공시일	2016-09-21
기준일	2016-09-20

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	2016-09-21
기준일	2016-09-20

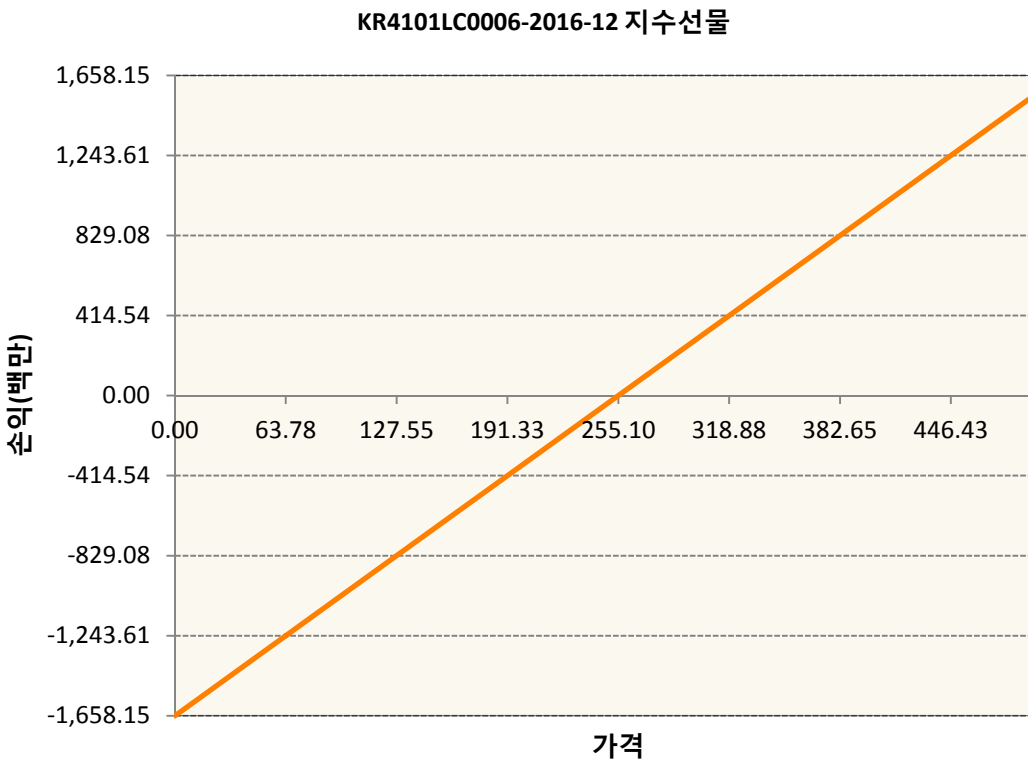
스마트인덱스모

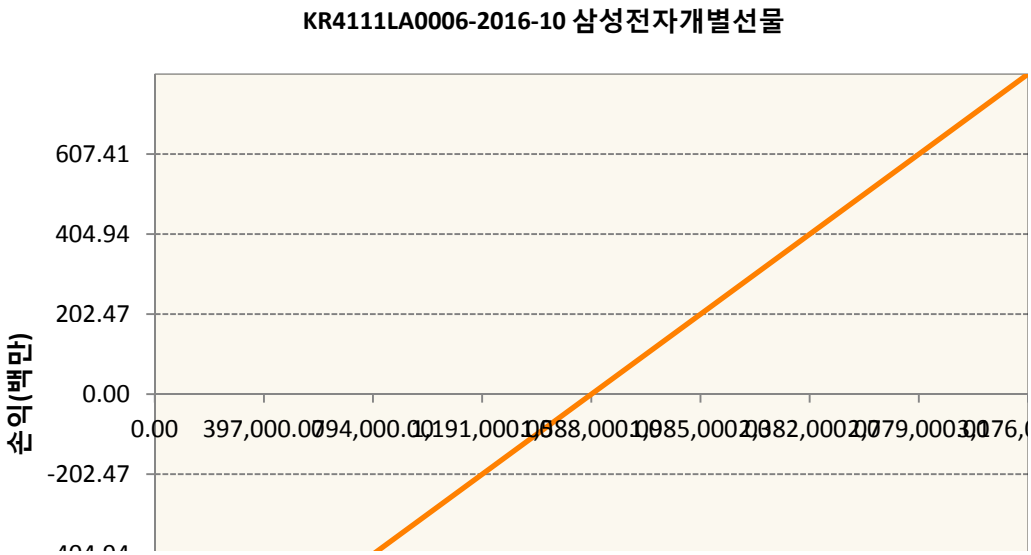
1. 계약금액

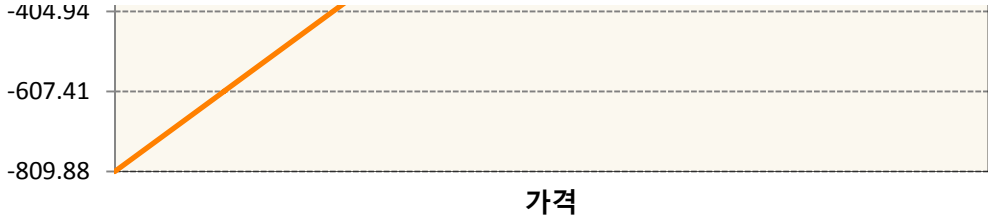
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	128	0	128	장내
누계	유가증권	선물	2,468	0	2,468	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101LC00 2016-12 지수선물							133
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-133	-133	-133	-133	-133	-133	-133
-5.33%	-88	-88	-88	-88	-88	-88	-88
-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%	88	88	88	88	88	88	88
8.00%	133	133	133	133	133	133	133
KR4111LA00 2016-10 삼성전자개별선물							65
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-65	-65	-65	-65	-65	-65	-65
-5.33%	-43	-43	-43	-43	-43	-43	-43
-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%	43	43	43	43	43	43	43
8.00%	65	65	65	65	65	65	65

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

(단위:백만원)

174

공시일	2016-09-21
기준일	2016-09-20

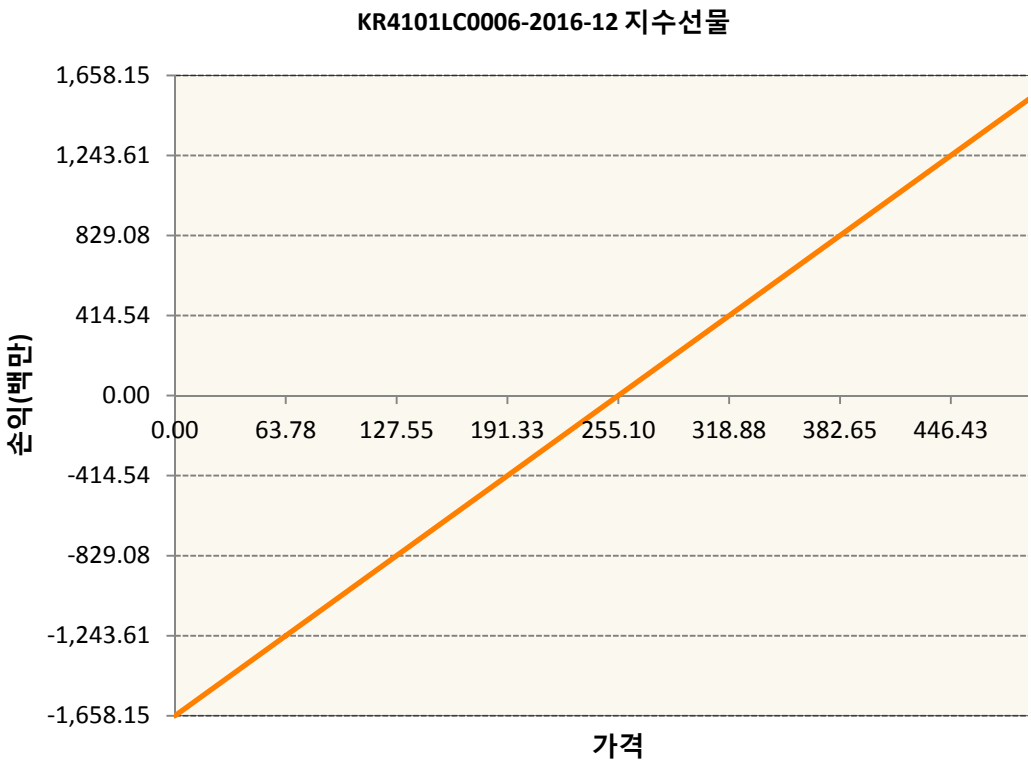
스마트레버리지목표전환형1호

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	1,658	0	1,658	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101LC00 2016-12 지수선물							133
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-133	-133	-133	-133	-133	-133	-133
-5.33%	-88	-88	-88	-88	-88	-88	-88
-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%	88	88	88	88	88	88	88
8.00%	133	133	133	133	133	133	133

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

103

공시일	2016-09-21
기준일	2016-09-20

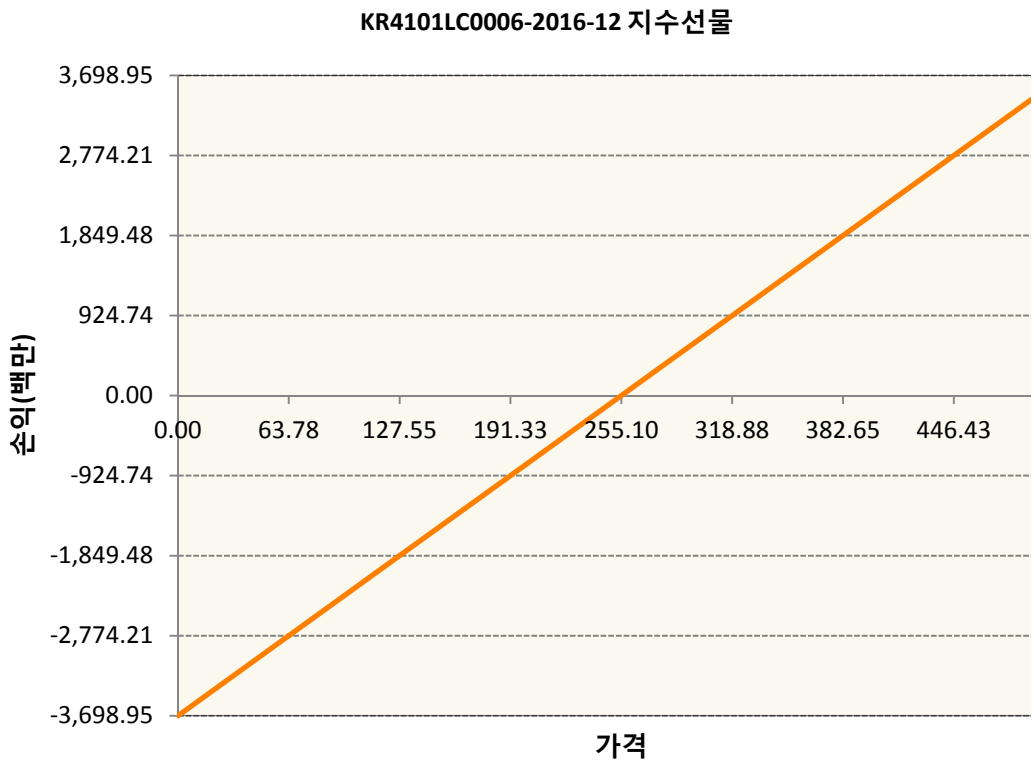
1.3배 레버리지 인덱스(주식-파생형)

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	3,699	0	3,699	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101LC00 2016-12 지수선물							296
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-296	-296	-296	-296	-296	-296	-296
-5.33%	-197	-197	-197	-197	-197	-197	-197
-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%	197	197	197	197	197	197	197
8.00%	296	296	296	296	296	296	296

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

230

공시일	2016-09-21
기준일	2016-09-20

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	875

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

732

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2016-09-21
기준일	2016-09-20

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	398

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

858

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2016-09-21
기준일	2016-09-20

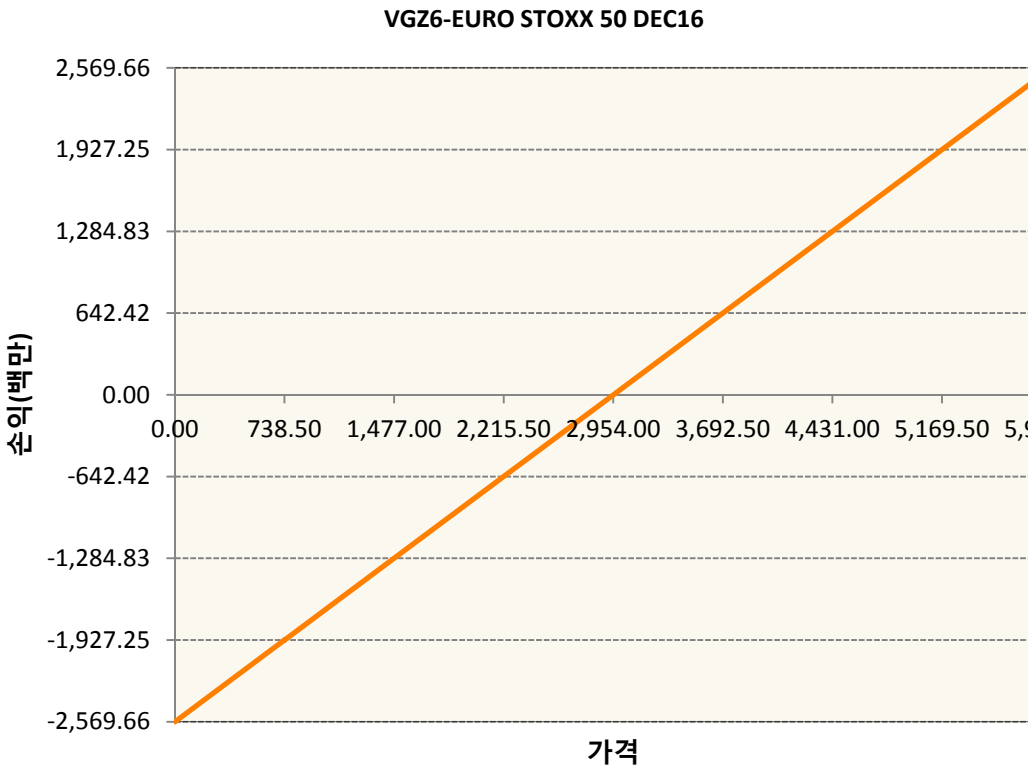
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,570	0	2,570	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGZ6	EURO STOXX 50 DEC16	206

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

(단위:백만원)

252

공시일	2016-09-21
기준일	2016-09-20

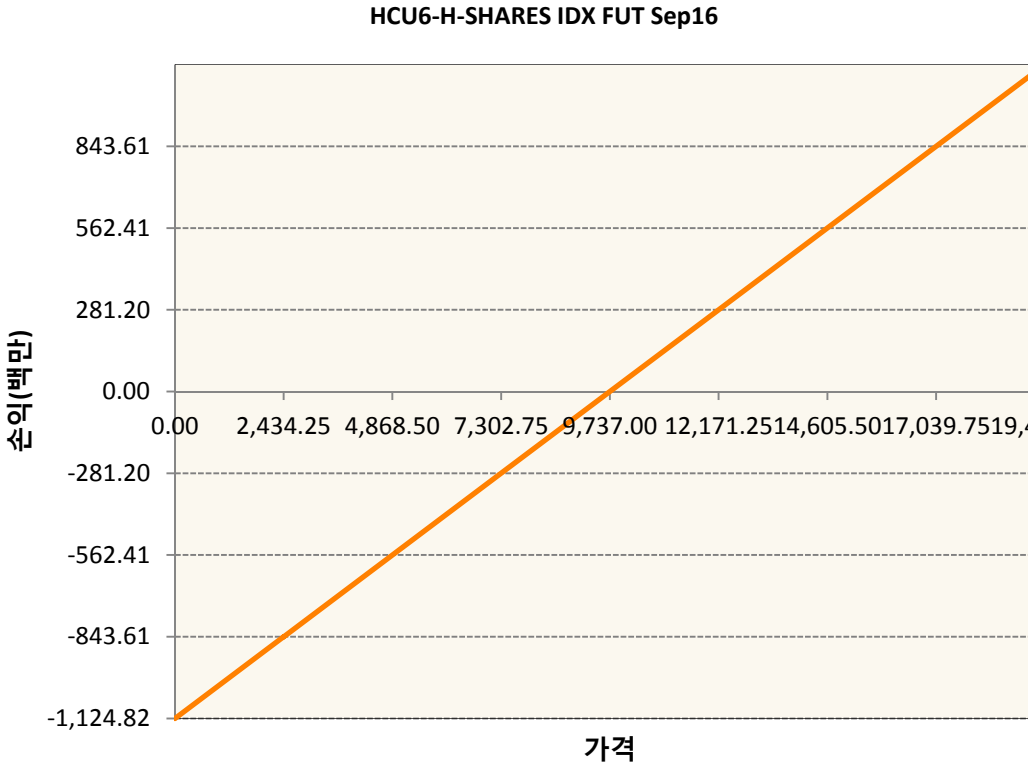
차이나인덱스모(주식-파생형)

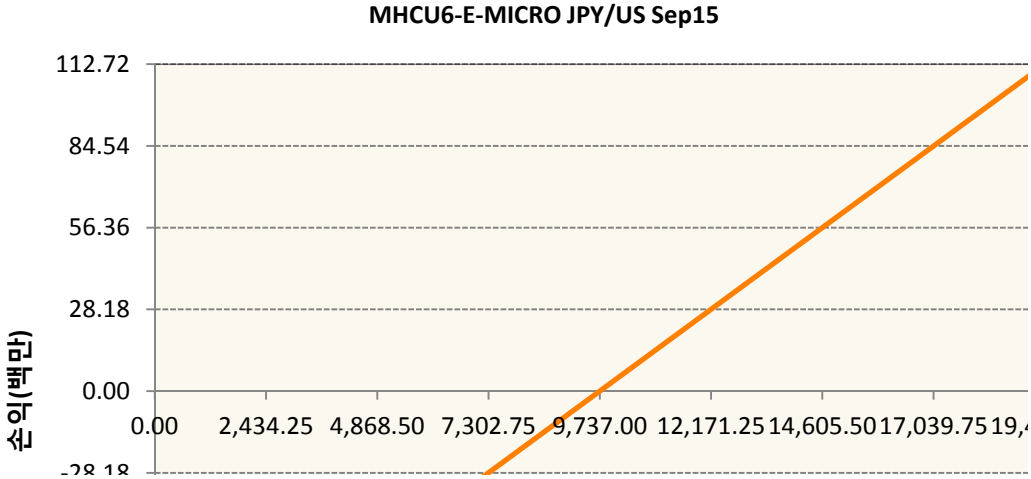
1. 계약금액

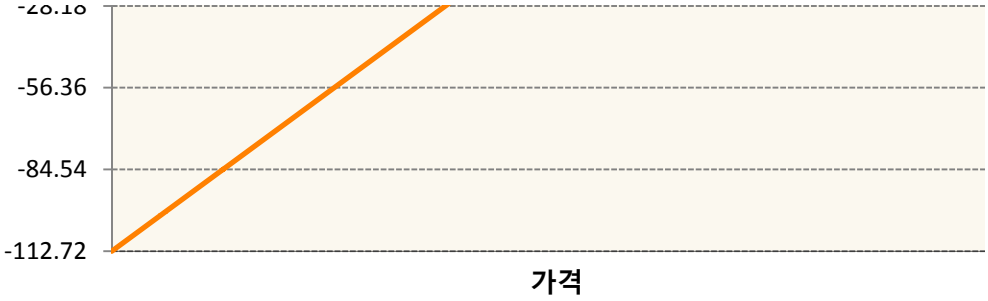
(단위:백만원)

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	113	0	113	
누계	유가증권	선물	1,125	0	1,125	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

HCU6	H-SHARES IDX FUT Sep16	90
MHCU6	E-MICRO JPY/US Sep15	9

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

129

공시일	2016-09-21
기준일	2016-09-20

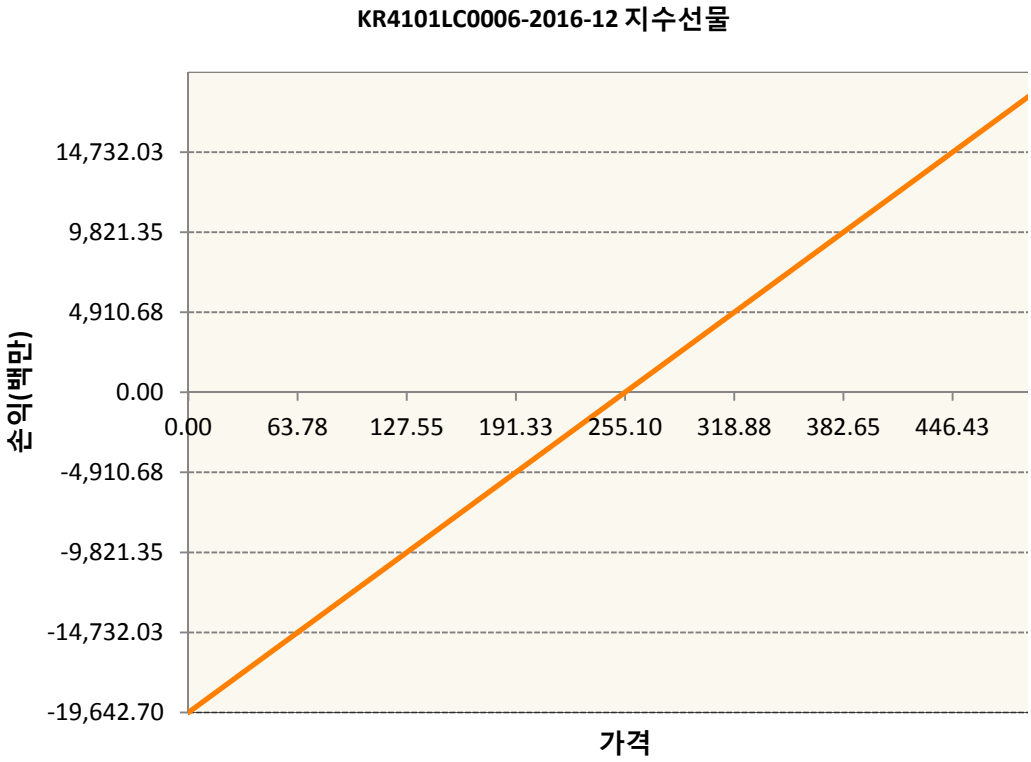
커버드콜(주식혼합-파생형)

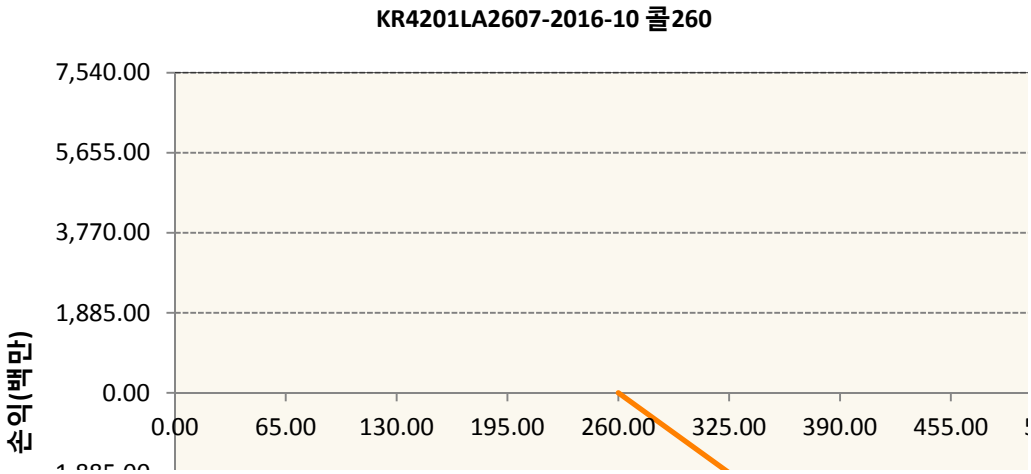
1. 계약금액

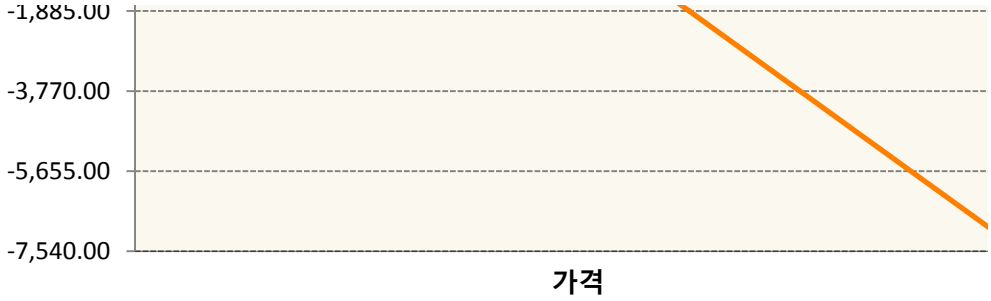
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	638	0	638	장내
신규	유가증권	옵션	0	130	-130	장내
누계	유가증권	선물	19,643	0	19,643	장내
누계	유가증권	옵션	0	7,540	-7,540	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101LC00 2016-12 지수선물							1,571
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,571	-1,571	-1,571	-1,571	-1,571	-1,571	-1,571
-5.33%	-1,048	-1,048	-1,048	-1,048	-1,048	-1,048	-1,048
-2.67%	-524	-524	-524	-524	-524	-524	-524
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	524	524	524	524	524	524	524
5.33%	1,048	1,048	1,048	1,048	1,048	1,048	1,048
8.00%	1,571	1,571	1,571	1,571	1,571	1,571	1,571
KR4201LA26 2016-10 콜260							2,069
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	251	251	251	251	250	248	245
-5.33%	251	249	246	242	236	228	217
-2.67%	234	222	207	189	169	146	121
0%	111	75	38	0	-39	-79	-119
2.67%	-303	-347	-391	-435	-480	-524	-569
5.33%	-1,058	-1,081	-1,108	-1,137	-1,169	-1,202	-1,236
8.00%	-1,993	-1,998	-2,007	-2,019	-2,033	-2,050	-2,069

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

3,269

공시일	2016-09-21
기준일	2016-09-20

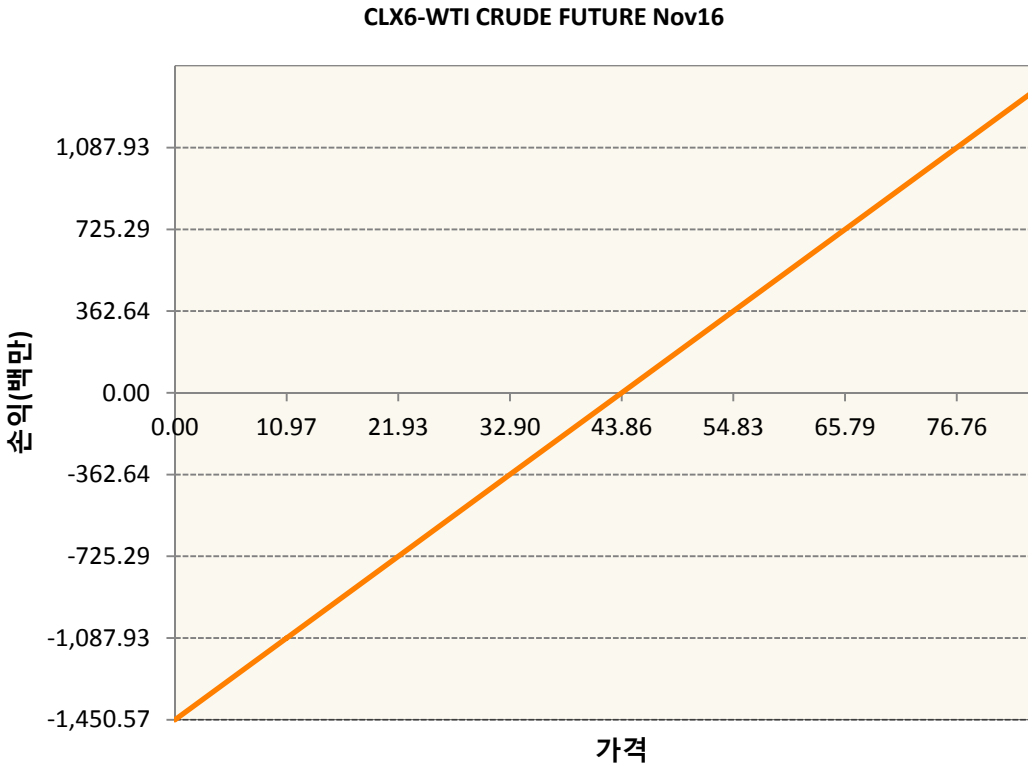
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

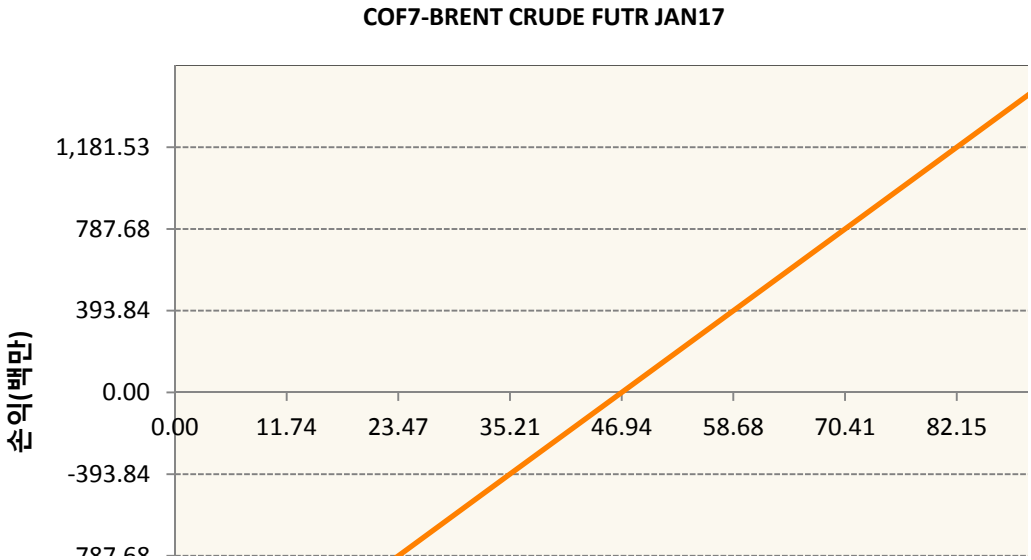
1. 계약금액

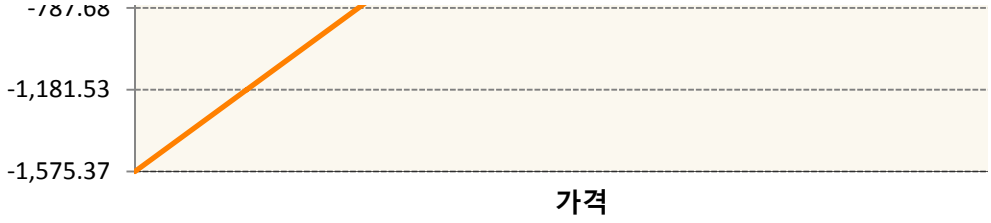
(단위:백만원)

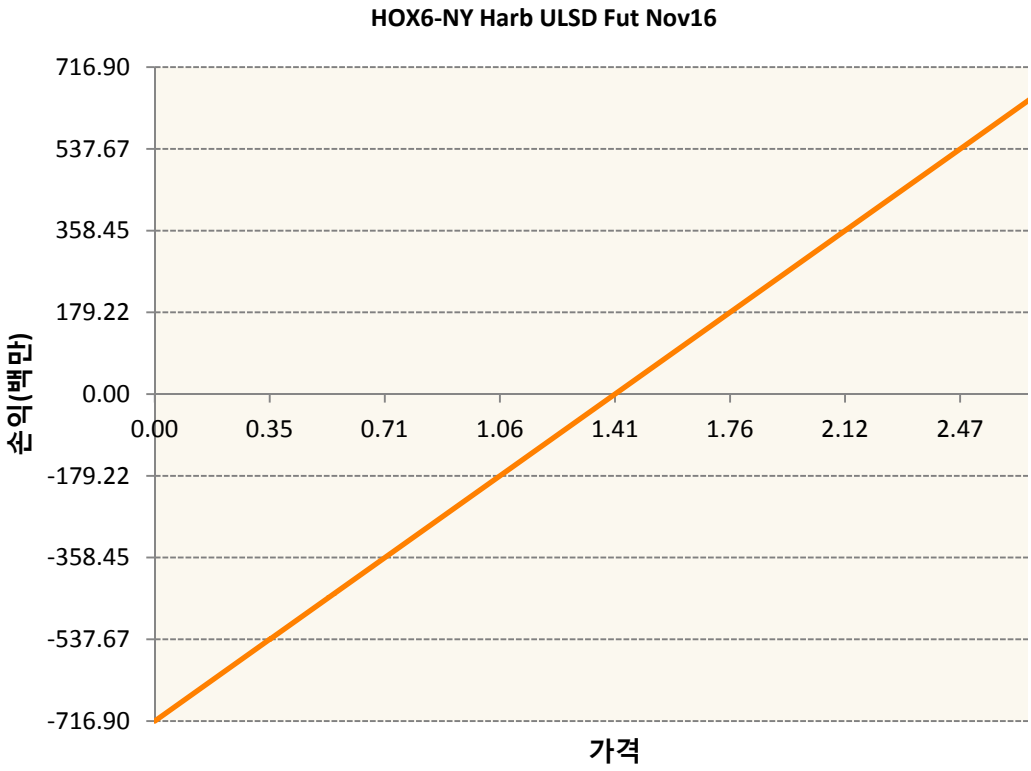
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	6,131	0	6,131	

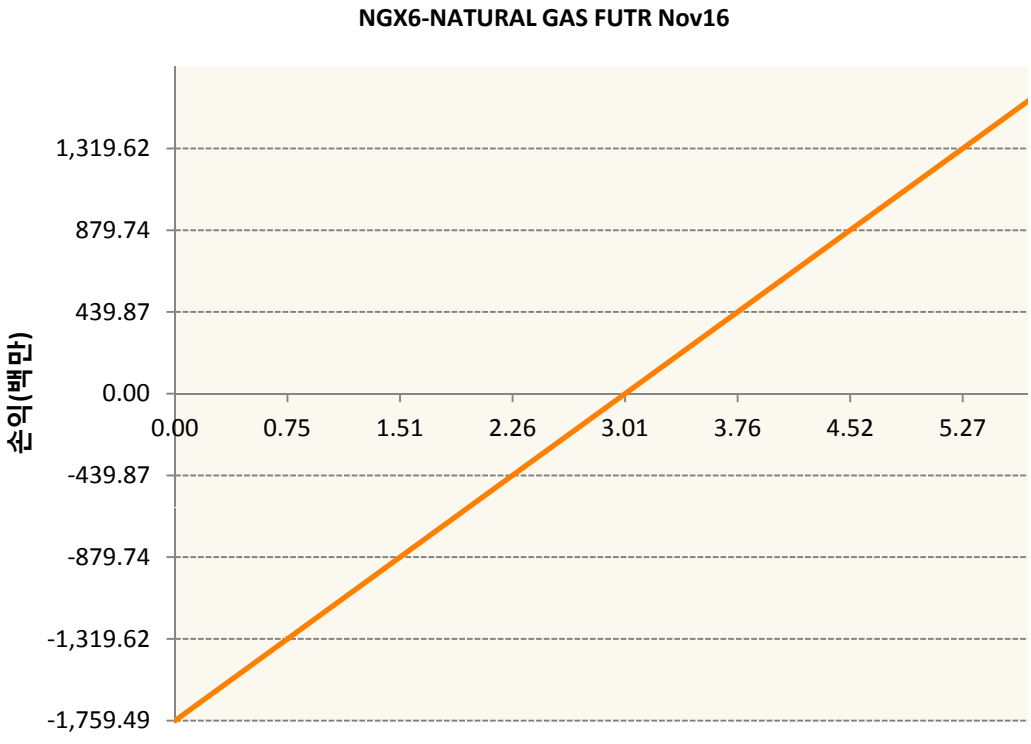
2. 만기시점의 손익구조



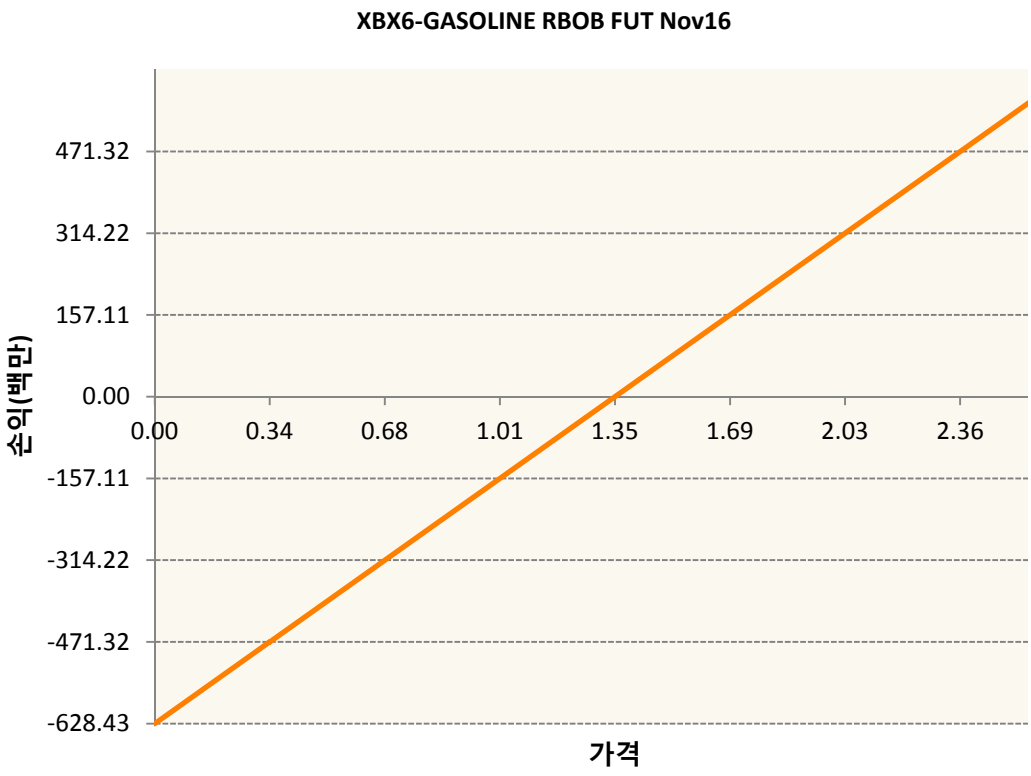



-1,181.53
-1,575.37
가격


HOX6-NY Harb ULSD Fut Nov16
716.90
537.67
358.45
179.22
0.00
-179.22
-358.45
-537.67
-716.90
0.00
0.35
0.71
1.06
1.41
1.76
2.12
2.47
순익(백만)
가격


NGX6-NATURAL GAS FUTR Nov16
1,319.62
879.74
439.87
0.00
-439.87
-879.74
-1,319.62
-1,759.49
0.00
0.75
1.51
2.26
3.01
3.76
4.52
5.27
순익(백만)

가격



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
CLX6	WTI CRUDE FUTURE Nov16	116
COF7	BRENT CRUDE FUTR JAN17	126
HOX6	NY Harb ULSD Fut Nov16	57
NGX6	NATURAL GAS FUTR Nov16	141
XBX6	GASOLINE RBOB FUT Nov16	50

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,088

공시일	2016-09-21
기준일	2016-09-20

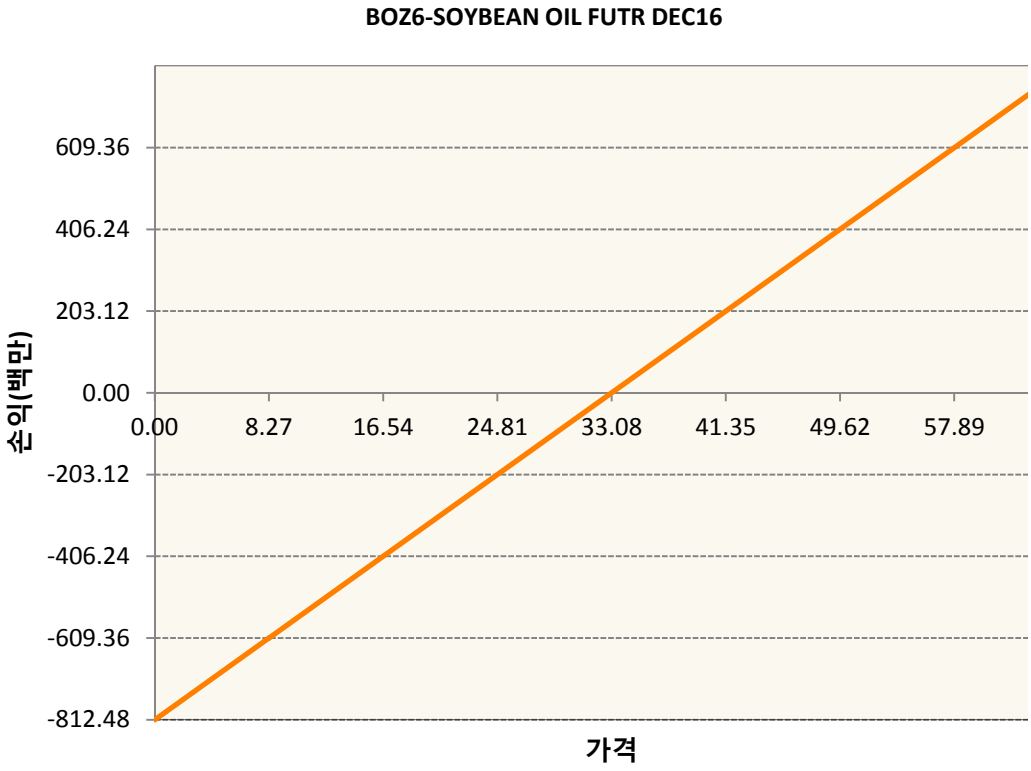
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

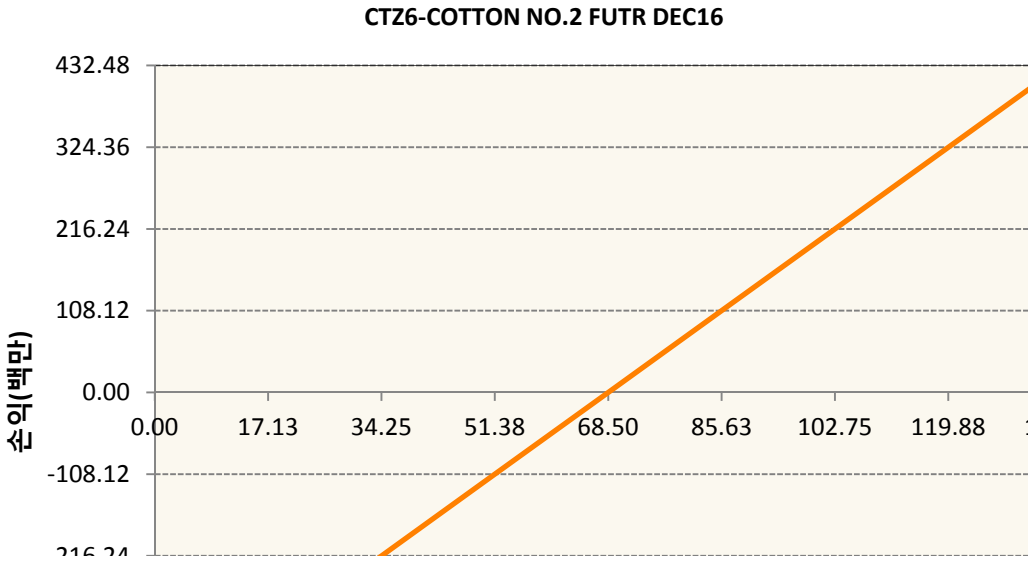
1. 계약금액

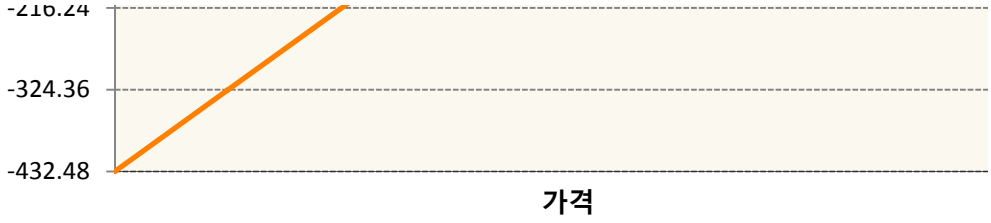
(단위:백만원)

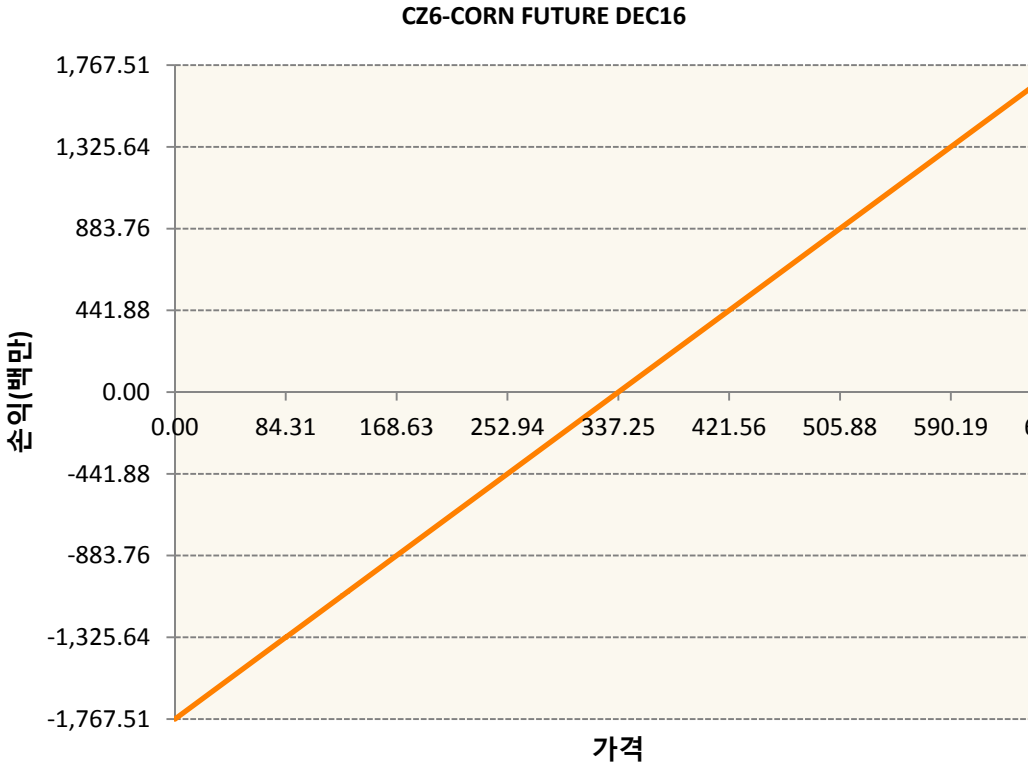
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	8,809	0	8,809	

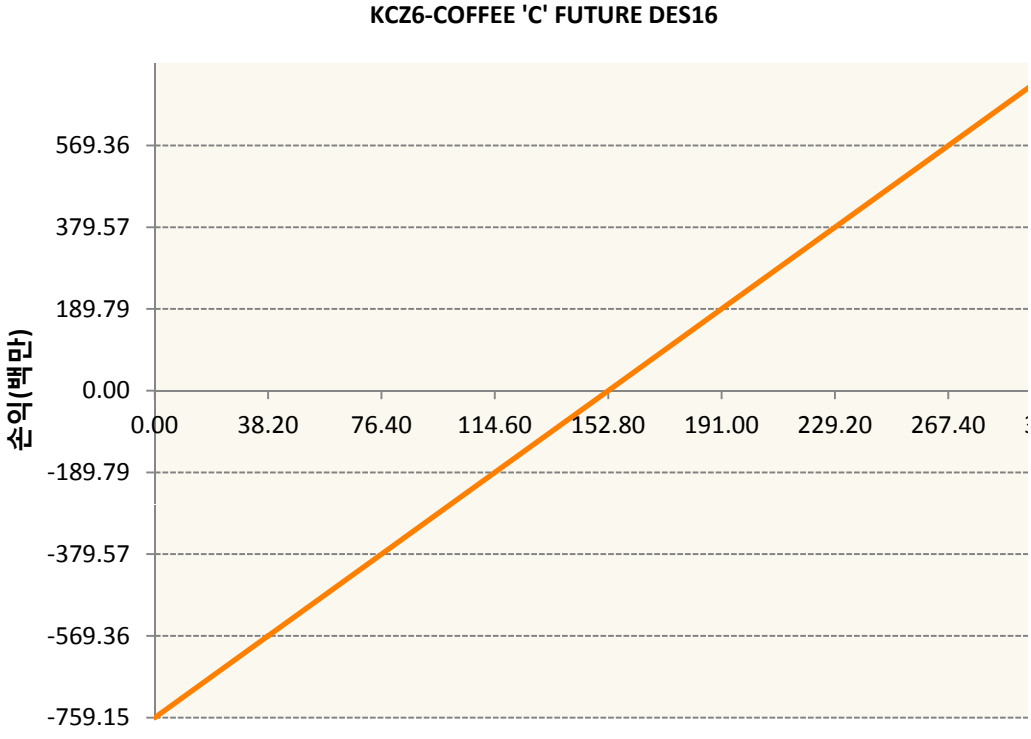
2. 만기시점의 손익구조



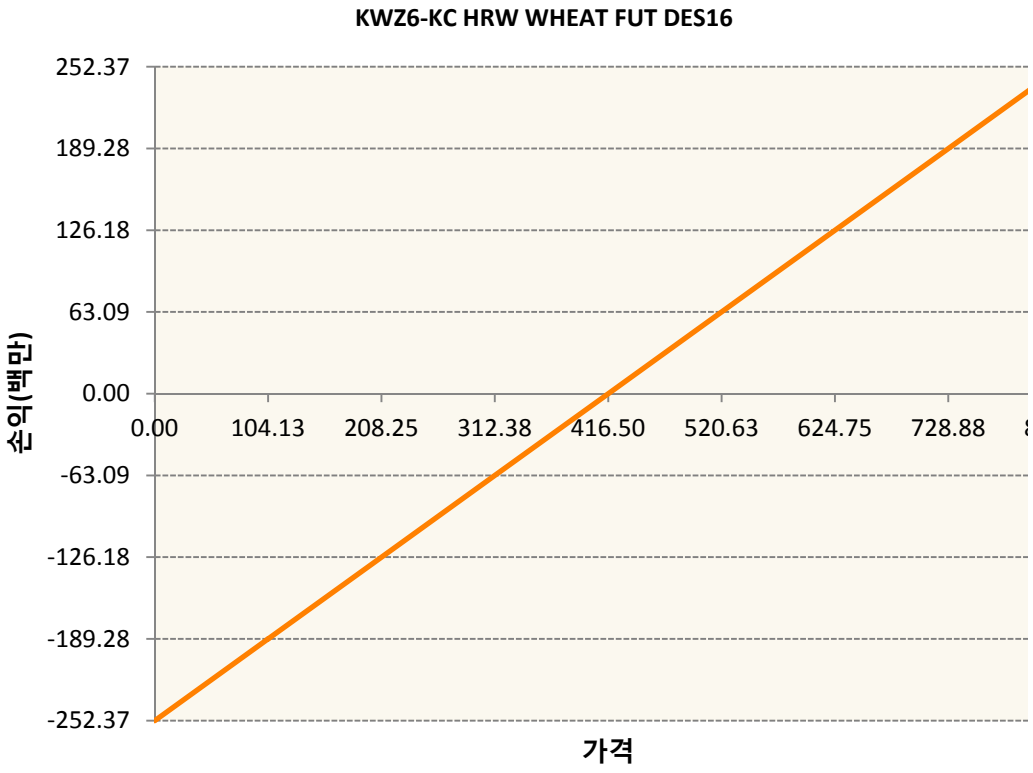


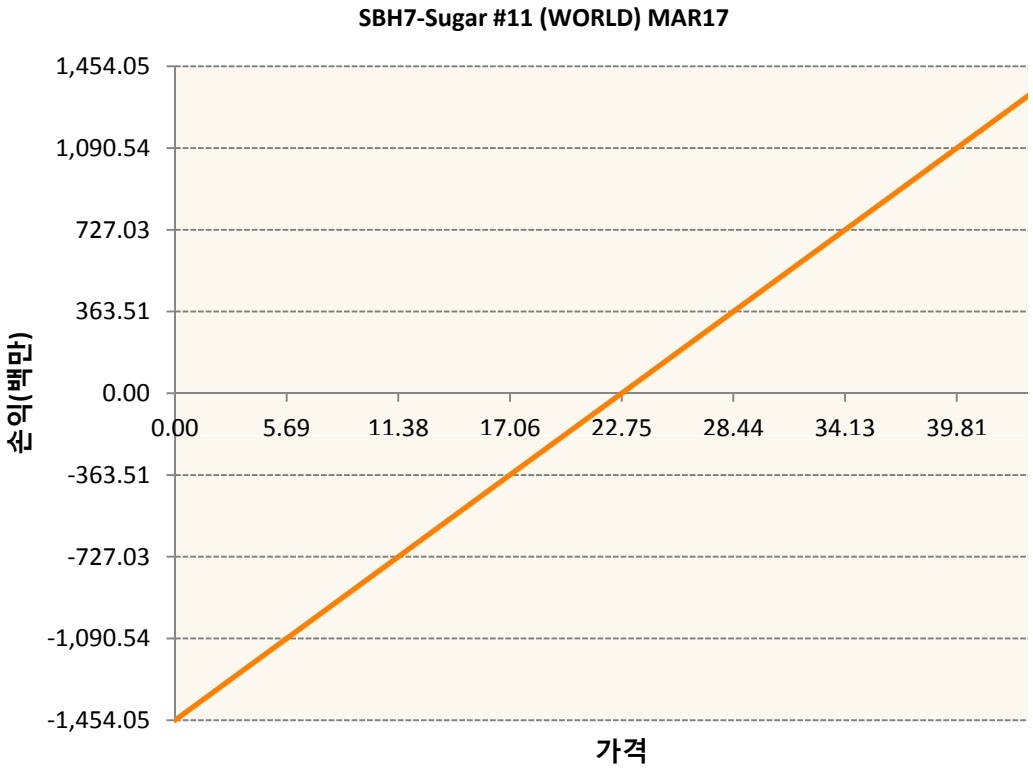

-216.24
-324.36
-432.48
가격

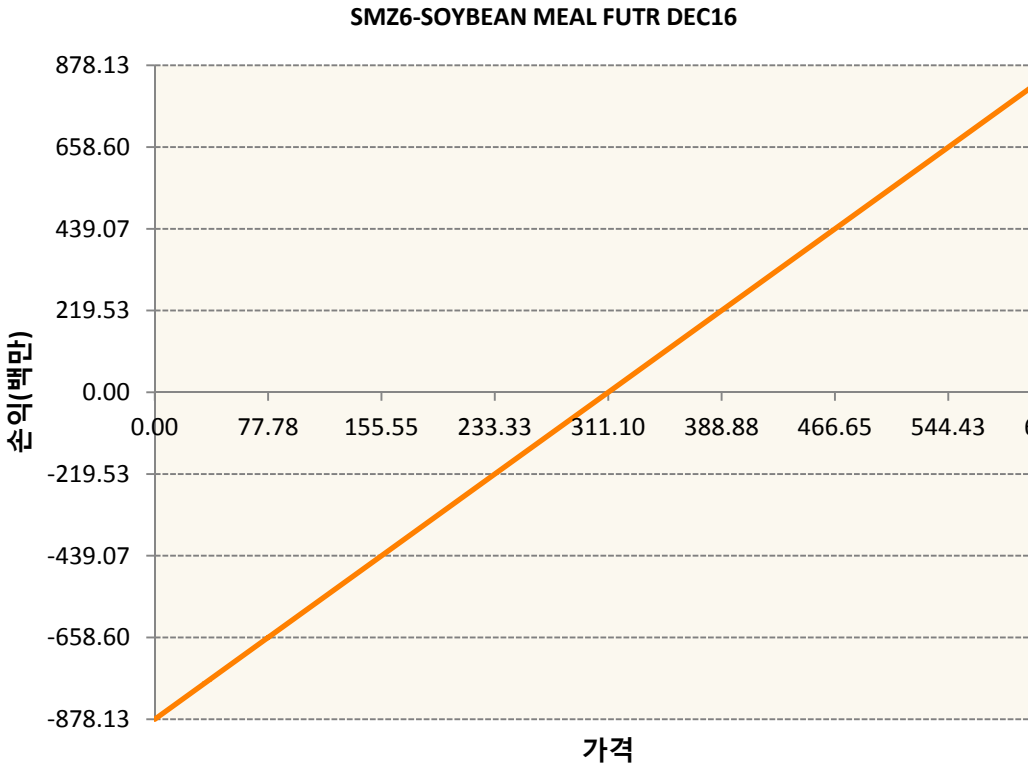

CZ6-CORN FUTURE DEC16
1,767.51
1,325.64
883.76
441.88
0.00
-441.88
-883.76
-1,325.64
-1,767.51
0.00
84.31
168.63
252.94
337.25
421.56
505.88
590.19
순익(백만)
가격

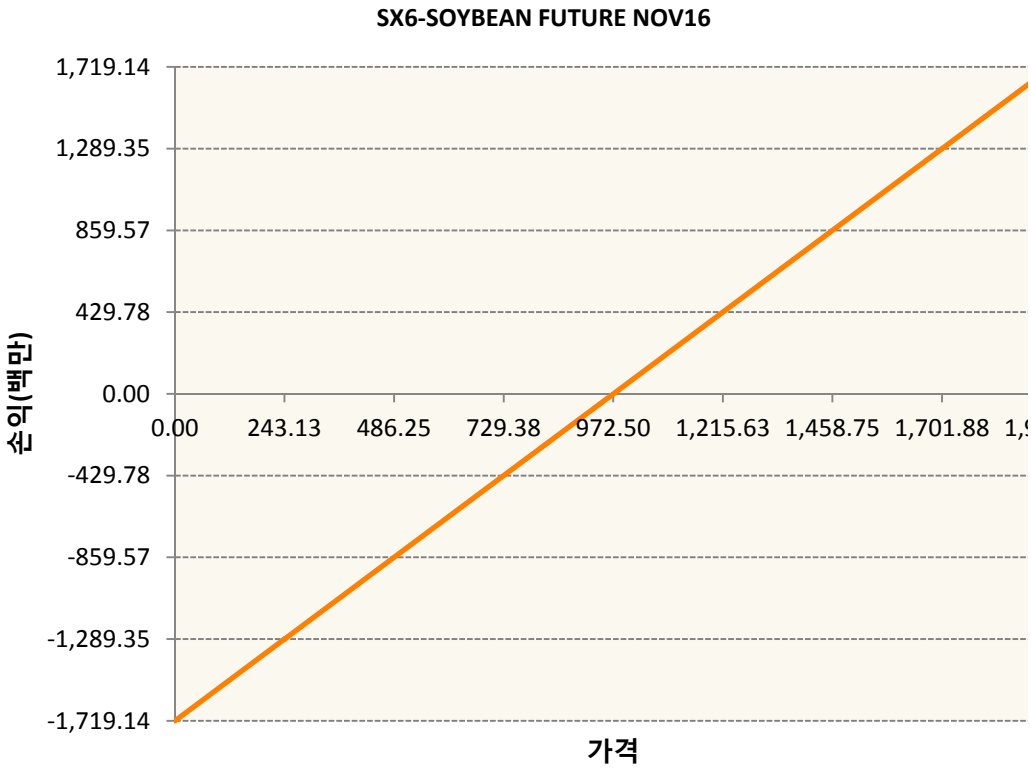

KCZ6-COFFEE 'C' FUTURE DES16
569.36
379.57
189.79
0.00
-189.79
-379.57
-569.36
-759.15
0.00
38.20
76.40
114.60
152.80
191.00
229.20
267.40
순익(백만)

가격

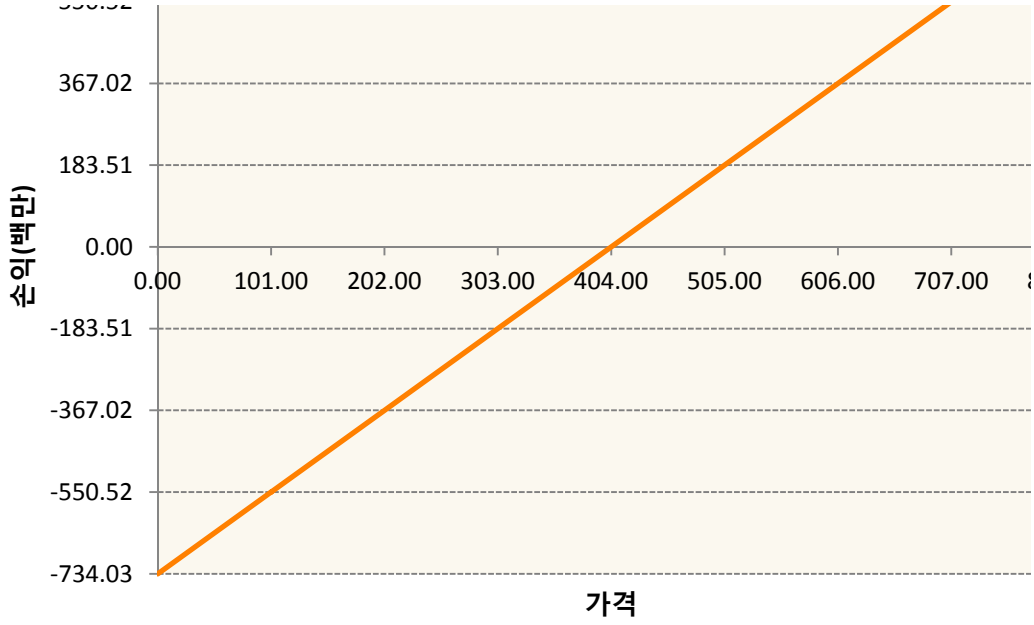

KWZ6-KC HRW WHEAT FUT DES16
252.37
189.28
126.18
63.09
0.00
-63.09
-126.18
-189.28
-252.37
0.00
104.13
208.25
312.38
416.50
520.63
624.75
728.88
손익(백만)
가격


SBH7-Sugar #11 (WORLD) MAR17
1,454.05
1,090.54
727.03
363.51
0.00
-363.51
-727.03
-1,090.54
-1,454.05
0.00
5.69
11.38
17.06
22.75
28.44
34.13
39.81
손익(백만)
가격


SMZ6-SOYBEAN MEAL FUTR DEC16
878.13
658.60
439.07
219.53
0.00
-219.53
-439.07
-658.60
-878.13
0.00
77.78
155.55
233.33
311.10
388.88
466.65
544.43
손익(백만)
가격


SX6-SOYBEAN FUTURE NOV16
1,719.14
1,289.35
859.57
429.78
0.00
-429.78
-859.57
-1,289.35
-1,719.14
0.00
243.13
486.25
729.38
972.50
1,215.63
1,458.75
1,701.88
손익(백만)
가격


WZ6-WHEAT FUTURE(CBT) DEC16
550.52



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

BOZ6	SOYBEAN OIL FUTR DEC16	65
CTZ6	COTTON NO.2 FUTR DEC16	35
CZ6	CORN FUTURE DEC16	141
KCZ6	COFFEE 'C' FUTURE DES16	61
KWZ6	KC HRW WHEAT FUT DES16	20
SBH7	Sugar #11 (WORLD) MAR17	116
SMZ6	SOYBEAN MEAL FUTR DEC16	70
SX6	SOYBEAN FUTURE NOV16	138
WZ6	WHEAT FUTURE(CBT) DEC16	59

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

886