공시일	2017-01-13
기준일	2017-01-12

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	2017-01-13
기준일	2017-01-12

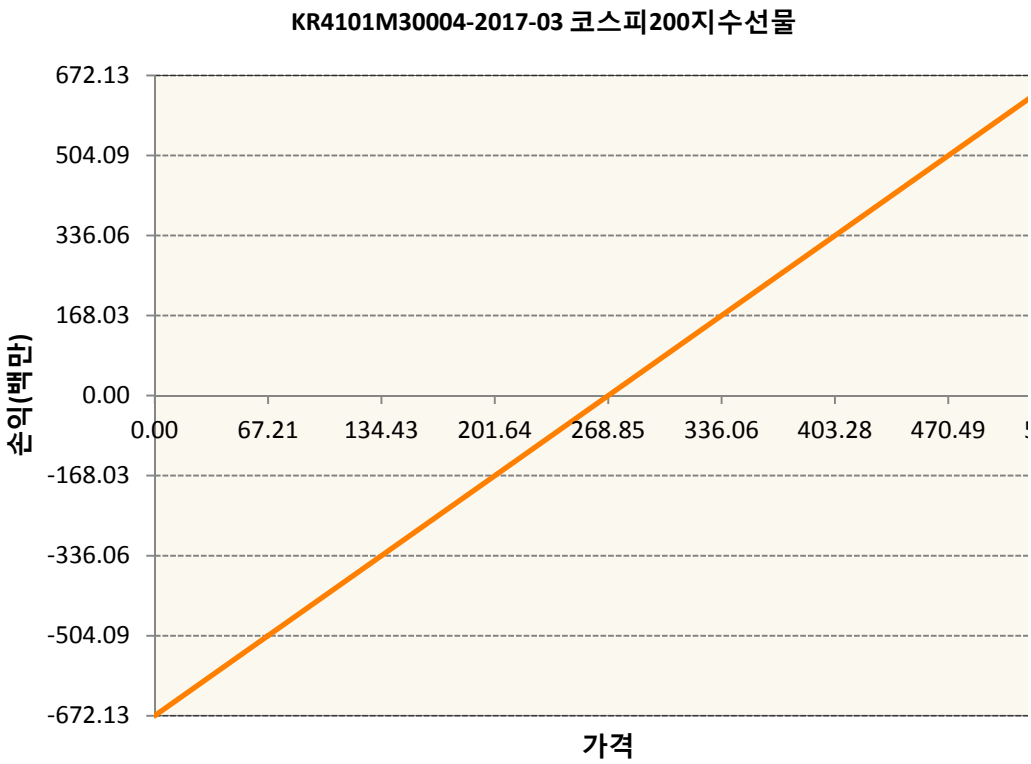
스마트인덱스모

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	672	0	672	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	2017-01-13
기준일	2017-01-12

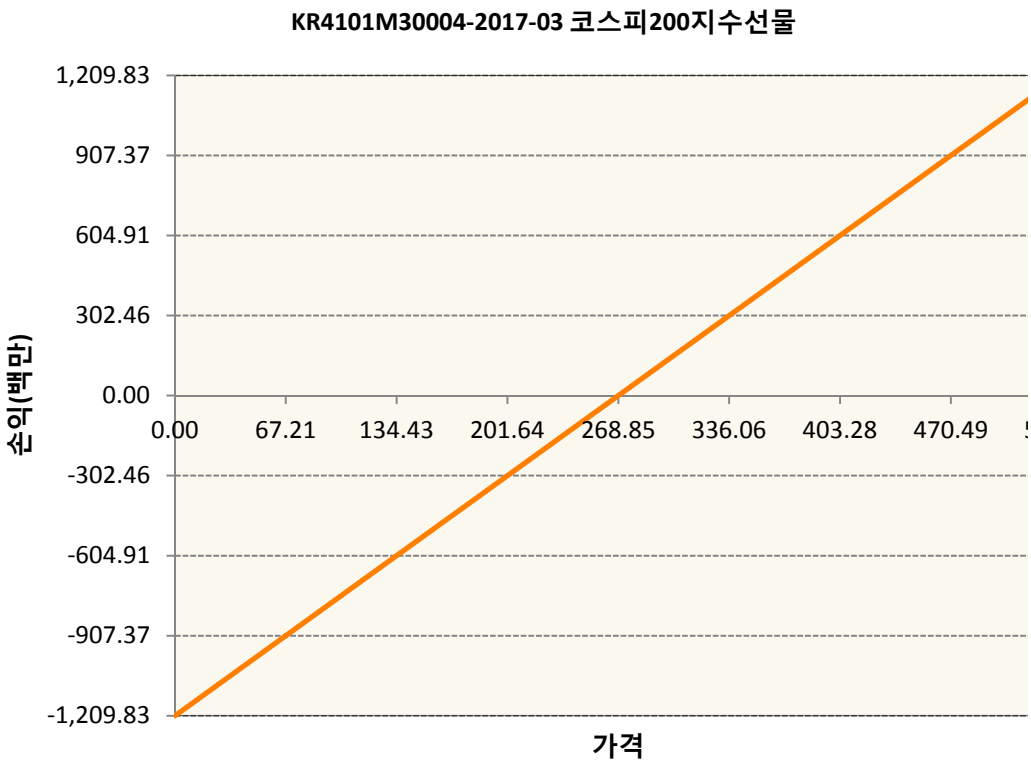
스마트레버리지목표전환형1호

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	1,210	0	1,210	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101M30(2017-03 코스피200지수선물							97
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-97	-97	-97	-97	-97	-97	-97
-5.33%	-65	-65	-65	-65	-65	-65	-65
-2.67%	-32	-32	-32	-32	-32	-32	-32
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	32	32	32	32	32	32	32
5.33%	65	65	65	65	65	65	65
8.00%	97	97	97	97	97	97	97

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

71

공시일	2017-01-13
기준일	2017-01-12

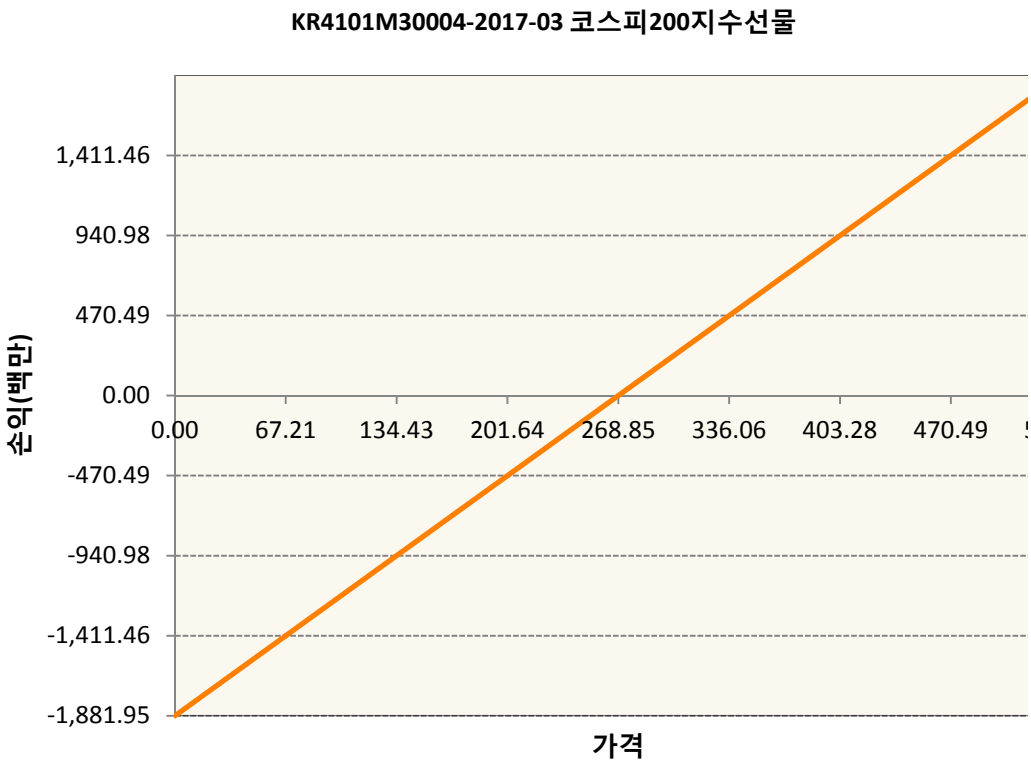
1.3배 레버리지 인덱스(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	269	-269	장내
누계	유가증권	선물	1,882	0	1,882	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101M30(2017-03 코스피200지수선물							151
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-151	-151	-151	-151	-151	-151	-151
-5.33%	-101	-101	-101	-101	-101	-101	-101
-2.67%	-50	-50	-50	-50	-50	-50	-50
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	50	50	50	50	50	50	50
5.33%	101	101	101	101	101	101	101
8.00%	151	151	151	151	151	151	151

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

110

공시일	2017-01-13
기준일	2017-01-12

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	918

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

695

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-01-13
기준일	2017-01-12

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	380

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

611

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-01-13
기준일	2017-01-12

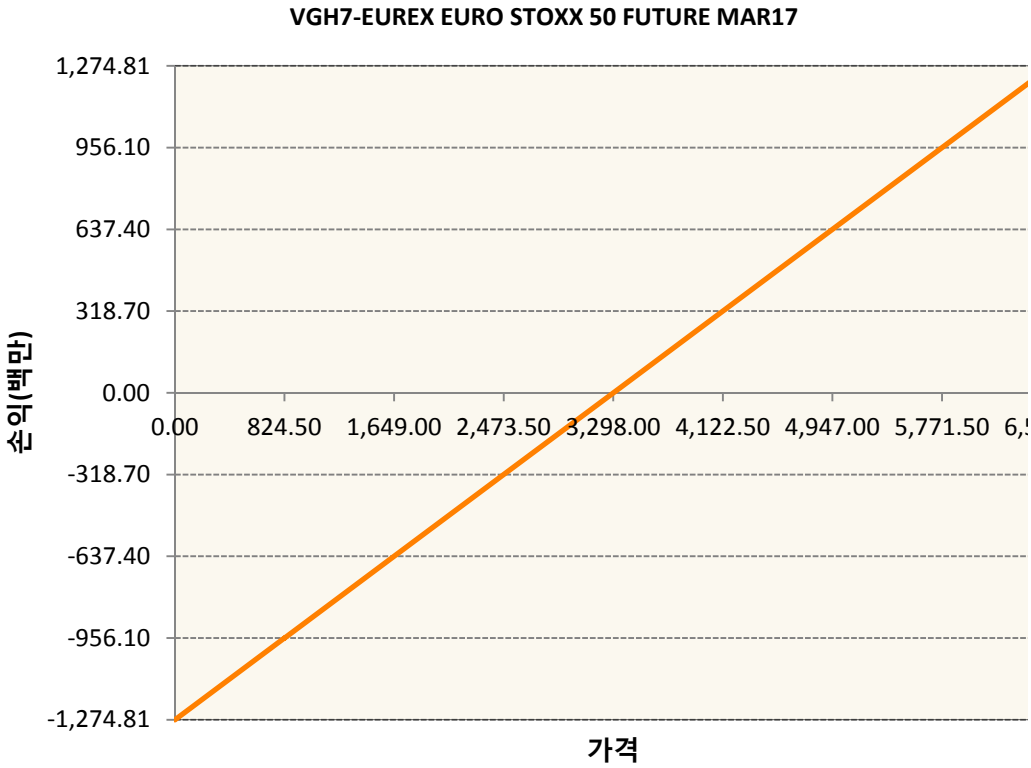
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,275	0	1,275	

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)

117

공시일	2017-01-13
기준일	2017-01-12

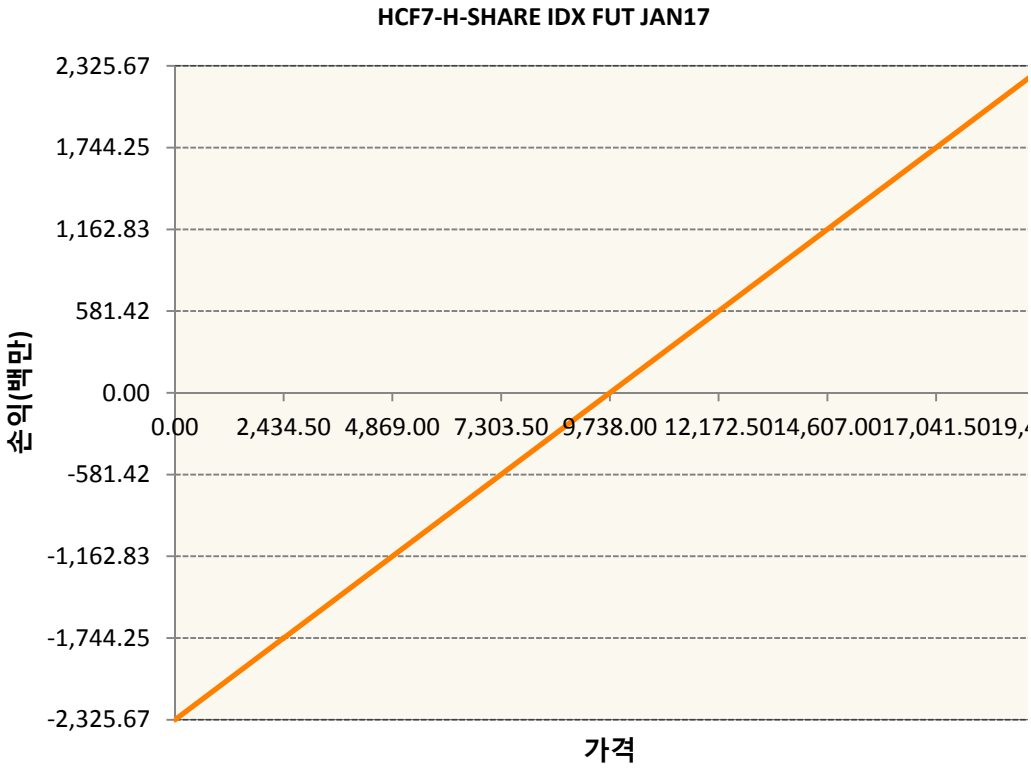
차이나인덱스모(주식-파생형)

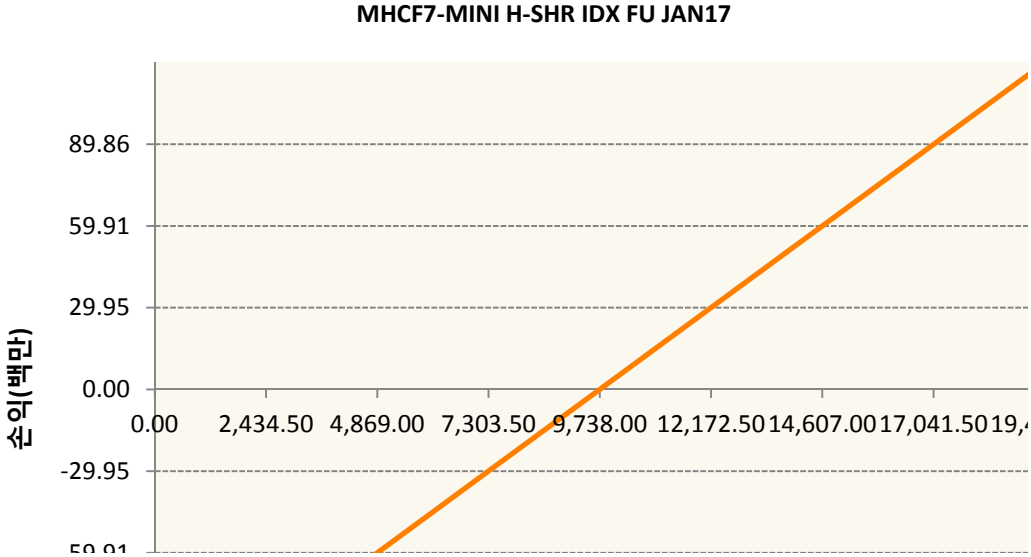
1. 계약금액

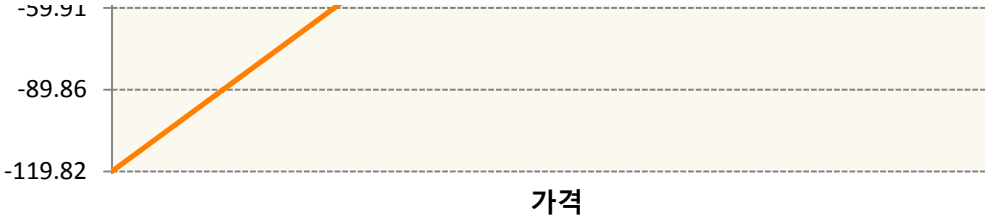
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,445	0	2,445	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCF7	H-SHARE IDX FUT JAN17	186
MHCF7	MINI H-SHR IDX FU JAN17	10

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	238

공시일	2017-01-13
기준일	2017-01-12

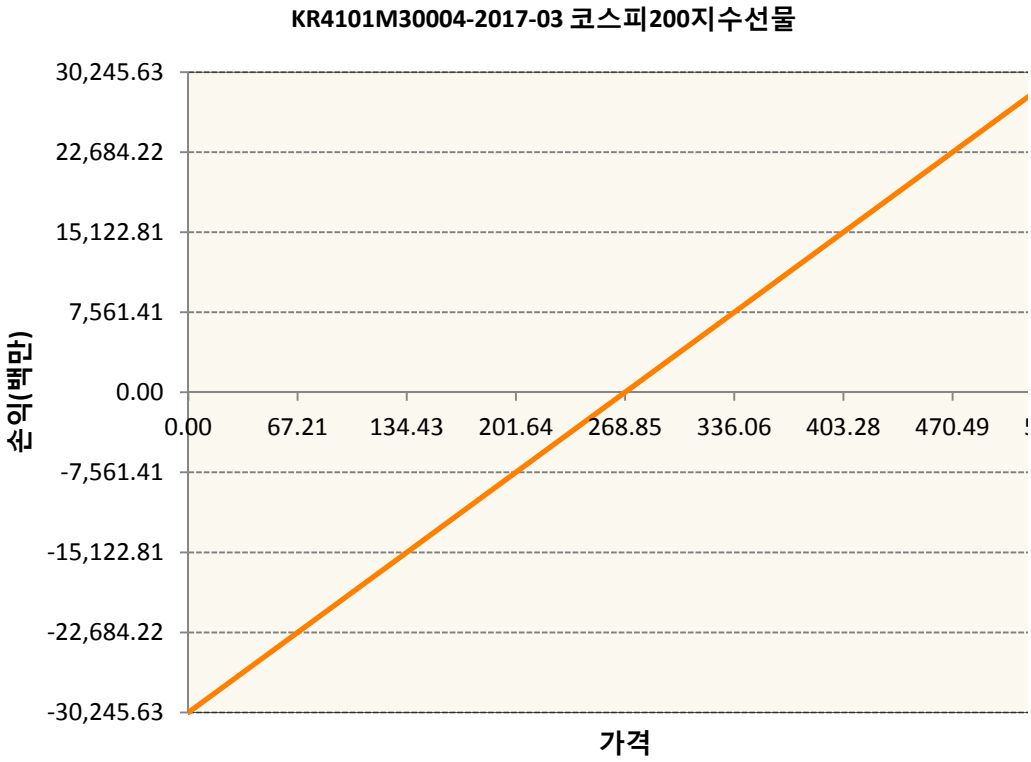
커버드콜(주식혼합-파생형)

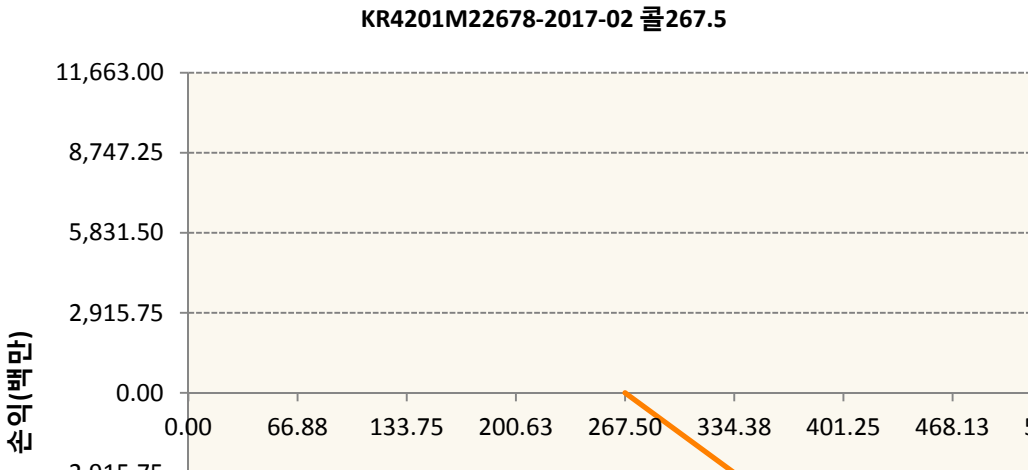
1. 계약금액

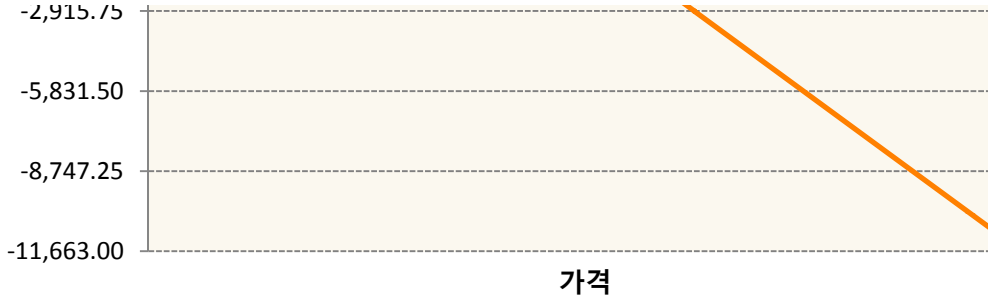
(단위:백만원)

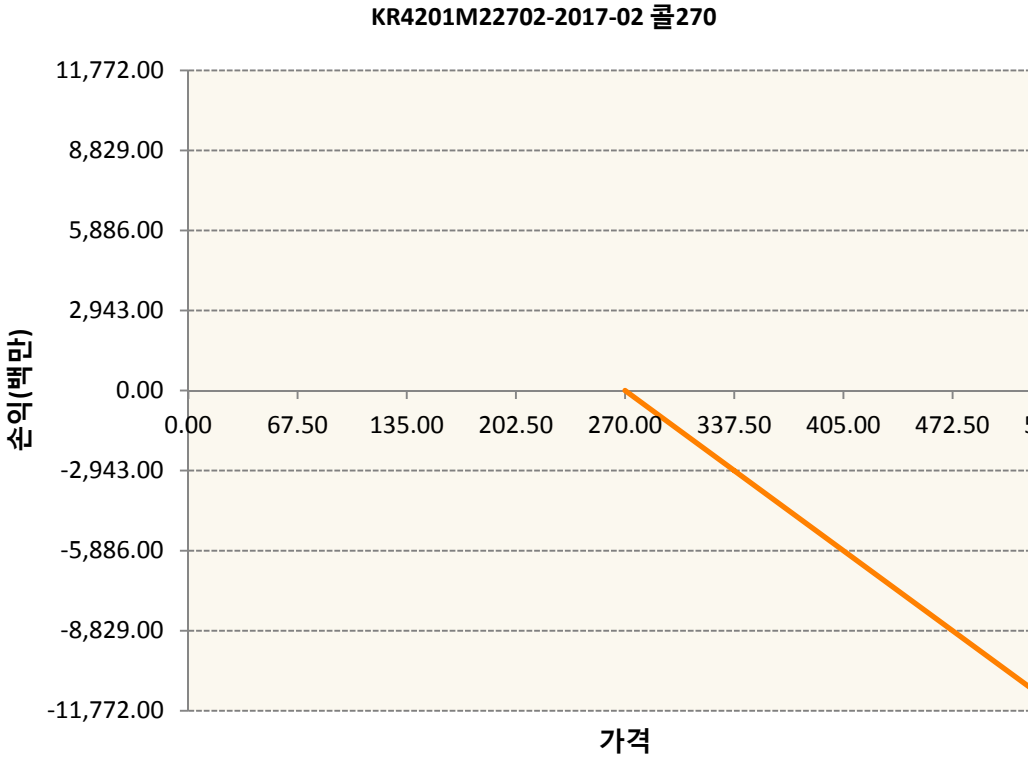
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	23,726	-23,726	장내
누계	유가증권	선물	30,246	0	30,246	장내
누계	유가증권	옵션	0	23,435	-23,435	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101M30(2017-03 코스피200지수선물							2,430
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-2,430	-2,430	-2,430	-2,430	-2,430	-2,430	-2,430
-5.33%	-1,620	-1,620	-1,620	-1,620	-1,620	-1,620	-1,620
-2.67%	-810	-810	-810	-810	-810	-810	-810
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	810	810	810	810	810	810	810
5.33%	1,620	1,620	1,620	1,620	1,620	1,620	1,620
8.00%	2,430	2,430	2,430	2,430	2,430	2,430	2,430
KR4201M22(2017-02 콜267.5							4,192
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,056	1,055	1,053	1,050	1,044	1,036	1,026
-5.33%	1,040	1,027	1,010	989	964	935	904
-2.67%	866	817	765	712	658	602	546
0%	181	121	61	0	-61	-123	-185
2.67%	-1,089	-1,115	-1,145	-1,178	-1,216	-1,256	-1,299
5.33%	-2,612	-2,616	-2,622	-2,632	-2,645	-2,662	-2,681
8.00%	-4,176	-4,177	-4,177	-4,179	-4,181	-4,186	-4,192
KR4201M22 2017-02 콜270							3,959
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	759	758	758	756	753	748	742
-5.33%	753	747	737	724	707	687	663
-2.67%	664	628	588	545	499	452	402
0%	191	128	64	0	-64	-128	-191
2.67%	-902	-941	-983	-1,029	-1,077	-1,127	-1,179
5.33%	-2,371	-2,380	-2,393	-2,410	-2,430	-2,455	-2,482
8.00%	-3,930	-3,931	-3,933	-3,936	-3,941	-3,949	-3,959

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

11,181

공시일	2017-01-13
기준일	2017-01-12

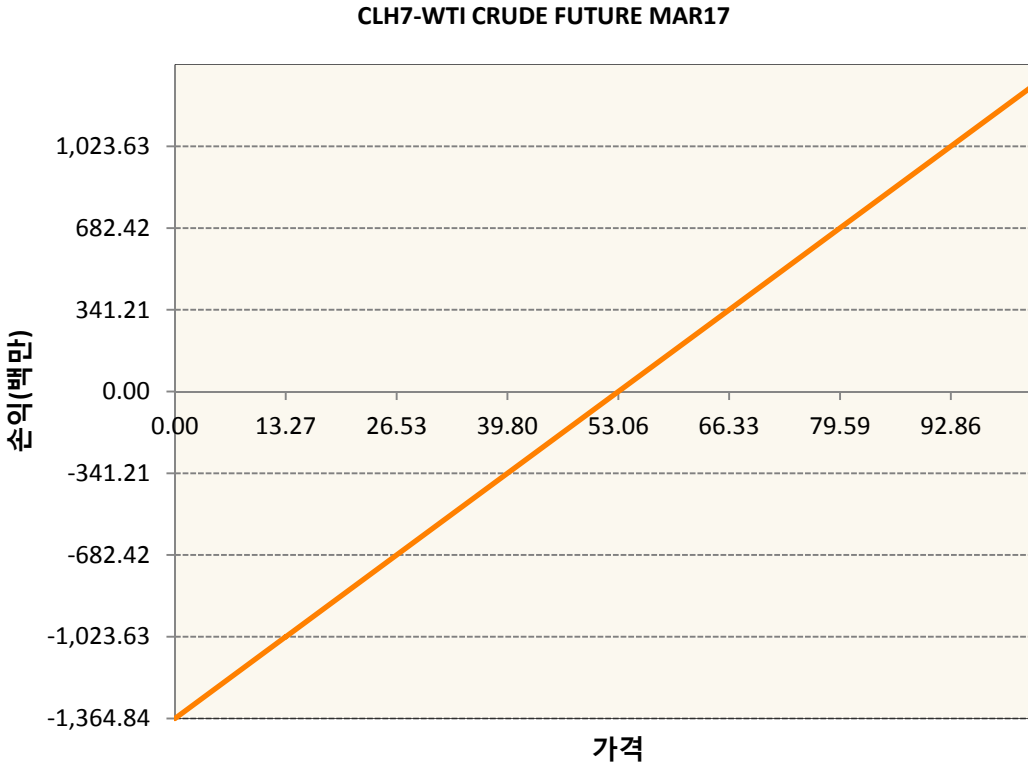
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

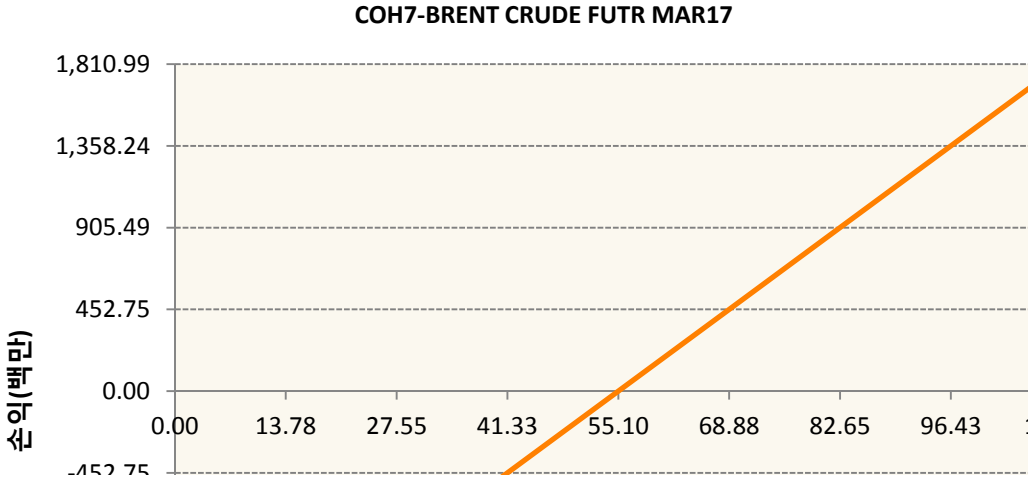
1. 계약금액

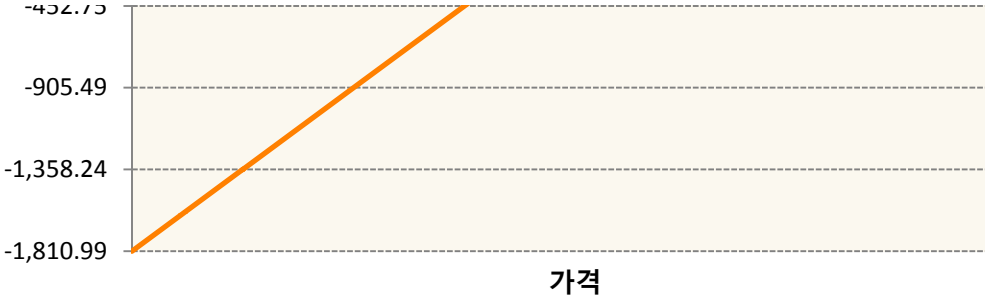
(단위:백만원)

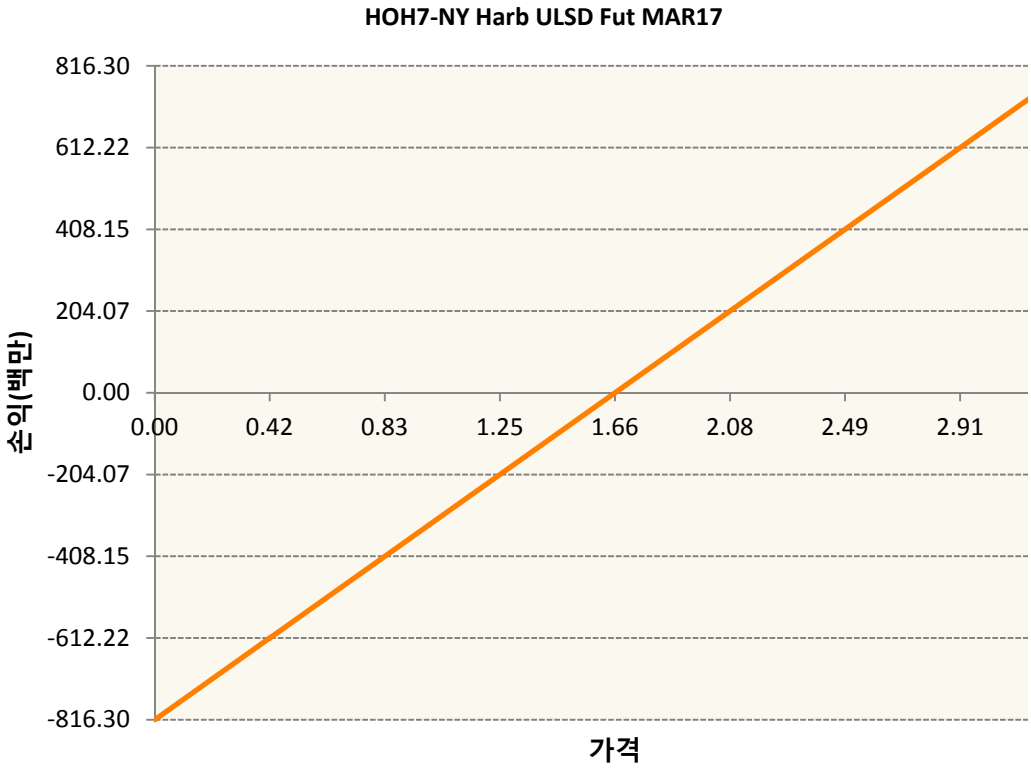
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	선물	유가증권	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	선물	유가증권	1,365	0	1,365	
누계	유가증권	선물	4,998	426	4,571	

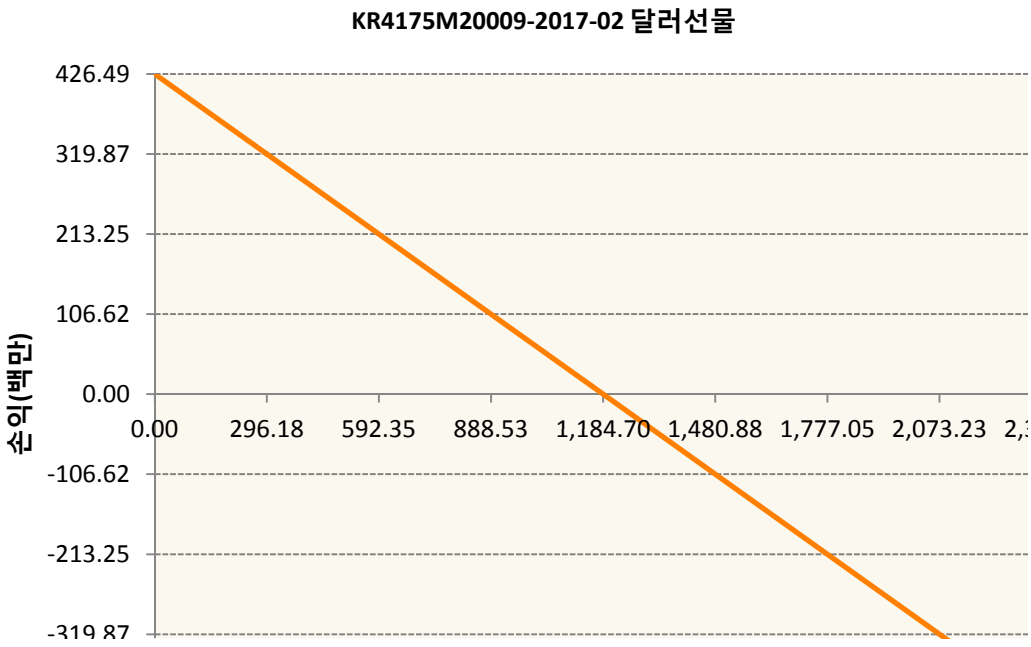
2. 만기시점의 손익구조

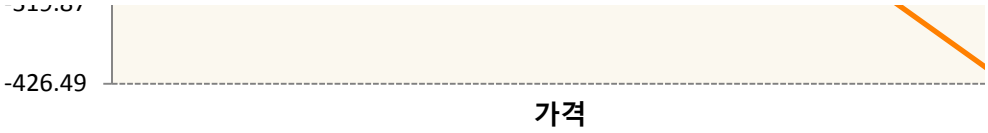


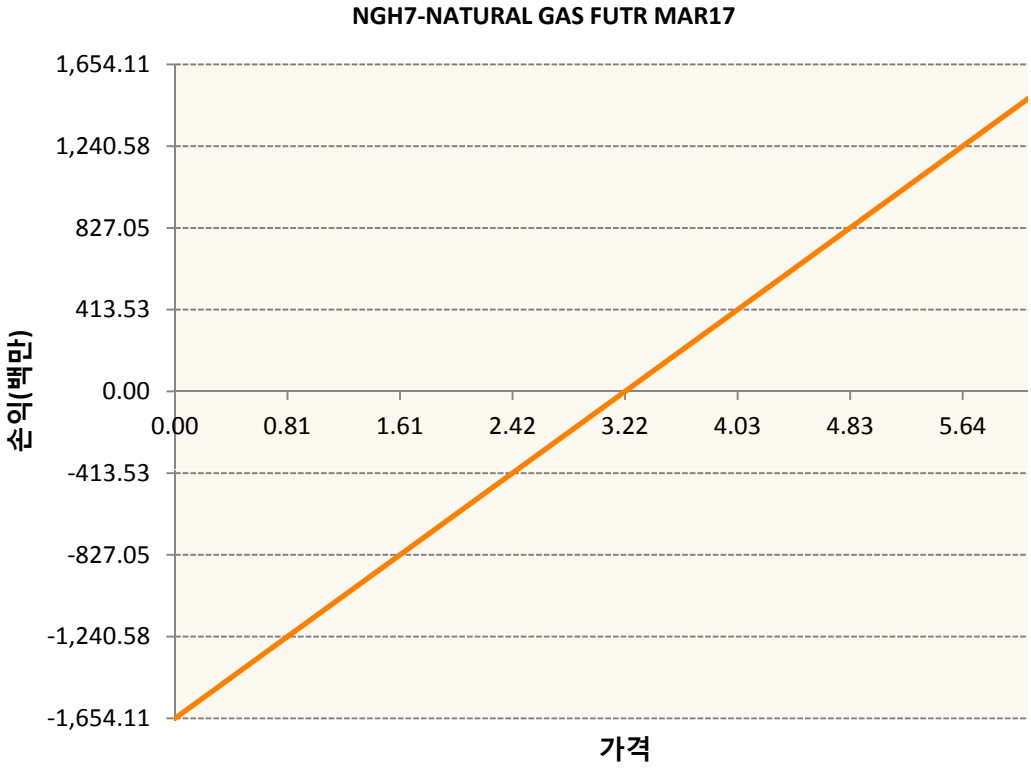


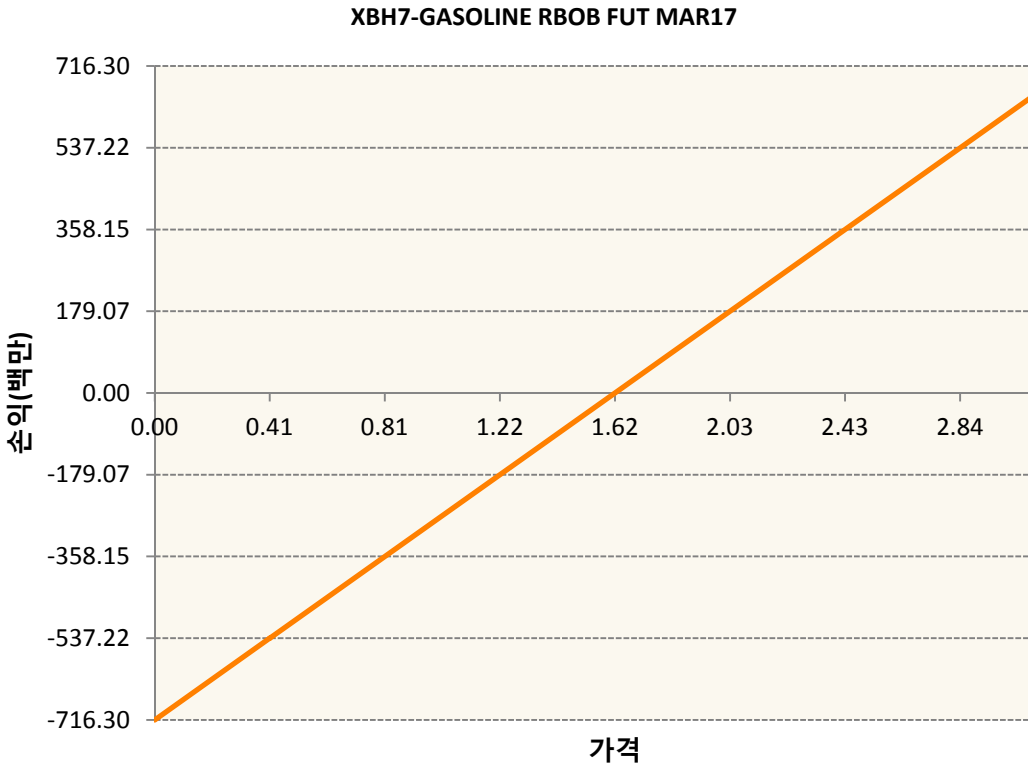

-905.49
-1,358.24
-1,810.99
가격


HOH7-NY Harb ULSD Fut MAR17
816.30
612.22
408.15
204.07
0.00
-204.07
-408.15
-612.22
-816.30
0.00
0.42
0.83
1.25
1.66
2.08
2.49
2.91
순익(백만)
가격


KR4175M20009-2017-02 달러선물
426.49
319.87
213.25
106.62
0.00
-106.62
-213.25
-319.87
0.00
296.18
592.35
888.53
1,184.70
1,480.88
1,777.05
2,073.23
순익(백만)


-426.49
가격


NGH7-NATURAL GAS FUTR MAR17
1,654.11
1,240.58
827.05
413.53
0.00
-413.53
-827.05
-1,240.58
-1,654.11
0.00
0.81
1.61
2.42
3.22
4.03
4.83
5.64
순익(백만)
가격


XBH7-GASOLINE RBOB FUT MAR17
716.30
537.22
358.15
179.07
0.00
-179.07
-358.15
-537.22
-716.30
0.00
0.41
0.81
1.22
1.62
2.03
2.43
2.84
순익(백만)
가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLH7	WTI CRUDE FUTURE MAR17	109
COH7	BRENT CRUDE FUTR MAR17	145
HOH7	NY Harb ULSD Fut MAR17	65
KR4175M20(	2017-02 달러선물	34
NGH7	NATURAL GAS FUTR MAR17	132
XBH7	GASOLINE RBOB FUT MAR17	57

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

1,184

공시일	2017-01-13
기준일	2017-01-12

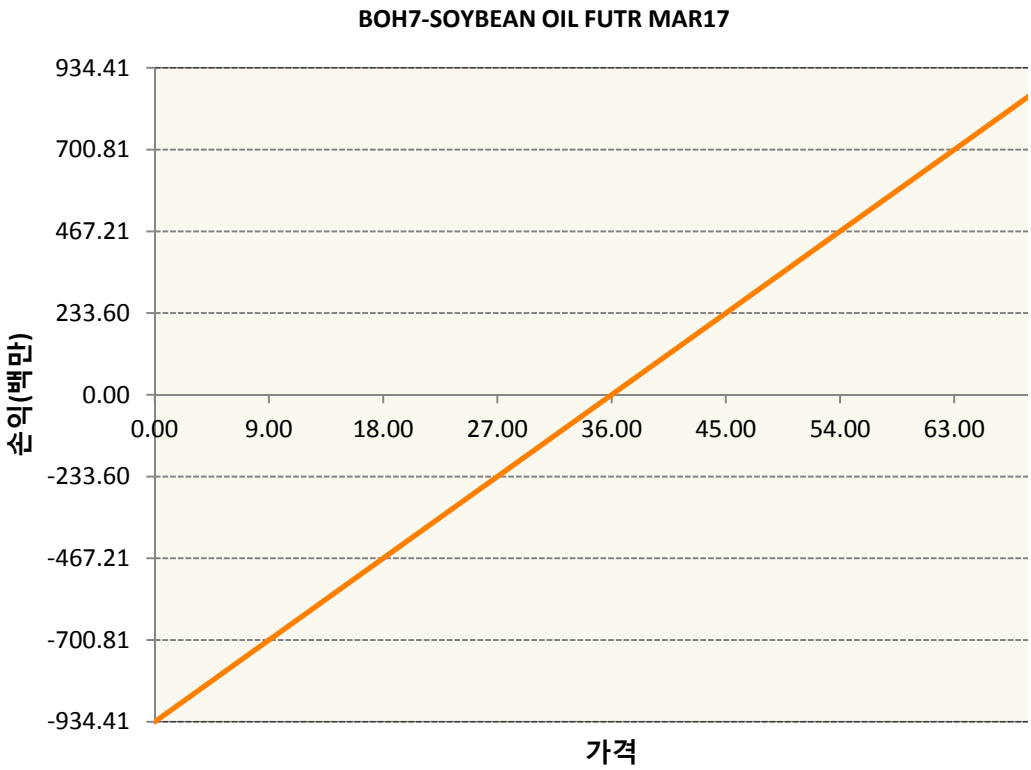
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

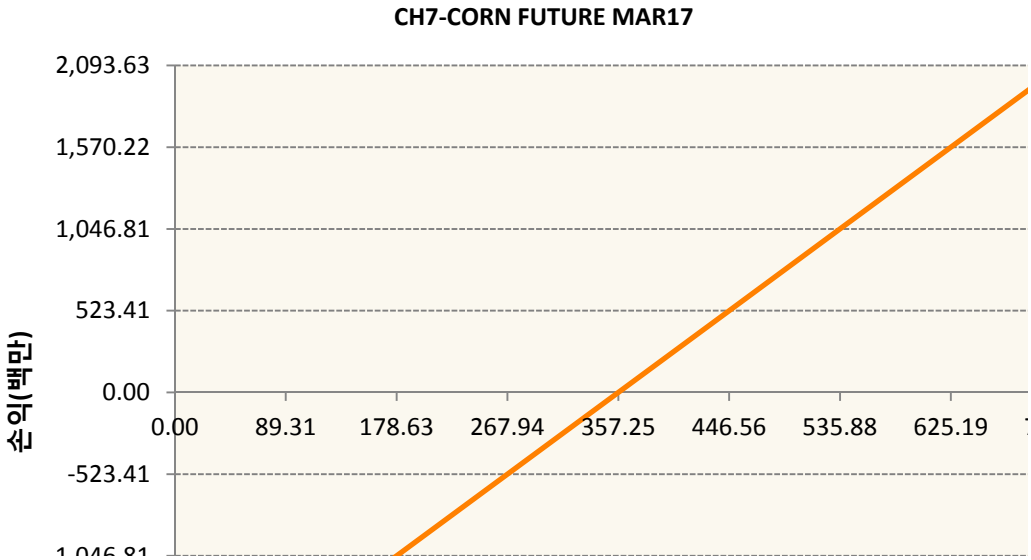
1. 계약금액

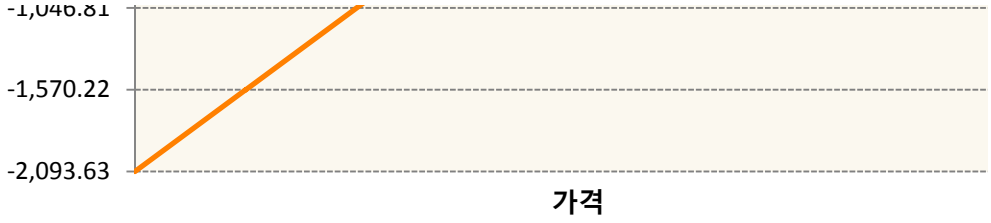
(단위:백만원)

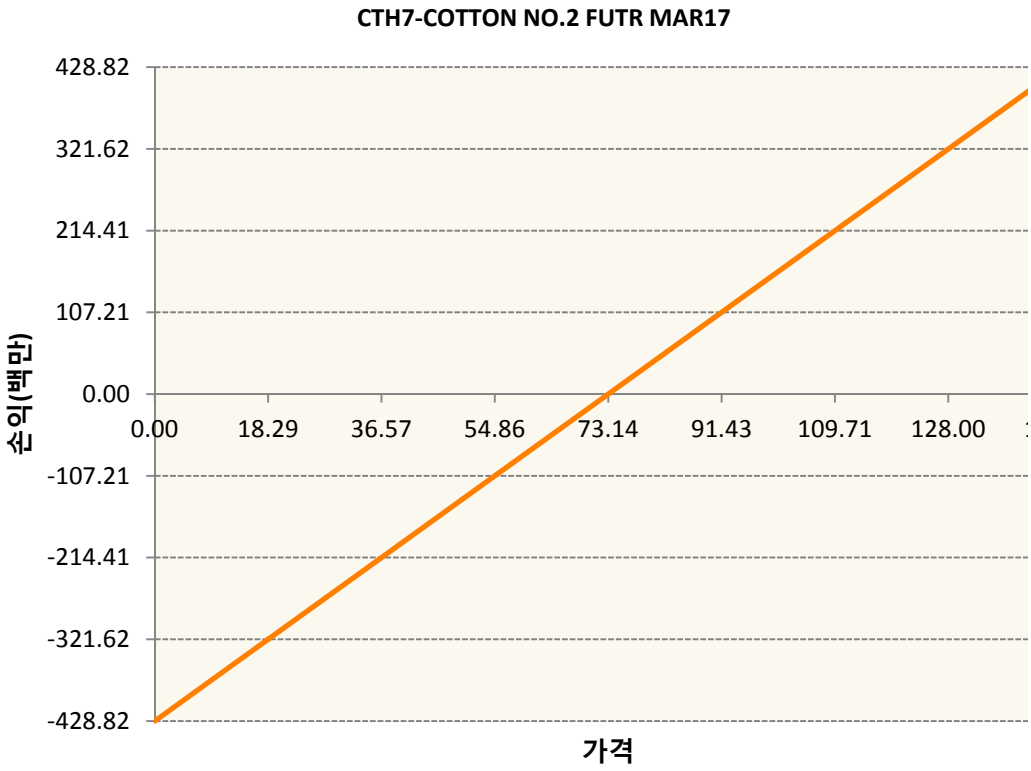
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	9,354	592	8,762	

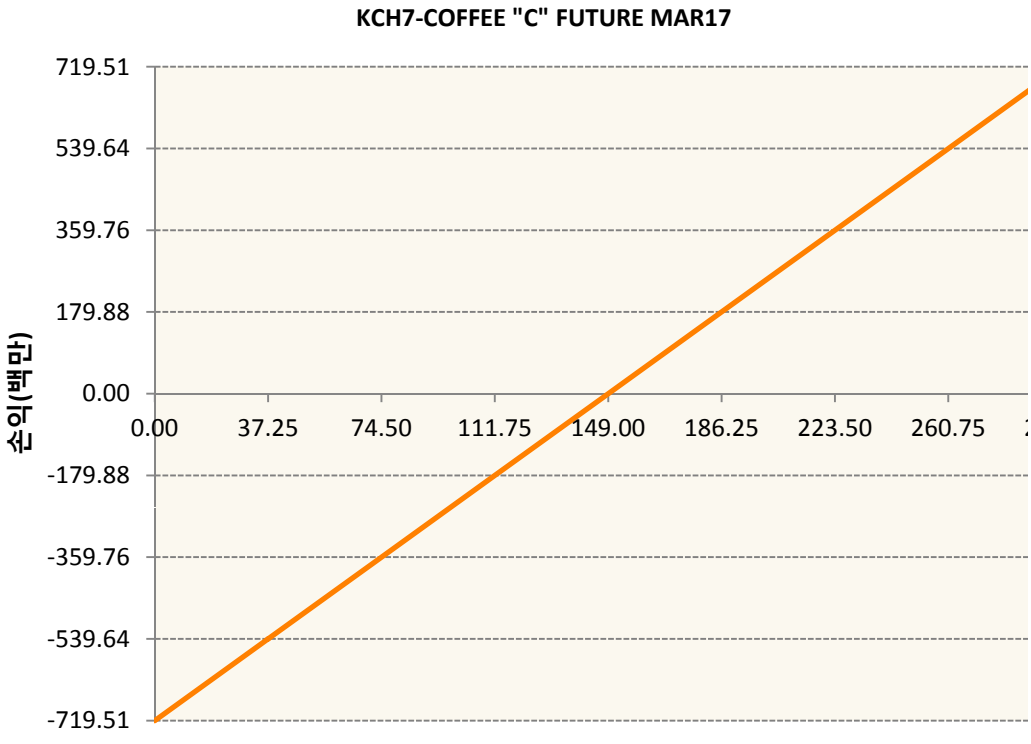
2. 만기시점의 손익구조





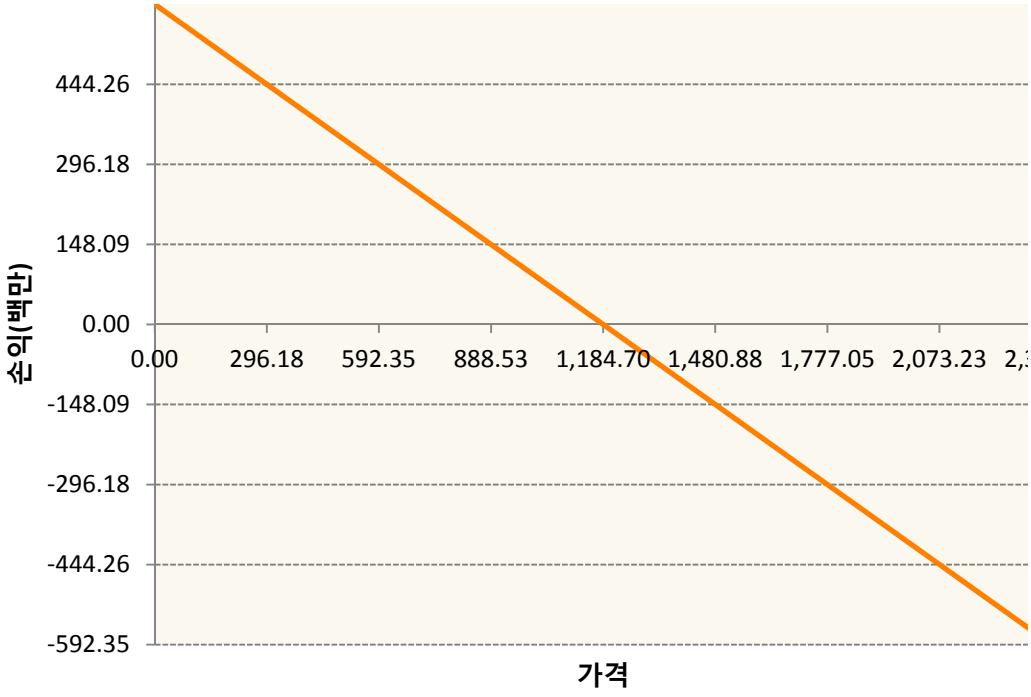

-1,046.81
-1,570.22
-2,093.63
가격


CTH7-COTTON NO.2 FUTR MAR17
428.82
321.62
214.41
107.21
0.00
-107.21
-214.41
-321.62
-428.82
0.00
18.29
36.57
54.86
73.14
91.43
109.71
128.00
손익(백만)
가격

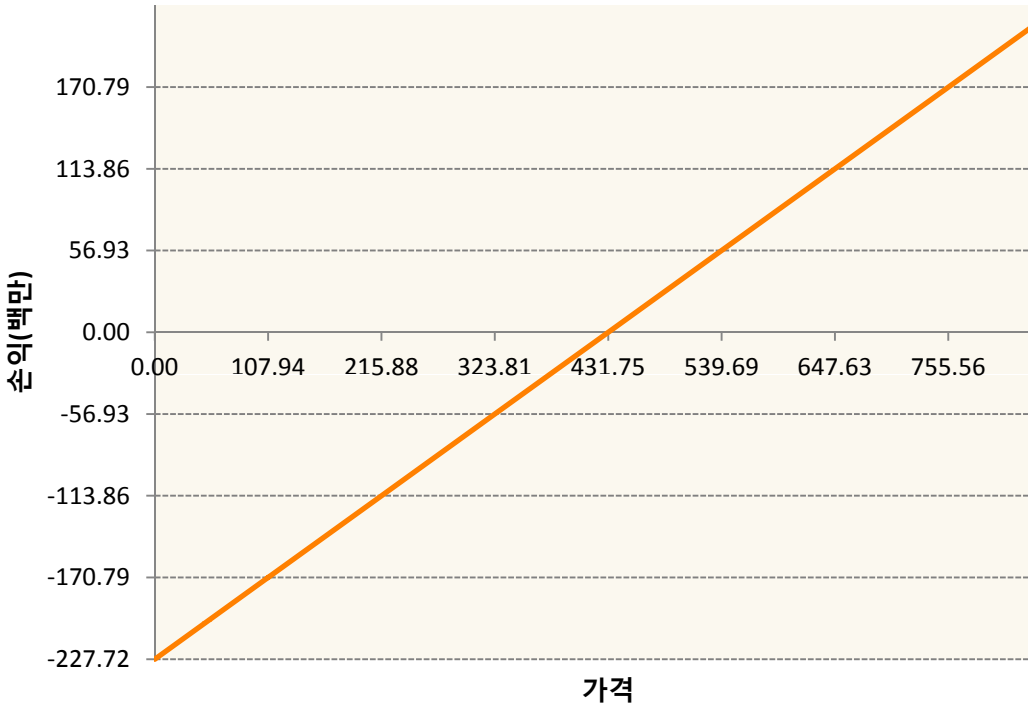

KCH7-COFFEE "C" FUTURE MAR17
719.51
539.64
359.76
179.88
0.00
-179.88
-359.76
-539.64
-719.51
0.00
37.25
74.50
111.75
149.00
186.25
223.50
260.75
손익(백만)

가격

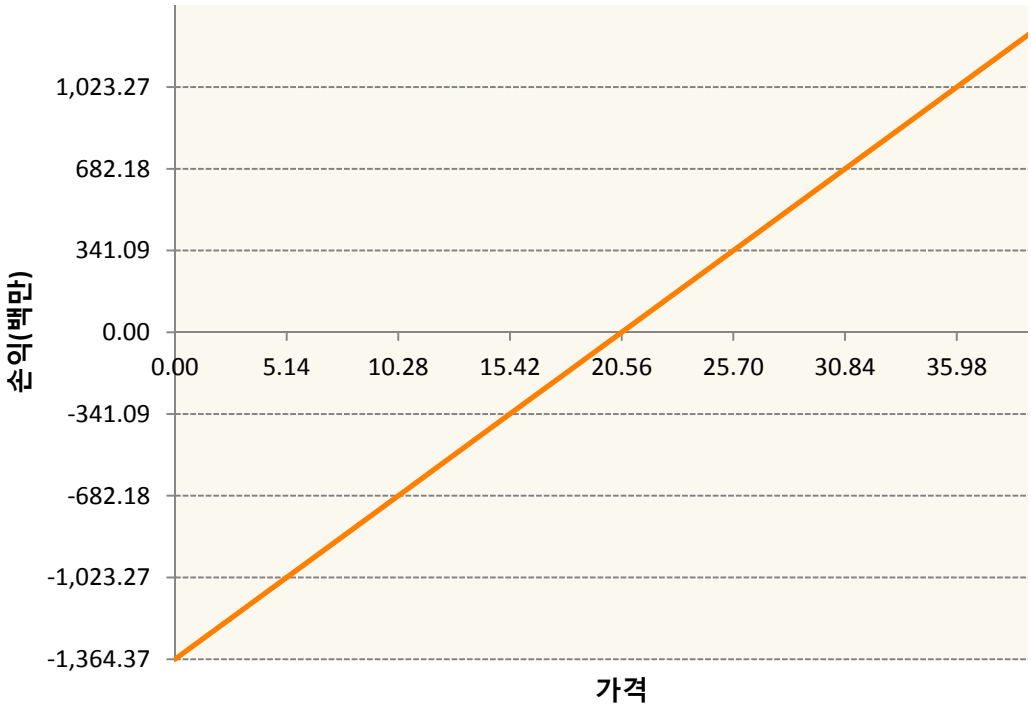
KR4175M20009-2017-02 달러선물



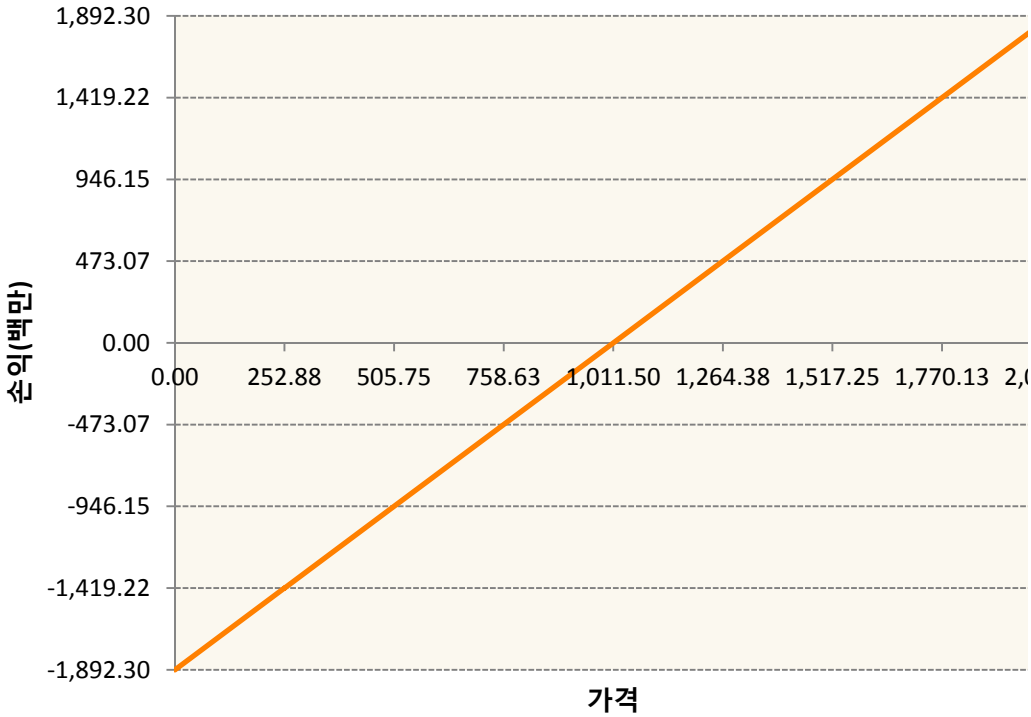
KWH7-KC HRW WHEAT FUT MAR17



SBH7-Sugar #11 (WORLD) MAR17

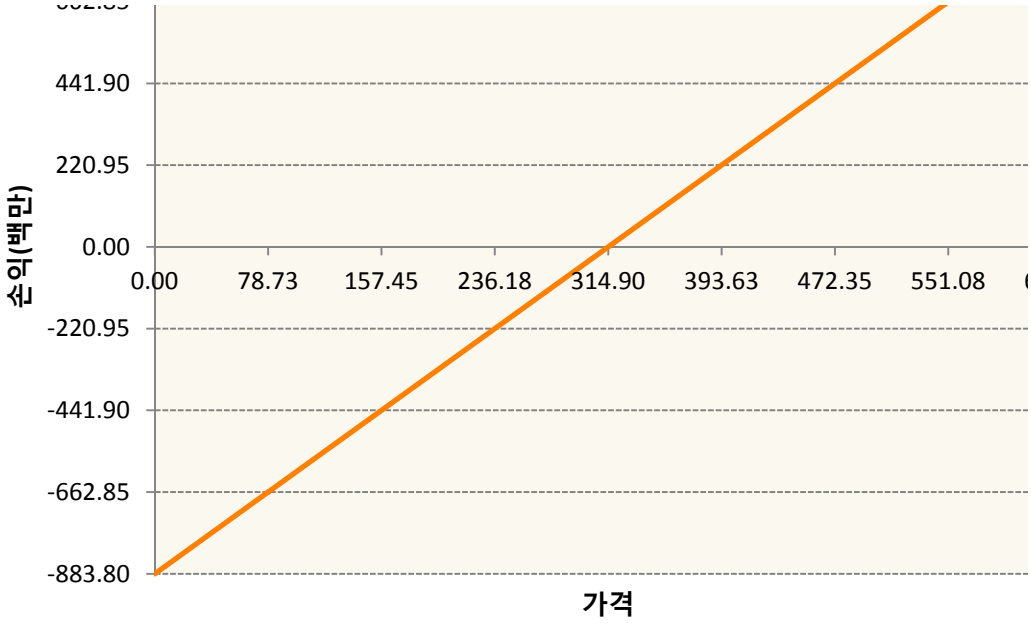


SH7-SOYBEAN FUTURE MAR17

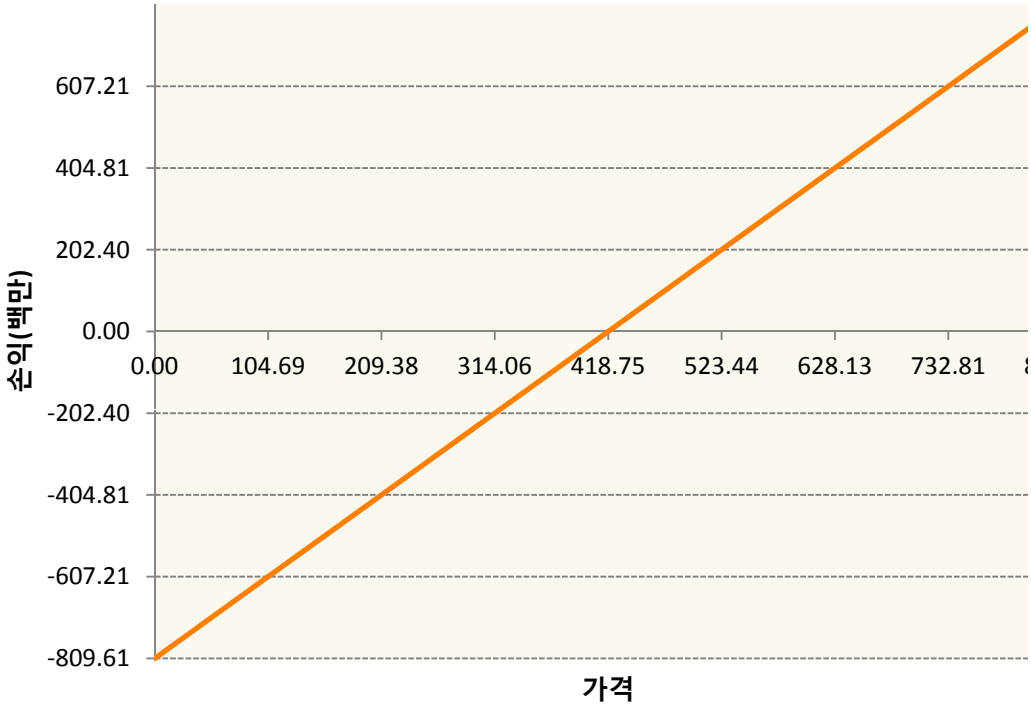


SMH7-SOYBEAN MEAL FUTR MAR17





WH7-WHEAT FUTURE(CBT) MAR17



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

BOH7	SOYBEAN OIL FUTR MAR17	75
CH7	CORN FUTURE MAR17	167
CTH7	COTTON NO.2 FUTR MAR17	34
KCH7	COFFEE "C" FUTURE MAR17	58
KR4175M20(	2017-02 달러선물	47

KWH7	KC HRW WHEAT FUT MAR17	18
SBH7	Sugar #11 (WORLD) MAR17	109
SH7	SOYBEAN FUTURE MAR17	151
SMH7	SOYBEAN MEAL FUTR MAR17	71
WH7	WHEAT FUTURE(CBT) MAR17	65

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

927