공시일	2016-12-19
기준일	2016-12-16

포커스농산물모(채권-파생평)

1. 계약금액

(단위:USD 백만)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	10	0	10	장외
누계	지수	스왑	10	0	10	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	2016-12-19
기준일	2016-12-16

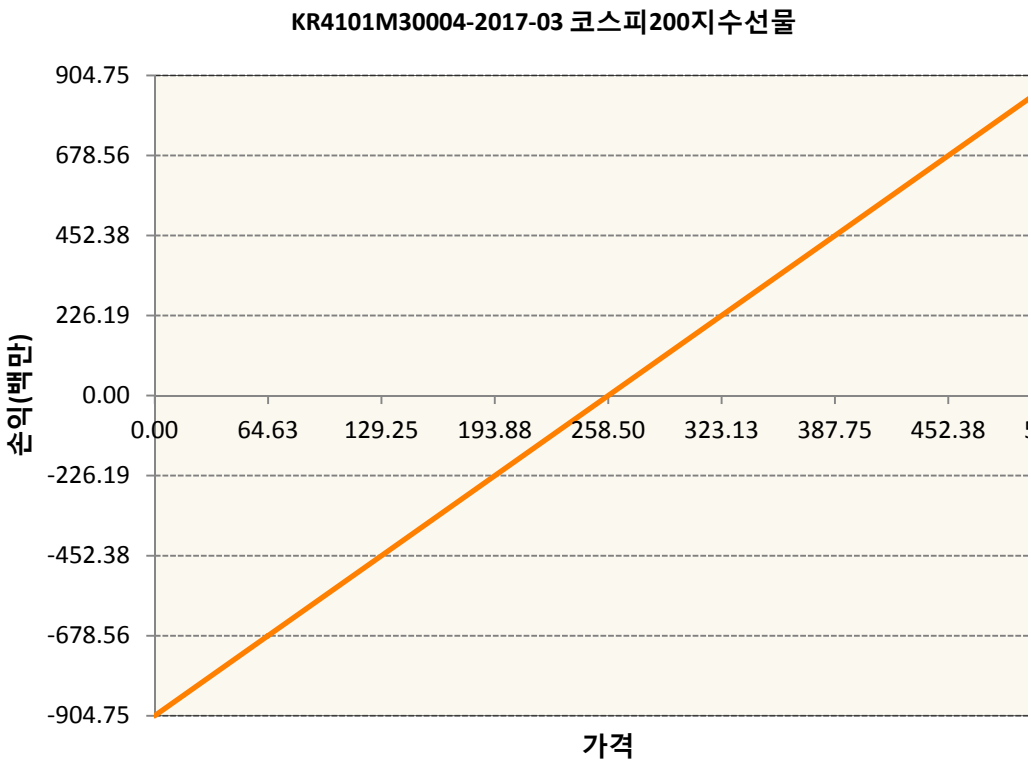
스마트인덱스모

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							74
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-74	-74	-74	-74	-74	-74	-74
-5.33%	-49	-49	-49	-49	-49	-49	-49
-2.67%	-25	-25	-25	-25	-25	-25	-25
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	25	25	25	25	25	25	25
5.33%	49	49	49	49	49	49	49
8.00%	74	74	74	74	74	74	74

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

56

공시일	2016-12-19
기준일	2016-12-16

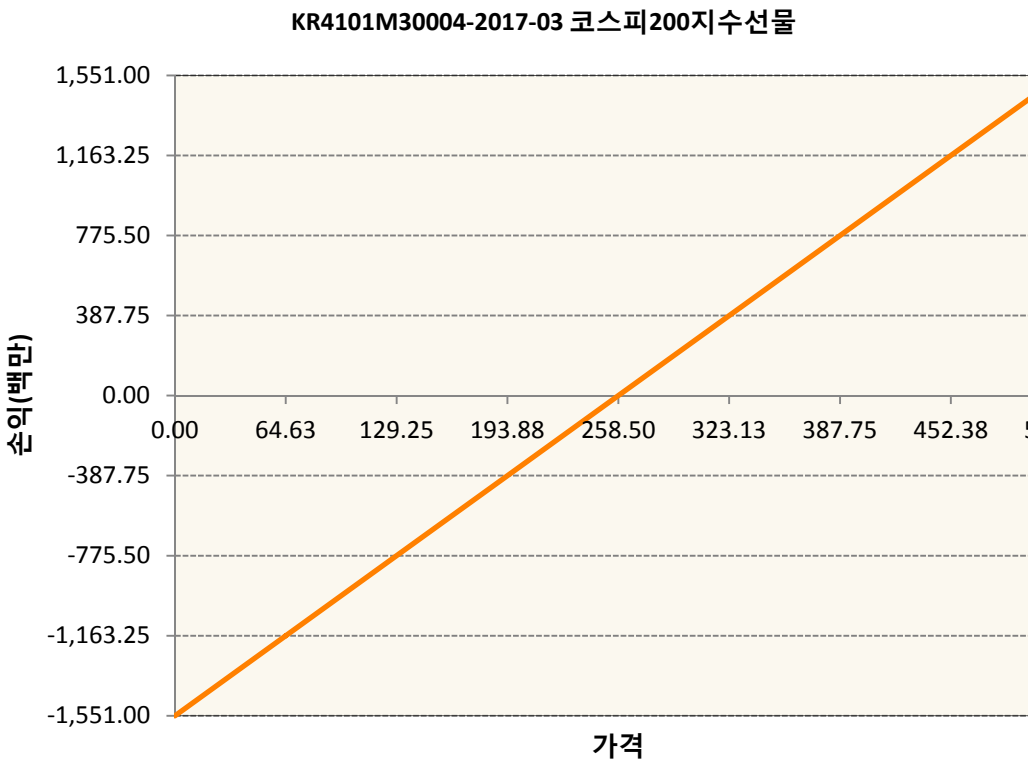
스마트레버리지목표전환형1호

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	1,551	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)

96

공시일	2016-12-19
기준일	2016-12-16

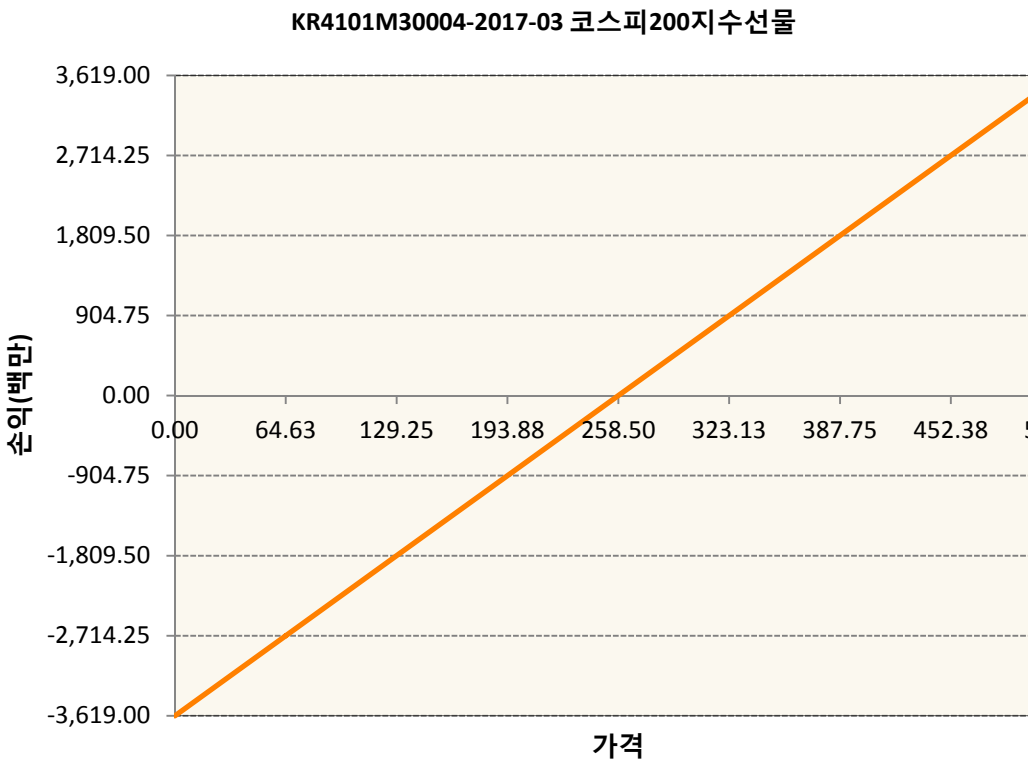
1.3배 레버리지 인덱스(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	259	-259	장내
누계	유가증권	선물	3,619	0	3,619	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101M30(2017-03 코스피200지수선물							294
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-294	-294	-294	-294	-294	-294	-294
-5.33%	-196	-196	-196	-196	-196	-196	-196
-2.67%	-98	-98	-98	-98	-98	-98	-98
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	98	98	98	98	98	98	98
5.33%	196	196	196	196	196	196	196
8.00%	294	294	294	294	294	294	294

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

223

공시일	2016-12-19
기준일	2016-12-16

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	905

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

722

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2016-12-19
기준일	2016-12-16

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	380

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

700

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2016-12-19
기준일	2016-12-16

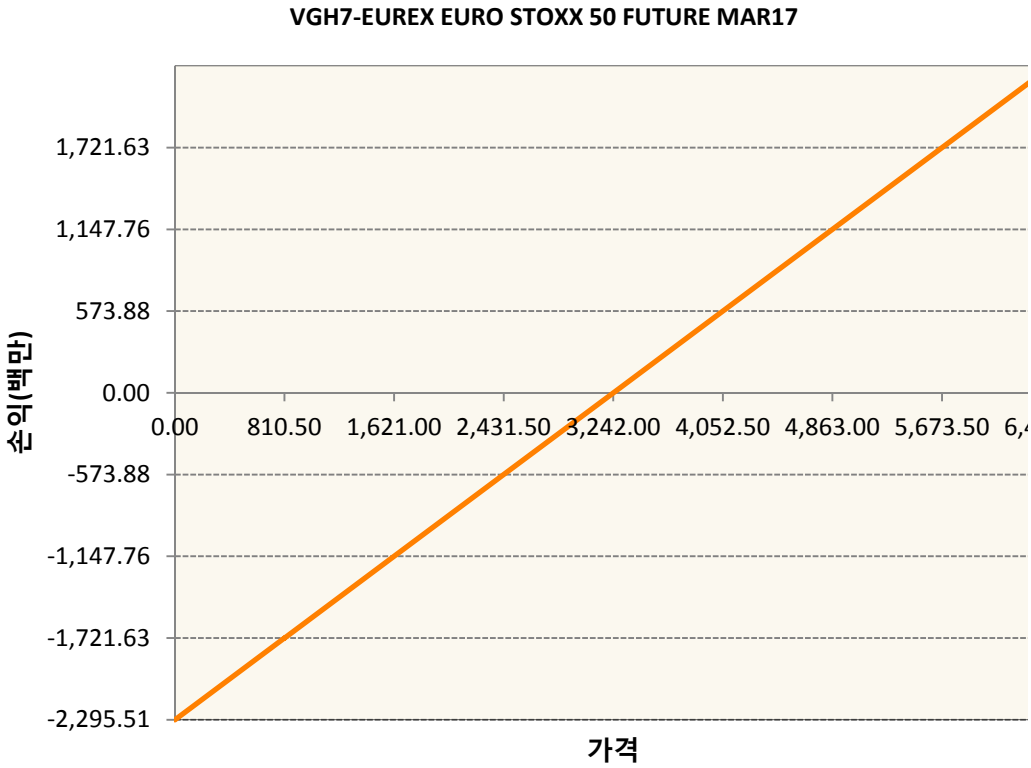
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,296	0	2,296	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGH7	EUREX EURO STOXX 50 FUTURE MAR17	184

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

(단위:백만원)

214

공시일	2016-12-19
기준일	2016-12-16

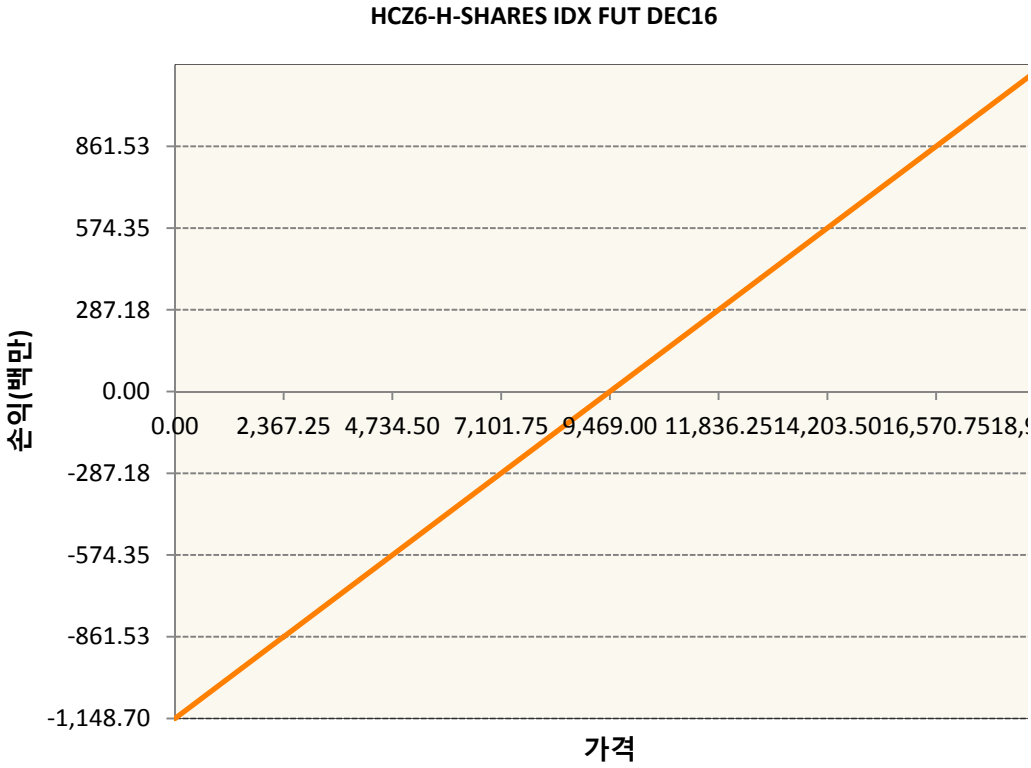
차이나인덱스모(주식-파생형)

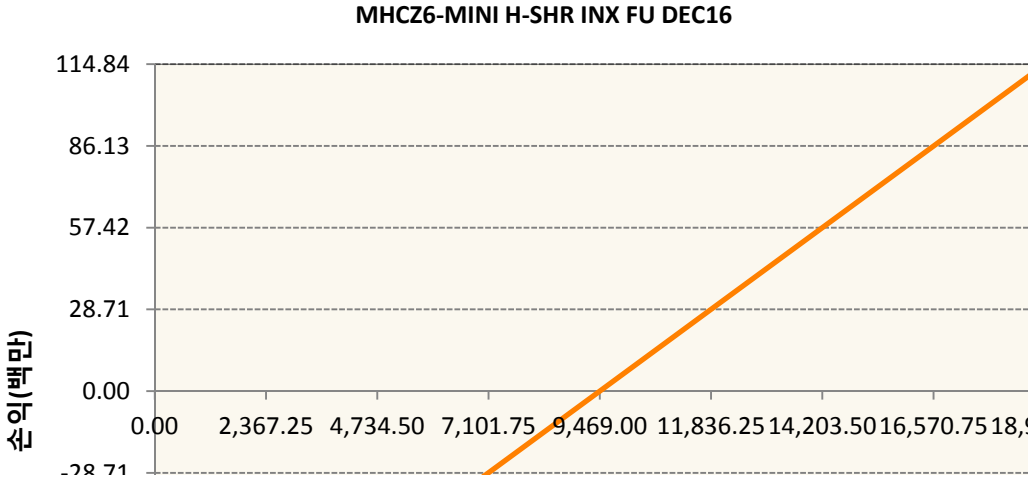
1. 계약금액

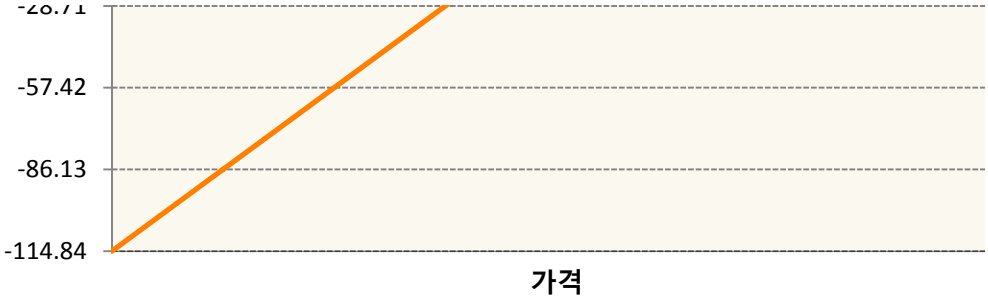
(단위:백만원)

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	1,149	0	1,149	
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)

110

공시일	2016-12-19
기준일	2016-12-16

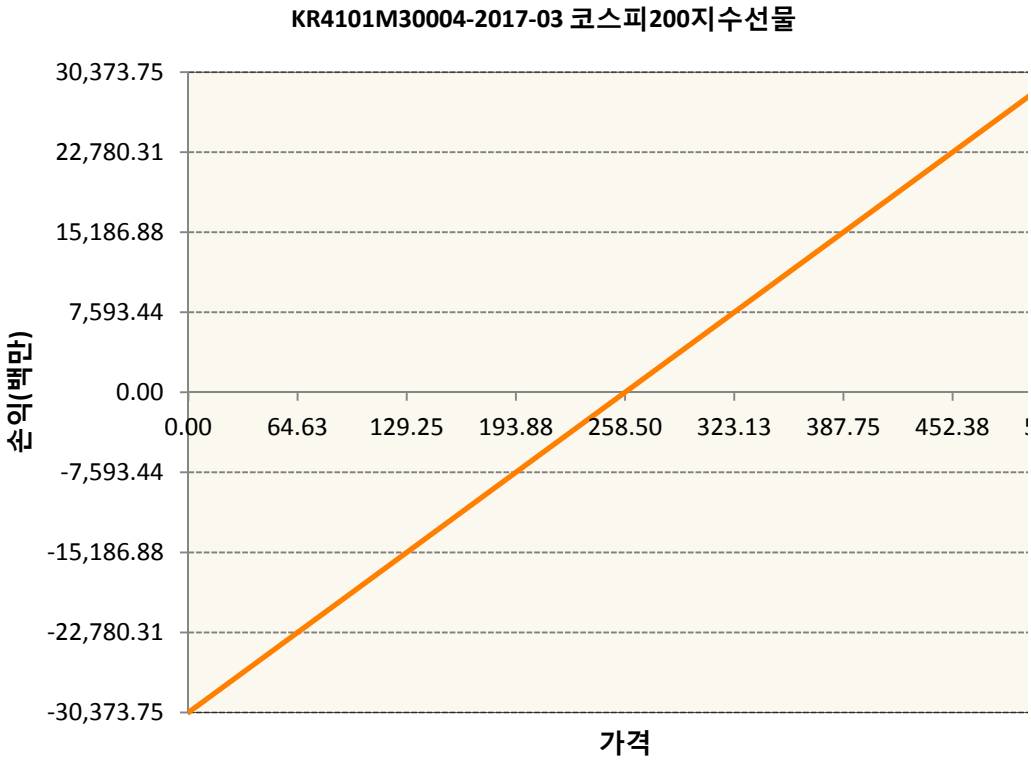
커버드콜(주식혼합-파생형)

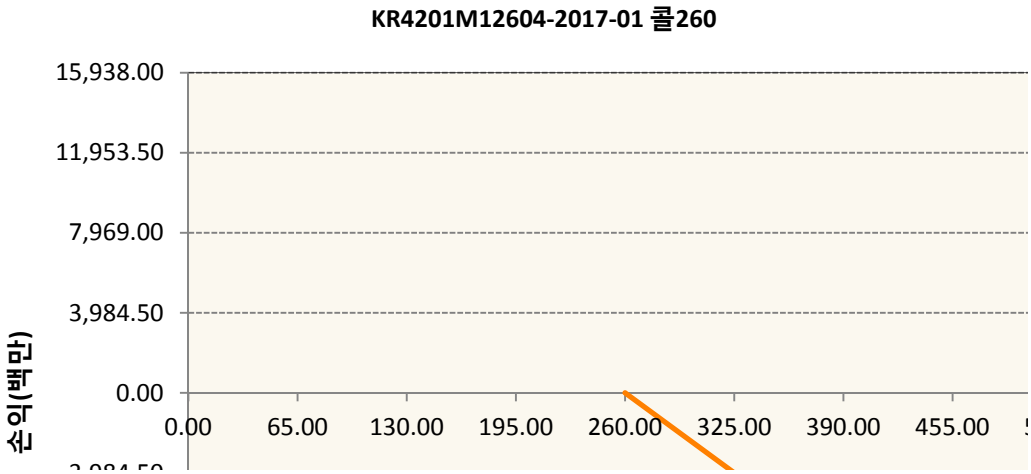
1. 계약금액

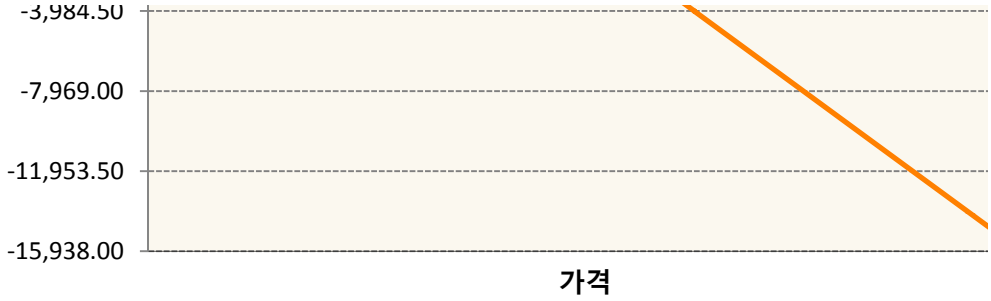
(단위:백만원)

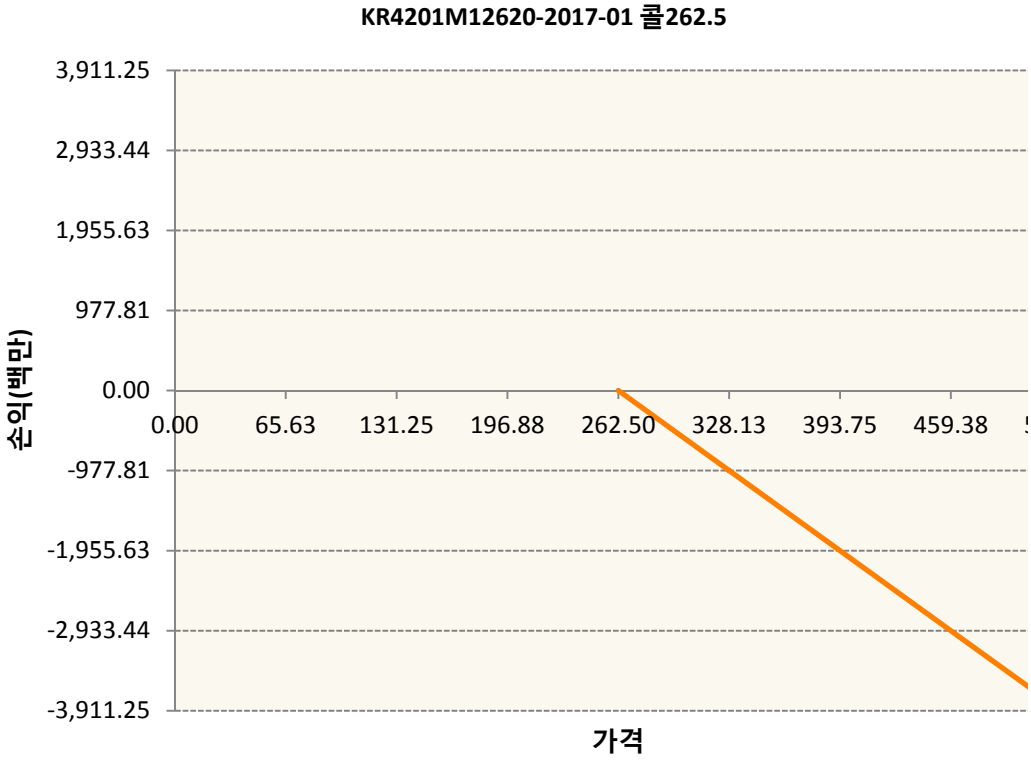
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	30,374	0	30,374	장내
누계	유가증권	옵션	0	19,849	-19,849	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101M30(2017-03 코스피200지수선물							2,468
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-2,468	-2,468	-2,468	-2,468	-2,468	-2,468	-2,468
-5.33%	-1,645	-1,645	-1,645	-1,645	-1,645	-1,645	-1,645
-2.67%	-823	-823	-823	-823	-823	-823	-823
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	823	823	823	823	823	823	823
5.33%	1,645	1,645	1,645	1,645	1,645	1,645	1,645
8.00%	2,468	2,468	2,468	2,468	2,468	2,468	2,468
KR4201M12(2017-01 콜260							5,845
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,378	1,377	1,376	1,373	1,369	1,363	1,355
-5.33%	1,365	1,354	1,337	1,316	1,291	1,261	1,227
-2.67%	1,164	1,106	1,044	981	915	848	780
0%	217	146	73	0	-74	-148	-223
2.67%	-1,586	-1,609	-1,639	-1,673	-1,712	-1,756	-1,802
5.33%	-3,694	-3,696	-3,700	-3,707	-3,718	-3,732	-3,749
8.00%	-5,836	-5,836	-5,836	-5,837	-5,838	-5,841	-5,845
KR4201M12(	2017-01 콜262.5						1,342

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	230	230	230	230	230	229	228
-5.33%	230	228	226	224	220	215	210
-2.67%	208	198	187	175	163	149	135
0%	57	38	19	0	-19	-38	-57
2.67%	-319	-329	-340	-352	-366	-380	-394
5.33%	-817	-819	-821	-825	-829	-835	-841
8.00%	-1,337	-1,337	-1,337	-1,338	-1,339	-1,340	-1,342

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

10,479

공시일	2016-12-19
기준일	2016-12-16

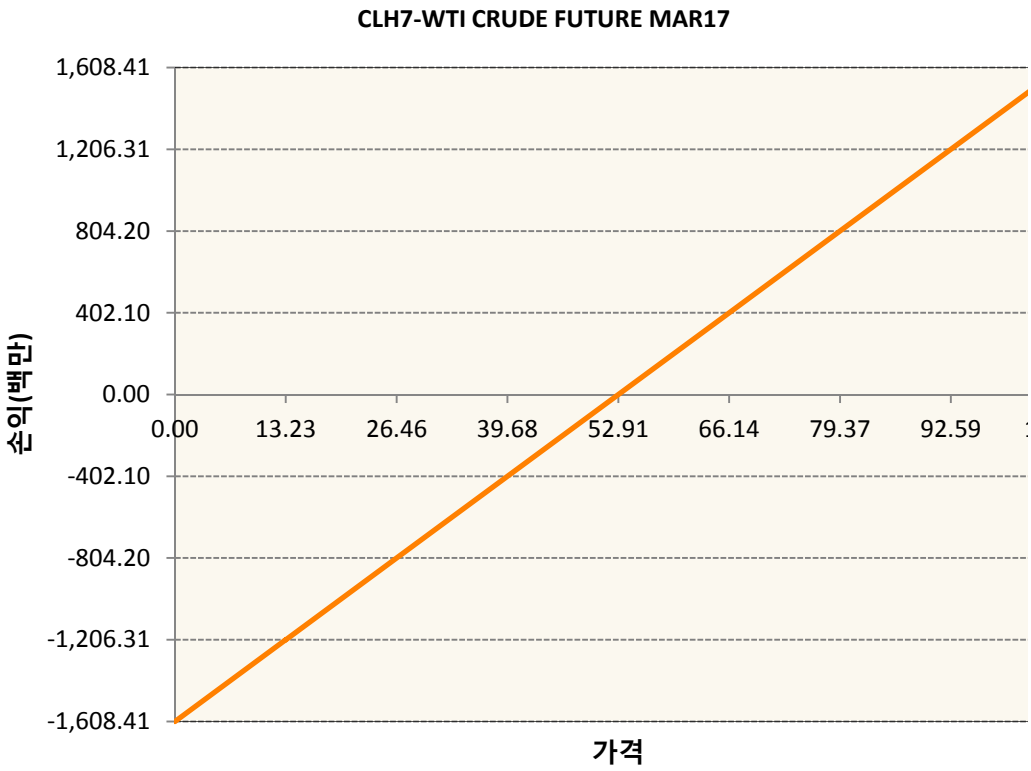
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

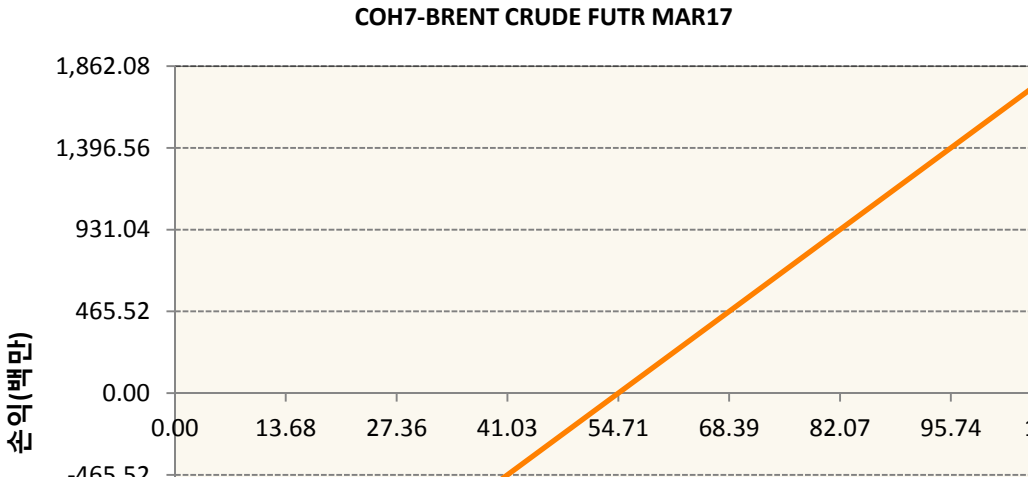
1. 계약금액

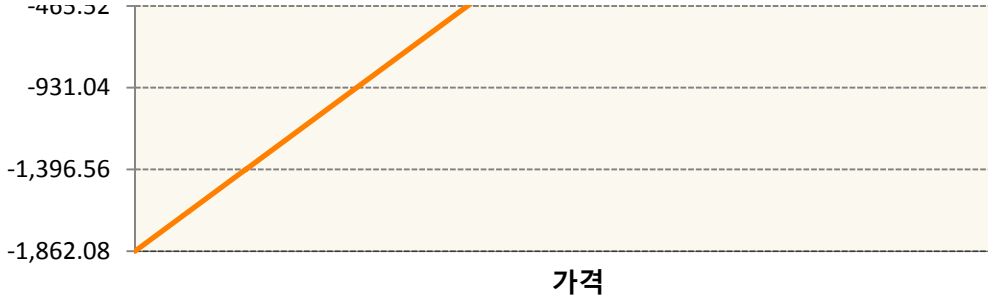
(단위:백만원)

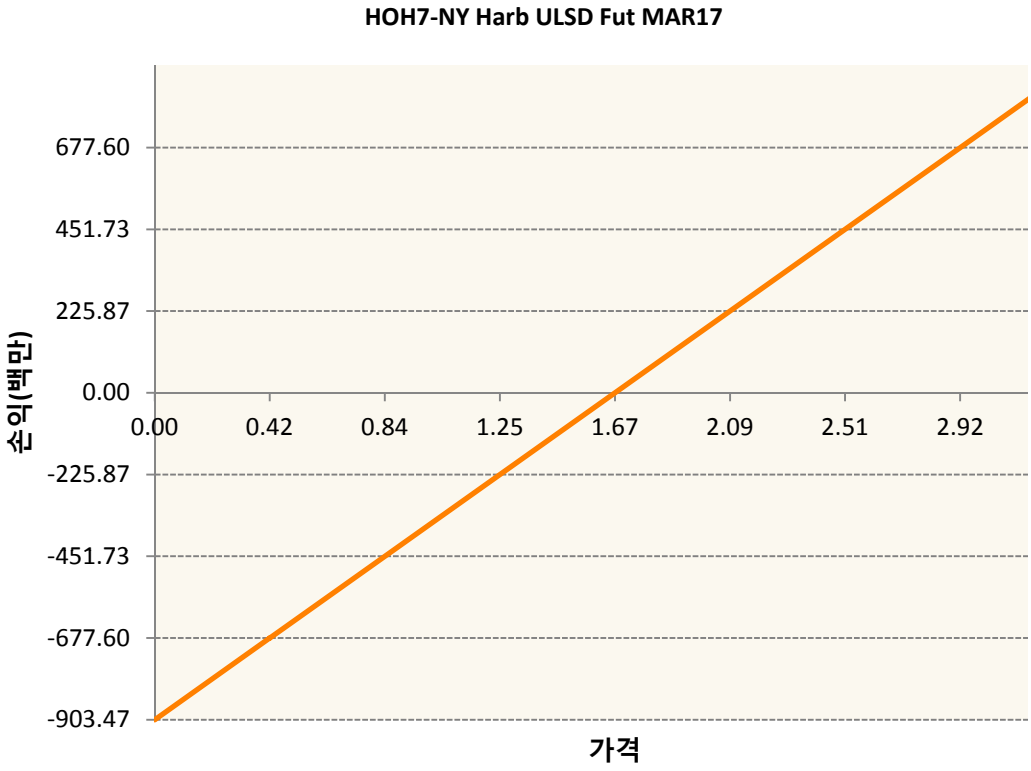
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	선물	유가증권	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	선물	유가증권	1,608	0	1,608	
누계	유가증권	선물	5,322	0	5,322	

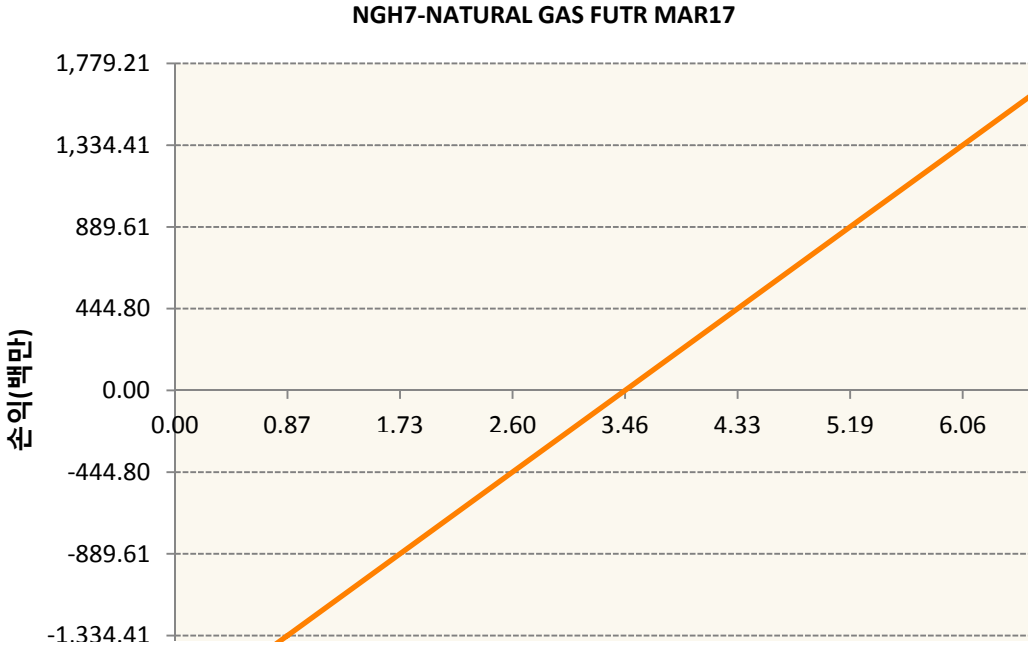
2. 만기시점의 손익구조

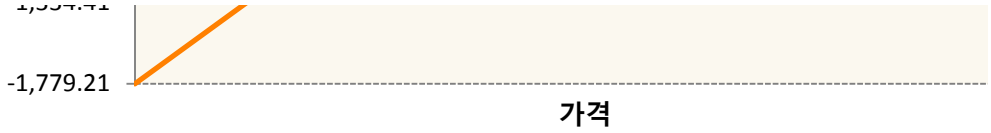


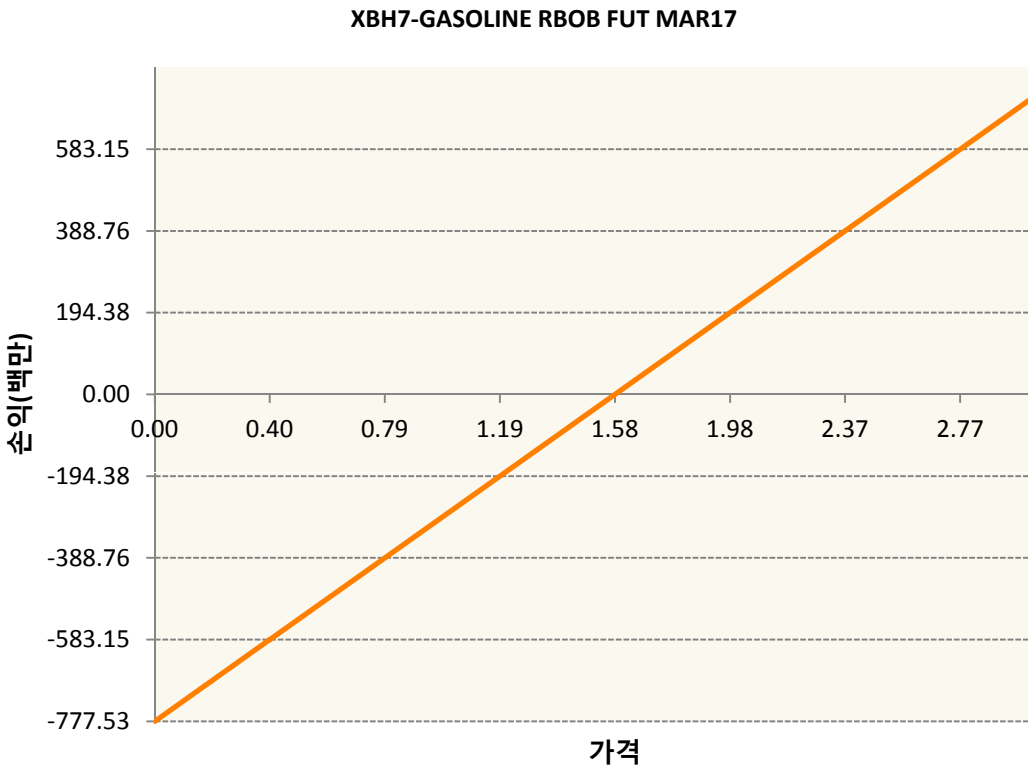



-931.04
-1,396.56
-1,862.08
가격


HOH7-NY Harb ULSD Fut MAR17
677.60
451.73
225.87
0.00
-225.87
-451.73
-677.60
-903.47
0.00
0.42
0.84
1.25
1.67
2.09
2.51
2.92
손익(백만)
가격


NGH7-NATURAL GAS FUTR MAR17
1,779.21
1,334.41
889.61
444.80
0.00
-444.80
-889.61
-1,334.41
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	129
COH7	BRENT CRUDE FUTR MAR17	149
HOH7	NY Harb ULSD Fut MAR17	72
NGH7	NATURAL GAS FUTR MAR17	142
XBH7	GASOLINE RBOB FUT MAR17	62

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

1,260

공시일	2016-12-19
기준일	2016-12-16

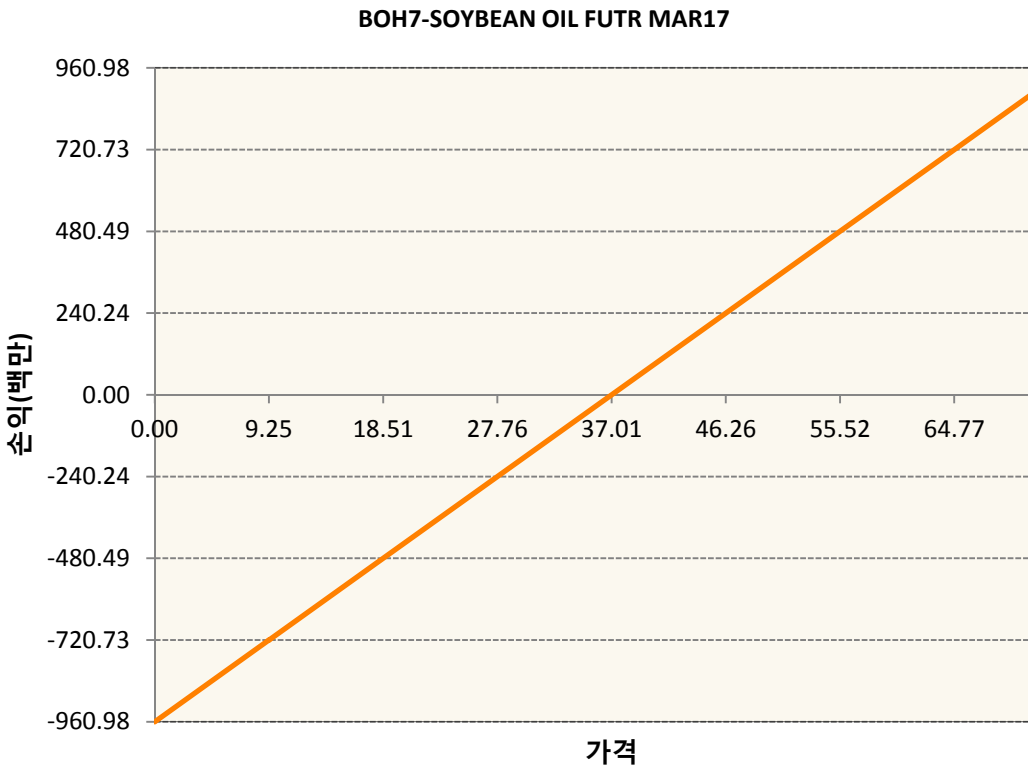
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

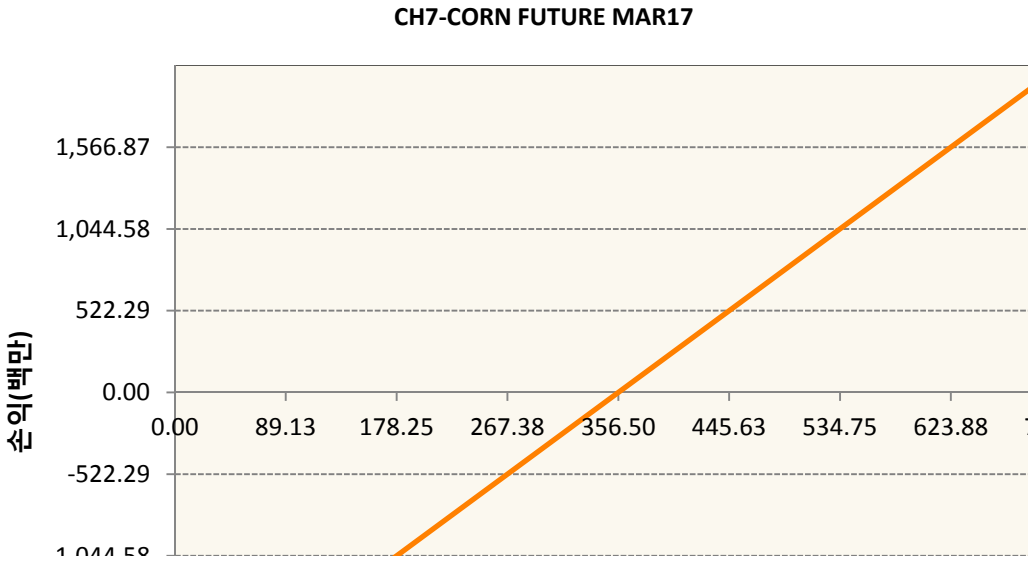
1. 계약금액

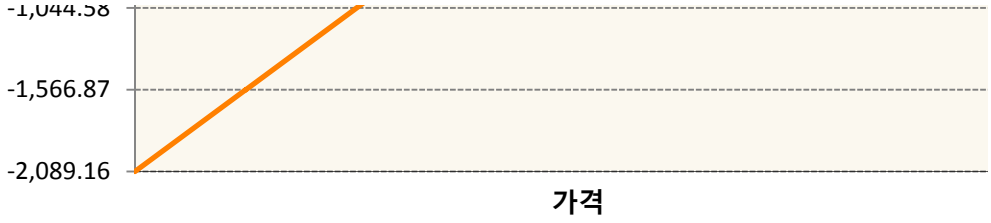
(단위:백만원)

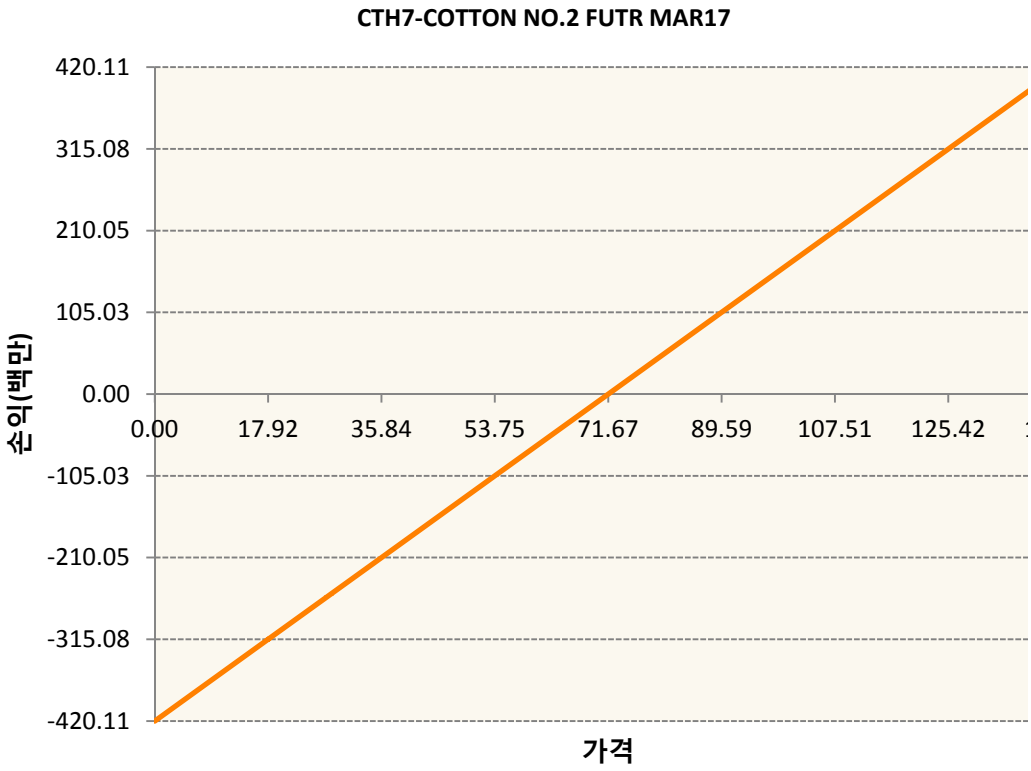
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	9,327	0	9,327	

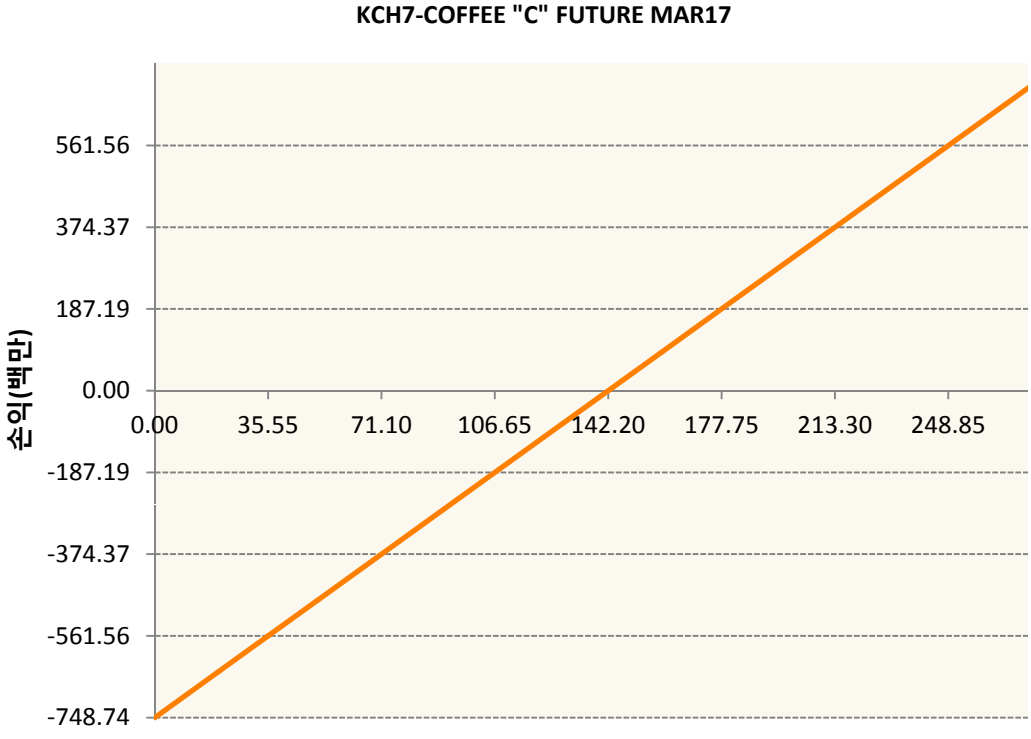
2. 만기시점의 손익구조





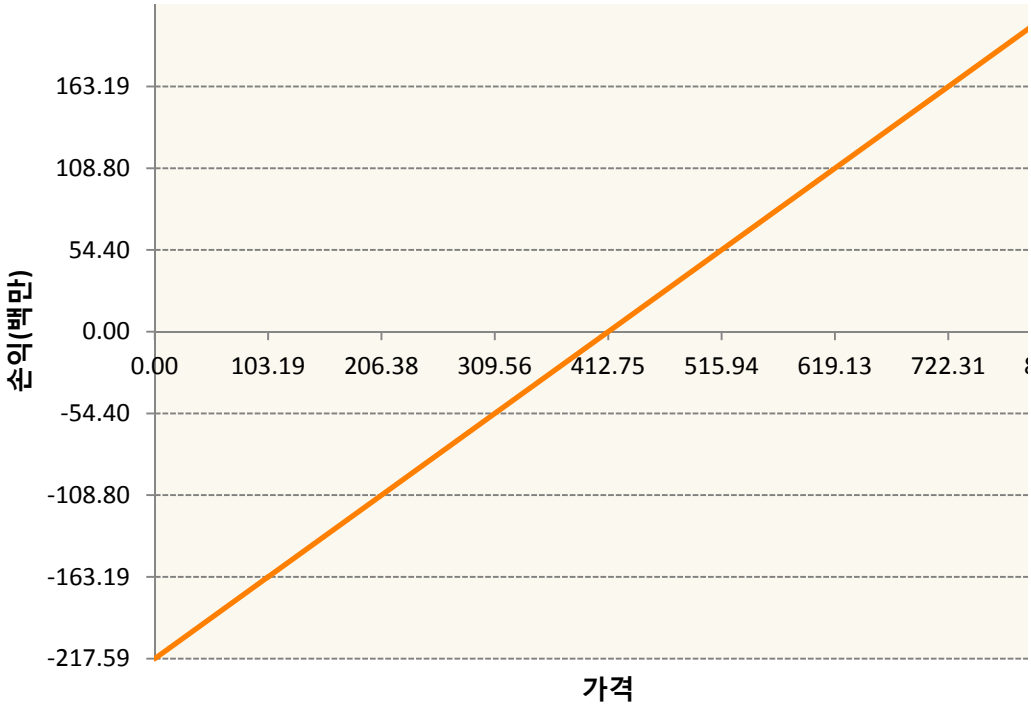

-1,044.58
-1,566.87
-2,089.16
가격


CTH7-COTTON NO.2 FUTR MAR17
420.11
315.08
210.05
105.03
0.00
-105.03
-210.05
-315.08
-420.11
0.00
17.92
35.84
53.75
71.67
89.59
107.51
125.42
순익(백만)
가격

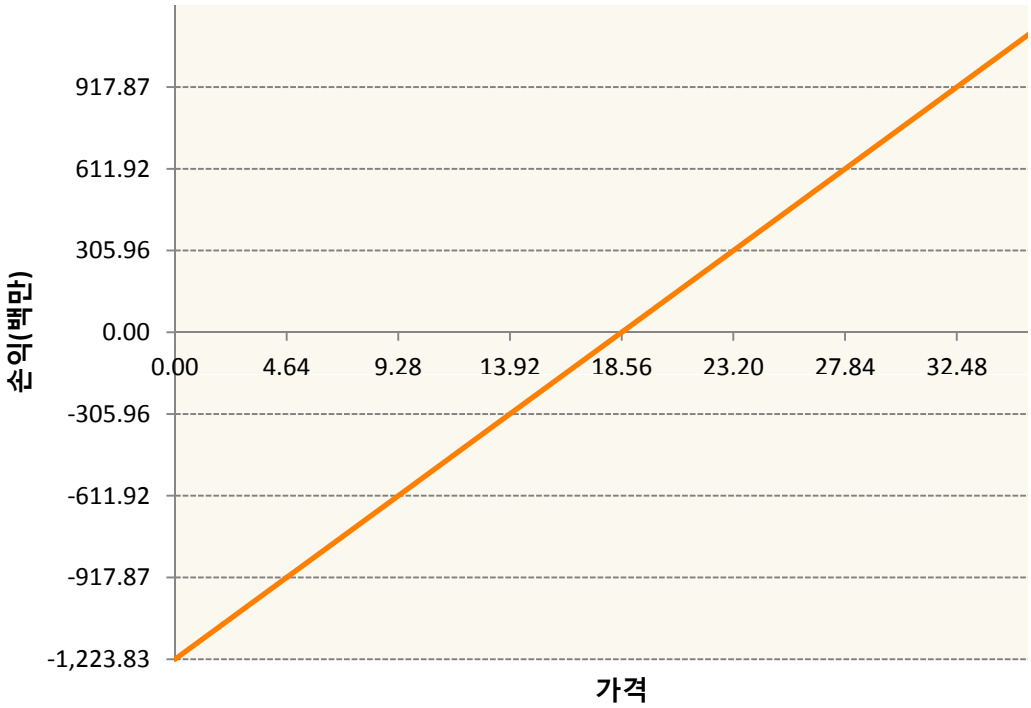

KCH7-COFFEE "C" FUTURE MAR17
561.56
374.37
187.19
0.00
-187.19
-374.37
-561.56
-748.74
0.00
35.55
71.10
106.65
142.20
177.75
213.30
248.85
순익(백만)

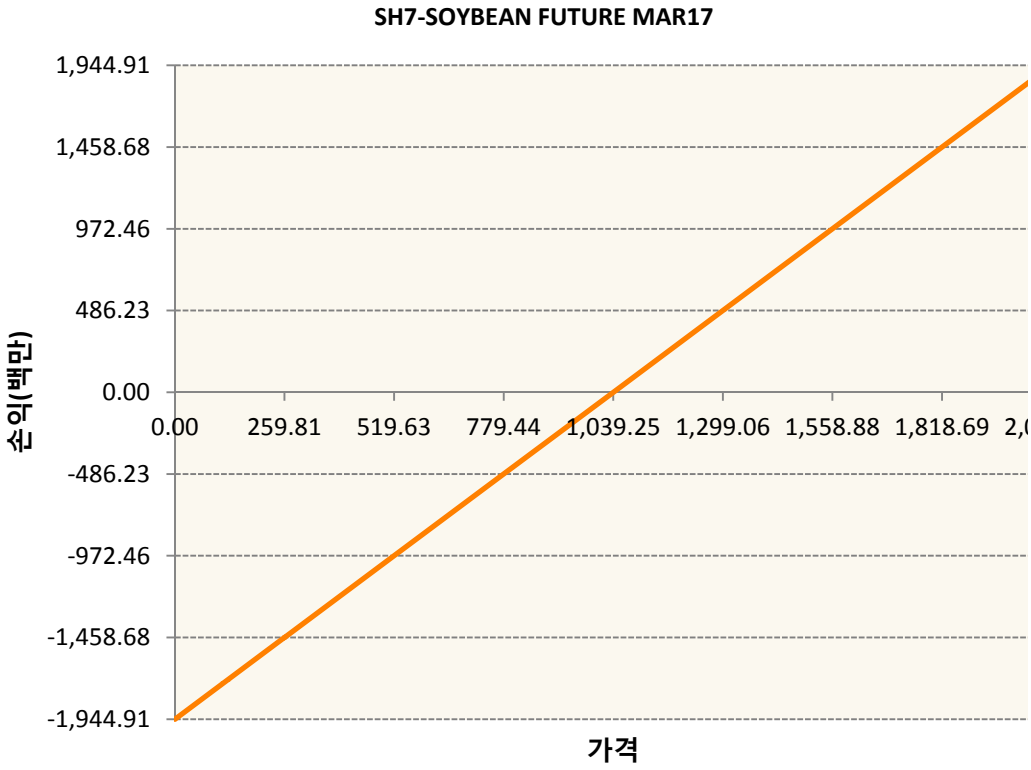
가격

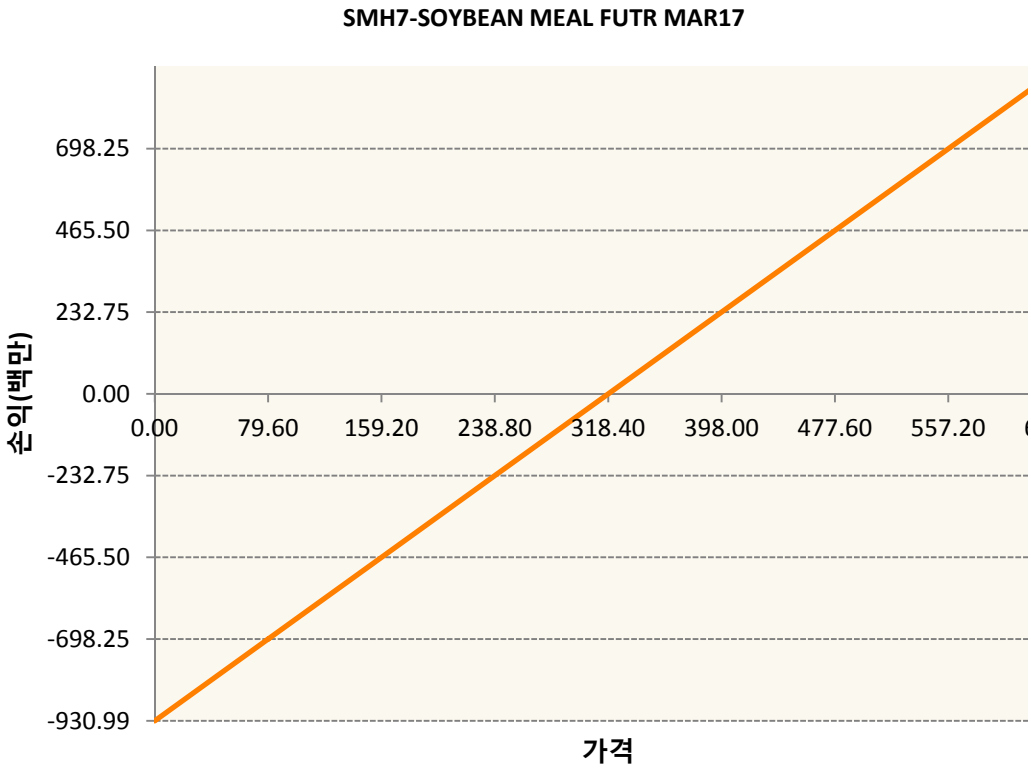
KWH7-KC HRW WHEAT FUT MAR17

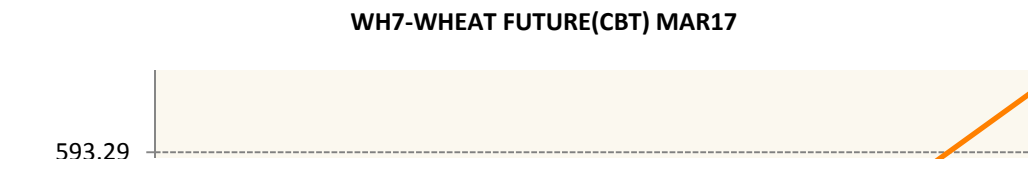


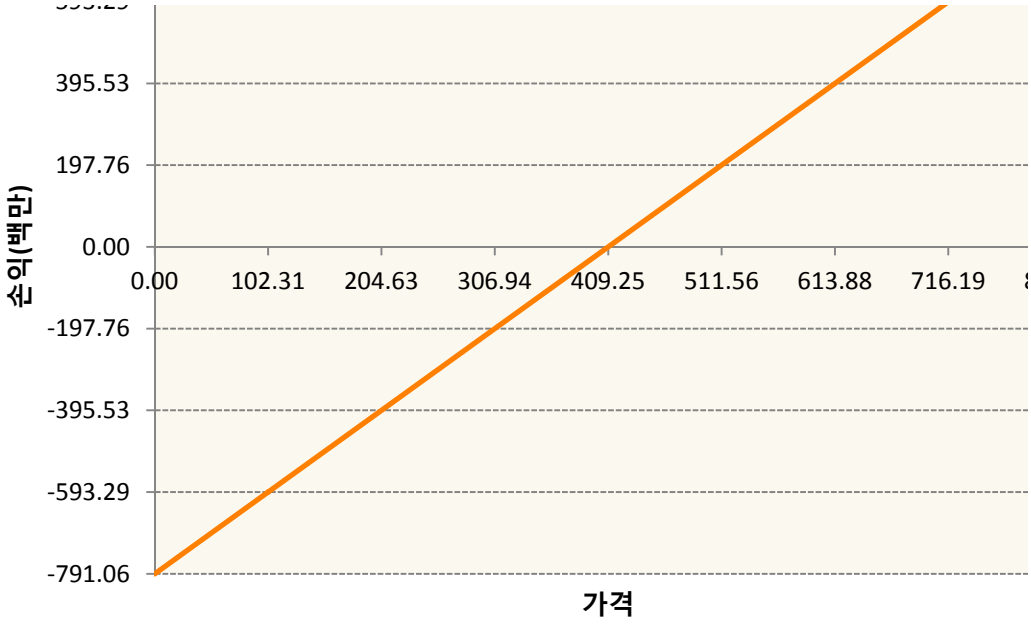
SBH7-Sugar #11 (WORLD) MAR17




SH7-SOYBEAN FUTURE MAR17
1,944.91
1,458.68
972.46
486.23
0.00
-486.23
-972.46
-1,458.68
-1,944.91
0.00
259.81
519.63
779.44
1,039.25
1,299.06
1,558.88
1,818.69
손익(백만)
가격


SMH7-SOYBEAN MEAL FUTR MAR17
698.25
465.50
232.75
0.00
-232.75
-465.50
-698.25
-930.99
0.00
79.60
159.20
238.80
318.40
398.00
477.60
557.20
손익(백만)
가격


WH7-WHEAT FUTURE(CBT) MAR17
593.29



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
BOH7	SOYBEAN OIL FUTR MAR17	77
CH7	CORN FUTURE MAR17	167
CTH7	COTTON NO.2 FUTR MAR17	34
KCH7	COFFEE "C" FUTURE MAR17	60
KWH7	KC HRW WHEAT FUT MAR17	17
SBH7	Sugar #11 (WORLD) MAR17	98
SH7	SOYBEAN FUTURE MAR17	156
SMH7	SOYBEAN MEAL FUTR MAR17	74
WH7	WHEAT FUTURE(CBT) MAR17	63

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	906