공시일	2016-10-20
기준일	2016-10-19

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	2016-10-20
기준일	2016-10-19

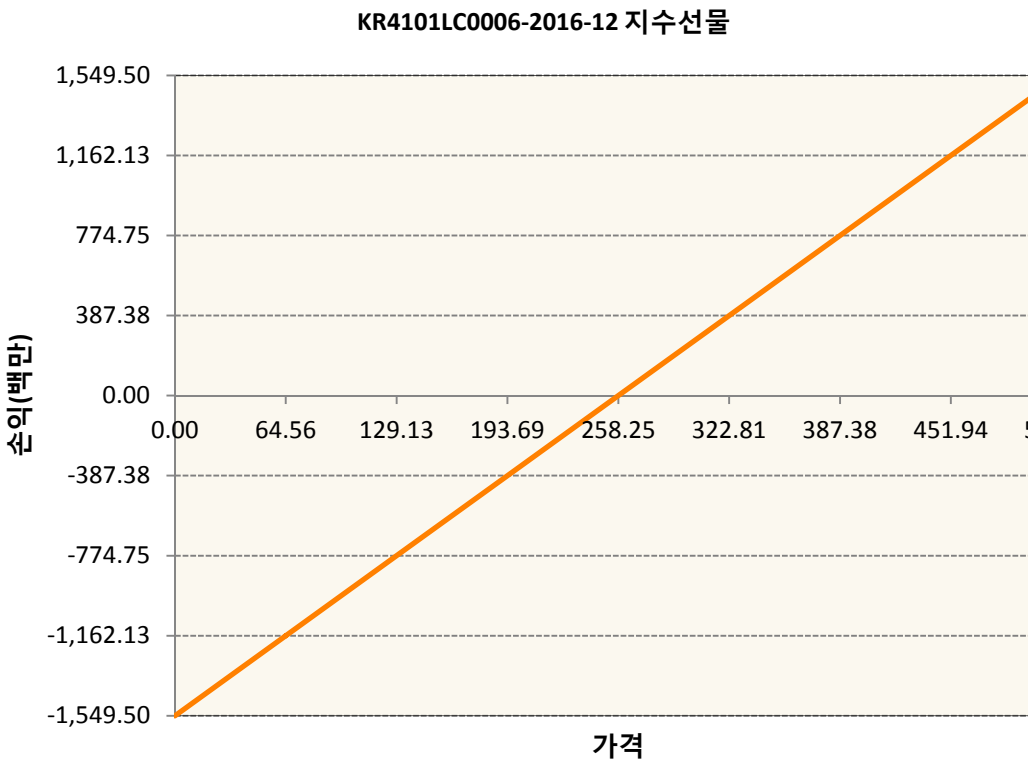
스마트인덱스모

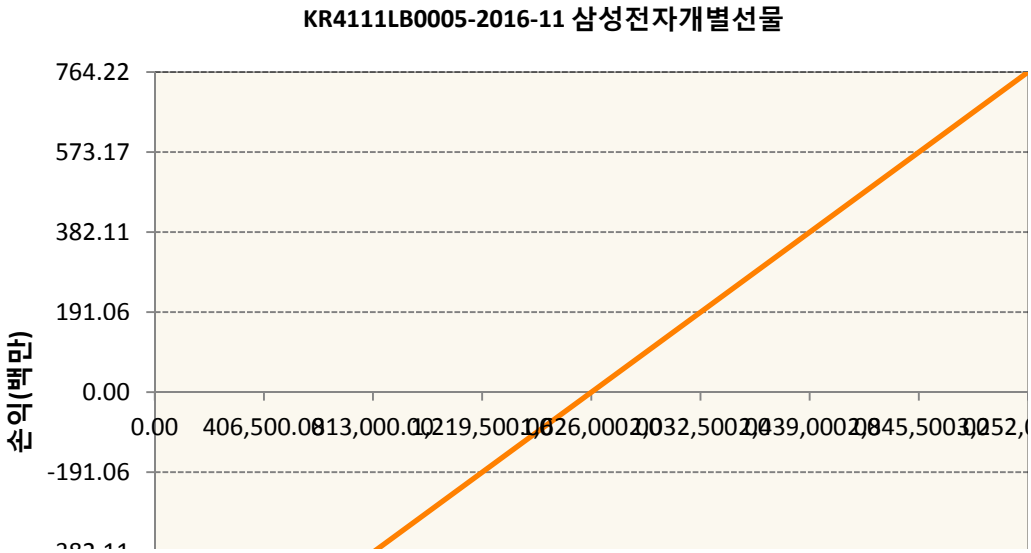
1. 계약금액

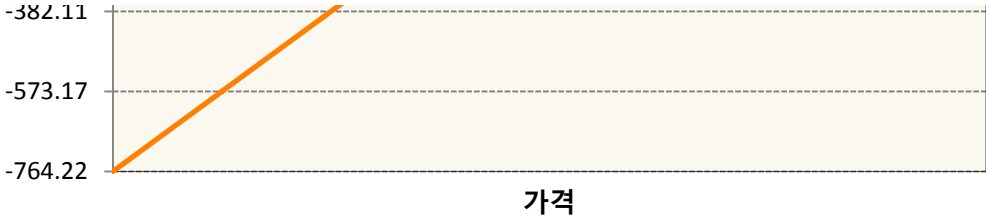
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	129	-129	장내
누계	유가증권	선물	2,314	0	2,314	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101LC00 2016-12 지수선물							124
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-124	-124	-124	-124	-124	-124	-124
-5.33%	-83	-83	-83	-83	-83	-83	-83
-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%	83	83	83	83	83	83	83
8.00%	124	124	124	124	124	124	124

KR4111LB00 2016-11 삼성전자개별선물							61
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-61	-61	-61	-61	-61	-61	-61
-5.33%	-41	-41	-41	-41	-41	-41	-41
-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%	41	41	41	41	41	41	41
8.00%	61	61	61	61	61	61	61

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

162

공시일	2016-10-20
기준일	2016-10-19

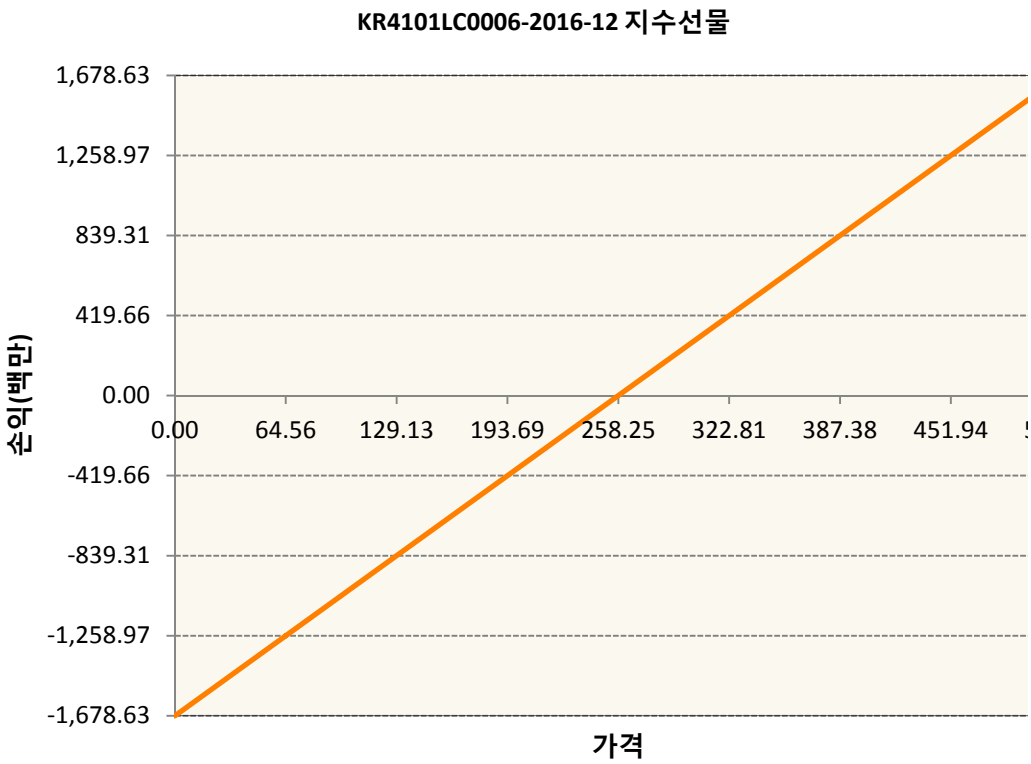
스마트레버리지목표전환형1호

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	1,679	0	1,679	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101LC00 2016-12 지수선물							134
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-134	-134	-134	-134	-134	-134	-134
-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%	134	134	134	134	134	134	134

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

101

공시일	2016-10-20
기준일	2016-10-19

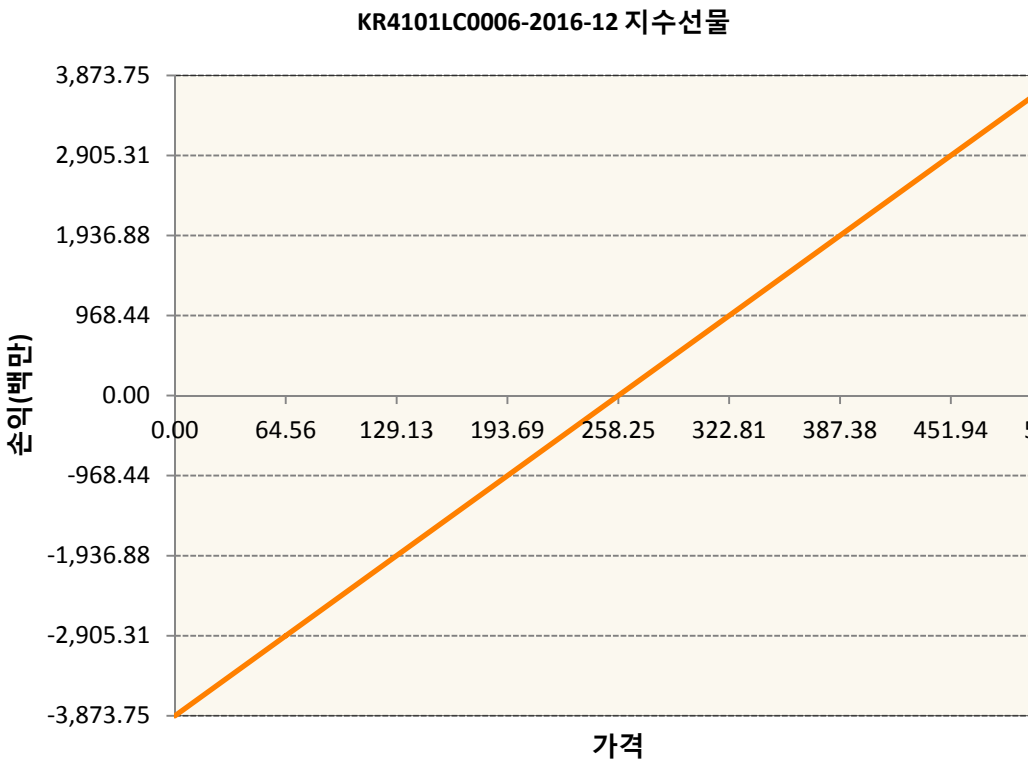
1.3배 레버리지 인덱스(주식-파생형)

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	3,874	0	3,874	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101LC00 2016-12 지수선물							310
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-310	-310	-310	-310	-310	-310	-310
-5.33%	-207	-207	-207	-207	-207	-207	-207
-2.67%	-103	-103	-103	-103	-103	-103	-103
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	103	103	103	103	103	103	103
5.33%	207	207	207	207	207	207	207
8.00%	310	310	310	310	310	310	310

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

234

공시일	2016-10-20
기준일	2016-10-19

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	875

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

716

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2016-10-20
기준일	2016-10-19

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)

805

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2016-10-20
기준일	2016-10-19

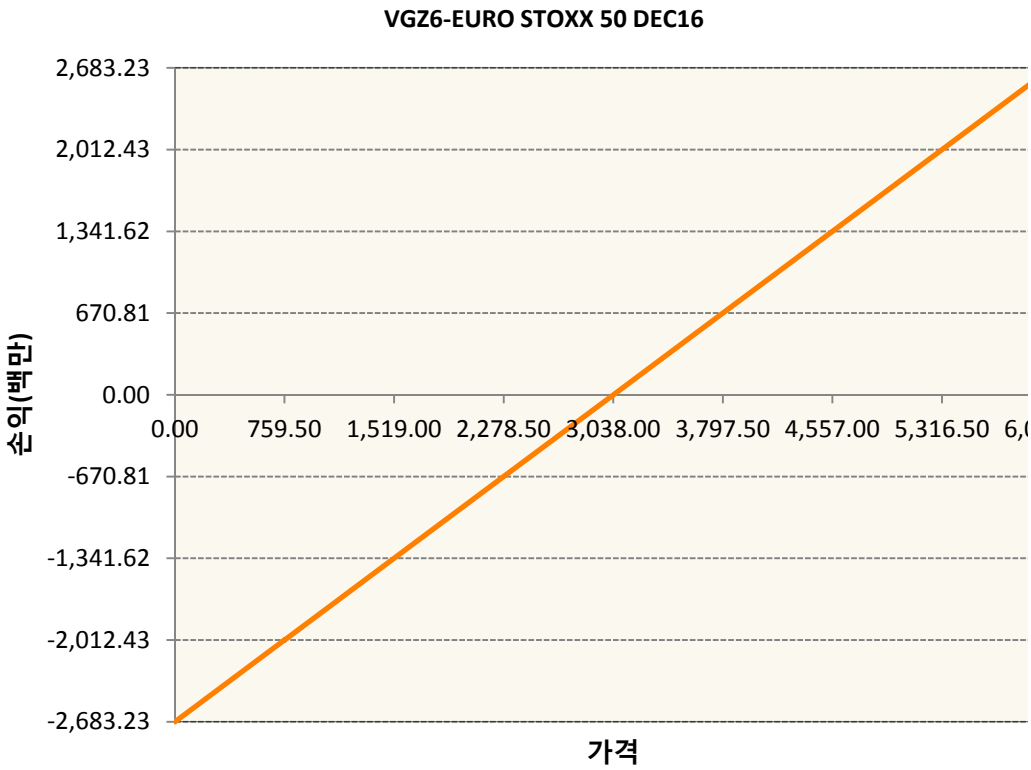
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,683	0	2,683	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGZ6	EURO STOXX 50 DEC16	215

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

(단위:백만원)

261

공시일	2016-10-20
기준일	2016-10-19

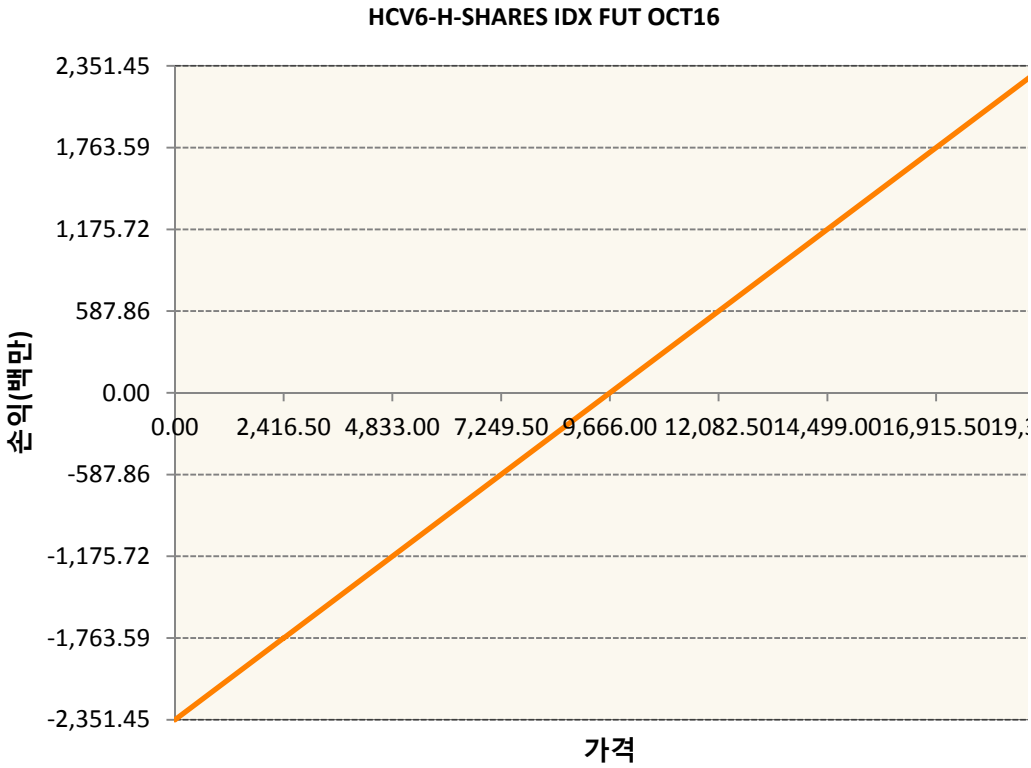
차이나인덱스모(주식-파생형)

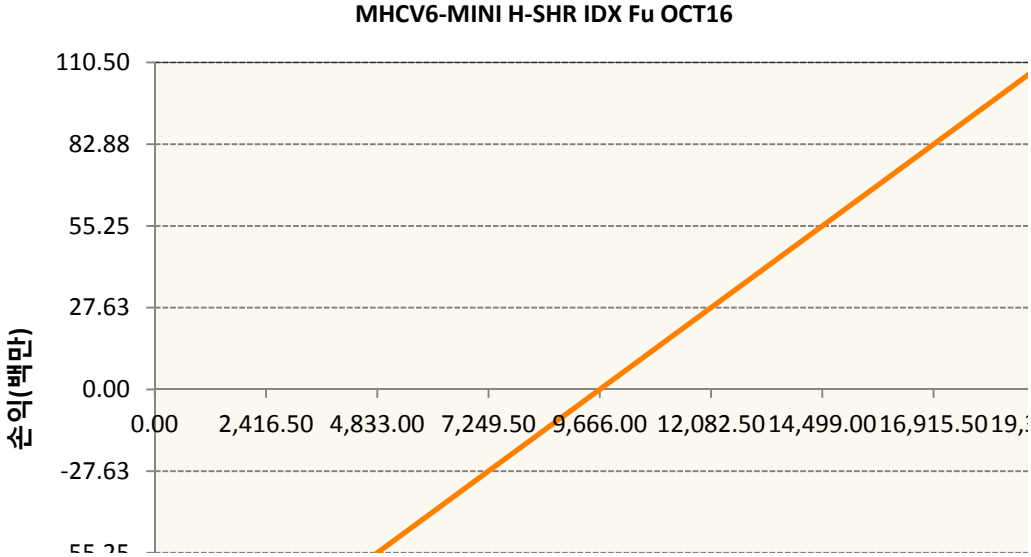
1. 계약금액

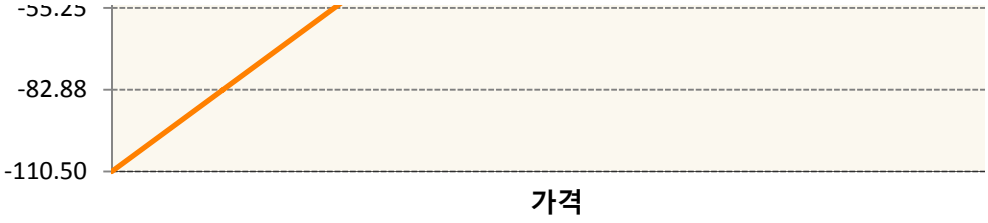
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,462	0	2,462	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCV6	H-SHARES IDX FUT OCT16	188
MHCV6	MINI H-SHR IDX Fu OCT16	9

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	266

공시일	2016-10-20
기준일	2016-10-19

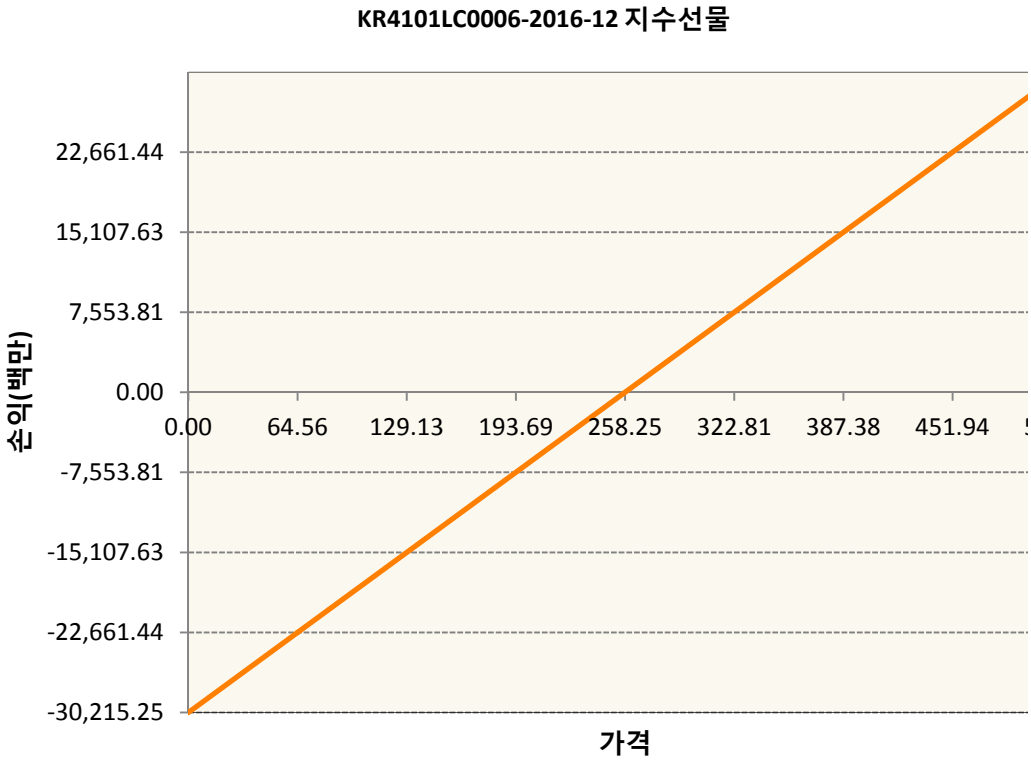
커버드콜(주식혼합-파생형)

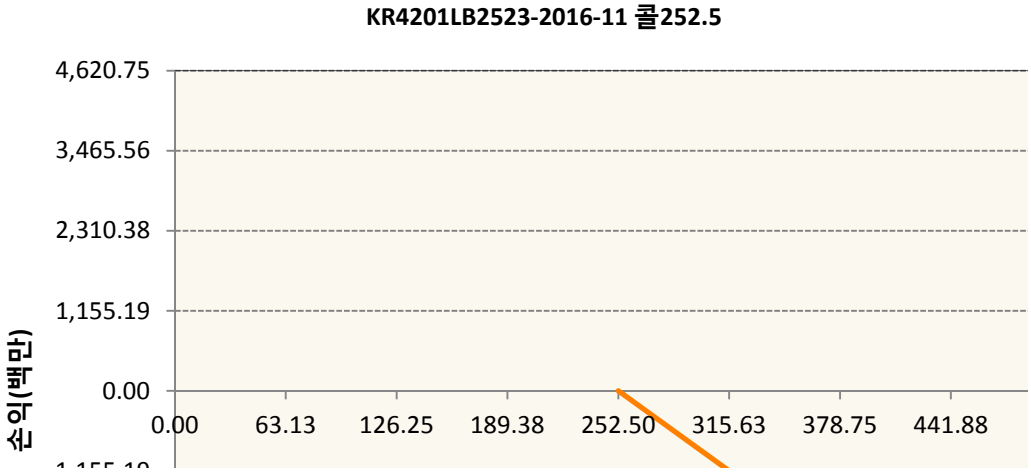
1. 계약금액

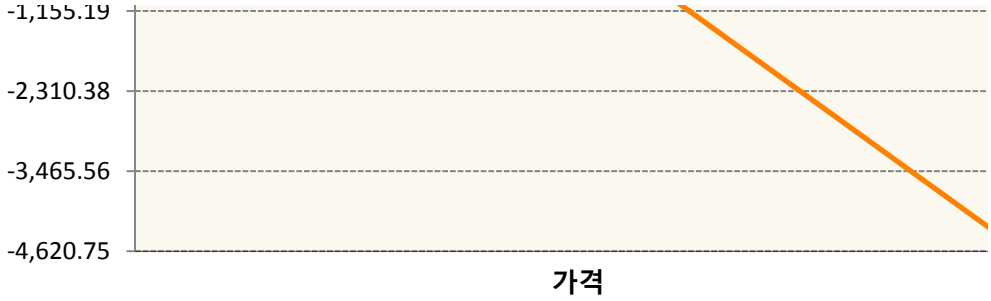
(단위:백만원)

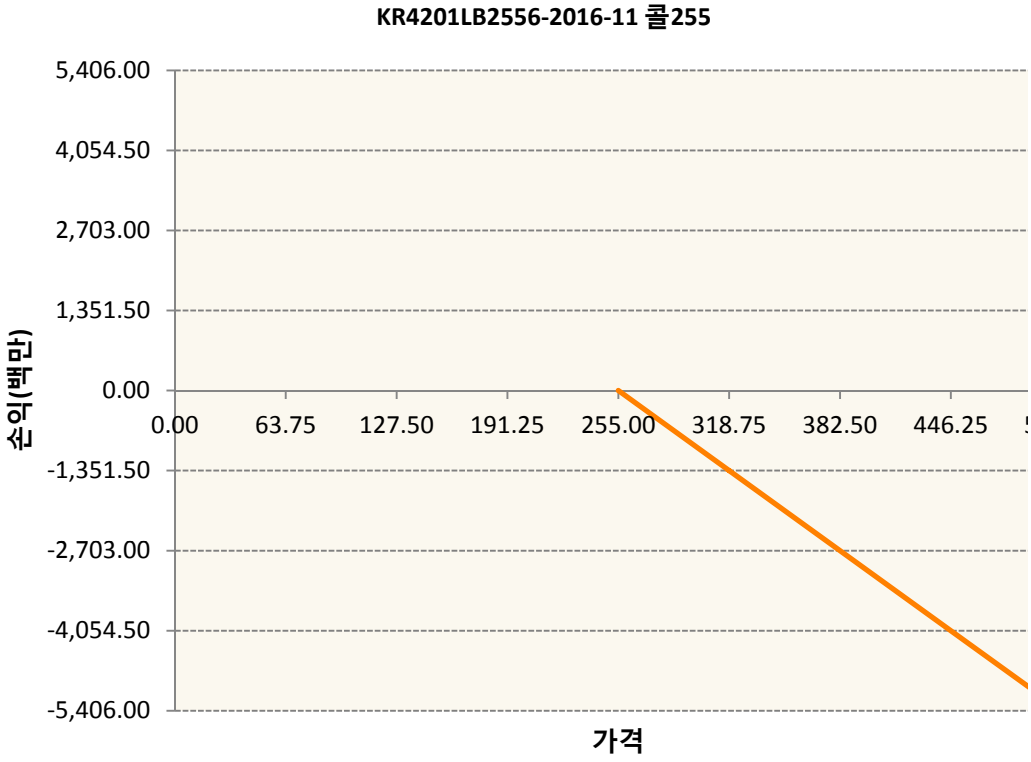
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	775	0	775	장내
신규	유가증권	옵션	0	156	-156	장내
누계	유가증권	선물	30,215	0	30,215	장내
누계	유가증권	옵션	0	10,027	-10,027	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101LC00 2016-12 지수선물							2,417
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-2,417	-2,417	-2,417	-2,417	-2,417	-2,417	-2,417
-5.33%	-1,611	-1,611	-1,611	-1,611	-1,611	-1,611	-1,611
-2.67%	-806	-806	-806	-806	-806	-806	-806
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	806	806	806	806	806	806	806
5.33%	1,611	1,611	1,611	1,611	1,611	1,611	1,611
8.00%	2,417	2,417	2,417	2,417	2,417	2,417	2,417
KR4201LB25 2016-11 콜252.5							1,771
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	637	635	632	628	623	616	608
-5.33%	612	600	586	571	554	537	518
-2.67%	458	432	407	381	356	330	305
0%	59	40	21	0	-21	-43	-66
2.67%	-515	-520	-527	-536	-546	-558	-571
5.33%	-1,139	-1,139	-1,140	-1,142	-1,145	-1,149	-1,154
8.00%	-1,768	-1,768	-1,768	-1,768	-1,769	-1,769	-1,771
KR4201LB25 2016-11 콜255							1,973

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	557	556	554	552	548	543	537
-5.33%	544	536	526	513	499	483	466
-2.67%	439	414	387	360	332	305	276
0%	84	56	28	0	-29	-57	-87
2.67%	-526	-537	-550	-565	-582	-600	-620
5.33%	-1,238	-1,239	-1,242	-1,247	-1,252	-1,260	-1,269
8.00%	-1,966	-1,966	-1,966	-1,967	-1,968	-1,970	-1,973

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

6,175

공시일	2016-10-20
기준일	2016-10-19

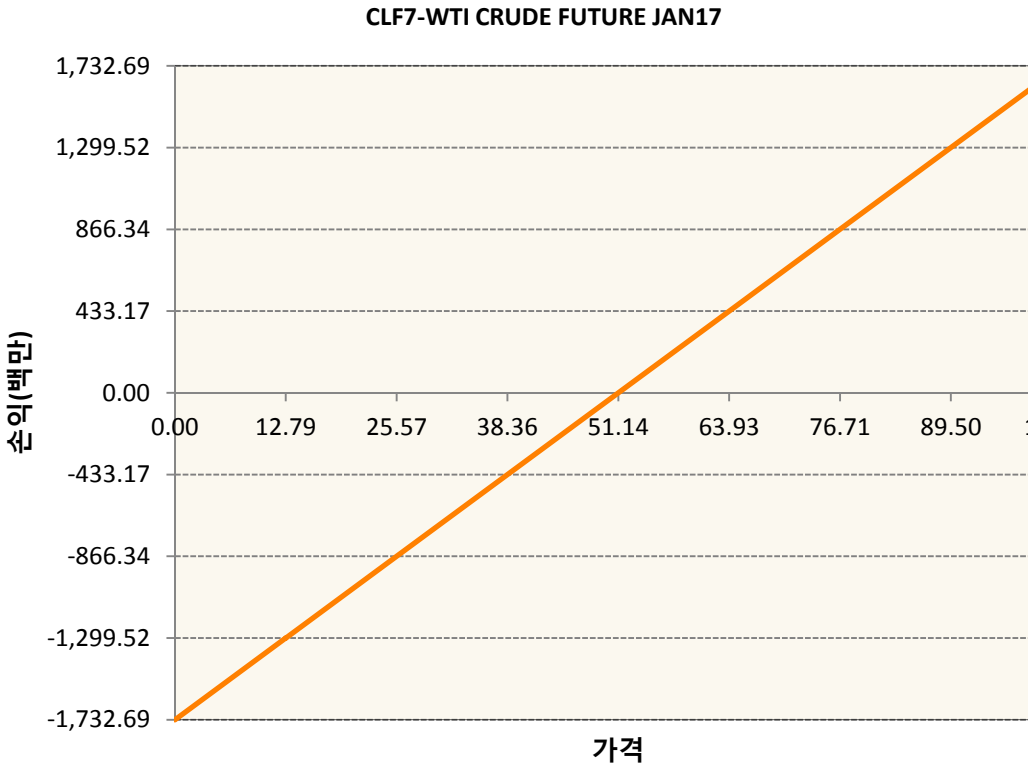
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

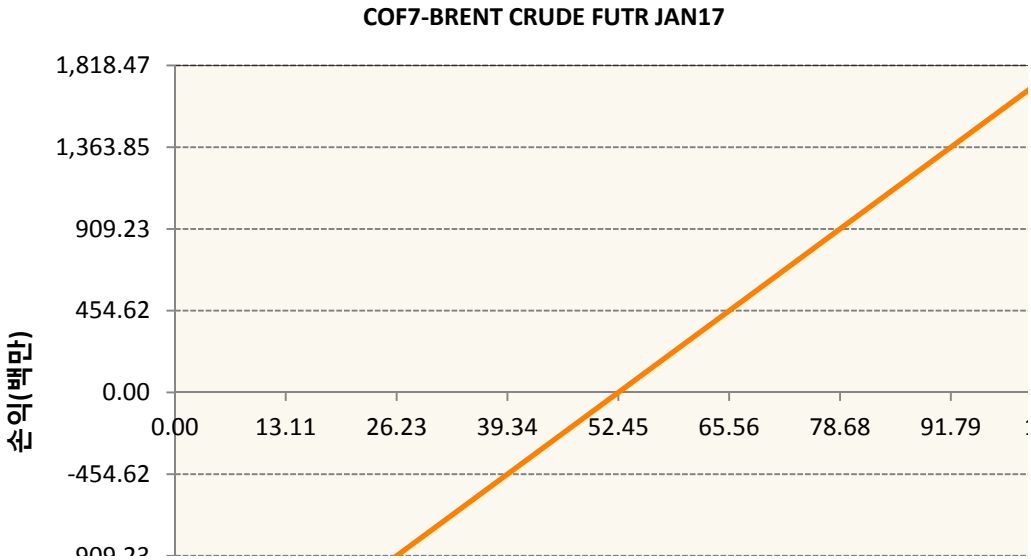
1. 계약금액

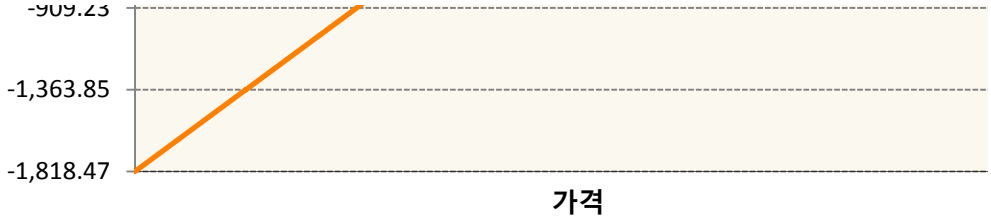
(단위:백만원)

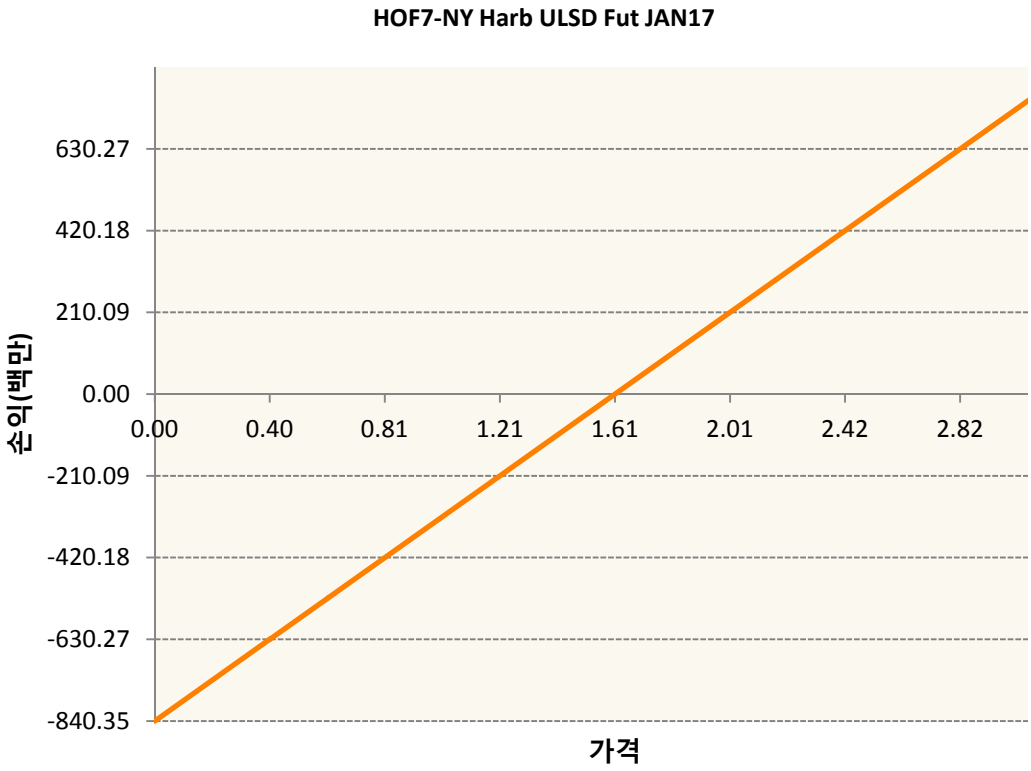
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	6,990	0	6,990	

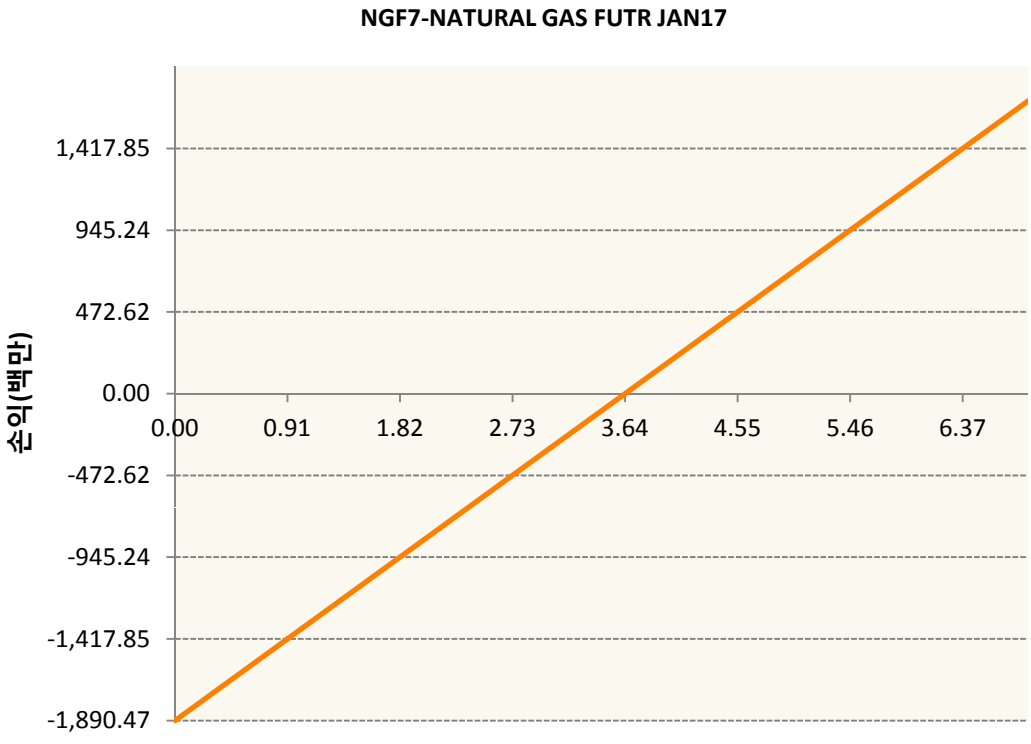
2. 만기시점의 손익구조



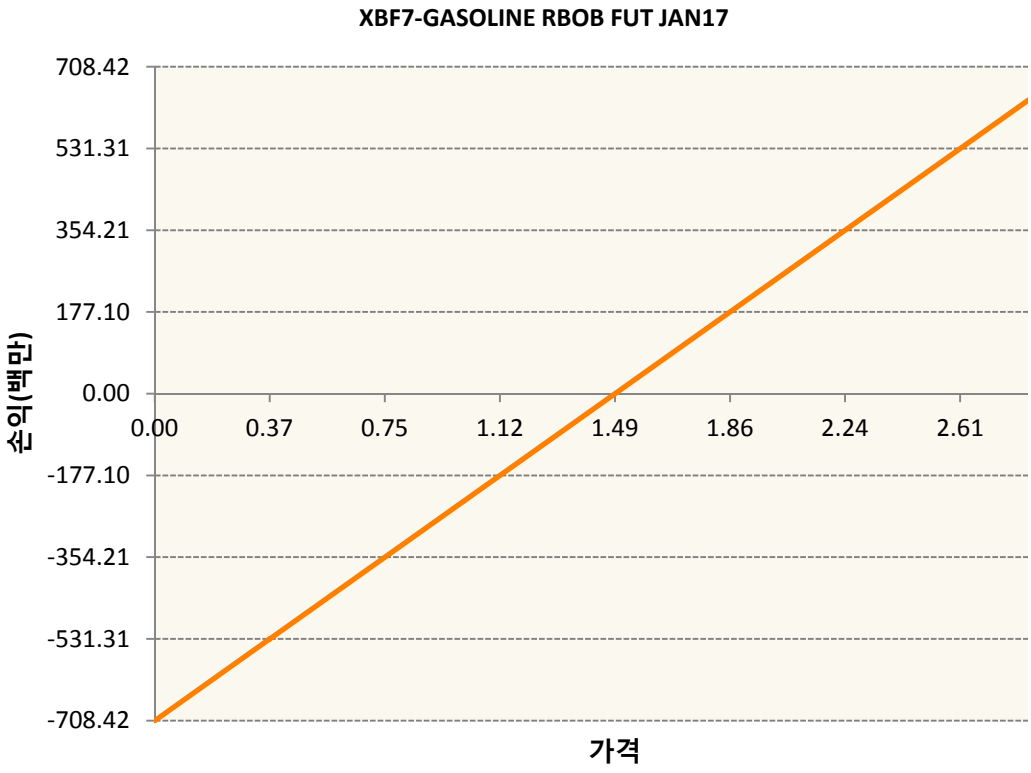



-909.23
-1,363.85
-1,818.47
가격


HOF7-NY Harb ULSD Fut JAN17
630.27
420.18
210.09
0.00
-210.09
-420.18
-630.27
-840.35
0.00
0.40
0.81
1.21
1.61
2.01
2.42
2.82
순익(백만)
가격


NGF7-NATURAL GAS FUTR JAN17
1,417.85
945.24
472.62
0.00
-472.62
-945.24
-1,417.85
-1,890.47
0.00
0.91
1.82
2.73
3.64
4.55
5.46
6.37
순익(백만)

가격



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
CLF7	WTI CRUDE FUTURE JAN17	139
COF7	BRENT CRUDE FUTR JAN17	145
HOF7	NY Harb ULSD Fut JAN17	67
NGF7	NATURAL GAS FUTR JAN17	151
XBF7	GASOLINE RBOB FUT JAN17	57

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,245

공시일	2016-10-20
기준일	2016-10-19

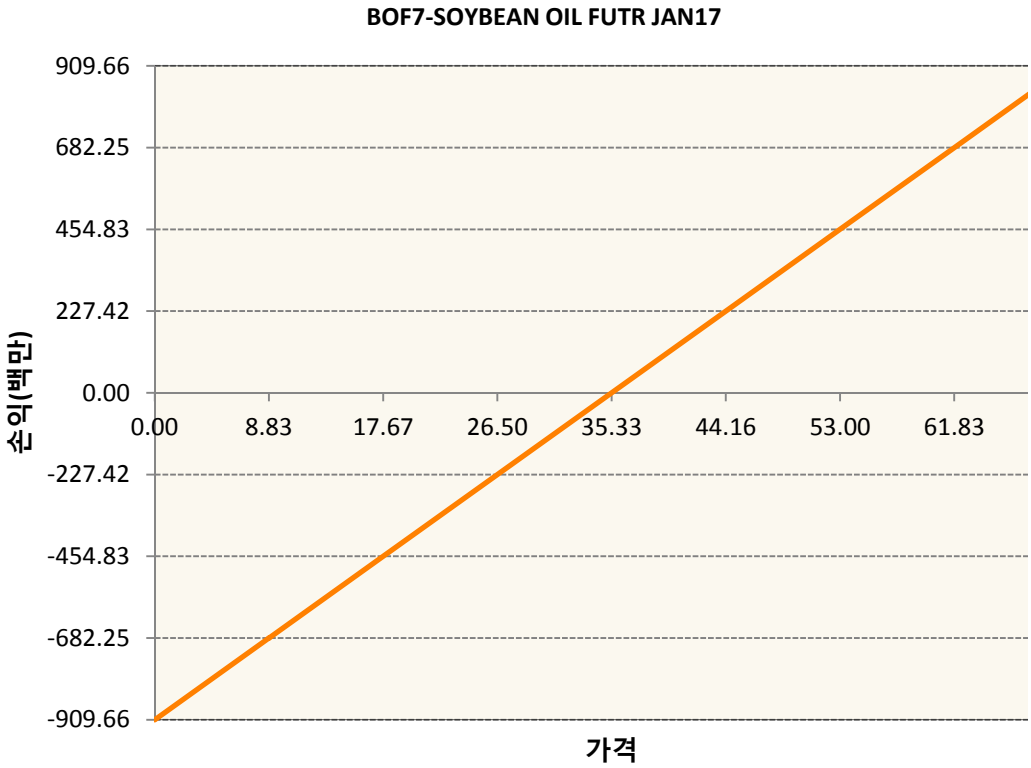
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

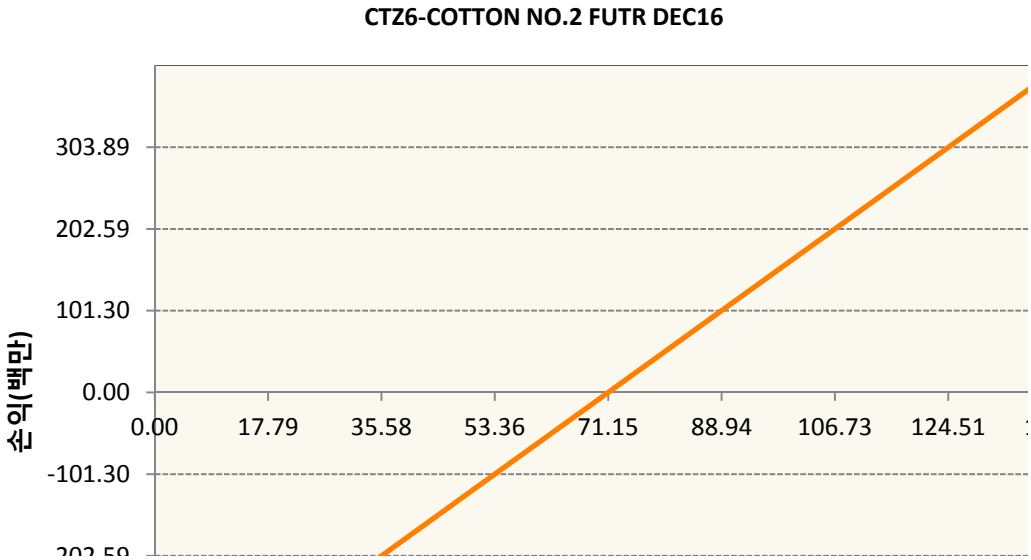
1. 계약금액

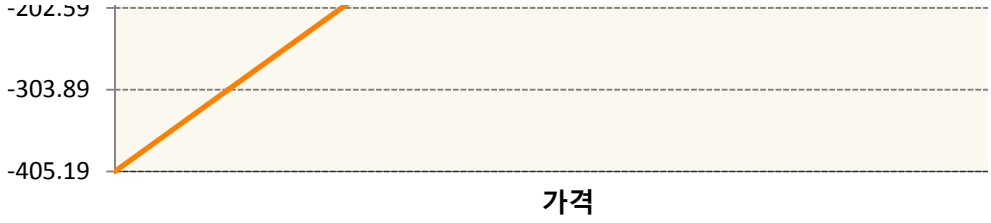
(단위:백만원)

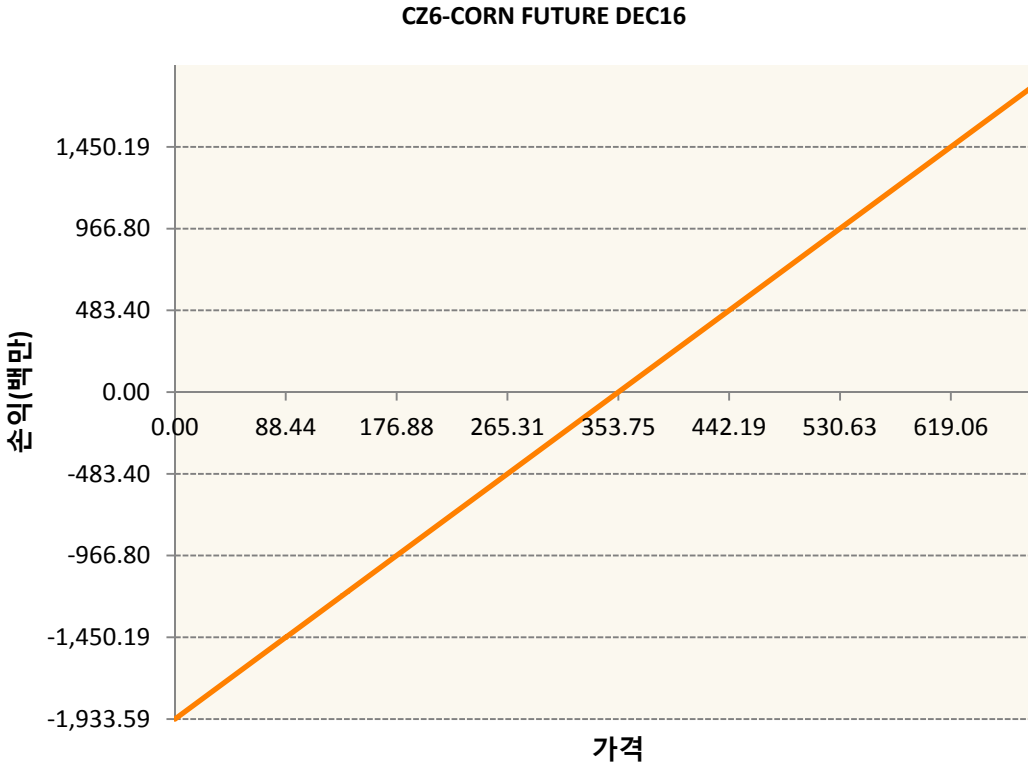
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	9,271	0	9,271	

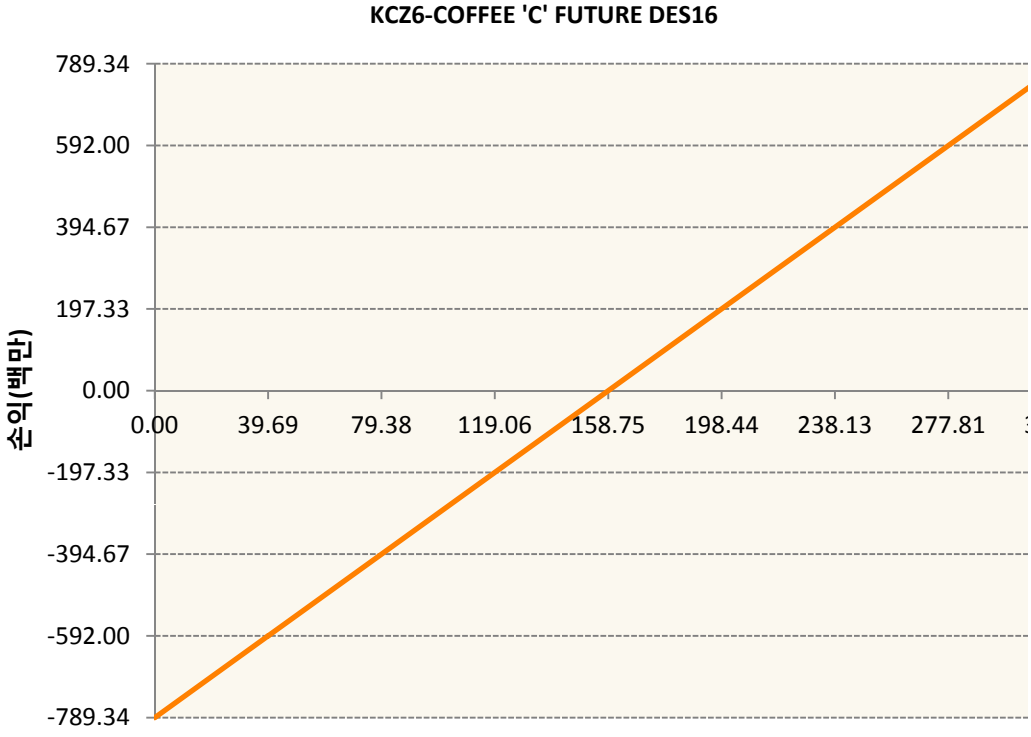
2. 만기시점의 손익구조



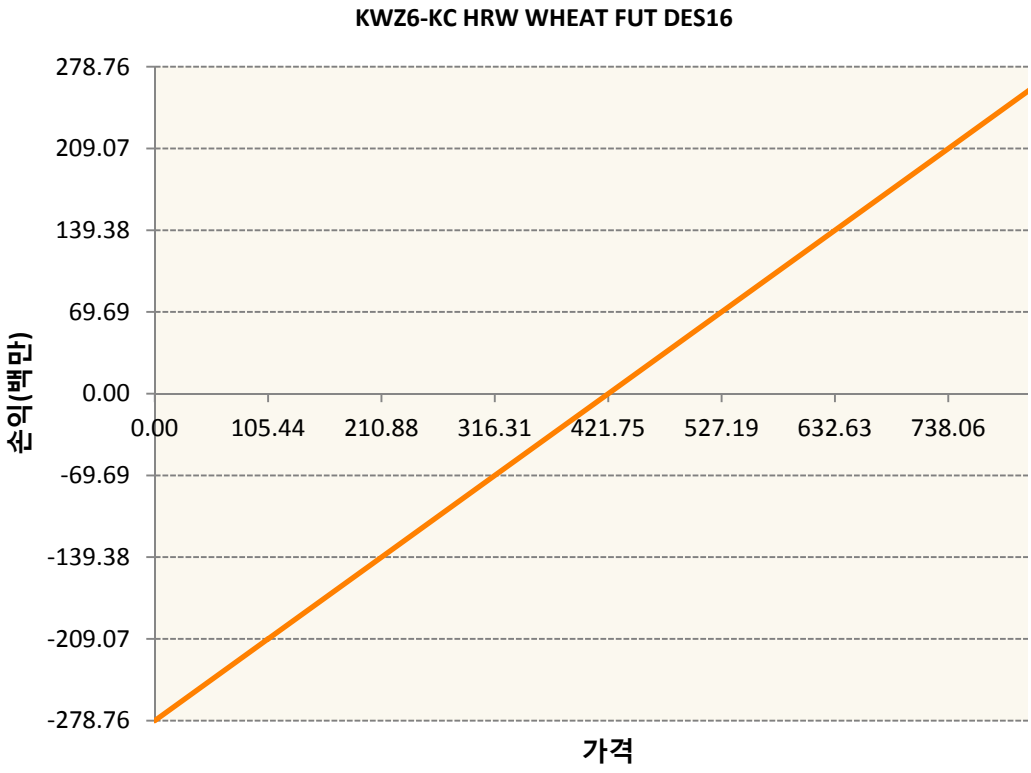


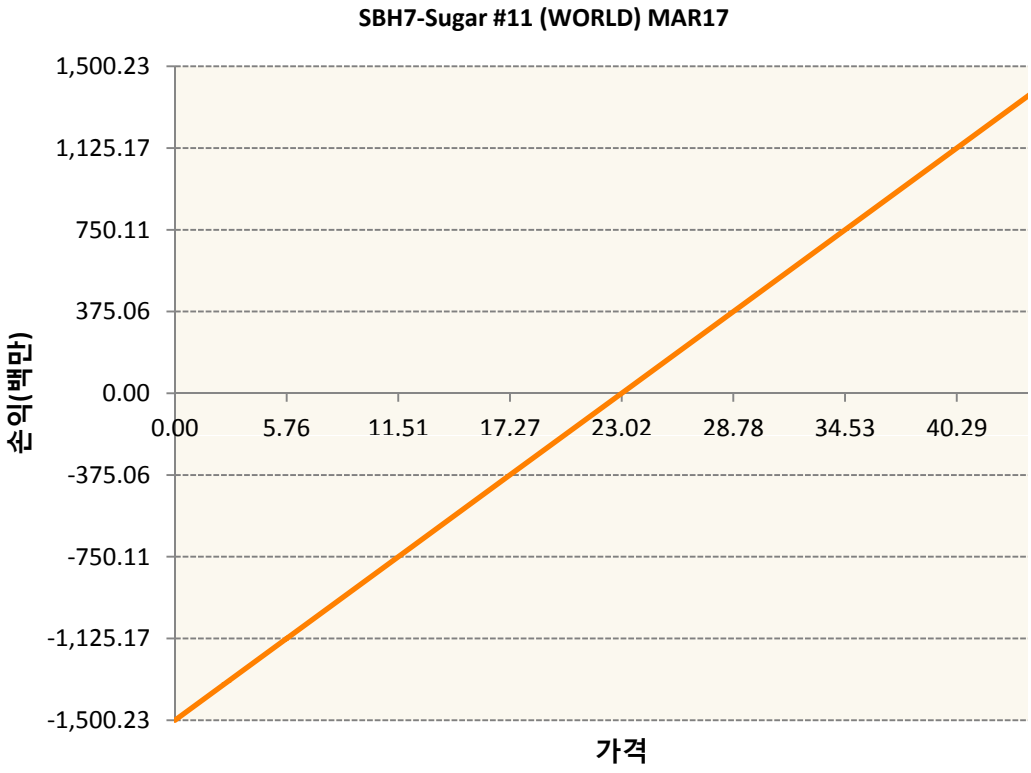

-303.89
-405.19
가격

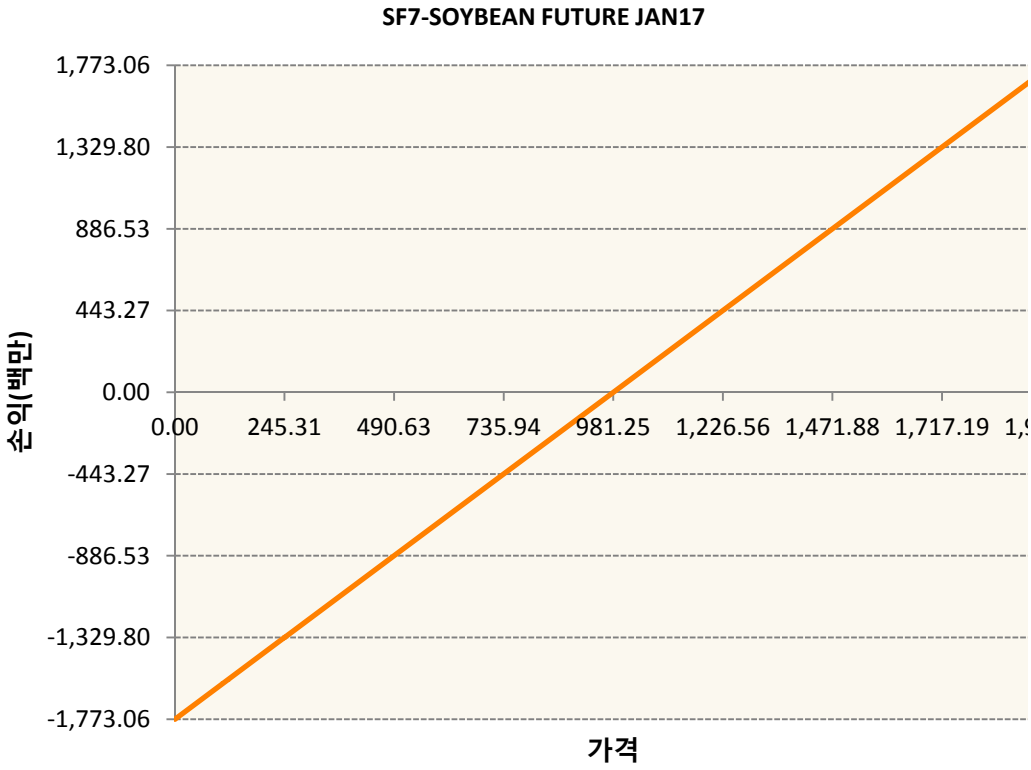

CZ6-CORN FUTURE DEC16
1,450.19
966.80
483.40
0.00
-483.40
-966.80
-1,450.19
-1,933.59
0.00
88.44
176.88
265.31
353.75
442.19
530.63
619.06
순익(백만)
가격

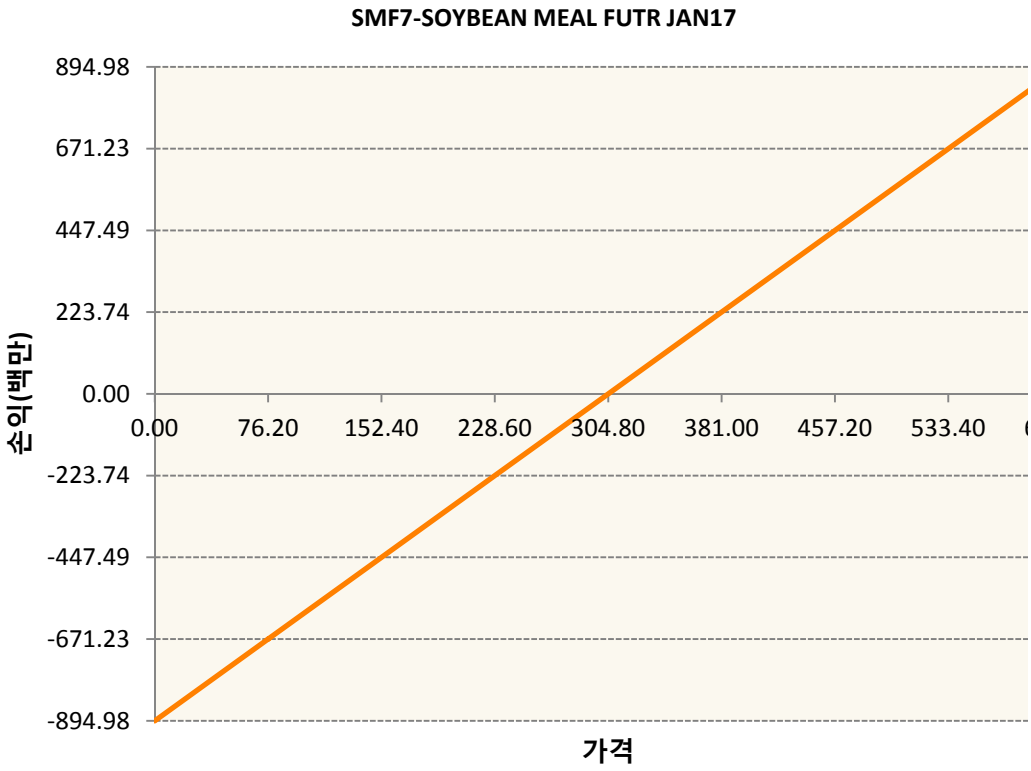

KCZ6-COFFEE 'C' FUTURE DES16
789.34
592.00
394.67
197.33
0.00
-197.33
-394.67
-592.00
-789.34
0.00
39.69
79.38
119.06
158.75
198.44
238.13
277.81
순익(백만)

가격

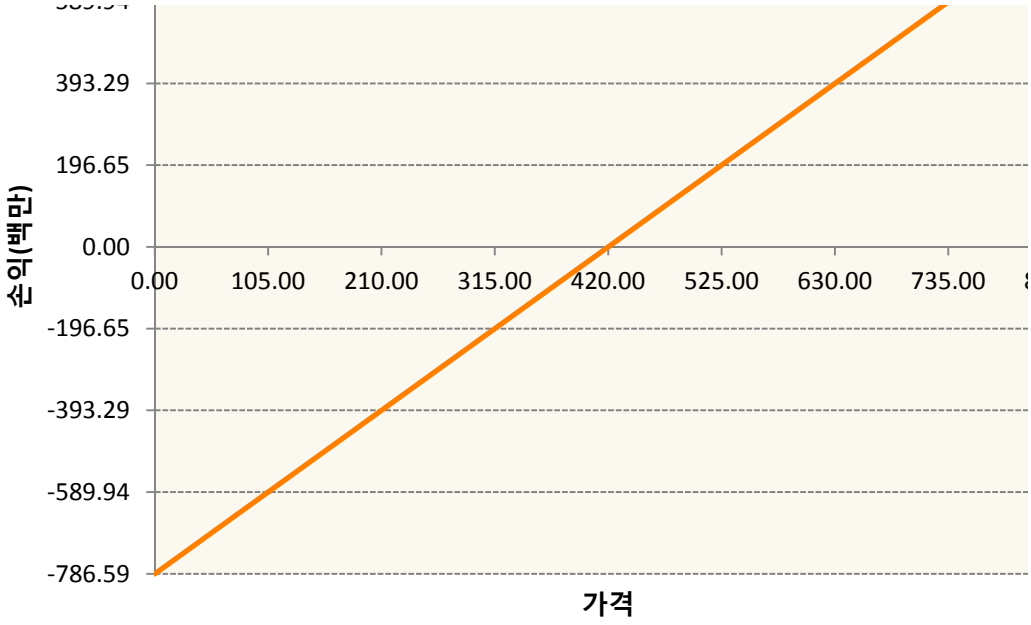

KWZ6-KC HRW WHEAT FUT DES16
278.76
209.07
139.38
69.69
0.00
-69.69
-139.38
-209.07
-278.76
0.00
105.44
210.88
316.31
421.75
527.19
632.63
738.06
손익(백만)
가격


SBH7-Sugar #11 (WORLD) MAR17
1,500.23
1,125.17
750.11
375.06
0.00
-375.06
-750.11
-1,125.17
-1,500.23
0.00
5.76
11.51
17.27
23.02
28.78
34.53
40.29
손익(백만)
가격


SF7-SOYBEAN FUTURE JAN17
1,773.06
1,329.80
886.53
443.27
0.00
-443.27
-886.53
-1,329.80
-1,773.06
0.00
245.31
490.63
735.94
981.25
1,226.56
1,471.88
1,717.19
손익(백만)
가격


SMF7-SOYBEAN MEAL FUTR JAN17
894.98
671.23
447.49
223.74
0.00
-223.74
-447.49
-671.23
-894.98
0.00
76.20
152.40
228.60
304.80
381.00
457.20
533.40
손익(백만)
가격


WZ6-WHEAT FUTURE(CBT) DEC16
786.59
589.94



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

BOF7	SOYBEAN OIL FUTR JAN17	73
CTZ6	COTTON NO.2 FUTR DEC16	32
CZ6	CORN FUTURE DEC16	155
KCZ6	COFFEE 'C' FUTURE DES16	63
KWZ6	KC HRW WHEAT FUT DES16	22
SBH7	Sugar #11 (WORLD) MAR17	120
SF7	SOYBEAN FUTURE JAN17	142
SMF7	SOYBEAN MEAL FUTR JAN17	72
WZ6	WHEAT FUTURE(CBT) DEC16	63

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

933