공시일	2017-02-10
기준일	2017-02-09

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	2017-02-10
기준일	2017-02-09

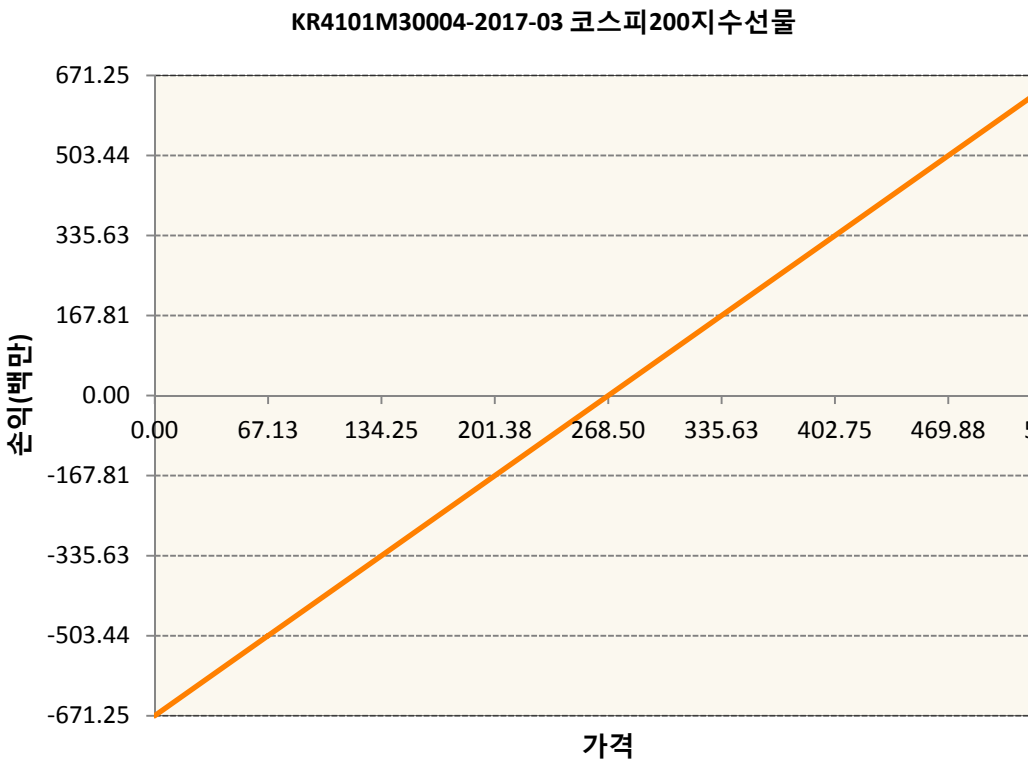
스마트인덱스모

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)

36

공시일	2017-02-10
기준일	2017-02-09

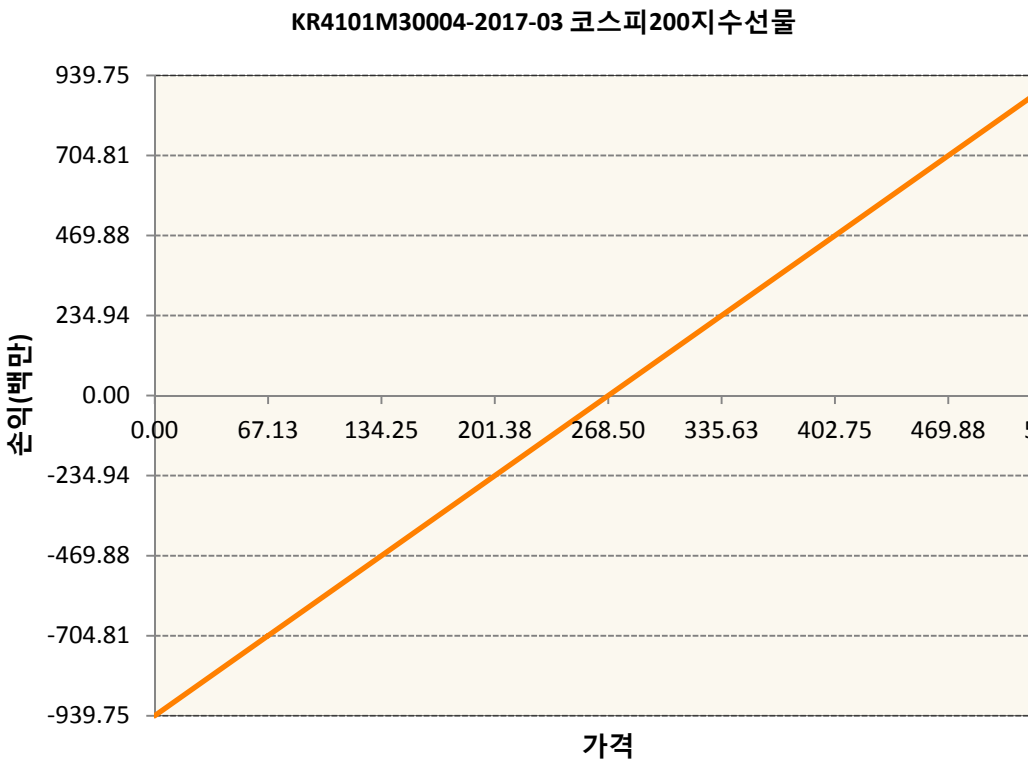
스마트레버리지목표전환형1호

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	940	0	940	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)

51

공시일	2017-02-10
기준일	2017-02-09

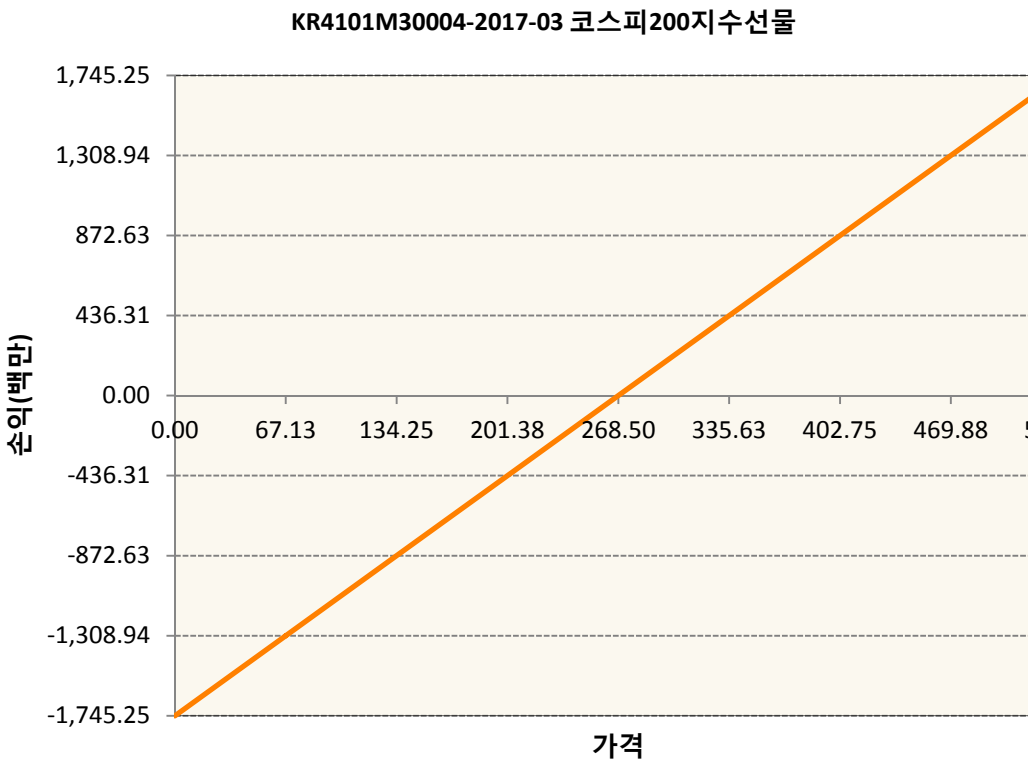
1.3배 레버리지 인덱스(주식-파생형)

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	1,745	0	1,745	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)

94

공시일	2017-02-10
기준일	2017-02-09

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	930

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

656

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-02-10
기준일	2017-02-09

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	384

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

542

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-02-10
기준일	2017-02-09

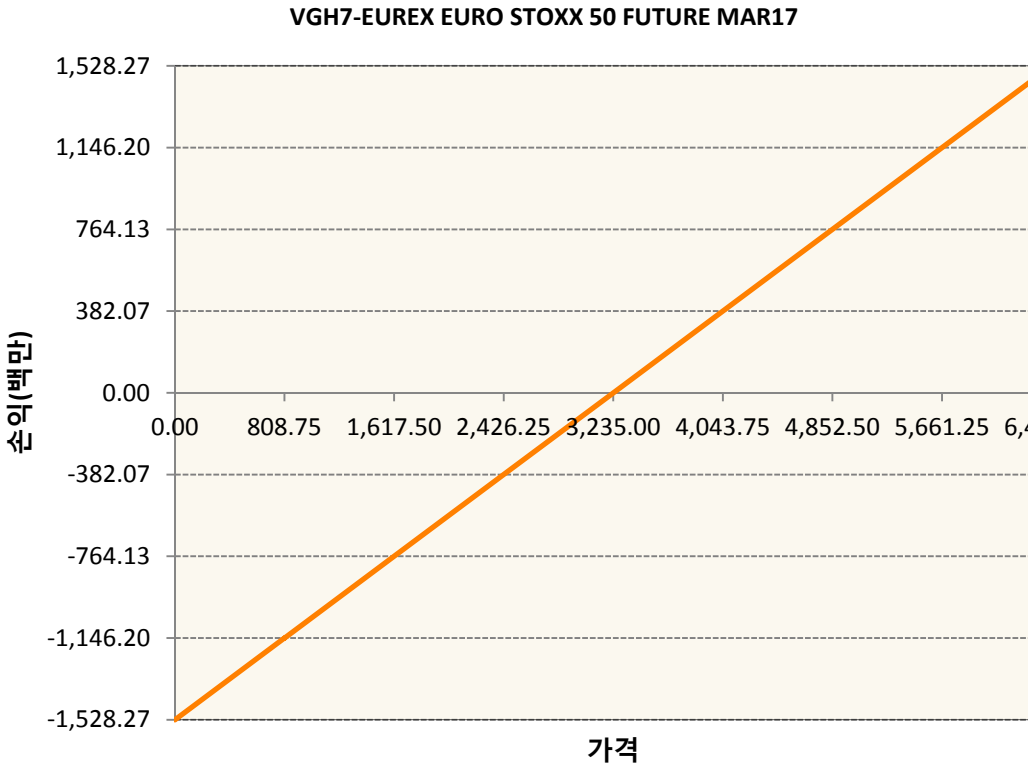
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,528	0	1,528	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGH7	EUREX EURO STOXX 50 FUTURE MAR17	122

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

(단위:백만원)

130

공시일	2017-02-10
기준일	2017-02-09

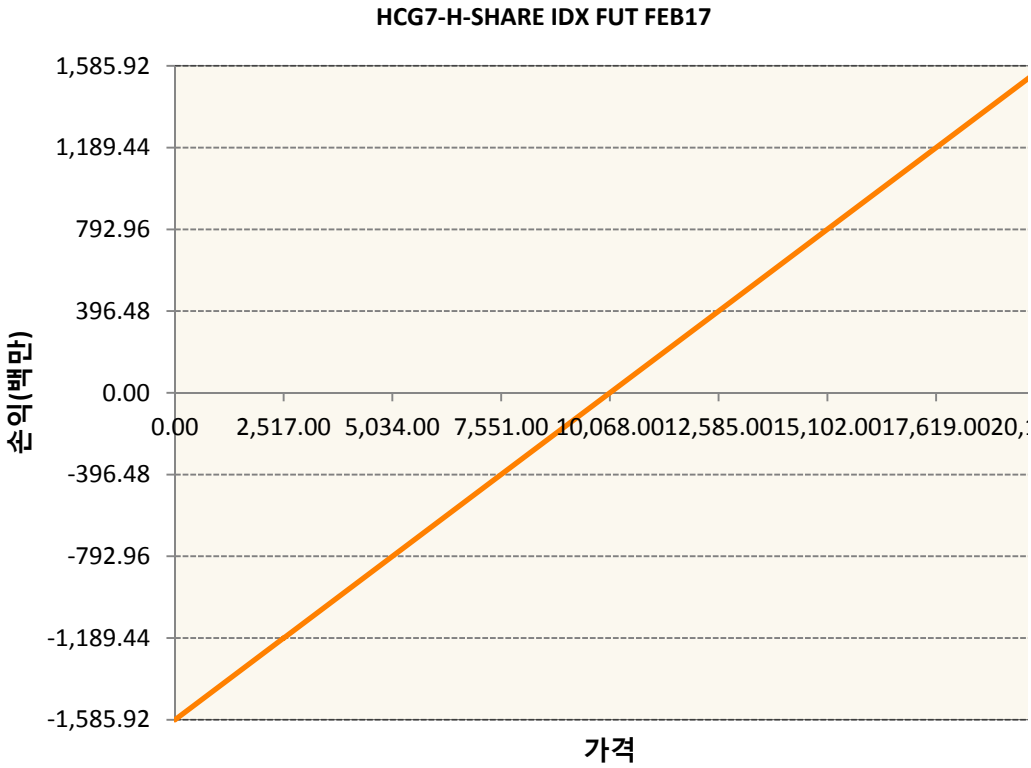
차이나인덱스모(주식-파생형)

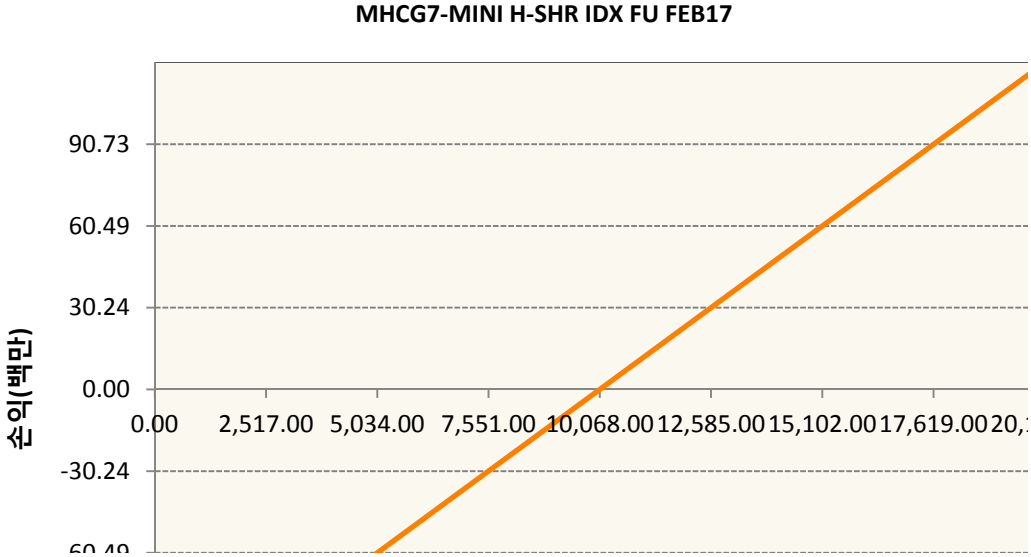
1. 계약금액

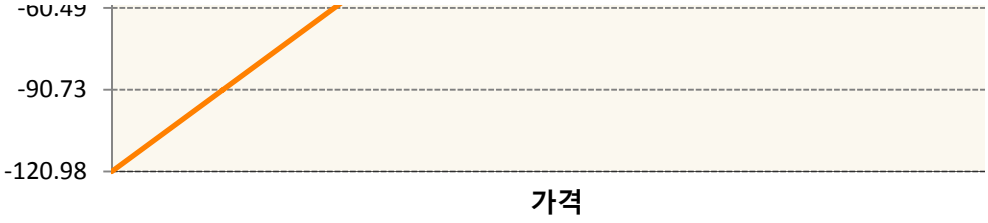
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,707	0	1,707	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCG7	H-SHARE IDX FUT FEB17	127
MHCG7	MINI H-SHR IDX FU FEB17	10

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	160

공시일	2017-02-10
기준일	2017-02-09

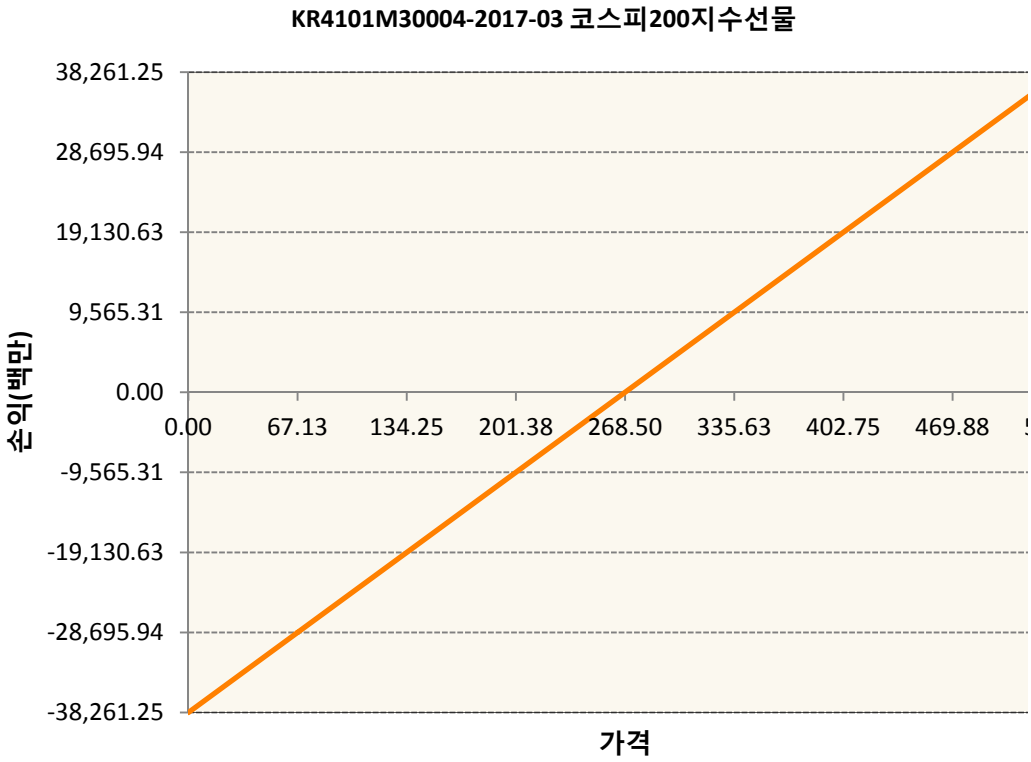
커버드콜모(주식혼합-파생형)

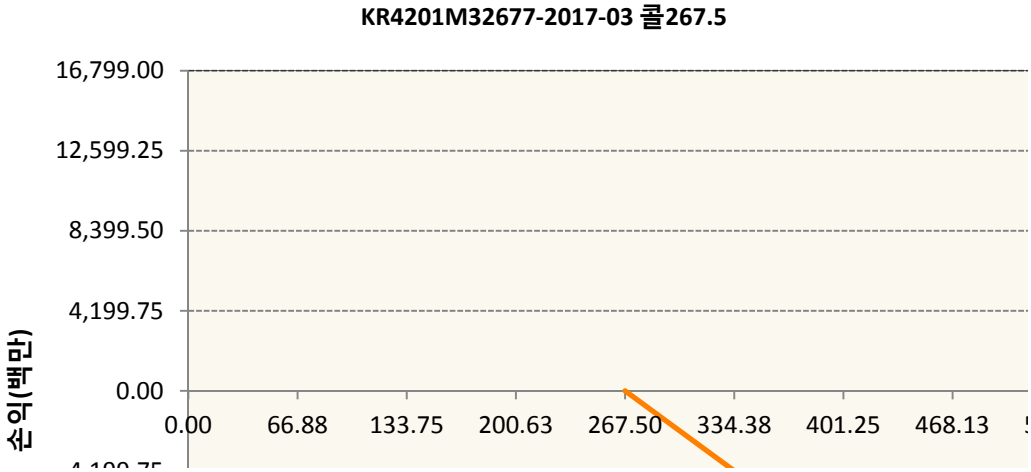
1. 계약금액

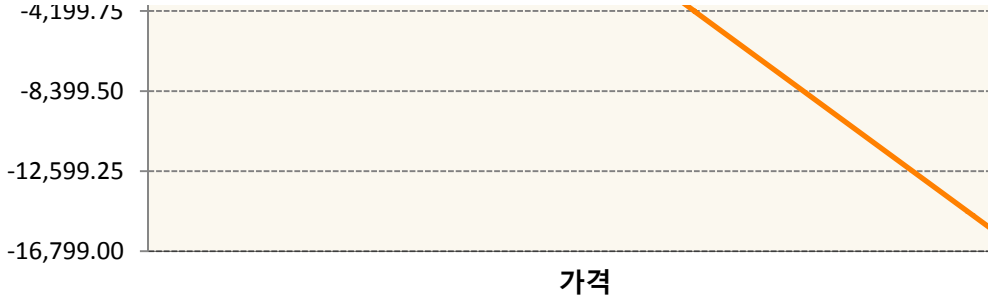
(단위:백만원)

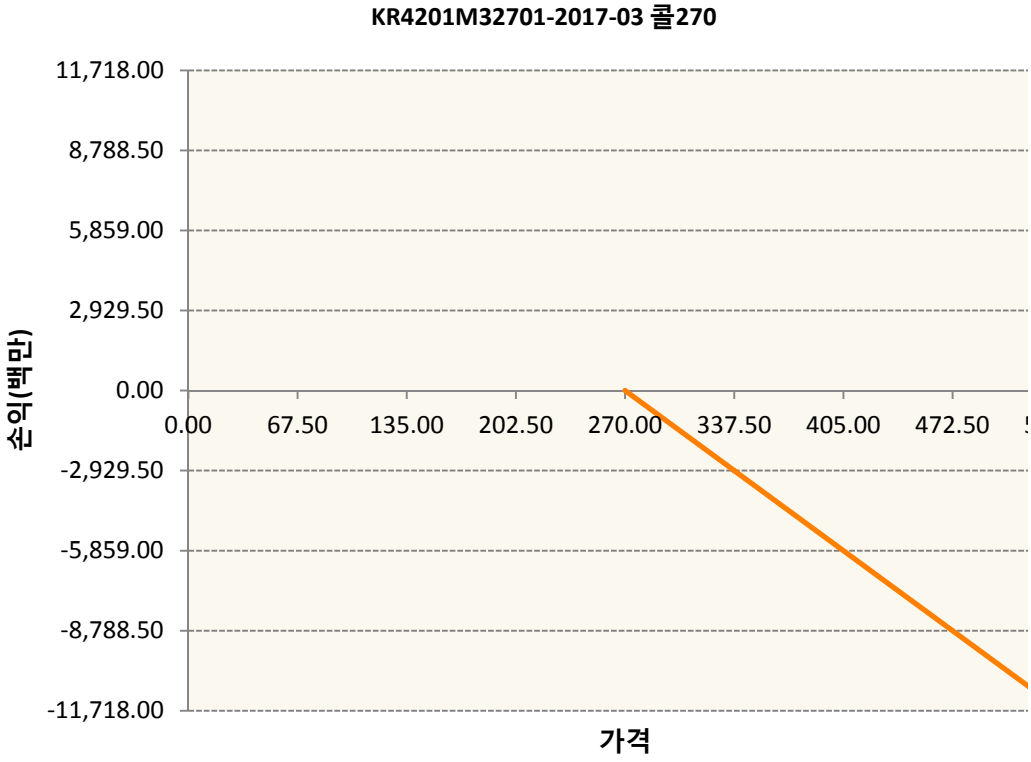
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	28,834	-28,834	장내
누계	유가증권	선물	38,261	0	38,261	장내
누계	유가증권	옵션	0	28,517	-28,517	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101M30(2017-03 코스피200지수선물							3,052
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-3,052	-3,052	-3,052	-3,052	-3,052	-3,052	-3,052
-5.33%	-2,034	-2,034	-2,034	-2,034	-2,034	-2,034	-2,034
-2.67%	-1,017	-1,017	-1,017	-1,017	-1,017	-1,017	-1,017
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	1,017	1,017	1,017	1,017	1,017	1,017	1,017
5.33%	2,034	2,034	2,034	2,034	2,034	2,034	2,034
8.00%	3,052	3,052	3,052	3,052	3,052	3,052	3,052
KR4201M32(2017-03 콜267.5							5,774
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,041	1,041	1,040	1,039	1,037	1,032	1,026
-5.33%	1,036	1,030	1,020	1,006	988	965	938
-2.67%	929	884	834	779	721	660	596
0%	251	167	84	0	-84	-167	-251
2.67%	-1,378	-1,422	-1,471	-1,525	-1,583	-1,644	-1,708
5.33%	-3,519	-3,526	-3,537	-3,553	-3,573	-3,598	-3,628
8.00%	-5,752	-5,752	-5,753	-5,756	-5,760	-5,766	-5,774
KR4201M32: 2017-03 콜270							3,704
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	479	479	479	478	477	476	474
-5.33%	478	476	473	468	461	451	439
-2.67%	447	428	405	379	349	316	280
0%	165	111	56	0	-56	-112	-169
2.67%	-739	-783	-830	-878	-928	-979	-1,031
5.33%	-2,140	-2,151	-2,166	-2,185	-2,207	-2,233	-2,262
8.00%	-3,674	-3,675	-3,677	-3,681	-3,686	-3,694	-3,704

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

12,942

공시일	2017-02-10
기준일	2017-02-09

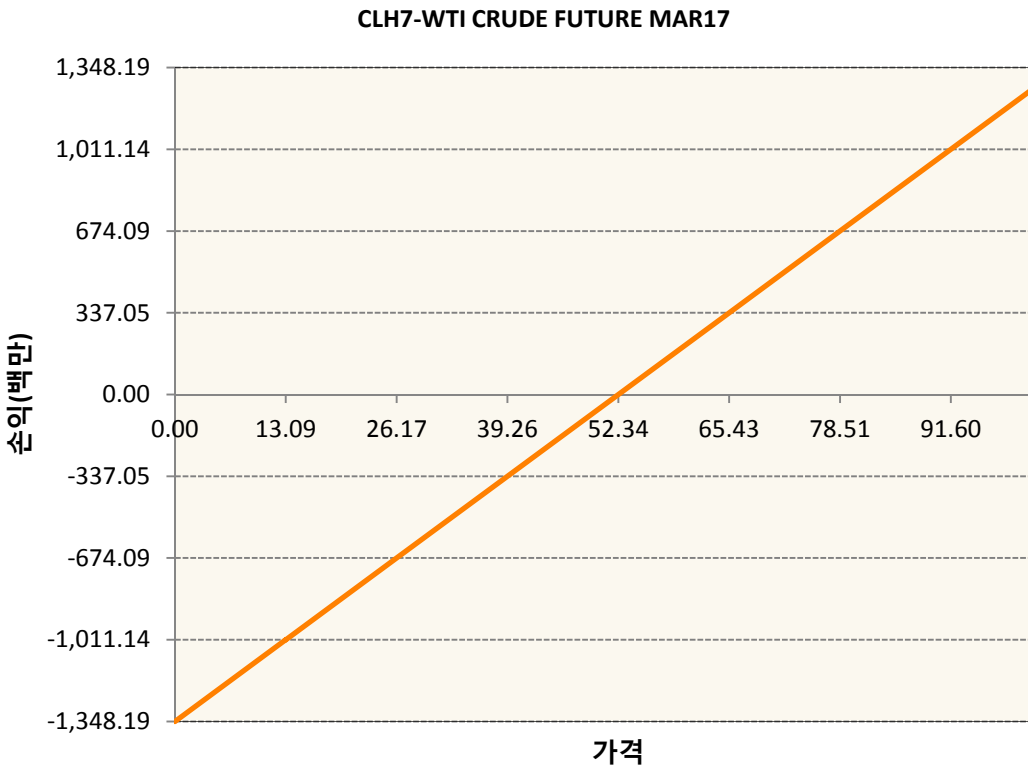
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

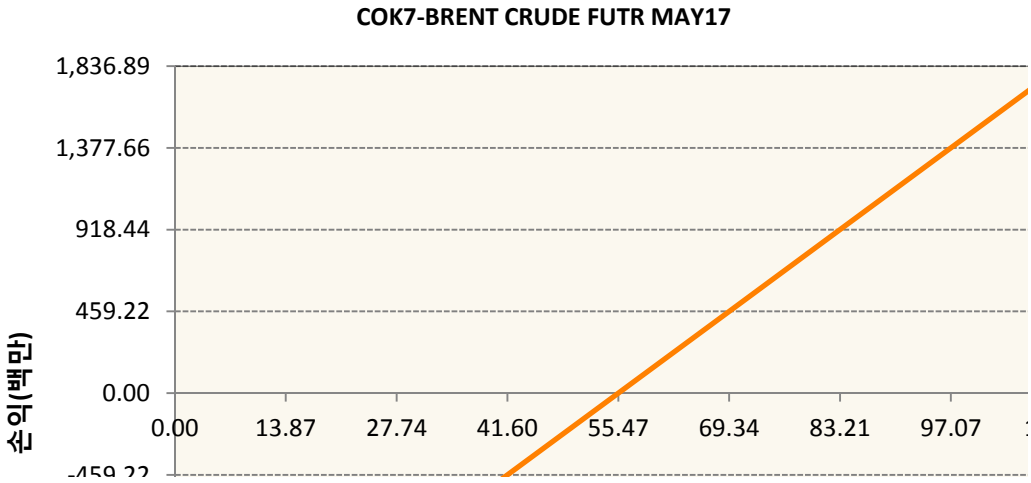
1. 계약금액

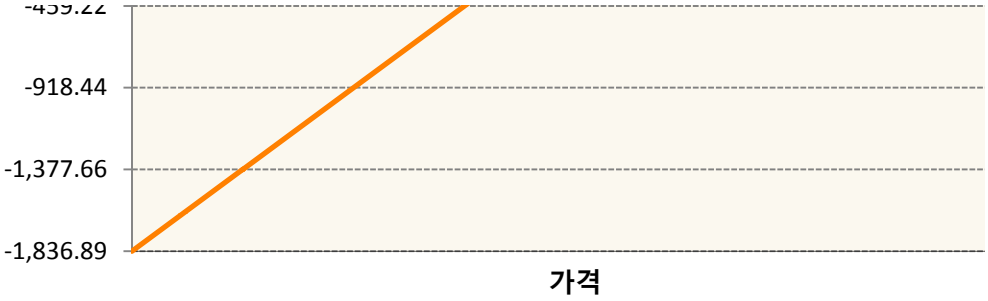
(단위:백만원)

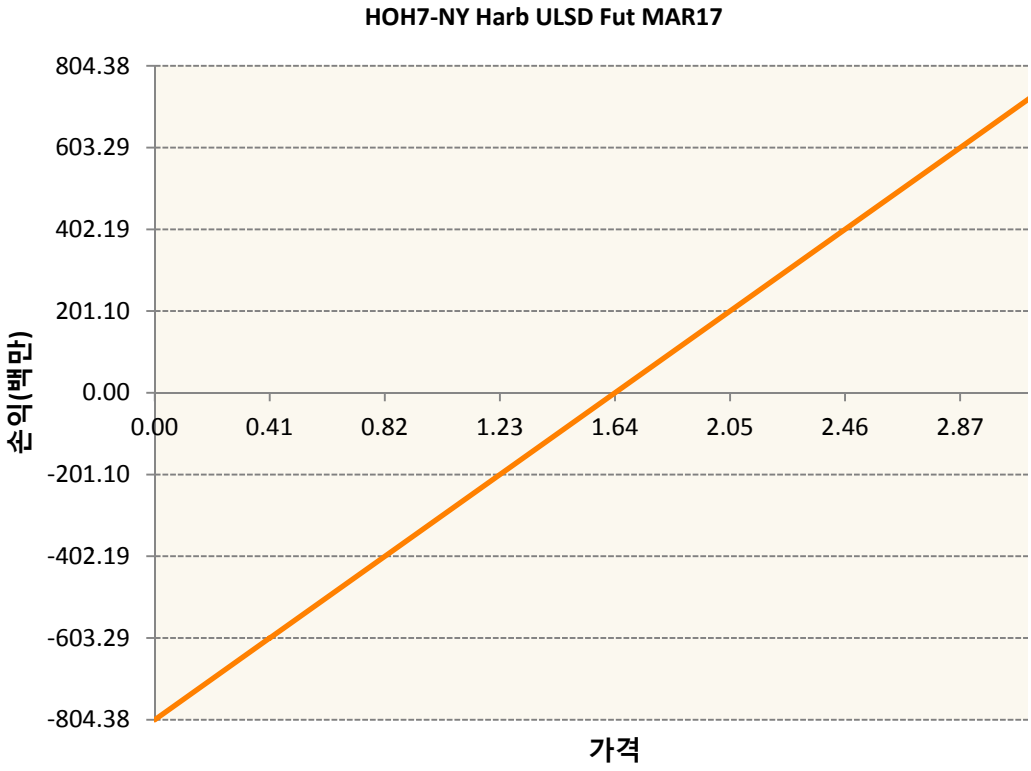
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	선물	유가증권	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	선물	유가증권	1,348	0	1,348	
누계	유가증권	선물	4,940	413	4,528	

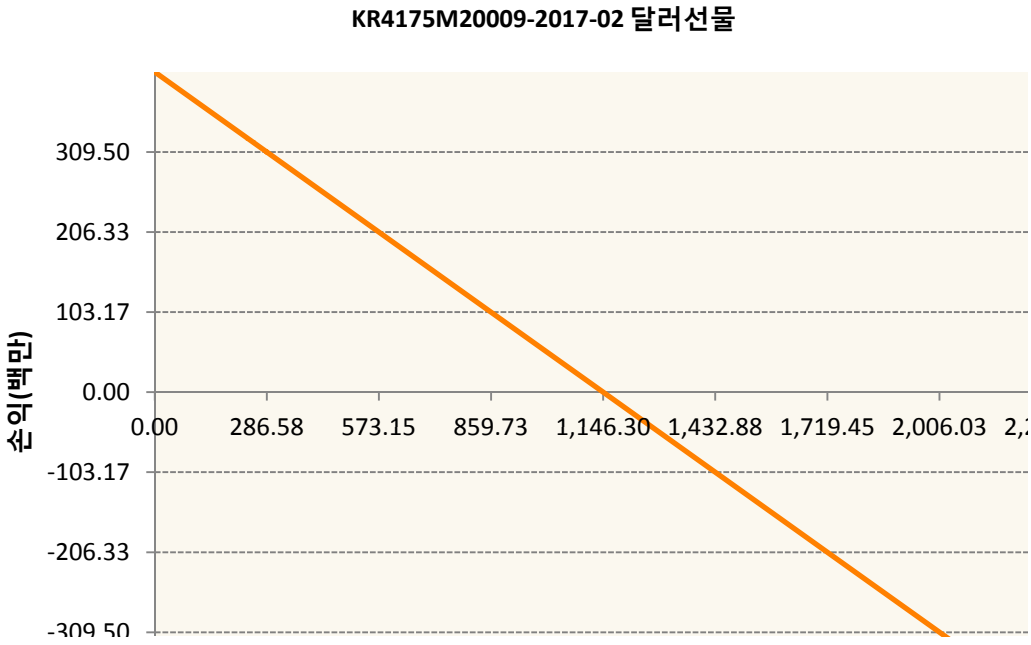
2. 만기시점의 손익구조

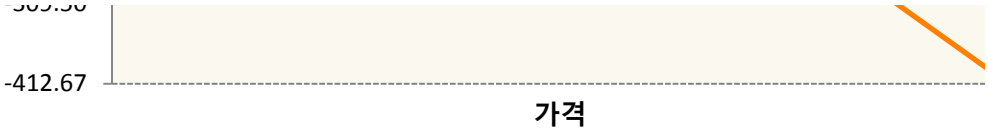


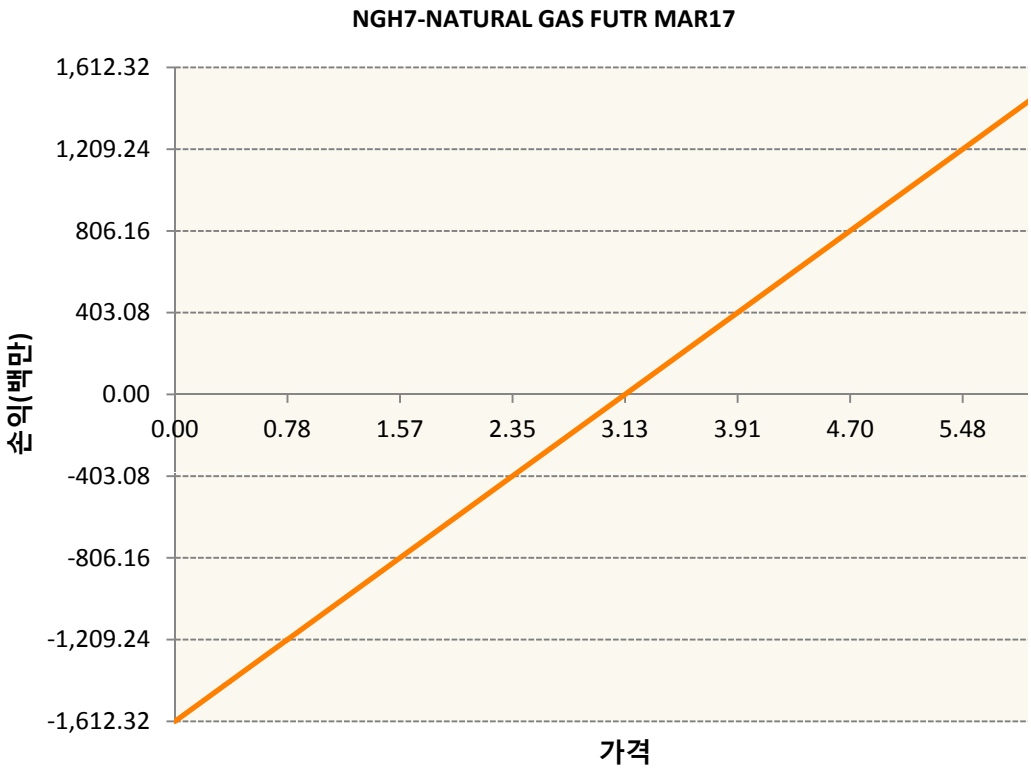


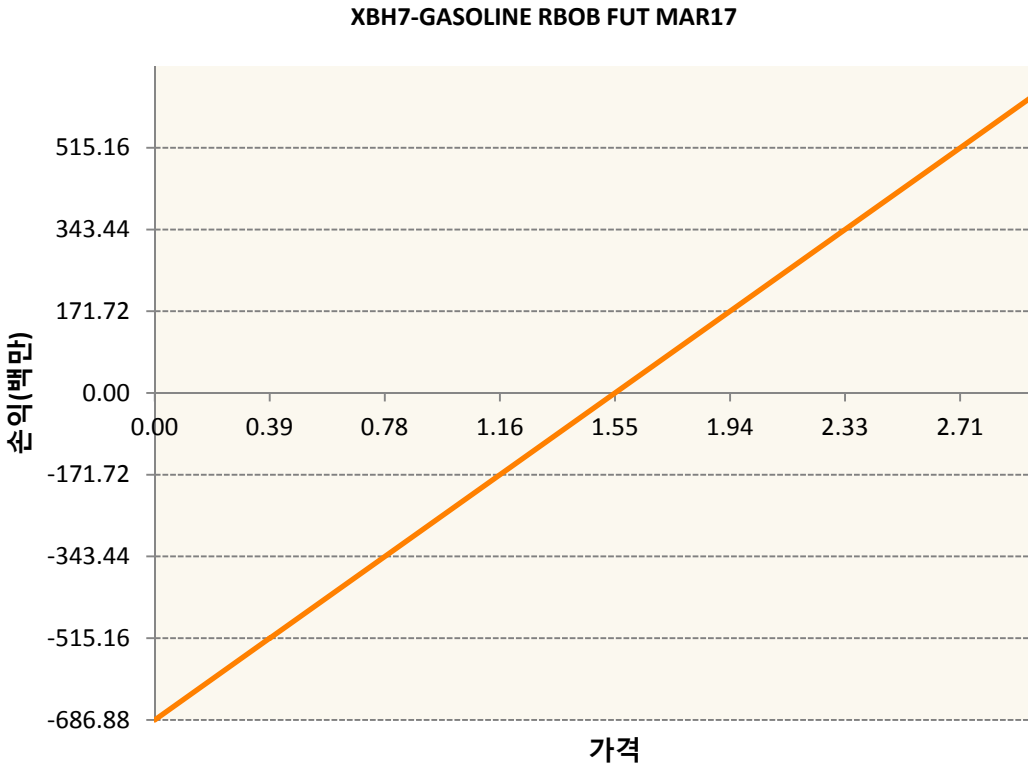

-459.22
-918.44
-1,377.66
-1,836.89
가격


HOH7-NY Harb ULSD Fut MAR17
804.38
603.29
402.19
201.10
0.00
-201.10
-402.19
-603.29
-804.38
0.00
0.41
0.82
1.23
1.64
2.05
2.46
2.87
순익(백만)
가격


KR4175M20009-2017-02 달러선물
309.50
206.33
103.17
0.00
-103.17
-206.33
-309.50
0.00
286.58
573.15
859.73
1,146.30
1,432.88
1,719.45
2,006.03
순익(백만)


-412.67
가격


NGH7-NATURAL GAS FUTR MAR17
1,612.32
1,209.24
806.16
403.08
0.00
-403.08
-806.16
-1,209.24
-1,612.32
0.00
0.78
1.57
2.35
3.13
3.91
4.70
5.48
순익(백만)
가격


XBH7-GASOLINE RBOB FUT MAR17
515.16
343.44
171.72
0.00
-171.72
-343.44
-515.16
-686.88
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	108
COK7	BRENT CRUDE FUTR MAY17	147
HOH7	NY Harb ULSD Fut MAR17	64
KR4175M20(	2017-02 달러선물	33
NGH7	NATURAL GAS FUTR MAR17	129
XBH7	GASOLINE RBOB FUT MAR17	55

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

1,120

공시일	2017-02-10
기준일	2017-02-09

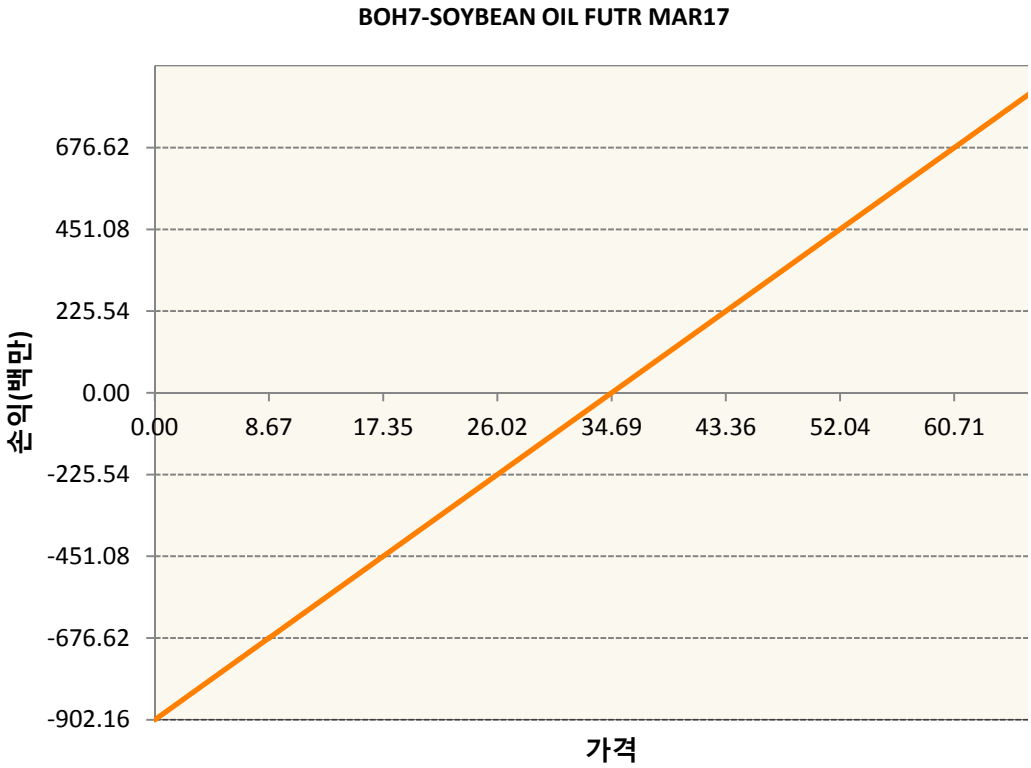
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

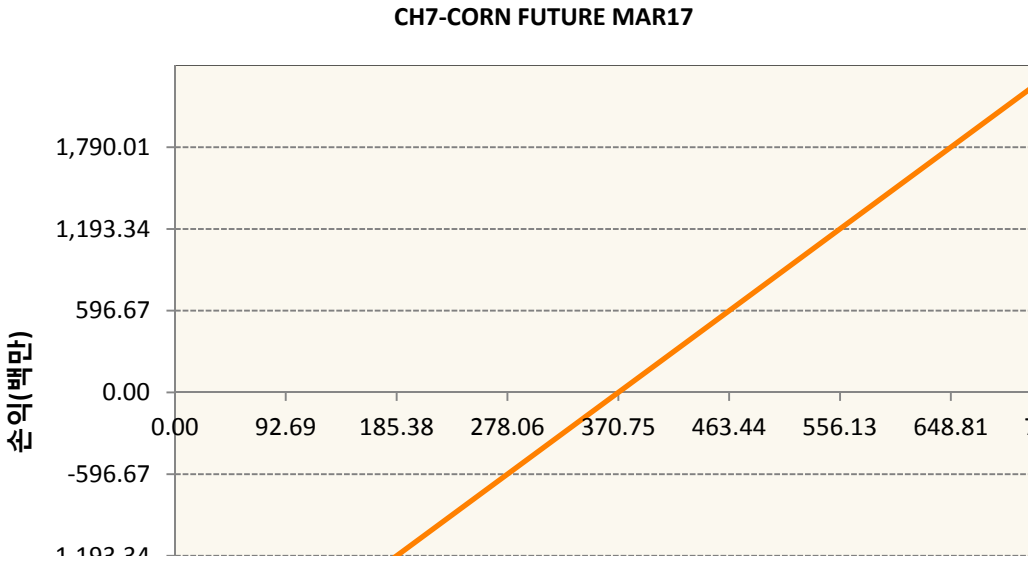
1. 계약금액

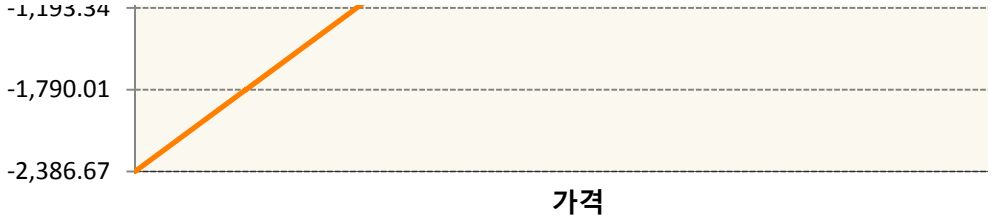
(단위:백만원)

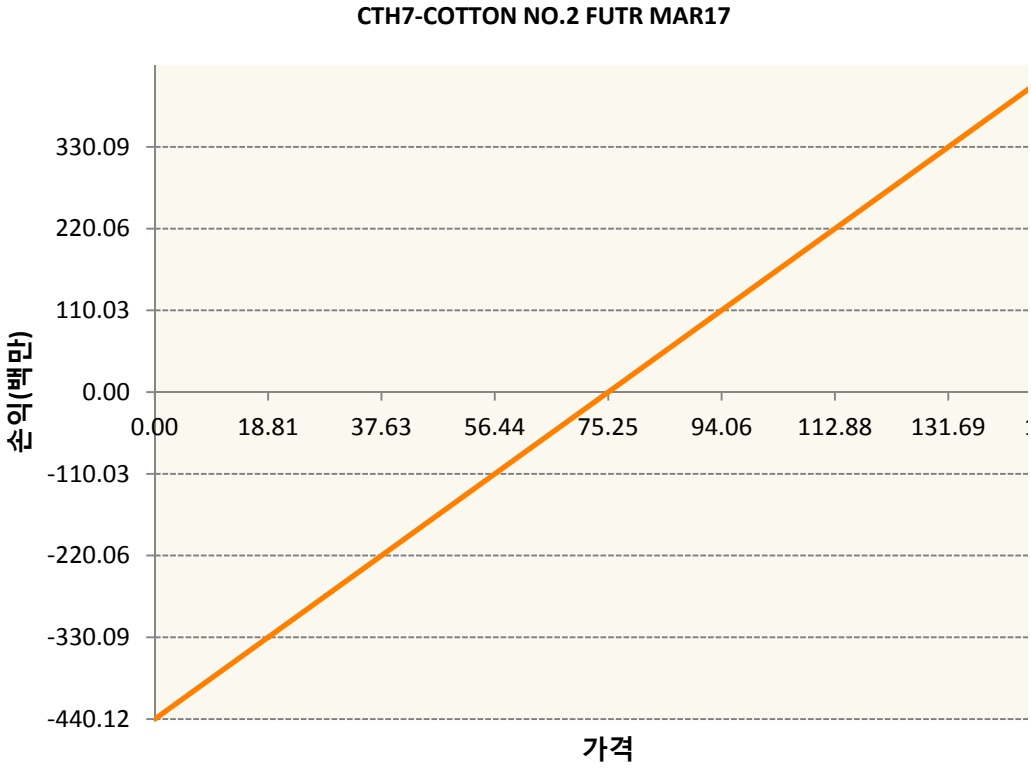
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	9,980	573	9,407	

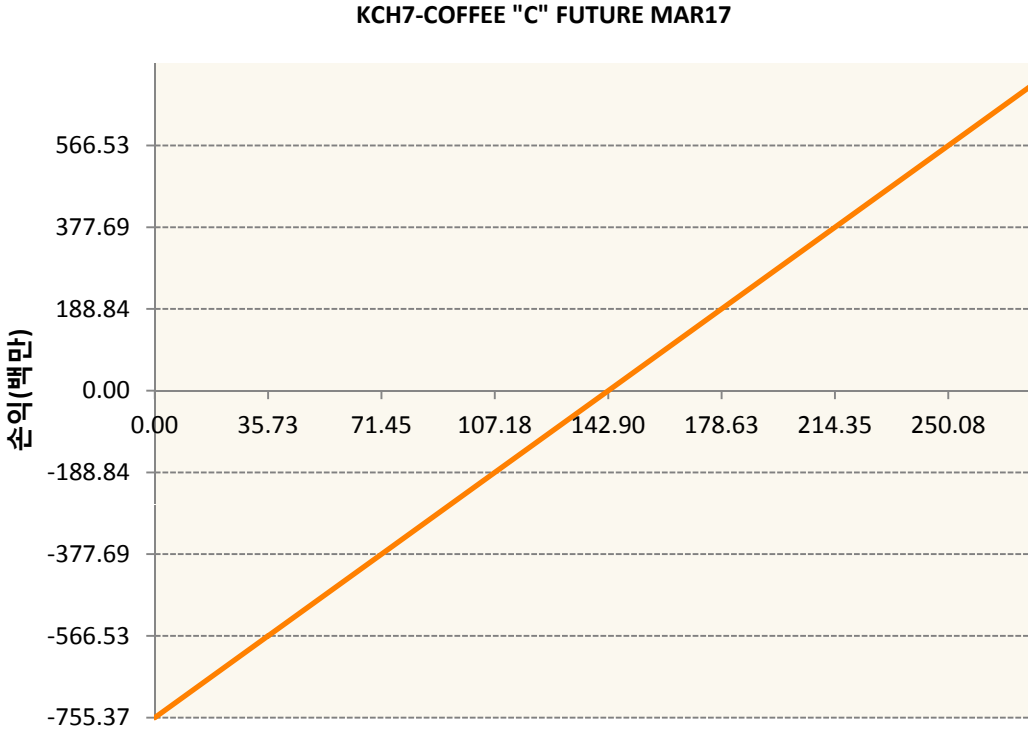
2. 만기시점의 손익구조



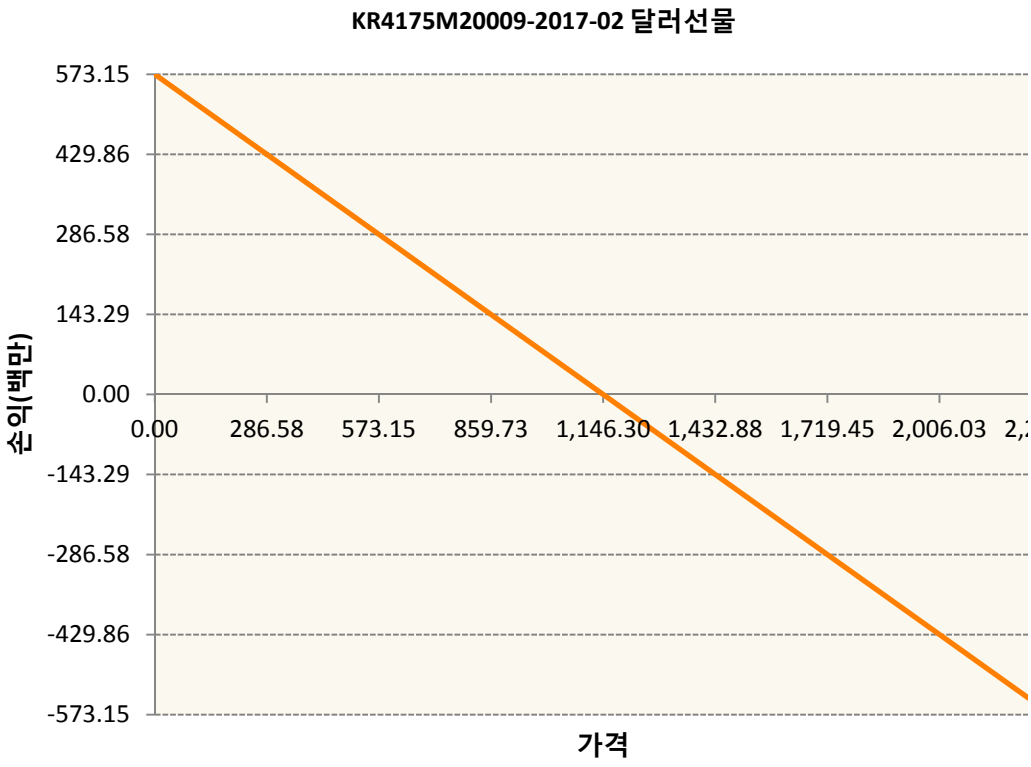


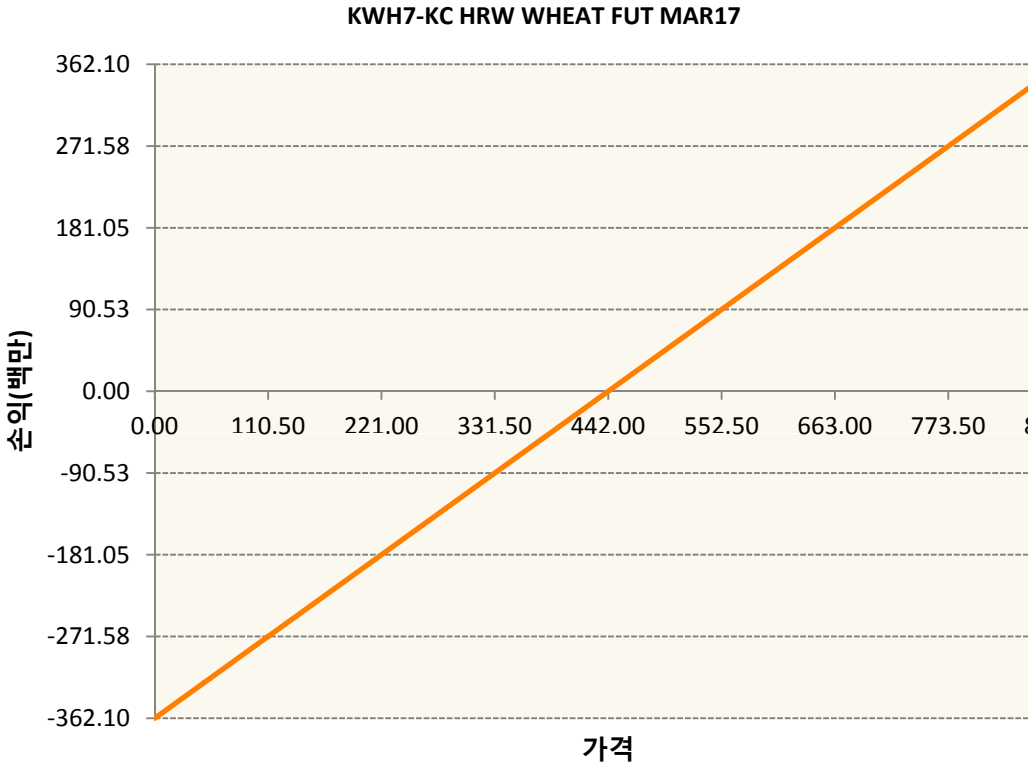

-1,790.01
-2,386.67
가격

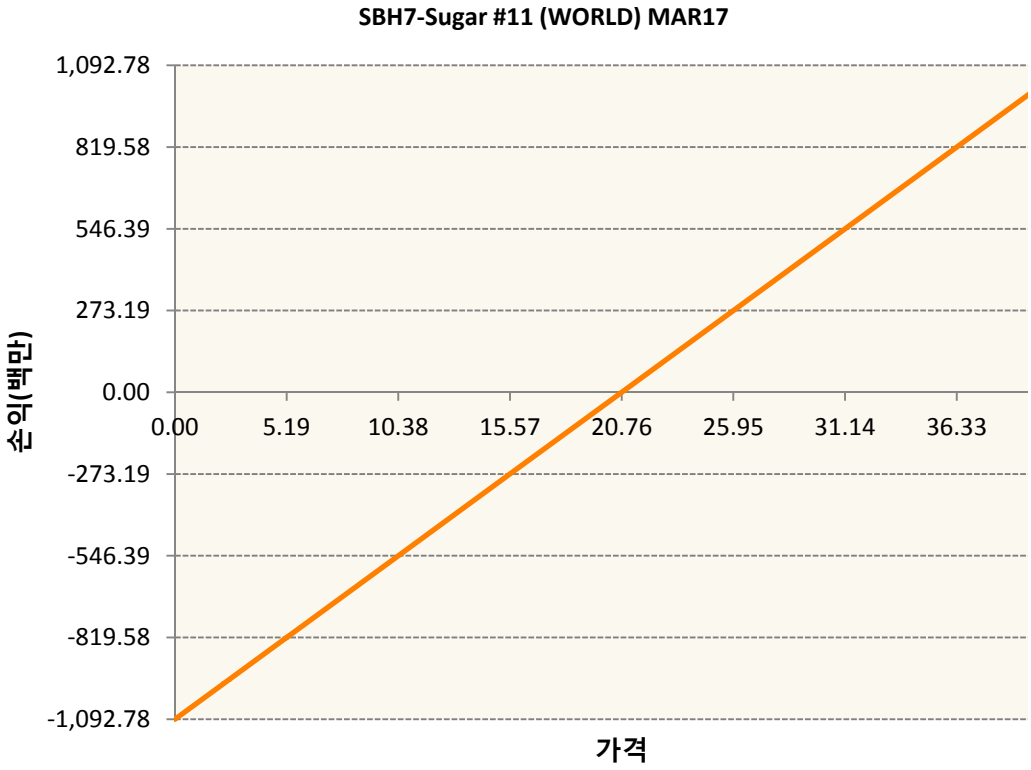

CTH7-COTTON NO.2 FUTR MAR17
330.09
220.06
110.03
0.00
-110.03
-220.06
-330.09
-440.12
0.00
18.81
37.63
56.44
75.25
94.06
112.88
131.69
순익(백만)
가격

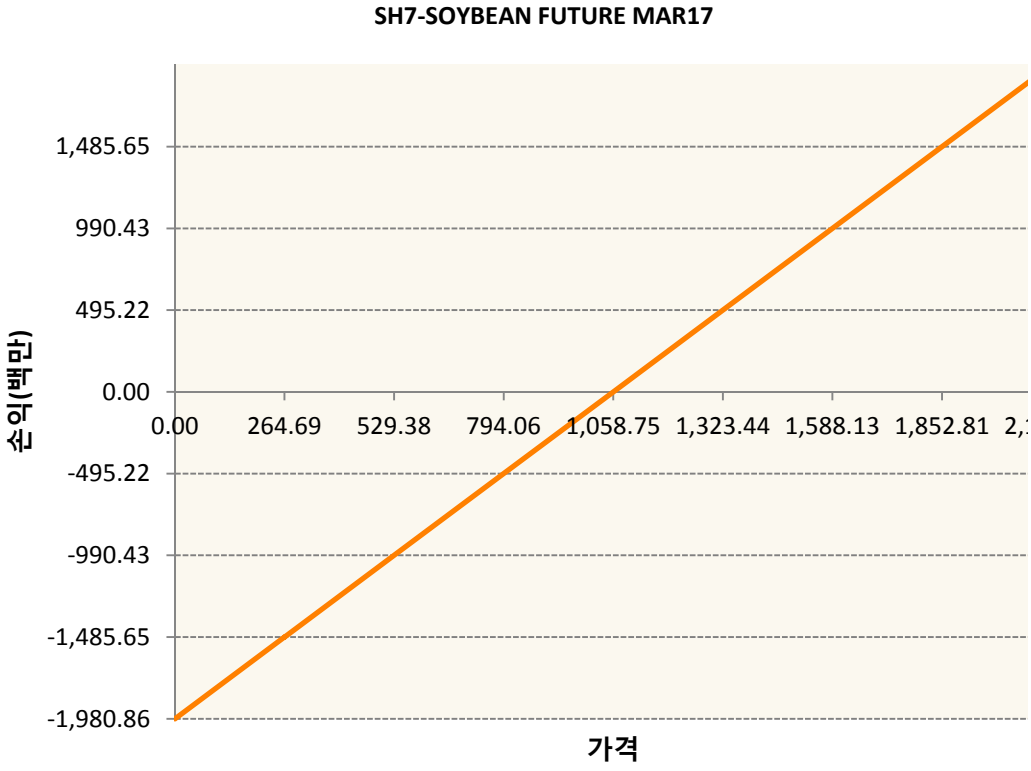

KCH7-COFFEE "C" FUTURE MAR17
566.53
377.69
188.84
0.00
-188.84
-377.69
-566.53
-755.37
0.00
35.73
71.45
107.18
142.90
178.63
214.35
250.08
순익(백만)

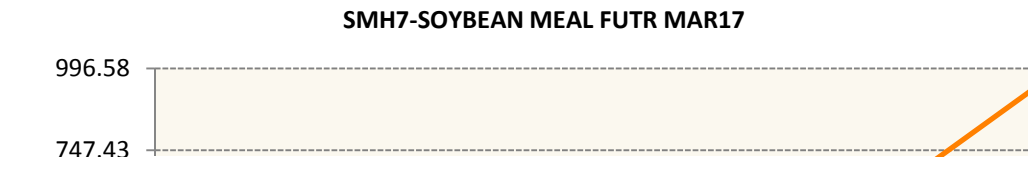
가격

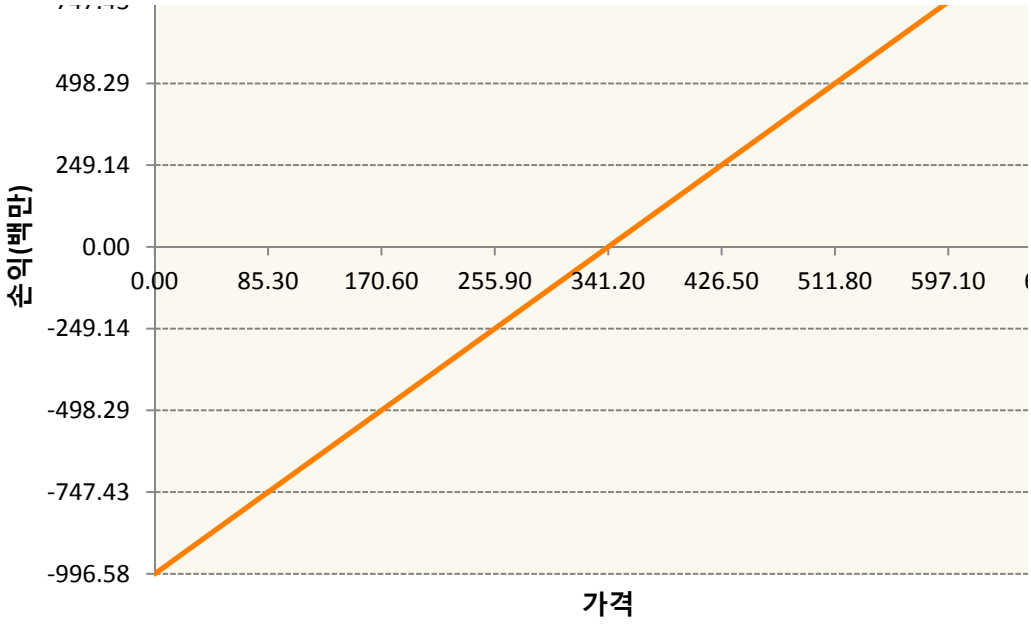

KR4175M20009-2017-02 달러선물
573.15
429.86
286.58
143.29
0.00
-143.29
-286.58
-429.86
-573.15
0.00
286.58
573.15
859.73
1,146.30
1,432.88
1,719.45
2,006.03
손익(백만)
가격

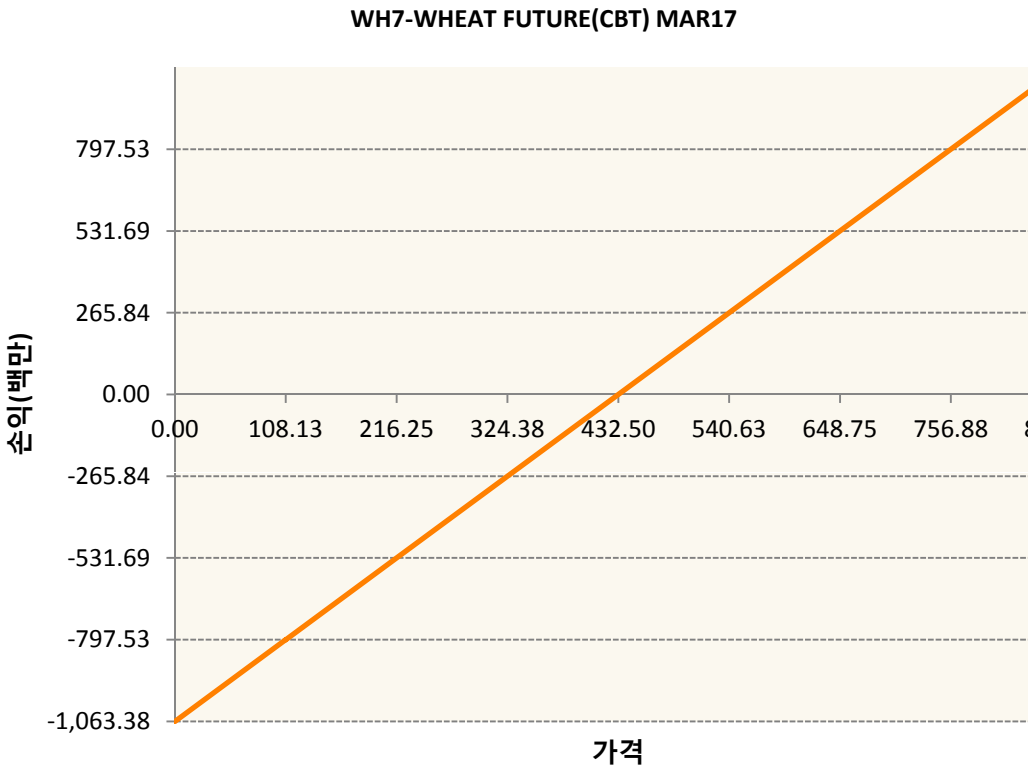

KWH7-KC HRW WHEAT FUT MAR17
362.10
271.58
181.05
90.53
0.00
-90.53
-181.05
-271.58
-362.10
0.00
110.50
221.00
331.50
442.00
552.50
663.00
773.50
손익(백만)
가격


SBH7-Sugar #11 (WORLD) MAR17
1,092.78
819.58
546.39
273.19
0.00
-273.19
-546.39
-819.58
-1,092.78
0.00
5.19
10.38
15.57
20.76
25.95
31.14
36.33
손익(백만)
가격


SH7-SOYBEAN FUTURE MAR17
1,485.65
990.43
495.22
0.00
-495.22
-990.43
-1,485.65
-1,980.86
0.00
264.69
529.38
794.06
1,058.75
1,323.44
1,588.13
1,852.81
손익(백만)
가격


SMH7-SOYBEAN MEAL FUTR MAR17
996.58
747.43





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

BOH7	SOYBEAN OIL FUTR MAR17	72
CH7	CORN FUTURE MAR17	191
CTH7	COTTON NO.2 FUTR MAR17	35
KCH7	COFFEE "C" FUTURE MAR17	60
KR4175M20(	2017-02 달러선물	46

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)

942