공시일	2016-10-28
기준일	2016-10-27

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	2016-10-28
기준일	2016-10-27

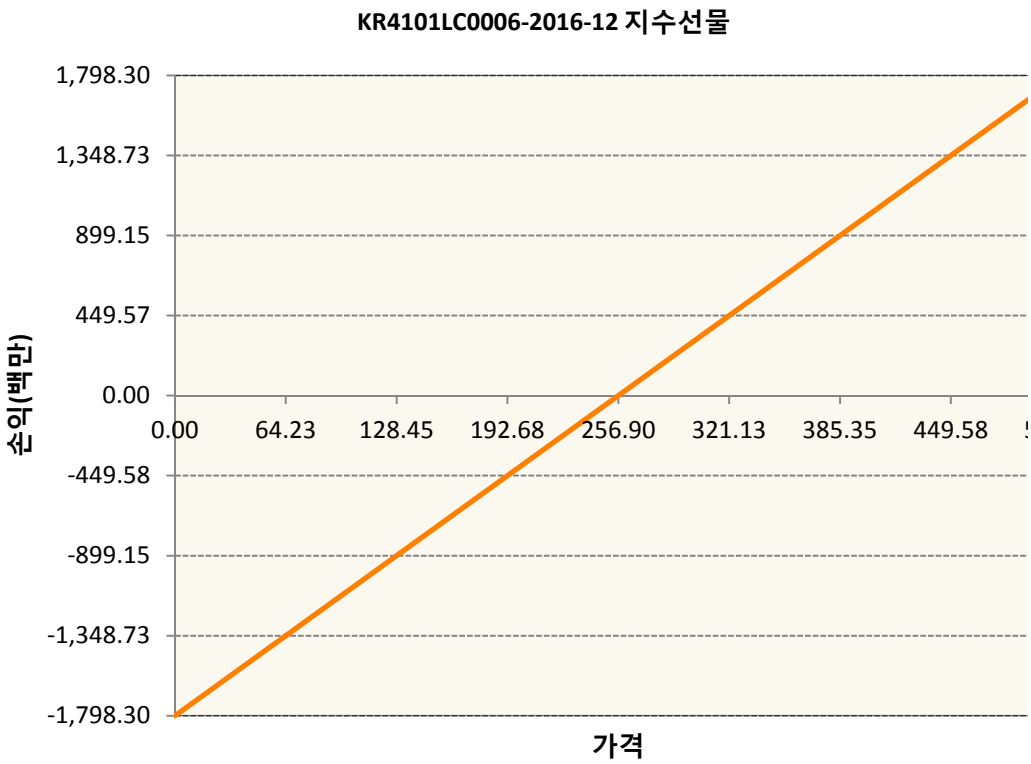
스마트인덱스모

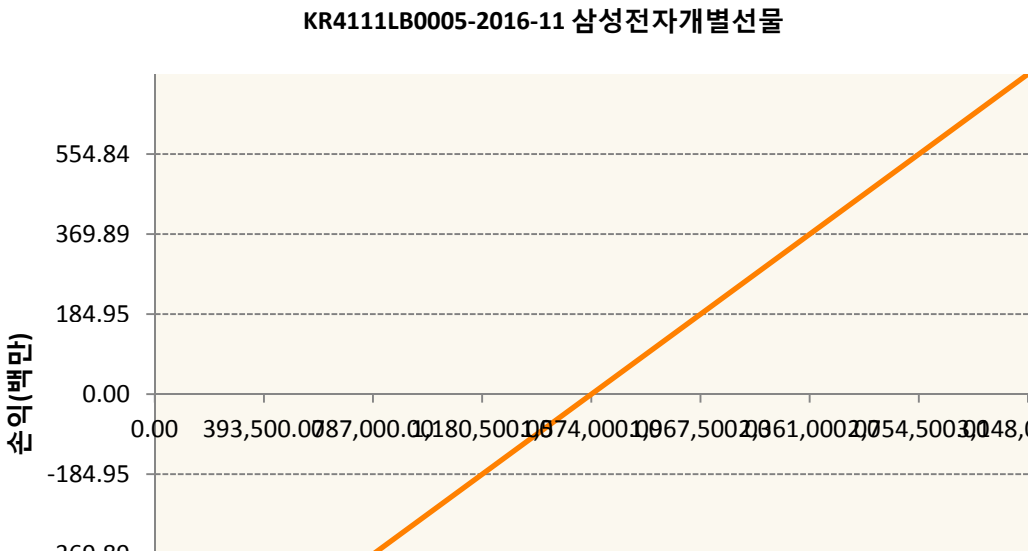
1. 계약금액

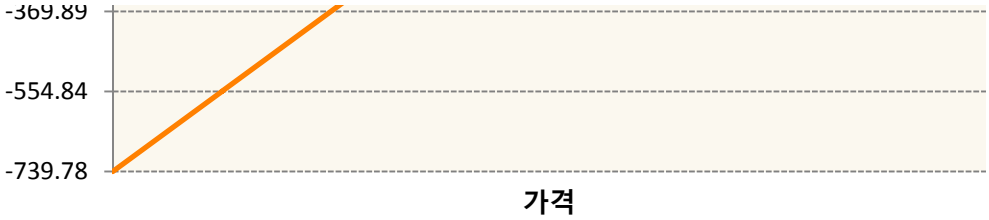
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	257	0	257	장내
누계	유가증권	선물	2,538	0	2,538	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101LC00 2016-12 지수선물							144
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-144	-144	-144	-144	-144	-144	-144
-5.33%	-96	-96	-96	-96	-96	-96	-96
-2.67%	-48	-48	-48	-48	-48	-48	-48
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	48	48	48	48	48	48	48
5.33%	96	96	96	96	96	96	96
8.00%	144	144	144	144	144	144	144

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)

175

공시일	2016-10-28
기준일	2016-10-27

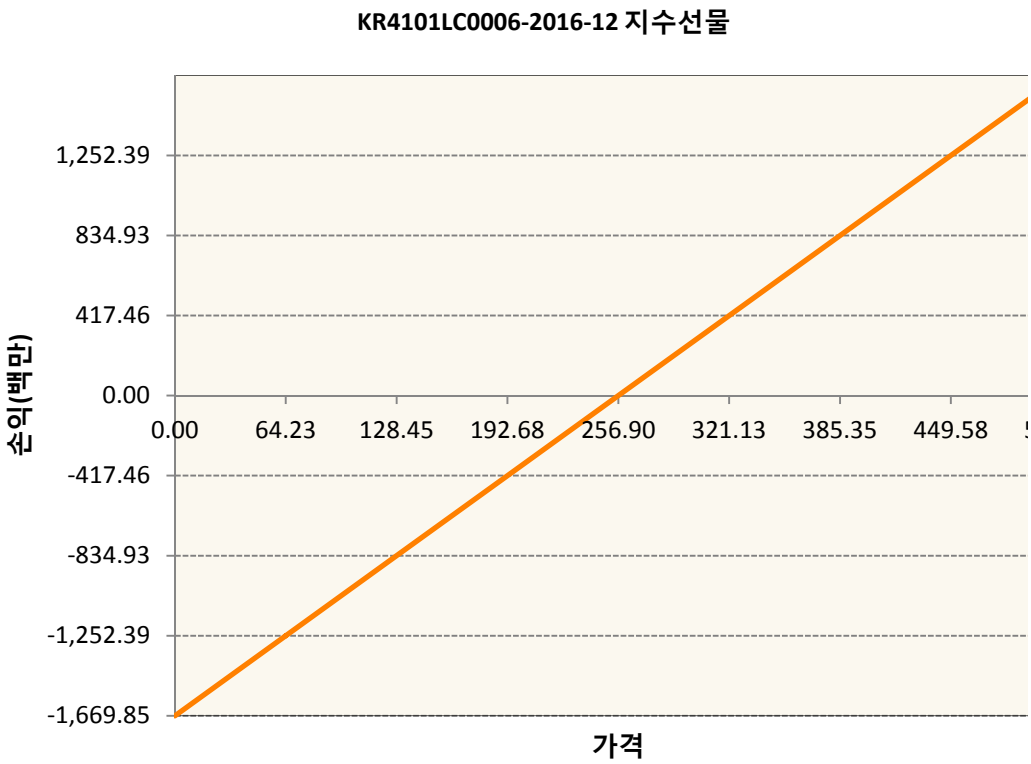
스마트레버리지목표전환형1호

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	1,670	0	1,670	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	2016-10-28
기준일	2016-10-27

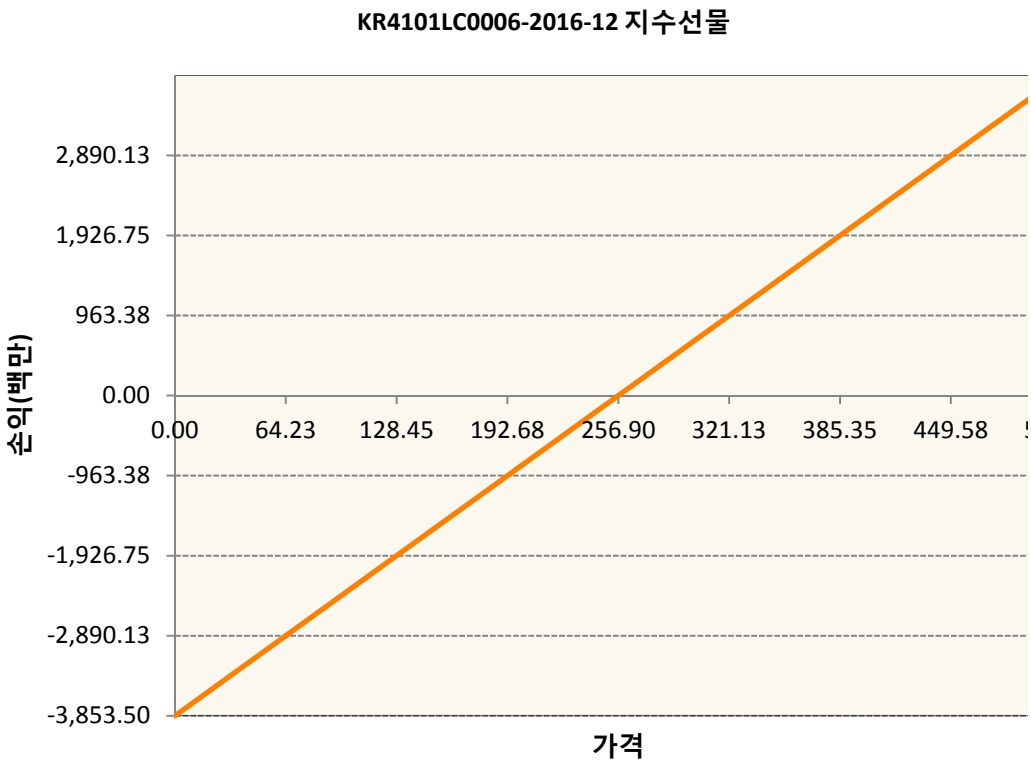
1.3배 레버리지 인덱스(주식-파생형)

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	3,854	0	3,854	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101LC00 2016-12 지수선물							308
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-308	-308	-308	-308	-308	-308	-308
-5.33%	-205	-205	-205	-205	-205	-205	-205
-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%	205	205	205	205	205	205	205
8.00%	308	308	308	308	308	308	308

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

233

공시일	2016-10-28
기준일	2016-10-27

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)

711

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2016-10-28
기준일	2016-10-27

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	402

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

779

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2016-10-28
기준일	2016-10-27

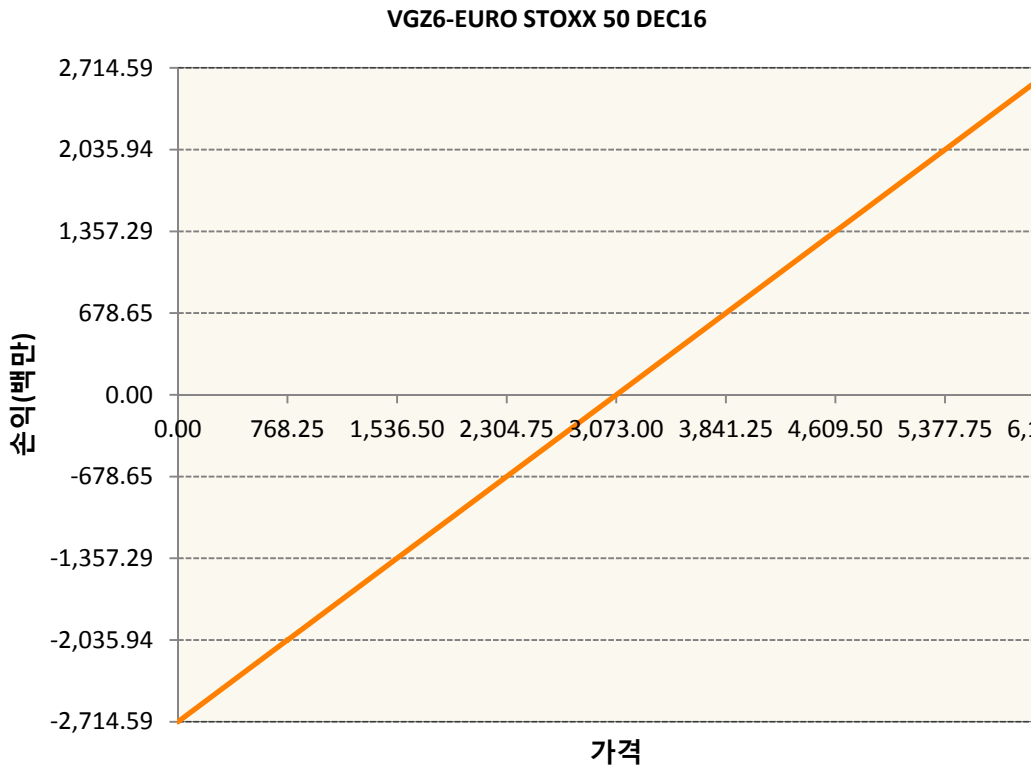
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,715	0	2,715	

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	2016-10-28
기준일	2016-10-27

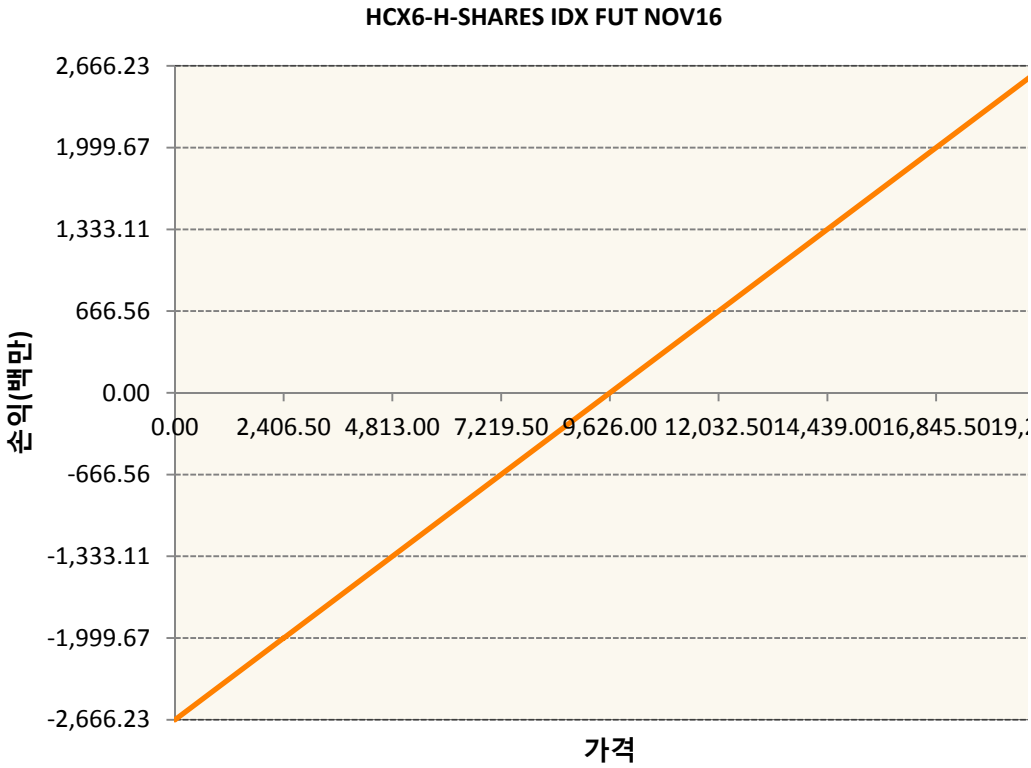
차이나인덱스모(주식-파생형)

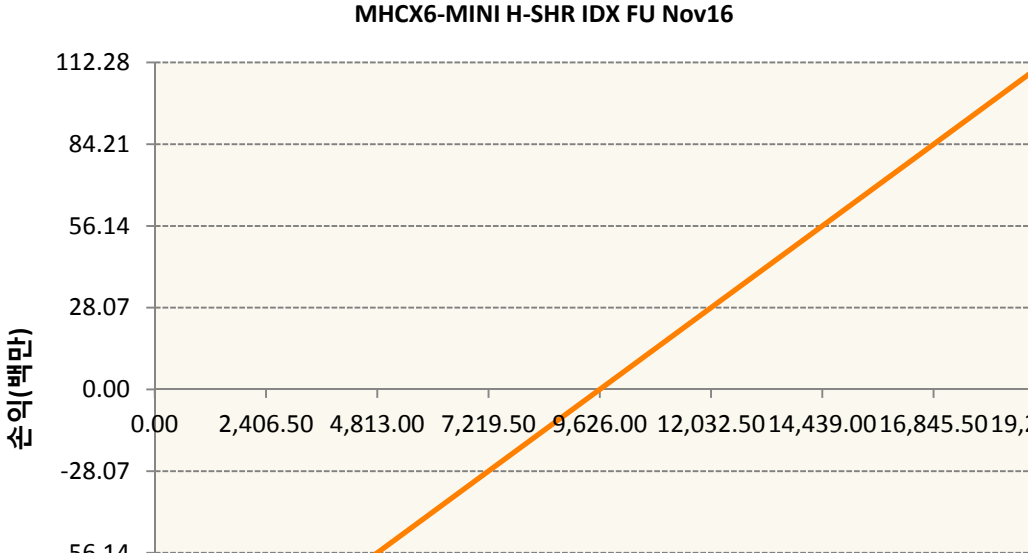
1. 계약금액

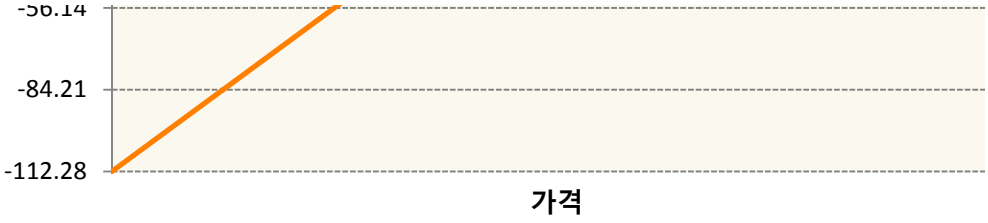
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,779	0	2,779	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

HCX6	H-SHARES IDX FUT NOV16	213
MHCX6	MINI H-SHR IDX FU Nov16	9

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

299

공시일	2016-10-28
기준일	2016-10-27

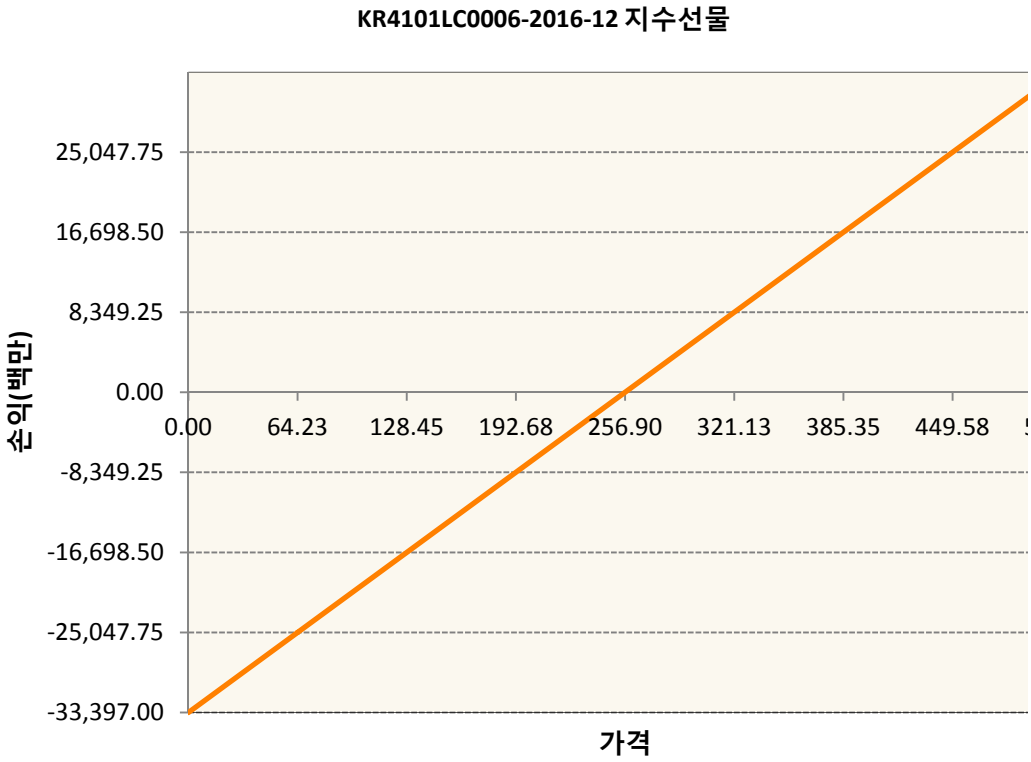
커버드콜(주식혼합-파생형)

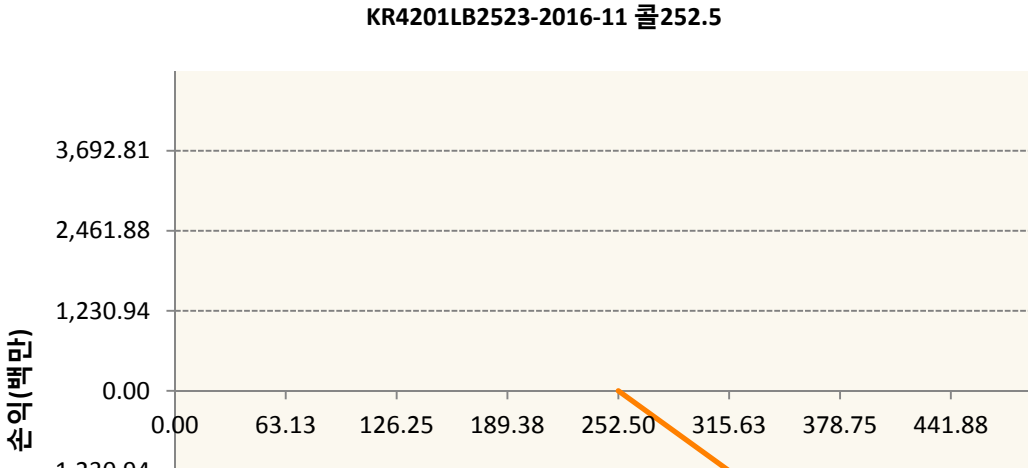
1. 계약금액

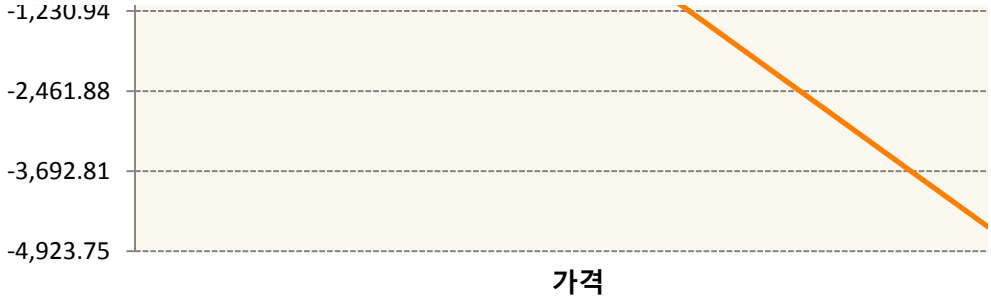
(단위:백만원)

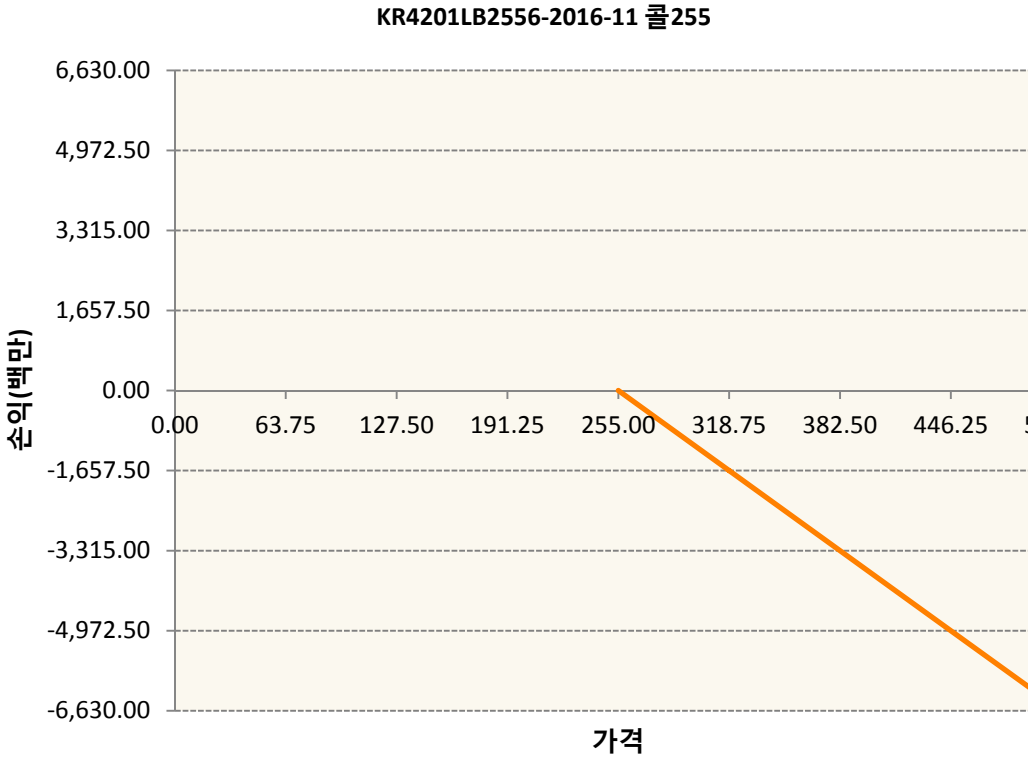
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	516	-516	장내
누계	유가증권	선물	33,397	0	33,397	장내
누계	유가증권	옵션	0	11,554	-11,554	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101LC00 2016-12 지수선물							2,669
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-2,669	-2,669	-2,669	-2,669	-2,669	-2,669	-2,669
-5.33%	-1,780	-1,780	-1,780	-1,780	-1,780	-1,780	-1,780
-2.67%	-890	-890	-890	-890	-890	-890	-890
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	890	890	890	890	890	890	890
5.33%	1,780	1,780	1,780	1,780	1,780	1,780	1,780
8.00%	2,669	2,669	2,669	2,669	2,669	2,669	2,669
KR4201LB25 2016-11 콜252.5							1,900
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	504	504	504	504	503	501	499
-5.33%	501	497	493	487	479	471	461
-2.67%	420	402	383	364	345	326	306
0%	49	33	17	0	-18	-36	-54
2.67%	-568	-570	-574	-578	-584	-592	-600
5.33%	-1,232	-1,233	-1,233	-1,233	-1,234	-1,235	-1,237
8.00%	-1,899	-1,899	-1,899	-1,899	-1,899	-1,900	-1,900
KR4201LB25 2016-11 콜255							2,425

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	457	457	456	456	456	455	454
-5.33%	455	454	451	447	442	435	427
-2.67%	411	394	376	357	336	314	292
0%	81	55	27	0	-28	-55	-83
2.67%	-657	-665	-675	-686	-700	-715	-731
5.33%	-1,535	-1,535	-1,536	-1,538	-1,540	-1,544	-1,549
8.00%	-2,424	-2,424	-2,424	-2,424	-2,424	-2,424	-2,425

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

7,380

공시일	2016-10-28
기준일	2016-10-27

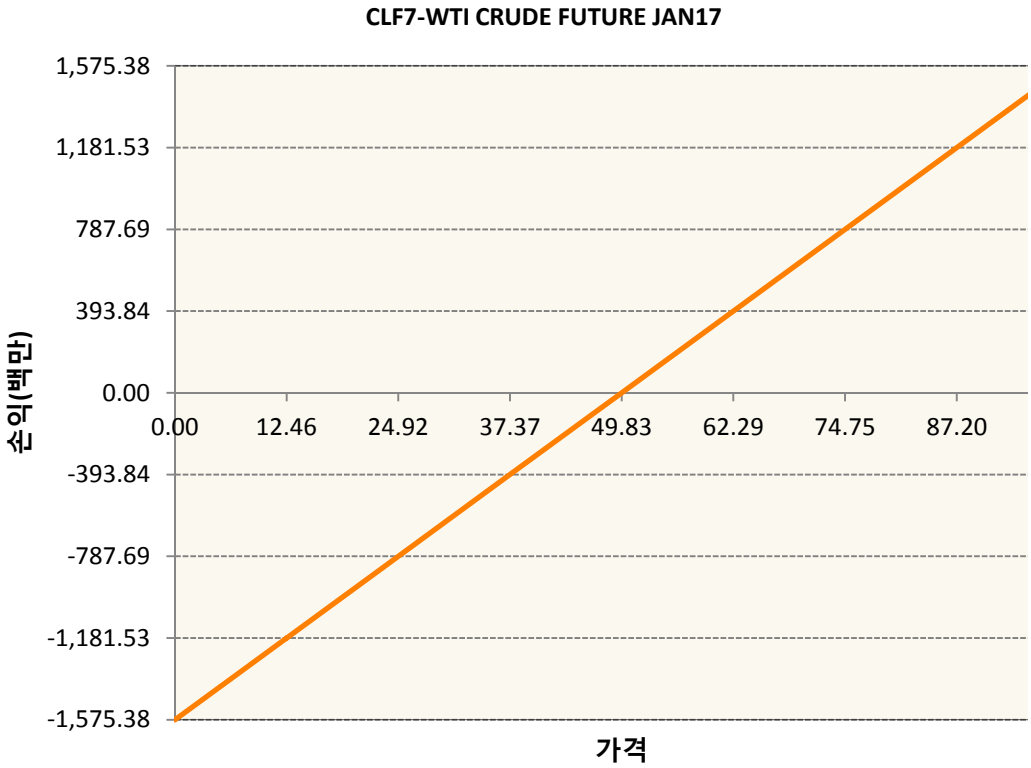
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

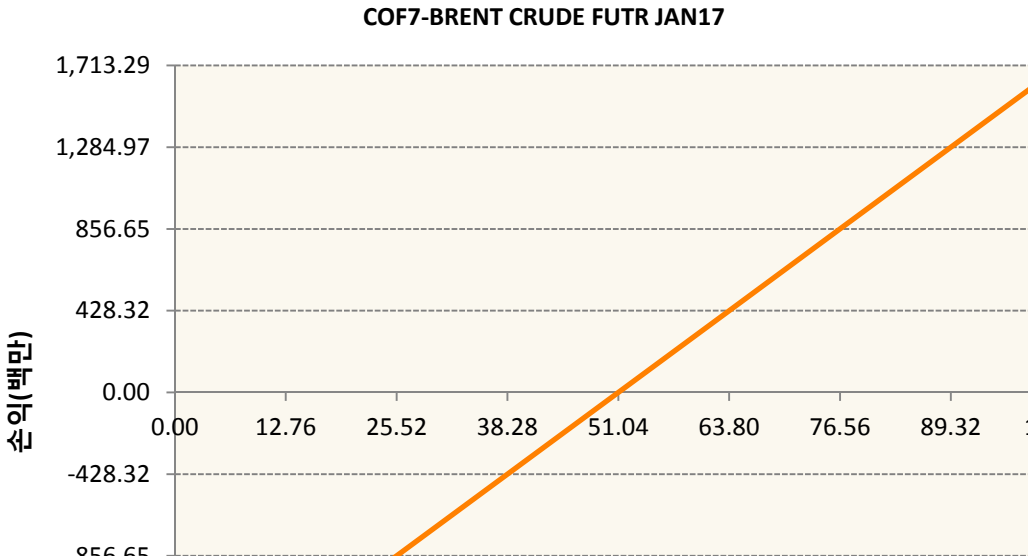
1. 계약금액

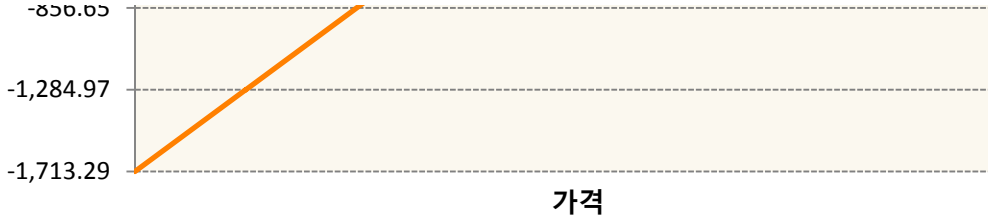
(단위:백만원)

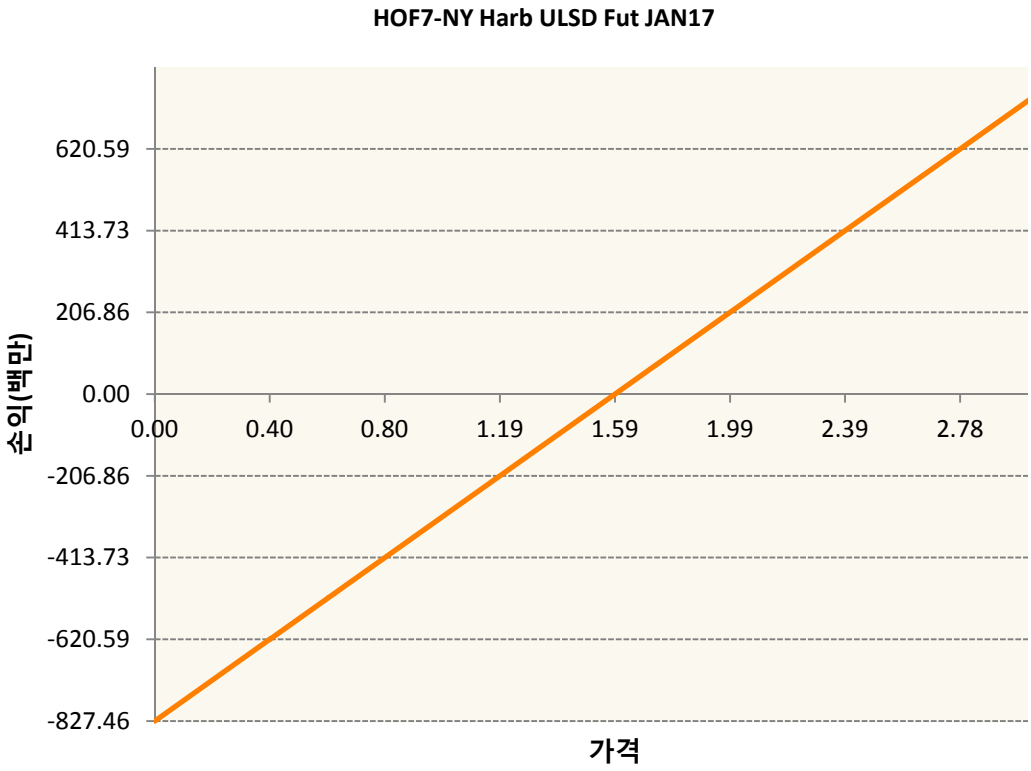
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	6,467	0	6,467	

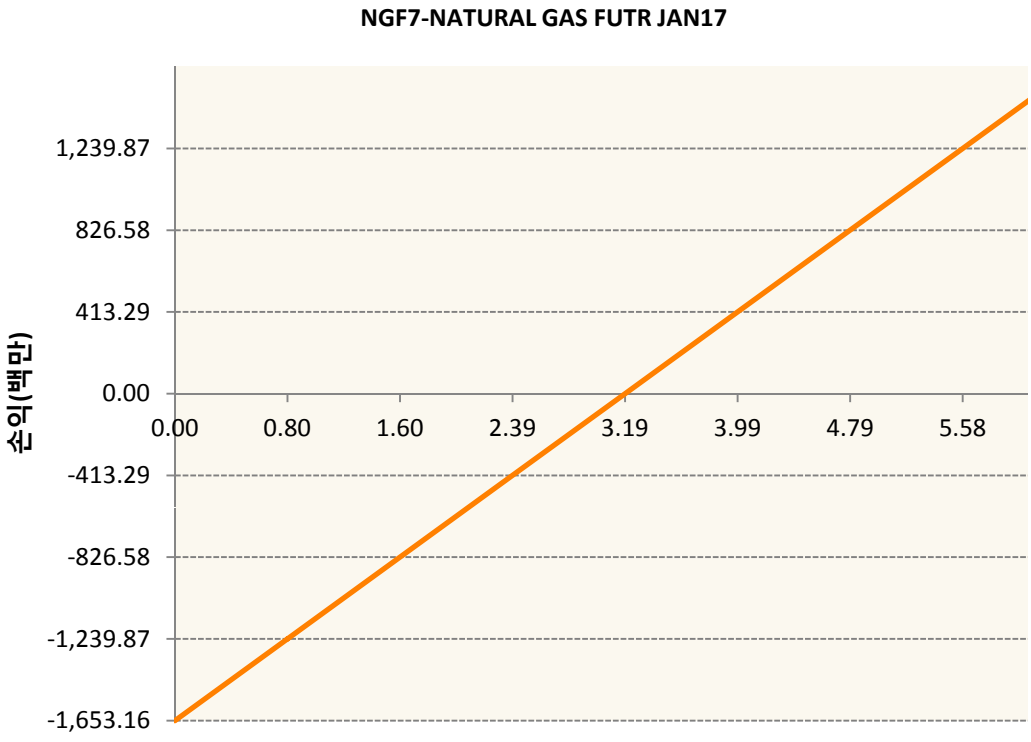
2. 만기시점의 손익구조



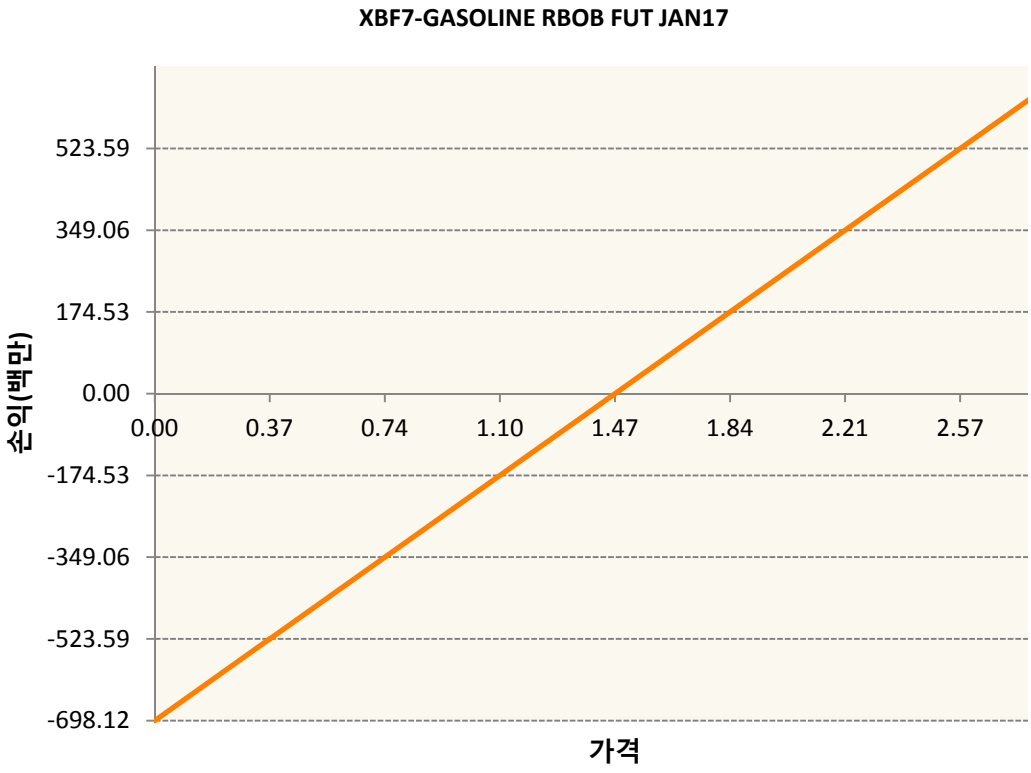



-856.65
-1,284.97
-1,713.29
가격


HOF7-NY Harb ULSD Fut JAN17
620.59
413.73
206.86
0.00
-206.86
-413.73
-620.59
-827.46
0.00
0.40
0.80
1.19
1.59
1.99
2.39
2.78
순익(백만)
가격


NGF7-NATURAL GAS FUTR JAN17
1,239.87
826.58
413.29
0.00
-413.29
-826.58
-1,239.87
-1,653.16
0.00
0.80
1.60
2.39
3.19
3.99
4.79
5.58
순익(백만)

가격



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
CLF7	WTI CRUDE FUTURE JAN17	126
COF7	BRENT CRUDE FUTR JAN17	137
HOF7	NY Harb ULSD Fut JAN17	66
NGF7	NATURAL GAS FUTR JAN17	132
XBF7	GASOLINE RBOB FUT JAN17	56

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,152

공시일	2016-10-28
기준일	2016-10-27

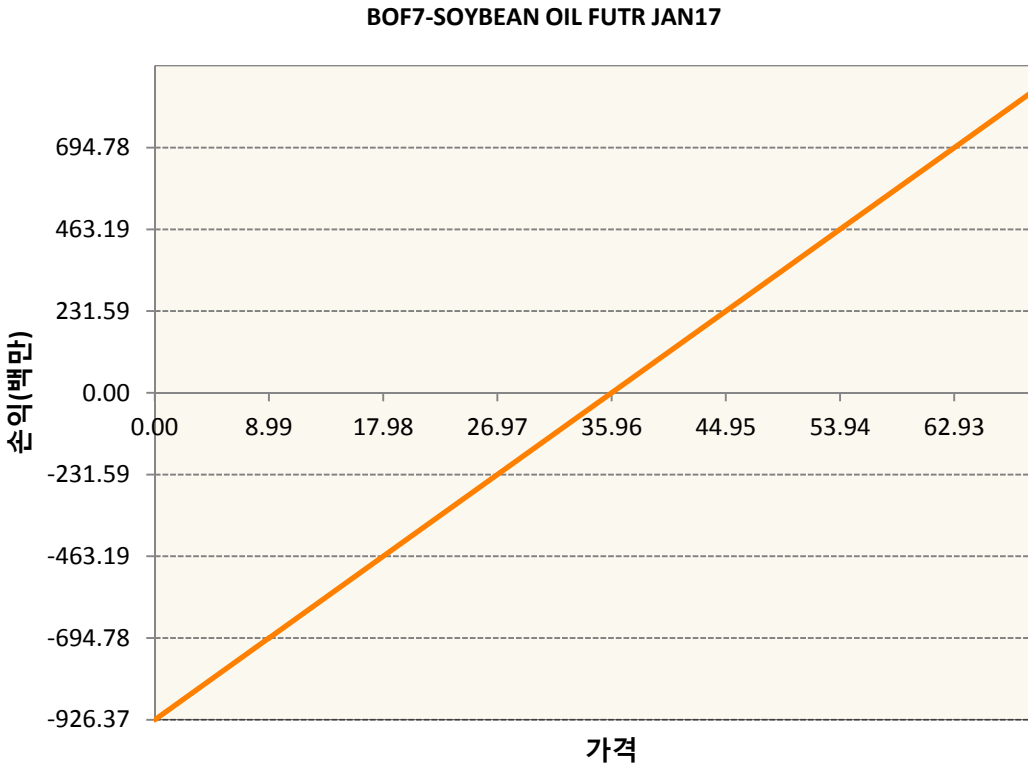
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

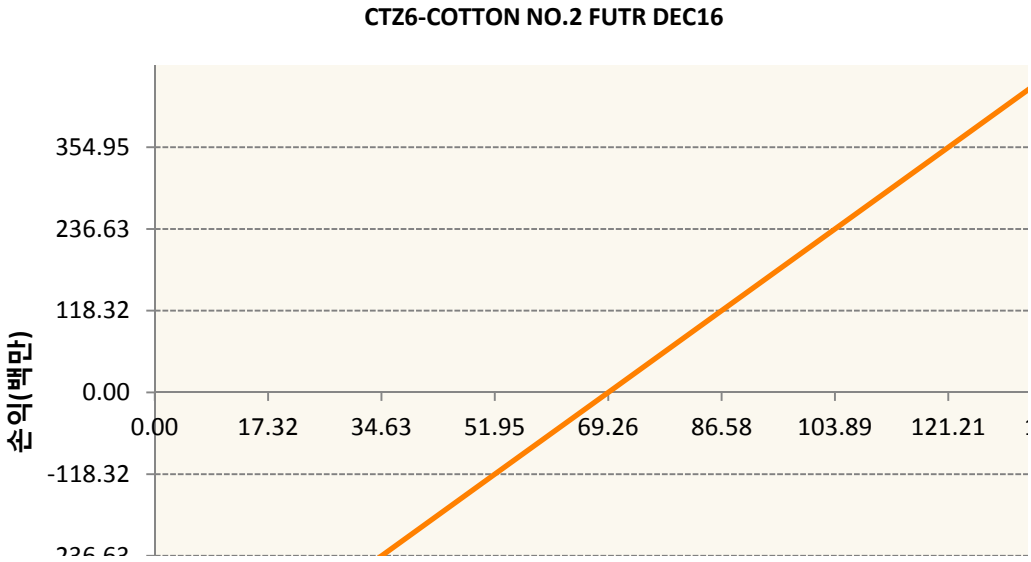
1. 계약금액

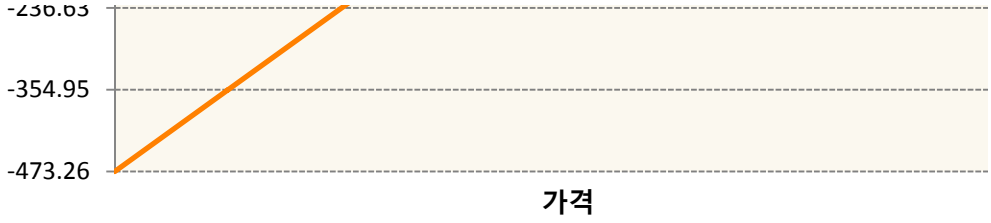
(단위:백만원)

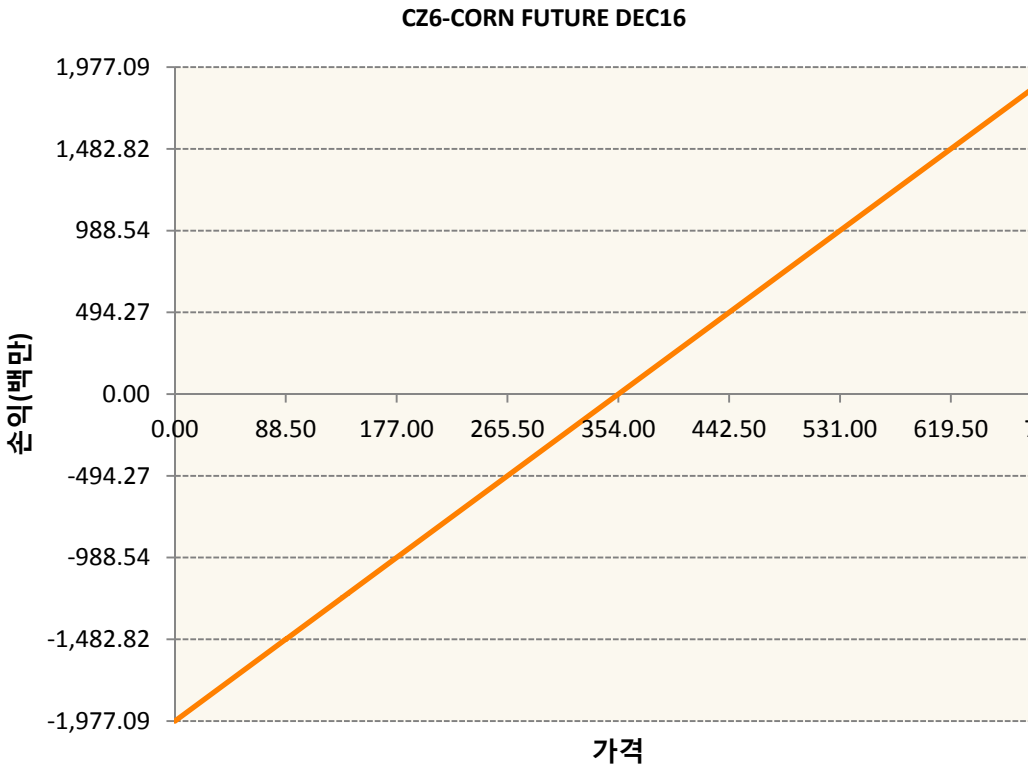
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	9,713	0	9,713	

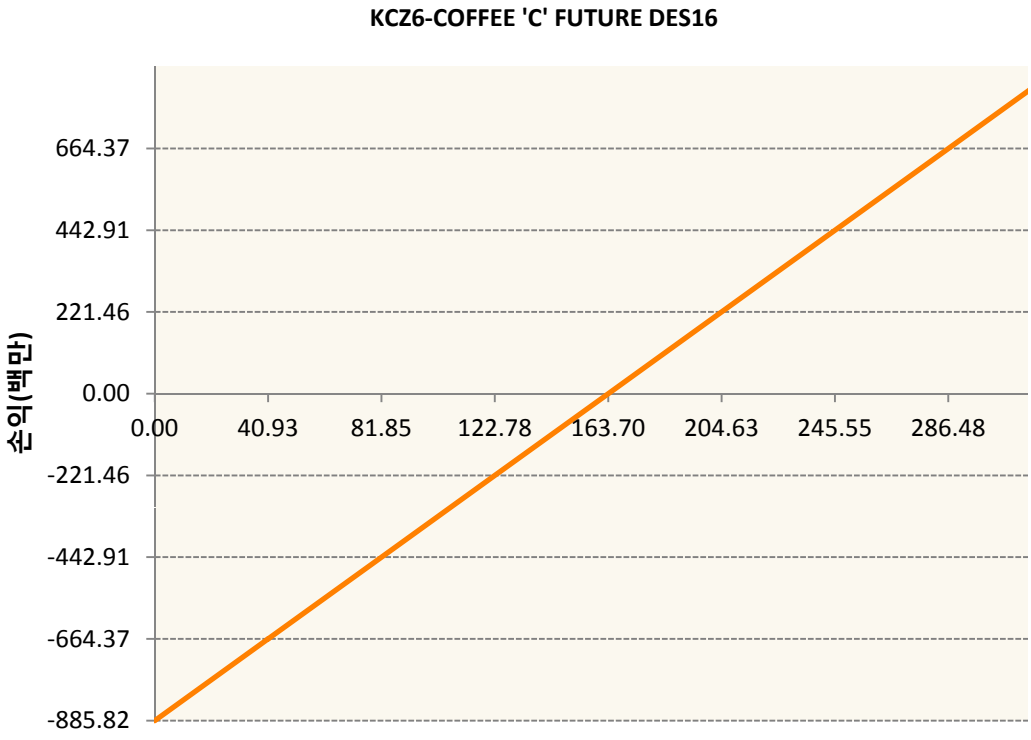
2. 만기시점의 손익구조





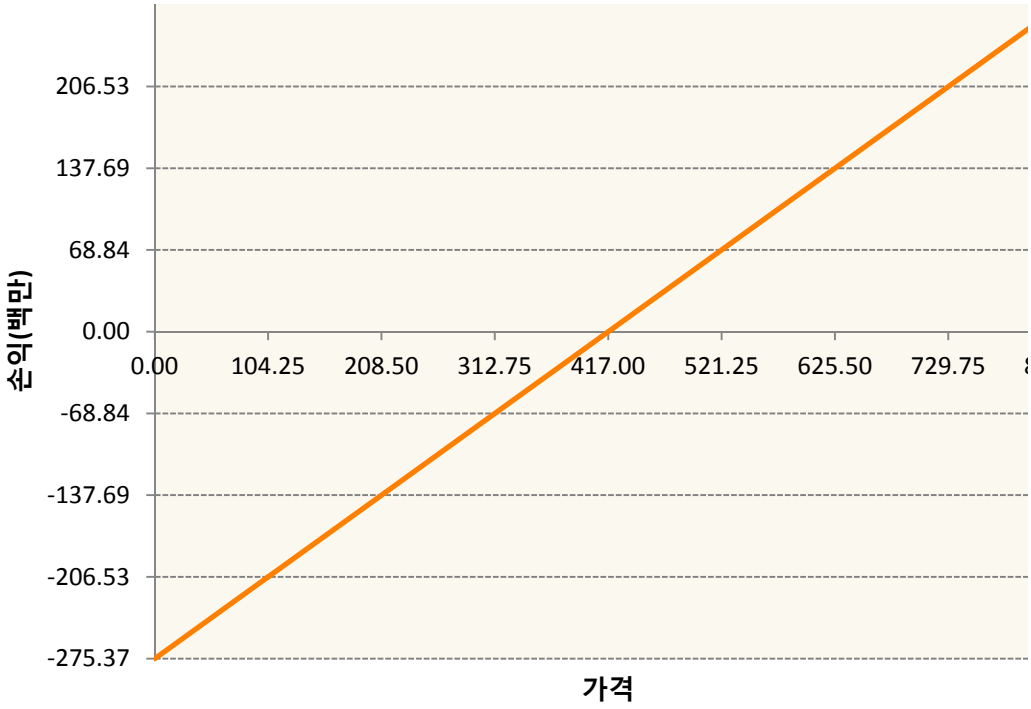

-354.95
-473.26
가격


CZ6-CORN FUTURE DEC16
1,977.09
1,482.82
988.54
494.27
0.00
-494.27
-988.54
-1,482.82
-1,977.09
0.00
88.50
177.00
265.50
354.00
442.50
531.00
619.50
순익(백만)
가격

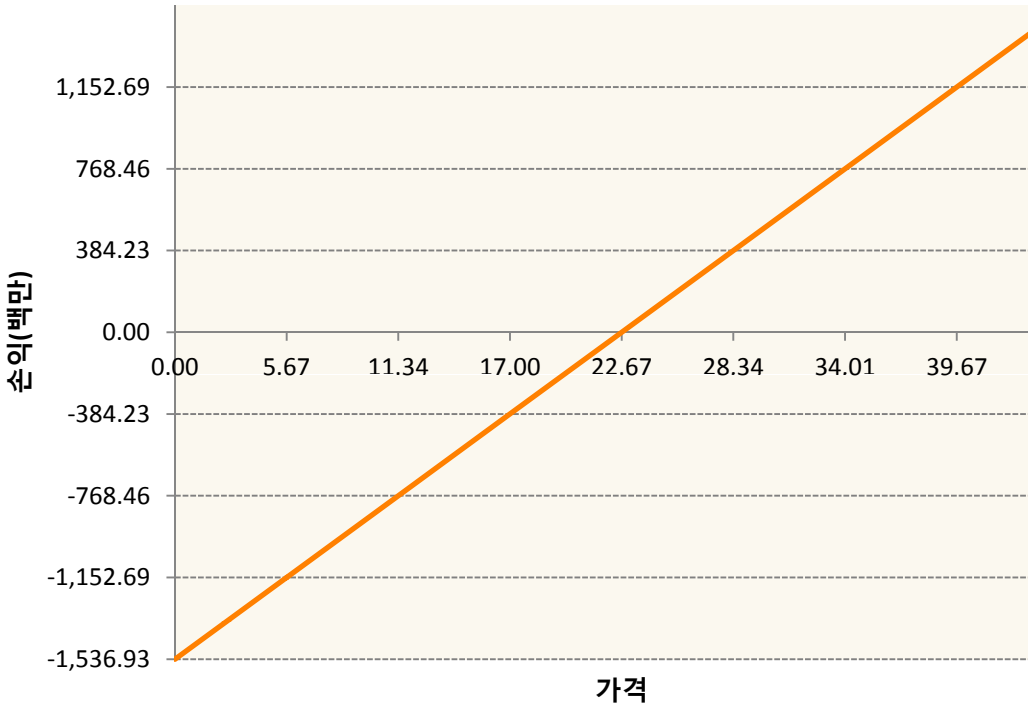

KCZ6-COFFEE 'C' FUTURE DES16
664.37
442.91
221.46
0.00
-221.46
-442.91
-664.37
-885.82
0.00
40.93
81.85
122.78
163.70
204.63
245.55
286.48
순익(백만)

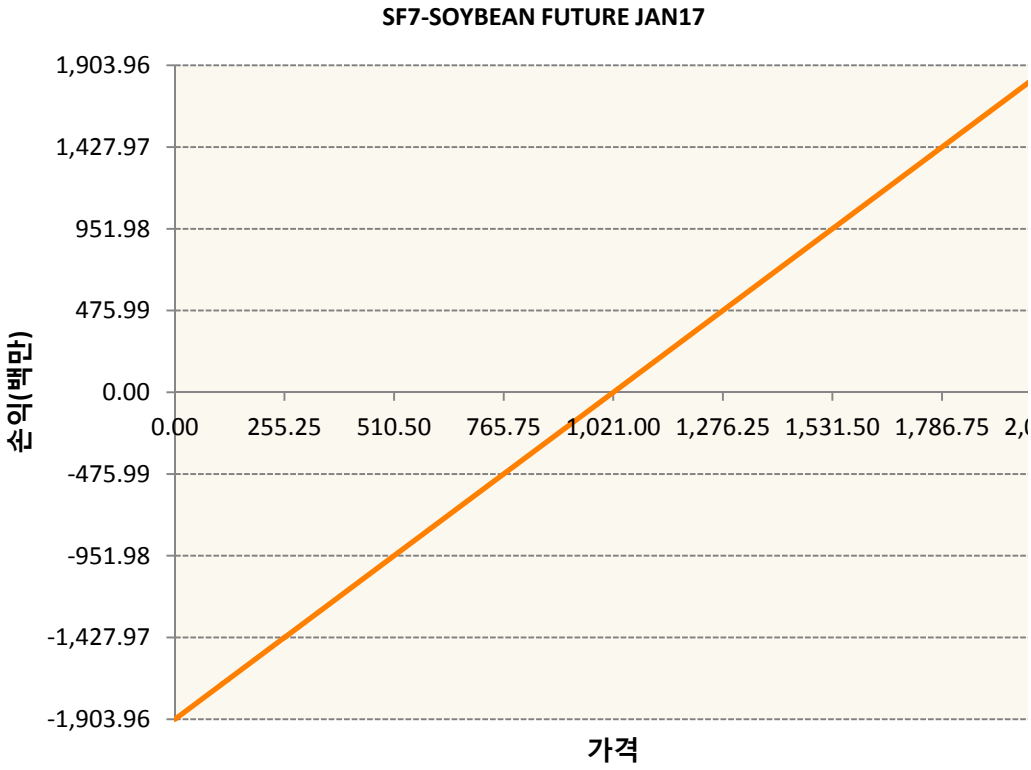
가격

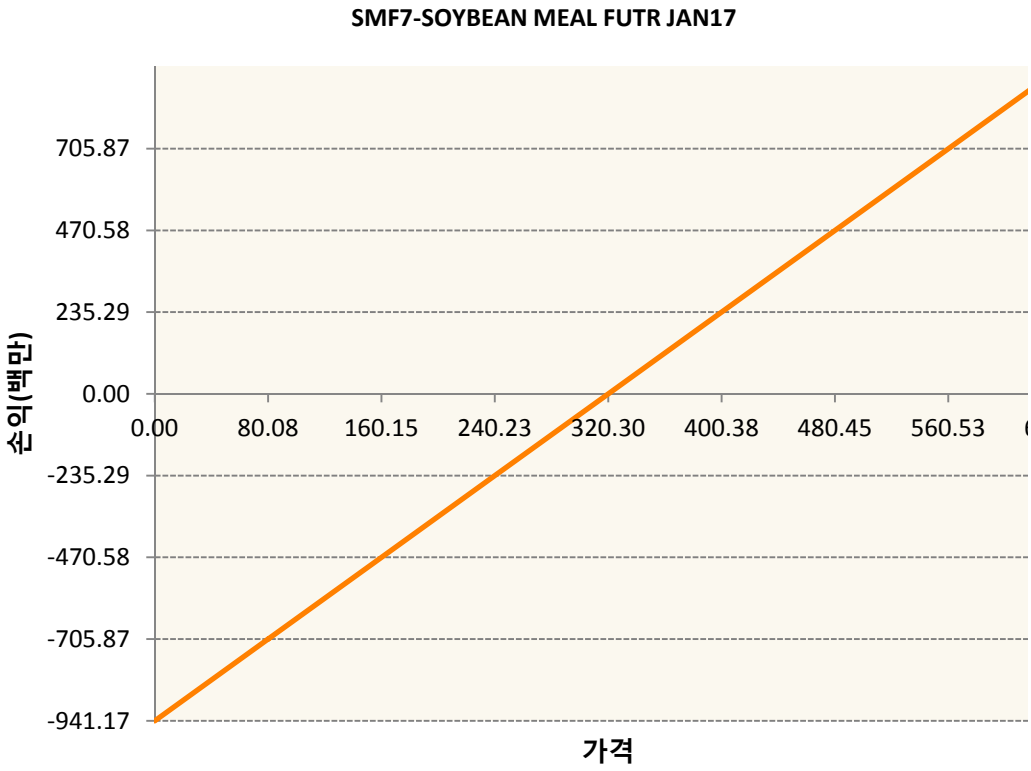
KWZ6-KC HRW WHEAT FUT DES16

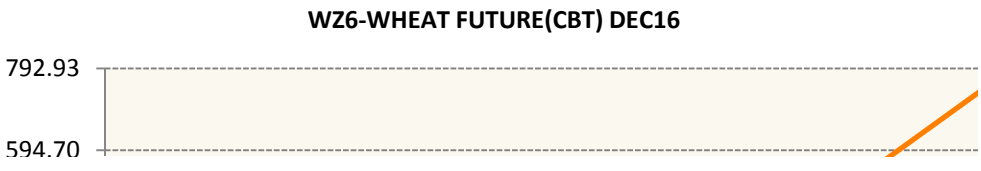


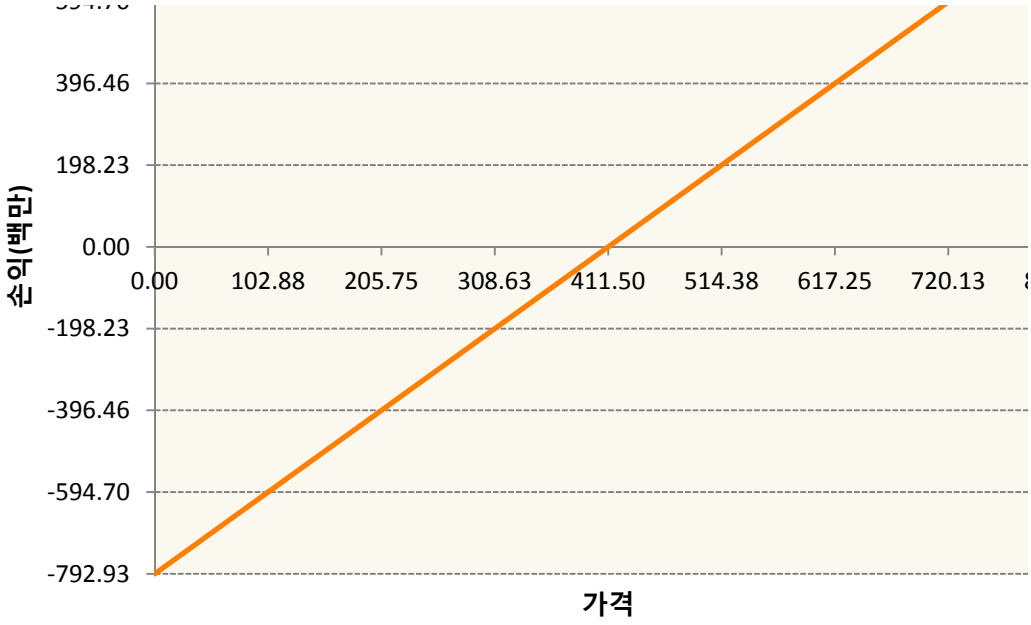
SBH7-Sugar #11 (WORLD) MAR17




SF7-SOYBEAN FUTURE JAN17
1,903.96
1,427.97
951.98
475.99
0.00
-475.99
-951.98
-1,427.97
-1,903.96
0.00
255.25
510.50
765.75
1,021.00
1,276.25
1,531.50
1,786.75
손익(백만)
가격


SMF7-SOYBEAN MEAL FUTR JAN17
705.87
470.58
235.29
0.00
-235.29
-470.58
-705.87
-941.17
0.00
80.08
160.15
240.23
320.30
400.38
480.45
560.53
손익(백만)
가격


WZ6-WHEAT FUTURE(CBT) DEC16
792.93
594.70



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

BOF7	SOYBEAN OIL FUTR JAN17	74
CTZ6	COTTON NO.2 FUTR DEC16	38
CZ6	CORN FUTURE DEC16	158
KCZ6	COFFEE 'C' FUTURE DES16	71
KWZ6	KC HRW WHEAT FUT DES16	22
SBH7	Sugar #11 (WORLD) MAR17	123
SF7	SOYBEAN FUTURE JAN17	152
SMF7	SOYBEAN MEAL FUTR JAN17	75
WZ6	WHEAT FUTURE(CBT) DEC16	63

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

973