공시일	2016-10-18
기준일	2016-10-17

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	2016-10-18
기준일	2016-10-17

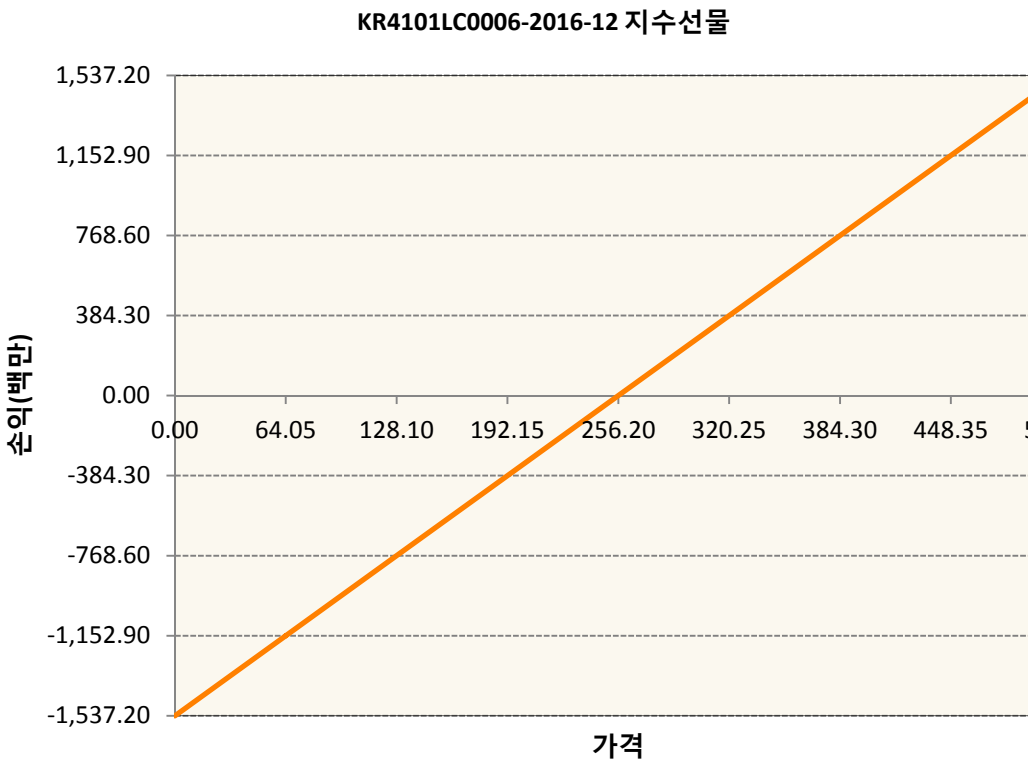
스마트인덱스모

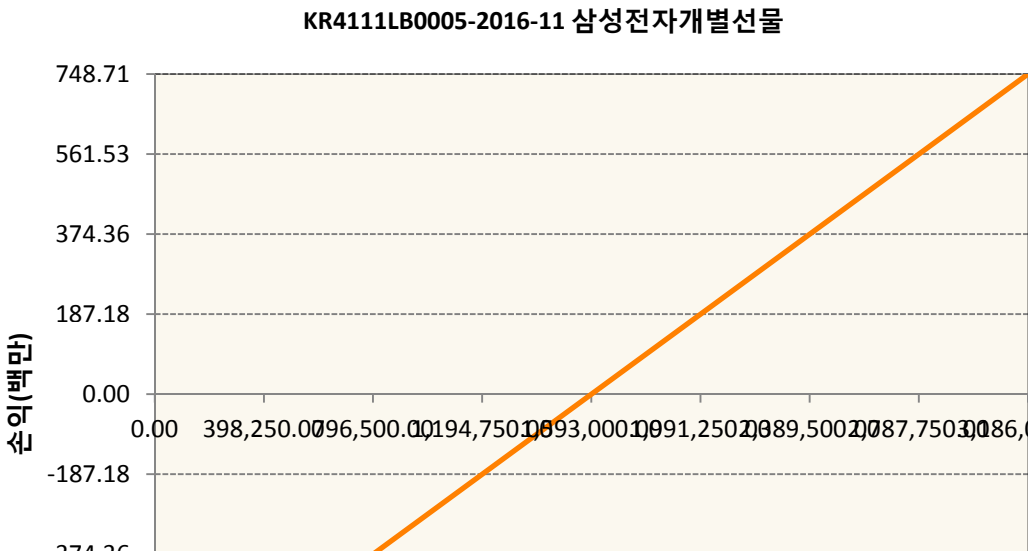
1. 계약금액

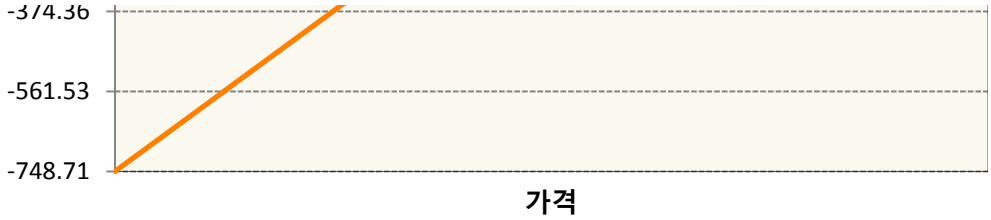
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	128	0	128	장내
누계	유가증권	선물	2,286	0	2,286	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101LC00 2016-12 지수선물							123
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-123	-123	-123	-123	-123	-123	-123
-5.33%	-82	-82	-82	-82	-82	-82	-82
-2.67%	-41	-41	-41	-41	-41	-41	-41
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	41	41	41	41	41	41	41
5.33%	82	82	82	82	82	82	82
8.00%	123	123	123	123	123	123	123
KR4111LB00 2016-11 삼성전자개별선물							60
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-60	-60	-60	-60	-60	-60	-60
-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%	60	60	60	60	60	60	60

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

160

공시일	2016-10-18
기준일	2016-10-17

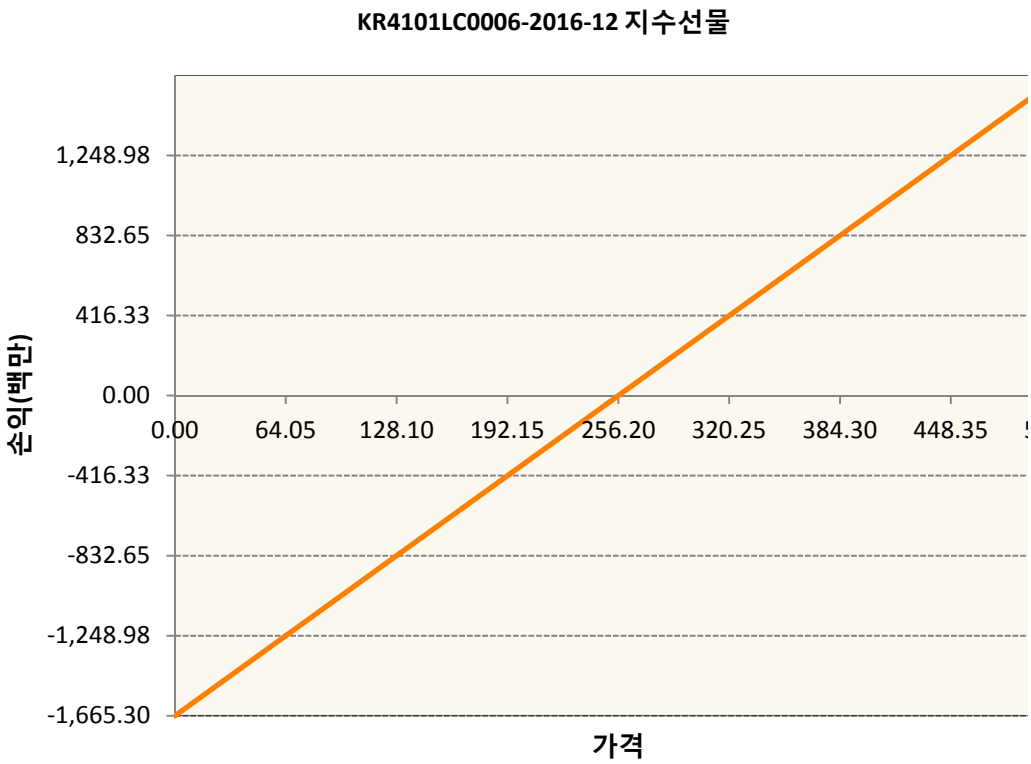
스마트레버리지목표전환형1호

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	1,665	0	1,665	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%	-89	-89	-89	-89	-89	-89	-89
-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%	89	89	89	89	89	89	89
8.00%	133	133	133	133	133	133	133

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

101

공시일	2016-10-18
기준일	2016-10-17

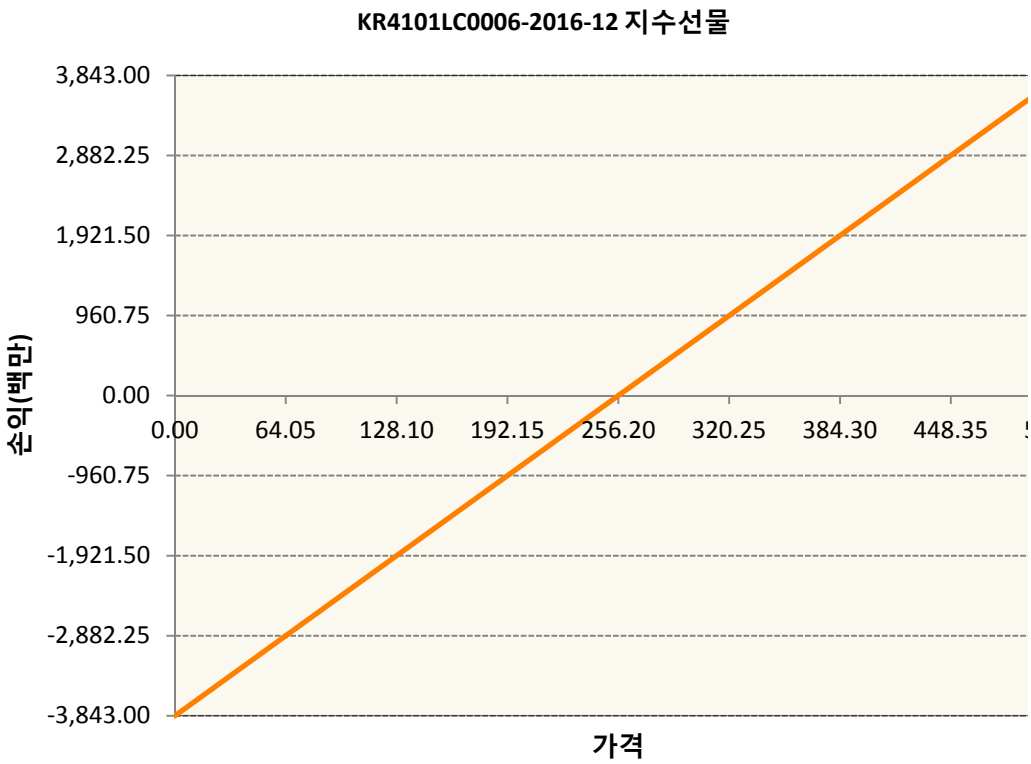
1.3배 레버리지 인덱스(주식-파생형)

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	3,843	0	3,843	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101LC00 2016-12 지수선물							307
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-307	-307	-307	-307	-307	-307	-307
-5.33%	-205	-205	-205	-205	-205	-205	-205
-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%	205	205	205	205	205	205	205
8.00%	307	307	307	307	307	307	307

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

232

공시일	2016-10-18
기준일	2016-10-17

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	871

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

713

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2016-10-18
기준일	2016-10-17

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)

794

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2016-10-18
기준일	2016-10-17

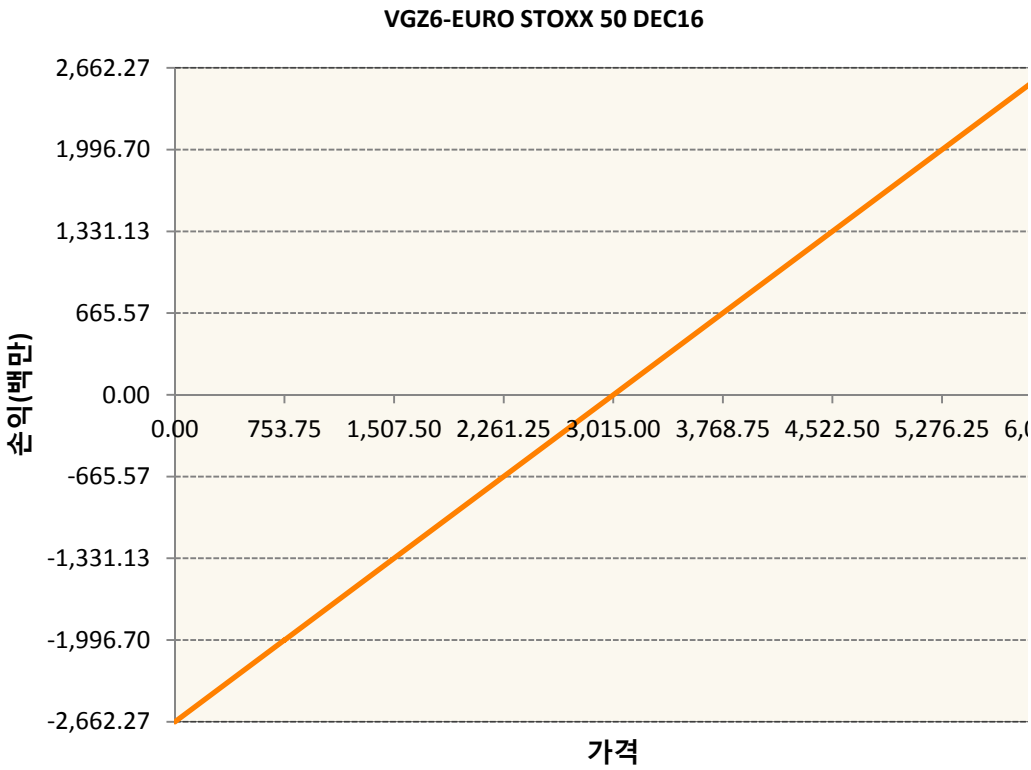
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,662	0	2,662	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGZ6	EURO STOXX 50 DEC16	213

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

(단위:백만원)

259

공시일	2016-10-18
기준일	2016-10-17

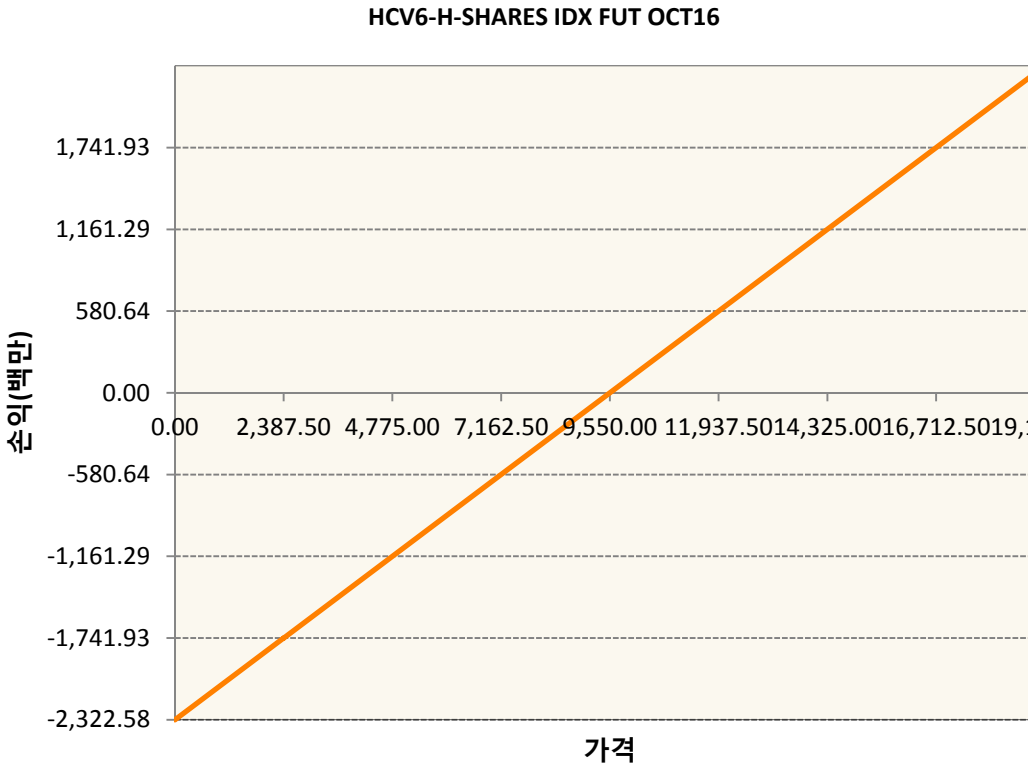
차이나인덱스모(주식-파생형)

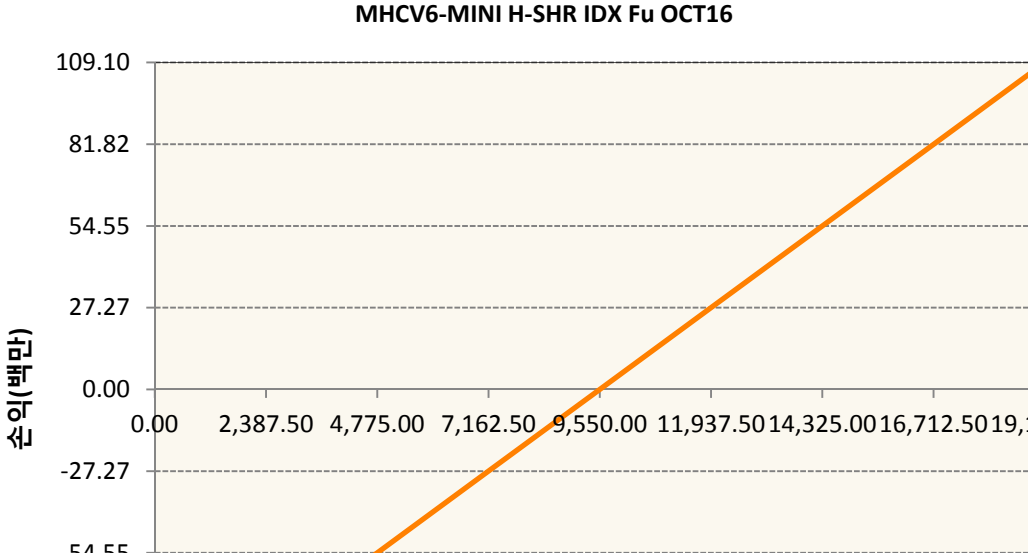
1. 계약금액

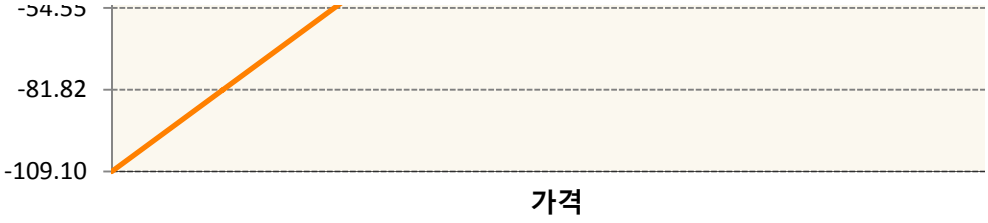
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,432	0	2,432	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCV6	H-SHARES IDX FUT OCT16	186
MHCV6	MINI H-SHR IDX Fu OCT16	9

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	263

공시일	2016-10-18
기준일	2016-10-17

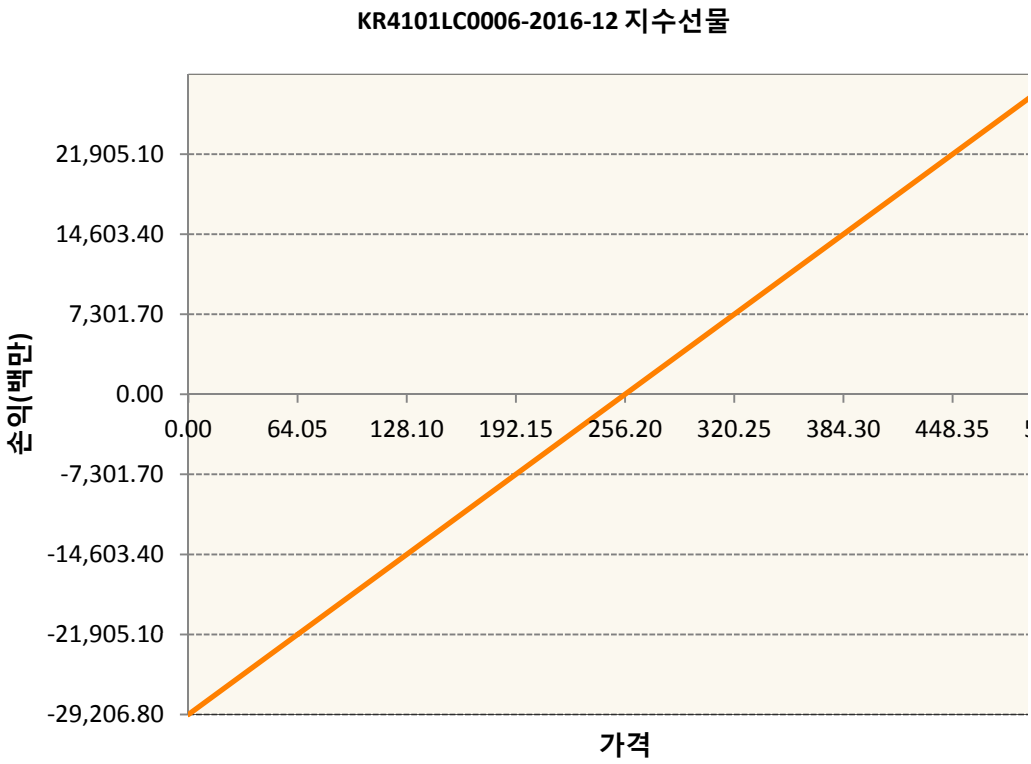
커버드콜(주식혼합-파생형)

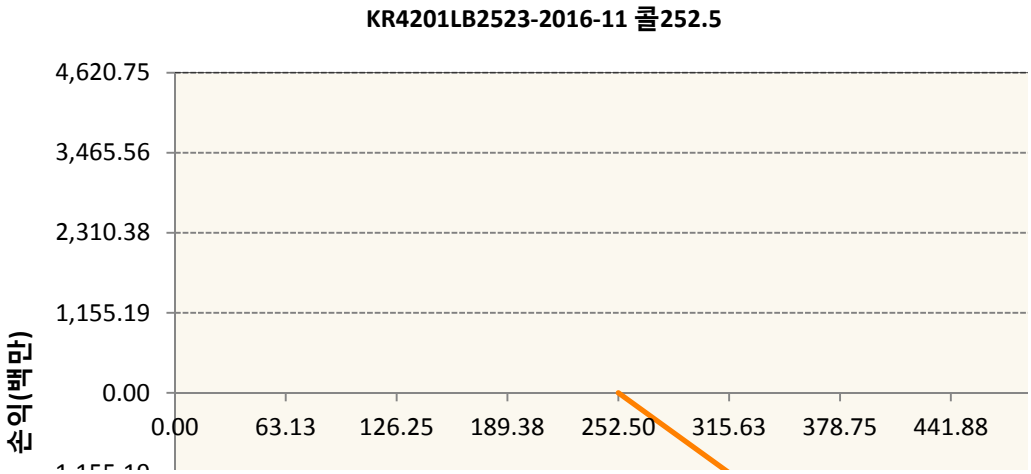
1. 계약금액

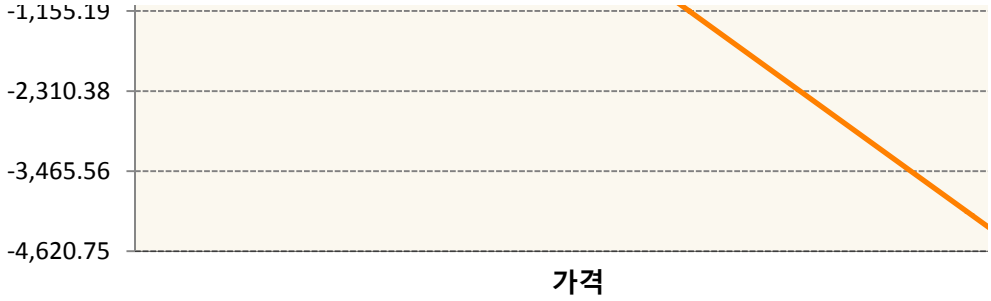
(단위:백만원)

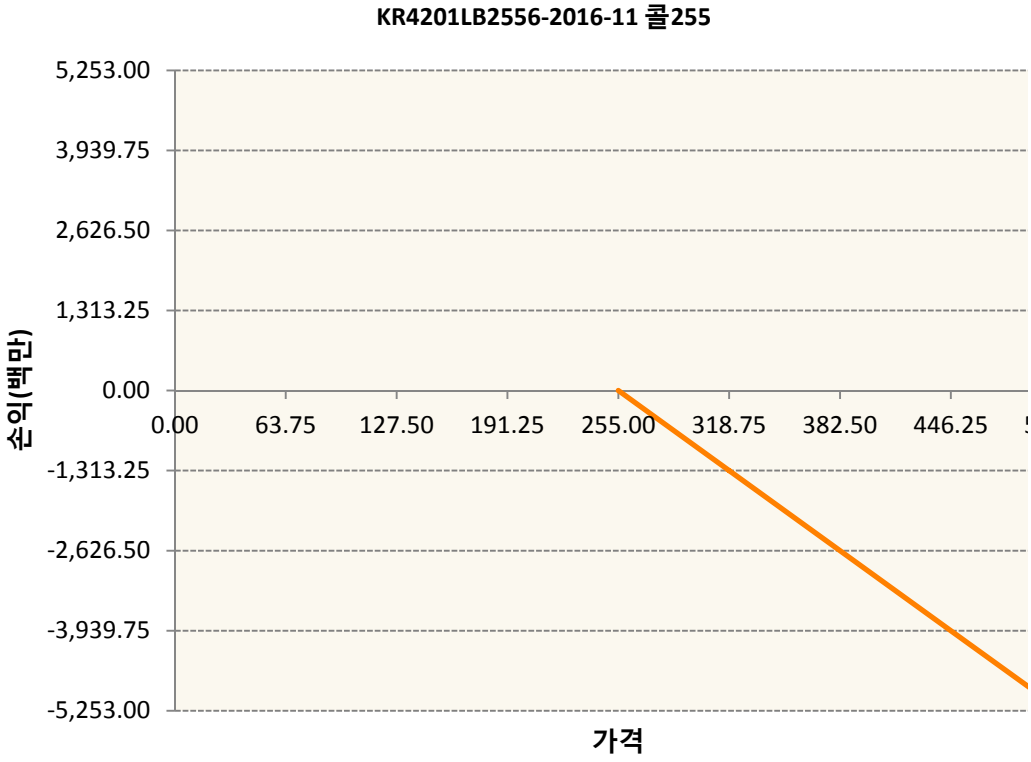
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	1,922	0	1,922	장내
신규	유가증권	옵션	0	388	-388	장내
누계	유가증권	선물	29,207	0	29,207	장내
누계	유가증권	옵션	0	9,874	-9,874	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101LC00 2016-12 지수선물							2,336
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-2,336	-2,336	-2,336	-2,336	-2,336	-2,336	-2,336
-5.33%	-1,558	-1,558	-1,558	-1,558	-1,558	-1,558	-1,558
-2.67%	-779	-779	-779	-779	-779	-779	-779
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	779	779	779	779	779	779	779
5.33%	1,558	1,558	1,558	1,558	1,558	1,558	1,558
8.00%	2,336	2,336	2,336	2,336	2,336	2,336	2,336
KR4201LB25 2016-11 콜252.5							1,679
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	536	534	531	527	521	514	506
-5.33%	516	506	493	478	462	444	425
-2.67%	401	375	349	322	295	268	241
0%	78	53	27	0	-27	-54	-81
2.67%	-441	-453	-466	-481	-498	-516	-536
5.33%	-1,046	-1,049	-1,052	-1,058	-1,065	-1,073	-1,083
8.00%	-1,669	-1,669	-1,670	-1,671	-1,673	-1,675	-1,679
KR4201LB25 2016-11 콜255							1,794

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	452	451	449	447	443	437	431
-5.33%	442	435	425	414	400	384	368
-2.67%	366	342	317	291	264	236	207
0%	97	65	32	0	-32	-65	-97
2.67%	-419	-438	-459	-482	-506	-531	-557
5.33%	-1,076	-1,082	-1,089	-1,099	-1,111	-1,124	-1,139
8.00%	-1,774	-1,774	-1,776	-1,778	-1,782	-1,787	-1,794

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

5,680

공시일	2016-10-18
기준일	2016-10-17

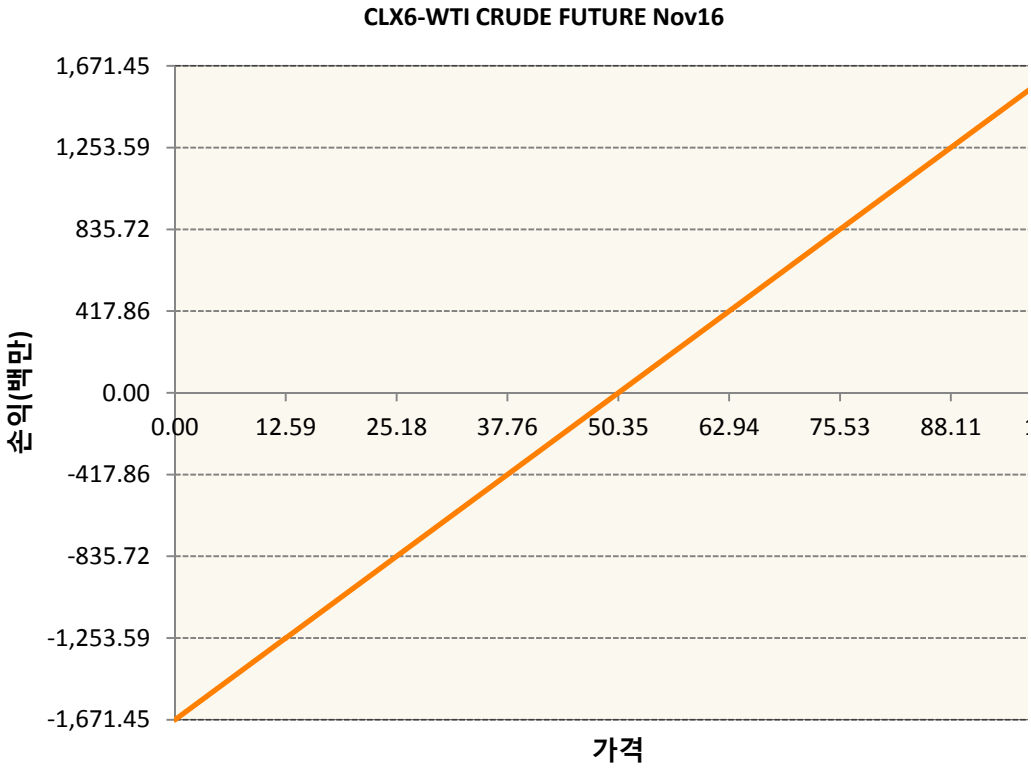
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

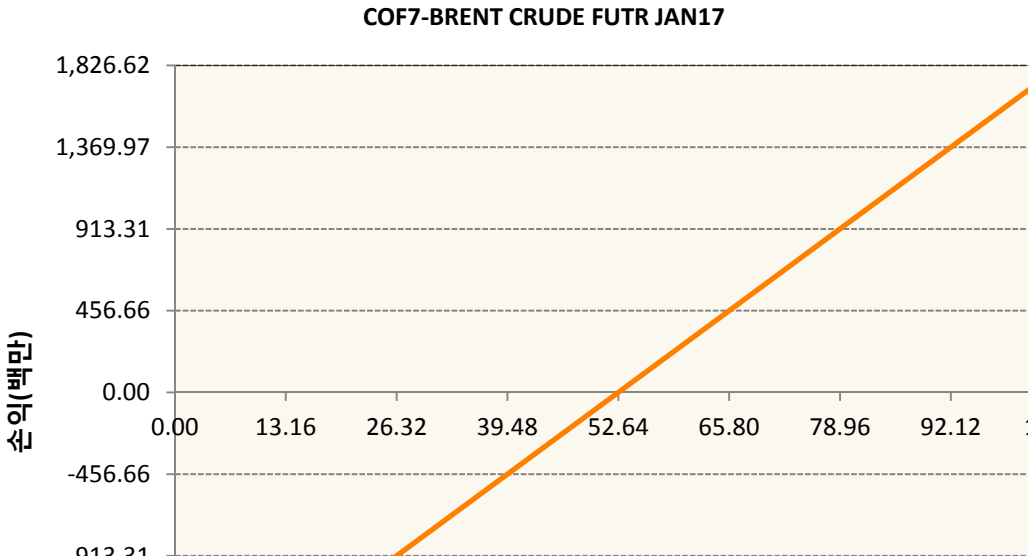
1. 계약금액

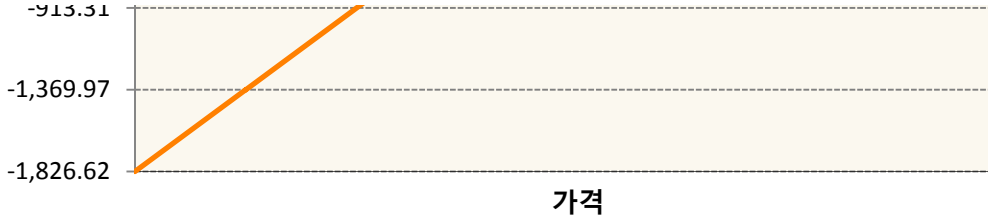
(단위:백만원)

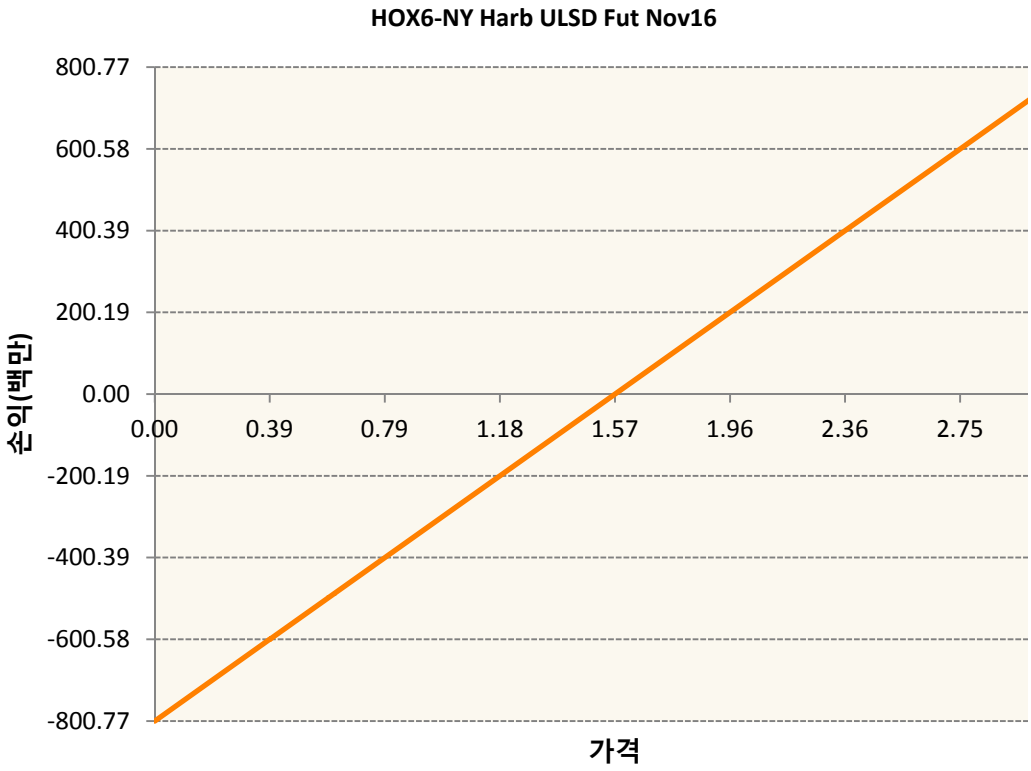
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	6,925	0	6,925	

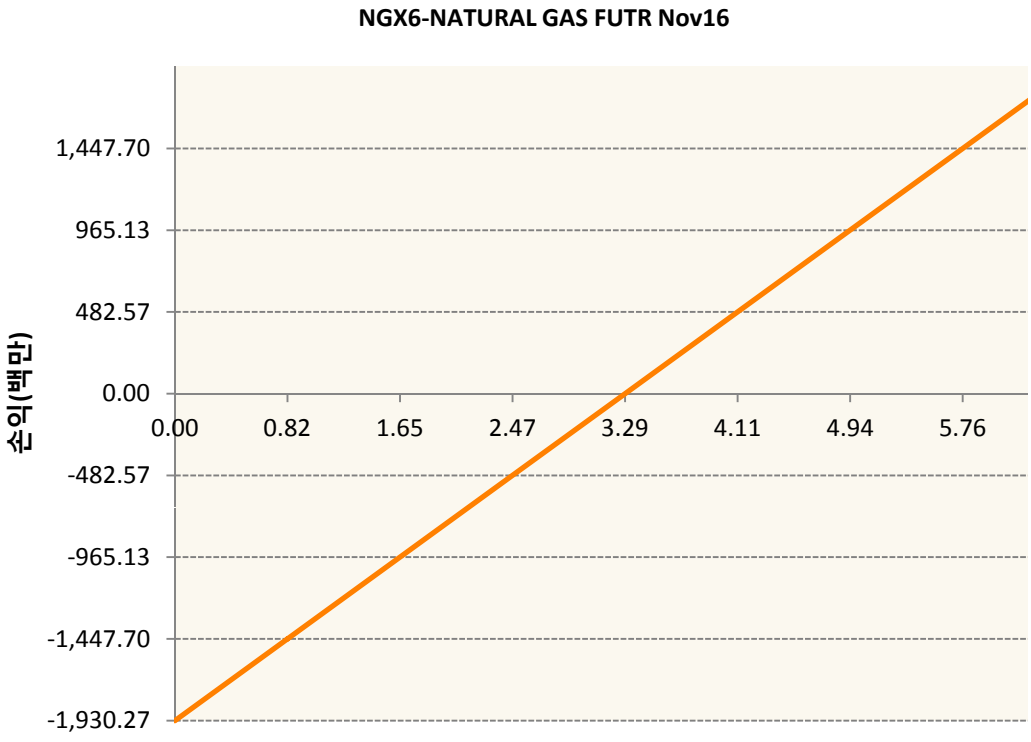
2. 만기시점의 손익구조



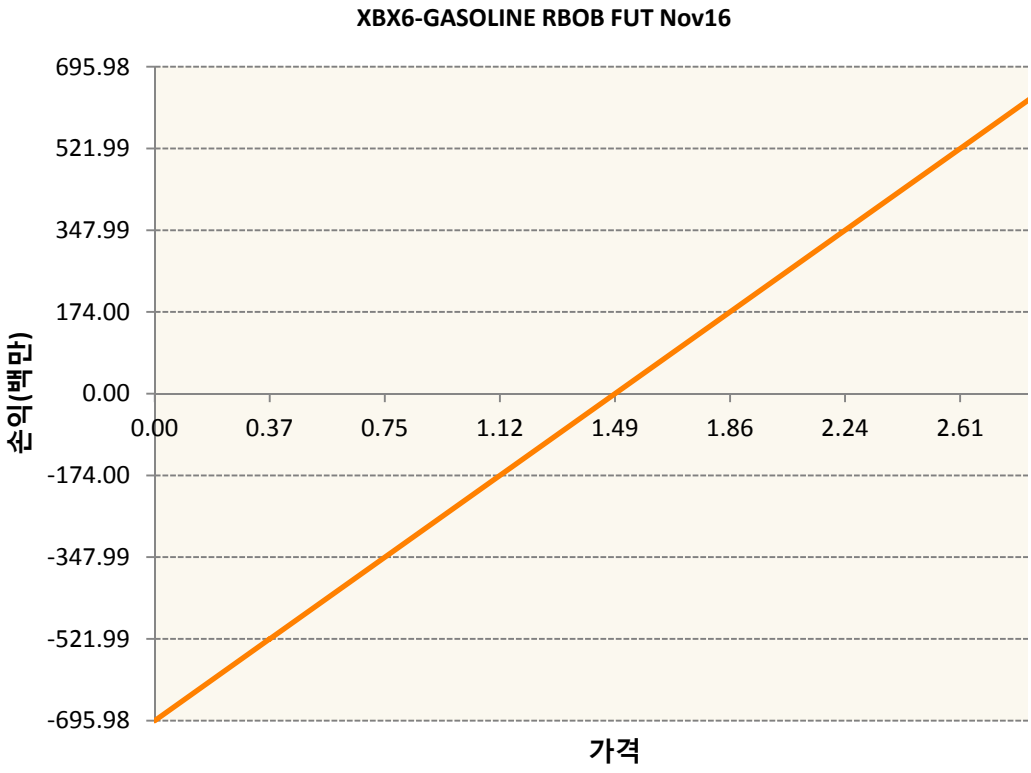



-913.31
-1,369.97
-1,826.62
가격


HOX6-NY Harb ULSD Fut Nov16
800.77
600.58
400.39
200.19
0.00
-200.19
-400.39
-600.58
-800.77
0.00
0.39
0.79
1.18
1.57
1.96
2.36
2.75
손익(백만)
가격


NGX6-NATURAL GAS FUTR Nov16
1,447.70
965.13
482.57
0.00
-482.57
-965.13
-1,447.70
-1,930.27
0.00
0.82
1.65
2.47
3.29
4.11
4.94
5.76
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	64
NGX6	NATURAL GAS FUTR Nov16	154
XBX6	GASOLINE RBOB FUT Nov16	56

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,234

공시일	2016-10-18
기준일	2016-10-17

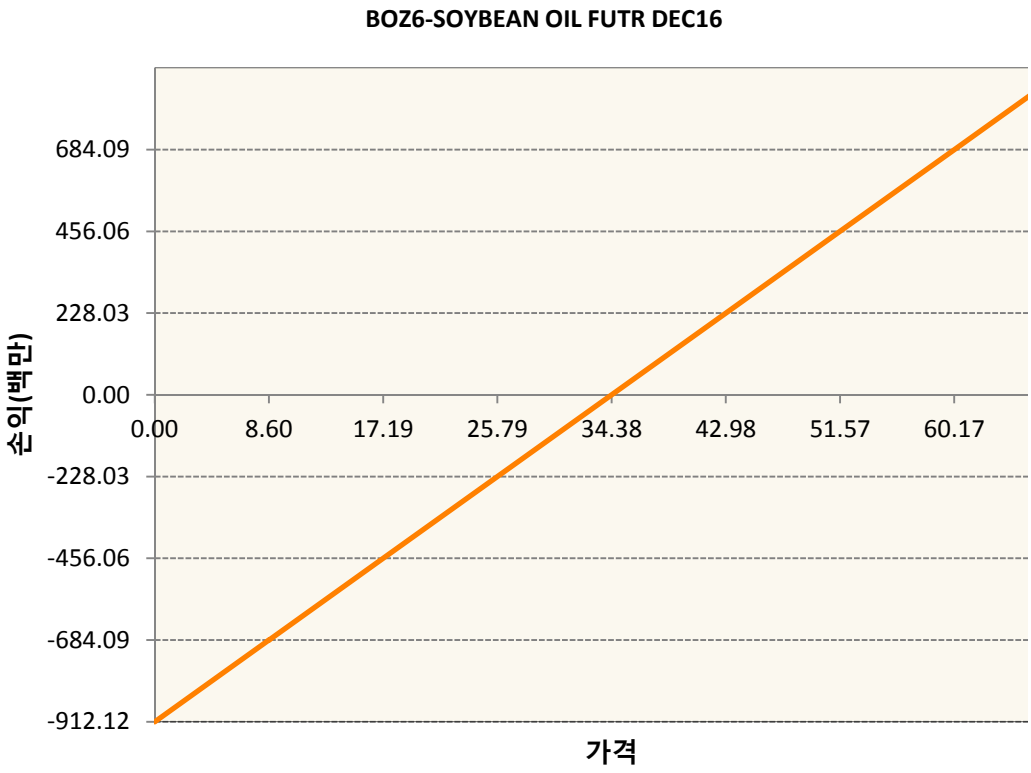
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

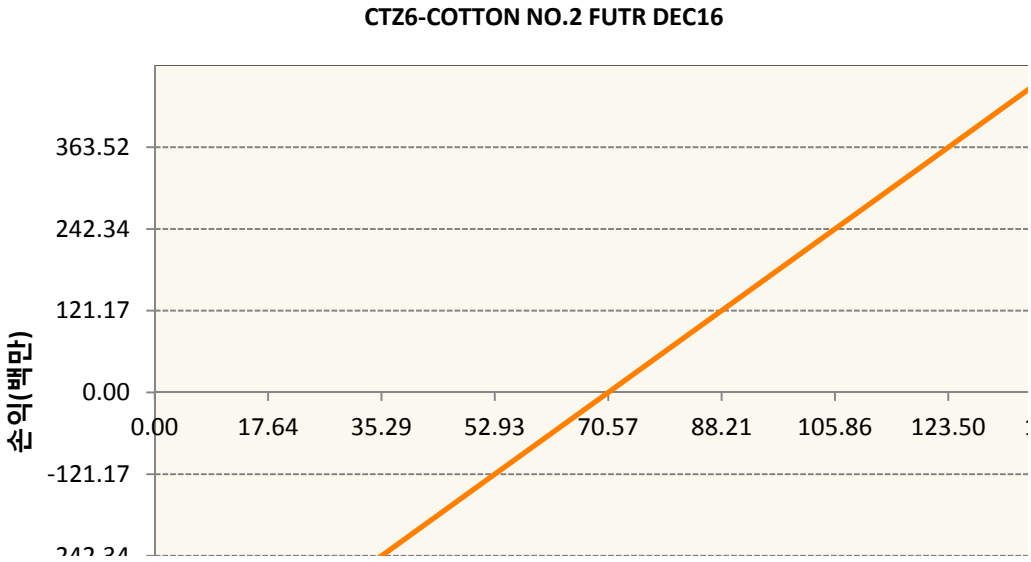
1. 계약금액

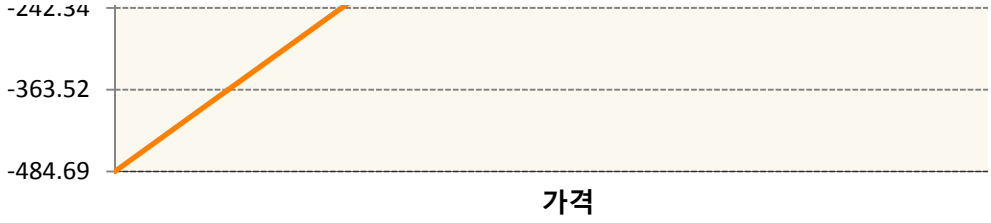
(단위:백만원)

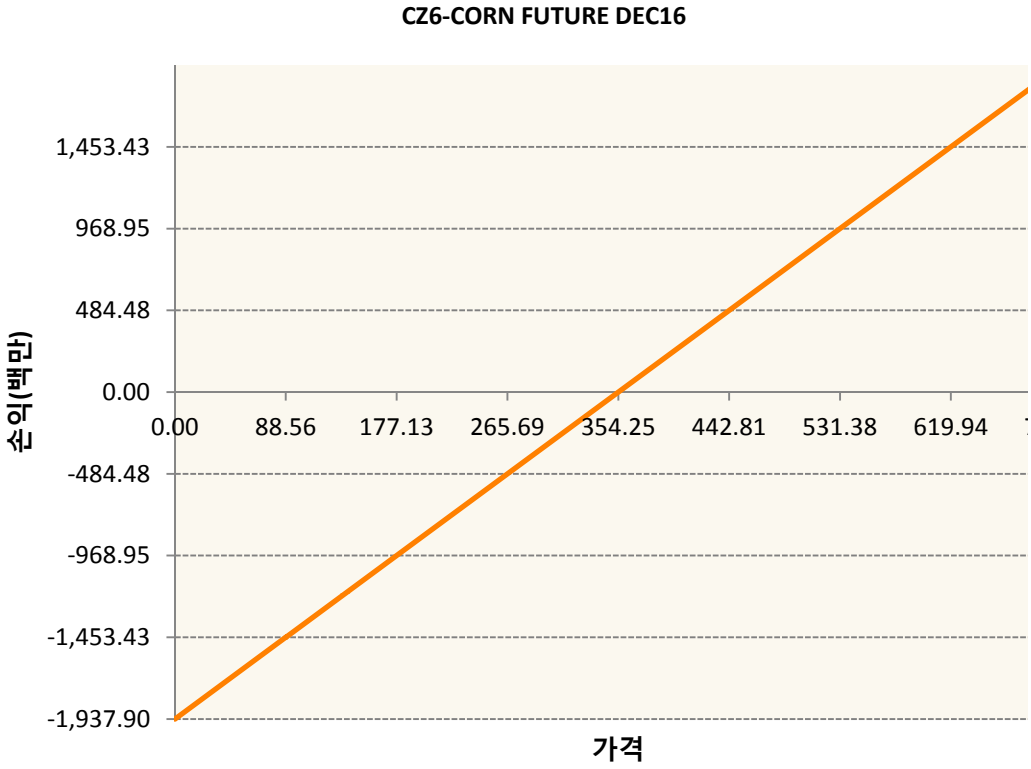
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	9,460	0	9,460	

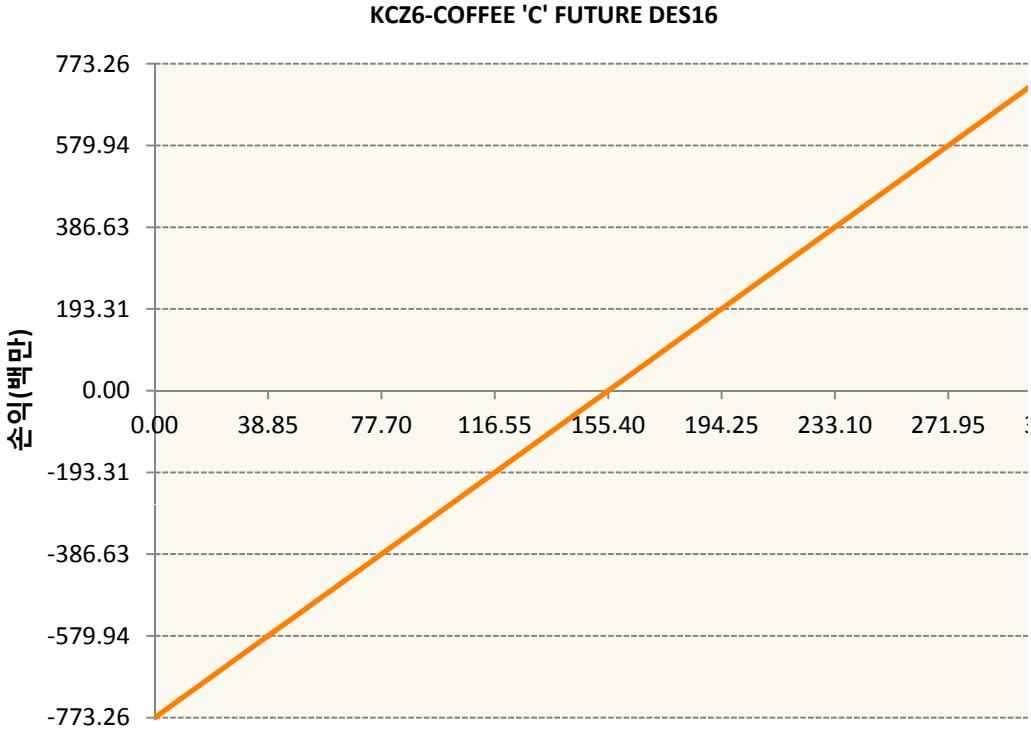
2. 만기시점의 손익구조





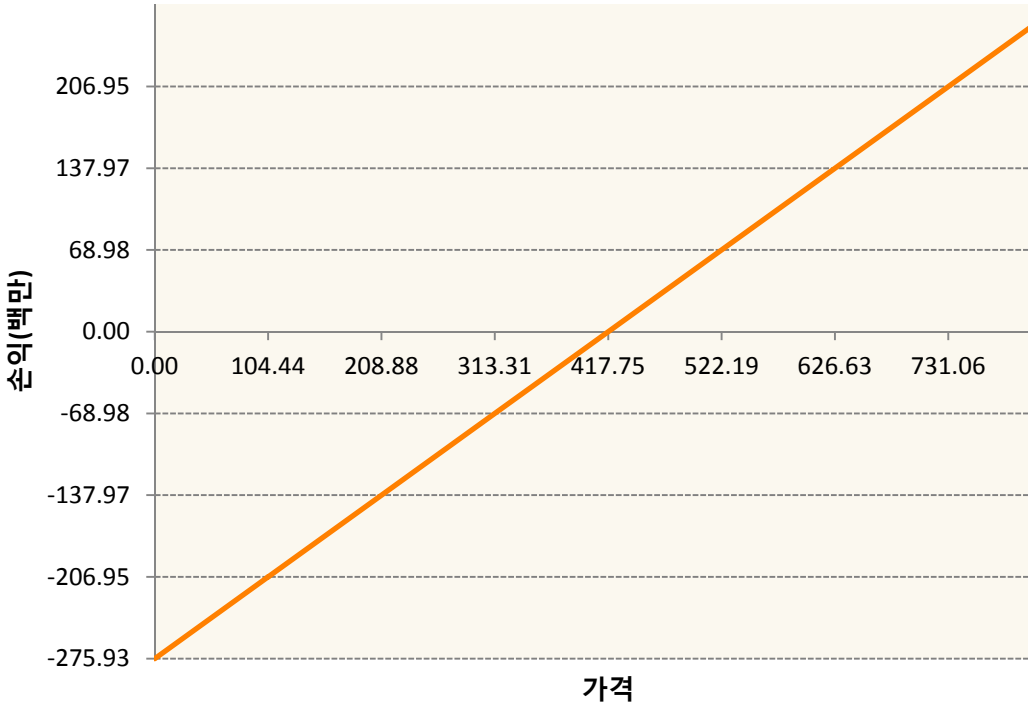

-242.34
-363.52
-484.69
가격


CZ6-CORN FUTURE DEC16
1,453.43
968.95
484.48
0.00
-484.48
-968.95
-1,453.43
-1,937.90
0.00
88.56
177.13
265.69
354.25
442.81
531.38
619.94
순익(백만)
가격

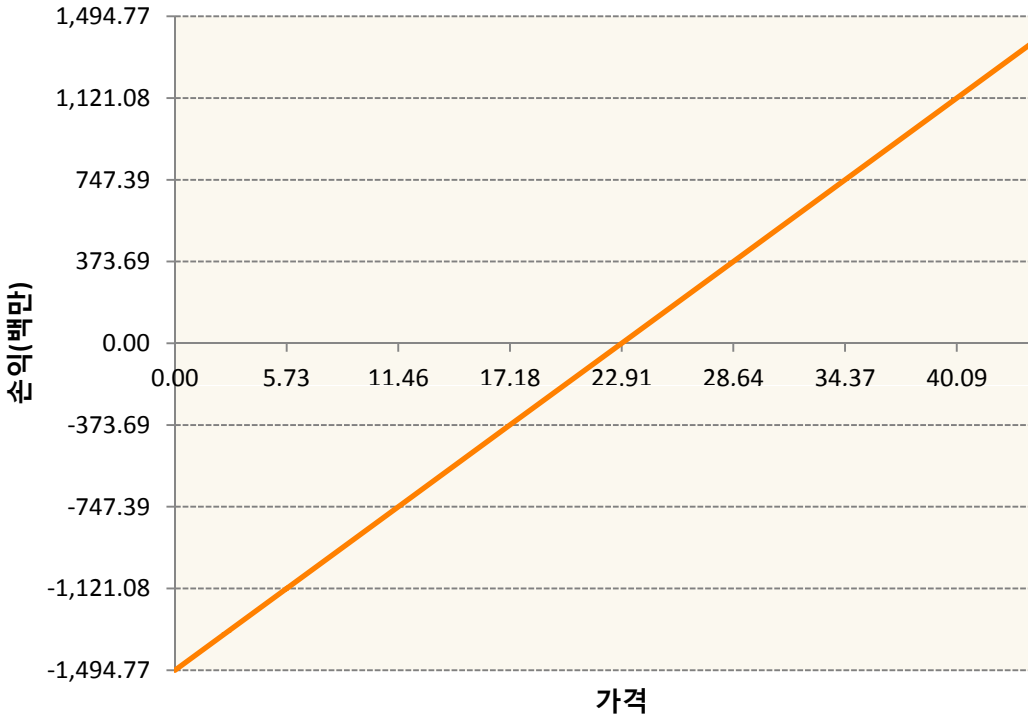

KCZ6-COFFEE 'C' FUTURE DES16
773.26
579.94
386.63
193.31
0.00
-193.31
-386.63
-579.94
-773.26
0.00
38.85
77.70
116.55
155.40
194.25
233.10
271.95
순익(백만)

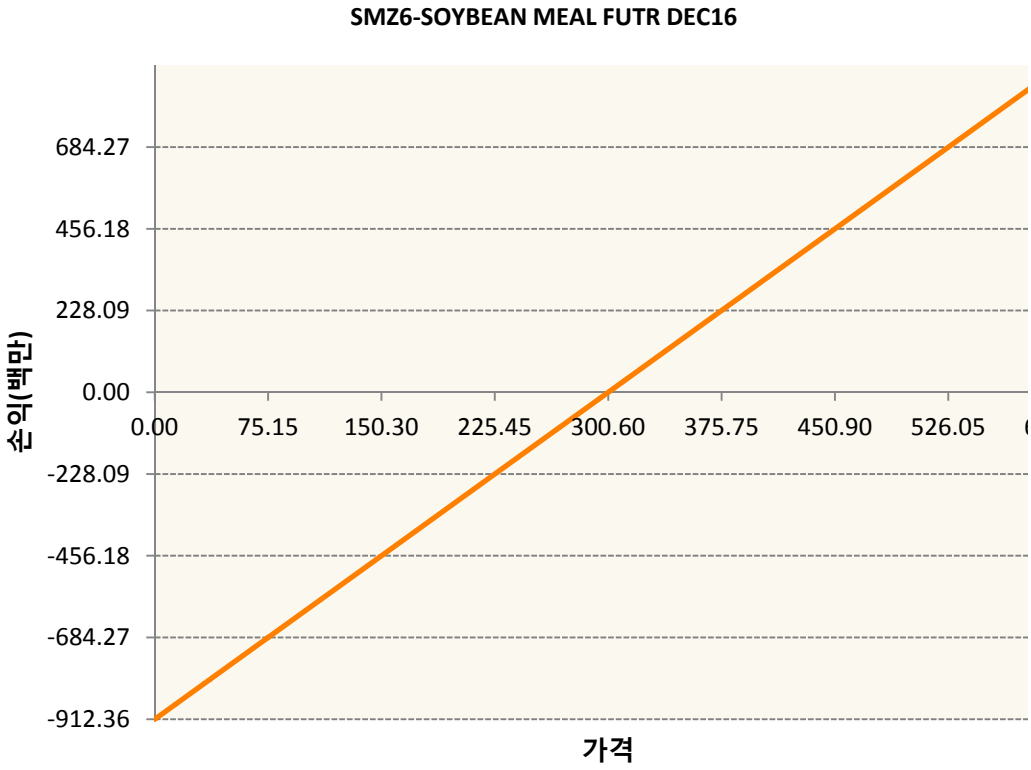
가격

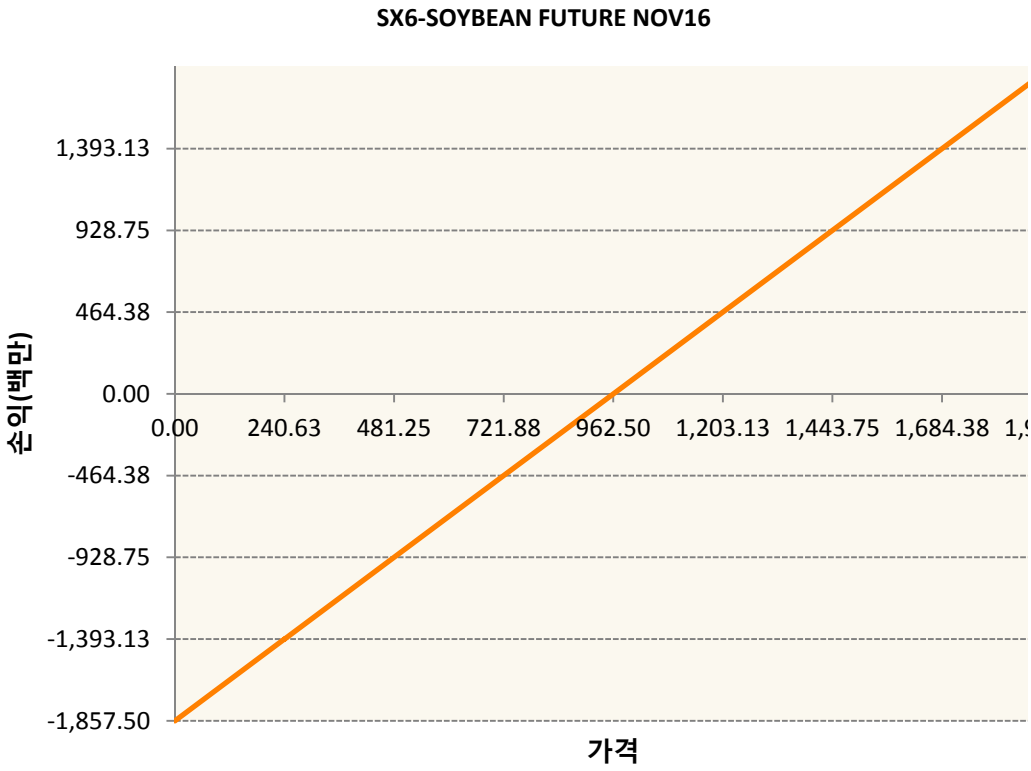
KWZ6-KC HRW WHEAT FUT DES16

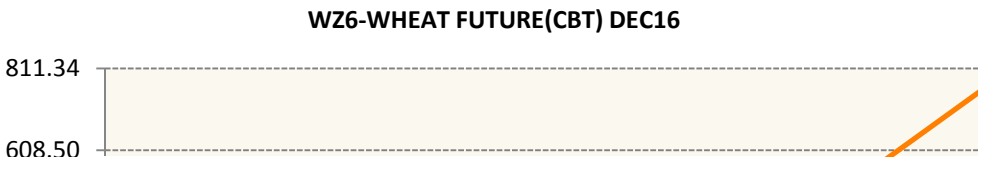


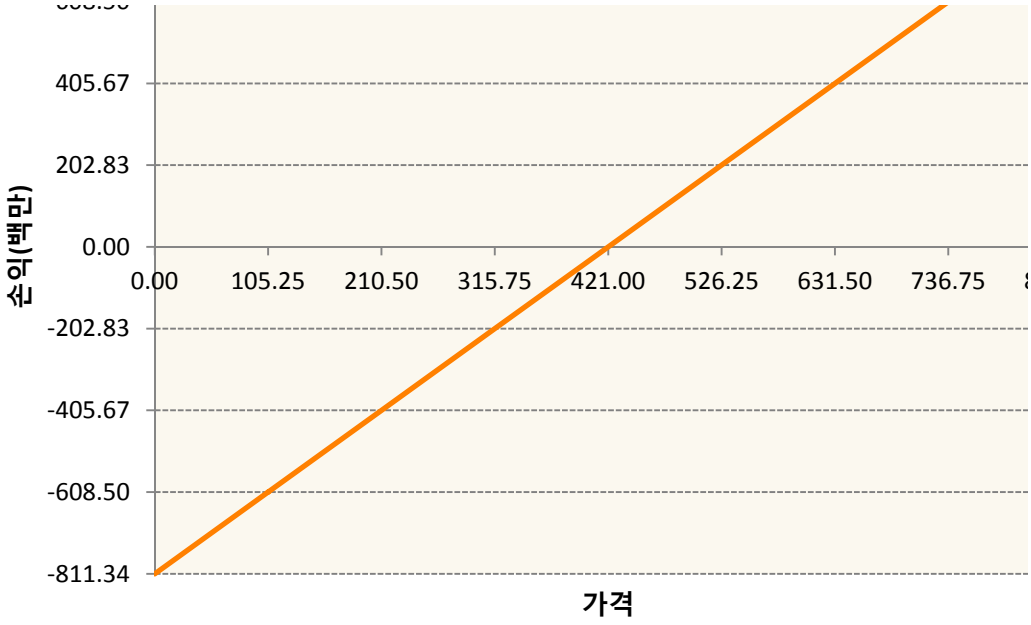
SBH7-Sugar #11 (WORLD) MAR17




SMZ6-SOYBEAN MEAL FUTR DEC16
684.27
456.18
228.09
0.00
-228.09
-456.18
-684.27
-912.36
손익(백만)
0.00
75.15
150.30
225.45
300.60
375.75
450.90
526.05
가격


SX6-SOYBEAN FUTURE NOV16
1,393.13
928.75
464.38
0.00
-464.38
-928.75
-1,393.13
-1,857.50
손익(백만)
0.00
240.63
481.25
721.88
962.50
1,203.13
1,443.75
1,684.38
가격


WZ6-WHEAT FUTURE(CBT) DEC16
811.34
608.50



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

BOZ6	SOYBEAN OIL FUTR DEC16	73
CTZ6	COTTON NO.2 FUTR DEC16	39
CZ6	CORN FUTURE DEC16	155
KCZ6	COFFEE 'C' FUTURE DES16	62
KWZ6	KC HRW WHEAT FUT DES16	22
SBH7	Sugar #11 (WORLD) MAR17	120
SMZ6	SOYBEAN MEAL FUTR DEC16	73
SX6	SOYBEAN FUTURE NOV16	149
WZ6	WHEAT FUTURE(CBT) DEC16	65

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

949