공시일	2016-11-24
기준일	2016-11-23

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	2016-11-24
기준일	2016-11-23

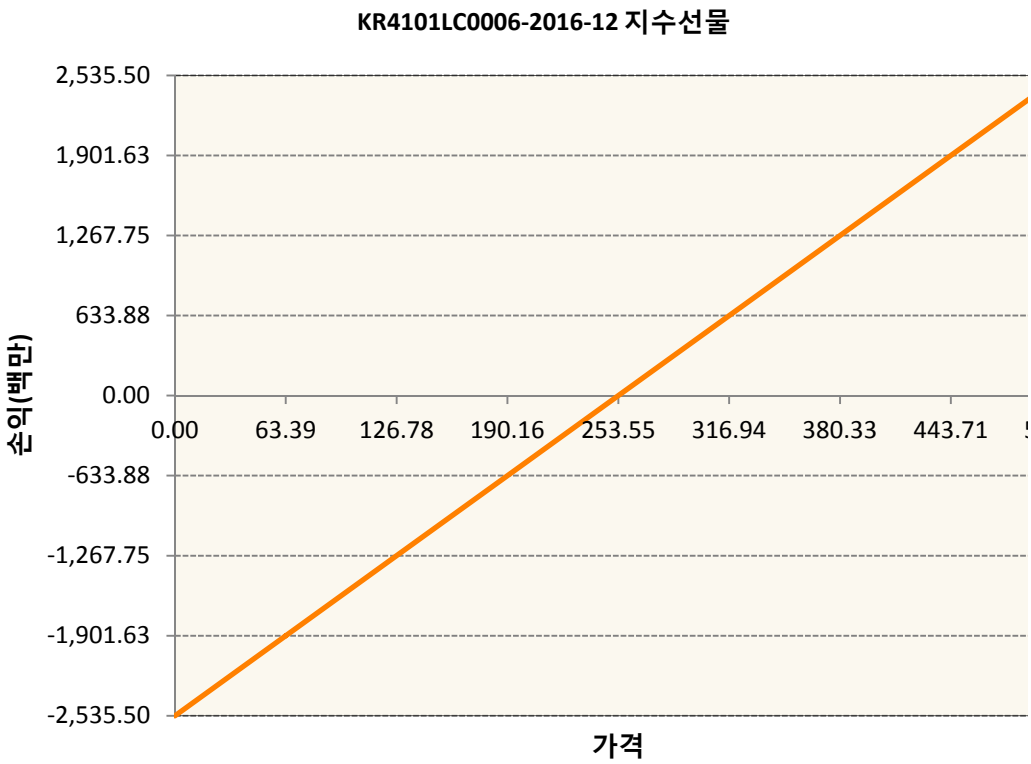
스마트인덱스모

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	2,536	0	2,536	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101LC00 2016-12 지수선물							203
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-203	-203	-203	-203	-203	-203	-203
-5.33%	-135	-135	-135	-135	-135	-135	-135
-2.67%	-68	-68	-68	-68	-68	-68	-68
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	68	68	68	68	68	68	68
5.33%	135	135	135	135	135	135	135
8.00%	203	203	203	203	203	203	203

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

157

공시일	2016-11-24
기준일	2016-11-23

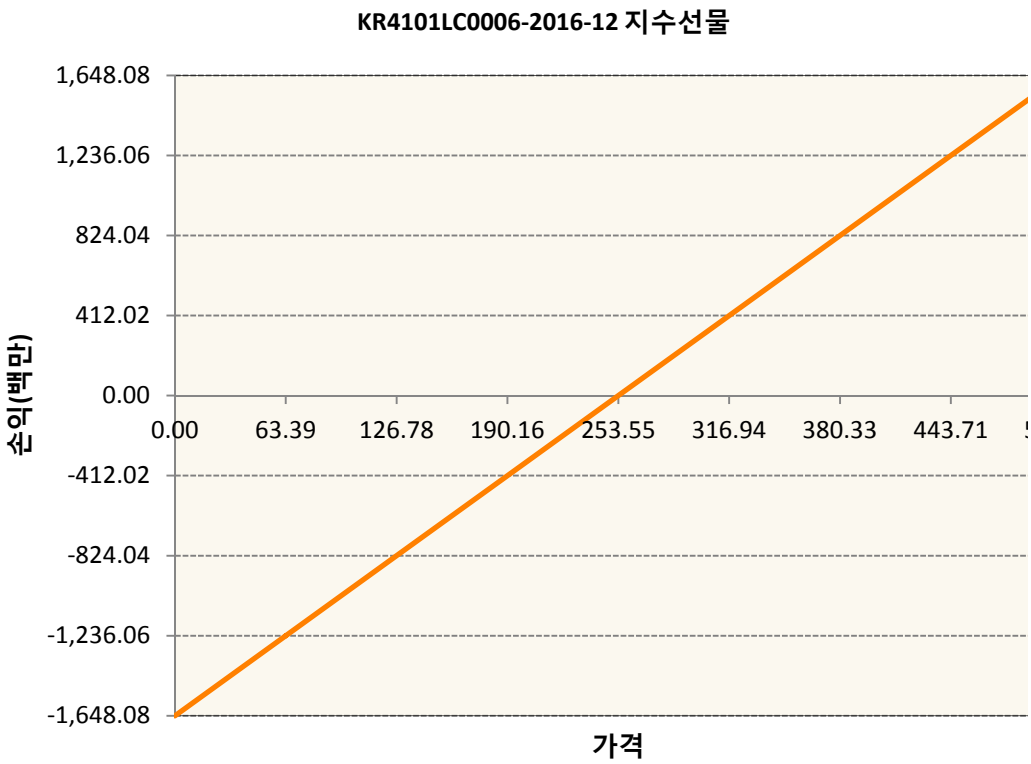
스마트레버리지목표전환형1호

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	1,648	0	1,648	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101LC00 2016-12 지수선물							132
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-132	-132	-132	-132	-132	-132	-132
-5.33%	-88	-88	-88	-88	-88	-88	-88
-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%	88	88	88	88	88	88	88
8.00%	132	132	132	132	132	132	132

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

102

공시일	2016-11-24
기준일	2016-11-23

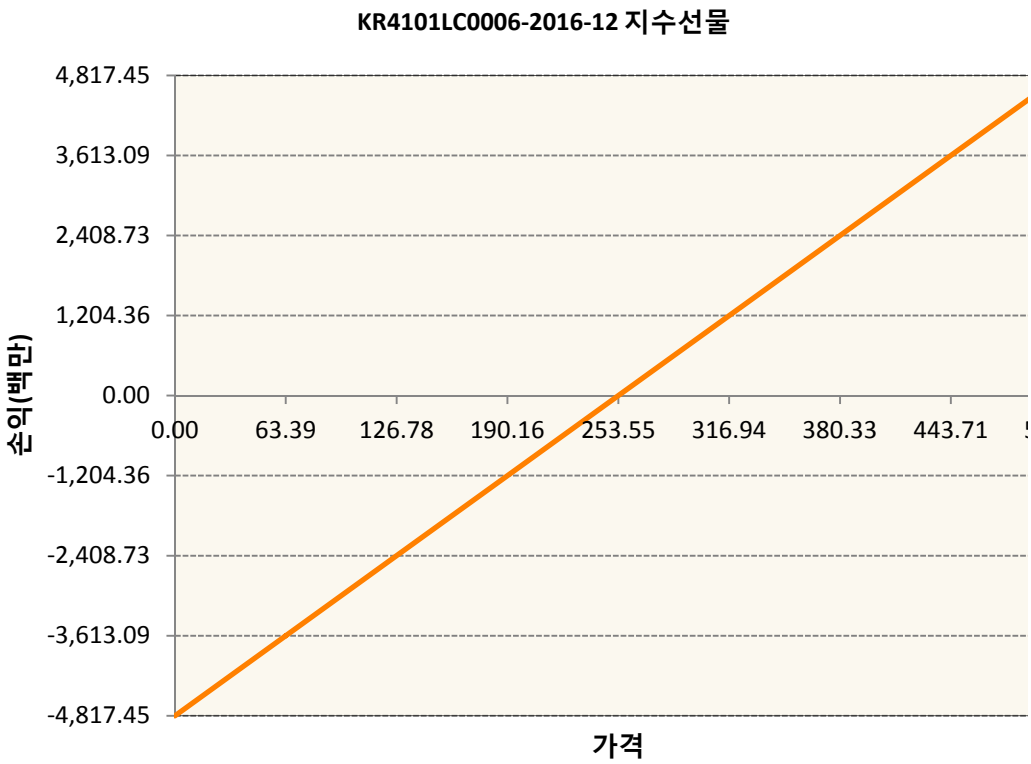
1.3배 레버리지 인덱스(주식-파생형)

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	4,817	0	4,817	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101LC00 2016-12 지수선물							386
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-386	-386	-386	-386	-386	-386	-386
-5.33%	-257	-257	-257	-257	-257	-257	-257
-2.67%	-129	-129	-129	-129	-129	-129	-129
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	129	129	129	129	129	129	129
5.33%	257	257	257	257	257	257	257
8.00%	386	386	386	386	386	386	386

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

298

공시일	2016-11-24
기준일	2016-11-23

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	882

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

712

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2016-11-24
기준일	2016-11-23

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	402

* 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	2016-11-24
기준일	2016-11-23

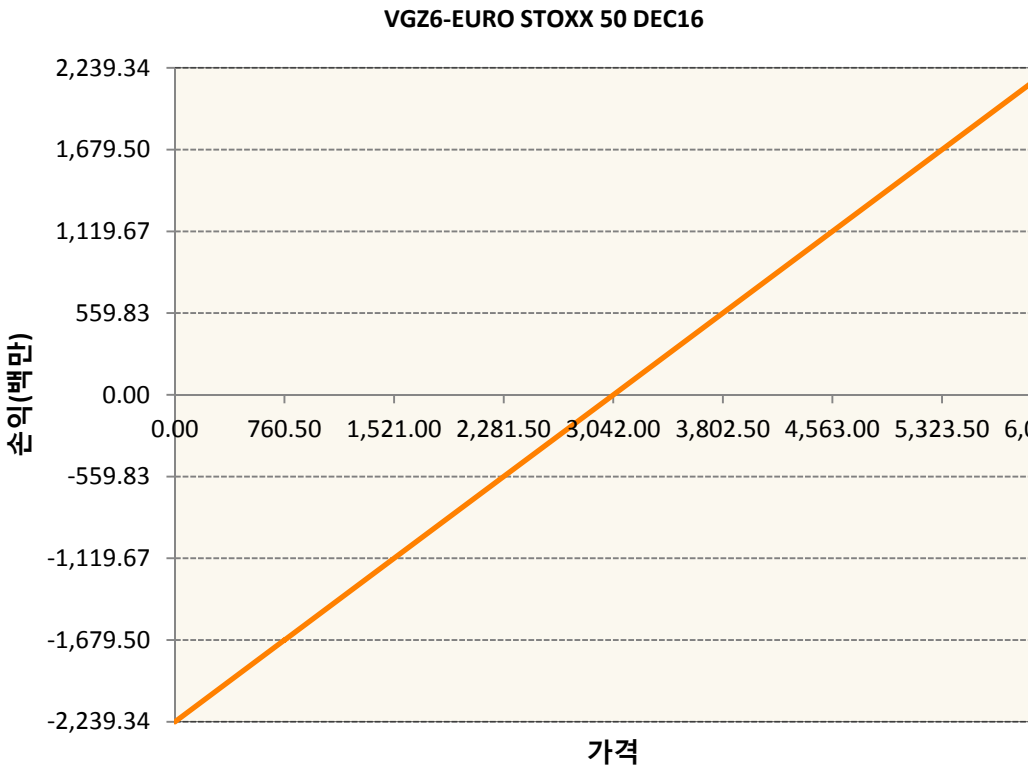
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,239	0	2,239	

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	2016-11-24
기준일	2016-11-23

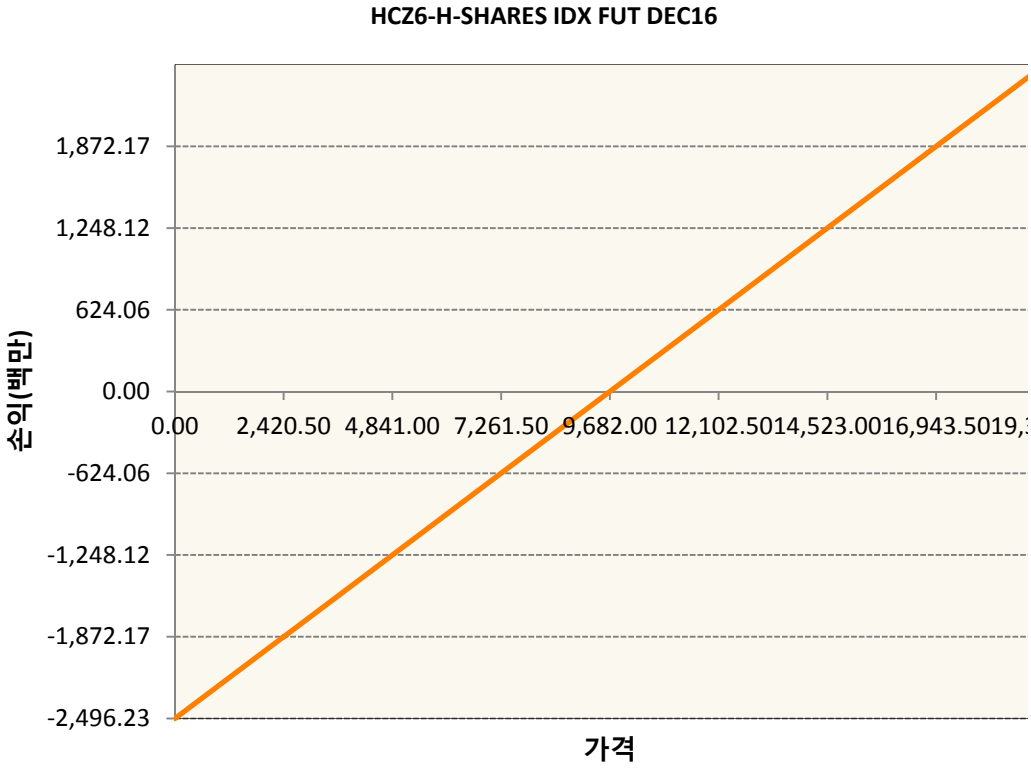
차이나인덱스모(주식-파생형)

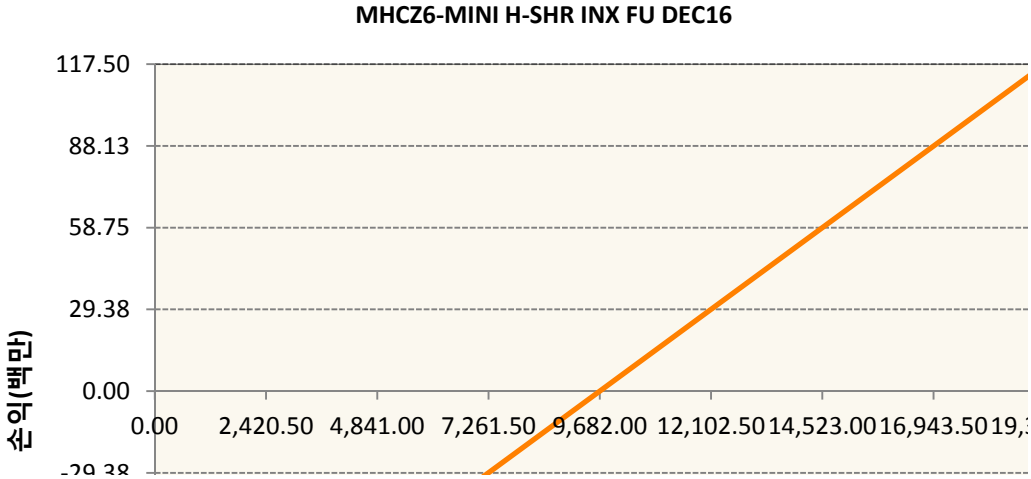
1. 계약금액

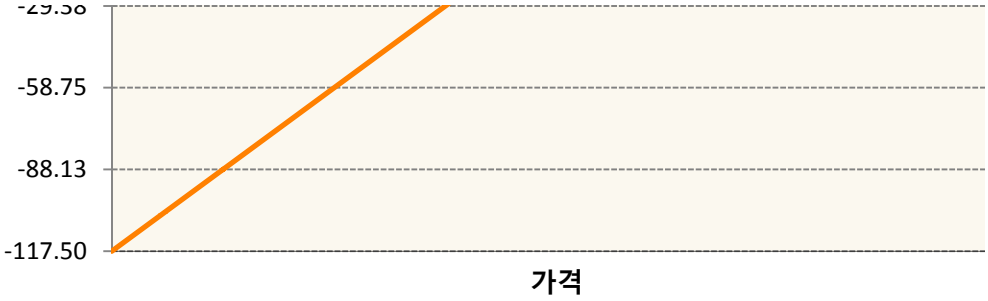
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,496	0	2,496	
누계	유가증권	선물	118	0	118	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

HCZ6	H-SHARES IDX FUT DEC16	200
MHCZ6	MINI H-SHR INX FU DEC16	9

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

238

공시일	2016-11-24
기준일	2016-11-23

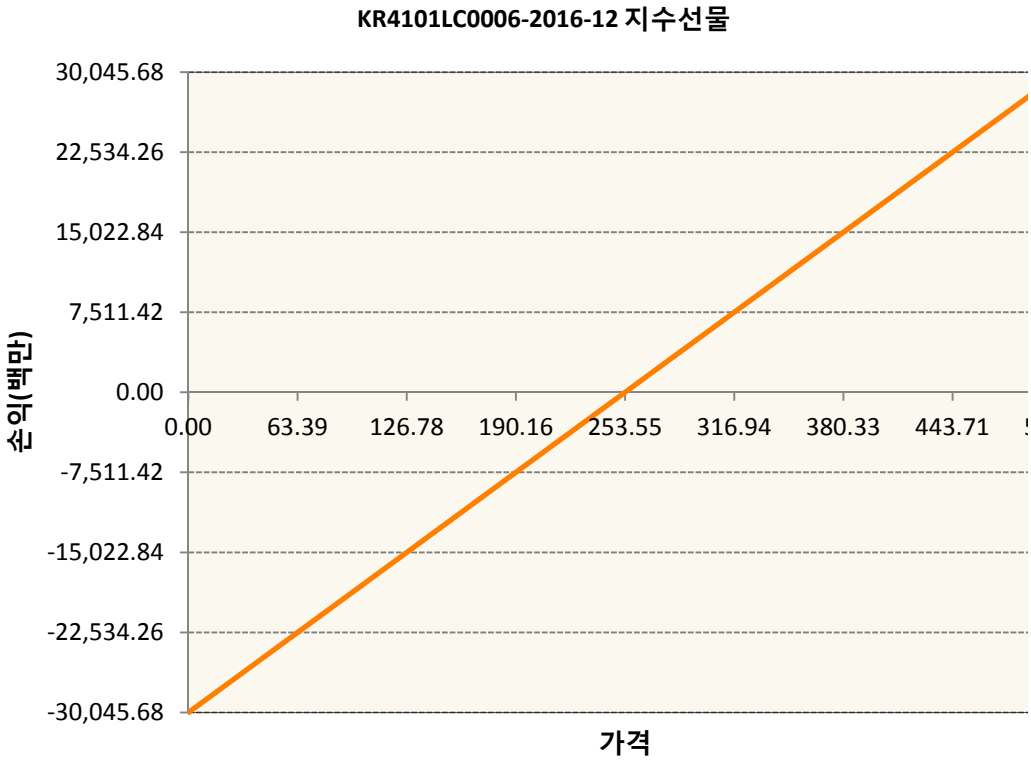
커버드콜(주식혼합-파생형)

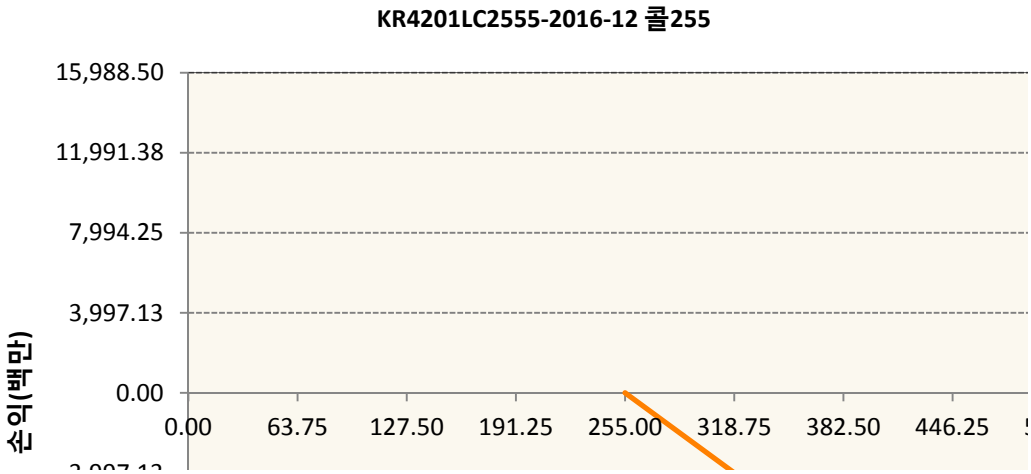
1. 계약금액

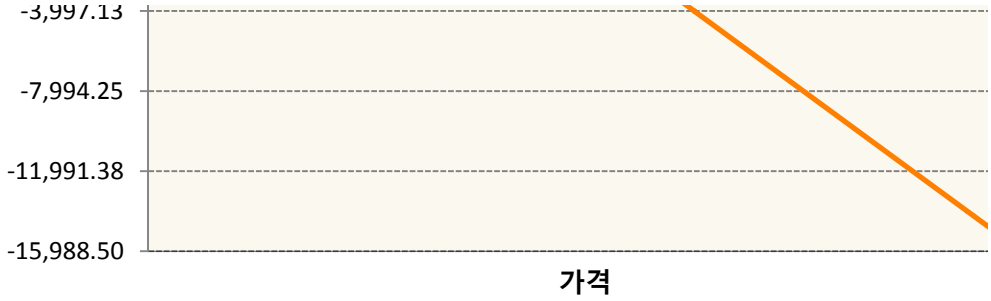
(단위:백만원)

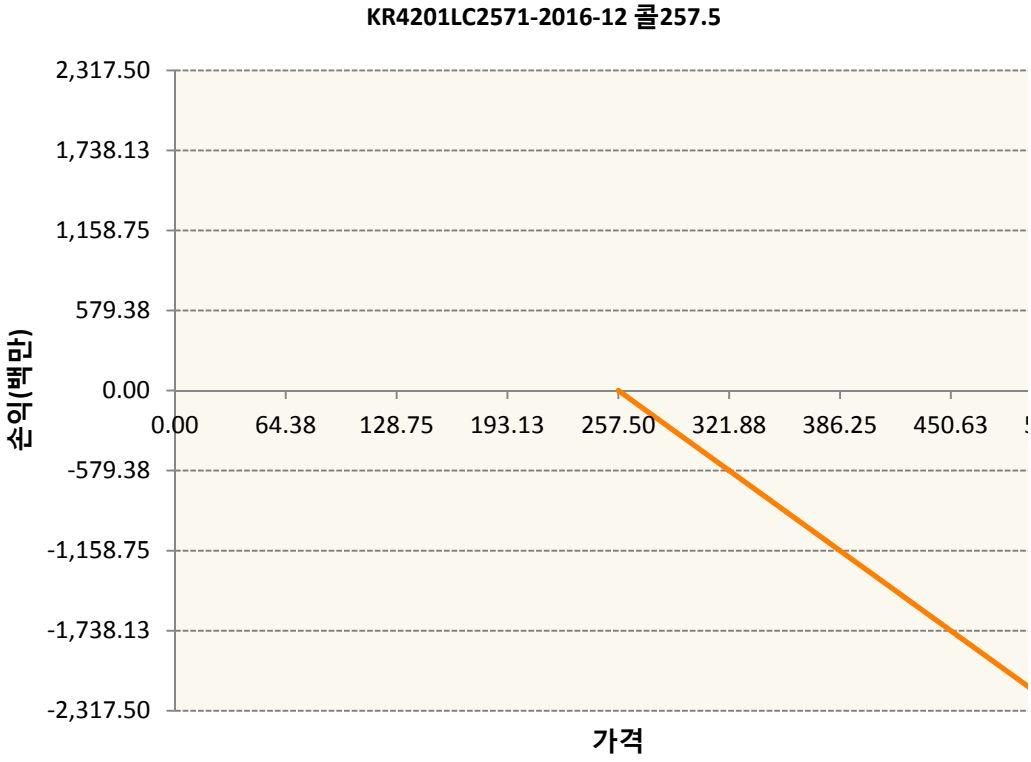
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	30,046	0	30,046	장내
누계	유가증권	옵션	0	18,306	-18,306	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101LC00 2016-12 지수선물							2,405
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-2,405	-2,405	-2,405	-2,405	-2,405	-2,405	-2,405
-5.33%	-1,603	-1,603	-1,603	-1,603	-1,603	-1,603	-1,603
-2.67%	-802	-802	-802	-802	-802	-802	-802
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	802	802	802	802	802	802	802
5.33%	1,603	1,603	1,603	1,603	1,603	1,603	1,603
8.00%	2,405	2,405	2,405	2,405	2,405	2,405	2,405
KR4201LC25 2016-12 콜255							5,356
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	591	591	591	591	590	590	589
-5.33%	590	590	589	586	582	576	568
-2.67%	567	551	530	505	476	443	407
0%	190	127	64	0	-64	-128	-192
2.67%	-1,204	-1,241	-1,282	-1,326	-1,373	-1,422	-1,474
5.33%	-3,231	-3,235	-3,242	-3,251	-3,264	-3,280	-3,299
8.00%	-5,348	-5,348	-5,348	-5,349	-5,350	-5,353	-5,356
KR4201LC25 2016-12 콜257.5							696

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	47	47	47	47	47	47	47
-5.33%	47	47	47	47	47	46	46
-2.67%	46	45	44	42	40	37	33
0%	22	15	8	0	-8	-16	-24
2.67%	-120	-128	-137	-145	-154	-162	-171
5.33%	-391	-392	-395	-397	-401	-405	-409
8.00%	-693	-693	-693	-694	-694	-695	-696

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

8,982

공시일	2016-11-24
기준일	2016-11-23

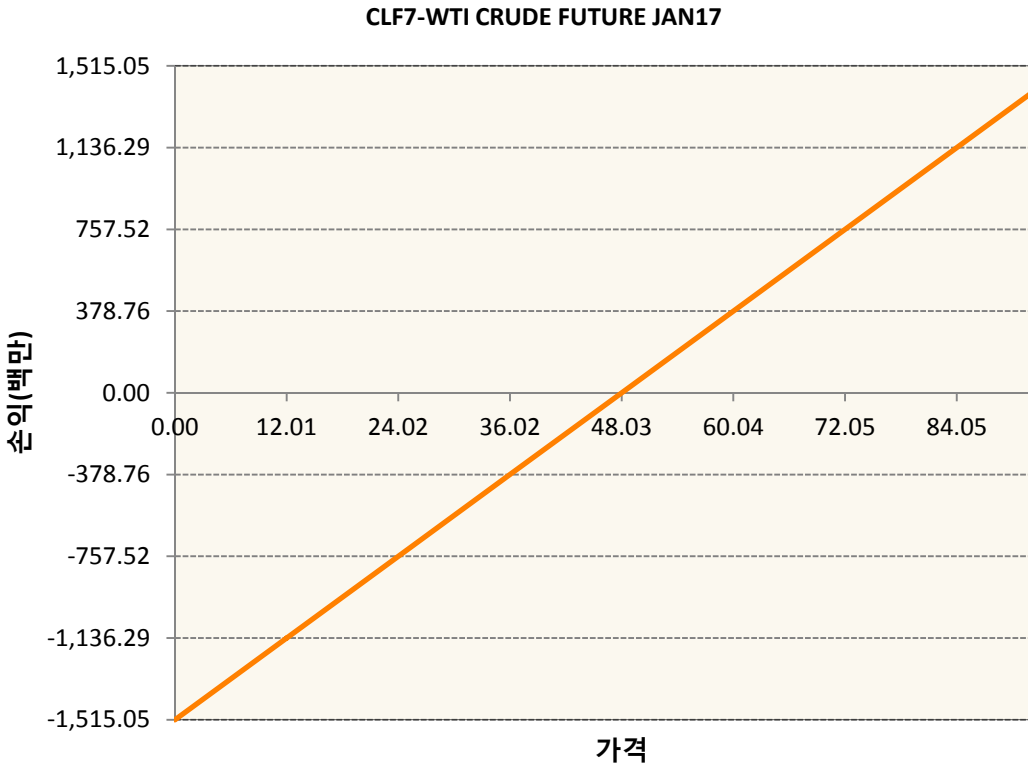
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

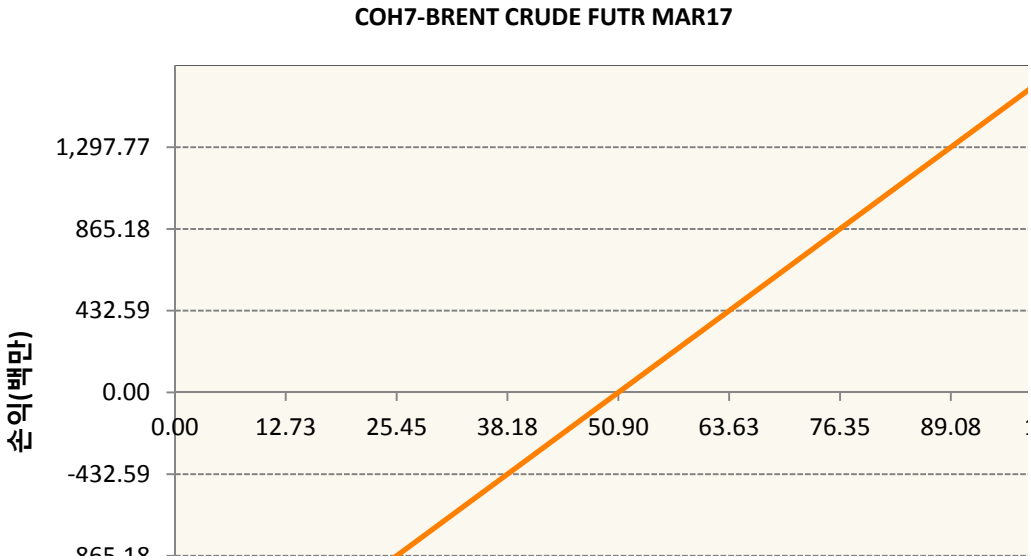
1. 계약금액

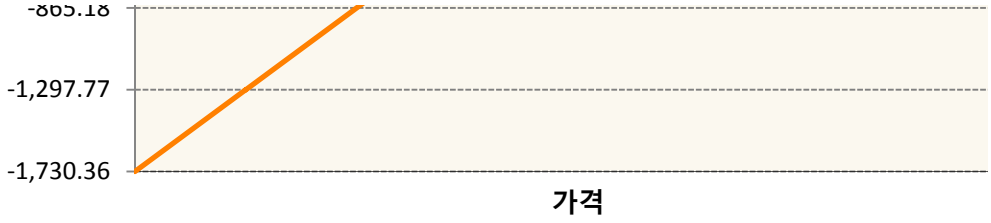
(단위:백만원)

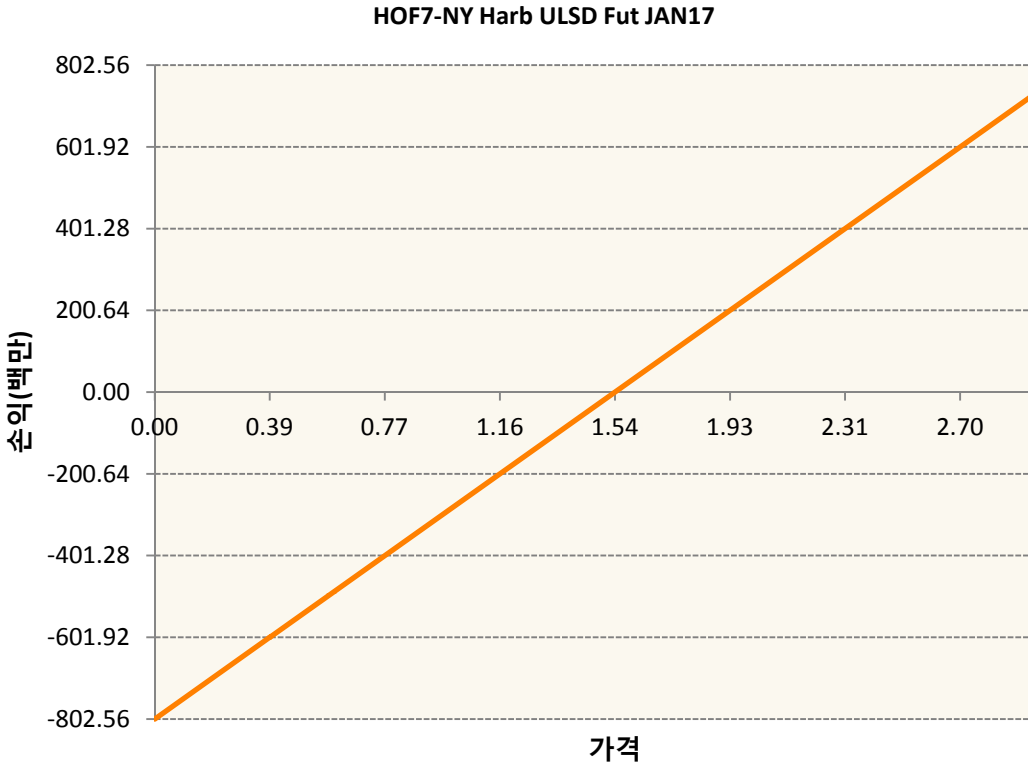
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	6,282	0	6,282	

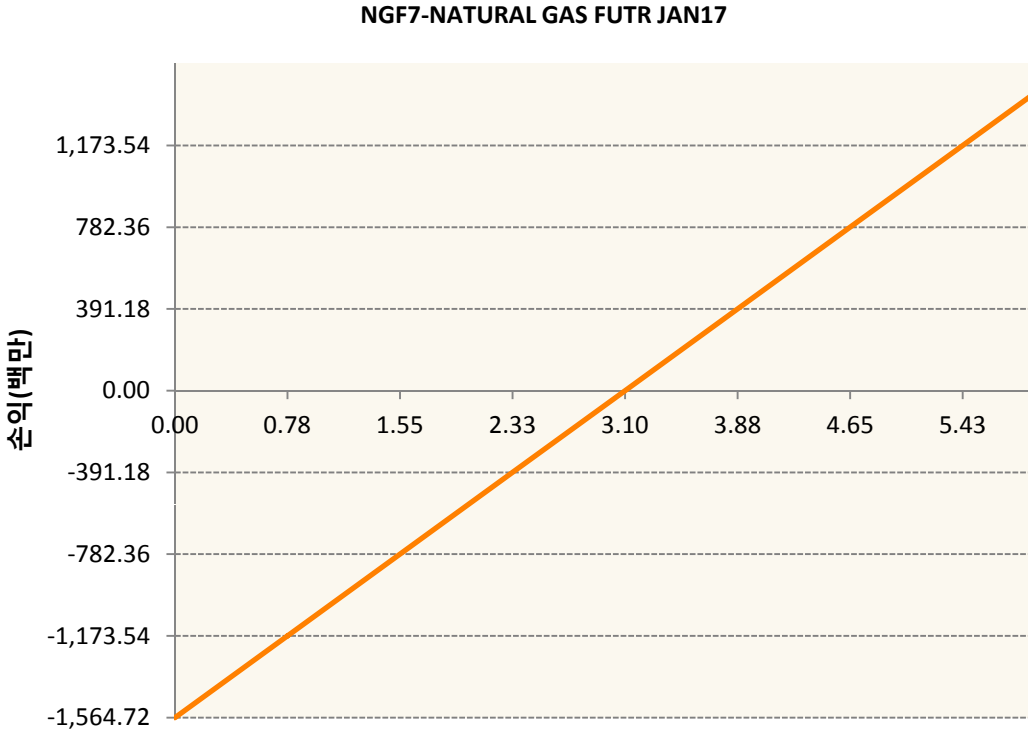
2. 만기시점의 손익구조



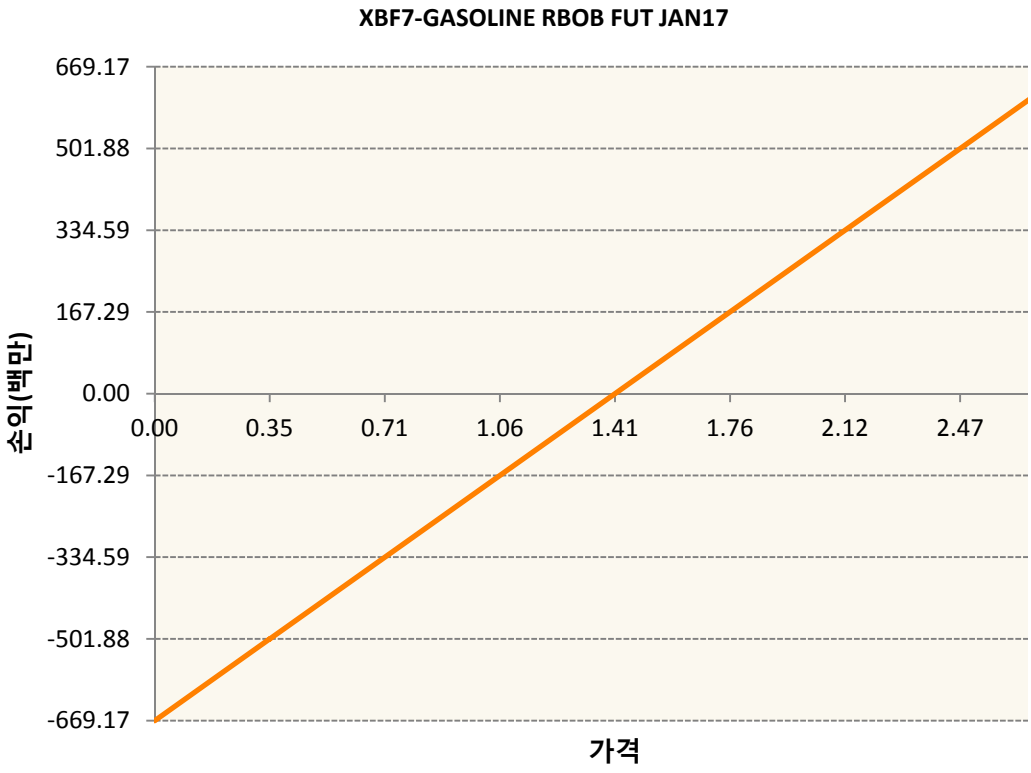



-1,297.77
-1,730.36
가격


HOF7-NY Harb ULSD Fut JAN17
802.56
601.92
401.28
200.64
0.00
-200.64
-401.28
-601.92
-802.56
0.00
0.39
0.77
1.16
1.54
1.93
2.31
2.70
순익(백만)
가격


NGF7-NATURAL GAS FUTR JAN17
1,173.54
782.36
391.18
0.00
-391.18
-782.36
-1,173.54
-1,564.72
0.00
0.78
1.55
2.33
3.10
3.88
4.65
5.43
순익(백만)

가격



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
CLF7	WTI CRUDE FUTURE JAN17	121
COH7	BRENT CRUDE FUTR MAR17	138
HOF7	NY Harb ULSD Fut JAN17	64
NGF7	NATURAL GAS FUTR JAN17	125
XBF7	GASOLINE RBOB FUT JAN17	54

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,128

공시일	2016-11-24
기준일	2016-11-23

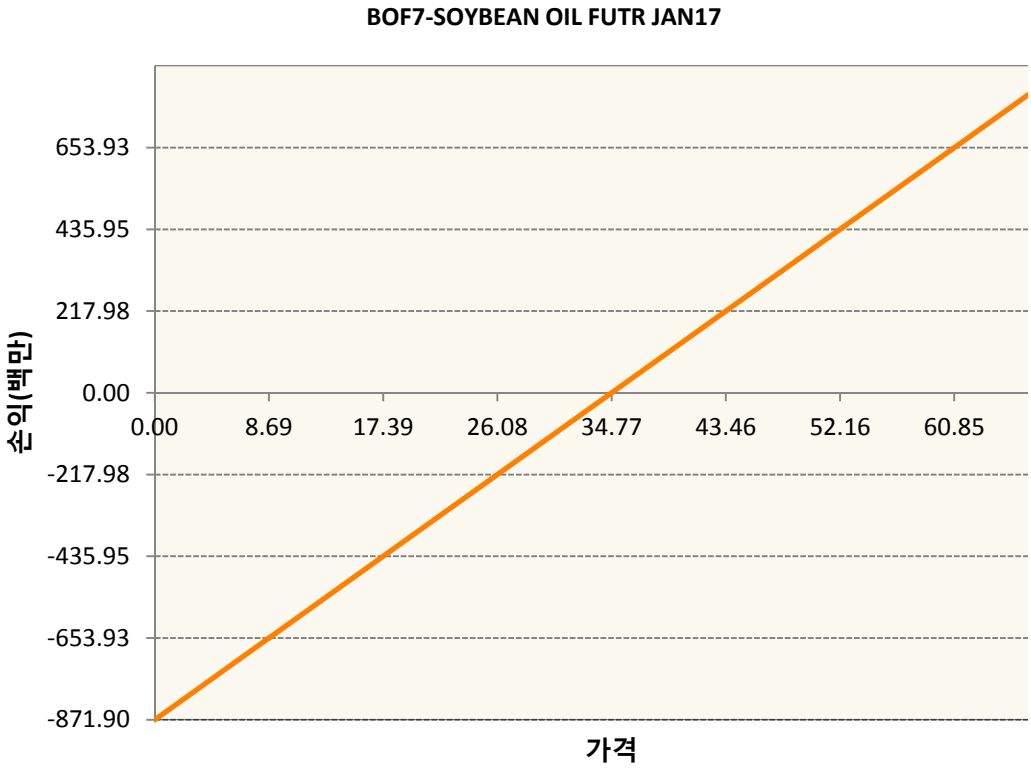
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

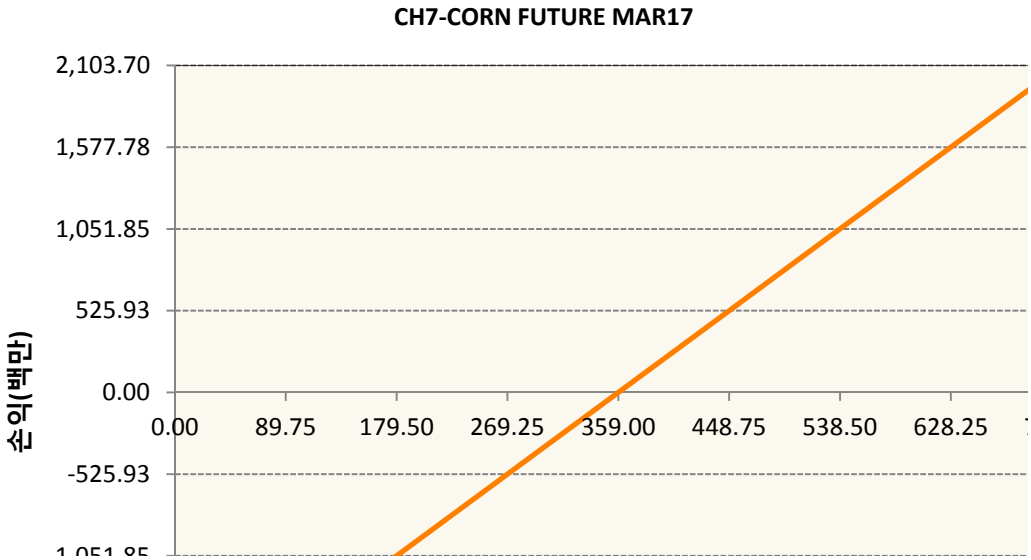
1. 계약금액

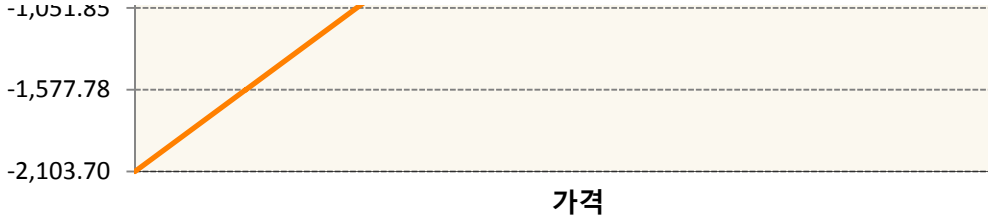
(단위:백만원)

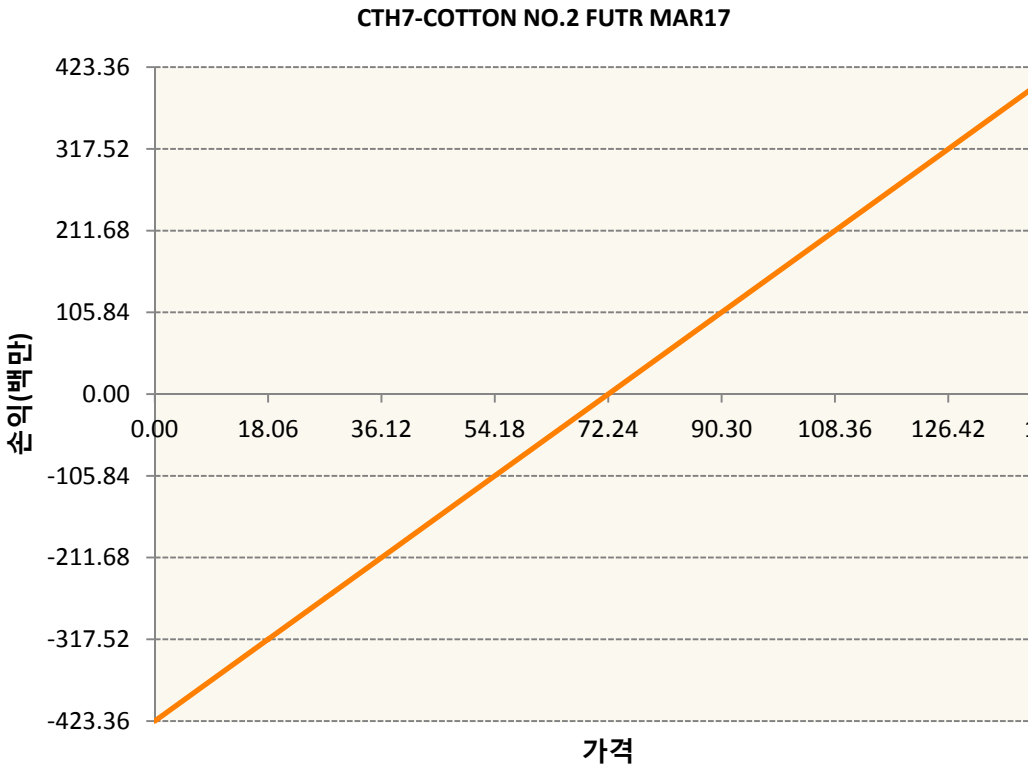
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	9,242	0	9,242	

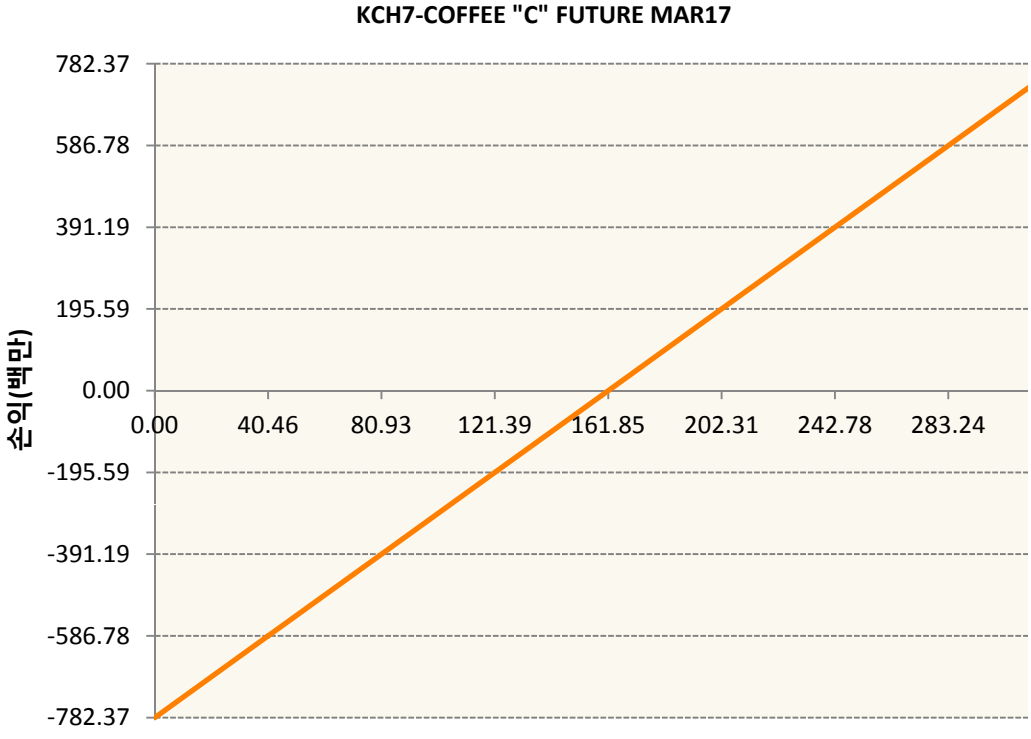
2. 만기시점의 손익구조





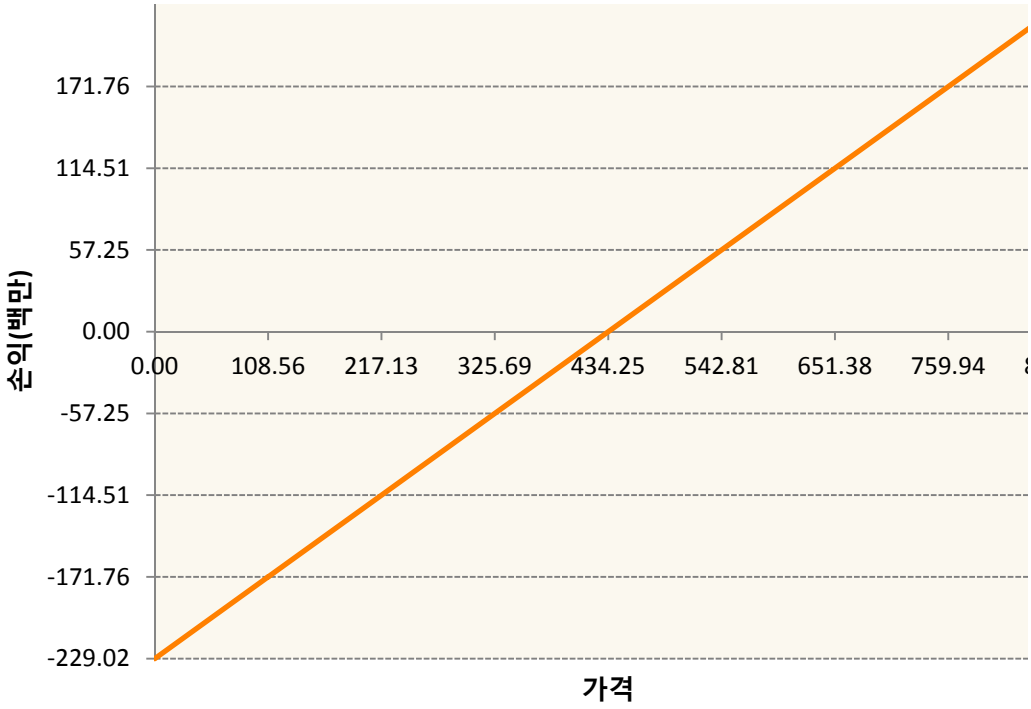

-1,577.78
-2,103.70
가격


CTH7-COTTON NO.2 FUTR MAR17
423.36
317.52
211.68
105.84
0.00
-105.84
-211.68
-317.52
-423.36
0.00
18.06
36.12
54.18
72.24
90.30
108.36
126.42
손익(백만)
가격

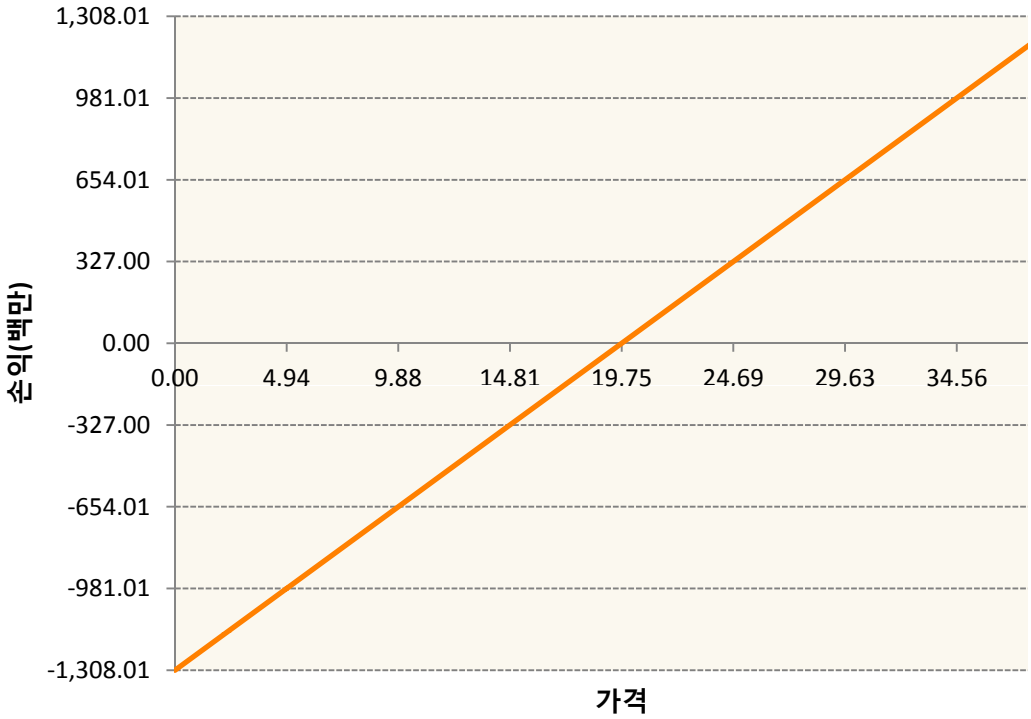

KCH7-COFFEE "C" FUTURE MAR17
782.37
586.78
391.19
195.59
0.00
-195.59
-391.19
-586.78
-782.37
0.00
40.46
80.93
121.39
161.85
202.31
242.78
283.24
손익(백만)

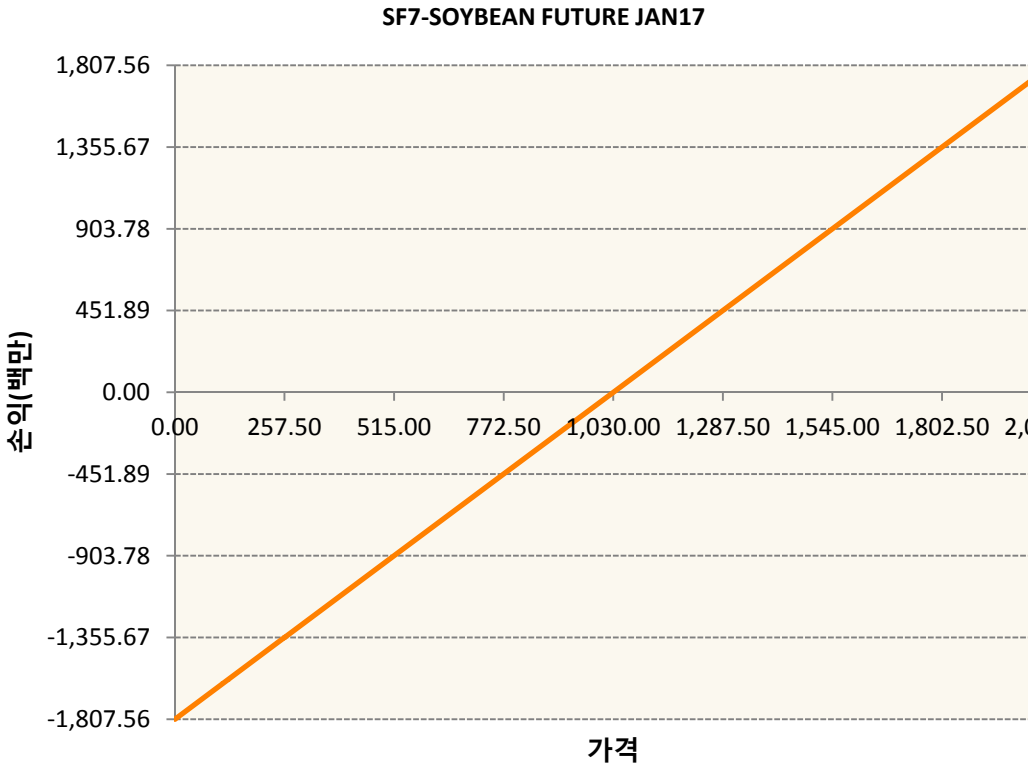
가격

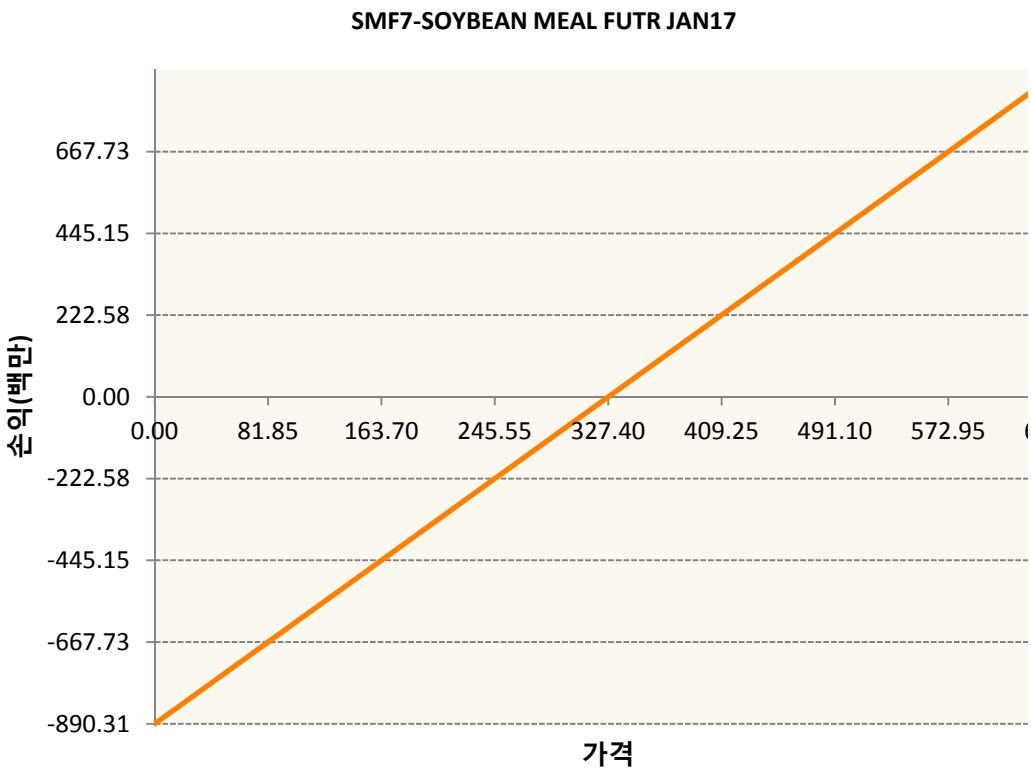
KWH7-KC HRW WHEAT FUT MAR17



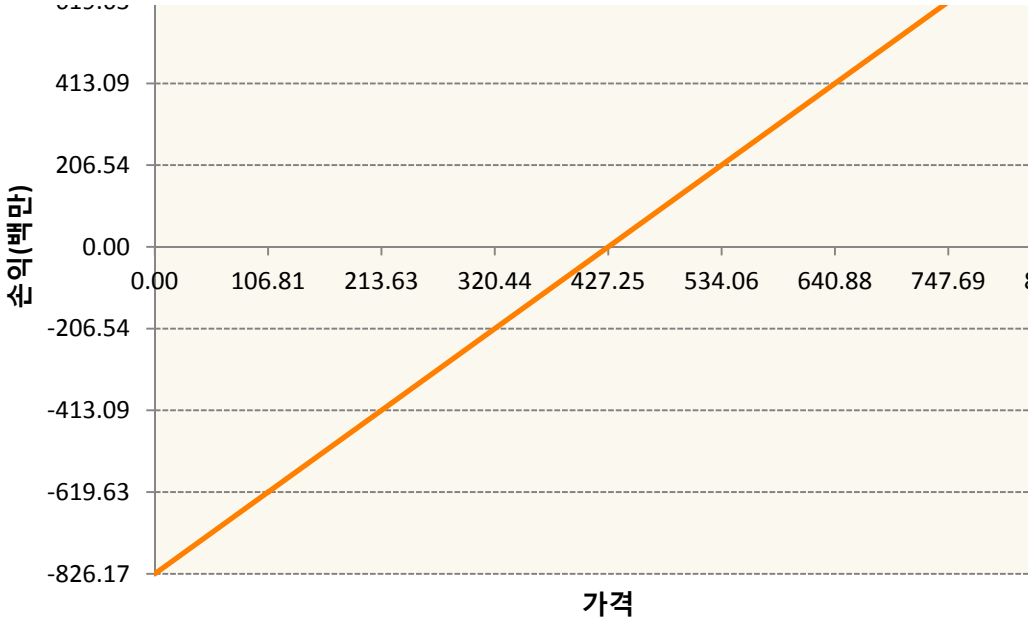
SBH7-Sugar #11 (WORLD) MAR17




SF7-SOYBEAN FUTURE JAN17
1,807.56
1,355.67
903.78
451.89
0.00
-451.89
-903.78
-1,355.67
-1,807.56
0.00
257.50
515.00
772.50
1,030.00
1,287.50
1,545.00
1,802.50
손익(백만)
가격


SMF7-SOYBEAN MEAL FUTR JAN17
667.73
445.15
222.58
0.00
-222.58
-445.15
-667.73
-890.31
0.00
81.85
163.70
245.55
327.40
409.25
491.10
572.95
손익(백만)
가격


WH7-WHEAT FUTURE(CBT) MAR17
826.17
619.63



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	105
SF7	SOYBEAN FUTURE JAN17	145
SMF7	SOYBEAN MEAL FUTR JAN17	71
WH7	WHEAT FUTURE(CBT) MAR17	66

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

919