공시일	2016-12-06
기준일	2016-12-05

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	2016-12-06
기준일	2016-12-05

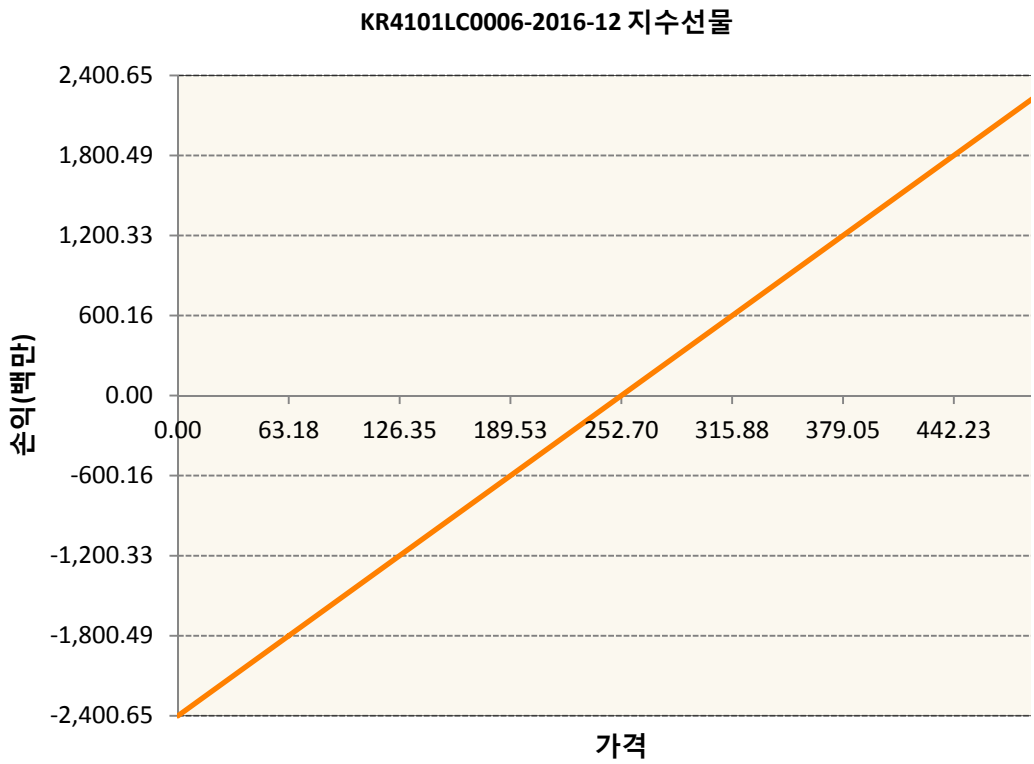
스마트인덱스모

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	2,401	0	2,401	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101LC00 2016-12 지수선물							192
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-192	-192	-192	-192	-192	-192	-192
-5.33%	-128	-128	-128	-128	-128	-128	-128
-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%	128	128	128	128	128	128	128
8.00%	192	192	192	192	192	192	192

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

145

공시일	2016-12-06
기준일	2016-12-05

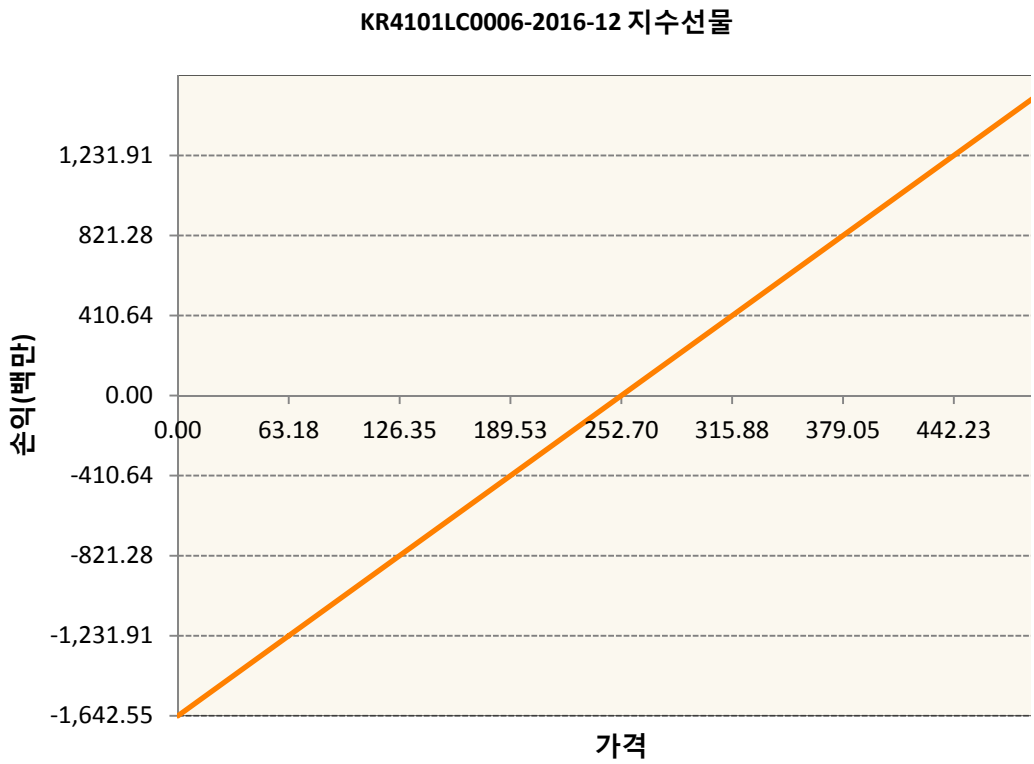
스마트레버리지목표전환형1호

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	1,643	0	1,643	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)

99

공시일	2016-12-06
기준일	2016-12-05

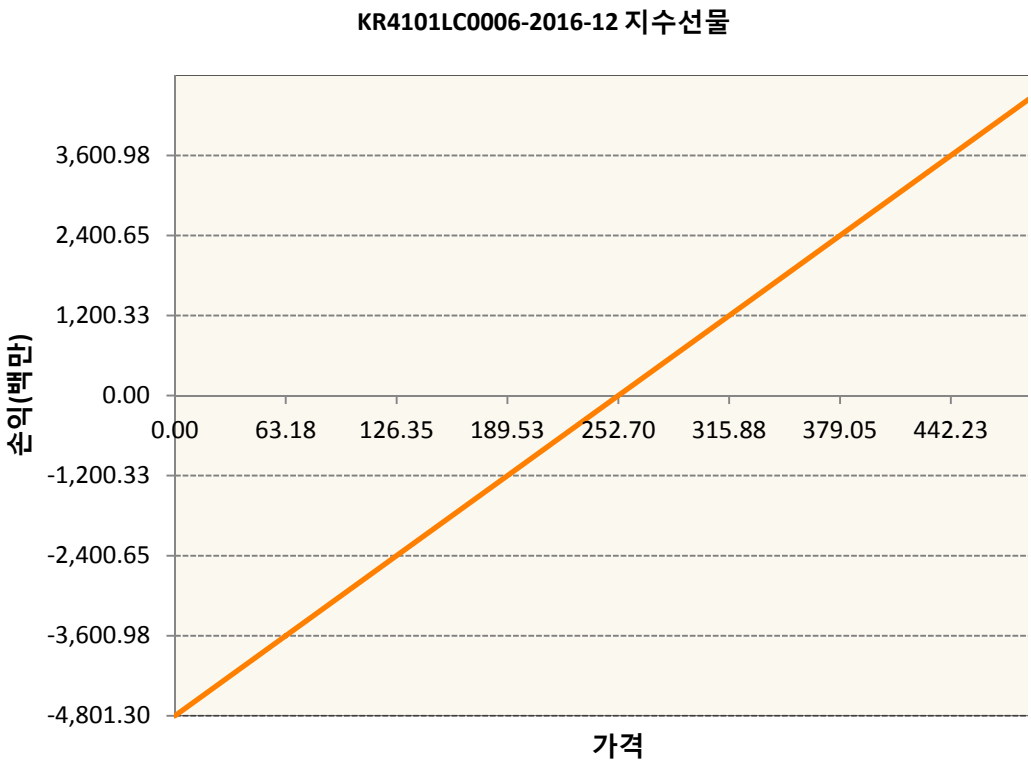
1.3배 레버리지 인덱스(주식-파생형)

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	4,801	0	4,801	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%	-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%	383	383	383	383	383	383	383

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

291

공시일	2016-12-06
기준일	2016-12-05

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)

711

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2016-12-06
기준일	2016-12-05

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	393

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

722

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2016-12-06
기준일	2016-12-05

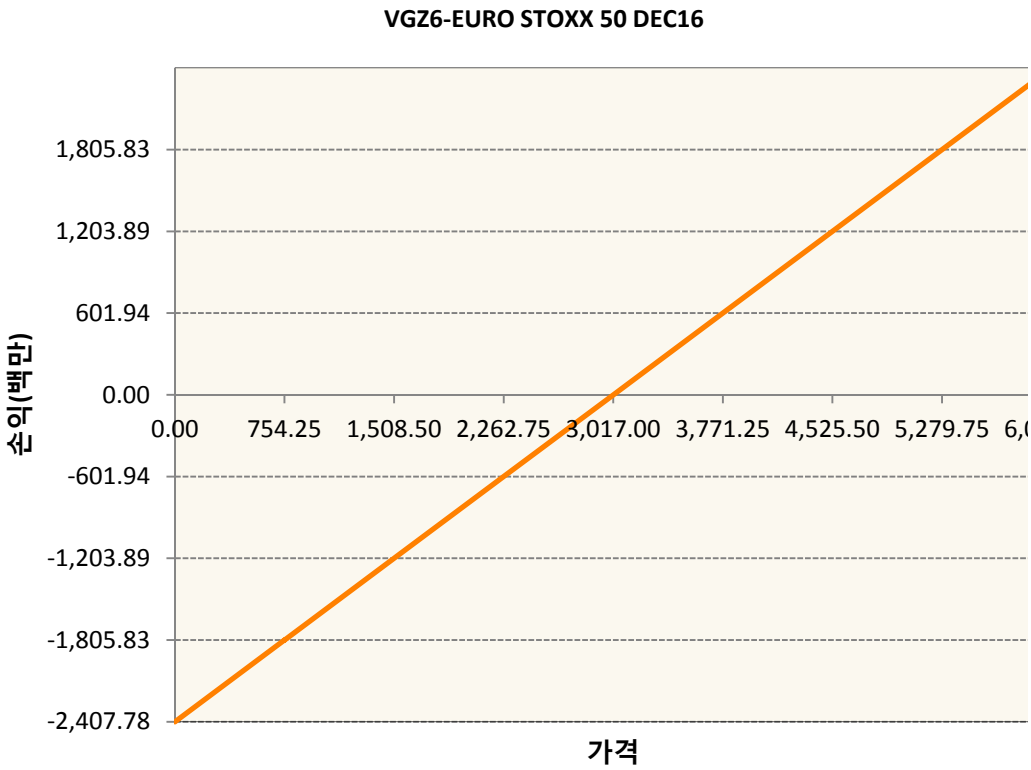
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,408	0	2,408	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGZ6	EURO STOXX 50 DEC16	193

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

(단위:백만원)

224

공시일	2016-12-06
기준일	2016-12-05

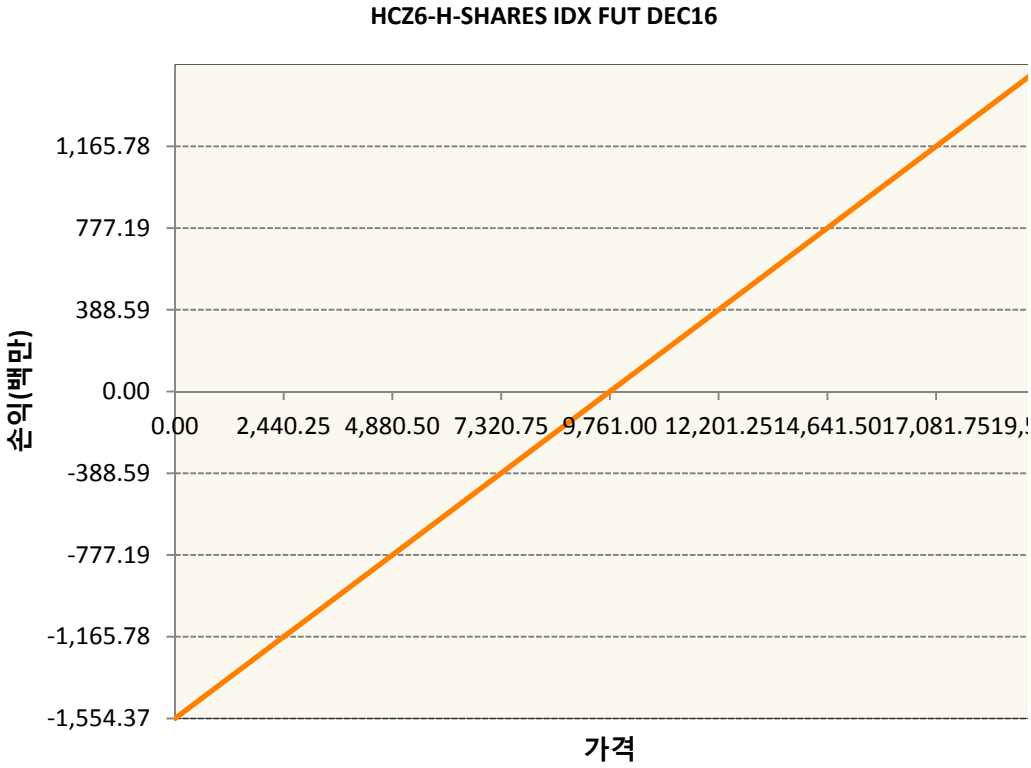
차이나인덱스모(주식-파생형)

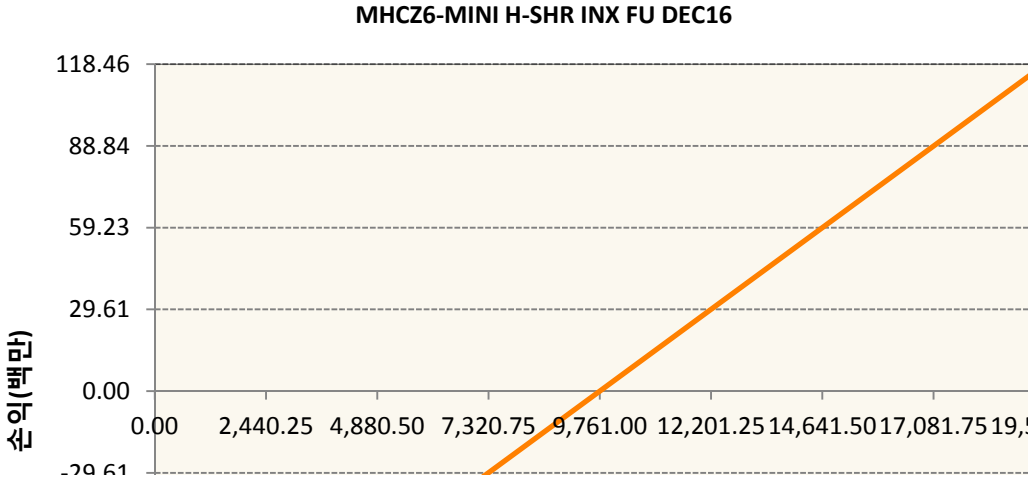
1. 계약금액

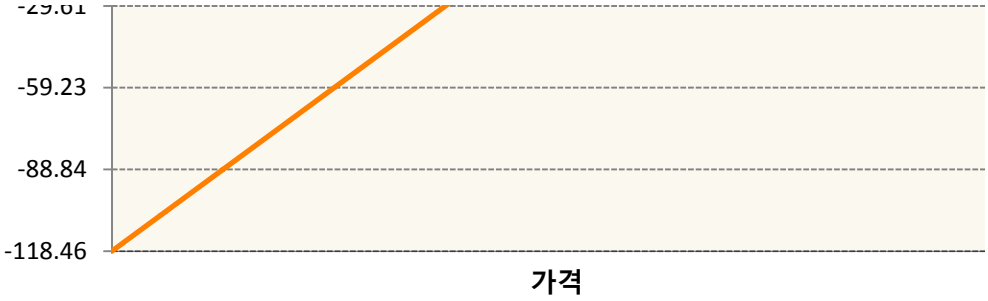
(단위:백만원)

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	1,554	0	1,554	
누계	유가증권	선물	118	0	118	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCZ6	H-SHARES IDX FUT DEC16	124
MHCZ6	MINI H-SHR INX FU DEC16	9

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	152

공시일	2016-12-06
기준일	2016-12-05

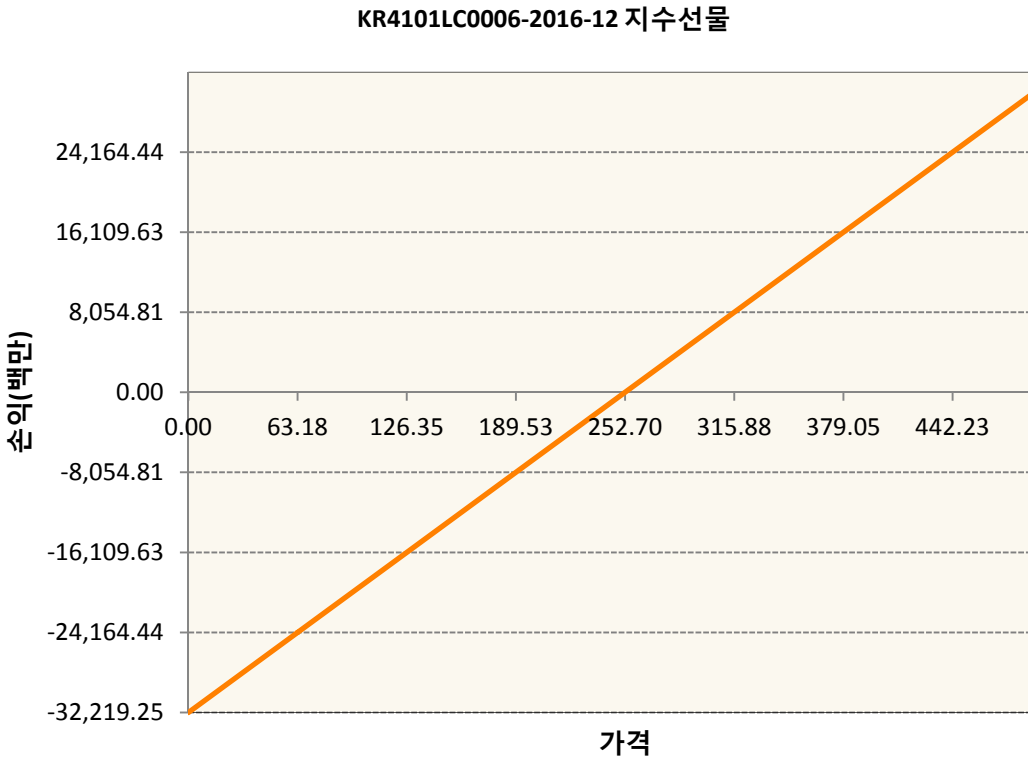
커버드콜(주식혼합-파생형)

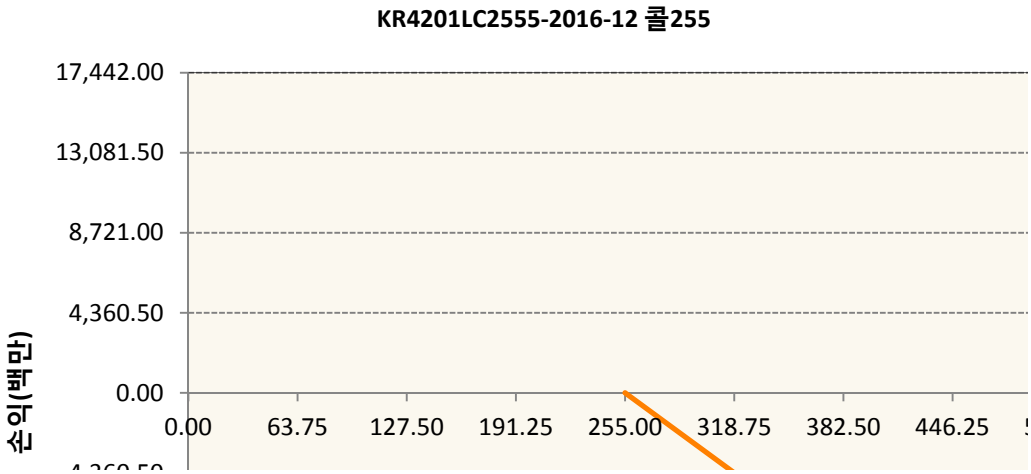
1. 계약금액

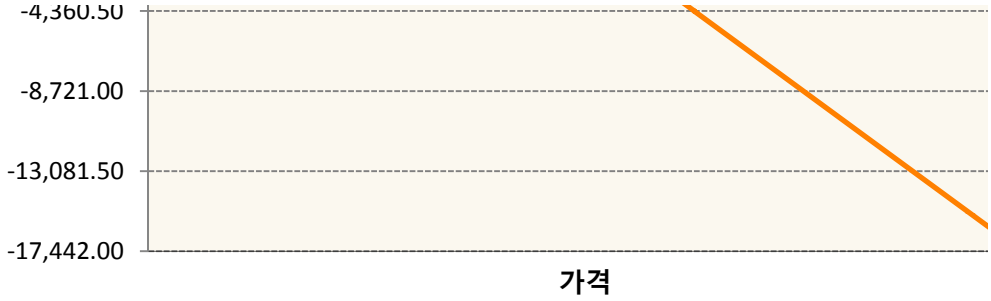
(단위:백만원)

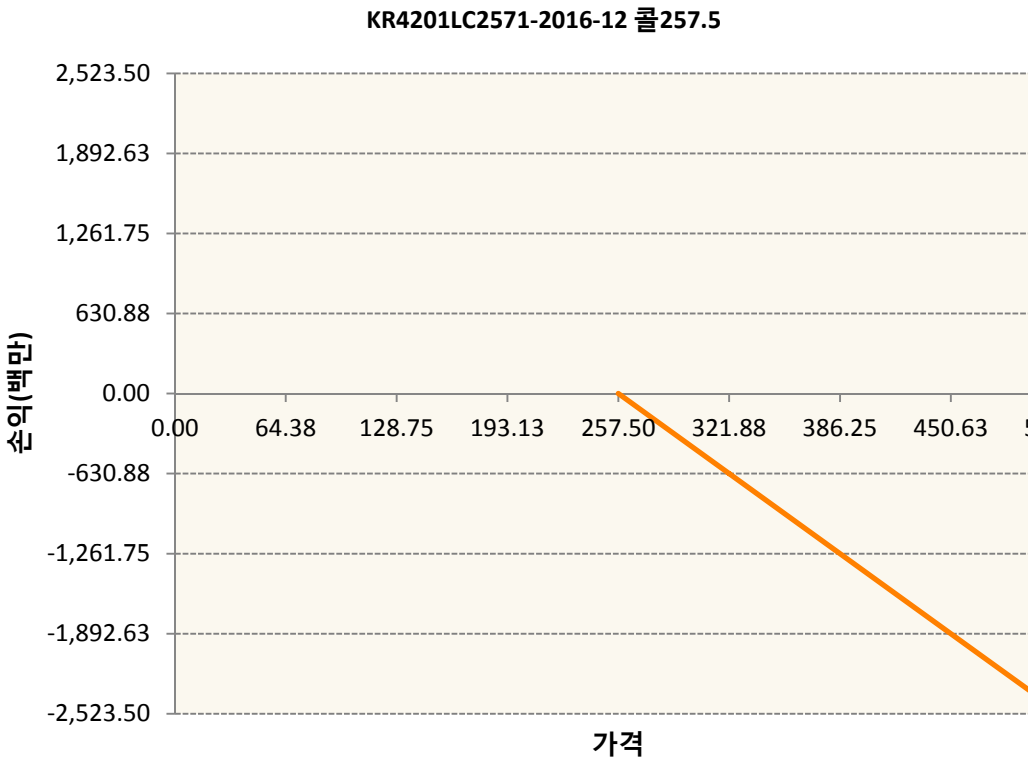
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	32,219	0	32,219	장내
누계	유가증권	옵션	0	19,966	-19,966	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101LC00 2016-12 지수선물							2,572
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-2,572	-2,572	-2,572	-2,572	-2,572	-2,572	-2,572
-5.33%	-1,715	-1,715	-1,715	-1,715	-1,715	-1,715	-1,715
-2.67%	-857	-857	-857	-857	-857	-857	-857
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	857	857	857	857	857	857	857
5.33%	1,715	1,715	1,715	1,715	1,715	1,715	1,715
8.00%	2,572	2,572	2,572	2,572	2,572	2,572	2,572
KR4201LC25 2016-12 콜255							5,824
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	95	95	95	95	95	95	95
-5.33%	95	95	95	95	95	95	95
-2.67%	95	95	95	95	94	94	93
0%	57	40	21	0	-23	-47	-72
2.67%	-1,241	-1,251	-1,263	-1,277	-1,294	-1,313	-1,333
5.33%	-3,525	-3,525	-3,525	-3,525	-3,525	-3,526	-3,526
8.00%	-5,824	-5,824	-5,824	-5,824	-5,824	-5,824	-5,824
KR4201LC25 2016-12 콜257.5							723

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	2	2	2	2	2	2	2
-5.33%	2	2	2	2	2	2	2
-2.67%	2	2	2	2	2	2	2
0%	2	2	1	0	-1	-3	-4
2.67%	-84	-88	-92	-97	-102	-106	-111
5.33%	-394	-394	-394	-394	-394	-395	-395
8.00%	-723	-723	-723	-723	-723	-723	-723

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

9,892

공시일	2016-12-06
기준일	2016-12-05

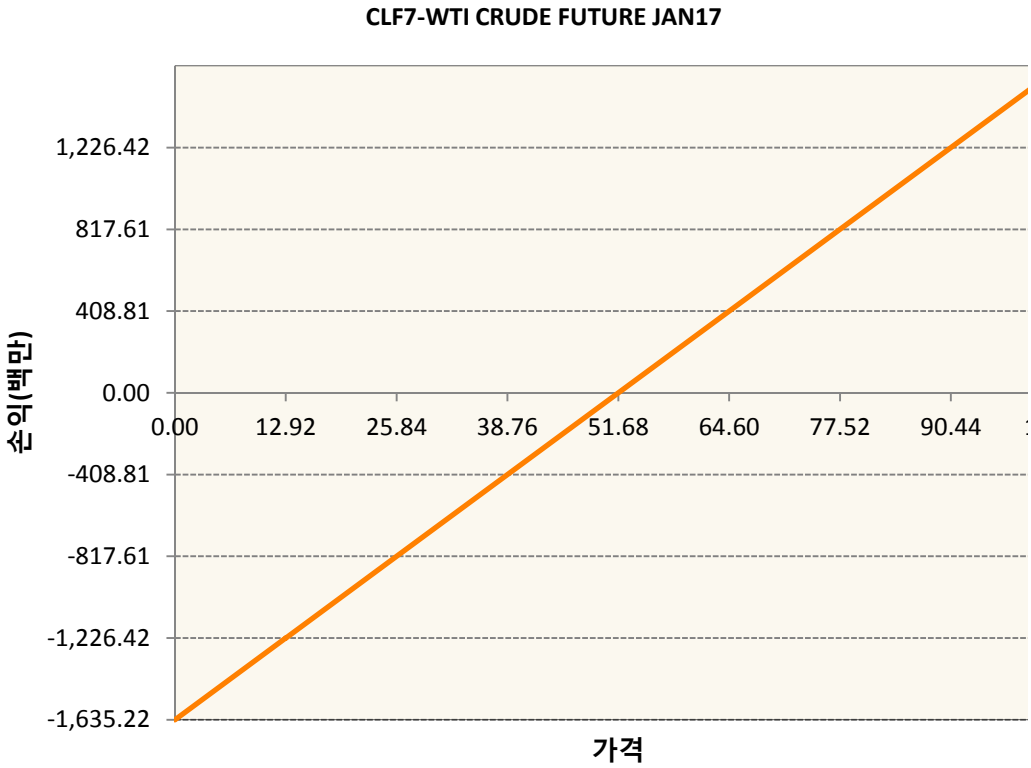
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

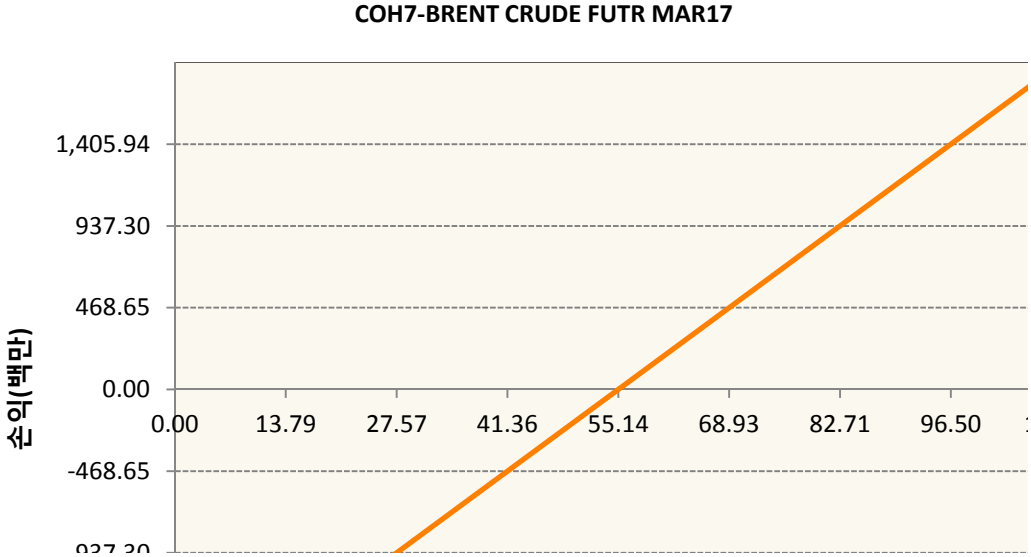
1. 계약금액

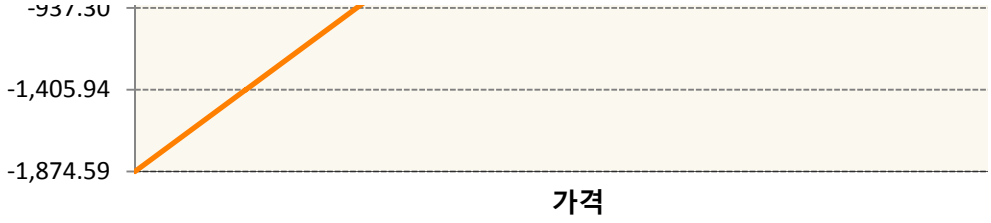
(단위:백만원)

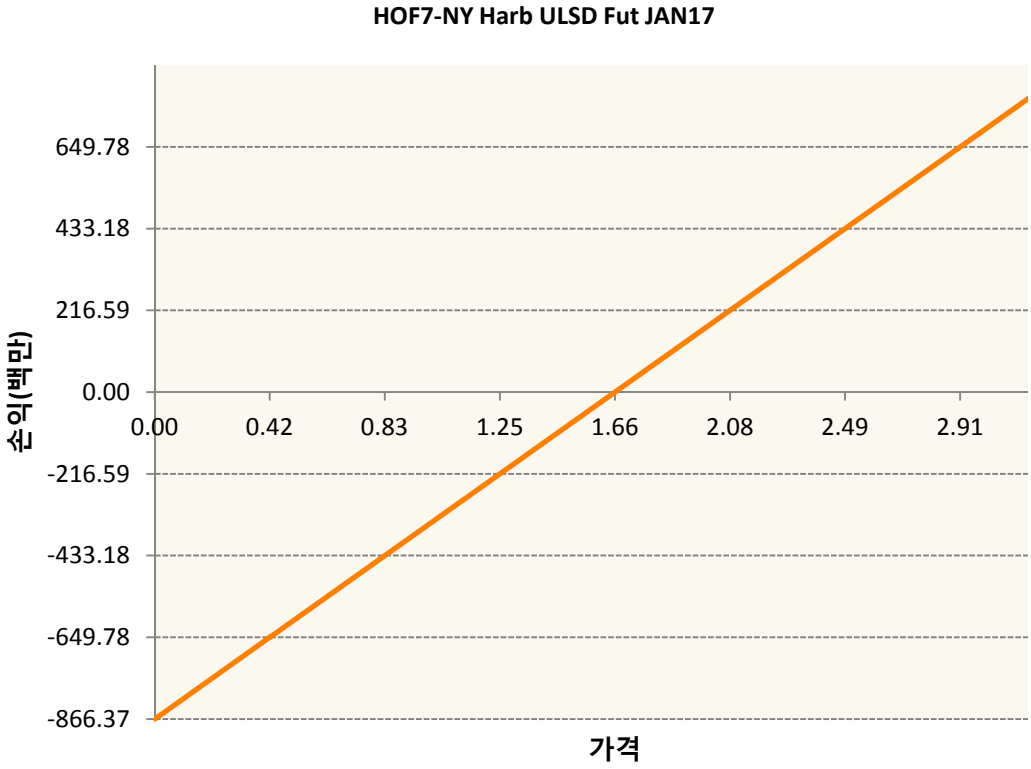
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	6,860	0	6,860	

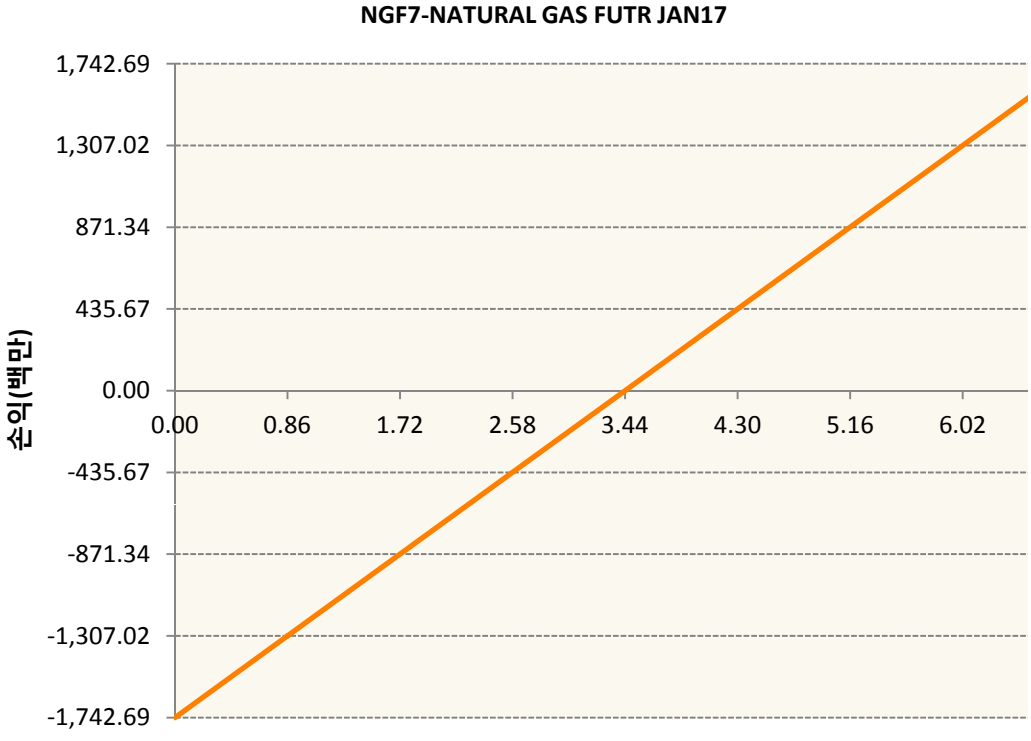
2. 만기시점의 손익구조



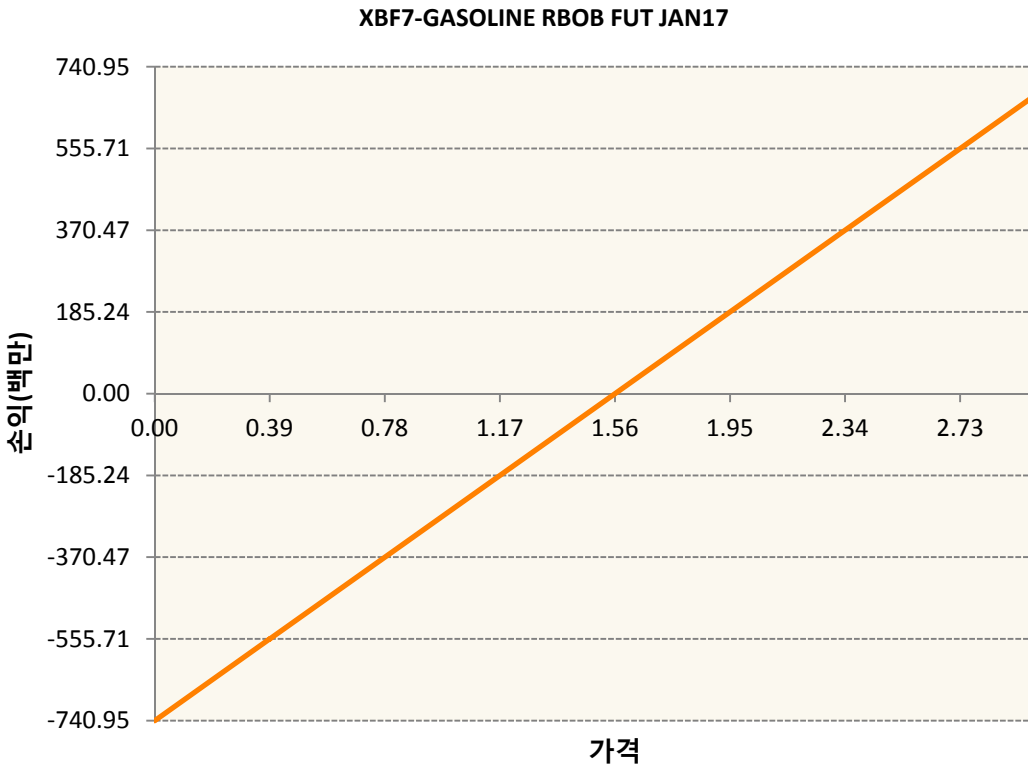



-1,405.94
-1,874.59
가격


HOF7-NY Harb ULSD Fut JAN17
649.78
433.18
216.59
0.00
-216.59
-433.18
-649.78
-866.37
0.00
0.42
0.83
1.25
1.66
2.08
2.49
2.91
순익(백만)
가격


NGF7-NATURAL GAS FUTR JAN17
1,742.69
1,307.02
871.34
435.67
0.00
-435.67
-871.34
-1,307.02
-1,742.69
0.00
0.86
1.72
2.58
3.44
4.30
5.16
6.02
순익(백만)

가격



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
CLF7	WTI CRUDE FUTURE JAN17	131
COH7	BRENT CRUDE FUTR MAR17	150
HOF7	NY Harb ULSD Fut JAN17	69
NGF7	NATURAL GAS FUTR JAN17	139
XBF7	GASOLINE RBOB FUT JAN17	59

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,249

공시일	2016-12-06
기준일	2016-12-05

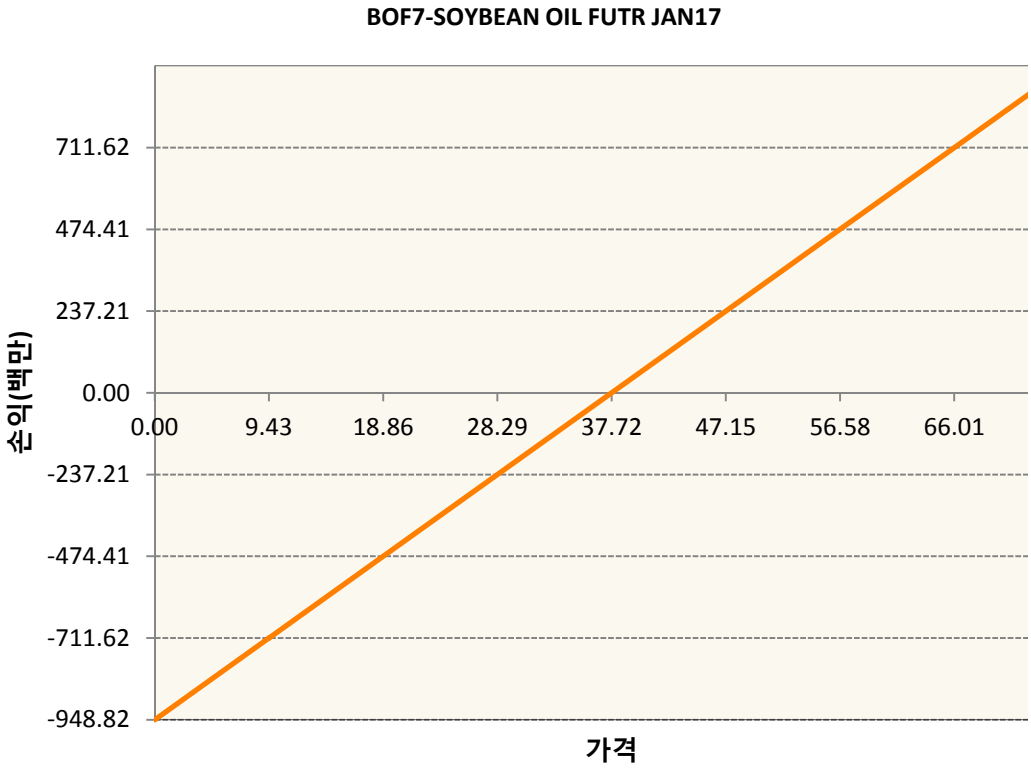
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

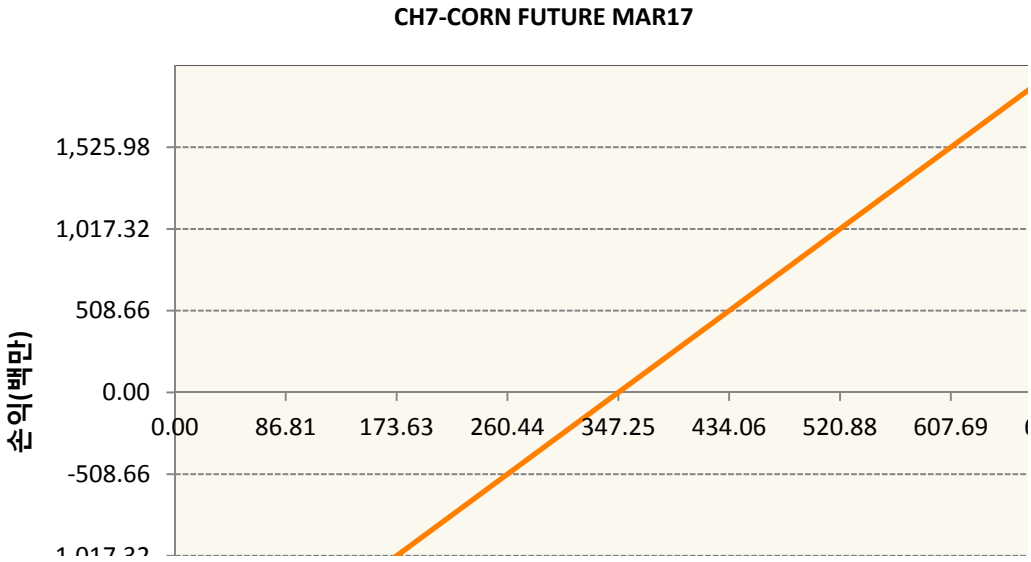
1. 계약금액

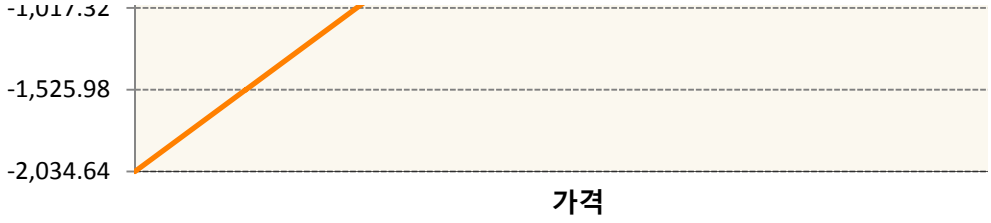
(단위:백만원)

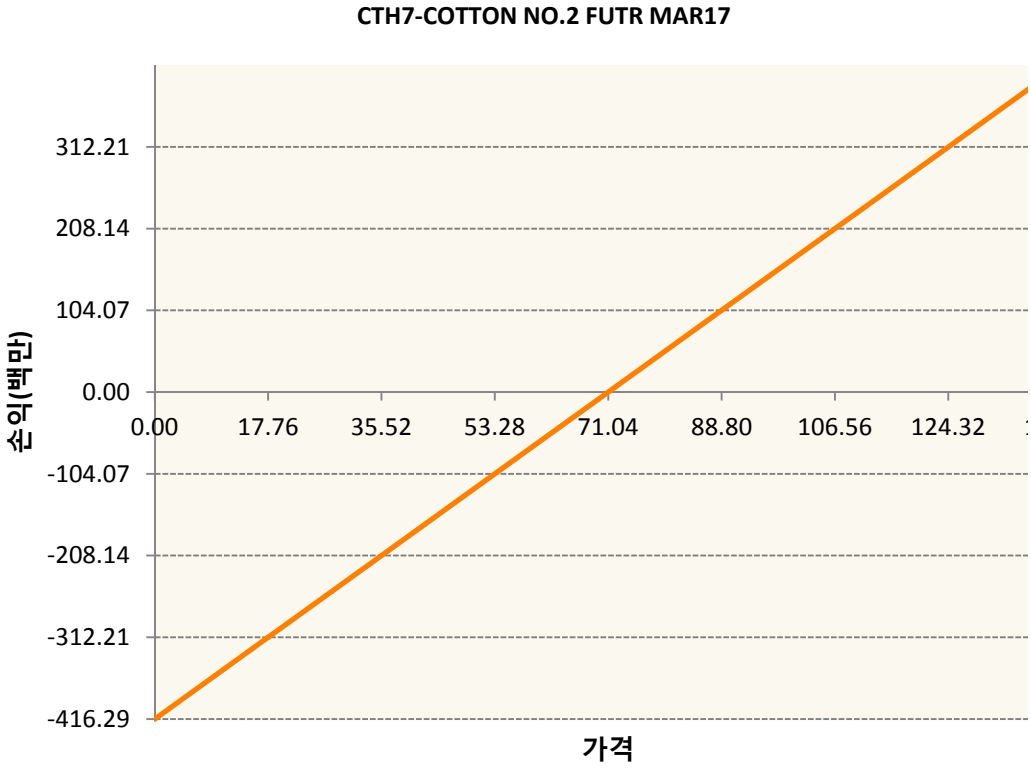
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	9,017	0	9,017	

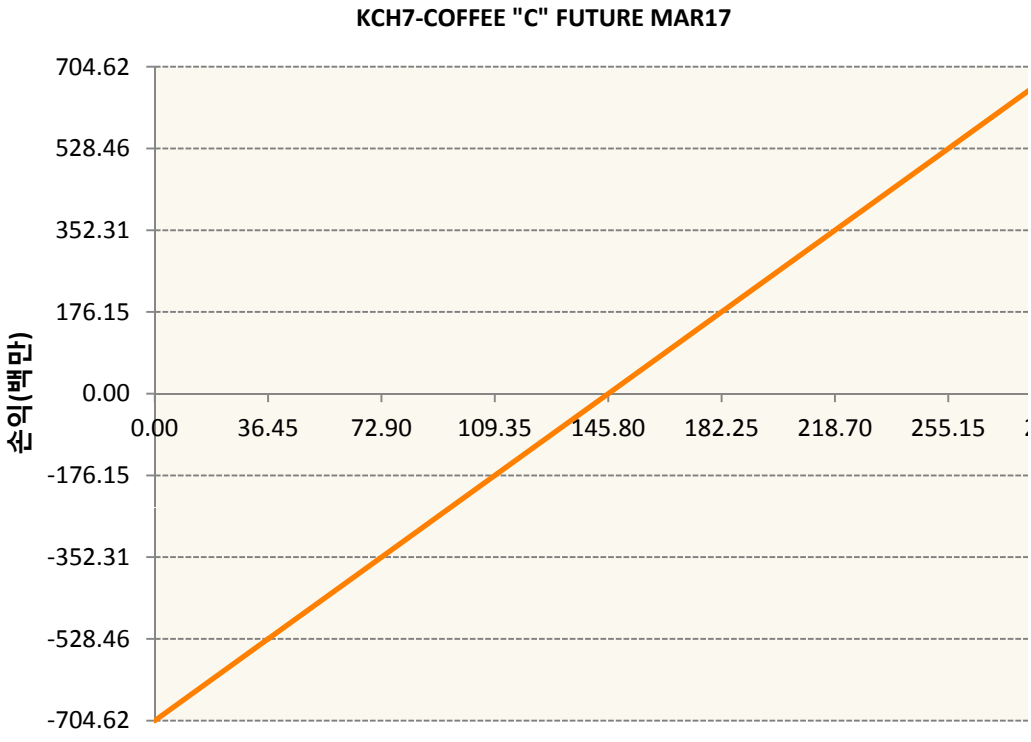
2. 만기시점의 손익구조





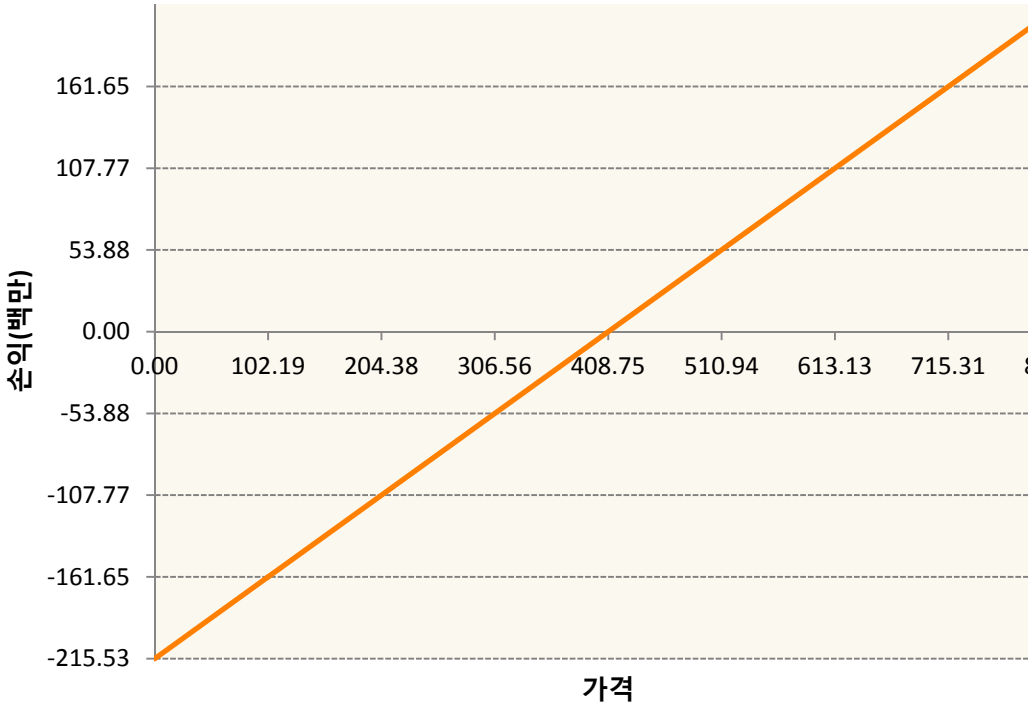

-1,525.98
-2,034.64
가격


CTH7-COTTON NO.2 FUTR MAR17
312.21
208.14
104.07
0.00
-104.07
-208.14
-312.21
-416.29
0.00
17.76
35.52
53.28
71.04
88.80
106.56
124.32
손익(백만)
가격

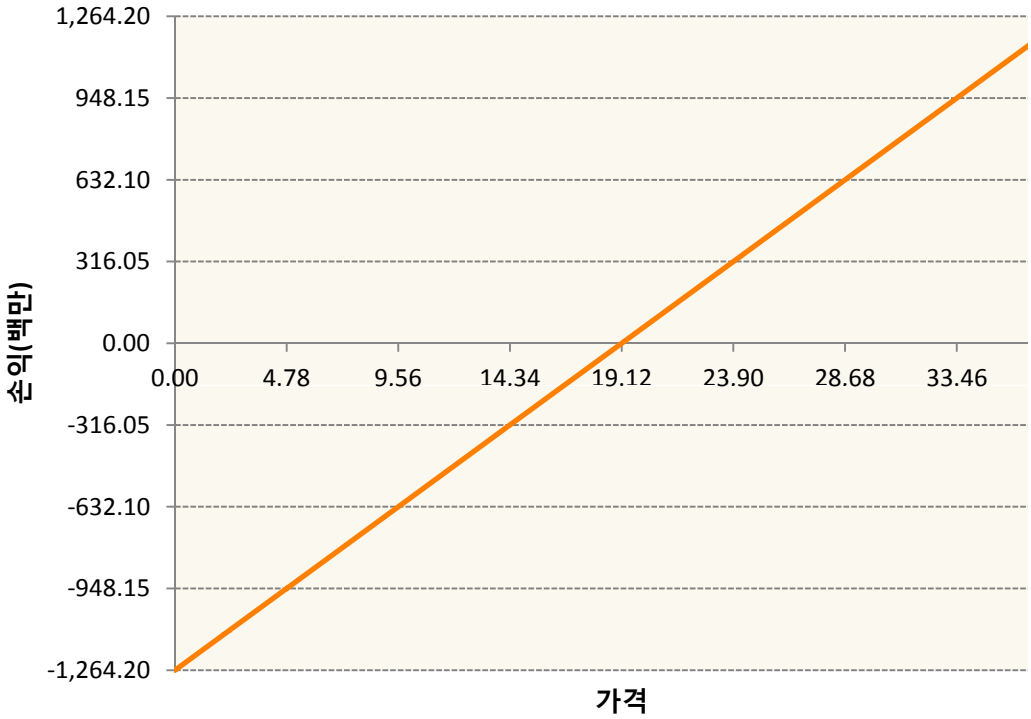

KCH7-COFFEE "C" FUTURE MAR17
704.62
528.46
352.31
176.15
0.00
-176.15
-352.31
-528.46
-704.62
0.00
36.45
72.90
109.35
145.80
182.25
218.70
255.15
손익(백만)

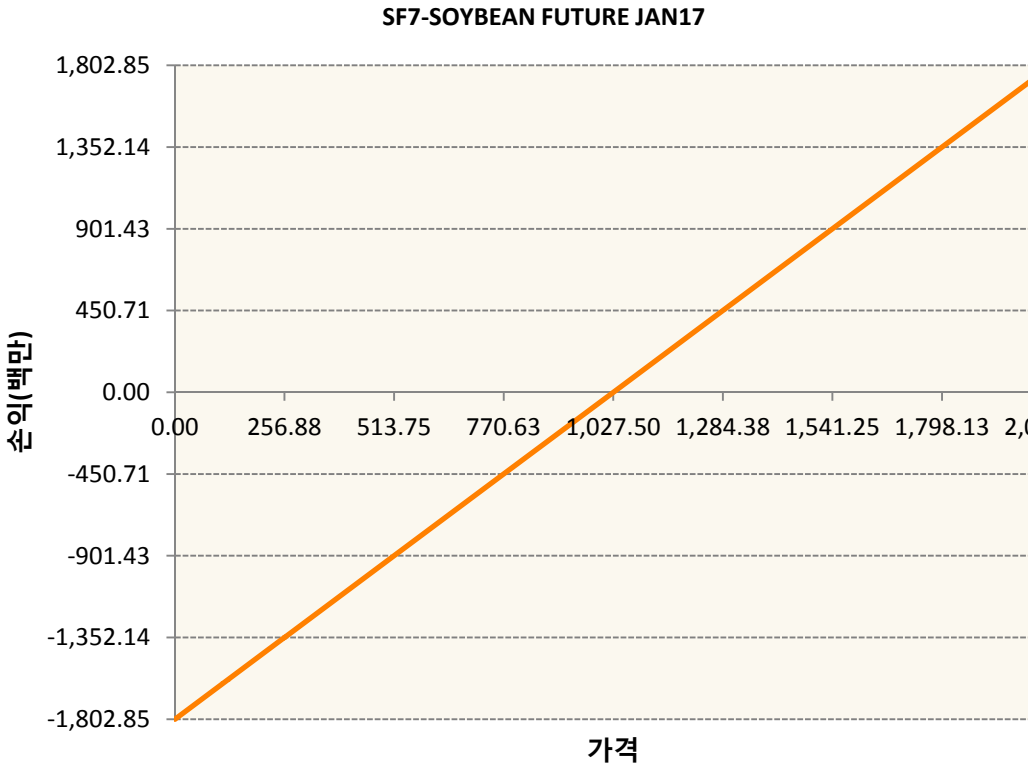
가격

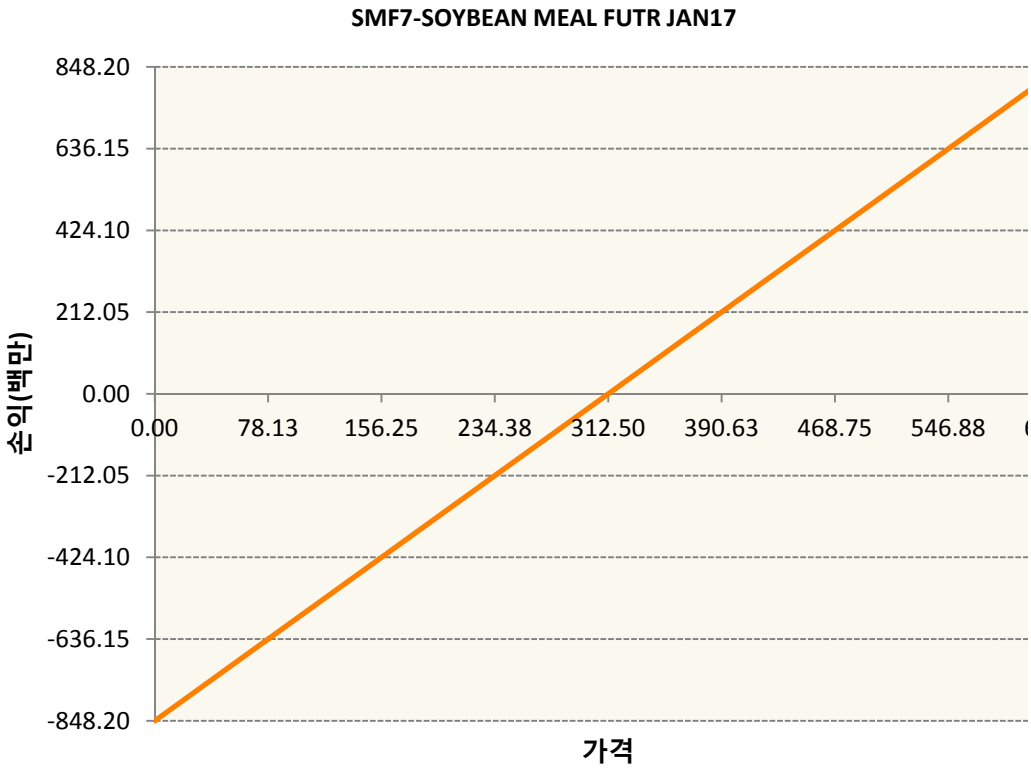
KWH7-KC HRW WHEAT FUT MAR17

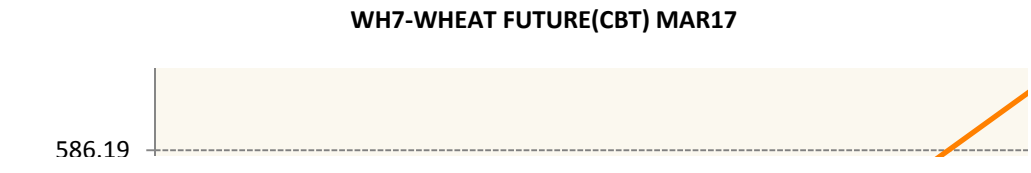


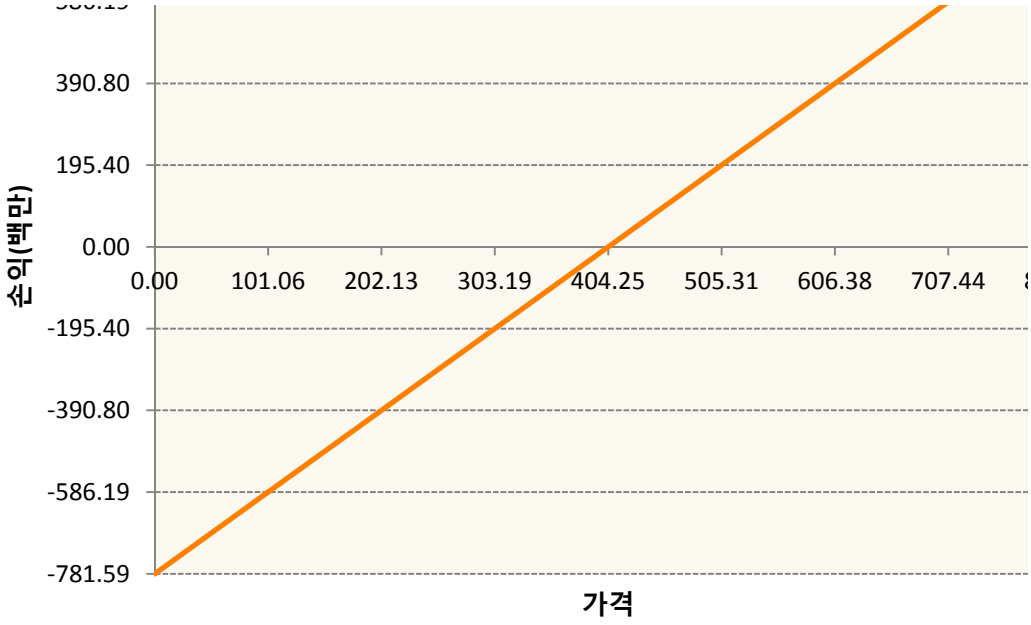
SBH7-Sugar #11 (WORLD) MAR17




SF7-SOYBEAN FUTURE JAN17
1,802.85
1,352.14
901.43
450.71
0.00
-450.71
-901.43
-1,352.14
-1,802.85
0.00
256.88
513.75
770.63
1,027.50
1,284.38
1,541.25
1,798.13
손익(백만)
가격


SMF7-SOYBEAN MEAL FUTR JAN17
848.20
636.15
424.10
212.05
0.00
-212.05
-424.10
-636.15
-848.20
0.00
78.13
156.25
234.38
312.50
390.63
468.75
546.88
손익(백만)
가격


WH7-WHEAT FUTURE(CBT) MAR17
586.19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

BOF7	SOYBEAN OIL FUTR JAN17	76
CH7	CORN FUTURE MAR17	163
CTH7	COTTON NO.2 FUTR MAR17	33
KCH7	COFFEE "C" FUTURE MAR17	56
KWH7	KC HRW WHEAT FUT MAR17	17
SBH7	Sugar #11 (WORLD) MAR17	101
SF7	SOYBEAN FUTURE JAN17	144
SMF7	SOYBEAN MEAL FUTR JAN17	68
WH7	WHEAT FUTURE(CBT) MAR17	63

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

882