공시일	2016-11-03
기준일	2016-11-02

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	2016-11-03
기준일	2016-11-02

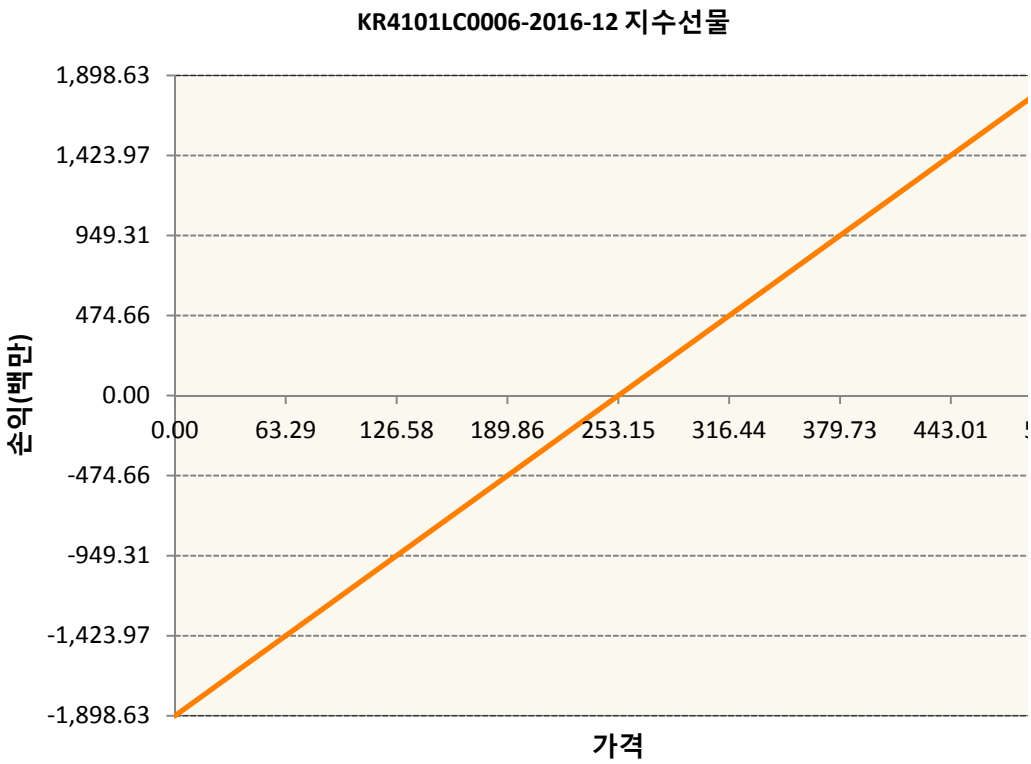
스마트인덱스모

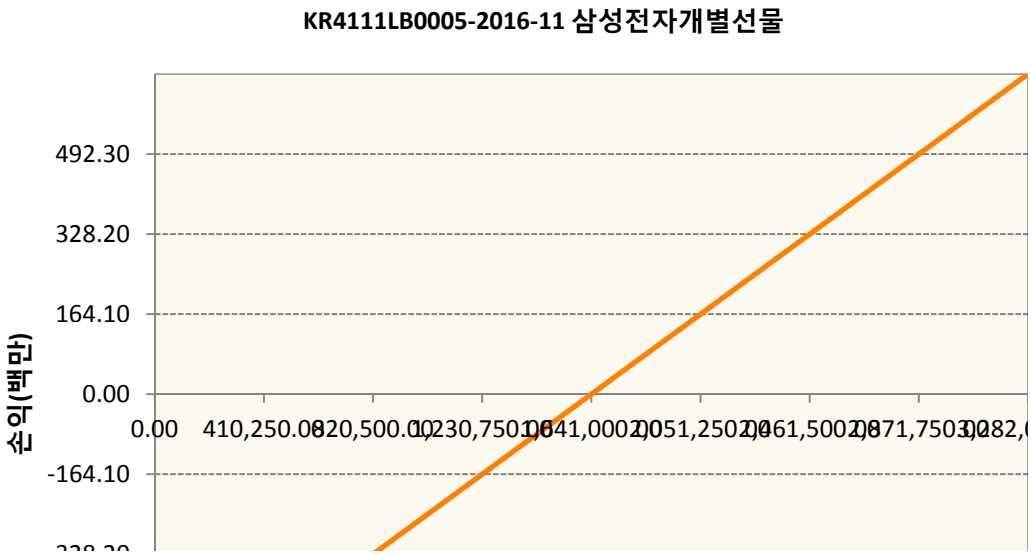
1. 계약금액

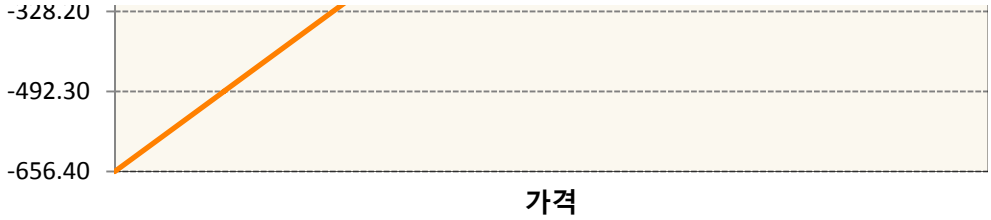
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	127	115	11	장내
누계	유가증권	선물	2,555	0	2,555	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101LC00 2016-12 지수선물							152
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-152	-152	-152	-152	-152	-152	-152
-5.33%	-101	-101	-101	-101	-101	-101	-101
-2.67%	-51	-51	-51	-51	-51	-51	-51
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	51	51	51	51	51	51	51
5.33%	101	101	101	101	101	101	101
8.00%	152	152	152	152	152	152	152
KR4111LB00 2016-11 삼성전자개별선물							53
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-53	-53	-53	-53	-53	-53	-53
-5.33%	-35	-35	-35	-35	-35	-35	-35
-2.67%	-18	-18	-18	-18	-18	-18	-18
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	18	18	18	18	18	18	18
5.33%	35	35	35	35	35	35	35
8.00%	53	53	53	53	53	53	53

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

175

공시일	2016-11-03
기준일	2016-11-02

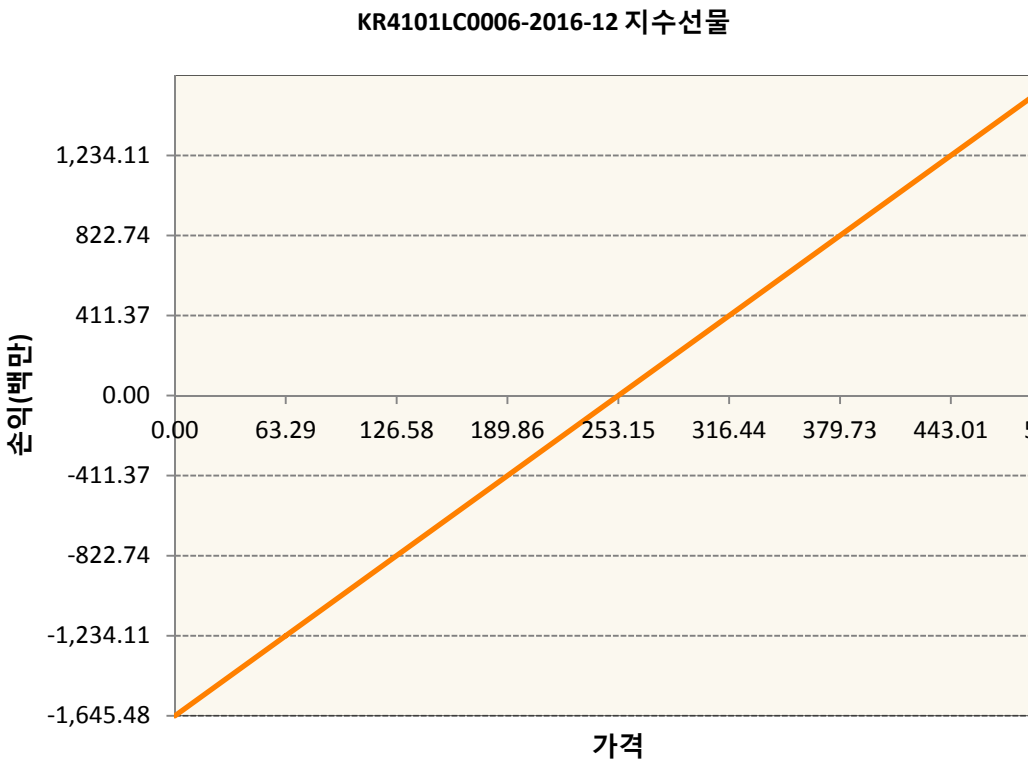
스마트레버리지목표전환형1호

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	1,645	0	1,645	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101LC00 2016-12 지수선물							131
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-131	-131	-131	-131	-131	-131	-131
-5.33%	-88	-88	-88	-88	-88	-88	-88
-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%	88	88	88	88	88	88	88
8.00%	131	131	131	131	131	131	131

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

100

공시일	2016-11-03
기준일	2016-11-02

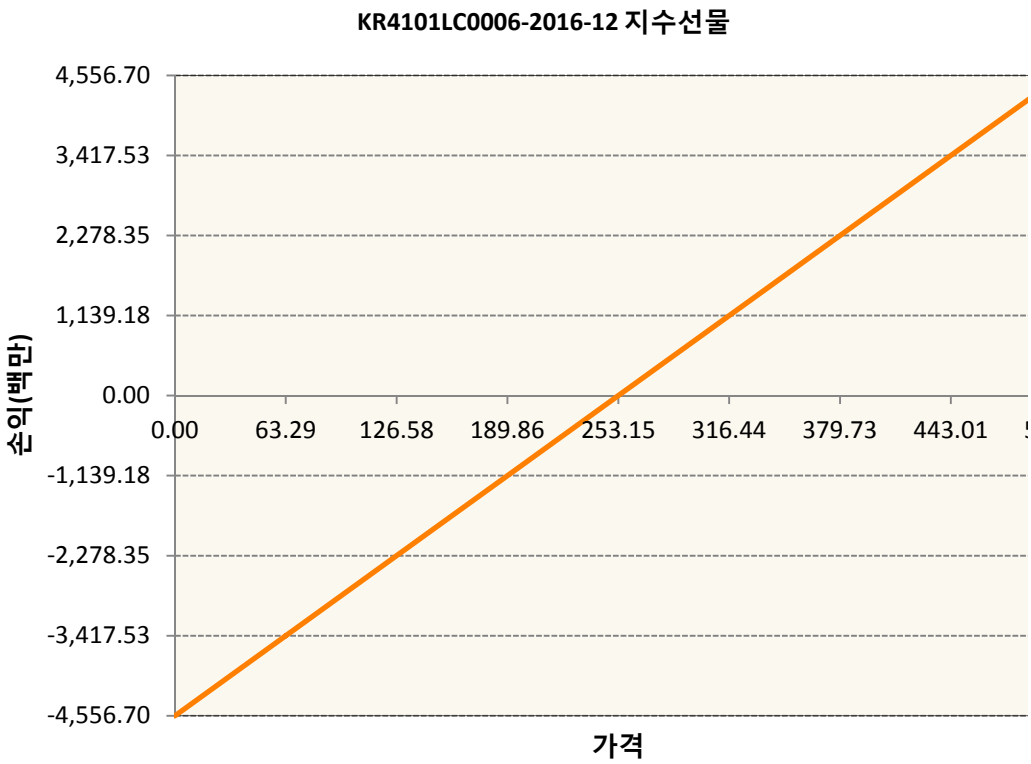
1.3배 레버리지 인덱스(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	759	0	759	장내
누계	유가증권	선물	4,557	0	4,557	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101LC00 2016-12 지수선물							364
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-364	-364	-364	-364	-364	-364	-364
-5.33%	-243	-243	-243	-243	-243	-243	-243
-2.67%	-121	-121	-121	-121	-121	-121	-121
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	121	121	121	121	121	121	121
5.33%	243	243	243	243	243	243	243
8.00%	364	364	364	364	364	364	364

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

276

공시일	2016-11-03
기준일	2016-11-02

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	867

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

700

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2016-11-03
기준일	2016-11-02

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)

767

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2016-11-03
기준일	2016-11-02

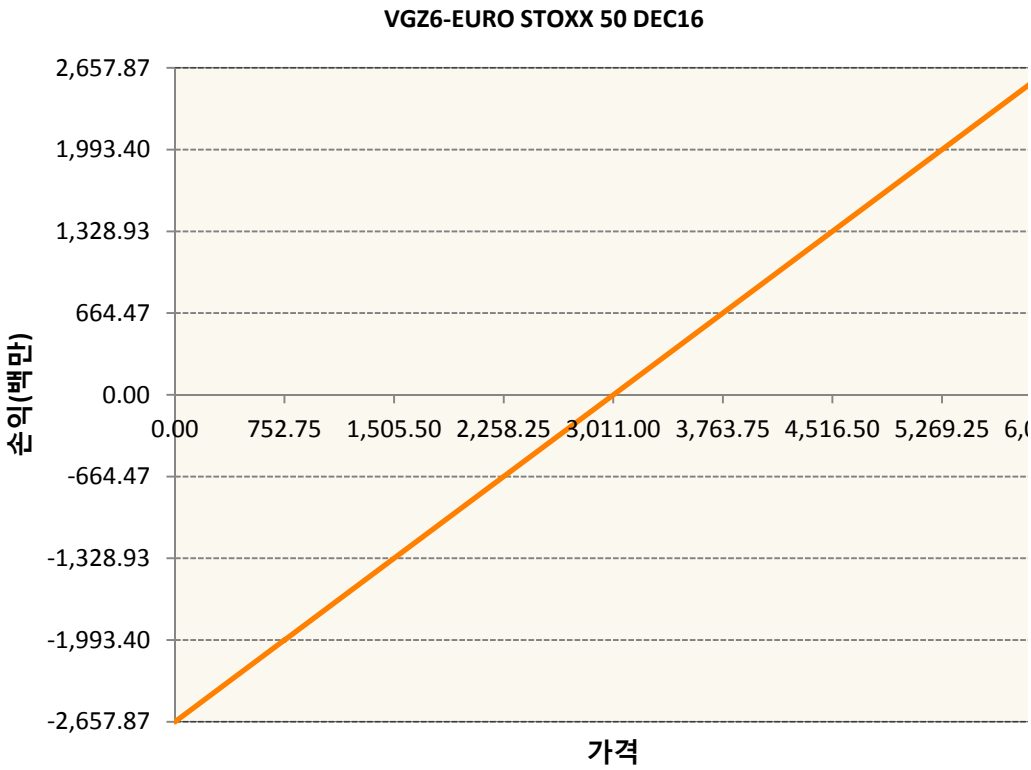
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,658	0	2,658	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGZ6	EURO STOXX 50 DEC16	213

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

(단위:백만원)

257

공시일	2016-11-03
기준일	2016-11-02

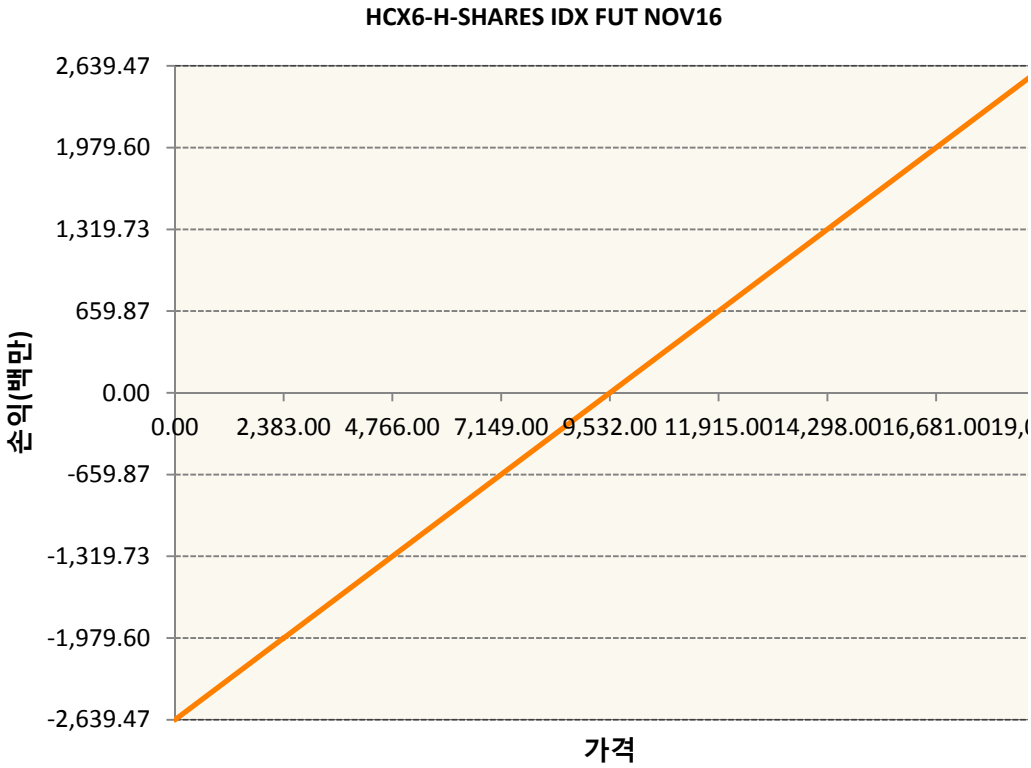
차이나인덱스모(주식-파생형)

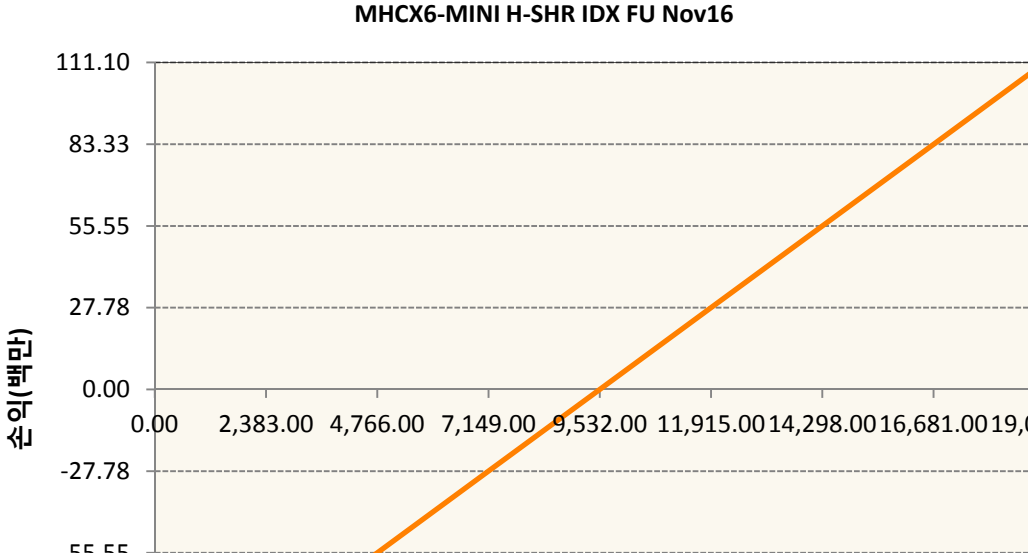
1. 계약금액

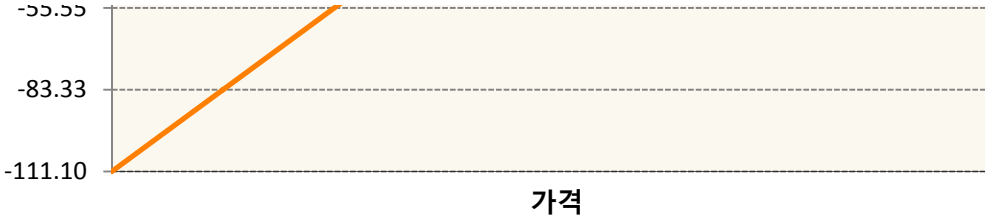
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,751	0	2,751	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	2016-11-03
기준일	2016-11-02

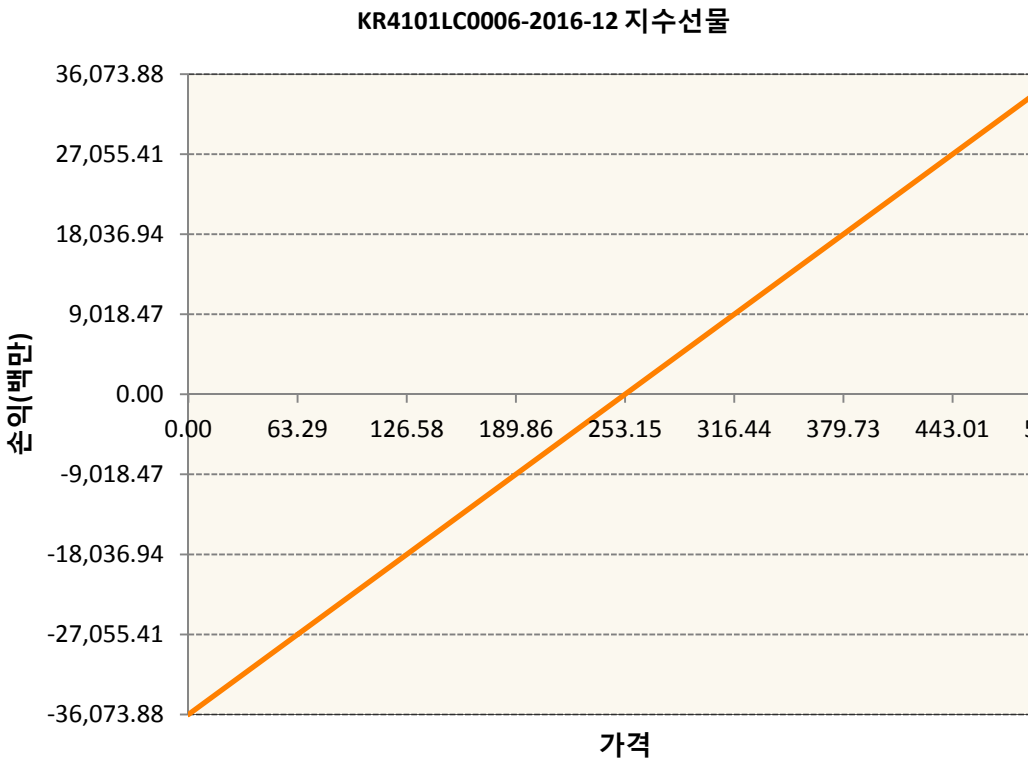
커버드콜(주식혼합-파생형)

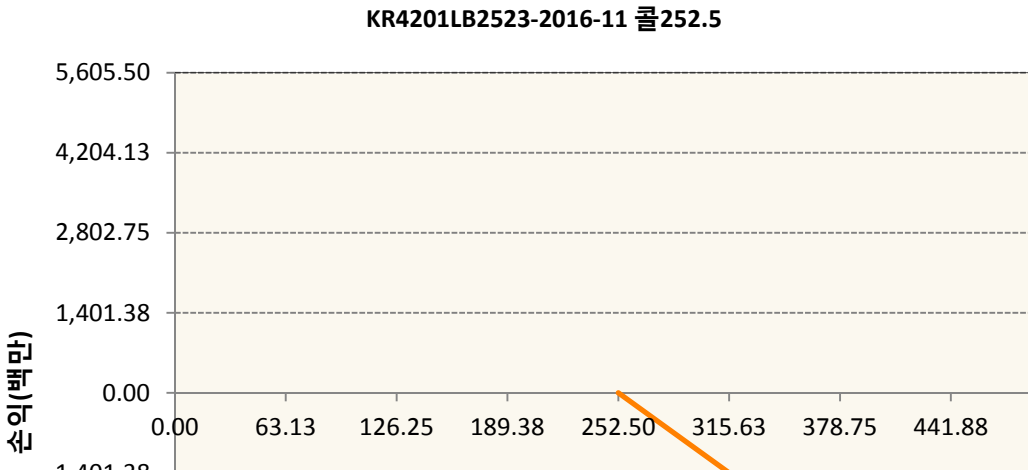
1. 계약금액

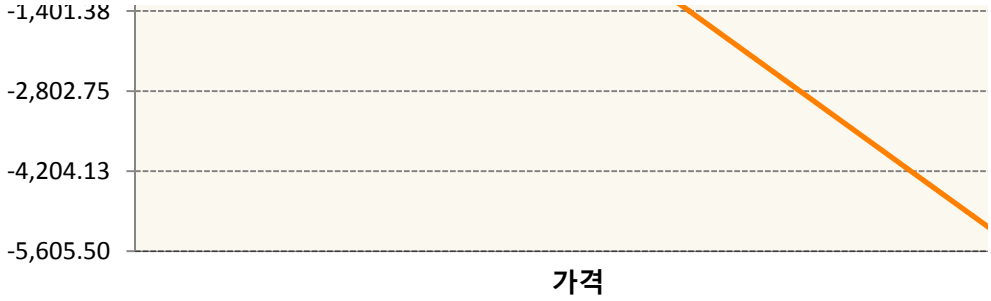
(단위:백만원)

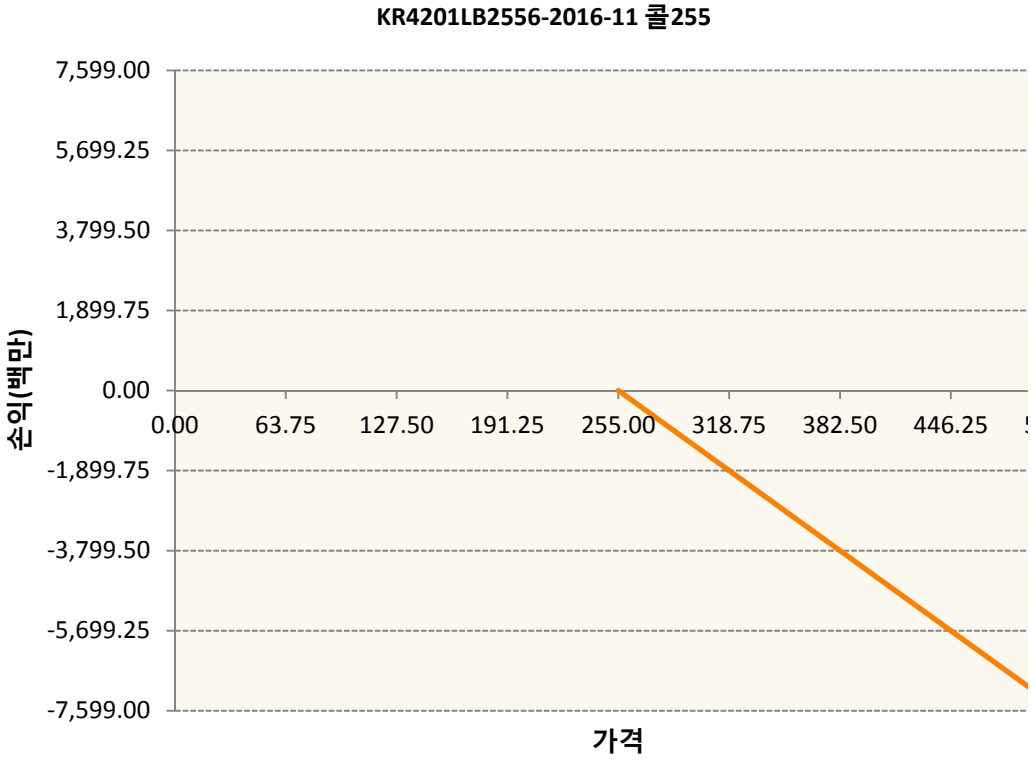
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	1,265	0	1,265	장내
신규	유가증권	옵션	0	256	-256	장내
누계	유가증권	선물	36,074	0	36,074	장내
누계	유가증권	옵션	0	13,205	-13,205	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101LC00 2016-12 지수선물							2,882
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-2,882	-2,882	-2,882	-2,882	-2,882	-2,882	-2,882
-5.33%	-1,922	-1,922	-1,922	-1,922	-1,922	-1,922	-1,922
-2.67%	-961	-961	-961	-961	-961	-961	-961
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	961	961	961	961	961	961	961
5.33%	1,922	1,922	1,922	1,922	1,922	1,922	1,922
8.00%	2,882	2,882	2,882	2,882	2,882	2,882	2,882
KR4201LB25 2016-11 콜252.5							1,978
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	303	303	303	303	303	302	302
-5.33%	303	302	301	298	295	291	286
-2.67%	281	271	259	245	231	215	199
0%	71	47	24	0	-24	-47	-71
2.67%	-498	-508	-519	-532	-546	-561	-577
5.33%	-1,229	-1,229	-1,231	-1,233	-1,236	-1,241	-1,246
8.00%	-1,976	-1,976	-1,976	-1,977	-1,977	-1,977	-1,978
KR4201LB25 2016-11 콜255							2,451

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	244	244	244	244	243	243	243
-5.33%	243	243	243	242	240	237	233
-2.67%	235	228	219	209	196	181	165
0%	89	60	30	0	-30	-61	-92
2.67%	-505	-527	-551	-576	-602	-629	-656
5.33%	-1,442	-1,446	-1,451	-1,457	-1,466	-1,477	-1,489
8.00%	-2,444	-2,444	-2,444	-2,445	-2,446	-2,448	-2,451

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

7,420

공시일	2016-11-03
기준일	2016-11-02

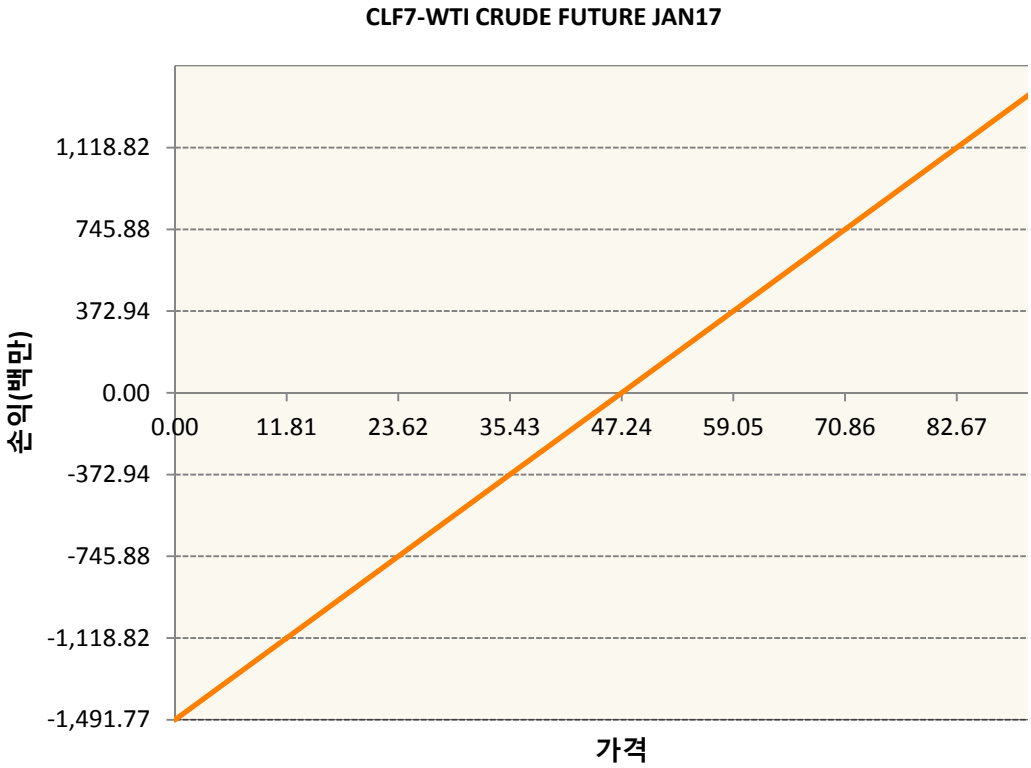
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

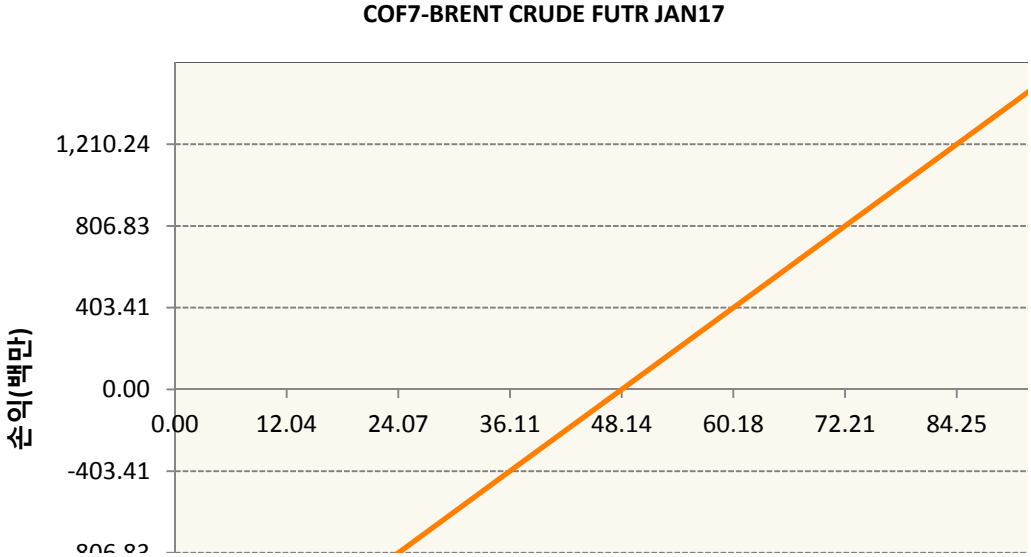
1. 계약금액

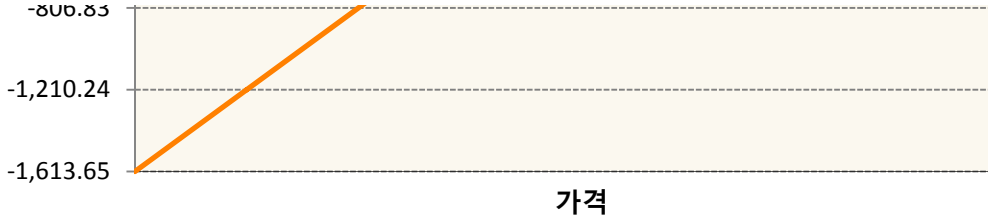
(단위:백만원)

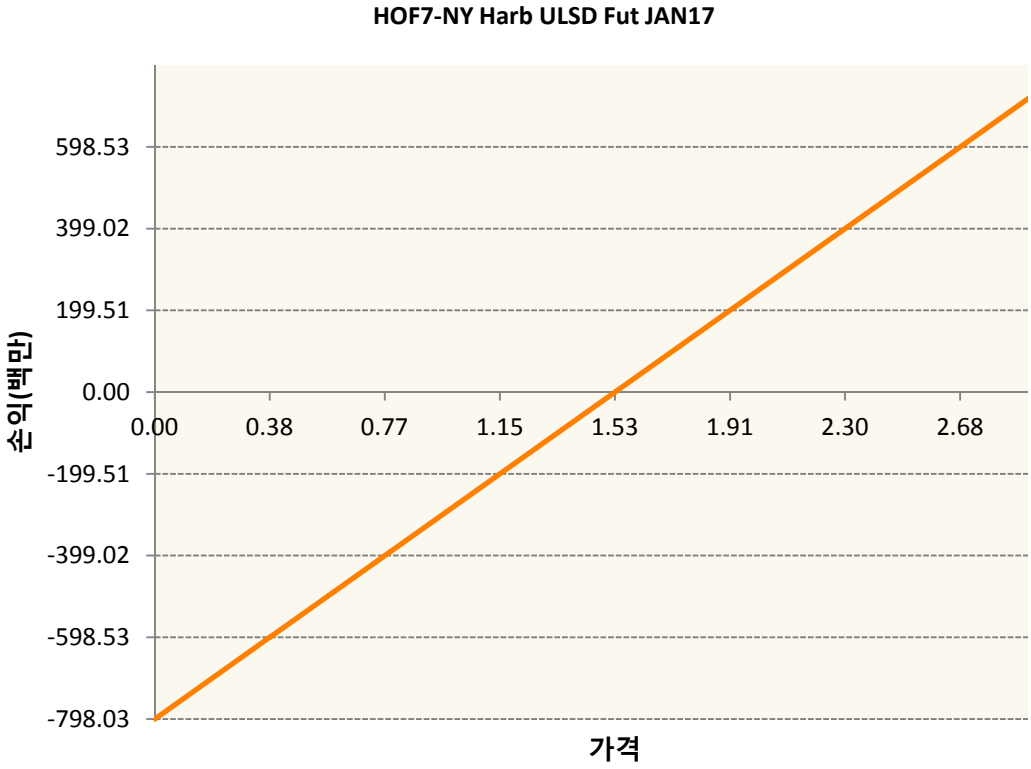
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	6,183	0	6,183	

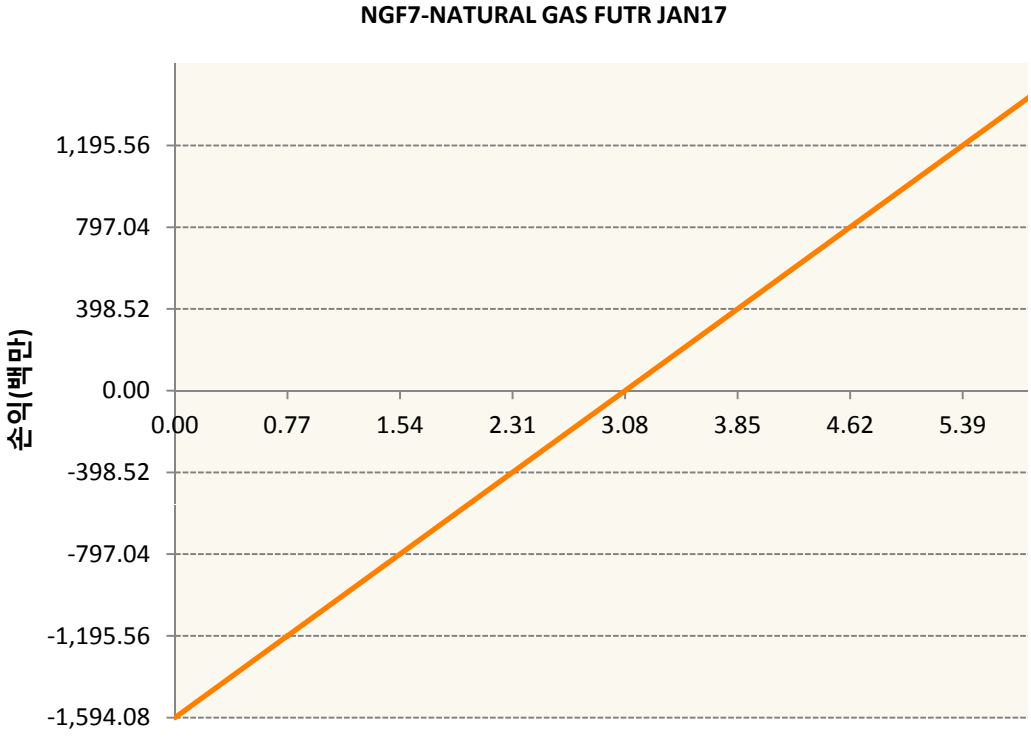
2. 만기시점의 손익구조



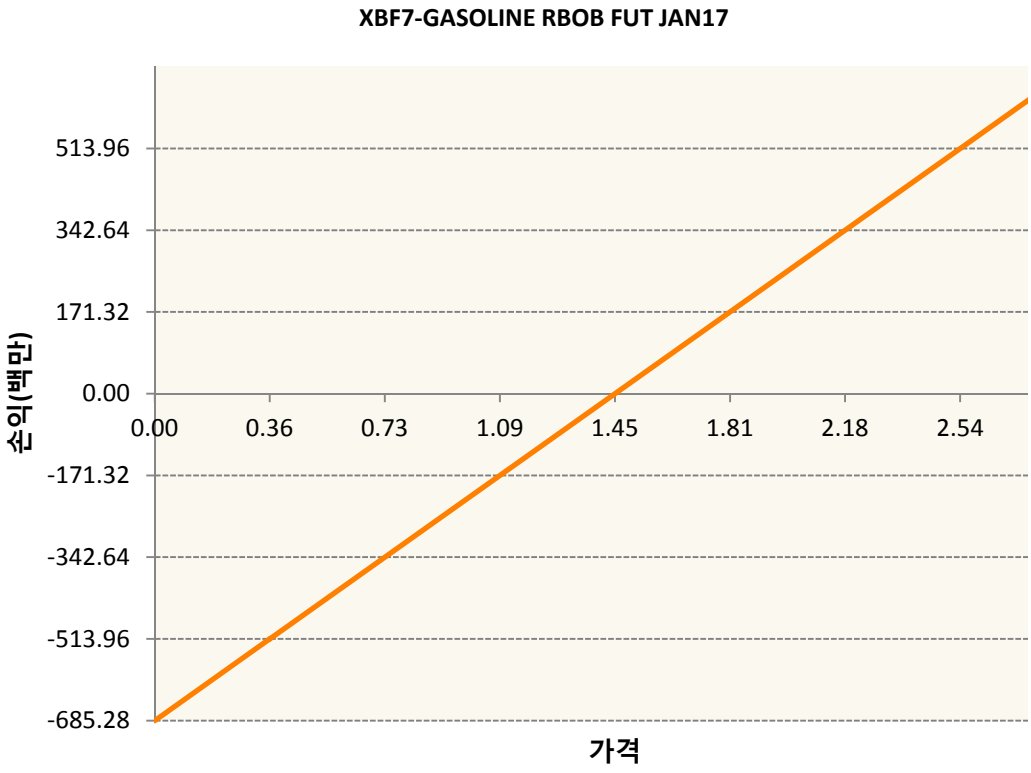



-1,210.24
-1,613.65
가격


HOF7-NY Harb ULSD Fut JAN17
598.53
399.02
199.51
0.00
-199.51
-399.02
-598.53
-798.03
0.00
0.38
0.77
1.15
1.53
1.91
2.30
2.68
순익(백만)
가격


NGF7-NATURAL GAS FUTR JAN17
1,195.56
797.04
398.52
0.00
-398.52
-797.04
-1,195.56
-1,594.08
0.00
0.77
1.54
2.31
3.08
3.85
4.62
5.39
순익(백만)

가격



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
CLF7	WTI CRUDE FUTURE JAN17	119
COF7	BRENT CRUDE FUTR JAN17	129
HOF7	NY Harb ULSD Fut JAN17	64
NGF7	NATURAL GAS FUTR JAN17	128
XBF7	GASOLINE RBOB FUT JAN17	55

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,106

공시일	2016-11-03
기준일	2016-11-02

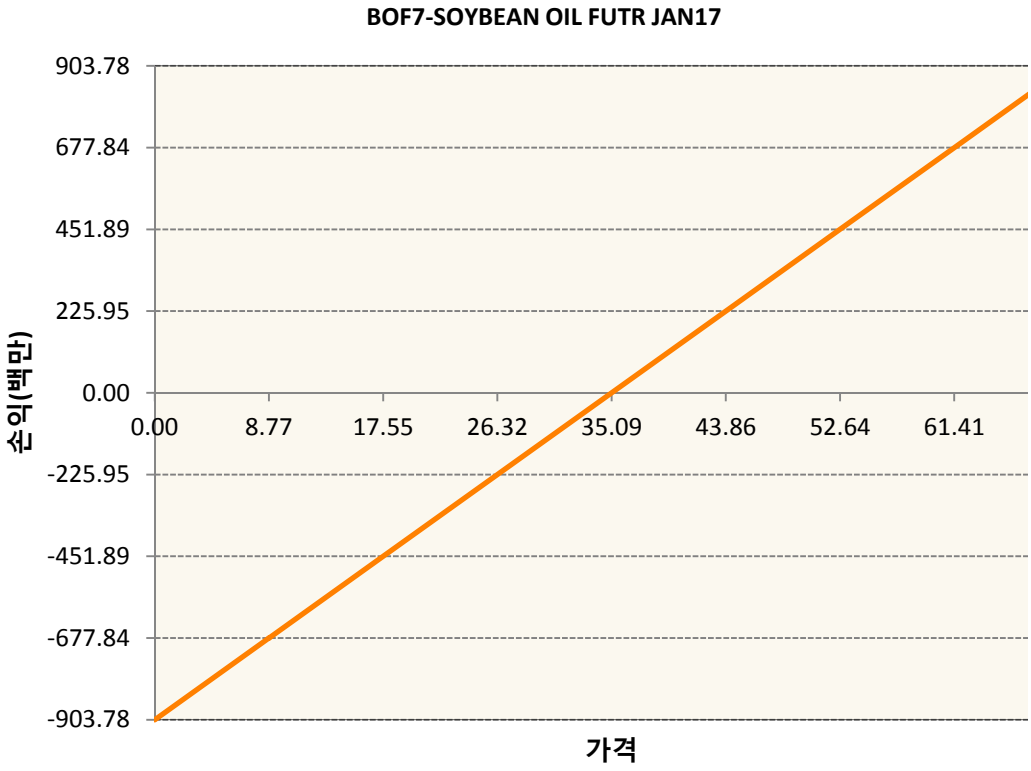
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

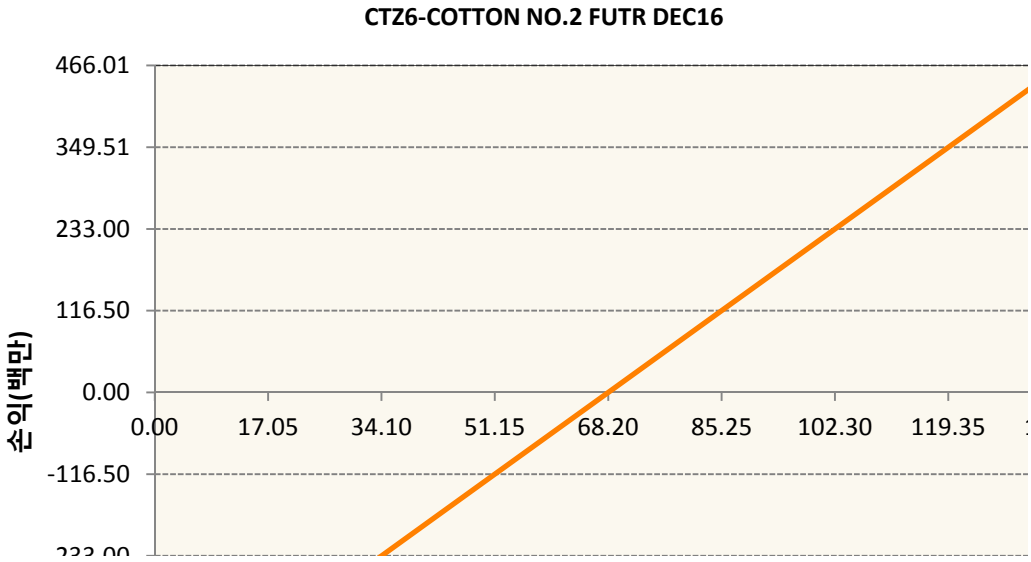
1. 계약금액

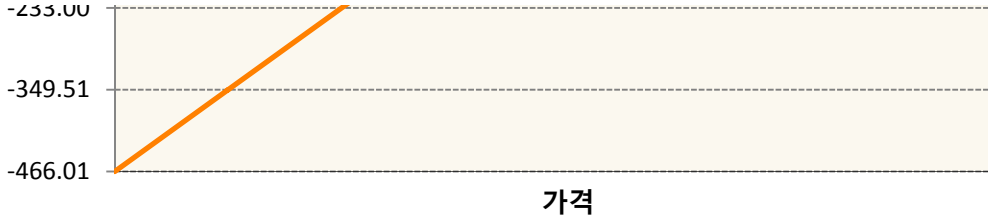
(단위:백만원)

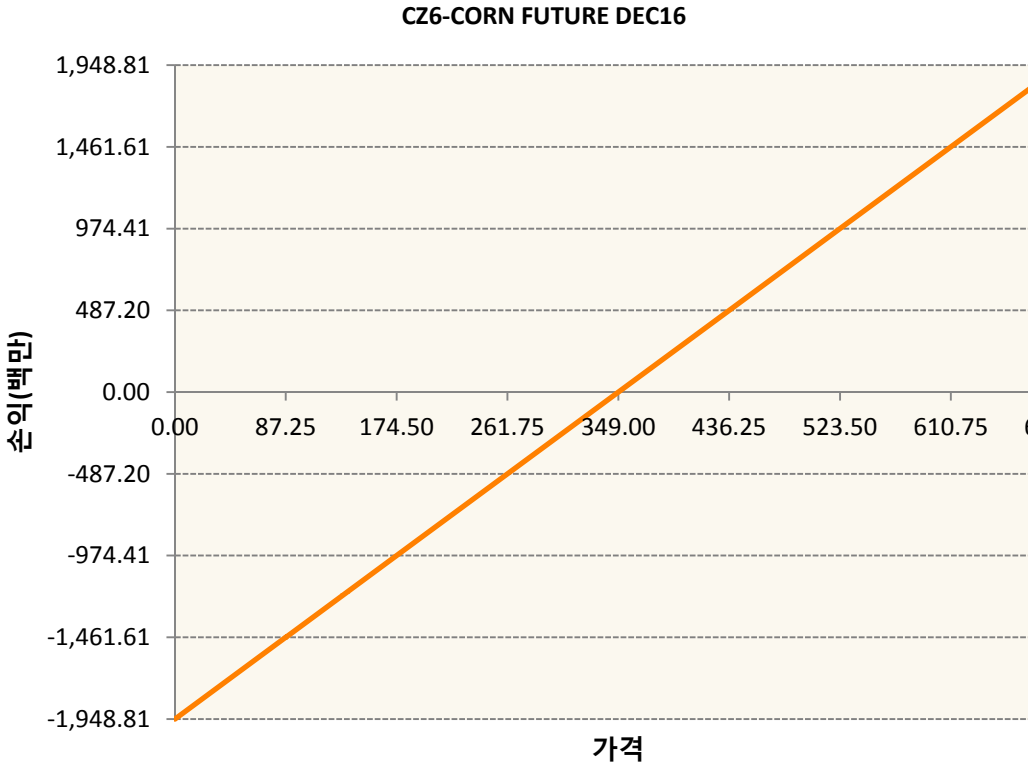
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	9,465	0	9,465	

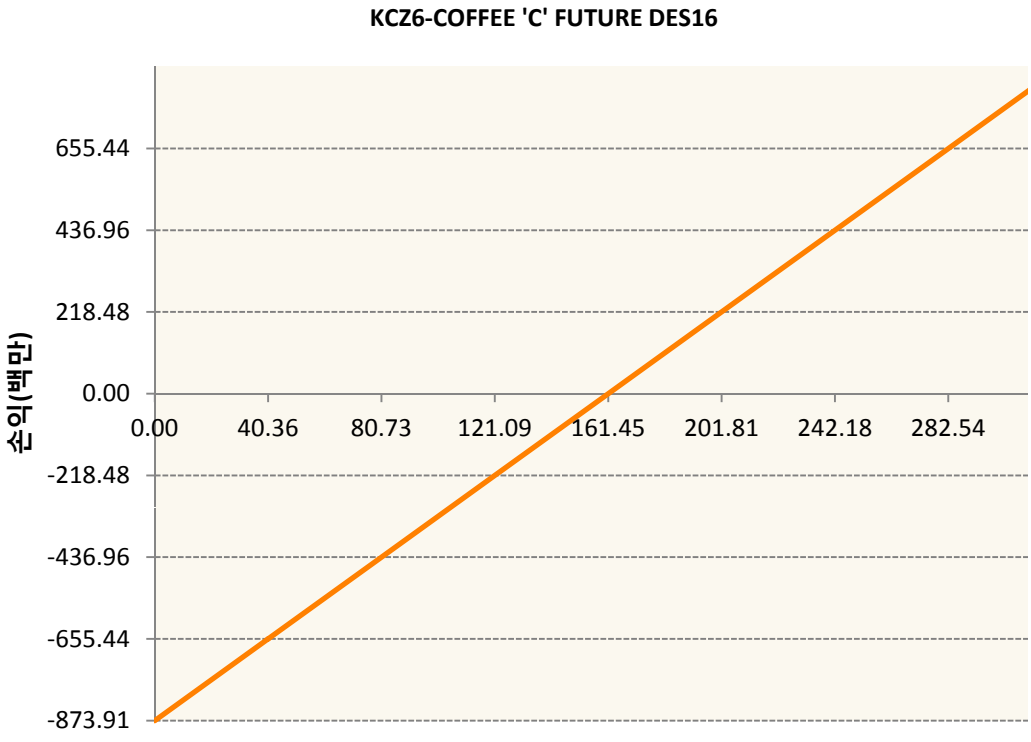
2. 만기시점의 손익구조



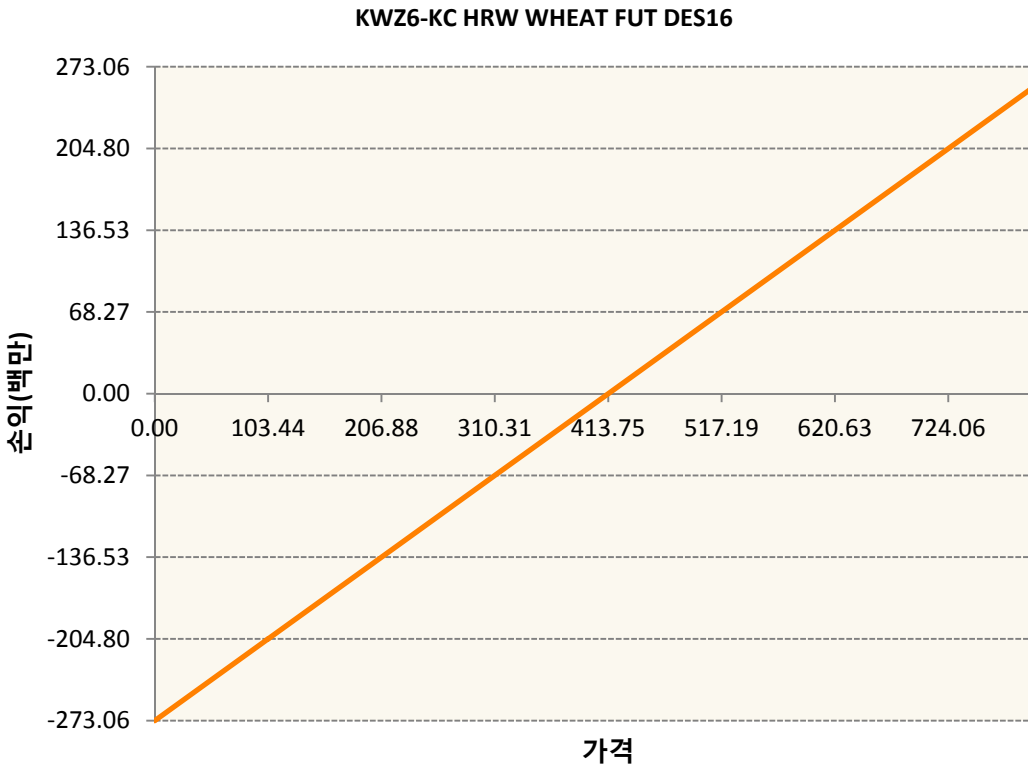


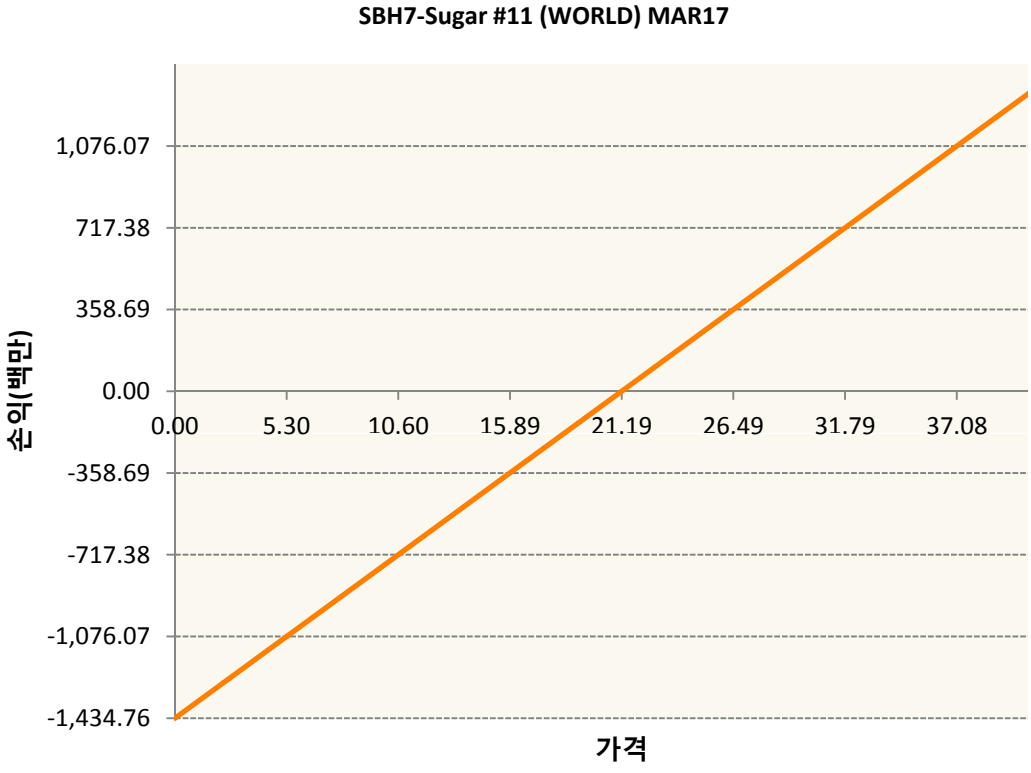

-233.00
-349.51
-466.01
가격

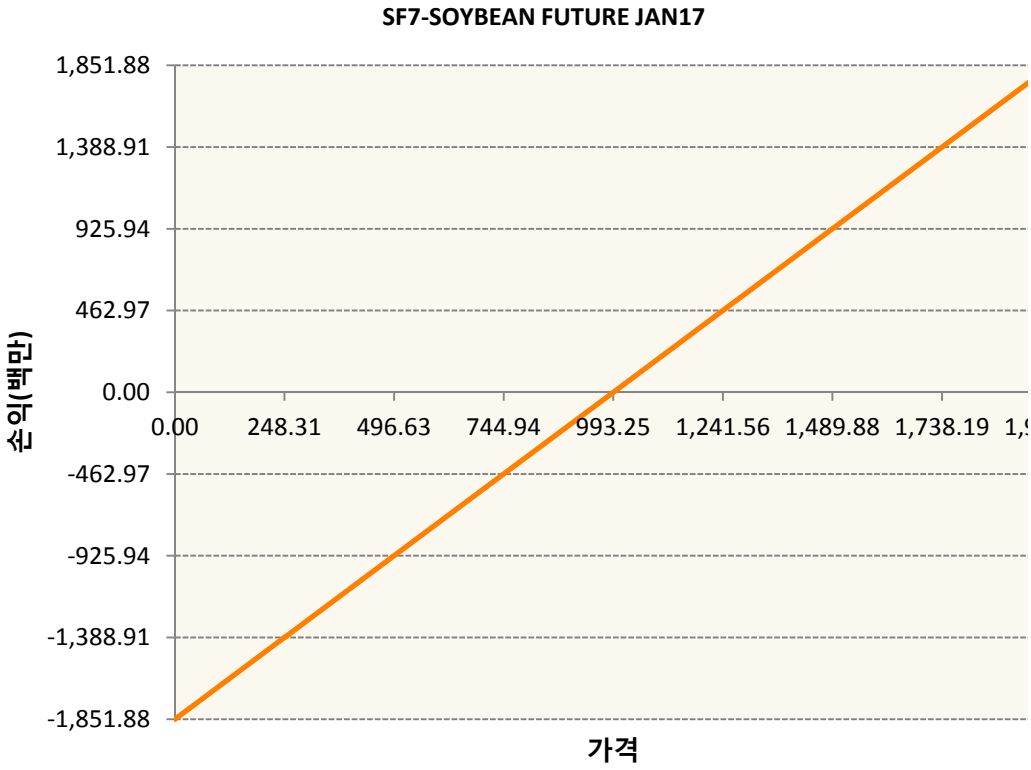

CZ6-CORN FUTURE DEC16
1,948.81
1,461.61
974.41
487.20
0.00
-487.20
-974.41
-1,461.61
-1,948.81
0.00
87.25
174.50
261.75
349.00
436.25
523.50
610.75
손익(백만)
가격

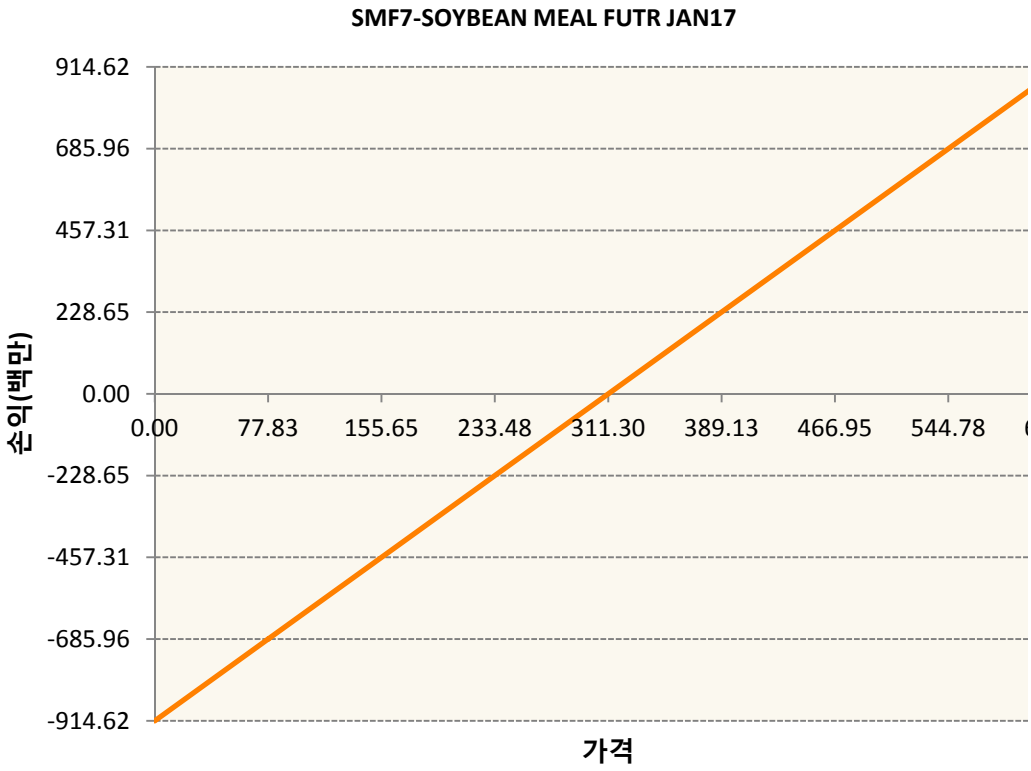

KCZ6-COFFEE 'C' FUTURE DES16
655.44
436.96
218.48
0.00
-218.48
-436.96
-655.44
-873.91
0.00
40.36
80.73
121.09
161.45
201.81
242.18
282.54
손익(백만)

가격

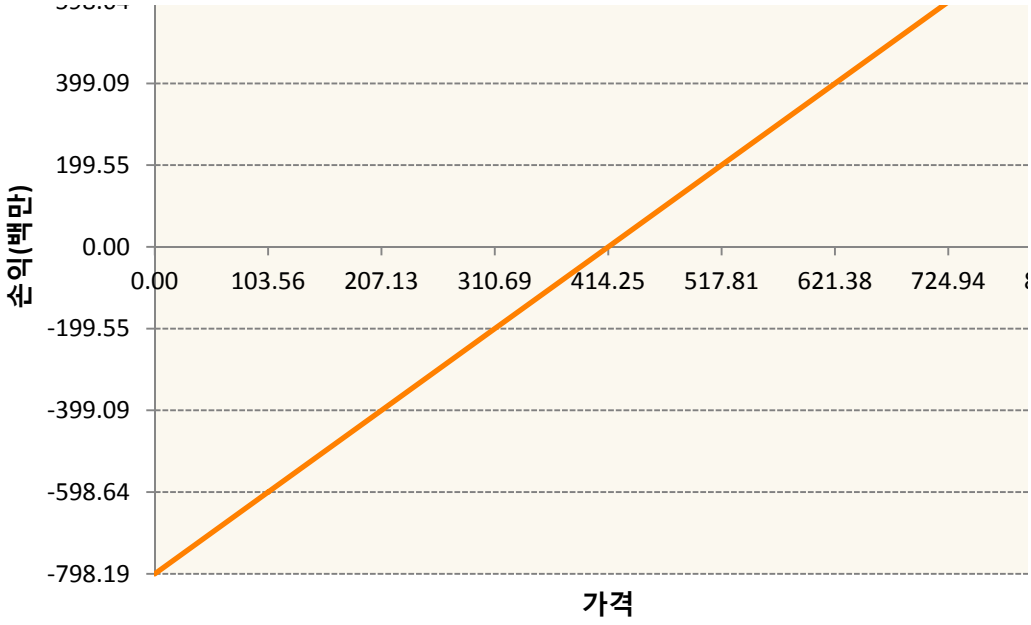

KWZ6-KC HRW WHEAT FUT DES16
273.06
204.80
136.53
68.27
0.00
-68.27
-136.53
-204.80
-273.06
0.00
103.44
206.88
310.31
413.75
517.19
620.63
724.06
손익(백만)
가격


SBH7-Sugar #11 (WORLD) MAR17
1,076.07
717.38
358.69
0.00
-358.69
-717.38
-1,076.07
-1,434.76
0.00
5.30
10.60
15.89
21.19
26.49
31.79
37.08
손익(백만)
가격


SF7-SOYBEAN FUTURE JAN17
1,851.88
1,388.91
925.94
462.97
0.00
-462.97
-925.94
-1,388.91
-1,851.88
0.00
248.31
496.63
744.94
993.25
1,241.56
1,489.88
1,738.19
손익(백만)
가격


SMF7-SOYBEAN MEAL FUTR JAN17
914.62
685.96
457.31
228.65
0.00
-228.65
-457.31
-685.96
-914.62
0.00
77.83
155.65
233.48
311.30
389.13
466.95
544.78
손익(백만)
가격


WZ6-WHEAT FUTURE(CBT) DEC16
798.19
598.64



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
BOF7	SOYBEAN OIL FUTR JAN17	72
CTZ6	COTTON NO.2 FUTR DEC16	37
CZ6	CORN FUTURE DEC16	156
KCZ6	COFFEE 'C' FUTURE DES16	70
KWZ6	KC HRW WHEAT FUT DES16	22
SBH7	Sugar #11 (WORLD) MAR17	115
SF7	SOYBEAN FUTURE JAN17	148
SMF7	SOYBEAN MEAL FUTR JAN17	73
WZ6	WHEAT FUTURE(CBT) DEC16	64

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	944