공시일	2016-11-08
기준일	2016-11-07

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	2016-11-08
기준일	2016-11-07

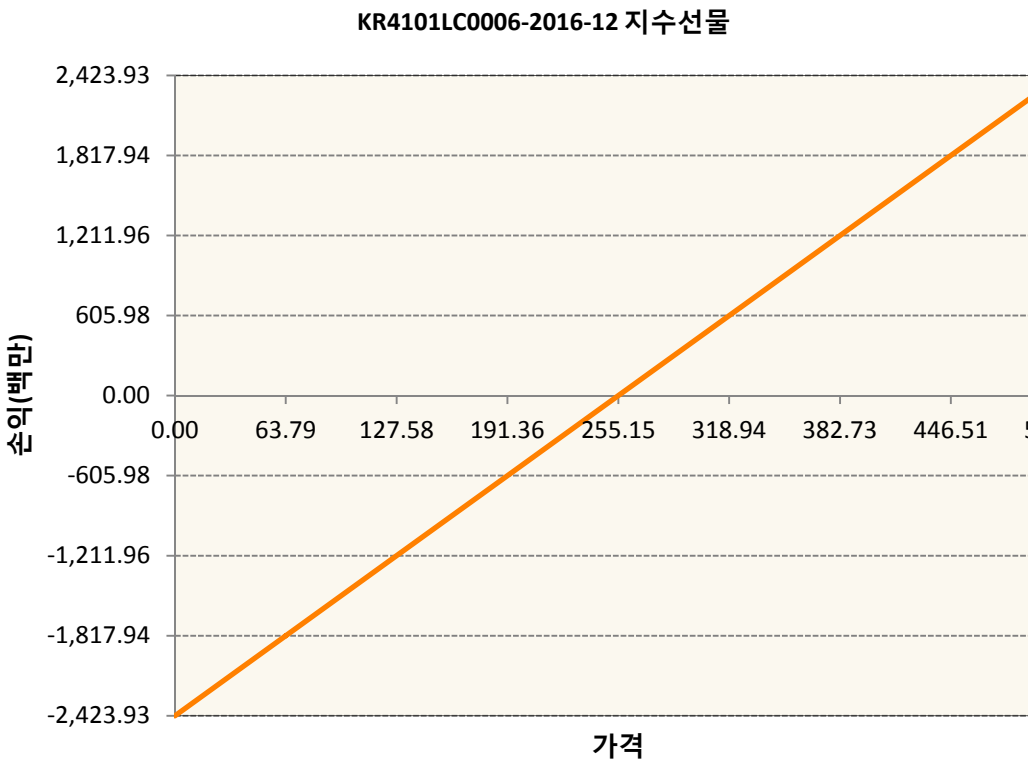
스마트인덱스모

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	128	0	128	장내
누계	유가증권	선물	2,424	0	2,424	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101LC00 2016-12 지수선물							193
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-193	-193	-193	-193	-193	-193	-193
-5.33%	-129	-129	-129	-129	-129	-129	-129
-2.67%	-64	-64	-64	-64	-64	-64	-64
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	64	64	64	64	64	64	64
5.33%	129	129	129	129	129	129	129
8.00%	193	193	193	193	193	193	193

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

147

공시일	2016-11-08
기준일	2016-11-07

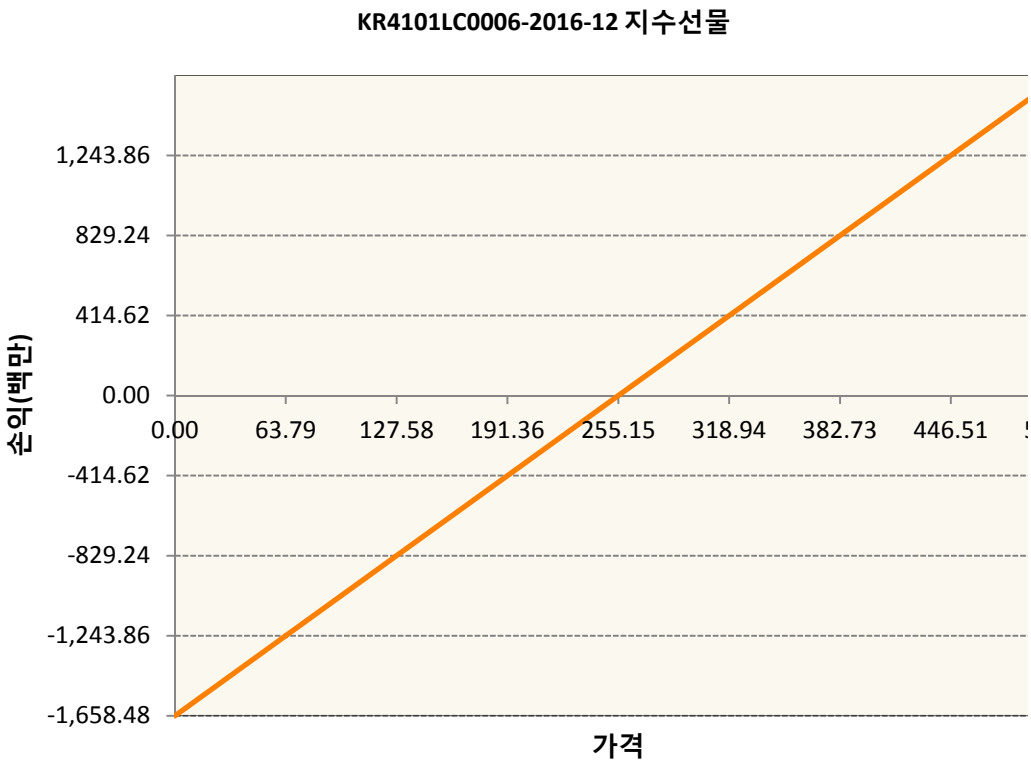
스마트레버리지목표전환형1호

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	1,658	0	1,658	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	2016-11-08
기준일	2016-11-07

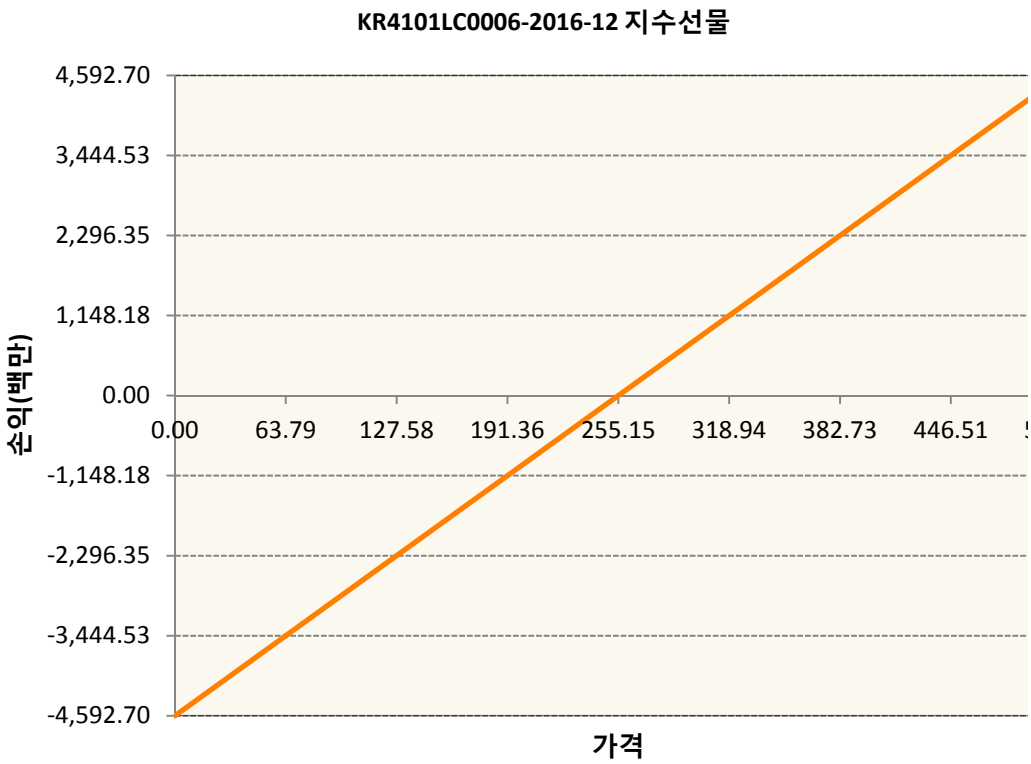
1.3배 레버리지 인덱스(주식-파생형)

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	4,593	0	4,593	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101LC00 2016-12 지수선물							367
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-367	-367	-367	-367	-367	-367	-367
-5.33%	-244	-244	-244	-244	-244	-244	-244
-2.67%	-122	-122	-122	-122	-122	-122	-122
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	122	122	122	122	122	122	122
5.33%	244	244	244	244	244	244	244
8.00%	367	367	367	367	367	367	367

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

278

공시일	2016-11-08
기준일	2016-11-07

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	855

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

691

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2016-11-08
기준일	2016-11-07

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	399

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

766

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2016-11-08
기준일	2016-11-07

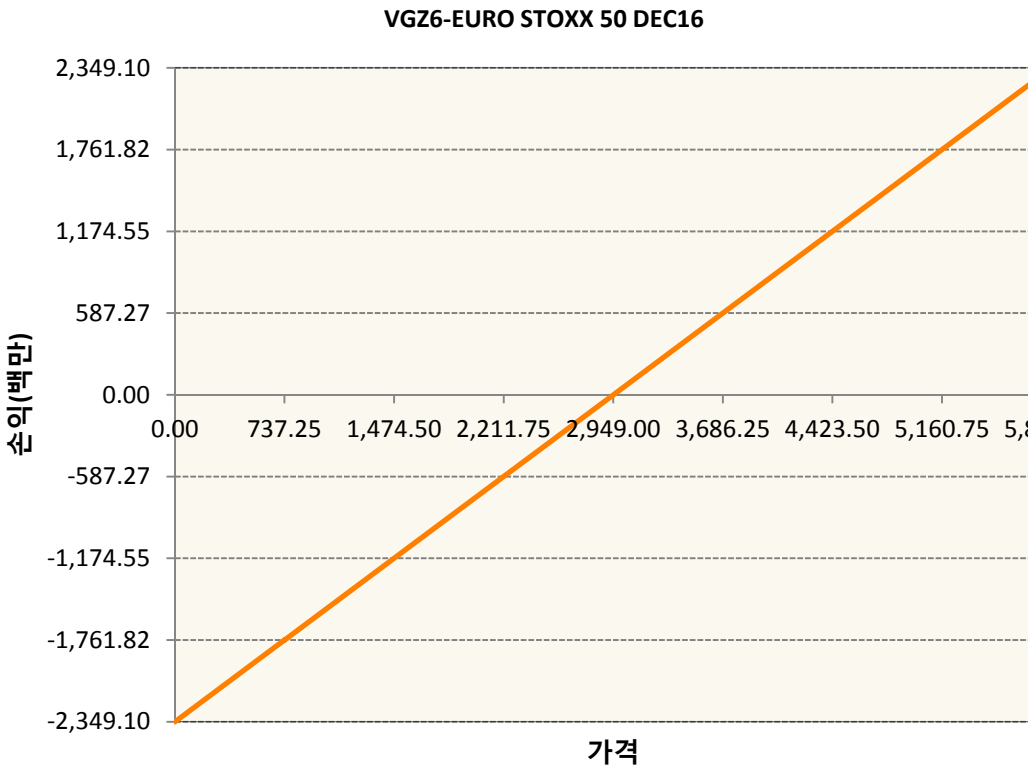
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,349	0	2,349	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGZ6	EURO STOXX 50 DEC16	188

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

(단위:백만원)

227

공시일	2016-11-08
기준일	2016-11-07

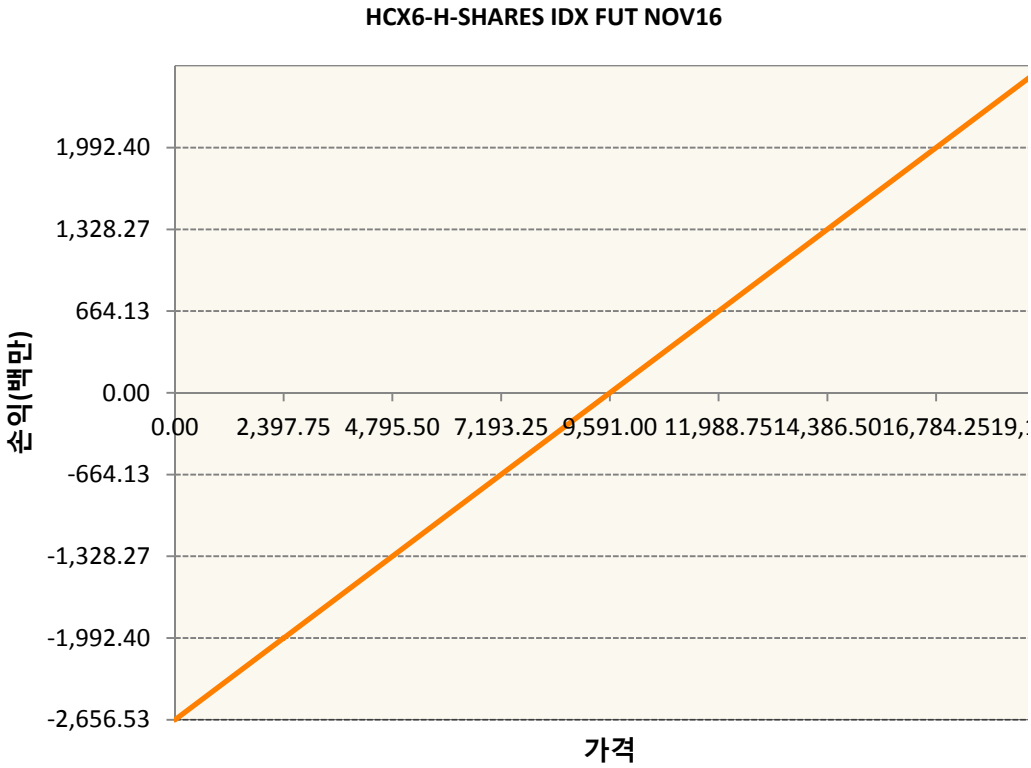
차이나인덱스모(주식-파생형)

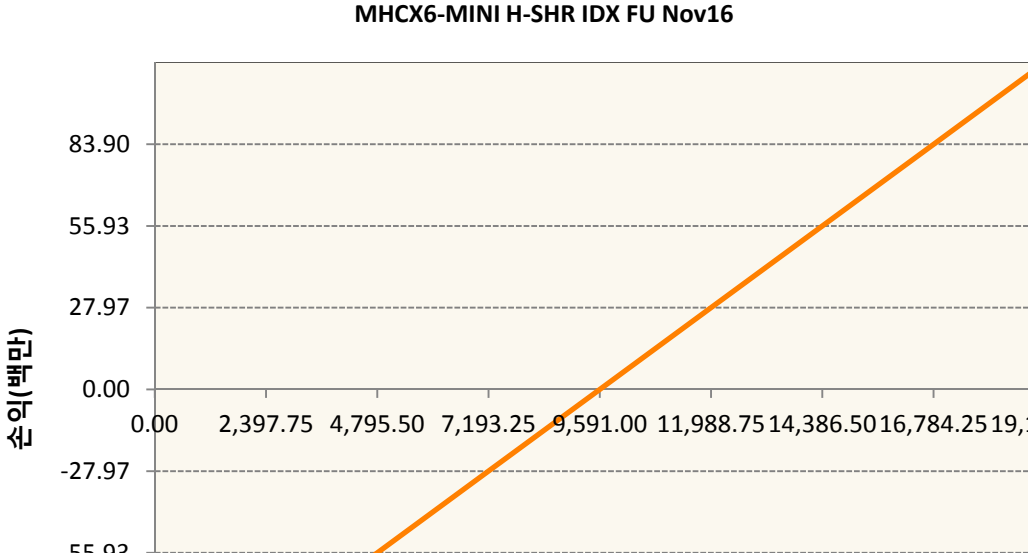
1. 계약금액

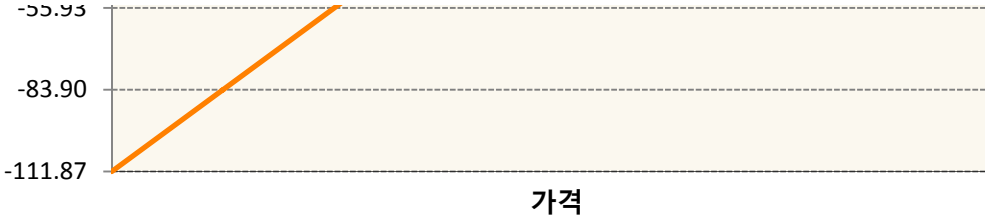
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,768	0	2,768	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCX6	H-SHARES IDX FUT NOV16	213
MHCX6	MINI H-SHR IDX FU Nov16	9

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	296

공시일	2016-11-08
기준일	2016-11-07

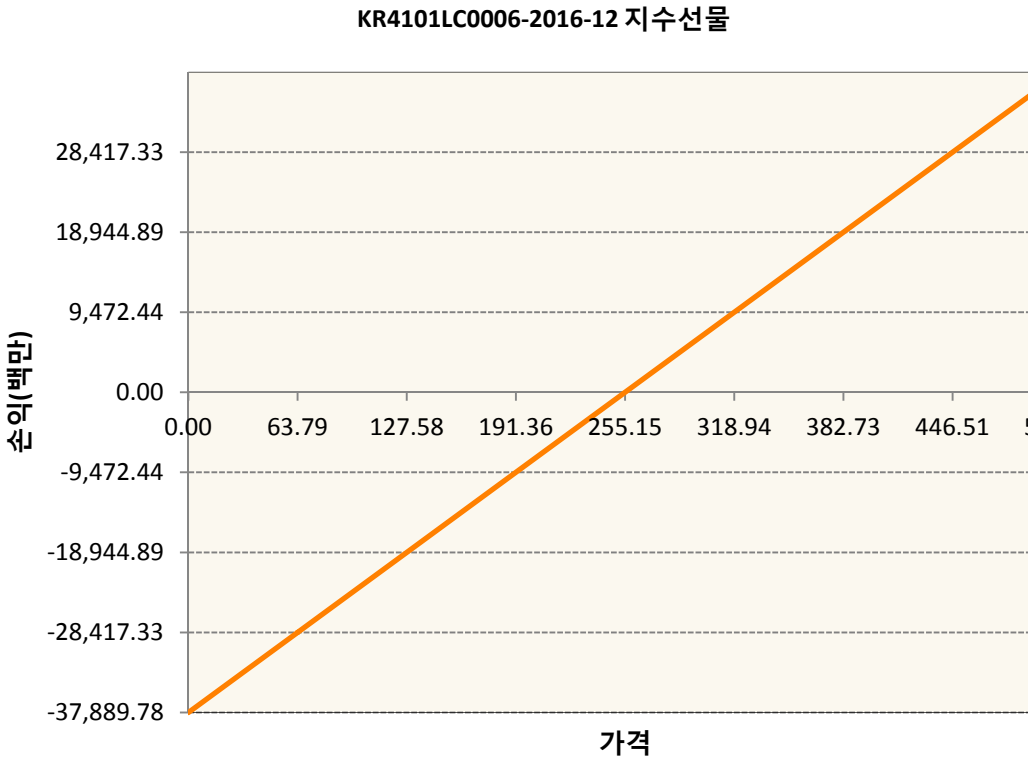
커버드콜(주식혼합-파생형)

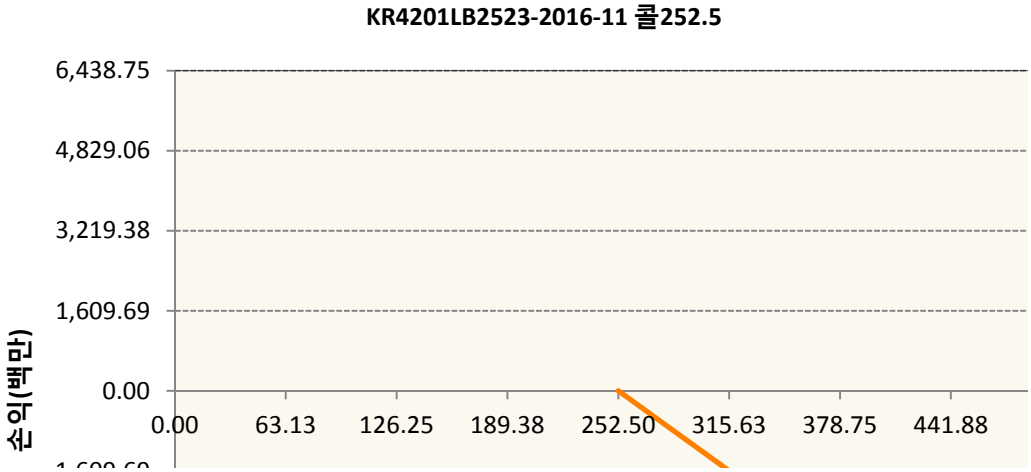
1. 계약금액

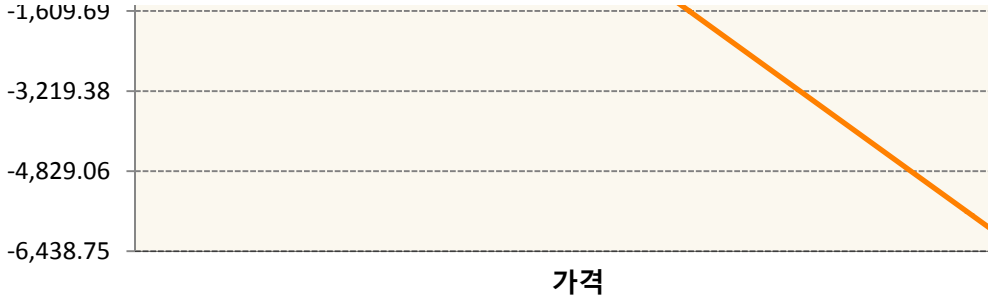
(단위:백만원)

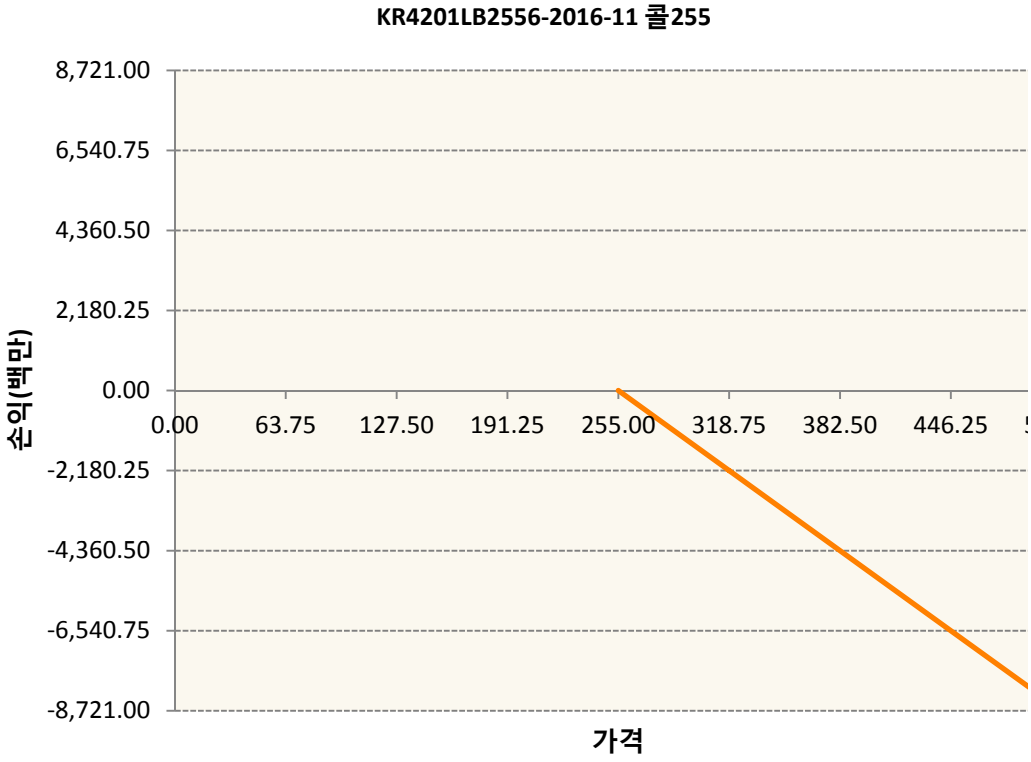
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	899	-899	장내
누계	유가증권	선물	37,890	0	37,890	장내
누계	유가증권	옵션	0	15,160	-15,160	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101LC00 2016-12 지수선물							3,025
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-3,025	-3,025	-3,025	-3,025	-3,025	-3,025	-3,025
-5.33%	-2,016	-2,016	-2,016	-2,016	-2,016	-2,016	-2,016
-2.67%	-1,008	-1,008	-1,008	-1,008	-1,008	-1,008	-1,008
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	1,008	1,008	1,008	1,008	1,008	1,008	1,008
5.33%	2,016	2,016	2,016	2,016	2,016	2,016	2,016
8.00%	3,025	3,025	3,025	3,025	3,025	3,025	3,025
KR4201LB25 2016-11 콜252.5							2,499
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	365	365	365	365	365	365	365
-5.33%	365	365	365	365	365	364	363
-2.67%	356	350	344	336	327	317	307
0%	43	29	15	0	-15	-30	-46
2.67%	-768	-768	-769	-770	-772	-775	-778
5.33%	-1,633	-1,633	-1,633	-1,633	-1,633	-1,633	-1,633
8.00%	-2,499	-2,499	-2,499	-2,499	-2,499	-2,499	-2,499
KR4201LB25 2016-11 콜255							3,171

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	242	242	242	242	242	242	242
-5.33%	242	242	242	242	242	242	242
-2.67%	241	239	236	233	228	221	214
0%	68	46	23	0	-23	-46	-69
2.67%	-853	-856	-861	-867	-875	-884	-894
5.33%	-2,010	-2,010	-2,010	-2,010	-2,011	-2,011	-2,012
8.00%	-3,171	-3,171	-3,171	-3,171	-3,171	-3,171	-3,171

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

10,202

공시일	2016-11-08
기준일	2016-11-07

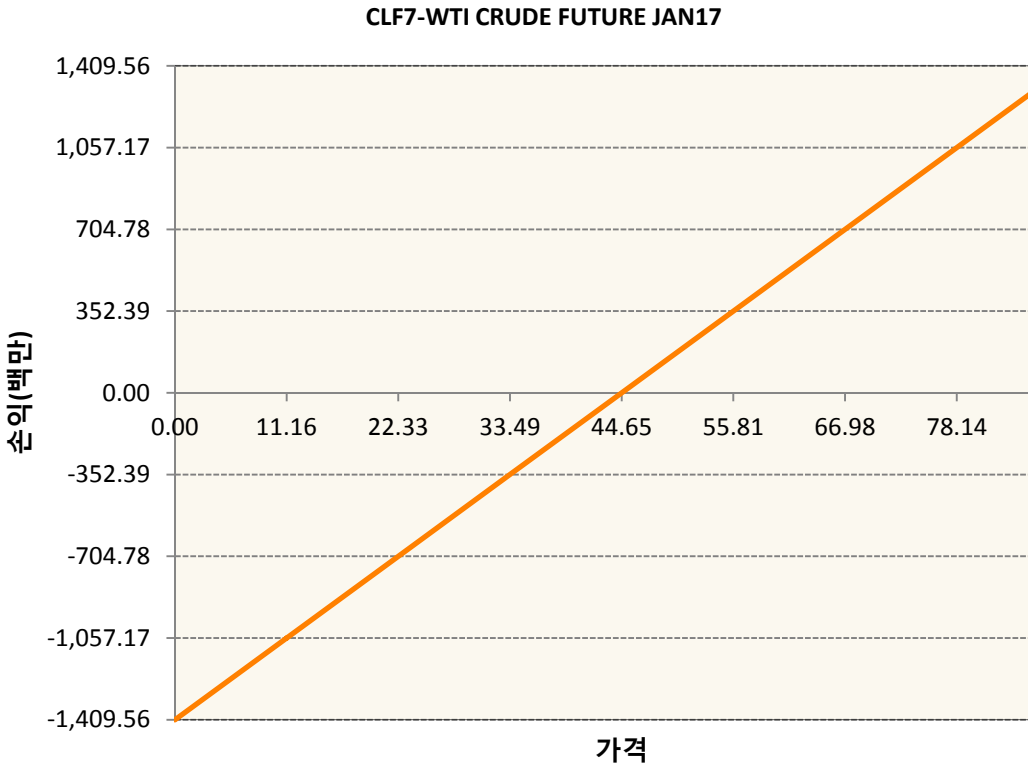
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

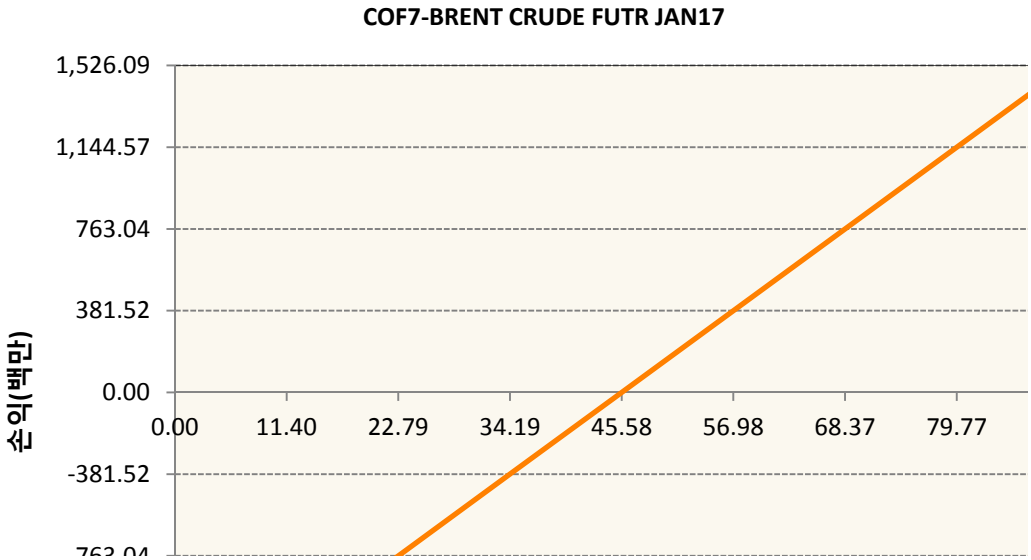
1. 계약금액

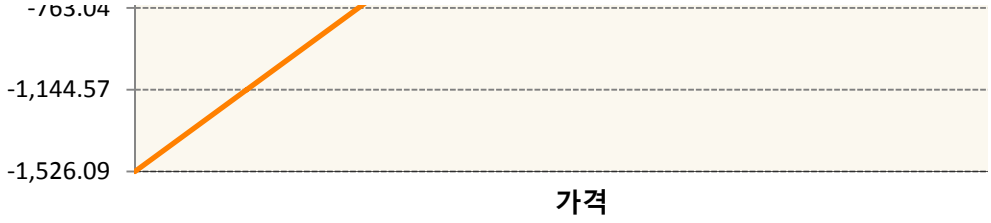
(단위:백만원)

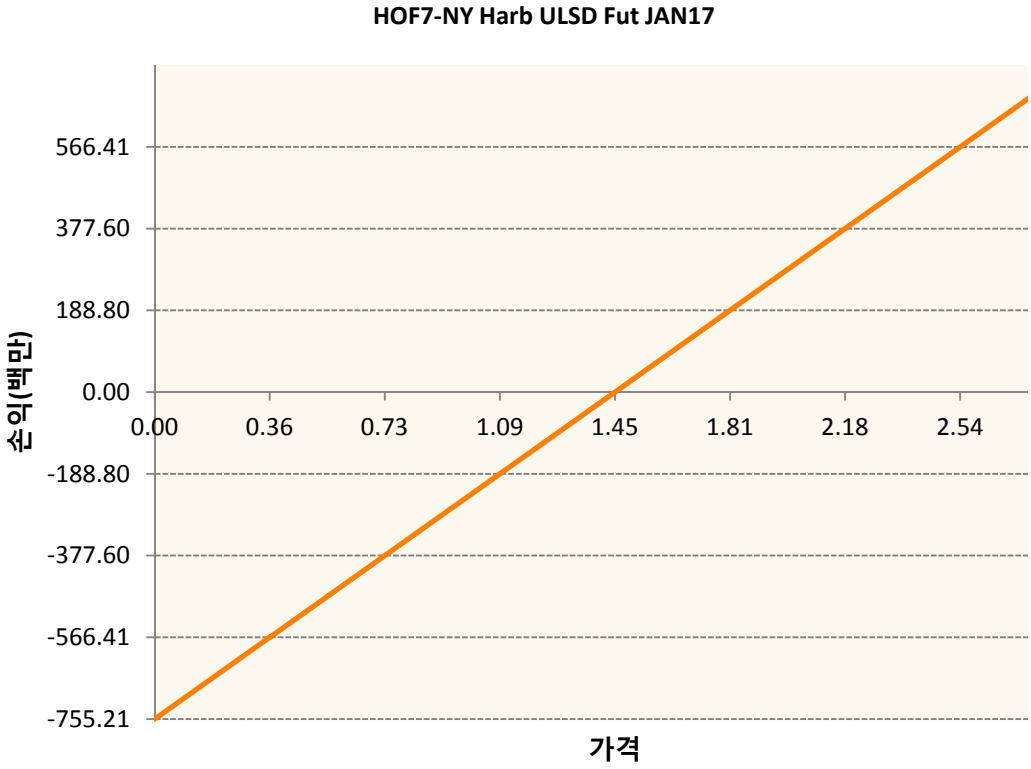
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	5,859	0	5,859	

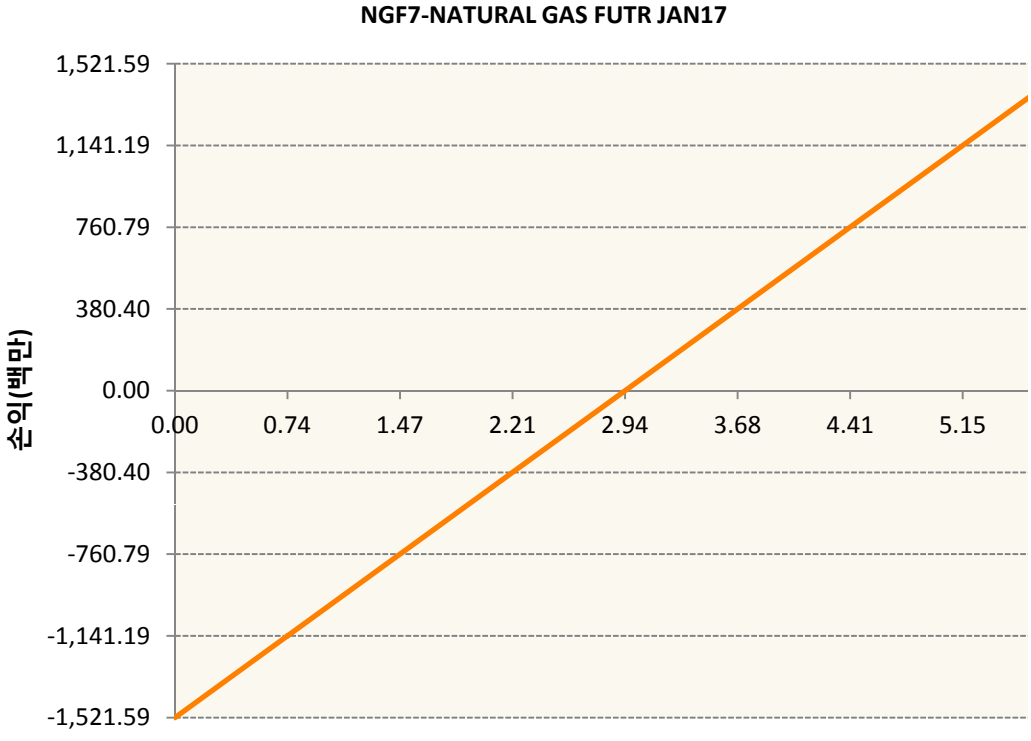
2. 만기시점의 손익구조



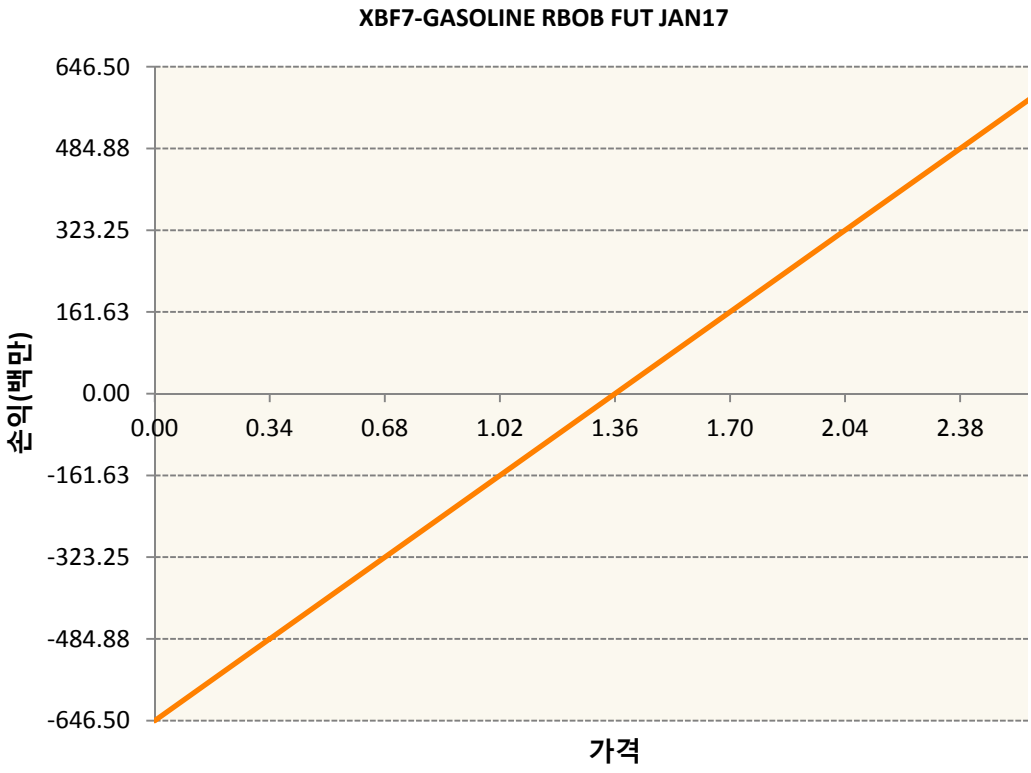



-763.04
-1,144.57
-1,526.09
가격


HOF7-NY Harb ULSD Fut JAN17
566.41
377.60
188.80
0.00
-188.80
-377.60
-566.41
-755.21
0.00
0.36
0.73
1.09
1.45
1.81
2.18
2.54
손익(백만)
가격


NGF7-NATURAL GAS FUTR JAN17
1,521.59
1,141.19
760.79
380.40
0.00
-380.40
-760.79
-1,141.19
-1,521.59
0.00
0.74
1.47
2.21
2.94
3.68
4.41
5.15
손익(백만)

가격



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
CLF7	WTI CRUDE FUTURE JAN17	113
COF7	BRENT CRUDE FUTR JAN17	122
HOF7	NY Harb ULSD Fut JAN17	60
NGF7	NATURAL GAS FUTR JAN17	122
XBF7	GASOLINE RBOB FUT JAN17	52

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,049

공시일	2016-11-08
기준일	2016-11-07

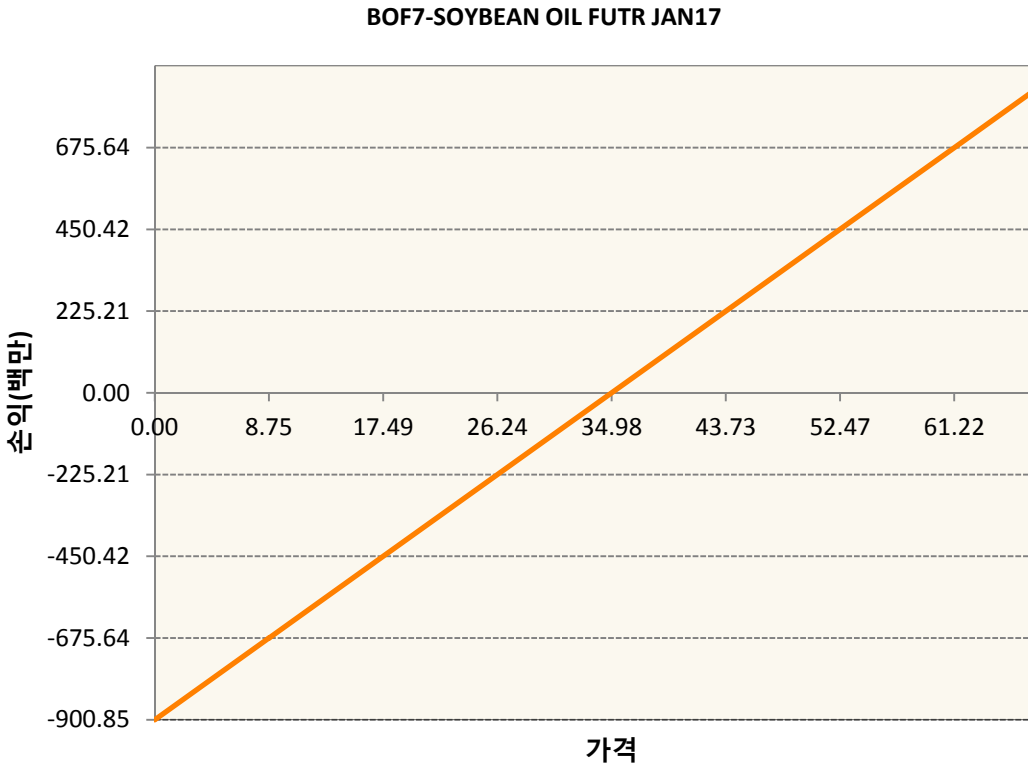
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

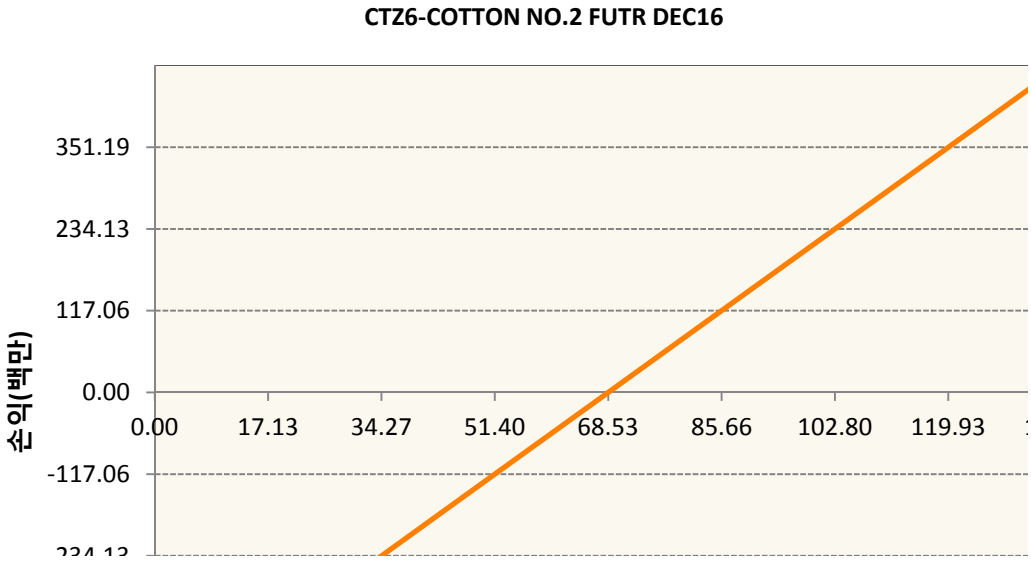
1. 계약금액

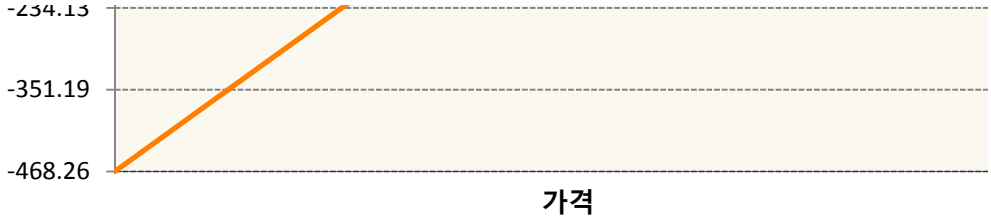
(단위:백만원)

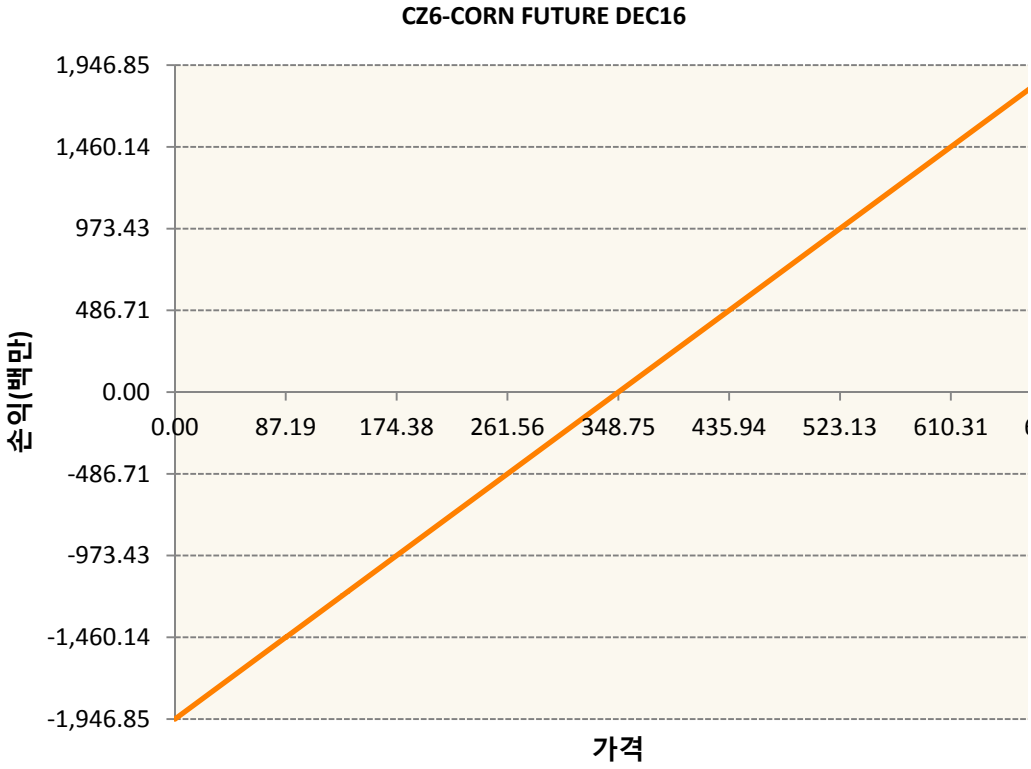
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	9,546	0	9,546	

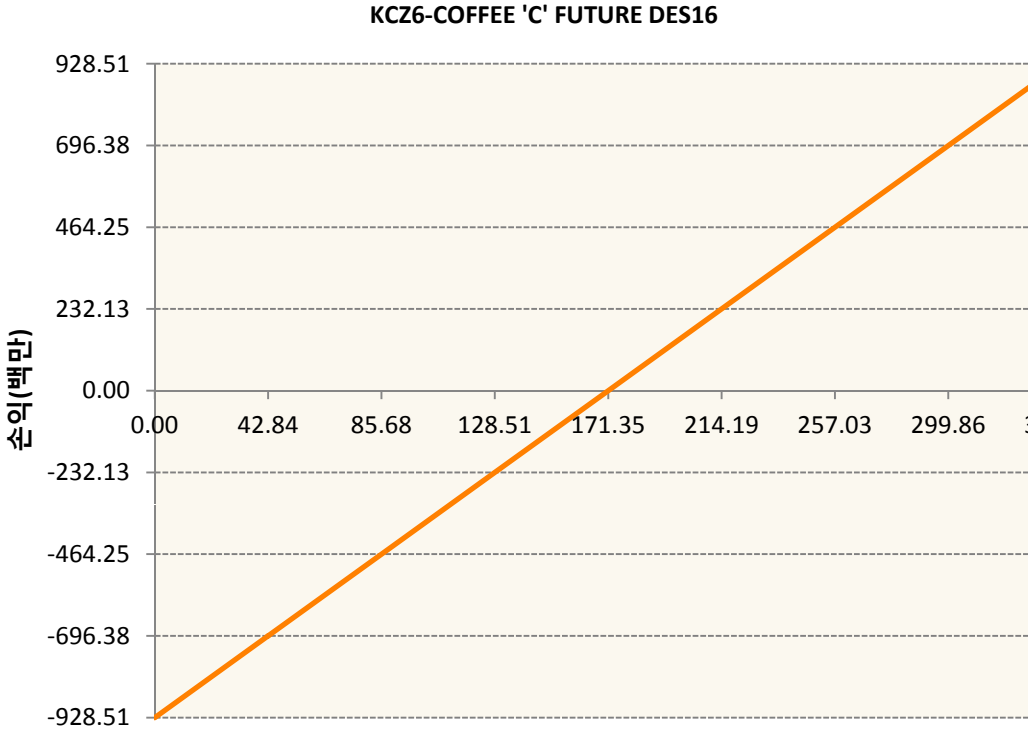
2. 만기시점의 손익구조





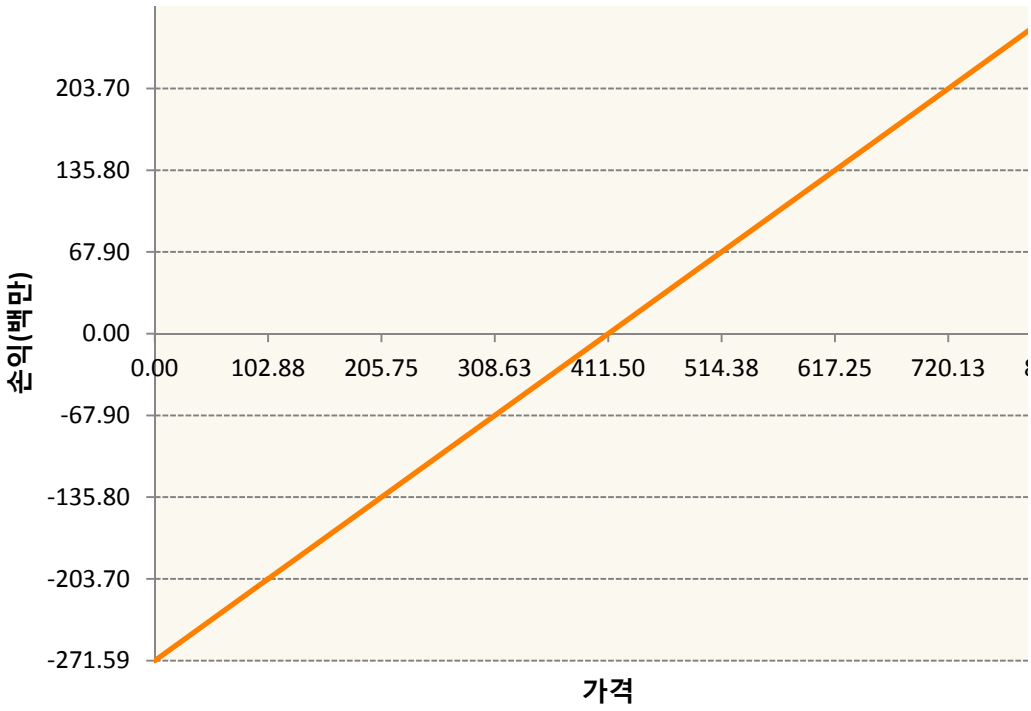

-234.13
-351.19
-468.26
가격


CZ6-CORN FUTURE DEC16
1,946.85
1,460.14
973.43
486.71
0.00
-486.71
-973.43
-1,460.14
-1,946.85
0.00
87.19
174.38
261.56
348.75
435.94
523.13
610.31
순익(백만)
가격

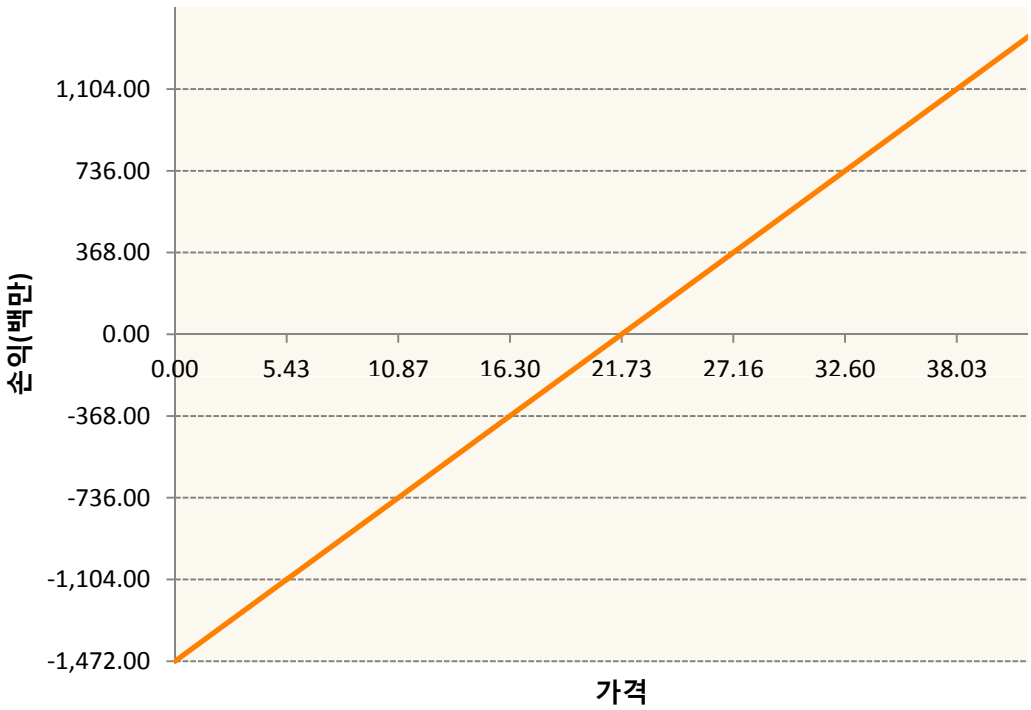

KCZ6-COFFEE 'C' FUTURE DES16
928.51
696.38
464.25
232.13
0.00
-232.13
-464.25
-696.38
-928.51
0.00
42.84
85.68
128.51
171.35
214.19
257.03
299.86
순익(백만)

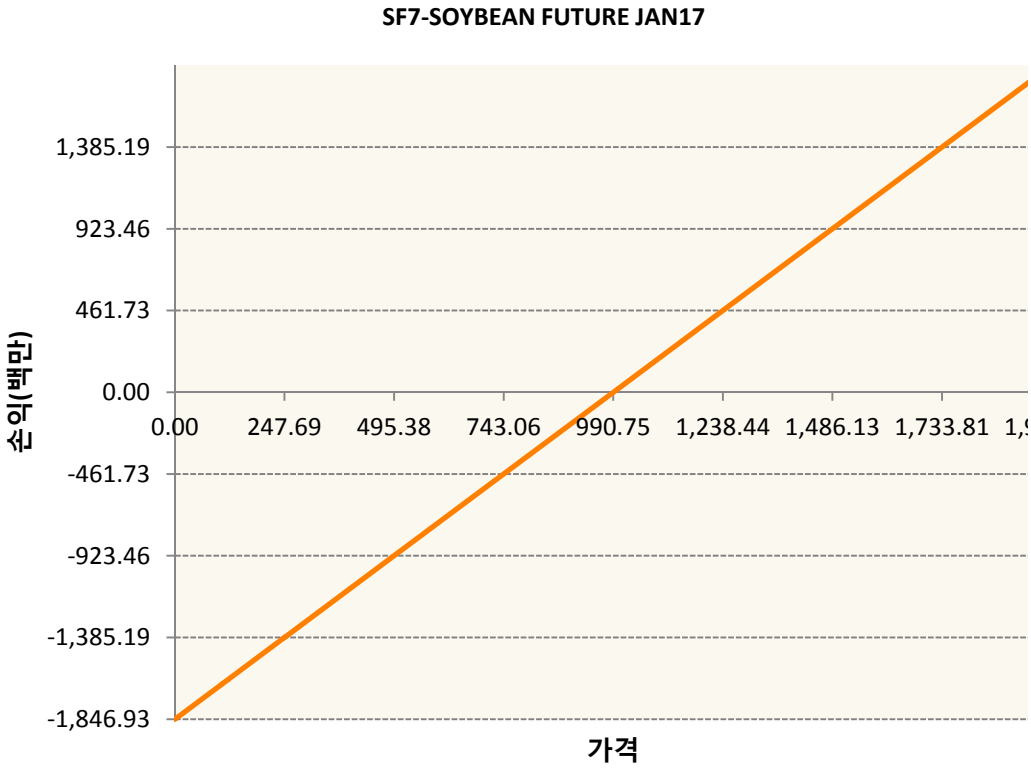
가격

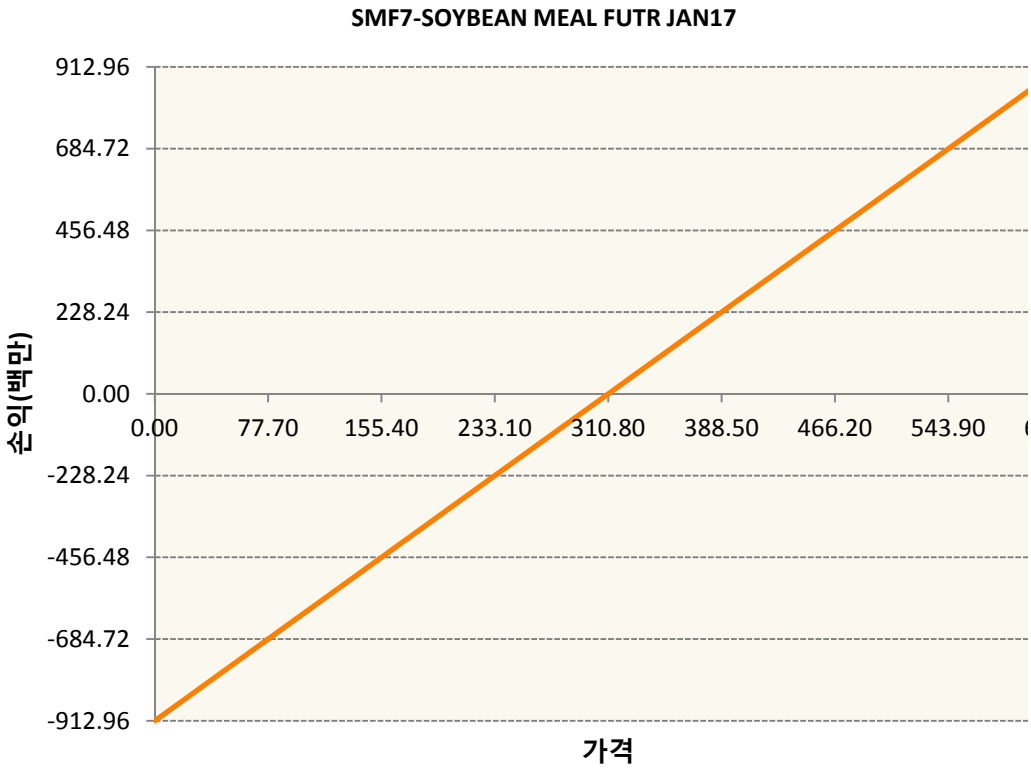
KWZ6-KC HRW WHEAT FUT DES16



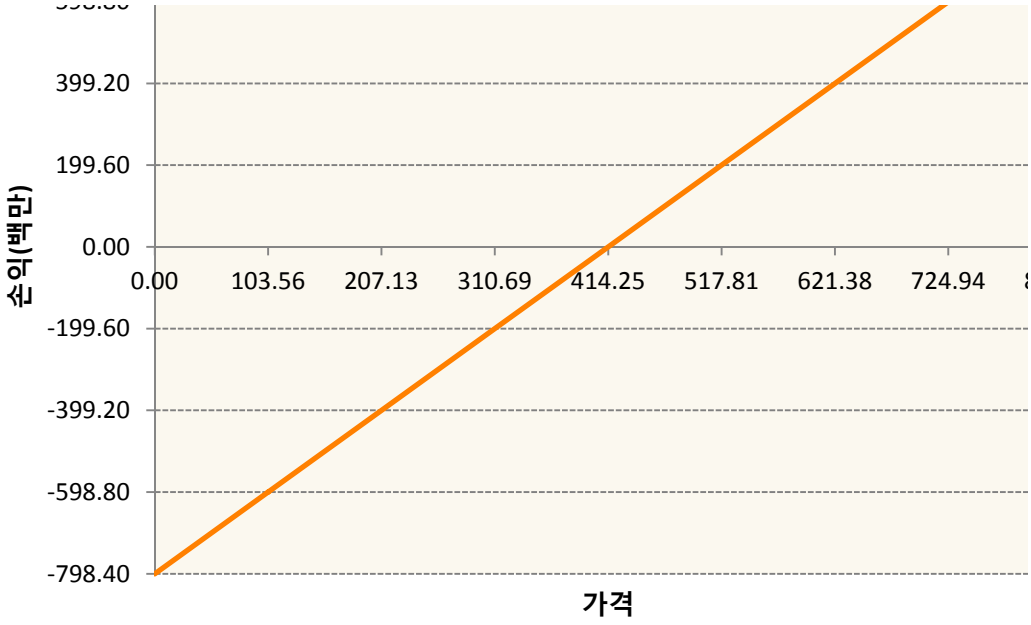
SBH7-Sugar #11 (WORLD) MAR17




SF7-SOYBEAN FUTURE JAN17
1,385.19
923.46
461.73
0.00
-461.73
-923.46
-1,385.19
-1,846.93
0.00
247.69
495.38
743.06
990.75
1,238.44
1,486.13
1,733.81
손익(백만)
가격


SMF7-SOYBEAN MEAL FUTR JAN17
912.96
684.72
456.48
228.24
0.00
-228.24
-456.48
-684.72
-912.96
0.00
77.70
155.40
233.10
310.80
388.50
466.20
543.90
손익(백만)
가격


WZ6-WHEAT FUTURE(CBT) DEC16
798.40
598.80



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	74
KWZ6	KC HRW WHEAT FUT DES16	22
SBH7	Sugar #11 (WORLD) MAR17	118
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)
	954