공시일	2016-12-12
기준일	2016-12-09

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	2016-12-12
기준일	2016-12-09

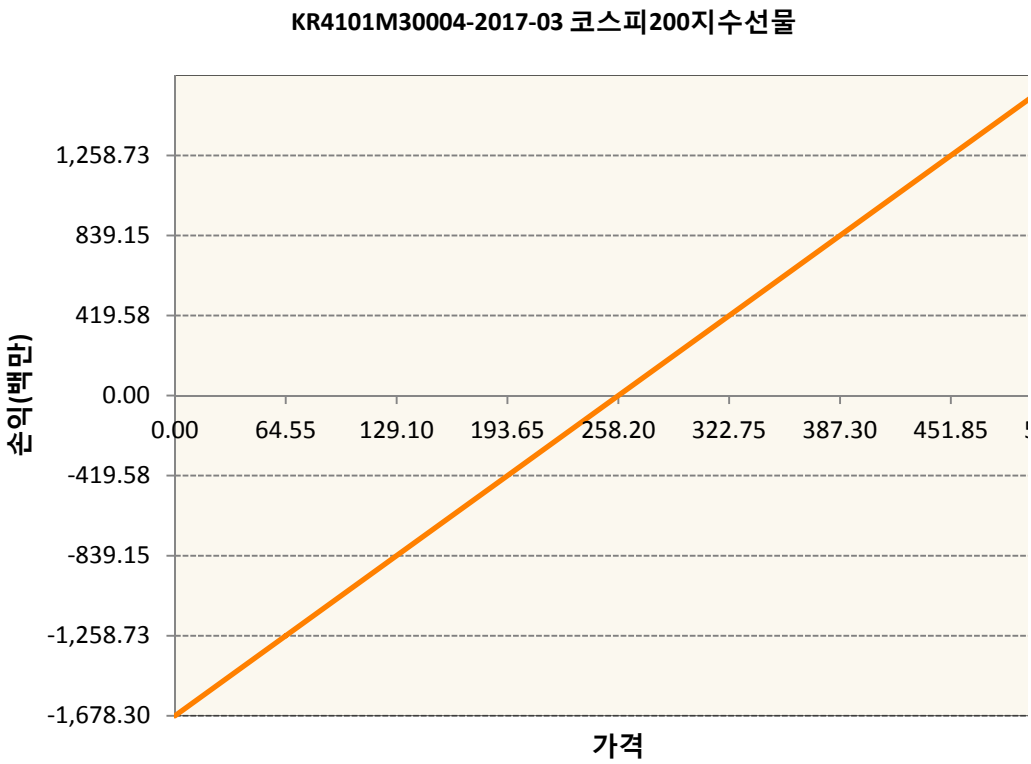
스마트인덱스모

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	516	-516	장내
누계	유가증권	선물	1,678	0	1,678	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%	-90	-90	-90	-90	-90	-90	-90
-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%	90	90	90	90	90	90	90
8.00%	136	136	136	136	136	136	136

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

103

공시일	2016-12-12
기준일	2016-12-09

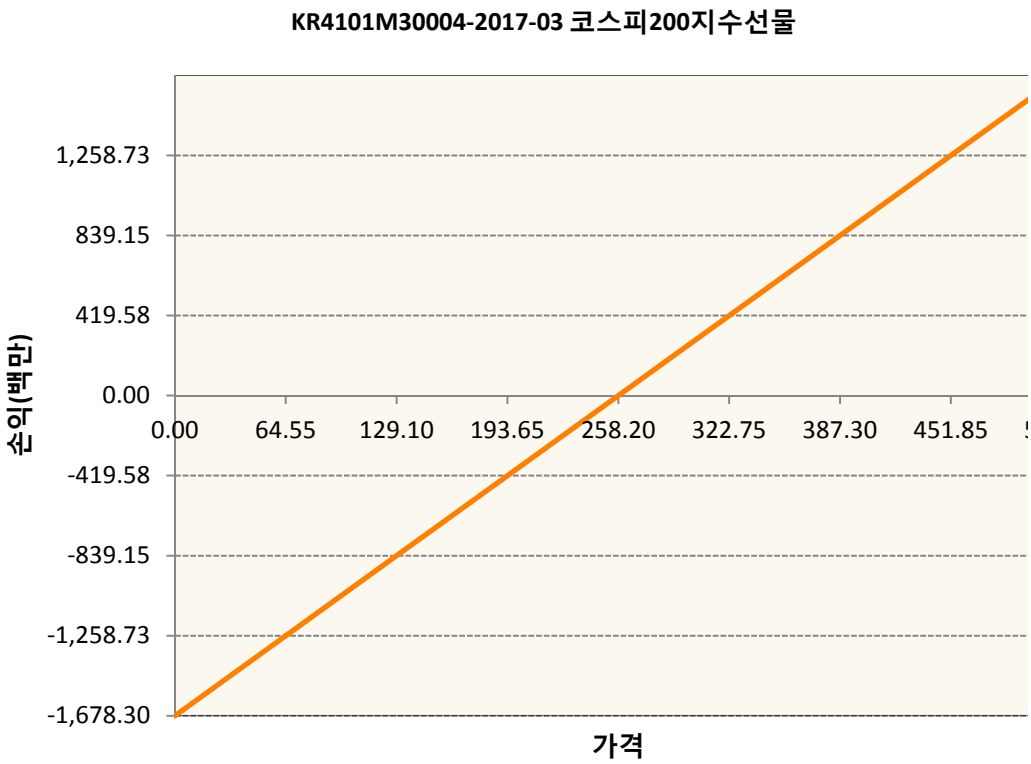
스마트레버리지목표전환형1호

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	1,678	0	1,678	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%	-90	-90	-90	-90	-90	-90	-90
-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%	90	90	90	90	90	90	90
8.00%	136	136	136	136	136	136	136

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

103

공시일	2016-12-12
기준일	2016-12-09

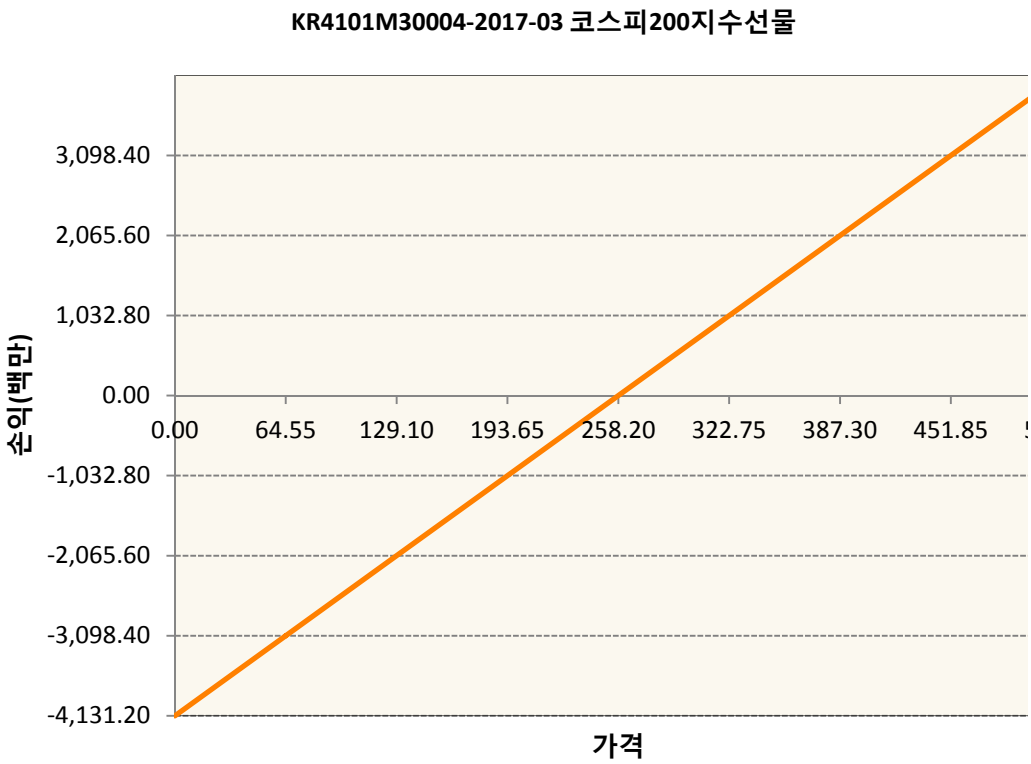
1.3배 레버리지 인덱스(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	774	-774	장내
누계	유가증권	선물	4,131	0	4,131	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101M30(2017-03 코스피200지수선물							334
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-334	-334	-334	-334	-334	-334	-334
-5.33%	-223	-223	-223	-223	-223	-223	-223
-2.67%	-111	-111	-111	-111	-111	-111	-111
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	111	111	111	111	111	111	111
5.33%	223	223	223	223	223	223	223
8.00%	334	334	334	334	334	334	334

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

254

공시일	2016-12-12
기준일	2016-12-09

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	904

* 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	2016-12-12
기준일	2016-12-09

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	4,972	0	4,972	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI50000 신한CSI500미래S161208	395

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

724

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2016-12-12
기준일	2016-12-09

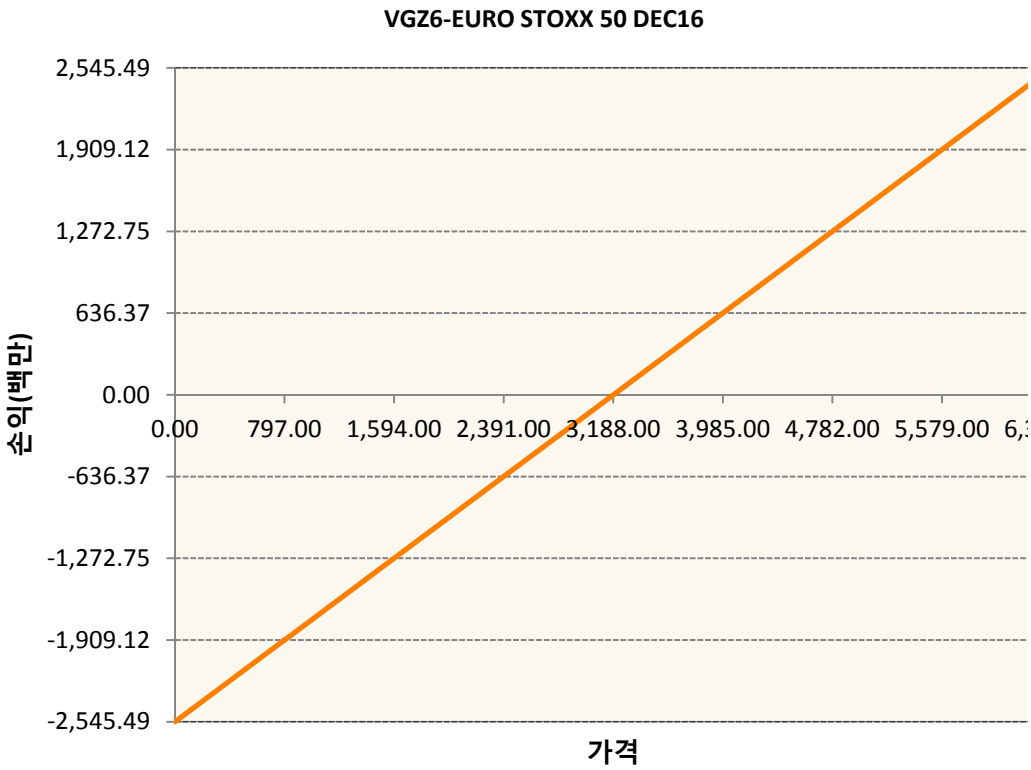
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,545	0	2,545	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGZ6	EURO STOXX 50 DEC16	204

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

(단위:백만원)

237

공시일	2016-12-12
기준일	2016-12-09

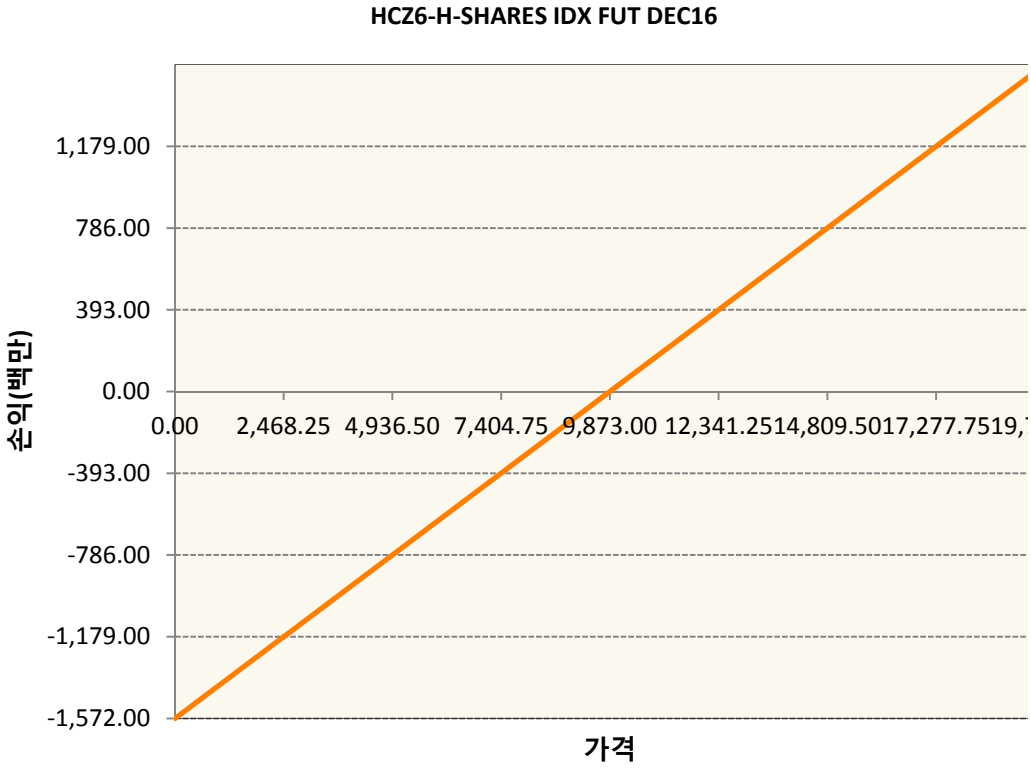
차이나인덱스모(주식-파생형)

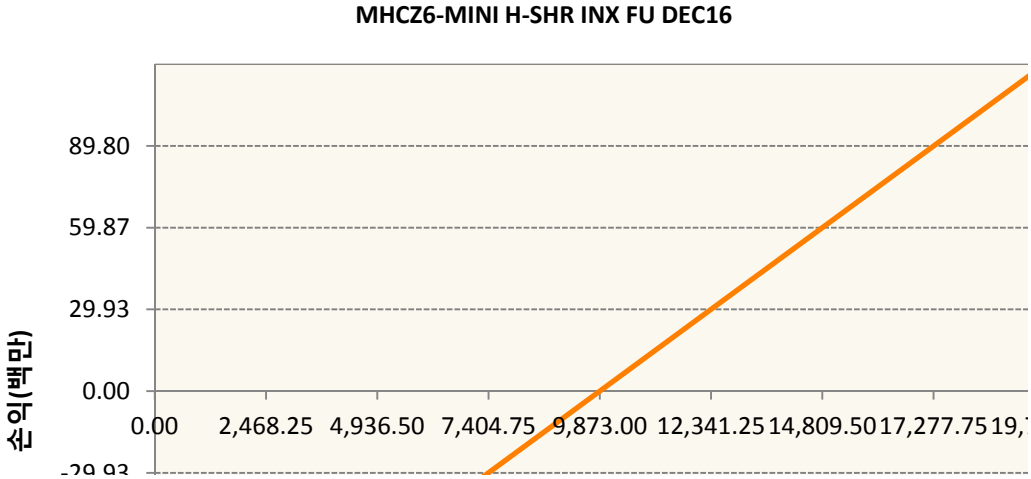
1. 계약금액

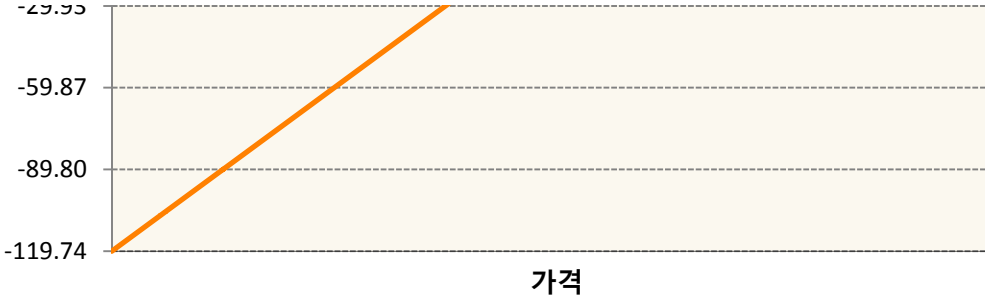
(단위:백만원)

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	1,572	0	1,572	
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	2016-12-12
기준일	2016-12-09

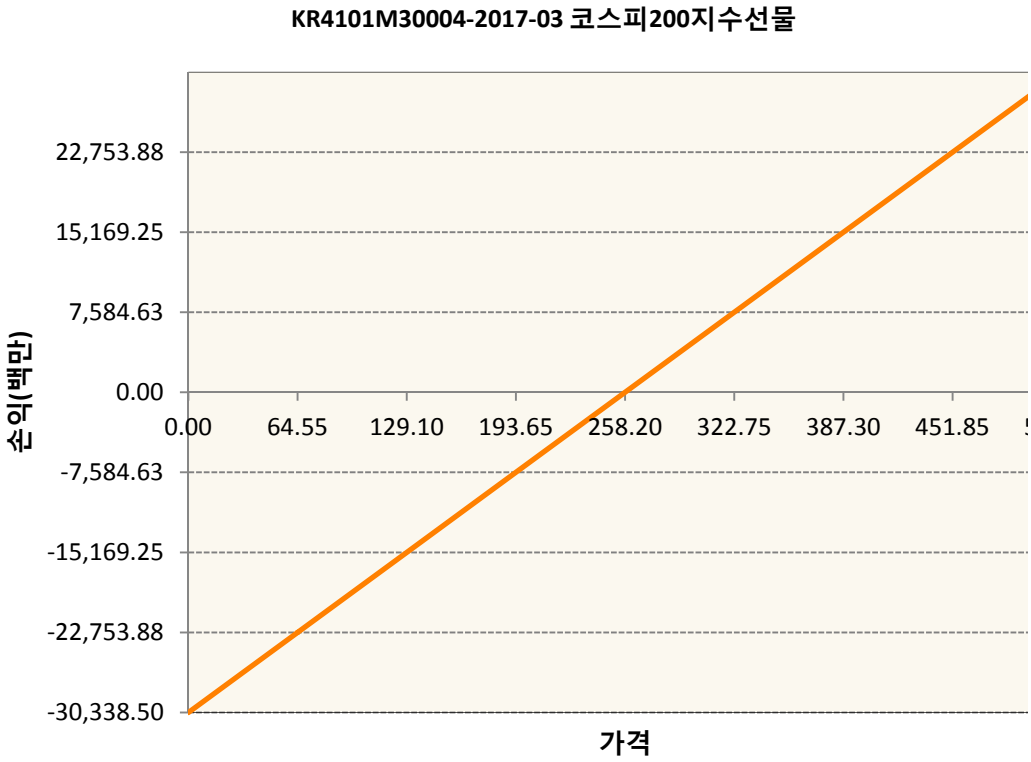
커버드콜(주식혼합-파생형)

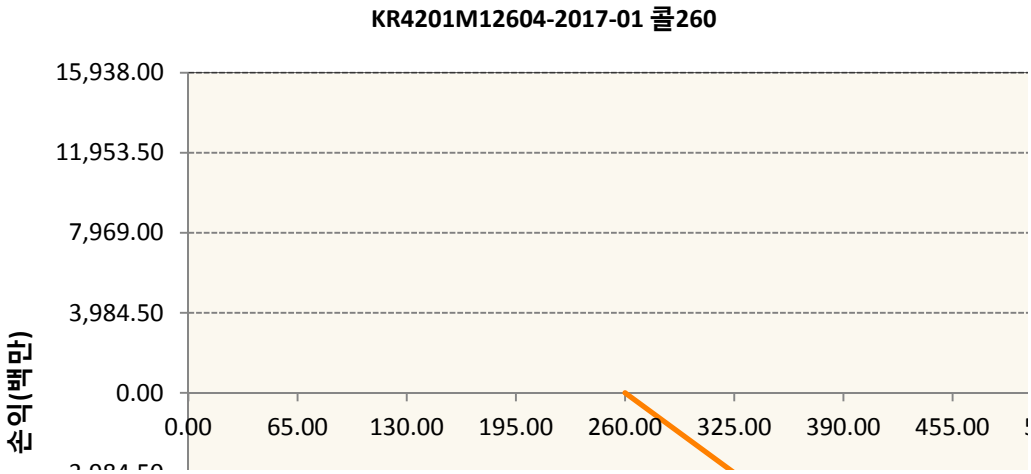
1. 계약금액

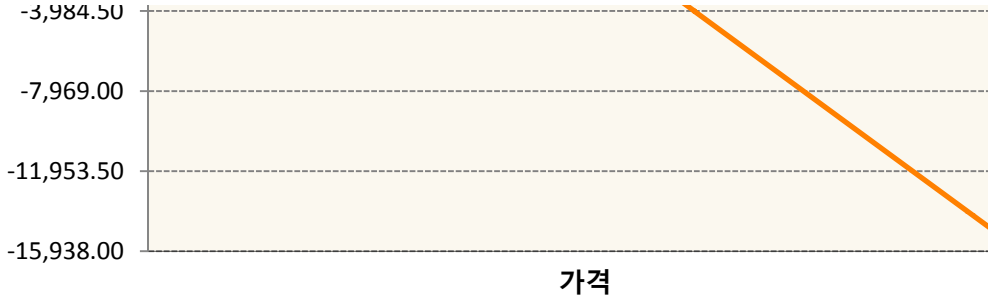
(단위:백만원)

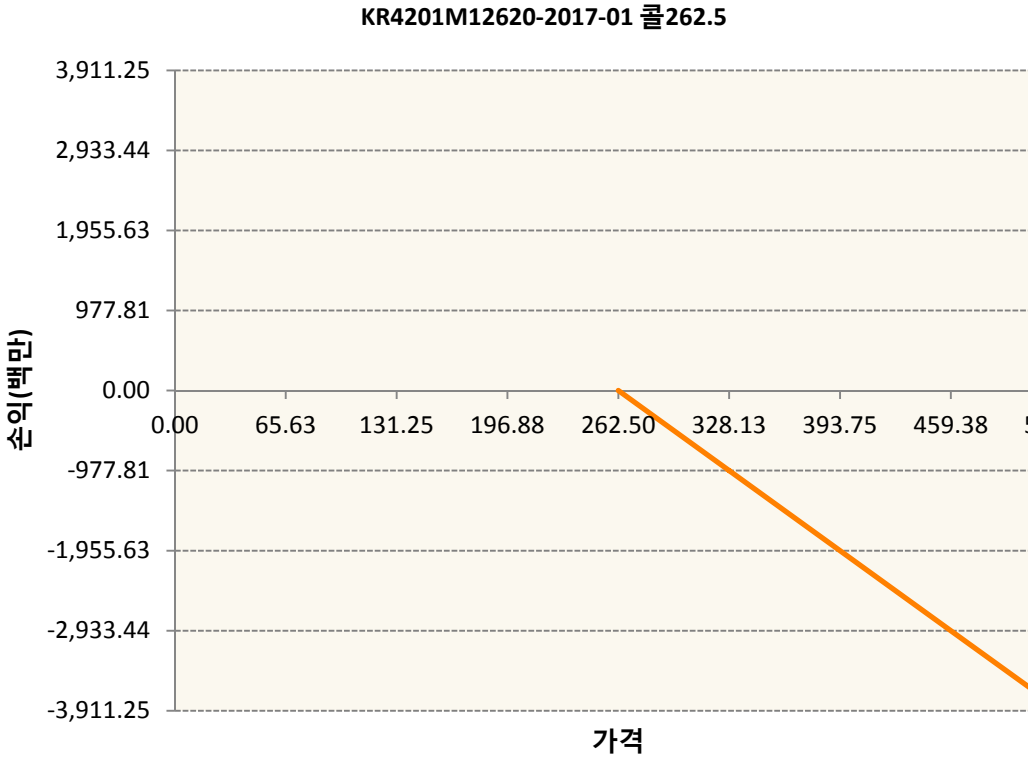
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	2,579	-2,579	장내
신규	유가증권	옵션	516	0	516	장내
누계	유가증권	선물	30,339	0	30,339	장내
누계	유가증권	옵션	0	19,849	-19,849	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101M30(2017-03 코스피200지수선물							2,453
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-2,453	-2,453	-2,453	-2,453	-2,453	-2,453	-2,453
-5.33%	-1,635	-1,635	-1,635	-1,635	-1,635	-1,635	-1,635
-2.67%	-818	-818	-818	-818	-818	-818	-818
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	818	818	818	818	818	818	818
5.33%	1,635	1,635	1,635	1,635	1,635	1,635	1,635
8.00%	2,453	2,453	2,453	2,453	2,453	2,453	2,453
KR4201M12(2017-01 콜260							5,391
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,344	1,341	1,336	1,328	1,315	1,299	1,278
-5.33%	1,315	1,293	1,264	1,228	1,186	1,139	1,088
-2.67%	1,092	1,019	943	863	780	696	609
0%	299	199	100	0	-100	-200	-299
2.67%	-1,234	-1,296	-1,363	-1,436	-1,512	-1,591	-1,673
5.33%	-3,213	-3,231	-3,257	-3,288	-3,326	-3,370	-3,420
8.00%	-5,322	-5,325	-5,330	-5,339	-5,352	-5,369	-5,391
KR4201M12(	2017-01 콜262.5						1,224

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	238	238	237	236	234	232	228
-5.33%	235	232	228	222	215	206	196
-2.67%	205	192	178	162	145	127	109
0%	72	48	24	0	-24	-48	-73
2.67%	-239	-259	-279	-301	-322	-344	-367
5.33%	-691	-699	-709	-720	-733	-747	-762
8.00%	-1,197	-1,199	-1,201	-1,205	-1,210	-1,217	-1,224

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

9,175

공시일	2016-12-12
기준일	2016-12-09

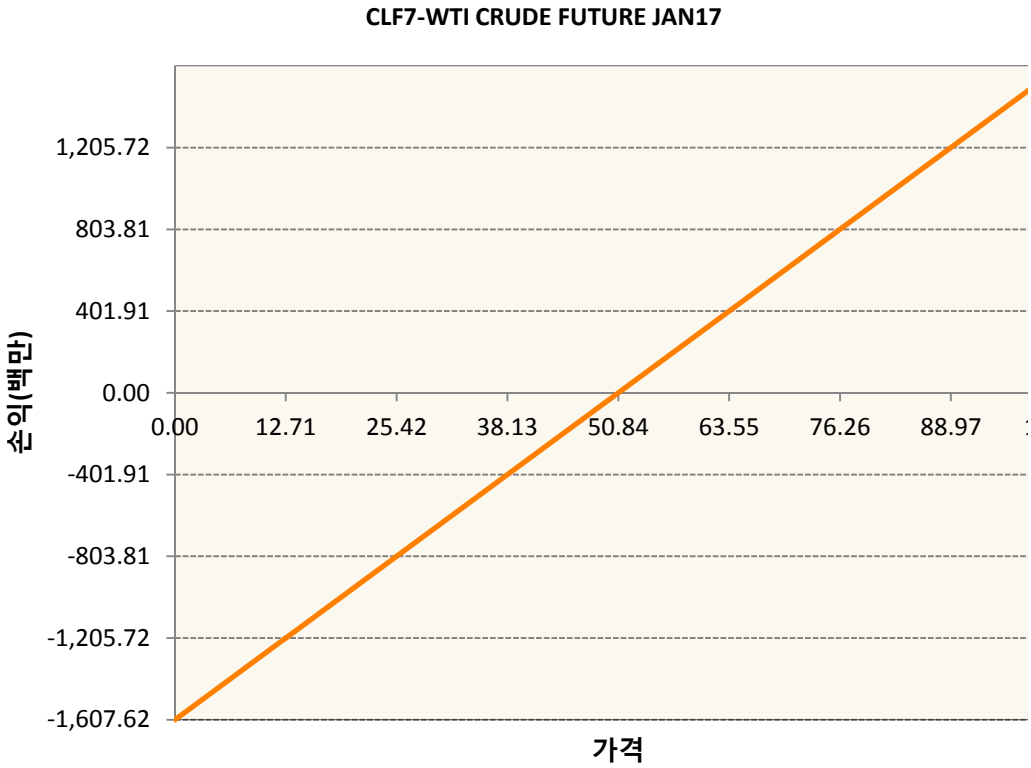
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

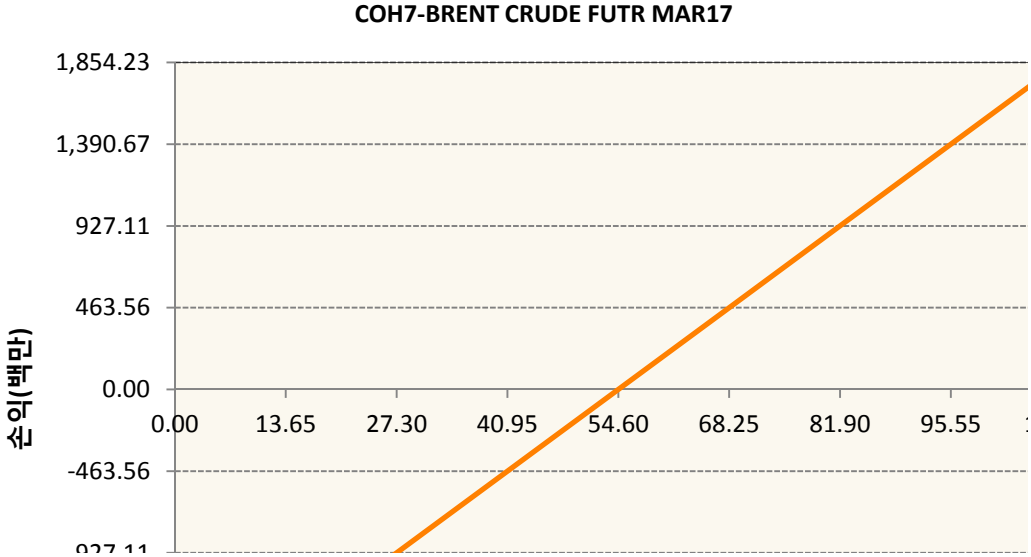
1. 계약금액

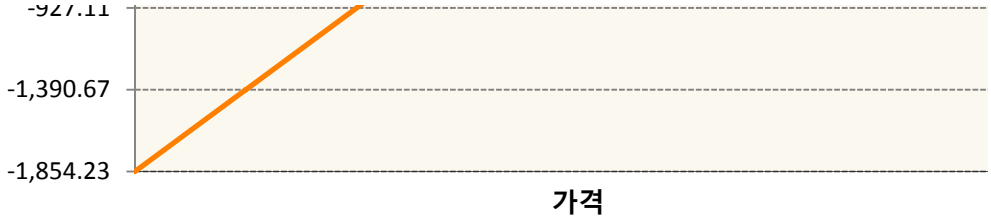
(단위:백만원)

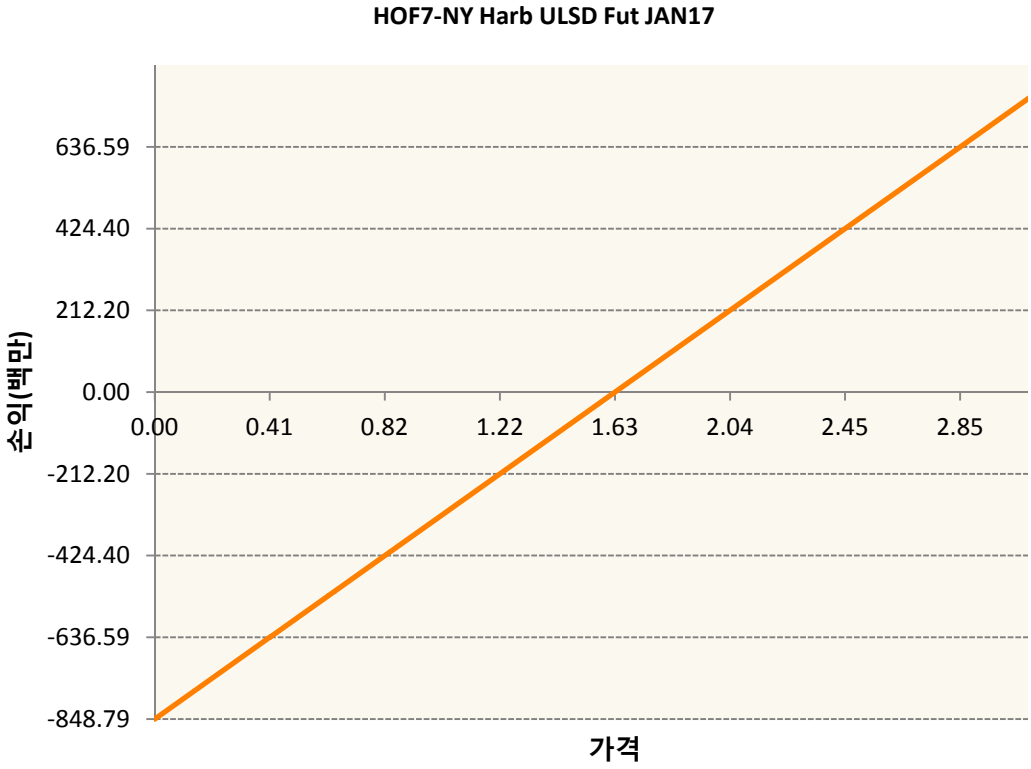
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	6,904	0	6,904	

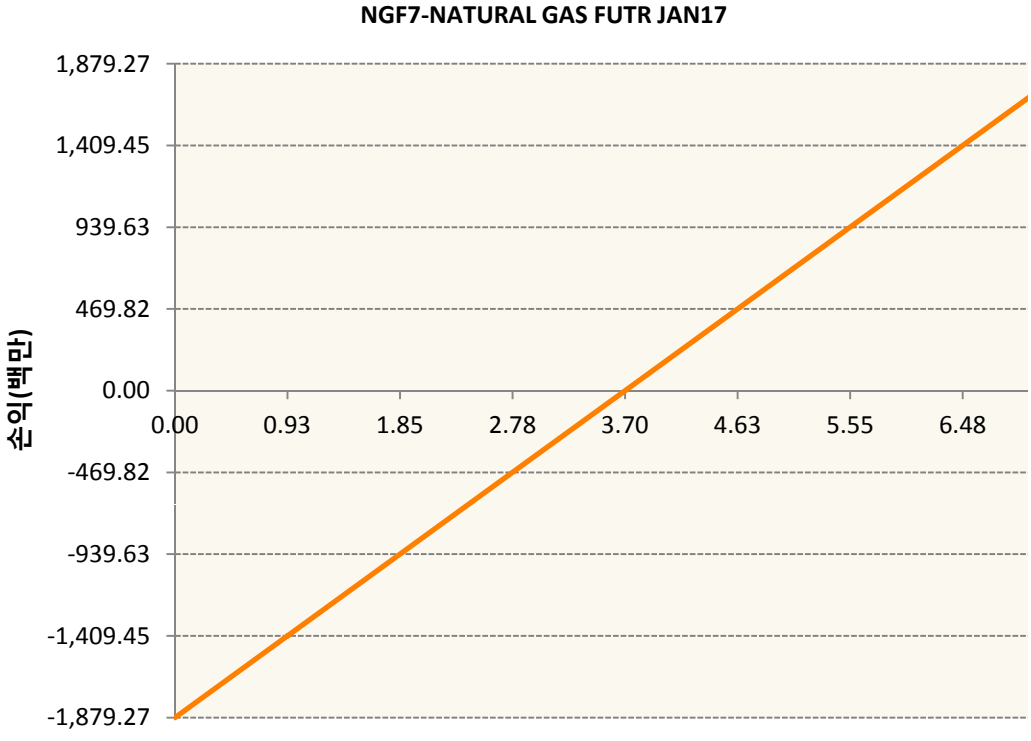
2. 만기시점의 손익구조



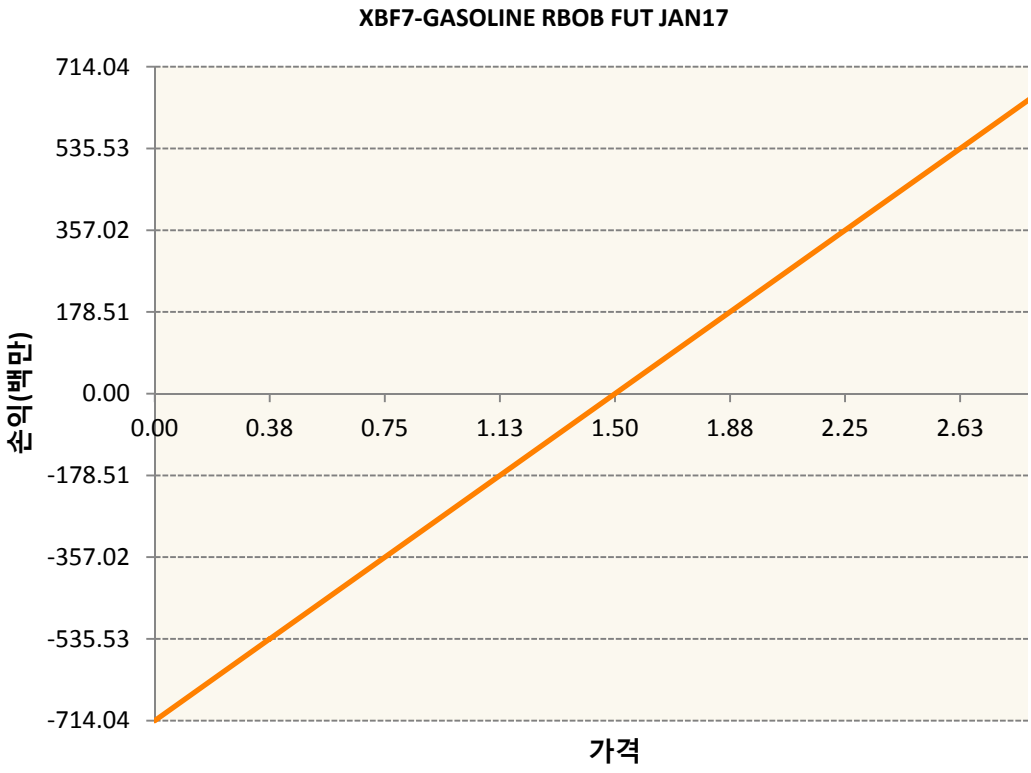



-1,390.67
-1,854.23
가격


HOF7-NY Harb ULSD Fut JAN17
636.59
424.40
212.20
0.00
-212.20
-424.40
-636.59
-848.79
0.00
0.41
0.82
1.22
1.63
2.04
2.45
2.85
순익(백만)
가격


NGF7-NATURAL GAS FUTR JAN17
1,879.27
1,409.45
939.63
469.82
0.00
-469.82
-939.63
-1,409.45
-1,879.27
0.00
0.93
1.85
2.78
3.70
4.63
5.55
6.48
순익(백만)

가격



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
CLF7	WTI CRUDE FUTURE JAN17	129
COH7	BRENT CRUDE FUTR MAR17	148
HOF7	NY Harb ULSD Fut JAN17	68
NGF7	NATURAL GAS FUTR JAN17	150
XBF7	GASOLINE RBOB FUT JAN17	57

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,254

공시일	2016-12-12
기준일	2016-12-09

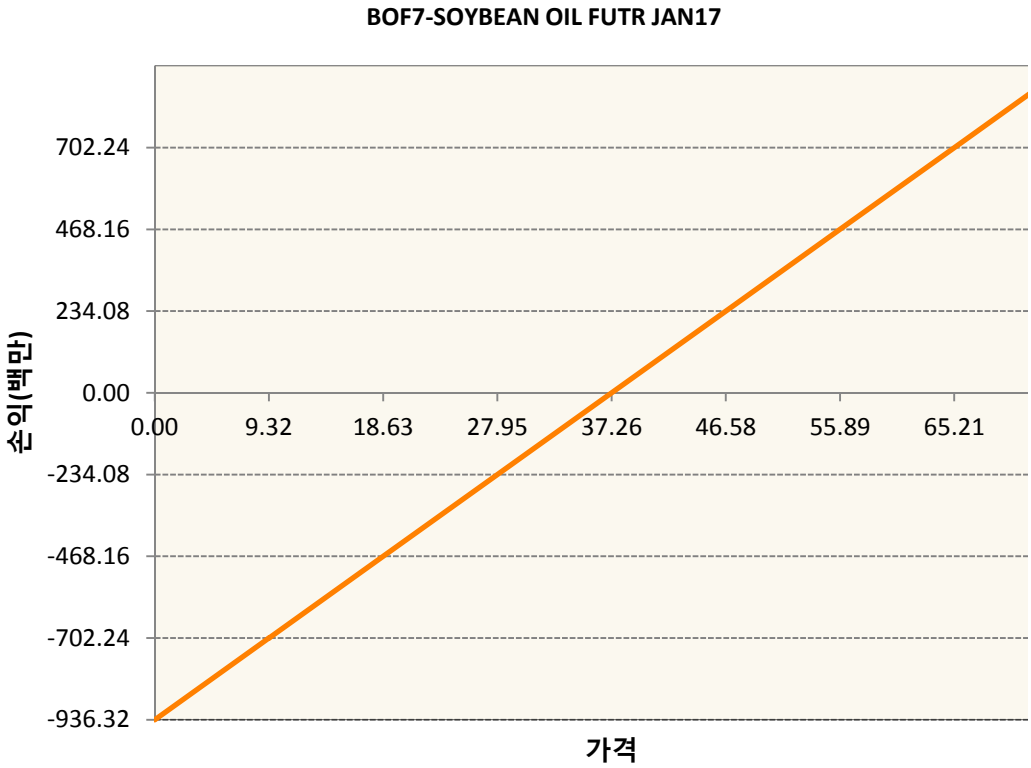
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

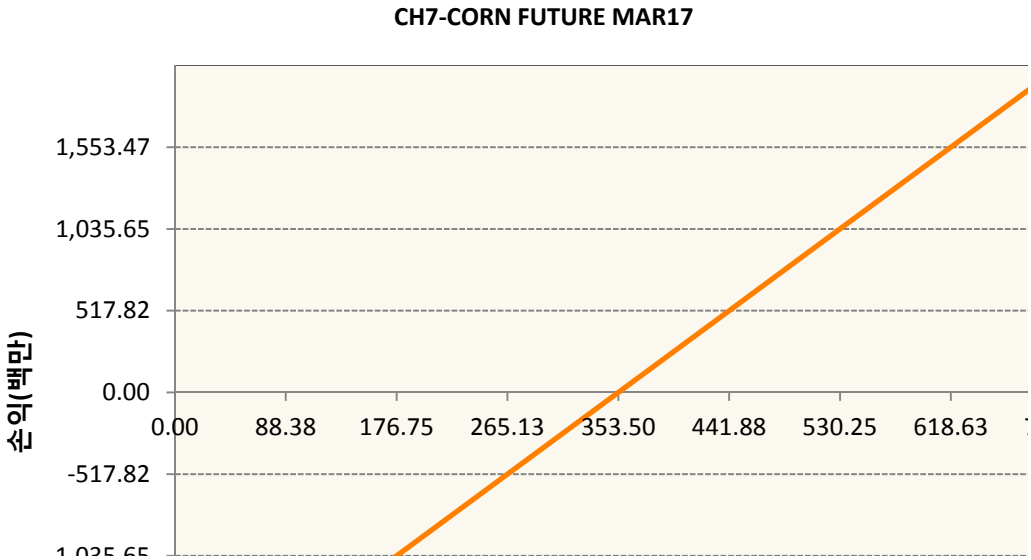
1. 계약금액

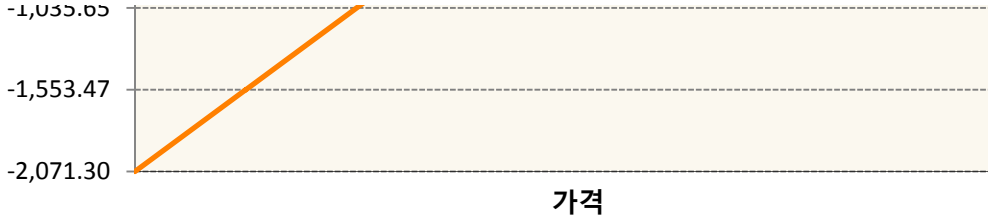
(단위:백만원)

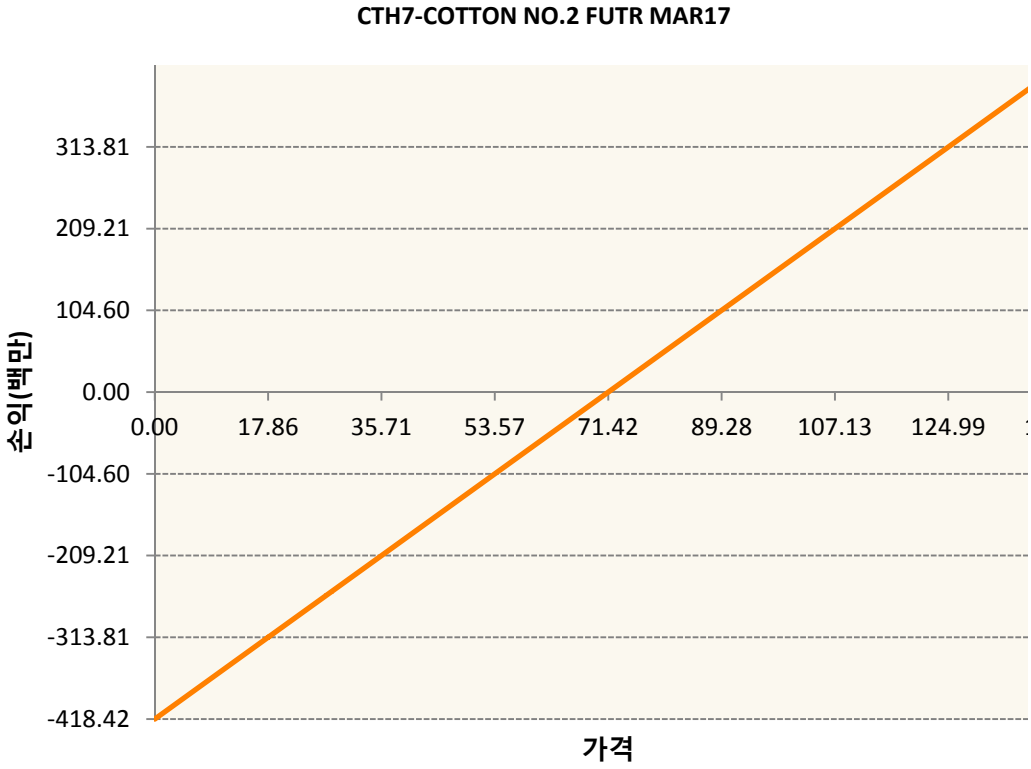
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	9,054	0	9,054	

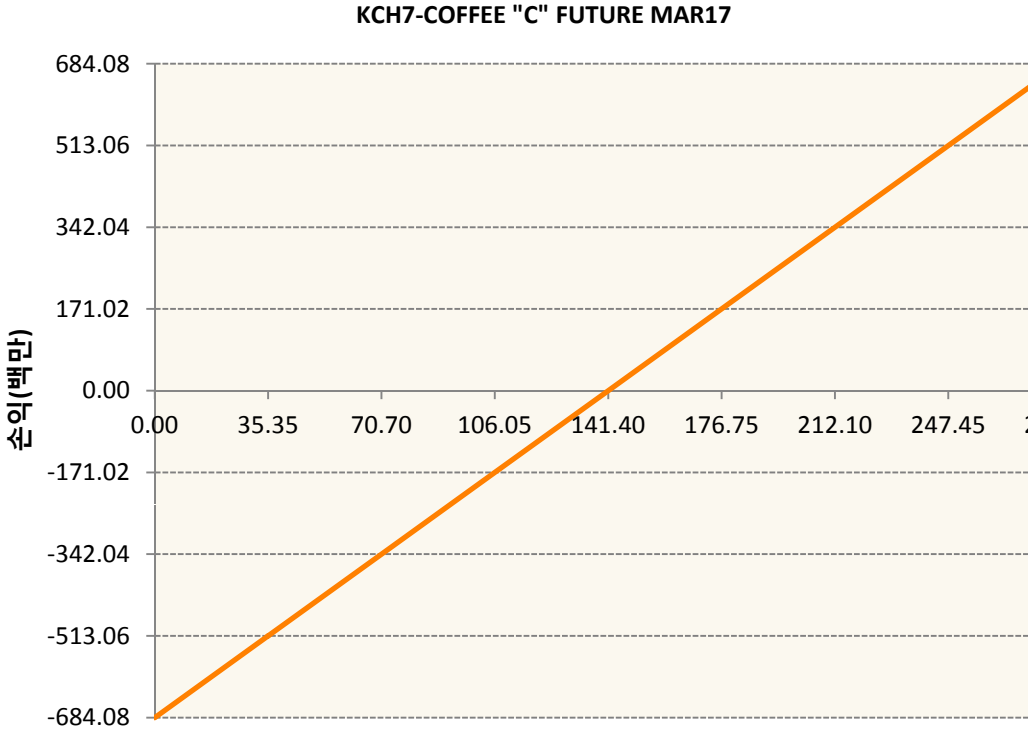
2. 만기시점의 손익구조



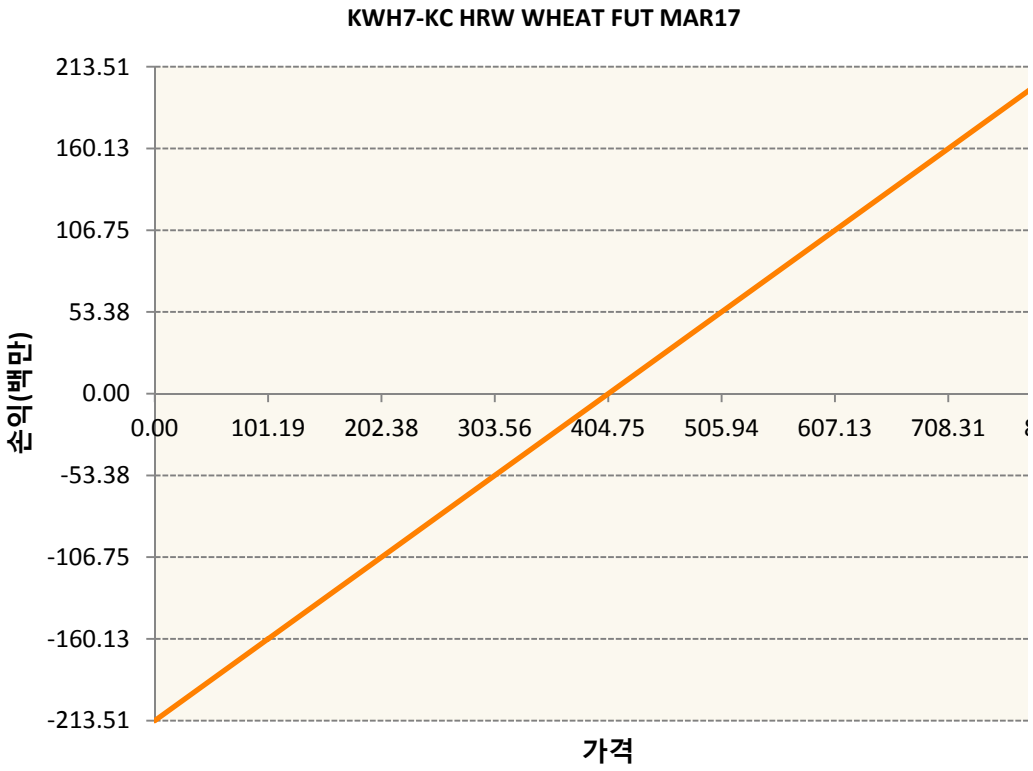


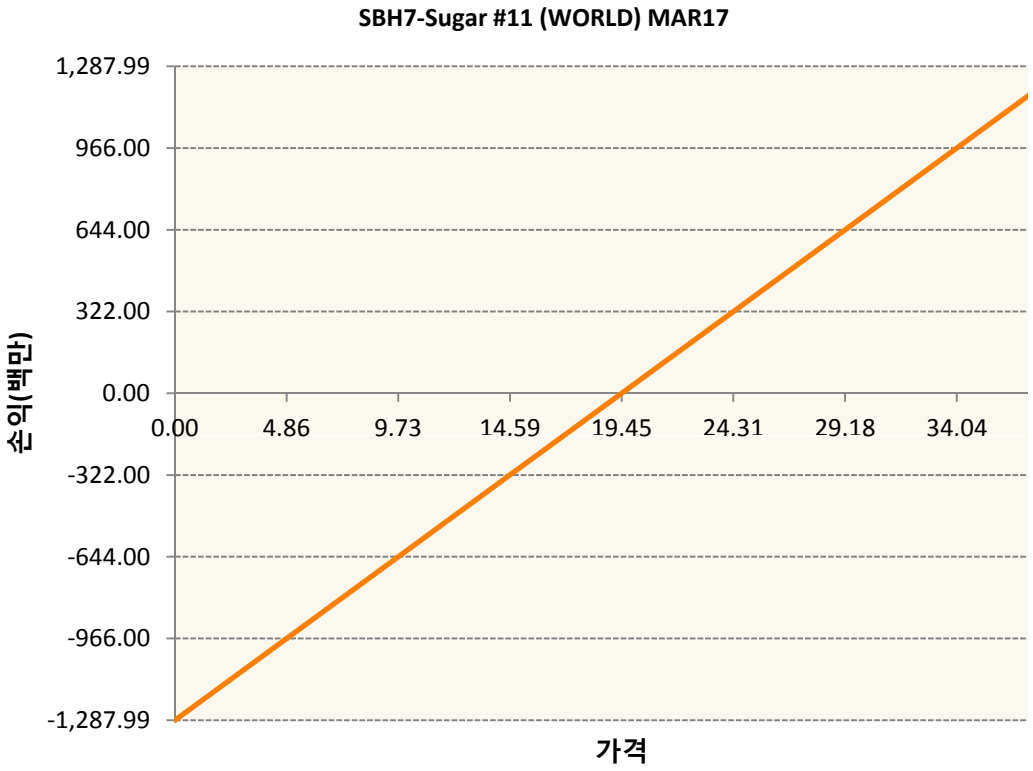

-1,553.47
-2,071.30
가격

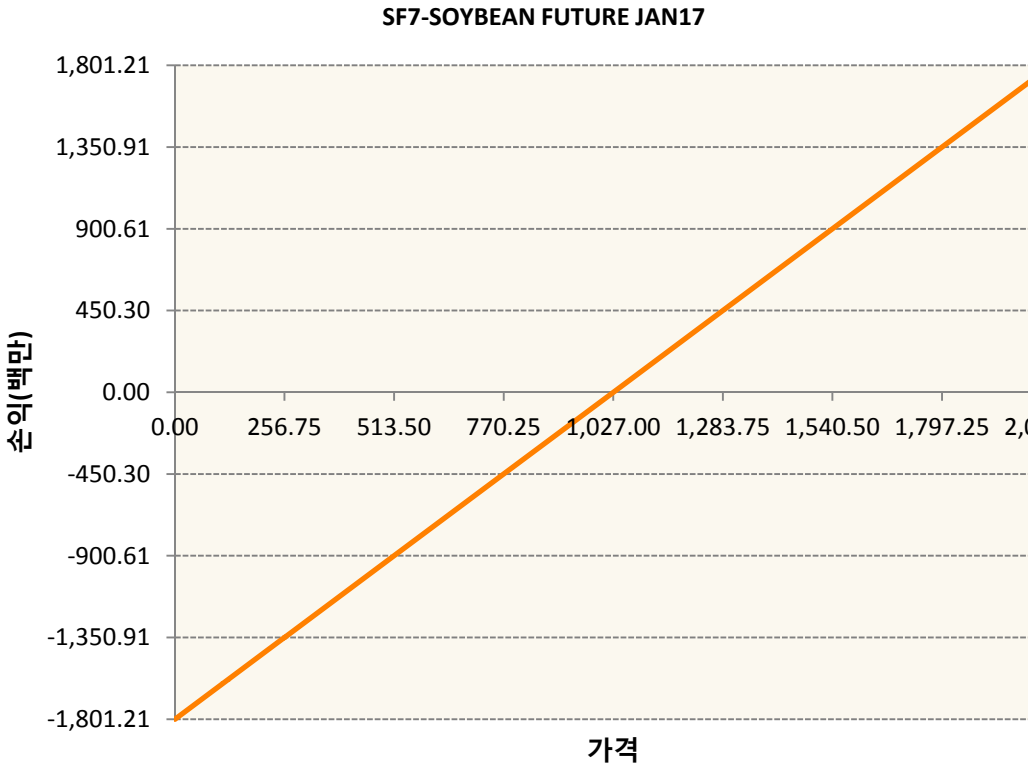

CTH7-COTTON NO.2 FUTR MAR17
313.81
209.21
104.60
0.00
-104.60
-209.21
-313.81
-418.42
0.00
17.86
35.71
53.57
71.42
89.28
107.13
124.99
순익(백만)
가격

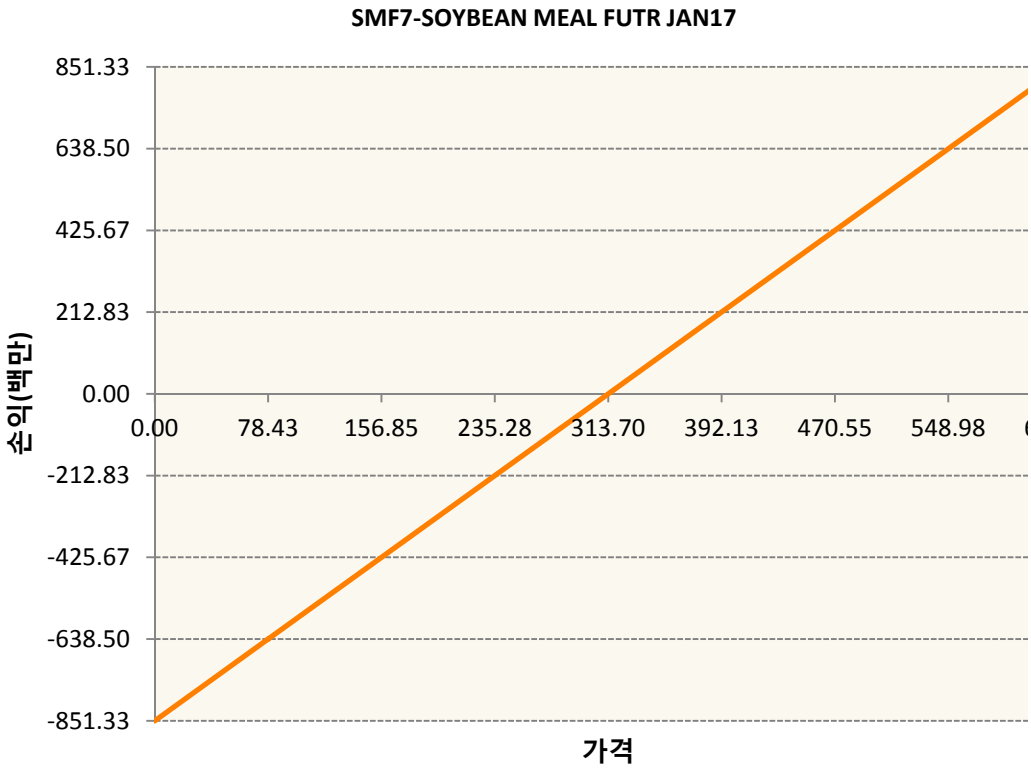

KCH7-COFFEE "C" FUTURE MAR17
684.08
513.06
342.04
171.02
0.00
-171.02
-342.04
-513.06
-684.08
0.00
35.35
70.70
106.05
141.40
176.75
212.10
247.45
순익(백만)

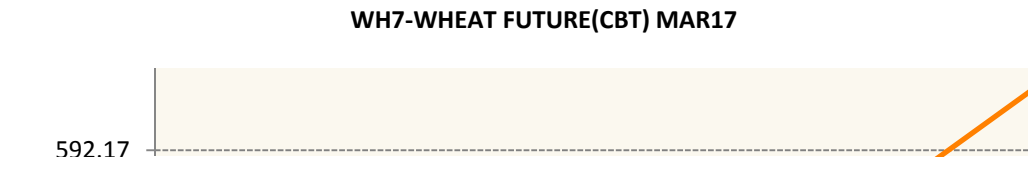
가격

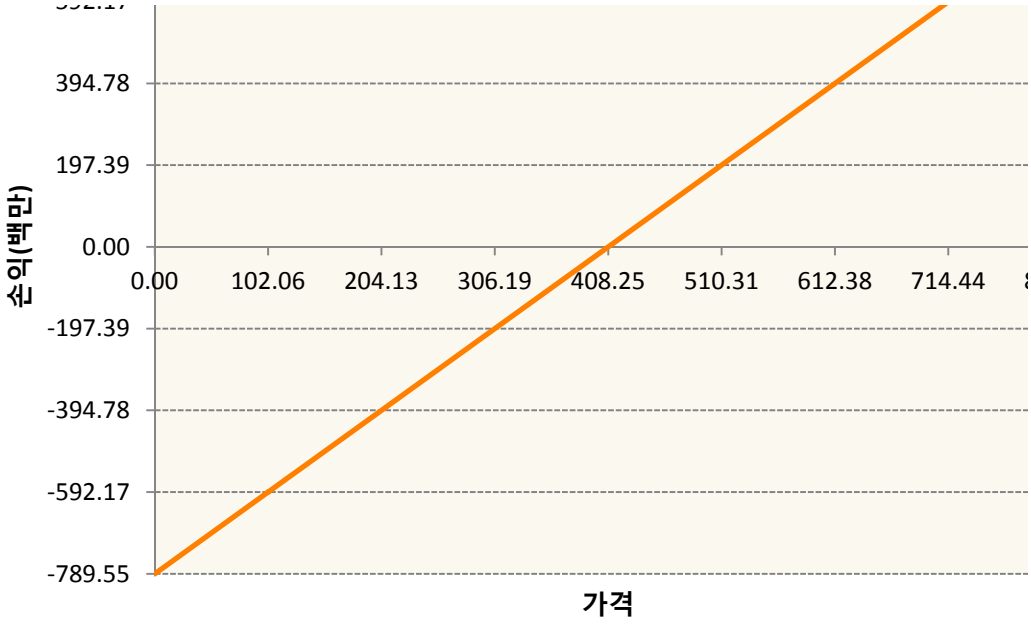

KWH7-KC HRW WHEAT FUT MAR17
213.51
160.13
106.75
53.38
0.00
-53.38
-106.75
-160.13
-213.51
0.00
101.19
202.38
303.56
404.75
505.94
607.13
708.31
손익(백만)
가격


SBH7-Sugar #11 (WORLD) MAR17
1,287.99
966.00
644.00
322.00
0.00
-322.00
-644.00
-966.00
-1,287.99
0.00
4.86
9.73
14.59
19.45
24.31
29.18
34.04
손익(백만)
가격


SF7-SOYBEAN FUTURE JAN17
1,801.21
1,350.91
900.61
450.30
0.00
-450.30
-900.61
-1,350.91
-1,801.21
0.00
256.75
513.50
770.25
1,027.00
1,283.75
1,540.50
1,797.25
손익(백만)
가격


SMF7-SOYBEAN MEAL FUTR JAN17
851.33
638.50
425.67
212.83
0.00
-212.83
-425.67
-638.50
-851.33
0.00
78.43
156.85
235.28
313.70
392.13
470.55
548.98
손익(백만)
가격


WH7-WHEAT FUTURE(CBT) MAR17
592.17



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

BOF7	SOYBEAN OIL FUTR JAN17	75
CH7	CORN FUTURE MAR17	166
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	144
SMF7	SOYBEAN MEAL FUTR JAN17	68
WH7	WHEAT FUTURE(CBT) MAR17	63

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

884