공시일	2016-12-13
기준일	2016-12-12

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	2016-12-13
기준일	2016-12-12

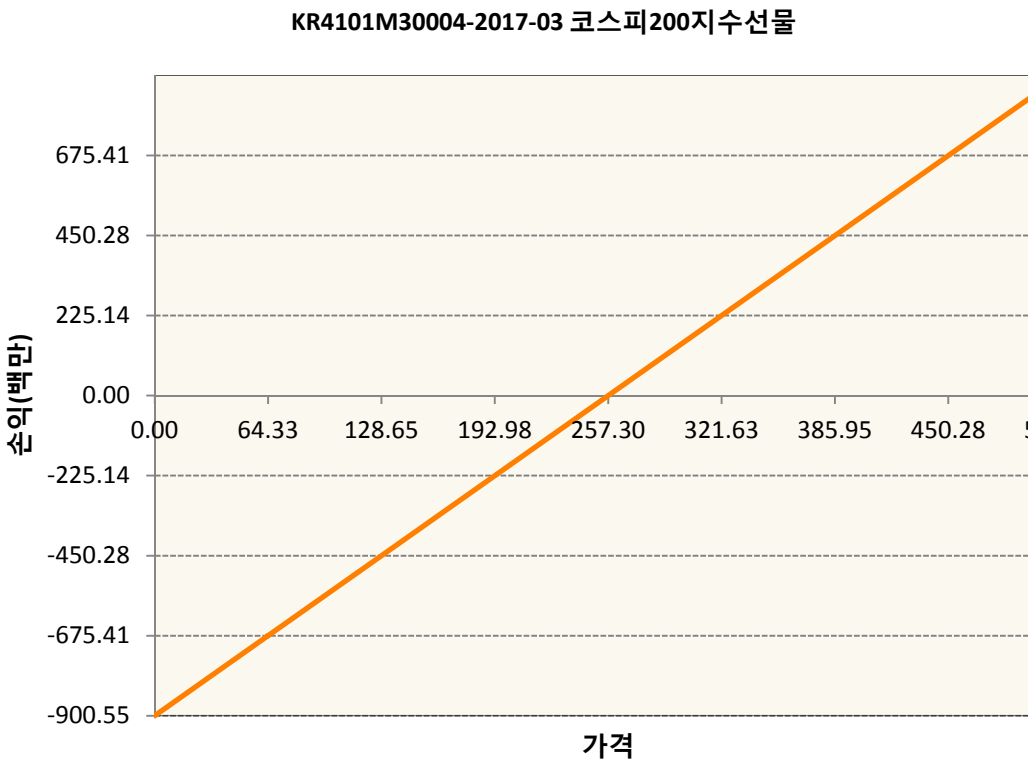
스마트인덱스모

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	901	0	901	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101M30(2017-03 코스피200지수선물							73
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-73	-73	-73	-73	-73	-73	-73
-5.33%	-49	-49	-49	-49	-49	-49	-49
-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%	49	49	49	49	49	49	49
8.00%	73	73	73	73	73	73	73

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

55

공시일	2016-12-13
기준일	2016-12-12

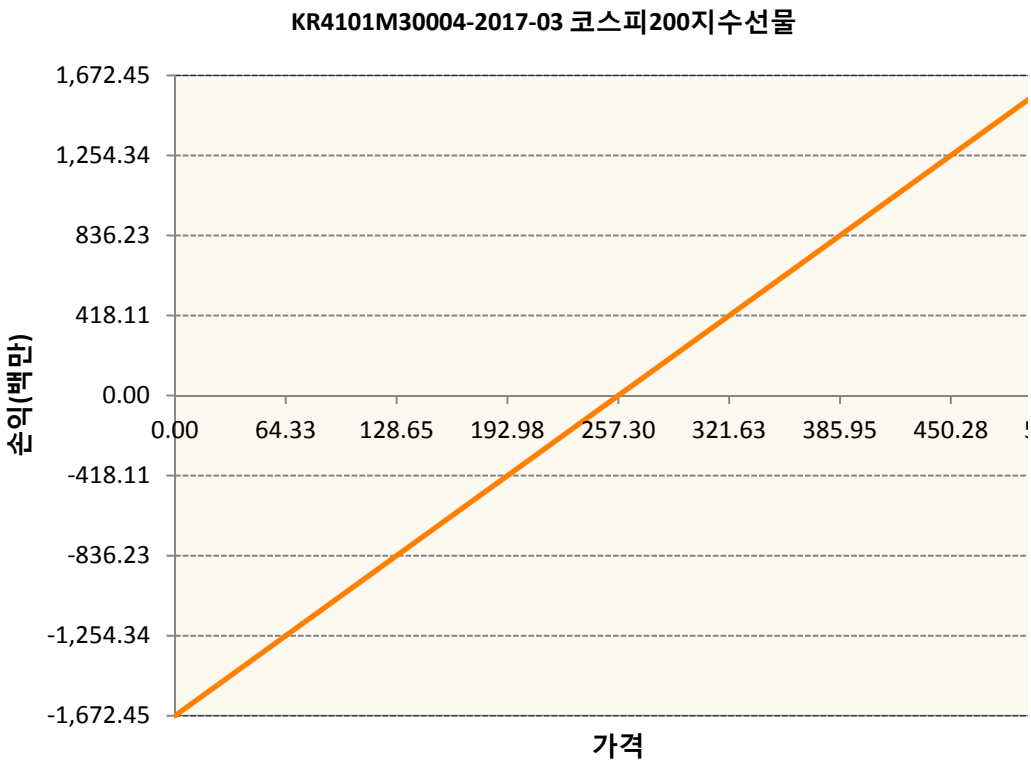
스마트레버리지목표전환형1호

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	1,672	0	1,672	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	2016-12-13
기준일	2016-12-12

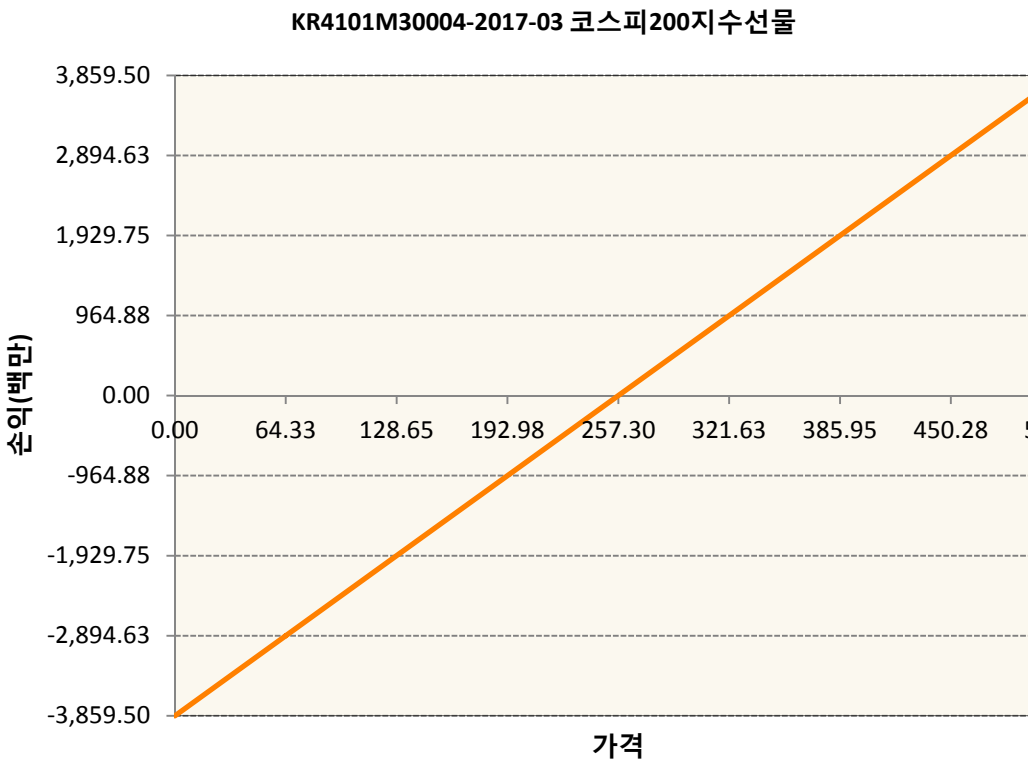
1.3배 레버리지 인덱스(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	257	-257	장내
누계	유가증권	선물	3,860	0	3,860	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101M30(2017-03 코스피200지수선물							313
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-313	-313	-313	-313	-313	-313	-313
-5.33%	-209	-209	-209	-209	-209	-209	-209
-2.67%	-104	-104	-104	-104	-104	-104	-104
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	104	104	104	104	104	104	104
5.33%	209	209	209	209	209	209	209
8.00%	313	313	313	313	313	313	313

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

238

공시일	2016-12-13
기준일	2016-12-12

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	907

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

729

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2016-12-13
기준일	2016-12-12

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	378

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

692

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2016-12-13
기준일	2016-12-12

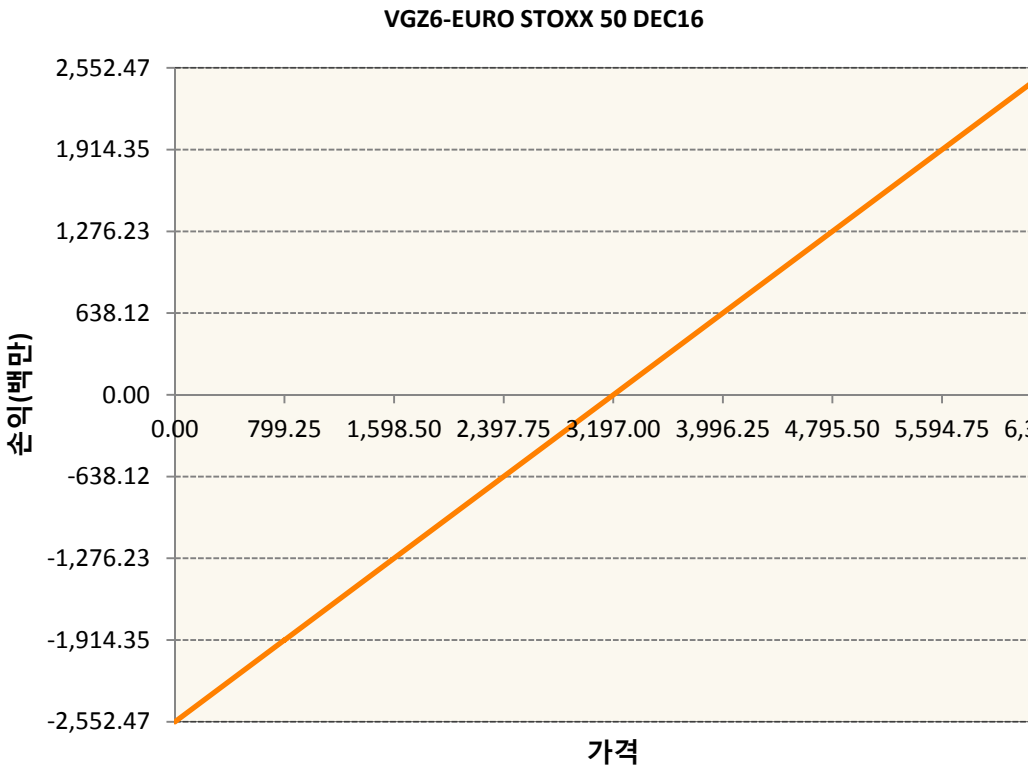
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,552	0	2,552	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGZ6	EURO STOXX 50 DEC16	204

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

(단위:백만원)

238

공시일	2016-12-13
기준일	2016-12-12

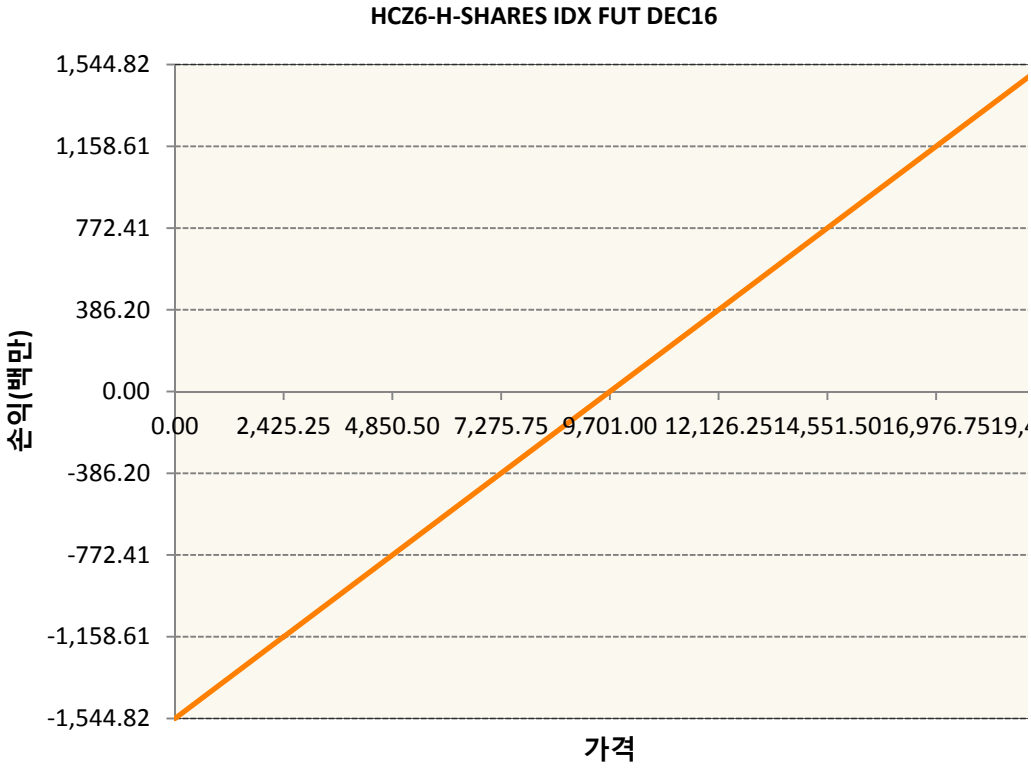
차이나인덱스모(주식-파생형)

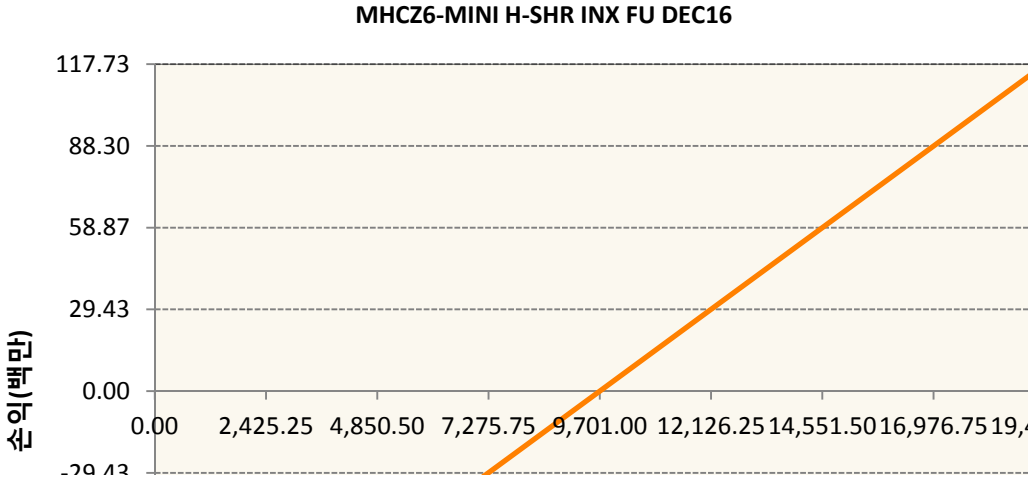
1. 계약금액

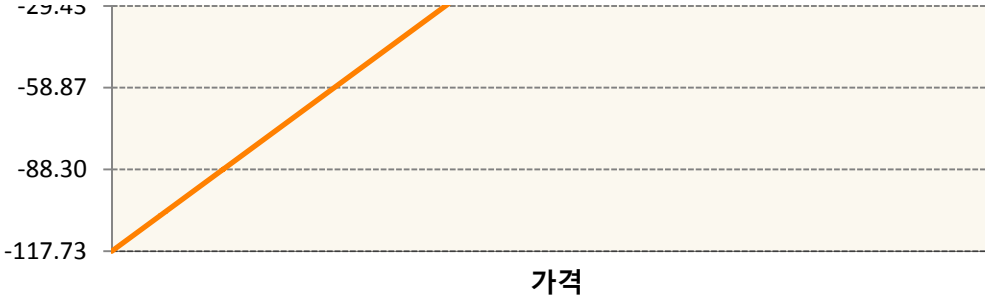
(단위:백만원)

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	1,545	0	1,545	
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)
	150

공시일	2016-12-13
기준일	2016-12-12

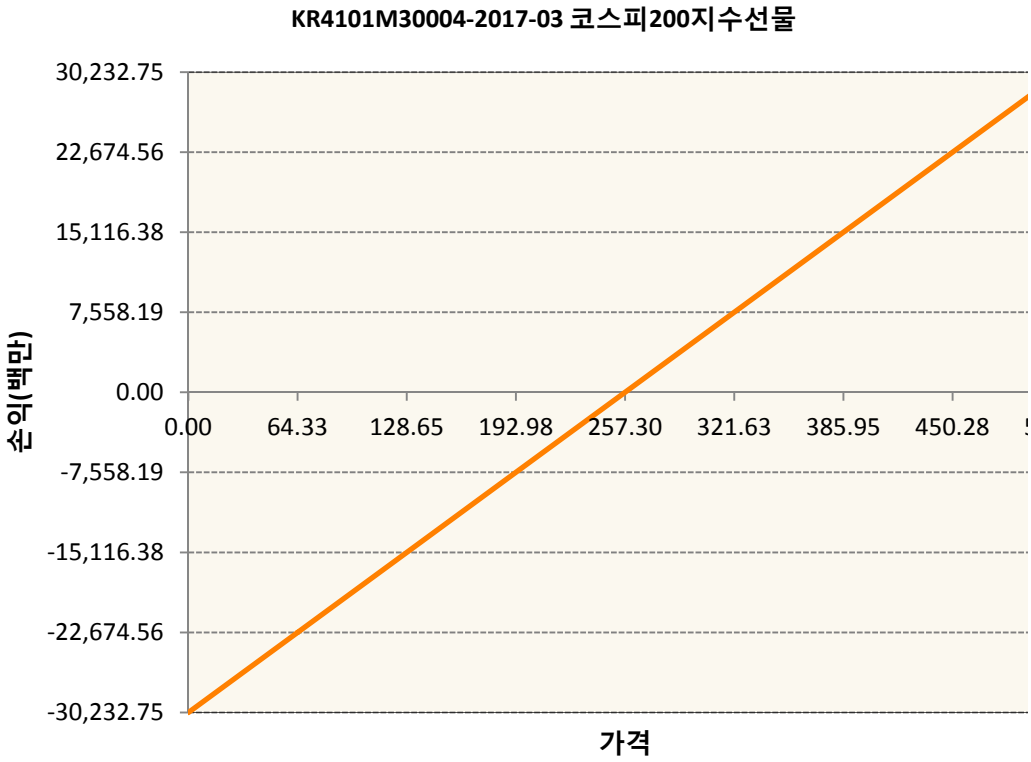
커버드콜(주식혼합-파생형)

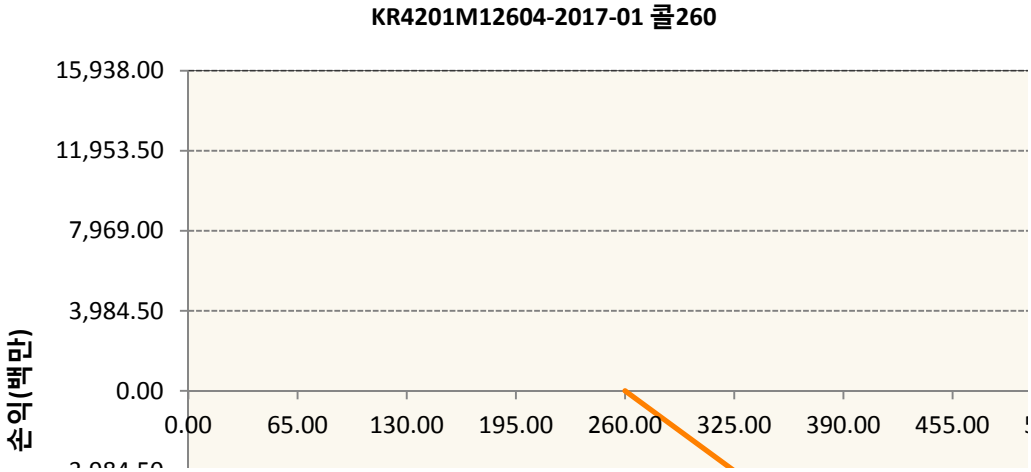
1. 계약금액

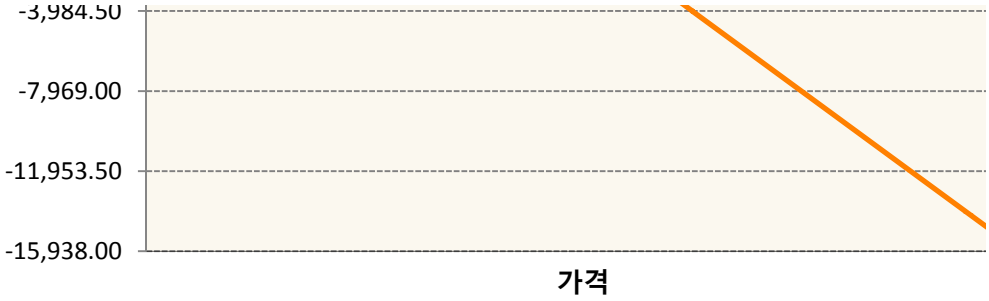
(단위:백만원)

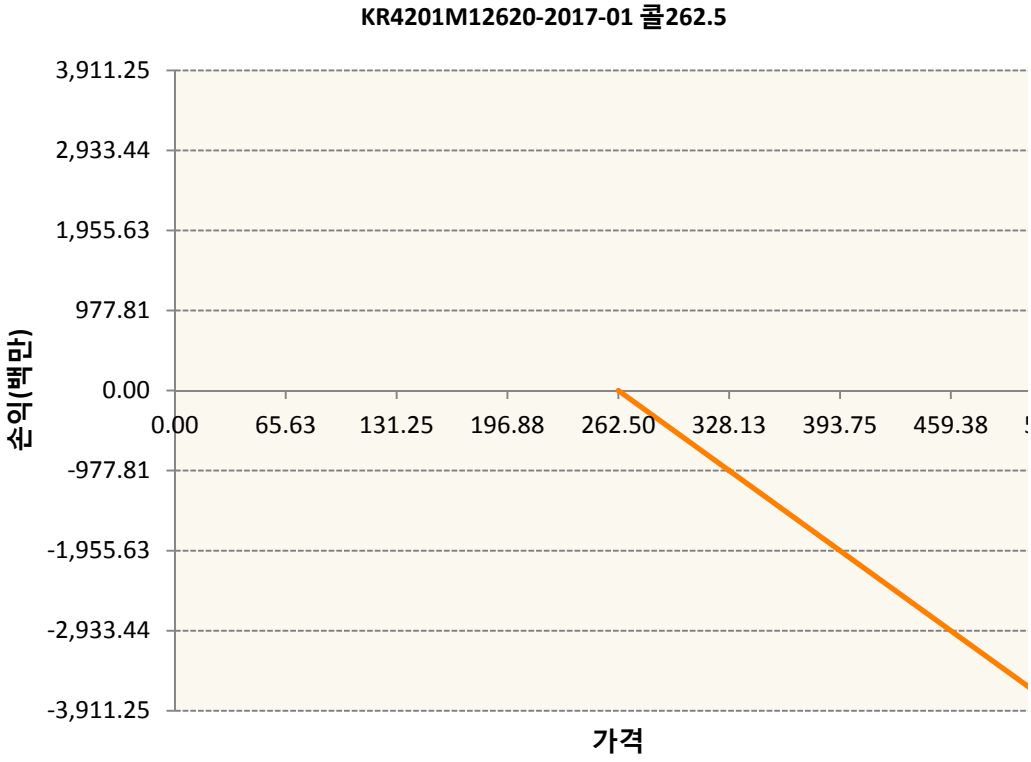
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	30,233	0	30,233	장내
누계	유가증권	옵션	0	19,849	-19,849	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101M30(2017-03 코스피200지수선물							2,451
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-2,451	-2,451	-2,451	-2,451	-2,451	-2,451	-2,451
-5.33%	-1,634	-1,634	-1,634	-1,634	-1,634	-1,634	-1,634
-2.67%	-817	-817	-817	-817	-817	-817	-817
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	817	817	817	817	817	817	817
5.33%	1,634	1,634	1,634	1,634	1,634	1,634	1,634
8.00%	2,451	2,451	2,451	2,451	2,451	2,451	2,451
KR4201M12(2017-01 콜260							5,411
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,245	1,244	1,240	1,235	1,226	1,214	1,199
-5.33%	1,226	1,209	1,186	1,157	1,123	1,084	1,039
-2.67%	1,038	974	905	833	757	680	601
0%	282	188	94	0	-94	-188	-283
2.67%	-1,253	-1,309	-1,371	-1,438	-1,508	-1,582	-1,658
5.33%	-3,245	-3,260	-3,281	-3,308	-3,341	-3,379	-3,422
8.00%	-5,358	-5,360	-5,364	-5,370	-5,380	-5,393	-5,411
KR4201M12(	2017-01 콜262.5						1,226

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	215	215	215	214	213	211	209
-5.33%	214	212	208	204	198	191	183
-2.67%	190	179	167	153	138	122	105
0%	68	45	23	0	-23	-45	-68
2.67%	-241	-259	-278	-298	-319	-339	-360
5.33%	-696	-703	-711	-721	-732	-745	-759
8.00%	-1,204	-1,205	-1,207	-1,210	-1,214	-1,219	-1,226

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

9,282

공시일	2016-12-13
기준일	2016-12-12

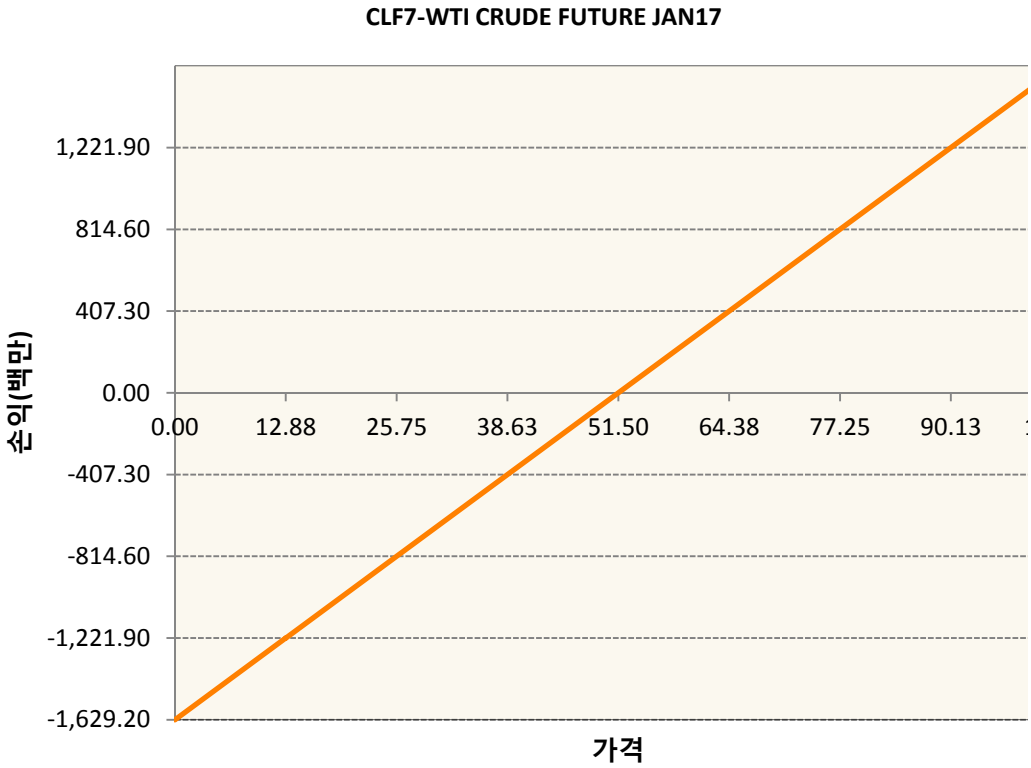
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

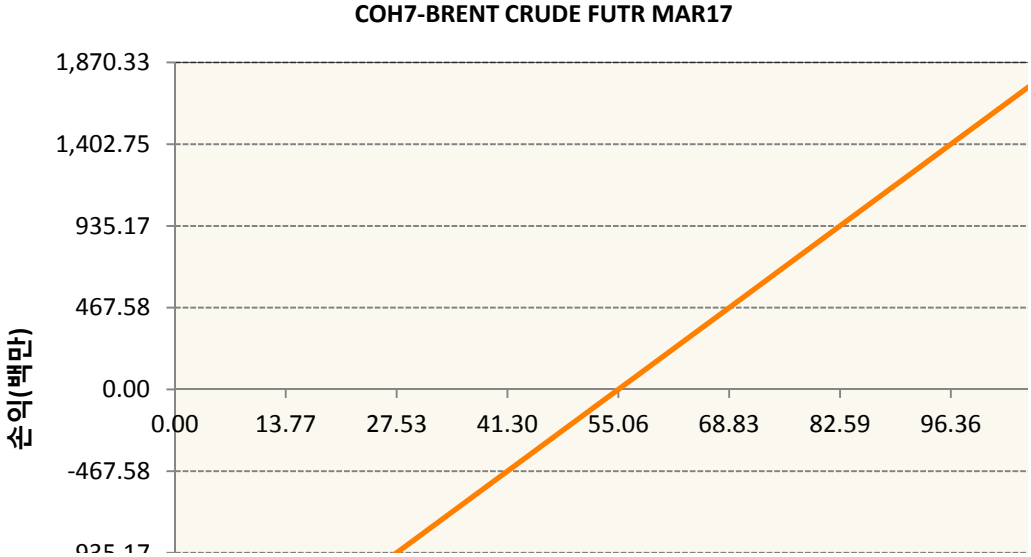
1. 계약금액

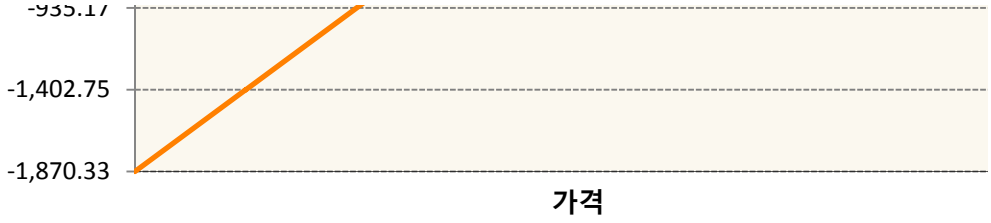
(단위:백만원)

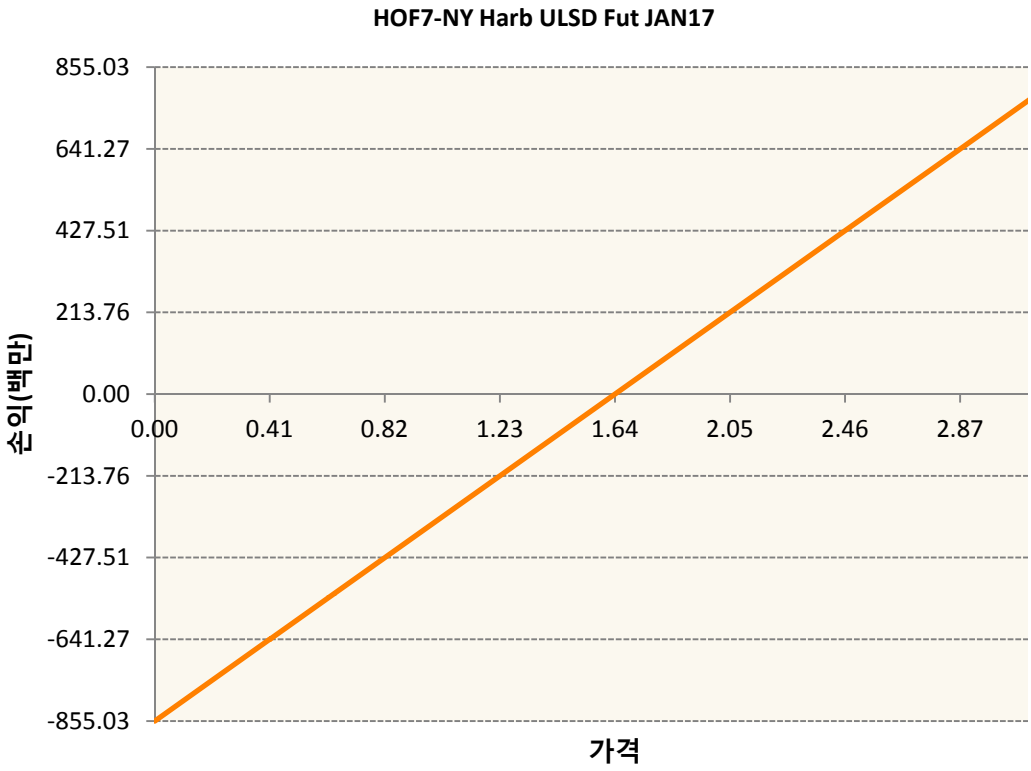
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	6,976	0	6,976	

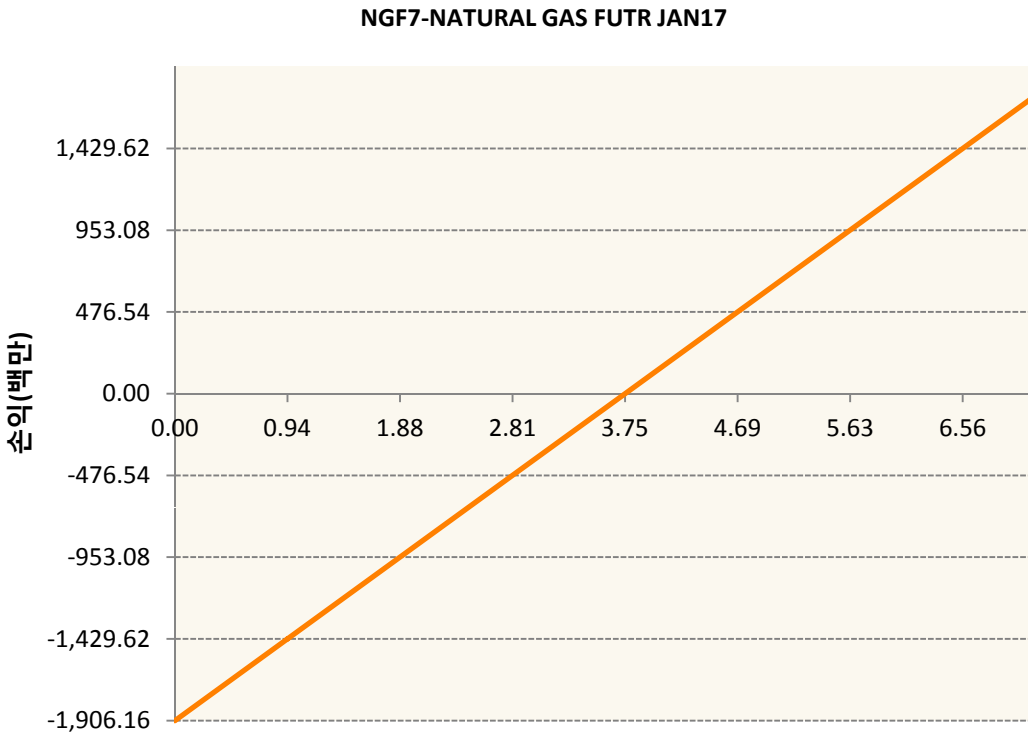
2. 만기시점의 손익구조



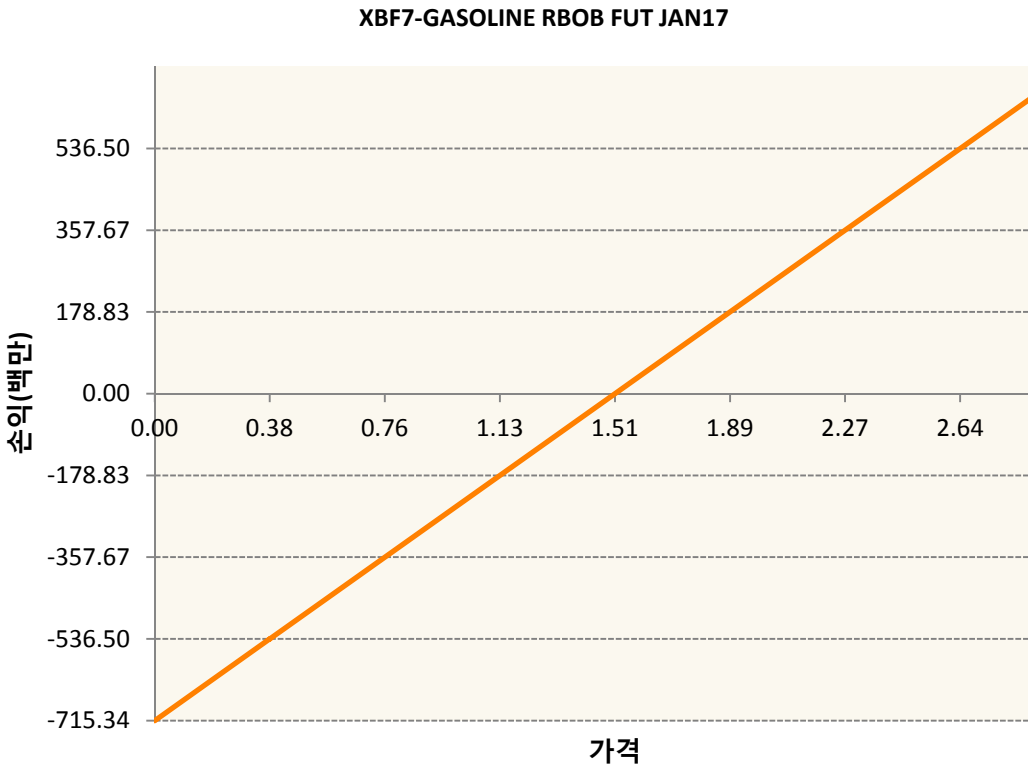



-1,402.75
-1,870.33
가격


HOF7-NY Harb ULSD Fut JAN17
855.03
641.27
427.51
213.76
0.00
-213.76
-427.51
-641.27
-855.03
0.00
0.41
0.82
1.23
1.64
2.05
2.46
2.87
순익(백만)
가격


NGF7-NATURAL GAS FUTR JAN17
1,429.62
953.08
476.54
0.00
-476.54
-953.08
-1,429.62
-1,906.16
0.00
0.94
1.88
2.81
3.75
4.69
5.63
6.56
순익(백만)

가격



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
CLF7	WTI CRUDE FUTURE JAN17	130
COH7	BRENT CRUDE FUTR MAR17	150
HOF7	NY Harb ULSD Fut JAN17	68
NGF7	NATURAL GAS FUTR JAN17	152
XBF7	GASOLINE RBOB FUT JAN17	57

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,267

공시일	2016-12-13
기준일	2016-12-12

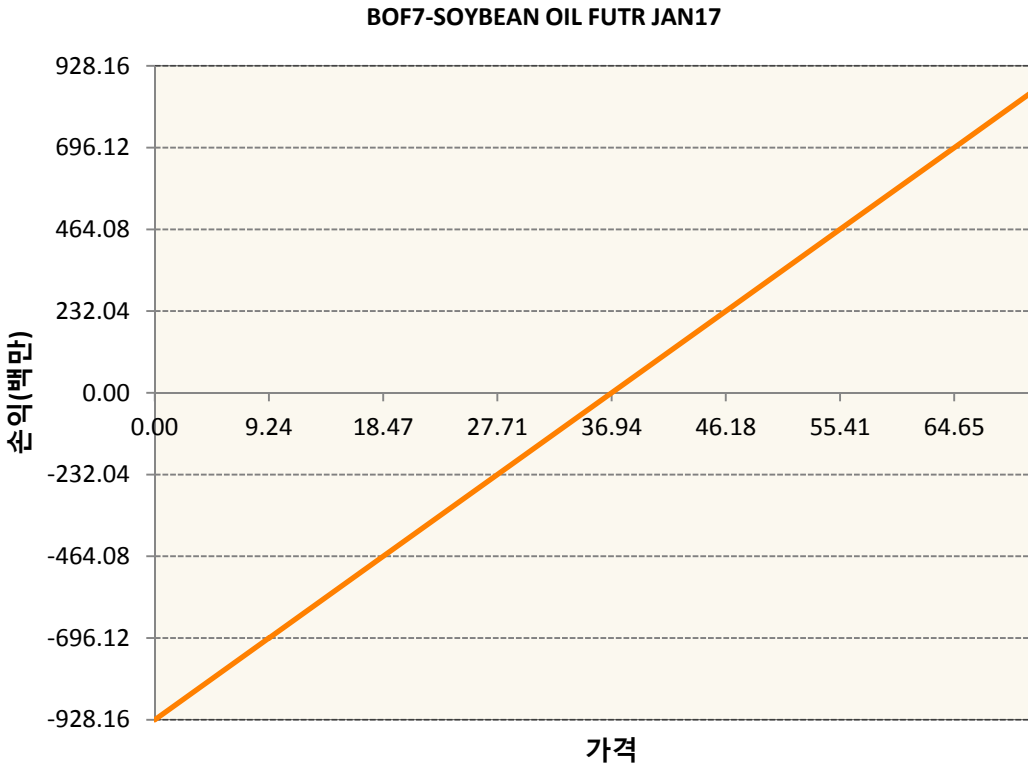
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

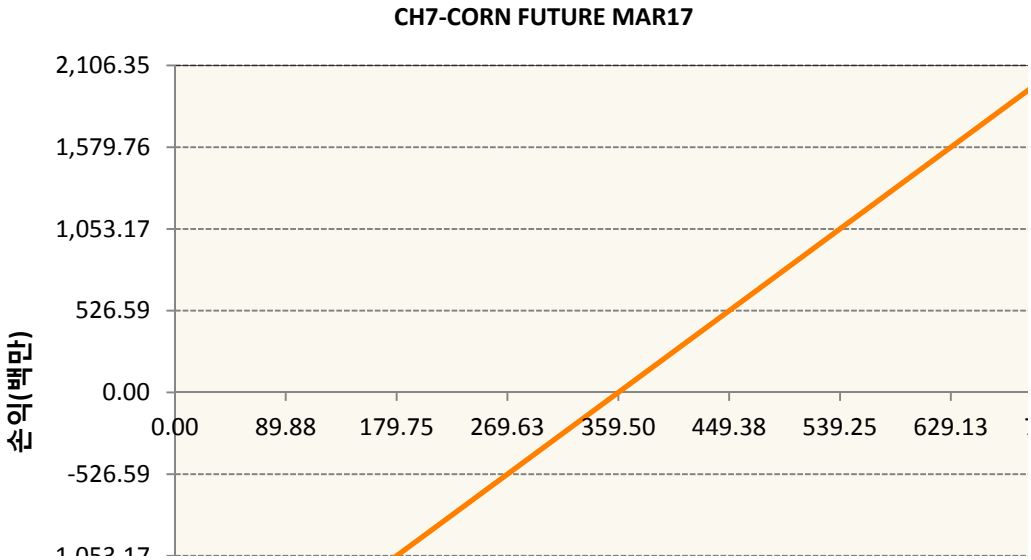
1. 계약금액

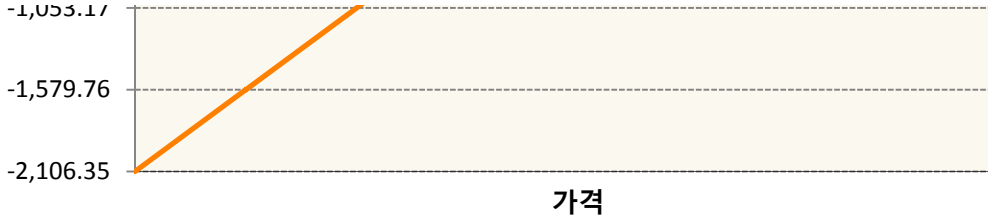
(단위:백만원)

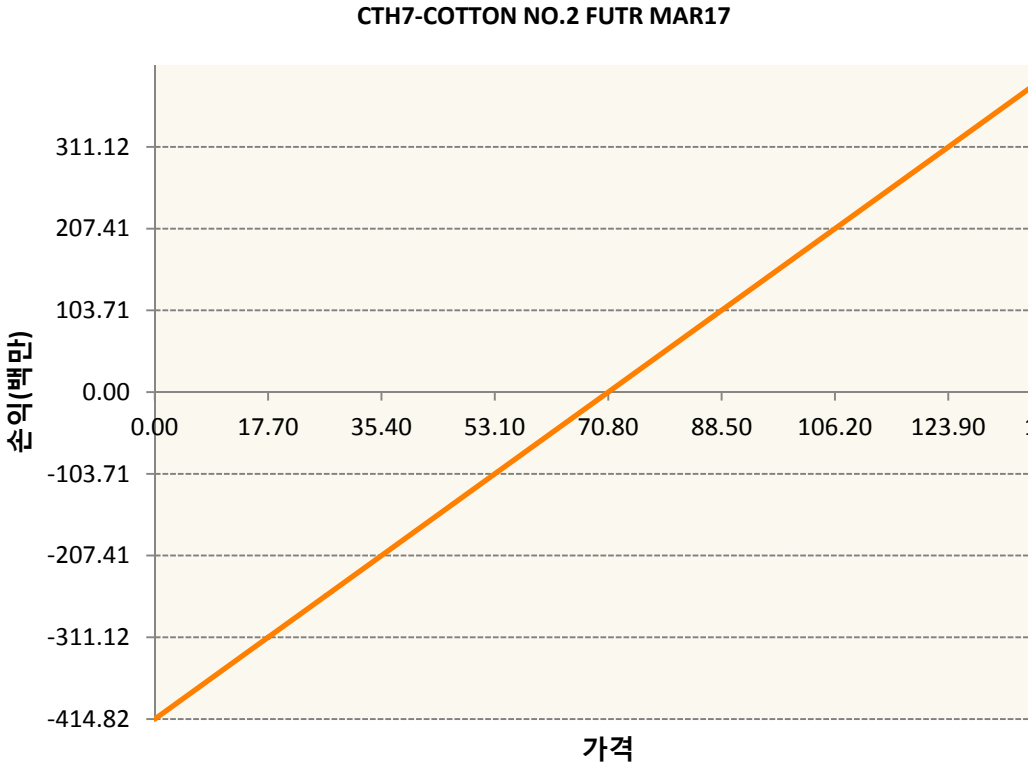
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	9,106	0	9,106	

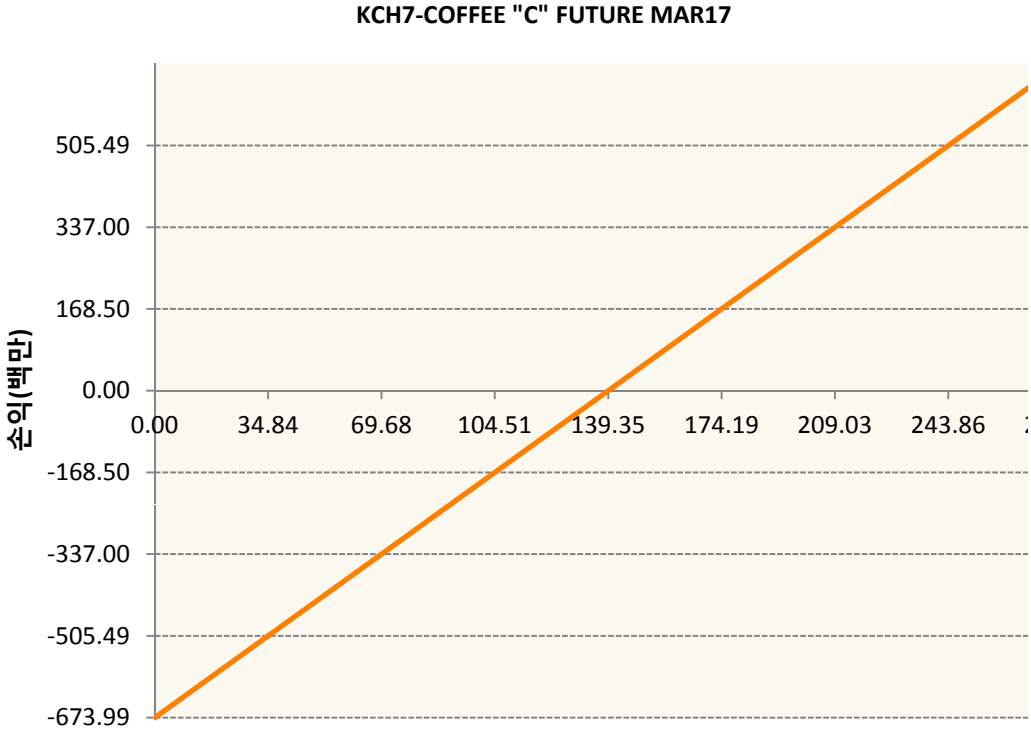
2. 만기시점의 손익구조



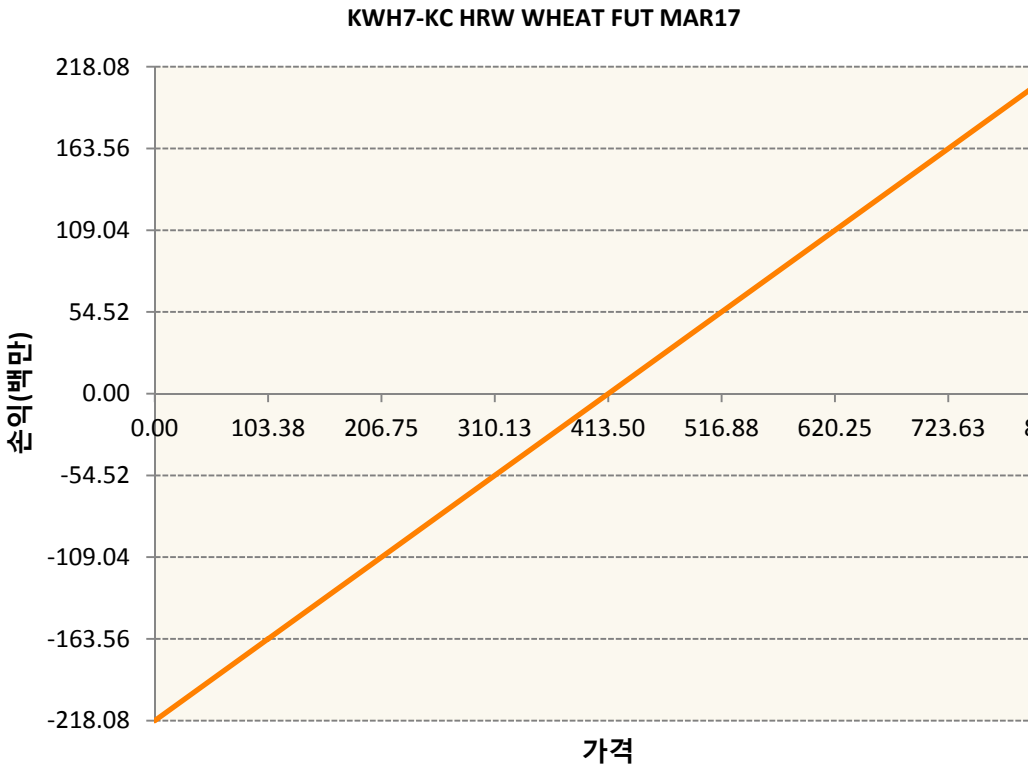


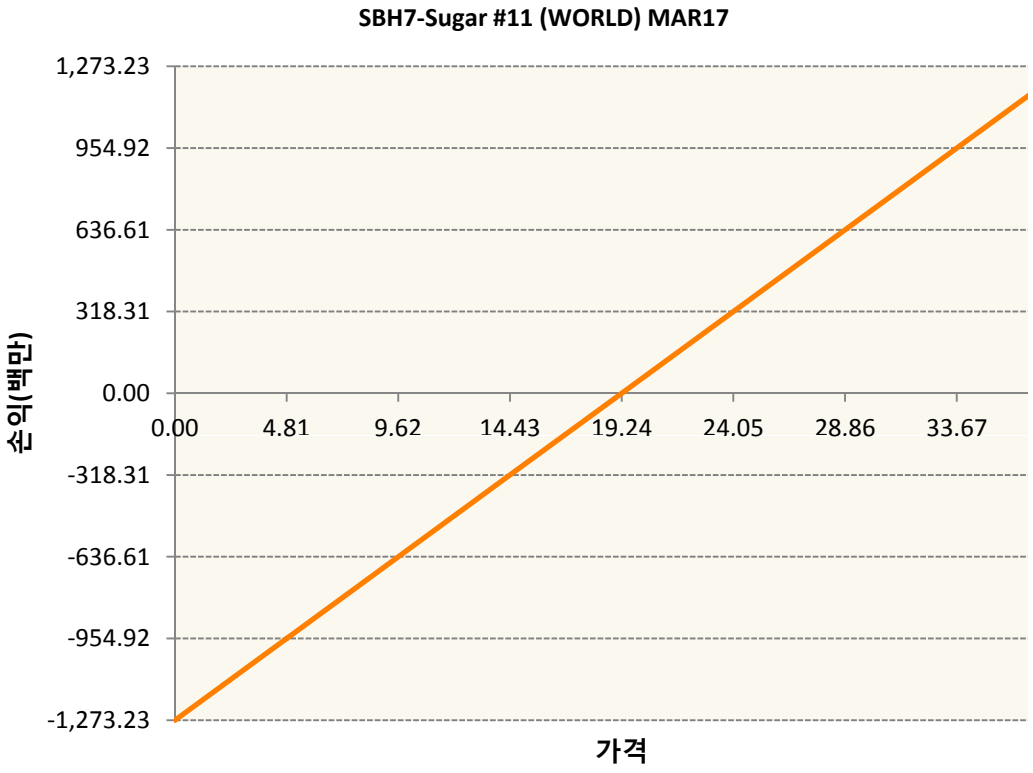

-1,579.76
-2,106.35
가격

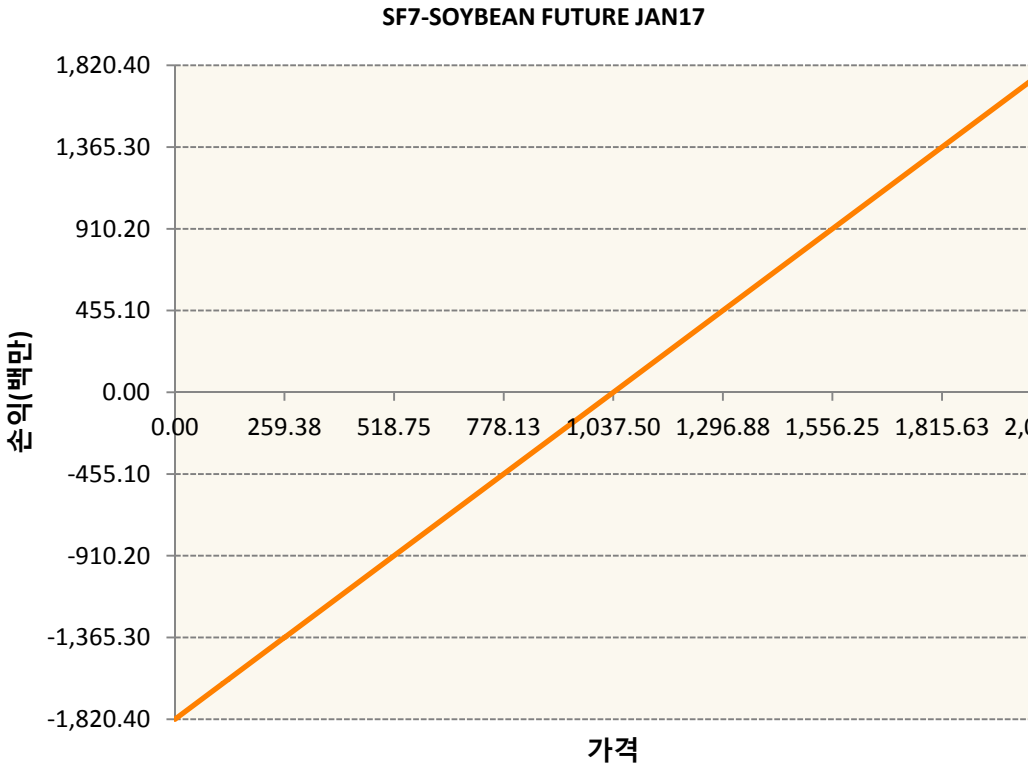

CTH7-COTTON NO.2 FUTR MAR17
311.12
207.41
103.71
0.00
-103.71
-207.41
-311.12
-414.82
0.00
17.70
35.40
53.10
70.80
88.50
106.20
123.90
순익(백만)
가격

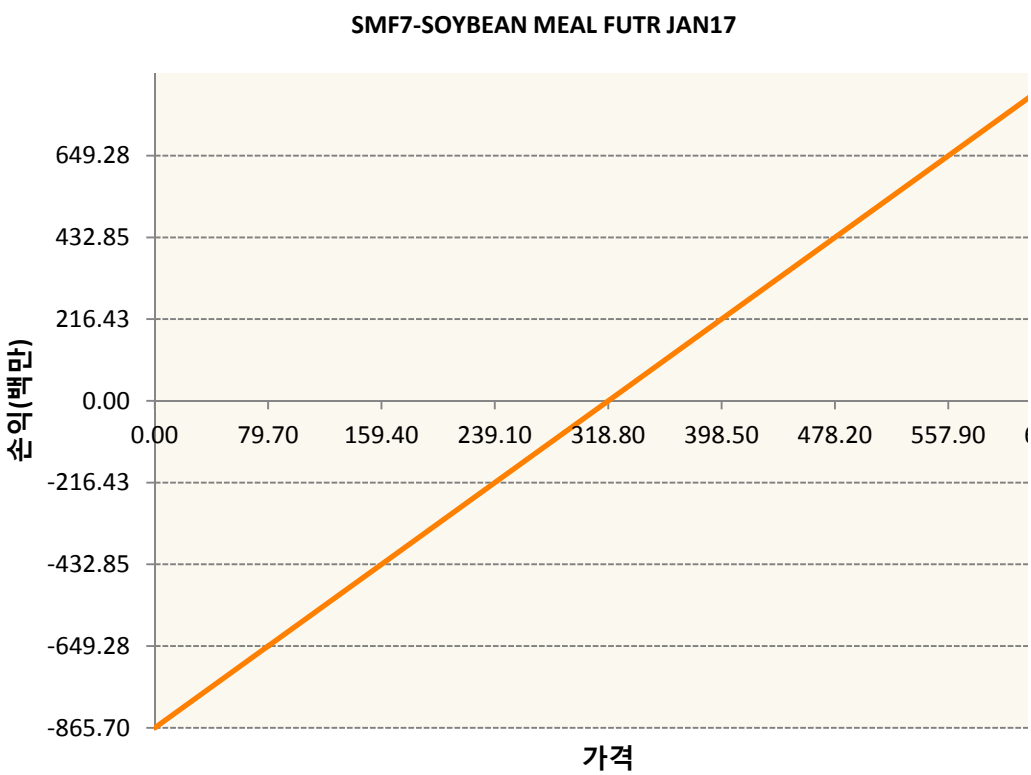

KCH7-COFFEE "C" FUTURE MAR17
505.49
337.00
168.50
0.00
-168.50
-337.00
-505.49
-673.99
0.00
34.84
69.68
104.51
139.35
174.19
209.03
243.86
순익(백만)

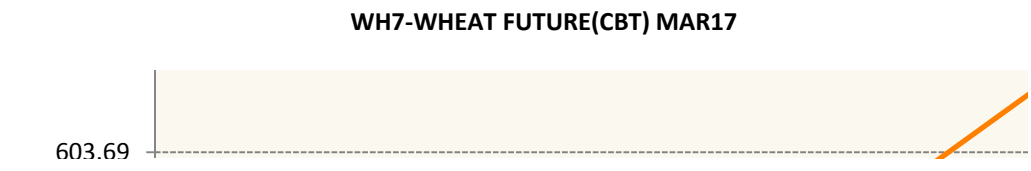
가격

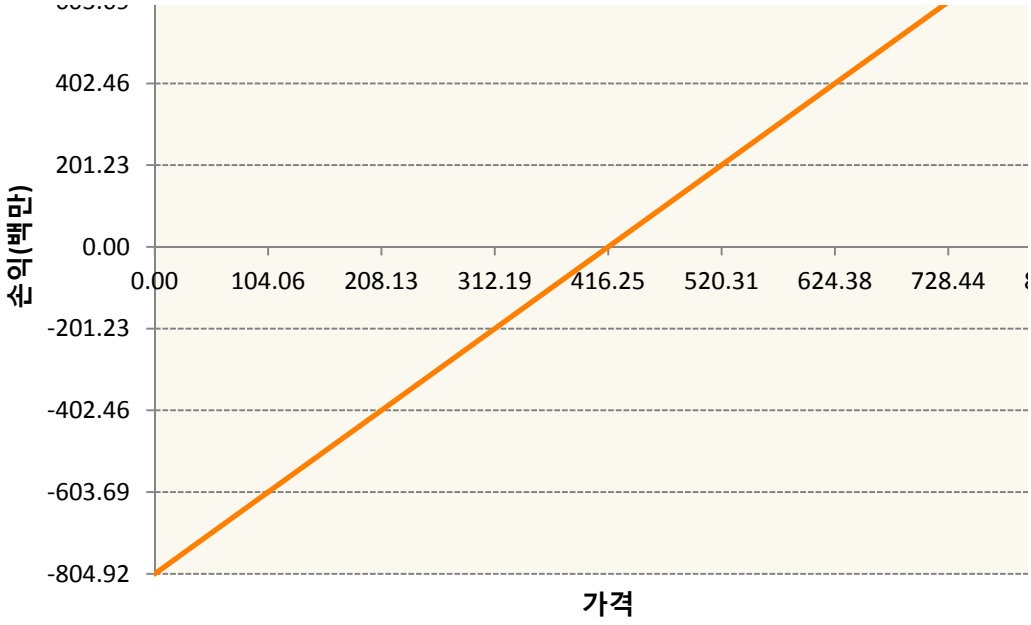

KWH7-KC HRW WHEAT FUT MAR17
218.08
163.56
109.04
54.52
0.00
-54.52
-109.04
-163.56
-218.08
0.00
103.38
206.75
310.13
413.50
516.88
620.25
723.63
손익(백만)
가격


SBH7-Sugar #11 (WORLD) MAR17
1,273.23
954.92
636.61
318.31
0.00
-318.31
-636.61
-954.92
-1,273.23
0.00
4.81
9.62
14.43
19.24
24.05
28.86
33.67
손익(백만)
가격


SF7-SOYBEAN FUTURE JAN17
1,820.40
1,365.30
910.20
455.10
0.00
-455.10
-910.20
-1,365.30
-1,820.40
0.00
259.38
518.75
778.13
1,037.50
1,296.88
1,556.25
1,815.63
손익(백만)
가격


SMF7-SOYBEAN MEAL FUTR JAN17
649.28
432.85
216.43
0.00
-216.43
-432.85
-649.28
-865.70
0.00
79.70
159.40
239.10
318.80
398.50
478.20
557.90
손익(백만)
가격


WH7-WHEAT FUTURE(CBT) MAR17
603.69



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

BOF7	SOYBEAN OIL FUTR JAN17	74
CH7	CORN FUTURE MAR17	169
CTH7	COTTON NO.2 FUTR MAR17	33
KCH7	COFFEE "C" FUTURE MAR17	54
KWH7	KC HRW WHEAT FUT MAR17	17
SBH7	Sugar #11 (WORLD) MAR17	102
SF7	SOYBEAN FUTURE JAN17	146
SMF7	SOYBEAN MEAL FUTR JAN17	69
WH7	WHEAT FUTURE(CBT) MAR17	64

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

888