공시일	2016-11-11
기준일	2016-11-10

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	2016-11-11
기준일	2016-11-10

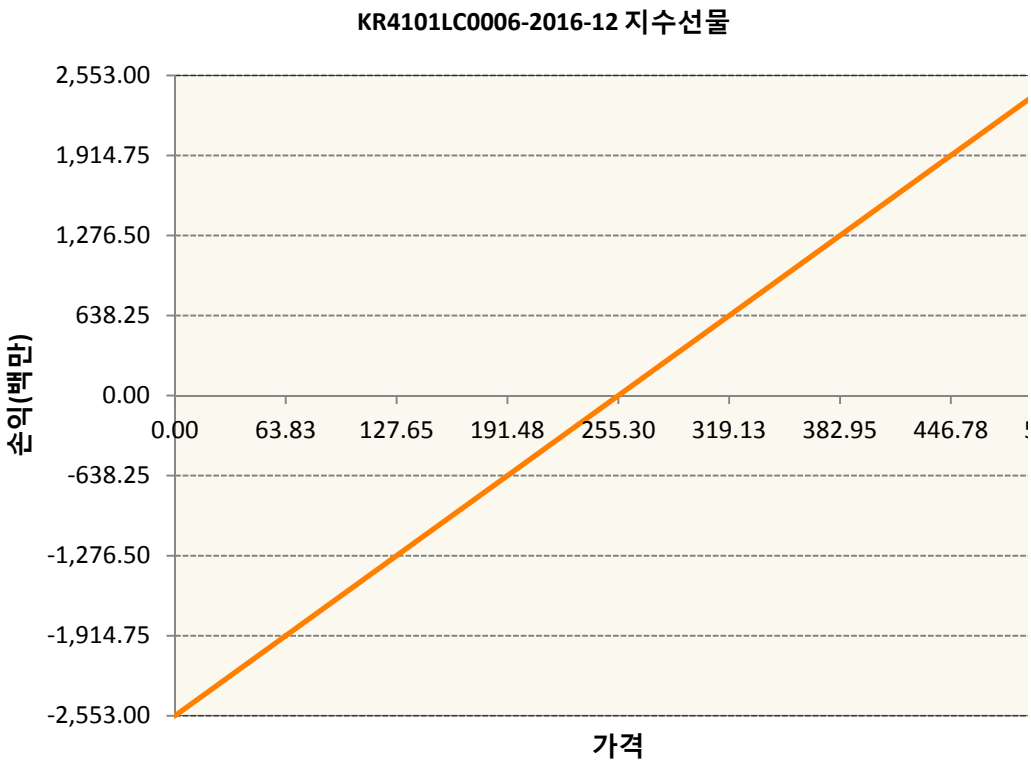
스마트인덱스모

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	2,553	0	2,553	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)

159

공시일	2016-11-11
기준일	2016-11-10

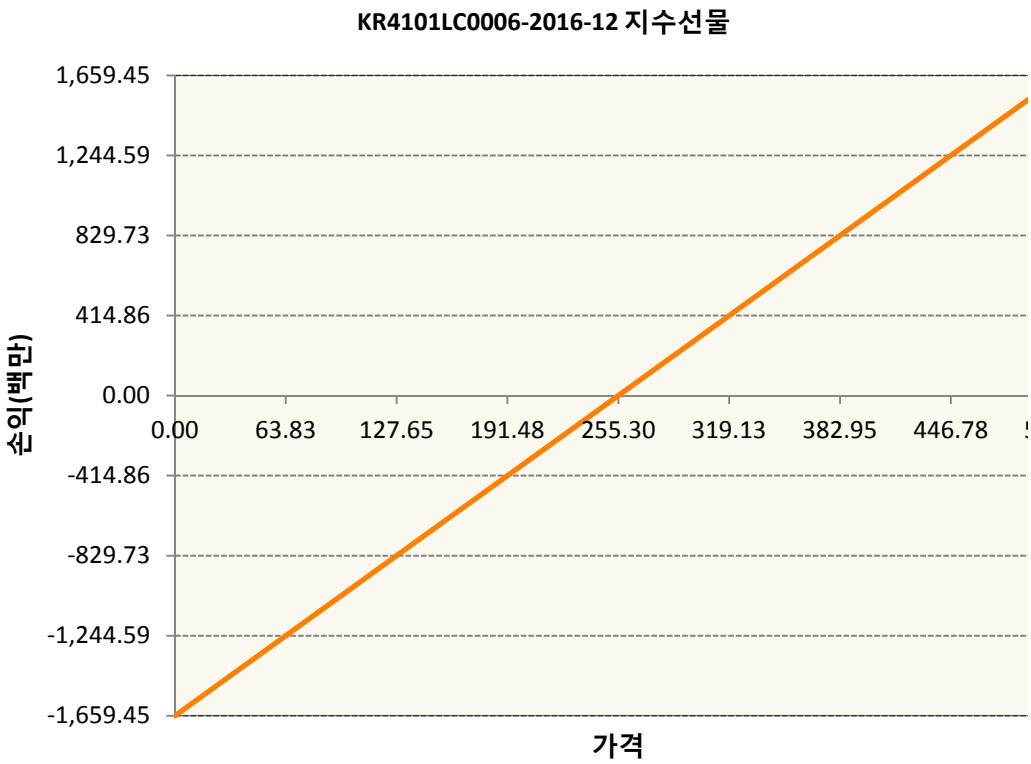
스마트레버리지목표전환형1호

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	1,659	0	1,659	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%	-89	-89	-89	-89	-89	-89	-89
-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%	89	89	89	89	89	89	89
8.00%	133	133	133	133	133	133	133

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

103

공시일	2016-11-11
기준일	2016-11-10

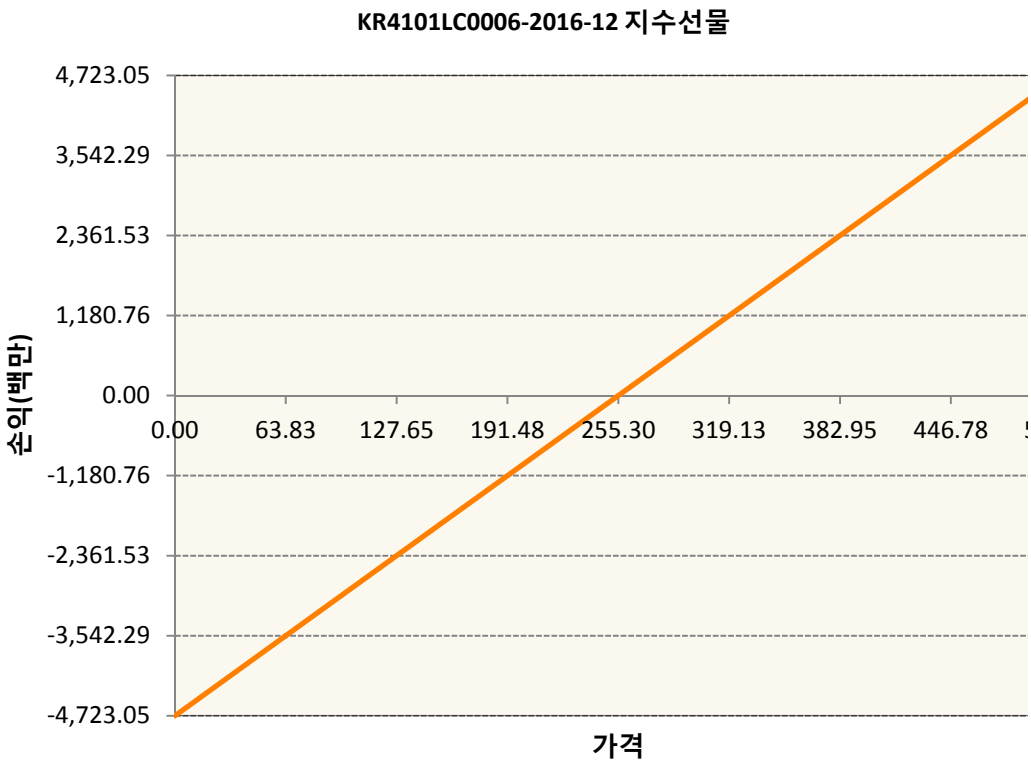
1.3배 레버리지 인덱스(주식-파생형)

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	4,723	0	4,723	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101LC00 2016-12 지수선물							378
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-378	-378	-378	-378	-378	-378	-378
-5.33%	-252	-252	-252	-252	-252	-252	-252
-2.67%	-126	-126	-126	-126	-126	-126	-126
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	126	126	126	126	126	126	126
5.33%	252	252	252	252	252	252	252
8.00%	378	378	378	378	378	378	378

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

294

공시일	2016-11-11
기준일	2016-11-10

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	874

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

711

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2016-11-11
기준일	2016-11-10

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	404

* 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	2016-11-11
기준일	2016-11-10

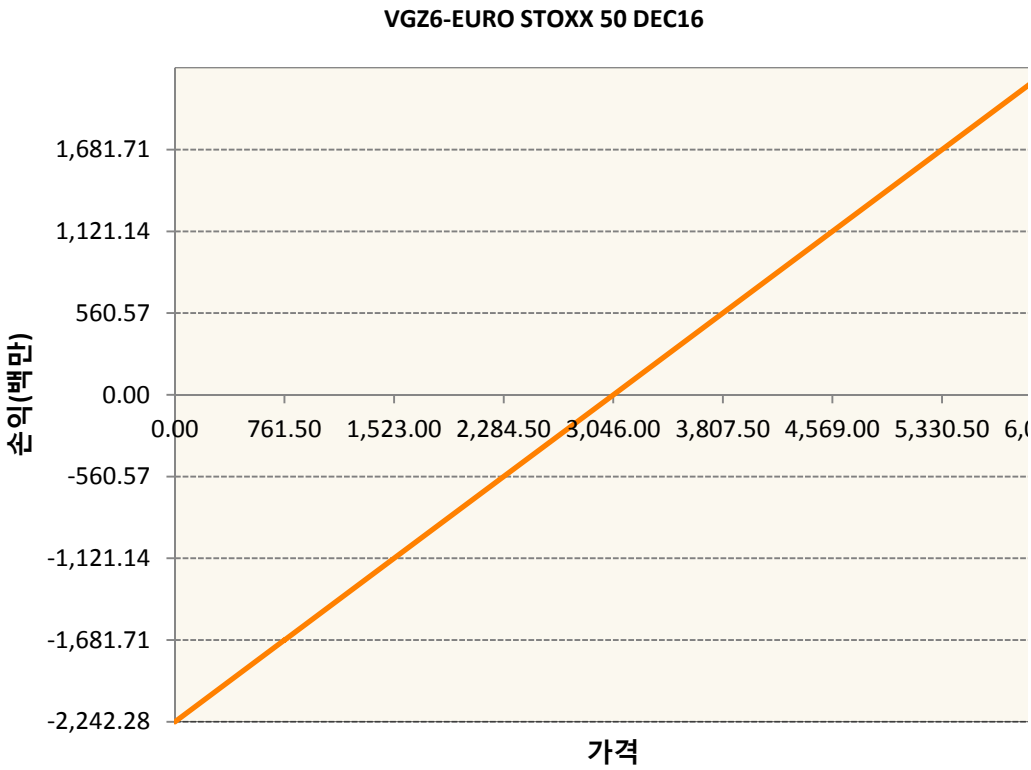
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,242	0	2,242	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGZ6	EURO STOXX 50 DEC16	179

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

(단위:백만원)

217

공시일	2016-11-11
기준일	2016-11-10

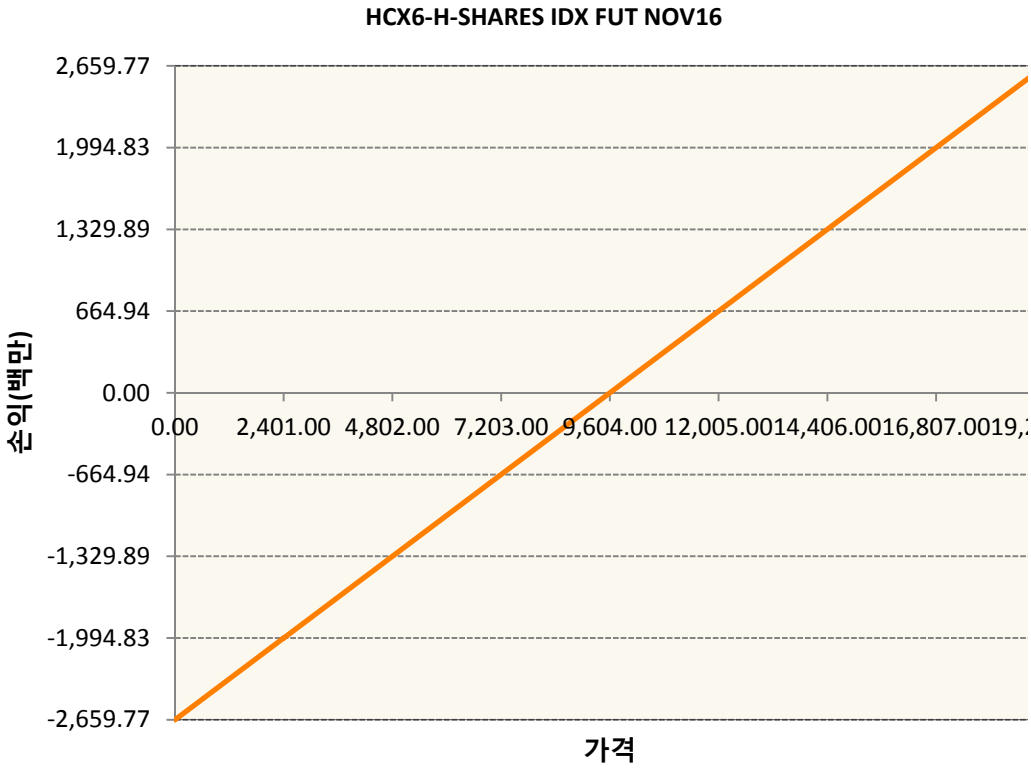
차이나인덱스모(주식-파생형)

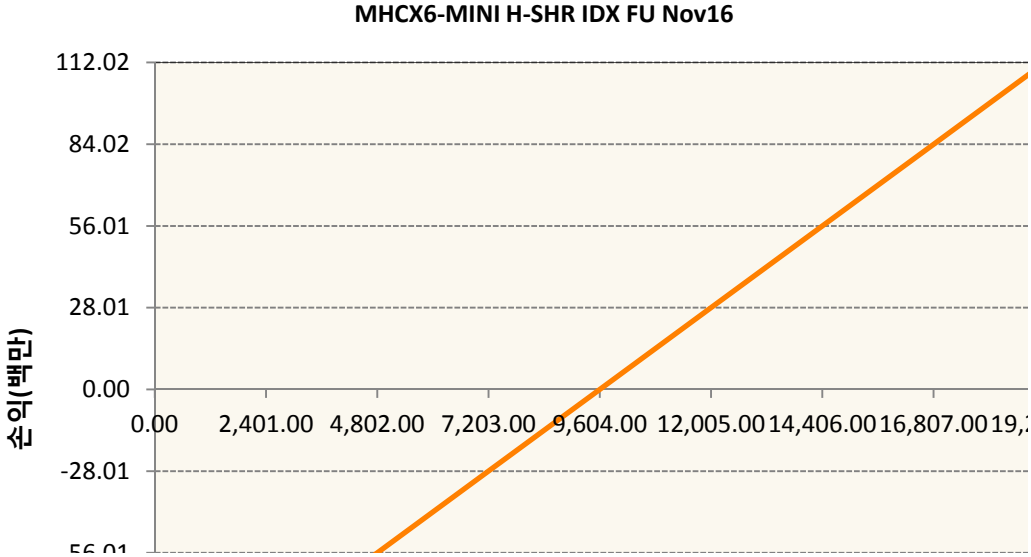
1. 계약금액

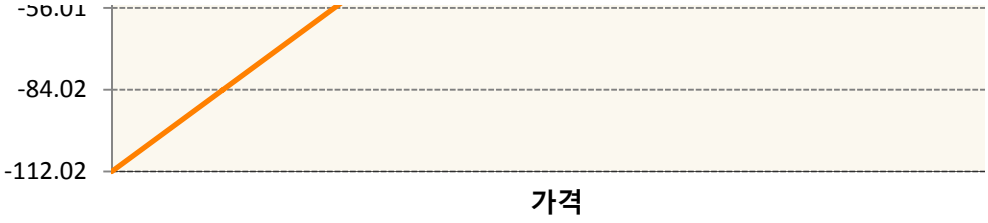
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,772	0	2,772	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	2016-11-11
기준일	2016-11-10

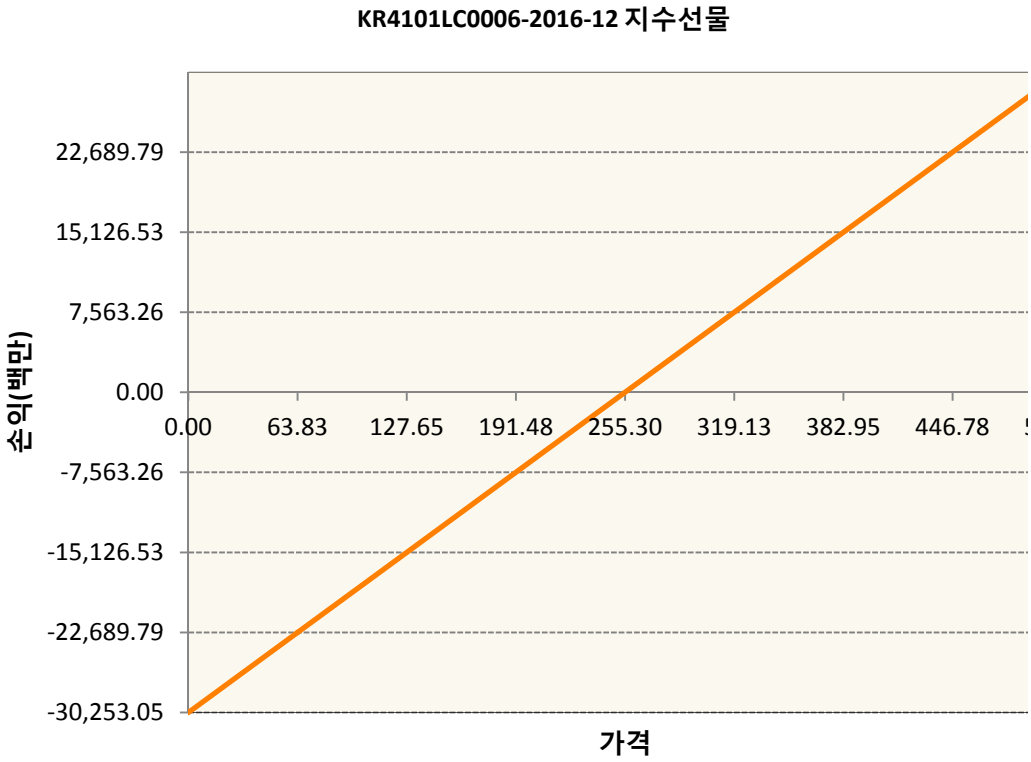
커버드콜(주식혼합-파생형)

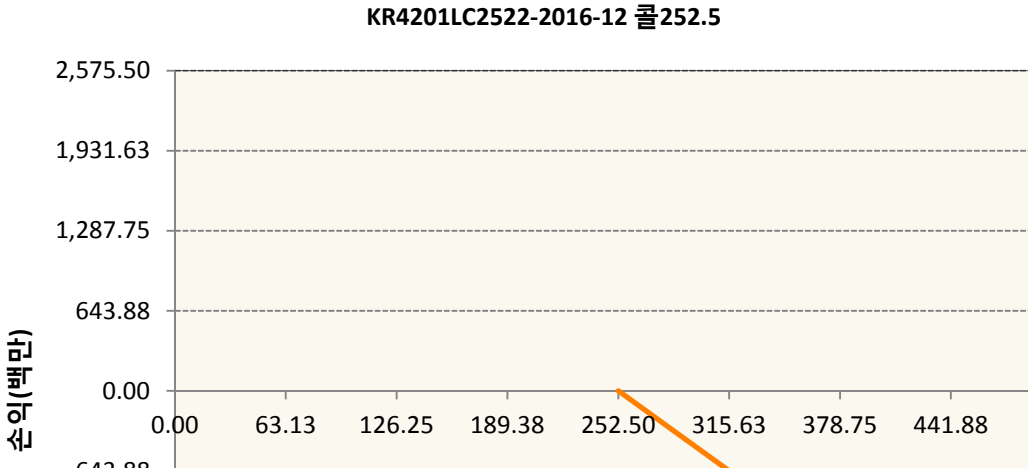
1. 계약금액

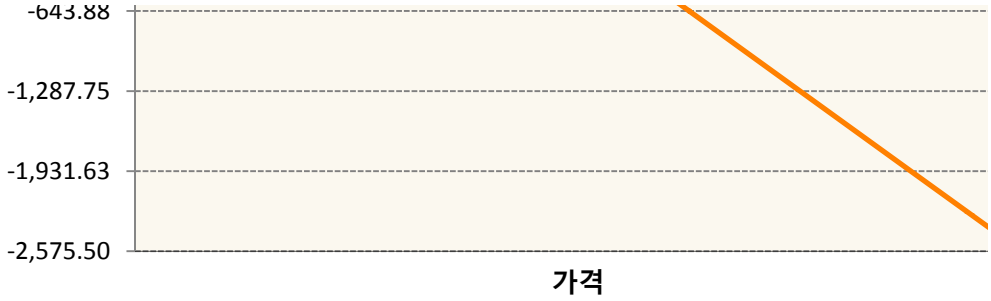
(단위:백만원)

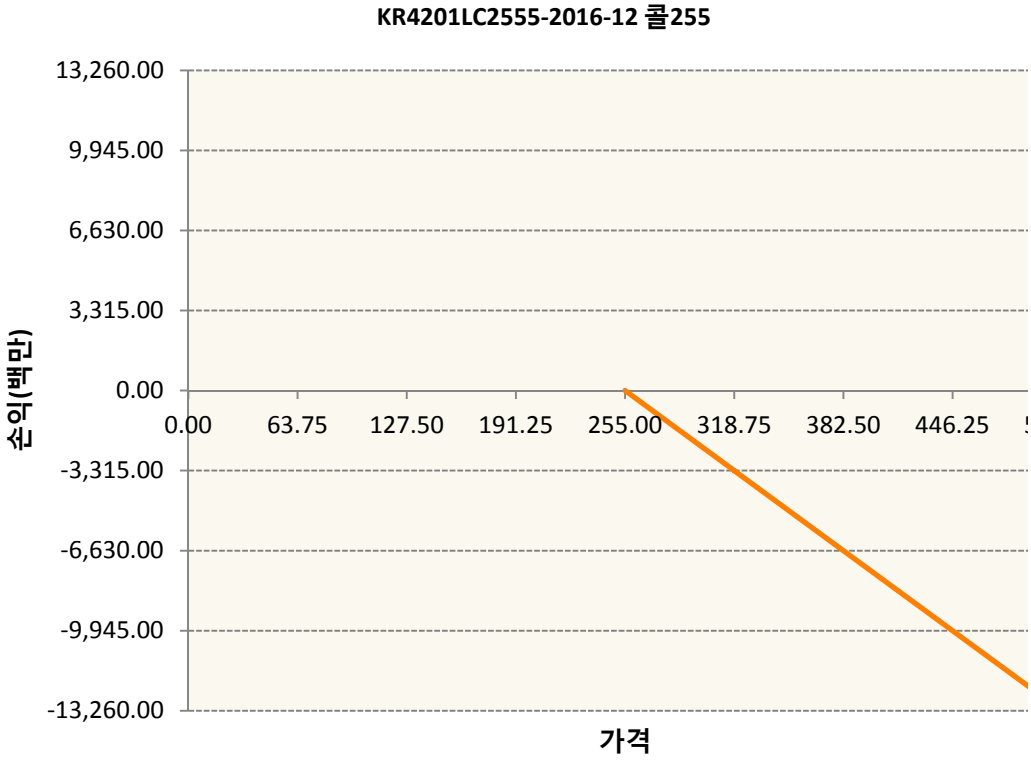
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	7,636	-7,636	장내
신규	유가증권	옵션	0	16,069	-16,069	장내
누계	유가증권	선물	30,253	0	30,253	장내
누계	유가증권	옵션	0	15,836	-15,836	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101LC00 2016-12 지수선물							2,420
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-2,420	-2,420	-2,420	-2,420	-2,420	-2,420	-2,420
-5.33%	-1,614	-1,614	-1,614	-1,614	-1,614	-1,614	-1,614
-2.67%	-807	-807	-807	-807	-807	-807	-807
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	807	807	807	807	807	807	807
5.33%	1,614	1,614	1,614	1,614	1,614	1,614	1,614
8.00%	2,420	2,420	2,420	2,420	2,420	2,420	2,420
KR4201LC25 2016-12 콜252.5							903
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	289	288	286	283	278	273	268
-5.33%	277	270	262	253	242	231	220
-2.67%	215	200	184	168	152	135	119
0%	51	34	17	0	-17	-34	-52
2.67%	-220	-229	-240	-251	-264	-277	-290
5.33%	-547	-550	-554	-559	-566	-573	-581
8.00%	-891	-892	-893	-894	-897	-900	-903
KR4201LC25 2016-12 콜255							4,350
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,123	1,119	1,112	1,103	1,089	1,071	1,049
-5.33%	1,092	1,069	1,040	1,005	965	920	870
-2.67%	899	834	765	692	618	541	463
0%	272	181	91	0	-91	-181	-272
2.67%	-928	-992	-1,061	-1,133	-1,208	-1,286	-1,365
5.33%	-2,519	-2,544	-2,575	-2,613	-2,656	-2,705	-2,758
8.00%	-4,254	-4,259	-4,268	-4,282	-4,300	-4,323	-4,350

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

7,591

공시일	2016-11-11
기준일	2016-11-10

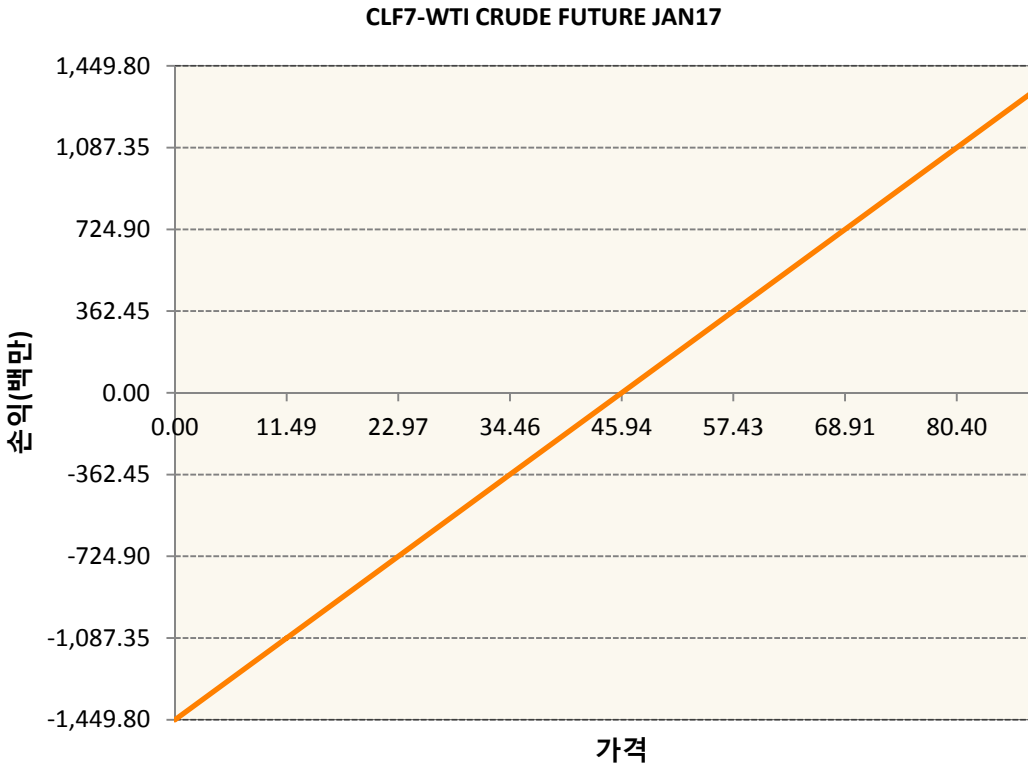
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

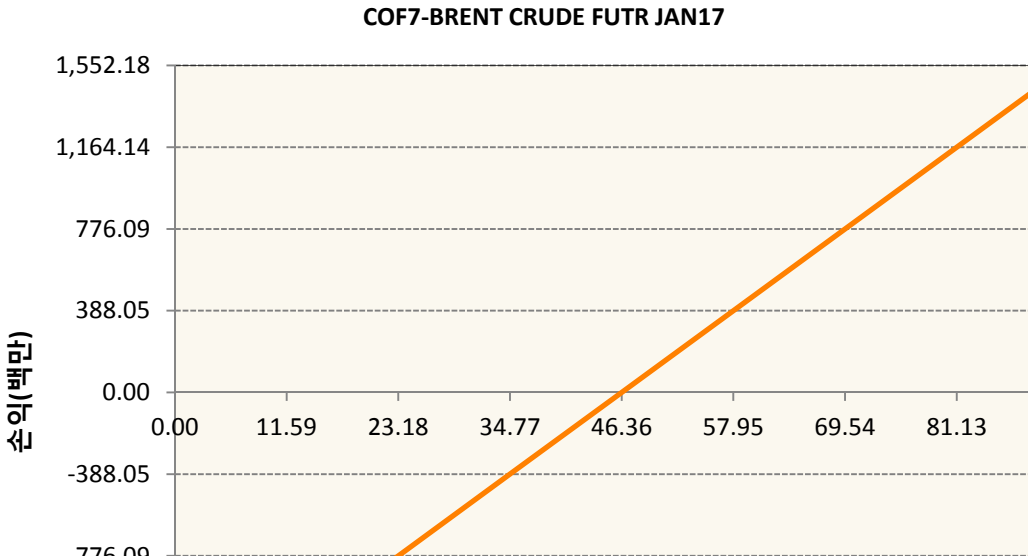
1. 계약금액

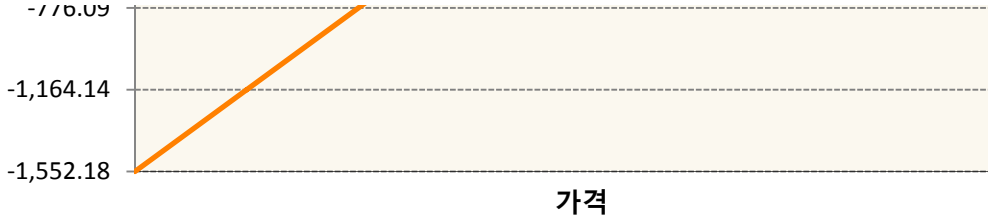
(단위:백만원)

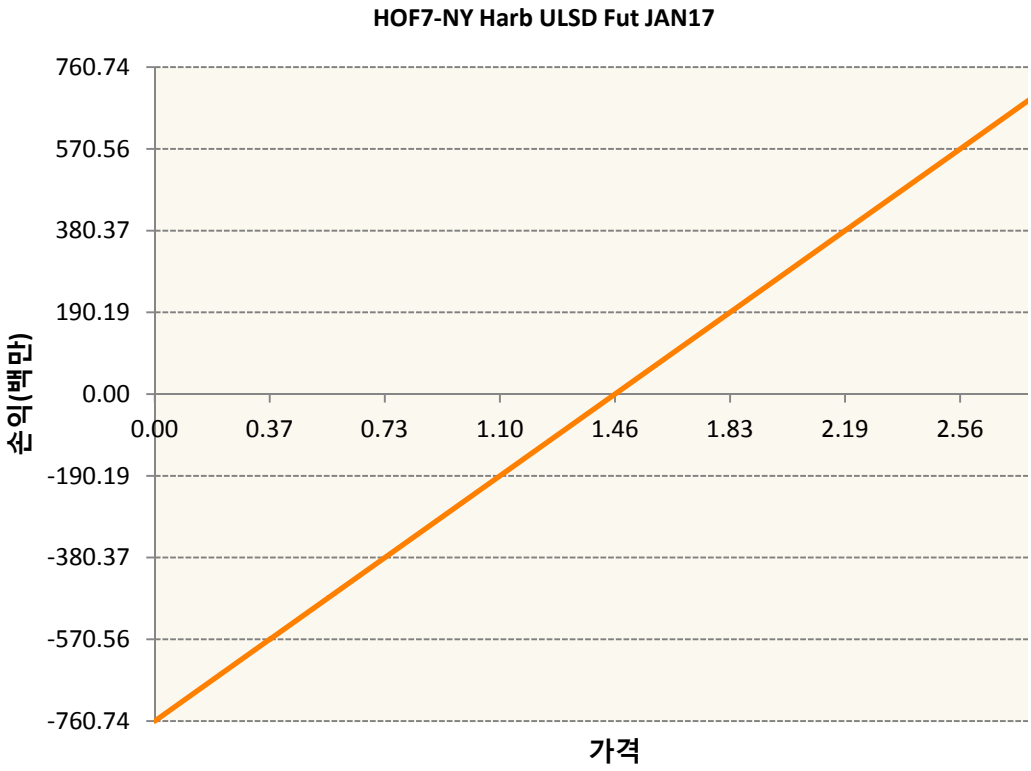
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	5,880	0	5,880	

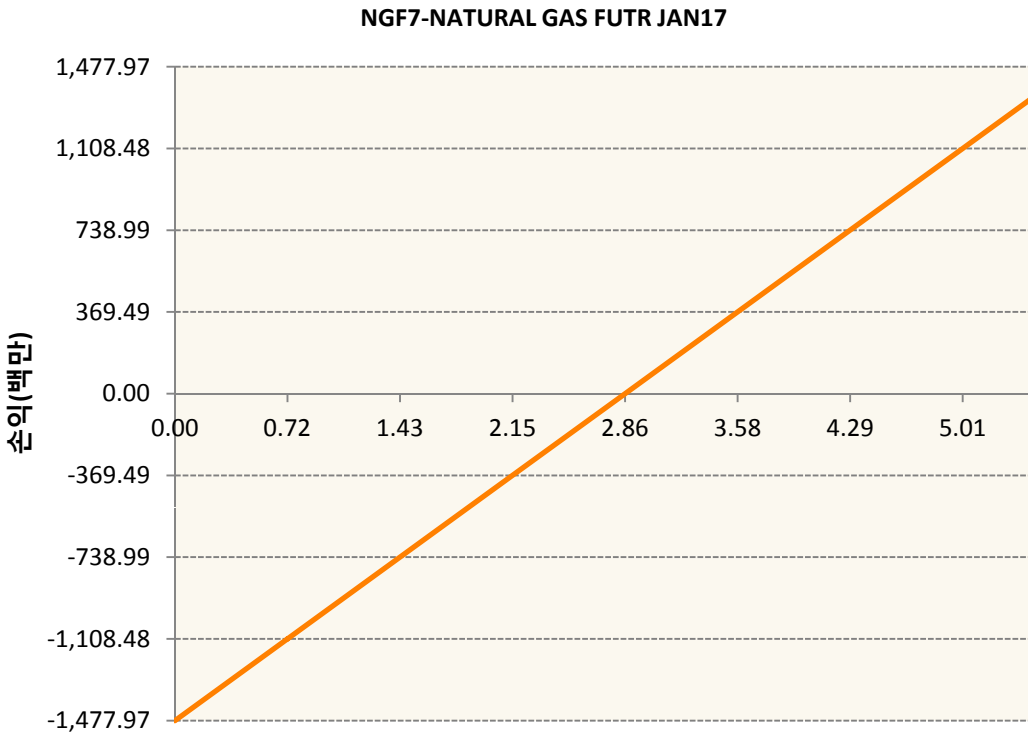
2. 만기시점의 손익구조



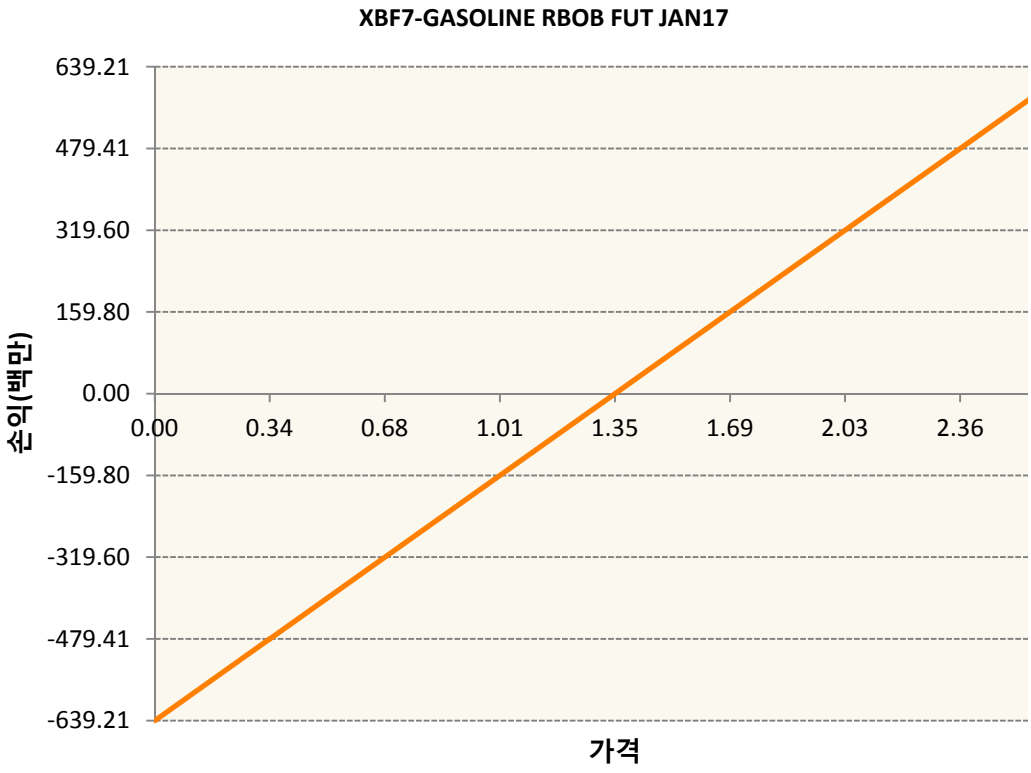



-1,164.14
-1,552.18
가격


HOF7-NY Harb ULSD Fut JAN17
760.74
570.56
380.37
190.19
0.00
-190.19
-380.37
-570.56
-760.74
0.00
0.37
0.73
1.10
1.46
1.83
2.19
2.56
순익(백만)
가격


NGF7-NATURAL GAS FUTR JAN17
1,477.97
1,108.48
738.99
369.49
0.00
-369.49
-738.99
-1,108.48
-1,477.97
0.00
0.72
1.43
2.15
2.86
3.58
4.29
5.01
순익(백만)

가격



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
CLF7	WTI CRUDE FUTURE JAN17	116
COF7	BRENT CRUDE FUTR JAN17	124
HOF7	NY Harb ULSD Fut JAN17	61
NGF7	NATURAL GAS FUTR JAN17	118
XBF7	GASOLINE RBOB FUT JAN17	51

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,051

공시일	2016-11-11
기준일	2016-11-10

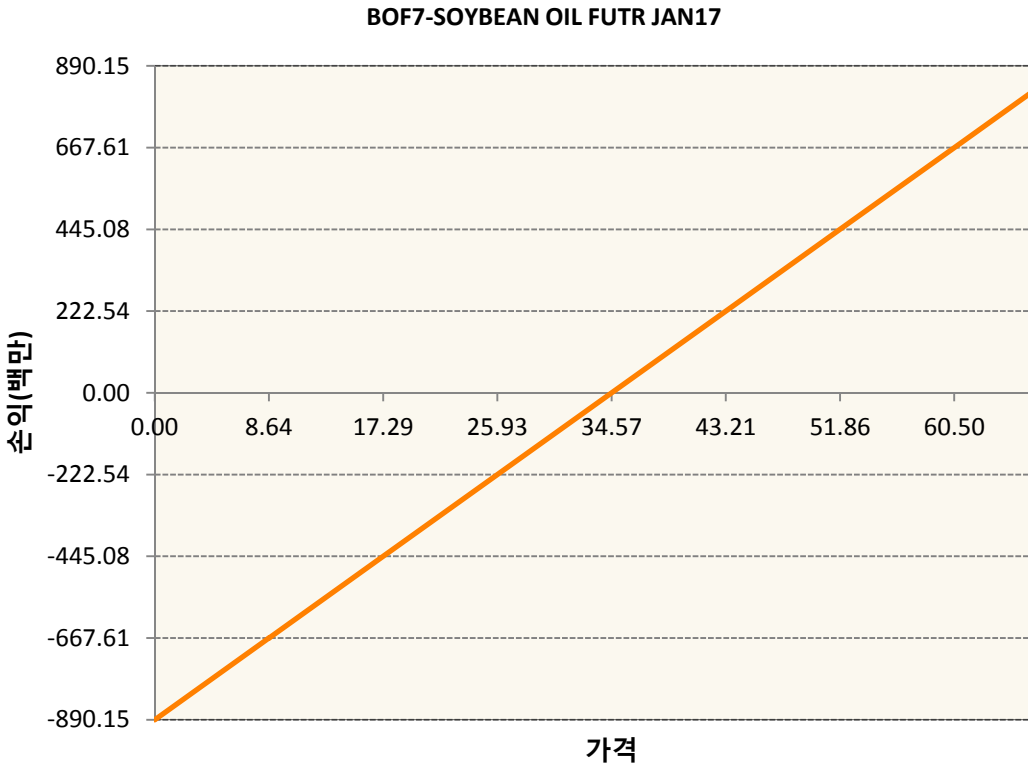
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

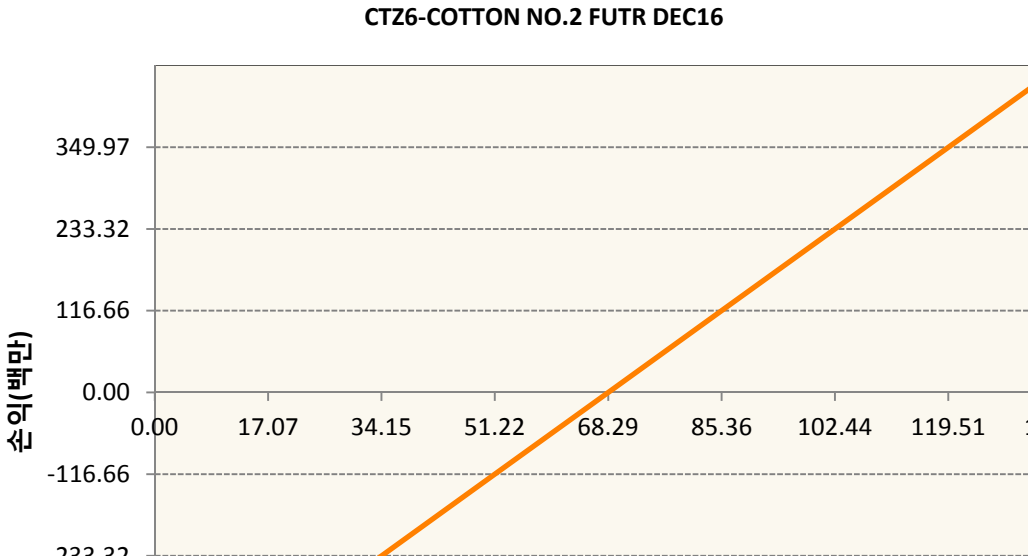
1. 계약금액

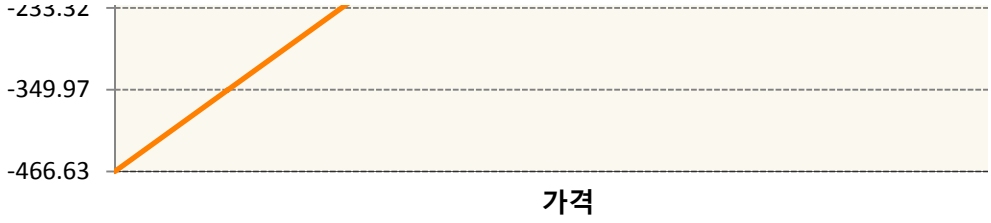
(단위:백만원)

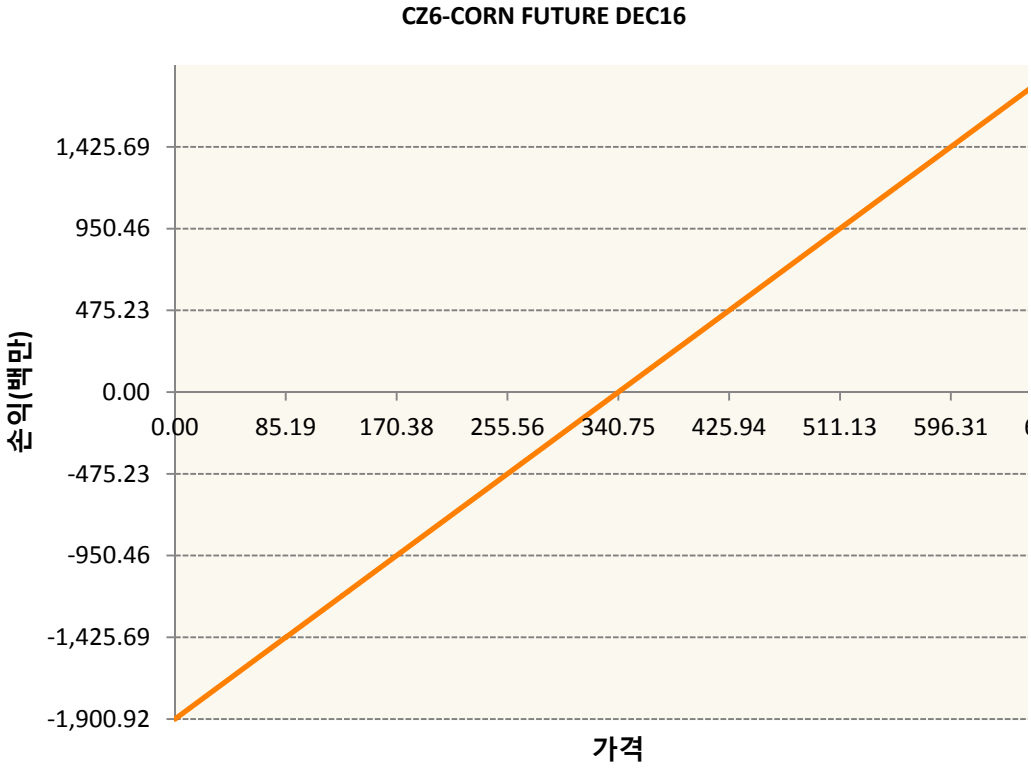
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	9,502	0	9,502	

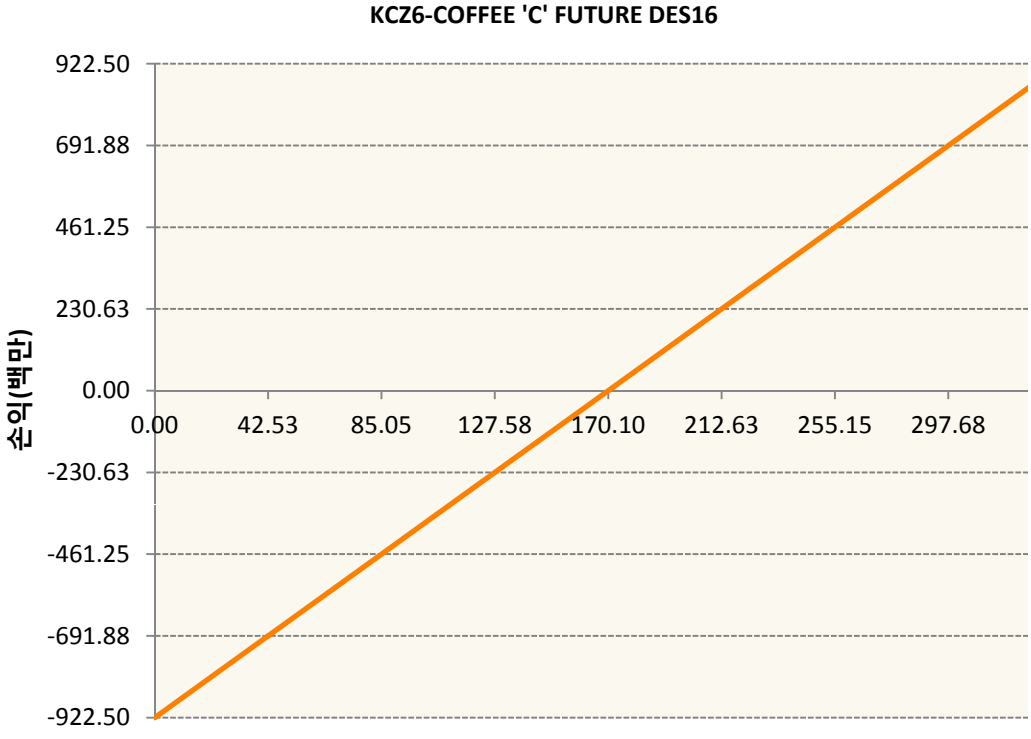
2. 만기시점의 손익구조



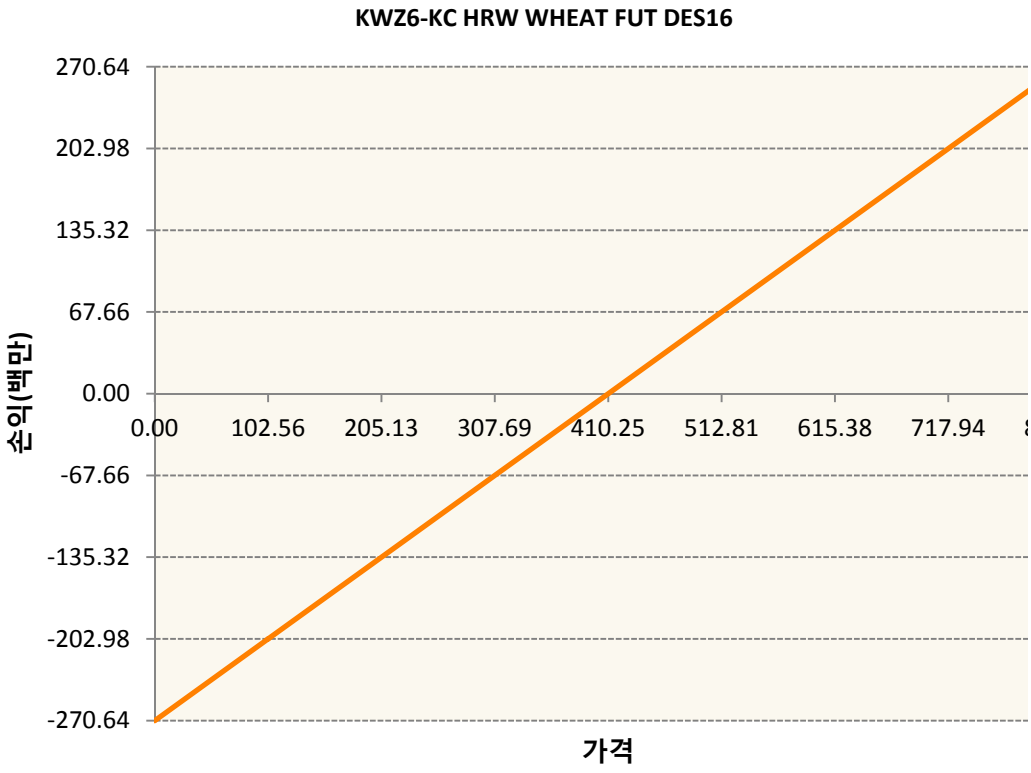


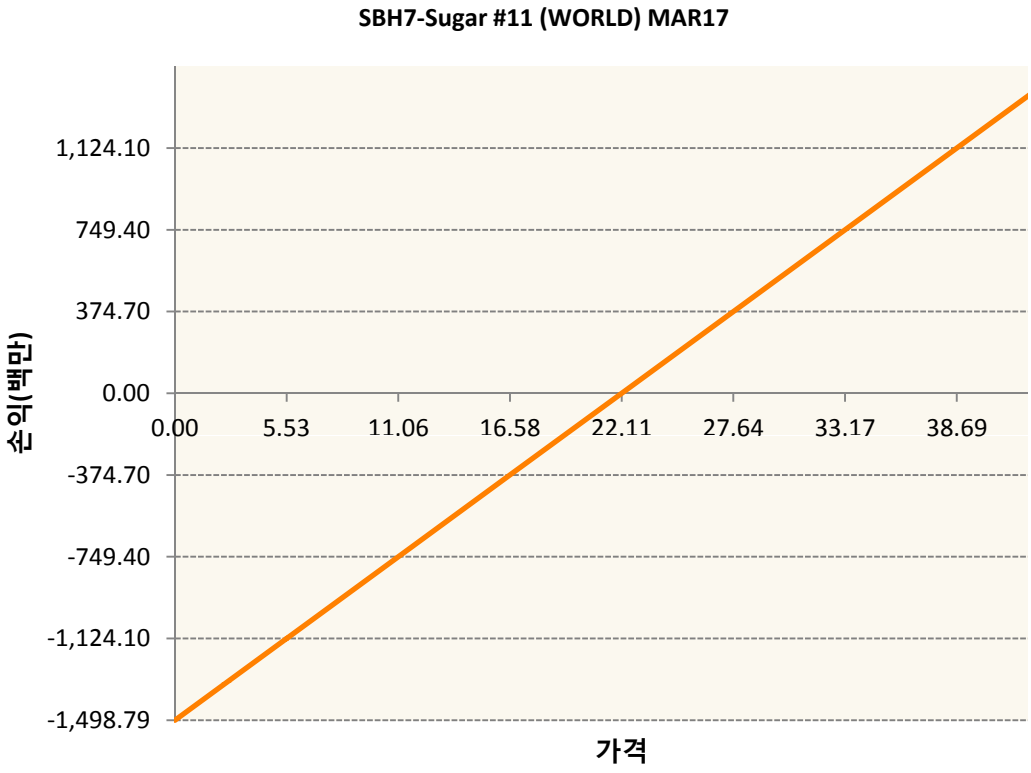

-233.32
-349.97
-466.63
가격

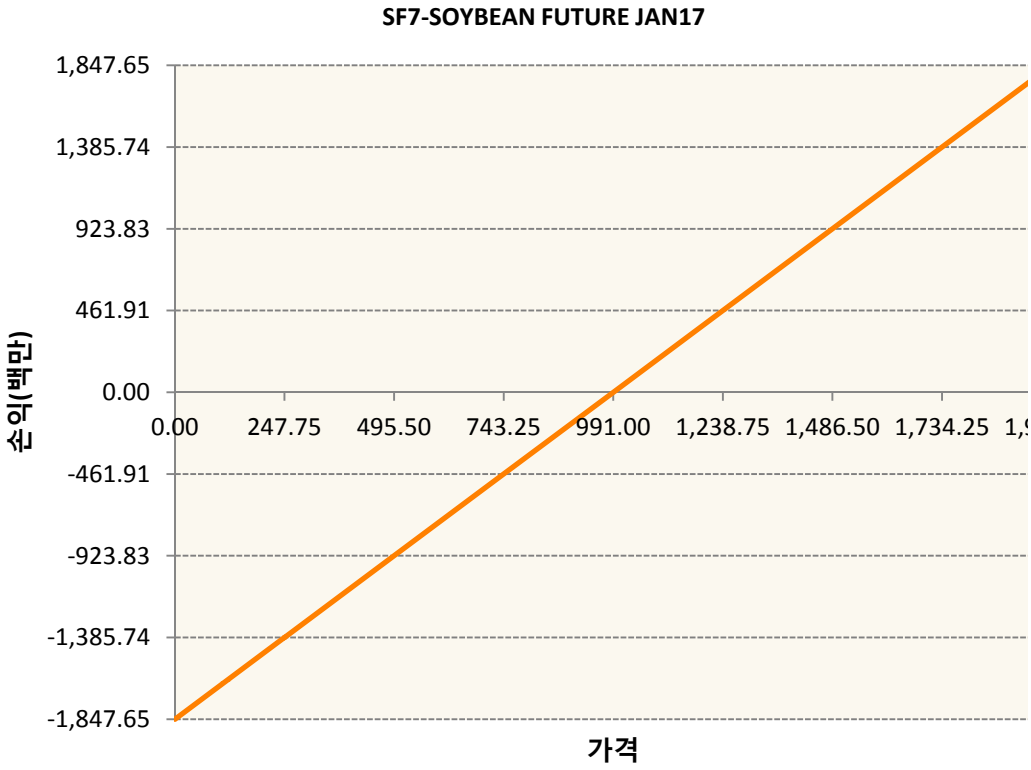

CZ6-CORN FUTURE DEC16
1,425.69
950.46
475.23
0.00
-475.23
-950.46
-1,425.69
-1,900.92
0.00
85.19
170.38
255.56
340.75
425.94
511.13
596.31
순익(백만)
가격

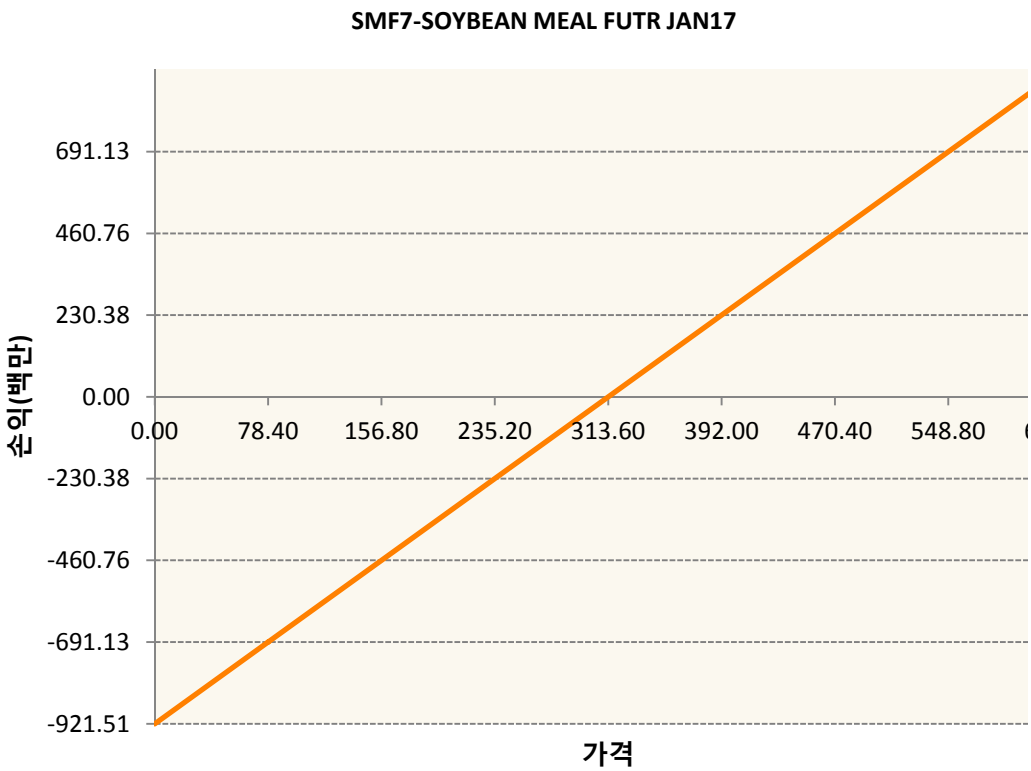

KCZ6-COFFEE 'C' FUTURE DES16
922.50
691.88
461.25
230.63
0.00
-230.63
-461.25
-691.88
-922.50
0.00
42.53
85.05
127.58
170.10
212.63
255.15
297.68
순익(백만)

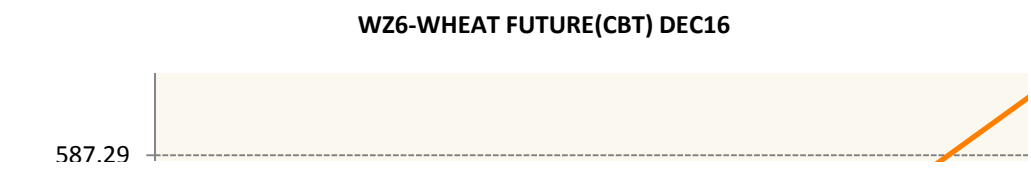
가격

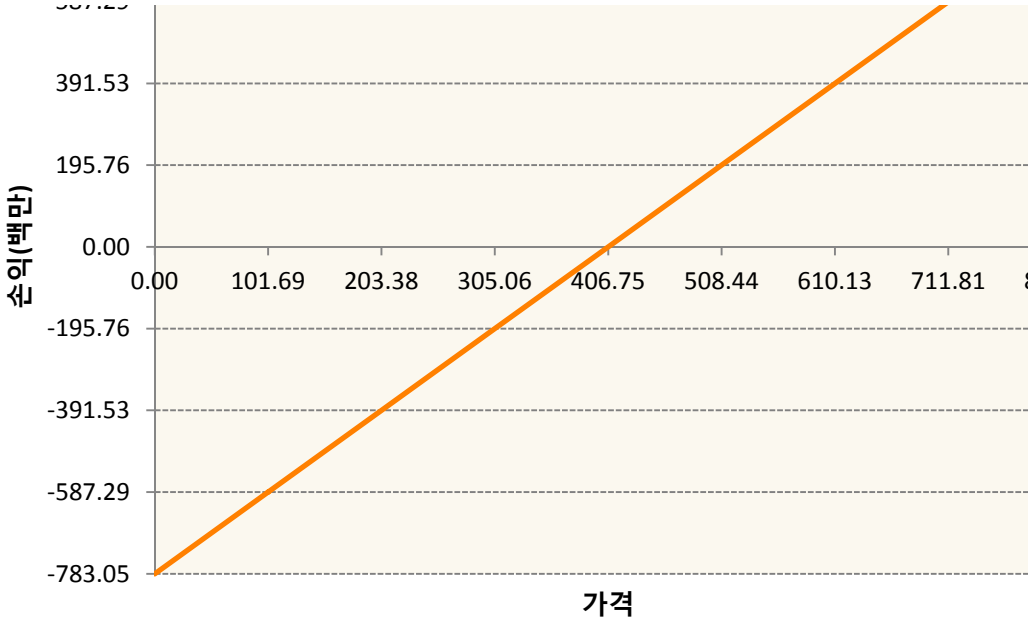

KWZ6-KC HRW WHEAT FUT DES16
270.64
202.98
135.32
67.66
0.00
-67.66
-135.32
-202.98
-270.64
0.00
102.56
205.13
307.69
410.25
512.81
615.38
717.94
손익(백만)
가격


SBH7-Sugar #11 (WORLD) MAR17
1,124.10
749.40
374.70
0.00
-374.70
-749.40
-1,124.10
-1,498.79
0.00
5.53
11.06
16.58
22.11
27.64
33.17
38.69
손익(백만)
가격


SF7-SOYBEAN FUTURE JAN17
1,847.65
1,385.74
923.83
461.91
0.00
-461.91
-923.83
-1,385.74
-1,847.65
0.00
247.75
495.50
743.25
991.00
1,238.75
1,486.50
1,734.25
손익(백만)
가격


SMF7-SOYBEAN MEAL FUTR JAN17
691.13
460.76
230.38
0.00
-230.38
-460.76
-691.13
-921.51
0.00
78.40
156.80
235.20
313.60
392.00
470.40
548.80
손익(백만)
가격


WZ6-WHEAT FUTURE(CBT) DEC16
587.29



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
BOF7	SOYBEAN OIL FUTR JAN17	71
CTZ6	COTTON NO.2 FUTR DEC16	37
CZ6	CORN FUTURE DEC16	152
KCZ6	COFFEE 'C' FUTURE DES16	74
KWZ6	KC HRW WHEAT FUT DES16	22
SBH7	Sugar #11 (WORLD) MAR17	120
SF7	SOYBEAN FUTURE JAN17	148
SMF7	SOYBEAN MEAL FUTR JAN17	74
WZ6	WHEAT FUTURE(CBT) DEC16	63

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	954