공시일	2016-09-08
기준일	2016-09-07

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	2016-09-08
기준일	2016-09-07

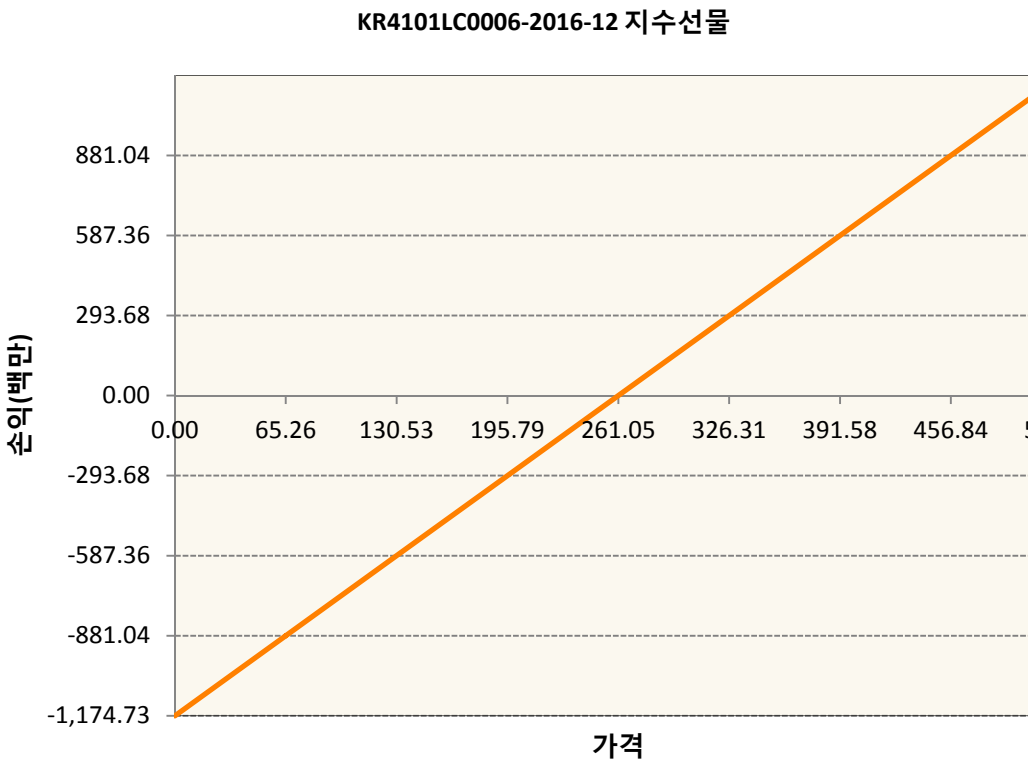
스마트인덱스모

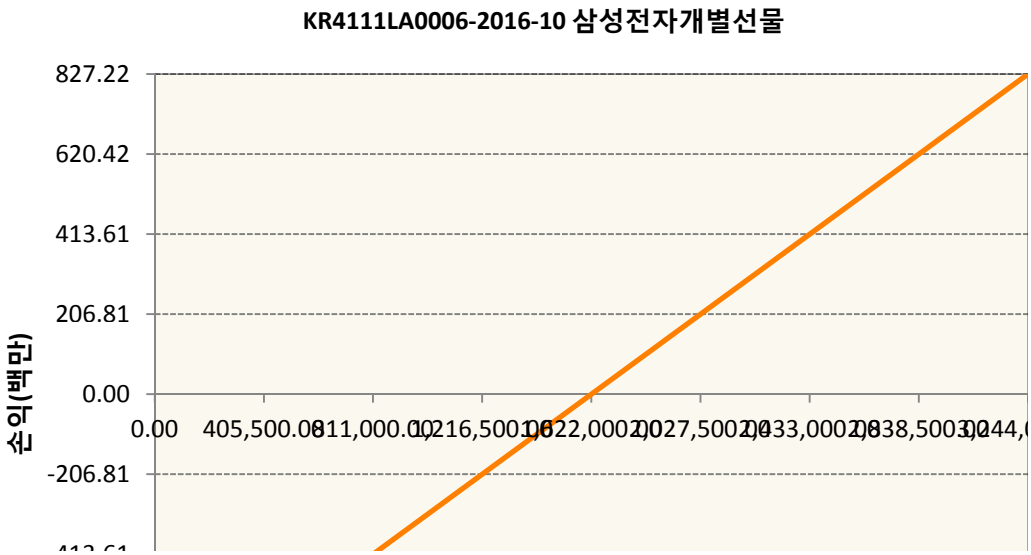
1. 계약금액

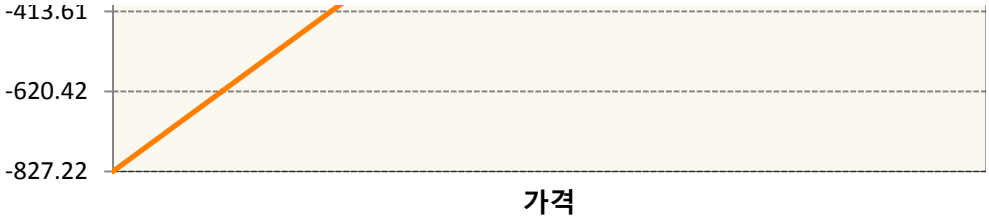
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	840	0	840	장내
누계	유가증권	선물	2,002	0	2,002	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101LC00 2016-12 지수선물							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
KR4111LA00 2016-10 삼성전자개별선물							66
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-66	-66	-66	-66	-66	-66	-66
-5.33%	-44	-44	-44	-44	-44	-44	-44
-2.67%	-22	-22	-22	-22	-22	-22	-22
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	22	22	22	22	22	22	22
5.33%	44	44	44	44	44	44	44
8.00%	66	66	66	66	66	66	66

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

139

공시일	2016-09-08
기준일	2016-09-07

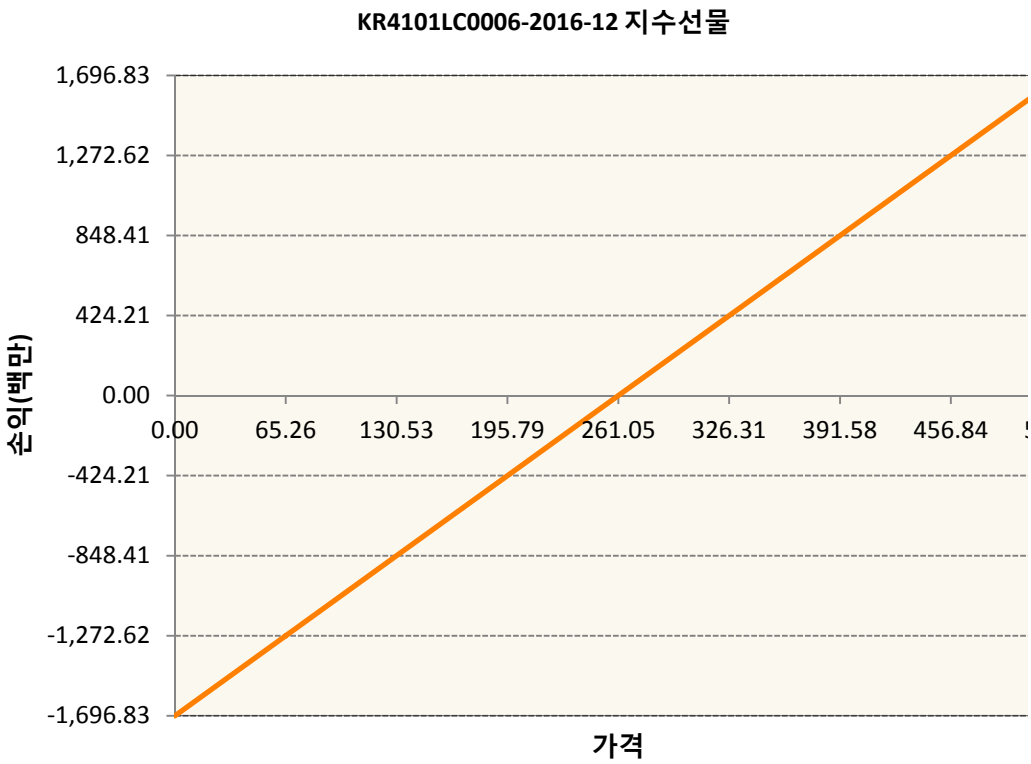
스마트레버리지목표전환형1호

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	1,697	0	1,697	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101LC00 2016-12 지수선물							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	2016-09-08
기준일	2016-09-07

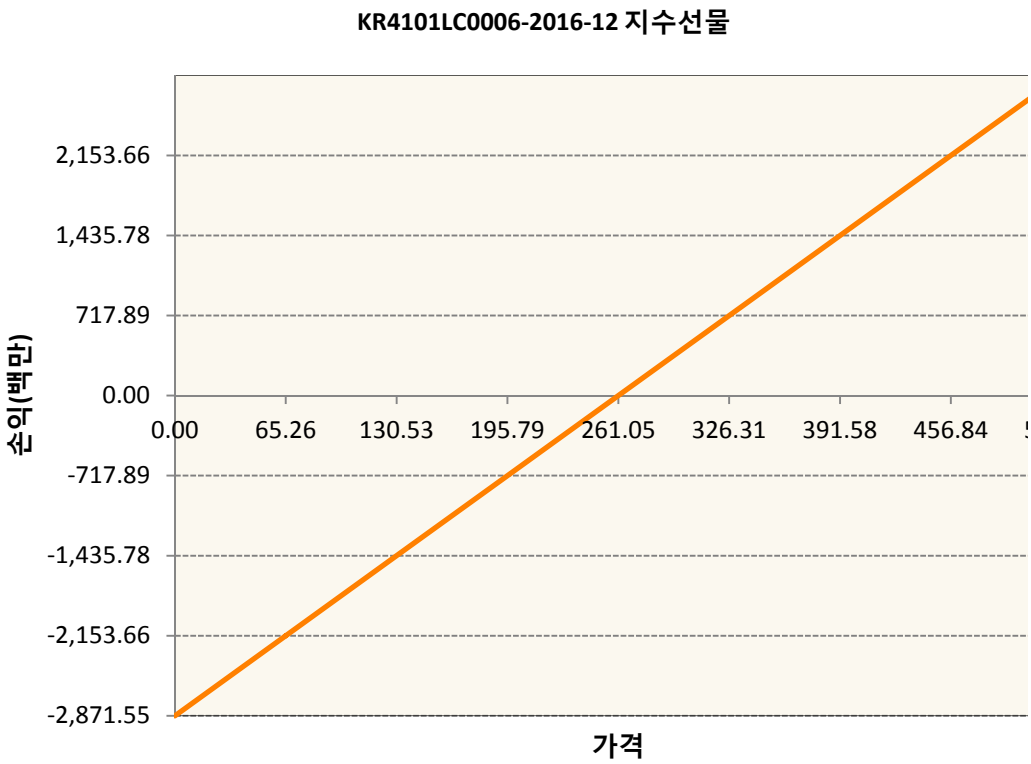
1.3배 레버리지 인덱스(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	394	653	-259	장내
누계	유가증권	선물	2,872	0	2,872	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101LC00 2016-12 지수선물							229
	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%	-153	-153	-153	-153	-153	-153	-153
-2.67%	-76	-76	-76	-76	-76	-76	-76
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	76	76	76	76	76	76	76
5.33%	153	153	153	153	153	153	153
8.00%	229	229	229	229	229	229	229

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

180

공시일	2016-09-08
기준일	2016-09-07

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	896

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

749

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2016-09-08
기준일	2016-09-07

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	407

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

883

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2016-09-08
기준일	2016-09-07

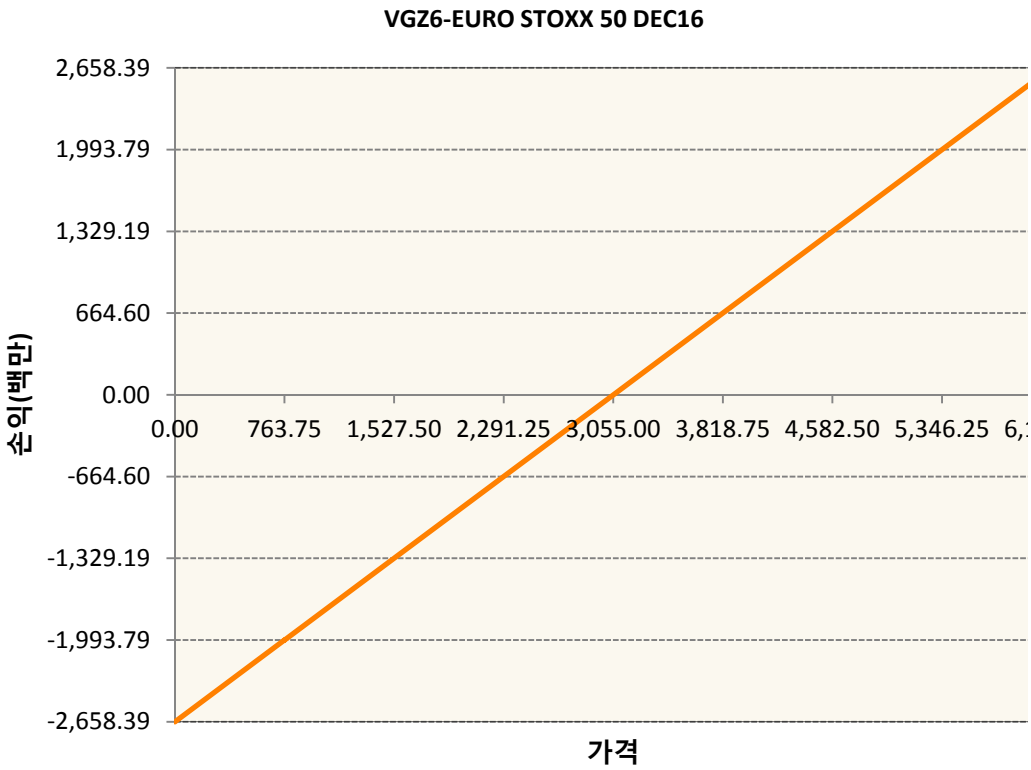
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,658	0	2,658	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGZ6	EURO STOXX 50 DEC16	213

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

(단위:백만원)

263

공시일	2016-09-08
기준일	2016-09-07

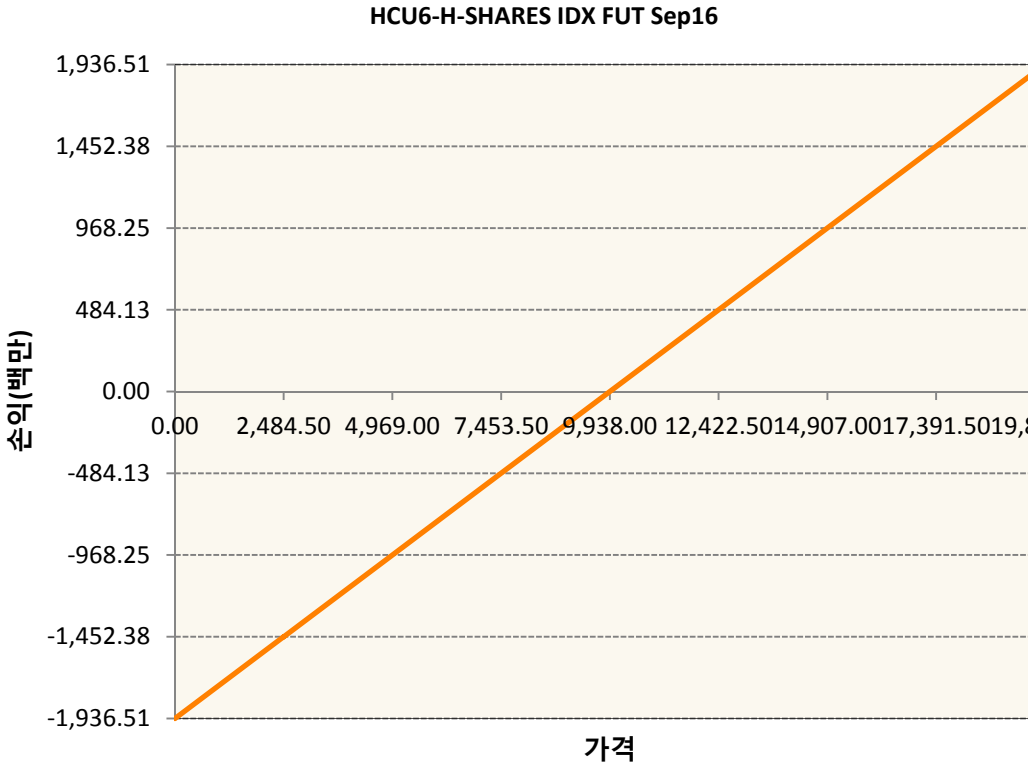
차이나인덱스모(주식-파생형)

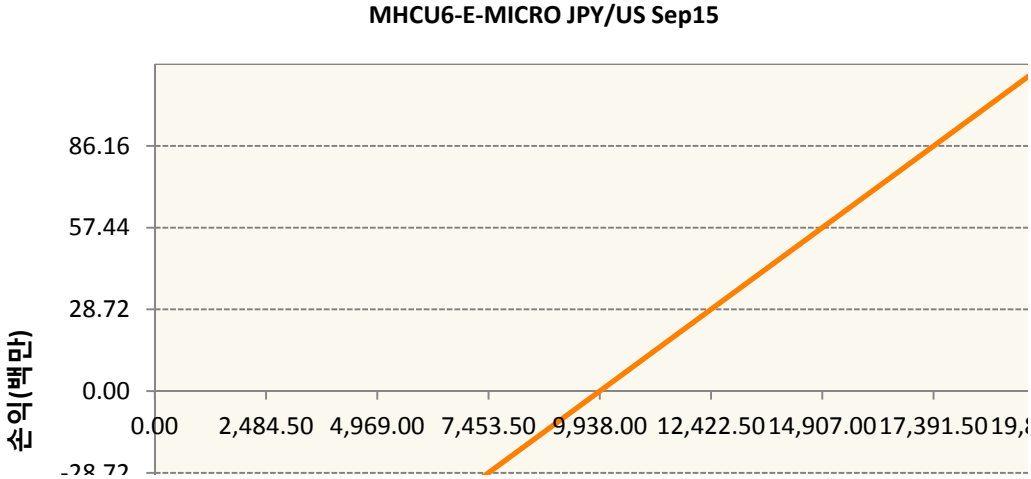
1. 계약금액

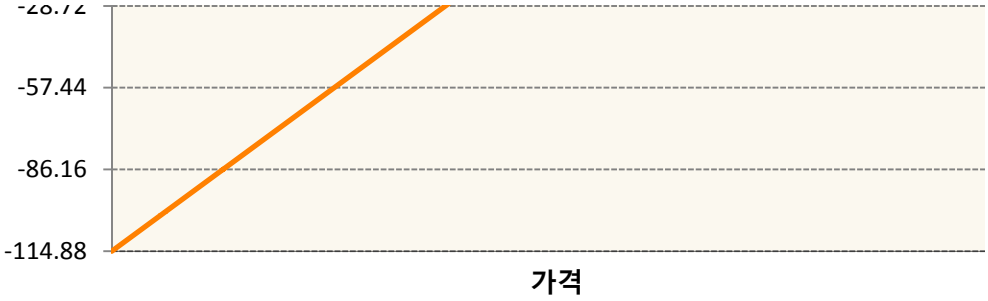
(단위:백만원)

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	115	0	115	
누계	유가증권	선물	1,937	0	1,937	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCU6	H-SHARES IDX FUT Sep16	155
MHCU6	E-MICRO JPY/US Sep15	9

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	222

공시일	2016-09-08
기준일	2016-09-07

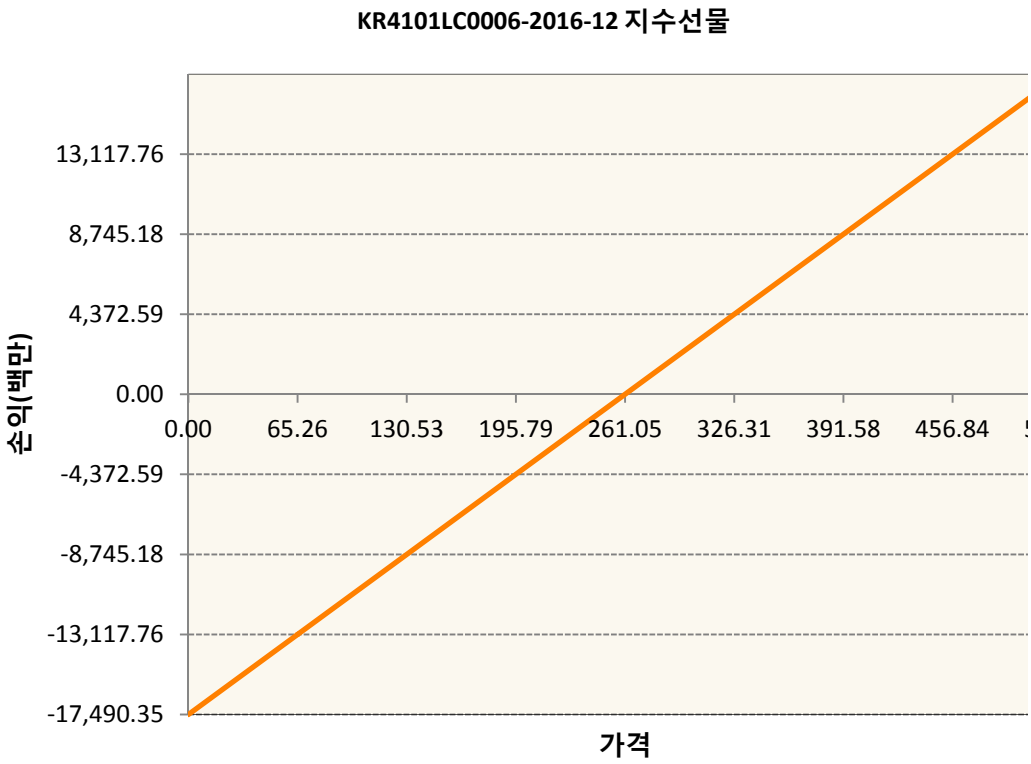
커버드콜(주식혼합-파생형)

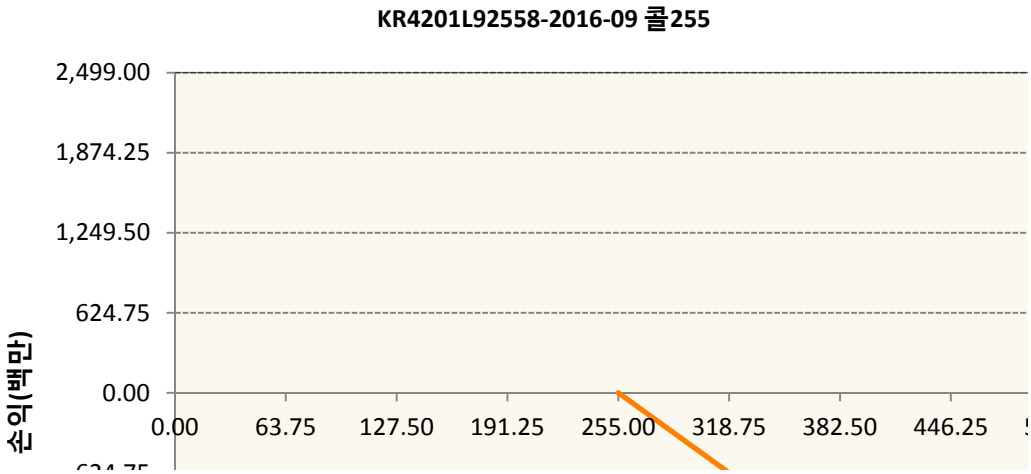
1. 계약금액

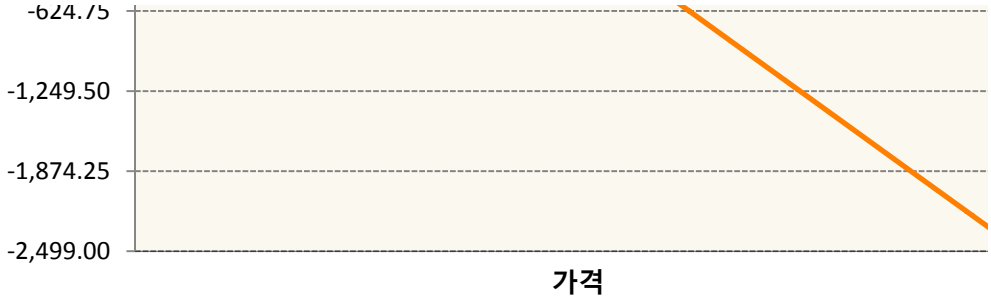
(단위:백만원)

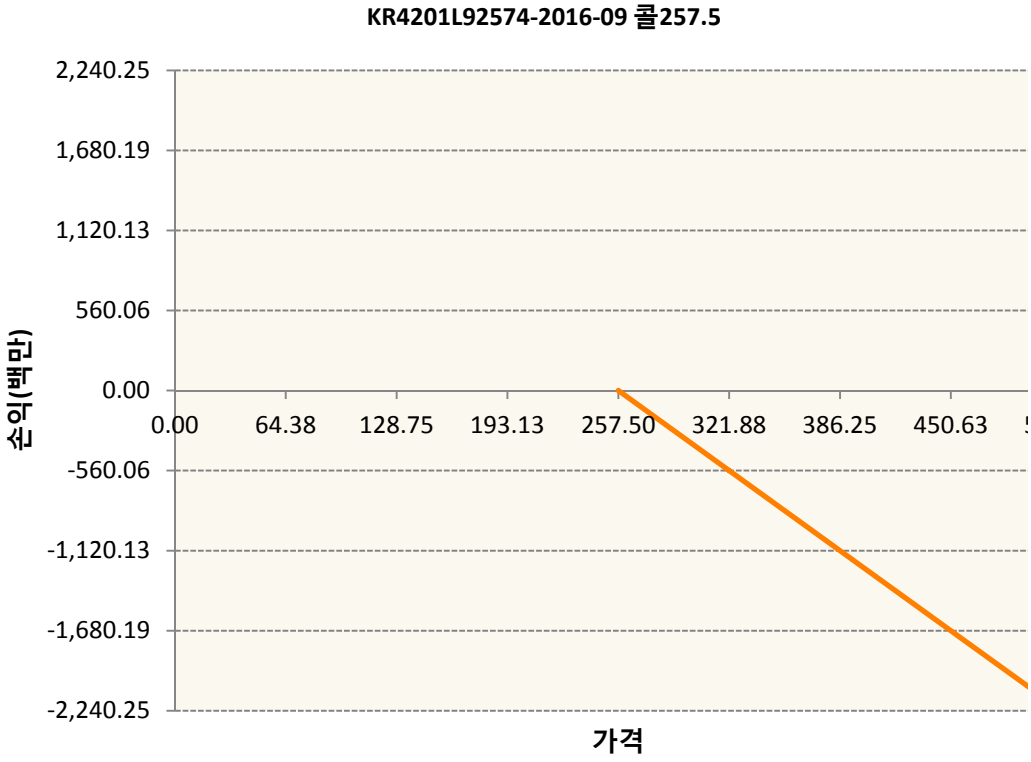
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	17,490	0	17,490	장내
누계	유가증권	옵션	0	4,739	-4,739	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101LC00 2016-12 지수선물							1,395
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,395	-1,395	-1,395	-1,395	-1,395	-1,395	-1,395
-5.33%	-930	-930	-930	-930	-930	-930	-930
-2.67%	-465	-465	-465	-465	-465	-465	-465
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	465	465	465	465	465	465	465
5.33%	930	930	930	930	930	930	930
8.00%	1,395	1,395	1,395	1,395	1,395	1,395	1,395
KR4201L925 2016-09 콜255							1,020
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	260	260	260	260	260	260	260
-5.33%	260	260	260	260	260	260	260
-2.67%	259	258	257	255	254	253	251
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-340	-340	-340	-340	-340	-340	-340
5.33%	-680	-680	-680	-680	-680	-680	-680
8.00%	-1,020	-1,020	-1,020	-1,020	-1,020	-1,020	-1,020
KR4201L925 2016-09 콜257.5							905

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	123	123	123	123	123	123	123
-5.33%	123	123	123	123	123	123	123
-2.67%	123	123	123	123	123	123	123
0%	1	1	0	0	0	-1	-2
2.67%	-301	-301	-301	-301	-301	-301	-301
5.33%	-603	-603	-603	-603	-603	-603	-603
8.00%	-905	-905	-905	-905	-905	-905	-905

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

3,773

공시일	2016-09-08
기준일	2016-09-07

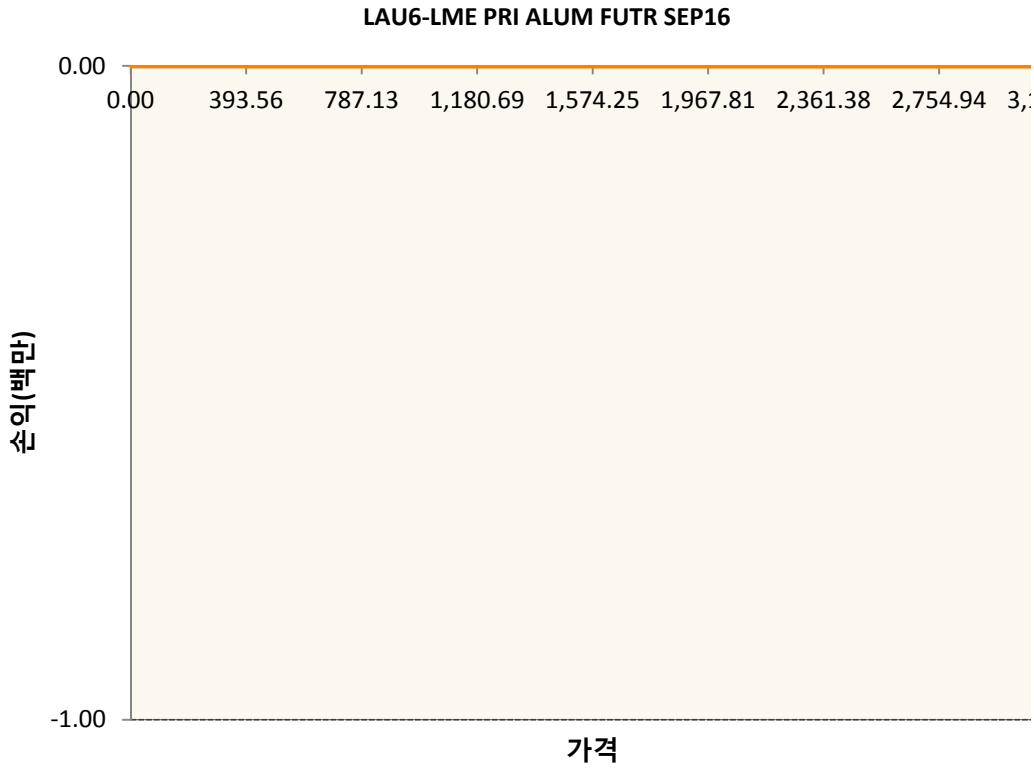
메탈인덱스플러스모(채권-파생형)

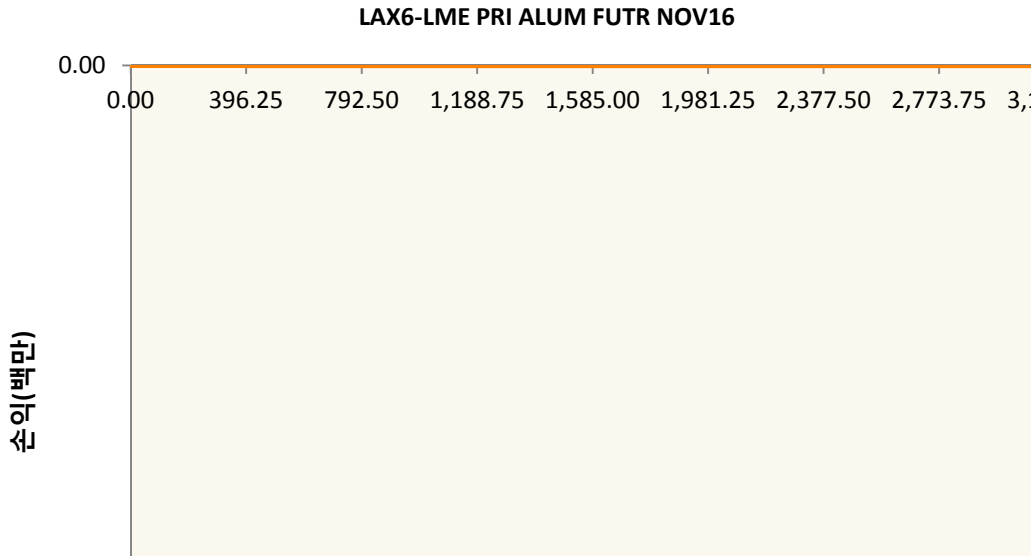
1. 계약금액

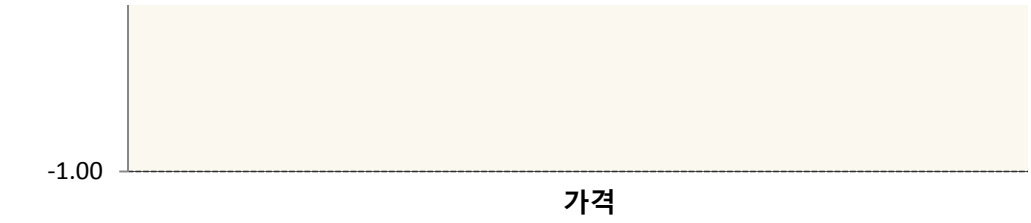
(단위:백만원)

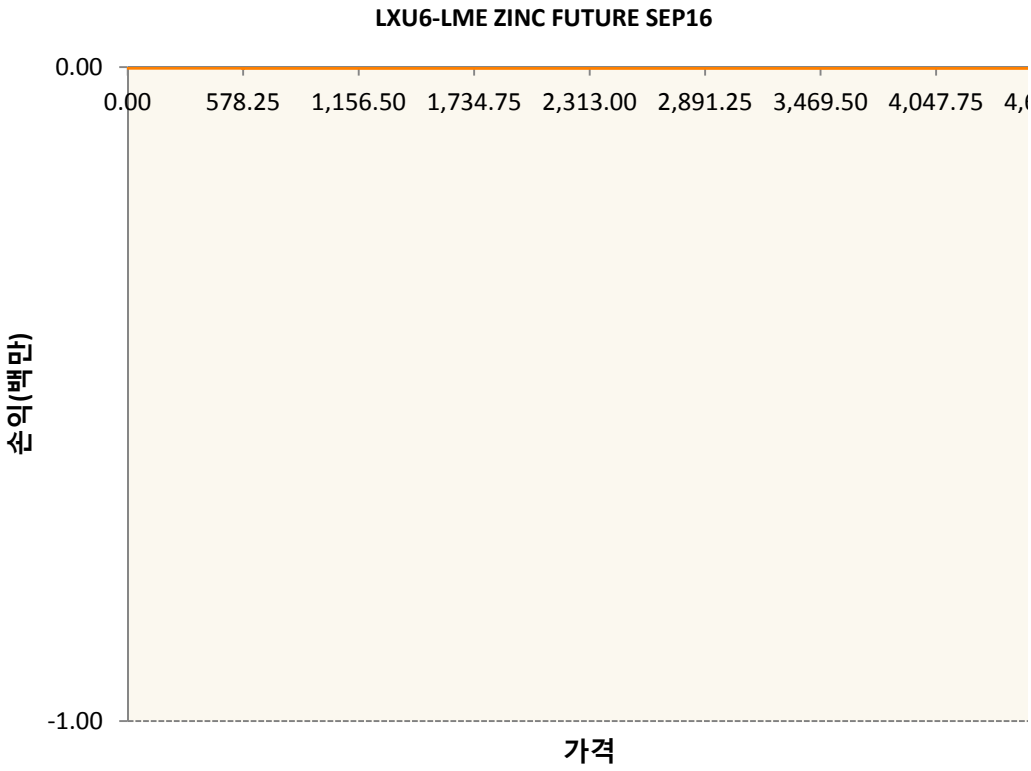
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	221	217	5	

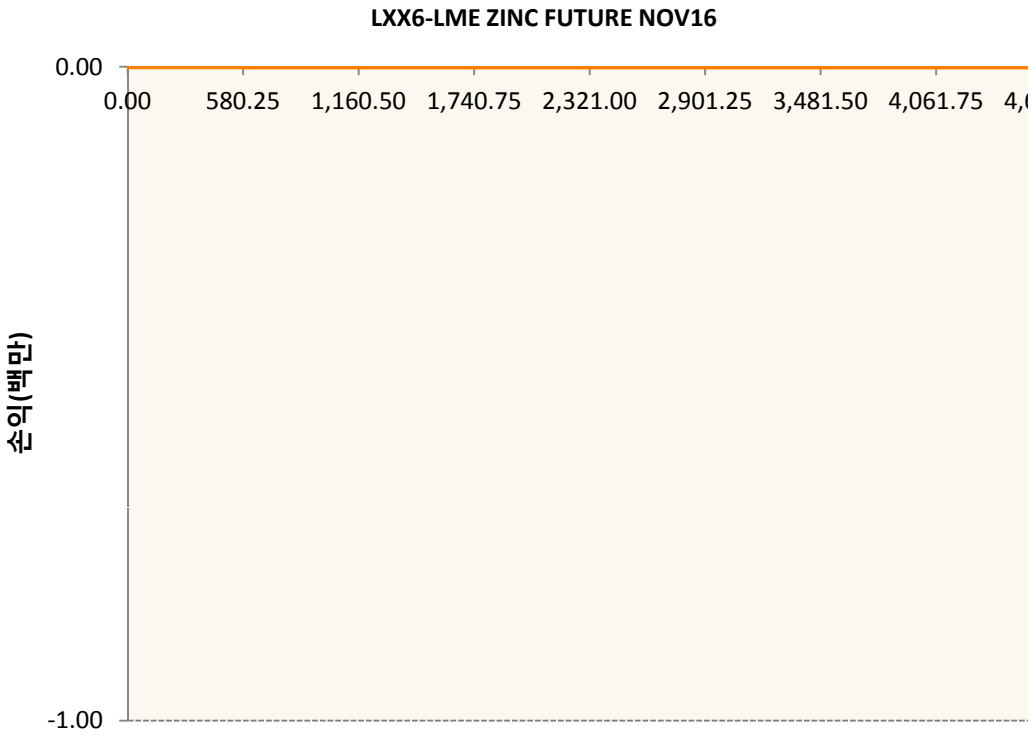
2. 만기시점의 손익구조






-1.00
가격


LXU6-LME ZINC FUTURE SEP16
0.00
0.00
578.25
1,156.50
1,734.75
2,313.00
2,891.25
3,469.50
4,047.75
순익(백만)
-1.00
가격


LXX6-LME ZINC FUTURE NOV16
0.00
0.00
580.25
1,160.50
1,740.75
2,321.00
2,901.25
3,481.50
4,061.75
순익(백만)
-1.00

가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

LAU6	LME PRI ALUM FUTR SEP16	0.1
LAX6	LME PRI ALUM FUTR NOV16	0
LXU6	LME ZINC FUTURE SEP16	0.4
LXX6	LME ZINC FUTURE NOV16	0

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

1

공시일	2016-09-08
기준일	2016-09-07

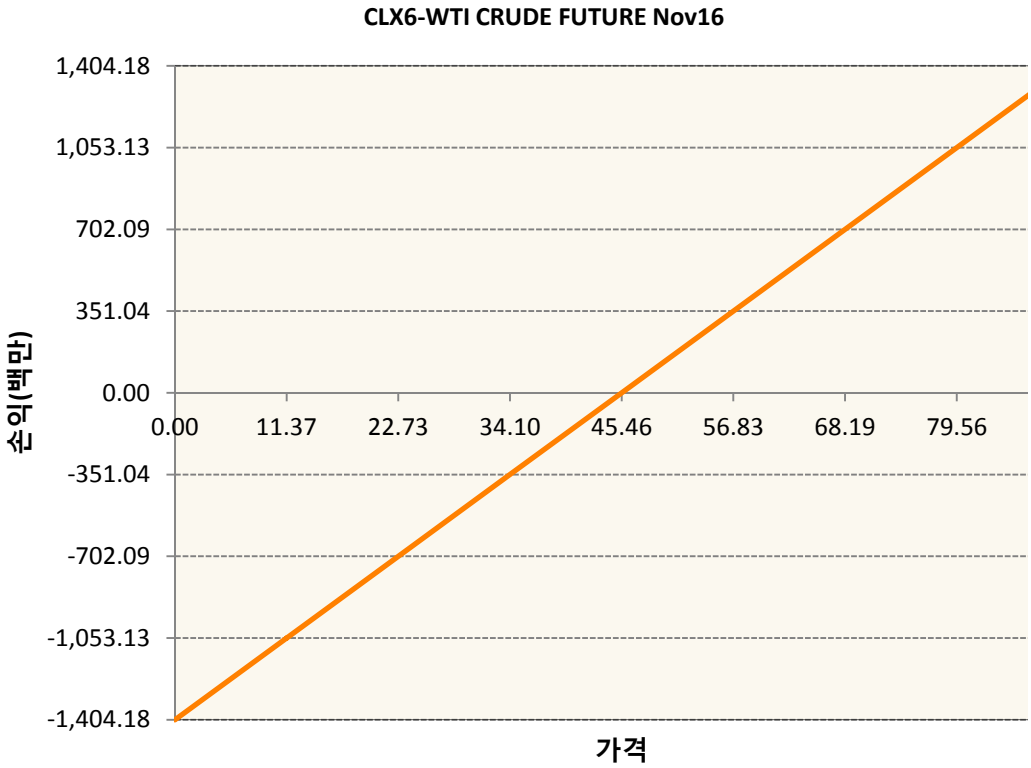
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

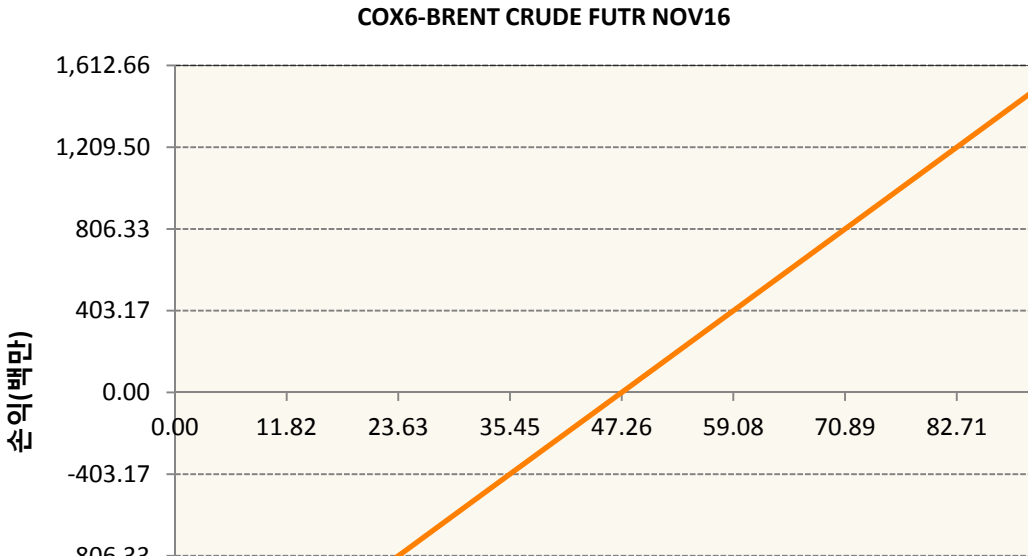
1. 계약금액

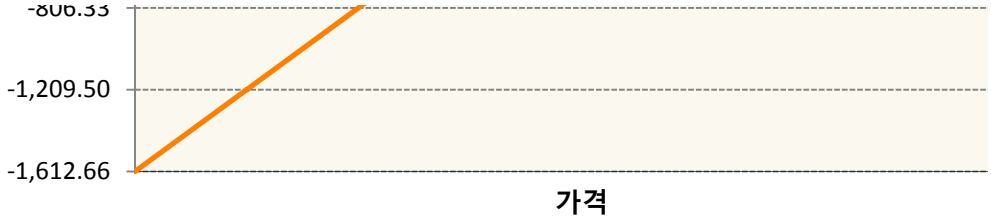
(단위:백만원)

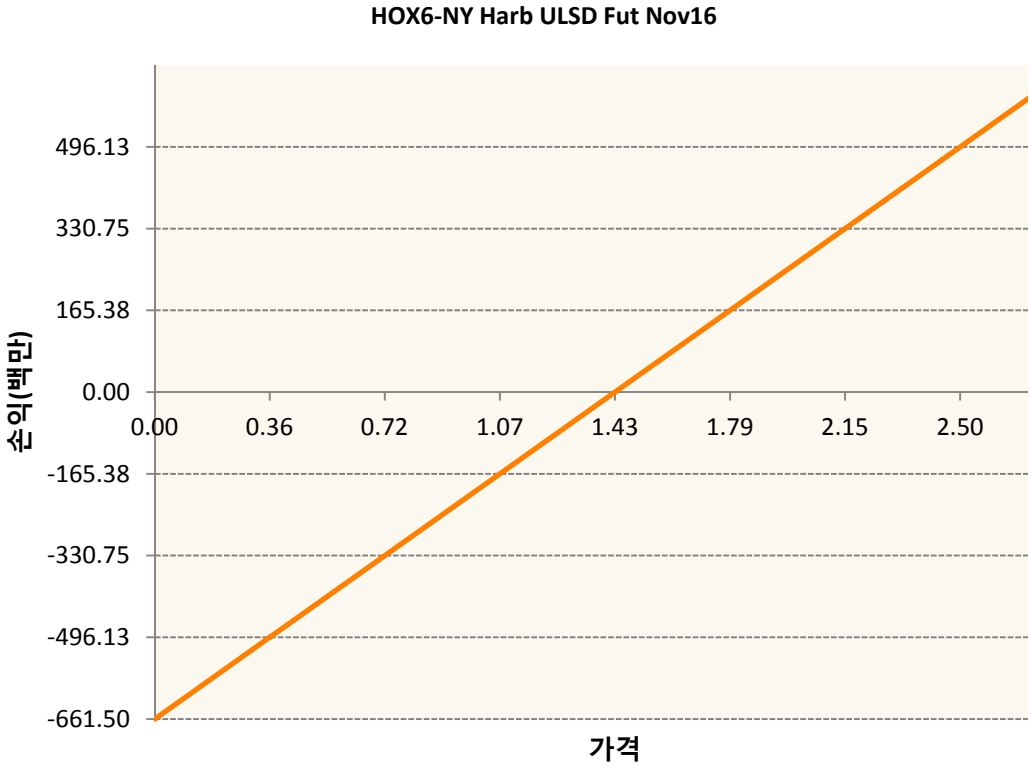
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	5,947	0	5,947	

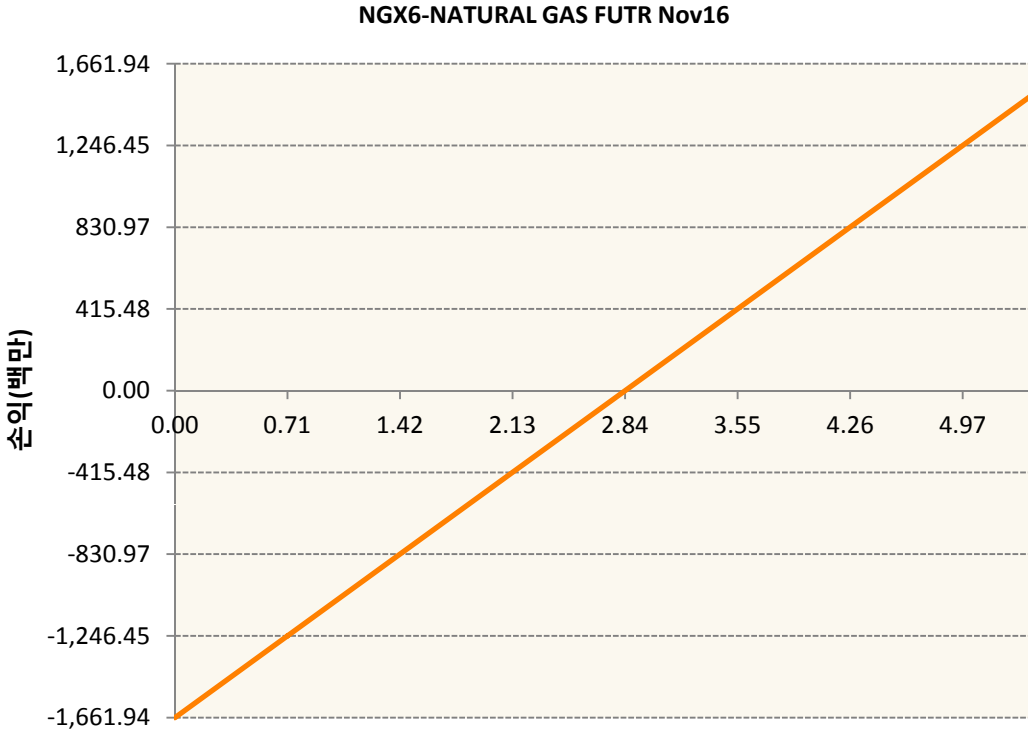
2. 만기시점의 손익구조



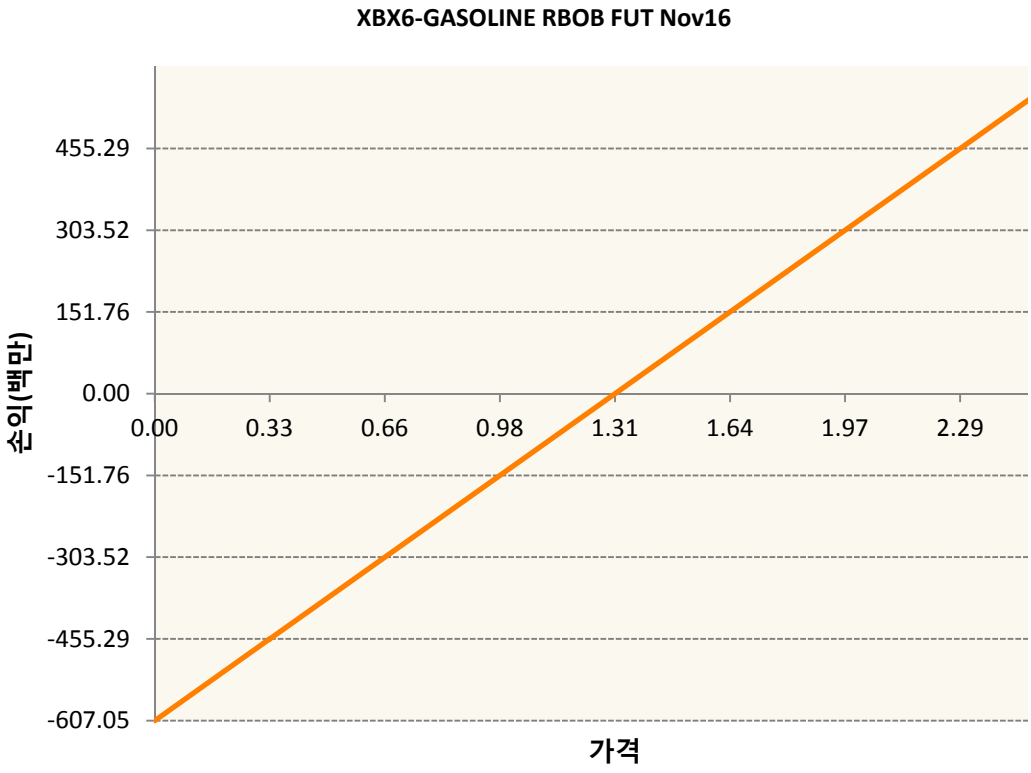



-1,209.50
-1,612.66
가격


HOX6-NY Harb ULSD Fut Nov16
496.13
330.75
165.38
0.00
-165.38
-330.75
-496.13
-661.50
0.00
0.36
0.72
1.07
1.43
1.79
2.15
2.50
손익(백만)
가격


NGX6-NATURAL GAS FUTR Nov16
1,661.94
1,246.45
830.97
415.48
0.00
-415.48
-830.97
-1,246.45
-1,661.94
0.00
0.71
1.42
2.13
2.84
3.55
4.26
4.97
손익(백만)

가격



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
CLX6	WTI CRUDE FUTURE Nov16	112
COX6	BRENT CRUDE FUTR NOV16	129
HOX6	NY Harb ULSD Fut Nov16	53
NGX6	NATURAL GAS FUTR Nov16	133
XBX6	GASOLINE RBOB FUT Nov16	49

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,056

공시일	2016-09-08
기준일	2016-09-07

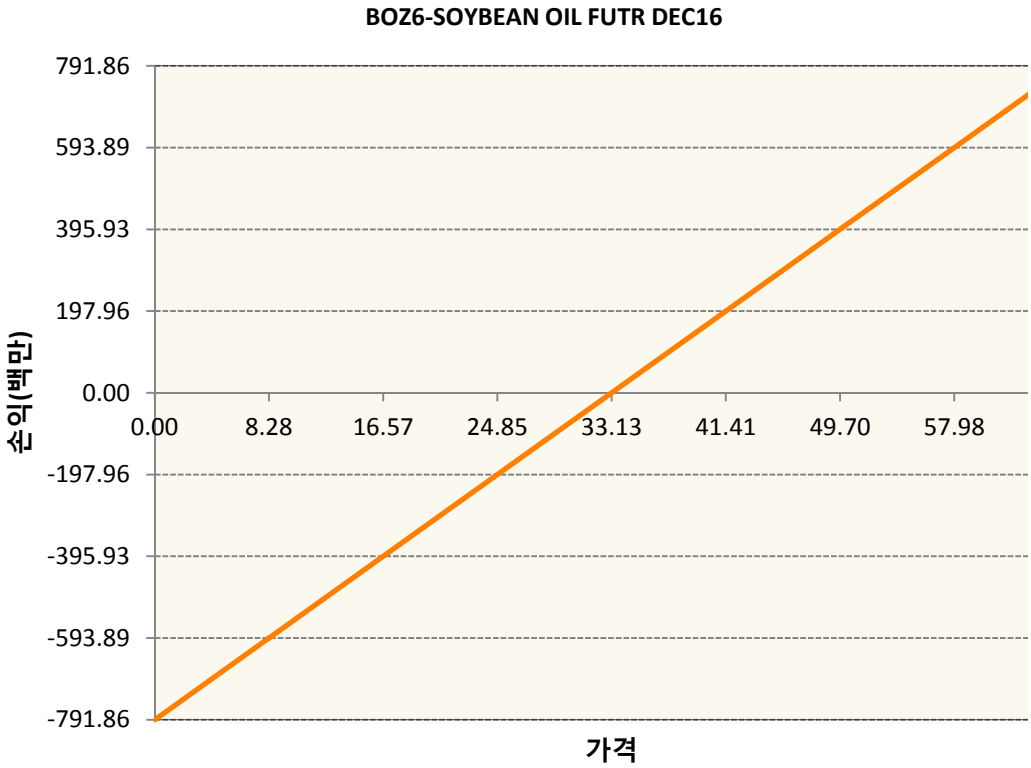
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

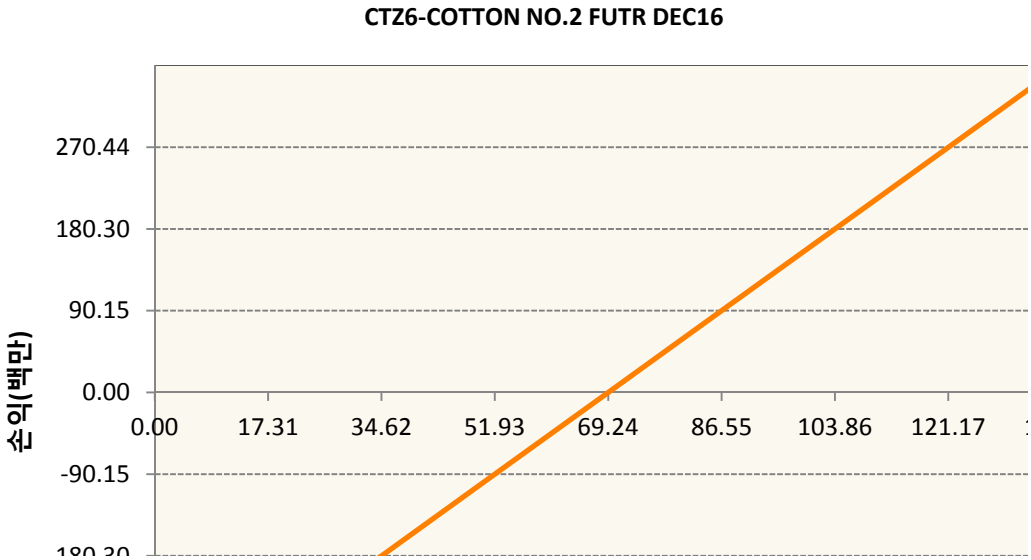
1. 계약금액

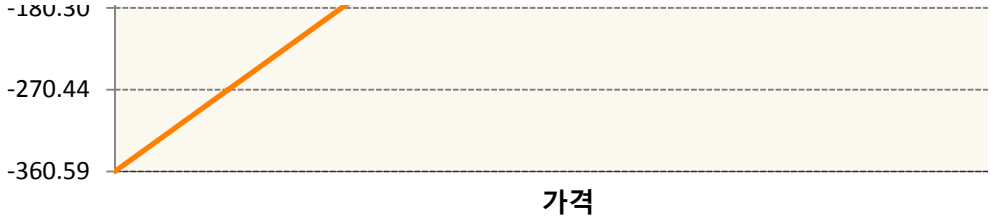
(단위:백만원)

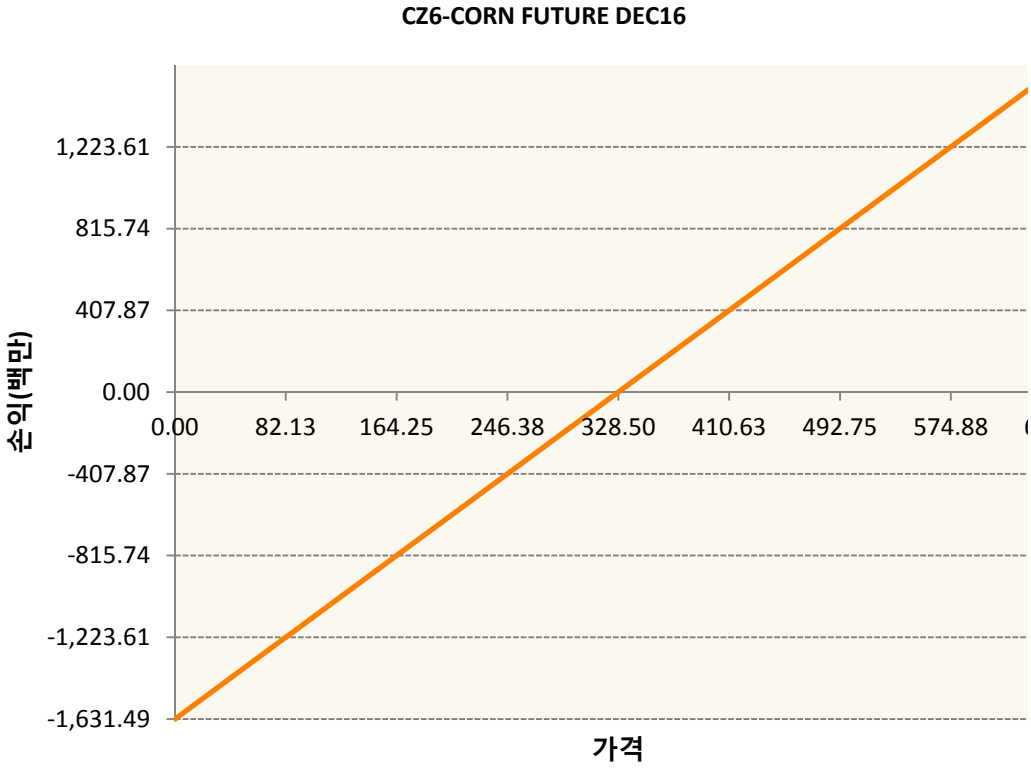
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	8,127	0	8,127	

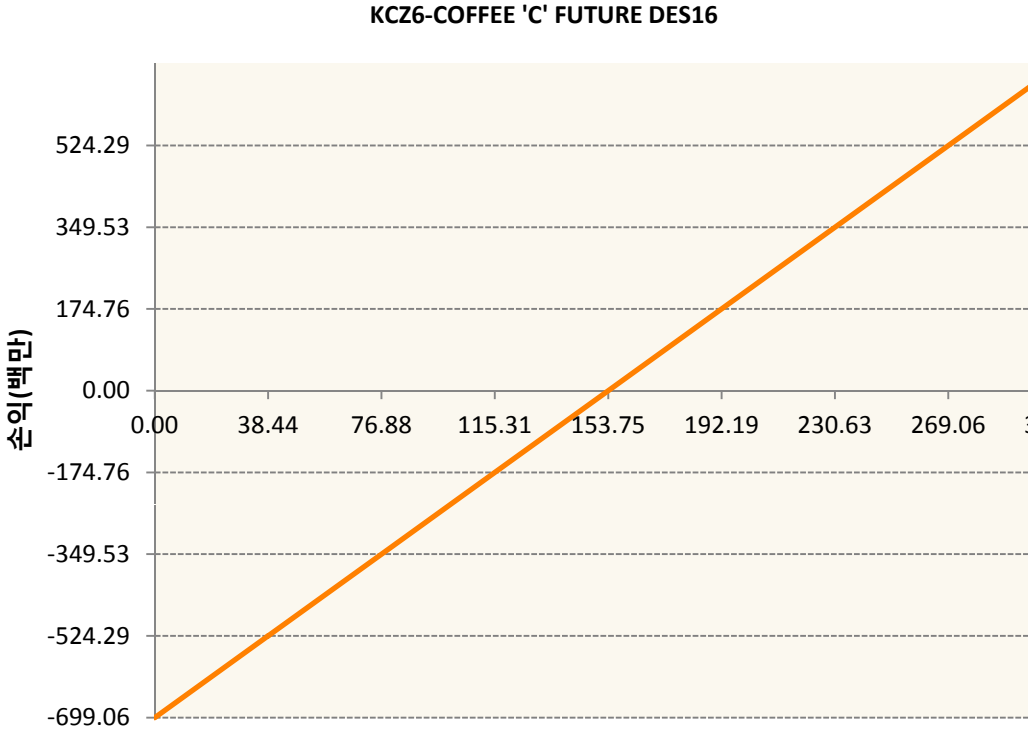
2. 만기시점의 손익구조



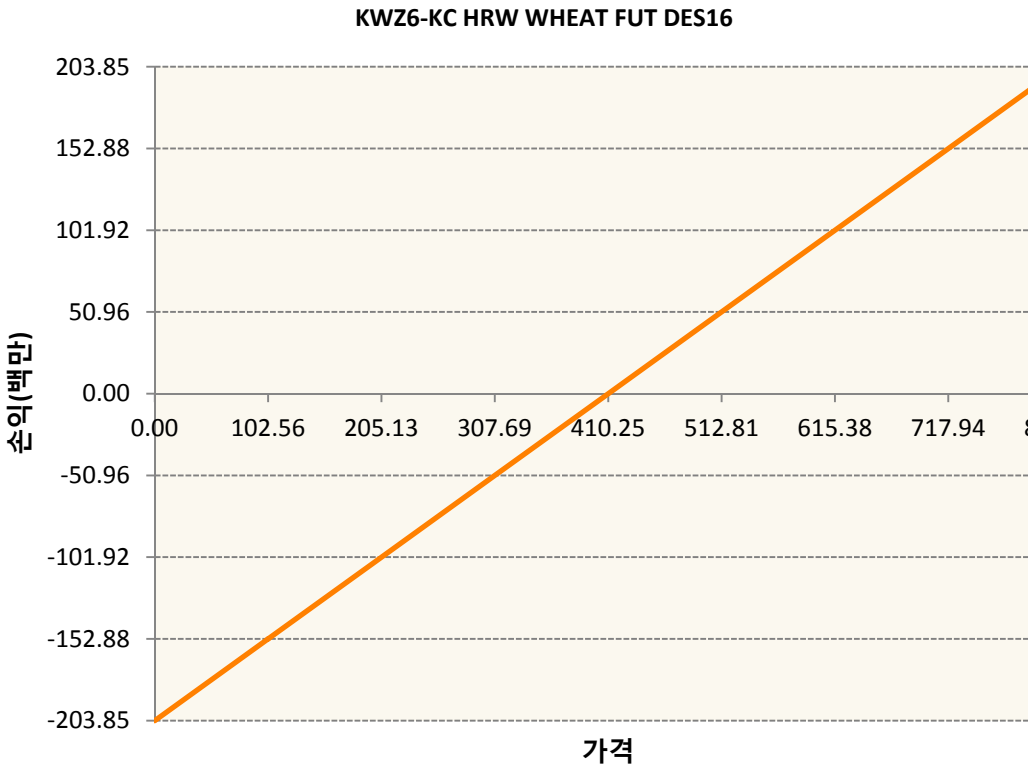


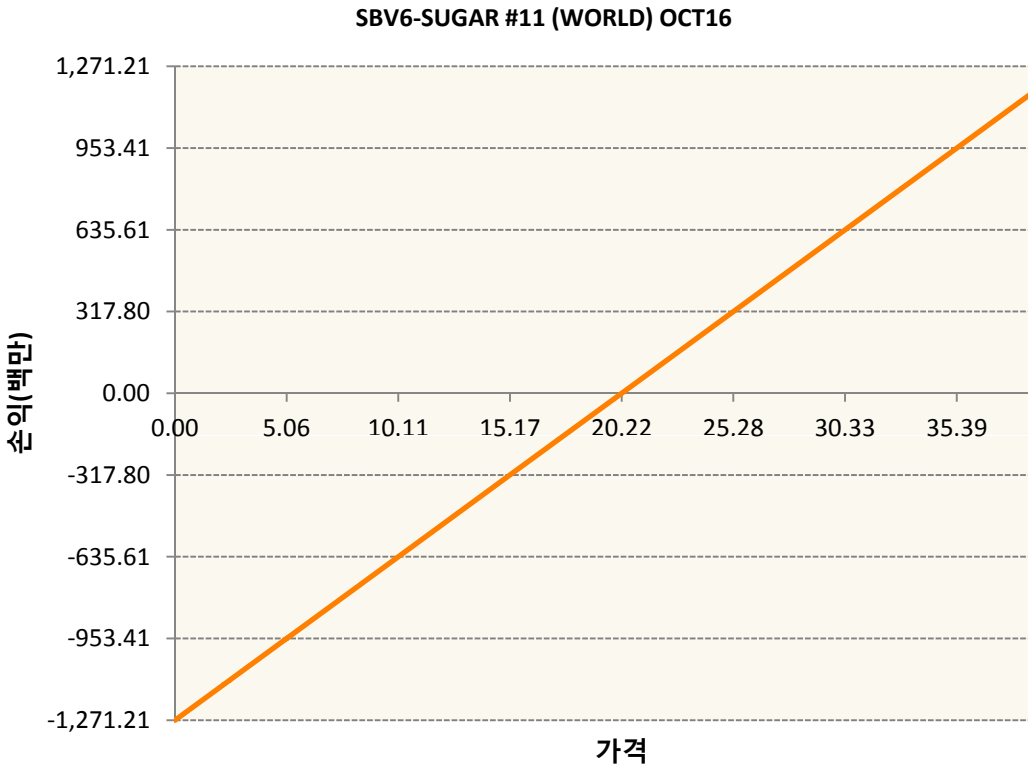

-180.30
-270.44
-360.59
가격

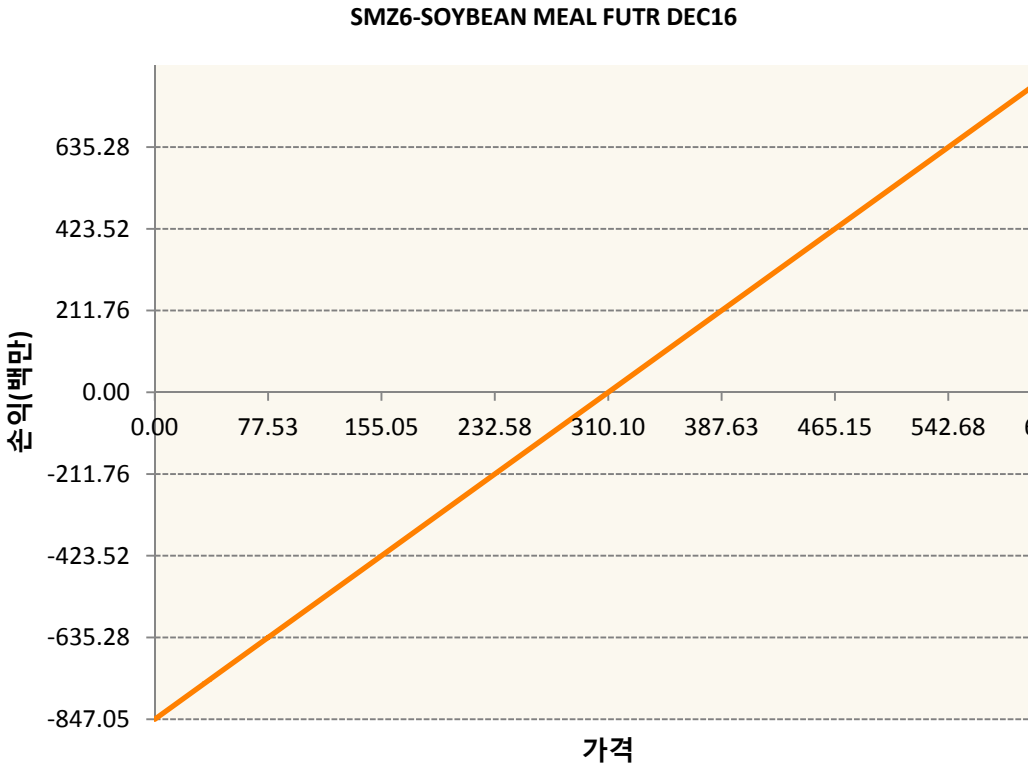

CZ6-CORN FUTURE DEC16
1,223.61
815.74
407.87
0.00
-407.87
-815.74
-1,223.61
-1,631.49
0.00
82.13
164.25
246.38
328.50
410.63
492.75
574.88
순익(백만)
가격

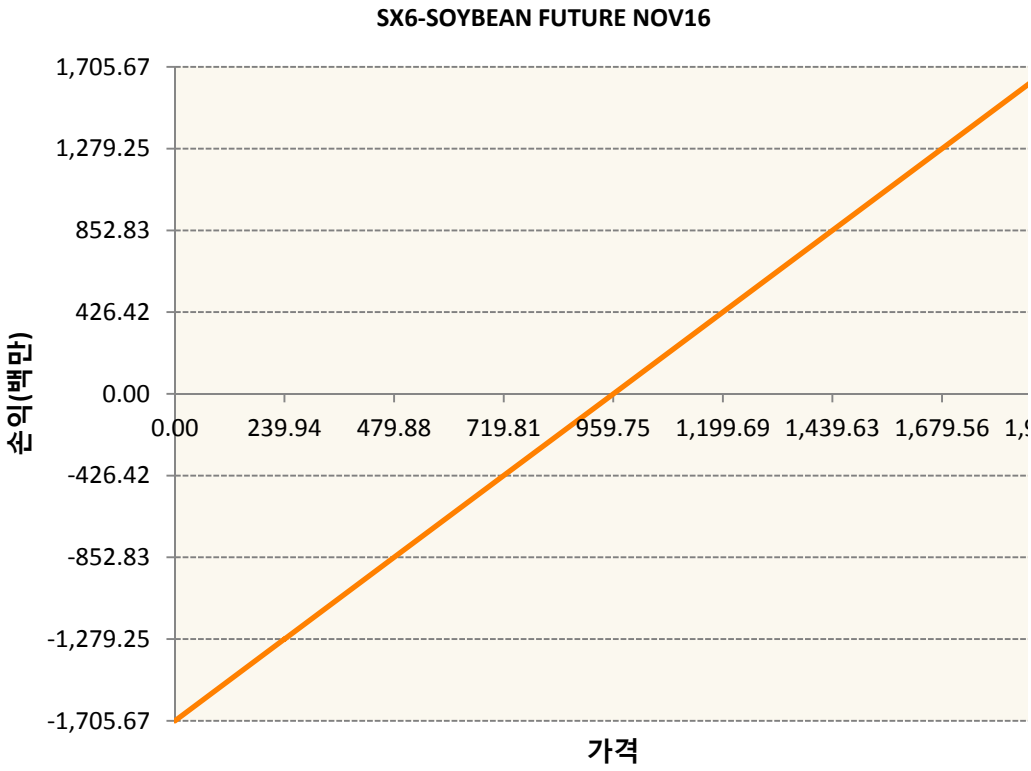

KCZ6-COFFEE 'C' FUTURE DES16
524.29
349.53
174.76
0.00
-174.76
-349.53
-524.29
-699.06
0.00
38.44
76.88
115.31
153.75
192.19
230.63
269.06
순익(백만)

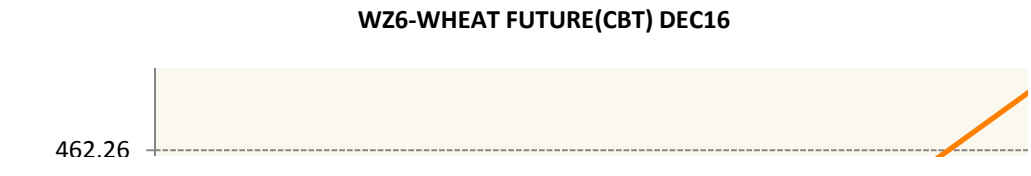
가격

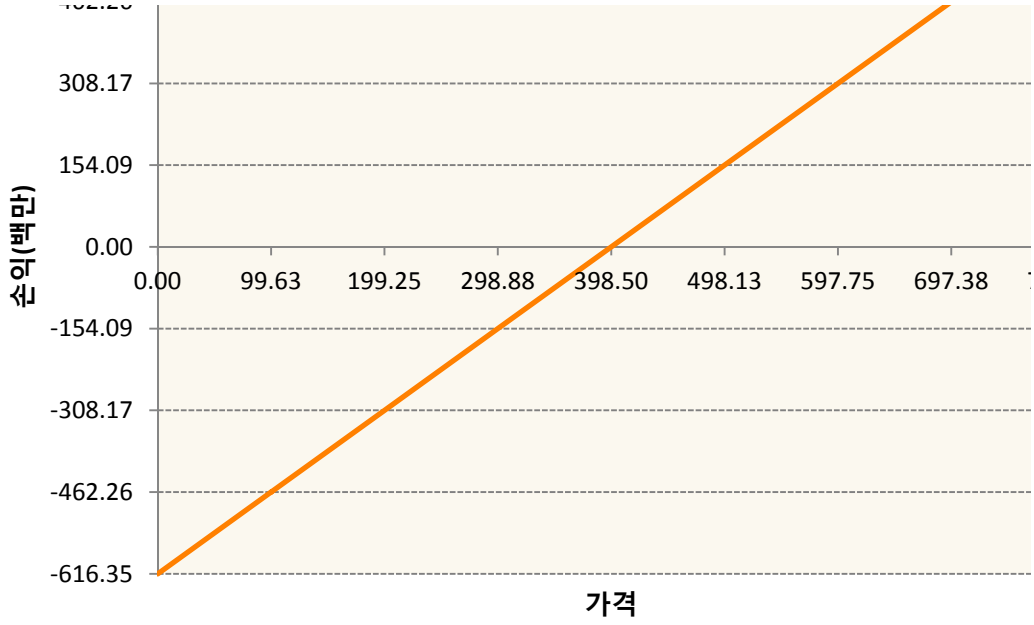

KWZ6-KC HRW WHEAT FUT DES16
203.85
152.88
101.92
50.96
0.00
-50.96
-101.92
-152.88
-203.85
0.00
102.56
205.13
307.69
410.25
512.81
615.38
717.94
손익(백만)
가격


SBV6-SUGAR #11 (WORLD) OCT16
1,271.21
953.41
635.61
317.80
0.00
-317.80
-635.61
-953.41
-1,271.21
0.00
5.06
10.11
15.17
20.22
25.28
30.33
35.39
손익(백만)
가격


SMZ6-SOYBEAN MEAL FUTR DEC16
635.28
423.52
211.76
0.00
-211.76
-423.52
-635.28
-847.05
손익(백만)
0.00
77.53
155.05
232.58
310.10
387.63
465.15
542.68
가격


SX6-SOYBEAN FUTURE NOV16
1,705.67
1,279.25
852.83
426.42
0.00
-426.42
-852.83
-1,279.25
-1,705.67
손익(백만)
0.00
239.94
479.88
719.81
959.75
1,199.69
1,439.63
1,679.56
가격


WZ6-WHEAT FUTURE(CBT) DEC16
462.26



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

BOZ6	SOYBEAN OIL FUTR DEC16	63
CTZ6	COTTON NO.2 FUTR DEC16	29
CZ6	CORN FUTURE DEC16	131
KCZ6	COFFEE 'C' FUTURE DES16	56
KWZ6	KC HRW WHEAT FUT DES16	16
SBV6	SUGAR #11 (WORLD) OCT16	102
SMZ6	SOYBEAN MEAL FUTR DEC16	68
SX6	SOYBEAN FUTURE NOV16	136
WZ6	WHEAT FUTURE(CBT) DEC16	49

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

807