공시일	2016-10-27
기준일	2016-10-26

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	2016-10-27
기준일	2016-10-26

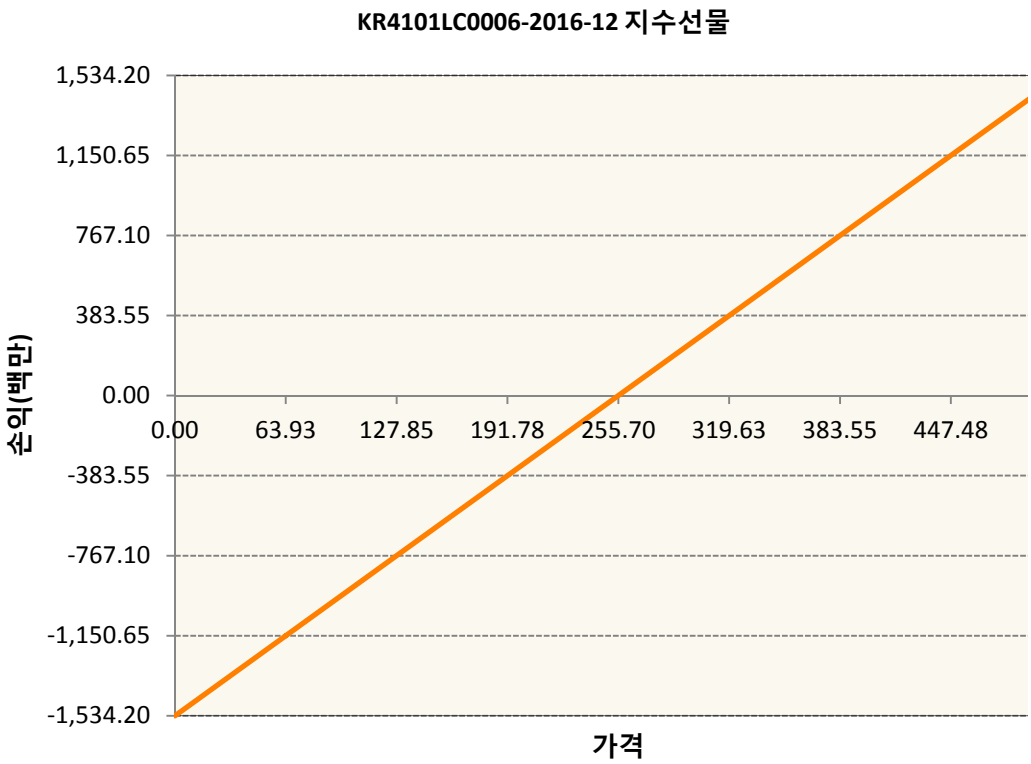
스마트인덱스모

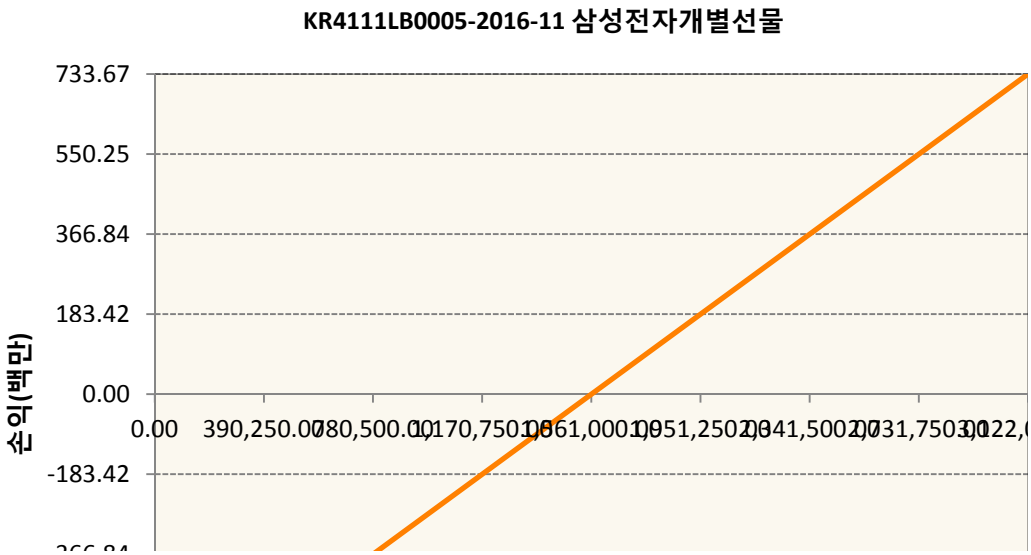
1. 계약금액

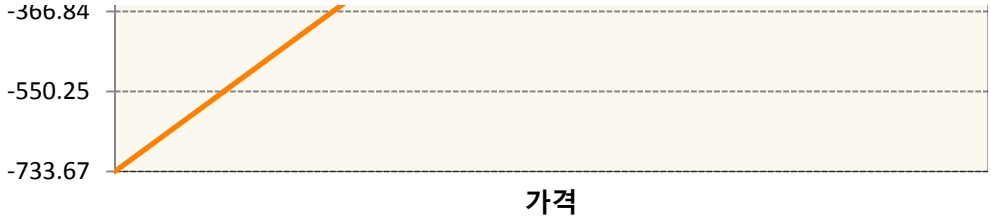
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,268	0	2,268	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							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%	-39	-39	-39	-39	-39	-39	-39
-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%	39	39	39	39	39	39	39
8.00%	59	59	59	59	59	59	59

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

159

공시일	2016-10-27
기준일	2016-10-26

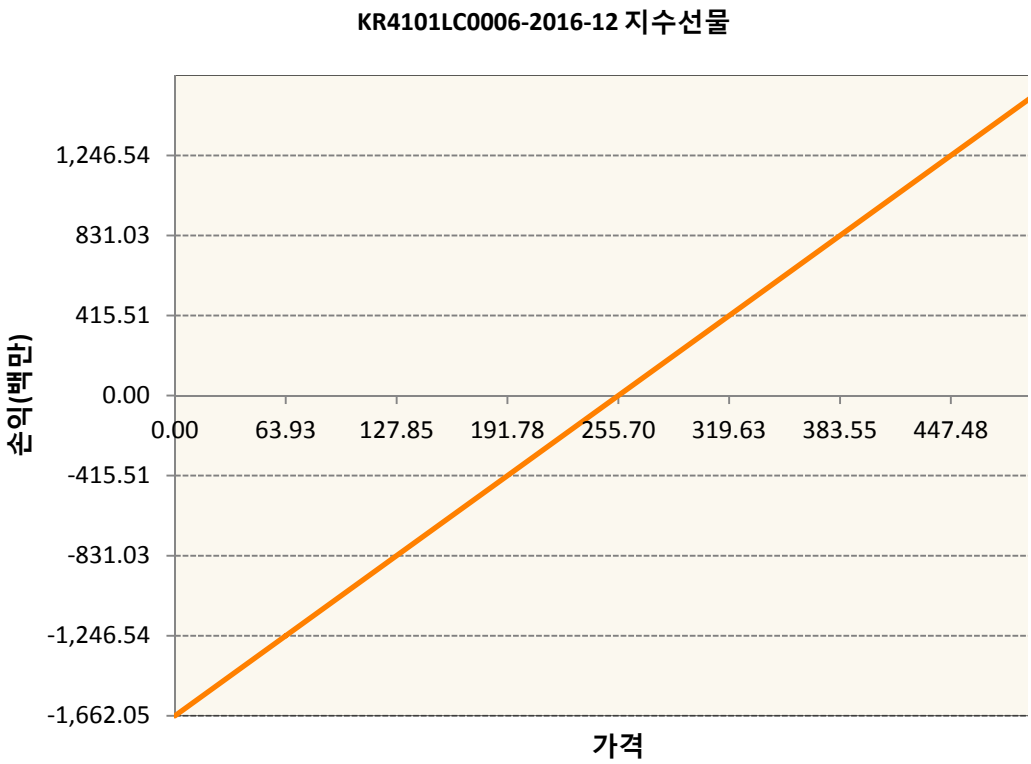
스마트레버리지목표전환형1호

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%	-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	2016-10-27
기준일	2016-10-26

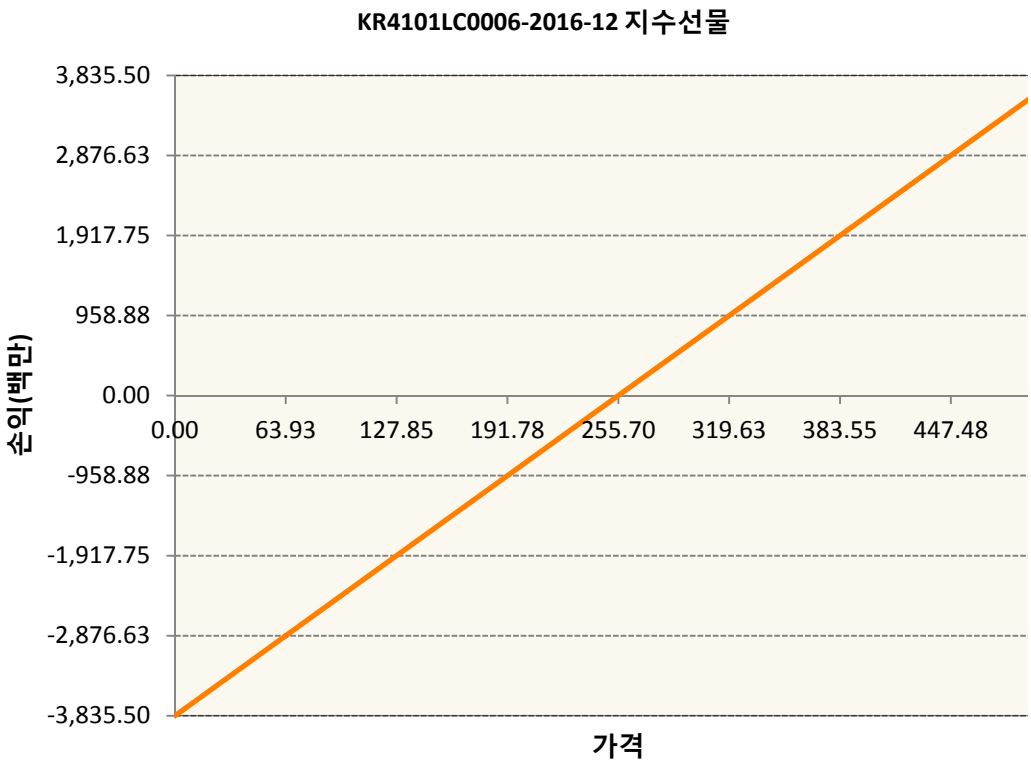
1.3배 레버리지 인덱스(주식-파생형)

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							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%	-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%	307	307	307	307	307	307	307

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

232

공시일	2016-10-27
기준일	2016-10-26

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	2016-10-27
기준일	2016-10-26

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)

787

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2016-10-27
기준일	2016-10-26

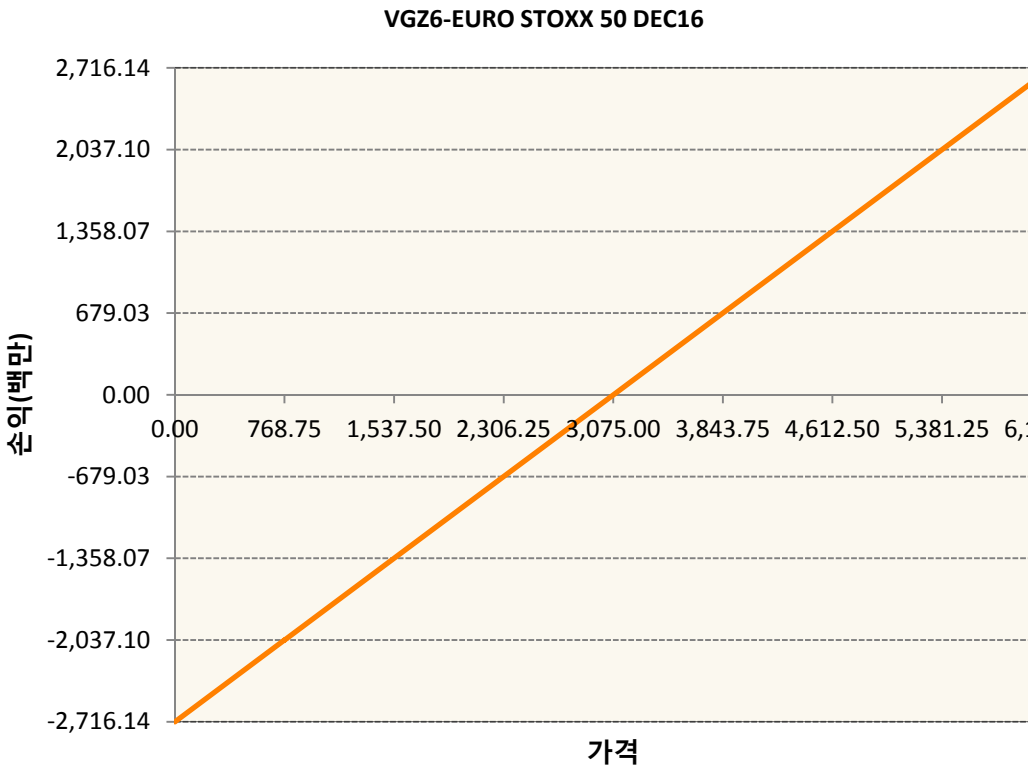
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,716	0	2,716	

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	2016-10-27
기준일	2016-10-26

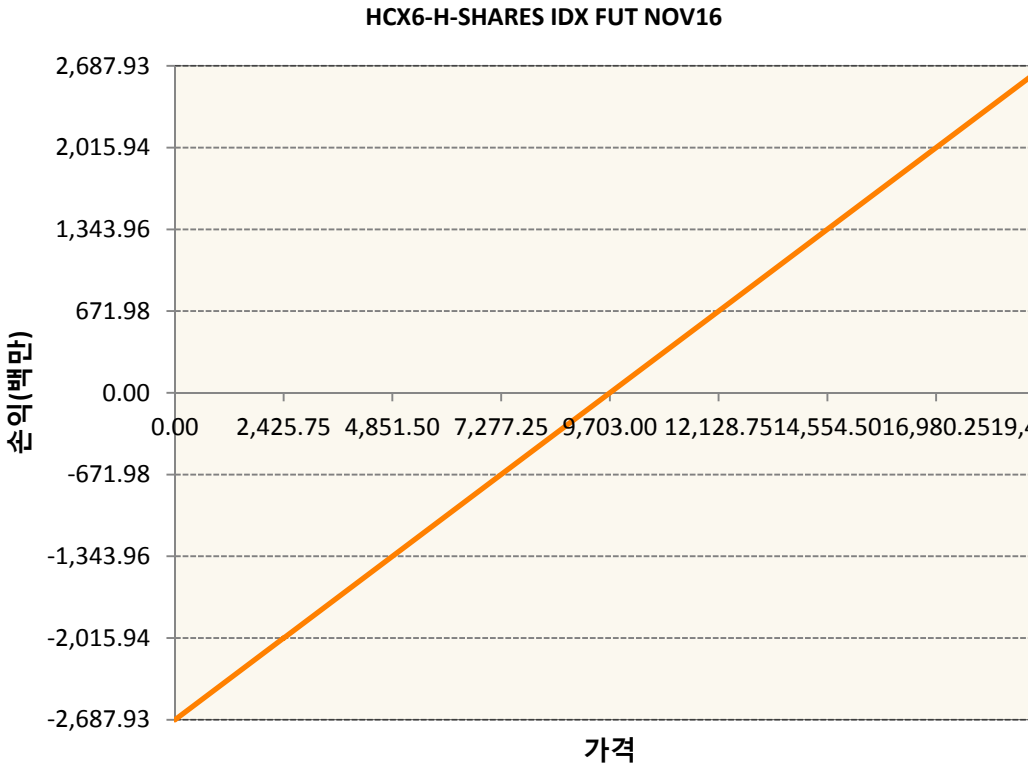
차이나인덱스모(주식-파생형)

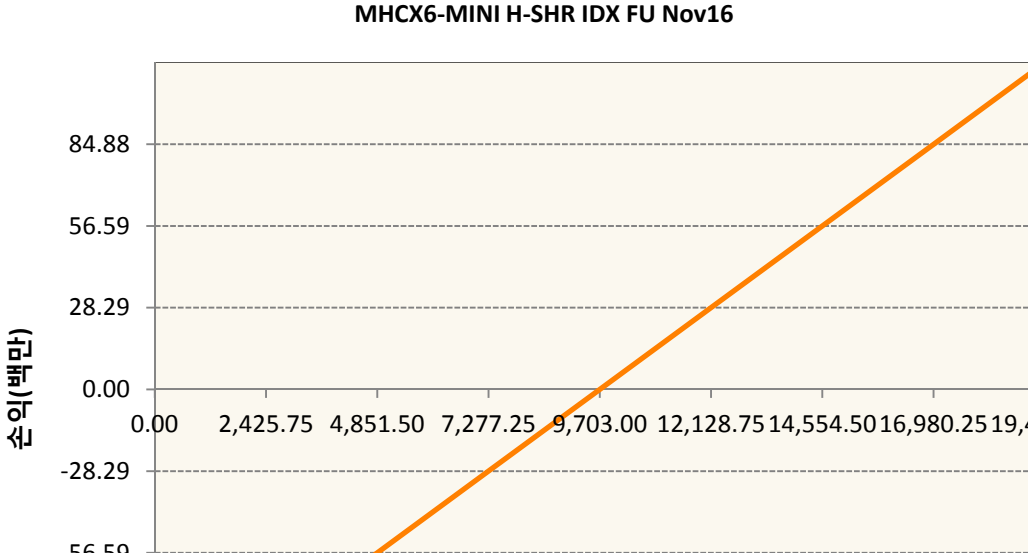
1. 계약금액

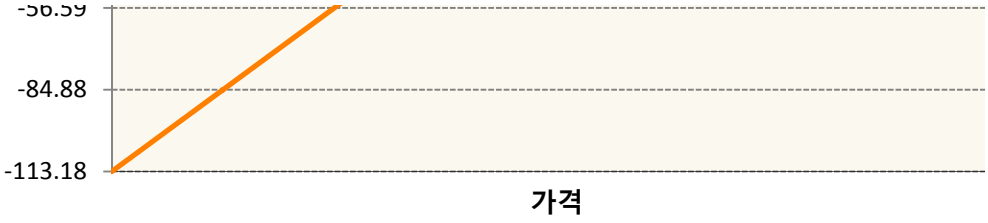
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,801	0	2,801	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCX6	H-SHARES IDX FUT NOV16	215
MHCX6	MINI H-SHR IDX FU Nov16	9

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	302

공시일	2016-10-27
기준일	2016-10-26

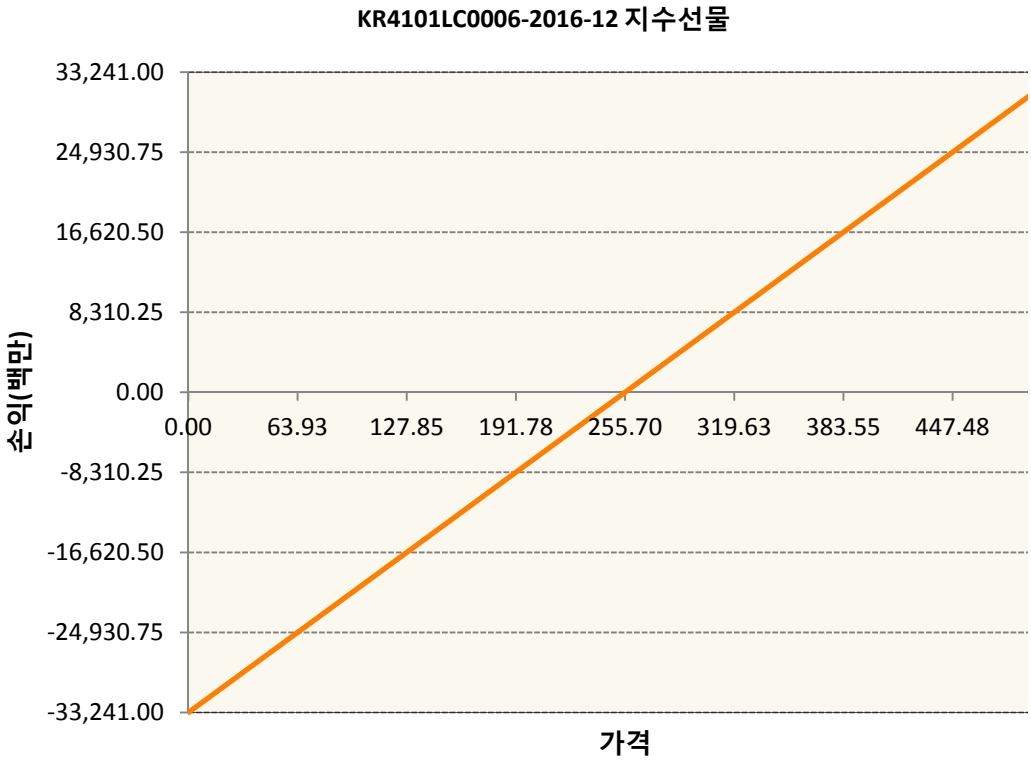
커버드콜(주식혼합-파생형)

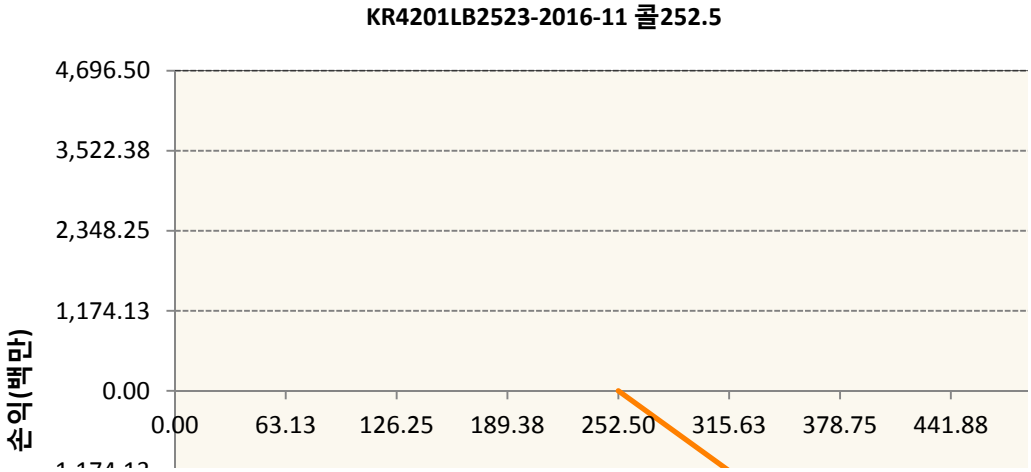
1. 계약금액

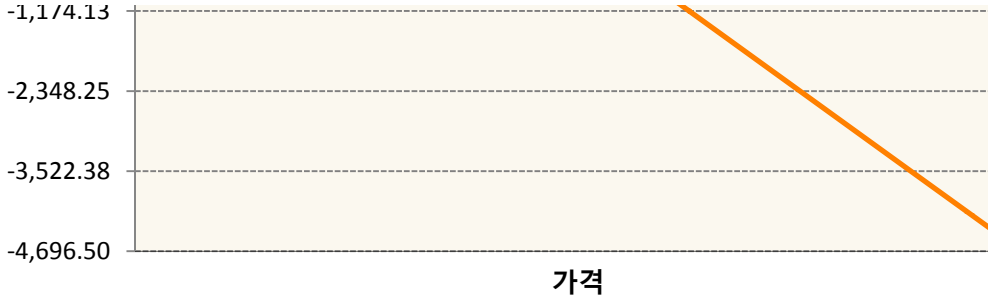
(단위:백만원)

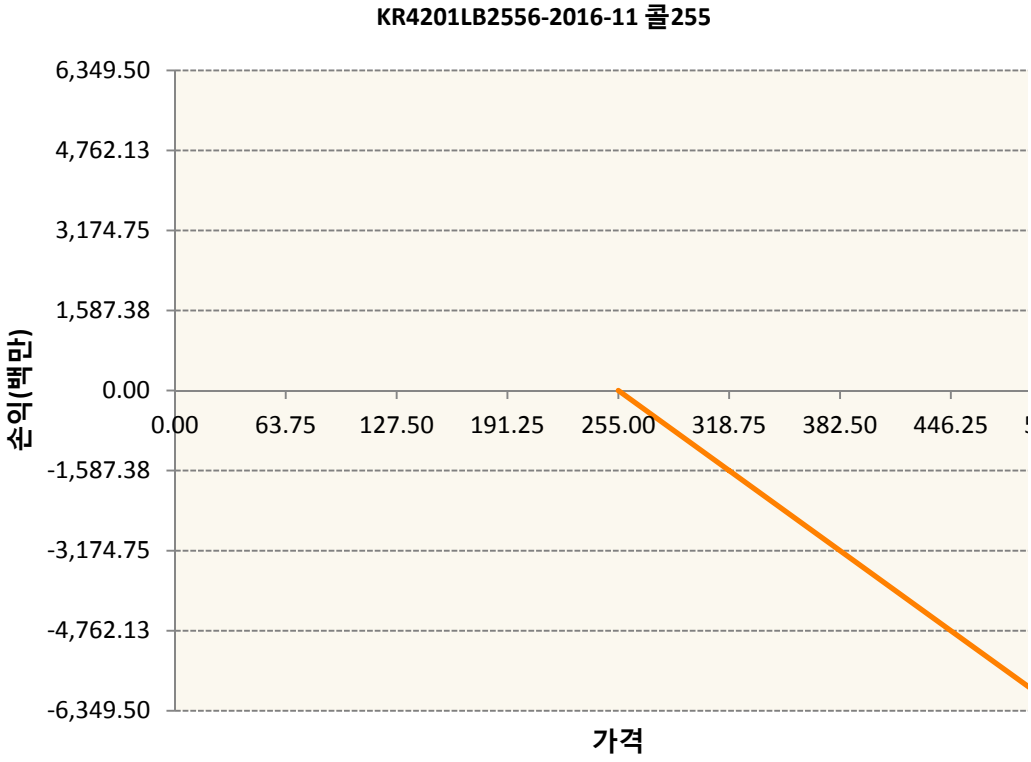
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	361	-361	장내
누계	유가증권	선물	33,241	0	33,241	장내
누계	유가증권	옵션	0	11,046	-11,046	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101LC00 2016-12 지수선물							2,657
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-2,657	-2,657	-2,657	-2,657	-2,657	-2,657	-2,657
-5.33%	-1,772	-1,772	-1,772	-1,772	-1,772	-1,772	-1,772
-2.67%	-886	-886	-886	-886	-886	-886	-886
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	886	886	886	886	886	886	886
5.33%	1,772	1,772	1,772	1,772	1,772	1,772	1,772
8.00%	2,657	2,657	2,657	2,657	2,657	2,657	2,657
KR4201LB25 2016-11 콜252.5							1,759
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	420	420	420	419	418	417	415
-5.33%	417	414	410	405	398	390	381
-2.67%	357	340	323	305	287	268	249
0%	57	38	19	0	-20	-40	-60
2.67%	-497	-502	-508	-516	-525	-535	-546
5.33%	-1,125	-1,125	-1,126	-1,127	-1,129	-1,131	-1,135
8.00%	-1,758	-1,758	-1,758	-1,758	-1,758	-1,759	-1,759
KR4201LB25 2016-11 콜255							2,231

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	378	378	378	377	377	376	375
-5.33%	377	375	373	369	364	358	350
-2.67%	344	329	313	295	275	255	234
0%	86	58	29	0	-29	-58	-86
2.67%	-557	-569	-584	-600	-618	-637	-657
5.33%	-1,380	-1,381	-1,384	-1,387	-1,392	-1,399	-1,406
8.00%	-2,227	-2,227	-2,227	-2,227	-2,228	-2,229	-2,231

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

6,856

공시일	2016-10-27
기준일	2016-10-26

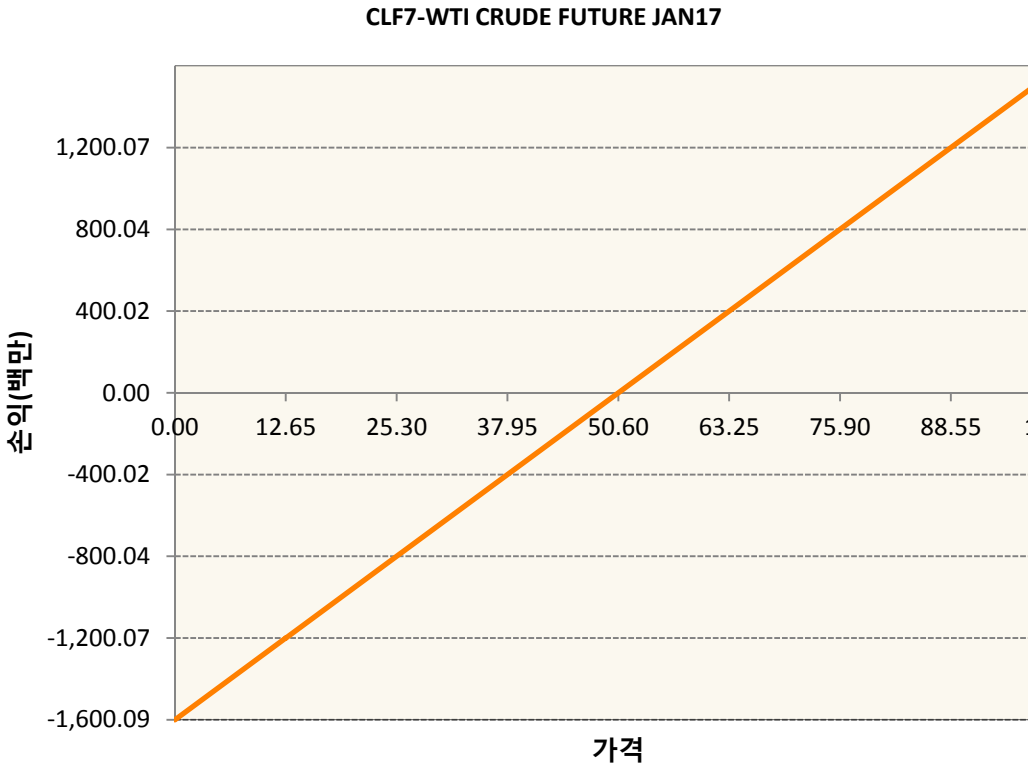
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

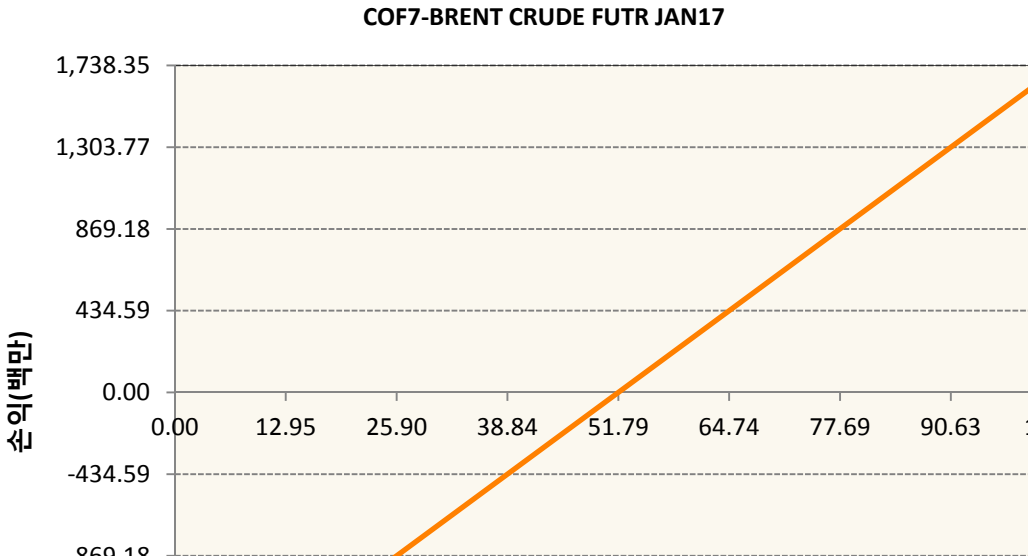
1. 계약금액

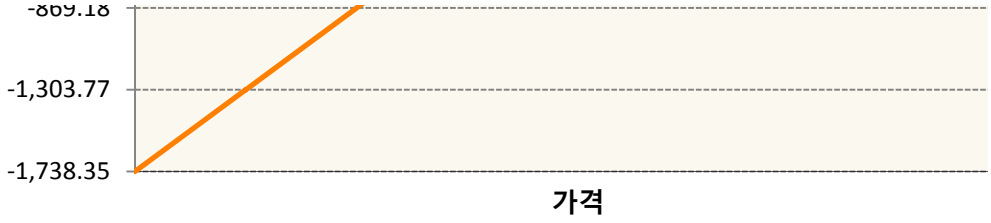
(단위:백만원)

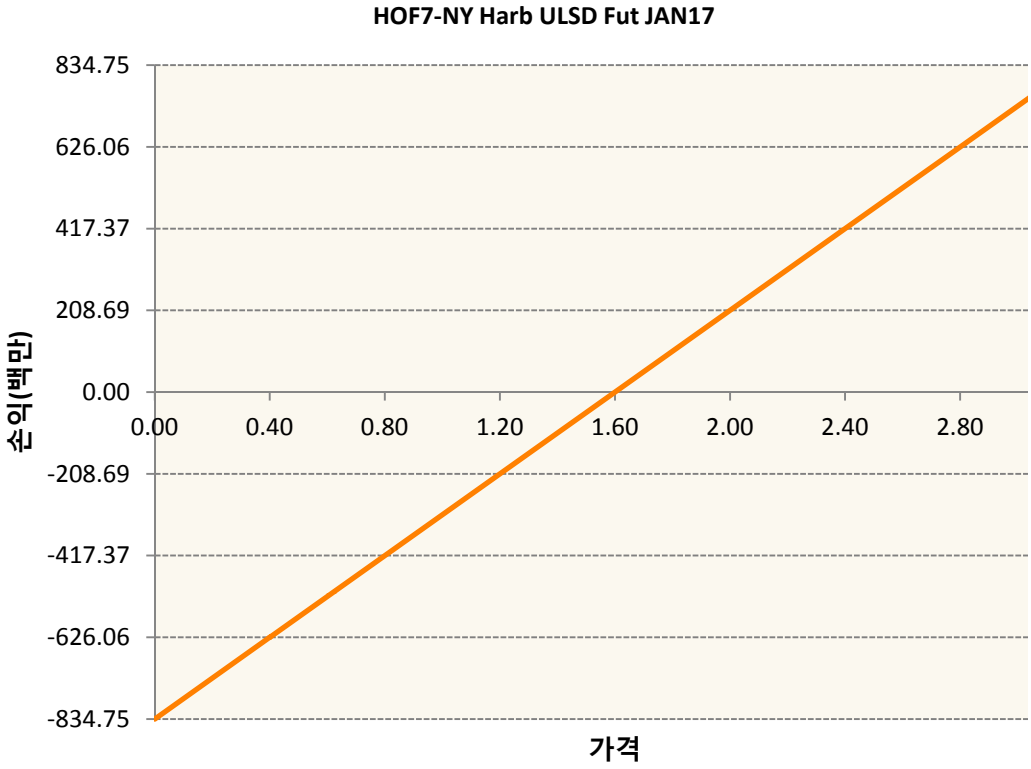
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	6,600	0	6,600	

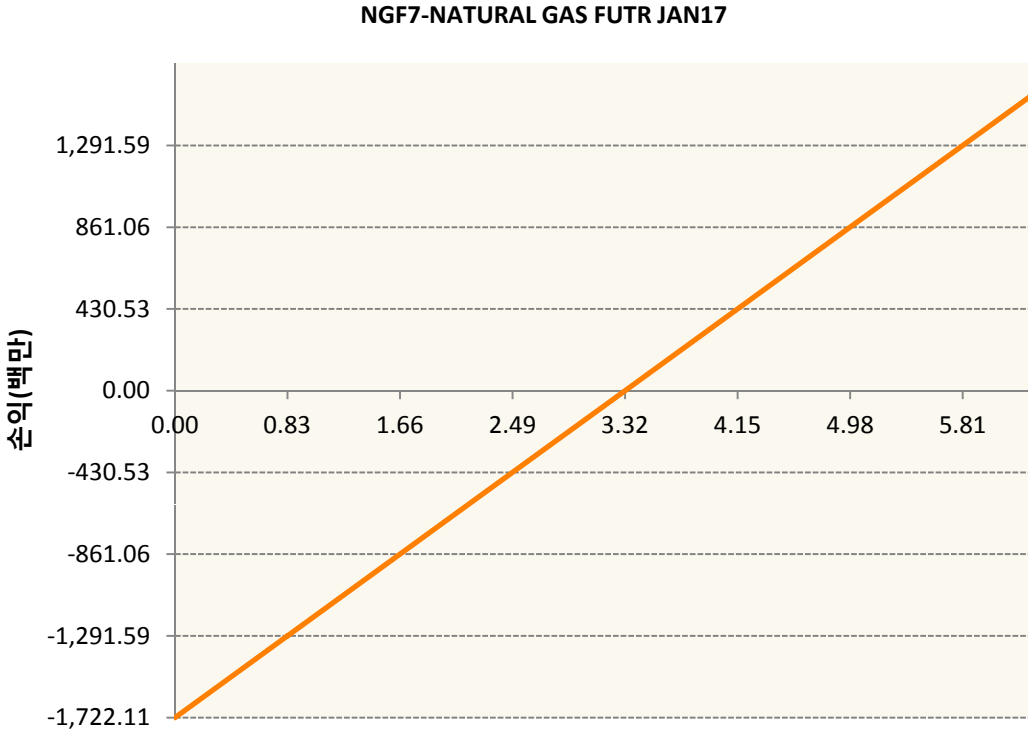
2. 만기시점의 손익구조



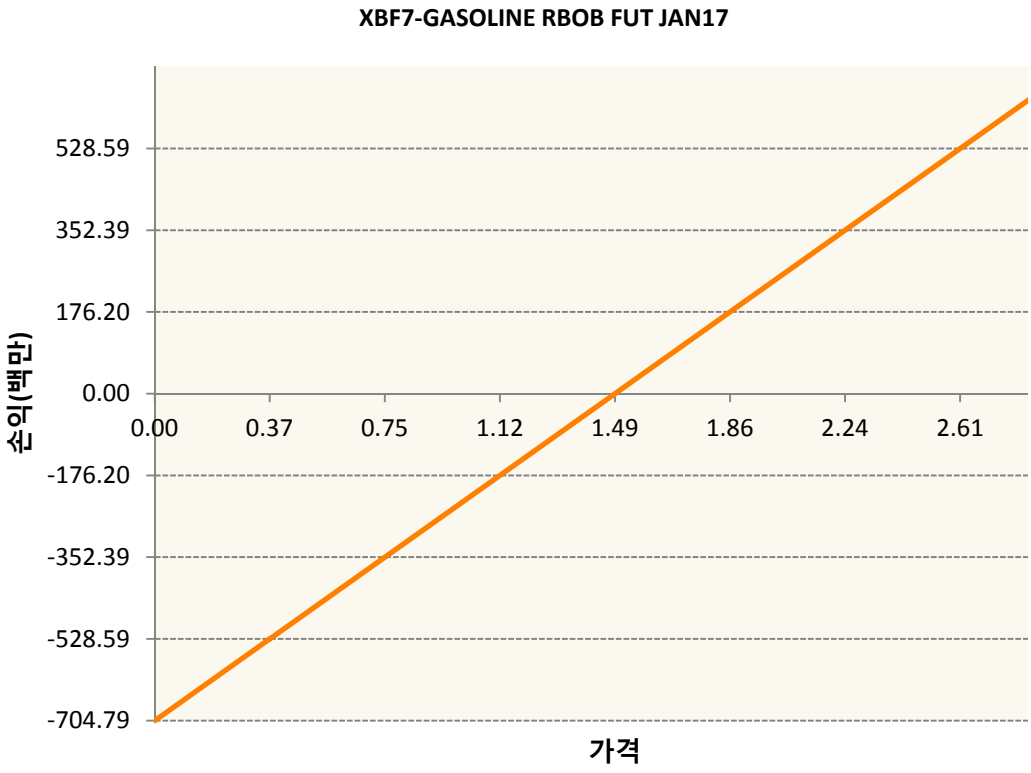



-1,303.77
-1,738.35
가격


HOF7-NY Harb ULSD Fut JAN17
834.75
626.06
417.37
208.69
0.00
-208.69
-417.37
-626.06
-834.75
0.00
0.40
0.80
1.20
1.60
2.00
2.40
2.80
순익(백만)
가격


NGF7-NATURAL GAS FUTR JAN17
1,291.59
861.06
430.53
0.00
-430.53
-861.06
-1,291.59
-1,722.11
0.00
0.83
1.66
2.49
3.32
4.15
4.98
5.81
순익(백만)

가격



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
CLF7	WTI CRUDE FUTURE JAN17	128
COF7	BRENT CRUDE FUTR JAN17	139
HOF7	NY Harb ULSD Fut JAN17	67
NGF7	NATURAL GAS FUTR JAN17	138
XBF7	GASOLINE RBOB FUT JAN17	56

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,175

공시일	2016-10-27
기준일	2016-10-26

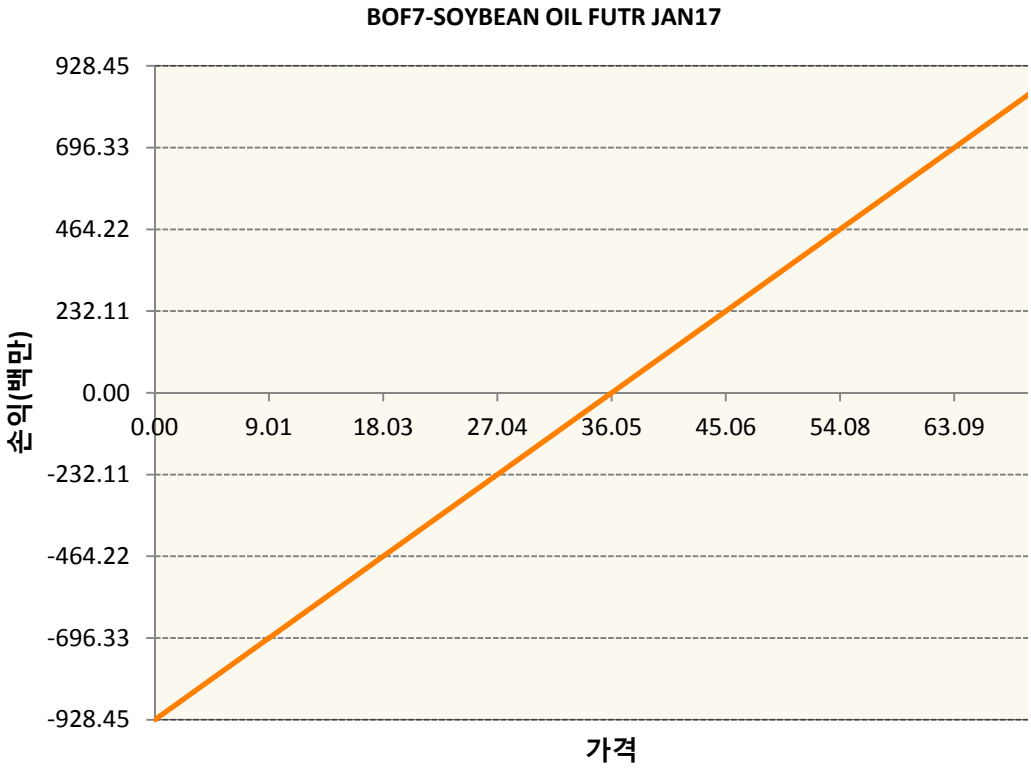
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

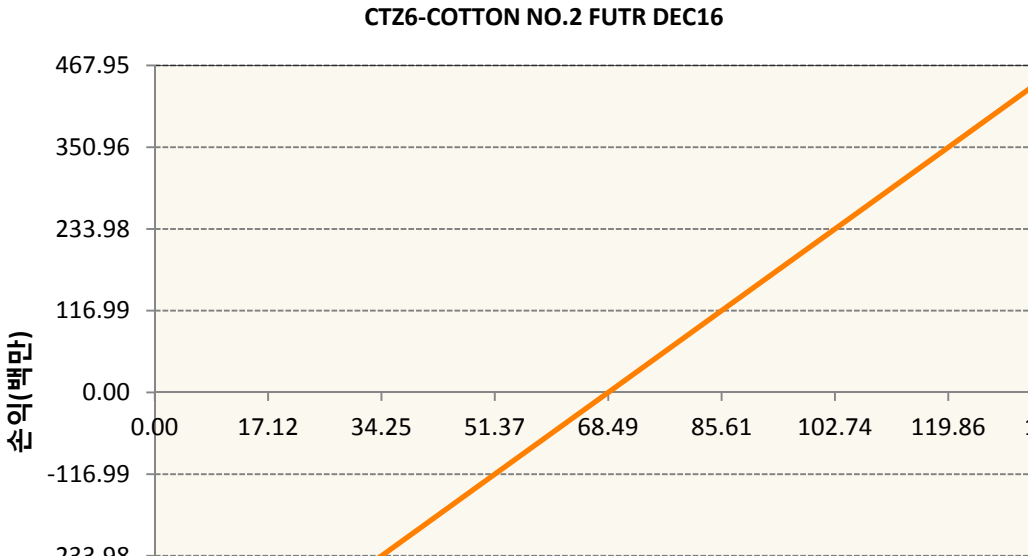
1. 계약금액

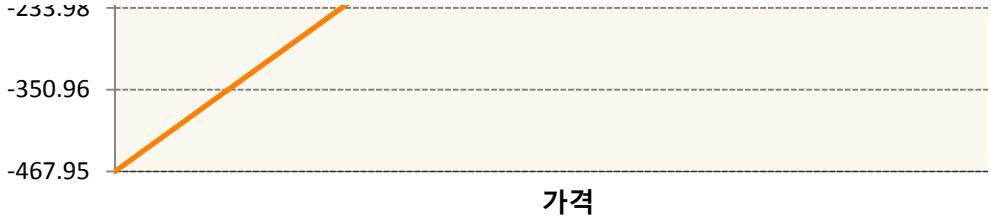
(단위:백만원)

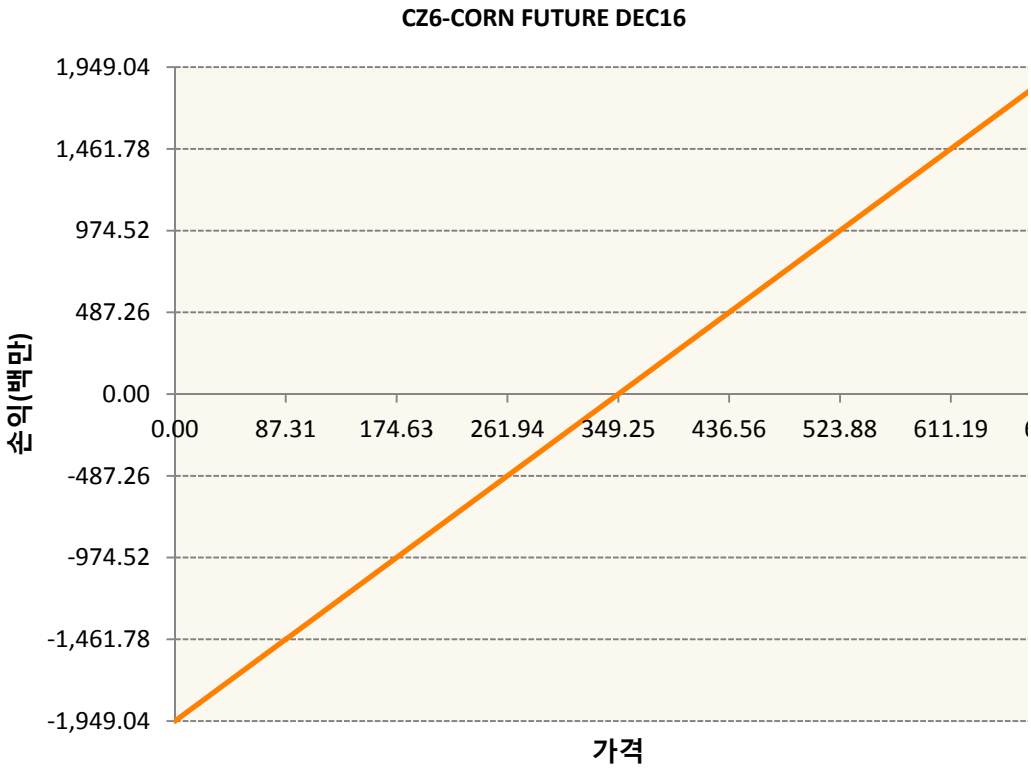
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	9,618	0	9,618	

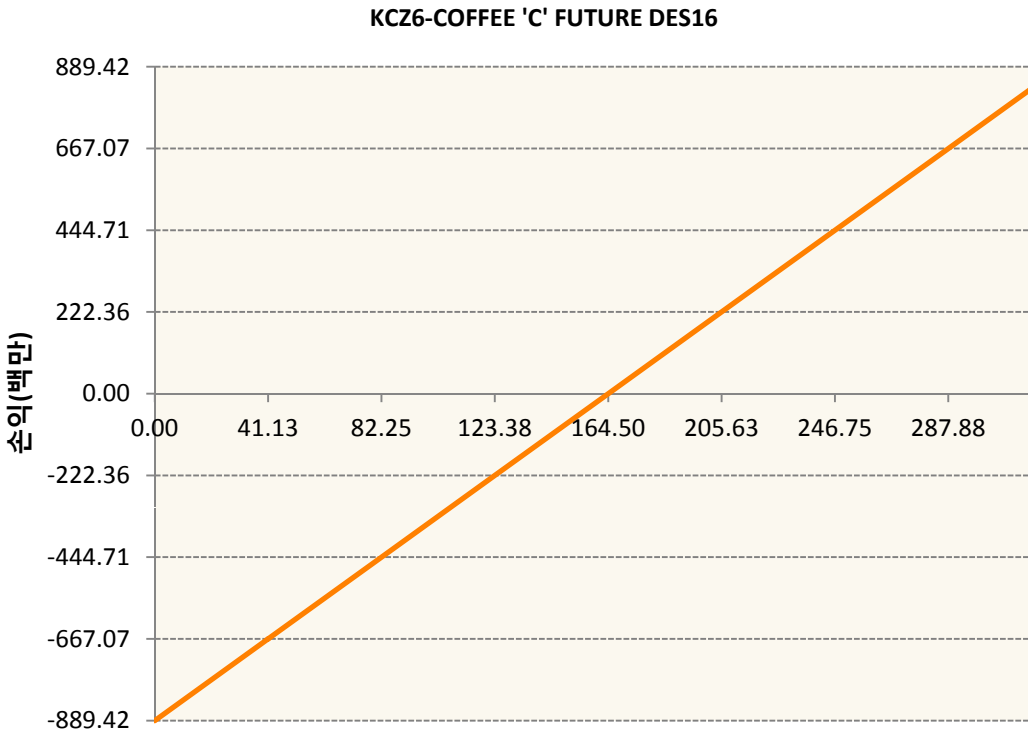
2. 만기시점의 손익구조



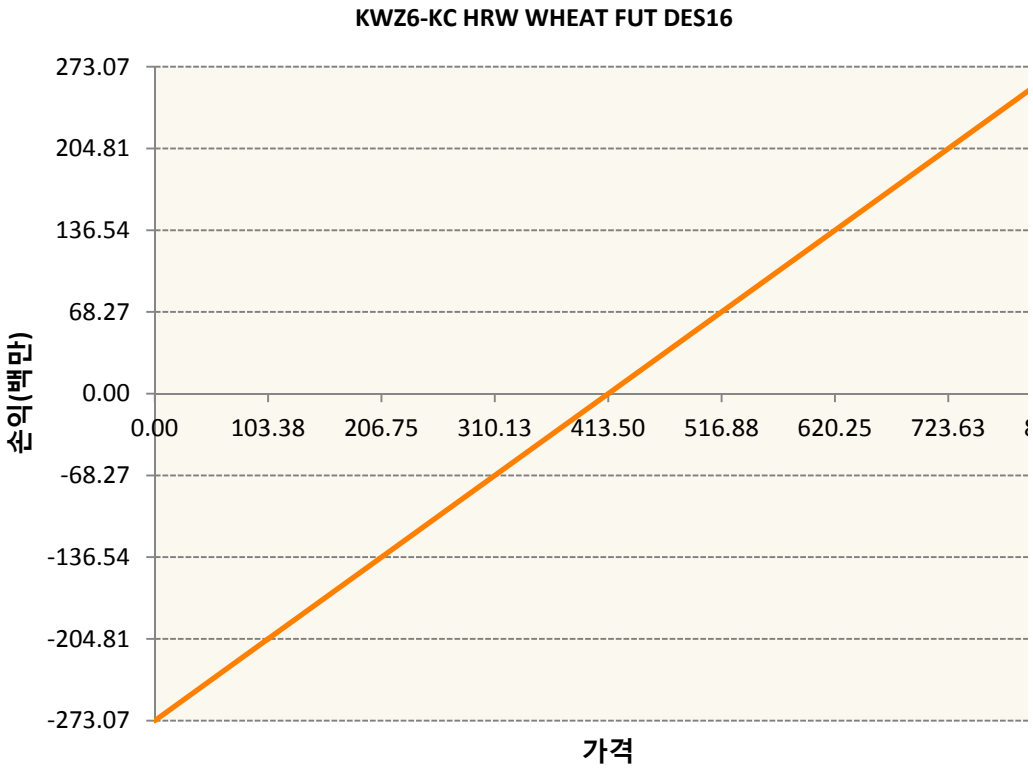


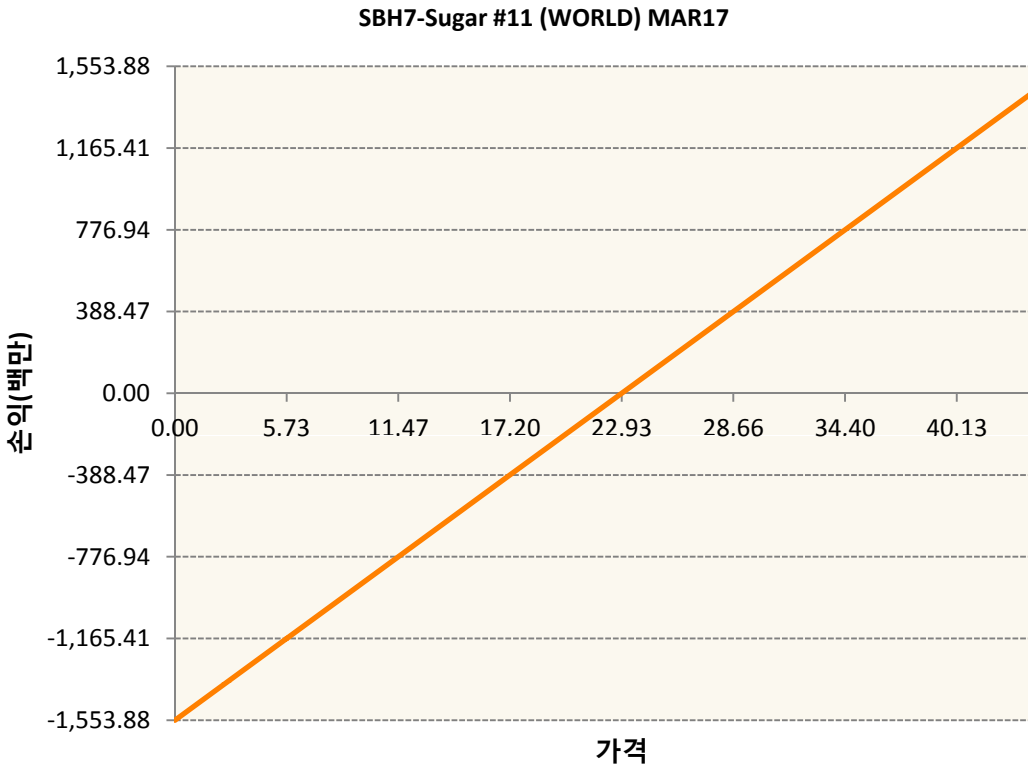

-350.96
-467.95
가격

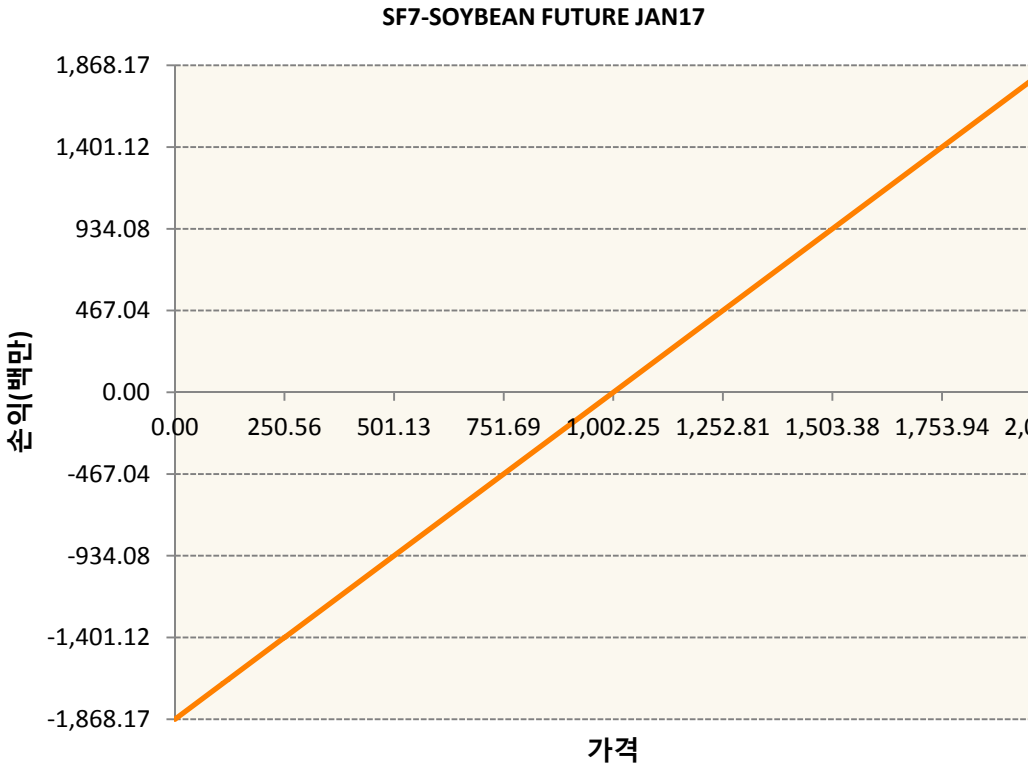

CZ6-CORN FUTURE DEC16
1,949.04
1,461.78
974.52
487.26
0.00
-487.26
-974.52
-1,461.78
-1,949.04
0.00
87.31
174.63
261.94
349.25
436.56
523.88
611.19
손익(백만)
가격

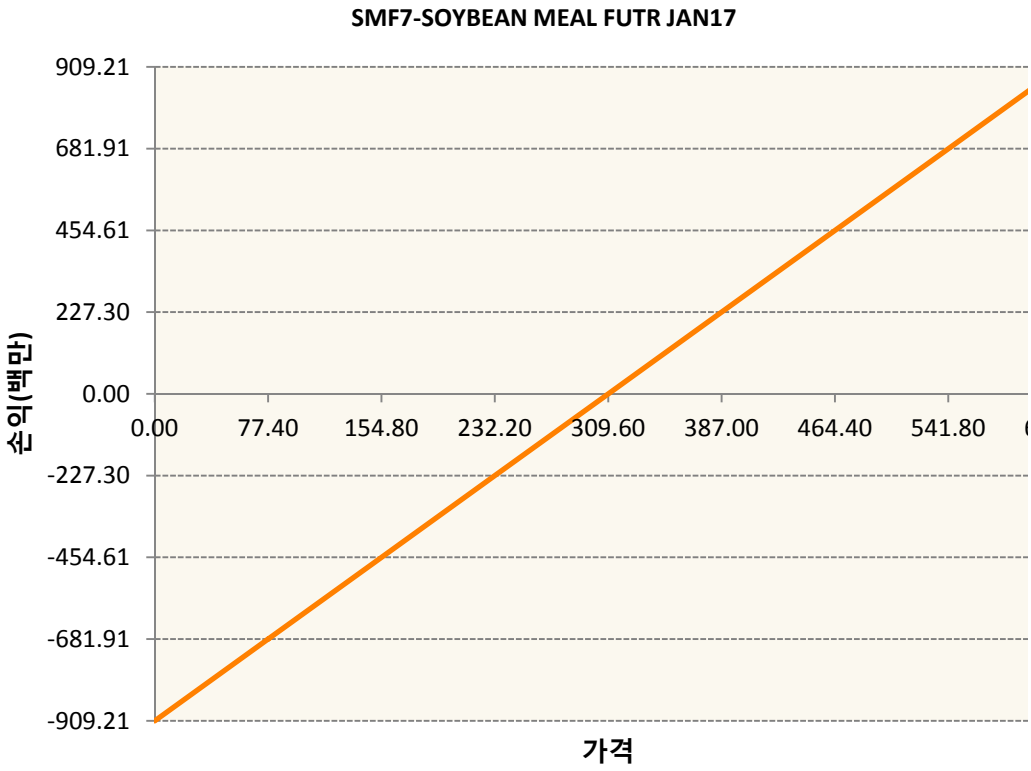

KCZ6-COFFEE 'C' FUTURE DES16
889.42
667.07
444.71
222.36
0.00
-222.36
-444.71
-667.07
-889.42
0.00
41.13
82.25
123.38
164.50
205.63
246.75
287.88
손익(백만)

가격

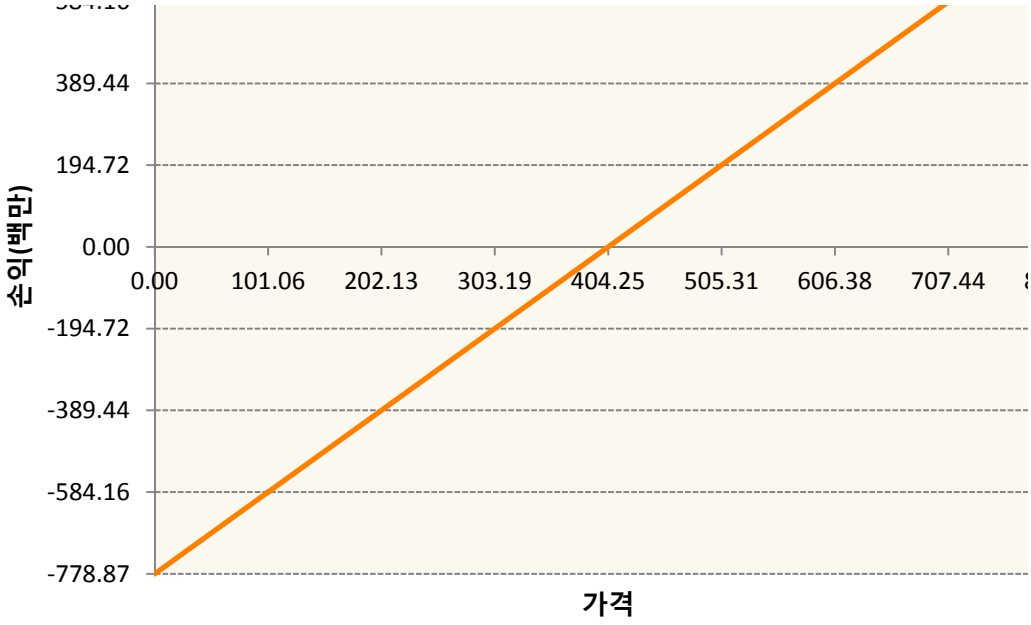

KWZ6-KC HRW WHEAT FUT DES16
273.07
204.81
136.54
68.27
0.00
-68.27
-136.54
-204.81
-273.07
0.00
103.38
206.75
310.13
413.50
516.88
620.25
723.63
손익(백만)
가격


SBH7-Sugar #11 (WORLD) MAR17
1,553.88
1,165.41
776.94
388.47
0.00
-388.47
-776.94
-1,165.41
-1,553.88
0.00
5.73
11.47
17.20
22.93
28.66
34.40
40.13
손익(백만)
가격


SF7-SOYBEAN FUTURE JAN17
1,868.17
1,401.12
934.08
467.04
0.00
-467.04
-934.08
-1,401.12
-1,868.17
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
909.21
681.91
454.61
227.30
0.00
-227.30
-454.61
-681.91
-909.21
0.00
77.40
154.80
232.20
309.60
387.00
464.40
541.80
손익(백만)
가격


WZ6-WHEAT FUTURE(CBT) DEC16
778.87
584.16



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

BOF7	SOYBEAN OIL FUTR JAN17	74
CTZ6	COTTON NO.2 FUTR DEC16	37
CZ6	CORN FUTURE DEC16	156
KCZ6	COFFEE 'C' FUTURE DES16	71
KWZ6	KC HRW WHEAT FUT DES16	22
SBH7	Sugar #11 (WORLD) MAR17	124
SF7	SOYBEAN FUTURE JAN17	149
SMF7	SOYBEAN MEAL FUTR JAN17	73
WZ6	WHEAT FUTURE(CBT) DEC16	62

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

965