공시일	2016-11-25
기준일	2016-11-24

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	2016-11-25
기준일	2016-11-24

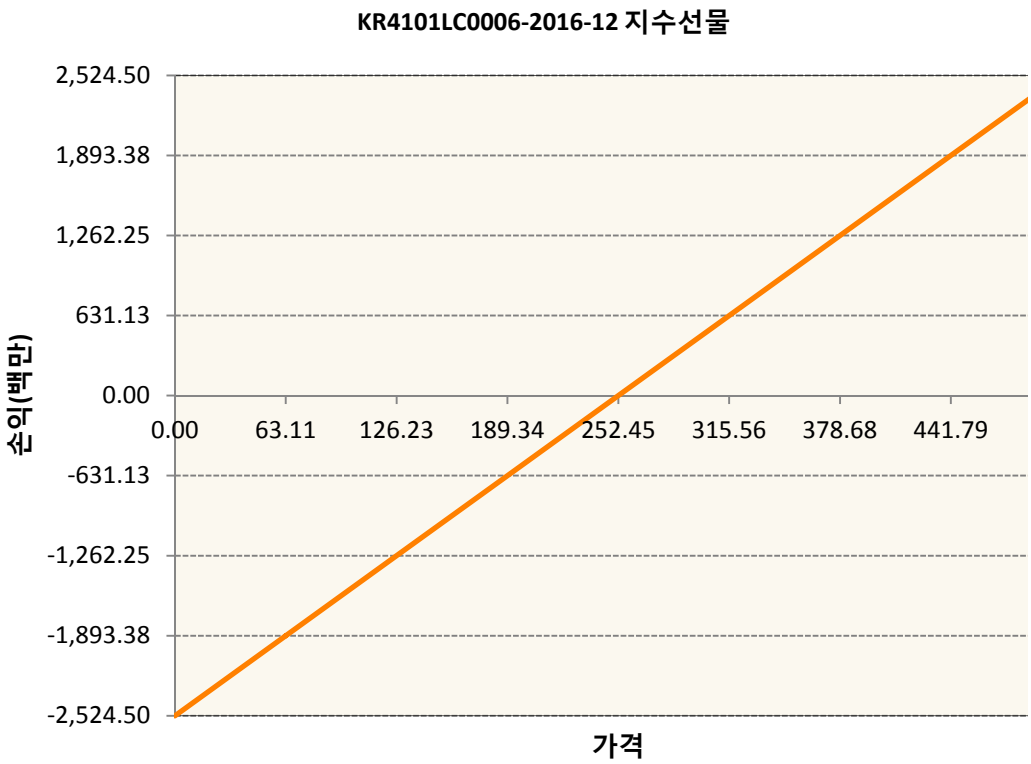
스마트인덱스모

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	2,525	0	2,525	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%	-134	-134	-134	-134	-134	-134	-134
-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%	134	134	134	134	134	134	134
8.00%	202	202	202	202	202	202	202

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

155

공시일	2016-11-25
기준일	2016-11-24

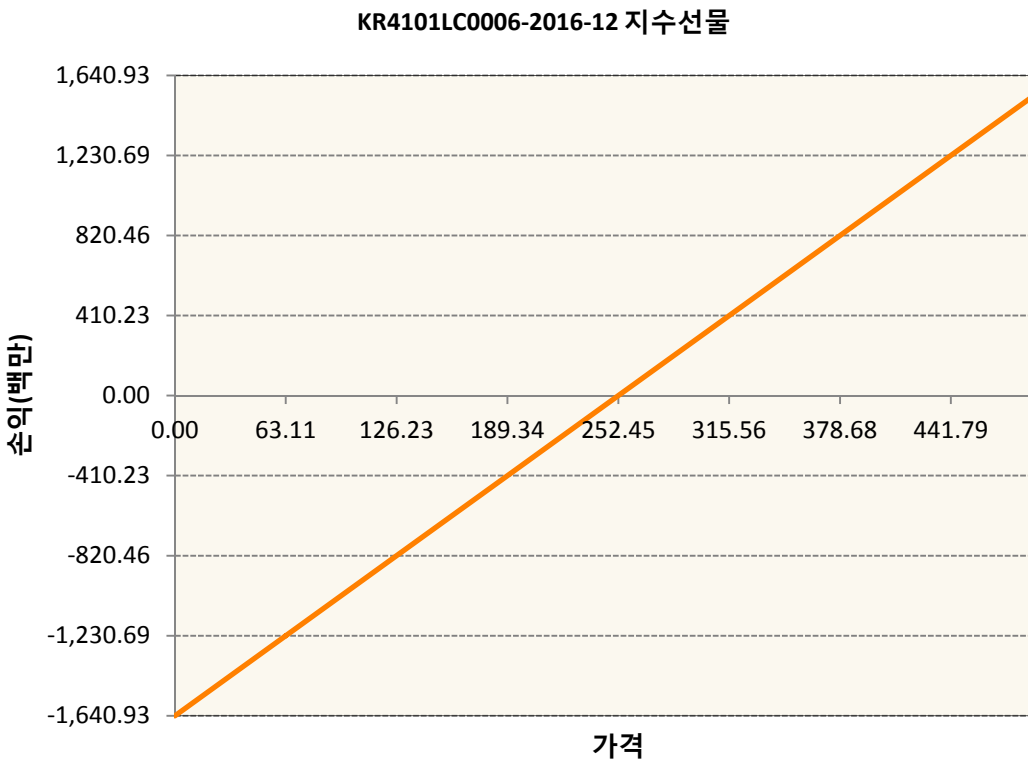
스마트레버리지목표전환형1호

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	1,641	0	1,641	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	2016-11-25
기준일	2016-11-24

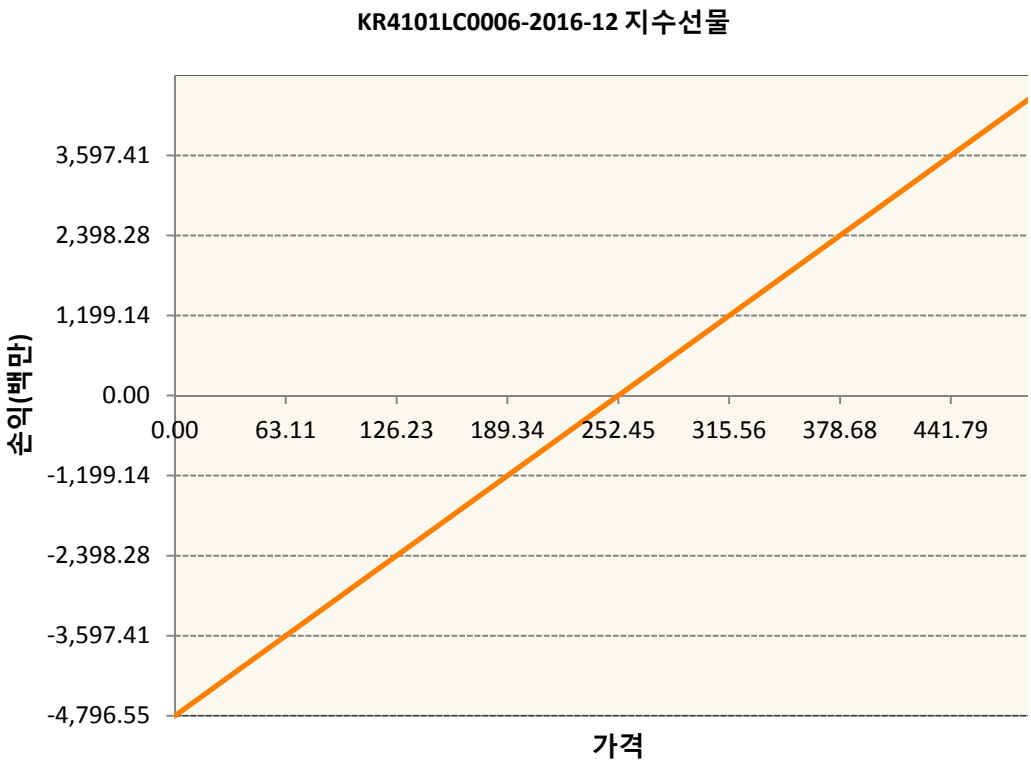
1.3배 레버리지 인덱스(주식-파생형)

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	4,797	0	4,797	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101LC00 2016-12 지수선물							383
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-383	-383	-383	-383	-383	-383	-383
-5.33%	-255	-255	-255	-255	-255	-255	-255
-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%	255	255	255	255	255	255	255
8.00%	383	383	383	383	383	383	383

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

295

공시일	2016-11-25
기준일	2016-11-24

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	881

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

710

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2016-11-25
기준일	2016-11-24

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)

755

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2016-11-25
기준일	2016-11-24

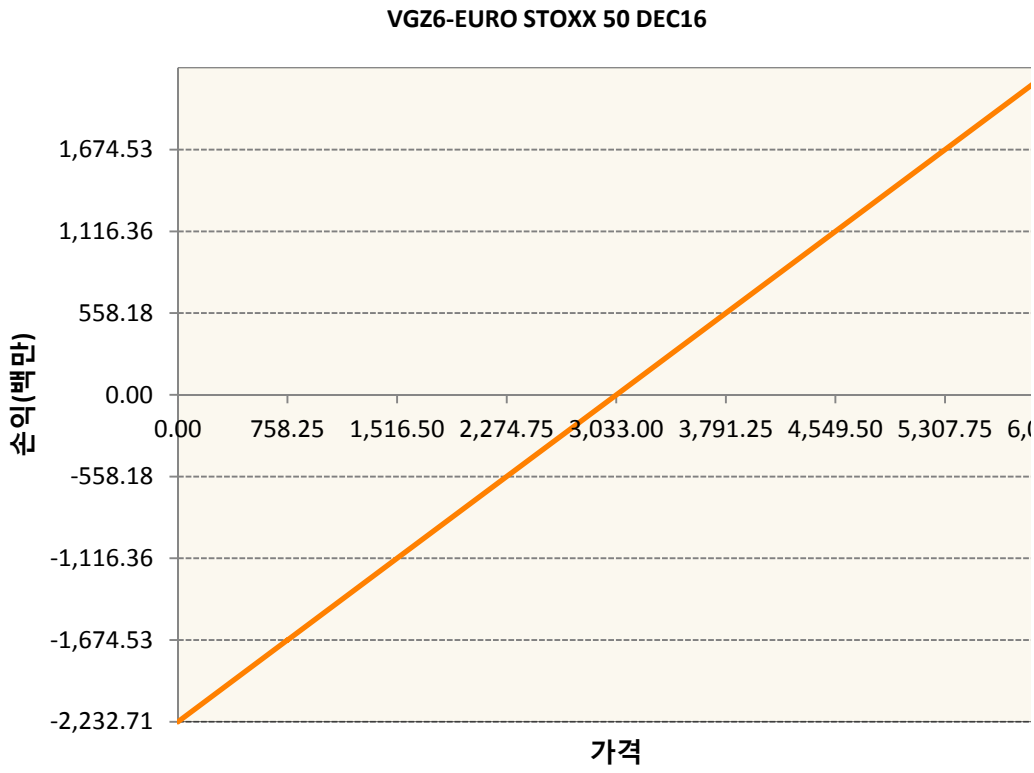
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,233	0	2,233	

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	2016-11-25
기준일	2016-11-24

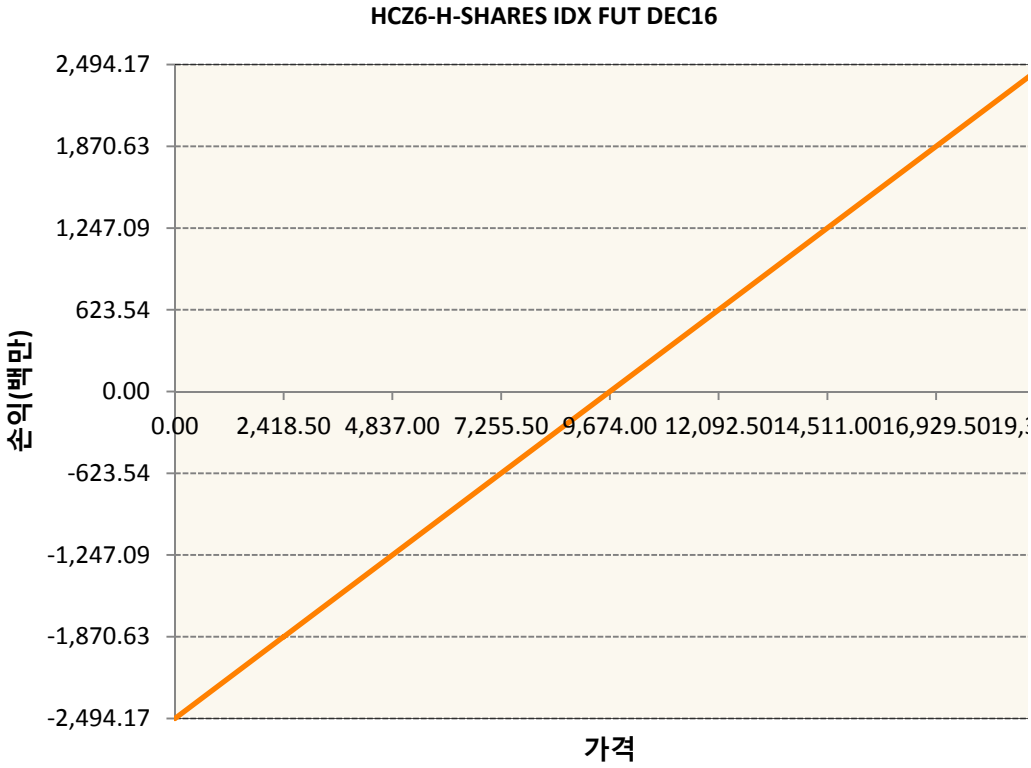
차이나인덱스모(주식-파생형)

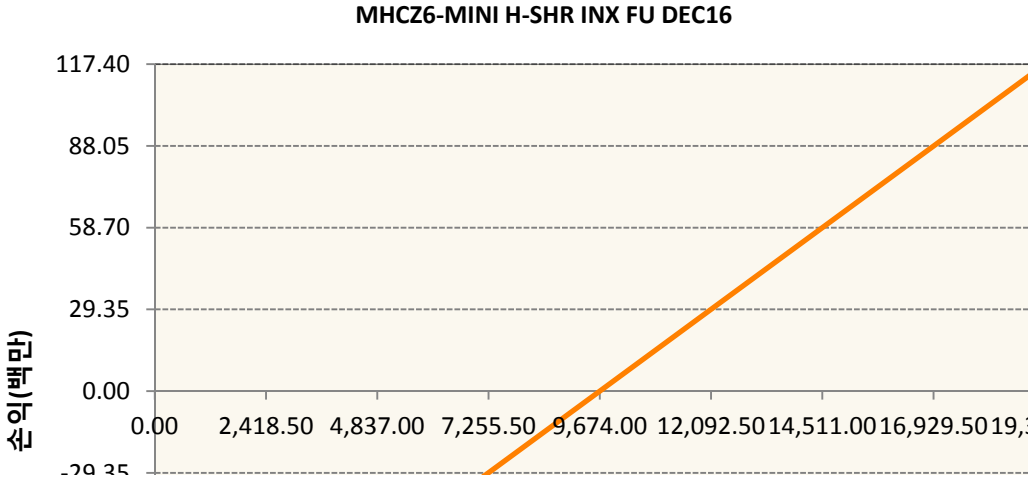
1. 계약금액

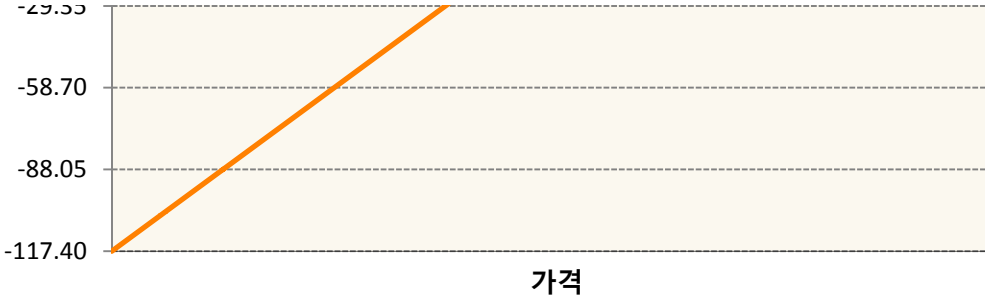
(단위:백만원)

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	2,494	0	2,494	
누계	유가증권	선물	117	0	117	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)

237

공시일	2016-11-25
기준일	2016-11-24

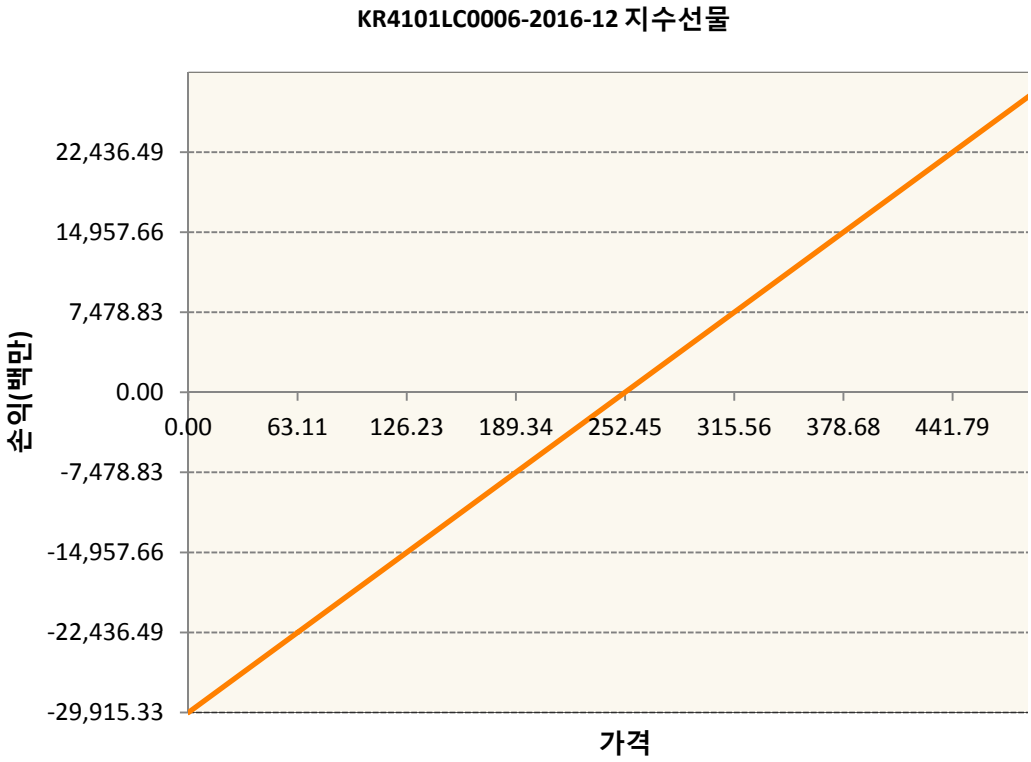
커버드콜(주식혼합-파생형)

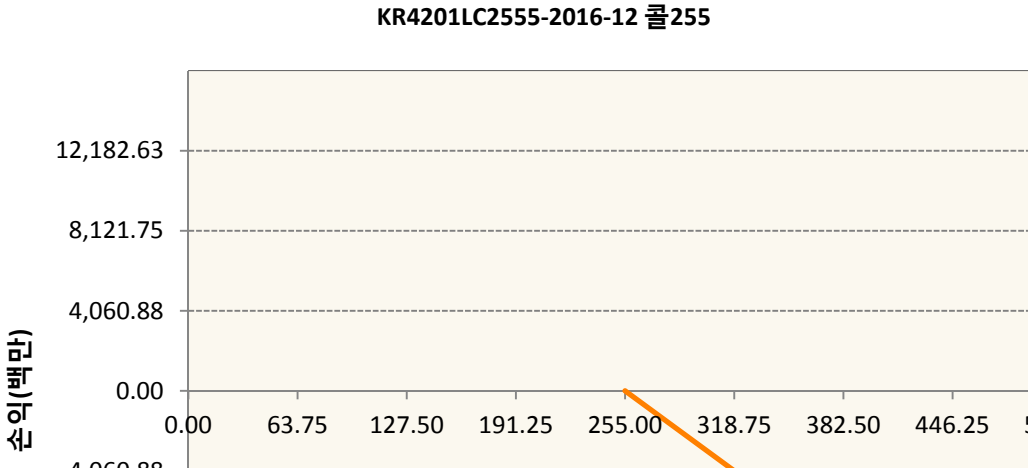
1. 계약금액

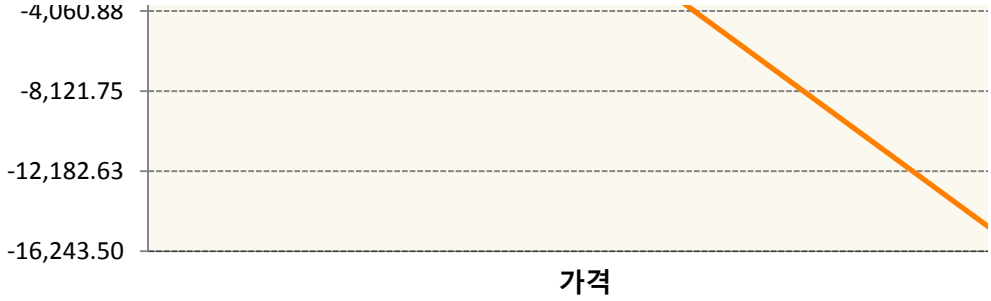
(단위:백만원)

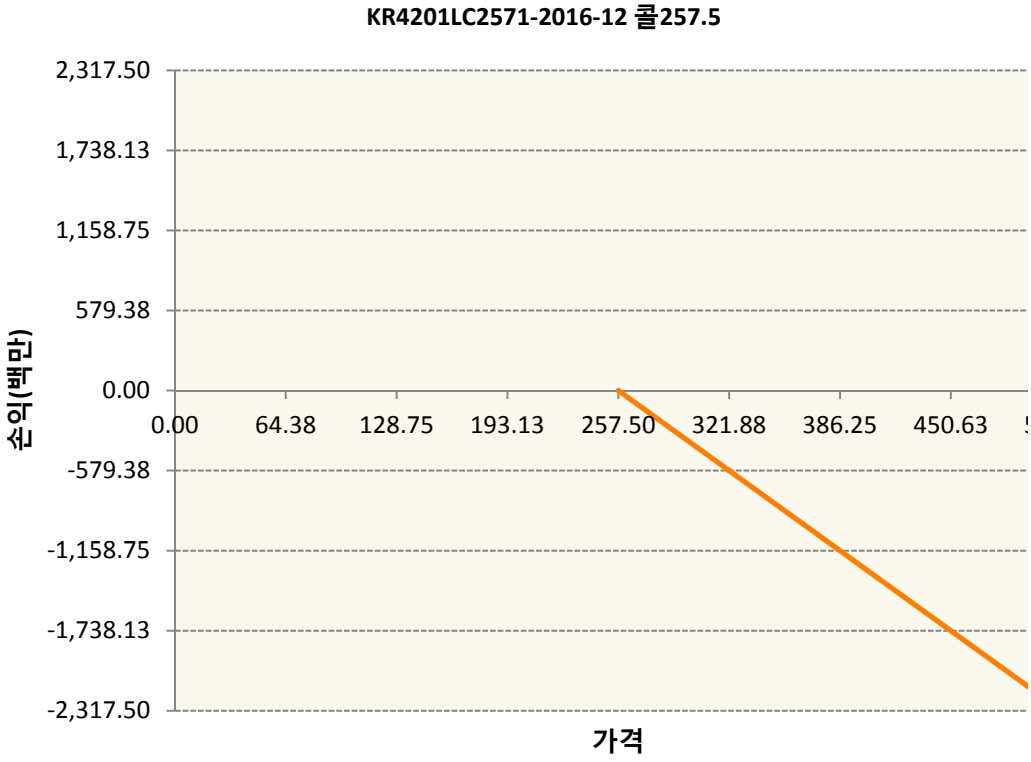
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	256	-256	장내
누계	유가증권	선물	29,915	0	29,915	장내
누계	유가증권	옵션	0	18,561	-18,561	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101LC00 2016-12 지수선물							2,389
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-2,389	-2,389	-2,389	-2,389	-2,389	-2,389	-2,389
-5.33%	-1,593	-1,593	-1,593	-1,593	-1,593	-1,593	-1,593
-2.67%	-796	-796	-796	-796	-796	-796	-796
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	796	796	796	796	796	796	796
5.33%	1,593	1,593	1,593	1,593	1,593	1,593	1,593
8.00%	2,389	2,389	2,389	2,389	2,389	2,389	2,389
KR4201LC25 2016-12 콜255							5,103
	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%	384	384	383	383	381	378	374
-2.67%	377	369	358	343	325	303	277
0%	163	110	56	0	-57	-115	-174
2.67%	-981	-1,029	-1,079	-1,132	-1,186	-1,241	-1,298
5.33%	-2,958	-2,964	-2,974	-2,988	-3,005	-3,026	-3,051
8.00%	-5,091	-5,091	-5,092	-5,093	-5,095	-5,098	-5,103
KR4201LC25 2016-12 콜257.5							638

	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	27	27
-2.67%	27	27	26	25	24	22	20
0%	16	11	6	0	-6	-13	-20
2.67%	-87	-96	-104	-113	-122	-131	-140
5.33%	-335	-338	-341	-345	-349	-354	-359
8.00%	-634	-634	-634	-635	-636	-637	-638

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

8,183

공시일	2016-11-25
기준일	2016-11-24

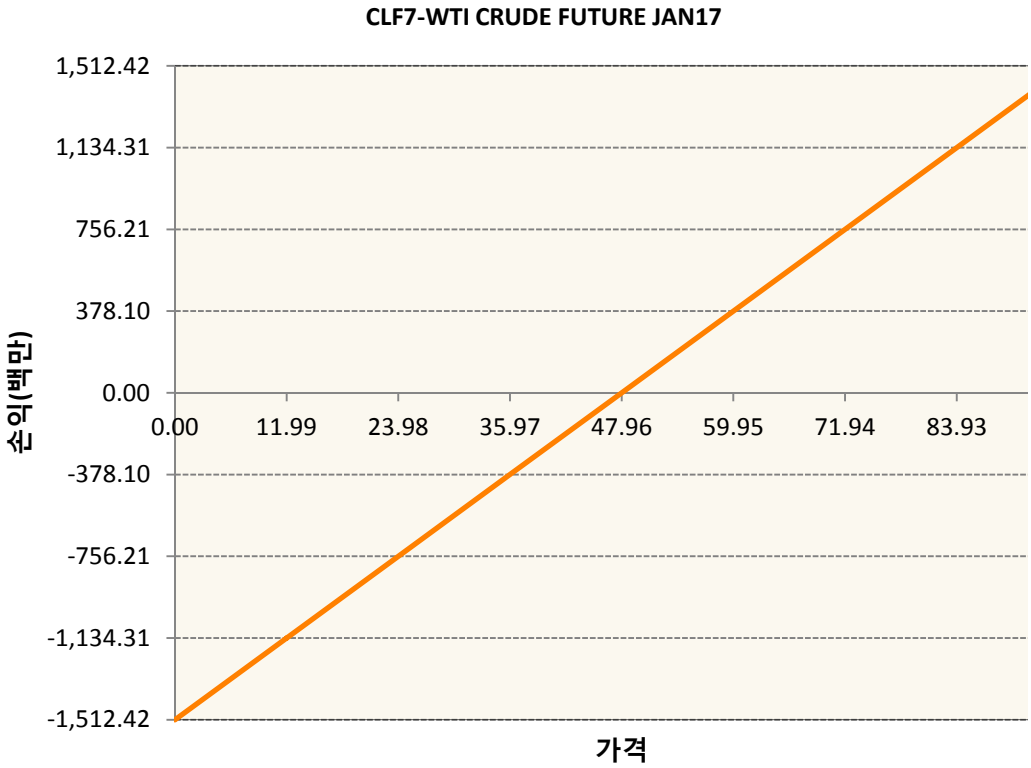
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

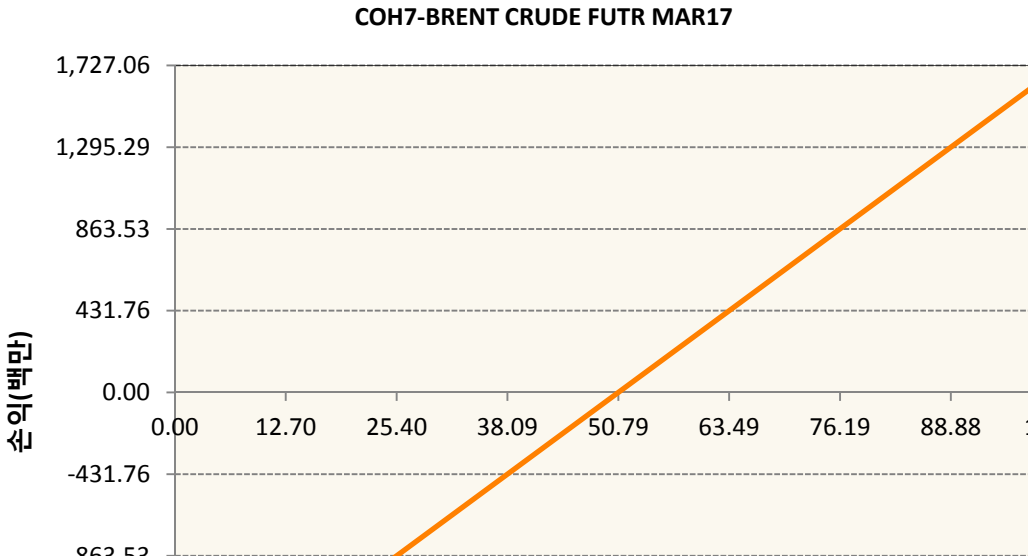
1. 계약금액

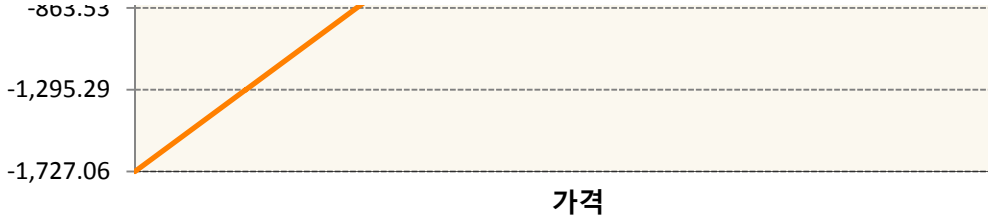
(단위:백만원)

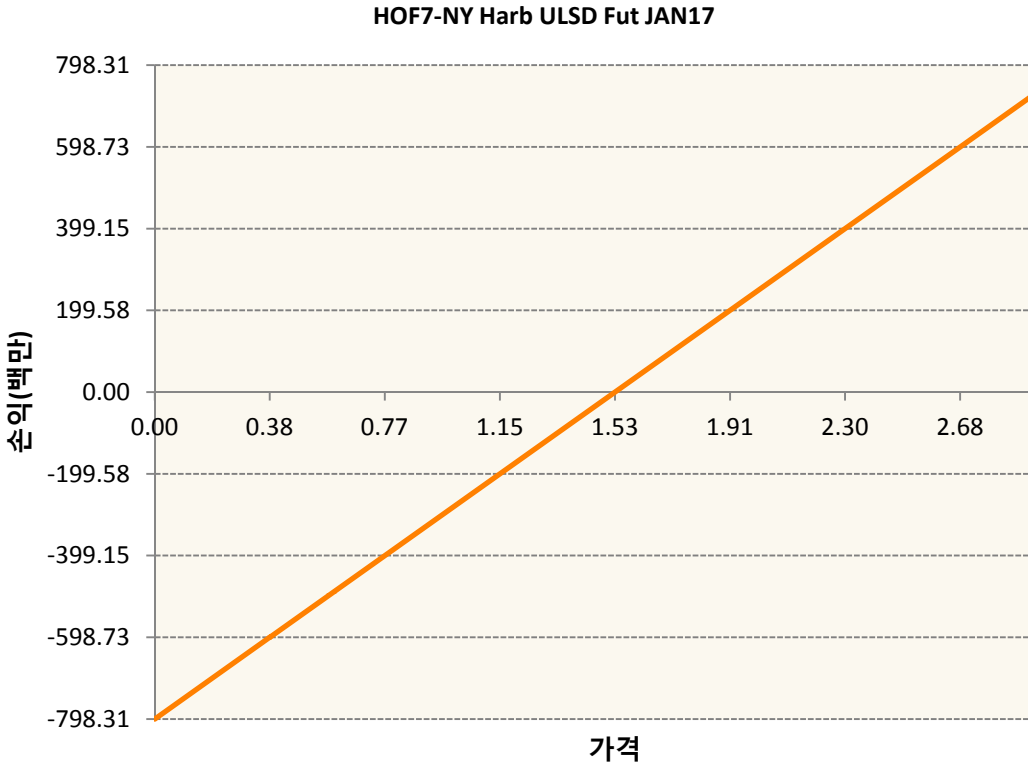
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	6,302	0	6,302	

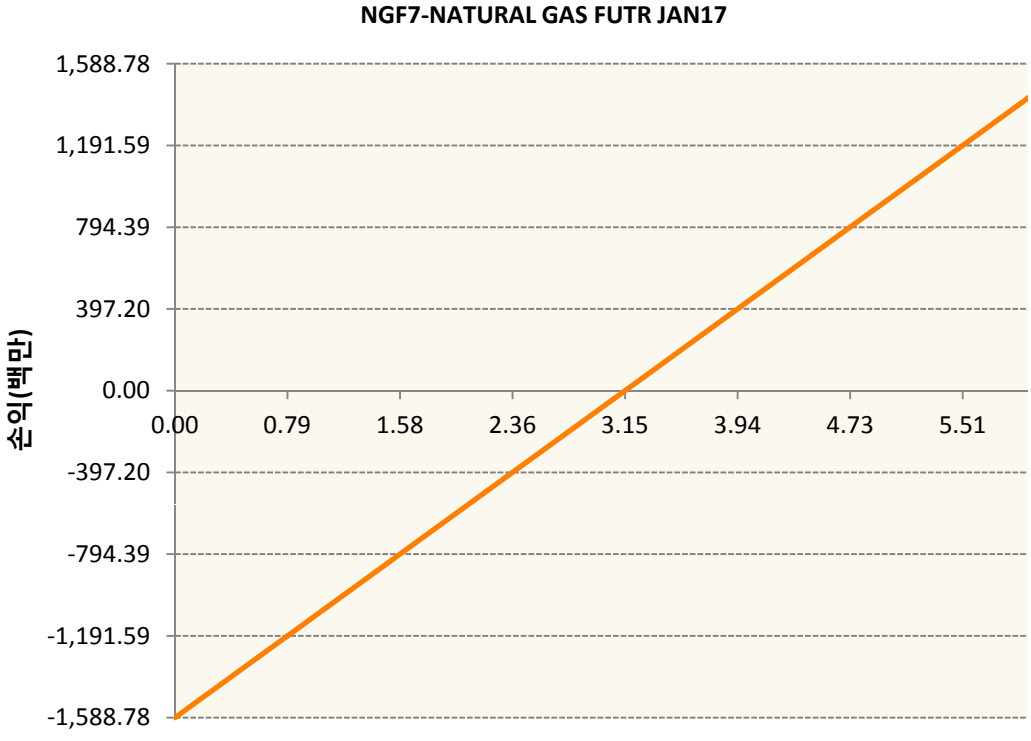
2. 만기시점의 손익구조



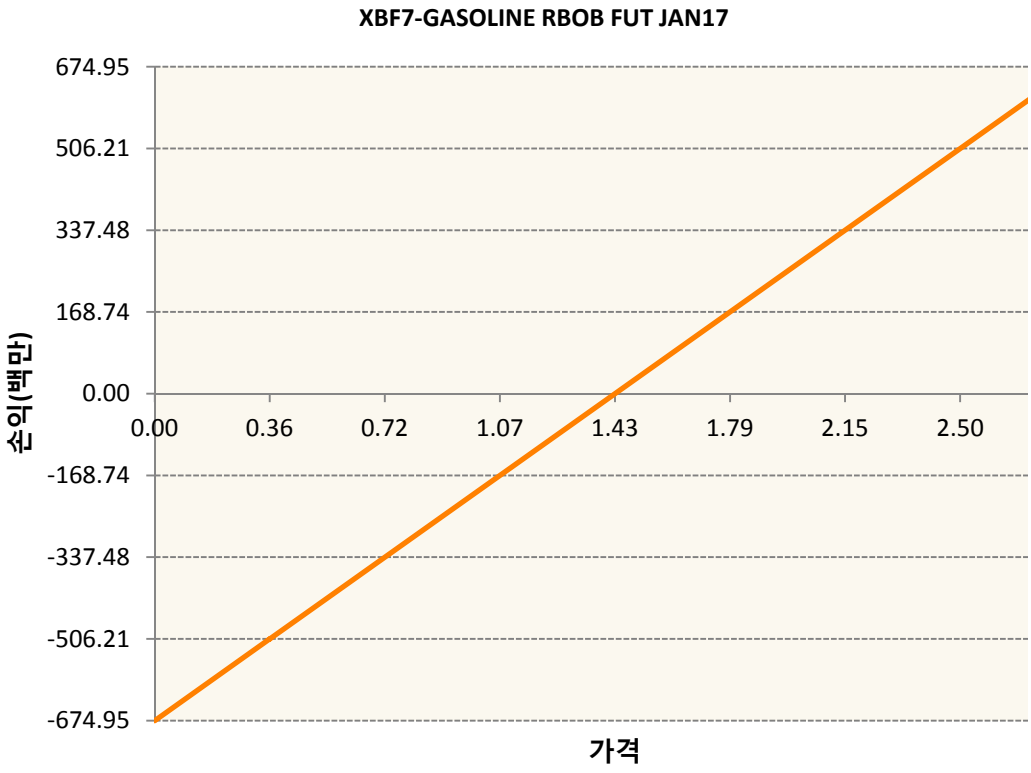



-1,295.29
-1,727.06
가격


HOF7-NY Harb ULSD Fut JAN17
798.31
598.73
399.15
199.58
0.00
-199.58
-399.15
-598.73
-798.31
0.00
0.38
0.77
1.15
1.53
1.91
2.30
2.68
순익(백만)
가격


NGF7-NATURAL GAS FUTR JAN17
1,588.78
1,191.59
794.39
397.20
0.00
-397.20
-794.39
-1,191.59
-1,588.78
0.00
0.79
1.58
2.36
3.15
3.94
4.73
5.51
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	127
XBF7	GASOLINE RBOB FUT JAN17	54

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,130

공시일	2016-11-25
기준일	2016-11-24

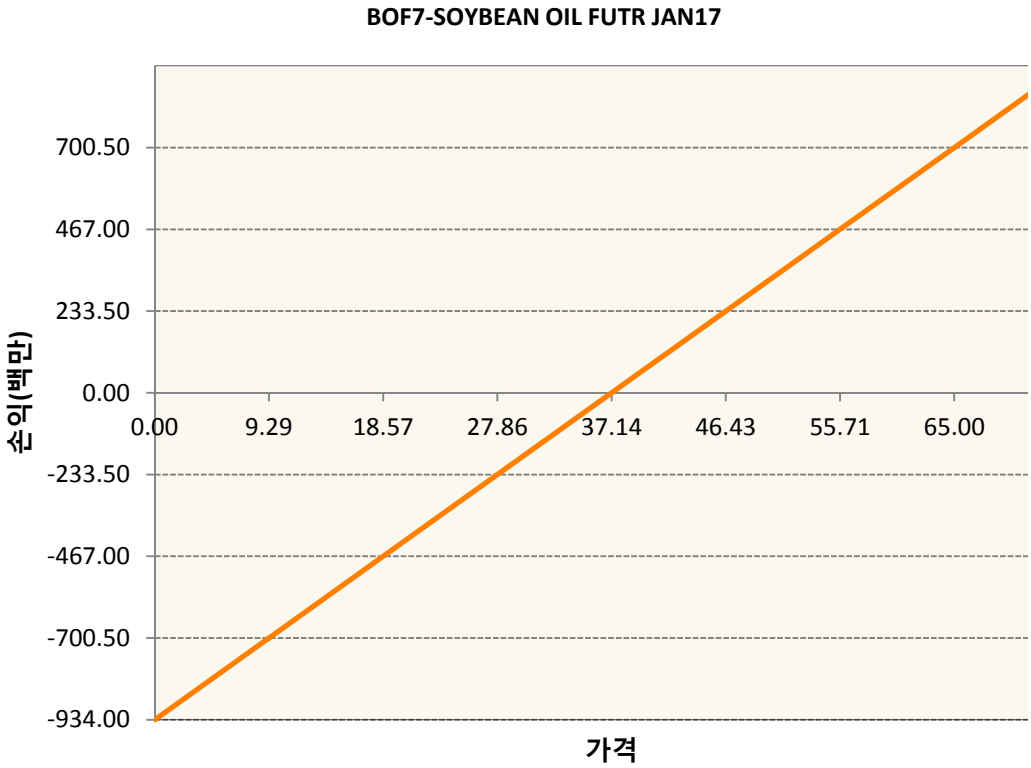
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

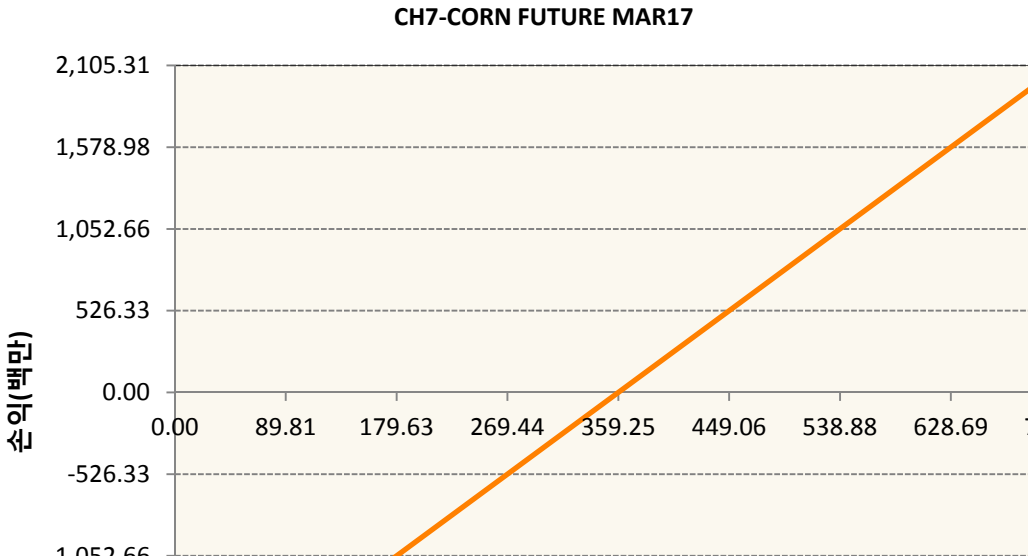
1. 계약금액

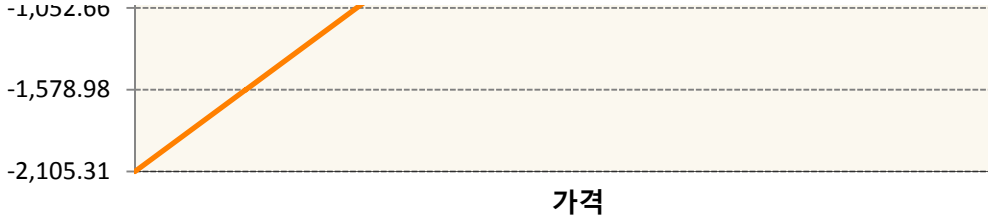
(단위:백만원)

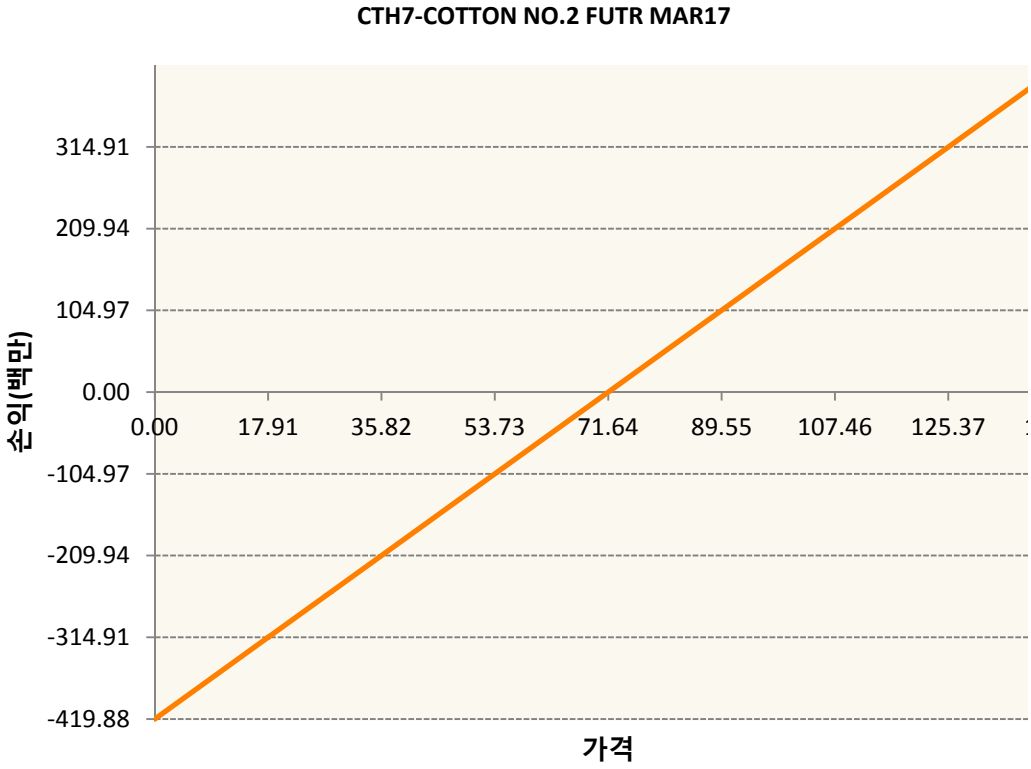
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	9,246	0	9,246	

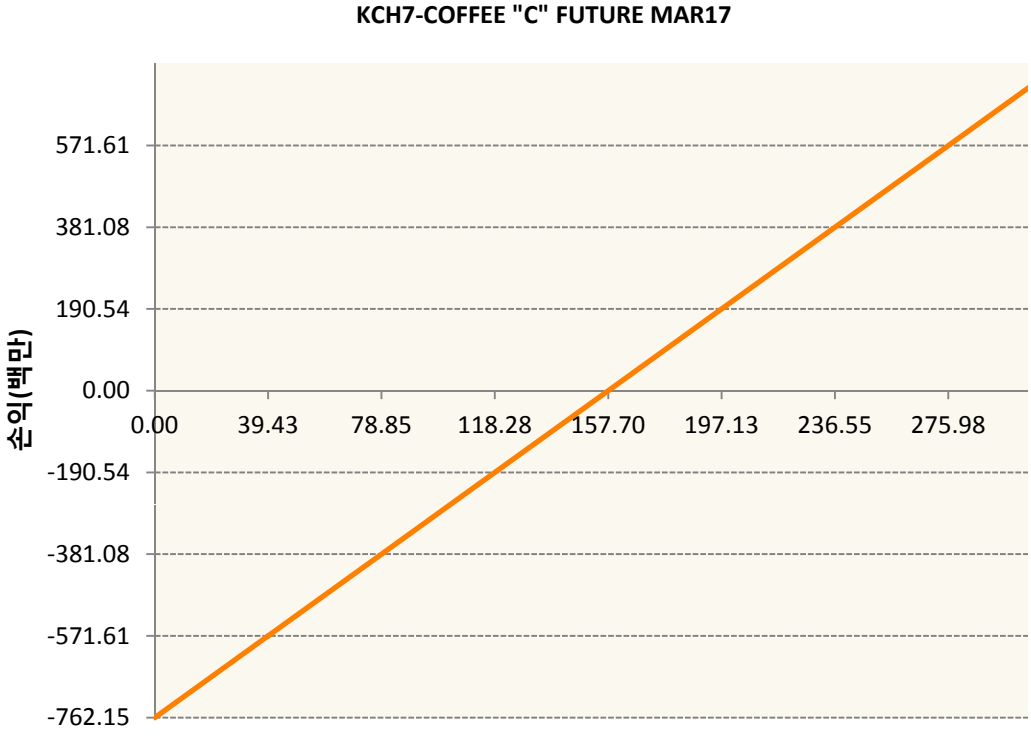
2. 만기시점의 손익구조





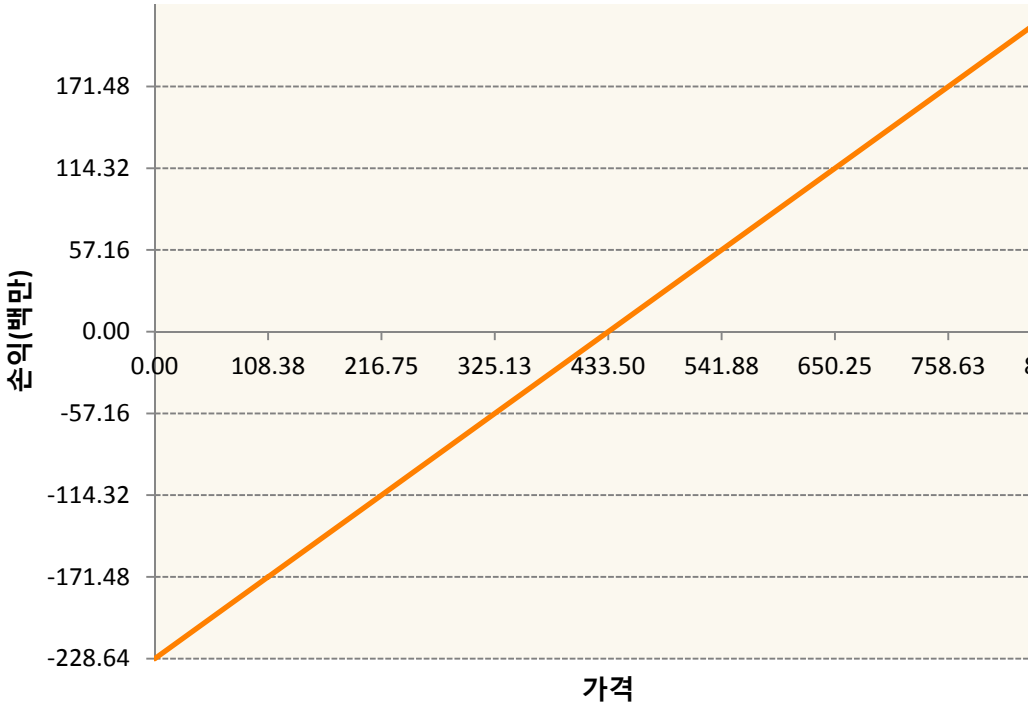

-1,578.98
-2,105.31
가격


CTH7-COTTON NO.2 FUTR MAR17
314.91
209.94
104.97
0.00
-104.97
-209.94
-314.91
-419.88
0.00
17.91
35.82
53.73
71.64
89.55
107.46
125.37
손익(백만)
가격

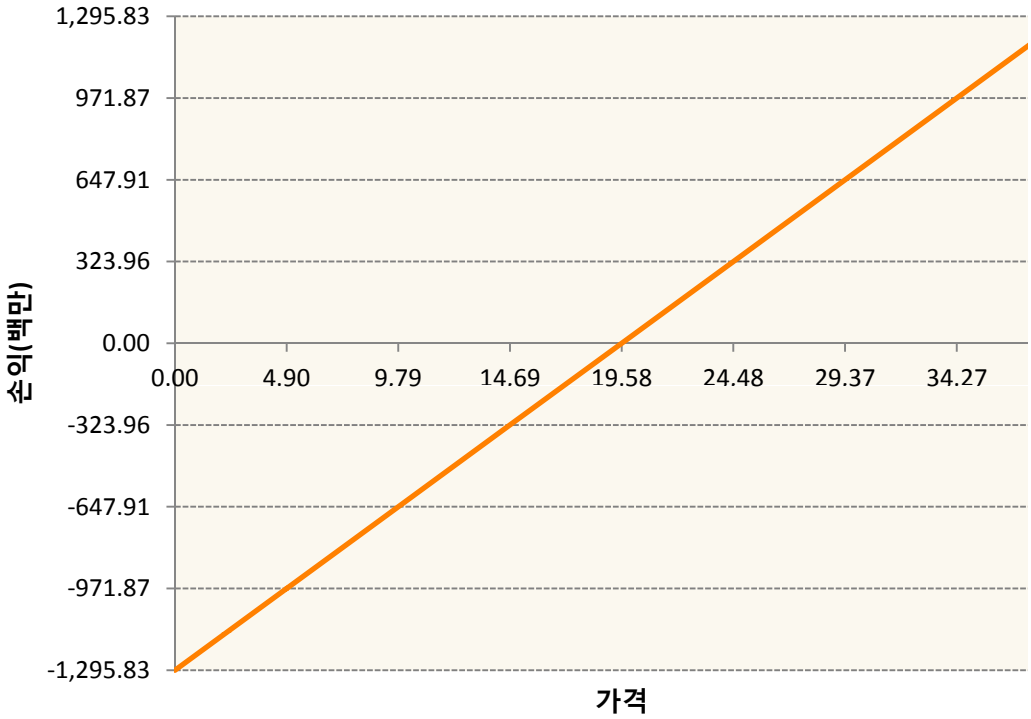

KCH7-COFFEE "C" FUTURE MAR17
571.61
381.08
190.54
0.00
-190.54
-381.08
-571.61
-762.15
0.00
39.43
78.85
118.28
157.70
197.13
236.55
275.98
손익(백만)

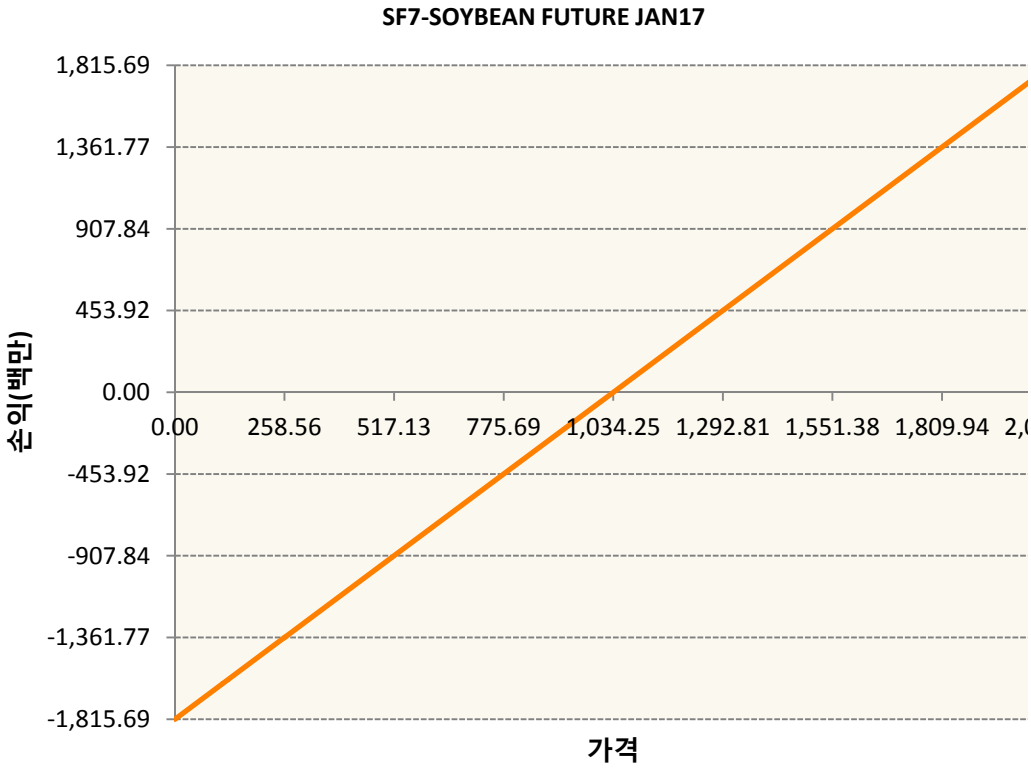
가격

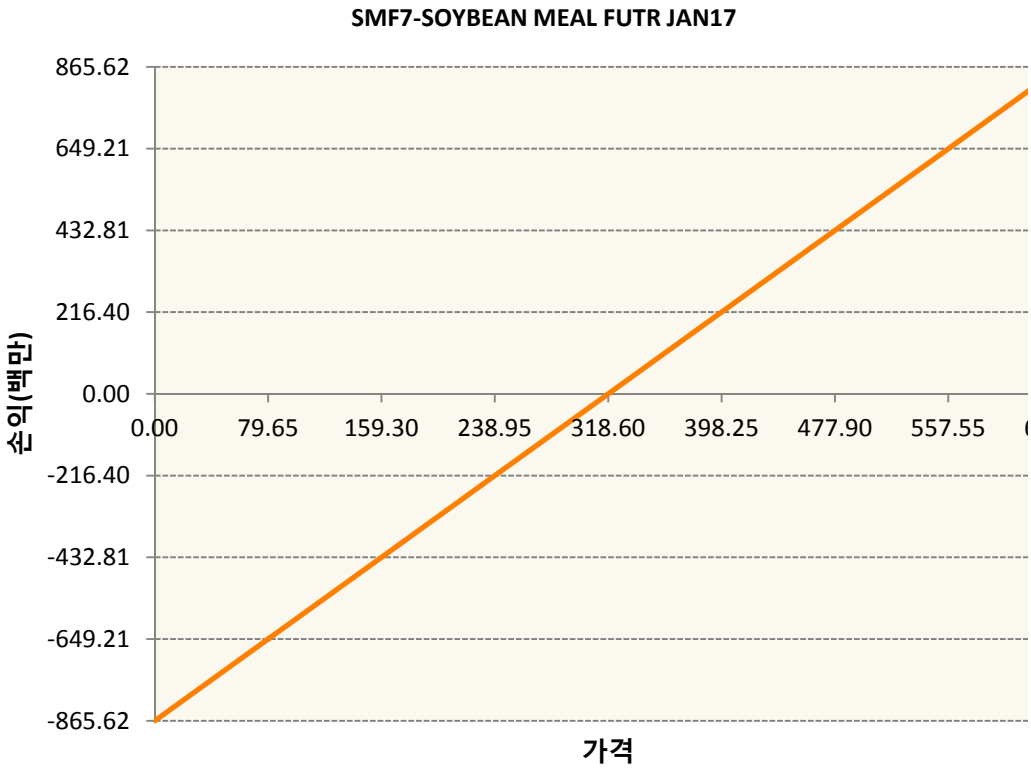
KWH7-KC HRW WHEAT FUT MAR17

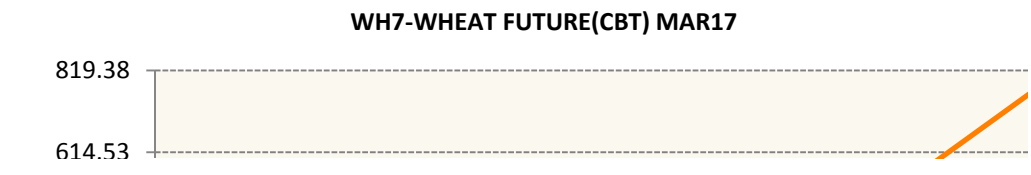


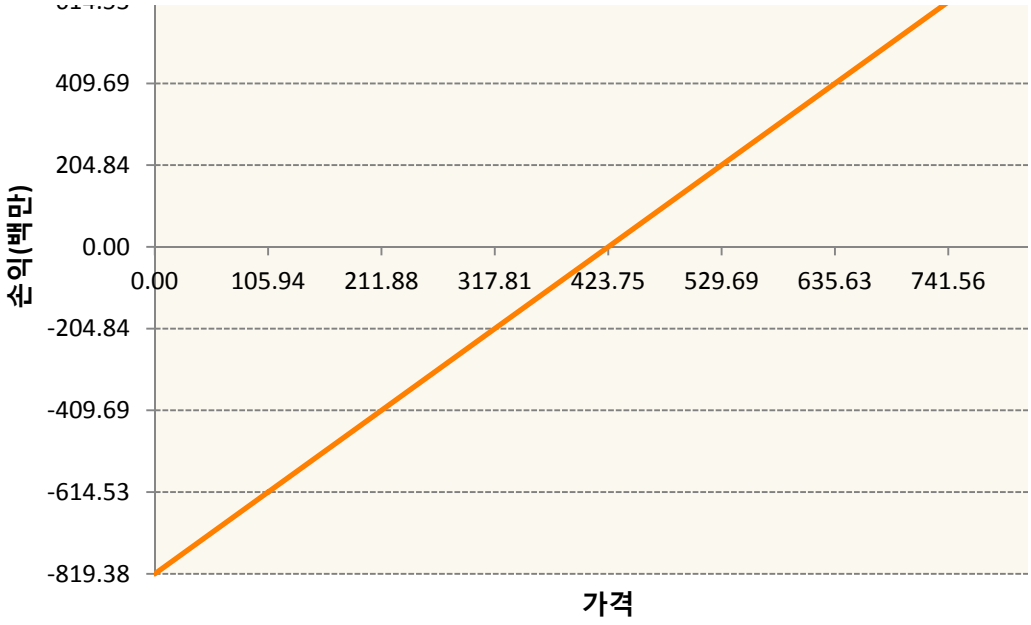
SBH7-Sugar #11 (WORLD) MAR17




SF7-SOYBEAN FUTURE JAN17
1,815.69
1,361.77
907.84
453.92
0.00
-453.92
-907.84
-1,361.77
-1,815.69
0.00
258.56
517.13
775.69
1,034.25
1,292.81
1,551.38
1,809.94
손익(백만)
가격


SMF7-SOYBEAN MEAL FUTR JAN17
865.62
649.21
432.81
216.40
0.00
-216.40
-432.81
-649.21
-865.62
0.00
79.65
159.30
238.95
318.60
398.25
477.90
557.55
손익(백만)
가격


WH7-WHEAT FUTURE(CBT) MAR17
819.38
614.53



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

BOF7	SOYBEAN OIL FUTR JAN17	75
CH7	CORN FUTURE MAR17	168
CTH7	COTTON NO.2 FUTR MAR17	34
KCH7	COFFEE "C" FUTURE MAR17	61
KWH7	KC HRW WHEAT FUT MAR17	18
SBH7	Sugar #11 (WORLD) MAR17	104
SF7	SOYBEAN FUTURE JAN17	145
SMF7	SOYBEAN MEAL FUTR JAN17	69
WH7	WHEAT FUTURE(CBT) MAR17	66

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

920