공시일	2016-12-02
기준일	2016-12-01

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	2016-12-02
기준일	2016-12-01

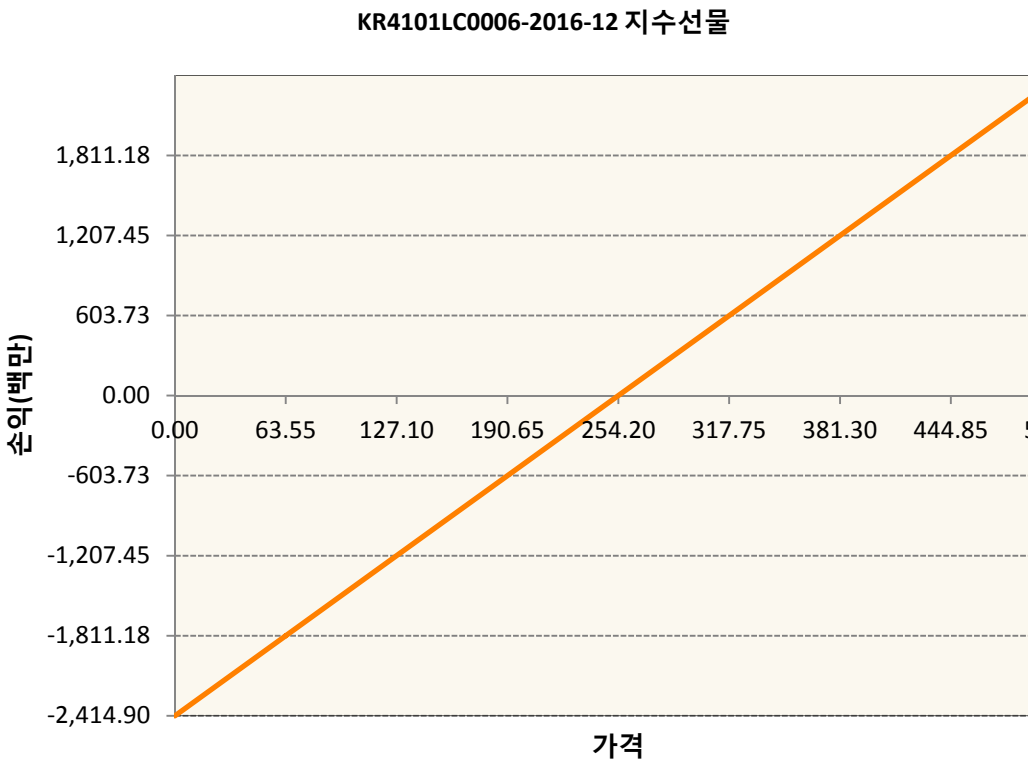
스마트인덱스모

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	2,415	0	2,415	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)

148

공시일	2016-12-02
기준일	2016-12-01

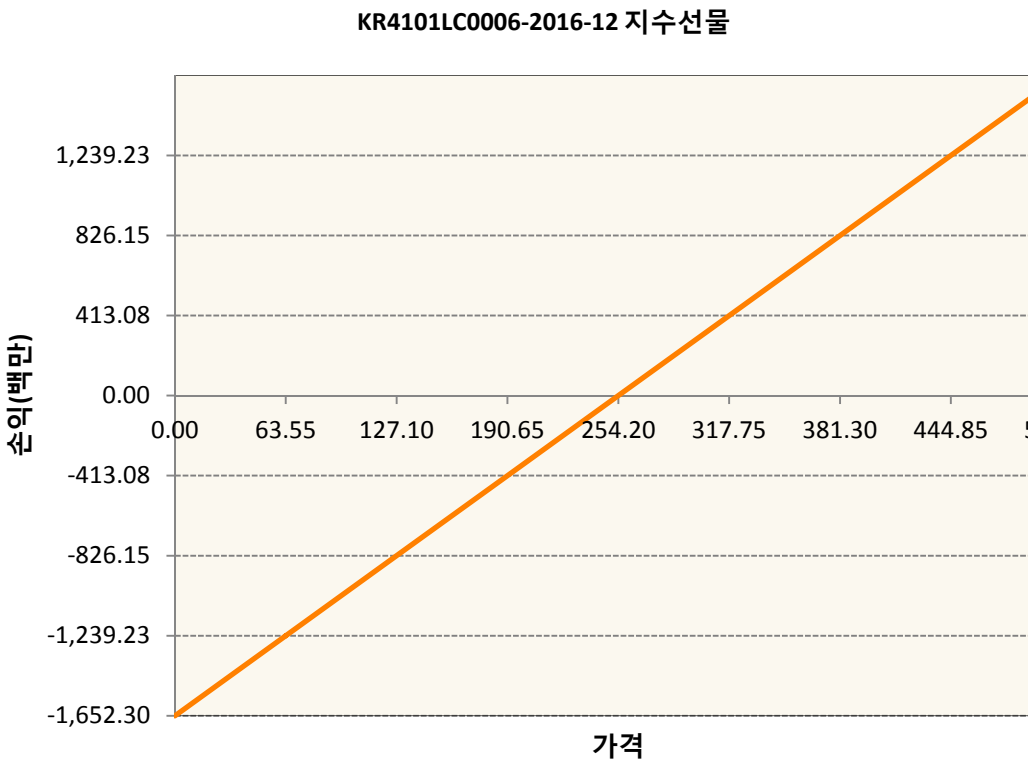
스마트레버리지목표전환형1호

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)

101

공시일	2016-12-02
기준일	2016-12-01

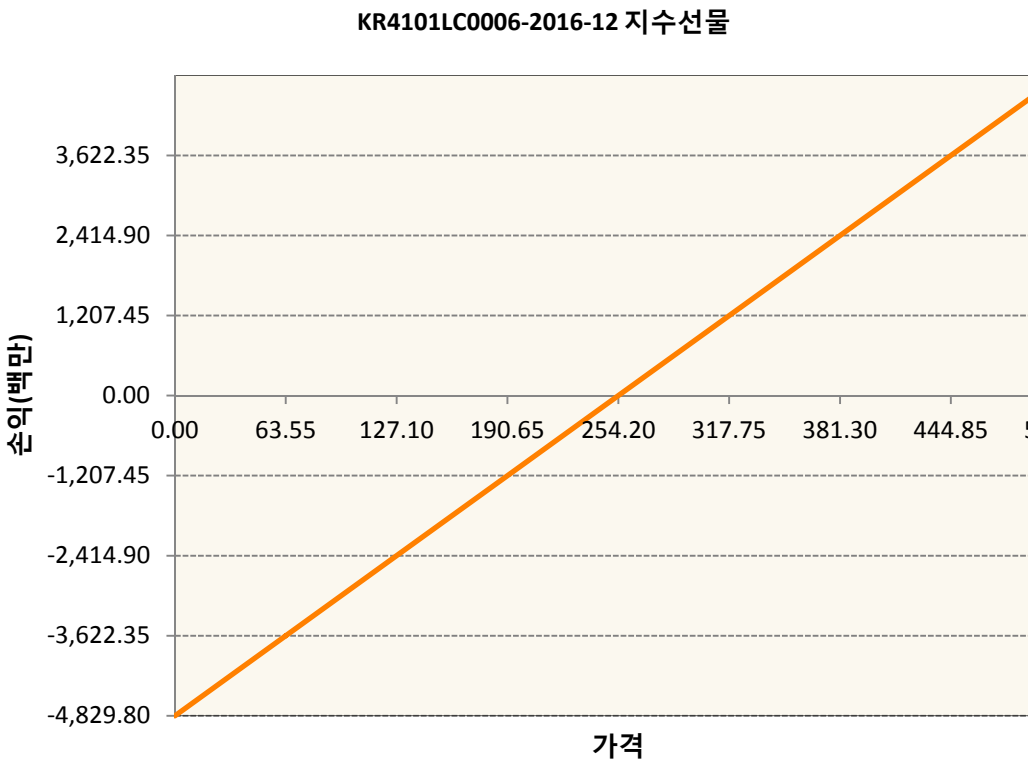
1.3배 레버리지 인덱스(주식-파생형)

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	4,830	0	4,830	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101LC00 2016-12 지수선물							387
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-387	-387	-387	-387	-387	-387	-387
-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%	387	387	387	387	387	387	387

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

296

공시일	2016-12-02
기준일	2016-12-01

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	2016-12-02
기준일	2016-12-01

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)

753

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2016-12-02
기준일	2016-12-01

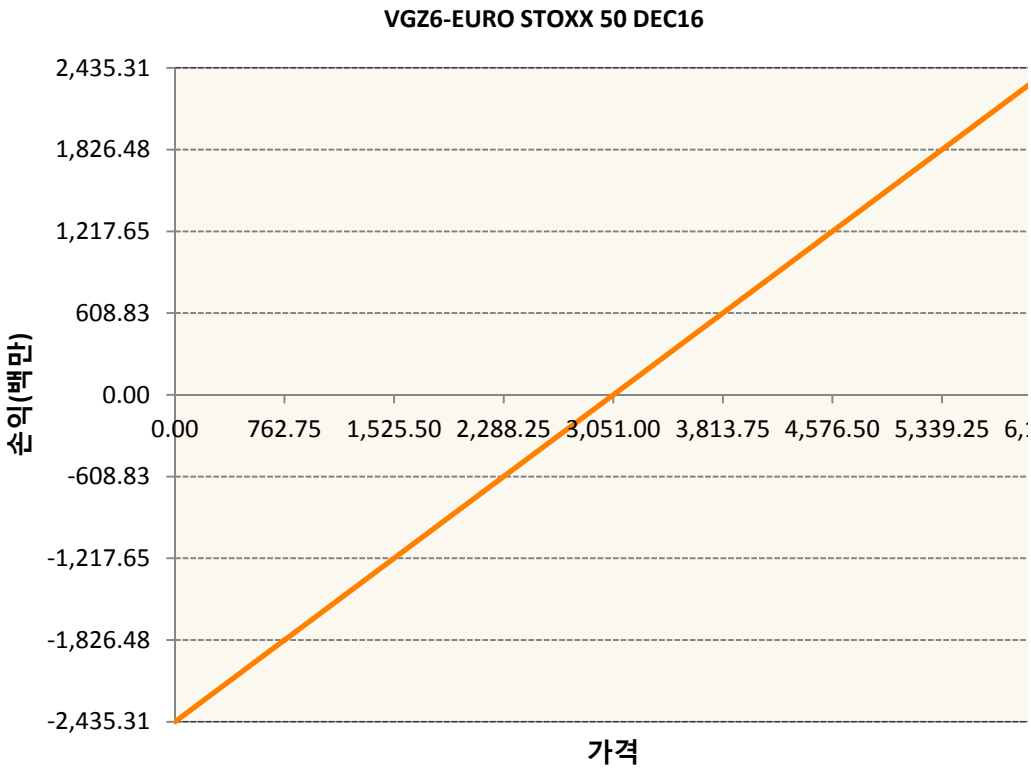
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,435	0	2,435	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGZ6	EURO STOXX 50 DEC16	195

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

(단위:백만원)

227

공시일	2016-12-02
기준일	2016-12-01

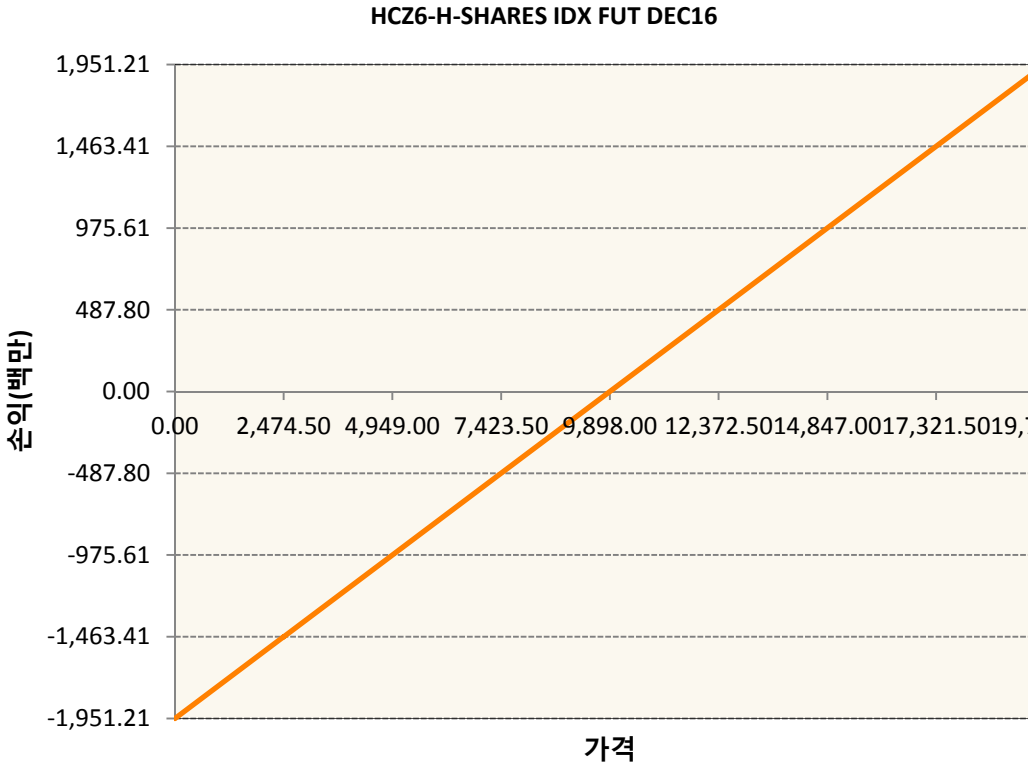
차이나인덱스모(주식-파생형)

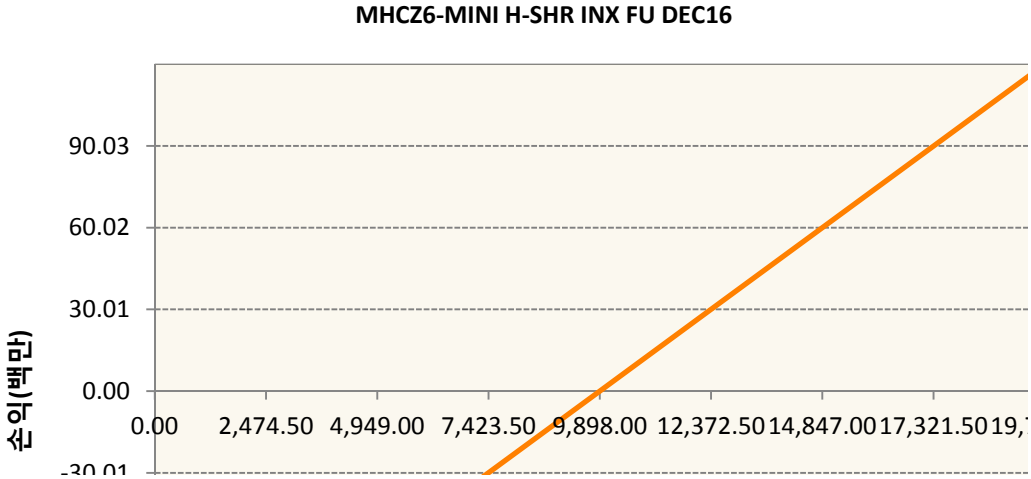
1. 계약금액

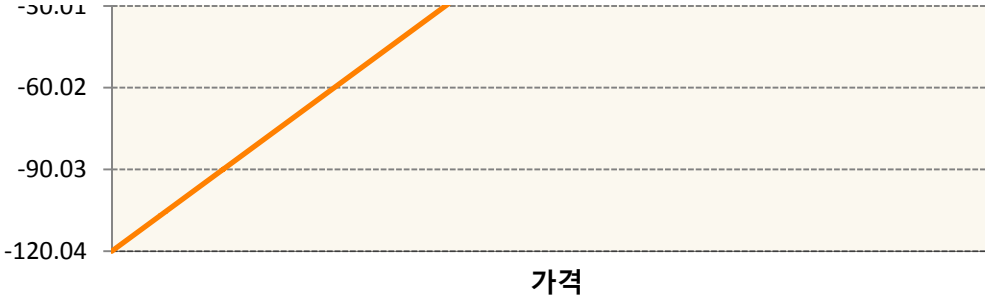
(단위:백만원)

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	1,951	0	1,951	
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	2016-12-02
기준일	2016-12-01

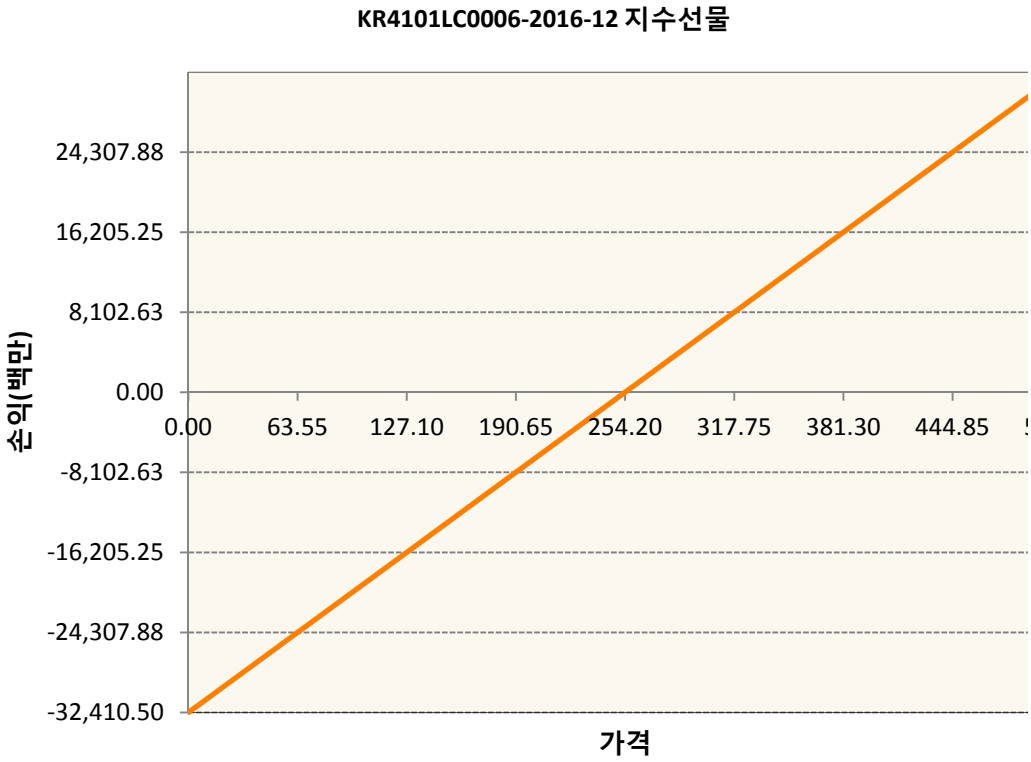
커버드콜(주식혼합-파생형)

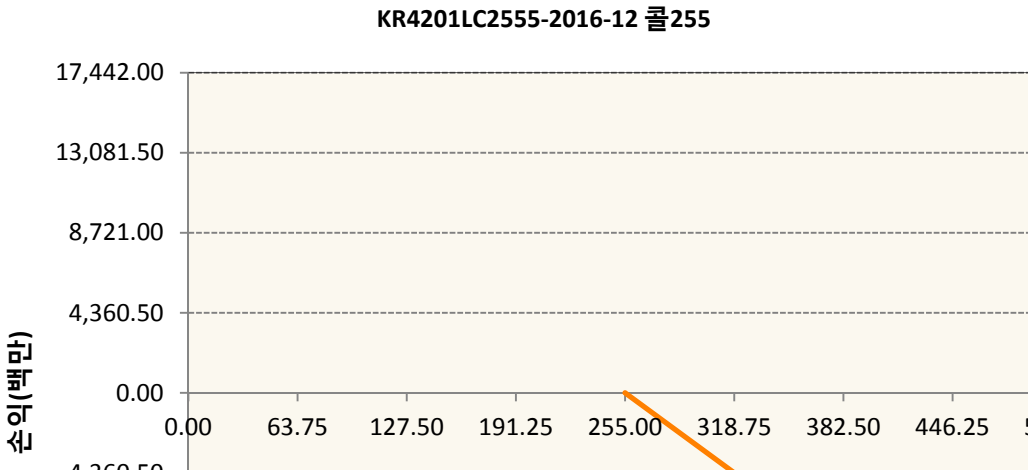
1. 계약금액

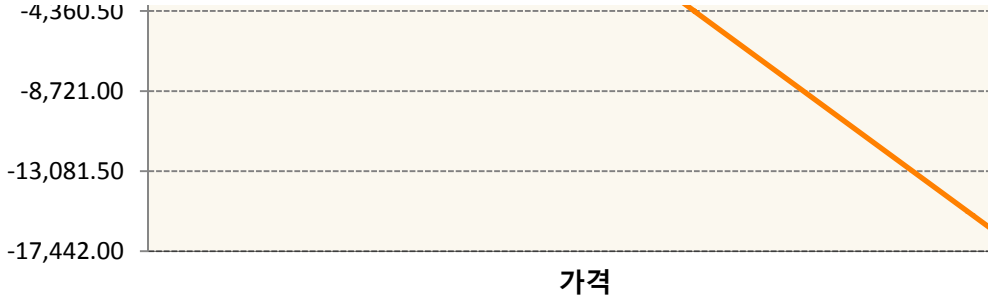
(단위:백만원)

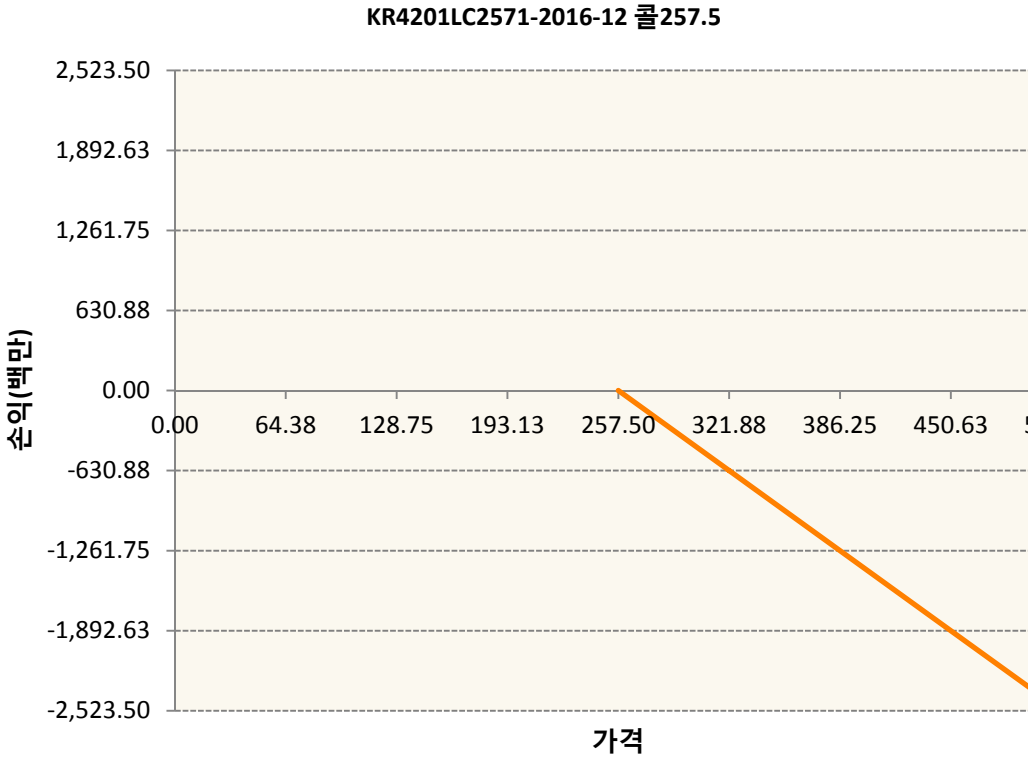
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	334	-334	장내
누계	유가증권	선물	32,411	0	32,411	장내
누계	유가증권	옵션	0	19,966	-19,966	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101LC00 2016-12 지수선물							2,596
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-2,596	-2,596	-2,596	-2,596	-2,596	-2,596	-2,596
-5.33%	-1,730	-1,730	-1,730	-1,730	-1,730	-1,730	-1,730
-2.67%	-865	-865	-865	-865	-865	-865	-865
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	865	865	865	865	865	865	865
5.33%	1,730	1,730	1,730	1,730	1,730	1,730	1,730
8.00%	2,596	2,596	2,596	2,596	2,596	2,596	2,596
KR4201LC25 2016-12 콜255							6,274
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	508	508	508	508	508	508	508
-5.33%	508	508	508	508	508	507	506
-2.67%	504	499	492	482	469	453	435
0%	147	98	49	0	-49	-98	-147
2.67%	-1,647	-1,657	-1,670	-1,687	-1,706	-1,729	-1,754
5.33%	-3,954	-3,954	-3,954	-3,955	-3,956	-3,958	-3,960
8.00%	-6,274	-6,274	-6,274	-6,274	-6,274	-6,274	-6,274
KR4201LC25 2016-12 콜257.5							818

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	31	31	31	31	31	31	31
-5.33%	31	31	31	31	31	31	31
-2.67%	31	31	31	30	30	29	27
0%	16	11	5	0	-6	-12	-18
2.67%	-164	-168	-172	-177	-182	-188	-193
5.33%	-486	-486	-486	-487	-487	-488	-489
8.00%	-818	-818	-818	-818	-818	-818	-818

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

11,437

공시일	2016-12-02
기준일	2016-12-01

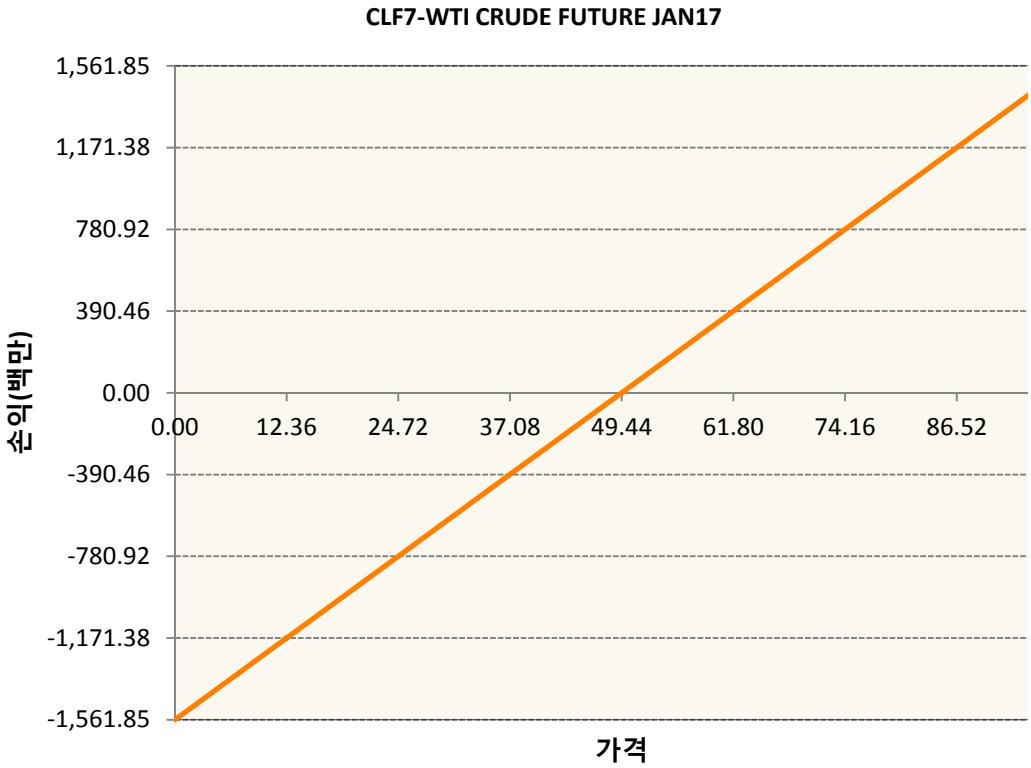
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

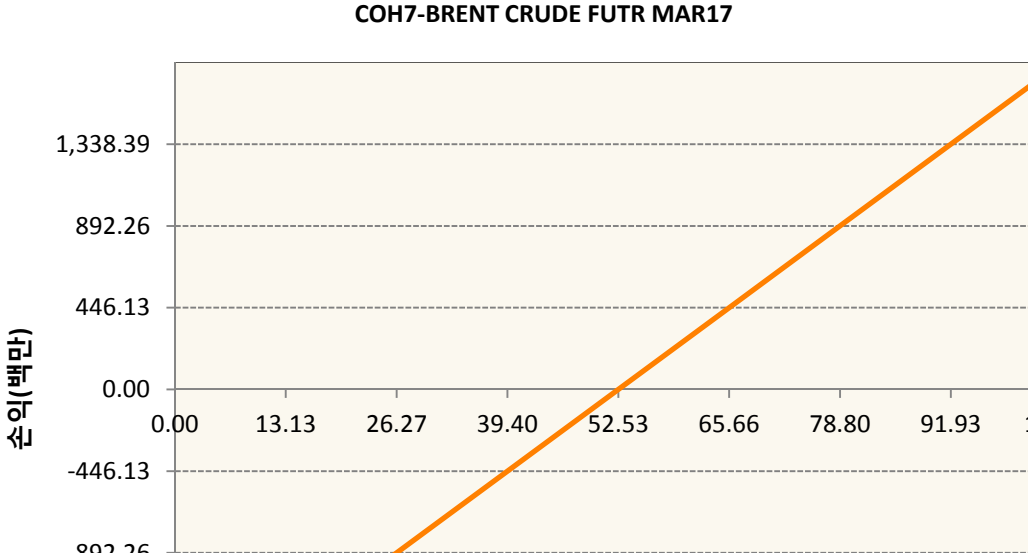
1. 계약금액

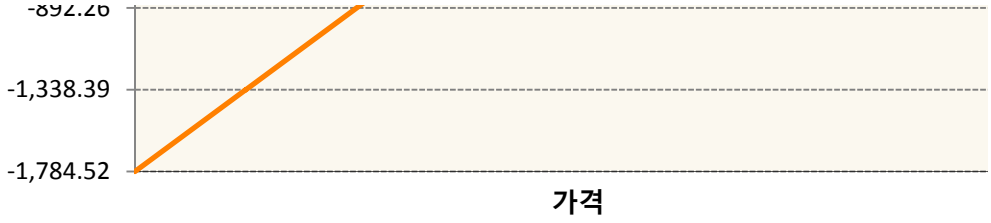
(단위:백만원)

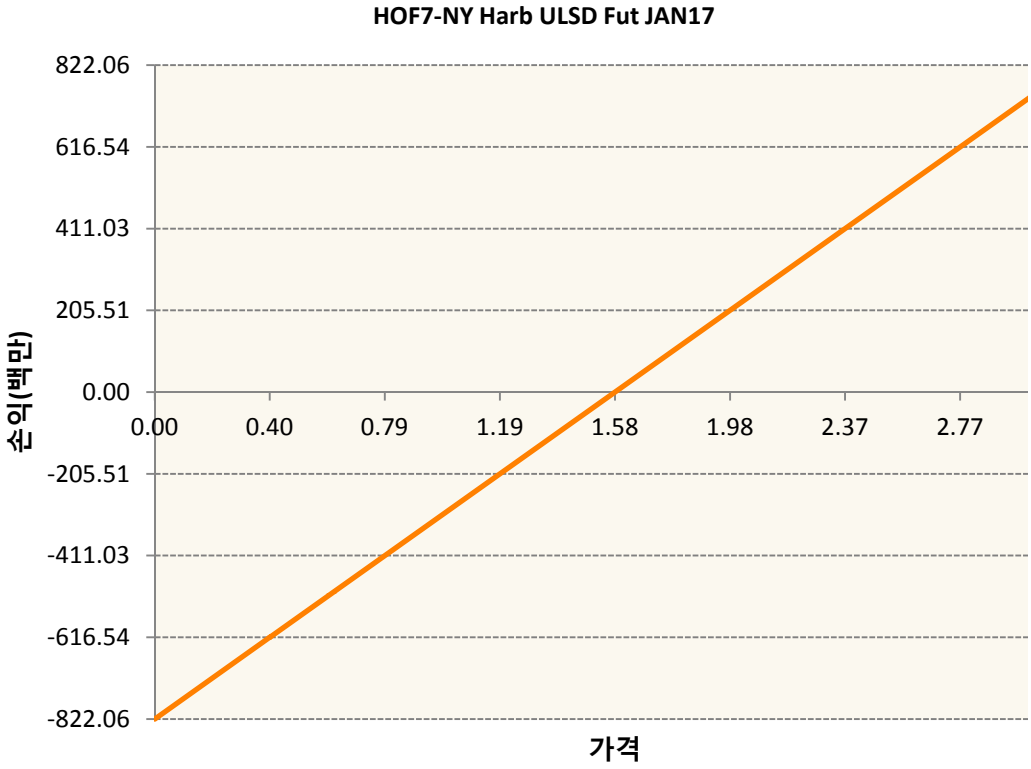
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	6,571	0	6,571	

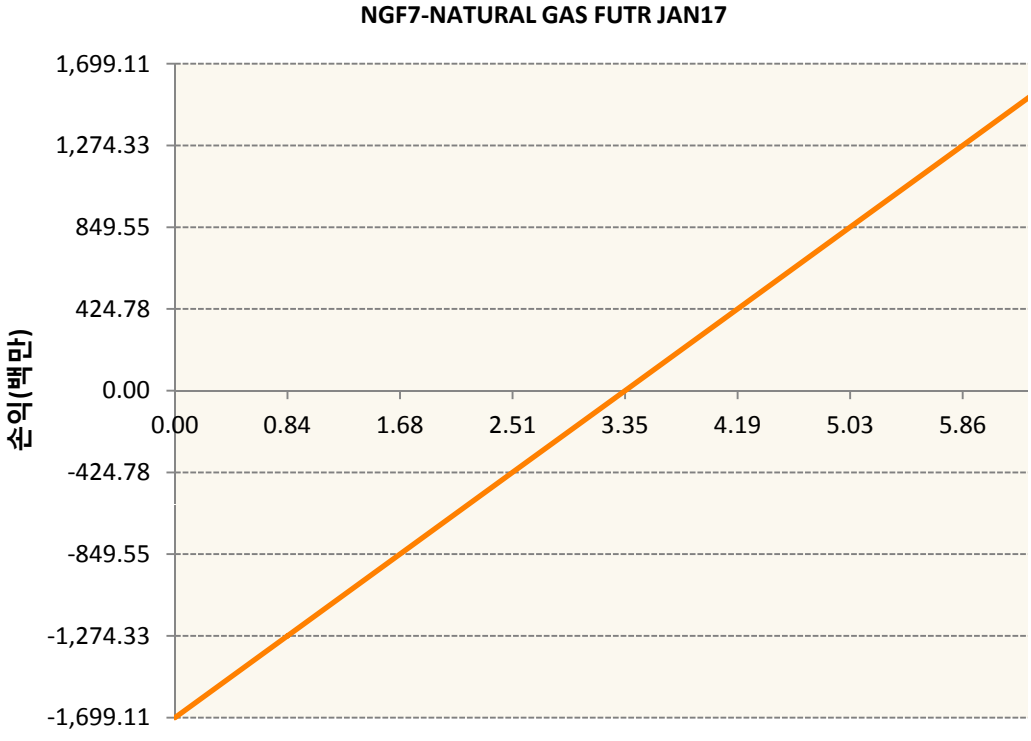
2. 만기시점의 손익구조



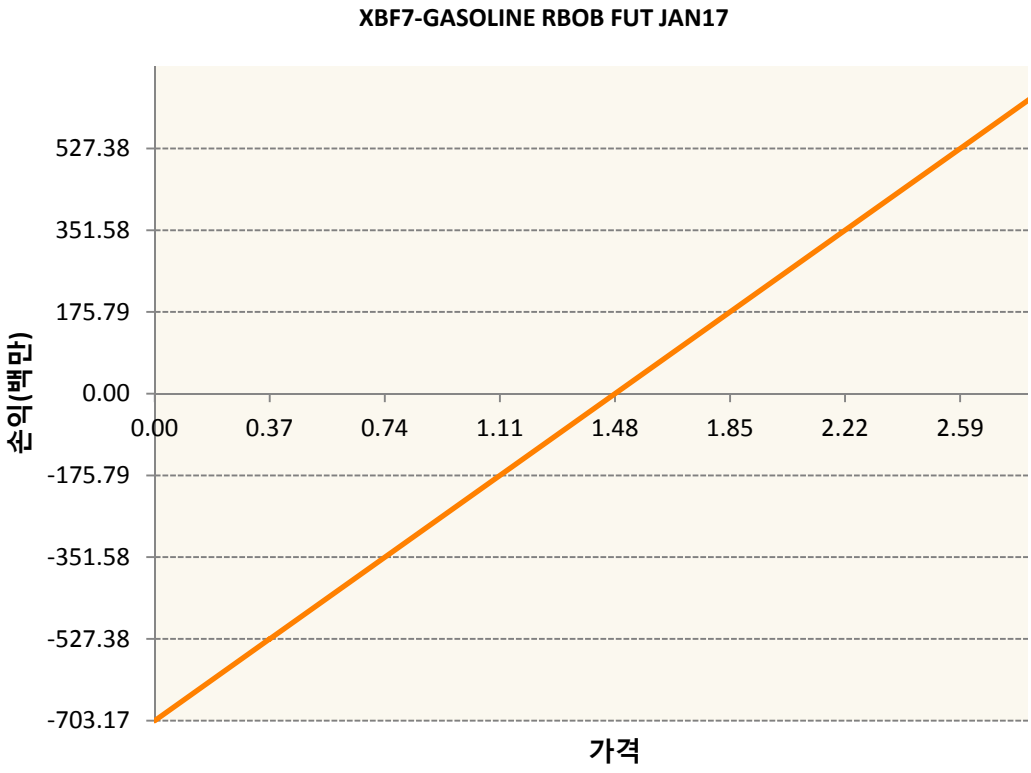



-892.26
-1,338.39
-1,784.52
가격


HOF7-NY Harb ULSD Fut JAN17
822.06
616.54
411.03
205.51
0.00
-205.51
-411.03
-616.54
-822.06
0.00
0.40
0.79
1.19
1.58
1.98
2.37
2.77
손익(백만)
가격


NGF7-NATURAL GAS FUTR JAN17
1,699.11
1,274.33
849.55
424.78
0.00
-424.78
-849.55
-1,274.33
-1,699.11
0.00
0.84
1.68
2.51
3.35
4.19
5.03
5.86
손익(백만)

가격



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
CLF7	WTI CRUDE FUTURE JAN17	125
COH7	BRENT CRUDE FUTR MAR17	143
HOF7	NY Harb ULSD Fut JAN17	66
NGF7	NATURAL GAS FUTR JAN17	136
XBF7	GASOLINE RBOB FUT JAN17	56

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,193

공시일	2016-12-02
기준일	2016-12-01

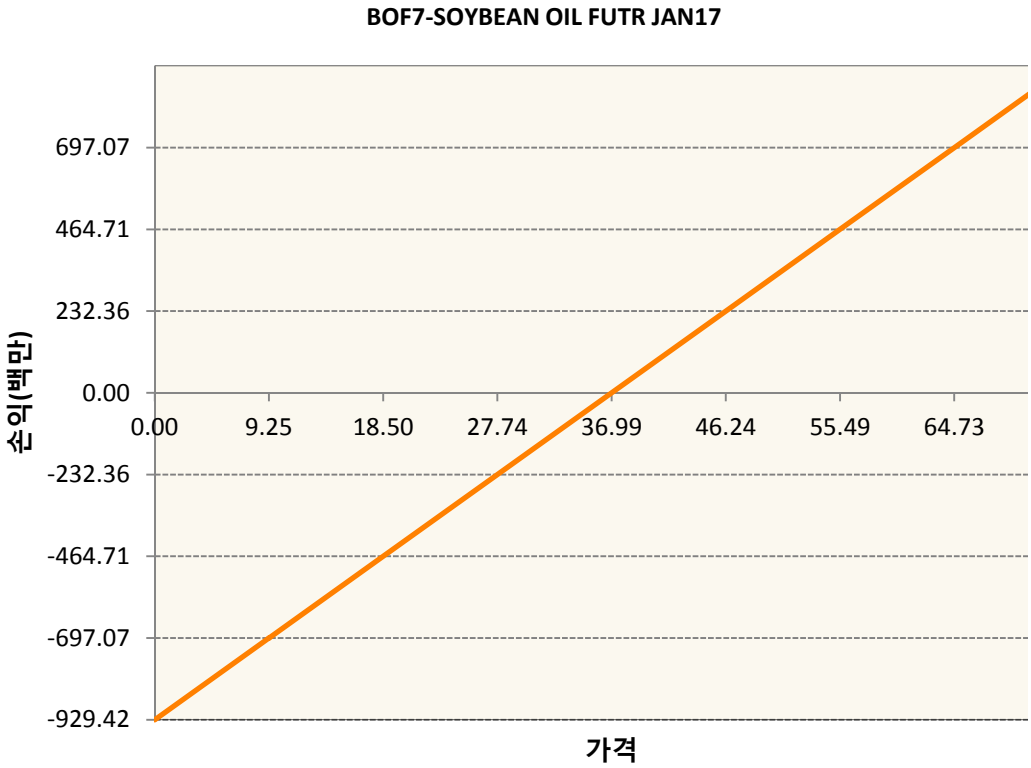
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

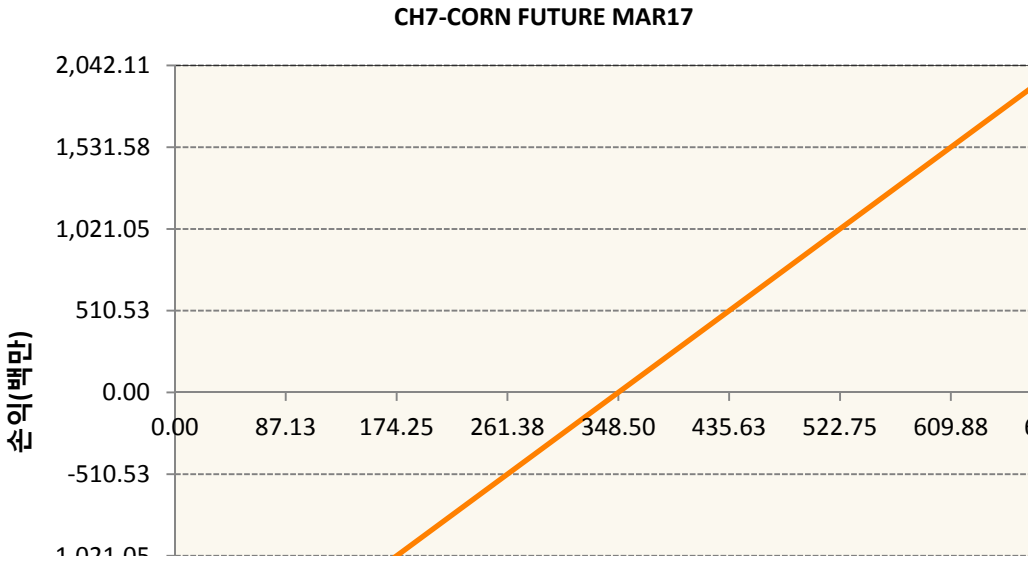
1. 계약금액

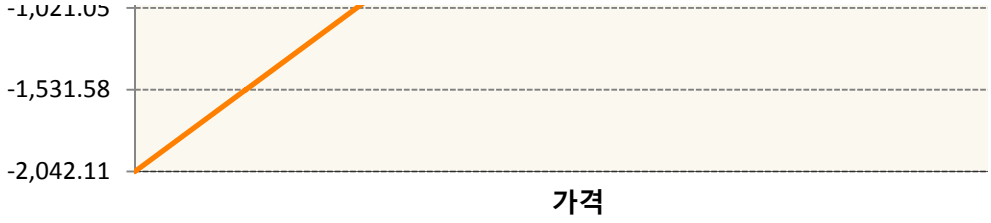
(단위:백만원)

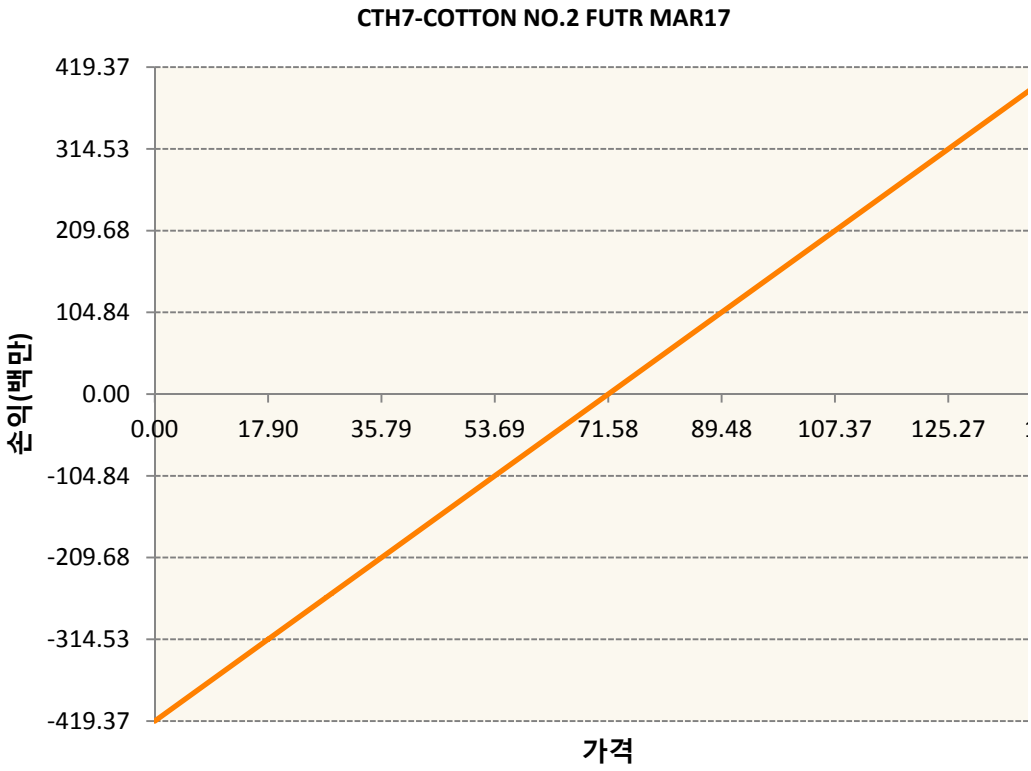
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	9,102	0	9,102	

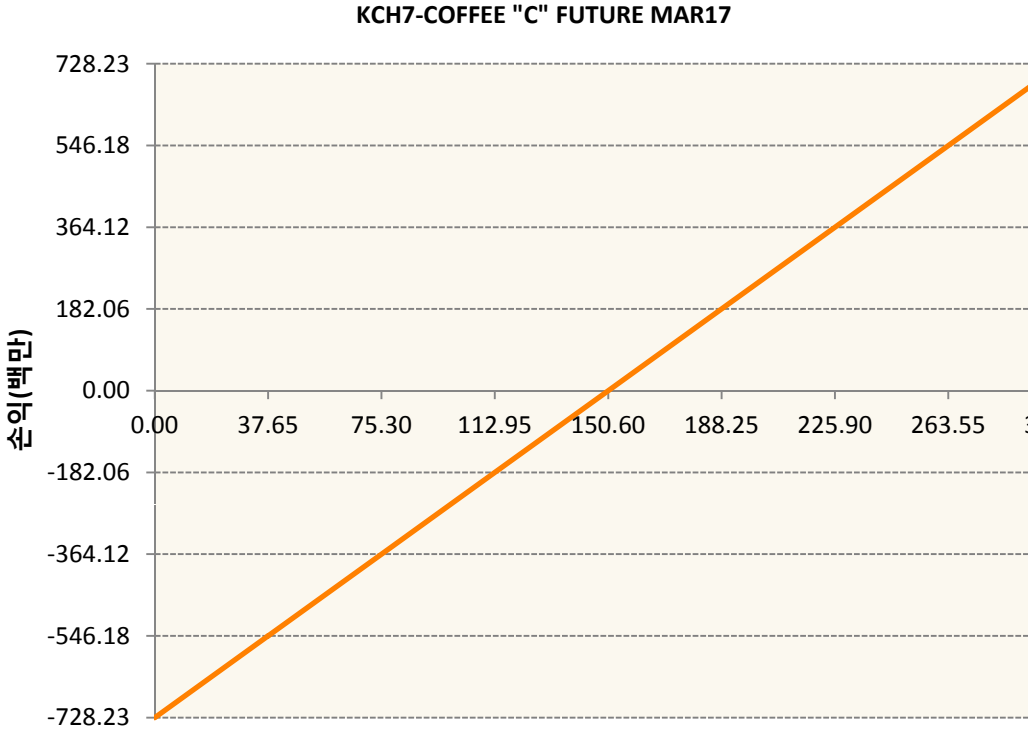
2. 만기시점의 손익구조



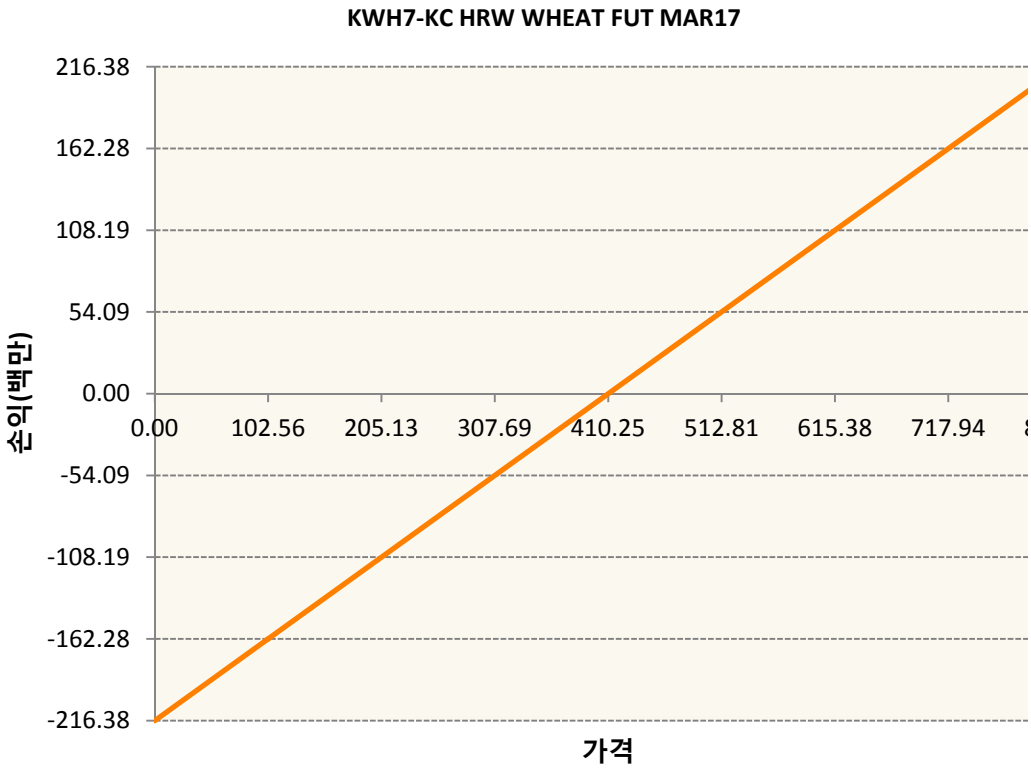


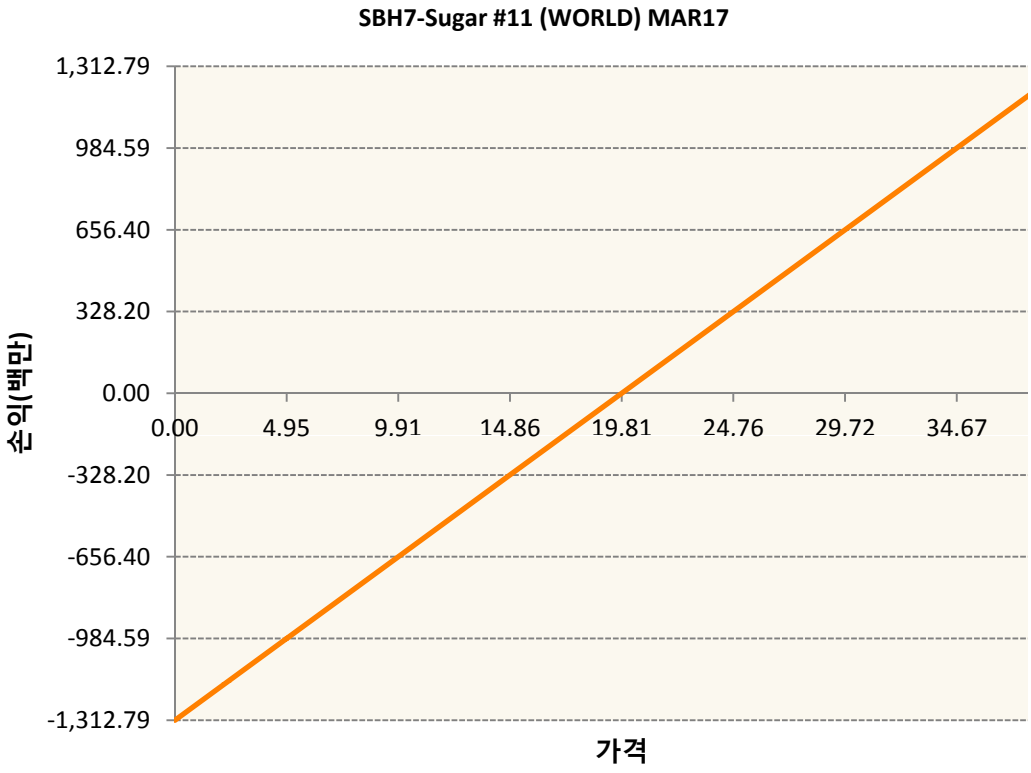

-1,531.58
-2,042.11
가격

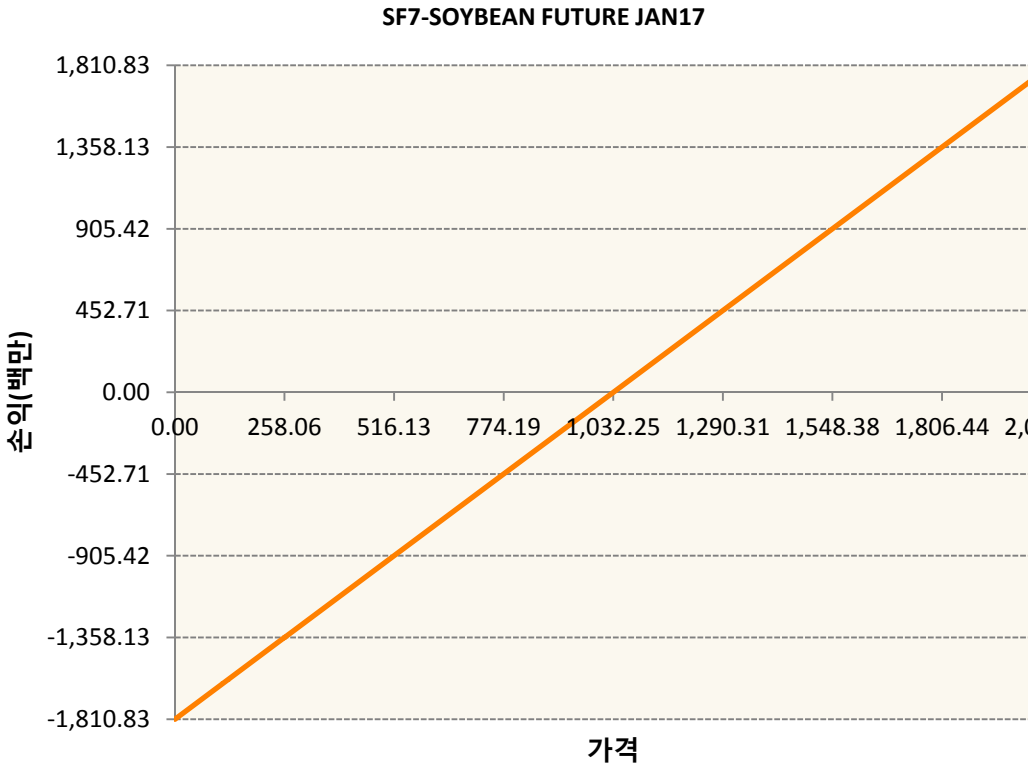

CTH7-COTTON NO.2 FUTR MAR17
419.37
314.53
209.68
104.84
0.00
-104.84
-209.68
-314.53
-419.37
0.00
17.90
35.79
53.69
71.58
89.48
107.37
125.27
손익(백만)
가격

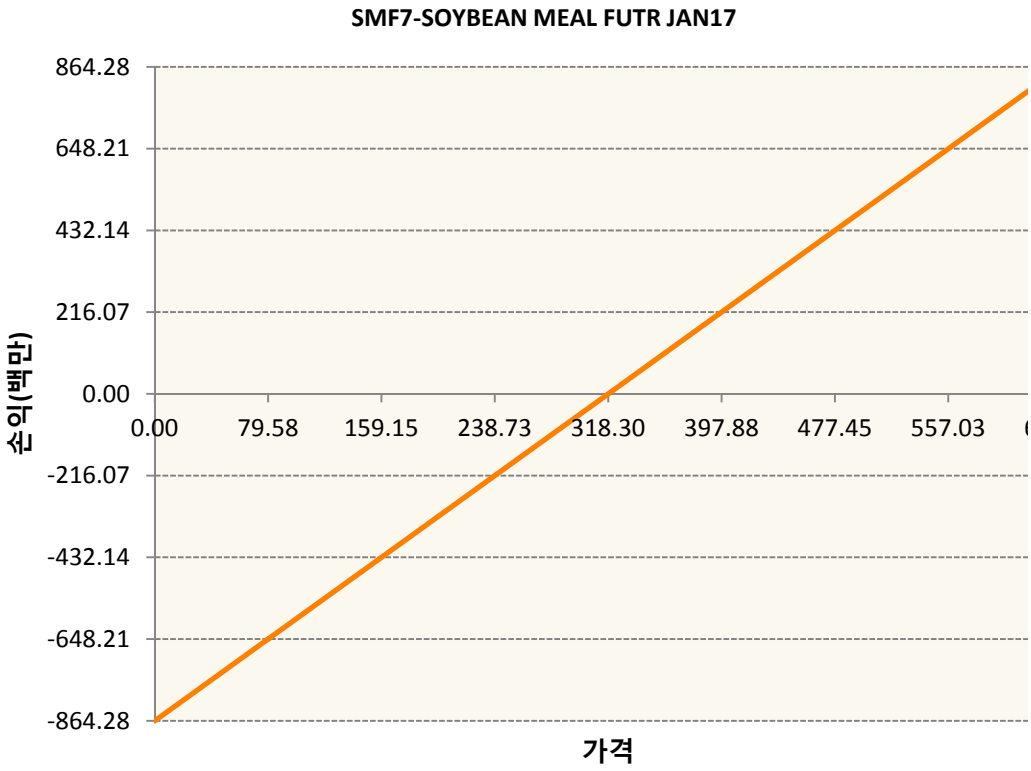

KCH7-COFFEE "C" FUTURE MAR17
728.23
546.18
364.12
182.06
0.00
-182.06
-364.12
-546.18
-728.23
0.00
37.65
75.30
112.95
150.60
188.25
225.90
263.55
손익(백만)

가격

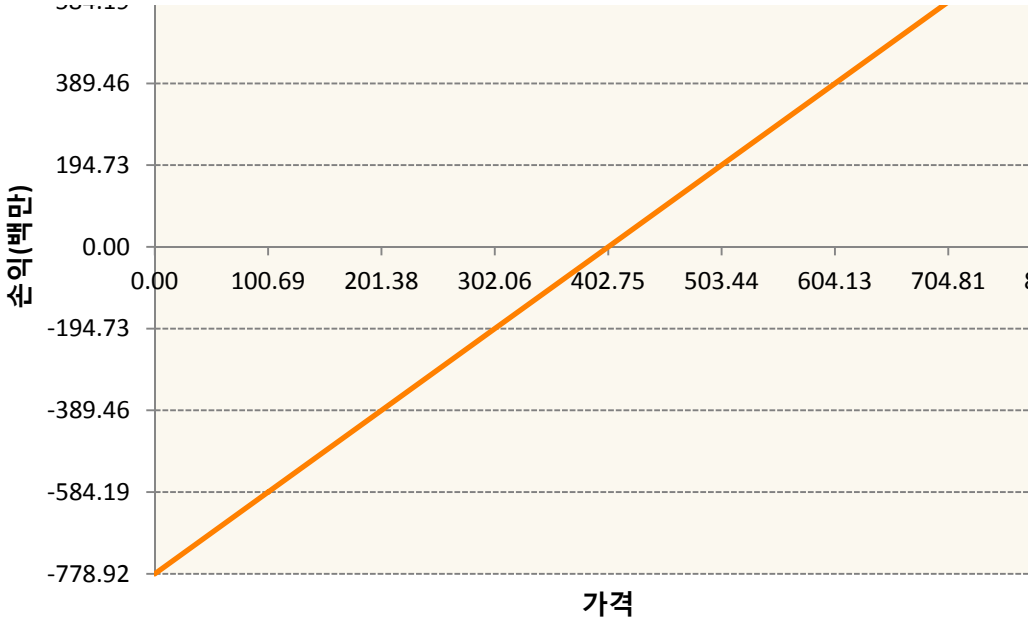

KWH7-KC HRW WHEAT FUT MAR17
216.38
162.28
108.19
54.09
0.00
-54.09
-108.19
-162.28
-216.38
0.00
102.56
205.13
307.69
410.25
512.81
615.38
717.94
손익(백만)
가격


SBH7-Sugar #11 (WORLD) MAR17
1,312.79
984.59
656.40
328.20
0.00
-328.20
-656.40
-984.59
-1,312.79
0.00
4.95
9.91
14.86
19.81
24.76
29.72
34.67
손익(백만)
가격


SF7-SOYBEAN FUTURE JAN17
1,810.83
1,358.13
905.42
452.71
0.00
-452.71
-905.42
-1,358.13
-1,810.83
0.00
258.06
516.13
774.19
1,032.25
1,290.31
1,548.38
1,806.44
손익(백만)
가격


SMF7-SOYBEAN MEAL FUTR JAN17
864.28
648.21
432.14
216.07
0.00
-216.07
-432.14
-648.21
-864.28
0.00
79.58
159.15
238.73
318.30
397.88
477.45
557.03
손익(백만)
가격


WH7-WHEAT FUTURE(CBT) MAR17
778.92
584.19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

BOF7	SOYBEAN OIL FUTR JAN17	74
CH7	CORN FUTURE MAR17	163
CTH7	COTTON NO.2 FUTR MAR17	34
KCH7	COFFEE "C" FUTURE MAR17	58
KWH7	KC HRW WHEAT FUT MAR17	17
SBH7	Sugar #11 (WORLD) MAR17	105
SF7	SOYBEAN FUTURE JAN17	145
SMF7	SOYBEAN MEAL FUTR JAN17	69
WH7	WHEAT FUTURE(CBT) MAR17	62

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

891