공시일	2016-09-19
기준일	2016-09-13

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	2016-09-19
기준일	2016-09-13

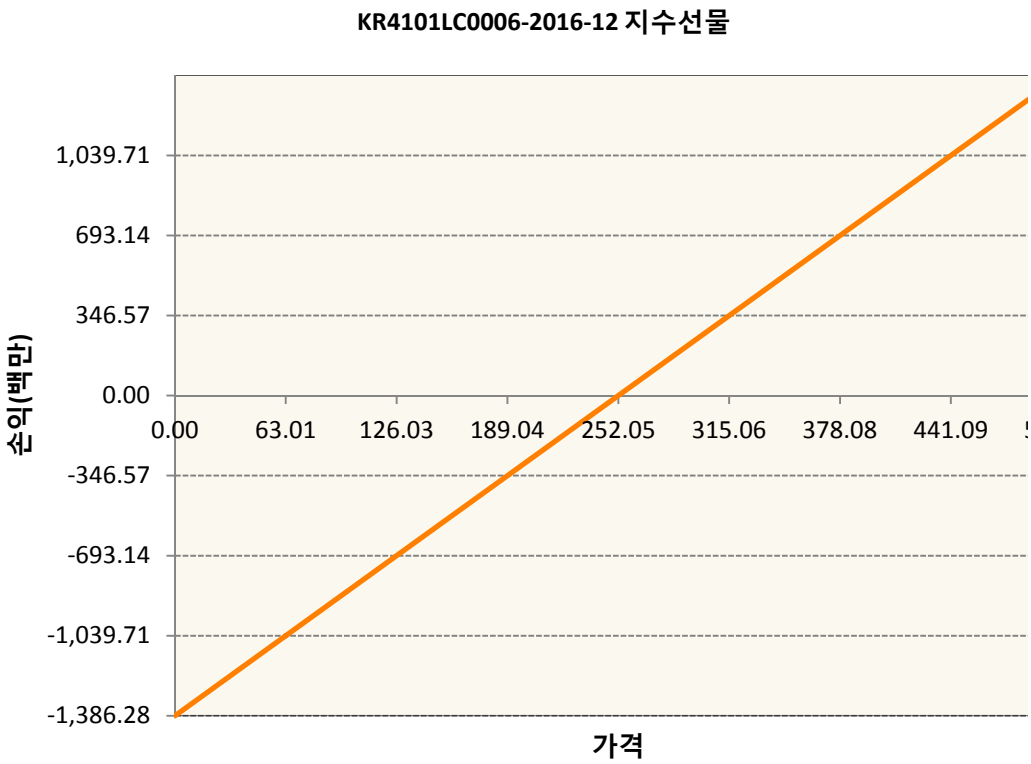
스마트인덱스모

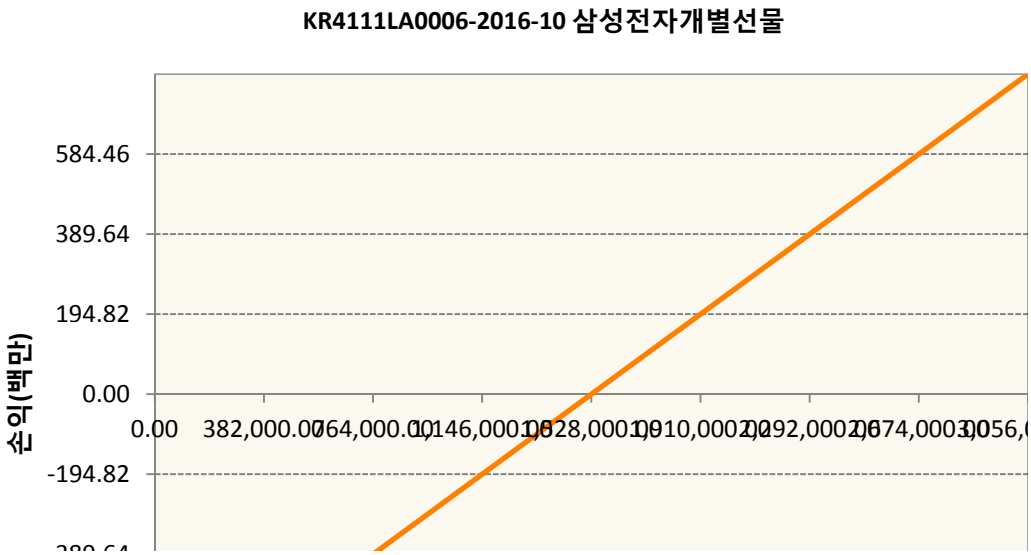
1. 계약금액

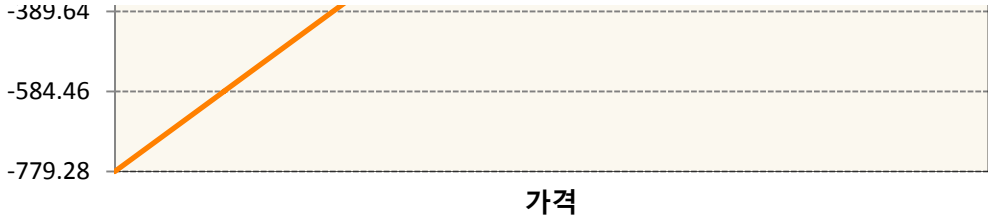
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	252	0	252	장내
누계	유가증권	선물	2,166	0	2,166	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101LC00 2016-12 지수선물							111
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-111	-111	-111	-111	-111	-111	-111
-5.33%	-74	-74	-74	-74	-74	-74	-74
-2.67%	-37	-37	-37	-37	-37	-37	-37
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	37	37	37	37	37	37	37
5.33%	74	74	74	74	74	74	74
8.00%	111	111	111	111	111	111	111

KR4111LA00 2016-10 삼성전자개별선물							62
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-62	-62	-62	-62	-62	-62	-62
-5.33%	-42	-42	-42	-42	-42	-42	-42
-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%	42	42	42	42	42	42	42
8.00%	62	62	62	62	62	62	62

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

155

공시일	2016-09-19
기준일	2016-09-13

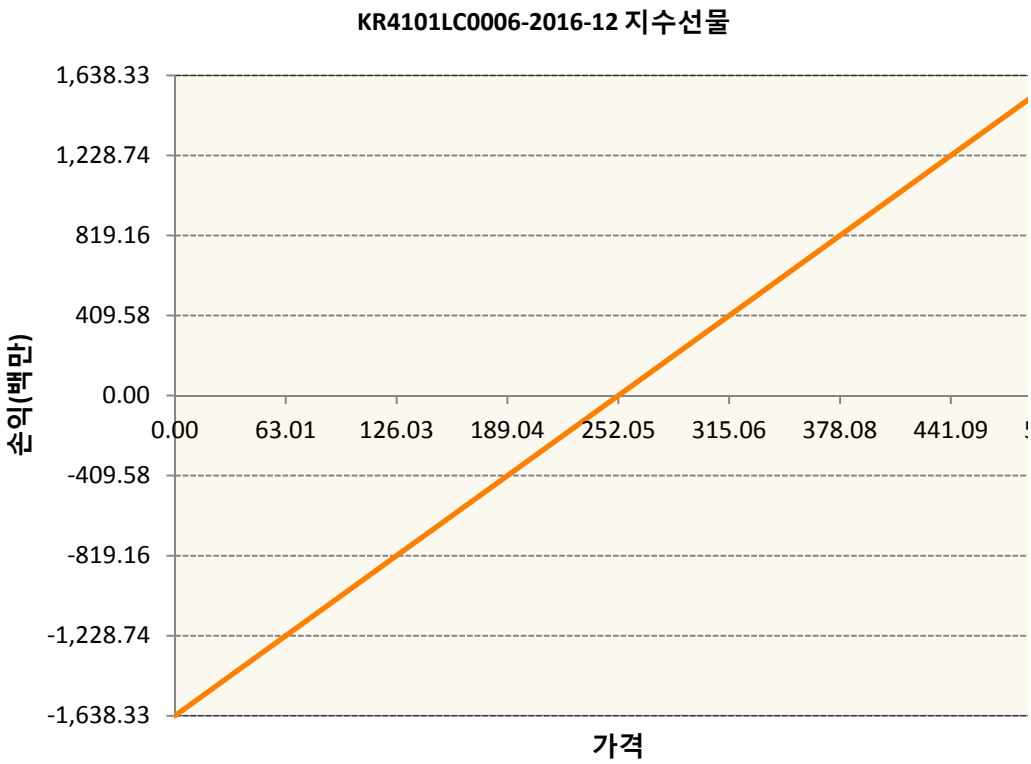
스마트레버리지목표전환형1호

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	1,638	0	1,638	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101LC00 2016-12 지수선물							131
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-131	-131	-131	-131	-131	-131	-131
-5.33%	-87	-87	-87	-87	-87	-87	-87
-2.67%	-44	-44	-44	-44	-44	-44	-44
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	44	44	44	44	44	44	44
5.33%	87	87	87	87	87	87	87
8.00%	131	131	131	131	131	131	131

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

103

공시일	2016-09-19
기준일	2016-09-13

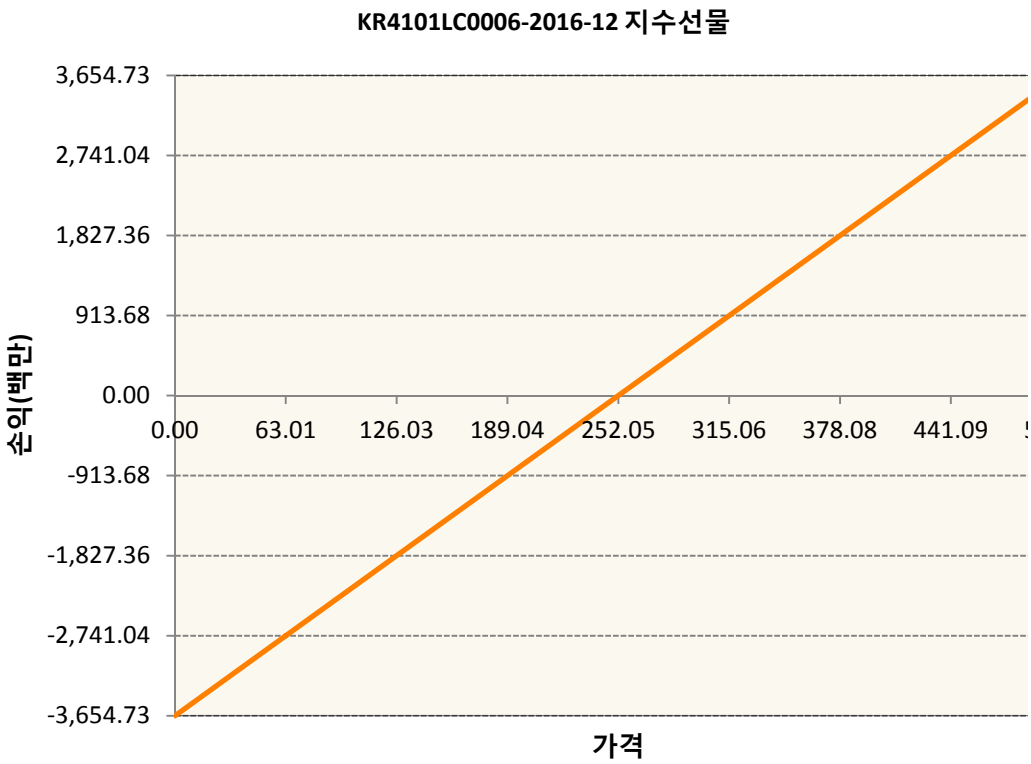
1.3배 레버리지 인덱스(주식-파생형)

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	3,655	0	3,655	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101LC00 2016-12 지수선물							292
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-292	-292	-292	-292	-292	-292	-292
-5.33%	-195	-195	-195	-195	-195	-195	-195
-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%	195	195	195	195	195	195	195
8.00%	292	292	292	292	292	292	292

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

229

공시일	2016-09-19
기준일	2016-09-13

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	881

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

734

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2016-09-19
기준일	2016-09-13

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	396

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

855

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2016-09-19
기준일	2016-09-13

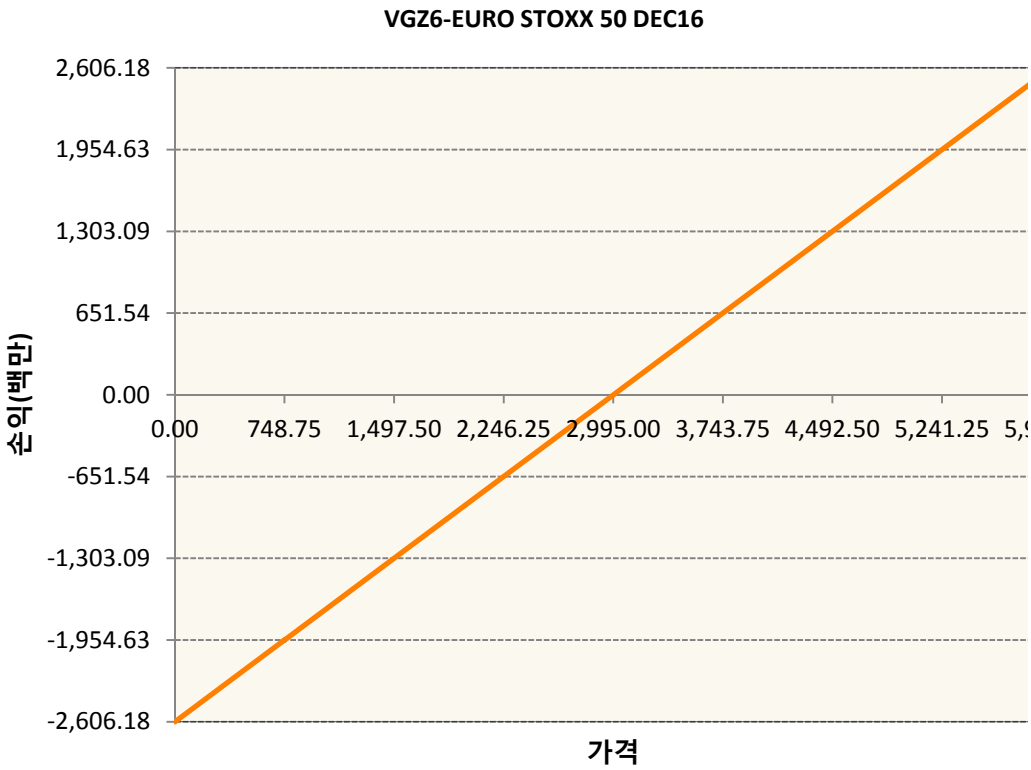
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,606	0	2,606	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGZ6	EURO STOXX 50 DEC16	208

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

(단위:백만원)

257

공시일	2016-09-19
기준일	2016-09-13

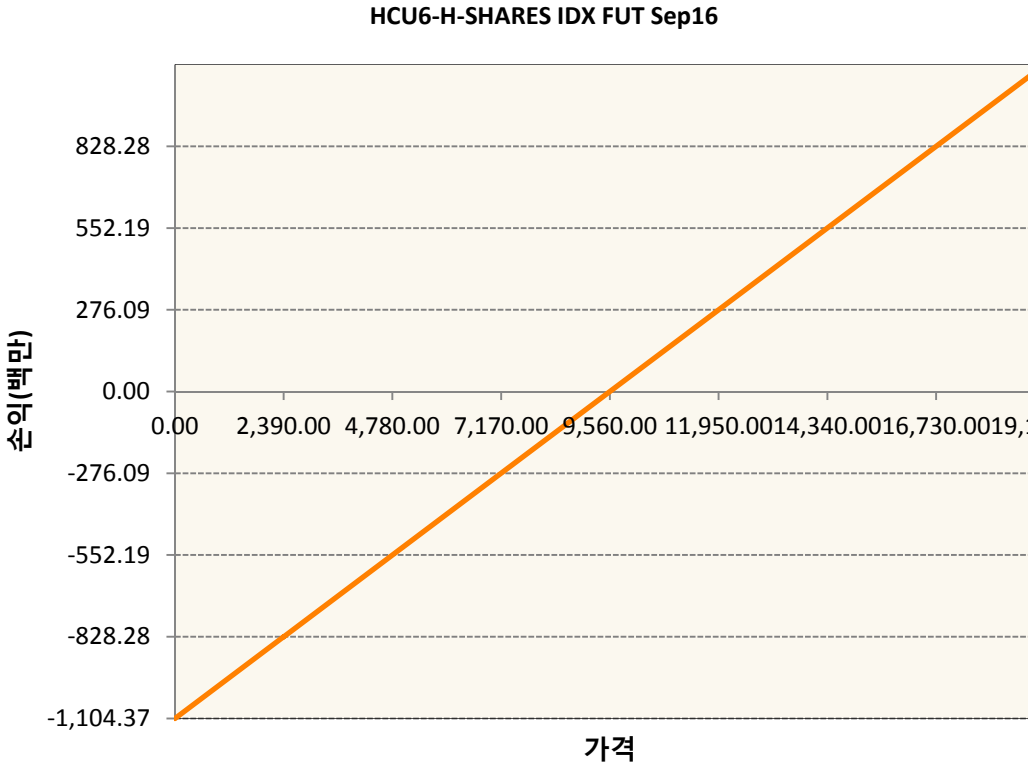
차이나인덱스모(주식-파생형)

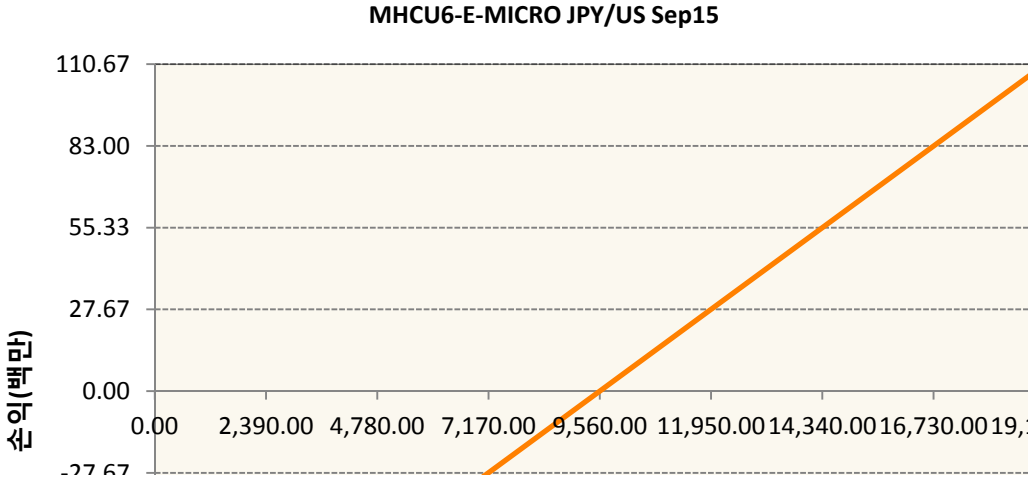
1. 계약금액

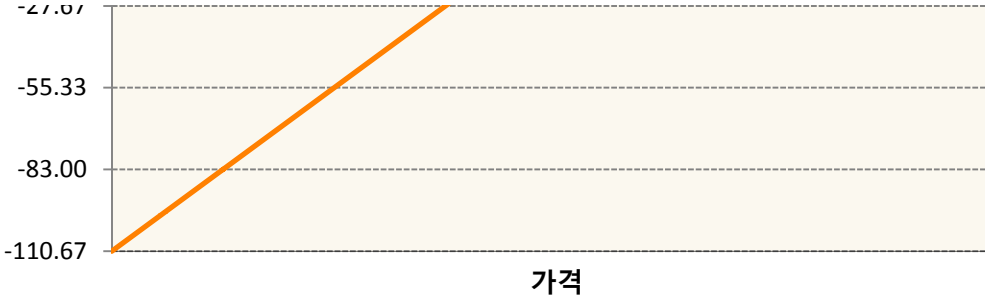
(단위:백만원)

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	1,104	0	1,104	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCU6	H-SHARES IDX FUT Sep16	88
MHCU6	E-MICRO JPY/US Sep15	9

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	129

공시일	2016-09-19
기준일	2016-09-13

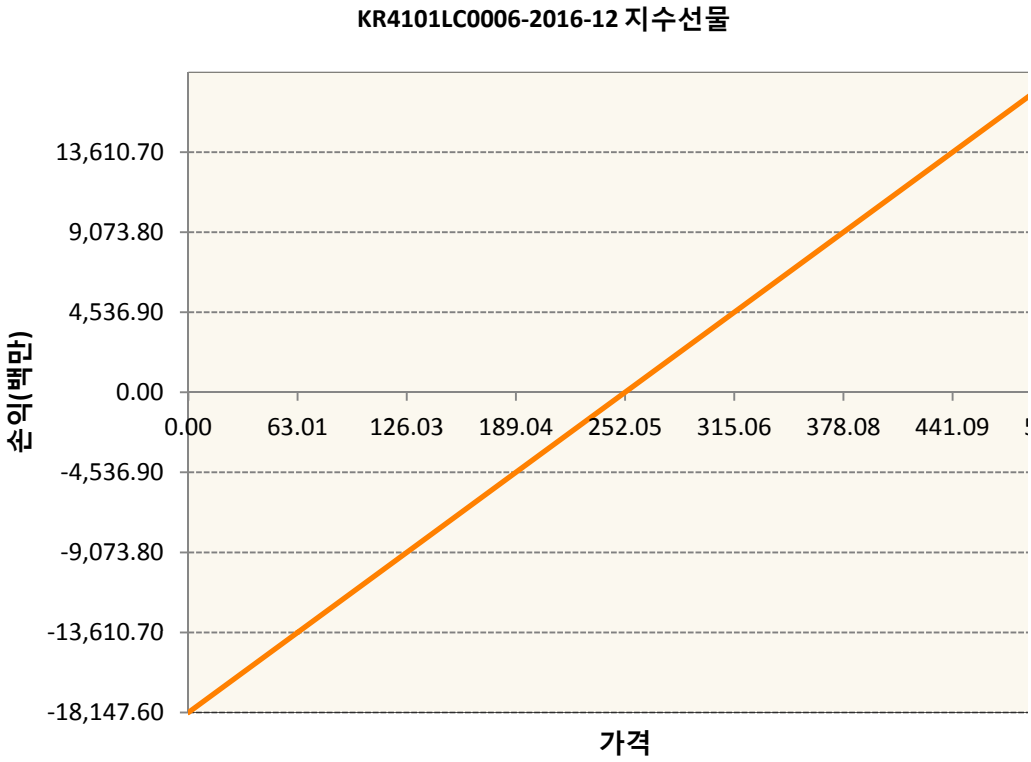
커버드콜(주식혼합-파생형)

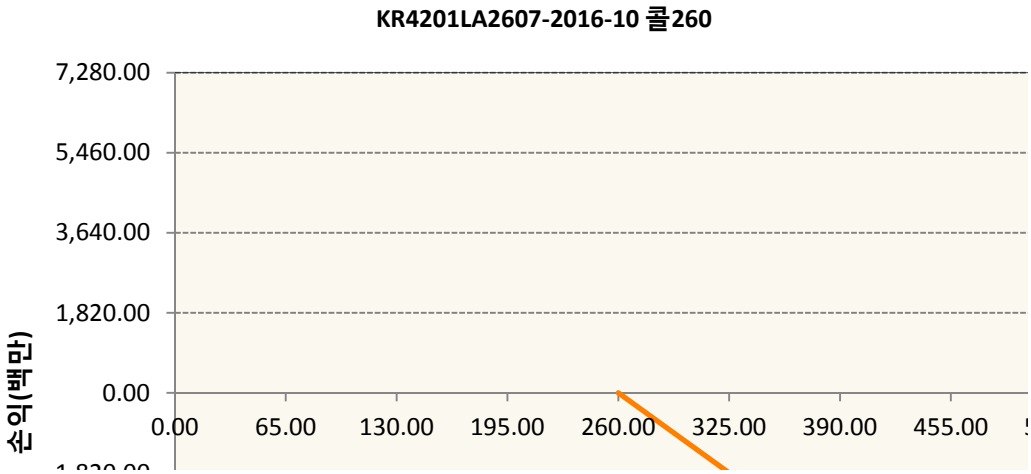
1. 계약금액

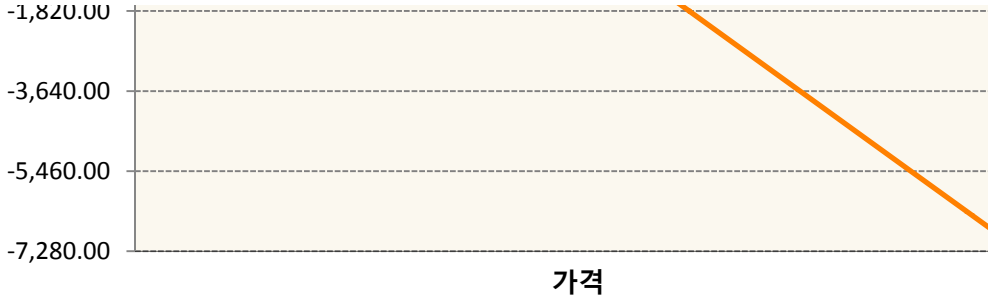
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	630	0	630	장내
신규	유가증권	옵션	0	130	-130	장내
누계	유가증권	선물	18,148	0	18,148	장내
누계	유가증권	옵션	0	7,280	-7,280	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101LC00 2016-12 지수선물							1,450
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,450	-1,450	-1,450	-1,450	-1,450	-1,450	-1,450
-5.33%	-967	-967	-967	-967	-967	-967	-967
-2.67%	-483	-483	-483	-483	-483	-483	-483
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	483	483	483	483	483	483	483
5.33%	967	967	967	967	967	967	967
8.00%	1,450	1,450	1,450	1,450	1,450	1,450	1,450
KR4201LA26 2016-10 콜260							1,685
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	206	206	206	205	203	200	195
-5.33%	205	203	199	194	186	175	163
-2.67%	191	179	164	146	124	99	72
0%	108	74	38	0	-40	-82	-125
2.67%	-164	-215	-267	-319	-371	-423	-475
5.33%	-714	-759	-806	-853	-902	-951	-1,001
8.00%	-1,498	-1,521	-1,548	-1,579	-1,612	-1,648	-1,685

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

2,621

공시일	2016-09-19
기준일	2016-09-13

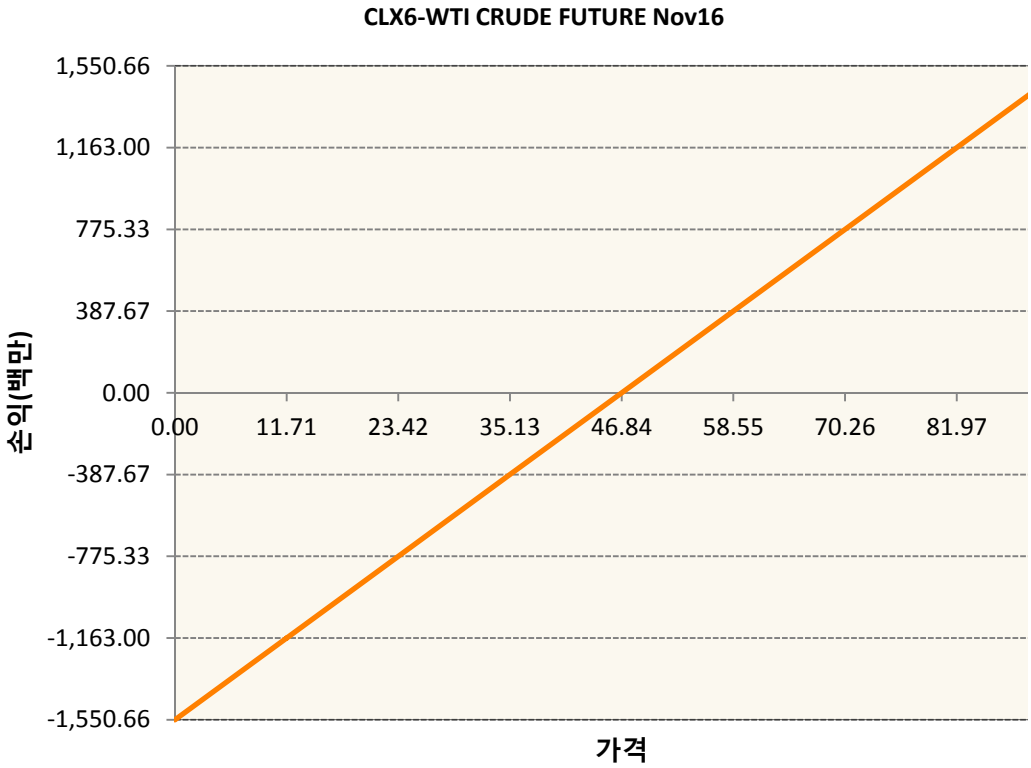
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

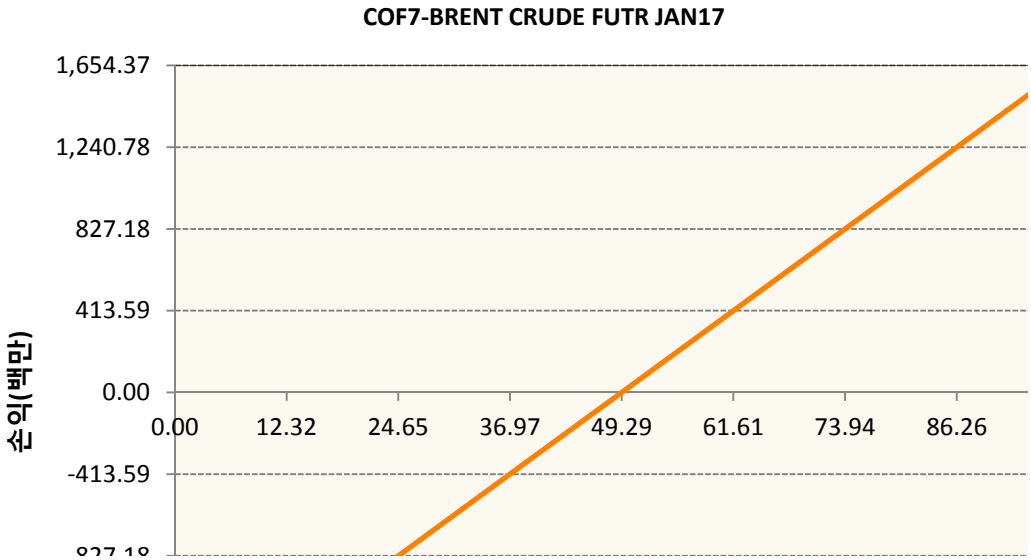
1. 계약금액

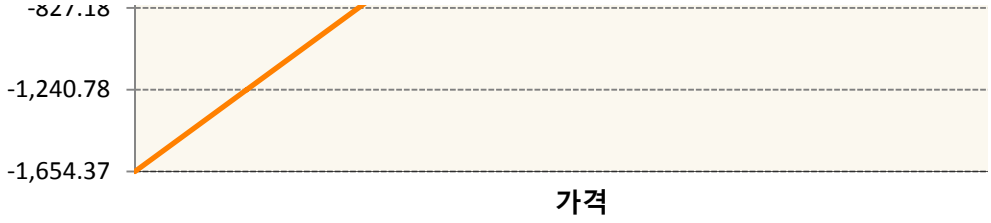
(단위:백만원)

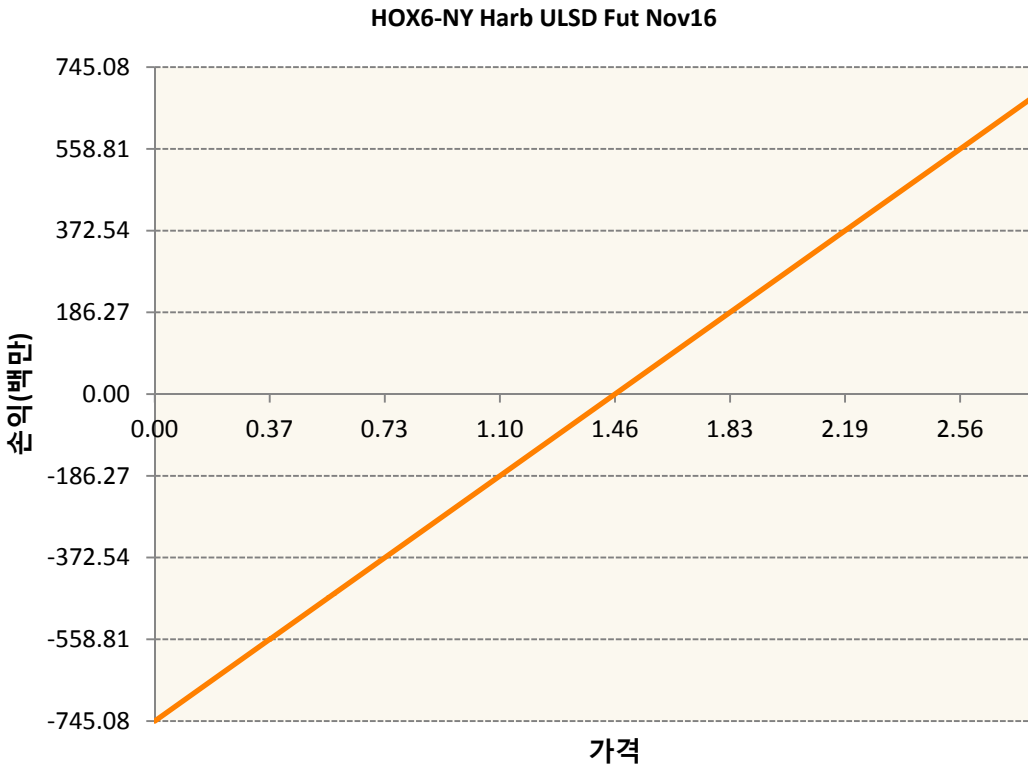
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	6,335	0	6,335	

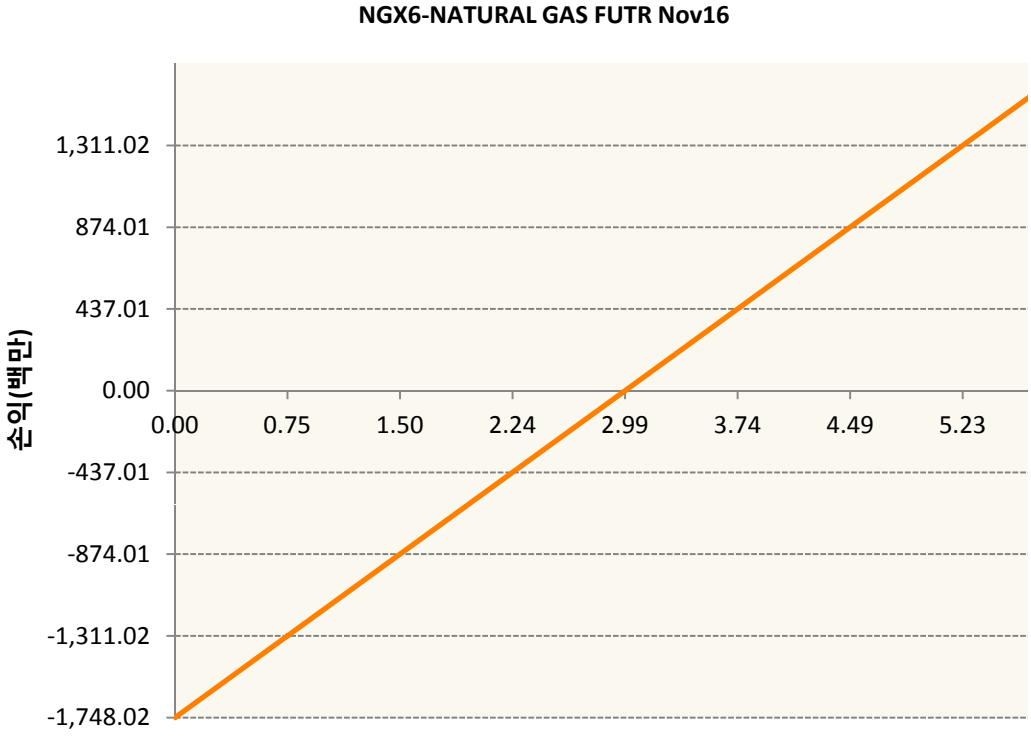
2. 만기시점의 손익구조



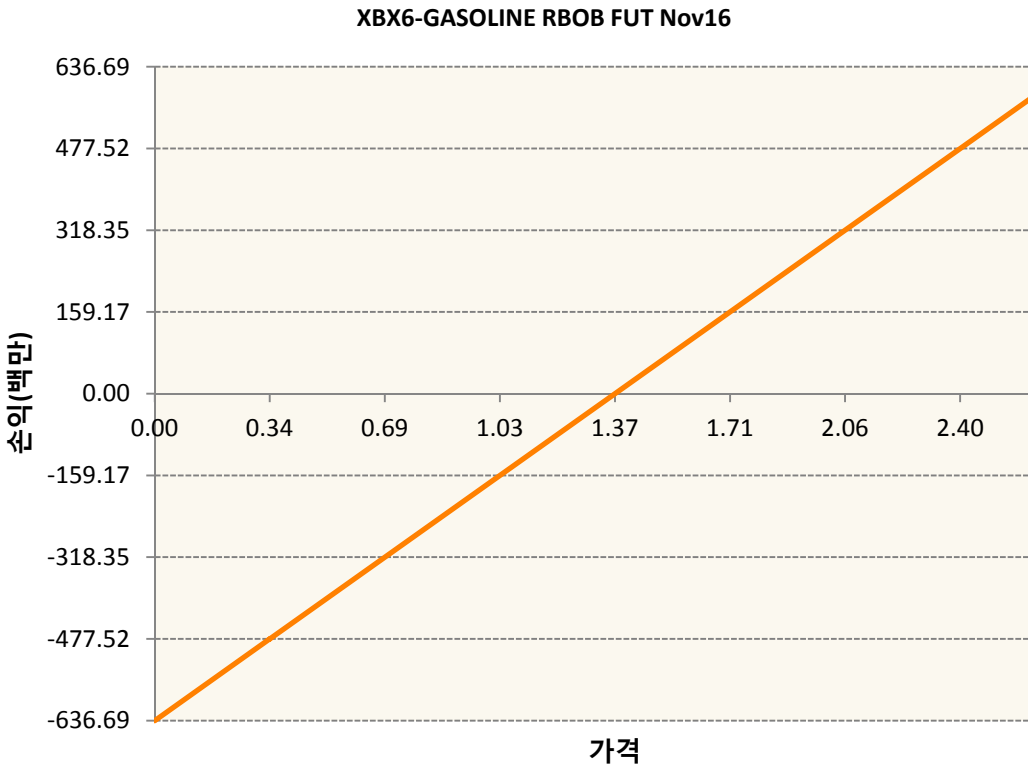



-1,240.78
-1,654.37
가격


HOX6-NY Harb ULSD Fut Nov16
745.08
558.81
372.54
186.27
0.00
-186.27
-372.54
-558.81
-745.08
0.00
0.37
0.73
1.10
1.46
1.83
2.19
2.56
손익(백만)
가격


NGX6-NATURAL GAS FUTR Nov16
1,311.02
874.01
437.01
0.00
-437.01
-874.01
-1,311.02
-1,748.02
0.00
0.75
1.50
2.24
2.99
3.74
4.49
5.23
손익(백만)

가격



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
CLX6	WTI CRUDE FUTURE Nov16	124
COF7	BRENT CRUDE FUTR JAN17	132
HOX6	NY Harb ULSD Fut Nov16	60
NGX6	NATURAL GAS FUTR Nov16	140
XBX6	GASOLINE RBOB FUT Nov16	51

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,126

공시일	2016-09-19
기준일	2016-09-13

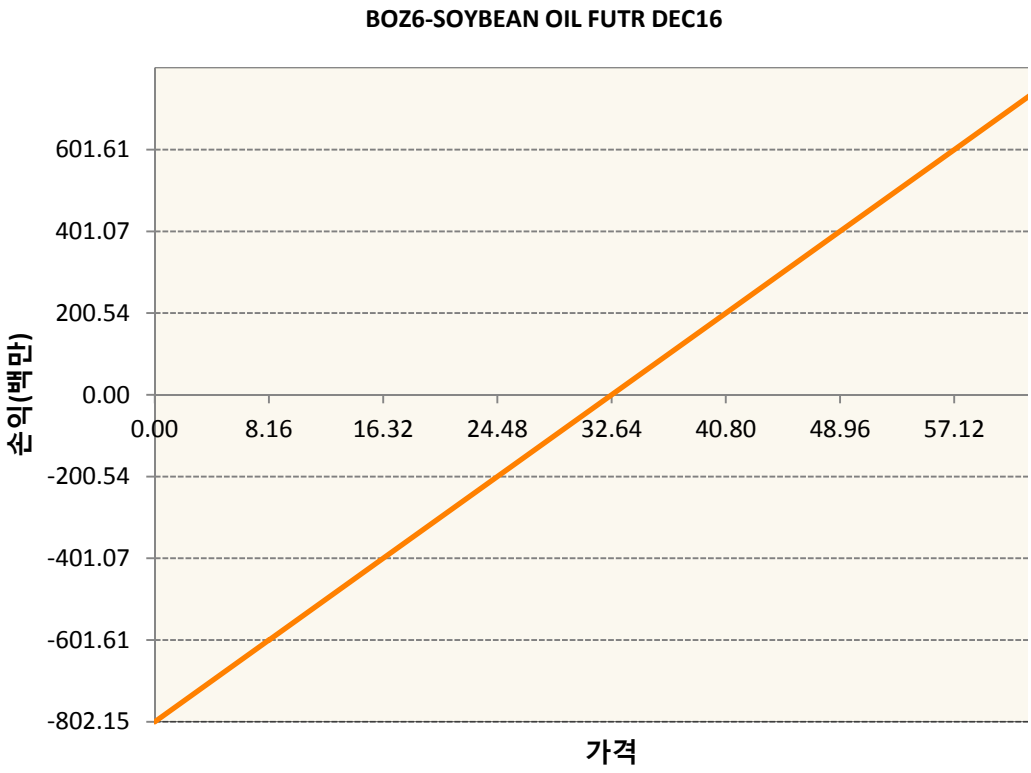
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

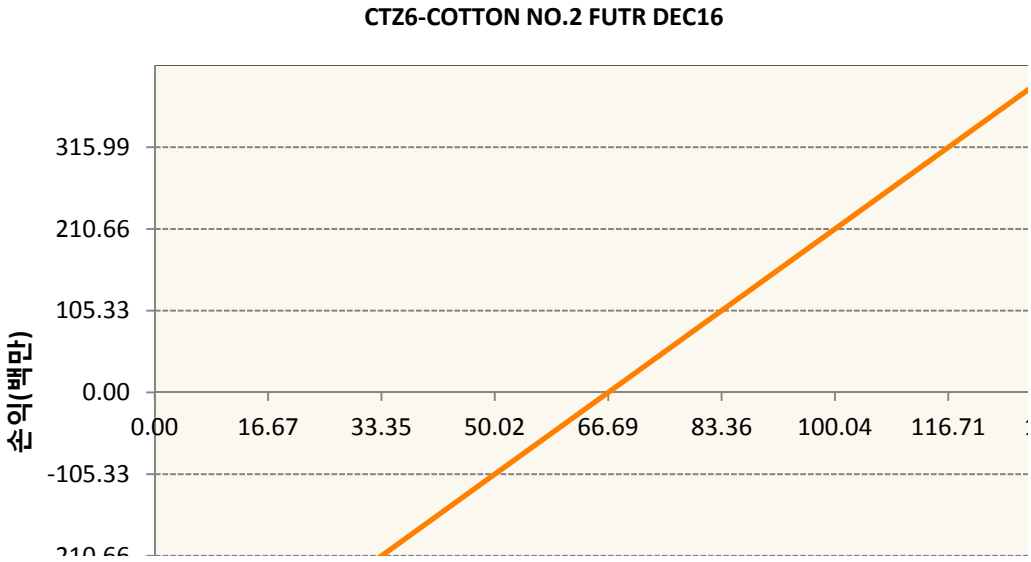
1. 계약금액

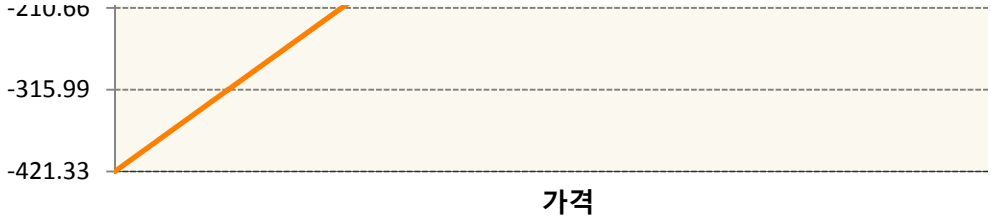
(단위:백만원)

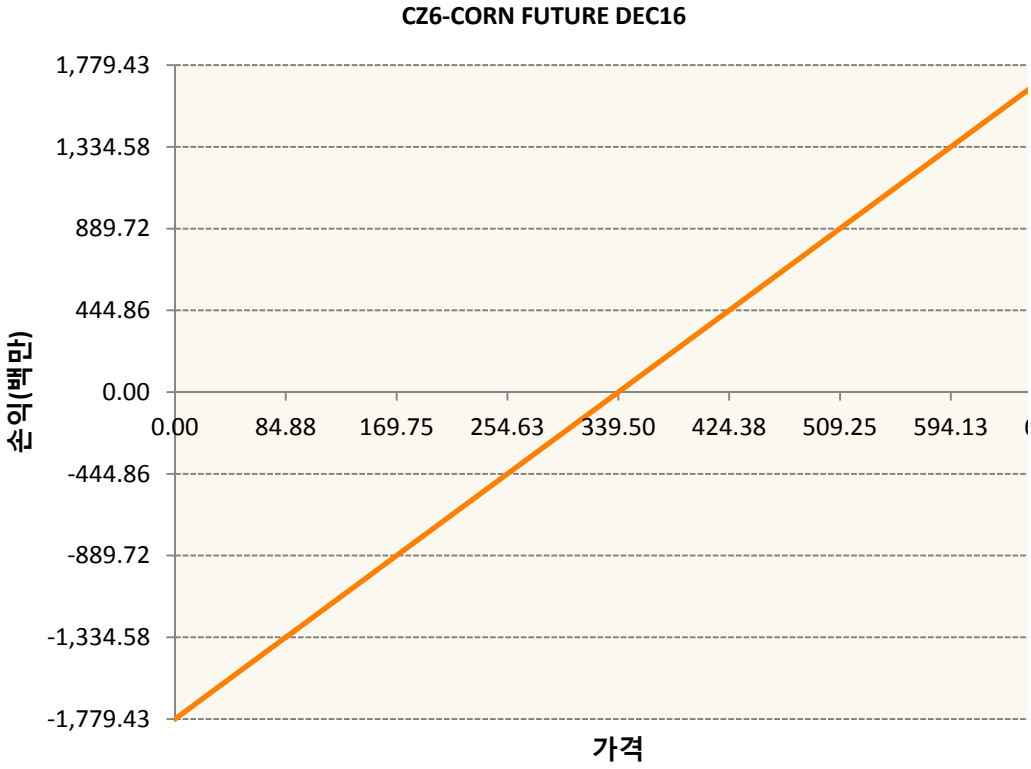
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	8,672	0	8,672	

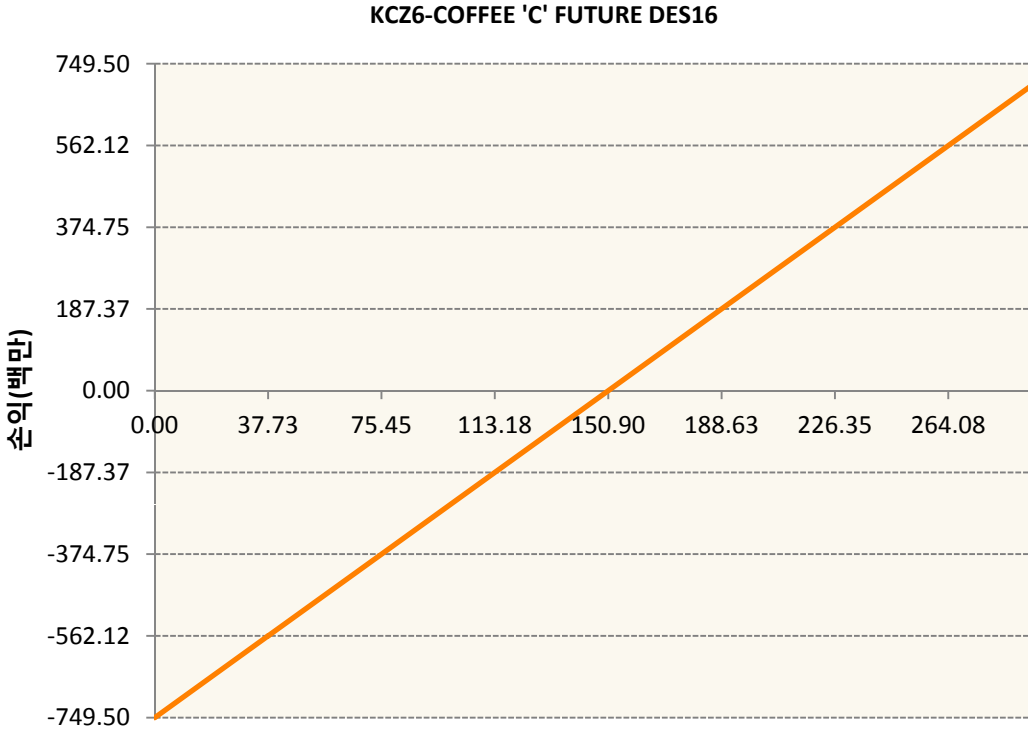
2. 만기시점의 손익구조





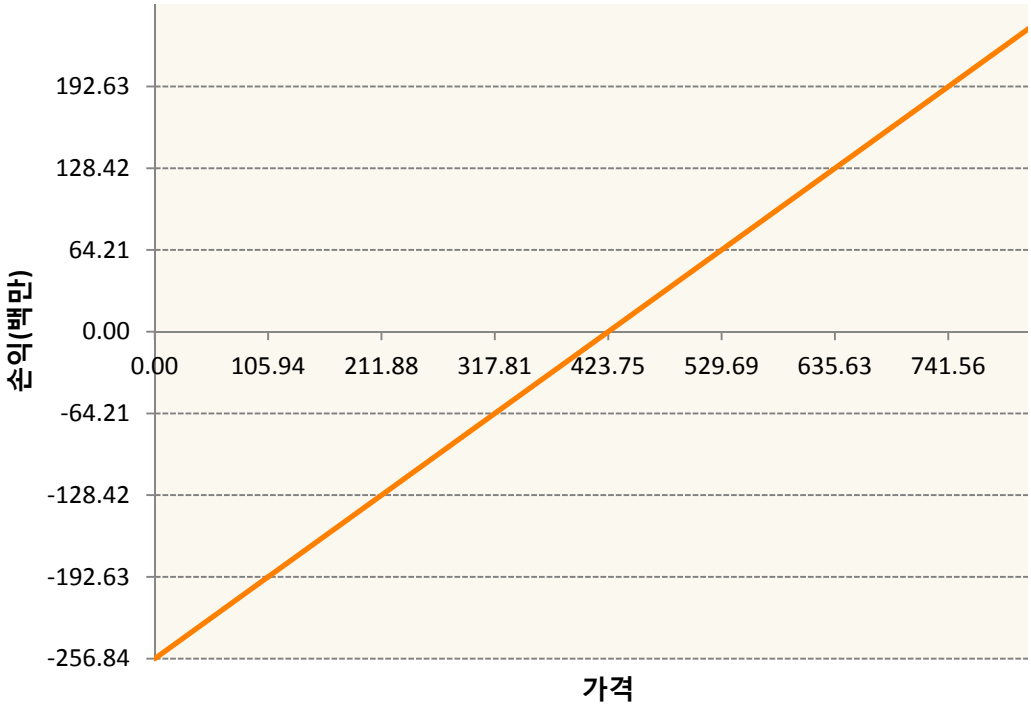

-210.66
-315.99
-421.33
가격


CZ6-CORN FUTURE DEC16
1,779.43
1,334.58
889.72
444.86
0.00
-444.86
-889.72
-1,334.58
-1,779.43
0.00
84.88
169.75
254.63
339.50
424.38
509.25
594.13
손익(백만)
가격

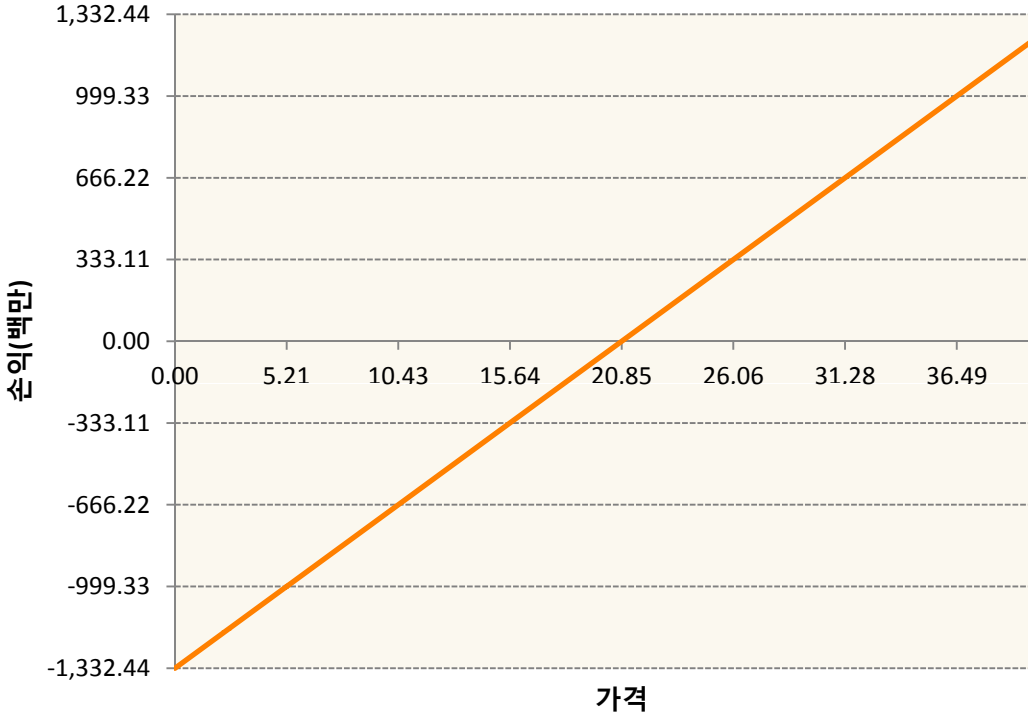

KCZ6-COFFEE 'C' FUTURE DES16
749.50
562.12
374.75
187.37
0.00
-187.37
-374.75
-562.12
-749.50
0.00
37.73
75.45
113.18
150.90
188.63
226.35
264.08
손익(백만)

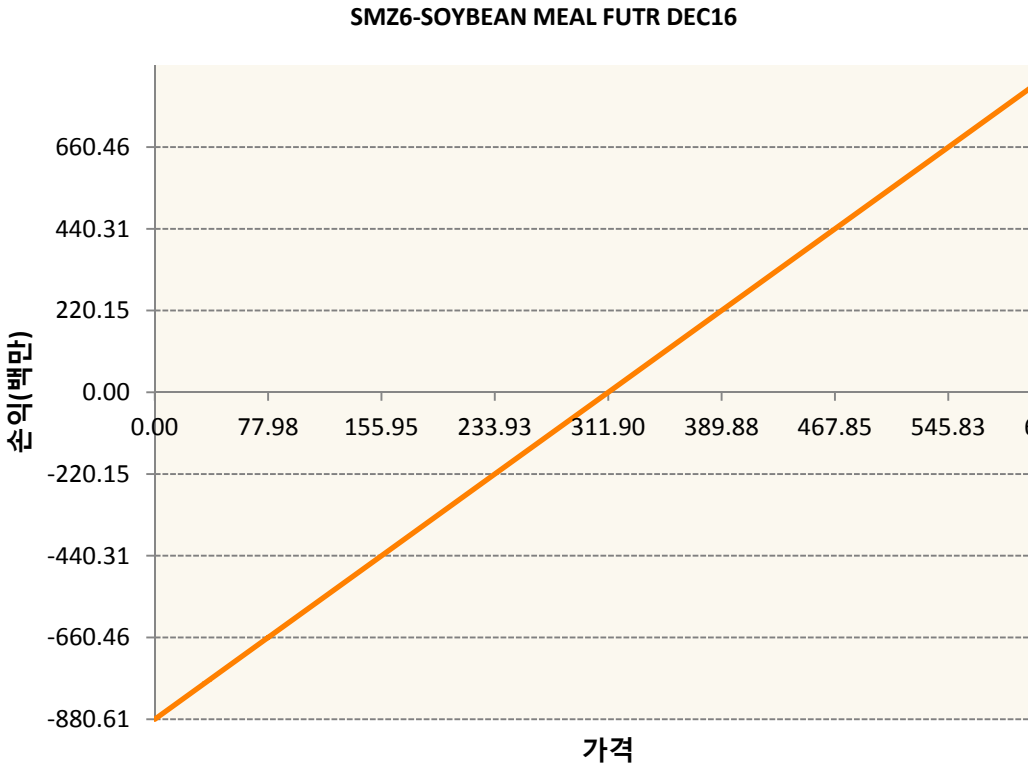
가격

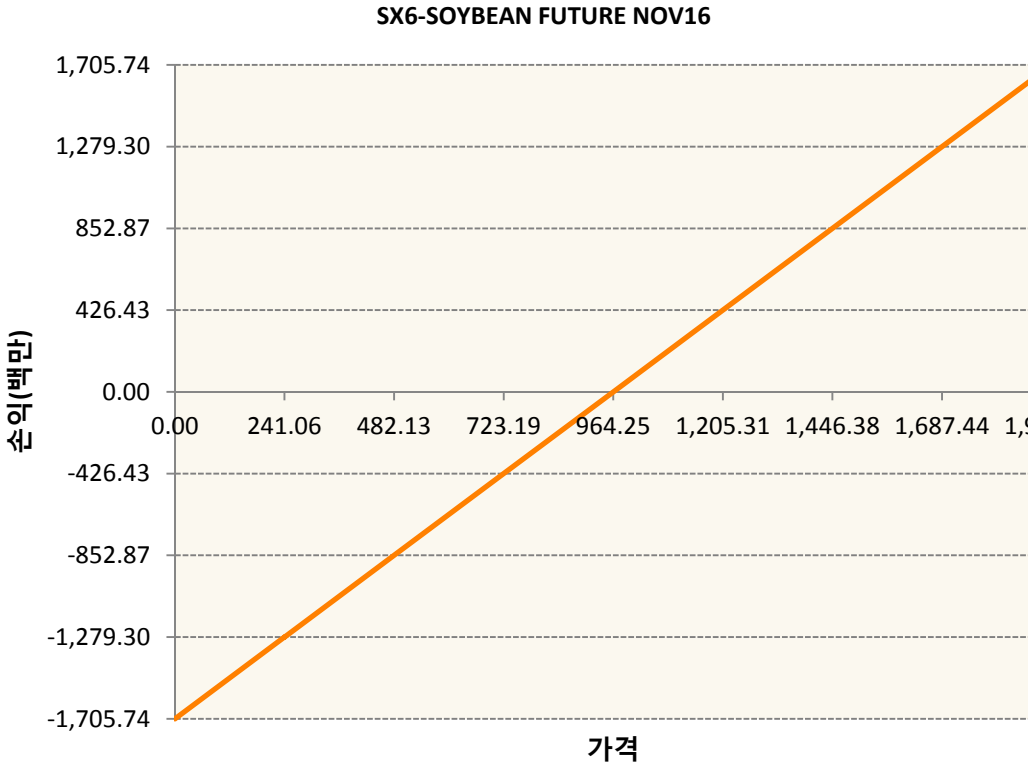
KWZ6-KC HRW WHEAT FUT DES16



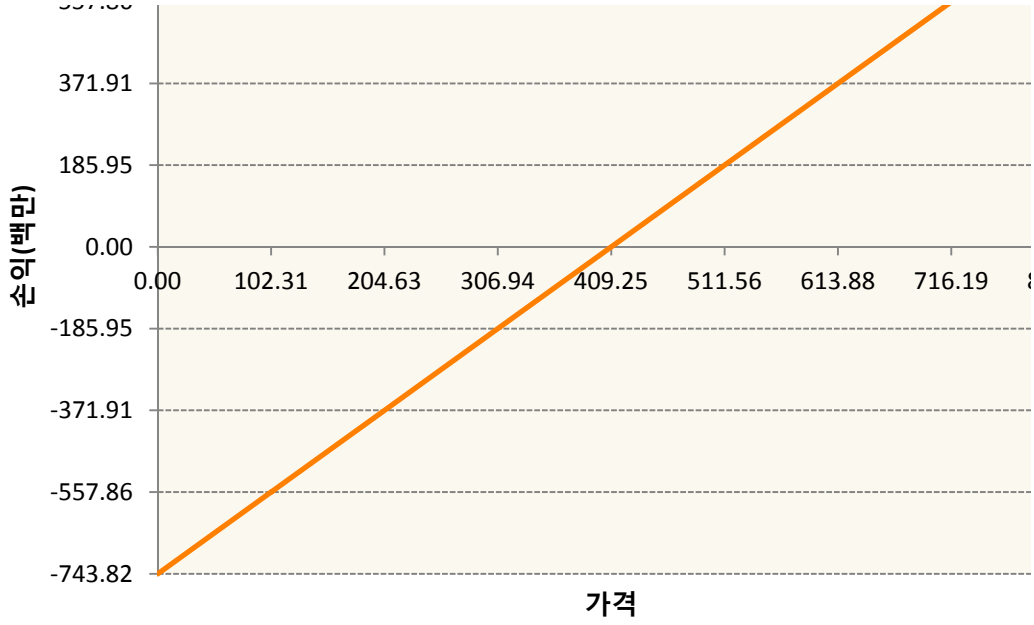
SBH7-Sugar #11 (WORLD) MAR17




SMZ6-SOYBEAN MEAL FUTR DEC16
660.46
440.31
220.15
0.00
-220.15
-440.31
-660.46
-880.61
0.00
77.98
155.95
233.93
311.90
389.88
467.85
545.83
손익(백만)
가격


SX6-SOYBEAN FUTURE NOV16
1,705.74
1,279.30
852.87
426.43
0.00
-426.43
-852.87
-1,279.30
-1,705.74
0.00
241.06
482.13
723.19
964.25
1,205.31
1,446.38
1,687.44
손익(백만)
가격


WZ6-WHEAT FUTURE(CBT) DEC16
557.86



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
BOZ6	SOYBEAN OIL FUTR DEC16	64
CTZ6	COTTON NO.2 FUTR DEC16	34
CZ6	CORN FUTURE DEC16	142
KCZ6	COFFEE 'C' FUTURE DES16	60
KWZ6	KC HRW WHEAT FUT DES16	21
SBH7	Sugar #11 (WORLD) MAR17	107
SMZ6	SOYBEAN MEAL FUTR DEC16	70
SX6	SOYBEAN FUTURE NOV16	136
WZ6	WHEAT FUTURE(CBT) DEC16	60

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	863