공시일	2016-11-01
기준일	2016-10-31

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	2016-11-01
기준일	2016-10-31

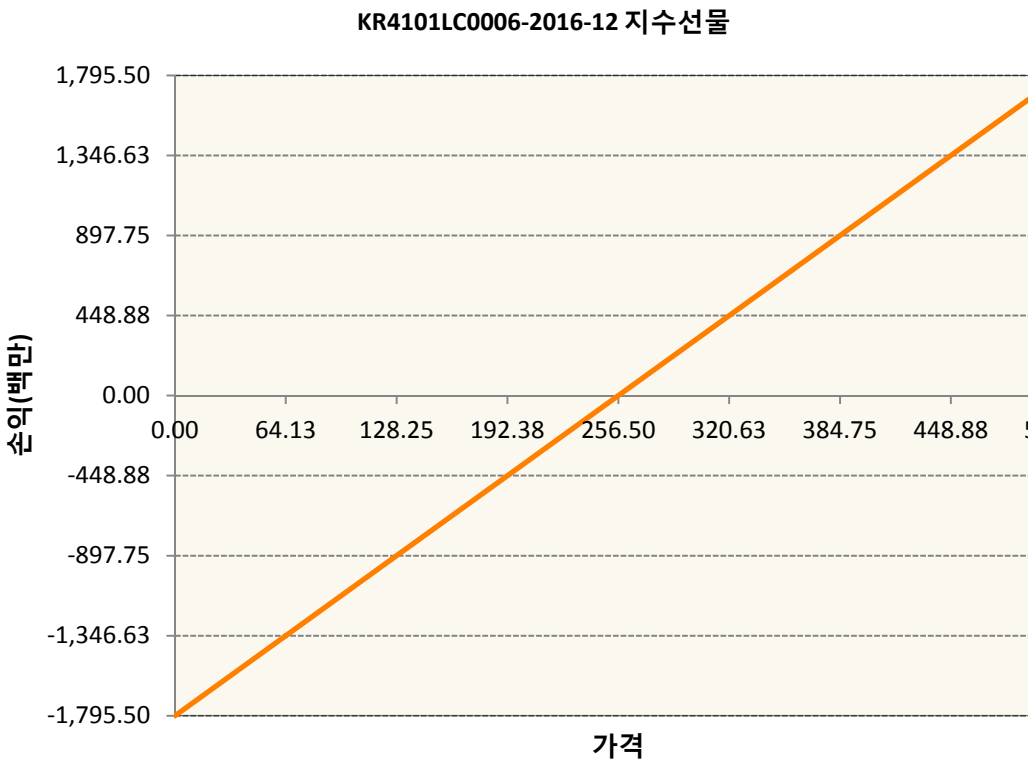
스마트인덱스모

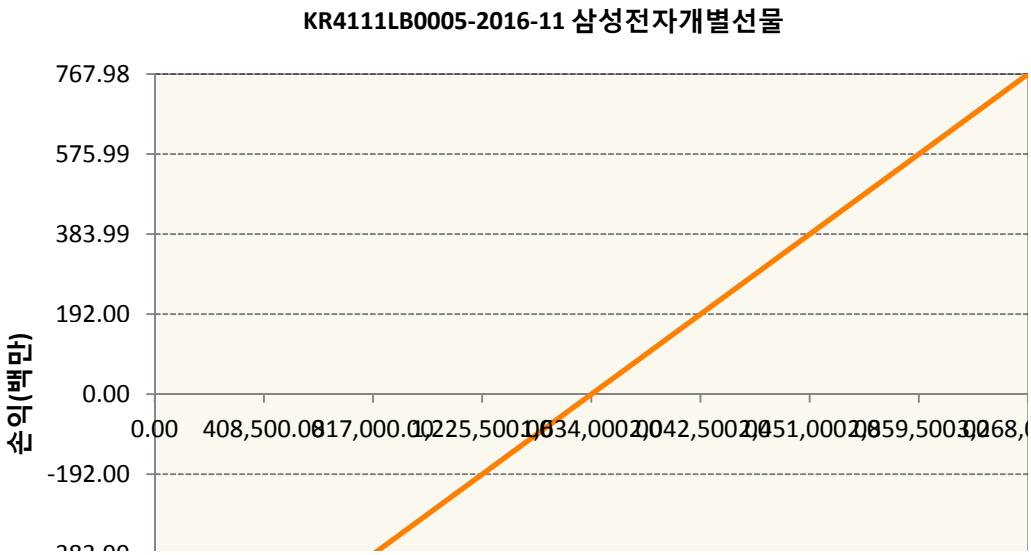
1. 계약금액

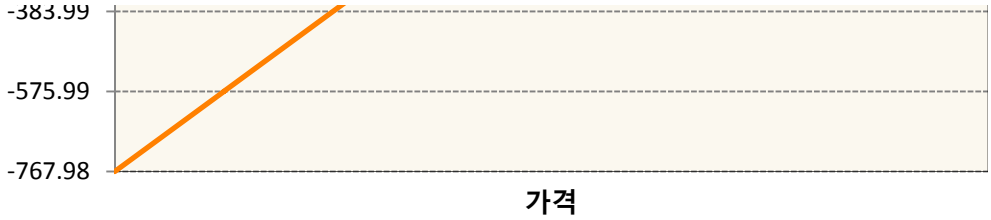
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,563	0	2,563	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101LC00 2016-12 지수선물							143
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-143	-143	-143	-143	-143	-143	-143
-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%	143	143	143	143	143	143	143

KR4111LB00 2016-11 삼성전자개별선물							62
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-62	-62	-62	-62	-62	-62	-62
-5.33%	-41	-41	-41	-41	-41	-41	-41
-2.67%	-21	-21	-21	-21	-21	-21	-21
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	21	21	21	21	21	21	21
5.33%	41	41	41	41	41	41	41
8.00%	62	62	62	62	62	62	62

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

178

공시일	2016-11-01
기준일	2016-10-31

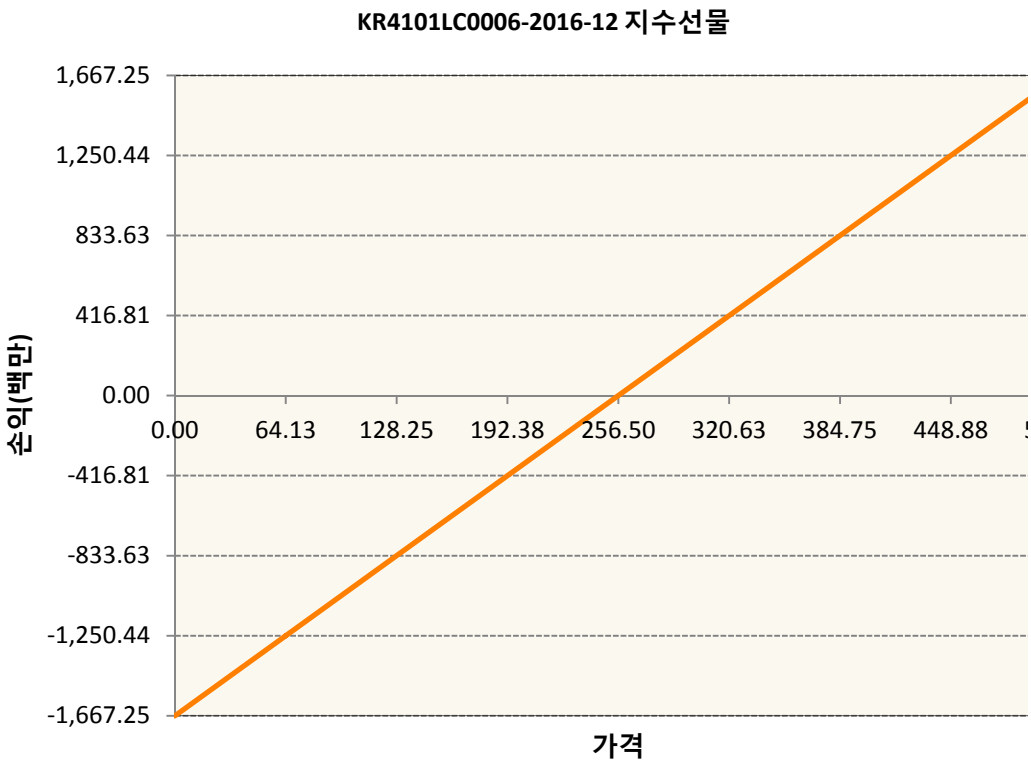
스마트레버리지목표전환형1호

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	1,667	0	1,667	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)

100

공시일	2016-11-01
기준일	2016-10-31

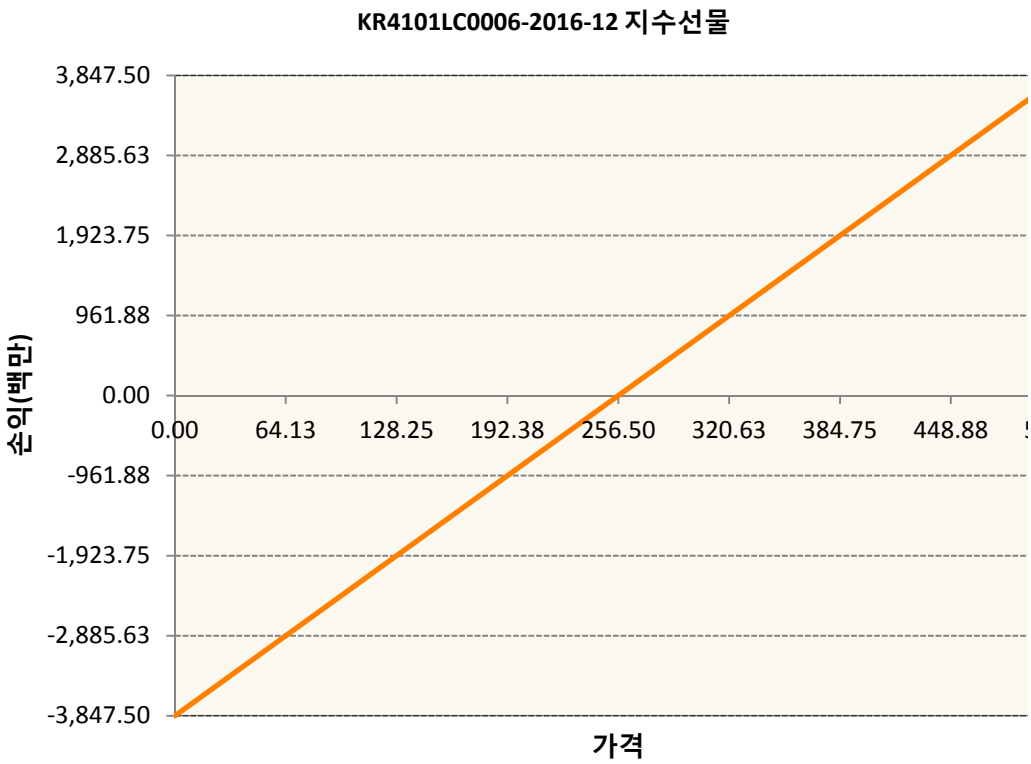
1.3배 레버리지 인덱스(주식-파생형)

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	3,848	0	3,848	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%	-205	-205	-205	-205	-205	-205	-205
-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%	205	205	205	205	205	205	205
8.00%	307	307	307	307	307	307	307

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

232

공시일	2016-11-01
기준일	2016-10-31

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	870

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

705

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2016-11-01
기준일	2016-10-31

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	2016-11-01
기준일	2016-10-31

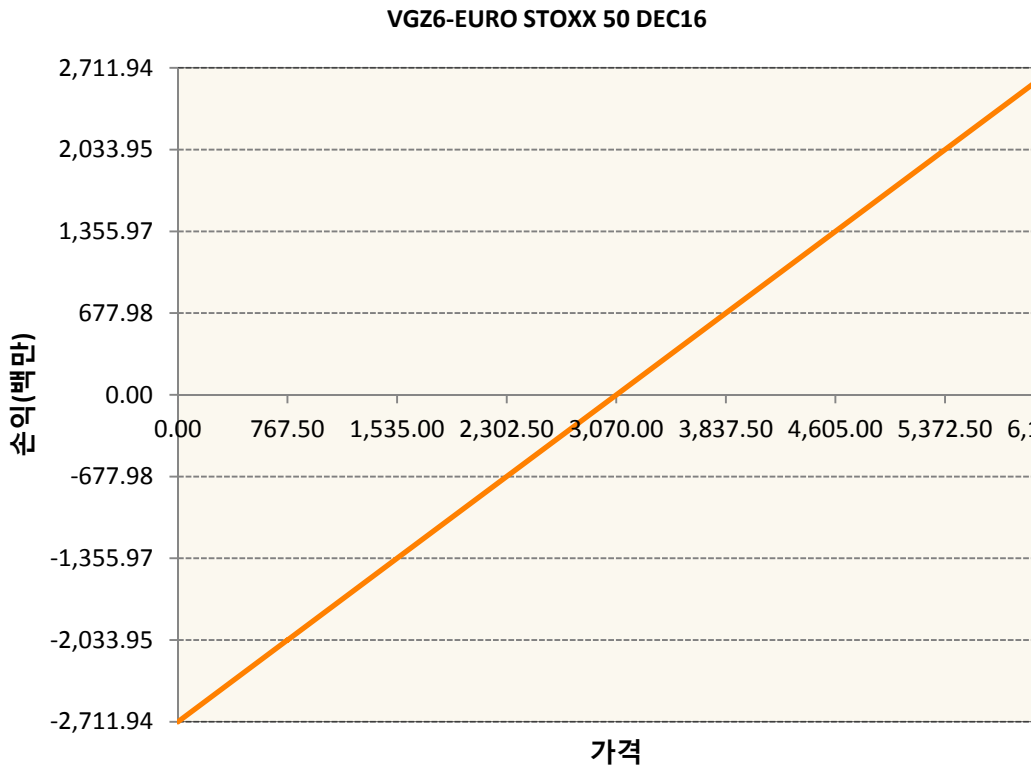
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,712	0	2,712	

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	2016-11-01
기준일	2016-10-31

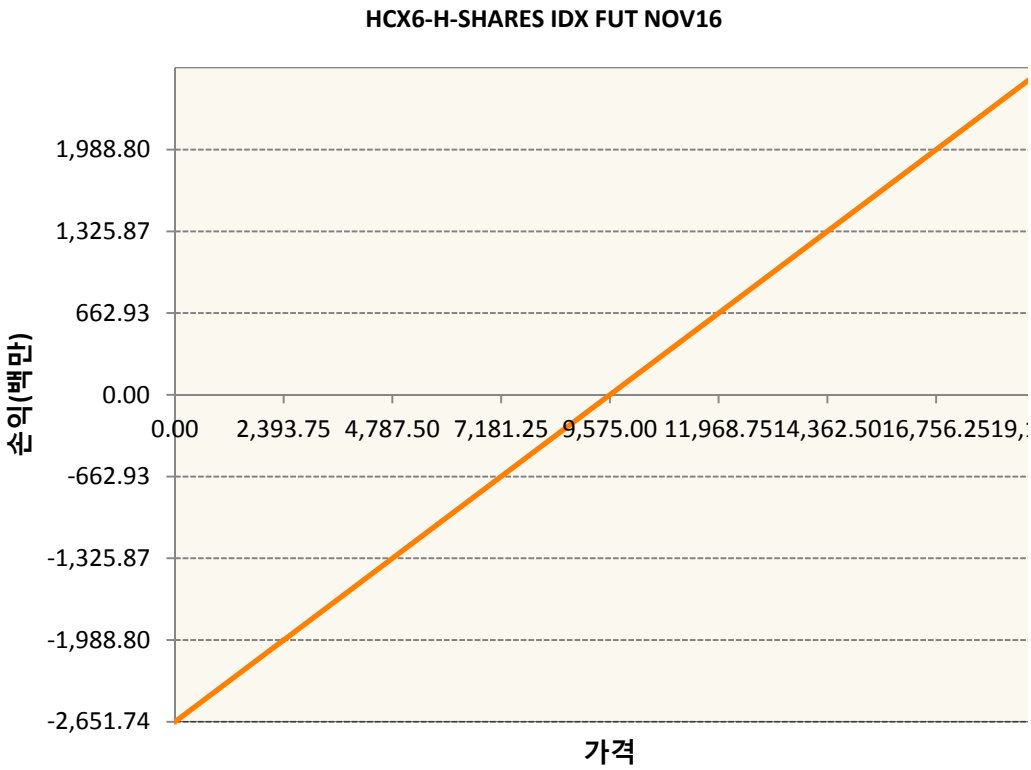
차이나인덱스모(주식-파생형)

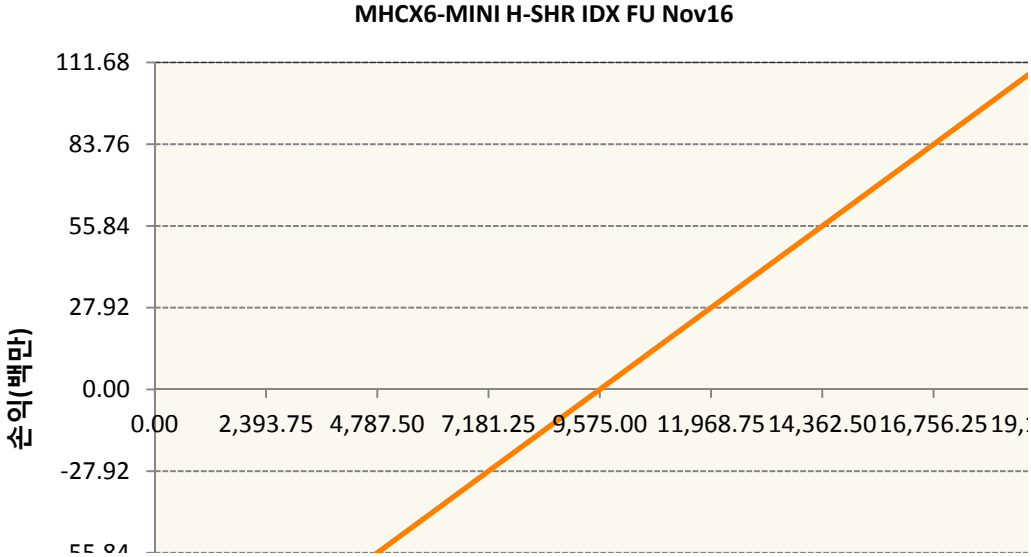
1. 계약금액

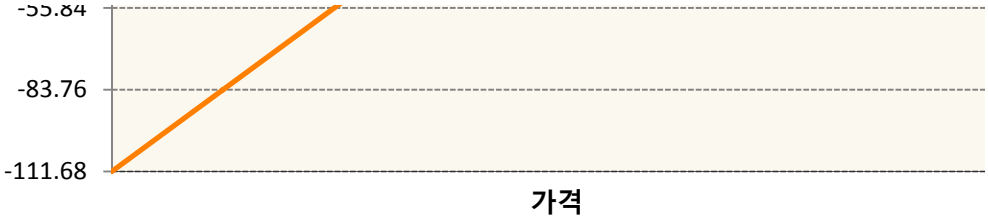
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,763	0	2,763	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

HCX6	H-SHARES IDX FUT NOV16	212
MHCX6	MINI H-SHR IDX FU Nov16	9

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

296

공시일	2016-11-01
기준일	2016-10-31

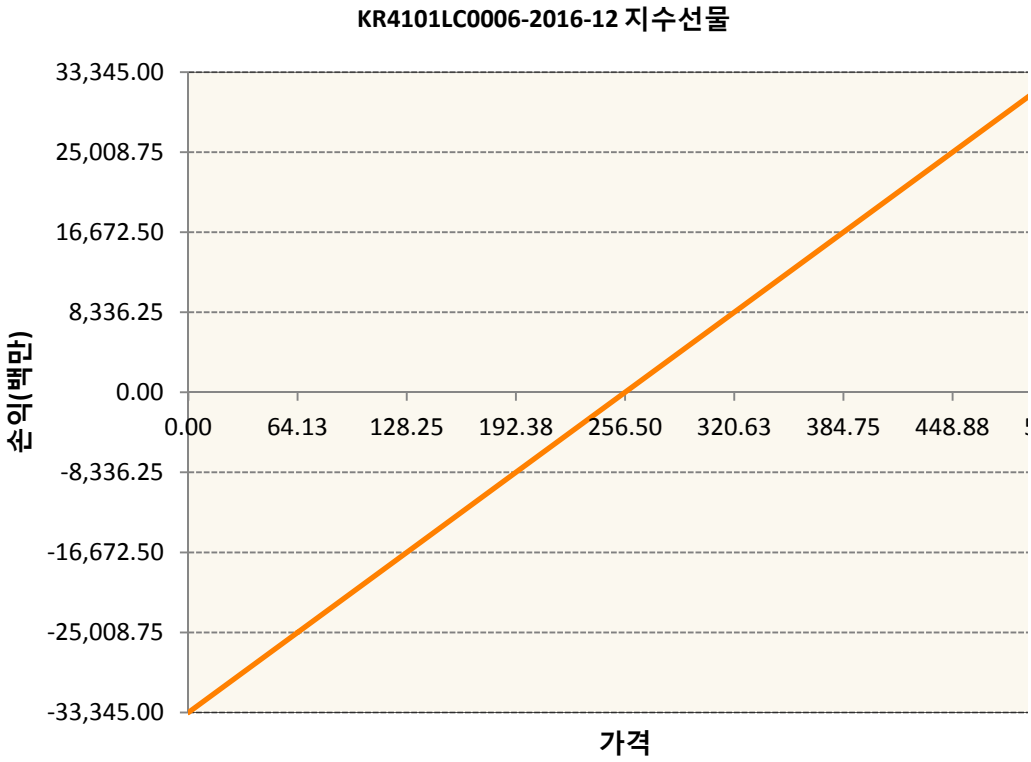
커버드콜(주식혼합-파생형)

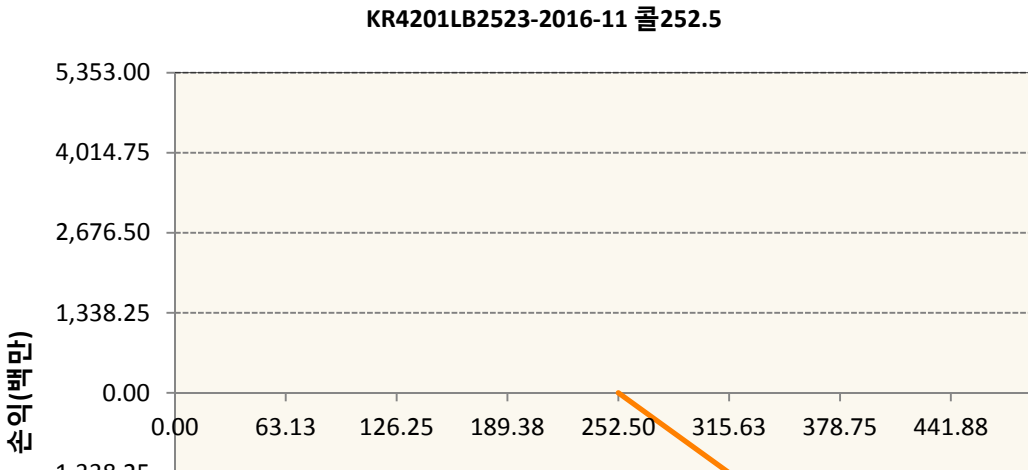
1. 계약금액

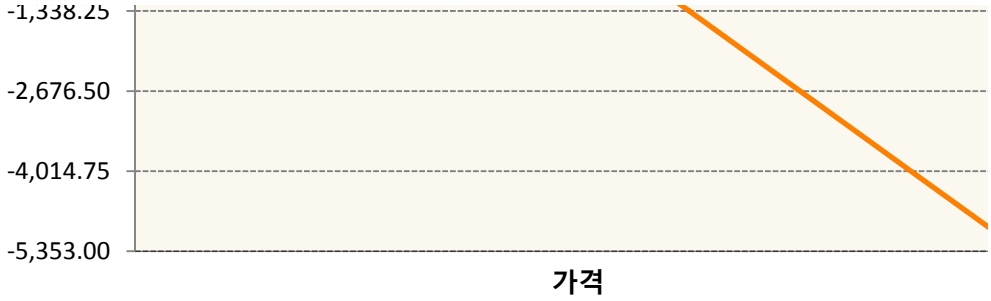
(단위:백만원)

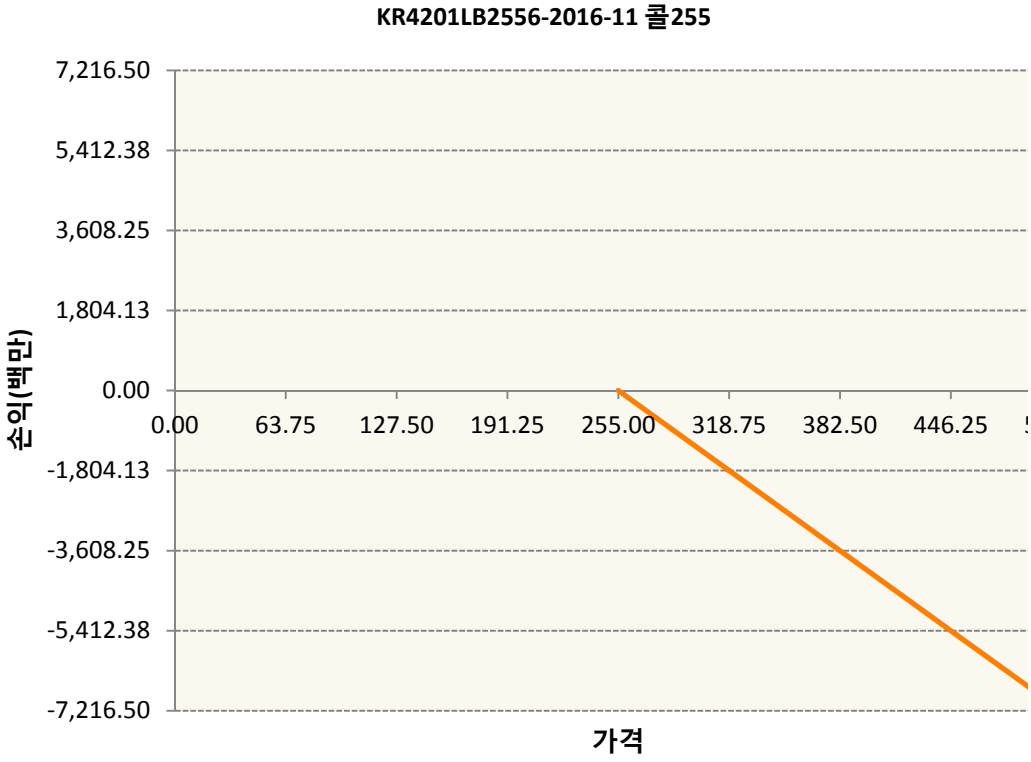
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	644	-644	장내
누계	유가증권	선물	33,345	0	33,345	장내
누계	유가증권	옵션	0	12,570	-12,570	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101LC00 2016-12 지수선물							2,662
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-2,662	-2,662	-2,662	-2,662	-2,662	-2,662	-2,662
-5.33%	-1,774	-1,774	-1,774	-1,774	-1,774	-1,774	-1,774
-2.67%	-887	-887	-887	-887	-887	-887	-887
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	887	887	887	887	887	887	887
5.33%	1,774	1,774	1,774	1,774	1,774	1,774	1,774
8.00%	2,662	2,662	2,662	2,662	2,662	2,662	2,662
KR4201LB25 2016-11 콜252.5							2,065
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	466	466	466	466	466	465	465
-5.33%	465	464	462	458	454	449	442
-2.67%	412	397	381	364	347	330	312
0%	48	33	17	0	-17	-35	-53
2.67%	-620	-622	-624	-628	-633	-640	-647
5.33%	-1,341	-1,341	-1,342	-1,342	-1,342	-1,343	-1,344
8.00%	-2,065	-2,065	-2,065	-2,065	-2,065	-2,065	-2,065
KR4201LB25 2016-11 콜255							2,630
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	396	396	396	396	396	396	395
-5.33%	396	395	394	393	390	387	382
-2.67%	373	361	348	333	316	299	280
0%	81	54	27	0	-27	-54	-81
2.67%	-708	-715	-724	-735	-747	-761	-777
5.33%	-1,664	-1,664	-1,664	-1,666	-1,667	-1,670	-1,674
8.00%	-2,629	-2,629	-2,629	-2,629	-2,629	-2,629	-2,630

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

8,006

공시일	2016-11-01
기준일	2016-10-31

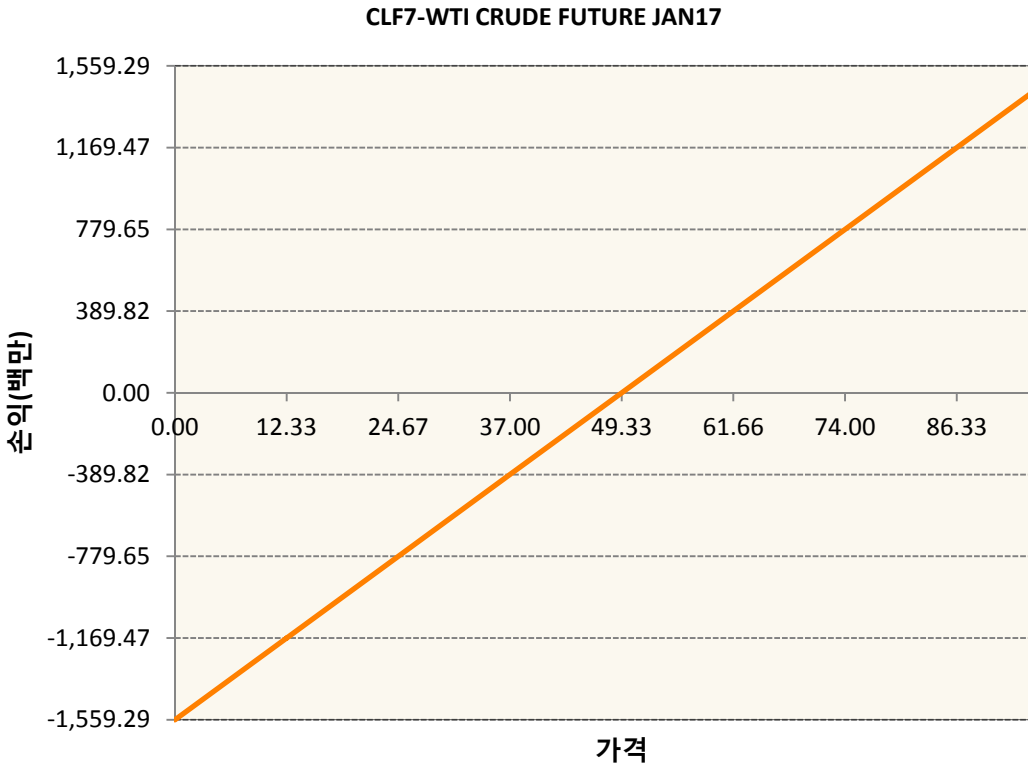
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

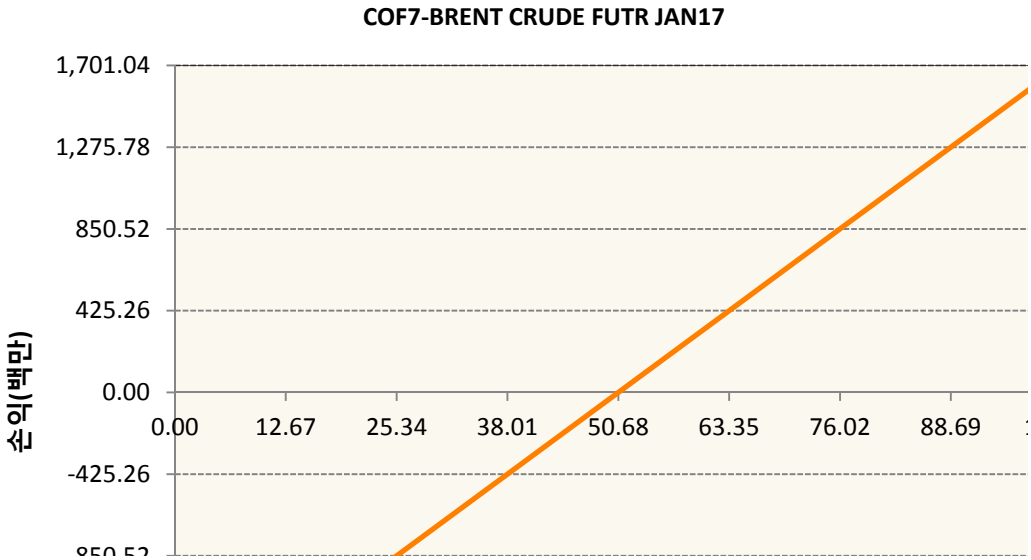
1. 계약금액

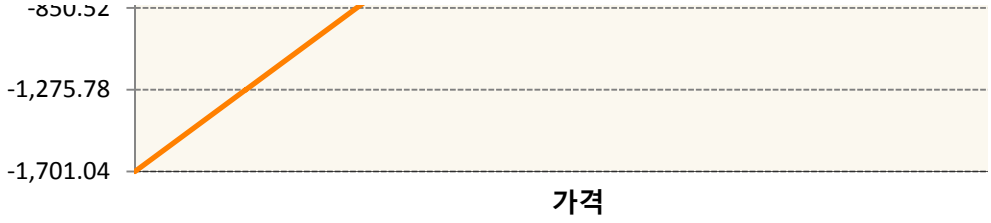
(단위:백만원)

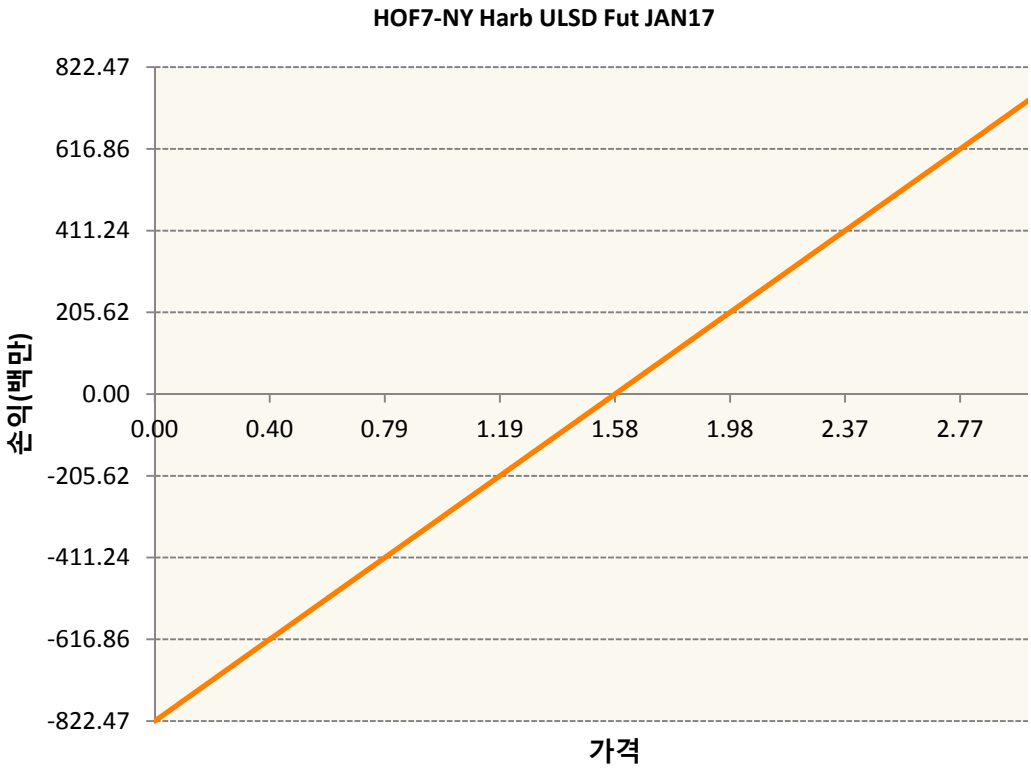
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	6,466	0	6,466	

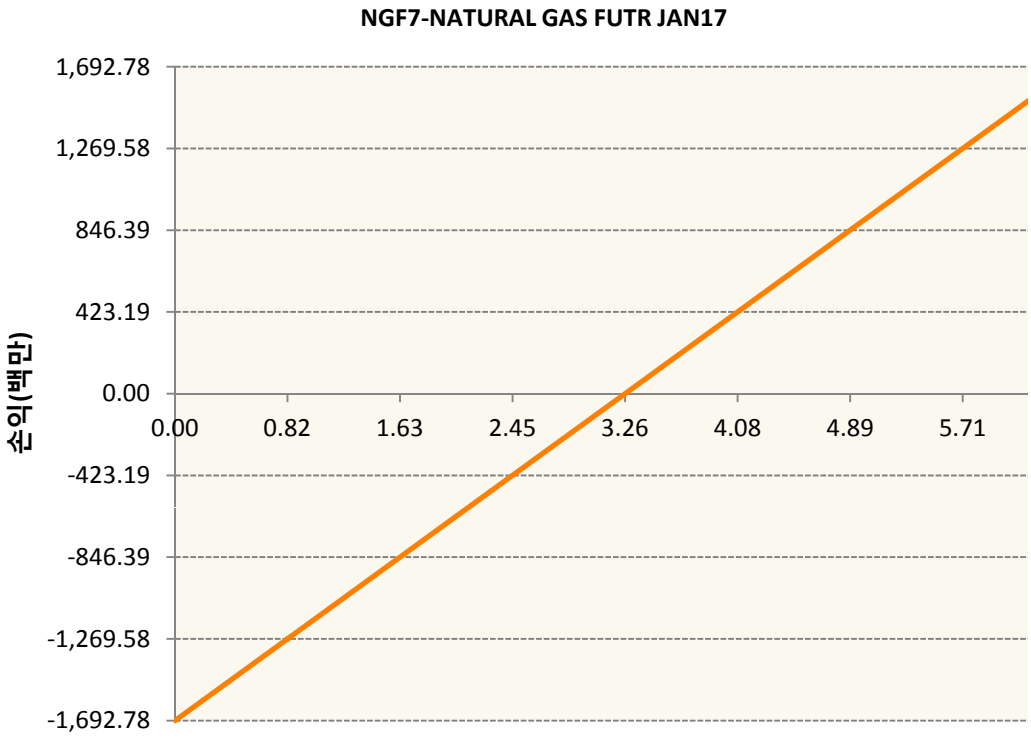
2. 만기시점의 손익구조



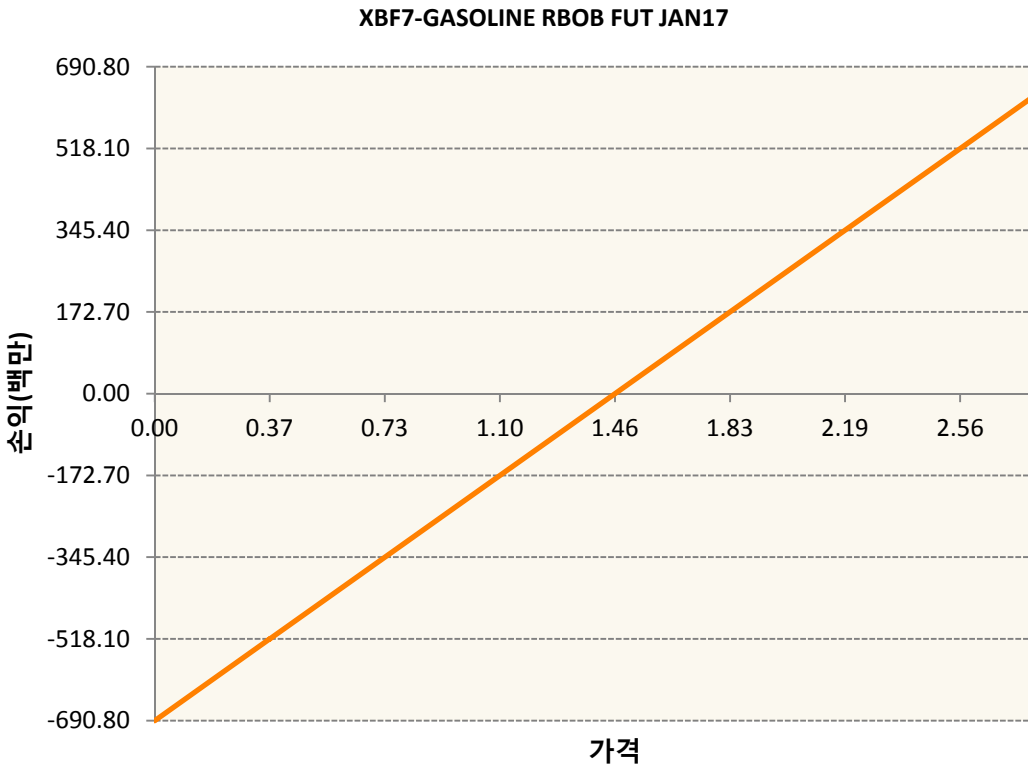



-1,275.78
-1,701.04
가격


HOF7-NY Harb ULSD Fut JAN17
822.47
616.86
411.24
205.62
0.00
-205.62
-411.24
-616.86
-822.47
0.00
0.40
0.79
1.19
1.58
1.98
2.37
2.77
순익(백만)
가격


NGF7-NATURAL GAS FUTR JAN17
1,692.78
1,269.58
846.39
423.19
0.00
-423.19
-846.39
-1,269.58
-1,692.78
0.00
0.82
1.63
2.45
3.26
4.08
4.89
5.71
순익(백만)

가격



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
CLF7	WTI CRUDE FUTURE JAN17	125
COF7	BRENT CRUDE FUTR JAN17	136
HOF7	NY Harb ULSD Fut JAN17	66
NGF7	NATURAL GAS FUTR JAN17	135
XBF7	GASOLINE RBOB FUT JAN17	55

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,155

공시일	2016-11-01
기준일	2016-10-31

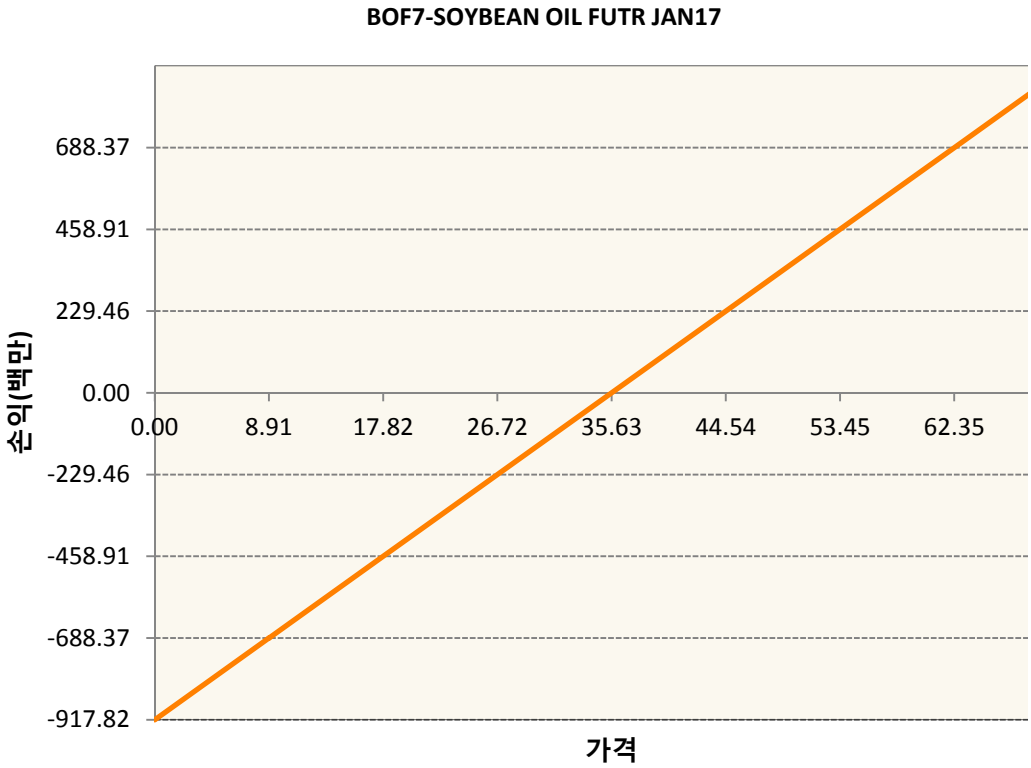
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

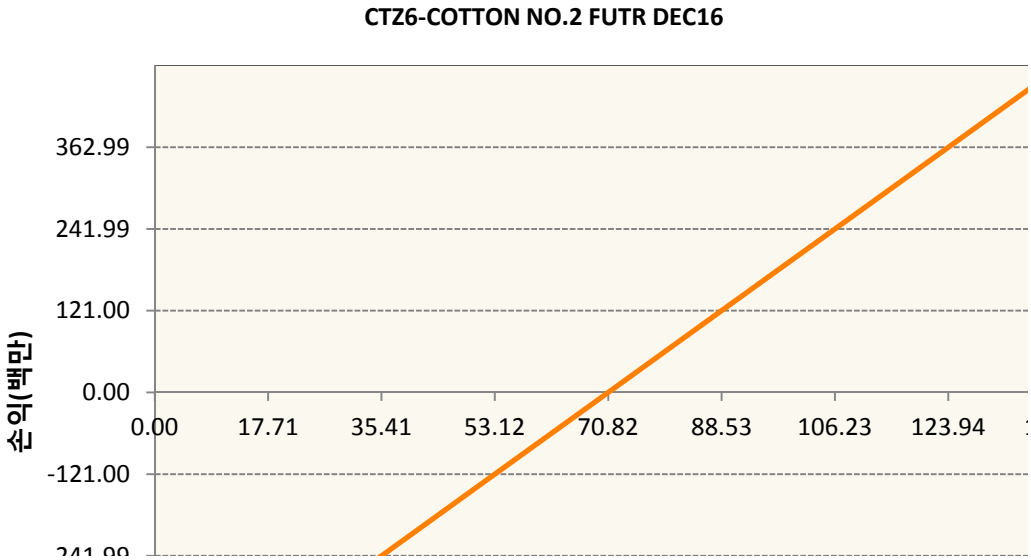
1. 계약금액

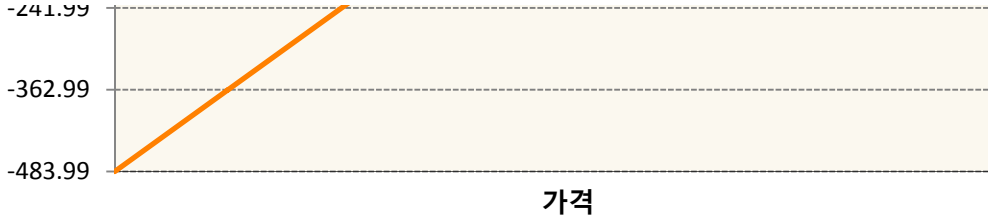
(단위:백만원)

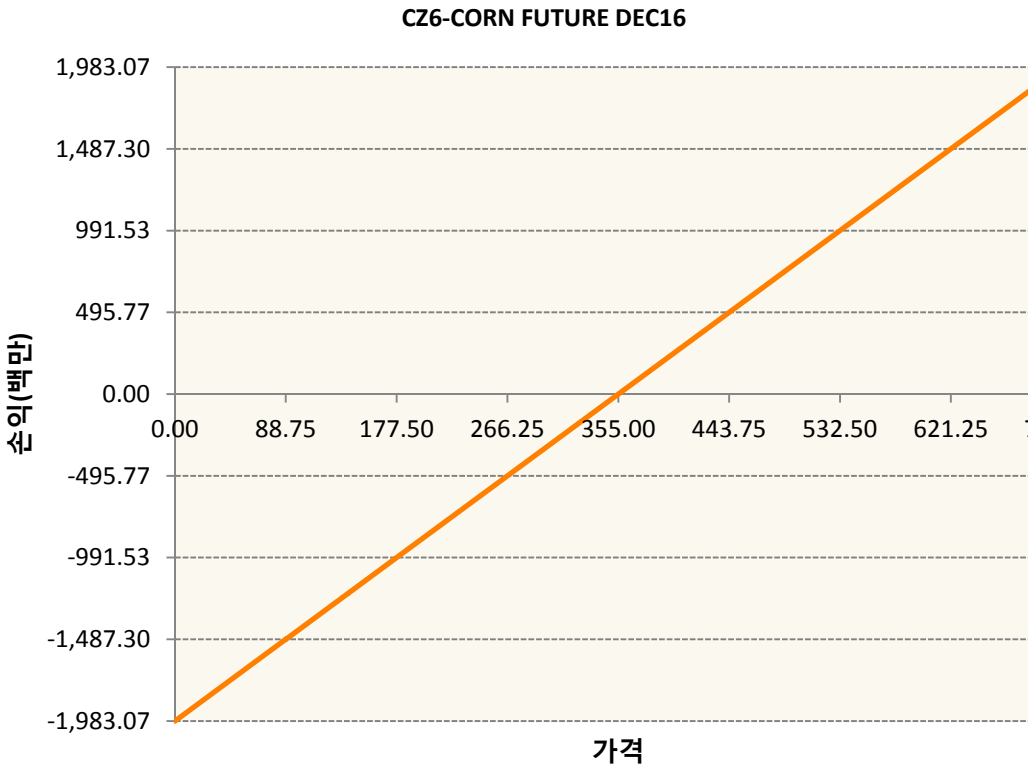
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	9,666	0	9,666	

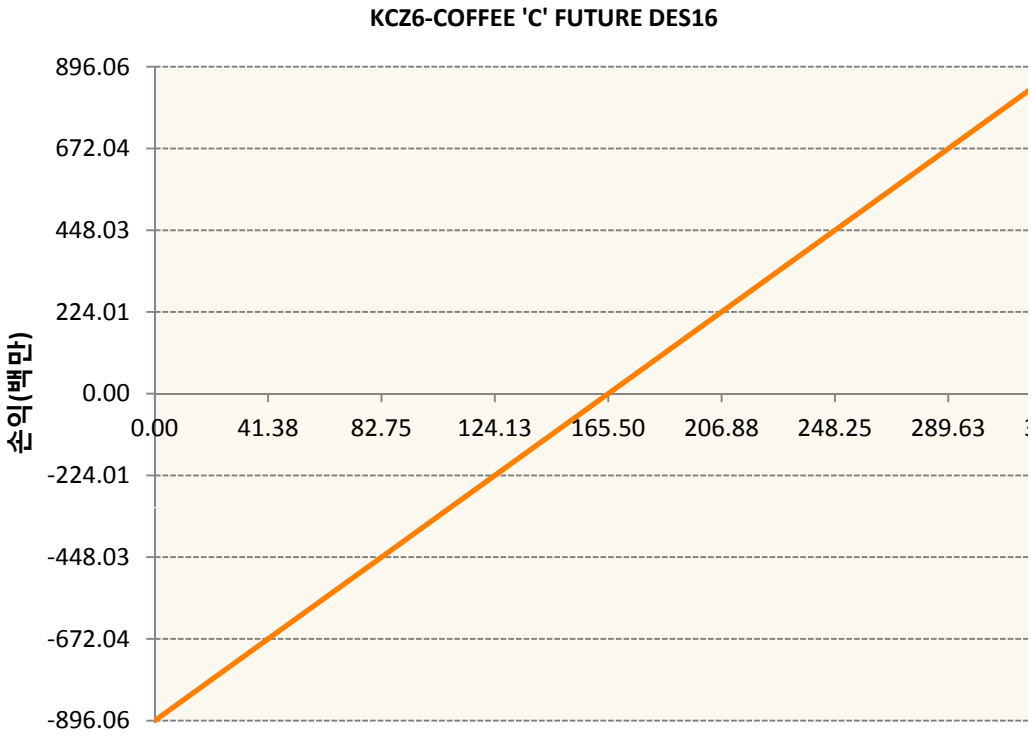
2. 만기시점의 손익구조



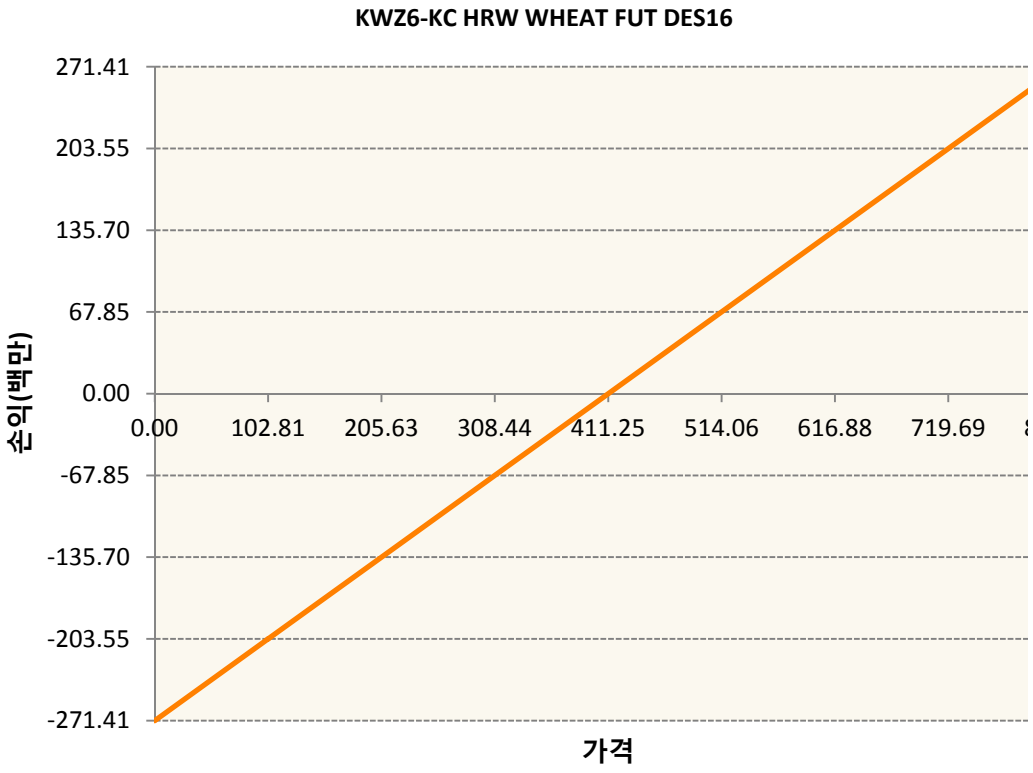


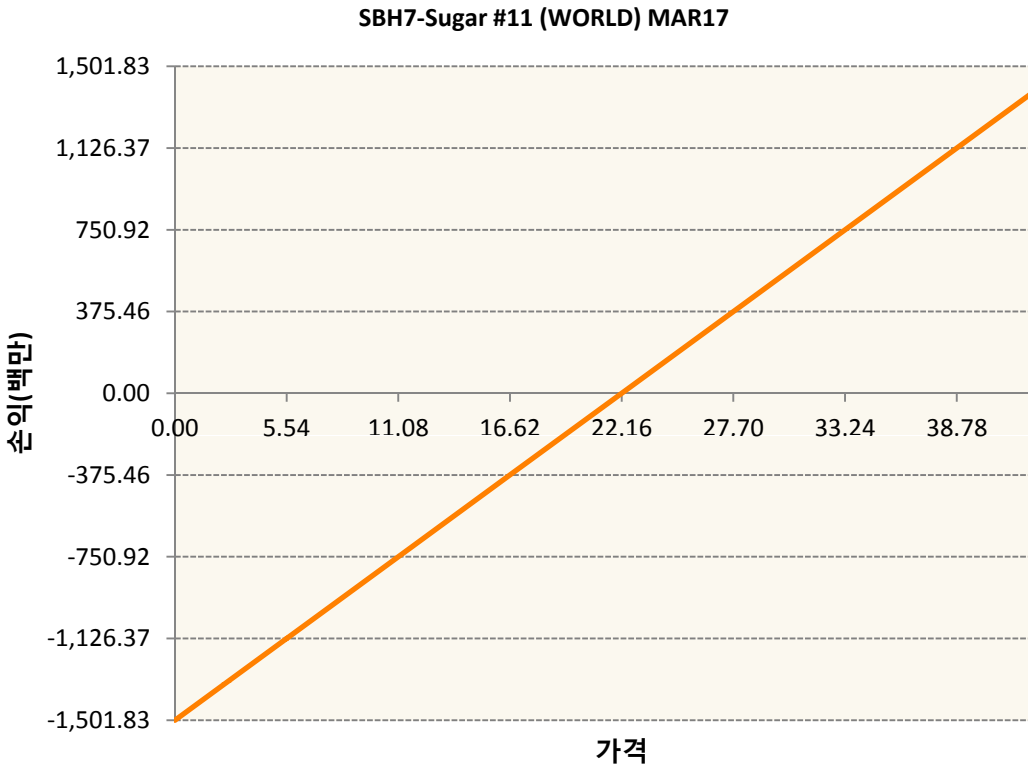

-241.99
-362.99
-483.99
가격

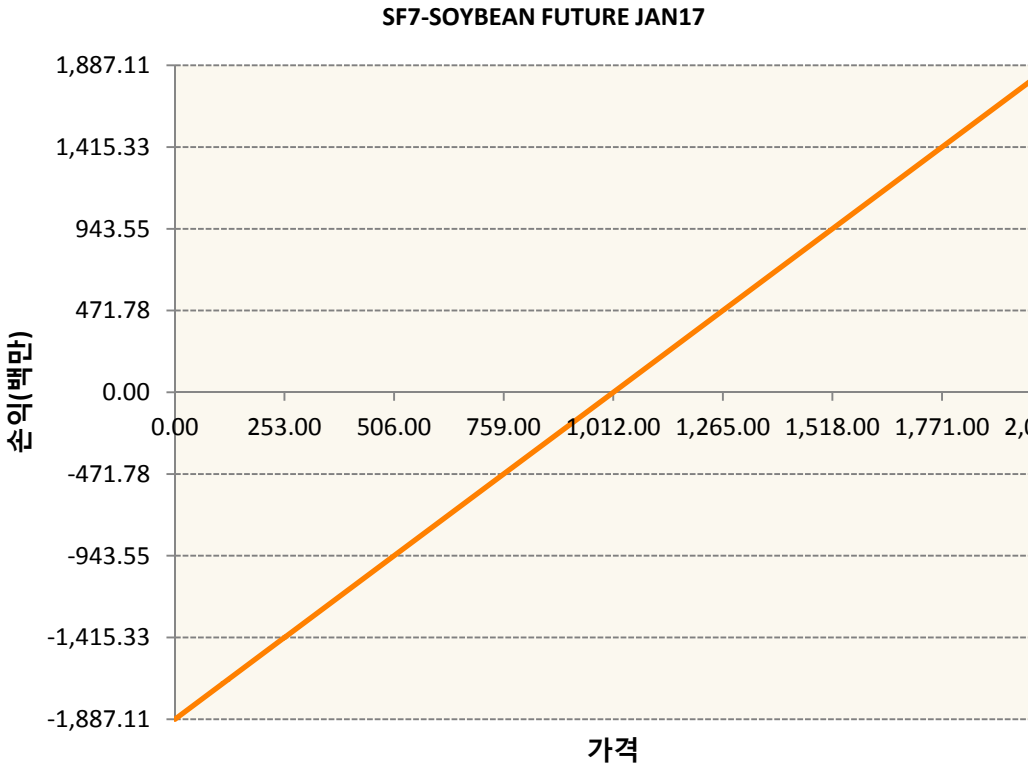

CZ6-CORN FUTURE DEC16
1,983.07
1,487.30
991.53
495.77
0.00
-495.77
-991.53
-1,487.30
-1,983.07
0.00
88.75
177.50
266.25
355.00
443.75
532.50
621.25
순익(백만)
가격

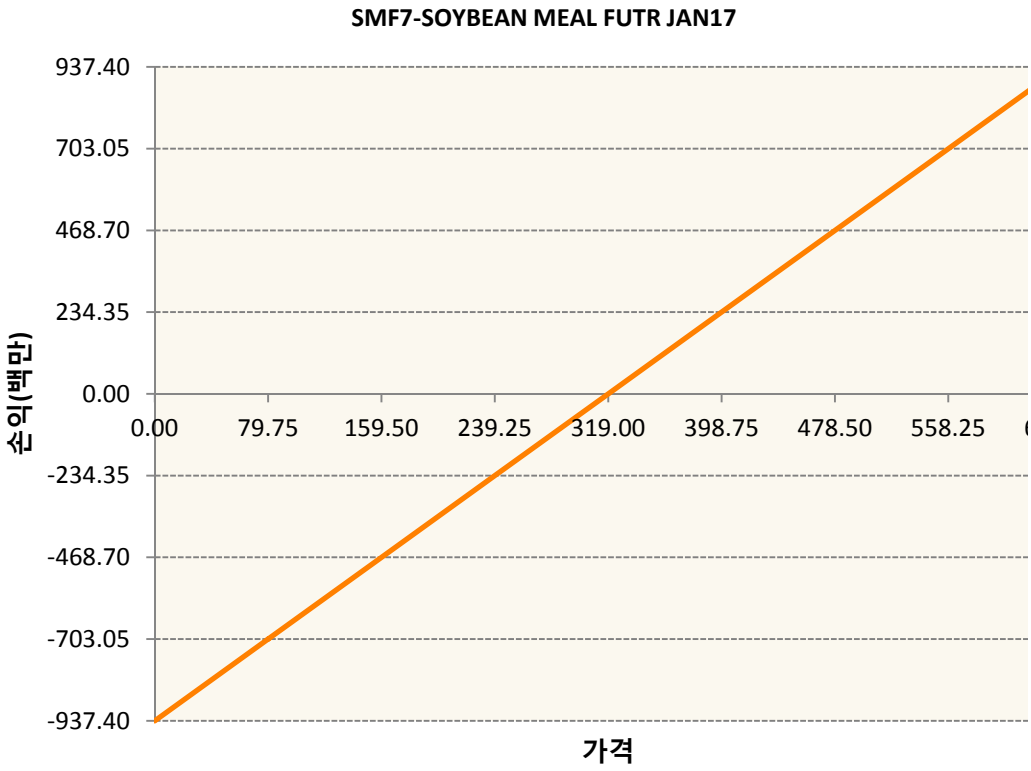

KCZ6-COFFEE 'C' FUTURE DES16
896.06
672.04
448.03
224.01
0.00
-224.01
-448.03
-672.04
-896.06
0.00
41.38
82.75
124.13
165.50
206.88
248.25
289.63
순익(백만)

가격

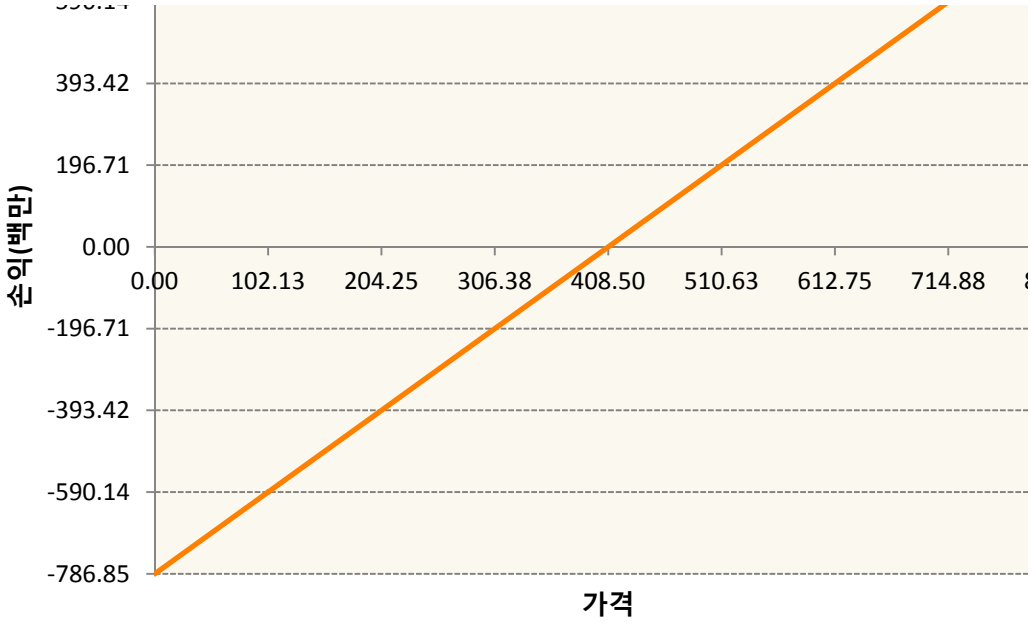

KWZ6-KC HRW WHEAT FUT DES16
271.41
203.55
135.70
67.85
0.00
-67.85
-135.70
-203.55
-271.41
0.00
102.81
205.63
308.44
411.25
514.06
616.88
719.69
손익(백만)
가격


SBH7-Sugar #11 (WORLD) MAR17
1,501.83
1,126.37
750.92
375.46
0.00
-375.46
-750.92
-1,126.37
-1,501.83
0.00
5.54
11.08
16.62
22.16
27.70
33.24
38.78
손익(백만)
가격


SF7-SOYBEAN FUTURE JAN17
1,887.11
1,415.33
943.55
471.78
0.00
-471.78
-943.55
-1,415.33
-1,887.11
0.00
253.00
506.00
759.00
1,012.00
1,265.00
1,518.00
1,771.00
손익(백만)
가격


SMF7-SOYBEAN MEAL FUTR JAN17
937.40
703.05
468.70
234.35
0.00
-234.35
-468.70
-703.05
-937.40
0.00
79.75
159.50
239.25
319.00
398.75
478.50
558.25
손익(백만)
가격


WZ6-WHEAT FUTURE(CBT) DEC16
786.85
590.14



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

BOF7	SOYBEAN OIL FUTR JAN17	73
CTZ6	COTTON NO.2 FUTR DEC16	39
CZ6	CORN FUTURE DEC16	159
KCZ6	COFFEE 'C' FUTURE DES16	72
KWZ6	KC HRW WHEAT FUT DES16	22
SBH7	Sugar #11 (WORLD) MAR17	120
SF7	SOYBEAN FUTURE JAN17	151
SMF7	SOYBEAN MEAL FUTR JAN17	75
WZ6	WHEAT FUTURE(CBT) DEC16	63

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

967