공시일	2016-12-07
기준일	2016-12-06

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	2016-12-07
기준일	2016-12-06

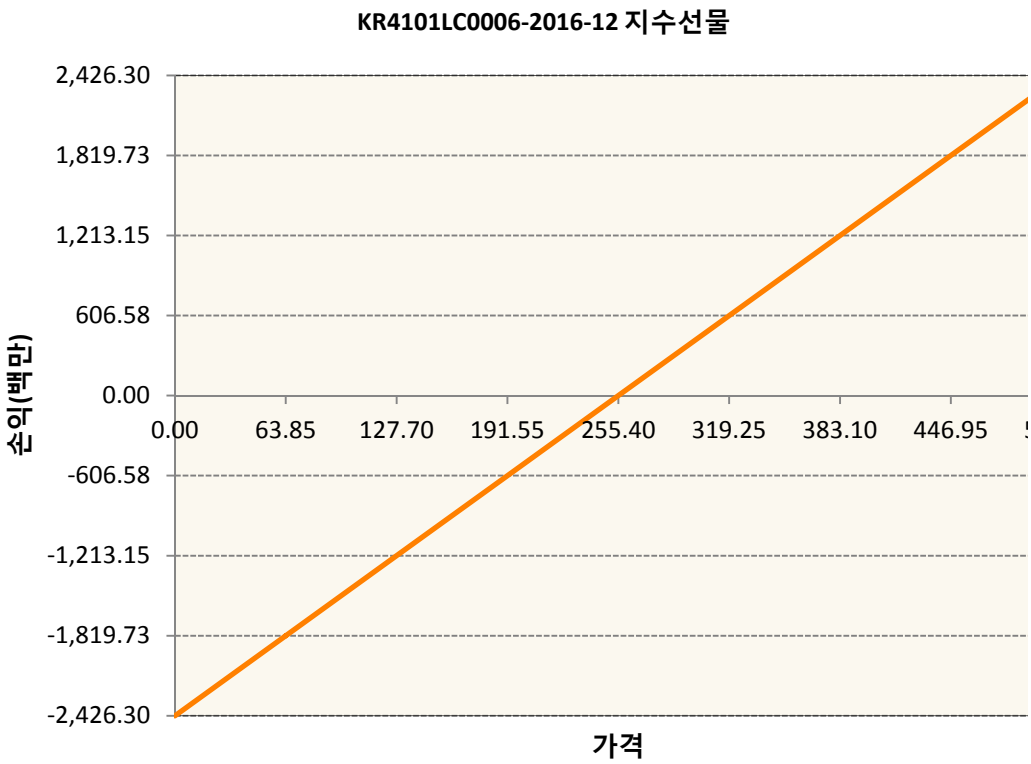
스마트인덱스모

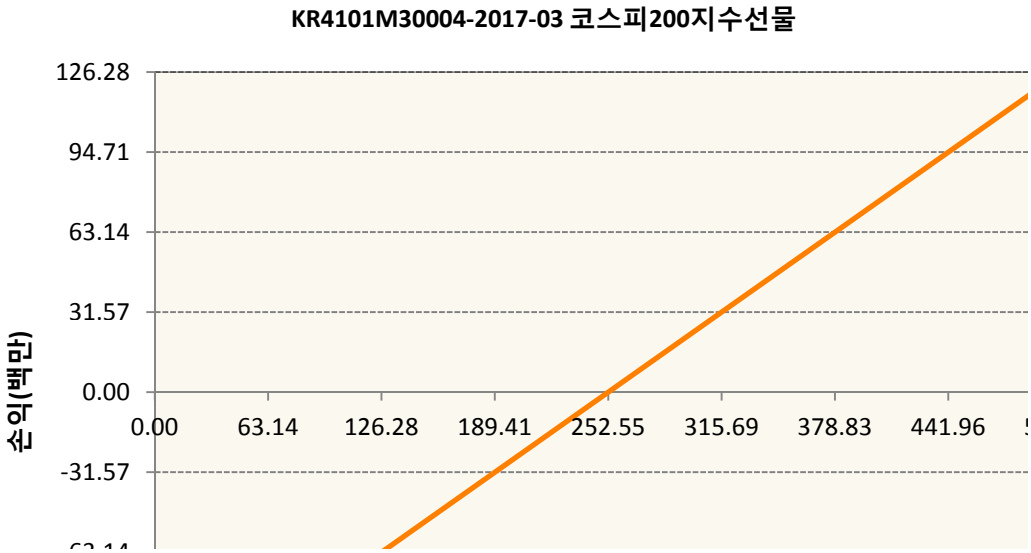
1. 계약금액

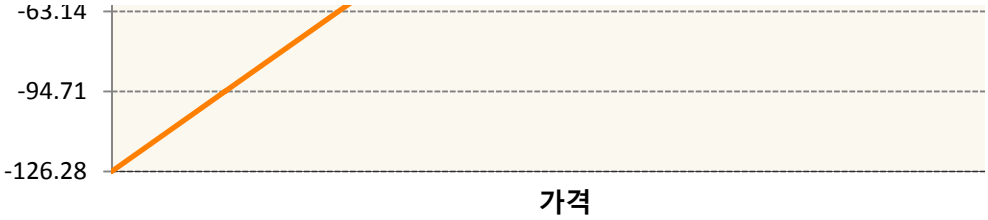
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	126	0	126	장내
누계	유가증권	선물	2,553	0	2,553	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101LC00 2016-12 지수선물							194
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-194	-194	-194	-194	-194	-194	-194
-5.33%	-130	-130	-130	-130	-130	-130	-130
-2.67%	-65	-65	-65	-65	-65	-65	-65
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	65	65	65	65	65	65	65
5.33%	130	130	130	130	130	130	130
8.00%	194	194	194	194	194	194	194
KR4101M30(2017-03 코스피200지수선물							10
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-10	-10	-10	-10	-10	-10	-10
-5.33%	-7	-7	-7	-7	-7	-7	-7
-2.67%	-3	-3	-3	-3	-3	-3	-3
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	3	3	3	3	3	3	3
5.33%	7	7	7	7	7	7	7
8.00%	10	10	10	10	10	10	10

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

155

공시일	2016-12-07
기준일	2016-12-06

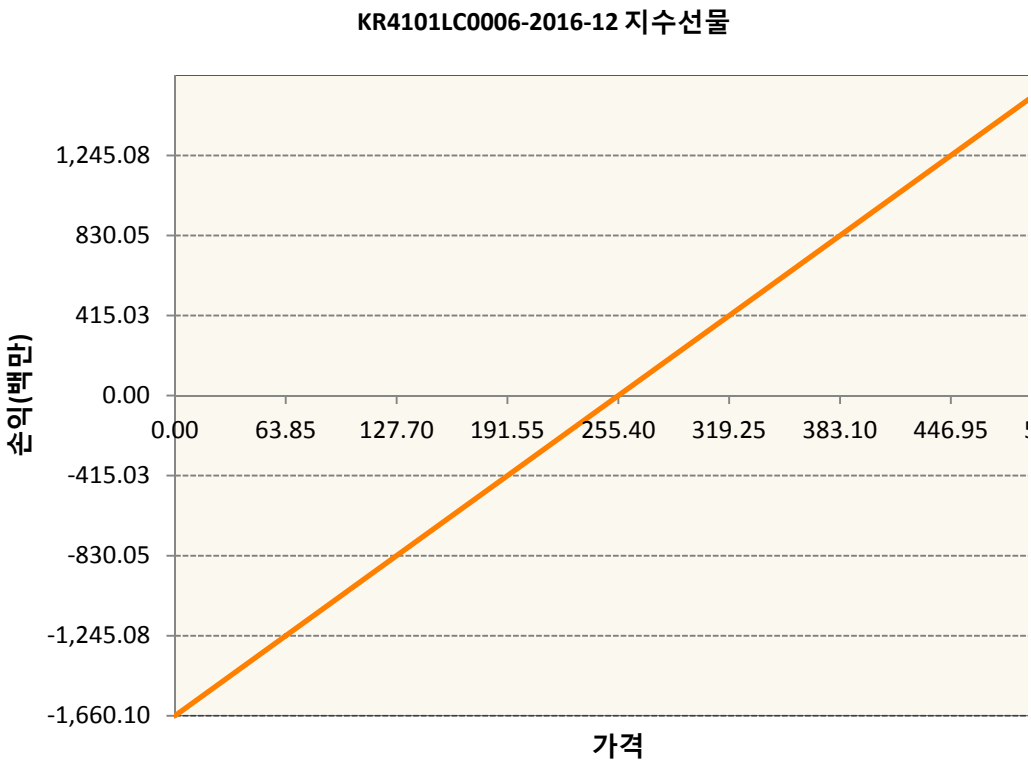
스마트레버리지목표전환형1호

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	1,660	0	1,660	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101LC00 2016-12 지수선물							133
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-133	-133	-133	-133	-133	-133	-133
-5.33%	-89	-89	-89	-89	-89	-89	-89
-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%	89	89	89	89	89	89	89
8.00%	133	133	133	133	133	133	133

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

100

공시일	2016-12-07
기준일	2016-12-06

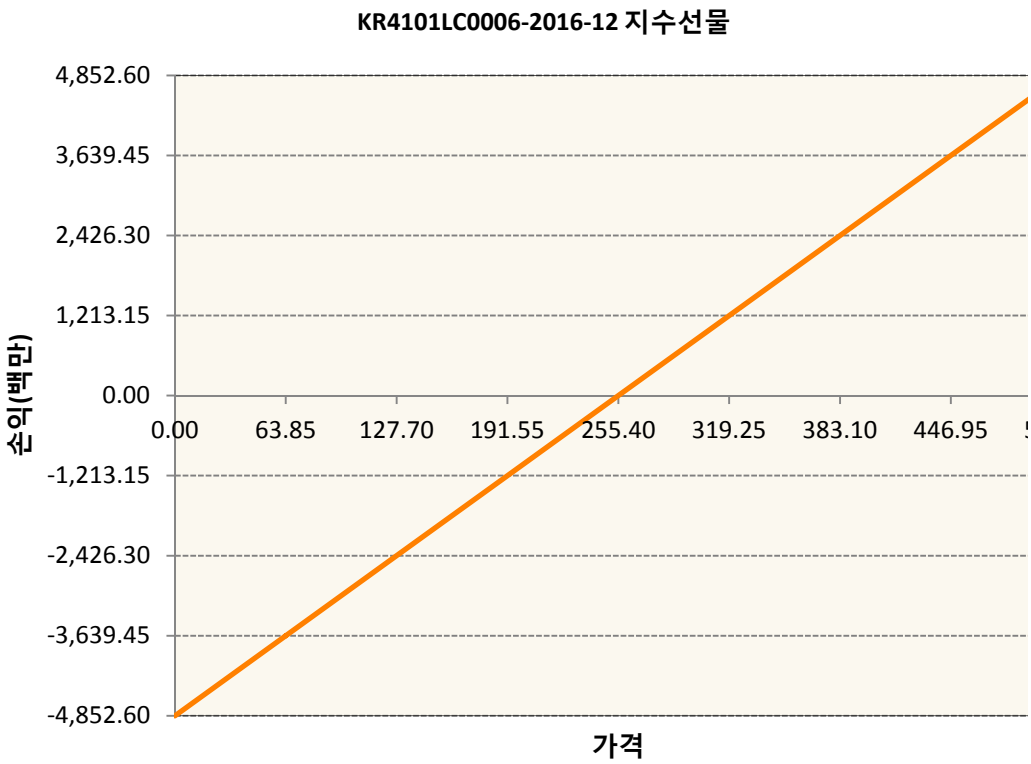
1.3배 레버리지 인덱스(주식-파생형)

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	4,853	0	4,853	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101LC00 2016-12 지수선물							389
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-389	-389	-389	-389	-389	-389	-389
-5.33%	-259	-259	-259	-259	-259	-259	-259
-2.67%	-130	-130	-130	-130	-130	-130	-130
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	130	130	130	130	130	130	130
5.33%	259	259	259	259	259	259	259
8.00%	389	389	389	389	389	389	389

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

294

공시일	2016-12-07
기준일	2016-12-06

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	886

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

713

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2016-12-07
기준일	2016-12-06

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	394

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

723

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2016-12-07
기준일	2016-12-06

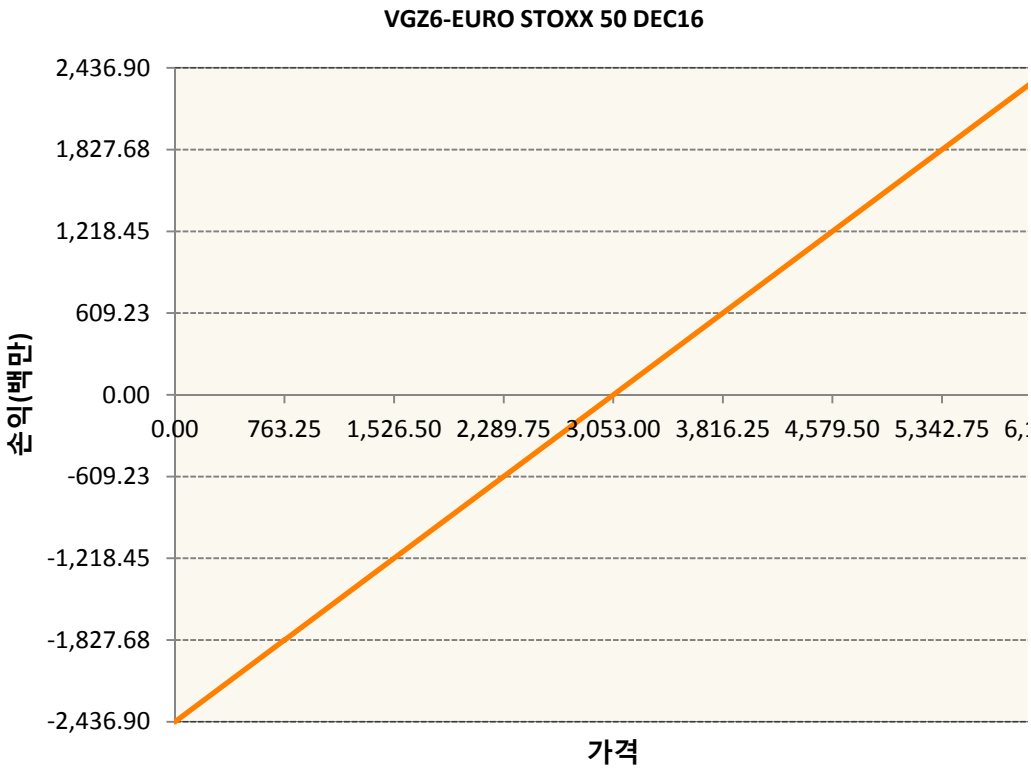
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,437	0	2,437	

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	2016-12-07
기준일	2016-12-06

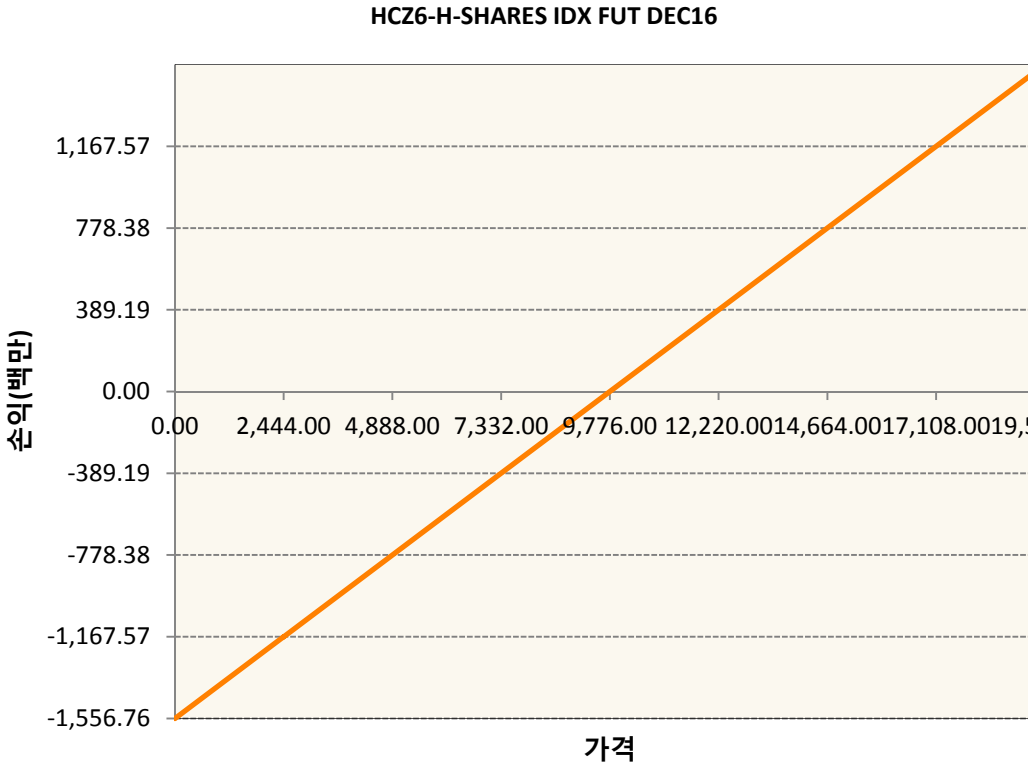
차이나인덱스모(주식-파생형)

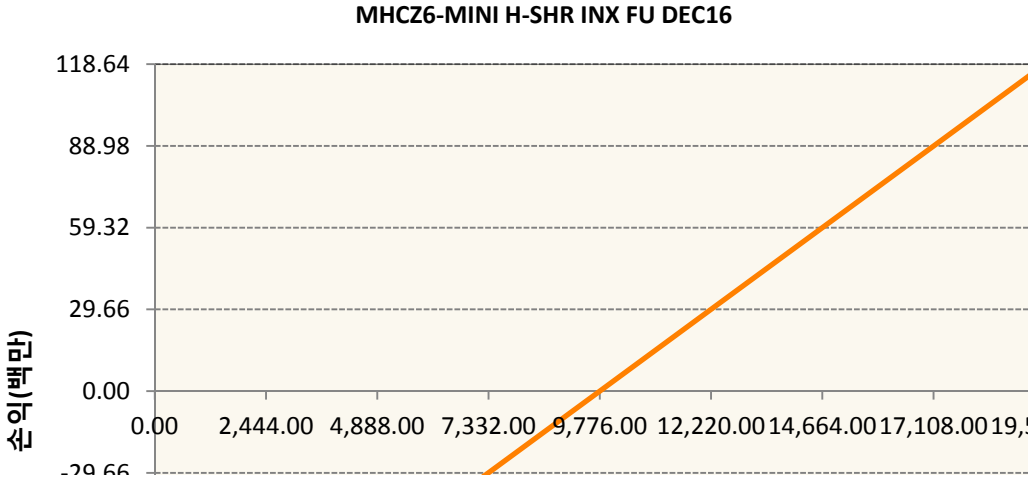
1. 계약금액

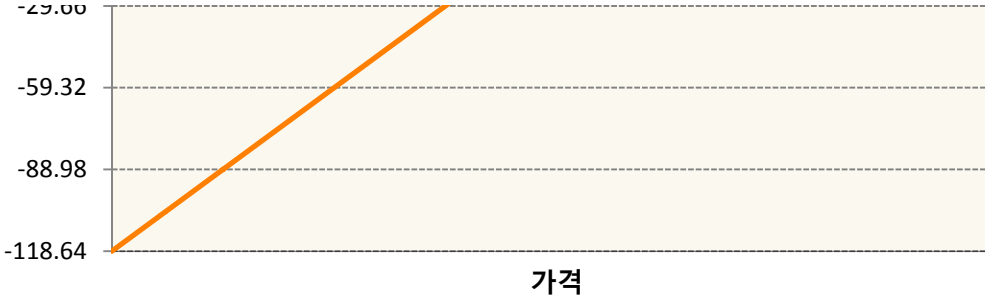
(단위:백만원)

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	1,557	0	1,557	
누계	유가증권	선물	119	0	119	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCZ6	H-SHARES IDX FUT DEC16	125
MHCZ6	MINI H-SHR INX FU DEC16	9

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

공시일	2016-12-07
기준일	2016-12-06

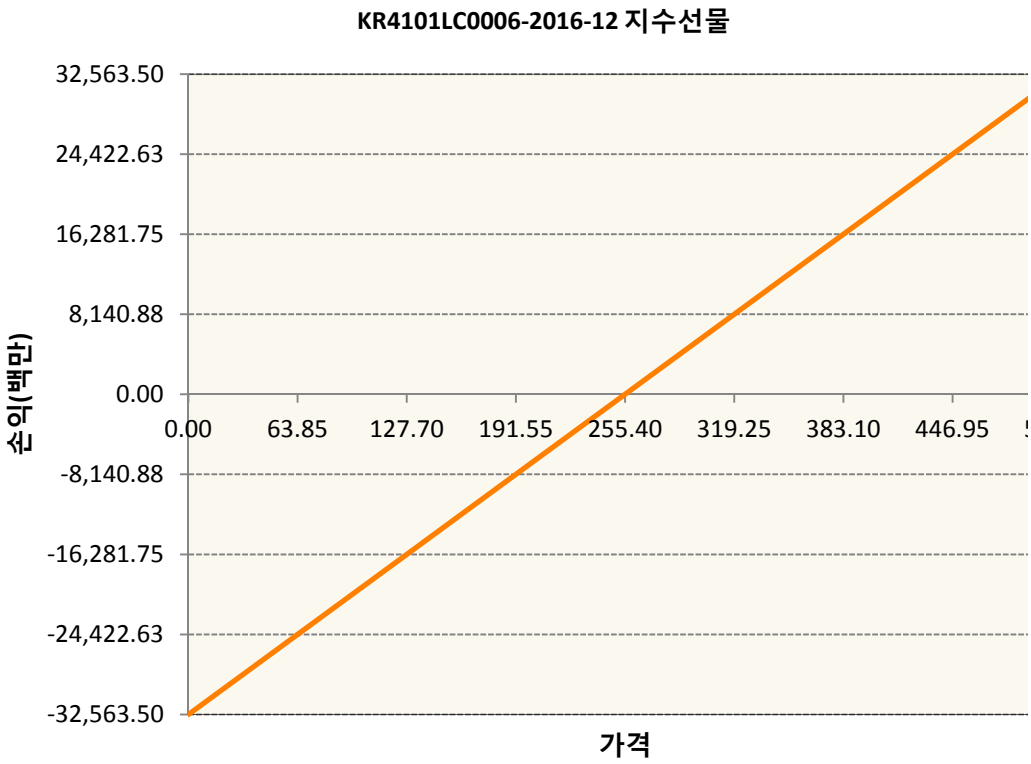
커버드콜(주식혼합-파생형)

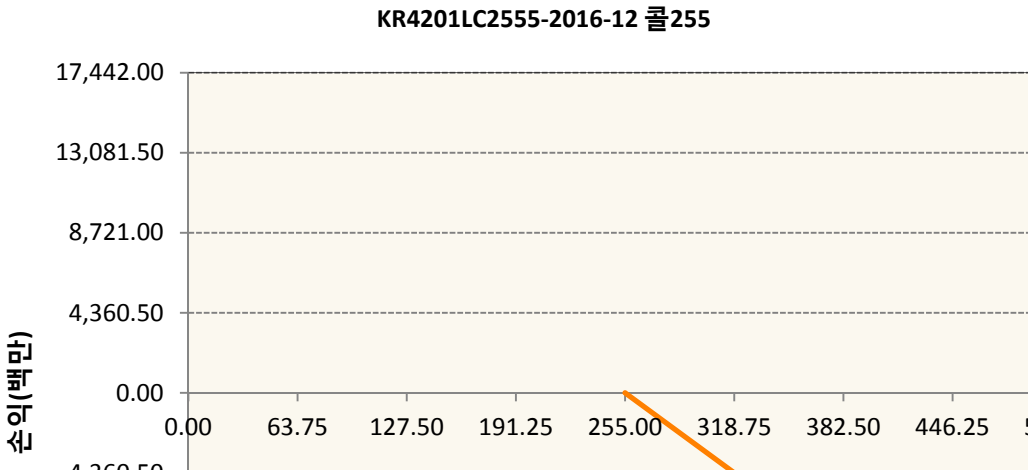
1. 계약금액

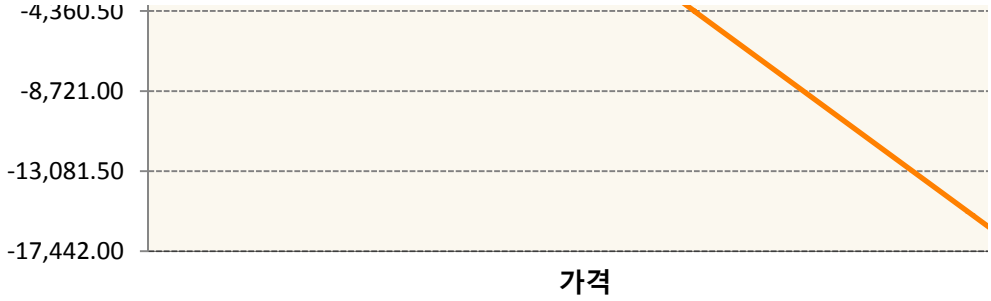
(단위:백만원)

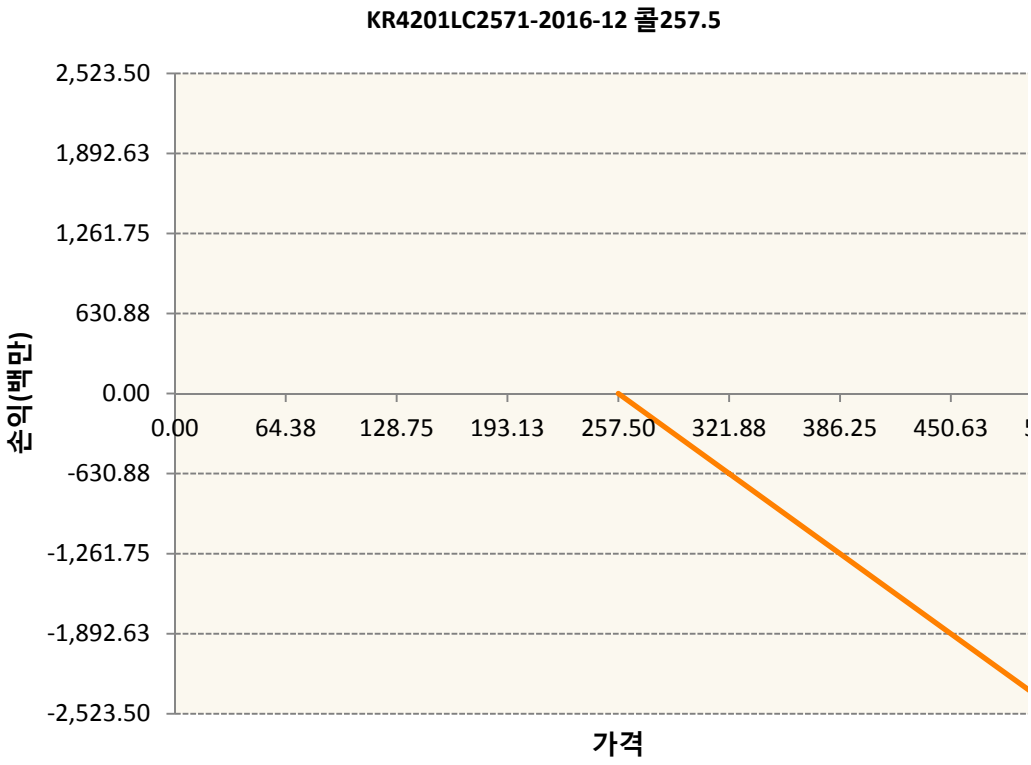
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	32,564	0	32,564	장내
누계	유가증권	옵션	0	19,966	-19,966	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101LC00 2016-12 지수선물							2,607
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-2,607	-2,607	-2,607	-2,607	-2,607	-2,607	-2,607
-5.33%	-1,738	-1,738	-1,738	-1,738	-1,738	-1,738	-1,738
-2.67%	-869	-869	-869	-869	-869	-869	-869
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	869	869	869	869	869	869	869
5.33%	1,738	1,738	1,738	1,738	1,738	1,738	1,738
8.00%	2,607	2,607	2,607	2,607	2,607	2,607	2,607
KR4201LC25 2016-12 콜255							6,783
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	426	426	426	426	426	426	426
-5.33%	426	426	426	426	426	426	426
-2.67%	426	426	425	425	424	423	421
0%	73	49	24	0	-25	-49	-74
2.67%	-2,121	-2,121	-2,121	-2,121	-2,121	-2,122	-2,122
5.33%	-4,452	-4,452	-4,452	-4,452	-4,452	-4,452	-4,452
8.00%	-6,783	-6,783	-6,783	-6,783	-6,783	-6,783	-6,783
KR4201LC25 2016-12 콜257.5							898

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	13	13	13	13	13	13	13
-5.33%	13	13	13	13	13	13	13
-2.67%	13	13	13	13	13	13	13
0%	7	5	3	0	-3	-5	-8
2.67%	-230	-230	-230	-230	-231	-231	-232
5.33%	-564	-564	-564	-564	-564	-564	-564
8.00%	-898	-898	-898	-898	-898	-898	-898

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

14,119

공시일	2016-12-07
기준일	2016-12-06

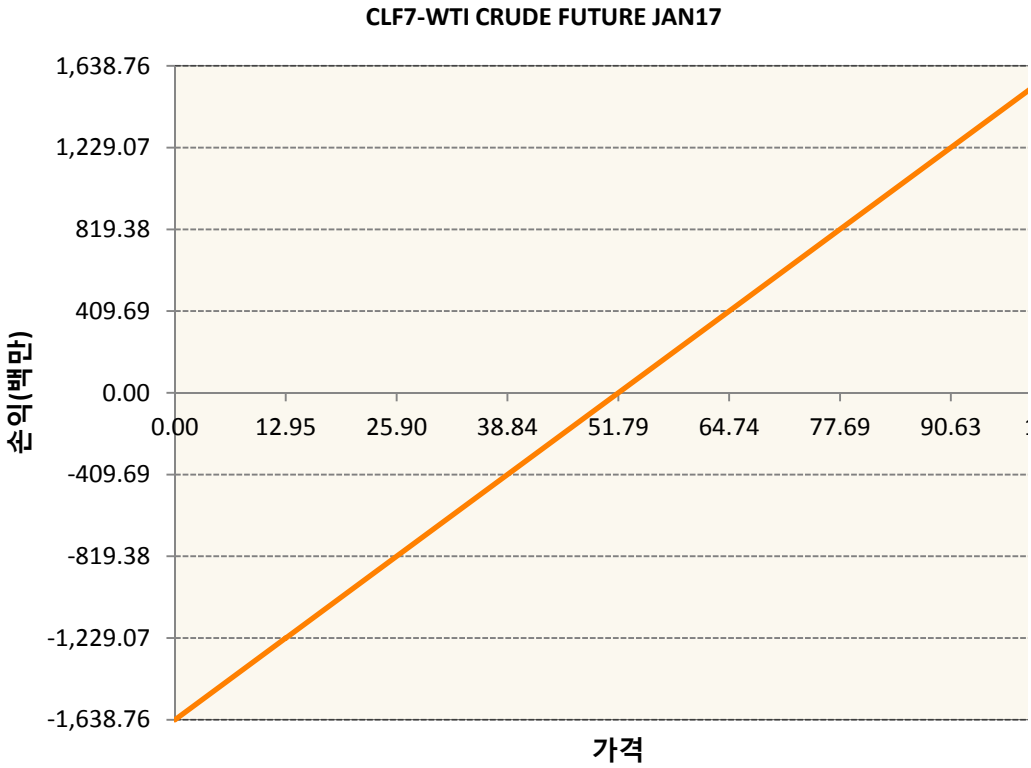
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

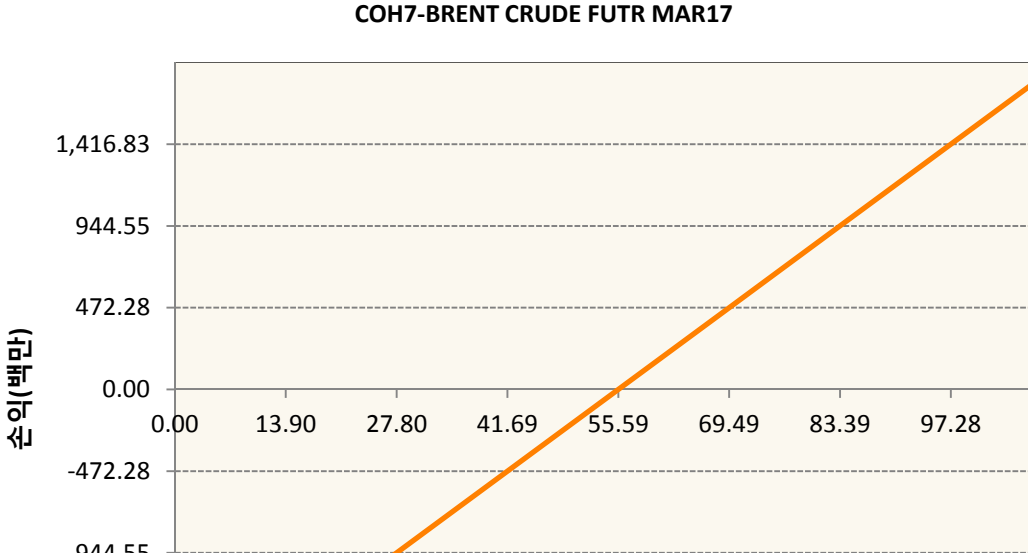
1. 계약금액

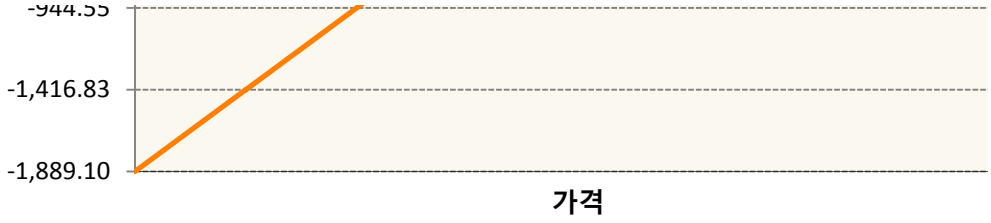
(단위:백만원)

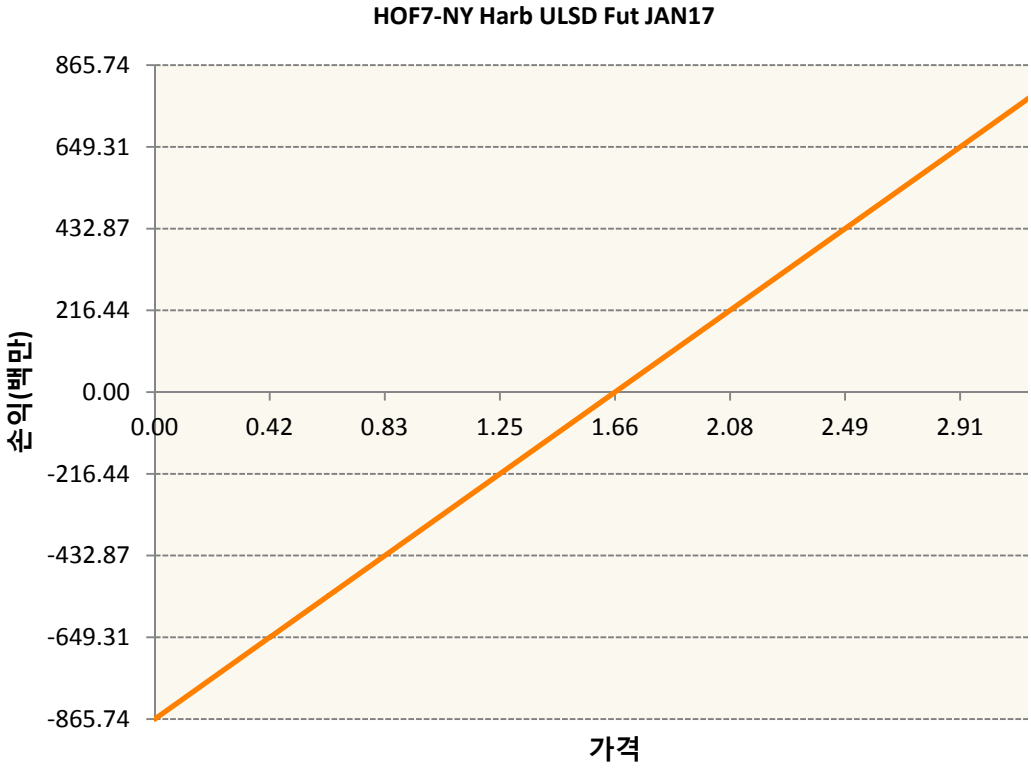
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	6,992	0	6,992	

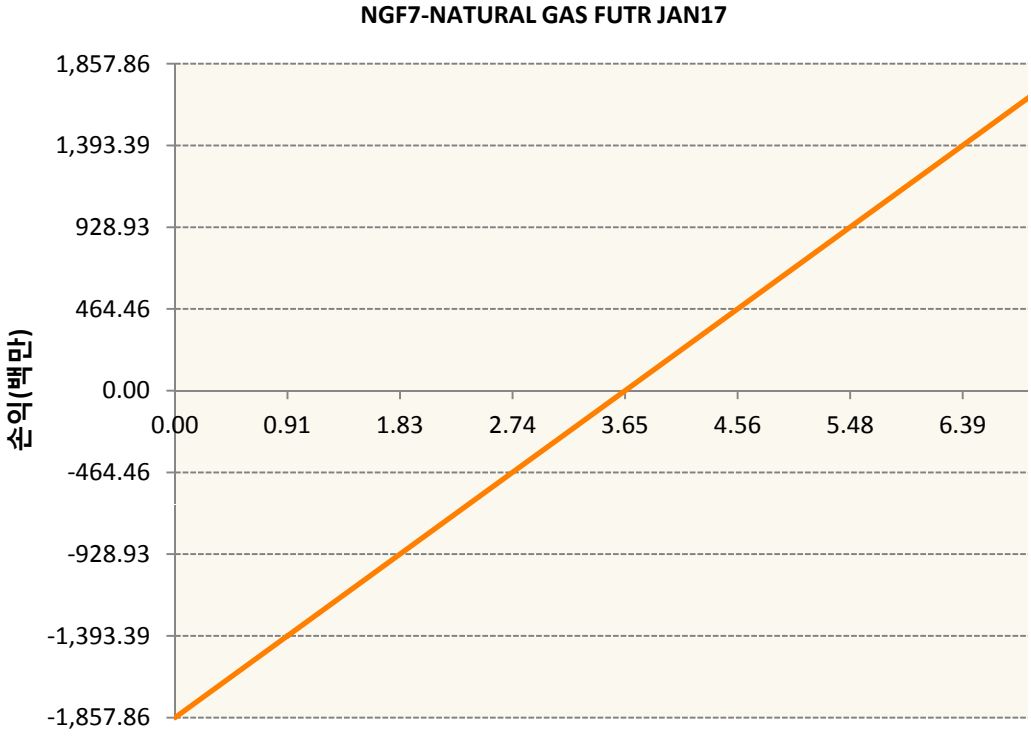
2. 만기시점의 손익구조



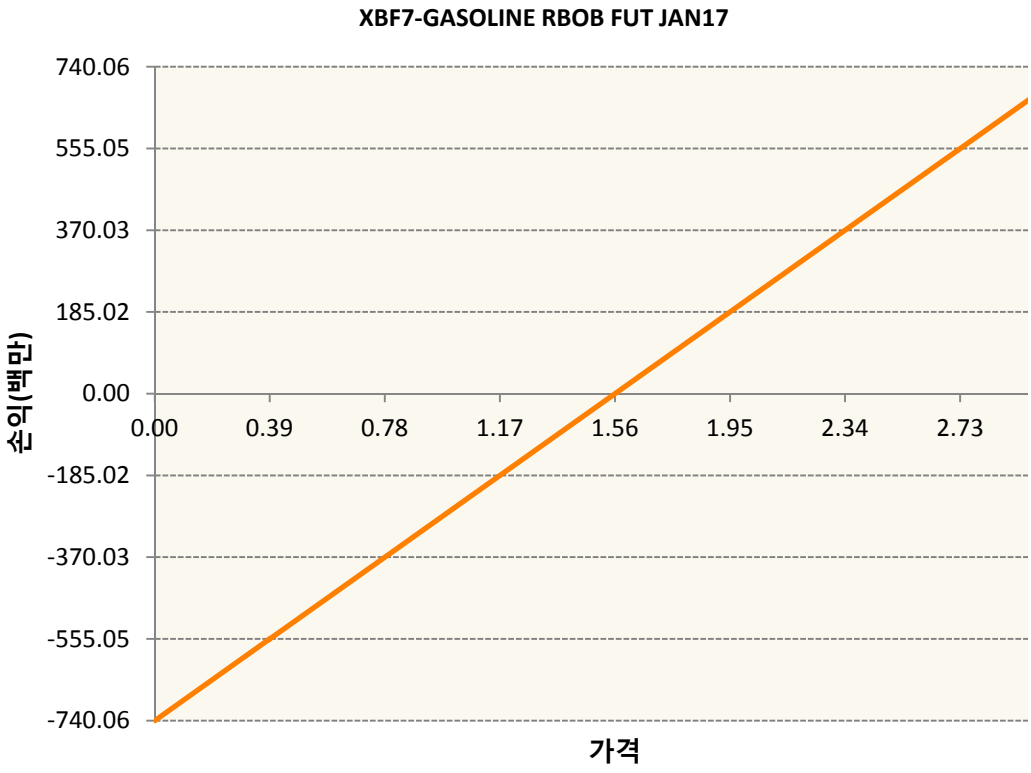



-944.55
-1,416.83
-1,889.10
가격


HOF7-NY Harb ULSD Fut JAN17
865.74
649.31
432.87
216.44
0.00
-216.44
-432.87
-649.31
-865.74
0.00
0.42
0.83
1.25
1.66
2.08
2.49
2.91
순익(백만)
가격


NGF7-NATURAL GAS FUTR JAN17
1,857.86
1,393.39
928.93
464.46
0.00
-464.46
-928.93
-1,393.39
-1,857.86
0.00
0.91
1.83
2.74
3.65
4.56
5.48
6.39
순익(백만)

가격



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
CLF7	WTI CRUDE FUTURE JAN17	131
COH7	BRENT CRUDE FUTR MAR17	151
HOF7	NY Harb ULSD Fut JAN17	69
NGF7	NATURAL GAS FUTR JAN17	149
XBF7	GASOLINE RBOB FUT JAN17	59

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,269

공시일	2016-12-07
기준일	2016-12-06

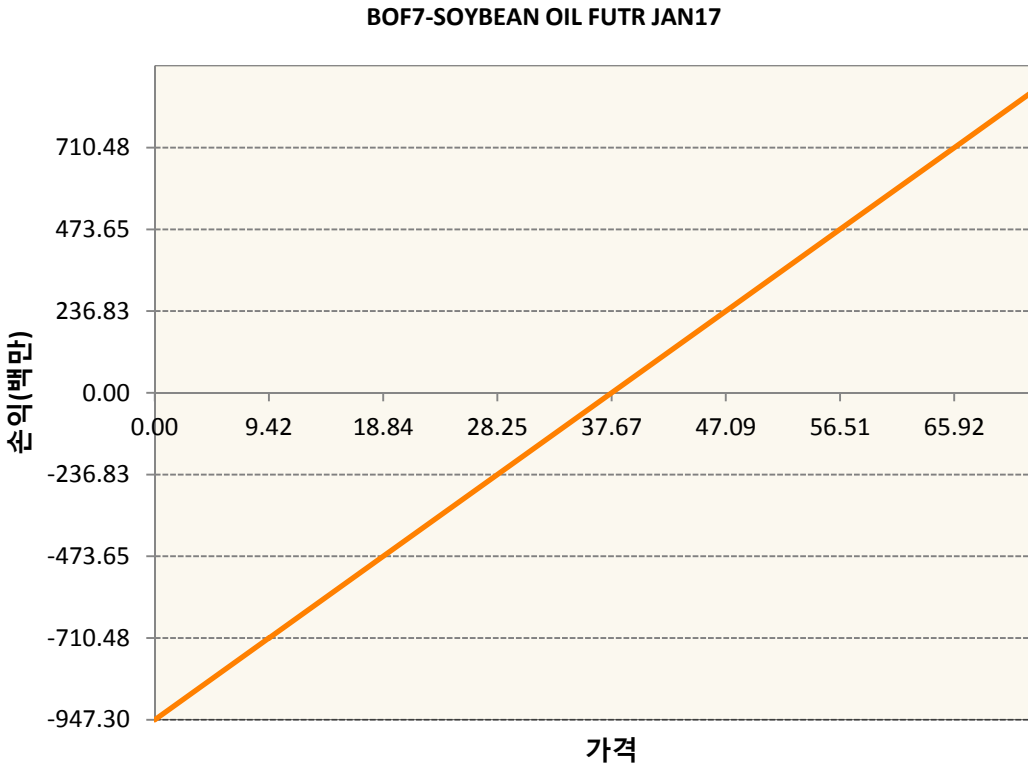
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

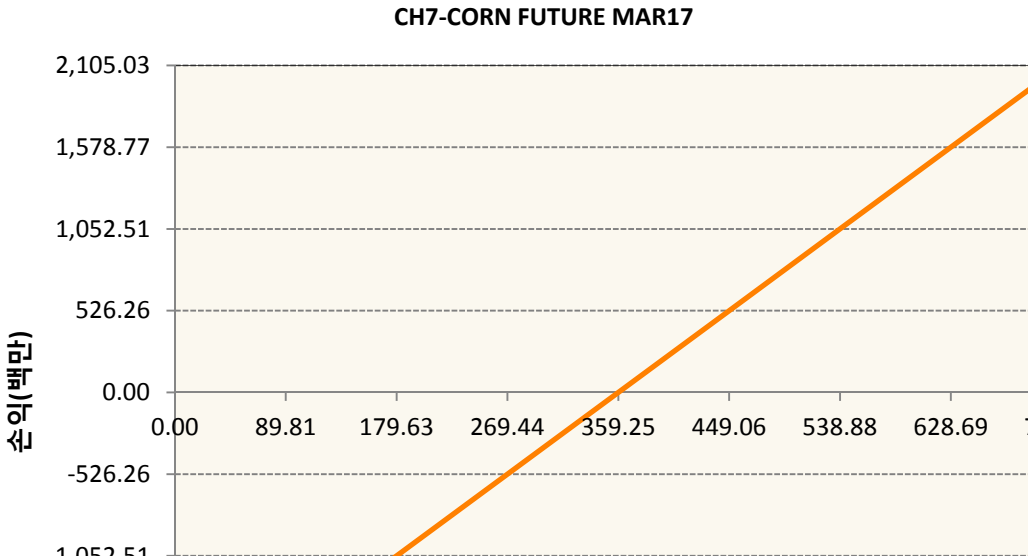
1. 계약금액

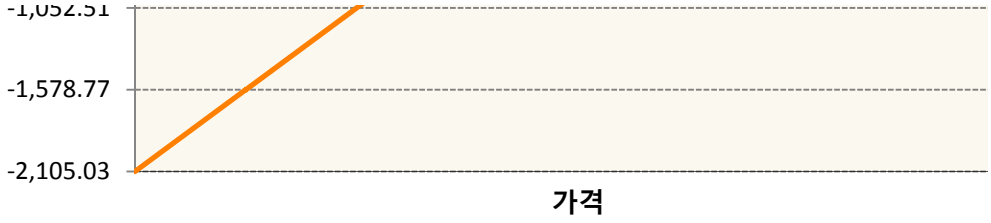
(단위:백만원)

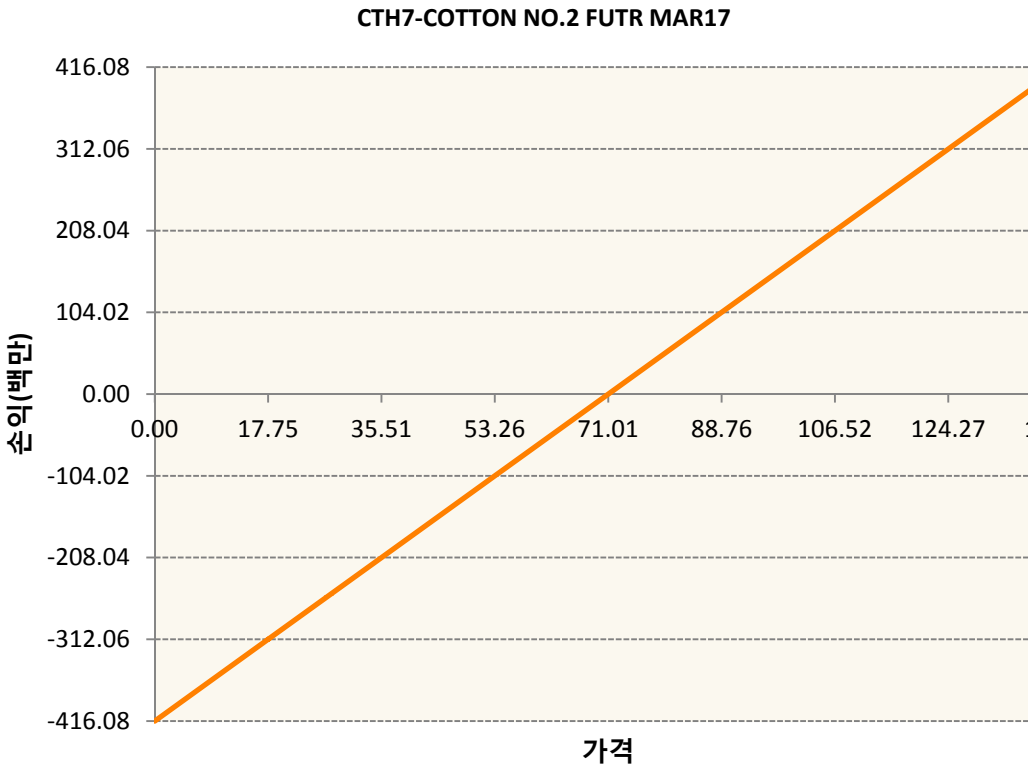
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	9,123	0	9,123	

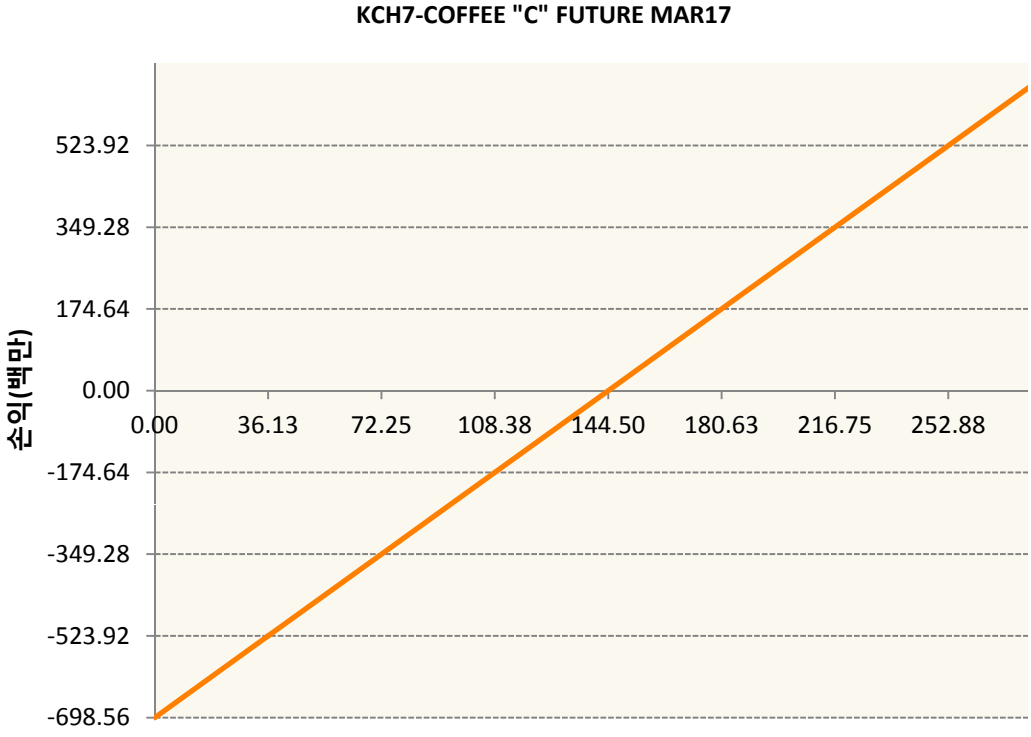
2. 만기시점의 손익구조



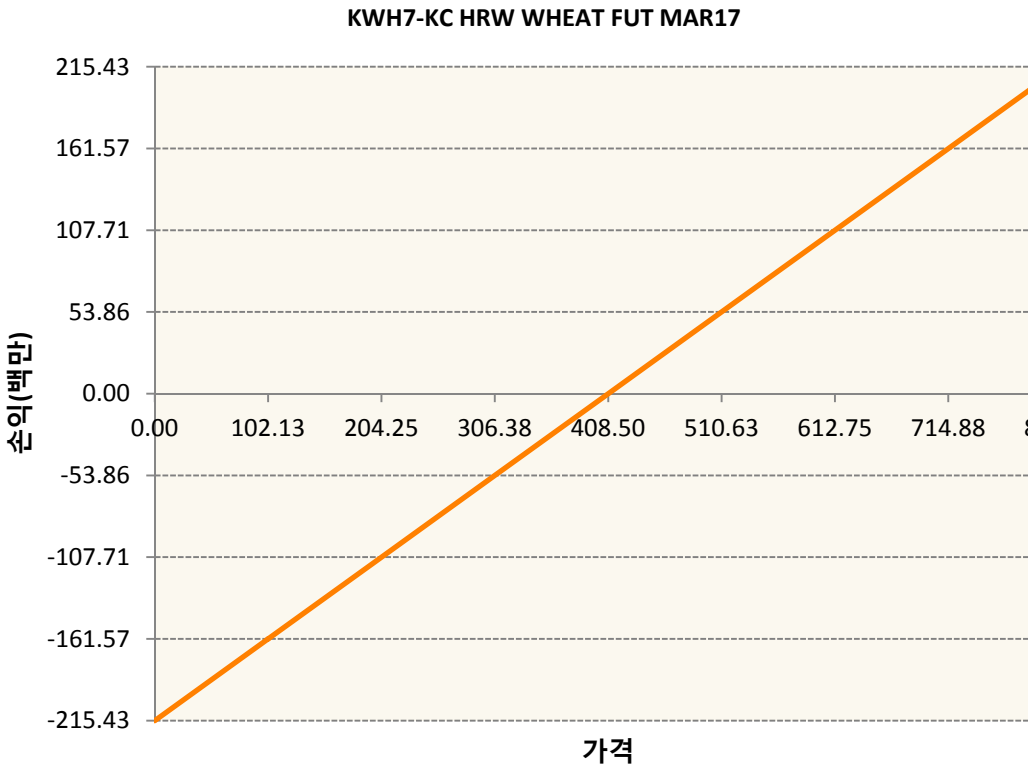


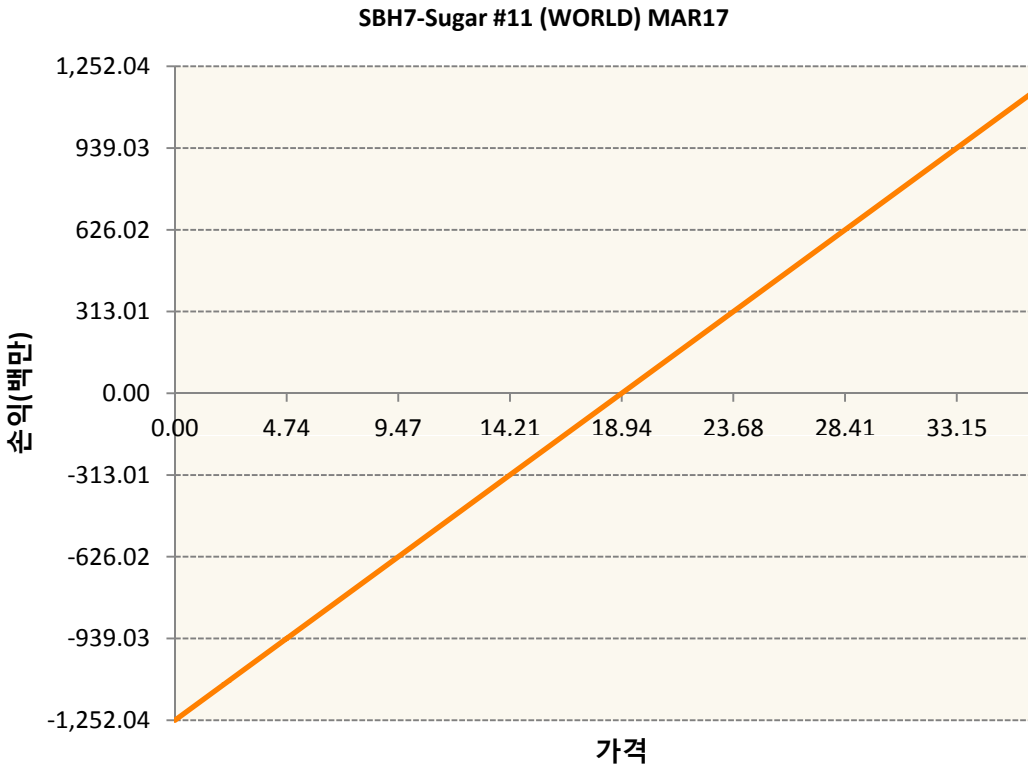

-1,578.77
-2,105.03
가격

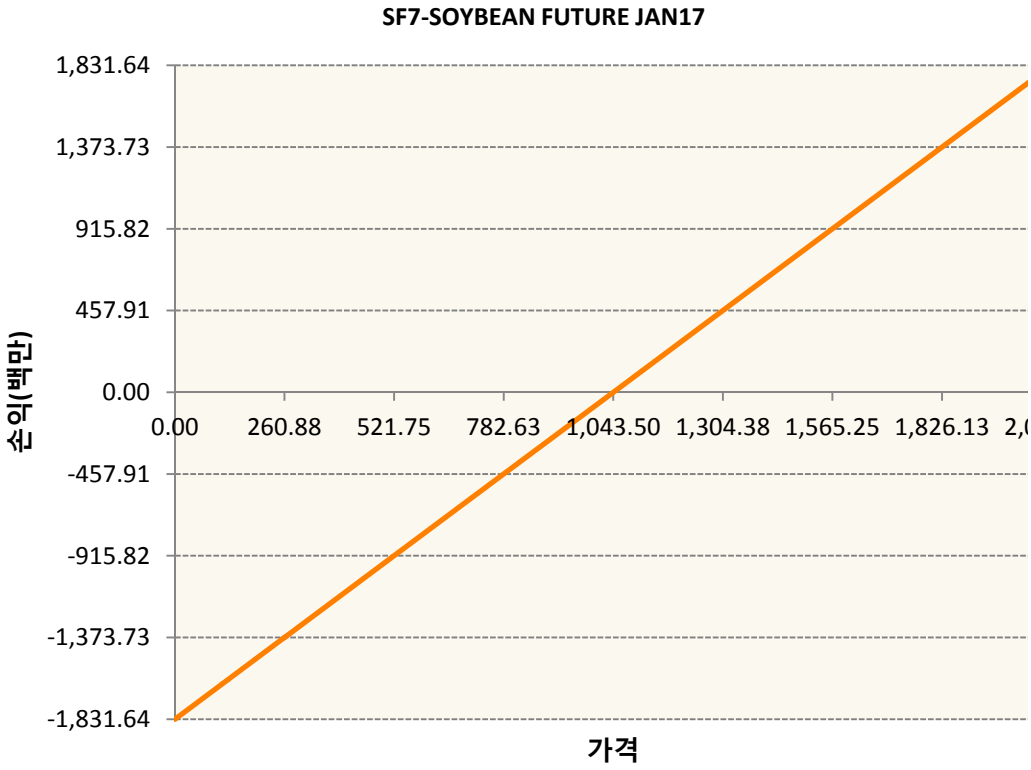

CTH7-COTTON NO.2 FUTR MAR17
416.08
312.06
208.04
104.02
0.00
-104.02
-208.04
-312.06
-416.08
0.00
17.75
35.51
53.26
71.01
88.76
106.52
124.27
손익(백만)
가격

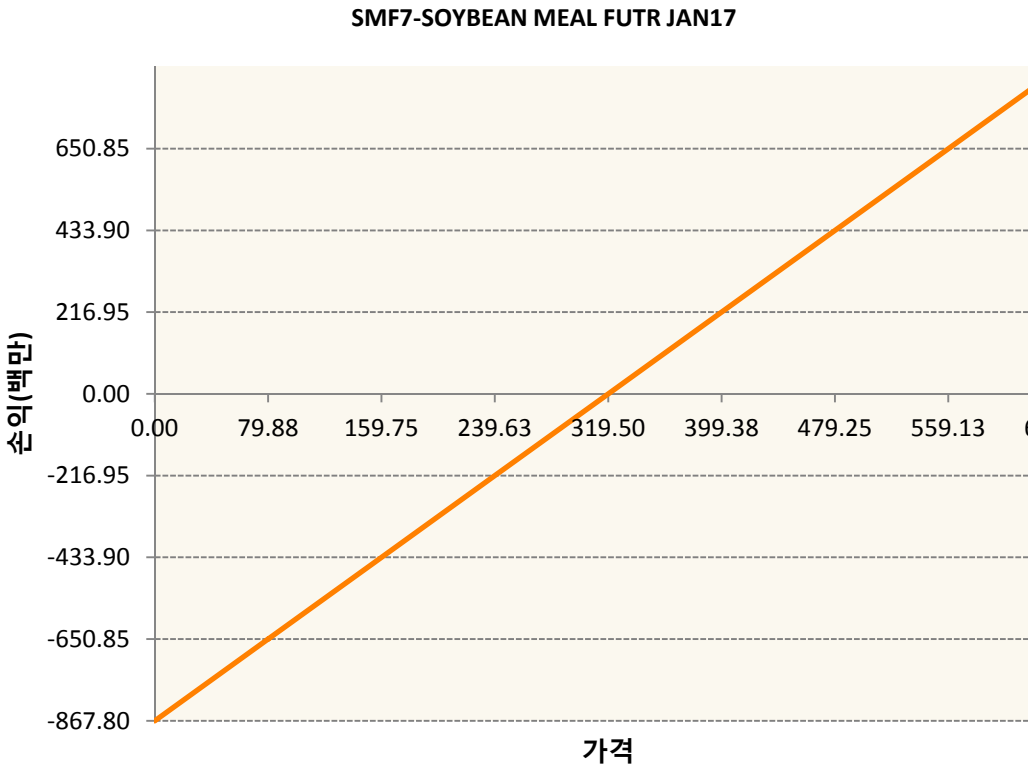

KCH7-COFFEE "C" FUTURE MAR17
523.92
349.28
174.64
0.00
-174.64
-349.28
-523.92
-698.56
0.00
36.13
72.25
108.38
144.50
180.63
216.75
252.88
손익(백만)

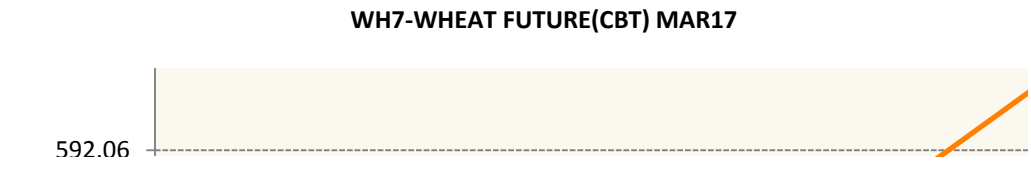
가격

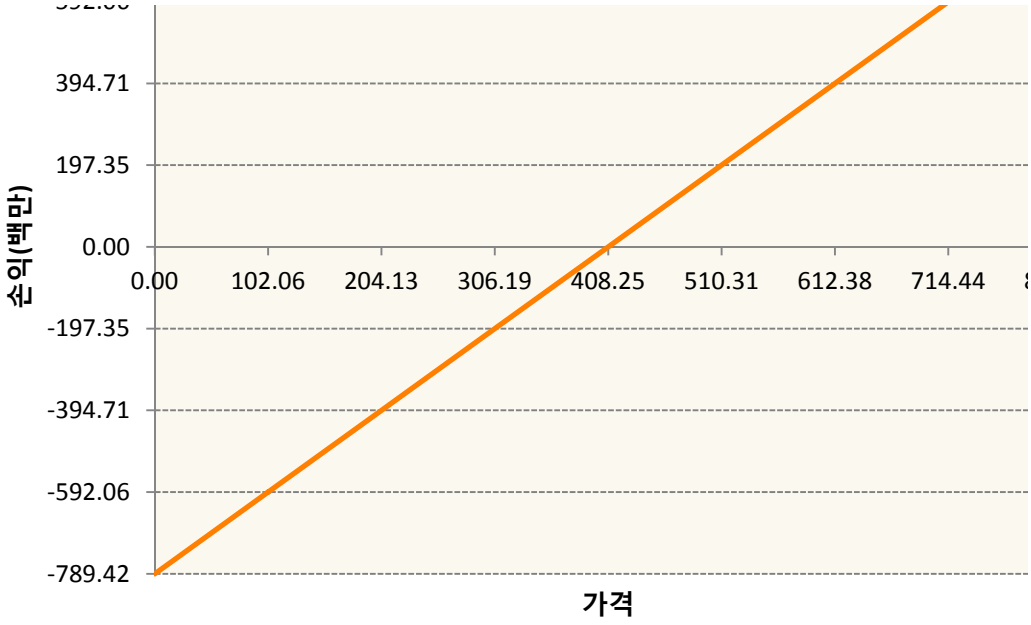

KWH7-KC HRW WHEAT FUT MAR17
215.43
161.57
107.71
53.86
0.00
-53.86
-107.71
-161.57
-215.43
0.00
102.13
204.25
306.38
408.50
510.63
612.75
714.88
손익(백만)
가격


SBH7-Sugar #11 (WORLD) MAR17
1,252.04
939.03
626.02
313.01
0.00
-313.01
-626.02
-939.03
-1,252.04
0.00
4.74
9.47
14.21
18.94
23.68
28.41
33.15
손익(백만)
가격


SF7-SOYBEAN FUTURE JAN17
1,831.64
1,373.73
915.82
457.91
0.00
-457.91
-915.82
-1,373.73
-1,831.64
0.00
260.88
521.75
782.63
1,043.50
1,304.38
1,565.25
1,826.13
손익(백만)
가격


SMF7-SOYBEAN MEAL FUTR JAN17
650.85
433.90
216.95
0.00
-216.95
-433.90
-650.85
-867.80
0.00
79.88
159.75
239.63
319.50
399.38
479.25
559.13
손익(백만)
가격


WH7-WHEAT FUTURE(CBT) MAR17
592.06



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
BOF7	SOYBEAN OIL FUTR JAN17	76
CH7	CORN FUTURE MAR17	168
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	100
SF7	SOYBEAN FUTURE JAN17	147
SMF7	SOYBEAN MEAL FUTR JAN17	69
WH7	WHEAT FUTURE(CBT) MAR17	63

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	892