공시일	2016-11-23
기준일	2016-11-22

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	2016-11-23
기준일	2016-11-22

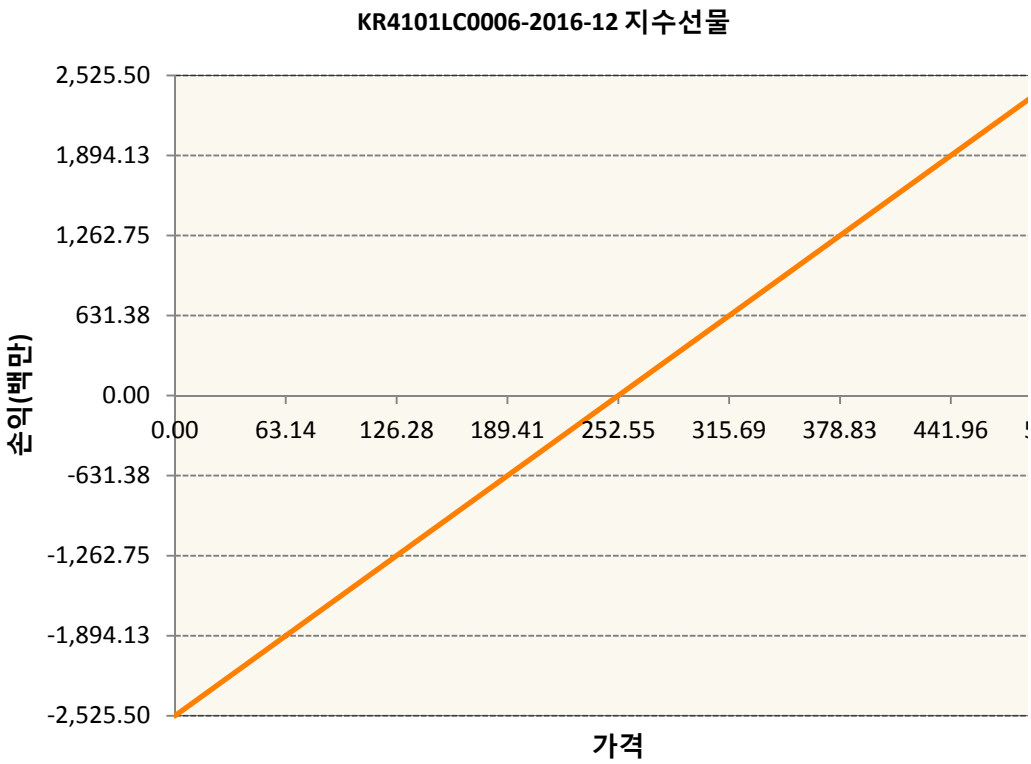
스마트인덱스모

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	126	0	126	장내
누계	유가증권	선물	2,526	0	2,526	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101LC00 2016-12 지수선물							202
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-202	-202	-202	-202	-202	-202	-202
-5.33%	-135	-135	-135	-135	-135	-135	-135
-2.67%	-67	-67	-67	-67	-67	-67	-67
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	67	67	67	67	67	67	67
5.33%	135	135	135	135	135	135	135
8.00%	202	202	202	202	202	202	202

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

156

공시일	2016-11-23
기준일	2016-11-22

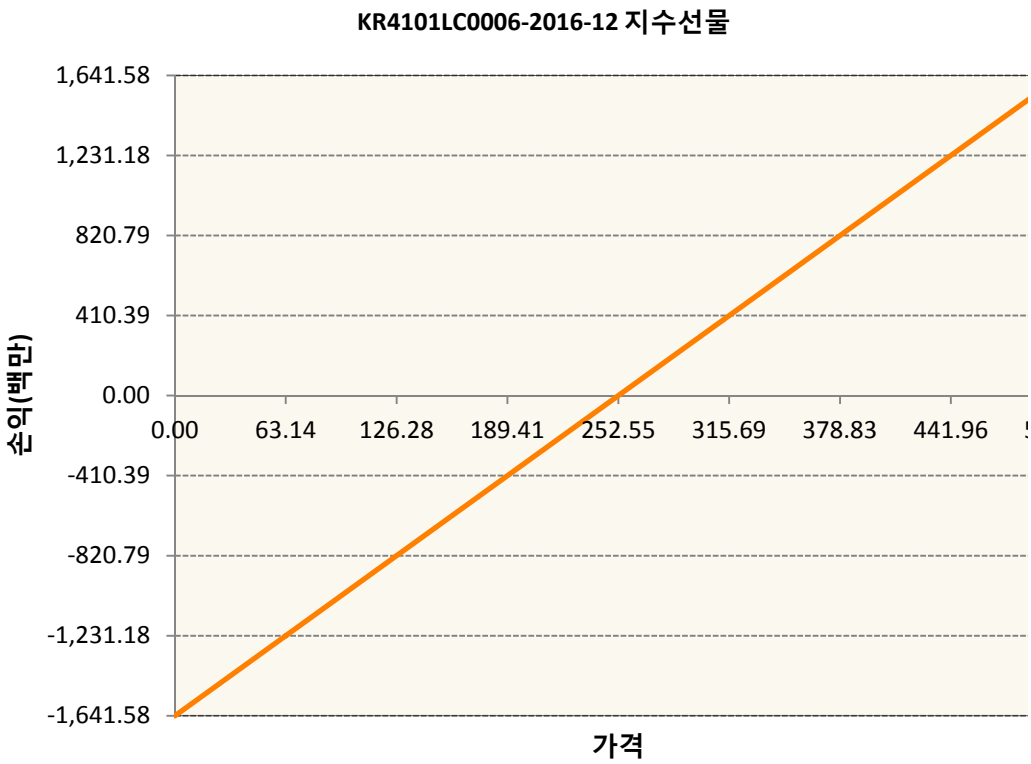
스마트레버리지목표전환형1호

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	1,642	0	1,642	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101LC00 2016-12 지수선물							131
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-131	-131	-131	-131	-131	-131	-131
-5.33%	-87	-87	-87	-87	-87	-87	-87
-2.67%	-44	-44	-44	-44	-44	-44	-44
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	44	44	44	44	44	44	44
5.33%	87	87	87	87	87	87	87
8.00%	131	131	131	131	131	131	131

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

101

공시일	2016-11-23
기준일	2016-11-22

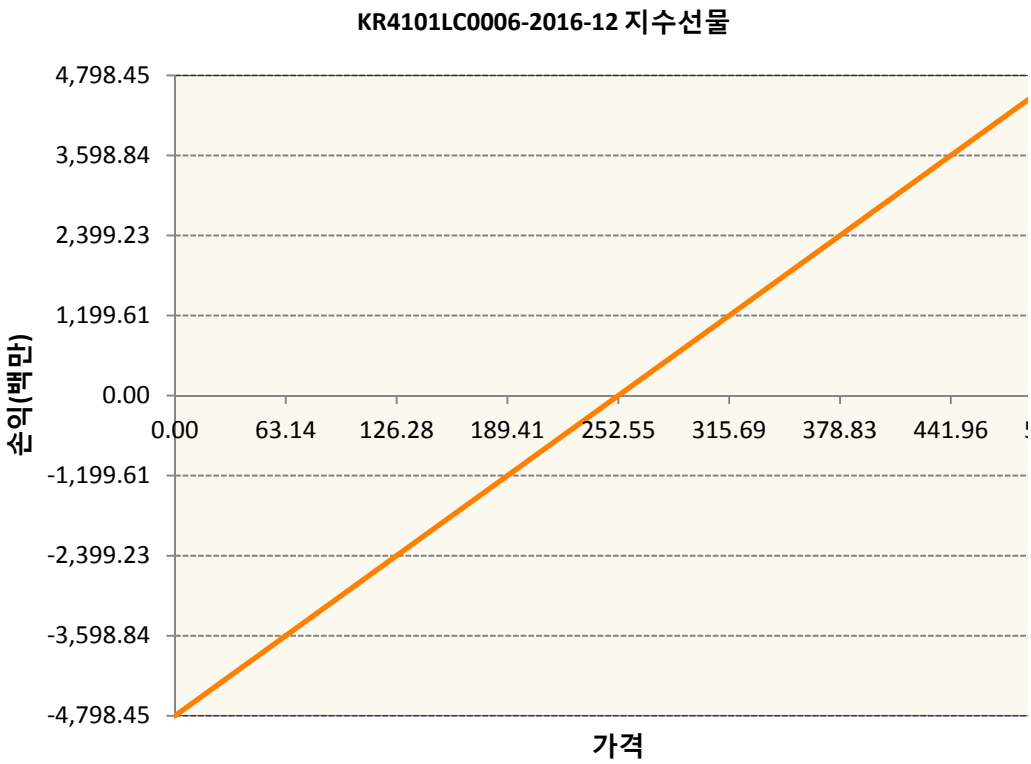
1.3배 레버리지 인덱스(주식-파생형)

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	4,798	0	4,798	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101LC00 2016-12 지수선물							384
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-384	-384	-384	-384	-384	-384	-384
-5.33%	-256	-256	-256	-256	-256	-256	-256
-2.67%	-128	-128	-128	-128	-128	-128	-128
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	128	128	128	128	128	128	128
5.33%	256	256	256	256	256	256	256
8.00%	384	384	384	384	384	384	384

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

296

공시일	2016-11-23
기준일	2016-11-22

SMART합성-MSCI선진국증권상장지

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	11,013	0	11,013	장외
누계	지수	스왑	11,013	0	11,013	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWMXWO0(신한MXWO 미래S161122	881

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

713

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2016-11-23
기준일	2016-11-22

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	404

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

762

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2016-11-23
기준일	2016-11-22

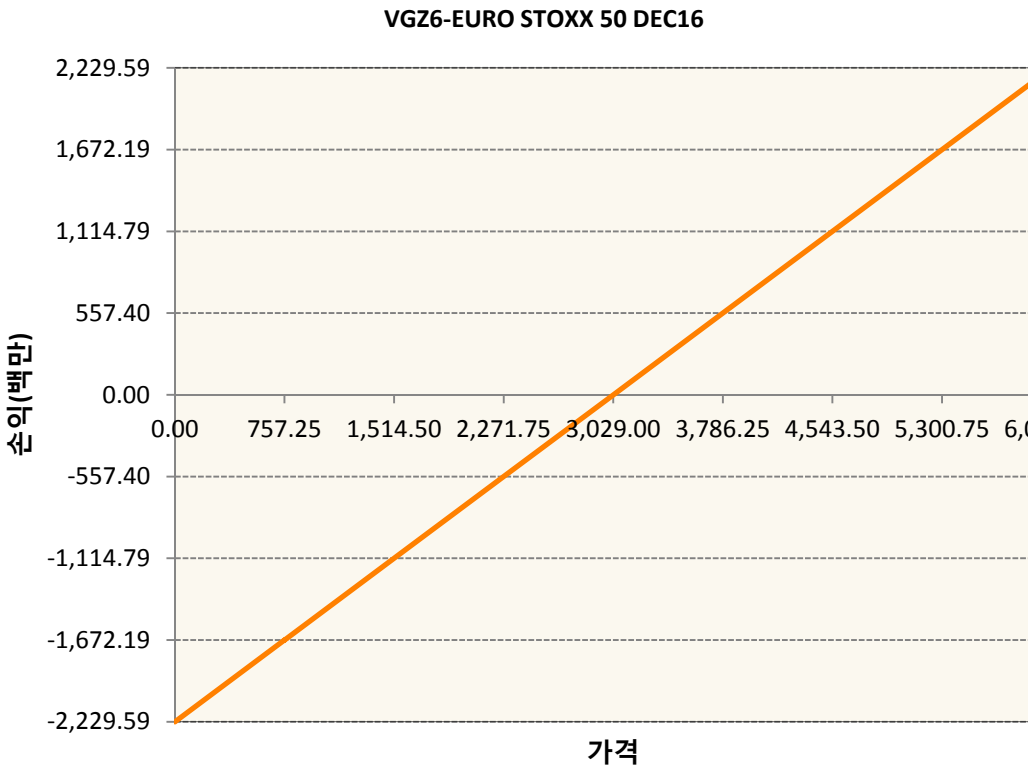
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,230	0	2,230	

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	2016-11-23
기준일	2016-11-22

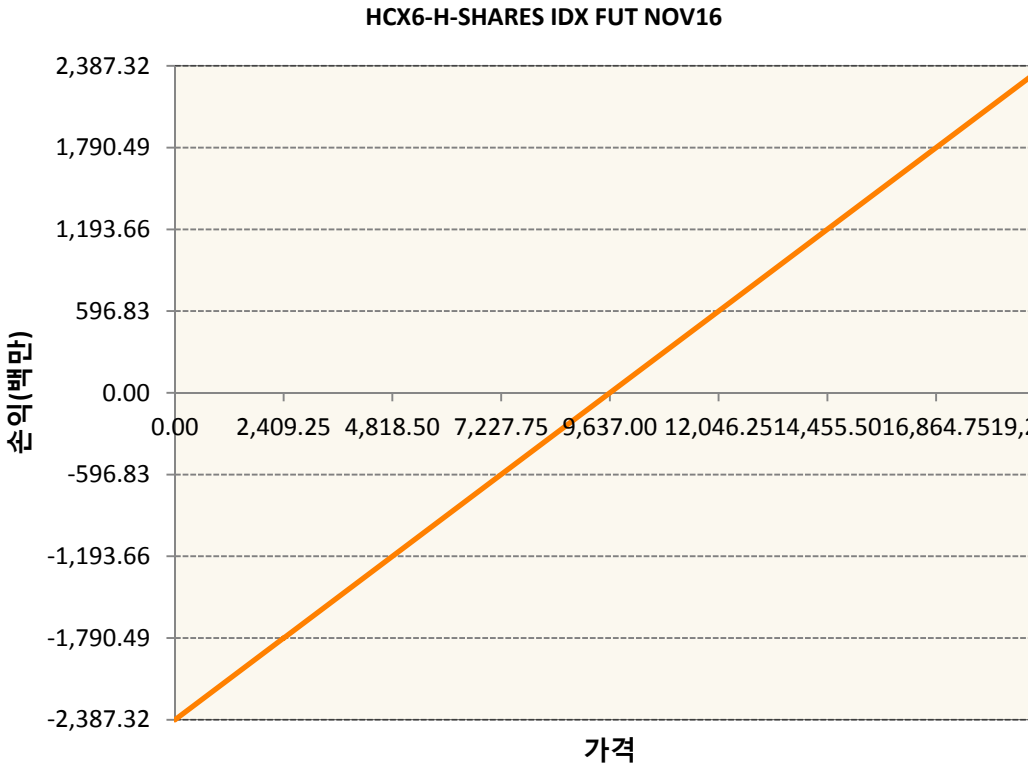
차이나인덱스모(주식-파생형)

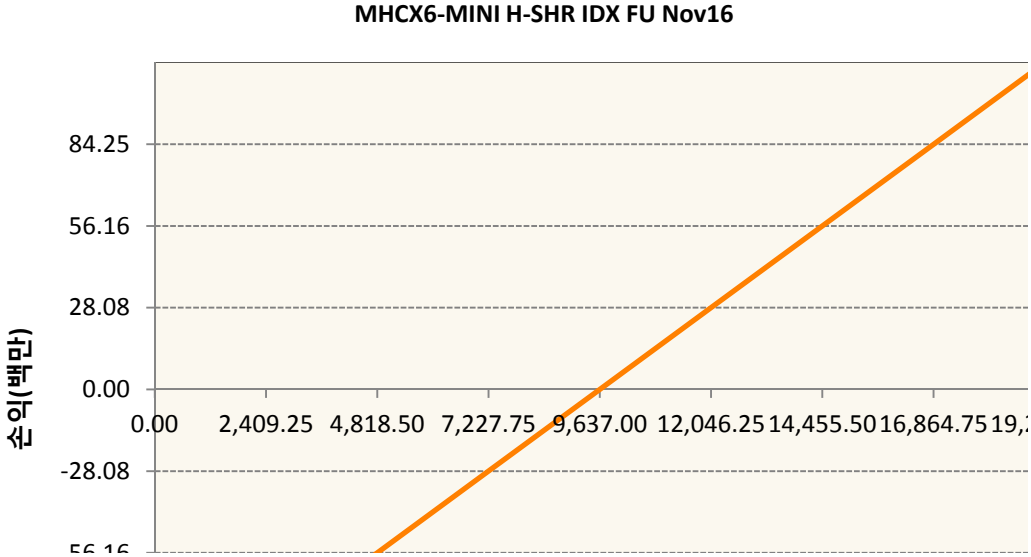
1. 계약금액

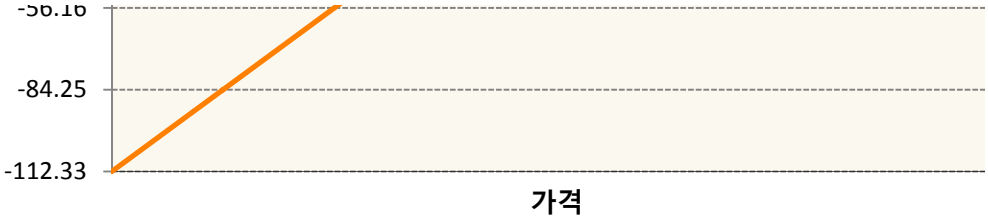
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,500	0	2,500	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

HCX6	H-SHARES IDX FUT NOV16	191
MHCX6	MINI H-SHR IDX FU Nov16	9

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

266

공시일	2016-11-23
기준일	2016-11-22

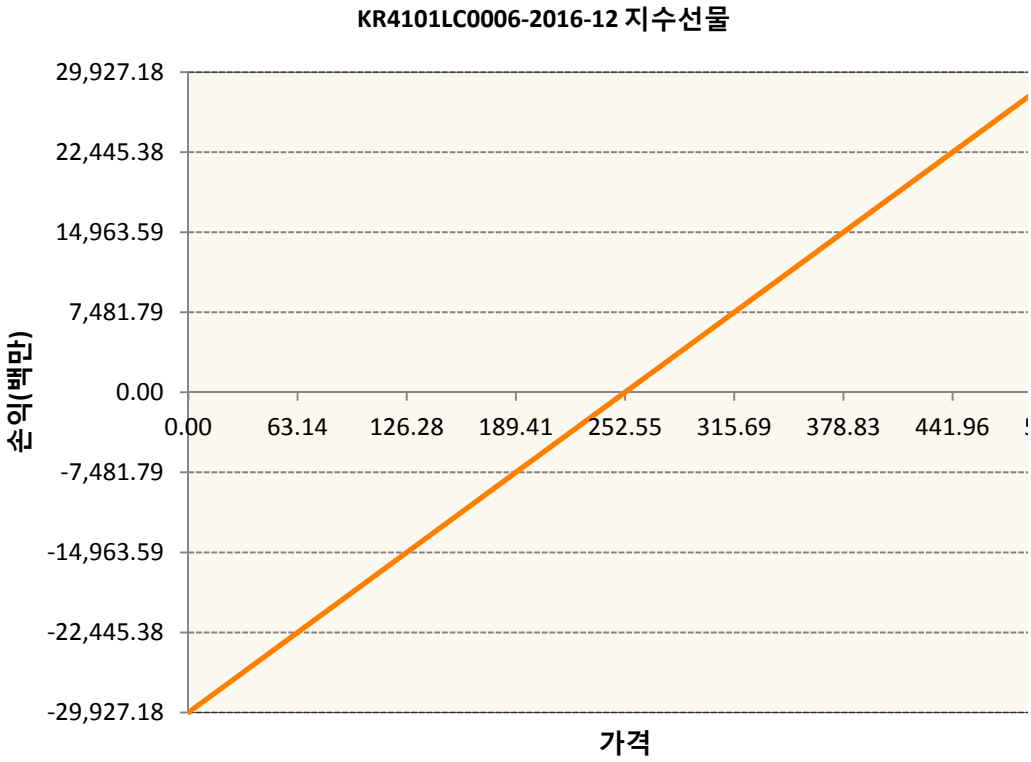
커버드콜(주식혼합-파생형)

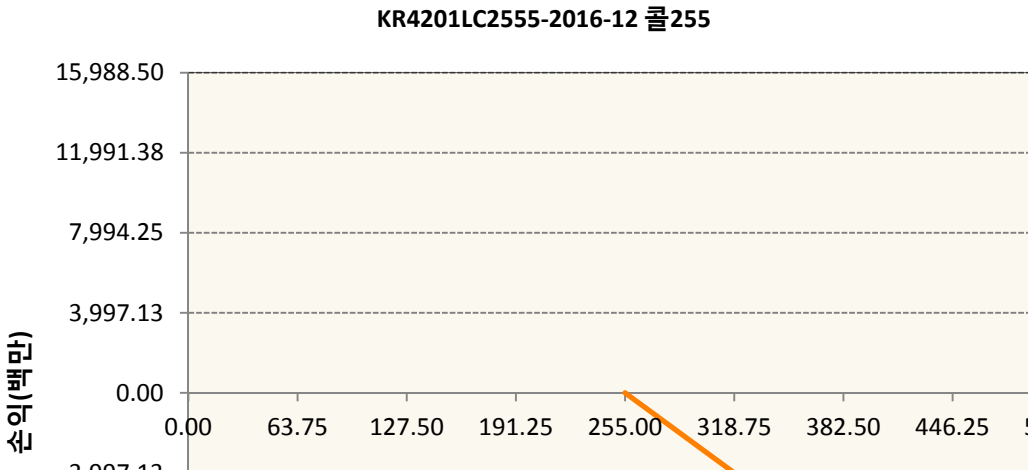
1. 계약금액

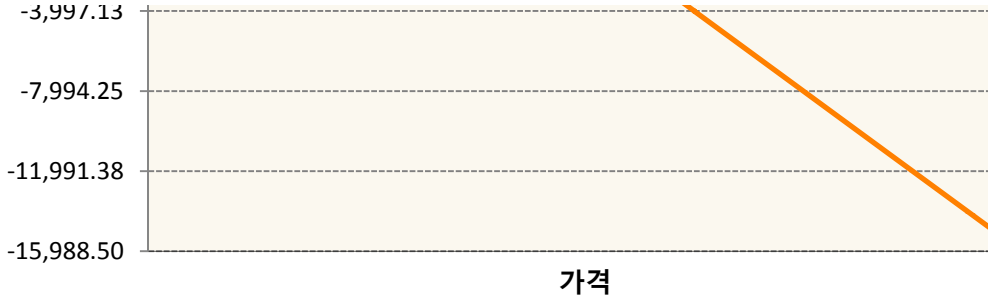
(단위:백만원)

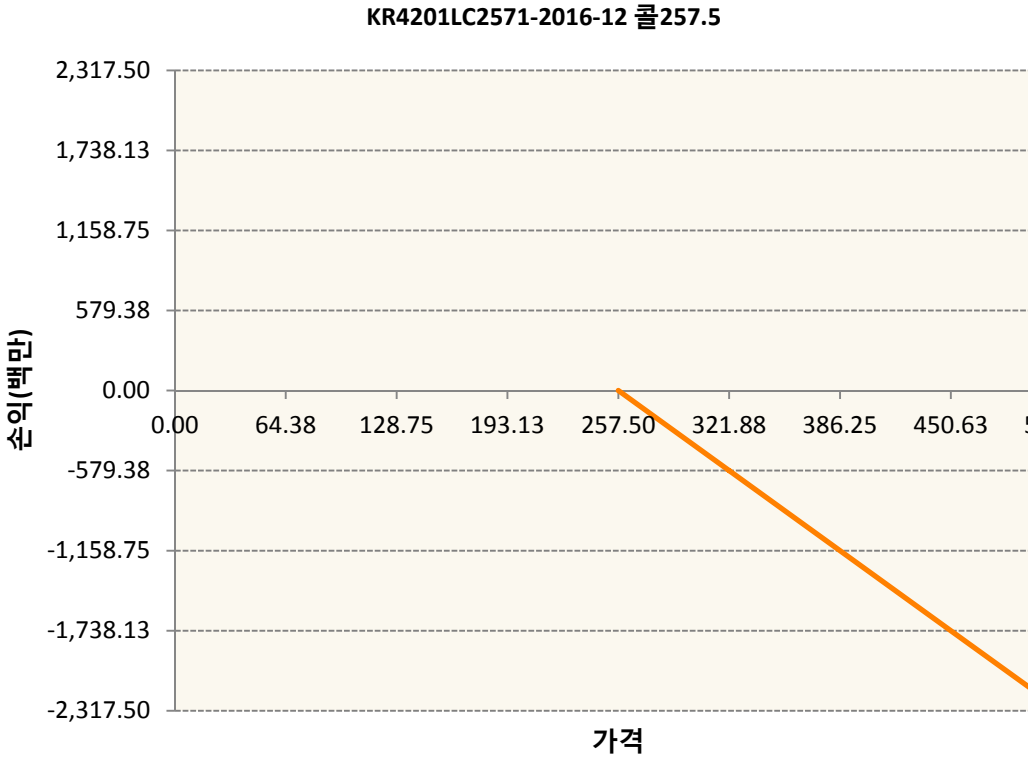
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	256	-256	장내
누계	유가증권	선물	29,927	0	29,927	장내
누계	유가증권	옵션	0	18,306	-18,306	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101LC00 2016-12 지수선물							2,392
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-2,392	-2,392	-2,392	-2,392	-2,392	-2,392	-2,392
-5.33%	-1,595	-1,595	-1,595	-1,595	-1,595	-1,595	-1,595
-2.67%	-797	-797	-797	-797	-797	-797	-797
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	797	797	797	797	797	797	797
5.33%	1,595	1,595	1,595	1,595	1,595	1,595	1,595
8.00%	2,392	2,392	2,392	2,392	2,392	2,392	2,392
KR4201LC25 2016-12 콜255							5,024
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	501	501	501	501	501	500	499
-5.33%	501	500	499	496	492	485	476
-2.67%	482	467	447	423	395	362	326
0%	193	130	65	0	-66	-133	-200
2.67%	-980	-1,034	-1,091	-1,151	-1,212	-1,274	-1,338
5.33%	-2,903	-2,913	-2,929	-2,948	-2,972	-3,000	-3,032
8.00%	-5,000	-5,000	-5,002	-5,004	-5,008	-5,015	-5,024
	KR4201LC25 2016-12 콜257.5						644

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	40	40	40	40	40	40	40
-5.33%	40	40	40	40	40	39	39
-2.67%	40	39	37	36	33	30	27
0%	21	15	8	0	-8	-16	-24
2.67%	-93	-103	-113	-123	-133	-143	-154
5.33%	-340	-343	-348	-352	-358	-364	-370
8.00%	-637	-637	-638	-639	-640	-642	-644

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

8,090

공시일	2016-11-23
기준일	2016-11-22

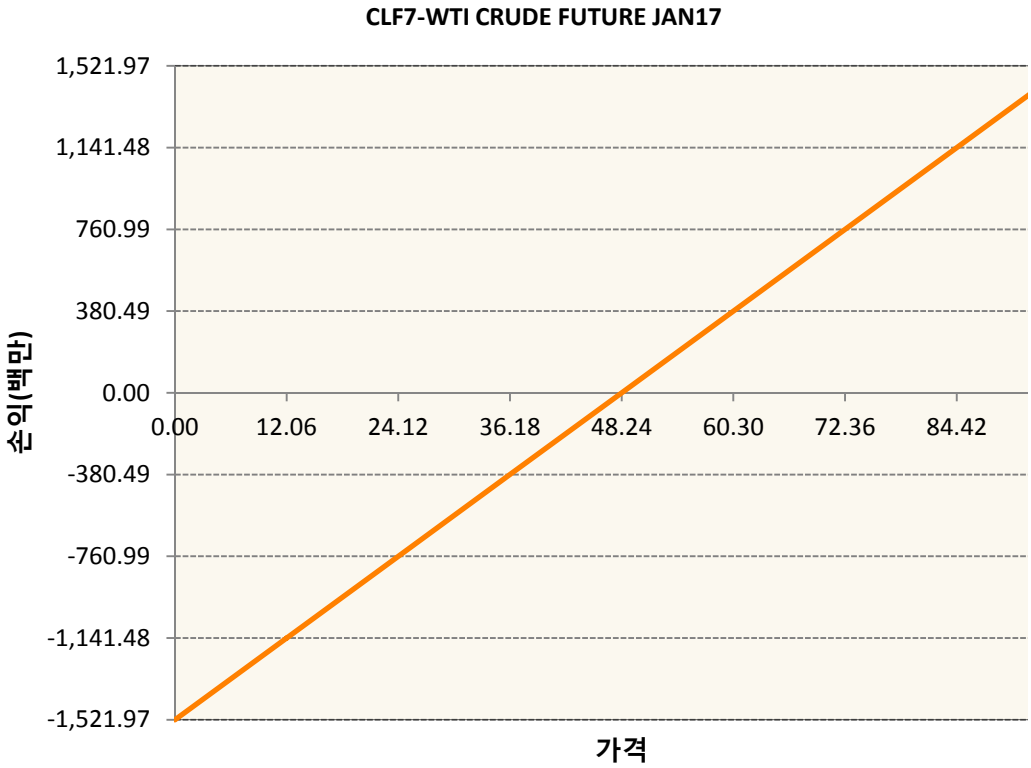
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

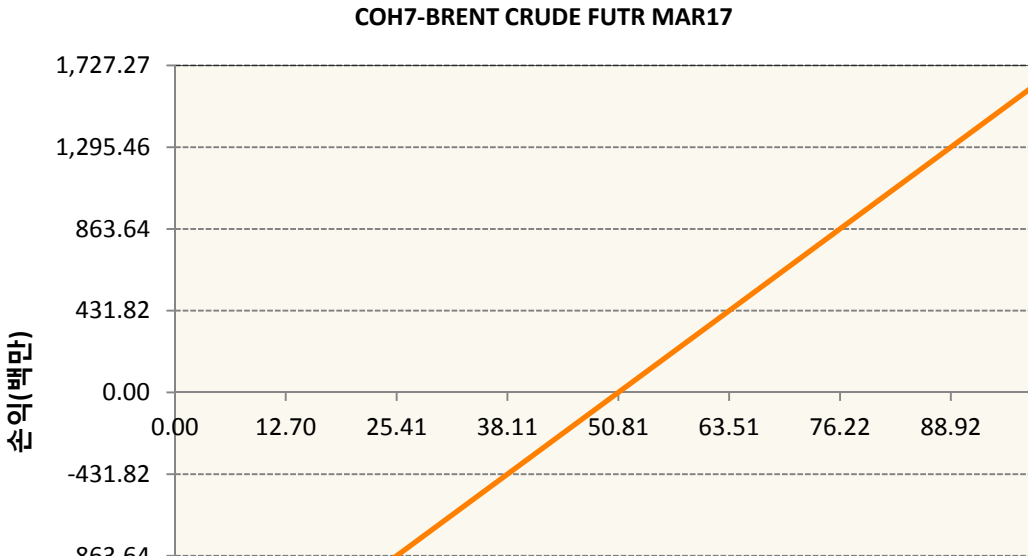
1. 계약금액

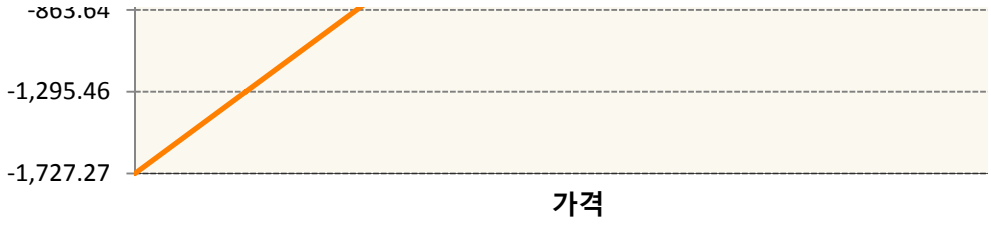
(단위:백만원)

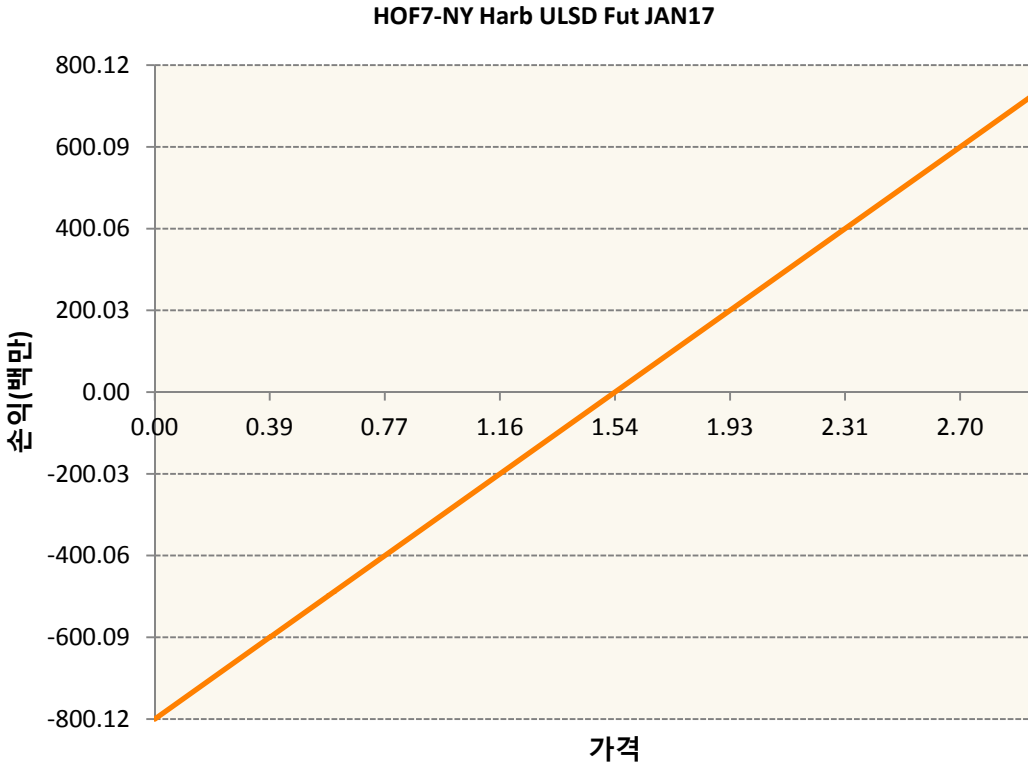
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	6,265	0	6,265	

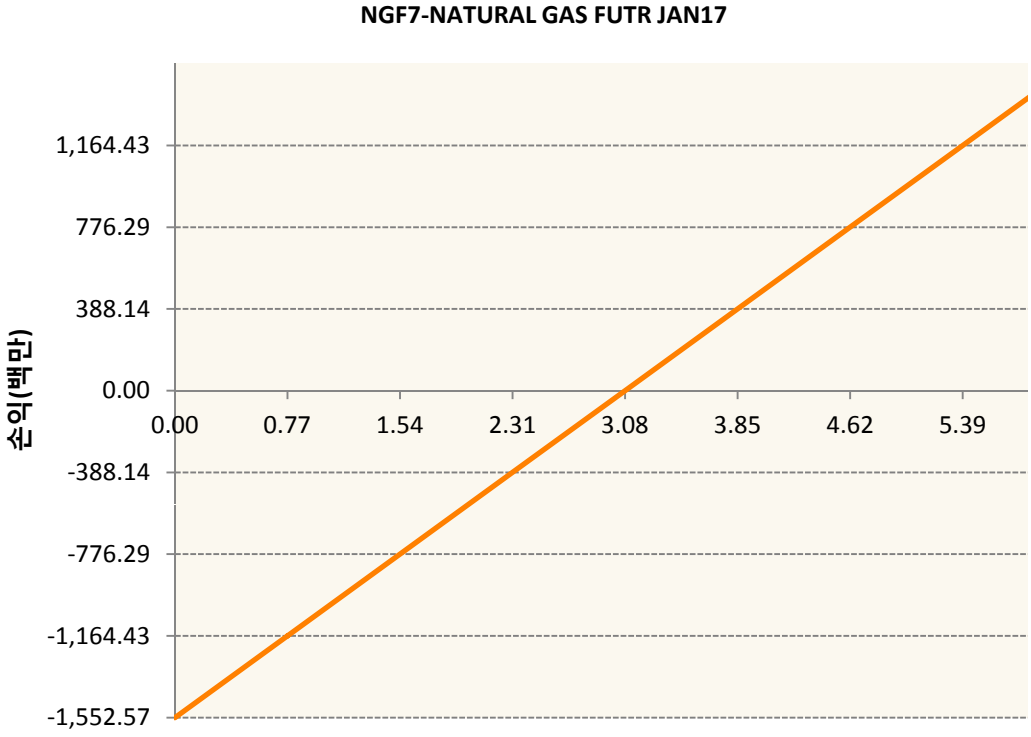
2. 만기시점의 손익구조



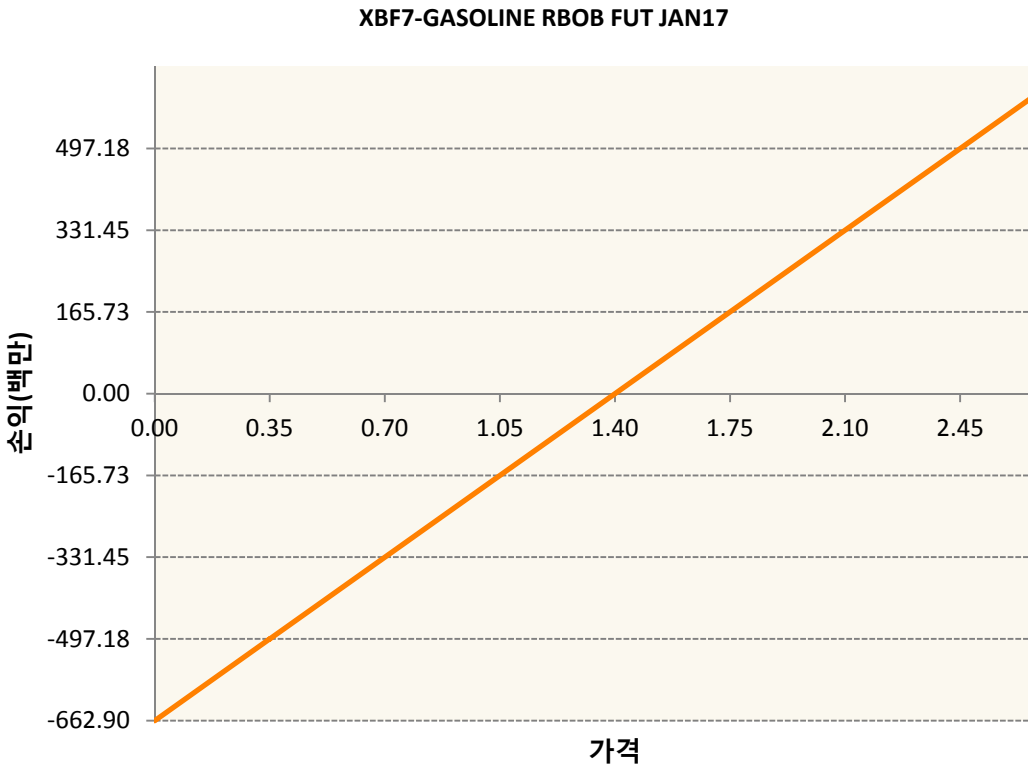



-1,295.46
-1,727.27
가격


HOF7-NY Harb ULSD Fut JAN17
800.12
600.09
400.06
200.03
0.00
-200.03
-400.06
-600.09
-800.12
0.00
0.39
0.77
1.16
1.54
1.93
2.31
2.70
손익(백만)
가격


NGF7-NATURAL GAS FUTR JAN17
1,164.43
776.29
388.14
0.00
-388.14
-776.29
-1,164.43
-1,552.57
0.00
0.77
1.54
2.31
3.08
3.85
4.62
5.39
손익(백만)

가격



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
CLF7	WTI CRUDE FUTURE JAN17	122
COH7	BRENT CRUDE FUTR MAR17	138
HOF7	NY Harb ULSD Fut JAN17	64
NGF7	NATURAL GAS FUTR JAN17	124
XBF7	GASOLINE RBOB FUT JAN17	53

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,126

공시일	2016-11-23
기준일	2016-11-22

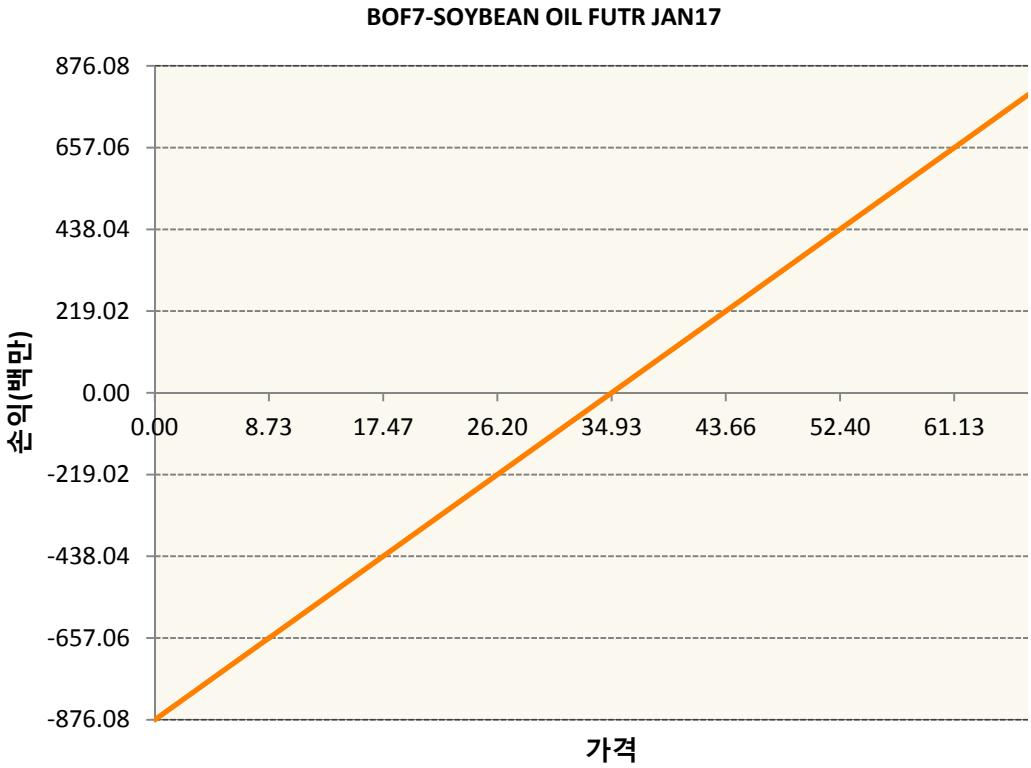
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

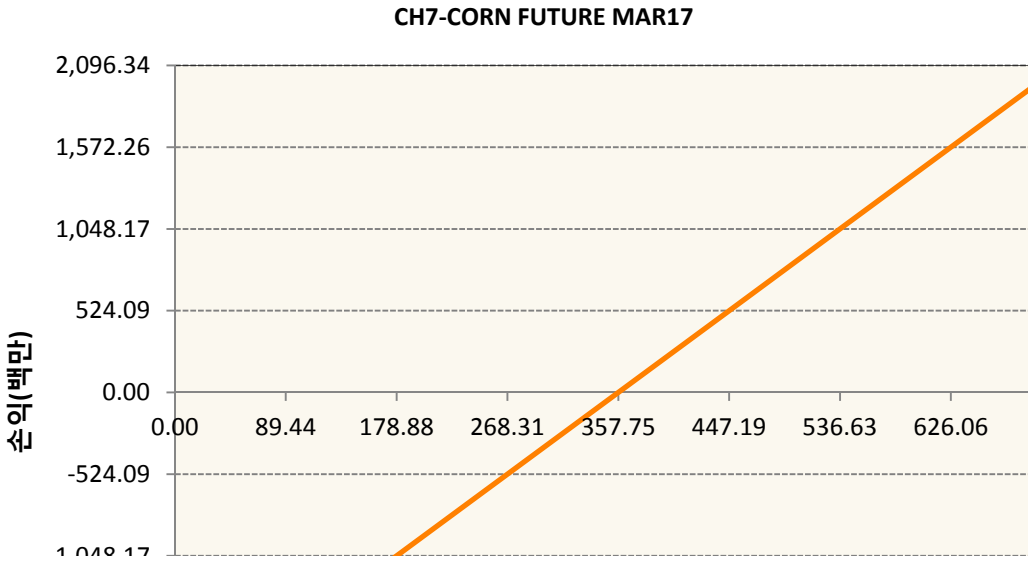
1. 계약금액

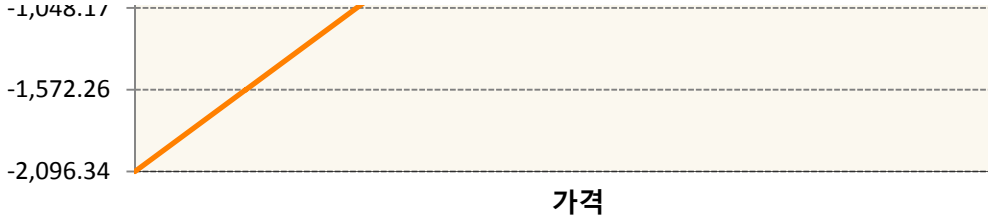
(단위:백만원)

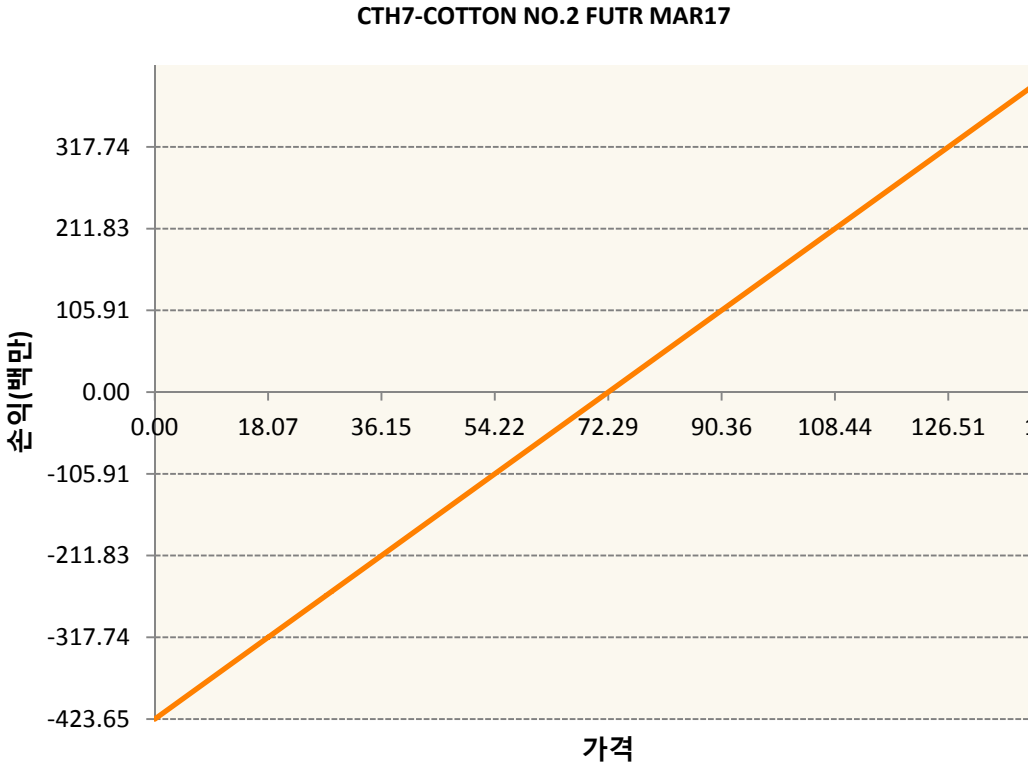
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	9,253	0	9,253	

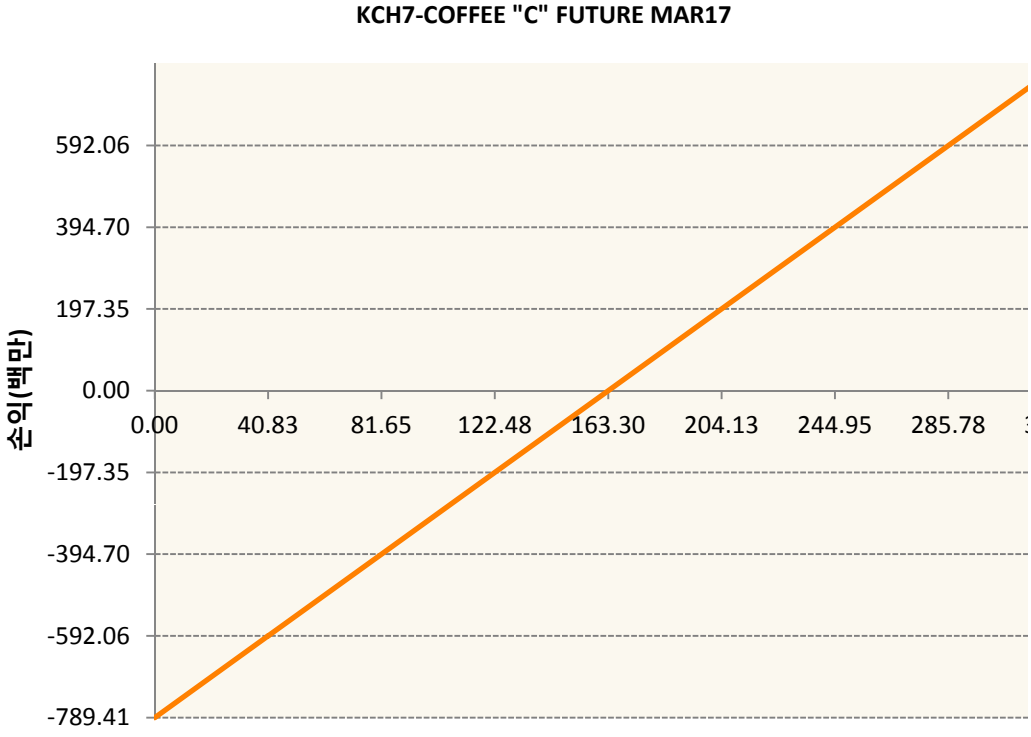
2. 만기시점의 손익구조



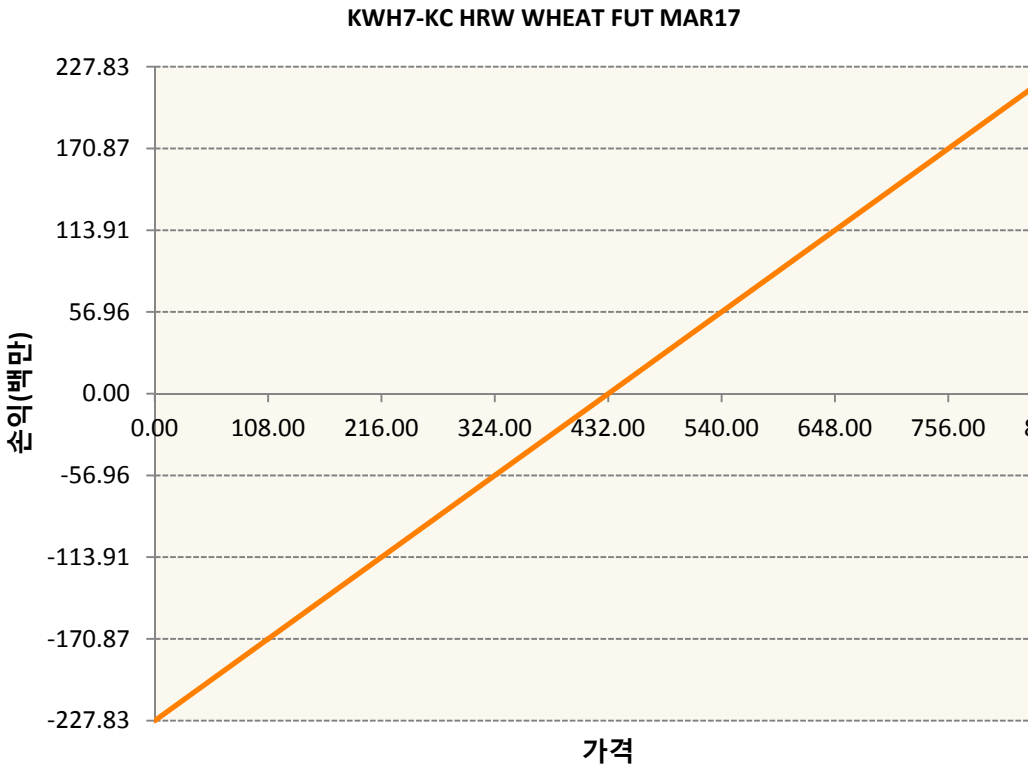


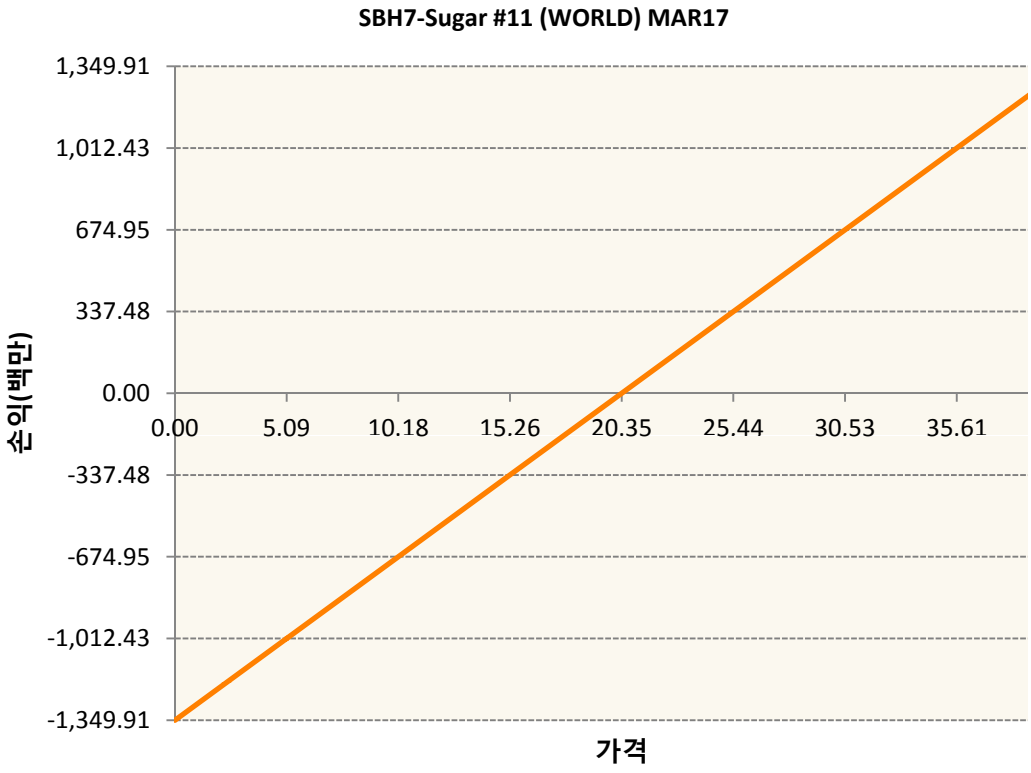

-1,572.26
-2,096.34
가격


CTH7-COTTON NO.2 FUTR MAR17
317.74
211.83
105.91
0.00
-105.91
-211.83
-317.74
-423.65
0.00
18.07
36.15
54.22
72.29
90.36
108.44
126.51
순익(백만)
가격

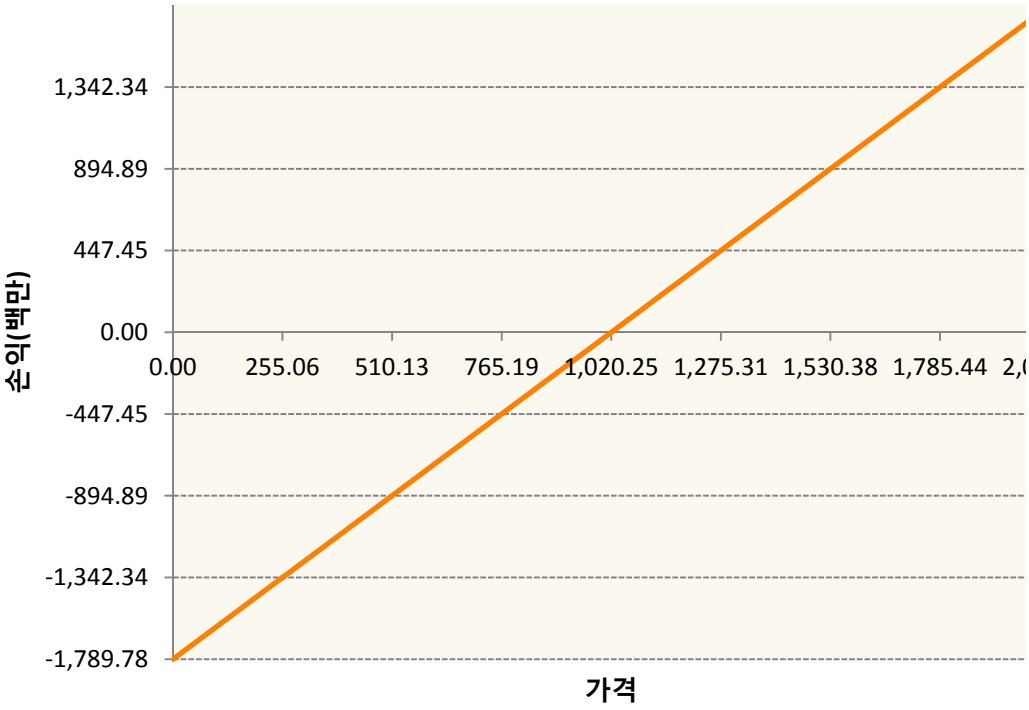

KCH7-COFFEE "C" FUTURE MAR17
592.06
394.70
197.35
0.00
-197.35
-394.70
-592.06
-789.41
0.00
40.83
81.65
122.48
163.30
204.13
244.95
285.78
순익(백만)

가격

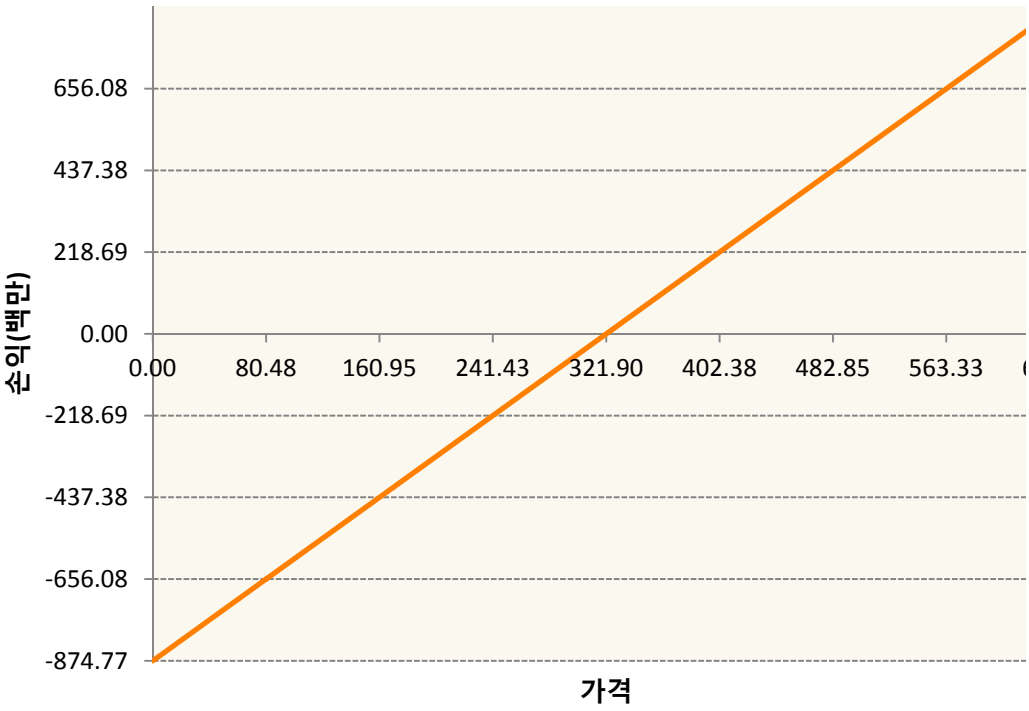

KWH7-KC HRW WHEAT FUT MAR17
227.83
170.87
113.91
56.96
0.00
-56.96
-113.91
-170.87
-227.83
0.00
108.00
216.00
324.00
432.00
540.00
648.00
756.00
손익(백만)
가격


SBH7-Sugar #11 (WORLD) MAR17
1,349.91
1,012.43
674.95
337.48
0.00
-337.48
-674.95
-1,012.43
-1,349.91
0.00
5.09
10.18
15.26
20.35
25.44
30.53
35.61
손익(백만)
가격

SF7-SOYBEAN FUTURE JAN17

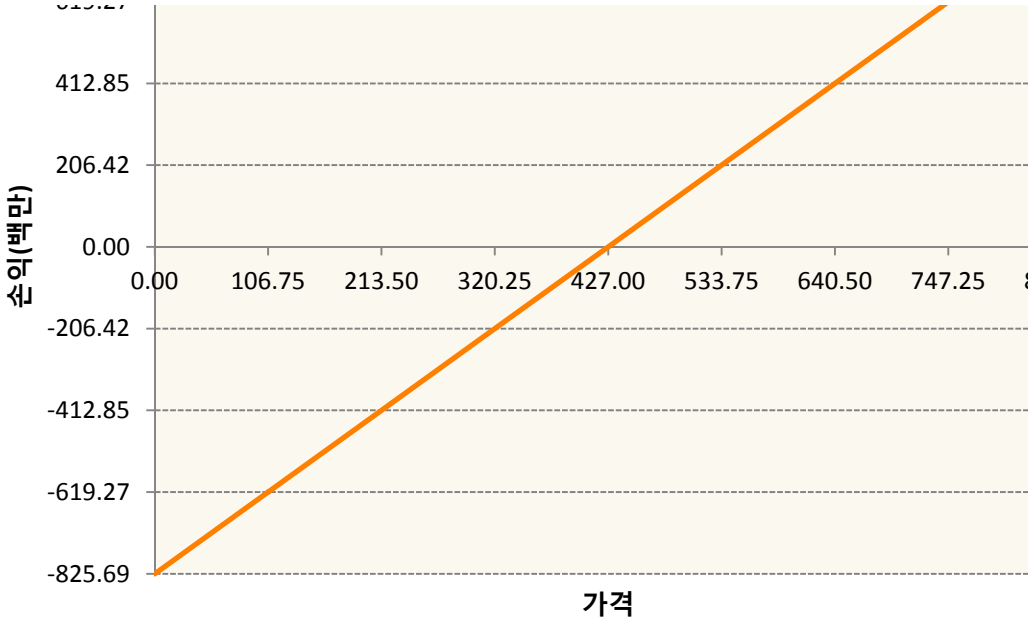


SMF7-SOYBEAN MEAL FUTR JAN17



WH7-WHEAT FUTURE(CBT) MAR17





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

BOF7	SOYBEAN OIL FUTR JAN17	70
CH7	CORN FUTURE MAR17	168
CTH7	COTTON NO.2 FUTR MAR17	34
KCH7	COFFEE "C" FUTURE MAR17	63
KWH7	KC HRW WHEAT FUT MAR17	18
SBH7	Sugar #11 (WORLD) MAR17	108
SF7	SOYBEAN FUTURE JAN17	143
SMF7	SOYBEAN MEAL FUTR JAN17	70
WH7	WHEAT FUTURE(CBT) MAR17	66

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

924