공시일	2016-12-23
기준일	2016-12-22

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	2016-12-23
기준일	2016-12-22

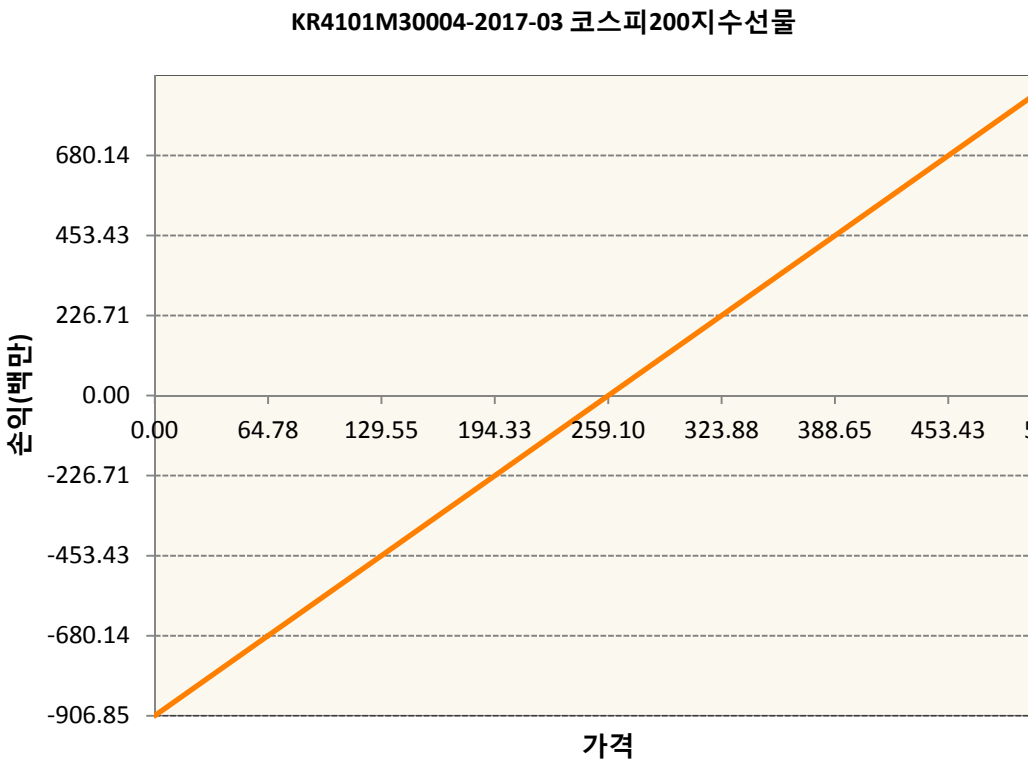
스마트인덱스모

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	907	0	907	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	2016-12-23
기준일	2016-12-22

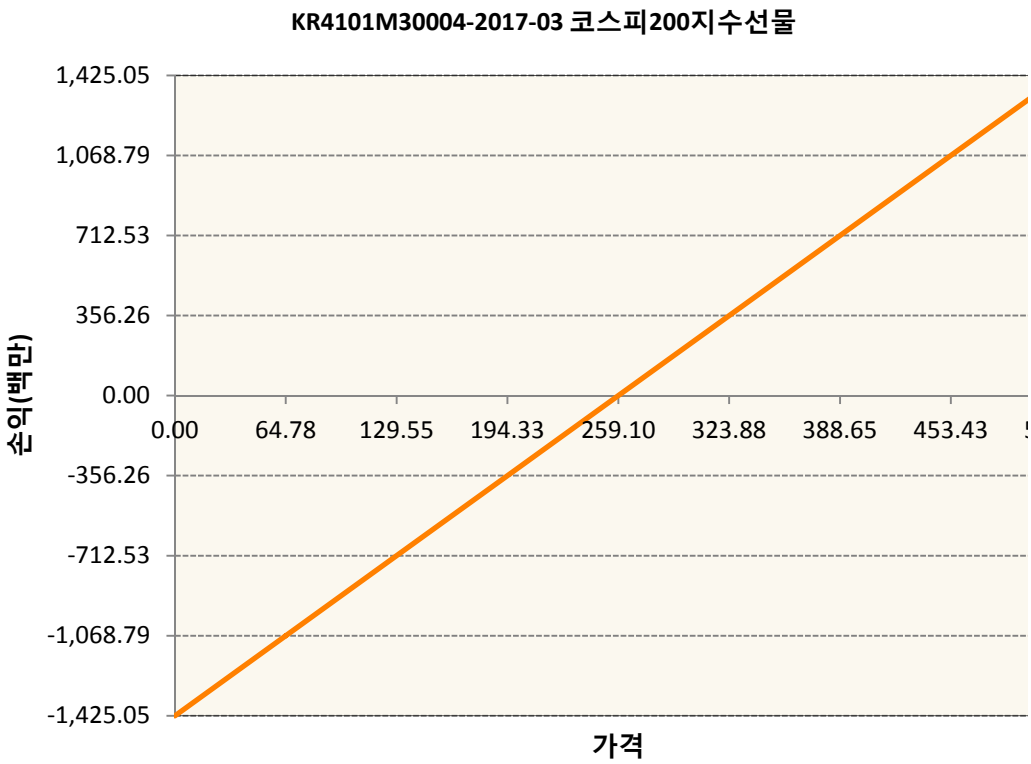
스마트레버리지목표전환형1호

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	1,425	0	1,425	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101M30(2017-03 코스피200지수선물							115
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-115	-115	-115	-115	-115	-115	-115
-5.33%	-77	-77	-77	-77	-77	-77	-77
-2.67%	-38	-38	-38	-38	-38	-38	-38
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	38	38	38	38	38	38	38
5.33%	77	77	77	77	77	77	77
8.00%	115	115	115	115	115	115	115

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

86

공시일	2016-12-23
기준일	2016-12-22

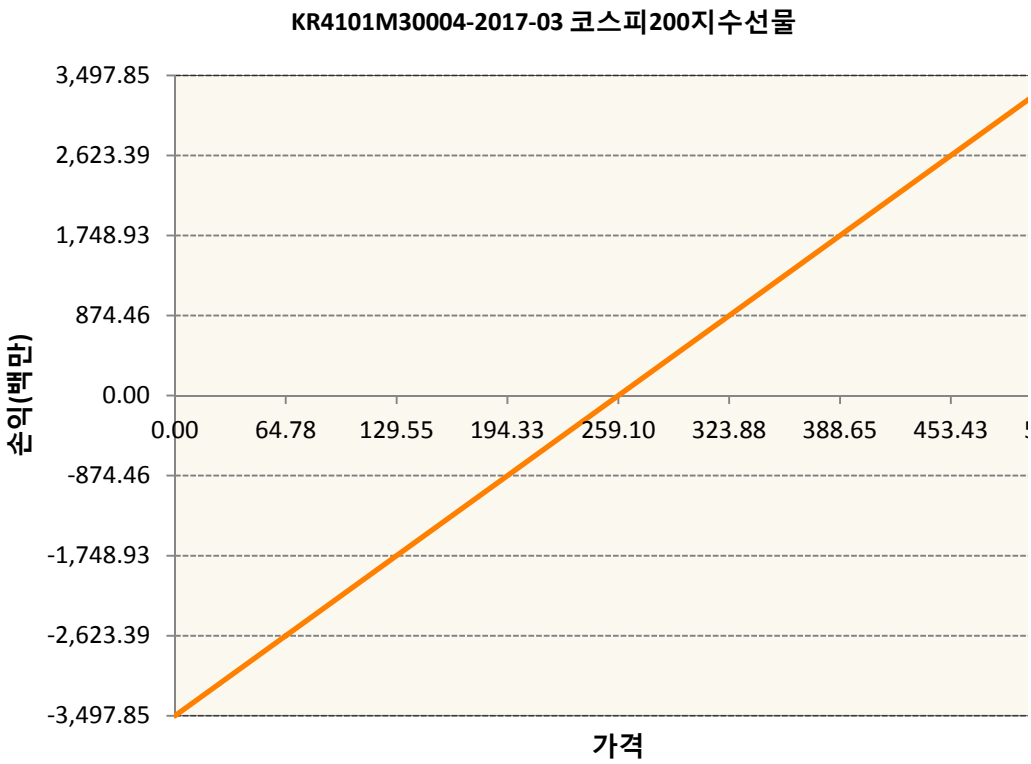
1.3배 레버리지 인덱스(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	130	-130	장내
누계	유가증권	선물	3,498	0	3,498	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101M30(2017-03 코스피200지수선물							283
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-283	-283	-283	-283	-283	-283	-283
-5.33%	-189	-189	-189	-189	-189	-189	-189
-2.67%	-94	-94	-94	-94	-94	-94	-94
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	94	94	94	94	94	94	94
5.33%	189	189	189	189	189	189	189
8.00%	283	283	283	283	283	283	283

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

212

공시일	2016-12-23
기준일	2016-12-22

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	908

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

719

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2016-12-23
기준일	2016-12-22

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	381

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

698

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2016-12-23
기준일	2016-12-22

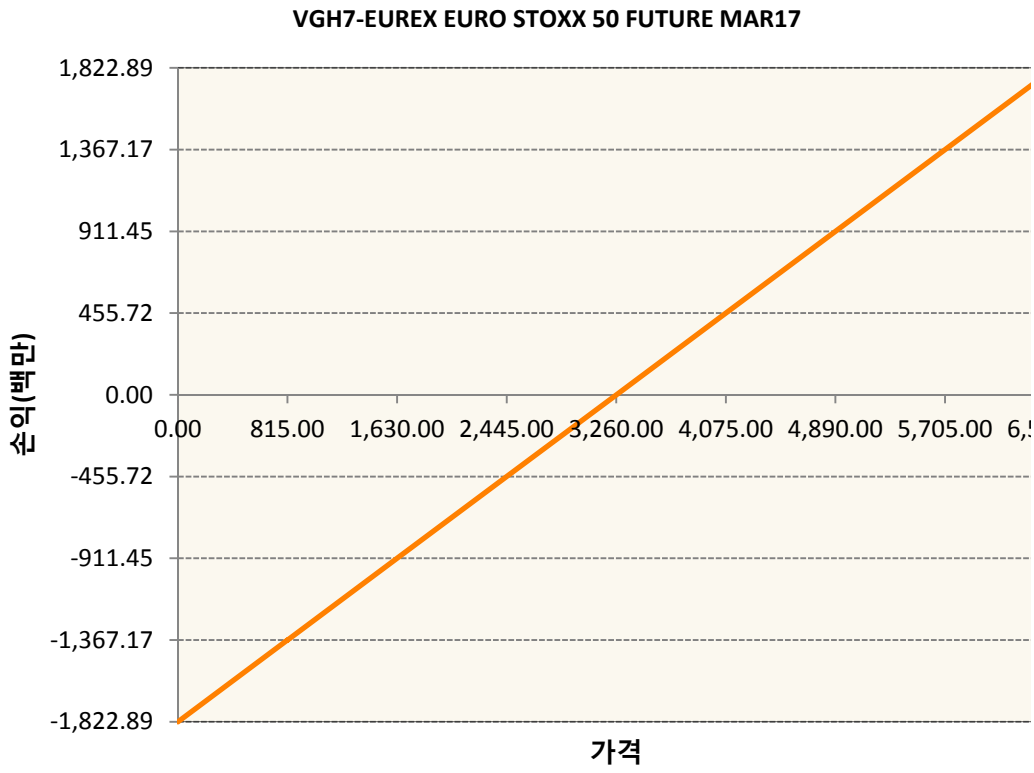
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,823	0	1,823	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGH7	EUREX EURO STOXX 50 FUTURE MAR17	146

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

(단위:백만원)

170

공시일	2016-12-23
기준일	2016-12-22

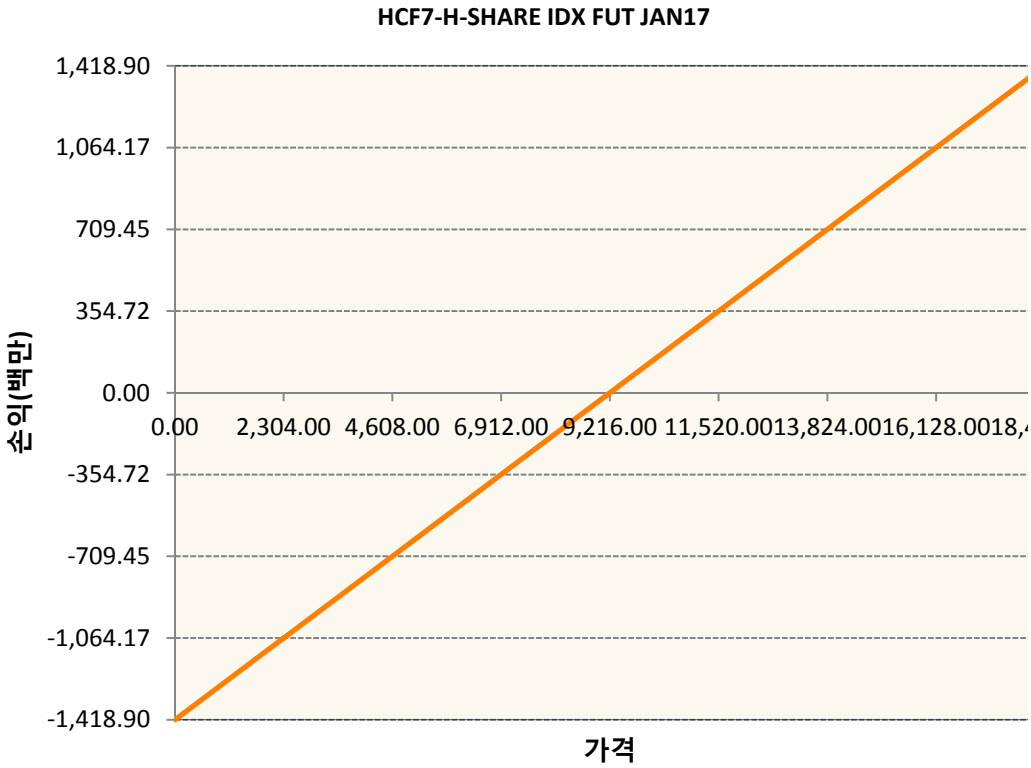
차이나인덱스모(주식-파생형)

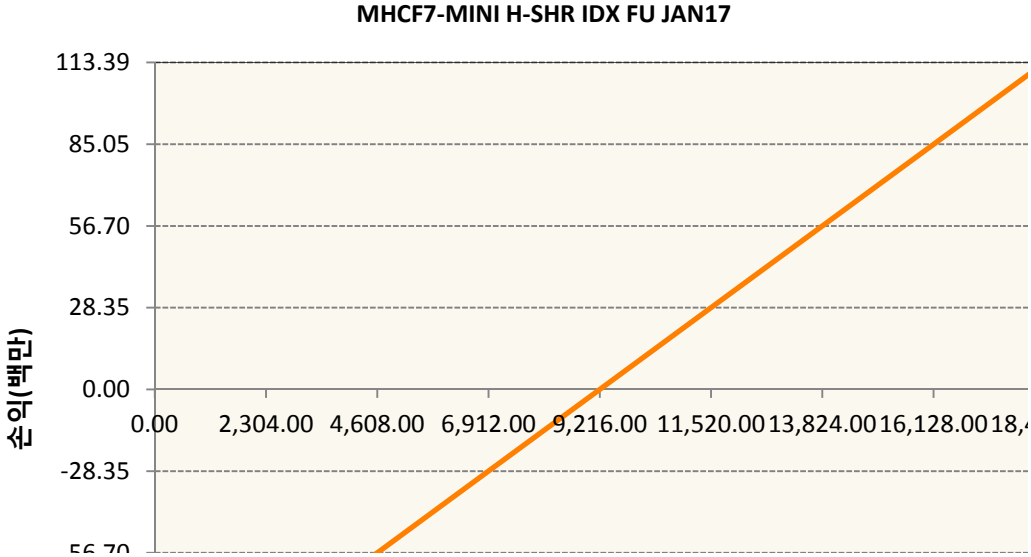
1. 계약금액

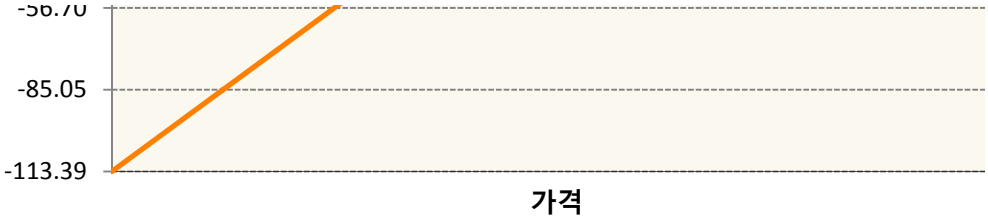
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,532	0	1,532	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCF7	H-SHARE IDX FUT JAN17	114
MHCF7	MINI H-SHR IDX FU JAN17	9

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	151

공시일	2016-12-23
기준일	2016-12-22

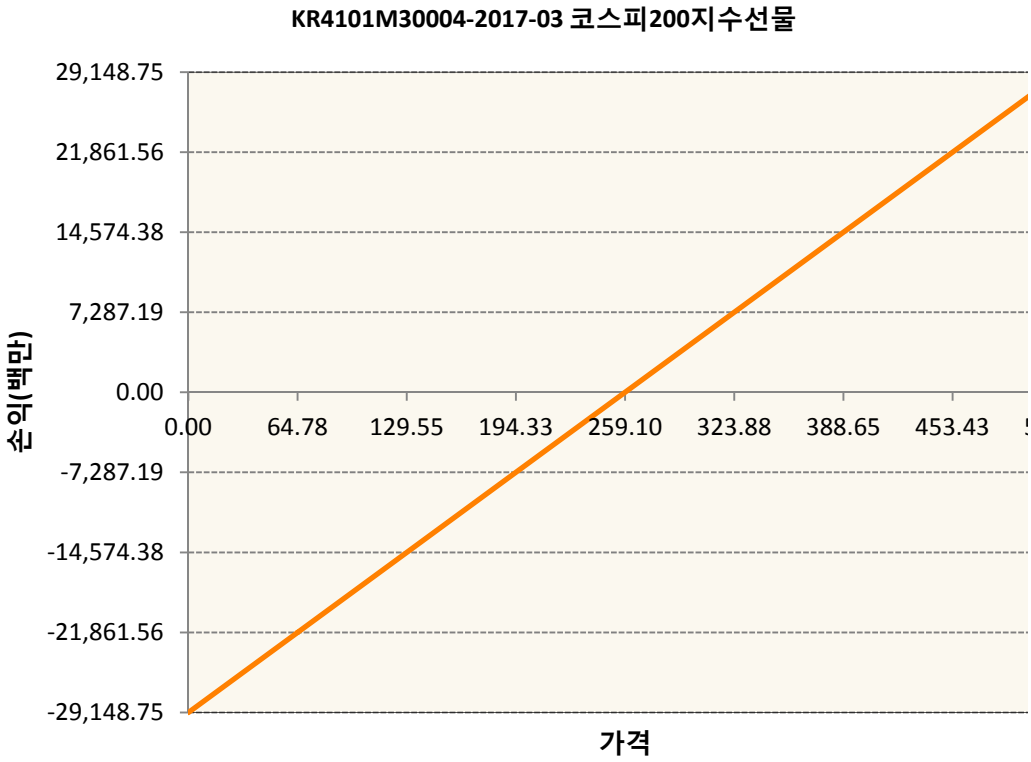
커버드콜(주식혼합-파생형)

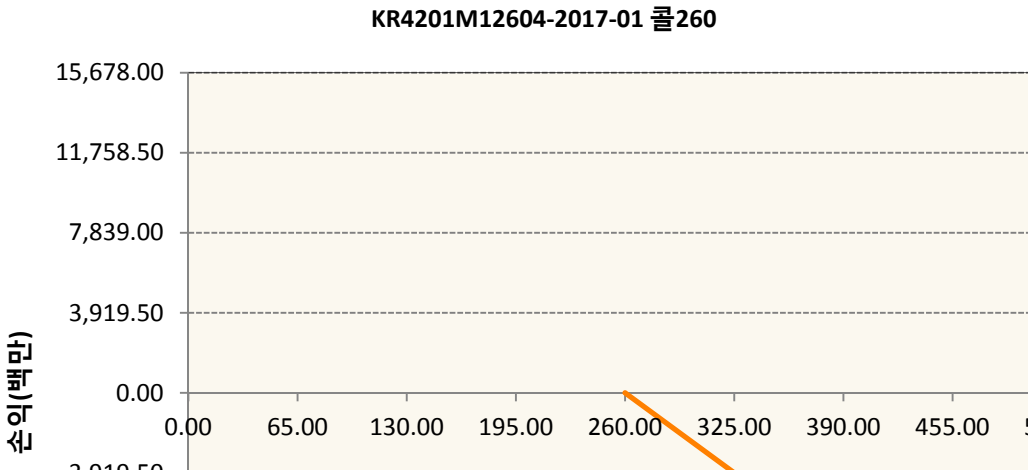
1. 계약금액

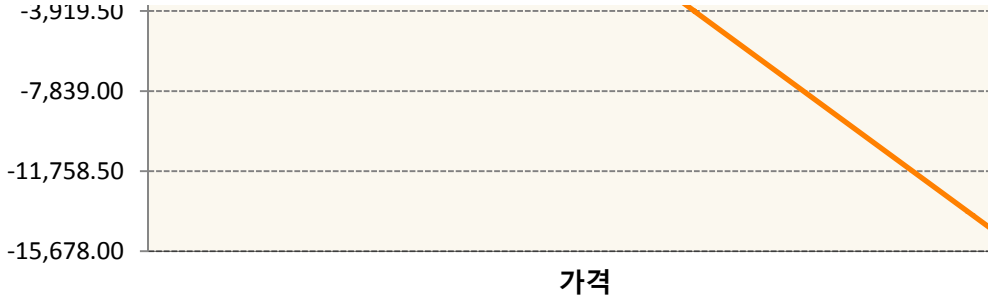
(단위:백만원)

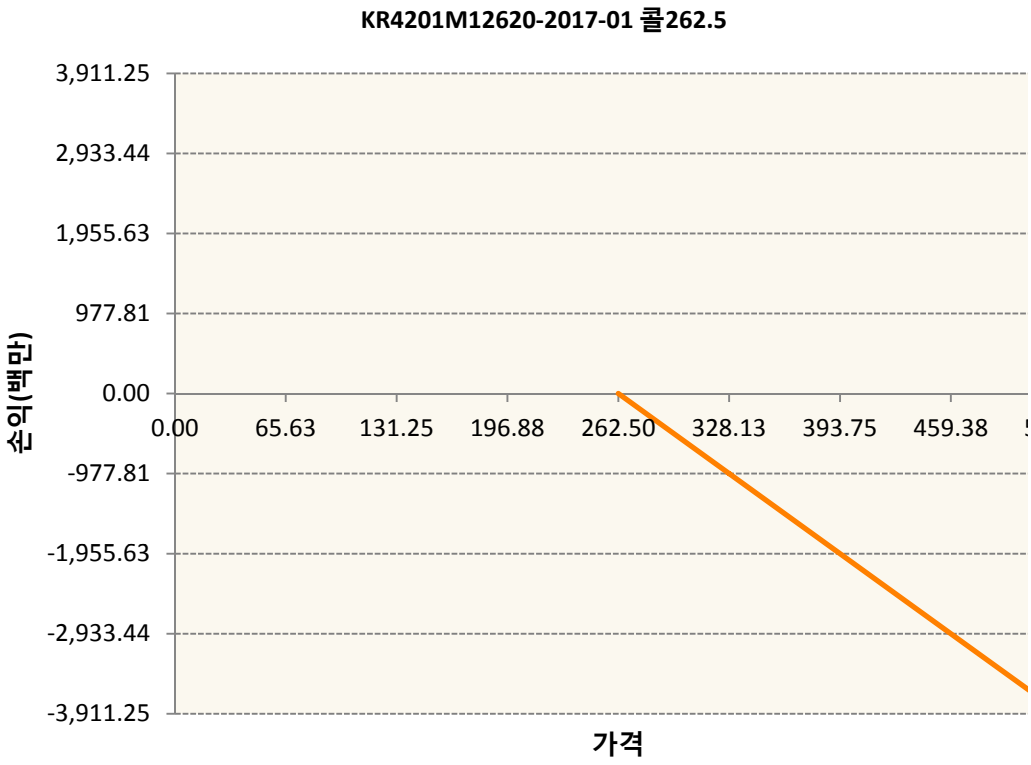
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	29,149	0	29,149	장내
누계	유가증권	옵션	0	19,589	-19,589	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101M30(2017-03 코스피200지수선물							2,358
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-2,358	-2,358	-2,358	-2,358	-2,358	-2,358	-2,358
-5.33%	-1,572	-1,572	-1,572	-1,572	-1,572	-1,572	-1,572
-2.67%	-786	-786	-786	-786	-786	-786	-786
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	786	786	786	786	786	786	786
5.33%	1,572	1,572	1,572	1,572	1,572	1,572	1,572
8.00%	2,358	2,358	2,358	2,358	2,358	2,358	2,358
KR4201M12(2017-01 콜260							5,781
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,127	1,127	1,127	1,126	1,125	1,123	1,120
-5.33%	1,124	1,120	1,113	1,103	1,090	1,074	1,054
-2.67%	1,010	969	924	877	827	775	722
0%	188	126	63	0	-64	-128	-192
2.67%	-1,592	-1,609	-1,630	-1,655	-1,685	-1,718	-1,755
5.33%	-3,674	-3,675	-3,677	-3,680	-3,686	-3,694	-3,704
8.00%	-5,778	-5,778	-5,778	-5,778	-5,779	-5,780	-5,781
KR4201M12(	2017-01 콜262.5						1,344

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	178	178	178	178	178	178	178
-5.33%	178	178	177	176	175	173	170
-2.67%	168	163	156	148	139	129	119
0%	49	33	16	0	-16	-33	-49
2.67%	-320	-328	-337	-347	-358	-370	-382
5.33%	-822	-823	-824	-827	-829	-833	-838
8.00%	-1,342	-1,342	-1,342	-1,342	-1,342	-1,343	-1,344

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

10,599

공시일	2016-12-23
기준일	2016-12-22

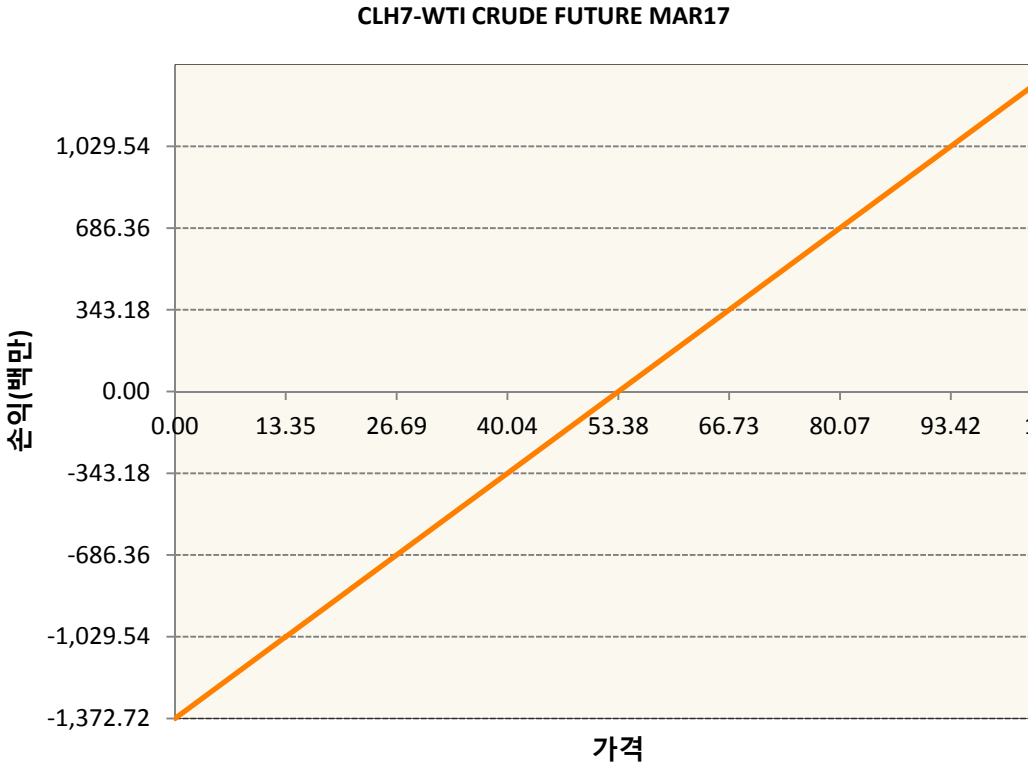
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

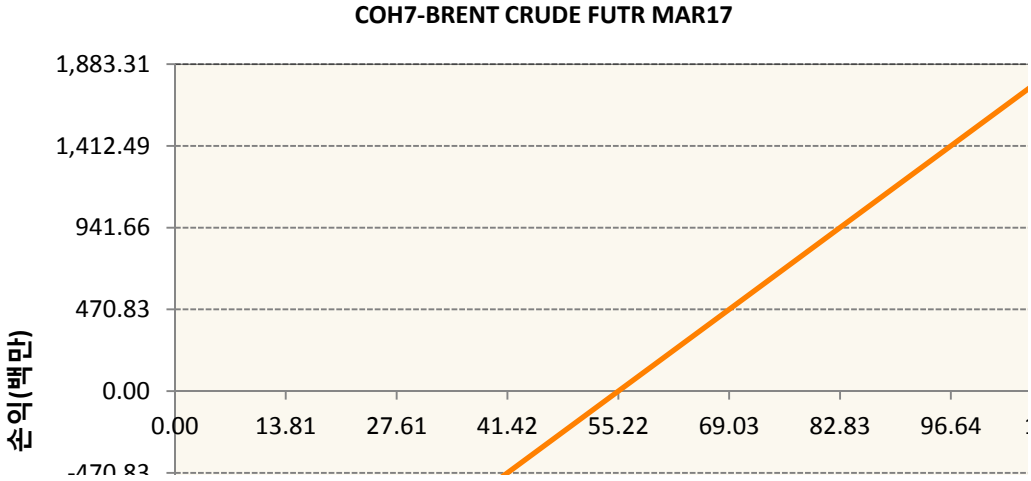
1. 계약금액

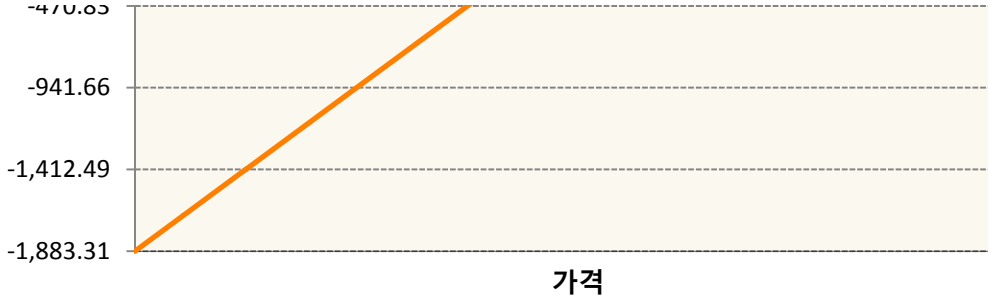
(단위:백만원)

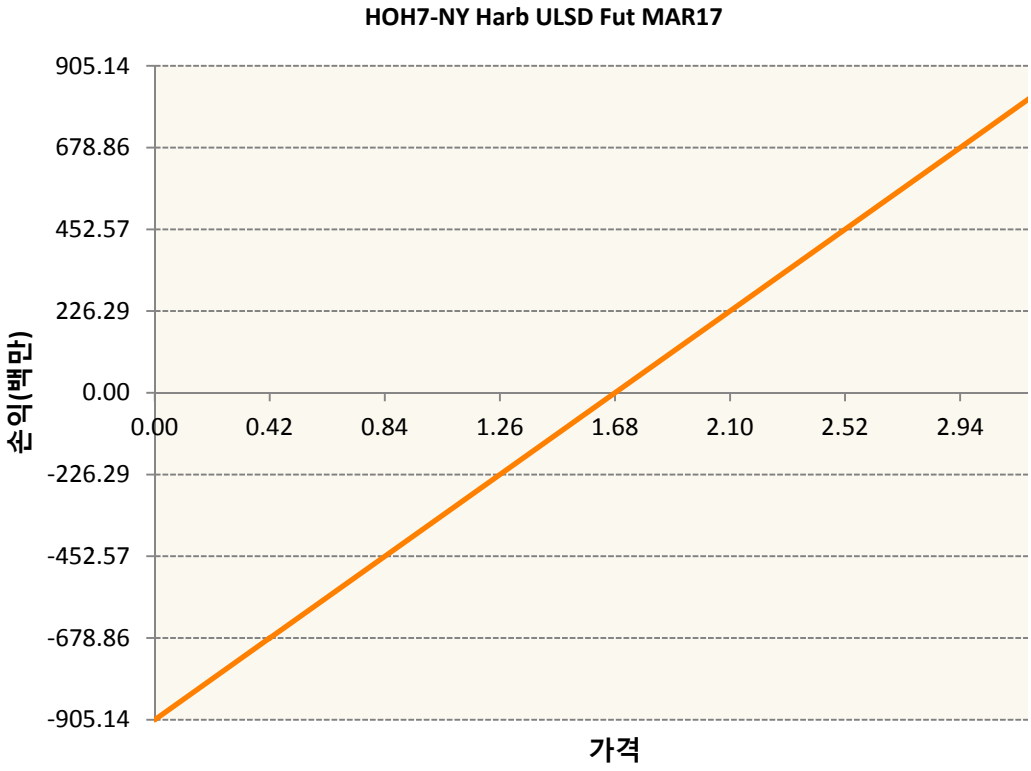
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	선물	유가증권	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	선물	유가증권	1,373	0	1,373	
누계	유가증권	선물	5,409	0	5,409	

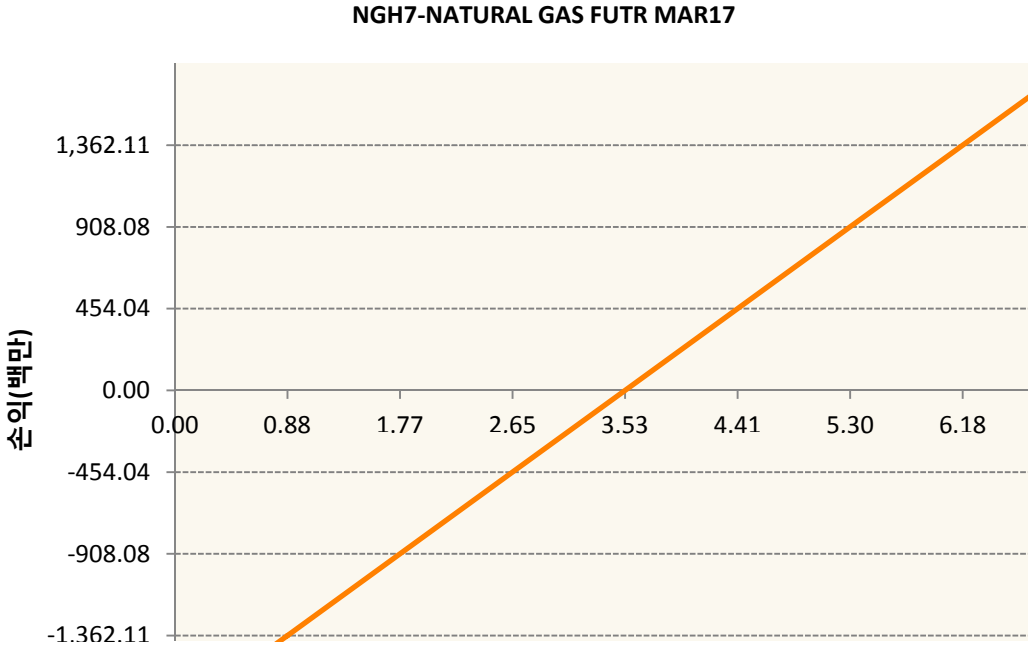
2. 만기시점의 손익구조

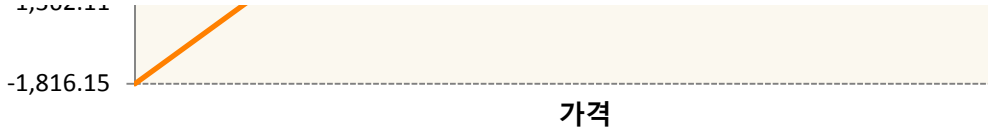


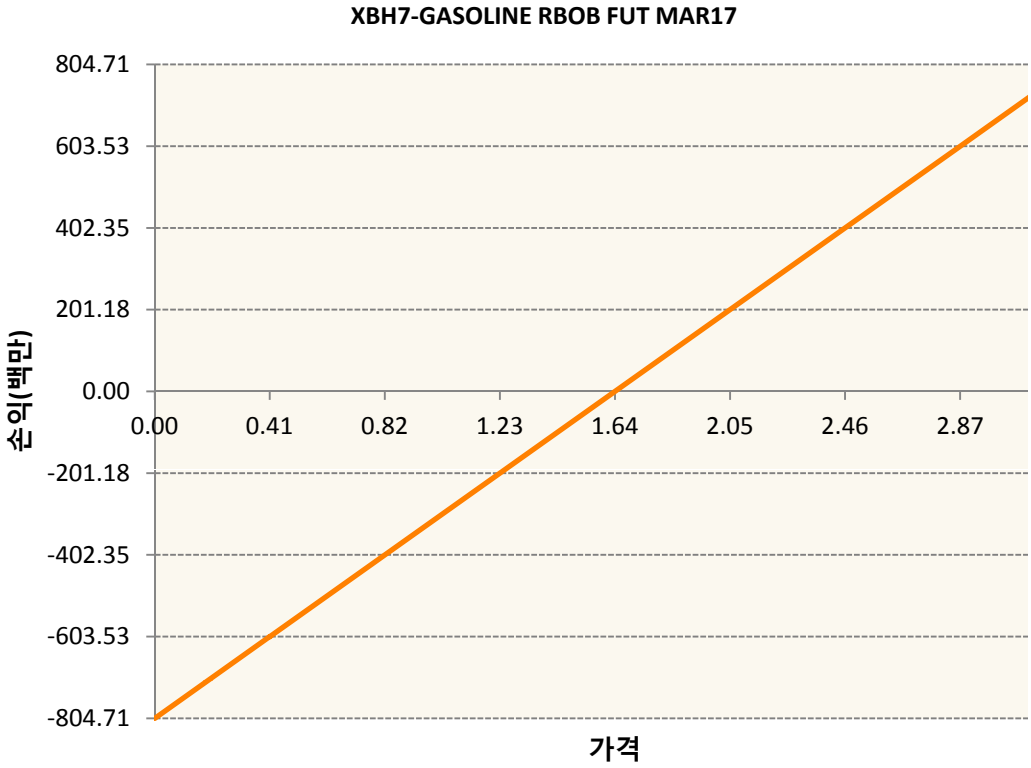



-941.66
-1,412.49
-1,883.31
가격


HOH7-NY Harb ULSD Fut MAR17
905.14
678.86
452.57
226.29
0.00
-226.29
-452.57
-678.86
-905.14
0.00
0.42
0.84
1.26
1.68
2.10
2.52
2.94
손익(백만)
가격


NGH7-NATURAL GAS FUTR MAR17
1,362.11
908.08
454.04
0.00
-454.04
-908.08
-1,362.11
0.00
0.88
1.77
2.65
3.53
4.41
5.30
6.18
손익(백만)





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLH7	WTI CRUDE FUTURE MAR17	110
COH7	BRENT CRUDE FUTR MAR17	151
HOH7	NY Harb ULSD Fut MAR17	72
NGH7	NATURAL GAS FUTR MAR17	145
XBH7	GASOLINE RBOB FUT MAR17	64

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

1,235

공시일	2016-12-23
기준일	2016-12-22

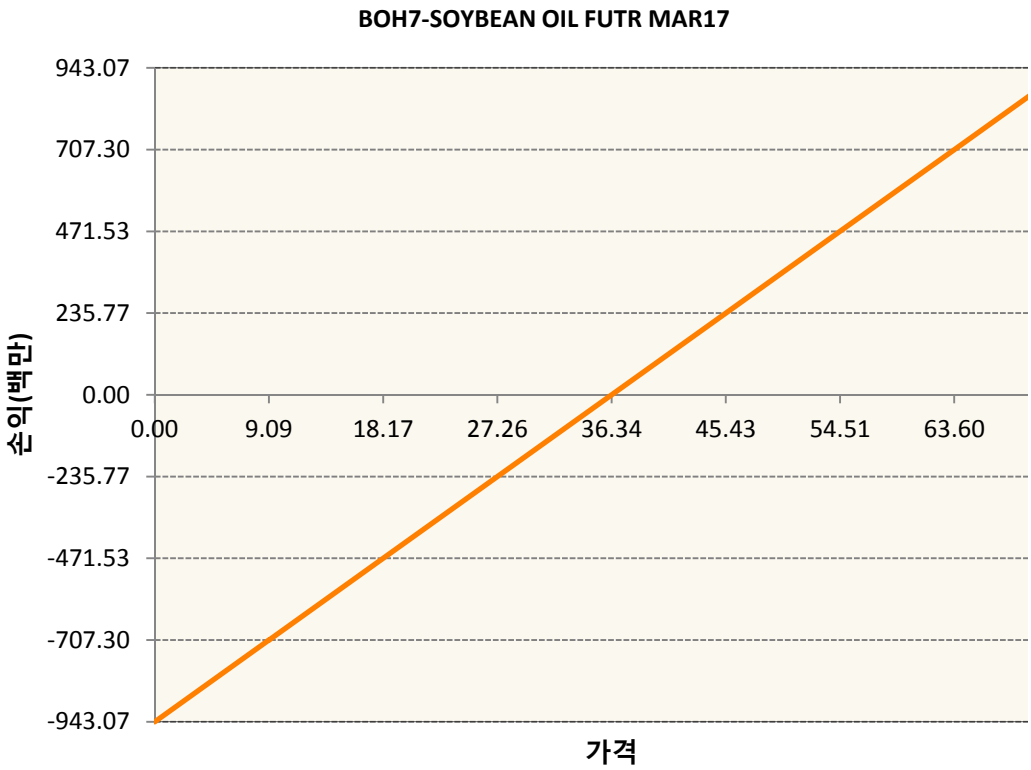
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

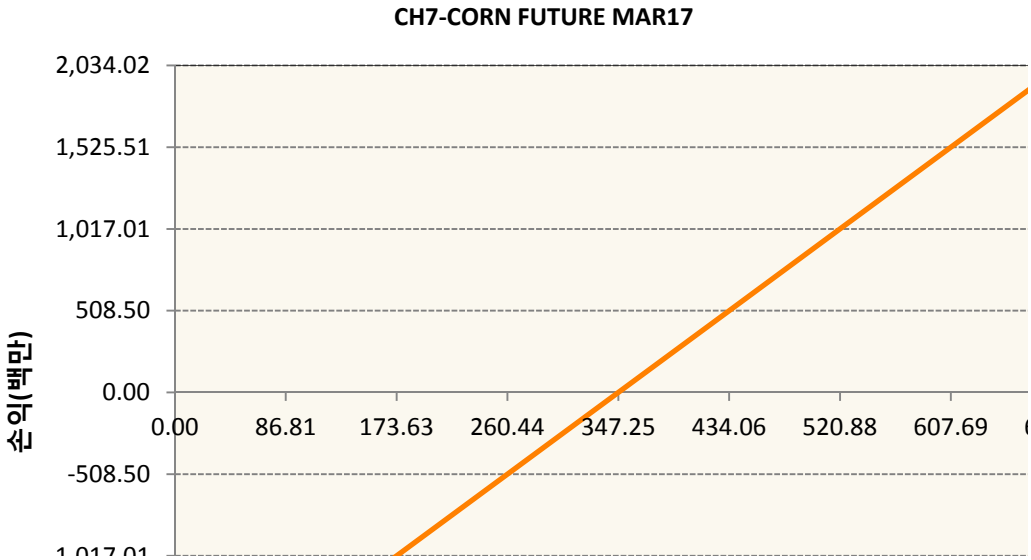
1. 계약금액

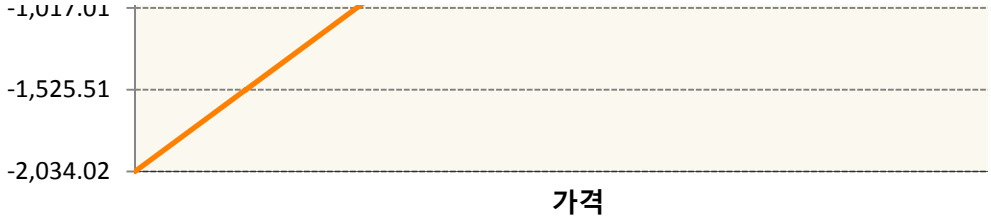
(단위:백만원)

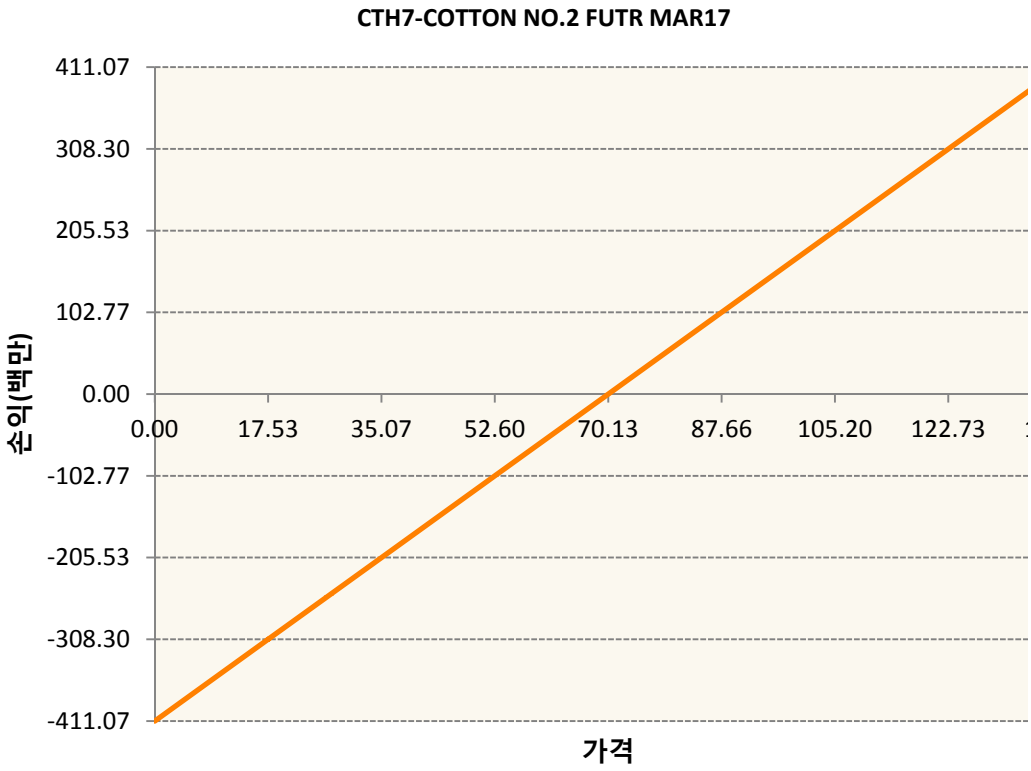
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	9,050	0	9,050	

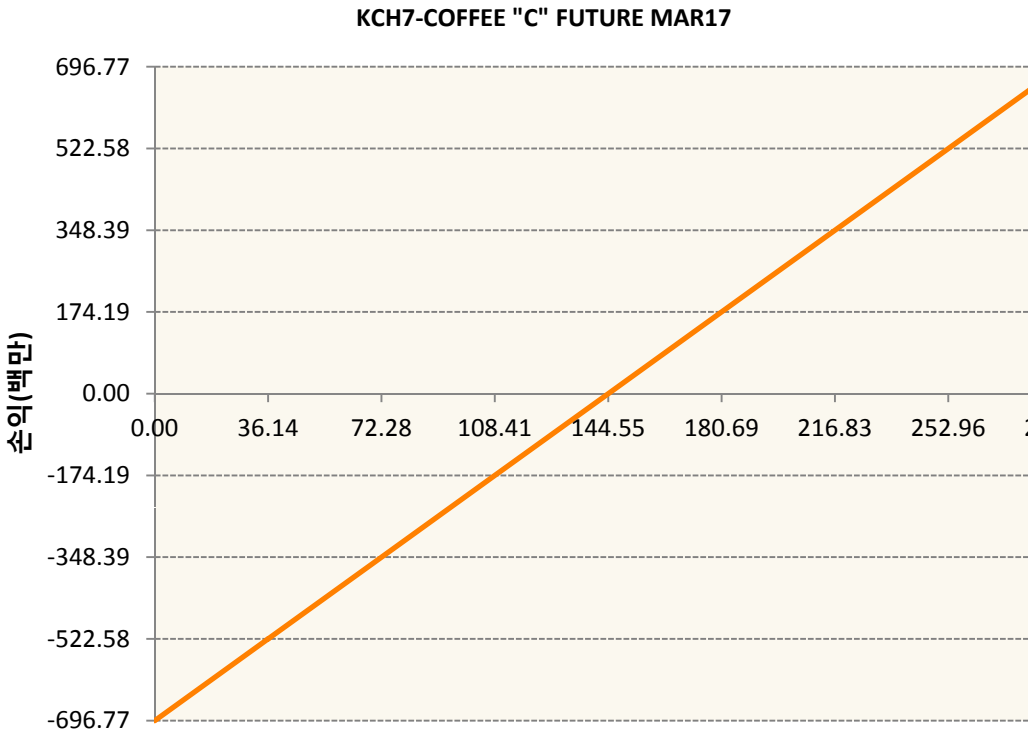
2. 만기시점의 손익구조





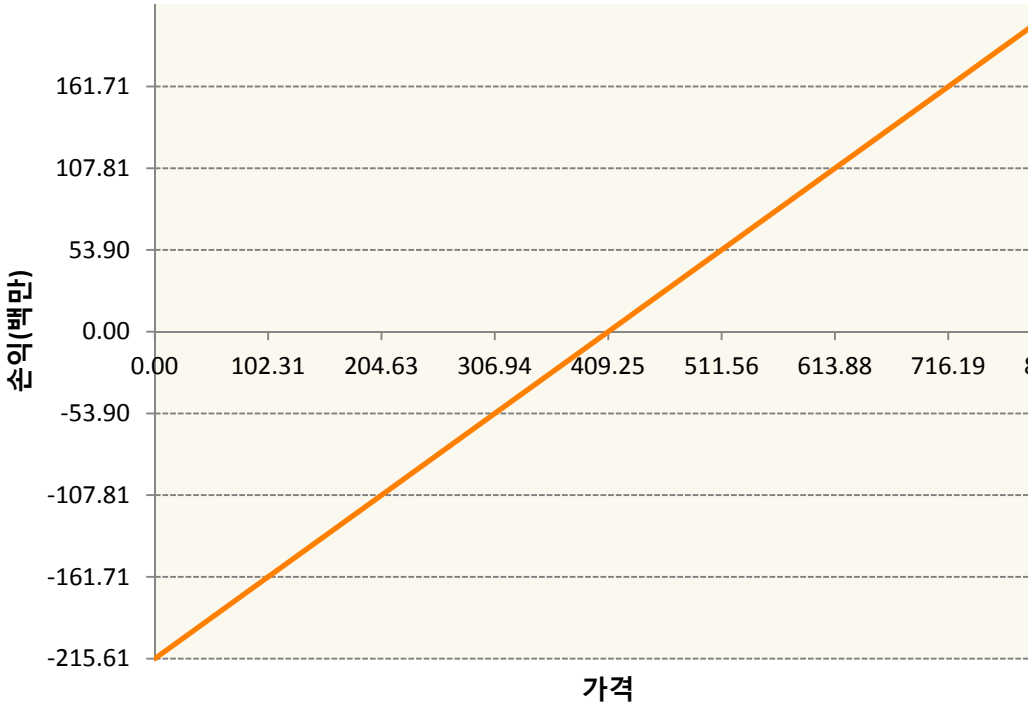

-1,525.51
-2,034.02
가격


CTH7-COTTON NO.2 FUTR MAR17
411.07
308.30
205.53
102.77
0.00
-102.77
-205.53
-308.30
-411.07
0.00
17.53
35.07
52.60
70.13
87.66
105.20
122.73
손익(백만)
가격

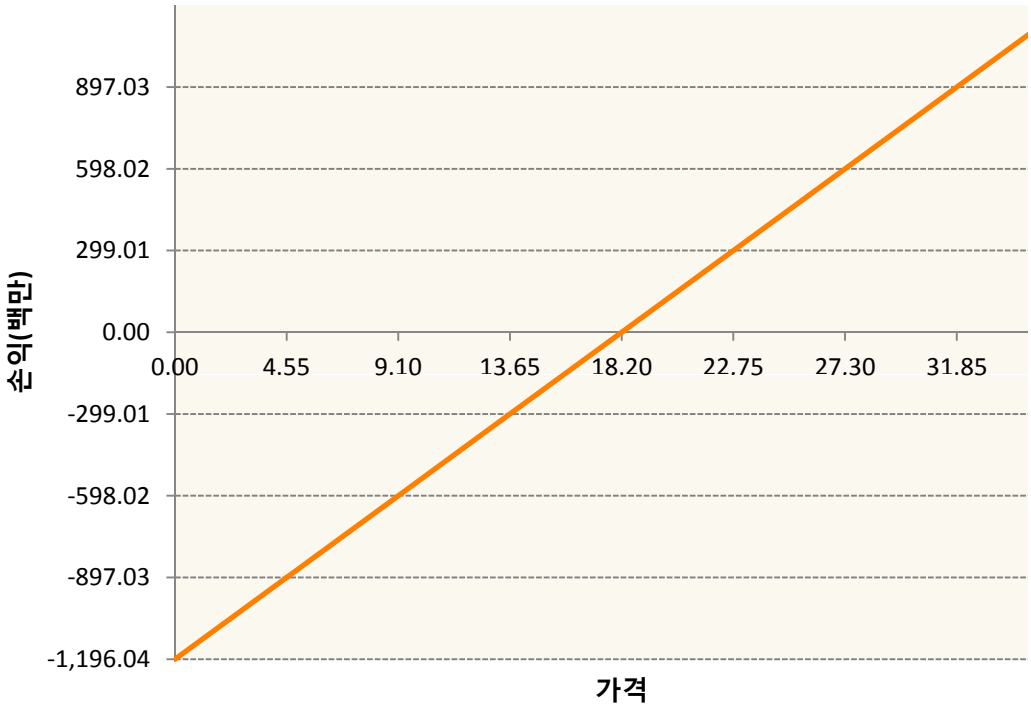

KCH7-COFFEE "C" FUTURE MAR17
696.77
522.58
348.39
174.19
0.00
-174.19
-348.39
-522.58
-696.77
0.00
36.14
72.28
108.41
144.55
180.69
216.83
252.96
손익(백만)

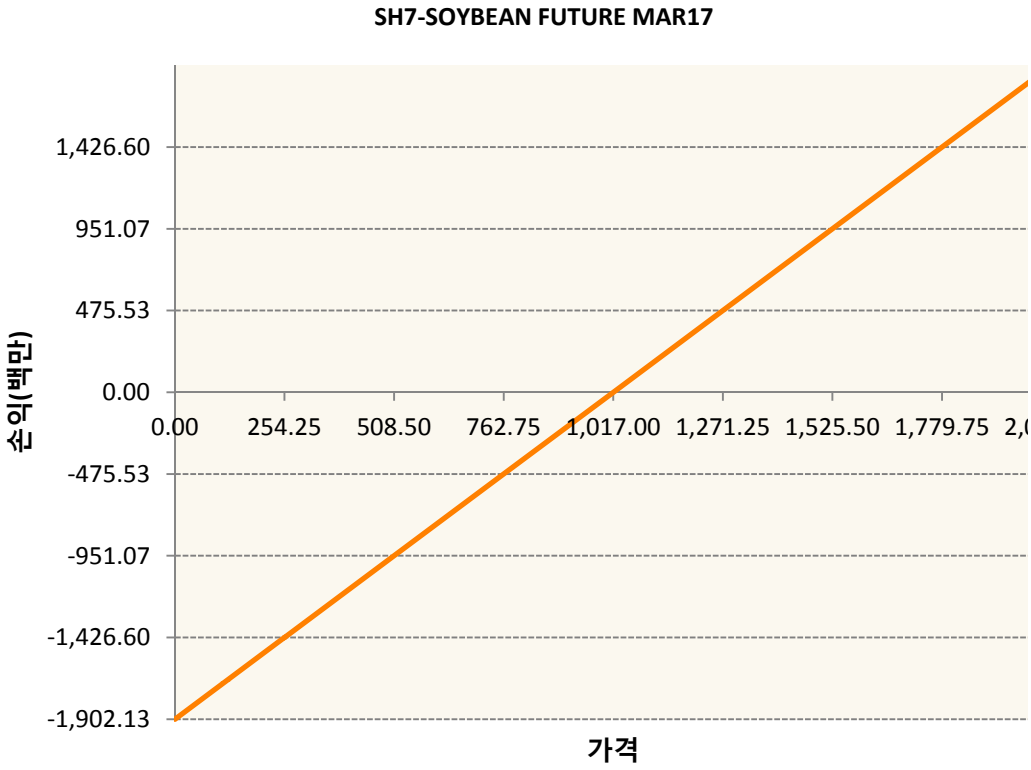
가격

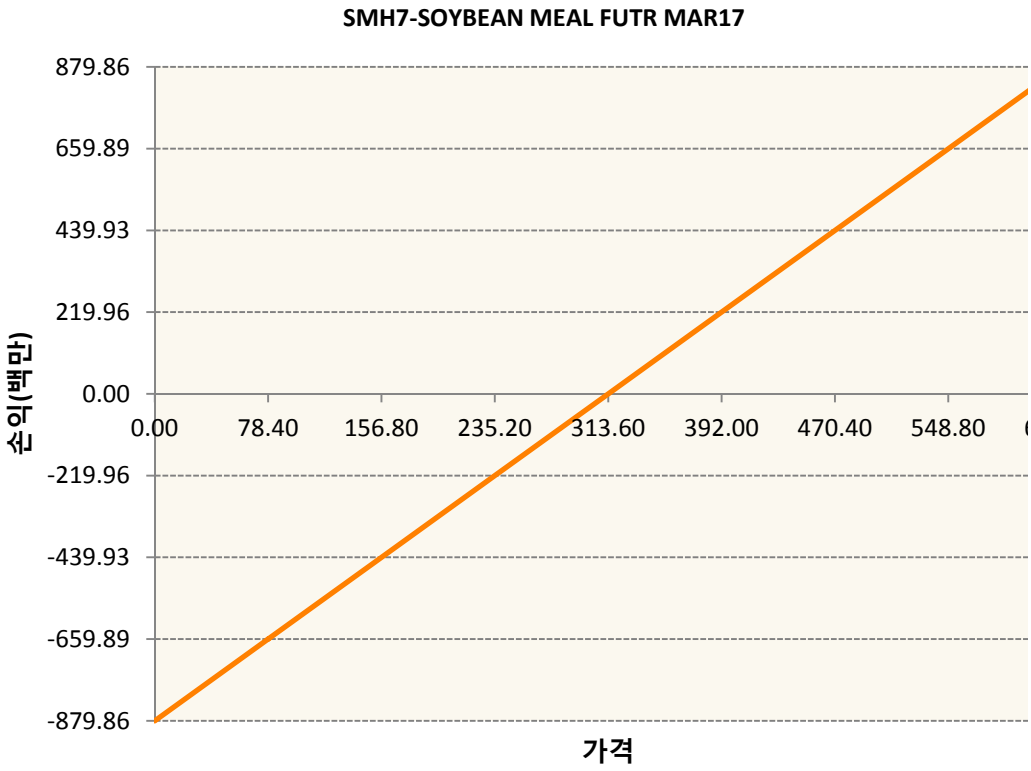
KWH7-KC HRW WHEAT FUT MAR17

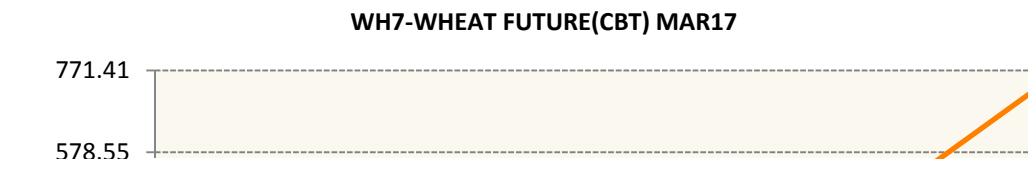


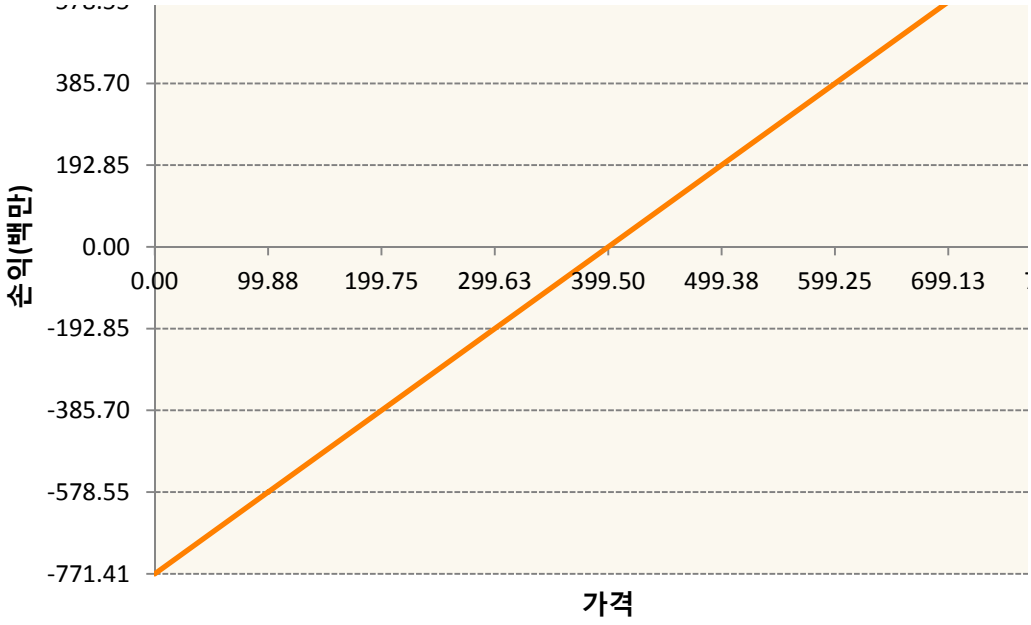
SBH7-Sugar #11 (WORLD) MAR17




SH7-SOYBEAN FUTURE MAR17
1,426.60
951.07
475.53
0.00
-475.53
-951.07
-1,426.60
-1,902.13
0.00
254.25
508.50
762.75
1,017.00
1,271.25
1,525.50
1,779.75
손익(백만)
가격


SMH7-SOYBEAN MEAL FUTR MAR17
879.86
659.89
439.93
219.96
0.00
-219.96
-439.93
-659.89
-879.86
0.00
78.40
156.80
235.20
313.60
392.00
470.40
548.80
손익(백만)
가격


WH7-WHEAT FUTURE(CBT) MAR17
771.41
578.55



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
BOH7	SOYBEAN OIL FUTR MAR17	75
CH7	CORN FUTURE MAR17	163
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	152
SMH7	SOYBEAN MEAL FUTR MAR17	70
WH7	WHEAT FUTURE(CBT) MAR17	62

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	875