공시일	2016-11-21
기준일	2016-11-18

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	11	0	11	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	2016-11-21
기준일	2016-11-18

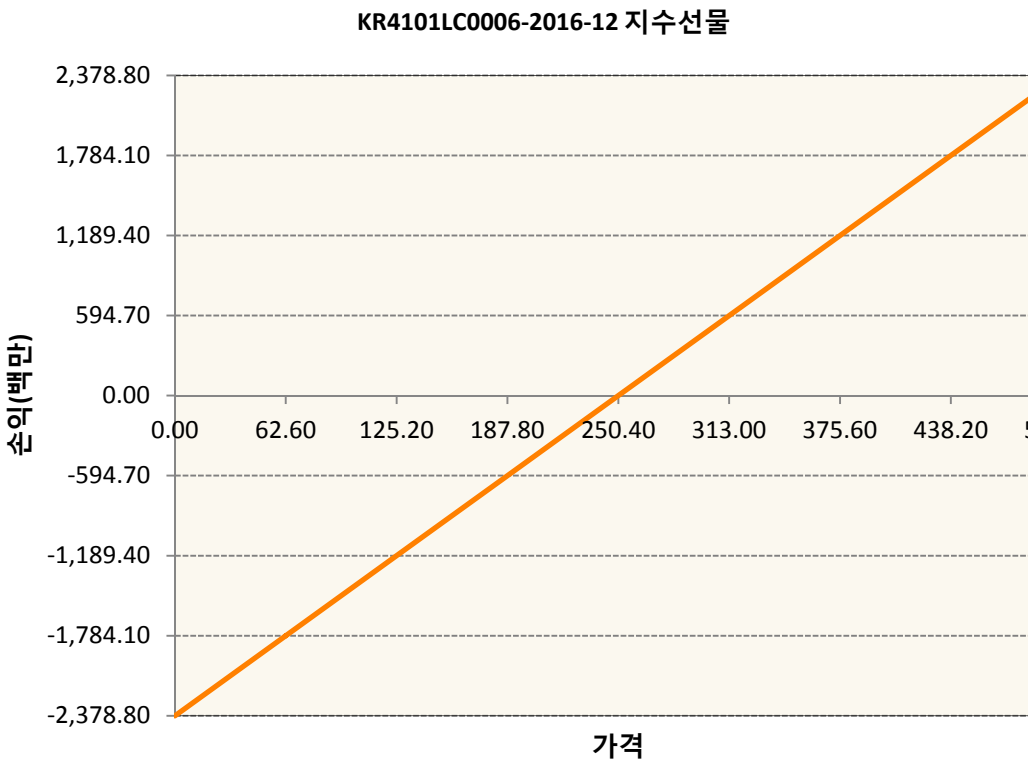
스마트인덱스모

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	2,379	0	2,379	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101LC00 2016-12 지수선물							190
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-190	-190	-190	-190	-190	-190	-190
-5.33%	-127	-127	-127	-127	-127	-127	-127
-2.67%	-63	-63	-63	-63	-63	-63	-63
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	63	63	63	63	63	63	63
5.33%	127	127	127	127	127	127	127
8.00%	190	190	190	190	190	190	190

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

148

공시일	2016-11-21
기준일	2016-11-18

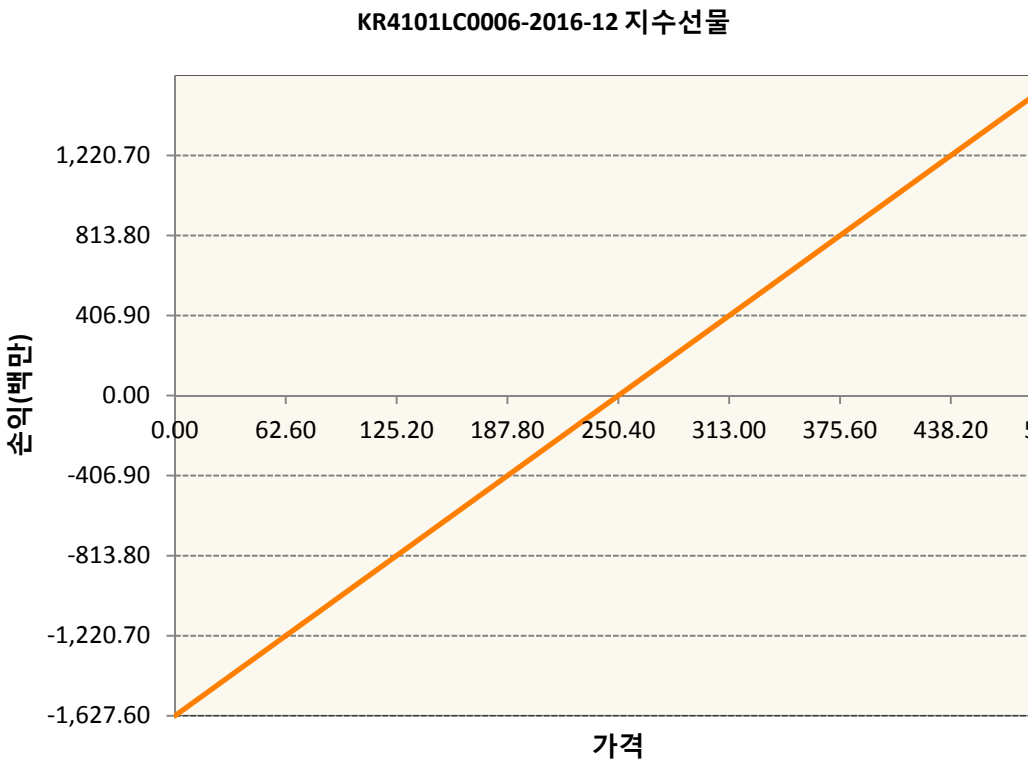
스마트레버리지목표전환형1호

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	1,628	0	1,628	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101LC00 2016-12 지수선물							130
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-130	-130	-130	-130	-130	-130	-130
-5.33%	-87	-87	-87	-87	-87	-87	-87
-2.67%	-43	-43	-43	-43	-43	-43	-43
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	43	43	43	43	43	43	43
5.33%	87	87	87	87	87	87	87
8.00%	130	130	130	130	130	130	130

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

101

공시일	2016-11-21
기준일	2016-11-18

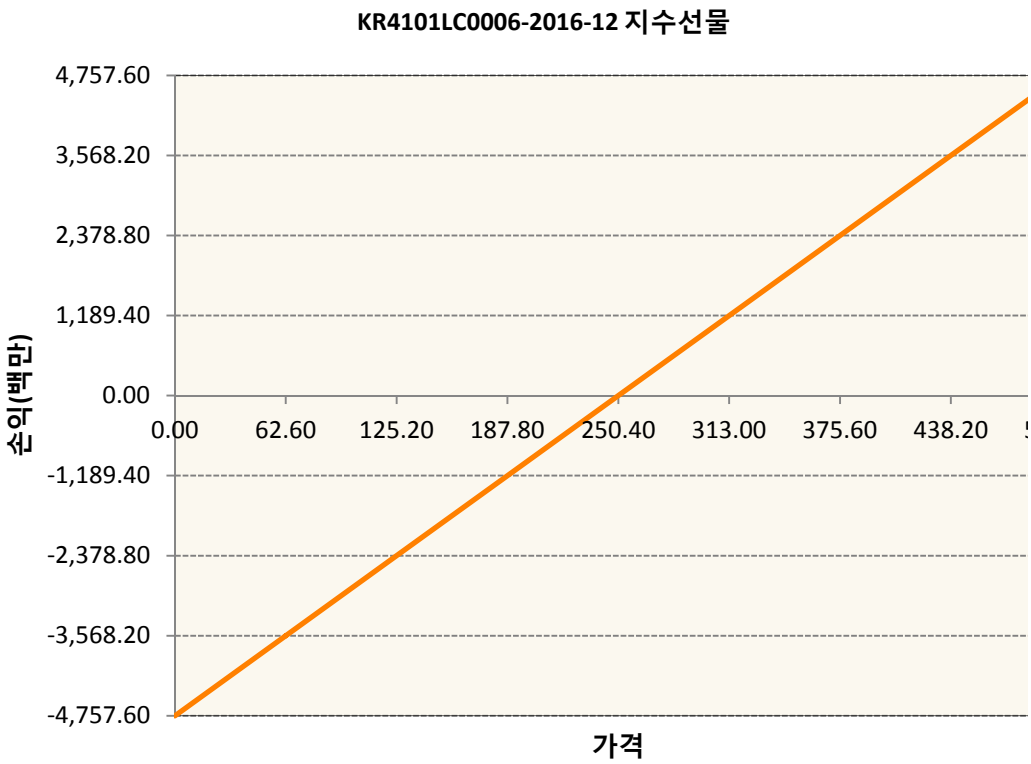
1.3배 레버리지 인덱스(주식-파생형)

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	4,758	0	4,758	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101LC00 2016-12 지수선물							380
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-380	-380	-380	-380	-380	-380	-380
-5.33%	-254	-254	-254	-254	-254	-254	-254
-2.67%	-127	-127	-127	-127	-127	-127	-127
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	127	127	127	127	127	127	127
5.33%	254	254	254	254	254	254	254
8.00%	380	380	380	380	380	380	380

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

296

공시일	2016-11-21
기준일	2016-11-18

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	11,105	0	11,105	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWMXWO0(신한MXWO 미래S160822	880

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

711

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2016-11-21
기준일	2016-11-18

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	5,098	0	5,098	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI50000 신한CSI500미래S160908	401

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

758

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2016-11-21
기준일	2016-11-18

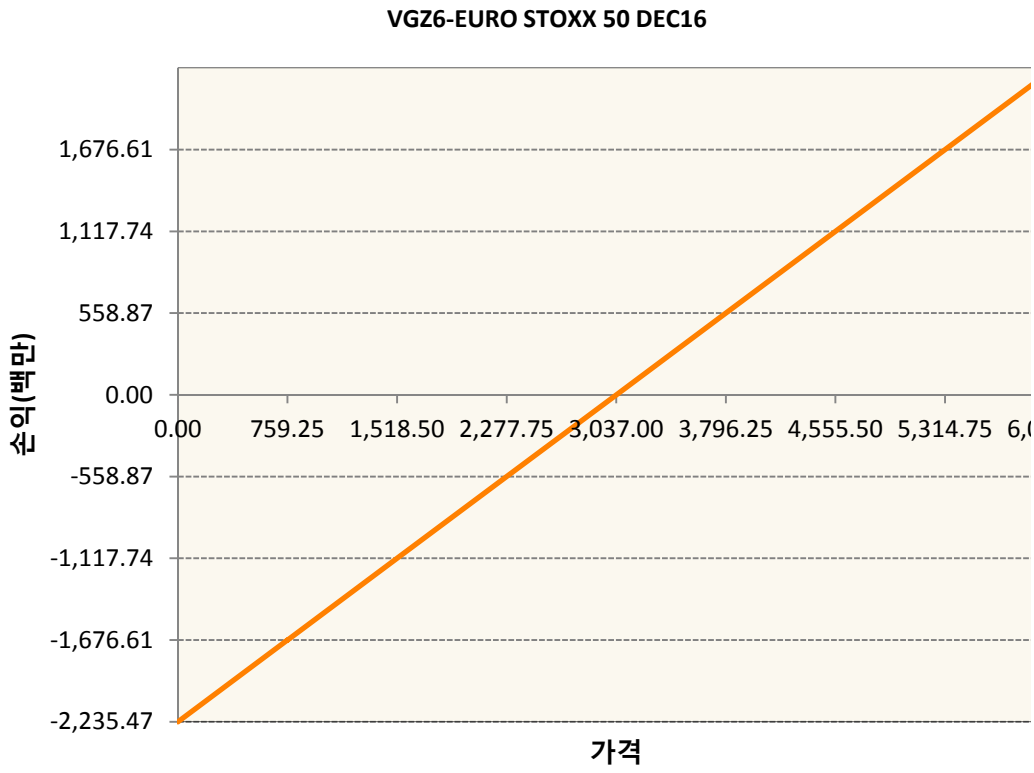
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,235	0	2,235	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGZ6	EURO STOXX 50 DEC16	179

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

(단위:백만원)

212

공시일	2016-11-21
기준일	2016-11-18

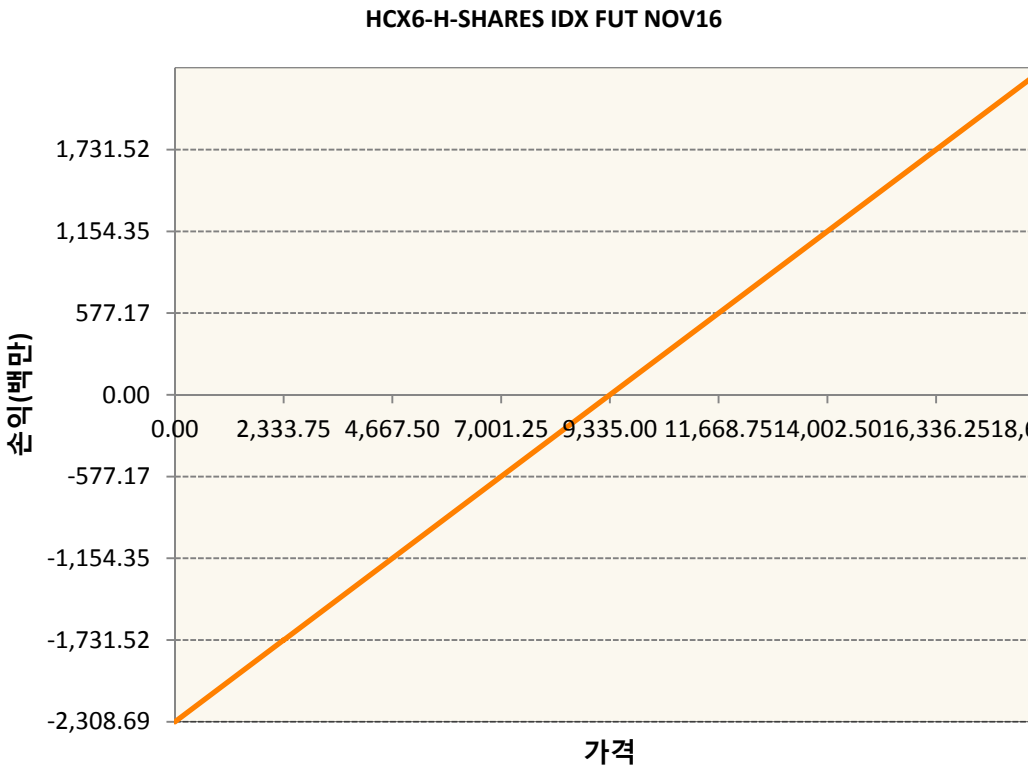
차이나인덱스모(주식-파생형)

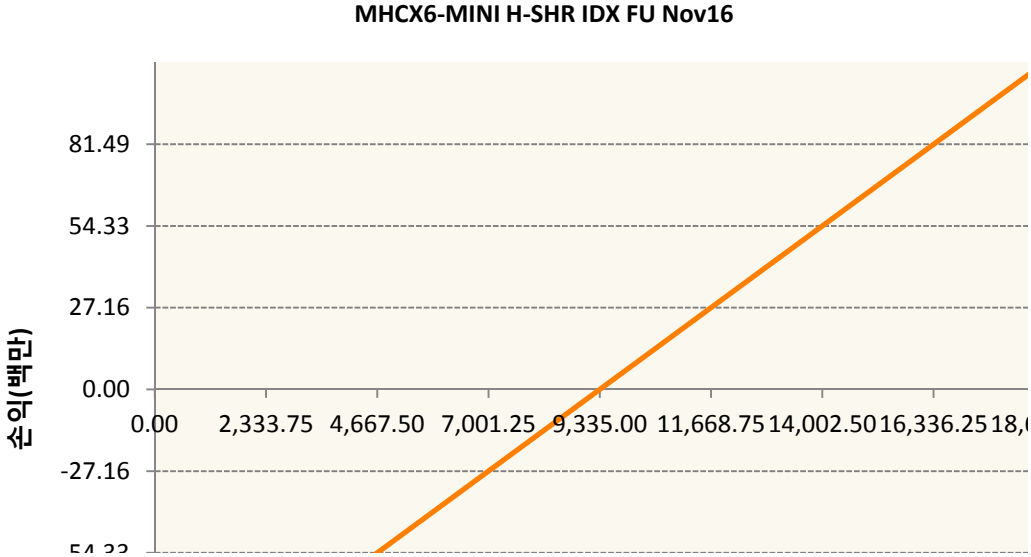
1. 계약금액

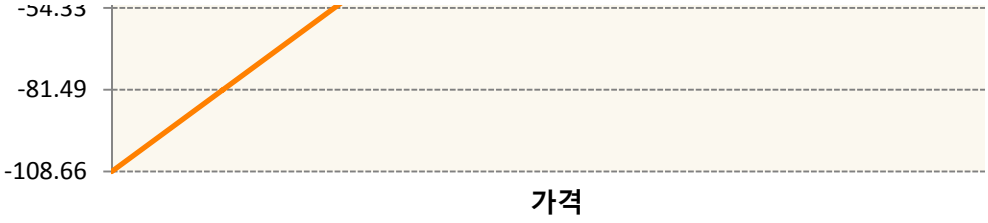
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,417	0	2,417	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCX6	H-SHARES IDX FUT NOV16	185
MHCX6	MINI H-SHR IDX FU Nov16	9

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	258

공시일	2016-11-21
기준일	2016-11-18

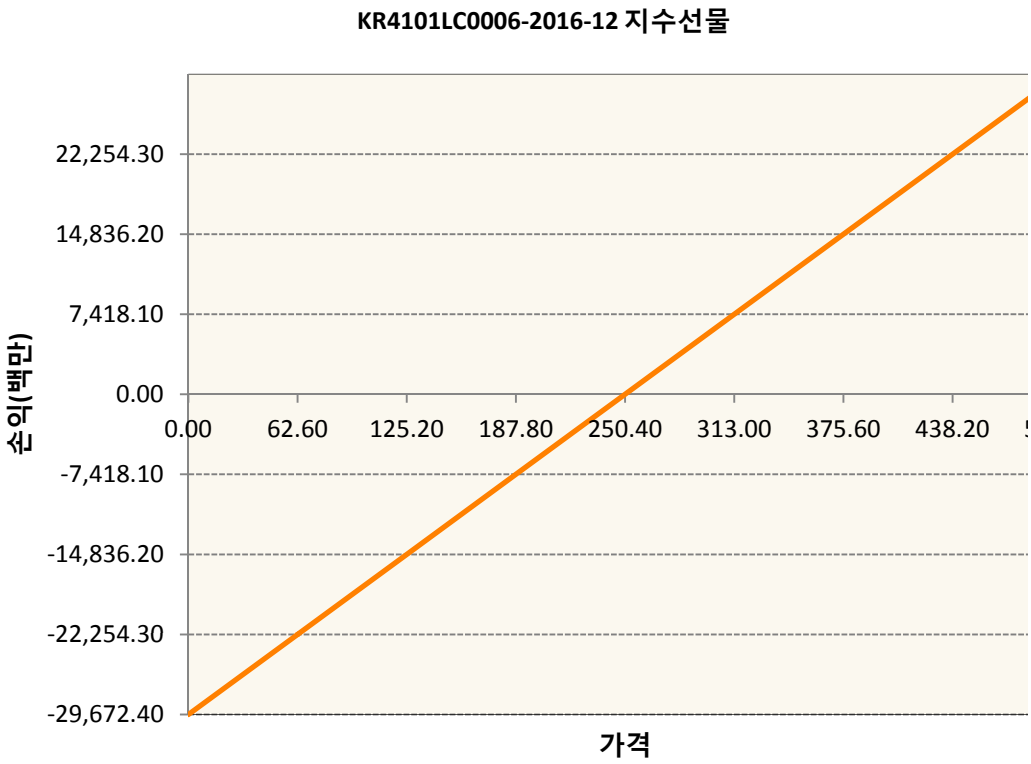
커버드콜(주식혼합-파생형)

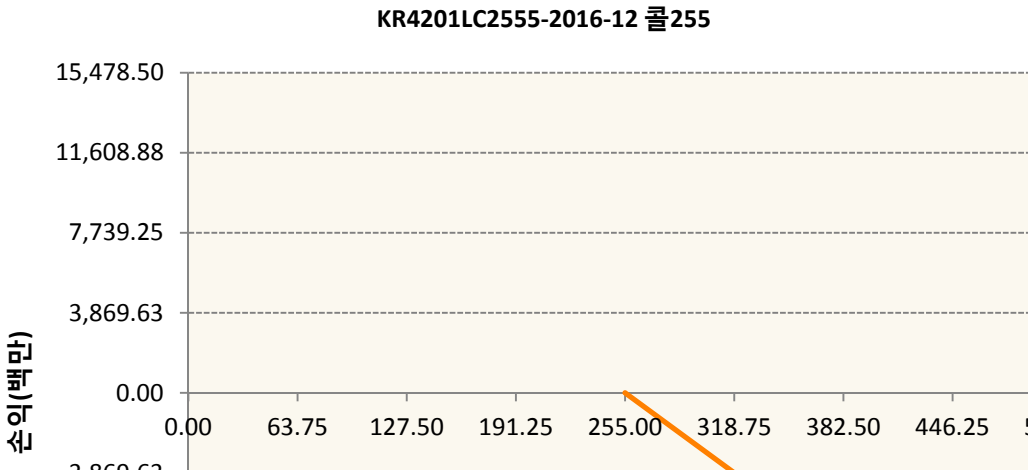
1. 계약금액

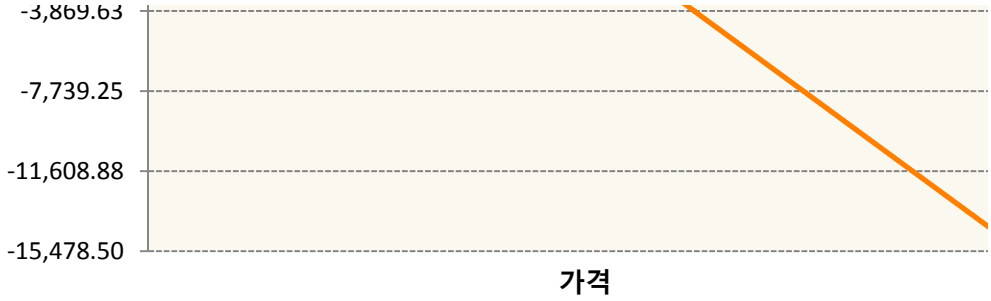
(단위:백만원)

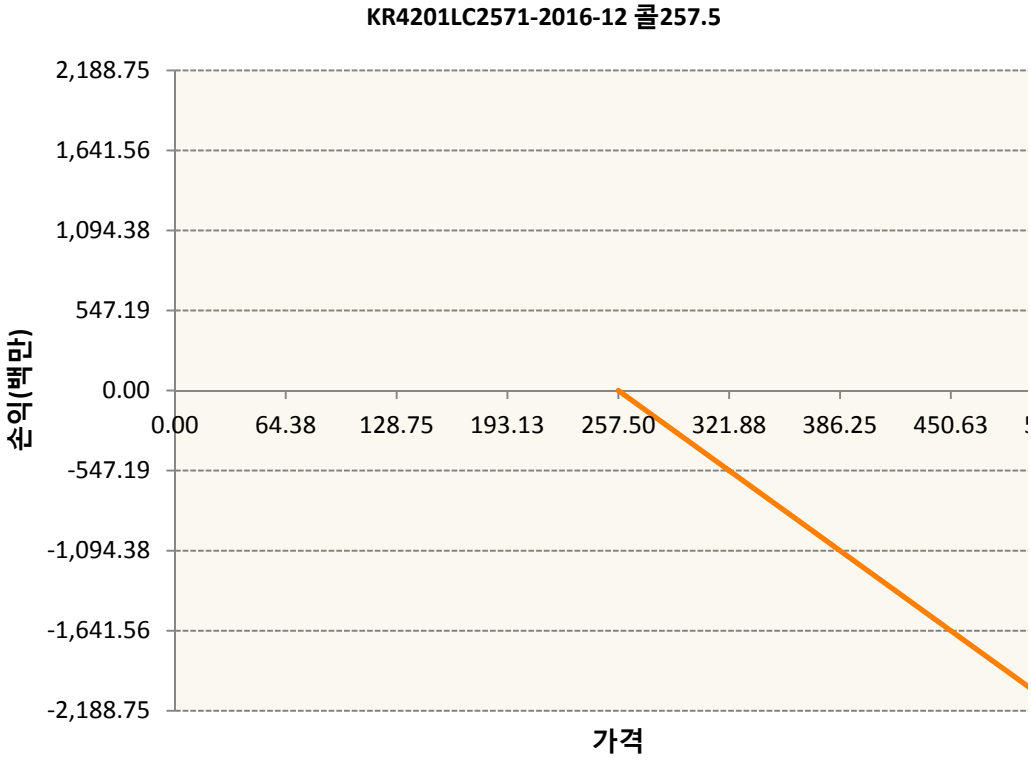
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	256	-256	장내
누계	유가증권	선물	29,672	0	29,672	장내
누계	유가증권	옵션	0	17,667	-17,667	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101LC00 2016-12 지수선물							2,372
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-2,372	-2,372	-2,372	-2,372	-2,372	-2,372	-2,372
-5.33%	-1,581	-1,581	-1,581	-1,581	-1,581	-1,581	-1,581
-2.67%	-791	-791	-791	-791	-791	-791	-791
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	791	791	791	791	791	791	791
5.33%	1,581	1,581	1,581	1,581	1,581	1,581	1,581
8.00%	2,372	2,372	2,372	2,372	2,372	2,372	2,372
KR4201LC25 2016-12 콜255							4,293
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	435	435	435	435	434	432	430
-5.33%	435	433	430	425	418	407	393
-2.67%	414	397	374	346	314	276	234
0%	200	136	69	0	-71	-144	-218
2.67%	-641	-722	-804	-886	-968	-1,051	-1,134
5.33%	-2,235	-2,273	-2,317	-2,366	-2,420	-2,477	-2,537
8.00%	-4,185	-4,192	-4,203	-4,219	-4,239	-4,264	-4,293
KR4201LC25 2016-12 콜257.5							530

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	37	37	37	37	37	37	36
-5.33%	37	37	36	36	36	35	34
-2.67%	36	35	33	30	27	24	20
0%	21	15	8	0	-8	-17	-26
2.67%	-57	-69	-81	-93	-105	-116	-128
5.33%	-245	-253	-262	-271	-280	-290	-300
8.00%	-506	-508	-511	-515	-519	-524	-530

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

6,593

공시일	2016-11-21
기준일	2016-11-18

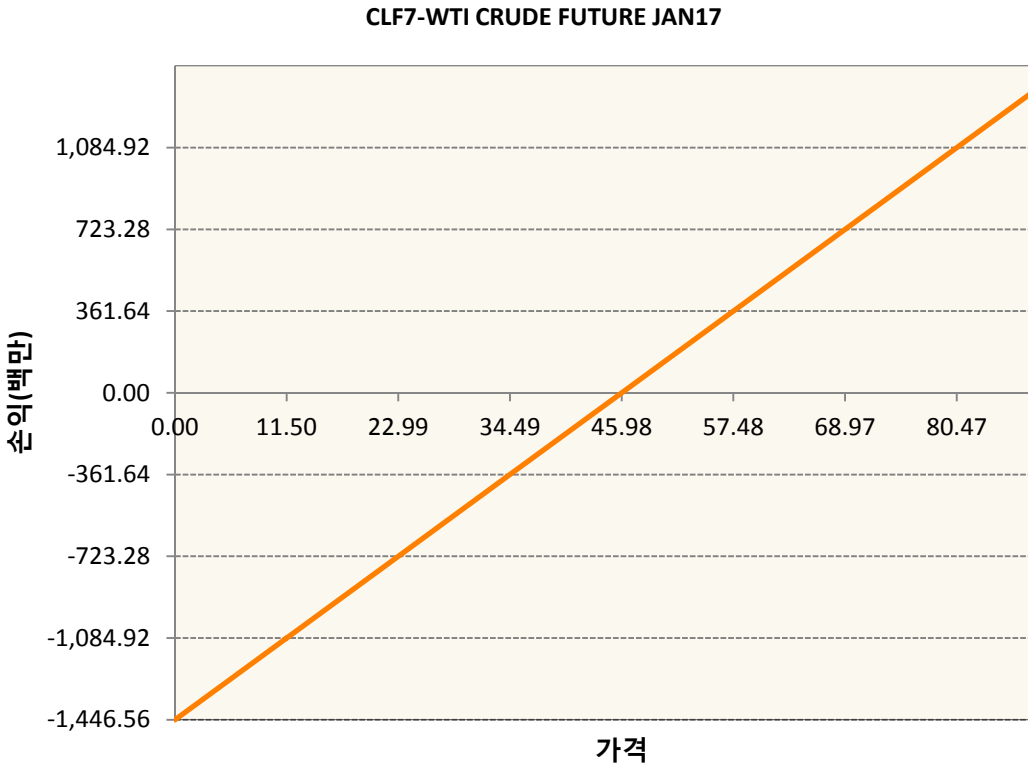
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

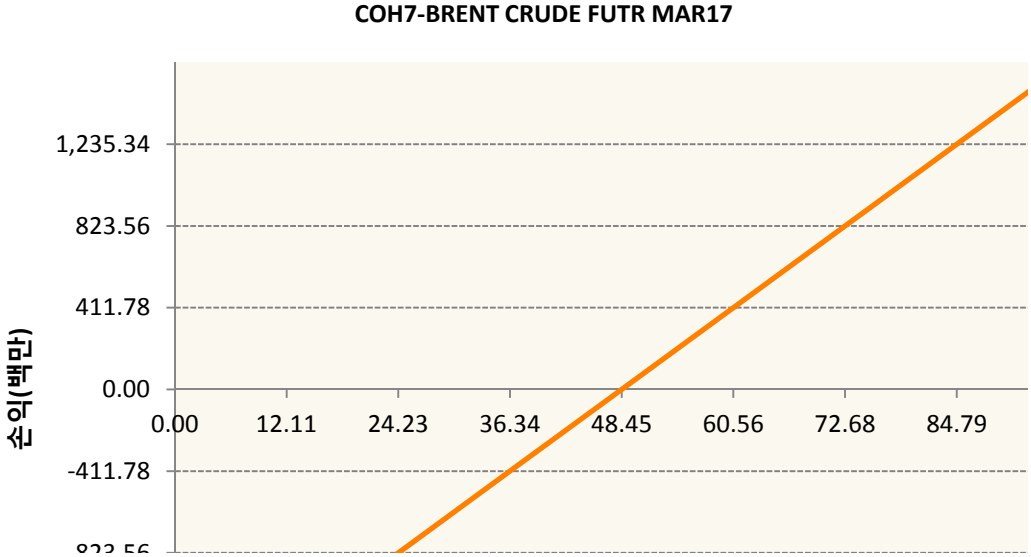
1. 계약금액

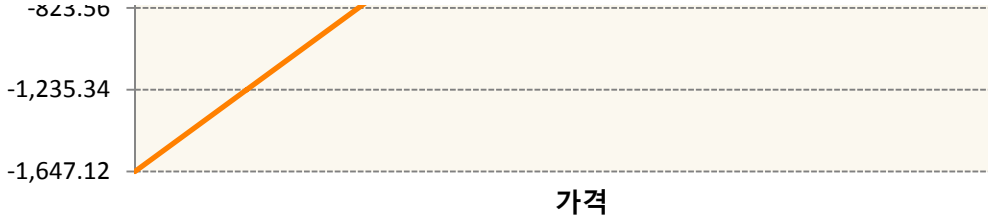
(단위:백만원)

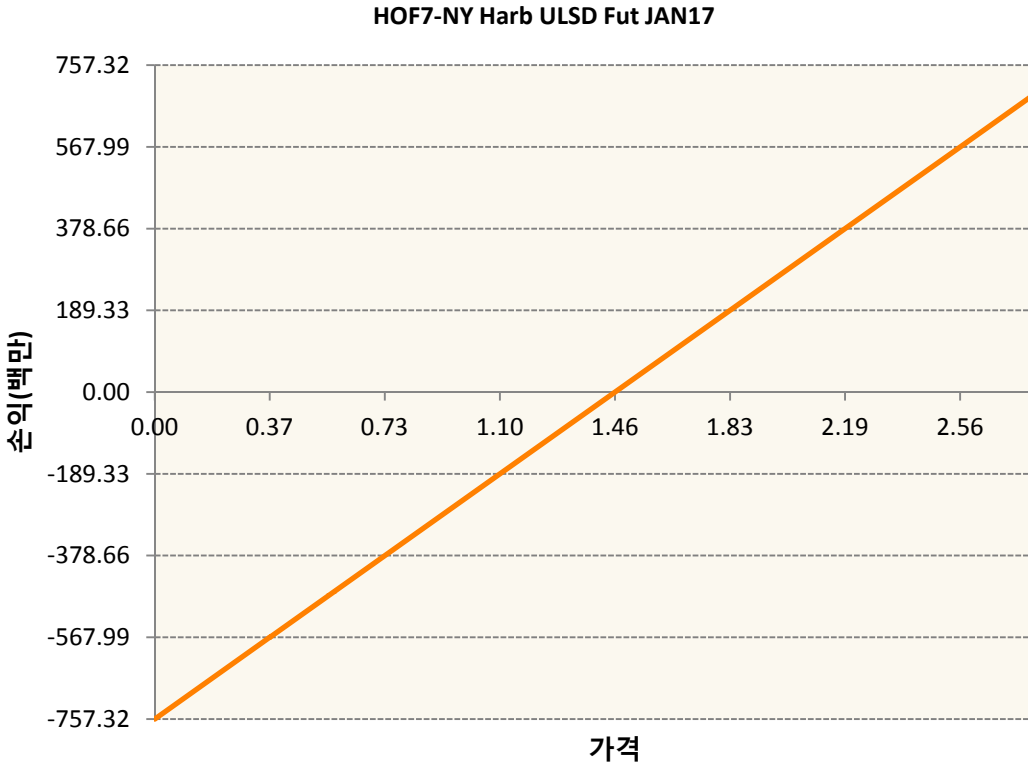
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	5,929	0	5,929	

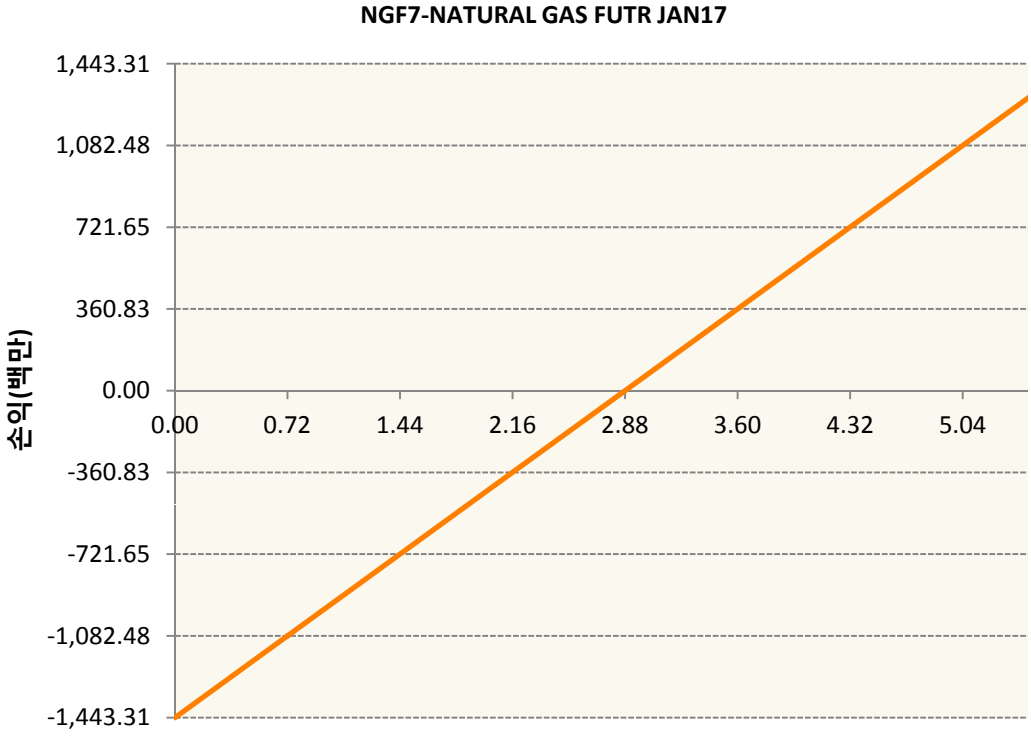
2. 만기시점의 손익구조



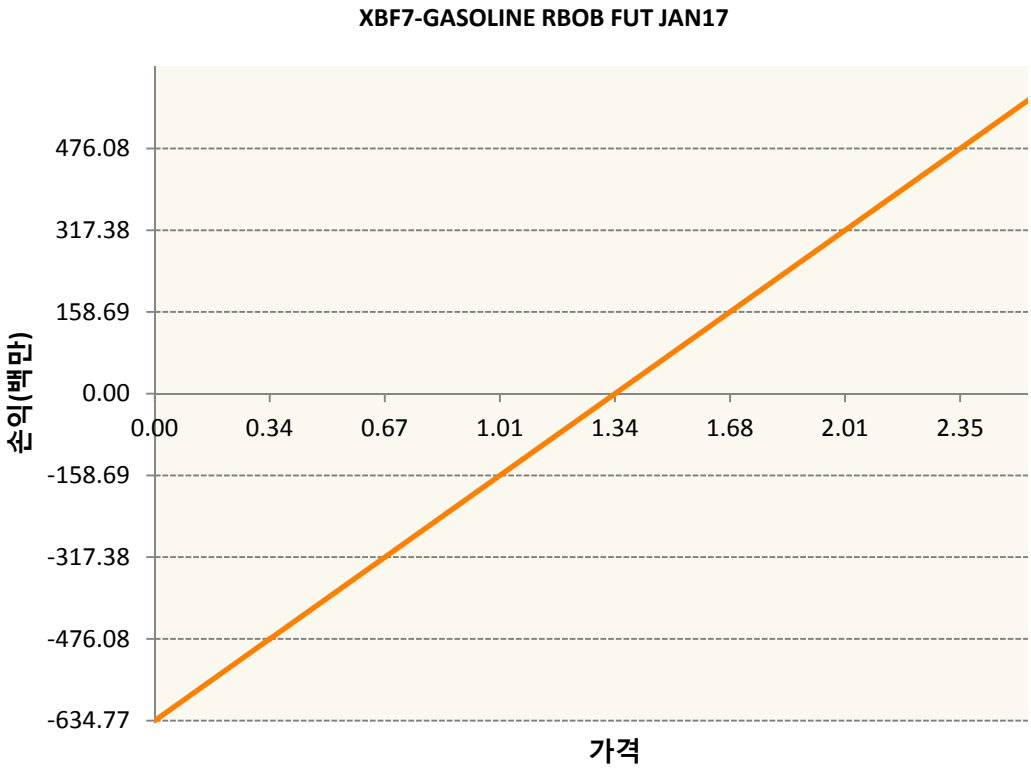



-1,235.34
-1,647.12
가격


HOF7-NY Harb ULSD Fut JAN17
757.32
567.99
378.66
189.33
0.00
-189.33
-378.66
-567.99
-757.32
0.00
0.37
0.73
1.10
1.46
1.83
2.19
2.56
순익(백만)
가격


NGF7-NATURAL GAS FUTR JAN17
1,443.31
1,082.48
721.65
360.83
0.00
-360.83
-721.65
-1,082.48
-1,443.31
0.00
0.72
1.44
2.16
2.88
3.60
4.32
5.04
순익(백만)

가격



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
CLF7	WTI CRUDE FUTURE JAN17	116
COH7	BRENT CRUDE FUTR MAR17	132
HOF7	NY Harb ULSD Fut JAN17	61
NGF7	NATURAL GAS FUTR JAN17	115
XBF7	GASOLINE RBOB FUT JAN17	51

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,063

공시일	2016-11-21
기준일	2016-11-18

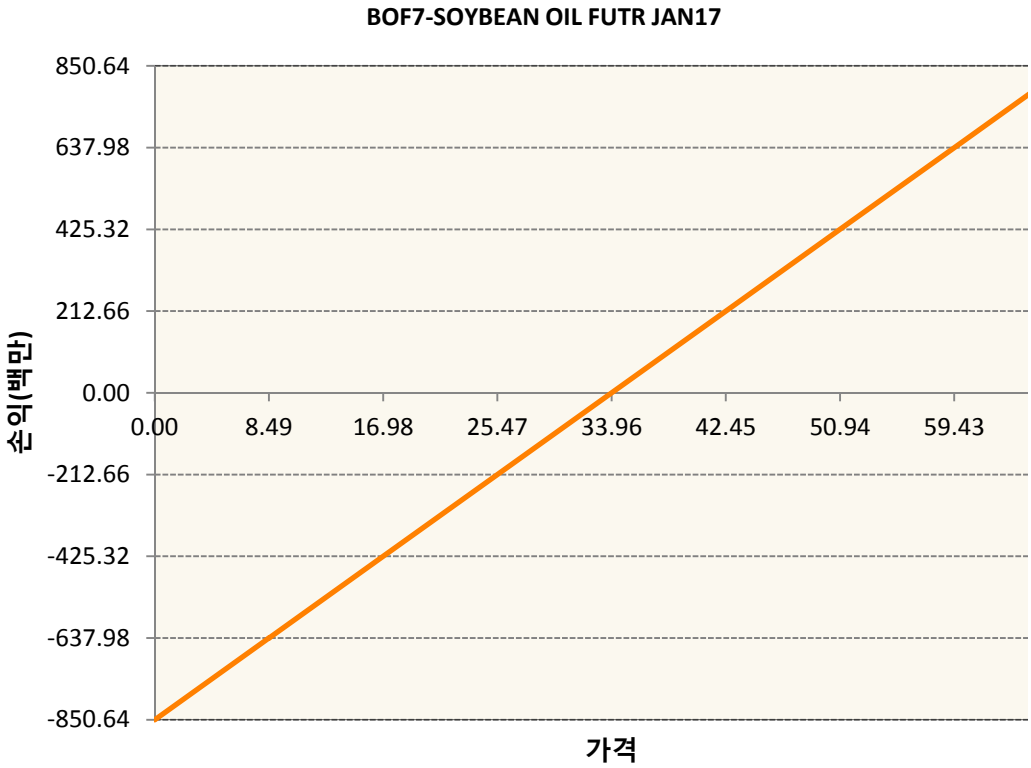
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

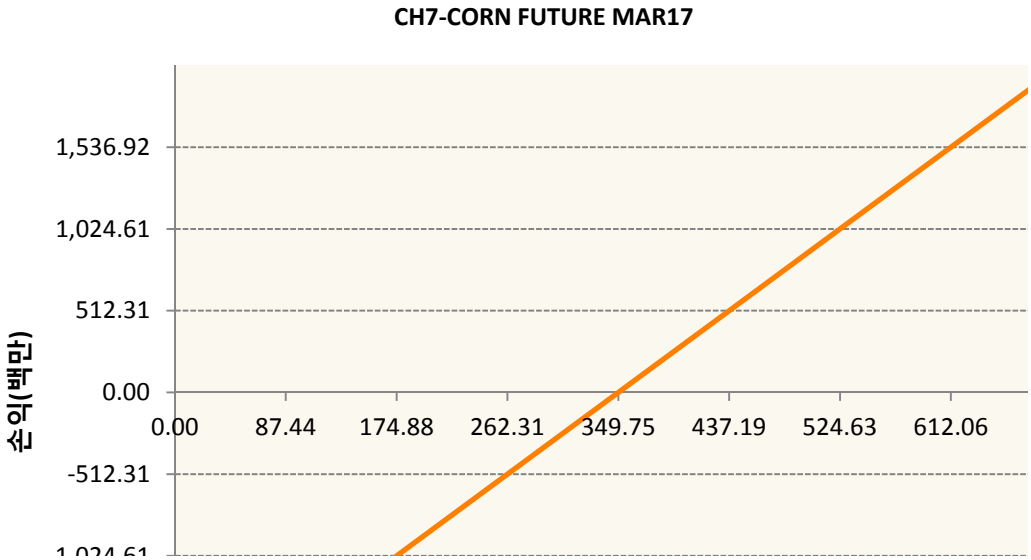
1. 계약금액

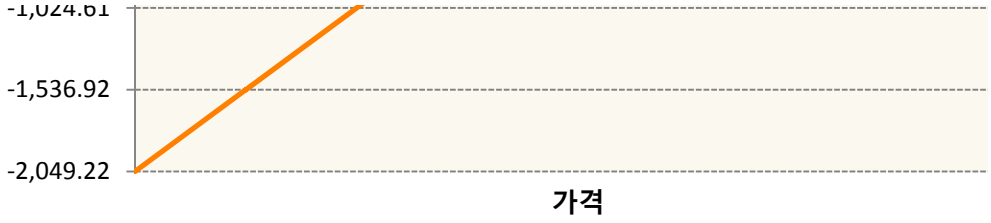
(단위:백만원)

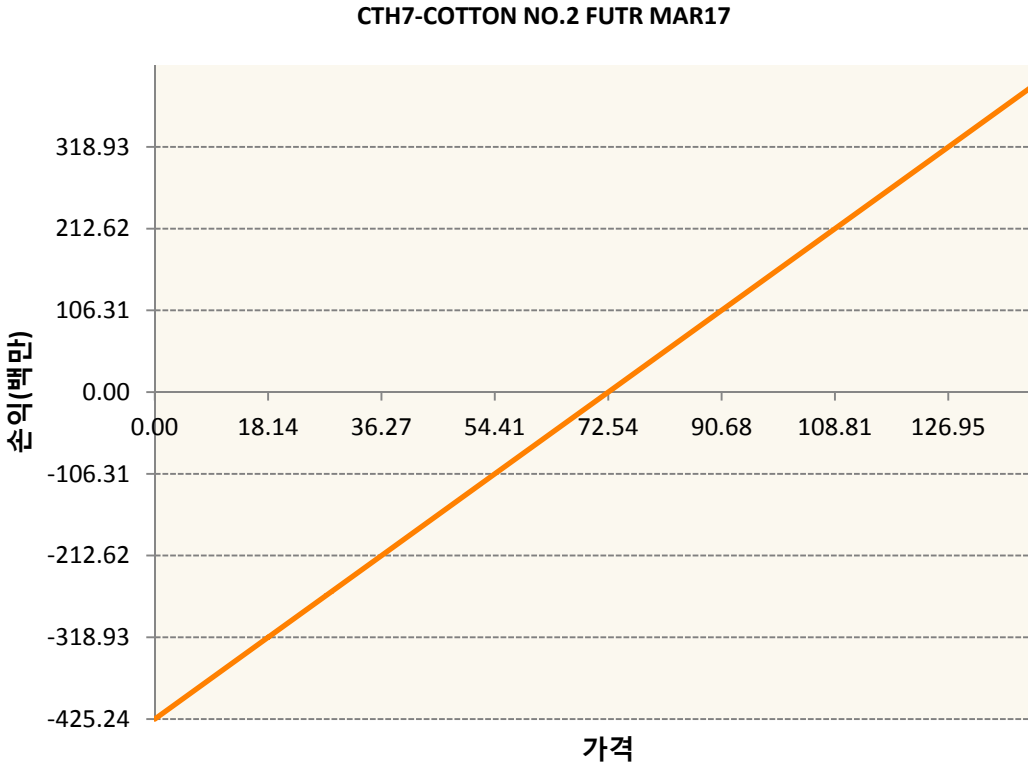
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	9,264	0	9,264	

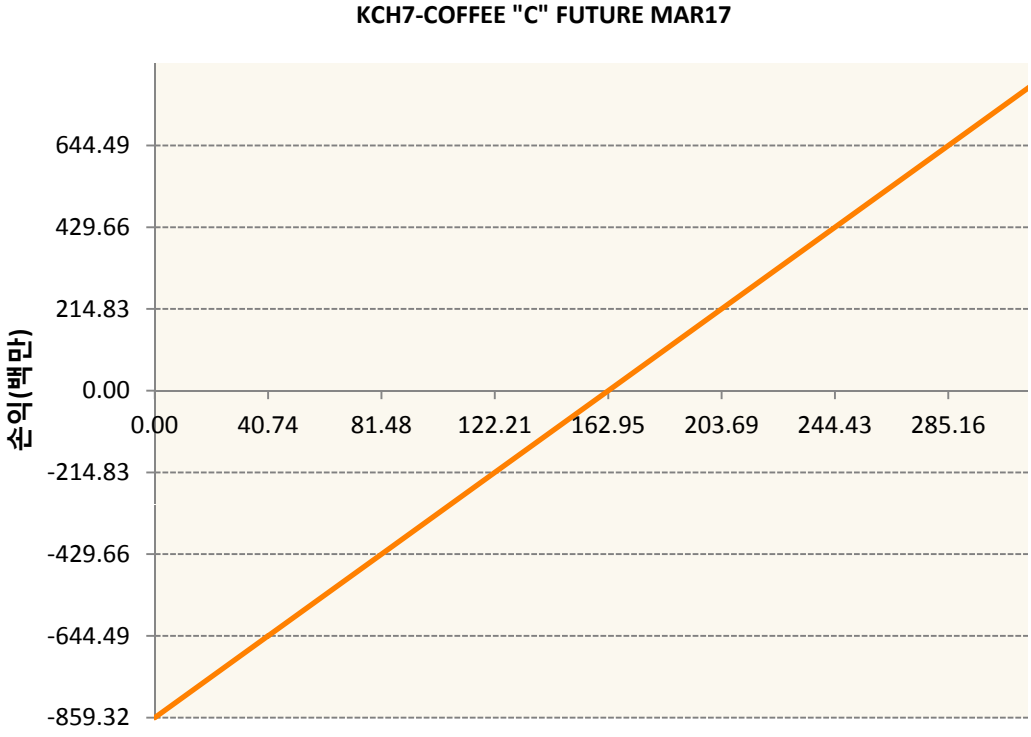
2. 만기시점의 손익구조





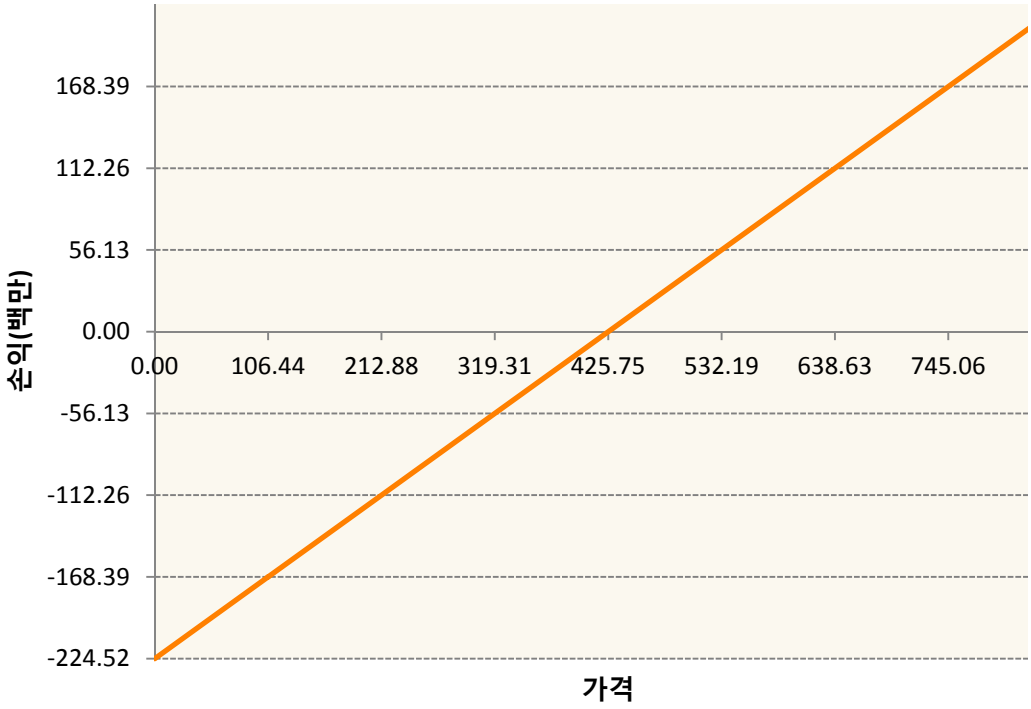

-1,536.92
-2,049.22
가격


CTH7-COTTON NO.2 FUTR MAR17
318.93
212.62
106.31
0.00
-106.31
-212.62
-318.93
-425.24
0.00
18.14
36.27
54.41
72.54
90.68
108.81
126.95
순익(백만)
가격

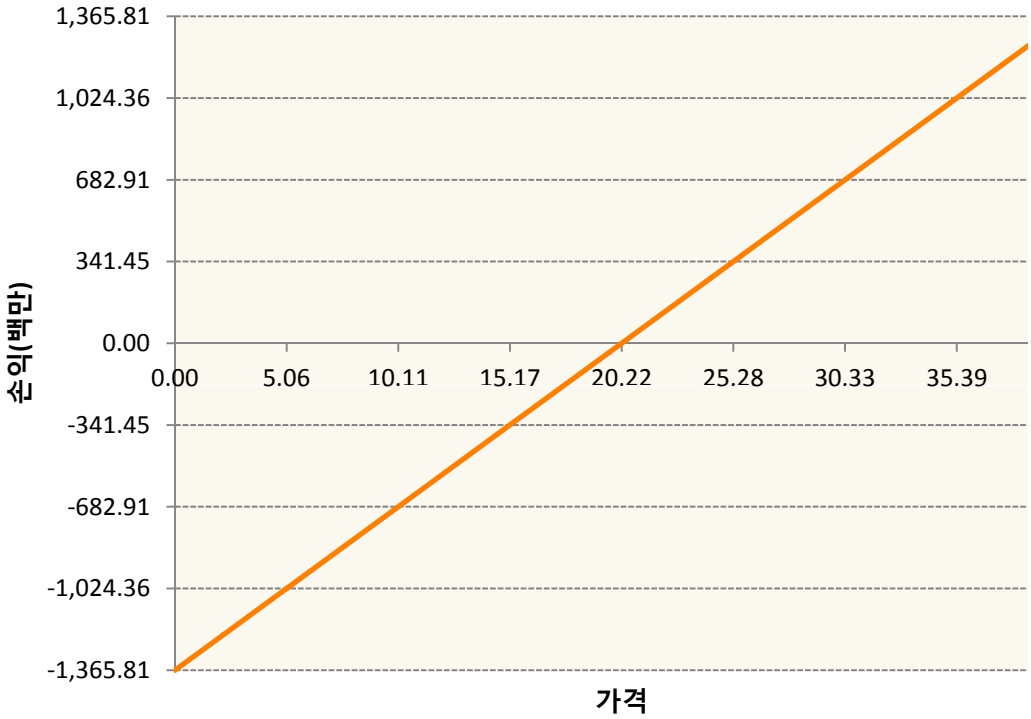

KCH7-COFFEE "C" FUTURE MAR17
644.49
429.66
214.83
0.00
-214.83
-429.66
-644.49
-859.32
0.00
40.74
81.48
122.21
162.95
203.69
244.43
285.16
순익(백만)

가격

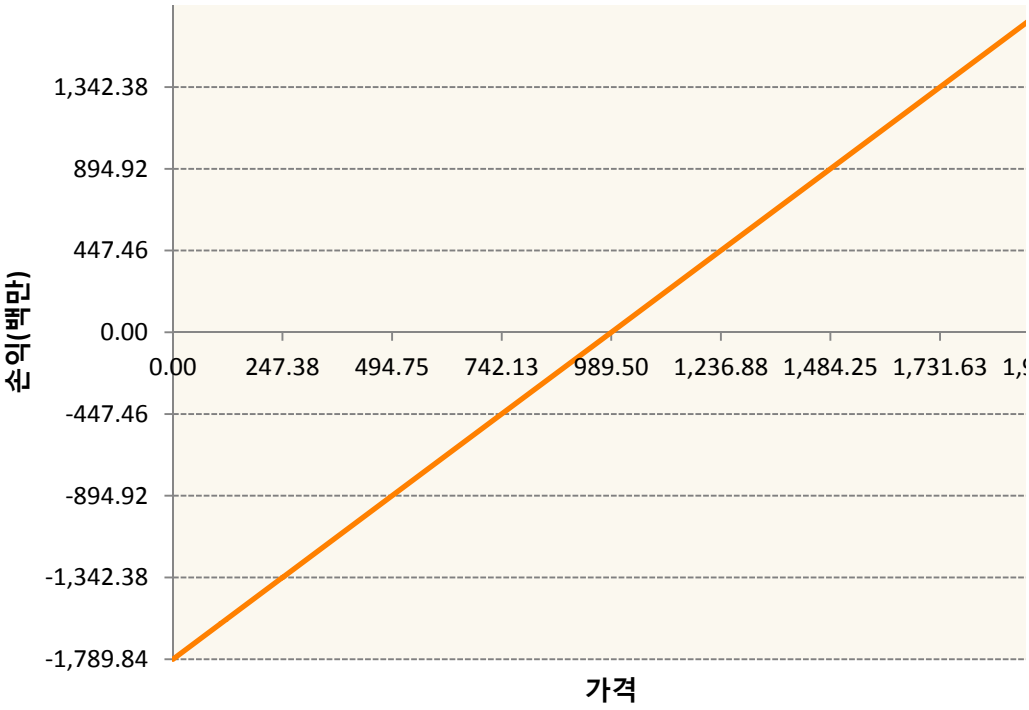
KWH7-KC HRW WHEAT FUT MAR17



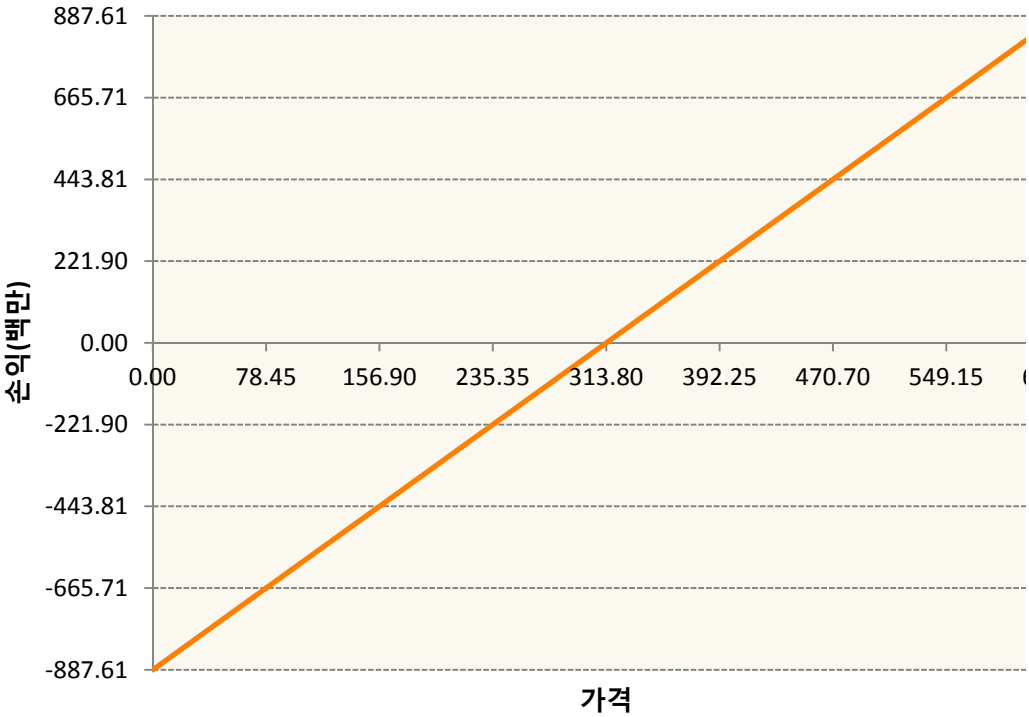
SBH7-Sugar #11 (WORLD) MAR17



SF7-SOYBEAN FUTURE JAN17

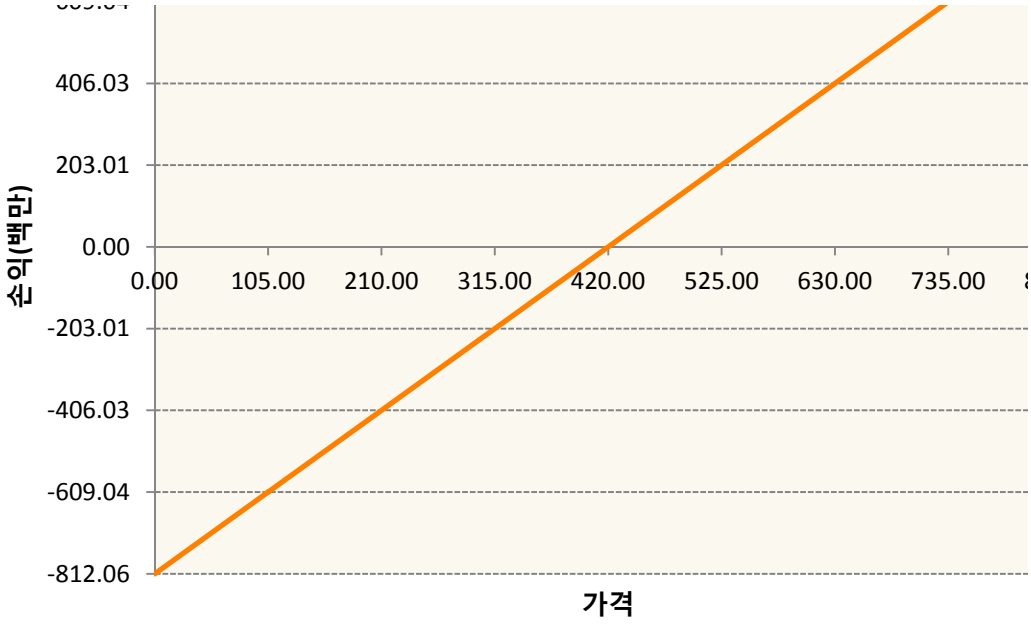


SMF7-SOYBEAN MEAL FUTR JAN17



WH7-WHEAT FUTURE(CBT) MAR17





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

BOF7	SOYBEAN OIL FUTR JAN17	68
CH7	CORN FUTURE MAR17	164
CTH7	COTTON NO.2 FUTR MAR17	34
KCH7	COFFEE "C" FUTURE MAR17	69
KWH7	KC HRW WHEAT FUT MAR17	18
SBH7	Sugar #11 (WORLD) MAR17	109
SF7	SOYBEAN FUTURE JAN17	143
SMF7	SOYBEAN MEAL FUTR JAN17	71
WH7	WHEAT FUTURE(CBT) MAR17	65

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

927