공시일	2016-09-28
기준일	2016-09-27

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	2016-09-28
기준일	2016-09-27

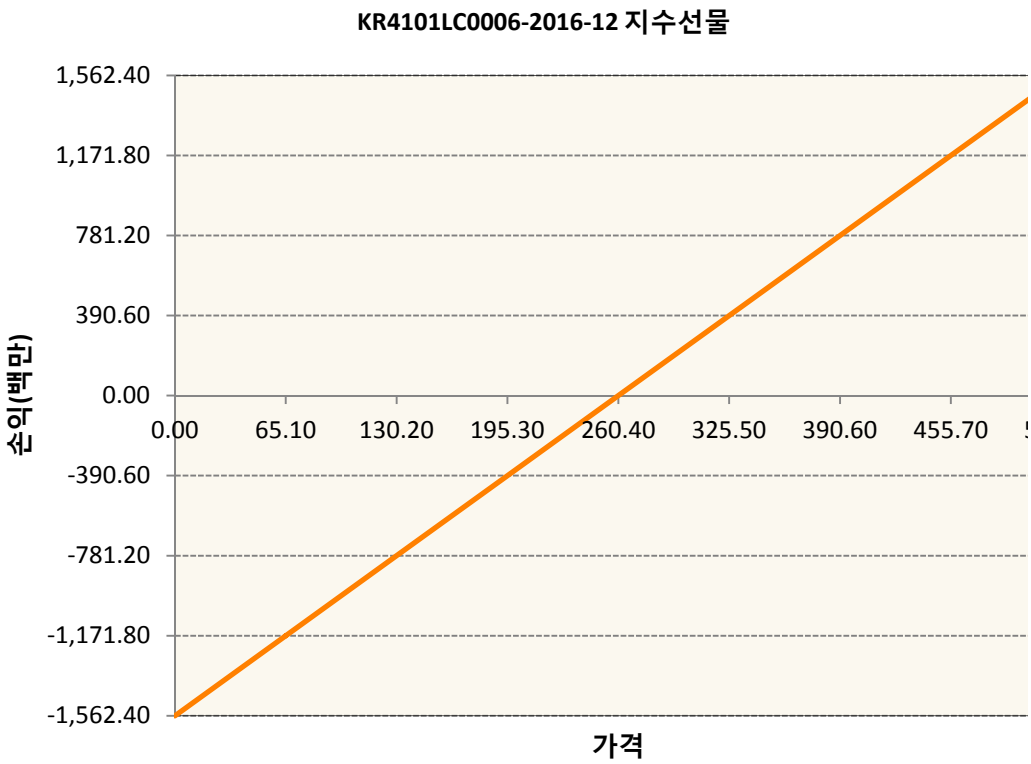
스마트인덱스모

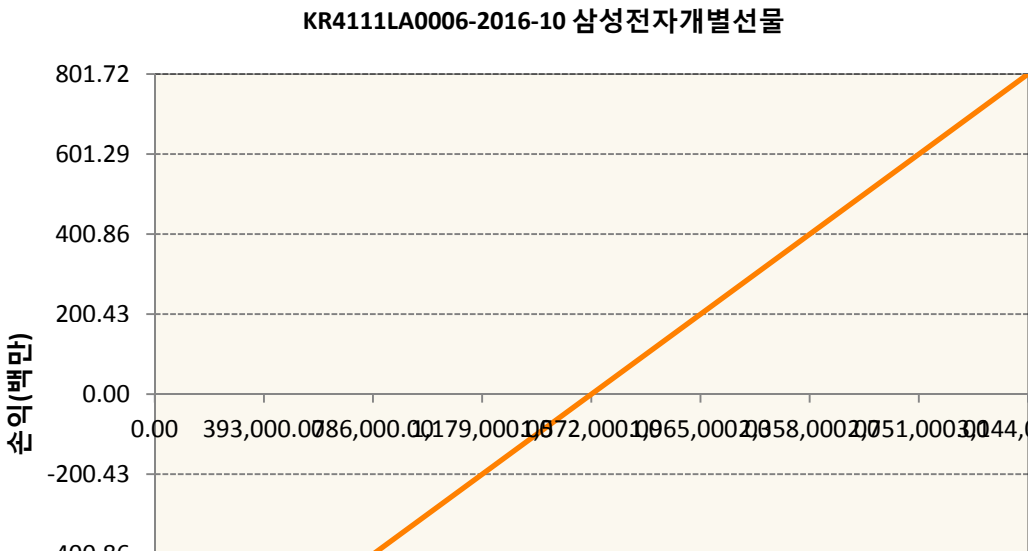
1. 계약금액

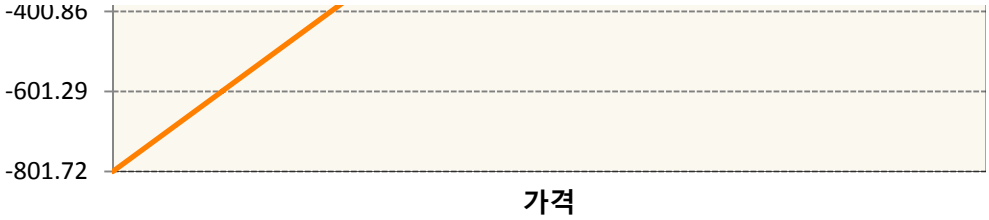
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,364	0	2,364	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101LC00 2016-12 지수선물							125
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-125	-125	-125	-125	-125	-125	-125
-5.33%	-83	-83	-83	-83	-83	-83	-83
-2.67%	-42	-42	-42	-42	-42	-42	-42
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	42	42	42	42	42	42	42
5.33%	83	83	83	83	83	83	83
8.00%	125	125	125	125	125	125	125
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)

165

공시일	2016-09-28
기준일	2016-09-27

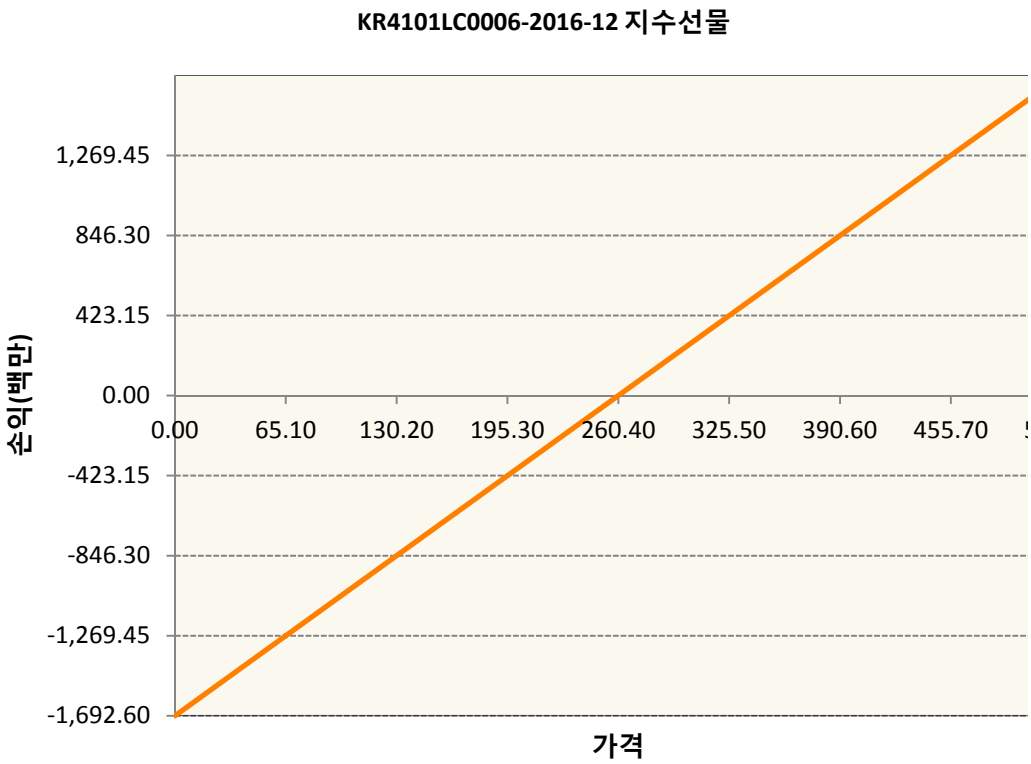
스마트레버리지목표전환형1호

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							135
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-135	-135	-135	-135	-135	-135	-135
-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%	135	135	135	135	135	135	135

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

104

공시일	2016-09-28
기준일	2016-09-27

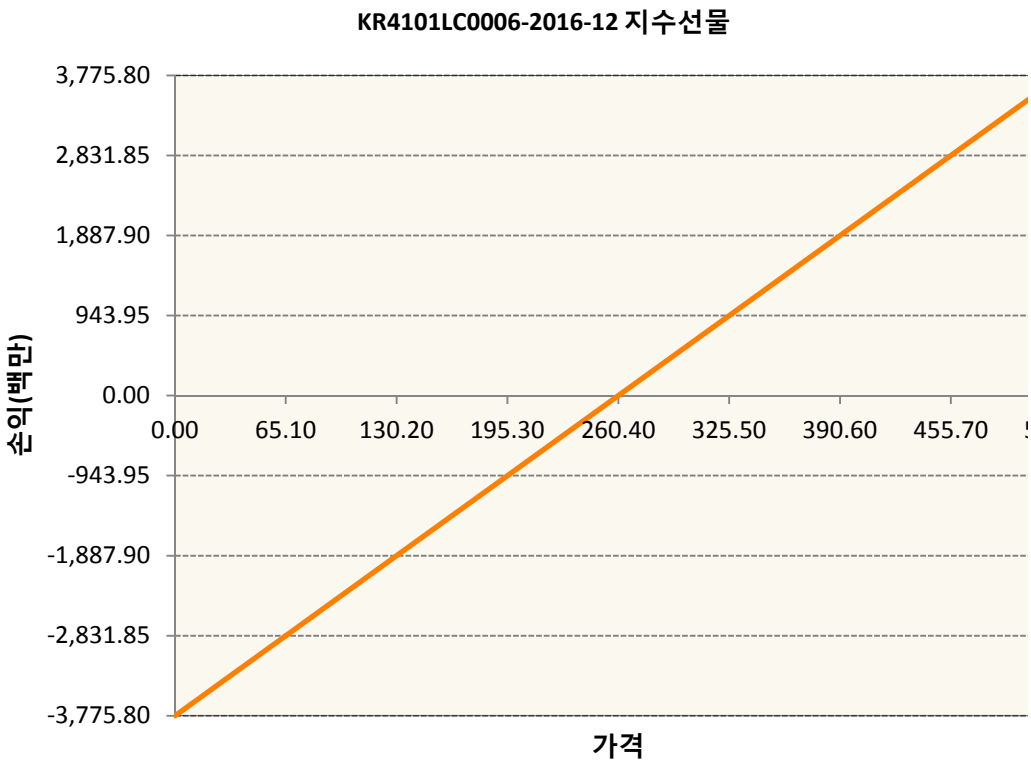
1.3배 레버리지 인덱스(주식-파생형)

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	3,776	0	3,776	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101LC00 2016-12 지수선물							301
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-301	-301	-301	-301	-301	-301	-301
-5.33%	-201	-201	-201	-201	-201	-201	-201
-2.67%	-100	-100	-100	-100	-100	-100	-100
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	100	100	100	100	100	100	100
5.33%	201	201	201	201	201	201	201
8.00%	301	301	301	301	301	301	301

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

232

공시일	2016-09-28
기준일	2016-09-27

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)

736

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2016-09-28
기준일	2016-09-27

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)

811

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2016-09-28
기준일	2016-09-27

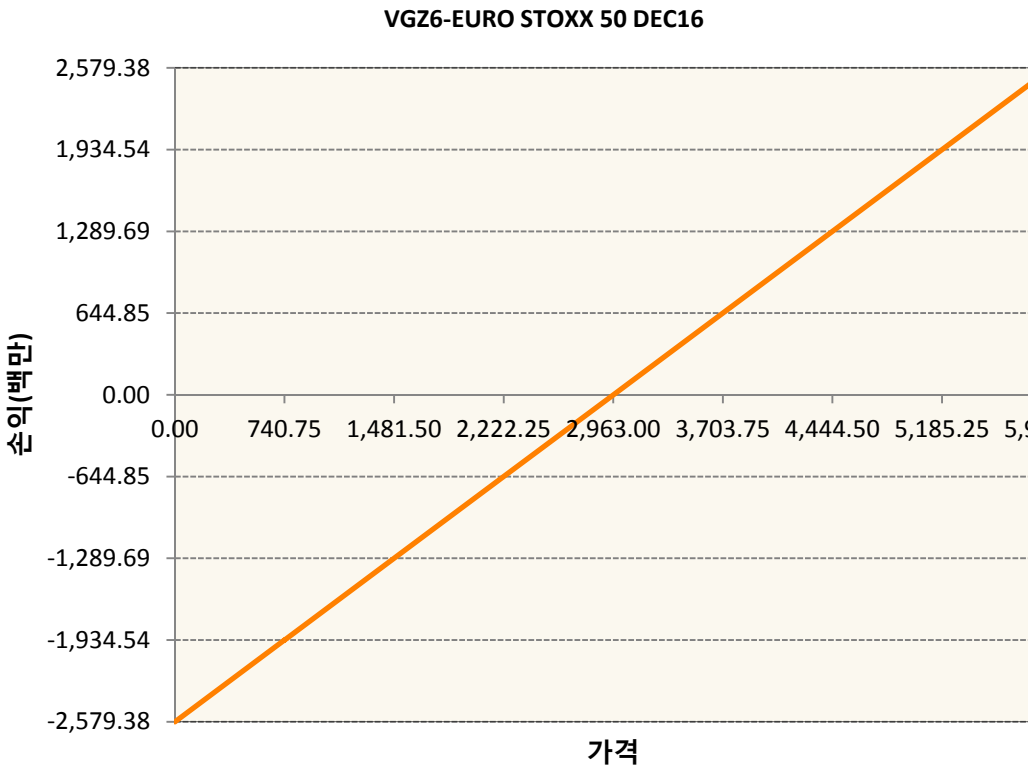
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,579	0	2,579	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGZ6	EURO STOXX 50 DEC16	206

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

(단위:백만원)

253

공시일	2016-09-28
기준일	2016-09-27

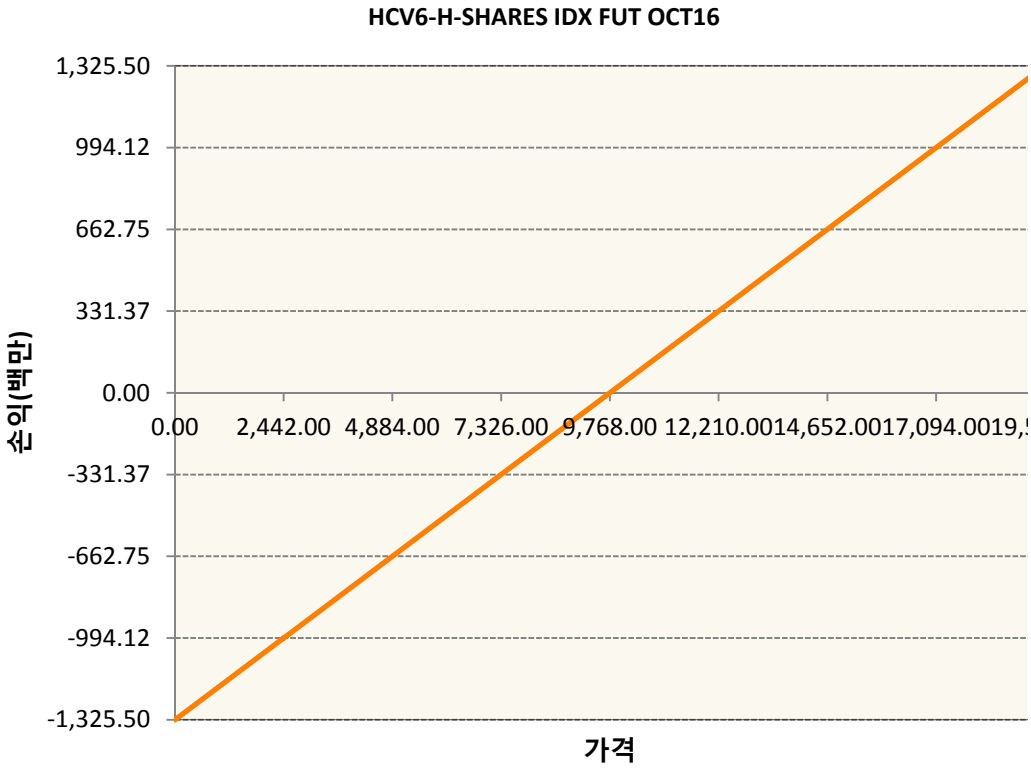
차이나인덱스모(주식-파생형)

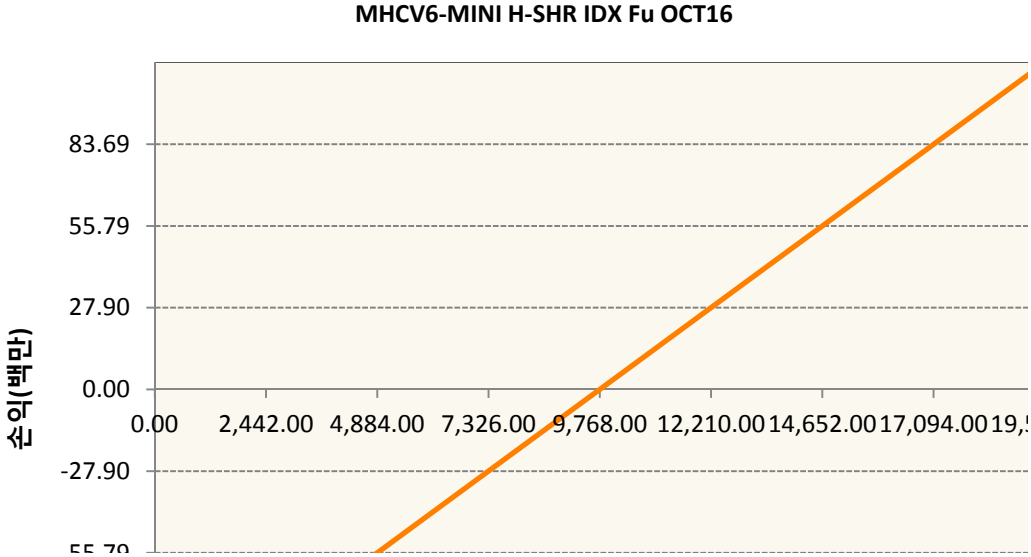
1. 계약금액

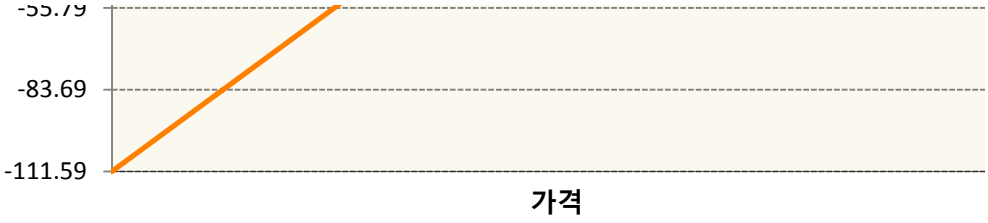
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,437	0	1,437	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCV6	H-SHARES IDX FUT OCT16	106
MHCV6	MINI H-SHR IDX Fu OCT16	9

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	157

공시일	2016-09-28
기준일	2016-09-27

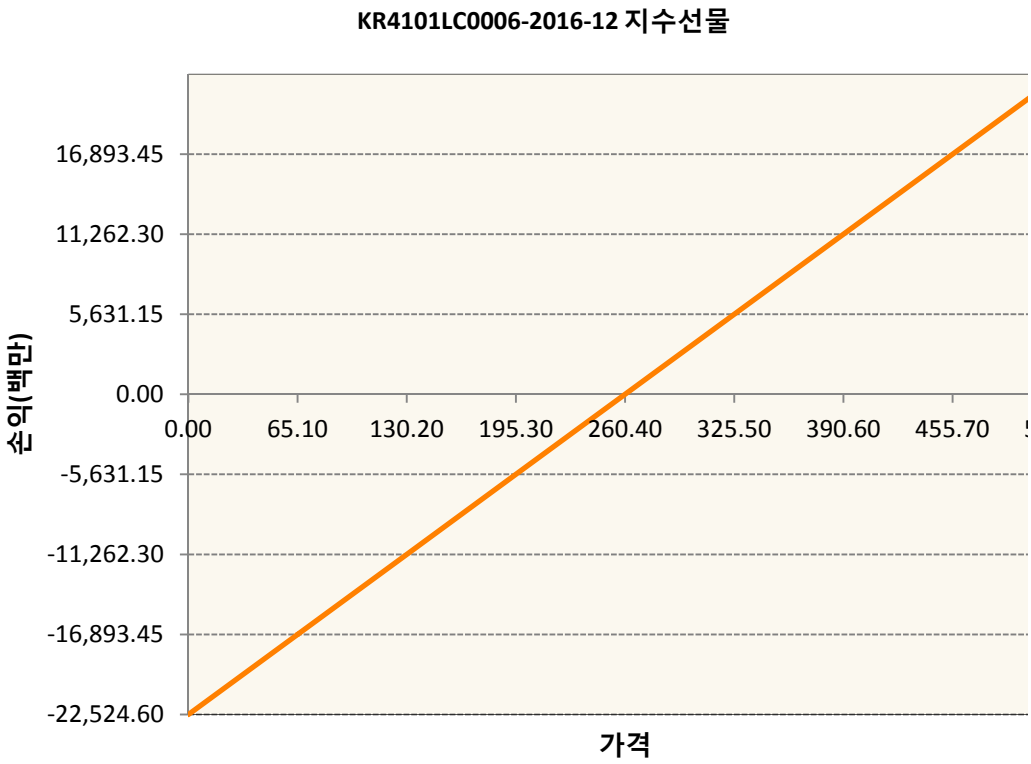
커버드콜(주식혼합-파생형)

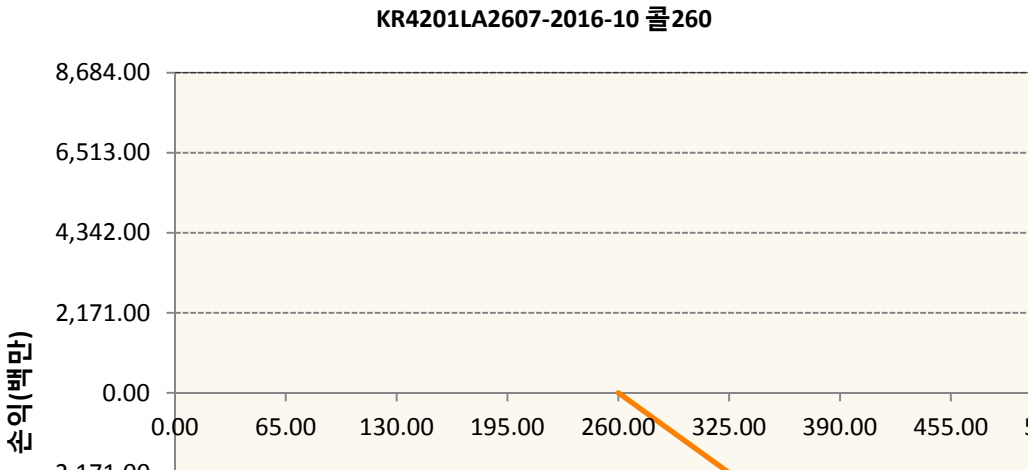
1. 계약금액

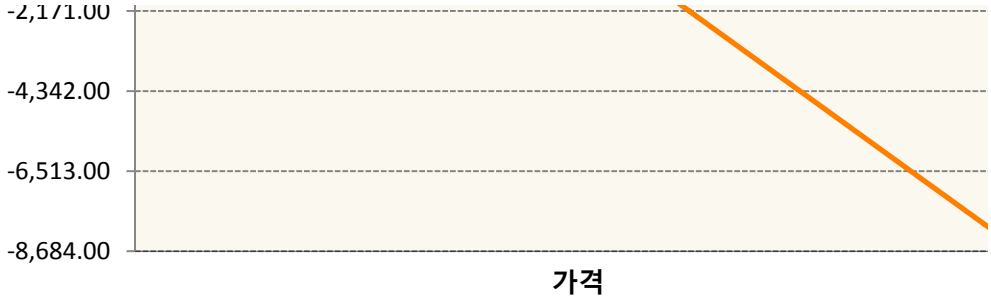
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	22,525	0	22,525	장내
누계	유가증권	옵션	0	8,684	-8,684	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101LC00 2016-12 지수선물 1,796

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,796	-1,796	-1,796	-1,796	-1,796	-1,796	-1,796
-5.33%	-1,197	-1,197	-1,197	-1,197	-1,197	-1,197	-1,197
-2.67%	-599	-599	-599	-599	-599	-599	-599
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	599	599	599	599	599	599	599
5.33%	1,197	1,197	1,197	1,197	1,197	1,197	1,197
8.00%	1,796	1,796	1,796	1,796	1,796	1,796	1,796

KR4201LA26 2016-10 콜260 2,993

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	400	400	400	400	399	399	398
-5.33%	399	399	397	395	392	387	380
-2.67%	377	364	349	331	312	290	267
0%	109	73	36	0	-36	-73	-109
2.67%	-717	-734	-754	-776	-800	-826	-852
5.33%	-1,835	-1,837	-1,839	-1,844	-1,850	-1,858	-1,867
8.00%	-2,989	-2,989	-2,989	-2,990	-2,990	-2,991	-2,993

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

(단위:백만원)

5,008

공시일	2016-09-28
기준일	2016-09-27

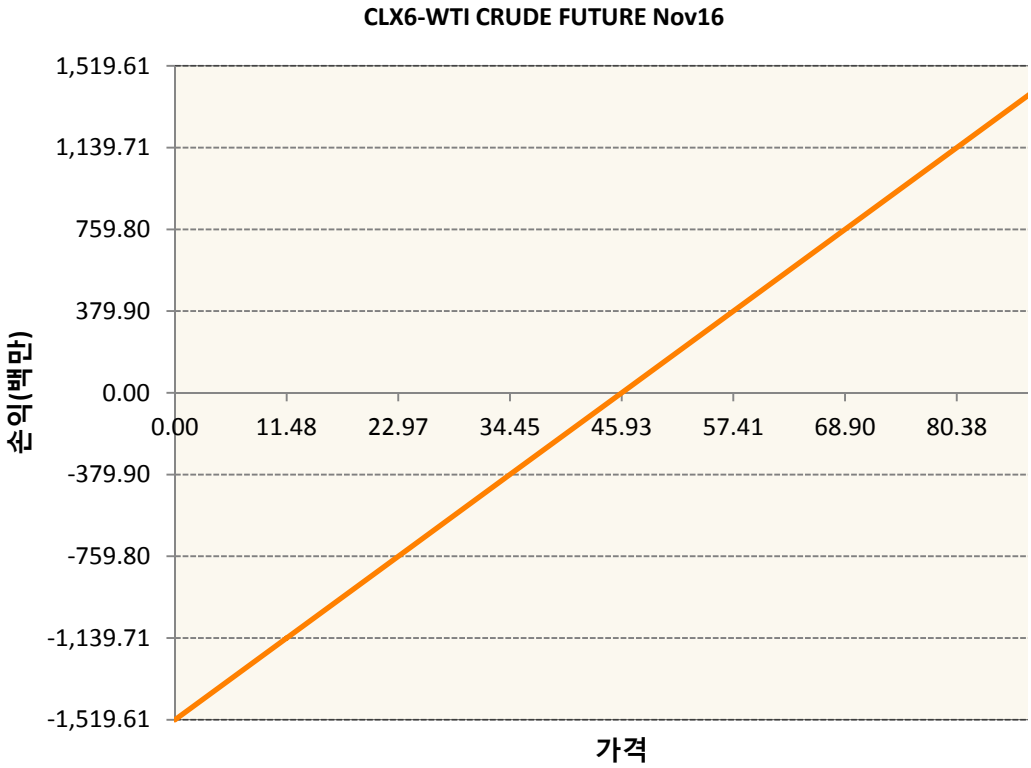
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

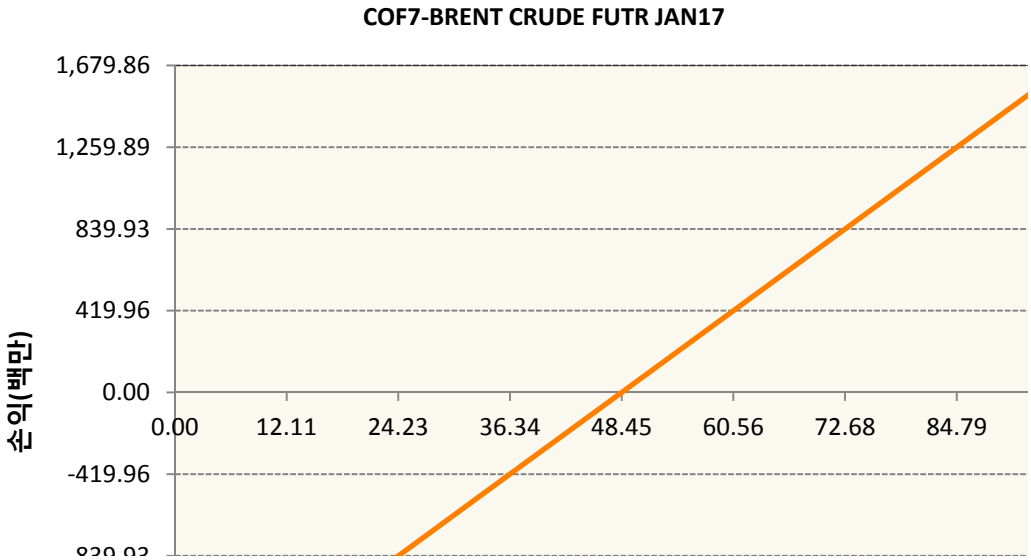
1. 계약금액

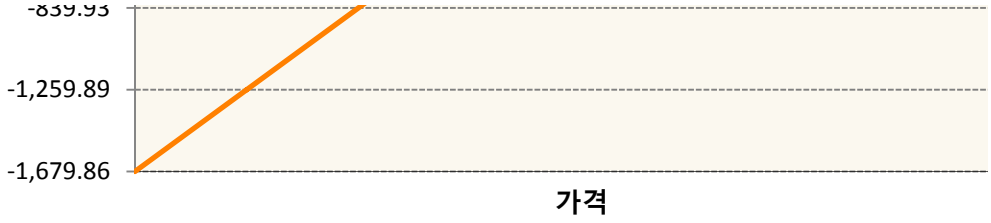
(단위:백만원)

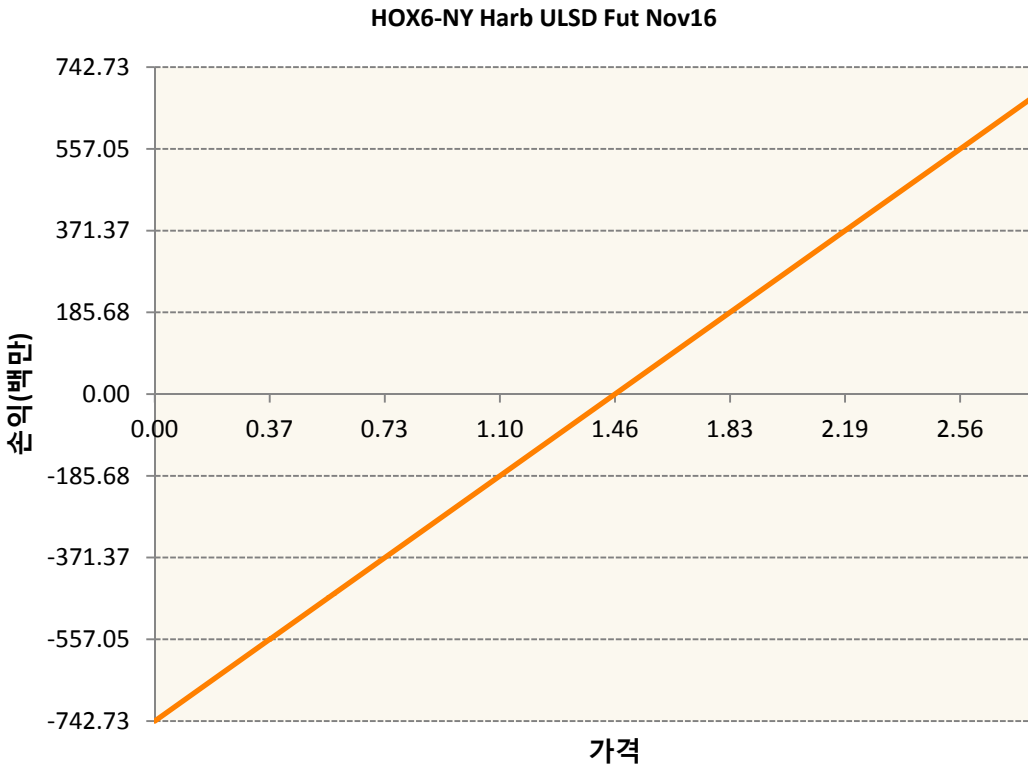
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	6,371	0	6,371	

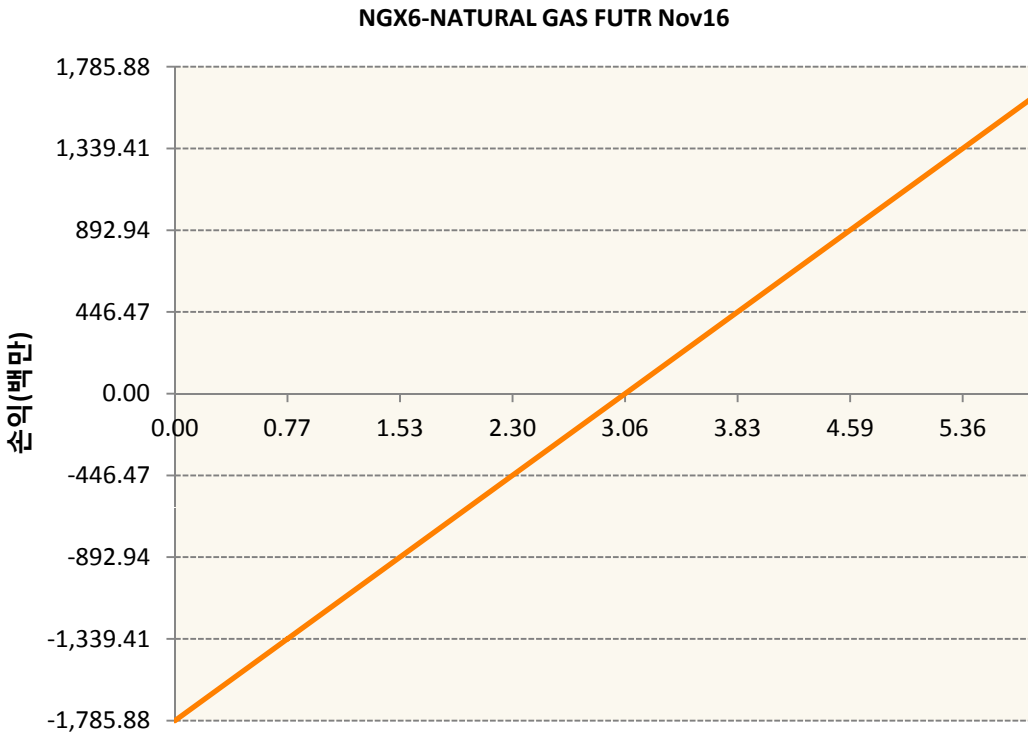
2. 만기시점의 손익구조



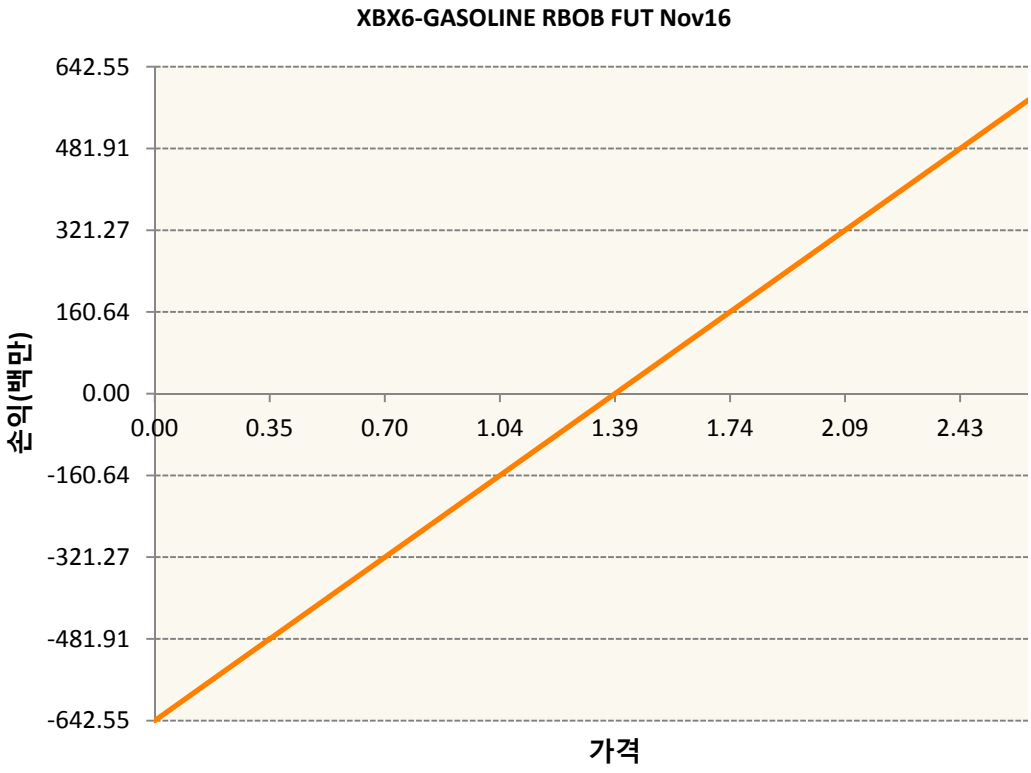



-1,259.89
-1,679.86
가격


HOX6-NY Harb ULSD Fut Nov16
742.73
557.05
371.37
185.68
0.00
-185.68
-371.37
-557.05
-742.73
0.00
0.37
0.73
1.10
1.46
1.83
2.19
2.56
손익(백만)
가격


NGX6-NATURAL GAS FUTR Nov16
1,785.88
1,339.41
892.94
446.47
0.00
-446.47
-892.94
-1,339.41
-1,785.88
0.00
0.77
1.53
2.30
3.06
3.83
4.59
5.36
손익(백만)

가격



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
CLX6	WTI CRUDE FUTURE Nov16	122
COF7	BRENT CRUDE FUTR JAN17	134
HOX6	NY Harb ULSD Fut Nov16	59
NGX6	NATURAL GAS FUTR Nov16	143
XBX6	GASOLINE RBOB FUT Nov16	51

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,134

공시일	2016-09-28
기준일	2016-09-27

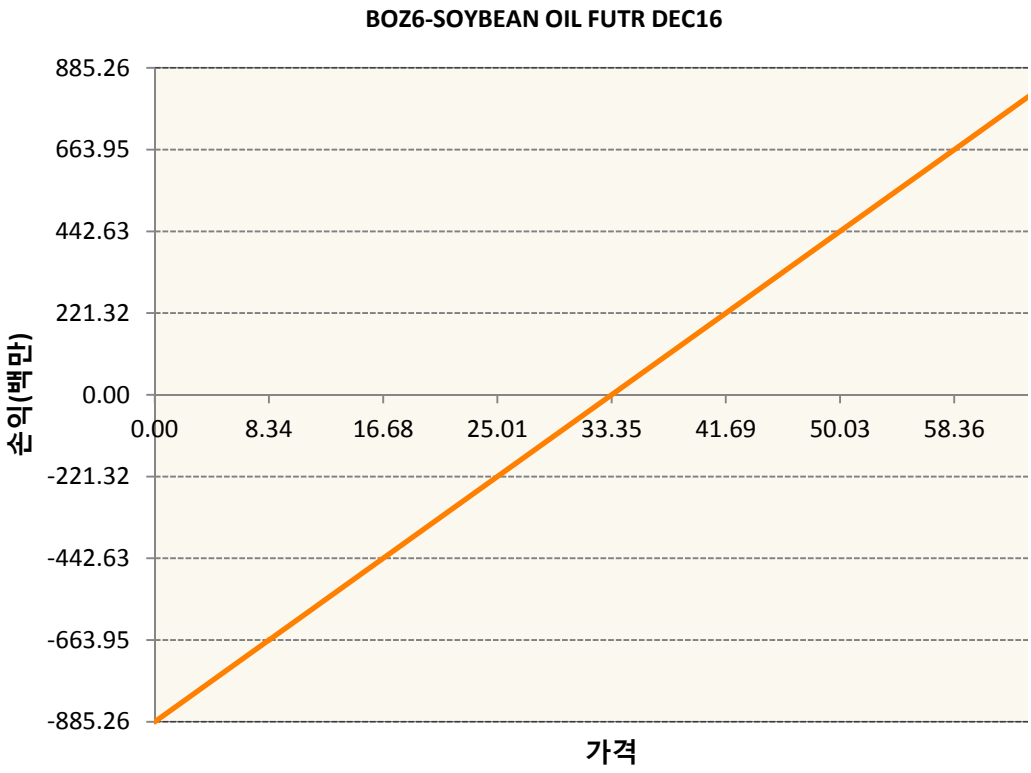
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

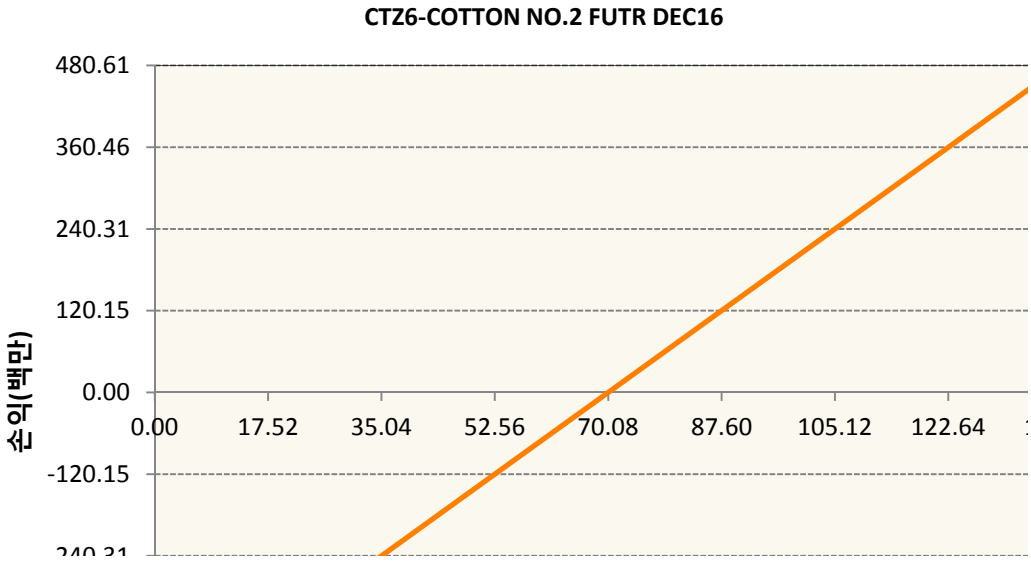
1. 계약금액

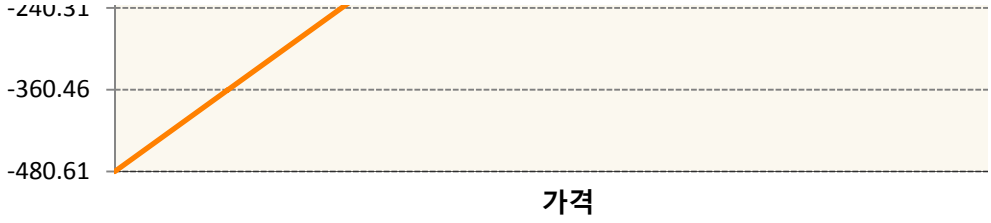
(단위:백만원)

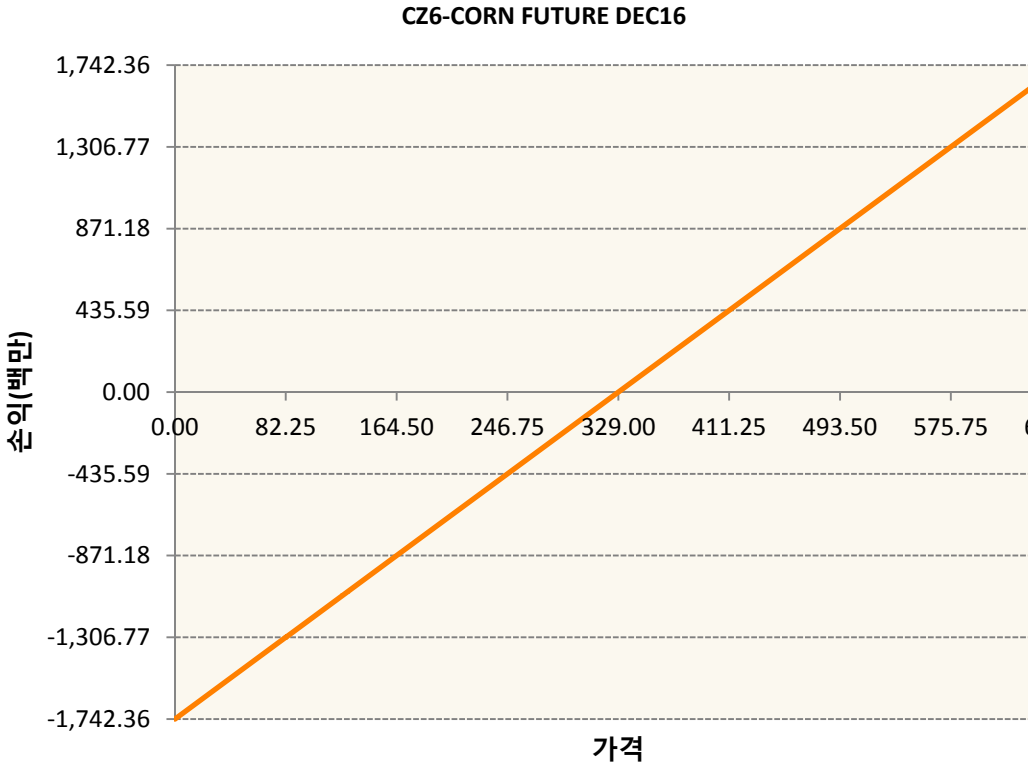
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	8,977	0	8,977	

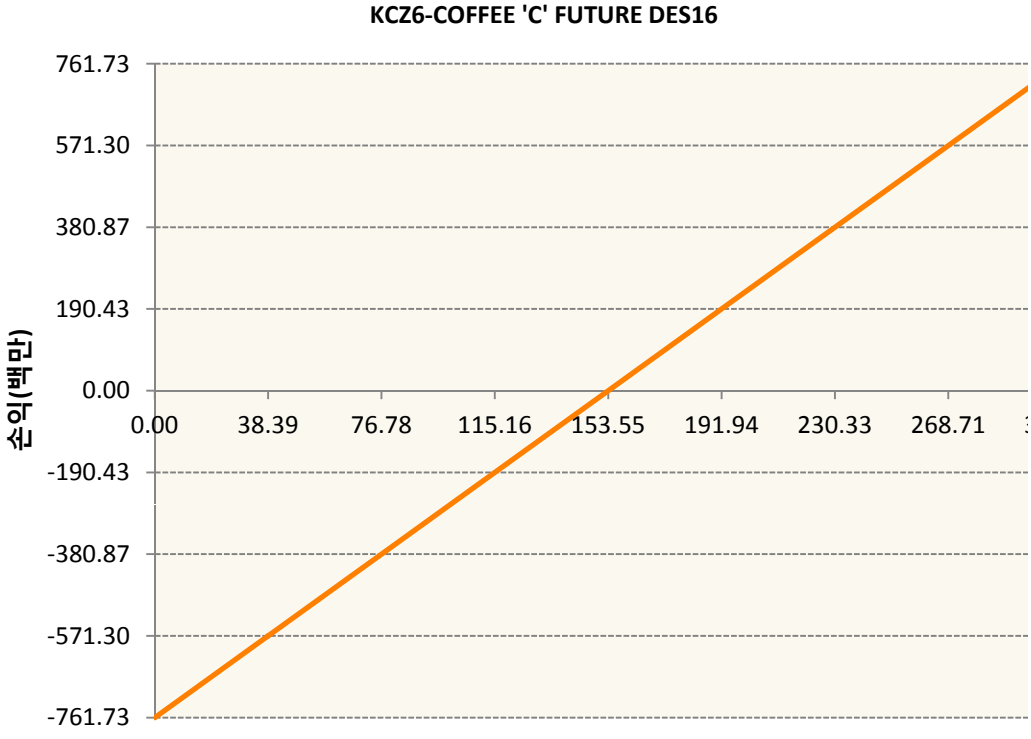
2. 만기시점의 손익구조





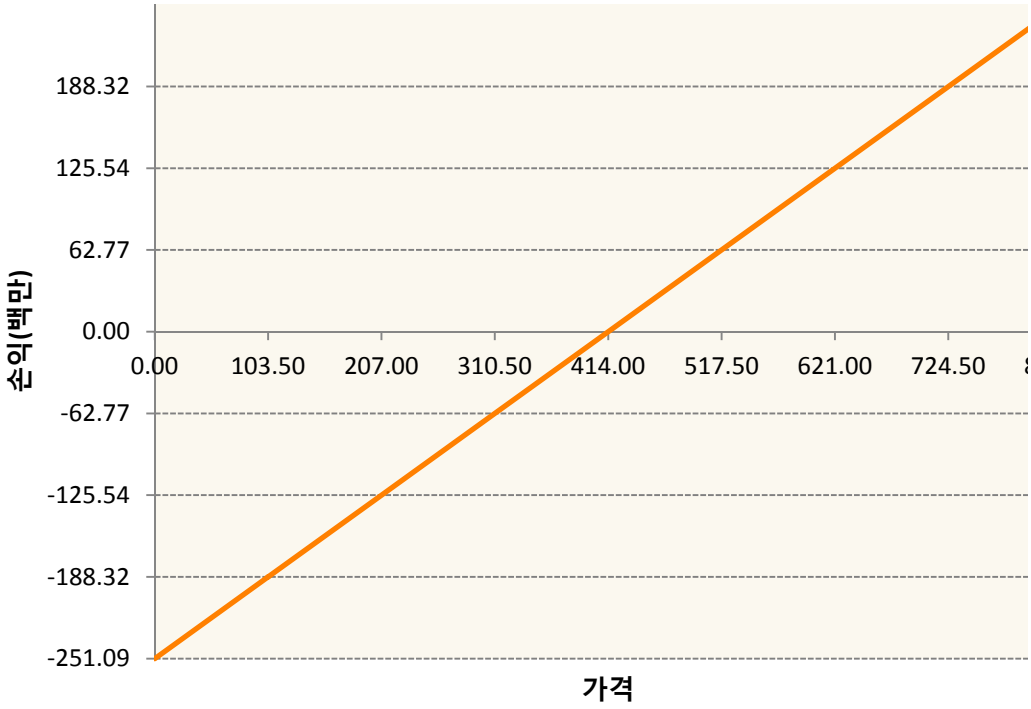

-240.31
-360.46
-480.61
가격


CZ6-CORN FUTURE DEC16
1,742.36
1,306.77
871.18
435.59
0.00
-435.59
-871.18
-1,306.77
-1,742.36
0.00
82.25
164.50
246.75
329.00
411.25
493.50
575.75
순익(백만)
가격

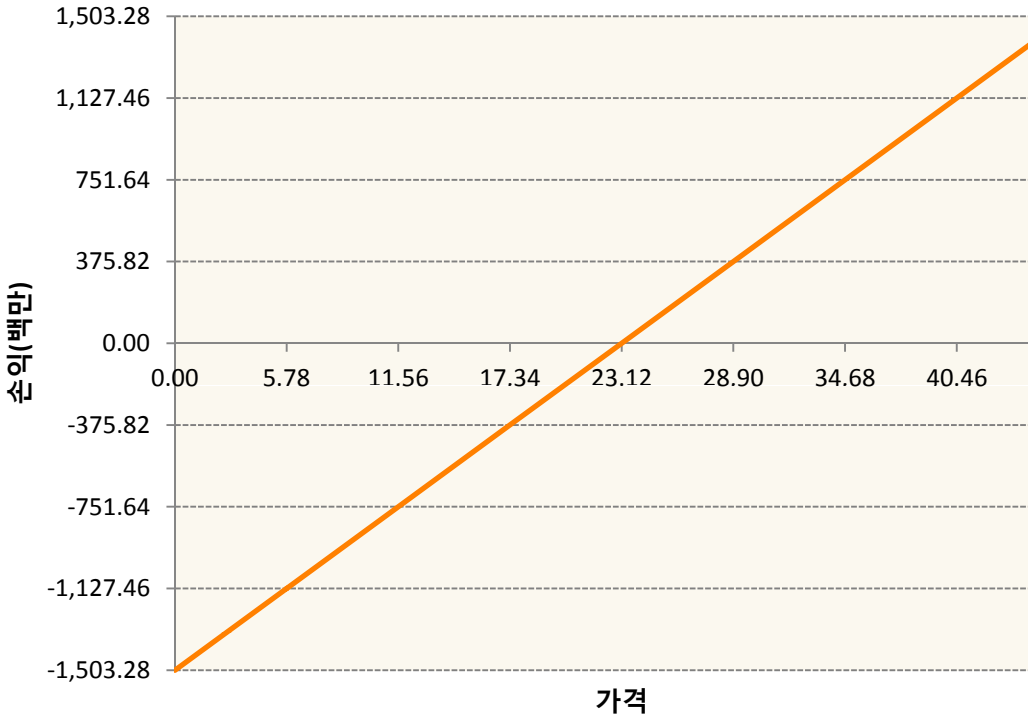

KCZ6-COFFEE 'C' FUTURE DES16
761.73
571.30
380.87
190.43
0.00
-190.43
-380.87
-571.30
-761.73
0.00
38.39
76.78
115.16
153.55
191.94
230.33
268.71
순익(백만)

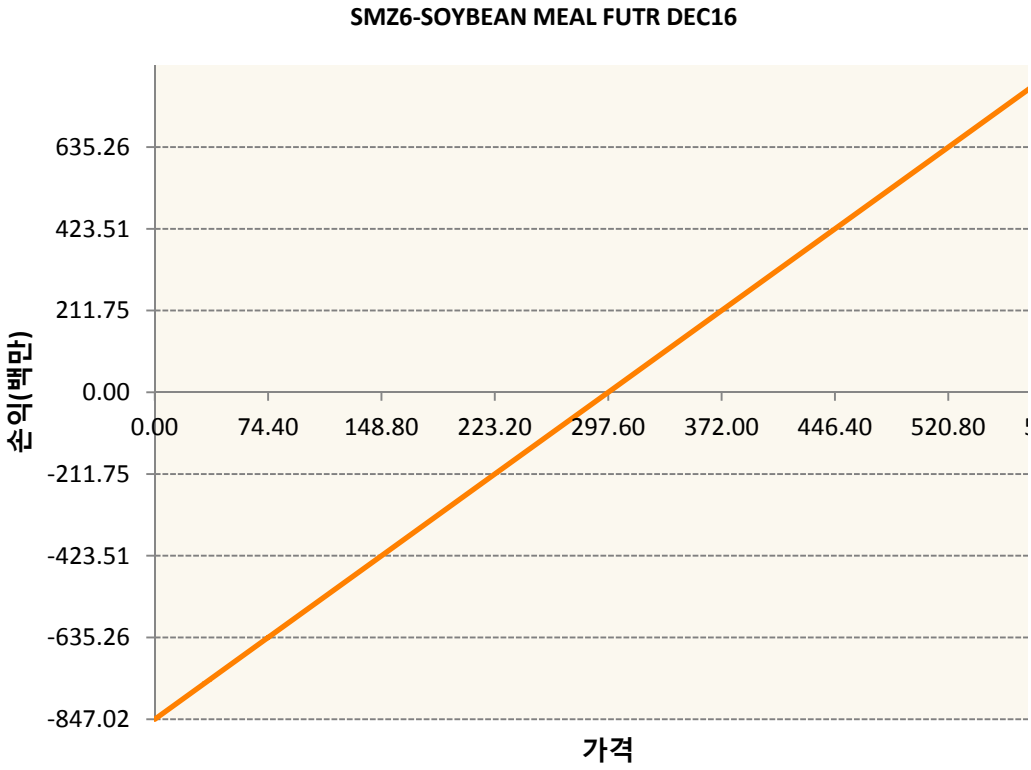
가격

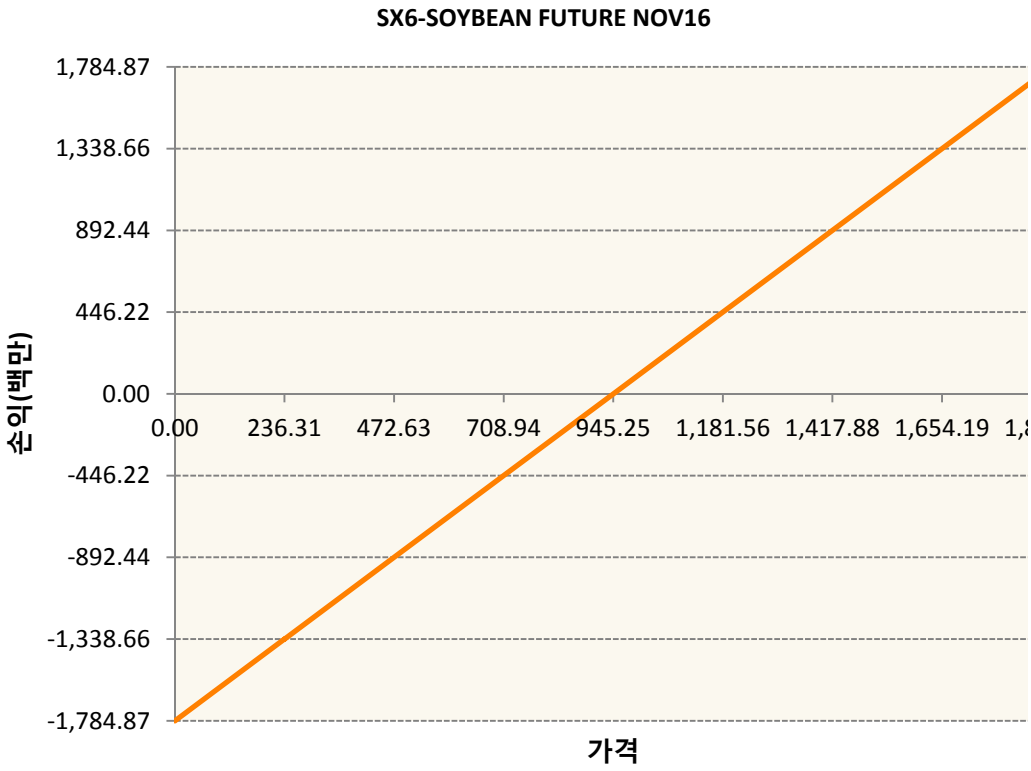
KWZ6-KC HRW WHEAT FUT DES16



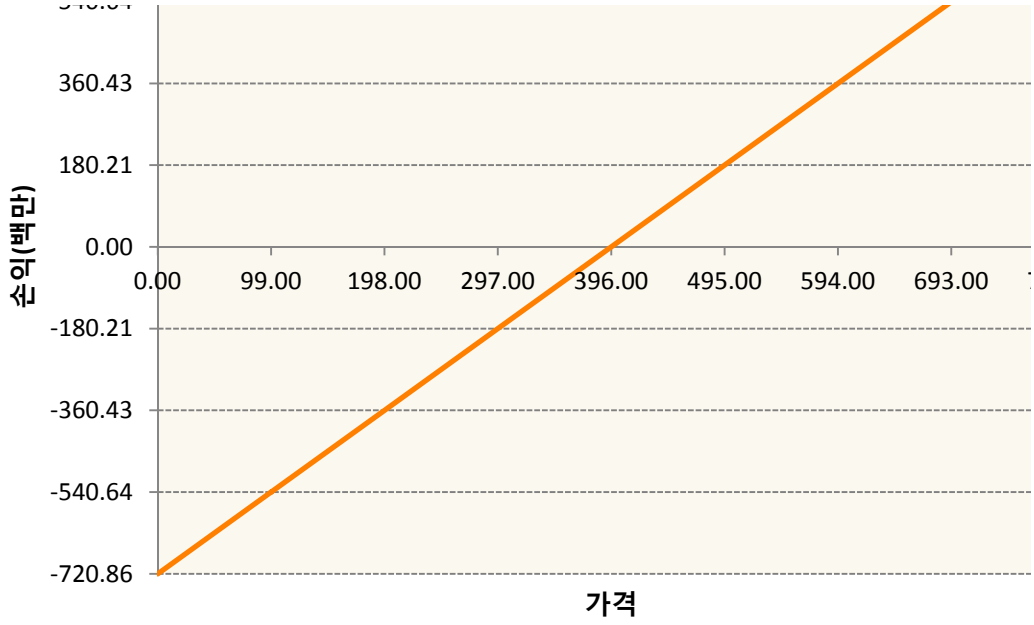
SBH7-Sugar #11 (WORLD) MAR17




SMZ6-SOYBEAN MEAL FUTR DEC16
635.26
423.51
211.75
0.00
-211.75
-423.51
-635.26
-847.02
0.00
74.40
148.80
223.20
297.60
372.00
446.40
520.80
손익(백만)
가격


SX6-SOYBEAN FUTURE NOV16
1,784.87
1,338.66
892.44
446.22
0.00
-446.22
-892.44
-1,338.66
-1,784.87
0.00
236.31
472.63
708.94
945.25
1,181.56
1,417.88
1,654.19
손익(백만)
가격


WZ6-WHEAT FUTURE(CBT) DEC16
720.86
540.64



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

BOZ6	SOYBEAN OIL FUTR DEC16	71
CTZ6	COTTON NO.2 FUTR DEC16	38
CZ6	CORN FUTURE DEC16	139
KCZ6	COFFEE 'C' FUTURE DES16	61
KWZ6	KC HRW WHEAT FUT DES16	20
SBH7	Sugar #11 (WORLD) MAR17	120
SMZ6	SOYBEAN MEAL FUTR DEC16	68
SX6	SOYBEAN FUTURE NOV16	143
WZ6	WHEAT FUTURE(CBT) DEC16	58

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

902