공시일	2016-12-21
기준일	2016-12-20

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	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	2016-12-21
기준일	2016-12-20

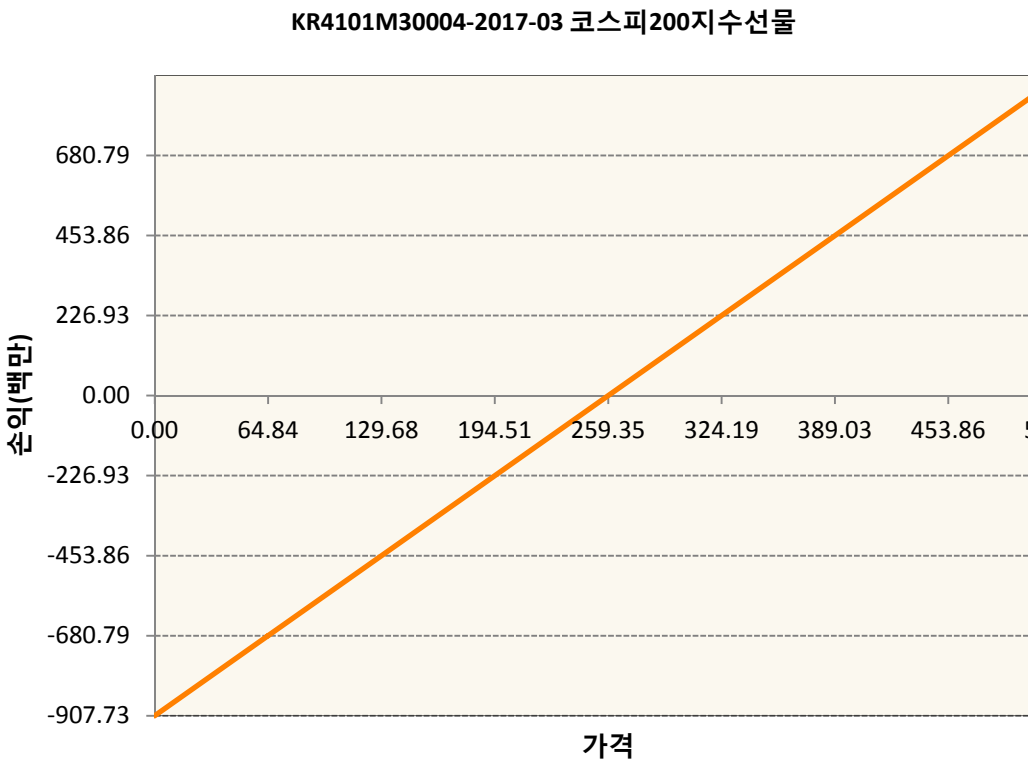
스마트인덱스모

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	908	0	908	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	2016-12-21
기준일	2016-12-20

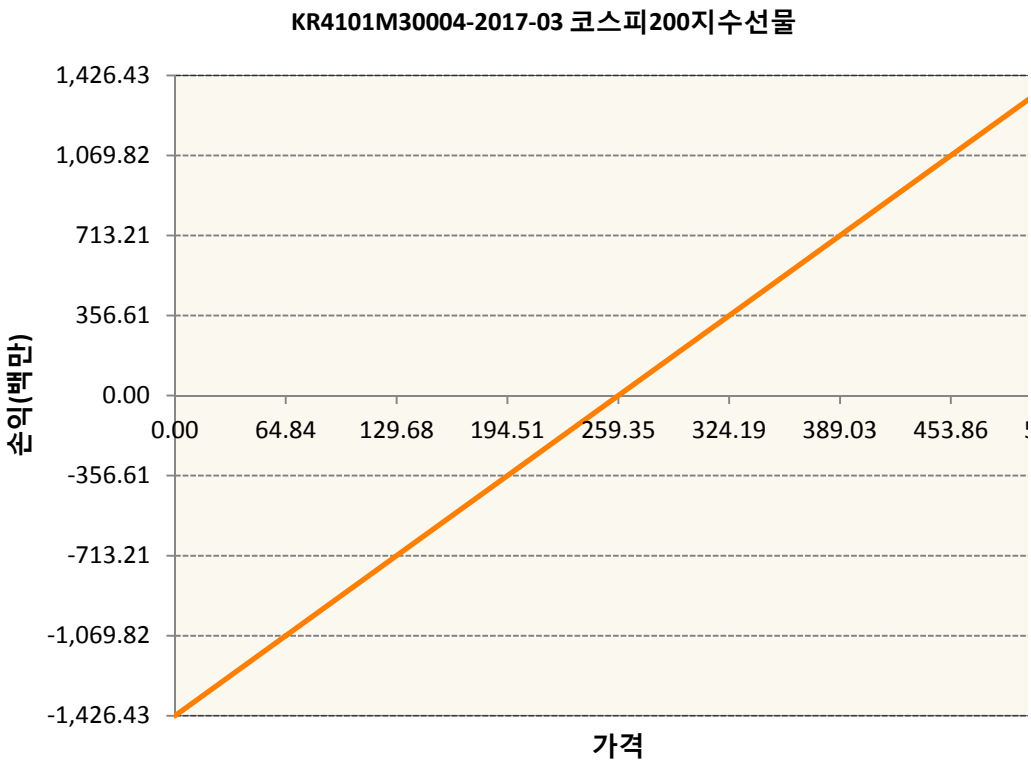
스마트레버리지목표전환형1호

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	130	-130	장내
누계	유가증권	선물	1,426	0	1,426	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101M30(2017-03 코스피200지수선물							116
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-116	-116	-116	-116	-116	-116	-116
-5.33%	-77	-77	-77	-77	-77	-77	-77
-2.67%	-39	-39	-39	-39	-39	-39	-39
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	39	39	39	39	39	39	39
5.33%	77	77	77	77	77	77	77
8.00%	116	116	116	116	116	116	116

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

88

공시일	2016-12-21
기준일	2016-12-20

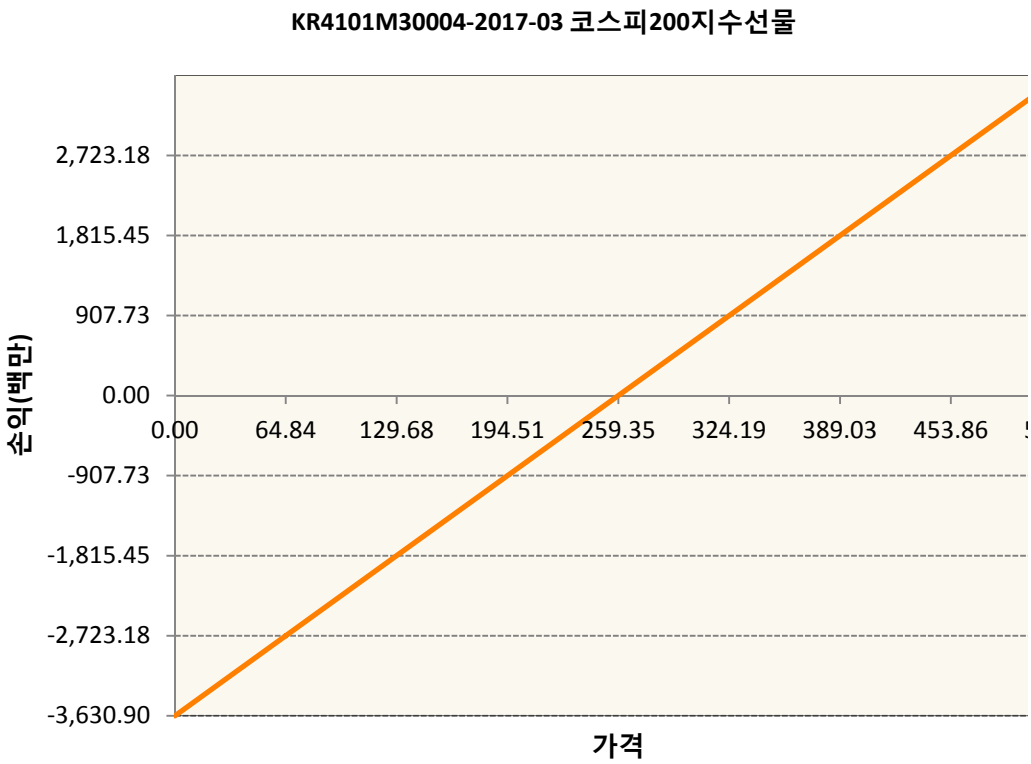
1.3배 레버리지 인덱스(주식-파생형)

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	3,631	0	3,631	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	2016-12-21
기준일	2016-12-20

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)

723

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2016-12-21
기준일	2016-12-20

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	379

* 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	2016-12-21
기준일	2016-12-20

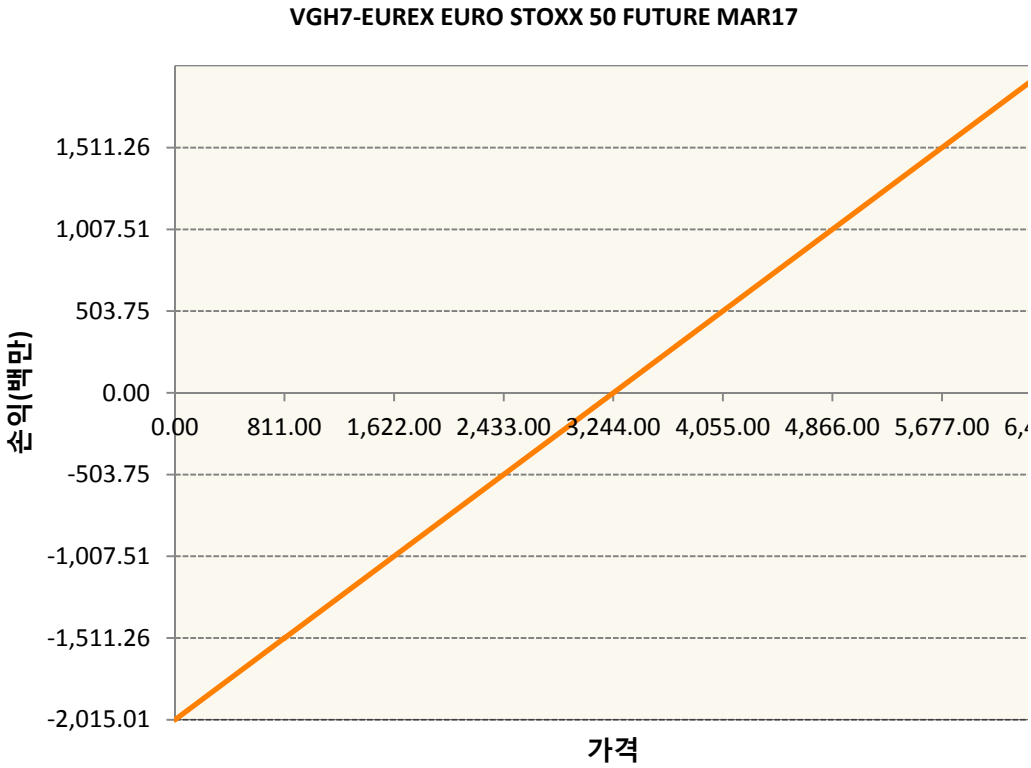
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,015	0	2,015	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGH7	EUREX EURO STOXX 50 FUTURE MAR17	161

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

(단위:백만원)

187

공시일	2016-12-21
기준일	2016-12-20

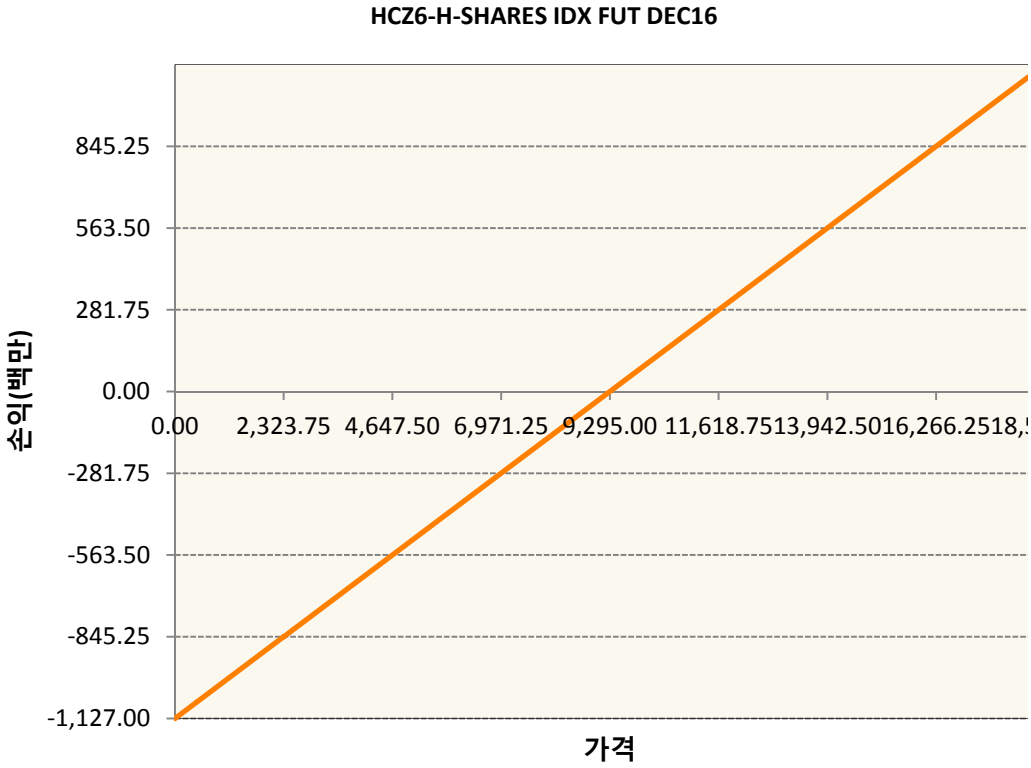
차이나인덱스모(주식-파생형)

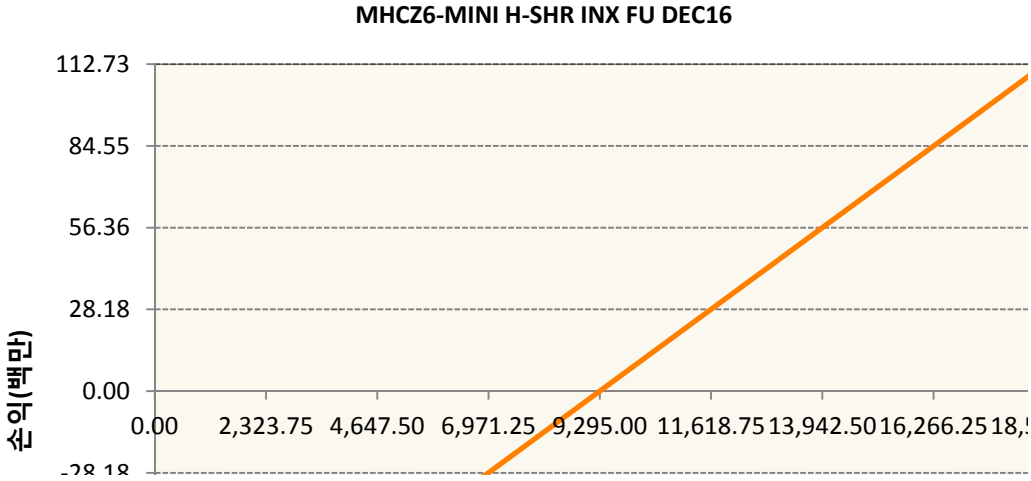
1. 계약금액

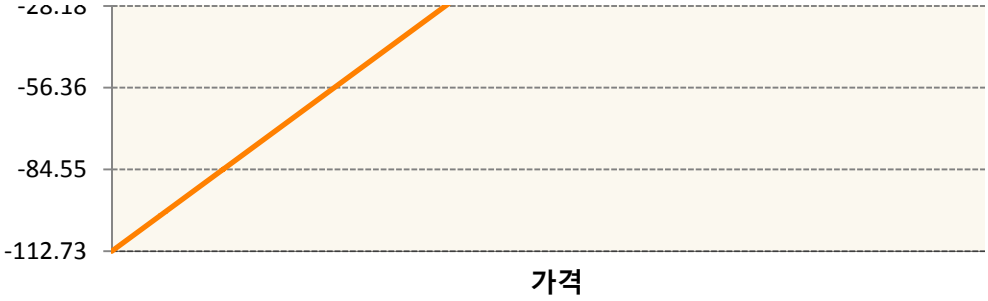
(단위:백만원)

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	1,127	0	1,127	
누계	유가증권	선물	113	0	113	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

HCZ6	H-SHARES IDX FUT DEC16	90
MHCZ6	MINI H-SHR INX FU DEC16	9

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

105

공시일	2016-12-21
기준일	2016-12-20

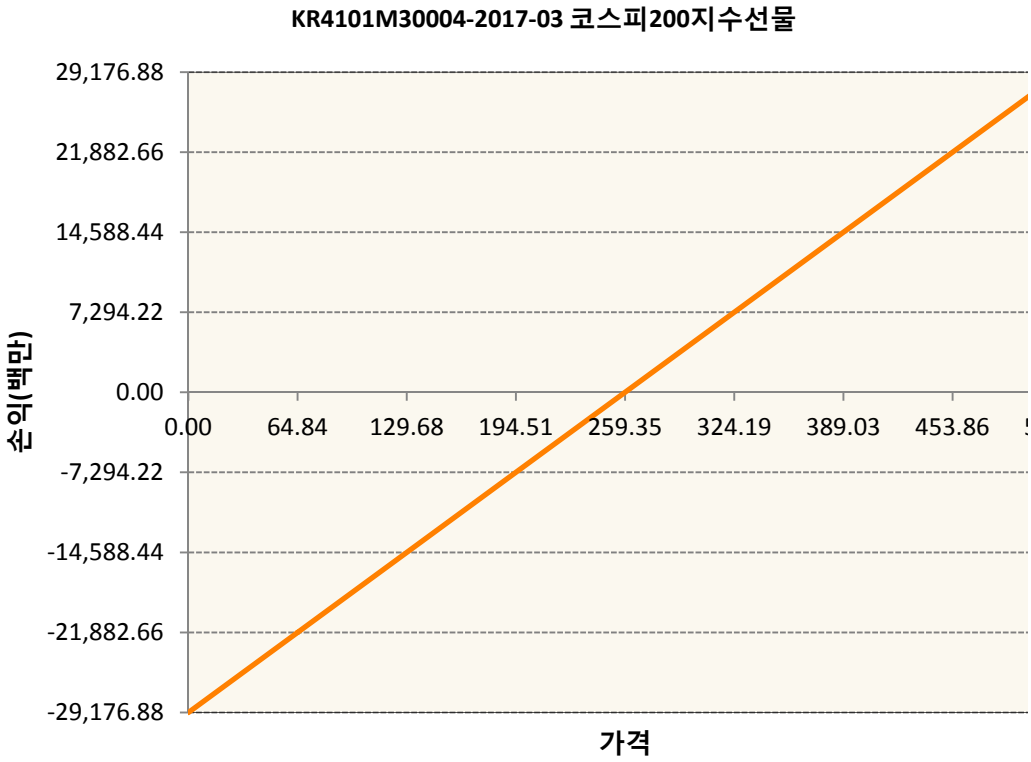
커버드콜(주식혼합-파생형)

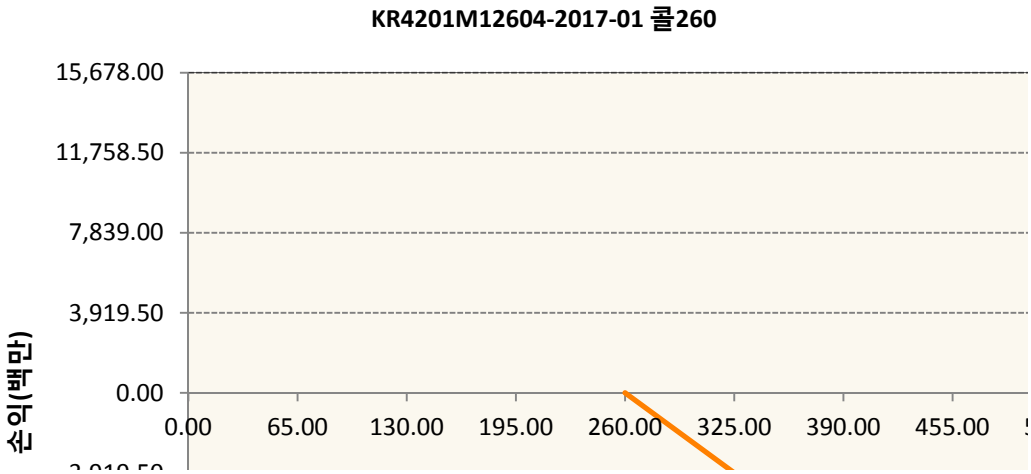
1. 계약금액

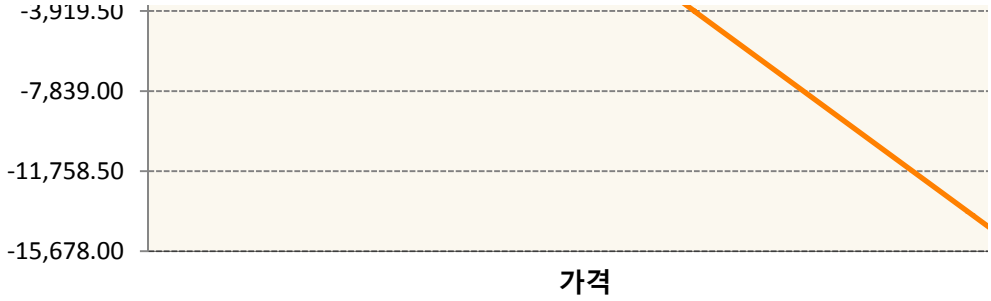
(단위:백만원)

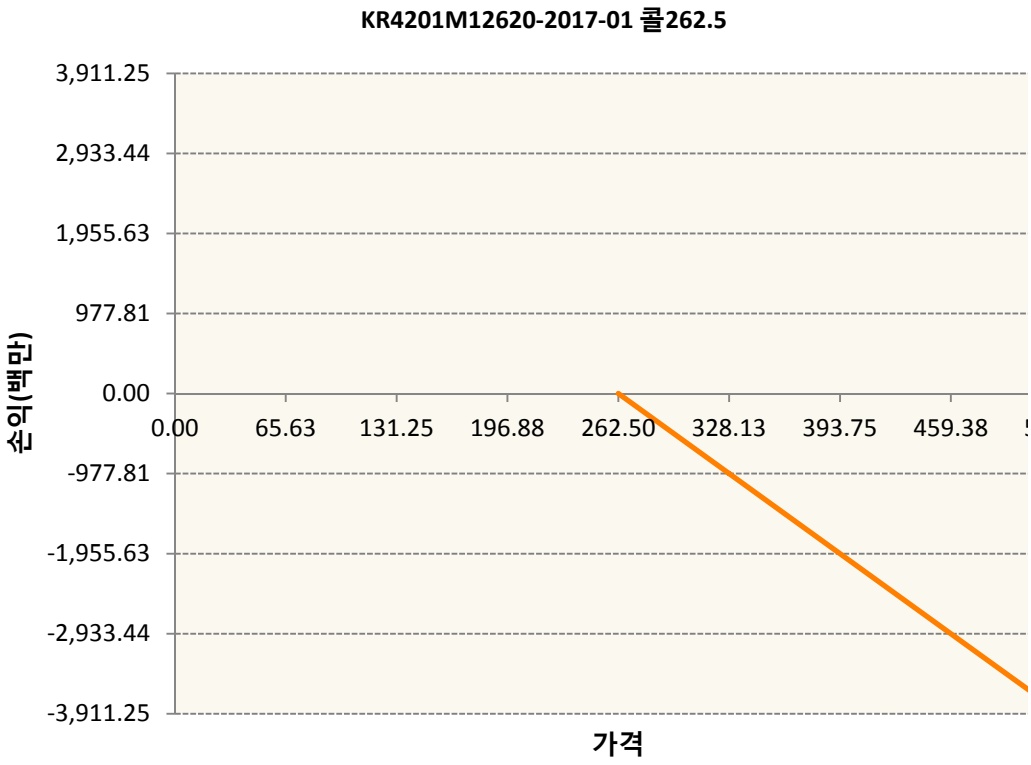
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	29,177	0	29,177	장내
누계	유가증권	옵션	0	19,589	-19,589	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101M30(2017-03 코스피200지수선물							2,363
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-2,363	-2,363	-2,363	-2,363	-2,363	-2,363	-2,363
-5.33%	-1,576	-1,576	-1,576	-1,576	-1,576	-1,576	-1,576
-2.67%	-788	-788	-788	-788	-788	-788	-788
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	788	788	788	788	788	788	788
5.33%	1,576	1,576	1,576	1,576	1,576	1,576	1,576
8.00%	2,363	2,363	2,363	2,363	2,363	2,363	2,363
KR4201M12(2017-01 콜260							5,825
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,287	1,287	1,286	1,285	1,283	1,279	1,274
-5.33%	1,280	1,273	1,262	1,247	1,229	1,206	1,181
-2.67%	1,117	1,067	1,014	959	902	843	783
0%	192	129	65	0	-66	-132	-199
2.67%	-1,625	-1,641	-1,663	-1,689	-1,719	-1,754	-1,791
5.33%	-3,712	-3,713	-3,715	-3,719	-3,725	-3,734	-3,746
8.00%	-5,821	-5,821	-5,821	-5,821	-5,822	-5,823	-5,825
KR4201M12(	2017-01 콜262.5						1,361

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	212	212	212	212	212	211	211
-5.33%	211	211	210	208	205	202	198
-2.67%	195	188	179	169	158	146	134
0%	52	35	17	0	-17	-35	-52
2.67%	-333	-341	-350	-360	-372	-383	-396
5.33%	-838	-839	-840	-842	-845	-849	-854
8.00%	-1,358	-1,358	-1,358	-1,359	-1,359	-1,360	-1,361

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

10,604

공시일	2016-12-21
기준일	2016-12-20

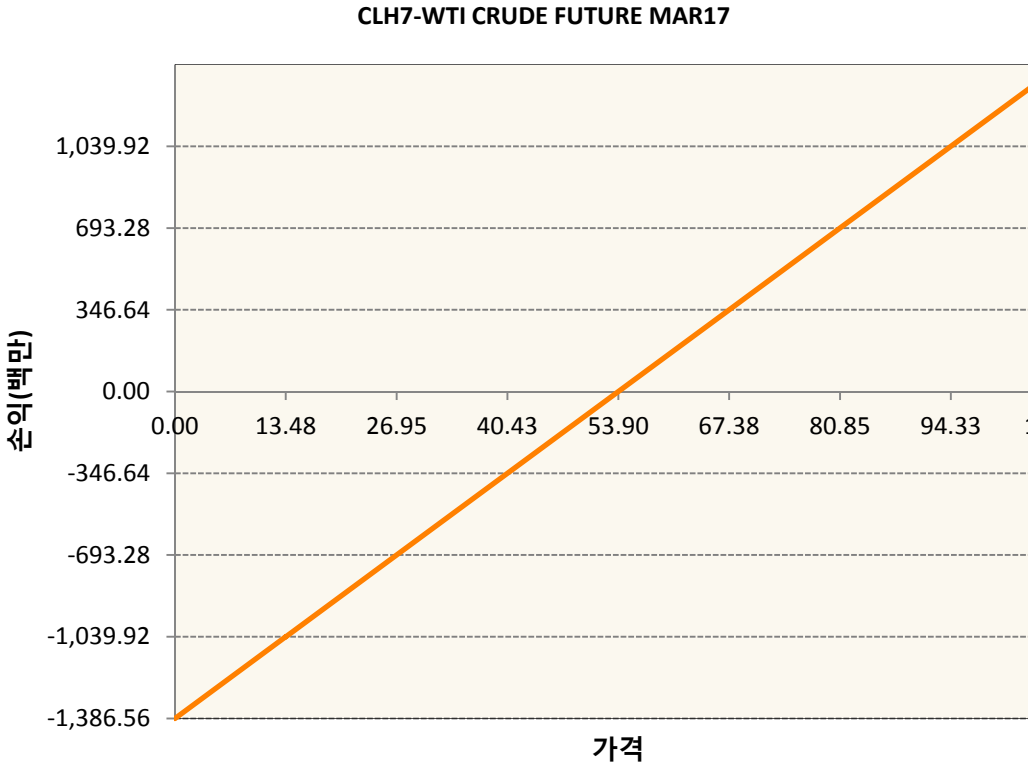
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

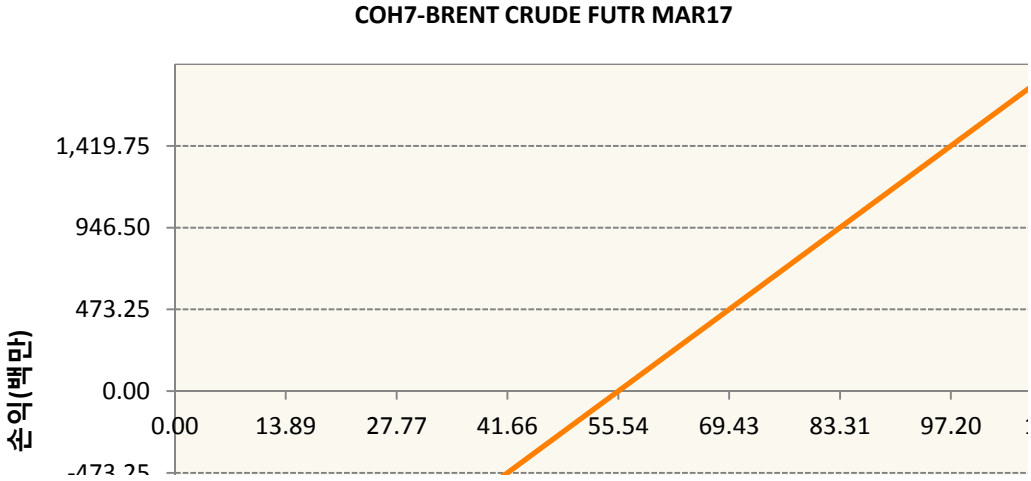
1. 계약금액

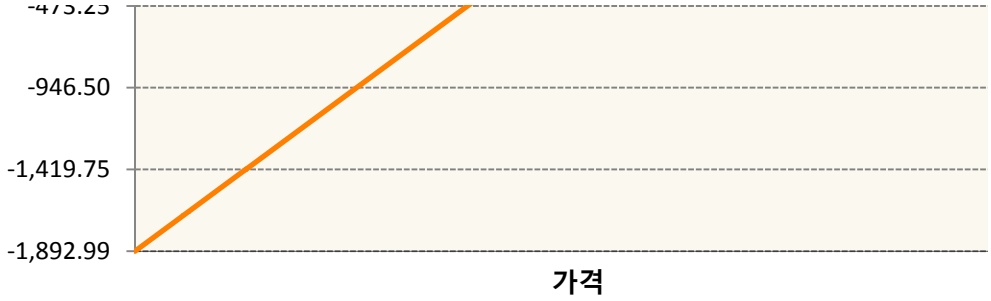
(단위:백만원)

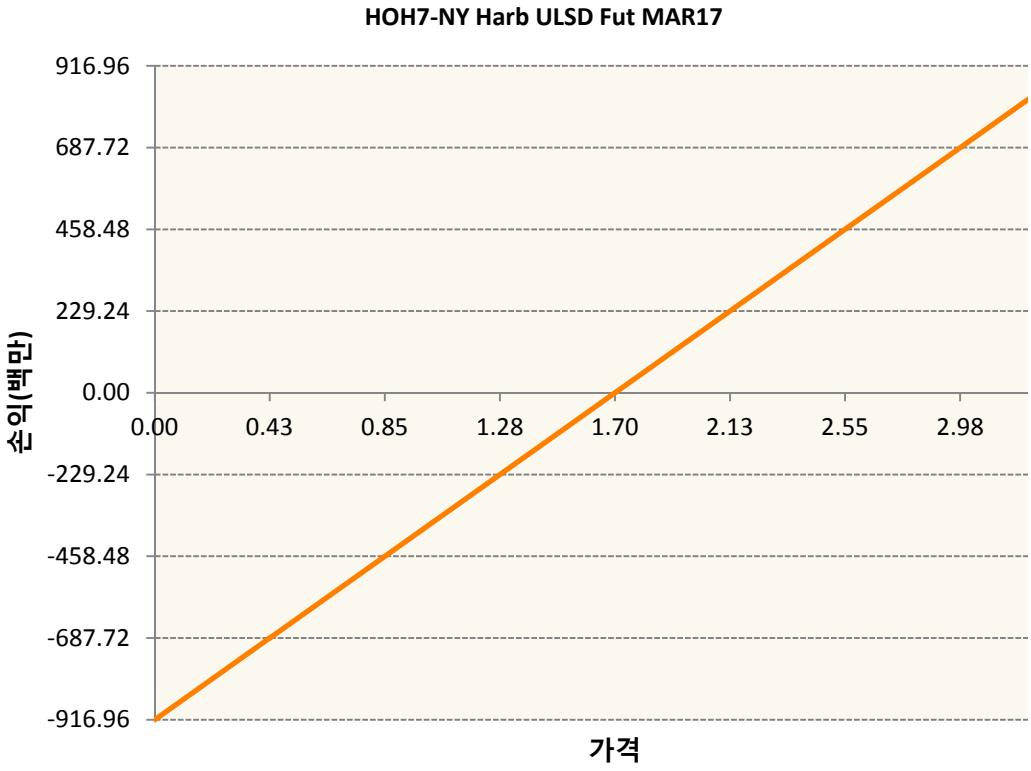
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	선물	유가증권	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	선물	유가증권	1,387	0	1,387	
누계	유가증권	선물	5,360	0	5,360	

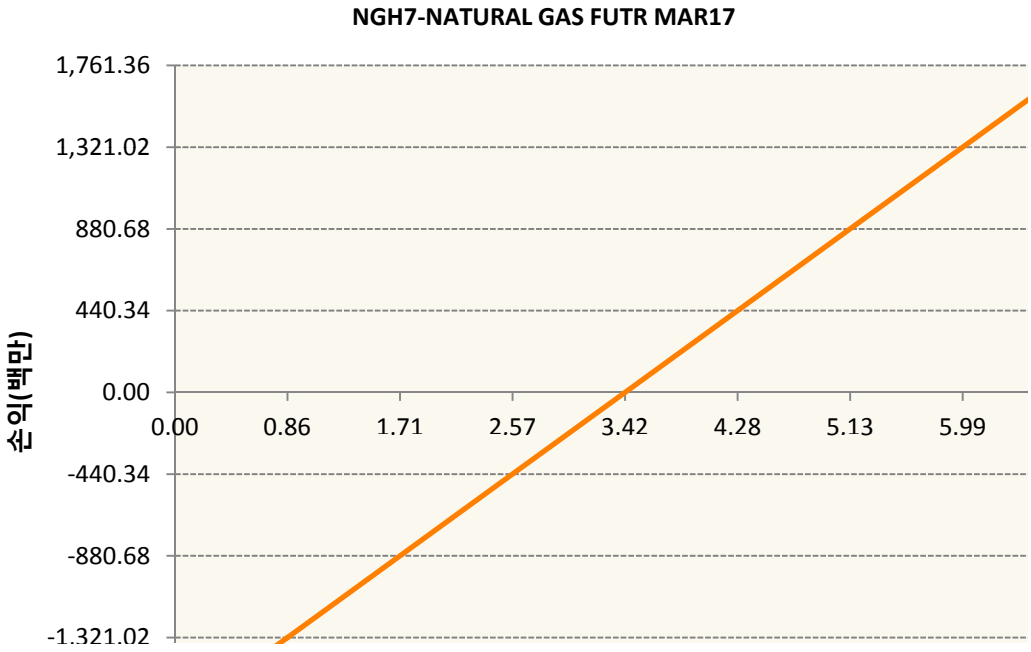
2. 만기시점의 손익구조

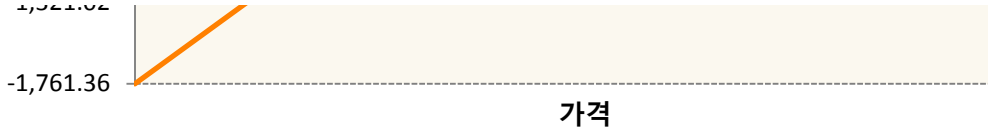


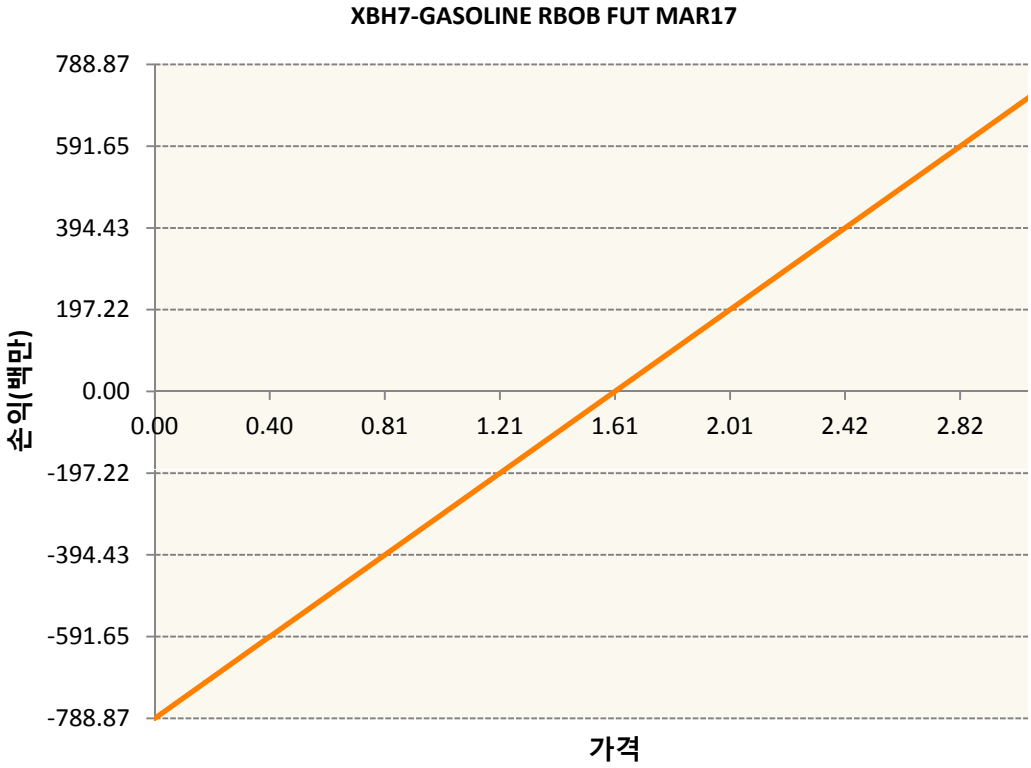



-946.50
-1,419.75
-1,892.99
가격


HOH7-NY Harb ULSD Fut MAR17
916.96
687.72
458.48
229.24
0.00
-229.24
-458.48
-687.72
-916.96
0.00
0.43
0.85
1.28
1.70
2.13
2.55
2.98
순익(백만)
가격


NGH7-NATURAL GAS FUTR MAR17
1,761.36
1,321.02
880.68
440.34
0.00
-440.34
-880.68
-1,321.02
0.00
0.86
1.71
2.57
3.42
4.28
5.13
5.99
순익(백만)





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLH7	WTI CRUDE FUTURE MAR17	111
COH7	BRENT CRUDE FUTR MAR17	151
HOH7	NY Harb ULSD Fut MAR17	73
NGH7	NATURAL GAS FUTR MAR17	141
XBH7	GASOLINE RBOB FUT MAR17	63

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

1,225

공시일	2016-12-21
기준일	2016-12-20

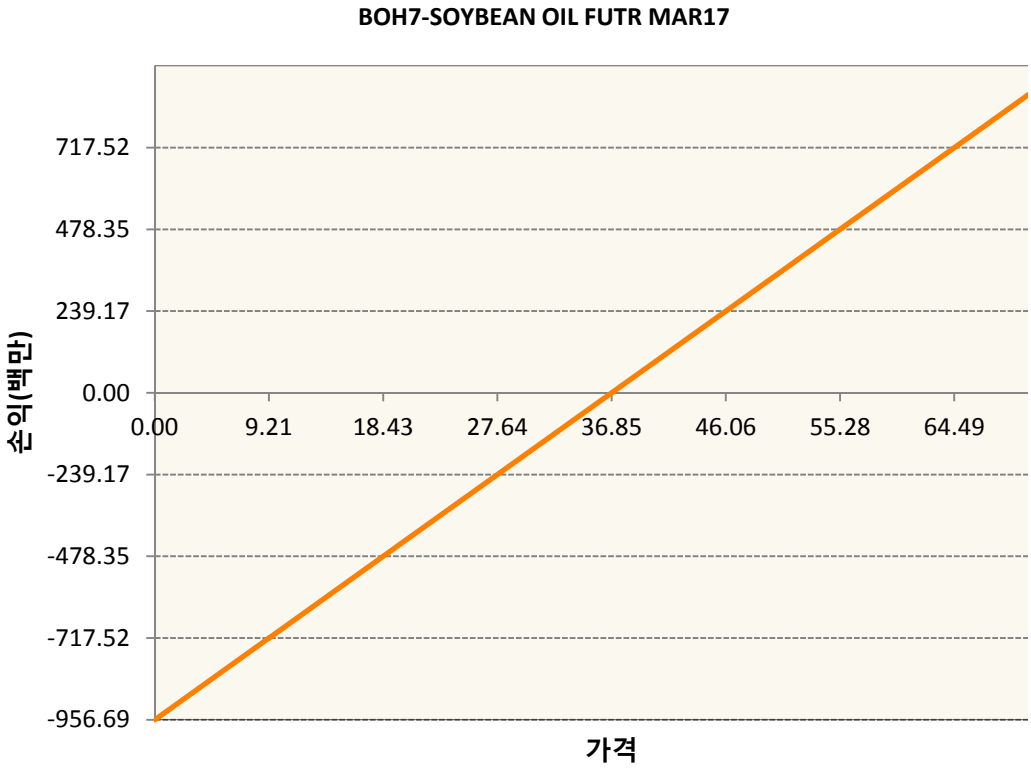
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

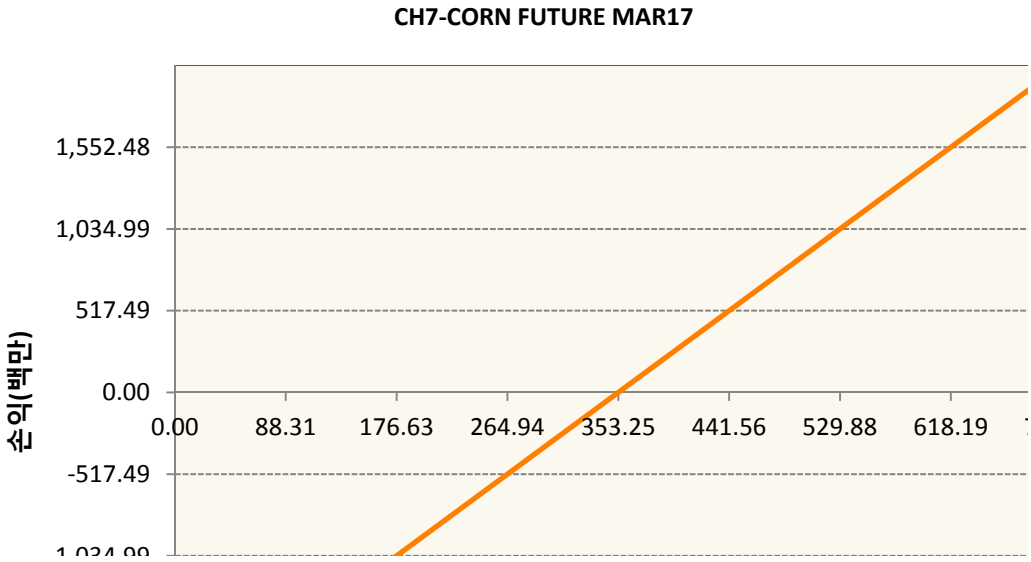
1. 계약금액

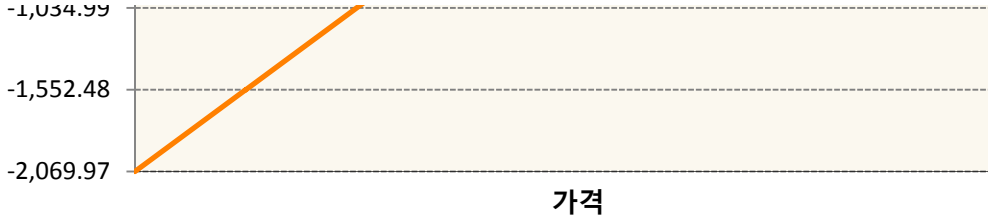
(단위:백만원)

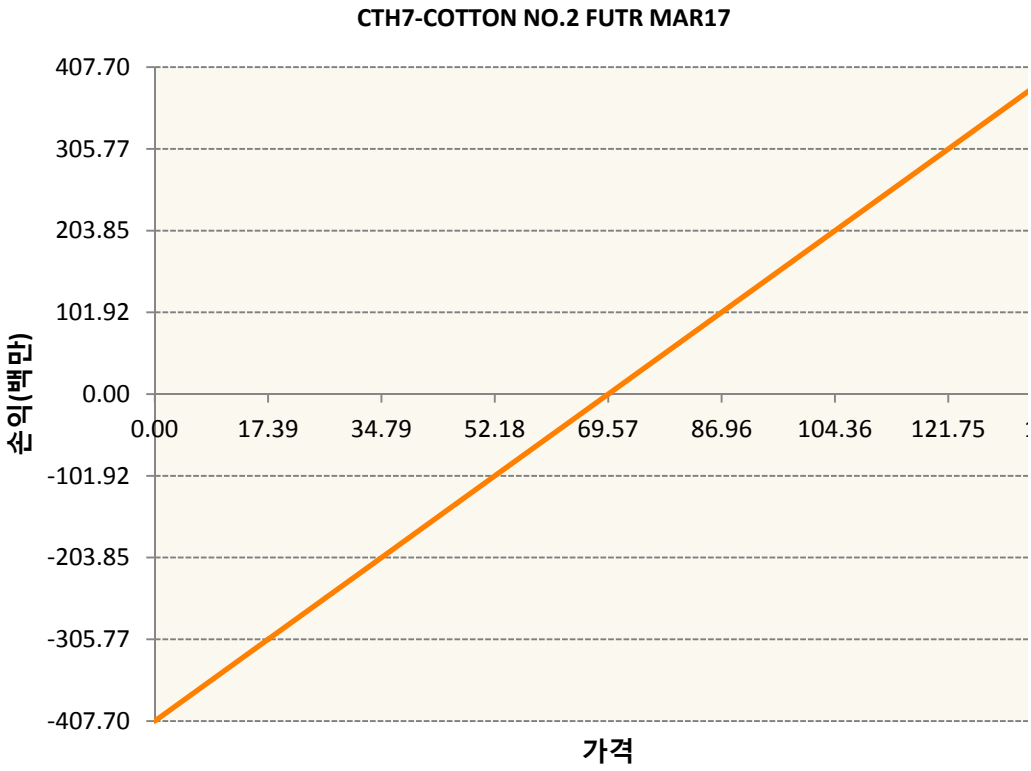
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	9,149	0	9,149	

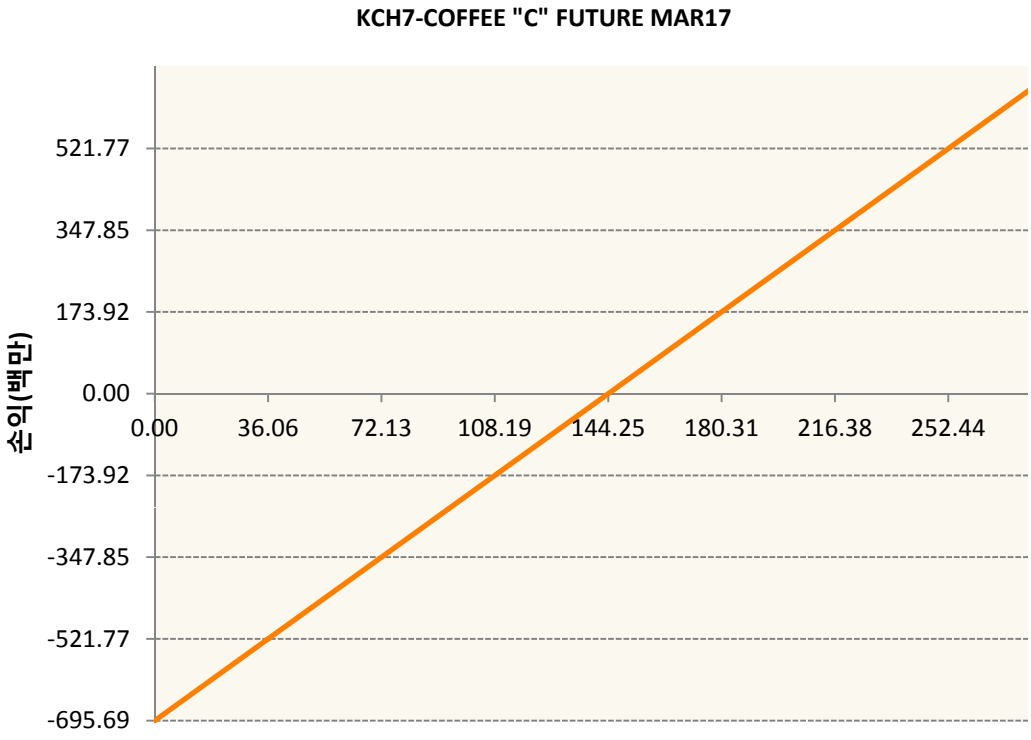
2. 만기시점의 손익구조



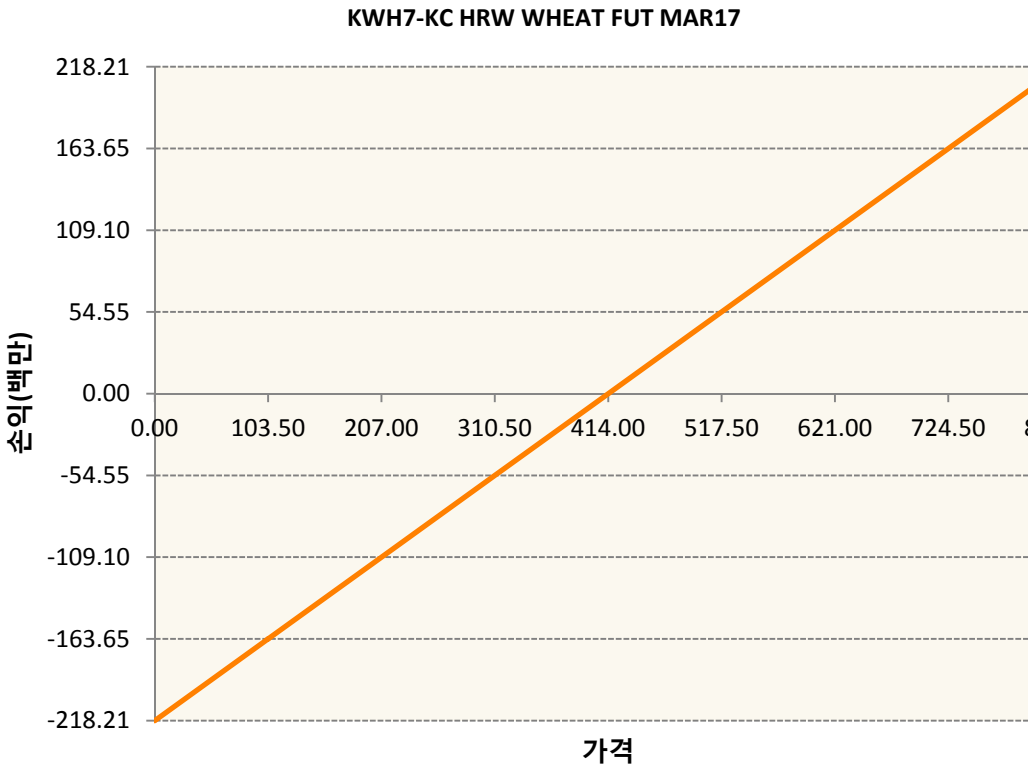


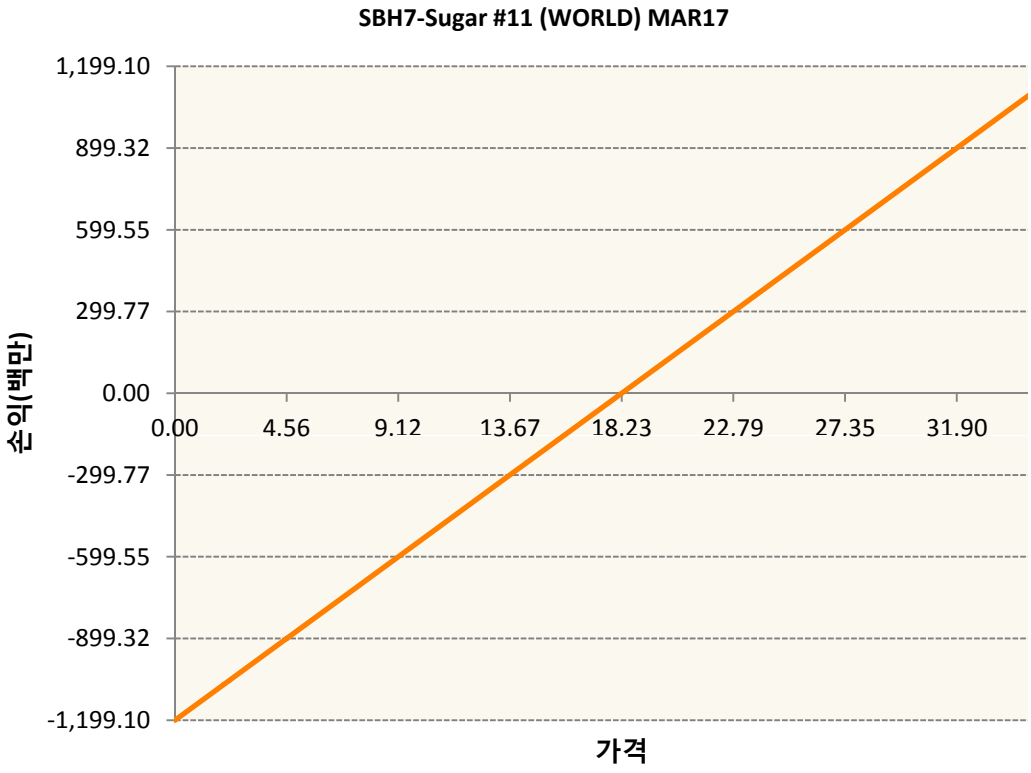

-1,034.99
-1,552.48
-2,069.97
가격

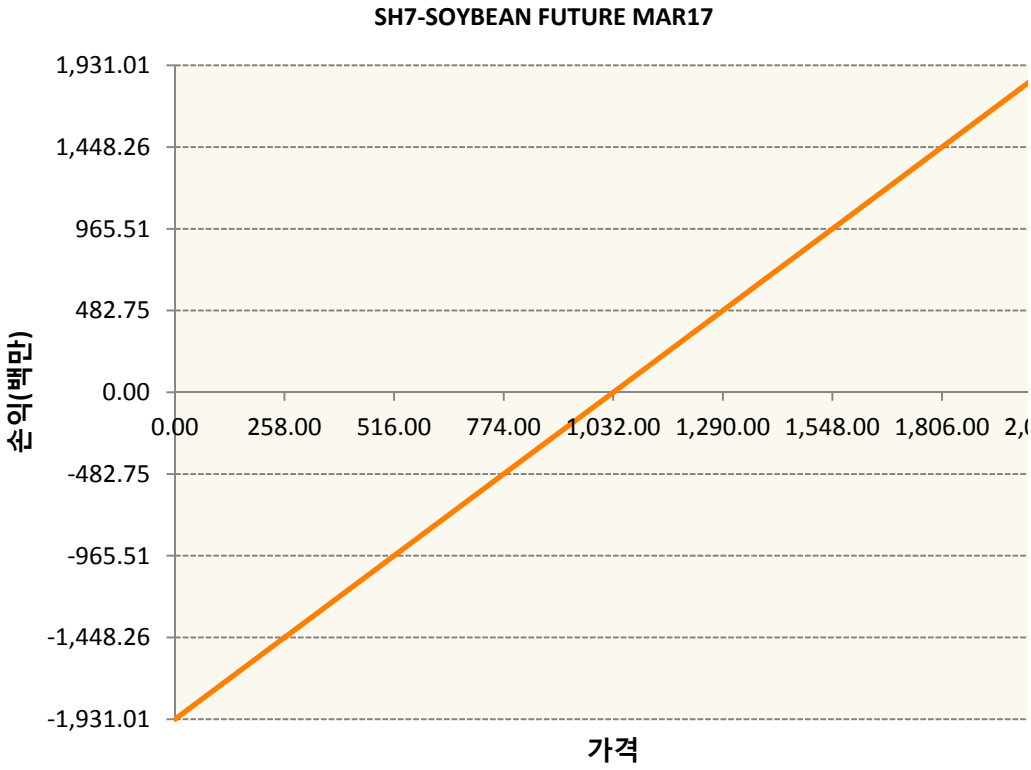

CTH7-COTTON NO.2 FUTR MAR17
407.70
305.77
203.85
101.92
0.00
-101.92
-203.85
-305.77
-407.70
0.00
17.39
34.79
52.18
69.57
86.96
104.36
121.75
순익(백만)
가격

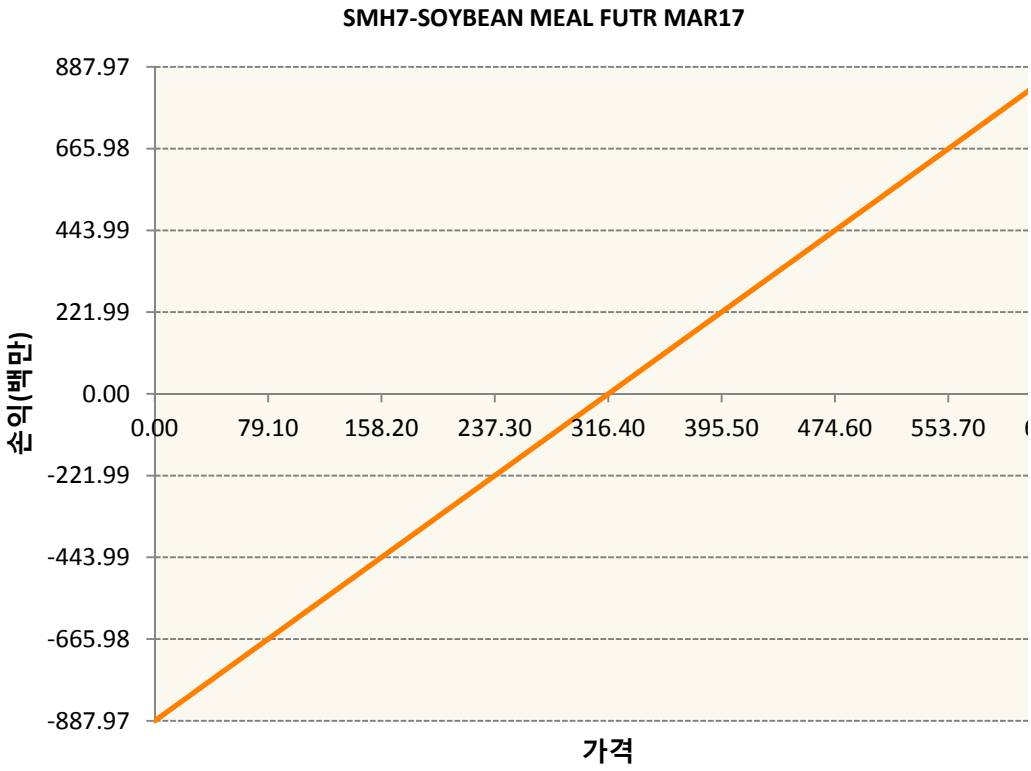

KCH7-COFFEE "C" FUTURE MAR17
521.77
347.85
173.92
0.00
-173.92
-347.85
-521.77
-695.69
0.00
36.06
72.13
108.19
144.25
180.31
216.38
252.44
순익(백만)

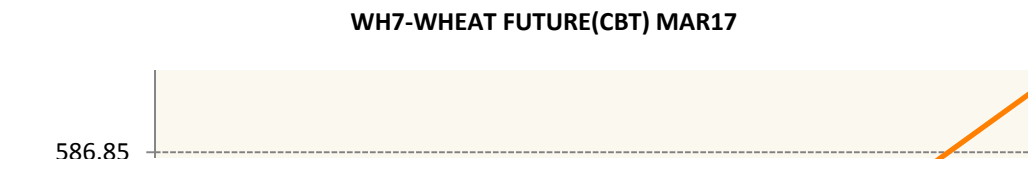
가격

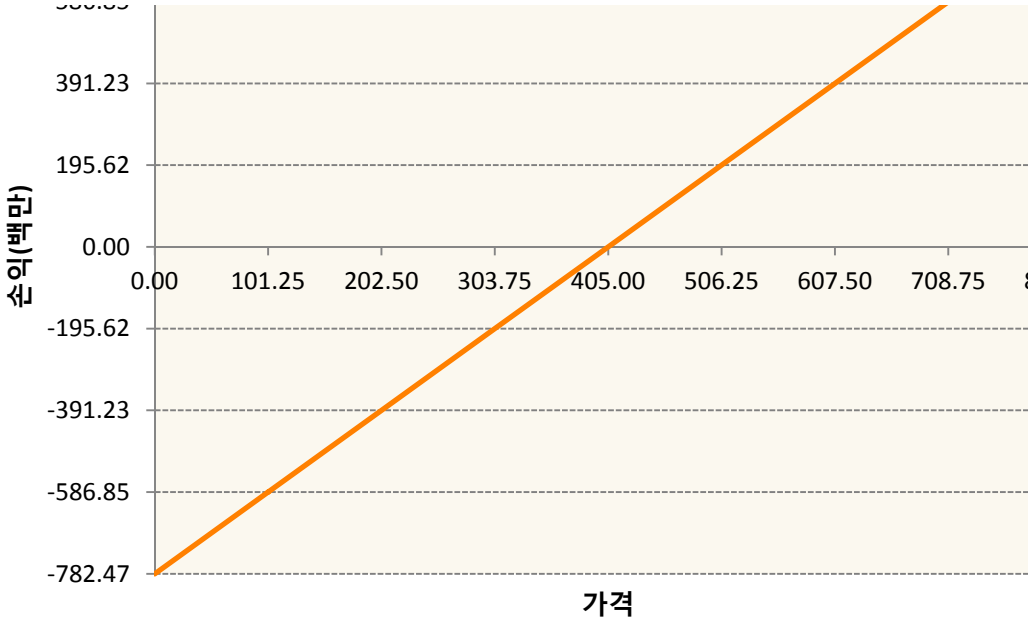

KWH7-KC HRW WHEAT FUT MAR17
218.21
163.65
109.10
54.55
0.00
-54.55
-109.10
-163.65
-218.21
0.00
103.50
207.00
310.50
414.00
517.50
621.00
724.50
손익(백만)
가격


SBH7-Sugar #11 (WORLD) MAR17
1,199.10
899.32
599.55
299.77
0.00
-299.77
-599.55
-899.32
-1,199.10
0.00
4.56
9.12
13.67
18.23
22.79
27.35
31.90
손익(백만)
가격


SH7-SOYBEAN FUTURE MAR17
1,931.01
1,448.26
965.51
482.75
0.00
-482.75
-965.51
-1,448.26
-1,931.01
0.00
258.00
516.00
774.00
1,032.00
1,290.00
1,548.00
1,806.00
손익(백만)
가격


SMH7-SOYBEAN MEAL FUTR MAR17
887.97
665.98
443.99
221.99
0.00
-221.99
-443.99
-665.98
-887.97
0.00
79.10
158.20
237.30
316.40
395.50
474.60
553.70
손익(백만)
가격


WH7-WHEAT FUTURE(CBT) MAR17
586.85



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

BOH7	SOYBEAN OIL FUTR MAR17	77
CH7	CORN FUTURE MAR17	166
CTH7	COTTON NO.2 FUTR MAR17	33
KCH7	COFFEE "C" FUTURE MAR17	56
KWH7	KC HRW WHEAT FUT MAR17	17
SBH7	Sugar #11 (WORLD) MAR17	96
SH7	SOYBEAN FUTURE MAR17	154
SMH7	SOYBEAN MEAL FUTR MAR17	71
WH7	WHEAT FUTURE(CBT) MAR17	63

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

885