공시일	2017-01-26
기준일	2017-01-25

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	2017-01-26
기준일	2017-01-25

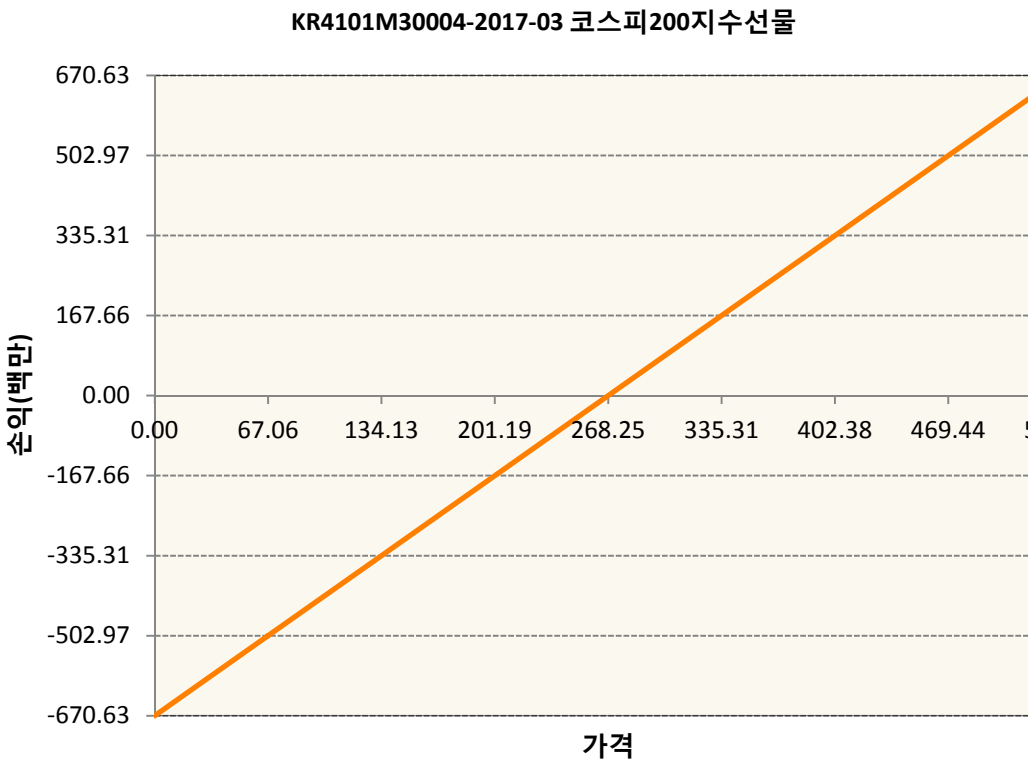
스마트인덱스모

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	671	0	671	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)

37

공시일	2017-01-26
기준일	2017-01-25

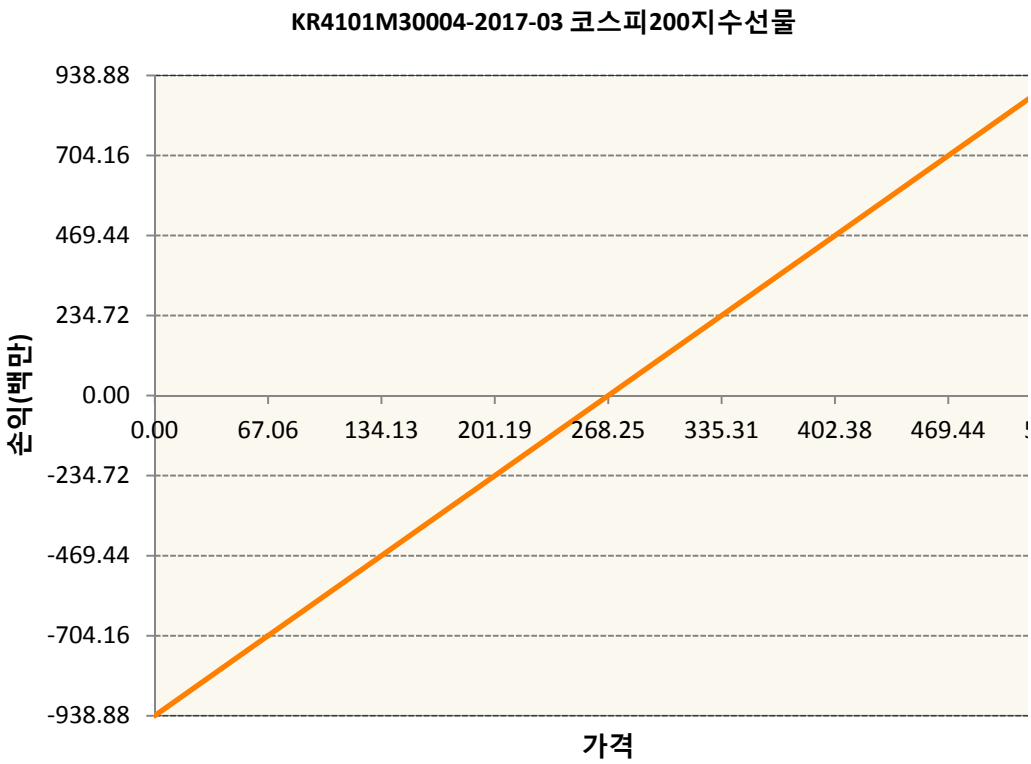
스마트레버리지목표전환형1호

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)

52

공시일	2017-01-26
기준일	2017-01-25

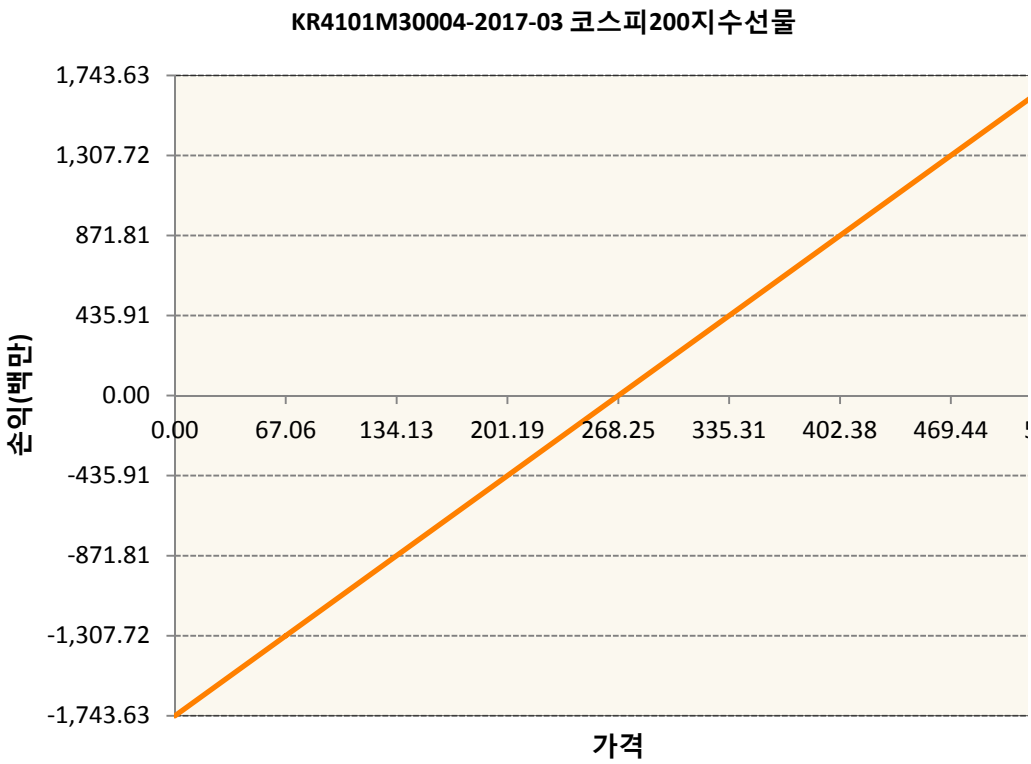
1.3배 레버리지 인덱스(주식-파생형)

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	1,744	0	1,744	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)

97

공시일	2017-01-26
기준일	2017-01-25

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	924

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

669

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-01-26
기준일	2017-01-25

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)

578

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-01-26
기준일	2017-01-25

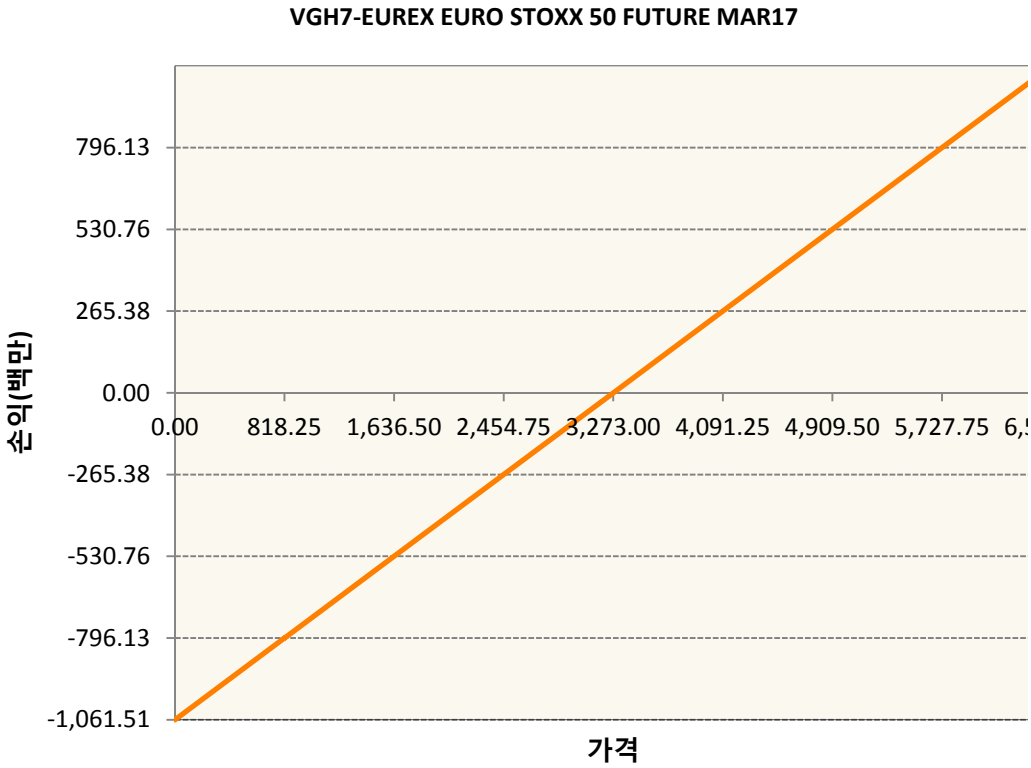
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,062	0	1,062	

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	2017-01-26
기준일	2017-01-25

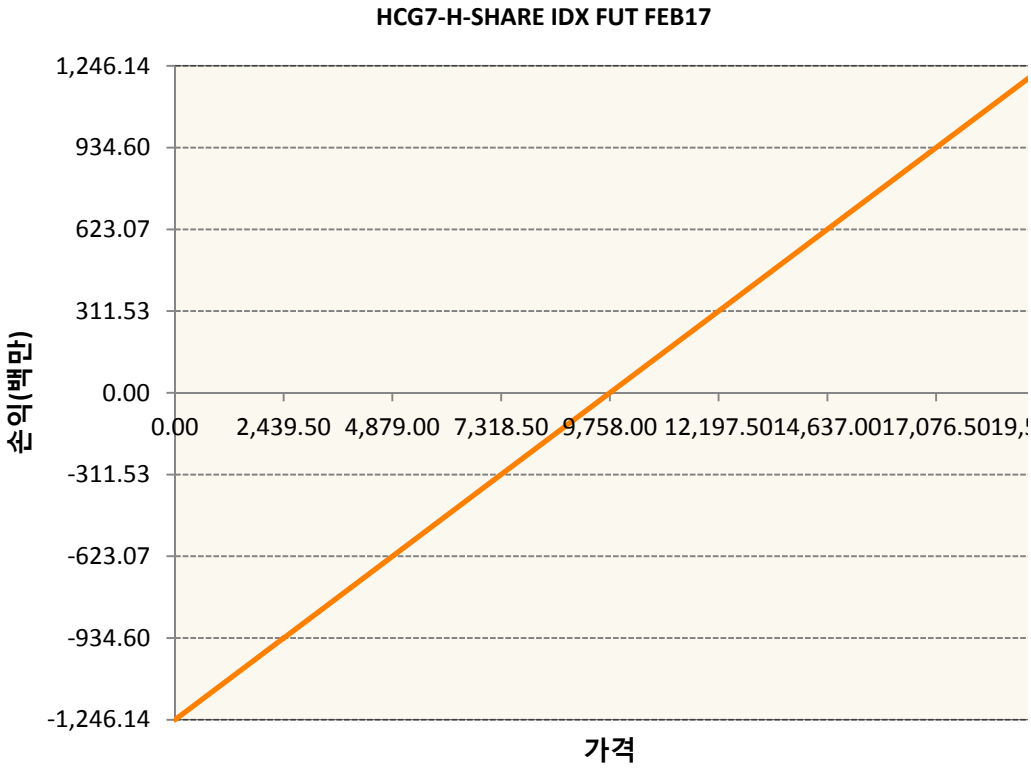
차이나인덱스모(주식-파생형)

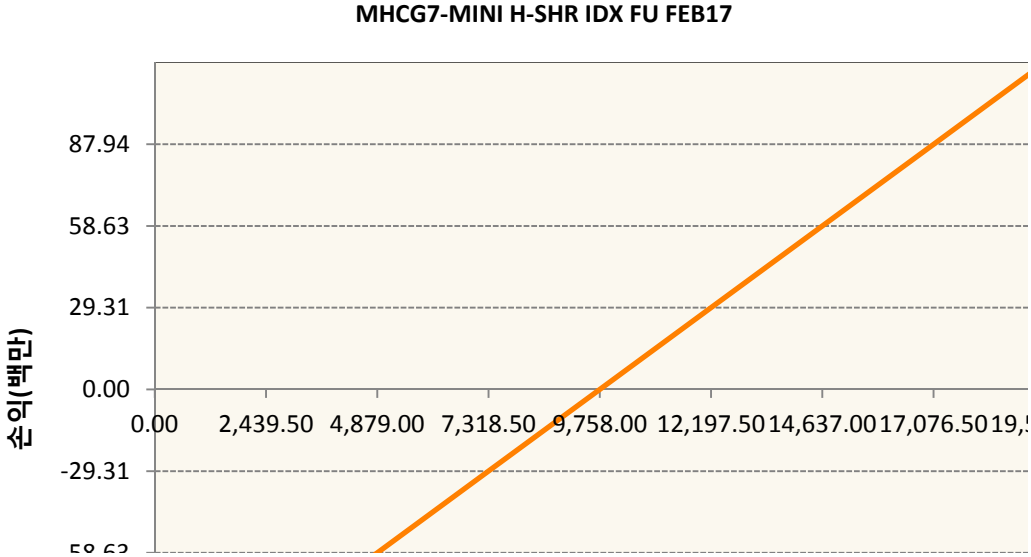
1. 계약금액

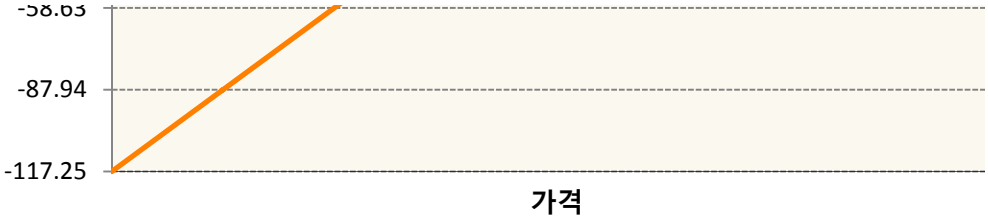
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,363	0	1,363	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	2017-01-26
기준일	2017-01-25

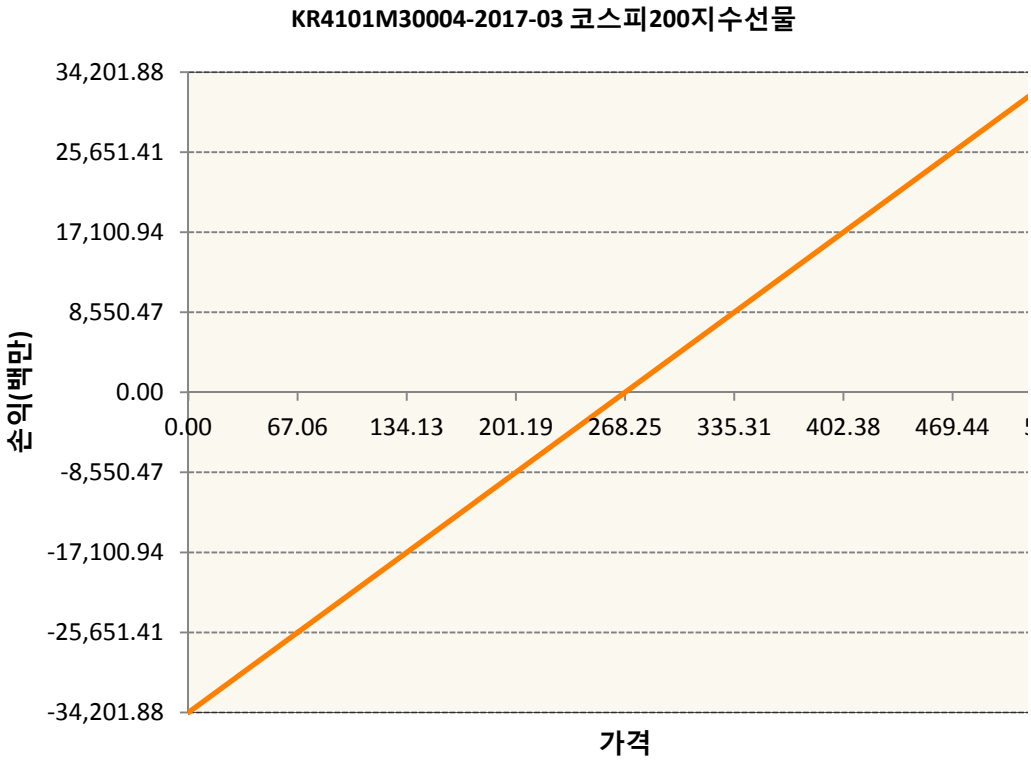
커버드콜(주식혼합-파생형)

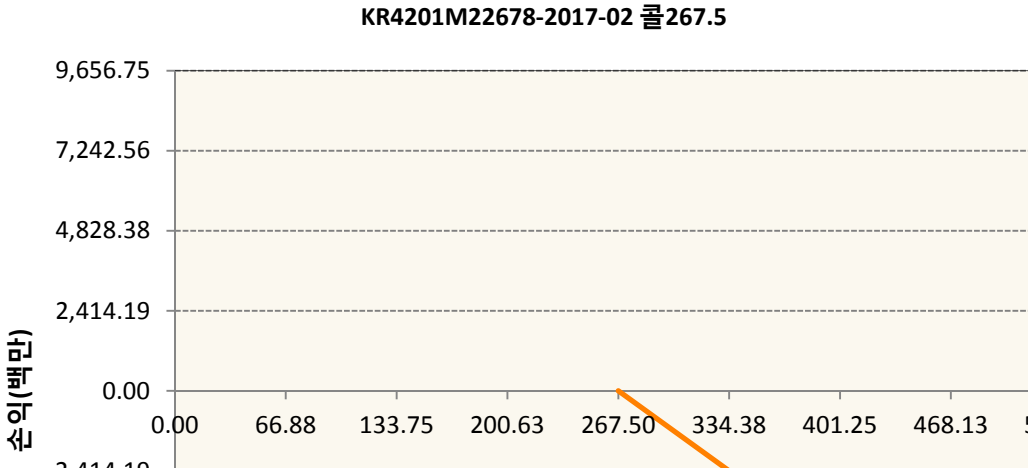
1. 계약금액

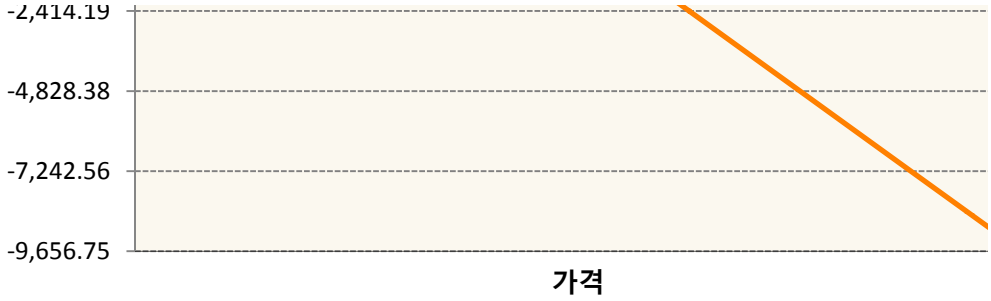
(단위:백만원)

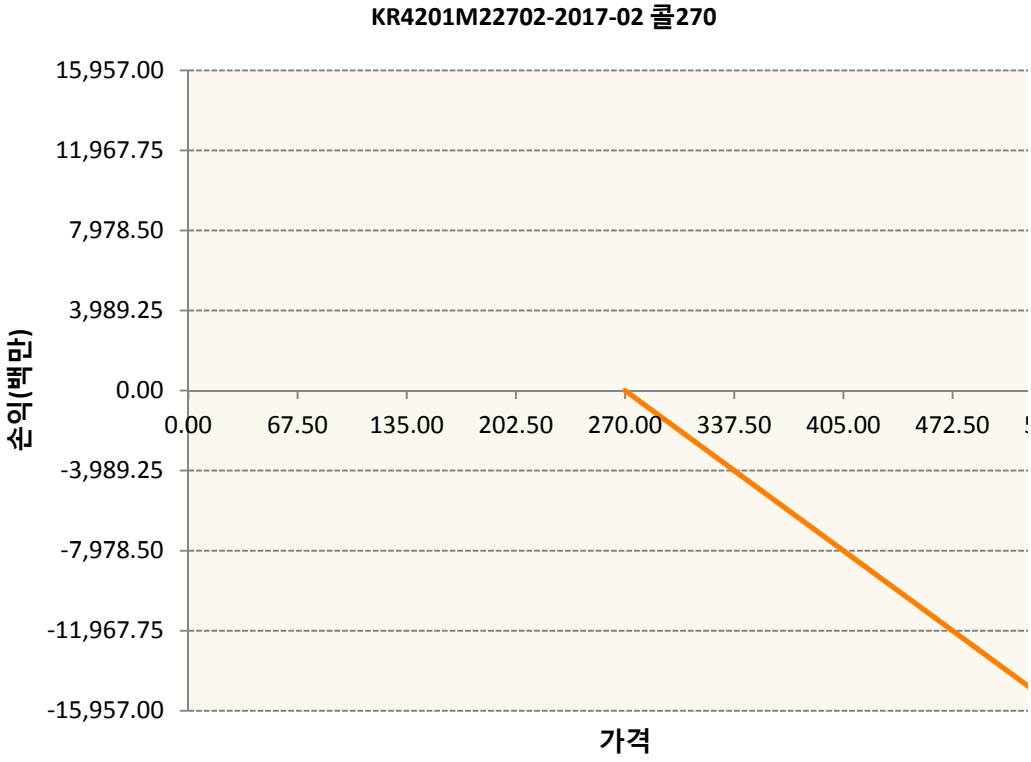
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	950	-950	장내
누계	유가증권	선물	34,202	0	34,202	장내
누계	유가증권	옵션	0	25,614	-25,614	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101M30(2017-03 코스피200지수선물							2,735
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-2,735	-2,735	-2,735	-2,735	-2,735	-2,735	-2,735
-5.33%	-1,823	-1,823	-1,823	-1,823	-1,823	-1,823	-1,823
-2.67%	-912	-912	-912	-912	-912	-912	-912
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	912	912	912	912	912	912	912
5.33%	1,823	1,823	1,823	1,823	1,823	1,823	1,823
8.00%	2,735	2,735	2,735	2,735	2,735	2,735	2,735
KR4201M22(2017-02 콜267.5							3,456
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	530	530	530	530	530	529	528
-5.33%	530	529	527	524	519	513	505
-2.67%	494	477	457	435	411	385	357
0%	117	78	39	0	-39	-78	-117
2.67%	-896	-910	-926	-944	-966	-989	-1,013
5.33%	-2,164	-2,165	-2,166	-2,169	-2,173	-2,179	-2,186
8.00%	-3,453	-3,453	-3,453	-3,453	-3,454	-3,454	-3,456
KR4201M22 2017-02 콜270							5,263

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	530	530	530	530	530	529	529
-5.33%	530	529	528	526	523	518	511
-2.67%	512	498	480	458	432	402	369
0%	184	123	62	0	-62	-125	-187
2.67%	-1,140	-1,180	-1,223	-1,270	-1,318	-1,369	-1,422
5.33%	-3,145	-3,150	-3,157	-3,167	-3,181	-3,198	-3,219
8.00%	-5,253	-5,253	-5,254	-5,254	-5,256	-5,259	-5,263

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

12,404

공시일	2017-01-26
기준일	2017-01-25

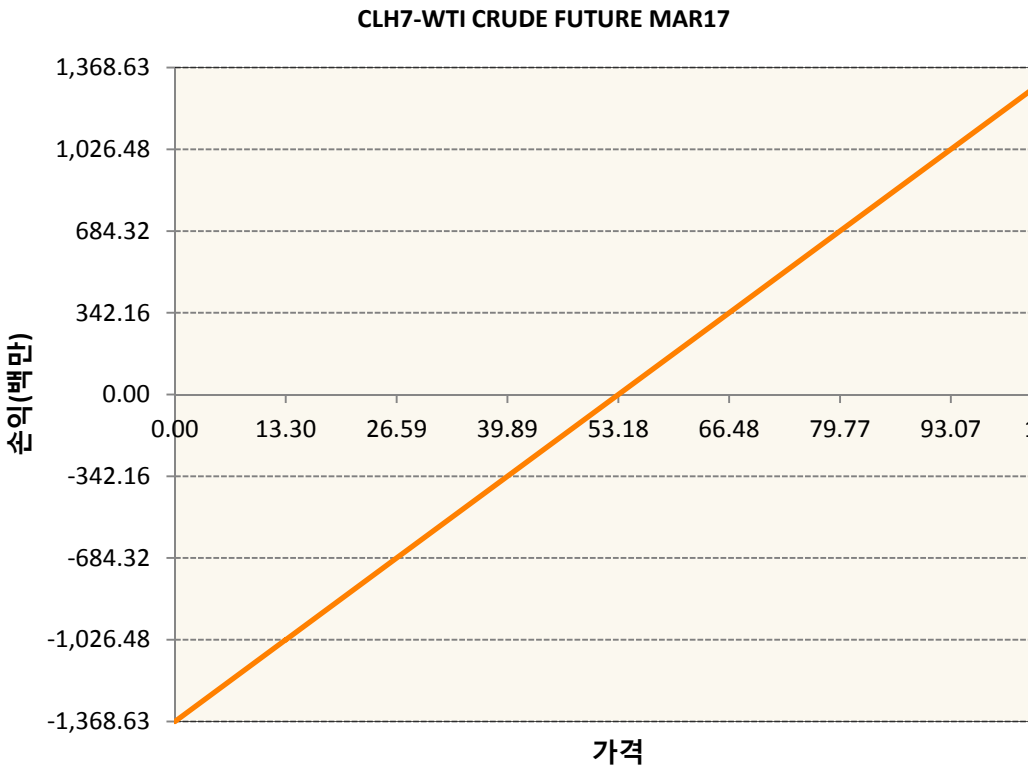
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

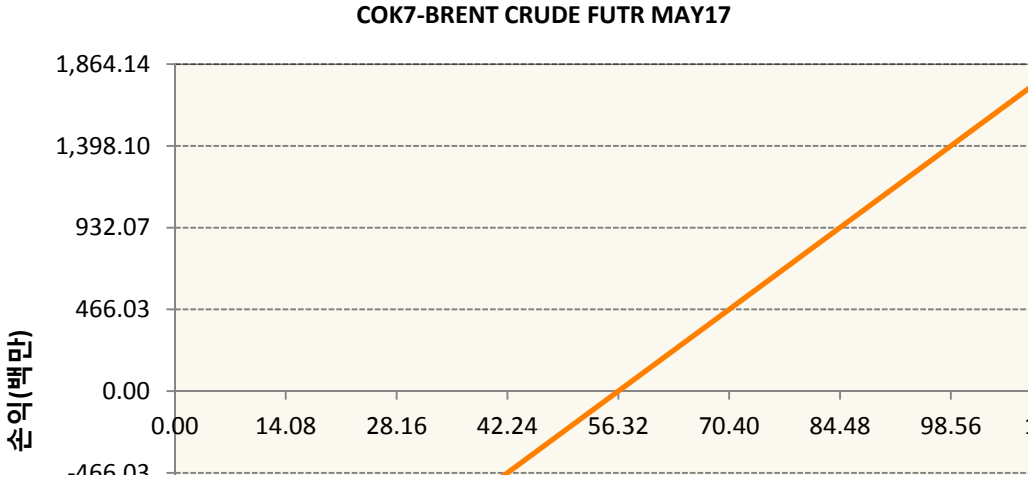
1. 계약금액

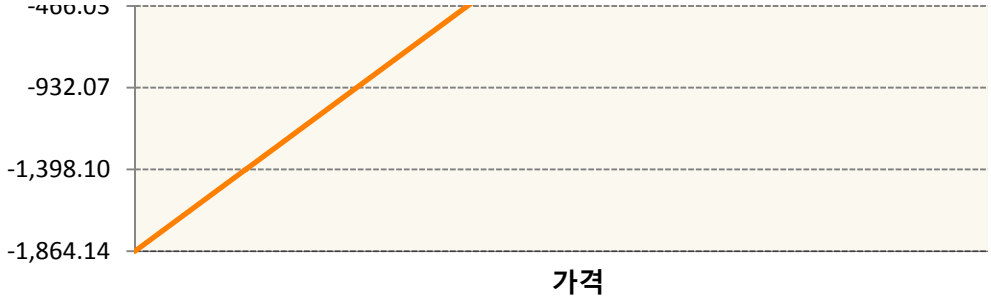
(단위:백만원)

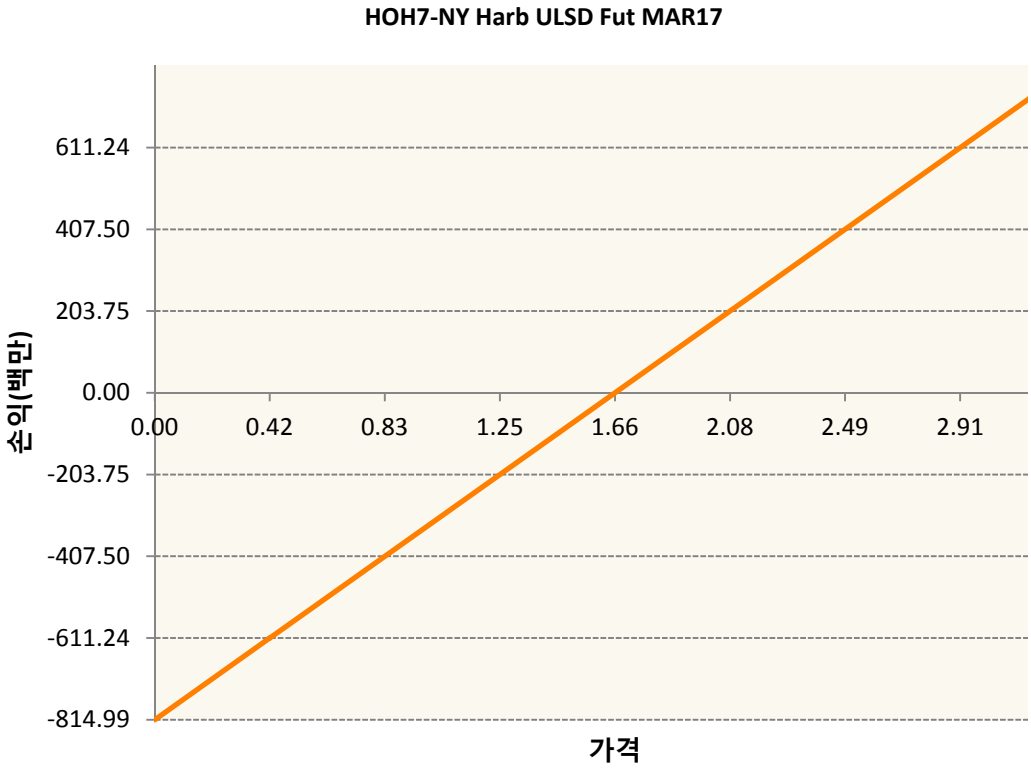
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	선물	유가증권	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	선물	유가증권	1,369	0	1,369	
누계	유가증권	선물	5,083	420	4,663	

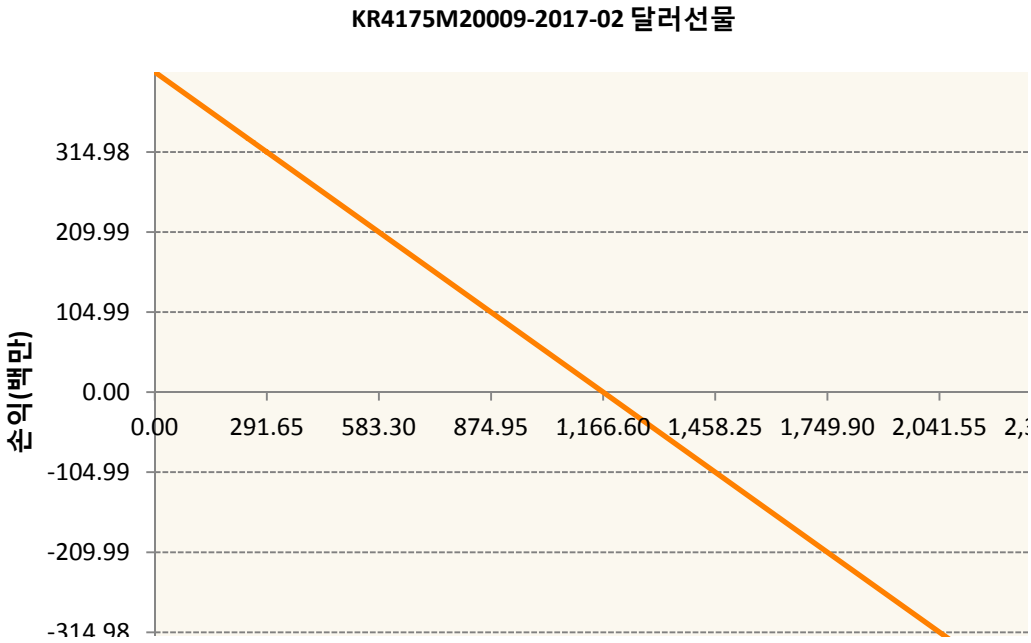
2. 만기시점의 손익구조

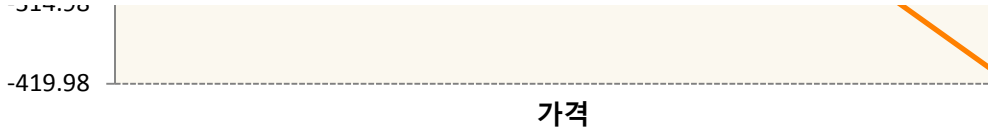


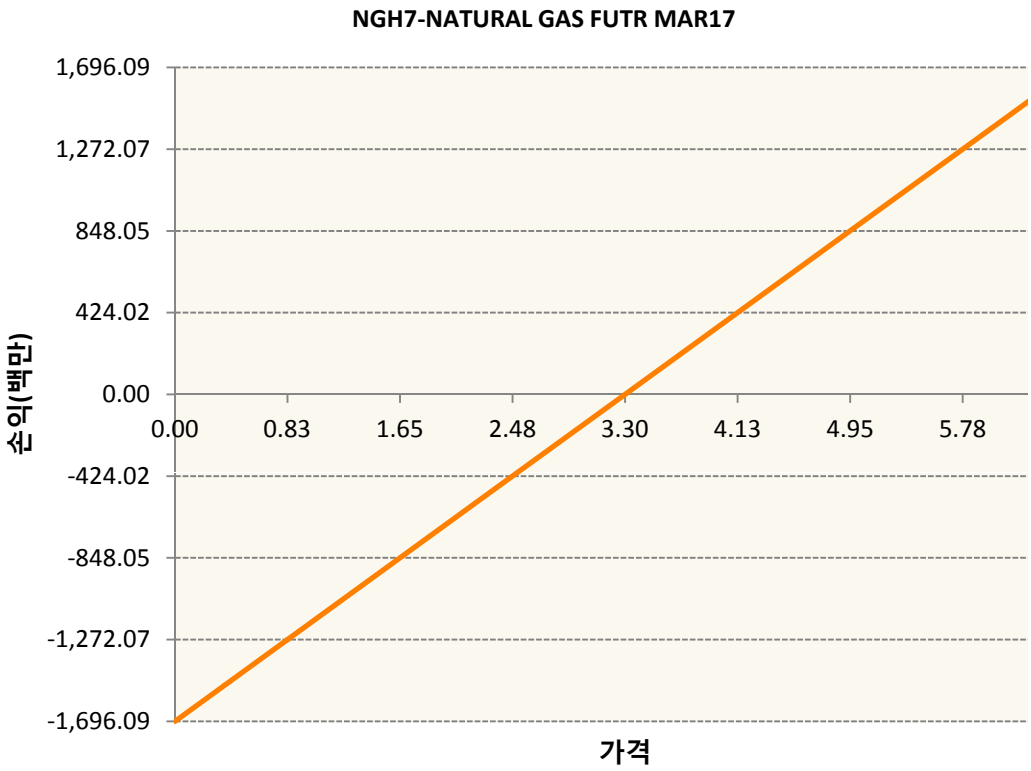


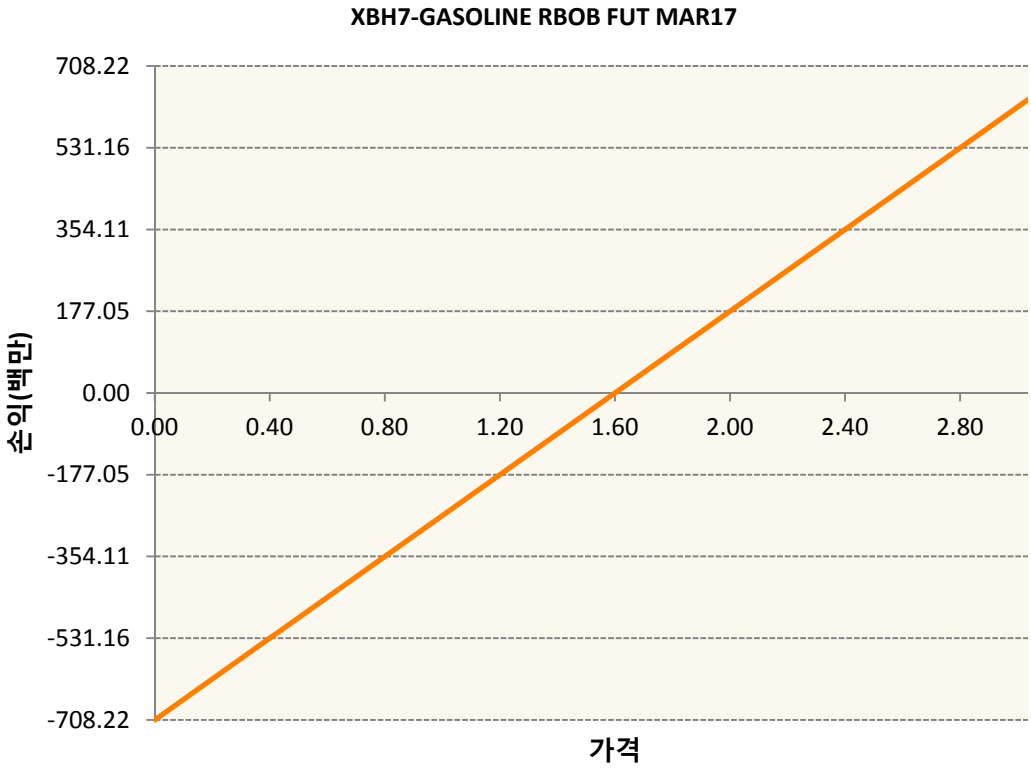

-932.07
-1,398.10
-1,864.14
가격


HOH7-NY Harb ULSD Fut MAR17
611.24
407.50
203.75
0.00
-203.75
-407.50
-611.24
-814.99
0.00
0.42
0.83
1.25
1.66
2.08
2.49
2.91
순익(백만)
가격


KR4175M20009-2017-02 달러선물
314.98
209.99
104.99
0.00
-104.99
-209.99
0.00
291.65
583.30
874.95
1,166.60
1,458.25
1,749.90
2,041.55
순익(백만)


-419.98
가격


NGH7-NATURAL GAS FUTR MAR17
1,696.09
1,272.07
848.05
424.02
0.00
-424.02
-848.05
-1,272.07
-1,696.09
0.00
0.83
1.65
2.48
3.30
4.13
4.95
5.78
순익(백만)
가격


XBH7-GASOLINE RBOB FUT MAR17
708.22
531.16
354.11
177.05
0.00
-177.05
-354.11
-531.16
-708.22
0.00
0.40
0.80
1.20
1.60
2.00
2.40
2.80
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	136
XBH7	GASOLINE RBOB FUT MAR17	57

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

1,181

공시일	2017-01-26
기준일	2017-01-25

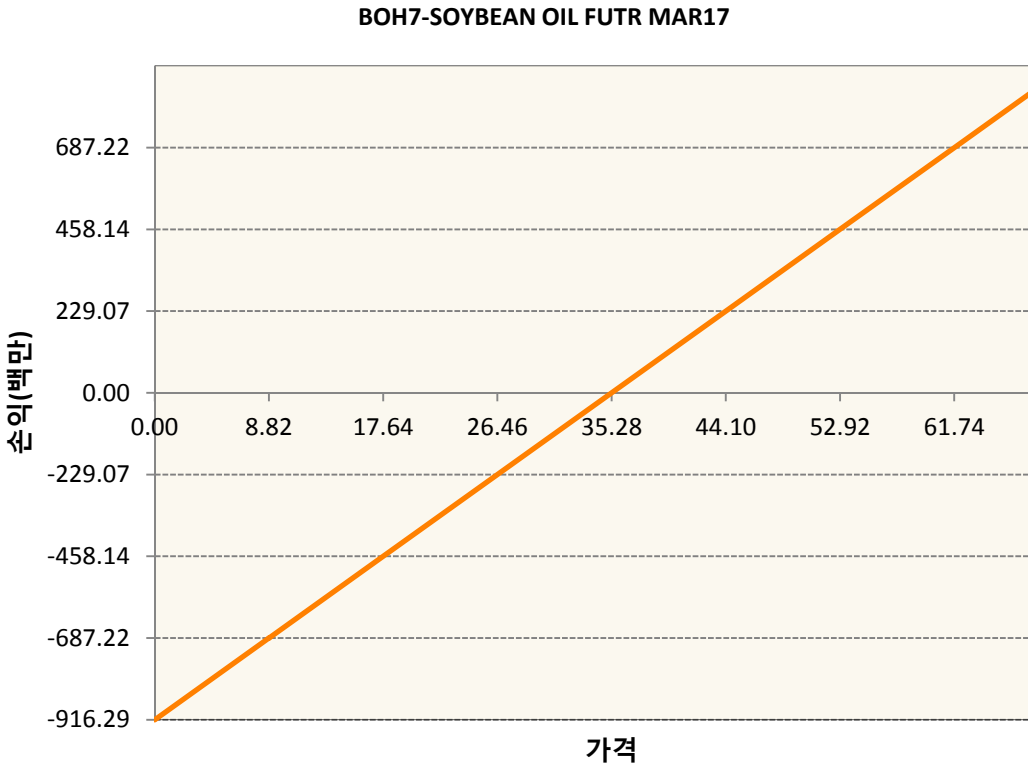
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

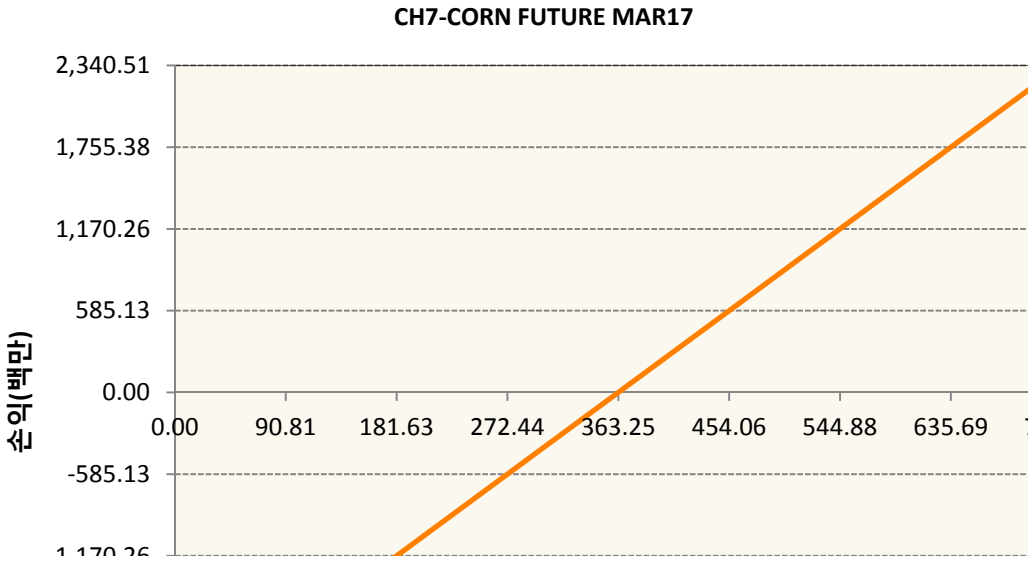
1. 계약금액

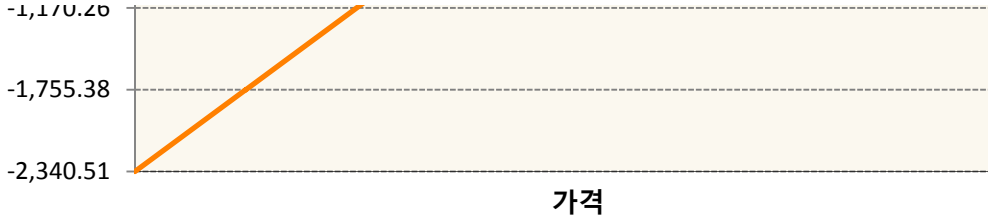
(단위:백만원)

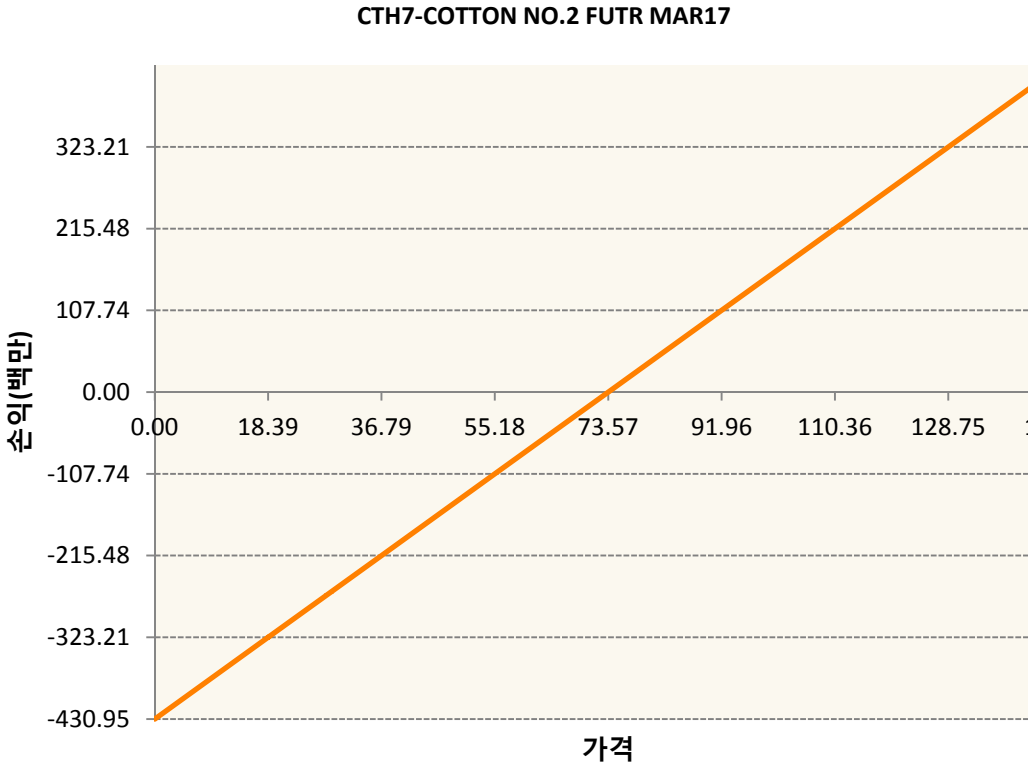
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	9,969	583	9,386	

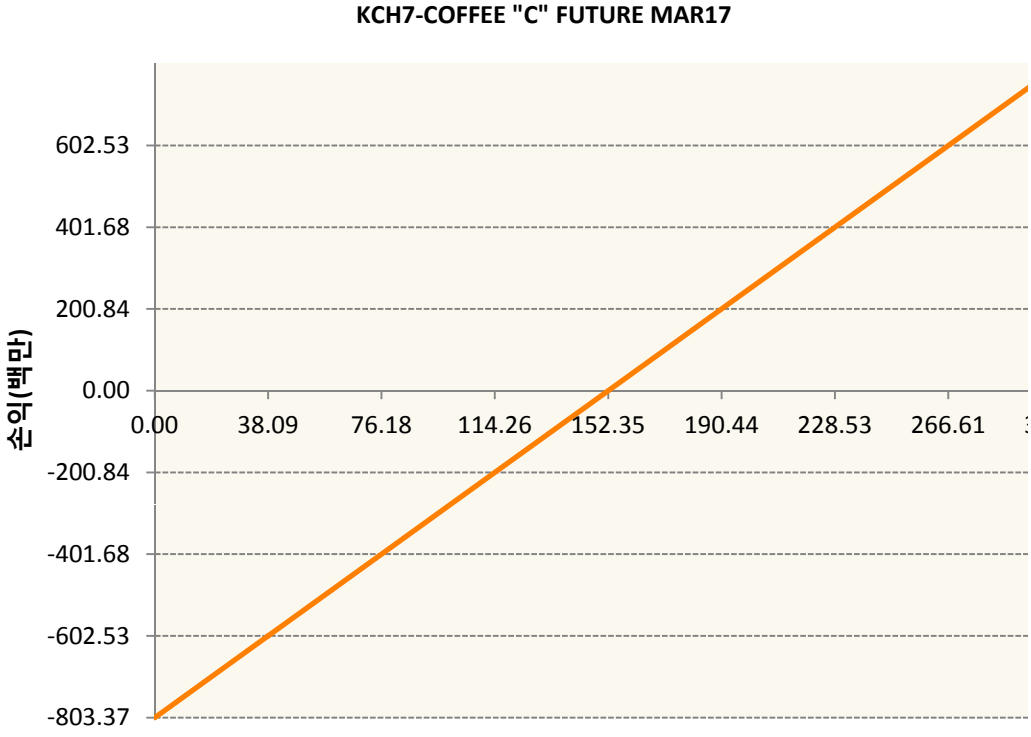
2. 만기시점의 손익구조



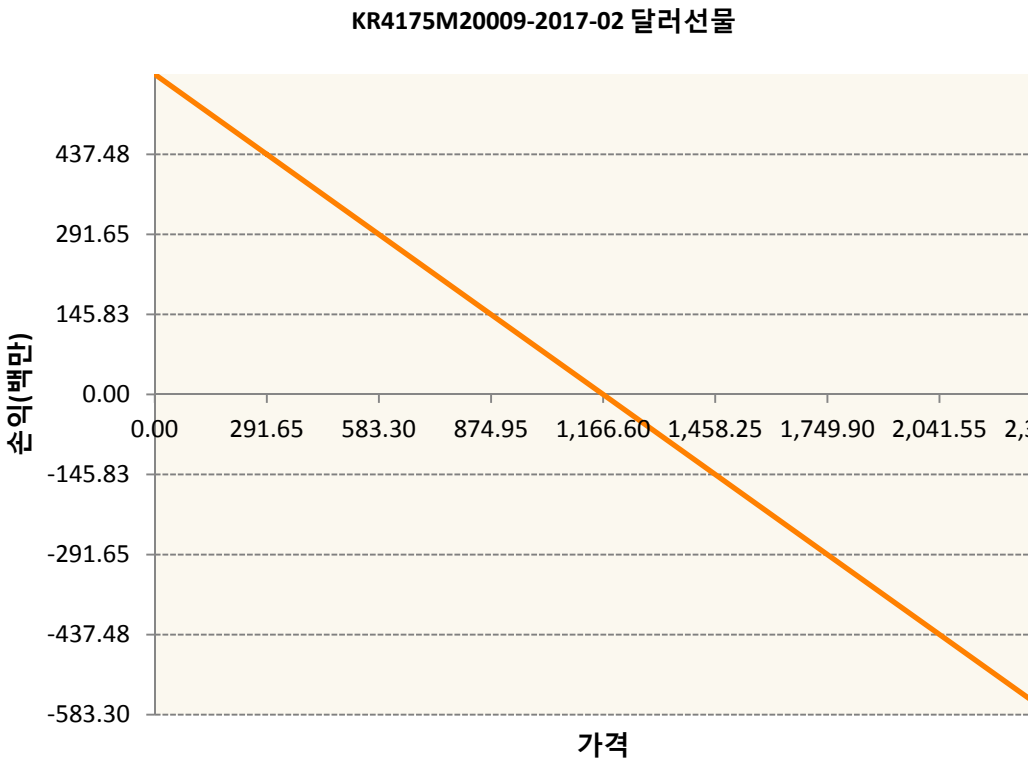


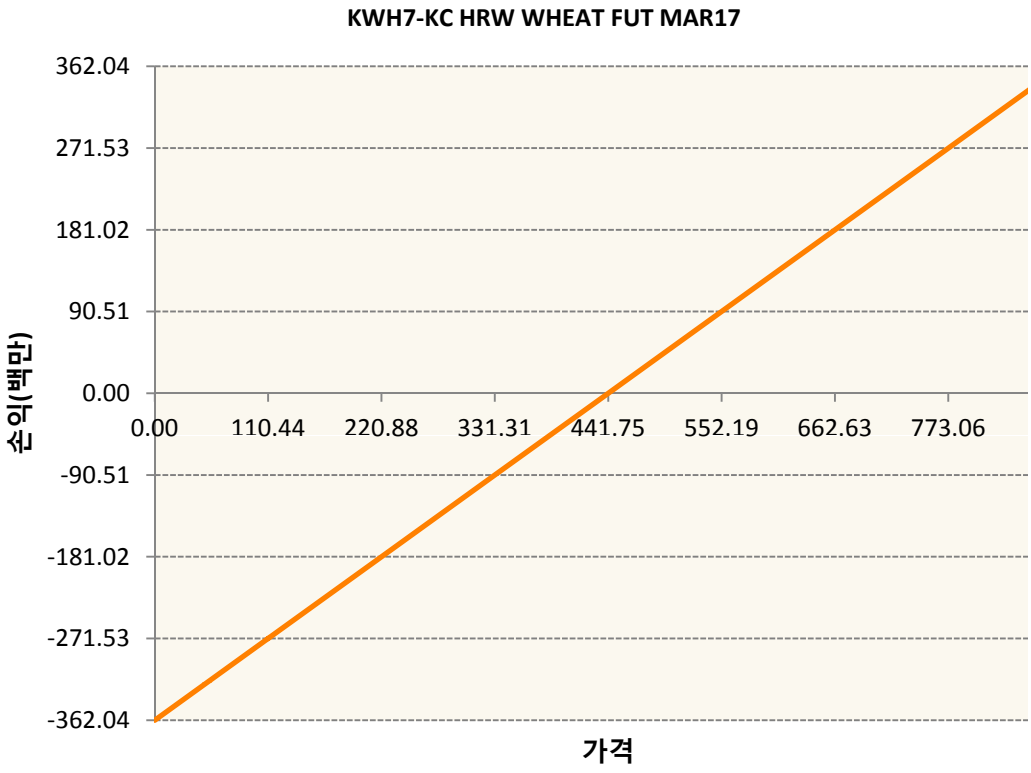

-1,755.38
-2,340.51
가격

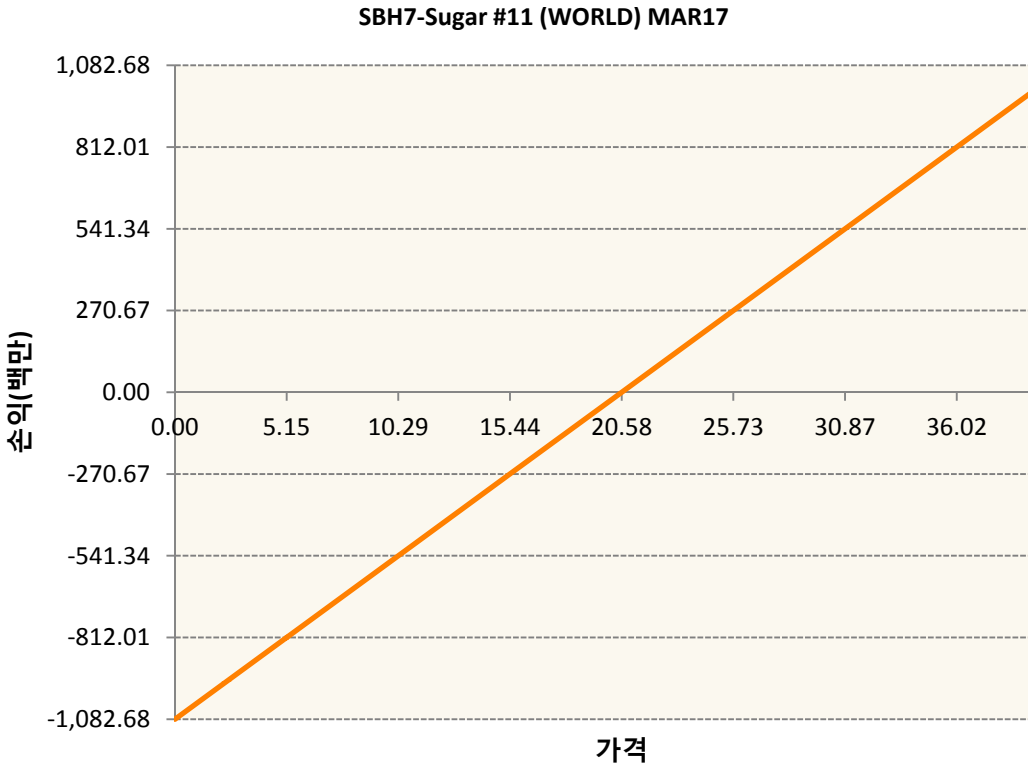

CTH7-COTTON NO.2 FUTR MAR17
323.21
215.48
107.74
0.00
-107.74
-215.48
-323.21
-430.95
0.00
18.39
36.79
55.18
73.57
91.96
110.36
128.75
순익(백만)
가격

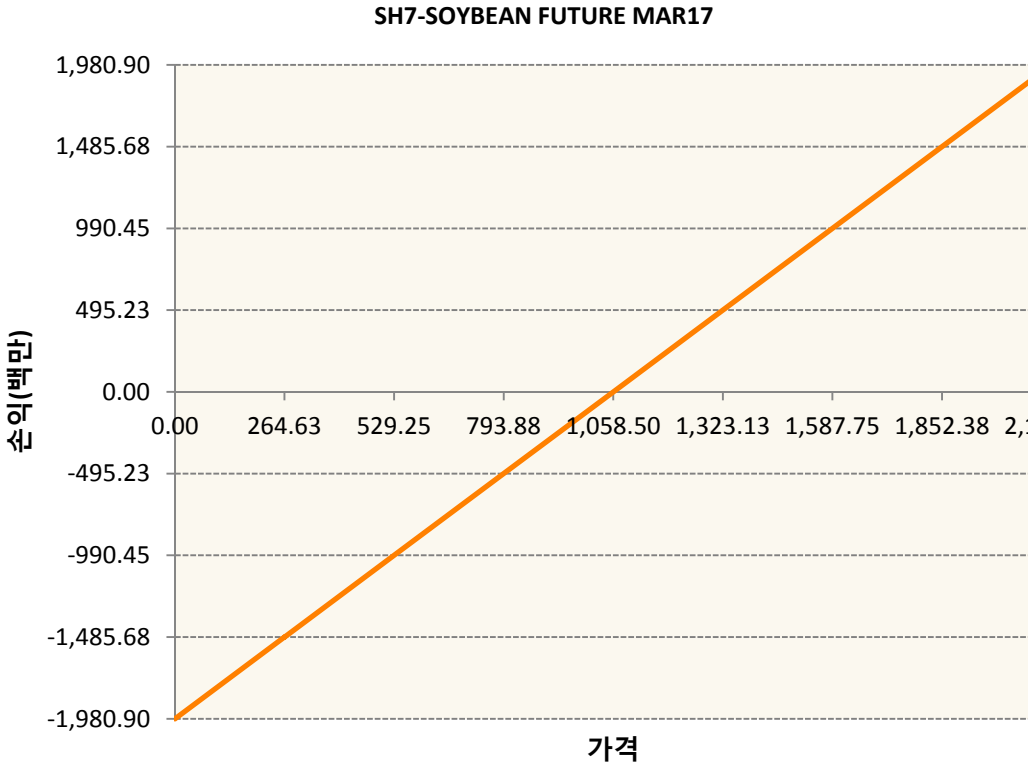

KCH7-COFFEE "C" FUTURE MAR17
602.53
401.68
200.84
0.00
-200.84
-401.68
-602.53
-803.37
0.00
38.09
76.18
114.26
152.35
190.44
228.53
266.61
순익(백만)

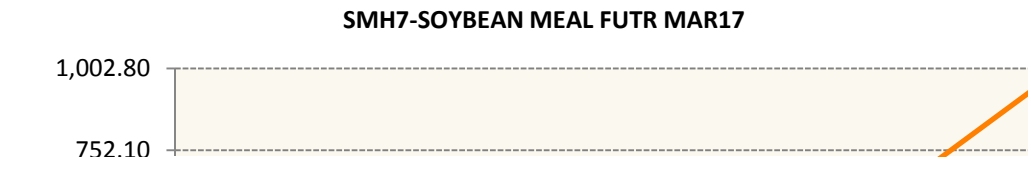
가격

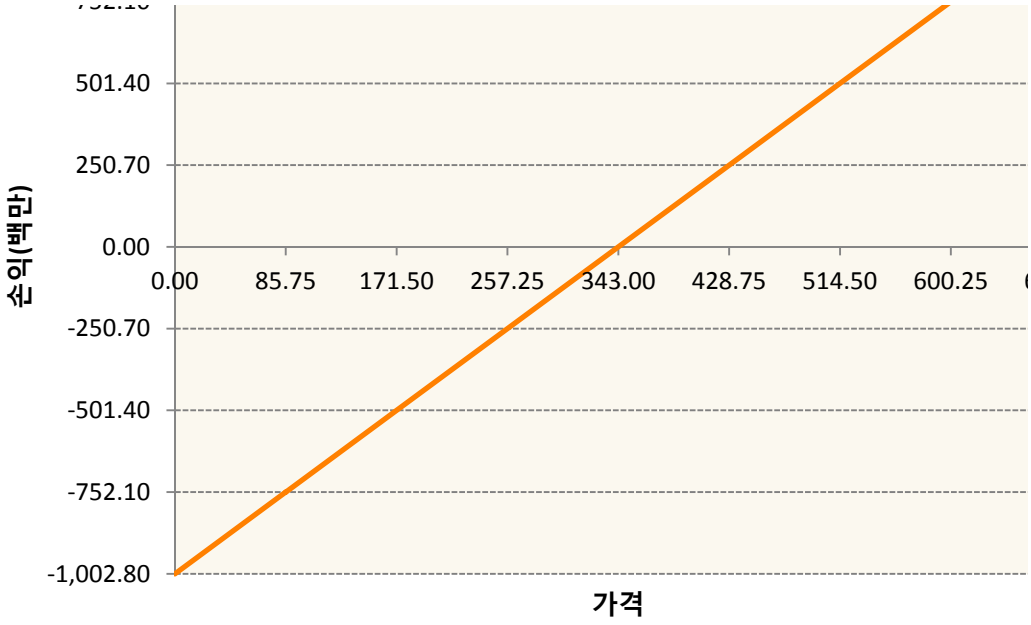

KR4175M20009-2017-02 달러선물
437.48
291.65
145.83
0.00
-145.83
-291.65
-437.48
-583.30
0.00
291.65
583.30
874.95
1,166.60
1,458.25
1,749.90
2,041.55
손익(백만)
가격

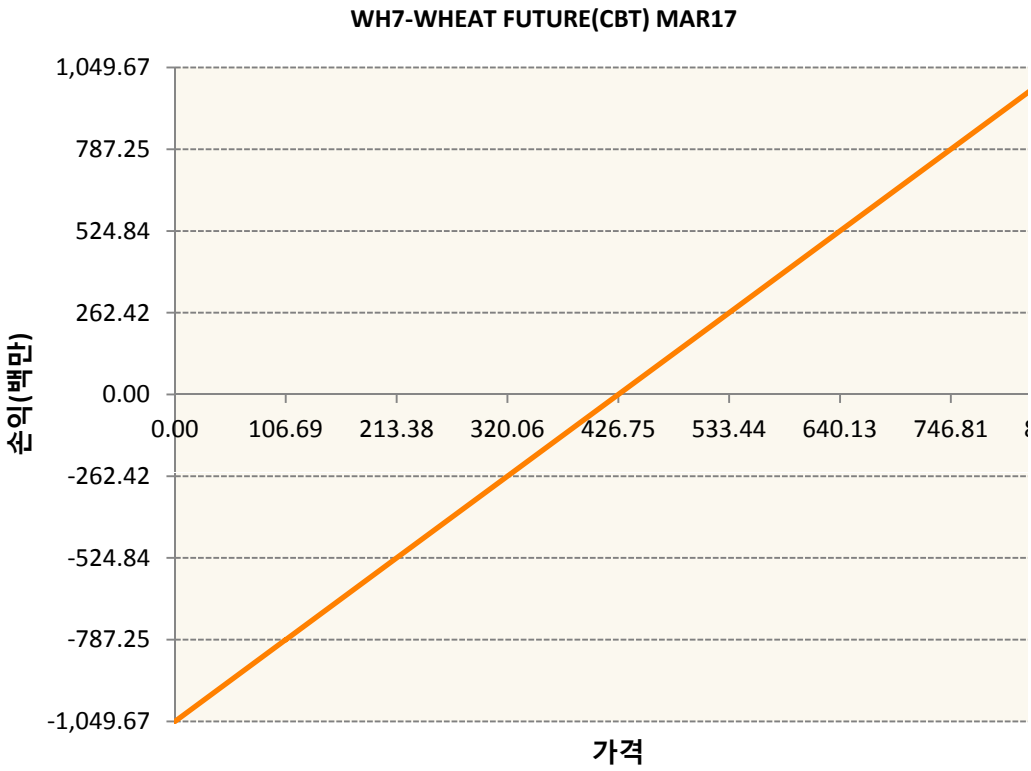

KWH7-KC HRW WHEAT FUT MAR17
362.04
271.53
181.02
90.51
0.00
-90.51
-181.02
-271.53
-362.04
0.00
110.44
220.88
331.31
441.75
552.19
662.63
773.06
손익(백만)
가격


SBH7-Sugar #11 (WORLD) MAR17
1,082.68
812.01
541.34
270.67
0.00
-270.67
-541.34
-812.01
-1,082.68
0.00
5.15
10.29
15.44
20.58
25.73
30.87
36.02
손익(백만)
가격


SH7-SOYBEAN FUTURE MAR17
1,980.90
1,485.68
990.45
495.23
0.00
-495.23
-990.45
-1,485.68
-1,980.90
0.00
264.63
529.25
793.88
1,058.50
1,323.13
1,587.75
1,852.38
손익(백만)
가격


SMH7-SOYBEAN MEAL FUTR MAR17
1,002.80
752.10





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

BOH7	SOYBEAN OIL FUTR MAR17	73
CH7	CORN FUTURE MAR17	187
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	87
SH7	SOYBEAN FUTURE MAR17	158
SMH7	SOYBEAN MEAL FUTR MAR17	80
WH7	WHEAT FUTURE(CBT) MAR17	84

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

949