공시일	2016-09-12
기준일	2016-09-09

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	2016-09-12
기준일	2016-09-09

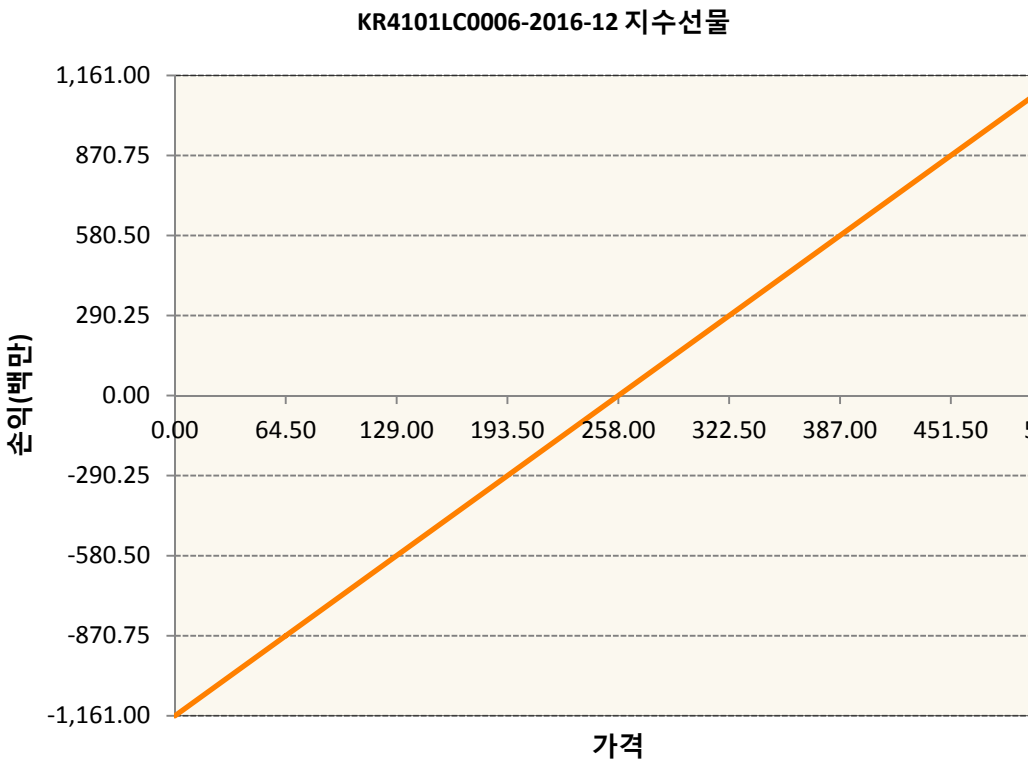
스마트인덱스모

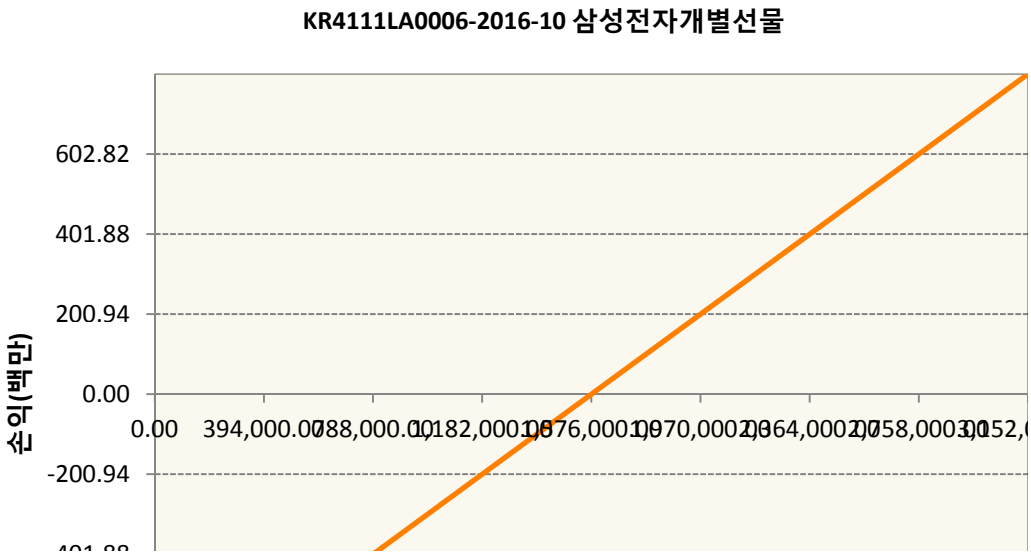
1. 계약금액

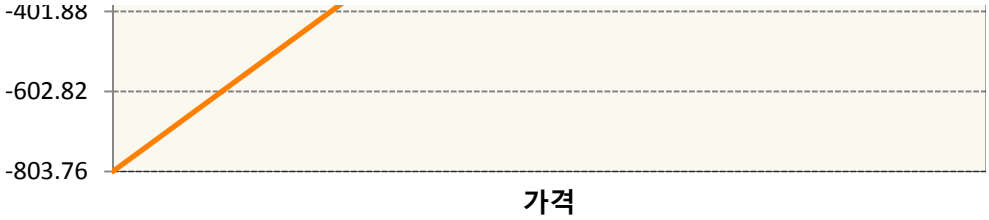
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,965	0	1,965	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101LC00 2016-12 지수선물							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
KR4111LA00 2016-10 삼성전자개별선물							64
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-64	-64	-64	-64	-64	-64	-64
-5.33%	-43	-43	-43	-43	-43	-43	-43
-2.67%	-21	-21	-21	-21	-21	-21	-21
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	21	21	21	21	21	21	21
5.33%	43	43	43	43	43	43	43
8.00%	64	64	64	64	64	64	64

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

139

공시일	2016-09-12
기준일	2016-09-09

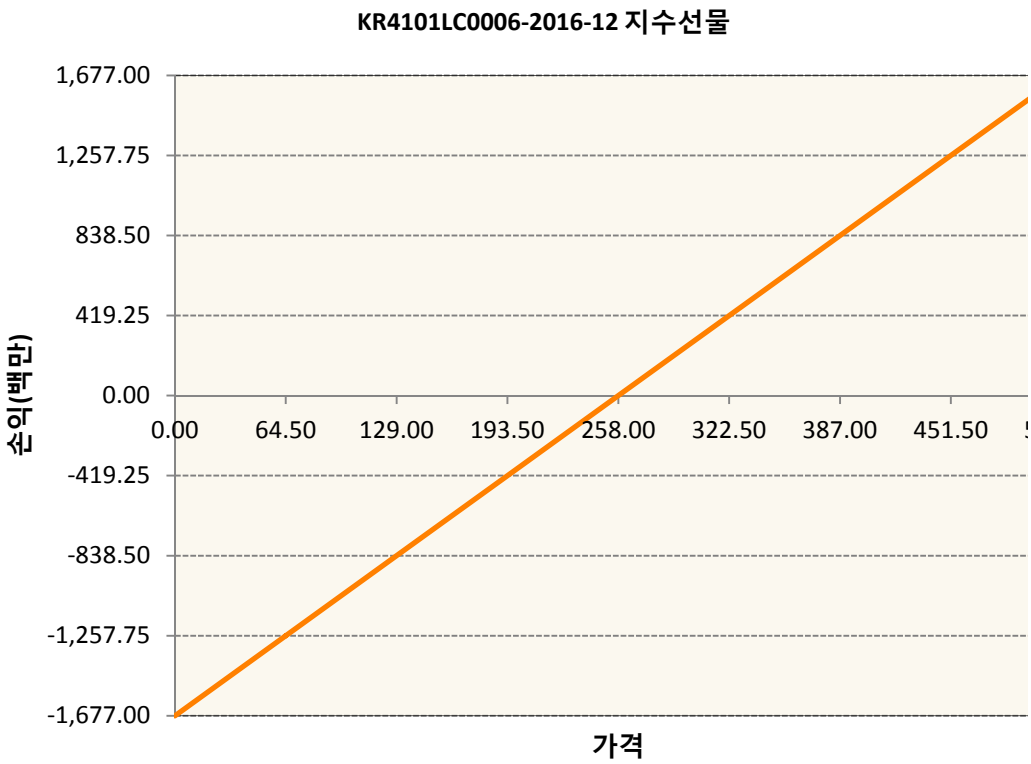
스마트레버리지목표전환형1호

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	1,677	0	1,677	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101LC00 2016-12 지수선물							134
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-134	-134	-134	-134	-134	-134	-134
-5.33%	-89	-89	-89	-89	-89	-89	-89
-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%	89	89	89	89	89	89	89
8.00%	134	134	134	134	134	134	134

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

105

공시일	2016-09-12
기준일	2016-09-09

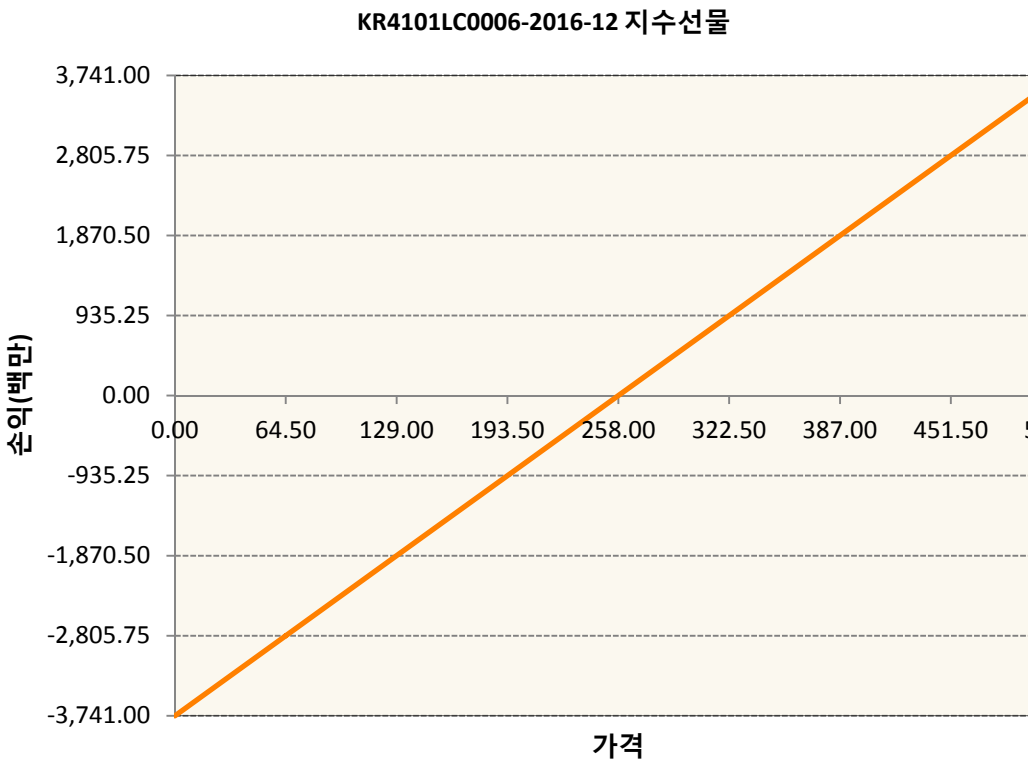
1.3배 레버리지 인덱스(주식-파생형)

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	3,741	0	3,741	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101LC00 2016-12 지수선물							298
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-298	-298	-298	-298	-298	-298	-298
-5.33%	-199	-199	-199	-199	-199	-199	-199
-2.67%	-99	-99	-99	-99	-99	-99	-99
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	99	99	99	99	99	99	99
5.33%	199	199	199	199	199	199	199
8.00%	298	298	298	298	298	298	298

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

234

공시일	2016-09-12
기준일	2016-09-09

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)

743

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2016-09-12
기준일	2016-09-09

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	5,098	0	5,098	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI50000 신한CSI500미래S160908	405

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

879

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2016-09-12
기준일	2016-09-09

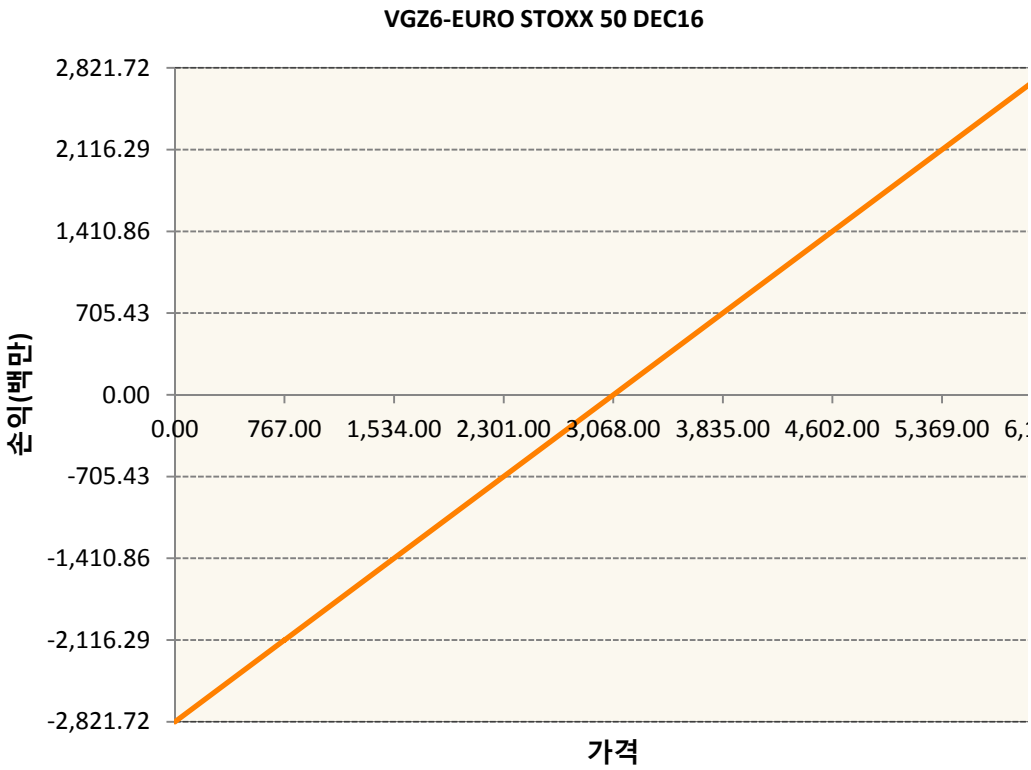
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,822	0	2,822	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGZ6	EURO STOXX 50 DEC16	226

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

(단위:백만원)

278

공시일	2016-09-12
기준일	2016-09-09

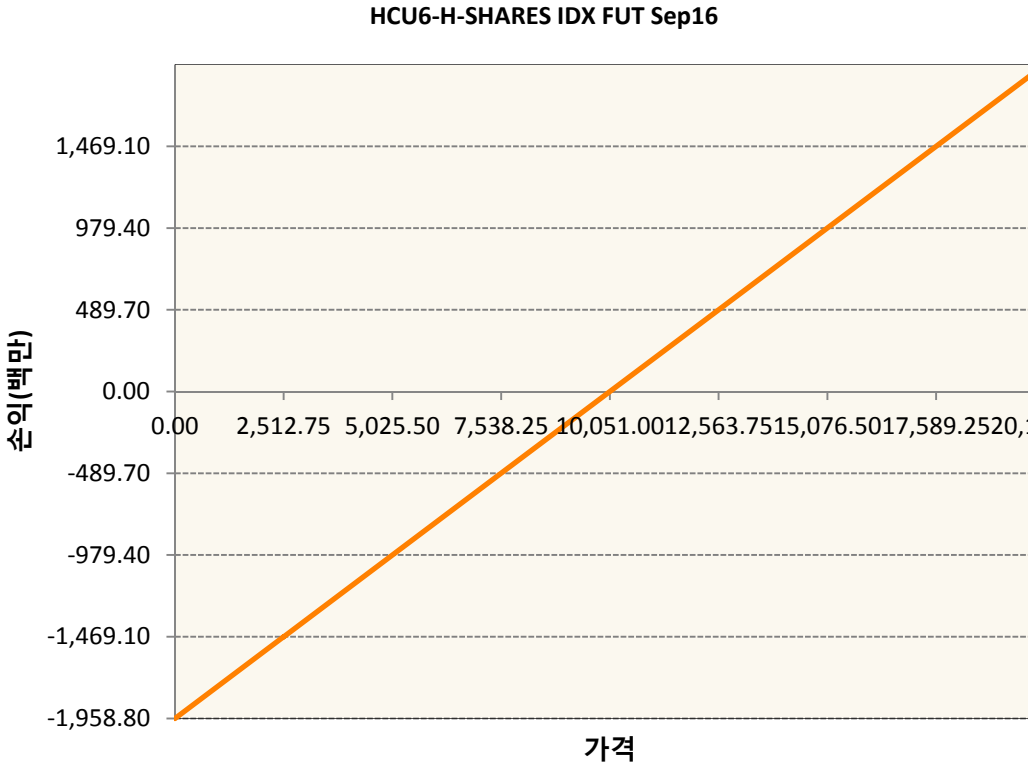
차이나인덱스모(주식-파생형)

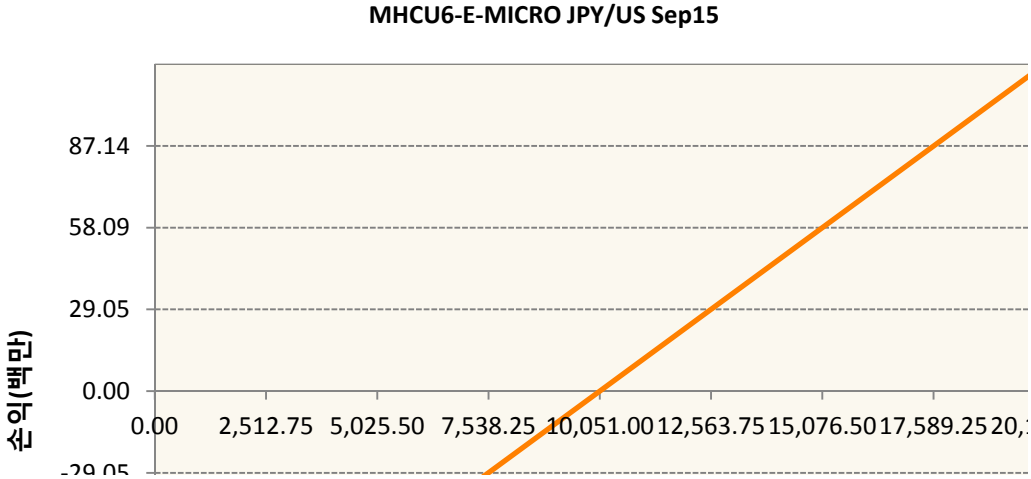
1. 계약금액

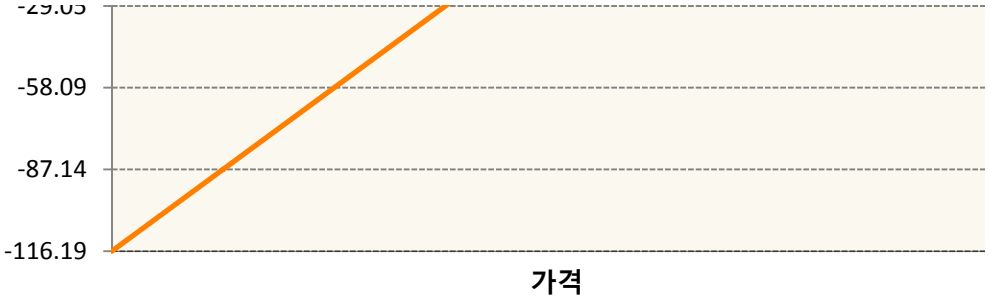
(단위:백만원)

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	1,959	0	1,959	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCU6	H-SHARES IDX FUT Sep16	157
MHCU6	E-MICRO JPY/US Sep15	9

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	225

공시일	2016-09-12
기준일	2016-09-09

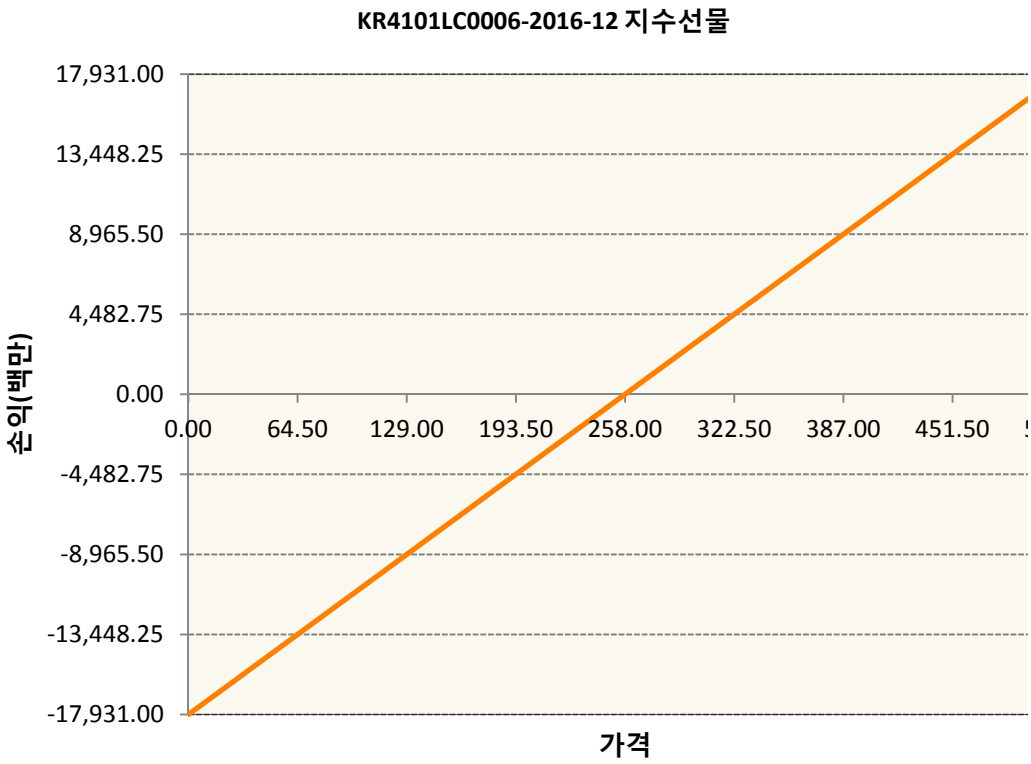
커버드콜(주식혼합-파생형)

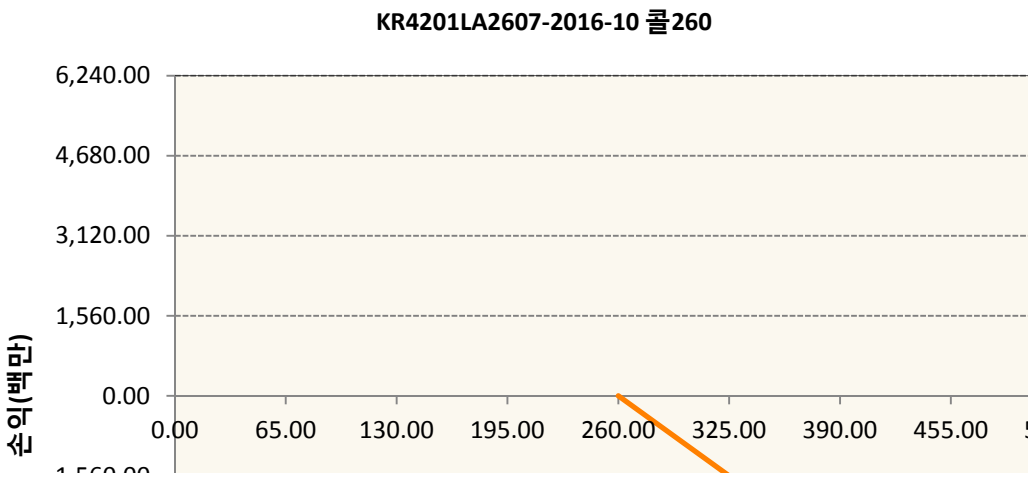
1. 계약금액

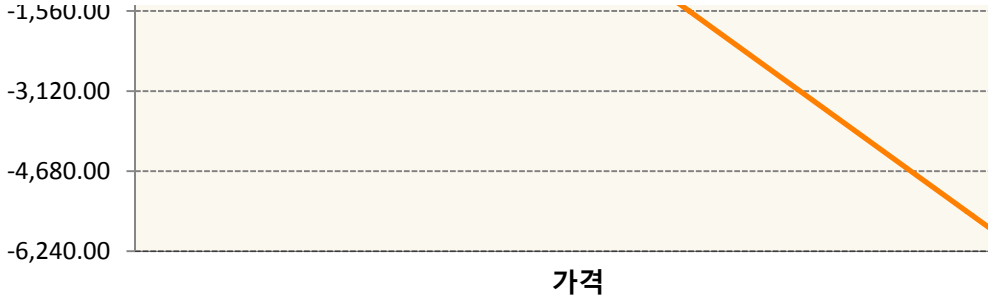
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	645	0	645	장내
신규	유가증권	옵션	0	131	-131	장내
누계	유가증권	선물	17,931	0	17,931	장내
누계	유가증권	옵션	0	6,240	-6,240	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101LC00 2016-12 지수선물							1,431
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,431	-1,431	-1,431	-1,431	-1,431	-1,431	-1,431
-5.33%	-954	-954	-954	-954	-954	-954	-954
-2.67%	-477	-477	-477	-477	-477	-477	-477
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	477	477	477	477	477	477	477
5.33%	954	954	954	954	954	954	954
8.00%	1,431	1,431	1,431	1,431	1,431	1,431	1,431
KR4201LA26 2016-10 콜260							1,880
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	301	301	301	300	298	296	292
-5.33%	299	296	292	286	278	268	256
-2.67%	270	255	237	216	194	170	145
0%	106	71	36	0	-36	-72	-108
2.67%	-339	-372	-405	-439	-474	-509	-545
5.33%	-1,036	-1,050	-1,066	-1,085	-1,106	-1,129	-1,153
8.00%	-1,836	-1,839	-1,843	-1,849	-1,858	-1,868	-1,880

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

3,106

공시일	2016-09-12
기준일	2016-09-09

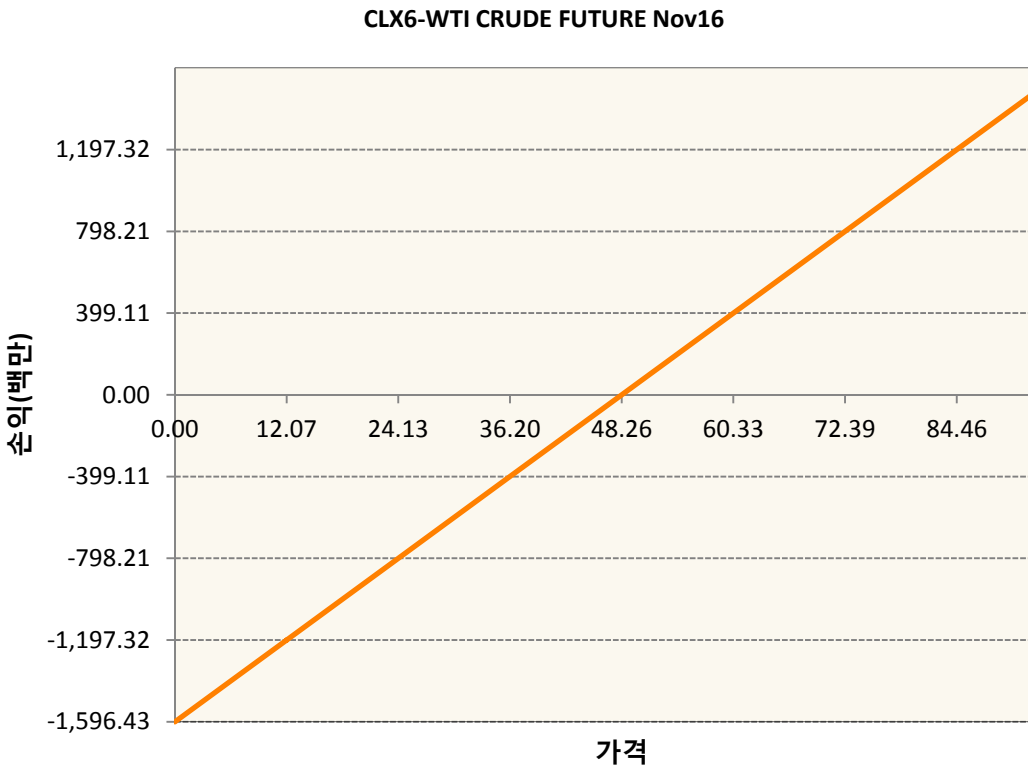
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

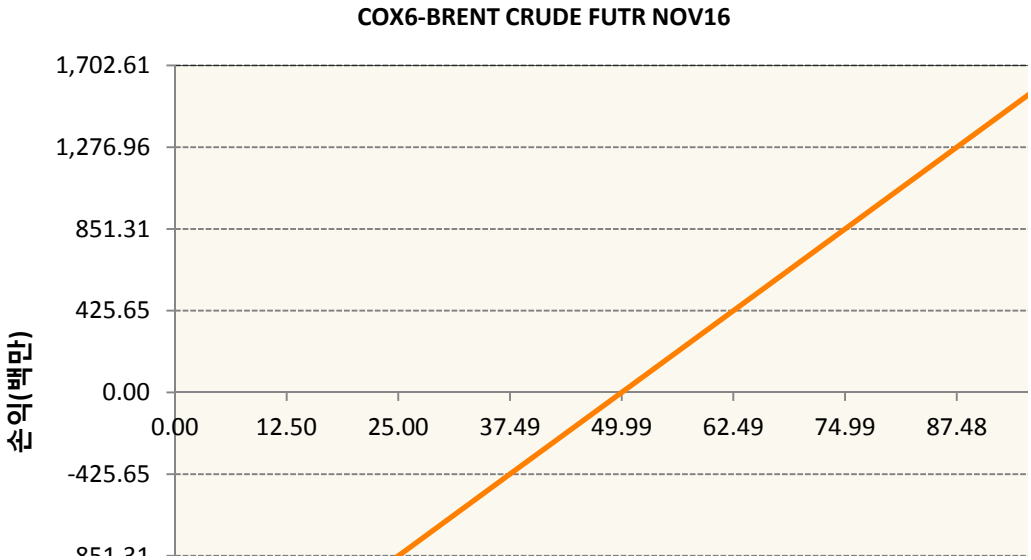
1. 계약금액

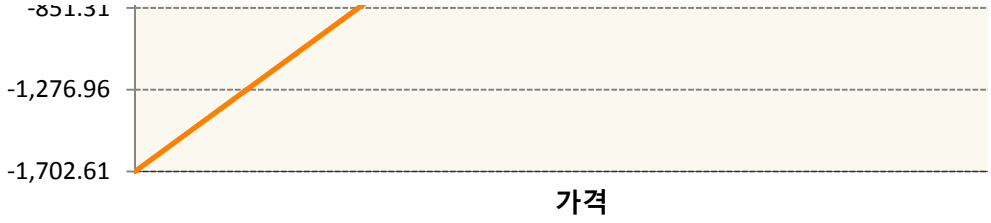
(단위:백만원)

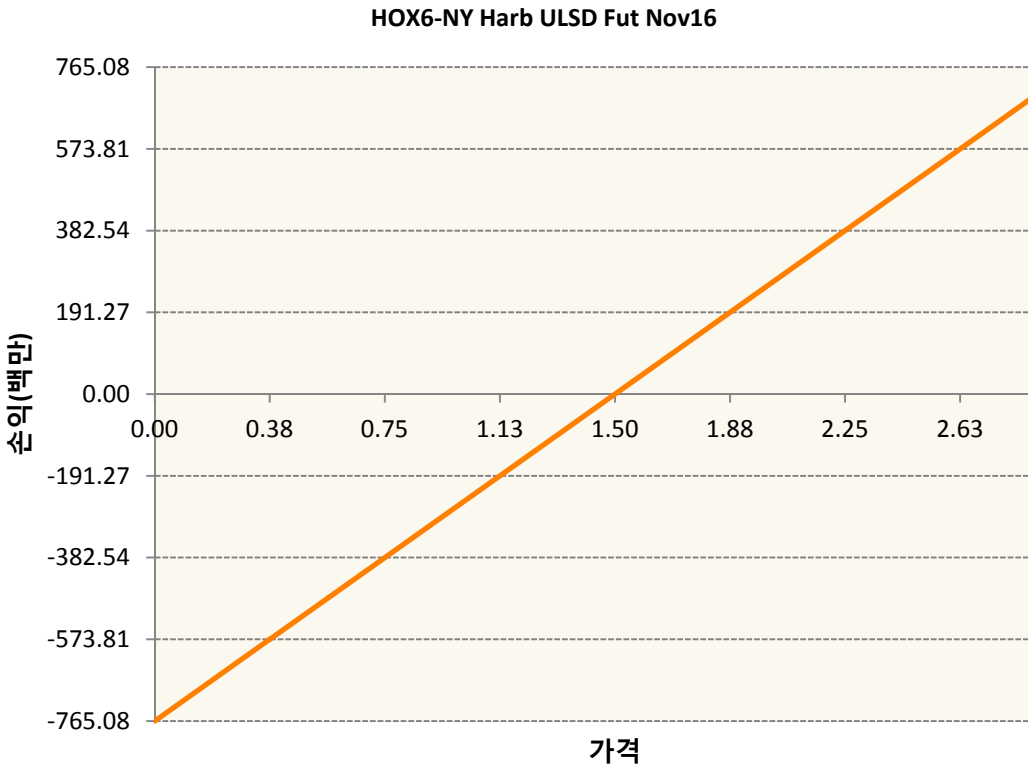
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	6,420	0	6,420	

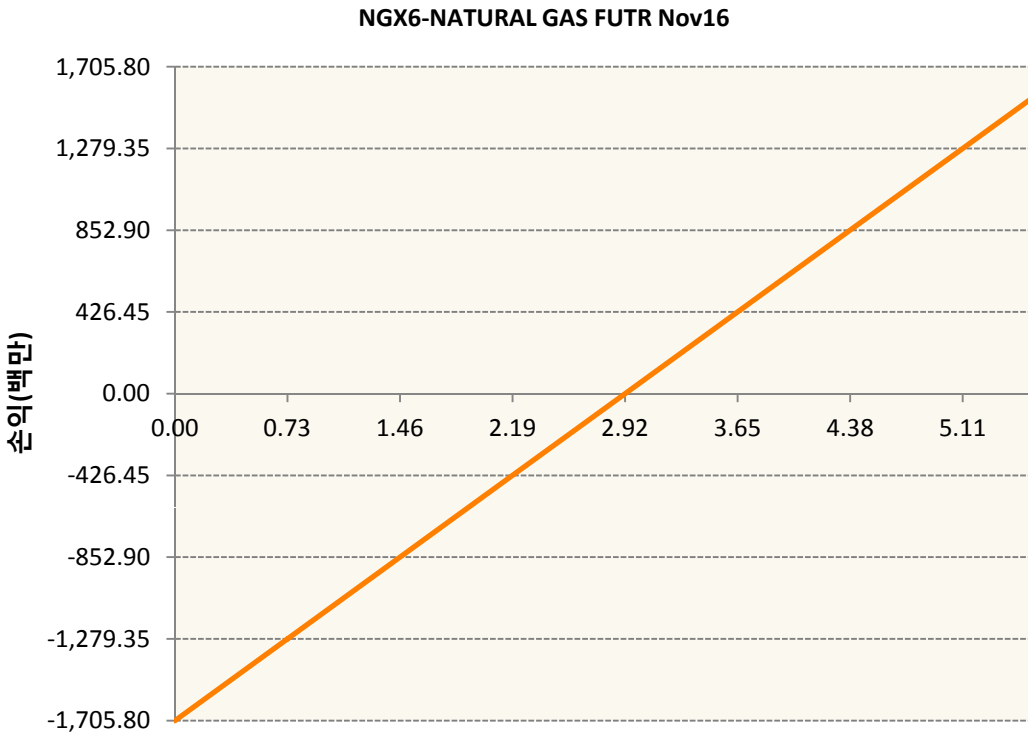
2. 만기시점의 손익구조



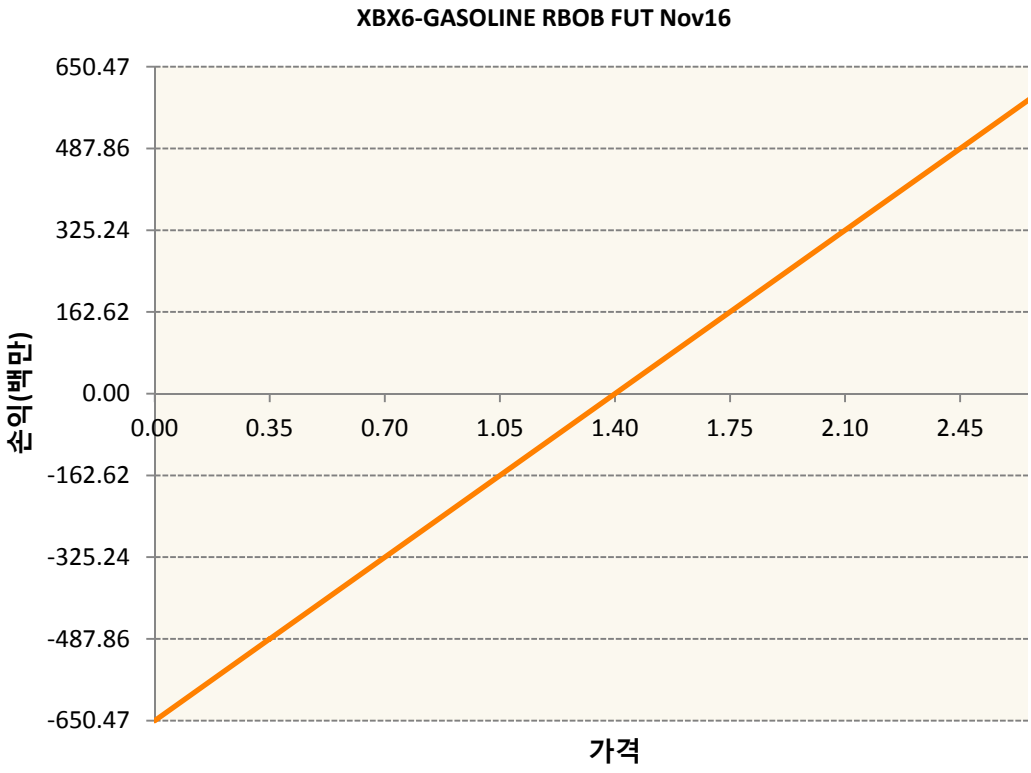



-1,276.96
-1,702.61
가격


HOX6-NY Harb ULSD Fut Nov16
765.08
573.81
382.54
191.27
0.00
-191.27
-382.54
-573.81
-765.08
0.00
0.38
0.75
1.13
1.50
1.88
2.25
2.63
손익(백만)
가격


NGX6-NATURAL GAS FUTR Nov16
1,705.80
1,279.35
852.90
426.45
0.00
-426.45
-852.90
-1,279.35
-1,705.80
0.00
0.73
1.46
2.19
2.92
3.65
4.38
5.11
손익(백만)

가격



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
CLX6	WTI CRUDE FUTURE Nov16	128
COX6	BRENT CRUDE FUTR NOV16	136
HOX6	NY Harb ULSD Fut Nov16	61
NGX6	NATURAL GAS FUTR Nov16	136
XBX6	GASOLINE RBOB FUT Nov16	52

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,140

공시일	2016-09-12
기준일	2016-09-09

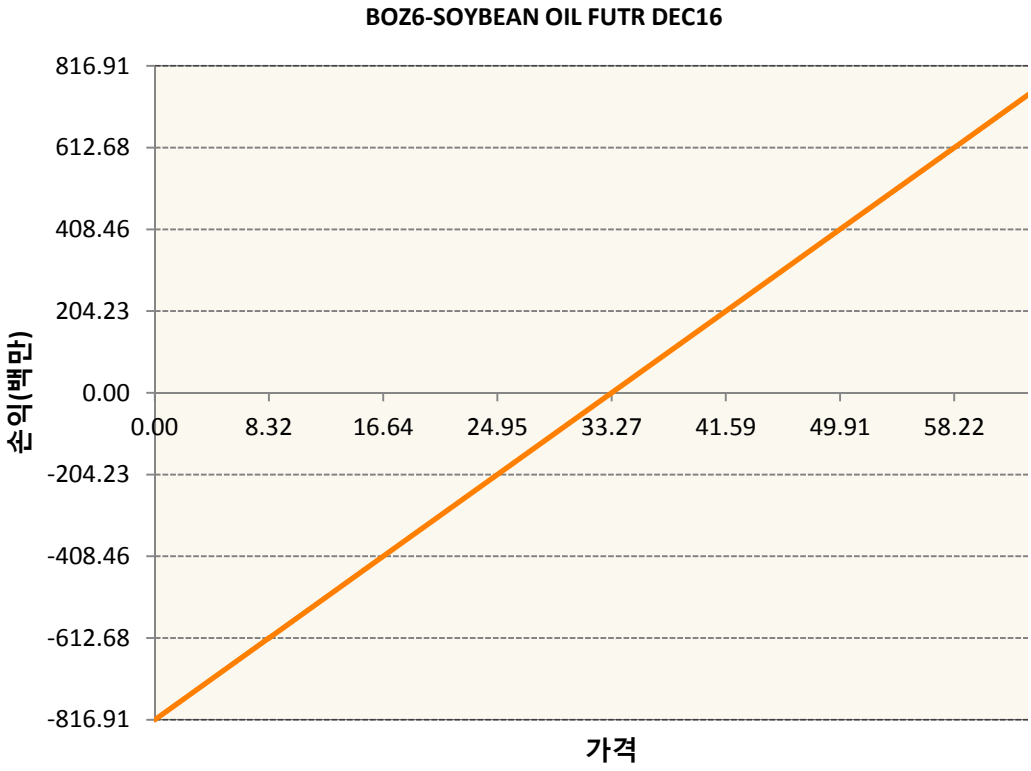
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

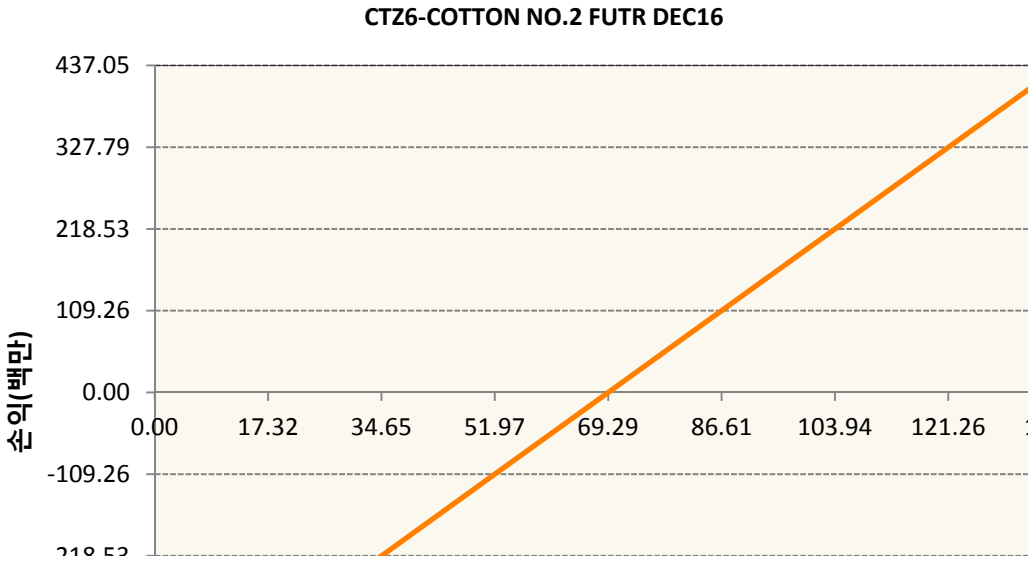
1. 계약금액

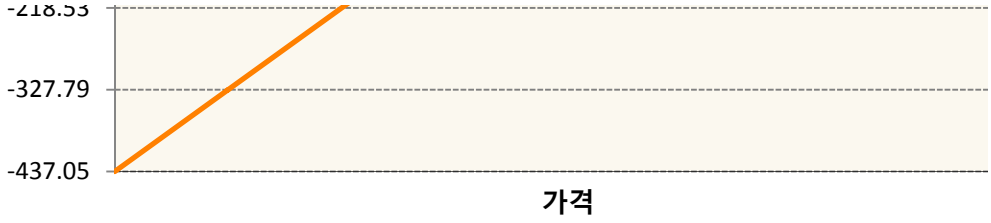
(단위:백만원)

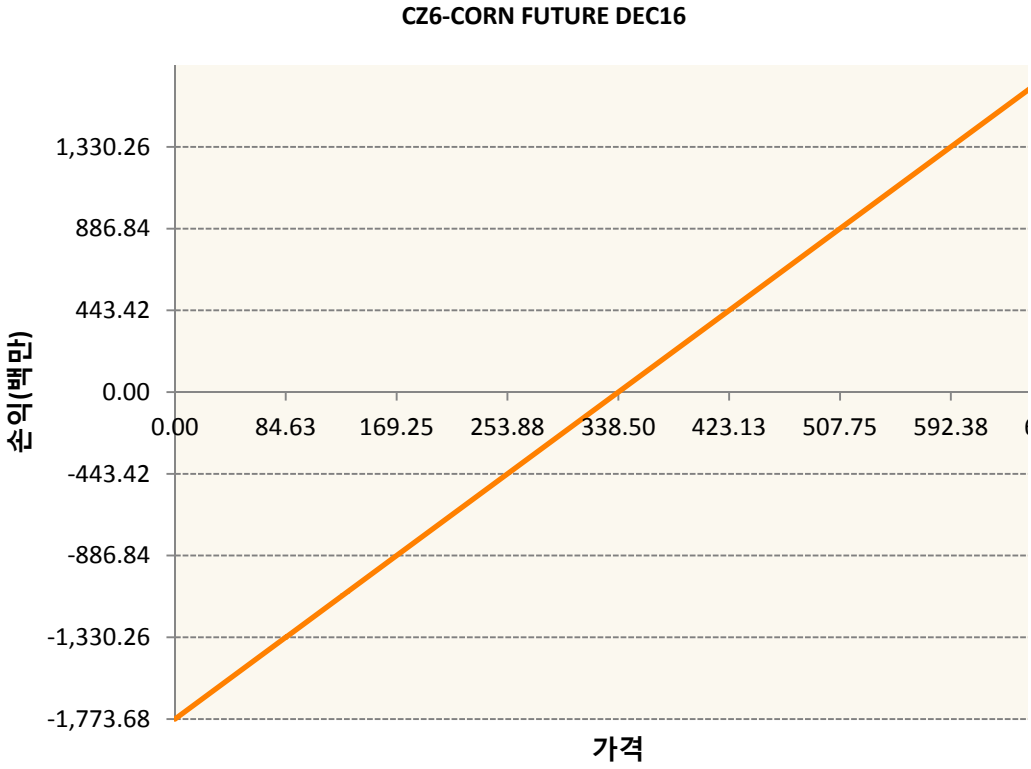
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	8,765	0	8,765	

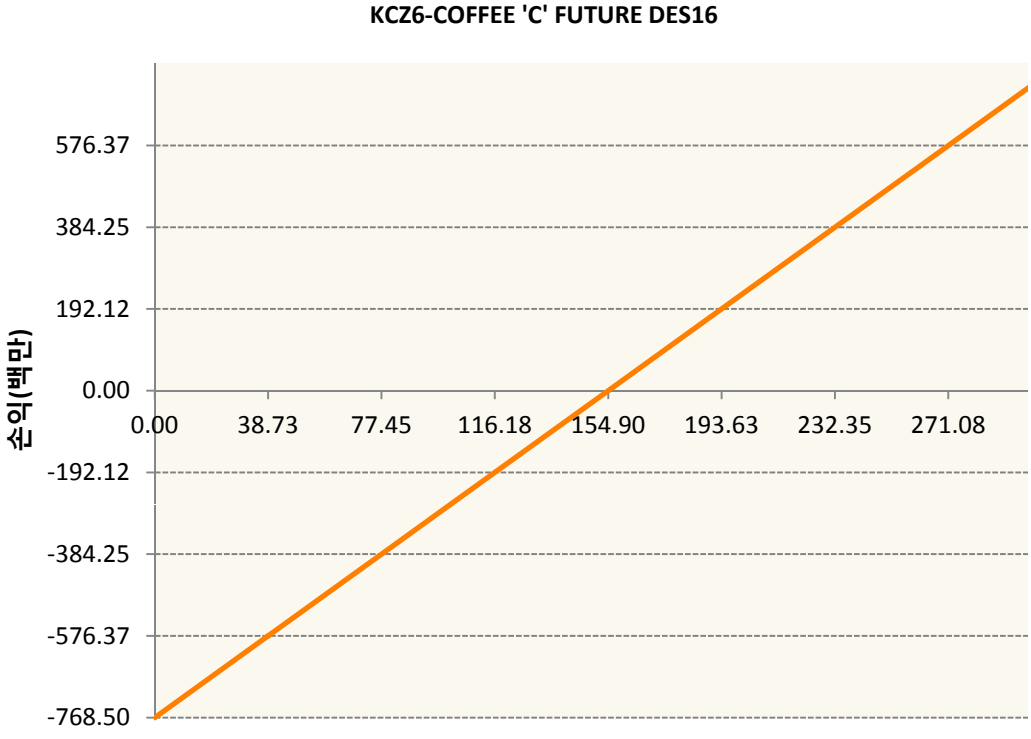
2. 만기시점의 손익구조



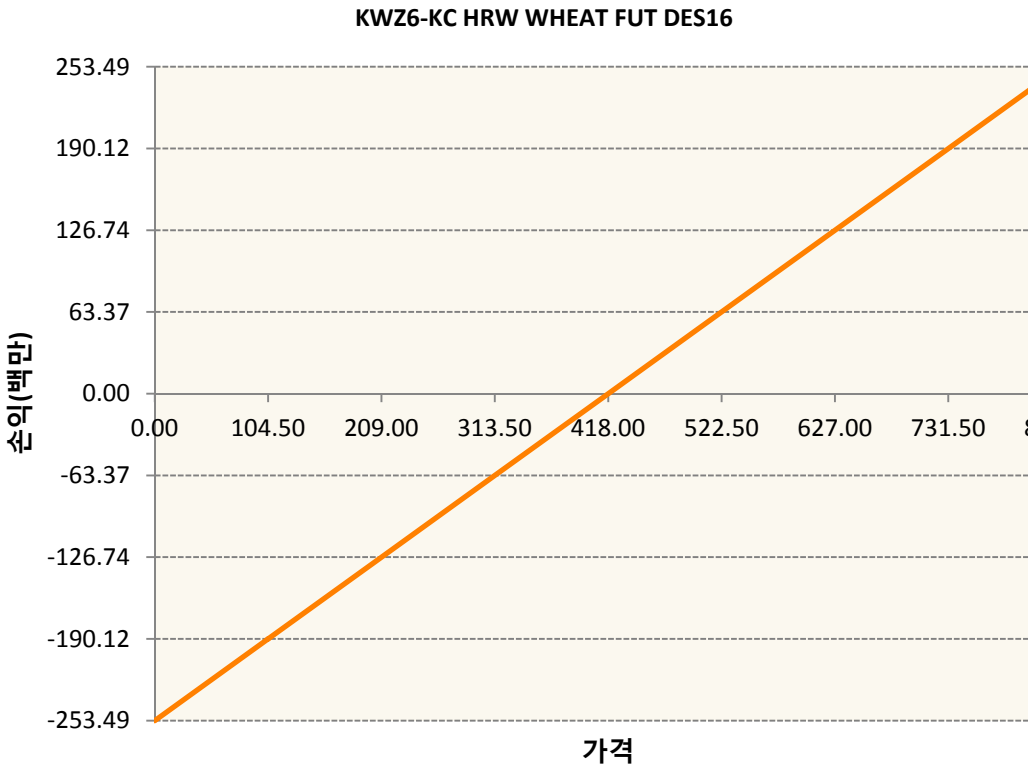


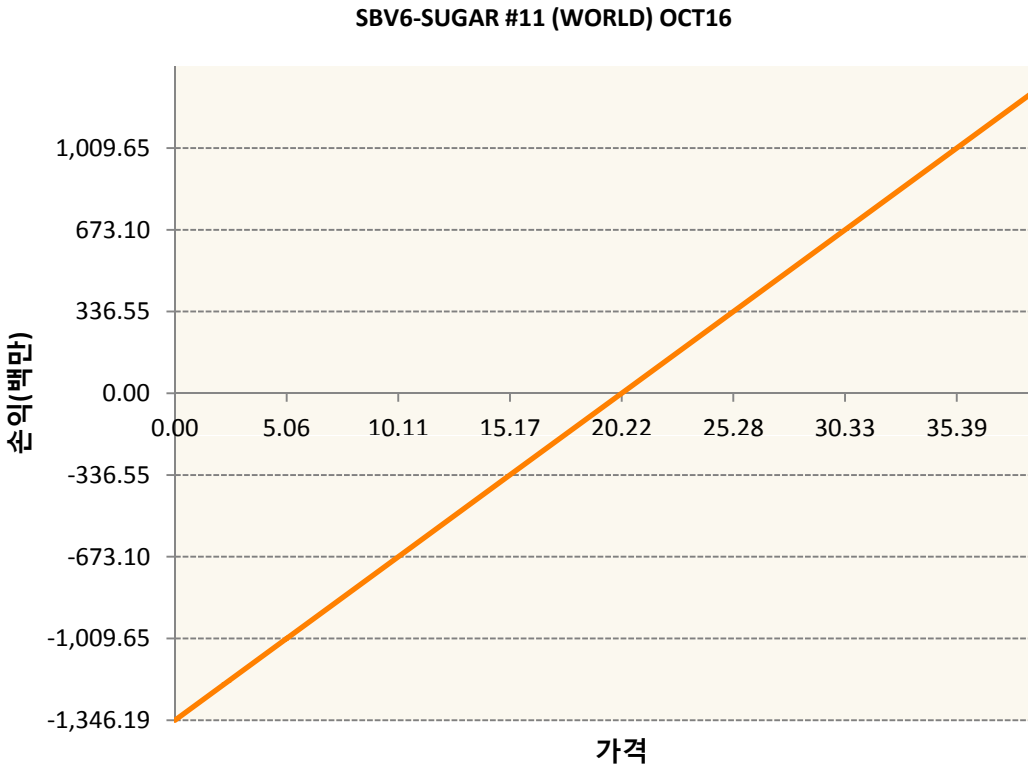

-218.53
-327.79
-437.05
가격

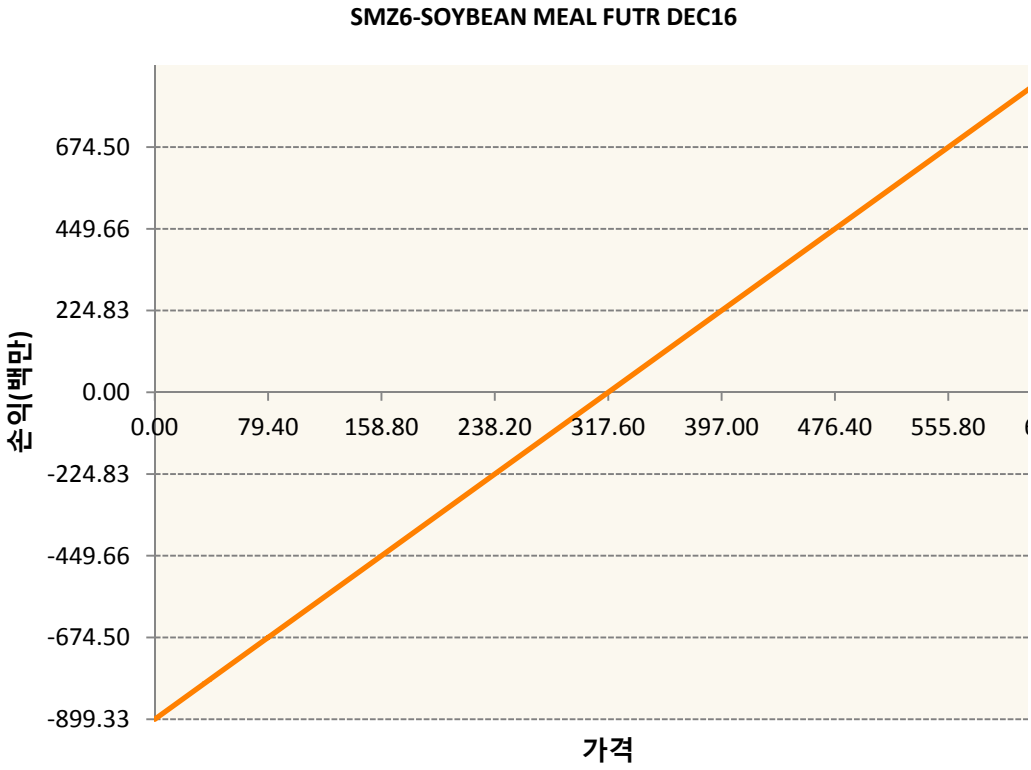

CZ6-CORN FUTURE DEC16
1,330.26
886.84
443.42
0.00
-443.42
-886.84
-1,330.26
-1,773.68
0.00
84.63
169.25
253.88
338.50
423.13
507.75
592.38
손익(백만)
가격

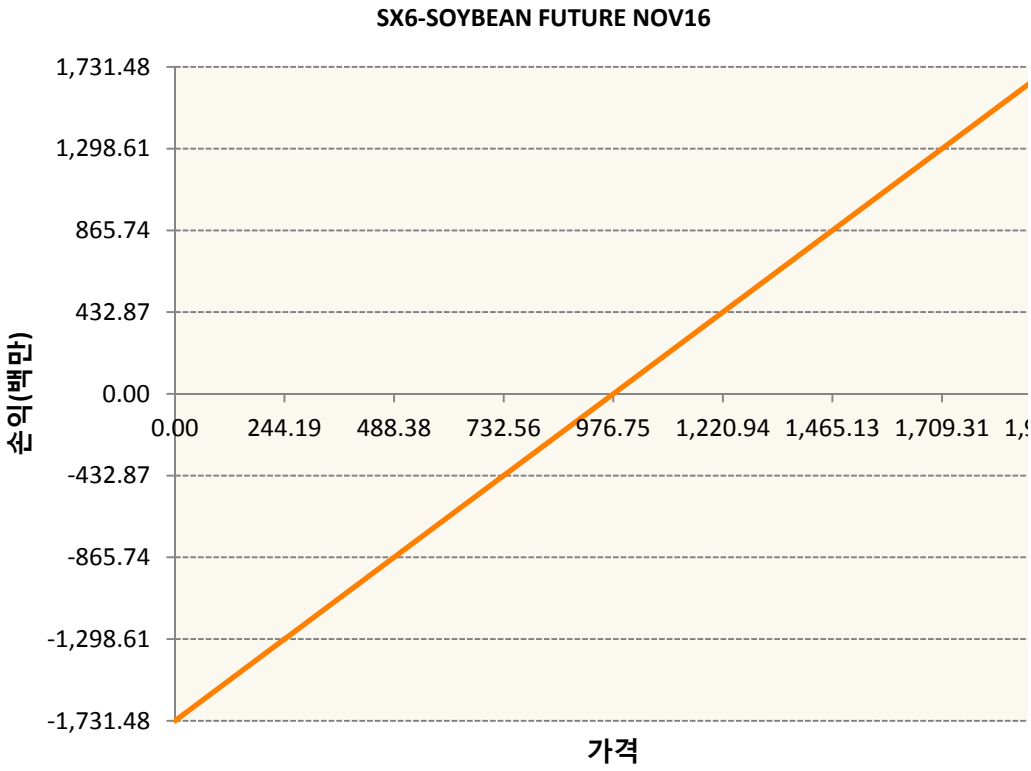

KCZ6-COFFEE 'C' FUTURE DES16
576.37
384.25
192.12
0.00
-192.12
-384.25
-576.37
-768.50
0.00
38.73
77.45
116.18
154.90
193.63
232.35
271.08
손익(백만)

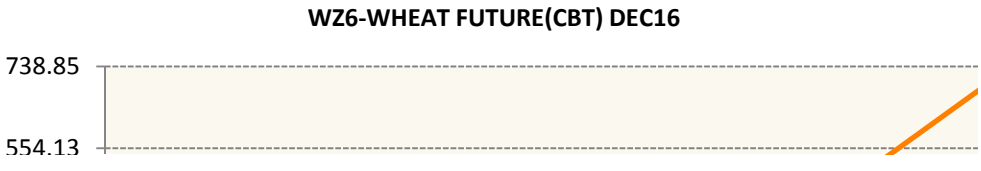
가격

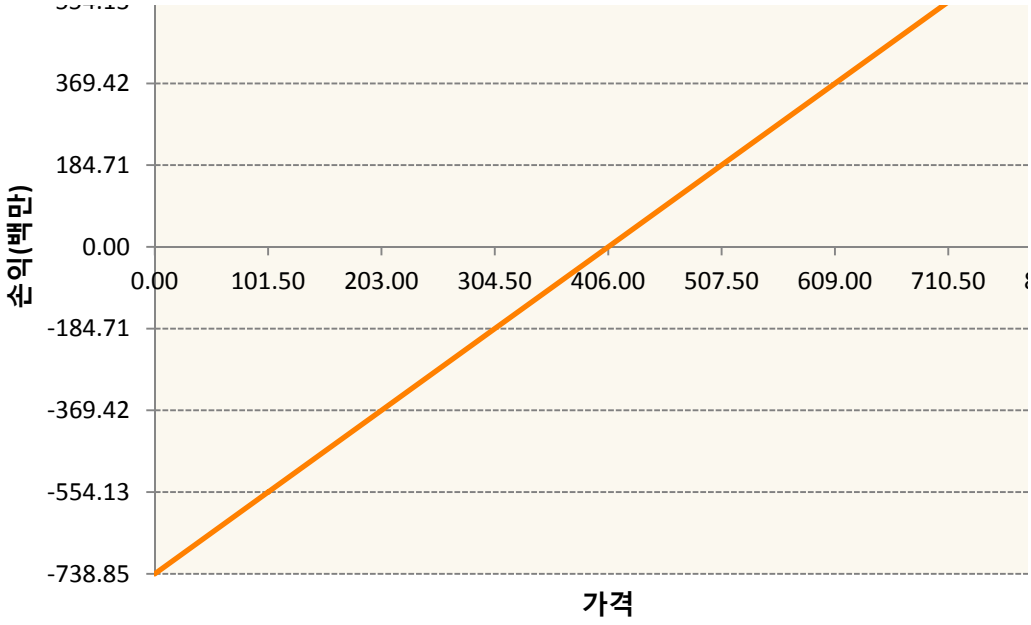

KWZ6-KC HRW WHEAT FUT DES16
253.49
190.12
126.74
63.37
0.00
-63.37
-126.74
-190.12
-253.49
0.00
104.50
209.00
313.50
418.00
522.50
627.00
731.50
손익(백만)
가격


SBV6-SUGAR #11 (WORLD) OCT16
1,009.65
673.10
336.55
0.00
-336.55
-673.10
-1,009.65
-1,346.19
0.00
5.06
10.11
15.17
20.22
25.28
30.33
35.39
손익(백만)
가격


SMZ6-SOYBEAN MEAL FUTR DEC16
674.50
449.66
224.83
0.00
-224.83
-449.66
-674.50
-899.33
0.00
79.40
158.80
238.20
317.60
397.00
476.40
555.80
손익(백만)
가격


SX6-SOYBEAN FUTURE NOV16
1,731.48
1,298.61
865.74
432.87
0.00
-432.87
-865.74
-1,298.61
-1,731.48
0.00
244.19
488.38
732.56
976.75
1,220.94
1,465.13
1,709.31
손익(백만)
가격


WZ6-WHEAT FUTURE(CBT) DEC16
738.85
554.13



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

BOZ6	SOYBEAN OIL FUTR DEC16	65
CTZ6	COTTON NO.2 FUTR DEC16	35
CZ6	CORN FUTURE DEC16	142
KCZ6	COFFEE 'C' FUTURE DES16	61
KWZ6	KC HRW WHEAT FUT DES16	20
SBV6	SUGAR #11 (WORLD) OCT16	108
SMZ6	SOYBEAN MEAL FUTR DEC16	72
SX6	SOYBEAN FUTURE NOV16	139
WZ6	WHEAT FUTURE(CBT) DEC16	59

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

872