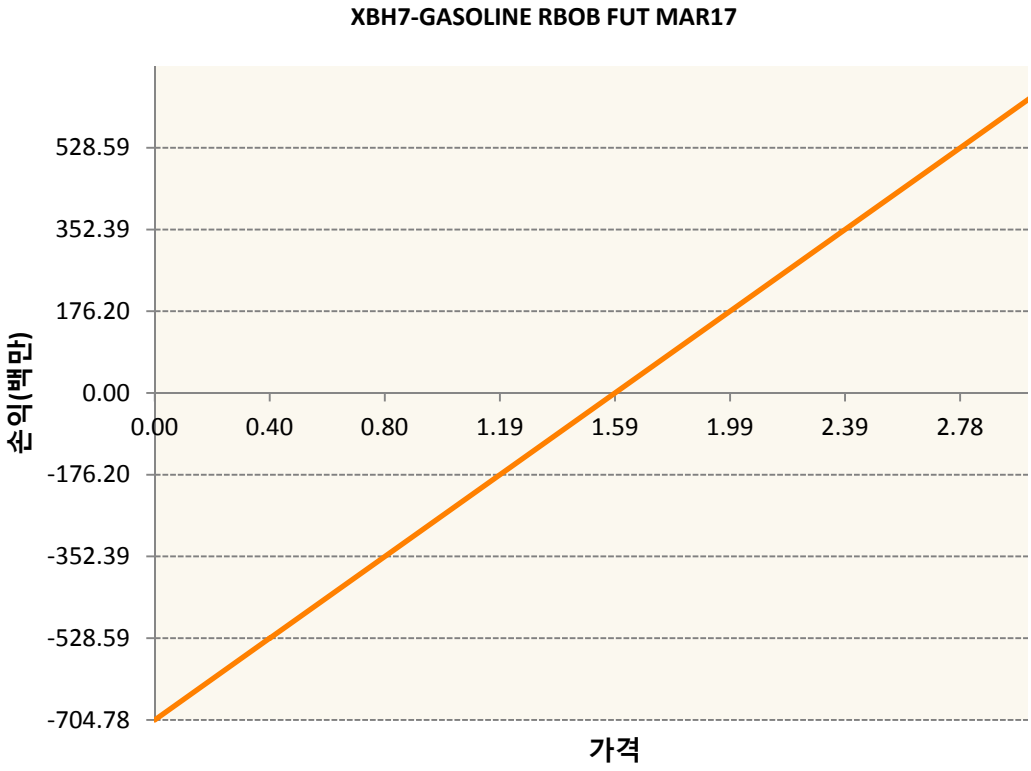

-935.01
-1,402.51
-1,870.01
가격


HOH7-NY Harb ULSD Fut MAR17
612.72
408.48
204.24
0.00
-204.24
-408.48
-612.72
-816.96
0.00
0.42
0.83
1.25
1.66
2.08
2.49
2.91
순익(백만)
가격


KR4175M20009-2017-02 달러선물
314.47
209.65
104.82
0.00
-104.82
-209.65
0.00
291.18
582.35
873.53
1,164.70
1,455.88
1,747.05
2,038.23
순익(백만)


-419.29
가격


NGH7-NATURAL GAS FUTR MAR17
1,653.05
1,239.79
826.53
413.26
0.00
-413.26
-826.53
-1,239.79
-1,653.05
0.00
0.80
1.61
2.41
3.21
4.01
4.82
5.62
순익(백만)
가격


XBH7-GASOLINE RBOB FUT MAR17
528.59
352.39
176.20
0.00
-176.20
-352.39
-528.59
-704.78
0.00
0.40
0.80
1.19
1.59
1.99
2.39
2.78
순익(백만)
가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLH7	WTI CRUDE FUTURE MAR17	110
COK7	BRENT CRUDE FUTR MAY17	150
HOH7	NY Harb ULSD Fut MAR17	65
KR4175M20(	2017-02 달러선물	34
NGH7	NATURAL GAS FUTR MAR17	132
XBH7	GASOLINE RBOB FUT MAR17	56

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

1,176

공시일	2017-01-24
기준일	2017-01-23

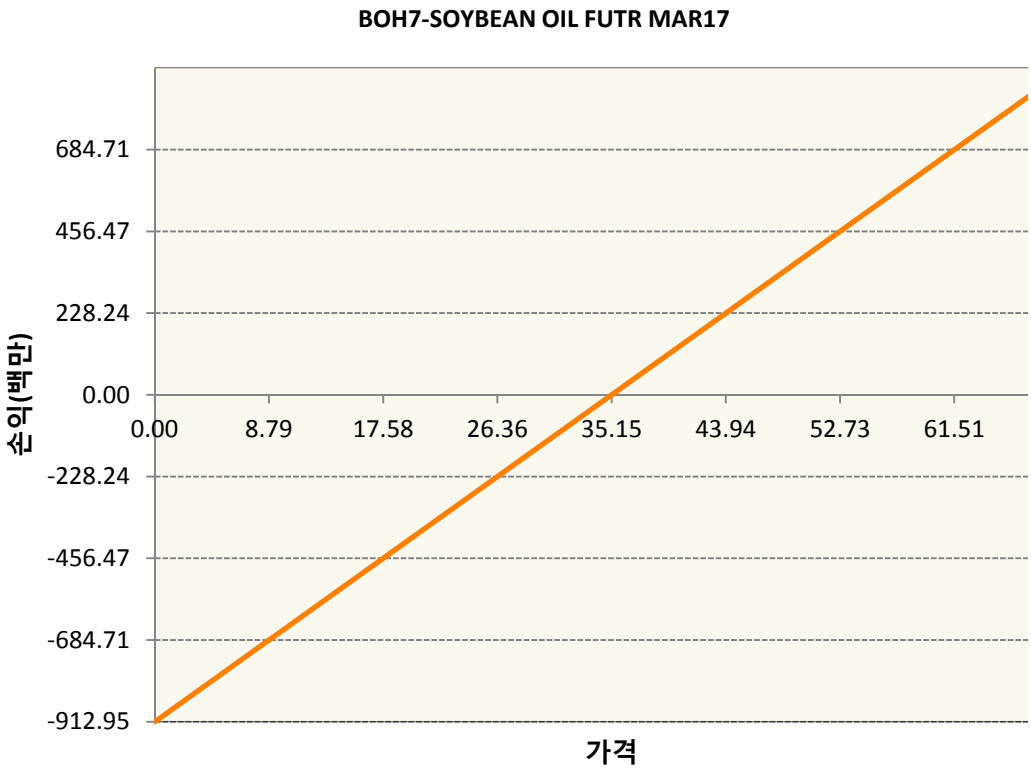
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

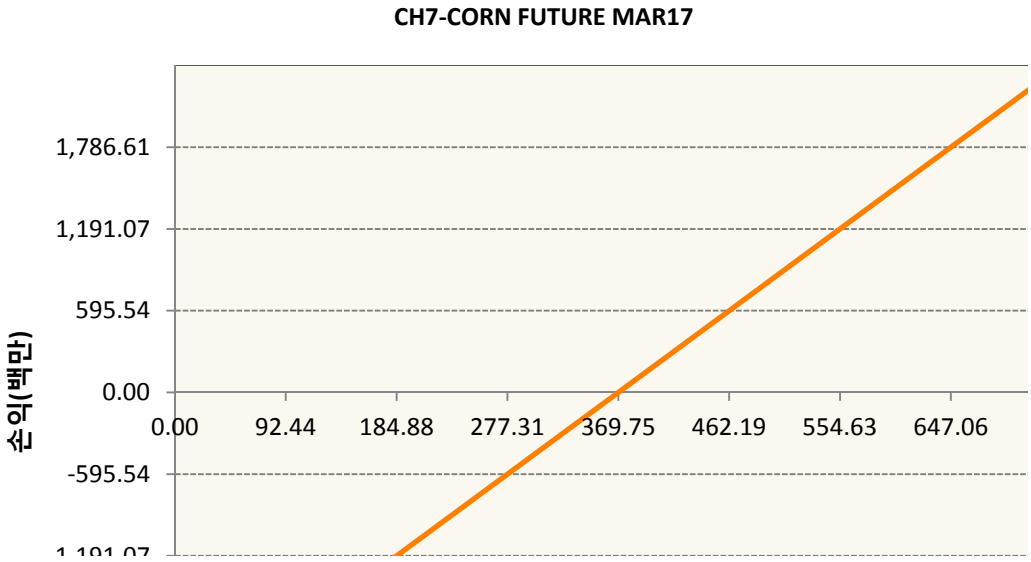
1. 계약금액

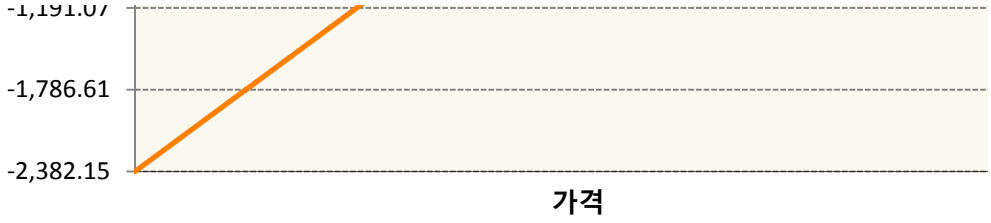
(단위:백만원)

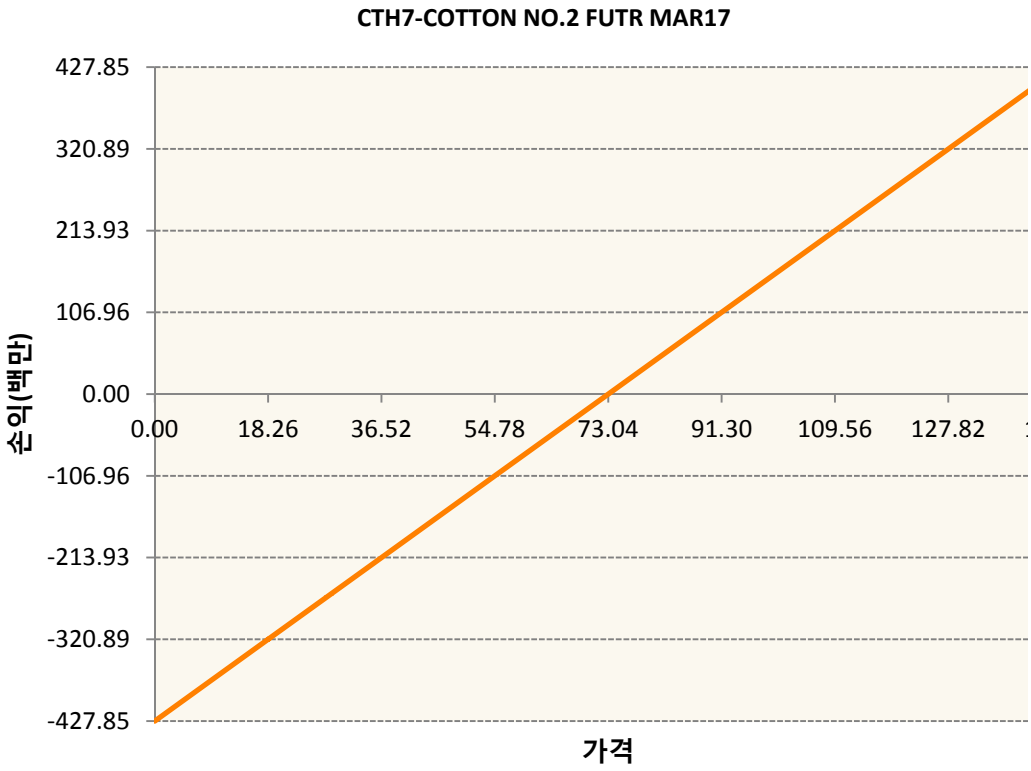
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	10,025	582	9,443	

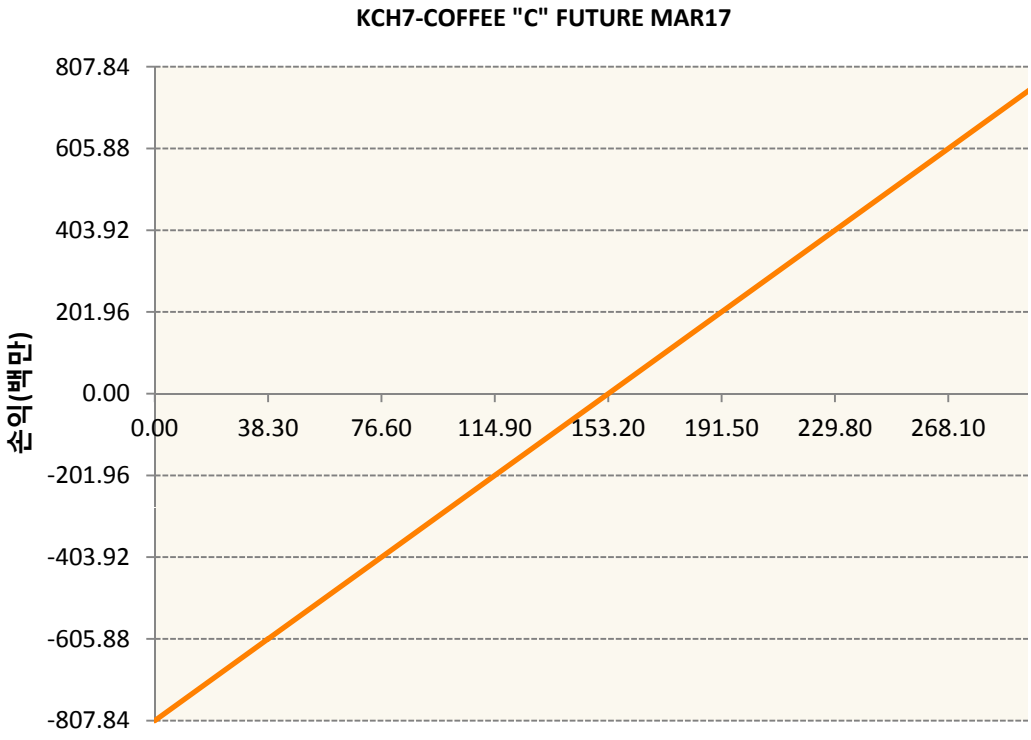
2. 만기시점의 손익구조





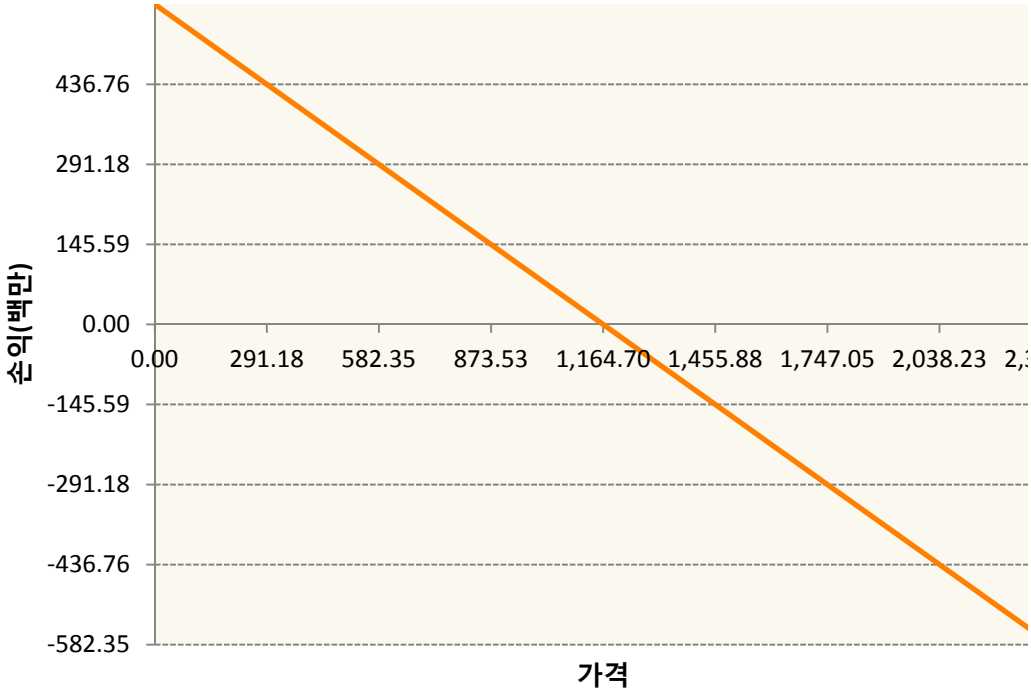

-1,786.61
-2,382.15
가격


CTH7-COTTON NO.2 FUTR MAR17
427.85
320.89
213.93
106.96
0.00
-106.96
-213.93
-320.89
-427.85
0.00
18.26
36.52
54.78
73.04
91.30
109.56
127.82
손익(백만)
가격

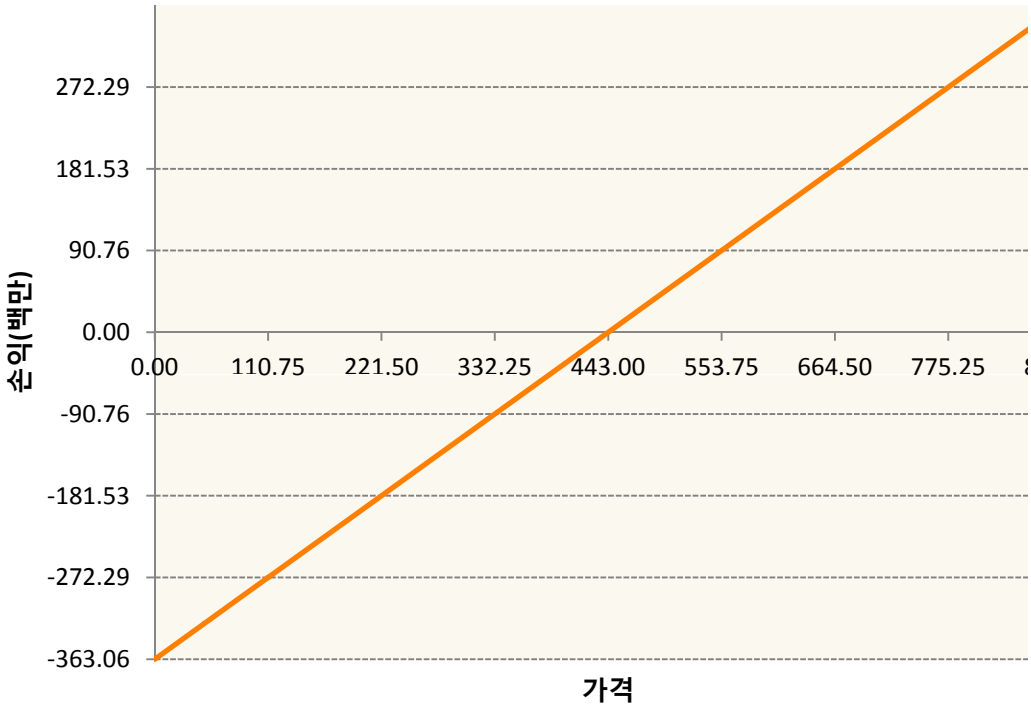

KCH7-COFFEE "C" FUTURE MAR17
807.84
605.88
403.92
201.96
0.00
-201.96
-403.92
-605.88
-807.84
0.00
38.30
76.60
114.90
153.20
191.50
229.80
268.10
손익(백만)

가격

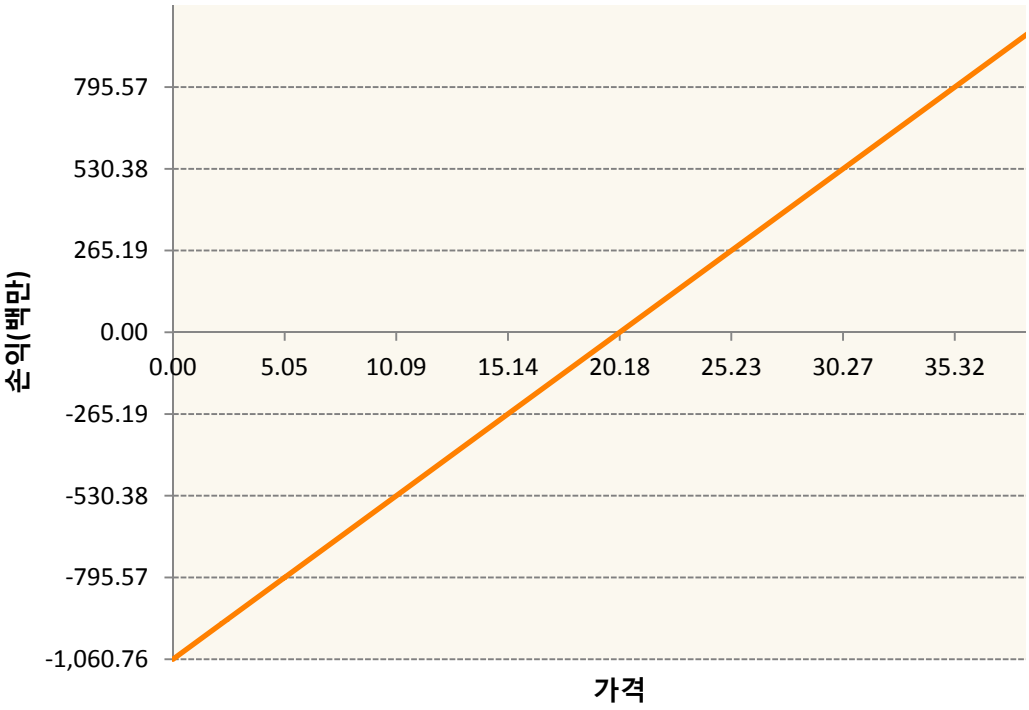
KR4175M20009-2017-02 달러선물



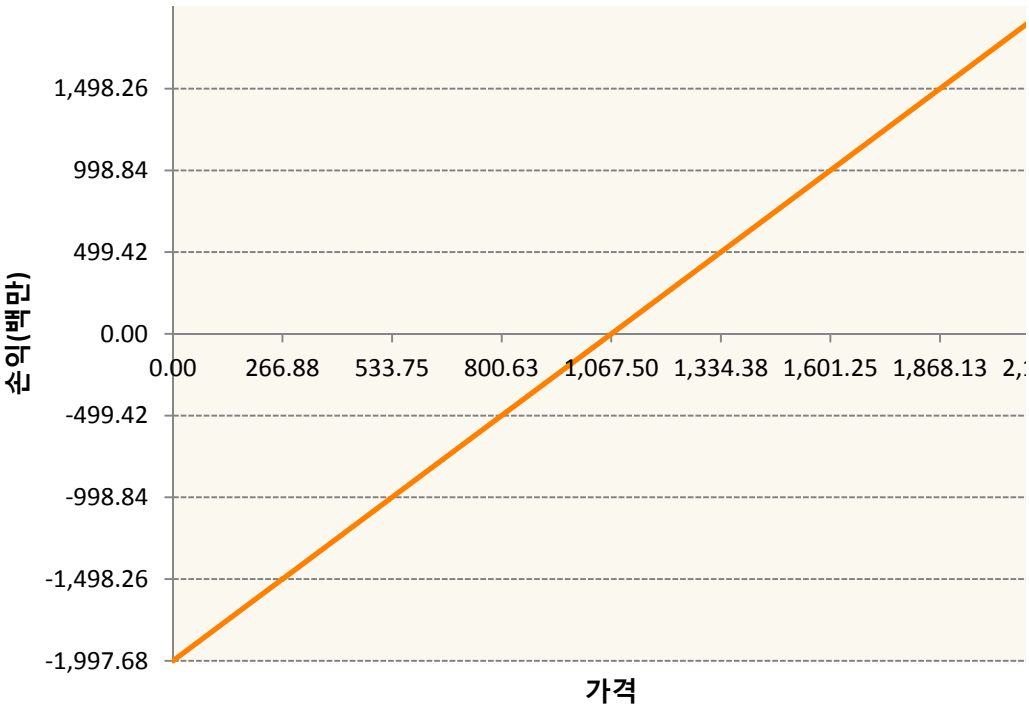
KWH7-KC HRW WHEAT FUT MAR17



SBH7-Sugar #11 (WORLD) MAR17

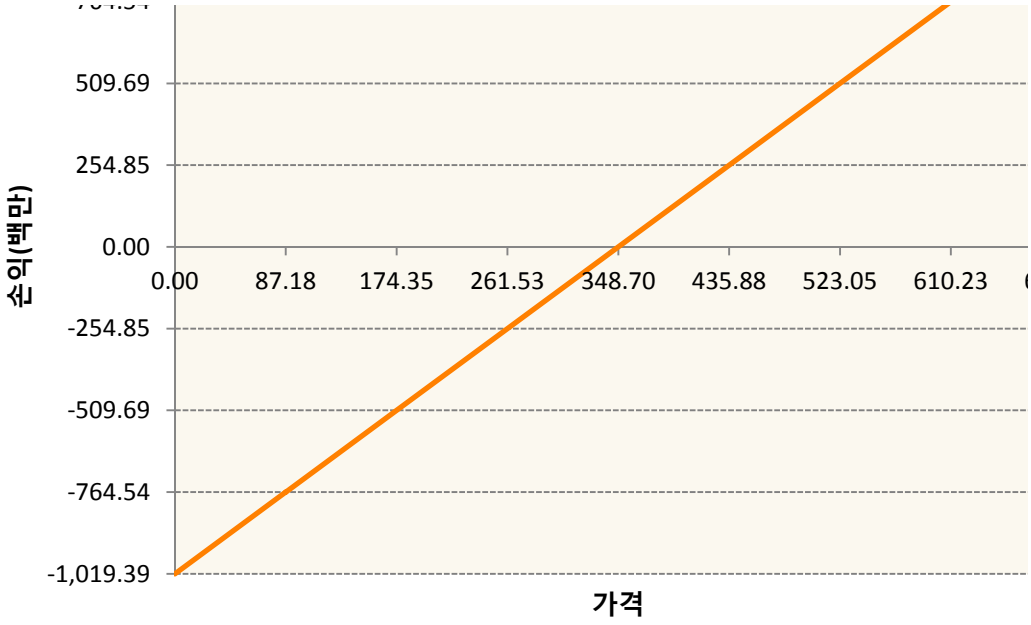


SH7-SOYBEAN FUTURE MAR17

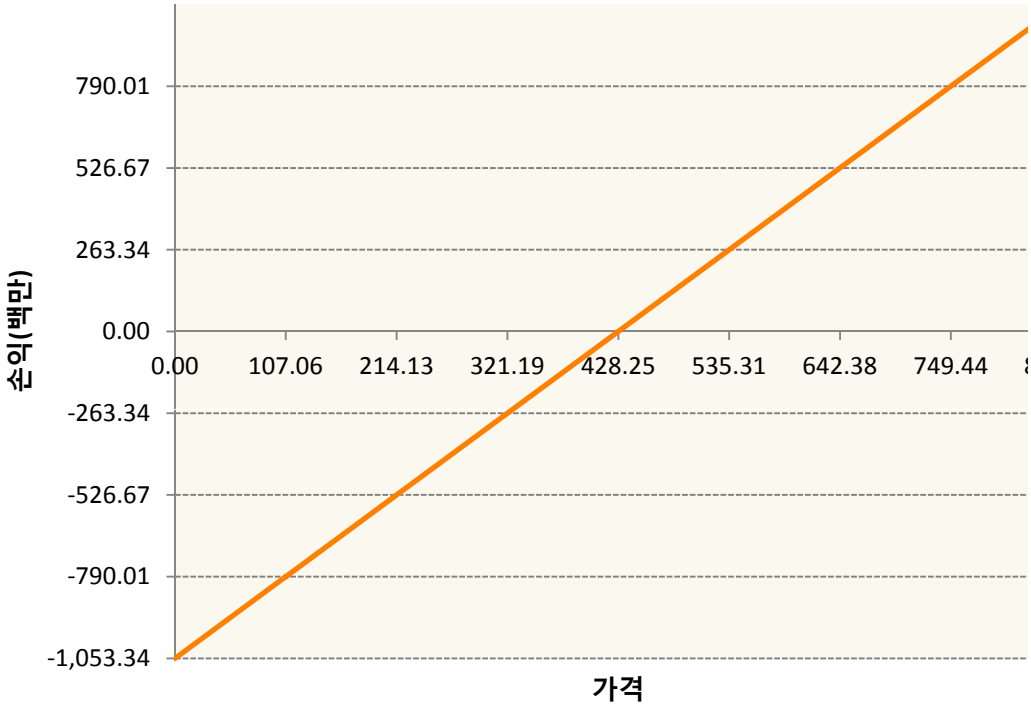


SMH7-SOYBEAN MEAL FUTR MAR17





WH7-WHEAT FUTURE(CBT) MAR17



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

BOH7	SOYBEAN OIL FUTR MAR17	73
CH7	CORN FUTURE MAR17	191
CTH7	COTTON NO.2 FUTR MAR17	34
KCH7	COFFEE "C" FUTURE MAR17	65
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	82
WH7	WHEAT FUTURE(CBT) MAR17	84

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

954