공시일	2016-09-06
기준일	2016-09-05

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	11	0	11	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	2016-09-06
기준일	2016-09-05

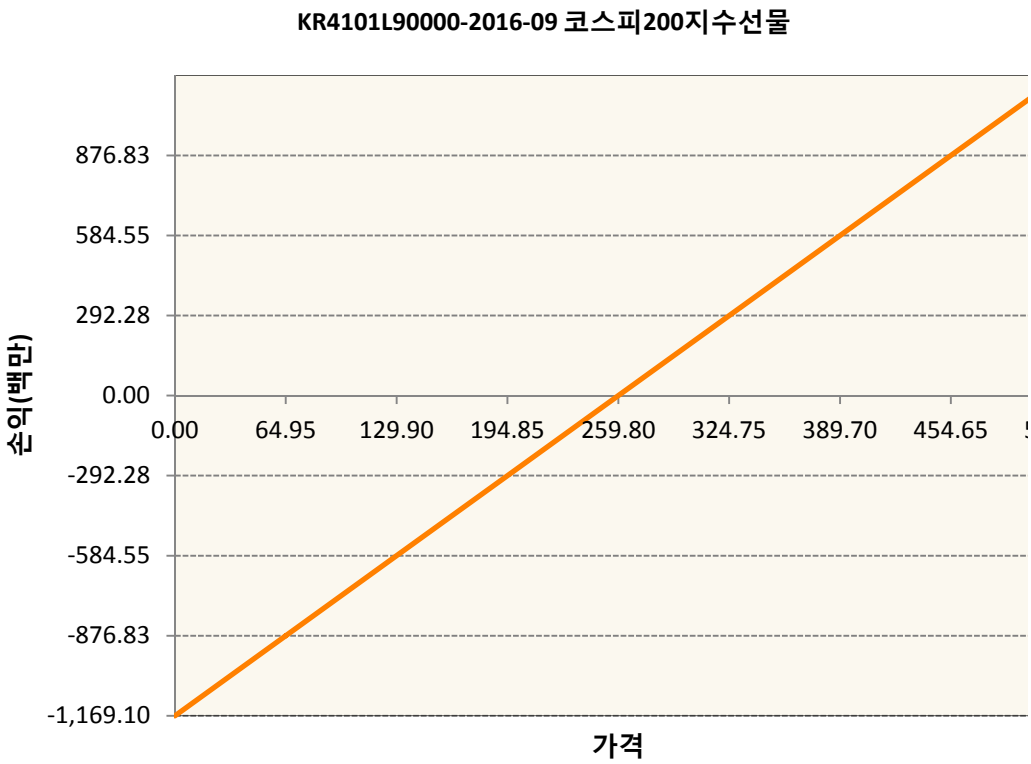
스마트인덱스모

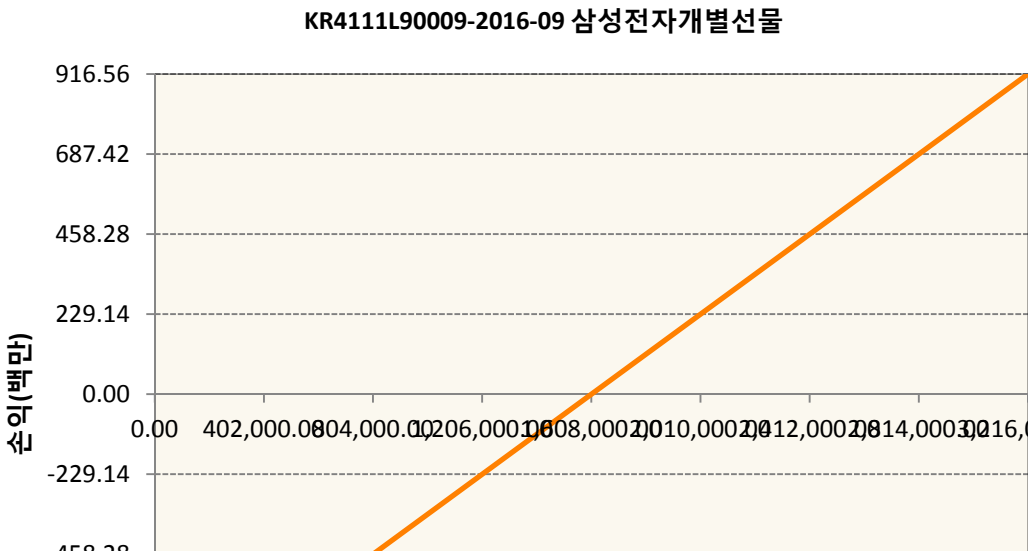
1. 계약금액

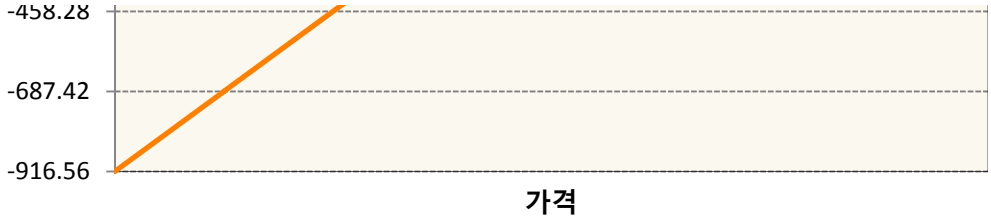
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,086	0	2,086	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101L900	2016-09 코스피200지수선물						93
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-93	-93	-93	-93	-93	-93	-93
-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%	93	93	93	93	93	93	93
KR4111L900	2016-09 삼성전자개별선물						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)

146

공시일	2016-09-06
기준일	2016-09-05

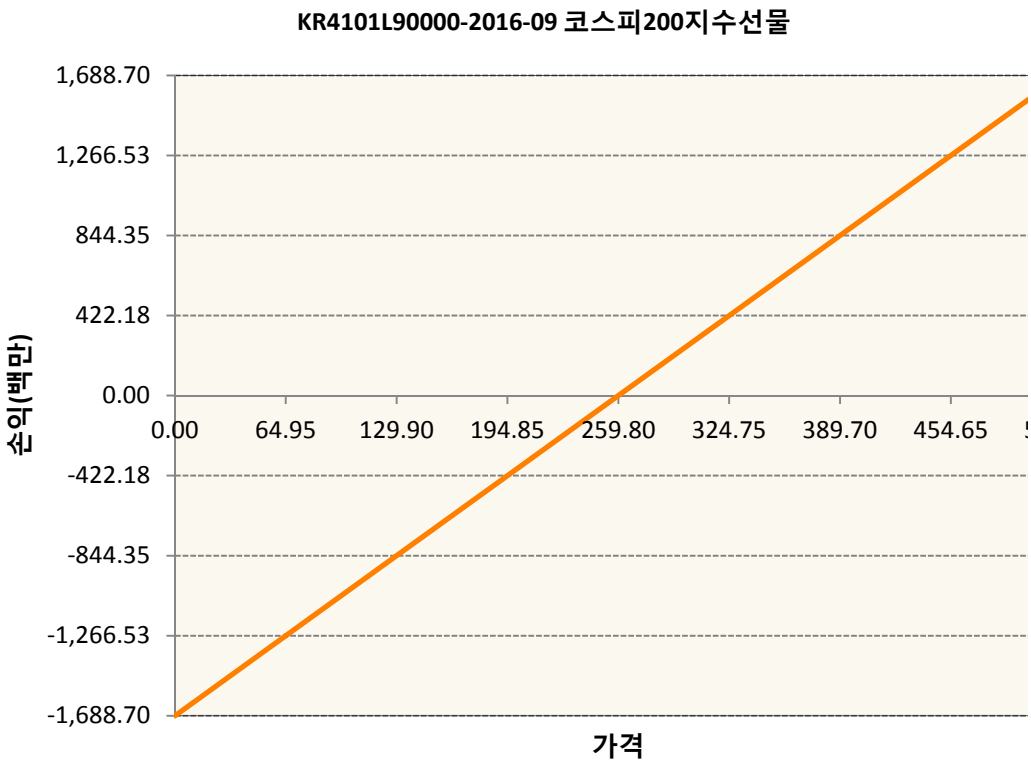
스마트레버리지목표전환형1호

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	1,689	0	1,689	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101L900 2016-09 코스피200지수선물							135
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-135	-135	-135	-135	-135	-135	-135
-5.33%	-90	-90	-90	-90	-90	-90	-90
-2.67%	-45	-45	-45	-45	-45	-45	-45
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	45	45	45	45	45	45	45
5.33%	90	90	90	90	90	90	90
8.00%	135	135	135	135	135	135	135

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

106

공시일	2016-09-06
기준일	2016-09-05

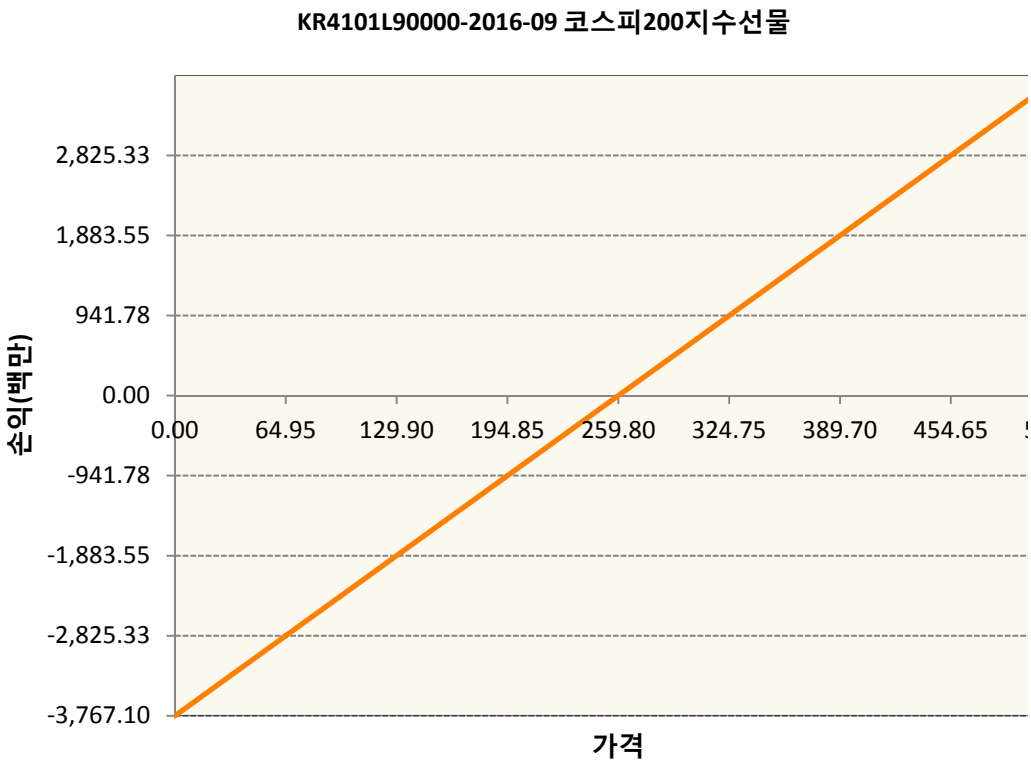
1.3배 레버리지 인덱스(주식-파생형)

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	3,767	0	3,767	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101L900	2016-09 코스피200지수선물						301
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-301	-301	-301	-301	-301	-301	-301
-5.33%	-201	-201	-201	-201	-201	-201	-201
-2.67%	-100	-100	-100	-100	-100	-100	-100
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	100	100	100	100	100	100	100
5.33%	201	201	201	201	201	201	201
8.00%	301	301	301	301	301	301	301

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

236

공시일	2016-09-06
기준일	2016-09-05

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	11,105	0	11,105	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWMXWO0(신한MXWO 미래S160822	890

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

745

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2016-09-06
기준일	2016-09-05

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	4,811	0	4,811	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI50000 신한CSI500미래S160608	401

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

870

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2016-09-06
기준일	2016-09-05

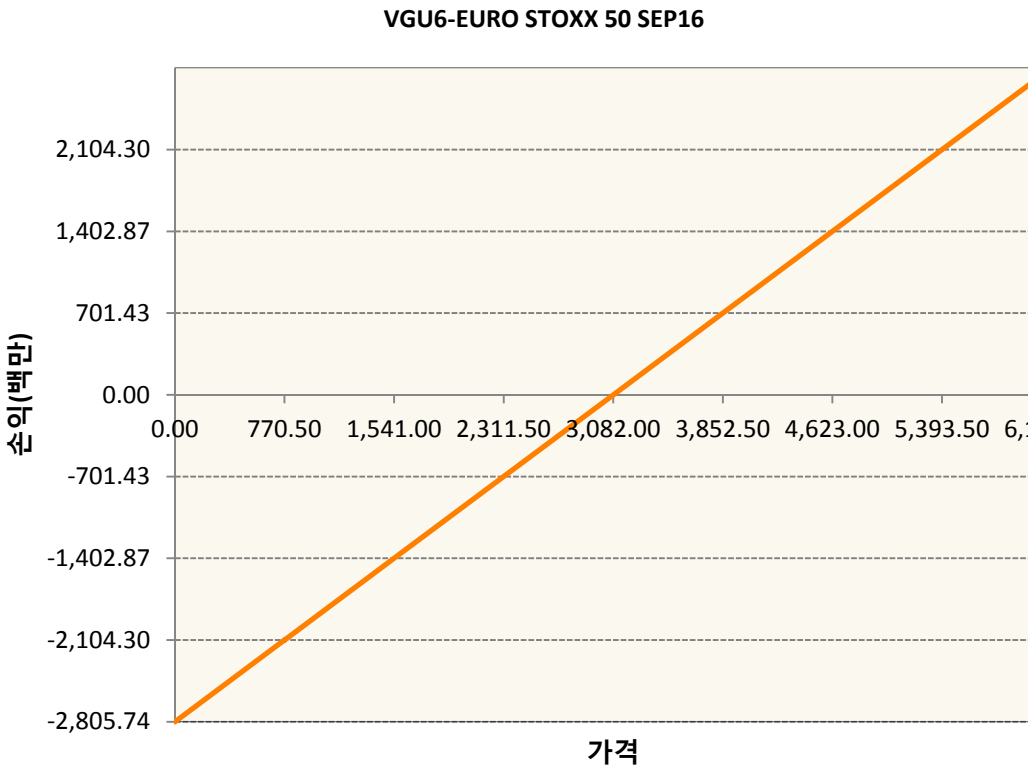
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,806	0	2,806	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGU6	EURO STOXX 50 SEP16	224

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

(단위:백만원)

277

공시일	2016-09-06
기준일	2016-09-05

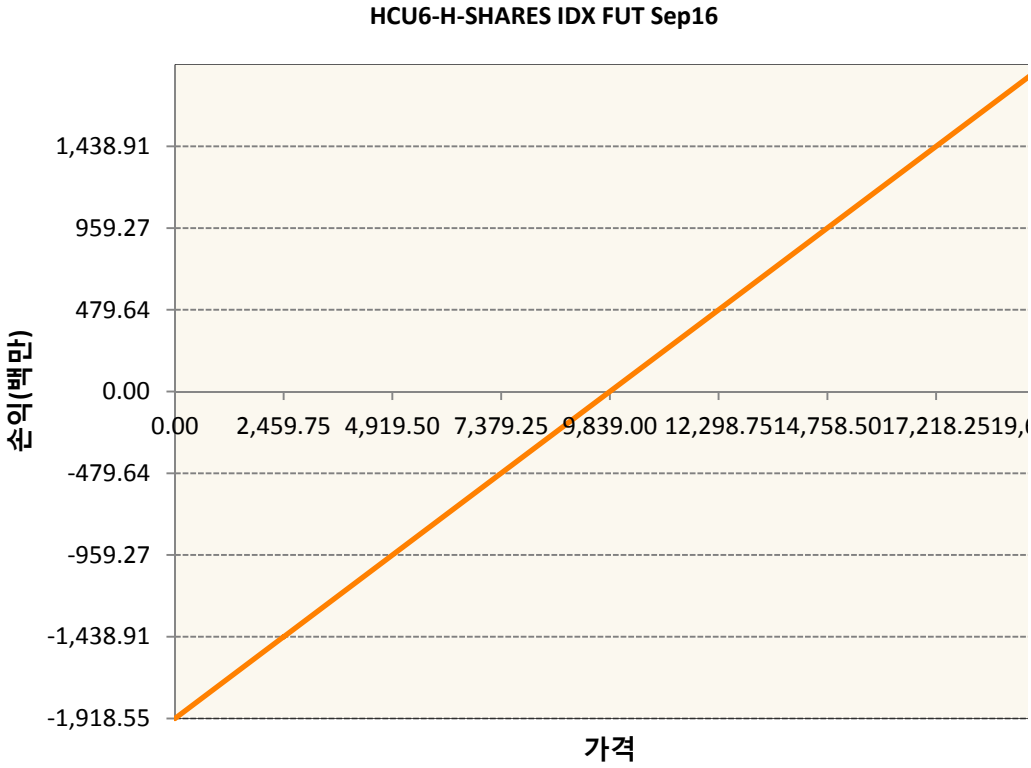
차이나인덱스모(주식-파생형)

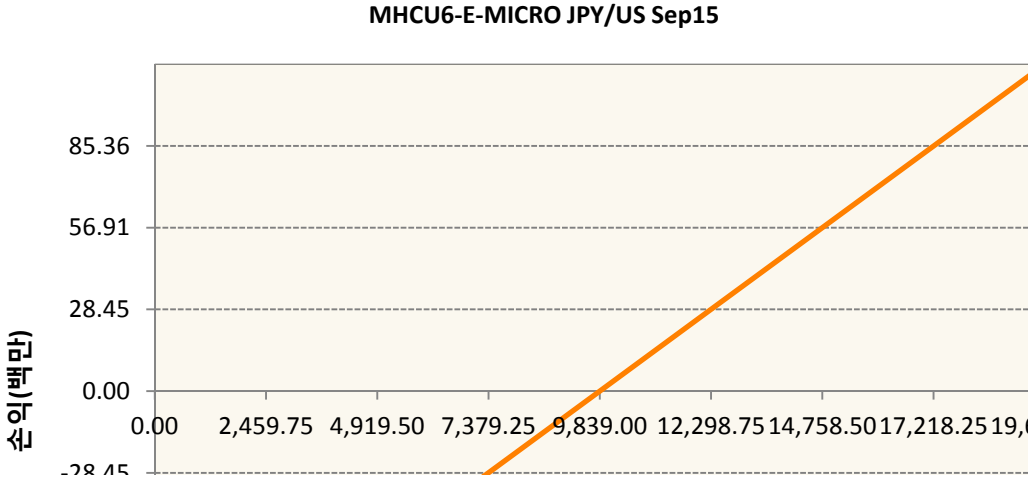
1. 계약금액

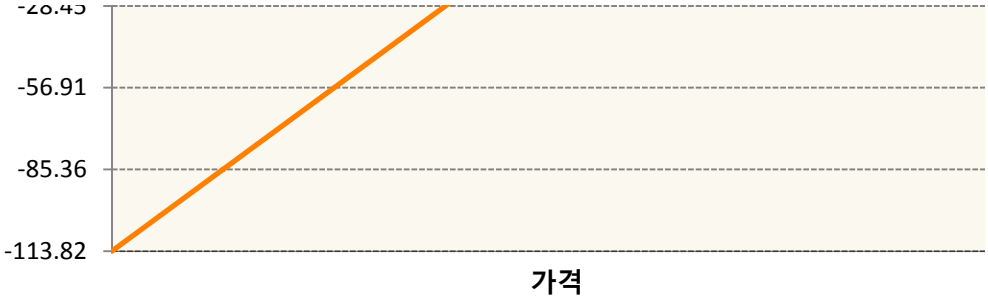
(단위:백만원)

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	114	0	114	
누계	유가증권	선물	1,919	0	1,919	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCU6	H-SHARES IDX FUT Sep16	153
MHCU6	E-MICRO JPY/US Sep15	9

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	220

공시일	2016-09-06
기준일	2016-09-05

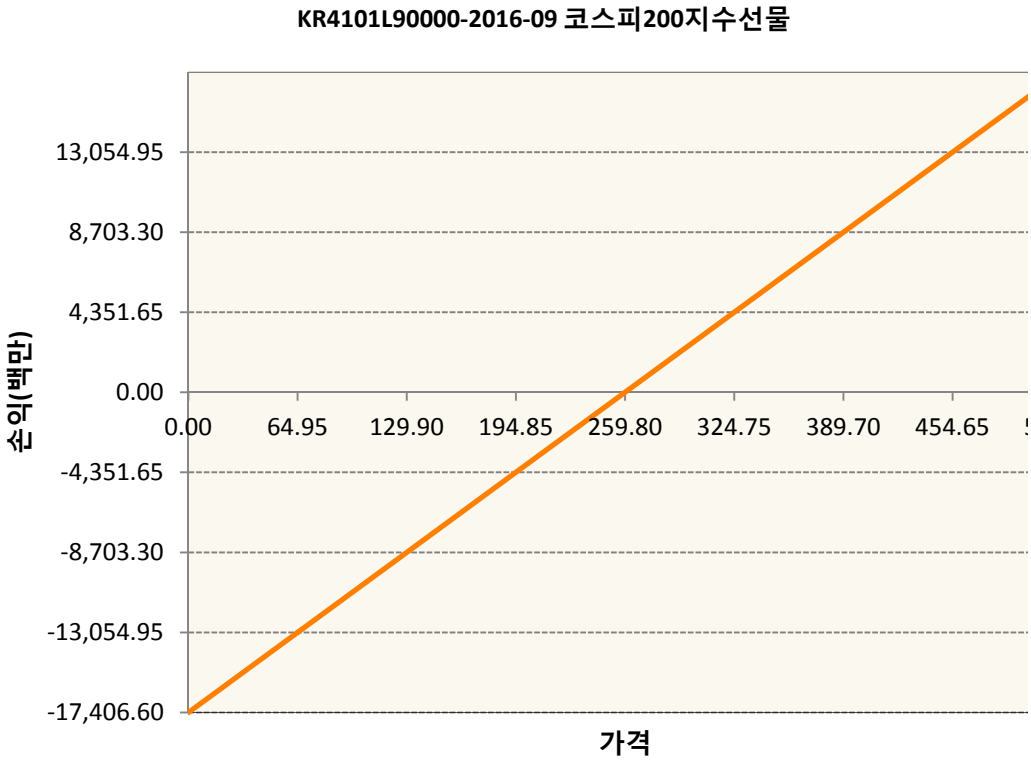
커버드콜(주식혼합-파생형)

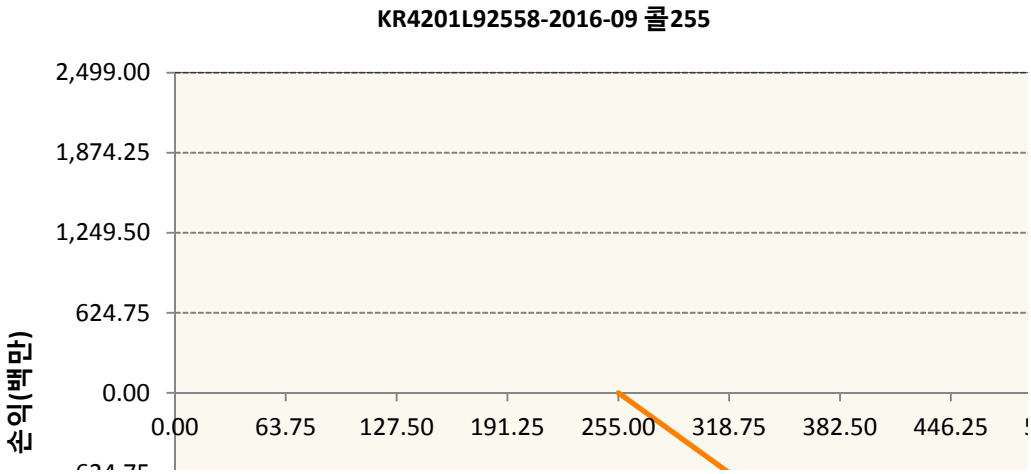
1. 계약금액

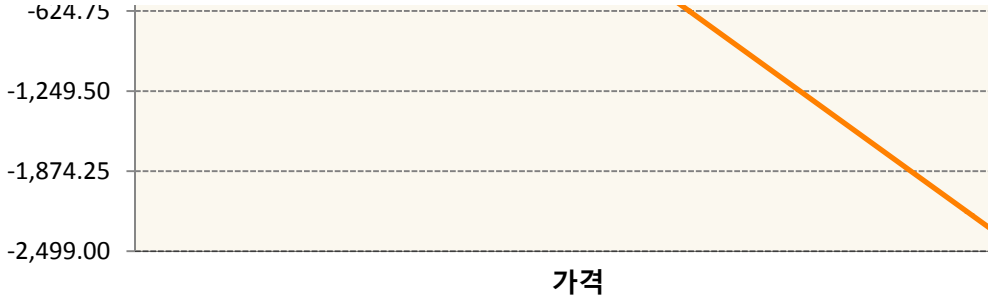
(단위:백만원)

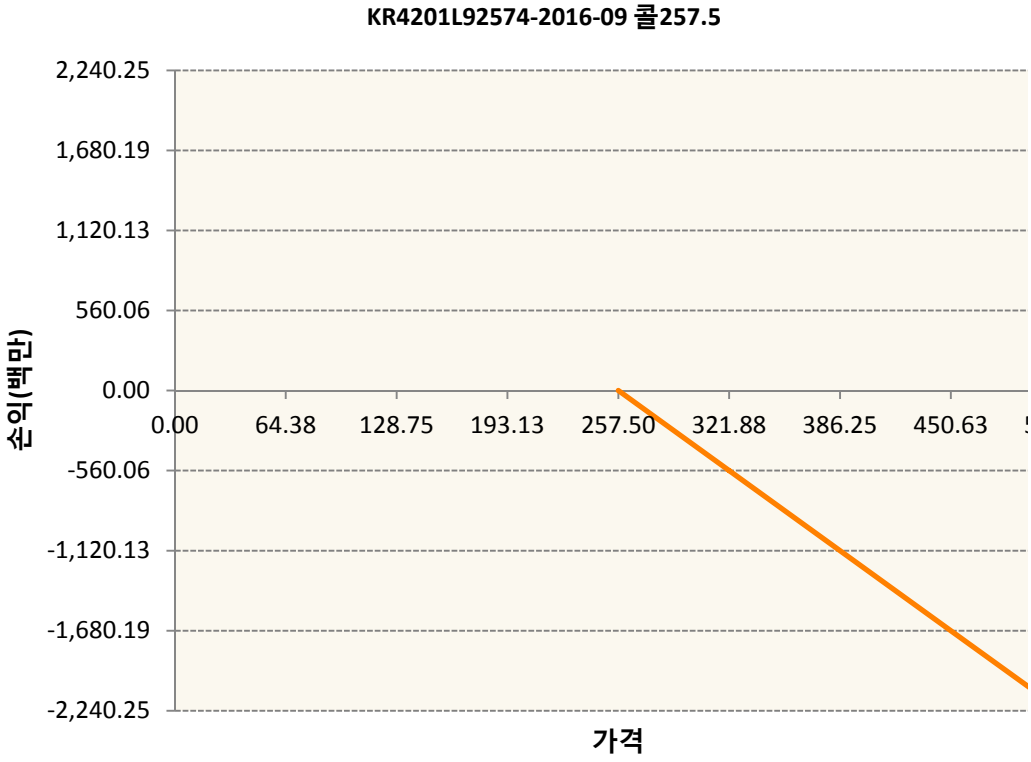
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	1,039	0	1,039	장내
신규	유가증권	옵션	0	208	-208	장내
누계	유가증권	선물	17,407	0	17,407	장내
누계	유가증권	옵션	0	4,739	-4,739	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101L900 2016-09 코스피200지수선물							1,392
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,392	-1,392	-1,392	-1,392	-1,392	-1,392	-1,392
-5.33%	-928	-928	-928	-928	-928	-928	-928
-2.67%	-464	-464	-464	-464	-464	-464	-464
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	464	464	464	464	464	464	464
5.33%	928	928	928	928	928	928	928
8.00%	1,392	1,392	1,392	1,392	1,392	1,392	1,392
KR4201L925 2016-09 콜255							1,016
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	229	229	229	229	229	229	229
-5.33%	229	229	229	229	229	229	229
-2.67%	224	222	219	217	214	211	208
0%	1	1	1	0	-1	-2	-3
2.67%	-337	-337	-337	-337	-337	-337	-337
5.33%	-677	-677	-677	-677	-677	-677	-677
8.00%	-1,016	-1,016	-1,016	-1,016	-1,016	-1,016	-1,016
KR4201L925 2016-09 콜257.5							891

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	106	106	106	106	106	106	106
-5.33%	106	106	106	106	106	106	106
-2.67%	105	105	105	104	104	103	102
0%	7	5	3	0	-3	-6	-8
2.67%	-288	-288	-288	-288	-288	-288	-289
5.33%	-590	-590	-590	-590	-590	-590	-590
8.00%	-891	-891	-891	-891	-891	-891	-891

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

3,813

공시일	2016-09-06
기준일	2016-09-05

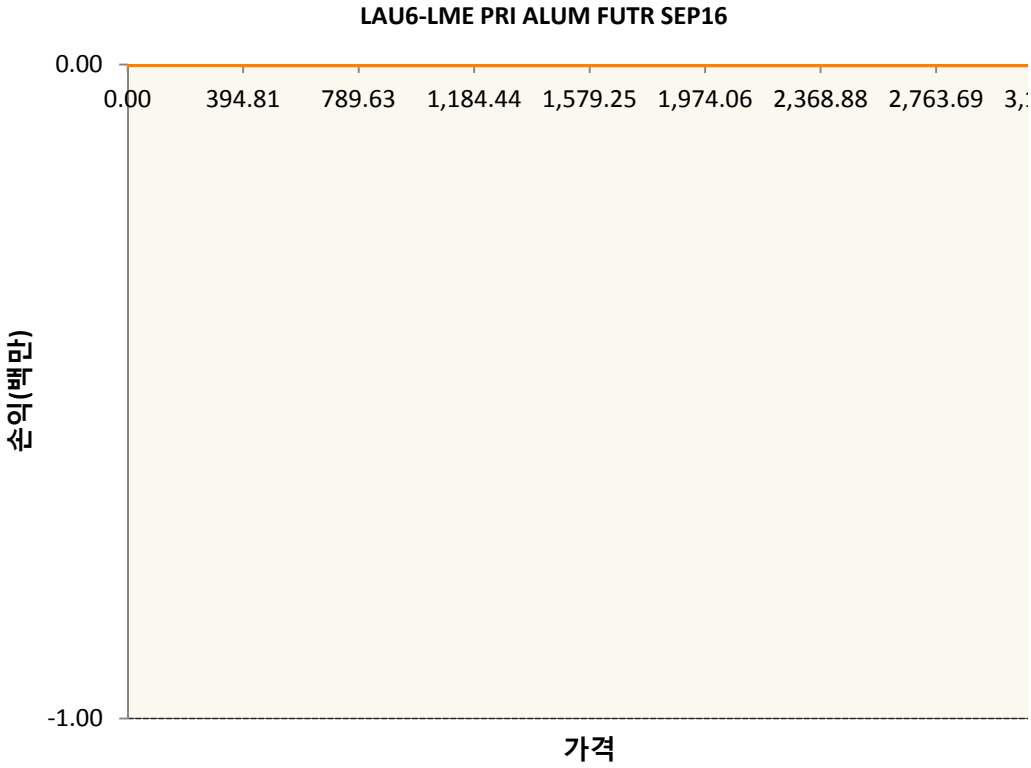
메탈인덱스플러스모(채권-파생형)

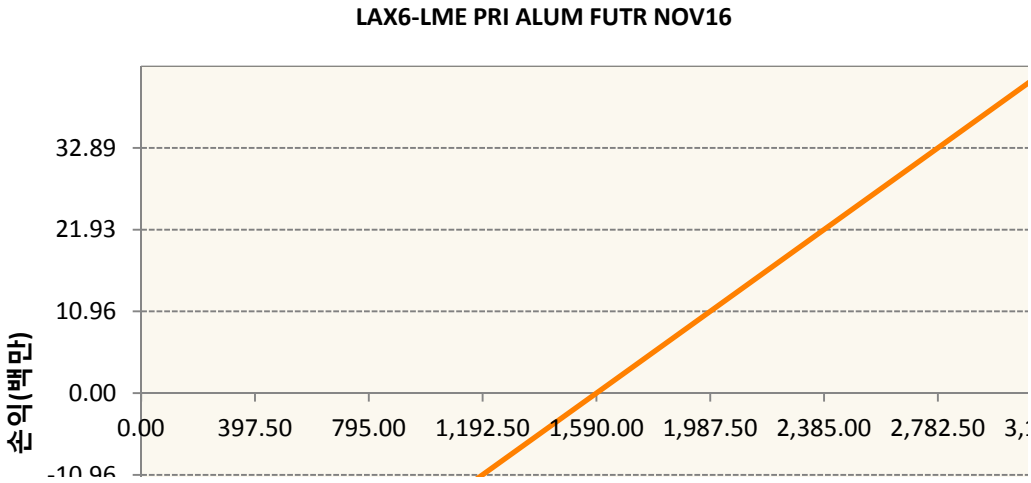
1. 계약금액

(단위:백만원)

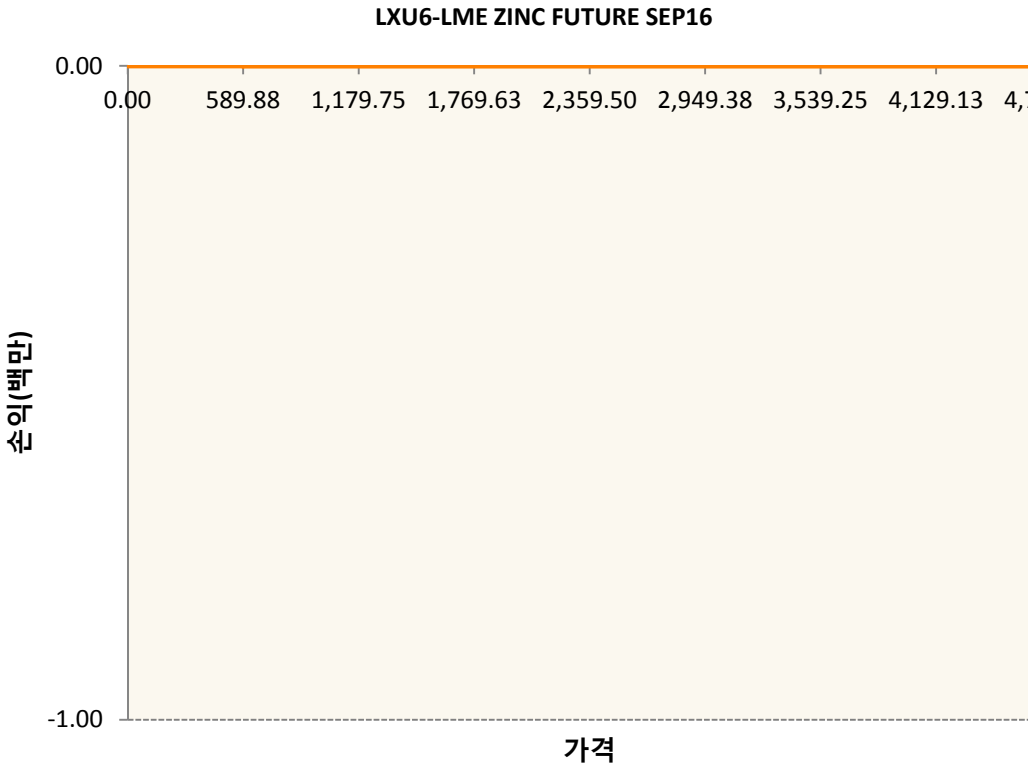
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	선물	유가증권	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	선물	유가증권	43	0	43	
누계	유가증권	선물	321	171	151	

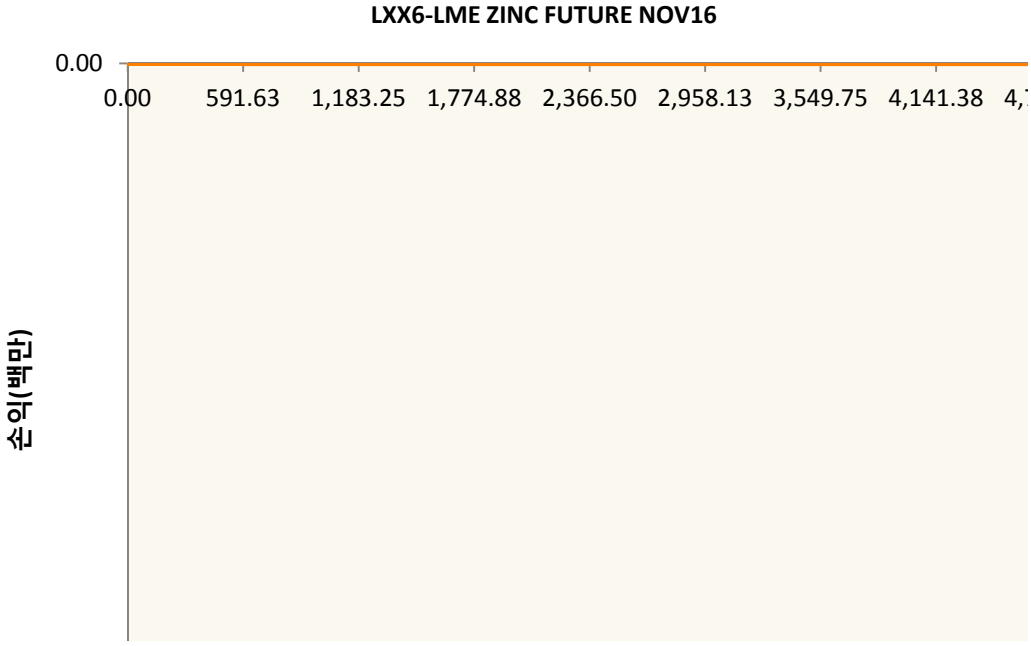
2. 만기시점의 손익구조

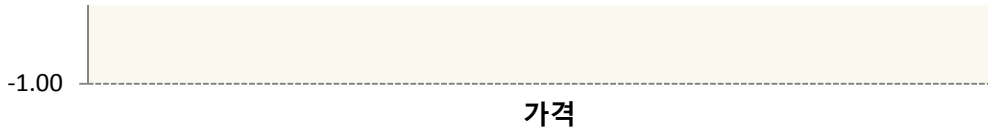


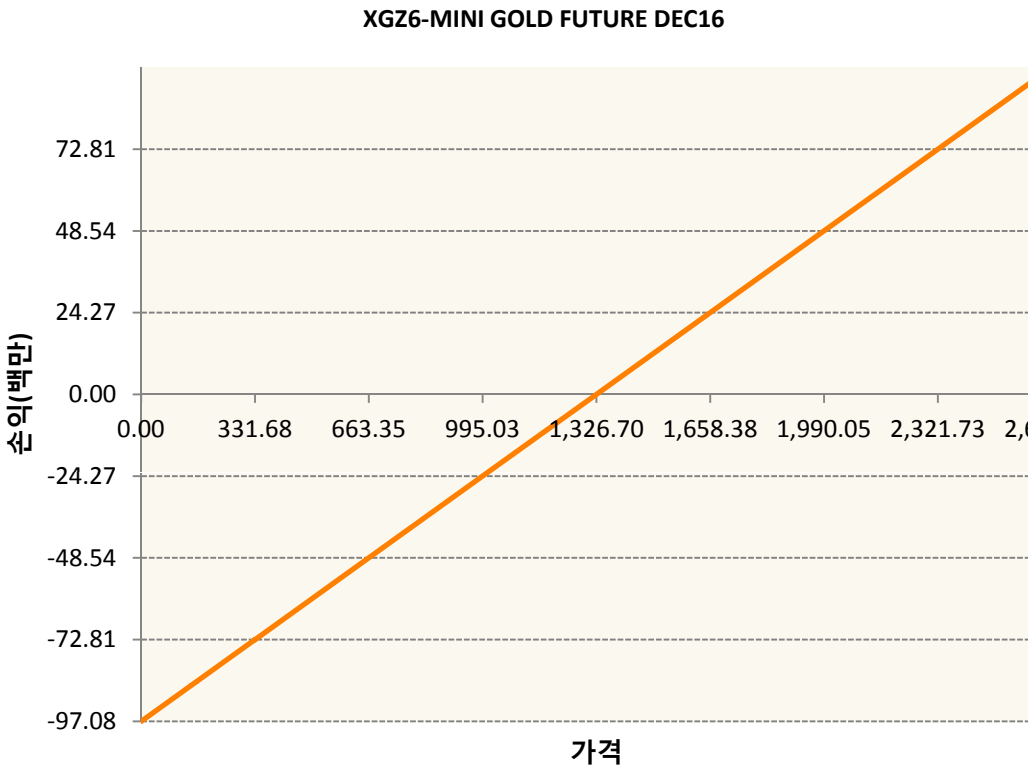


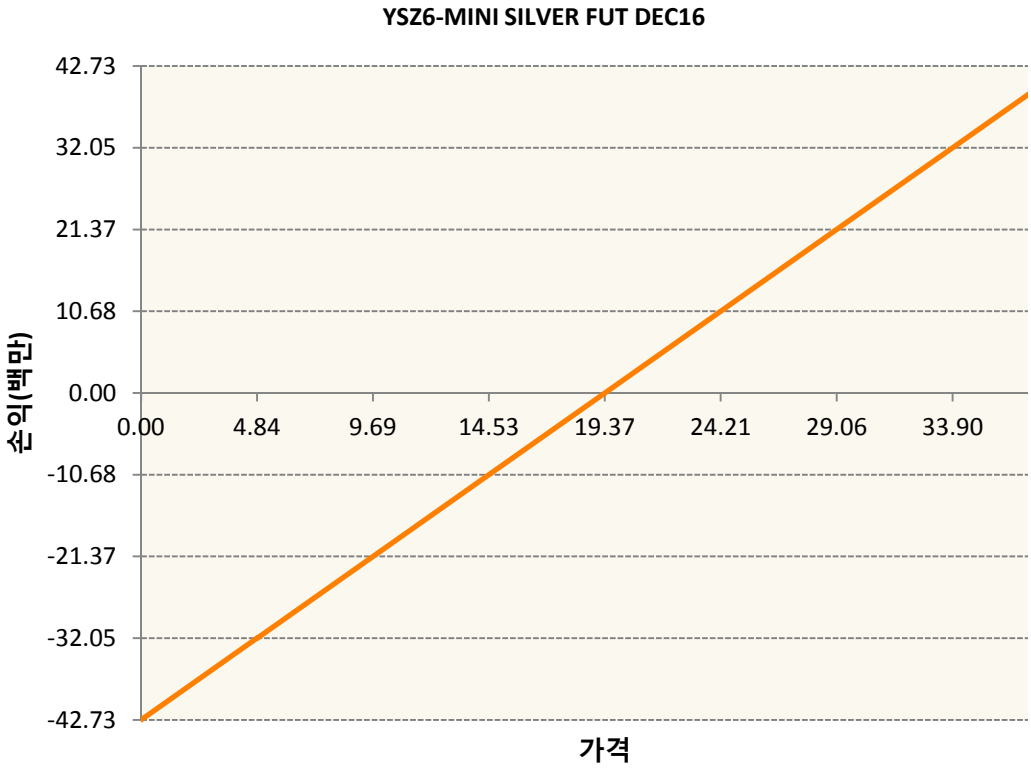

-10.96
-21.93
-32.89
-43.85
가격


LXU6-LME ZINC FUTURE SEP16
0.00
0.00
589.88
1,179.75
1,769.63
2,359.50
2,949.38
3,539.25
4,129.13
-1.00
순익(백만)
가격


LXX6-LME ZINC FUTURE NOV16
0.00
0.00
591.63
1,183.25
1,774.88
2,366.50
2,958.13
3,549.75
4,141.38
순익(백만)


-1.00
가격


XGZ6-MINI GOLD FUTURE DEC16
72.81
48.54
24.27
0.00
-24.27
-48.54
-72.81
-97.08
순익(백만)
0.00
331.68
663.35
995.03
1,326.70
1,658.38
1,990.05
2,321.73
가격


YSZ6-MINI SILVER FUT DEC16
42.73
32.05
21.37
10.68
0.00
-10.68
-21.37
-32.05
-42.73
순익(백만)
0.00
4.84
9.69
14.53
19.37
24.21
29.06
33.90
가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

LAU6	LME PRI ALUM FUTR SEP16	0
LAX6	LME PRI ALUM FUTR NOV16	4
LXU6	LME ZINC FUTURE SEP16	1
LXX6	LME ZINC FUTURE NOV16	0.2
XGZ6	MINI GOLD FUTURE DEC16	8
YSZ6	MINI SILVER FUT DEC16	3

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

14

공시일	2016-09-06
기준일	2016-09-05

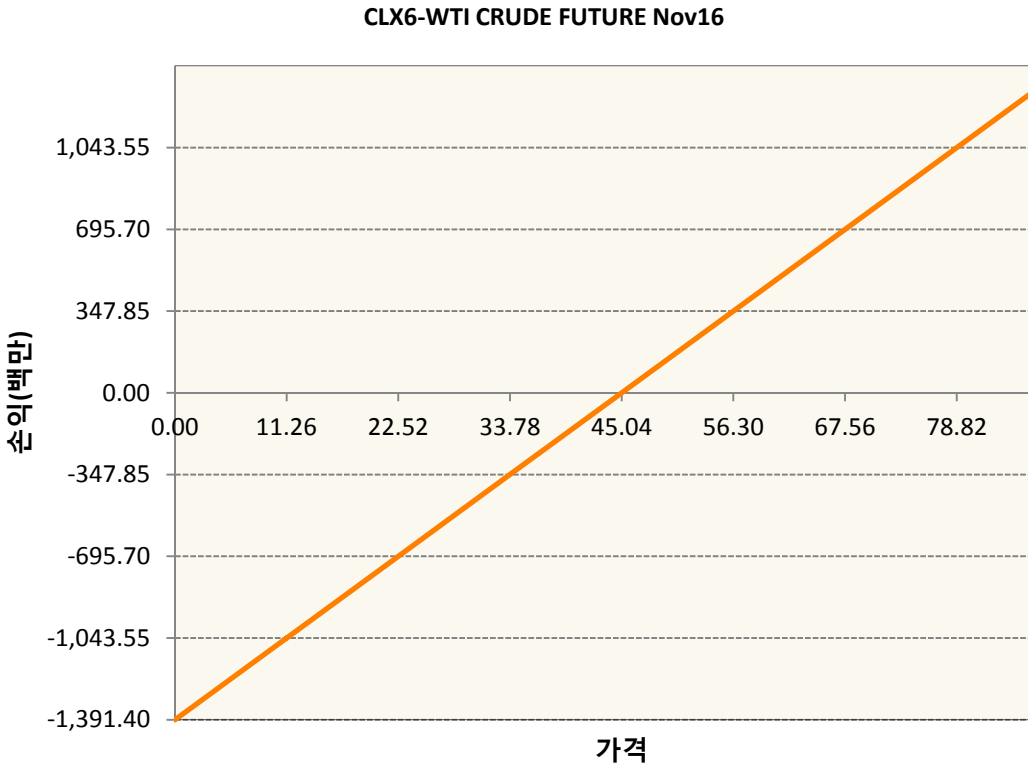
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

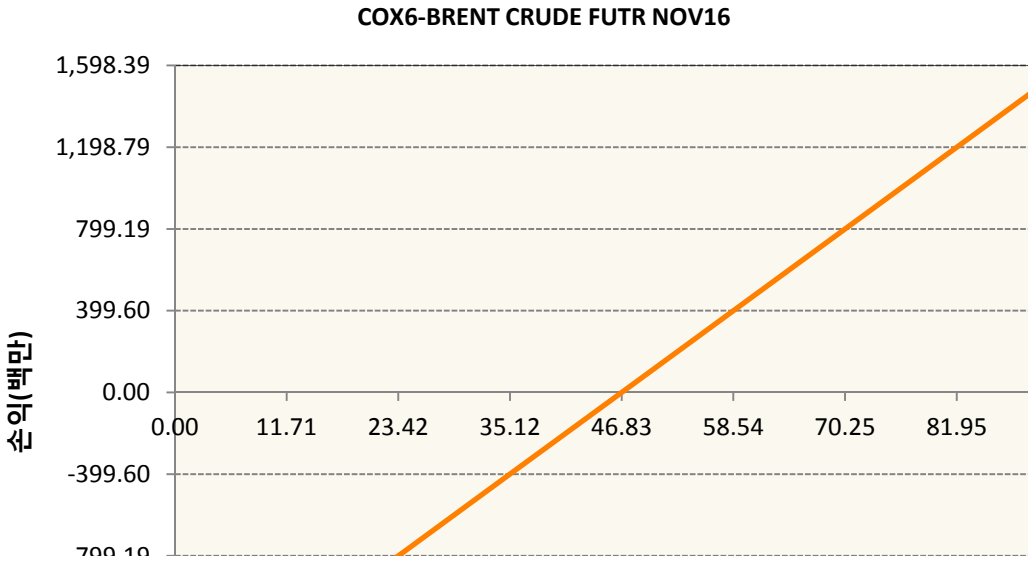
1. 계약금액

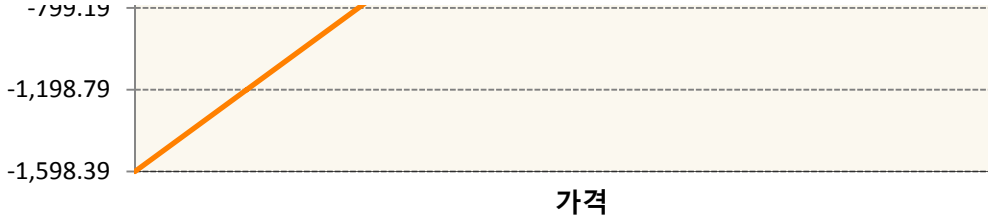
(단위:백만원)

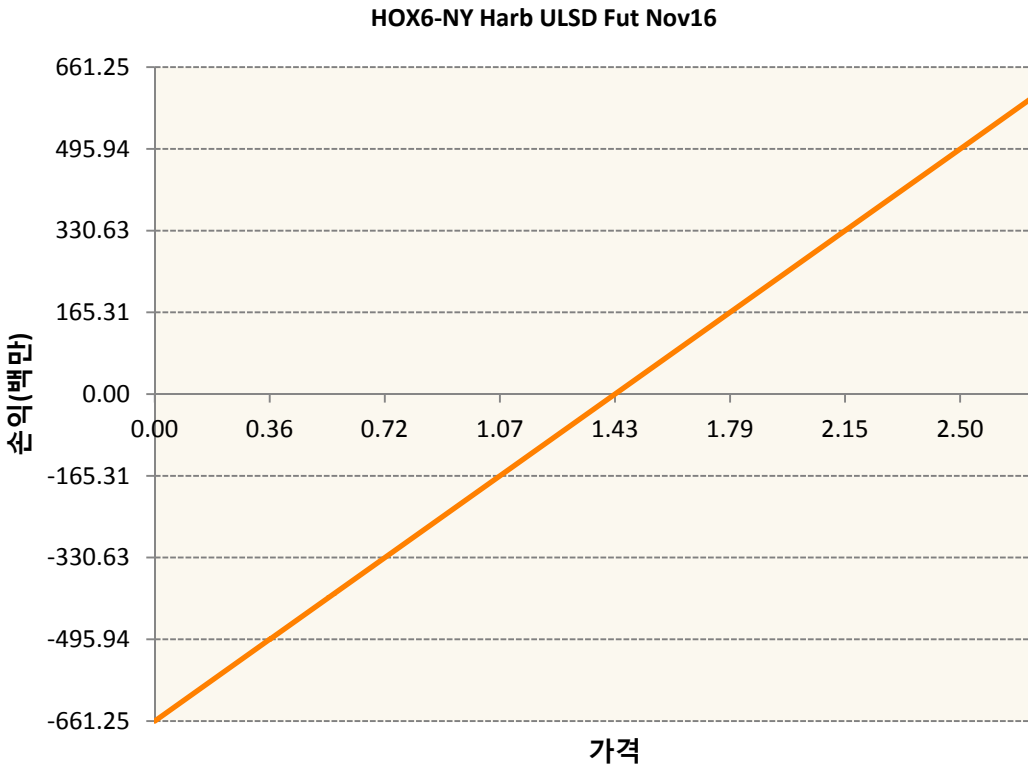
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	5,948	0	5,948	

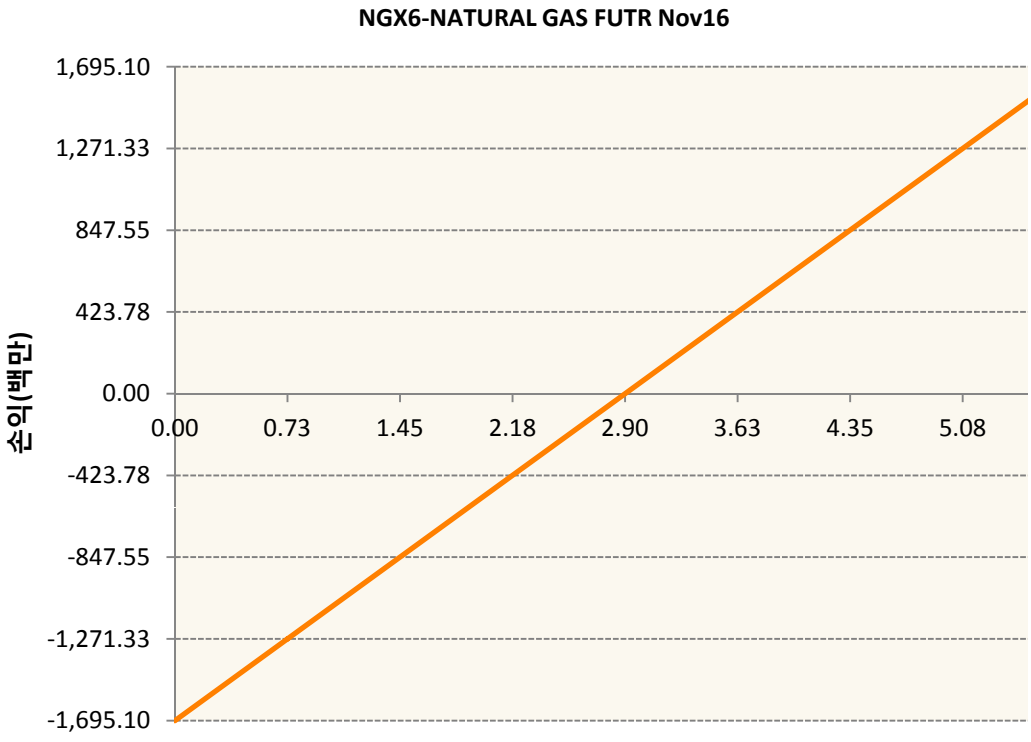
2. 만기시점의 손익구조



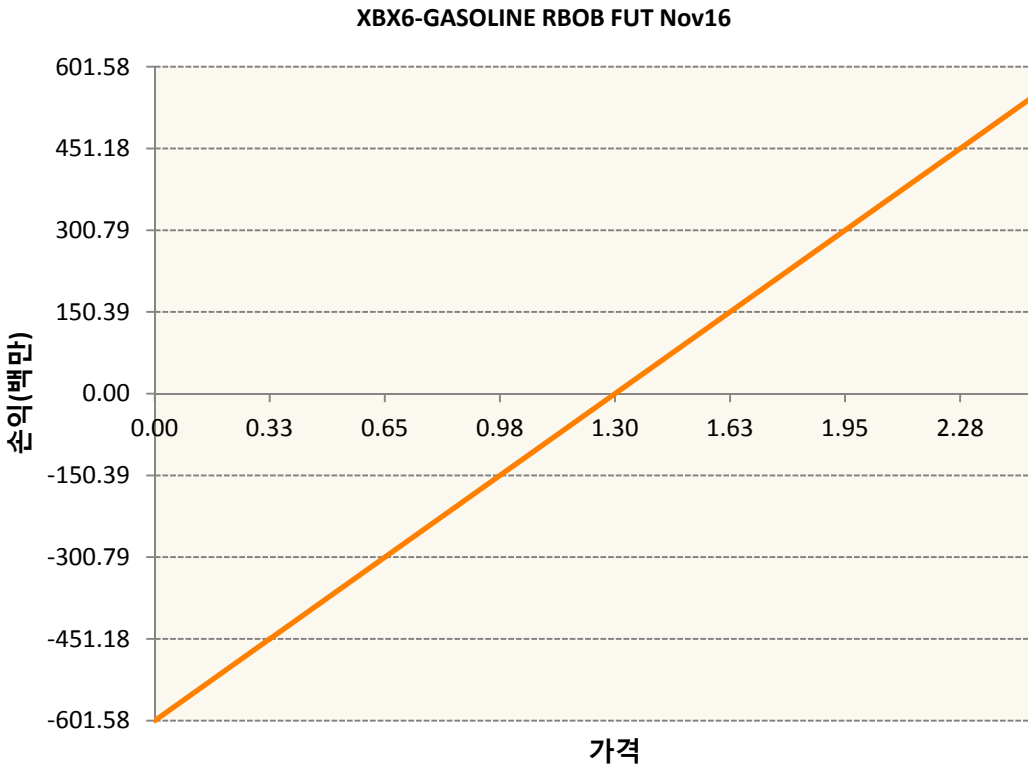



-1,198.79
-1,598.39
가격


HOX6-NY Harb ULSD Fut Nov16
661.25
495.94
330.63
165.31
0.00
-165.31
-330.63
-495.94
-661.25
0.00
0.36
0.72
1.07
1.43
1.79
2.15
2.50
손익(백만)
가격


NGX6-NATURAL GAS FUTR Nov16
1,695.10
1,271.33
847.55
423.78
0.00
-423.78
-847.55
-1,271.33
-1,695.10
0.00
0.73
1.45
2.18
2.90
3.63
4.35
5.08
손익(백만)

가격



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
CLX6	WTI CRUDE FUTURE Nov16	111
COX6	BRENT CRUDE FUTR NOV16	128
HOX6	NY Harb ULSD Fut Nov16	53
NGX6	NATURAL GAS FUTR Nov16	136
XBX6	GASOLINE RBOB FUT Nov16	48

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,060

공시일	2016-09-06
기준일	2016-09-05

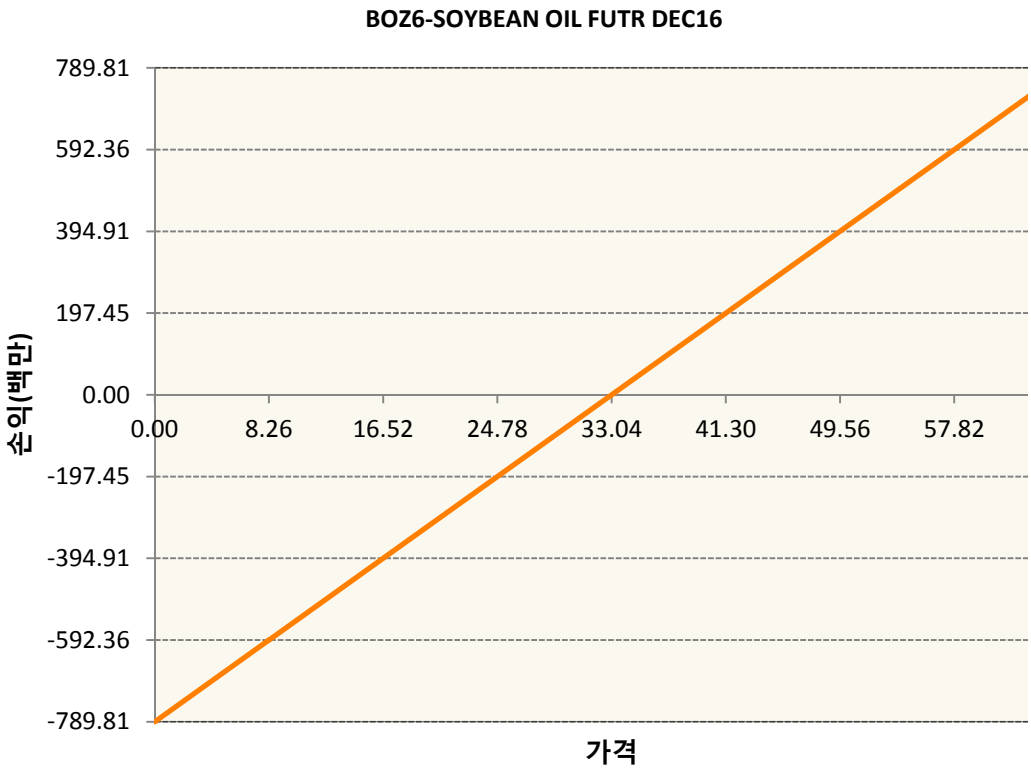
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

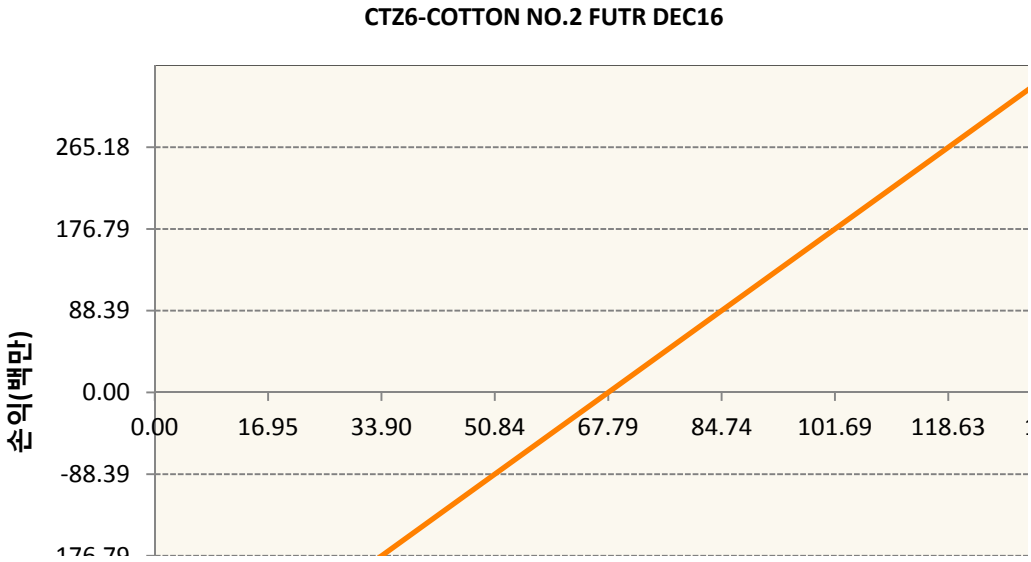
1. 계약금액

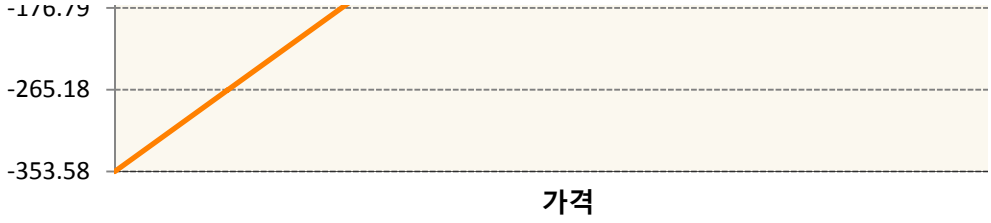
(단위:백만원)

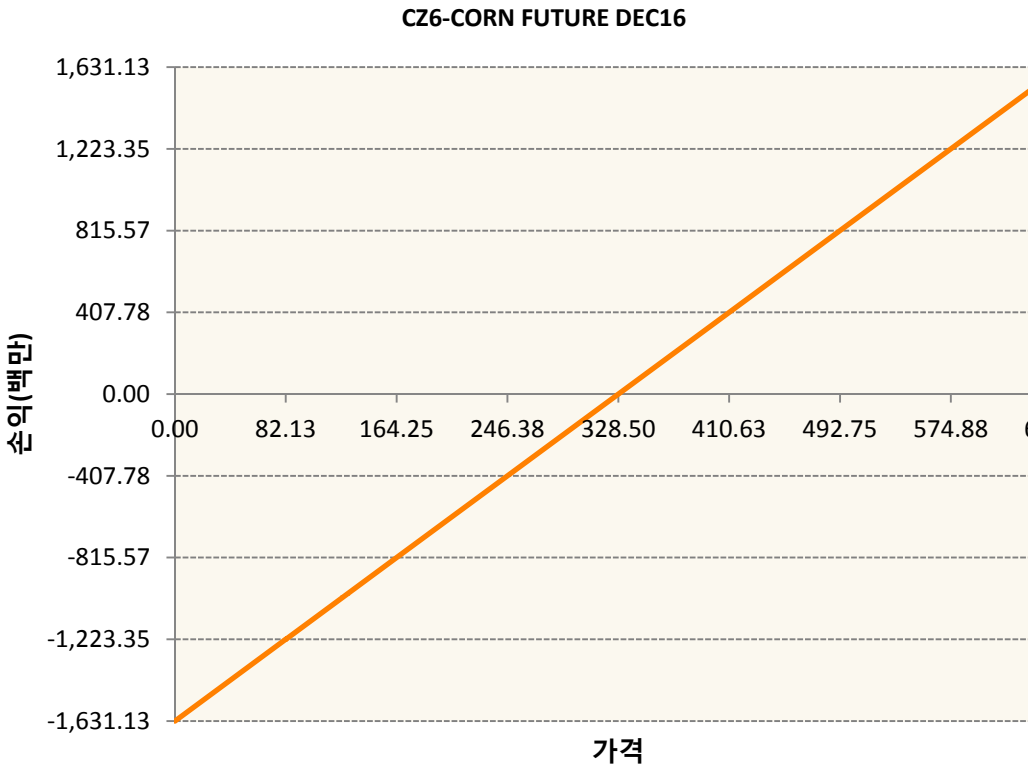
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	8,082	0	8,082	

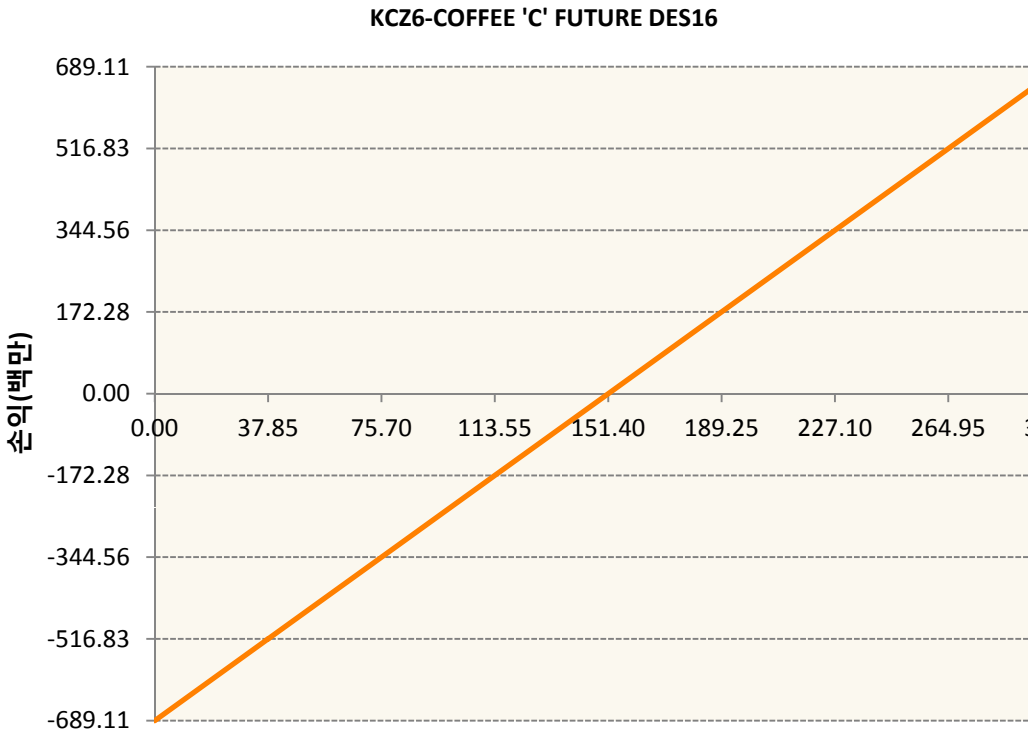
2. 만기시점의 손익구조



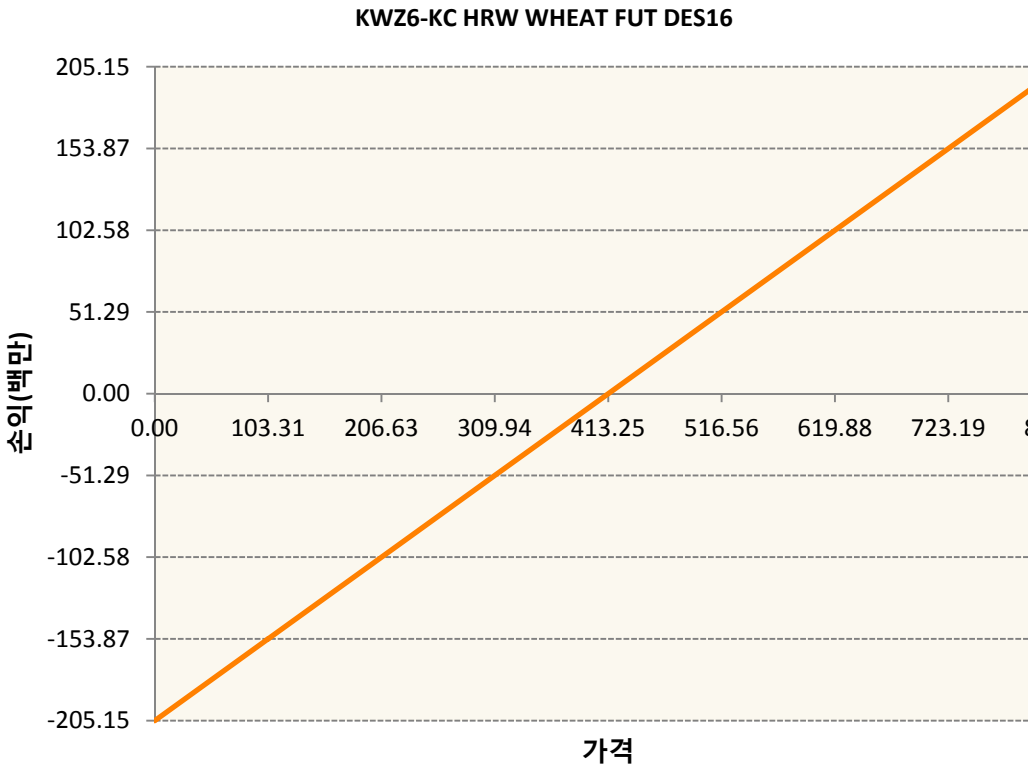


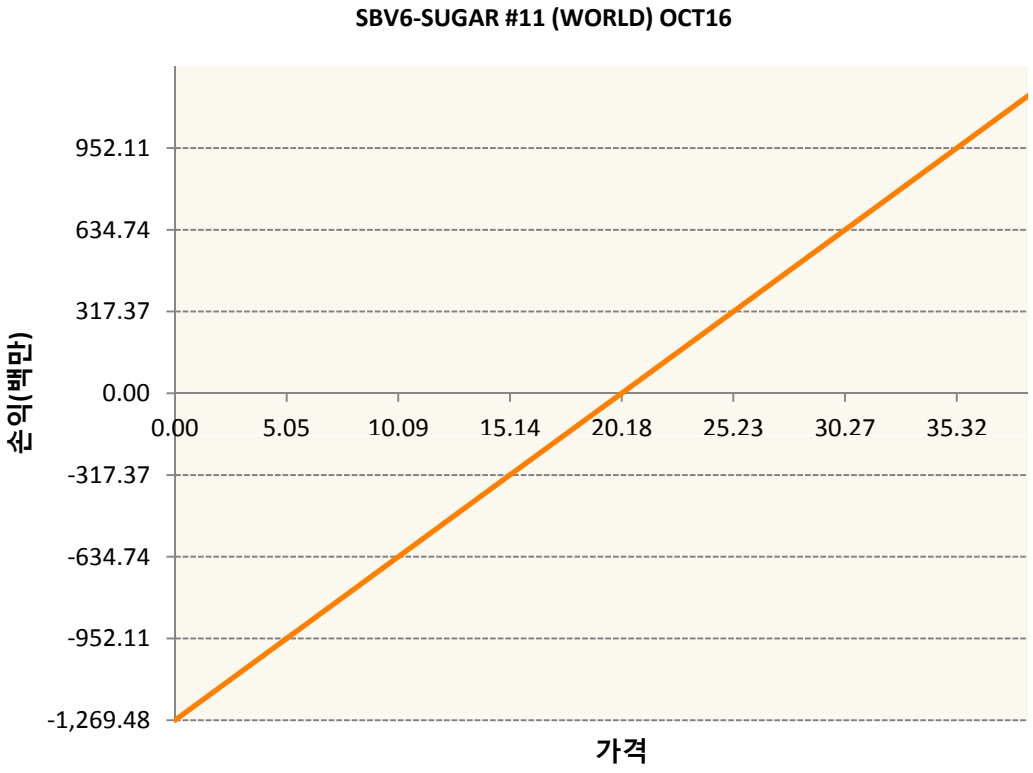

-265.18
-353.58
가격

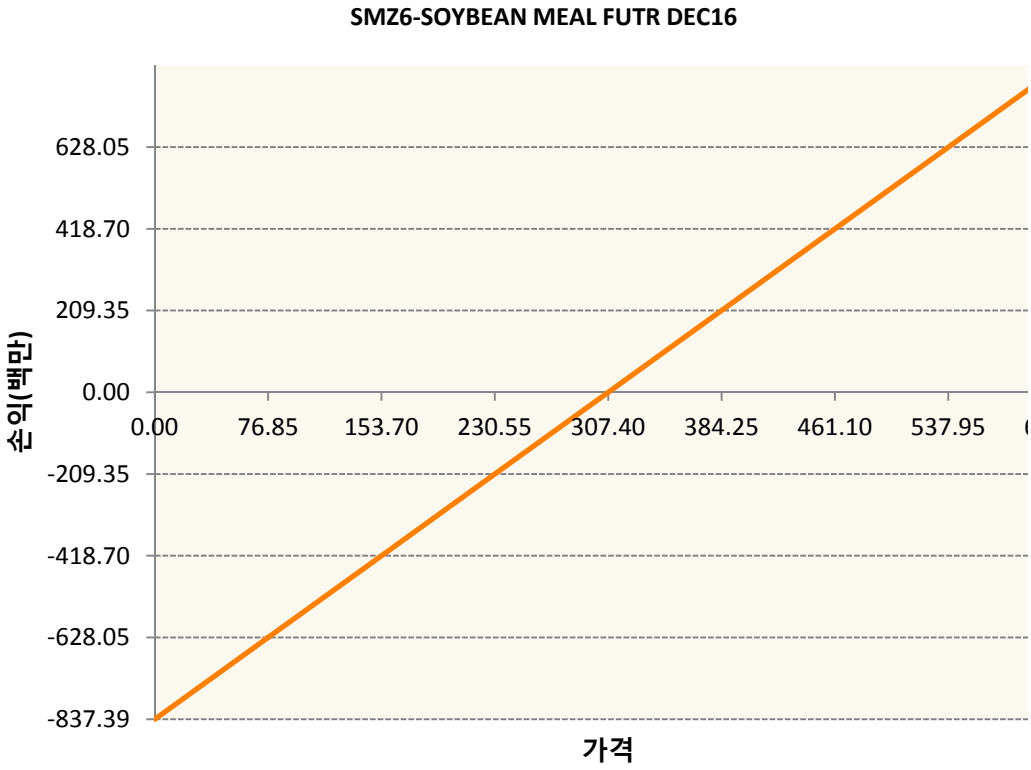

CZ6-CORN FUTURE DEC16
1,631.13
1,223.35
815.57
407.78
0.00
-407.78
-815.57
-1,223.35
-1,631.13
0.00
82.13
164.25
246.38
328.50
410.63
492.75
574.88
순익(백만)
가격

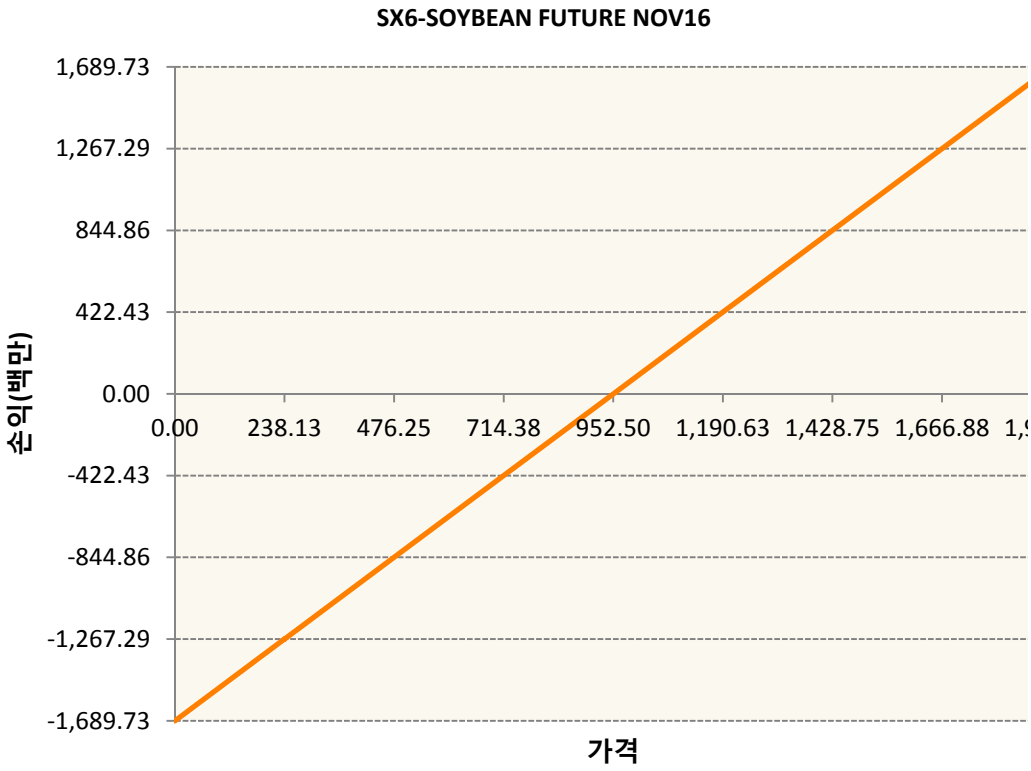

KCZ6-COFFEE 'C' FUTURE DES16
689.11
516.83
344.56
172.28
0.00
-172.28
-344.56
-516.83
-689.11
0.00
37.85
75.70
113.55
151.40
189.25
227.10
264.95
순익(백만)

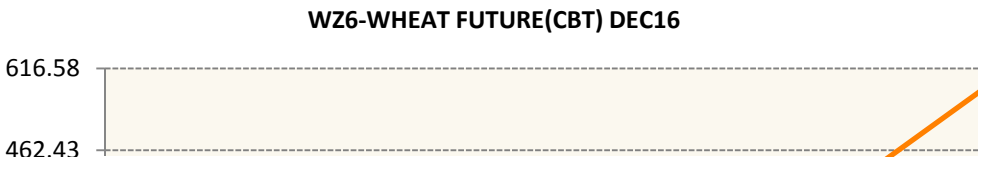
가격

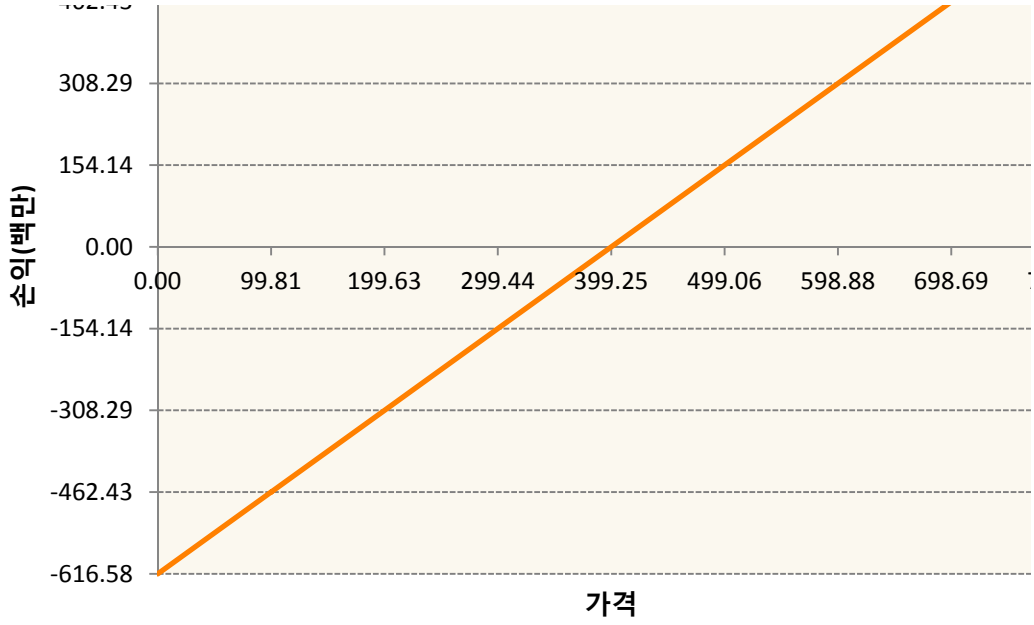

KWZ6-KC HRW WHEAT FUT DES16
205.15
153.87
102.58
51.29
0.00
-51.29
-102.58
-153.87
-205.15
0.00
103.31
206.63
309.94
413.25
516.56
619.88
723.19
손익(백만)
가격


SBV6-SUGAR #11 (WORLD) OCT16
952.11
634.74
317.37
0.00
-317.37
-634.74
-952.11
-1,269.48
0.00
5.05
10.09
15.14
20.18
25.23
30.27
35.32
손익(백만)
가격


SMZ6-SOYBEAN MEAL FUTR DEC16
628.05
418.70
209.35
0.00
-209.35
-418.70
-628.05
-837.39
0.00
76.85
153.70
230.55
307.40
384.25
461.10
537.95
손익(백만)
가격


SX6-SOYBEAN FUTURE NOV16
1,689.73
1,267.29
844.86
422.43
0.00
-422.43
-844.86
-1,267.29
-1,689.73
0.00
238.13
476.25
714.38
952.50
1,190.63
1,428.75
1,666.88
손익(백만)
가격


WZ6-WHEAT FUTURE(CBT) DEC16
616.58
462.43



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

BOZ6	SOYBEAN OIL FUTR DEC16	63
CTZ6	COTTON NO.2 FUTR DEC16	28
CZ6	CORN FUTURE DEC16	130
KCZ6	COFFEE 'C' FUTURE DES16	55
KWZ6	KC HRW WHEAT FUT DES16	16
SBV6	SUGAR #11 (WORLD) OCT16	102
SMZ6	SOYBEAN MEAL FUTR DEC16	67
SX6	SOYBEAN FUTURE NOV16	135
WZ6	WHEAT FUTURE(CBT) DEC16	49

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

804