공시일	2016-10-25
기준일	2016-10-24

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	2016-10-25
기준일	2016-10-24

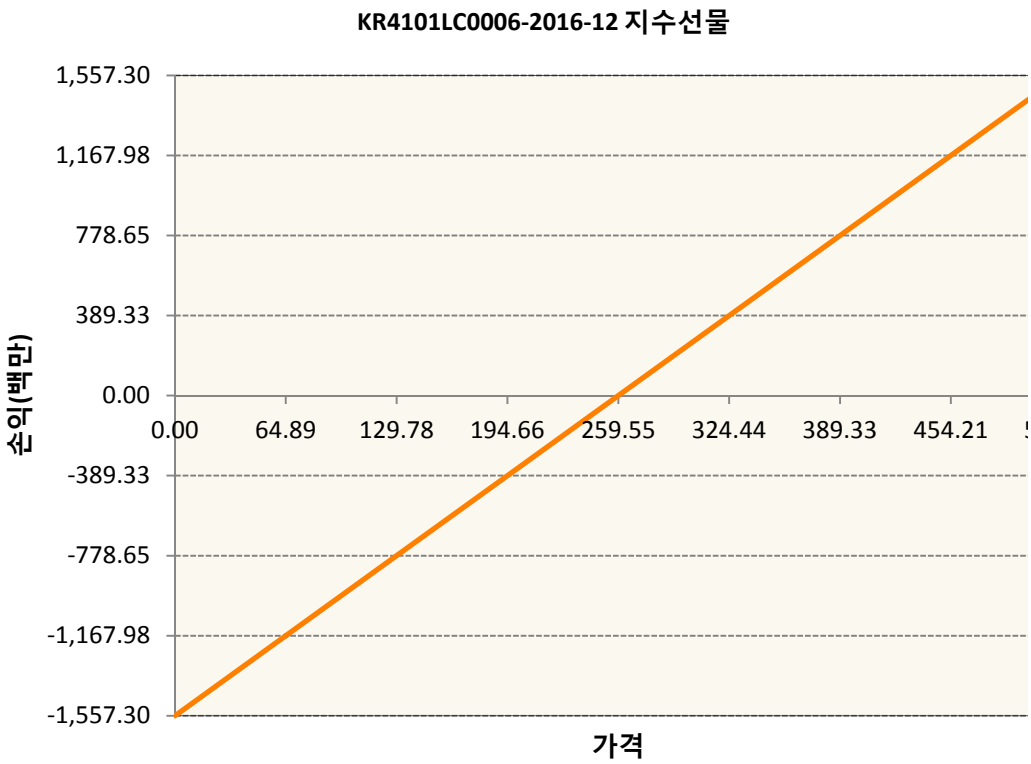
스마트인덱스모

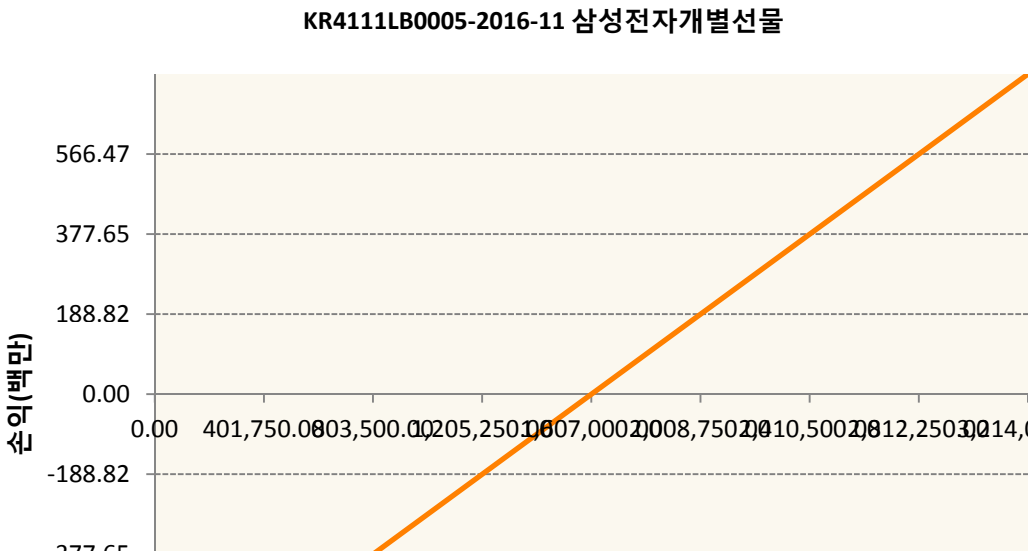
1. 계약금액

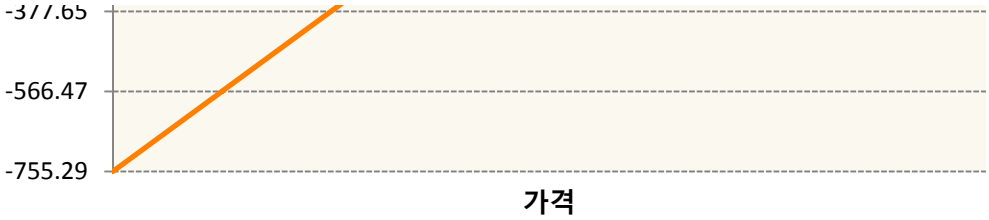
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,313	0	2,313	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
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)

162

공시일	2016-10-25
기준일	2016-10-24

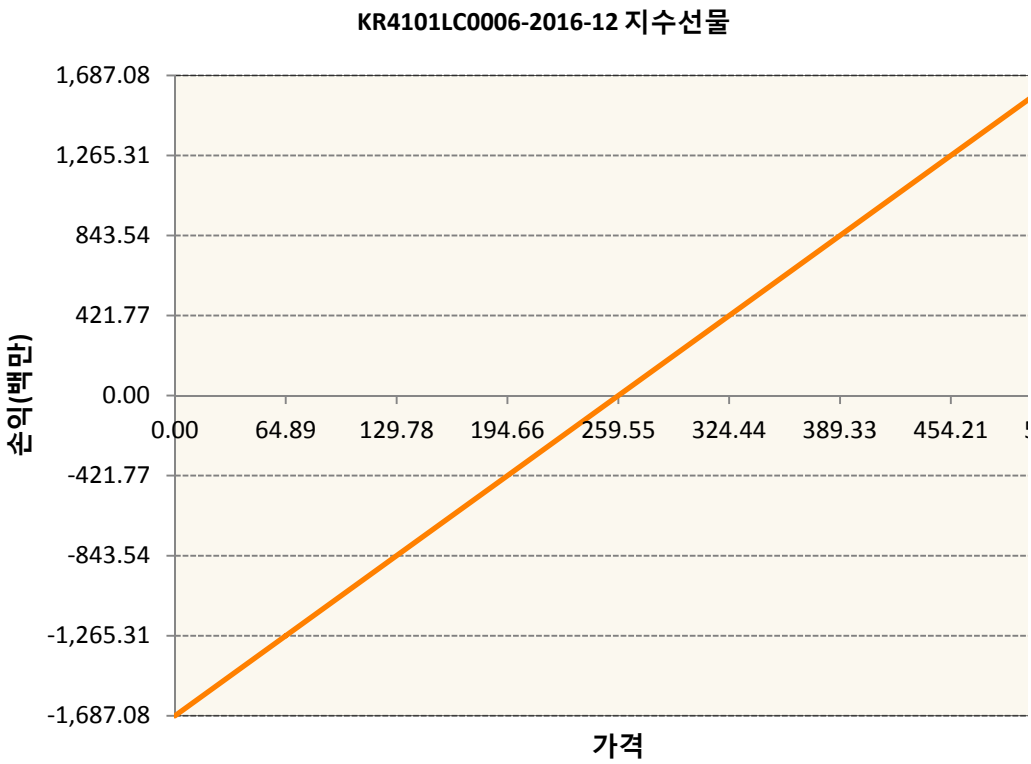
스마트레버리지목표전환형1호

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	1,687	0	1,687	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)

102

공시일	2016-10-25
기준일	2016-10-24

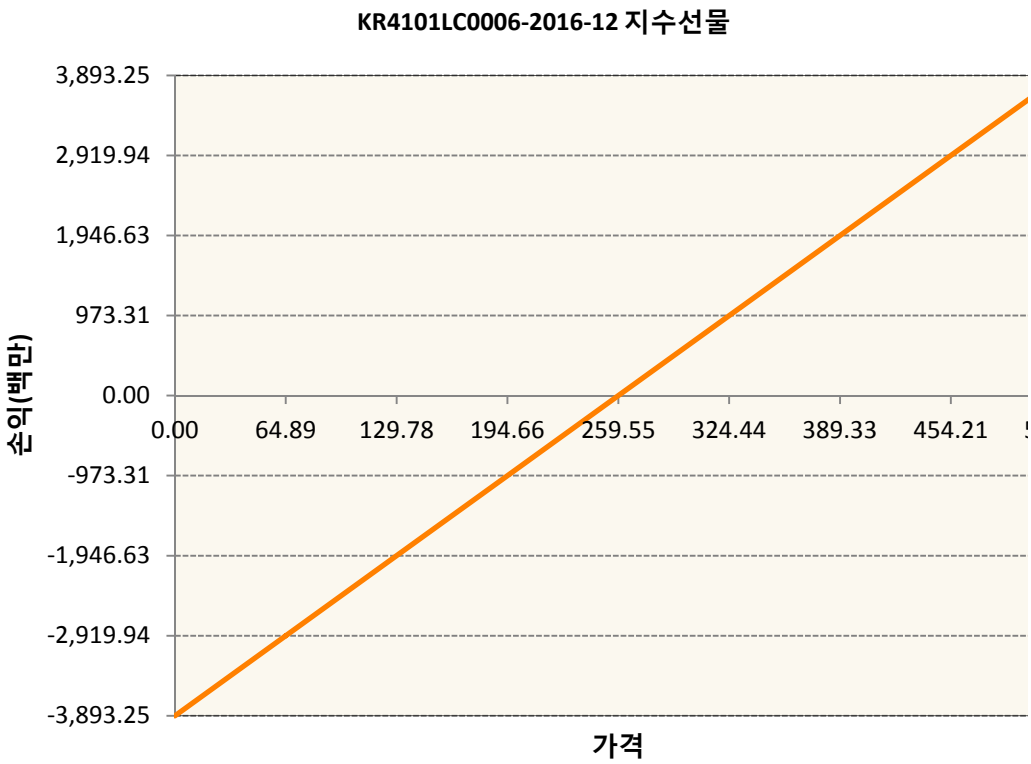
1.3배 레버리지 인덱스(주식-파생형)

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	3,893	0	3,893	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101LC00 2016-12 지수선물							311
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-311	-311	-311	-311	-311	-311	-311
-5.33%	-208	-208	-208	-208	-208	-208	-208
-2.67%	-104	-104	-104	-104	-104	-104	-104
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	104	104	104	104	104	104	104
5.33%	208	208	208	208	208	208	208
8.00%	311	311	311	311	311	311	311

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

235

공시일	2016-10-25
기준일	2016-10-24

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	876

* 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	2016-10-25
기준일	2016-10-24

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	404

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

803

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2016-10-25
기준일	2016-10-24

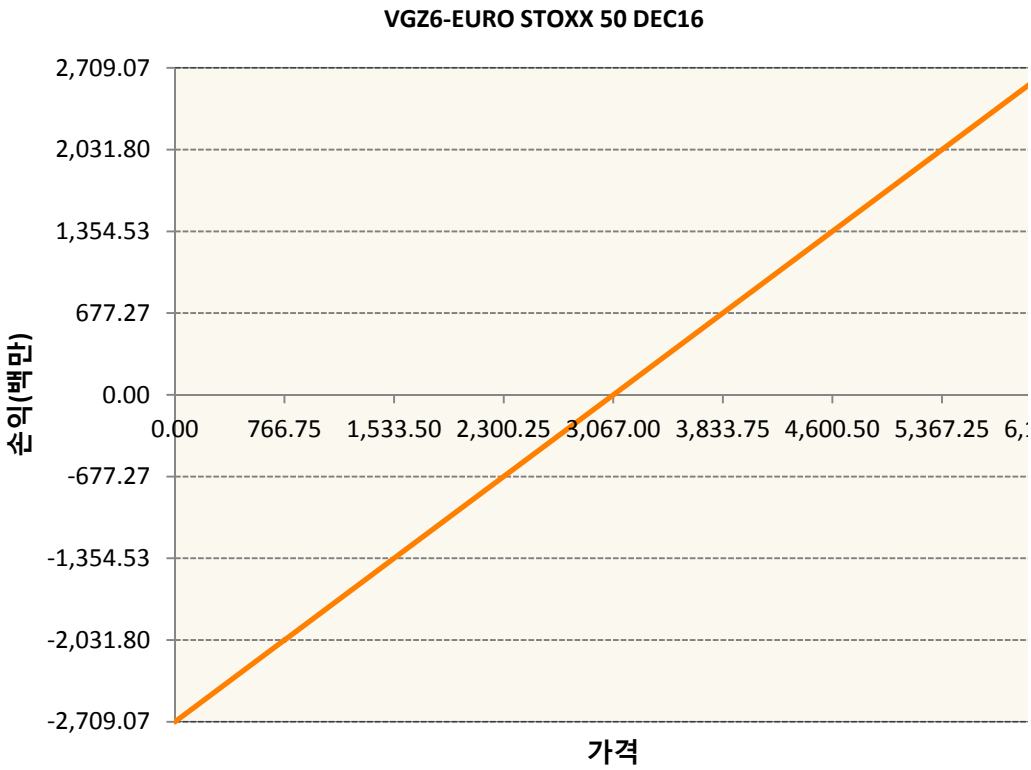
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,709	0	2,709	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGZ6	EURO STOXX 50 DEC16	217

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

(단위:백만원)

263

공시일	2016-10-25
기준일	2016-10-24

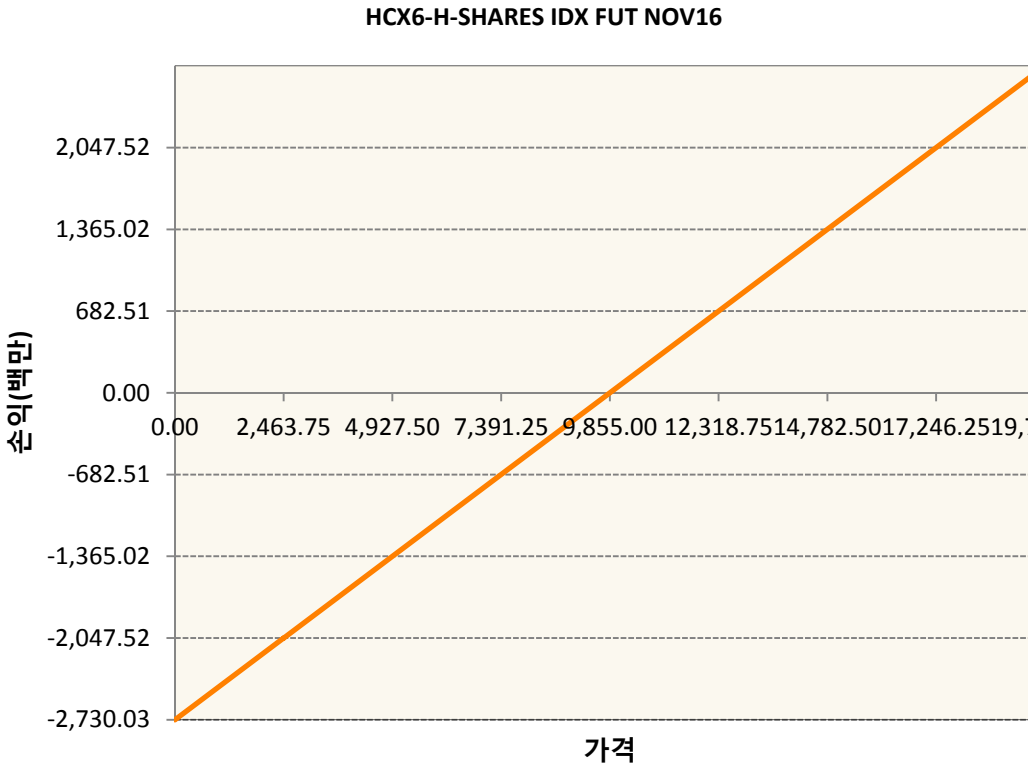
차이나인덱스모(주식-파생형)

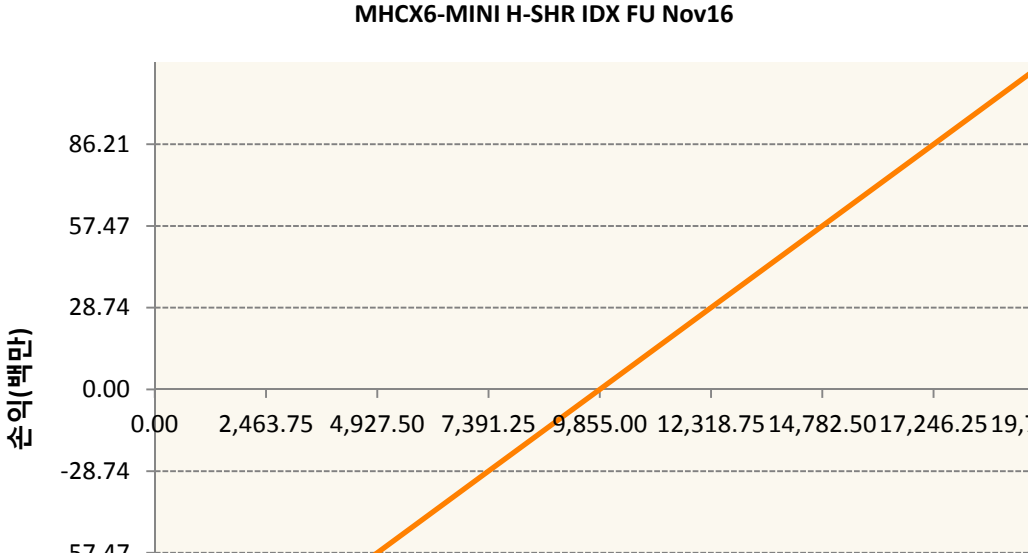
1. 계약금액

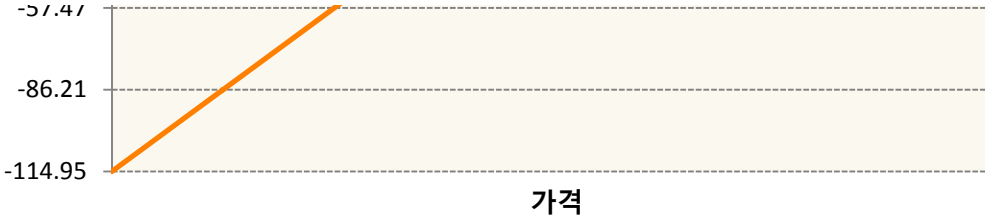
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,845	0	2,845	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

HCX6	H-SHARES IDX FUT NOV16	218
MHCX6	MINI H-SHR IDX FU Nov16	9

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

306

공시일	2016-10-25
기준일	2016-10-24

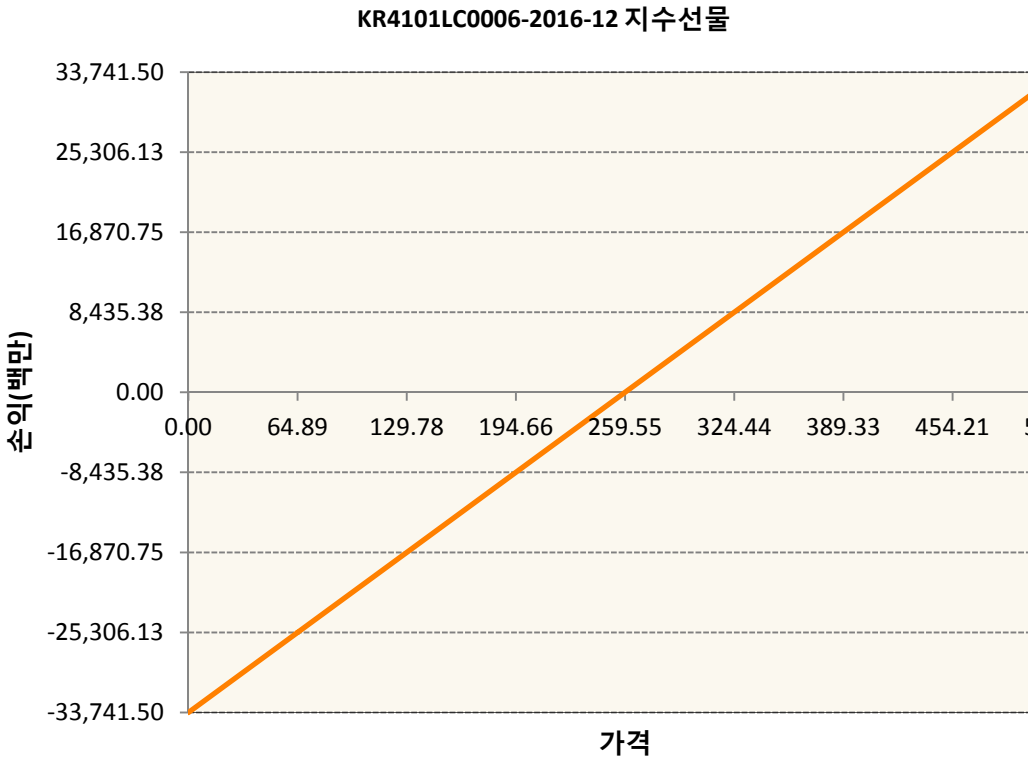
커버드콜(주식혼합-파생형)

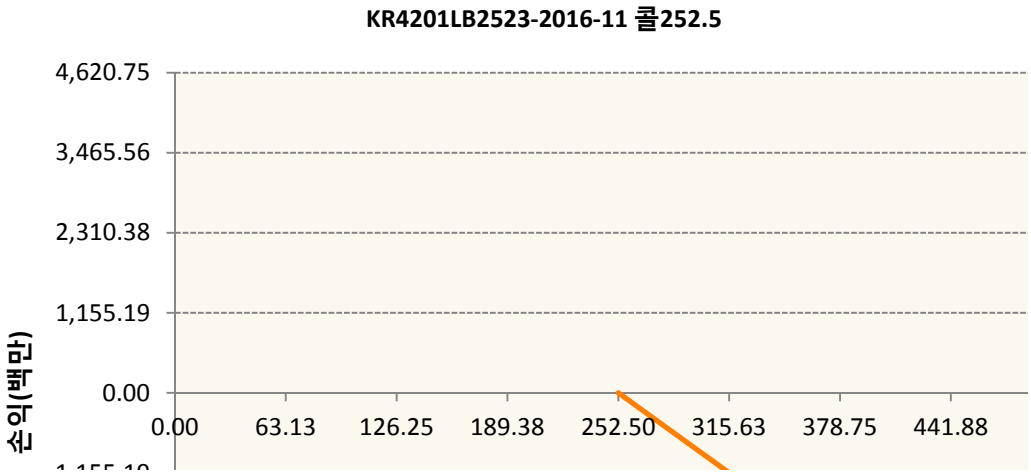
1. 계약금액

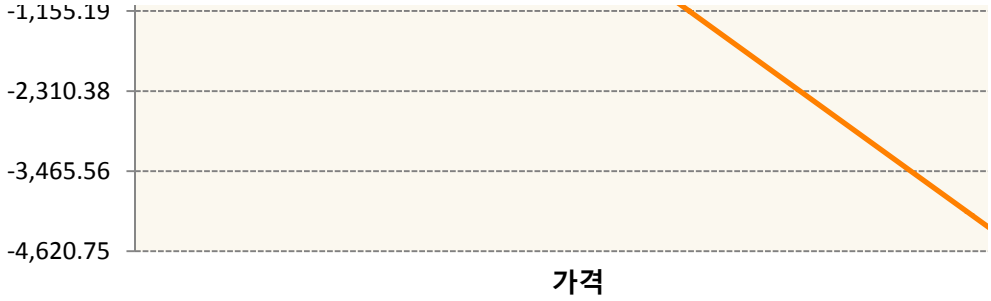
(단위:백만원)

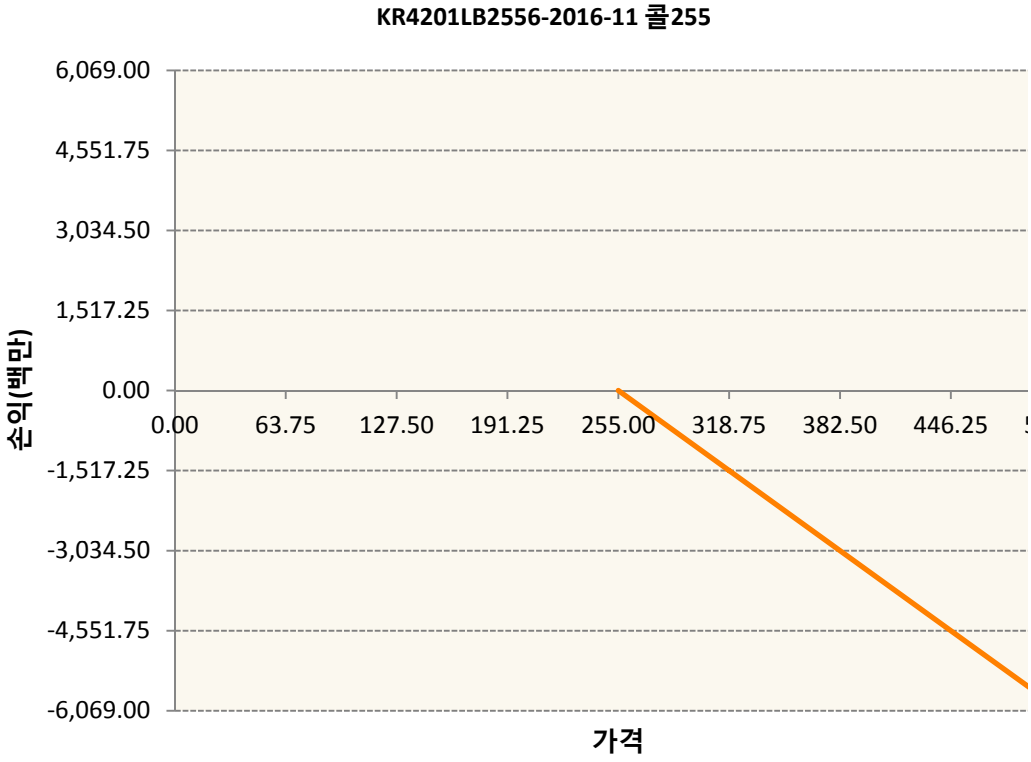
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	2,594	0	2,594	장내
신규	유가증권	옵션	0	521	-521	장내
누계	유가증권	선물	33,742	0	33,742	장내
누계	유가증권	옵션	0	10,690	-10,690	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101LC00 2016-12 지수선물							2,699
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-2,699	-2,699	-2,699	-2,699	-2,699	-2,699	-2,699
-5.33%	-1,799	-1,799	-1,799	-1,799	-1,799	-1,799	-1,799
-2.67%	-900	-900	-900	-900	-900	-900	-900
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	900	900	900	900	900	900	900
5.33%	1,799	1,799	1,799	1,799	1,799	1,799	1,799
8.00%	2,699	2,699	2,699	2,699	2,699	2,699	2,699
KR4201LB25 2016-11 콜252.5							1,839
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	694	694	692	689	686	682	676
-5.33%	673	663	652	639	625	611	595
-2.67%	498	476	455	433	411	390	368
0%	36	25	13	0	-14	-30	-46
2.67%	-574	-575	-578	-581	-585	-591	-597
5.33%	-1,206	-1,206	-1,206	-1,206	-1,207	-1,208	-1,210
8.00%	-1,838	-1,838	-1,838	-1,838	-1,839	-1,839	-1,839
KR4201LB25 2016-11 콜255							2,327

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	672	672	671	670	667	664	660
-5.33%	663	656	647	636	624	610	594
-2.67%	537	512	485	459	432	405	378
0%	67	46	23	0	-24	-49	-74
2.67%	-684	-689	-695	-703	-713	-724	-737
5.33%	-1,503	-1,503	-1,503	-1,505	-1,506	-1,509	-1,513
8.00%	-2,325	-2,325	-2,325	-2,325	-2,325	-2,326	-2,327

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

7,019

공시일	2016-10-25
기준일	2016-10-24

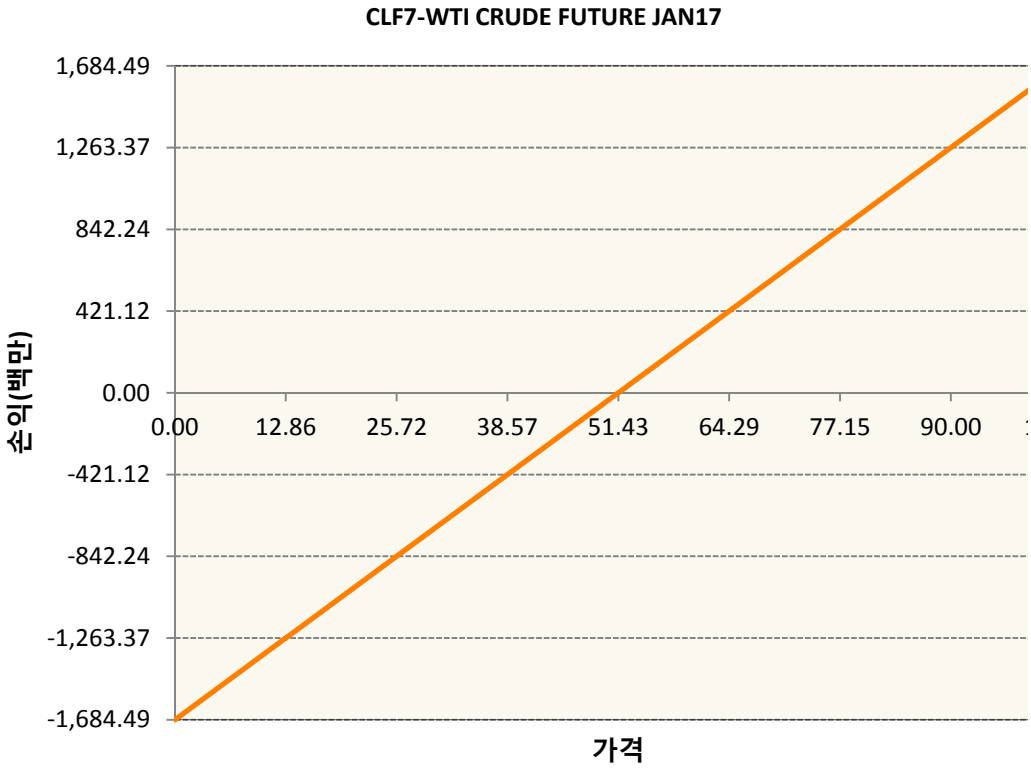
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

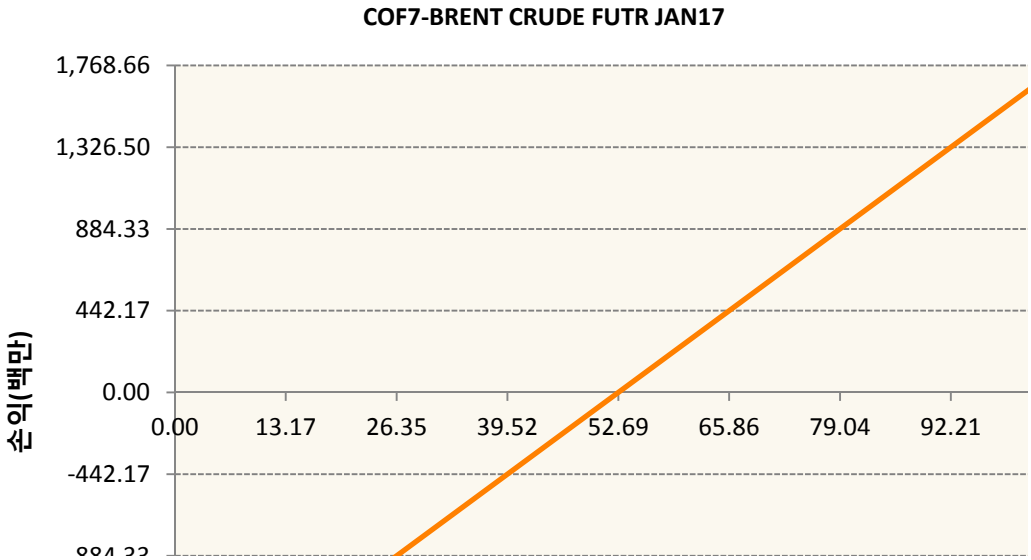
1. 계약금액

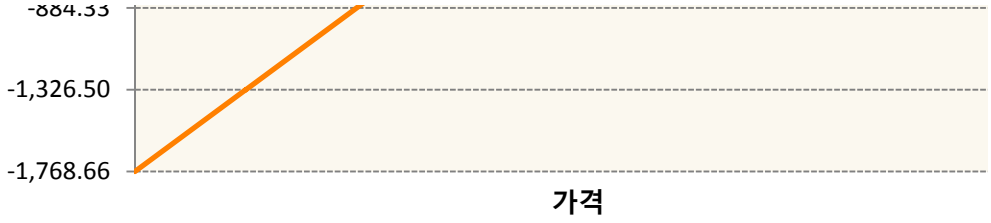
(단위:백만원)

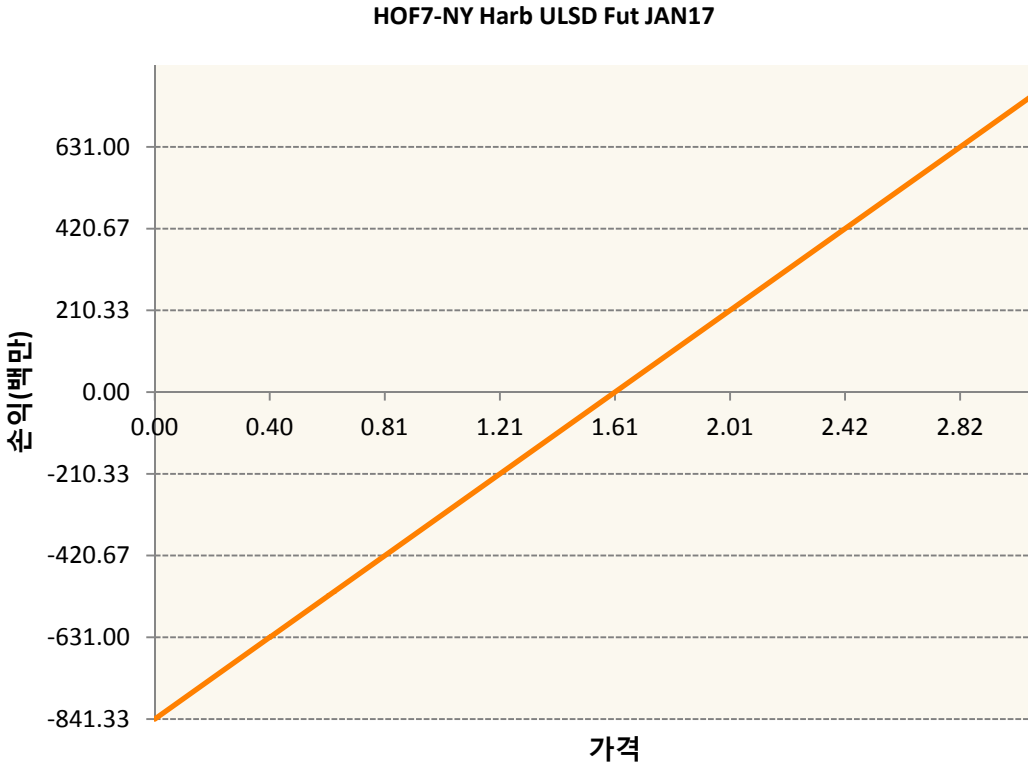
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	6,831	0	6,831	

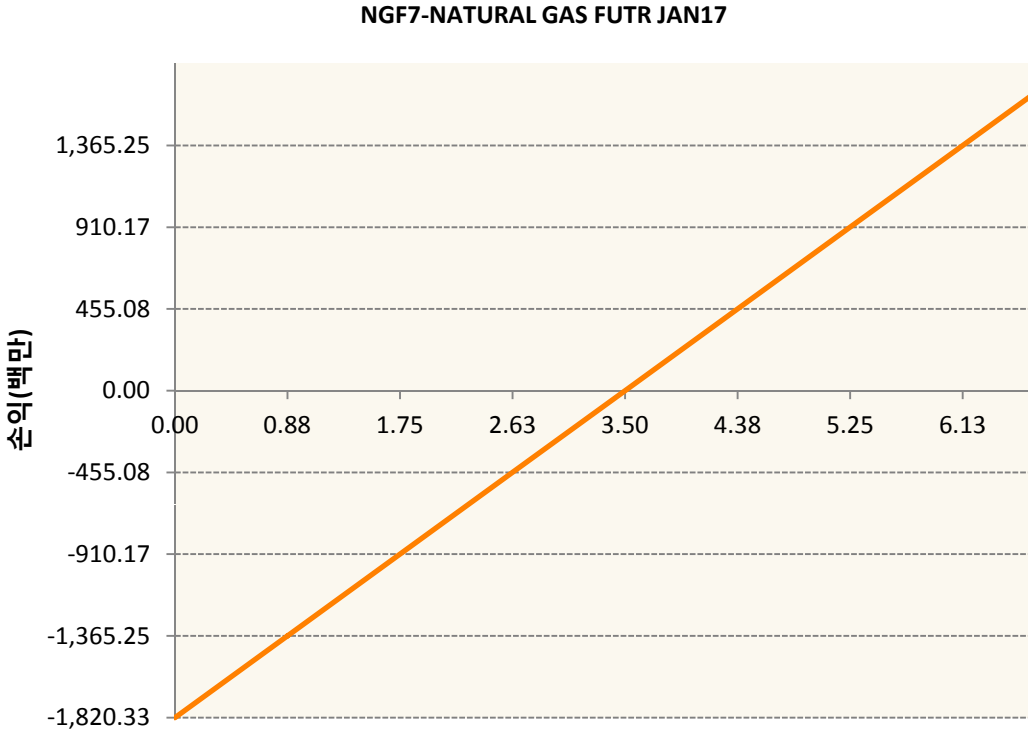
2. 만기시점의 손익구조



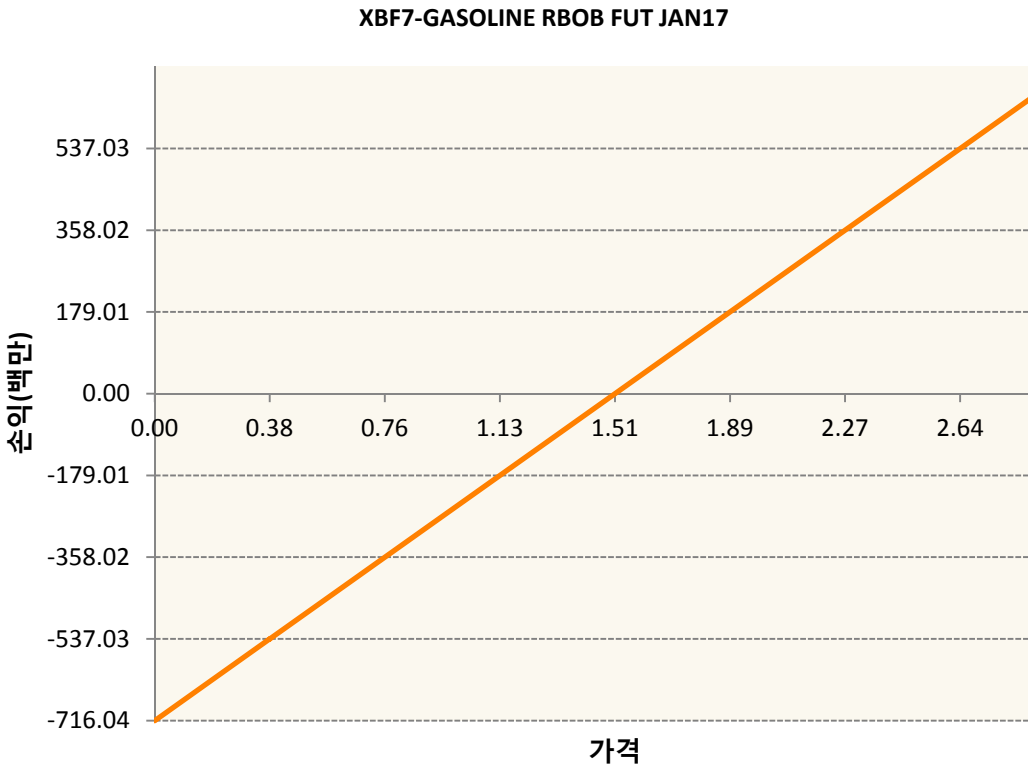



-884.33
-1,326.50
-1,768.66
가격


HOF7-NY Harb ULSD Fut JAN17
631.00
420.67
210.33
0.00
-210.33
-420.67
-631.00
-841.33
0.00
0.40
0.81
1.21
1.61
2.01
2.42
2.82
손익(백만)
가격


NGF7-NATURAL GAS FUTR JAN17
1,365.25
910.17
455.08
0.00
-455.08
-910.17
-1,365.25
-1,820.33
0.00
0.88
1.75
2.63
3.50
4.38
5.25
6.13
손익(백만)

가격



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
CLF7	WTI CRUDE FUTURE JAN17	135
COF7	BRENT CRUDE FUTR JAN17	141
HOF7	NY Harb ULSD Fut JAN17	67
NGF7	NATURAL GAS FUTR JAN17	146
XBF7	GASOLINE RBOB FUT JAN17	57

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,217

공시일	2016-10-25
기준일	2016-10-24

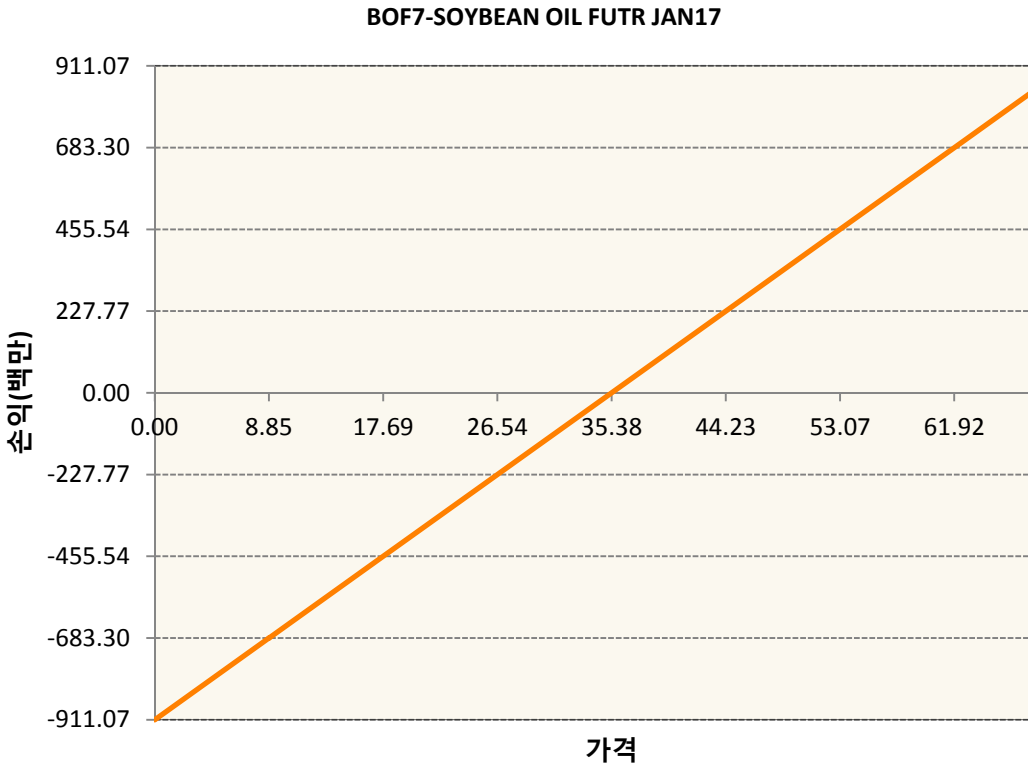
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

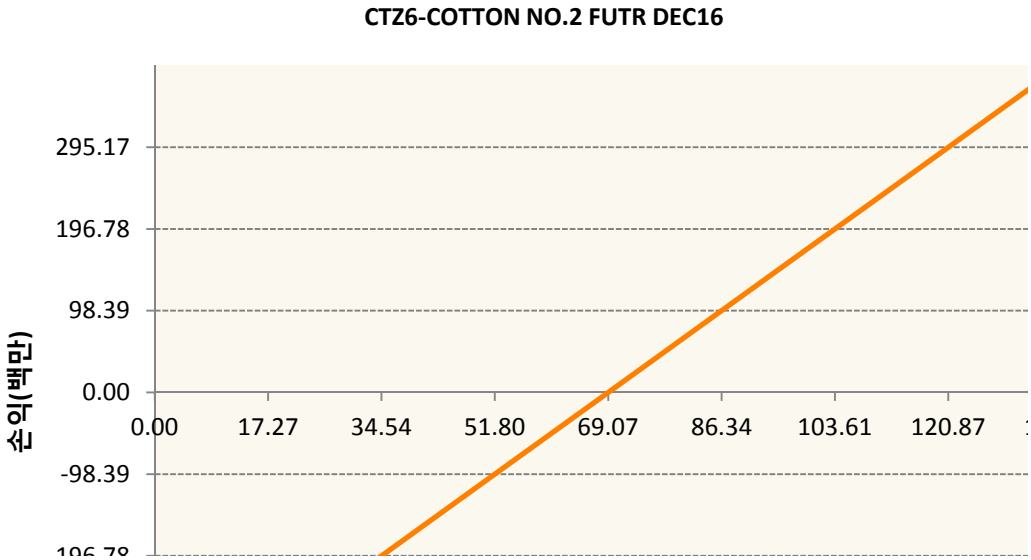
1. 계약금액

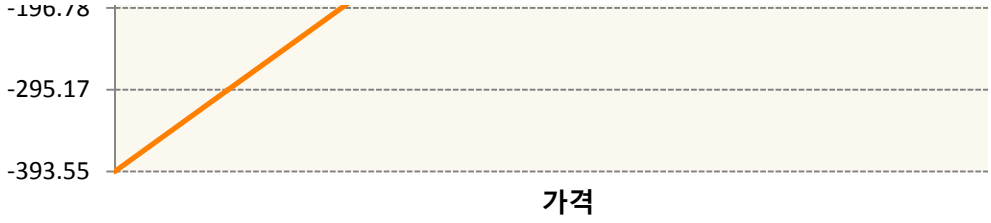
(단위:백만원)

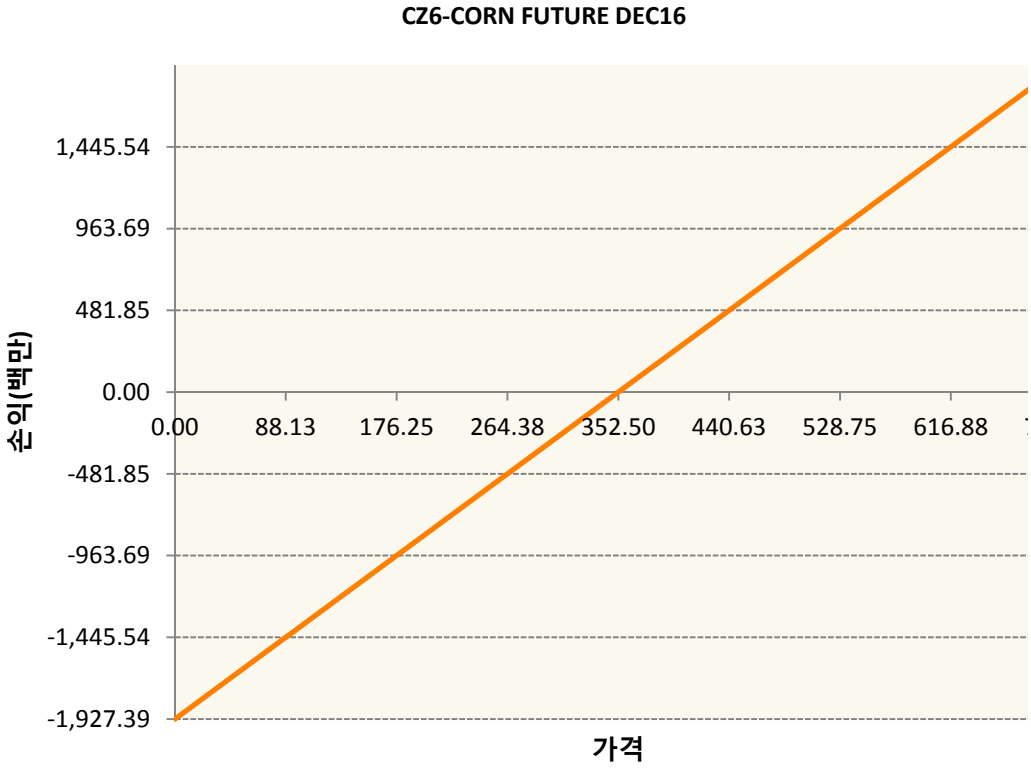
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	9,241	0	9,241	

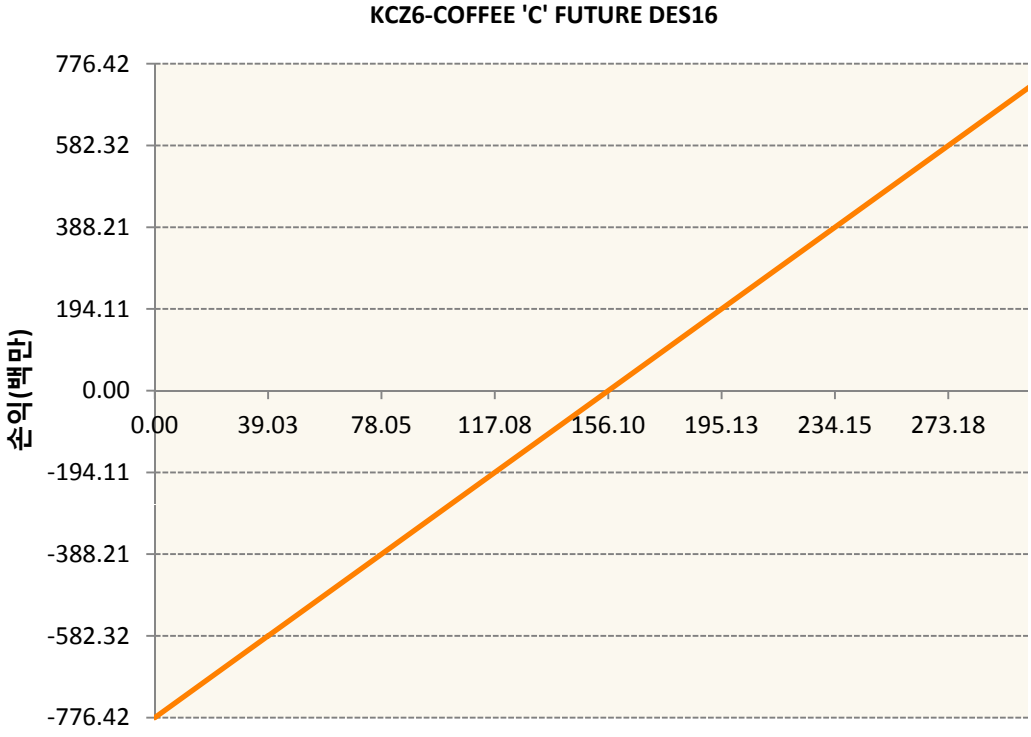
2. 만기시점의 손익구조





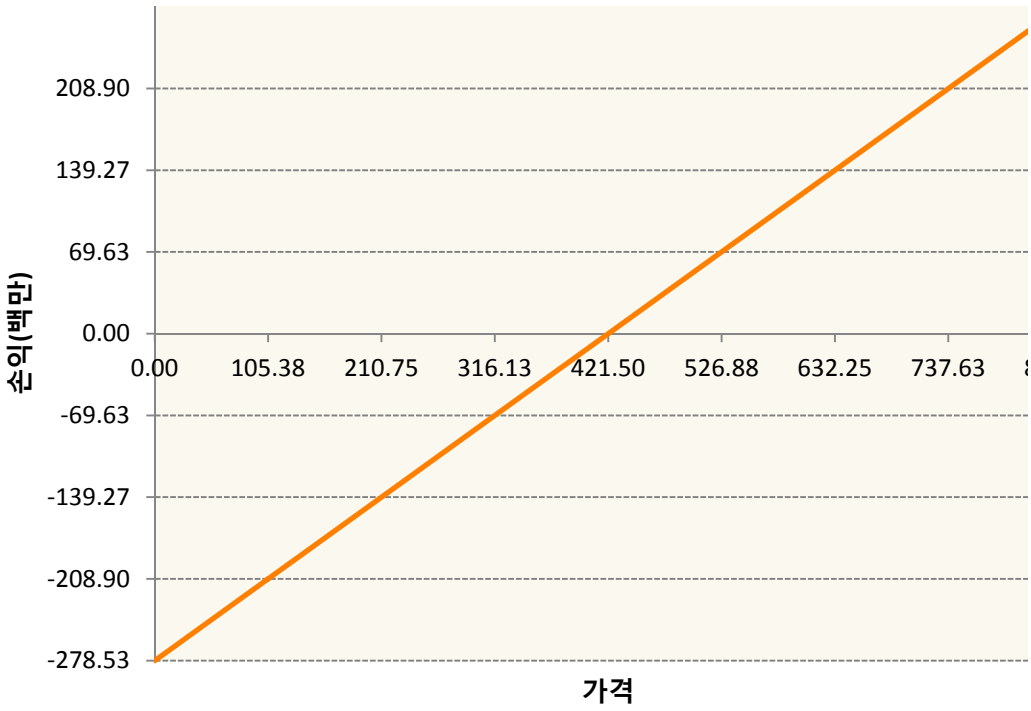

-196.78
-295.17
-393.55
가격


CZ6-CORN FUTURE DEC16
1,445.54
963.69
481.85
0.00
-481.85
-963.69
-1,445.54
-1,927.39
0.00
88.13
176.25
264.38
352.50
440.63
528.75
616.88
순익(백만)
가격

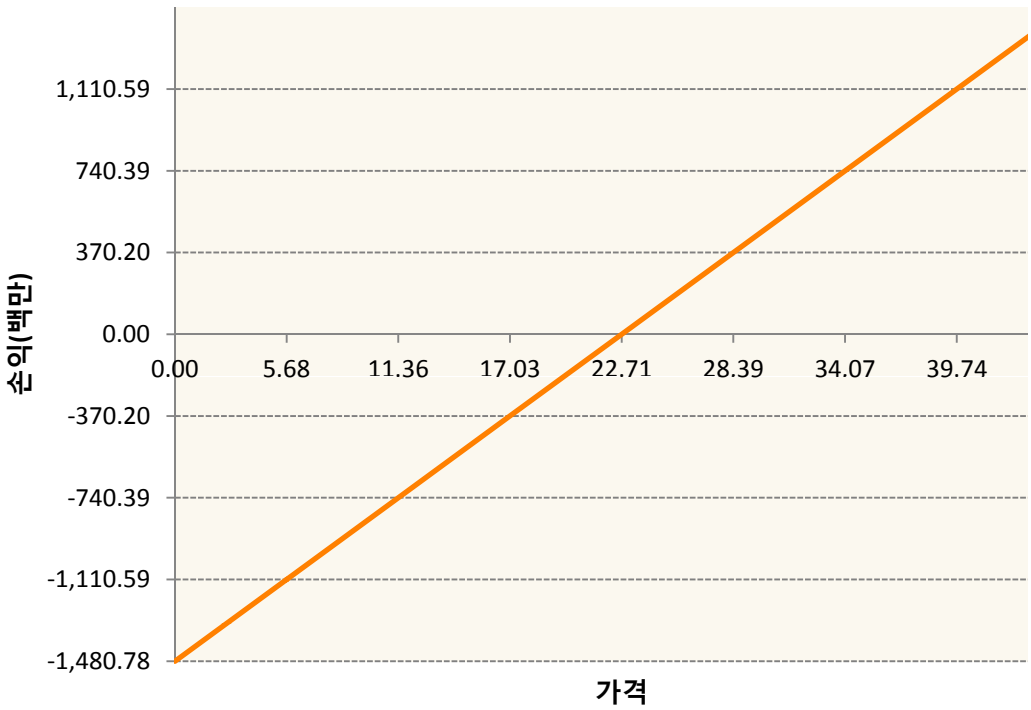

KCZ6-COFFEE 'C' FUTURE DES16
776.42
582.32
388.21
194.11
0.00
-194.11
-388.21
-582.32
-776.42
0.00
39.03
78.05
117.08
156.10
195.13
234.15
273.18
순익(백만)

가격

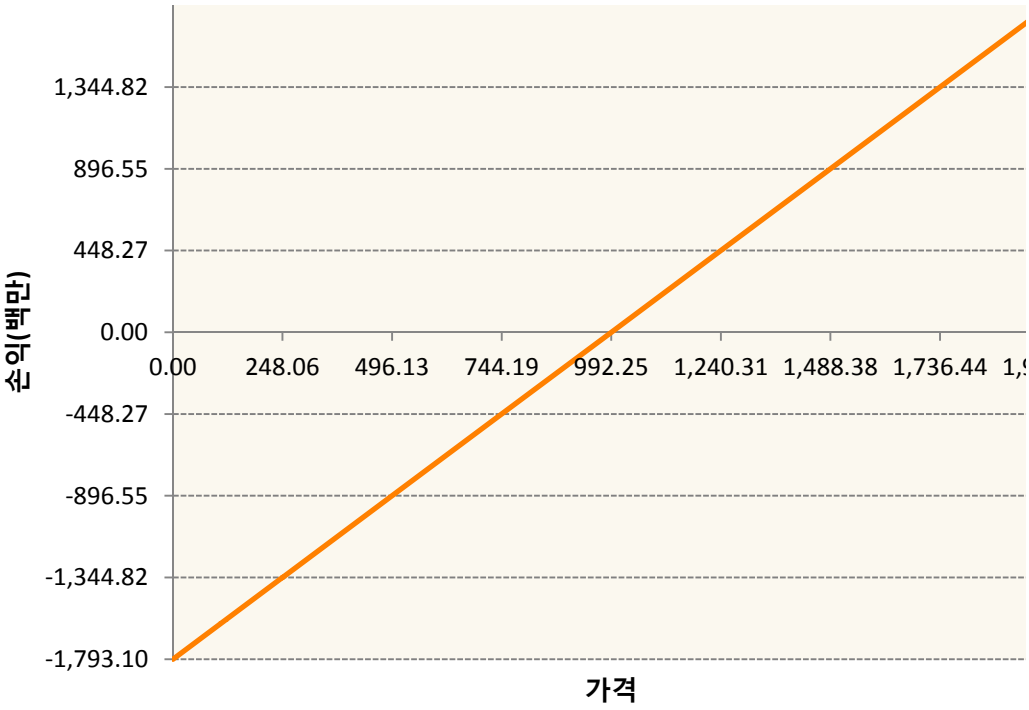
KWZ6-KC HRW WHEAT FUT DES16



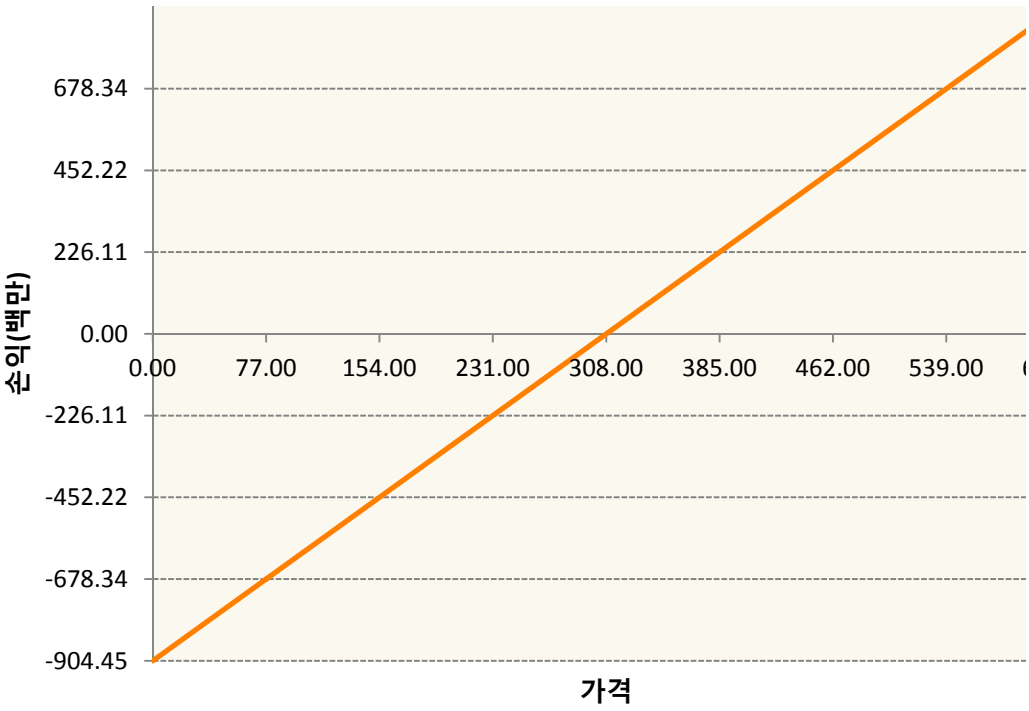
SBH7-Sugar #11 (WORLD) MAR17



SF7-SOYBEAN FUTURE JAN17

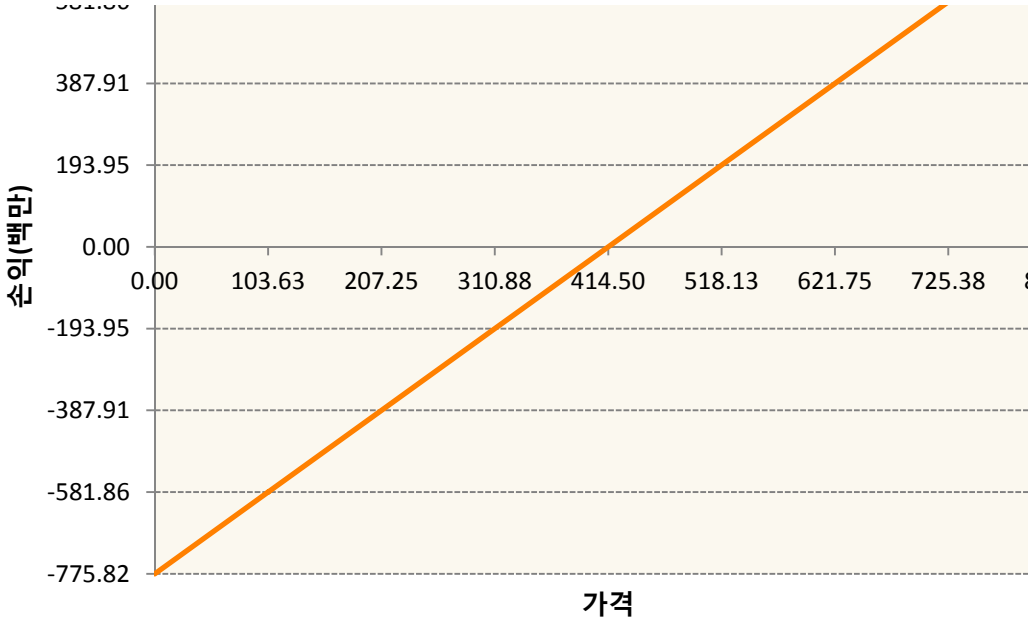


SMF7-SOYBEAN MEAL FUTR JAN17



WZ6-WHEAT FUTURE(CBT) DEC16





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

BOF7	SOYBEAN OIL FUTR JAN17	73
CTZ6	COTTON NO.2 FUTR DEC16	31
CZ6	CORN FUTURE DEC16	154
KCZ6	COFFEE 'C' FUTURE DES16	62
KWZ6	KC HRW WHEAT FUT DES16	22
SBH7	Sugar #11 (WORLD) MAR17	118
SF7	SOYBEAN FUTURE JAN17	143
SMF7	SOYBEAN MEAL FUTR JAN17	72
WZ6	WHEAT FUTURE(CBT) DEC16	62

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

927