공시일	2016-12-09
기준일	2016-12-08

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	2016-12-09
기준일	2016-12-08

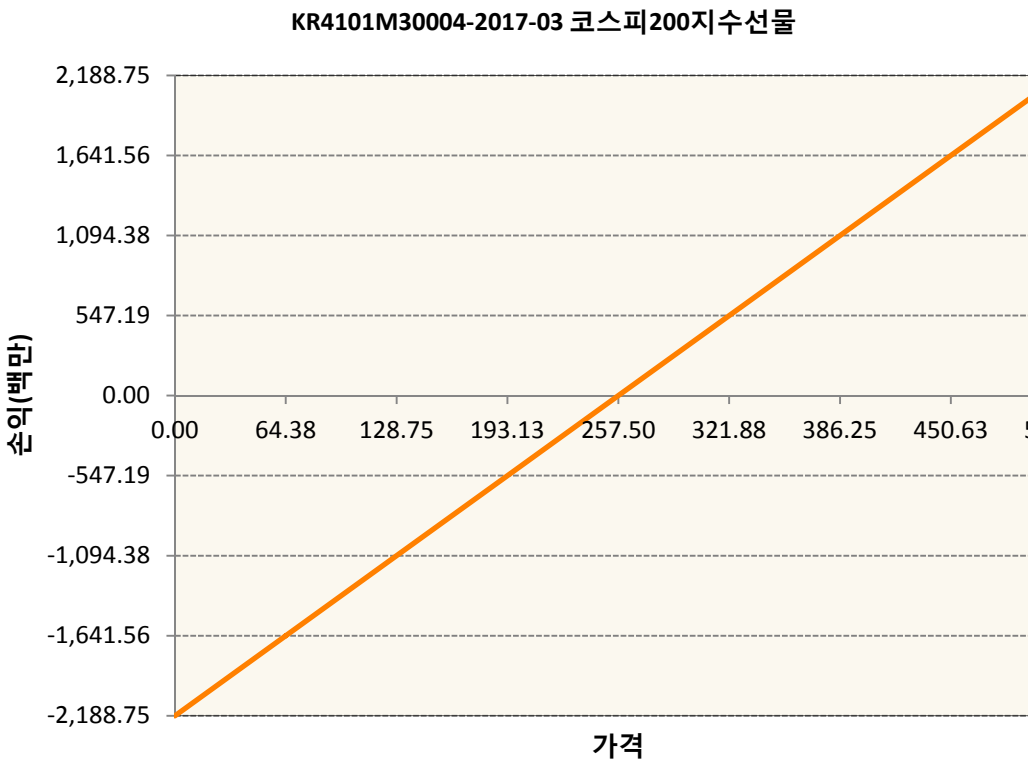
스마트인덱스모

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	1,028	0	1,028	장내
누계	유가증권	선물	2,189	0	2,189	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101M30(2017-03 코스피200지수선물							178
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-178	-178	-178	-178	-178	-178	-178
-5.33%	-119	-119	-119	-119	-119	-119	-119
-2.67%	-59	-59	-59	-59	-59	-59	-59
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	59	59	59	59	59	59	59
5.33%	119	119	119	119	119	119	119
8.00%	178	178	178	178	178	178	178

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

136

공시일	2016-12-09
기준일	2016-12-08

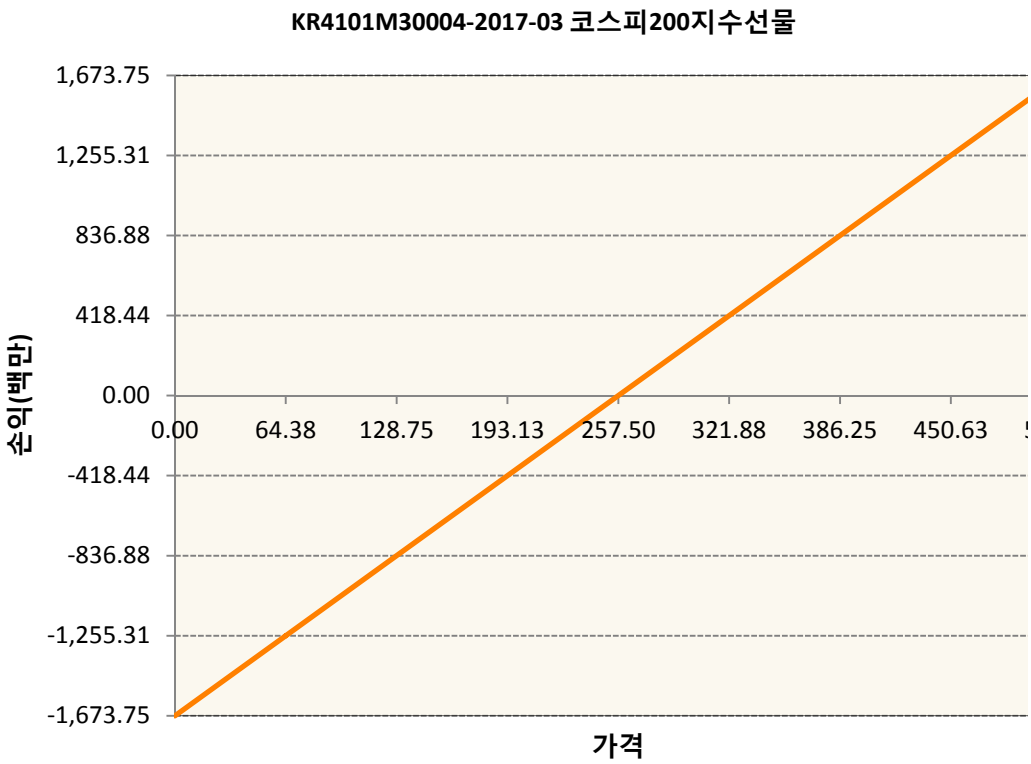
스마트레버리지목표전환형1호

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	900	0	900	장내
누계	유가증권	선물	1,674	0	1,674	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101M30(2017-03 코스피200지수선물							136
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-136	-136	-136	-136	-136	-136	-136
-5.33%	-91	-91	-91	-91	-91	-91	-91
-2.67%	-45	-45	-45	-45	-45	-45	-45
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	45	45	45	45	45	45	45
5.33%	91	91	91	91	91	91	91
8.00%	136	136	136	136	136	136	136

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

104

공시일	2016-12-09
기준일	2016-12-08

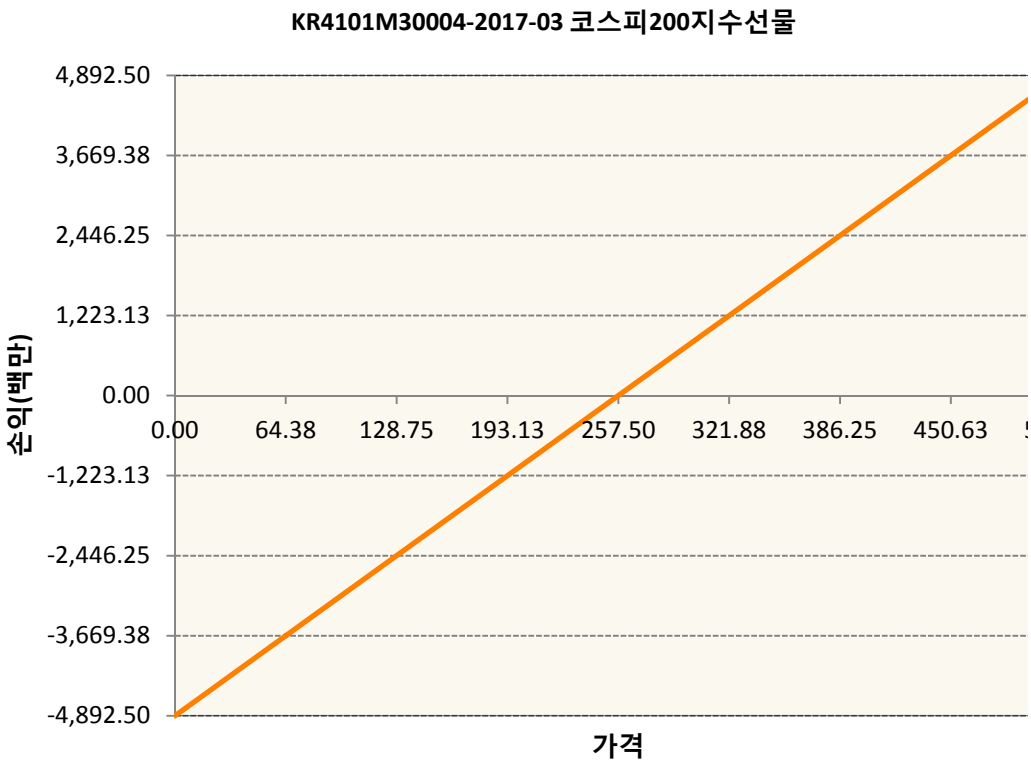
1.3배 레버리지 인덱스(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	2,570	0	2,570	장내
누계	유가증권	선물	4,893	0	4,893	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101M30(2017-03 코스피200지수선물							398
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-398	-398	-398	-398	-398	-398	-398
-5.33%	-265	-265	-265	-265	-265	-265	-265
-2.67%	-133	-133	-133	-133	-133	-133	-133
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	133	133	133	133	133	133	133
5.33%	265	265	265	265	265	265	265
8.00%	398	398	398	398	398	398	398

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

304

공시일	2016-12-09
기준일	2016-12-08

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	901

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

726

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2016-12-09
기준일	2016-12-08

SMART중국본토중소형CSI500상장

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	4,972	0	4,972	장외
누계	지수	스왑	4,972	0	4,972	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI50000 신한CSI500미래S161208	396

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

726

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2016-12-09
기준일	2016-12-08

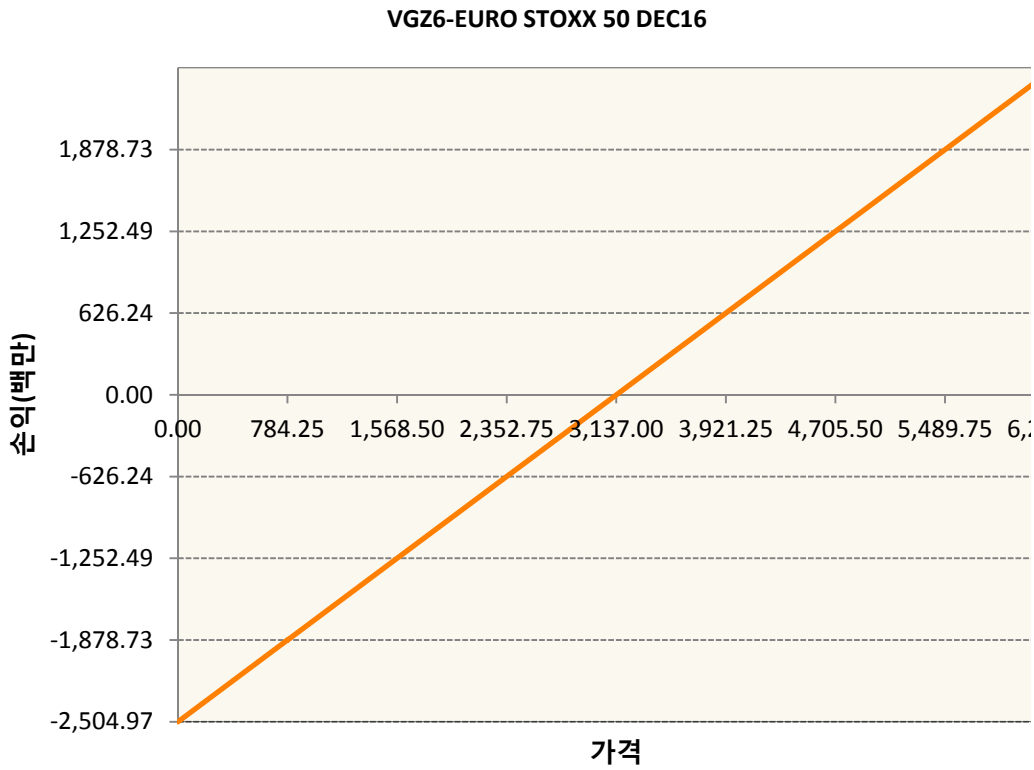
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,505	0	2,505	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGZ6	EURO STOXX 50 DEC16	200

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

(단위:백만원)

233

공시일	2016-12-09
기준일	2016-12-08

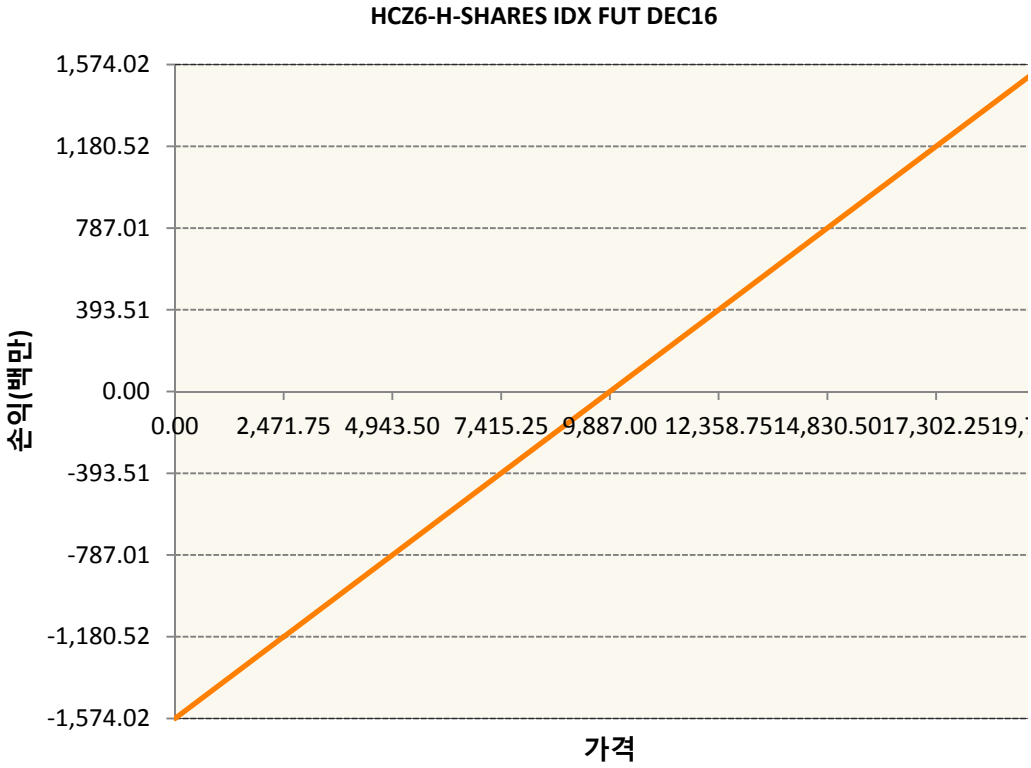
차이나인덱스모(주식-파생형)

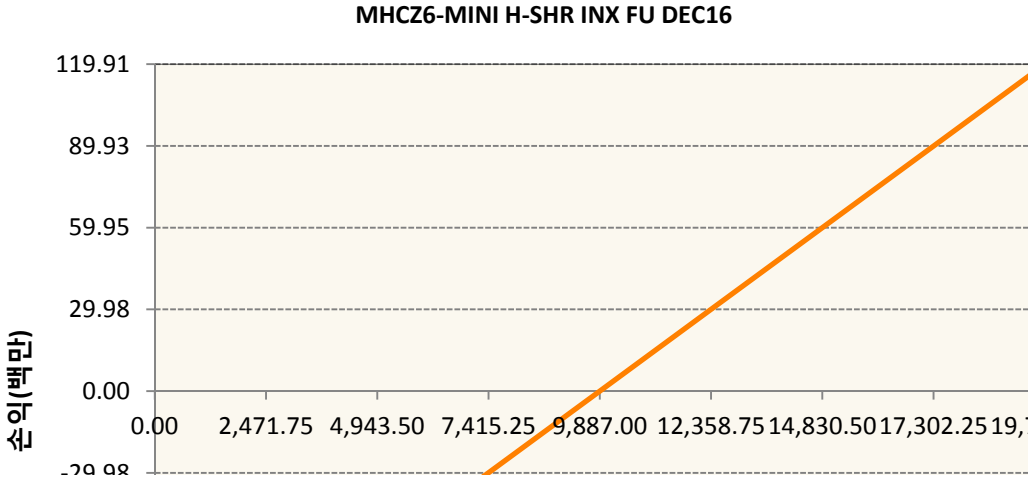
1. 계약금액

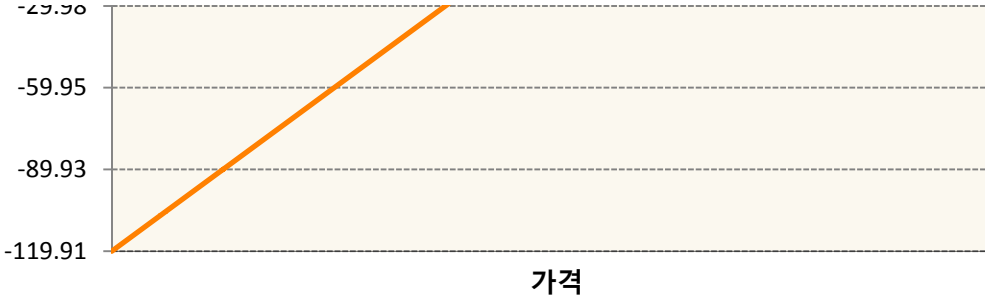
(단위:백만원)

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	1,574	0	1,574	
누계	유가증권	선물	120	0	120	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCZ6	H-SHARES IDX FUT DEC16	126
MHCZ6	MINI H-SHR INX FU DEC16	10

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

공시일	2016-12-09
기준일	2016-12-08

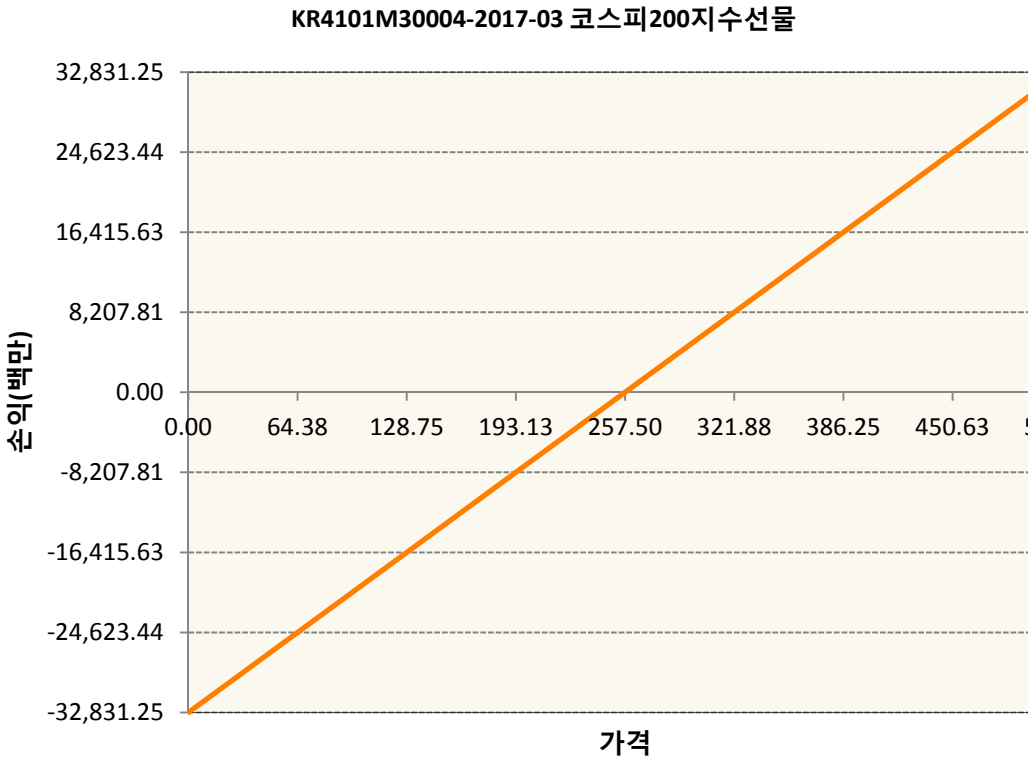
커버드콜(주식혼합-파생형)

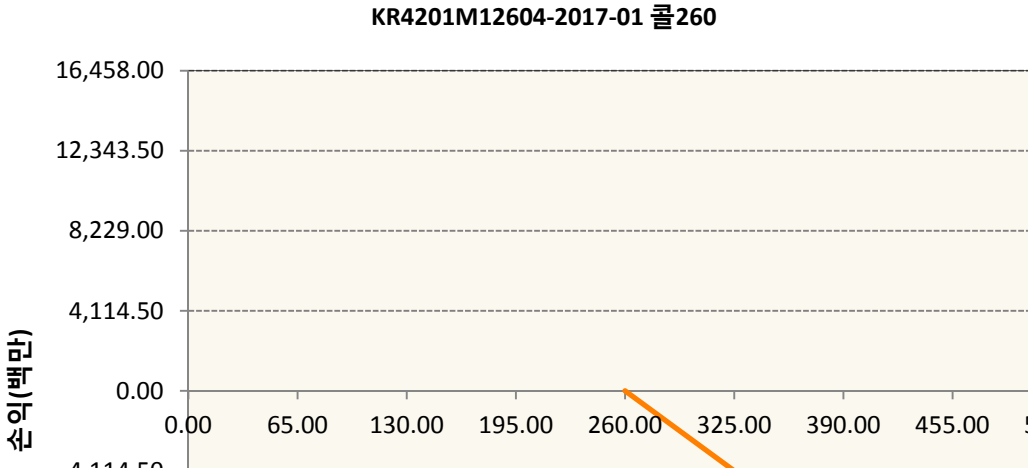
1. 계약금액

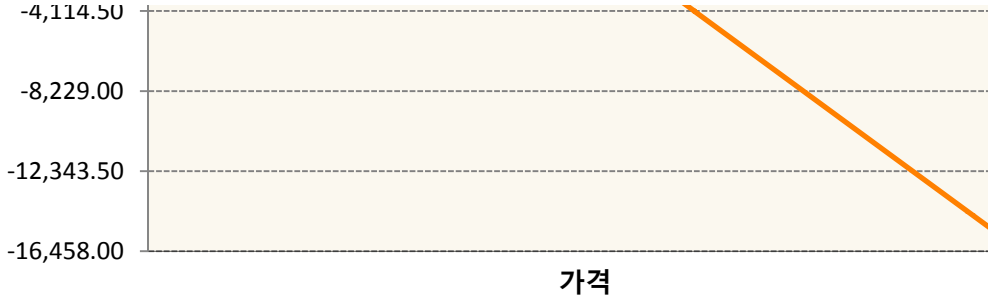
(단위:백만원)

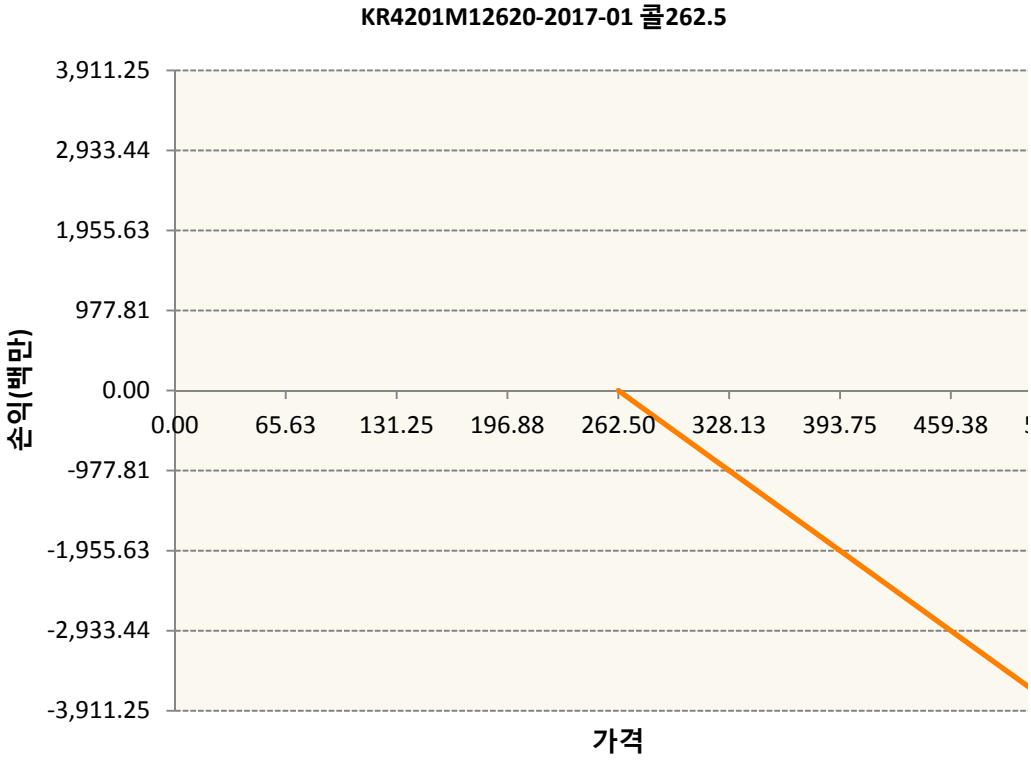
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	16,445	0	16,445	장내
신규	유가증권	옵션	0	20,493	-20,493	장내
누계	유가증권	선물	32,831	0	32,831	장내
누계	유가증권	옵션	0	20,369	-20,369	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101M30(2017-03 코스피200지수선물							2,672
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-2,672	-2,672	-2,672	-2,672	-2,672	-2,672	-2,672
-5.33%	-1,782	-1,782	-1,782	-1,782	-1,782	-1,782	-1,782
-2.67%	-891	-891	-891	-891	-891	-891	-891
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	891	891	891	891	891	891	891
5.33%	1,782	1,782	1,782	1,782	1,782	1,782	1,782
8.00%	2,672	2,672	2,672	2,672	2,672	2,672	2,672
KR4201M12(2017-01 콜260							5,772
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,528	1,525	1,520	1,511	1,499	1,482	1,461
-5.33%	1,494	1,469	1,438	1,400	1,356	1,307	1,253
-2.67%	1,223	1,146	1,065	982	896	809	721
0%	288	193	96	0	-97	-194	-291
2.67%	-1,423	-1,473	-1,529	-1,591	-1,657	-1,728	-1,802
5.33%	-3,529	-3,541	-3,558	-3,581	-3,610	-3,644	-3,684
8.00%	-5,727	-5,728	-5,731	-5,736	-5,744	-5,756	-5,772
	KR4201M12(	2017-01 콜262.5					1,278

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	262	262	262	260	259	256	253
-5.33%	259	256	251	246	238	230	220
-2.67%	225	211	196	179	162	144	126
0%	70	47	23	0	-23	-47	-70
2.67%	-273	-290	-307	-326	-345	-365	-385
5.33%	-747	-752	-759	-767	-777	-788	-800
8.00%	-1,260	-1,261	-1,262	-1,264	-1,268	-1,272	-1,278

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

10,009

공시일	2016-12-09
기준일	2016-12-08

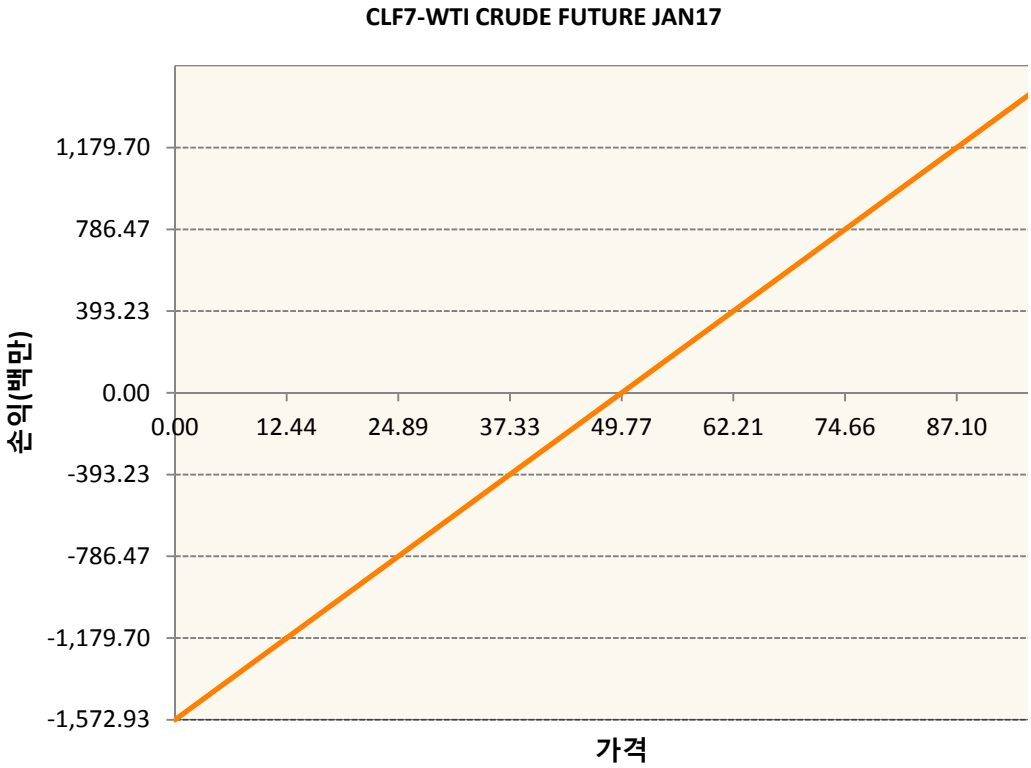
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

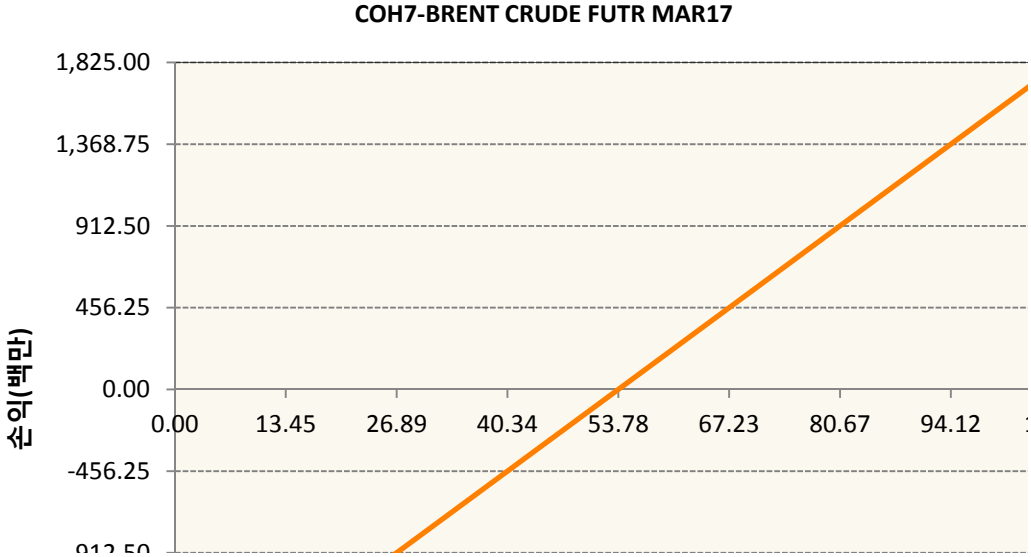
1. 계약금액

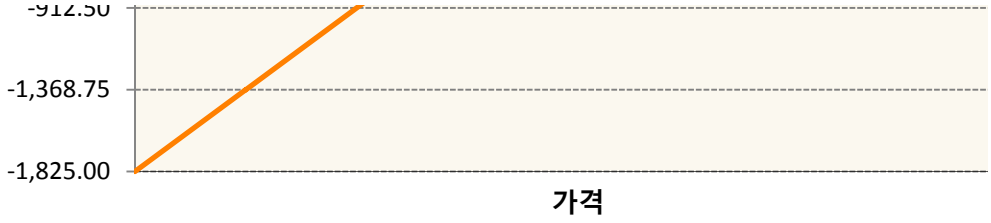
(단위:백만원)

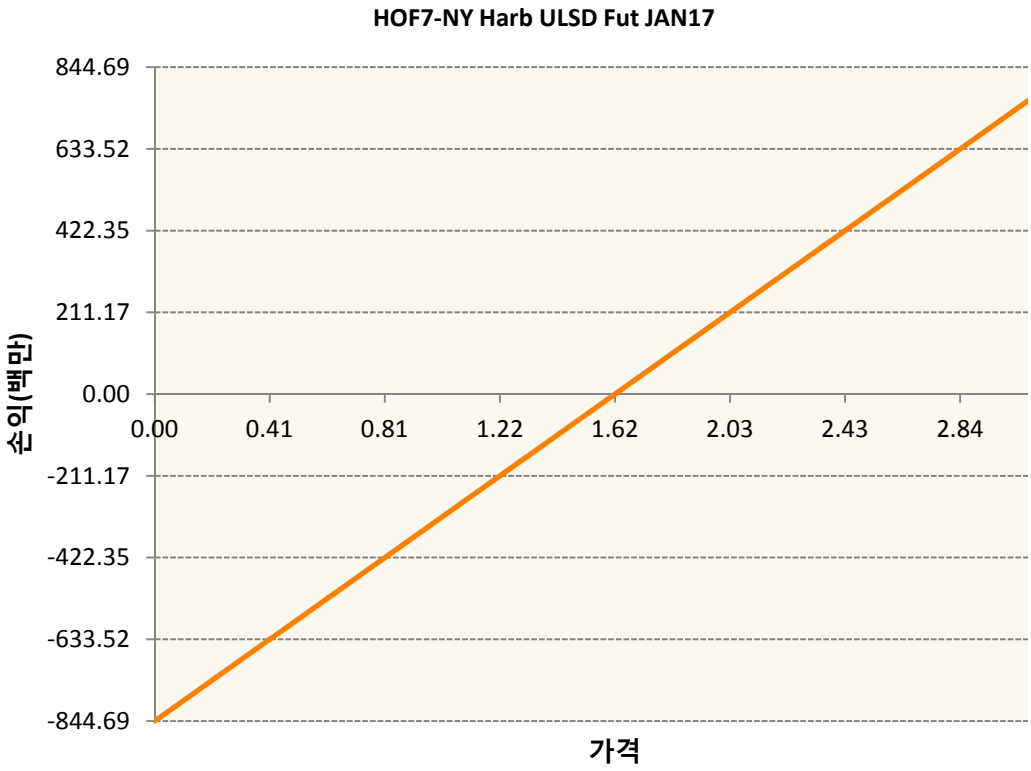
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	6,789	0	6,789	

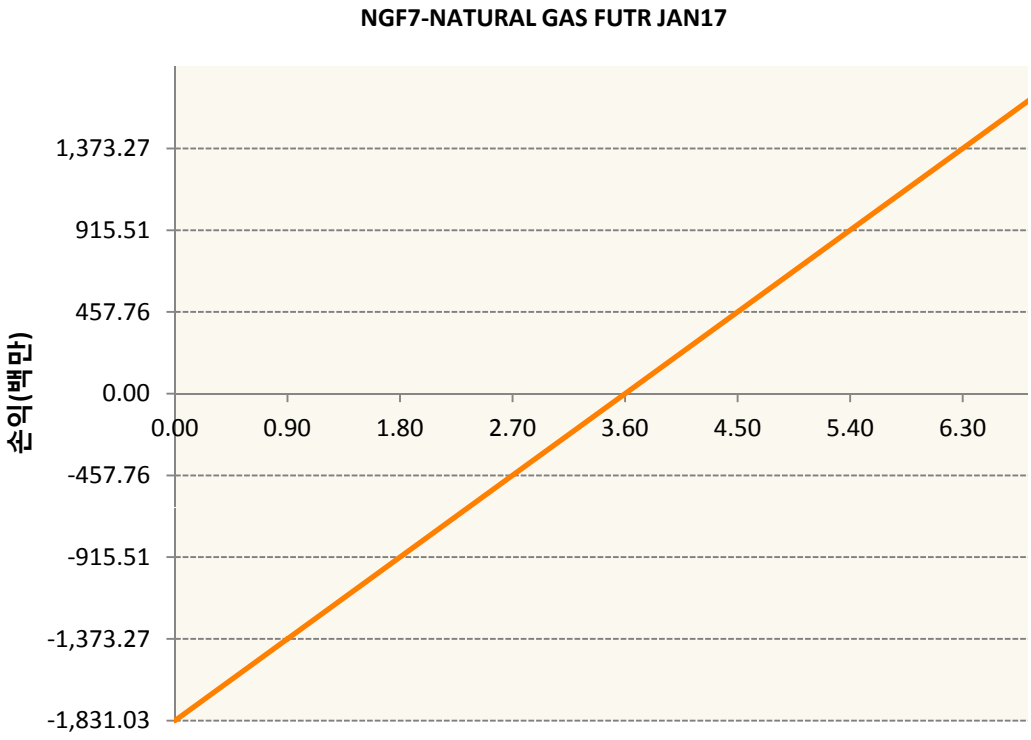
2. 만기시점의 손익구조



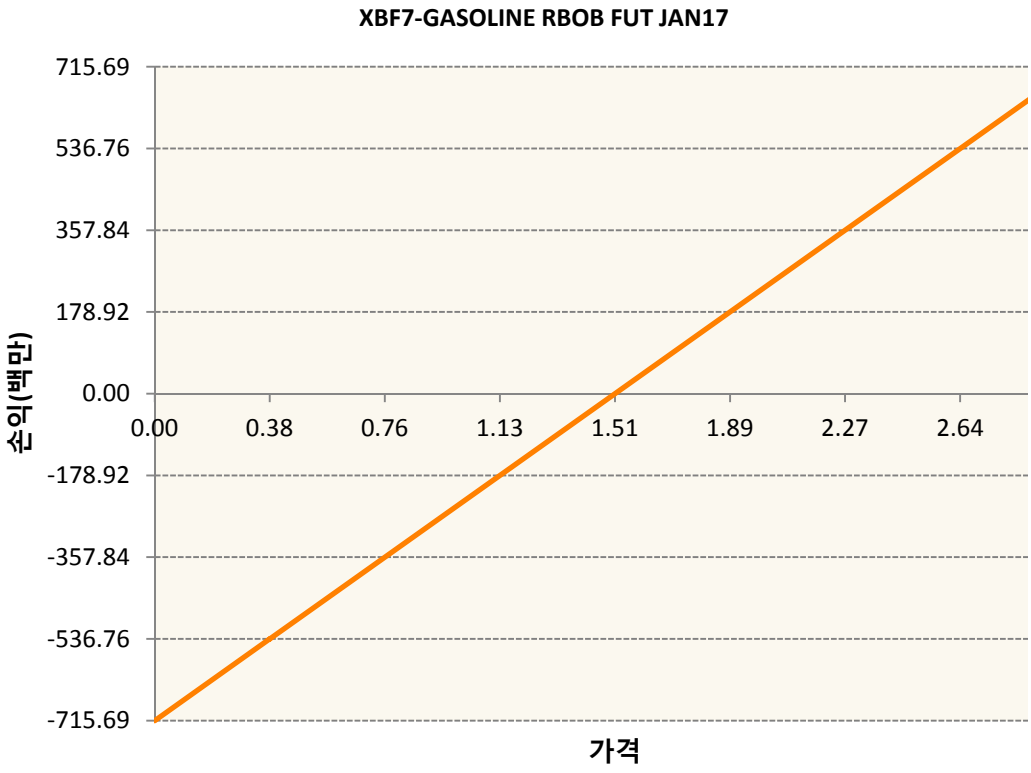



-912.50
-1,368.75
-1,825.00
가격


HOF7-NY Harb ULSD Fut JAN17
844.69
633.52
422.35
211.17
0.00
-211.17
-422.35
-633.52
-844.69
0.00
0.41
0.81
1.22
1.62
2.03
2.43
2.84
손익(백만)
가격


NGF7-NATURAL GAS FUTR JAN17
1,373.27
915.51
457.76
0.00
-457.76
-915.51
-1,373.27
-1,831.03
0.00
0.90
1.80
2.70
3.60
4.50
5.40
6.30
손익(백만)

가격



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
CLF7	WTI CRUDE FUTURE JAN17	126
COH7	BRENT CRUDE FUTR MAR17	146
HOF7	NY Harb ULSD Fut JAN17	68
NGF7	NATURAL GAS FUTR JAN17	146
XBF7	GASOLINE RBOB FUT JAN17	57

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,233

공시일	2016-12-09
기준일	2016-12-08

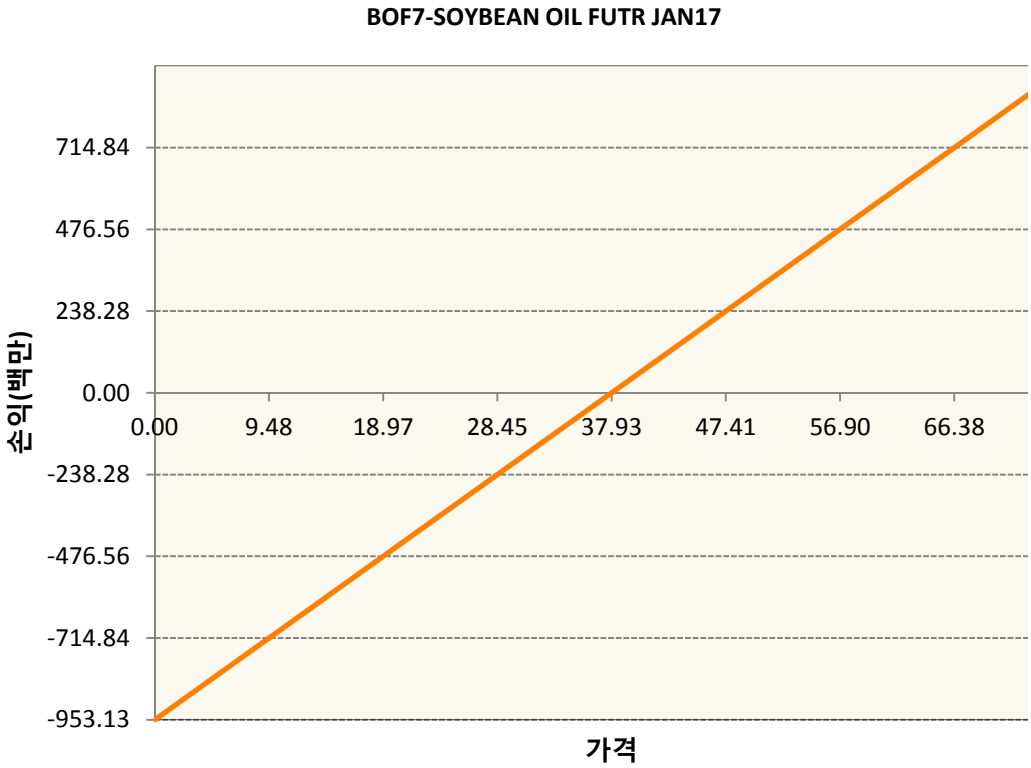
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

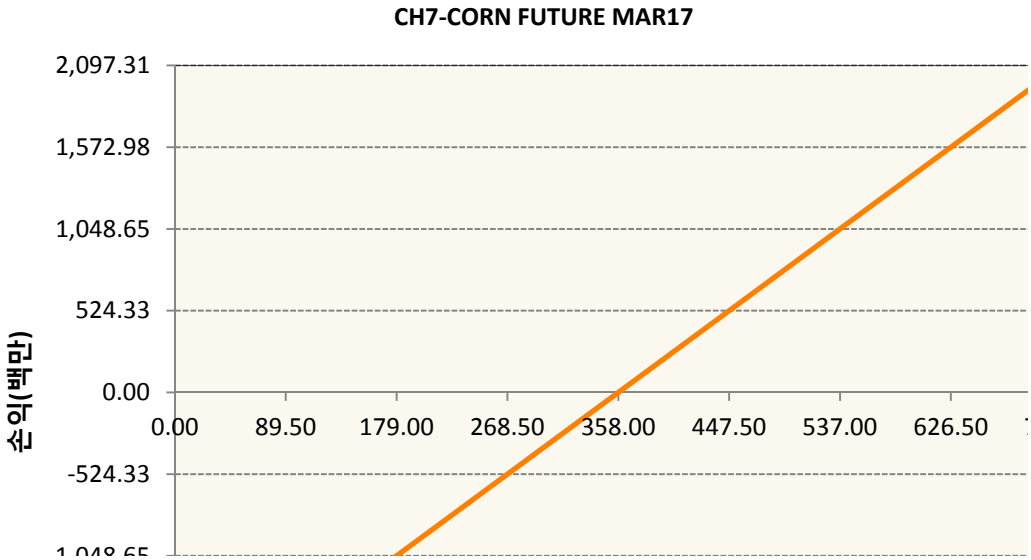
1. 계약금액

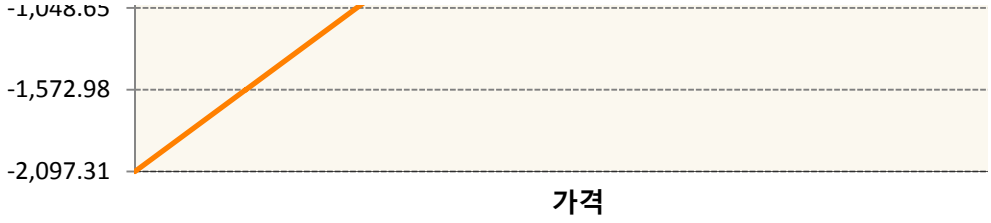
(단위:백만원)

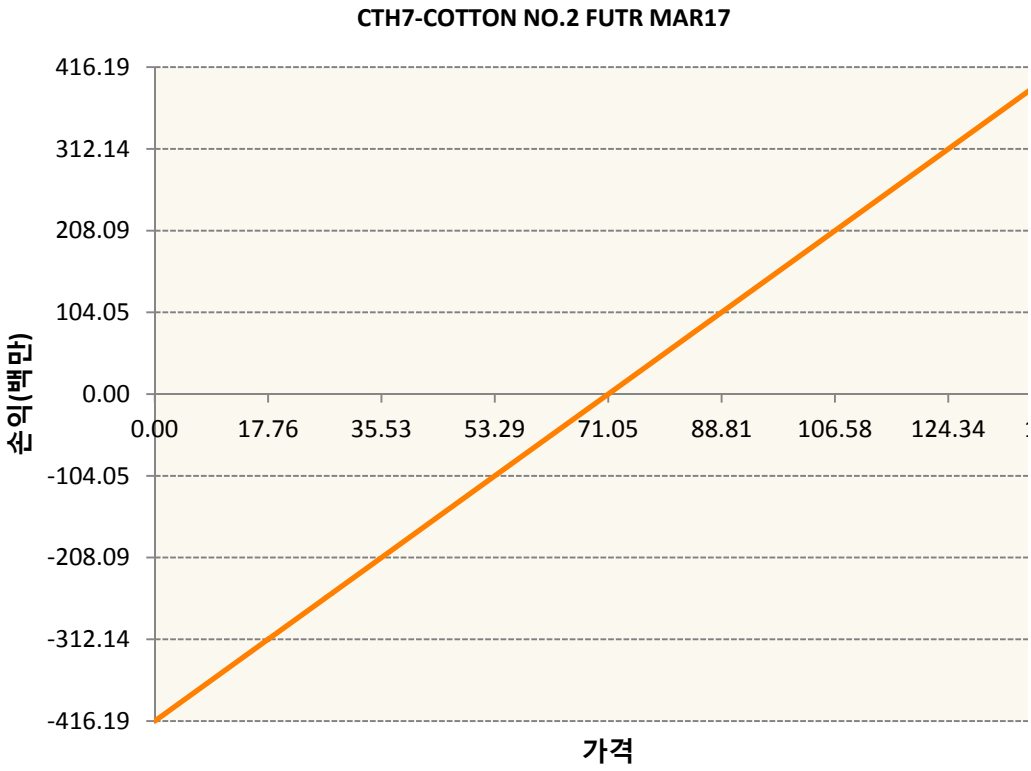
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	9,151	0	9,151	

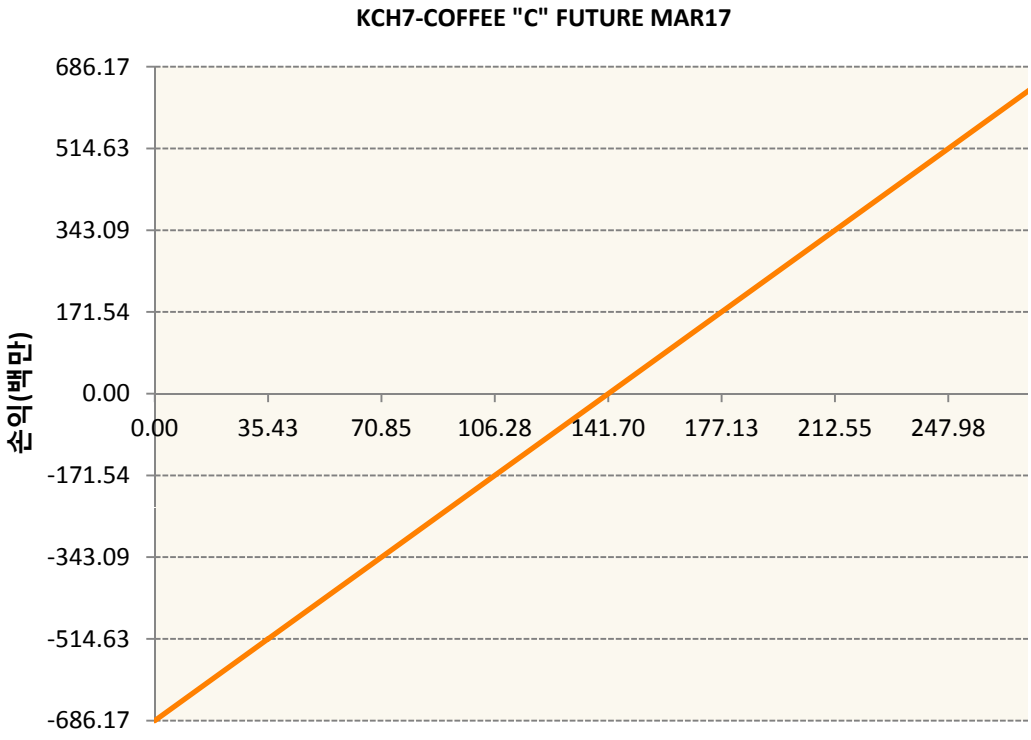
2. 만기시점의 손익구조



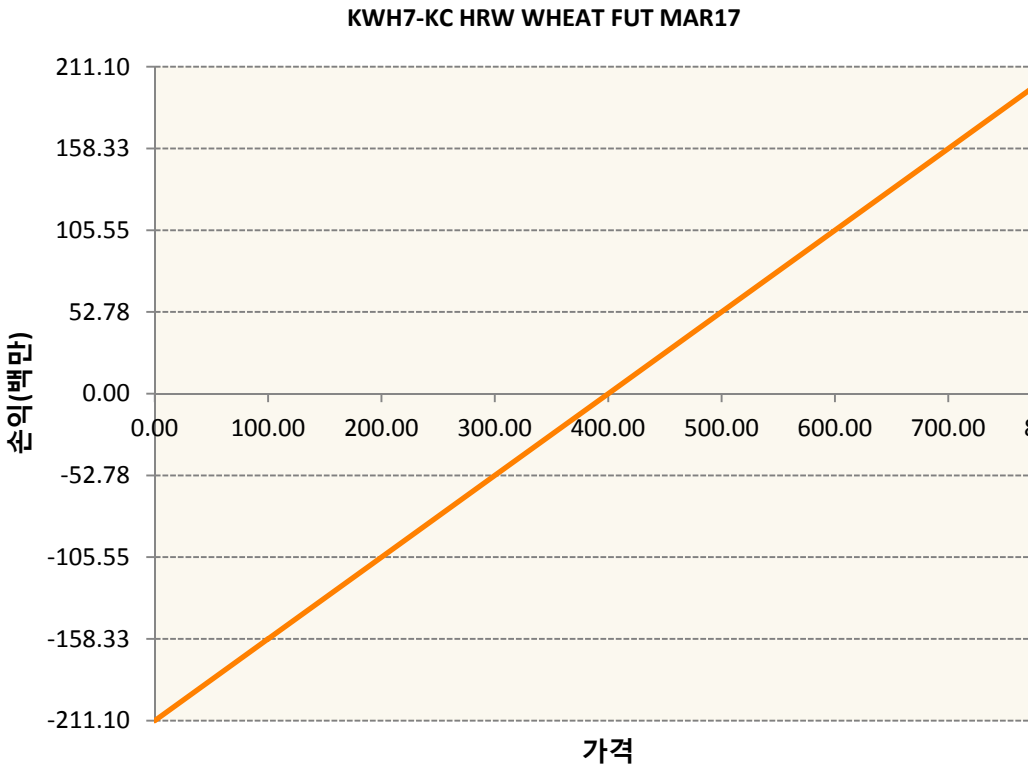


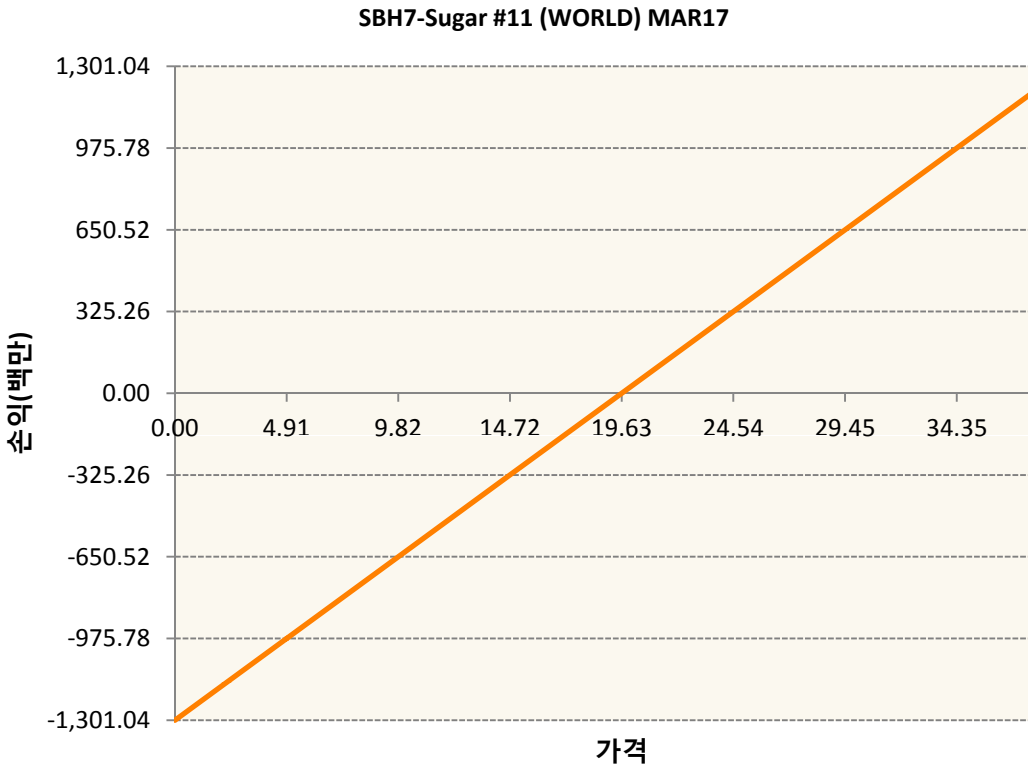

-1,572.98
-2,097.31
가격

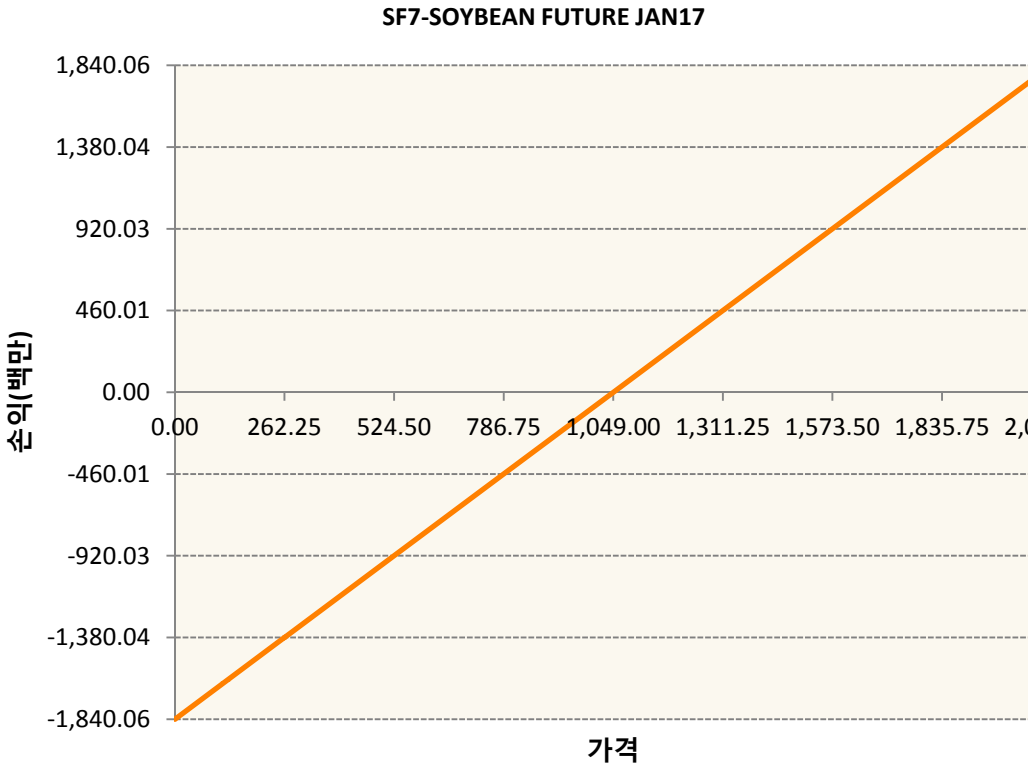

CTH7-COTTON NO.2 FUTR MAR17
416.19
312.14
208.09
104.05
0.00
-104.05
-208.09
-312.14
-416.19
0.00
17.76
35.53
53.29
71.05
88.81
106.58
124.34
손익(백만)
가격

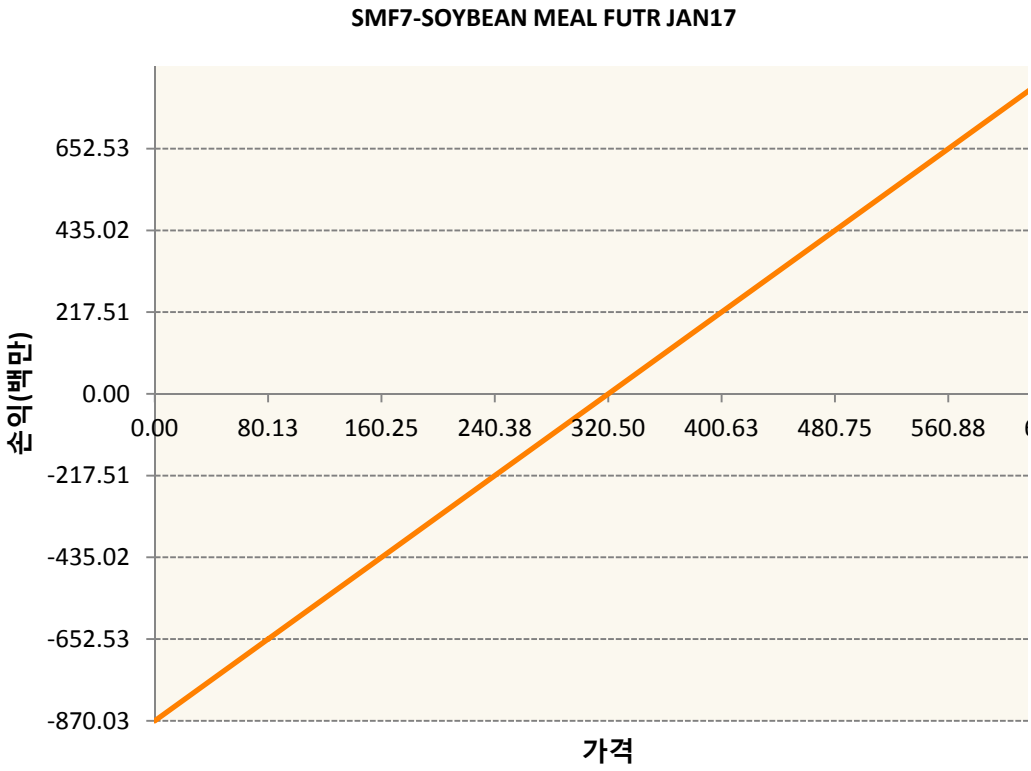

KCH7-COFFEE "C" FUTURE MAR17
686.17
514.63
343.09
171.54
0.00
-171.54
-343.09
-514.63
-686.17
0.00
35.43
70.85
106.28
141.70
177.13
212.55
247.98
손익(백만)

가격

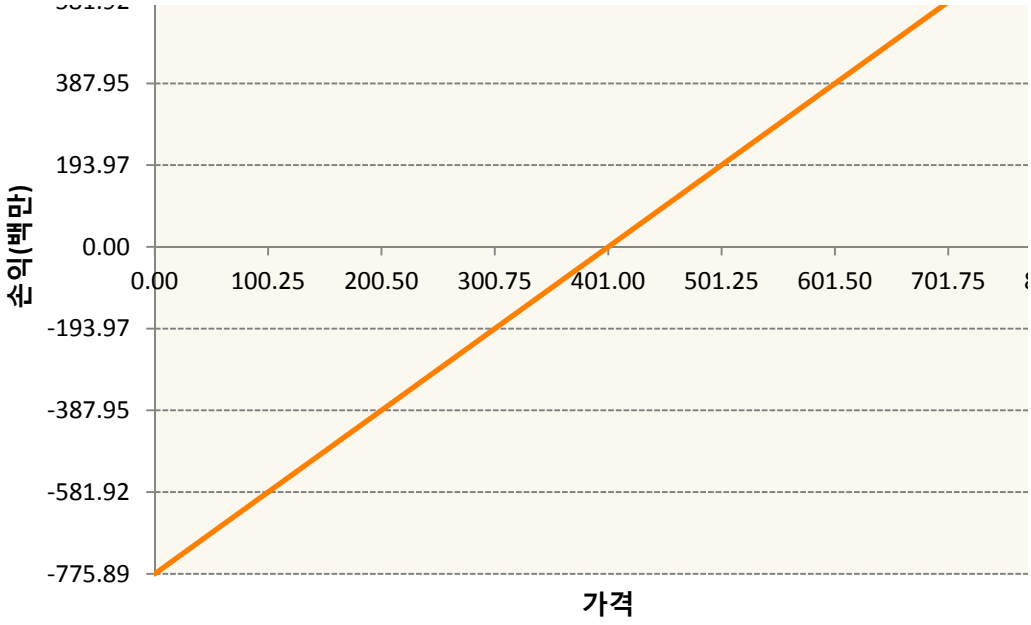

KWH7-KC HRW WHEAT FUT MAR17
211.10
158.33
105.55
52.78
0.00
-52.78
-105.55
-158.33
-211.10
0.00
100.00
200.00
300.00
400.00
500.00
600.00
700.00
손익(백만)
가격


SBH7-Sugar #11 (WORLD) MAR17
1,301.04
975.78
650.52
325.26
0.00
-325.26
-650.52
-975.78
-1,301.04
0.00
4.91
9.82
14.72
19.63
24.54
29.45
34.35
손익(백만)
가격


SF7-SOYBEAN FUTURE JAN17
1,840.06
1,380.04
920.03
460.01
0.00
-460.01
-920.03
-1,380.04
-1,840.06
0.00
262.25
524.50
786.75
1,049.00
1,311.25
1,573.50
1,835.75
손익(백만)
가격


SMF7-SOYBEAN MEAL FUTR JAN17
652.53
435.02
217.51
0.00
-217.51
-435.02
-652.53
-870.03
0.00
80.13
160.25
240.38
320.50
400.63
480.75
560.88
손익(백만)
가격


WH7-WHEAT FUTURE(CBT) MAR17
775.89
581.92



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	55
KWH7	KC HRW WHEAT FUT MAR17	17
SBH7	Sugar #11 (WORLD) MAR17	104
SF7	SOYBEAN FUTURE JAN17	147
SMF7	SOYBEAN MEAL FUTR JAN17	70
WH7	WHEAT FUTURE(CBT) MAR17	62

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

894