공시일	2016-10-31
기준일	2016-10-28

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	2016-10-31
기준일	2016-10-28

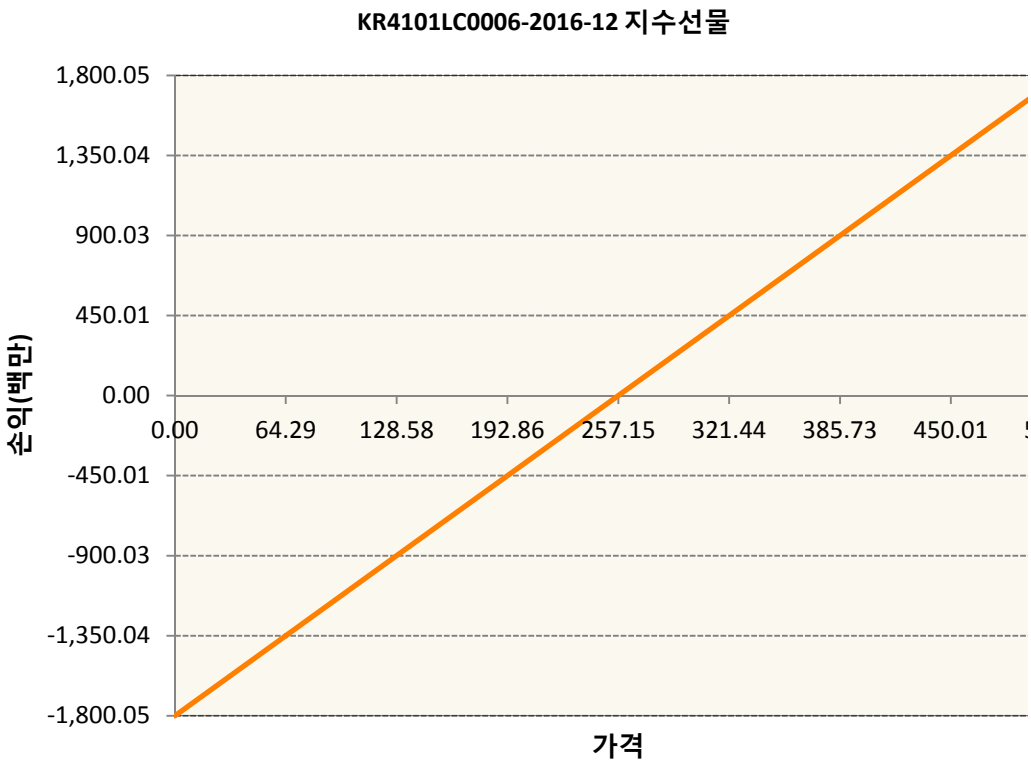
스마트인덱스모

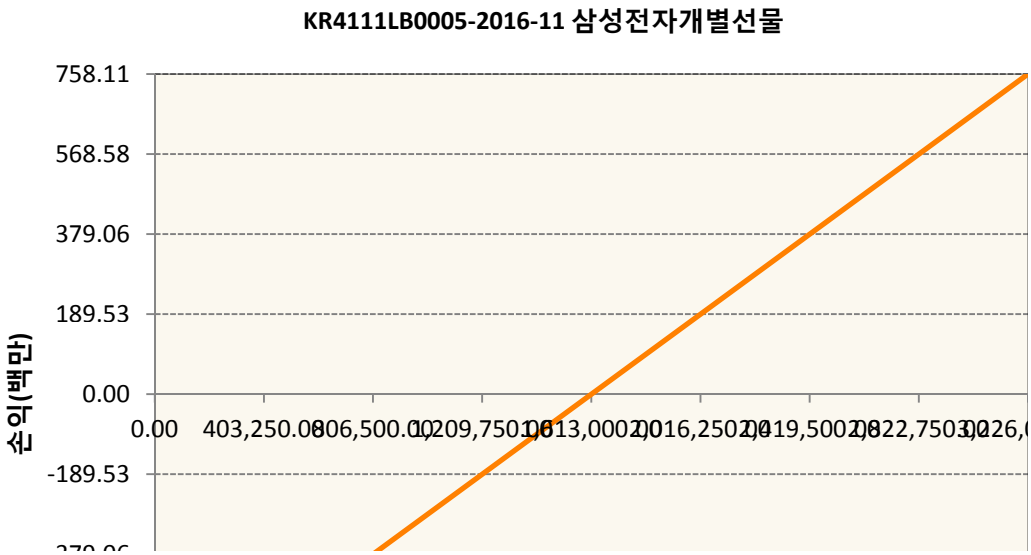
1. 계약금액

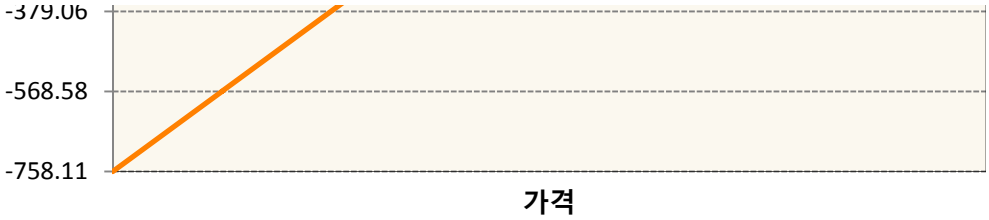
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,558	0	2,558	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							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%	-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%	61	61	61	61	61	61	61

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

177

공시일	2016-10-31
기준일	2016-10-28

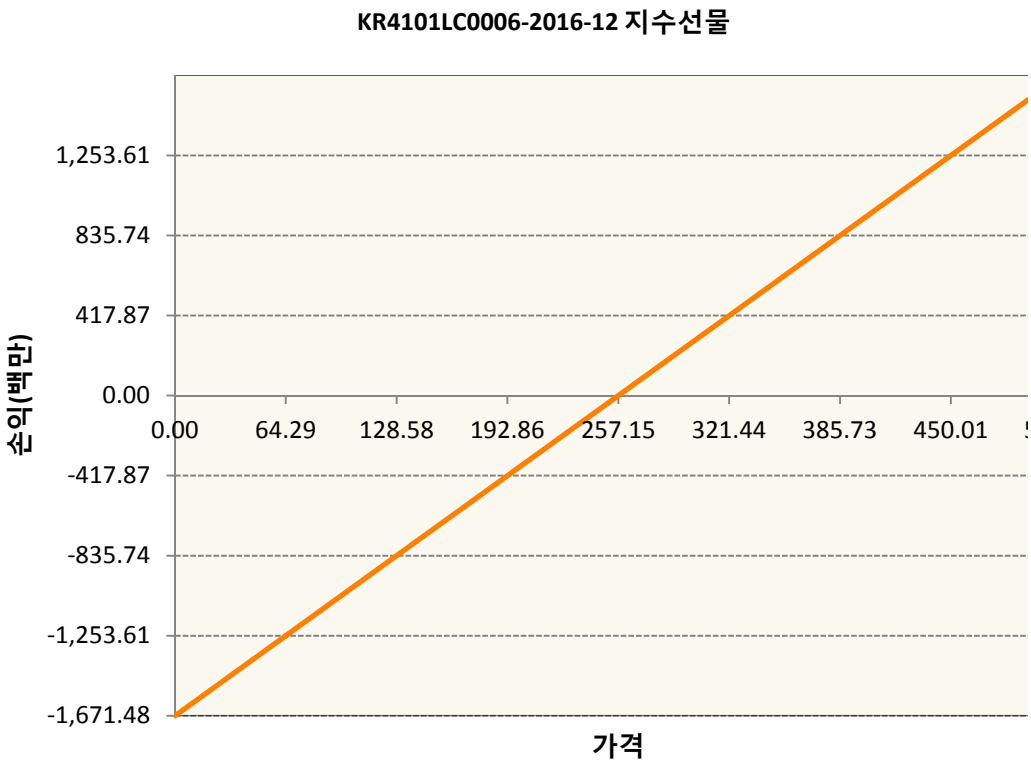
스마트레버리지목표전환형1호

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	1,671	0	1,671	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	2016-10-31
기준일	2016-10-28

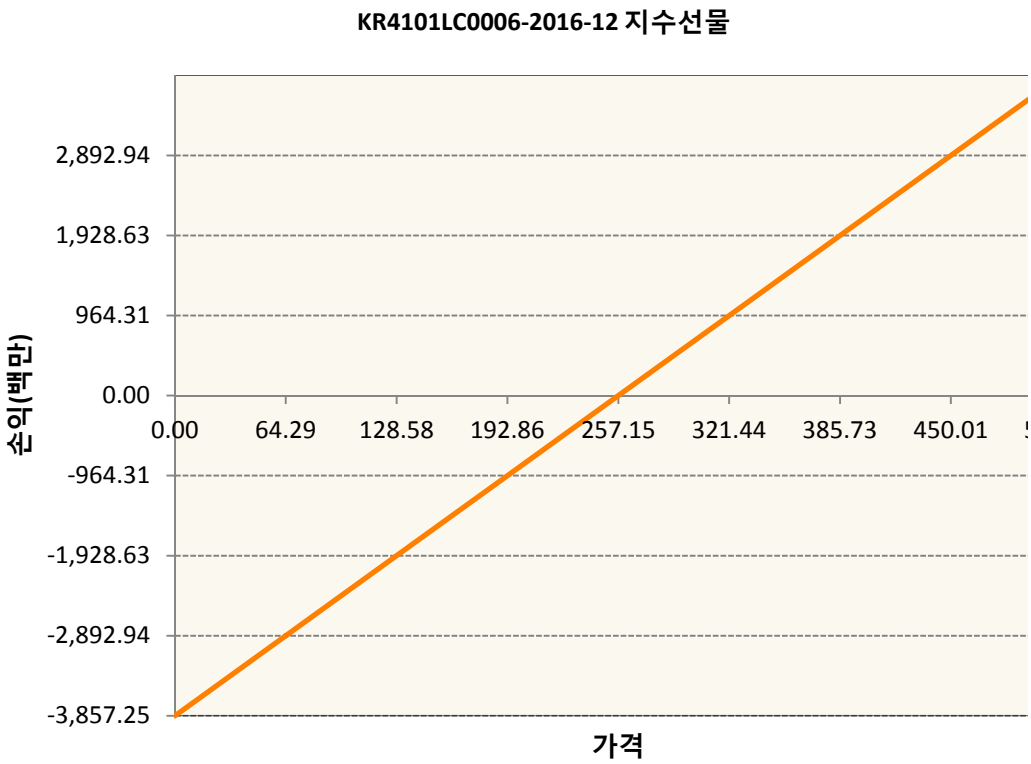
1.3배 레버리지 인덱스(주식-파생형)

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	3,857	0	3,857	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)

232

공시일	2016-10-31
기준일	2016-10-28

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	872

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

707

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2016-10-31
기준일	2016-10-28

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	398

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

770

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2016-10-31
기준일	2016-10-28

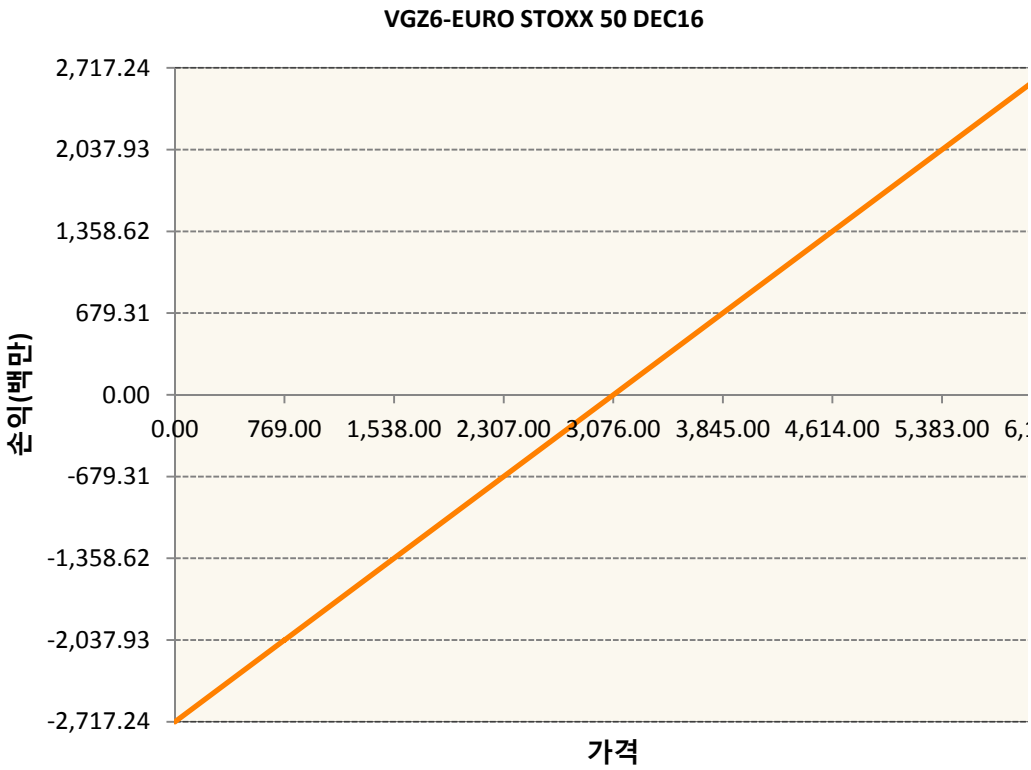
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,717	0	2,717	

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	2016-10-31
기준일	2016-10-28

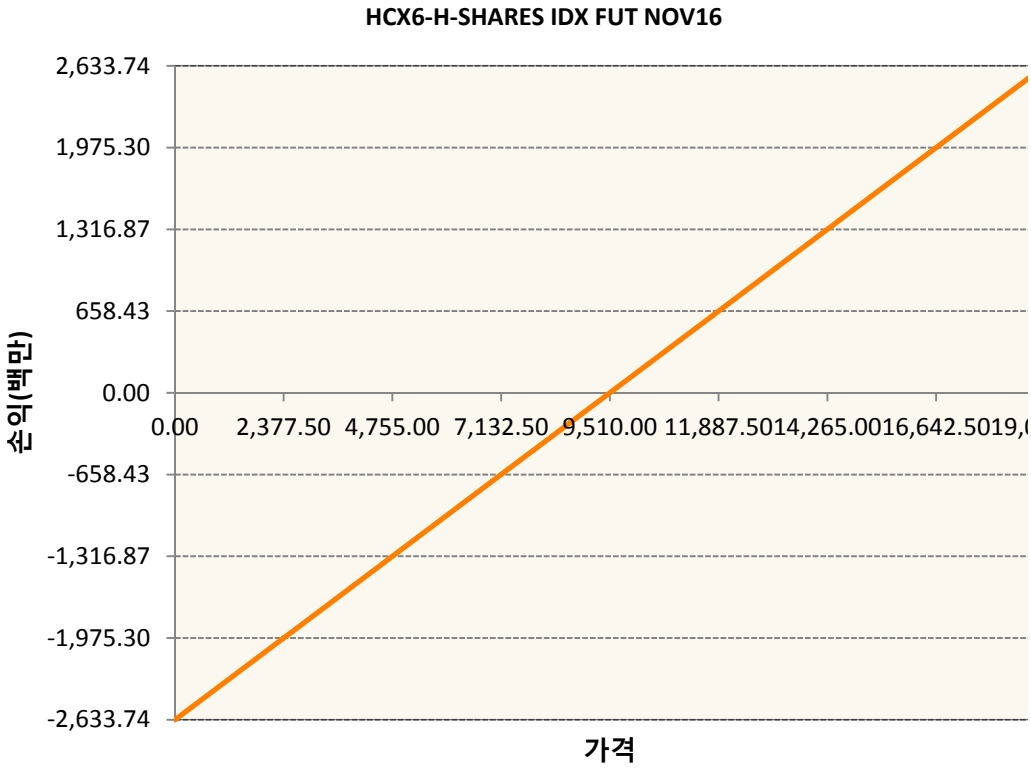
차이나인덱스모(주식-파생형)

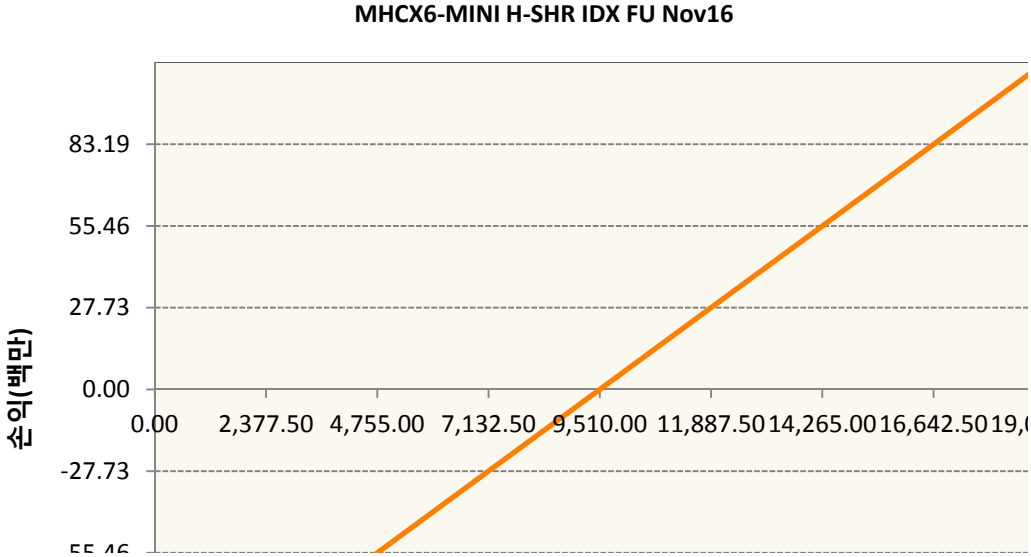
1. 계약금액

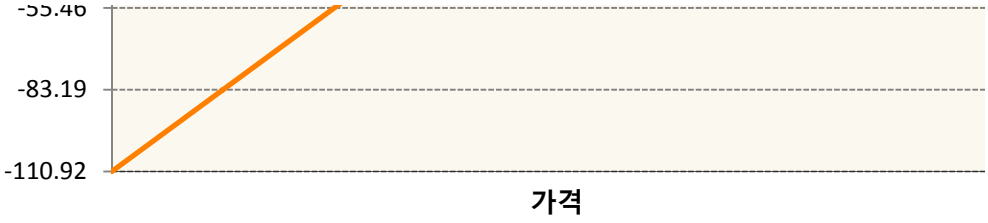
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,745	0	2,745	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCX6	H-SHARES IDX FUT NOV16	211
MHCX6	MINI H-SHR IDX FU Nov16	9

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	295

공시일	2016-10-31
기준일	2016-10-28

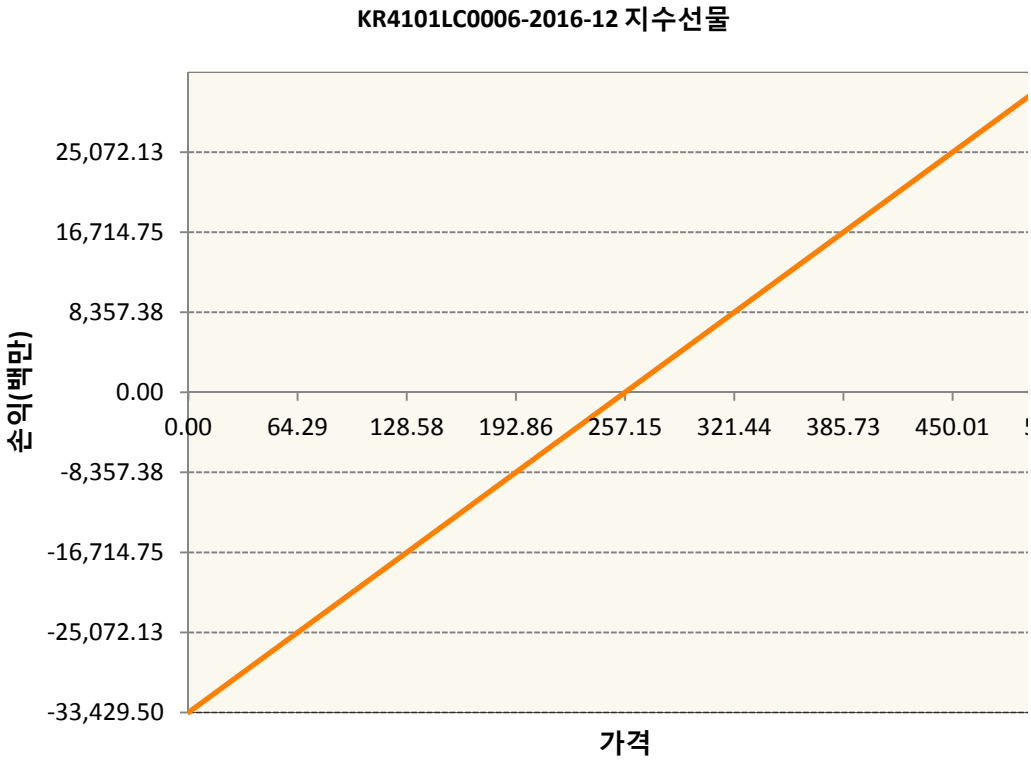
커버드콜(주식혼합-파생형)

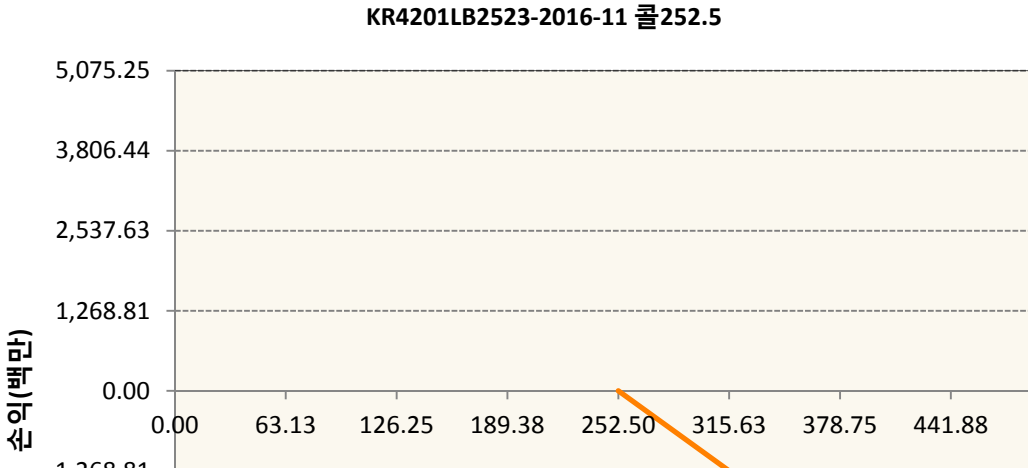
1. 계약금액

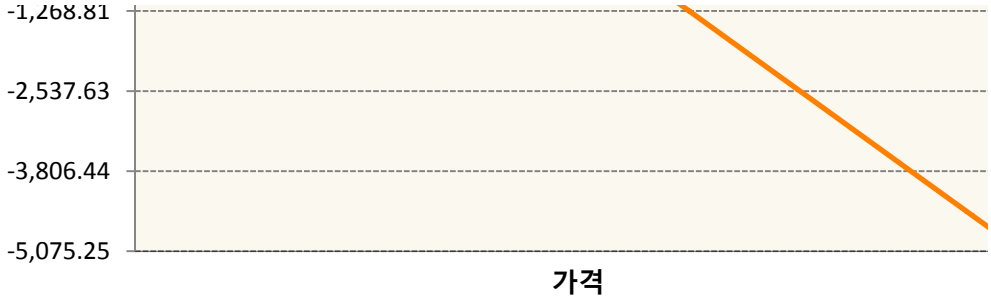
(단위:백만원)

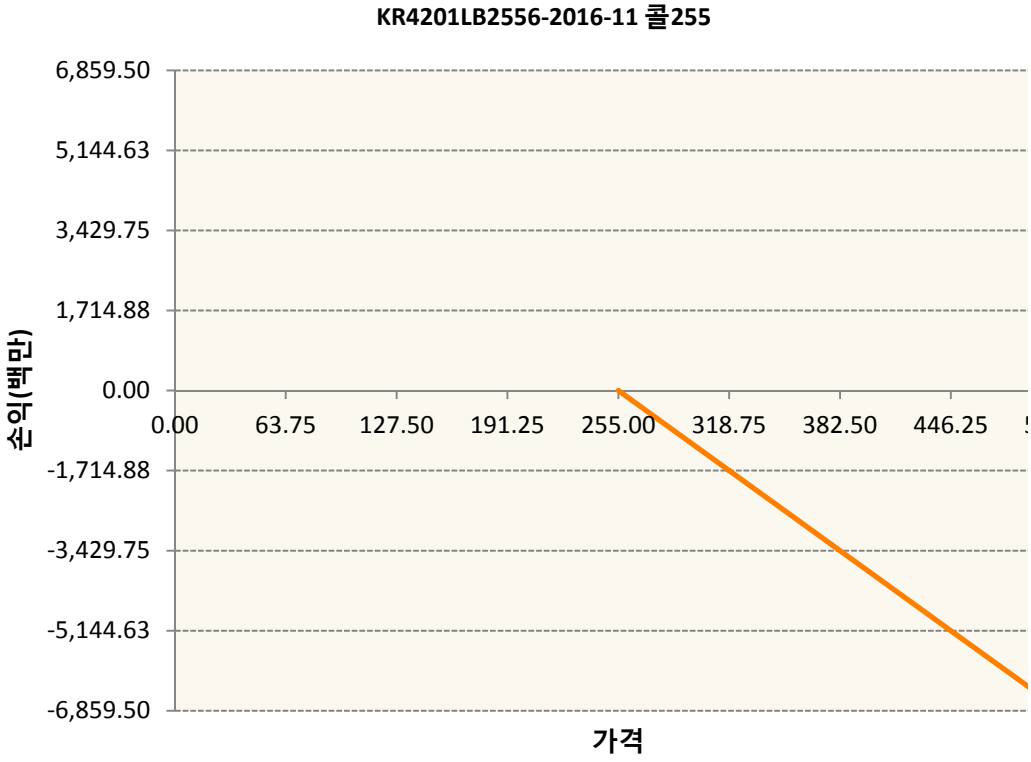
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	387	-387	장내
누계	유가증권	선물	33,430	0	33,430	장내
누계	유가증권	옵션	0	11,935	-11,935	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101LC00 2016-12 지수선물							2,668
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-2,668	-2,668	-2,668	-2,668	-2,668	-2,668	-2,668
-5.33%	-1,779	-1,779	-1,779	-1,779	-1,779	-1,779	-1,779
-2.67%	-889	-889	-889	-889	-889	-889	-889
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	889	889	889	889	889	889	889
5.33%	1,779	1,779	1,779	1,779	1,779	1,779	1,779
8.00%	2,668	2,668	2,668	2,668	2,668	2,668	2,668
KR4201LB25 2016-11 콜252.5							1,964
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	500	500	500	499	499	498	497
-5.33%	497	495	491	486	480	473	464
-2.67%	424	407	389	371	353	334	315
0%	47	32	16	0	-17	-35	-53
2.67%	-591	-593	-596	-601	-606	-612	-620
5.33%	-1,277	-1,277	-1,277	-1,277	-1,278	-1,279	-1,281
8.00%	-1,964	-1,964	-1,964	-1,964	-1,964	-1,964	-1,964
KR4201LB25 2016-11 콜255							2,517

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	445	445	445	445	445	444	444
-5.33%	445	444	442	439	434	429	422
-2.67%	407	392	375	357	338	317	296
0%	80	54	27	0	-27	-54	-82
2.67%	-687	-694	-703	-714	-726	-741	-756
5.33%	-1,597	-1,597	-1,598	-1,599	-1,601	-1,604	-1,608
8.00%	-2,516	-2,516	-2,516	-2,516	-2,516	-2,517	-2,517

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

7,639

공시일	2016-10-31
기준일	2016-10-28

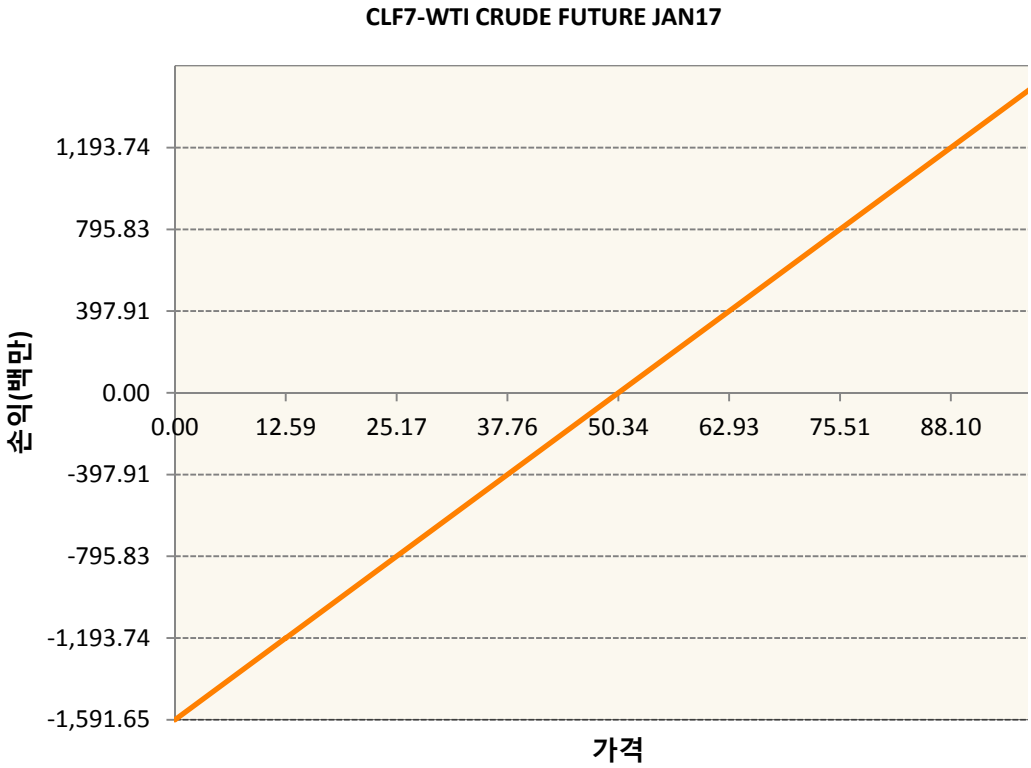
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

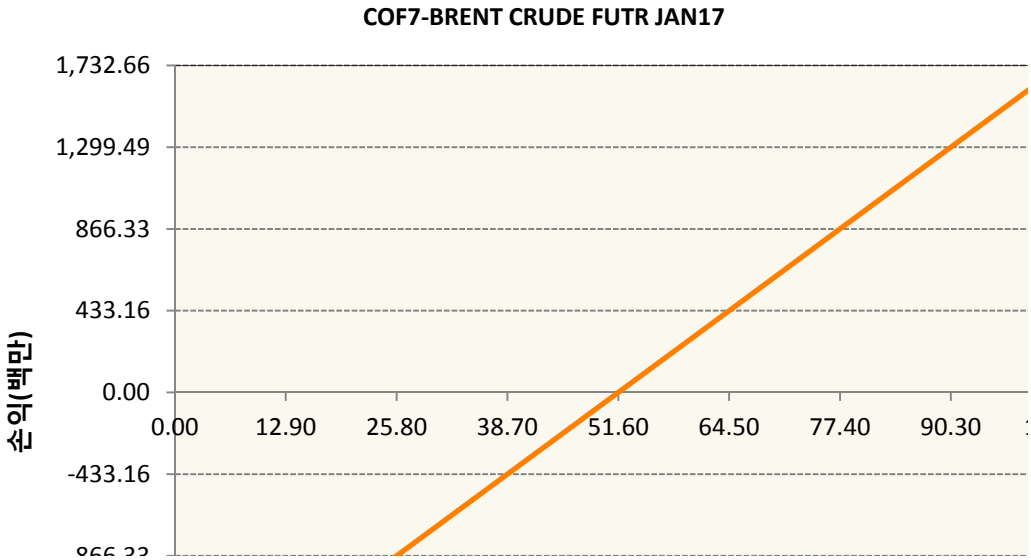
1. 계약금액

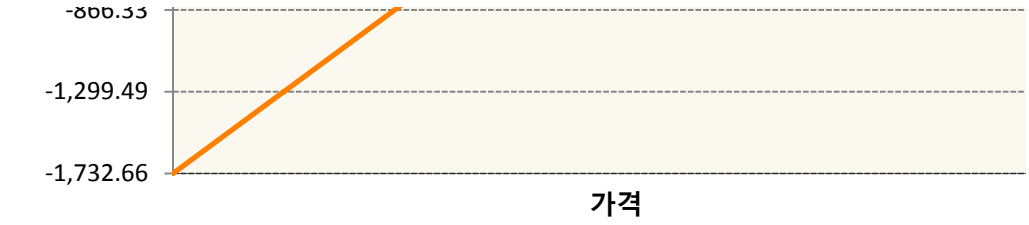
(단위:백만원)

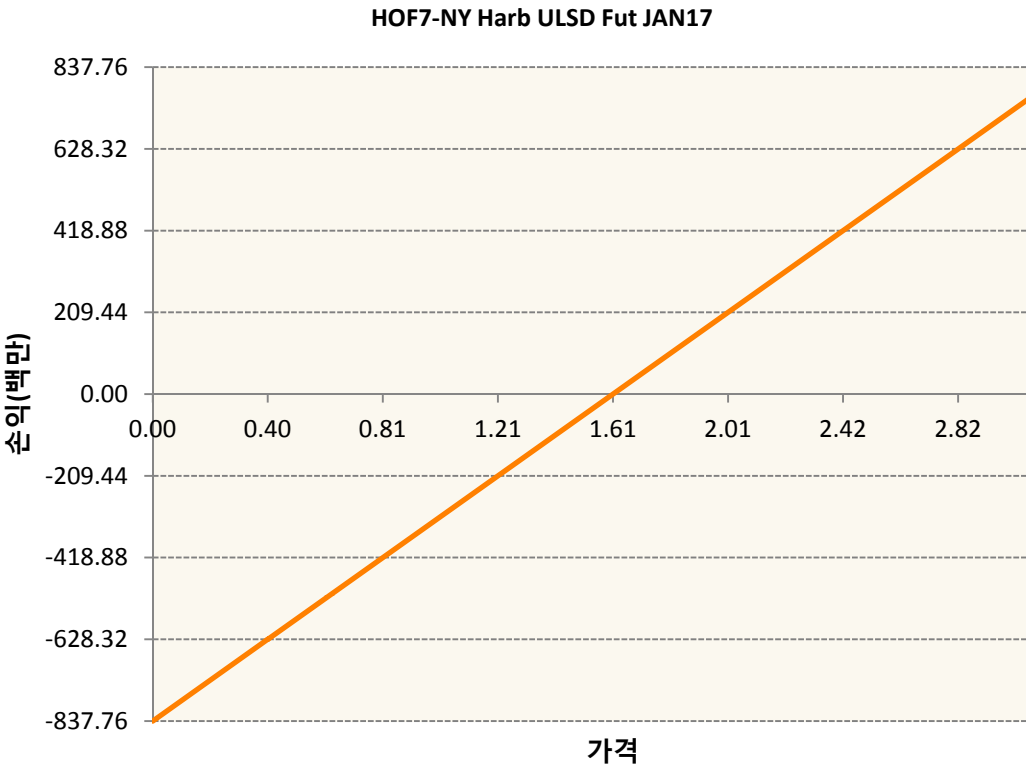
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	6,543	0	6,543	

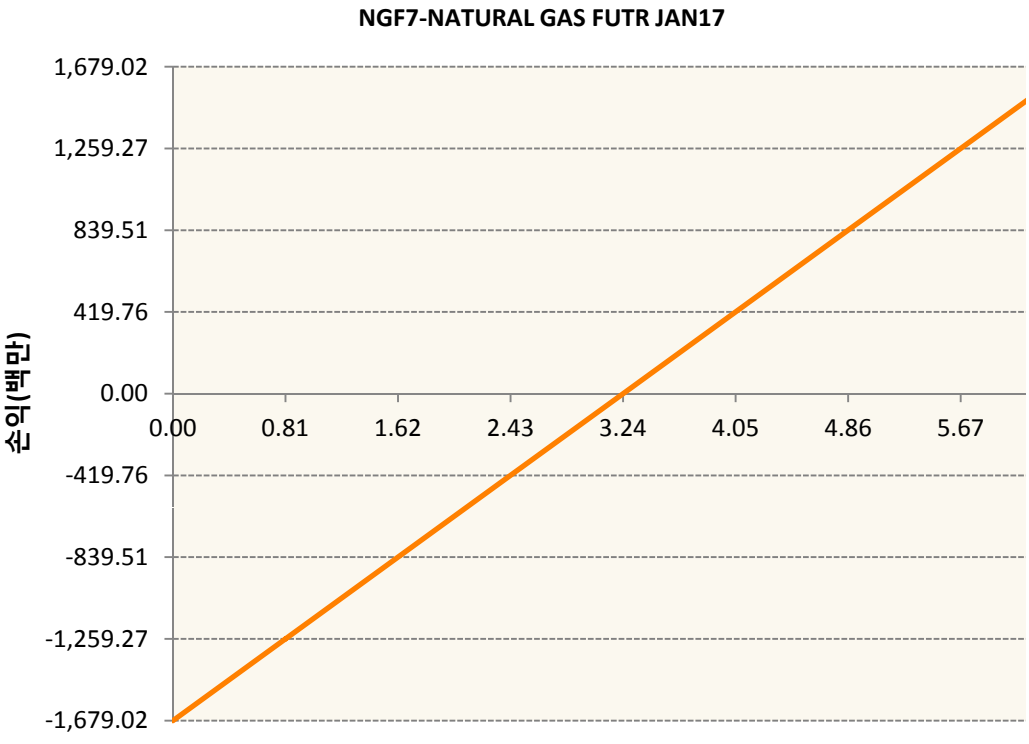
2. 만기시점의 손익구조



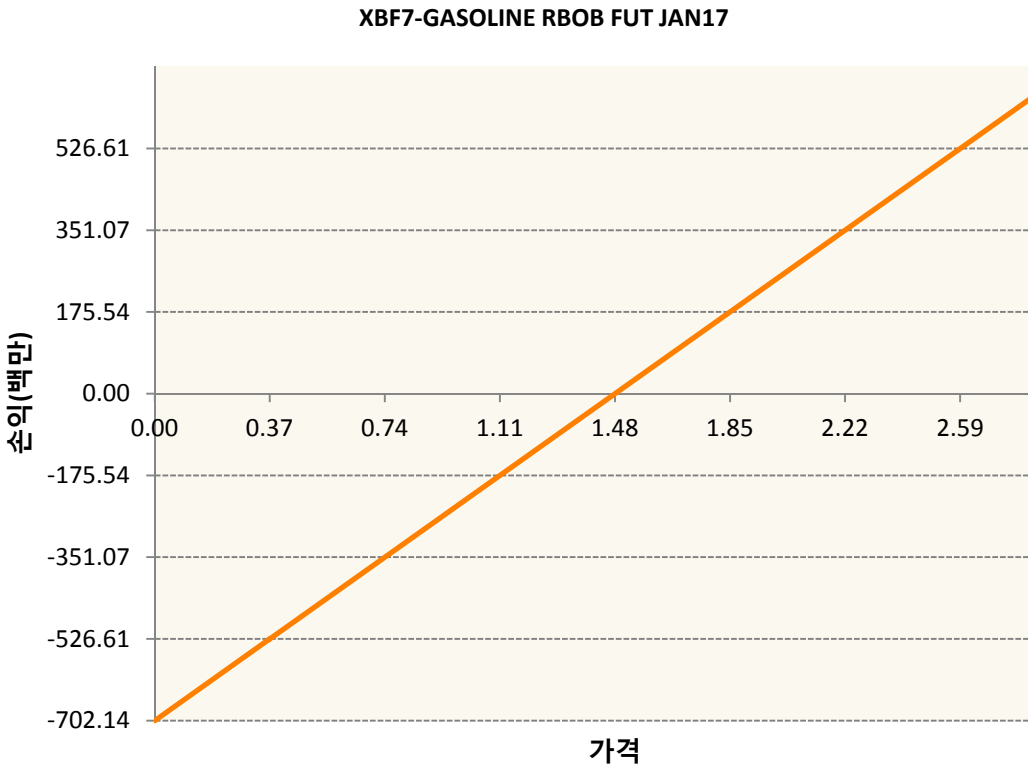



-866.33
-1,299.49
-1,732.66
가격


HOF7-NY Harb ULSD Fut JAN17
837.76
628.32
418.88
209.44
0.00
-209.44
-418.88
-628.32
-837.76
0.00
0.40
0.81
1.21
1.61
2.01
2.42
2.82
손익(백만)
가격


NGF7-NATURAL GAS FUTR JAN17
1,679.02
1,259.27
839.51
419.76
0.00
-419.76
-839.51
-1,259.27
-1,679.02
0.00
0.81
1.62
2.43
3.24
4.05
4.86
5.67
손익(백만)

가격



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
CLF7	WTI CRUDE FUTURE JAN17	127
COF7	BRENT CRUDE FUTR JAN17	139
HOF7	NY Harb ULSD Fut JAN17	67
NGF7	NATURAL GAS FUTR JAN17	134
XBF7	GASOLINE RBOB FUT JAN17	56

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,164

공시일	2016-10-31
기준일	2016-10-28

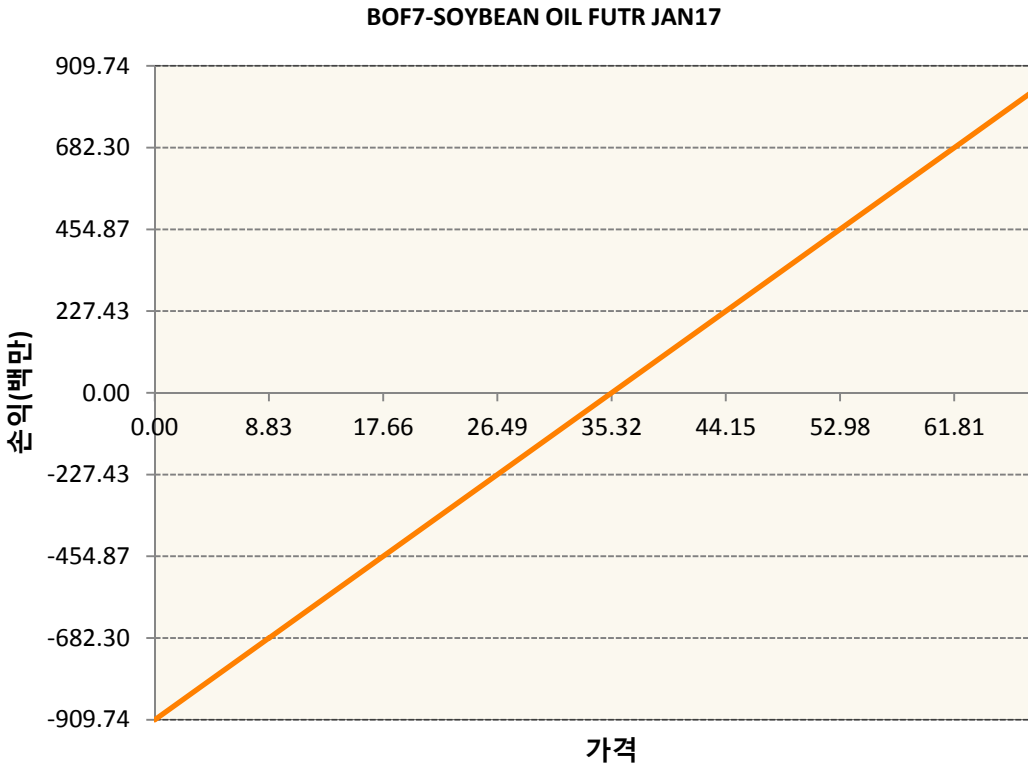
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

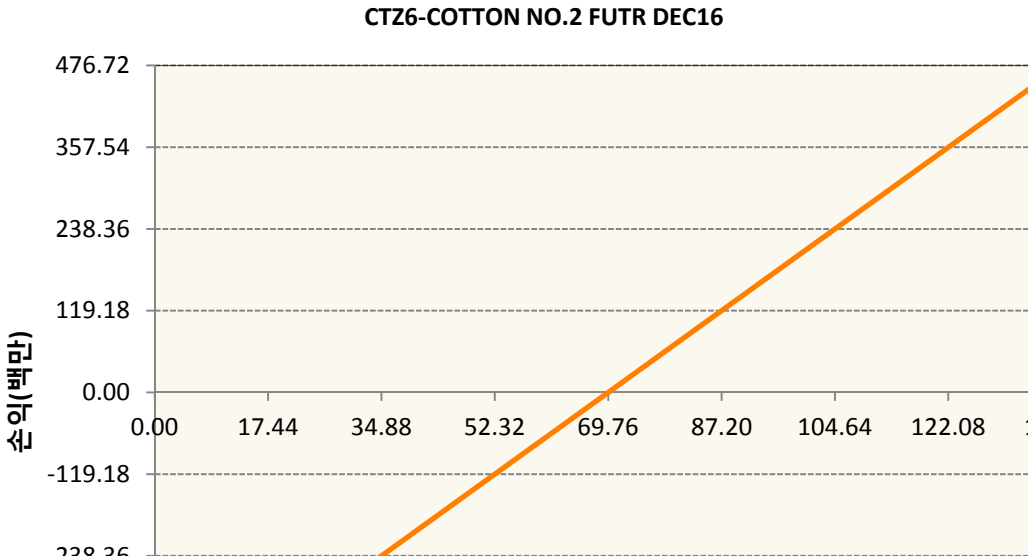
1. 계약금액

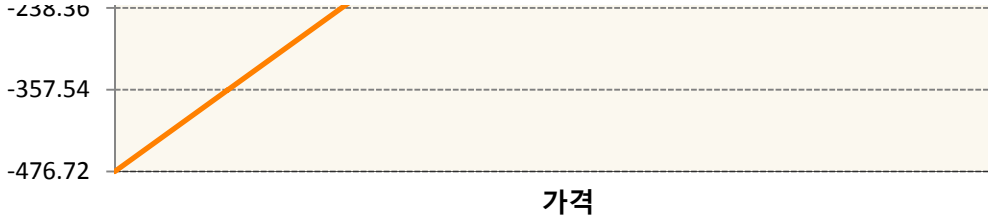
(단위:백만원)

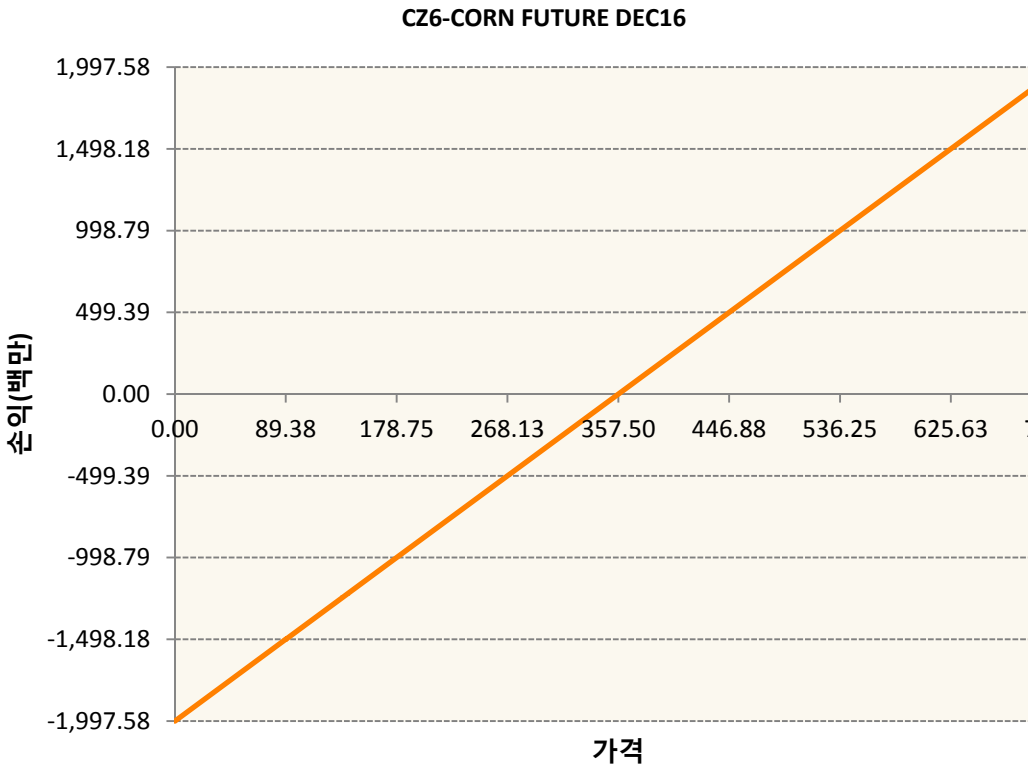
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	9,760	0	9,760	

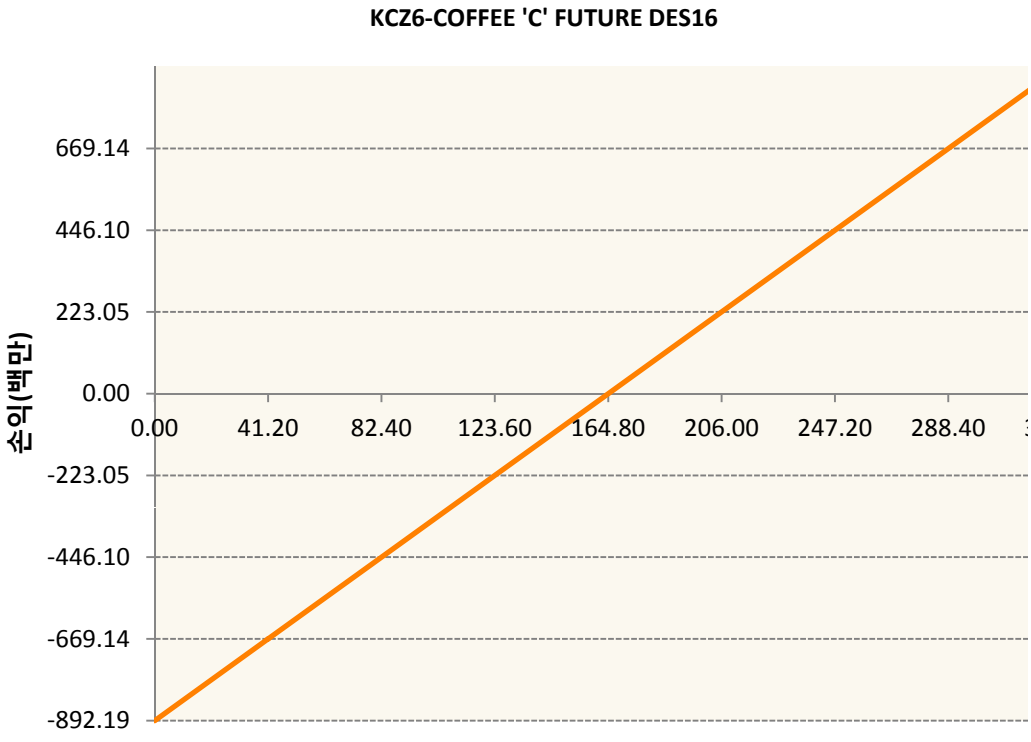
2. 만기시점의 손익구조



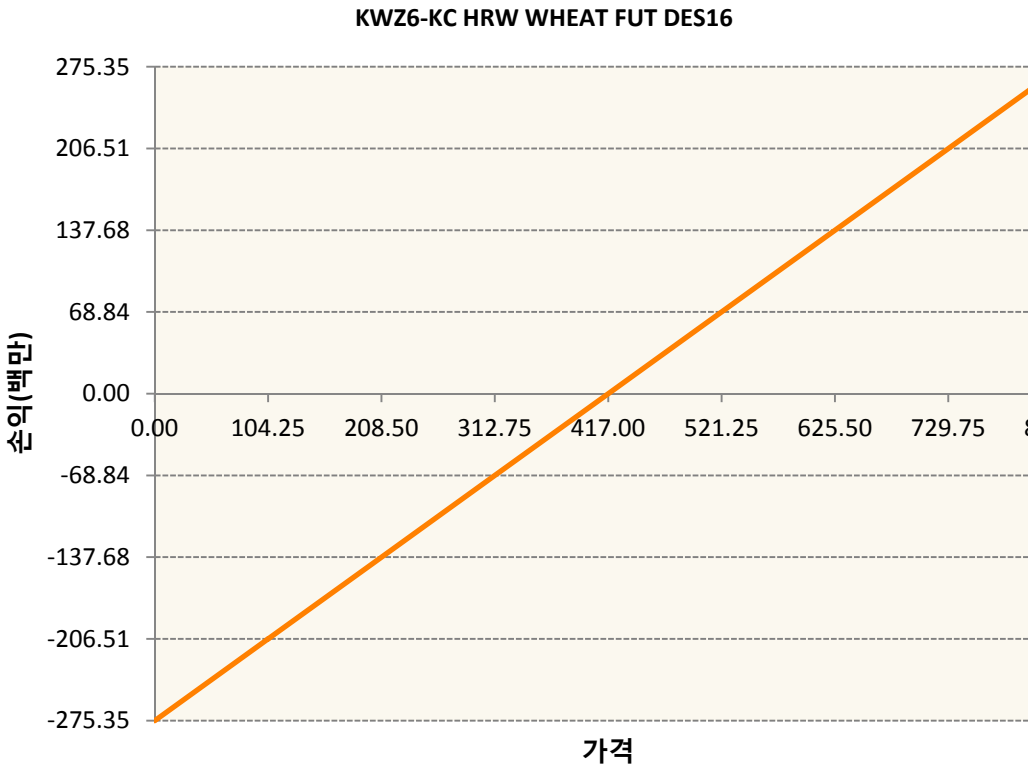


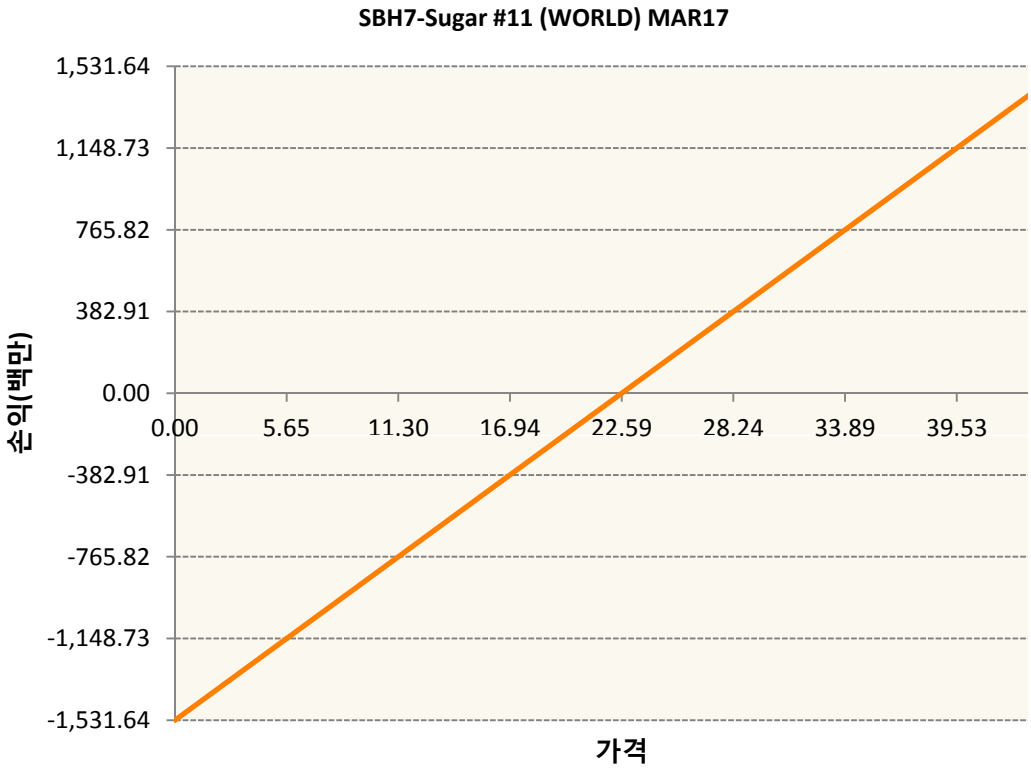

-357.54
-476.72
가격

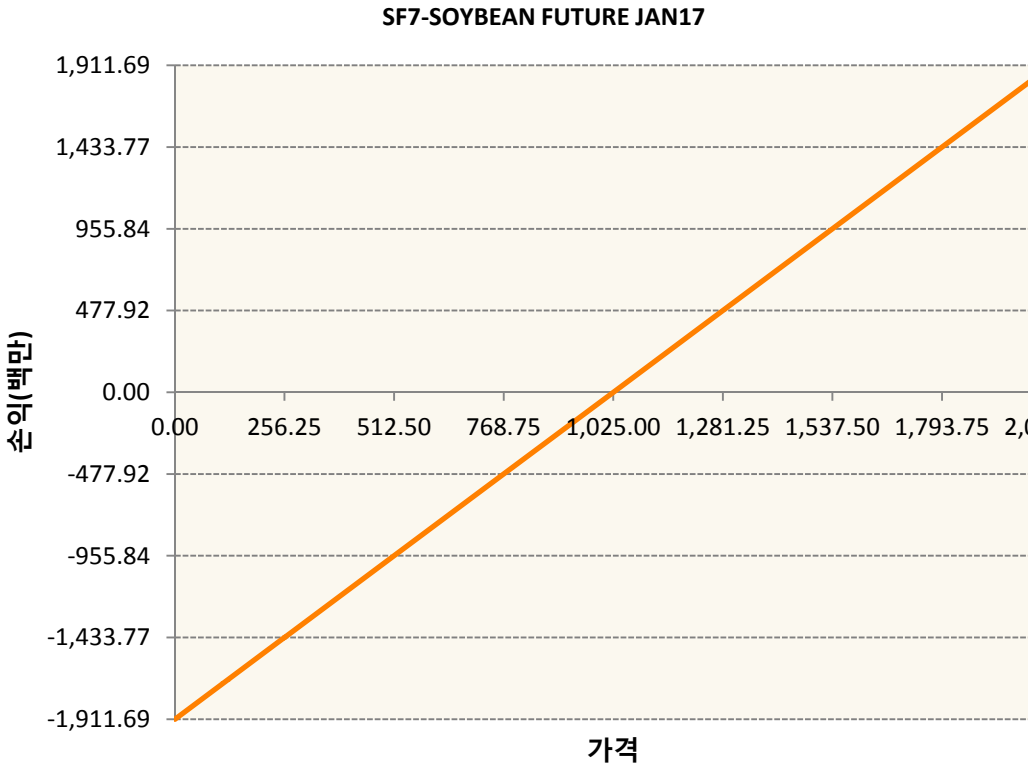

CZ6-CORN FUTURE DEC16
1,997.58
1,498.18
998.79
499.39
0.00
-499.39
-998.79
-1,498.18
-1,997.58
0.00
89.38
178.75
268.13
357.50
446.88
536.25
625.63
순익(백만)
가격

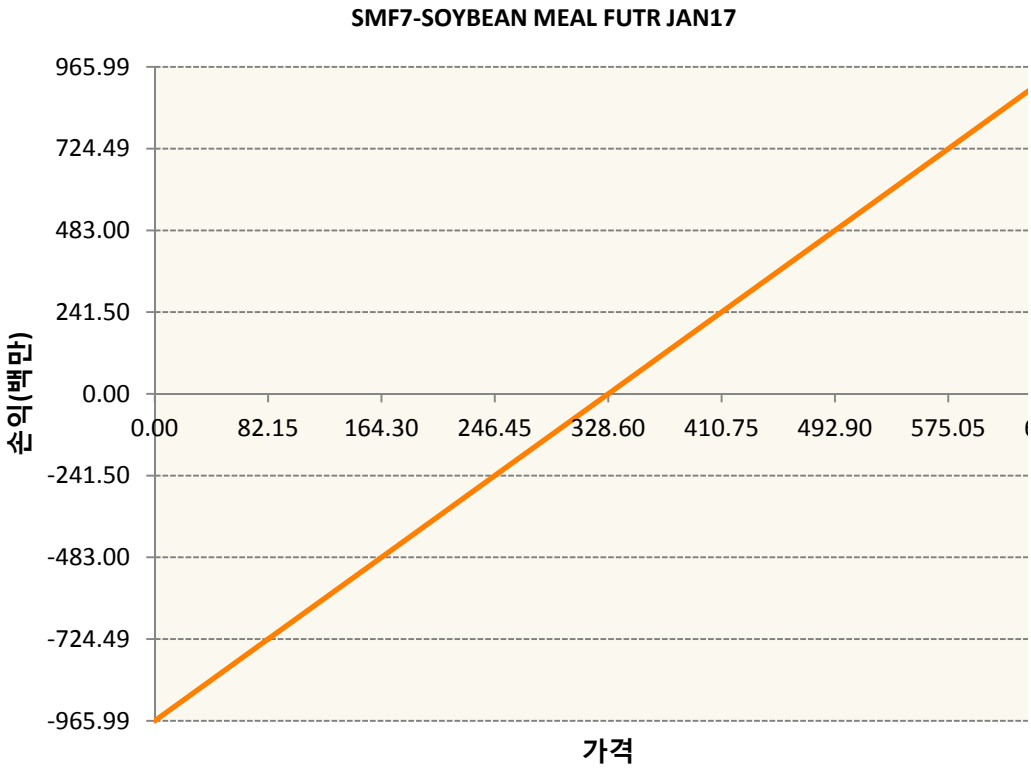

KCZ6-COFFEE 'C' FUTURE DES16
669.14
446.10
223.05
0.00
-223.05
-446.10
-669.14
-892.19
0.00
41.20
82.40
123.60
164.80
206.00
247.20
288.40
순익(백만)

가격

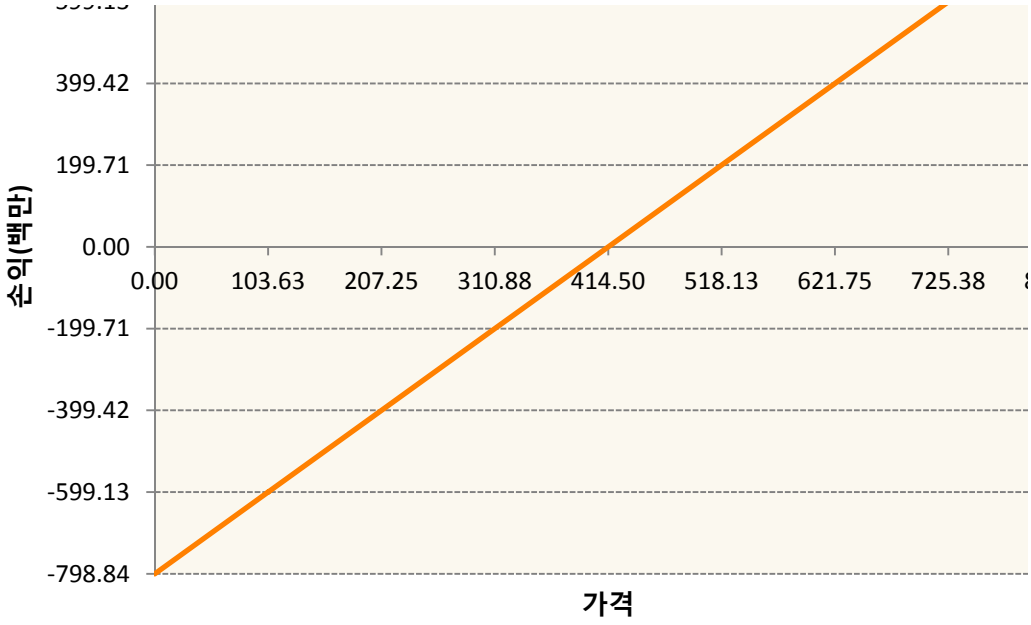

KWZ6-KC HRW WHEAT FUT DES16
275.35
206.51
137.68
68.84
0.00
-68.84
-137.68
-206.51
-275.35
0.00
104.25
208.50
312.75
417.00
521.25
625.50
729.75
손익(백만)
가격


SBH7-Sugar #11 (WORLD) MAR17
1,531.64
1,148.73
765.82
382.91
0.00
-382.91
-765.82
-1,148.73
-1,531.64
0.00
5.65
11.30
16.94
22.59
28.24
33.89
39.53
손익(백만)
가격


SF7-SOYBEAN FUTURE JAN17
1,911.69
1,433.77
955.84
477.92
0.00
-477.92
-955.84
-1,433.77
-1,911.69
0.00
256.25
512.50
768.75
1,025.00
1,281.25
1,537.50
1,793.75
손익(백만)
가격


SMF7-SOYBEAN MEAL FUTR JAN17
965.99
724.49
483.00
241.50
0.00
-241.50
-483.00
-724.49
-965.99
0.00
82.15
164.30
246.45
328.60
410.75
492.90
575.05
손익(백만)
가격


WZ6-WHEAT FUTURE(CBT) DEC16
599.13



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

BOF7	SOYBEAN OIL FUTR JAN17	73
CTZ6	COTTON NO.2 FUTR DEC16	38
CZ6	CORN FUTURE DEC16	160
KCZ6	COFFEE 'C' FUTURE DES16	71
KWZ6	KC HRW WHEAT FUT DES16	22
SBH7	Sugar #11 (WORLD) MAR17	123
SF7	SOYBEAN FUTURE JAN17	153
SMF7	SOYBEAN MEAL FUTR JAN17	77
WZ6	WHEAT FUTURE(CBT) DEC16	64

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

977