공시일	2016-12-15
기준일	2016-12-14

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	2016-12-15
기준일	2016-12-14

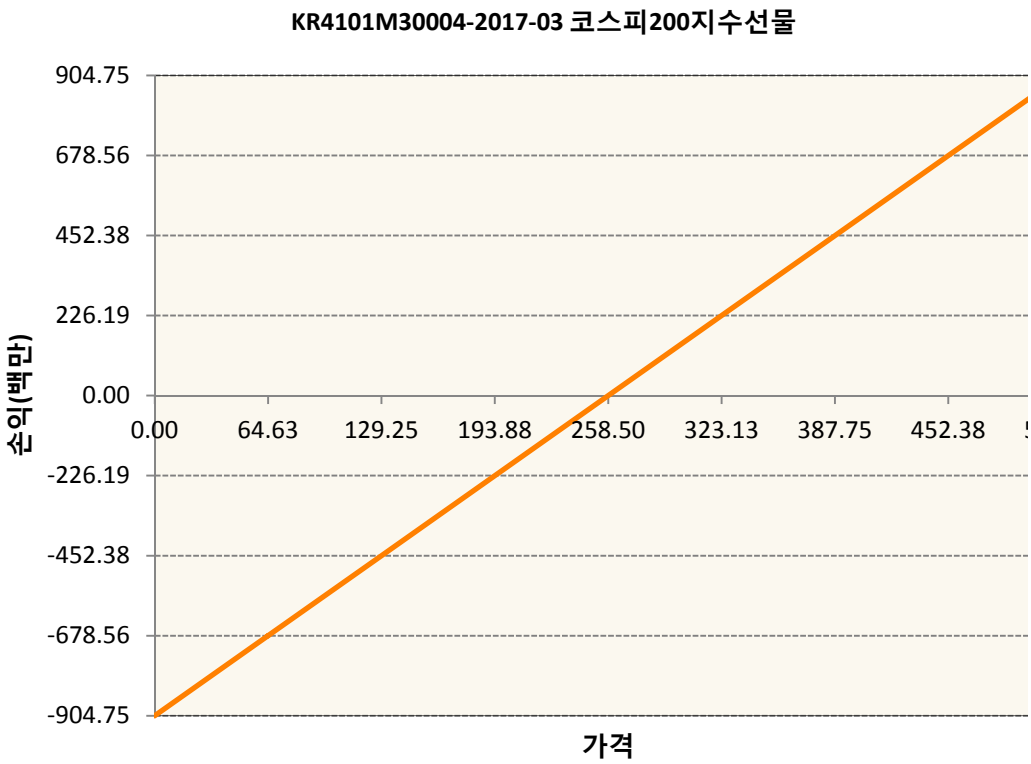
스마트인덱스모

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	905	0	905	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)

56

공시일	2016-12-15
기준일	2016-12-14

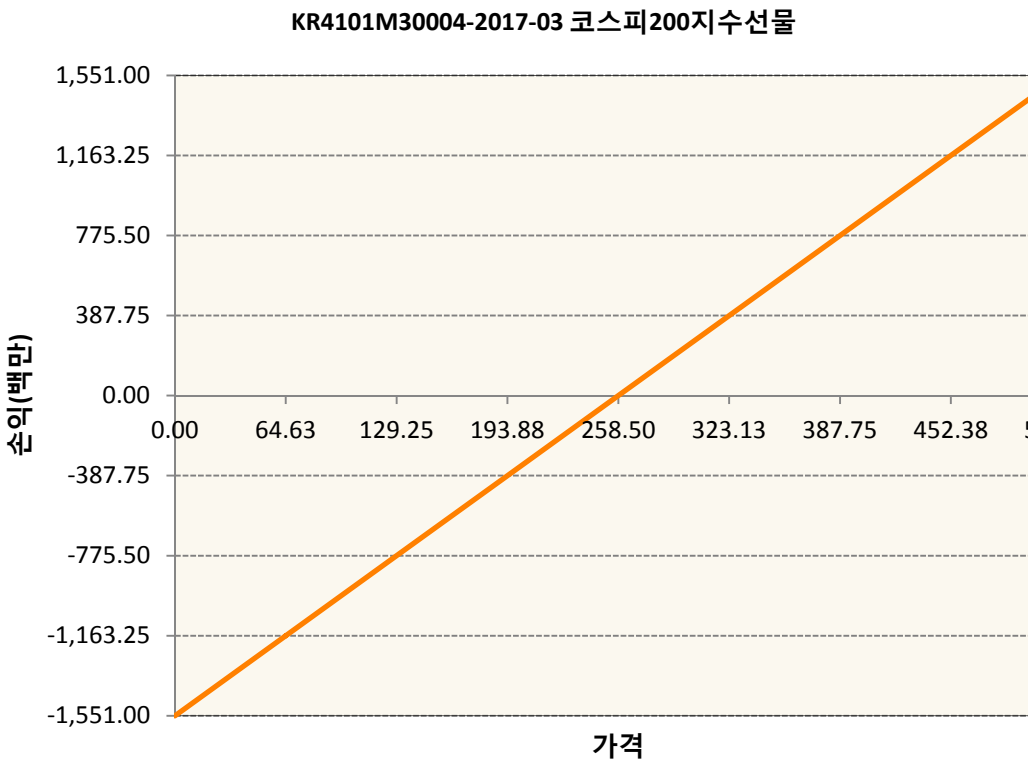
스마트레버리지목표전환형1호

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	129	-129	장내
누계	유가증권	선물	1,551	0	1,551	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101M30(2017-03 코스피200지수선물							126
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-126	-126	-126	-126	-126	-126	-126
-5.33%	-84	-84	-84	-84	-84	-84	-84
-2.67%	-42	-42	-42	-42	-42	-42	-42
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	42	42	42	42	42	42	42
5.33%	84	84	84	84	84	84	84
8.00%	126	126	126	126	126	126	126

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

95

공시일	2016-12-15
기준일	2016-12-14

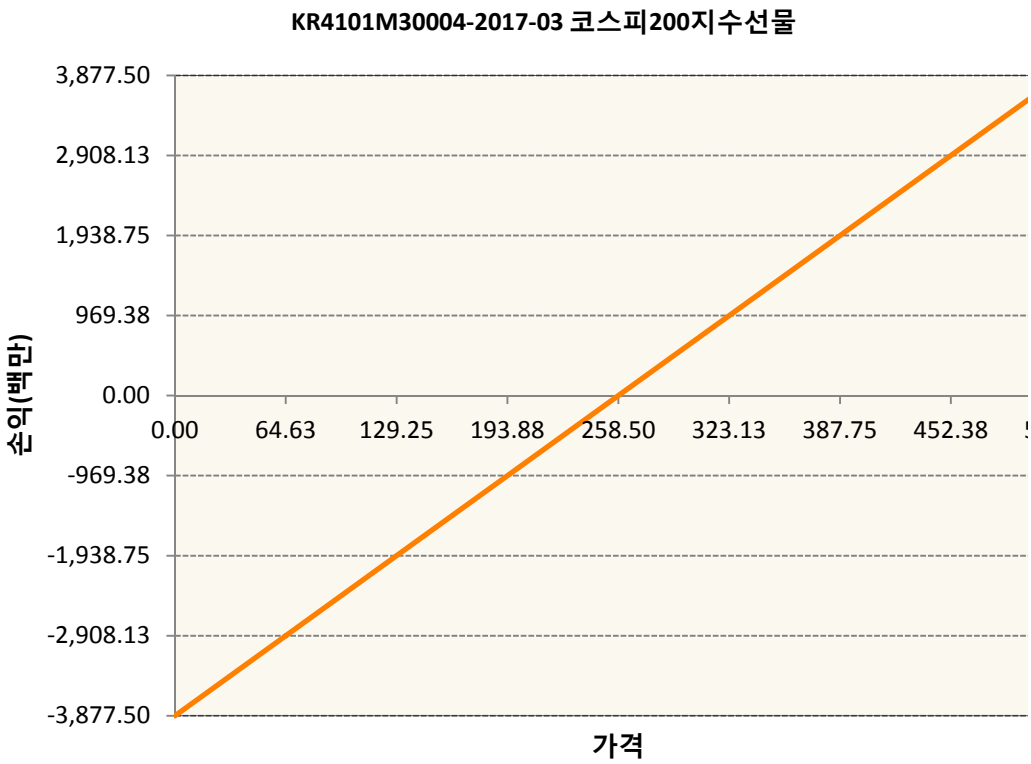
1.3배 레버리지 인덱스(주식-파생형)

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	3,878	0	3,878	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101M30(2017-03 코스피200지수선물							314
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-314	-314	-314	-314	-314	-314	-314
-5.33%	-210	-210	-210	-210	-210	-210	-210
-2.67%	-105	-105	-105	-105	-105	-105	-105
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	105	105	105	105	105	105	105
5.33%	210	210	210	210	210	210	210
8.00%	314	314	314	314	314	314	314

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

239

공시일	2016-12-15
기준일	2016-12-14

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	914

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

734

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2016-12-15
기준일	2016-12-14

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)

696

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2016-12-15
기준일	2016-12-14

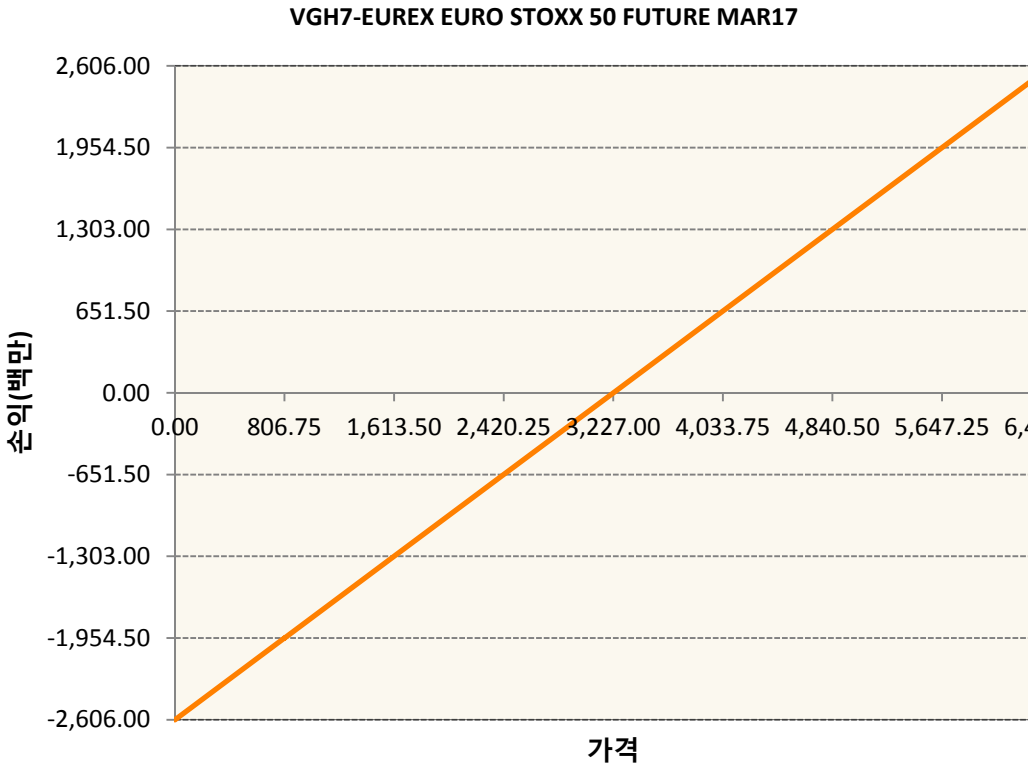
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,606	0	2,606	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGH7	EUREX EURO STOXX 50 FUTURE MAR17	208

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

(단위:백만원)

243

공시일	2016-12-15
기준일	2016-12-14

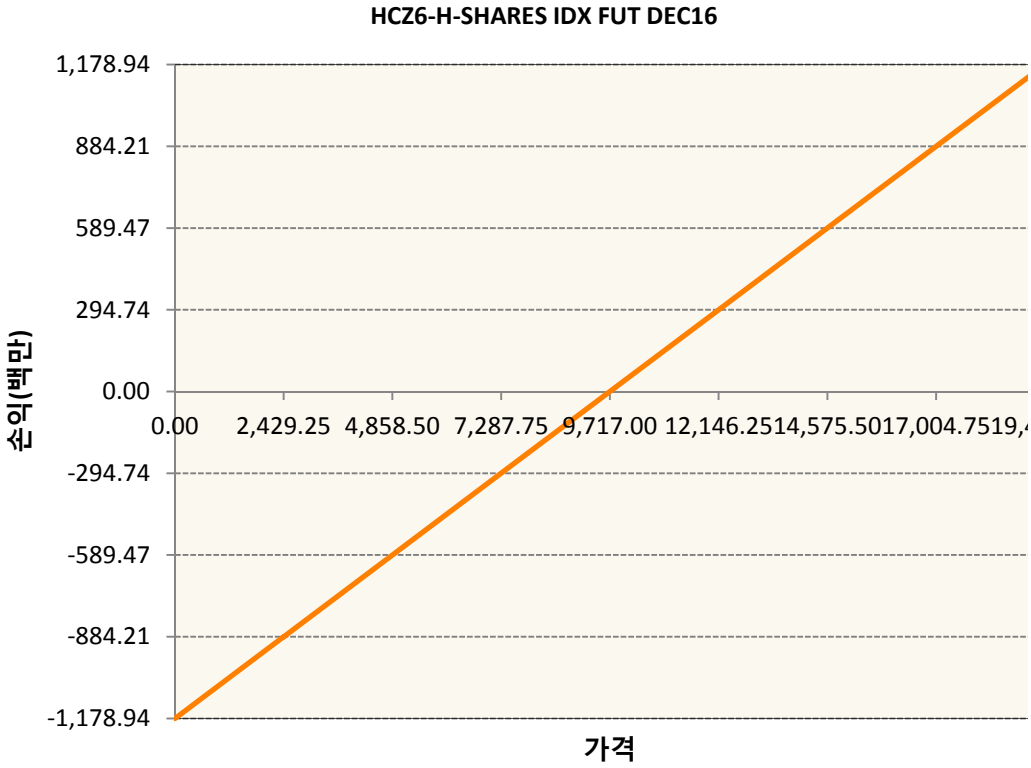
차이나인덱스모(주식-파생형)

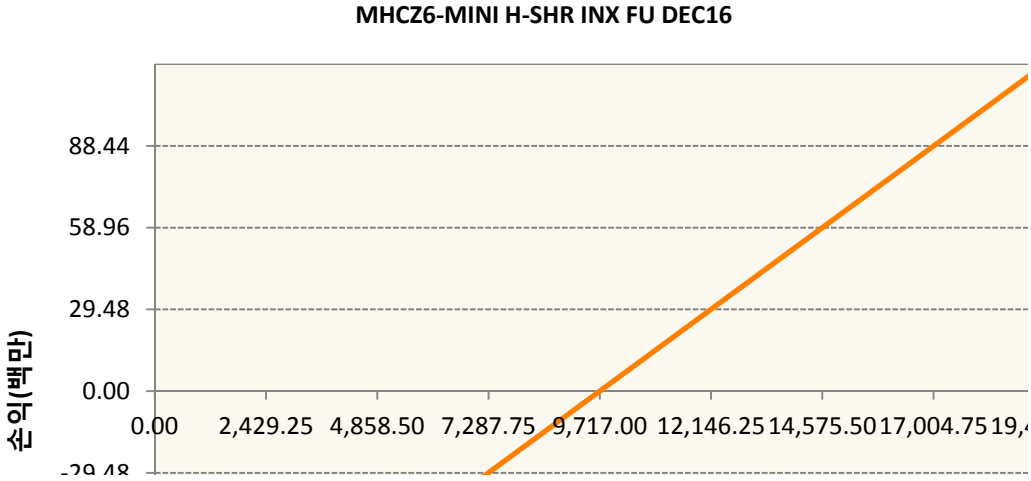
1. 계약금액

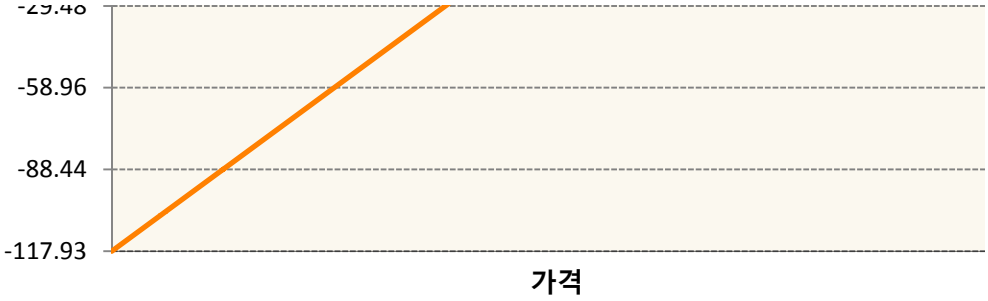
(단위:백만원)

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	1,179	0	1,179	
누계	유가증권	선물	118	0	118	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

HCZ6	H-SHARES IDX FUT DEC16	94
MHCZ6	MINI H-SHR INX FU DEC16	9

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

117

공시일	2016-12-15
기준일	2016-12-14

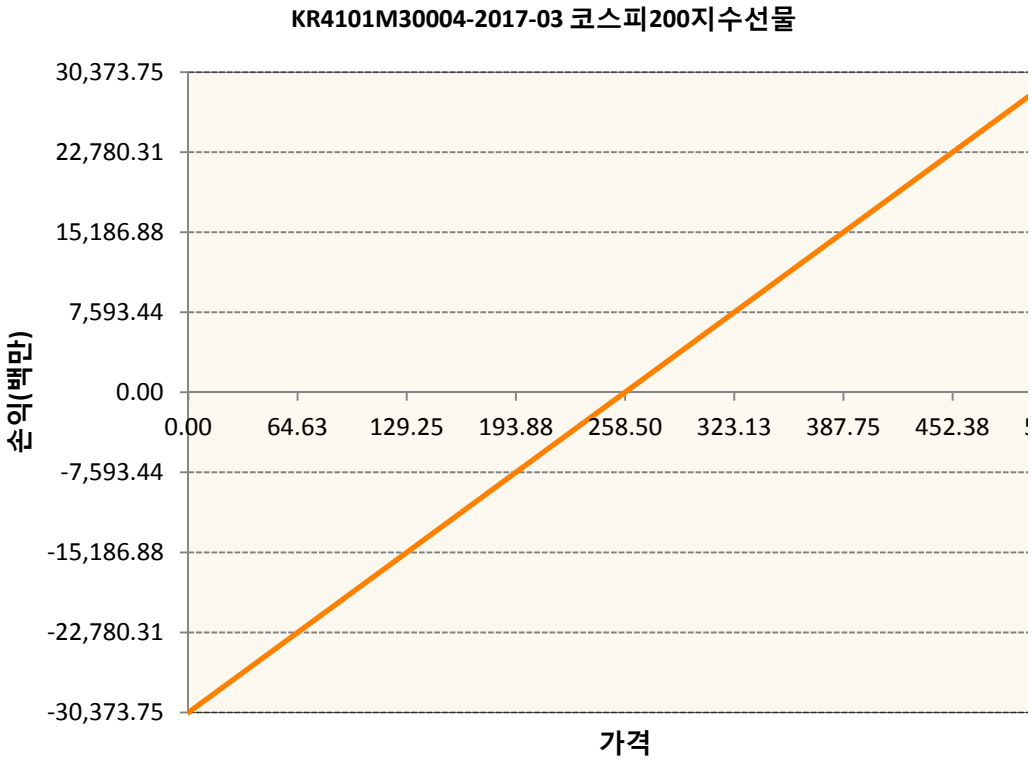
커버드콜(주식혼합-파생형)

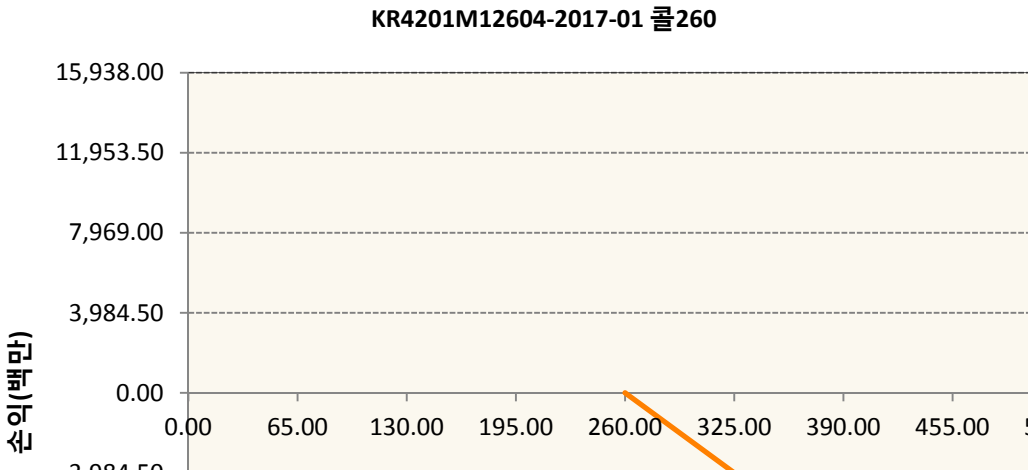
1. 계약금액

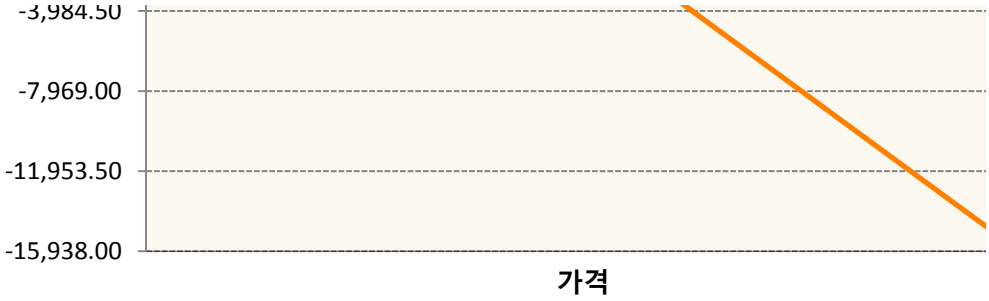
(단위:백만원)

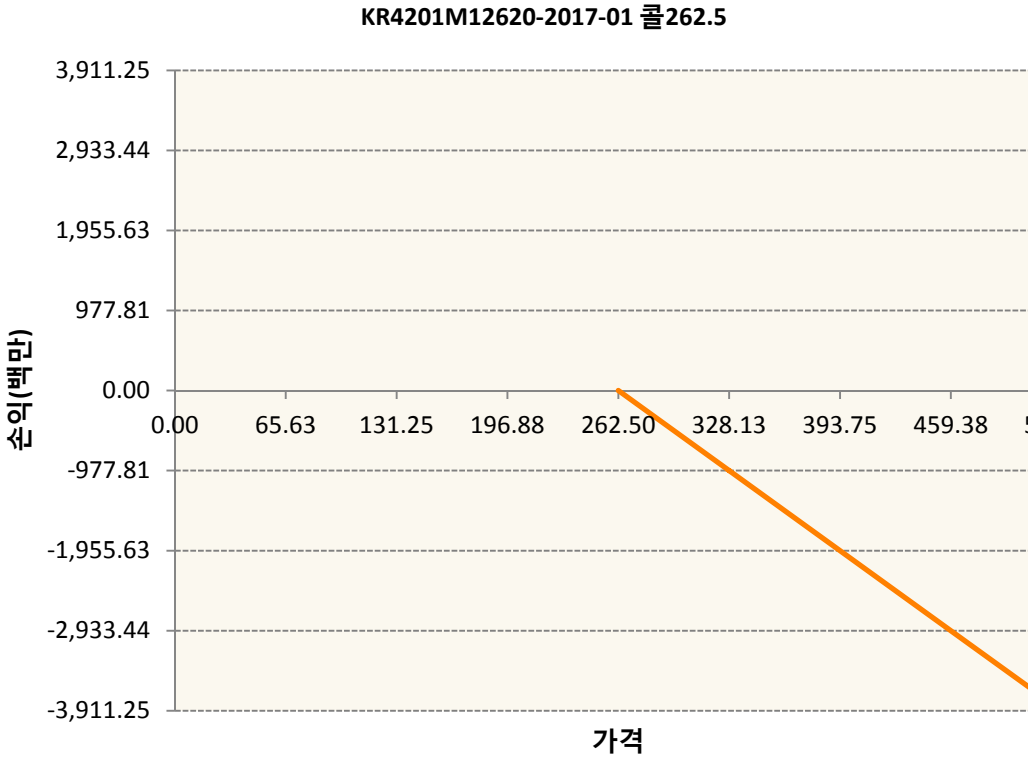
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	30,374	0	30,374	장내
누계	유가증권	옵션	0	19,849	-19,849	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101M30(2017-03 코스피200지수선물							2,463
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-2,463	-2,463	-2,463	-2,463	-2,463	-2,463	-2,463
-5.33%	-1,642	-1,642	-1,642	-1,642	-1,642	-1,642	-1,642
-2.67%	-821	-821	-821	-821	-821	-821	-821
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	821	821	821	821	821	821	821
5.33%	1,642	1,642	1,642	1,642	1,642	1,642	1,642
8.00%	2,463	2,463	2,463	2,463	2,463	2,463	2,463
KR4201M12(2017-01 콜260							5,700
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,345	1,344	1,342	1,339	1,333	1,324	1,313
-5.33%	1,329	1,315	1,296	1,271	1,241	1,207	1,169
-2.67%	1,126	1,064	999	931	861	790	716
0%	243	163	82	0	-82	-164	-247
2.67%	-1,470	-1,504	-1,544	-1,590	-1,641	-1,695	-1,752
5.33%	-3,546	-3,551	-3,560	-3,572	-3,589	-3,611	-3,637
8.00%	-5,681	-5,681	-5,682	-5,684	-5,687	-5,692	-5,700
KR4201M12(	2017-01 콜262.5						1,302

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	229	228	228	228	227	226	224
-5.33%	227	226	223	220	215	209	203
-2.67%	204	193	182	169	155	140	125
0%	62	41	21	0	-21	-41	-62
2.67%	-291	-304	-318	-333	-349	-366	-383
5.33%	-776	-779	-784	-789	-796	-804	-813
8.00%	-1,293	-1,294	-1,294	-1,295	-1,297	-1,299	-1,302

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

10,048

공시일	2016-12-15
기준일	2016-12-14

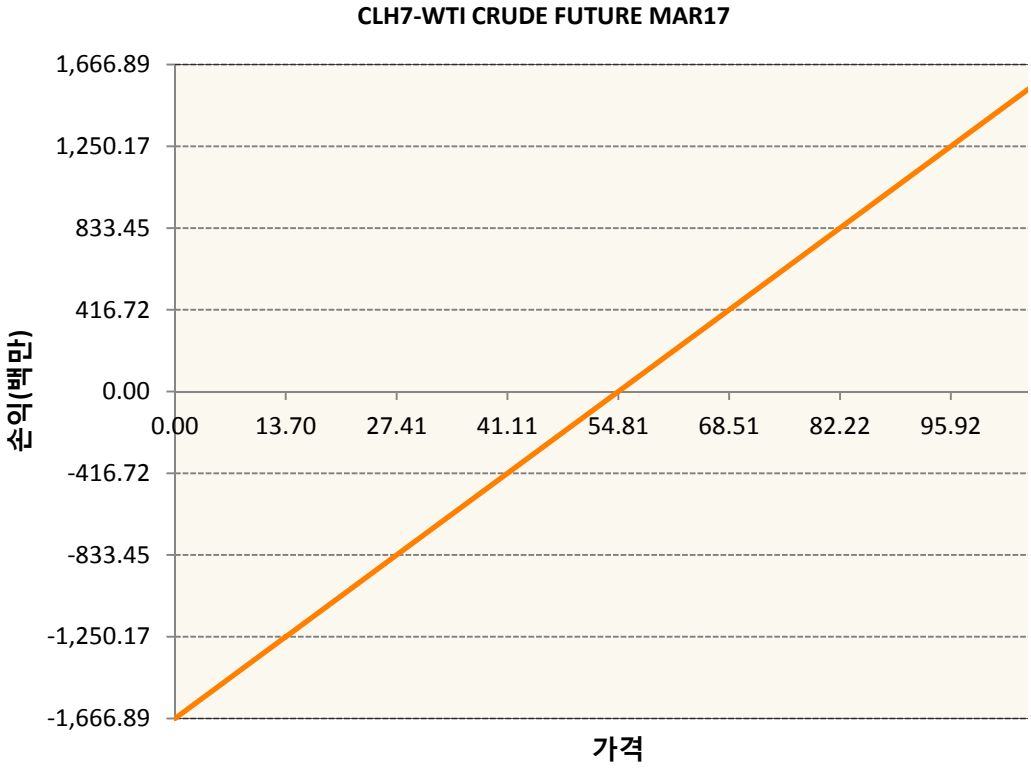
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

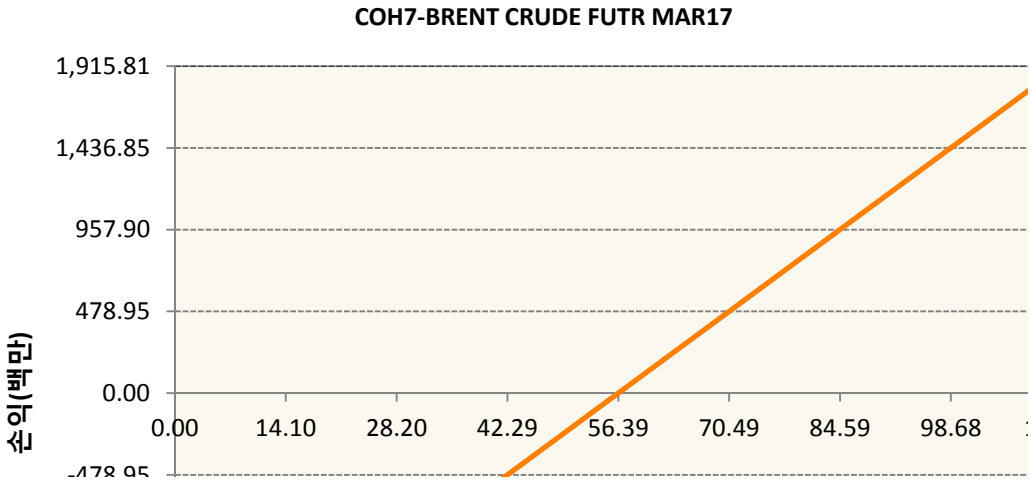
1. 계약금액

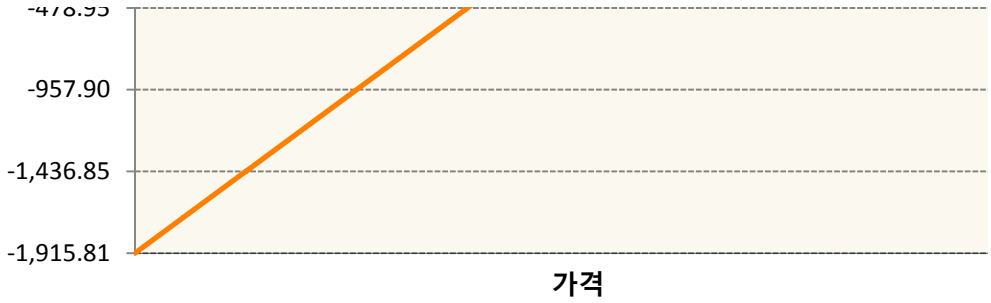
(단위:백만원)

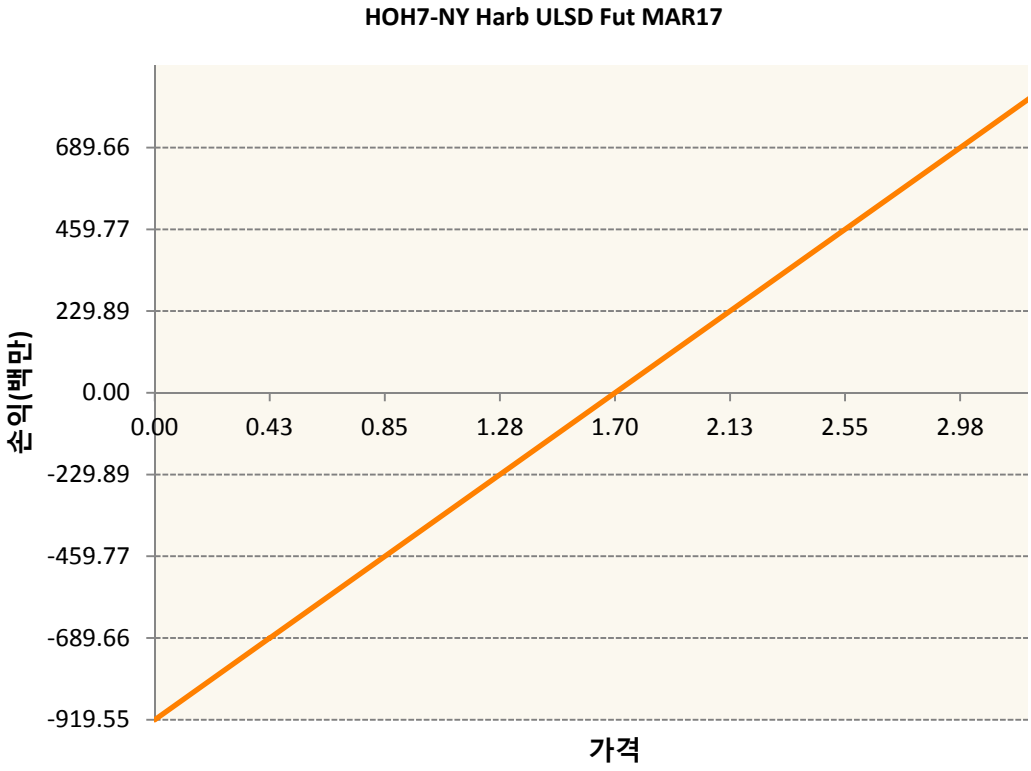
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	선물	유가증권	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	선물	유가증권	1,667	0	1,667	
누계	유가증권	선물	5,397	0	5,397	

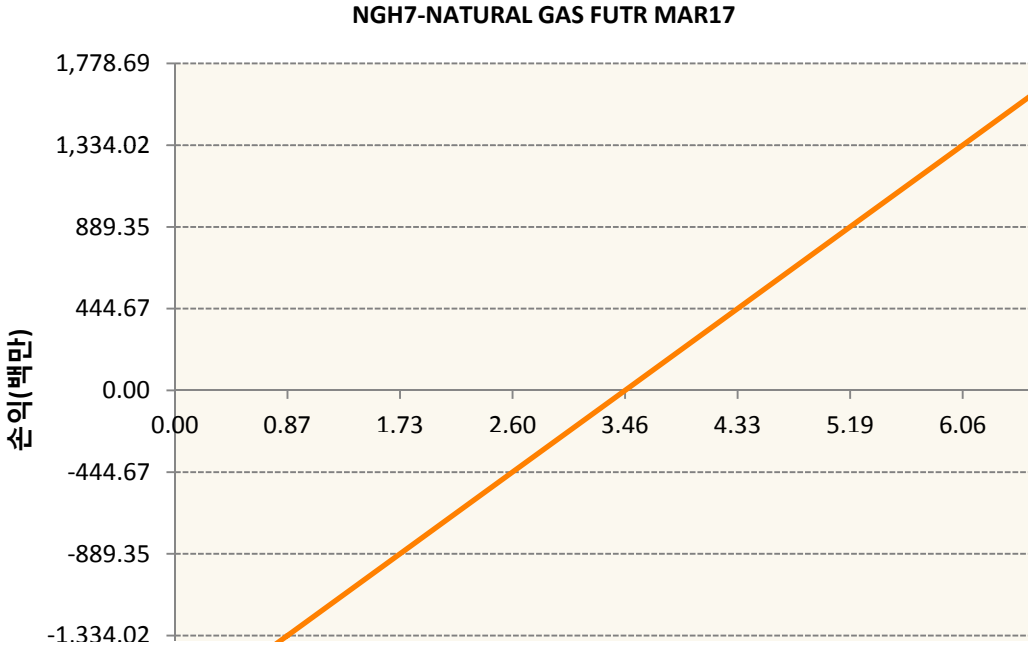
2. 만기시점의 손익구조

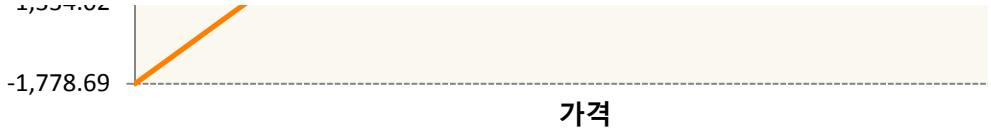


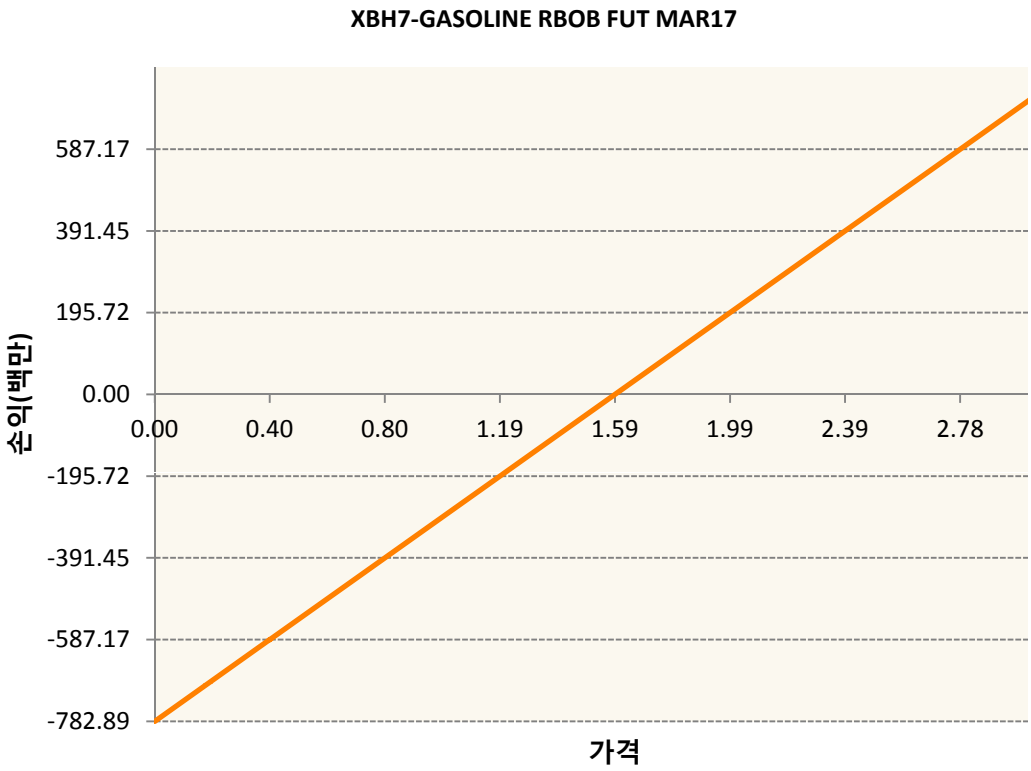



-957.90
-1,436.85
-1,915.81
가격


HOH7-NY Harb ULSD Fut MAR17
689.66
459.77
229.89
0.00
-229.89
-459.77
-689.66
-919.55
0.00
0.43
0.85
1.28
1.70
2.13
2.55
2.98
손익(백만)
가격


NGH7-NATURAL GAS FUTR MAR17
1,778.69
1,334.02
889.35
444.67
0.00
-444.67
-889.35
-1,334.02
0.00
0.87
1.73
2.60
3.46
4.33
5.19
6.06
손익(백만)





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLH7	WTI CRUDE FUTURE MAR17	133
COH7	BRENT CRUDE FUTR MAR17	153
HOH7	NY Harb ULSD Fut MAR17	74
NGH7	NATURAL GAS FUTR MAR17	142
XBH7	GASOLINE RBOB FUT MAR17	63

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

1,284

공시일	2016-12-15
기준일	2016-12-14

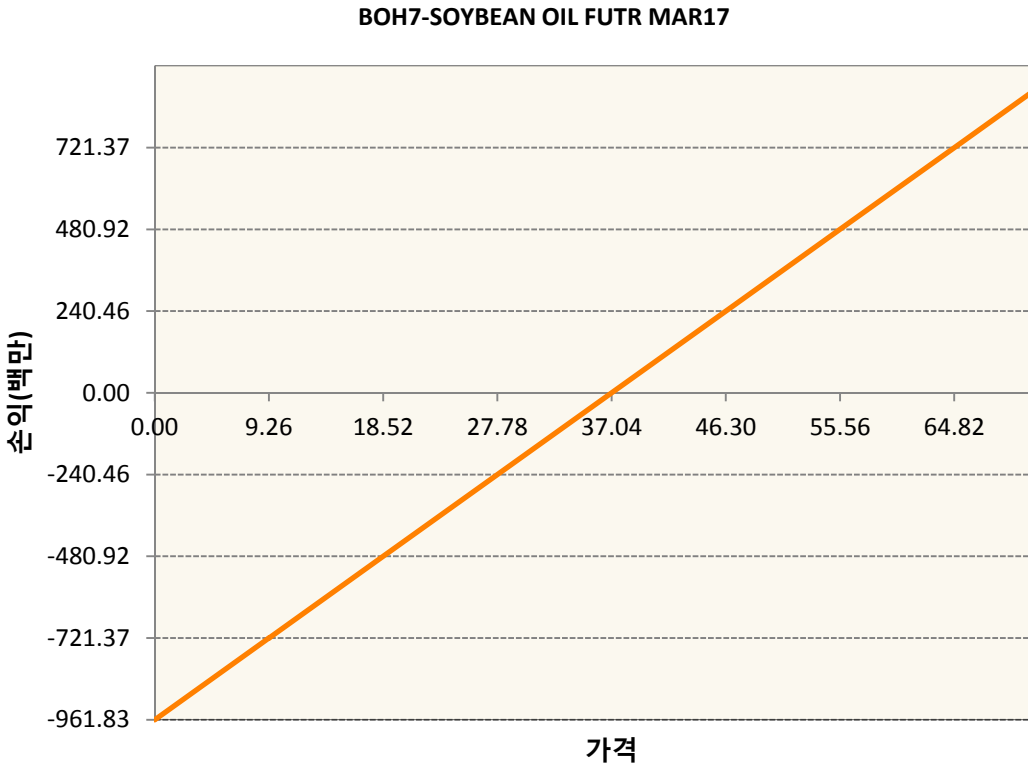
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

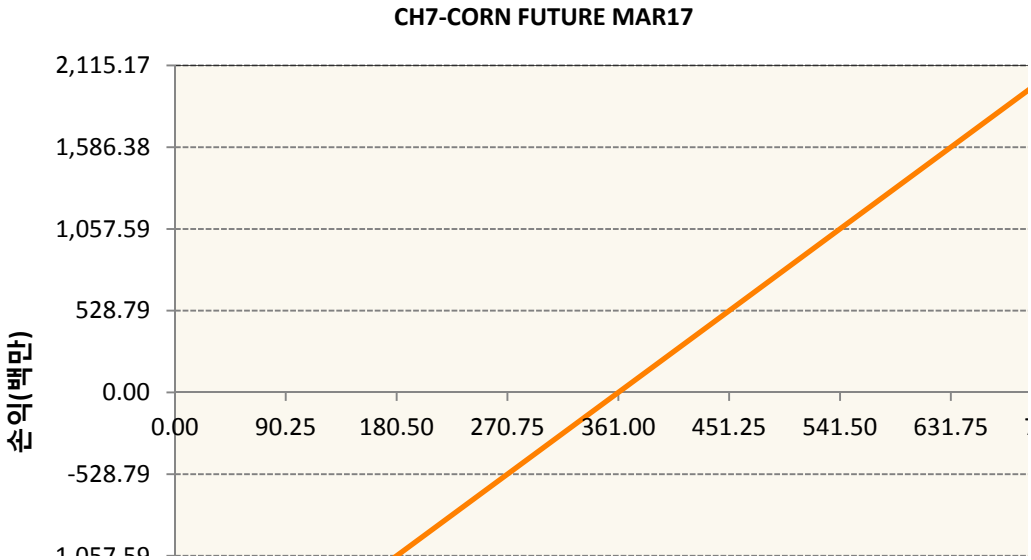
1. 계약금액

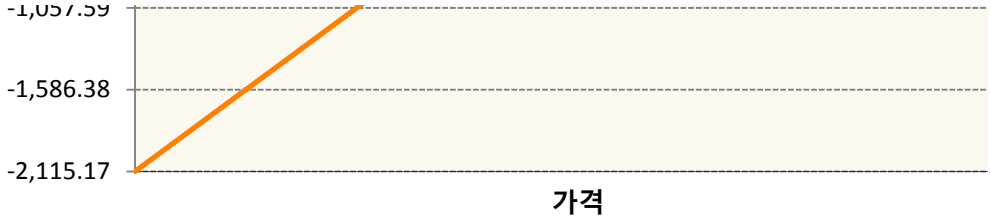
(단위:백만원)

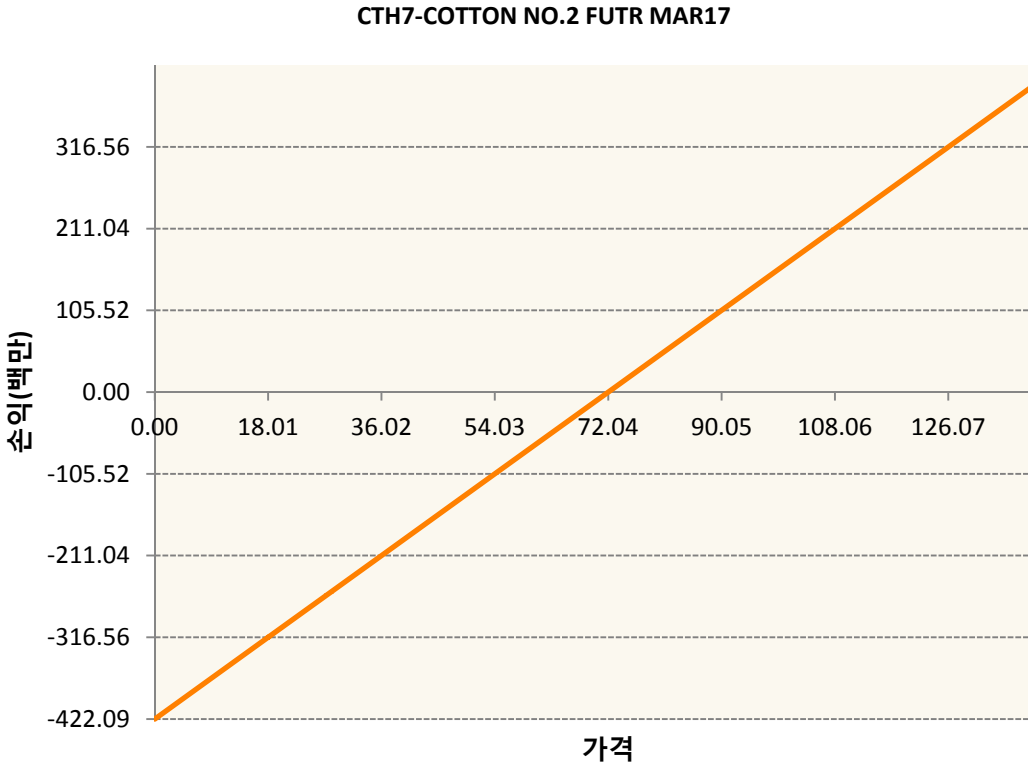
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	9,388	0	9,388	

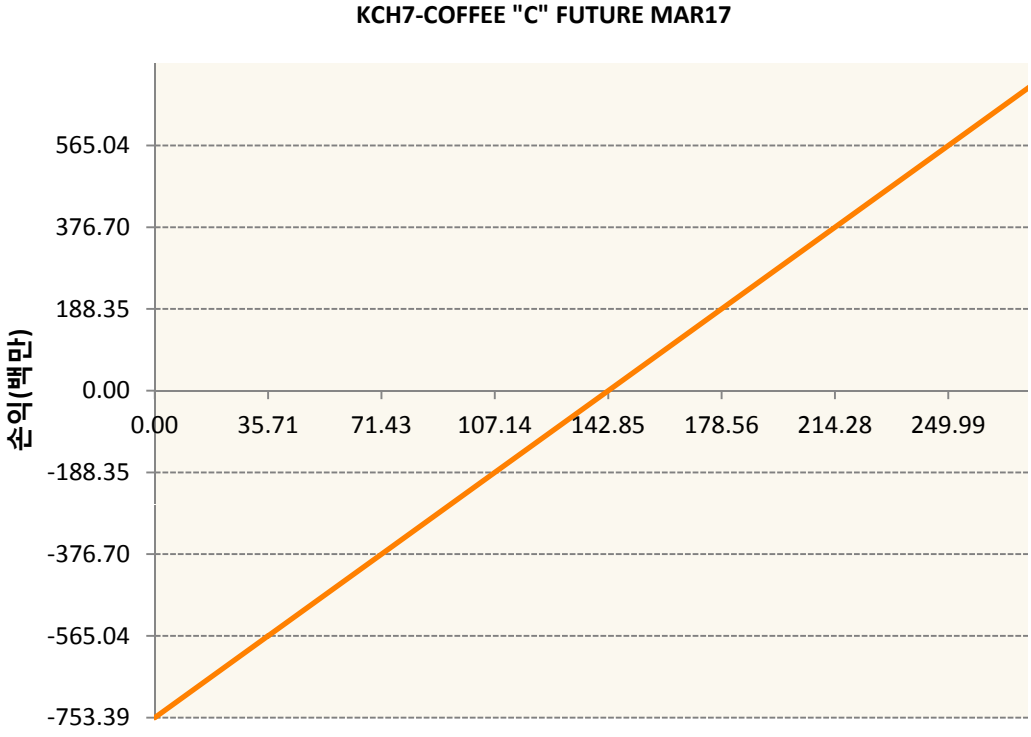
2. 만기시점의 손익구조



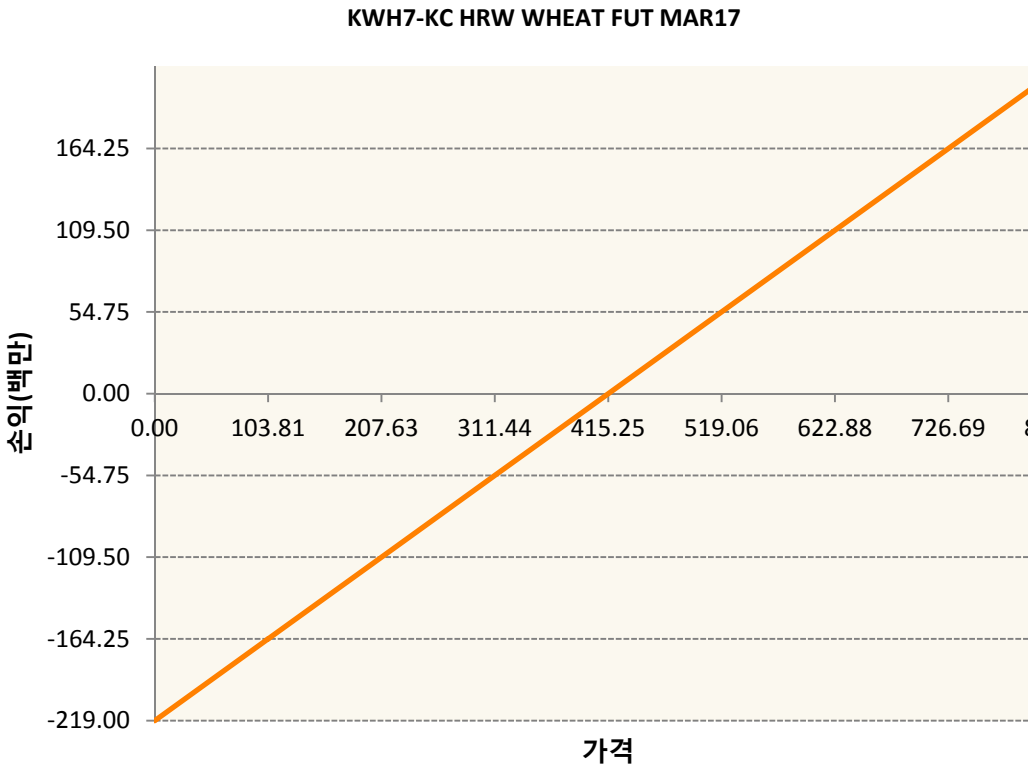


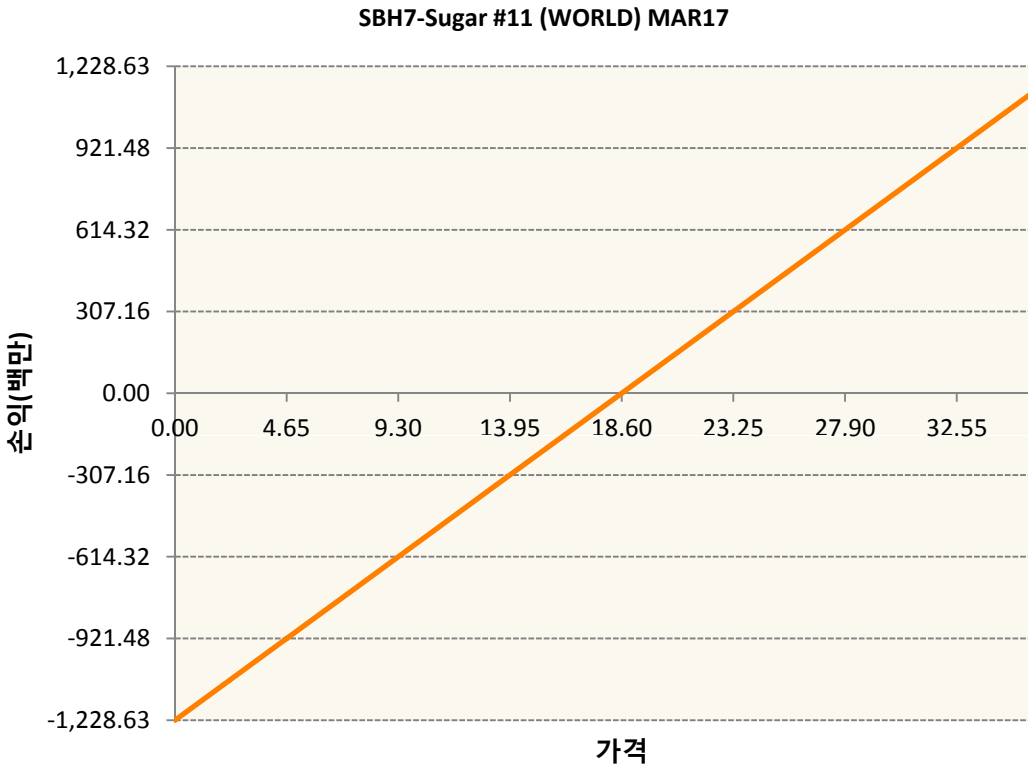

-1,586.38
-2,115.17
가격

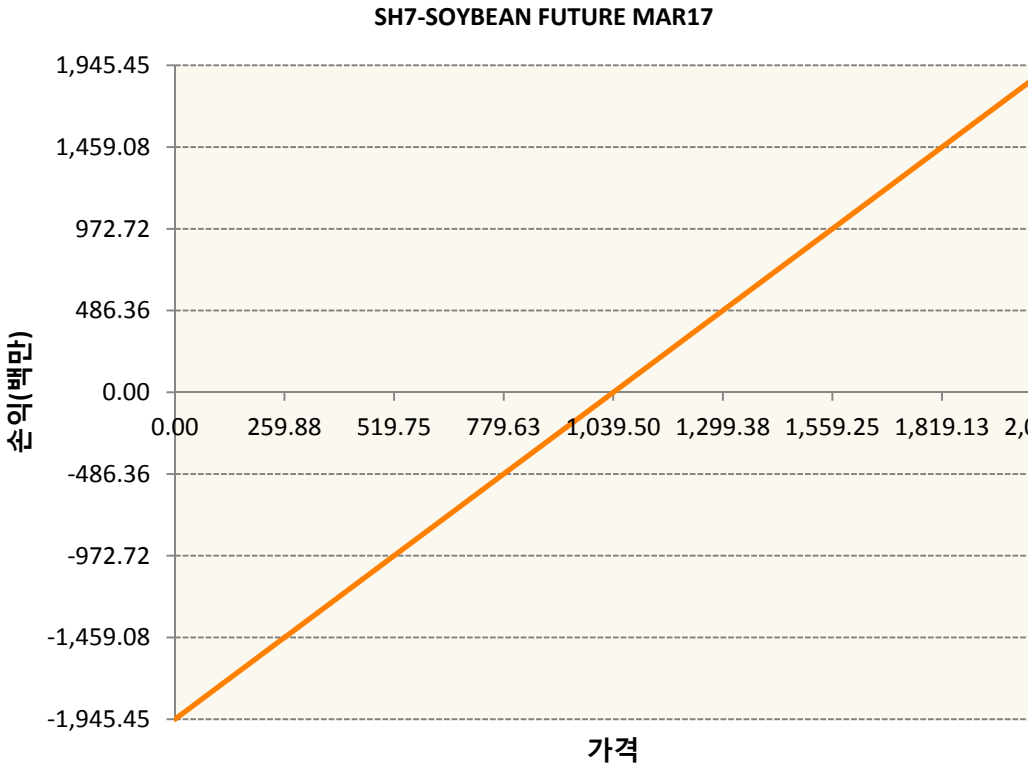

CTH7-COTTON NO.2 FUTR MAR17
316.56
211.04
105.52
0.00
-105.52
-211.04
-316.56
-422.09
0.00
18.01
36.02
54.03
72.04
90.05
108.06
126.07
순익(백만)
가격

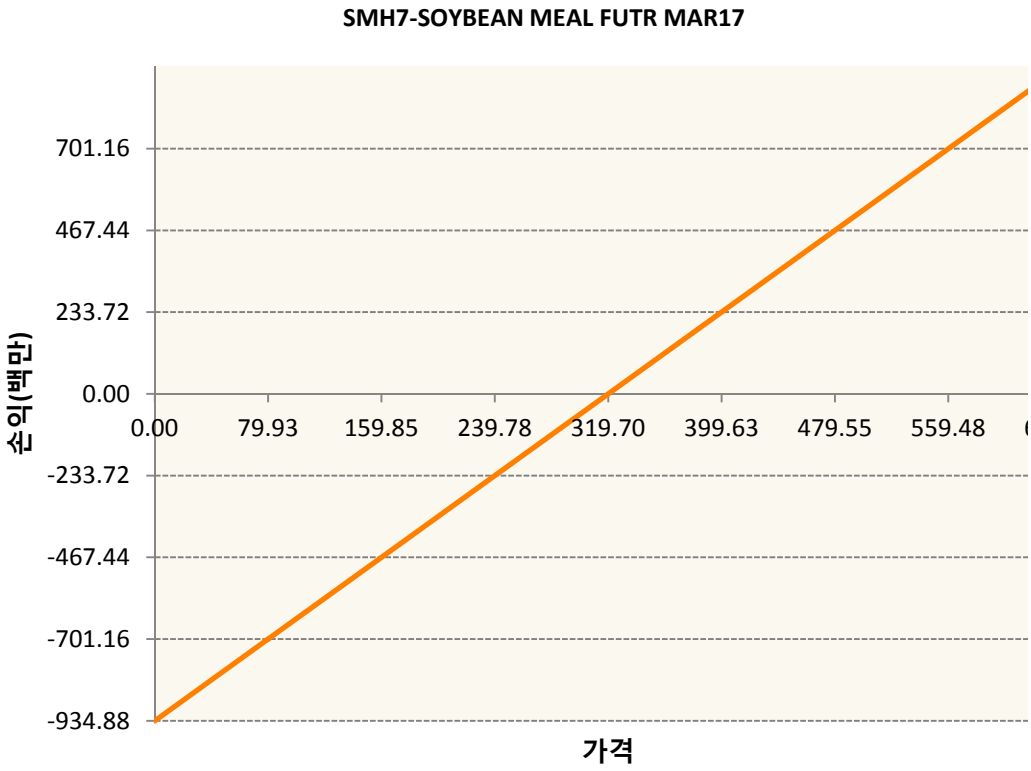

KCH7-COFFEE "C" FUTURE MAR17
565.04
376.70
188.35
0.00
-188.35
-376.70
-565.04
-753.39
0.00
35.71
71.43
107.14
142.85
178.56
214.28
249.99
순익(백만)

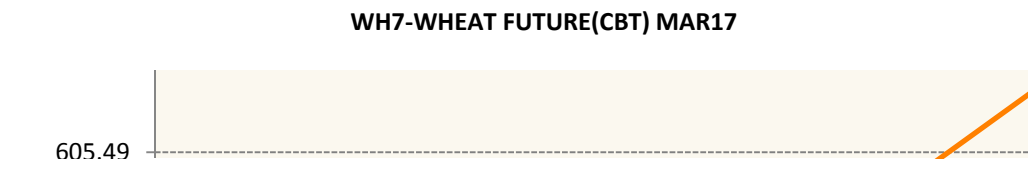
가격

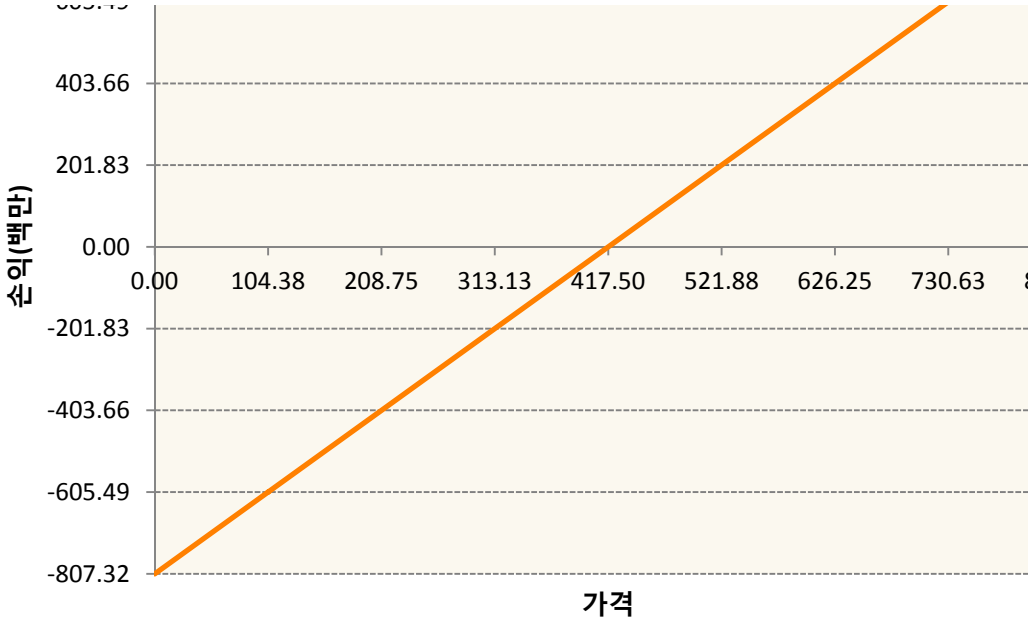

KWH7-KC HRW WHEAT FUT MAR17
164.25
109.50
54.75
0.00
-54.75
-109.50
-164.25
-219.00
0.00
103.81
207.63
311.44
415.25
519.06
622.88
726.69
손익(백만)
가격


SBH7-Sugar #11 (WORLD) MAR17
1,228.63
921.48
614.32
307.16
0.00
-307.16
-614.32
-921.48
-1,228.63
0.00
4.65
9.30
13.95
18.60
23.25
27.90
32.55
손익(백만)
가격


SH7-SOYBEAN FUTURE MAR17
1,945.45
1,459.08
972.72
486.36
0.00
-486.36
-972.72
-1,459.08
-1,945.45
0.00
259.88
519.75
779.63
1,039.50
1,299.38
1,559.25
1,819.13
손익(백만)
가격


SMH7-SOYBEAN MEAL FUTR MAR17
701.16
467.44
233.72
0.00
-233.72
-467.44
-701.16
-934.88
0.00
79.93
159.85
239.78
319.70
399.63
479.55
559.48
손익(백만)
가격


WH7-WHEAT FUTURE(CBT) MAR17
605.49



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
BOH7	SOYBEAN OIL FUTR MAR17	77
CH7	CORN FUTURE MAR17	169
CTH7	COTTON NO.2 FUTR MAR17	34
KCH7	COFFEE "C" FUTURE MAR17	60
KWH7	KC HRW WHEAT FUT MAR17	18
SBH7	Sugar #11 (WORLD) MAR17	98
SH7	SOYBEAN FUTURE MAR17	156
SMH7	SOYBEAN MEAL FUTR MAR17	75
WH7	WHEAT FUTURE(CBT) MAR17	65

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	911