공시일	2016-09-09
기준일	2016-09-08

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	2016-09-09
기준일	2016-09-08

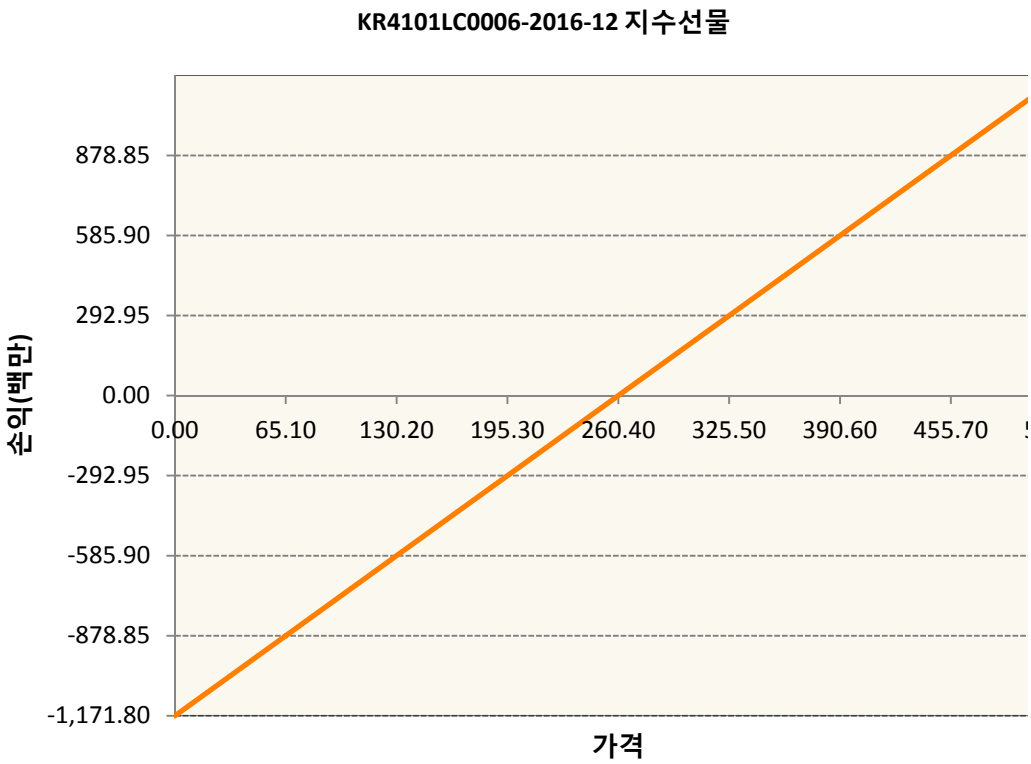
스마트인덱스모

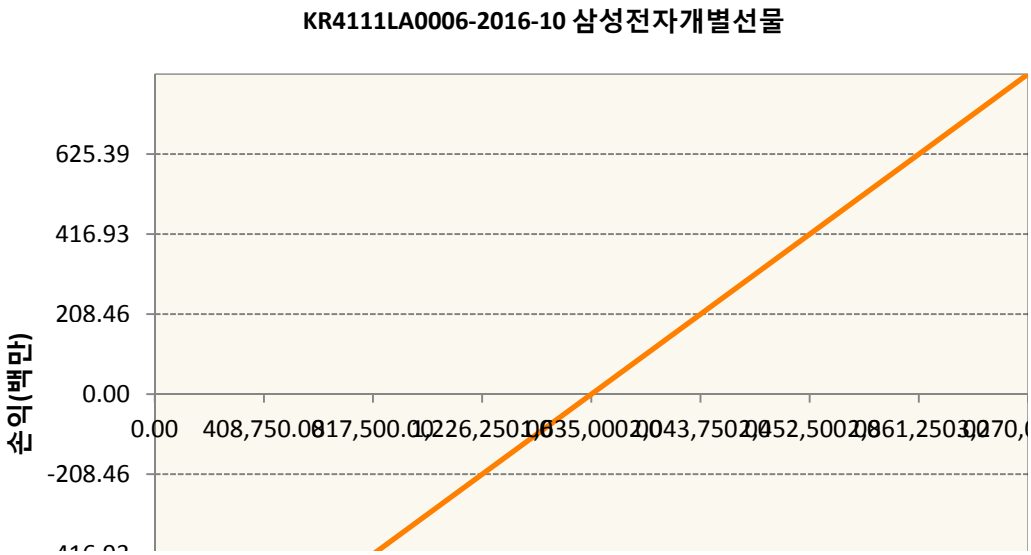
1. 계약금액

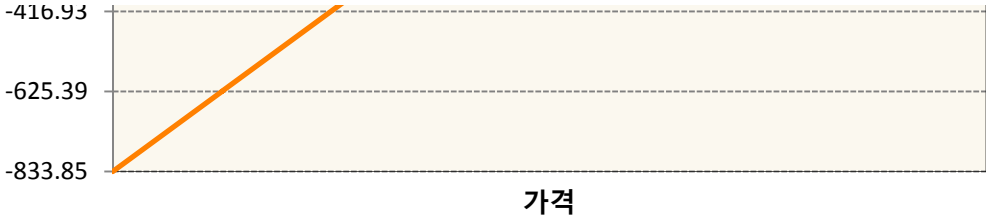
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,006	0	2,006	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%	-63	-63	-63	-63	-63	-63	-63
-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%	63	63	63	63	63	63	63
8.00%	94	94	94	94	94	94	94

KR4111LA00 2016-10 삼성전자개별선물							67
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-67	-67	-67	-67	-67	-67	-67
-5.33%	-45	-45	-45	-45	-45	-45	-45
-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%	45	45	45	45	45	45	45
8.00%	67	67	67	67	67	67	67

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

(단위:백만원)

140

공시일	2016-09-09
기준일	2016-09-08

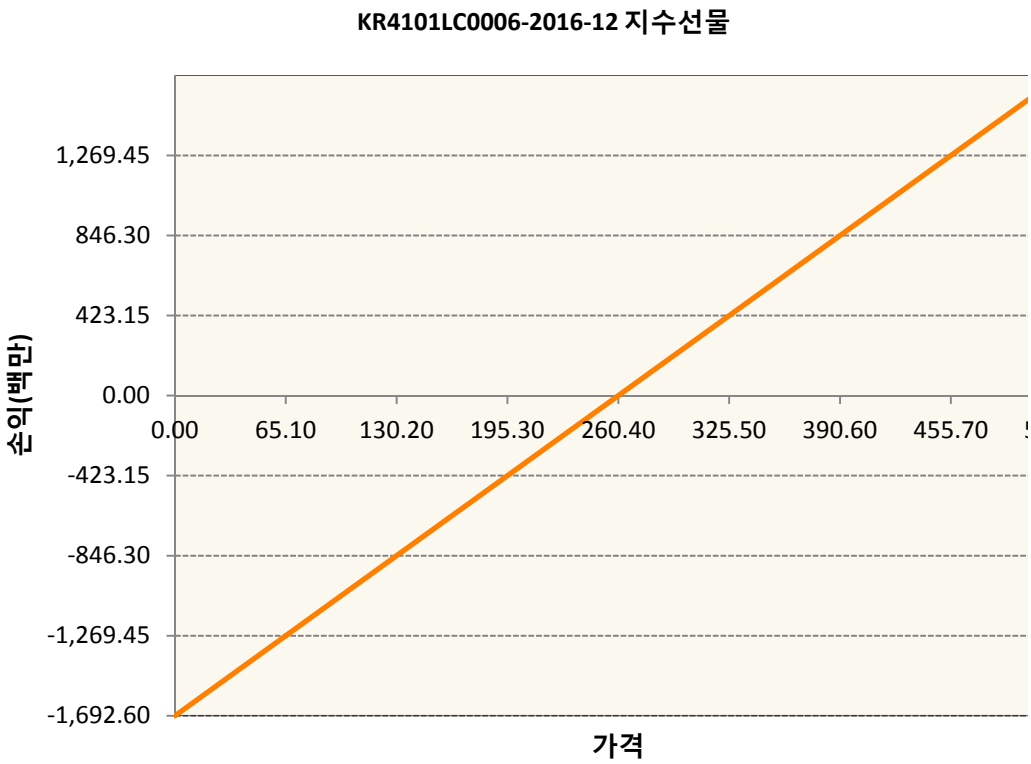
스마트레버리지목표전환형1호

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	1,693	0	1,693	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101LC00 2016-12 지수선물							136
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-136	-136	-136	-136	-136	-136	-136
-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%	136	136	136	136	136	136	136

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

106

공시일	2016-09-09
기준일	2016-09-08

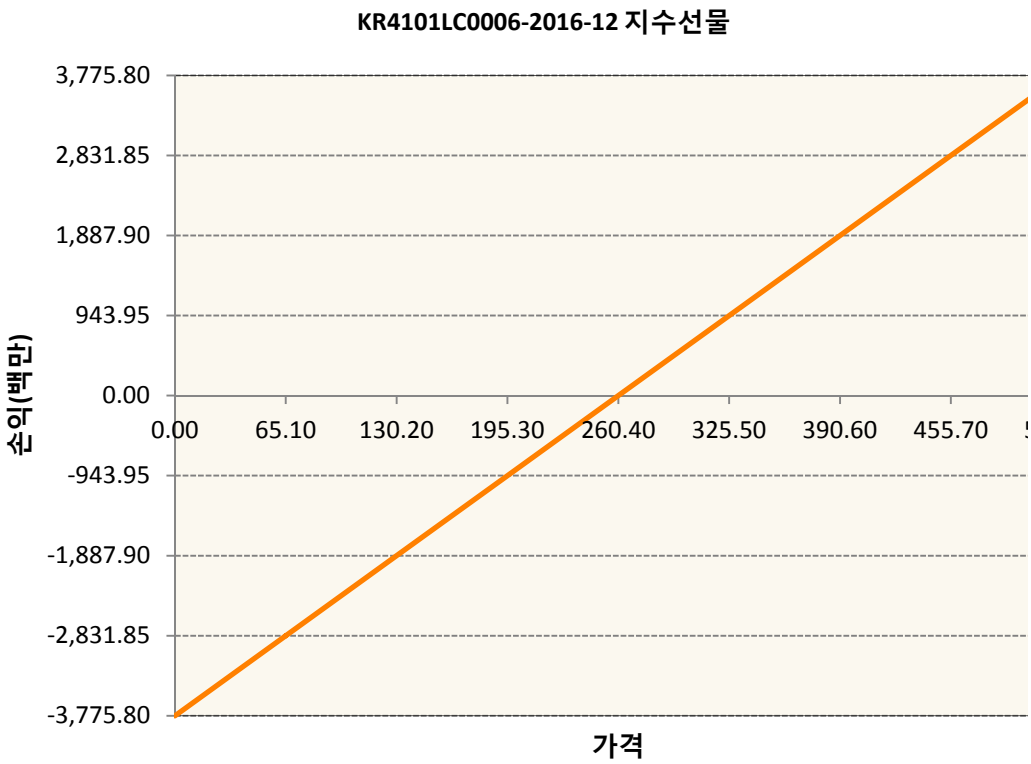
1.3배 레버리지 인덱스(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	912	0	912	장내
누계	유가증권	선물	3,776	0	3,776	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101LC00 2016-12 지수선물							303
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-303	-303	-303	-303	-303	-303	-303
-5.33%	-202	-202	-202	-202	-202	-202	-202
-2.67%	-101	-101	-101	-101	-101	-101	-101
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	101	101	101	101	101	101	101
5.33%	202	202	202	202	202	202	202
8.00%	303	303	303	303	303	303	303

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

236

공시일	2016-09-09
기준일	2016-09-08

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	897

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

744

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2016-09-09
기준일	2016-09-08

SMART중국본토중소형CSI500상장

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	5,098	0	5,098	장외
누계	지수	스왑	5,098	0	5,098	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI50000 신한CSI500미래S160908	409

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

888

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2016-09-09
기준일	2016-09-08

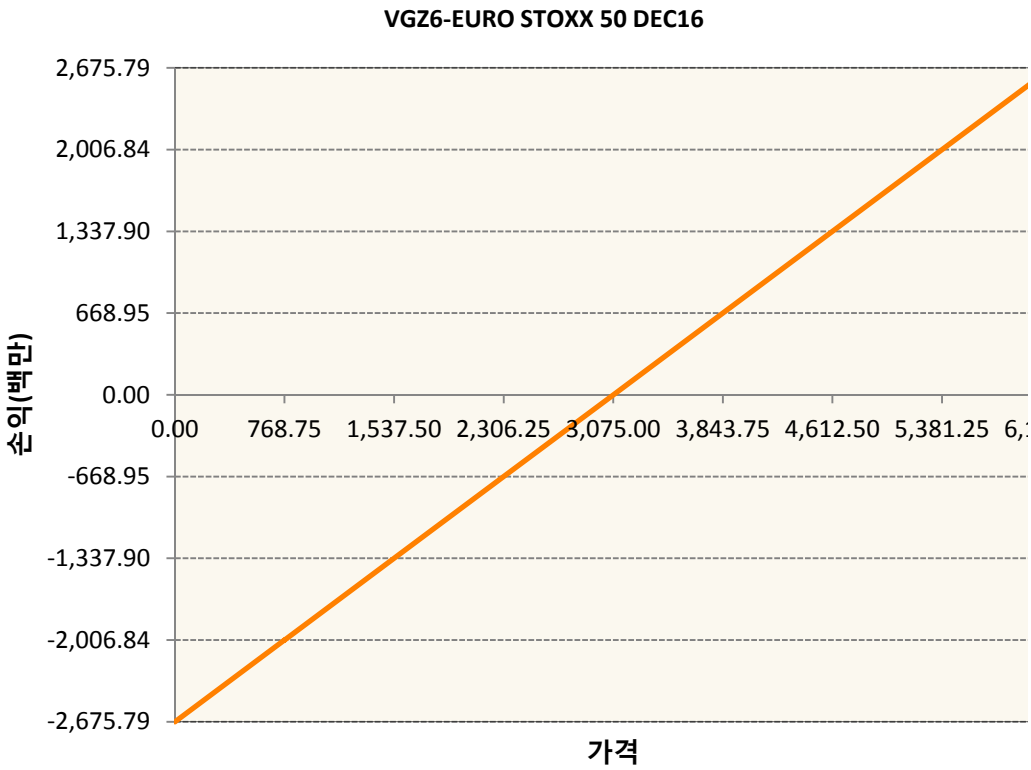
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,676	0	2,676	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGZ6	EURO STOXX 50 DEC16	214

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

(단위:백만원)

264

공시일	2016-09-09
기준일	2016-09-08

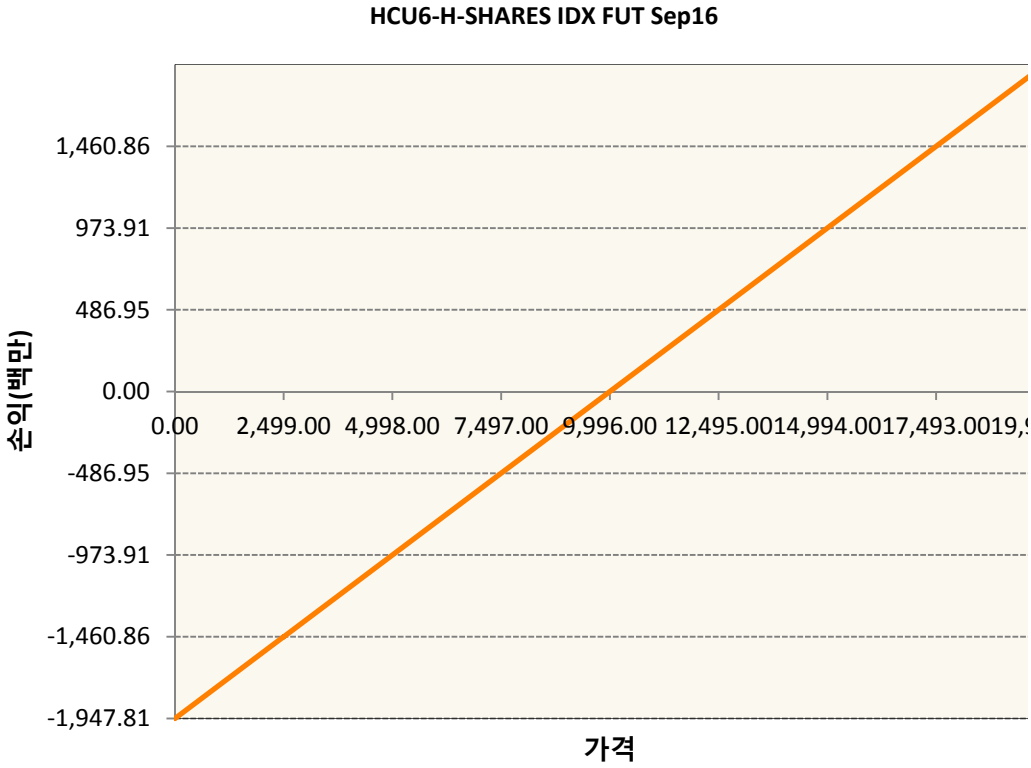
차이나인덱스모(주식-파생형)

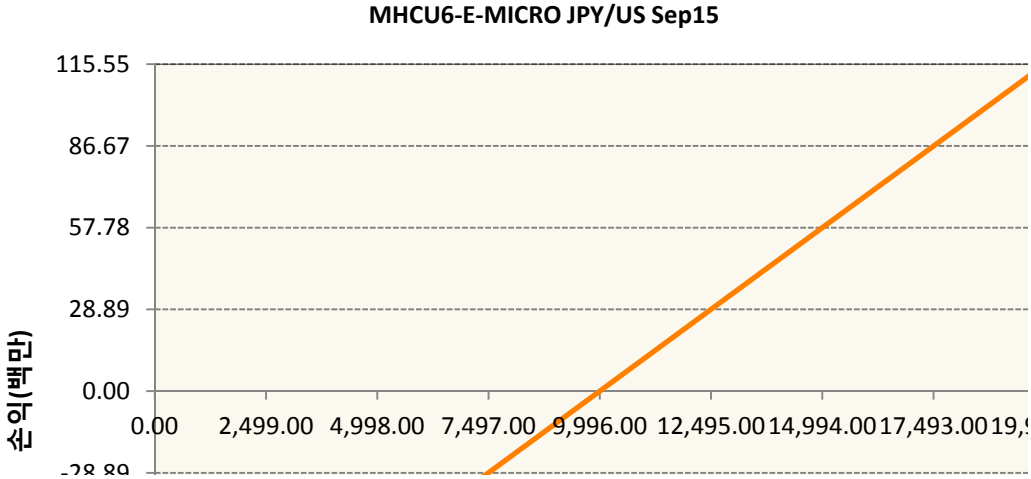
1. 계약금액

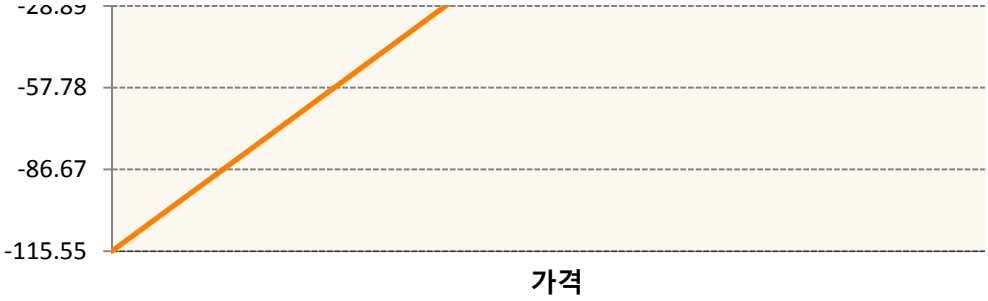
(단위:백만원)

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	116	0	116	
누계	유가증권	선물	1,948	0	1,948	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCU6	H-SHARES IDX FUT Sep16	156
MHCU6	E-MICRO JPY/US Sep15	9

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	223

공시일	2016-09-09
기준일	2016-09-08

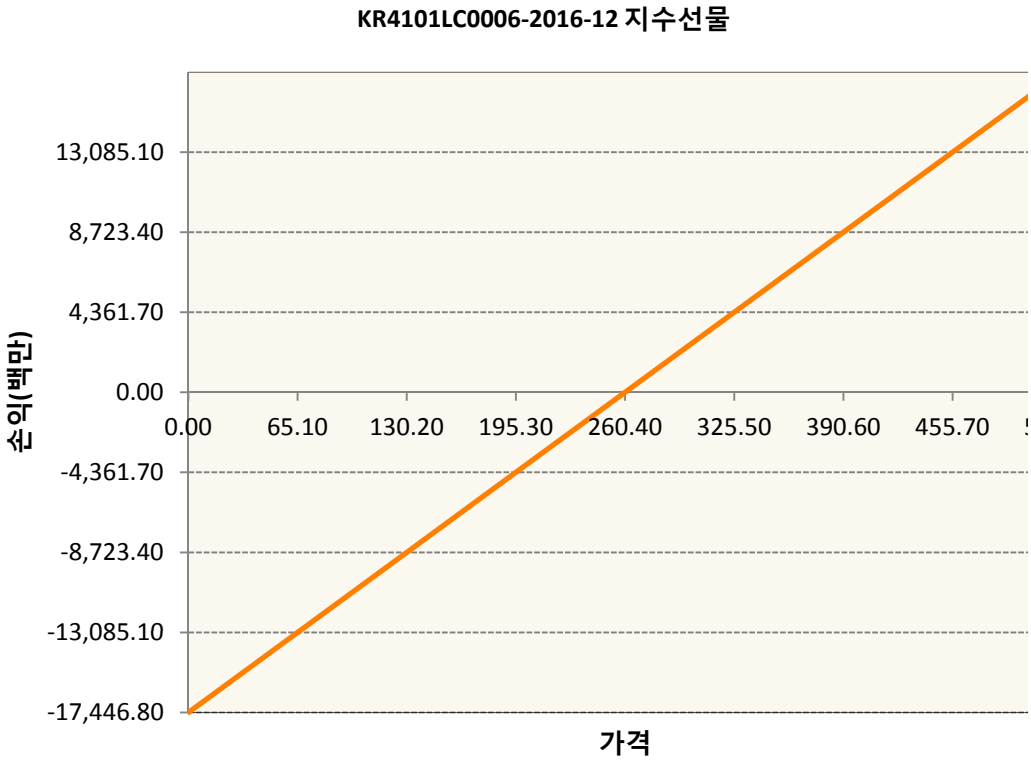
커버드콜(주식혼합-파생형)

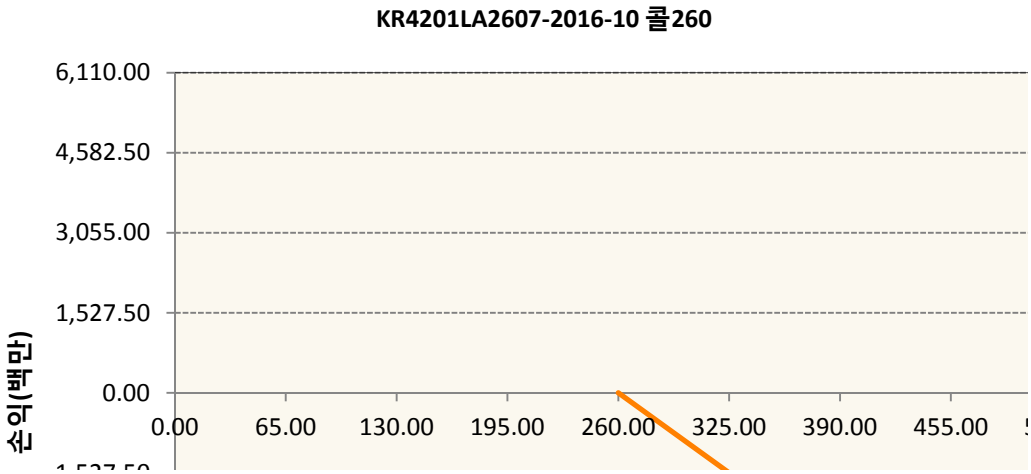
1. 계약금액

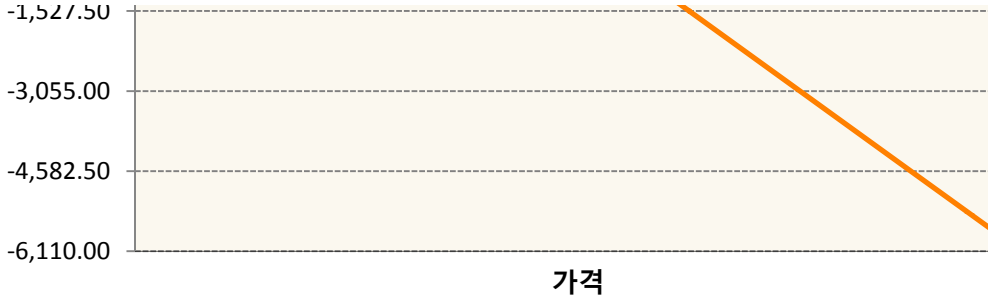
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	6,192	-6,192	장내
누계	유가증권	선물	17,447	0	17,447	장내
누계	유가증권	옵션	0	6,110	-6,110	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101LC00 2016-12 지수선물							1,398
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,398	-1,398	-1,398	-1,398	-1,398	-1,398	-1,398
-5.33%	-932	-932	-932	-932	-932	-932	-932
-2.67%	-466	-466	-466	-466	-466	-466	-466
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	466	466	466	466	466	466	466
5.33%	932	932	932	932	932	932	932
8.00%	1,398	1,398	1,398	1,398	1,398	1,398	1,398
KR4201LA26 2016-10 콜260							2,085
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	474	473	472	470	467	463	457
-5.33%	467	461	453	442	430	415	399
-2.67%	397	373	347	320	292	263	233
0%	106	71	35	0	-35	-71	-106
2.67%	-488	-508	-531	-556	-582	-609	-637
5.33%	-1,255	-1,261	-1,268	-1,277	-1,289	-1,303	-1,318
8.00%	-2,066	-2,067	-2,068	-2,070	-2,074	-2,078	-2,085

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

3,452

공시일	2016-09-09
기준일	2016-09-08

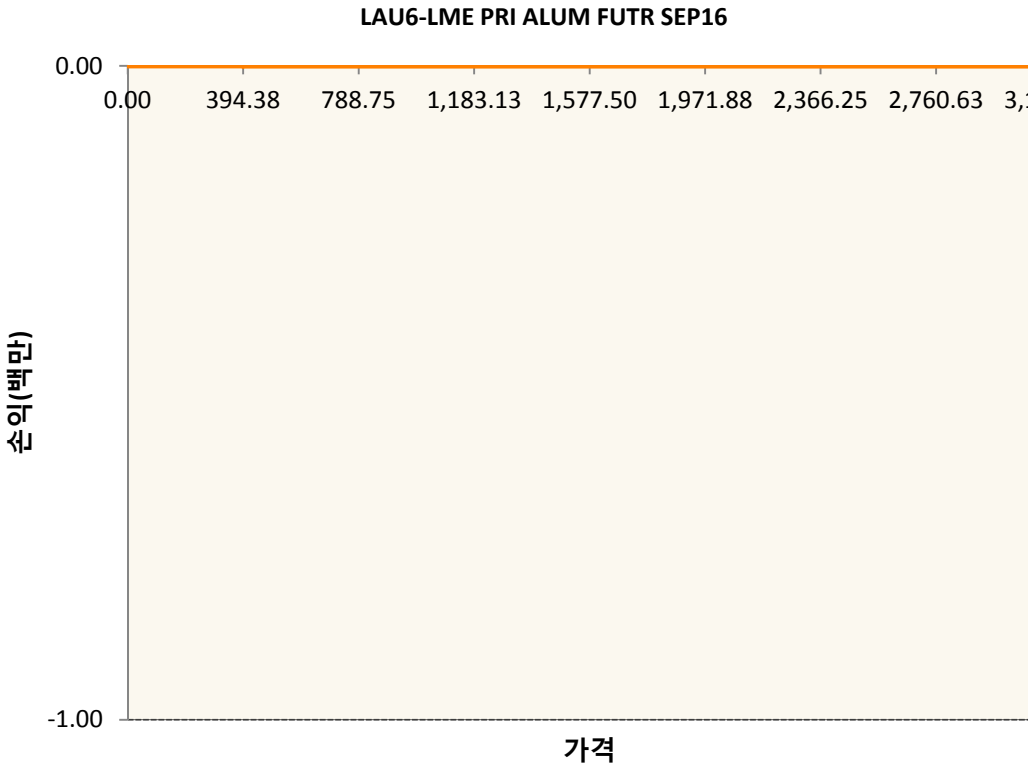
메탈인덱스플러스모(채권-파생형)

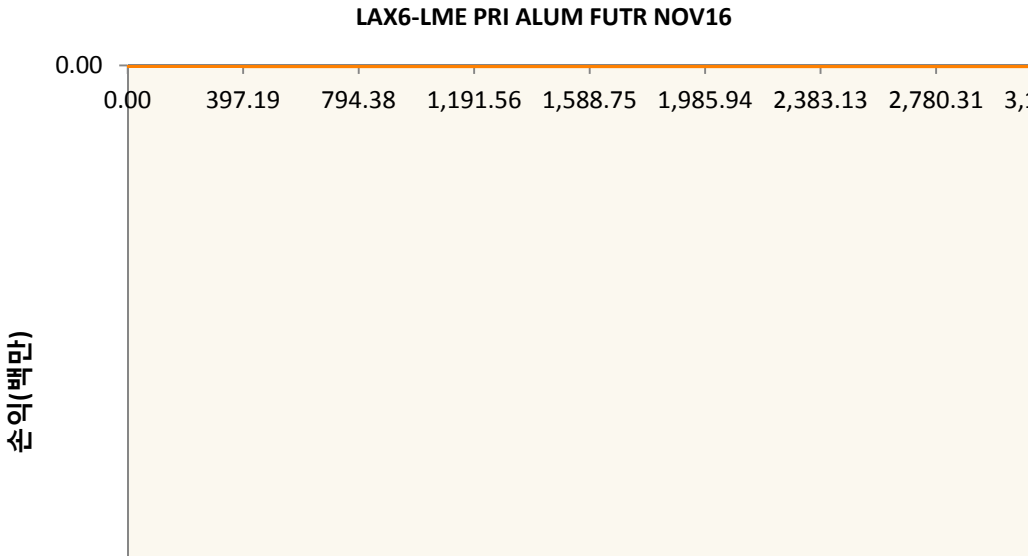
1. 계약금액

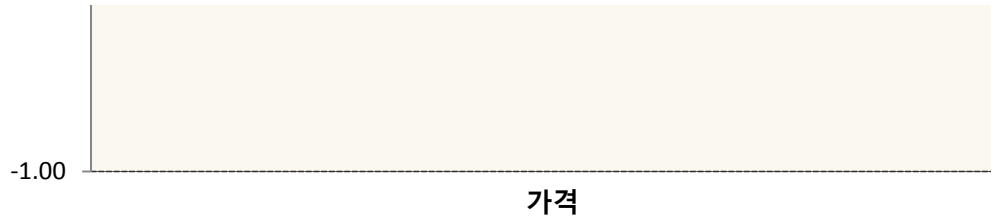
(단위:백만원)

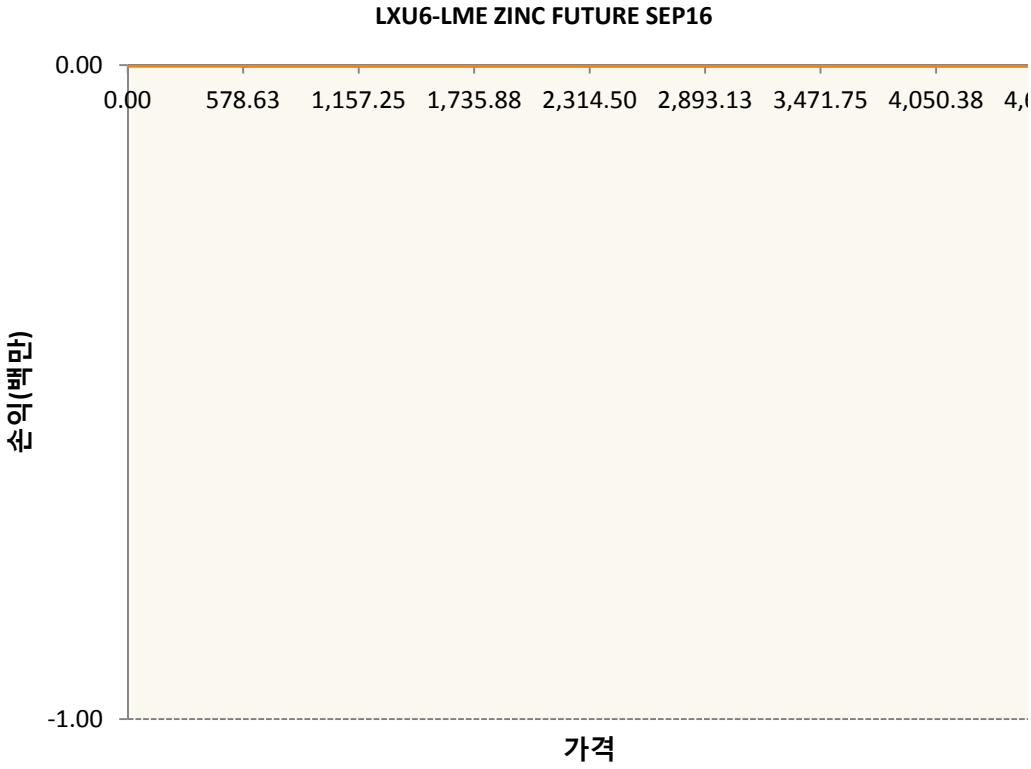
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	222	216	5	

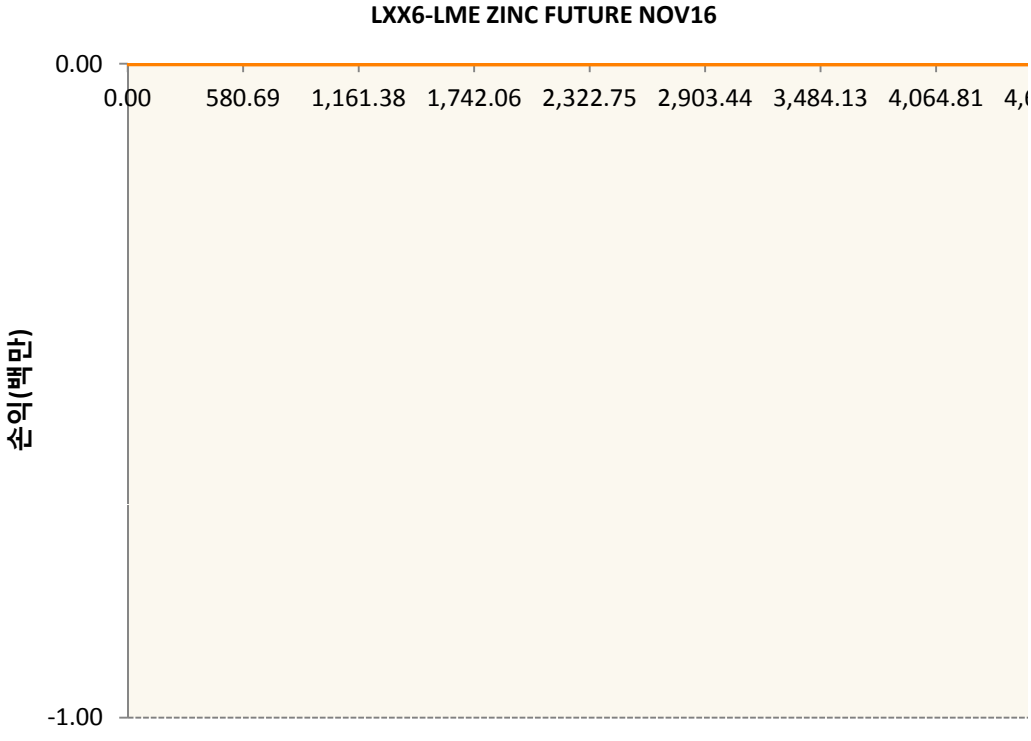
2. 만기시점의 손익구조






-1.00
가격


LXU6-LME ZINC FUTURE SEP16
0.00
0.00
578.63
1,157.25
1,735.88
2,314.50
2,893.13
3,471.75
4,050.38
순익(백만)
-1.00
가격


LXX6-LME ZINC FUTURE NOV16
0.00
0.00
580.69
1,161.38
1,742.06
2,322.75
2,903.44
3,484.13
4,064.81
순익(백만)
-1.00

가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

LAU6	LME PRI ALUM FUTR SEP16	0
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	2016-09-09
기준일	2016-09-08

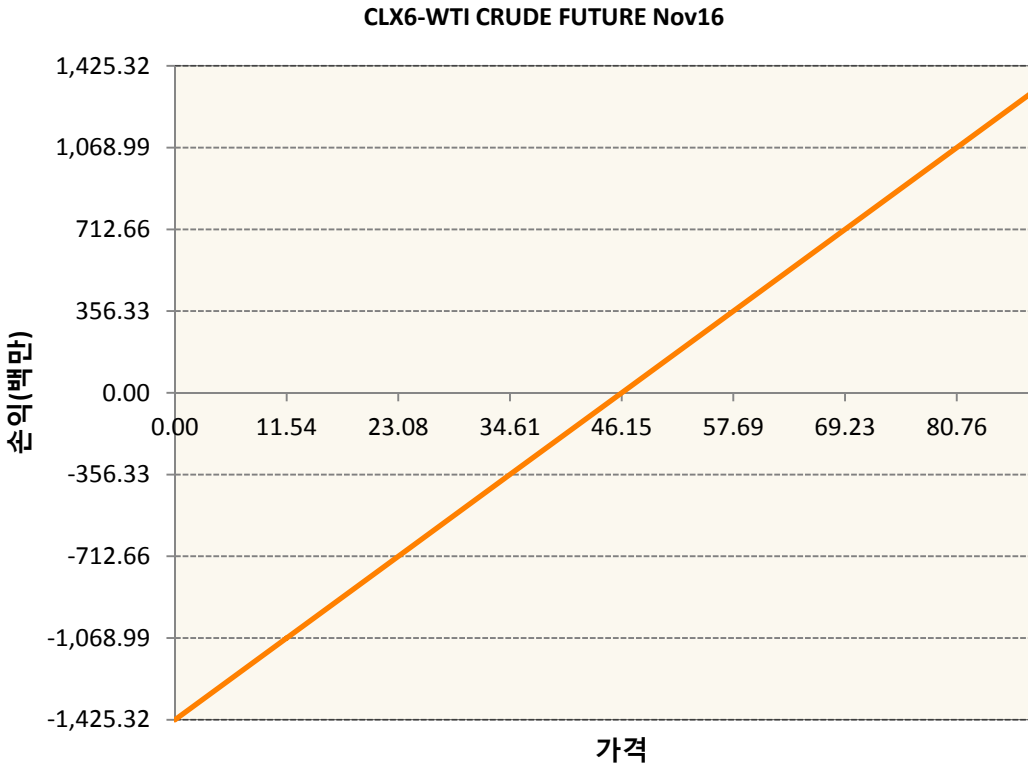
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

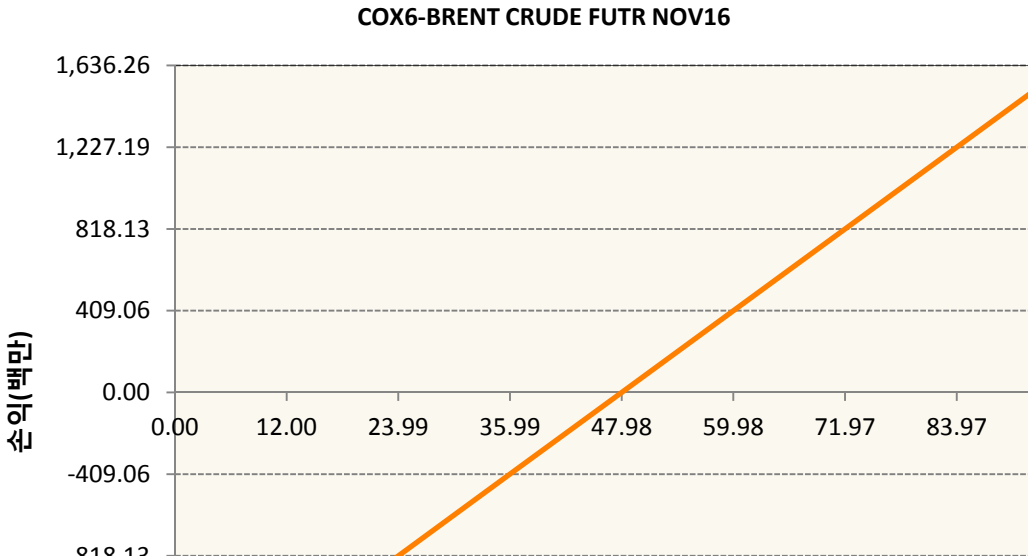
1. 계약금액

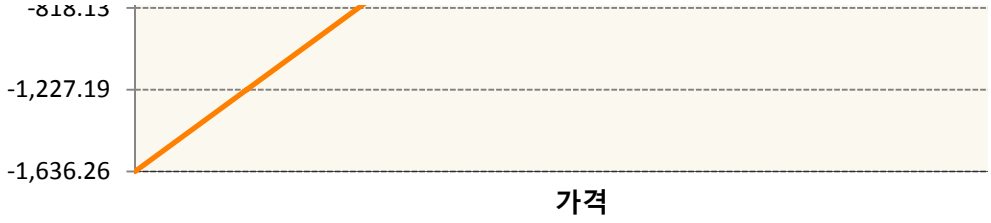
(단위:백만원)

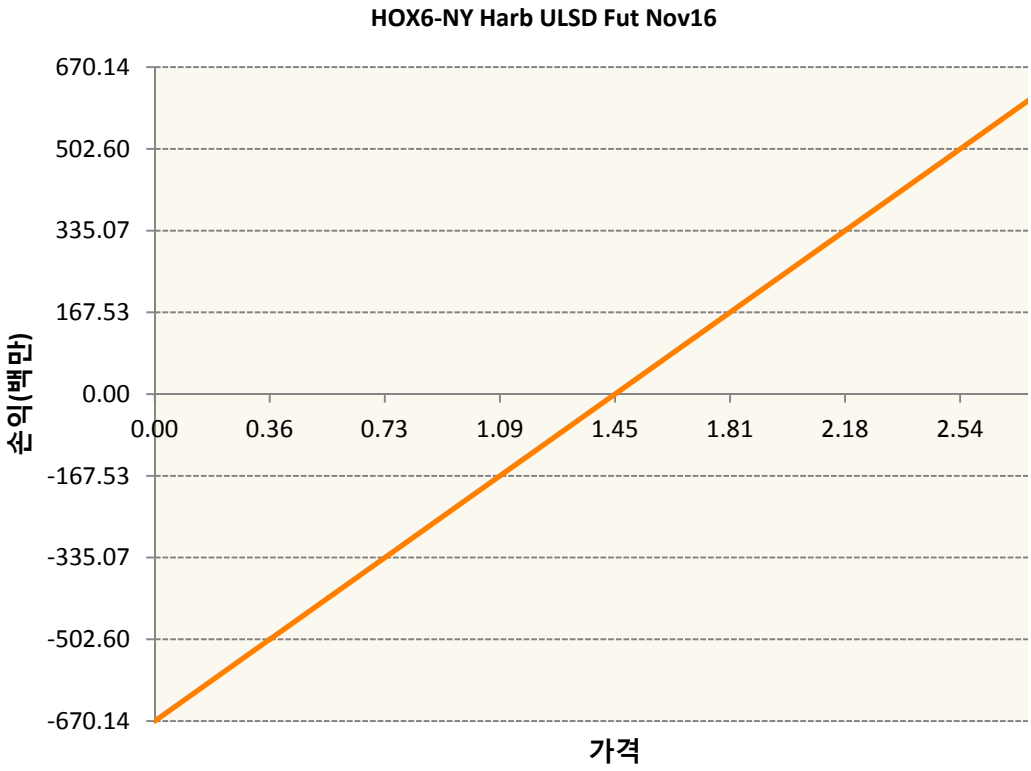
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	5,995	0	5,995	

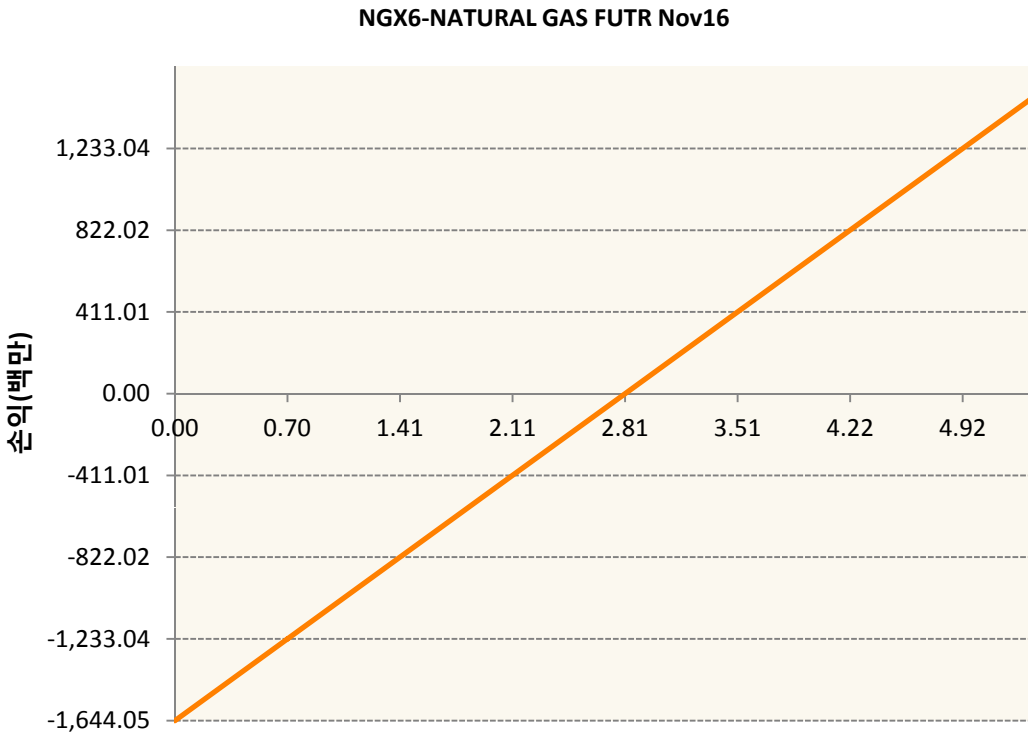
2. 만기시점의 손익구조



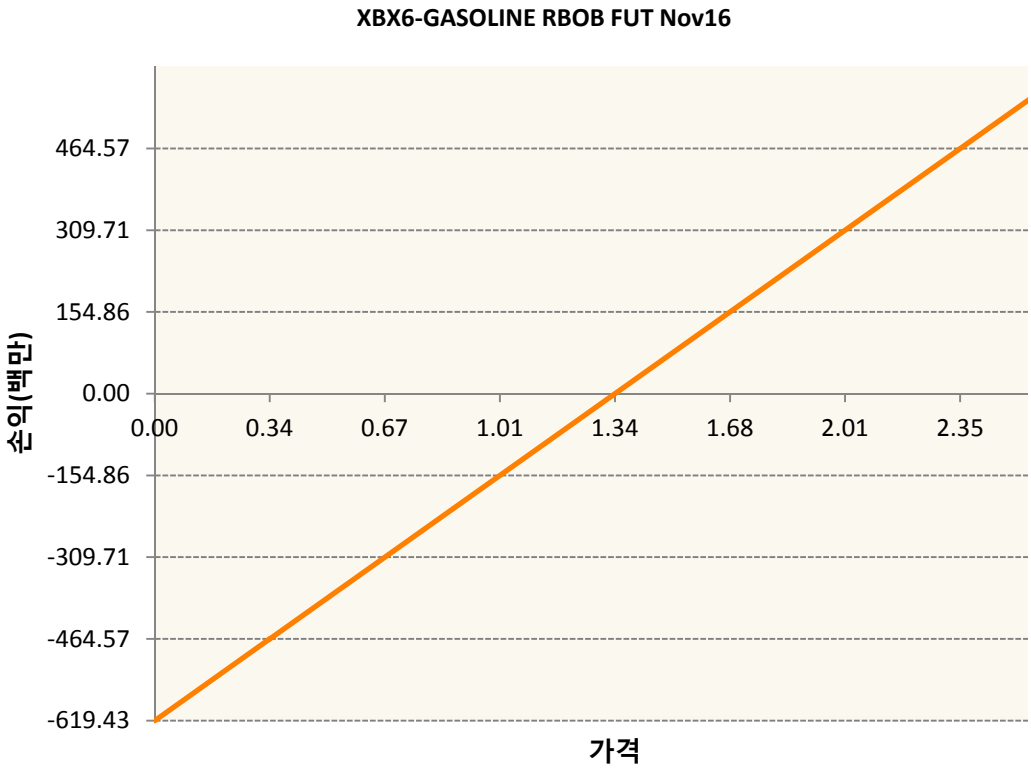



-1,227.19
-1,636.26
가격


HOX6-NY Harb ULSD Fut Nov16
670.14
502.60
335.07
167.53
0.00
-167.53
-335.07
-502.60
-670.14
0.00
0.36
0.73
1.09
1.45
1.81
2.18
2.54
손익(백만)
가격


NGX6-NATURAL GAS FUTR Nov16
1,233.04
822.02
411.01
0.00
-411.01
-822.02
-1,233.04
-1,644.05
0.00
0.70
1.41
2.11
2.81
3.51
4.22
4.92
손익(백만)

가격



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
CLX6	WTI CRUDE FUTURE Nov16	114
COX6	BRENT CRUDE FUTR NOV16	131
HOX6	NY Harb ULSD Fut Nov16	54
NGX6	NATURAL GAS FUTR Nov16	132
XBX6	GASOLINE RBOB FUT Nov16	50

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,065

공시일	2016-09-09
기준일	2016-09-08

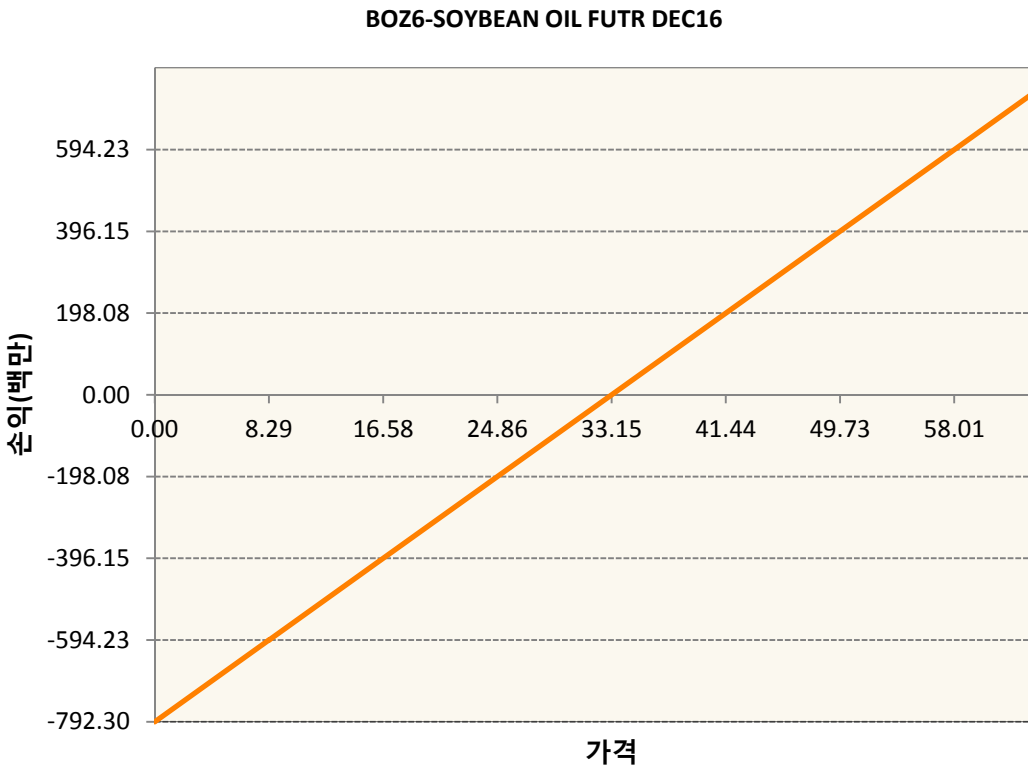
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

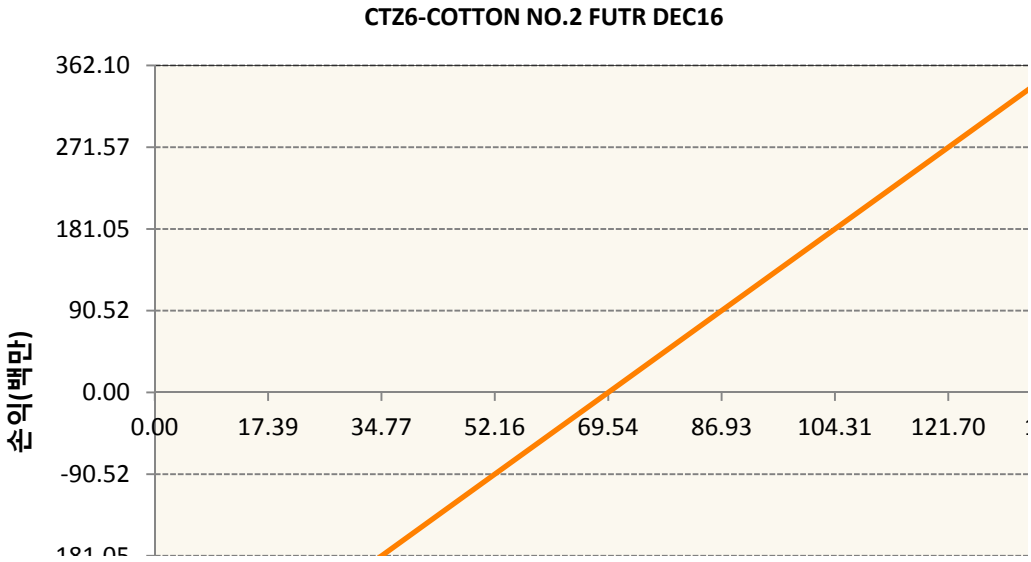
1. 계약금액

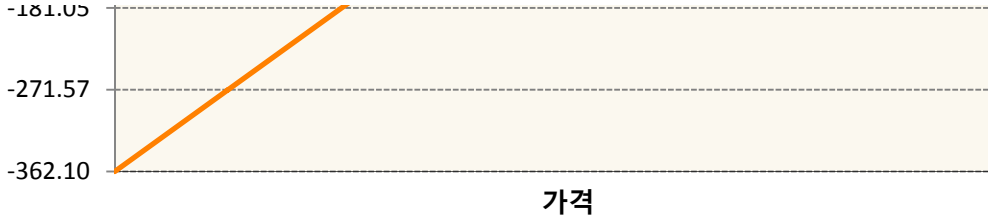
(단위:백만원)

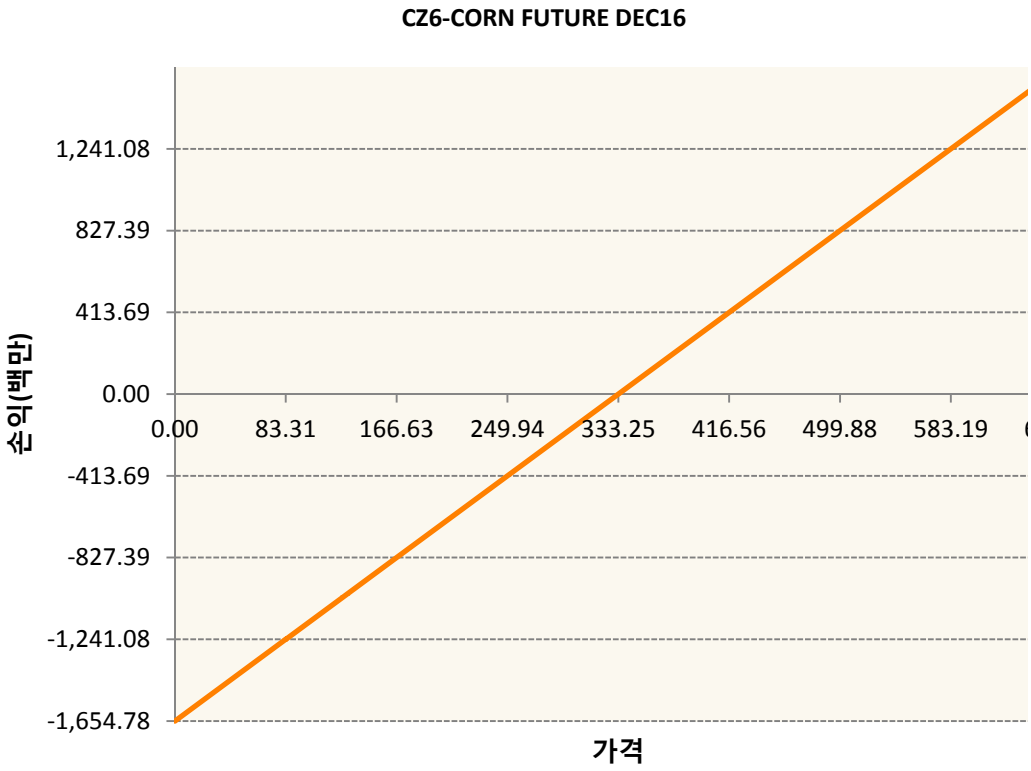
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	8,211	0	8,211	

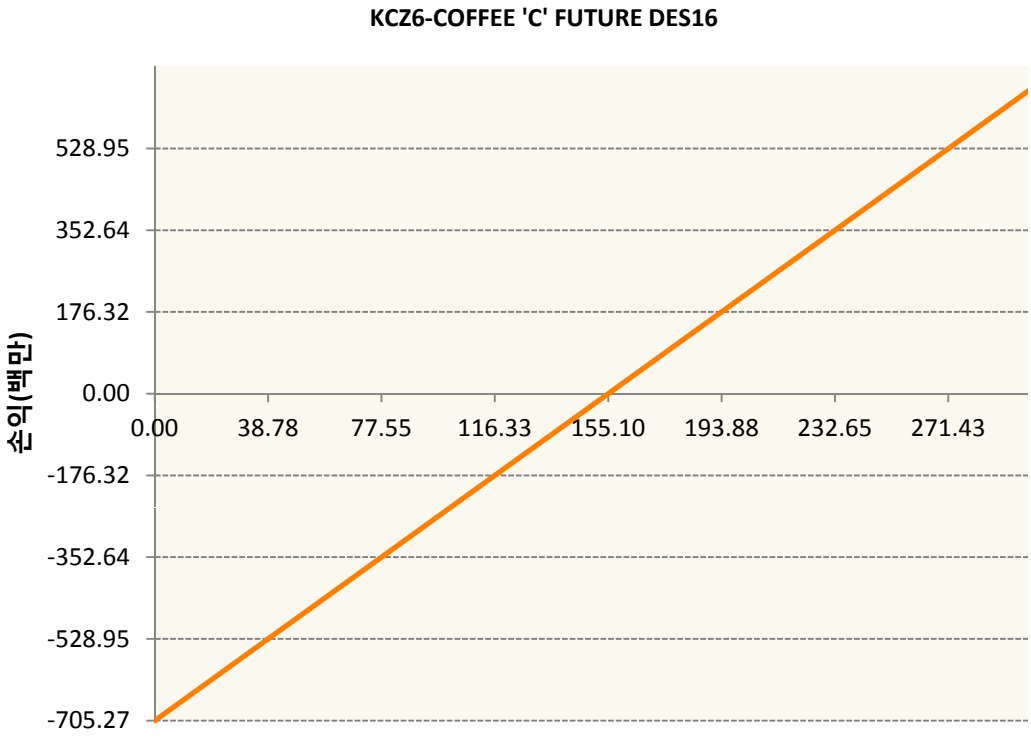
2. 만기시점의 손익구조





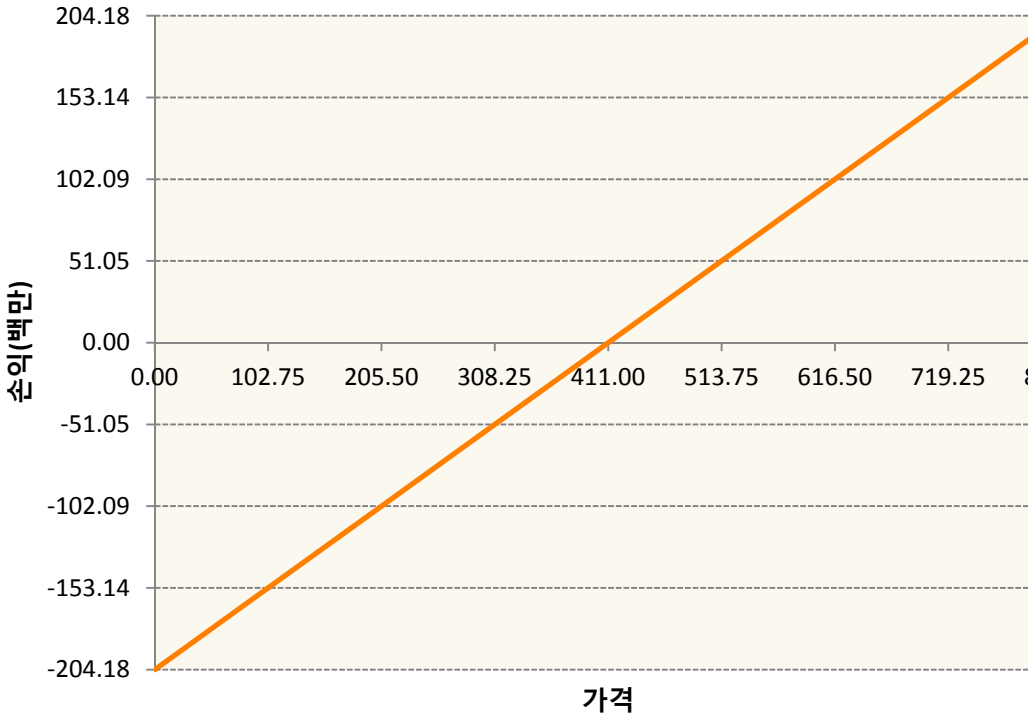

-271.57
-362.10
가격


CZ6-CORN FUTURE DEC16
1,241.08
827.39
413.69
0.00
-413.69
-827.39
-1,241.08
-1,654.78
0.00
83.31
166.63
249.94
333.25
416.56
499.88
583.19
순익(백만)
가격

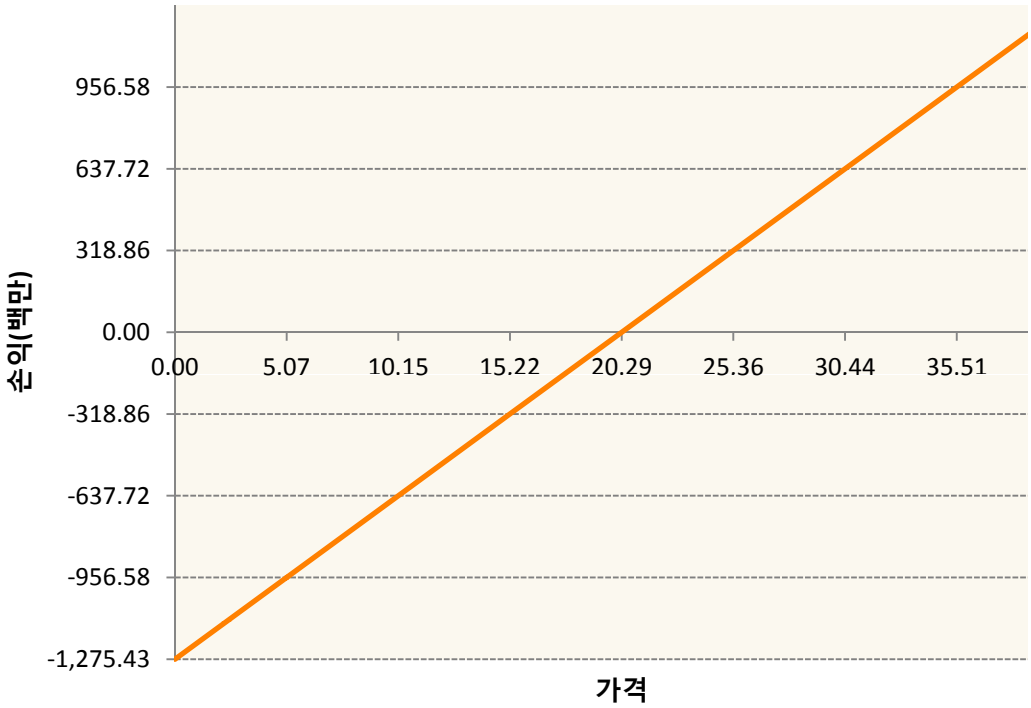

KCZ6-COFFEE 'C' FUTURE DES16
528.95
352.64
176.32
0.00
-176.32
-352.64
-528.95
-705.27
0.00
38.78
77.55
116.33
155.10
193.88
232.65
271.43
순익(백만)

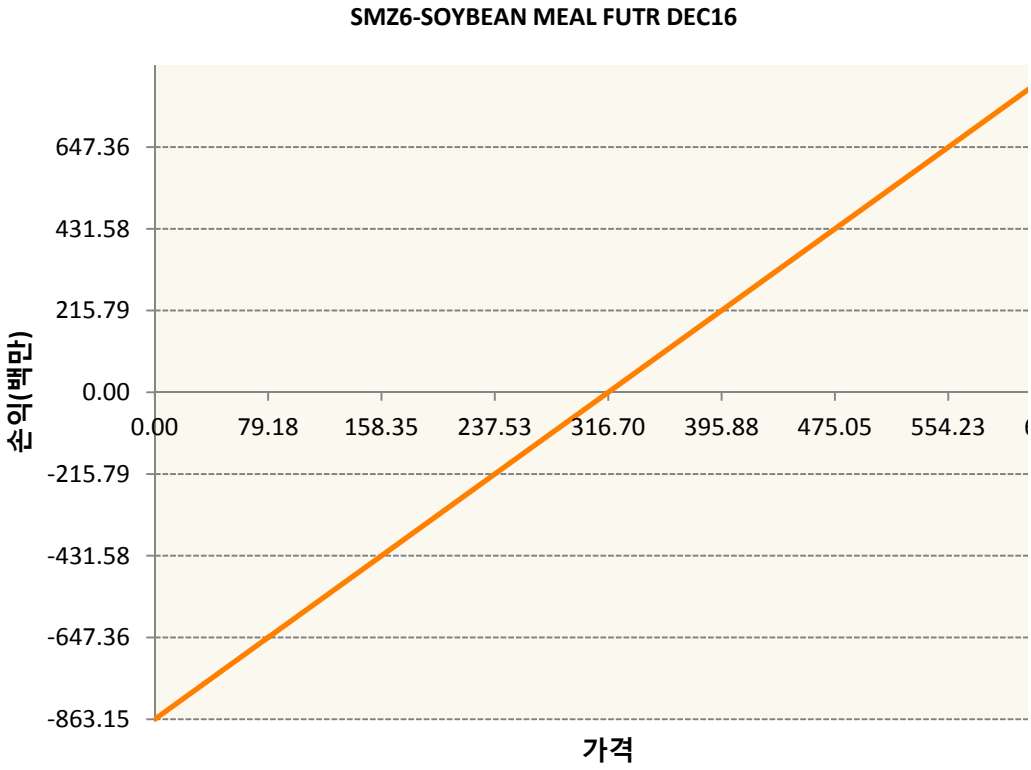
가격

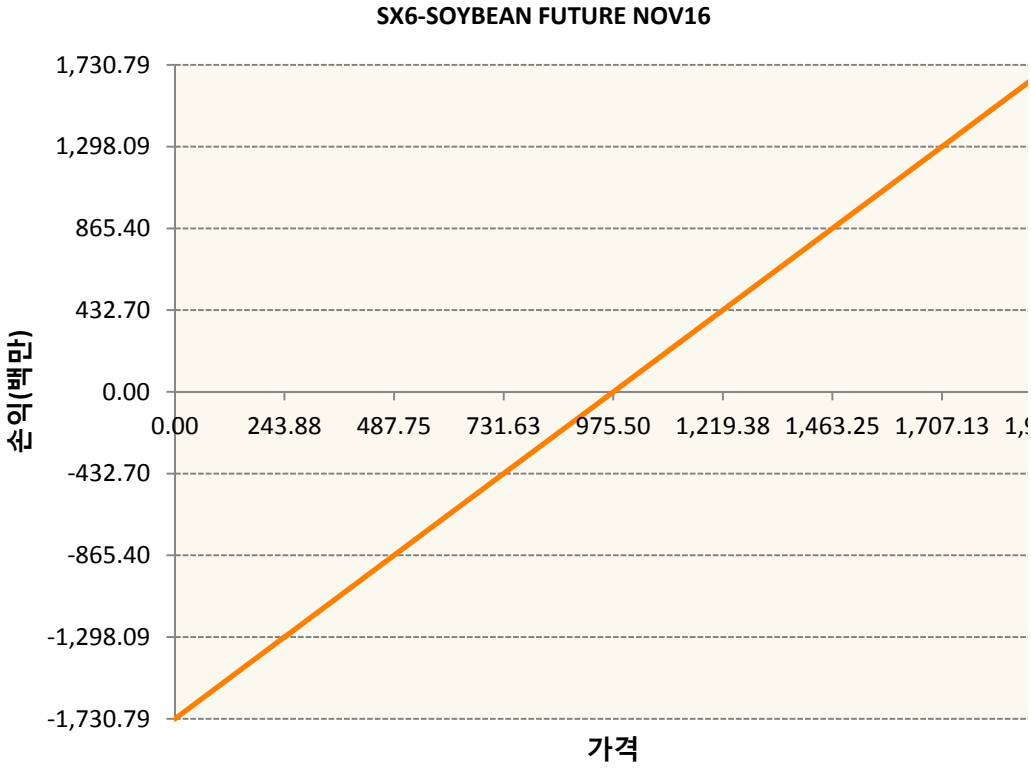
KWZ6-KC HRW WHEAT FUT DES16



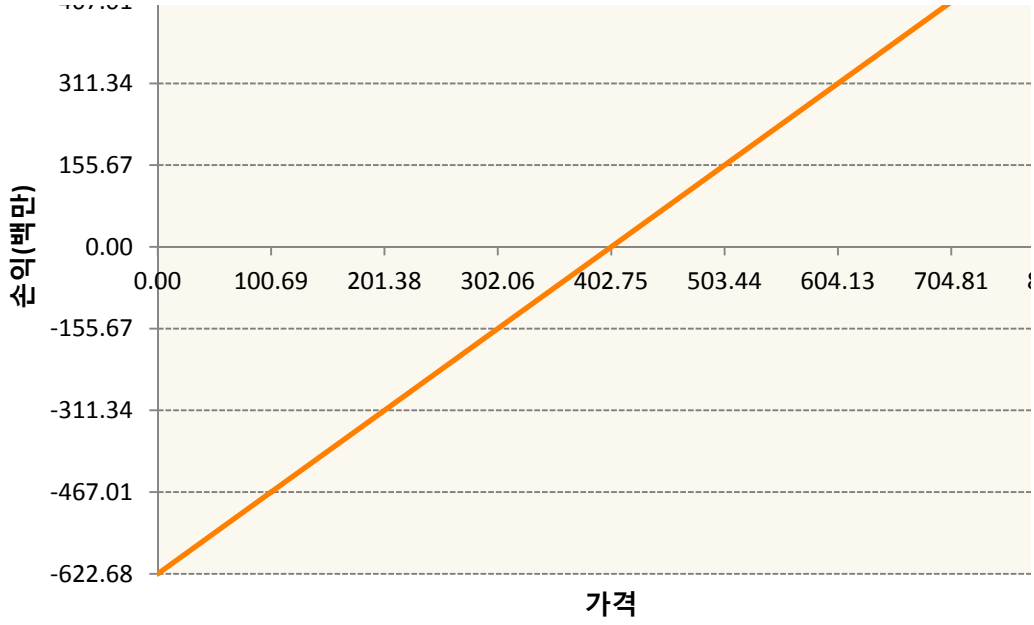
SBV6-SUGAR #11 (WORLD) OCT16




SMZ6-SOYBEAN MEAL FUTR DEC16
647.36
431.58
215.79
0.00
-215.79
-431.58
-647.36
-863.15
0.00
79.18
158.35
237.53
316.70
395.88
475.05
554.23
손익(백만)
가격


SX6-SOYBEAN FUTURE NOV16
1,730.79
1,298.09
865.40
432.70
0.00
-432.70
-865.40
-1,298.09
-1,730.79
0.00
243.88
487.75
731.63
975.50
1,219.38
1,463.25
1,707.13
손익(백만)
가격


WZ6-WHEAT FUTURE(CBT) DEC16
622.68
467.01



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

BOZ6	SOYBEAN OIL FUTR DEC16	63
CTZ6	COTTON NO.2 FUTR DEC16	29
CZ6	CORN FUTURE DEC16	132
KCZ6	COFFEE 'C' FUTURE DES16	56
KWZ6	KC HRW WHEAT FUT DES16	16
SBV6	SUGAR #11 (WORLD) OCT16	102
SMZ6	SOYBEAN MEAL FUTR DEC16	69
SX6	SOYBEAN FUTURE NOV16	138
WZ6	WHEAT FUTURE(CBT) DEC16	50

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

815