공시일	2016-12-08
기준일	2016-12-07

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	2016-12-08
기준일	2016-12-07

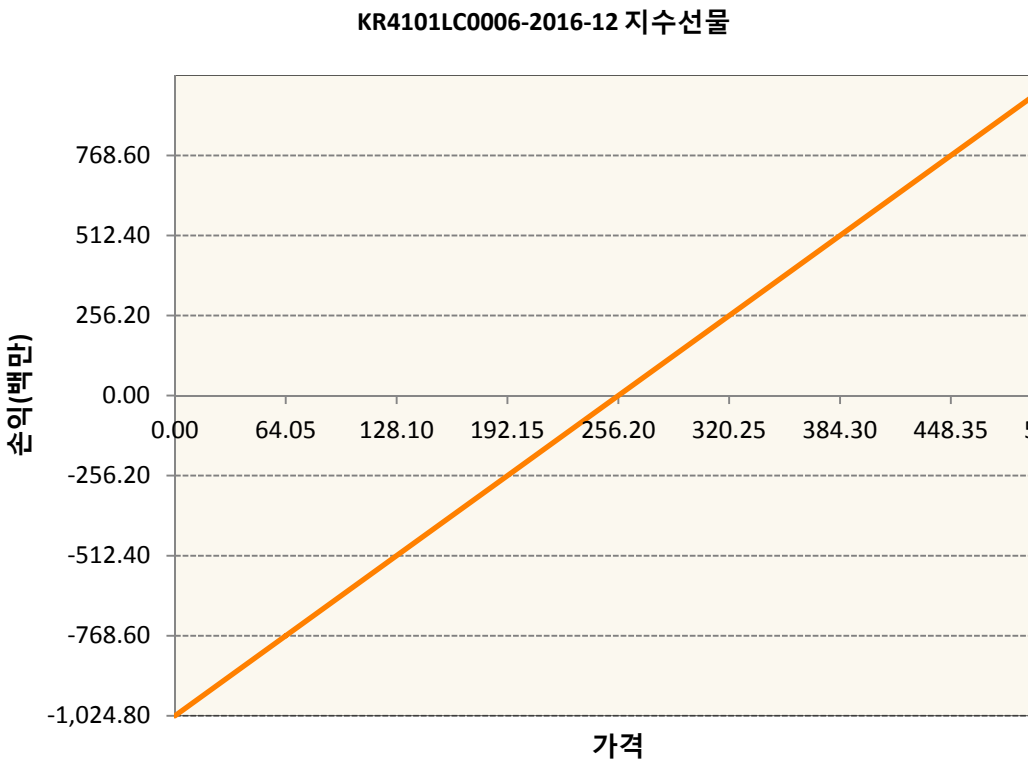
스마트인덱스모

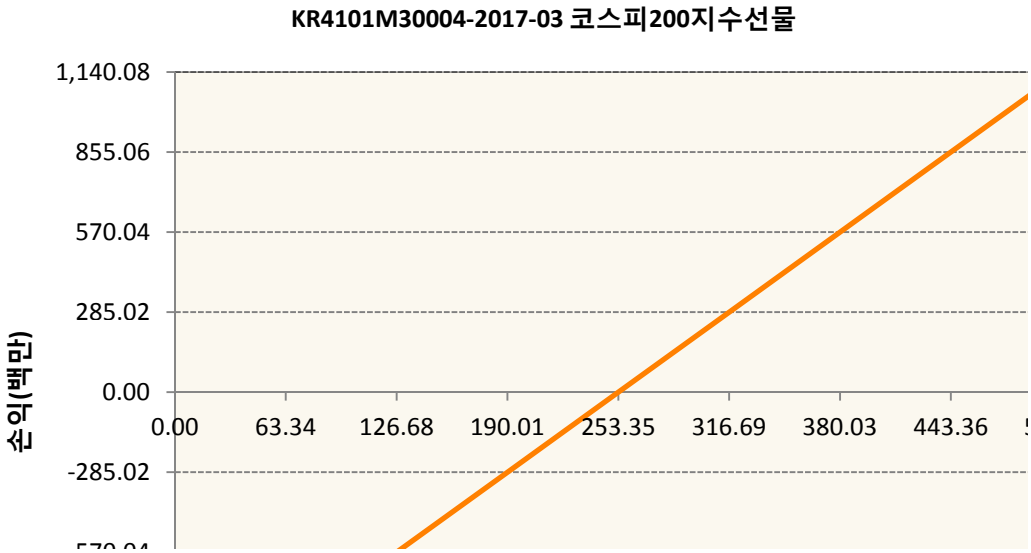
1. 계약금액

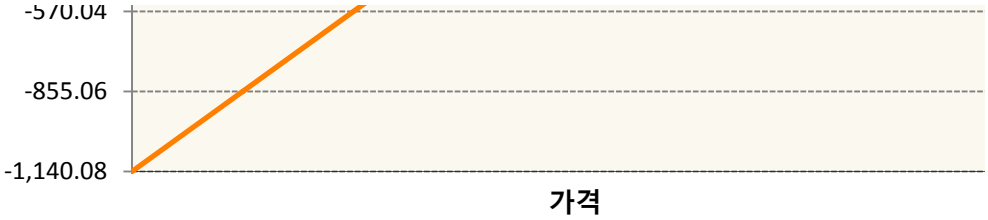
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	1,013	1,409	-396	장내
누계	유가증권	선물	2,165	0	2,165	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101LC00 2016-12 지수선물							82
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-82	-82	-82	-82	-82	-82	-82
-5.33%	-55	-55	-55	-55	-55	-55	-55
-2.67%	-27	-27	-27	-27	-27	-27	-27
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	27	27	27	27	27	27	27
5.33%	55	55	55	55	55	55	55
8.00%	82	82	82	82	82	82	82
KR4101M30(2017-03 코스피200지수선물							92
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-92	-92	-92	-92	-92	-92	-92
-5.33%	-62	-62	-62	-62	-62	-62	-62
-2.67%	-31	-31	-31	-31	-31	-31	-31
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	31	31	31	31	31	31	31
5.33%	62	62	62	62	62	62	62
8.00%	92	92	92	92	92	92	92

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

131

공시일	2016-12-08
기준일	2016-12-07

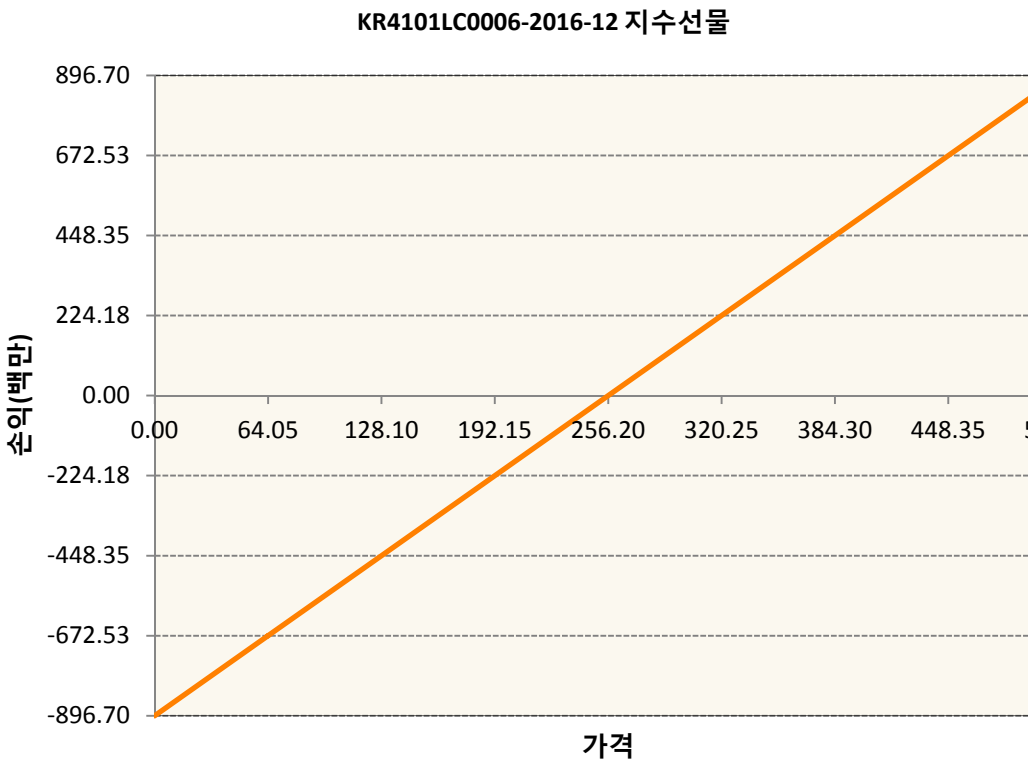
스마트레버리지목표전환형1호

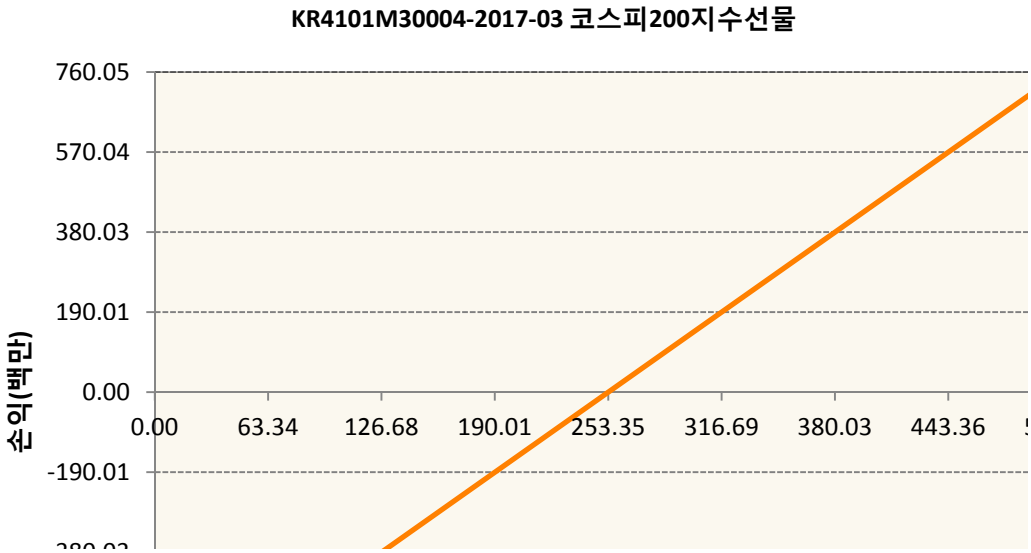
1. 계약금액

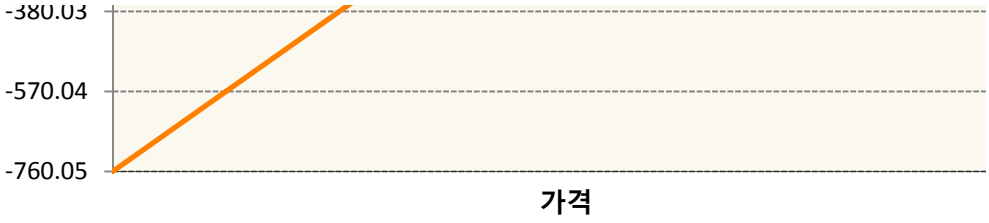
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	760	769	-9	장내
누계	유가증권	선물	1,657	0	1,657	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101LC00 2016-12 지수선물							72
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-72	-72	-72	-72	-72	-72	-72
-5.33%	-48	-48	-48	-48	-48	-48	-48
-2.67%	-24	-24	-24	-24	-24	-24	-24
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	24	24	24	24	24	24	24
5.33%	48	48	48	48	48	48	48
8.00%	72	72	72	72	72	72	72
KR4101M30(2017-03 코스피200지수선물							62
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-62	-62	-62	-62	-62	-62	-62
-5.33%	-41	-41	-41	-41	-41	-41	-41
-2.67%	-21	-21	-21	-21	-21	-21	-21
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	21	21	21	21	21	21	21
5.33%	41	41	41	41	41	41	41
8.00%	62	62	62	62	62	62	62

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

101

공시일	2016-12-08
기준일	2016-12-07

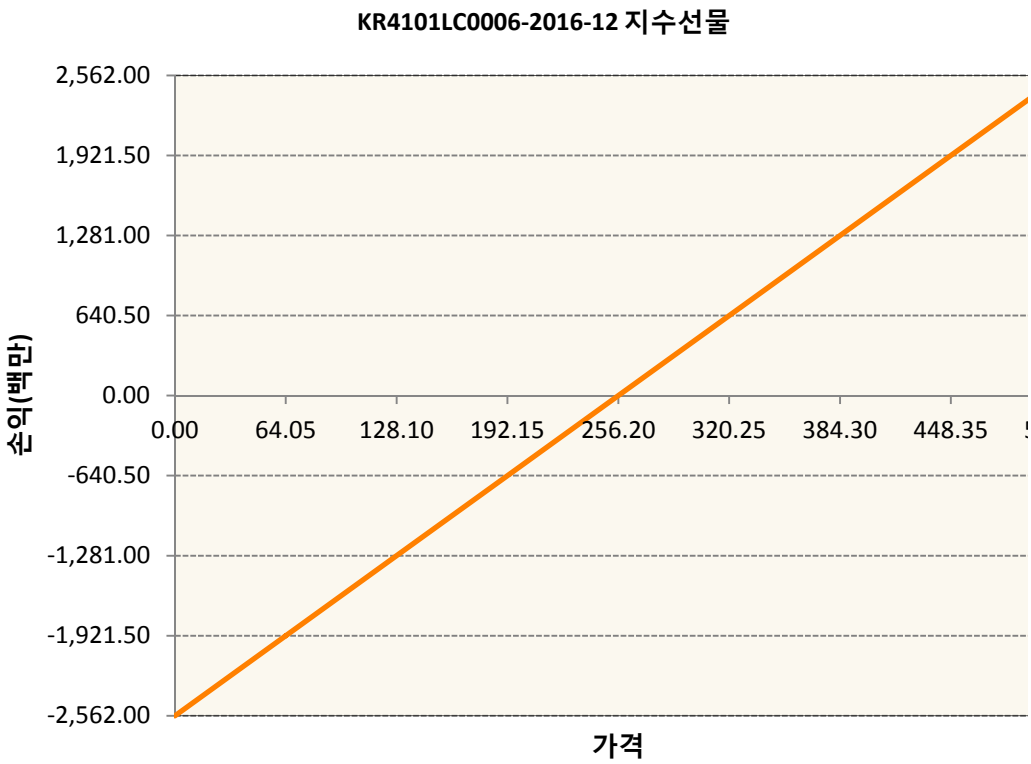
1.3배 레버리지 인덱스(주식-파생형)

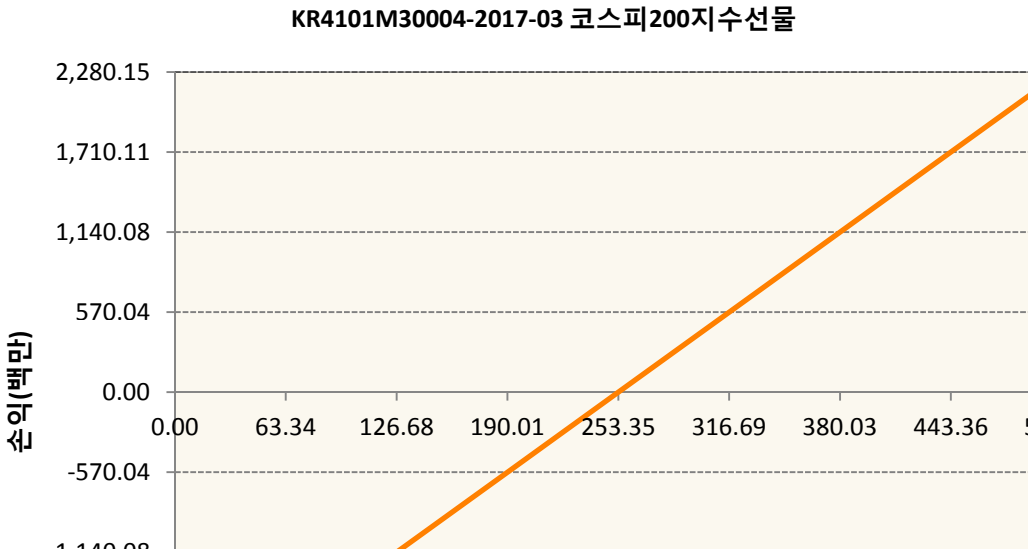
1. 계약금액

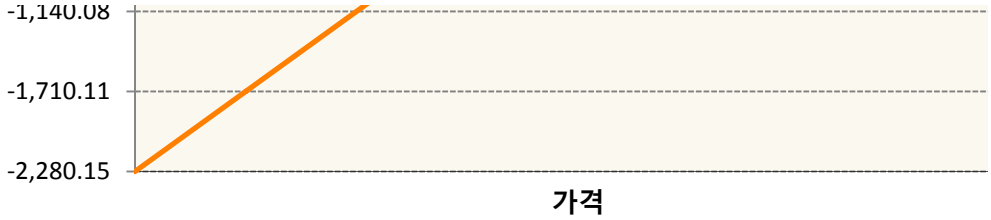
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	2,280	2,305	-26	장내
누계	유가증권	선물	4,842	0	4,842	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101LC00 2016-12 지수선물							205
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-205	-205	-205	-205	-205	-205	-205
-5.33%	-137	-137	-137	-137	-137	-137	-137
-2.67%	-68	-68	-68	-68	-68	-68	-68
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	68	68	68	68	68	68	68
5.33%	137	137	137	137	137	137	137
8.00%	205	205	205	205	205	205	205
KR4101M30(2017-03 코스피200지수선물							185
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-185	-185	-185	-185	-185	-185	-185
-5.33%	-123	-123	-123	-123	-123	-123	-123
-2.67%	-62	-62	-62	-62	-62	-62	-62
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	62	62	62	62	62	62	62
5.33%	123	123	123	123	123	123	123
8.00%	185	185	185	185	185	185	185

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

294

공시일	2016-12-08
기준일	2016-12-07

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	891

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

717

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2016-12-08
기준일	2016-12-07

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	398

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

731

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2016-12-08
기준일	2016-12-07

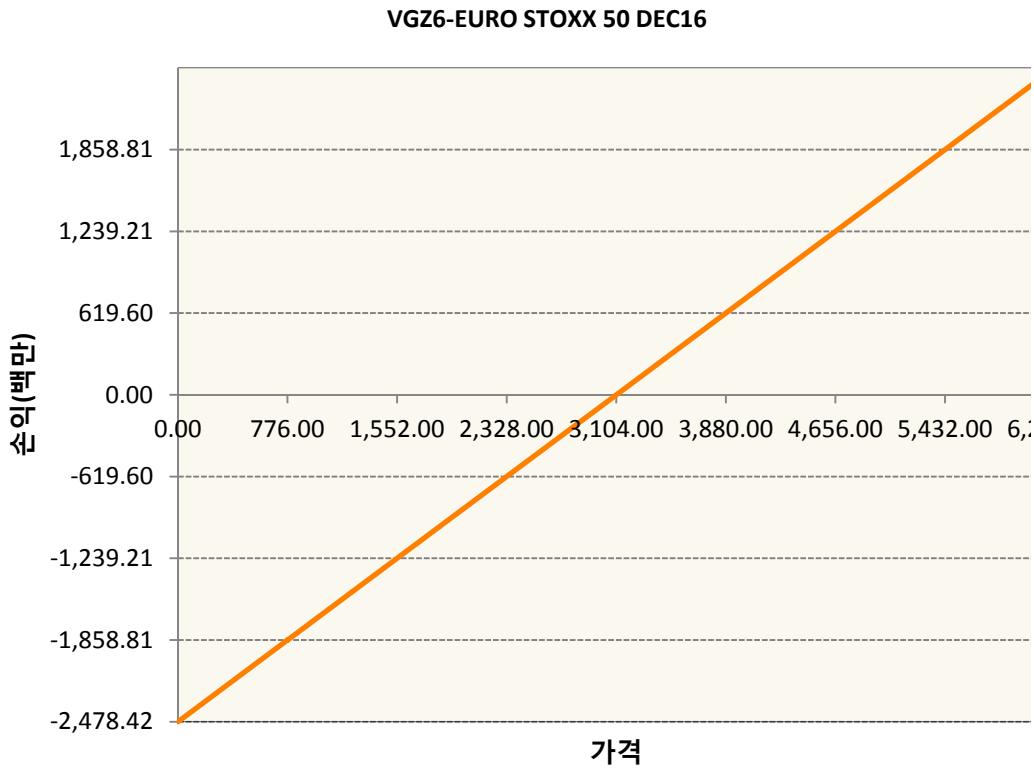
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,478	0	2,478	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGZ6	EURO STOXX 50 DEC16	198

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

(단위:백만원)

231

공시일	2016-12-08
기준일	2016-12-07

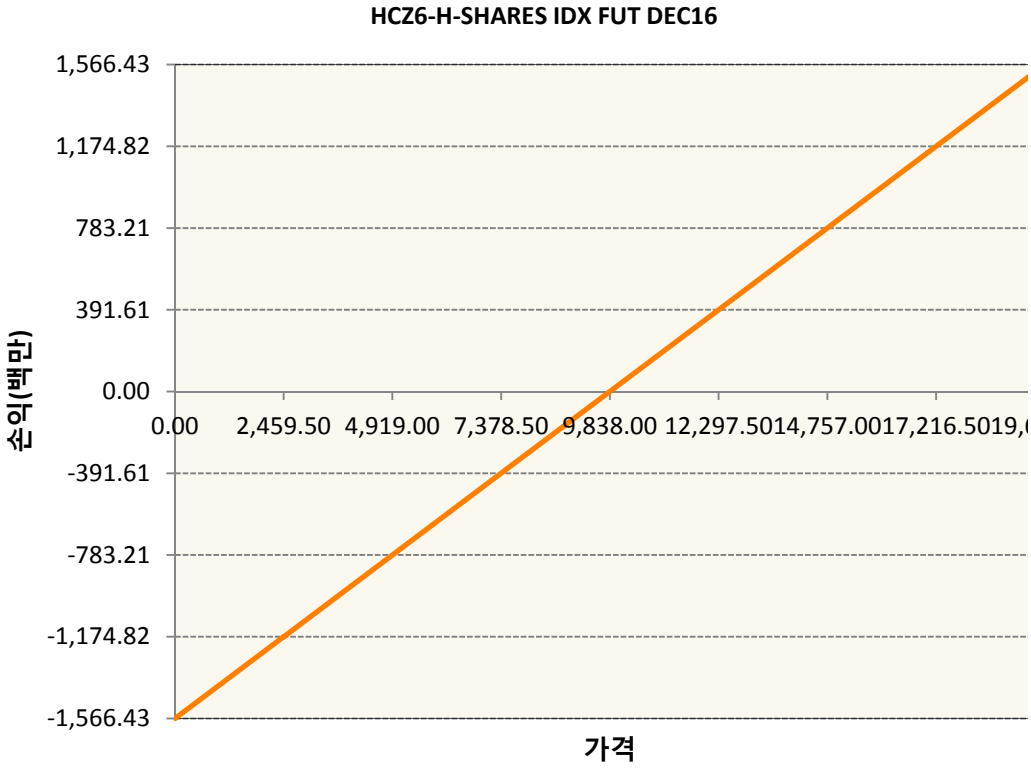
차이나인덱스모(주식-파생형)

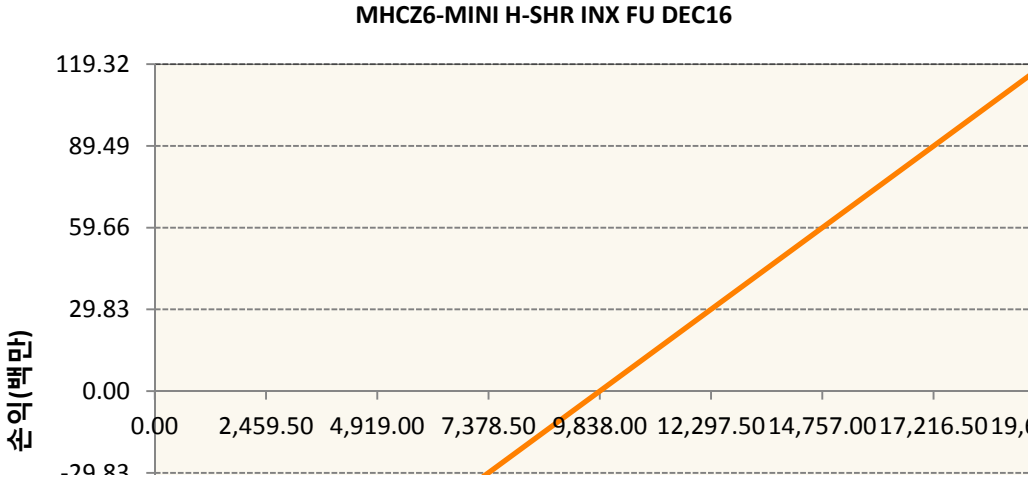
1. 계약금액

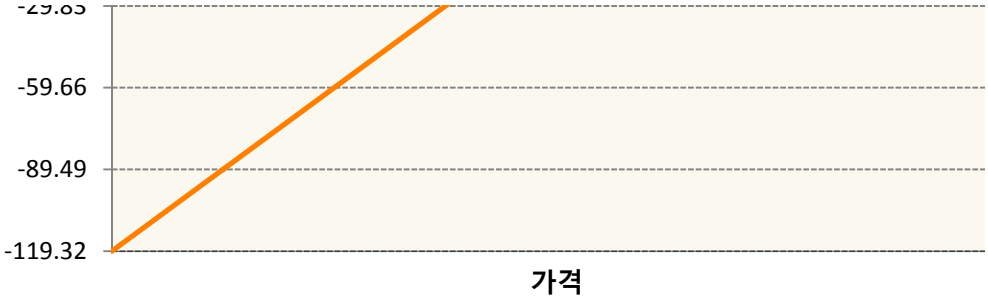
(단위:백만원)

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	1,566	0	1,566	
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	10

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	153

공시일	2016-12-08
기준일	2016-12-07

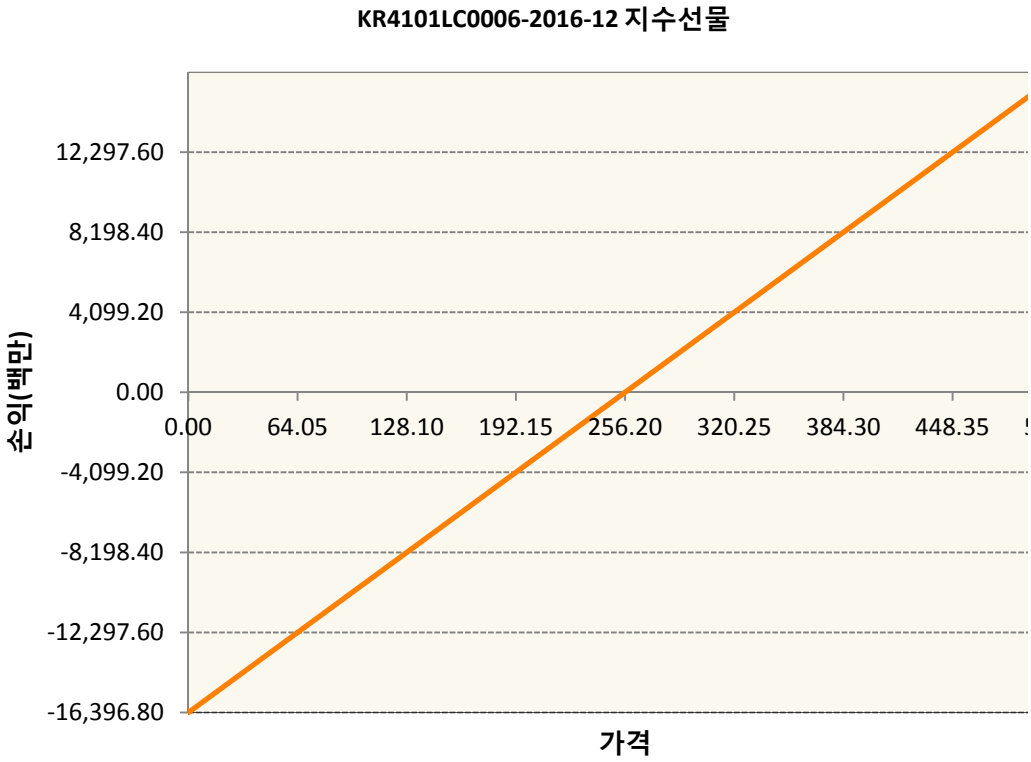
커버드콜(주식혼합-파생형)

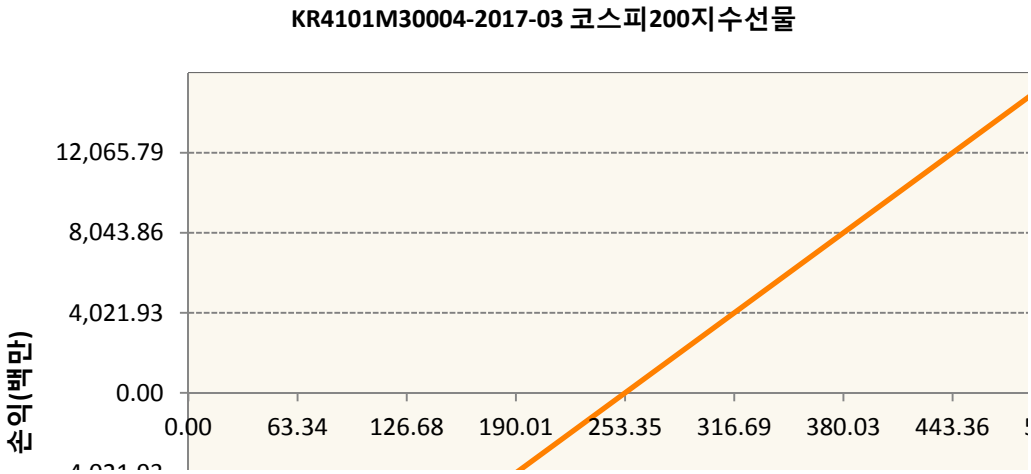
1. 계약금액

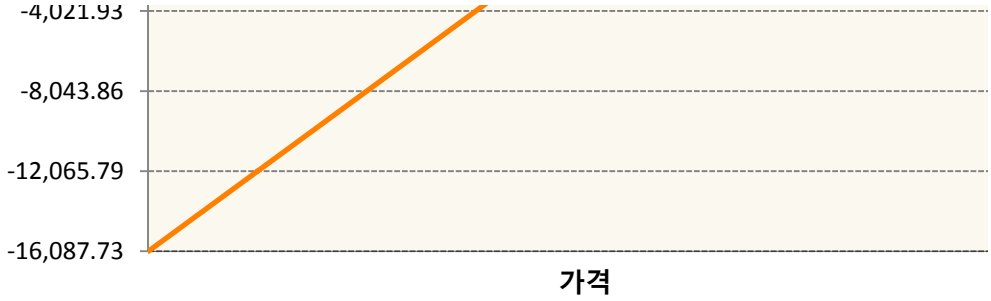
(단위:백만원)

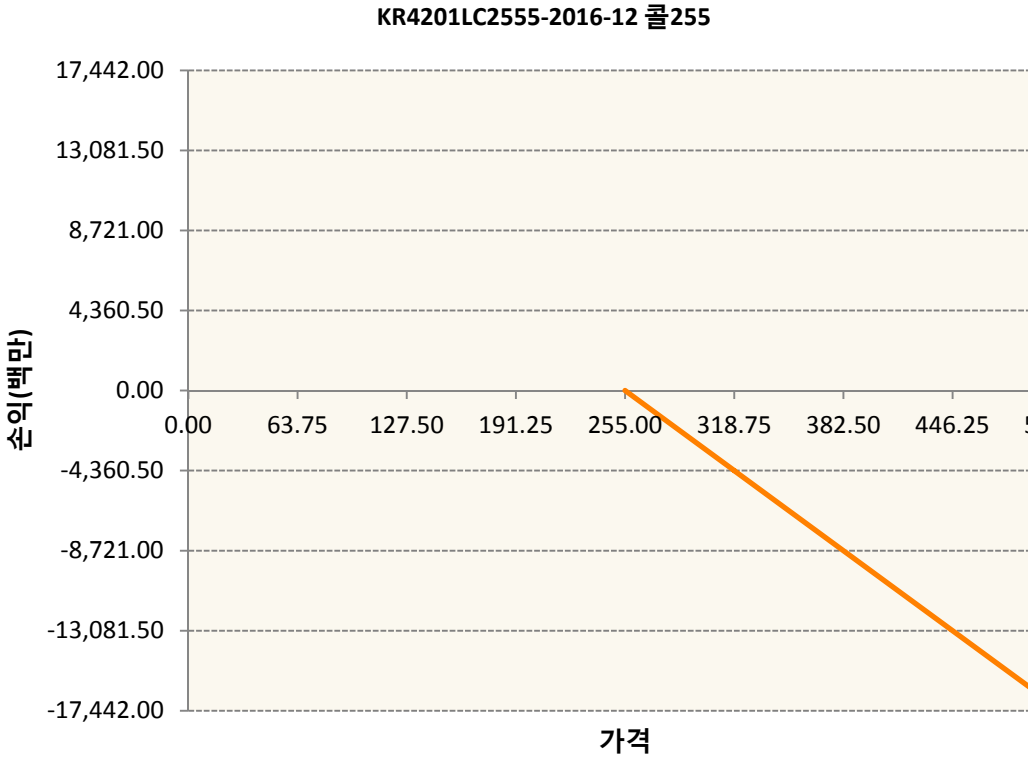
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	16,081	16,261	-180	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	32,485	0	32,485	장내
누계	유가증권	옵션	0	19,966	-19,966	장내

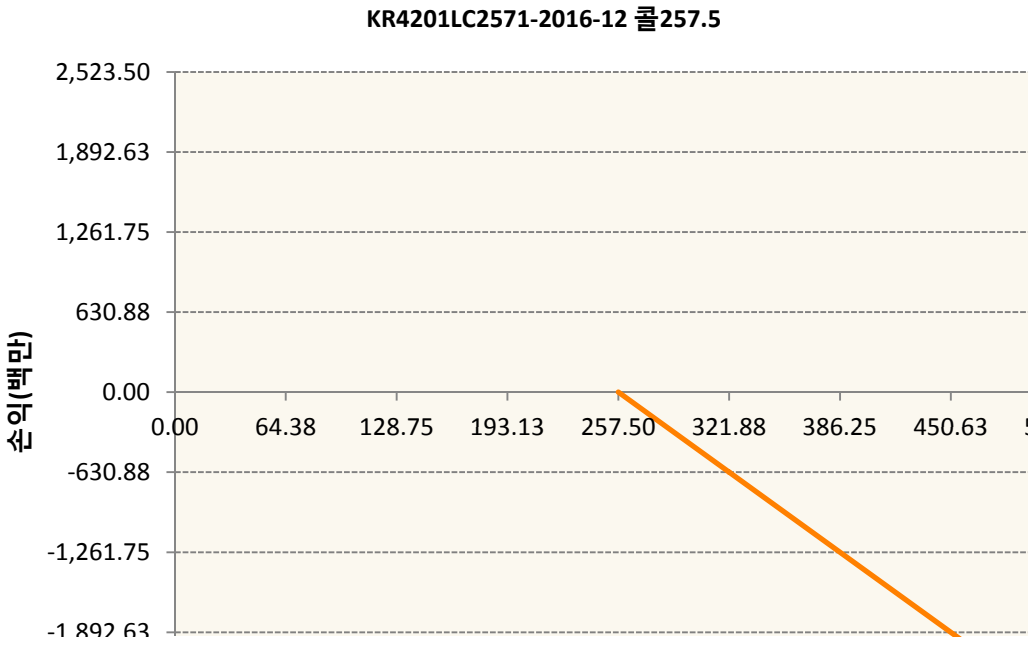
2. 만기시점의 손익구조

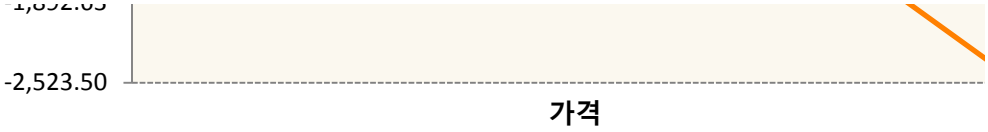





-4,021.93
-8,043.86
-12,065.79
-16,087.73
가격


KR4201LC2555-2016-12 콜255
17,442.00
13,081.50
8,721.00
4,360.50
0.00
-4,360.50
-8,721.00
-13,081.50
-17,442.00
0.00
63.75
127.50
191.25
255.00
318.75
382.50
446.25
순익(백만)
가격


KR4201LC2571-2016-12 콜257.5
2,523.50
1,892.63
1,261.75
630.88
0.00
-630.88
-1,261.75
-1,892.63
0.00
64.38
128.75
193.13
257.50
321.88
386.25
450.63
순익(백만)



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101LC00 2016-12 지수선물							1,312
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,312	-1,312	-1,312	-1,312	-1,312	-1,312	-1,312
-5.33%	-875	-875	-875	-875	-875	-875	-875
-2.67%	-437	-437	-437	-437	-437	-437	-437
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	437	437	437	437	437	437	437
5.33%	875	875	875	875	875	875	875
8.00%	1,312	1,312	1,312	1,312	1,312	1,312	1,312
KR4101M30(2017-03 코스피200지수선물							1,302
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,302	-1,302	-1,302	-1,302	-1,302	-1,302	-1,302
-5.33%	-868	-868	-868	-868	-868	-868	-868
-2.67%	-434	-434	-434	-434	-434	-434	-434
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	434	434	434	434	434	434	434
5.33%	868	868	868	868	868	868	868
8.00%	1,302	1,302	1,302	1,302	1,302	1,302	1,302
KR4201LC25 2016-12 콜255							6,958
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	514	514	514	514	514	514	514
-5.33%	514	514	514	514	514	514	514
-2.67%	514	514	514	514	514	514	513
0%	32	22	12	0	-12	-25	-39
2.67%	-2,282	-2,282	-2,282	-2,282	-2,282	-2,282	-2,282
5.33%	-4,620	-4,620	-4,620	-4,620	-4,620	-4,620	-4,620
8.00%	-6,958	-6,958	-6,958	-6,958	-6,958	-6,958	-6,958
KR4201LC25 2016-12 콜257.5							938
	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%	10	10	10	10	10	10	10
-2.67%	10	10	10	10	10	10	10

0%	5	4	2	0	-2	-4	-6
2.67%	-268	-268	-268	-268	-268	-268	-268
5.33%	-603	-603	-603	-603	-603	-603	-603
8.00%	-938	-938	-938	-938	-938	-938	-938

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

14,910

공시일	2016-12-08
기준일	2016-12-07

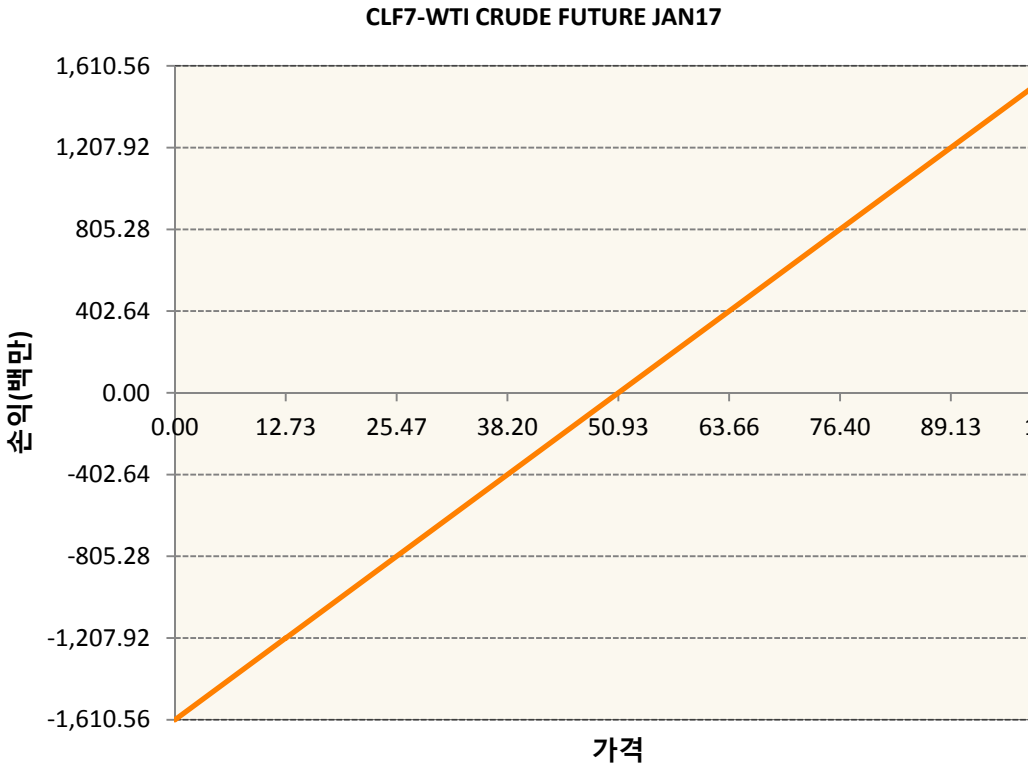
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

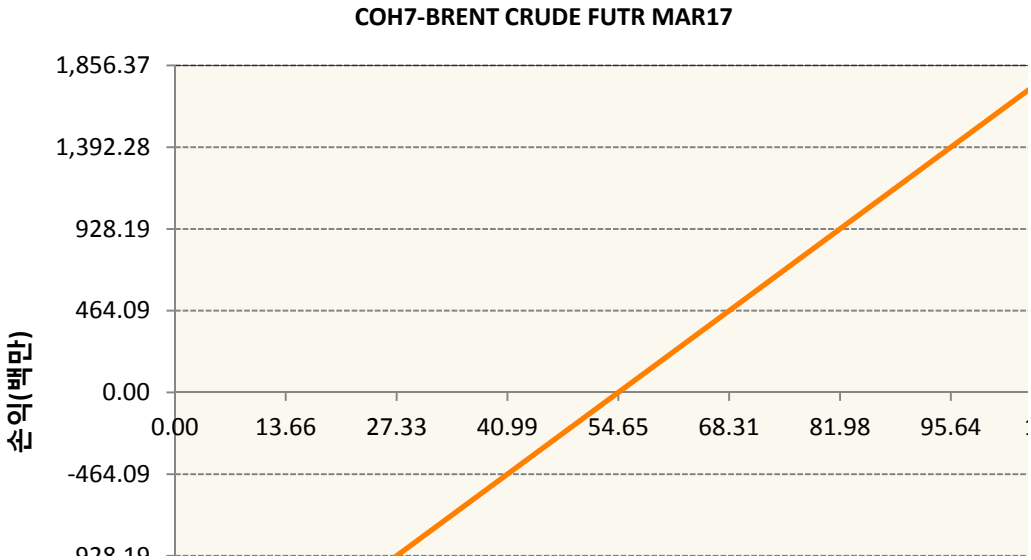
1. 계약금액

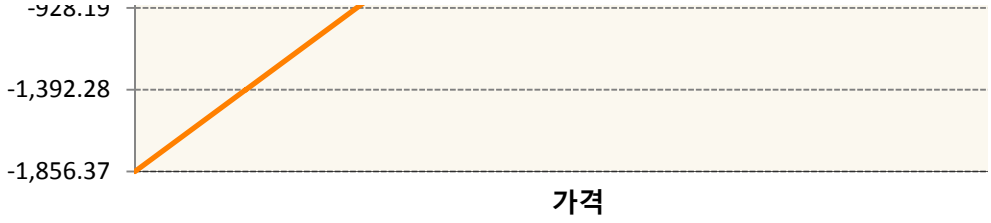
(단위:백만원)

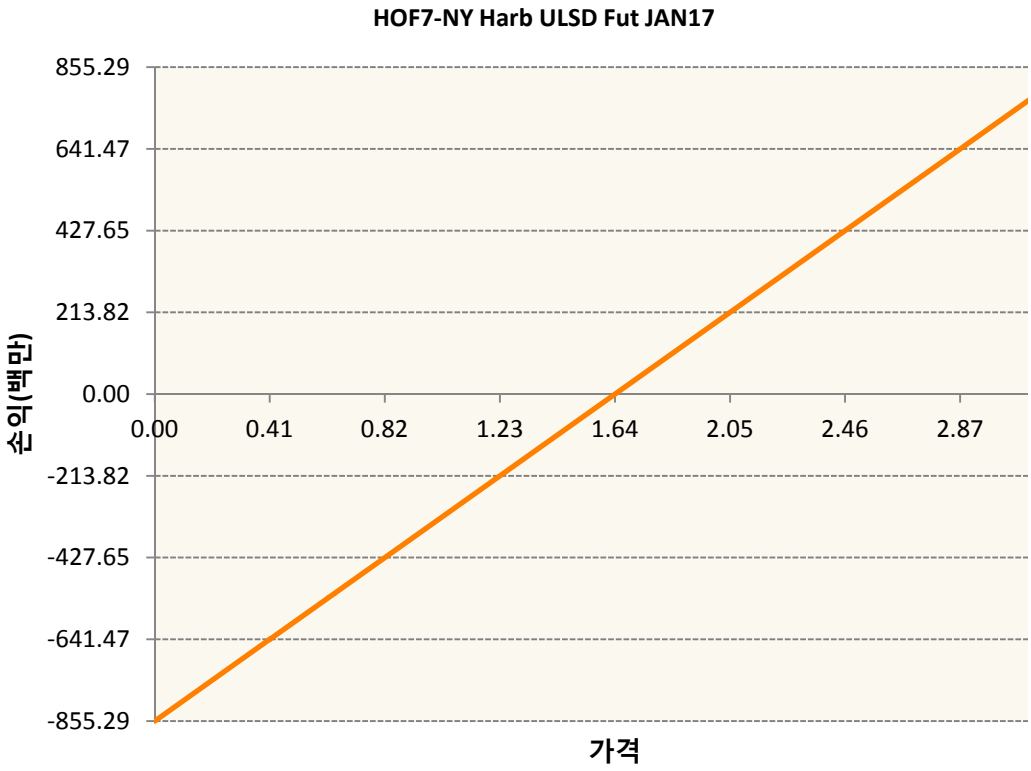
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	6,899	0	6,899	

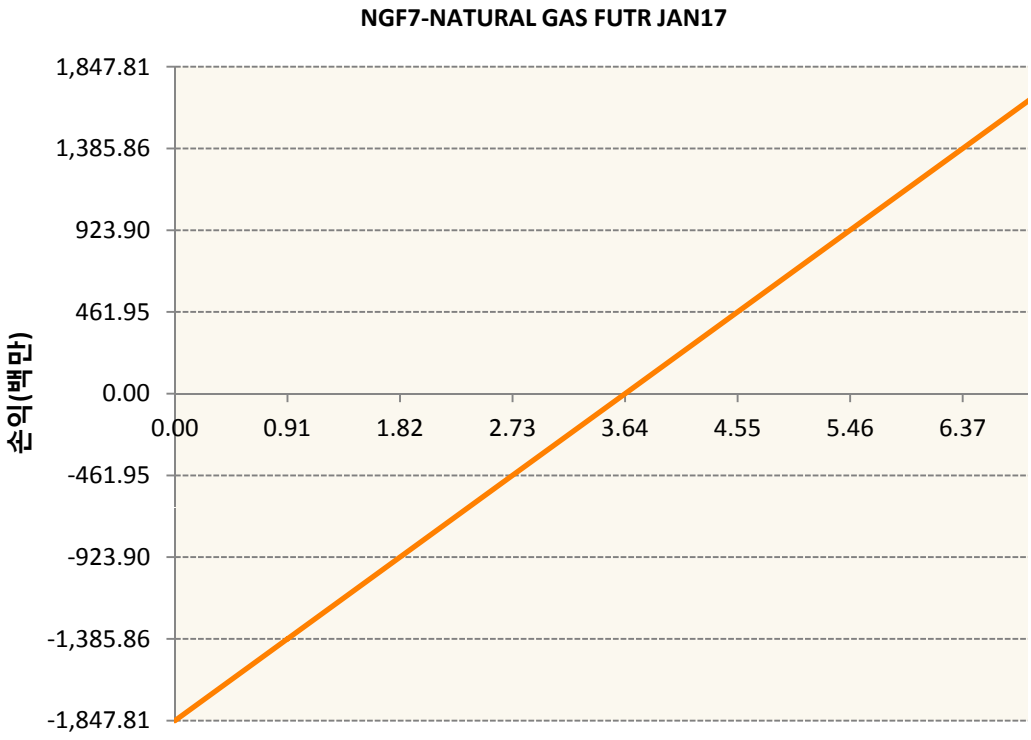
2. 만기시점의 손익구조



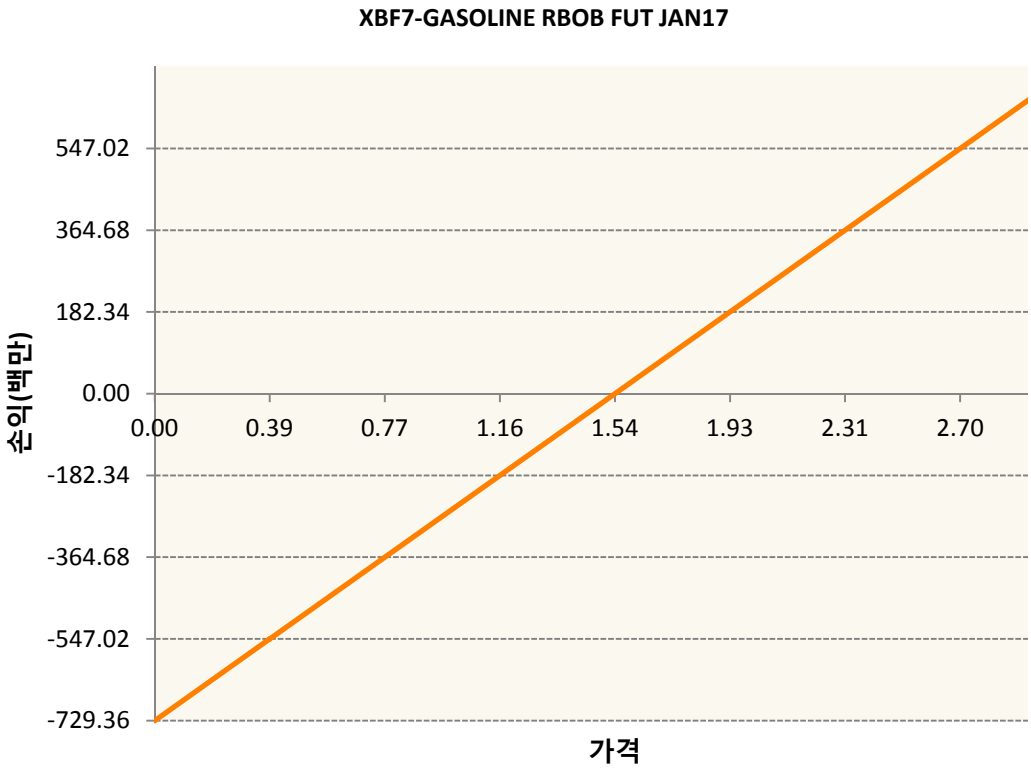



-928.19
-1,392.28
-1,856.37
가격


HOF7-NY Harb ULSD Fut JAN17
855.29
641.47
427.65
213.82
0.00
-213.82
-427.65
-641.47
-855.29
0.00
0.41
0.82
1.23
1.64
2.05
2.46
2.87
손익(백만)
가격


NGF7-NATURAL GAS FUTR JAN17
1,847.81
1,385.86
923.90
461.95
0.00
-461.95
-923.90
-1,385.86
-1,847.81
0.00
0.91
1.82
2.73
3.64
4.55
5.46
6.37
손익(백만)

가격



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
CLF7	WTI CRUDE FUTURE JAN17	129
COH7	BRENT CRUDE FUTR MAR17	149
HOF7	NY Harb ULSD Fut JAN17	68
NGF7	NATURAL GAS FUTR JAN17	148
XBF7	GASOLINE RBOB FUT JAN17	58

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,253

공시일	2016-12-08
기준일	2016-12-07

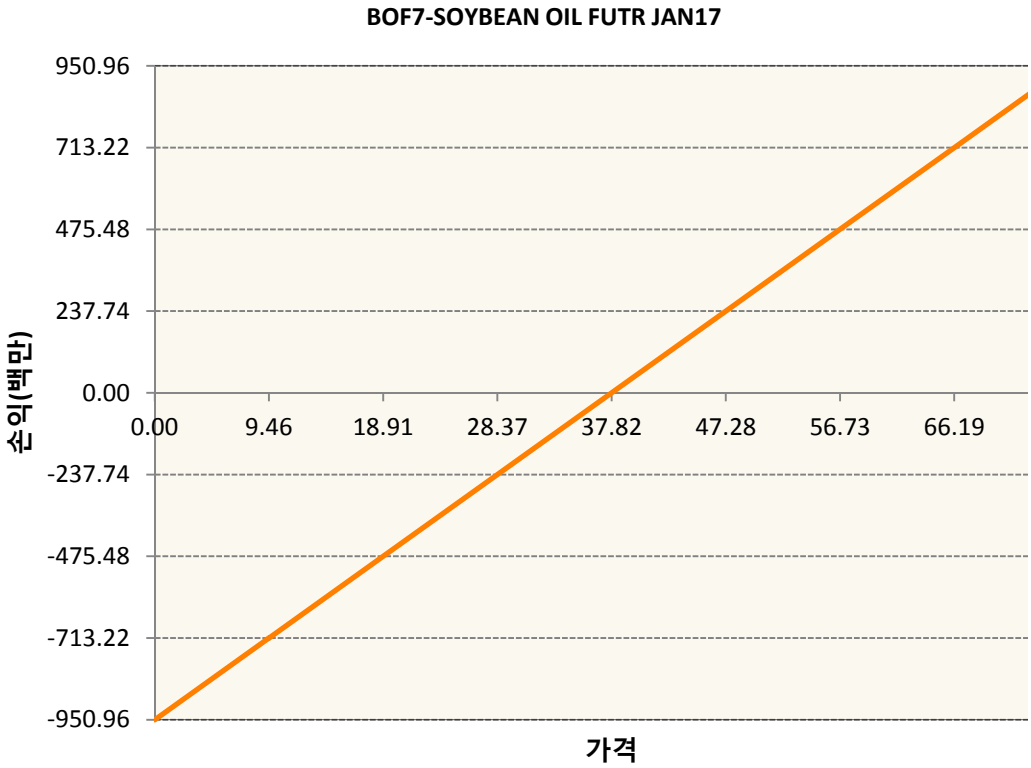
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

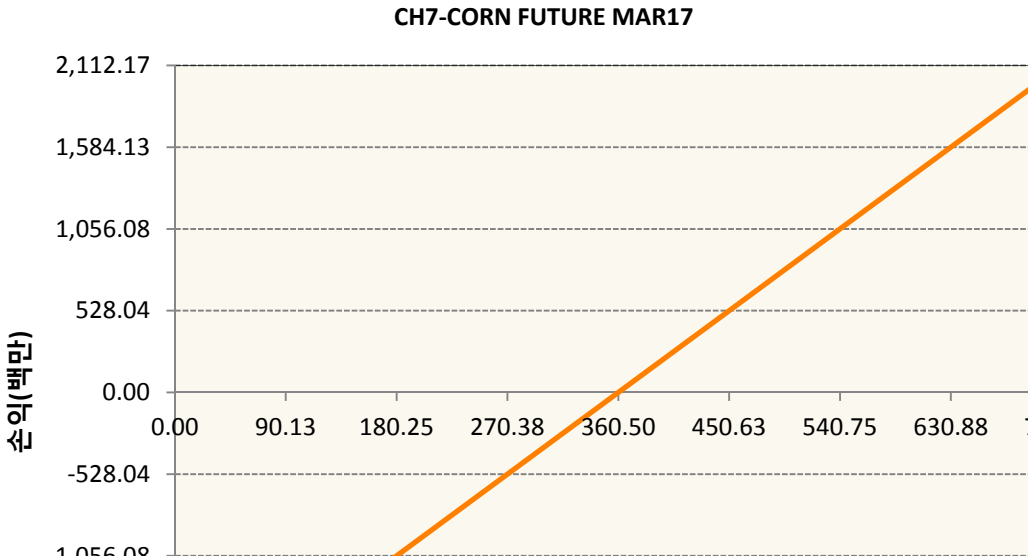
1. 계약금액

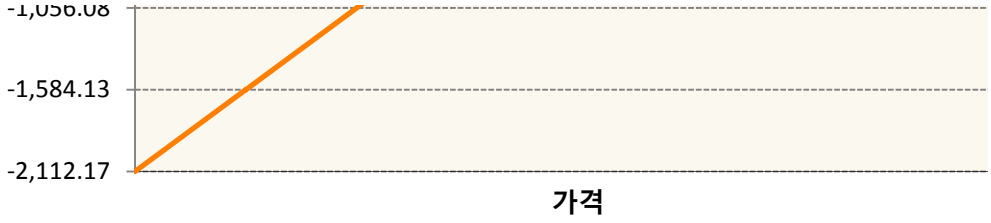
(단위:백만원)

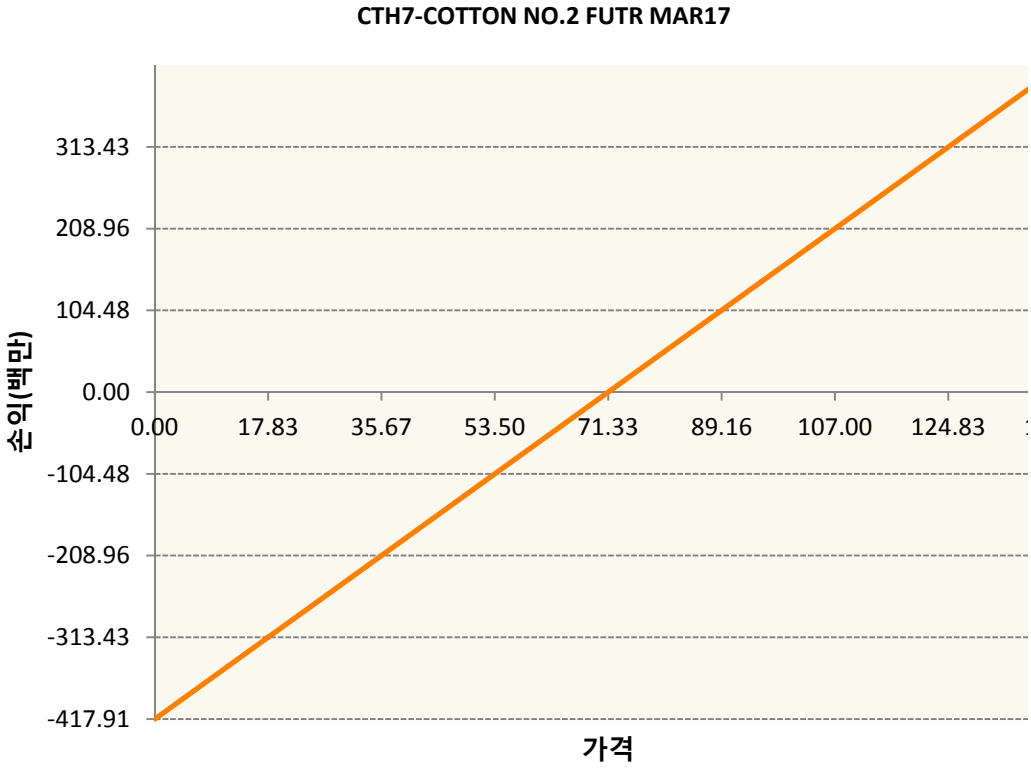
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	9,173	0	9,173	

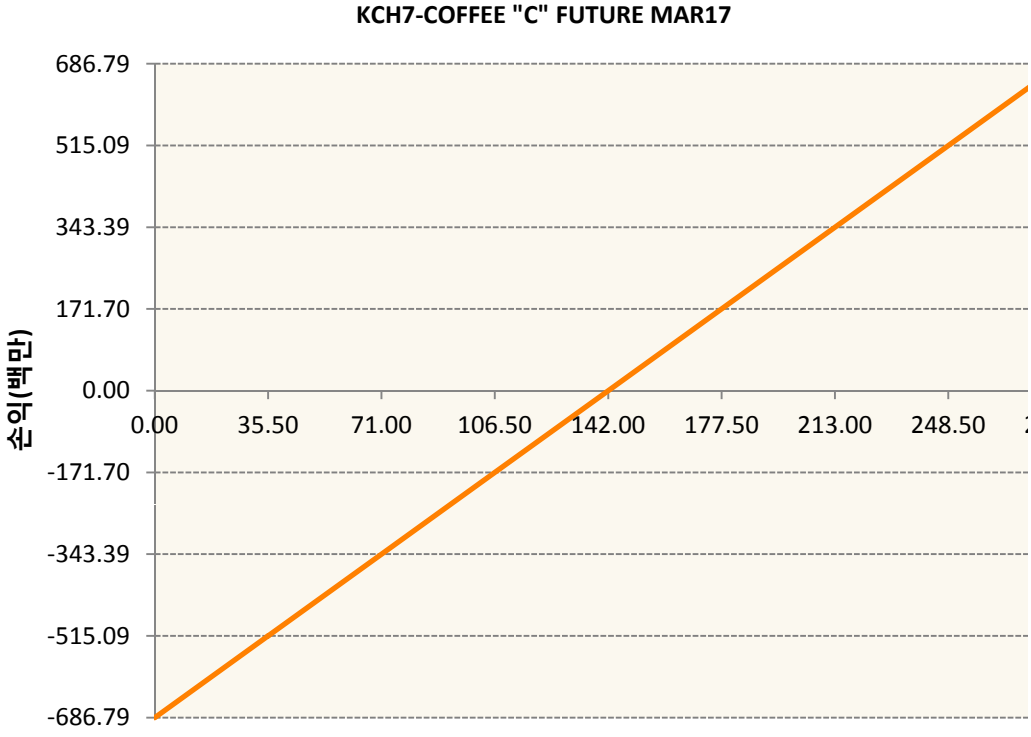
2. 만기시점의 손익구조



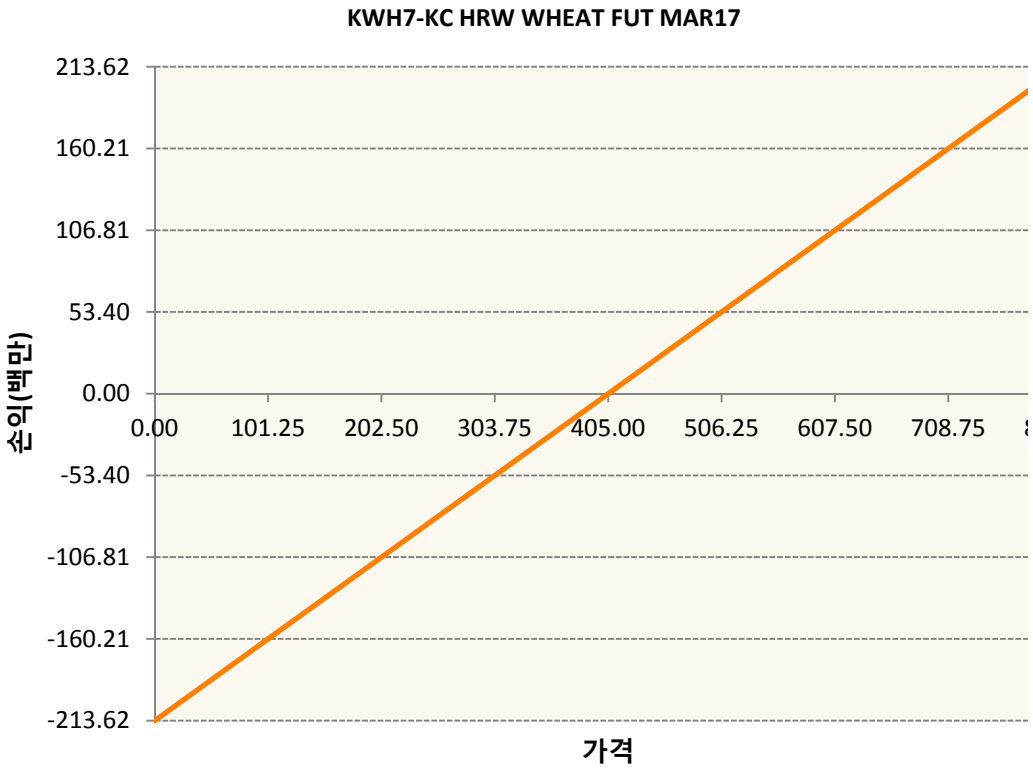


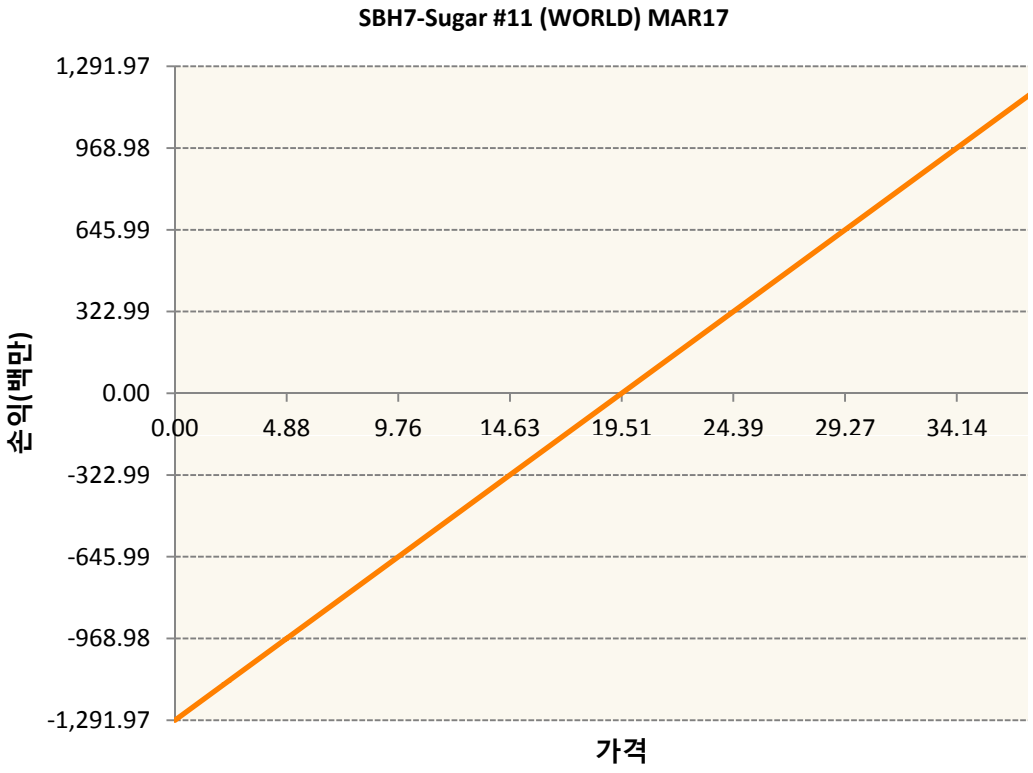

-1,584.13
-2,112.17
가격

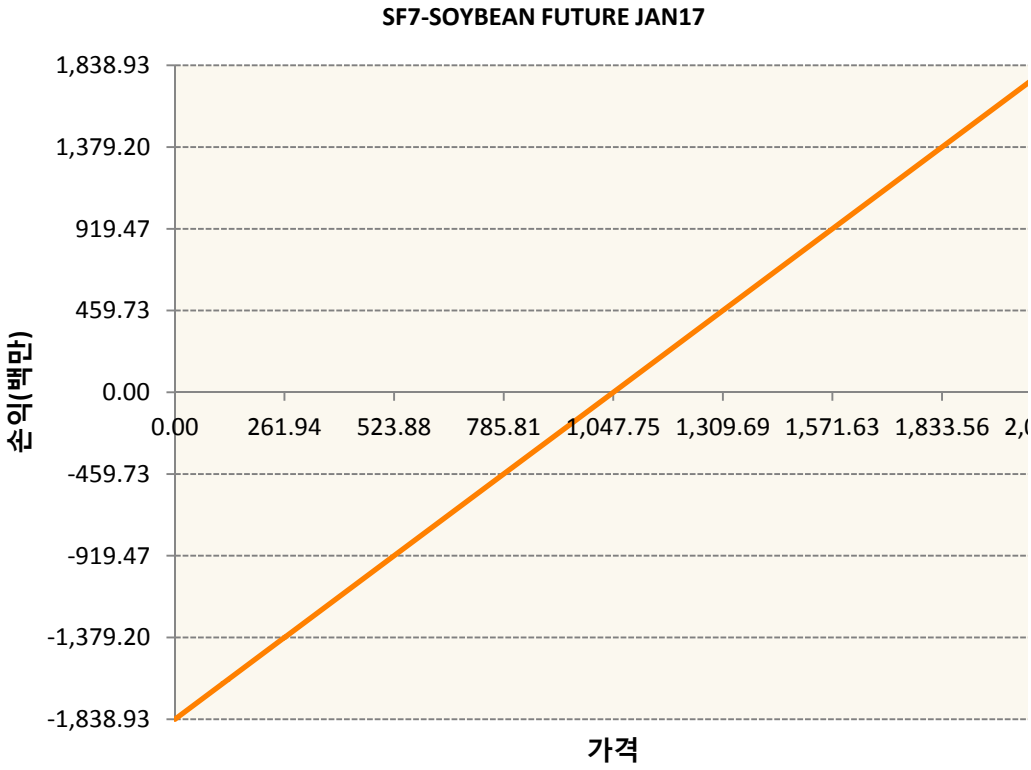

CTH7-COTTON NO.2 FUTR MAR17
313.43
208.96
104.48
0.00
-104.48
-208.96
-313.43
-417.91
0.00
17.83
35.67
53.50
71.33
89.16
107.00
124.83
손익(백만)
가격

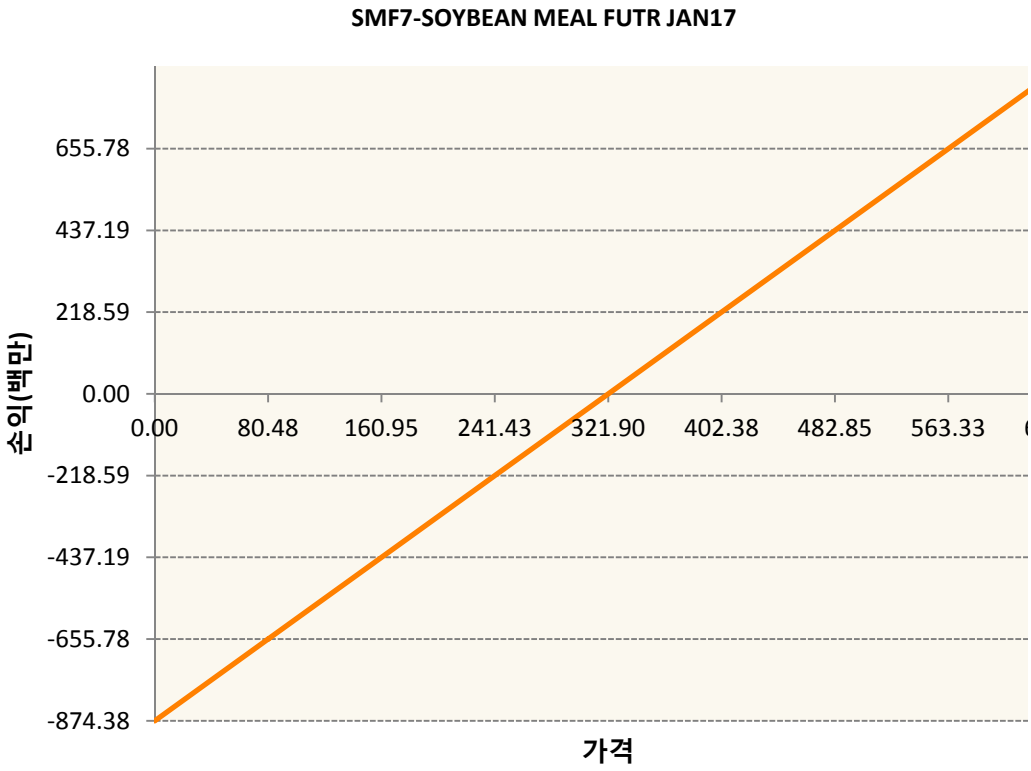

KCH7-COFFEE "C" FUTURE MAR17
686.79
515.09
343.39
171.70
0.00
-171.70
-343.39
-515.09
-686.79
0.00
35.50
71.00
106.50
142.00
177.50
213.00
248.50
손익(백만)

가격

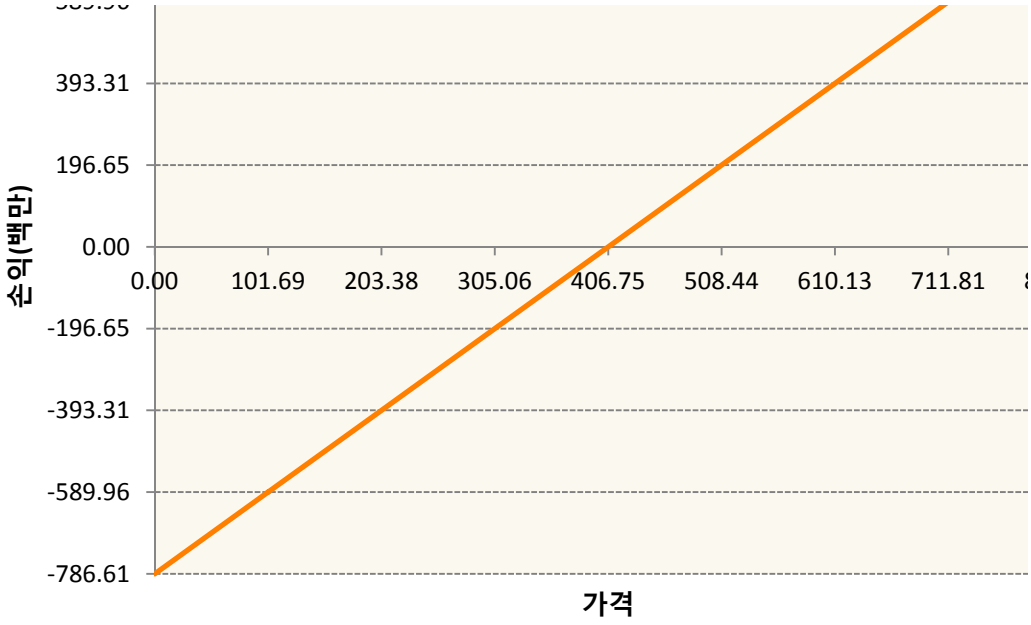

KWH7-KC HRW WHEAT FUT MAR17
213.62
160.21
106.81
53.40
0.00
-53.40
-106.81
-160.21
-213.62
0.00
101.25
202.50
303.75
405.00
506.25
607.50
708.75
손익(백만)
가격


SBH7-Sugar #11 (WORLD) MAR17
1,291.97
968.98
645.99
322.99
0.00
-322.99
-645.99
-968.98
-1,291.97
0.00
4.88
9.76
14.63
19.51
24.39
29.27
34.14
손익(백만)
가격


SF7-SOYBEAN FUTURE JAN17
1,838.93
1,379.20
919.47
459.73
0.00
-459.73
-919.47
-1,379.20
-1,838.93
0.00
261.94
523.88
785.81
1,047.75
1,309.69
1,571.63
1,833.56
손익(백만)
가격


SMF7-SOYBEAN MEAL FUTR JAN17
655.78
437.19
218.59
0.00
-218.59
-437.19
-655.78
-874.38
0.00
80.48
160.95
241.43
321.90
402.38
482.85
563.33
손익(백만)
가격


WH7-WHEAT FUTURE(CBT) MAR17
786.61
589.96



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
BOF7	SOYBEAN OIL FUTR JAN17	76
CH7	CORN FUTURE MAR17	169
CTH7	COTTON NO.2 FUTR MAR17	33
KCH7	COFFEE "C" FUTURE MAR17	55
KWH7	KC HRW WHEAT FUT MAR17	17
SBH7	Sugar #11 (WORLD) MAR17	103
SF7	SOYBEAN FUTURE JAN17	147
SMF7	SOYBEAN MEAL FUTR JAN17	70
WH7	WHEAT FUTURE(CBT) MAR17	63

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	896