공시일	2016-12-01
기준일	2016-11-30

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	2016-12-01
기준일	2016-11-30

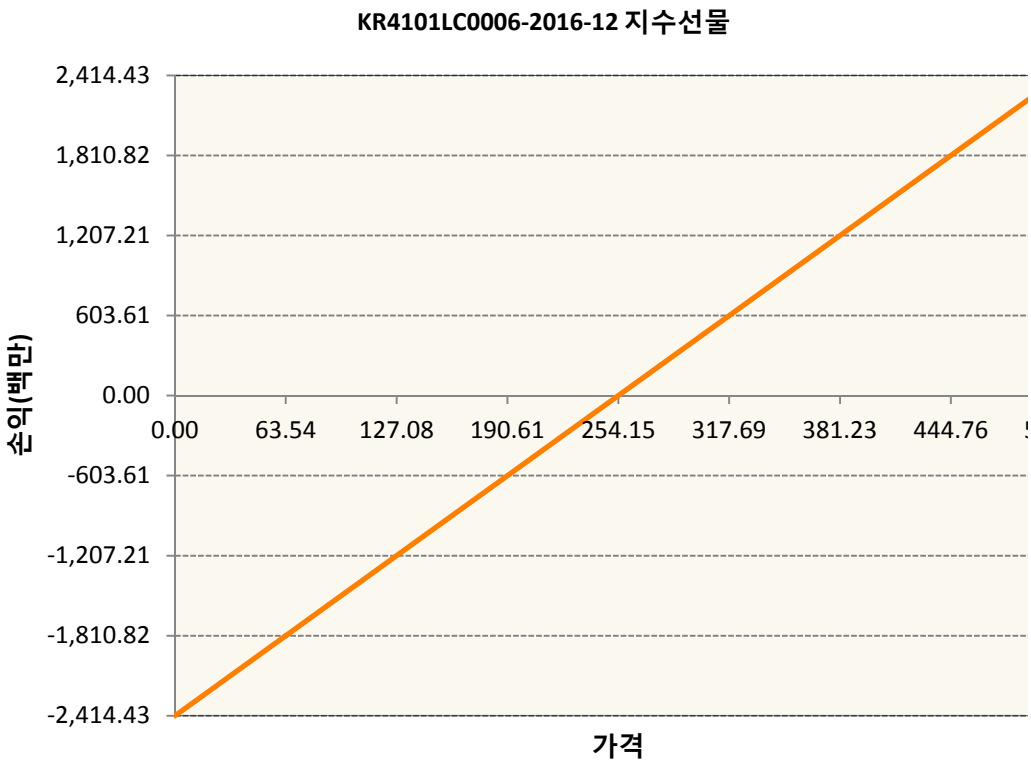
스마트인덱스모

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	127	-127	장내
누계	유가증권	선물	2,414	0	2,414	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101LC00 2016-12 지수선물							193
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-193	-193	-193	-193	-193	-193	-193
-5.33%	-129	-129	-129	-129	-129	-129	-129
-2.67%	-64	-64	-64	-64	-64	-64	-64
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	64	64	64	64	64	64	64
5.33%	129	129	129	129	129	129	129
8.00%	193	193	193	193	193	193	193

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

149

공시일	2016-12-01
기준일	2016-11-30

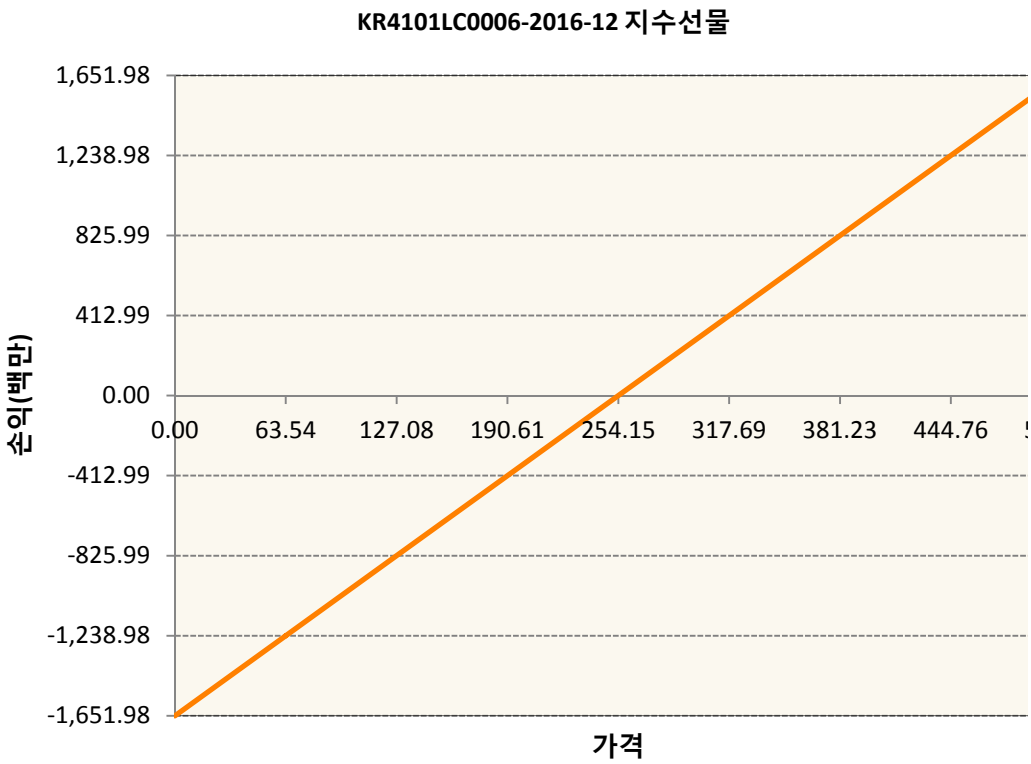
스마트레버리지목표전환형1호

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	1,652	0	1,652	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	2016-12-01
기준일	2016-11-30

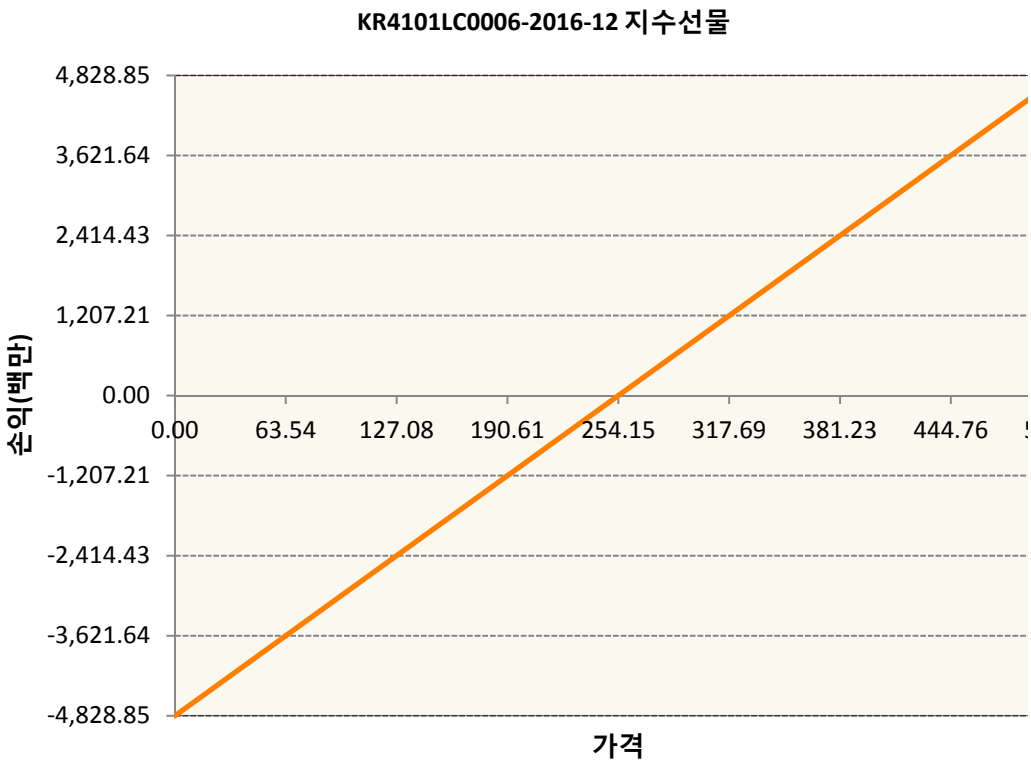
1.3배 레버리지 인덱스(주식-파생형)

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	4,829	0	4,829	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%	-258	-258	-258	-258	-258	-258	-258
-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%	258	258	258	258	258	258	258
8.00%	386	386	386	386	386	386	386

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

297

공시일	2016-12-01
기준일	2016-11-30

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	884

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

714

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2016-12-01
기준일	2016-11-30

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)

751

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2016-12-01
기준일	2016-11-30

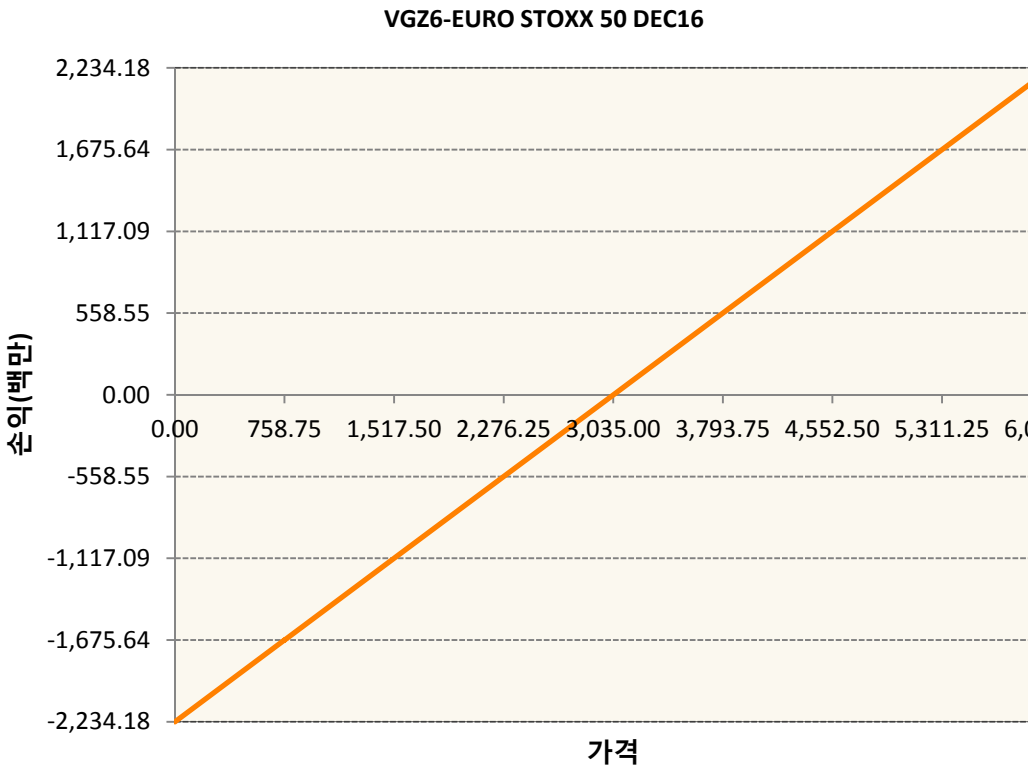
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,234	0	2,234	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGZ6	EURO STOXX 50 DEC16	179

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

(단위:백만원)

209

공시일	2016-12-01
기준일	2016-11-30

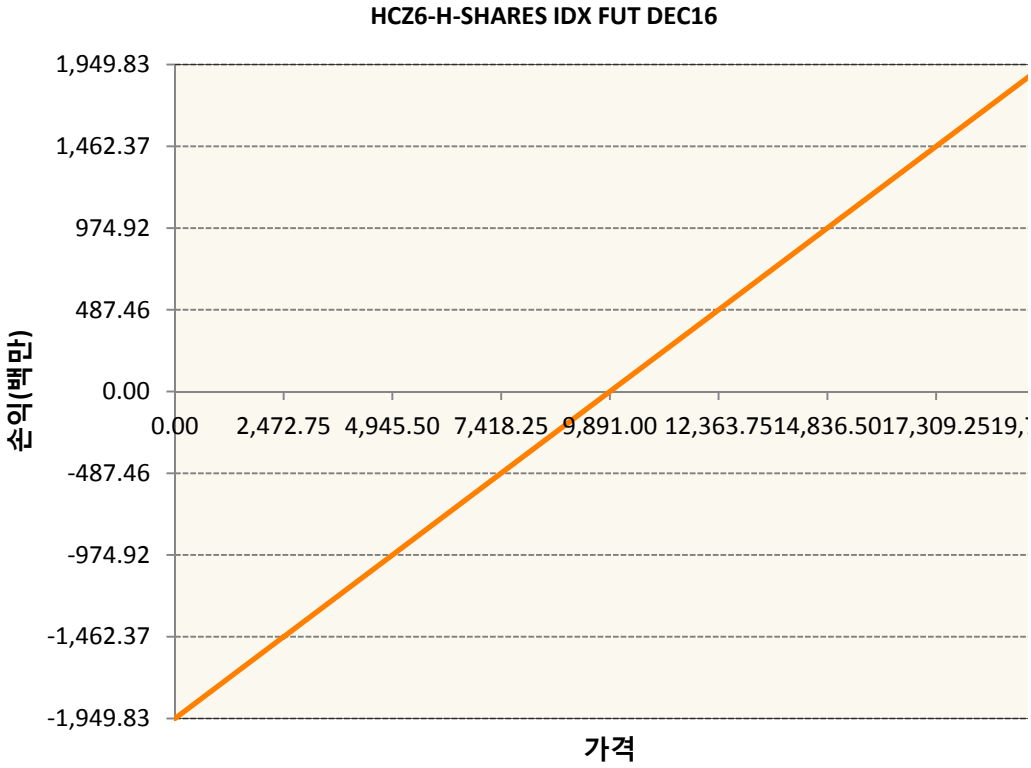
차이나인덱스모(주식-파생형)

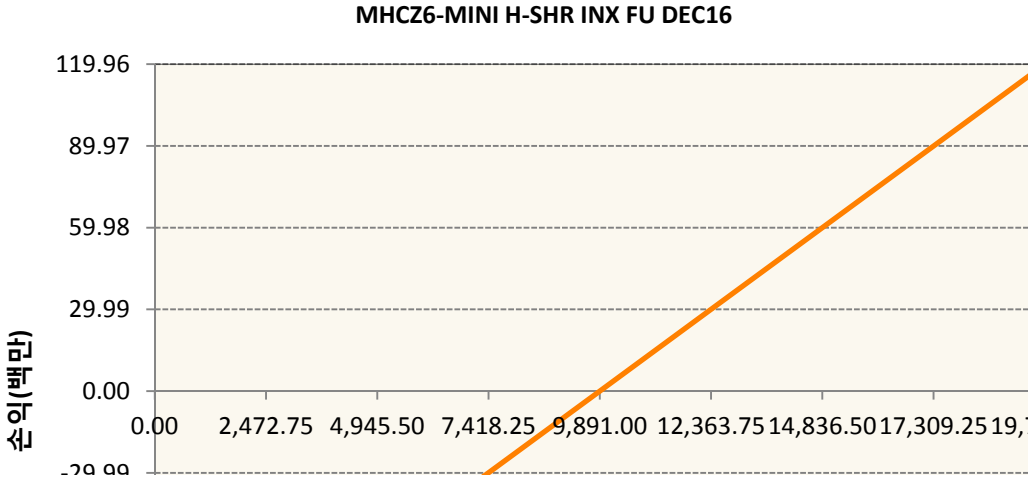
1. 계약금액

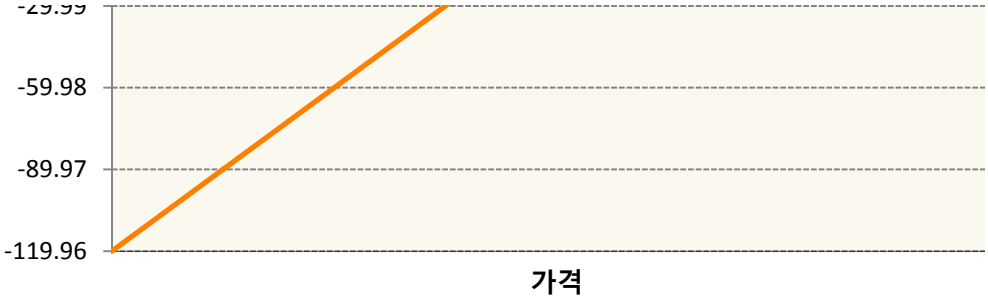
(단위:백만원)

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	1,950	0	1,950	
누계	유가증권	선물	120	0	120	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCZ6	H-SHARES IDX FUT DEC16	156
MHCZ6	MINI H-SHR INX FU DEC16	10

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	188

공시일	2016-12-01
기준일	2016-11-30

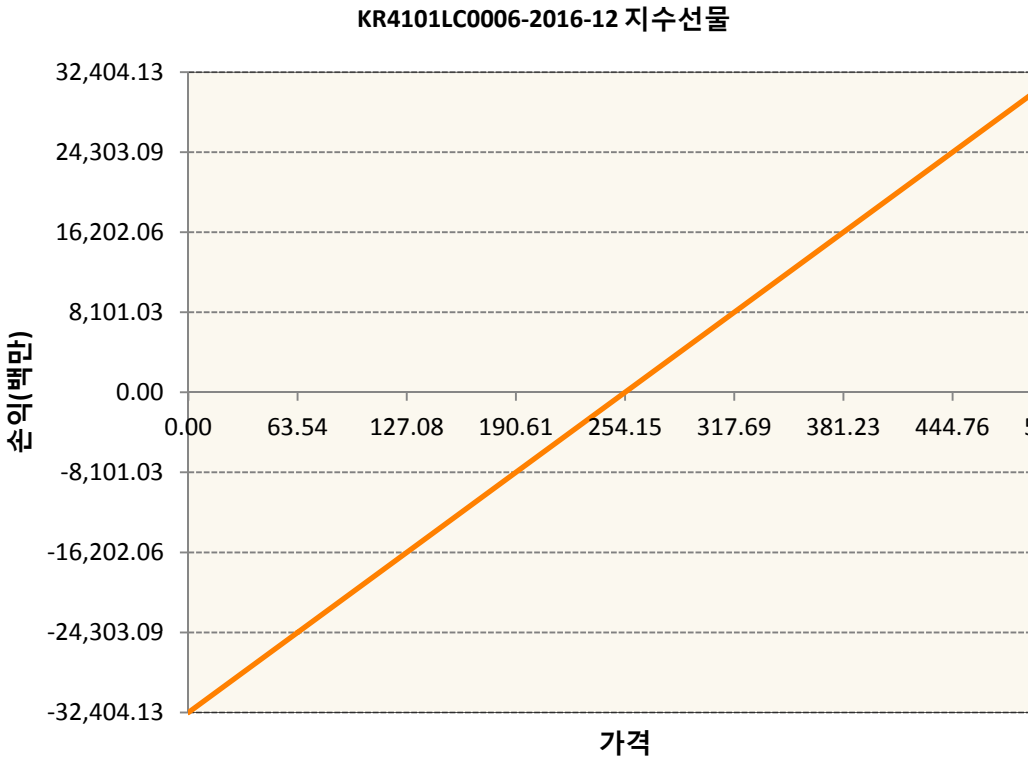
커버드콜(주식혼합-파생형)

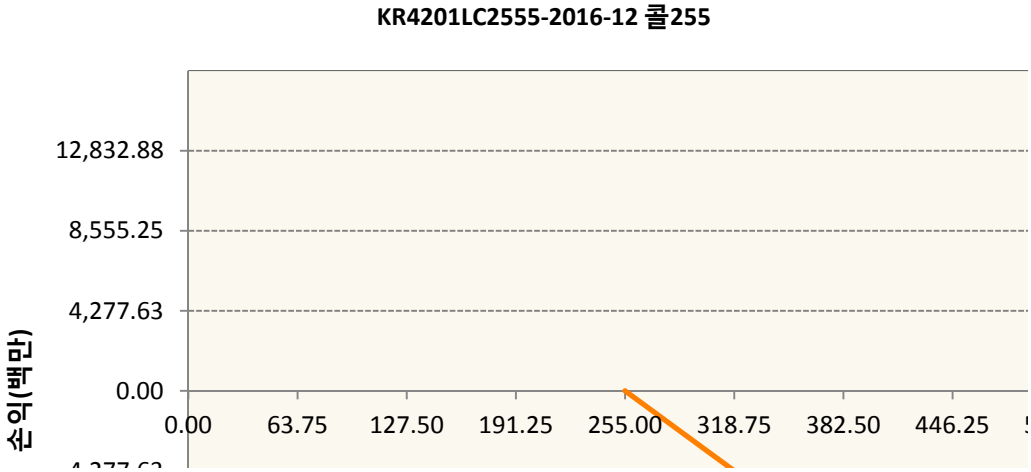
1. 계약금액

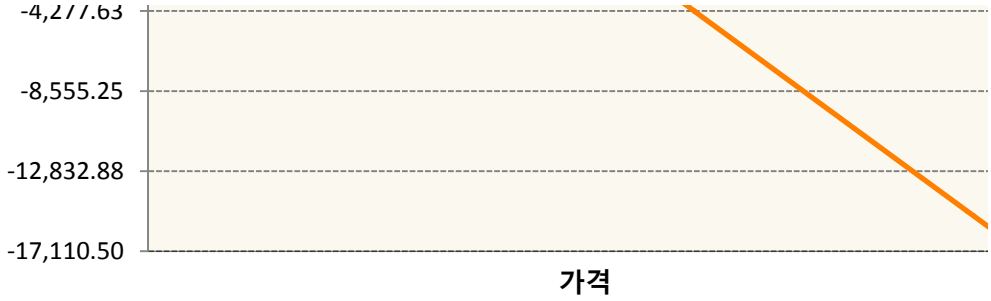
(단위:백만원)

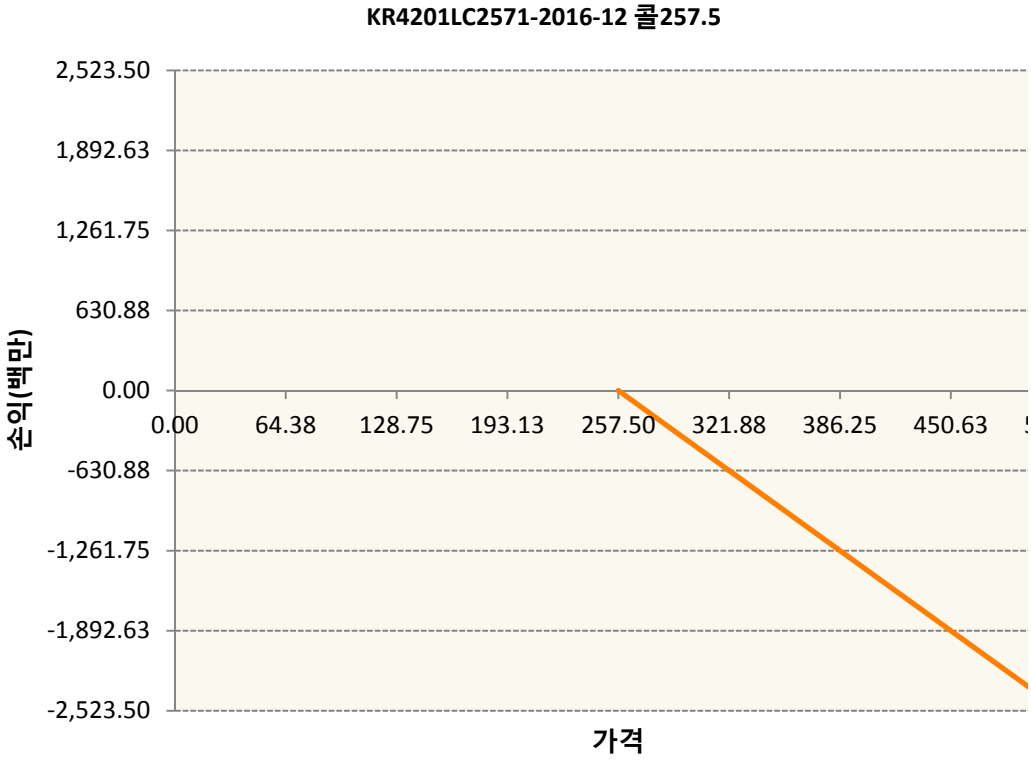
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	411	-411	장내
누계	유가증권	선물	32,404	0	32,404	장내
누계	유가증권	옵션	0	19,634	-19,634	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101LC00 2016-12 지수선물							2,593
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-2,593	-2,593	-2,593	-2,593	-2,593	-2,593	-2,593
-5.33%	-1,729	-1,729	-1,729	-1,729	-1,729	-1,729	-1,729
-2.67%	-864	-864	-864	-864	-864	-864	-864
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	864	864	864	864	864	864	864
5.33%	1,729	1,729	1,729	1,729	1,729	1,729	1,729
8.00%	2,593	2,593	2,593	2,593	2,593	2,593	2,593
KR4201LC25 2016-12 콜255							6,059
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	515	515	515	515	515	515	515
-5.33%	515	515	515	515	514	513	511
-2.67%	509	502	493	480	465	446	425
0%	155	104	52	0	-52	-104	-156
2.67%	-1,534	-1,549	-1,567	-1,590	-1,615	-1,644	-1,675
5.33%	-3,785	-3,785	-3,786	-3,787	-3,789	-3,792	-3,797
8.00%	-6,059	-6,059	-6,059	-6,059	-6,059	-6,059	-6,059
KR4201LC25 2016-12 콜257.5							804
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	34	34	34	34	34	34	34
-5.33%	34	34	34	34	34	34	34
-2.67%	34	34	33	33	32	31	29
0%	17	12	6	0	-6	-13	-19
2.67%	-155	-160	-165	-171	-177	-183	-190
5.33%	-472	-472	-472	-473	-474	-475	-477
8.00%	-804	-804	-804	-804	-804	-804	-804

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

10,864

공시일	2016-12-01
기준일	2016-11-30

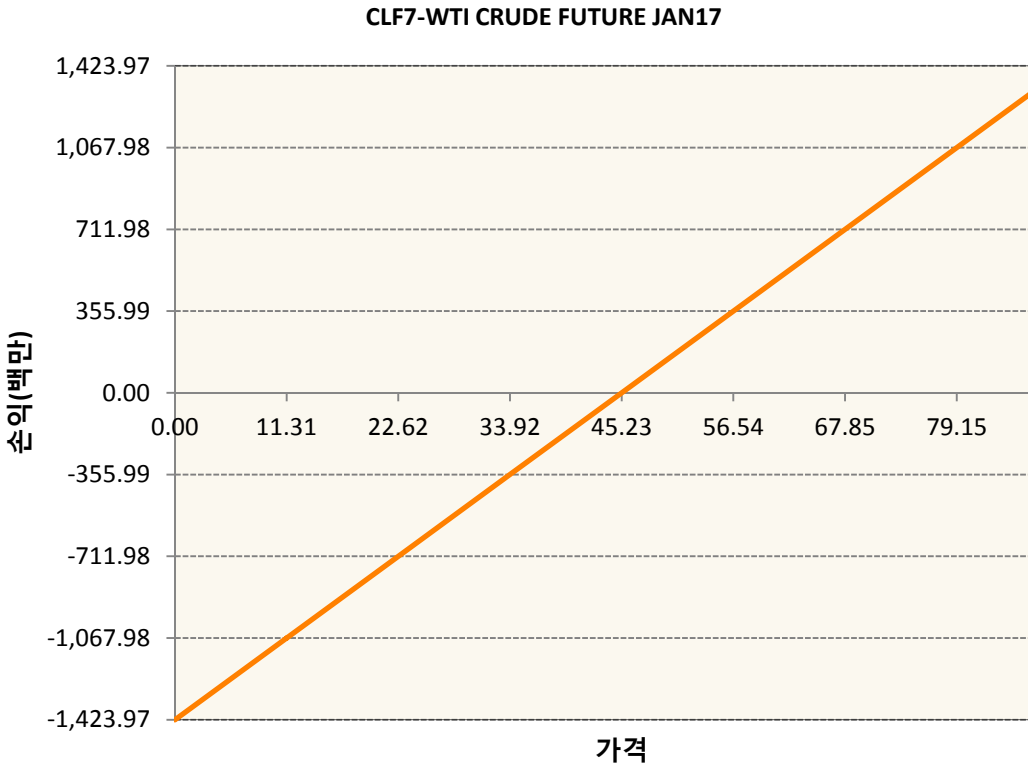
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

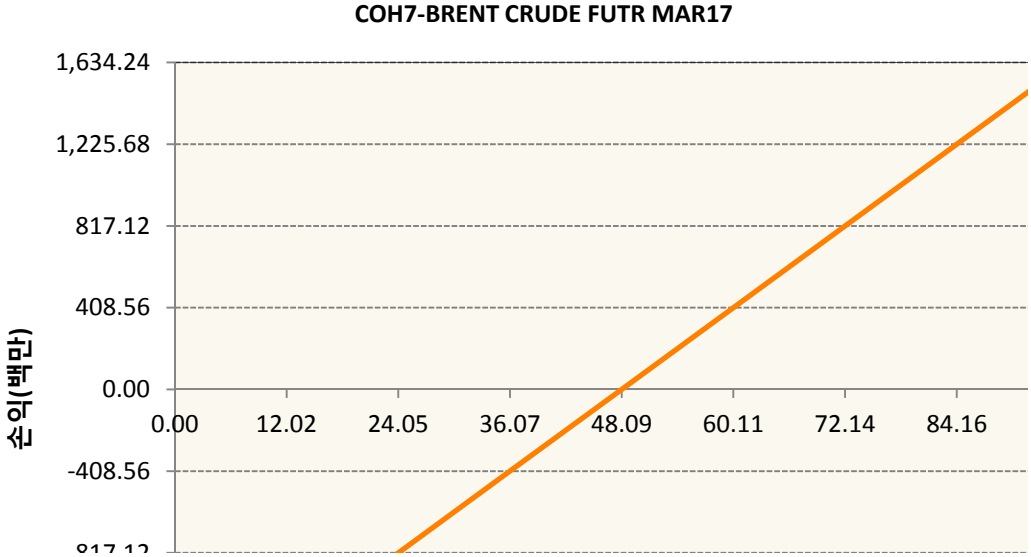
1. 계약금액

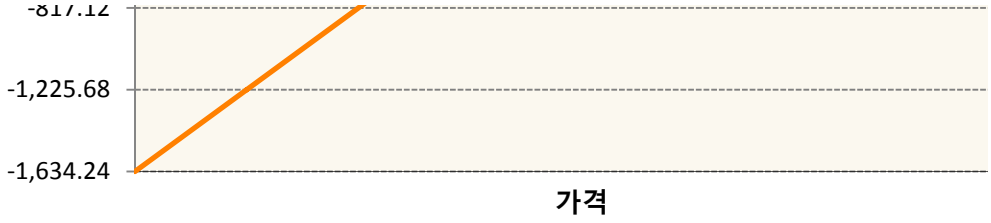
(단위:백만원)

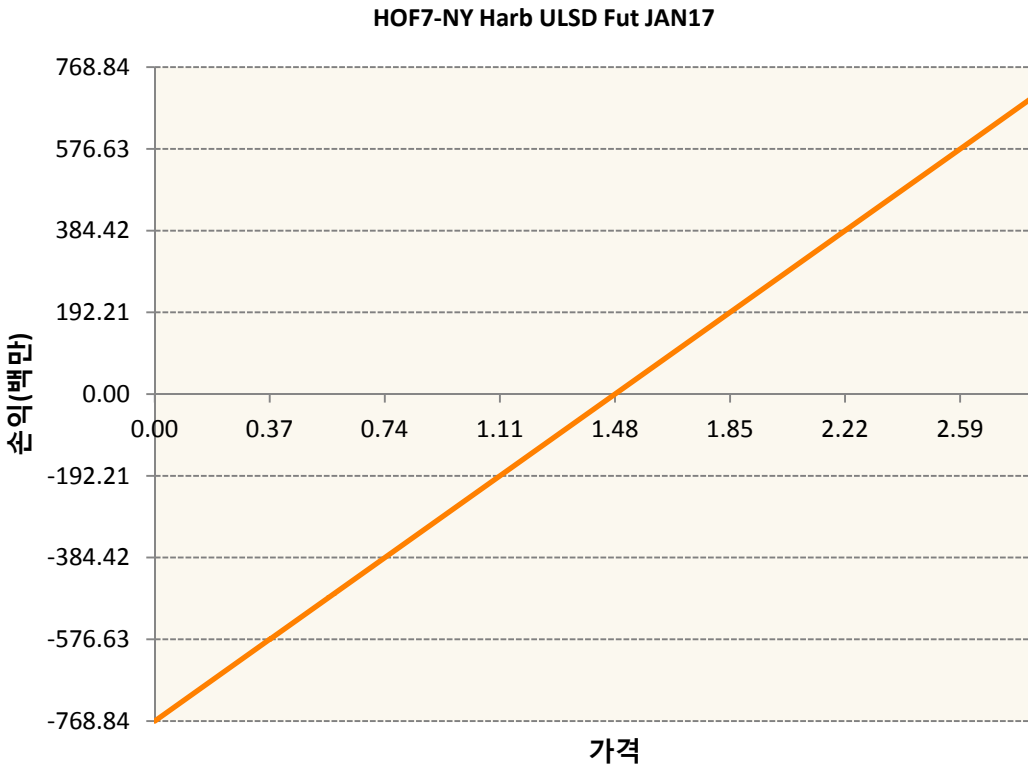
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	6,158	0	6,158	

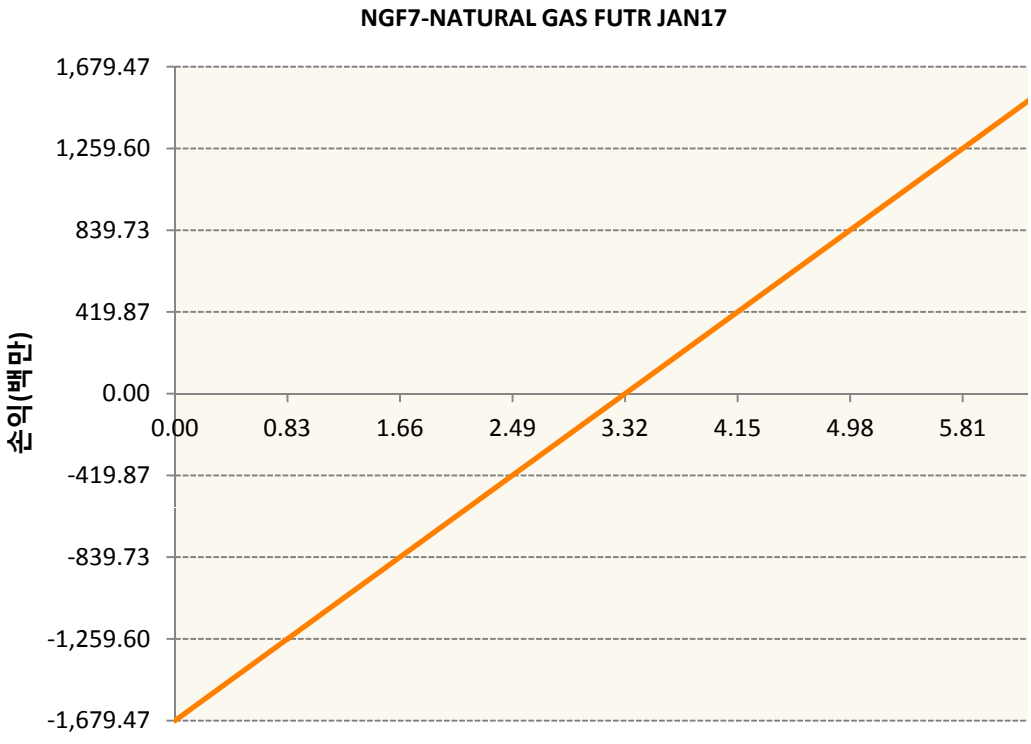
2. 만기시점의 손익구조



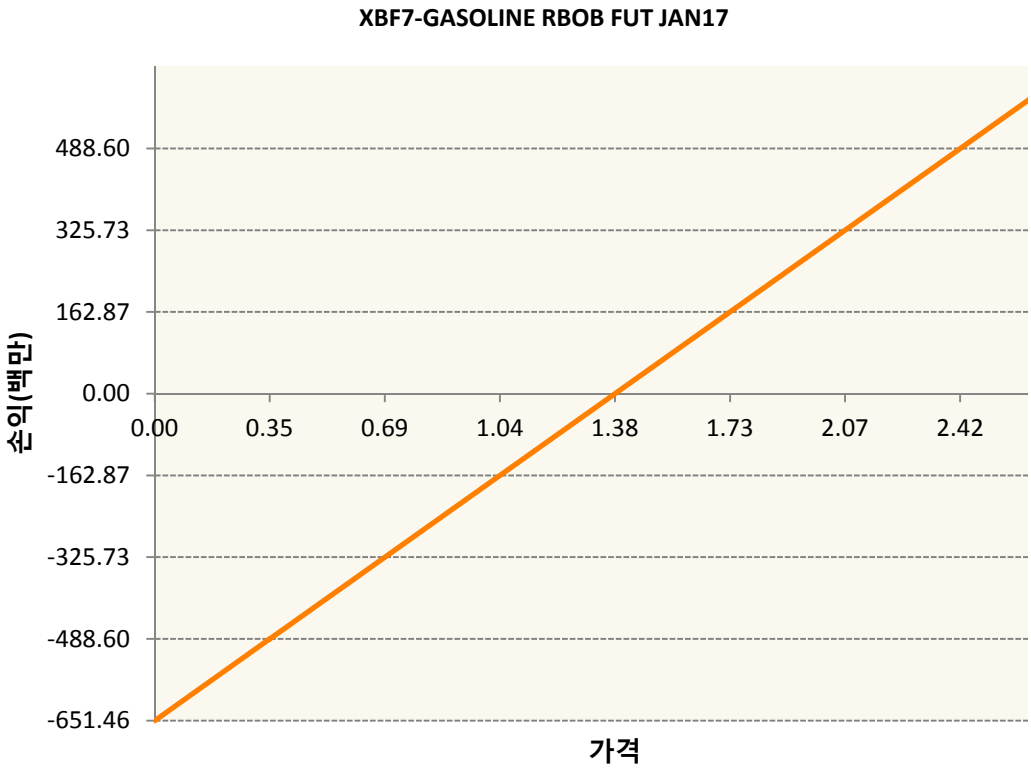



-1,225.68
-1,634.24
가격


HOF7-NY Harb ULSD Fut JAN17
768.84
576.63
384.42
192.21
0.00
-192.21
-384.42
-576.63
-768.84
0.00
0.37
0.74
1.11
1.48
1.85
2.22
2.59
손익(백만)
가격


NGF7-NATURAL GAS FUTR JAN17
1,679.47
1,259.60
839.73
419.87
0.00
-419.87
-839.73
-1,259.60
-1,679.47
0.00
0.83
1.66
2.49
3.32
4.15
4.98
5.81
손익(백만)

가격



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
CLF7	WTI CRUDE FUTURE JAN17	114
COH7	BRENT CRUDE FUTR MAR17	131
HOF7	NY Harb ULSD Fut JAN17	62
NGF7	NATURAL GAS FUTR JAN17	134
XBF7	GASOLINE RBOB FUT JAN17	52

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,109

공시일	2016-12-01
기준일	2016-11-30

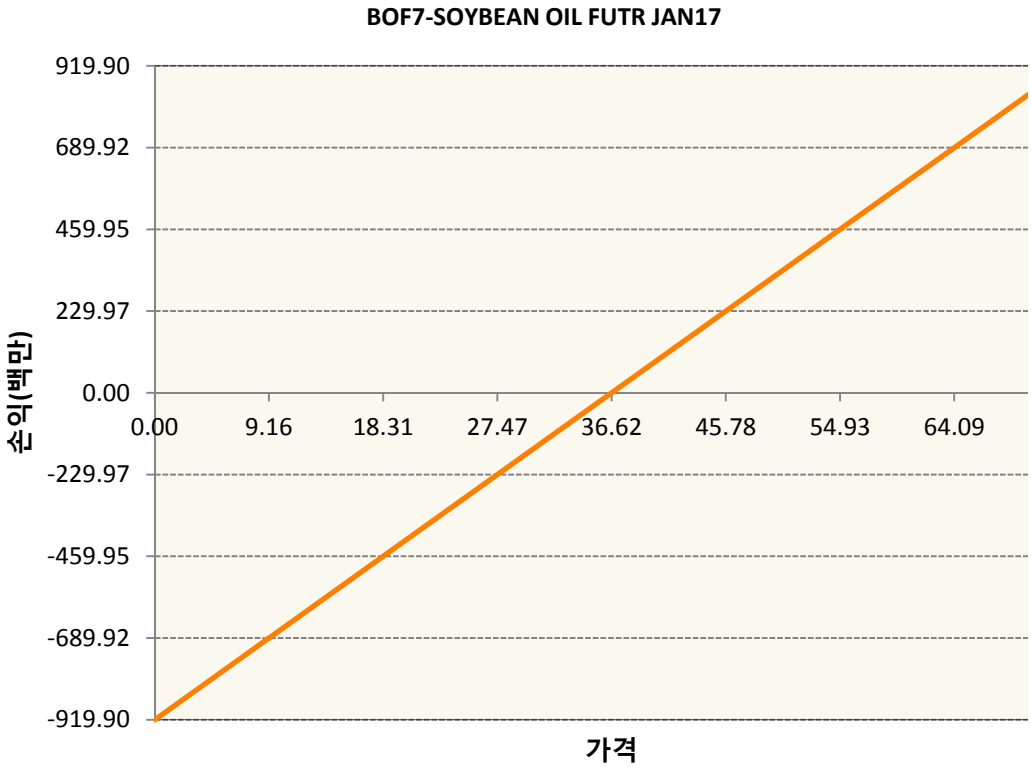
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

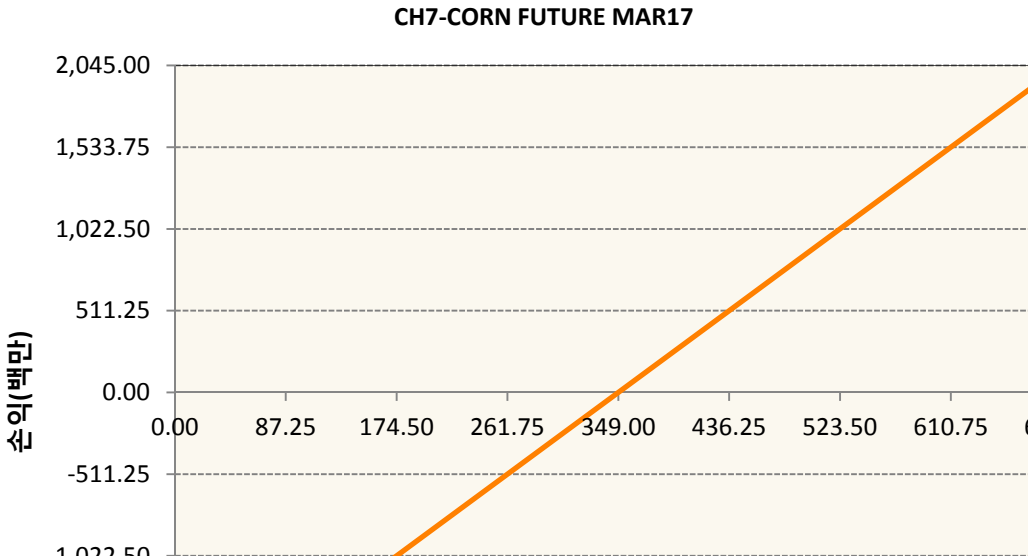
1. 계약금액

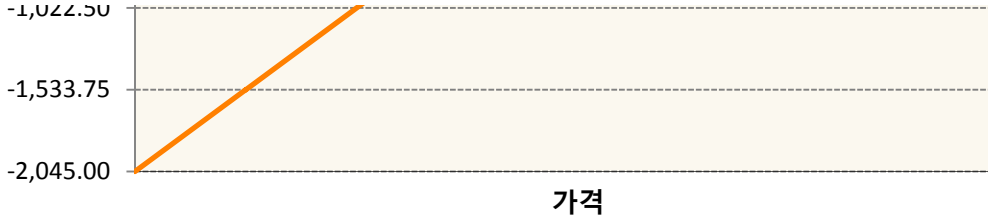
(단위:백만원)

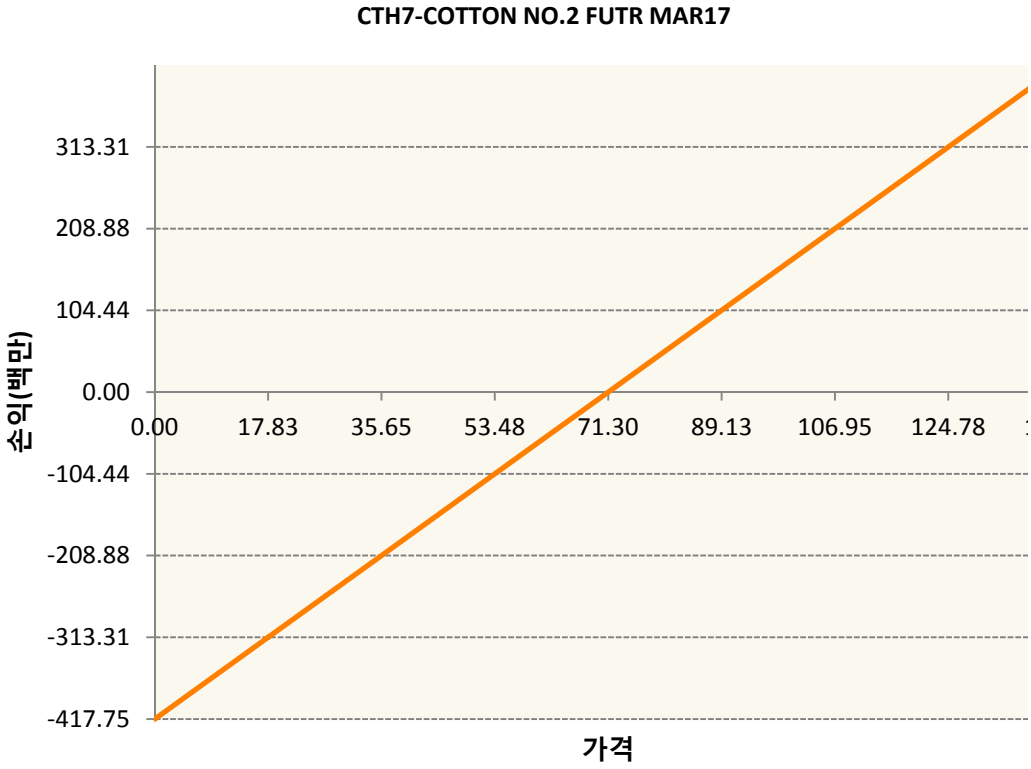
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	9,146	0	9,146	

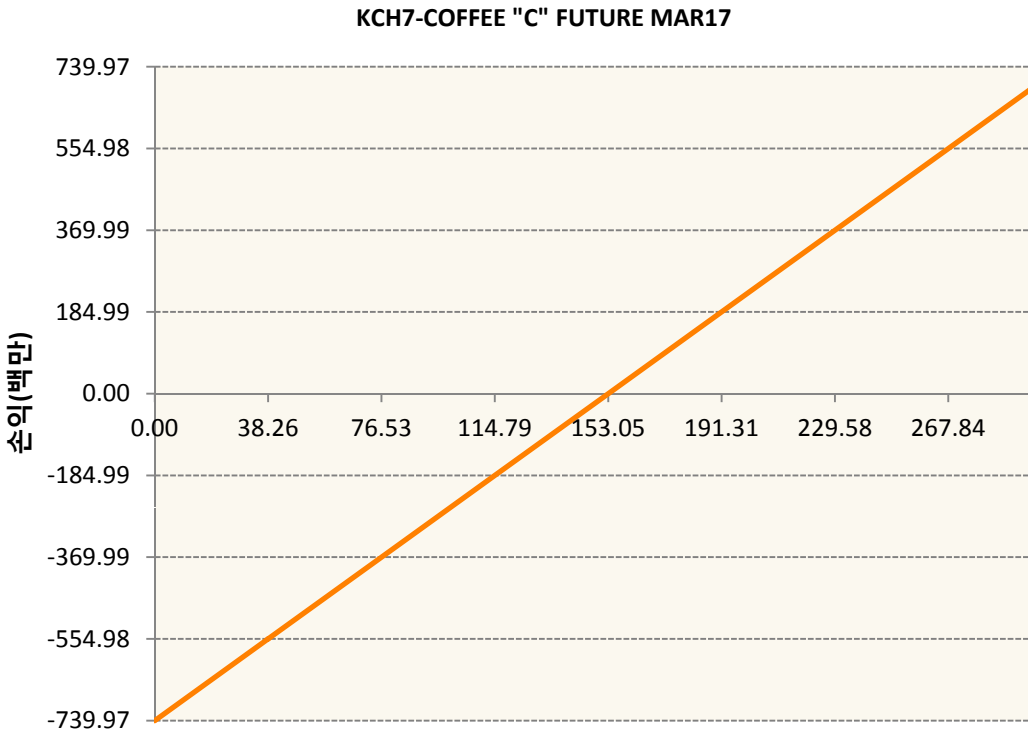
2. 만기시점의 손익구조





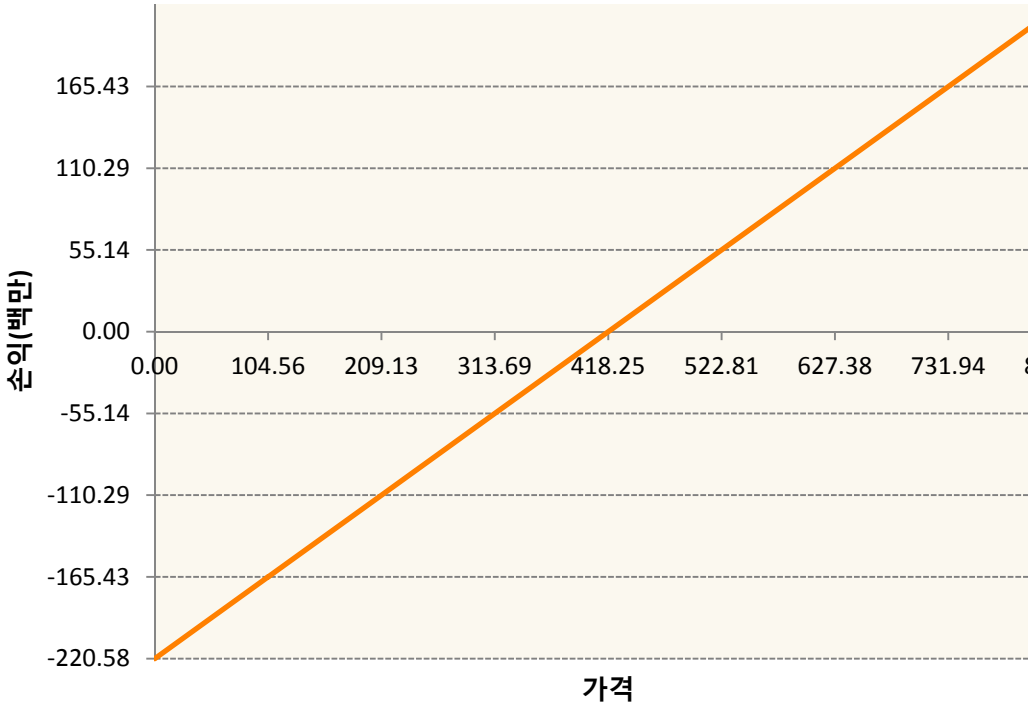

-1,533.75
-2,045.00
가격


CTH7-COTTON NO.2 FUTR MAR17
313.31
208.88
104.44
0.00
-104.44
-208.88
-313.31
-417.75
0.00
17.83
35.65
53.48
71.30
89.13
106.95
124.78
순익(백만)
가격

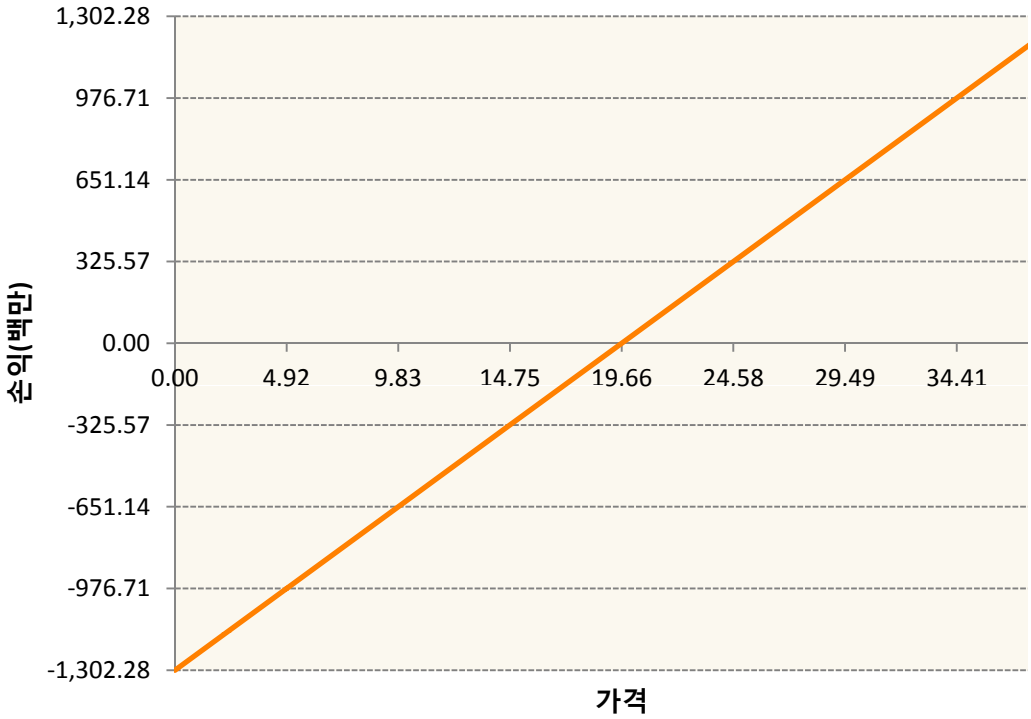

KCH7-COFFEE "C" FUTURE MAR17
739.97
554.98
369.99
184.99
0.00
-184.99
-369.99
-554.98
-739.97
0.00
38.26
76.53
114.79
153.05
191.31
229.58
267.84
순익(백만)

가격

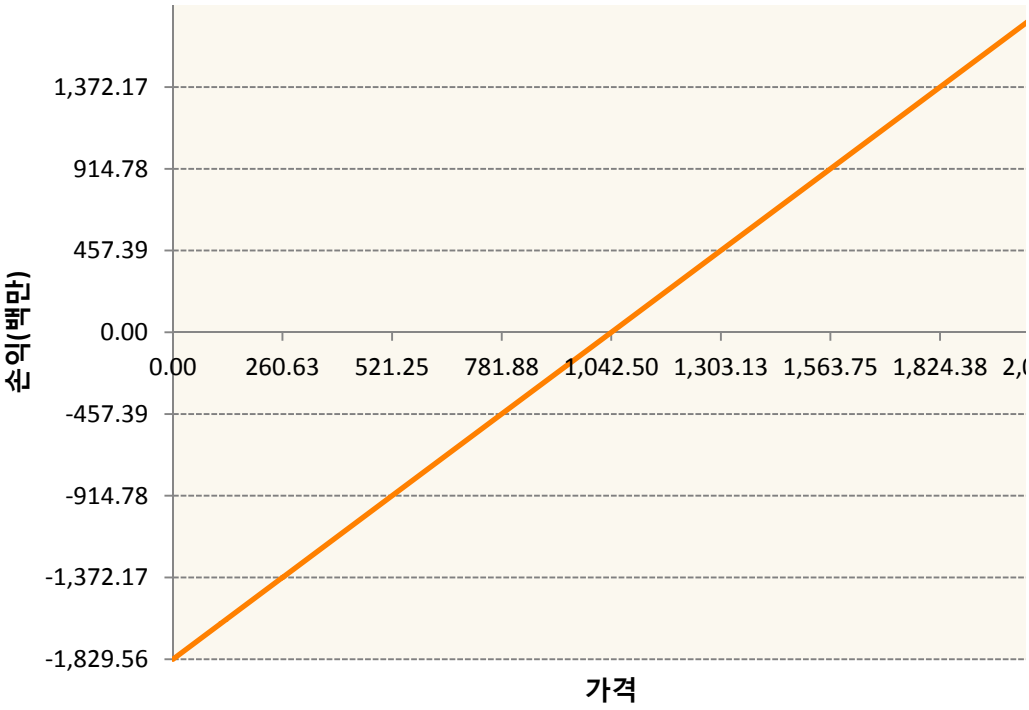
KWH7-KC HRW WHEAT FUT MAR17



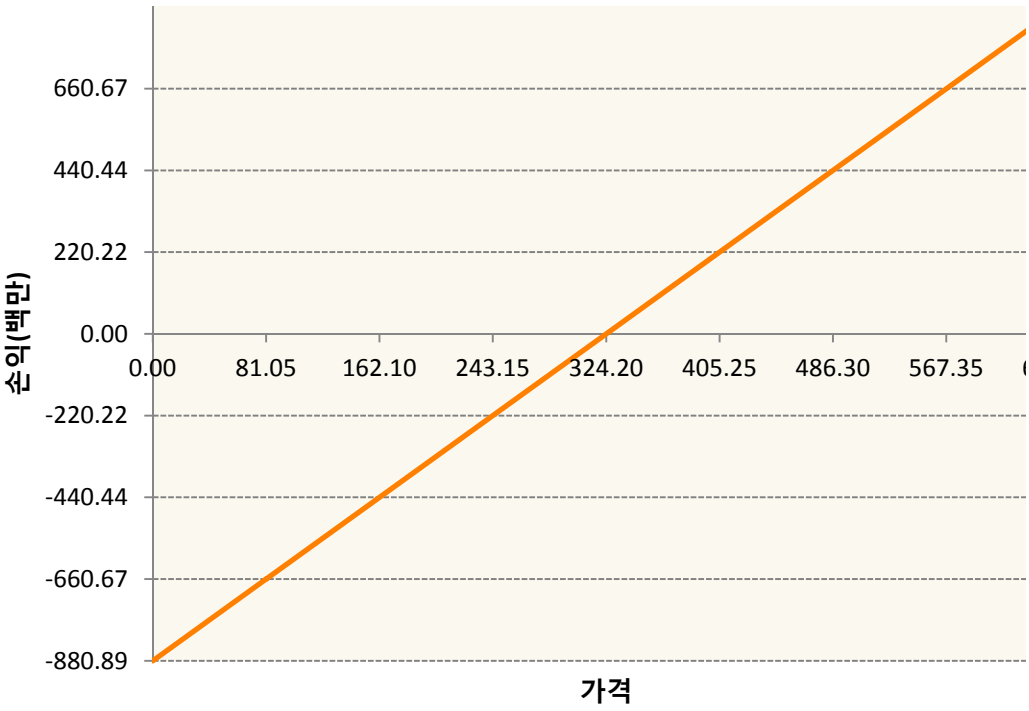
SBH7-Sugar #11 (WORLD) MAR17



SF7-SOYBEAN FUTURE JAN17

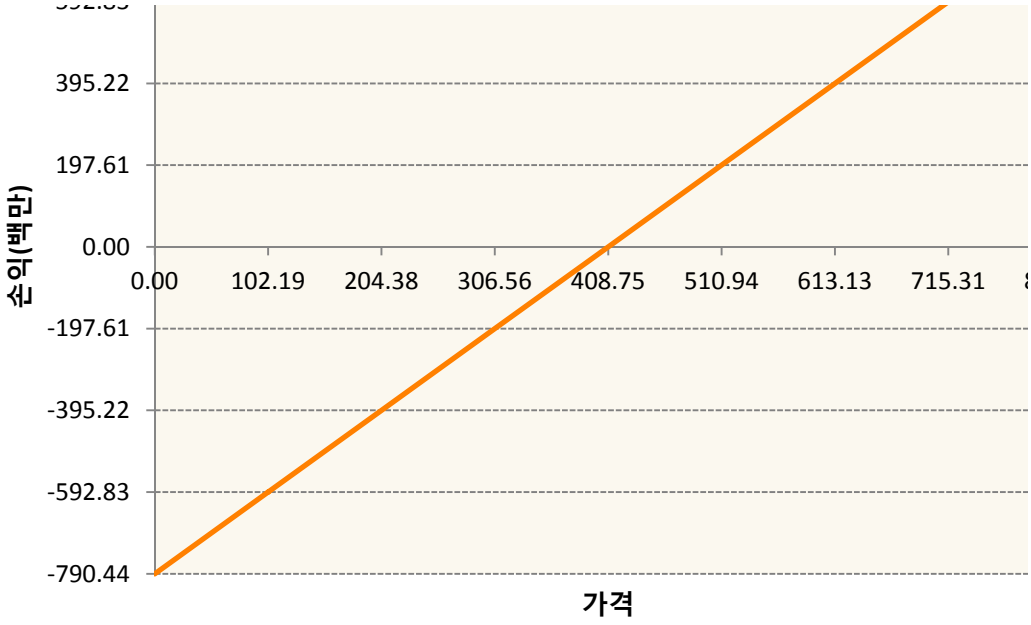


SMF7-SOYBEAN MEAL FUTR JAN17



WH7-WHEAT FUTURE(CBT) MAR17





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
BOF7	SOYBEAN OIL FUTR JAN17	74
CH7	CORN FUTURE MAR17	164
CTH7	COTTON NO.2 FUTR MAR17	33
KCH7	COFFEE "C" FUTURE MAR17	59
KWH7	KC HRW WHEAT FUT MAR17	18
SBH7	Sugar #11 (WORLD) MAR17	104
SF7	SOYBEAN FUTURE JAN17	146
SMF7	SOYBEAN MEAL FUTR JAN17	70
WH7	WHEAT FUTURE(CBT) MAR17	63

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	907