공시일	2017-01-17
기준일	2017-01-16

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	2017-01-17
기준일	2017-01-16

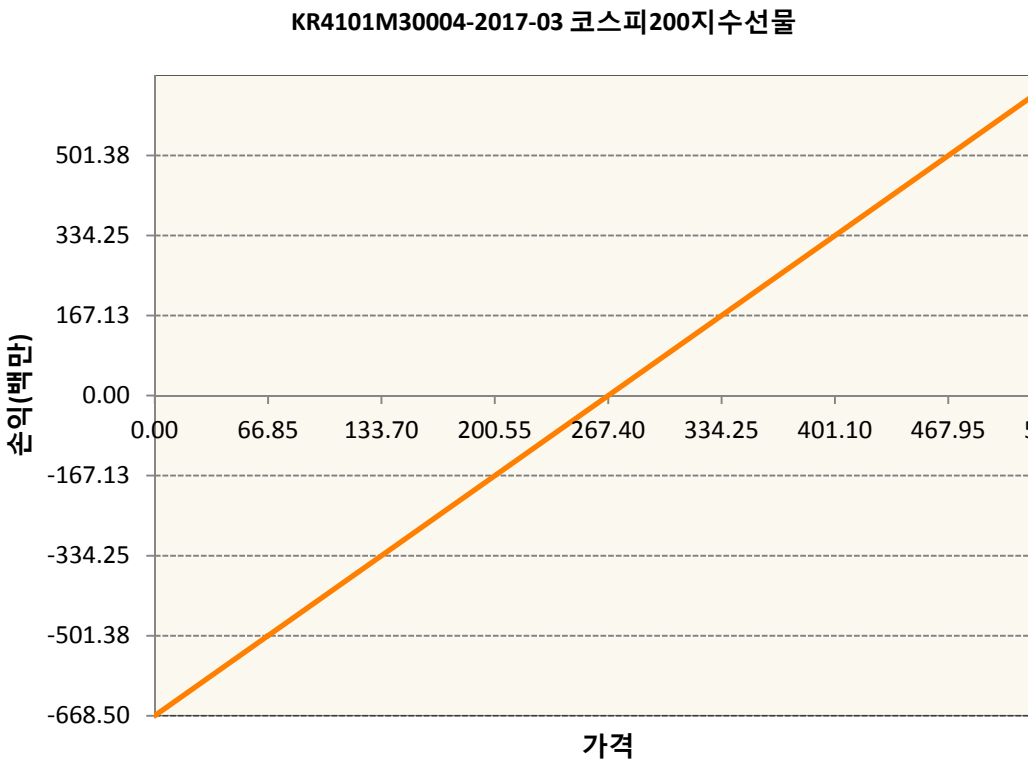
스마트인덱스모

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%	-35	-35	-35	-35	-35	-35	-35
-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%	35	35	35	35	35	35	35
8.00%	53	53	53	53	53	53	53

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

39

공시일	2017-01-17
기준일	2017-01-16

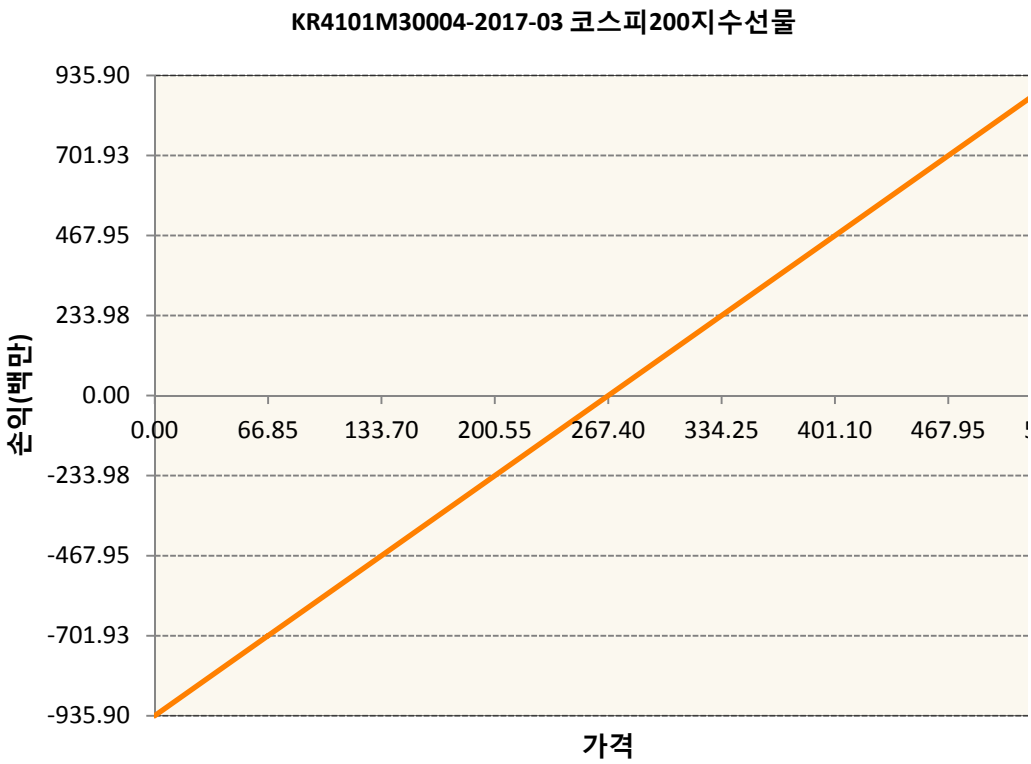
스마트레버리지목표전환형1호

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	936	0	936	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	2017-01-17
기준일	2017-01-16

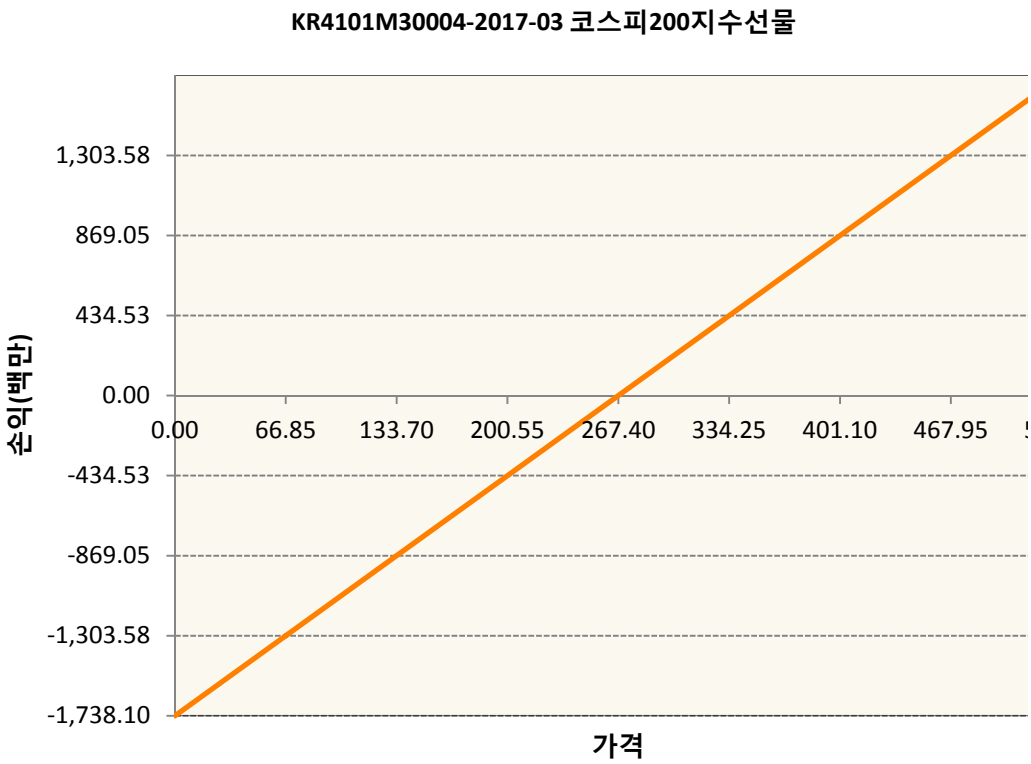
1.3배 레버리지 인덱스(주식-파생형)

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	1,738	0	1,738	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101M30(2017-03 코스피200지수선물							138
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-138	-138	-138	-138	-138	-138	-138
-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%	138	138	138	138	138	138	138

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

101

공시일	2017-01-17
기준일	2017-01-16

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	923

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

697

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-01-17
기준일	2017-01-16

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	365

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

583

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-01-17
기준일	2017-01-16

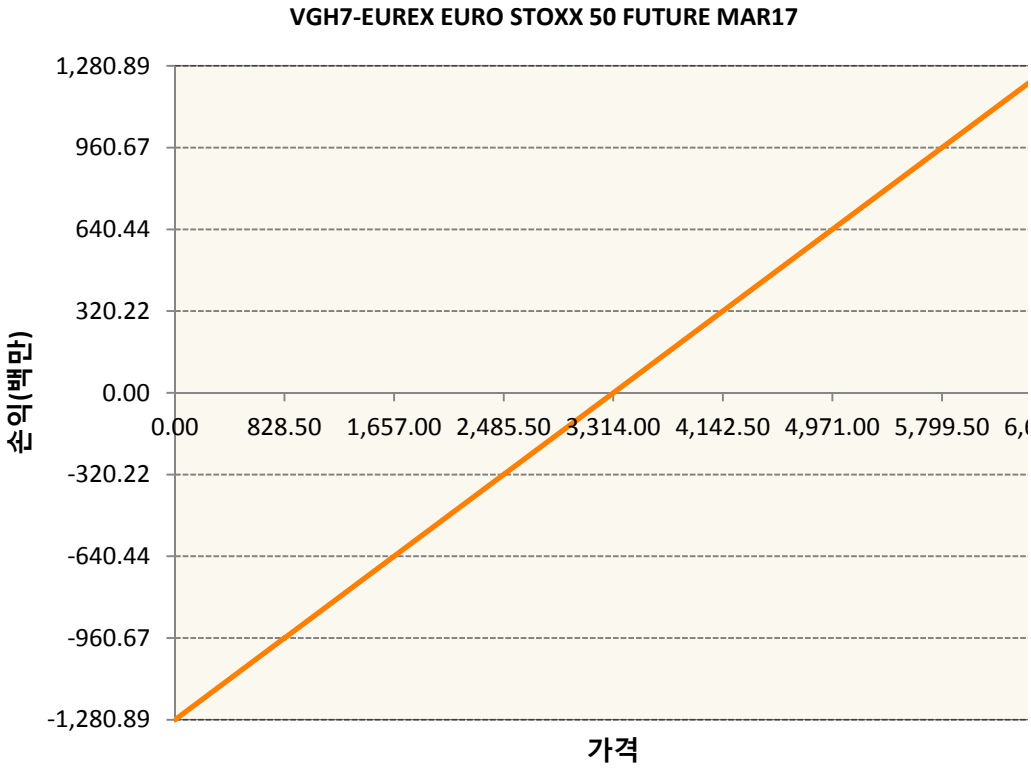
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,281	0	1,281	

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)

114

공시일	2017-01-17
기준일	2017-01-16

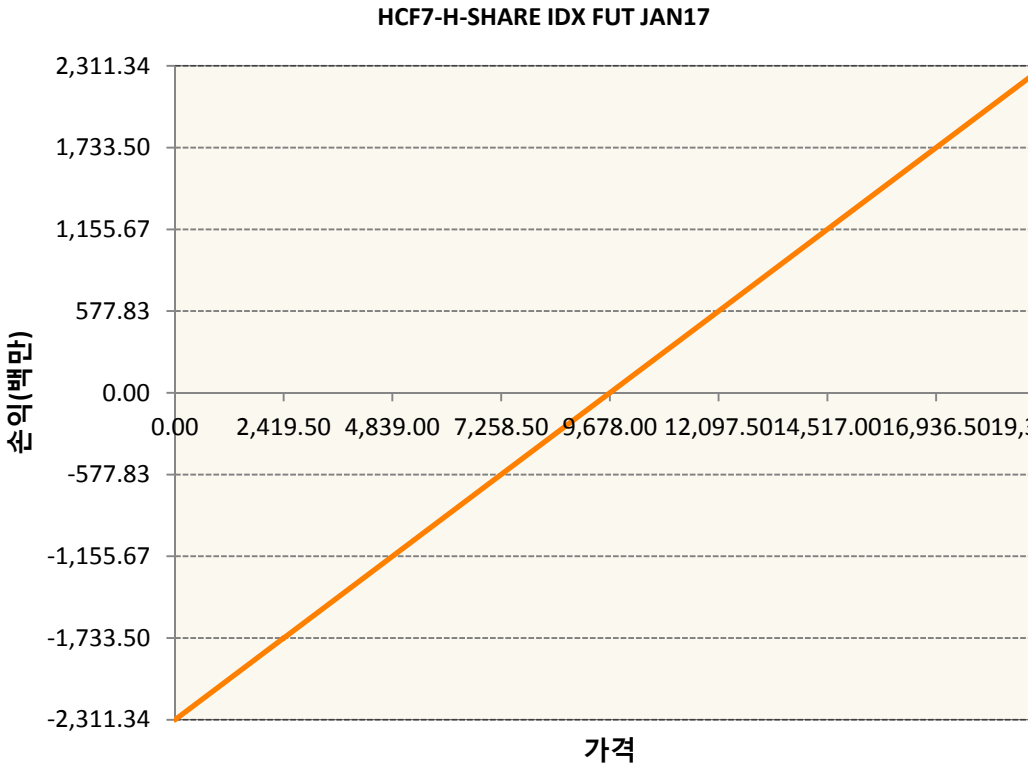
차이나인덱스모(주식-파생형)

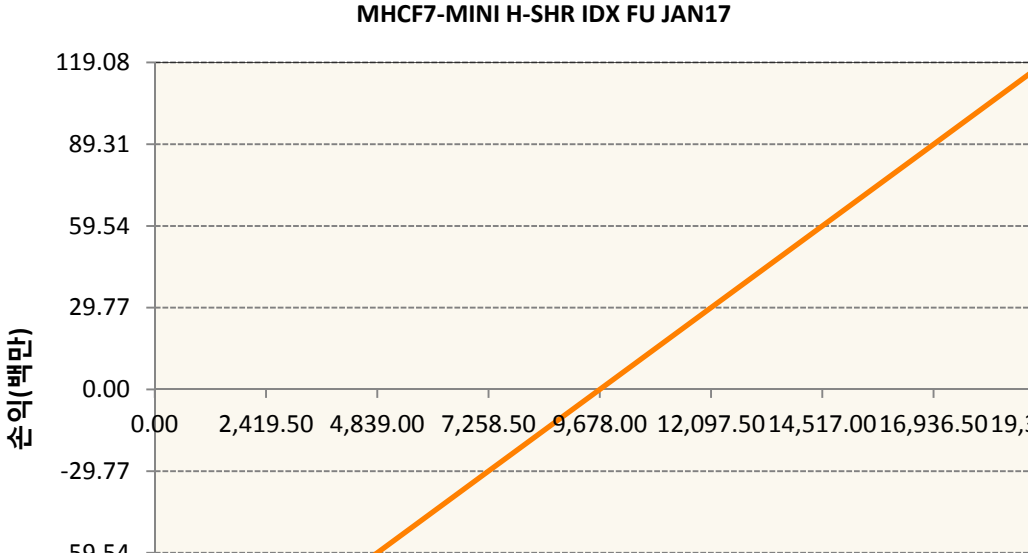
1. 계약금액

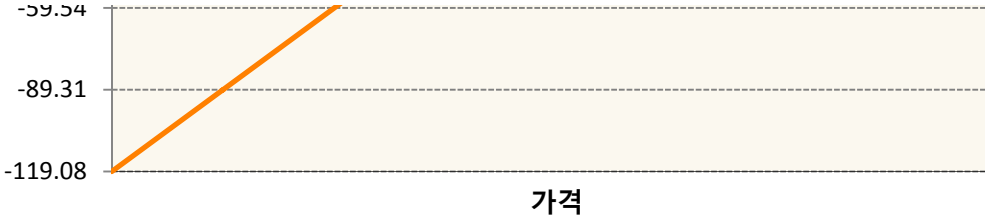
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,430	0	2,430	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCF7	H-SHARE IDX FUT JAN17	185
MHCF7	MINI H-SHR IDX FU JAN17	10

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	237

공시일	2017-01-17
기준일	2017-01-16

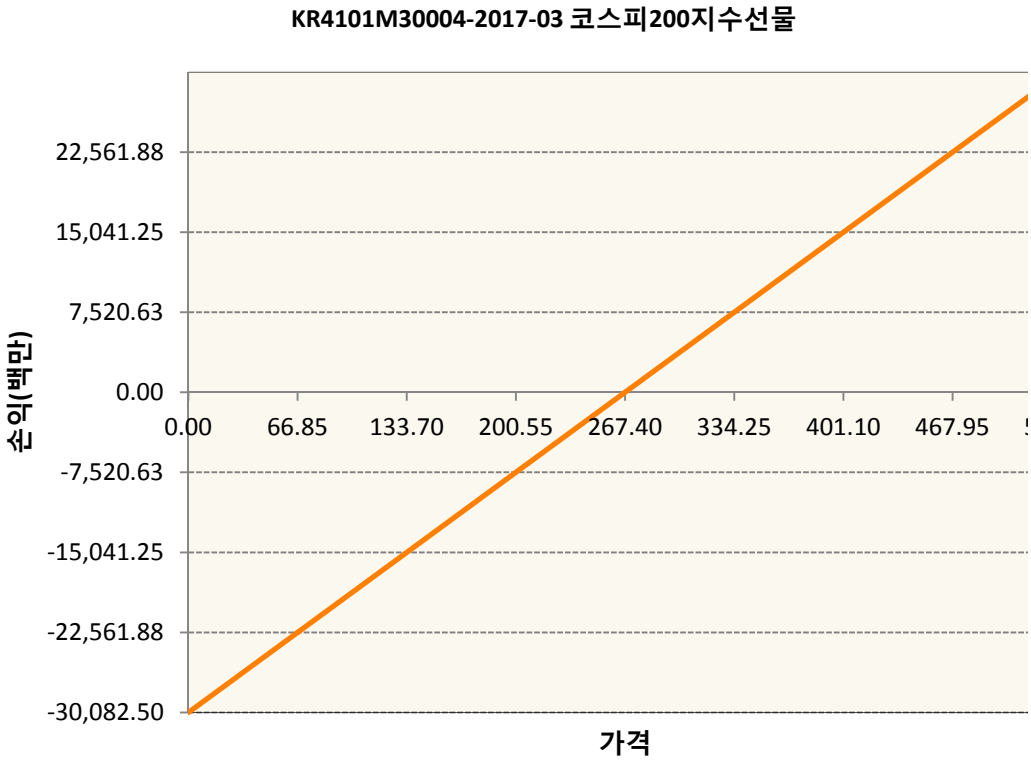
커버드콜(주식혼합-파생형)

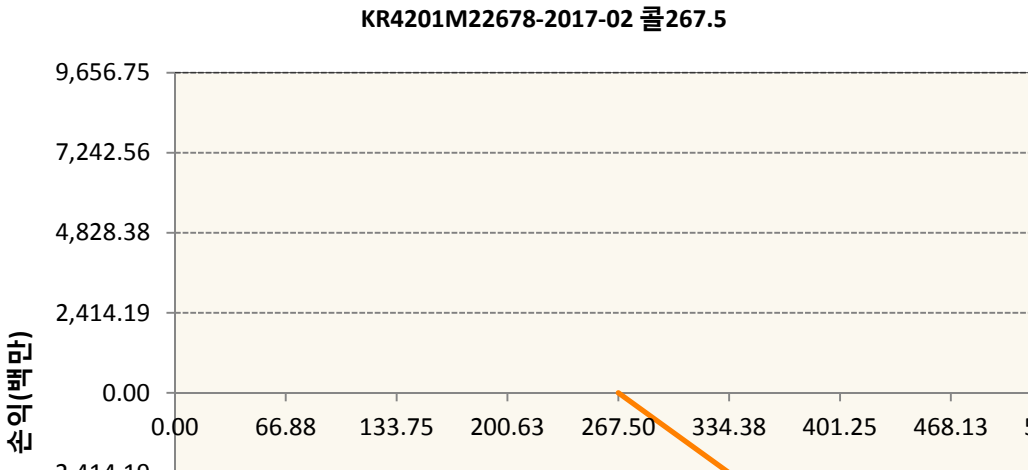
1. 계약금액

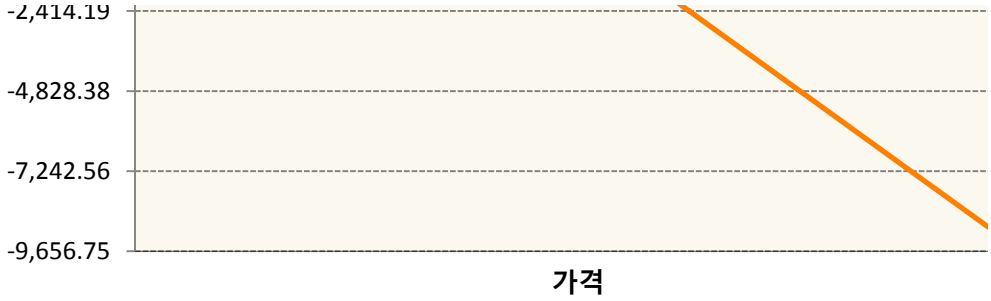
(단위:백만원)

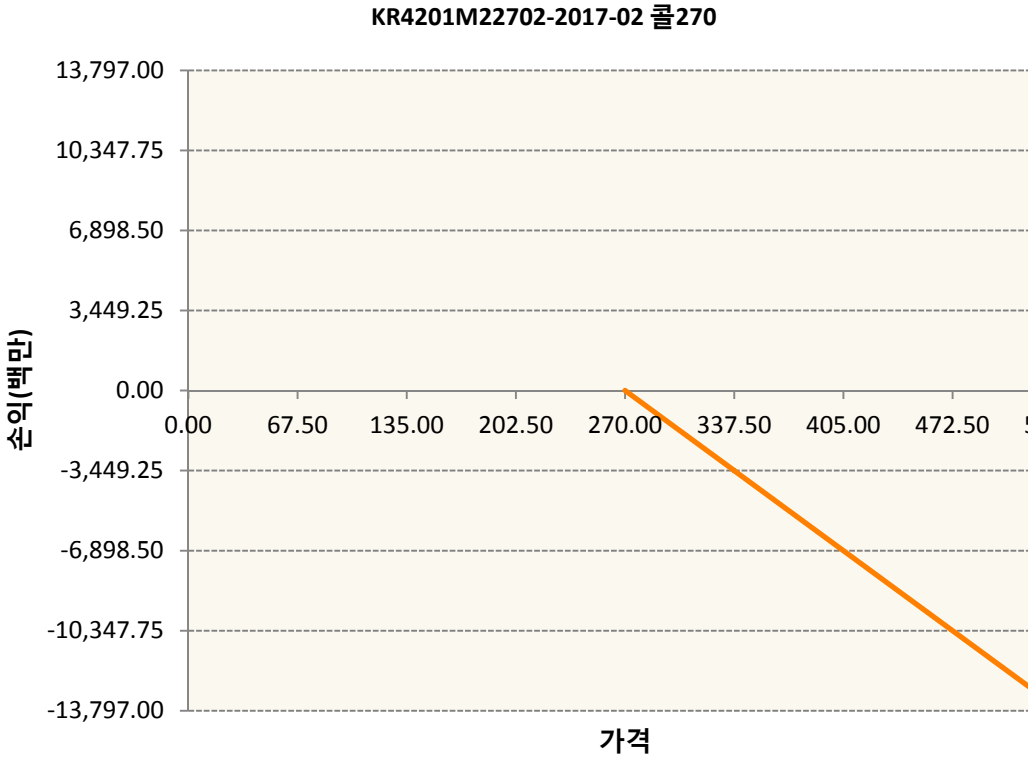
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	30,083	0	30,083	장내
누계	유가증권	옵션	0	23,454	-23,454	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101M30(2017-03 코스피200지수선물							2,395
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-2,395	-2,395	-2,395	-2,395	-2,395	-2,395	-2,395
-5.33%	-1,597	-1,597	-1,597	-1,597	-1,597	-1,597	-1,597
-2.67%	-798	-798	-798	-798	-798	-798	-798
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	798	798	798	798	798	798	798
5.33%	1,597	1,597	1,597	1,597	1,597	1,597	1,597
8.00%	2,395	2,395	2,395	2,395	2,395	2,395	2,395
KR4201M22(2017-02 콜267.5							3,152
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	461	461	461	460	459	458	456
-5.33%	460	458	454	449	442	432	420
-2.67%	424	405	383	358	330	300	268
0%	141	94	47	0	-47	-95	-142
2.67%	-674	-707	-742	-779	-818	-858	-899
5.33%	-1,860	-1,867	-1,877	-1,890	-1,906	-1,925	-1,946
8.00%	-3,132	-3,133	-3,134	-3,136	-3,140	-3,145	-3,152
KR4201M22: 2017-02 콜270							4,082

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	418	418	418	418	417	416	415
-5.33%	418	417	415	411	405	397	387
-2.67%	399	384	365	341	313	281	246
0%	175	119	60	0	-61	-124	-187
2.67%	-701	-762	-825	-888	-952	-1,017	-1,083
5.33%	-2,249	-2,269	-2,295	-2,324	-2,358	-2,396	-2,437
8.00%	-4,031	-4,033	-4,037	-4,044	-4,054	-4,066	-4,082

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

9,625

공시일	2017-01-17
기준일	2017-01-16

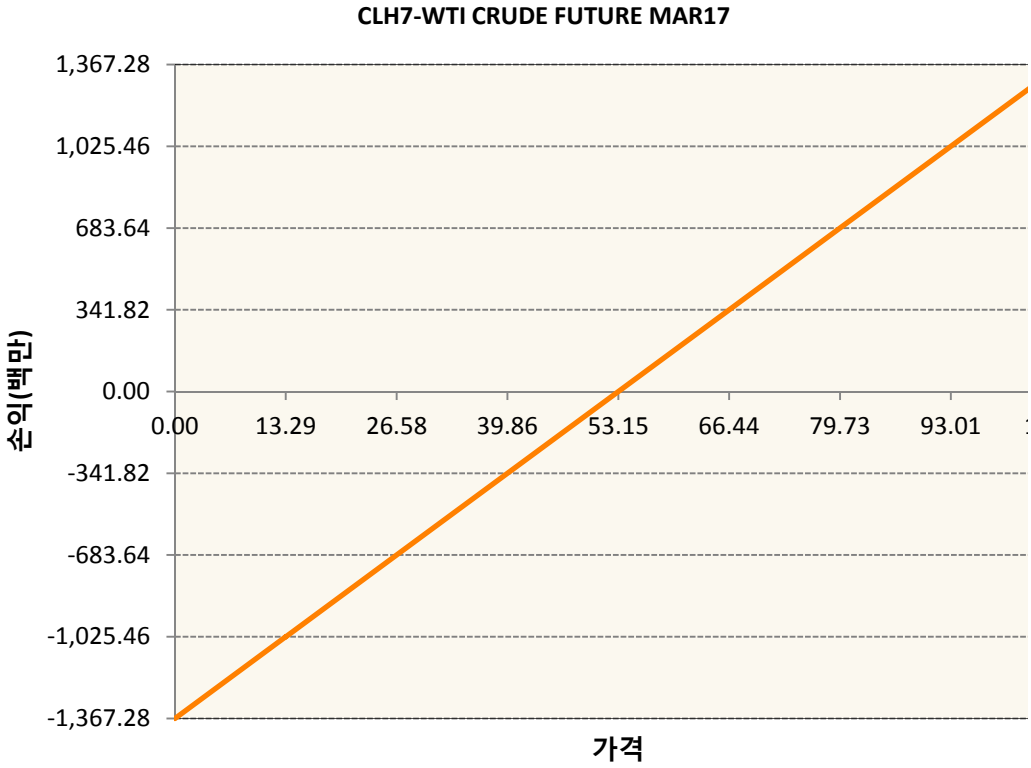
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

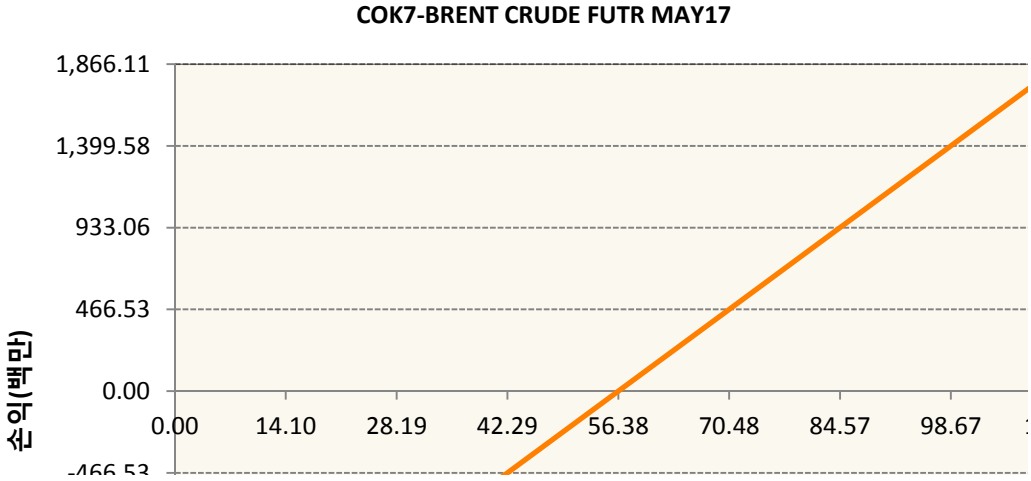
1. 계약금액

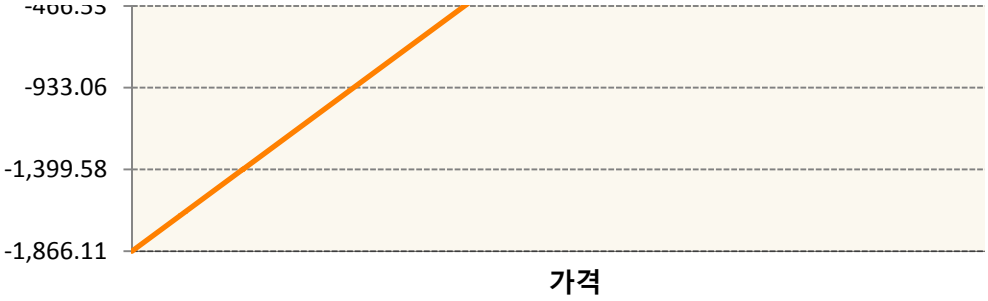
(단위:백만원)

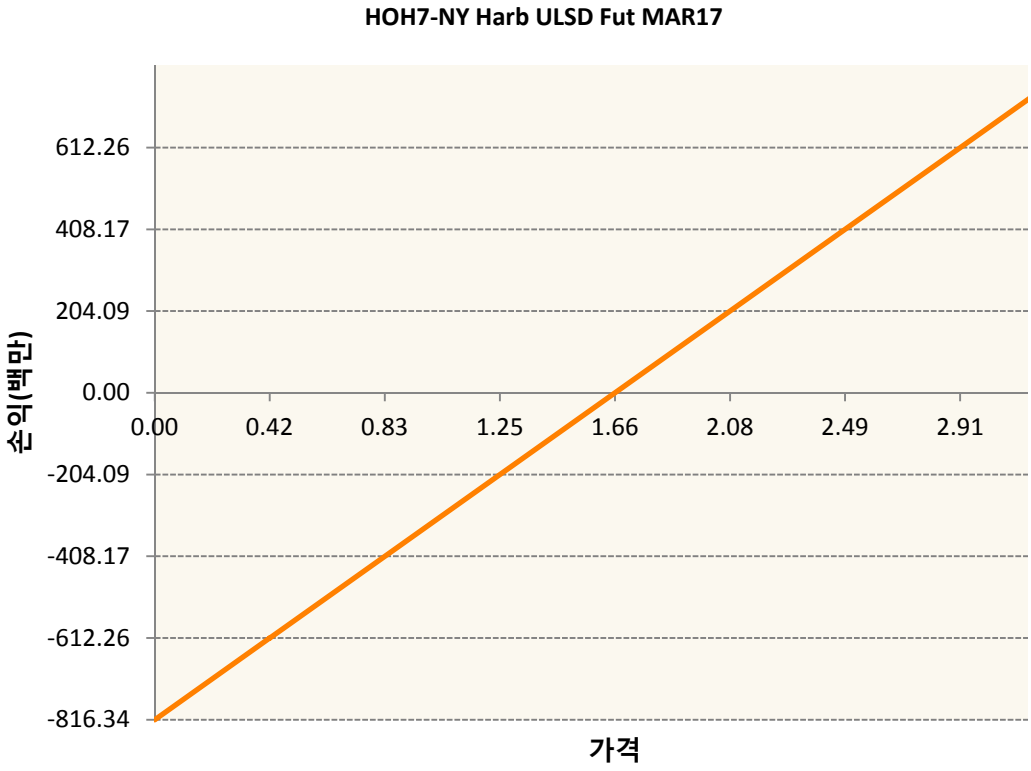
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	선물	유가증권	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	선물	유가증권	1,367	0	1,367	
누계	유가증권	선물	5,154	425	4,729	

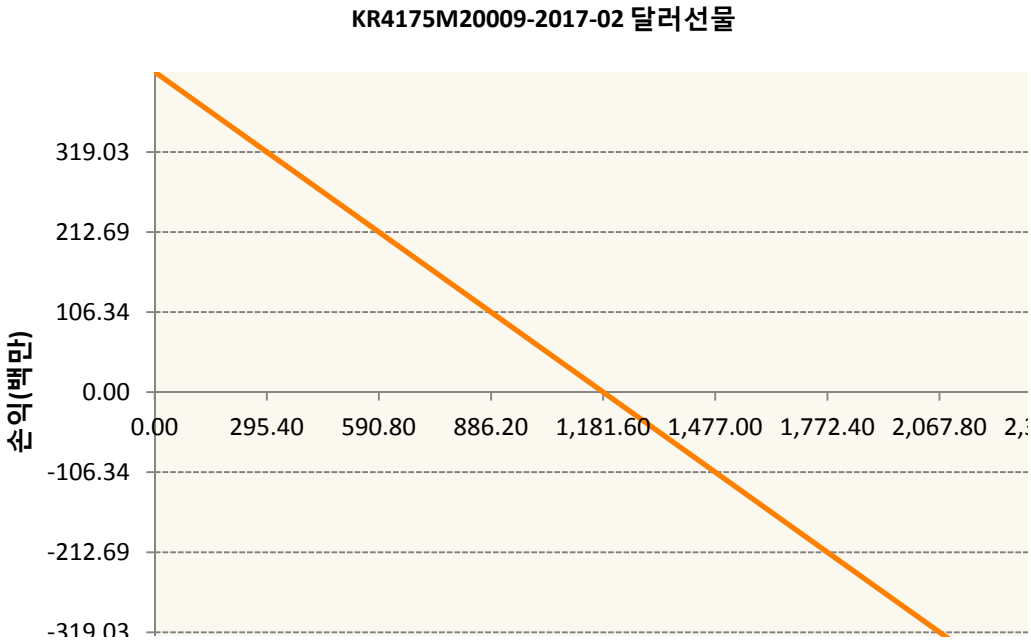
2. 만기시점의 손익구조

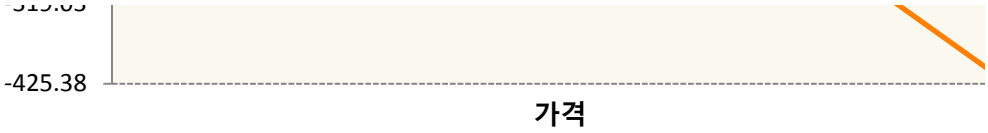


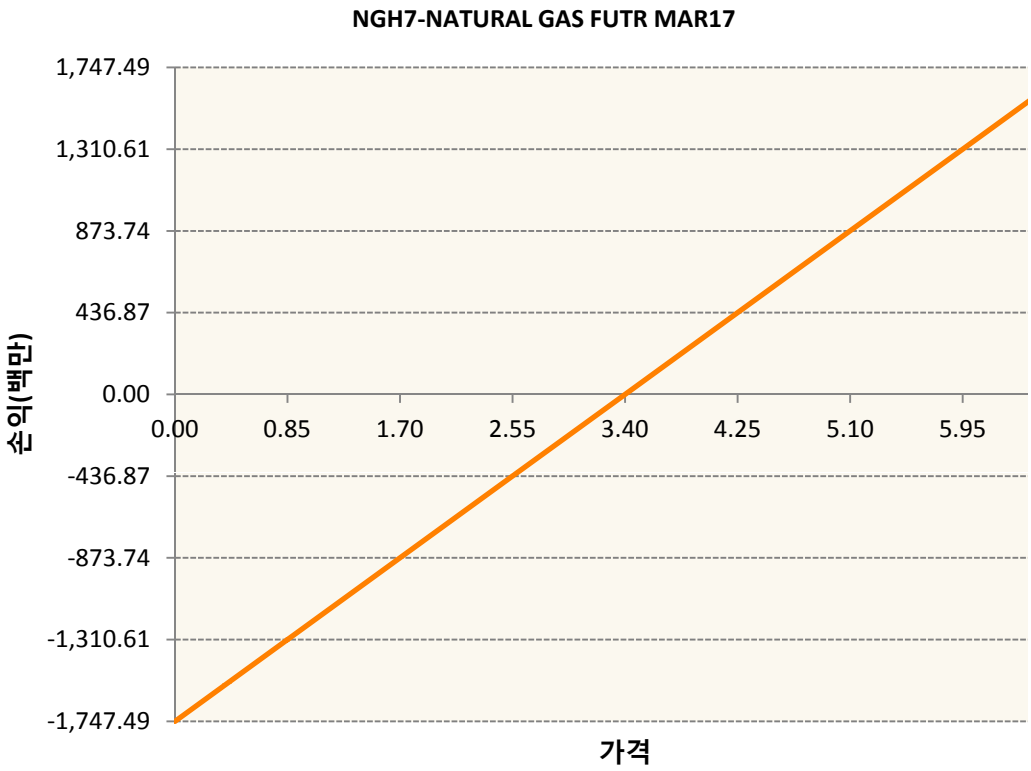


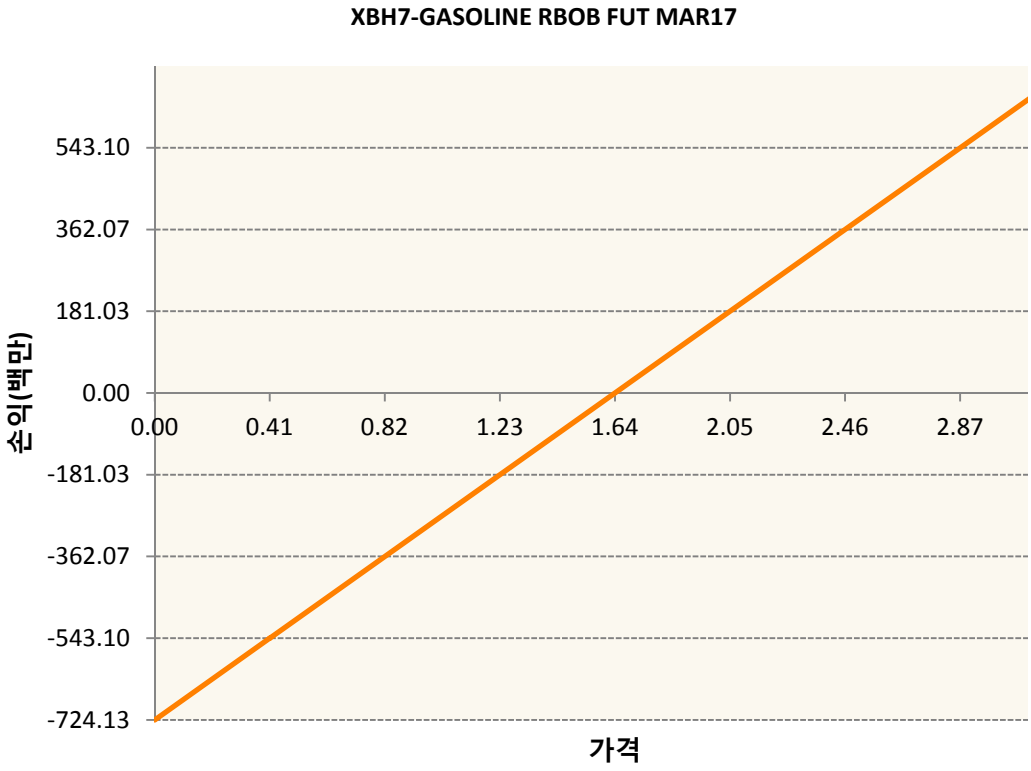

-933.06
-1,399.58
-1,866.11
가격


HOH7-NY Harb ULSD Fut MAR17
612.26
408.17
204.09
0.00
-204.09
-408.17
-612.26
-816.34
0.00
0.42
0.83
1.25
1.66
2.08
2.49
2.91
순익(백만)
가격


KR4175M20009-2017-02 달러선물
319.03
212.69
106.34
0.00
-106.34
-212.69
-319.03
0.00
295.40
590.80
886.20
1,181.60
1,477.00
1,772.40
2,067.80
순익(백만)


-425.38
가격


NGH7-NATURAL GAS FUTR MAR17
1,747.49
1,310.61
873.74
436.87
0.00
-436.87
-873.74
-1,310.61
-1,747.49
0.00
0.85
1.70
2.55
3.40
4.25
5.10
5.95
순익(백만)
가격


XBH7-GASOLINE RBOB FUT MAR17
543.10
362.07
181.03
0.00
-181.03
-362.07
-543.10
-724.13
0.00
0.41
0.82
1.23
1.64
2.05
2.46
2.87
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	140
XBH7	GASOLINE RBOB FUT MAR17	58

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

1,211

공시일	2017-01-17
기준일	2017-01-16

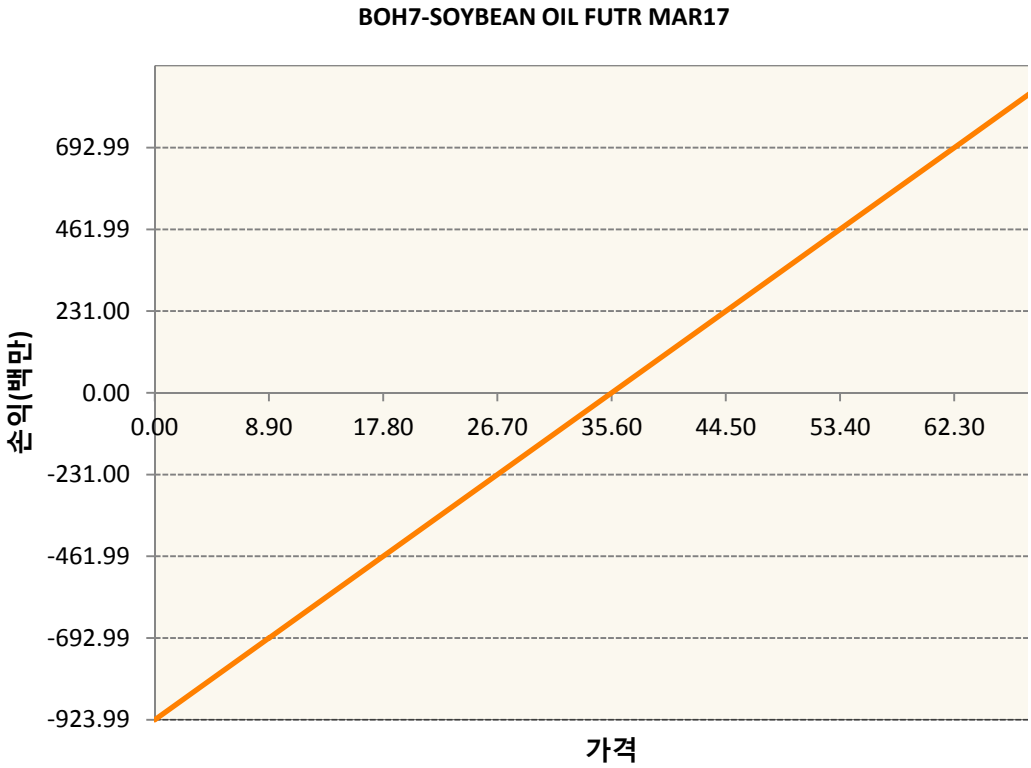
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

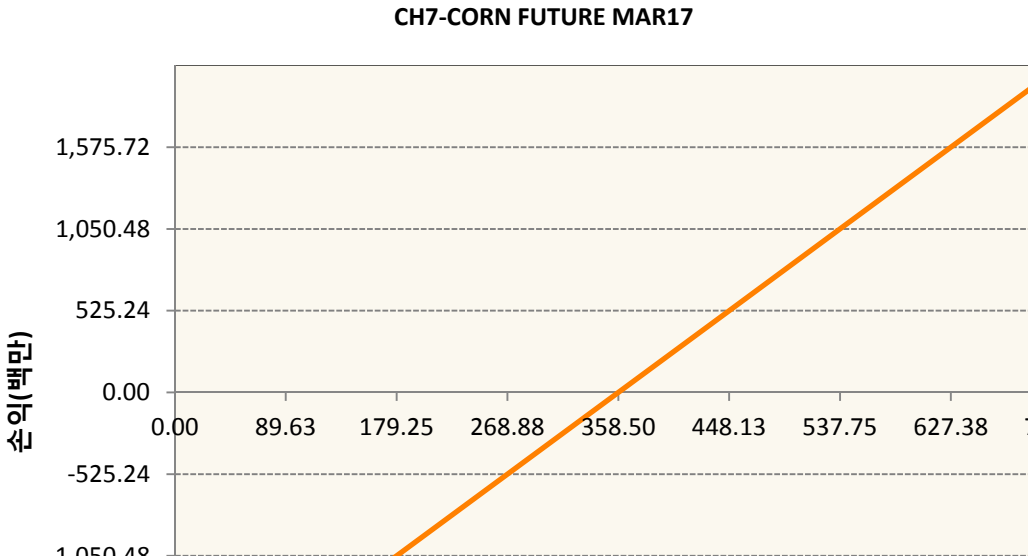
1. 계약금액

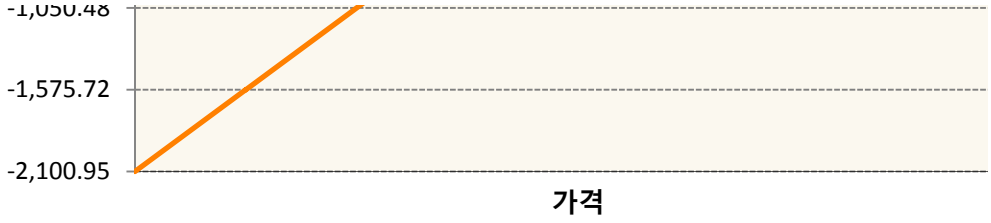
(단위:백만원)

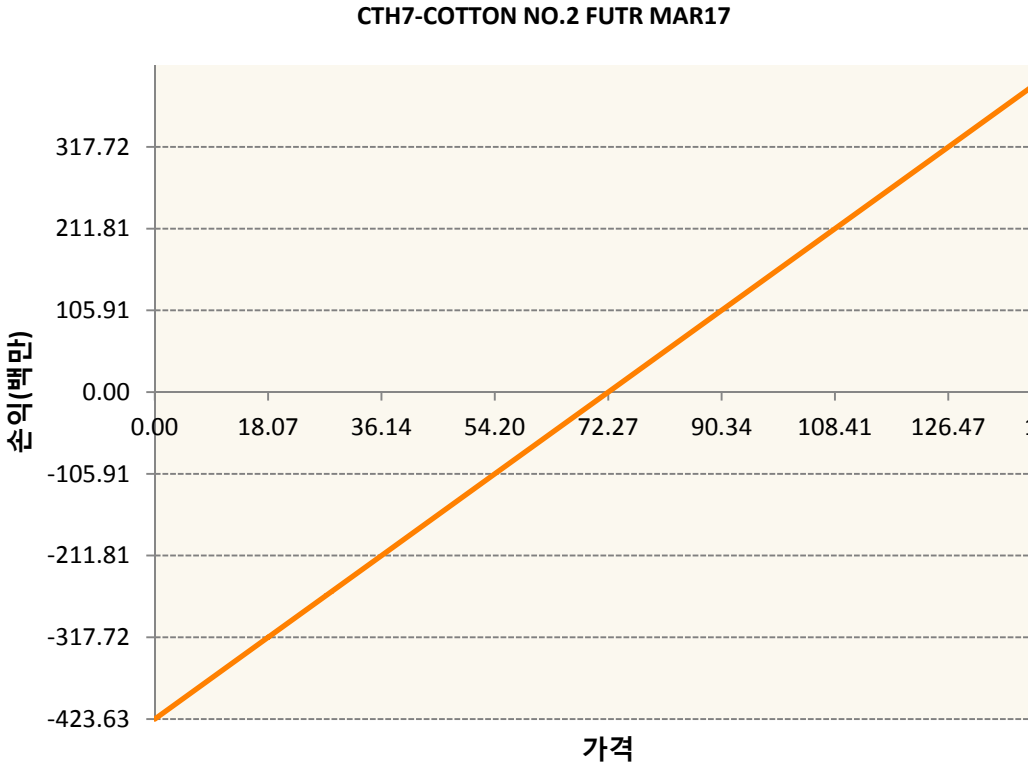
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	9,488	591	8,897	

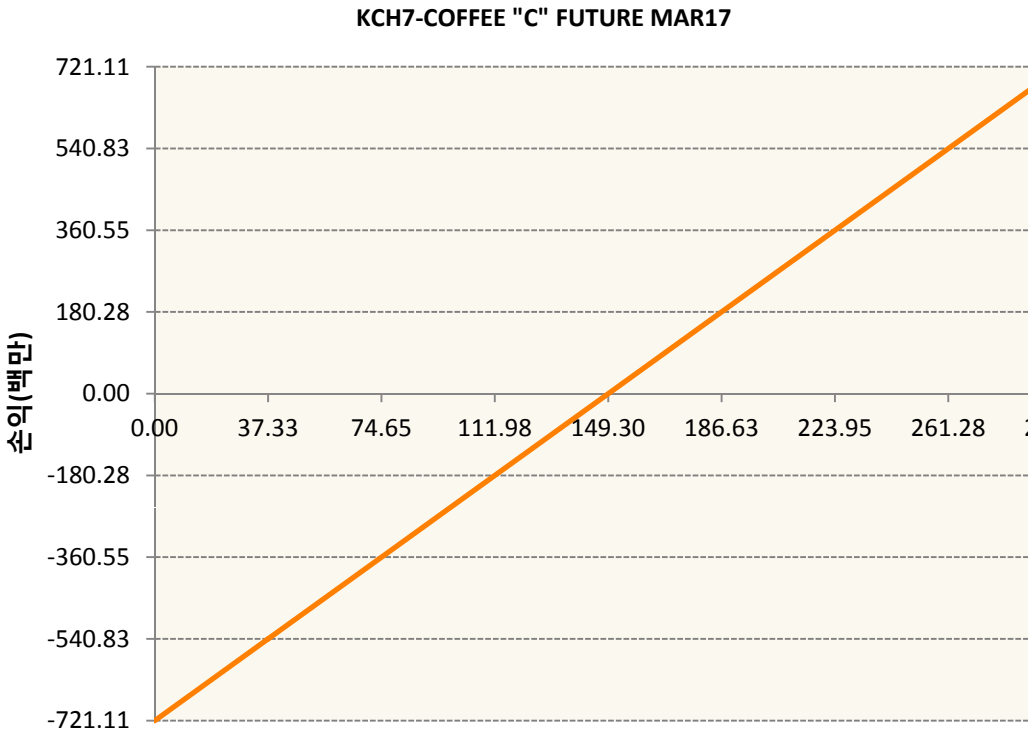
2. 만기시점의 손익구조



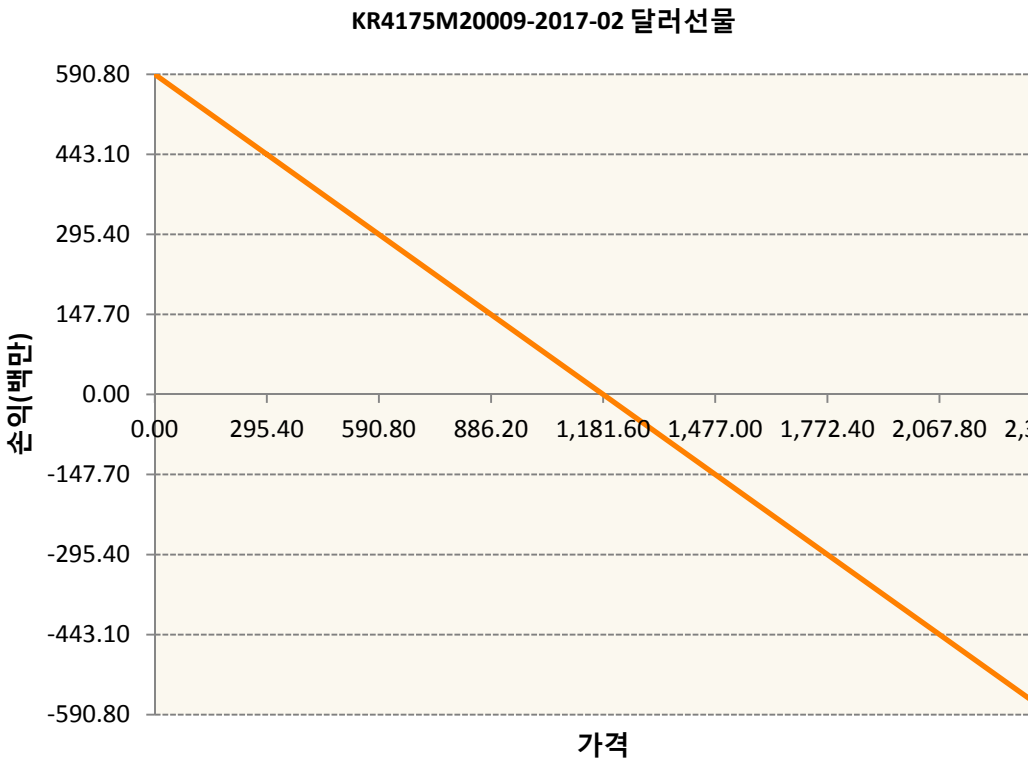


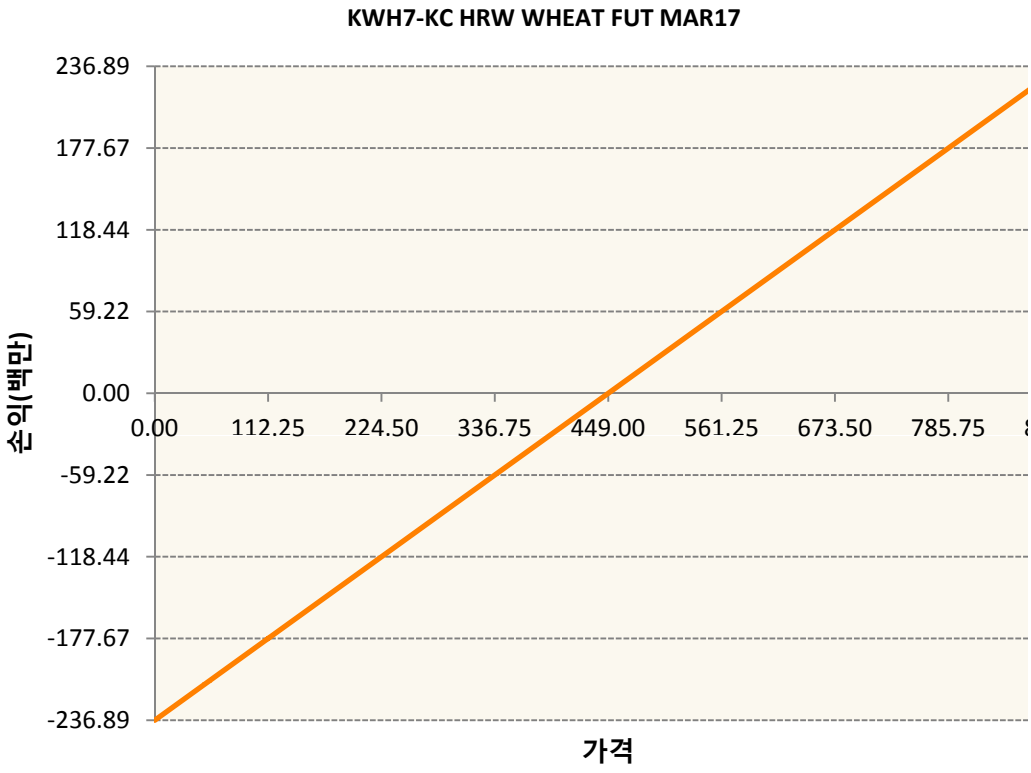

-1,575.72
-2,100.95
가격

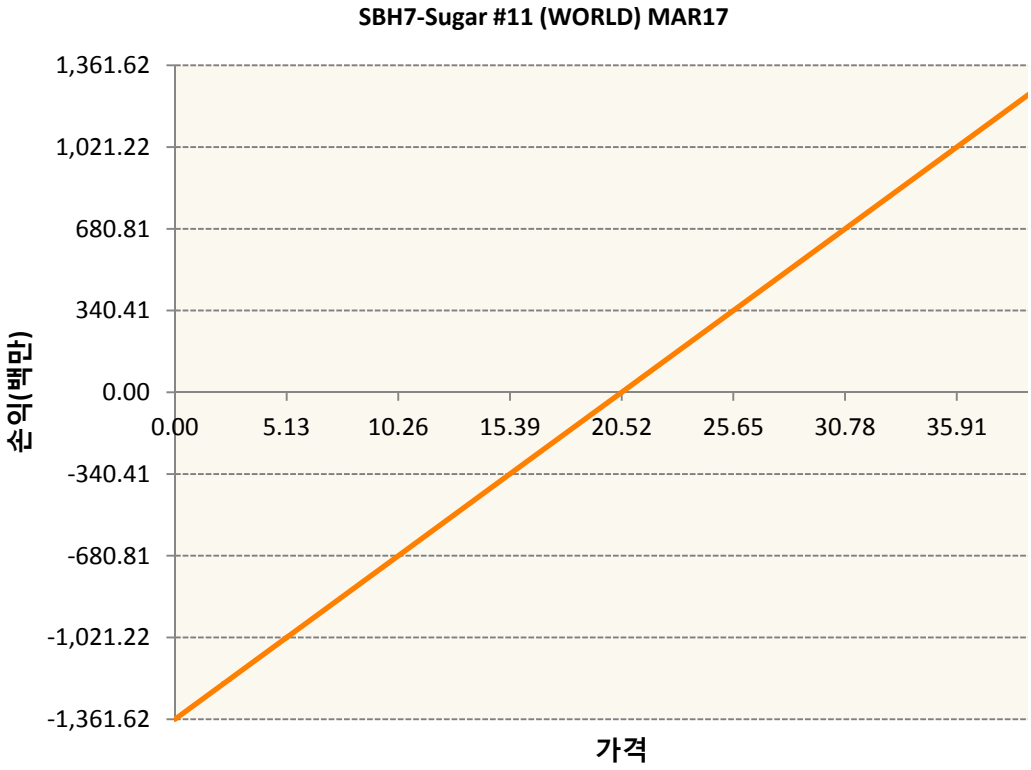

CTH7-COTTON NO.2 FUTR MAR17
317.72
211.81
105.91
0.00
-105.91
-211.81
-317.72
-423.63
0.00
18.07
36.14
54.20
72.27
90.34
108.41
126.47
순익(백만)
가격

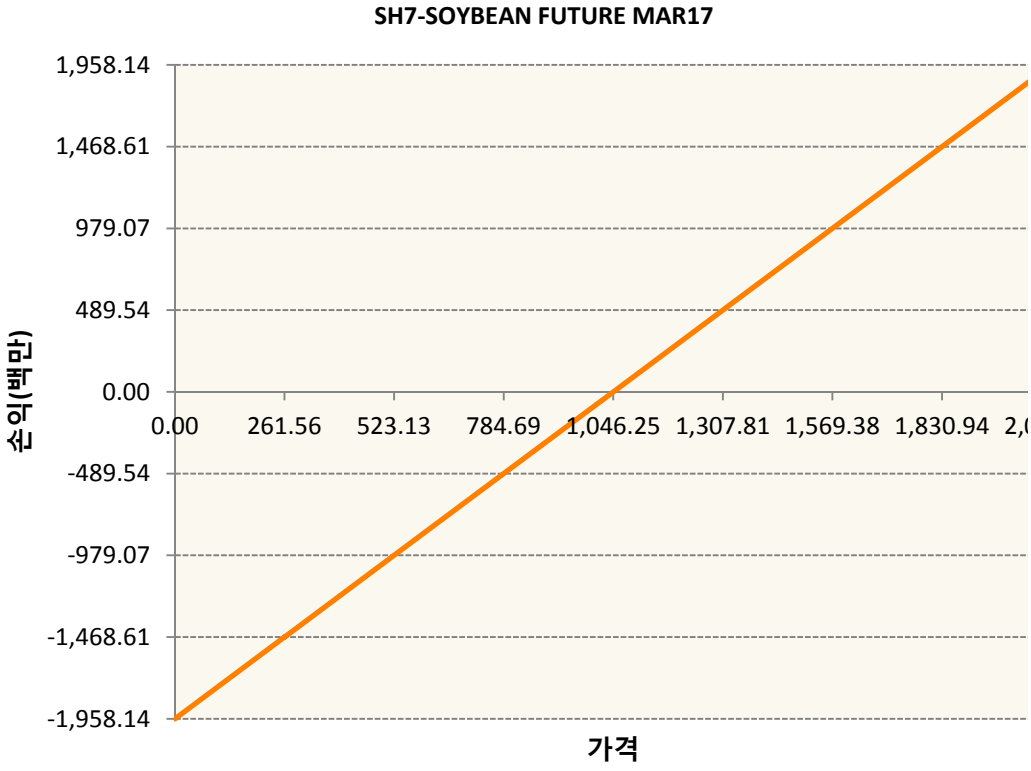

KCH7-COFFEE "C" FUTURE MAR17
721.11
540.83
360.55
180.28
0.00
-180.28
-360.55
-540.83
-721.11
0.00
37.33
74.65
111.98
149.30
186.63
223.95
261.28
순익(백만)

가격

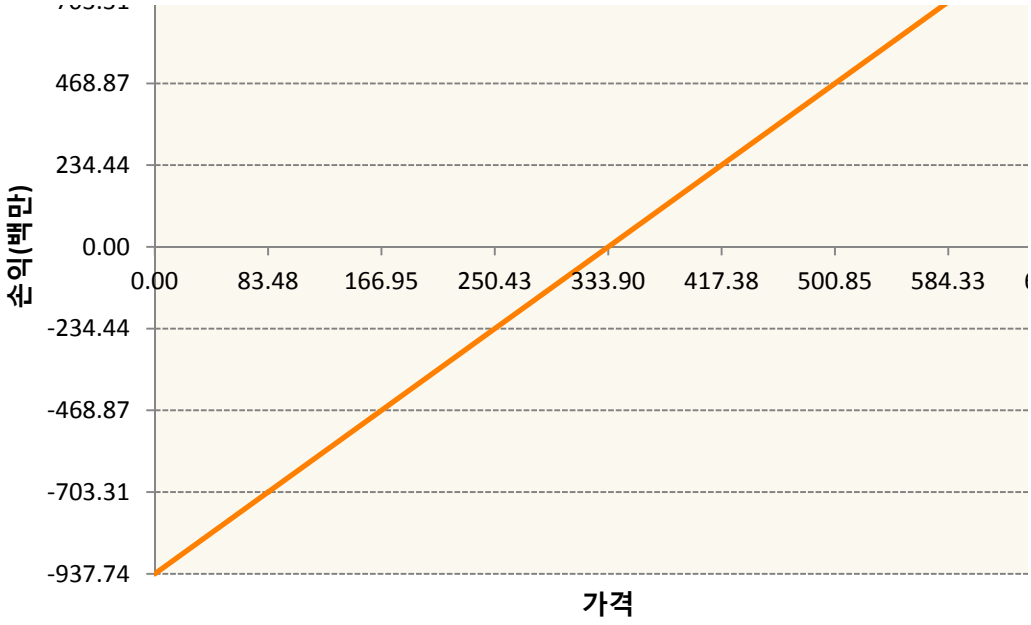

KR4175M20009-2017-02 달러선물
590.80
443.10
295.40
147.70
0.00
-147.70
-295.40
-443.10
-590.80
0.00
295.40
590.80
886.20
1,181.60
1,477.00
1,772.40
2,067.80
손익(백만)
가격

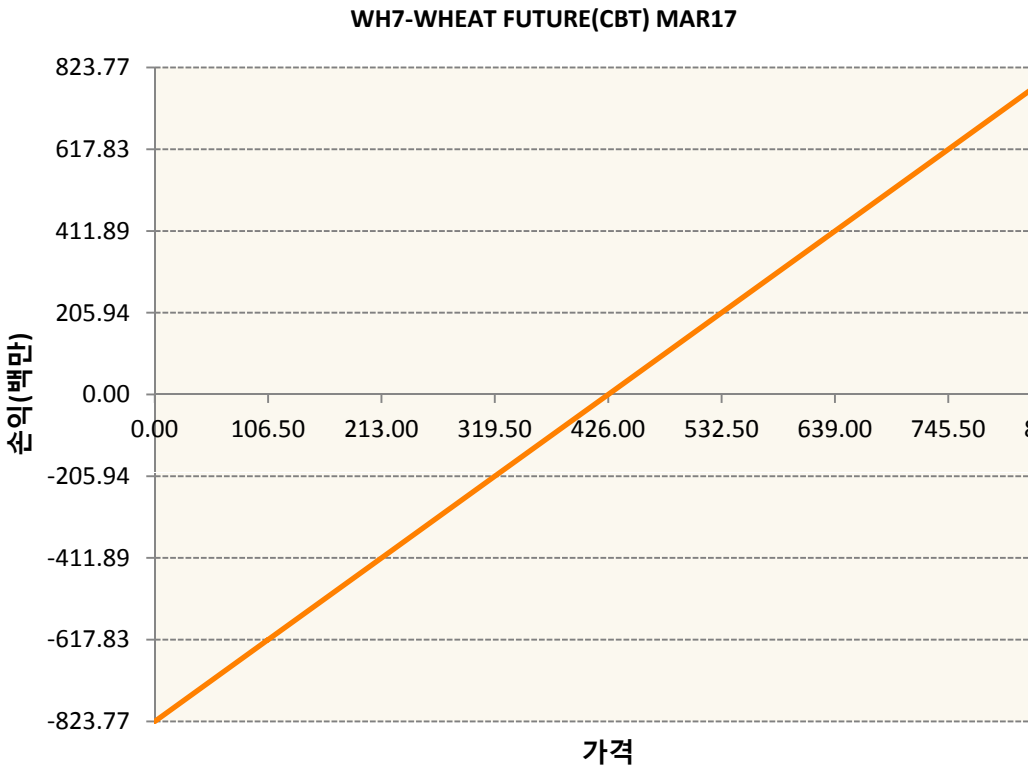

KWH7-KC HRW WHEAT FUT MAR17
236.89
177.67
118.44
59.22
0.00
-59.22
-118.44
-177.67
-236.89
0.00
112.25
224.50
336.75
449.00
561.25
673.50
785.75
손익(백만)
가격


SBH7-Sugar #11 (WORLD) MAR17
1,361.62
1,021.22
680.81
340.41
0.00
-340.41
-680.81
-1,021.22
-1,361.62
0.00
5.13
10.26
15.39
20.52
25.65
30.78
35.91
손익(백만)
가격


SH7-SOYBEAN FUTURE MAR17
1,958.14
1,468.61
979.07
489.54
0.00
-489.54
-979.07
-1,468.61
-1,958.14
0.00
261.56
523.13
784.69
1,046.25
1,307.81
1,569.38
1,830.94
손익(백만)
가격


SMH7-SOYBEAN MEAL FUTR MAR17
937.74
703.31





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

BOH7	SOYBEAN OIL FUTR MAR17	74
CH7	CORN FUTURE MAR17	168
CTH7	COTTON NO.2 FUTR MAR17	34
KCH7	COFFEE "C" FUTURE MAR17	58
KR4175M20(	2017-02 달러선물	47

KWH7	KC HRW WHEAT FUT MAR17	19
SBH7	Sugar #11 (WORLD) MAR17	109
SH7	SOYBEAN FUTURE MAR17	157
SMH7	SOYBEAN MEAL FUTR MAR17	75
WH7	WHEAT FUTURE(CBT) MAR17	66

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

923