공시일	2016-11-04
기준일	2016-11-03

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	2016-11-04
기준일	2016-11-03

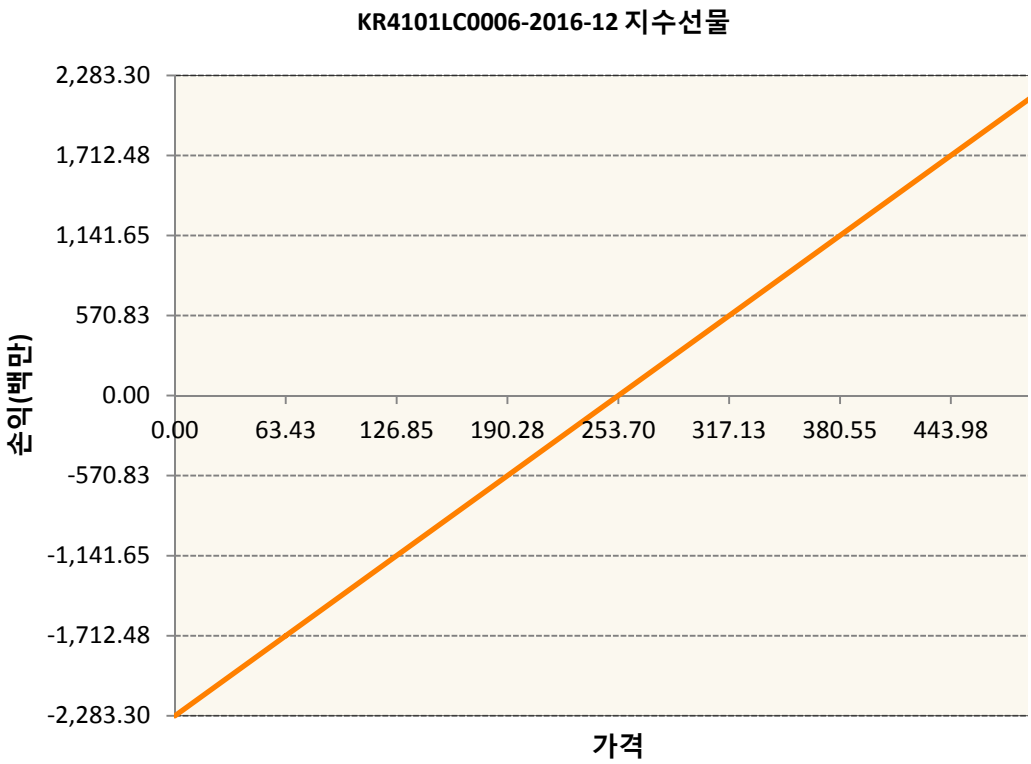
스마트인덱스모

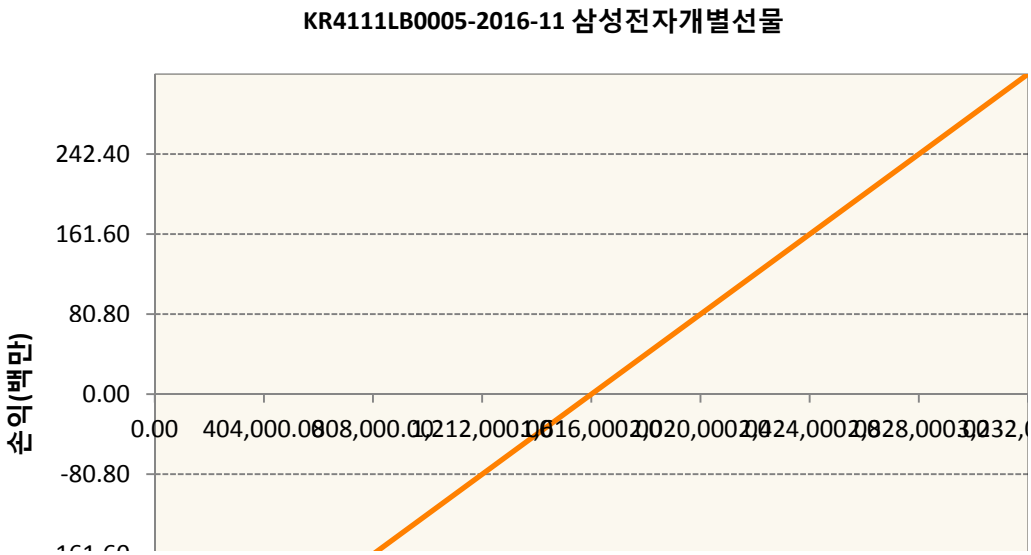
1. 계약금액

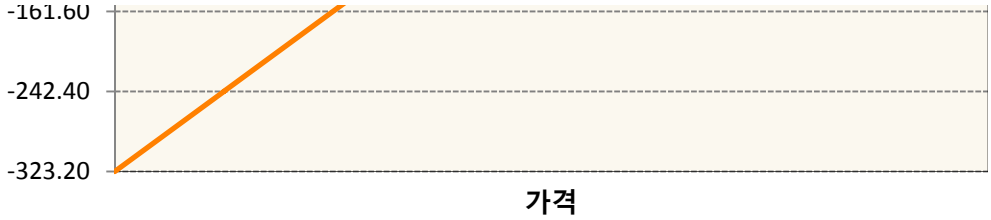
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	381	324	57	장내
누계	유가증권	선물	2,607	0	2,607	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101LC00 2016-12 지수선물							182
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-182	-182	-182	-182	-182	-182	-182
-5.33%	-121	-121	-121	-121	-121	-121	-121
-2.67%	-61	-61	-61	-61	-61	-61	-61
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	61	61	61	61	61	61	61
5.33%	121	121	121	121	121	121	121
8.00%	182	182	182	182	182	182	182

KR4111LB00 2016-11 삼성전자개별선물							26
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-26	-26	-26	-26	-26	-26	-26
-5.33%	-17	-17	-17	-17	-17	-17	-17
-2.67%	-9	-9	-9	-9	-9	-9	-9
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	9	9	9	9	9	9	9
5.33%	17	17	17	17	17	17	17
8.00%	26	26	26	26	26	26	26

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

168

공시일	2016-11-04
기준일	2016-11-03

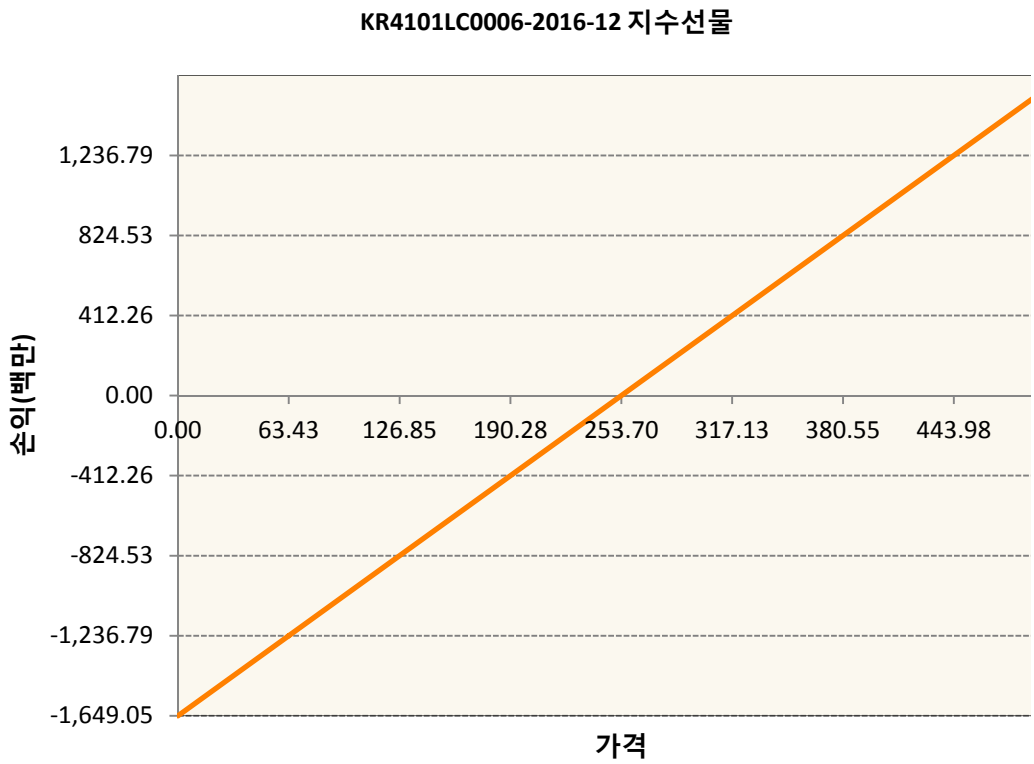
스마트레버리지목표전환형1호

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	1,649	0	1,649	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101LC00 2016-12 지수선물							132
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-132	-132	-132	-132	-132	-132	-132
-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%	132	132	132	132	132	132	132

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

100

공시일	2016-11-04
기준일	2016-11-03

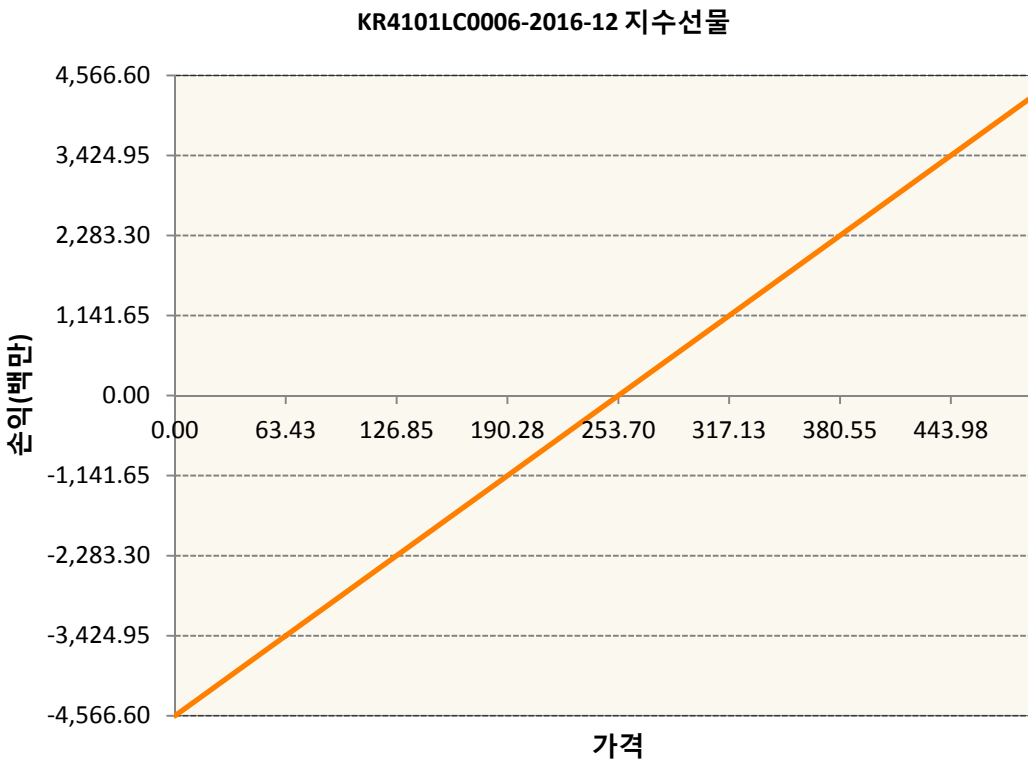
1.3배 레버리지 인덱스(주식-파생형)

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	4,567	0	4,567	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	2016-11-04
기준일	2016-11-03

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	861

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

696

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2016-11-04
기준일	2016-11-03

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	400

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

771

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2016-11-04
기준일	2016-11-03

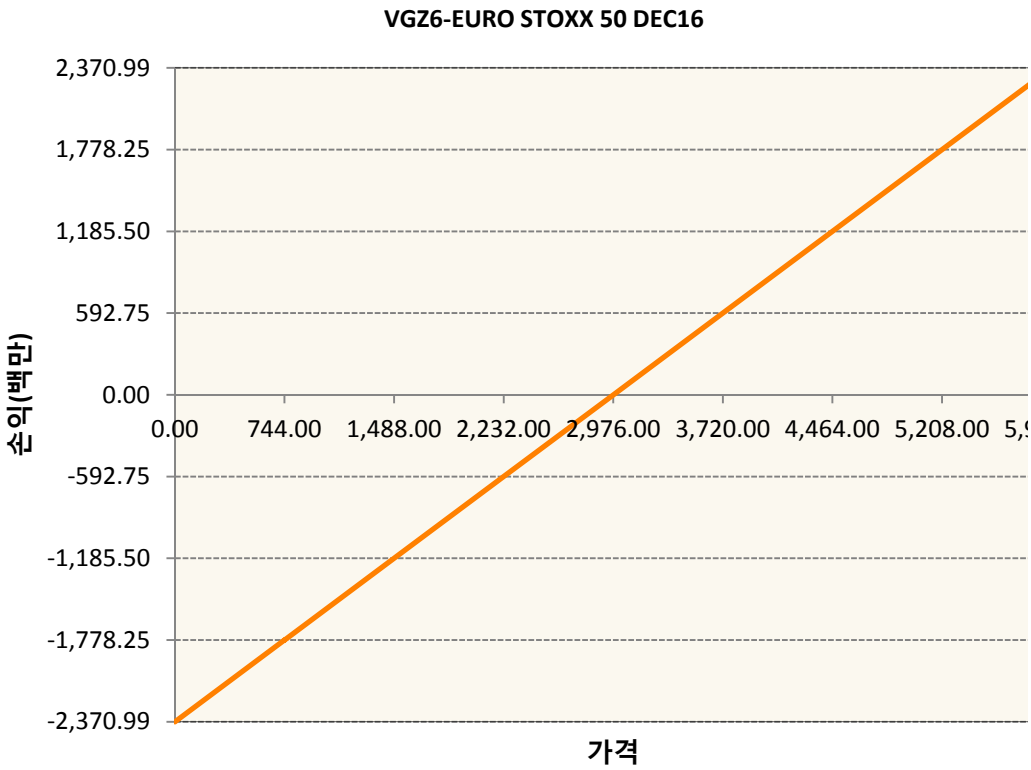
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,371	0	2,371	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGZ6	EURO STOXX 50 DEC16	190

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

(단위:백만원)

229

공시일	2016-11-04
기준일	2016-11-03

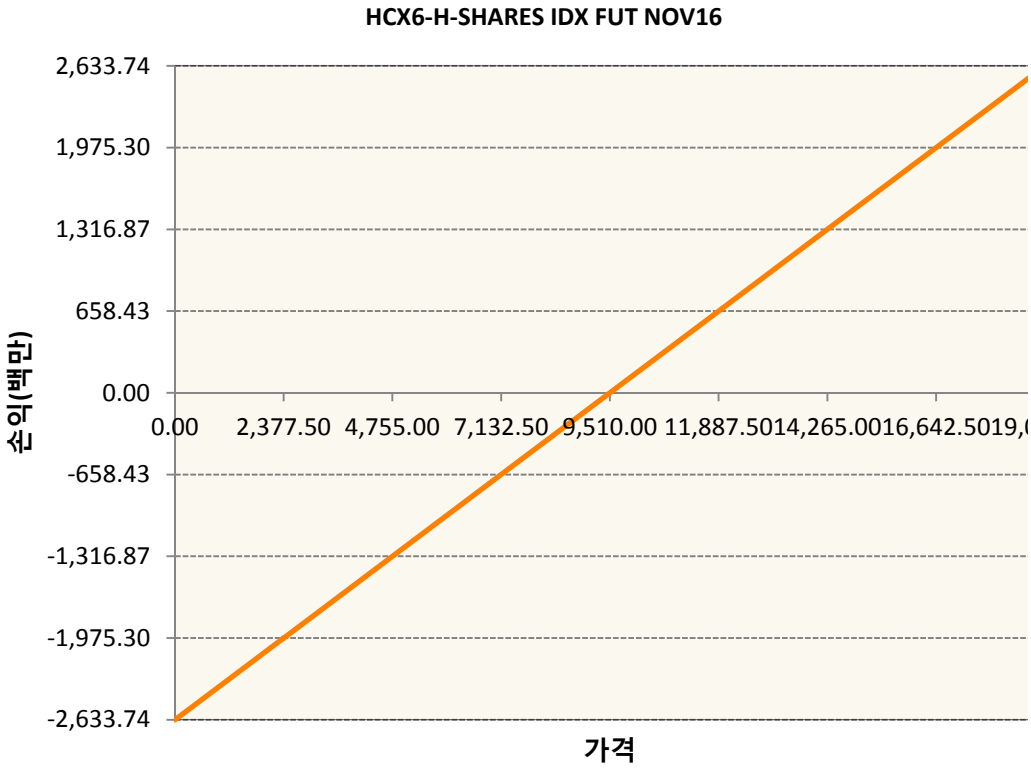
차이나인덱스모(주식-파생형)

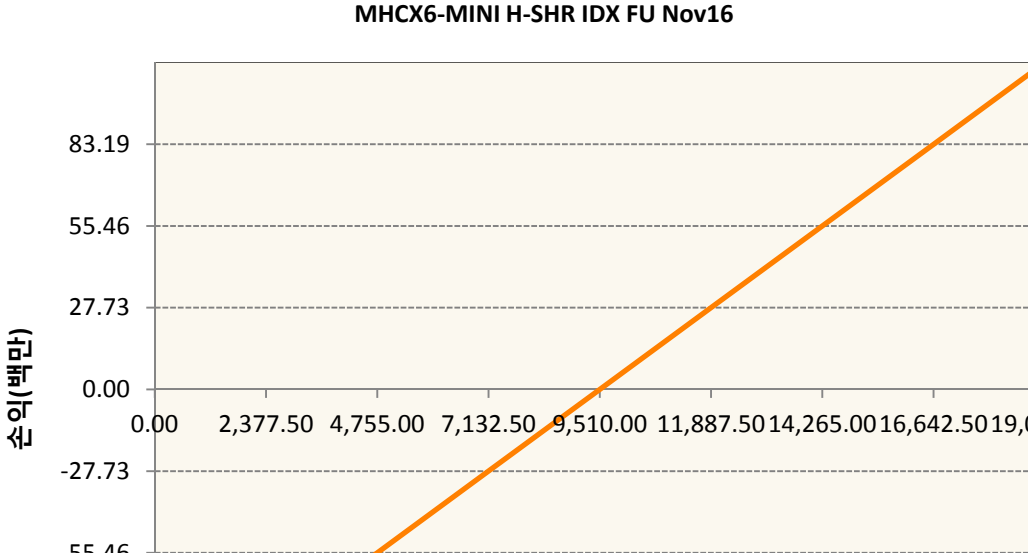
1. 계약금액

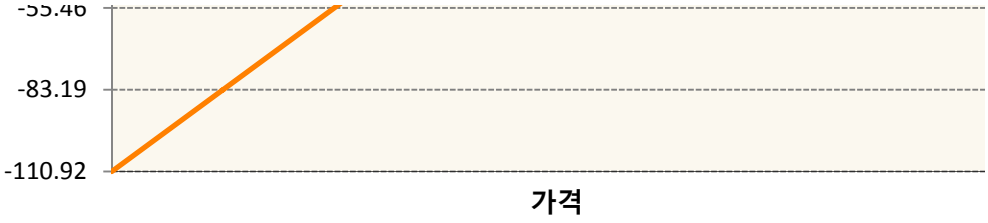
(단위:백만원)

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	2016-11-04
기준일	2016-11-03

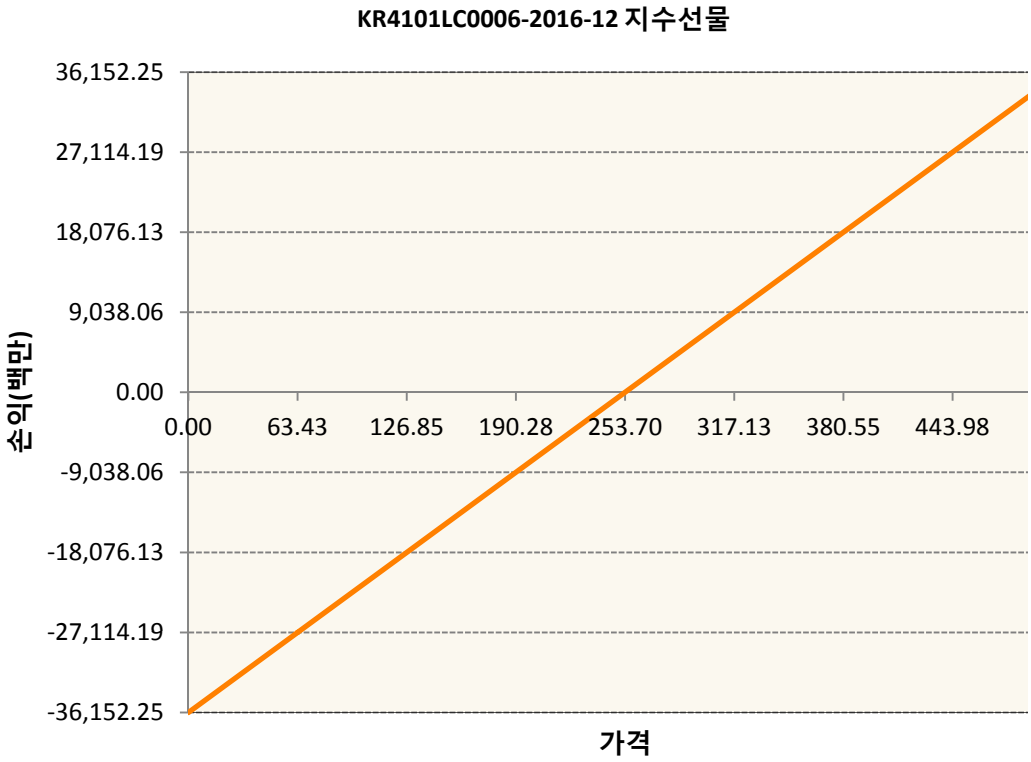
커버드콜(주식혼합-파생형)

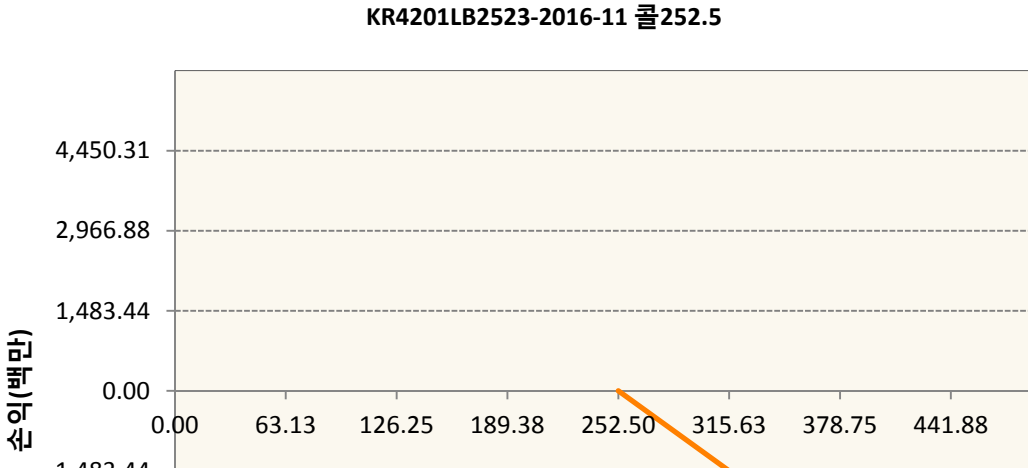
1. 계약금액

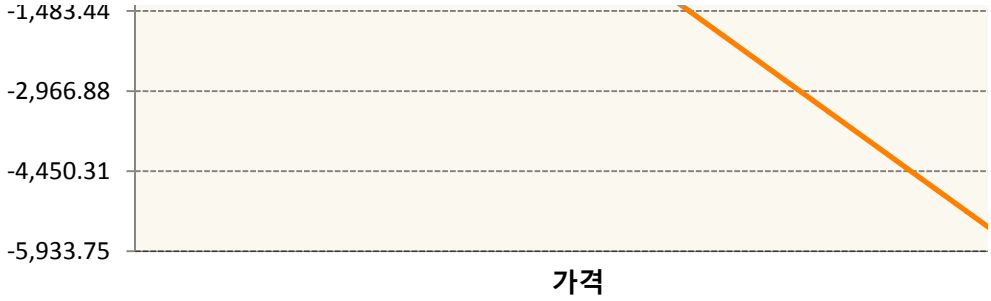
(단위:백만원)

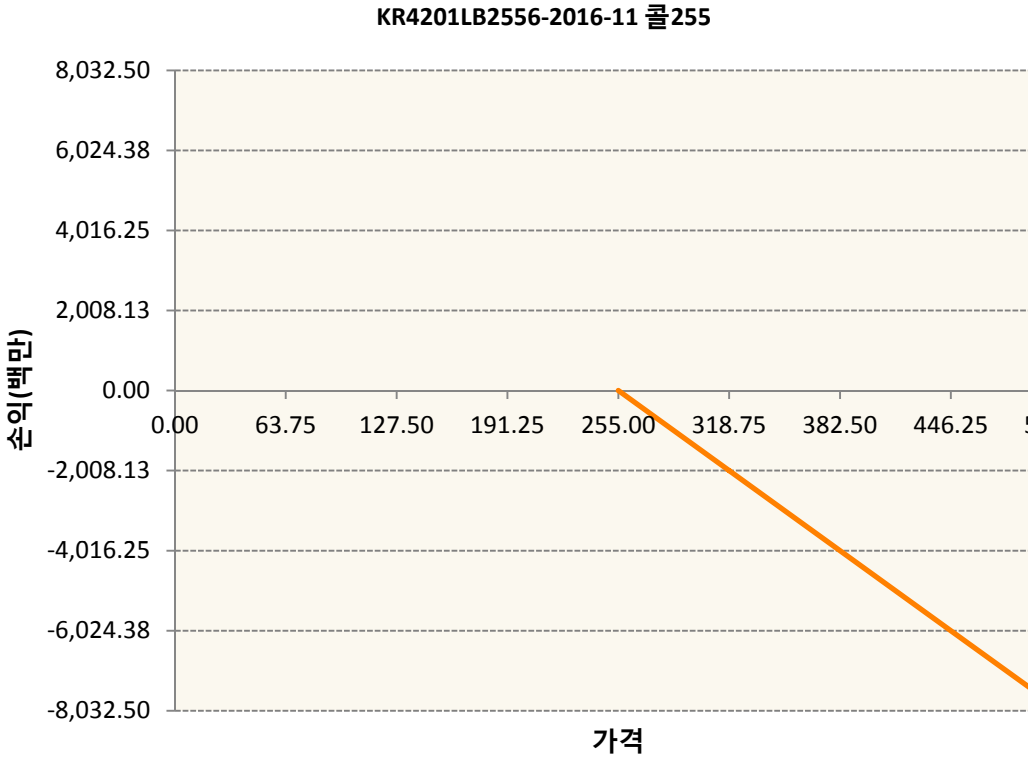
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	769	-769	장내
누계	유가증권	선물	36,152	0	36,152	장내
누계	유가증권	옵션	0	13,966	-13,966	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101LC00 2016-12 지수선물							2,883
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-2,883	-2,883	-2,883	-2,883	-2,883	-2,883	-2,883
-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%	2,883	2,883	2,883	2,883	2,883	2,883	2,883
KR4201LB25 2016-11 콜252.5							2,121
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	302	302	302	302	302	302	302
-5.33%	302	302	301	300	297	294	290
-2.67%	285	276	265	253	240	225	210
0%	70	46	23	0	-23	-46	-70
2.67%	-548	-556	-566	-577	-589	-602	-617
5.33%	-1,328	-1,328	-1,329	-1,330	-1,333	-1,336	-1,340
8.00%	-2,120	-2,120	-2,120	-2,120	-2,120	-2,120	-2,121
KR4201LB25 2016-11 콜255							2,624

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	233	233	233	233	233	233	232
-5.33%	233	233	232	232	230	229	226
-2.67%	227	222	215	205	194	182	168
0%	86	58	29	0	-30	-59	-89
2.67%	-554	-574	-596	-619	-643	-668	-694
5.33%	-1,560	-1,562	-1,565	-1,570	-1,577	-1,585	-1,595
8.00%	-2,620	-2,620	-2,620	-2,621	-2,621	-2,622	-2,624

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

7,917

공시일	2016-11-04
기준일	2016-11-03

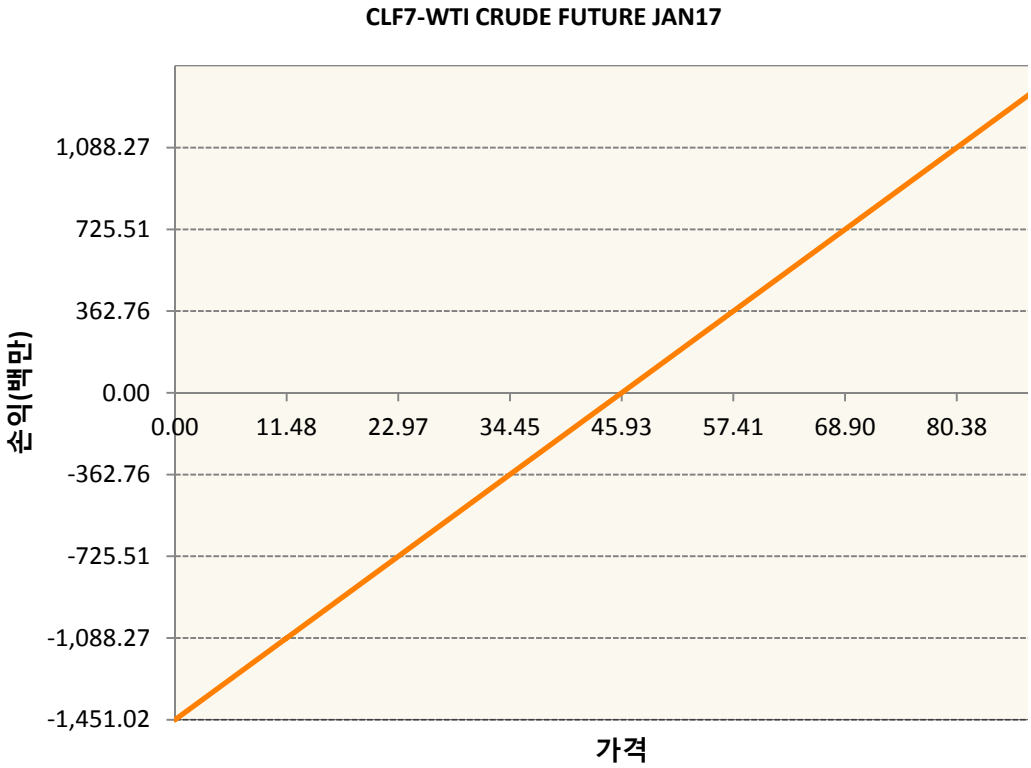
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

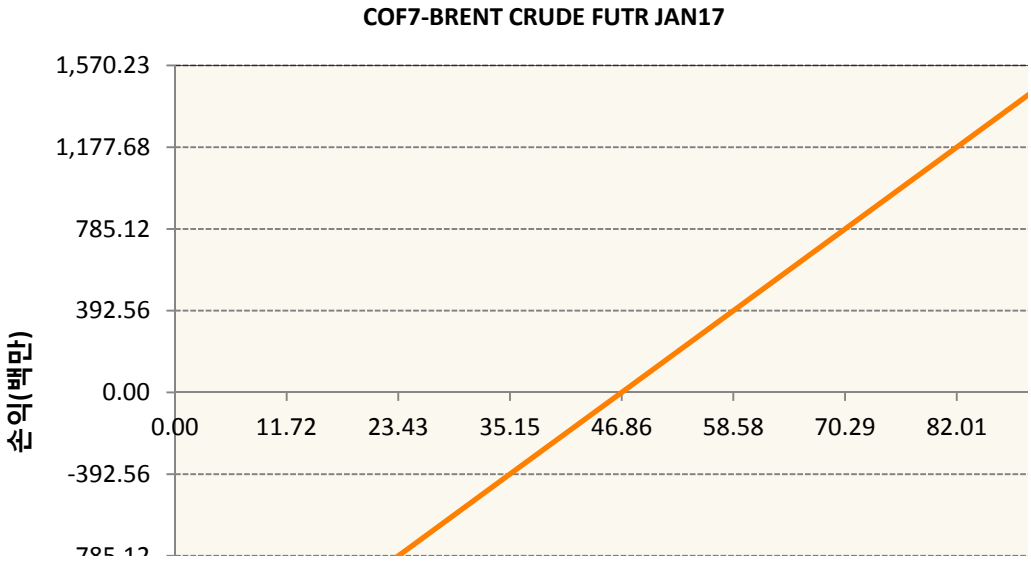
1. 계약금액

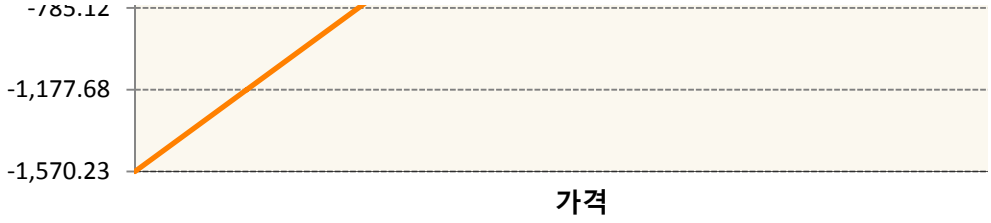
(단위:백만원)

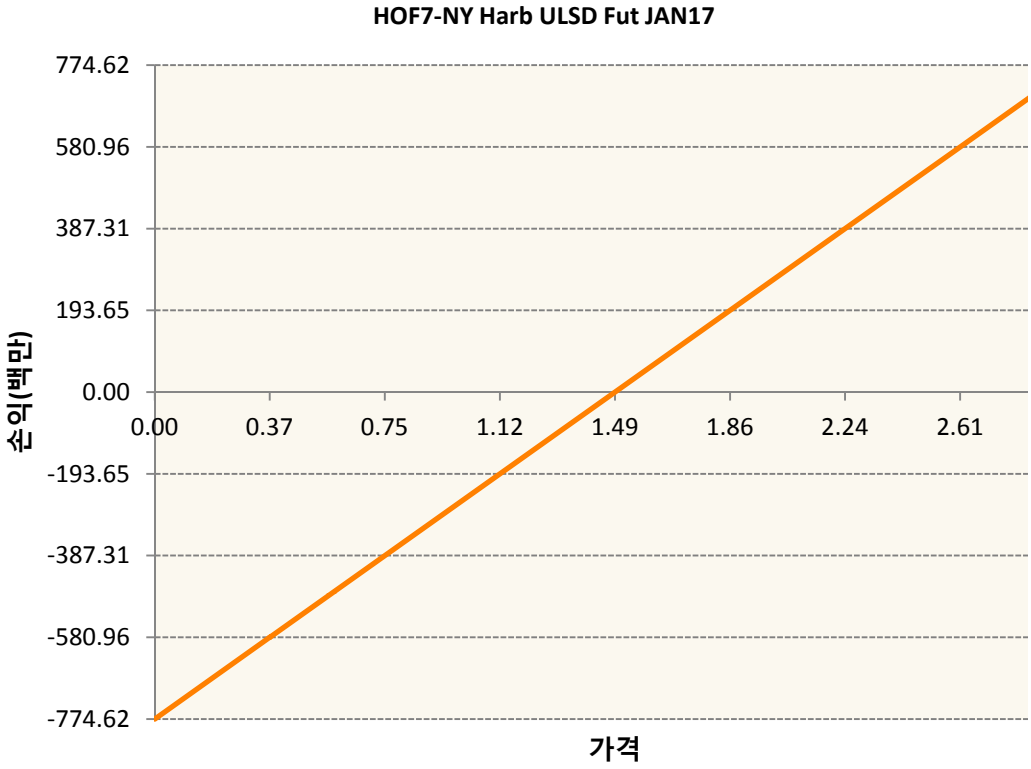
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	6,010	0	6,010	

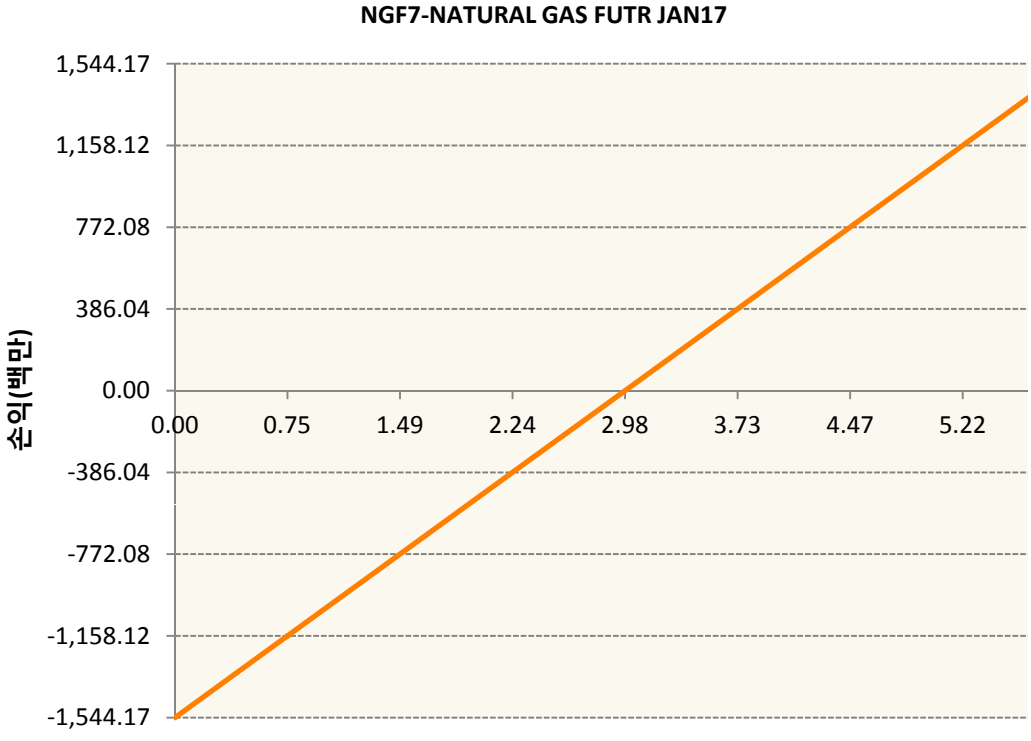
2. 만기시점의 손익구조



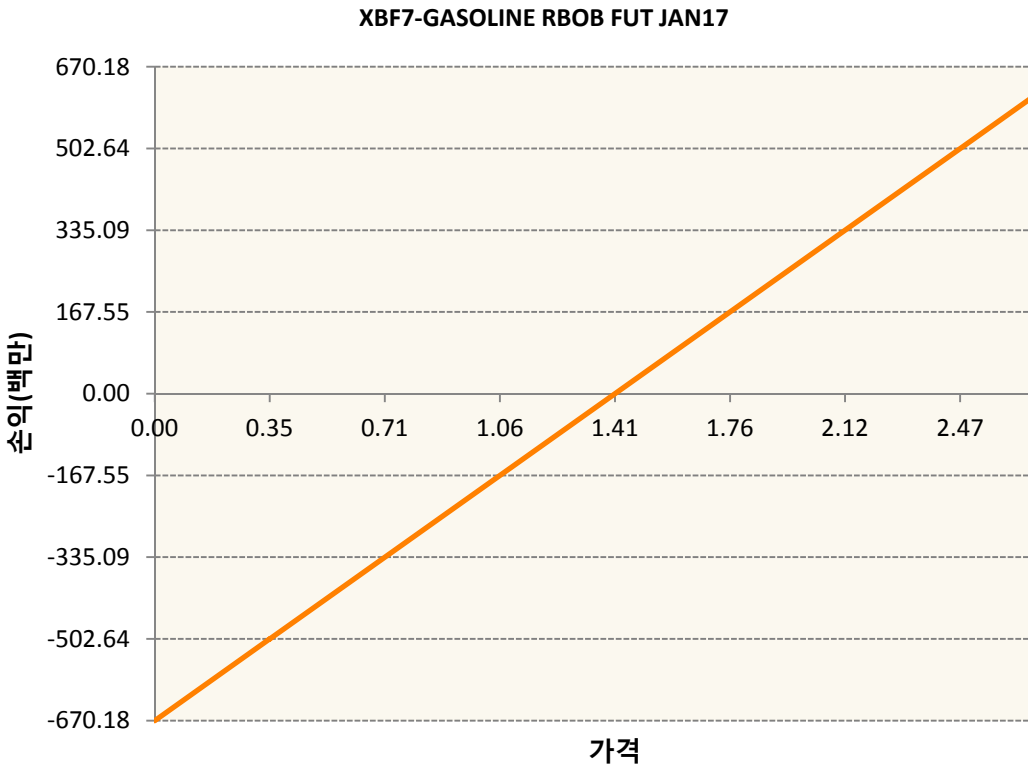



-1,177.68
-1,570.23
가격


HOF7-NY Harb ULSD Fut JAN17
774.62
580.96
387.31
193.65
0.00
-193.65
-387.31
-580.96
-774.62
0.00
0.37
0.75
1.12
1.49
1.86
2.24
2.61
순익(백만)
가격


NGF7-NATURAL GAS FUTR JAN17
1,544.17
1,158.12
772.08
386.04
0.00
-386.04
-772.08
-1,158.12
-1,544.17
0.00
0.75
1.49
2.24
2.98
3.73
4.47
5.22
순익(백만)

가격



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
CLF7	WTI CRUDE FUTURE JAN17	116
COF7	BRENT CRUDE FUTR JAN17	126
HOF7	NY Harb ULSD Fut JAN17	62
NGF7	NATURAL GAS FUTR JAN17	124
XBF7	GASOLINE RBOB FUT JAN17	54

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,076

공시일	2016-11-04
기준일	2016-11-03

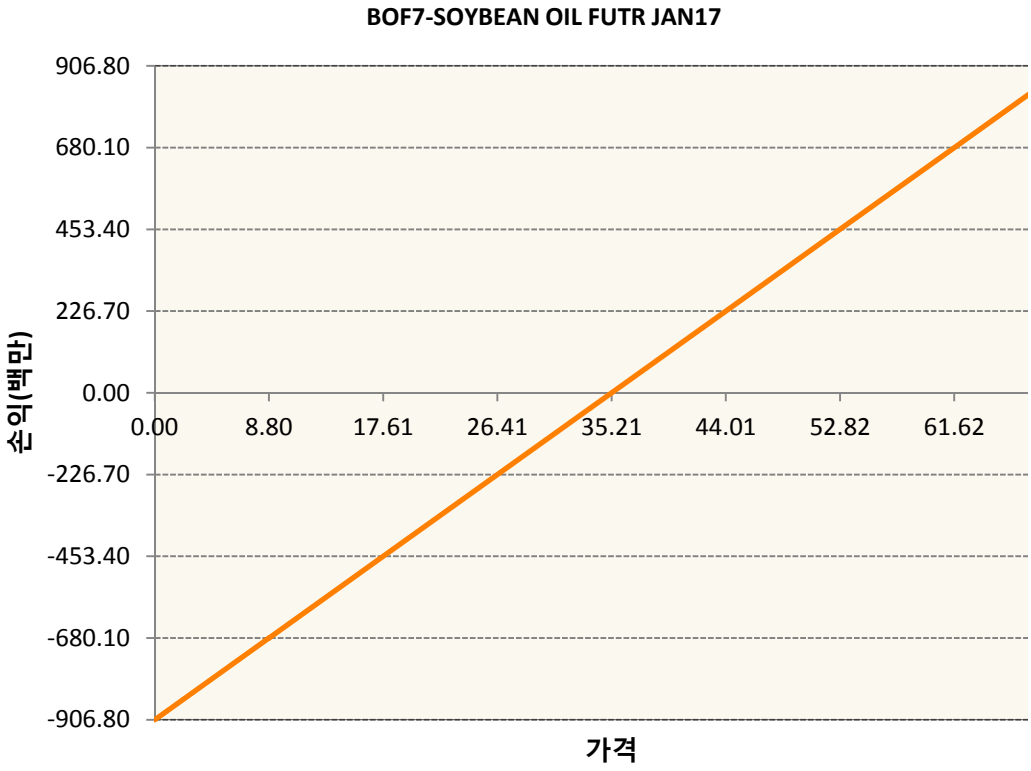
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

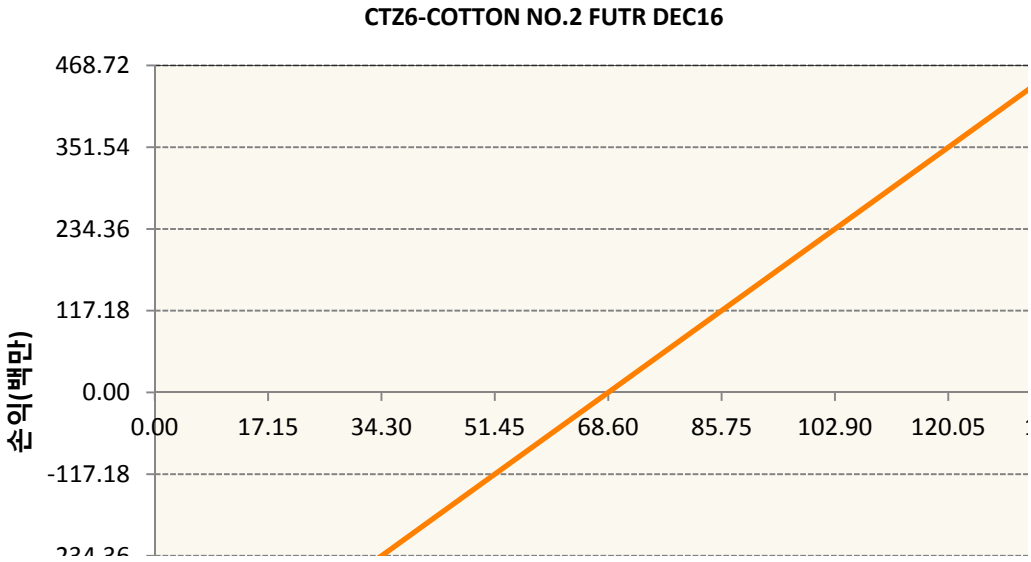
1. 계약금액

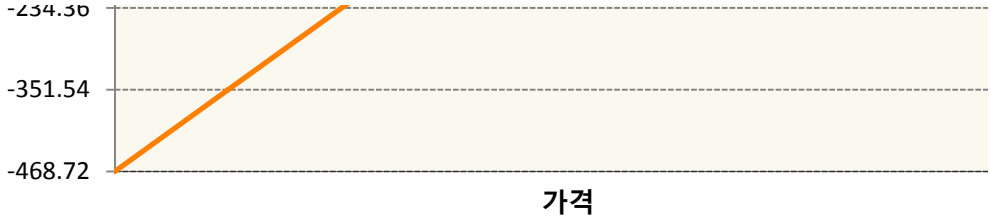
(단위:백만원)

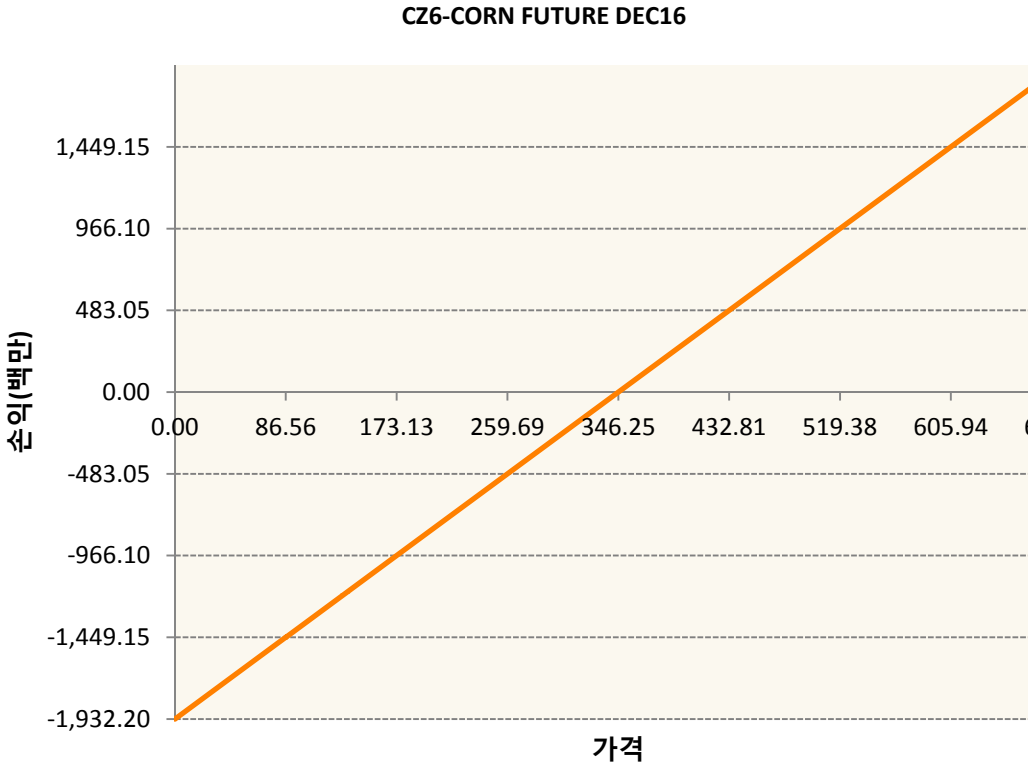
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	9,483	0	9,483	

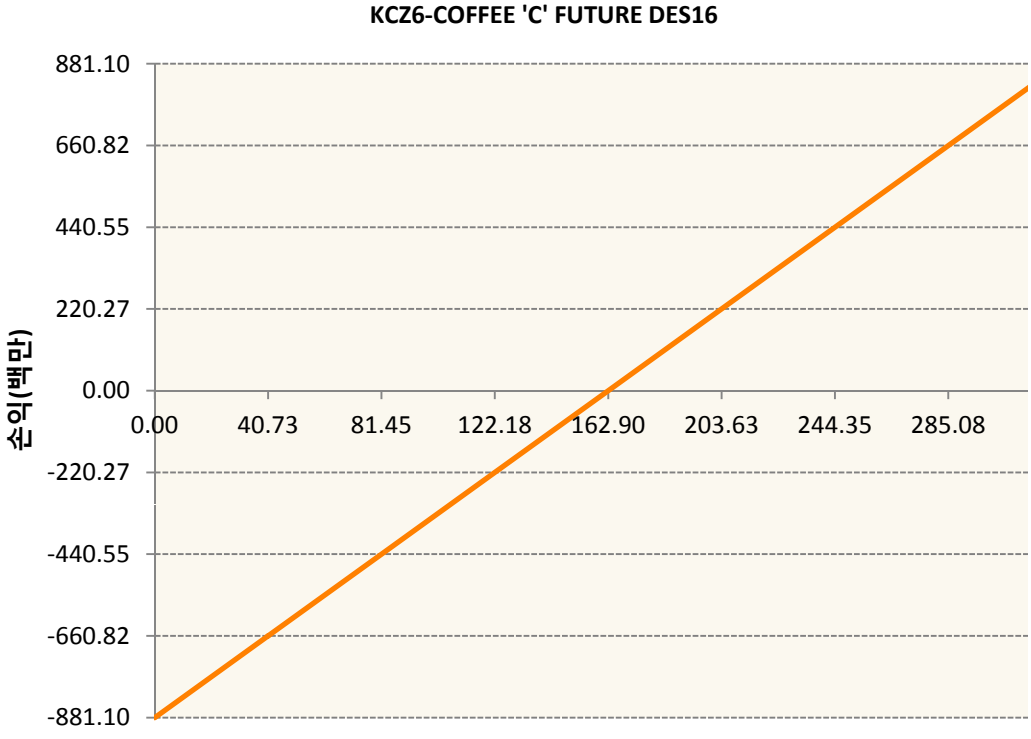
2. 만기시점의 손익구조



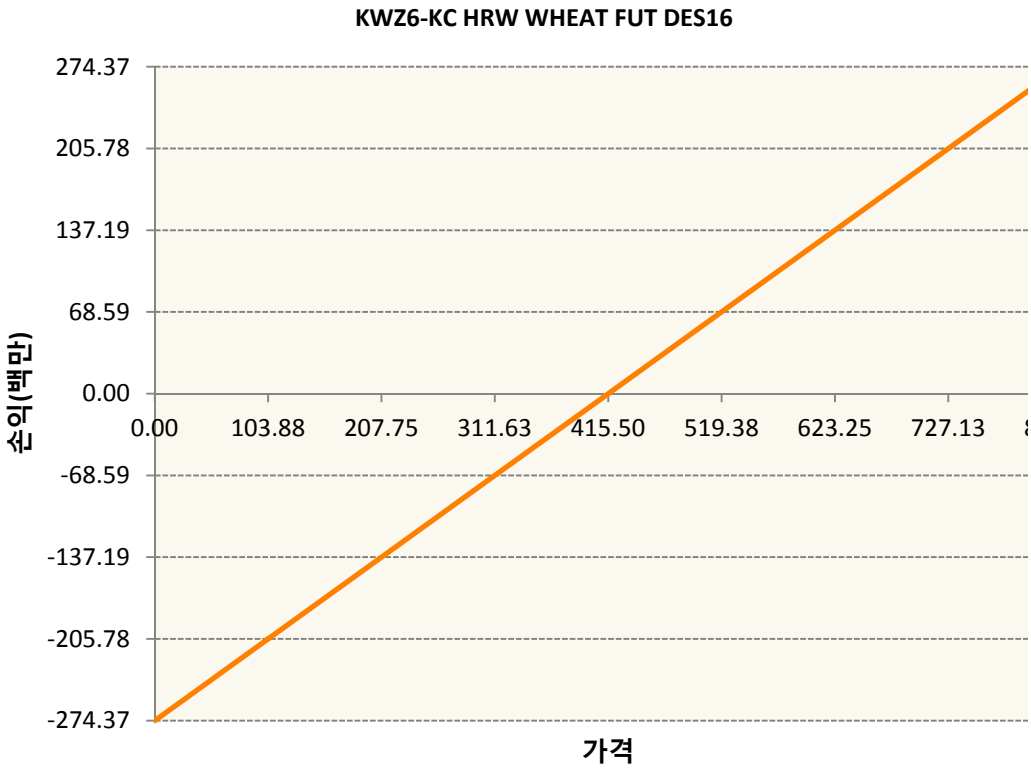


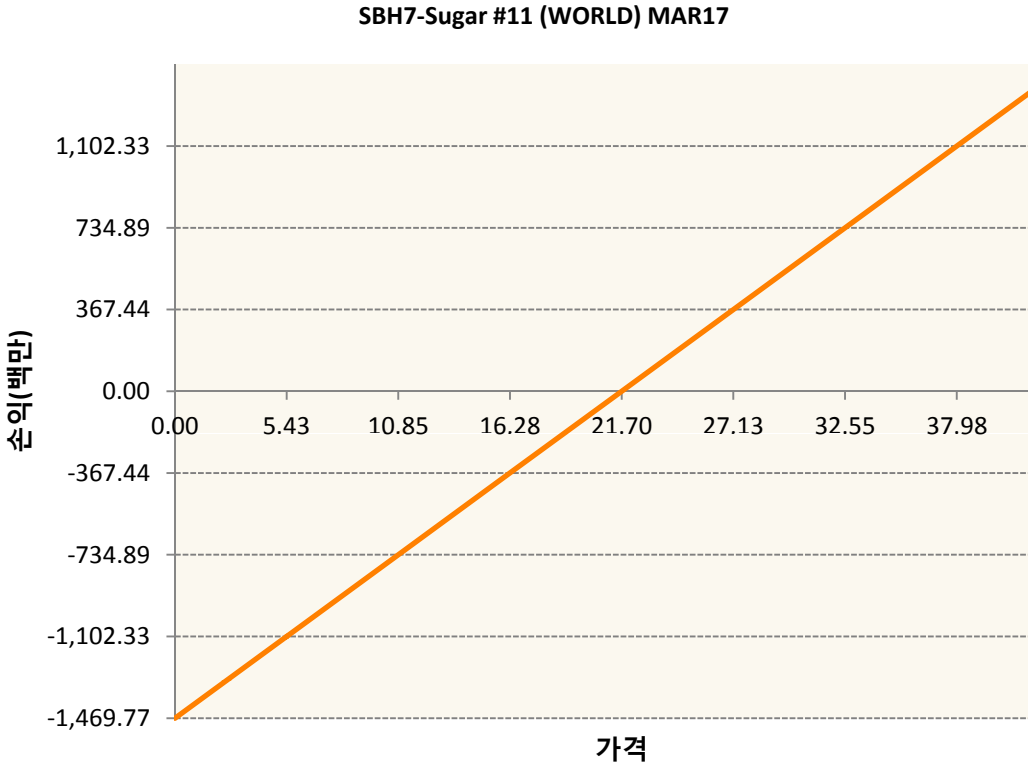

-234.36
-351.54
-468.72
가격


CZ6-CORN FUTURE DEC16
1,449.15
966.10
483.05
0.00
-483.05
-966.10
-1,449.15
-1,932.20
0.00
86.56
173.13
259.69
346.25
432.81
519.38
605.94
순익(백만)
가격

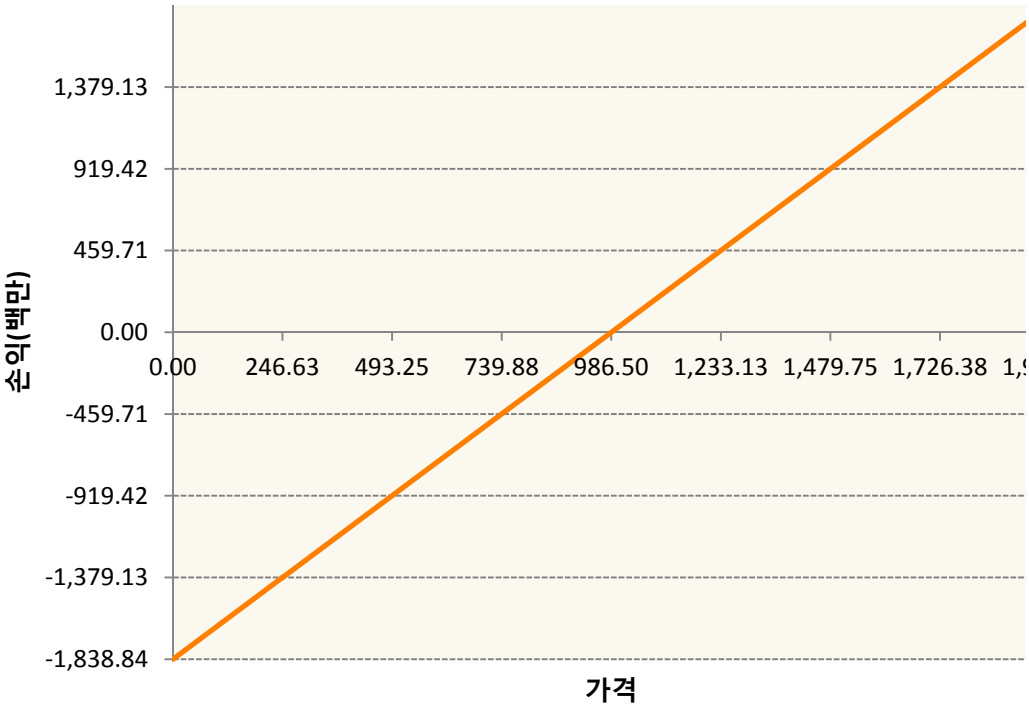

KCZ6-COFFEE 'C' FUTURE DES16
881.10
660.82
440.55
220.27
0.00
-220.27
-440.55
-660.82
-881.10
0.00
40.73
81.45
122.18
162.90
203.63
244.35
285.08
순익(백만)

가격

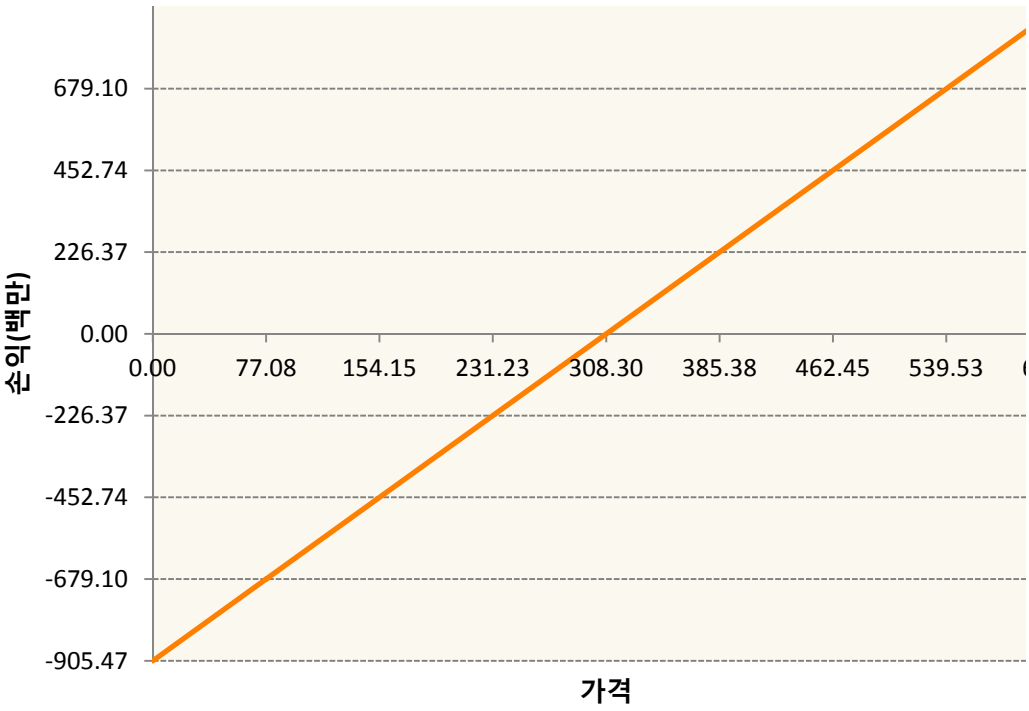

KWZ6-KC HRW WHEAT FUT DES16
274.37
205.78
137.19
68.59
0.00
-68.59
-137.19
-205.78
-274.37
0.00
103.88
207.75
311.63
415.50
519.38
623.25
727.13
손익(백만)
가격


SBH7-Sugar #11 (WORLD) MAR17
1,102.33
734.89
367.44
0.00
-367.44
-734.89
-1,102.33
-1,469.77
0.00
5.43
10.85
16.28
21.70
27.13
32.55
37.98
손익(백만)
가격

SF7-SOYBEAN FUTURE JAN17

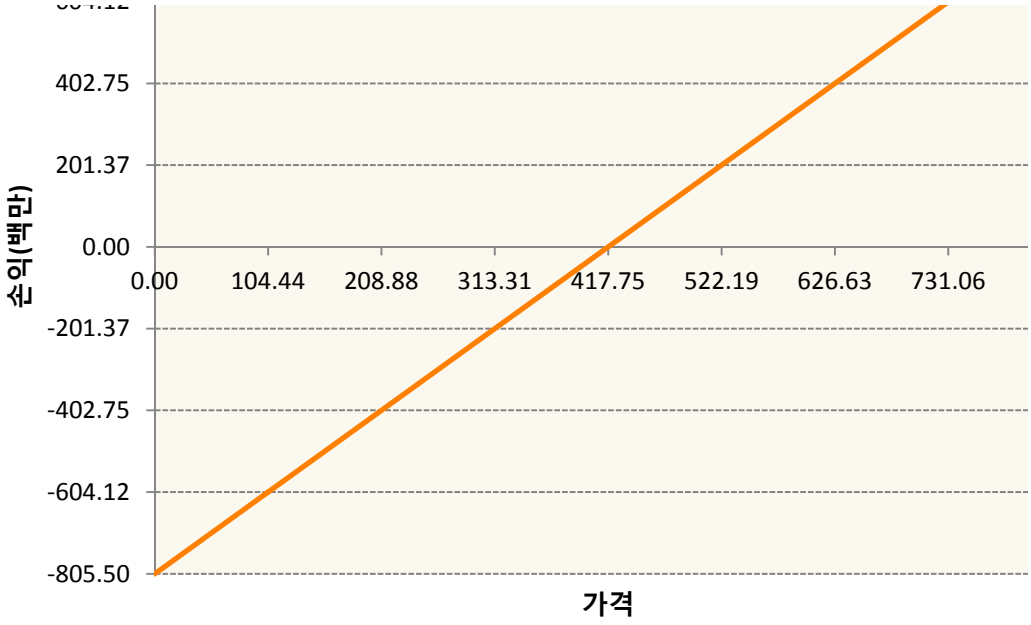


SMF7-SOYBEAN MEAL FUTR JAN17



WZ6-WHEAT FUTURE(CBT) DEC16





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

BOF7	SOYBEAN OIL FUTR JAN17	73
CTZ6	COTTON NO.2 FUTR DEC16	37
CZ6	CORN FUTURE DEC16	155
KCZ6	COFFEE 'C' FUTURE DES16	70
KWZ6	KC HRW WHEAT FUT DES16	22
SBH7	Sugar #11 (WORLD) MAR17	118
SF7	SOYBEAN FUTURE JAN17	147
SMF7	SOYBEAN MEAL FUTR JAN17	72
WZ6	WHEAT FUTURE(CBT) DEC16	64

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

947