공시일	2016-12-27
기준일	2016-12-26

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	2016-12-27
기준일	2016-12-26

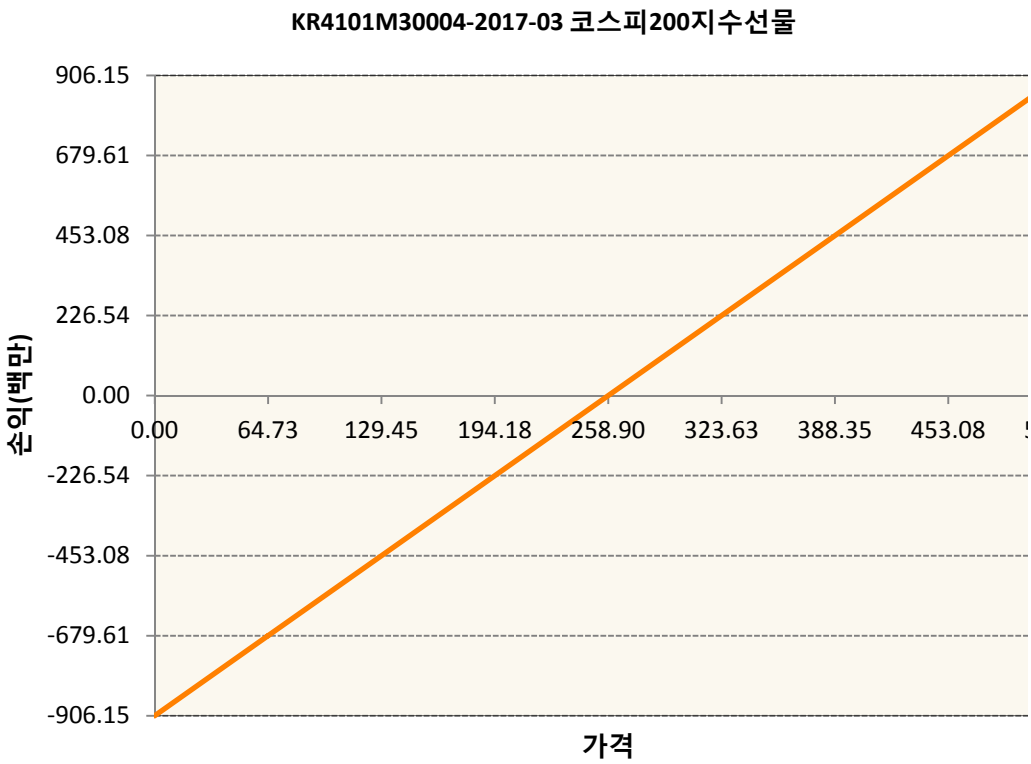
스마트인덱스모

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	906	0	906	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	2016-12-27
기준일	2016-12-26

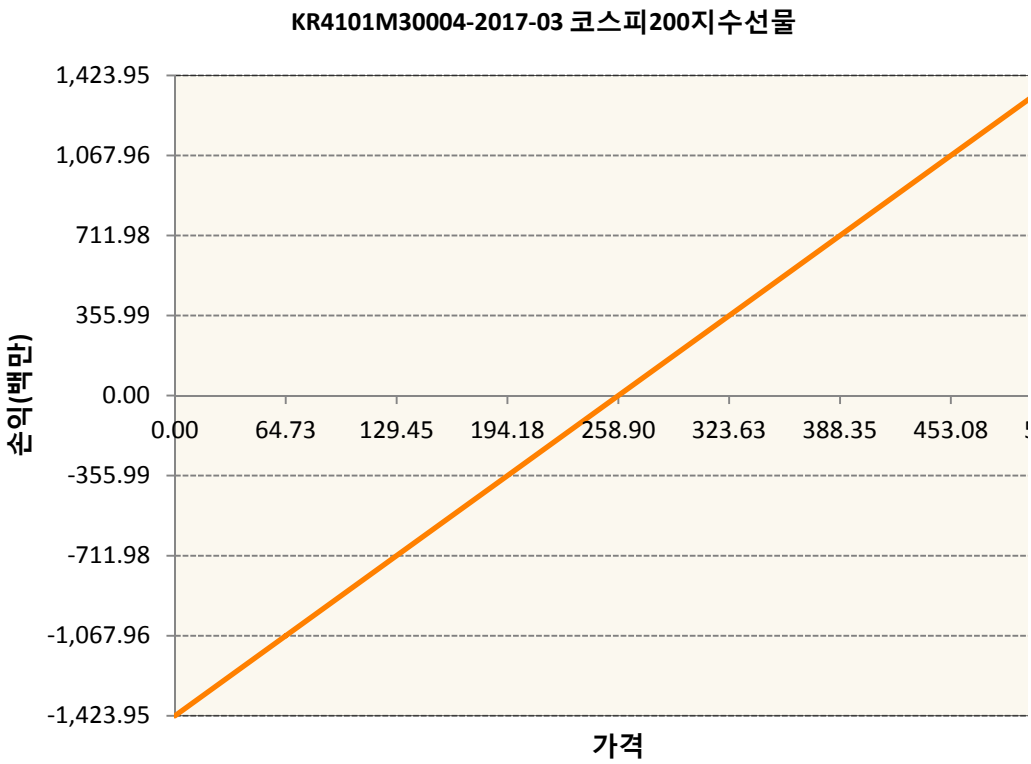
스마트레버리지목표전환형1호

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	1,424	0	1,424	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	2016-12-27
기준일	2016-12-26

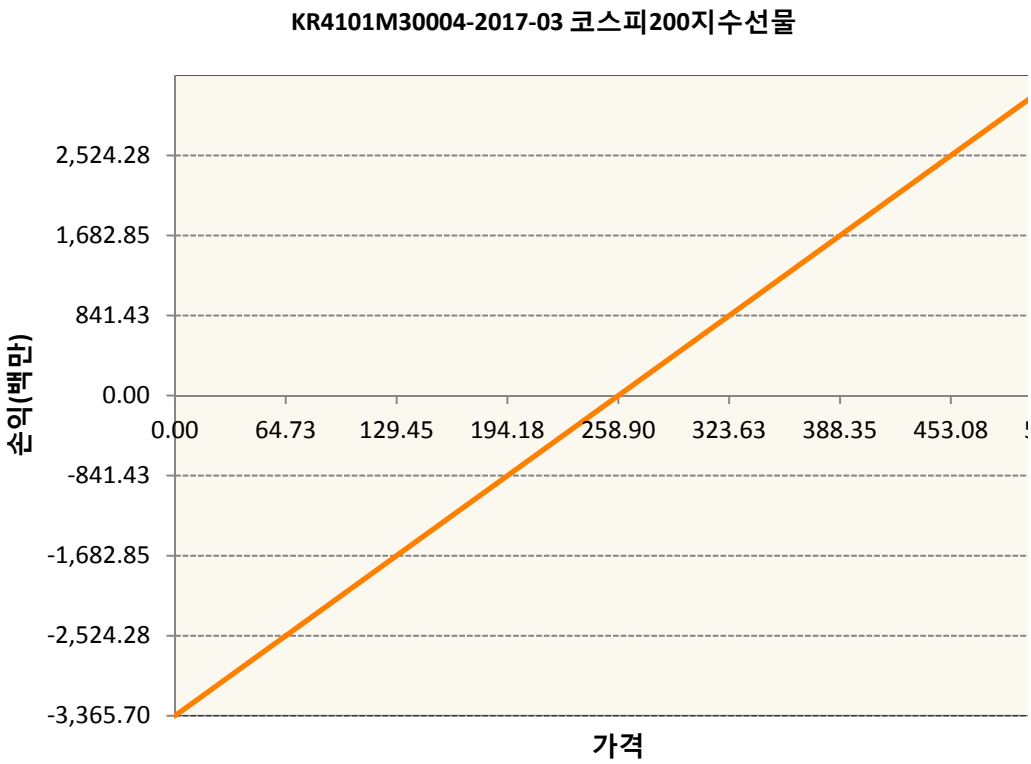
1.3배 레버리지 인덱스(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	129	-129	장내
누계	유가증권	선물	3,366	0	3,366	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101M30(2017-03 코스피200지수선물							272
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-272	-272	-272	-272	-272	-272	-272
-5.33%	-182	-182	-182	-182	-182	-182	-182
-2.67%	-91	-91	-91	-91	-91	-91	-91
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	91	91	91	91	91	91	91
5.33%	182	182	182	182	182	182	182
8.00%	272	272	272	272	272	272	272

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

204

공시일	2016-12-27
기준일	2016-12-26

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)

715

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2016-12-27
기준일	2016-12-26

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)

692

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2016-12-27
기준일	2016-12-26

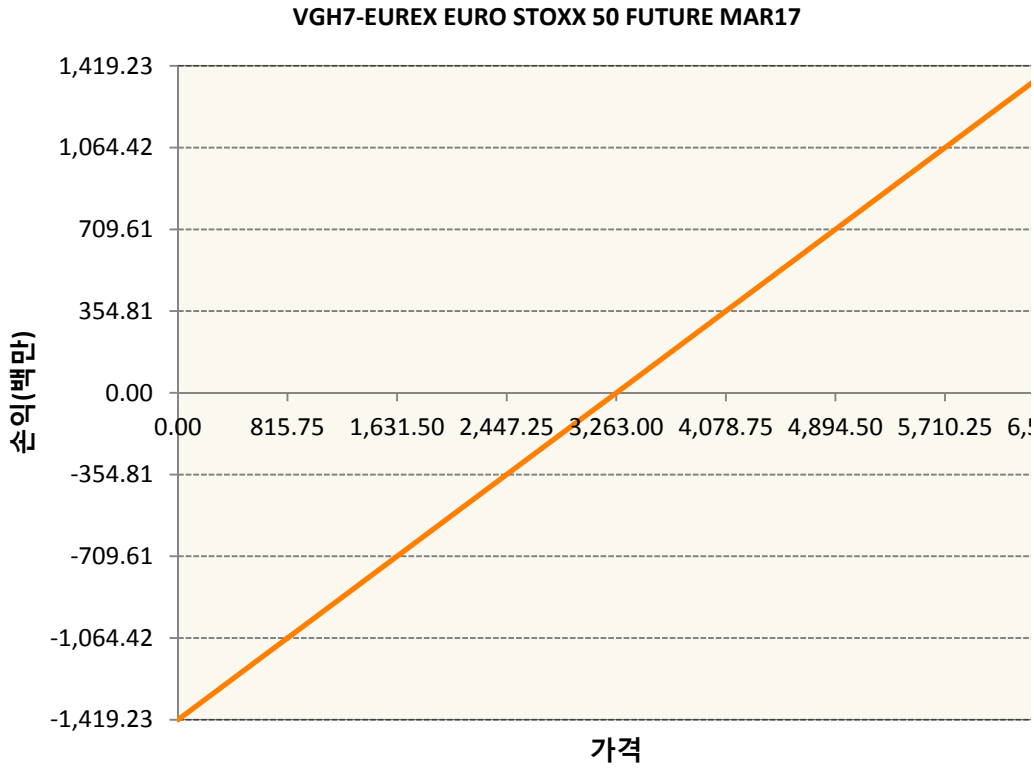
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,419	0	1,419	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGH7	EUREX EURO STOXX 50 FUTURE MAR17	114

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

(단위:백만원)

132

공시일	2016-12-27
기준일	2016-12-26

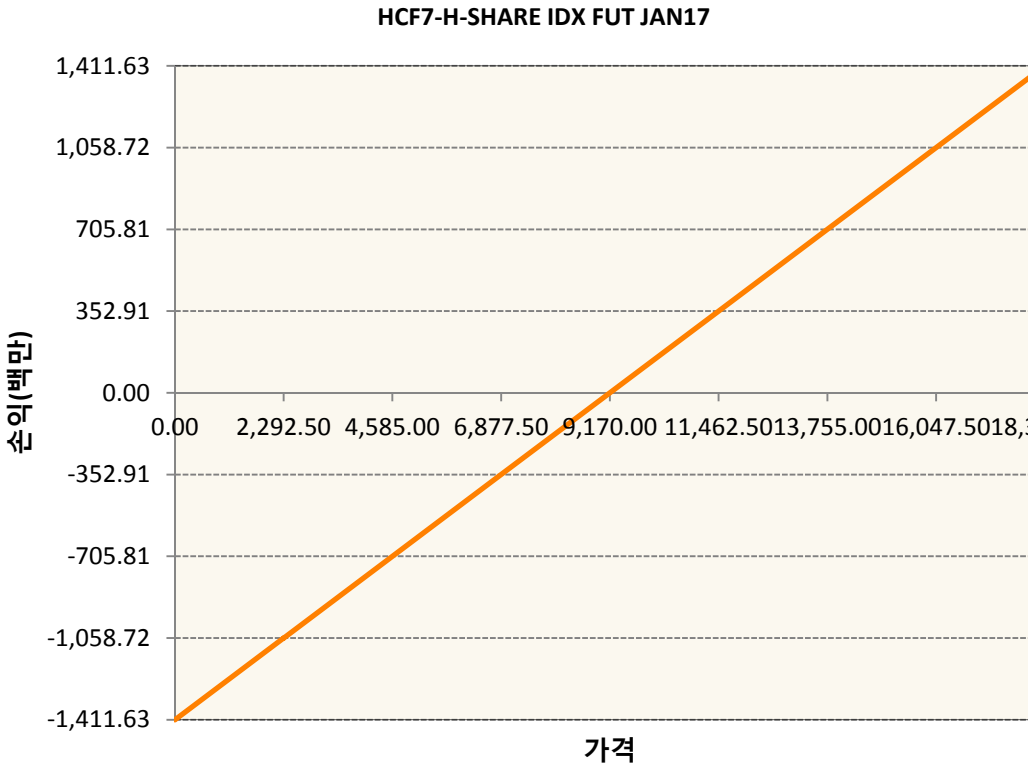
차이나인덱스모(주식-파생형)

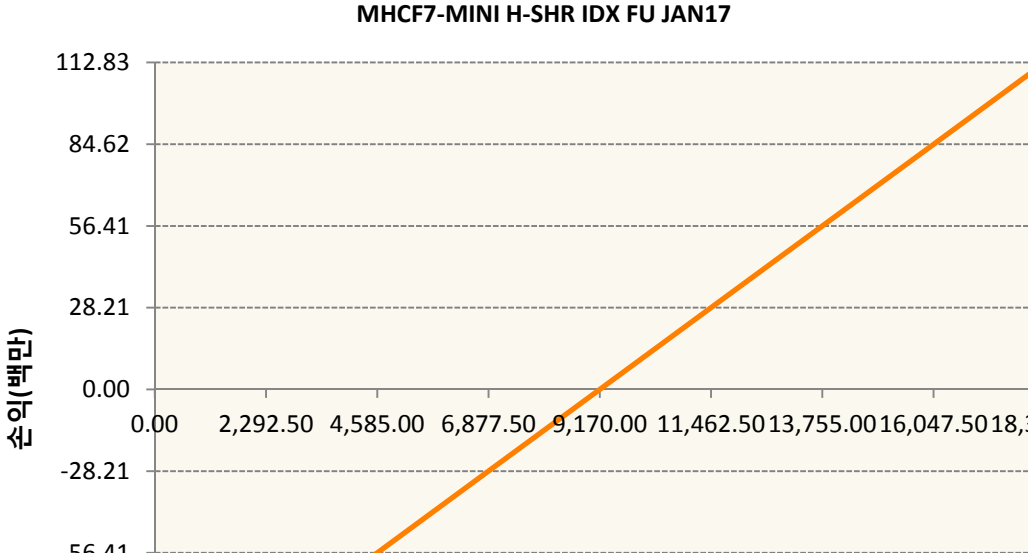
1. 계약금액

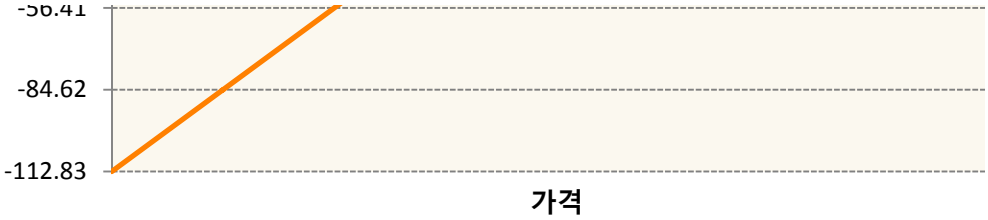
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,524	0	1,524	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

HCF7	H-SHARE IDX FUT JAN17	113
MHCF7	MINI H-SHR IDX FU JAN17	9

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

150

공시일	2016-12-27
기준일	2016-12-26

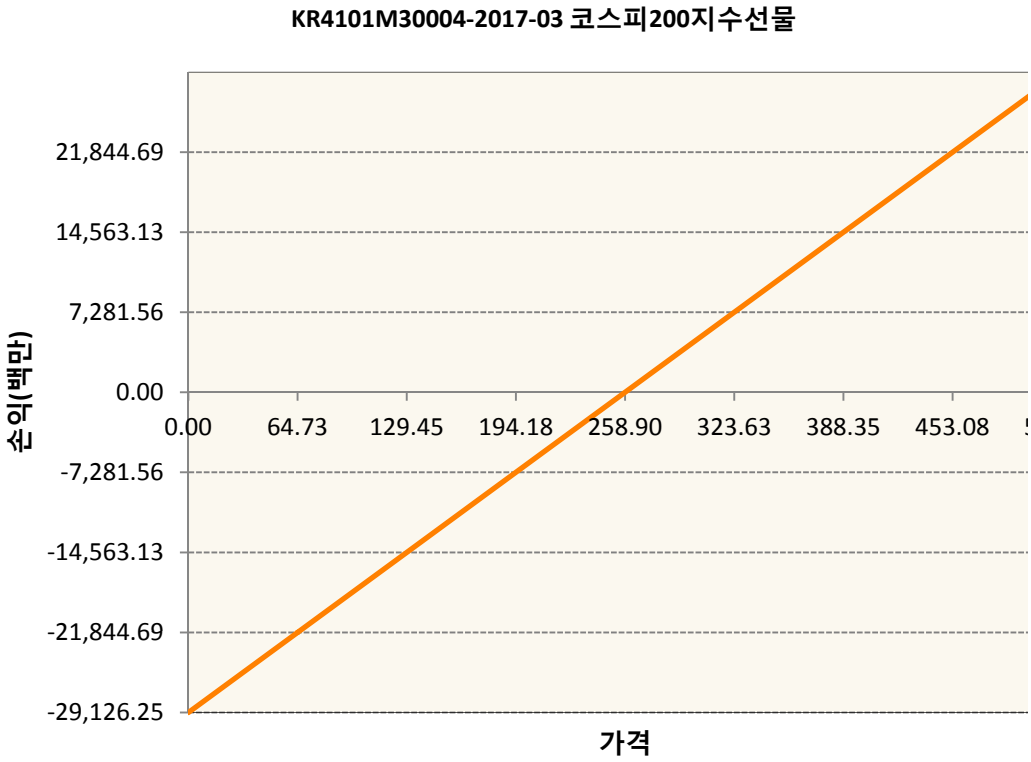
커버드콜(주식혼합-파생형)

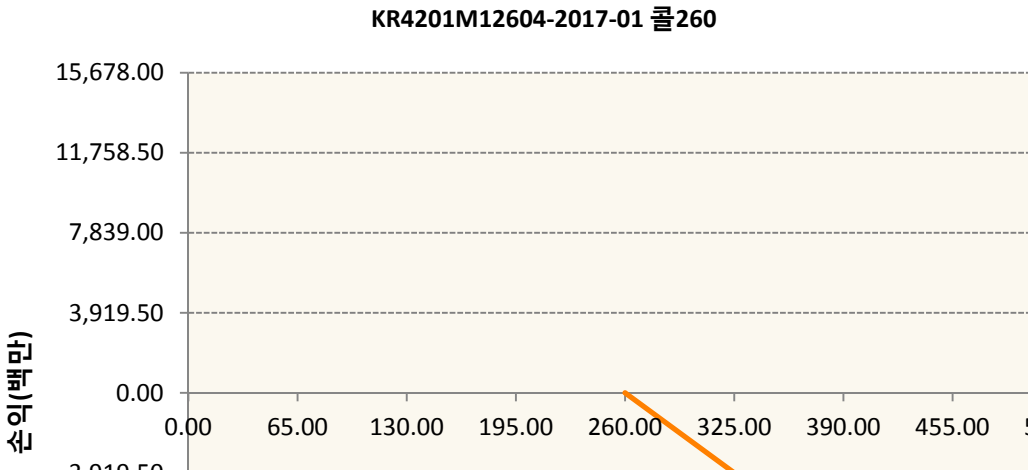
1. 계약금액

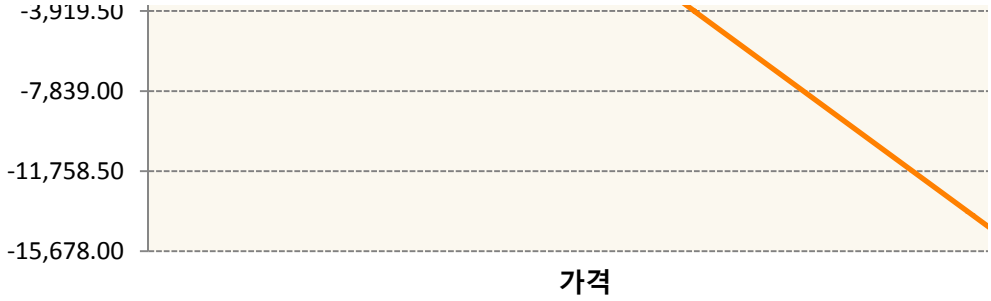
(단위:백만원)

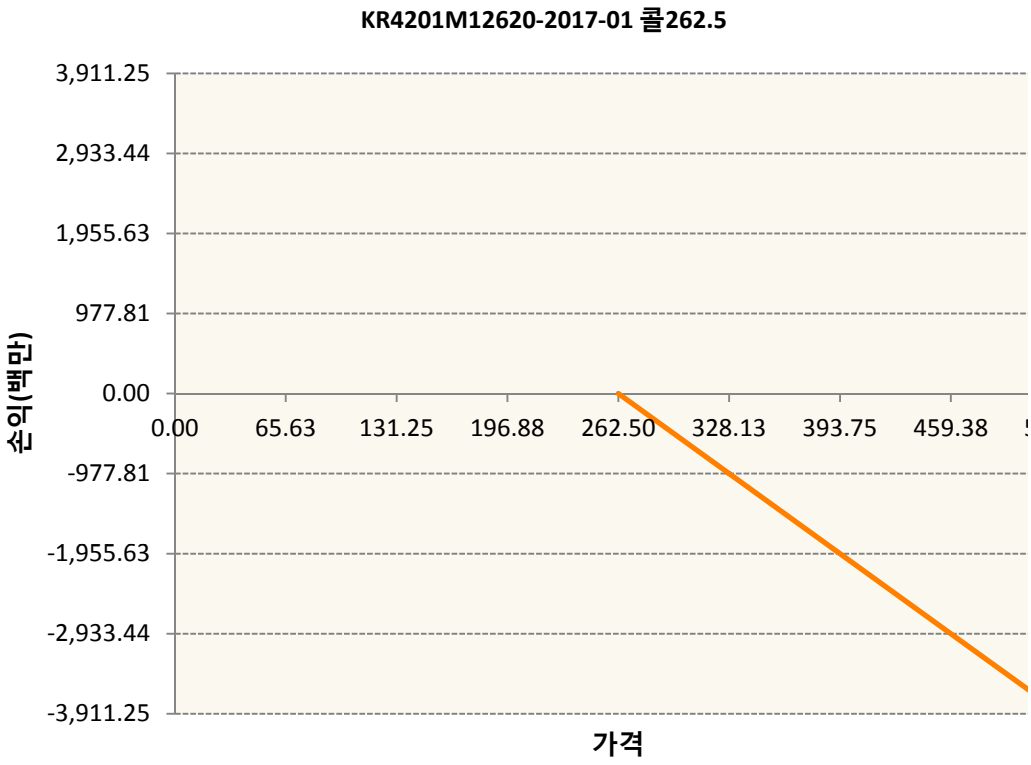
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	29,126	0	29,126	장내
누계	유가증권	옵션	0	19,589	-19,589	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101M30(2017-03 코스피200지수선물							2,357
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-2,357	-2,357	-2,357	-2,357	-2,357	-2,357	-2,357
-5.33%	-1,571	-1,571	-1,571	-1,571	-1,571	-1,571	-1,571
-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%	1,571	1,571	1,571	1,571	1,571	1,571	1,571
8.00%	2,357	2,357	2,357	2,357	2,357	2,357	2,357
KR4201M12(2017-01 콜260							5,829
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,057	1,057	1,057	1,057	1,056	1,055	1,054
-5.33%	1,056	1,053	1,049	1,043	1,034	1,022	1,007
-2.67%	968	933	895	854	810	765	717
0%	173	116	58	0	-59	-118	-177
2.67%	-1,634	-1,647	-1,663	-1,683	-1,707	-1,735	-1,766
5.33%	-3,724	-3,724	-3,725	-3,727	-3,730	-3,735	-3,743
8.00%	-5,828	-5,828	-5,828	-5,828	-5,828	-5,828	-5,829
	KR4201M12(	2017-01 콜262.5					1,355

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	161	161	161	161	161	161	161
-5.33%	161	161	161	160	159	158	156
-2.67%	154	150	145	138	131	123	114
0%	45	30	15	0	-15	-30	-45
2.67%	-328	-334	-342	-351	-360	-371	-381
5.33%	-834	-835	-835	-837	-839	-841	-845
8.00%	-1,354	-1,354	-1,354	-1,354	-1,354	-1,354	-1,355

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

10,862

공시일	2016-12-27
기준일	2016-12-26

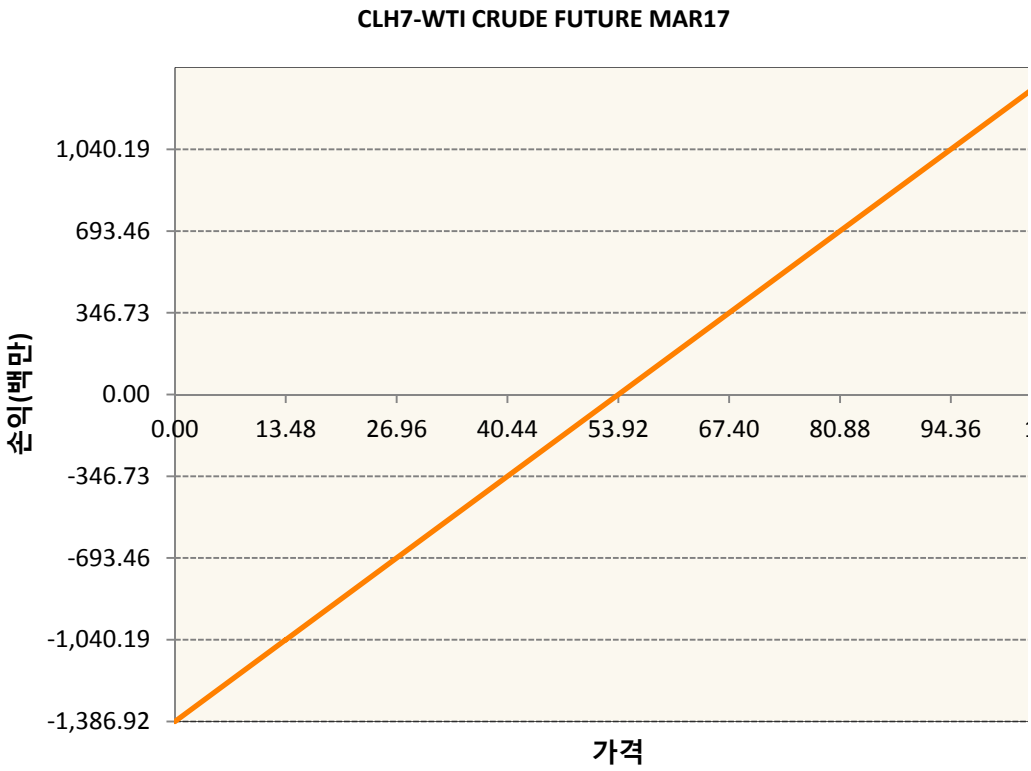
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

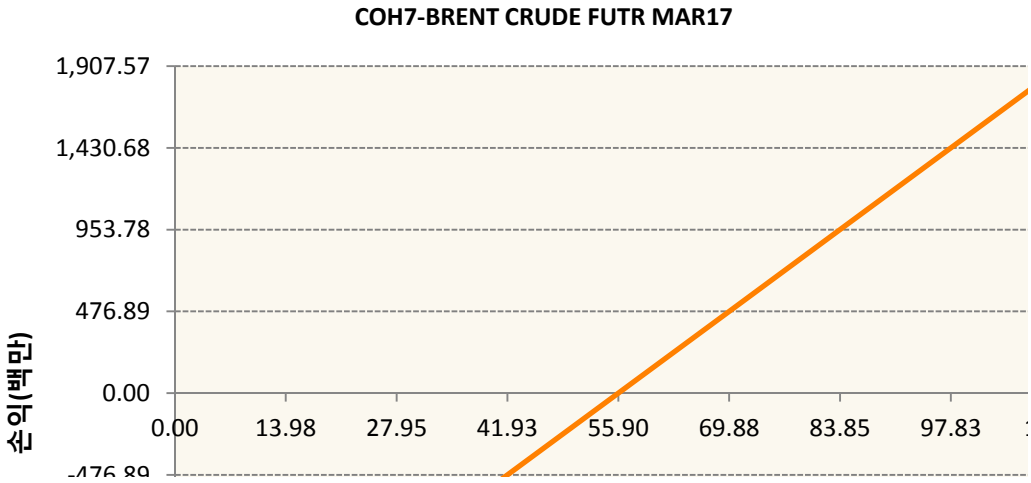
1. 계약금액

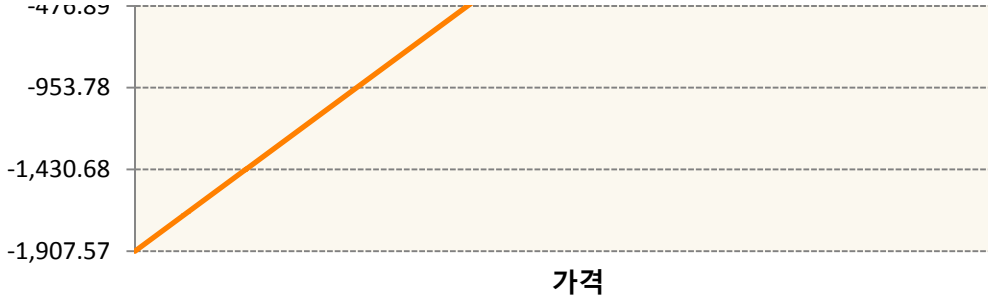
(단위:백만원)

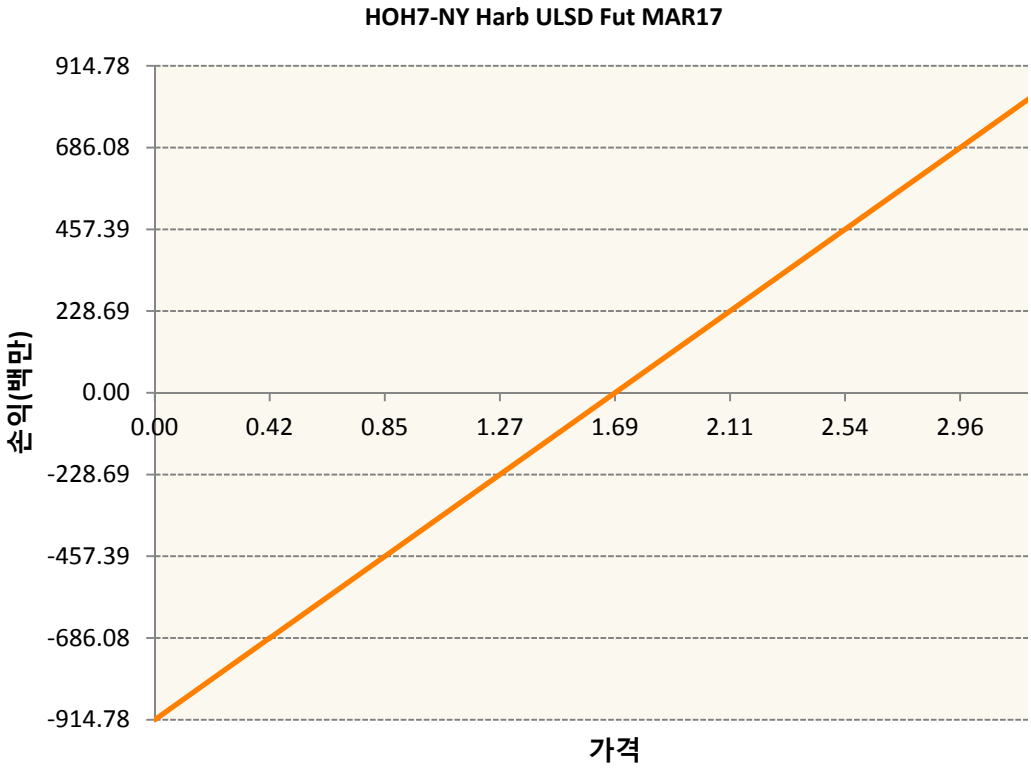
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	선물	유가증권	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	선물	유가증권	1,387	0	1,387	
누계	유가증권	선물	5,509	0	5,509	

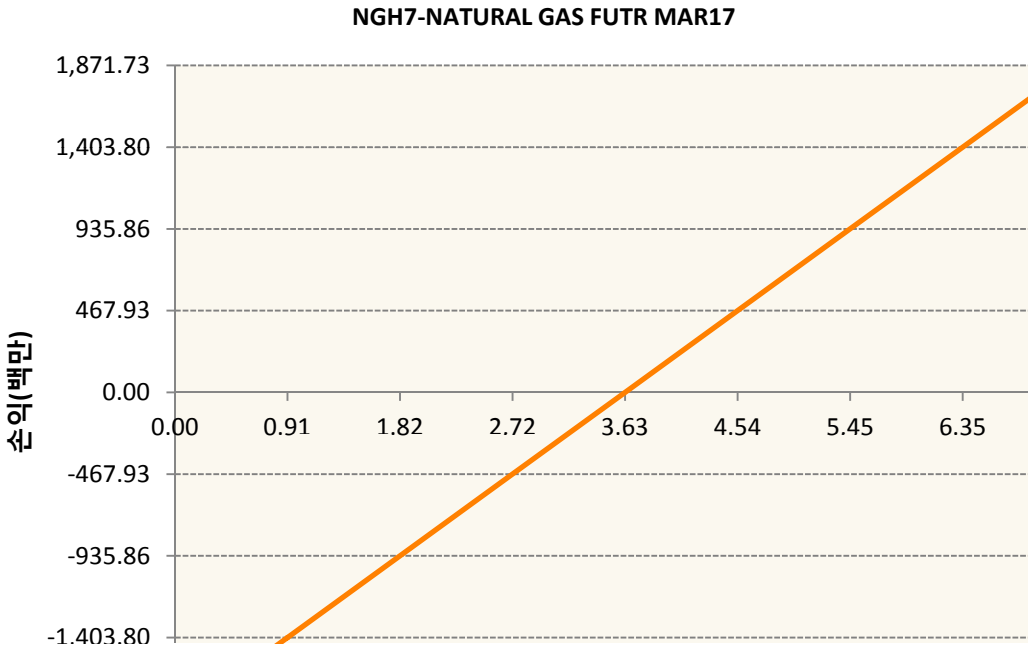
2. 만기시점의 손익구조

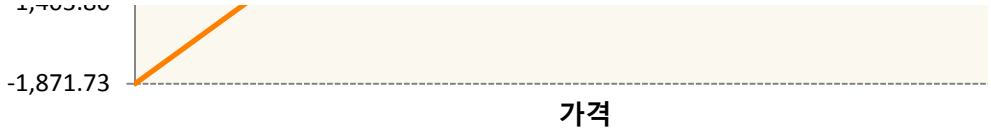


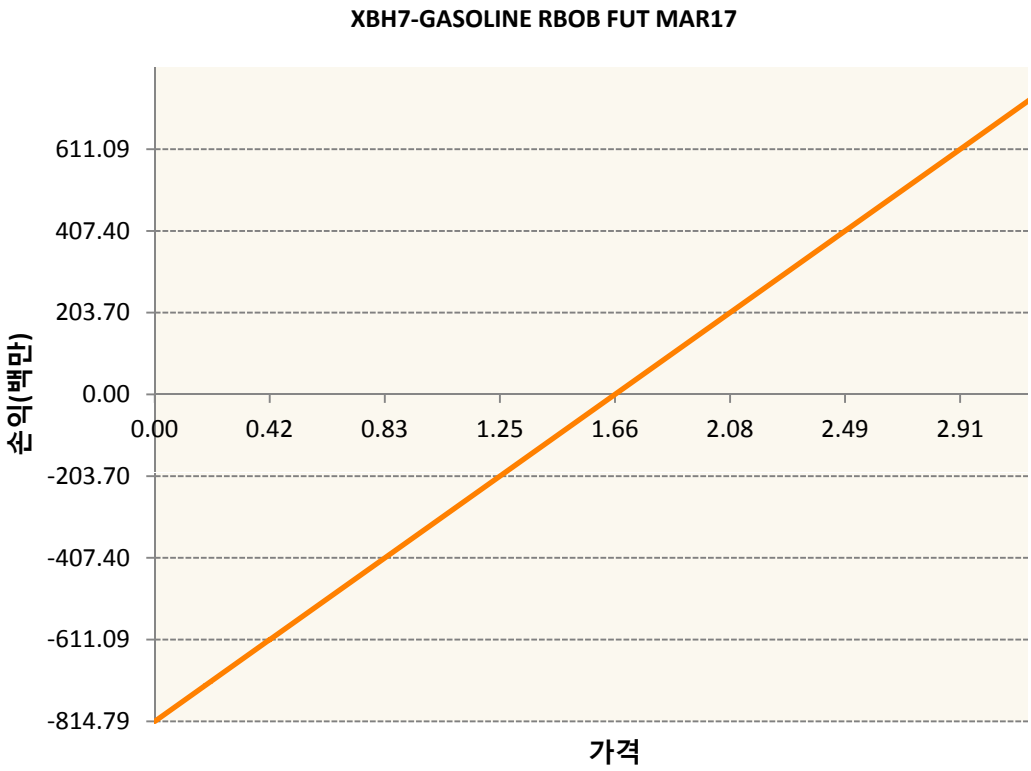



-953.78
-1,430.68
-1,907.57
가격


HOH7-NY Harb ULSD Fut MAR17
914.78
686.08
457.39
228.69
0.00
-228.69
-457.39
-686.08
-914.78
0.00
0.42
0.85
1.27
1.69
2.11
2.54
2.96
순익(백만)
가격


NGH7-NATURAL GAS FUTR MAR17
1,871.73
1,403.80
935.86
467.93
0.00
-467.93
-935.86
-1,403.80
0.00
0.91
1.82
2.72
3.63
4.54
5.45
6.35
순익(백만)





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLH7	WTI CRUDE FUTURE MAR17	111
COH7	BRENT CRUDE FUTR MAR17	153
HOH7	NY Harb ULSD Fut MAR17	73
NGH7	NATURAL GAS FUTR MAR17	150
XBH7	GASOLINE RBOB FUT MAR17	65

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

1,255

공시일	2016-12-27
기준일	2016-12-26

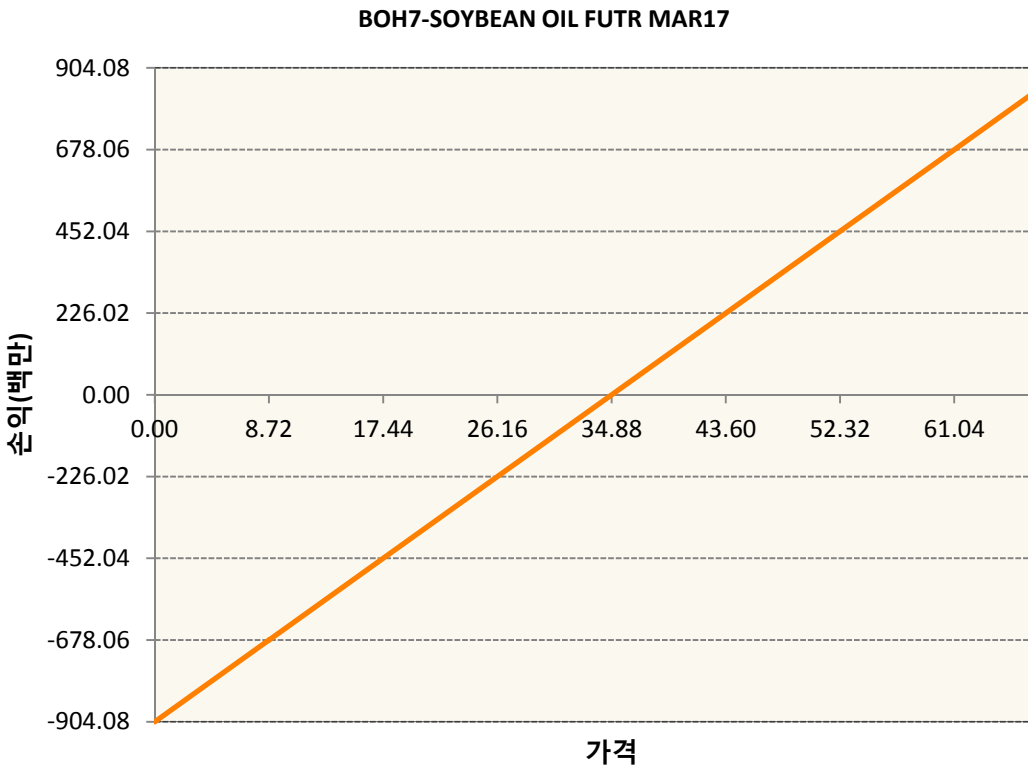
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

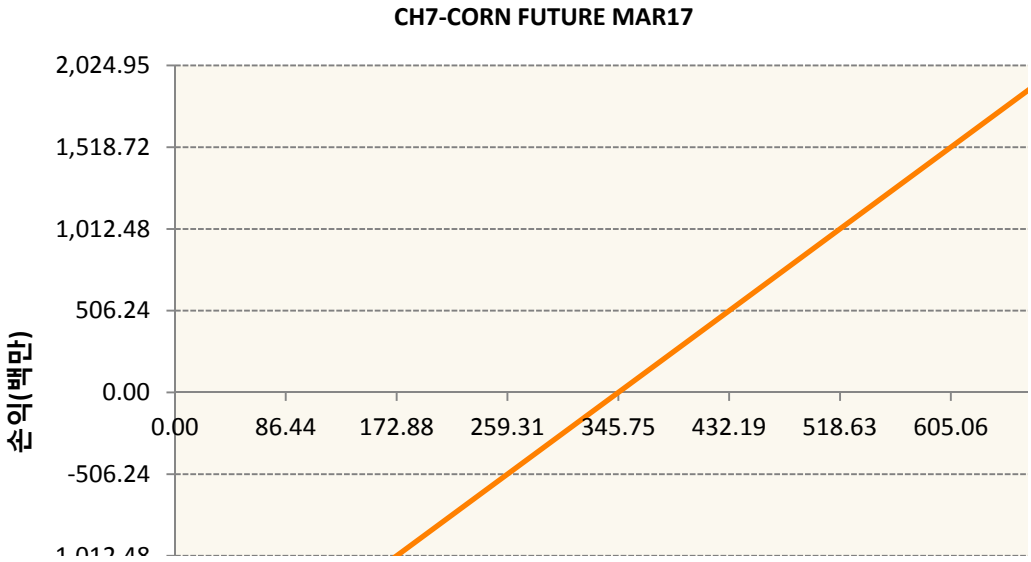
1. 계약금액

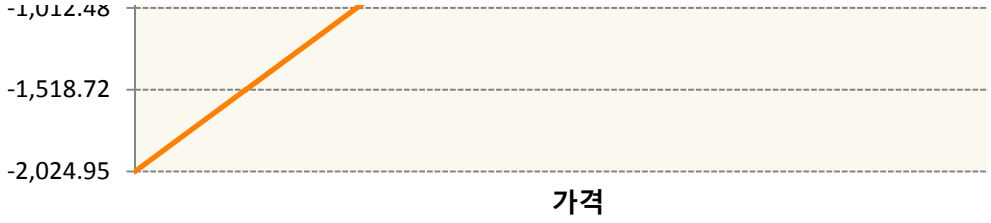
(단위:백만원)

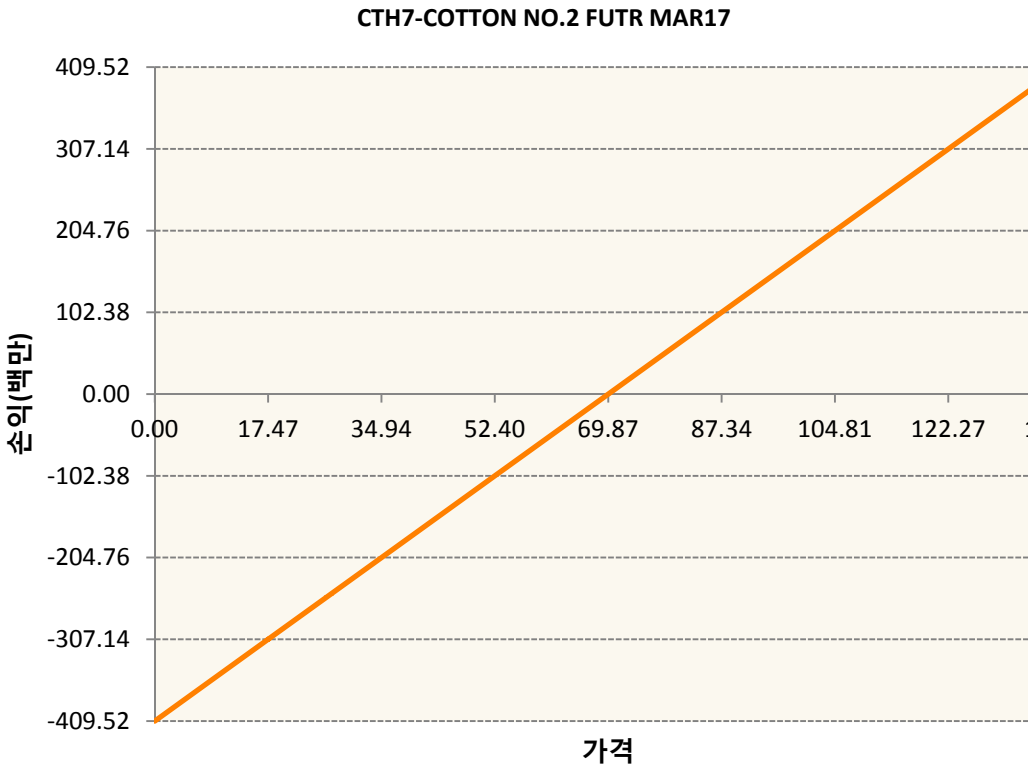
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	8,898	0	8,898	

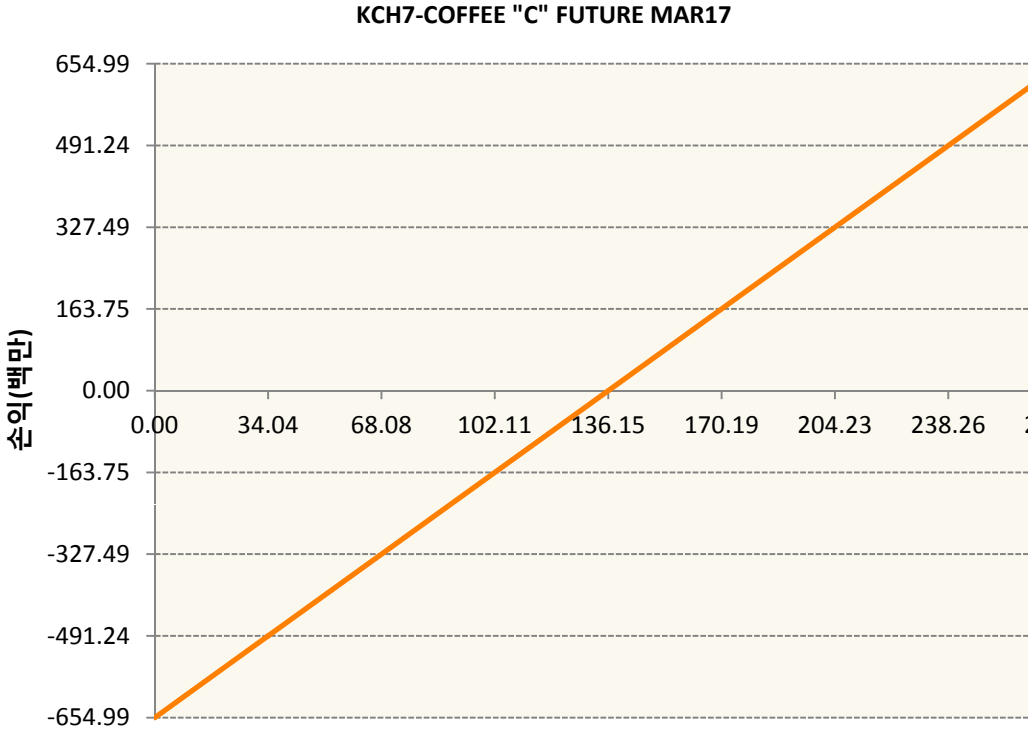
2. 만기시점의 손익구조





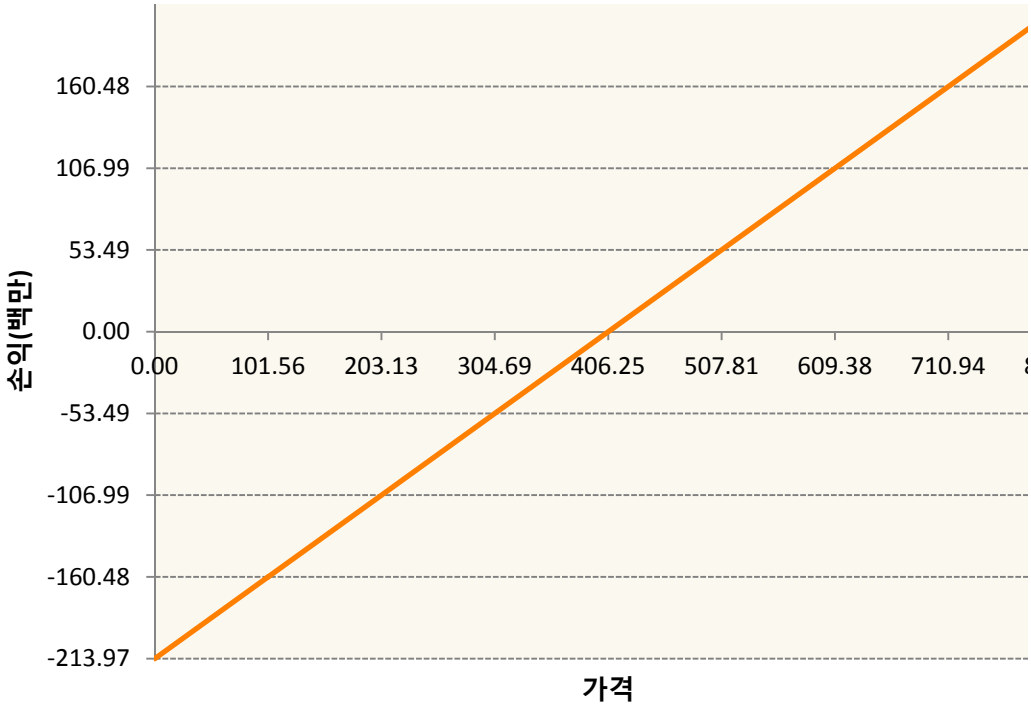

-1,518.72
-2,024.95
가격


CTH7-COTTON NO.2 FUTR MAR17
409.52
307.14
204.76
102.38
0.00
-102.38
-204.76
-307.14
-409.52
0.00
17.47
34.94
52.40
69.87
87.34
104.81
122.27
손익(백만)
가격

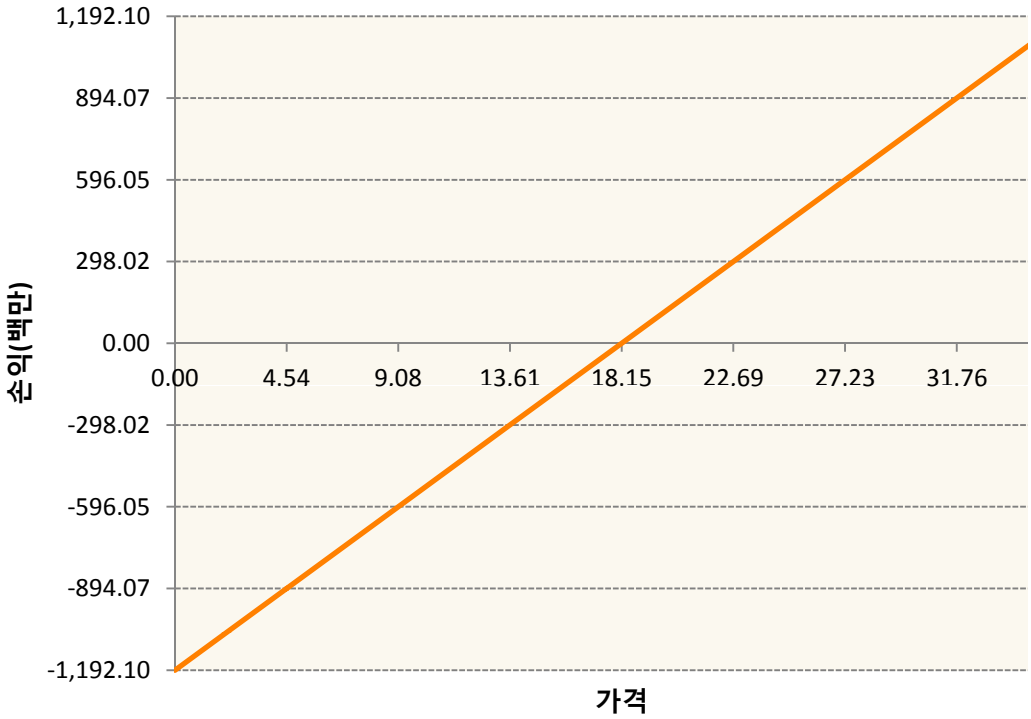

KCH7-COFFEE "C" FUTURE MAR17
654.99
491.24
327.49
163.75
0.00
-163.75
-327.49
-491.24
-654.99
0.00
34.04
68.08
102.11
136.15
170.19
204.23
238.26
손익(백만)

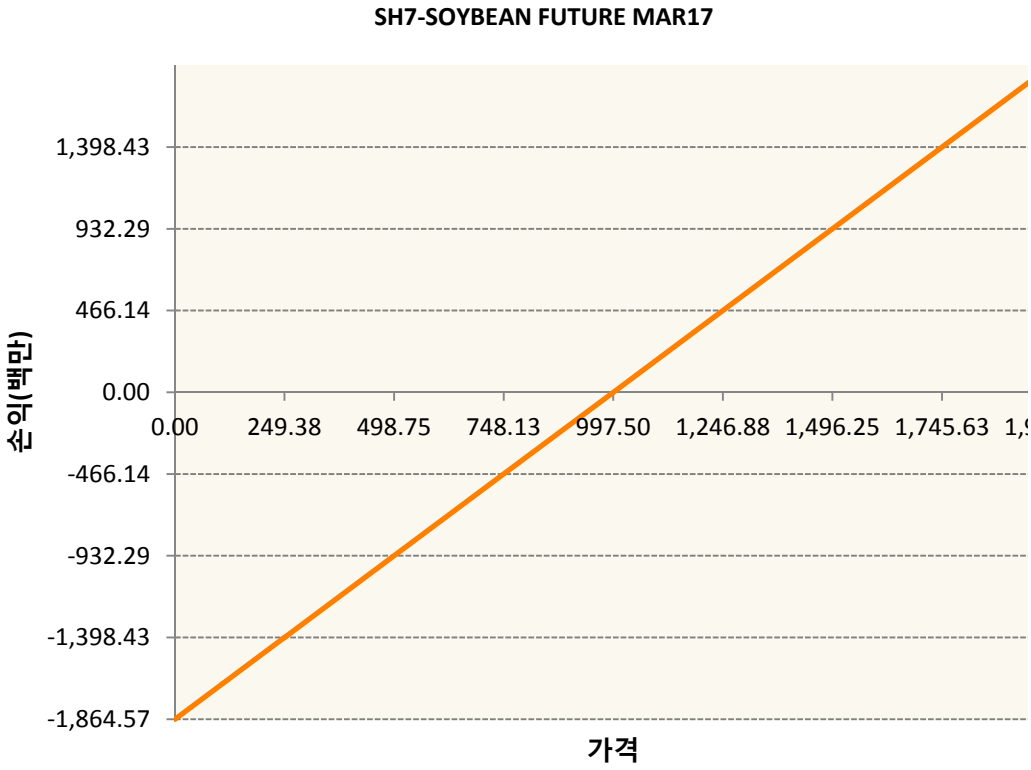
가격

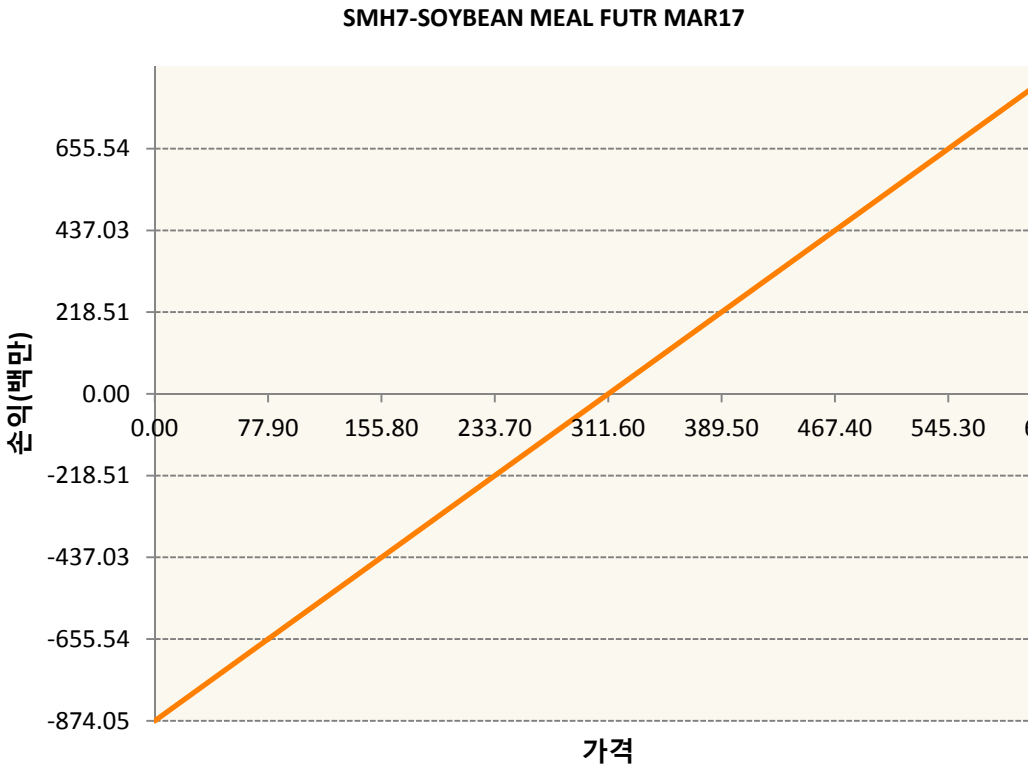
KWH7-KC HRW WHEAT FUT MAR17



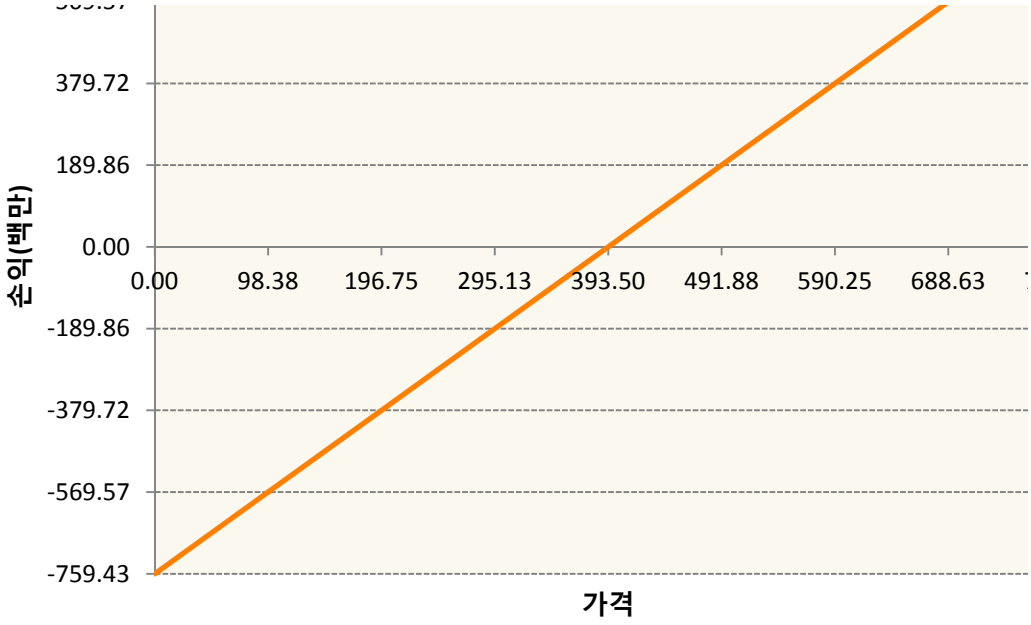
SBH7-Sugar #11 (WORLD) MAR17




SH7-SOYBEAN FUTURE MAR17
1,398.43
932.29
466.14
0.00
-466.14
-932.29
-1,398.43
-1,864.57
0.00
249.38
498.75
748.13
997.50
1,246.88
1,496.25
1,745.63
손익(백만)
가격


SMH7-SOYBEAN MEAL FUTR MAR17
655.54
437.03
218.51
0.00
-218.51
-437.03
-655.54
-874.05
0.00
77.90
155.80
233.70
311.60
389.50
467.40
545.30
손익(백만)
가격


WH7-WHEAT FUTURE(CBT) MAR17
759.43
569.57



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
BOH7	SOYBEAN OIL FUTR MAR17	72
CH7	CORN FUTURE MAR17	162
CTH7	COTTON NO.2 FUTR MAR17	33
KCH7	COFFEE "C" FUTURE MAR17	52
KWH7	KC HRW WHEAT FUT MAR17	17
SBH7	Sugar #11 (WORLD) MAR17	95
SH7	SOYBEAN FUTURE MAR17	149
SMH7	SOYBEAN MEAL FUTR MAR17	70
WH7	WHEAT FUTURE(CBT) MAR17	61

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	860