공시일	2016-10-26
기준일	2016-10-25

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	2016-10-26
기준일	2016-10-25

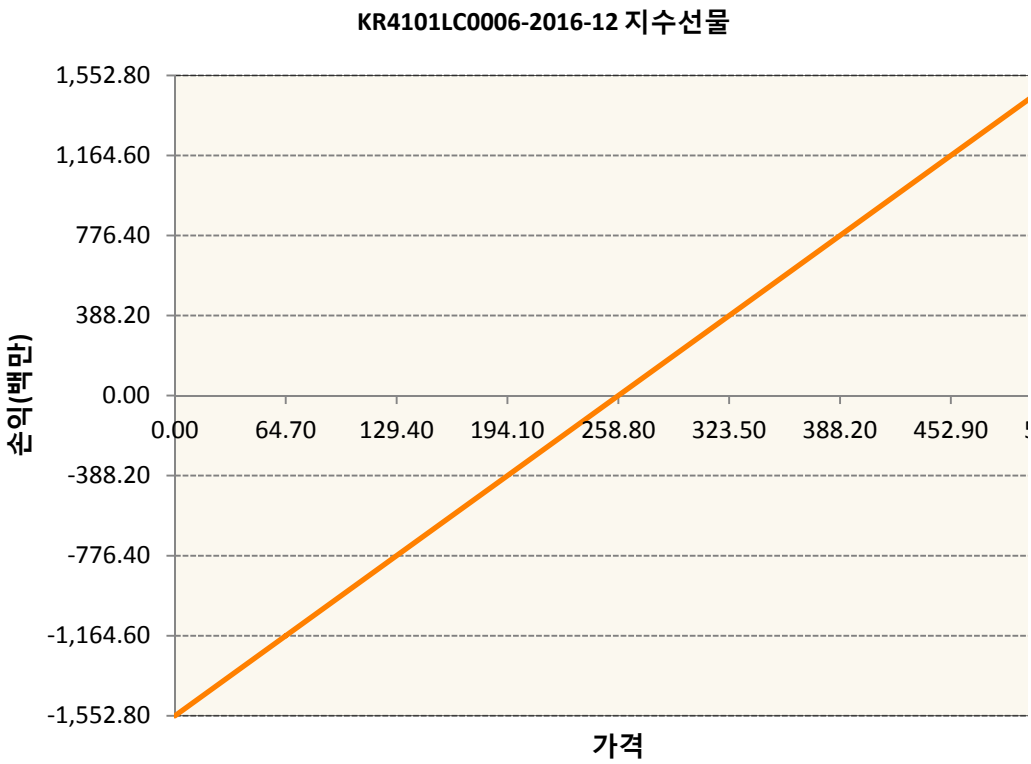
스마트인덱스모

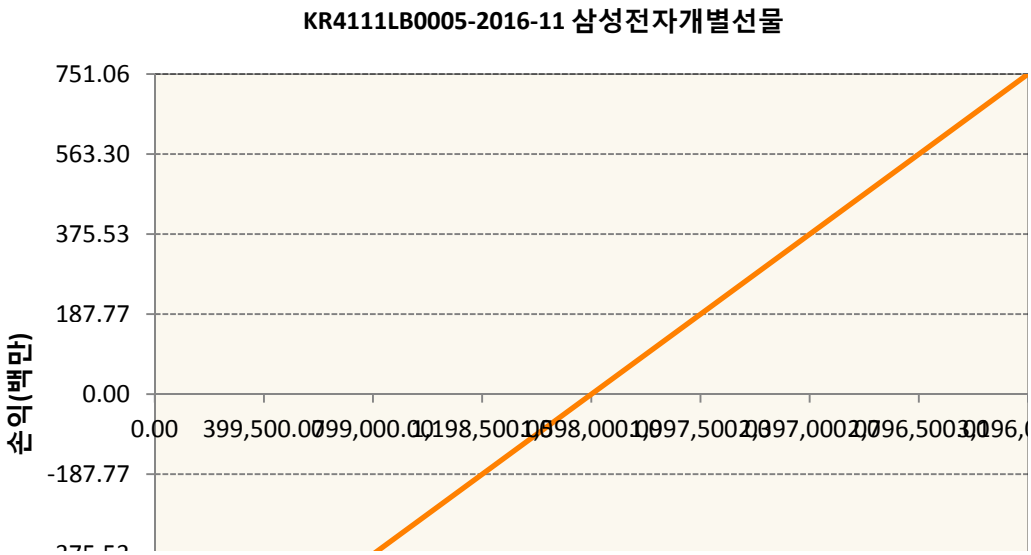
1. 계약금액

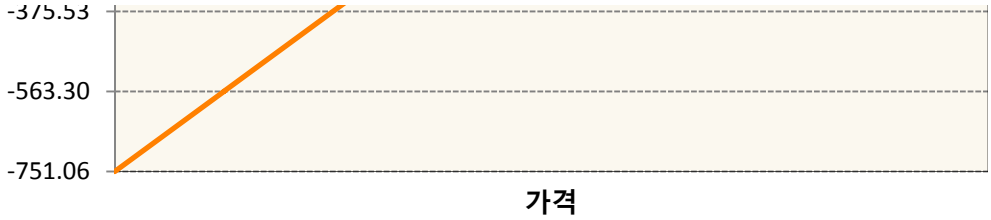
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,304	0	2,304	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							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)

161

공시일	2016-10-26
기준일	2016-10-25

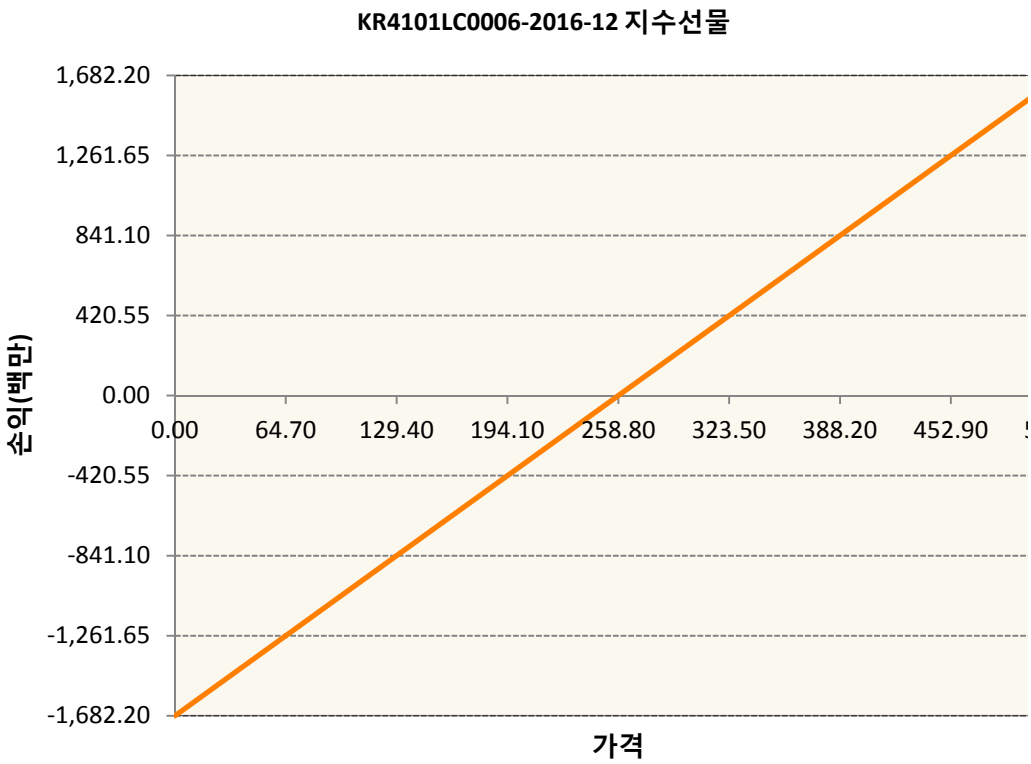
스마트레버리지목표전환형1호

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	1,682	0	1,682	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	2016-10-26
기준일	2016-10-25

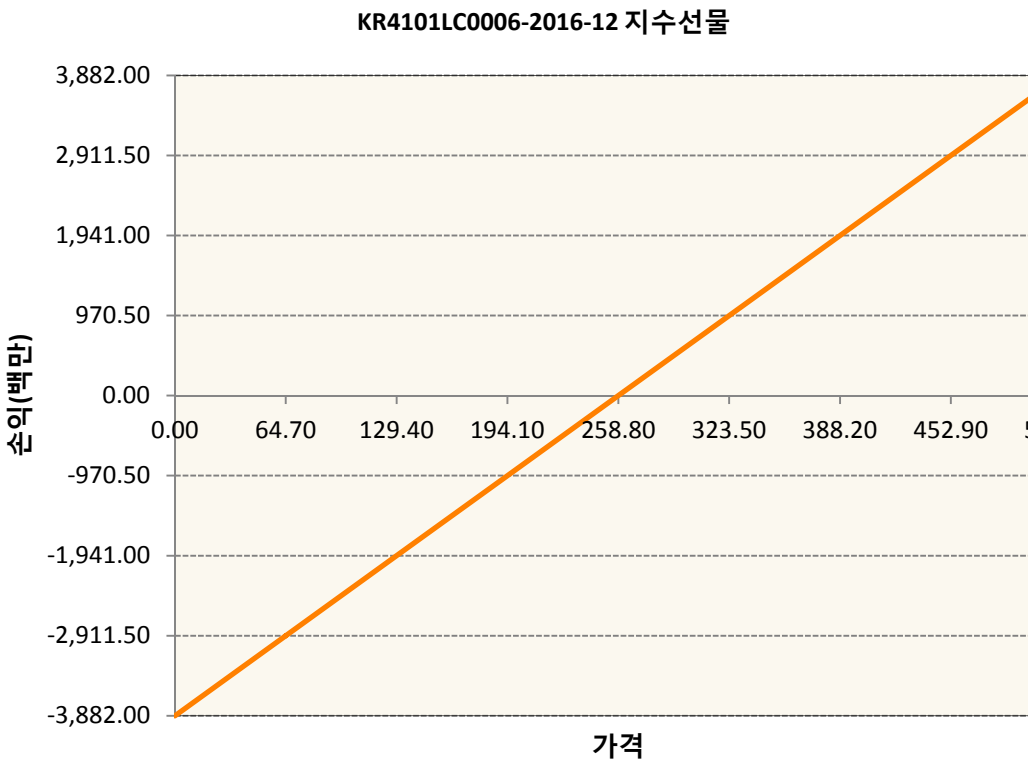
1.3배 레버리지 인덱스(주식-파생형)

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	3,882	0	3,882	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	2016-10-26
기준일	2016-10-25

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	878

* 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	2016-10-26
기준일	2016-10-25

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	405

* 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	2016-10-26
기준일	2016-10-25

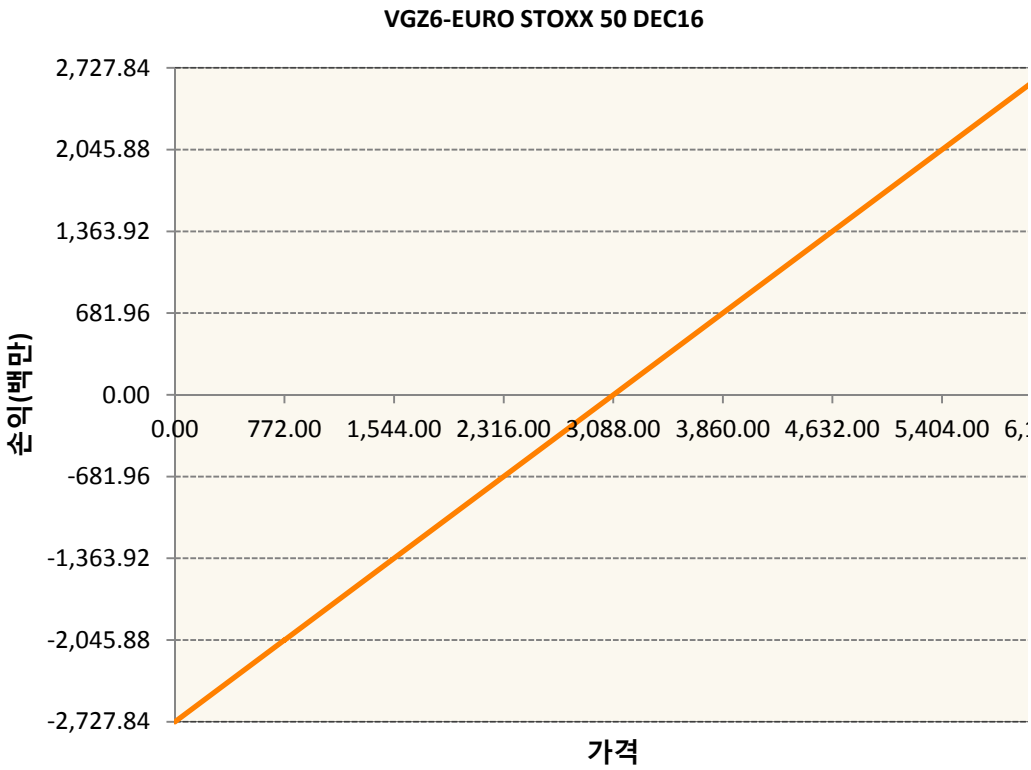
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,728	0	2,728	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGZ6	EURO STOXX 50 DEC16	218

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

(단위:백만원)

265

공시일	2016-10-26
기준일	2016-10-25

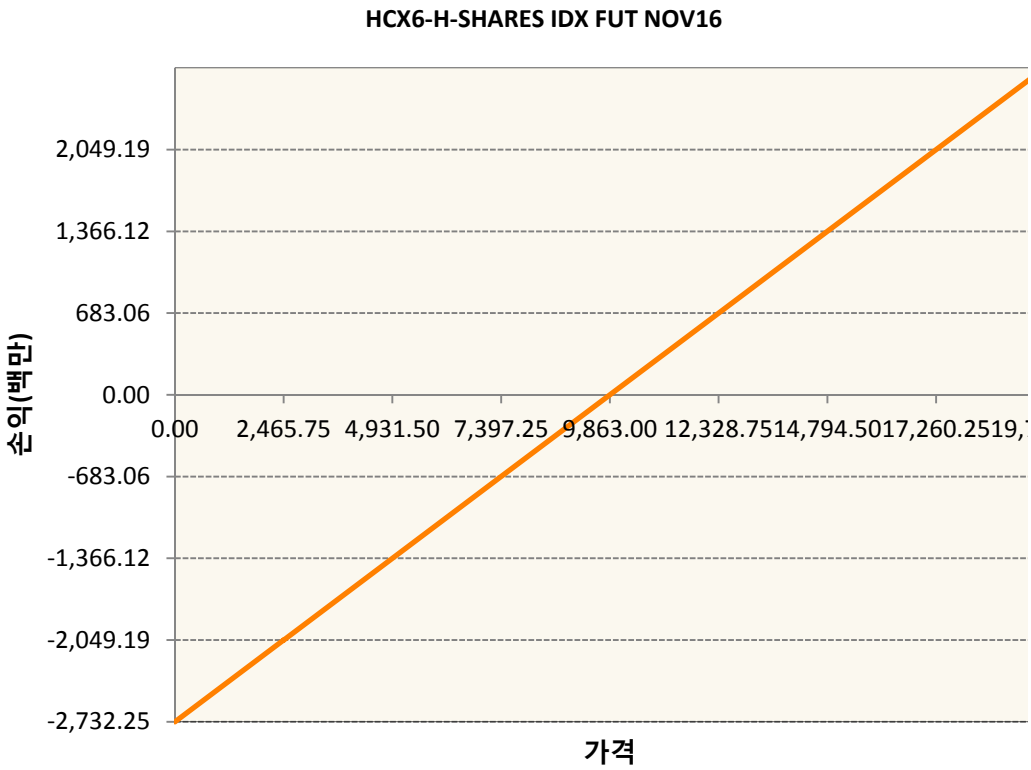
차이나인덱스모(주식-파생형)

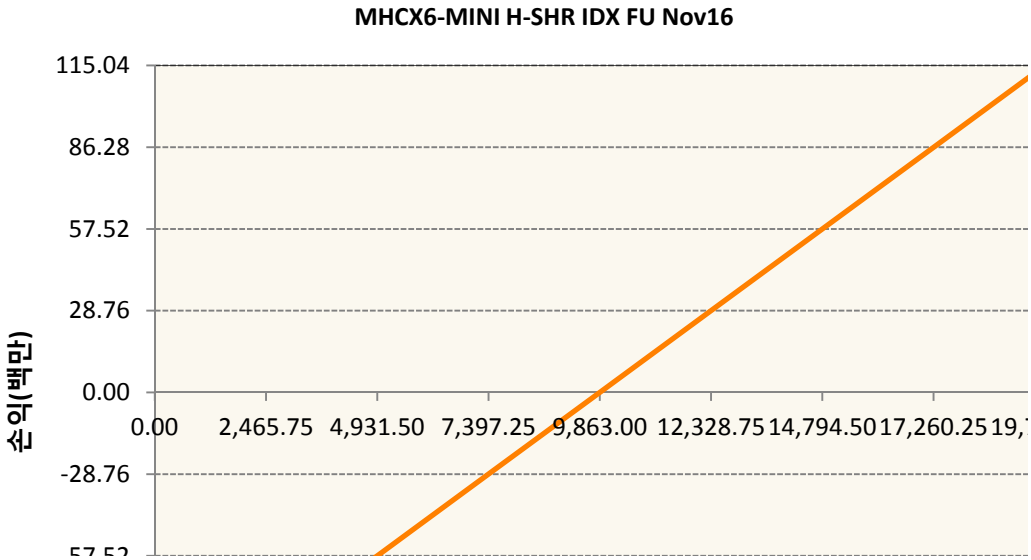
1. 계약금액

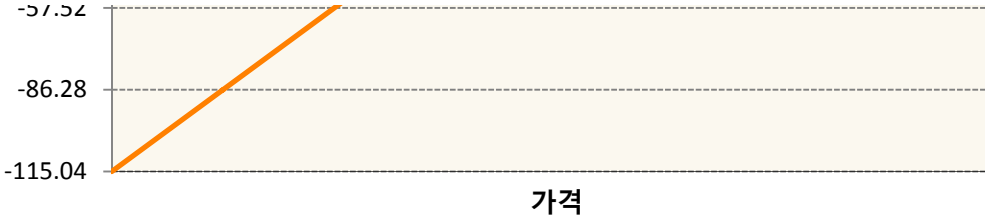
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,847	0	2,847	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCX6	H-SHARES IDX FUT NOV16	219
MHCX6	MINI H-SHR IDX FU Nov16	9

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	307

공시일	2016-10-26
기준일	2016-10-25

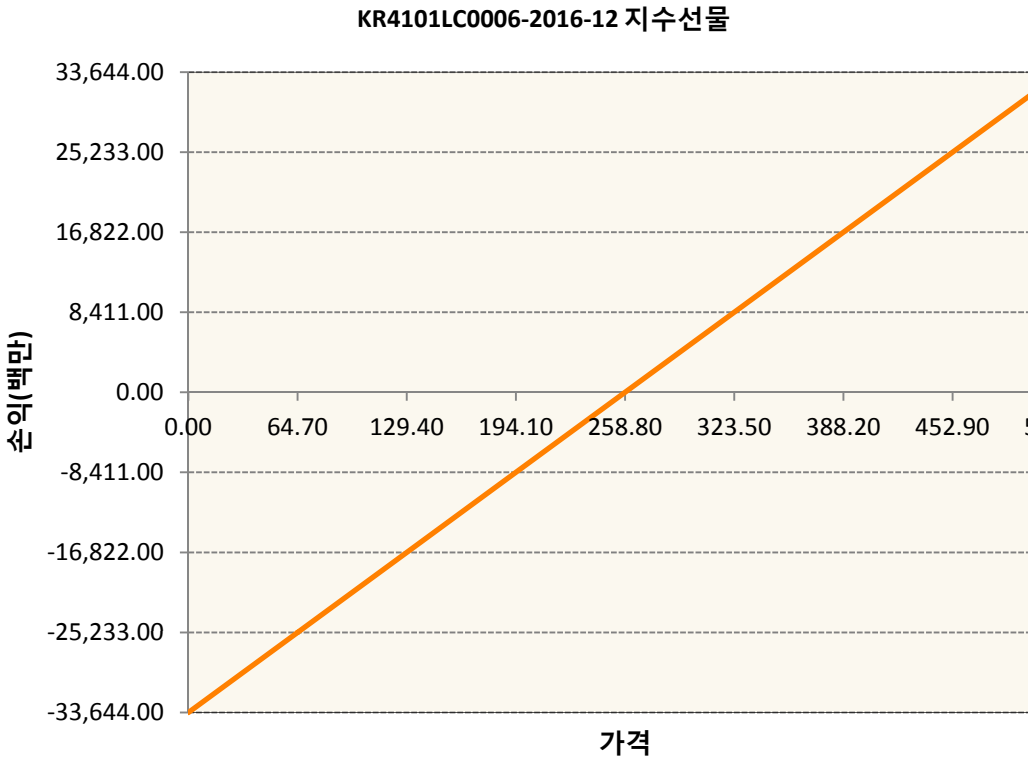
커버드콜(주식혼합-파생형)

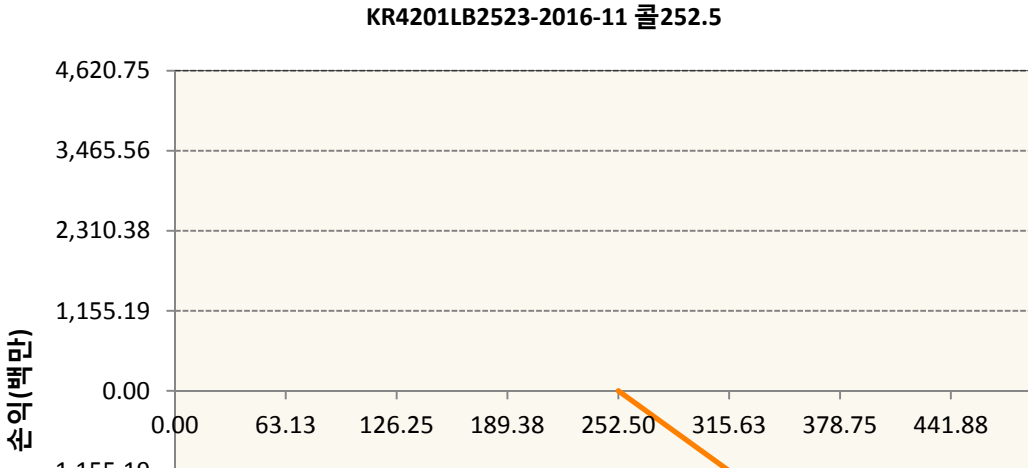
1. 계약금액

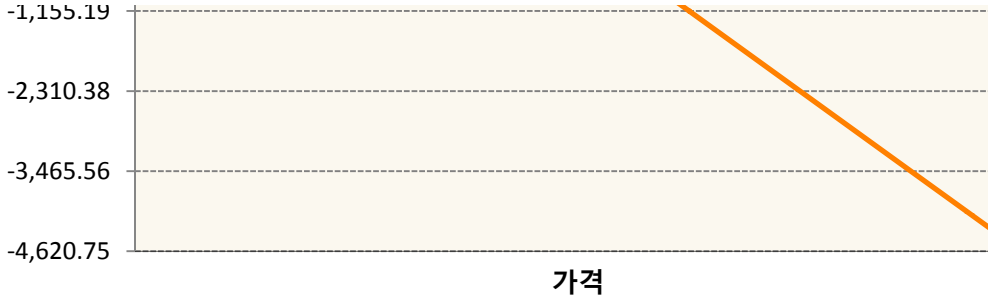
(단위:백만원)

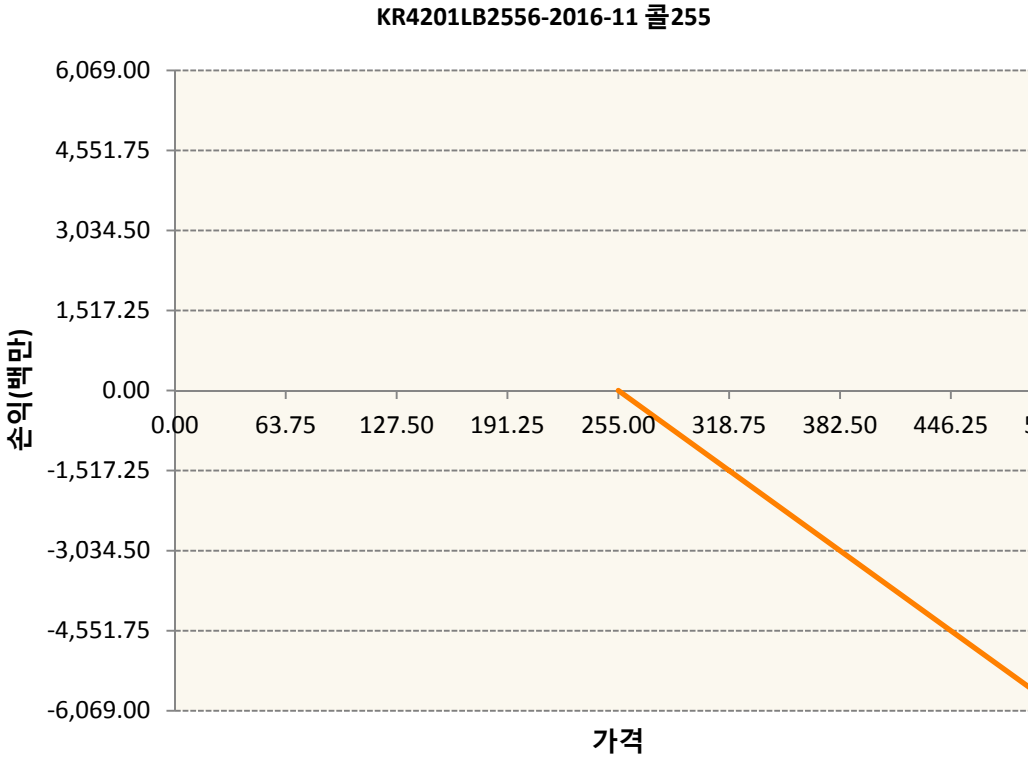
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	33,644	0	33,644	장내
누계	유가증권	옵션	0	10,690	-10,690	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101LC00 2016-12 지수선물							2,689
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-2,689	-2,689	-2,689	-2,689	-2,689	-2,689	-2,689
-5.33%	-1,793	-1,793	-1,793	-1,793	-1,793	-1,793	-1,793
-2.67%	-896	-896	-896	-896	-896	-896	-896
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	896	896	896	896	896	896	896
5.33%	1,793	1,793	1,793	1,793	1,793	1,793	1,793
8.00%	2,689	2,689	2,689	2,689	2,689	2,689	2,689
KR4201LB25 2016-11 콜252.5							1,828
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	616	616	615	614	612	609	606
-5.33%	605	598	590	580	570	558	545
-2.67%	469	449	429	409	388	368	348
0%	37	26	13	0	-14	-29	-45
2.67%	-568	-569	-571	-574	-578	-583	-590
5.33%	-1,197	-1,197	-1,197	-1,198	-1,198	-1,199	-1,200
8.00%	-1,828	-1,828	-1,828	-1,828	-1,828	-1,828	-1,828
KR4201LB25 2016-11 콜255							2,305

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	577	577	577	576	575	573	571
-5.33%	573	569	564	556	548	537	526
-2.67%	486	464	442	418	394	370	346
0%	68	46	23	0	-24	-48	-73
2.67%	-669	-674	-680	-688	-697	-708	-721
5.33%	-1,484	-1,484	-1,485	-1,486	-1,487	-1,490	-1,493
8.00%	-2,304	-2,304	-2,304	-2,304	-2,304	-2,304	-2,305

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

7,066

공시일	2016-10-26
기준일	2016-10-25

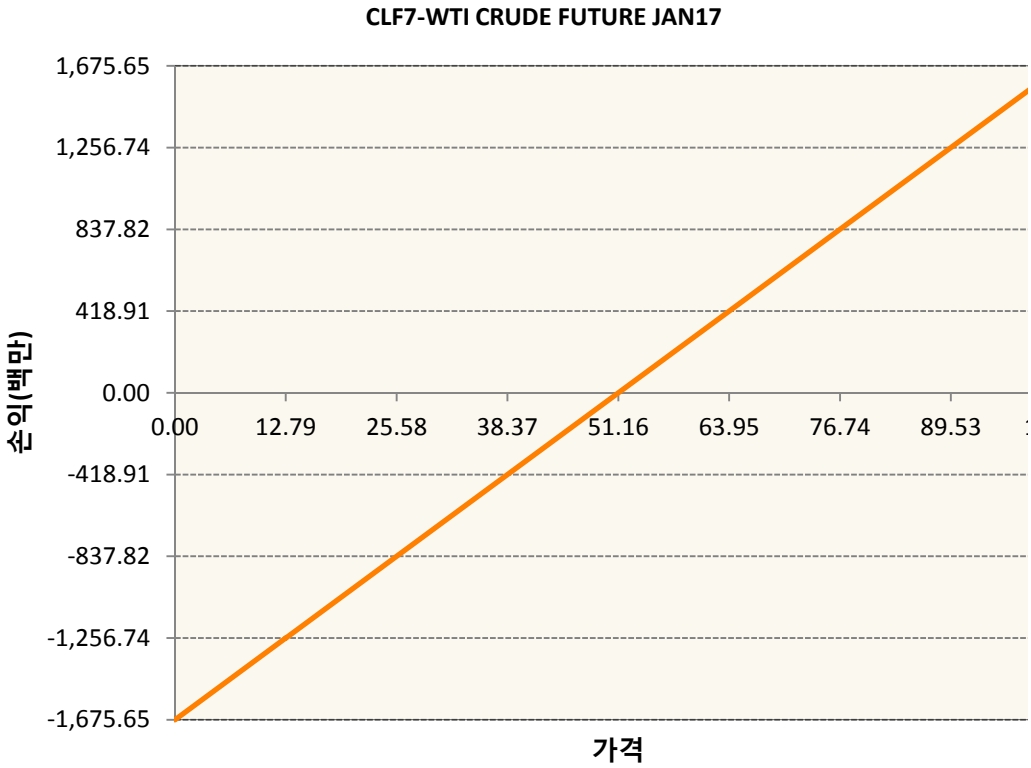
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

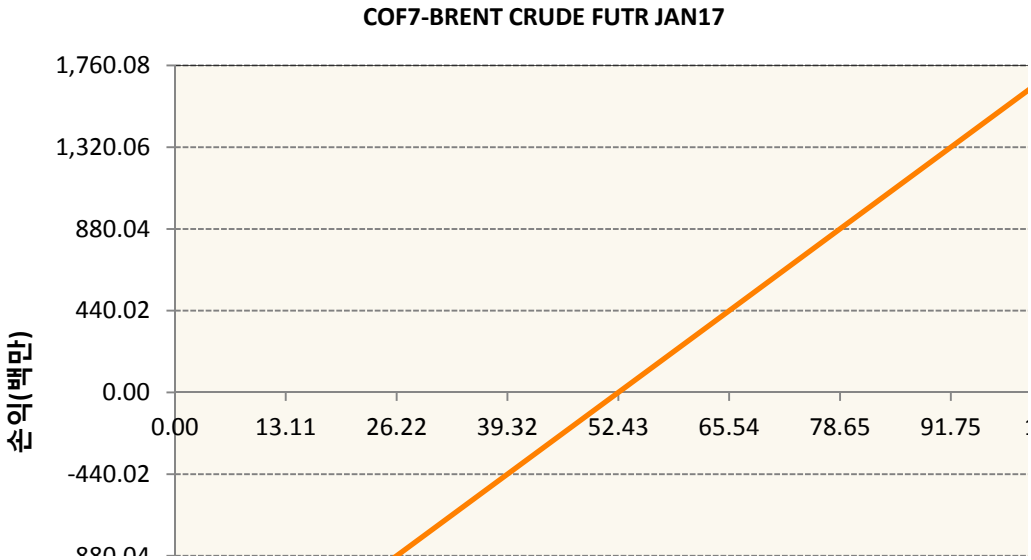
1. 계약금액

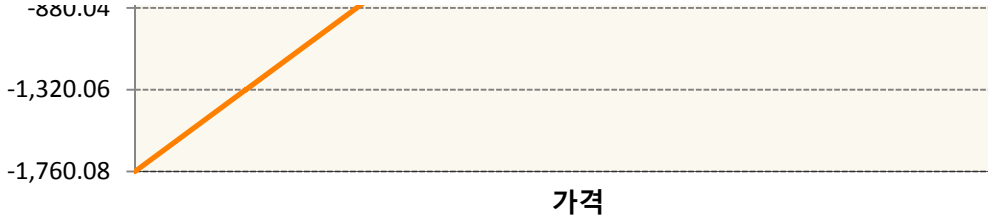
(단위:백만원)

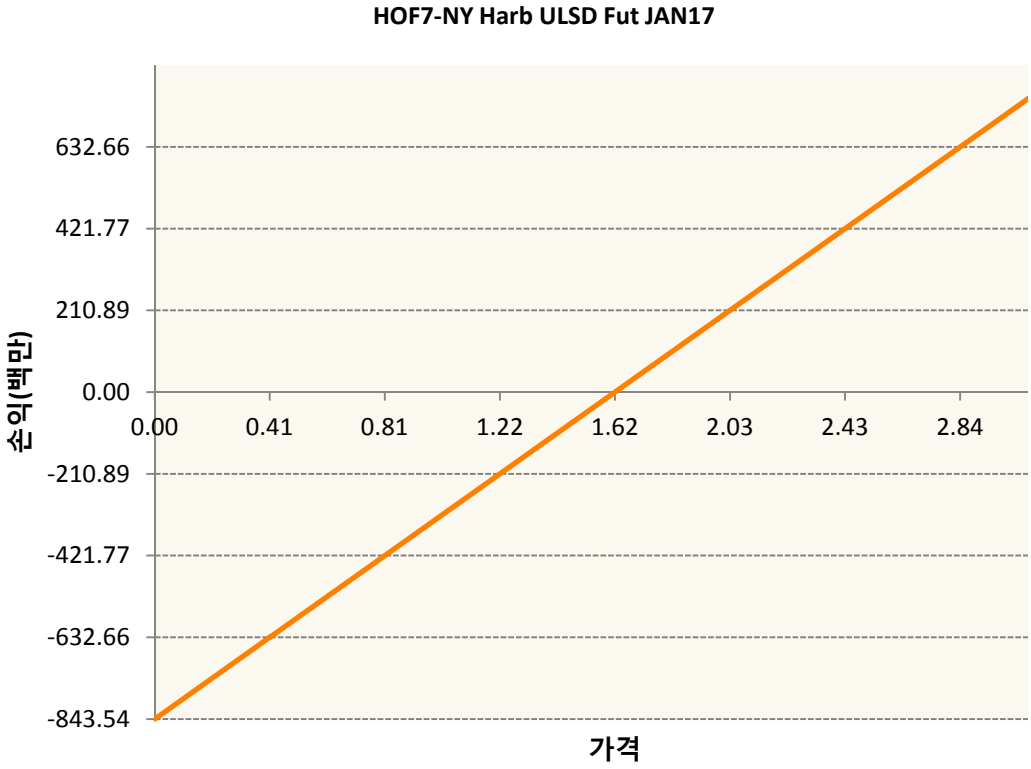
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	6,786	0	6,786	

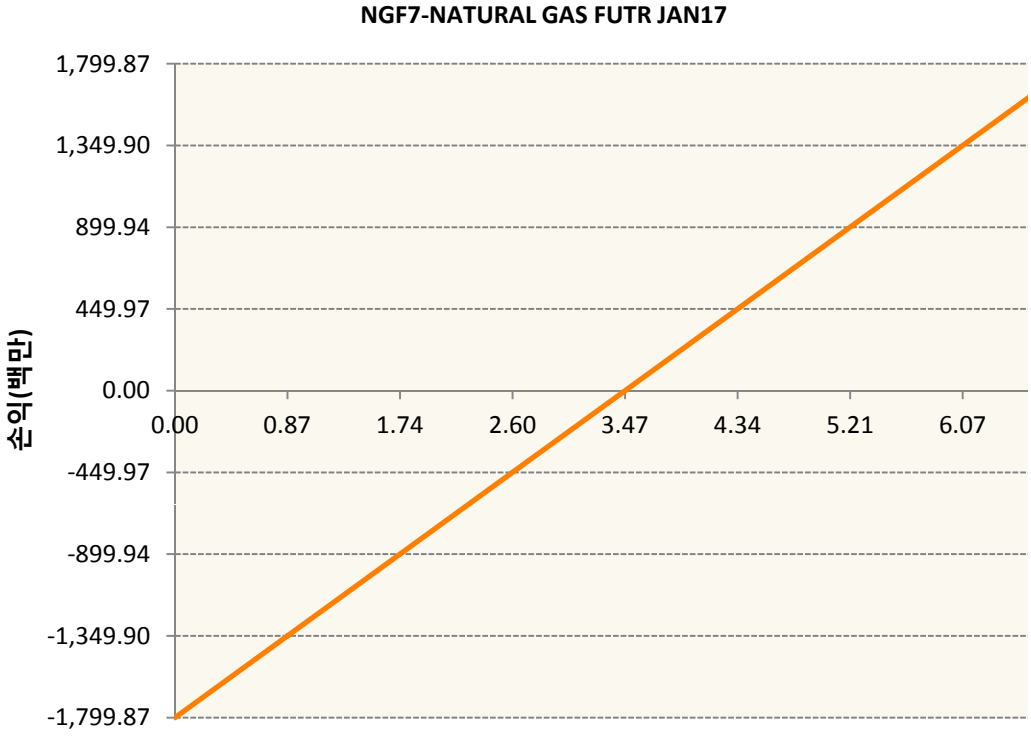
2. 만기시점의 손익구조



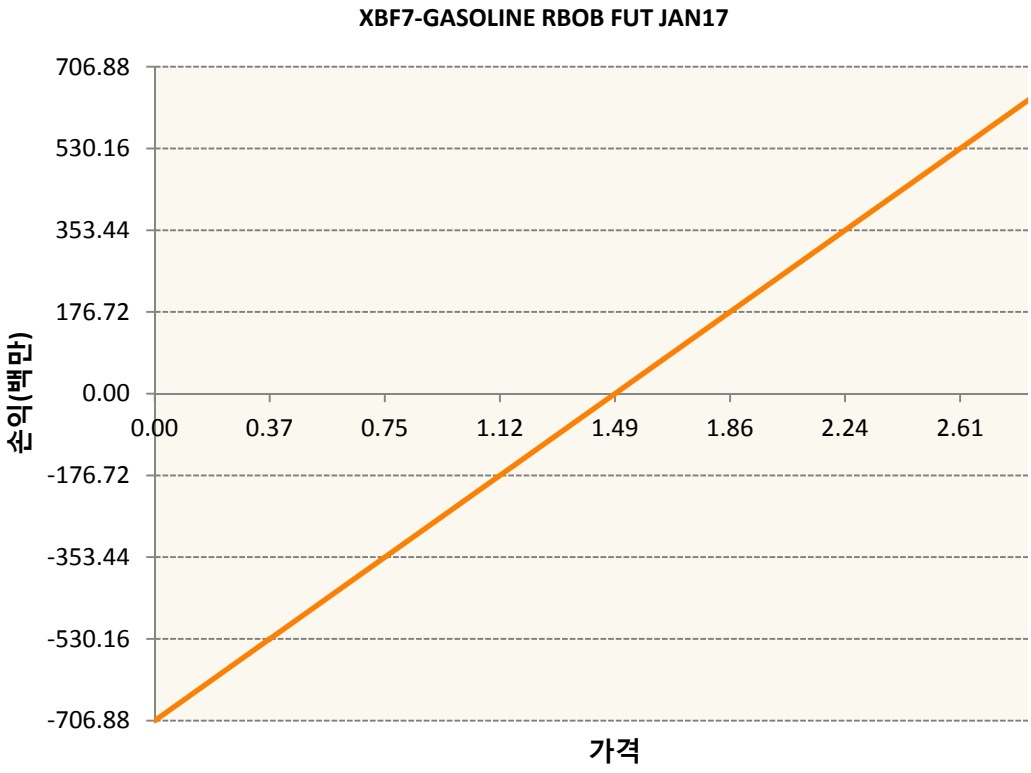



-1,320.06
-1,760.08
가격


HOF7-NY Harb ULSD Fut JAN17
632.66
421.77
210.89
0.00
-210.89
-421.77
-632.66
-843.54
0.00
0.41
0.81
1.22
1.62
2.03
2.43
2.84
순익(백만)
가격


NGF7-NATURAL GAS FUTR JAN17
1,799.87
1,349.90
899.94
449.97
0.00
-449.97
-899.94
-1,349.90
-1,799.87
0.00
0.87
1.74
2.60
3.47
4.34
5.21
6.07
순익(백만)

가격



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
CLF7	WTI CRUDE FUTURE JAN17	134
COF7	BRENT CRUDE FUTR JAN17	141
HOF7	NY Harb ULSD Fut JAN17	67
NGF7	NATURAL GAS FUTR JAN17	144
XBF7	GASOLINE RBOB FUT JAN17	57

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,209

공시일	2016-10-26
기준일	2016-10-25

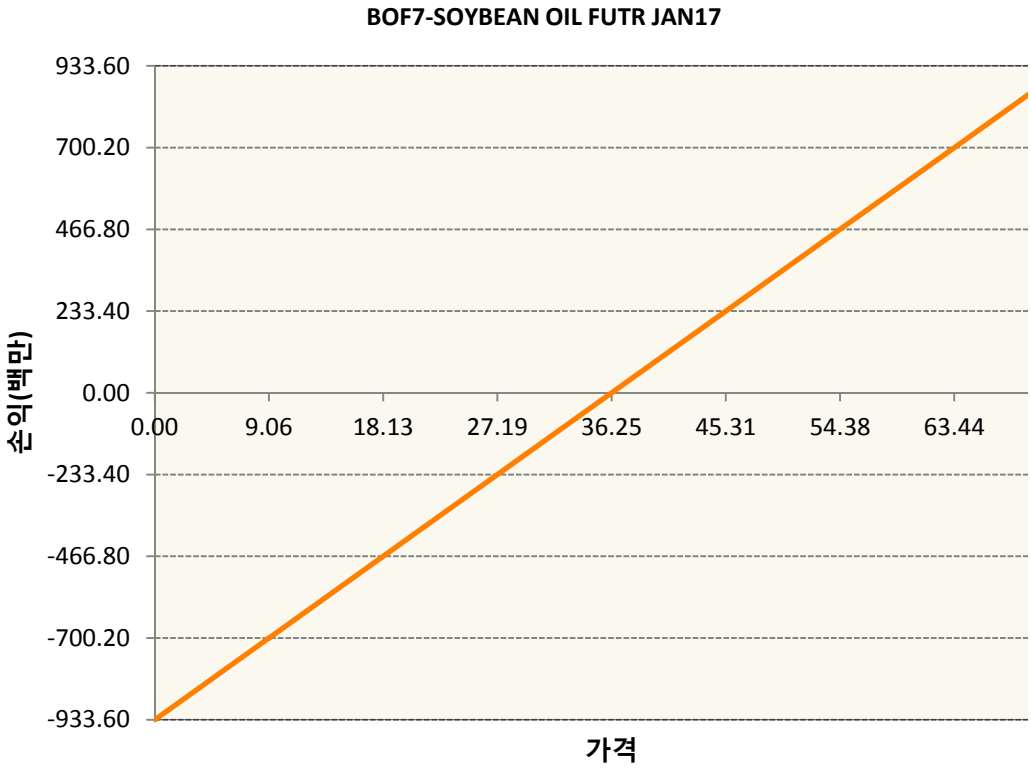
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

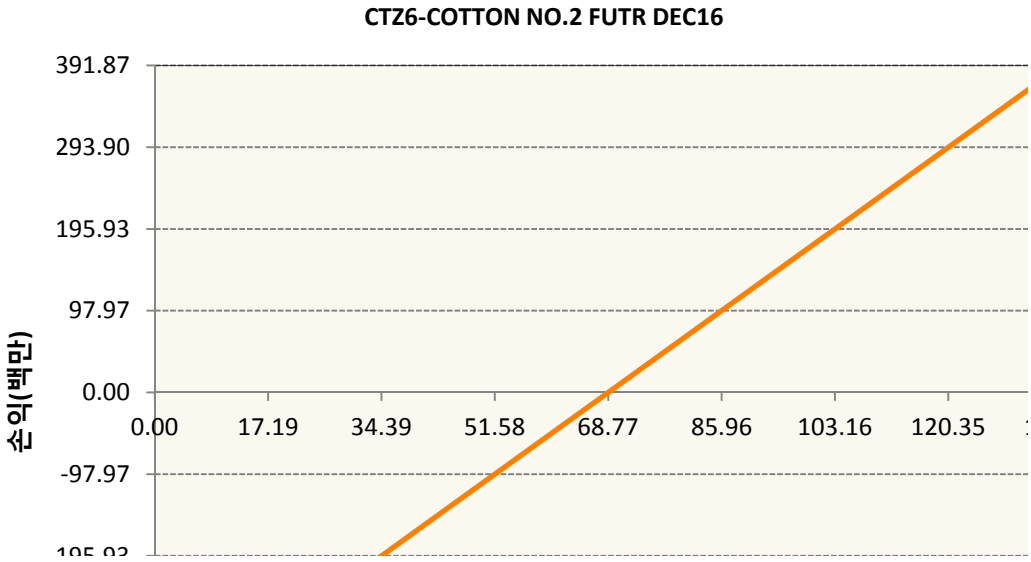
1. 계약금액

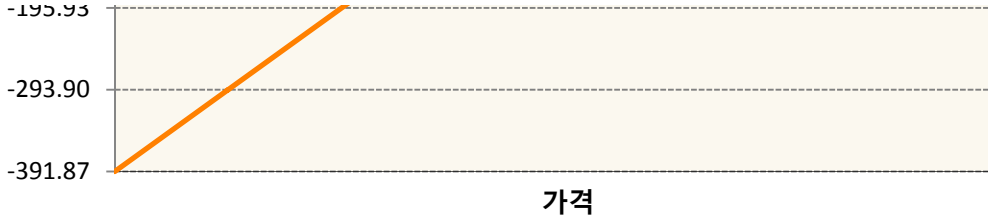
(단위:백만원)

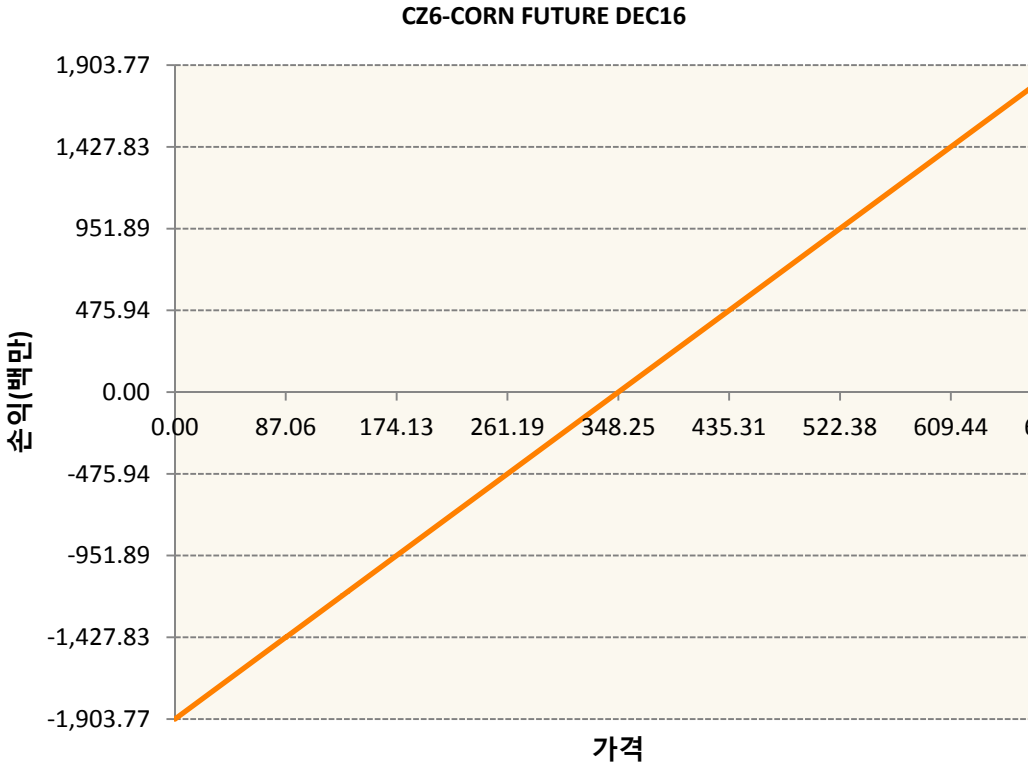
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	9,272	0	9,272	

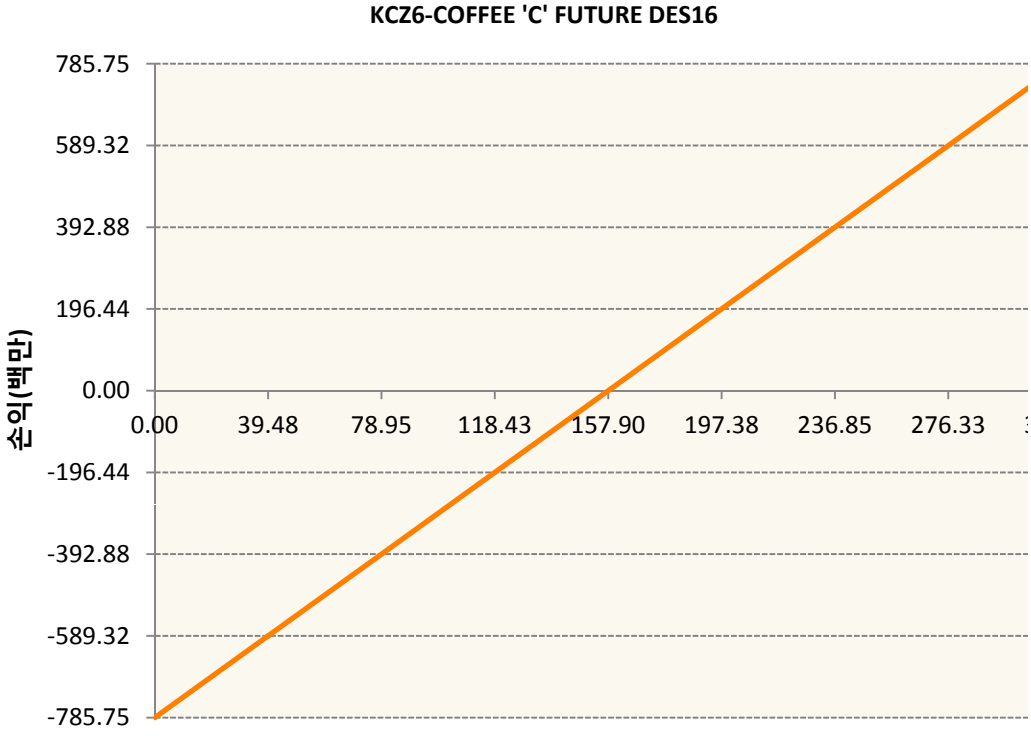
2. 만기시점의 손익구조





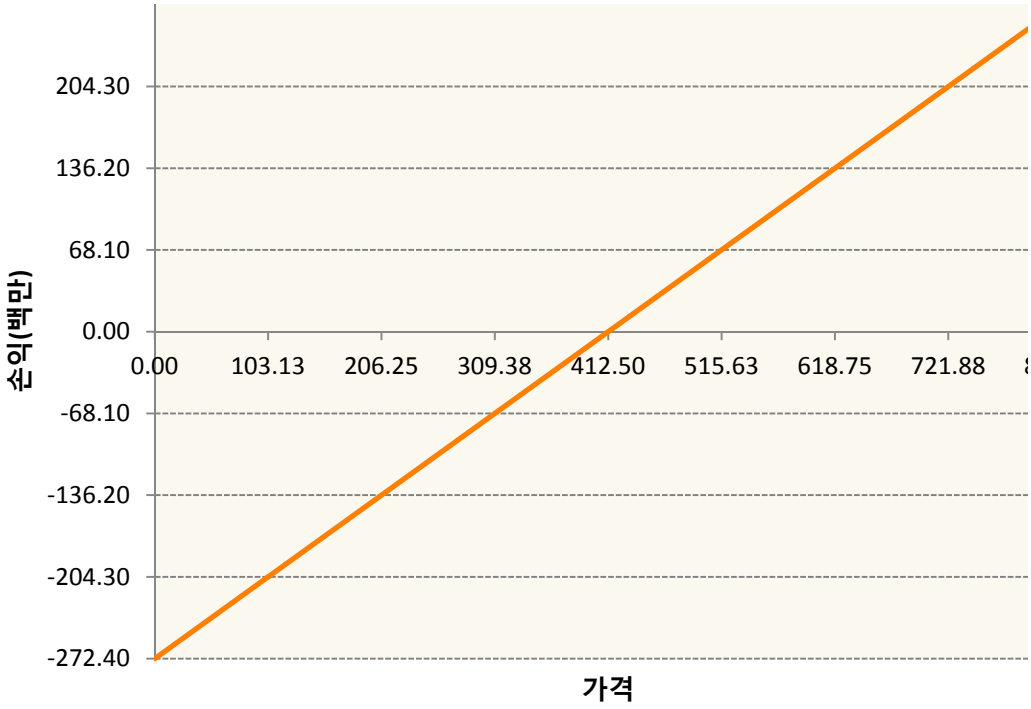

-293.90
-391.87
가격


CZ6-CORN FUTURE DEC16
1,903.77
1,427.83
951.89
475.94
0.00
-475.94
-951.89
-1,427.83
-1,903.77
0.00
87.06
174.13
261.19
348.25
435.31
522.38
609.44
순익(백만)
가격

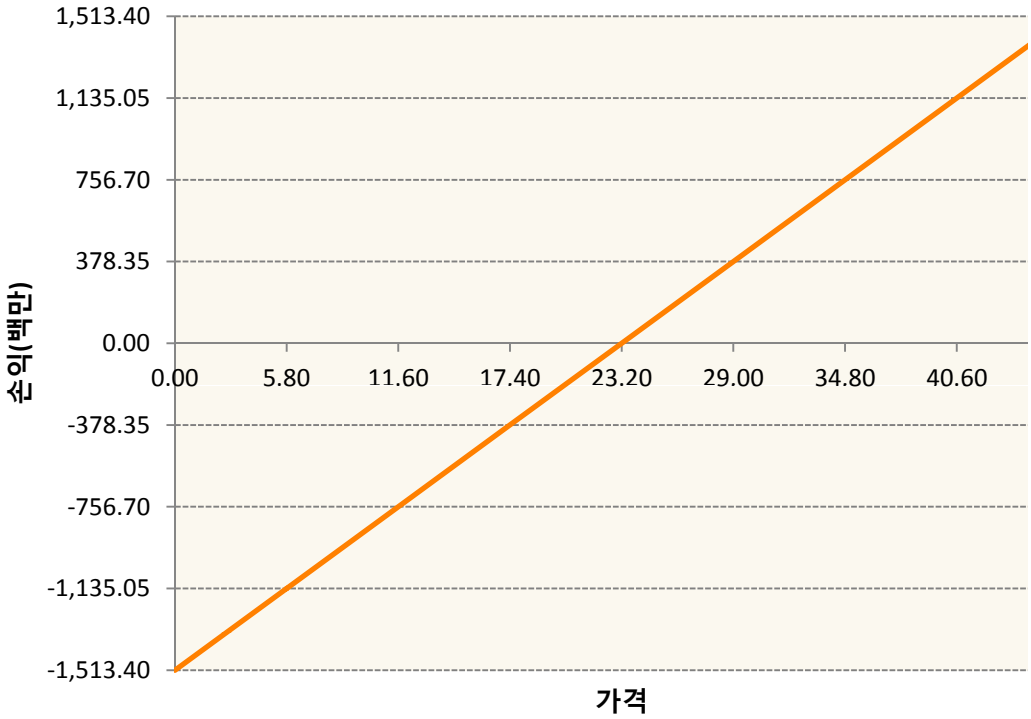

KCZ6-COFFEE 'C' FUTURE DES16
785.75
589.32
392.88
196.44
0.00
-196.44
-392.88
-589.32
-785.75
0.00
39.48
78.95
118.43
157.90
197.38
236.85
276.33
순익(백만)

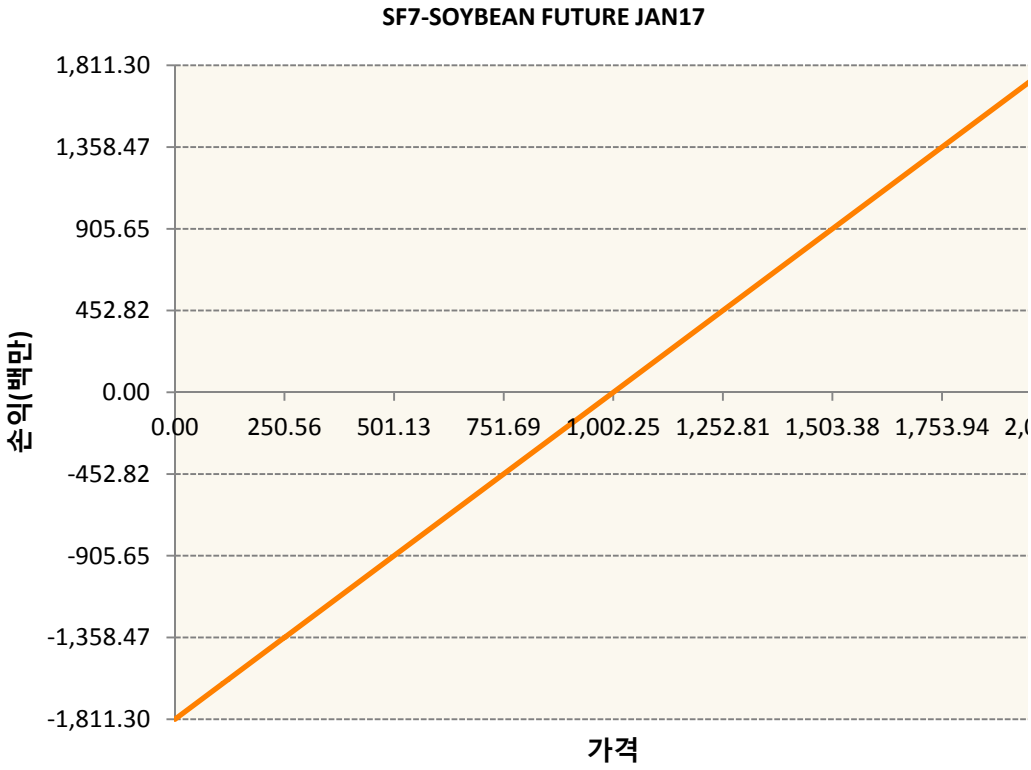
가격

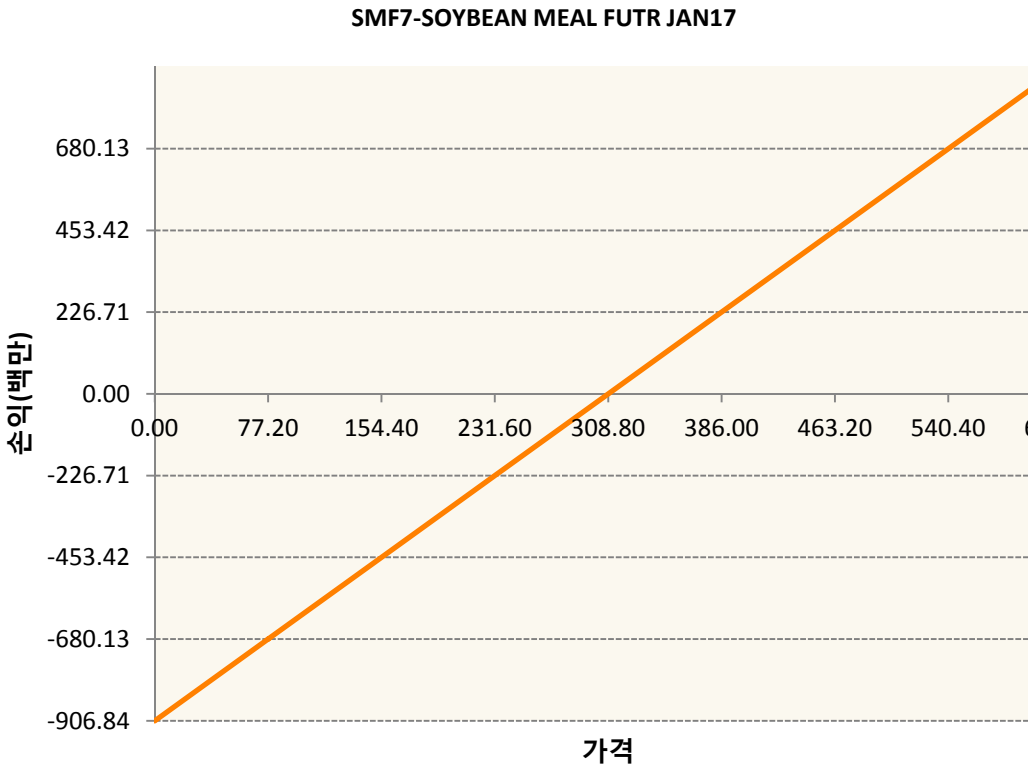
KWZ6-KC HRW WHEAT FUT DES16

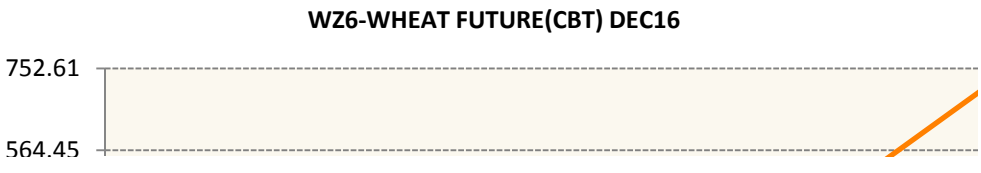


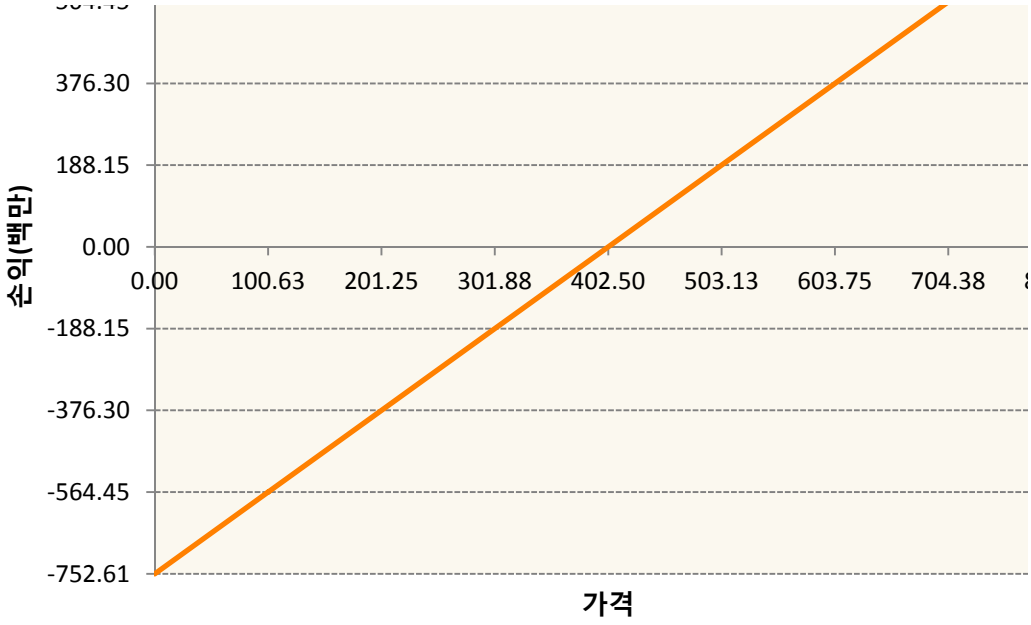
SBH7-Sugar #11 (WORLD) MAR17




SF7-SOYBEAN FUTURE JAN17
1,811.30
1,358.47
905.65
452.82
0.00
-452.82
-905.65
-1,358.47
-1,811.30
0.00
250.56
501.13
751.69
1,002.25
1,252.81
1,503.38
1,753.94
손익(백만)
가격


SMF7-SOYBEAN MEAL FUTR JAN17
680.13
453.42
226.71
0.00
-226.71
-453.42
-680.13
-906.84
0.00
77.20
154.40
231.60
308.80
386.00
463.20
540.40
손익(백만)
가격


WZ6-WHEAT FUTURE(CBT) DEC16
752.61
564.45



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

BOF7	SOYBEAN OIL FUTR JAN17	75
CTZ6	COTTON NO.2 FUTR DEC16	31
CZ6	CORN FUTURE DEC16	152
KCZ6	COFFEE 'C' FUTURE DES16	63
KWZ6	KC HRW WHEAT FUT DES16	22
SBH7	Sugar #11 (WORLD) MAR17	121
SF7	SOYBEAN FUTURE JAN17	145
SMF7	SOYBEAN MEAL FUTR JAN17	73
WZ6	WHEAT FUTURE(CBT) DEC16	60

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

930