공시일	2016-11-07
기준일	2016-11-04

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	2016-11-07
기준일	2016-11-04

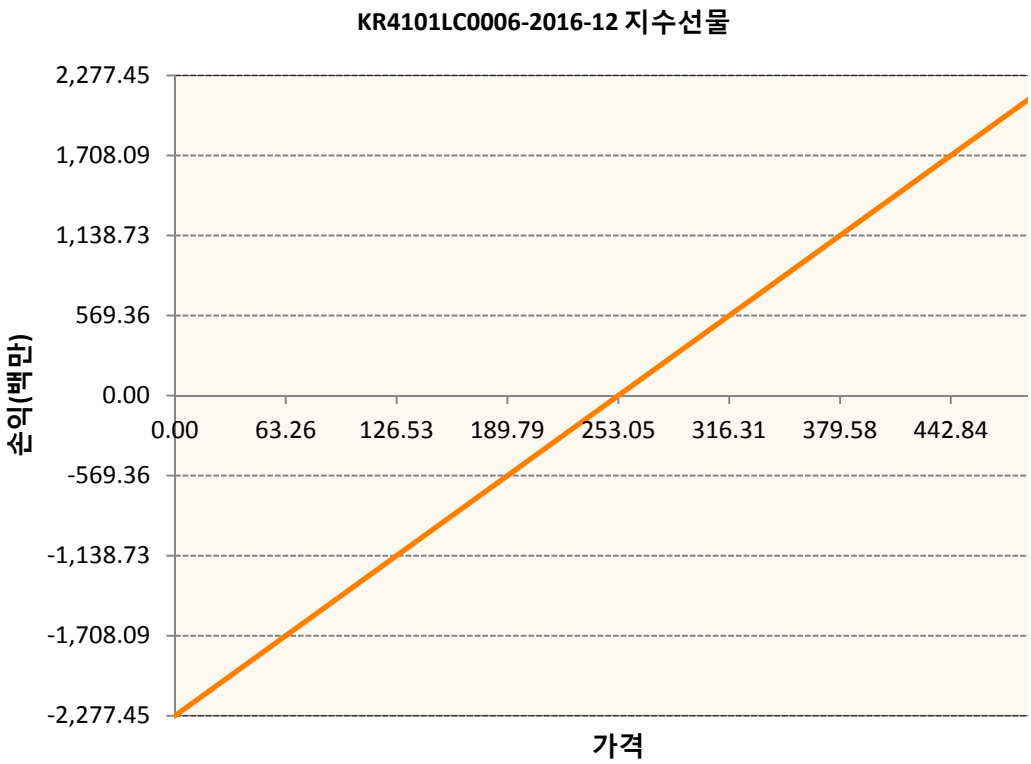
스마트인덱스모

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	2,277	0	2,277	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

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

138

공시일	2016-11-07
기준일	2016-11-04

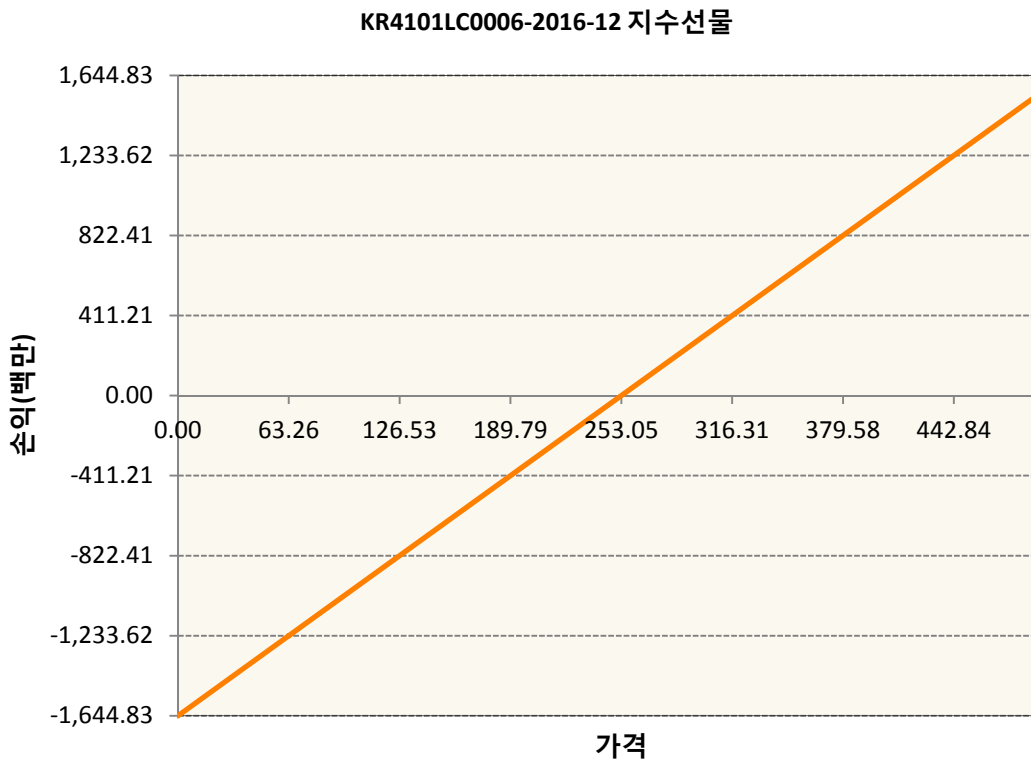
스마트레버리지목표전환형1호

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)

99

공시일	2016-11-07
기준일	2016-11-04

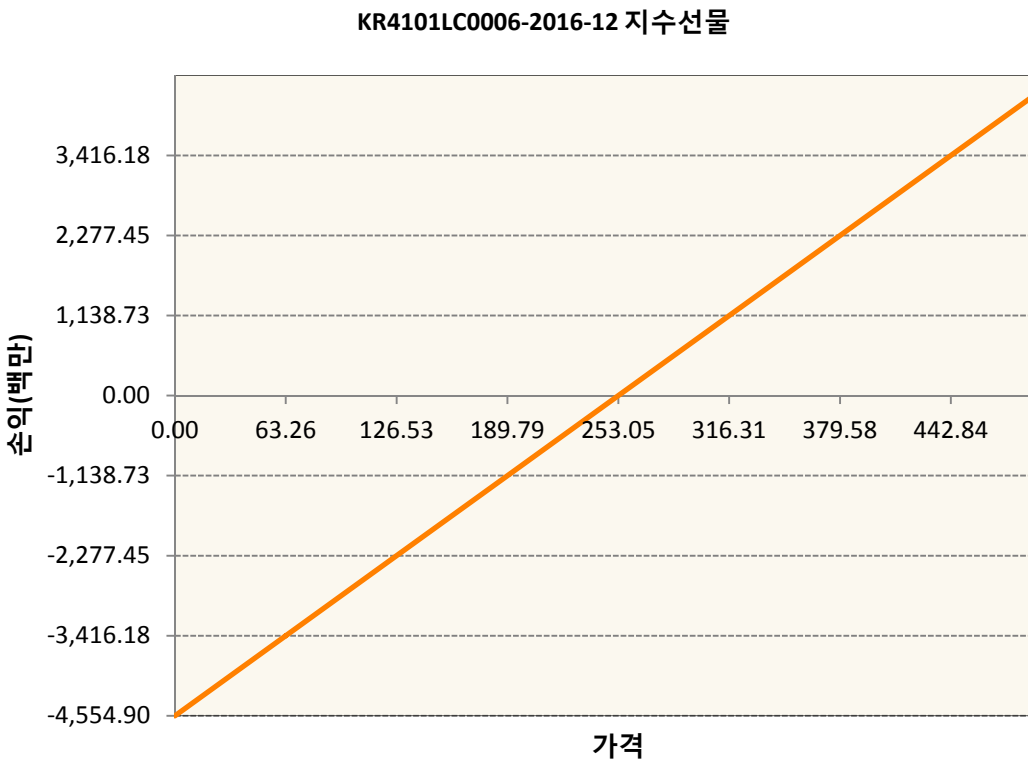
1.3배 레버리지 인덱스(주식-파생형)

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	4,555	0	4,555	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%	-242	-242	-242	-242	-242	-242	-242
-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%	242	242	242	242	242	242	242
8.00%	364	364	364	364	364	364	364

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

275

공시일	2016-11-07
기준일	2016-11-04

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	858

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

694

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2016-11-07
기준일	2016-11-04

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	2016-11-07
기준일	2016-11-04

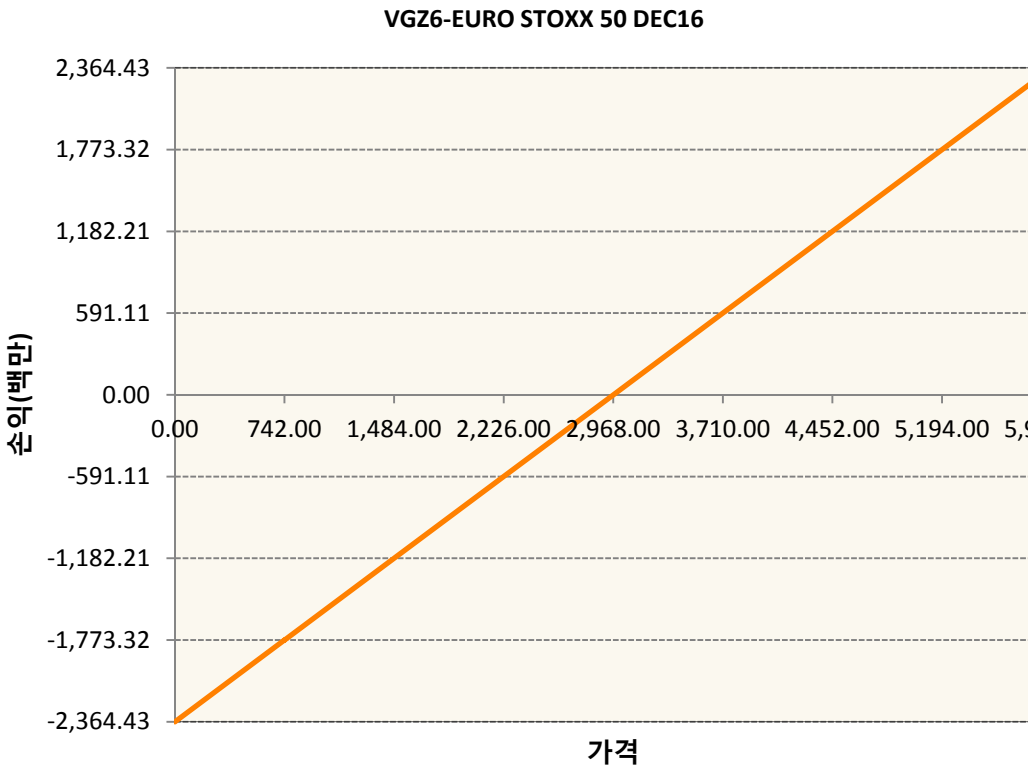
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,364	0	2,364	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGZ6	EURO STOXX 50 DEC16	189

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

(단위:백만원)

228

공시일	2016-11-07
기준일	2016-11-04

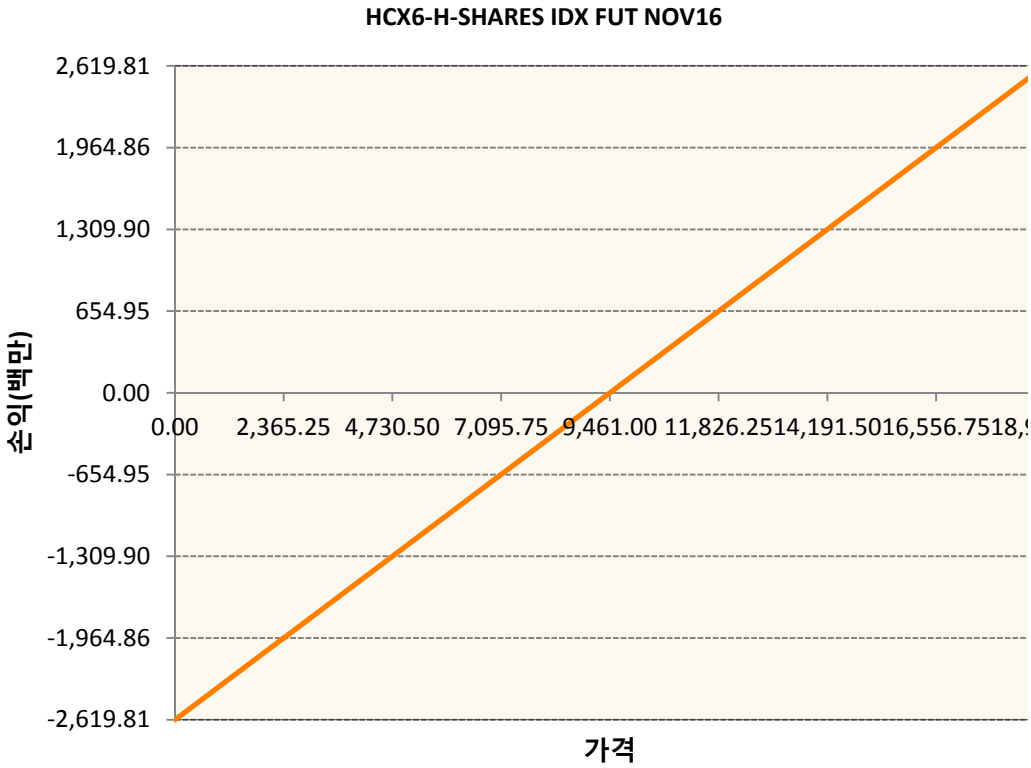
차이나인덱스모(주식-파생형)

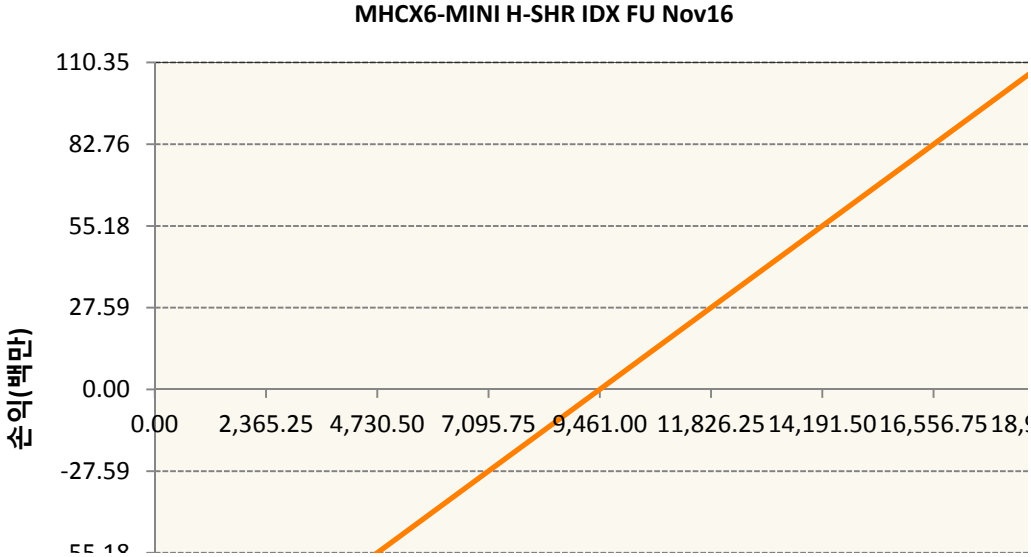
1. 계약금액

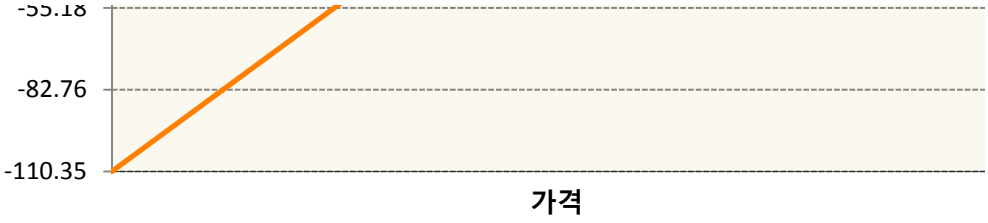
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,730	0	2,730	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCX6	H-SHARES IDX FUT NOV16	210
MHCX6	MINI H-SHR IDX FU Nov16	9

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	292

공시일	2016-11-07
기준일	2016-11-04

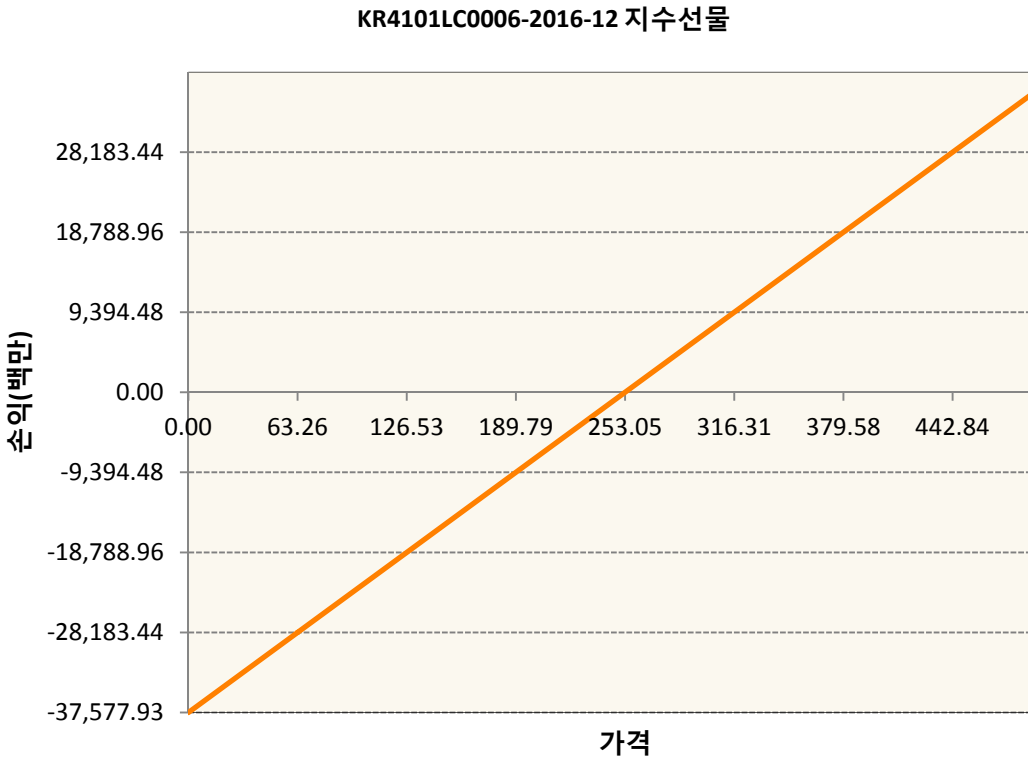
커버드콜(주식혼합-파생형)

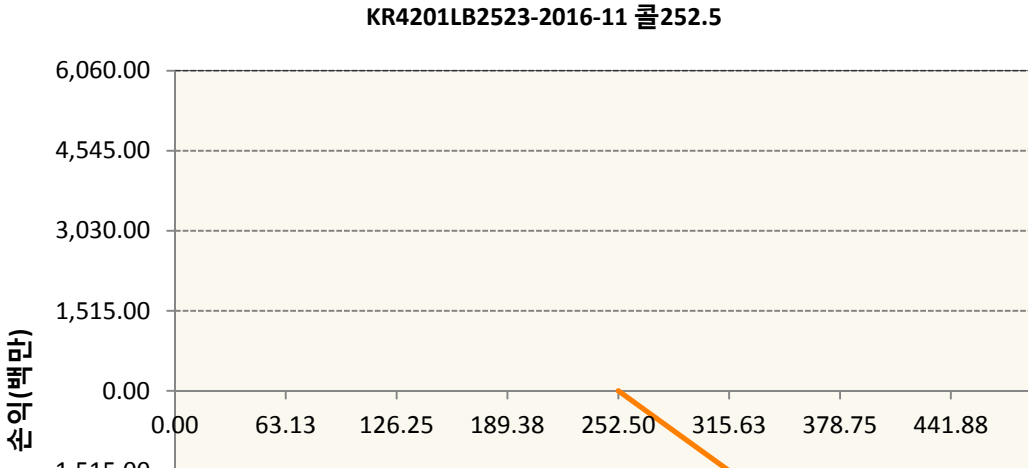
1. 계약금액

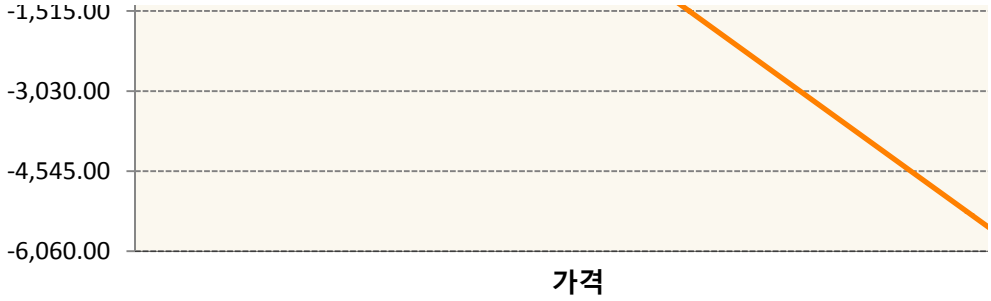
(단위:백만원)

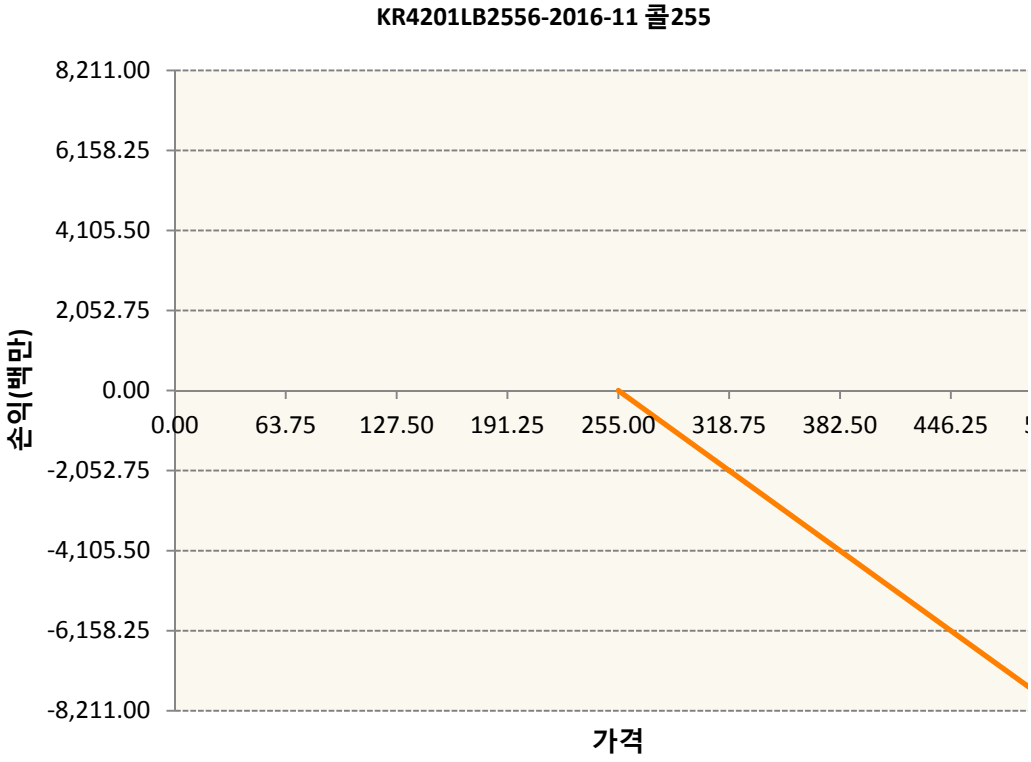
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	1,518	0	1,518	장내
신규	유가증권	옵션	0	307	-307	장내
누계	유가증권	선물	37,578	0	37,578	장내
누계	유가증권	옵션	0	14,271	-14,271	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101LC00 2016-12 지수선물							3,001
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-3,001	-3,001	-3,001	-3,001	-3,001	-3,001	-3,001
-5.33%	-2,000	-2,000	-2,000	-2,000	-2,000	-2,000	-2,000
-2.67%	-1,000	-1,000	-1,000	-1,000	-1,000	-1,000	-1,000
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	1,000	1,000	1,000	1,000	1,000	1,000	1,000
5.33%	2,000	2,000	2,000	2,000	2,000	2,000	2,000
8.00%	3,001	3,001	3,001	3,001	3,001	3,001	3,001
KR4201LB25 2016-11 콜252.5							2,143
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	289	289	289	289	289	289	289
-5.33%	289	289	288	287	285	282	278
-2.67%	274	266	256	244	231	217	202
0%	71	48	24	0	-24	-48	-71
2.67%	-542	-551	-561	-573	-587	-601	-617
5.33%	-1,334	-1,334	-1,336	-1,337	-1,340	-1,343	-1,348
8.00%	-2,142	-2,142	-2,142	-2,142	-2,142	-2,142	-2,143
KR4201LB25 2016-11 콜255							2,644

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	220	220	220	220	220	220	220
-5.33%	220	220	220	219	218	217	214
-2.67%	215	211	204	195	185	173	159
0%	86	58	29	0	-30	-60	-90
2.67%	-539	-561	-584	-609	-635	-662	-689
5.33%	-1,557	-1,560	-1,564	-1,569	-1,577	-1,586	-1,597
8.00%	-2,639	-2,639	-2,639	-2,640	-2,640	-2,642	-2,644

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

7,992

공시일	2016-11-07
기준일	2016-11-04

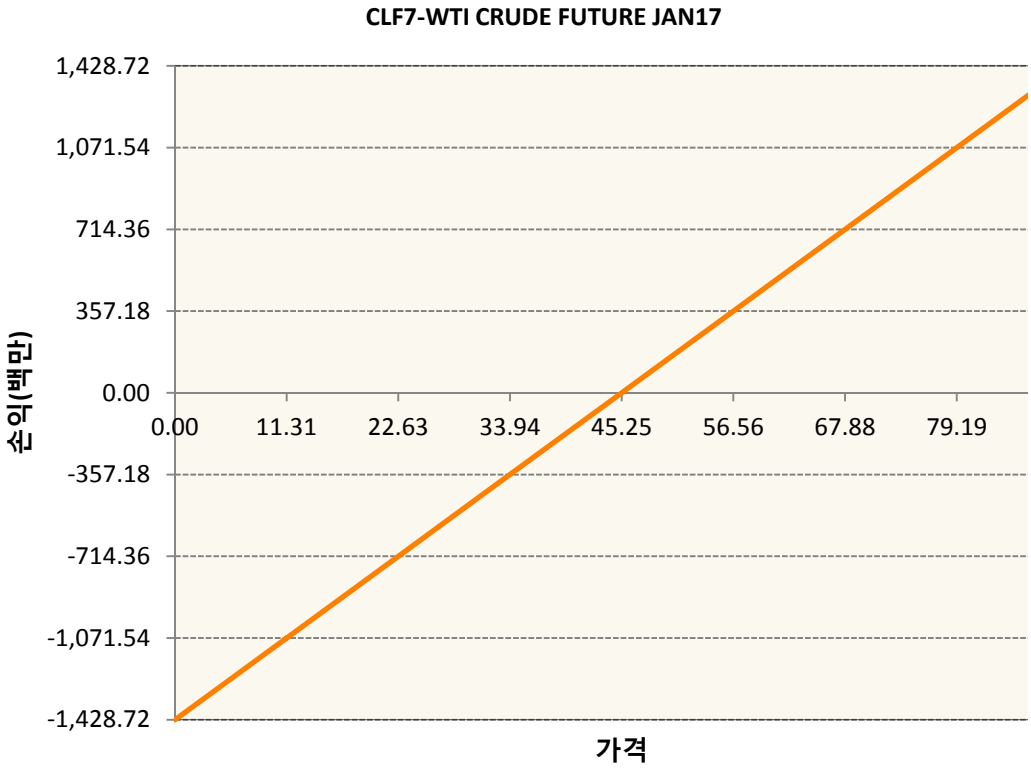
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

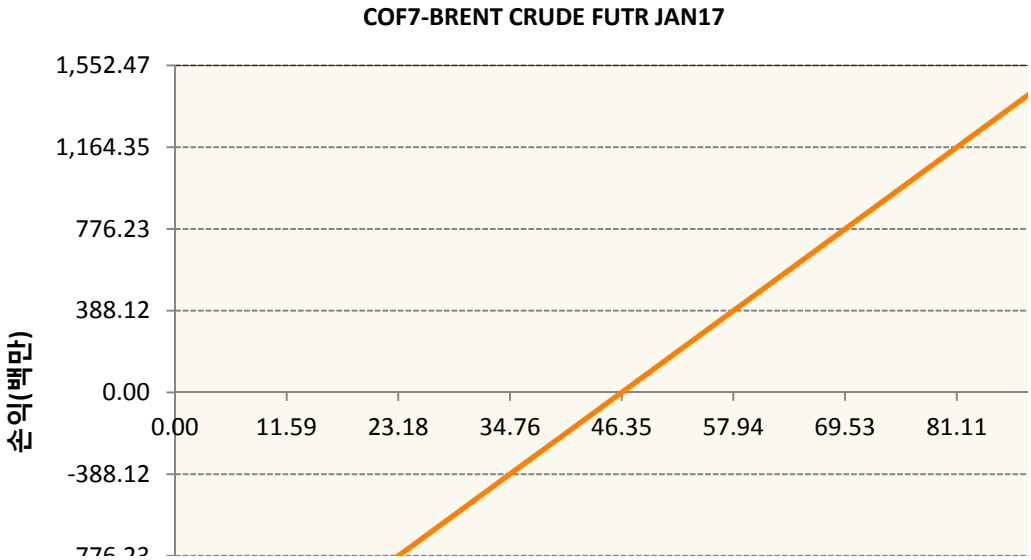
1. 계약금액

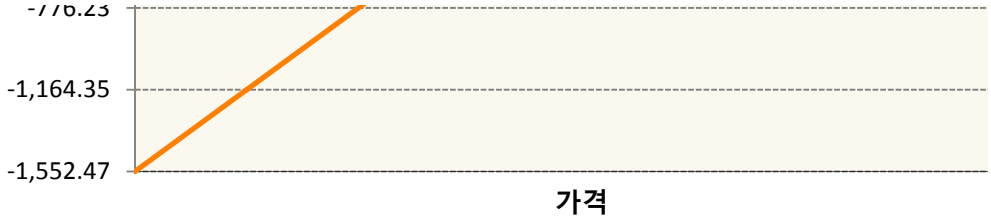
(단위:백만원)

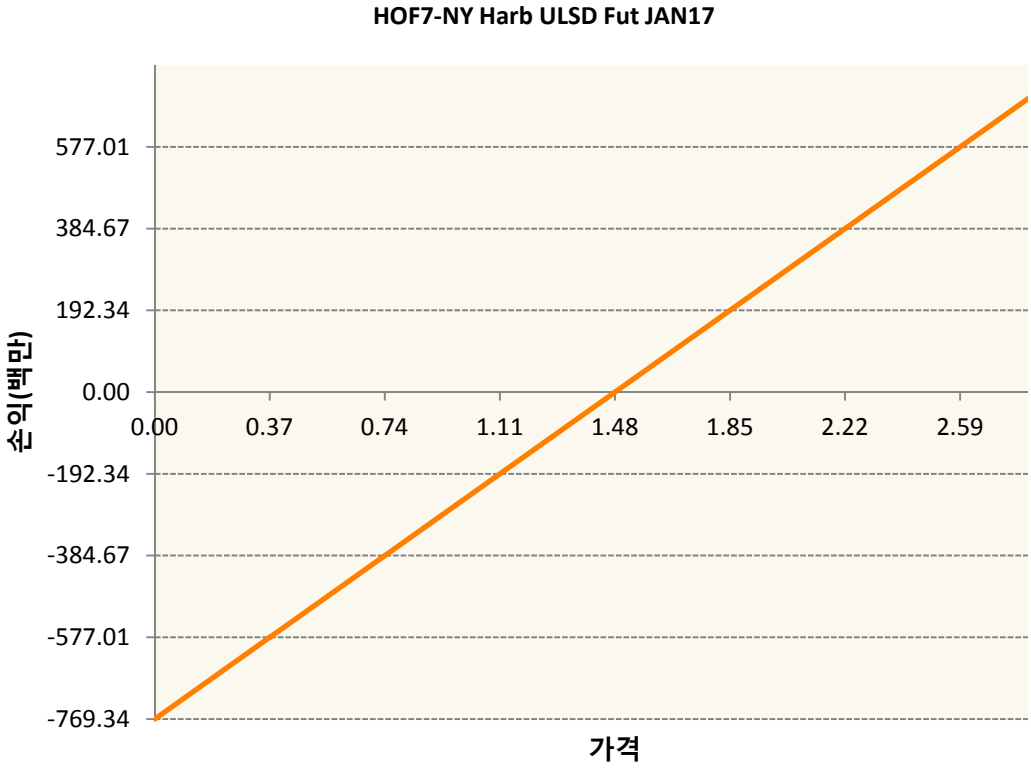
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	5,942	0	5,942	

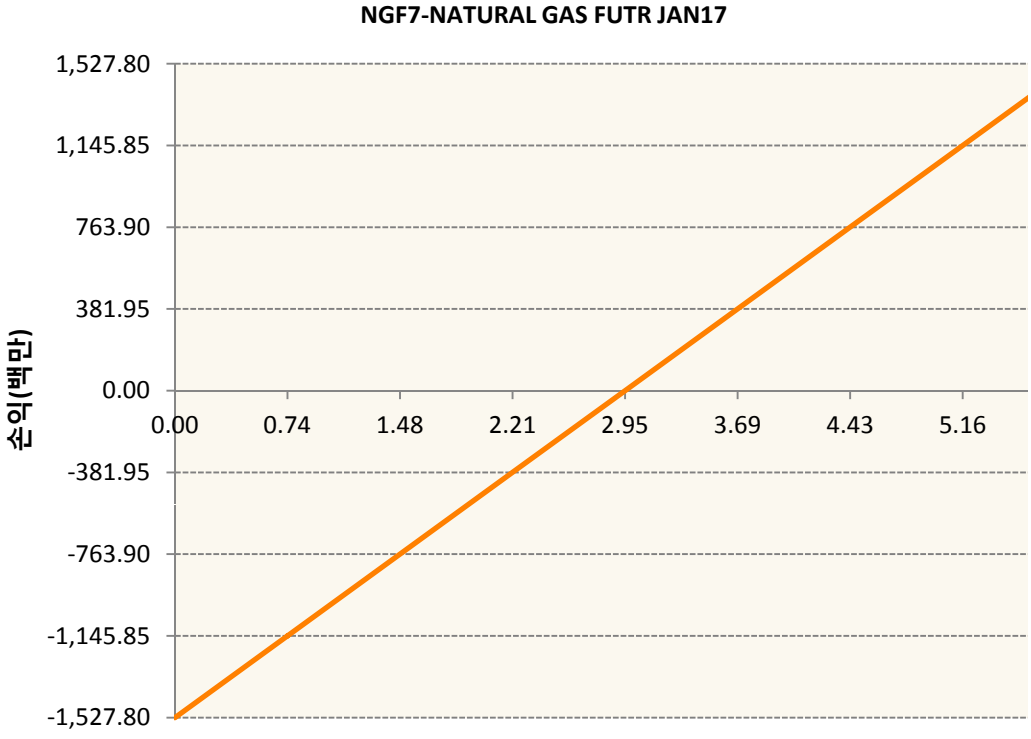
2. 만기시점의 손익구조



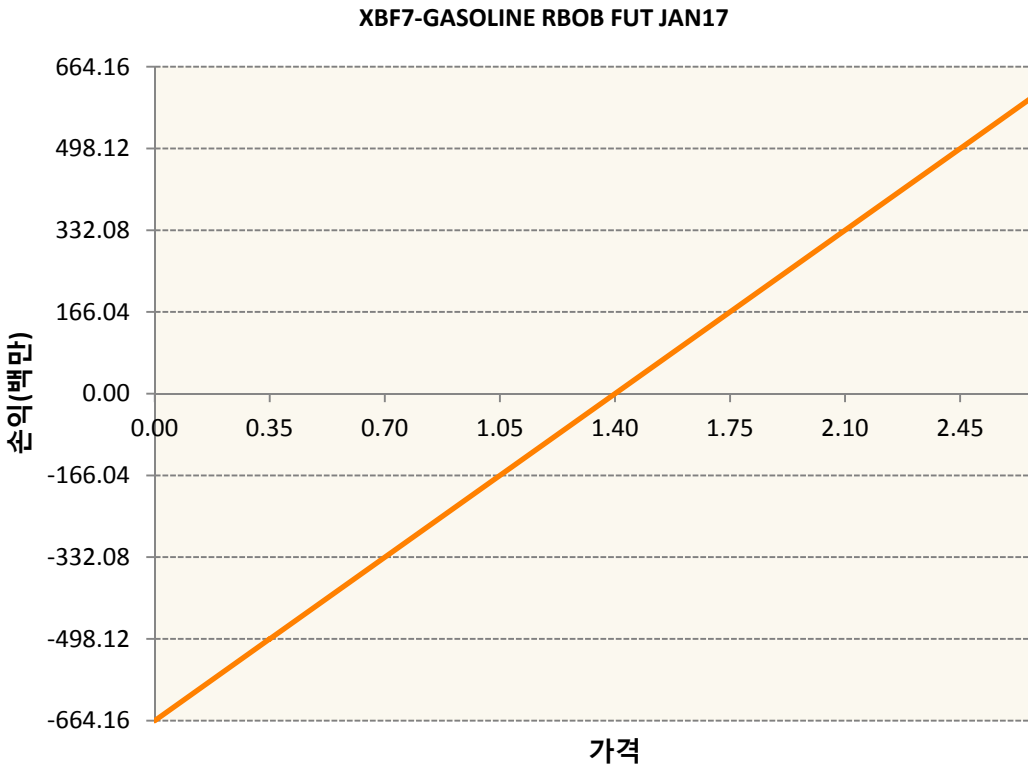



-1,164.35
-1,552.47
가격


HOF7-NY Harb ULSD Fut JAN17
577.01
384.67
192.34
0.00
-192.34
-384.67
-577.01
-769.34
0.00
0.37
0.74
1.11
1.48
1.85
2.22
2.59
순익(백만)
가격


NGF7-NATURAL GAS FUTR JAN17
1,527.80
1,145.85
763.90
381.95
0.00
-381.95
-763.90
-1,145.85
-1,527.80
0.00
0.74
1.48
2.21
2.95
3.69
4.43
5.16
순익(백만)

가격



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
CLF7	WTI CRUDE FUTURE JAN17	114
COF7	BRENT CRUDE FUTR JAN17	124
HOF7	NY Harb ULSD Fut JAN17	62
NGF7	NATURAL GAS FUTR JAN17	122
XBF7	GASOLINE RBOB FUT JAN17	53

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,064

공시일	2016-11-07
기준일	2016-11-04

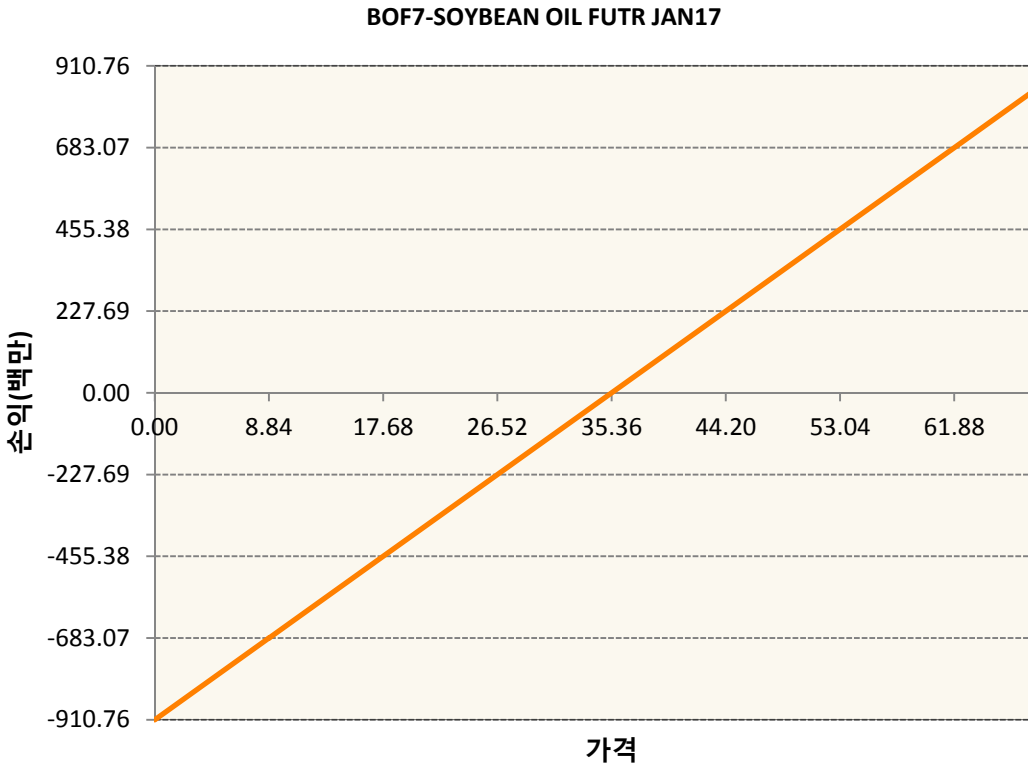
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

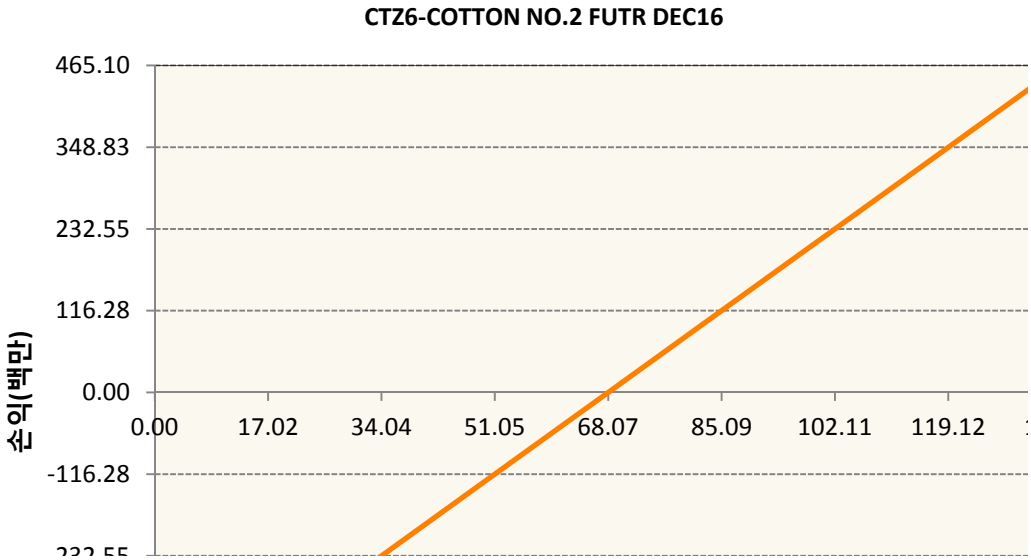
1. 계약금액

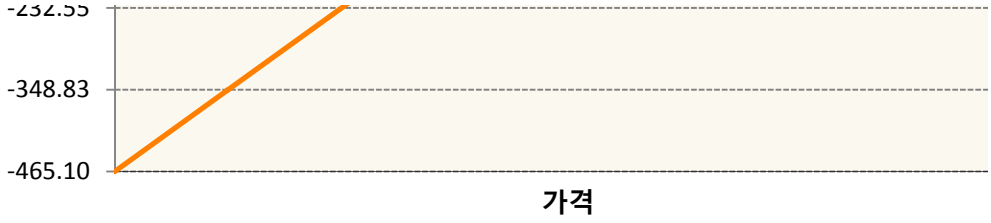
(단위:백만원)

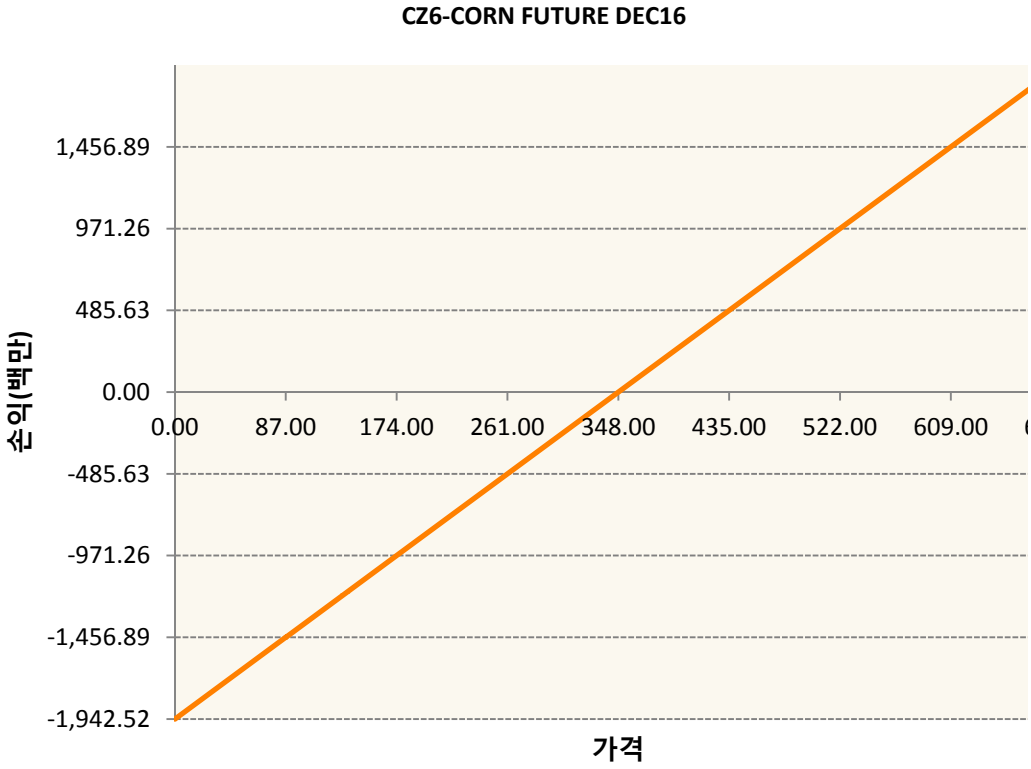
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	9,485	0	9,485	

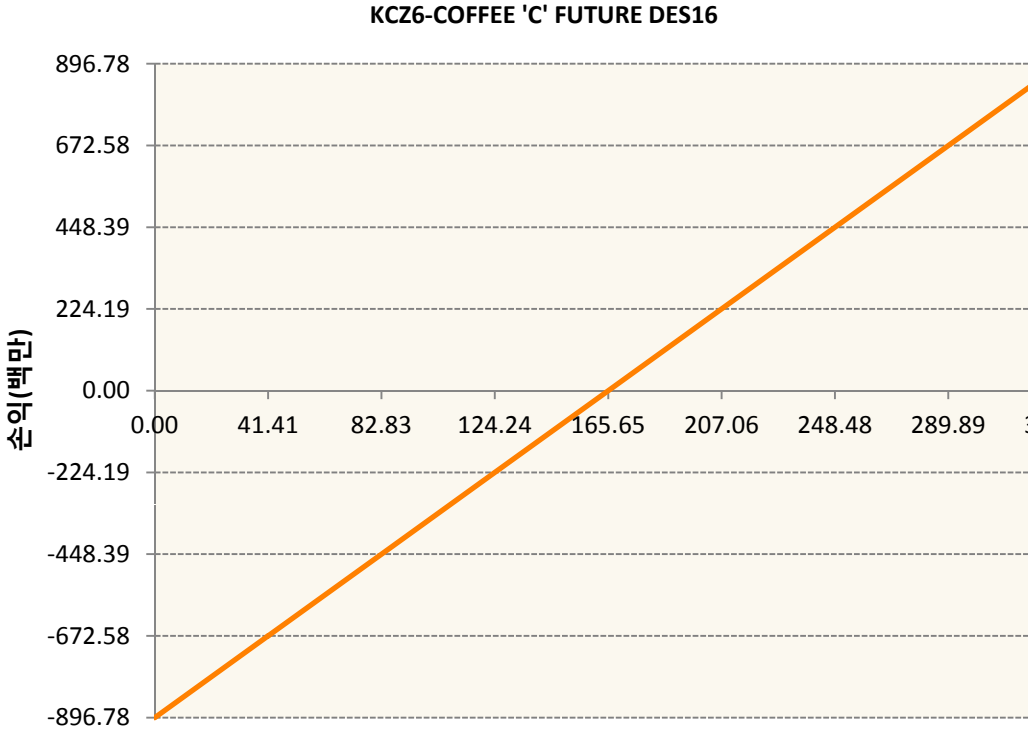
2. 만기시점의 손익구조



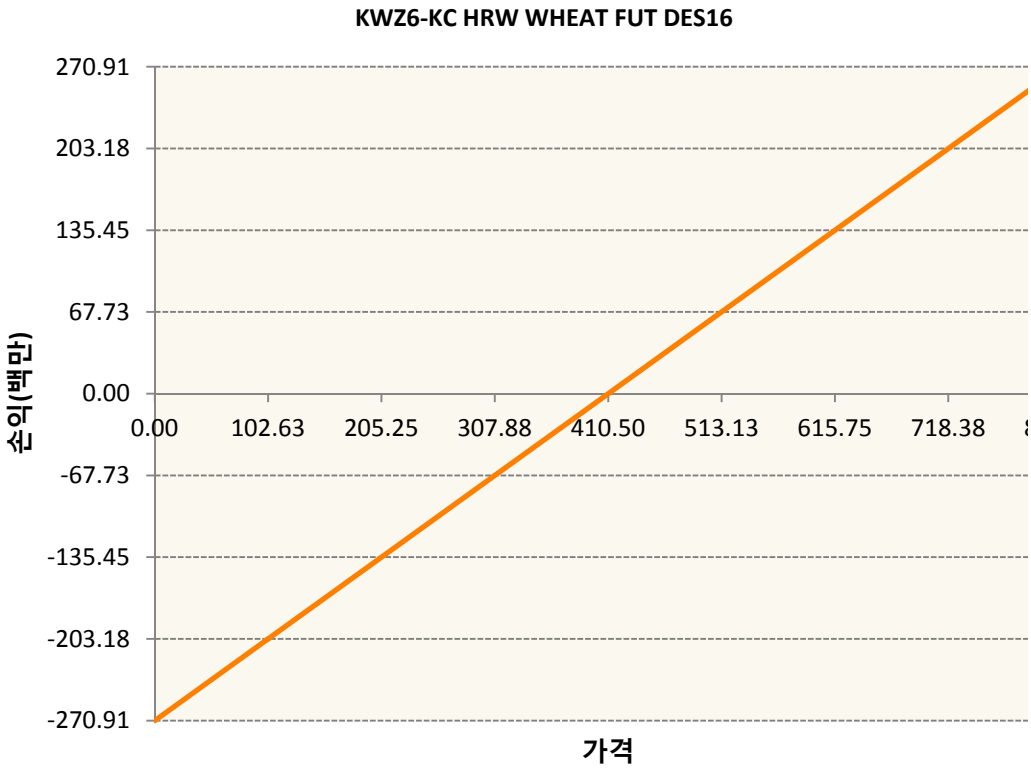


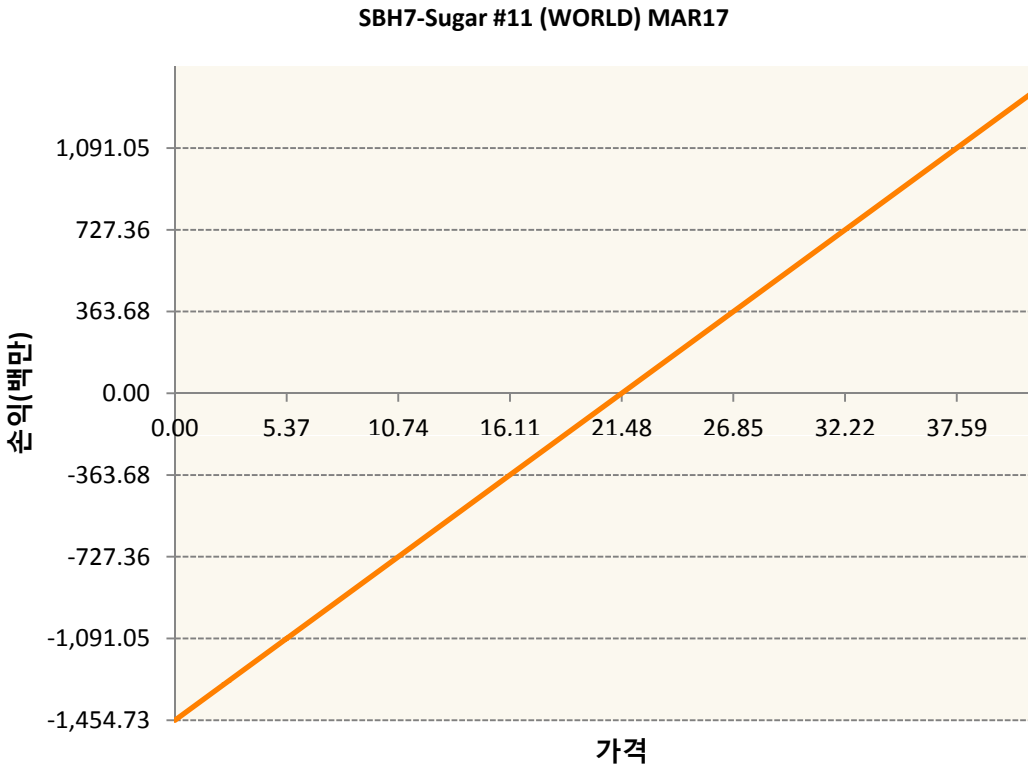

-348.83
-465.10
가격


CZ6-CORN FUTURE DEC16
1,456.89
971.26
485.63
0.00
-485.63
-971.26
-1,456.89
-1,942.52
0.00
87.00
174.00
261.00
348.00
435.00
522.00
609.00
손익(백만)
가격

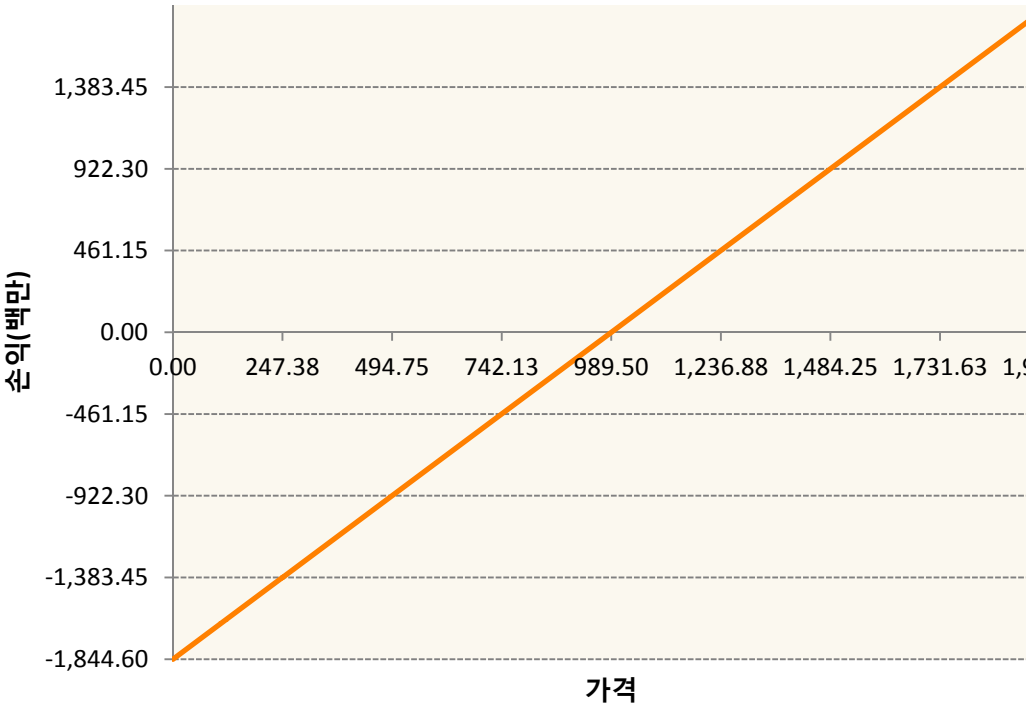

KCZ6-COFFEE 'C' FUTURE DES16
896.78
672.58
448.39
224.19
0.00
-224.19
-448.39
-672.58
-896.78
0.00
41.41
82.83
124.24
165.65
207.06
248.48
289.89
손익(백만)

가격

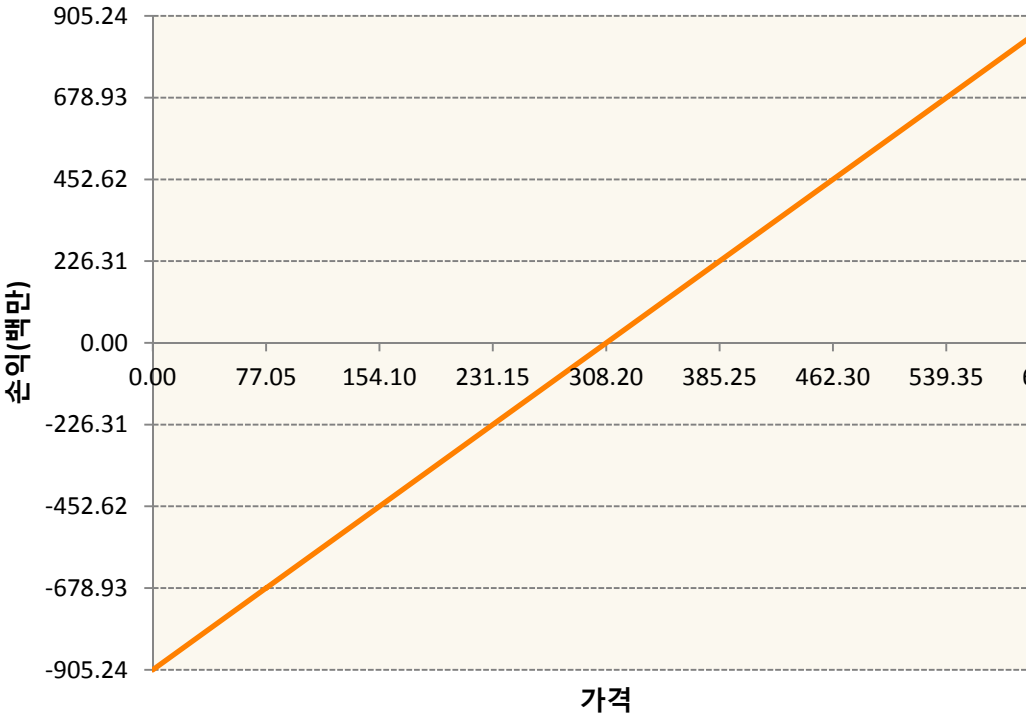

KWZ6-KC HRW WHEAT FUT DES16
270.91
203.18
135.45
67.73
0.00
-67.73
-135.45
-203.18
-270.91
0.00
102.63
205.25
307.88
410.50
513.13
615.75
718.38
손익(백만)
가격


SBH7-Sugar #11 (WORLD) MAR17
1,091.05
727.36
363.68
0.00
-363.68
-727.36
-1,091.05
-1,454.73
0.00
5.37
10.74
16.11
21.48
26.85
32.22
37.59
손익(백만)
가격

SF7-SOYBEAN FUTURE JAN17

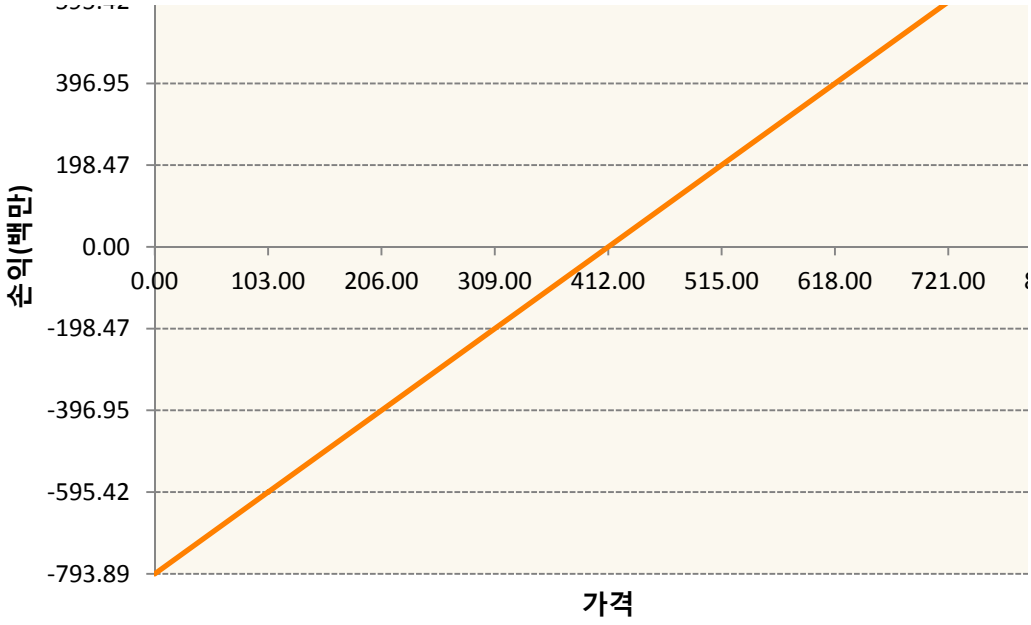


SMF7-SOYBEAN MEAL FUTR JAN17



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	72
KWZ6	KC HRW WHEAT FUT DES16	22
SBH7	Sugar #11 (WORLD) MAR17	116
SF7	SOYBEAN FUTURE JAN17	148
SMF7	SOYBEAN MEAL FUTR JAN17	72
WZ6	WHEAT FUTURE(CBT) DEC16	64

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	947