공시일	2016-10-17
기준일	2016-10-14

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	2016-10-17
기준일	2016-10-14

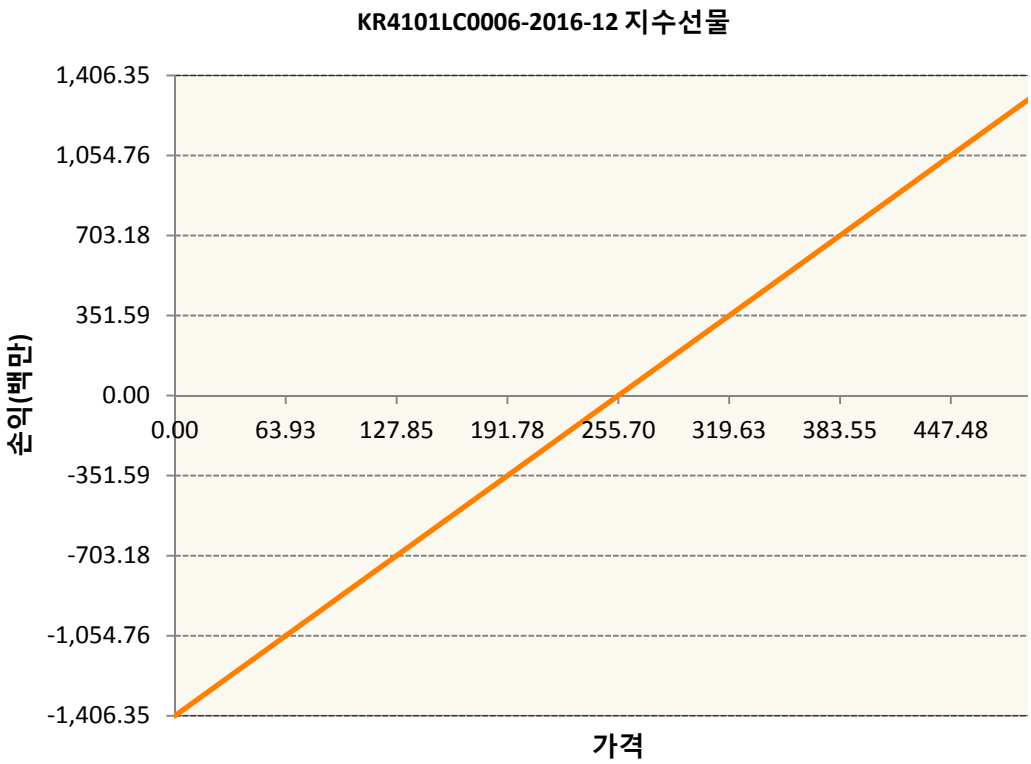
스마트인덱스모

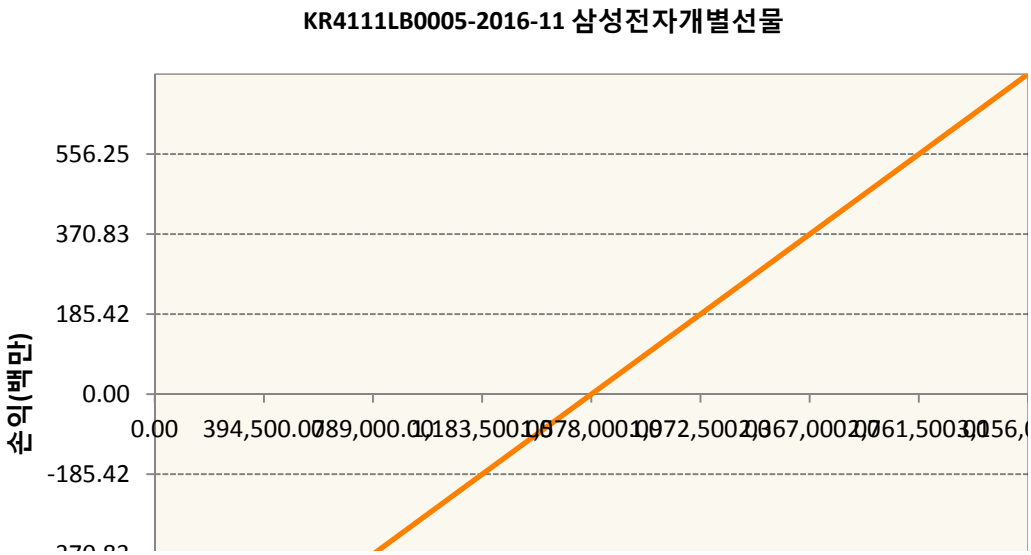
1. 계약금액

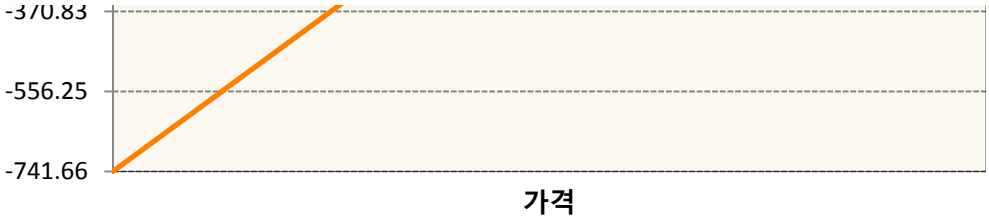
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,148	0	2,148	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%	-75	-75	-75	-75	-75	-75	-75
-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%	75	75	75	75	75	75	75
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%	-40	-40	-40	-40	-40	-40	-40
-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%	40	40	40	40	40	40	40
8.00%	59	59	59	59	59	59	59

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

151

공시일	2016-10-17
기준일	2016-10-14

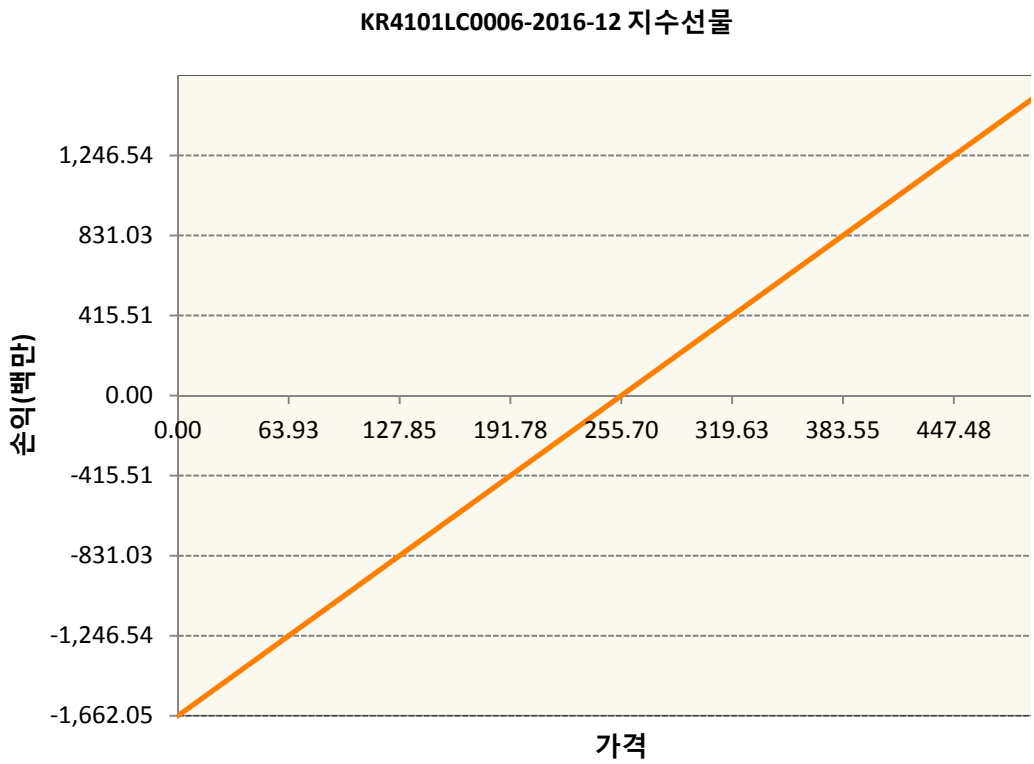
스마트레버리지목표전환형1호

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	1,662	0	1,662	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)

100

공시일	2016-10-17
기준일	2016-10-14

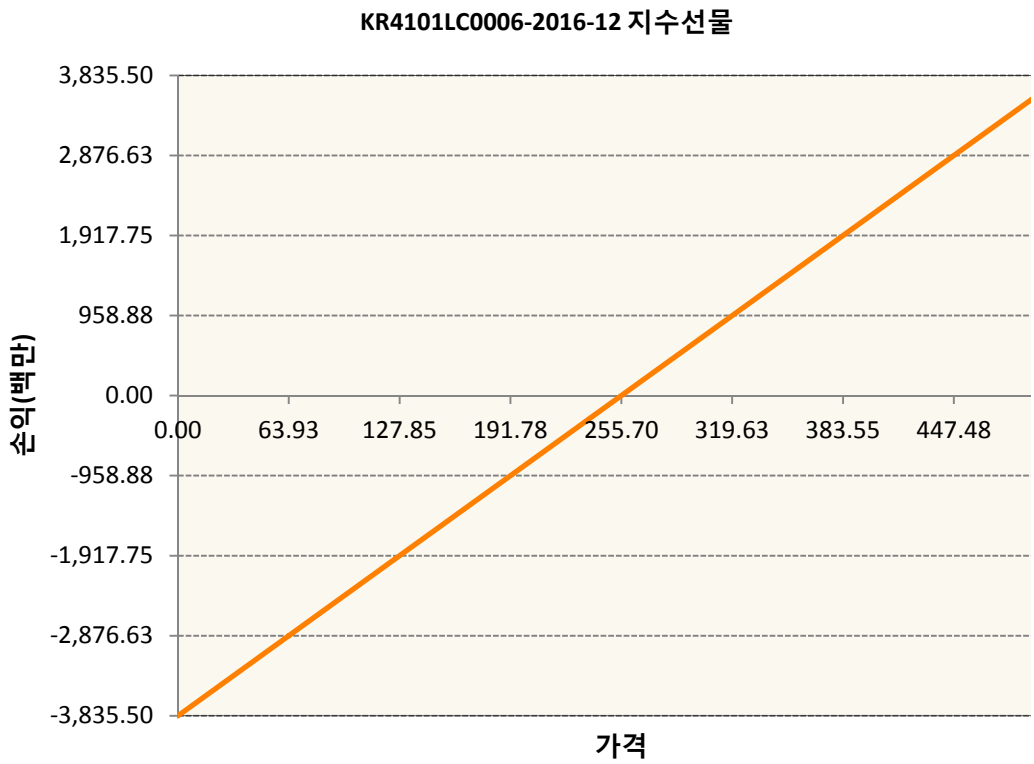
1.3배 레버리지 인덱스(주식-파생형)

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	3,836	0	3,836	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101LC00 2016-12 지수선물							306
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-306	-306	-306	-306	-306	-306	-306
-5.33%	-204	-204	-204	-204	-204	-204	-204
-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%	204	204	204	204	204	204	204
8.00%	306	306	306	306	306	306	306

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

231

공시일	2016-10-17
기준일	2016-10-14

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	869

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

712

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2016-10-17
기준일	2016-10-14

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	402

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

814

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2016-10-17
기준일	2016-10-14

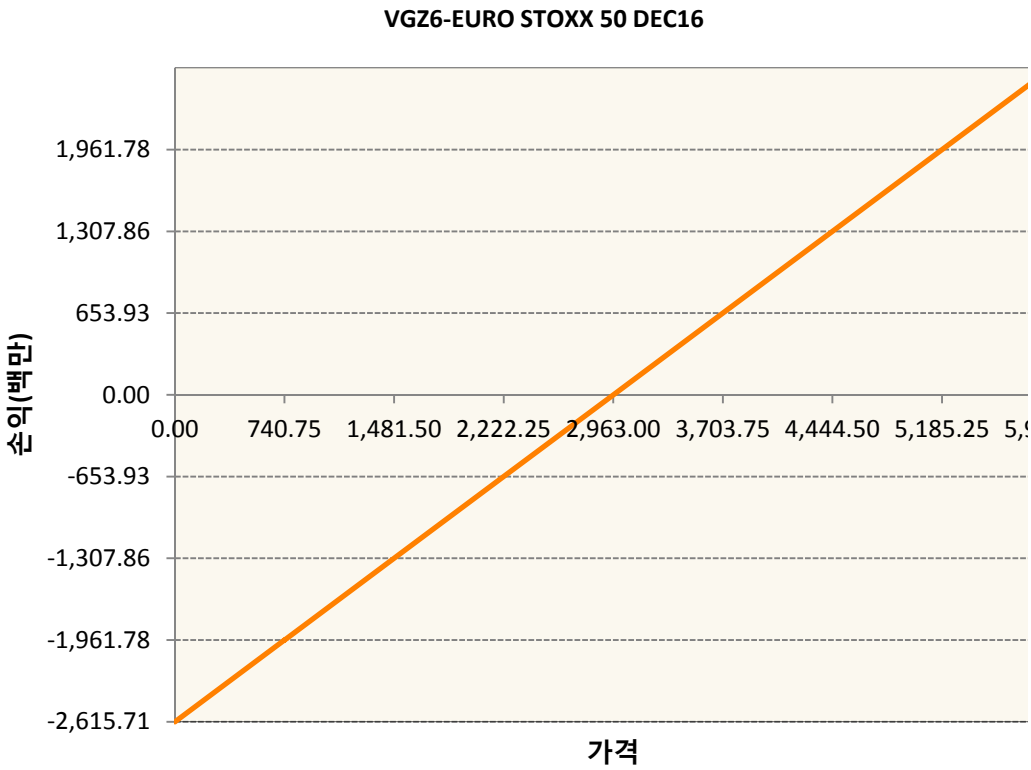
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,616	0	2,616	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGZ6	EURO STOXX 50 DEC16	209

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

(단위:백만원)

255

공시일	2016-10-17
기준일	2016-10-14

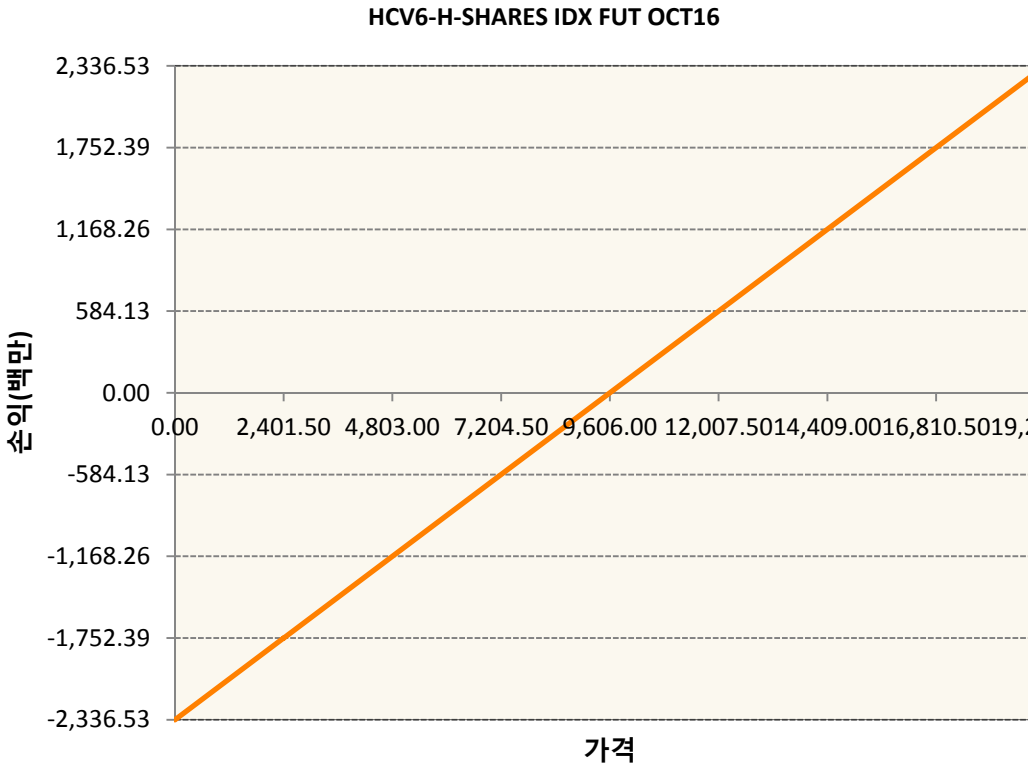
차이나인덱스모(주식-파생형)

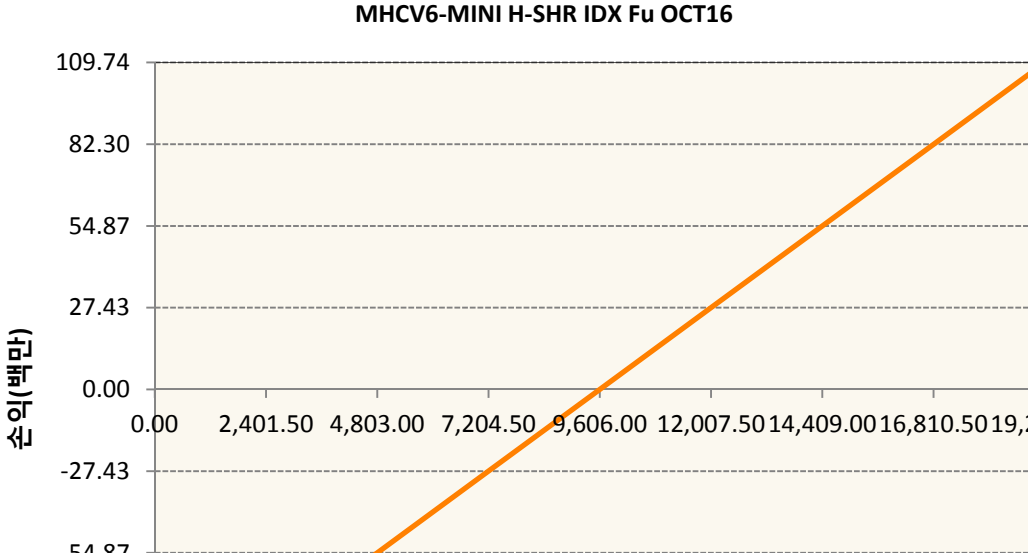
1. 계약금액

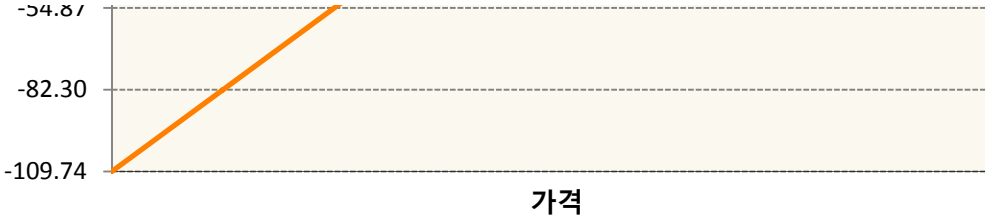
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,446	0	2,446	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCV6	H-SHARES IDX FUT OCT16	187
MHCV6	MINI H-SHR IDX Fu OCT16	9

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	265

공시일	2016-10-17
기준일	2016-10-14

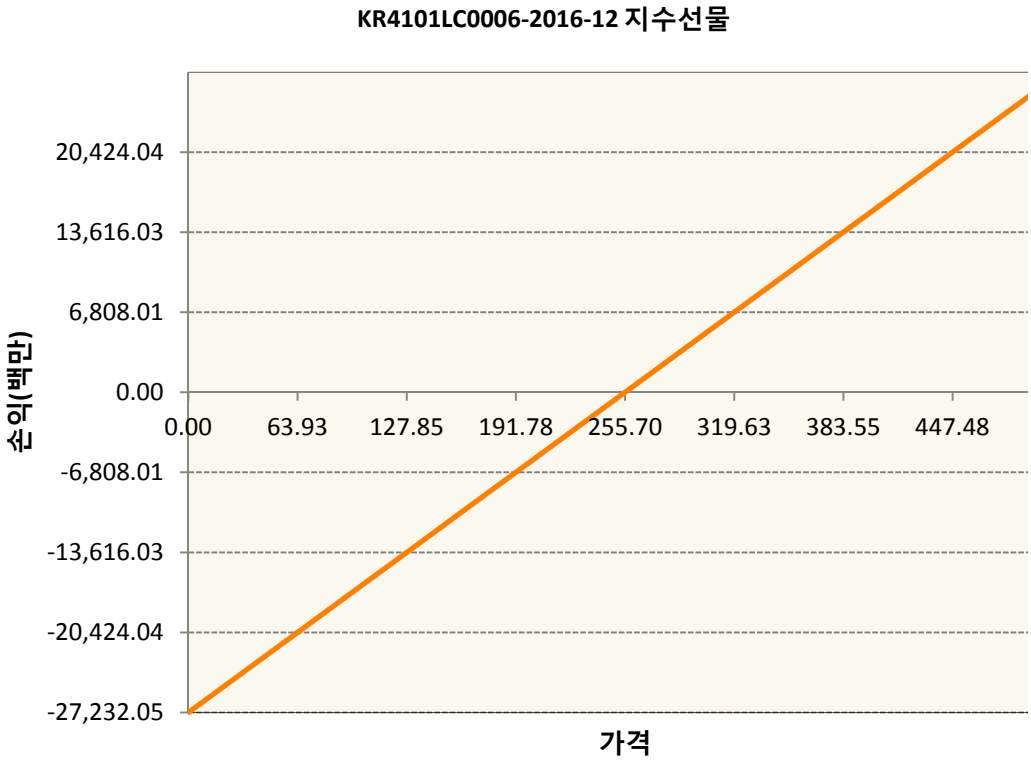
커버드콜(주식혼합-파생형)

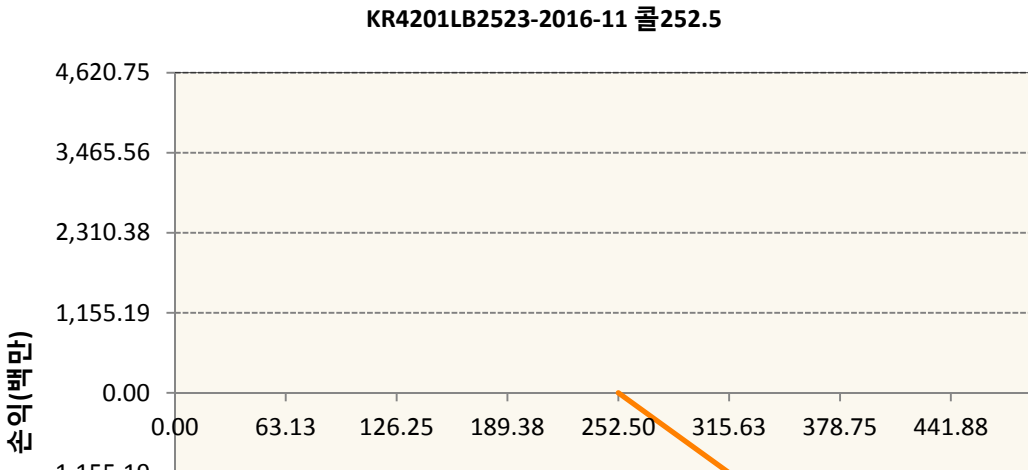
1. 계약금액

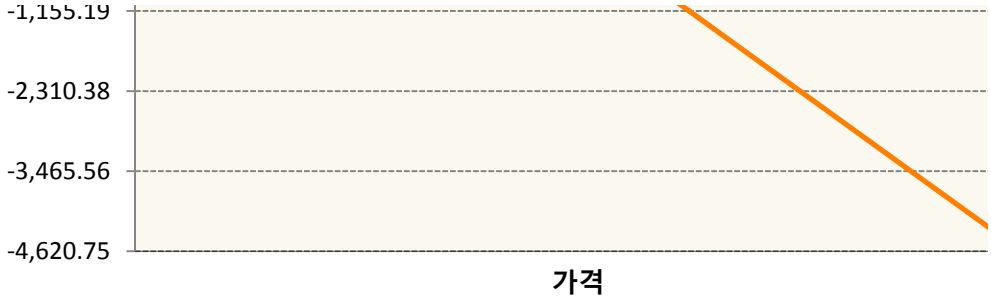
(단위:백만원)

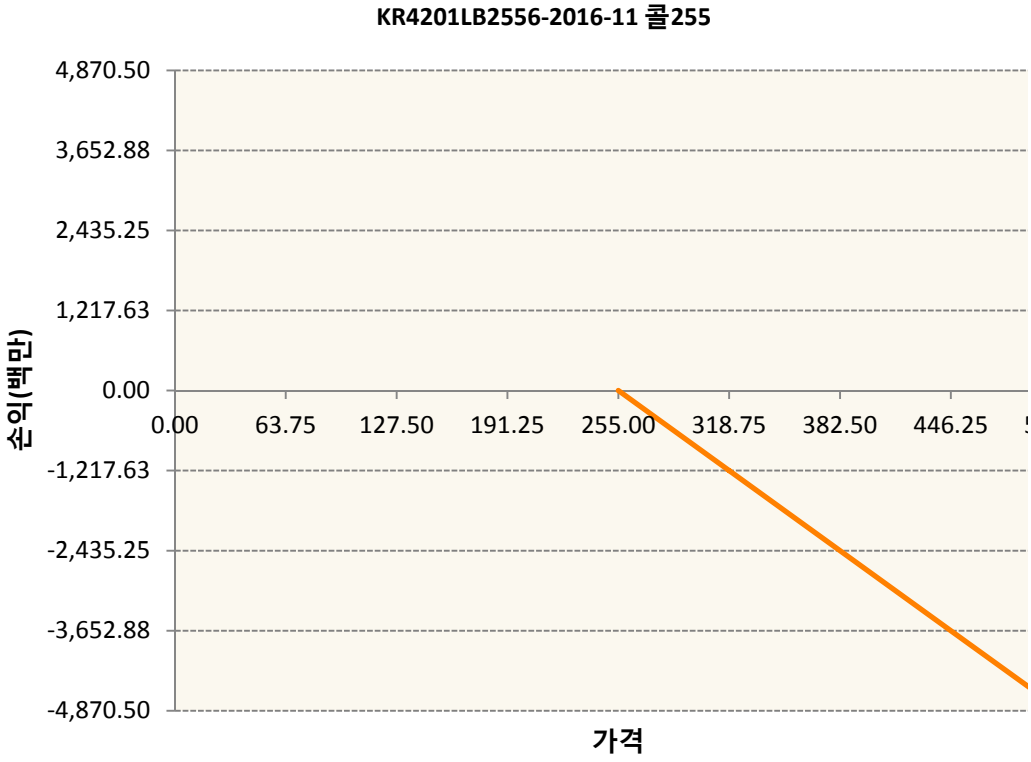
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	2,558	0	2,558	장내
신규	유가증권	옵션	1,933	4,105	-2,172	장내
누계	유가증권	선물	27,232	0	27,232	장내
누계	유가증권	옵션	0	9,491	-9,491	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101LC00 2016-12 지수선물							2,173
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-2,173	-2,173	-2,173	-2,173	-2,173	-2,173	-2,173
-5.33%	-1,449	-1,449	-1,449	-1,449	-1,449	-1,449	-1,449
-2.67%	-724	-724	-724	-724	-724	-724	-724
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	724	724	724	724	724	724	724
5.33%	1,449	1,449	1,449	1,449	1,449	1,449	1,449
8.00%	2,173	2,173	2,173	2,173	2,173	2,173	2,173
KR4201LB25 2016-11 콜252.5							1,626
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	486	484	482	477	472	465	456
-5.33%	470	460	447	433	417	400	381
-2.67%	372	347	320	294	267	239	212
0%	86	58	29	0	-29	-58	-88
2.67%	-401	-416	-433	-452	-472	-494	-516
5.33%	-991	-995	-1,001	-1,009	-1,019	-1,030	-1,043
8.00%	-1,609	-1,610	-1,611	-1,613	-1,616	-1,620	-1,626
KR4201LB25 2016-11 콜255							1,600

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	379	378	376	374	370	365	359
-5.33%	371	365	356	346	333	319	304
-2.67%	312	290	268	244	219	193	167
0%	94	63	31	0	-31	-63	-94
2.67%	-344	-366	-390	-414	-440	-467	-494
5.33%	-932	-940	-950	-962	-976	-992	-1,010
8.00%	-1,571	-1,572	-1,575	-1,579	-1,584	-1,591	-1,600

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

5,208

공시일	2016-10-17
기준일	2016-10-14

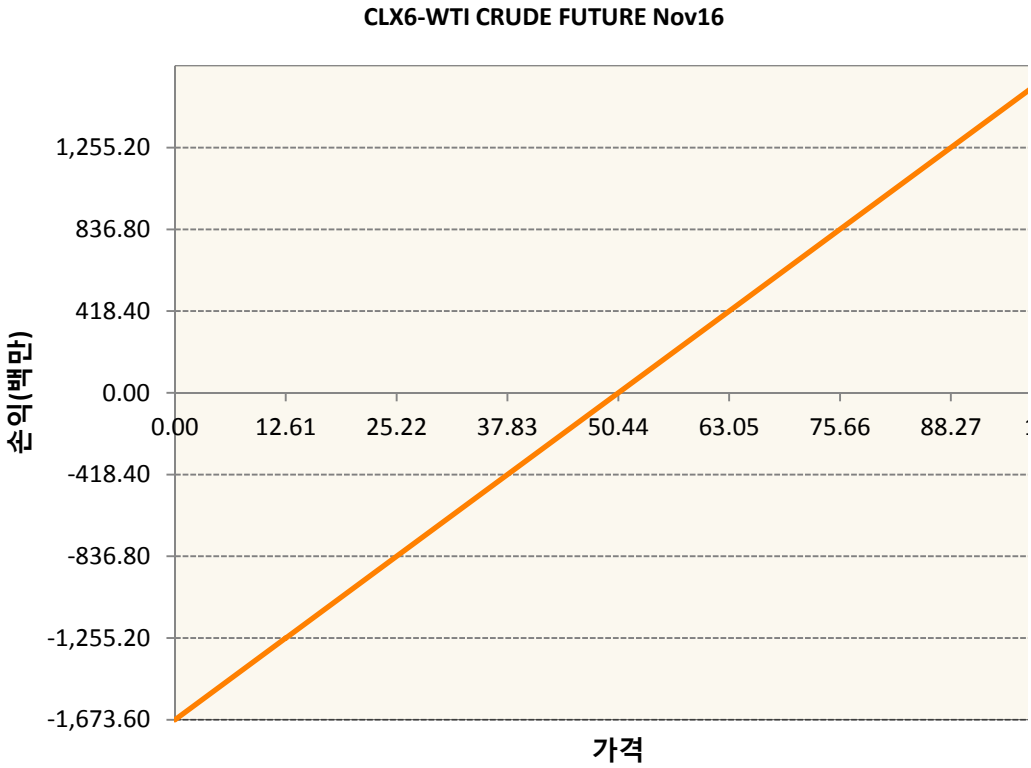
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

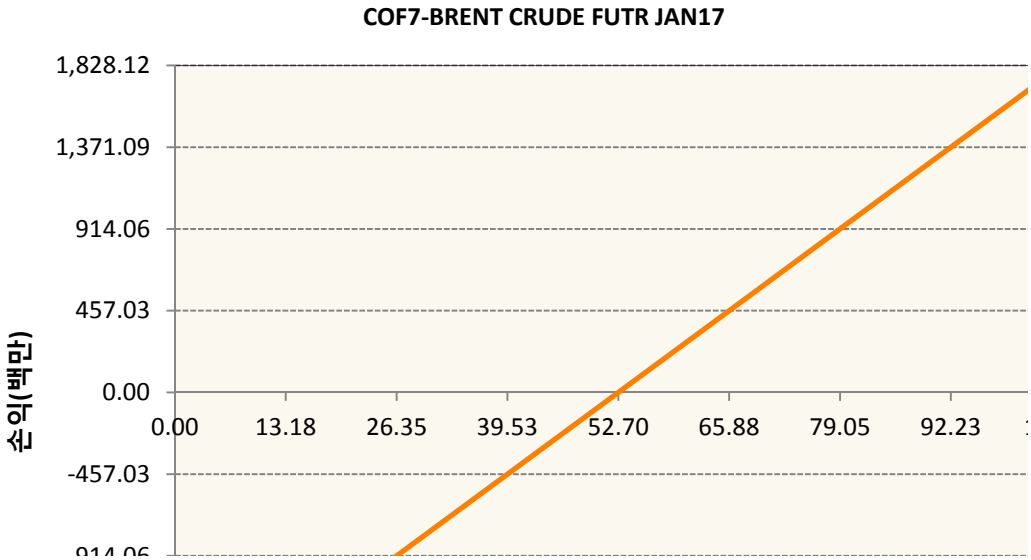
1. 계약금액

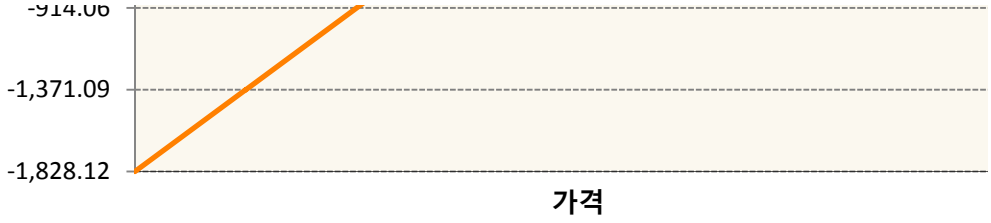
(단위:백만원)

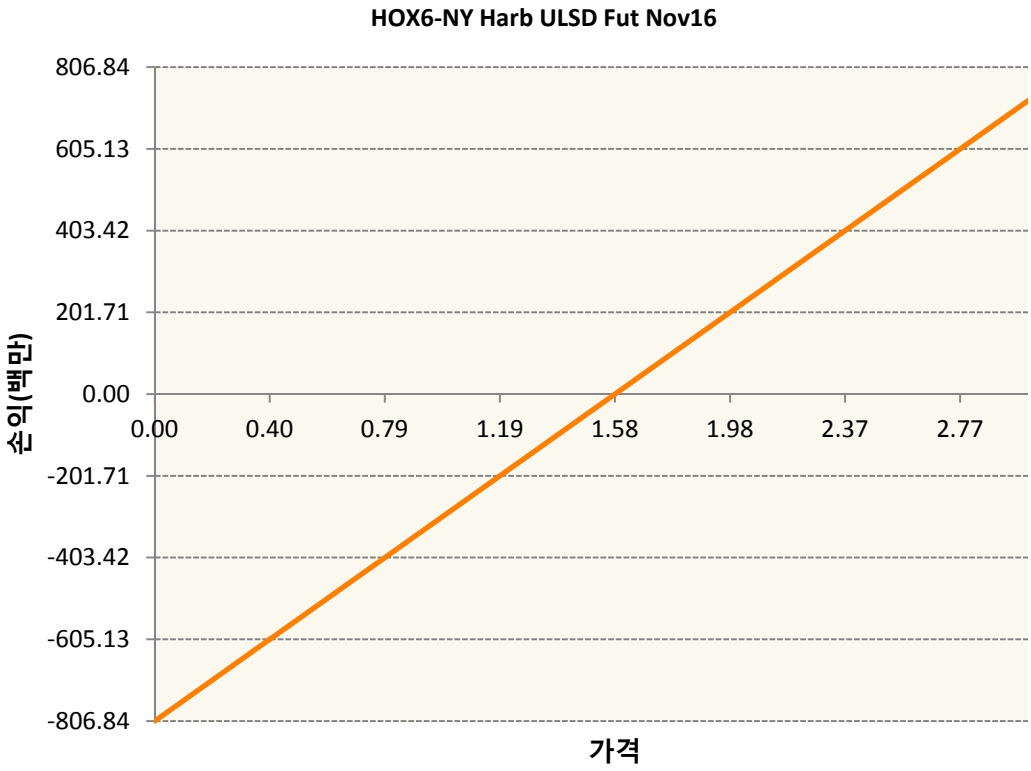
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	6,961	0	6,961	

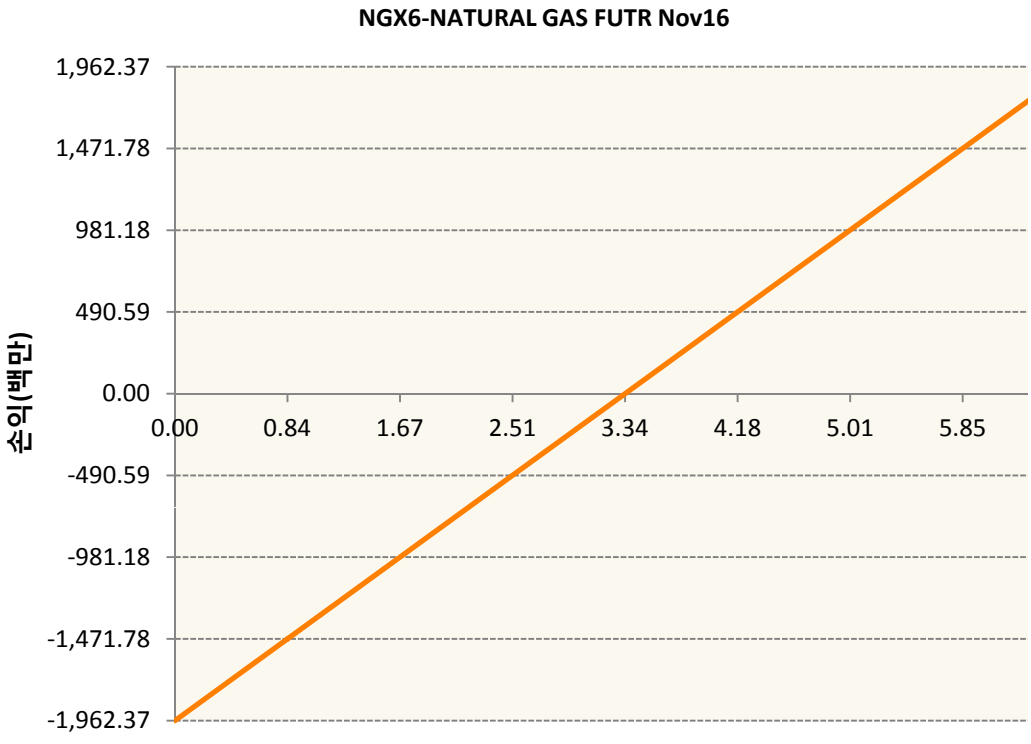
2. 만기시점의 손익구조



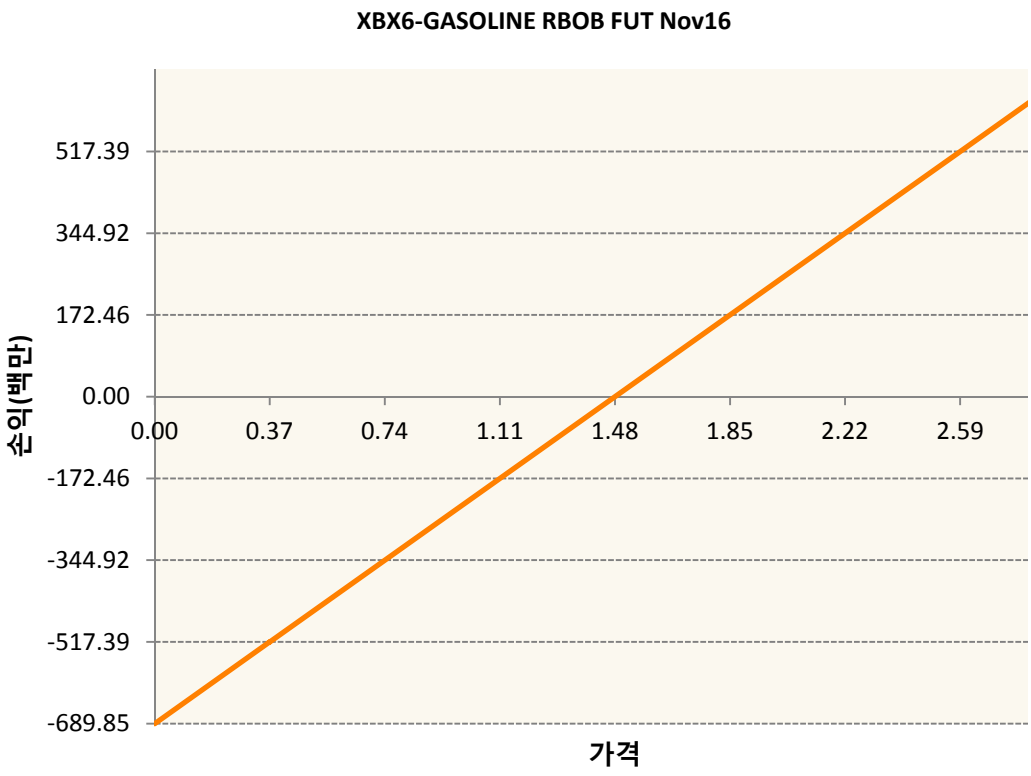



-914.06
-1,371.09
-1,828.12
가격


HOX6-NY Harb ULSD Fut Nov16
806.84
605.13
403.42
201.71
0.00
-201.71
-403.42
-605.13
-806.84
0.00
0.40
0.79
1.19
1.58
1.98
2.37
2.77
손익(백만)
가격


NGX6-NATURAL GAS FUTR Nov16
1,962.37
1,471.78
981.18
490.59
0.00
-490.59
-981.18
-1,471.78
-1,962.37
0.00
0.84
1.67
2.51
3.34
4.18
5.01
5.85
손익(백만)

가격



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
CLX6	WTI CRUDE FUTURE Nov16	134
COF7	BRENT CRUDE FUTR JAN17	146
HOX6	NY Harb ULSD Fut Nov16	65
NGX6	NATURAL GAS FUTR Nov16	157
XBX6	GASOLINE RBOB FUT Nov16	55

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,241

공시일	2016-10-17
기준일	2016-10-14

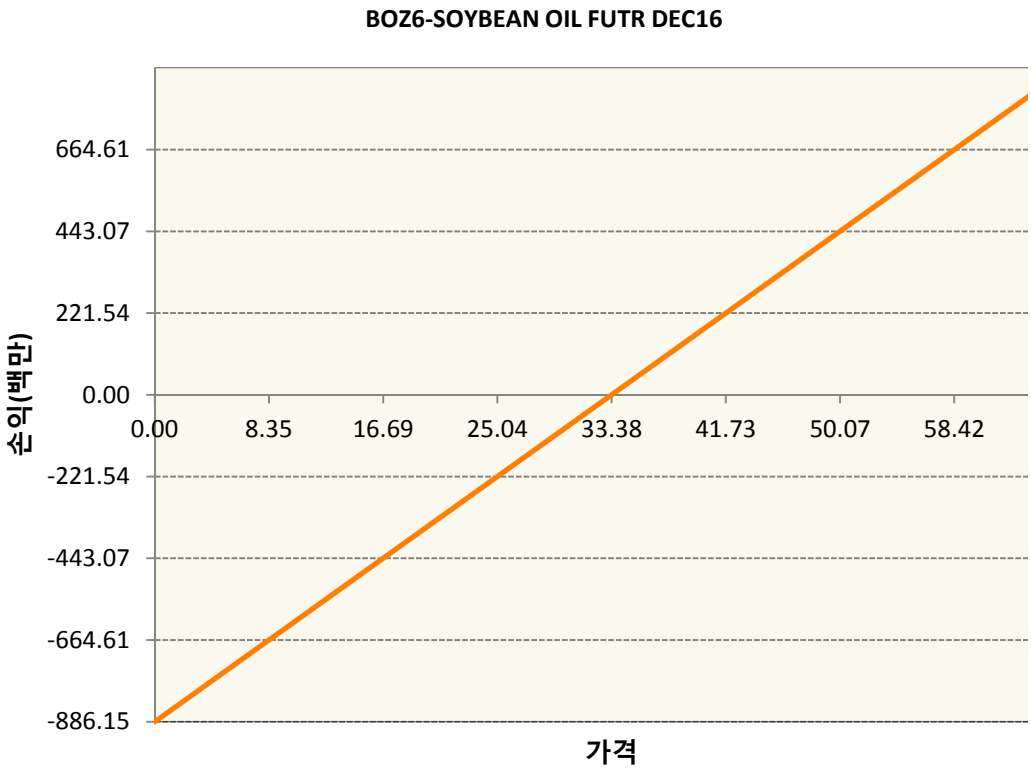
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

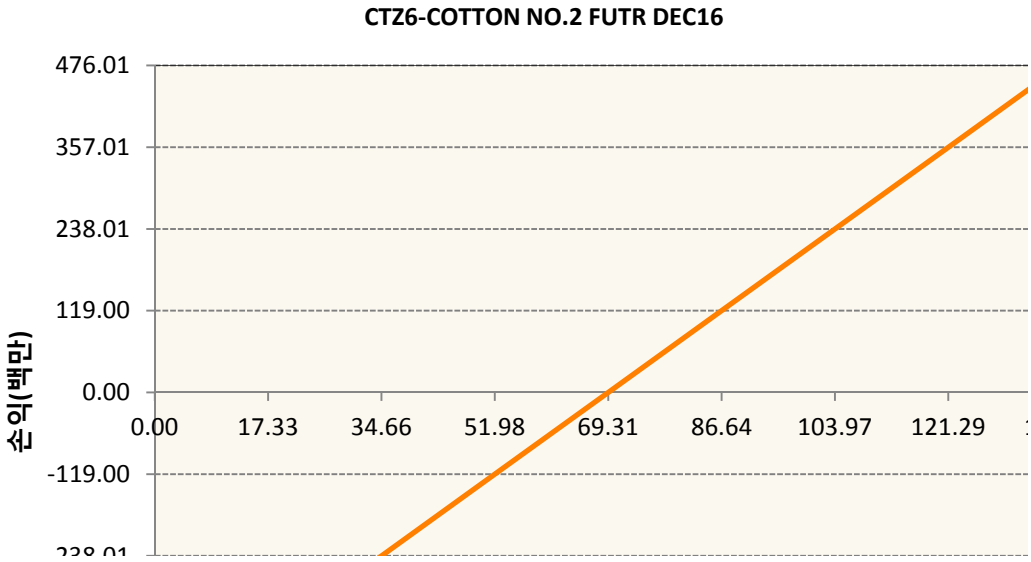
1. 계약금액

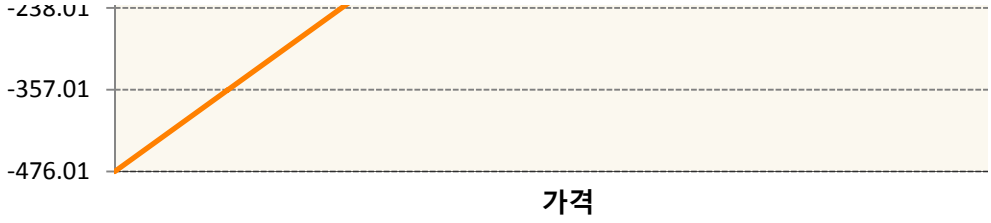
(단위:백만원)

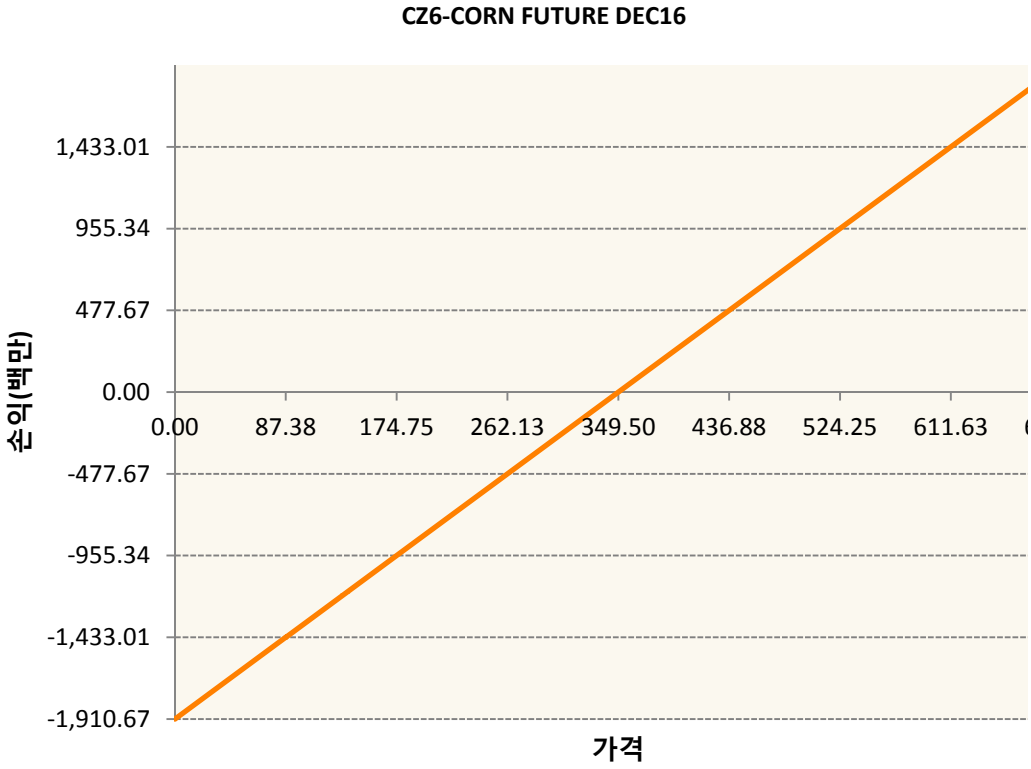
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	9,368	0	9,368	

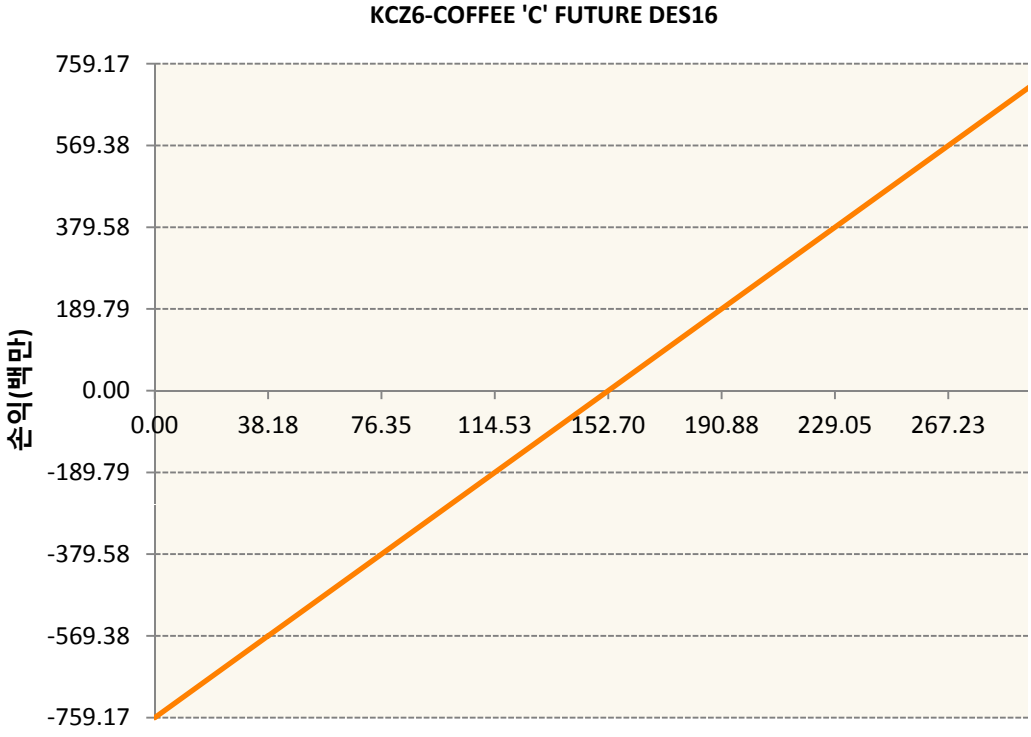
2. 만기시점의 손익구조



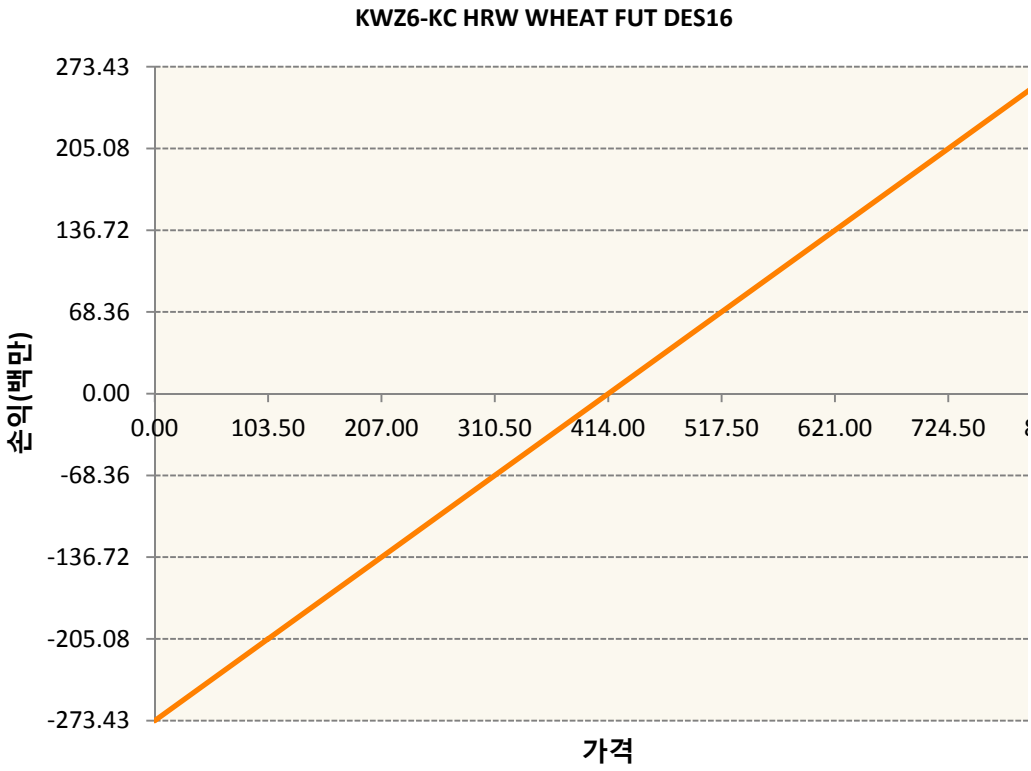


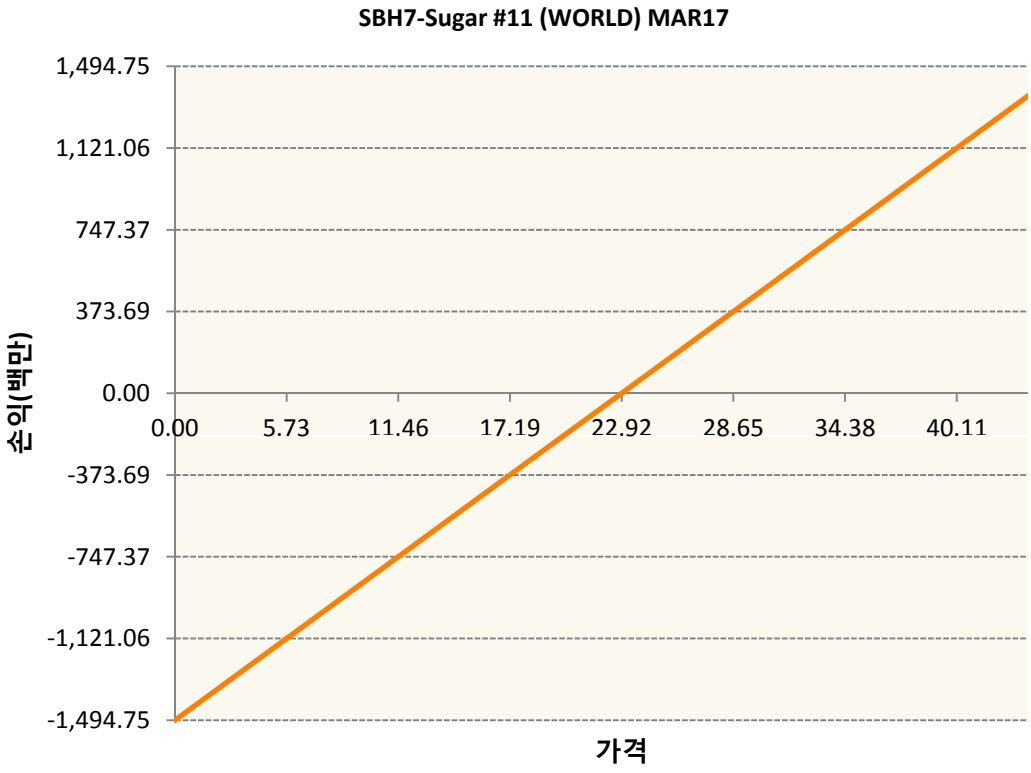

-357.01
-476.01
가격

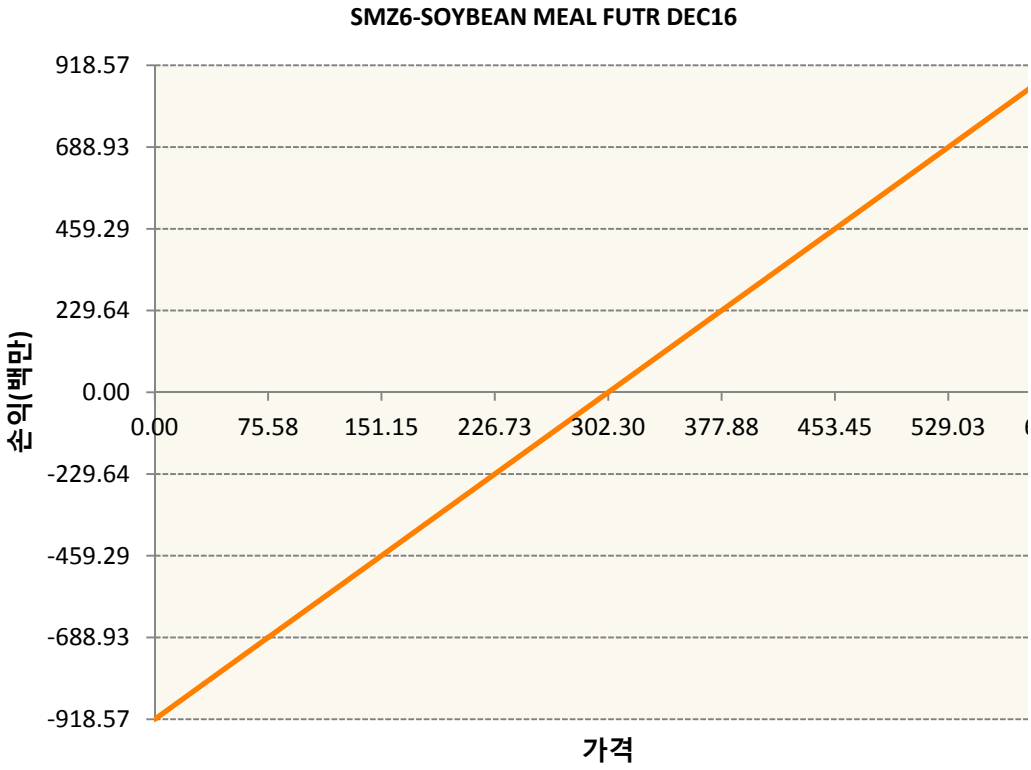

CZ6-CORN FUTURE DEC16
1,433.01
955.34
477.67
0.00
-477.67
-955.34
-1,433.01
-1,910.67
0.00
87.38
174.75
262.13
349.50
436.88
524.25
611.63
손익(백만)
가격

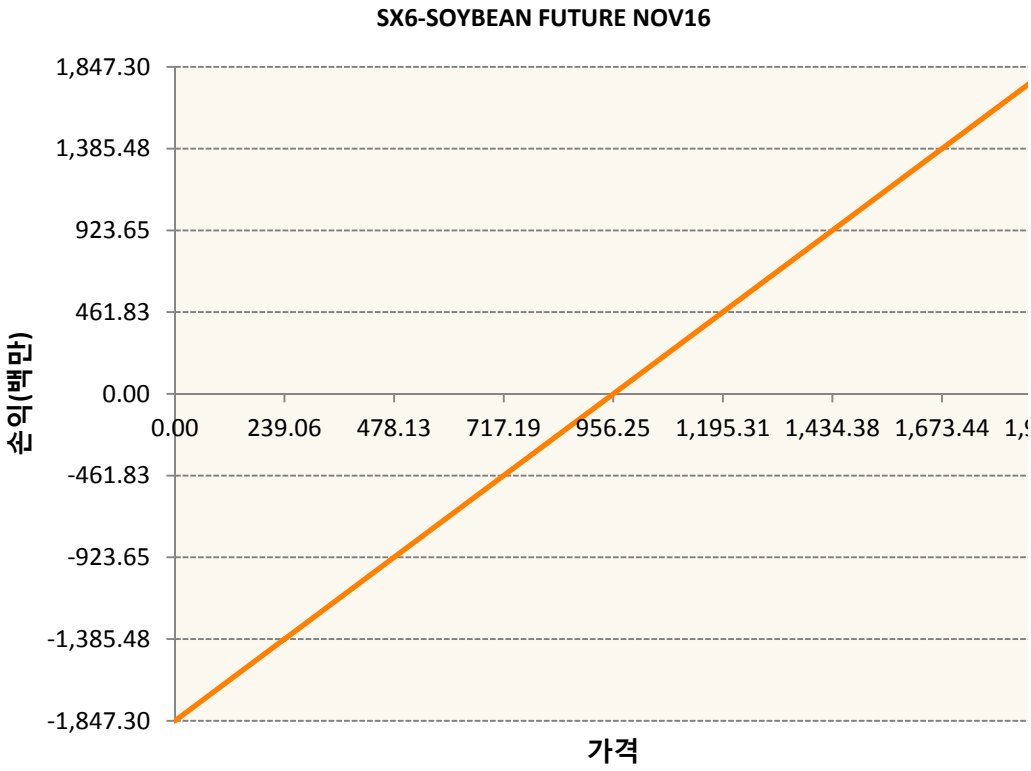

KCZ6-COFFEE 'C' FUTURE DES16
759.17
569.38
379.58
189.79
0.00
-189.79
-379.58
-569.38
-759.17
0.00
38.18
76.35
114.53
152.70
190.88
229.05
267.23
손익(백만)

가격

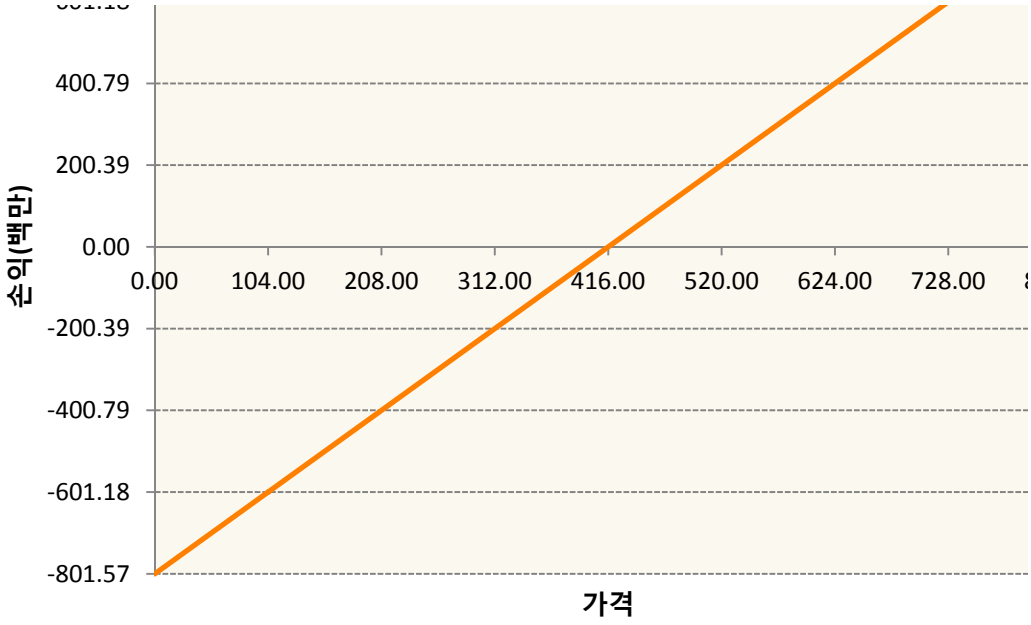

KWZ6-KC HRW WHEAT FUT DES16
273.43
205.08
136.72
68.36
0.00
-68.36
-136.72
-205.08
-273.43
0.00
103.50
207.00
310.50
414.00
517.50
621.00
724.50
손익(백만)
가격


SBH7-Sugar #11 (WORLD) MAR17
1,494.75
1,121.06
747.37
373.69
0.00
-373.69
-747.37
-1,121.06
-1,494.75
0.00
5.73
11.46
17.19
22.92
28.65
34.38
40.11
손익(백만)
가격


SMZ6-SOYBEAN MEAL FUTR DEC16
918.57
688.93
459.29
229.64
0.00
-229.64
-459.29
-688.93
-918.57
0.00
75.58
151.15
226.73
302.30
377.88
453.45
529.03
손익(백만)
가격


SX6-SOYBEAN FUTURE NOV16
1,847.30
1,385.48
923.65
461.83
0.00
-461.83
-923.65
-1,385.48
-1,847.30
0.00
239.06
478.13
717.19
956.25
1,195.31
1,434.38
1,673.44
손익(백만)
가격


WZ6-WHEAT FUTURE(CBT) DEC16
601.18



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

BOZ6	SOYBEAN OIL FUTR DEC16	71
CTZ6	COTTON NO.2 FUTR DEC16	38
CZ6	CORN FUTURE DEC16	153
KCZ6	COFFEE 'C' FUTURE DES16	61
KWZ6	KC HRW WHEAT FUT DES16	22
SBH7	Sugar #11 (WORLD) MAR17	120
SMZ6	SOYBEAN MEAL FUTR DEC16	73
SX6	SOYBEAN FUTURE NOV16	148
WZ6	WHEAT FUTURE(CBT) DEC16	64

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

941