공시일	2016-11-14
기준일	2016-11-11

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	2016-11-14
기준일	2016-11-11

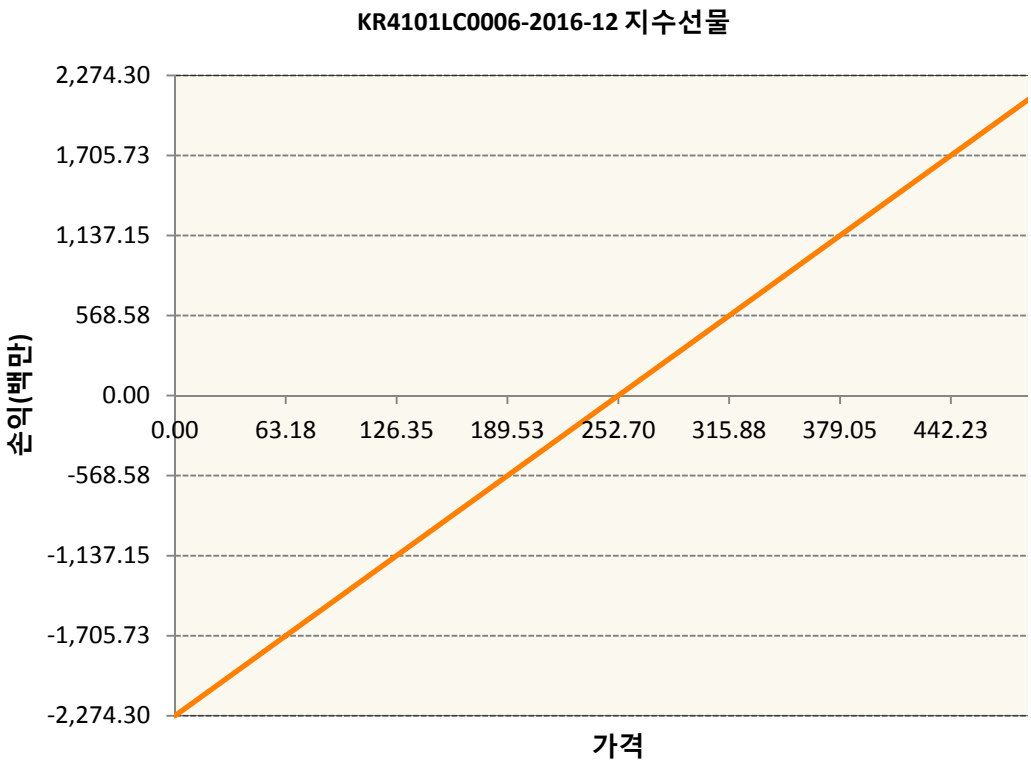
스마트인덱스모

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	253	-253	장내
누계	유가증권	선물	2,274	0	2,274	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101LC00 2016-12 지수선물							181
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-181	-181	-181	-181	-181	-181	-181
-5.33%	-121	-121	-121	-121	-121	-121	-121
-2.67%	-60	-60	-60	-60	-60	-60	-60
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	60	60	60	60	60	60	60
5.33%	121	121	121	121	121	121	121
8.00%	181	181	181	181	181	181	181

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

142

공시일	2016-11-14
기준일	2016-11-11

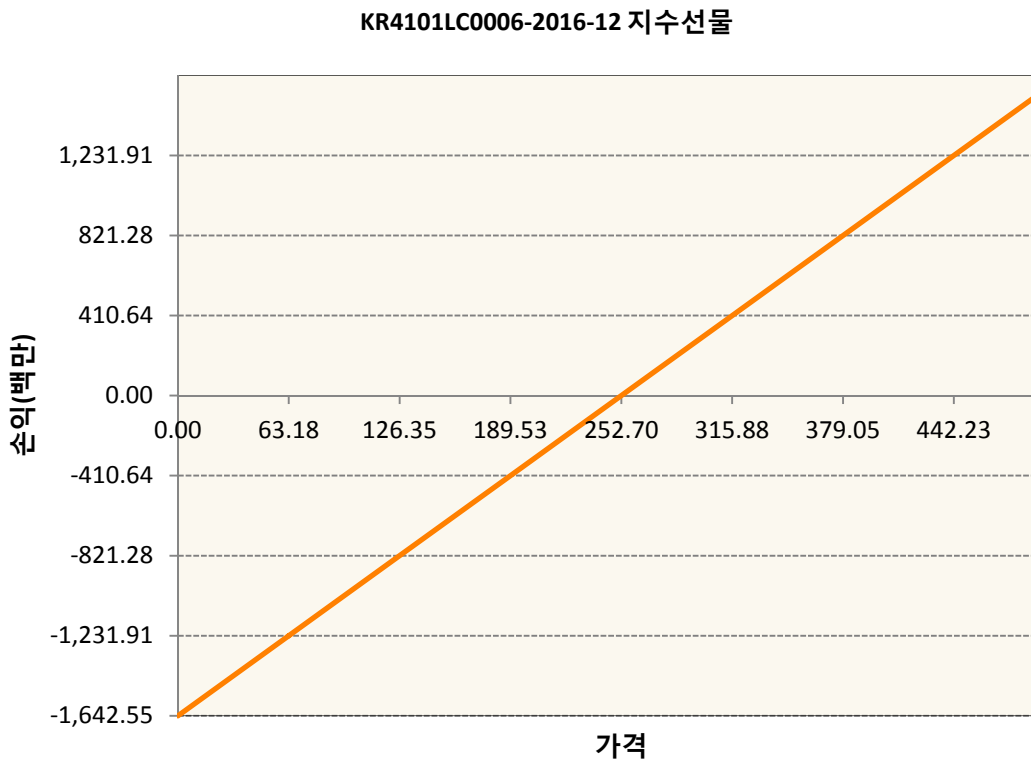
스마트레버리지목표전환형1호

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	1,643	0	1,643	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%	-87	-87	-87	-87	-87	-87	-87
-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%	87	87	87	87	87	87	87
8.00%	131	131	131	131	131	131	131

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

102

공시일	2016-11-14
기준일	2016-11-11

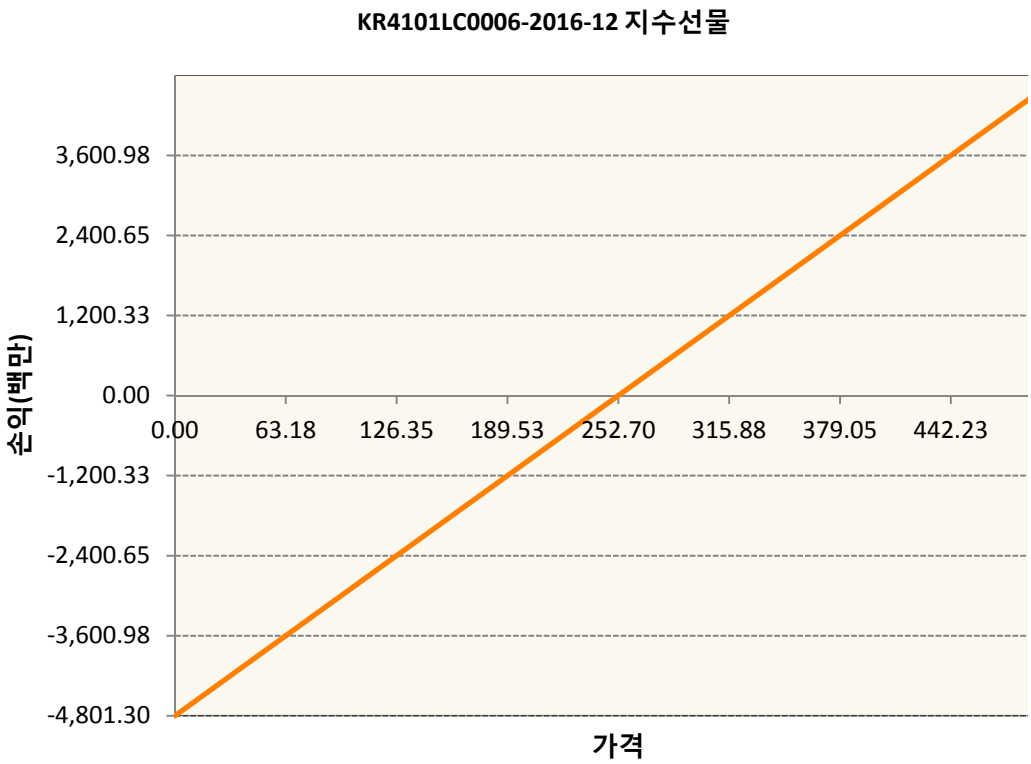
1.3배 레버리지 인덱스(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	126	0	126	장내
누계	유가증권	선물	4,801	0	4,801	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101LC00 2016-12 지수선물							383
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-383	-383	-383	-383	-383	-383	-383
-5.33%	-255	-255	-255	-255	-255	-255	-255
-2.67%	-128	-128	-128	-128	-128	-128	-128
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	128	128	128	128	128	128	128
5.33%	255	255	255	255	255	255	255
8.00%	383	383	383	383	383	383	383

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

300

공시일	2016-11-14
기준일	2016-11-11

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	876

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

713

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2016-11-14
기준일	2016-11-11

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	405

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

768

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2016-11-14
기준일	2016-11-11

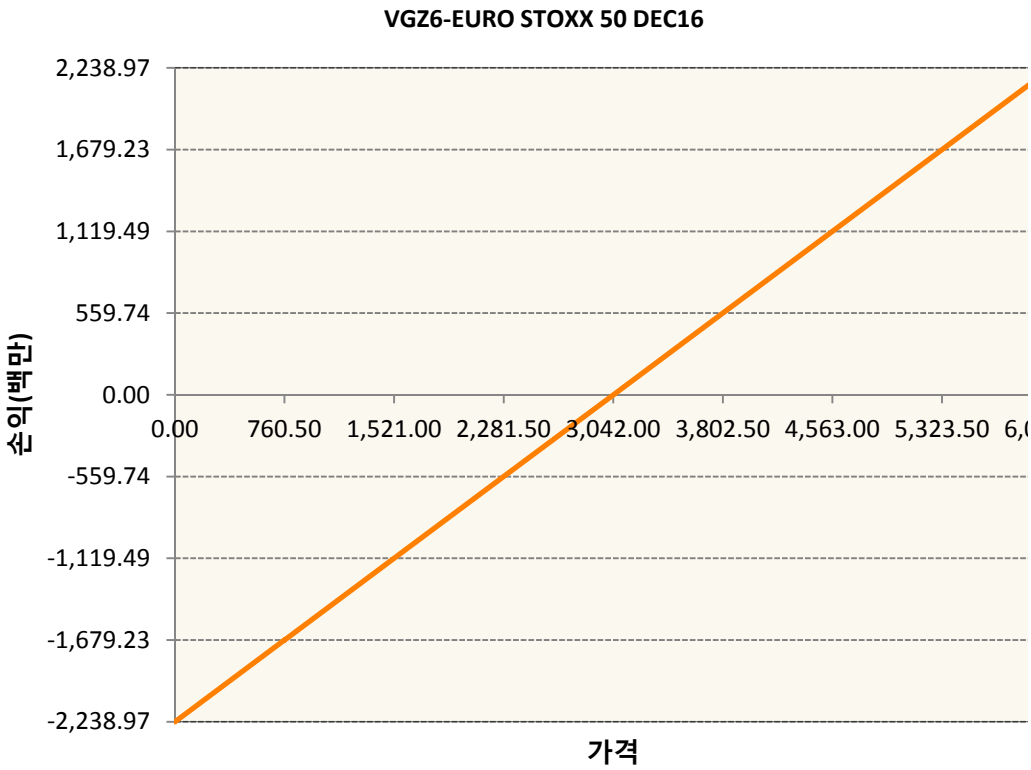
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,239	0	2,239	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGZ6	EURO STOXX 50 DEC16	179

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

(단위:백만원)

215

공시일	2016-11-14
기준일	2016-11-11

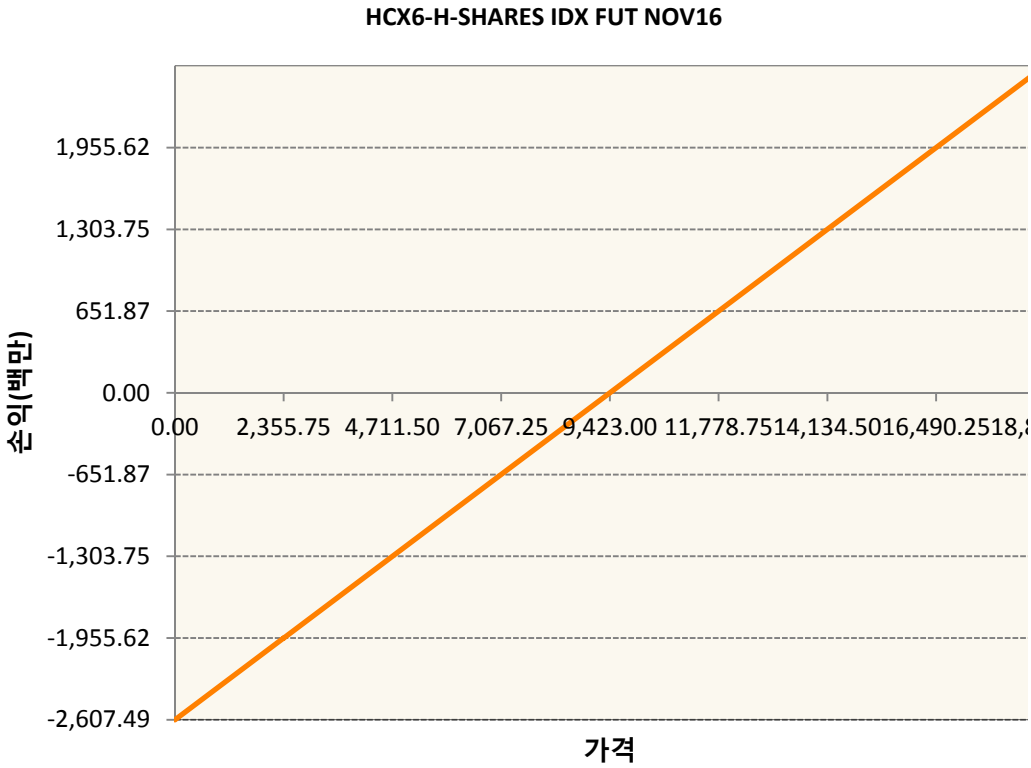
차이나인덱스모(주식-파생형)

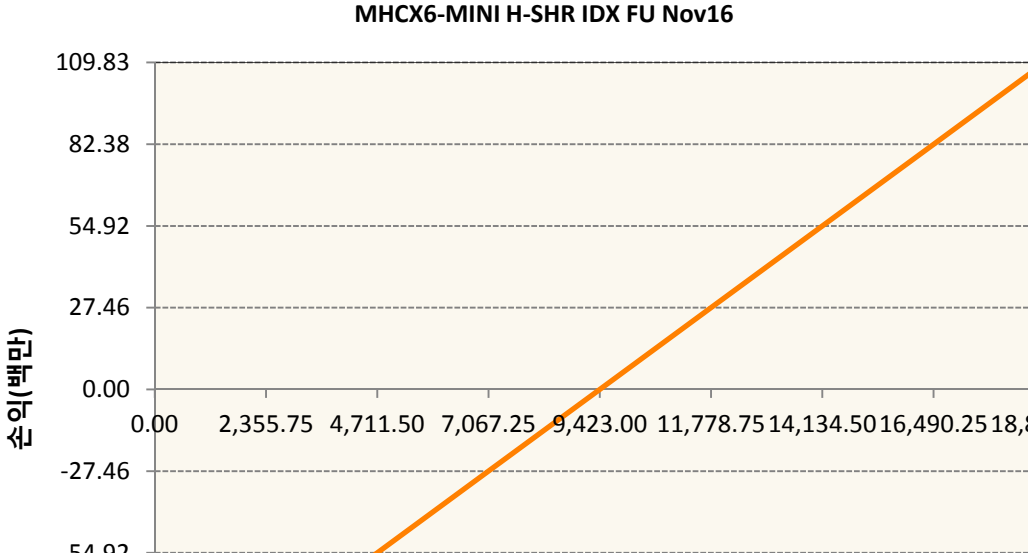
1. 계약금액

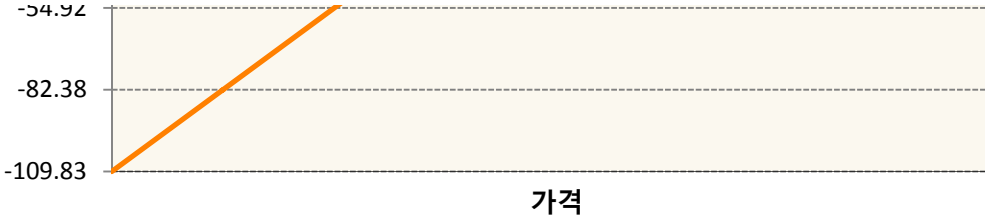
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,717	0	2,717	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCX6	H-SHARES IDX FUT NOV16	209
MHCX6	MINI H-SHR IDX FU Nov16	9

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	291

공시일	2016-11-14
기준일	2016-11-11

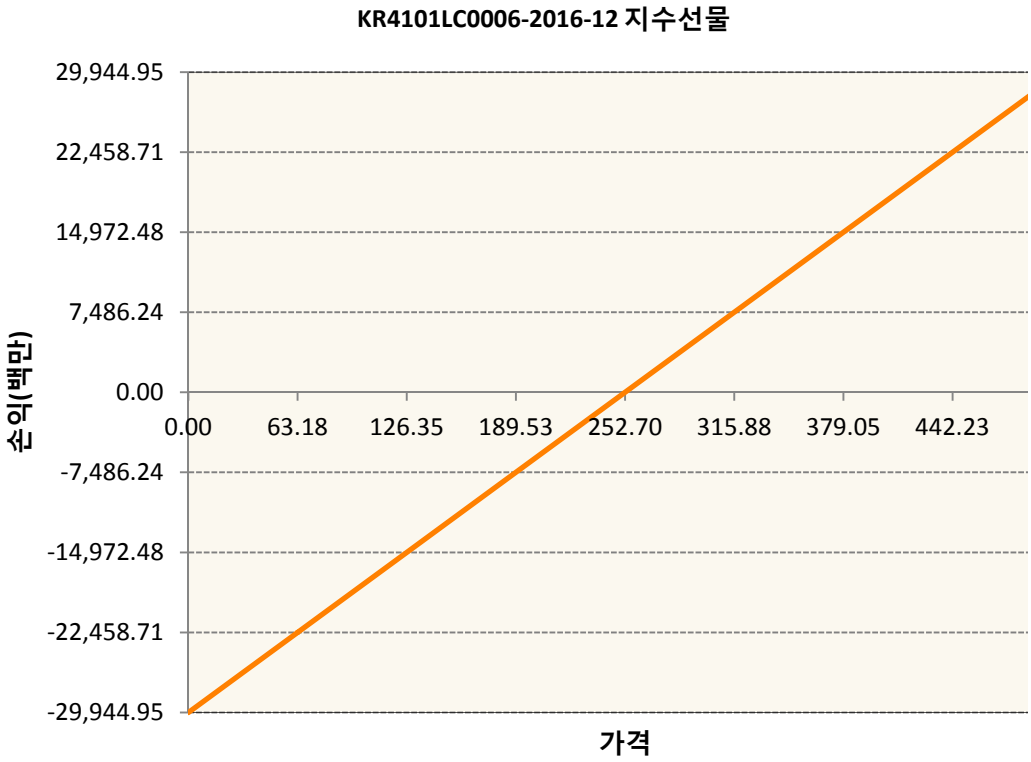
커버드콜(주식혼합-파생형)

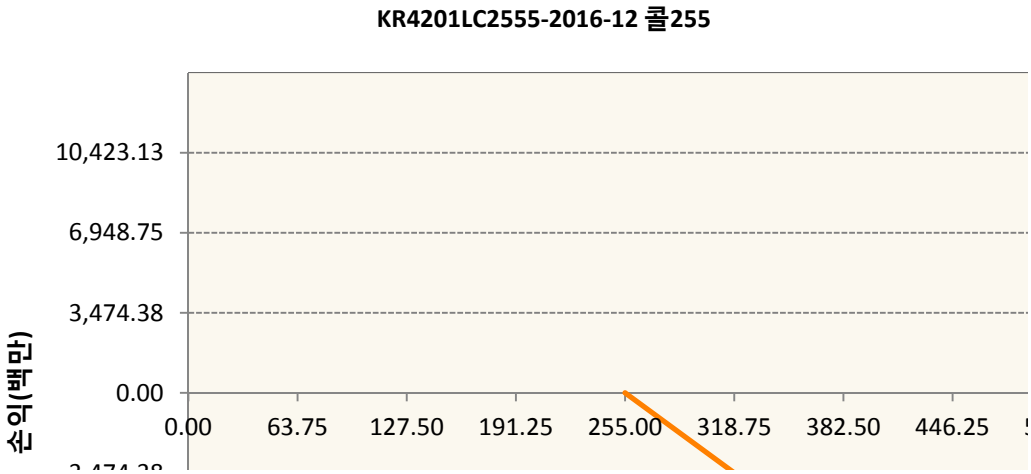
1. 계약금액

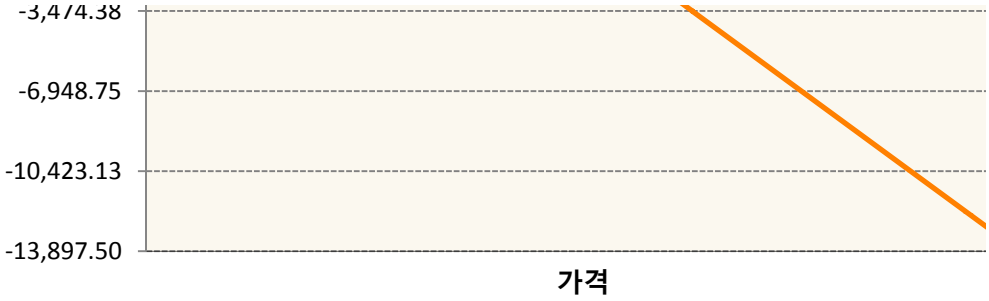
(단위:백만원)

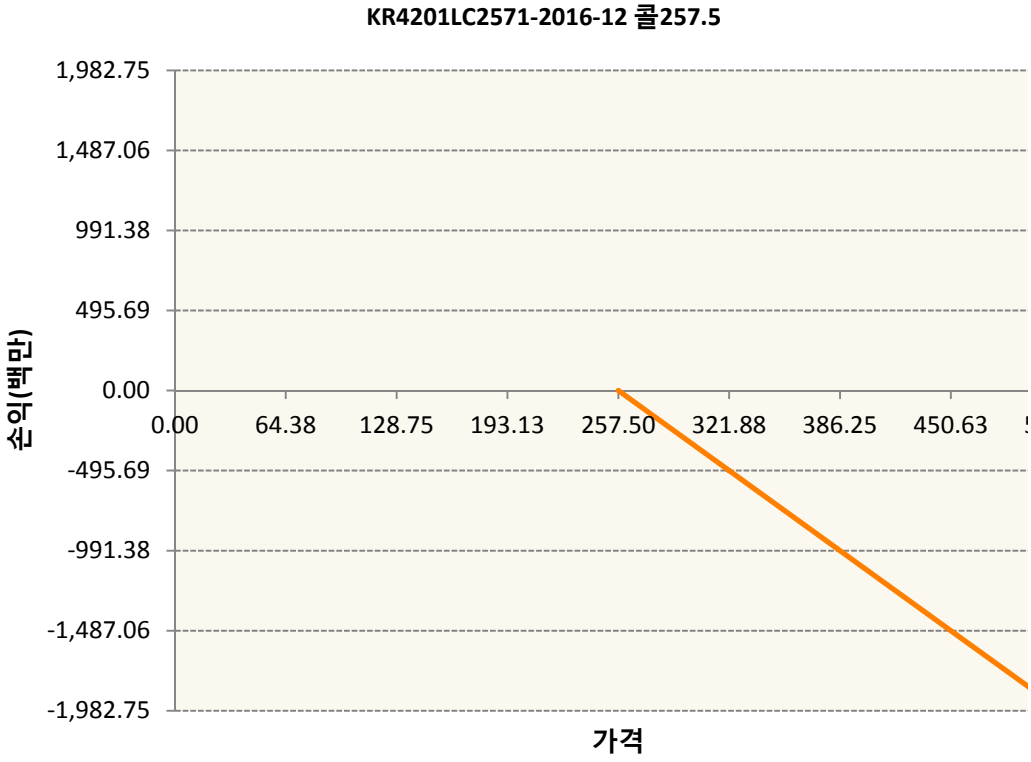
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	2,638	-2,638	장내
누계	유가증권	선물	29,945	0	29,945	장내
누계	유가증권	옵션	0	15,880	-15,880	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101LC00 2016-12 지수선물							2,389
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-2,389	-2,389	-2,389	-2,389	-2,389	-2,389	-2,389
-5.33%	-1,593	-1,593	-1,593	-1,593	-1,593	-1,593	-1,593
-2.67%	-796	-796	-796	-796	-796	-796	-796
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	796	796	796	796	796	796	796
5.33%	1,593	1,593	1,593	1,593	1,593	1,593	1,593
8.00%	2,389	2,389	2,389	2,389	2,389	2,389	2,389
KR4201LC25 2016-12 콜255							4,069
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	778	776	773	768	760	748	733
-5.33%	766	754	737	714	686	652	614
-2.67%	671	624	571	513	451	384	314
0%	271	182	91	0	-92	-184	-277
2.67%	-682	-770	-860	-950	-1,042	-1,134	-1,227
5.33%	-2,156	-2,203	-2,256	-2,316	-2,380	-2,448	-2,519
8.00%	-3,895	-3,909	-3,930	-3,956	-3,988	-4,026	-4,069
KR4201LC25 2016-12 콜257.5							523

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	78	78	77	77	76	75	74
-5.33%	77	76	75	73	70	66	62
-2.67%	70	66	60	54	47	39	31
0%	34	23	12	0	-12	-24	-36
2.67%	-70	-83	-97	-111	-124	-138	-152
5.33%	-254	-263	-273	-283	-294	-305	-317
8.00%	-489	-493	-497	-502	-509	-516	-523

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

6,526

공시일	2016-11-14
기준일	2016-11-11

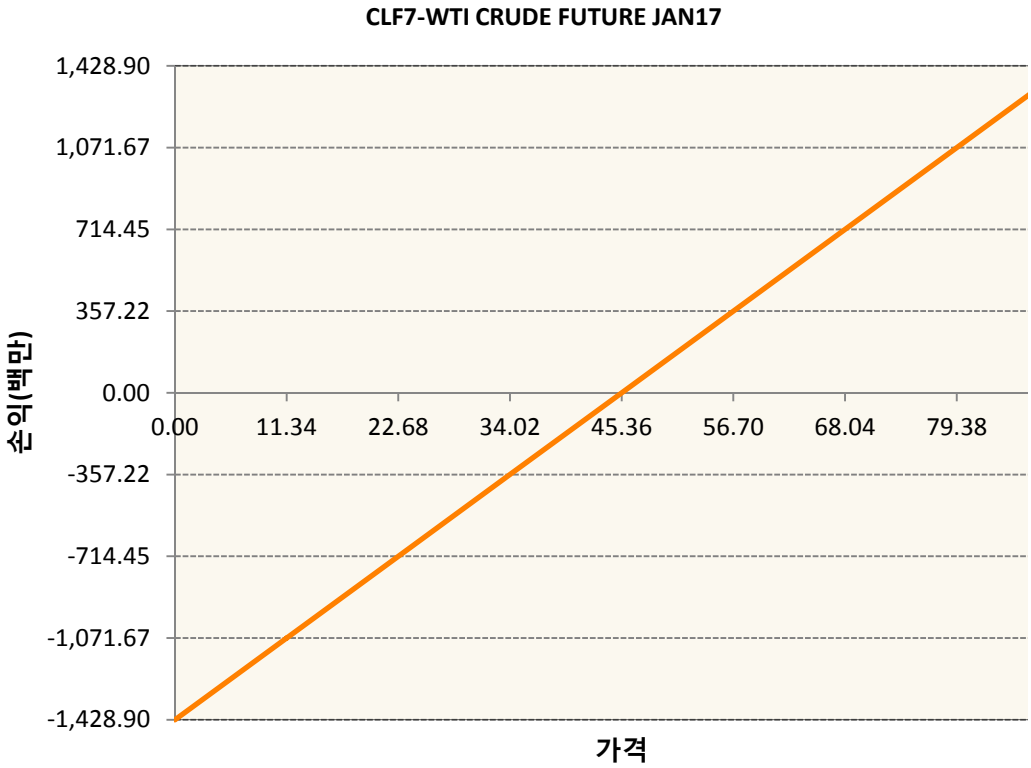
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

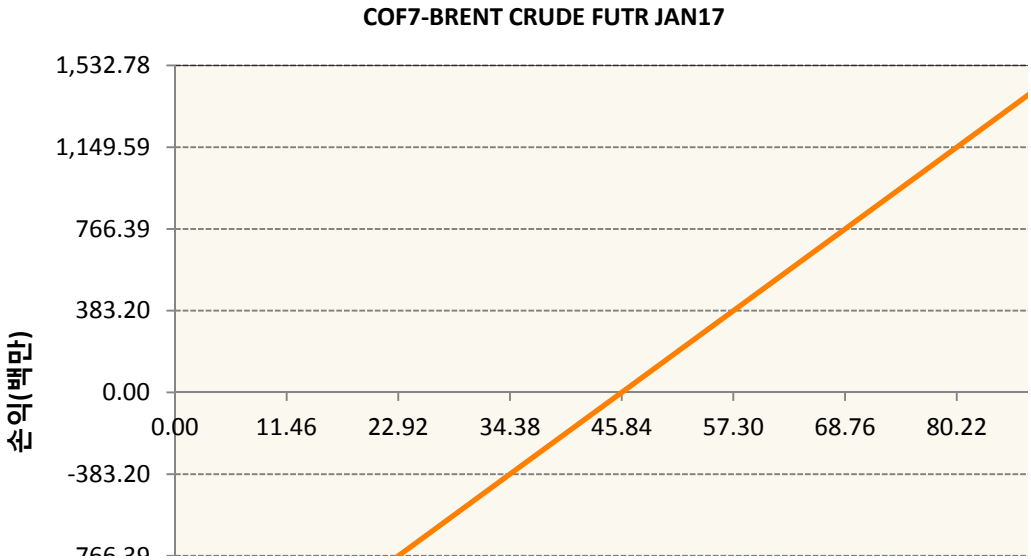
1. 계약금액

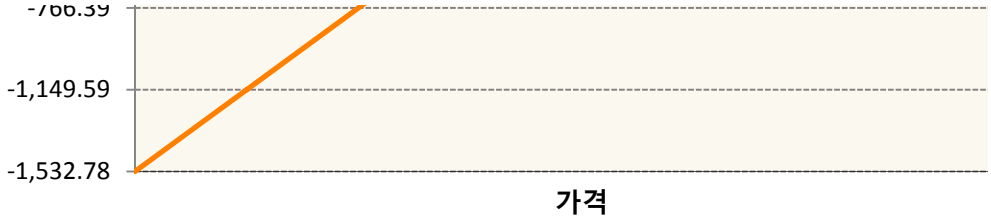
(단위:백만원)

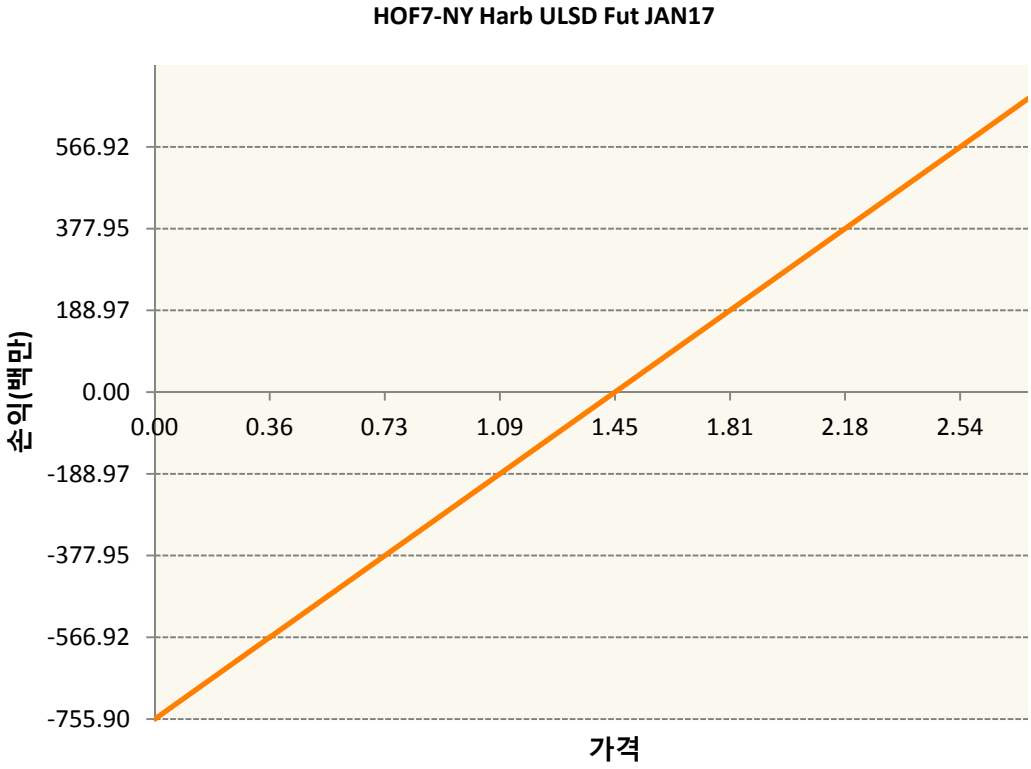
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	5,797	0	5,797	

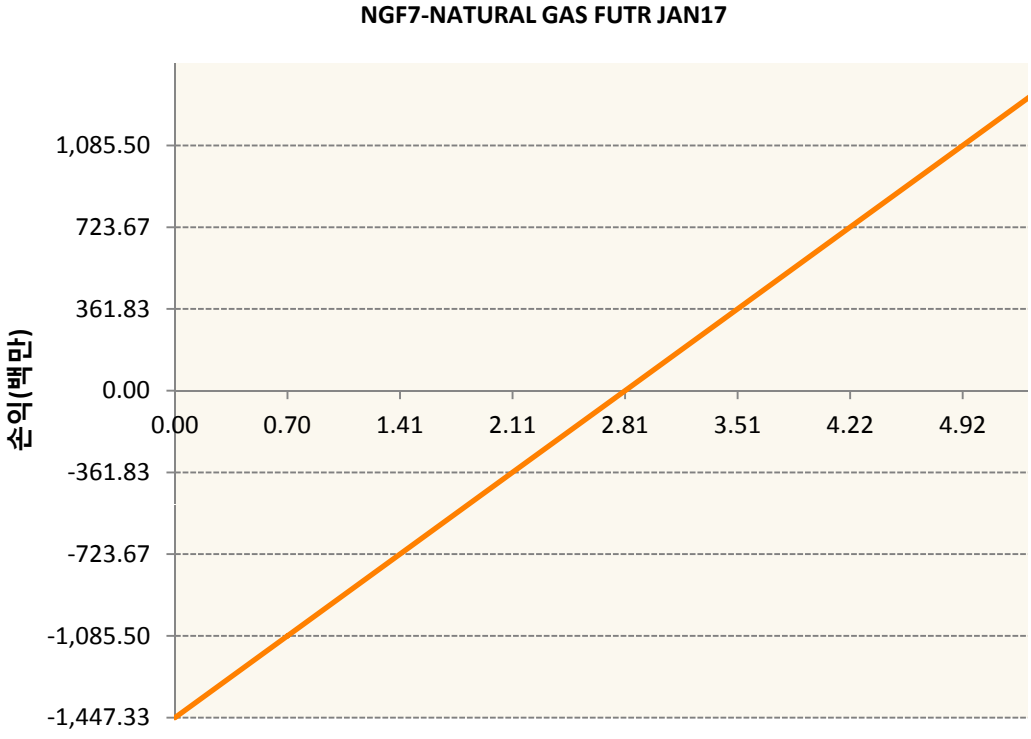
2. 만기시점의 손익구조



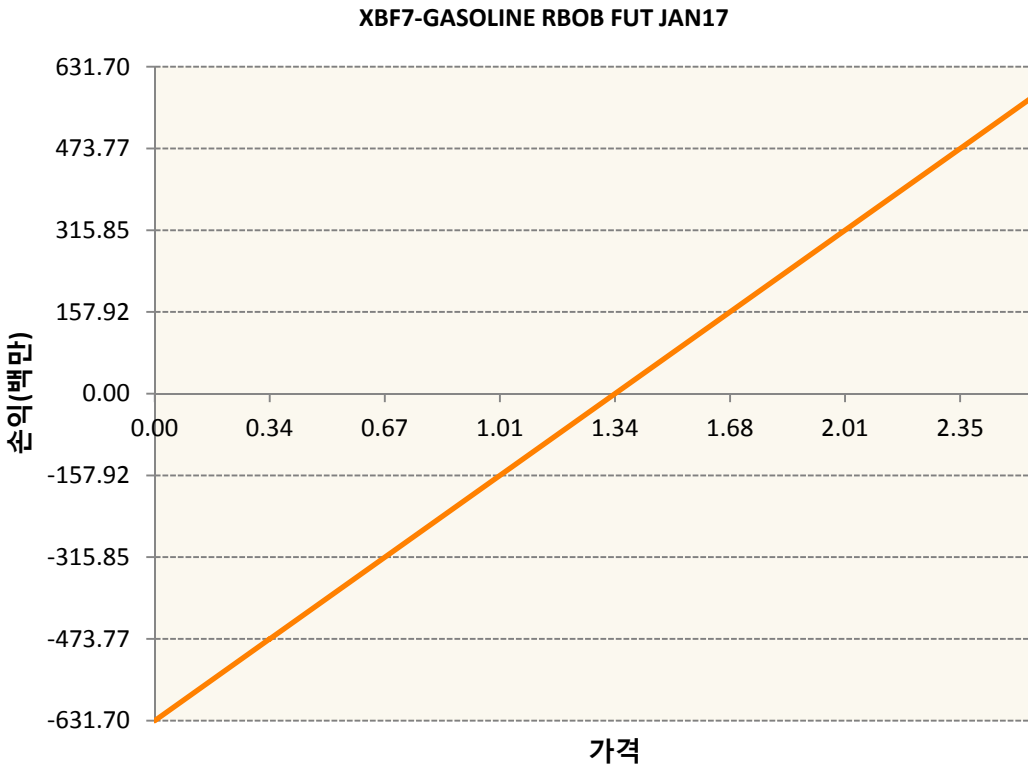



-1,149.59
-1,532.78
가격


HOF7-NY Harb ULSD Fut JAN17
566.92
377.95
188.97
0.00
-188.97
-377.95
-566.92
-755.90
0.00
0.36
0.73
1.09
1.45
1.81
2.18
2.54
순익(백만)
가격


NGF7-NATURAL GAS FUTR JAN17
1,085.50
723.67
361.83
0.00
-361.83
-723.67
-1,085.50
-1,447.33
0.00
0.70
1.41
2.11
2.81
3.51
4.22
4.92
순익(백만)

가격



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
CLF7	WTI CRUDE FUTURE JAN17	114
COF7	BRENT CRUDE FUTR JAN17	123
HOF7	NY Harb ULSD Fut JAN17	60
NGF7	NATURAL GAS FUTR JAN17	116
XBF7	GASOLINE RBOB FUT JAN17	51

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,036

공시일	2016-11-14
기준일	2016-11-11

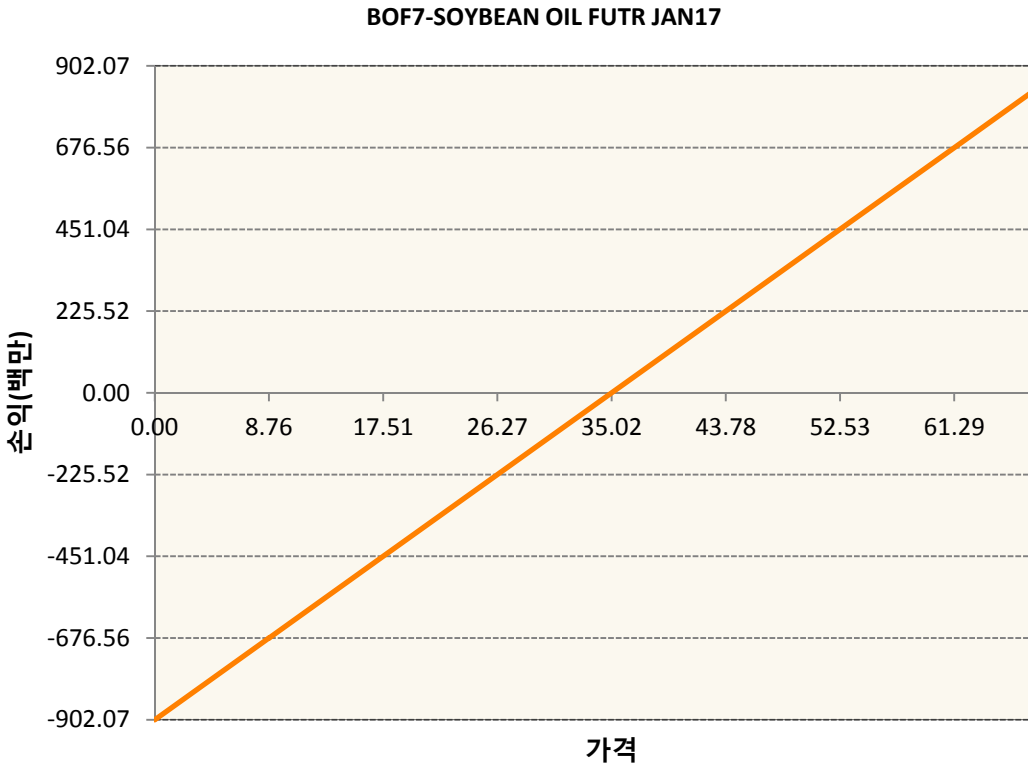
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

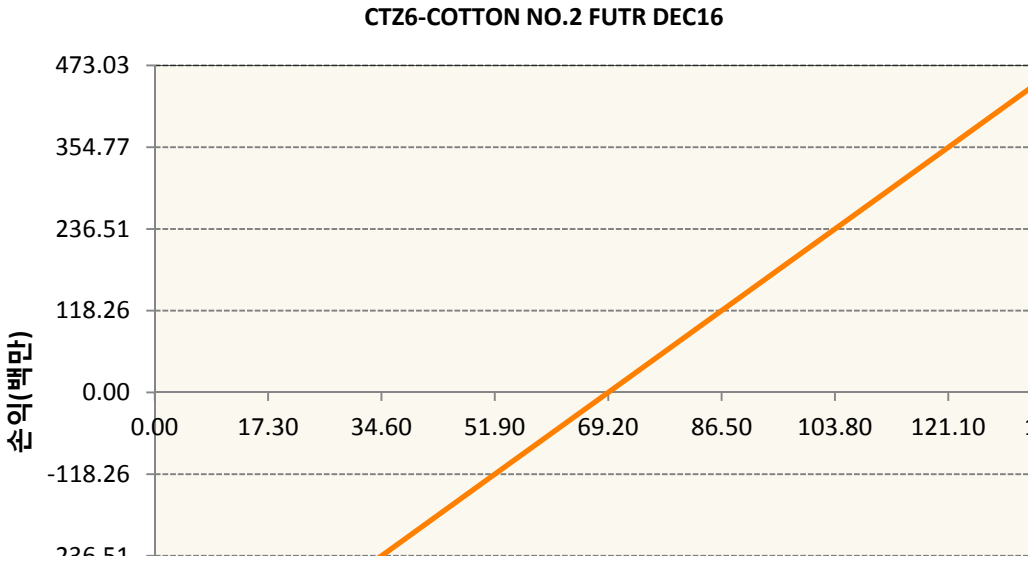
1. 계약금액

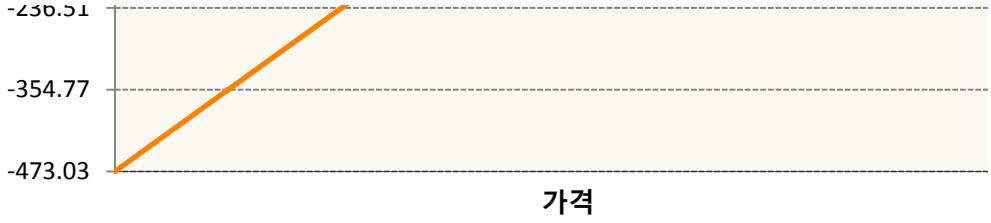
(단위:백만원)

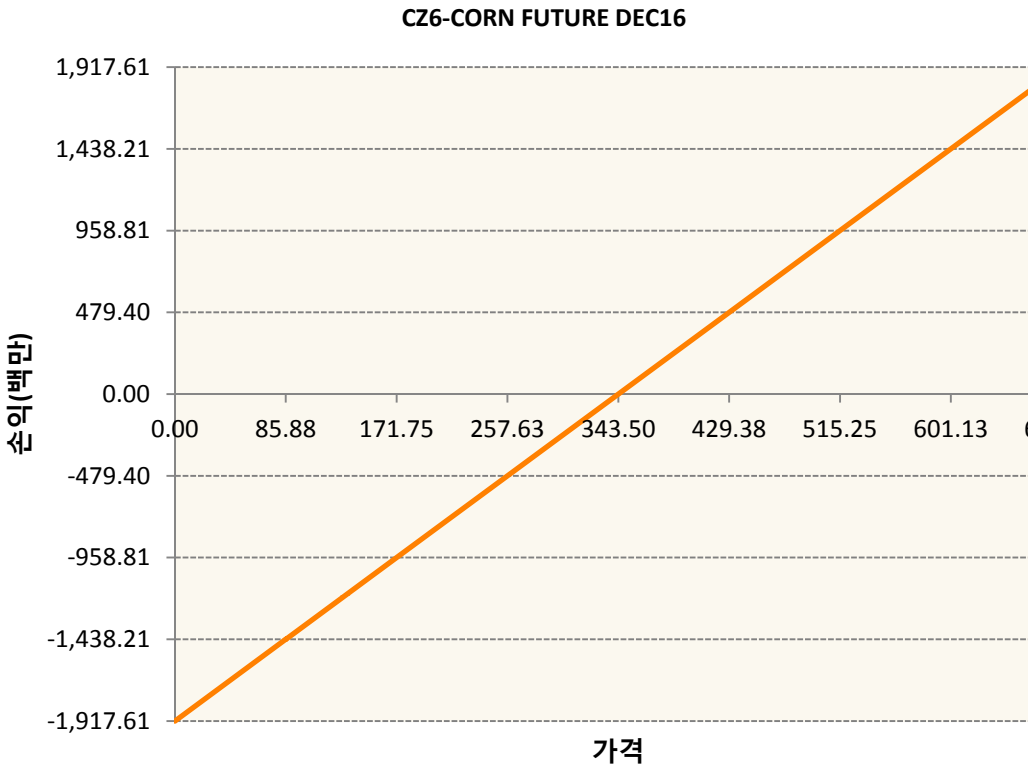
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	9,469	0	9,469	

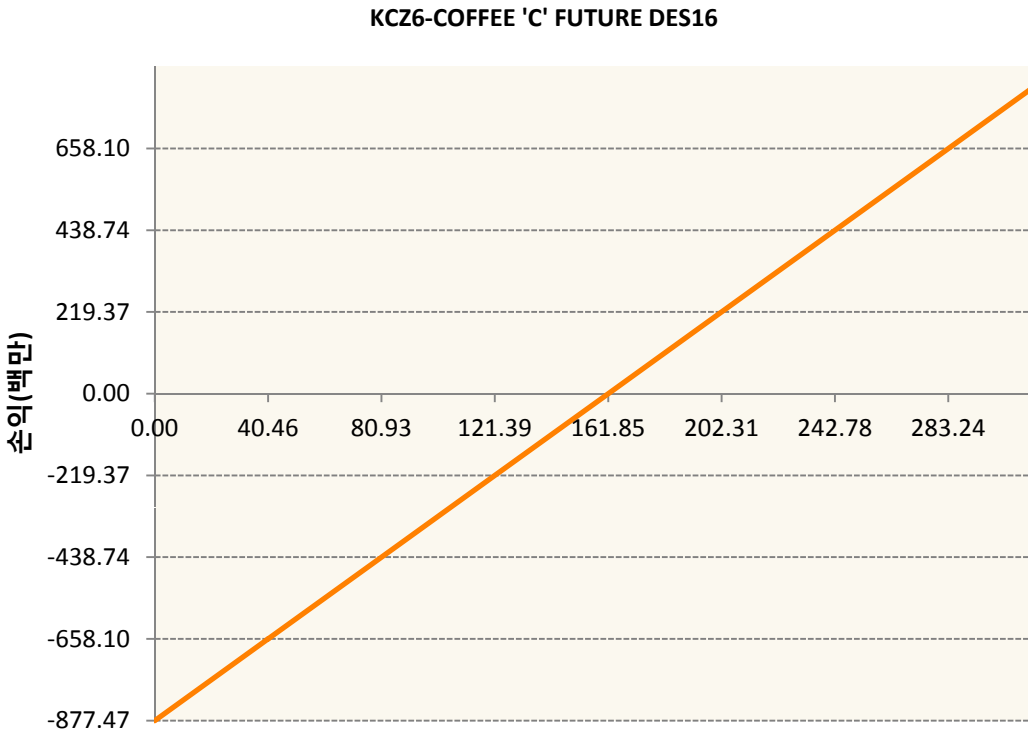
2. 만기시점의 손익구조



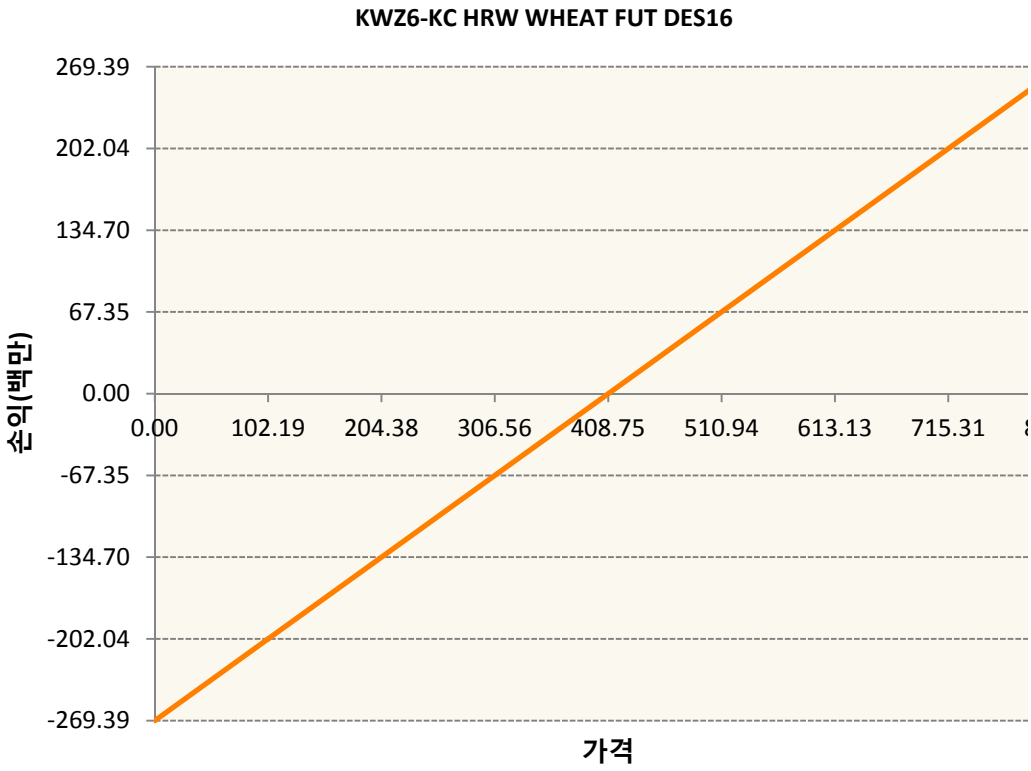


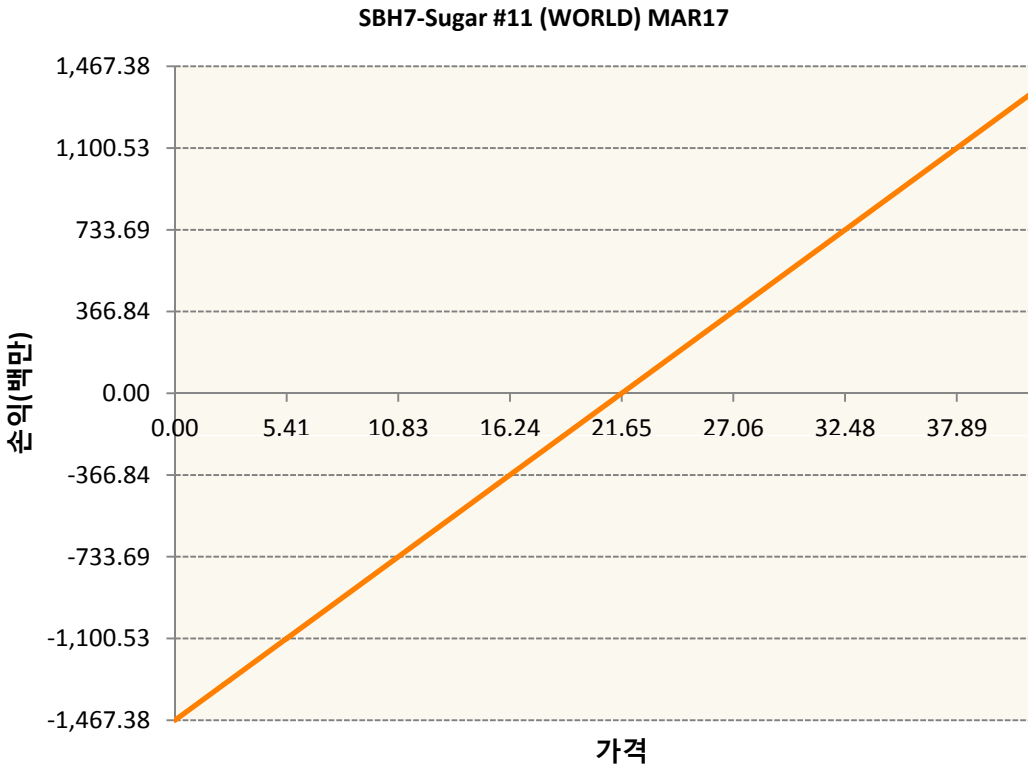

-354.77
-473.03
가격


CZ6-CORN FUTURE DEC16
1,917.61
1,438.21
958.81
479.40
0.00
-479.40
-958.81
-1,438.21
-1,917.61
0.00
85.88
171.75
257.63
343.50
429.38
515.25
601.13
순익(백만)
가격

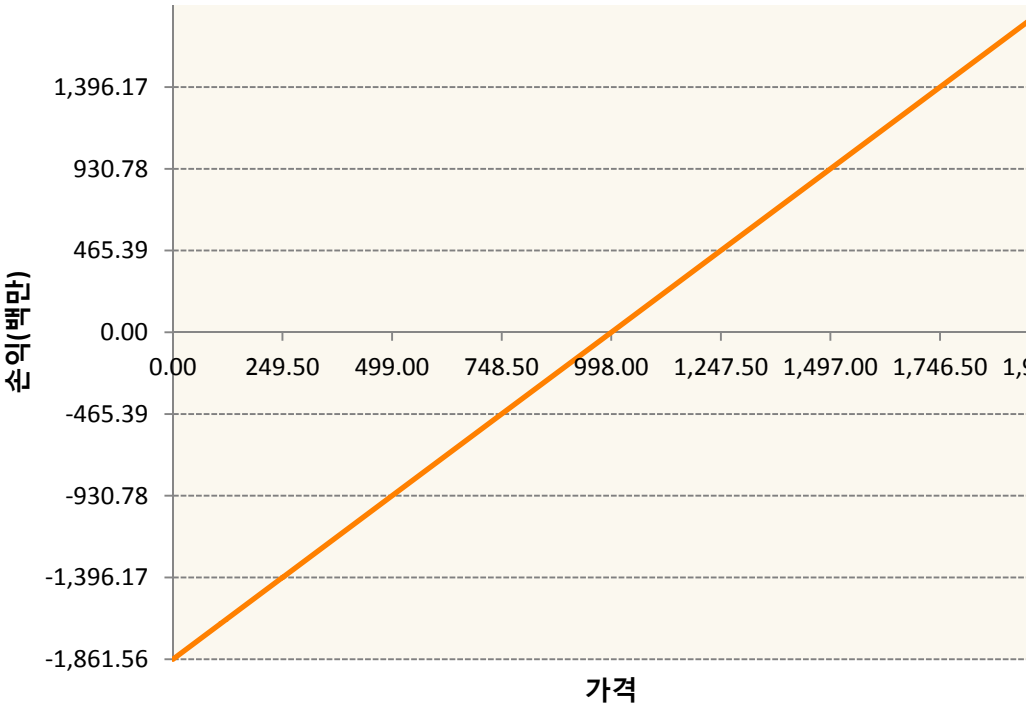

KCZ6-COFFEE 'C' FUTURE DES16
658.10
438.74
219.37
0.00
-219.37
-438.74
-658.10
-877.47
0.00
40.46
80.93
121.39
161.85
202.31
242.78
283.24
순익(백만)

가격

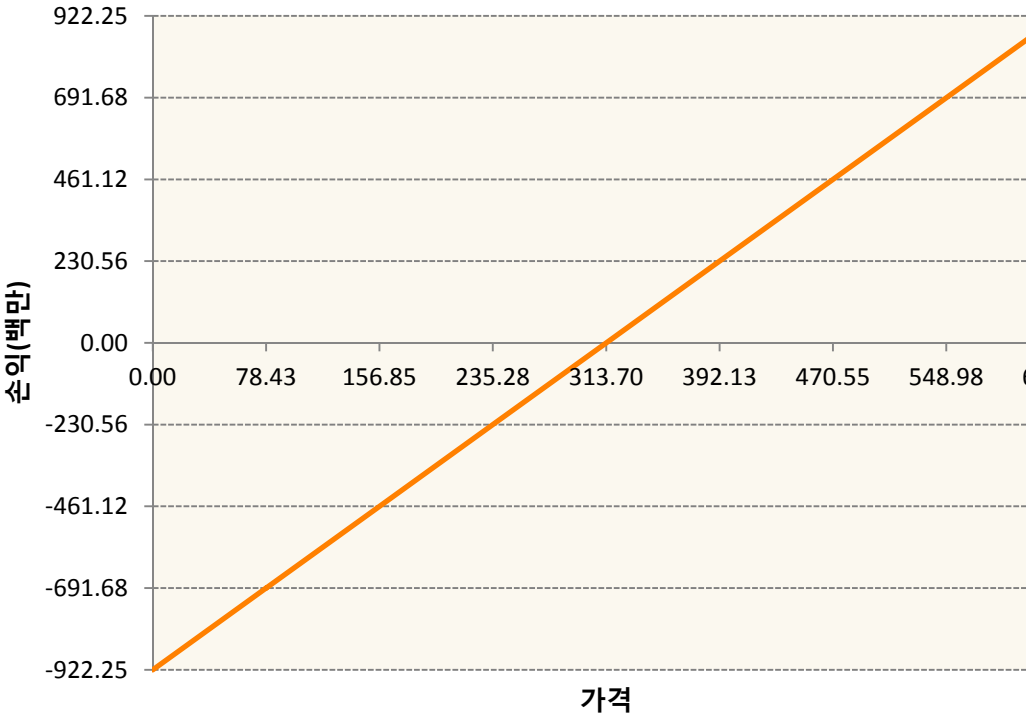

KWZ6-KC HRW WHEAT FUT DES16
269.39
202.04
134.70
67.35
0.00
-67.35
-134.70
-202.04
-269.39
0.00
102.19
204.38
306.56
408.75
510.94
613.13
715.31
손익(백만)
가격


SBH7-Sugar #11 (WORLD) MAR17
1,467.38
1,100.53
733.69
366.84
0.00
-366.84
-733.69
-1,100.53
-1,467.38
0.00
5.41
10.83
16.24
21.65
27.06
32.48
37.89
손익(백만)
가격

SF7-SOYBEAN FUTURE JAN17

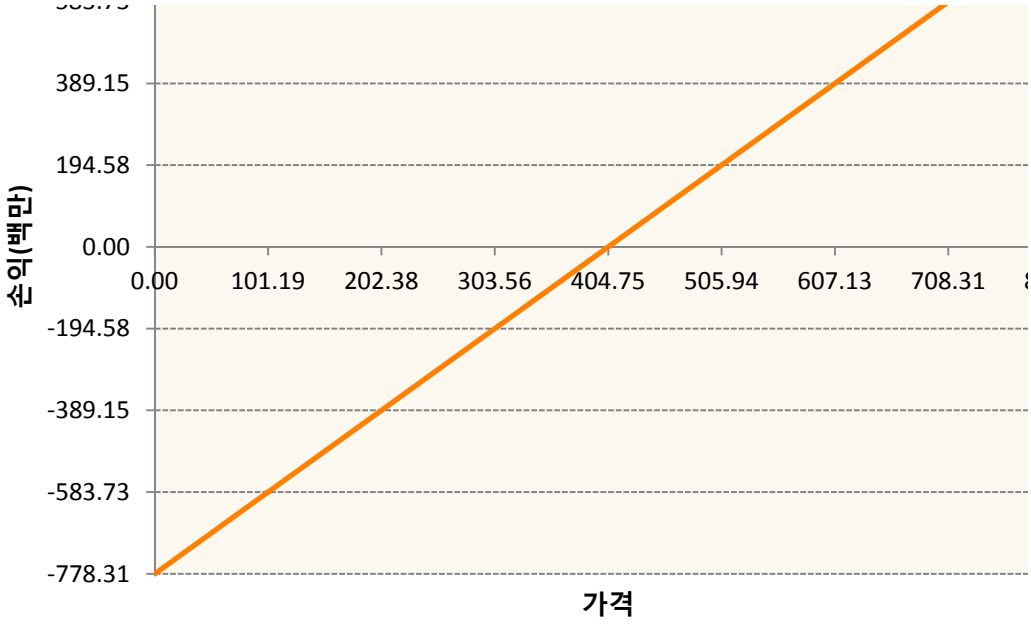


SMF7-SOYBEAN MEAL FUTR JAN17



WZ6-WHEAT FUTURE(CBT) DEC16





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
BOF7	SOYBEAN OIL FUTR JAN17	72
CTZ6	COTTON NO.2 FUTR DEC16	38
CZ6	CORN FUTURE DEC16	153
KCZ6	COFFEE 'C' FUTURE DES16	70
KWZ6	KC HRW WHEAT FUT DES16	22
SBH7	Sugar #11 (WORLD) MAR17	117
SF7	SOYBEAN FUTURE JAN17	149
SMF7	SOYBEAN MEAL FUTR JAN17	74
WZ6	WHEAT FUTURE(CBT) DEC16	62

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	948