공시일	2016-12-16
기준일	2016-12-15

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	2016-12-16
기준일	2016-12-15

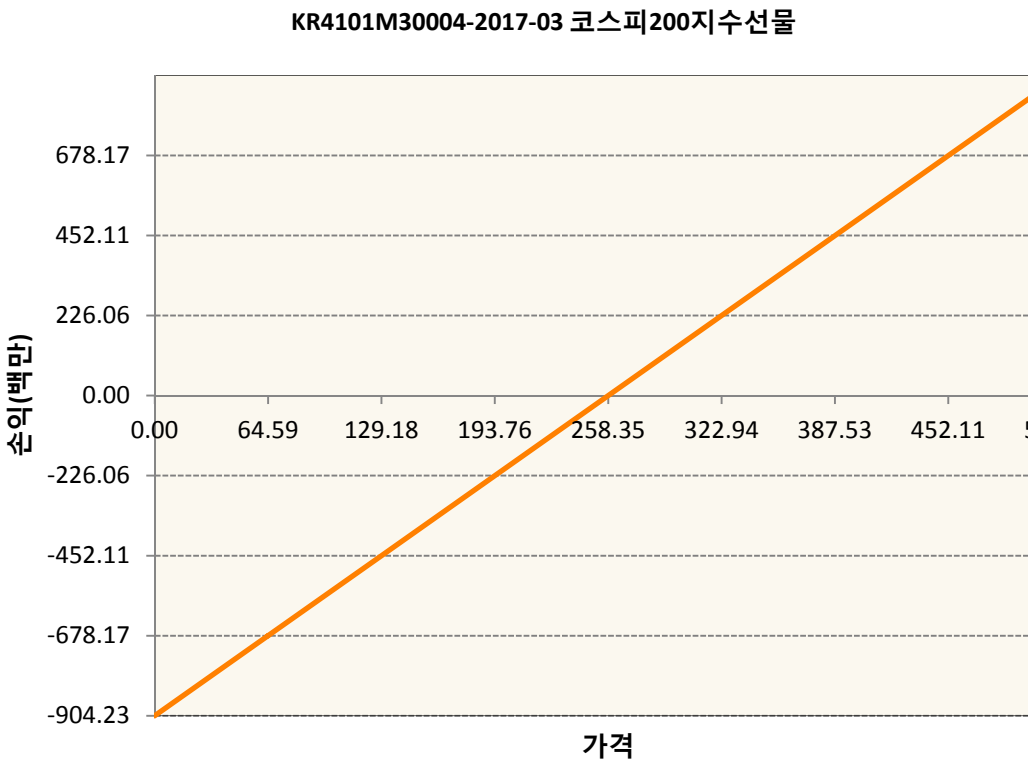
스마트인덱스모

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	904	0	904	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	2016-12-16
기준일	2016-12-15

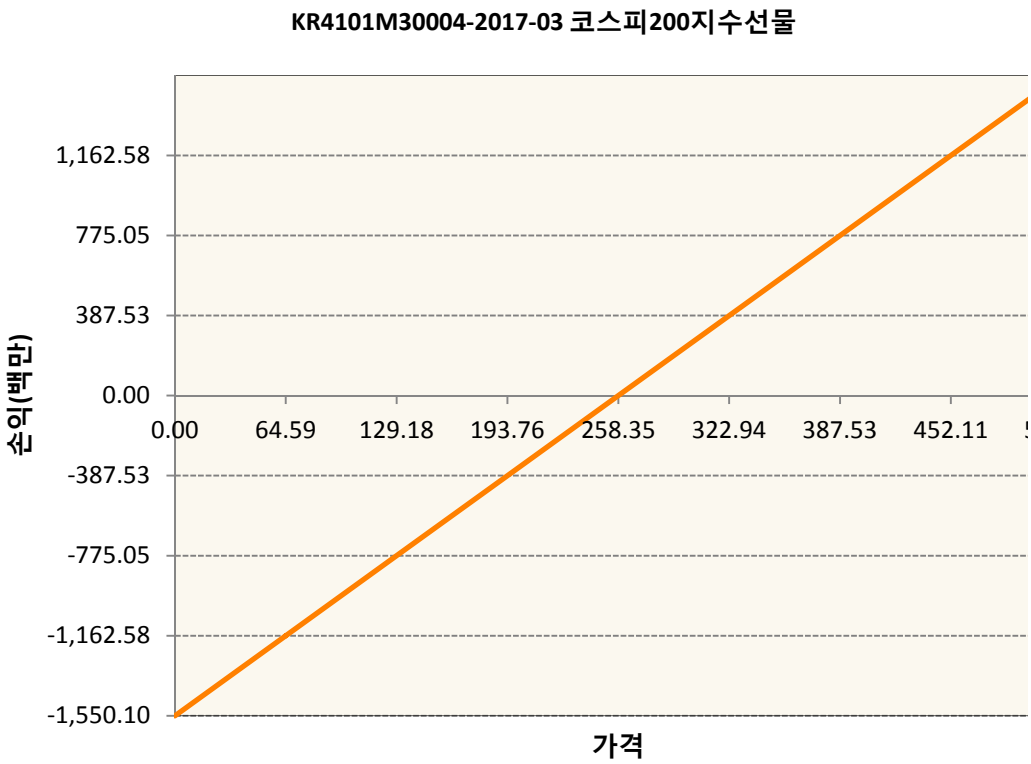
스마트레버리지목표전환형1호

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	1,550	0	1,550	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101M30(2017-03 코스피200지수선물							125
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-125	-125	-125	-125	-125	-125	-125
-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%	125	125	125	125	125	125	125

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

95

공시일	2016-12-16
기준일	2016-12-15

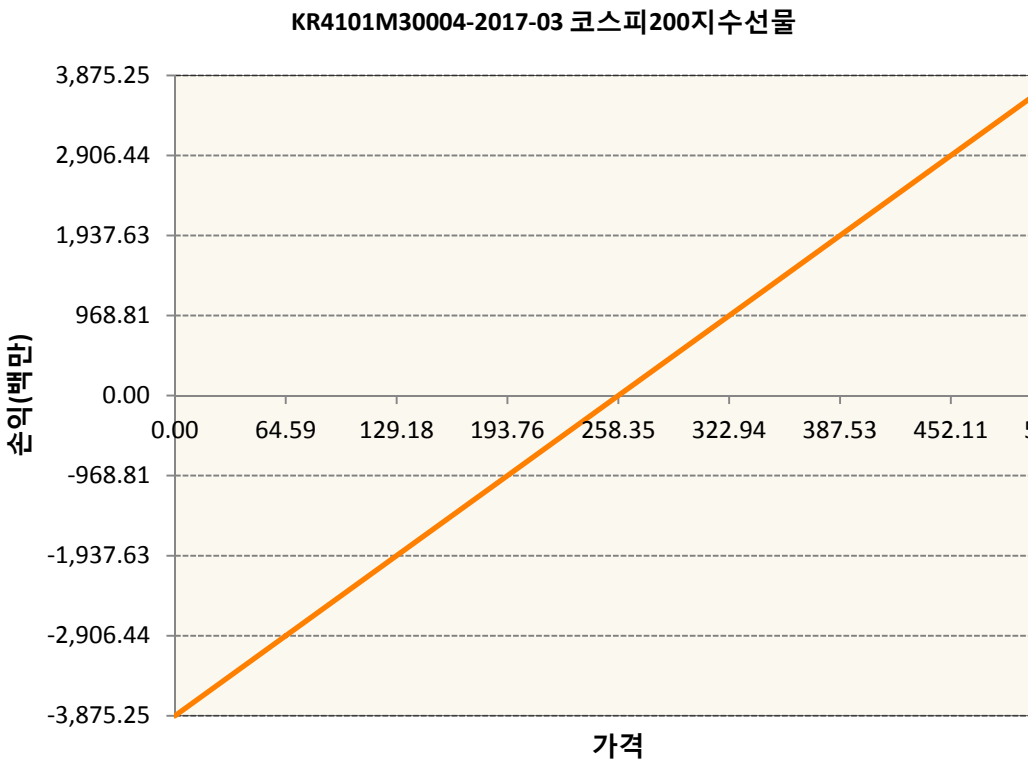
1.3배 레버리지 인덱스(주식-파생형)

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	3,875	0	3,875	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%	-209	-209	-209	-209	-209	-209	-209
-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%	209	209	209	209	209	209	209
8.00%	314	314	314	314	314	314	314

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

238

공시일	2016-12-16
기준일	2016-12-15

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	910

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

730

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2016-12-16
기준일	2016-12-15

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)

697

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2016-12-16
기준일	2016-12-15

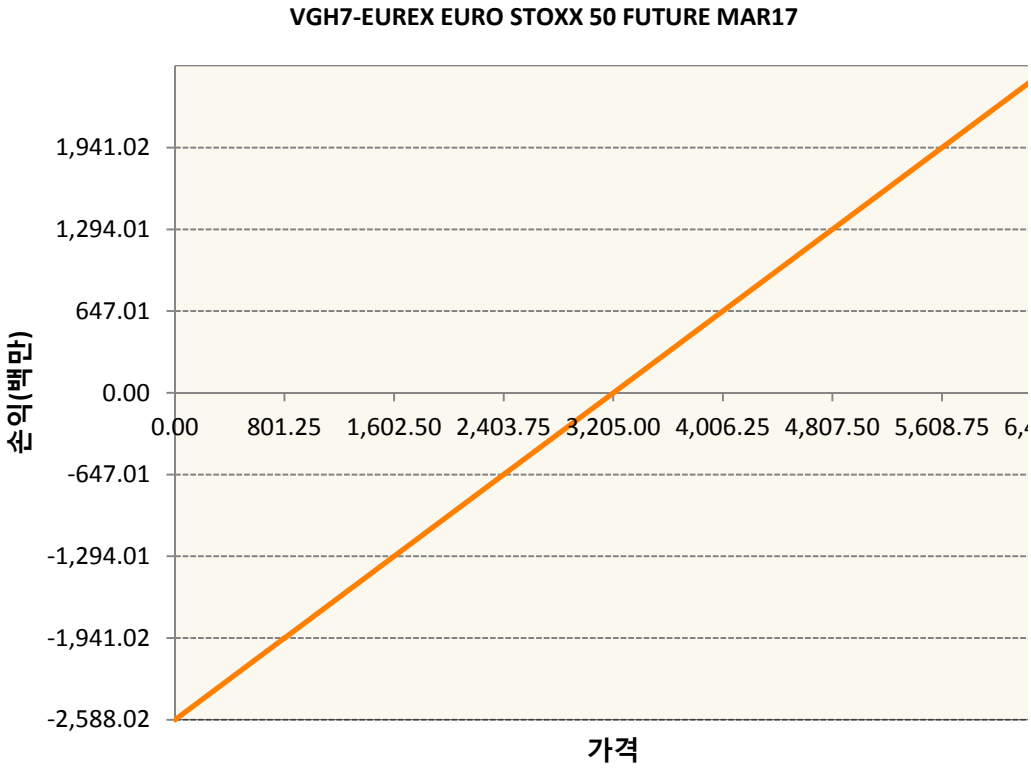
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,588	0	2,588	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGH7	EUREX EURO STOXX 50 FUTURE MAR17	207

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

(단위:백만원)

242

공시일	2016-12-16
기준일	2016-12-15

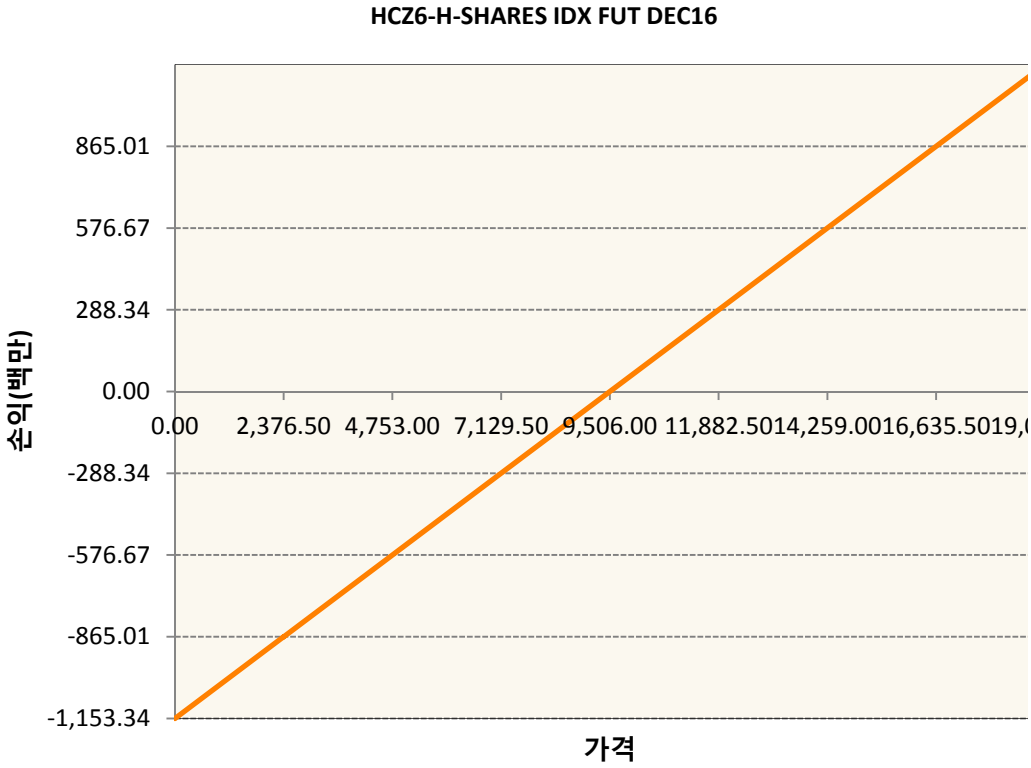
차이나인덱스모(주식-파생형)

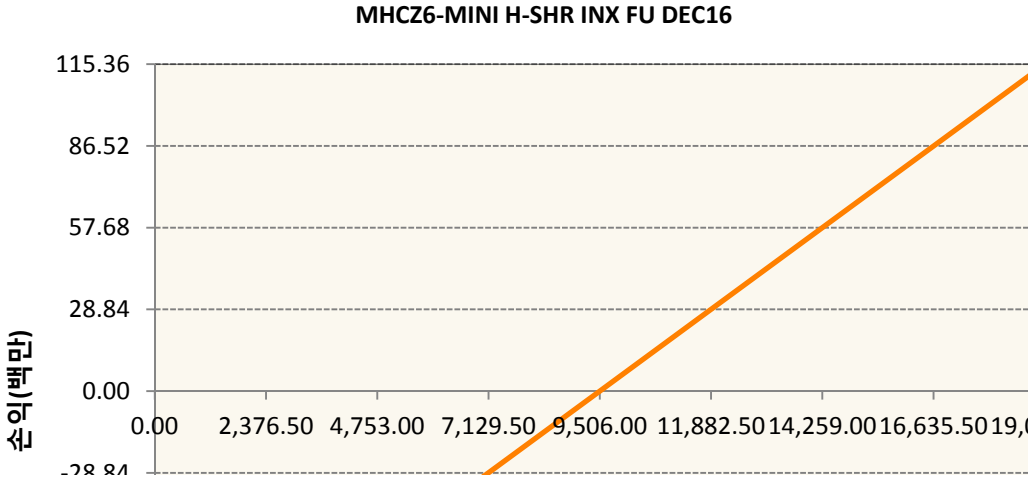
1. 계약금액

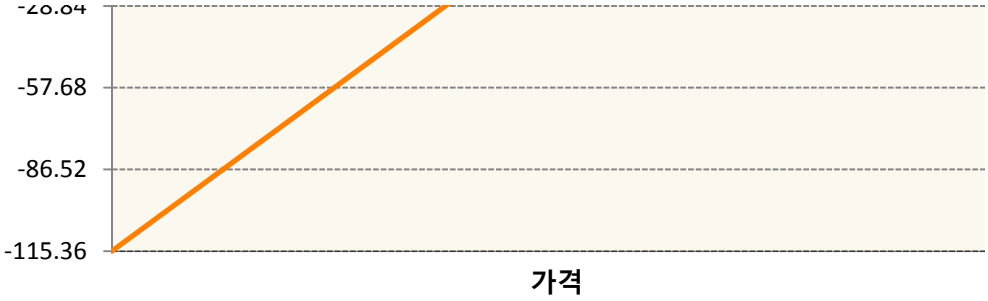
(단위:백만원)

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	1,153	0	1,153	
누계	유가증권	선물	115	0	115	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCZ6	H-SHARES IDX FUT DEC16	92
MHCZ6	MINI H-SHR INX FU DEC16	9

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	114

공시일	2016-12-16
기준일	2016-12-15

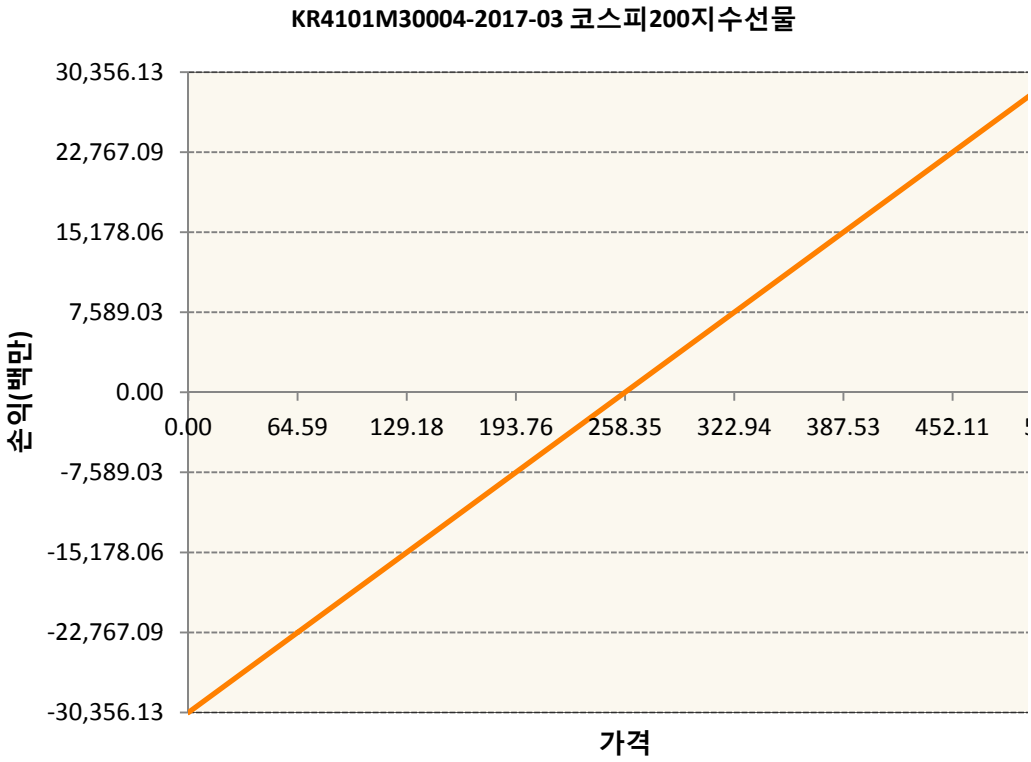
커버드콜(주식혼합-파생형)

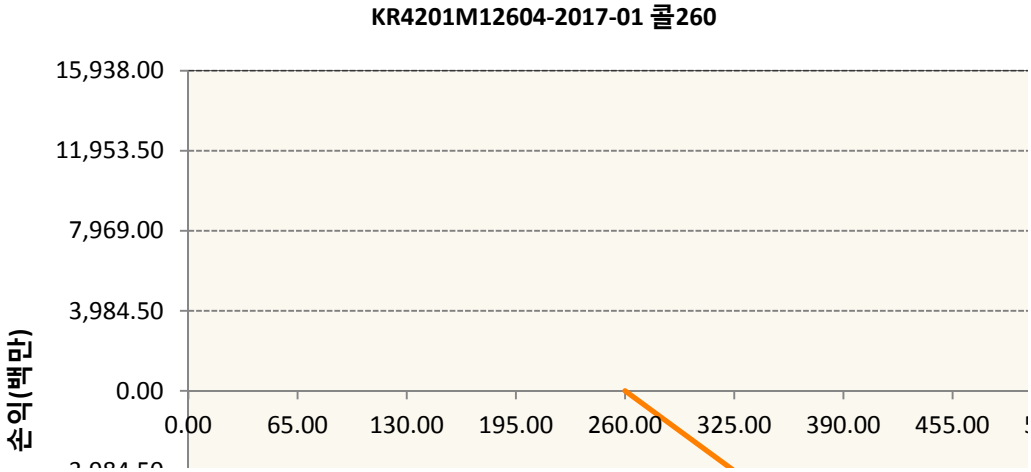
1. 계약금액

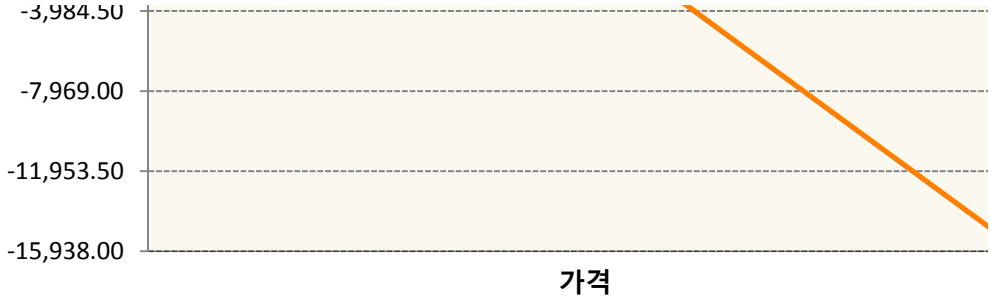
(단위:백만원)

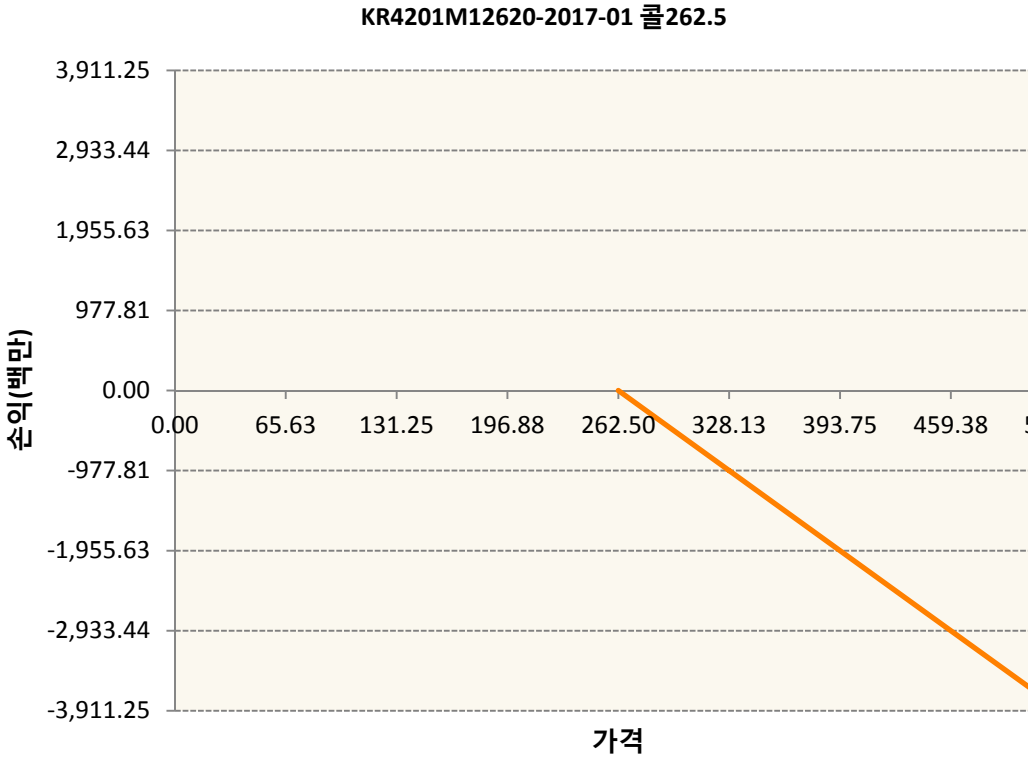
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	30,356	0	30,356	장내
누계	유가증권	옵션	0	19,849	-19,849	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101M30(2017-03 코스피200지수선물							2,458
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-2,458	-2,458	-2,458	-2,458	-2,458	-2,458	-2,458
-5.33%	-1,638	-1,638	-1,638	-1,638	-1,638	-1,638	-1,638
-2.67%	-819	-819	-819	-819	-819	-819	-819
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	819	819	819	819	819	819	819
5.33%	1,638	1,638	1,638	1,638	1,638	1,638	1,638
8.00%	2,458	2,458	2,458	2,458	2,458	2,458	2,458
KR4201M12(2017-01 콜260							5,659
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,204	1,203	1,202	1,200	1,196	1,191	1,182
-5.33%	1,194	1,185	1,171	1,152	1,129	1,101	1,069
-2.67%	1,038	985	927	867	804	739	672
0%	236	158	79	0	-79	-159	-238
2.67%	-1,441	-1,475	-1,514	-1,559	-1,608	-1,661	-1,717
5.33%	-3,511	-3,516	-3,524	-3,536	-3,551	-3,571	-3,596
8.00%	-5,642	-5,642	-5,643	-5,645	-5,647	-5,652	-5,659
KR4201M12(	2017-01 콜262.5						1,287

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	199	199	199	199	198	197	196
-5.33%	198	197	196	193	190	185	180
-2.67%	182	173	163	152	140	128	114
0%	58	39	19	0	-20	-39	-59
2.67%	-280	-293	-307	-322	-338	-354	-370
5.33%	-763	-766	-770	-775	-782	-789	-798
8.00%	-1,279	-1,279	-1,280	-1,281	-1,282	-1,284	-1,287

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

10,029

공시일	2016-12-16
기준일	2016-12-15

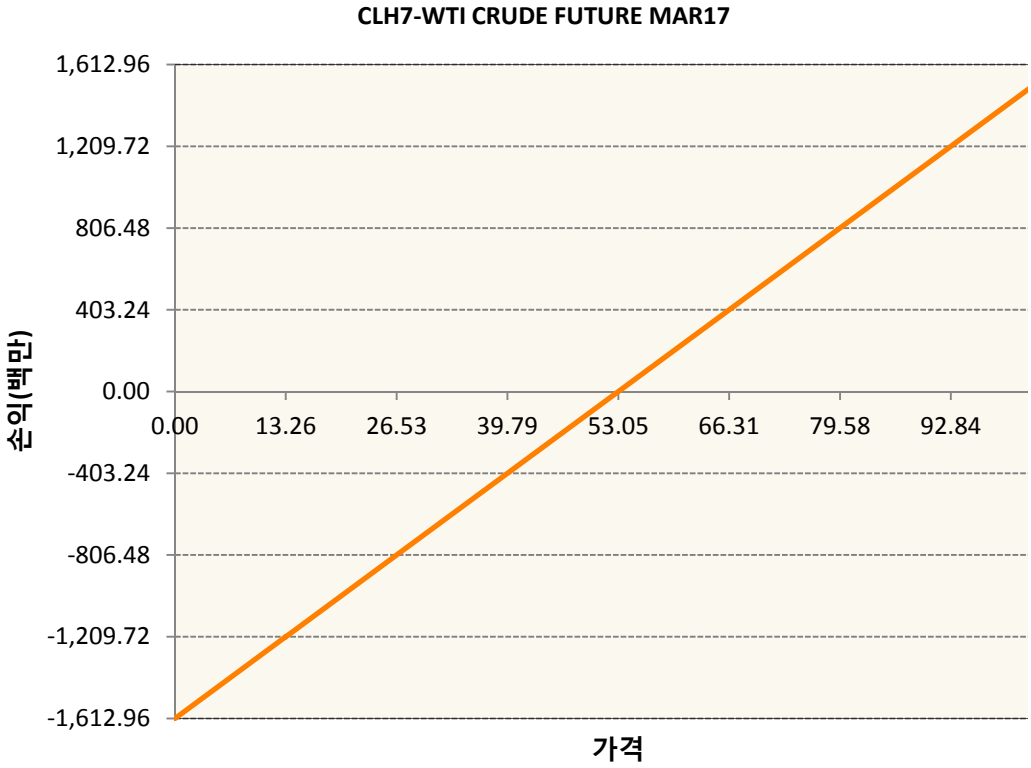
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

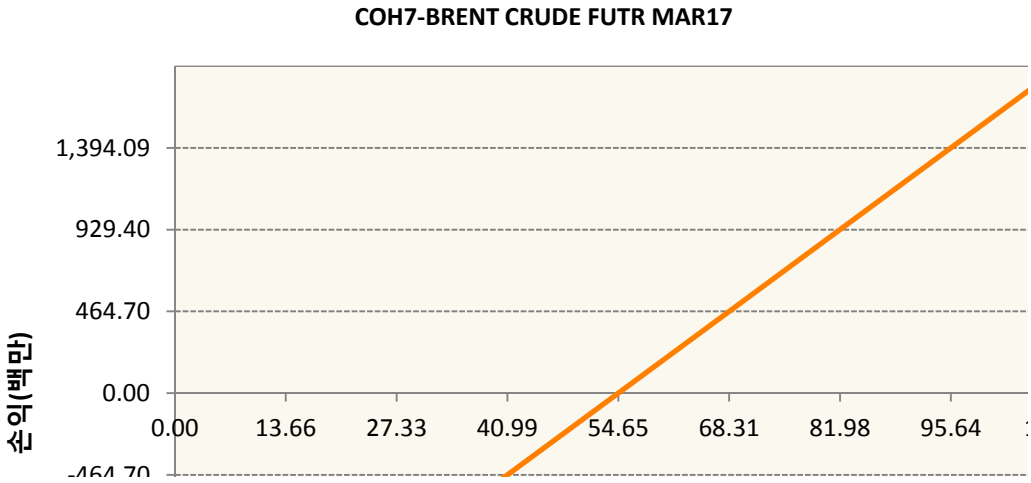
1. 계약금액

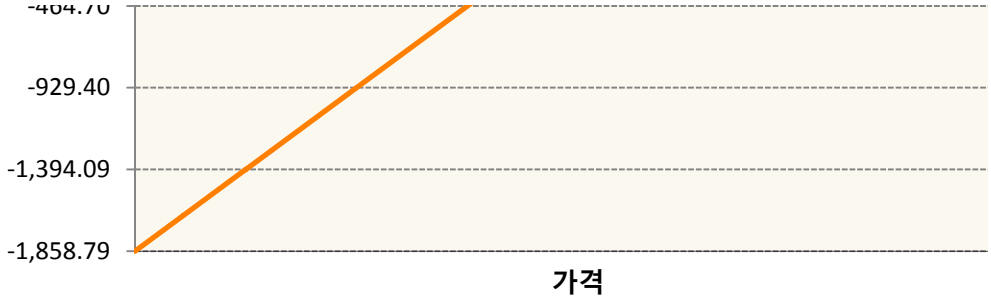
(단위:백만원)

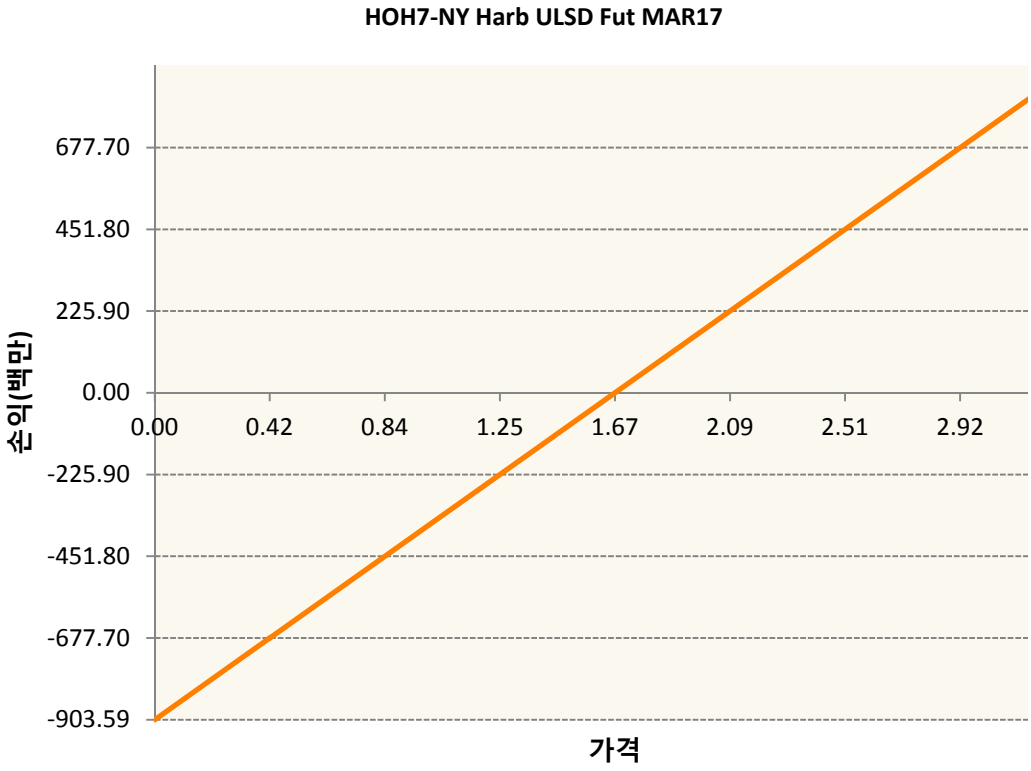
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	선물	유가증권	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	선물	유가증권	1,613	0	1,613	
누계	유가증권	선물	5,356	0	5,356	

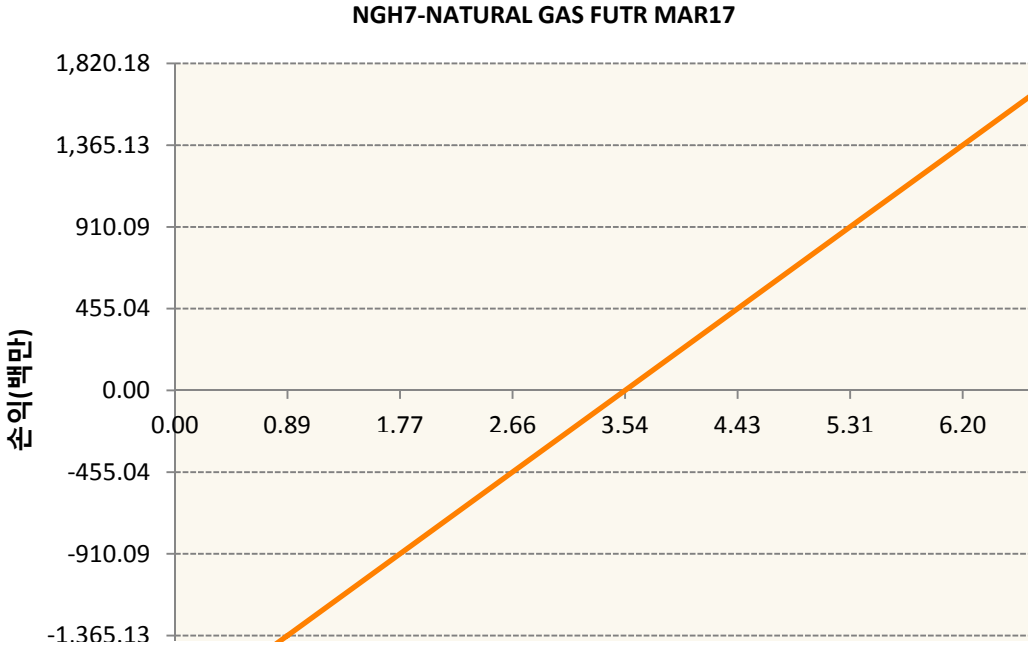
2. 만기시점의 손익구조

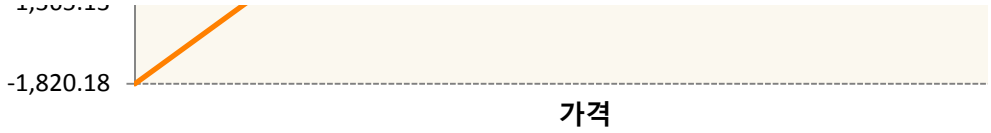


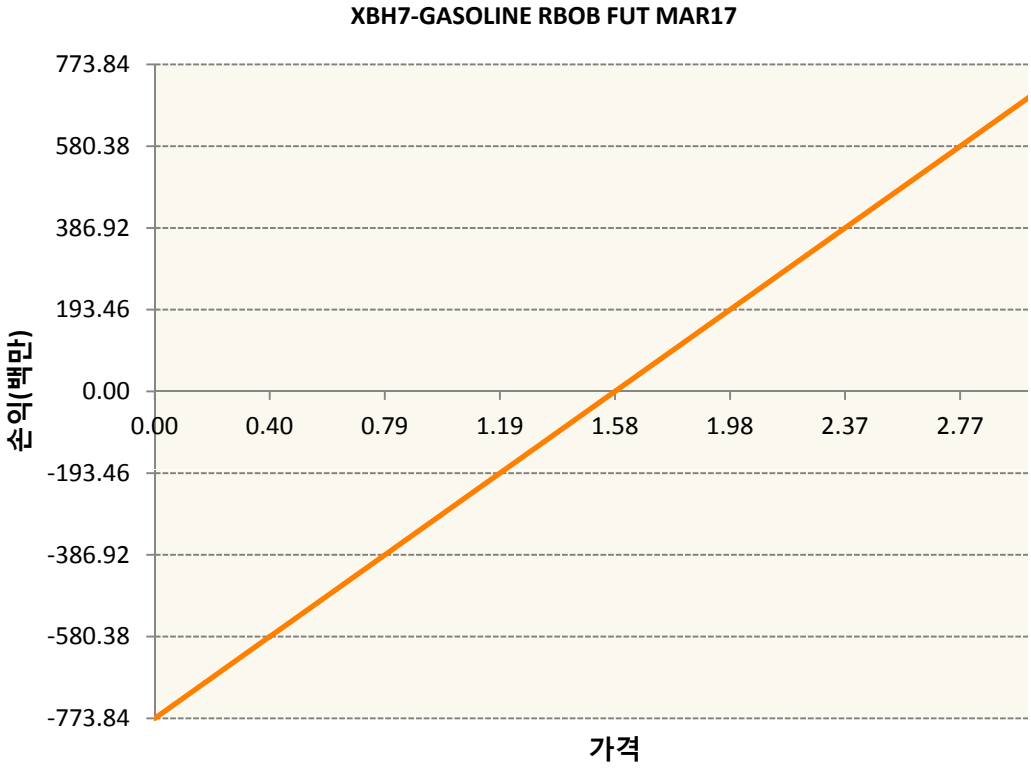



-929.40
-1,394.09
-1,858.79
가격


HOH7-NY Harb ULSD Fut MAR17
677.70
451.80
225.90
0.00
-225.90
-451.80
-677.70
-903.59
0.00
0.42
0.84
1.25
1.67
2.09
2.51
2.92
순익(백만)
가격


NGH7-NATURAL GAS FUTR MAR17
1,820.18
1,365.13
910.09
455.04
0.00
-455.04
-910.09
-1,365.13
0.00
0.89
1.77
2.66
3.54
4.43
5.31
6.20
순익(백만)





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLH7	WTI CRUDE FUTURE MAR17	129
COH7	BRENT CRUDE FUTR MAR17	149
HOH7	NY Harb ULSD Fut MAR17	72
NGH7	NATURAL GAS FUTR MAR17	146
XBH7	GASOLINE RBOB FUT MAR17	62

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

1,267

공시일	2016-12-16
기준일	2016-12-15

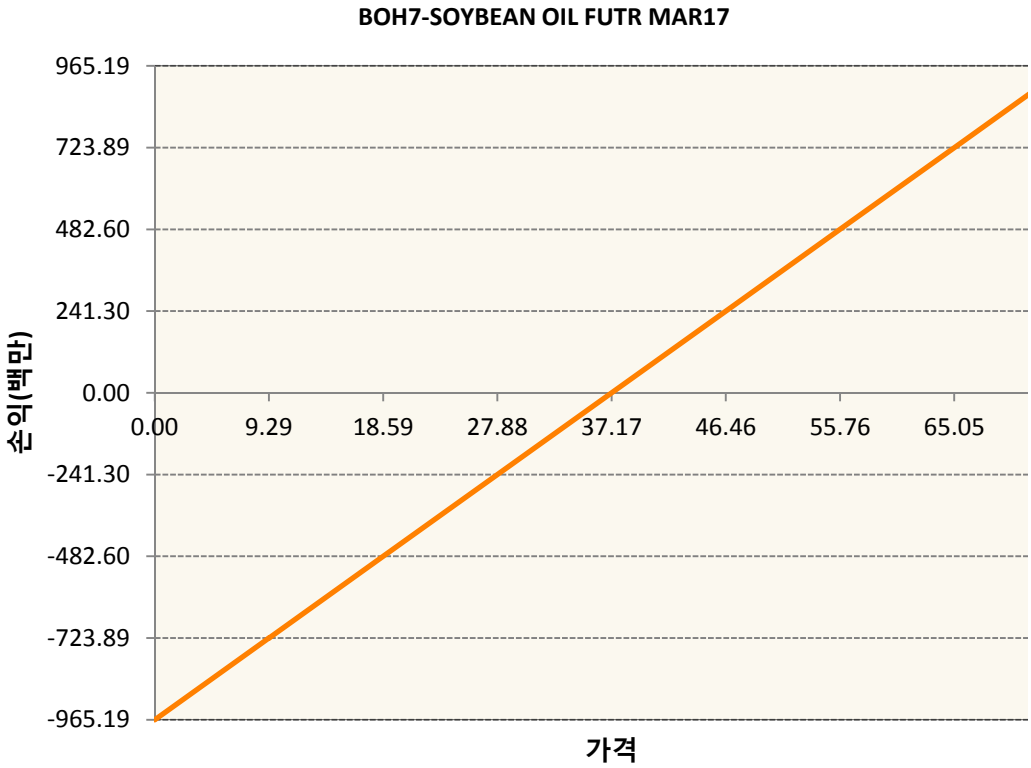
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

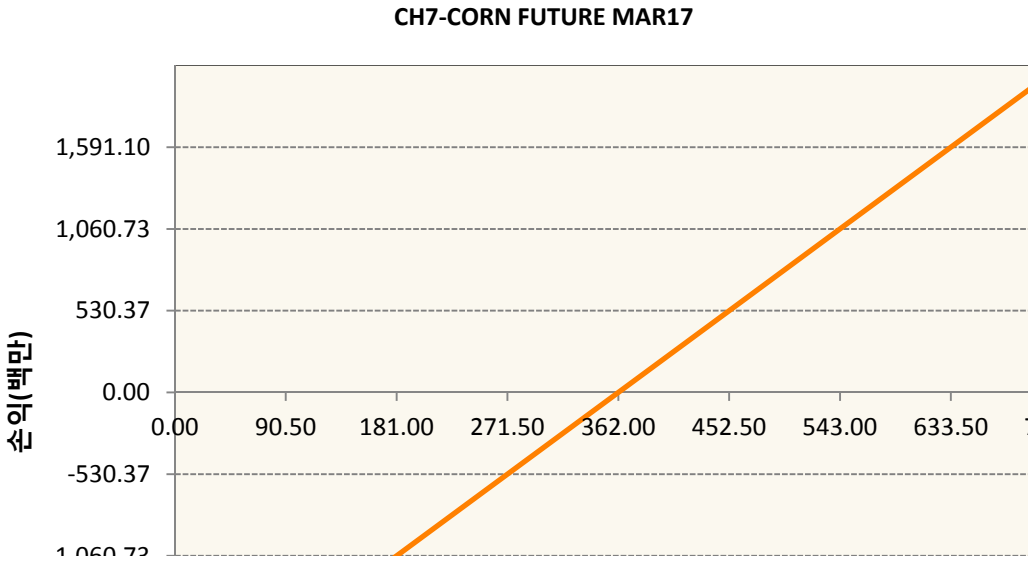
1. 계약금액

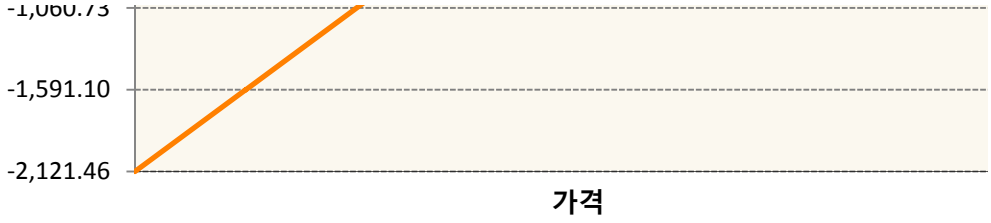
(단위:백만원)

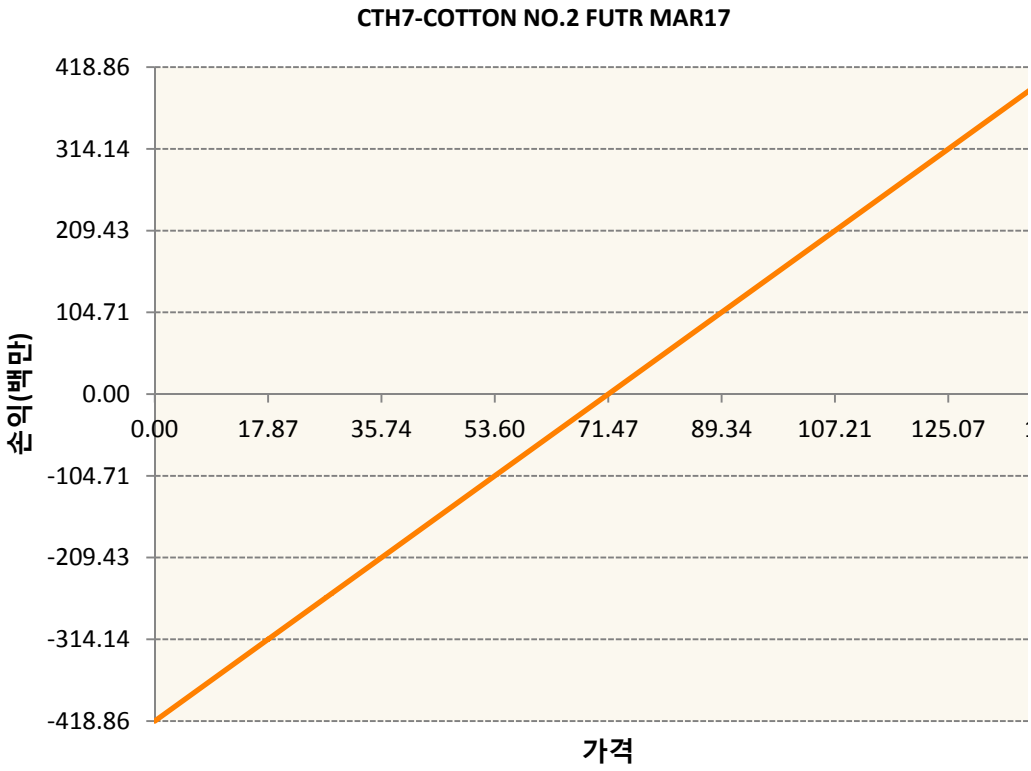
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	9,346	0	9,346	

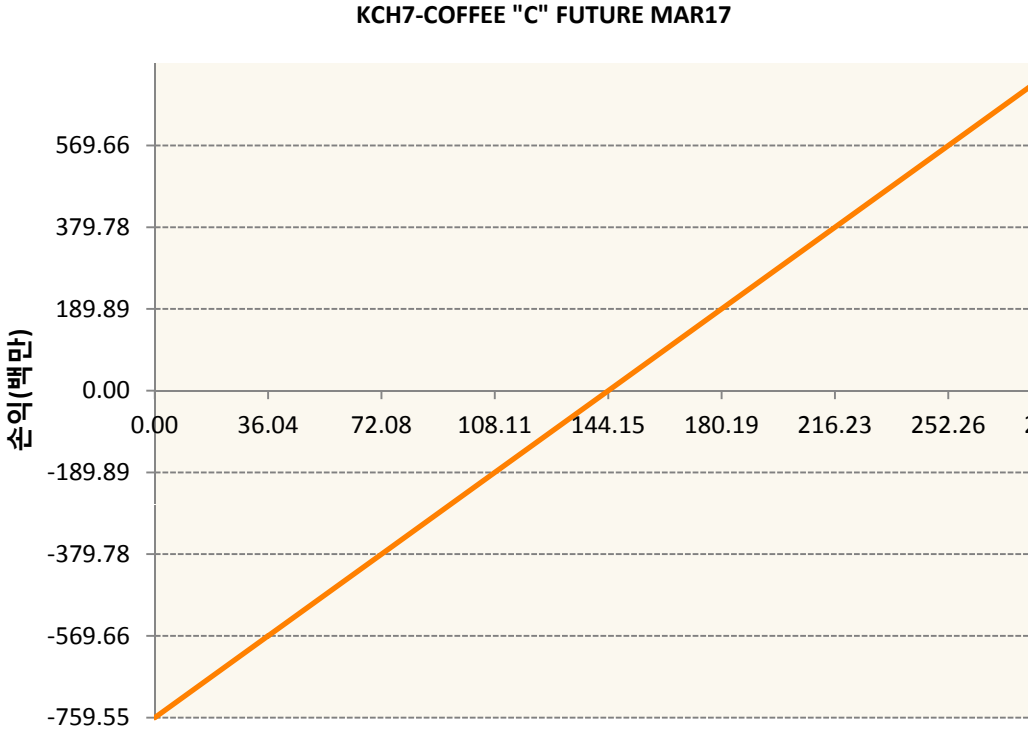
2. 만기시점의 손익구조



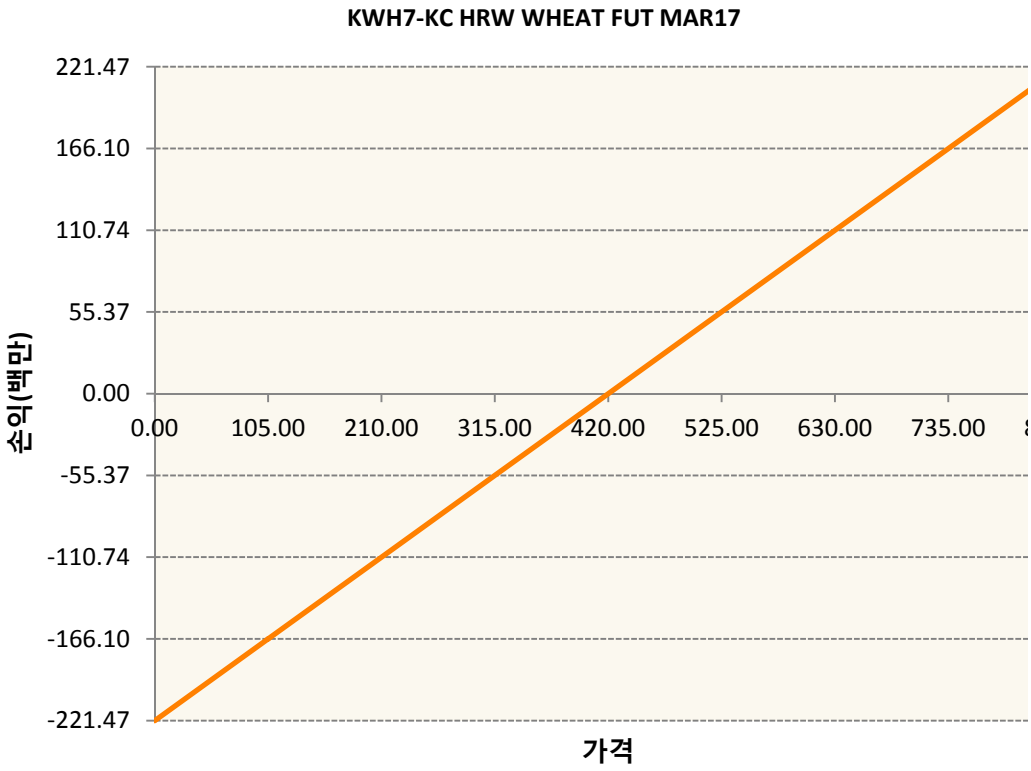


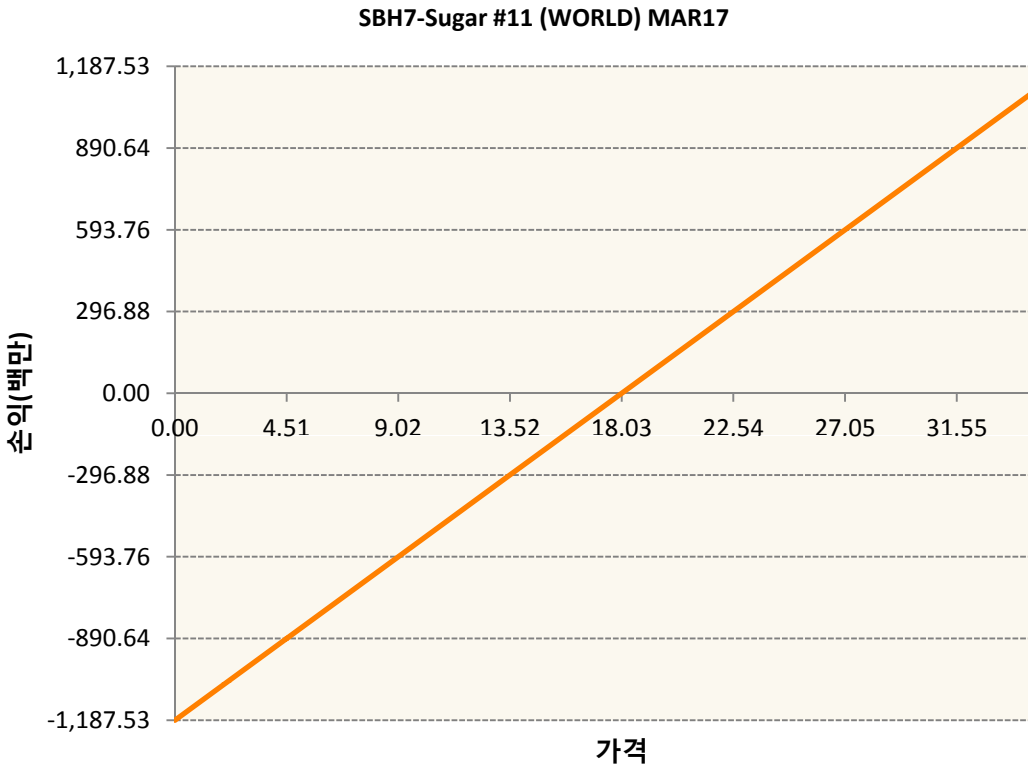

-1,591.10
-2,121.46
가격

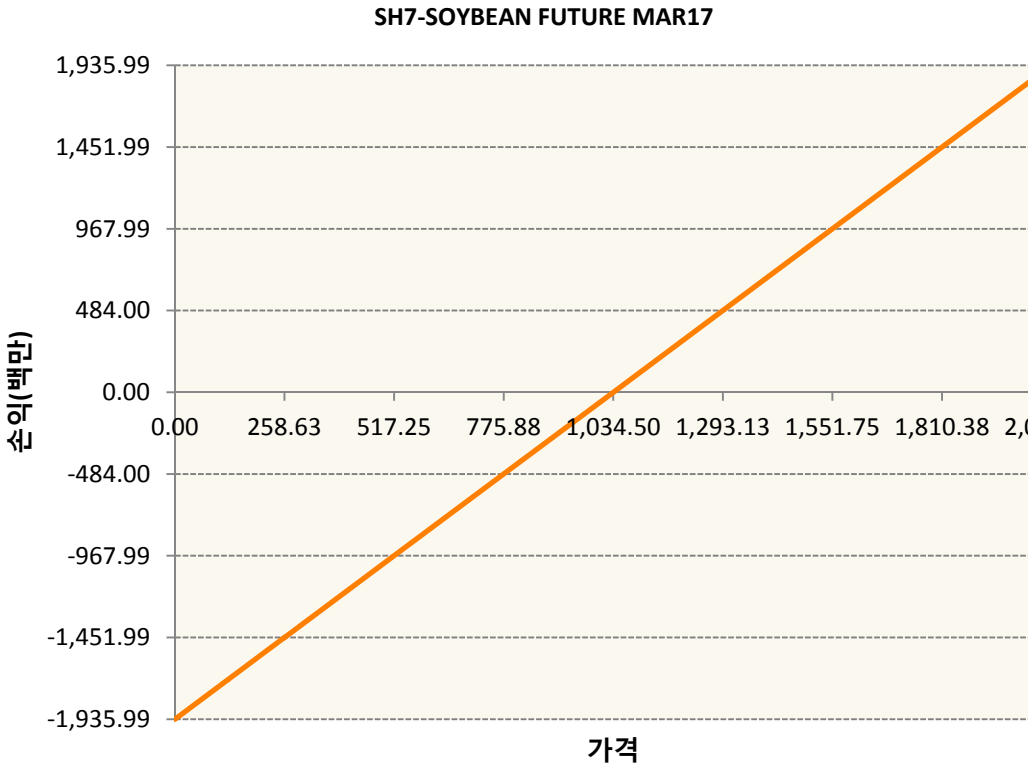

CTH7-COTTON NO.2 FUTR MAR17
418.86
314.14
209.43
104.71
0.00
-104.71
-209.43
-314.14
-418.86
0.00
17.87
35.74
53.60
71.47
89.34
107.21
125.07
손익(백만)
가격

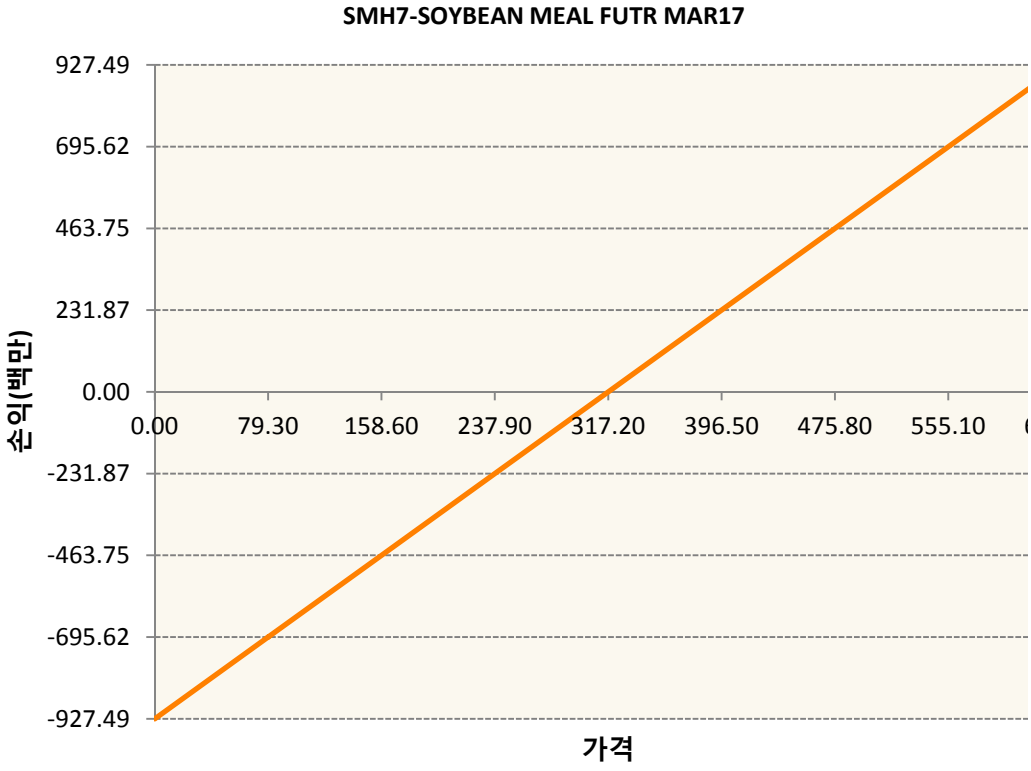

KCH7-COFFEE "C" FUTURE MAR17
569.66
379.78
189.89
0.00
-189.89
-379.78
-569.66
-759.55
0.00
36.04
72.08
108.11
144.15
180.19
216.23
252.26
손익(백만)

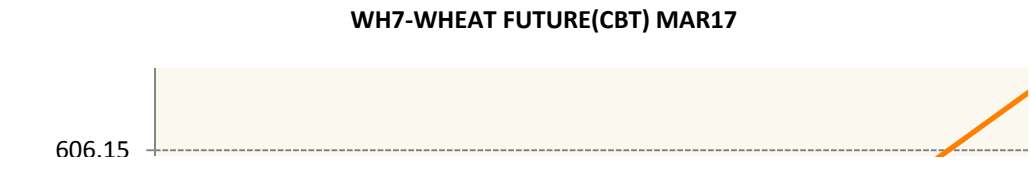
가격

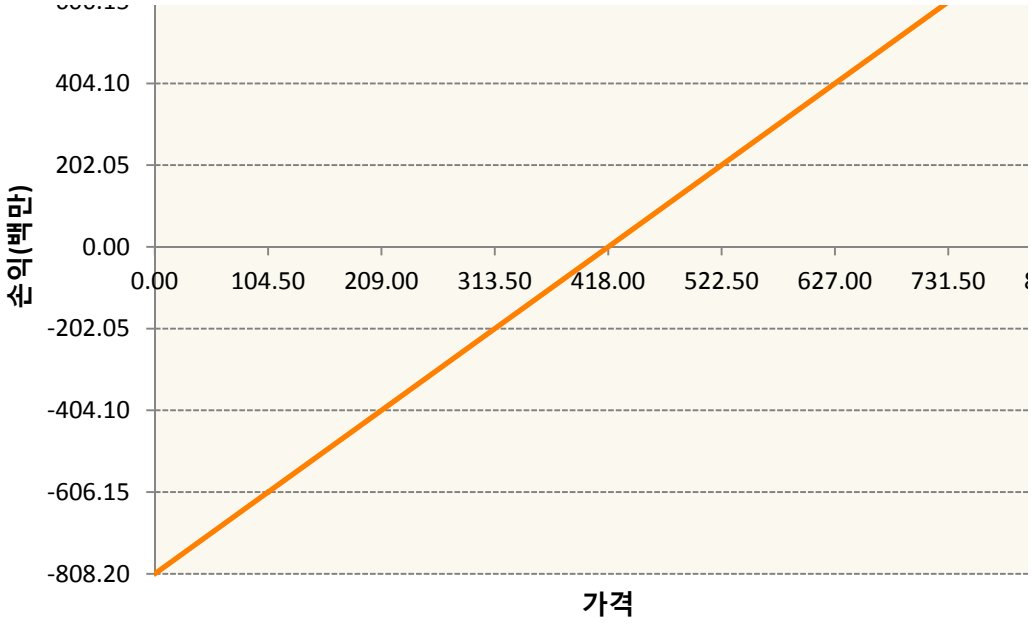

KWH7-KC HRW WHEAT FUT MAR17
221.47
166.10
110.74
55.37
0.00
-55.37
-110.74
-166.10
-221.47
0.00
105.00
210.00
315.00
420.00
525.00
630.00
735.00
손익(백만)
가격


SBH7-Sugar #11 (WORLD) MAR17
1,187.53
890.64
593.76
296.88
0.00
-296.88
-593.76
-890.64
-1,187.53
0.00
4.51
9.02
13.52
18.03
22.54
27.05
31.55
손익(백만)
가격


SH7-SOYBEAN FUTURE MAR17
1,935.99
1,451.99
967.99
484.00
0.00
-484.00
-967.99
-1,451.99
-1,935.99
0.00
258.63
517.25
775.88
1,034.50
1,293.13
1,551.75
1,810.38
손익(백만)
가격


SMH7-SOYBEAN MEAL FUTR MAR17
927.49
695.62
463.75
231.87
0.00
-231.87
-463.75
-695.62
-927.49
0.00
79.30
158.60
237.90
317.20
396.50
475.80
555.10
손익(백만)
가격


WH7-WHEAT FUTURE(CBT) MAR17
606.15



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

BOH7	SOYBEAN OIL FUTR MAR17	77
CH7	CORN FUTURE MAR17	170
CTH7	COTTON NO.2 FUTR MAR17	34
KCH7	COFFEE "C" FUTURE MAR17	61
KWH7	KC HRW WHEAT FUT MAR17	18
SBH7	Sugar #11 (WORLD) MAR17	95
SH7	SOYBEAN FUTURE MAR17	155
SMH7	SOYBEAN MEAL FUTR MAR17	74
WH7	WHEAT FUTURE(CBT) MAR17	65

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

906