공시일	2016-11-09
기준일	2016-11-08

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	2016-11-09
기준일	2016-11-08

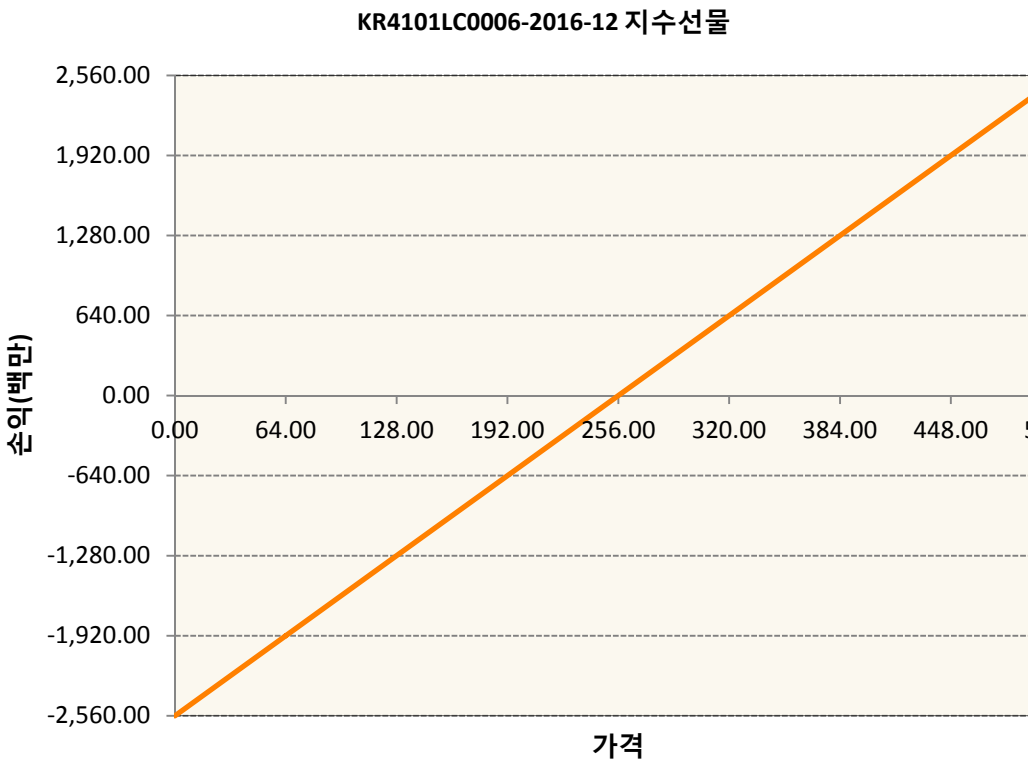
스마트인덱스모

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	2,560	0	2,560	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101LC00 2016-12 지수선물							204
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-204	-204	-204	-204	-204	-204	-204
-5.33%	-136	-136	-136	-136	-136	-136	-136
-2.67%	-68	-68	-68	-68	-68	-68	-68
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	68	68	68	68	68	68	68
5.33%	136	136	136	136	136	136	136
8.00%	204	204	204	204	204	204	204

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

155

공시일	2016-11-09
기준일	2016-11-08

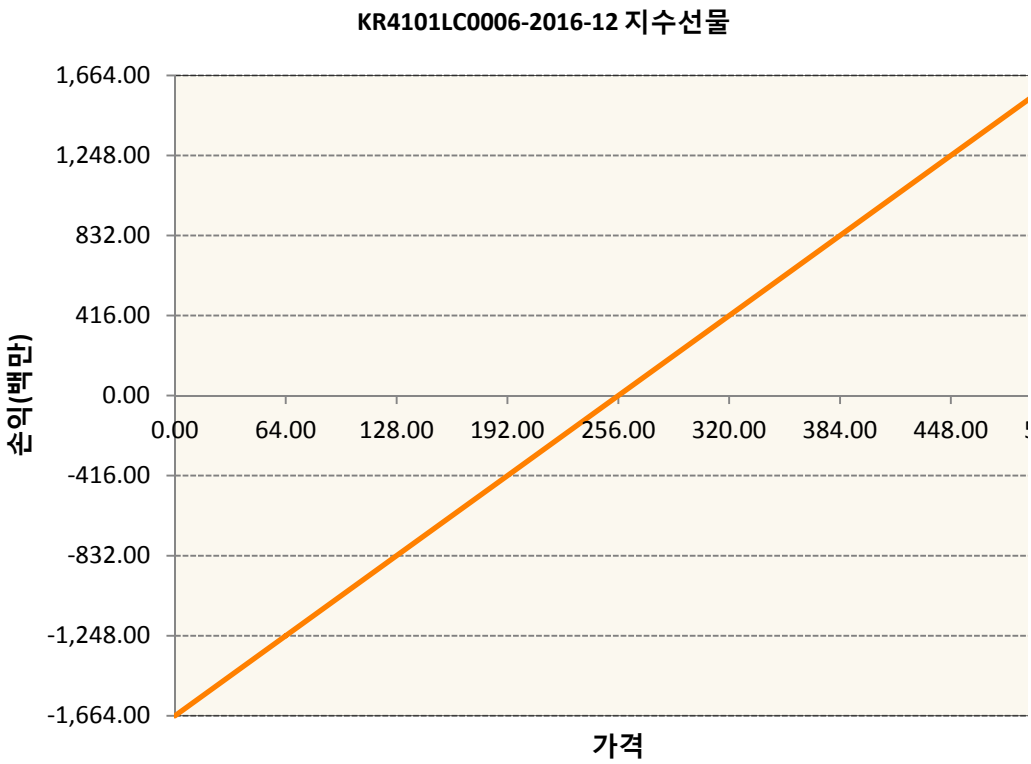
스마트레버리지목표전환형1호

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	1,664	0	1,664	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%	-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%	133	133	133	133	133	133	133

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

101

공시일	2016-11-09
기준일	2016-11-08

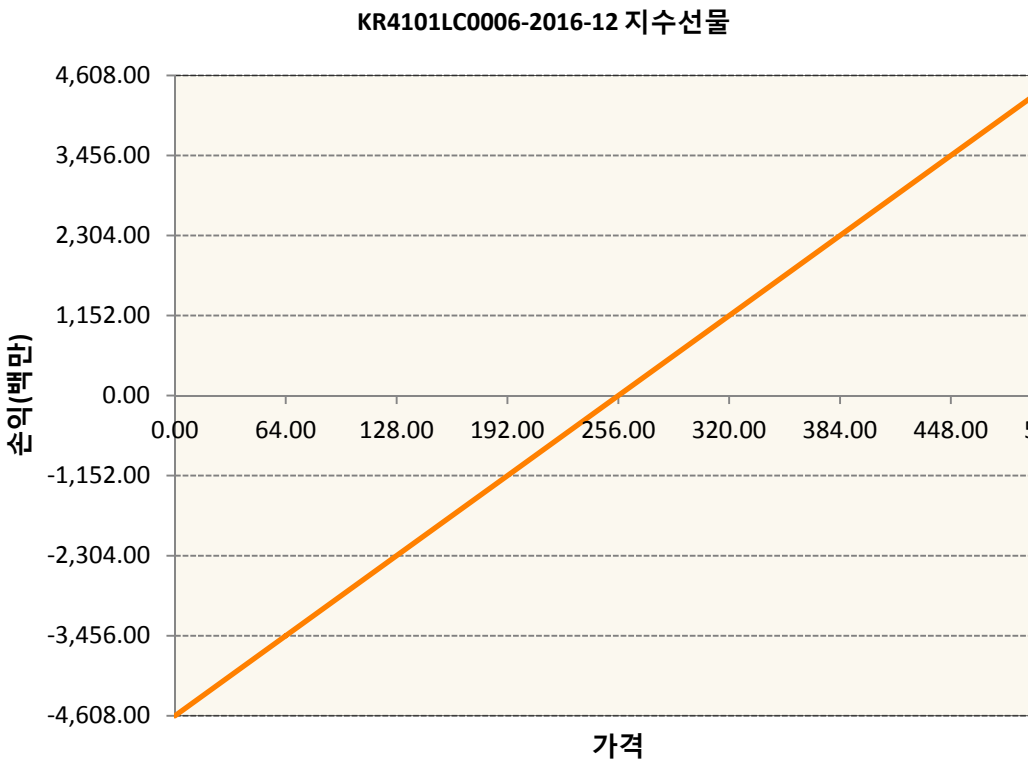
1.3배 레버리지 인덱스(주식-파생형)

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	4,608	0	4,608	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101LC00 2016-12 지수선물							368
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-368	-368	-368	-368	-368	-368	-368
-5.33%	-245	-245	-245	-245	-245	-245	-245
-2.67%	-123	-123	-123	-123	-123	-123	-123
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	123	123	123	123	123	123	123
5.33%	245	245	245	245	245	245	245
8.00%	368	368	368	368	368	368	368

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

278

공시일	2016-11-09
기준일	2016-11-08

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	868

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

706

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2016-11-09
기준일	2016-11-08

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	401

* 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	2016-11-09
기준일	2016-11-08

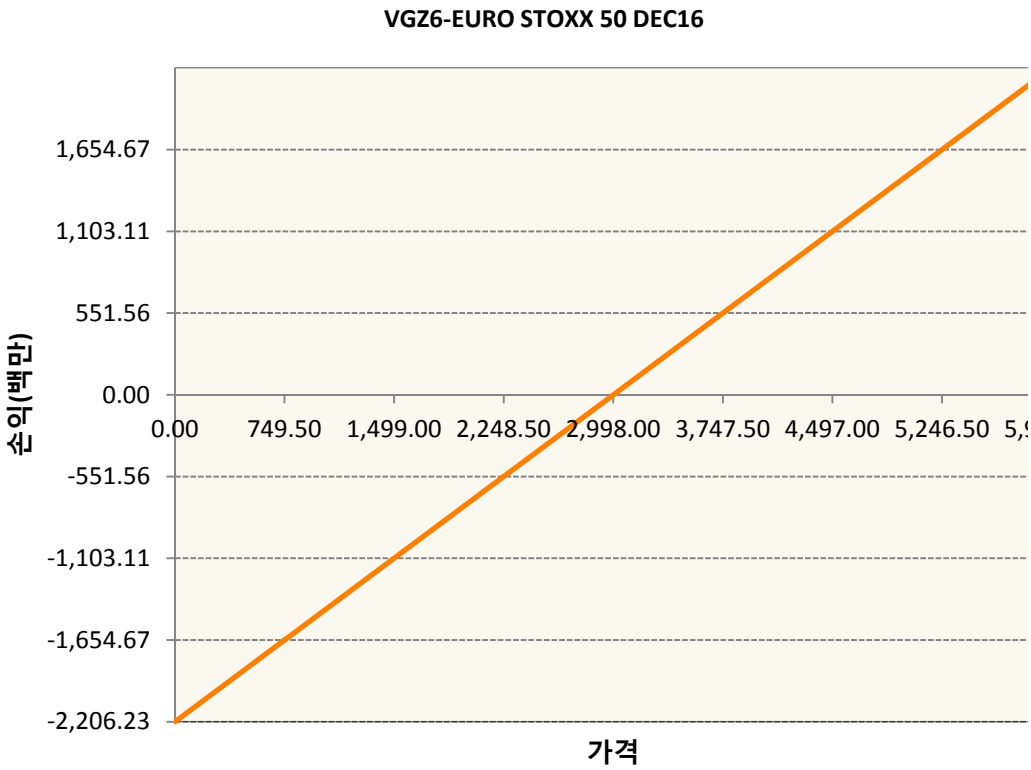
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,206	0	2,206	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGZ6	EURO STOXX 50 DEC16	176

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

(단위:백만원)

213

공시일	2016-11-09
기준일	2016-11-08

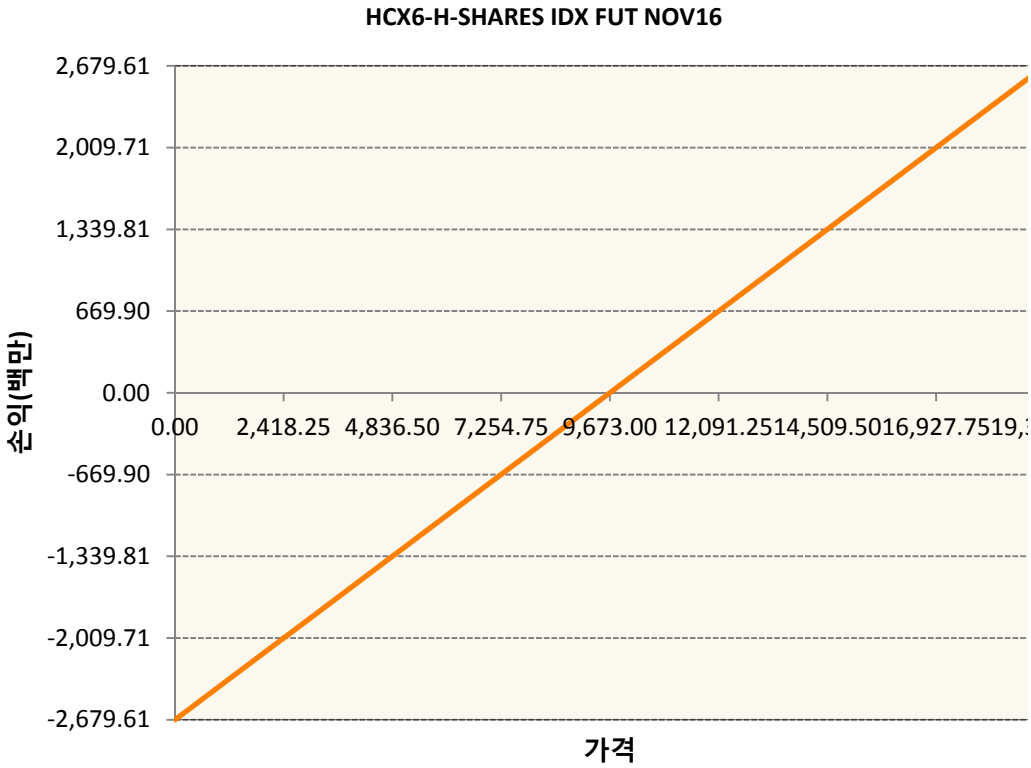
차이나인덱스모(주식-파생형)

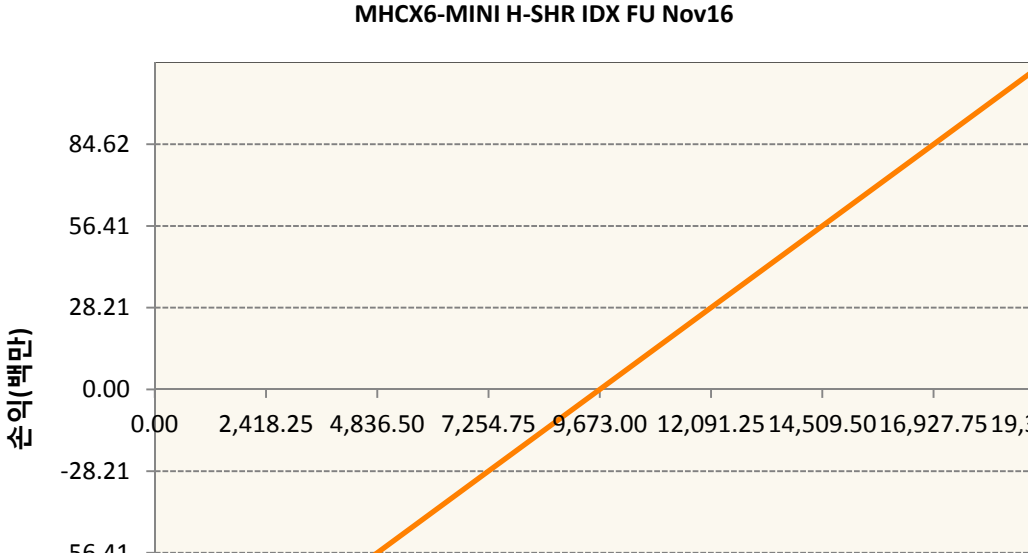
1. 계약금액

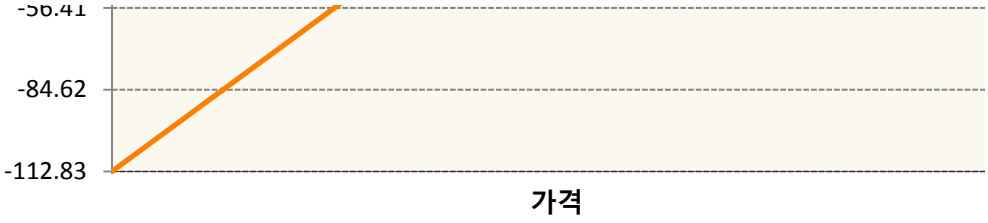
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,792	0	2,792	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

HCX6	H-SHARES IDX FUT NOV16	214
MHCX6	MINI H-SHR IDX FU Nov16	9

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

298

공시일	2016-11-09
기준일	2016-11-08

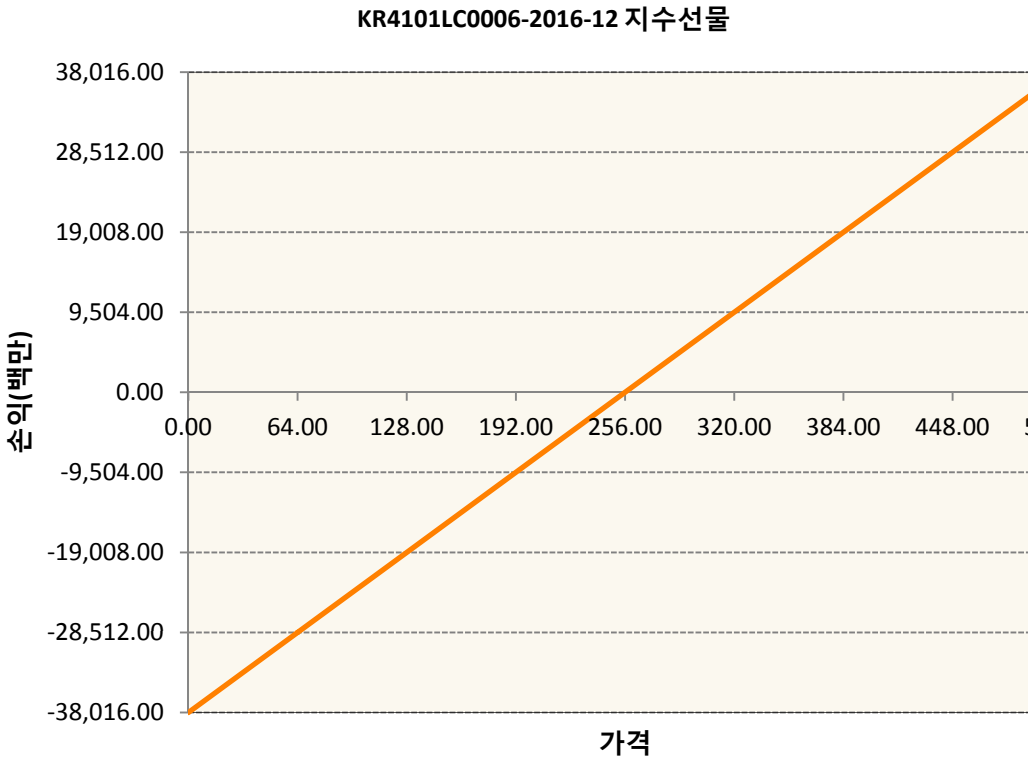
커버드콜(주식혼합-파생형)

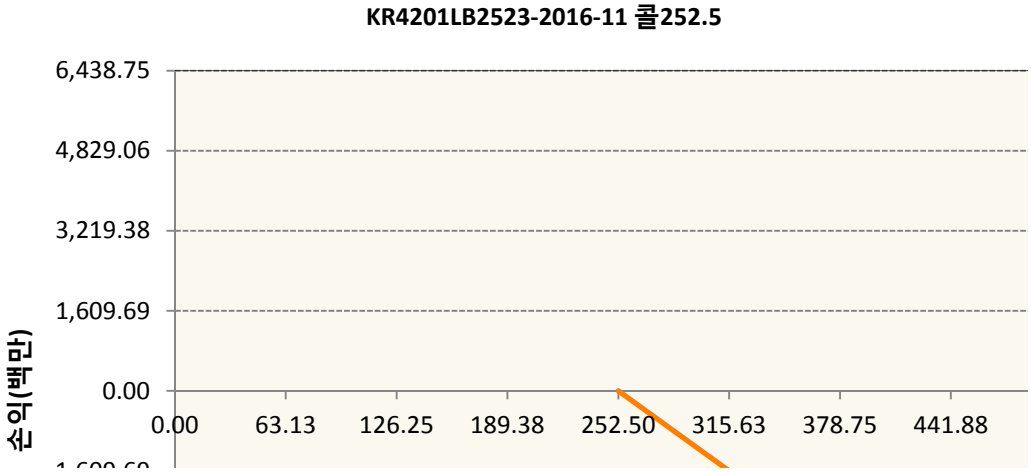
1. 계약금액

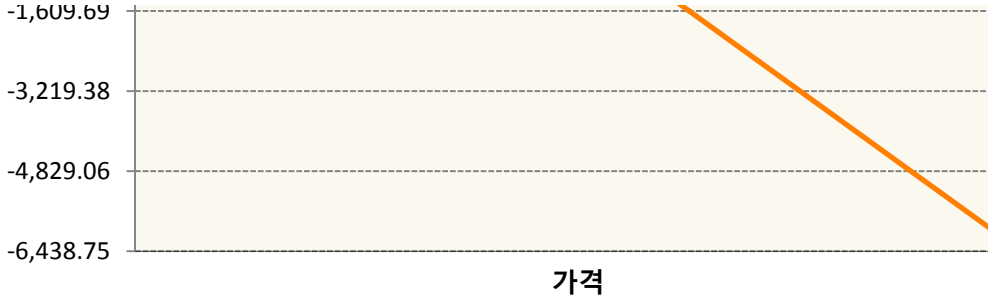
(단위:백만원)

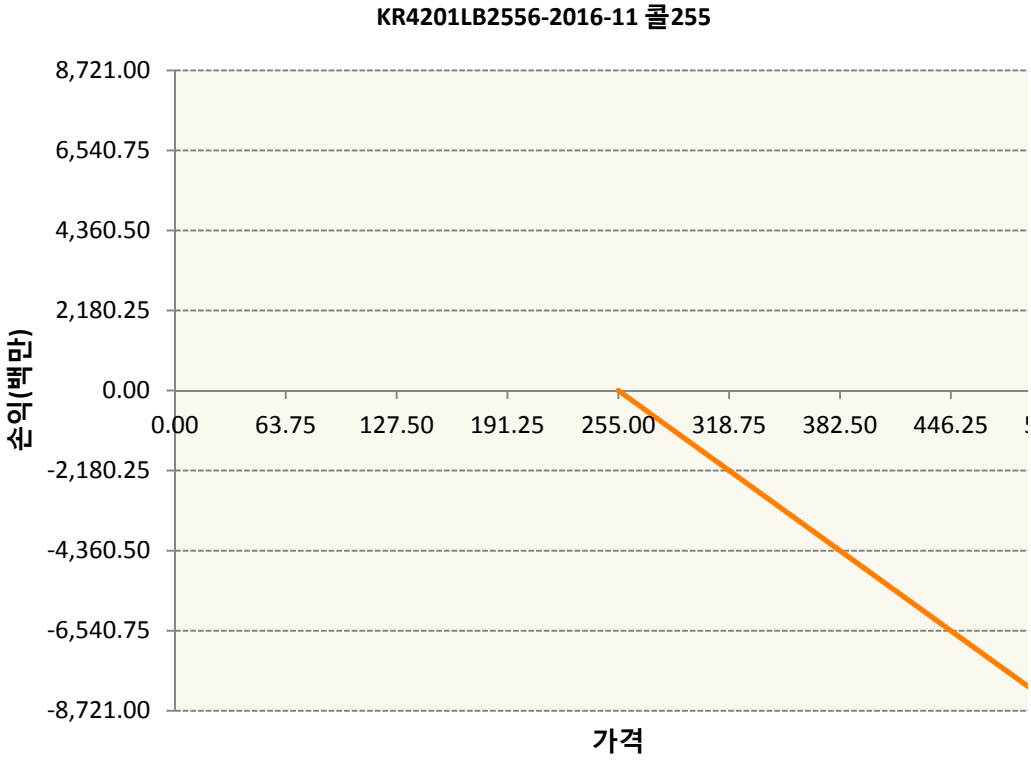
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	38,016	0	38,016	장내
누계	유가증권	옵션	0	15,160	-15,160	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101LC00 2016-12 지수선물							3,032
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-3,032	-3,032	-3,032	-3,032	-3,032	-3,032	-3,032
-5.33%	-2,022	-2,022	-2,022	-2,022	-2,022	-2,022	-2,022
-2.67%	-1,011	-1,011	-1,011	-1,011	-1,011	-1,011	-1,011
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	1,011	1,011	1,011	1,011	1,011	1,011	1,011
5.33%	2,022	2,022	2,022	2,022	2,022	2,022	2,022
8.00%	3,032	3,032	3,032	3,032	3,032	3,032	3,032
KR4201LB25 2016-11 콜252.5							2,561
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	394	394	394	394	394	394	394
-5.33%	394	394	394	394	394	394	394
-2.67%	389	386	381	376	370	363	356
0%	24	17	9	0	-9	-19	-30
2.67%	-825	-825	-825	-825	-825	-826	-826
5.33%	-1,693	-1,693	-1,693	-1,693	-1,693	-1,693	-1,693
8.00%	-2,561	-2,561	-2,561	-2,561	-2,561	-2,561	-2,561
KR4201LB25 2016-11 콜255							3,296
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	240	240	240	240	240	240	240
-5.33%	240	240	240	240	240	240	240
-2.67%	240	239	238	236	234	231	227
0%	54	36	18	0	-18	-36	-54
2.67%	-968	-969	-969	-971	-973	-976	-979
5.33%	-2,132	-2,132	-2,132	-2,132	-2,132	-2,132	-2,132
8.00%	-3,296	-3,296	-3,296	-3,296	-3,296	-3,296	-3,296

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

10,927

공시일	2016-11-09
기준일	2016-11-08

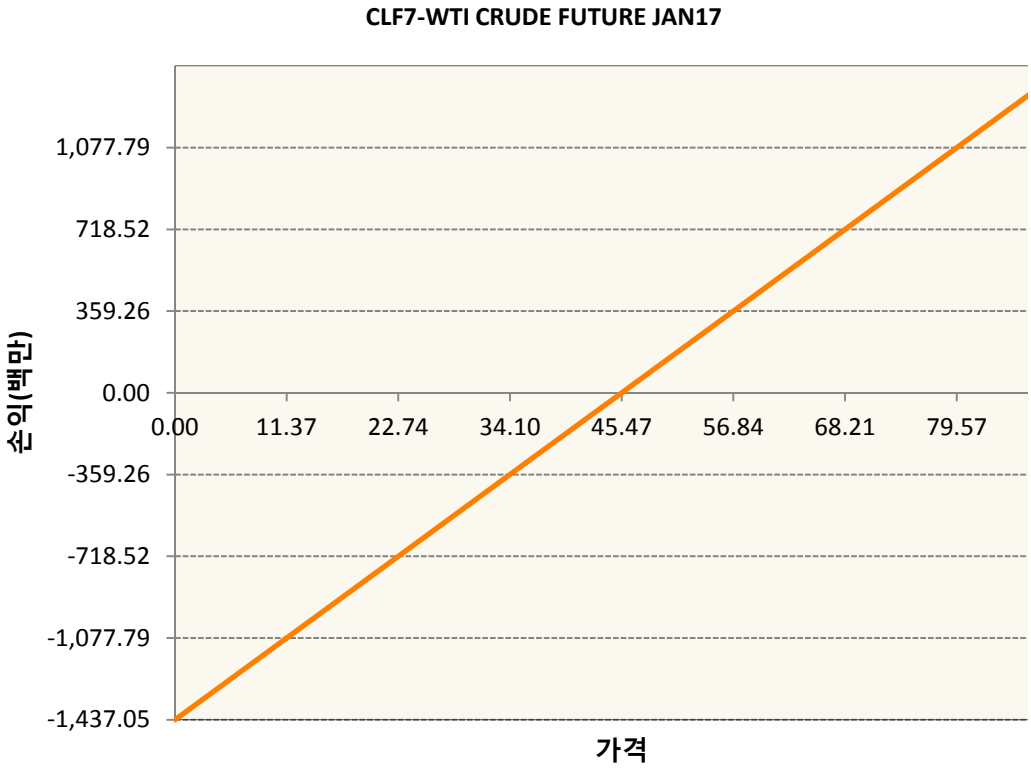
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

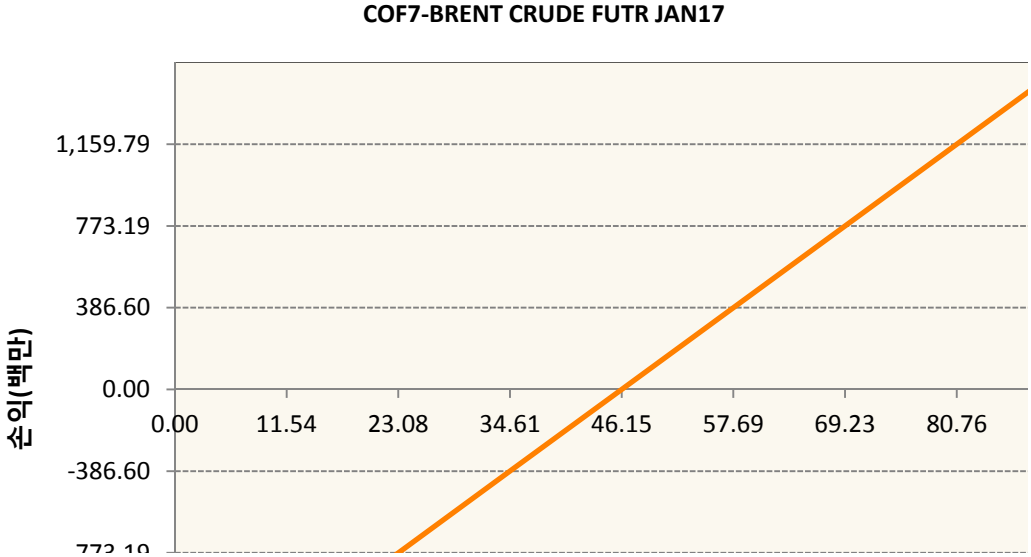
1. 계약금액

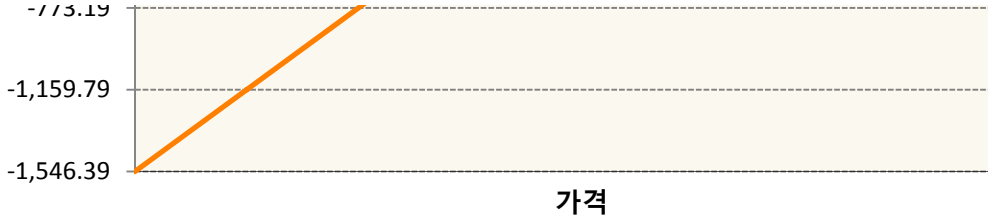
(단위:백만원)

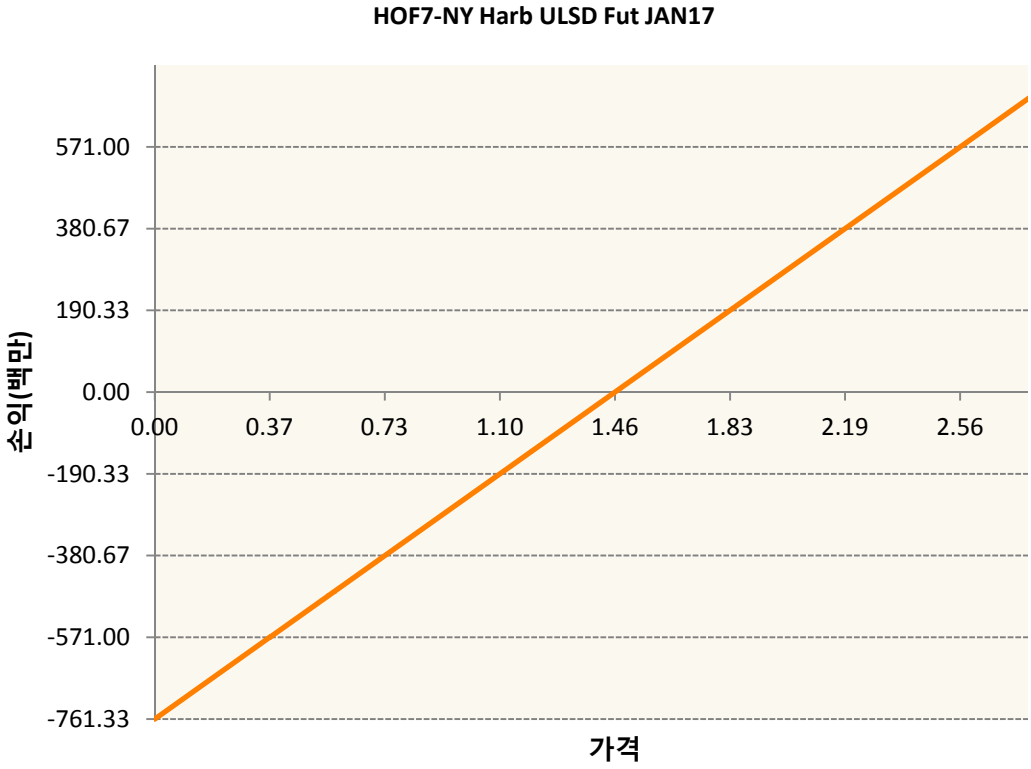
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	5,937	0	5,937	

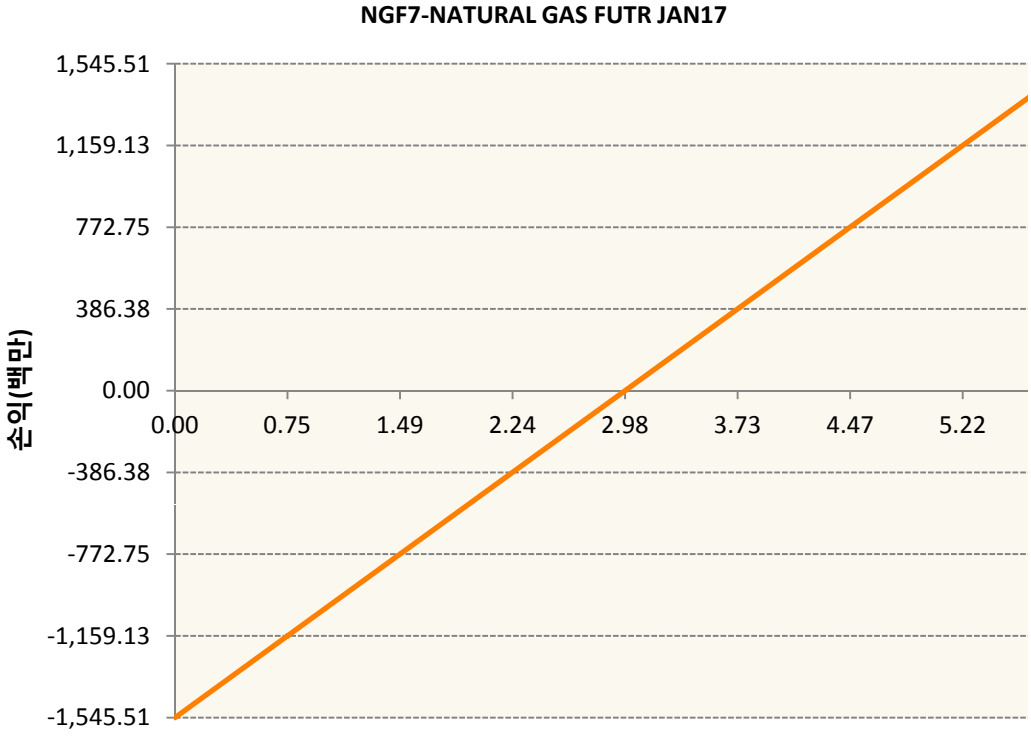
2. 만기시점의 손익구조



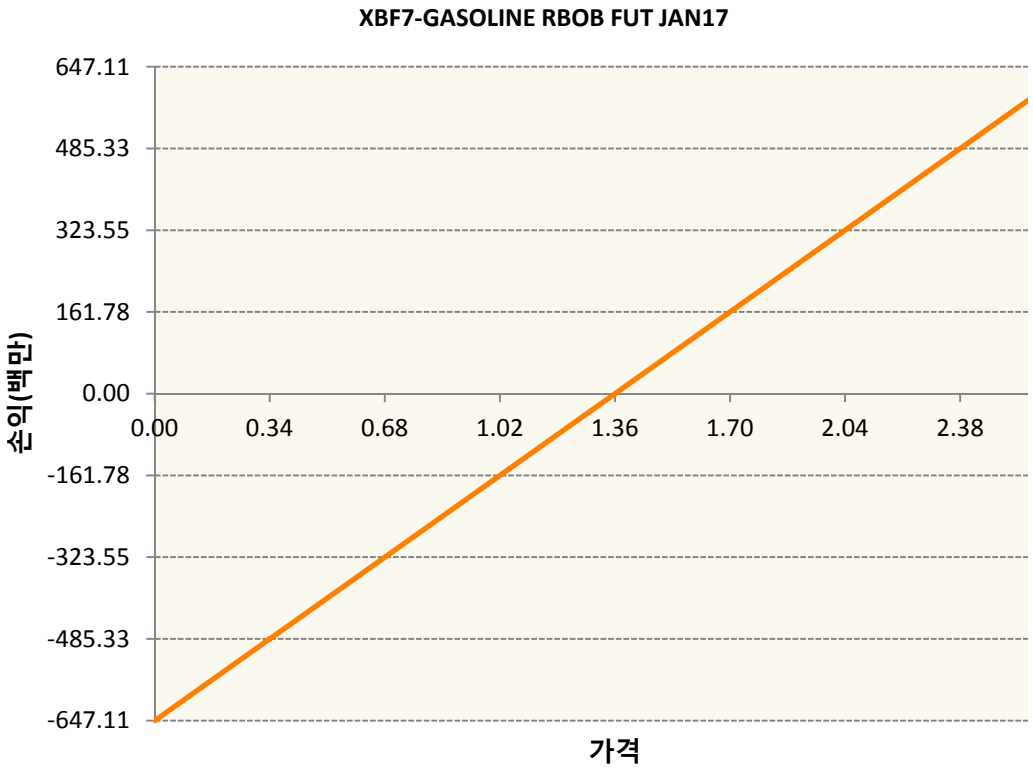



-1,159.79
-1,546.39
가격


HOF7-NY Harb ULSD Fut JAN17
571.00
380.67
190.33
0.00
-190.33
-380.67
-571.00
-761.33
0.00
0.37
0.73
1.10
1.46
1.83
2.19
2.56
순익(백만)
가격


NGF7-NATURAL GAS FUTR JAN17
1,545.51
1,159.13
772.75
386.38
0.00
-386.38
-772.75
-1,159.13
-1,545.51
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	115
COF7	BRENT CRUDE FUTR JAN17	124
HOF7	NY Harb ULSD Fut JAN17	61
NGF7	NATURAL GAS FUTR JAN17	124
XBF7	GASOLINE RBOB FUT JAN17	52

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,062

공시일	2016-11-09
기준일	2016-11-08

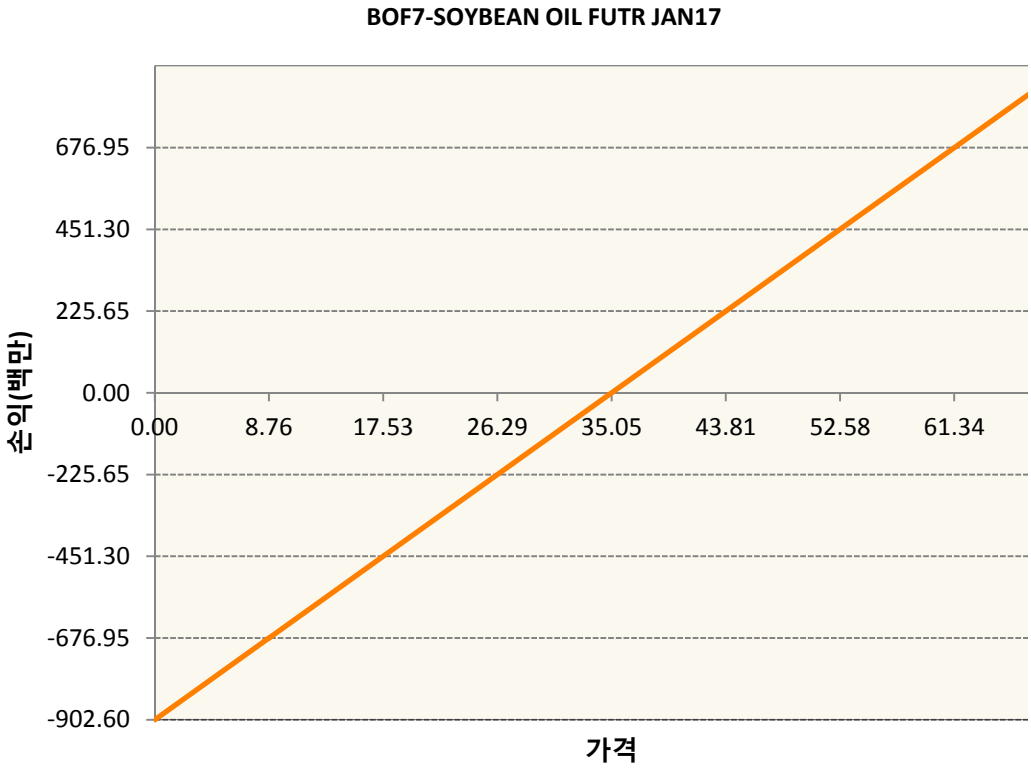
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

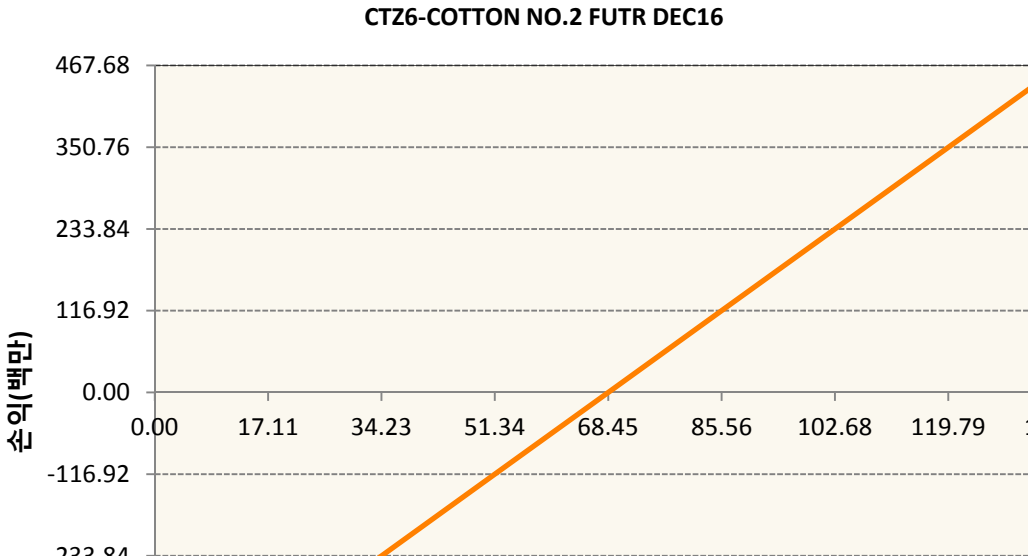
1. 계약금액

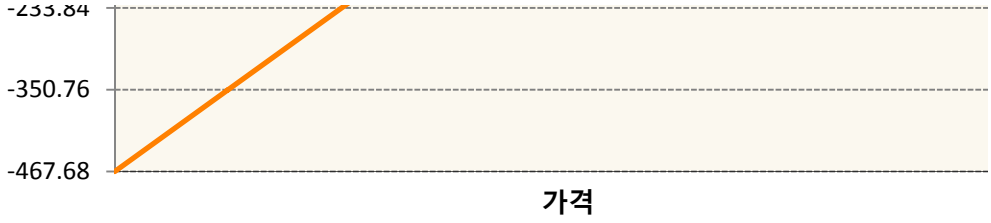
(단위:백만원)

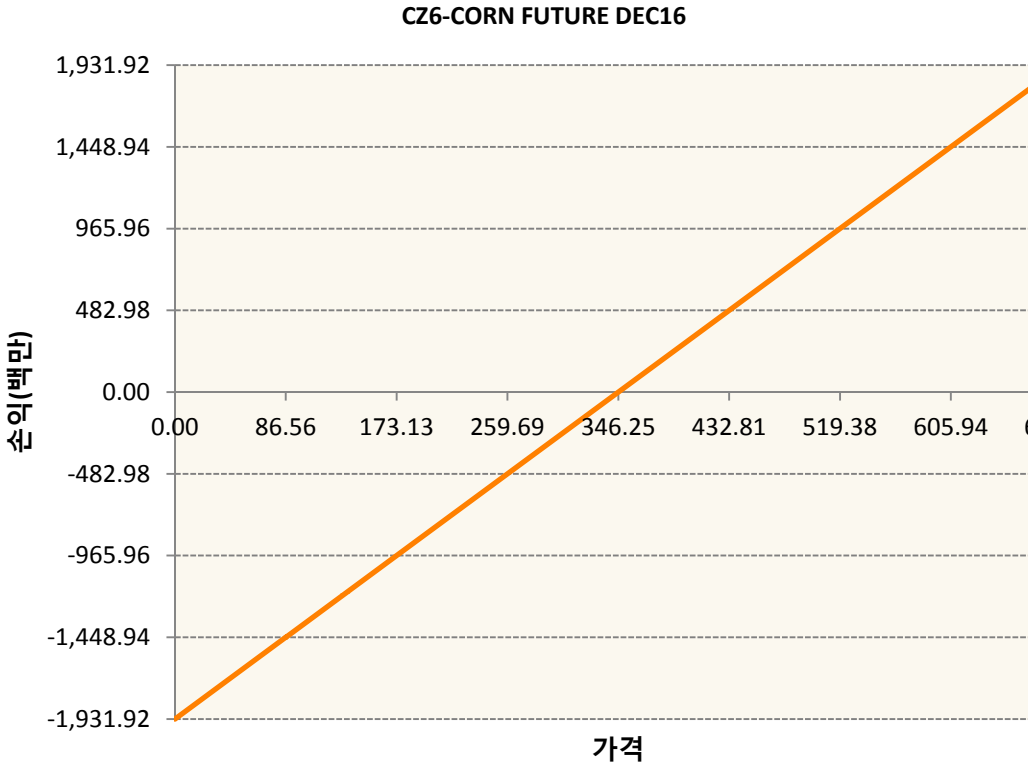
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	9,599	0	9,599	

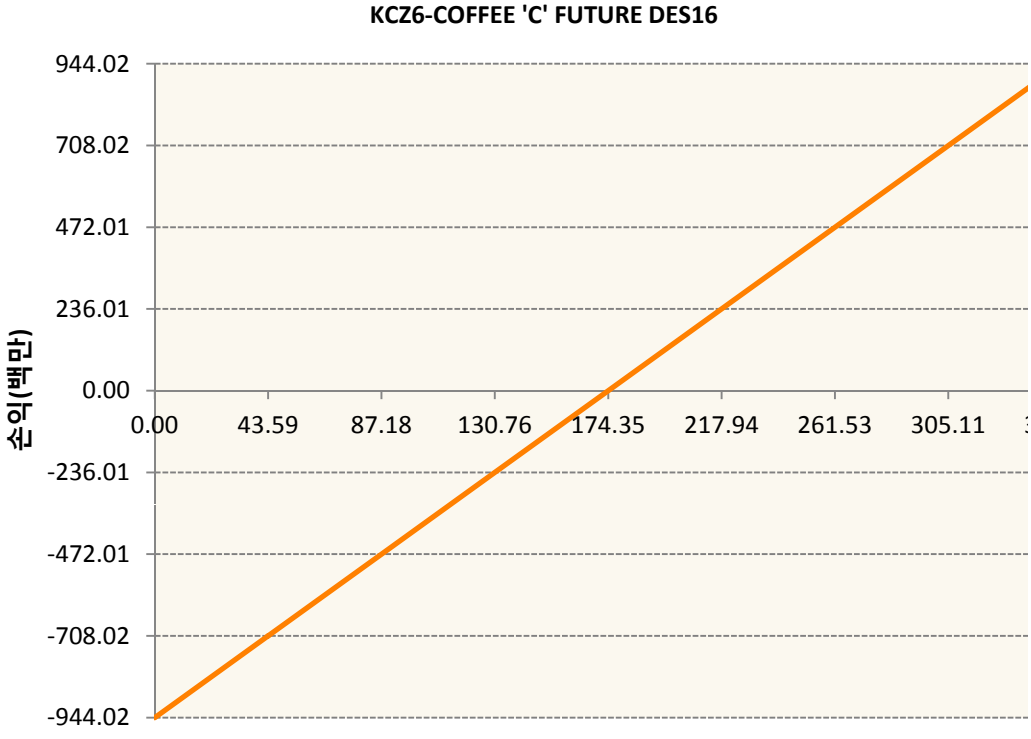
2. 만기시점의 손익구조



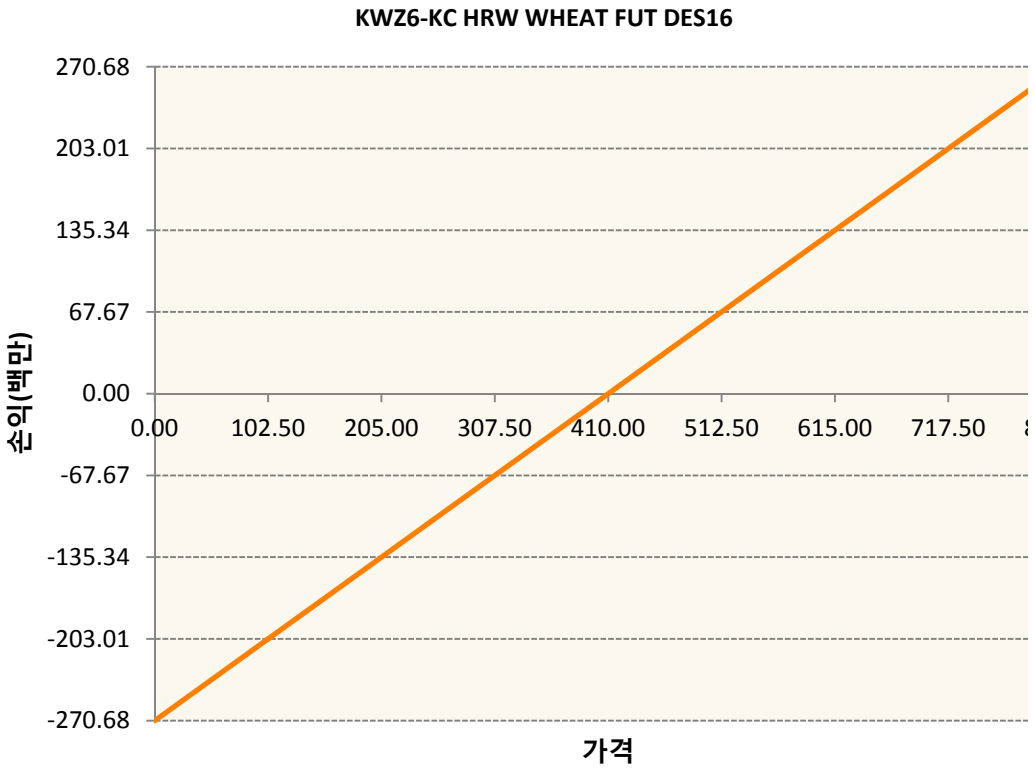


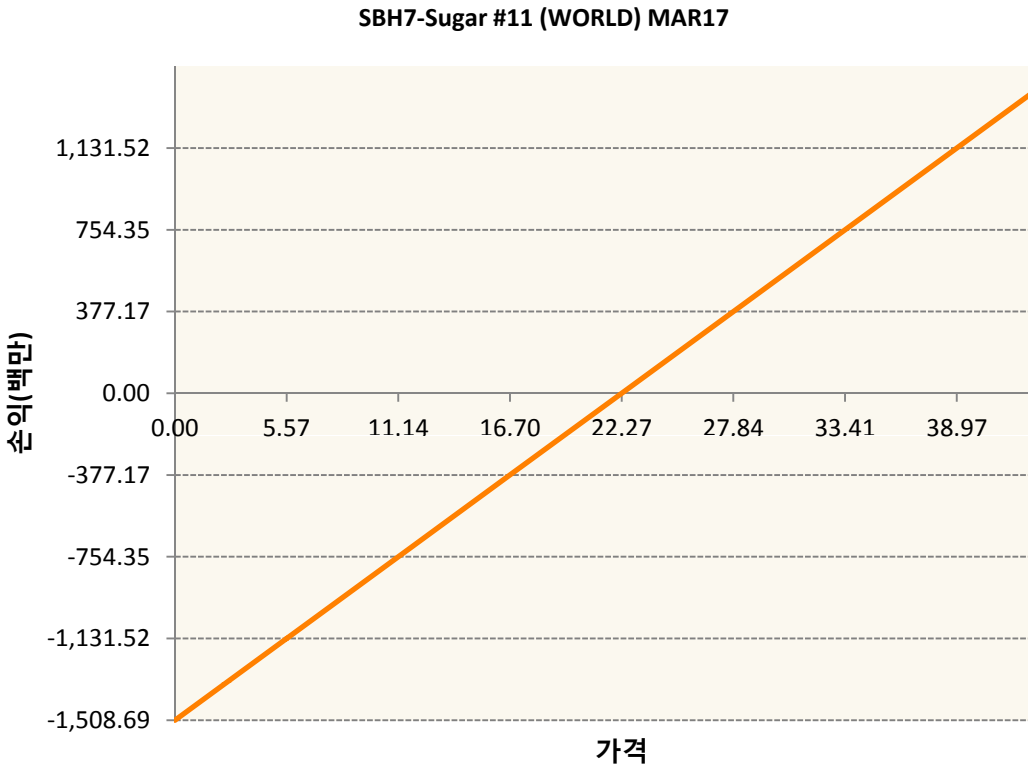

-233.84
-350.76
-467.68
가격


CZ6-CORN FUTURE DEC16
1,931.92
1,448.94
965.96
482.98
0.00
-482.98
-965.96
-1,448.94
-1,931.92
0.00
86.56
173.13
259.69
346.25
432.81
519.38
605.94
순익(백만)
가격

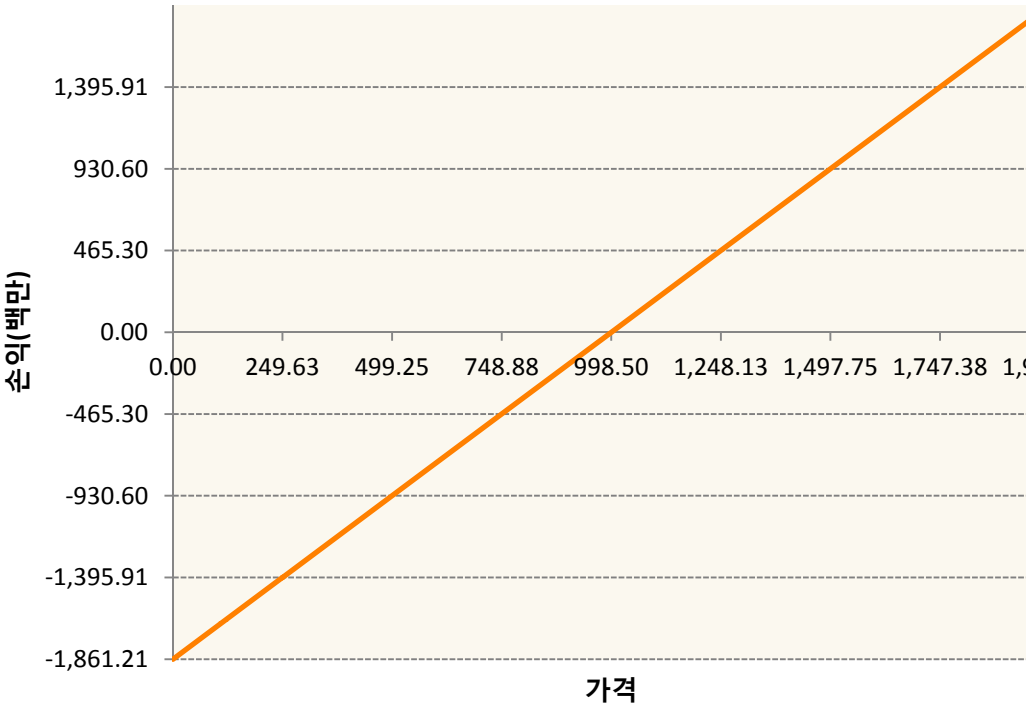

KCZ6-COFFEE 'C' FUTURE DES16
944.02
708.02
472.01
236.01
0.00
-236.01
-472.01
-708.02
-944.02
0.00
43.59
87.18
130.76
174.35
217.94
261.53
305.11
순익(백만)

가격

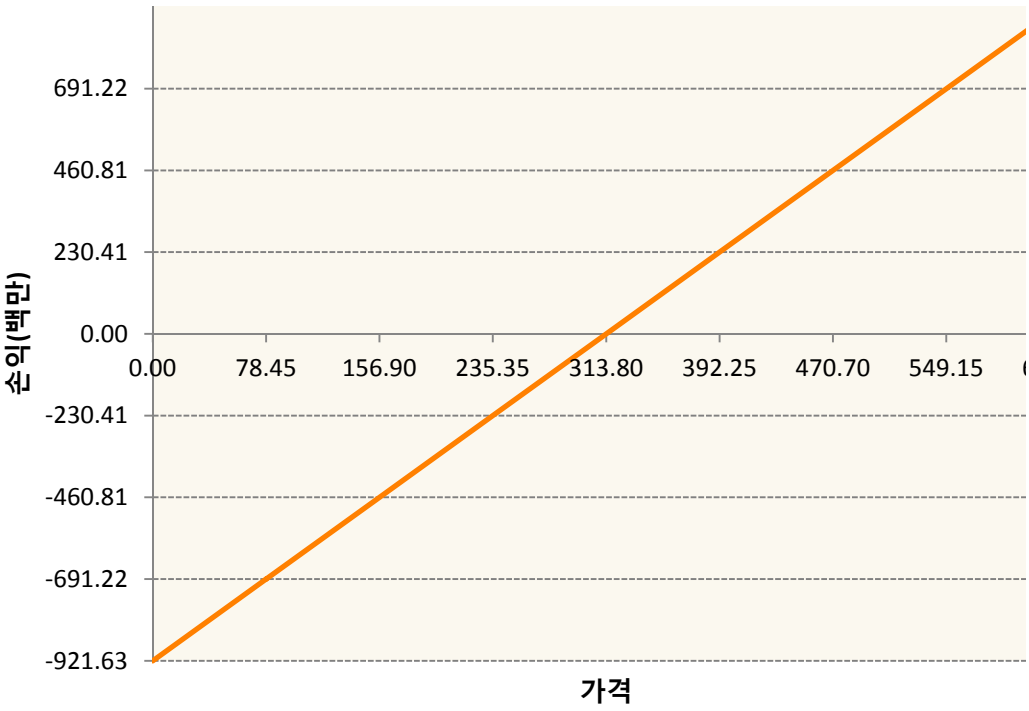

KWZ6-KC HRW WHEAT FUT DES16
270.68
203.01
135.34
67.67
0.00
-67.67
-135.34
-203.01
-270.68
0.00
102.50
205.00
307.50
410.00
512.50
615.00
717.50
손익(백만)
가격


SBH7-Sugar #11 (WORLD) MAR17
1,131.52
754.35
377.17
0.00
-377.17
-754.35
-1,131.52
-1,508.69
0.00
5.57
11.14
16.70
22.27
27.84
33.41
38.97
손익(백만)
가격

SF7-SOYBEAN FUTURE JAN17

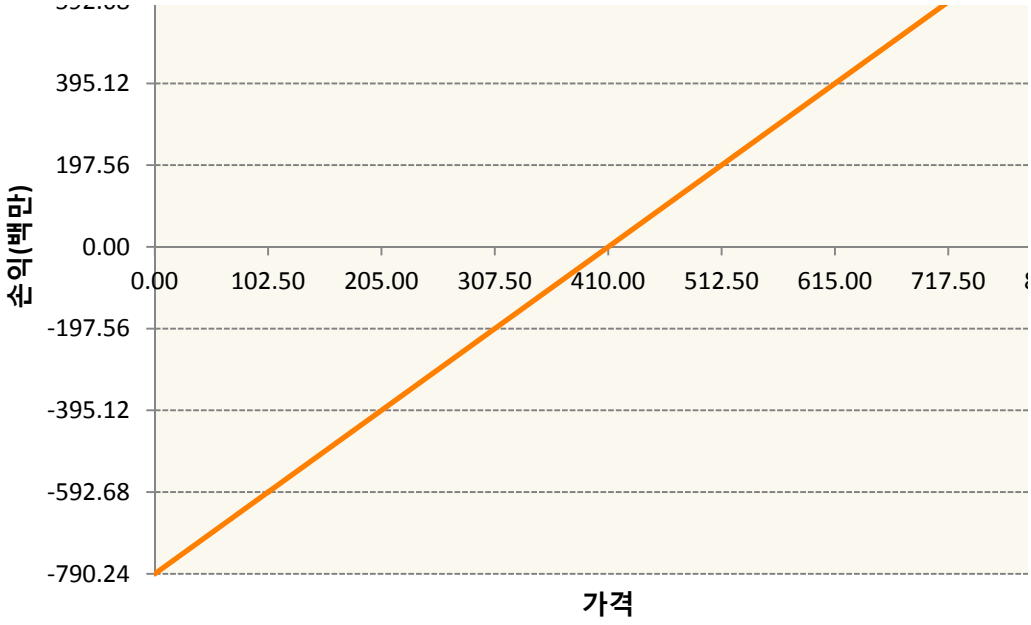


SMF7-SOYBEAN MEAL FUTR JAN17



WZ6-WHEAT FUTURE(CBT) DEC16





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

BOF7	SOYBEAN OIL FUTR JAN17	72
CTZ6	COTTON NO.2 FUTR DEC16	37
CZ6	CORN FUTURE DEC16	155
KCZ6	COFFEE 'C' FUTURE DES16	76
KWZ6	KC HRW WHEAT FUT DES16	22
SBH7	Sugar #11 (WORLD) MAR17	121
SF7	SOYBEAN FUTURE JAN17	149
SMF7	SOYBEAN MEAL FUTR JAN17	74
WZ6	WHEAT FUTURE(CBT) DEC16	63

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

960