공시일	2016-11-22
기준일	2016-11-21

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	2016-11-22
기준일	2016-11-21

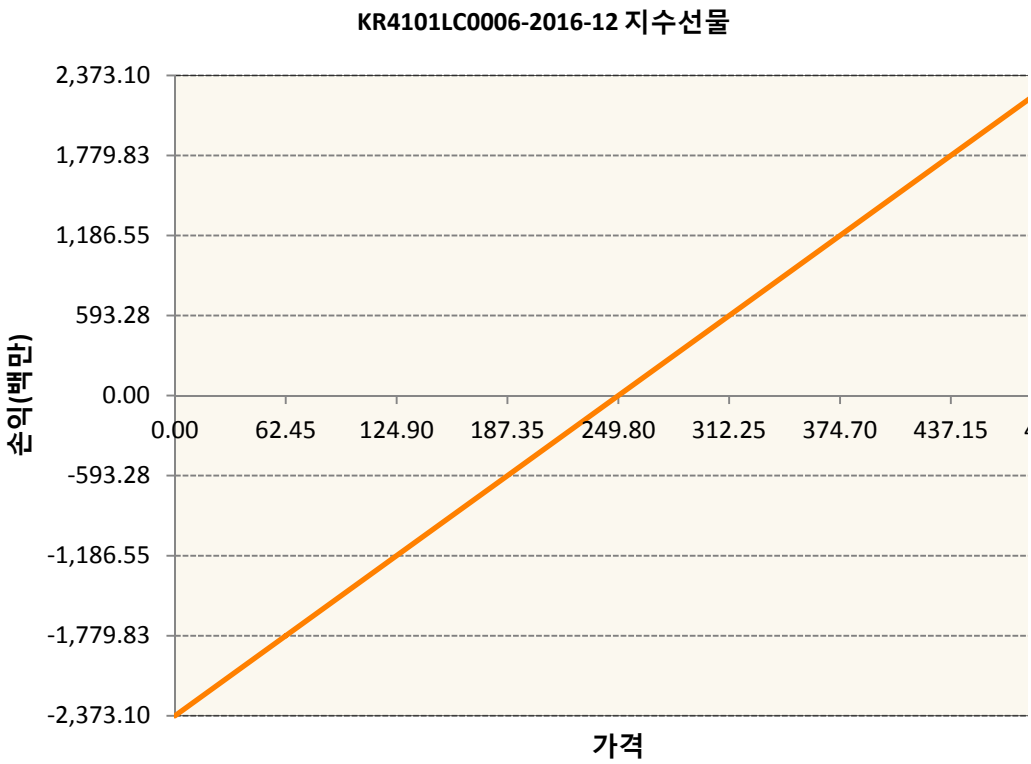
스마트인덱스모

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	2,373	0	2,373	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%	-126	-126	-126	-126	-126	-126	-126
-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%	126	126	126	126	126	126	126
8.00%	190	190	190	190	190	190	190

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

146

공시일	2016-11-22
기준일	2016-11-21

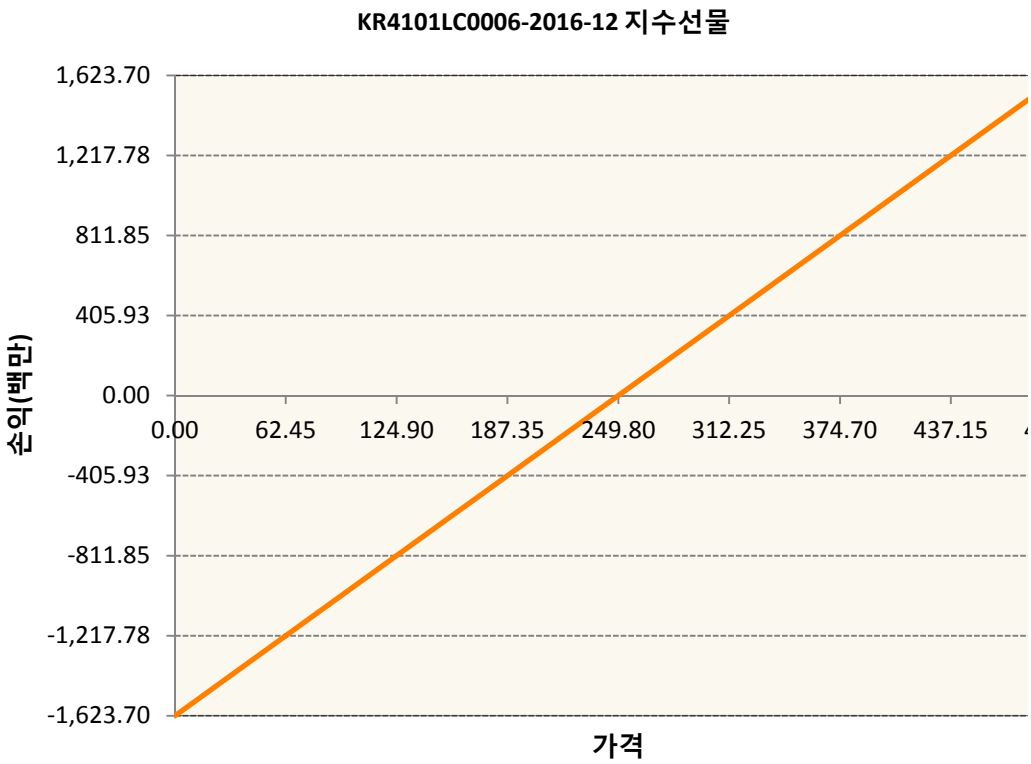
스마트레버리지목표전환형1호

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	1,624	0	1,624	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%	-86	-86	-86	-86	-86	-86	-86
-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%	86	86	86	86	86	86	86
8.00%	130	130	130	130	130	130	130

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

100

공시일	2016-11-22
기준일	2016-11-21

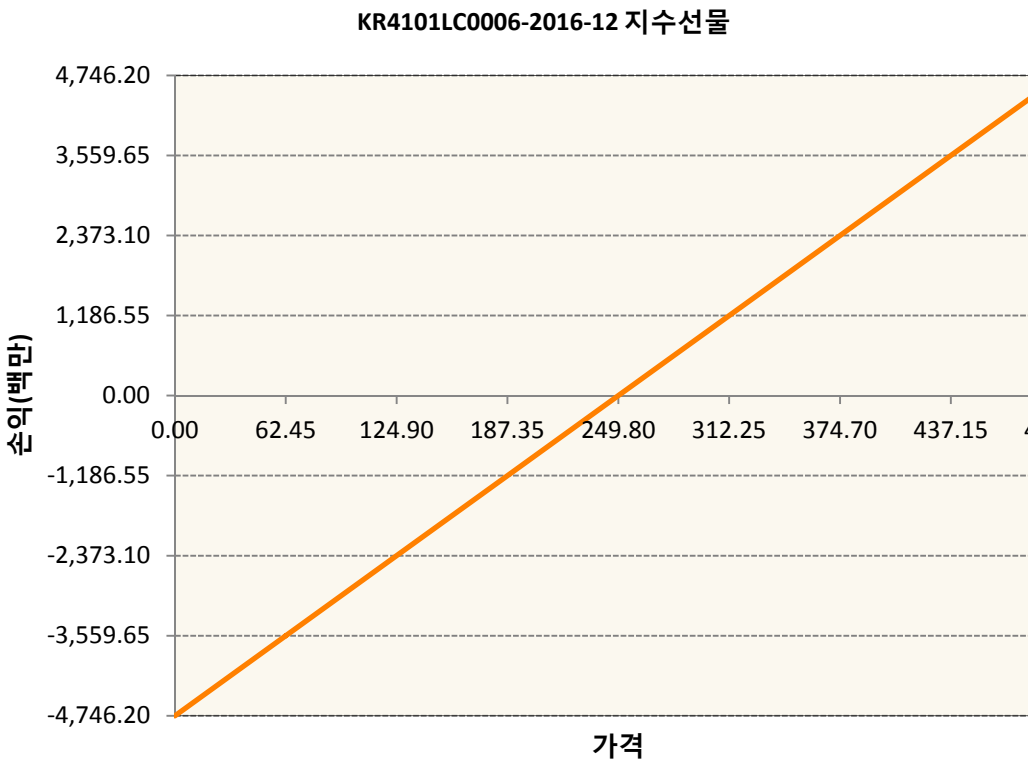
1.3배 레버리지 인덱스(주식-파생형)

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	4,746	0	4,746	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101LC00 2016-12 지수선물							379
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-379	-379	-379	-379	-379	-379	-379
-5.33%	-253	-253	-253	-253	-253	-253	-253
-2.67%	-126	-126	-126	-126	-126	-126	-126
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	126	126	126	126	126	126	126
5.33%	253	253	253	253	253	253	253
8.00%	379	379	379	379	379	379	379

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

293

공시일	2016-11-22
기준일	2016-11-21

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	875

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

707

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2016-11-22
기준일	2016-11-21

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	400

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

756

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2016-11-22
기준일	2016-11-21

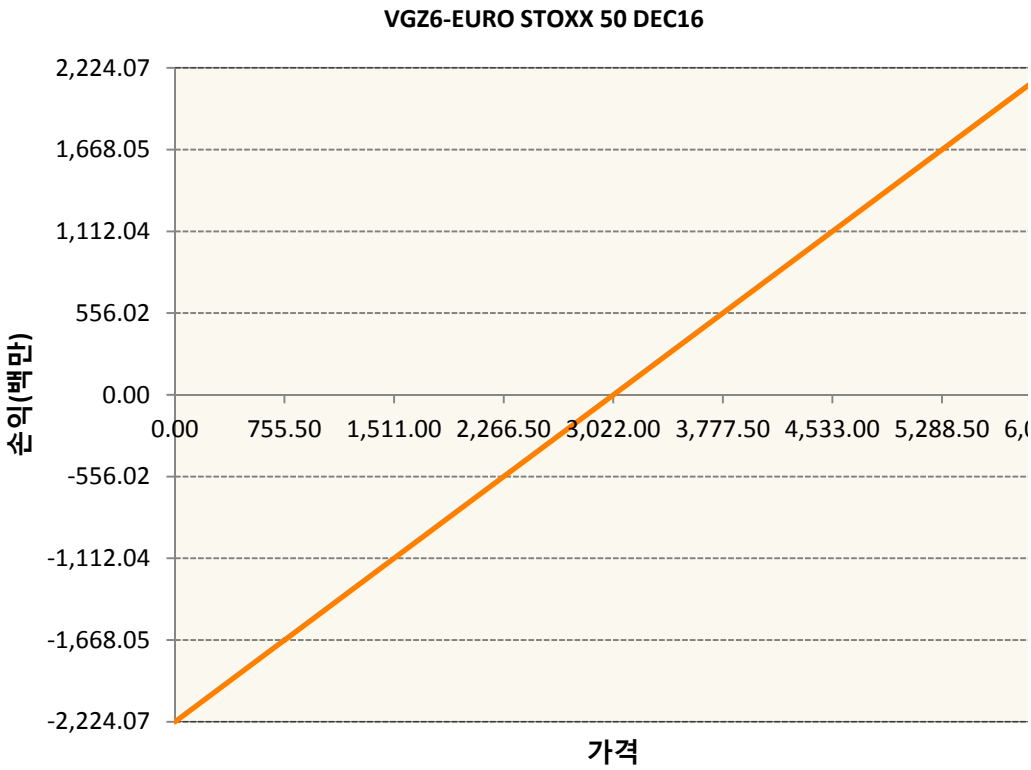
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,224	0	2,224	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGZ6	EURO STOXX 50 DEC16	178

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

(단위:백만원)

211

공시일	2016-11-22
기준일	2016-11-21

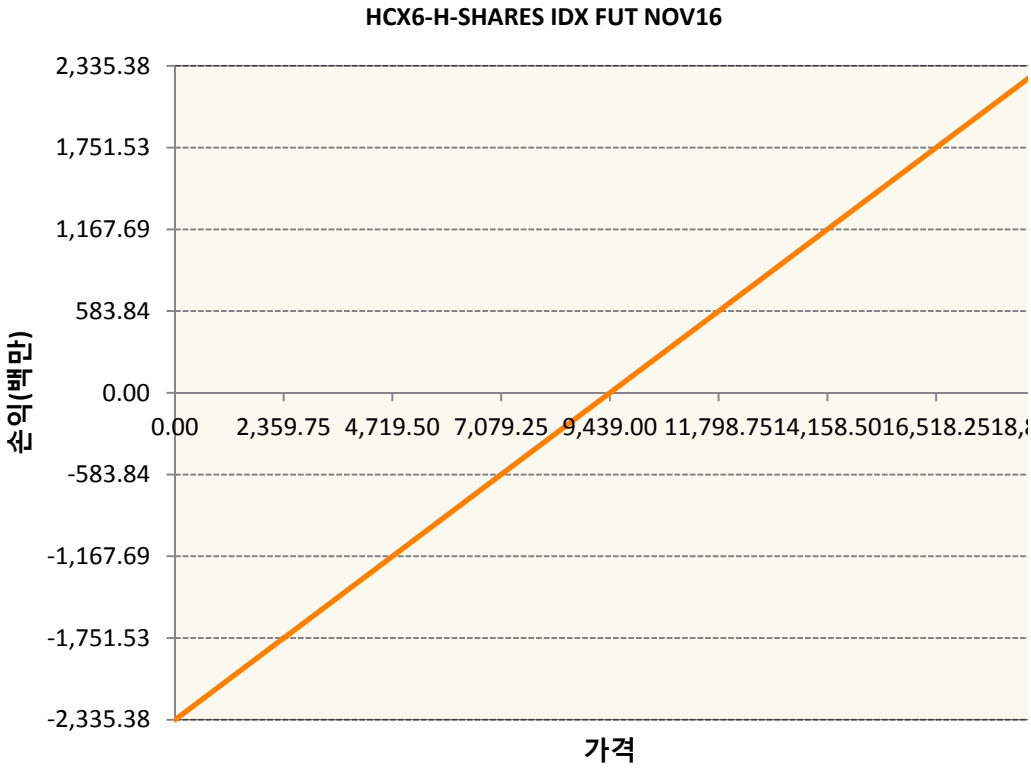
차이나인덱스모(주식-파생형)

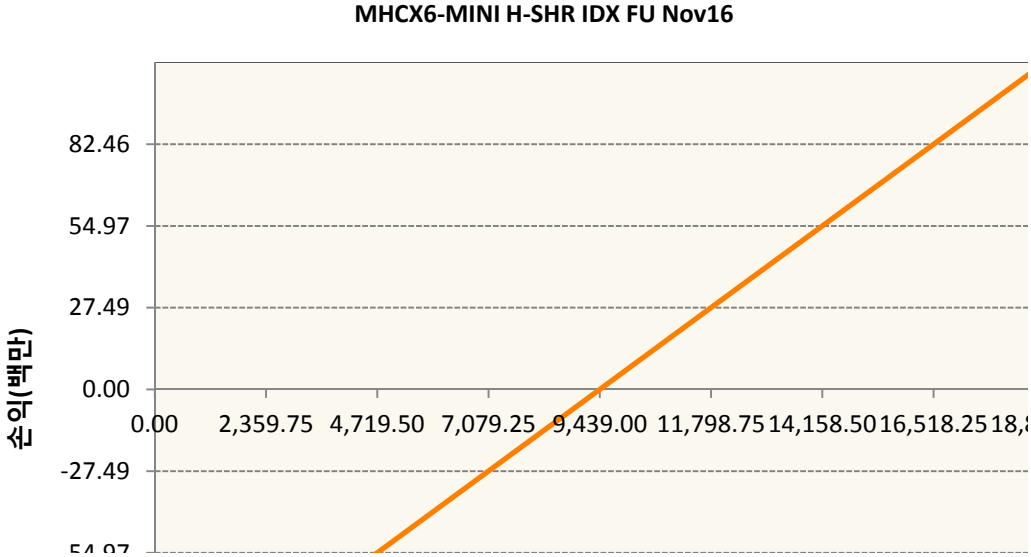
1. 계약금액

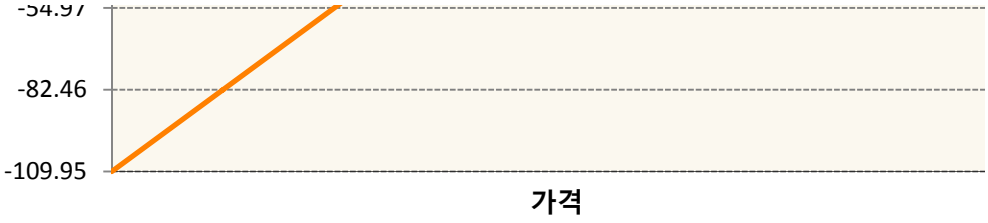
(단위:백만원)

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)
HCX6	H-SHARES IDX FUT NOV16	187
MHCX6	MINI H-SHR IDX FU Nov16	9

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	260

공시일	2016-11-22
기준일	2016-11-21

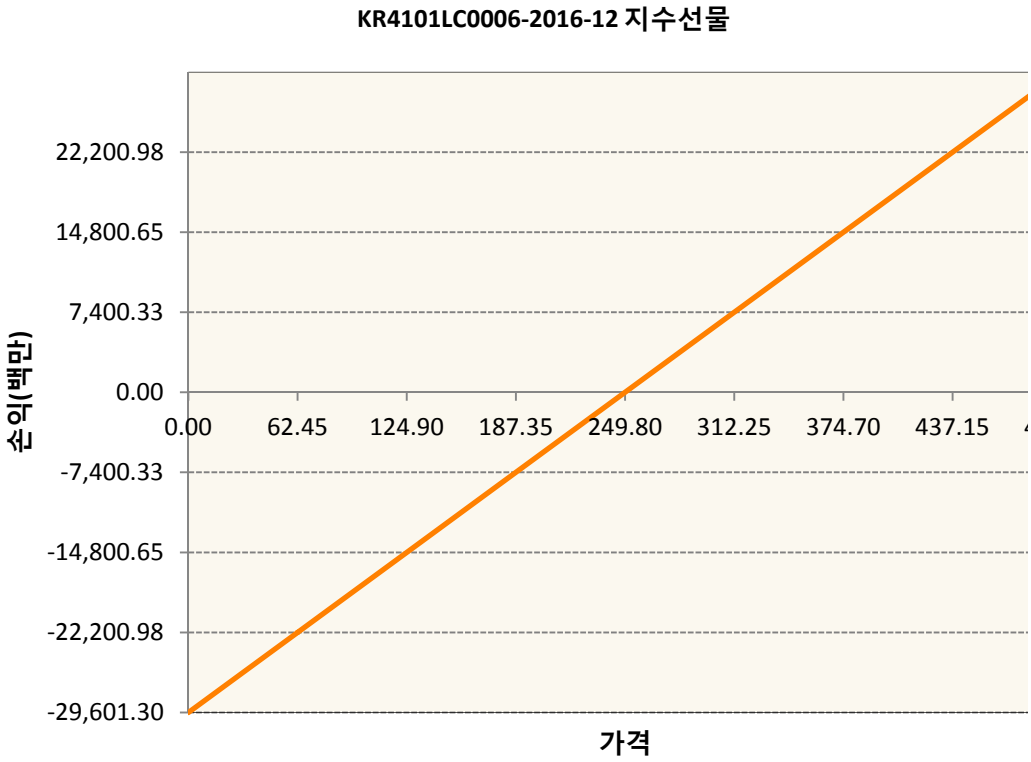
커버드콜(주식혼합-파생형)

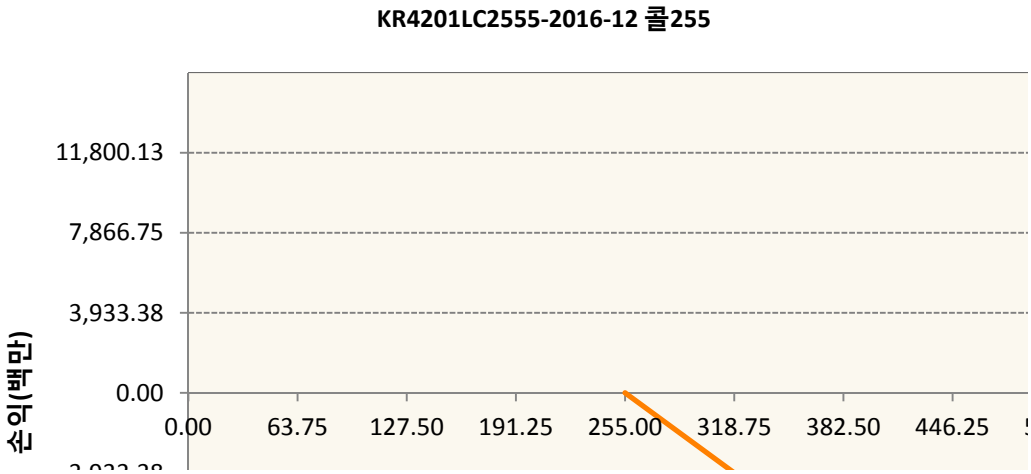
1. 계약금액

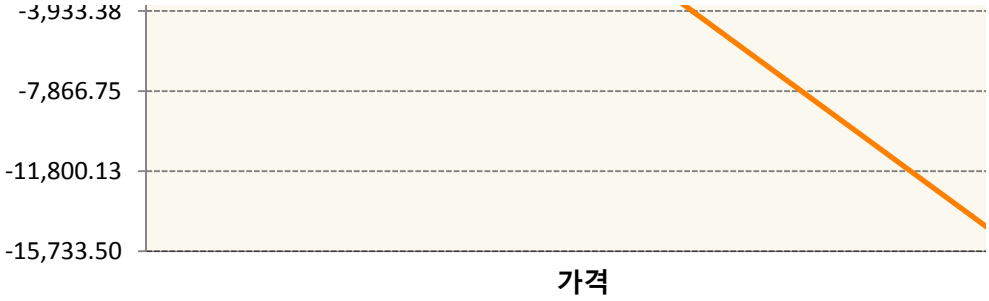
(단위:백만원)

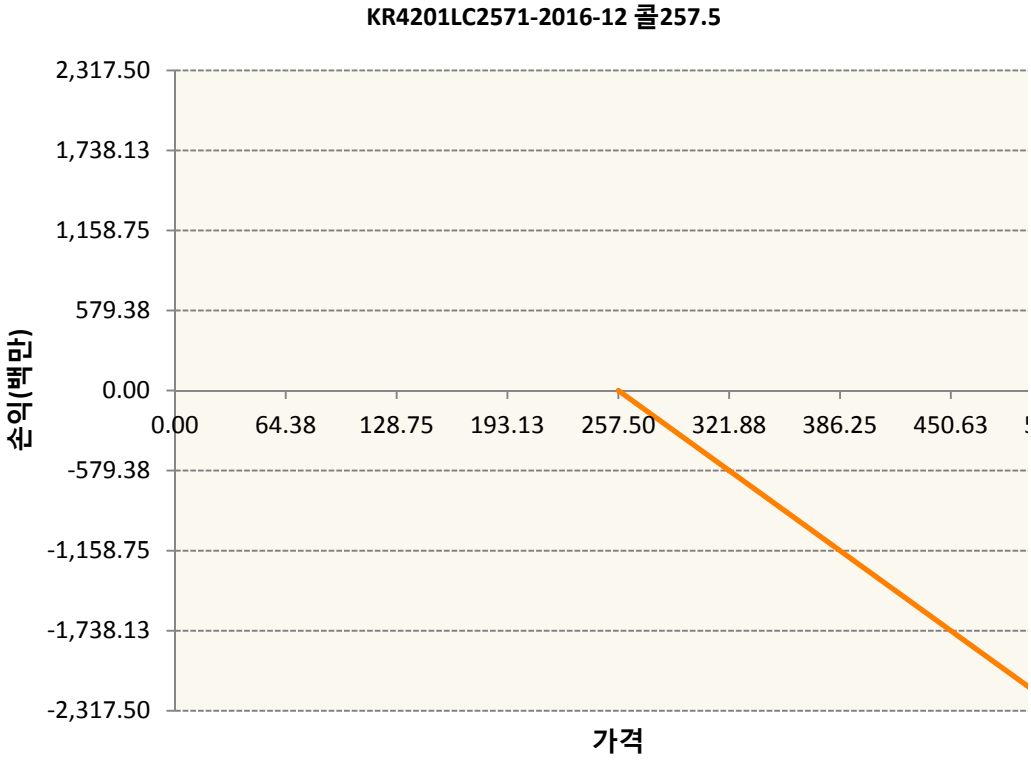
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	385	-385	장내
누계	유가증권	선물	29,601	0	29,601	장내
누계	유가증권	옵션	0	18,051	-18,051	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101LC00 2016-12 지수선물							2,365
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-2,365	-2,365	-2,365	-2,365	-2,365	-2,365	-2,365
-5.33%	-1,577	-1,577	-1,577	-1,577	-1,577	-1,577	-1,577
-2.67%	-788	-788	-788	-788	-788	-788	-788
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	788	788	788	788	788	788	788
5.33%	1,577	1,577	1,577	1,577	1,577	1,577	1,577
8.00%	2,365	2,365	2,365	2,365	2,365	2,365	2,365
KR4201LC25 2016-12 콜255							4,229
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	333	333	333	333	333	332	331
-5.33%	333	333	331	329	324	318	309
-2.67%	323	313	298	278	254	225	193
0%	170	117	60	0	-63	-127	-194
2.67%	-581	-660	-739	-818	-897	-977	-1,056
5.33%	-2,156	-2,193	-2,236	-2,284	-2,336	-2,391	-2,449
8.00%	-4,131	-4,137	-4,147	-4,161	-4,179	-4,202	-4,229
KR4201LC25 2016-12 콜257.5							537

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	27	27	27	27	27	27	27
-5.33%	27	27	27	27	27	26	26
-2.67%	27	26	25	24	22	19	16
0%	17	12	7	0	-7	-15	-23
2.67%	-51	-62	-74	-85	-97	-109	-120
5.33%	-239	-247	-256	-266	-275	-285	-295
8.00%	-513	-515	-518	-522	-526	-531	-537

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

6,360

공시일	2016-11-22
기준일	2016-11-21

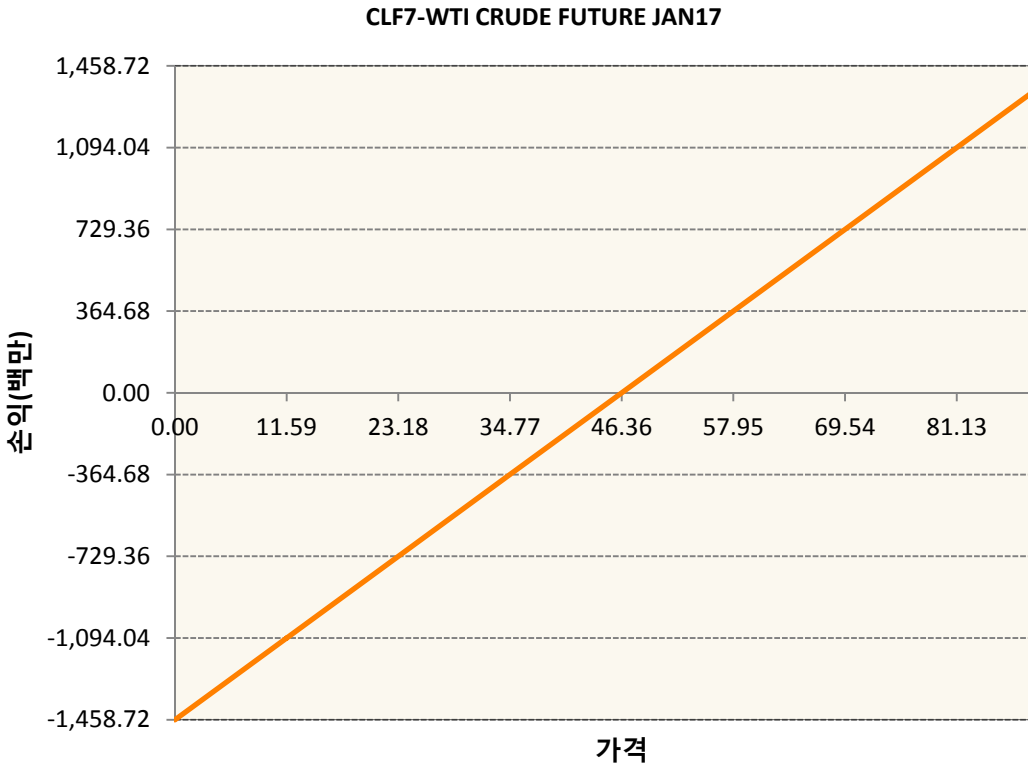
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

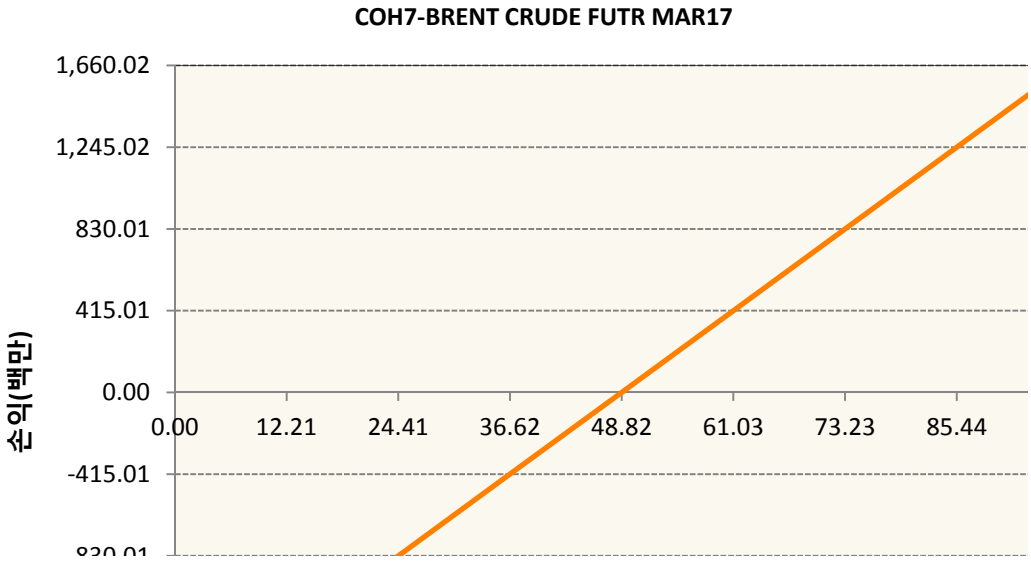
1. 계약금액

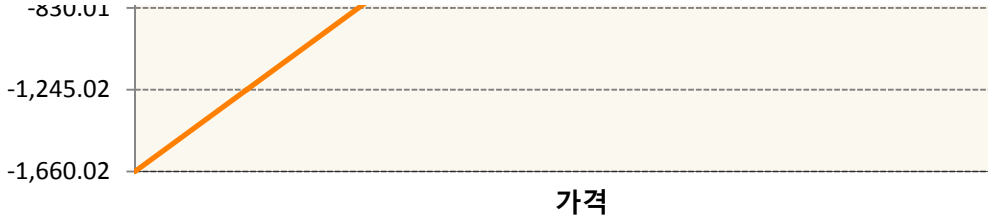
(단위:백만원)

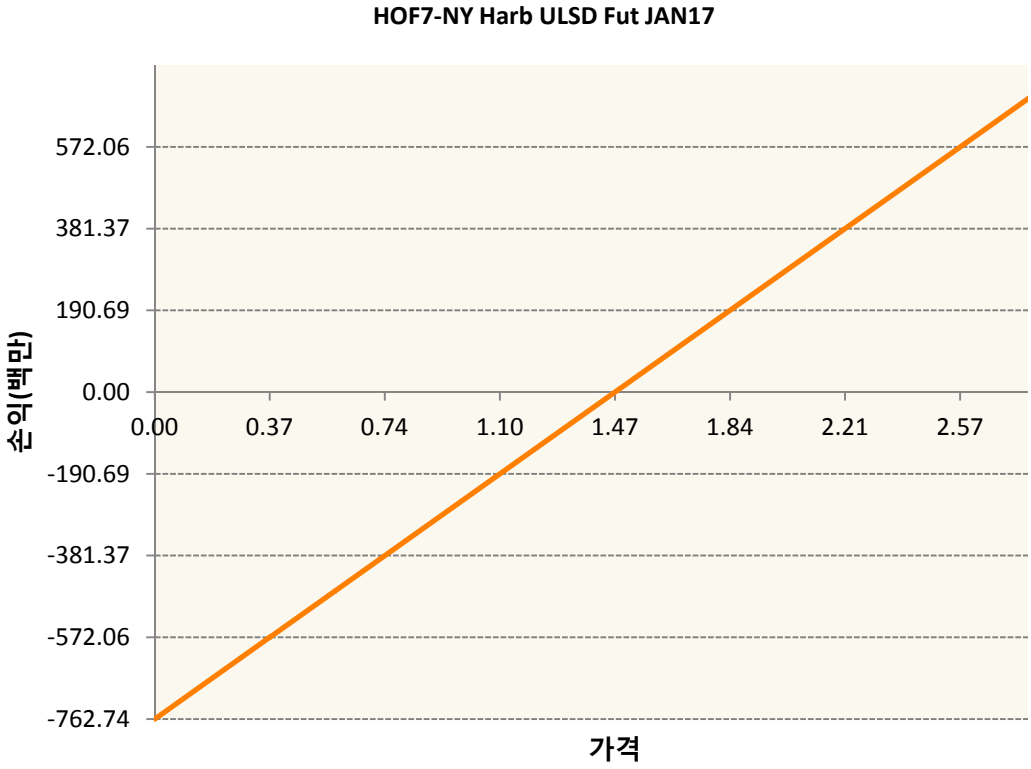
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	6,013	0	6,013	

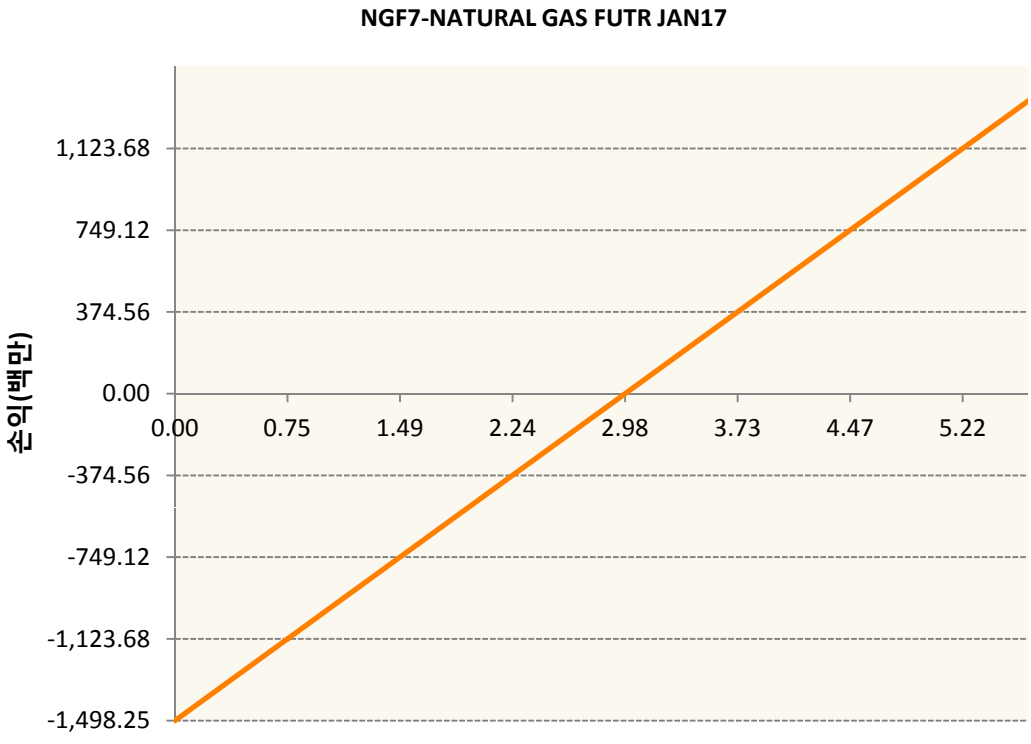
2. 만기시점의 손익구조



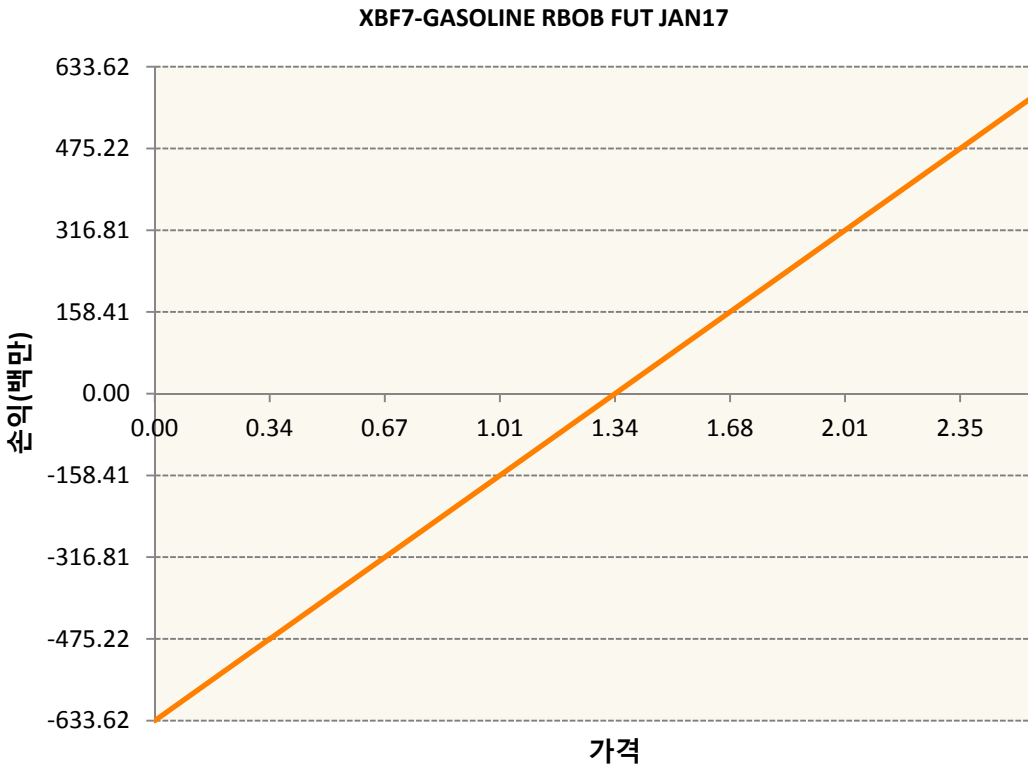



-1,245.02
-1,660.02
가격


HOF7-NY Harb ULSD Fut JAN17
572.06
381.37
190.69
0.00
-190.69
-381.37
-572.06
-762.74
0.00
0.37
0.74
1.10
1.47
1.84
2.21
2.57
순익(백만)
가격


NGF7-NATURAL GAS FUTR JAN17
1,123.68
749.12
374.56
0.00
-374.56
-749.12
-1,123.68
-1,498.25
0.00
0.75
1.49
2.24
2.98
3.73
4.47
5.22
순익(백만)

가격



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
CLF7	WTI CRUDE FUTURE JAN17	117
COH7	BRENT CRUDE FUTR MAR17	133
HOF7	NY Harb ULSD Fut JAN17	61
NGF7	NATURAL GAS FUTR JAN17	120
XBF7	GASOLINE RBOB FUT JAN17	51

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,078

공시일	2016-11-22
기준일	2016-11-21

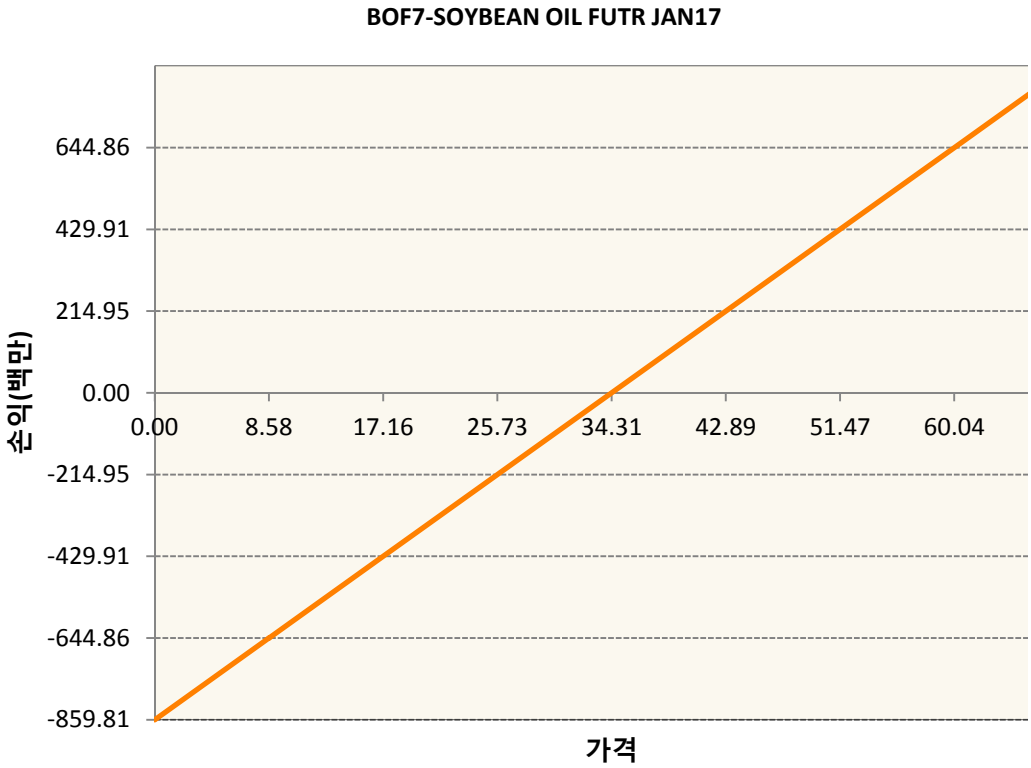
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

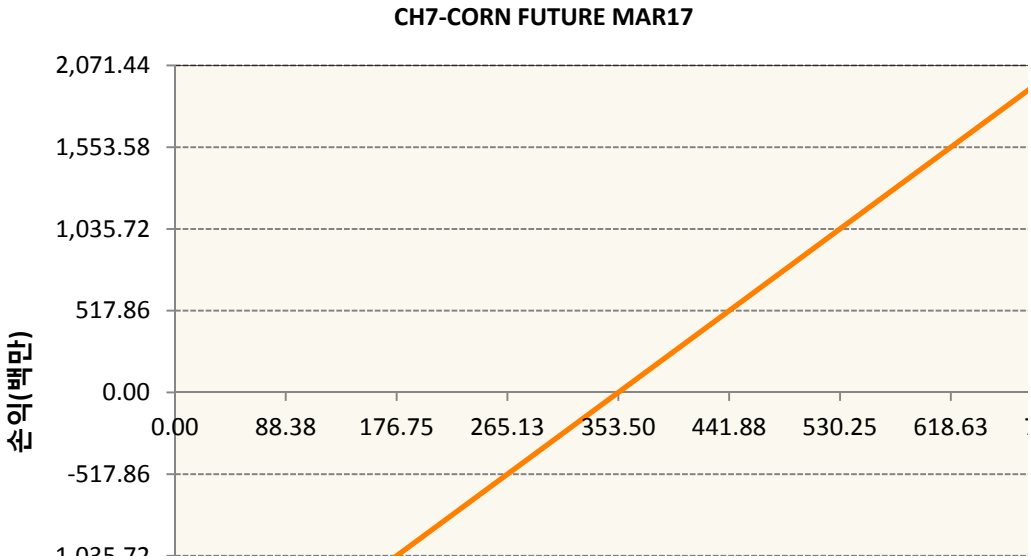
1. 계약금액

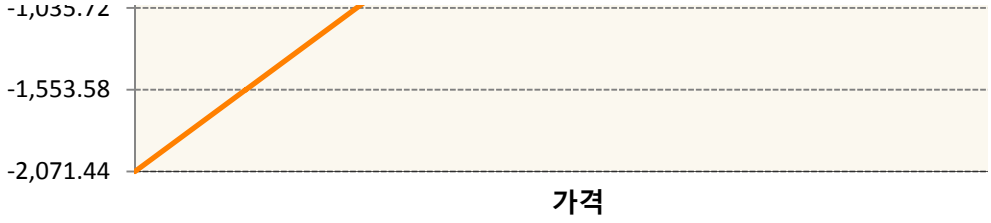
(단위:백만원)

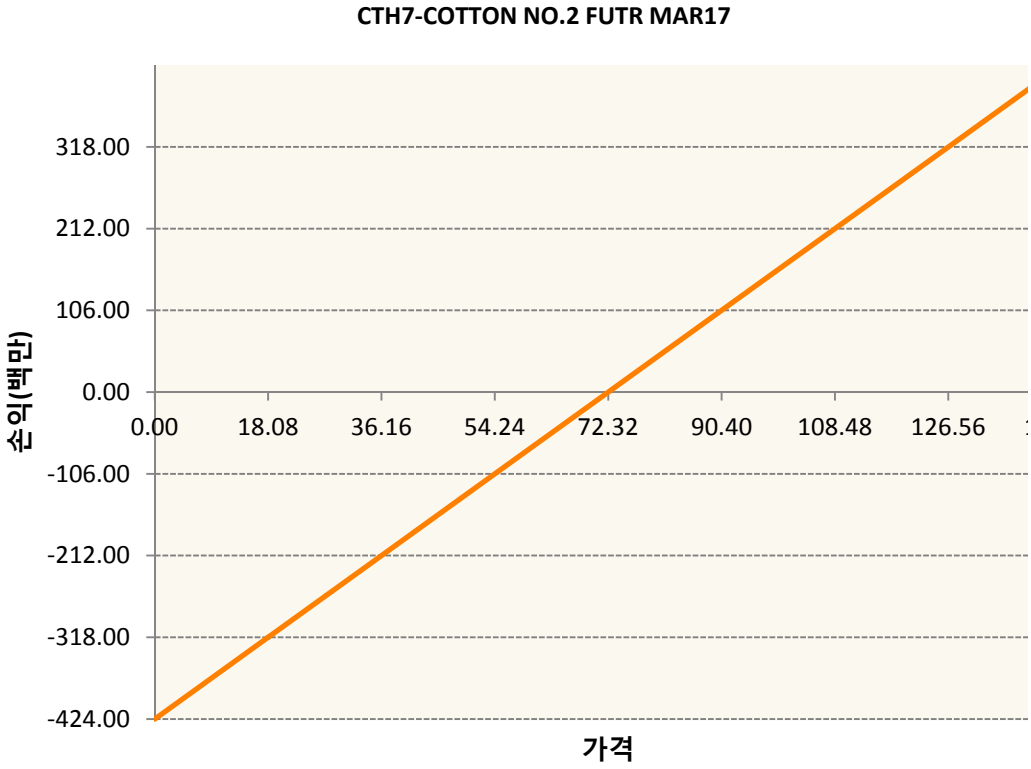
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	9,302	0	9,302	

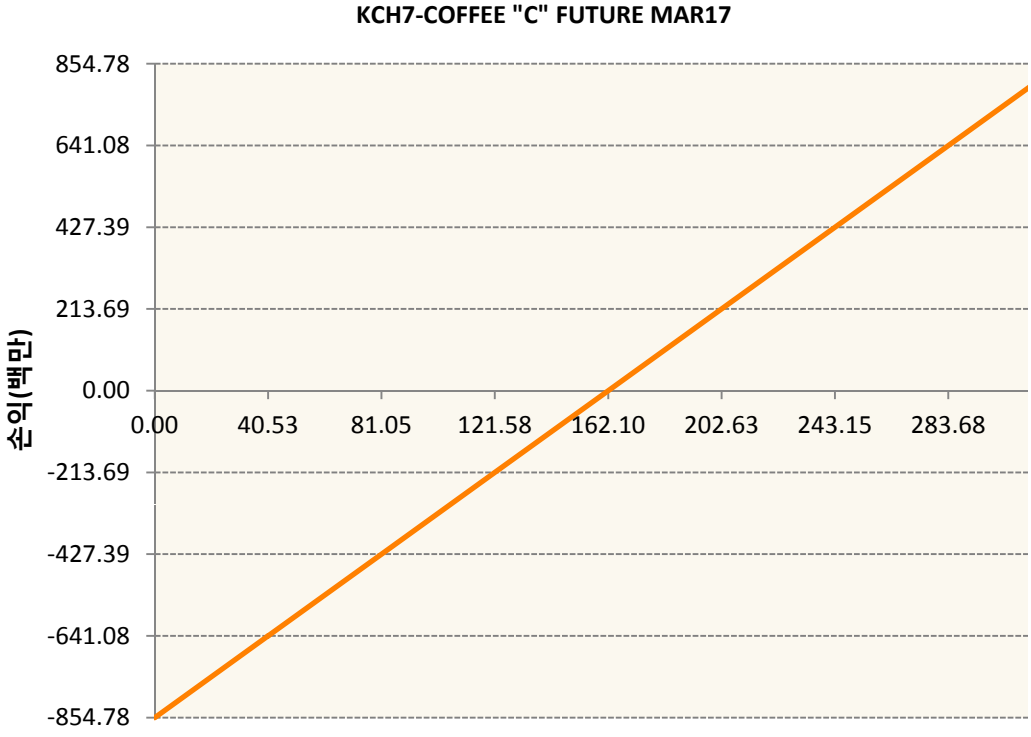
2. 만기시점의 손익구조



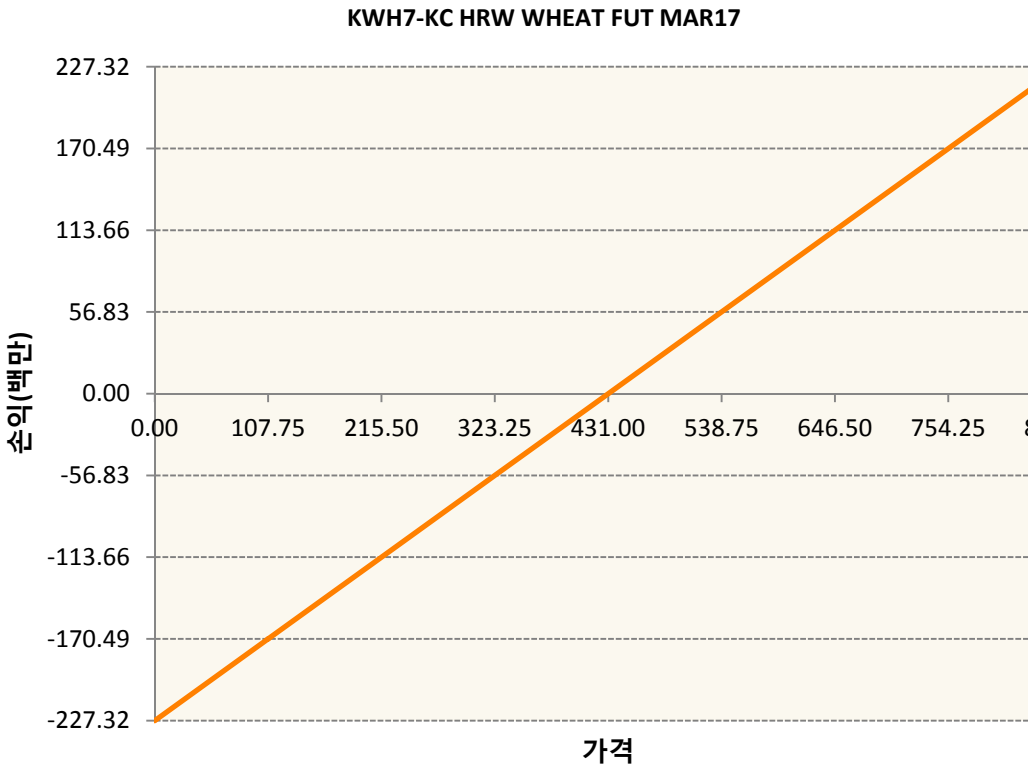


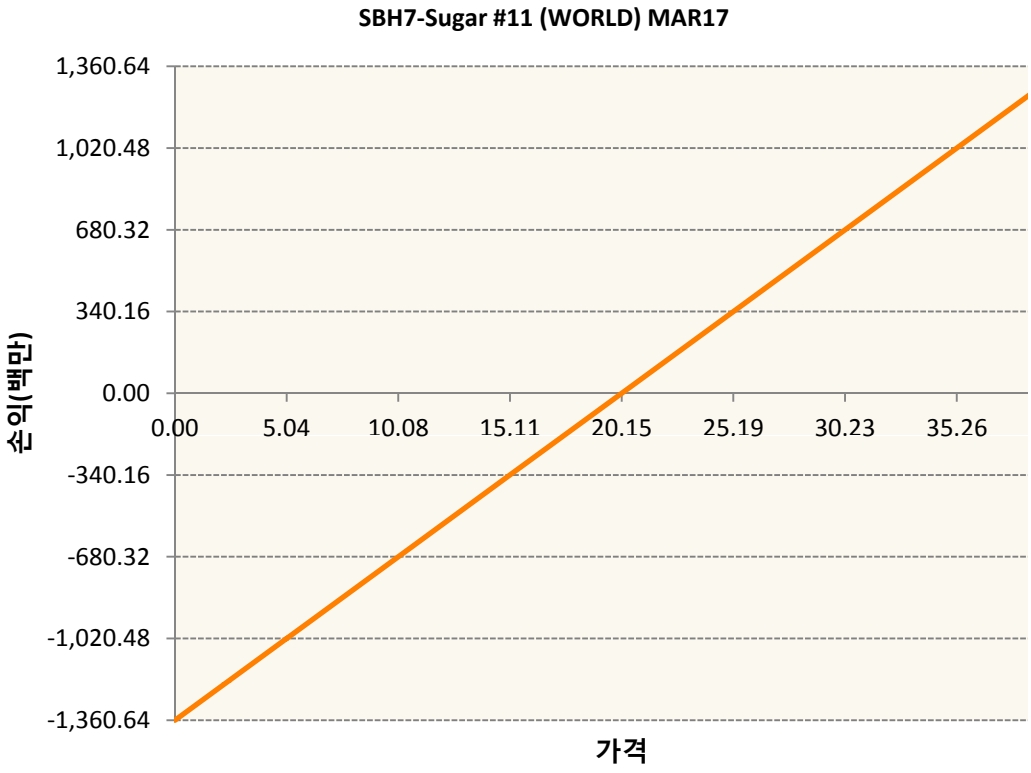

-1,553.58
-2,071.44
가격

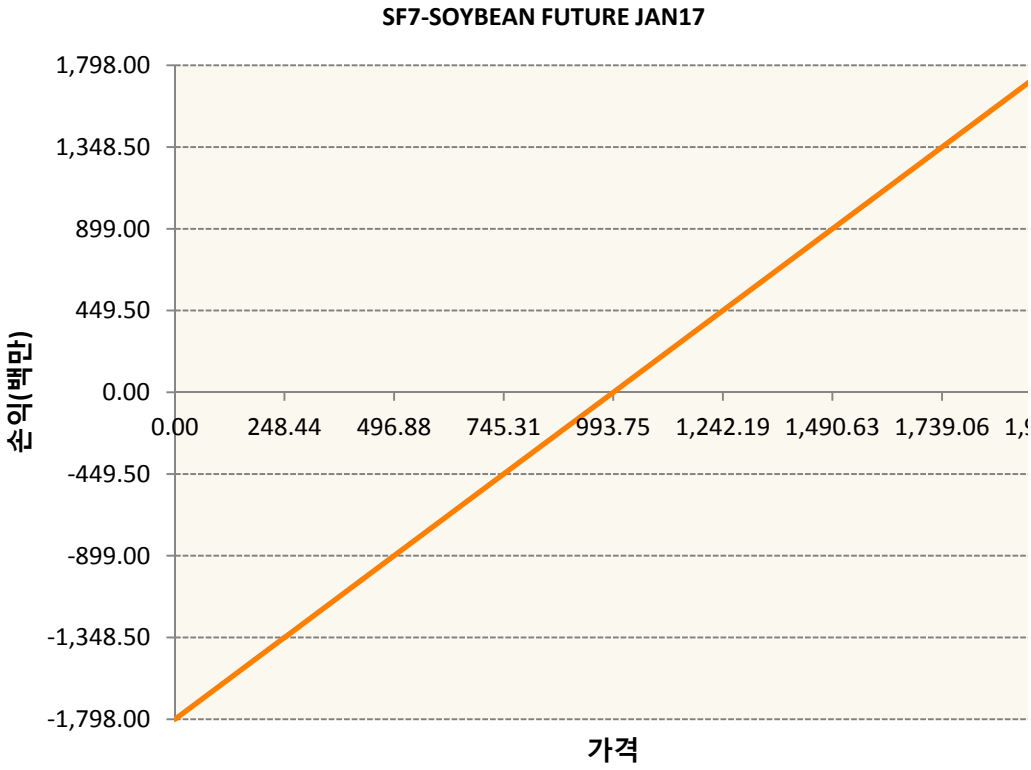

CTH7-COTTON NO.2 FUTR MAR17
318.00
212.00
106.00
0.00
-106.00
-212.00
-318.00
-424.00
0.00
18.08
36.16
54.24
72.32
90.40
108.48
126.56
순익(백만)
가격

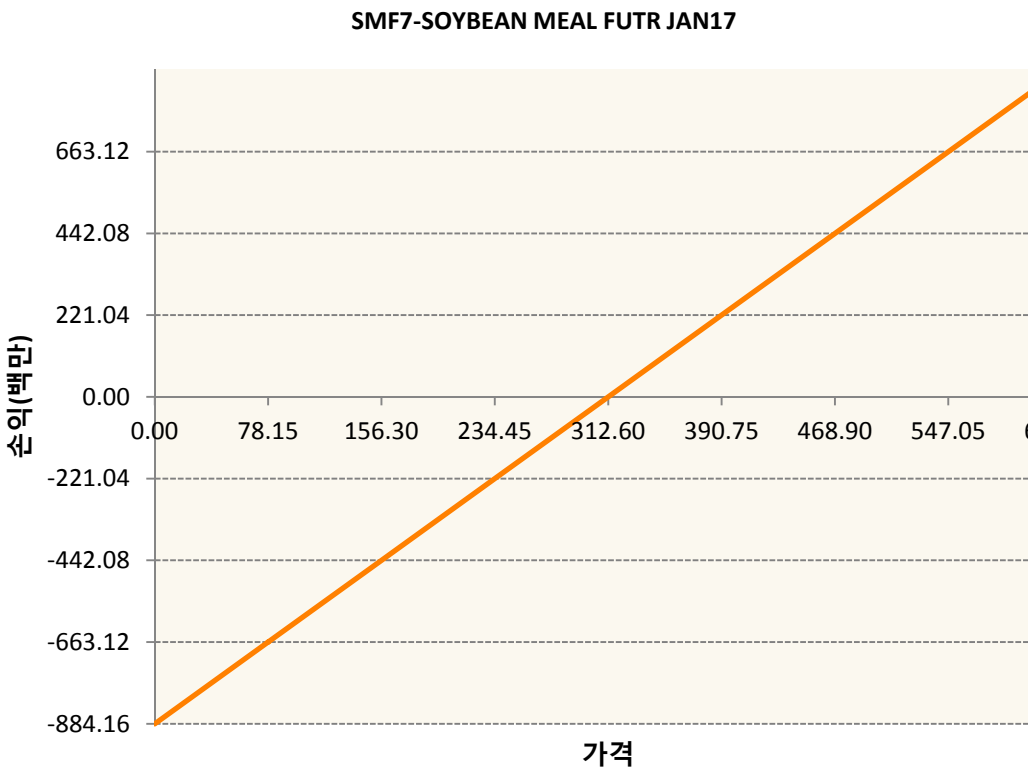

KCH7-COFFEE "C" FUTURE MAR17
854.78
641.08
427.39
213.69
0.00
-213.69
-427.39
-641.08
-854.78
0.00
40.53
81.05
121.58
162.10
202.63
243.15
283.68
순익(백만)

가격

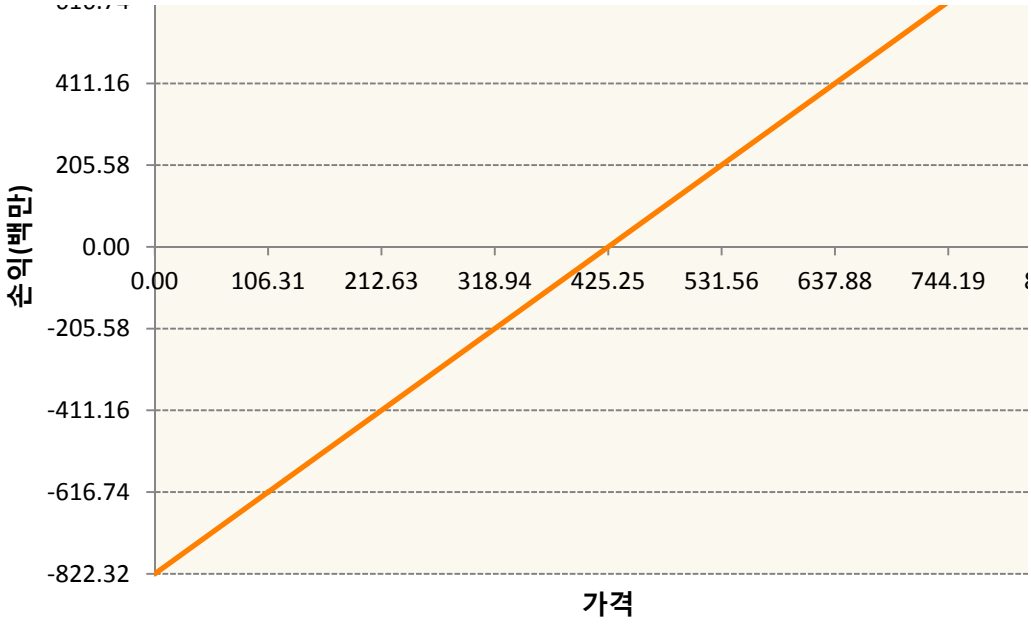

KWH7-KC HRW WHEAT FUT MAR17
227.32
170.49
113.66
56.83
0.00
-56.83
-113.66
-170.49
-227.32
0.00
107.75
215.50
323.25
431.00
538.75
646.50
754.25
손익(백만)
가격


SBH7-Sugar #11 (WORLD) MAR17
1,360.64
1,020.48
680.32
340.16
0.00
-340.16
-680.32
-1,020.48
-1,360.64
0.00
5.04
10.08
15.11
20.15
25.19
30.23
35.26
손익(백만)
가격


SF7-SOYBEAN FUTURE JAN17
1,798.00
1,348.50
899.00
449.50
0.00
-449.50
-899.00
-1,348.50
-1,798.00
0.00
248.44
496.88
745.31
993.75
1,242.19
1,490.63
1,739.06
손익(백만)
가격


SMF7-SOYBEAN MEAL FUTR JAN17
663.12
442.08
221.04
0.00
-221.04
-442.08
-663.12
-884.16
0.00
78.15
156.30
234.45
312.60
390.75
468.90
547.05
손익(백만)
가격


WH7-WHEAT FUTURE(CBT) MAR17
822.32
616.74



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

BOF7	SOYBEAN OIL FUTR JAN17	69
CH7	CORN FUTURE MAR17	166
CTH7	COTTON NO.2 FUTR MAR17	34
KCH7	COFFEE "C" FUTURE MAR17	68
KWH7	KC HRW WHEAT FUT MAR17	18
SBH7	Sugar #11 (WORLD) MAR17	109
SF7	SOYBEAN FUTURE JAN17	144
SMF7	SOYBEAN MEAL FUTR JAN17	71
WH7	WHEAT FUTURE(CBT) MAR17	66

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

931