공시일	2016-09-13
기준일	2016-09-12

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	2016-09-13
기준일	2016-09-12

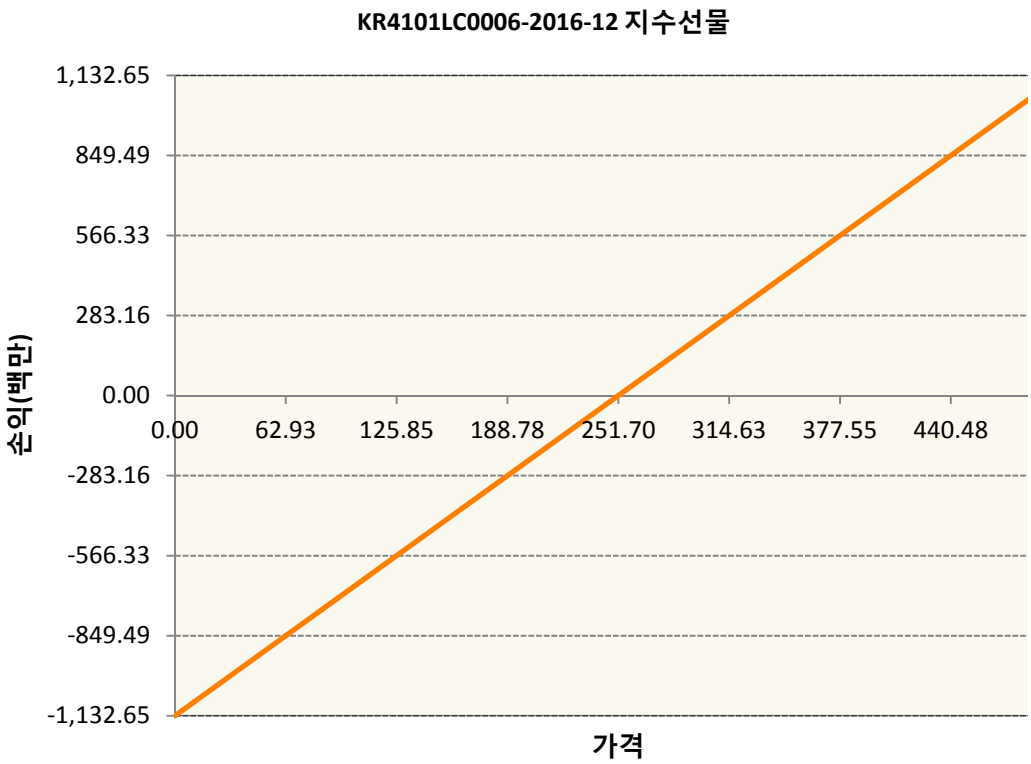
스마트인덱스모

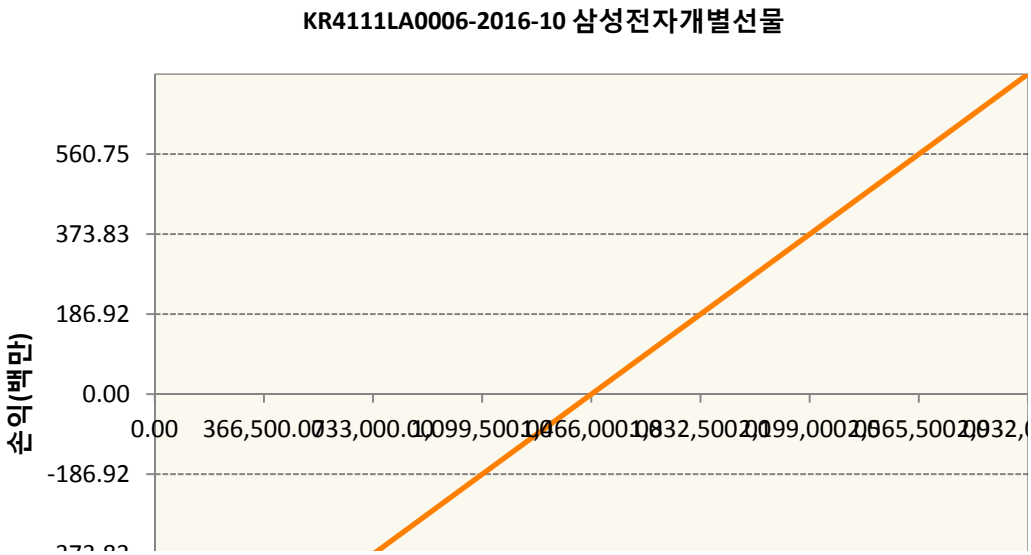
1. 계약금액

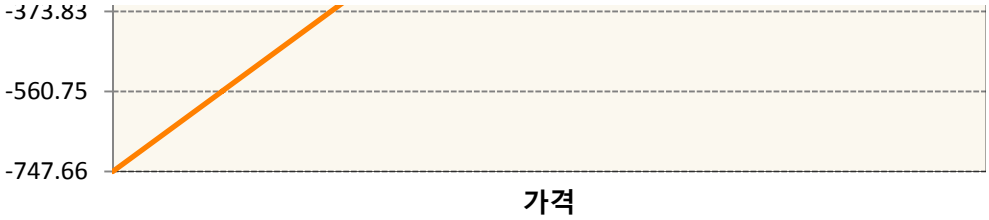
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,880	0	1,880	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101LC00 2016-12 지수선물							90
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-90	-90	-90	-90	-90	-90	-90
-5.33%	-60	-60	-60	-60	-60	-60	-60
-2.67%	-30	-30	-30	-30	-30	-30	-30
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	30	30	30	30	30	30	30
5.33%	60	60	60	60	60	60	60
8.00%	90	90	90	90	90	90	90
KR4111LA00 2016-10 삼성전자개별선물							60
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-60	-60	-60	-60	-60	-60	-60
-5.33%	-40	-40	-40	-40	-40	-40	-40
-2.67%	-20	-20	-20	-20	-20	-20	-20
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	20	20	20	20	20	20	20
5.33%	40	40	40	40	40	40	40
8.00%	60	60	60	60	60	60	60

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

139

공시일	2016-09-13
기준일	2016-09-12

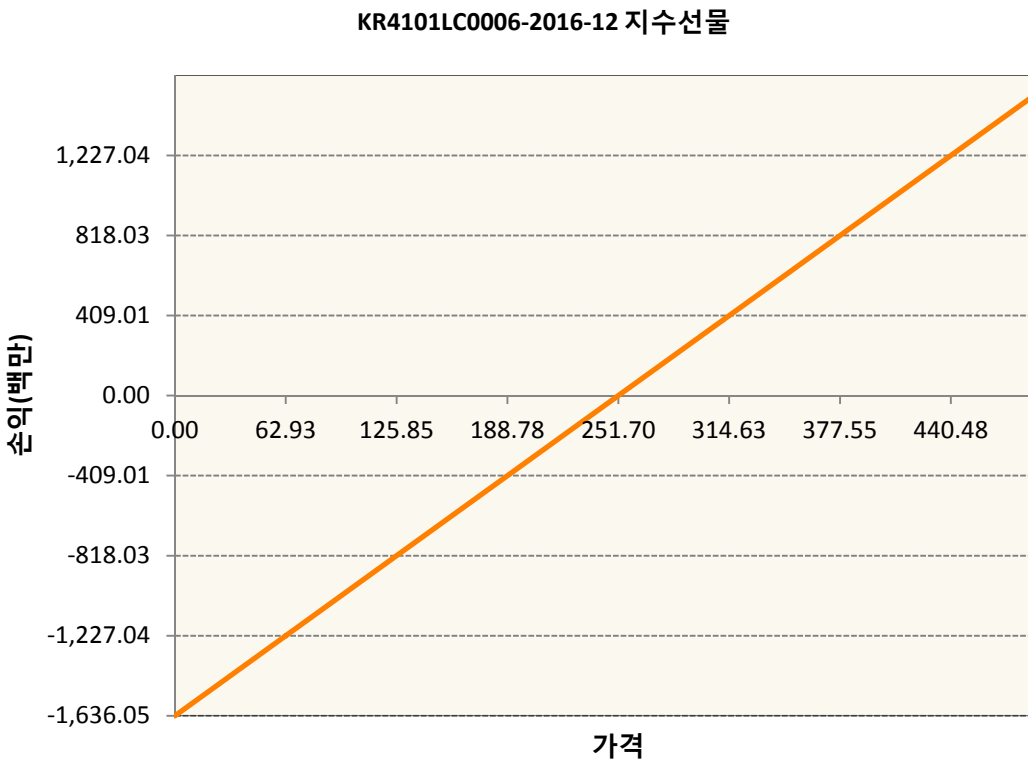
스마트레버리지목표전환형1호

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	1,636	0	1,636	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101LC00 2016-12 지수선물							130
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-130	-130	-130	-130	-130	-130	-130
-5.33%	-87	-87	-87	-87	-87	-87	-87
-2.67%	-43	-43	-43	-43	-43	-43	-43
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	43	43	43	43	43	43	43
5.33%	87	87	87	87	87	87	87
8.00%	130	130	130	130	130	130	130

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

104

공시일	2016-09-13
기준일	2016-09-12

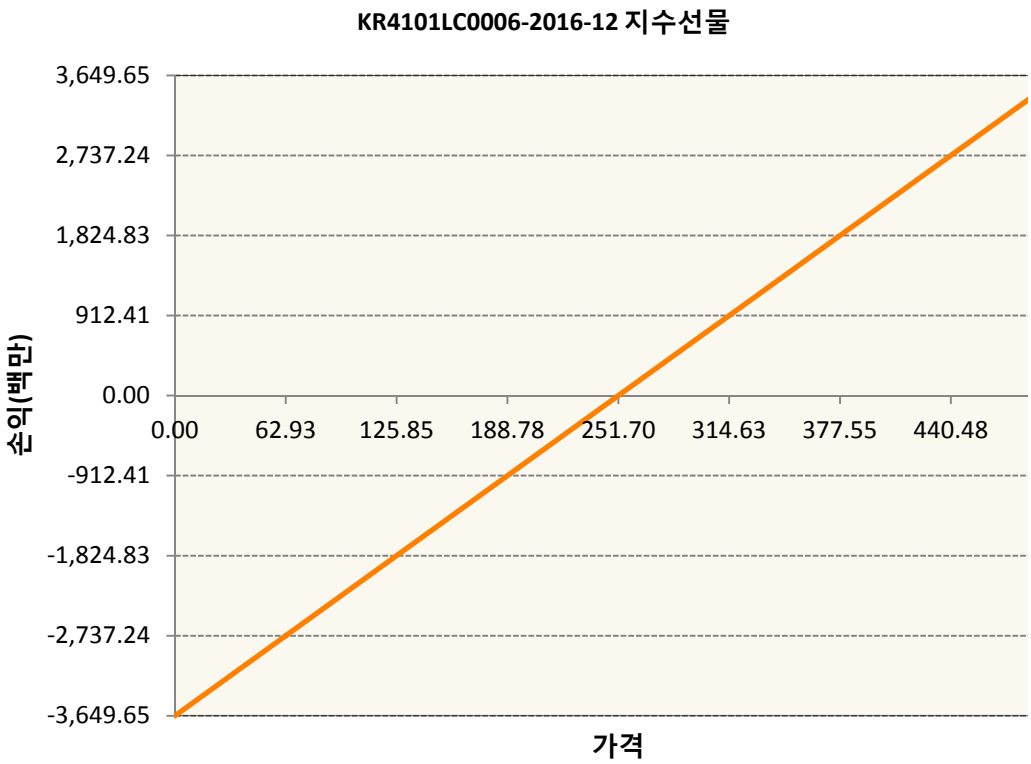
1.3배 레버리지 인덱스(주식-파생형)

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	3,650	0	3,650	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101LC00 2016-12 지수선물							291
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-291	-291	-291	-291	-291	-291	-291
-5.33%	-194	-194	-194	-194	-194	-194	-194
-2.67%	-97	-97	-97	-97	-97	-97	-97
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	97	97	97	97	97	97	97
5.33%	194	194	194	194	194	194	194
8.00%	291	291	291	291	291	291	291

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

233

공시일	2016-09-13
기준일	2016-09-12

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	877

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

731

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2016-09-13
기준일	2016-09-12

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	394

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

851

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2016-09-13
기준일	2016-09-12

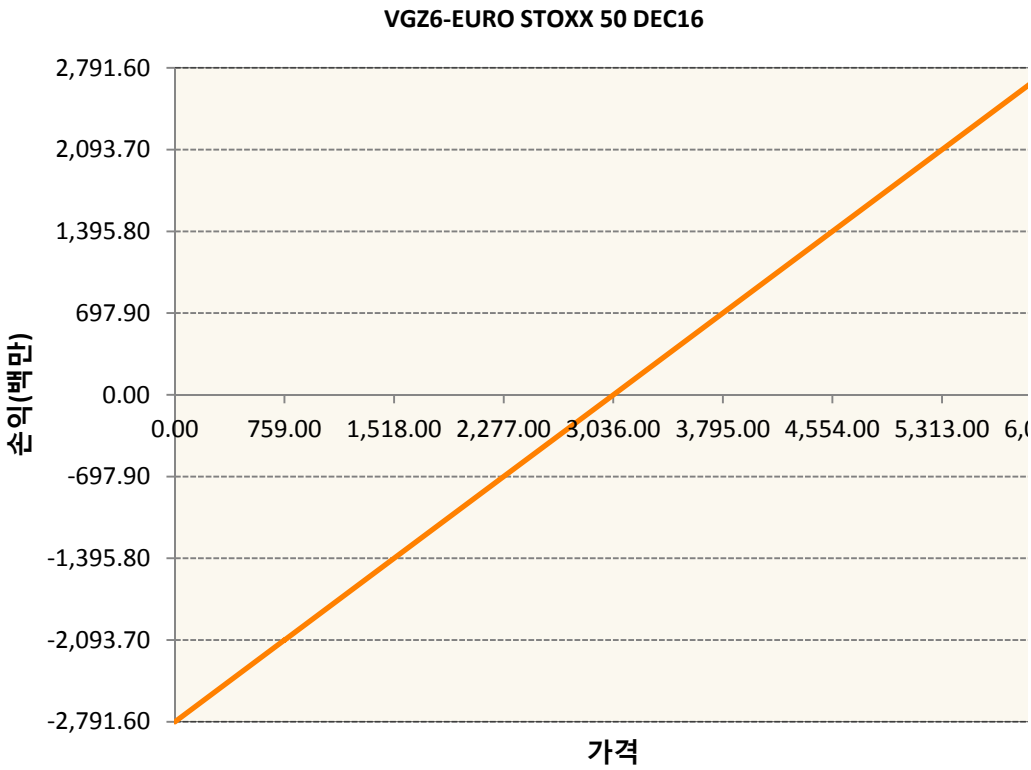
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,792	0	2,792	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGZ6	EURO STOXX 50 DEC16	223

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

(단위:백만원)

275

공시일	2016-09-13
기준일	2016-09-12

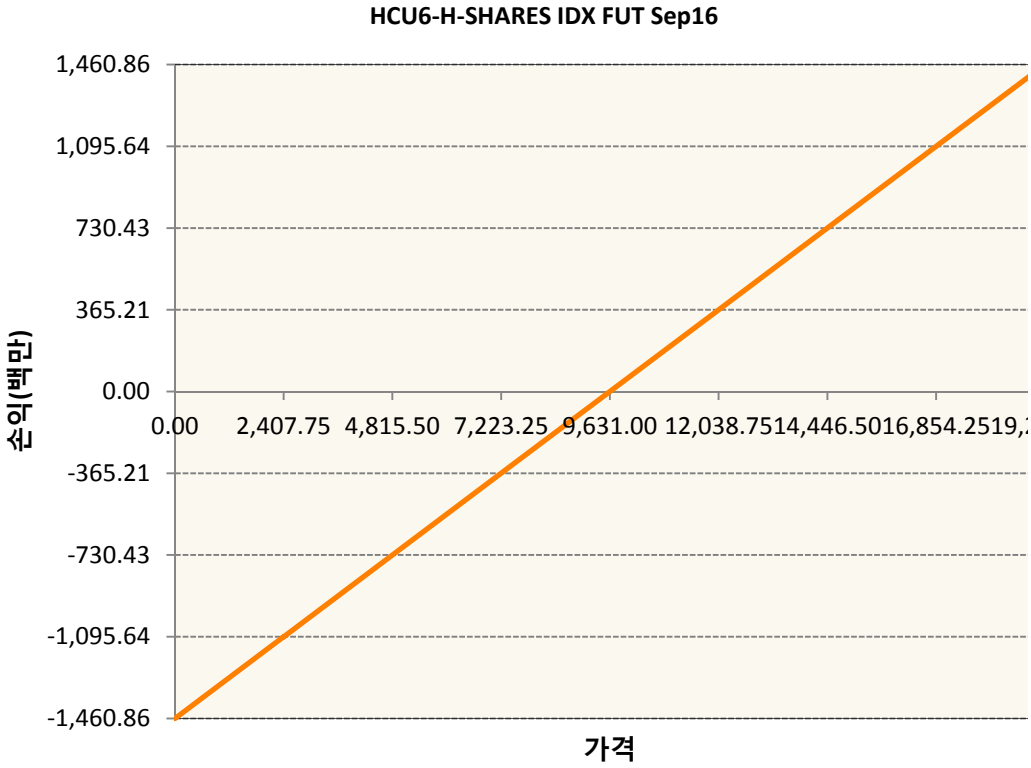
차이나인덱스모(주식-파생형)

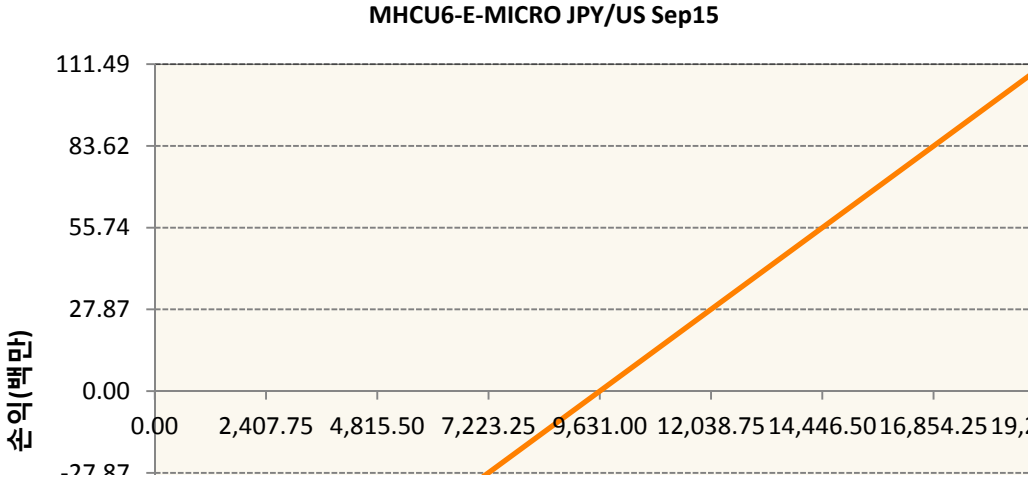
1. 계약금액

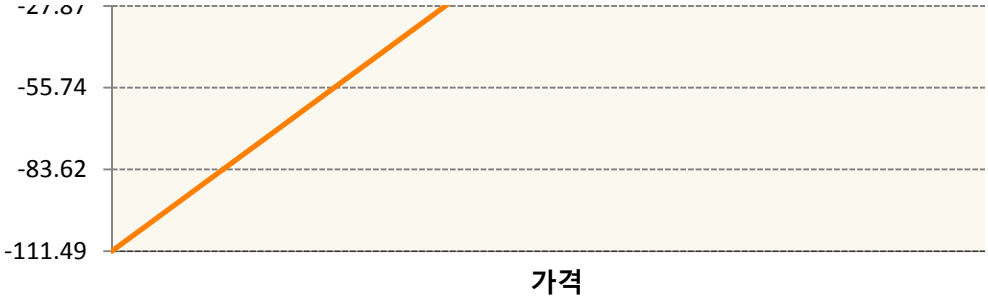
(단위:백만원)

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	111	0	111	
누계	유가증권	선물	1,461	0	1,461	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

HCU6	H-SHARES IDX FUT Sep16	117
MHCU6	E-MICRO JPY/US Sep15	9

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

169

공시일	2016-09-13
기준일	2016-09-12

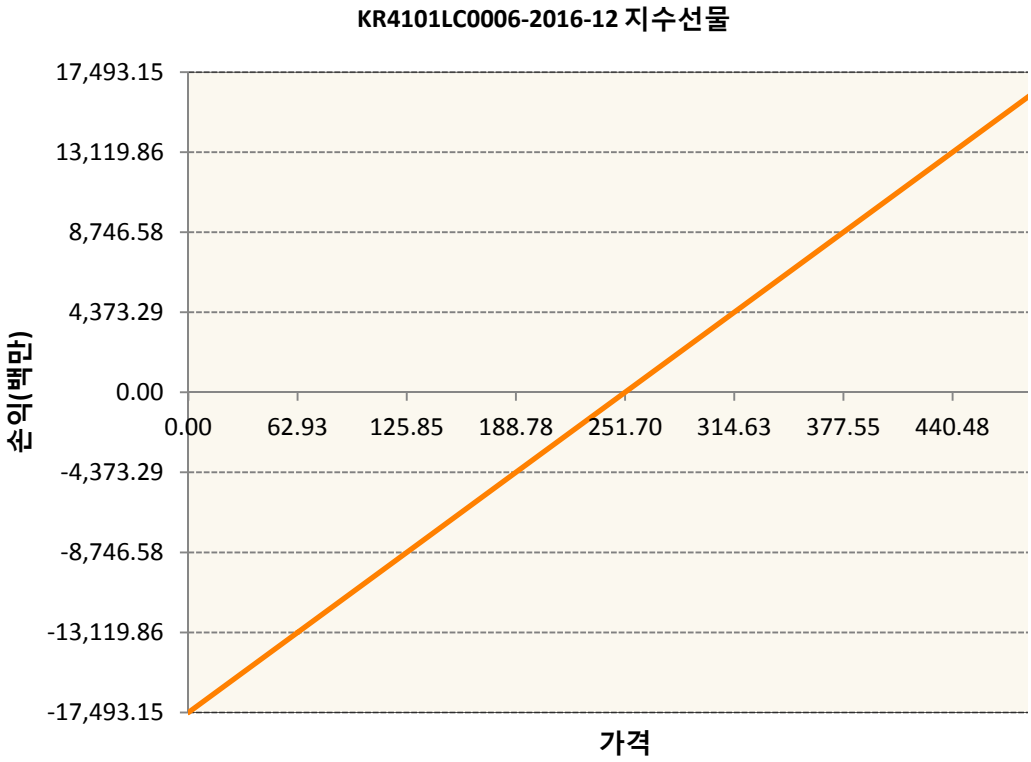
커버드콜(주식혼합-파생형)

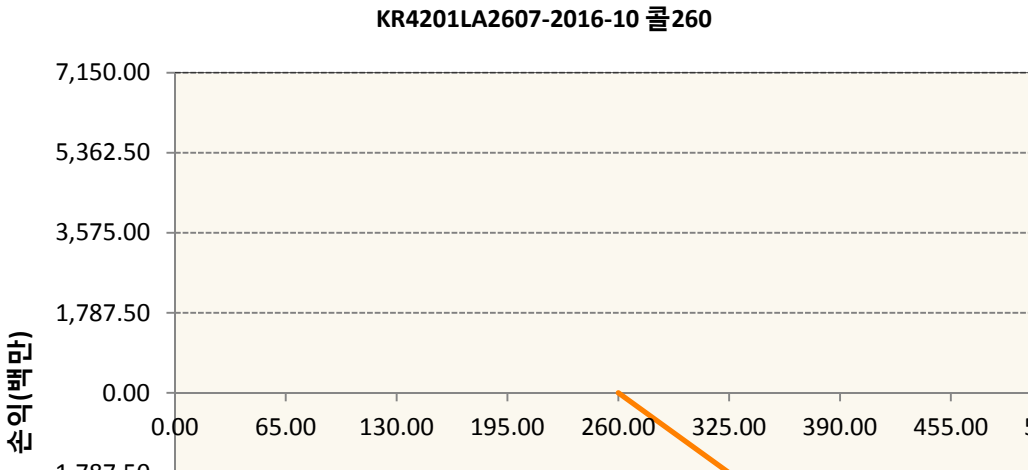
1. 계약금액

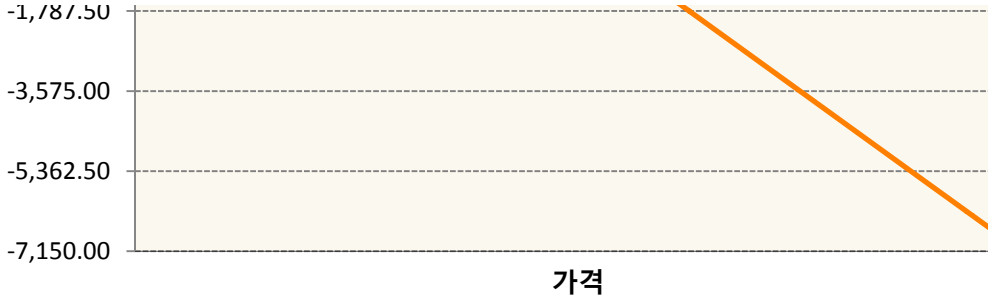
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	913	-913	장내
누계	유가증권	선물	17,493	0	17,493	장내
누계	유가증권	옵션	0	7,150	-7,150	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101LC00 2016-12 지수선물							1,393
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,393	-1,393	-1,393	-1,393	-1,393	-1,393	-1,393
-5.33%	-929	-929	-929	-929	-929	-929	-929
-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%	929	929	929	929	929	929	929
8.00%	1,393	1,393	1,393	1,393	1,393	1,393	1,393
KR4201LA26 2016-10 콜260							1,548
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	167	167	166	166	164	162	158
-5.33%	166	165	162	158	151	143	132
-2.67%	156	147	135	120	101	80	56
0%	94	66	34	0	-36	-74	-114
2.67%	-127	-176	-226	-276	-326	-376	-427
5.33%	-611	-659	-708	-757	-807	-857	-907
8.00%	-1,341	-1,368	-1,399	-1,433	-1,469	-1,508	-1,548

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

2,418

공시일	2016-09-13
기준일	2016-09-12

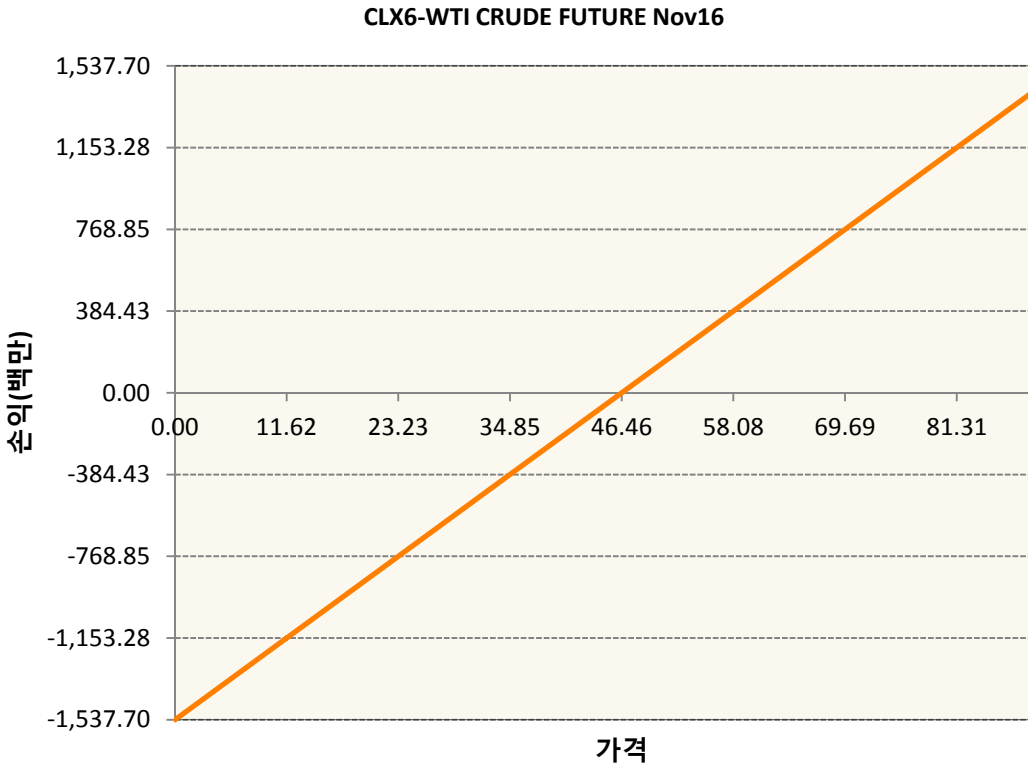
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

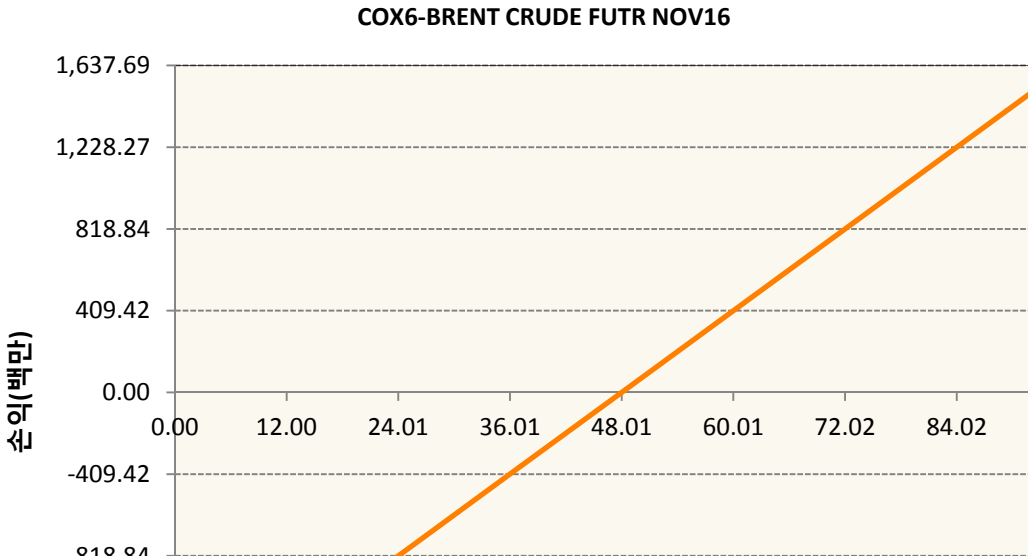
1. 계약금액

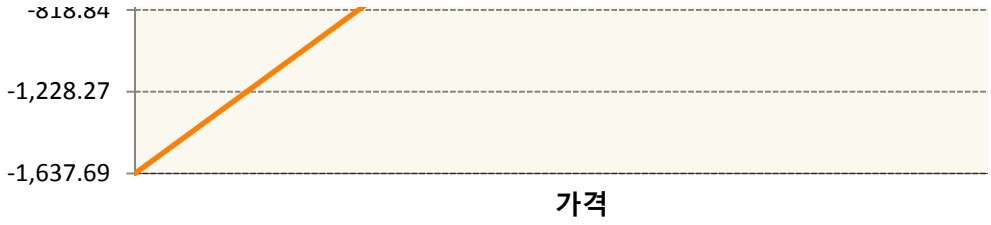
(단위:백만원)

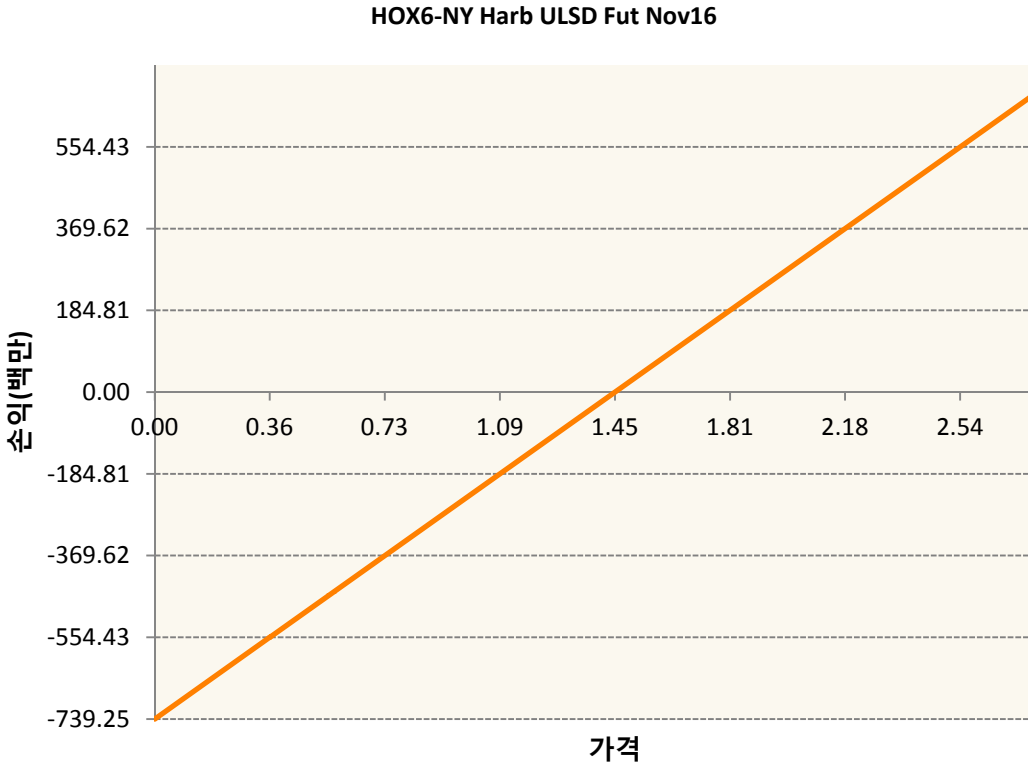
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	6,233	0	6,233	

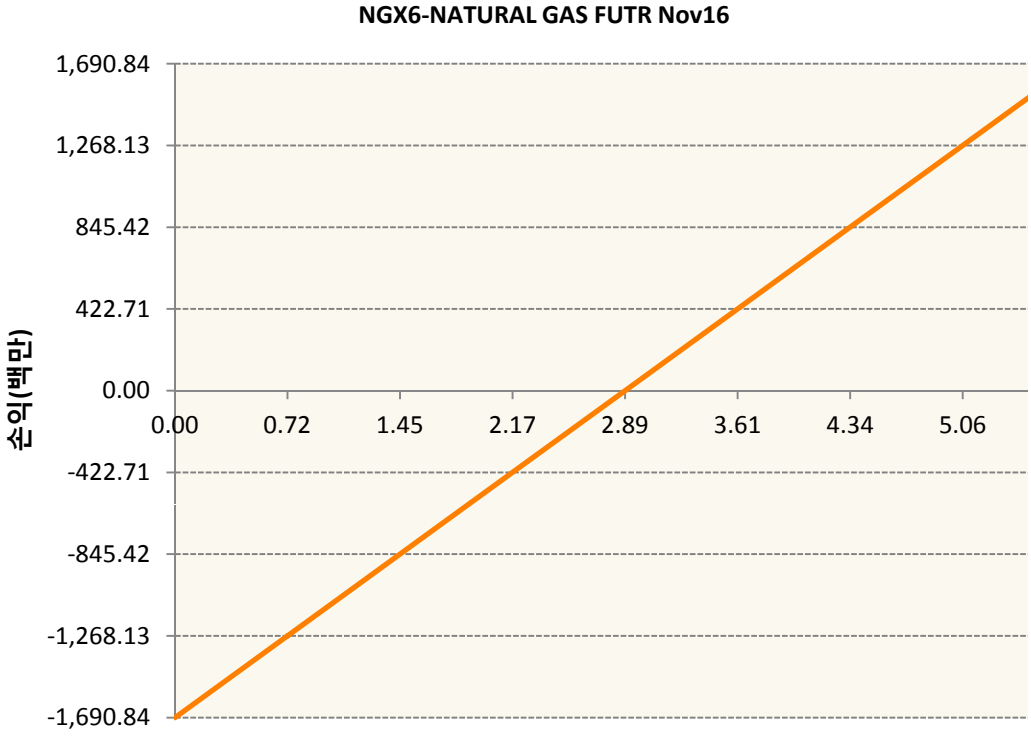
2. 만기시점의 손익구조



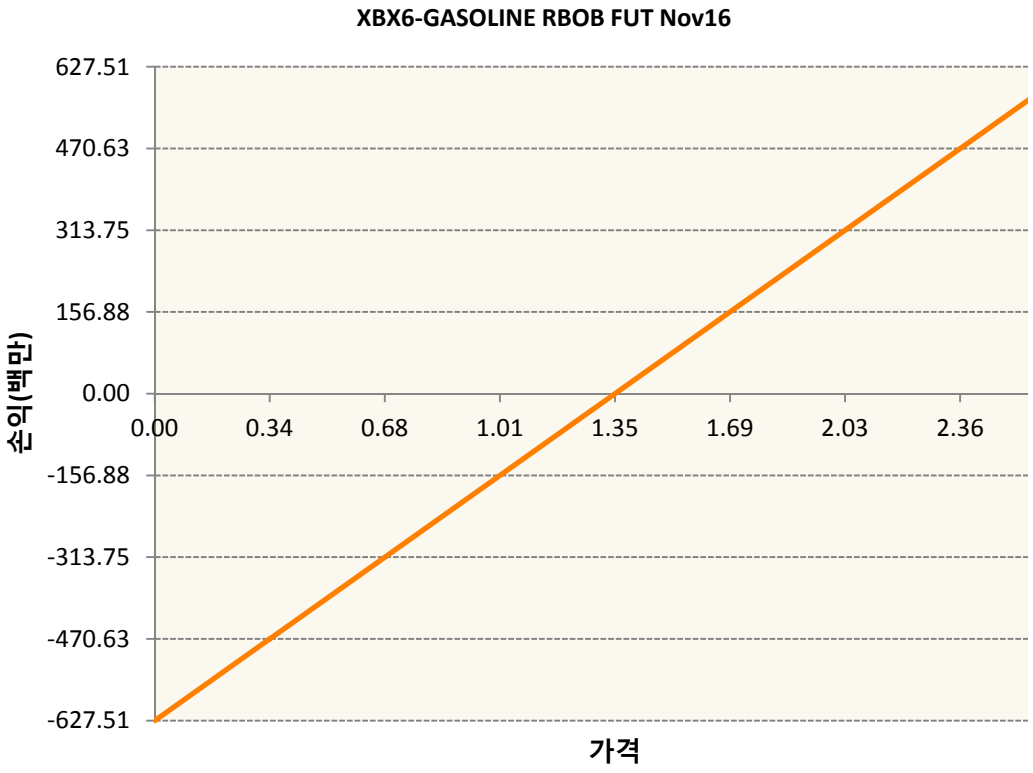



-1,228.27
-1,637.69
가격


HOX6-NY Harb ULSD Fut Nov16
554.43
369.62
184.81
0.00
-184.81
-369.62
-554.43
-739.25
0.00
0.36
0.73
1.09
1.45
1.81
2.18
2.54
순익(백만)
가격


NGX6-NATURAL GAS FUTR Nov16
1,690.84
1,268.13
845.42
422.71
0.00
-422.71
-845.42
-1,268.13
-1,690.84
0.00
0.72
1.45
2.17
2.89
3.61
4.34
5.06
순익(백만)

가격



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
CLX6	WTI CRUDE FUTURE Nov16	123
COX6	BRENT CRUDE FUTR NOV16	131
HOX6	NY Harb ULSD Fut Nov16	59
NGX6	NATURAL GAS FUTR Nov16	135
XBX6	GASOLINE RBOB FUT Nov16	50

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,108

공시일	2016-09-13
기준일	2016-09-12

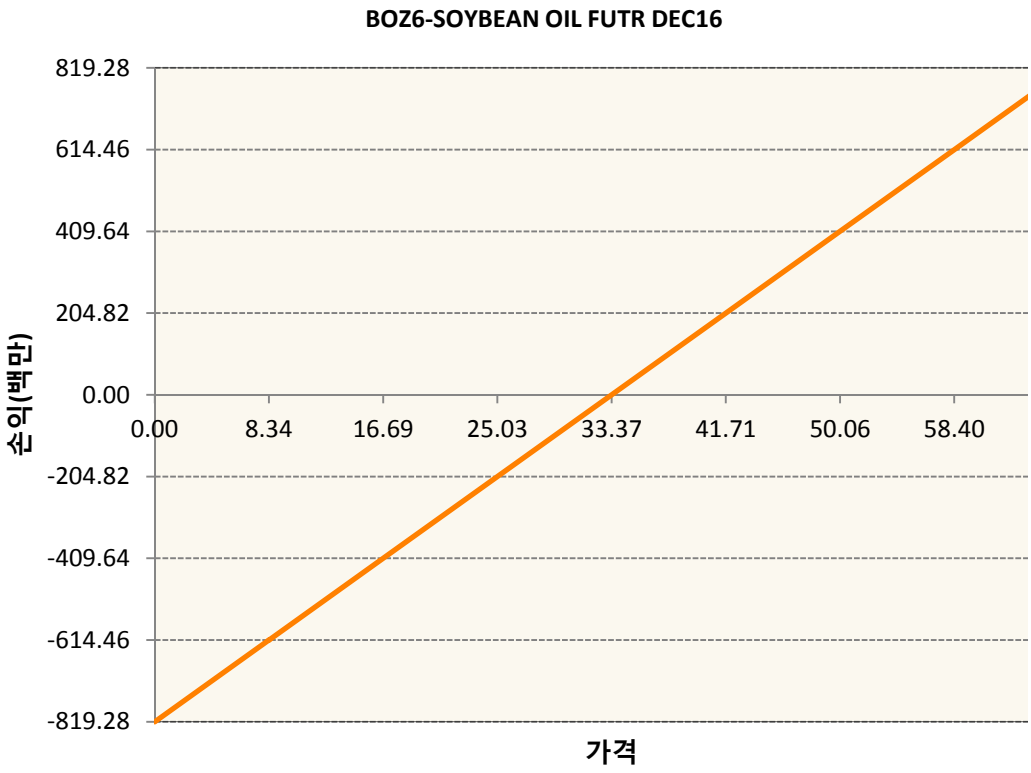
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

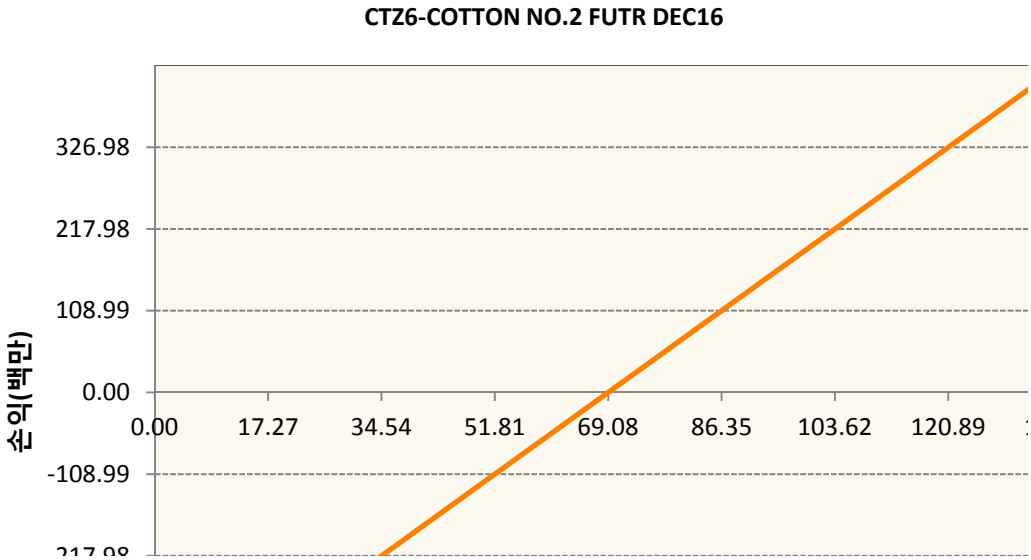
1. 계약금액

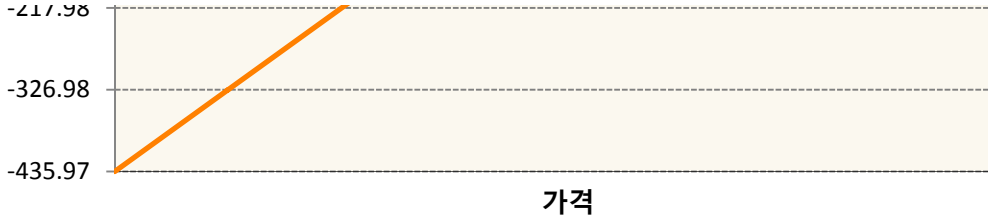
(단위:백만원)

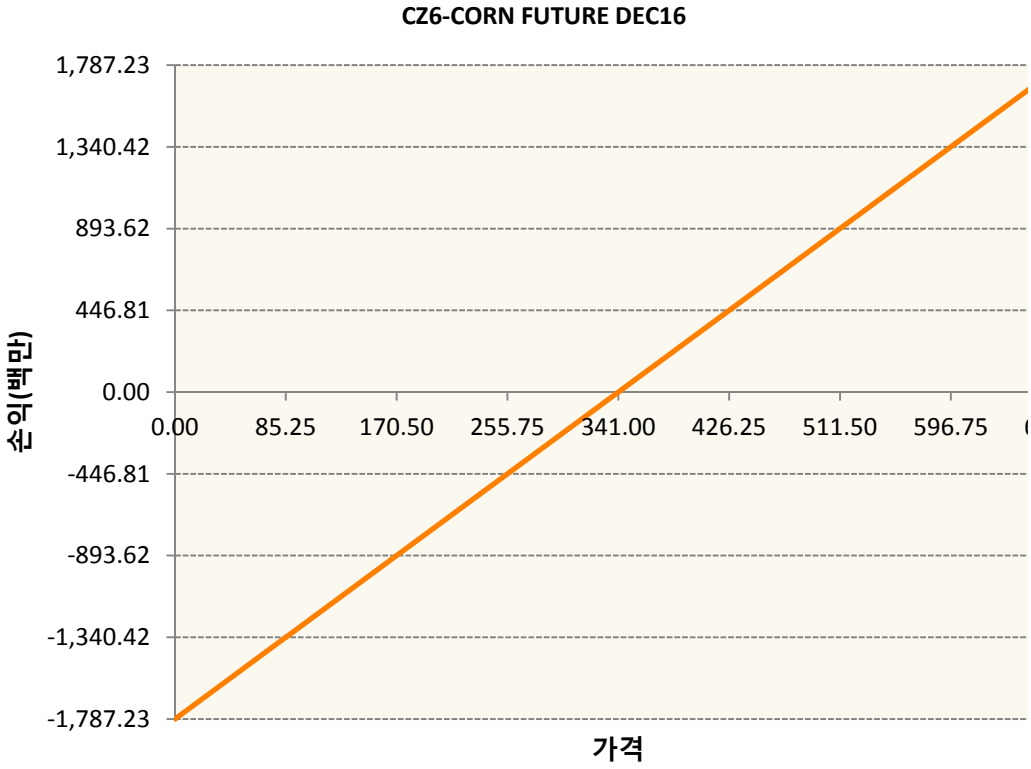
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	8,740	0	8,740	

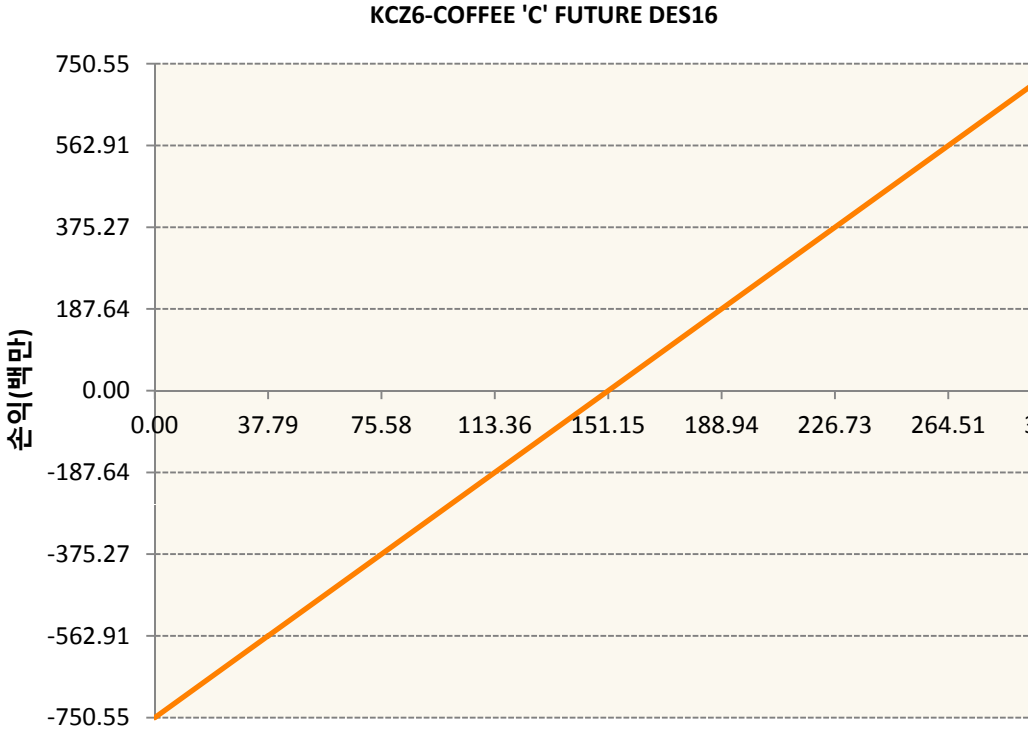
2. 만기시점의 손익구조



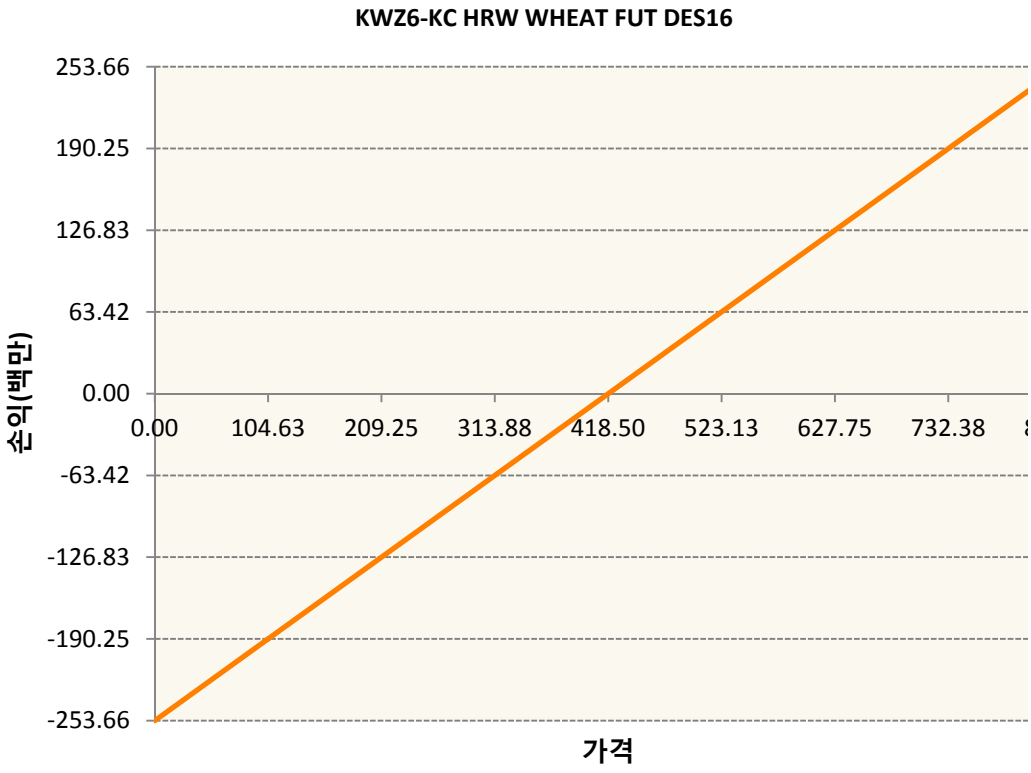


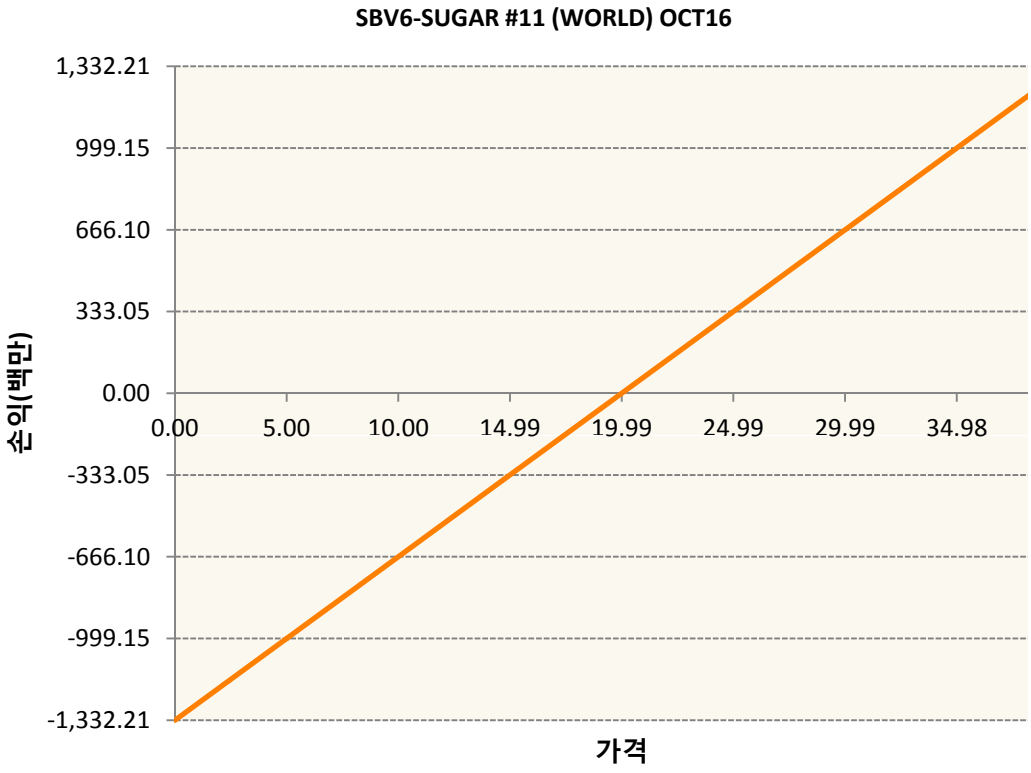

-217.98
-326.98
-435.97
가격

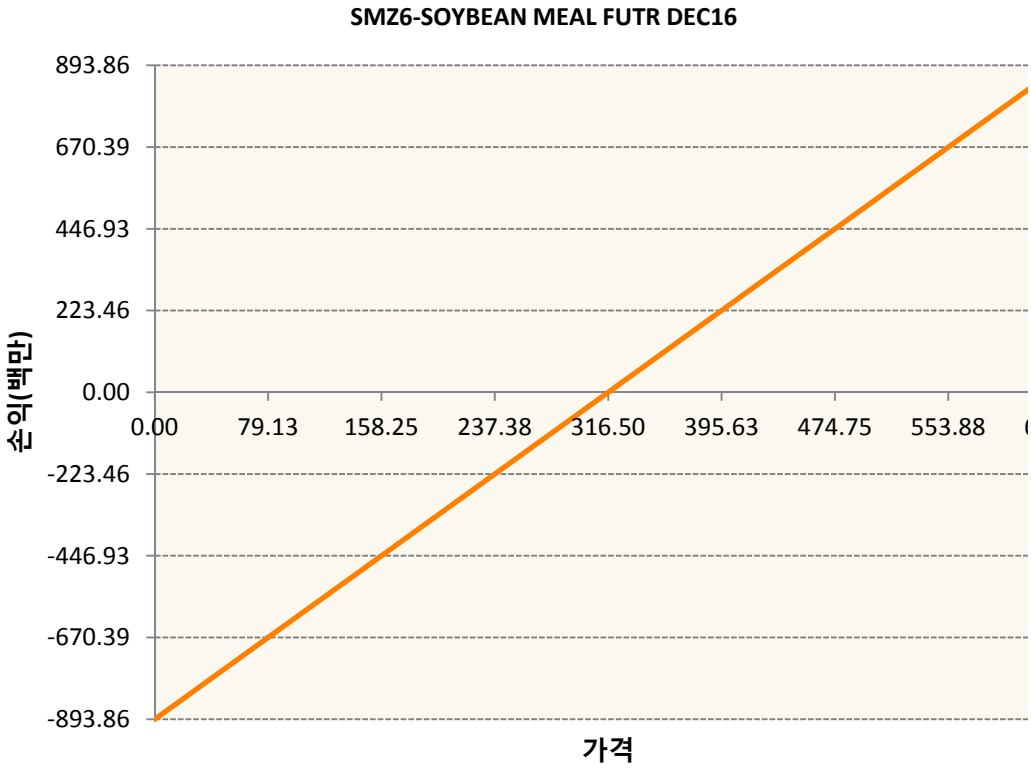

CZ6-CORN FUTURE DEC16
1,787.23
1,340.42
893.62
446.81
0.00
-446.81
-893.62
-1,340.42
-1,787.23
0.00
85.25
170.50
255.75
341.00
426.25
511.50
596.75
순익(백만)
가격

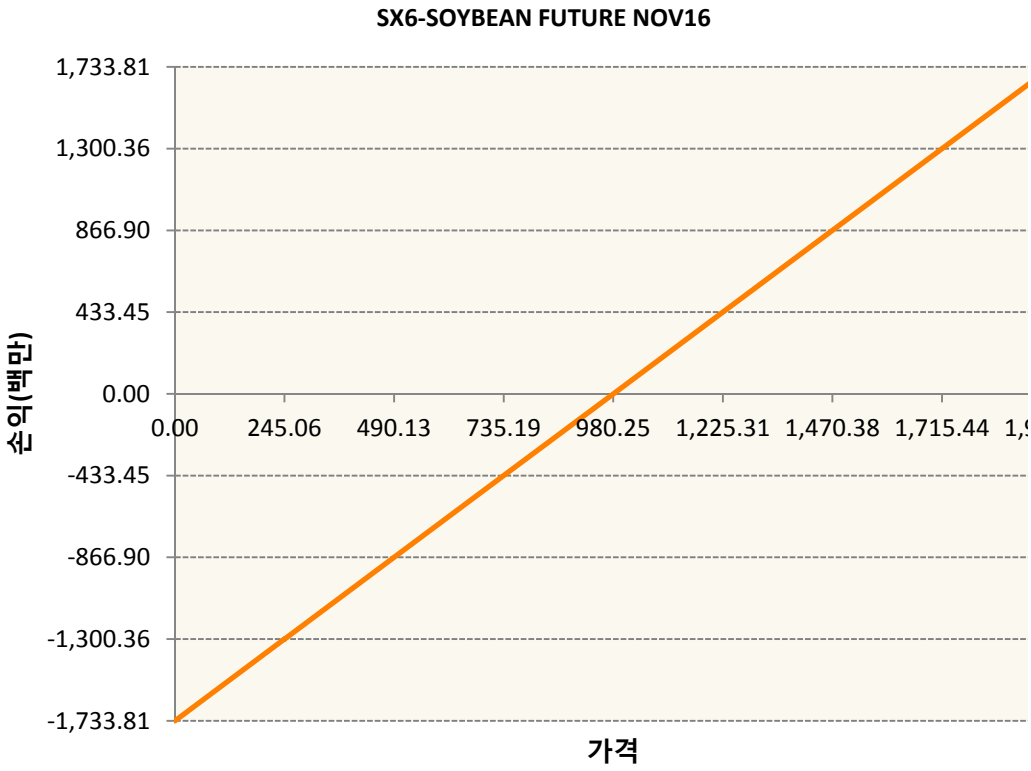

KCZ6-COFFEE 'C' FUTURE DES16
750.55
562.91
375.27
187.64
0.00
-187.64
-375.27
-562.91
-750.55
0.00
37.79
75.58
113.36
151.15
188.94
226.73
264.51
순익(백만)

가격

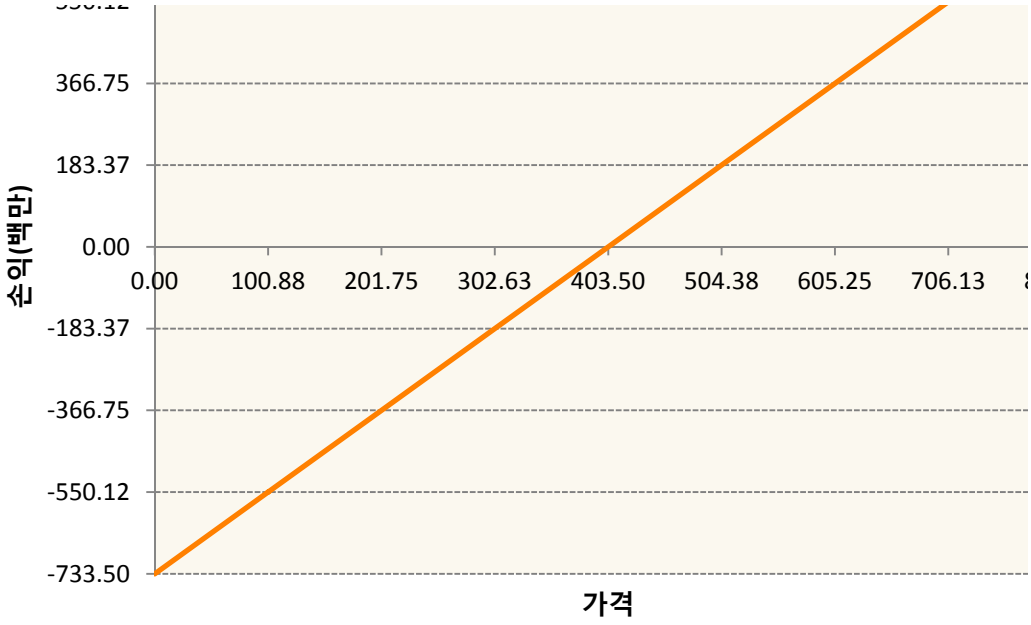

KWZ6-KC HRW WHEAT FUT DES16
253.66
190.25
126.83
63.42
0.00
-63.42
-126.83
-190.25
-253.66
0.00
104.63
209.25
313.88
418.50
523.13
627.75
732.38
손익(백만)
가격


SBV6-SUGAR #11 (WORLD) OCT16
1,332.21
999.15
666.10
333.05
0.00
-333.05
-666.10
-999.15
-1,332.21
0.00
5.00
10.00
14.99
19.99
24.99
29.99
34.98
손익(백만)
가격


SMZ6-SOYBEAN MEAL FUTR DEC16
893.86
670.39
446.93
223.46
0.00
-223.46
-446.93
-670.39
-893.86
0.00
79.13
158.25
237.38
316.50
395.63
474.75
553.88
손익(백만)
가격


SX6-SOYBEAN FUTURE NOV16
1,733.81
1,300.36
866.90
433.45
0.00
-433.45
-866.90
-1,300.36
-1,733.81
0.00
245.06
490.13
735.19
980.25
1,225.31
1,470.38
1,715.44
손익(백만)
가격


WZ6-WHEAT FUTURE(CBT) DEC16
550.12



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

BOZ6	SOYBEAN OIL FUTR DEC16	66
CTZ6	COTTON NO.2 FUTR DEC16	35
CZ6	CORN FUTURE DEC16	143
KCZ6	COFFEE 'C' FUTURE DES16	60
KWZ6	KC HRW WHEAT FUT DES16	20
SBV6	SUGAR #11 (WORLD) OCT16	107
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)

868