공시일	2016-12-30
기준일	2016-12-29

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	2016-12-30
기준일	2016-12-29

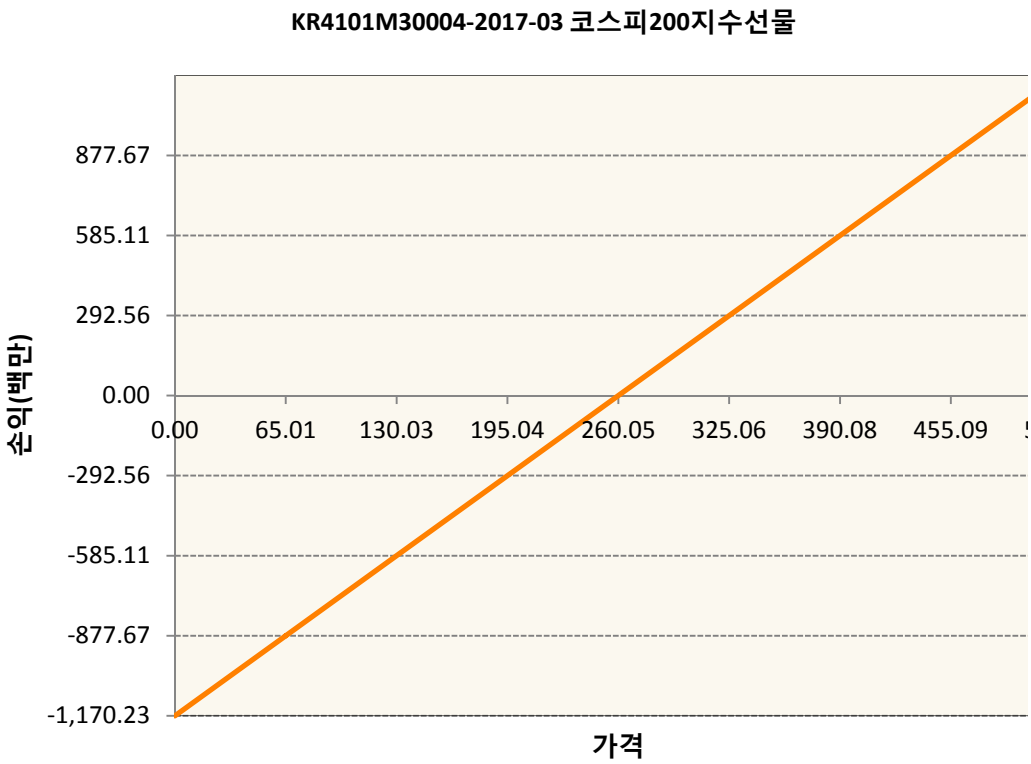
스마트인덱스모

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	259	0	259	장내
누계	유가증권	선물	1,170	0	1,170	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101M30(2017-03 코스피200지수선물 94

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-94	-94	-94	-94	-94	-94	-94
-5.33%	-62	-62	-62	-62	-62	-62	-62
-2.67%	-31	-31	-31	-31	-31	-31	-31
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	31	31	31	31	31	31	31
5.33%	62	62	62	62	62	62	62
8.00%	94	94	94	94	94	94	94

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

70

공시일	2016-12-30
기준일	2016-12-29

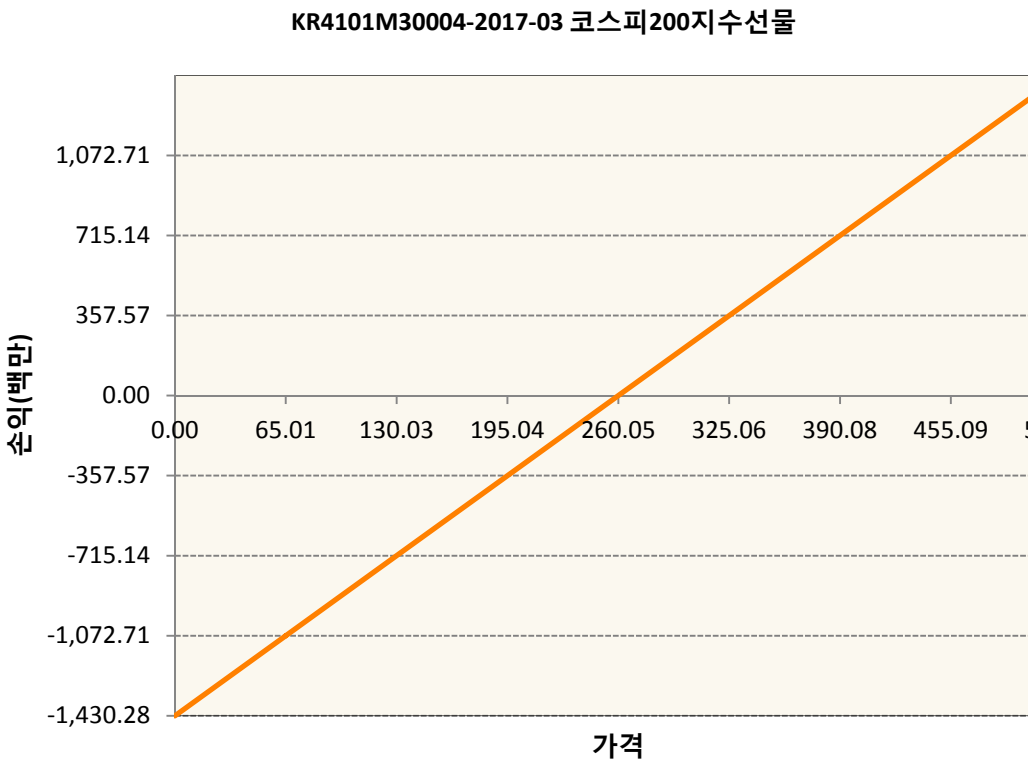
스마트레버리지목표전환형1호

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	1,430	0	1,430	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101M30(2017-03 코스피200지수선물							114
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-114	-114	-114	-114	-114	-114	-114
-5.33%	-76	-76	-76	-76	-76	-76	-76
-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%	76	76	76	76	76	76	76
8.00%	114	114	114	114	114	114	114

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

86

공시일	2016-12-30
기준일	2016-12-29

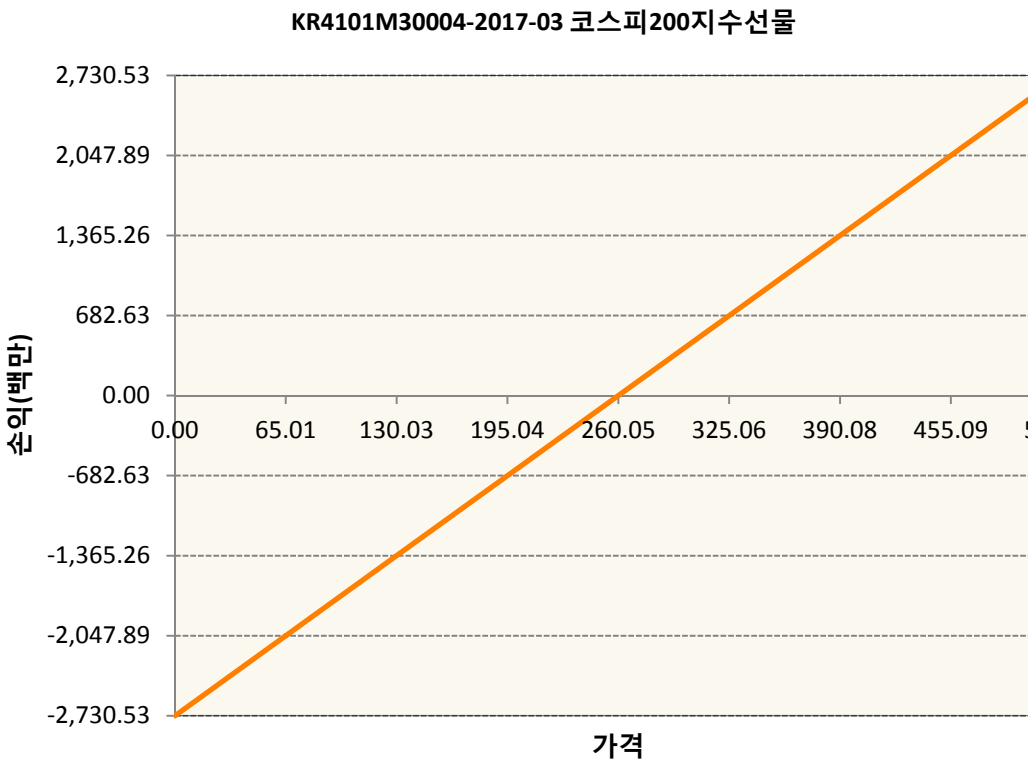
1.3배 레버리지 인덱스(주식-파생형)

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	2,731	0	2,731	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101M30(2017-03 코스피200지수선물							218
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-218	-218	-218	-218	-218	-218	-218
-5.33%	-146	-146	-146	-146	-146	-146	-146
-2.67%	-73	-73	-73	-73	-73	-73	-73
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	73	73	73	73	73	73	73
5.33%	146	146	146	146	146	146	146
8.00%	218	218	218	218	218	218	218

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

164

공시일	2016-12-30
기준일	2016-12-29

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	904

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

708

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2016-12-30
기준일	2016-12-29

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	375

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

687

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2016-12-30
기준일	2016-12-29

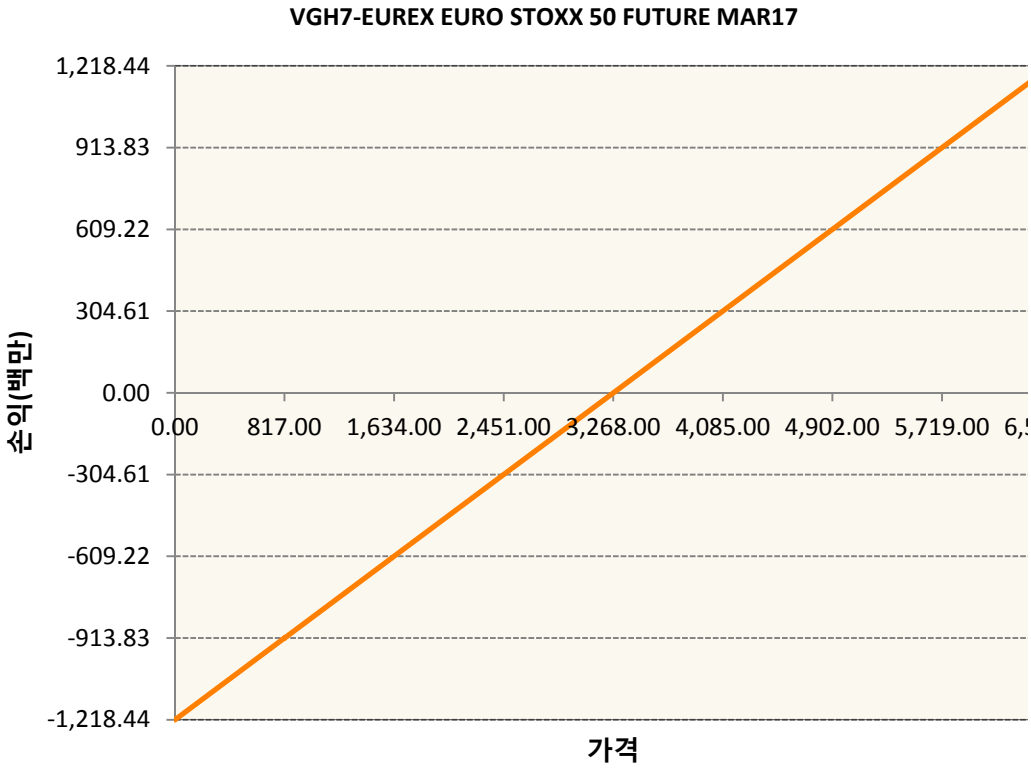
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,218	0	1,218	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGH7	EUREX EURO STOXX 50 FUTURE MAR17	97

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

(단위:백만원)

113

공시일	2016-12-30
기준일	2016-12-29

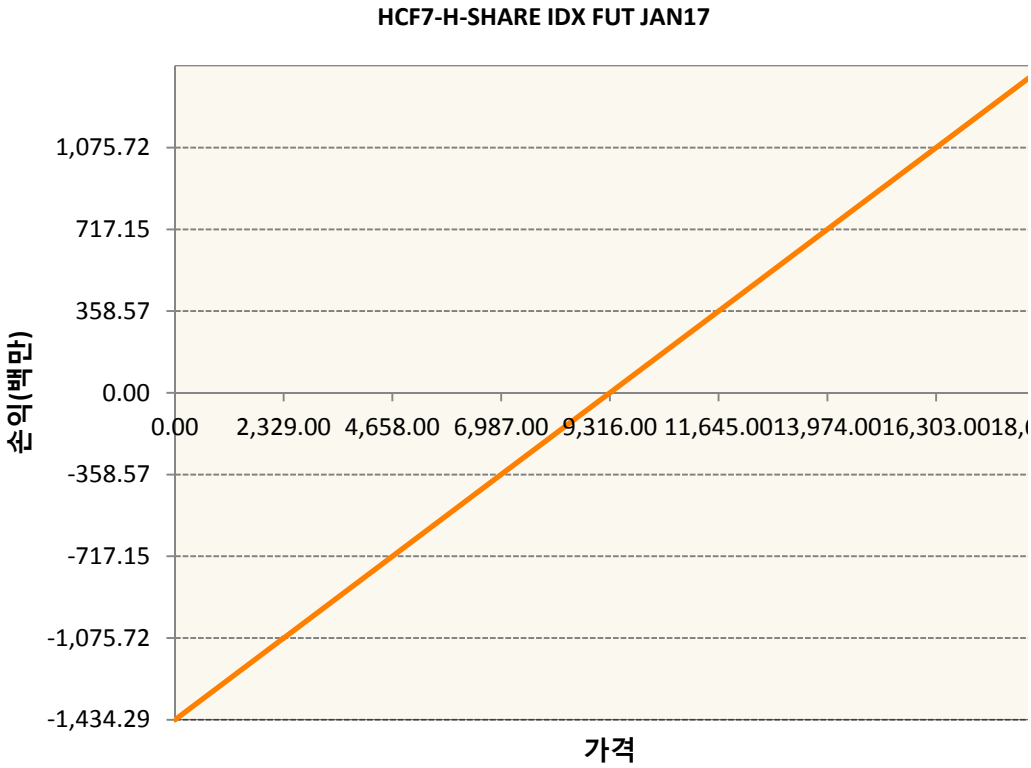
차이나인덱스모(주식-파생형)

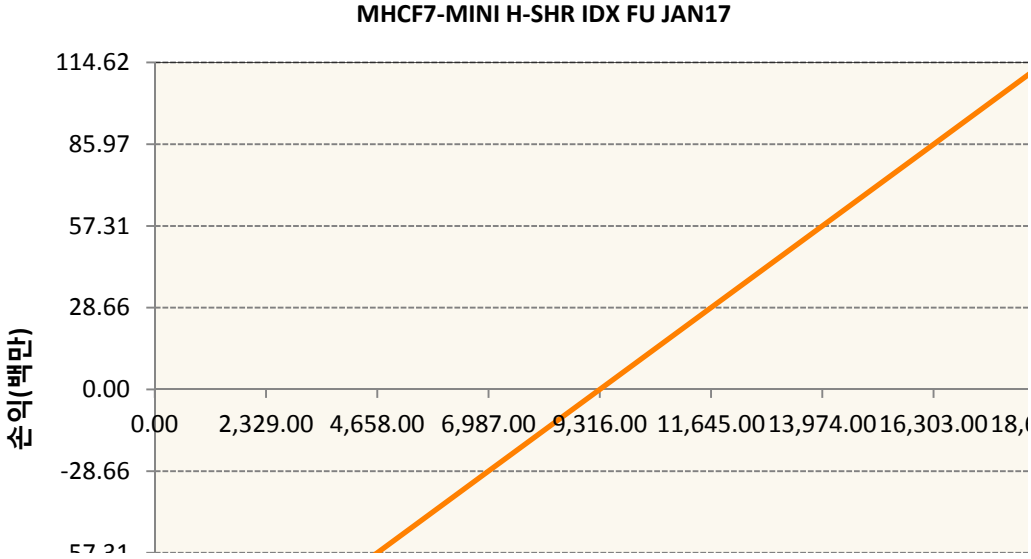
1. 계약금액

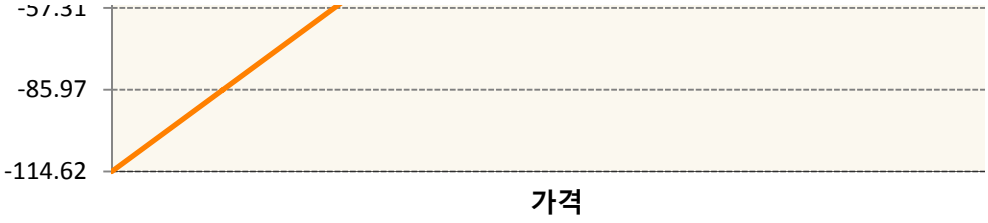
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,549	0	1,549	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCF7	H-SHARE IDX FUT JAN17	115
MHCF7	MINI H-SHR IDX FU JAN17	9

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	152

공시일	2016-12-30
기준일	2016-12-29

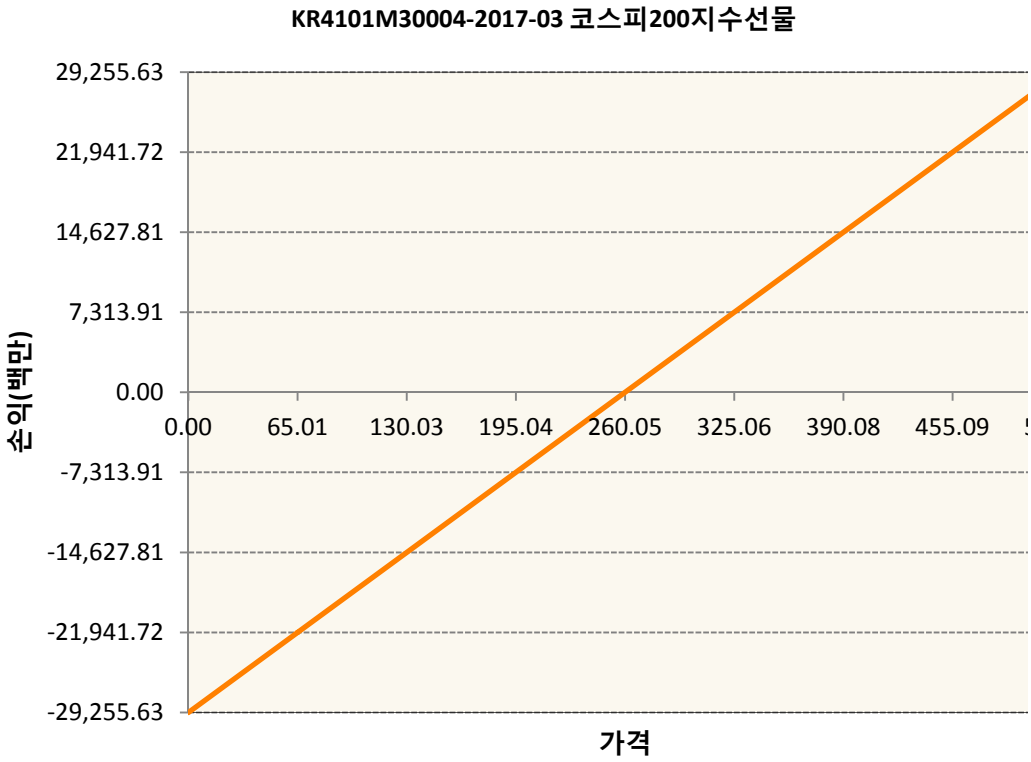
커버드콜(주식혼합-파생형)

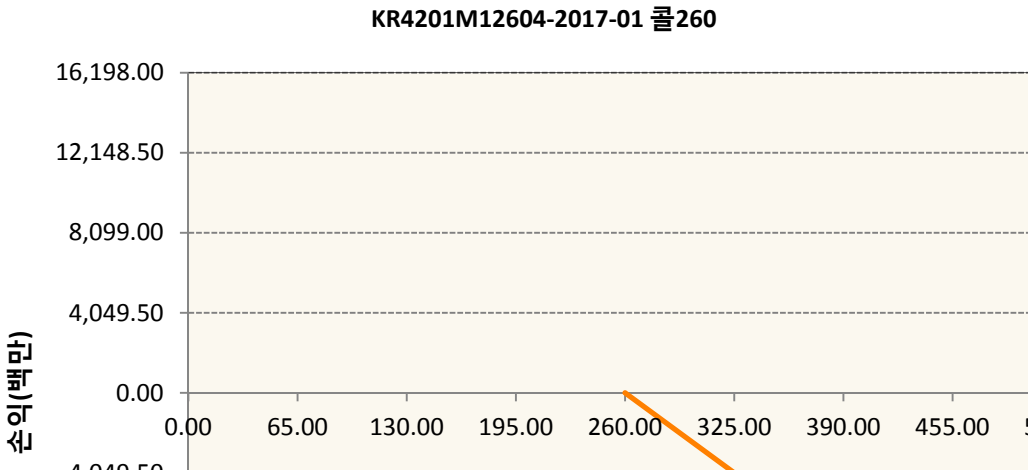
1. 계약금액

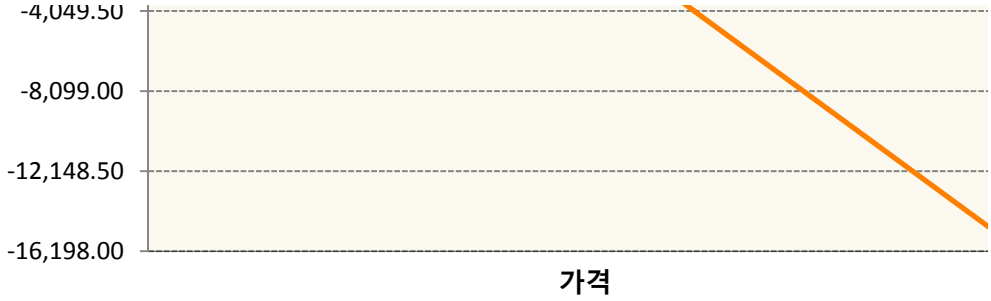
(단위:백만원)

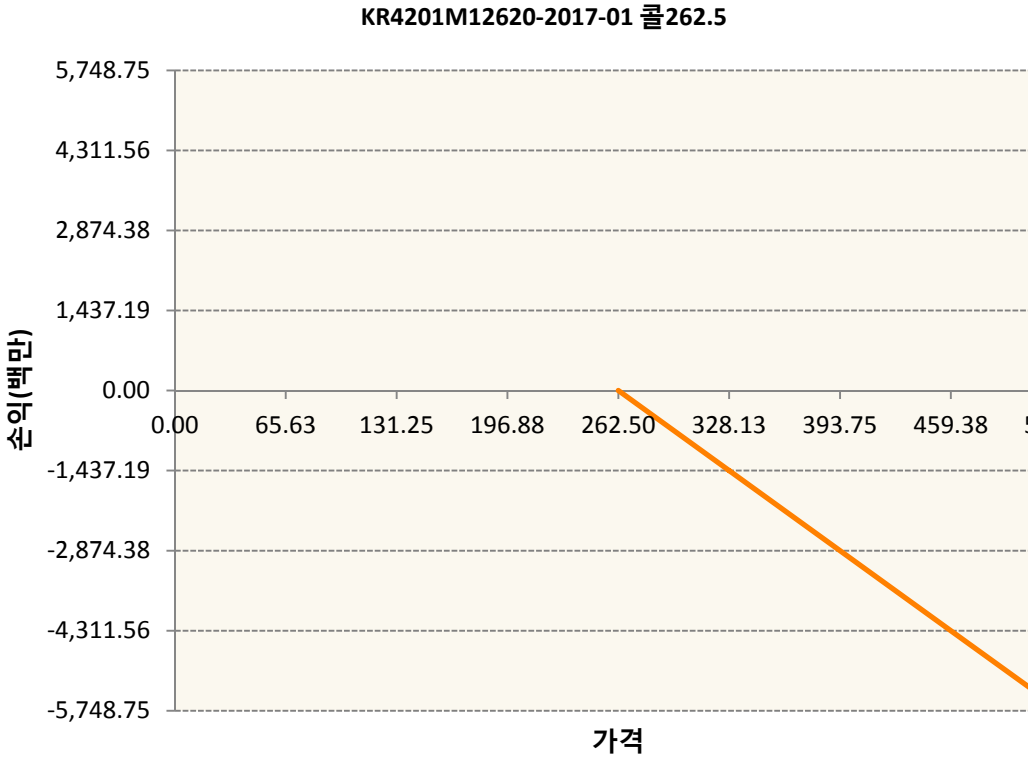
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	1,840	-1,840	장내
누계	유가증권	선물	29,256	0	29,256	장내
누계	유가증권	옵션	0	21,947	-21,947	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101M30(2017-03 코스피200지수선물							2,340
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-2,340	-2,340	-2,340	-2,340	-2,340	-2,340	-2,340
-5.33%	-1,560	-1,560	-1,560	-1,560	-1,560	-1,560	-1,560
-2.67%	-780	-780	-780	-780	-780	-780	-780
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	780	780	780	780	780	780	780
5.33%	1,560	1,560	1,560	1,560	1,560	1,560	1,560
8.00%	2,340	2,340	2,340	2,340	2,340	2,340	2,340
KR4201M12(2017-01 콜260							5,757
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	723	723	723	723	723	722	722
-5.33%	723	722	721	719	715	709	702
-2.67%	692	674	651	624	594	561	525
0%	180	120	60	0	-60	-120	-180
2.67%	-1,472	-1,492	-1,516	-1,545	-1,577	-1,612	-1,650
5.33%	-3,596	-3,597	-3,599	-3,602	-3,607	-3,615	-3,624
8.00%	-5,754	-5,754	-5,754	-5,755	-5,755	-5,755	-5,757
KR4201M12(	2017-01 콜262.5						1,864

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	141	141	141	141	141	141	141
-5.33%	141	141	141	141	141	140	139
-2.67%	139	136	133	128	122	115	106
0%	56	38	19	0	-20	-39	-59
2.67%	-385	-399	-413	-429	-446	-463	-481
5.33%	-1,104	-1,105	-1,107	-1,110	-1,115	-1,120	-1,126
8.00%	-1,862	-1,862	-1,862	-1,862	-1,862	-1,863	-1,864

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

11,218

공시일	2016-12-30
기준일	2016-12-29

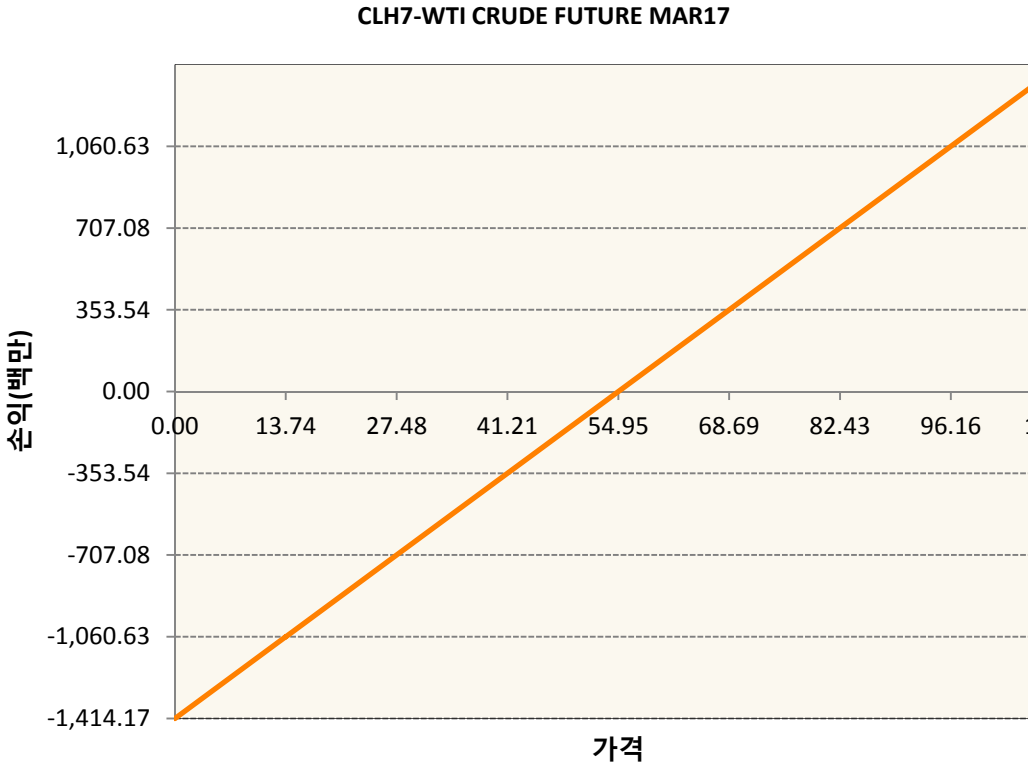
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

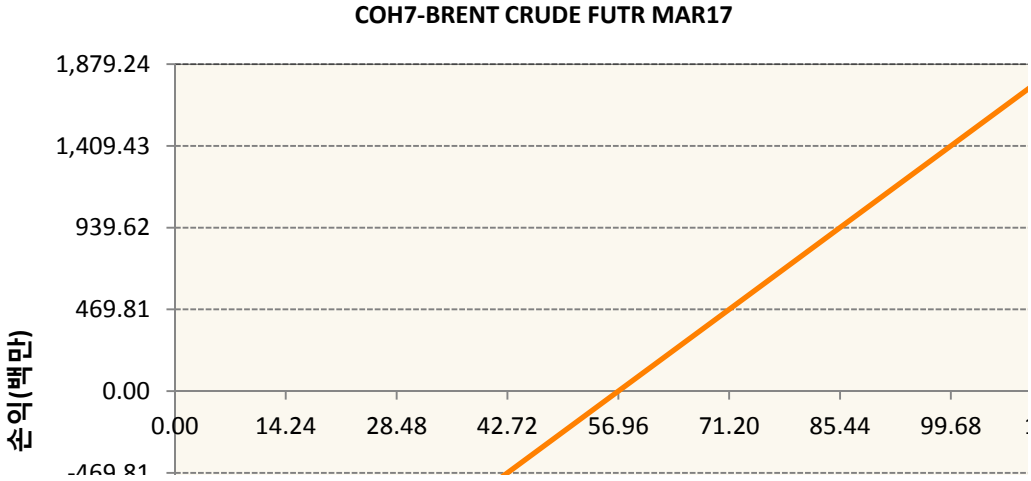
1. 계약금액

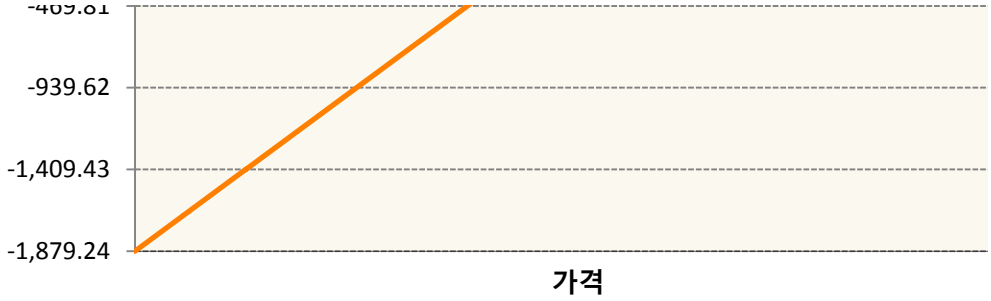
(단위:백만원)

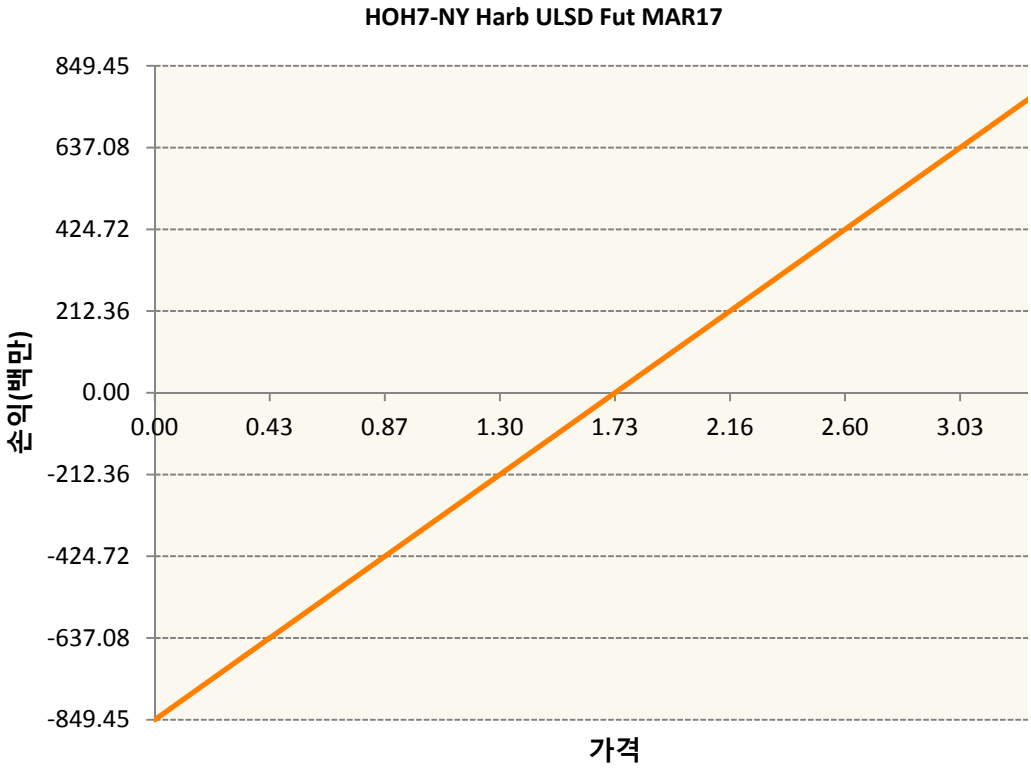
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	선물	유가증권	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	선물	유가증권	1,414	0	1,414	
누계	유가증권	선물	5,452	0	5,452	

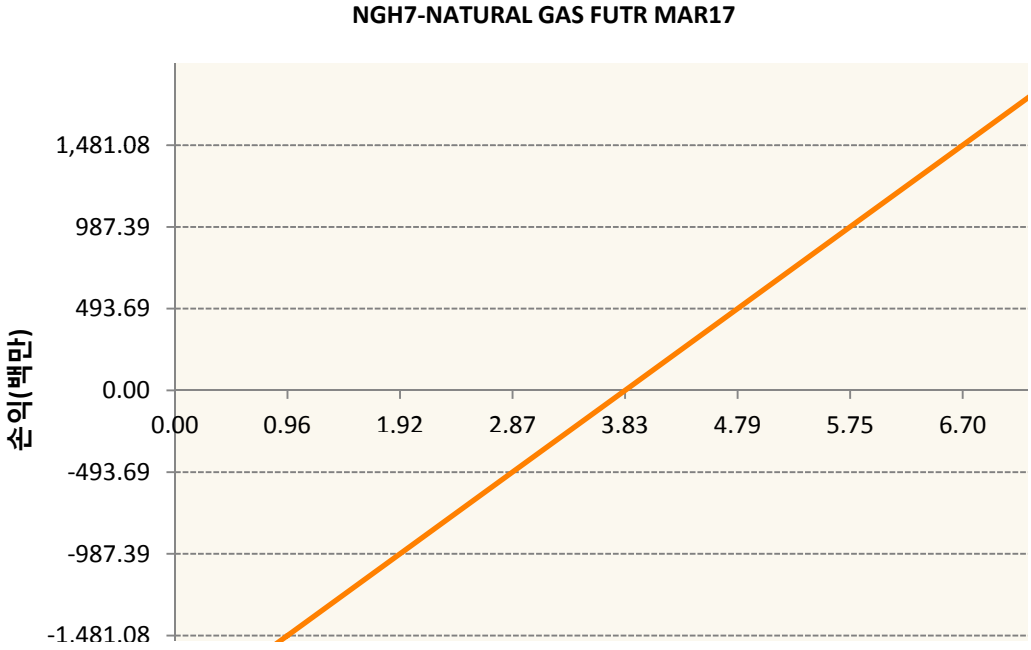
2. 만기시점의 손익구조

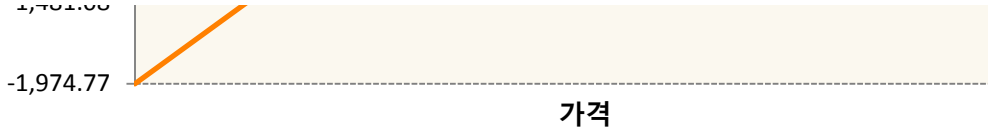


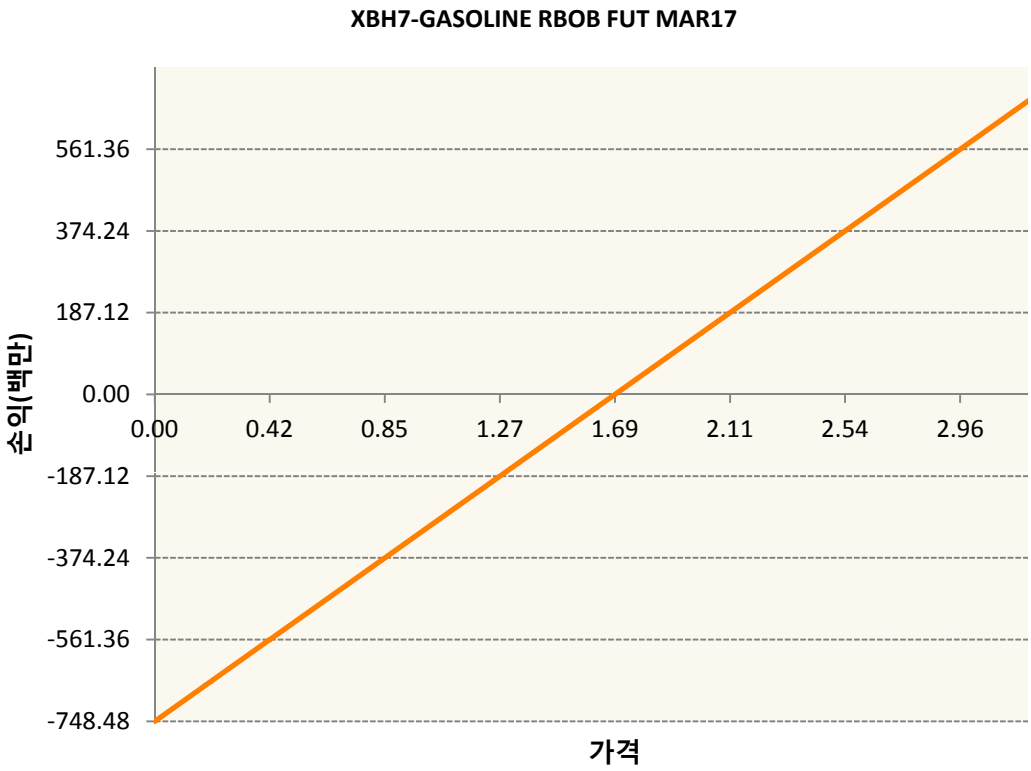



-939.62
-1,409.43
-1,879.24
가격


HOH7-NY Harb ULSD Fut MAR17
849.45
637.08
424.72
212.36
0.00
-212.36
-424.72
-637.08
-849.45
0.00
0.43
0.87
1.30
1.73
2.16
2.60
3.03
순익(백만)
가격


NGH7-NATURAL GAS FUTR MAR17
1,481.08
987.39
493.69
0.00
-493.69
-987.39
-1,481.08
0.00
0.96
1.92
2.87
3.83
4.79
5.75
6.70
순익(백만)





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLH7	WTI CRUDE FUTURE MAR17	113
COH7	BRENT CRUDE FUTR MAR17	150
HOH7	NY Harb ULSD Fut MAR17	68
NGH7	NATURAL GAS FUTR MAR17	158
XBH7	GASOLINE RBOB FUT MAR17	60

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

1,253

공시일	2016-12-30
기준일	2016-12-29

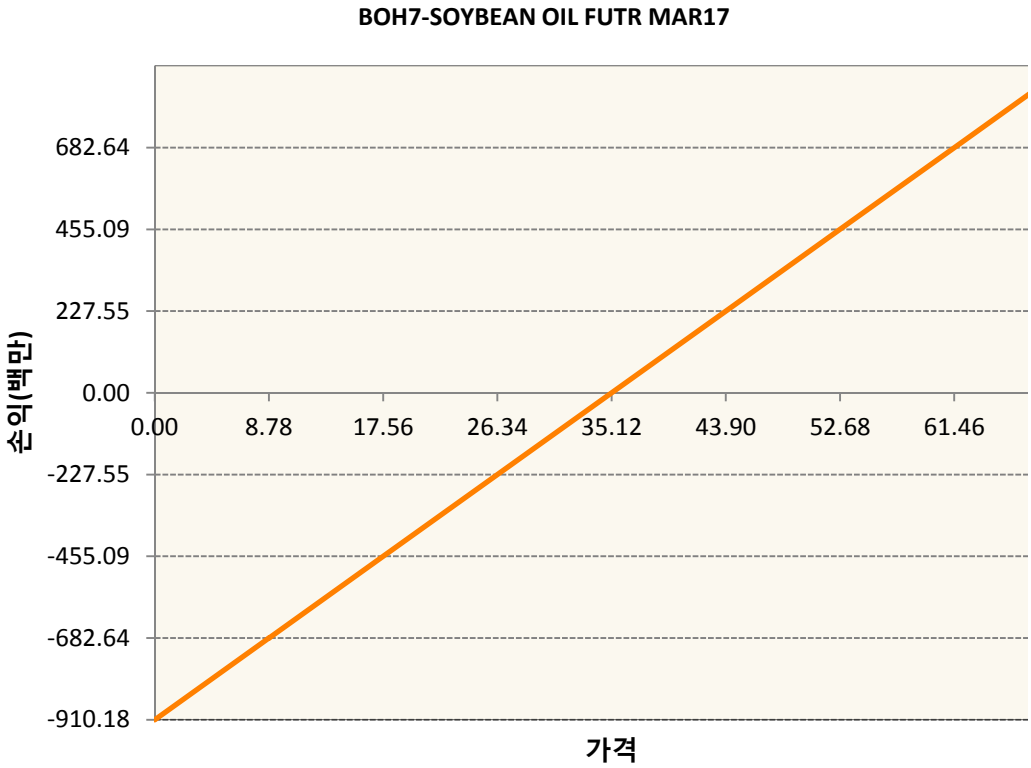
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

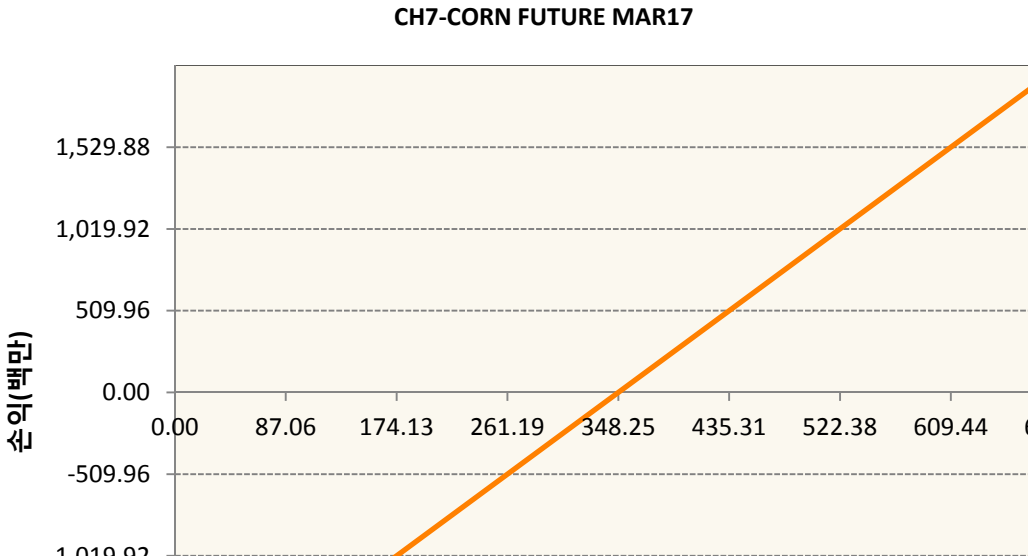
1. 계약금액

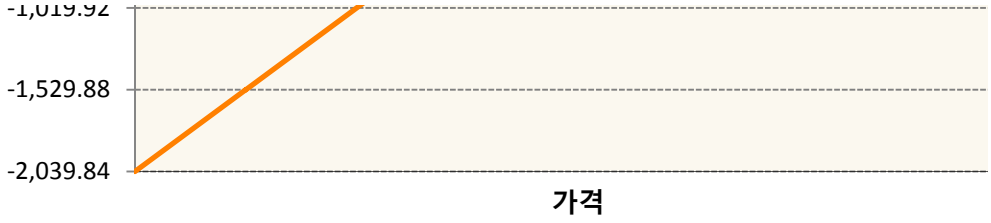
(단위:백만원)

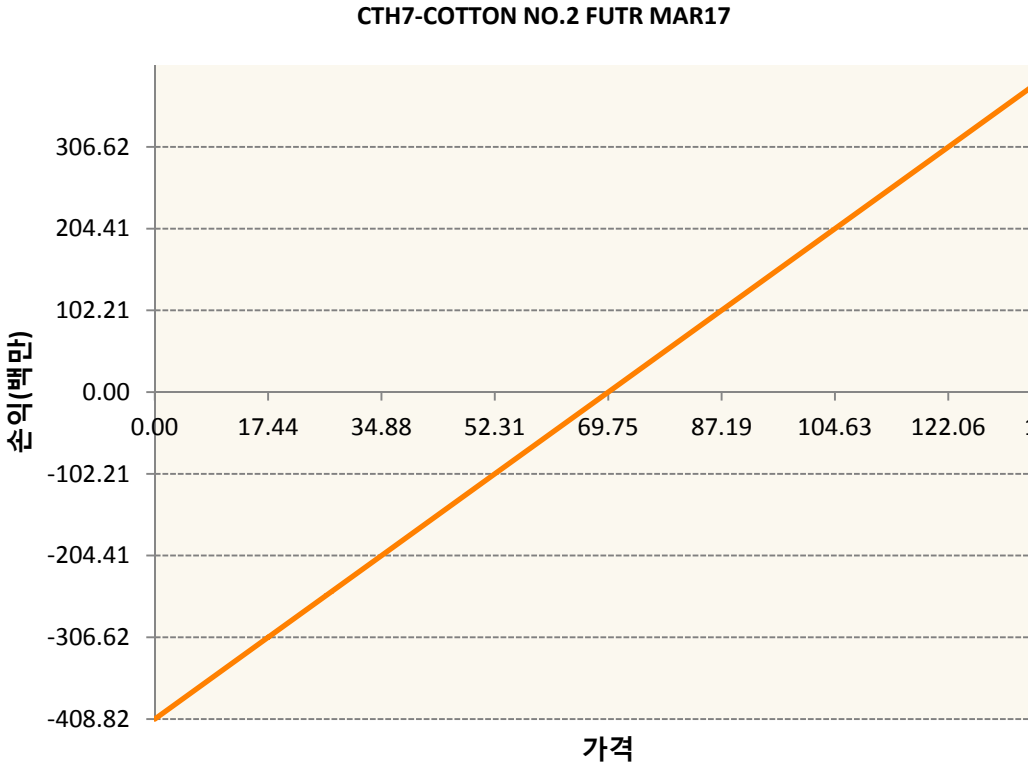
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	9,042	0	9,042	

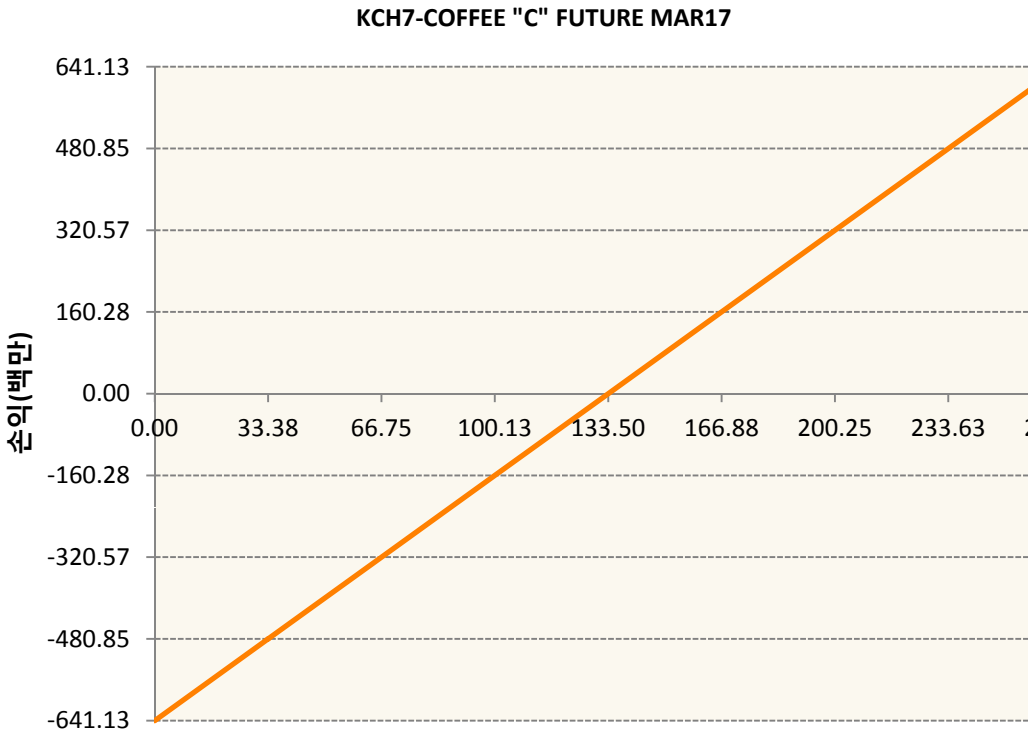
2. 만기시점의 손익구조



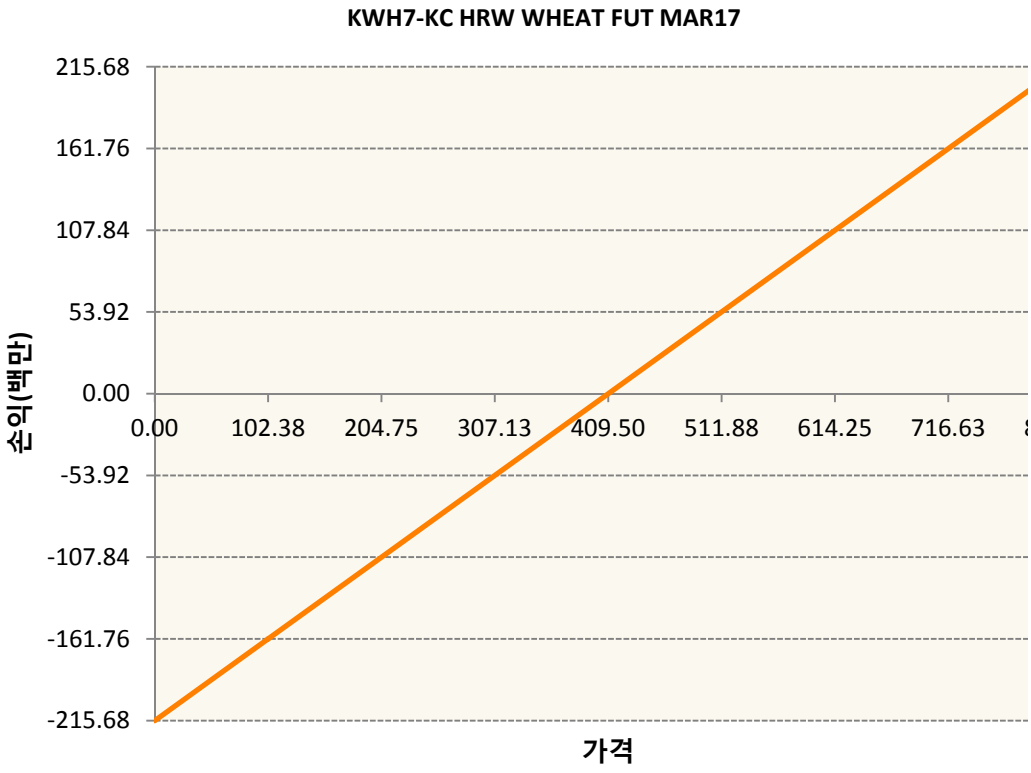


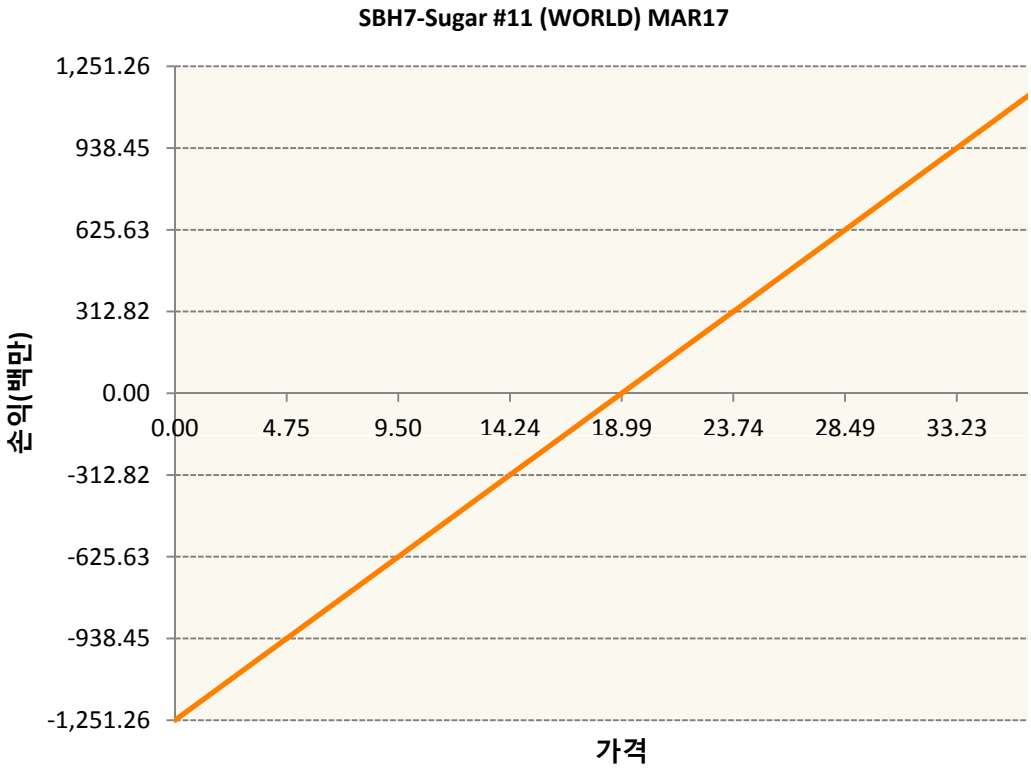

-1,529.88
-2,039.84
가격


CTH7-COTTON NO.2 FUTR MAR17
306.62
204.41
102.21
0.00
-102.21
-204.41
-306.62
-408.82
0.00
17.44
34.88
52.31
69.75
87.19
104.63
122.06
순익(백만)
가격

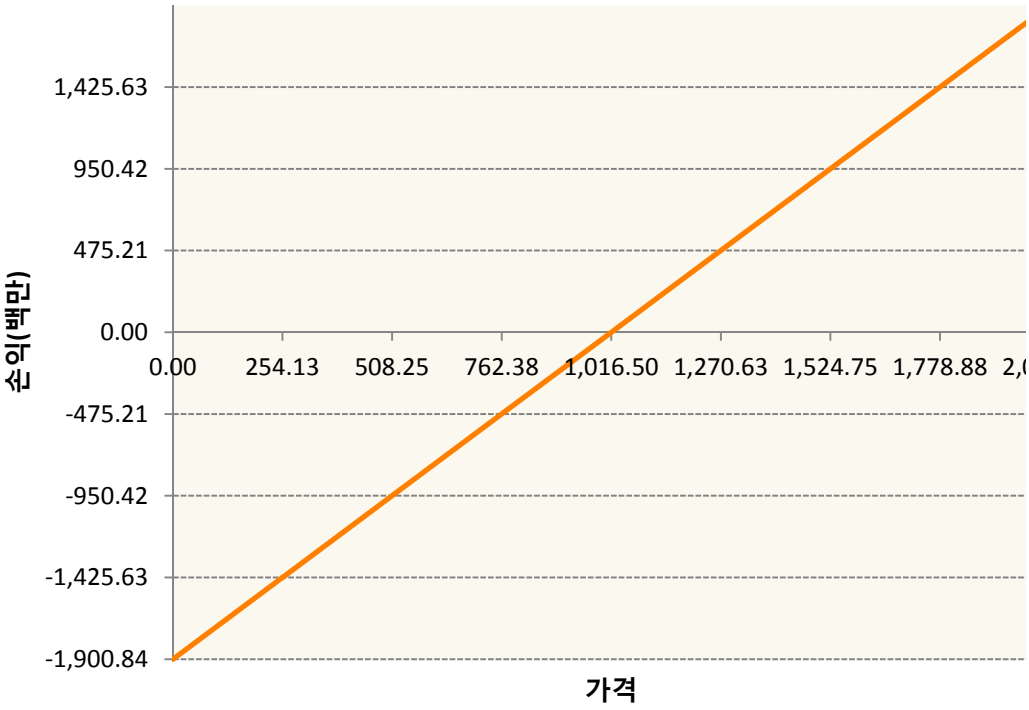

KCH7-COFFEE "C" FUTURE MAR17
641.13
480.85
320.57
160.28
0.00
-160.28
-320.57
-480.85
-641.13
0.00
33.38
66.75
100.13
133.50
166.88
200.25
233.63
순익(백만)

가격

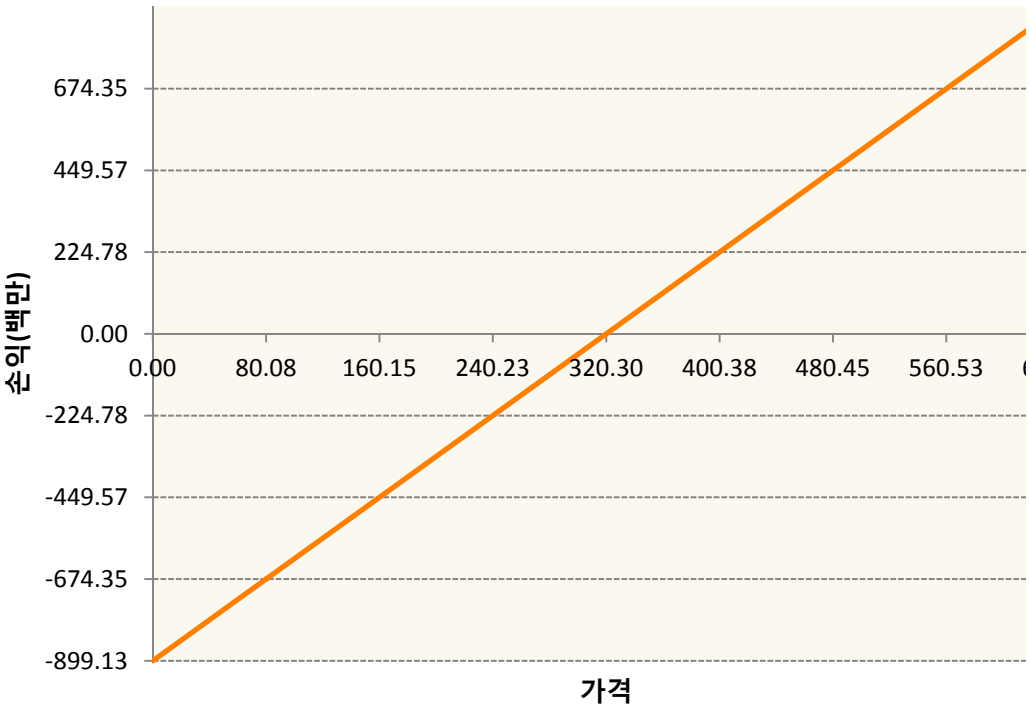

KWH7-KC HRW WHEAT FUT MAR17
215.68
161.76
107.84
53.92
0.00
-53.92
-107.84
-161.76
-215.68
0.00
102.38
204.75
307.13
409.50
511.88
614.25
716.63
손익(백만)
가격


SBH7-Sugar #11 (WORLD) MAR17
1,251.26
938.45
625.63
312.82
0.00
-312.82
-625.63
-938.45
-1,251.26
0.00
4.75
9.50
14.24
18.99
23.74
28.49
33.23
손익(백만)
가격

SH7-SOYBEAN FUTURE MAR17

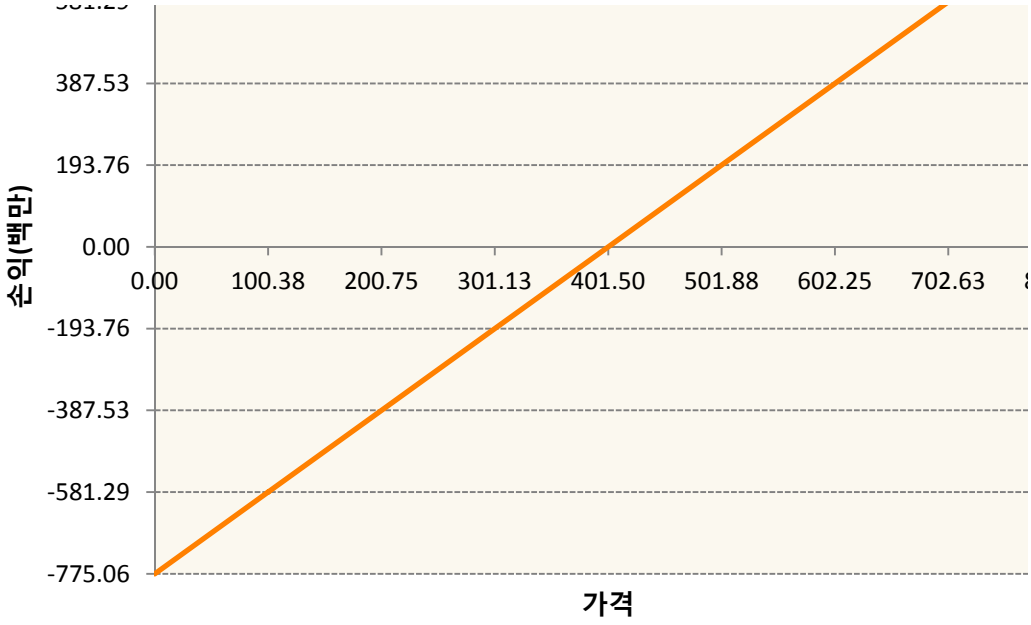


SMH7-SOYBEAN MEAL FUTR MAR17



WH7-WHEAT FUTURE(CBT) MAR17





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
BOH7	SOYBEAN OIL FUTR MAR17	73
CH7	CORN FUTURE MAR17	163
CTH7	COTTON NO.2 FUTR MAR17	33
KCH7	COFFEE "C" FUTURE MAR17	51
KWH7	KC HRW WHEAT FUT MAR17	17
SBH7	Sugar #11 (WORLD) MAR17	100
SH7	SOYBEAN FUTURE MAR17	152
SMH7	SOYBEAN MEAL FUTR MAR17	72
WH7	WHEAT FUTURE(CBT) MAR17	62

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	873