공시일	2017-01-31
기준일	2017-01-26

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	2017-01-31
기준일	2017-01-26

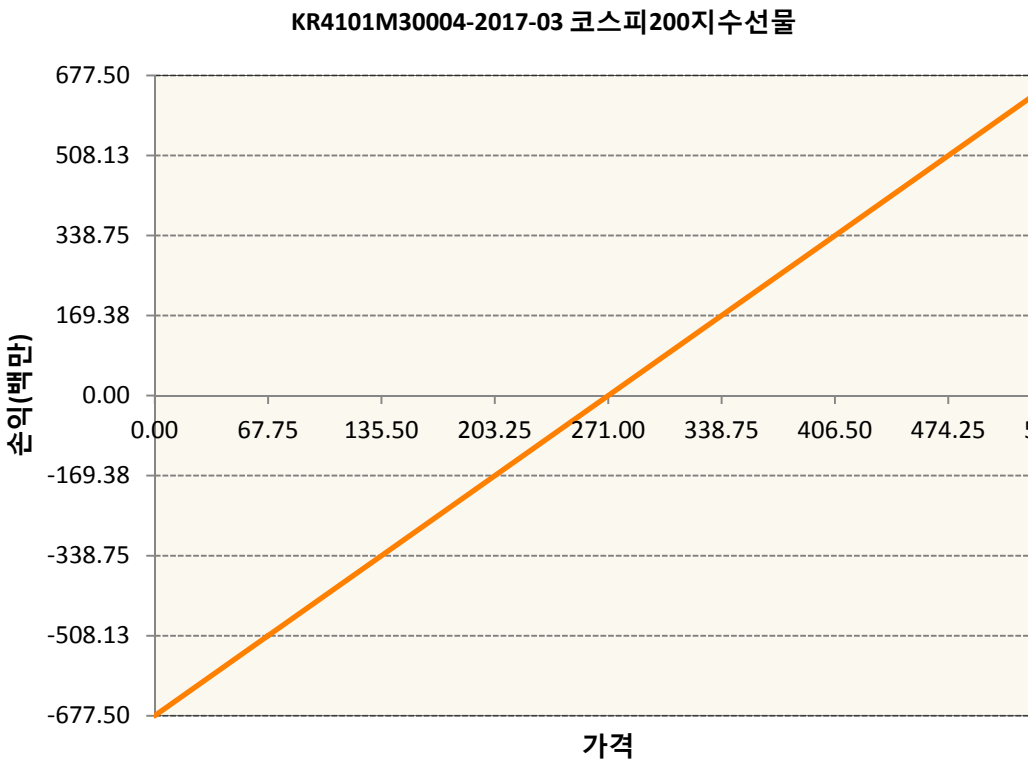
스마트인덱스모

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	678	0	678	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)

38

공시일	2017-01-31
기준일	2017-01-26

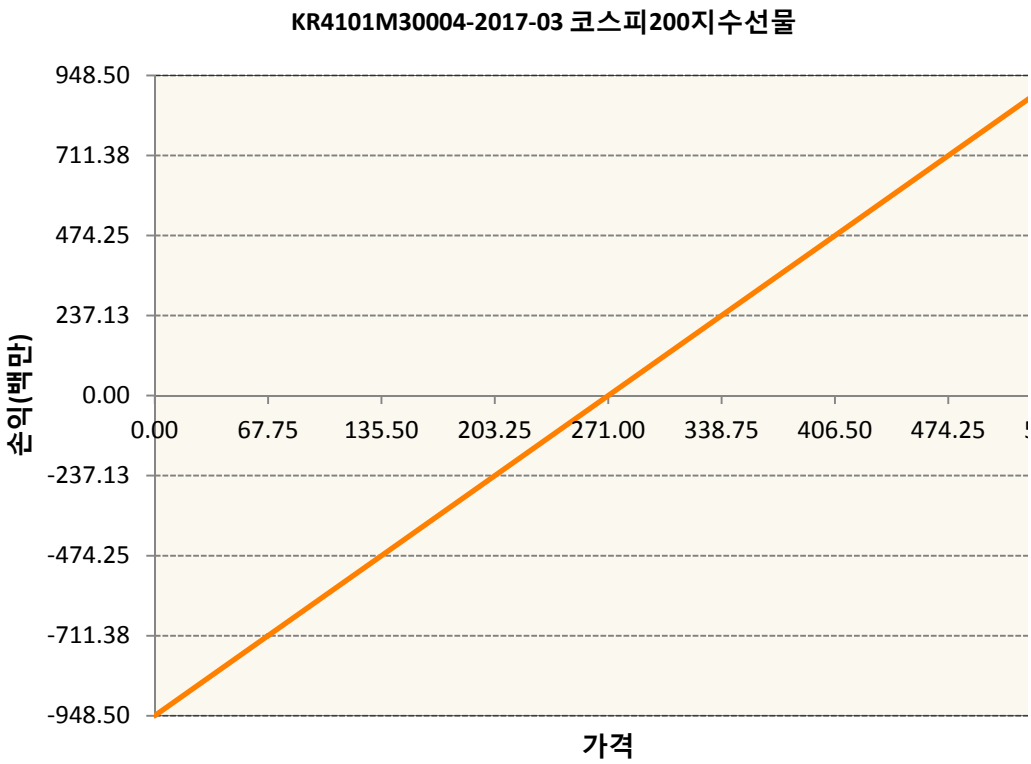
스마트레버리지목표전환형1호

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	949	0	949	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101M30(2017-03 코스피200지수선물							76
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-76	-76	-76	-76	-76	-76	-76
-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%	76	76	76	76	76	76	76

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

53

공시일	2017-01-31
기준일	2017-01-26

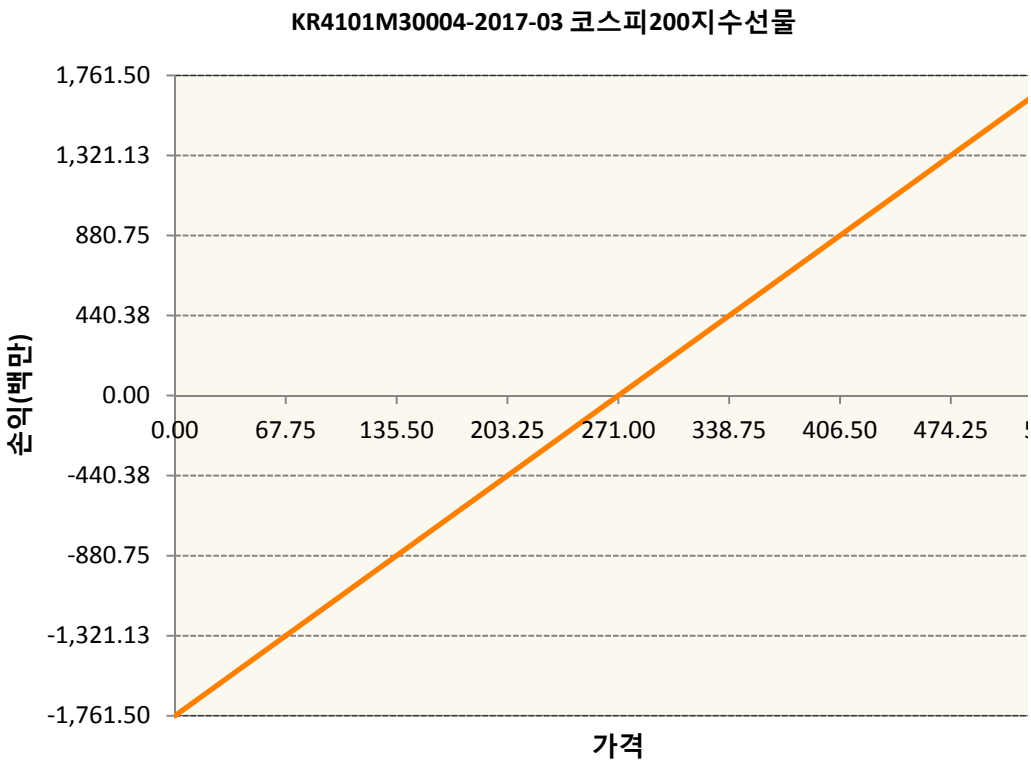
1.3배 레버리지 인덱스(주식-파생형)

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	1,762	0	1,762	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101M30(2017-03 코스피200지수선물							141
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-141	-141	-141	-141	-141	-141	-141
-5.33%	-94	-94	-94	-94	-94	-94	-94
-2.67%	-47	-47	-47	-47	-47	-47	-47
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	47	47	47	47	47	47	47
5.33%	94	94	94	94	94	94	94
8.00%	141	141	141	141	141	141	141

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

98

공시일	2017-01-31
기준일	2017-01-26

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	932

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

673

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-01-31
기준일	2017-01-26

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	378

* 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	2017-01-31
기준일	2017-01-26

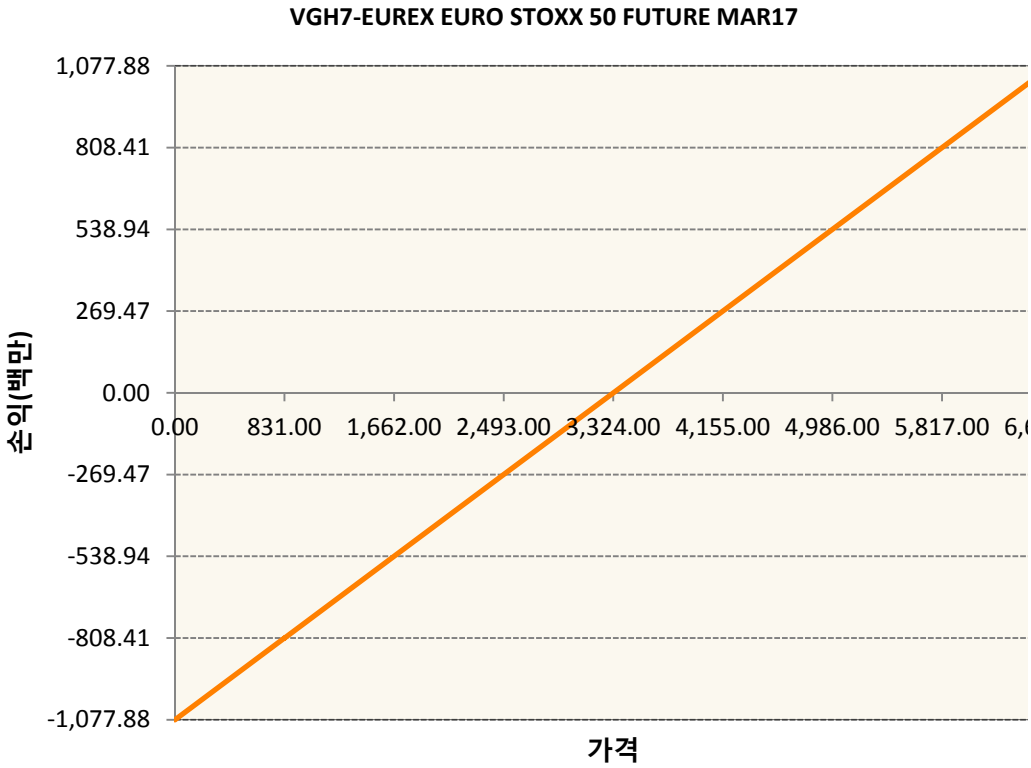
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,078	0	1,078	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGH7	EUREX EURO STOXX 50 FUTURE MAR17	86

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

(단위:백만원)

92

공시일	2017-01-31
기준일	2017-01-26

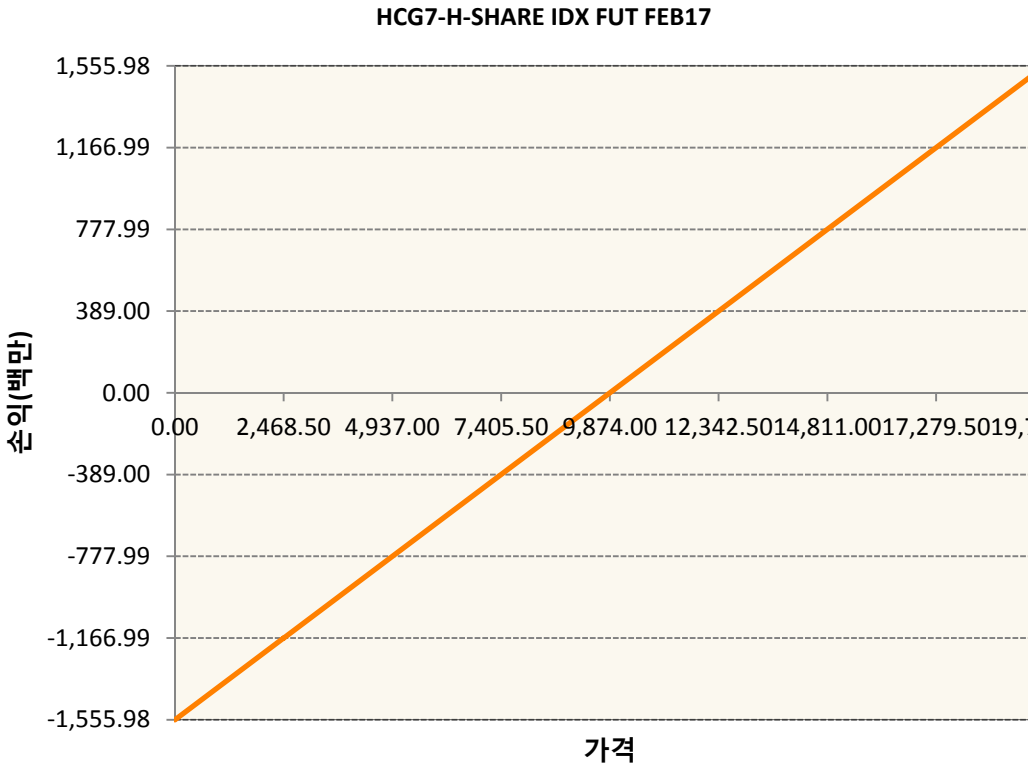
차이나인덱스모(주식-파생형)

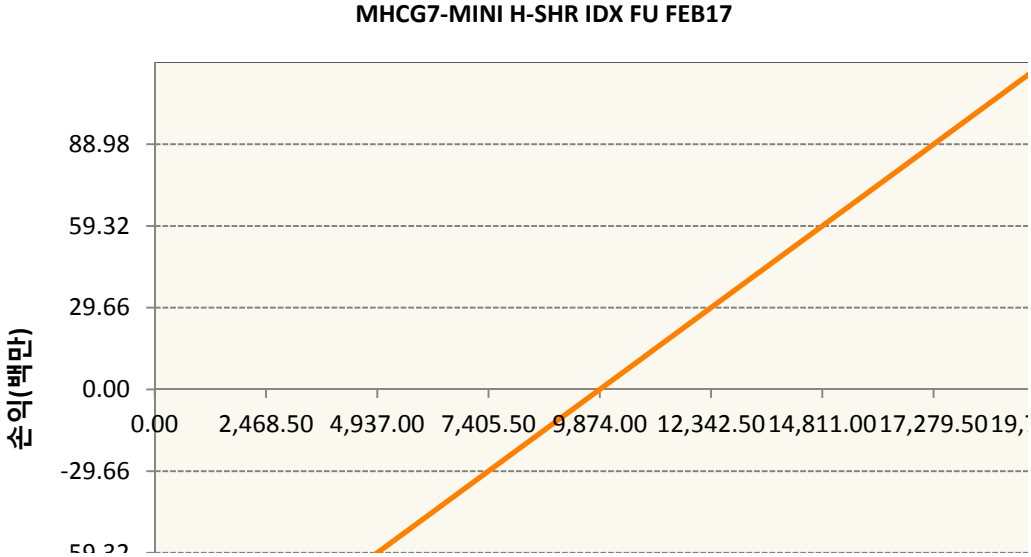
1. 계약금액

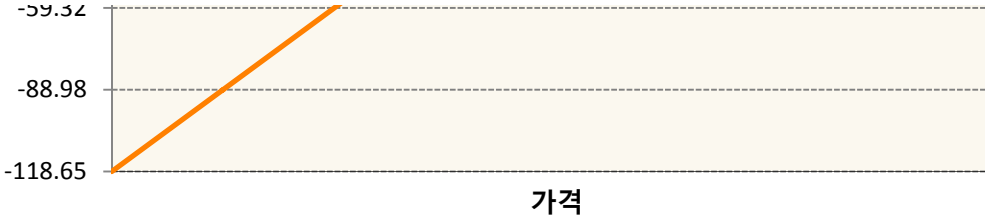
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,675	0	1,675	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCG7	H-SHARE IDX FUT FEB17	124
MHCG7	MINI H-SHR IDX FU FEB17	9

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	162

공시일	2017-01-31
기준일	2017-01-26

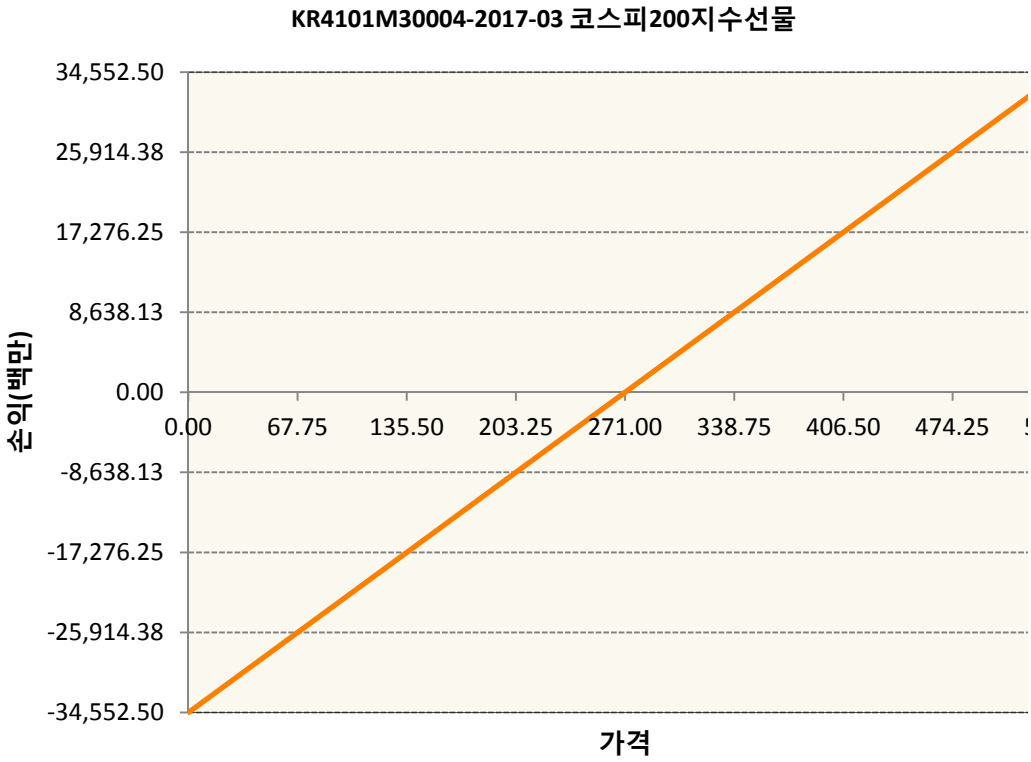
커버드콜(주식혼합-파생형)

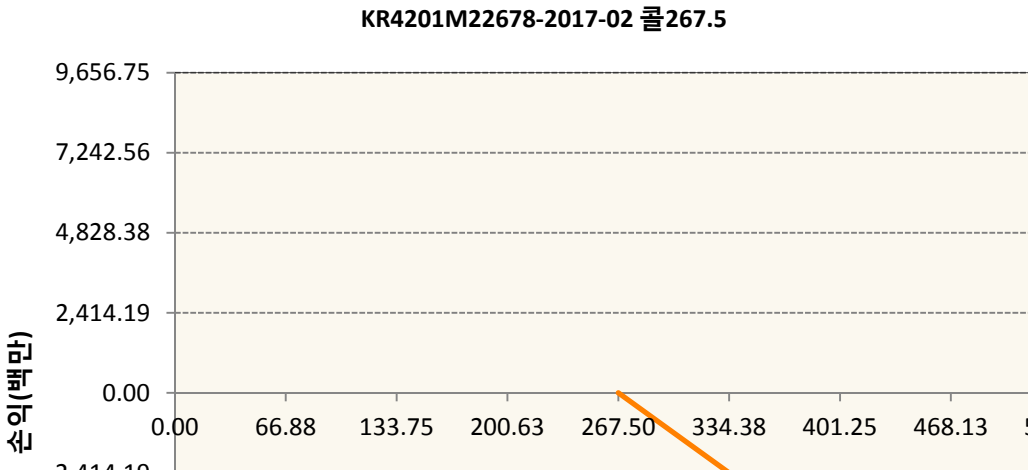
1. 계약금액

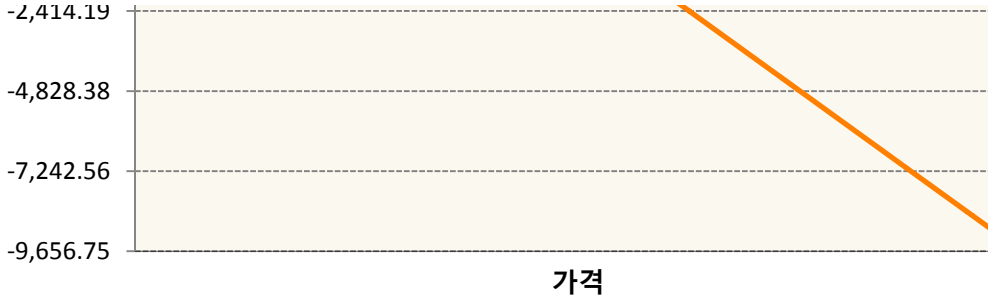
(단위:백만원)

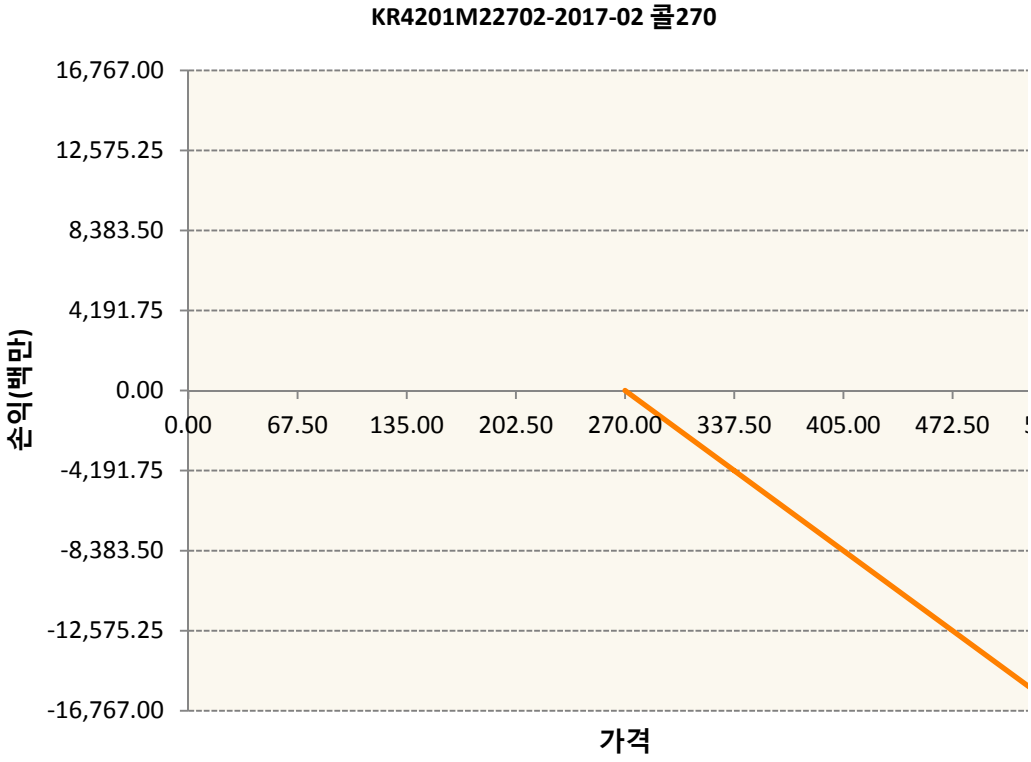
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	818	-818	장내
누계	유가증권	선물	34,553	0	34,553	장내
누계	유가증권	옵션	0	26,424	-26,424	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101M30(2017-03 코스피200지수선물							2,759
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-2,759	-2,759	-2,759	-2,759	-2,759	-2,759	-2,759
-5.33%	-1,839	-1,839	-1,839	-1,839	-1,839	-1,839	-1,839
-2.67%	-920	-920	-920	-920	-920	-920	-920
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	920	920	920	920	920	920	920
5.33%	1,839	1,839	1,839	1,839	1,839	1,839	1,839
8.00%	2,759	2,759	2,759	2,759	2,759	2,759	2,759
KR4201M22(2017-02 콜267.5							3,685
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	754	754	754	753	753	753	752
-5.33%	752	751	748	743	737	729	720
-2.67%	680	656	630	603	575	546	516
0%	93	63	32	0	-32	-65	-99
2.67%	-1,086	-1,090	-1,096	-1,105	-1,115	-1,127	-1,141
5.33%	-2,383	-2,384	-2,384	-2,384	-2,385	-2,387	-2,390
8.00%	-3,685	-3,685	-3,685	-3,685	-3,685	-3,685	-3,685
KR4201M22: 2017-02 콜270							6,035

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	826	826	826	826	826	825	825
-5.33%	826	825	823	820	816	809	800
-2.67%	785	763	736	705	671	633	593
0%	187	125	62	0	-62	-125	-187
2.67%	-1,585	-1,604	-1,626	-1,654	-1,685	-1,719	-1,756
5.33%	-3,795	-3,796	-3,797	-3,800	-3,805	-3,812	-3,821
8.00%	-6,033	-6,033	-6,033	-6,033	-6,033	-6,034	-6,035

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

14,360

공시일	2017-01-31
기준일	2017-01-26

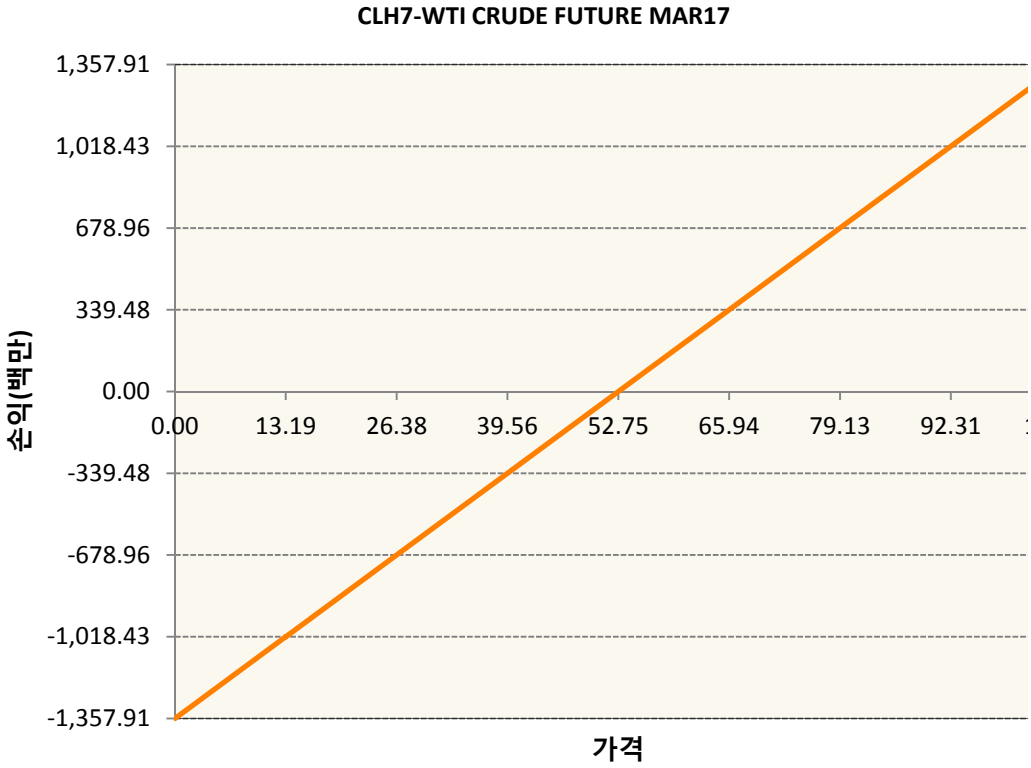
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

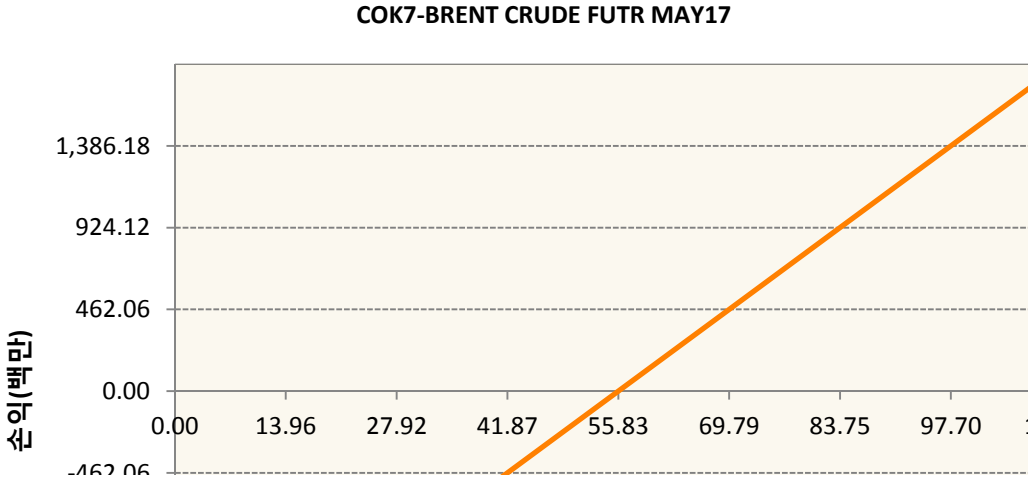
1. 계약금액

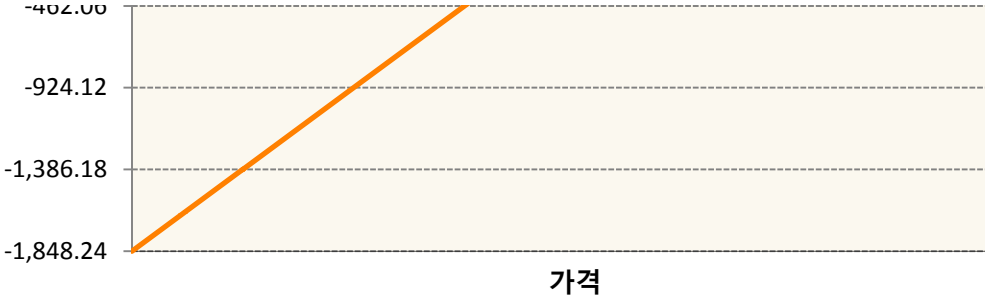
(단위:백만원)

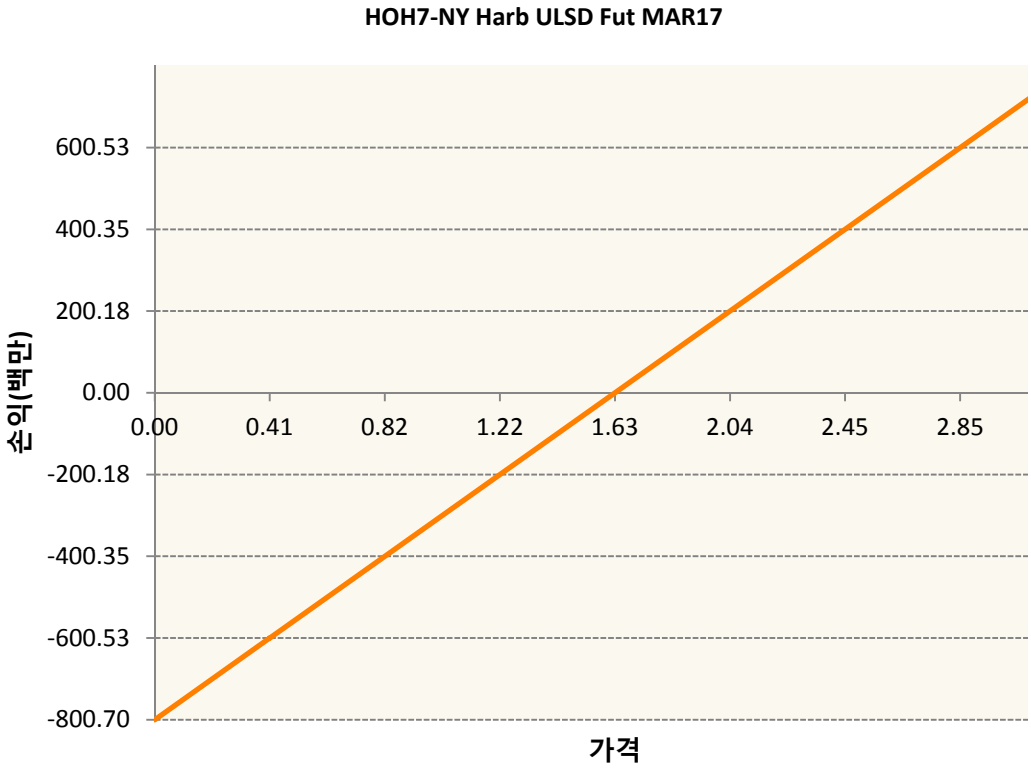
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	선물	유가증권	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	선물	유가증권	1,358	0	1,358	
누계	유가증권	선물	5,058	417	4,641	

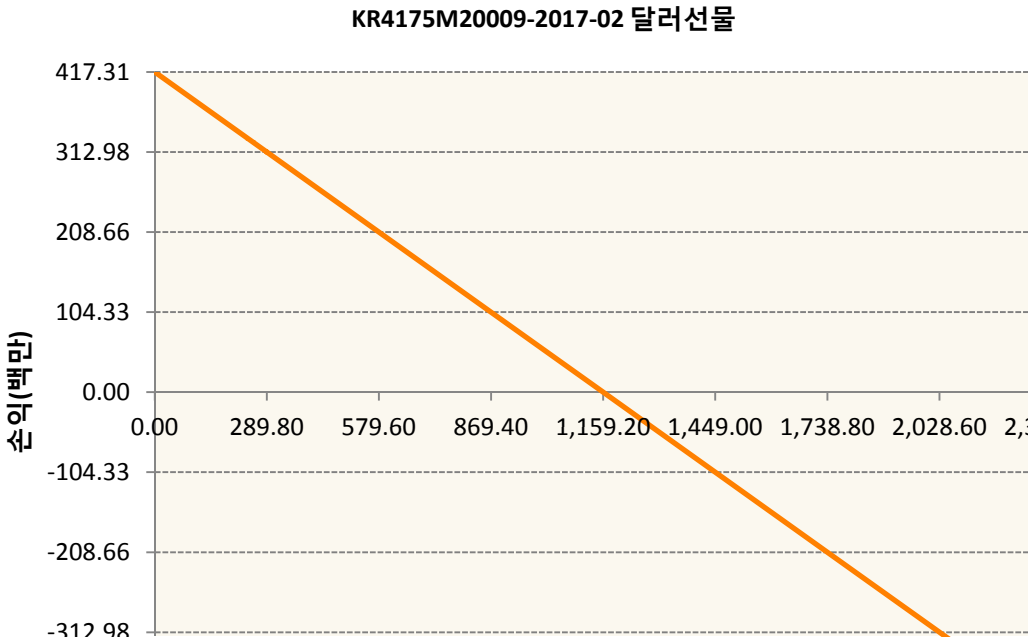
2. 만기시점의 손익구조

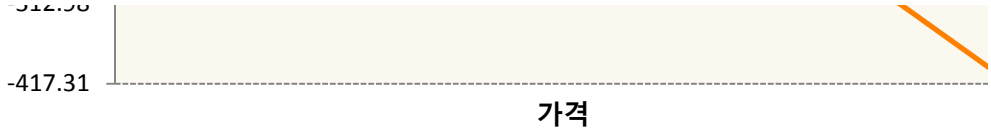


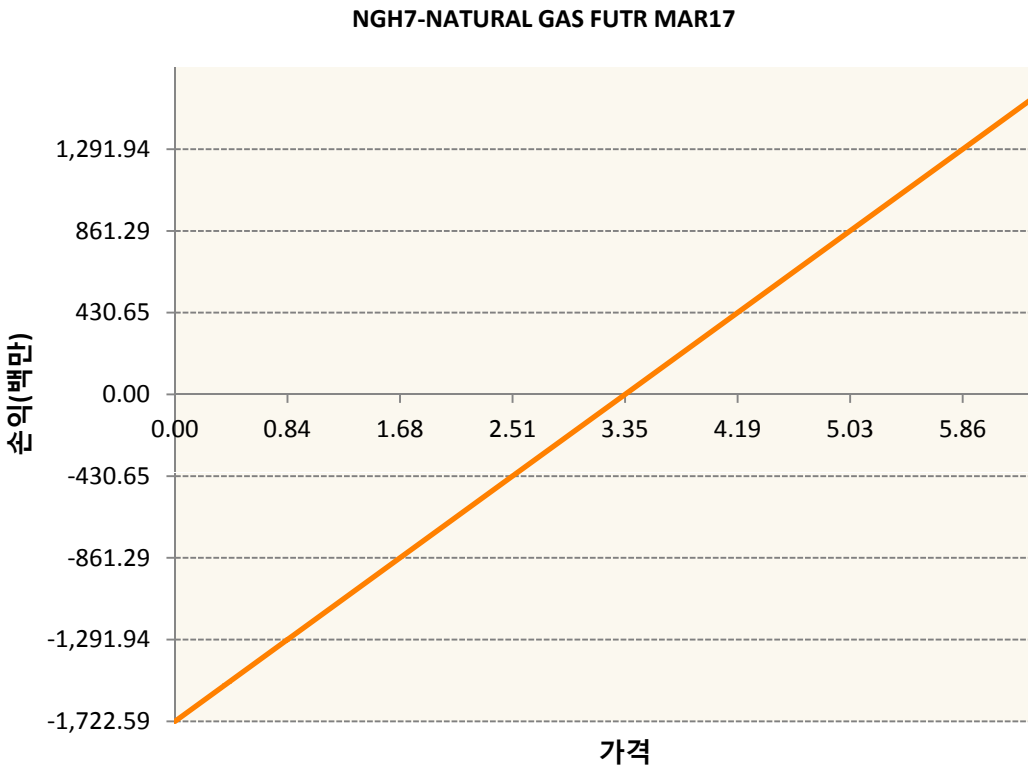


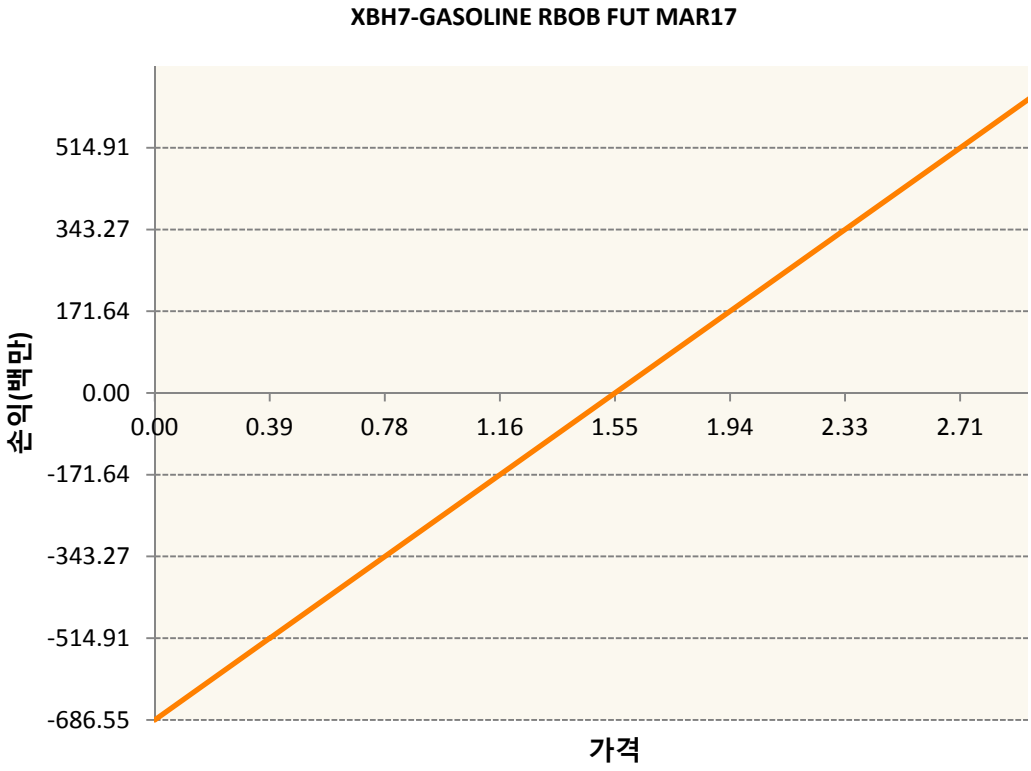

-924.12
-1,386.18
-1,848.24
가격


HOH7-NY Harb ULSD Fut MAR17
600.53
400.35
200.18
0.00
-200.18
-400.35
-600.53
-800.70
0.00
0.41
0.82
1.22
1.63
2.04
2.45
2.85
순익(백만)
가격


KR4175M20009-2017-02 달러선물
417.31
312.98
208.66
104.33
0.00
-104.33
-208.66
0.00
289.80
579.60
869.40
1,159.20
1,449.00
1,738.80
2,028.60
순익(백만)


-417.31
가격


NGH7-NATURAL GAS FUTR MAR17
1,291.94
861.29
430.65
0.00
-430.65
-861.29
-1,291.94
-1,722.59
0.00
0.84
1.68
2.51
3.35
4.19
5.03
5.86
순익(백만)
가격


XBH7-GASOLINE RBOB FUT MAR17
514.91
343.27
171.64
0.00
-171.64
-343.27
-514.91
-686.55
0.00
0.39
0.78
1.16
1.55
1.94
2.33
2.71
순익(백만)
가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLH7	WTI CRUDE FUTURE MAR17	109
COK7	BRENT CRUDE FUTR MAY17	148
HOH7	NY Harb ULSD Fut MAR17	64
KR4175M20(	2017-02 달러선물	33
NGH7	NATURAL GAS FUTR MAR17	138
XBH7	GASOLINE RBOB FUT MAR17	55

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

1,175

공시일	2017-01-31
기준일	2017-01-26

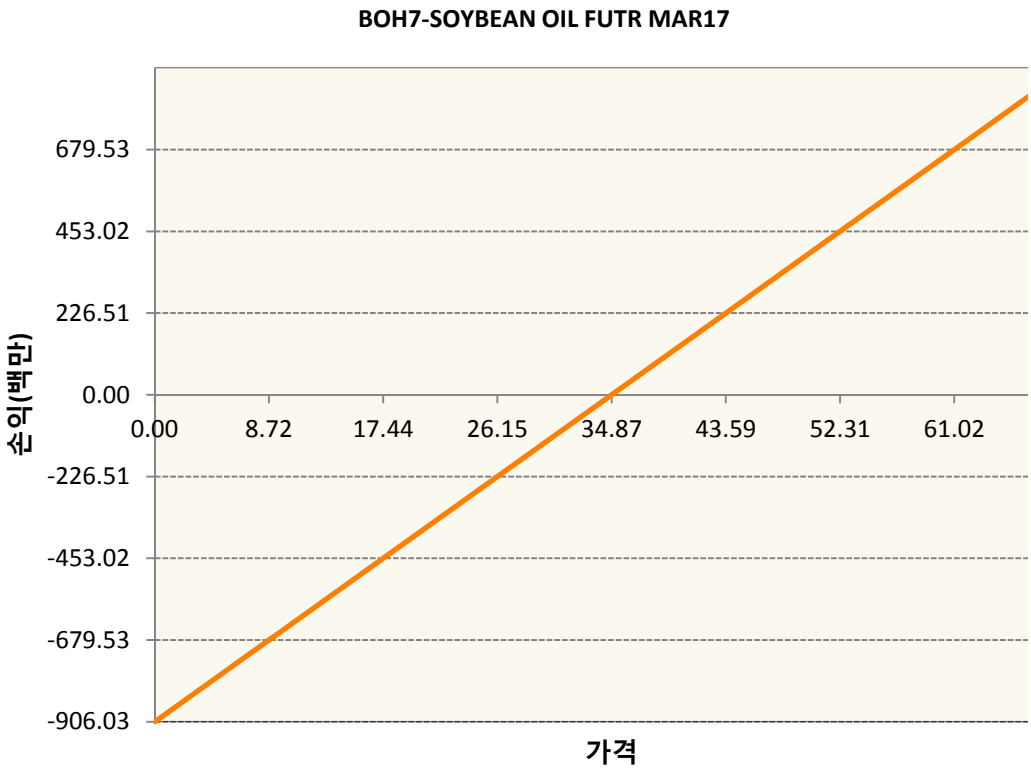
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

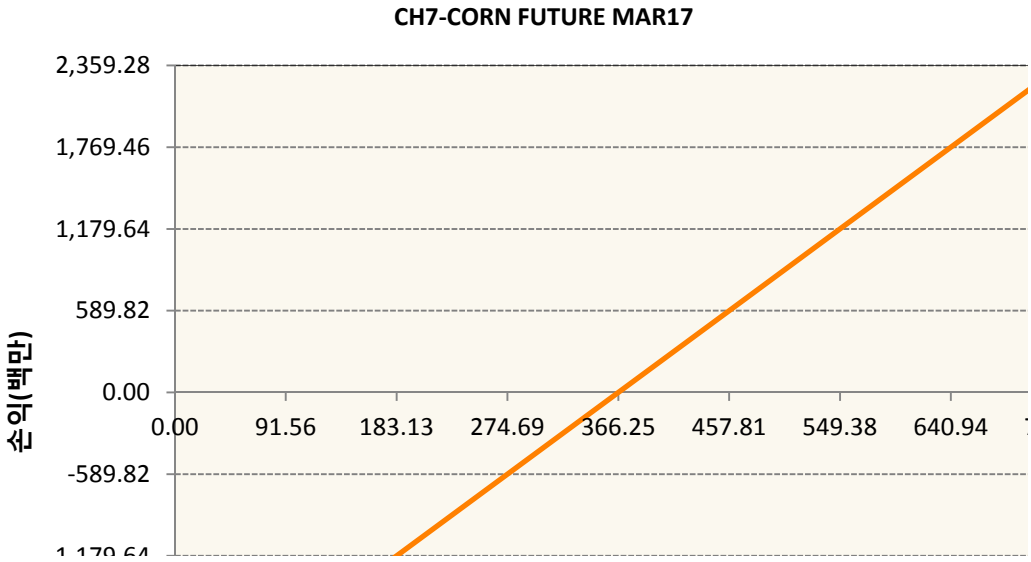
1. 계약금액

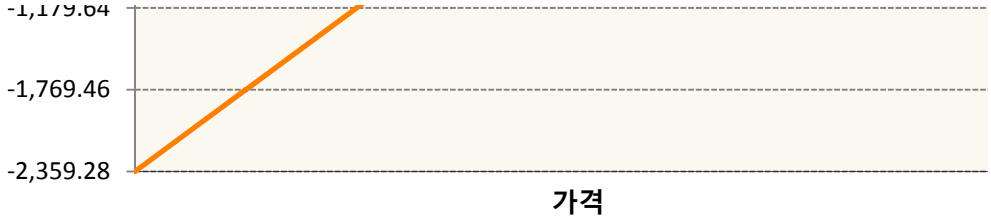
(단위:백만원)

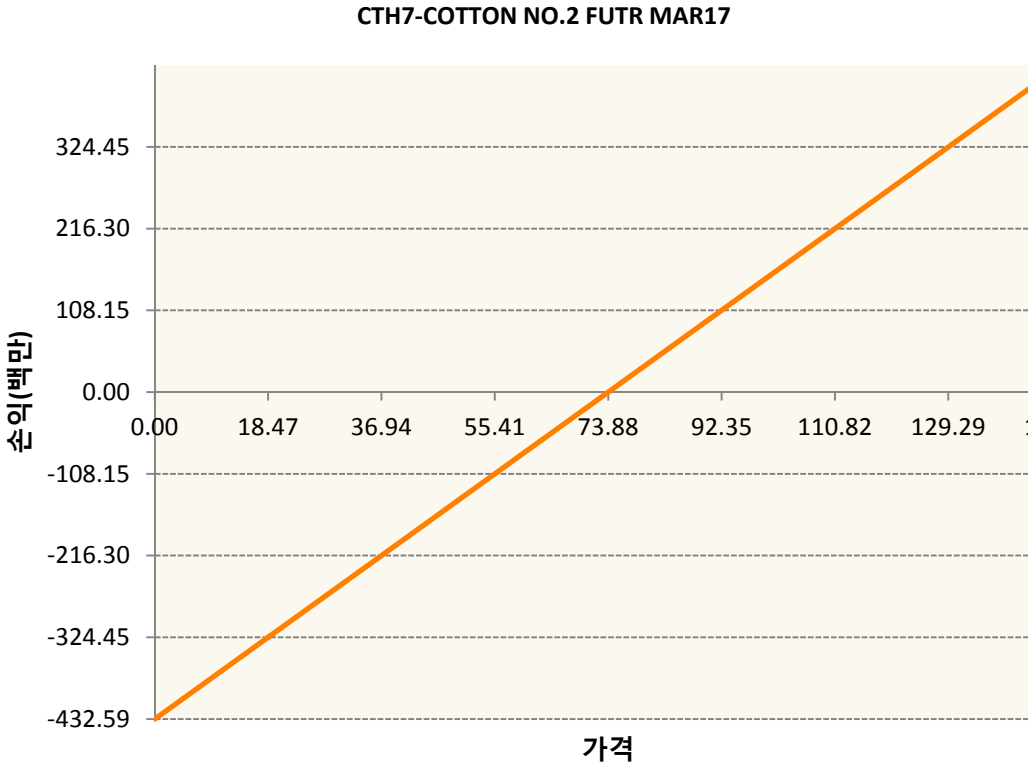
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	9,955	580	9,375	

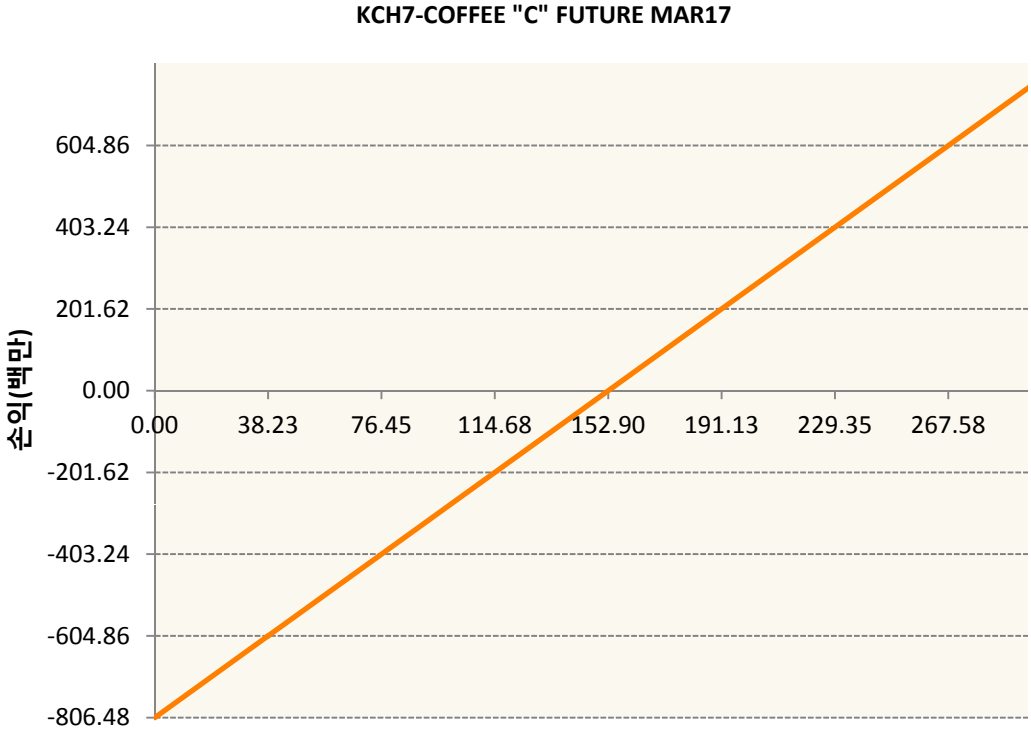
2. 만기시점의 손익구조



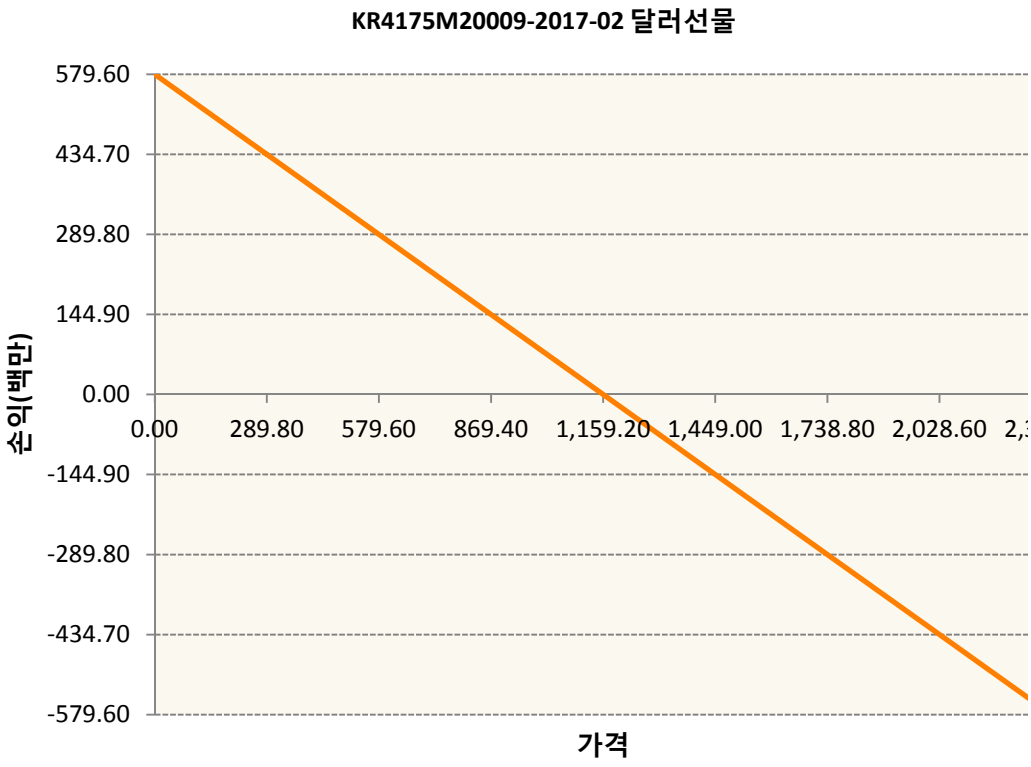


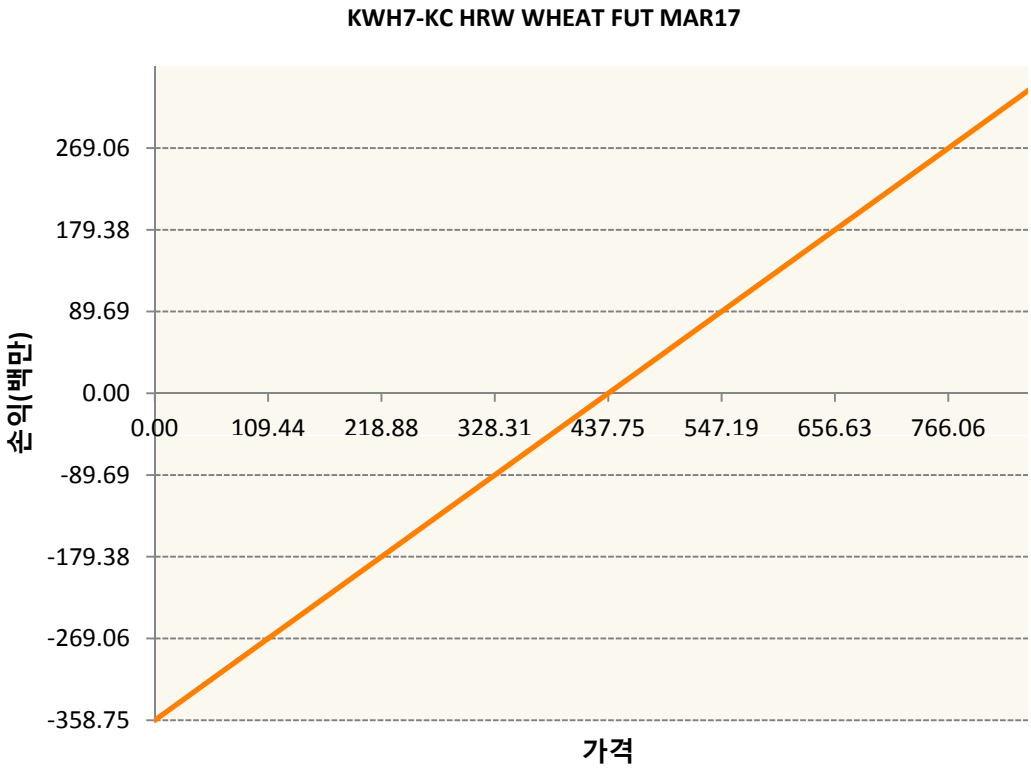

-1,769.46
-2,359.28
가격

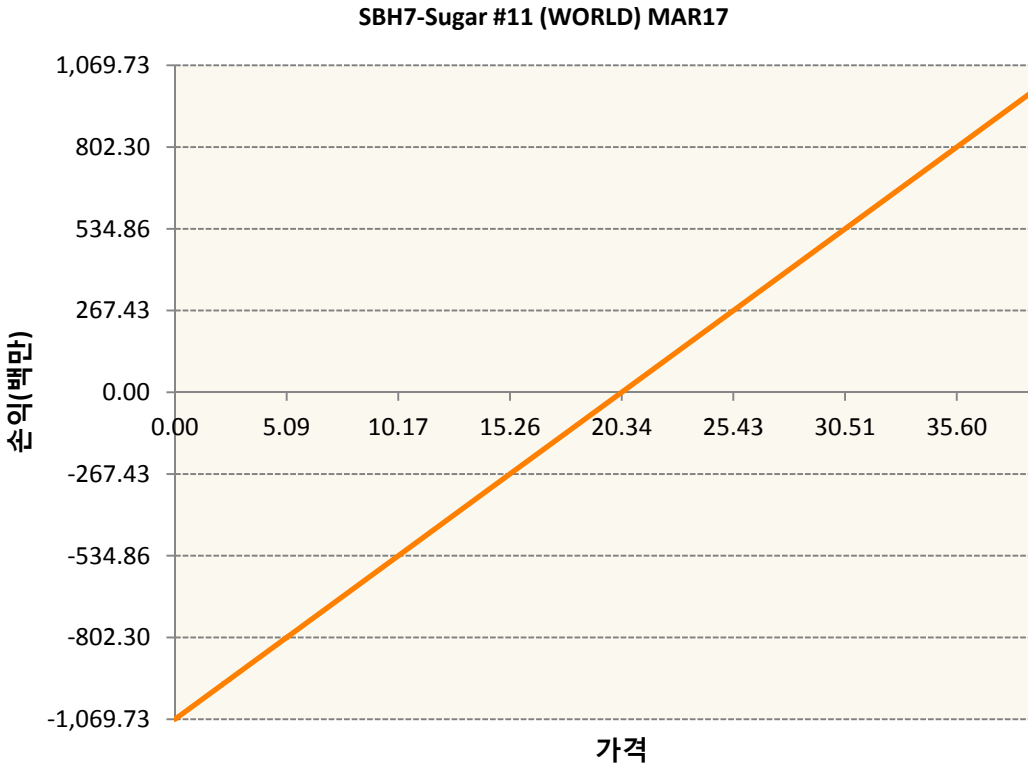

CTH7-COTTON NO.2 FUTR MAR17
324.45
216.30
108.15
0.00
-108.15
-216.30
-324.45
-432.59
0.00
18.47
36.94
55.41
73.88
92.35
110.82
129.29
순익(백만)
가격

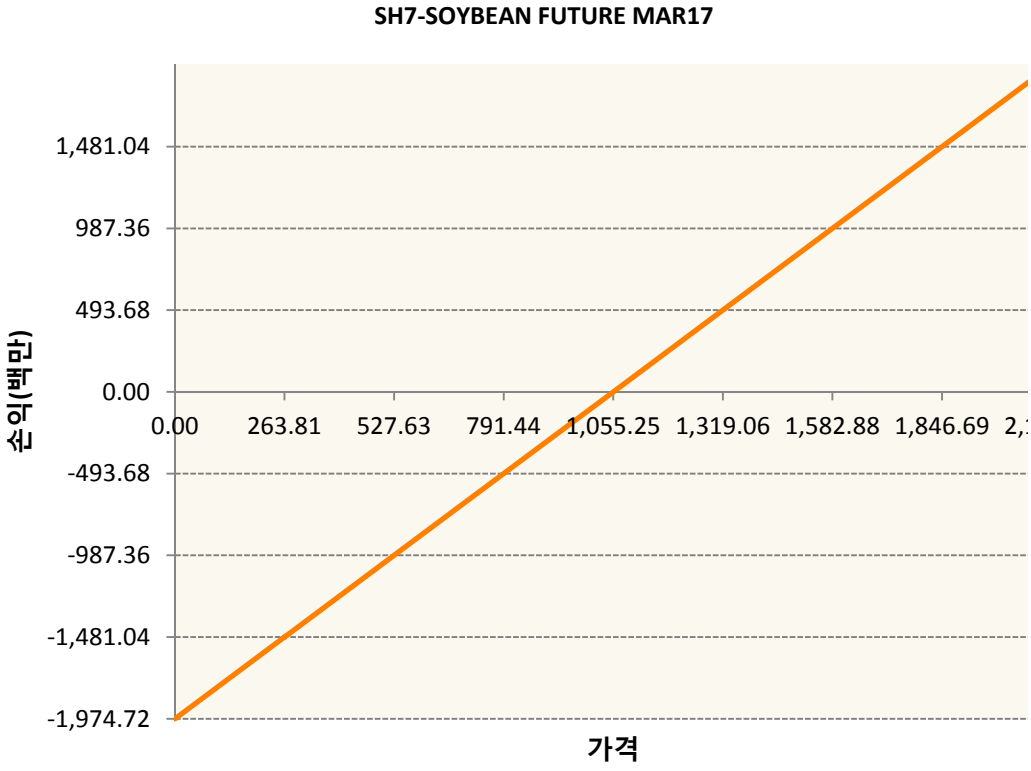

KCH7-COFFEE "C" FUTURE MAR17
604.86
403.24
201.62
0.00
-201.62
-403.24
-604.86
-806.48
0.00
38.23
76.45
114.68
152.90
191.13
229.35
267.58
순익(백만)

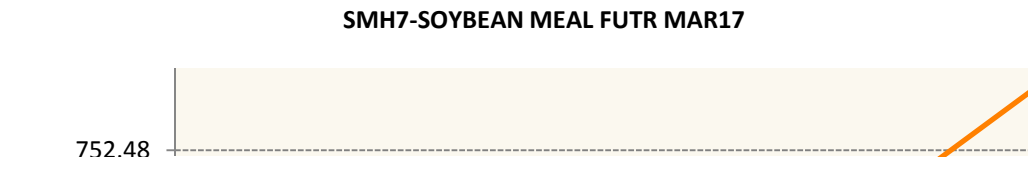
가격

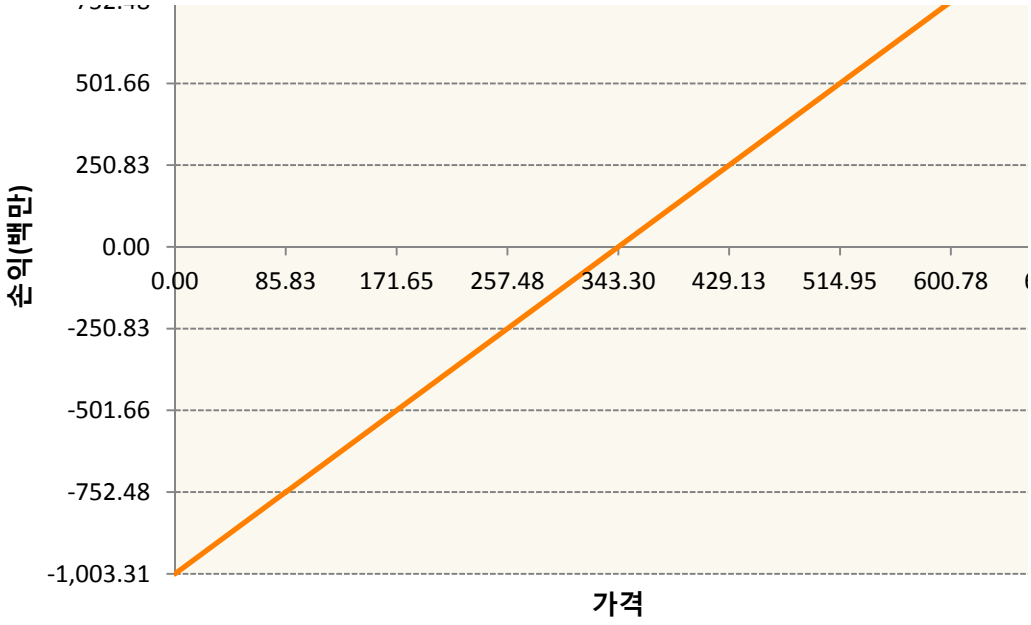

KR4175M20009-2017-02 달러선물
579.60
434.70
289.80
144.90
0.00
-144.90
-289.80
-434.70
-579.60
0.00
289.80
579.60
869.40
1,159.20
1,449.00
1,738.80
2,028.60
손익(백만)
가격

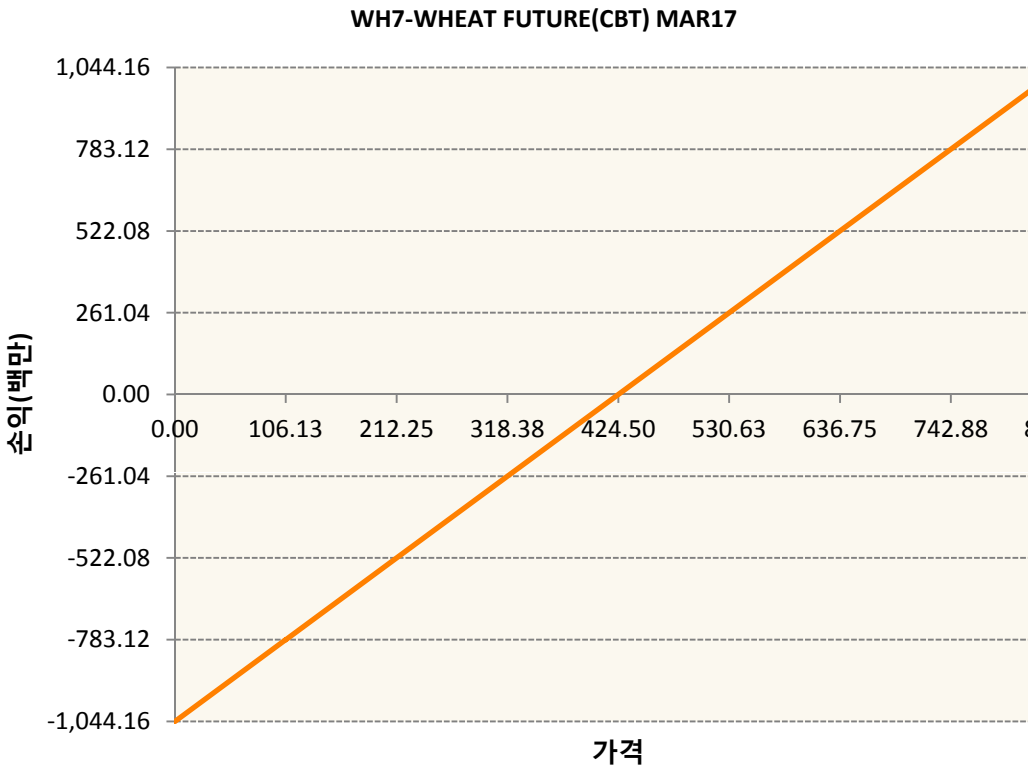

KWH7-KC HRW WHEAT FUT MAR17
269.06
179.38
89.69
0.00
-89.69
-179.38
-269.06
-358.75
0.00
109.44
218.88
328.31
437.75
547.19
656.63
766.06
손익(백만)
가격


SBH7-Sugar #11 (WORLD) MAR17
1,069.73
802.30
534.86
267.43
0.00
-267.43
-534.86
-802.30
-1,069.73
0.00
5.09
10.17
15.26
20.34
25.43
30.51
35.60
손익(백만)
가격


SH7-SOYBEAN FUTURE MAR17
1,481.04
987.36
493.68
0.00
-493.68
-987.36
-1,481.04
-1,974.72
0.00
263.81
527.63
791.44
1,055.25
1,319.06
1,582.88
1,846.69
손익(백만)
가격


SMH7-SOYBEAN MEAL FUTR MAR17
752.48





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

BOH7	SOYBEAN OIL FUTR MAR17	72
CH7	CORN FUTURE MAR17	189
CTH7	COTTON NO.2 FUTR MAR17	35
KCH7	COFFEE "C" FUTURE MAR17	65
KR4175M20(	2017-02 달러선물	46

KWH7	KC HRW WHEAT FUT MAR17	29
SBH7	Sugar #11 (WORLD) MAR17	86
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)

946