공시일	2016-09-30
기준일	2016-09-29

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	2016-09-30
기준일	2016-09-29

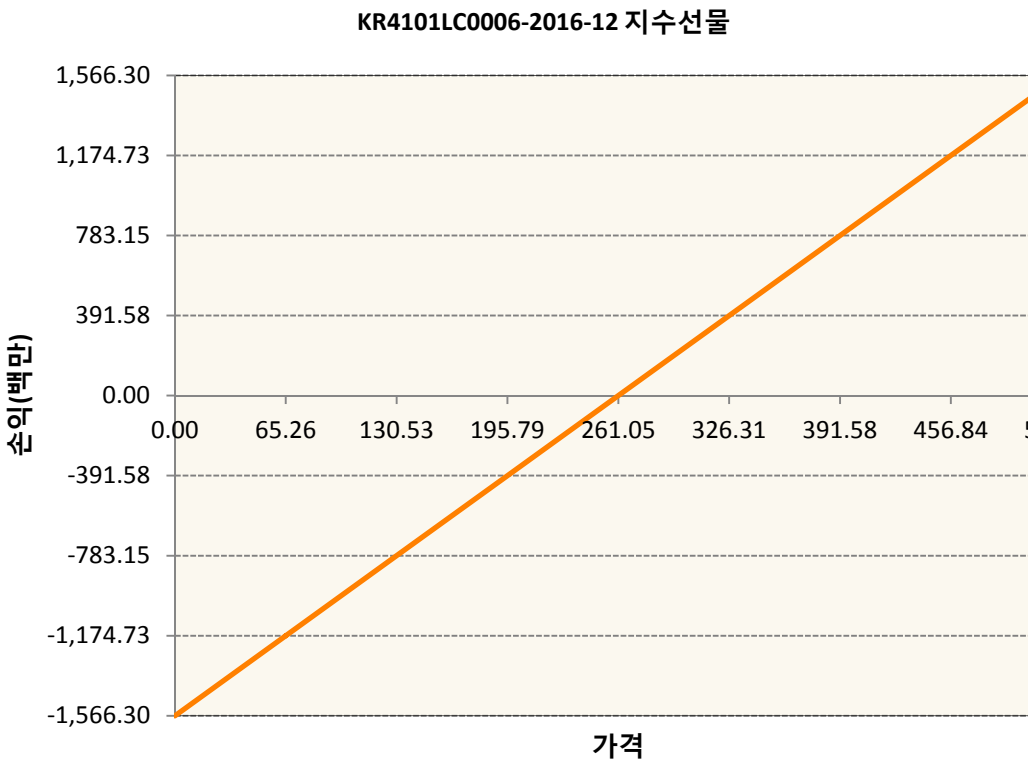
스마트인덱스모

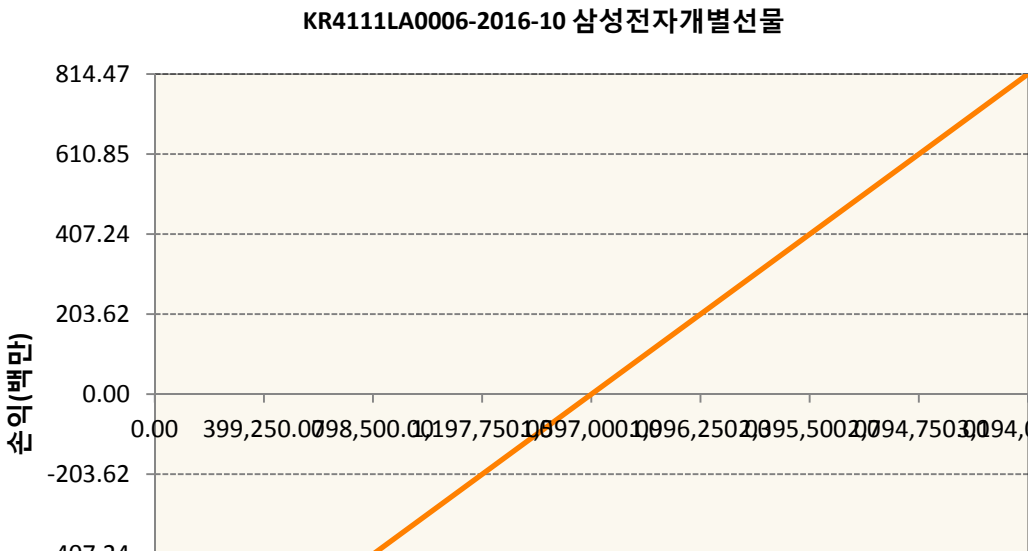
1. 계약금액

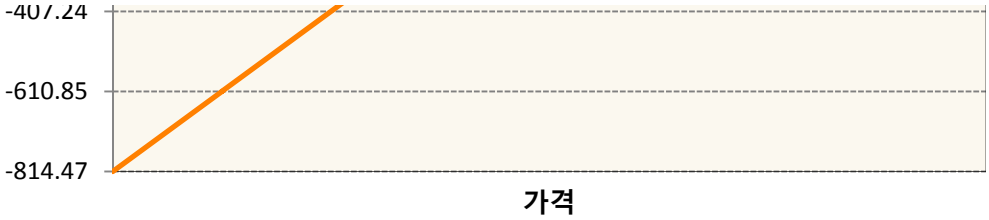
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,381	0	2,381	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							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%	-44	-44	-44	-44	-44	-44	-44
-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%	44	44	44	44	44	44	44
8.00%	65	65	65	65	65	65	65

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

165

공시일	2016-09-30
기준일	2016-09-29

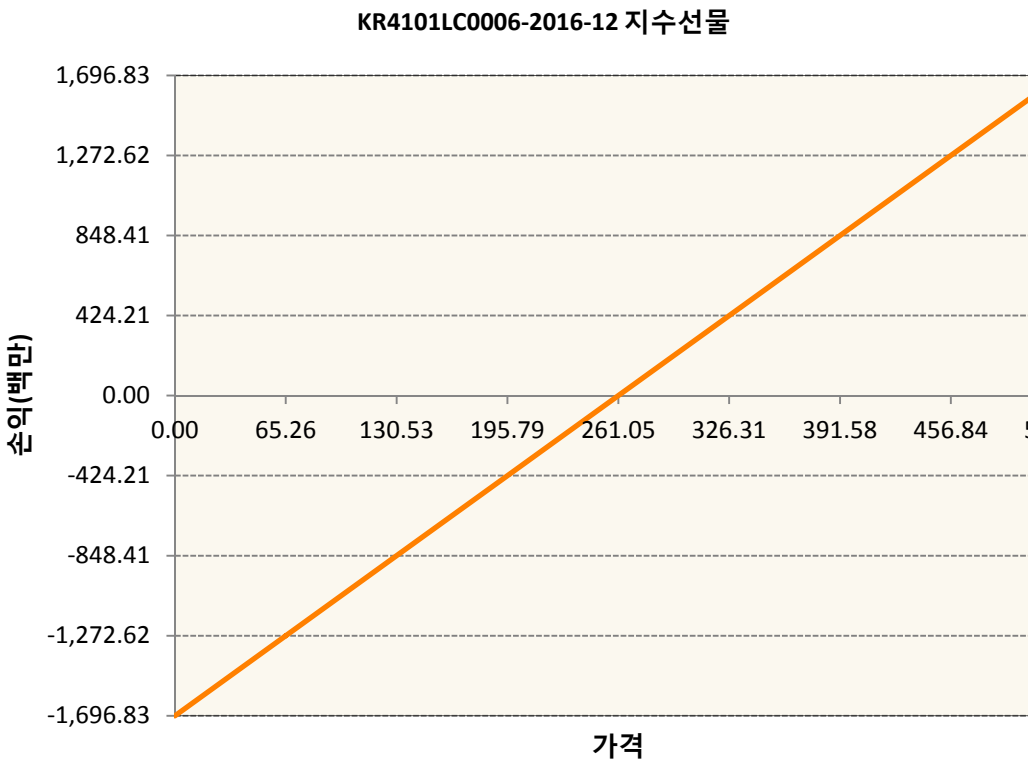
스마트레버리지목표전환형1호

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	1,697	0	1,697	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)

103

공시일	2016-09-30
기준일	2016-09-29

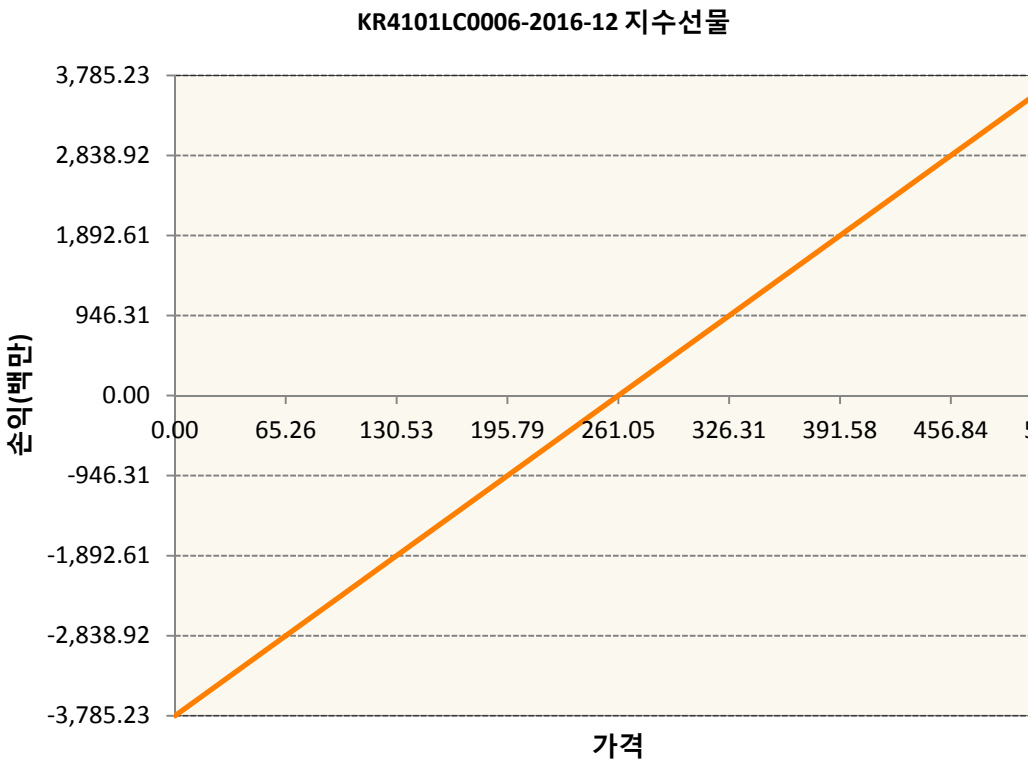
1.3배 레버리지 인덱스(주식-파생형)

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	3,785	0	3,785	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101LC00 2016-12 지수선물							302
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-302	-302	-302	-302	-302	-302	-302
-5.33%	-201	-201	-201	-201	-201	-201	-201
-2.67%	-101	-101	-101	-101	-101	-101	-101
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	101	101	101	101	101	101	101
5.33%	201	201	201	201	201	201	201
8.00%	302	302	302	302	302	302	302

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

230

공시일	2016-09-30
기준일	2016-09-29

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	887

* 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	2016-09-30
기준일	2016-09-29

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	395

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

810

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2016-09-30
기준일	2016-09-29

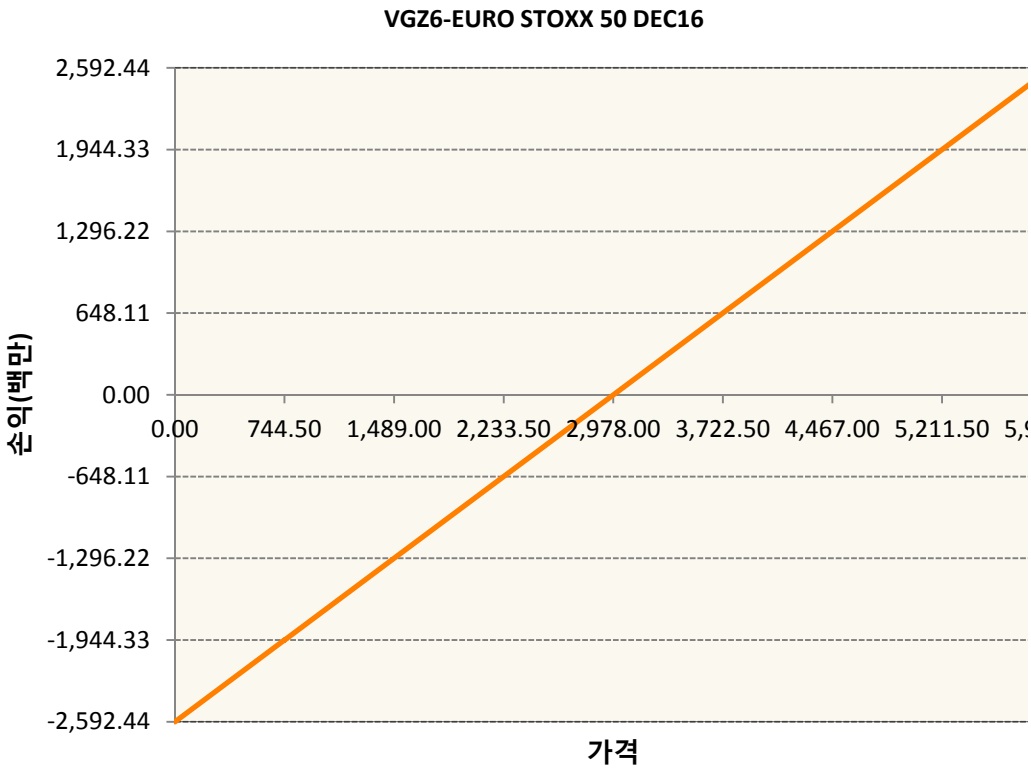
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,592	0	2,592	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGZ6	EURO STOXX 50 DEC16	207

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

(단위:백만원)

253

공시일	2016-09-30
기준일	2016-09-29

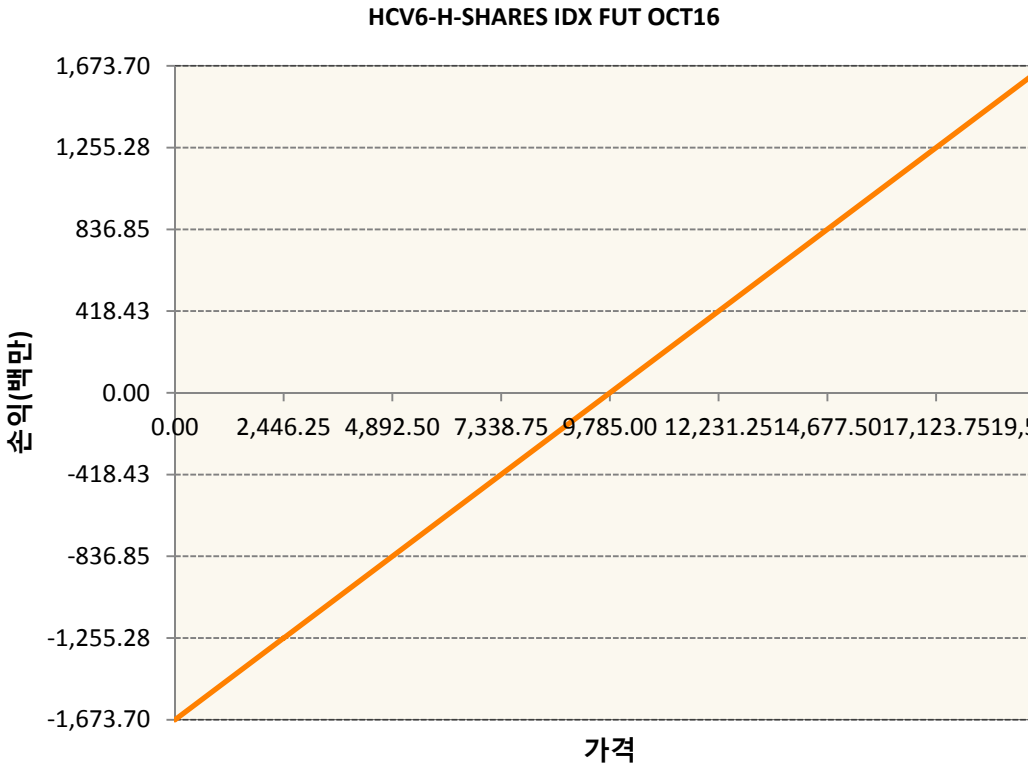
차이나인덱스모(주식-파생형)

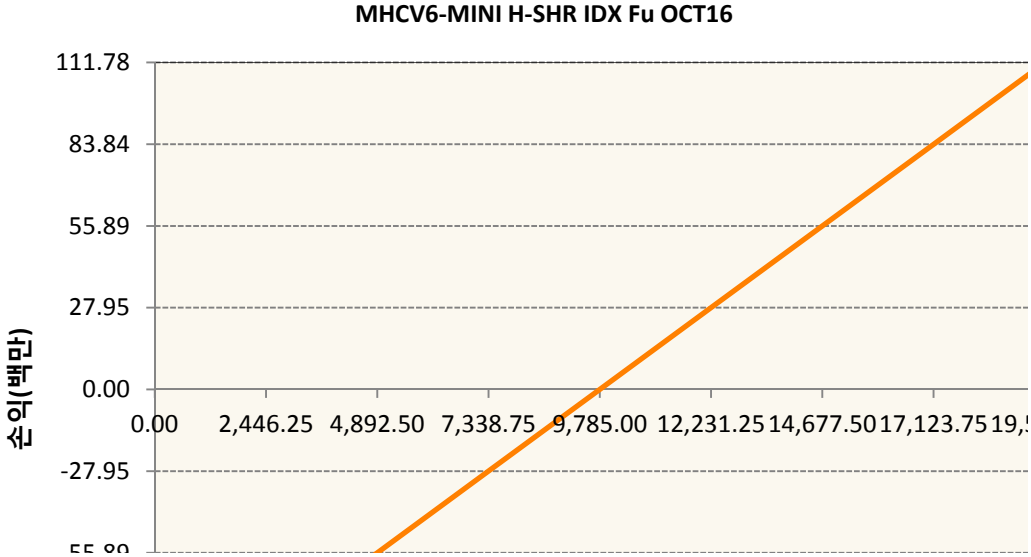
1. 계약금액

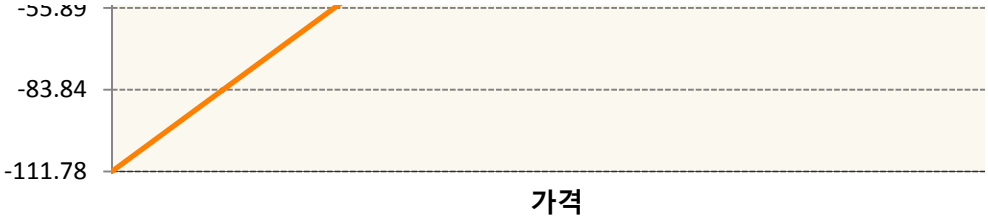
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,785	0	1,785	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCV6	H-SHARES IDX FUT OCT16	134
MHCV6	MINI H-SHR IDX Fu OCT16	9

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	194

공시일	2016-09-30
기준일	2016-09-29

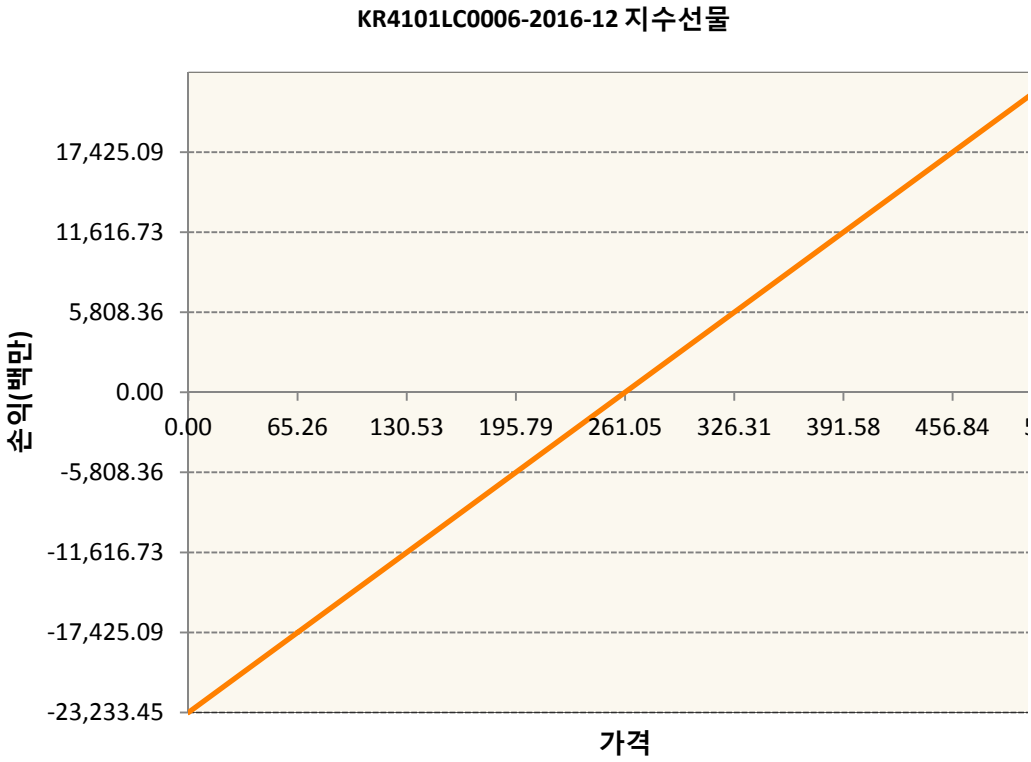
커버드콜(주식혼합-파생형)

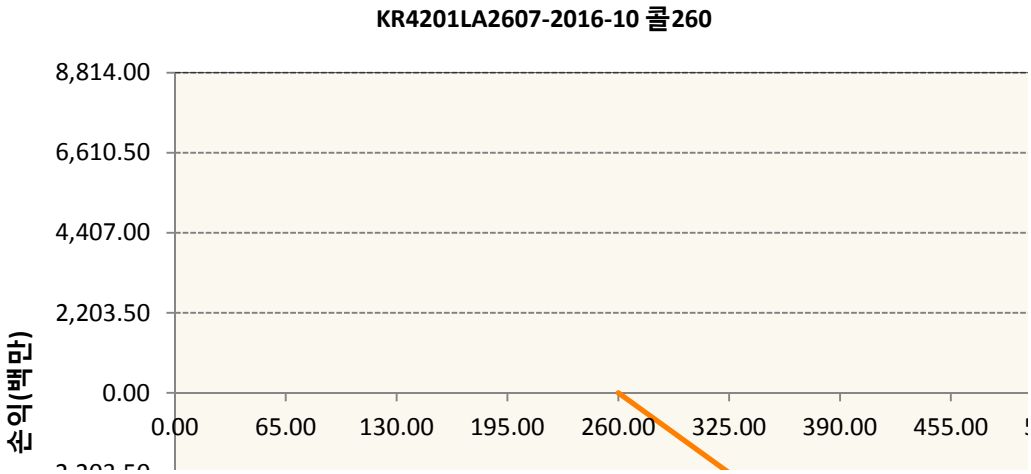
1. 계약금액

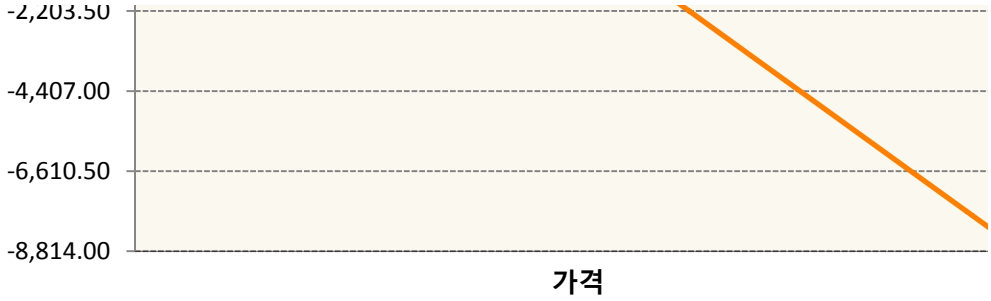
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	653	0	653	장내
신규	유가증권	옵션	0	131	-131	장내
누계	유가증권	선물	23,233	0	23,233	장내
누계	유가증권	옵션	0	8,814	-8,814	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101LC00 2016-12 지수선물							1,854
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,854	-1,854	-1,854	-1,854	-1,854	-1,854	-1,854
-5.33%	-1,236	-1,236	-1,236	-1,236	-1,236	-1,236	-1,236
-2.67%	-618	-618	-618	-618	-618	-618	-618
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	618	618	618	618	618	618	618
5.33%	1,236	1,236	1,236	1,236	1,236	1,236	1,236
8.00%	1,854	1,854	1,854	1,854	1,854	1,854	1,854
KR4201LA26 2016-10 콜260							3,143
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	442	442	442	442	441	441	441
-5.33%	441	441	440	438	435	430	425
-2.67%	417	404	389	371	351	330	308
0%	103	69	34	0	-34	-69	-103
2.67%	-810	-821	-835	-852	-870	-891	-912
5.33%	-1,966	-1,966	-1,968	-1,970	-1,973	-1,978	-1,984
8.00%	-3,142	-3,142	-3,142	-3,142	-3,142	-3,142	-3,143

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

5,358

공시일	2016-09-30
기준일	2016-09-29

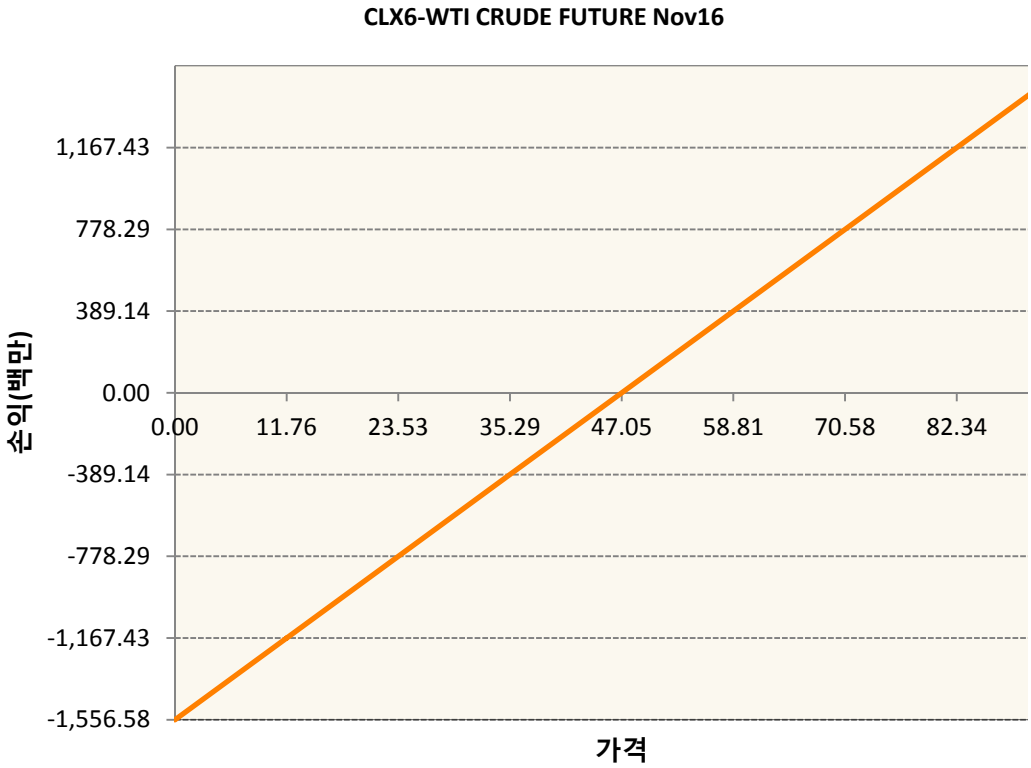
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

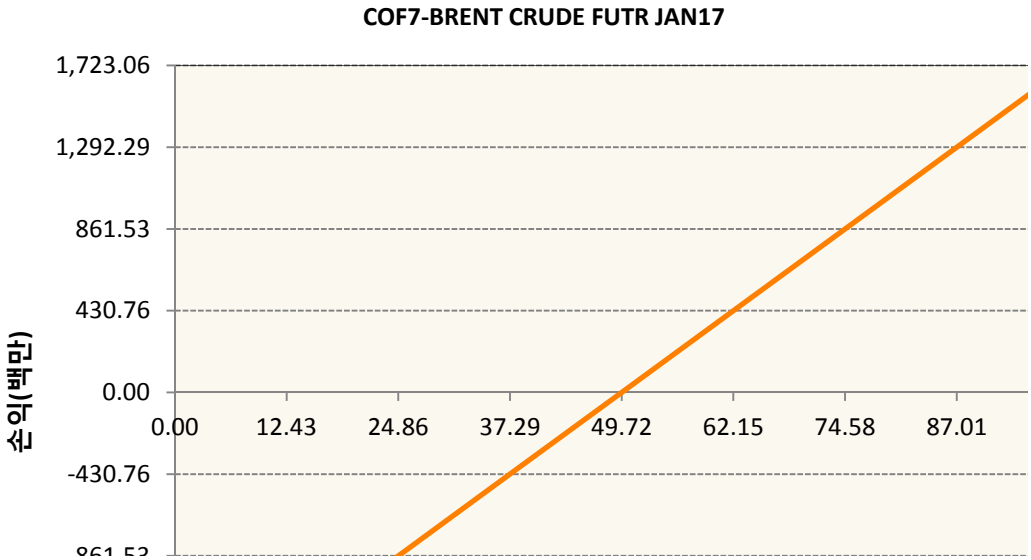
1. 계약금액

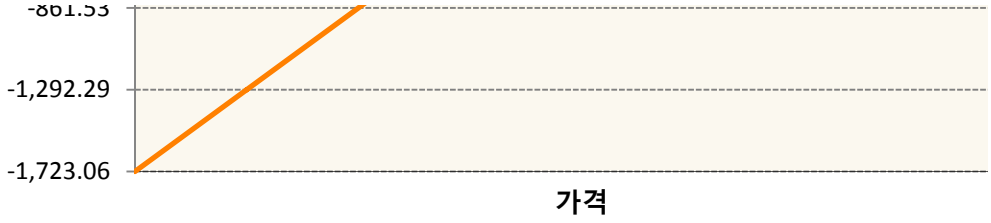
(단위:백만원)

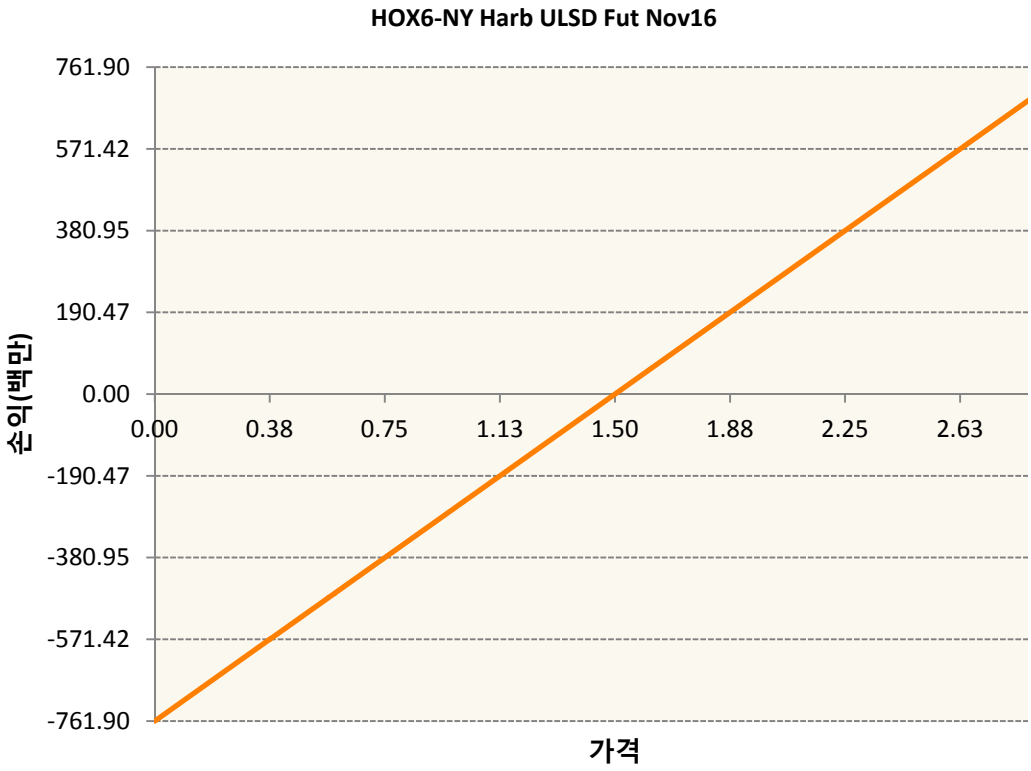
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	6,464	0	6,464	

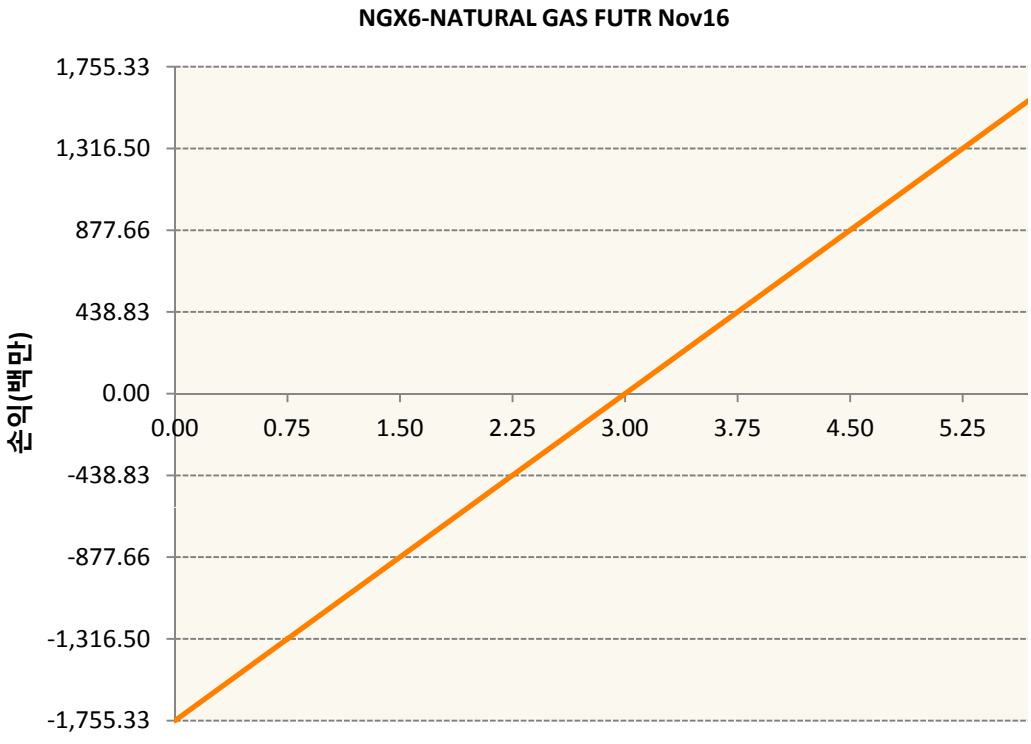
2. 만기시점의 손익구조



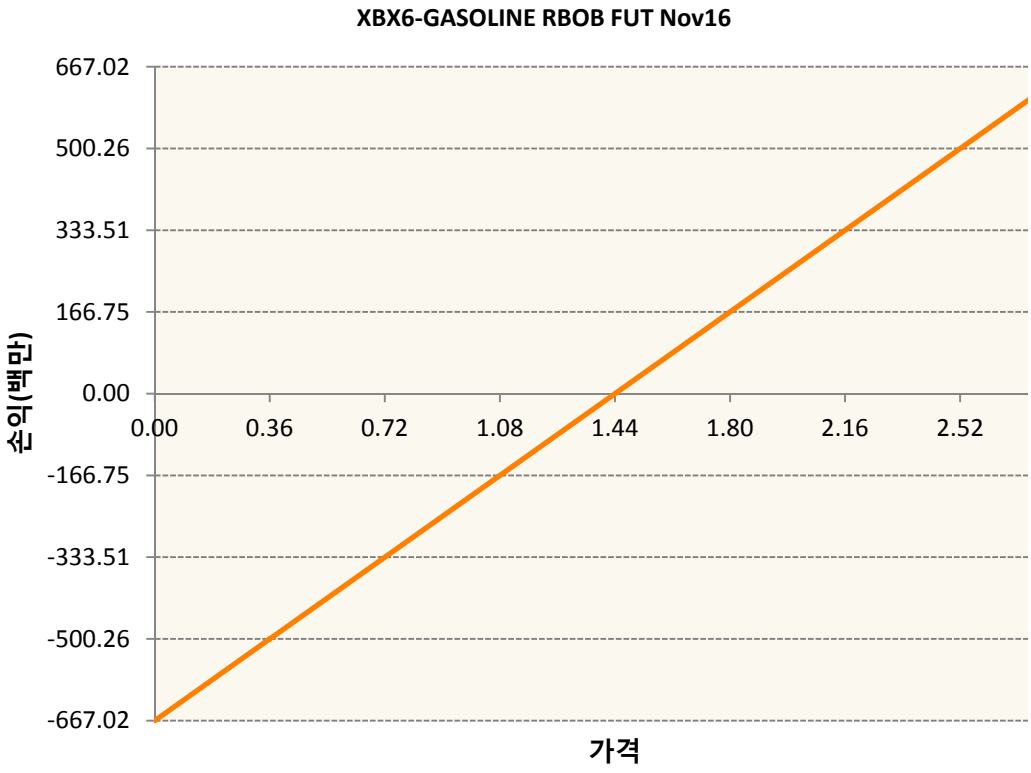



-1,292.29
-1,723.06
가격


HOX6-NY Harb ULSD Fut Nov16
761.90
571.42
380.95
190.47
0.00
-190.47
-380.95
-571.42
-761.90
0.00
0.38
0.75
1.13
1.50
1.88
2.25
2.63
순익(백만)
가격


NGX6-NATURAL GAS FUTR Nov16
1,755.33
1,316.50
877.66
438.83
0.00
-438.83
-877.66
-1,316.50
-1,755.33
0.00
0.75
1.50
2.25
3.00
3.75
4.50
5.25
순익(백만)

가격



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
CLX6	WTI CRUDE FUTURE Nov16	125
COF7	BRENT CRUDE FUTR JAN17	138
HOX6	NY Harb ULSD Fut Nov16	61
NGX6	NATURAL GAS FUTR Nov16	140
XBX6	GASOLINE RBOB FUT Nov16	53

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,156

공시일	2016-09-30
기준일	2016-09-29

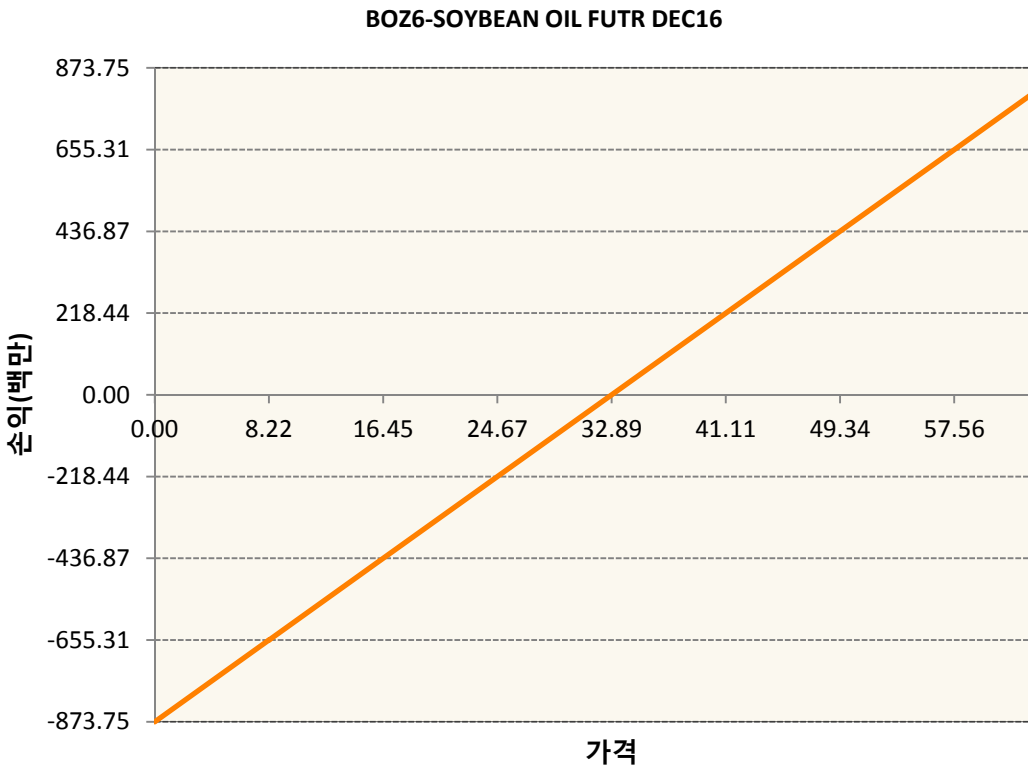
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

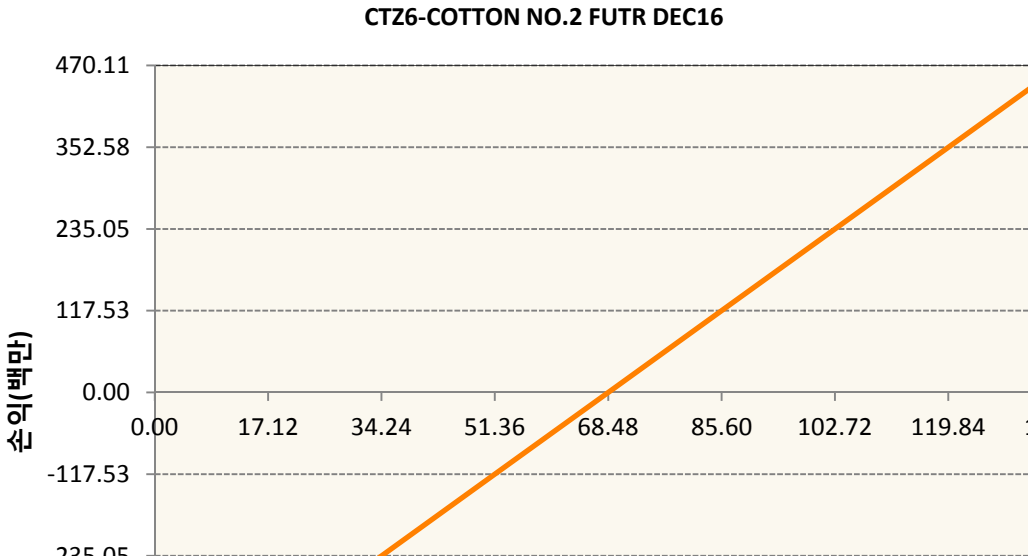
1. 계약금액

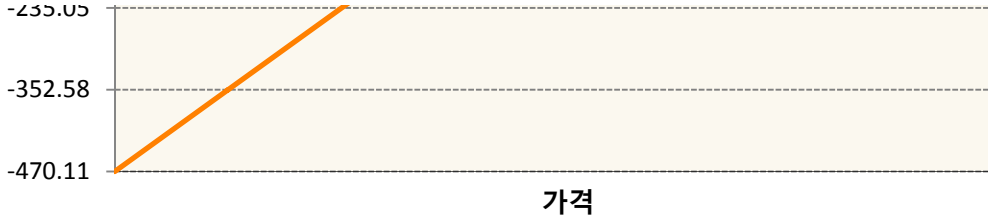
(단위:백만원)

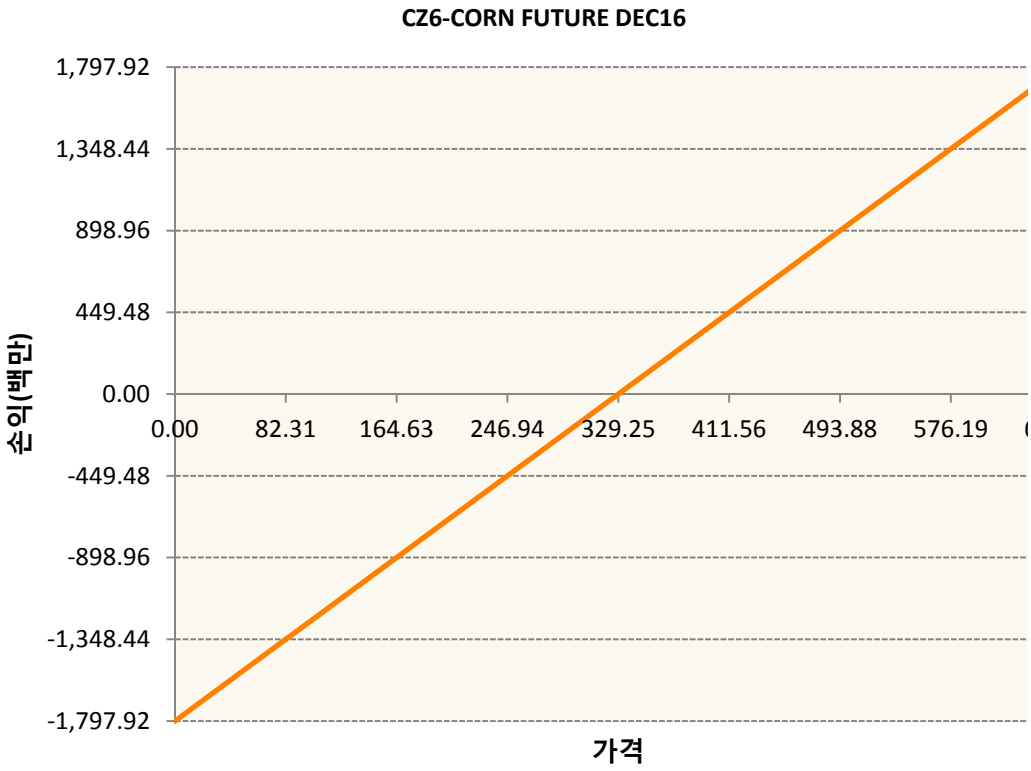
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	9,258	0	9,258	

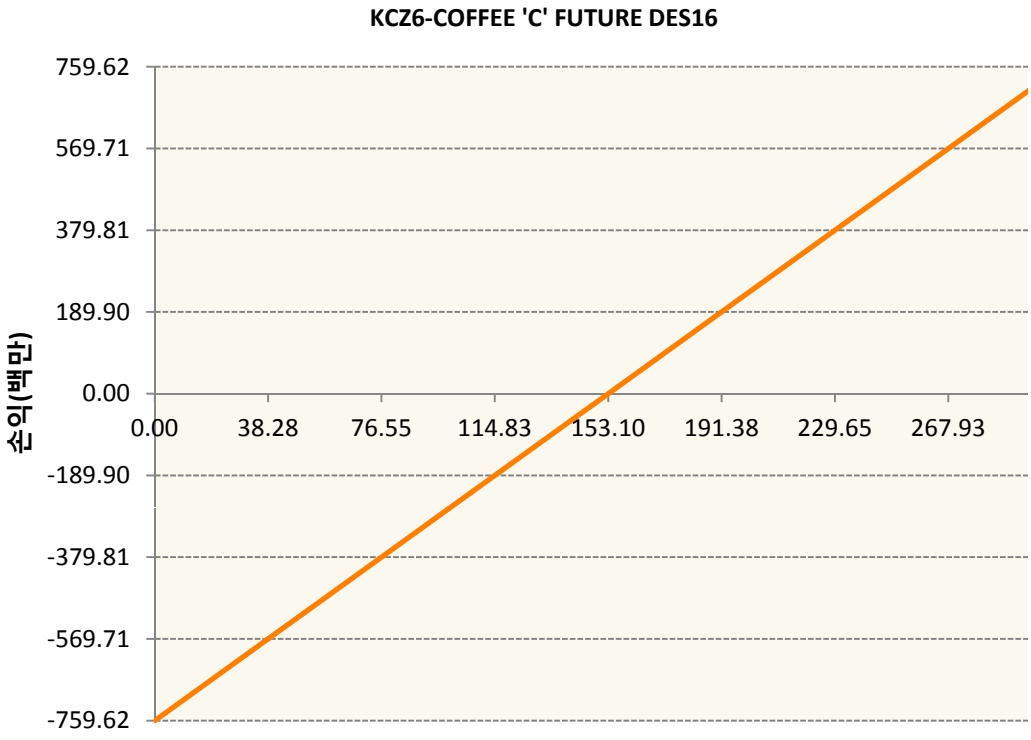
2. 만기시점의 손익구조



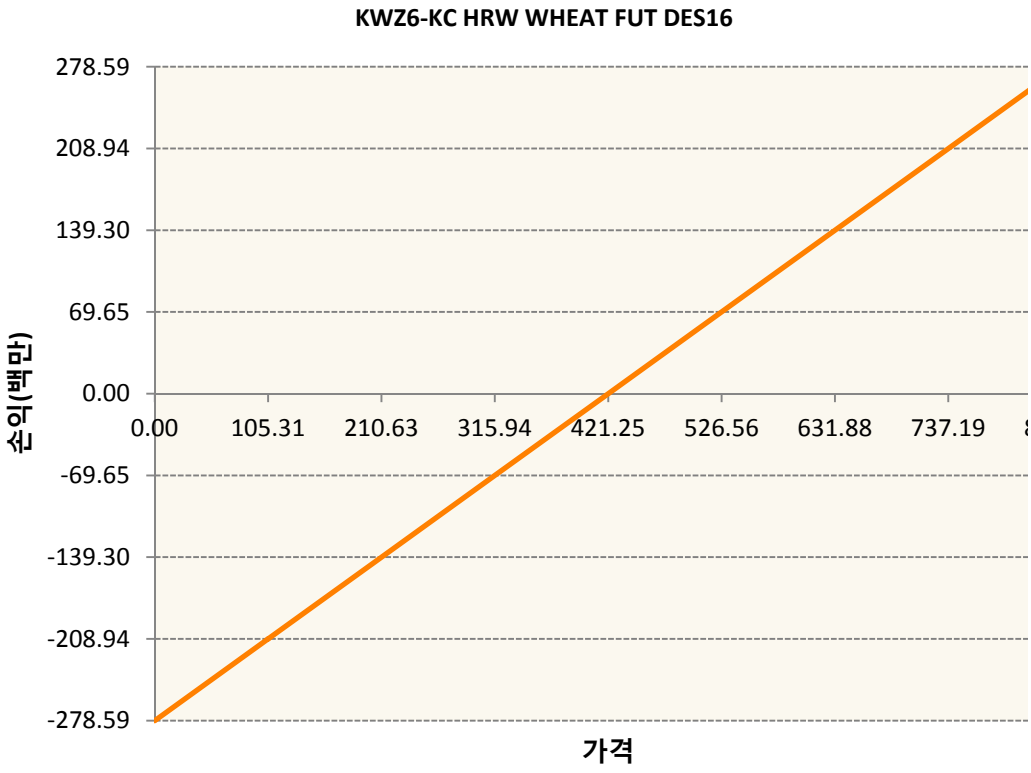


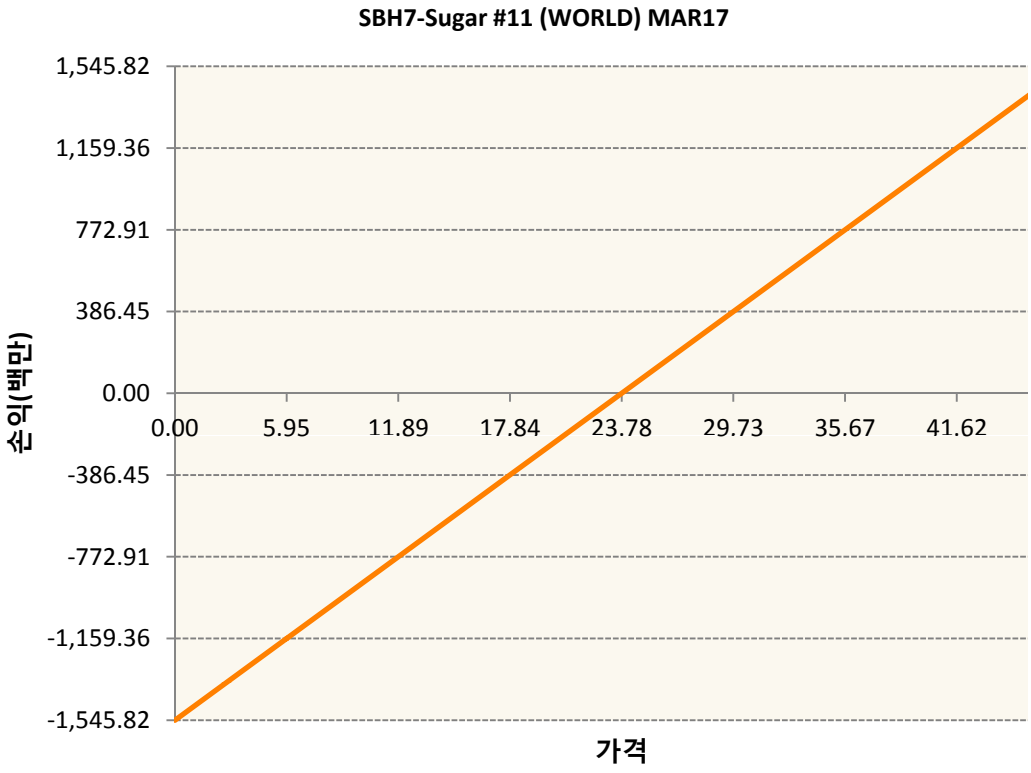

-352.58
-470.11
가격

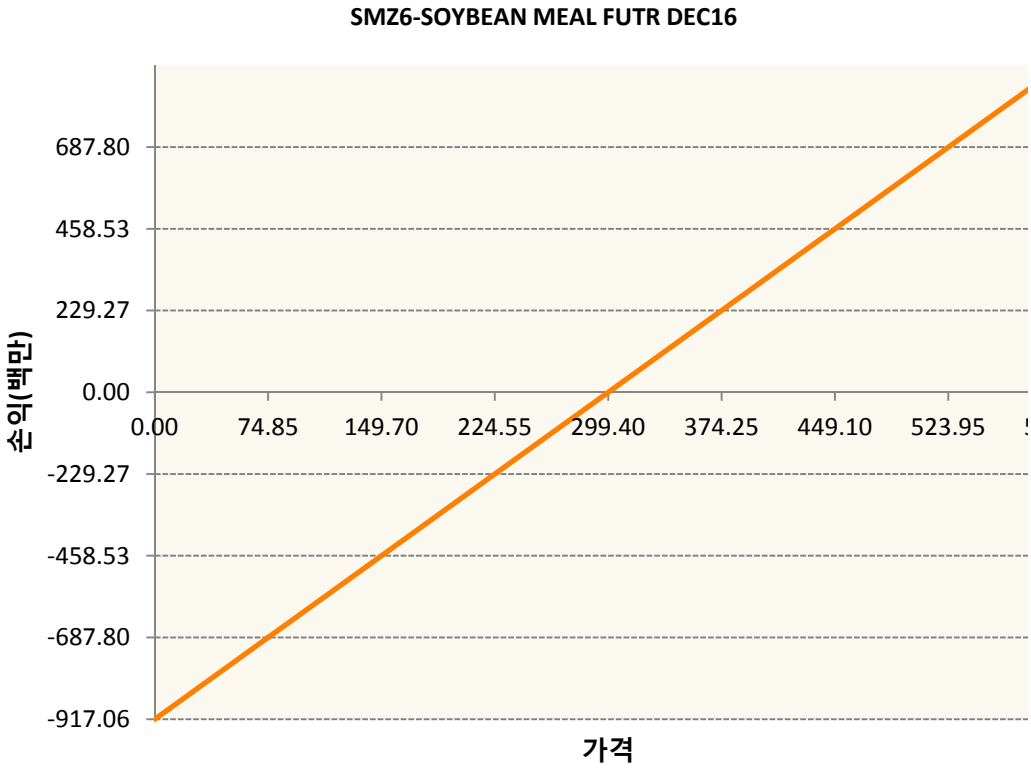

CZ6-CORN FUTURE DEC16
1,797.92
1,348.44
898.96
449.48
0.00
-449.48
-898.96
-1,348.44
-1,797.92
0.00
82.31
164.63
246.94
329.25
411.56
493.88
576.19
순익(백만)
가격

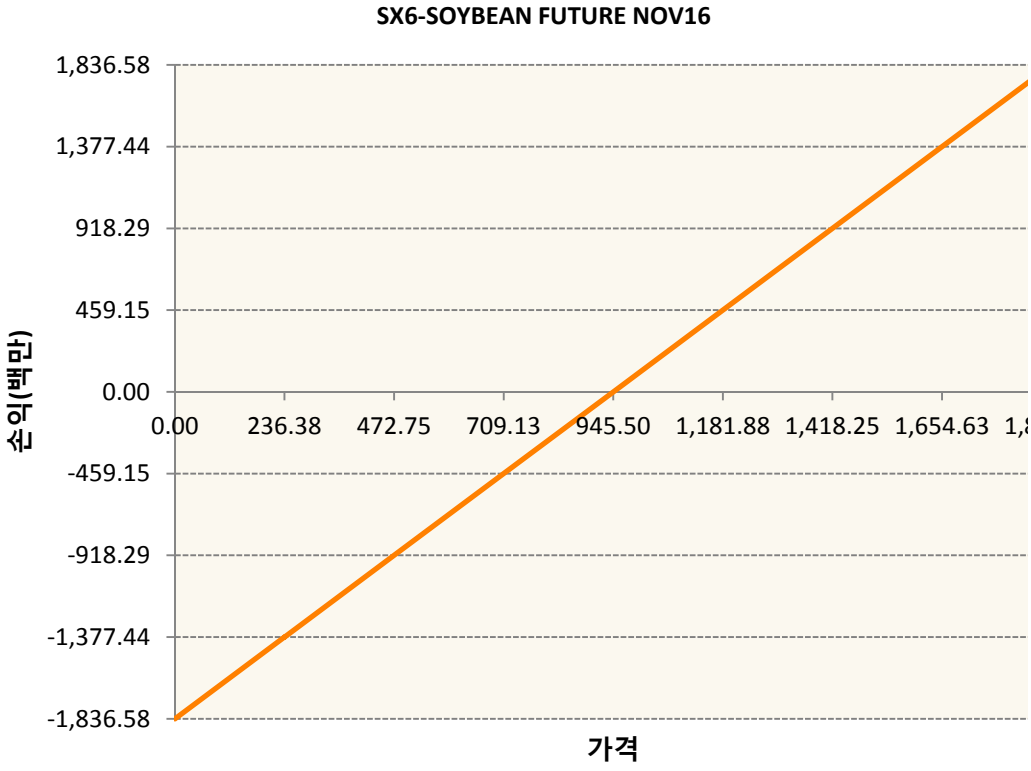

KCZ6-COFFEE 'C' FUTURE DES16
759.62
569.71
379.81
189.90
0.00
-189.90
-379.81
-569.71
-759.62
0.00
38.28
76.55
114.83
153.10
191.38
229.65
267.93
순익(백만)

가격

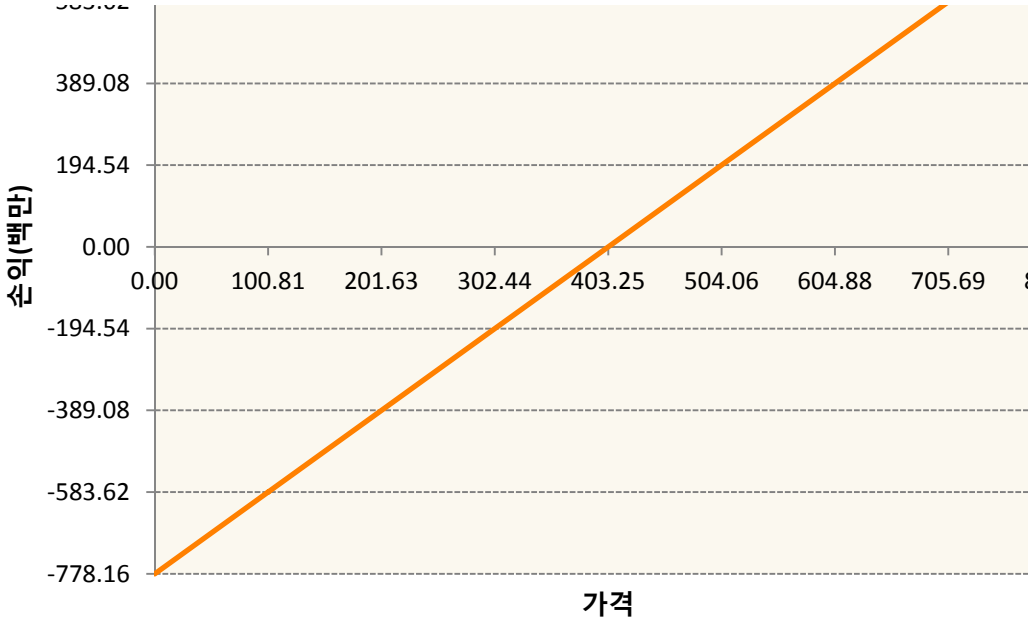

KWZ6-KC HRW WHEAT FUT DES16
278.59
208.94
139.30
69.65
0.00
-69.65
-139.30
-208.94
-278.59
0.00
105.31
210.63
315.94
421.25
526.56
631.88
737.19
손익(백만)
가격


SBH7-Sugar #11 (WORLD) MAR17
1,545.82
1,159.36
772.91
386.45
0.00
-386.45
-772.91
-1,159.36
-1,545.82
0.00
5.95
11.89
17.84
23.78
29.73
35.67
41.62
손익(백만)
가격


SMZ6-SOYBEAN MEAL FUTR DEC16
687.80
458.53
229.27
0.00
-229.27
-458.53
-687.80
-917.06
손익(백만)
0.00
74.85
149.70
224.55
299.40
374.25
449.10
523.95
가격


SX6-SOYBEAN FUTURE NOV16
1,836.58
1,377.44
918.29
459.15
0.00
-459.15
-918.29
-1,377.44
-1,836.58
손익(백만)
0.00
236.38
472.75
709.13
945.50
1,181.88
1,418.25
1,654.63
가격


WZ6-WHEAT FUTURE(CBT) DEC16
583.62



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
BOZ6	SOYBEAN OIL FUTR DEC16	70
CTZ6	COTTON NO.2 FUTR DEC16	38
CZ6	CORN FUTURE DEC16	144
KCZ6	COFFEE 'C' FUTURE DES16	61
KWZ6	KC HRW WHEAT FUT DES16	22
SBH7	Sugar #11 (WORLD) MAR17	124
SMZ6	SOYBEAN MEAL FUTR DEC16	73
SX6	SOYBEAN FUTURE NOV16	147
WZ6	WHEAT FUTURE(CBT) DEC16	62

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	929