공시일	2017-01-25
기준일	2017-01-24

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	2017-01-25
기준일	2017-01-24

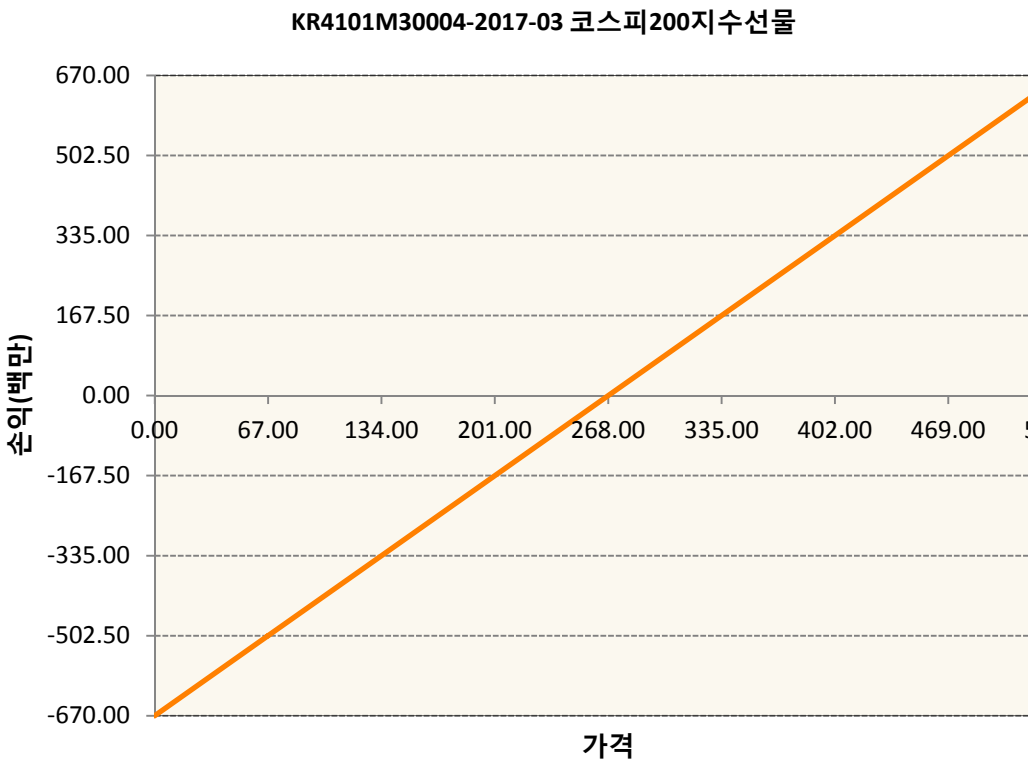
스마트인덱스모

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)

38

공시일	2017-01-25
기준일	2017-01-24

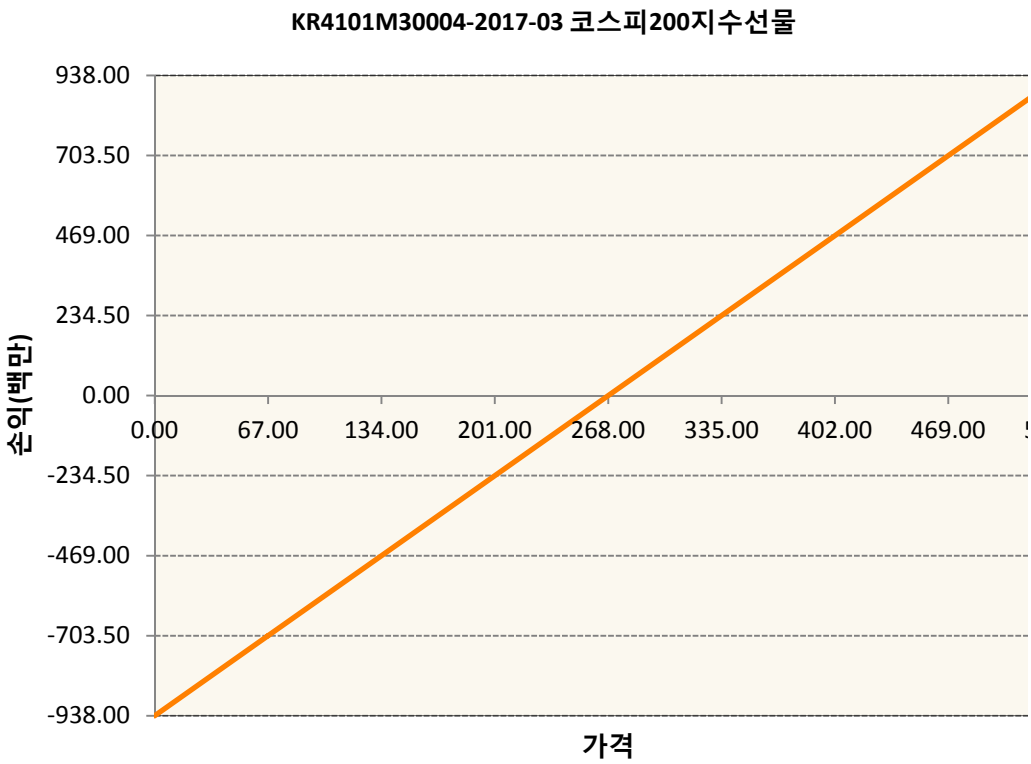
스마트레버리지목표전환형1호

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)

53

공시일	2017-01-25
기준일	2017-01-24

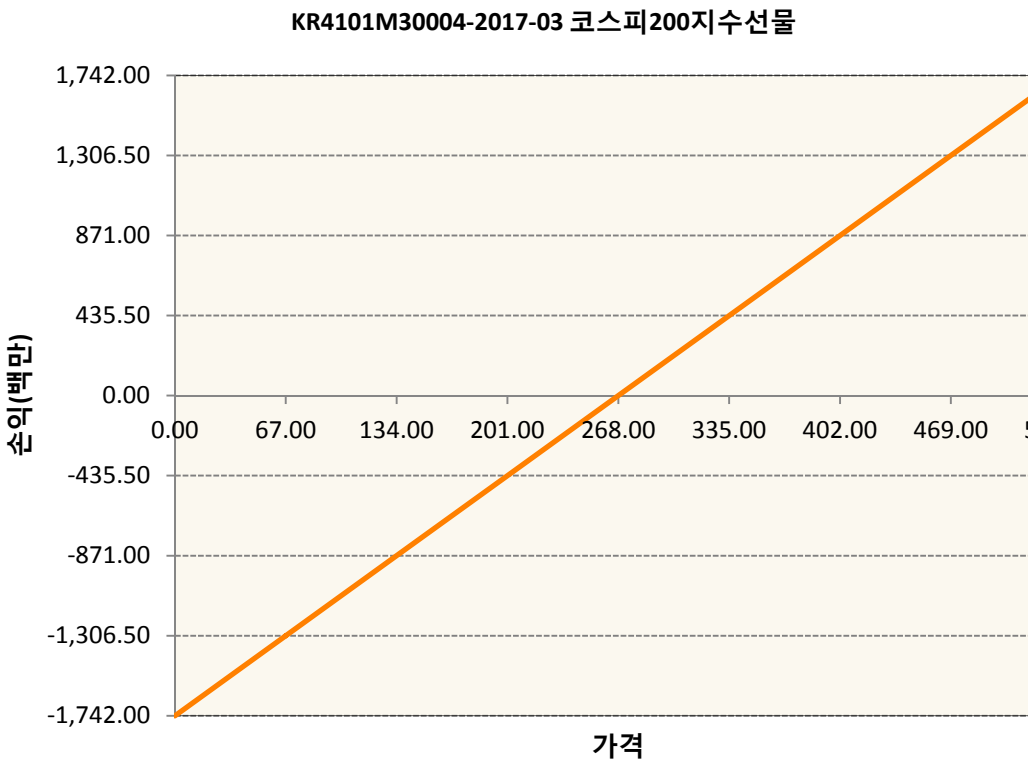
1.3배 레버리지 인덱스(주식-파생형)

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)

98

공시일	2017-01-25
기준일	2017-01-24

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)

678

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-01-25
기준일	2017-01-24

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	375

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

580

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-01-25
기준일	2017-01-24

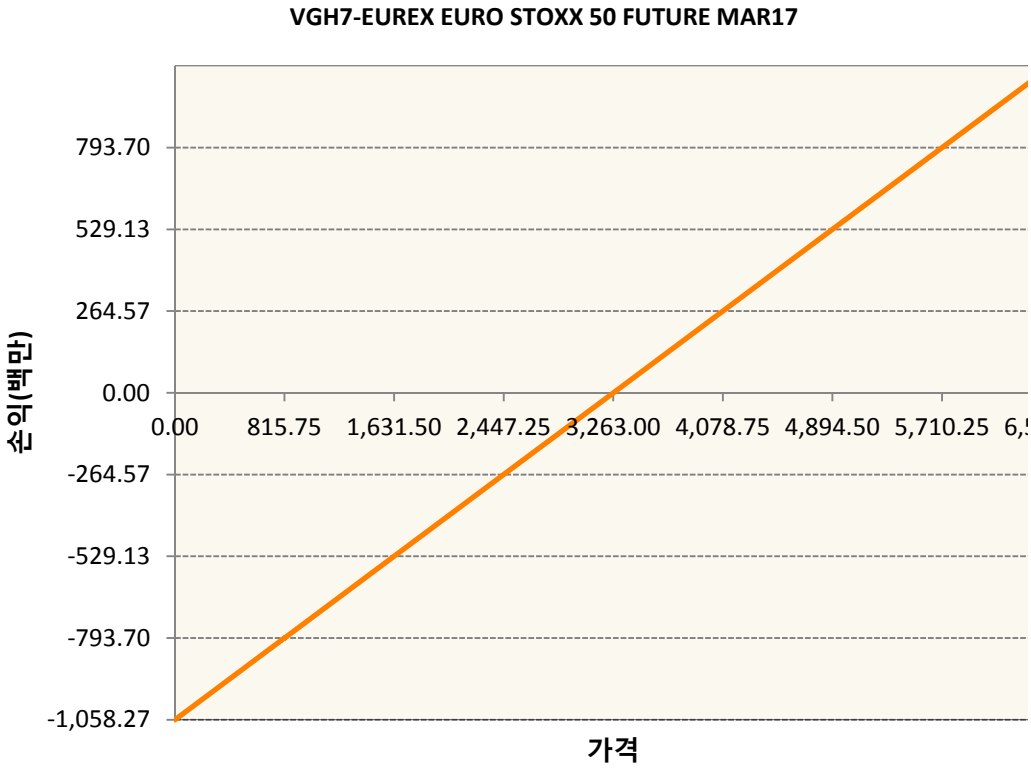
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,058	0	1,058	

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)

91

공시일	2017-01-25
기준일	2017-01-24

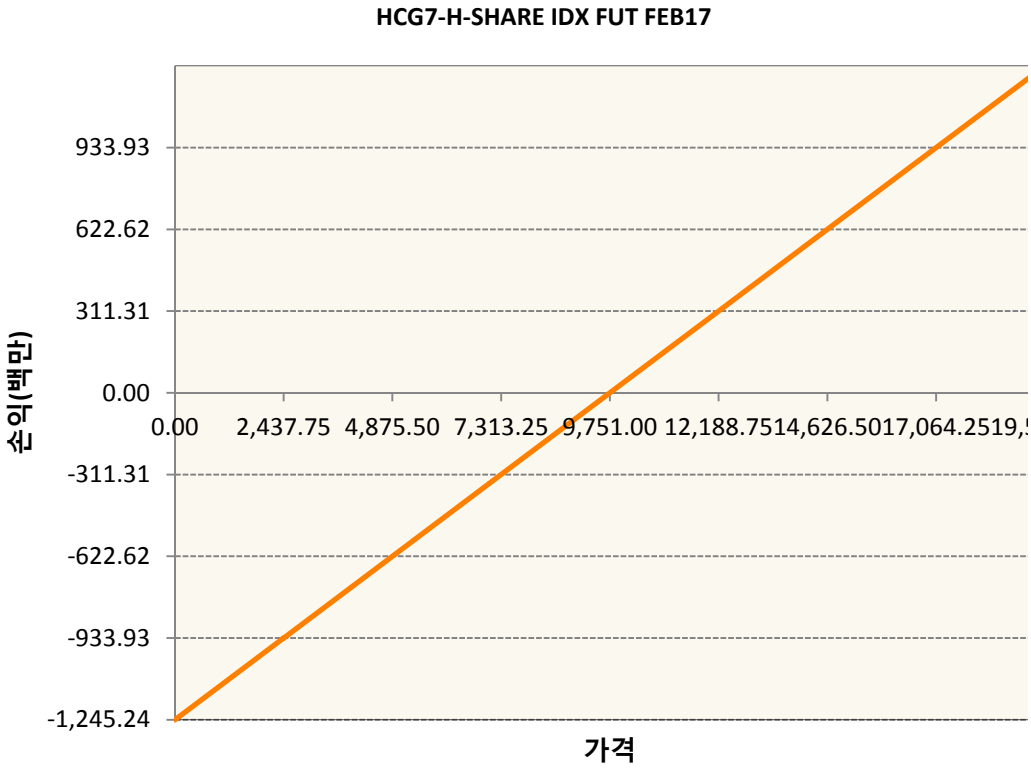
차이나인덱스모(주식-파생형)

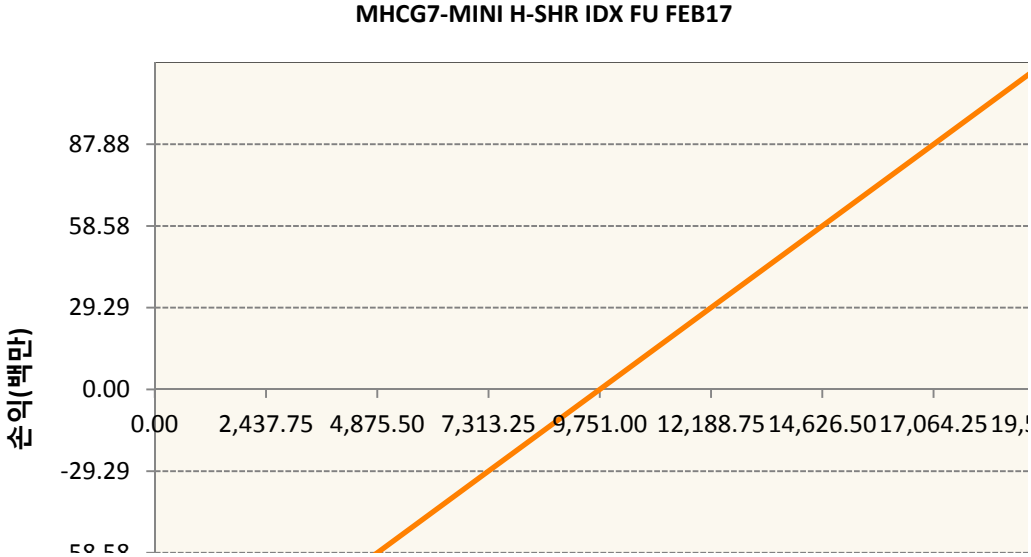
1. 계약금액

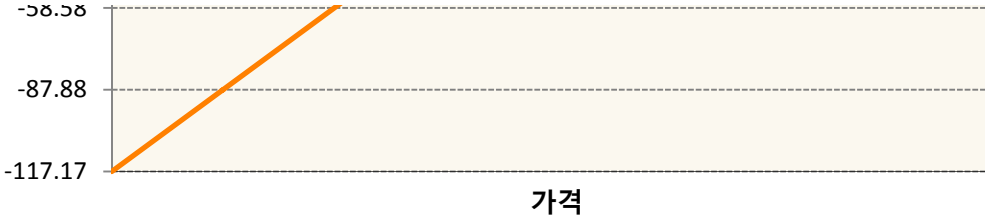
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,362	0	1,362	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCG7	H-SHARE IDX FUT FEB17	100
MHCG7	MINI H-SHR IDX FU FEB17	9

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

공시일	2017-01-25
기준일	2017-01-24

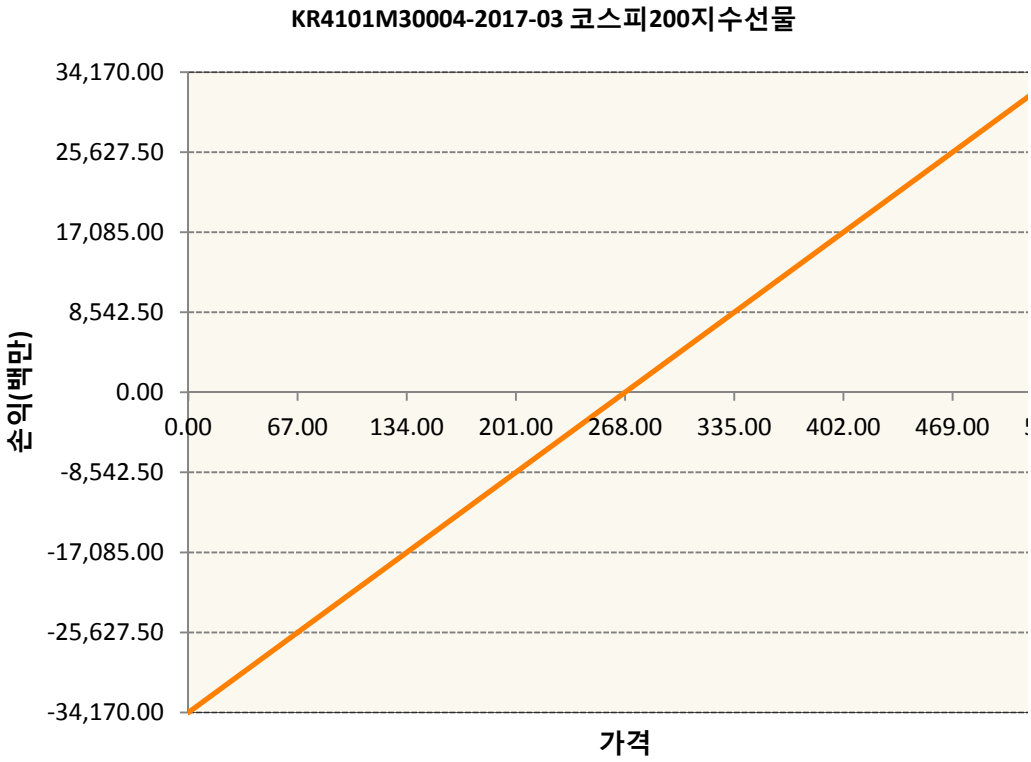
커버드콜(주식혼합-파생형)

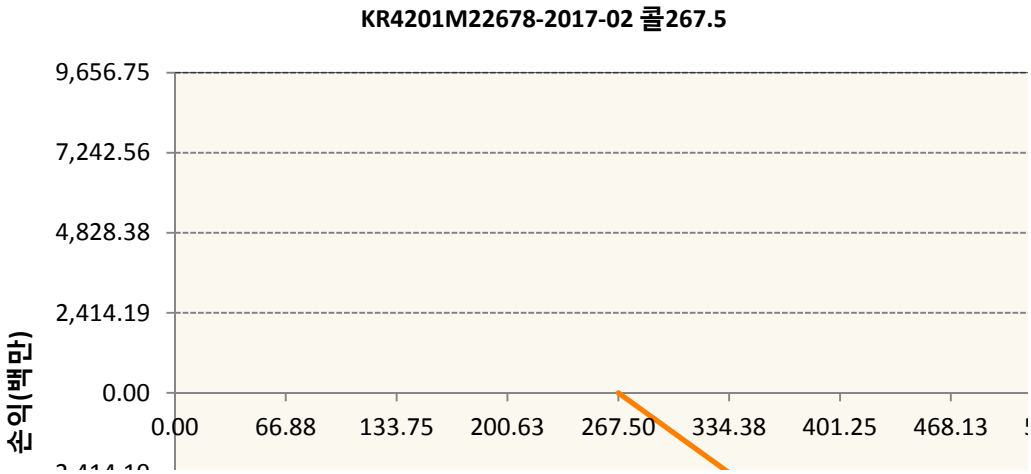
1. 계약금액

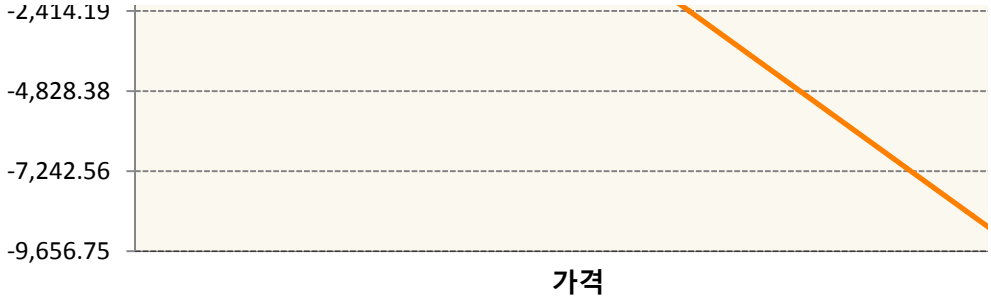
(단위:백만원)

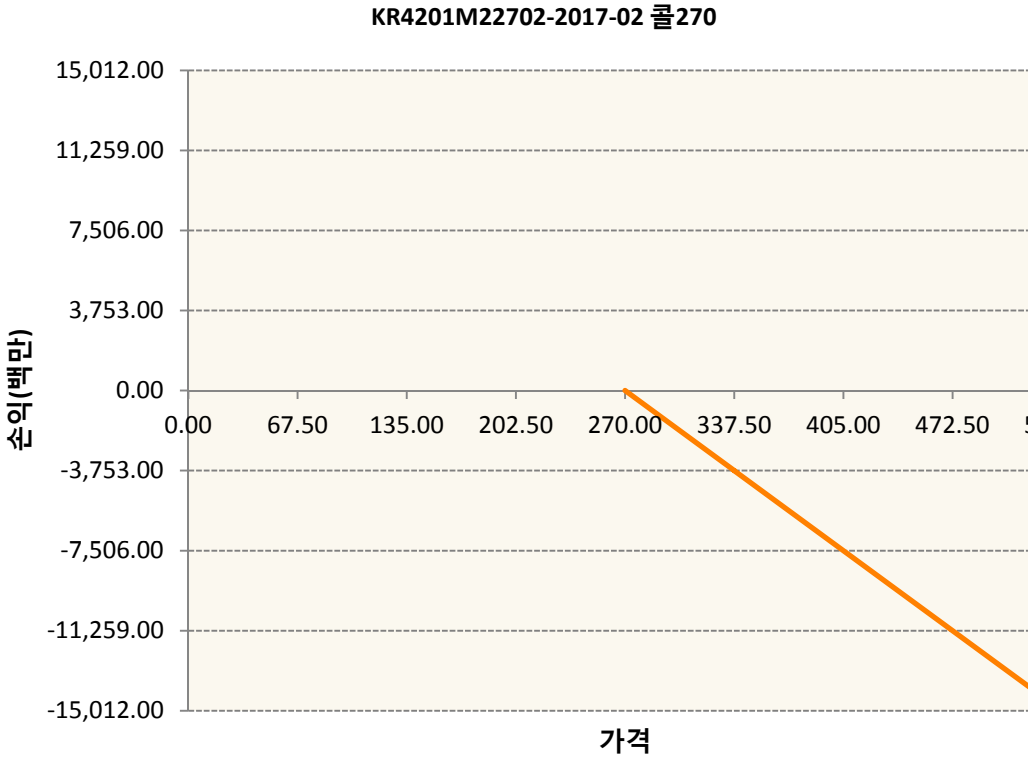
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	407	-407	장내
누계	유가증권	선물	34,170	0	34,170	장내
누계	유가증권	옵션	0	24,669	-24,669	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101M30(2017-03 코스피200지수선물							2,726
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-2,726	-2,726	-2,726	-2,726	-2,726	-2,726	-2,726
-5.33%	-1,818	-1,818	-1,818	-1,818	-1,818	-1,818	-1,818
-2.67%	-909	-909	-909	-909	-909	-909	-909
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	909	909	909	909	909	909	909
5.33%	1,818	1,818	1,818	1,818	1,818	1,818	1,818
8.00%	2,726	2,726	2,726	2,726	2,726	2,726	2,726
KR4201M22(2017-02 콜267.5							3,340
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	485	485	485	485	484	483	482
-5.33%	484	483	481	477	472	465	457
-2.67%	452	435	415	393	368	342	314
0%	126	84	42	0	-42	-84	-126
2.67%	-807	-827	-849	-875	-902	-931	-962
5.33%	-2,050	-2,052	-2,056	-2,061	-2,069	-2,078	-2,090
8.00%	-3,335	-3,335	-3,335	-3,335	-3,336	-3,338	-3,340
KR4201M22: 2017-02 콜270							4,747
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	460	460	460	460	459	459	458
-5.33%	460	459	458	456	452	446	439
-2.67%	443	431	413	392	367	338	306
0%	176	119	60	0	-61	-122	-183
2.67%	-938	-986	-1,037	-1,090	-1,146	-1,202	-1,260
5.33%	-2,757	-2,765	-2,778	-2,794	-2,815	-2,839	-2,867
8.00%	-4,728	-4,729	-4,730	-4,732	-4,735	-4,740	-4,747

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

11,298

공시일	2017-01-25
기준일	2017-01-24

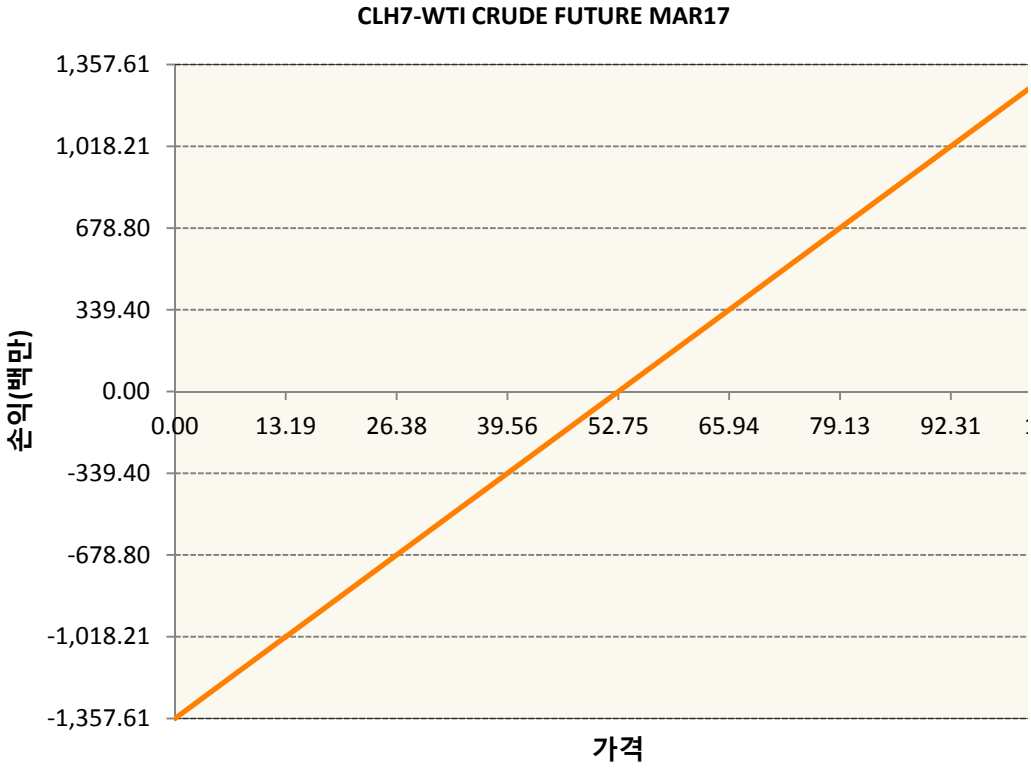
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

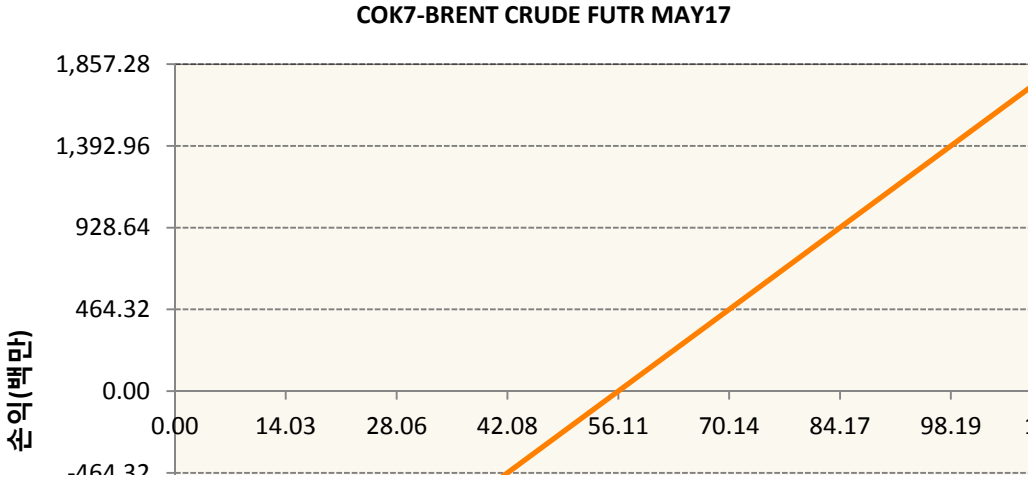
1. 계약금액

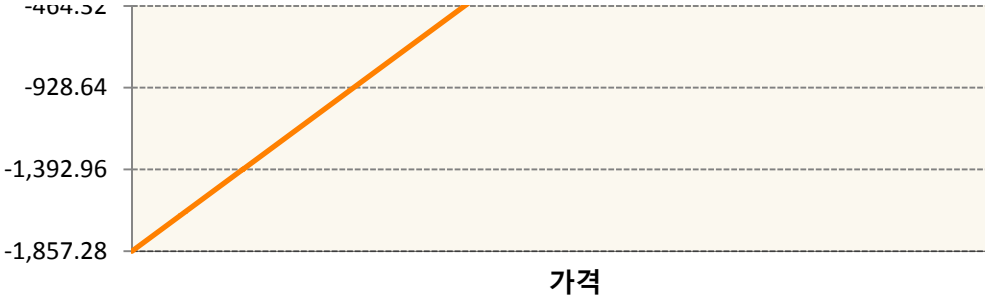
(단위:백만원)

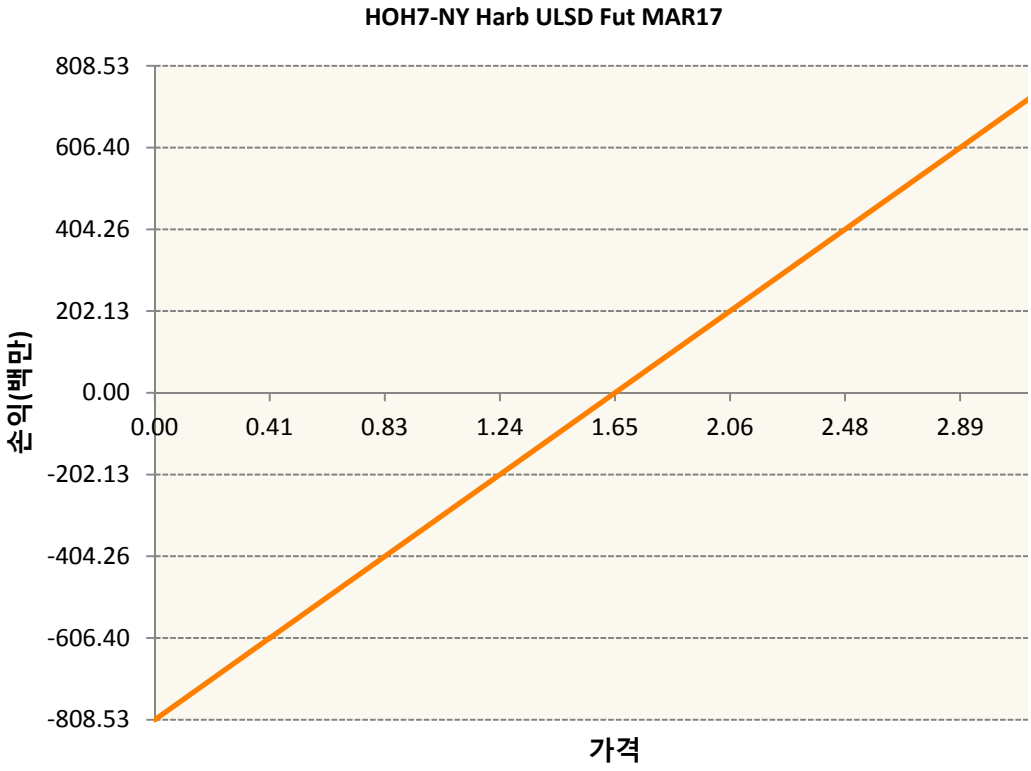
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	선물	유가증권	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	선물	유가증권	1,358	0	1,358	
누계	유가증권	선물	5,047	420	4,627	

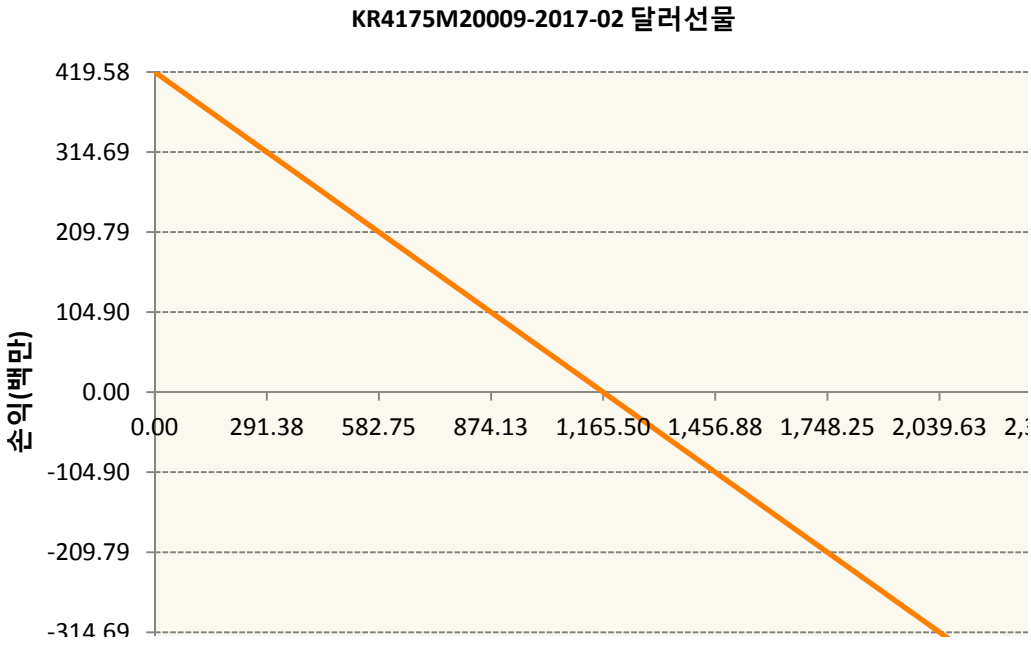
2. 만기시점의 손익구조

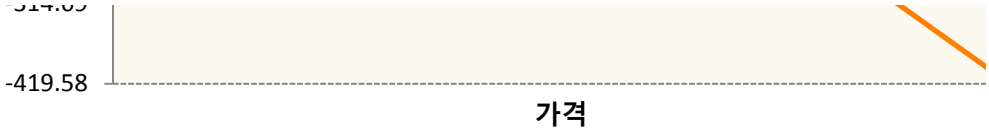


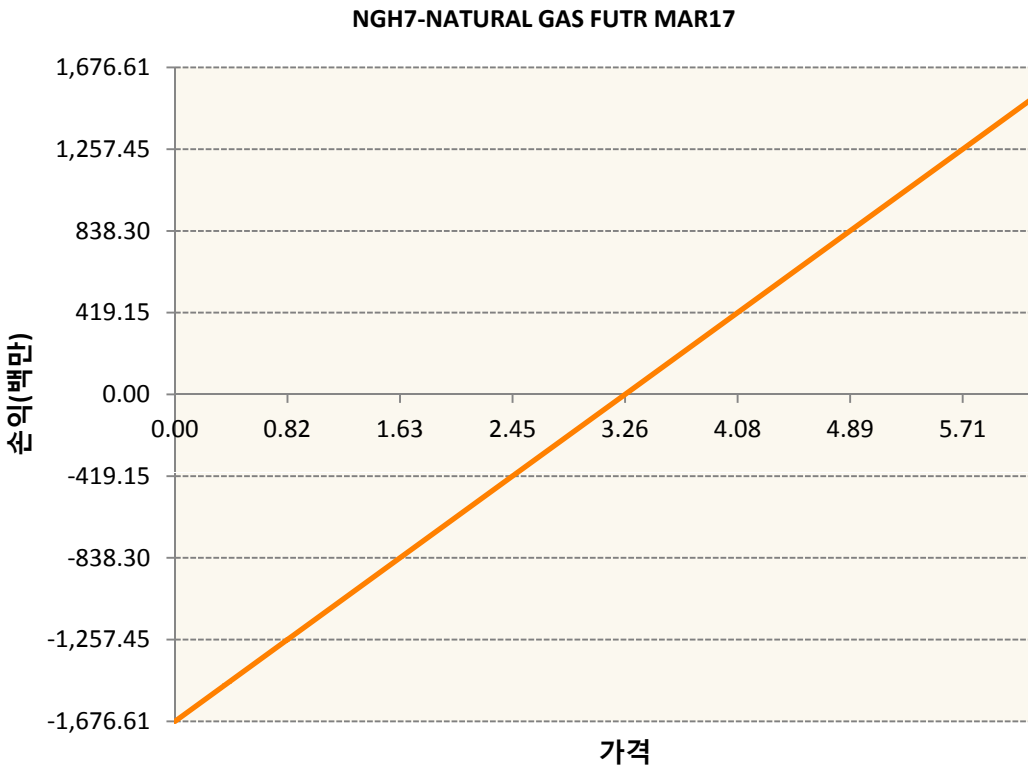


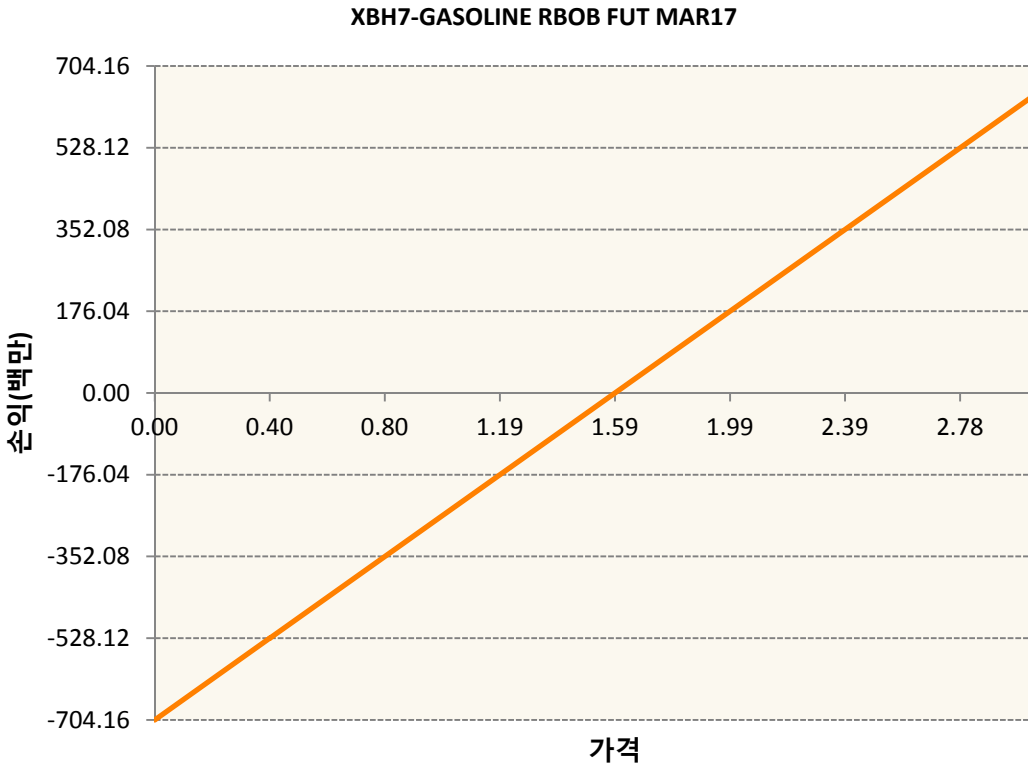

-928.64
-1,392.96
-1,857.28
가격


HOH7-NY Harb ULSD Fut MAR17
808.53
606.40
404.26
202.13
0.00
-202.13
-404.26
-606.40
-808.53
0.00
0.41
0.83
1.24
1.65
2.06
2.48
2.89
순익(백만)
가격


KR4175M20009-2017-02 달러선물
419.58
314.69
209.79
104.90
0.00
-104.90
-209.79
-314.69
0.00
291.38
582.75
874.13
1,165.50
1,456.88
1,748.25
2,039.63
순익(백만)


-419.58
가격


NGH7-NATURAL GAS FUTR MAR17
1,676.61
1,257.45
838.30
419.15
0.00
-419.15
-838.30
-1,257.45
-1,676.61
0.00
0.82
1.63
2.45
3.26
4.08
4.89
5.71
순익(백만)
가격


XBH7-GASOLINE RBOB FUT MAR17
704.16
528.12
352.08
176.04
0.00
-176.04
-352.08
-528.12
-704.16
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	109
COK7	BRENT CRUDE FUTR MAY17	149
HOH7	NY Harb ULSD Fut MAR17	65
KR4175M20(	2017-02 달러선물	34
NGH7	NATURAL GAS FUTR MAR17	134
XBH7	GASOLINE RBOB FUT MAR17	56

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

1,173

공시일	2017-01-25
기준일	2017-01-24

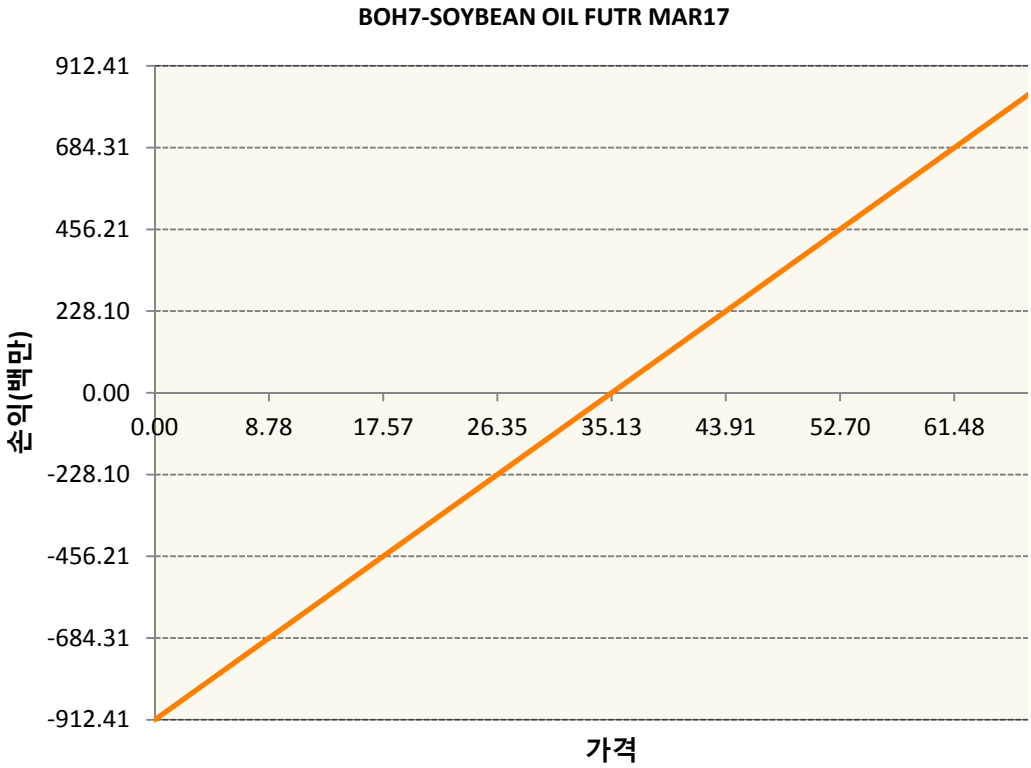
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

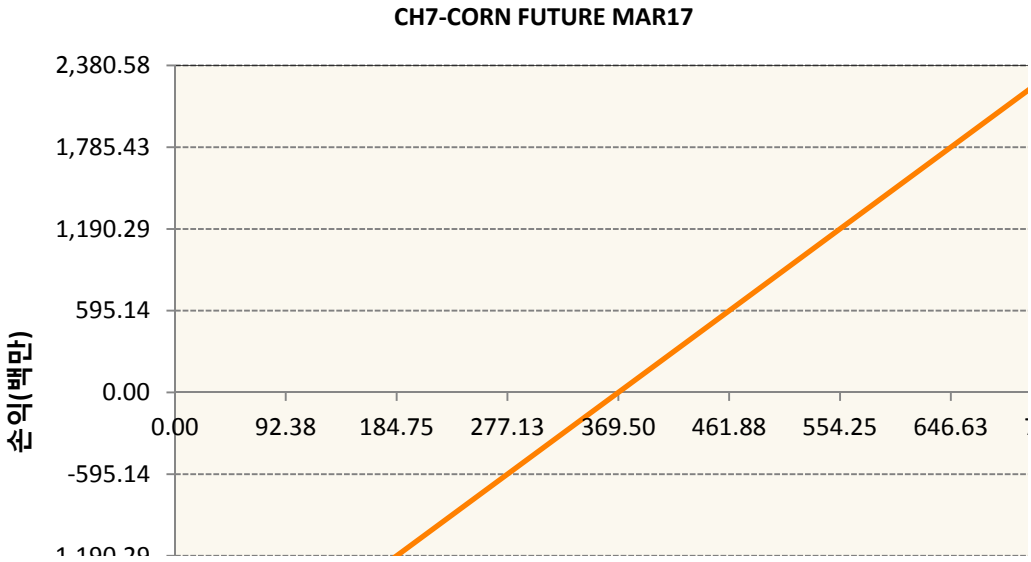
1. 계약금액

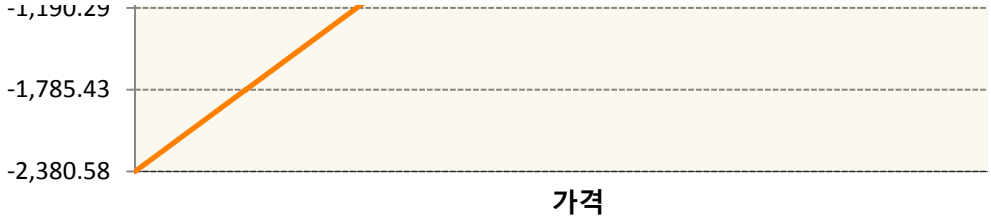
(단위:백만원)

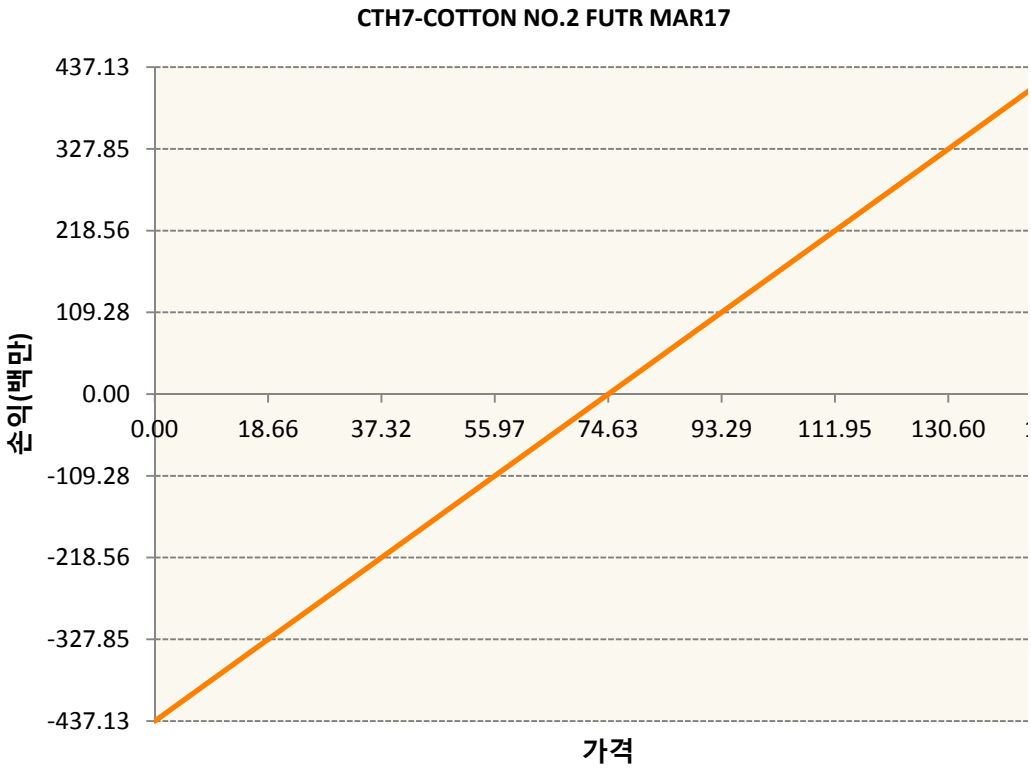
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	10,049	583	9,467	

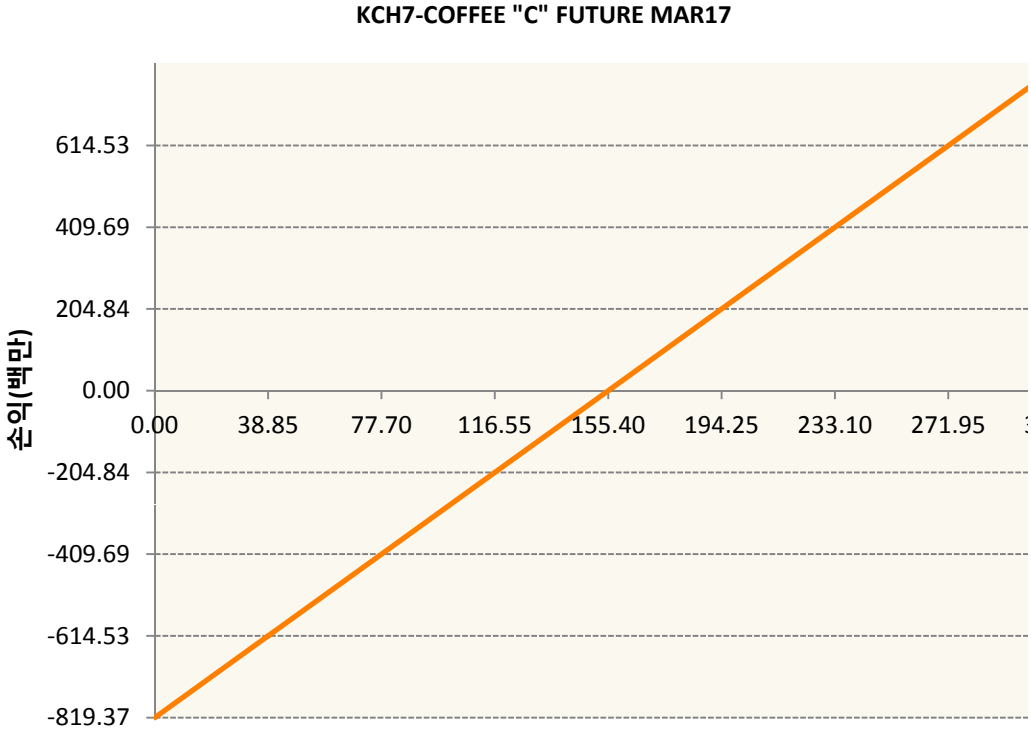
2. 만기시점의 손익구조



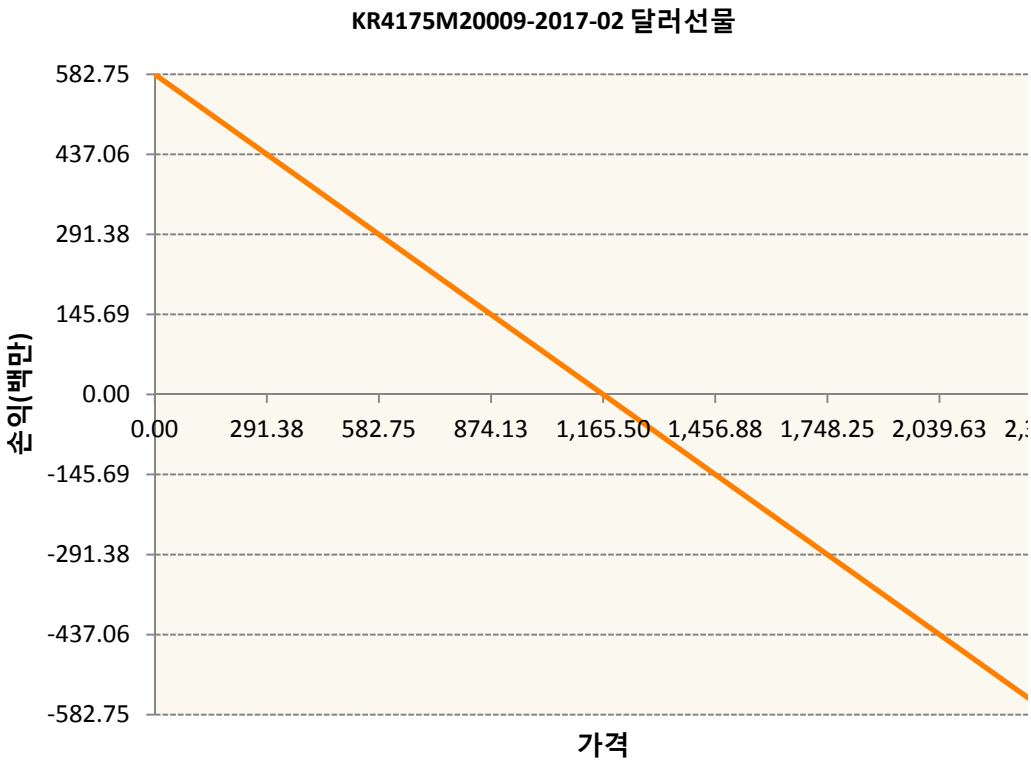


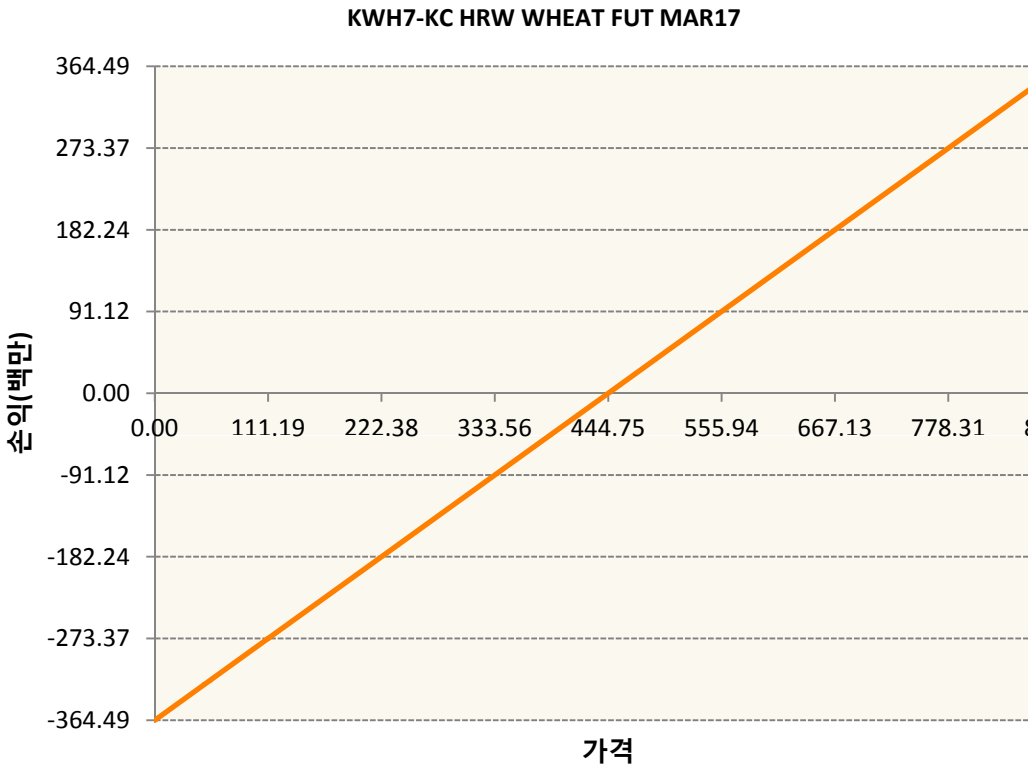

-1,190.29
-1,785.43
-2,380.58
가격

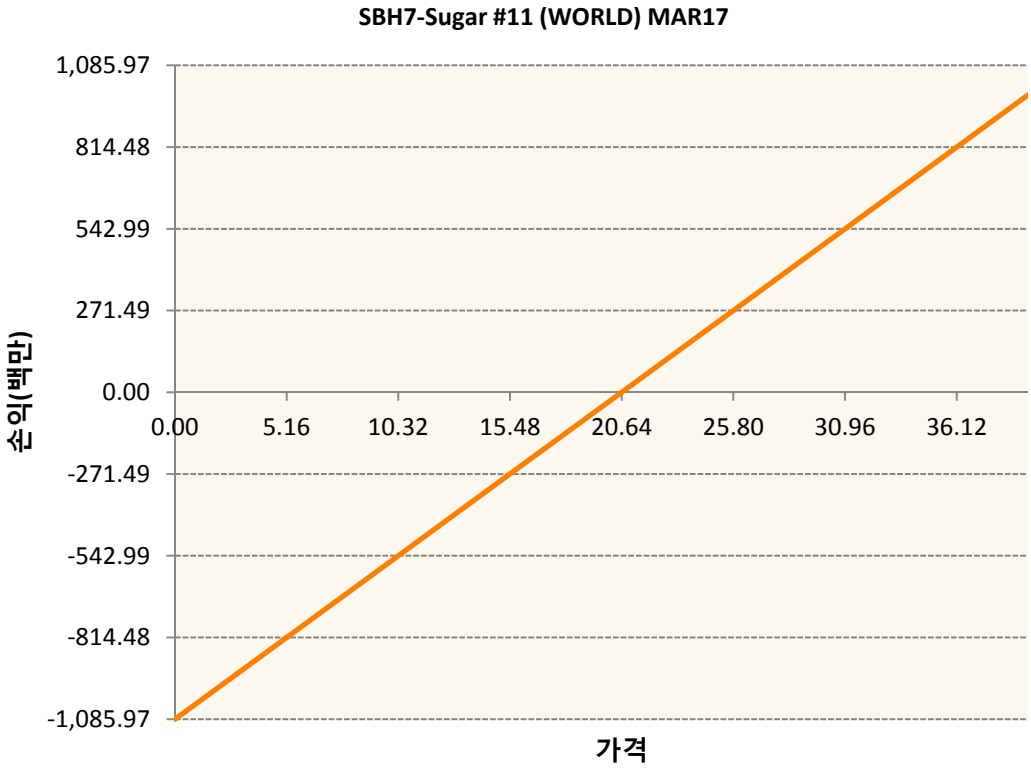

CTH7-COTTON NO.2 FUTR MAR17
437.13
327.85
218.56
109.28
0.00
-109.28
-218.56
-327.85
-437.13
0.00
18.66
37.32
55.97
74.63
93.29
111.95
130.60
손익(백만)
가격

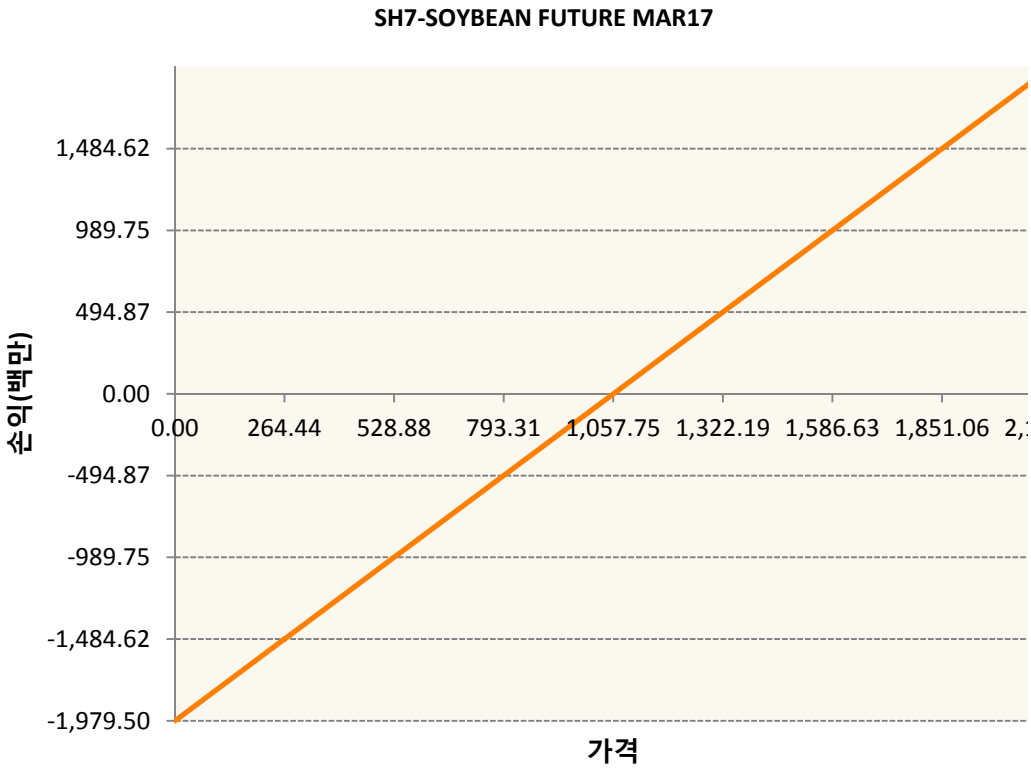

KCH7-COFFEE "C" FUTURE MAR17
614.53
409.69
204.84
0.00
-204.84
-409.69
-614.53
-819.37
0.00
38.85
77.70
116.55
155.40
194.25
233.10
271.95
손익(백만)

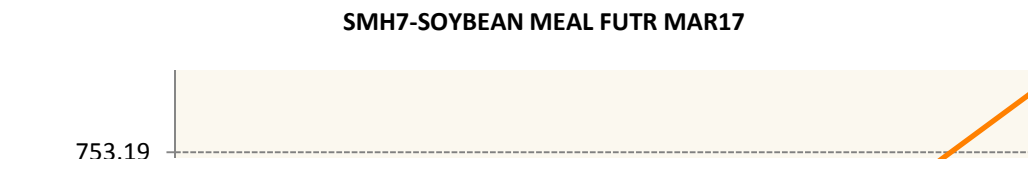
가격

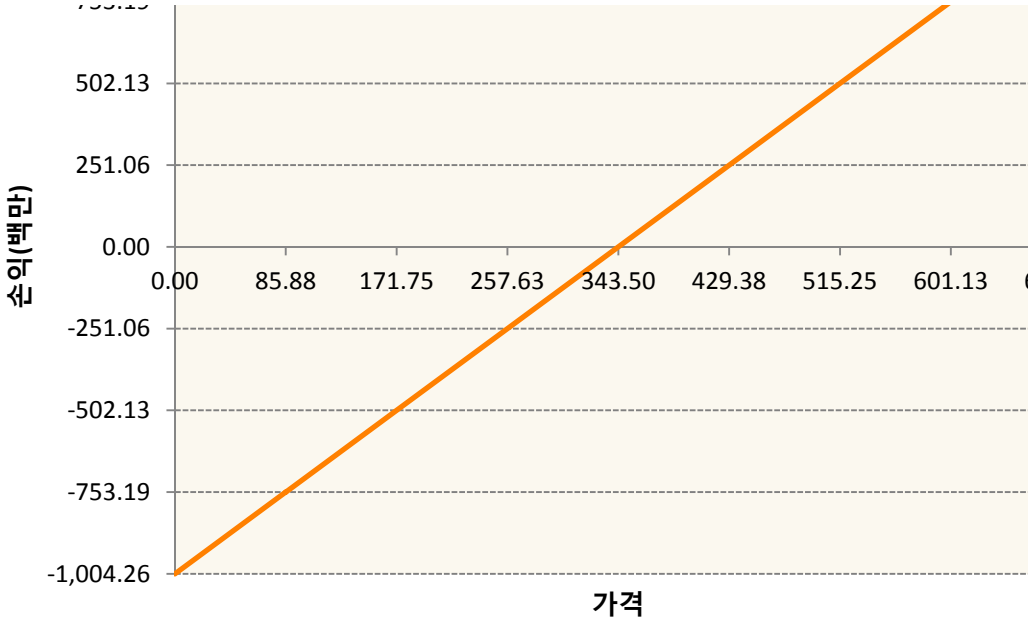

KR4175M20009-2017-02 달러선물
582.75
437.06
291.38
145.69
0.00
-145.69
-291.38
-437.06
-582.75
0.00
291.38
582.75
874.13
1,165.50
1,456.88
1,748.25
2,039.63
손익(백만)
가격


KWH7-KC HRW WHEAT FUT MAR17
364.49
273.37
182.24
91.12
0.00
-91.12
-182.24
-273.37
-364.49
0.00
111.19
222.38
333.56
444.75
555.94
667.13
778.31
손익(백만)
가격

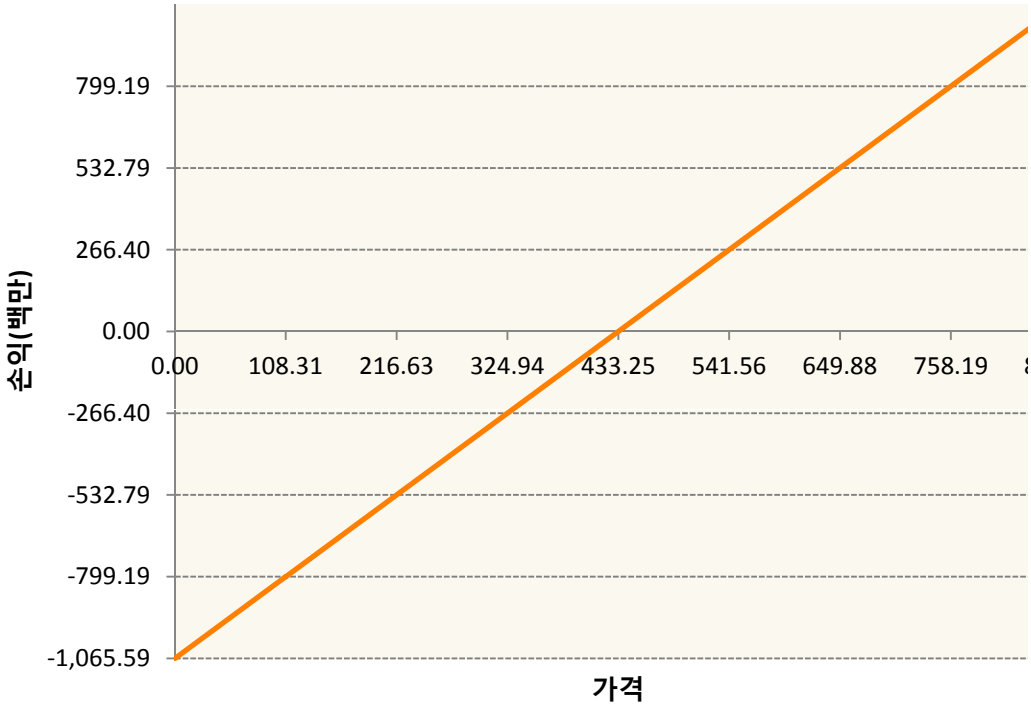

SBH7-Sugar #11 (WORLD) MAR17
1,085.97
814.48
542.99
271.49
0.00
-271.49
-542.99
-814.48
-1,085.97
0.00
5.16
10.32
15.48
20.64
25.80
30.96
36.12
손익(백만)
가격


SH7-SOYBEAN FUTURE MAR17
1,484.62
989.75
494.87
0.00
-494.87
-989.75
-1,484.62
-1,979.50
0.00
264.44
528.88
793.31
1,057.75
1,322.19
1,586.63
1,851.06
손익(백만)
가격


SMH7-SOYBEAN MEAL FUTR MAR17
753.19



WH7-WHEAT FUTURE(CBT) MAR17



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

BOH7	SOYBEAN OIL FUTR MAR17	73
CH7	CORN FUTURE MAR17	190
CTH7	COTTON NO.2 FUTR MAR17	35
KCH7	COFFEE "C" FUTURE MAR17	66
KR4175M20(	2017-02 달러선물	47

KWH7	KC HRW WHEAT FUT MAR17	29
SBH7	Sugar #11 (WORLD) MAR17	87
SH7	SOYBEAN FUTURE MAR17	158
SMH7	SOYBEAN MEAL FUTR MAR17	80
WH7	WHEAT FUTURE(CBT) MAR17	85

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

958