공시일	2016-10-14
기준일	2016-10-13

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	2016-10-14
기준일	2016-10-13

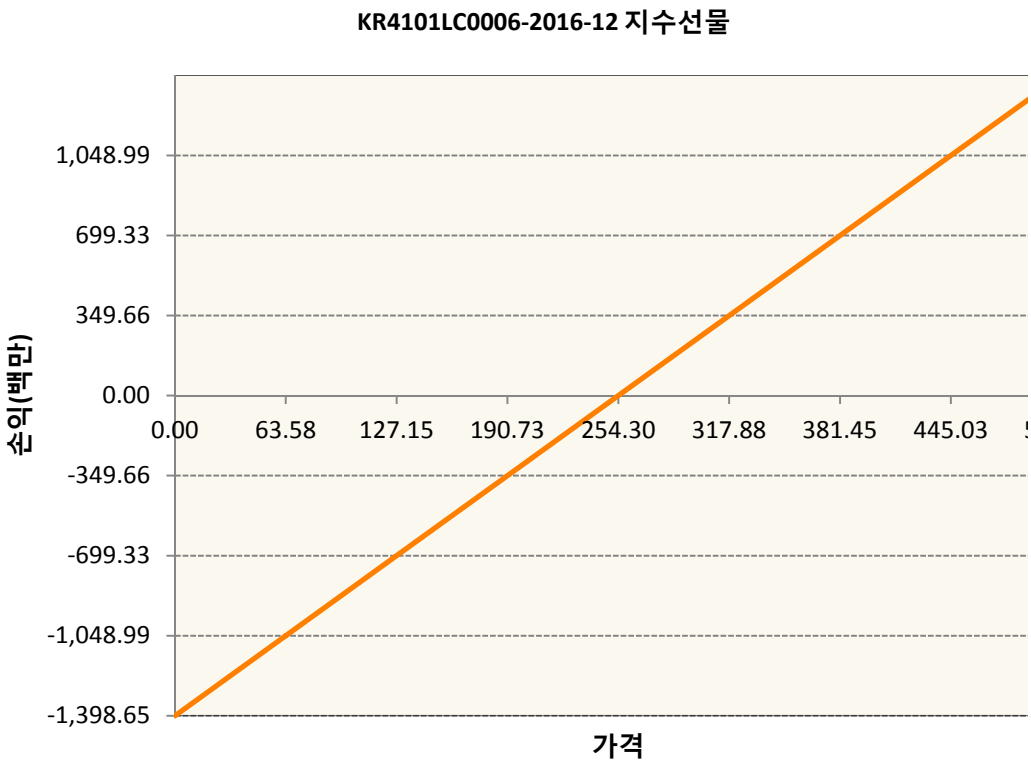
스마트인덱스모

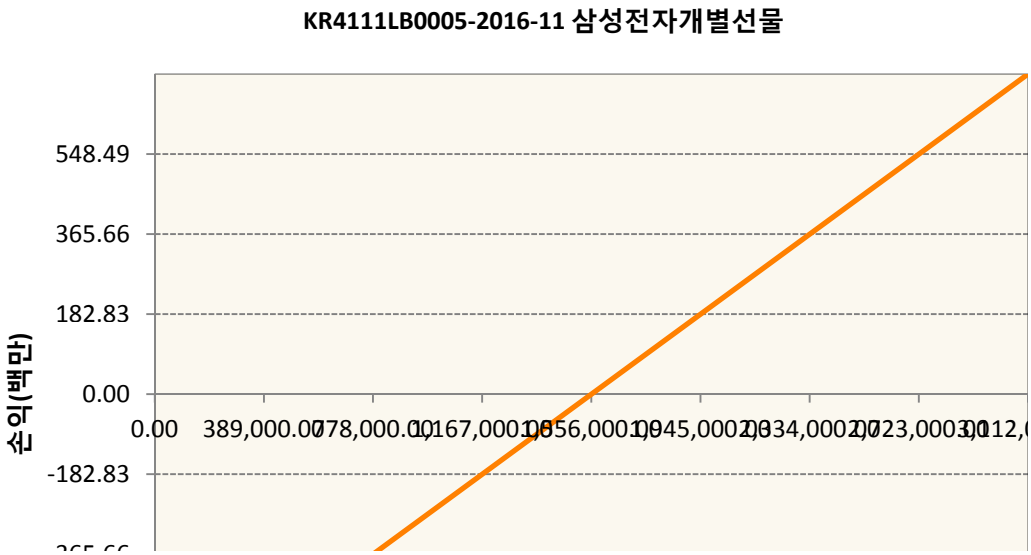
1. 계약금액

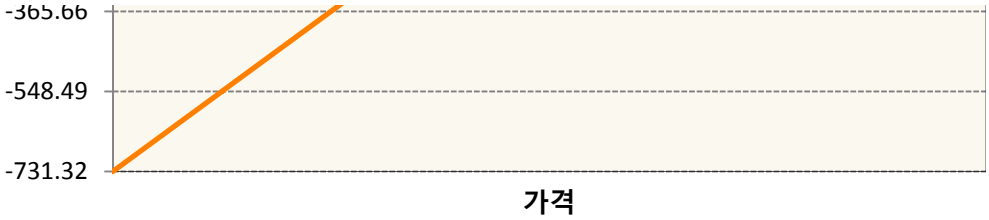
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,130	0	2,130	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101LC00 2016-12 지수선물							112
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-112	-112	-112	-112	-112	-112	-112
-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%	112	112	112	112	112	112	112
KR4111LB00 2016-11 삼성전자개별선물							59
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-59	-59	-59	-59	-59	-59	-59
-5.33%	-39	-39	-39	-39	-39	-39	-39
-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%	39	39	39	39	39	39	39
8.00%	59	59	59	59	59	59	59

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

150

공시일	2016-10-14
기준일	2016-10-13

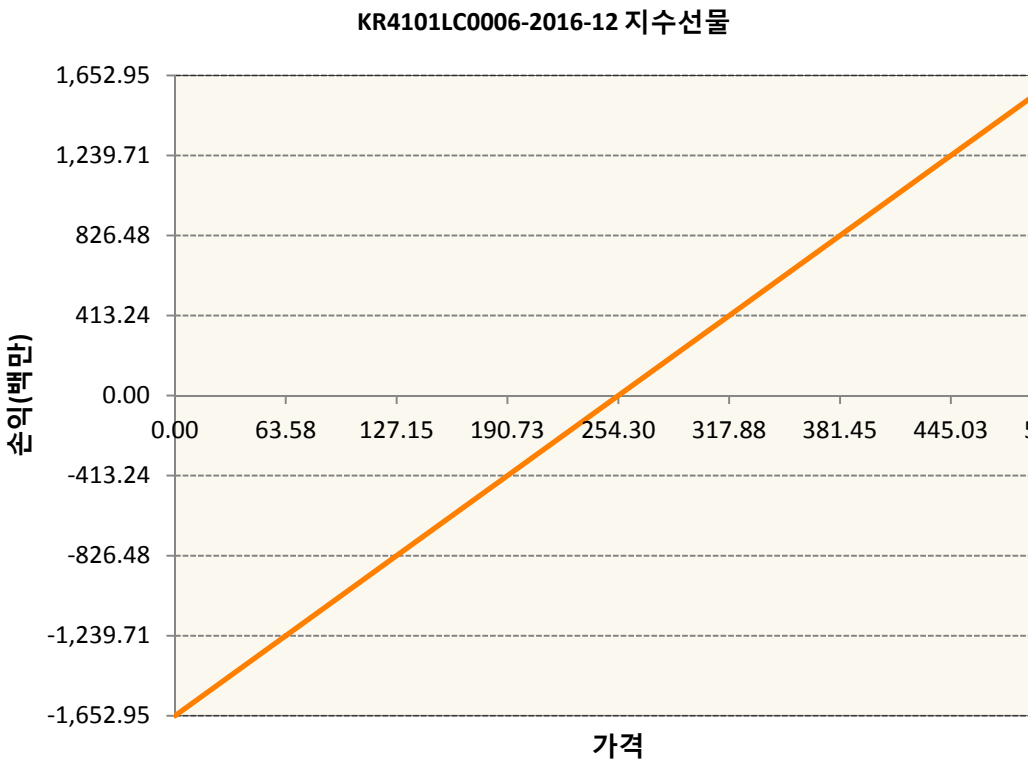
스마트레버리지목표전환형1호

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	1,653	0	1,653	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101LC00 2016-12 지수선물	132

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-132	-132	-132	-132	-132	-132	-132
-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%	132	132	132	132	132	132	132

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

100

공시일	2016-10-14
기준일	2016-10-13

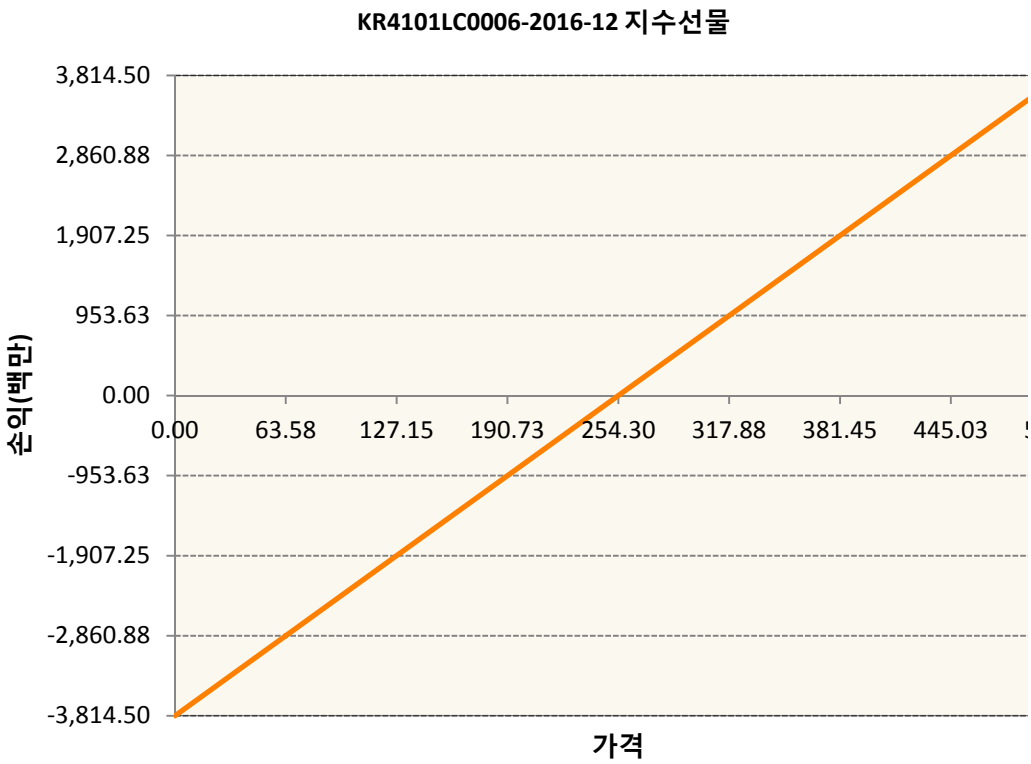
1.3배 레버리지 인덱스(주식-파생형)

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	3,815	0	3,815	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101LC00 2016-12 지수선물							305
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-305	-305	-305	-305	-305	-305	-305
-5.33%	-203	-203	-203	-203	-203	-203	-203
-2.67%	-102	-102	-102	-102	-102	-102	-102
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	102	102	102	102	102	102	102
5.33%	203	203	203	203	203	203	203
8.00%	305	305	305	305	305	305	305

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

230

공시일	2016-10-14
기준일	2016-10-13

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	872

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

715

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2016-10-14
기준일	2016-10-13

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	403

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

821

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2016-10-14
기준일	2016-10-13

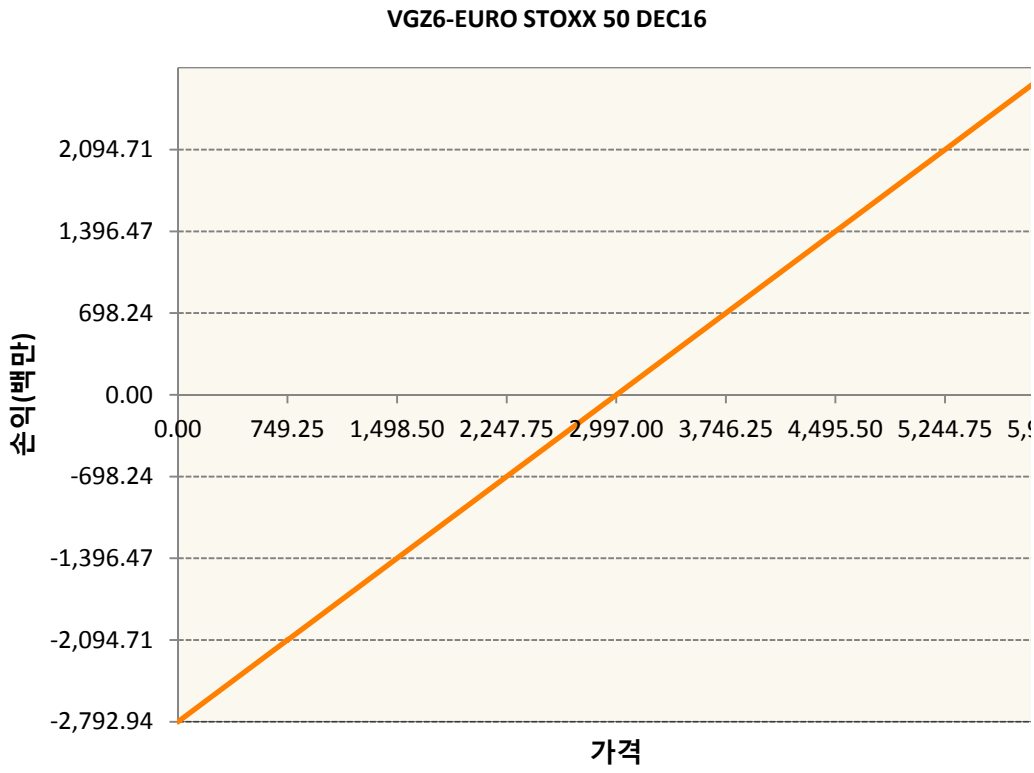
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,793	0	2,793	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGZ6	EURO STOXX 50 DEC16	223

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

(단위:백만원)

272

공시일	2016-10-14
기준일	2016-10-13

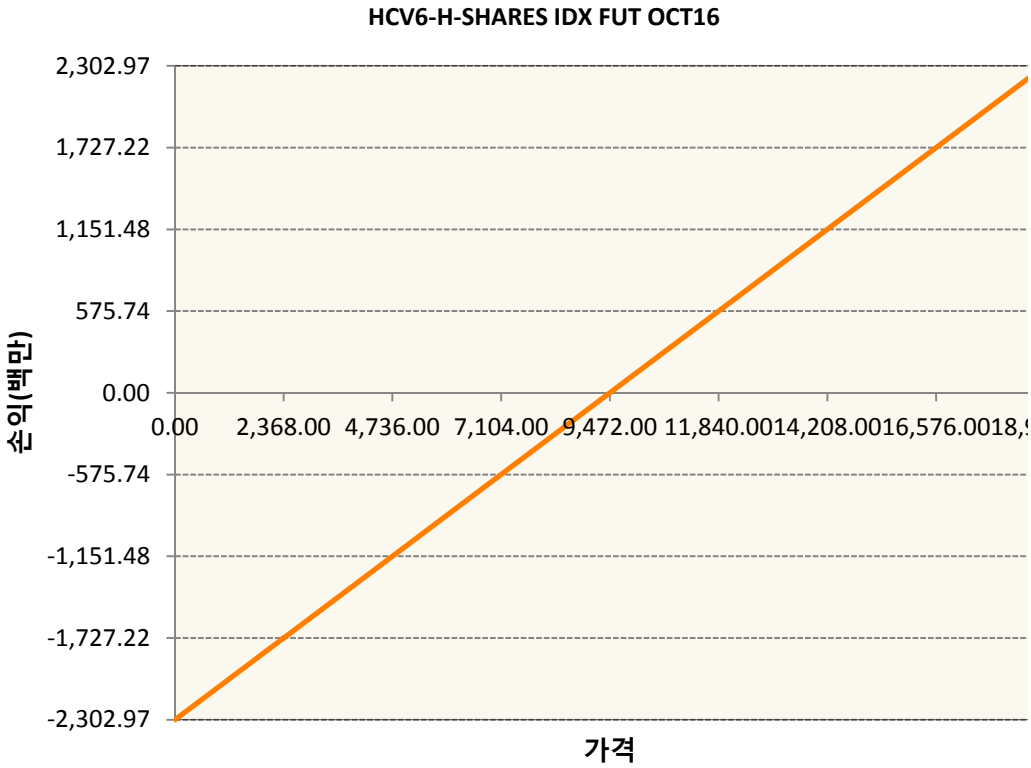
차이나인덱스모(주식-파생형)

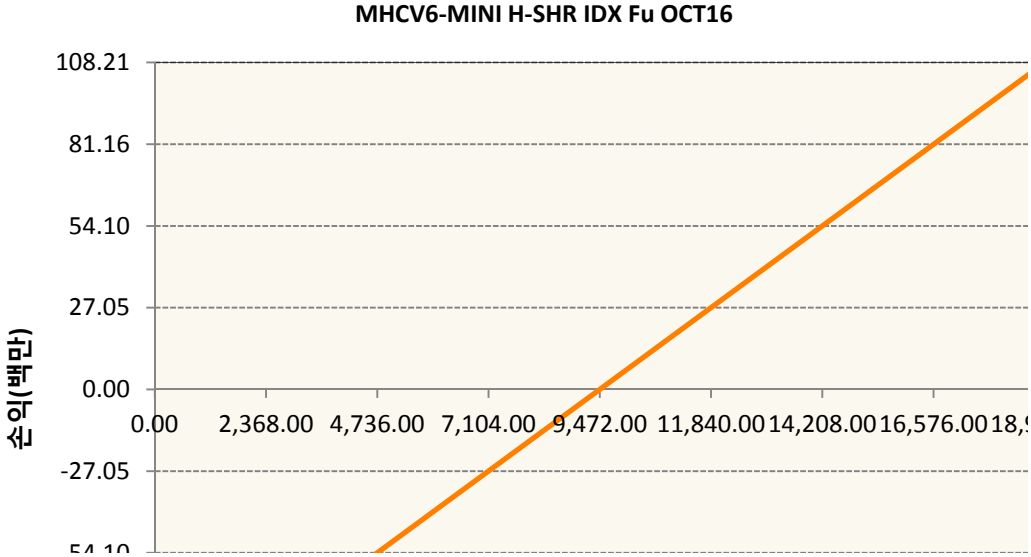
1. 계약금액

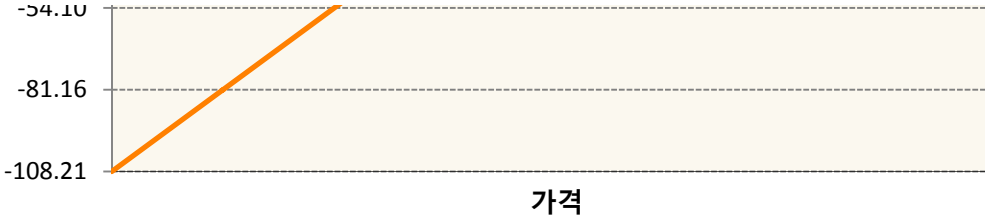
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,411	0	2,411	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

HCV6	H-SHARES IDX FUT OCT16	184
MHCV6	MINI H-SHR IDX Fu OCT16	9

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

261

공시일	2016-10-14
기준일	2016-10-13

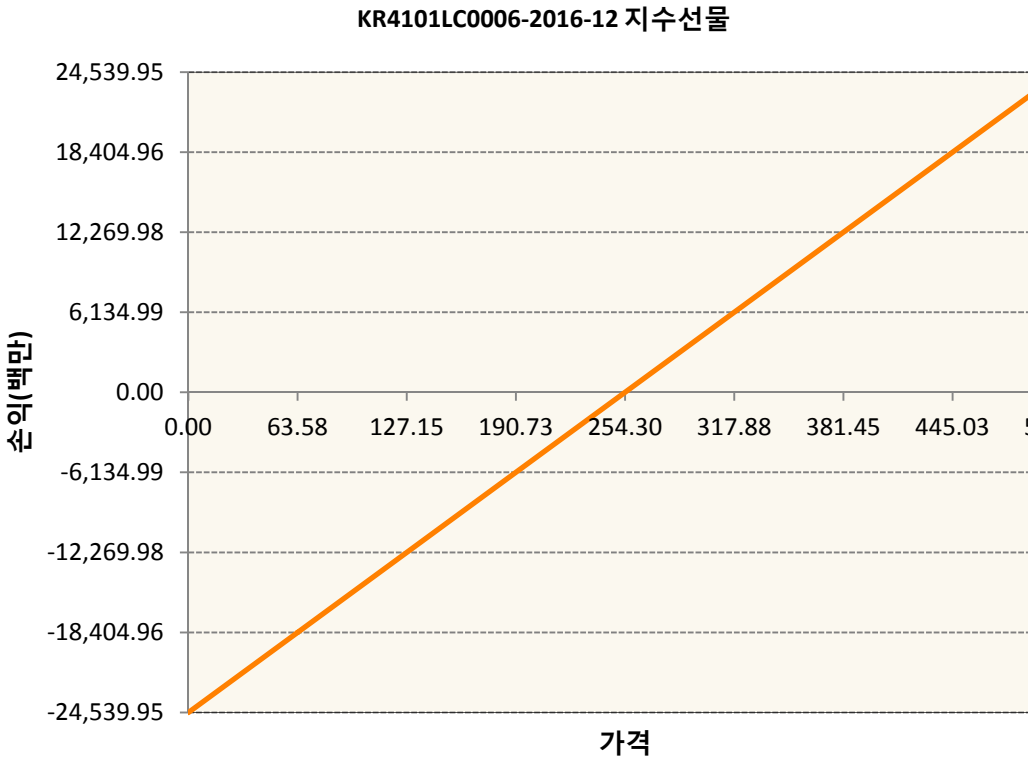
커버드콜(주식혼합-파생형)

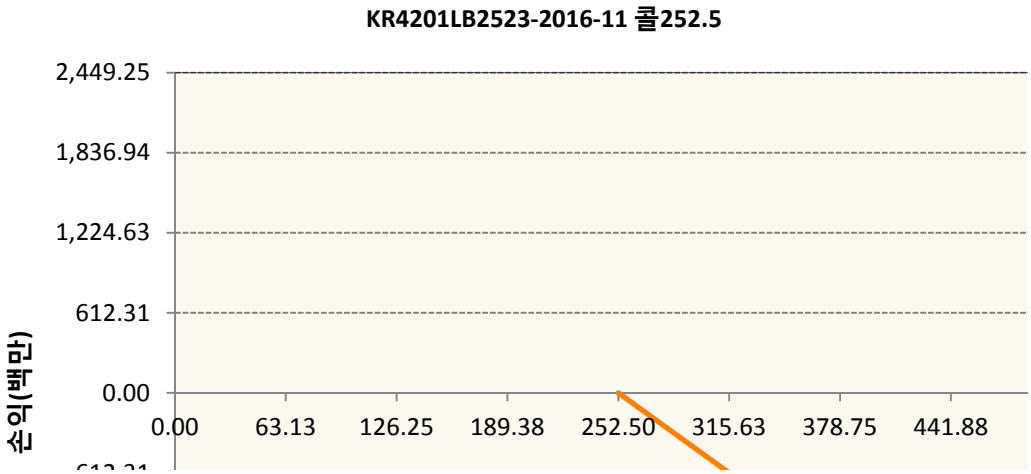
1. 계약금액

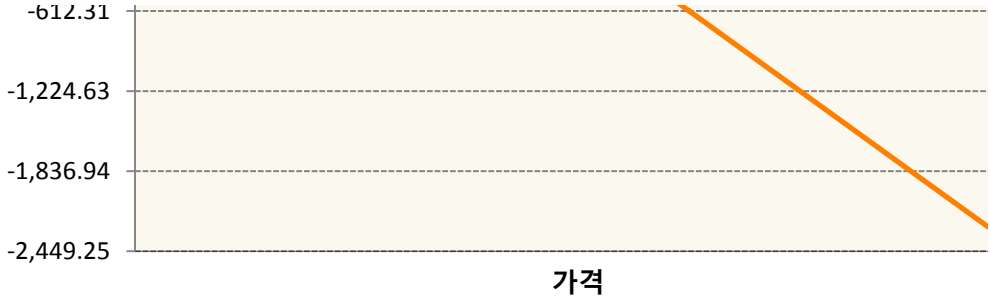
(단위:백만원)

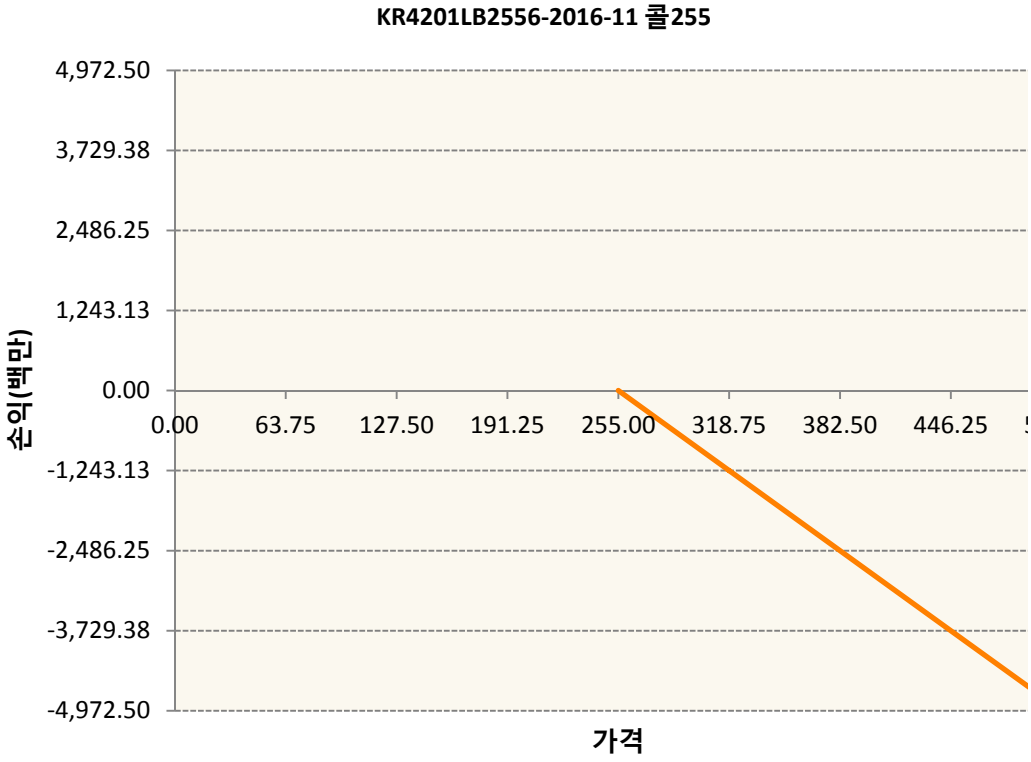
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	7,538	-7,538	장내
누계	유가증권	선물	24,540	0	24,540	장내
누계	유가증권	옵션	0	7,422	-7,422	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101LC00 2016-12 지수선물							1,960
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,960	-1,960	-1,960	-1,960	-1,960	-1,960	-1,960
-5.33%	-1,307	-1,307	-1,307	-1,307	-1,307	-1,307	-1,307
-2.67%	-653	-653	-653	-653	-653	-653	-653
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	653	653	653	653	653	653	653
5.33%	1,307	1,307	1,307	1,307	1,307	1,307	1,307
8.00%	1,960	1,960	1,960	1,960	1,960	1,960	1,960
KR4201LB25 2016-11 콜252.5							825
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	242	241	239	237	233	229	223
-5.33%	233	227	220	212	203	193	183
-2.67%	186	172	157	142	127	112	96
0%	52	34	17	0	-17	-34	-52
2.67%	-184	-196	-208	-221	-235	-249	-263
5.33%	-485	-489	-494	-501	-509	-517	-527
8.00%	-808	-808	-810	-812	-816	-820	-825
KR4201LB25 2016-11 콜255							1,554

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	367	366	364	361	356	350	342
-5.33%	359	351	342	330	316	300	282
-2.67%	301	279	255	229	202	174	145
0%	104	70	35	0	-35	-70	-105
2.67%	-298	-327	-357	-388	-419	-451	-484
5.33%	-865	-878	-894	-912	-932	-954	-978
8.00%	-1,503	-1,506	-1,512	-1,519	-1,529	-1,541	-1,554

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

4,014

공시일	2016-10-14
기준일	2016-10-13

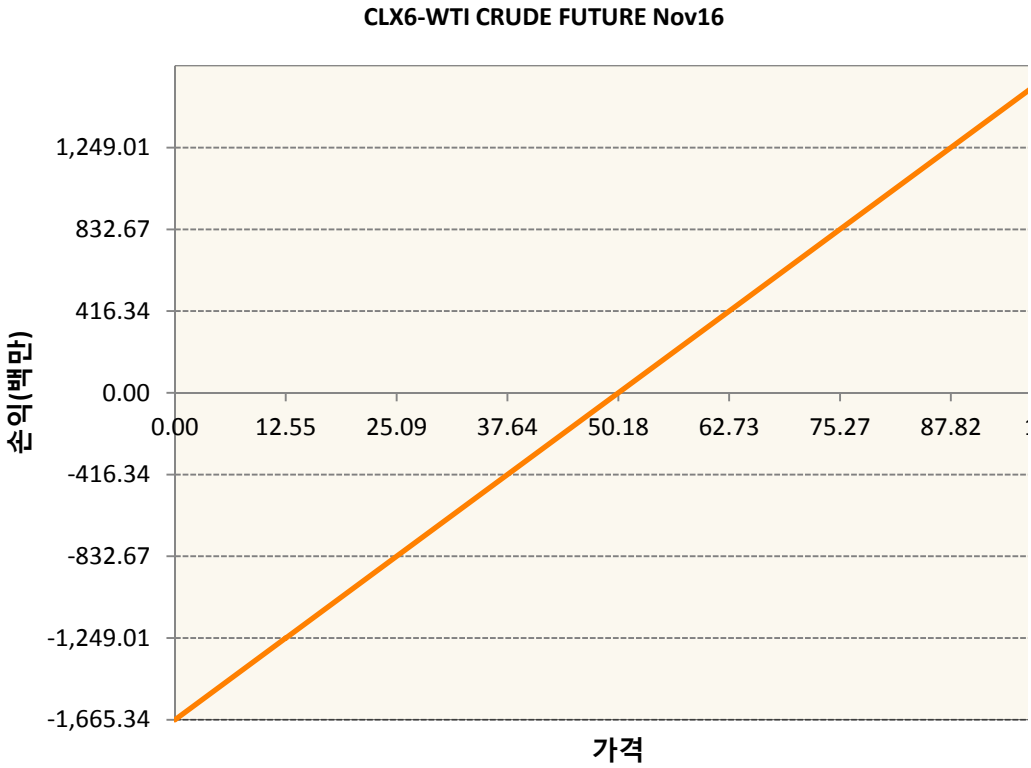
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

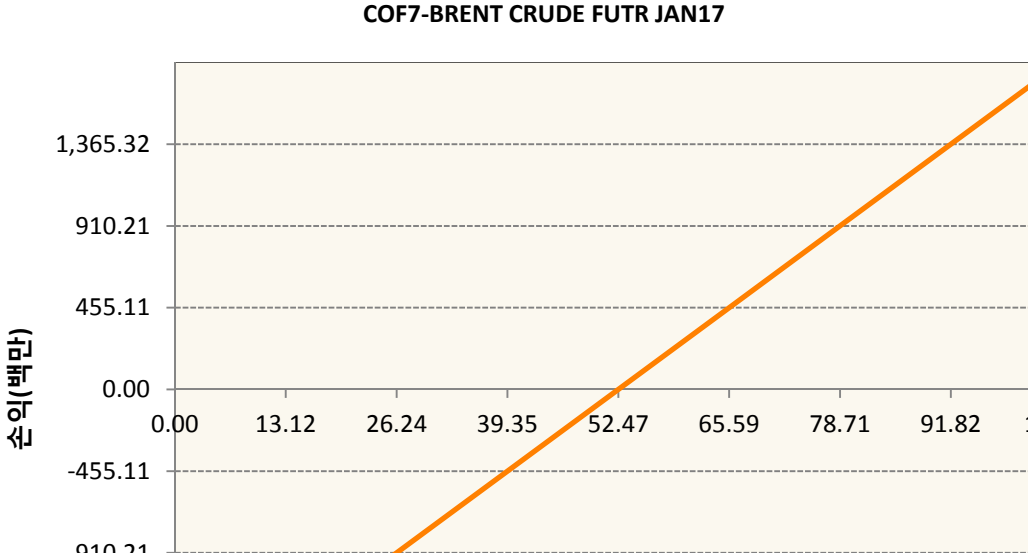
1. 계약금액

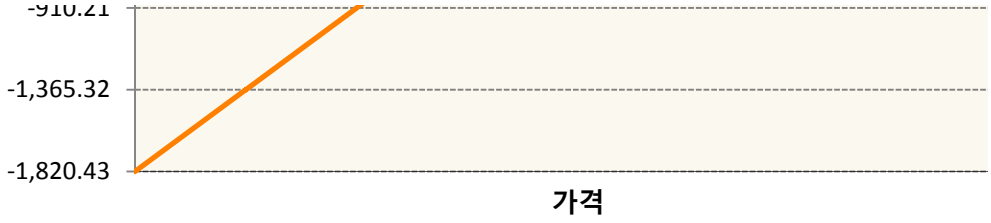
(단위:백만원)

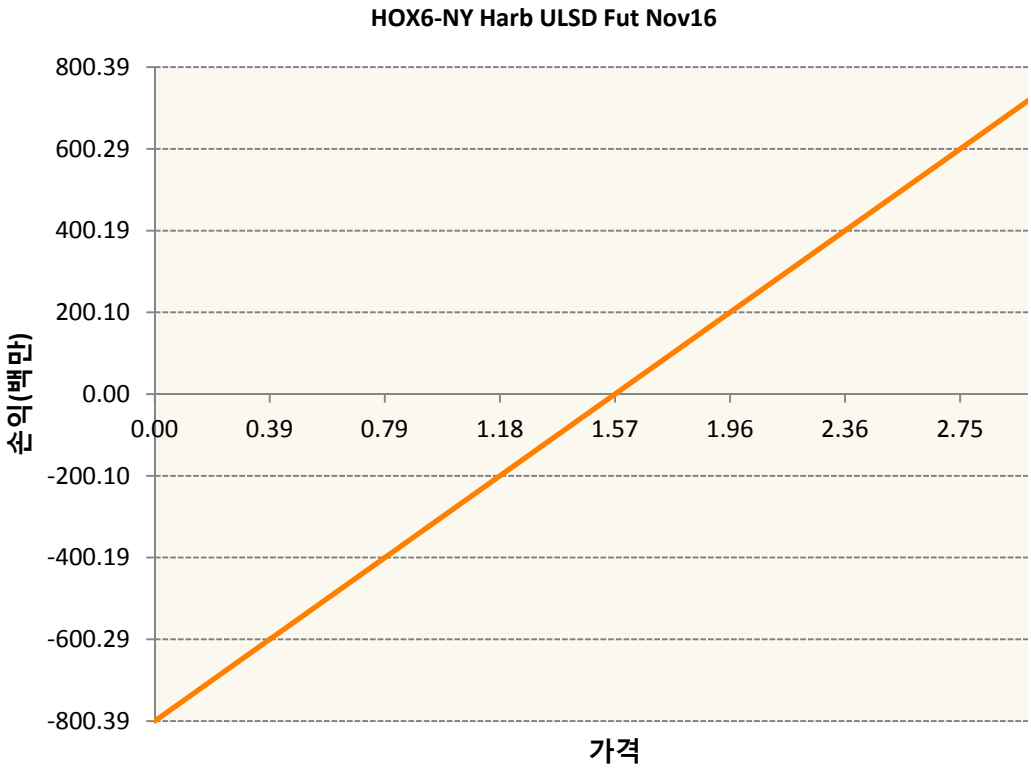
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	6,851	0	6,851	

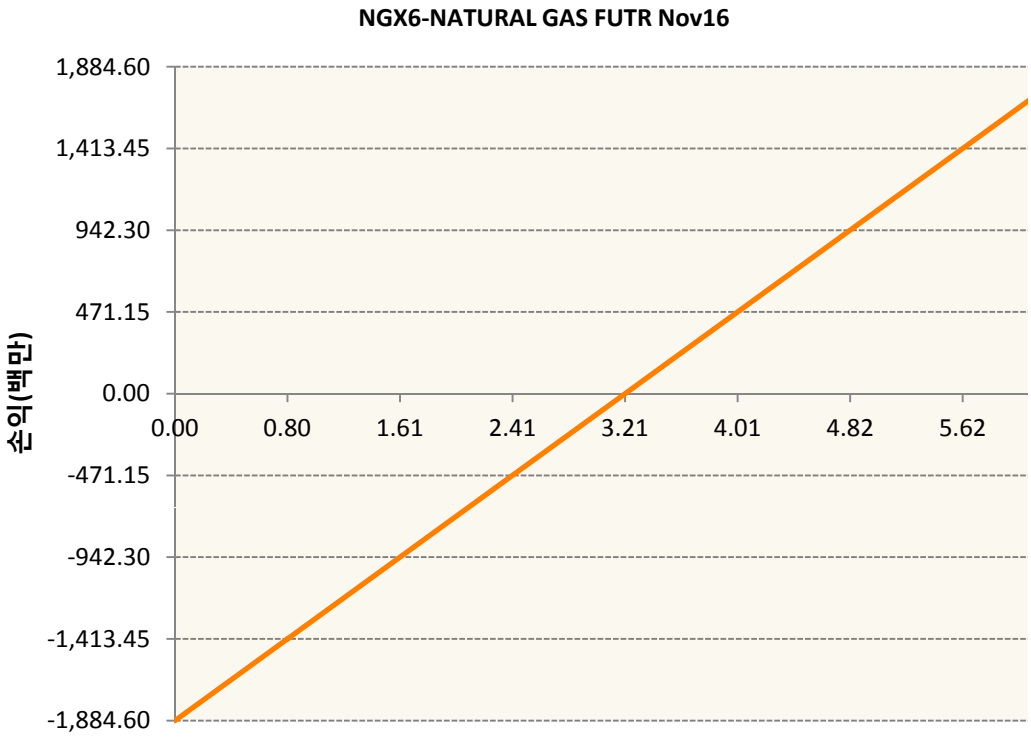
2. 만기시점의 손익구조



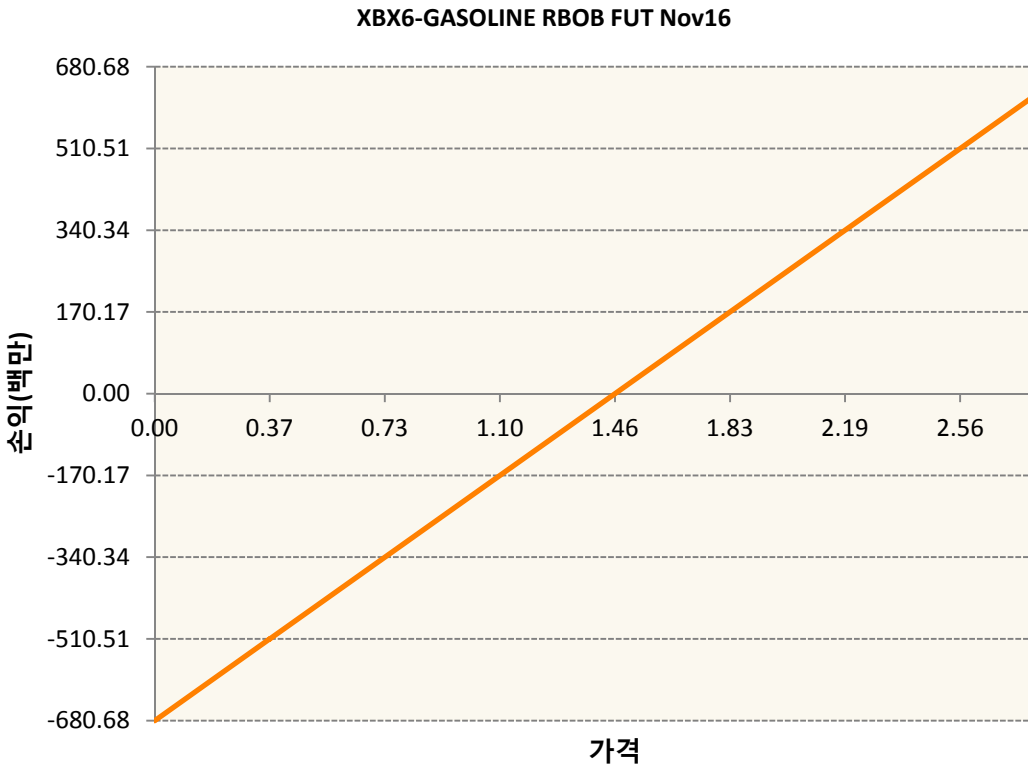



-910.21
-1,365.32
-1,820.43
가격


HOX6-NY Harb ULSD Fut Nov16
800.39
600.29
400.19
200.10
0.00
-200.10
-400.19
-600.29
-800.39
0.00
0.39
0.79
1.18
1.57
1.96
2.36
2.75
손익(백만)
가격


NGX6-NATURAL GAS FUTR Nov16
1,884.60
1,413.45
942.30
471.15
0.00
-471.15
-942.30
-1,413.45
-1,884.60
0.00
0.80
1.61
2.41
3.21
4.01
4.82
5.62
손익(백만)

가격



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
CLX6	WTI CRUDE FUTURE Nov16	133
COF7	BRENT CRUDE FUTR JAN17	146
HOX6	NY Harb ULSD Fut Nov16	64
NGX6	NATURAL GAS FUTR Nov16	151
XBX6	GASOLINE RBOB FUT Nov16	54

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,221

공시일	2016-10-14
기준일	2016-10-13

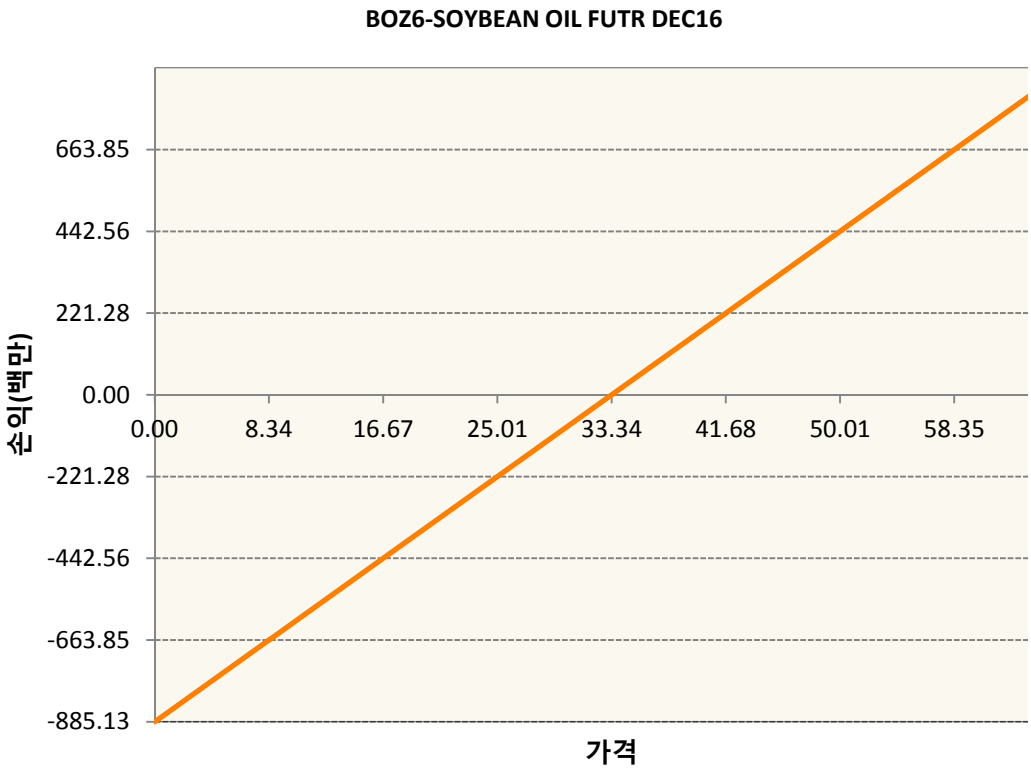
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

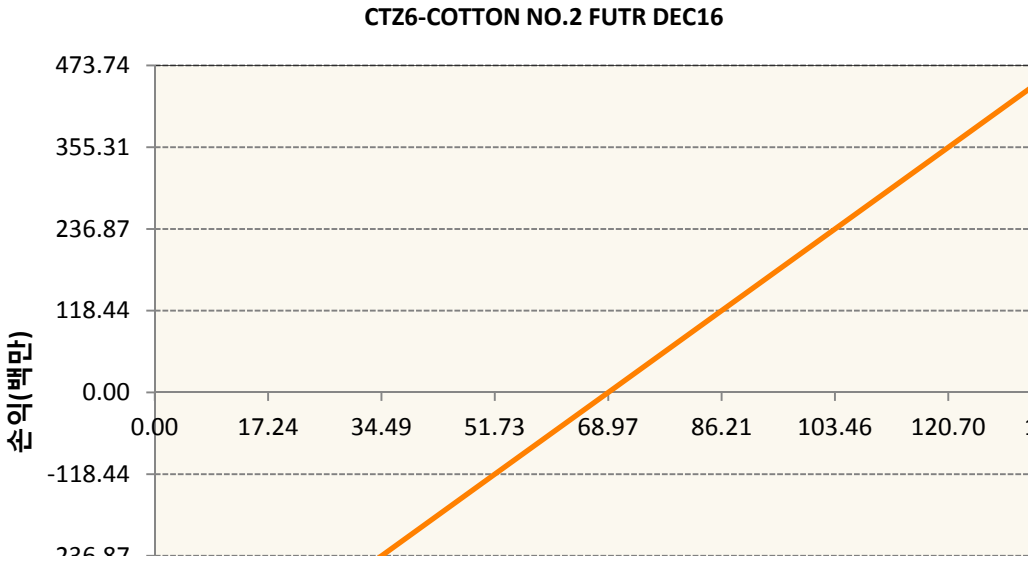
1. 계약금액

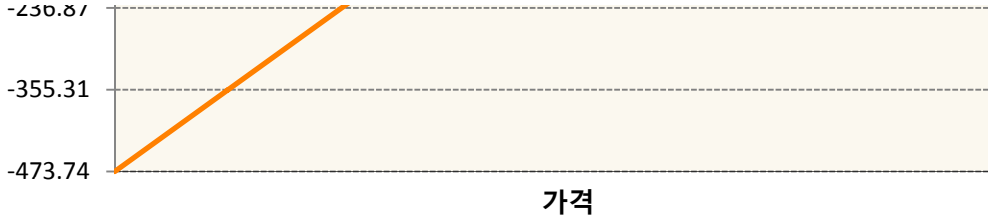
(단위:백만원)

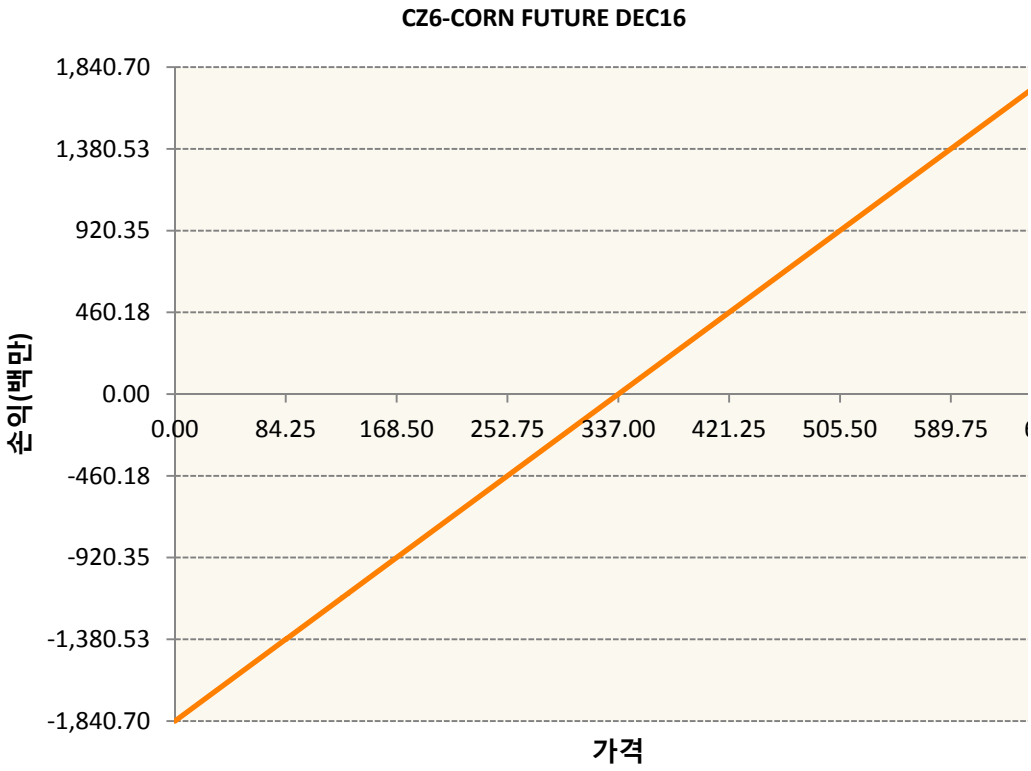
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	9,219	0	9,219	

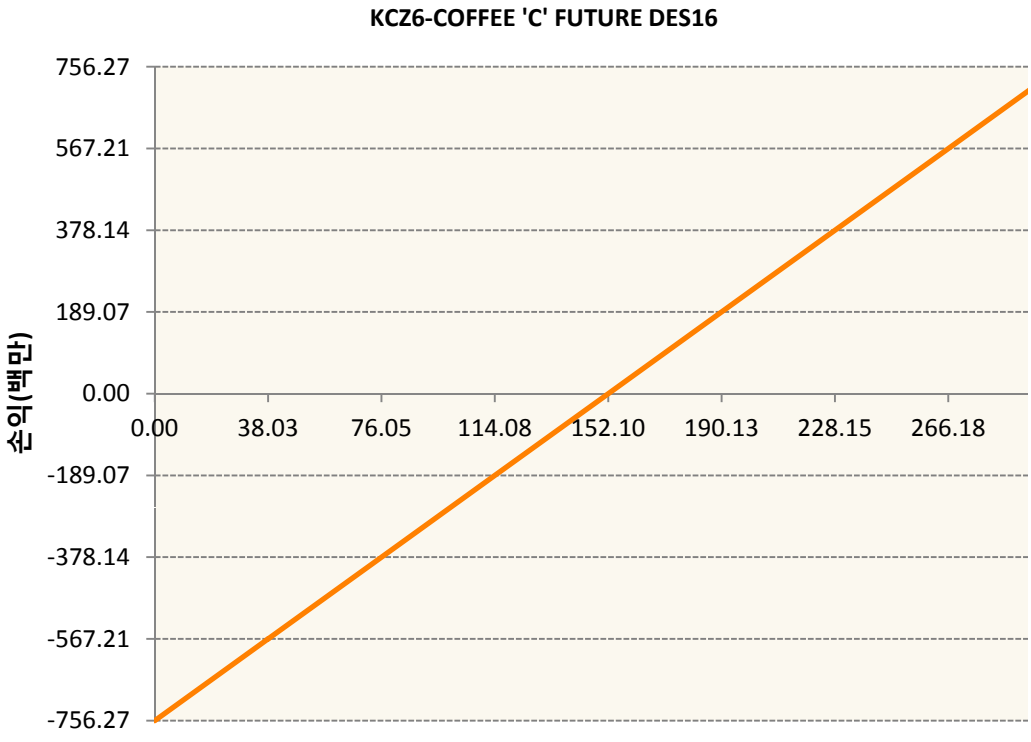
2. 만기시점의 손익구조



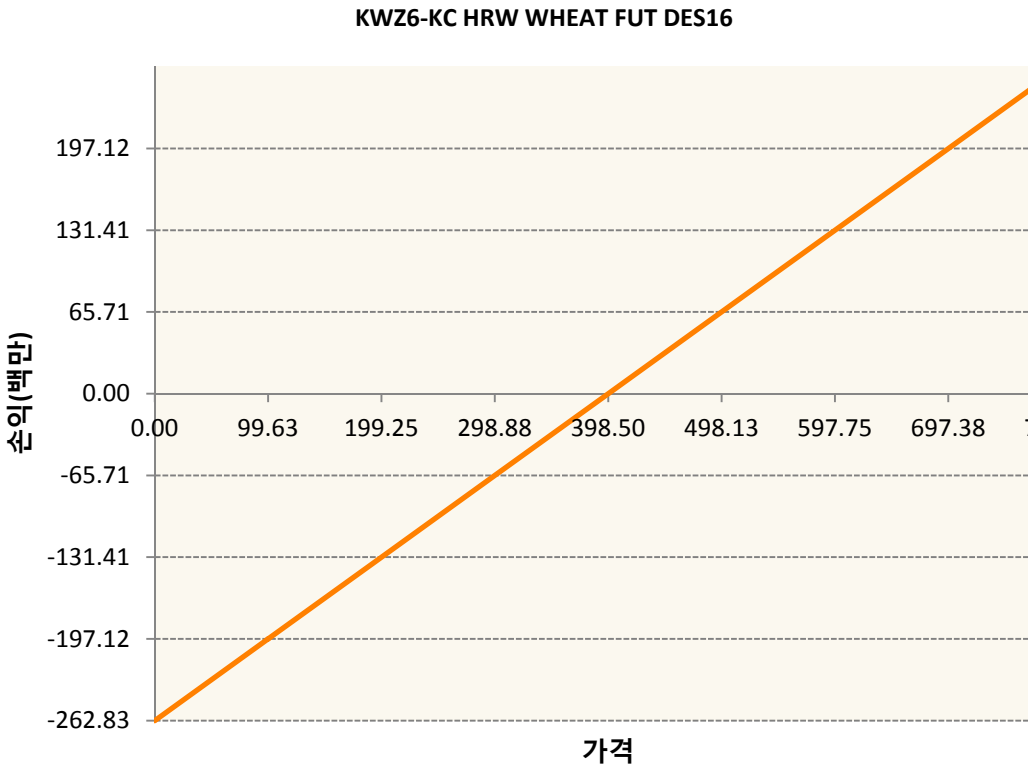


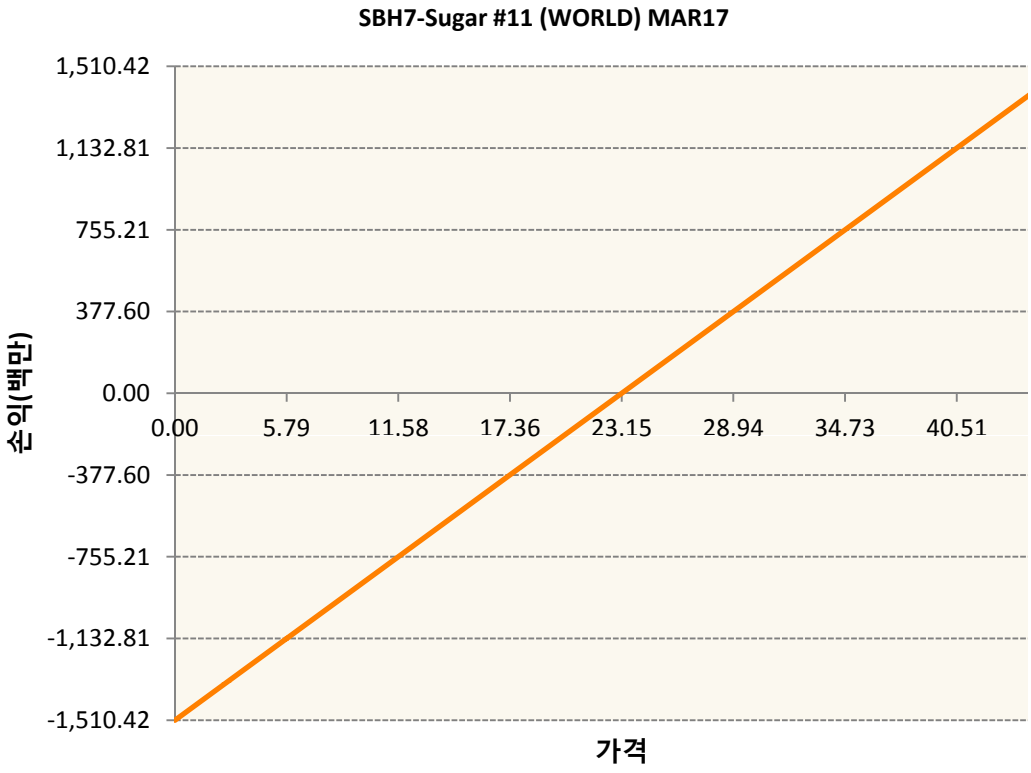

-355.31
-473.74
가격

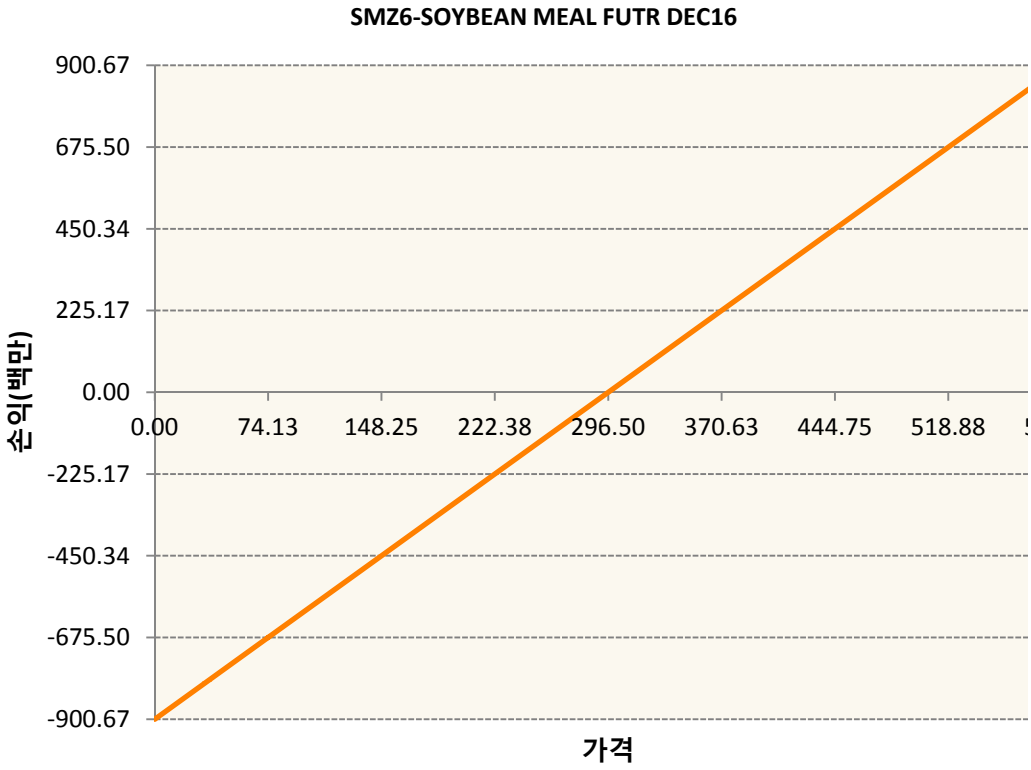

CZ6-CORN FUTURE DEC16
1,840.70
1,380.53
920.35
460.18
0.00
-460.18
-920.35
-1,380.53
-1,840.70
0.00
84.25
168.50
252.75
337.00
421.25
505.50
589.75
순익(백만)
가격

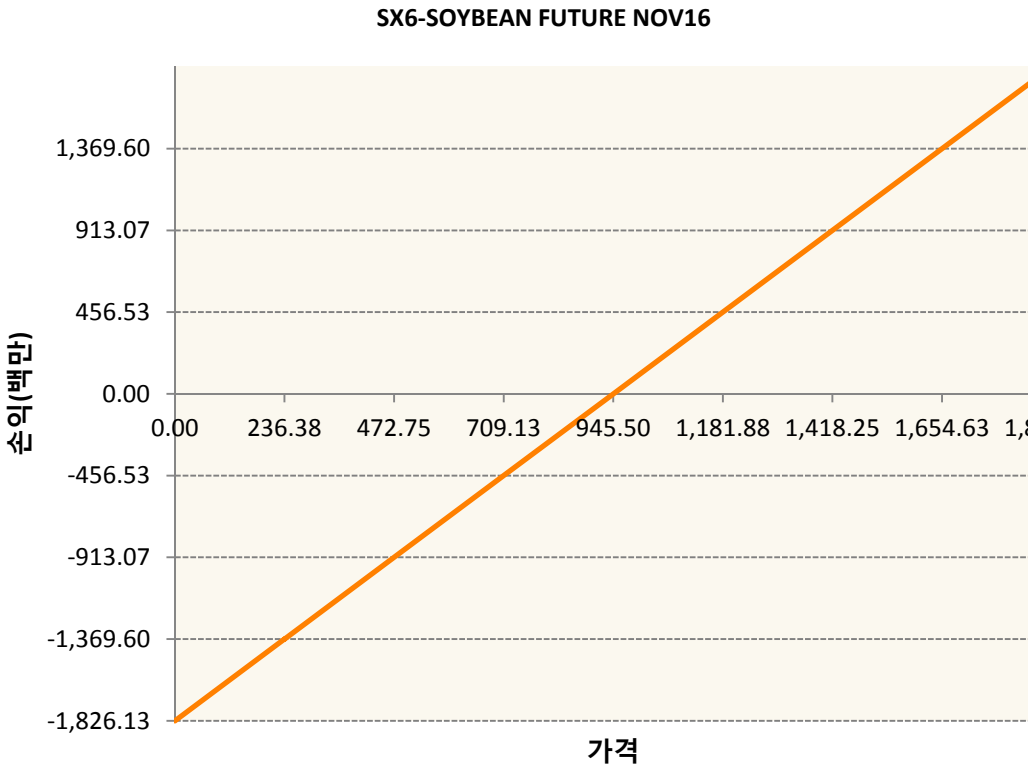

KCZ6-COFFEE 'C' FUTURE DES16
756.27
567.21
378.14
189.07
0.00
-189.07
-378.14
-567.21
-756.27
0.00
38.03
76.05
114.08
152.10
190.13
228.15
266.18
순익(백만)

가격

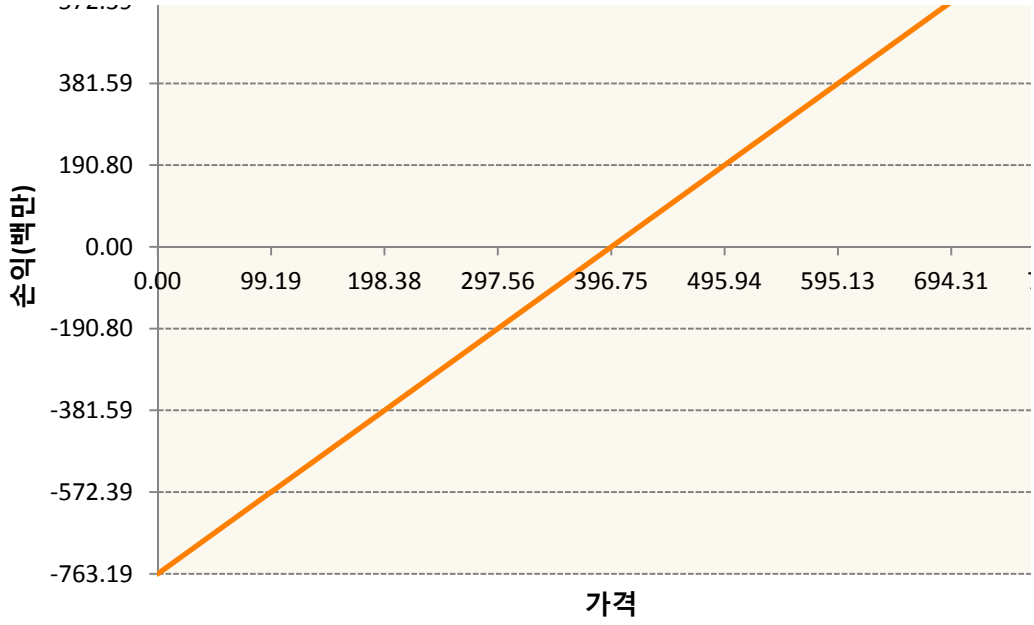

KWZ6-KC HRW WHEAT FUT DES16
197.12
131.41
65.71
0.00
-65.71
-131.41
-197.12
-262.83
0.00
99.63
199.25
298.88
398.50
498.13
597.75
697.38
손익(백만)
가격


SBH7-Sugar #11 (WORLD) MAR17
1,510.42
1,132.81
755.21
377.60
0.00
-377.60
-755.21
-1,132.81
-1,510.42
0.00
5.79
11.58
17.36
23.15
28.94
34.73
40.51
손익(백만)
가격


SMZ6-SOYBEAN MEAL FUTR DEC16
900.67
675.50
450.34
225.17
0.00
-225.17
-450.34
-675.50
-900.67
0.00
74.13
148.25
222.38
296.50
370.63
444.75
518.88
손익(백만)
가격


SX6-SOYBEAN FUTURE NOV16
1,369.60
913.07
456.53
0.00
-456.53
-913.07
-1,369.60
-1,826.13
0.00
236.38
472.75
709.13
945.50
1,181.88
1,418.25
1,654.63
손익(백만)
가격


WZ6-WHEAT FUTURE(CBT) DEC16
763.19
572.39



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
BOZ6	SOYBEAN OIL FUTR DEC16	71
CTZ6	COTTON NO.2 FUTR DEC16	38
CZ6	CORN FUTURE DEC16	147
KCZ6	COFFEE 'C' FUTURE DES16	61
KWZ6	KC HRW WHEAT FUT DES16	21
SBH7	Sugar #11 (WORLD) MAR17	121
SMZ6	SOYBEAN MEAL FUTR DEC16	72
SX6	SOYBEAN FUTURE NOV16	146
WZ6	WHEAT FUTURE(CBT) DEC16	61

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	926