공시일	2016-11-15
기준일	2016-11-14

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	2016-11-15
기준일	2016-11-14

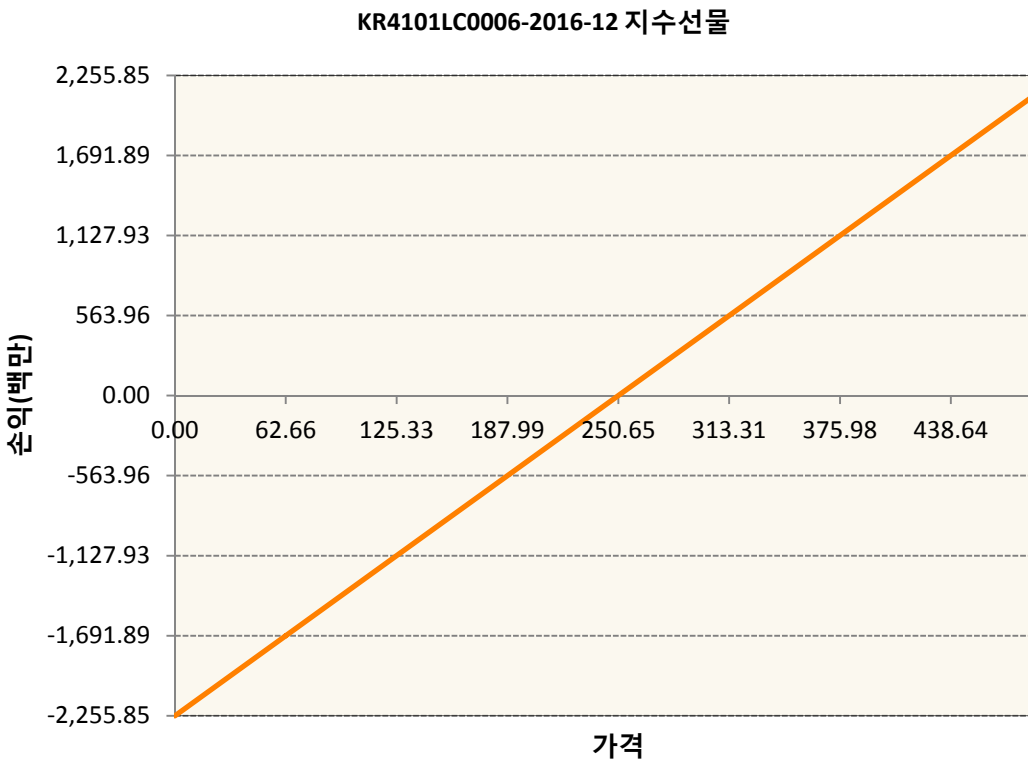
스마트인덱스모

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	2,256	0	2,256	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101LC00 2016-12 지수선물							180
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-180	-180	-180	-180	-180	-180	-180
-5.33%	-120	-120	-120	-120	-120	-120	-120
-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%	120	120	120	120	120	120	120
8.00%	180	180	180	180	180	180	180

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

141

공시일	2016-11-15
기준일	2016-11-14

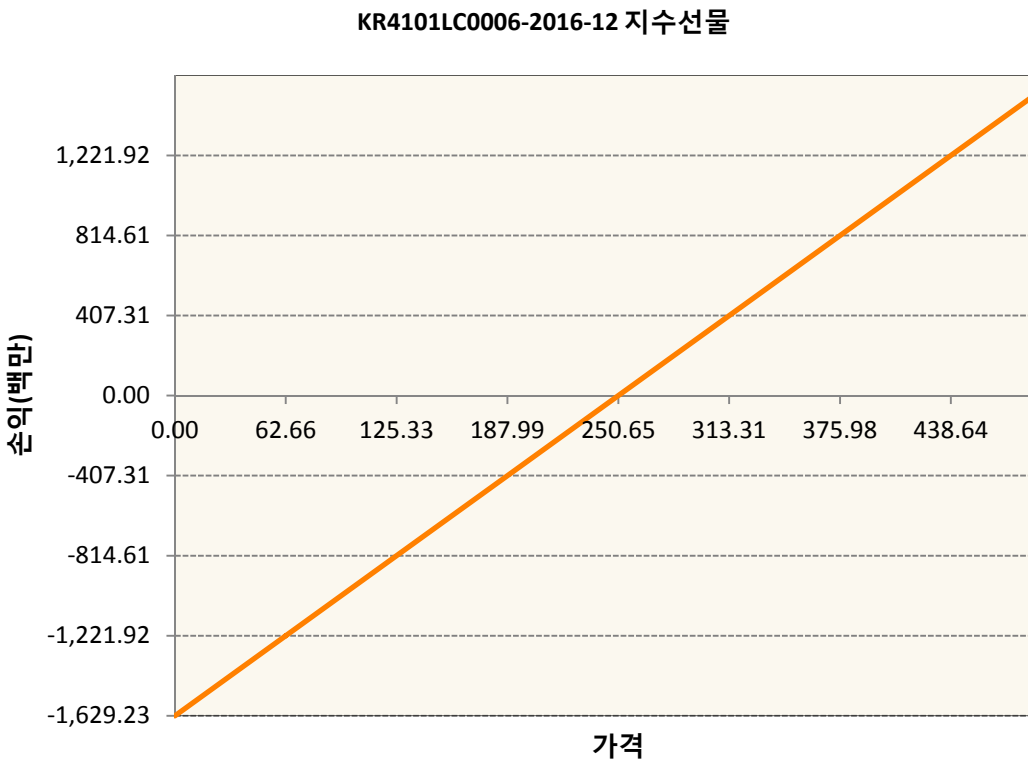
스마트레버리지목표전환형1호

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	1,629	0	1,629	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101LC00 2016-12 지수선물							130
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-130	-130	-130	-130	-130	-130	-130
-5.33%	-87	-87	-87	-87	-87	-87	-87
-2.67%	-43	-43	-43	-43	-43	-43	-43
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	43	43	43	43	43	43	43
5.33%	87	87	87	87	87	87	87
8.00%	130	130	130	130	130	130	130

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

102

공시일	2016-11-15
기준일	2016-11-14

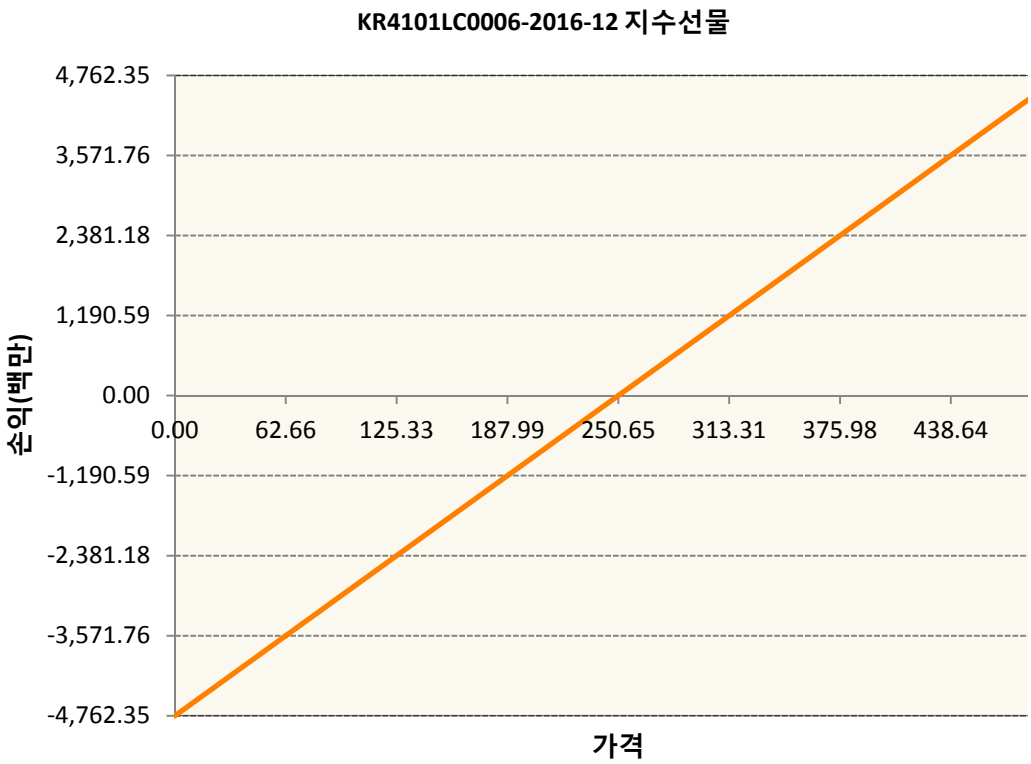
1.3배 레버리지 인덱스(주식-파생형)

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	4,762	0	4,762	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101LC00 2016-12 지수선물							380
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-380	-380	-380	-380	-380	-380	-380
-5.33%	-253	-253	-253	-253	-253	-253	-253
-2.67%	-127	-127	-127	-127	-127	-127	-127
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	127	127	127	127	127	127	127
5.33%	253	253	253	253	253	253	253
8.00%	380	380	380	380	380	380	380

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

298

공시일	2016-11-15
기준일	2016-11-14

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)

710

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2016-11-15
기준일	2016-11-14

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)

766

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2016-11-15
기준일	2016-11-14

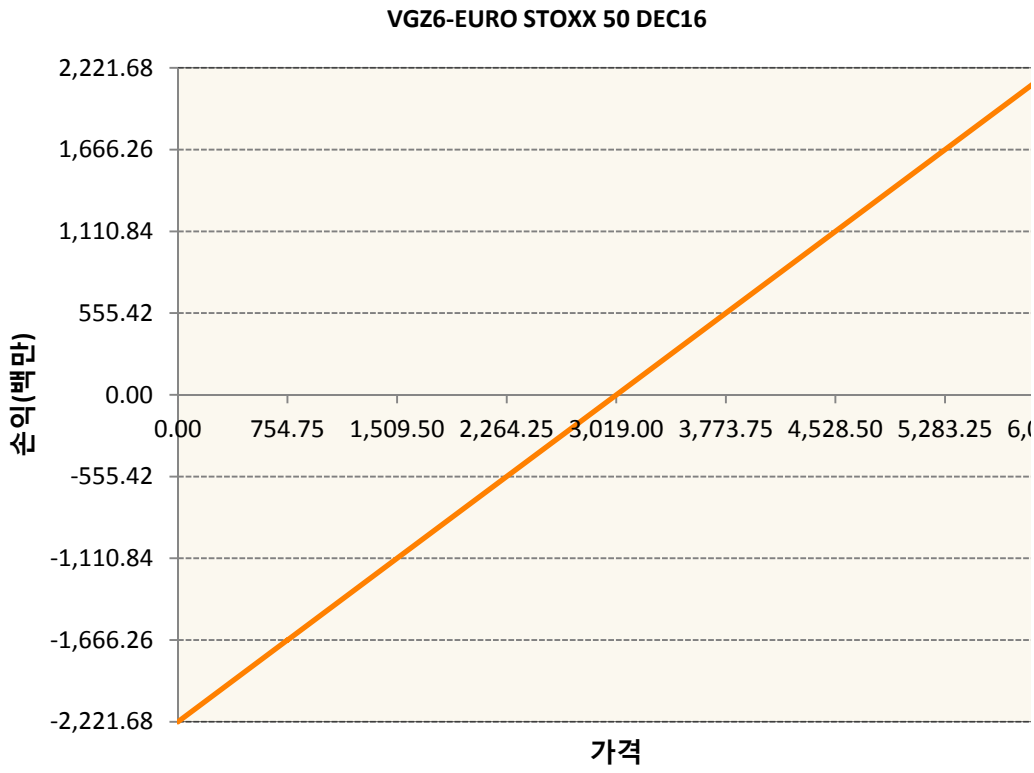
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,222	0	2,222	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGZ6	EURO STOXX 50 DEC16	178

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

(단위:백만원)

213

공시일	2016-11-15
기준일	2016-11-14

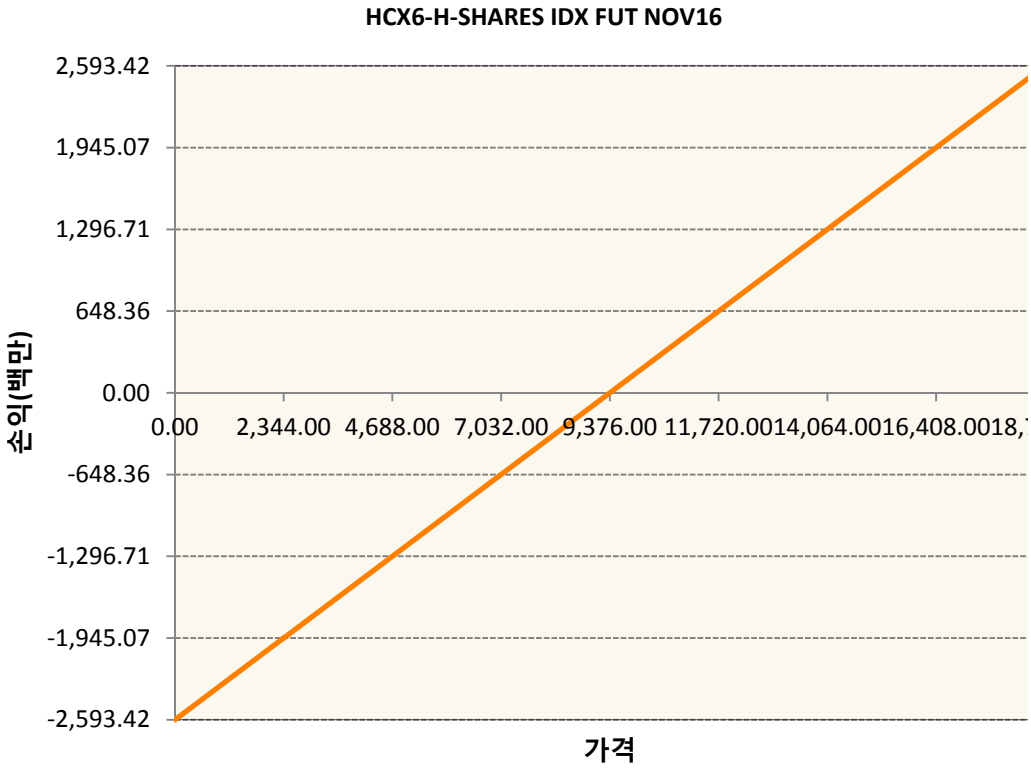
차이나인덱스모(주식-파생형)

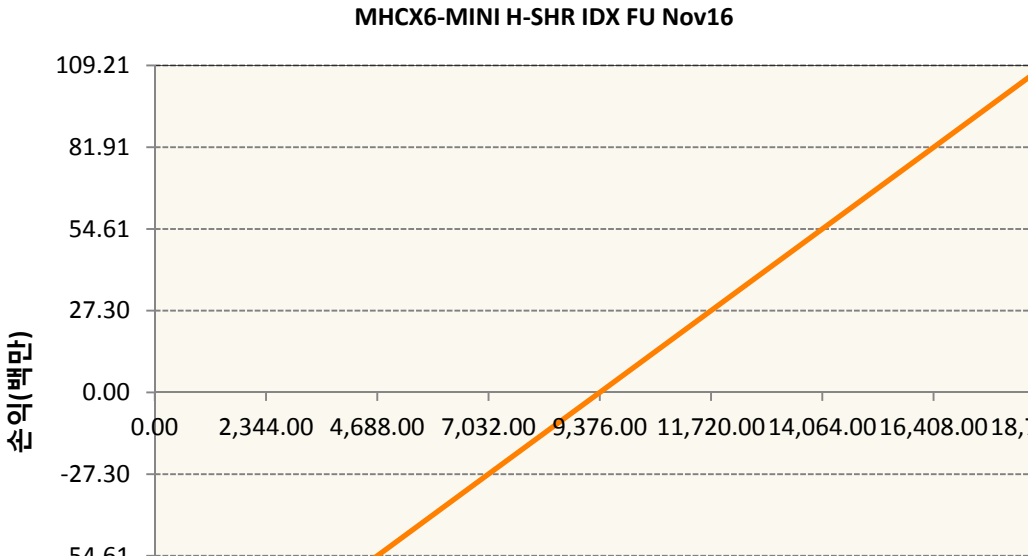
1. 계약금액

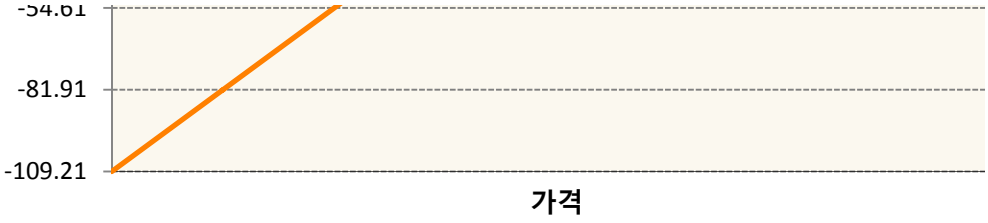
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,703	0	2,703	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCX6	H-SHARES IDX FUT NOV16	207
MHCX6	MINI H-SHR IDX FU Nov16	9

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	290

공시일	2016-11-15
기준일	2016-11-14

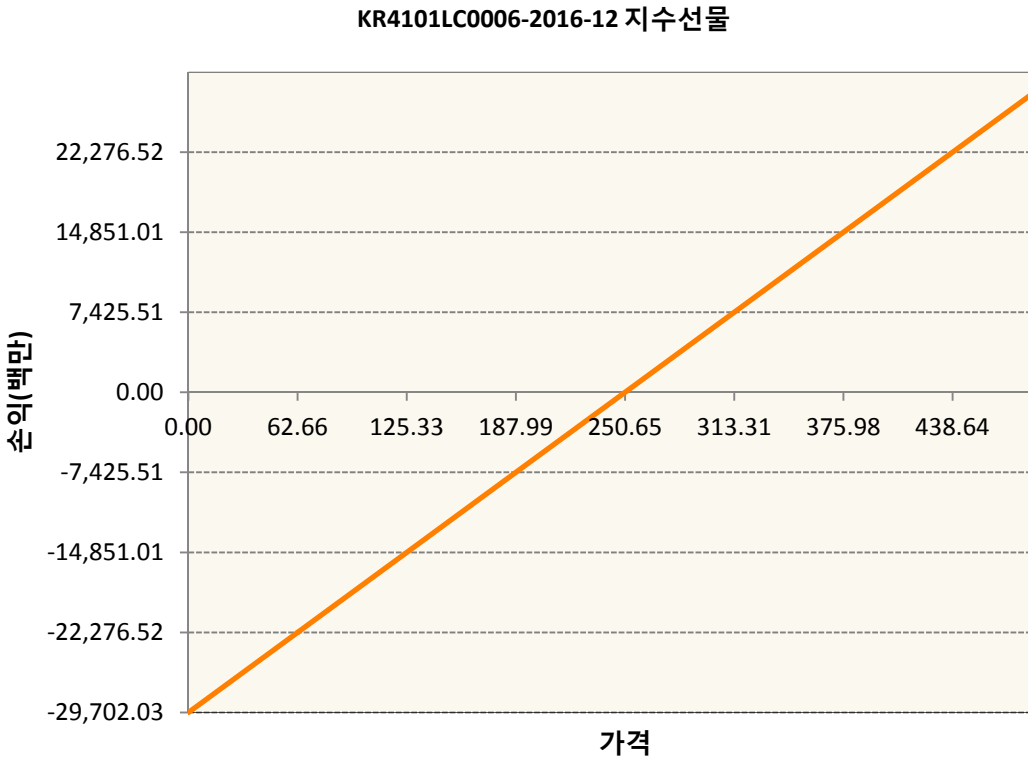
커버드콜(주식혼합-파생형)

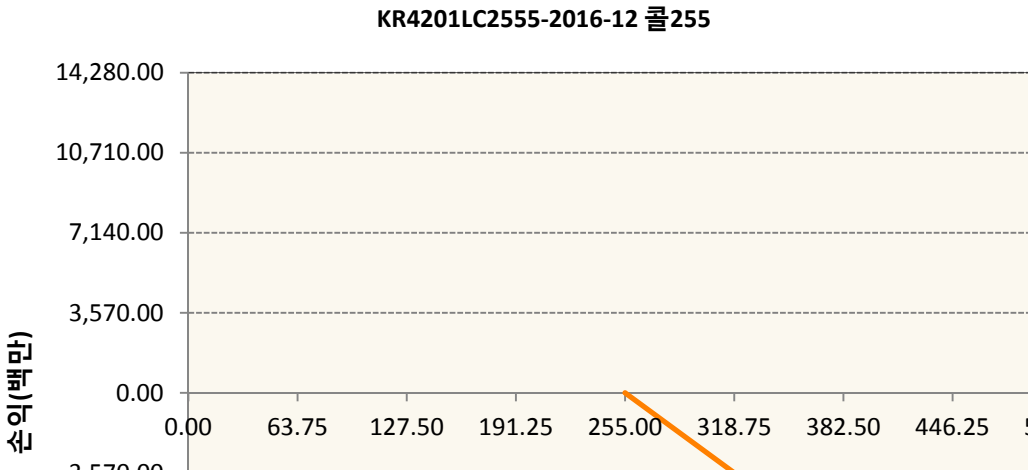
1. 계약금액

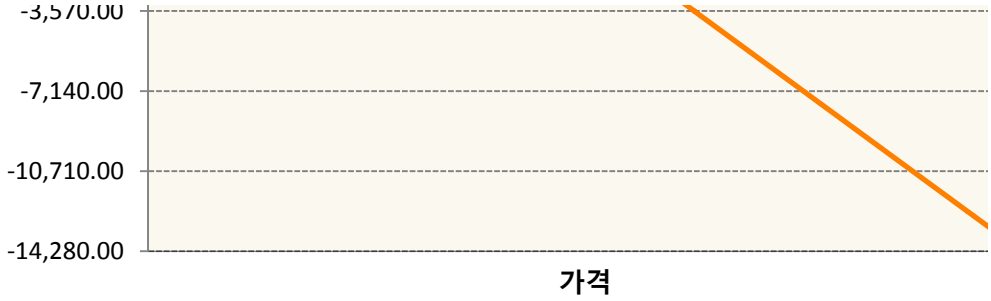
(단위:백만원)

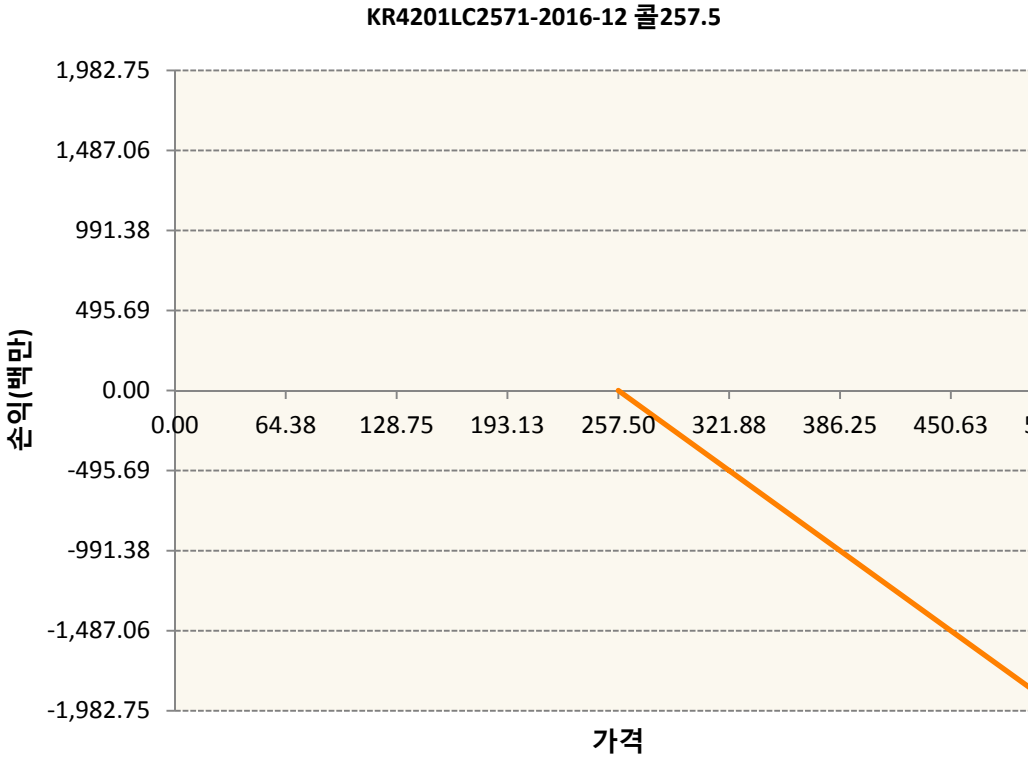
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	385	-385	장내
누계	유가증권	선물	29,702	0	29,702	장내
누계	유가증권	옵션	0	16,263	-16,263	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101LC00 2016-12 지수선물							2,370
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-2,370	-2,370	-2,370	-2,370	-2,370	-2,370	-2,370
-5.33%	-1,580	-1,580	-1,580	-1,580	-1,580	-1,580	-1,580
-2.67%	-790	-790	-790	-790	-790	-790	-790
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	790	790	790	790	790	790	790
5.33%	1,580	1,580	1,580	1,580	1,580	1,580	1,580
8.00%	2,370	2,370	2,370	2,370	2,370	2,370	2,370
KR4201LC25 2016-12 콜255							3,844
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	651	650	648	643	635	625	610
-5.33%	643	633	619	599	573	542	505
-2.67%	574	534	487	433	374	310	243
0%	267	181	91	0	-93	-187	-282
2.67%	-531	-632	-735	-837	-940	-1,042	-1,145
5.33%	-1,880	-1,948	-2,021	-2,099	-2,181	-2,266	-2,353
8.00%	-3,579	-3,606	-3,641	-3,683	-3,731	-3,785	-3,844
KR4201LC25 2016-12 콜257.5							476

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	63	63	63	62	62	61	59
-5.33%	62	62	61	59	56	53	49
-2.67%	58	54	49	44	37	30	22
0%	31	21	11	0	-11	-23	-35
2.67%	-50	-65	-79	-93	-107	-122	-136
5.33%	-209	-221	-233	-246	-258	-271	-285
8.00%	-428	-434	-441	-448	-457	-466	-476

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

6,009

공시일	2016-11-15
기준일	2016-11-14

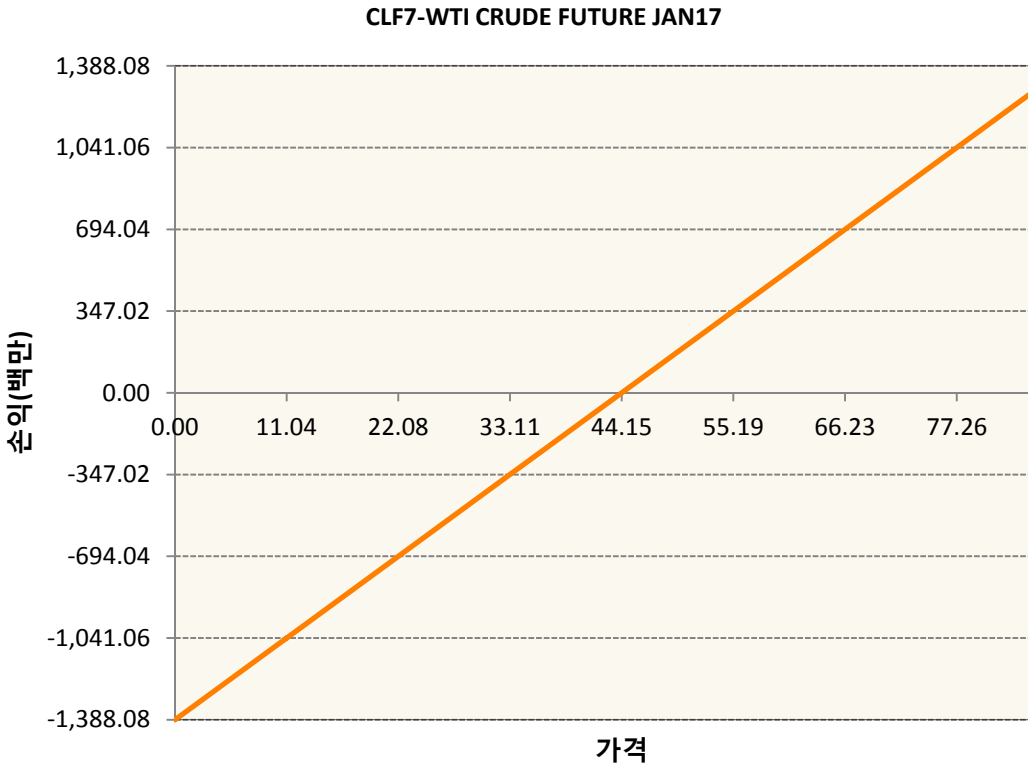
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

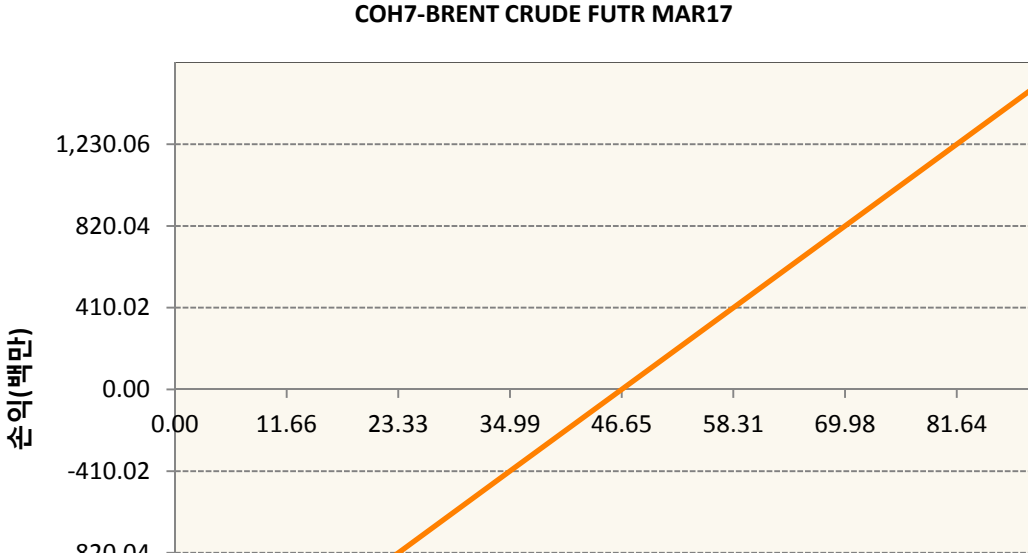
1. 계약금액

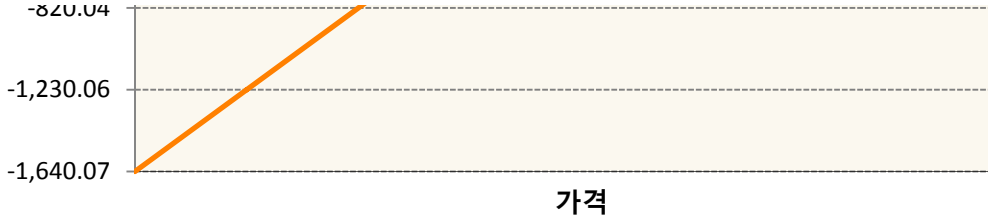
(단위:백만원)

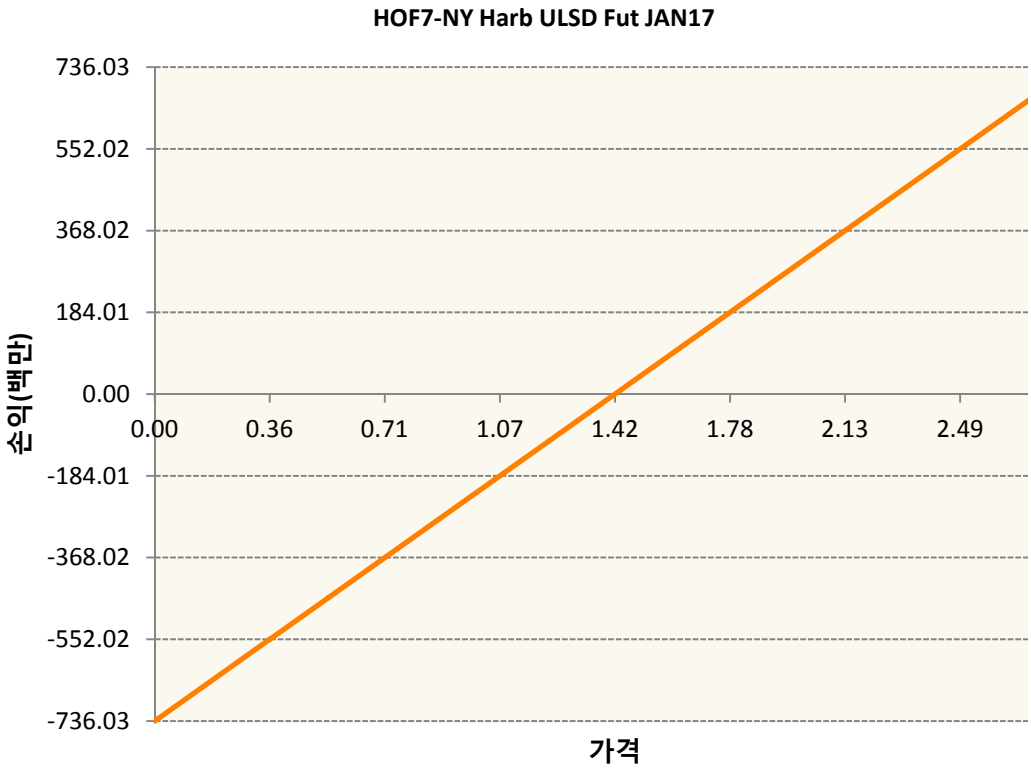
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	5,847	0	5,847	

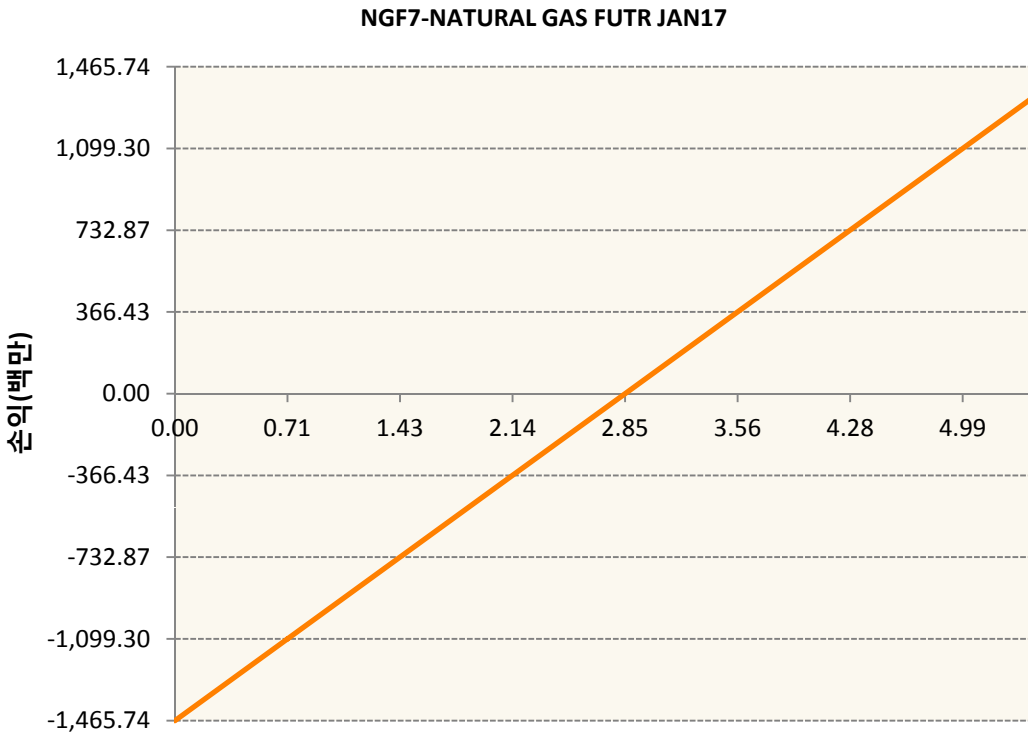
2. 만기시점의 손익구조



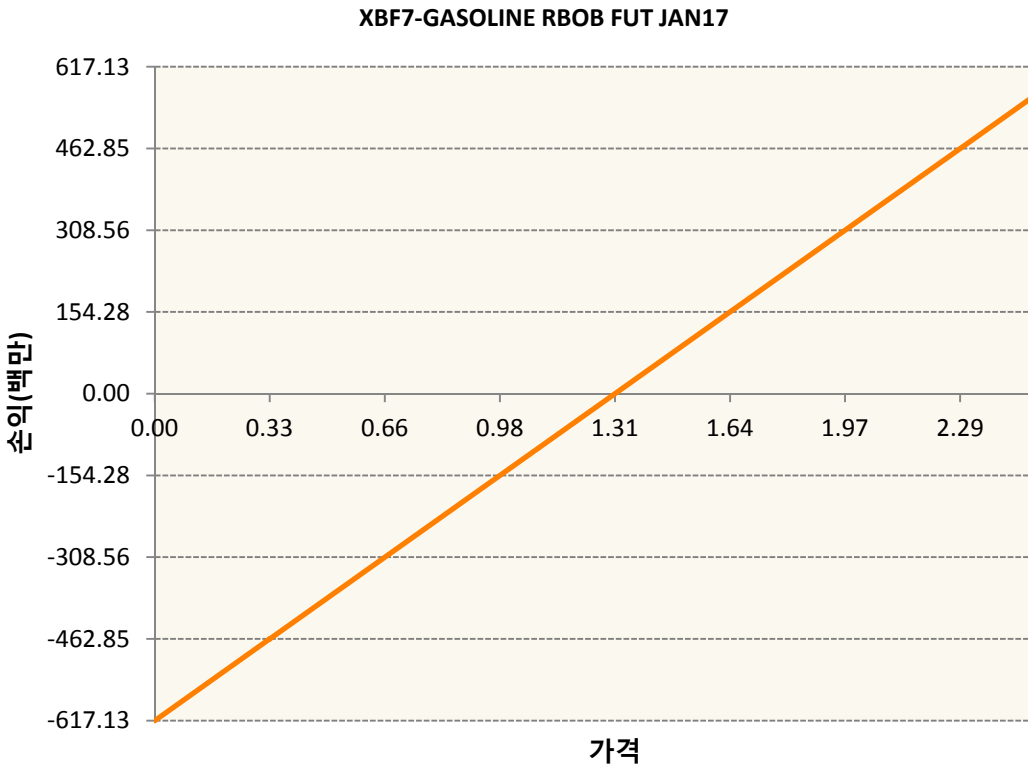



-820.04
-1,230.06
-1,640.07
가격


HOF7-NY Harb ULSD Fut JAN17
736.03
552.02
368.02
184.01
0.00
-184.01
-368.02
-552.02
-736.03
0.00
0.36
0.71
1.07
1.42
1.78
2.13
2.49
손익(백만)
가격


NGF7-NATURAL GAS FUTR JAN17
1,465.74
1,099.30
732.87
366.43
0.00
-366.43
-732.87
-1,099.30
-1,465.74
0.00
0.71
1.43
2.14
2.85
3.56
4.28
4.99
손익(백만)

가격



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
CLF7	WTI CRUDE FUTURE JAN17	111
COH7	BRENT CRUDE FUTR MAR17	131
HOF7	NY Harb ULSD Fut JAN17	59
NGF7	NATURAL GAS FUTR JAN17	117
XBF7	GASOLINE RBOB FUT JAN17	49

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,045

공시일	2016-11-15
기준일	2016-11-14

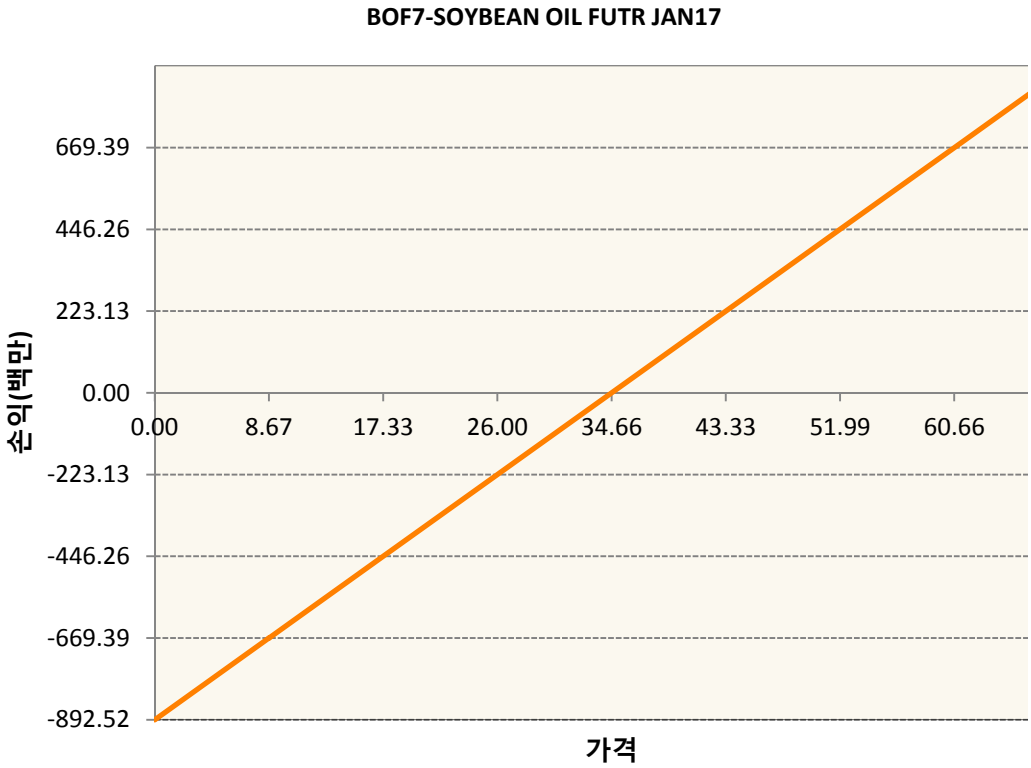
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

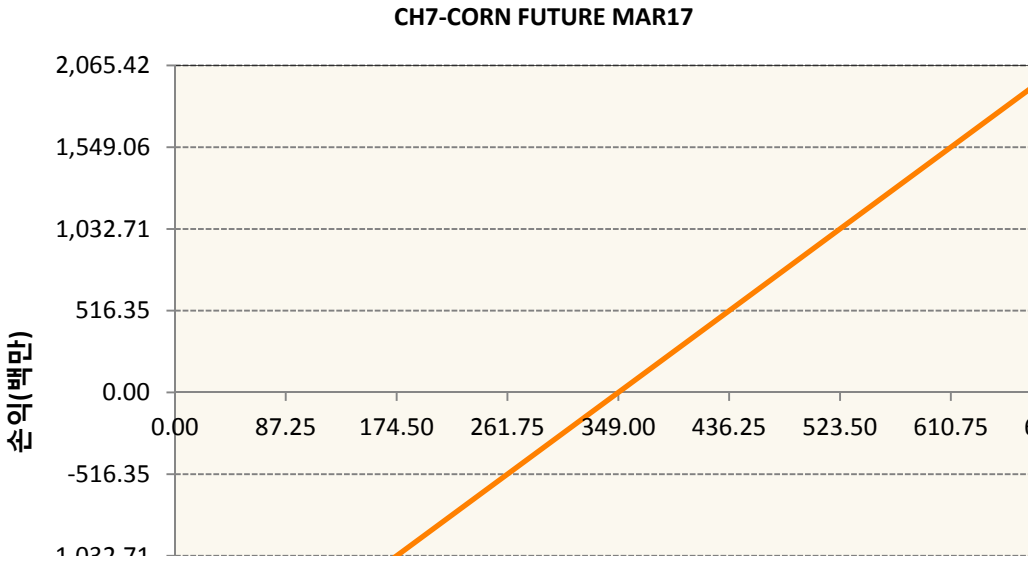
1. 계약금액

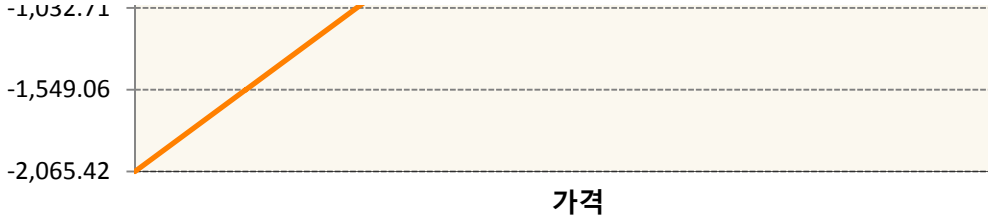
(단위:백만원)

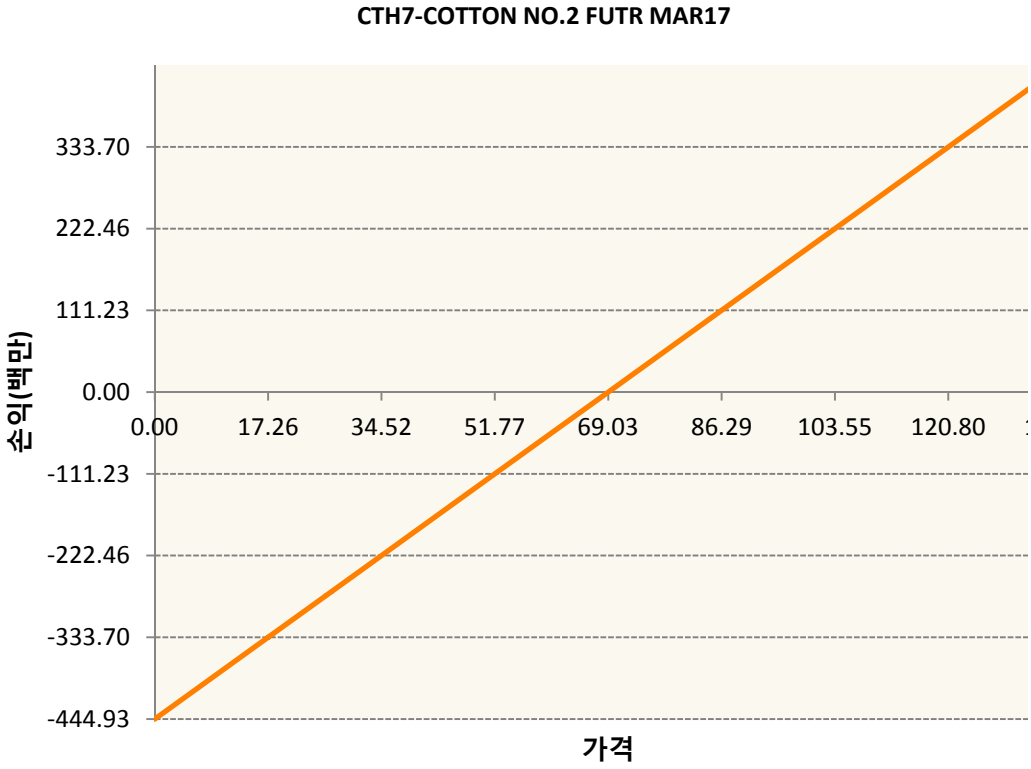
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	9,650	0	9,650	

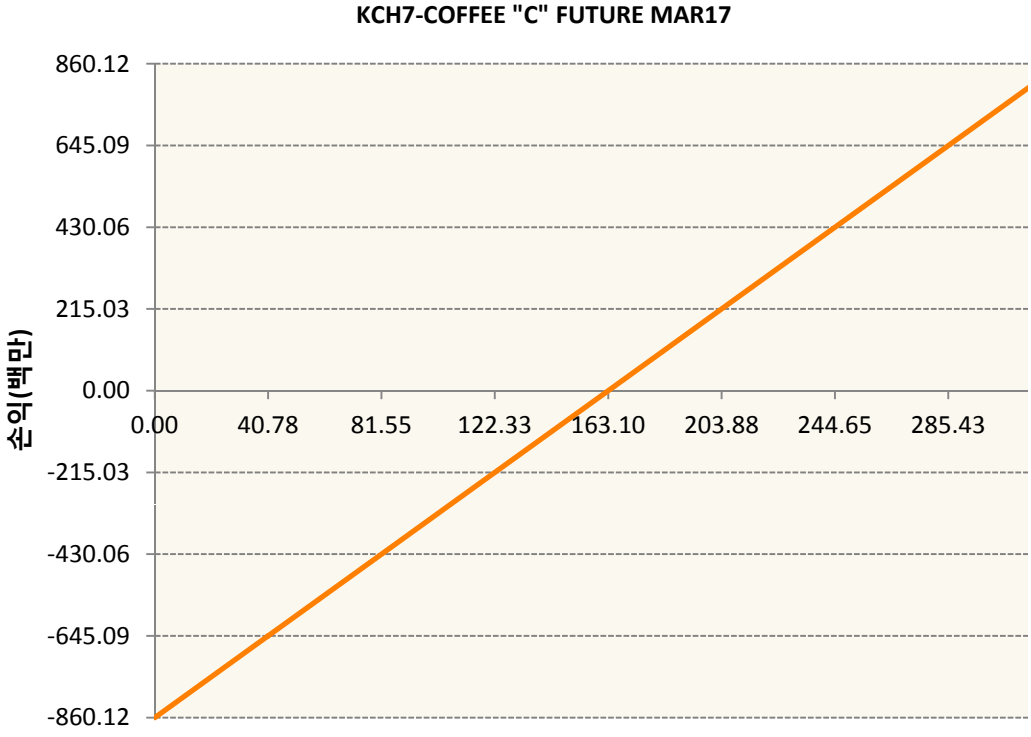
2. 만기시점의 손익구조





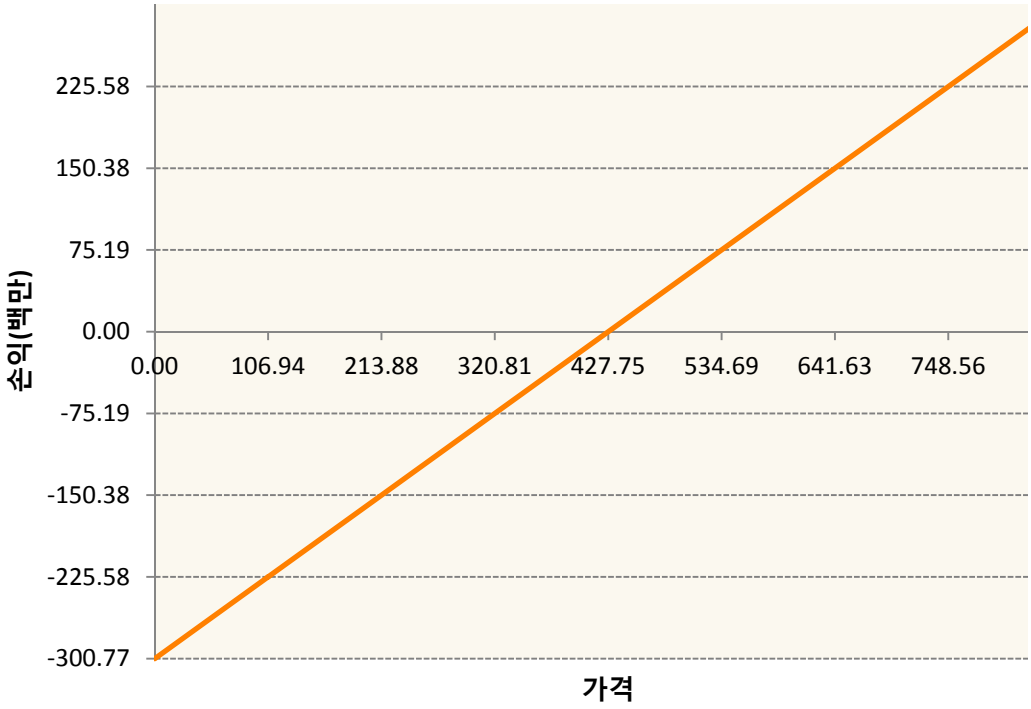

-1,549.06
-2,065.42
가격


CTH7-COTTON NO.2 FUTR MAR17
333.70
222.46
111.23
0.00
-111.23
-222.46
-333.70
-444.93
0.00
17.26
34.52
51.77
69.03
86.29
103.55
120.80
손익(백만)
가격

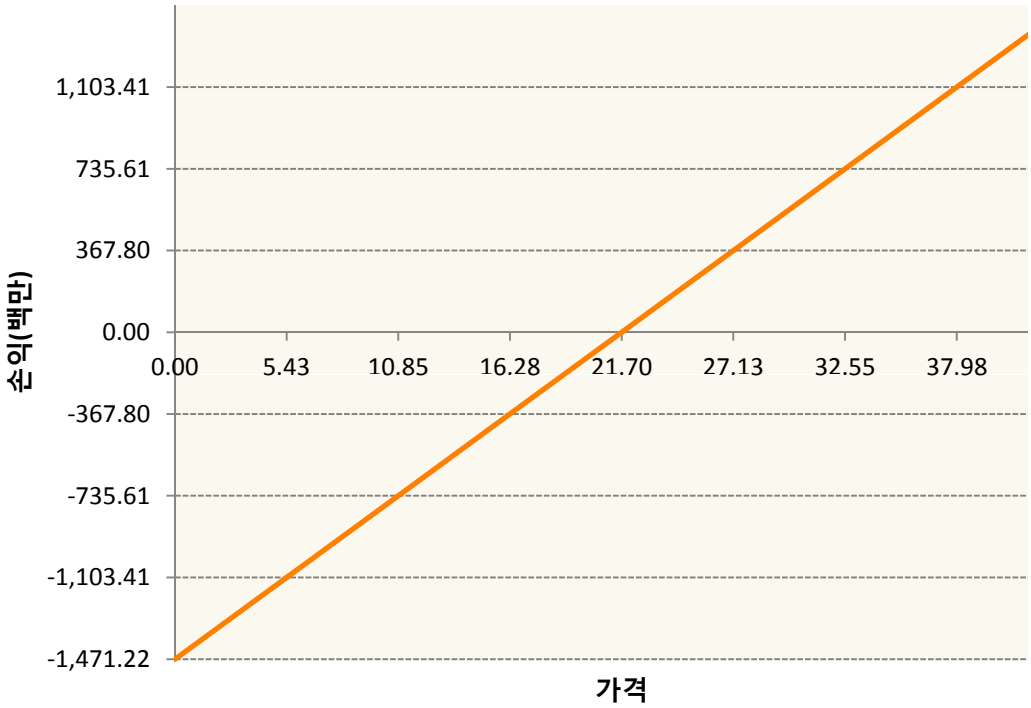

KCH7-COFFEE "C" FUTURE MAR17
860.12
645.09
430.06
215.03
0.00
-215.03
-430.06
-645.09
-860.12
0.00
40.78
81.55
122.33
163.10
203.88
244.65
285.43
손익(백만)

가격

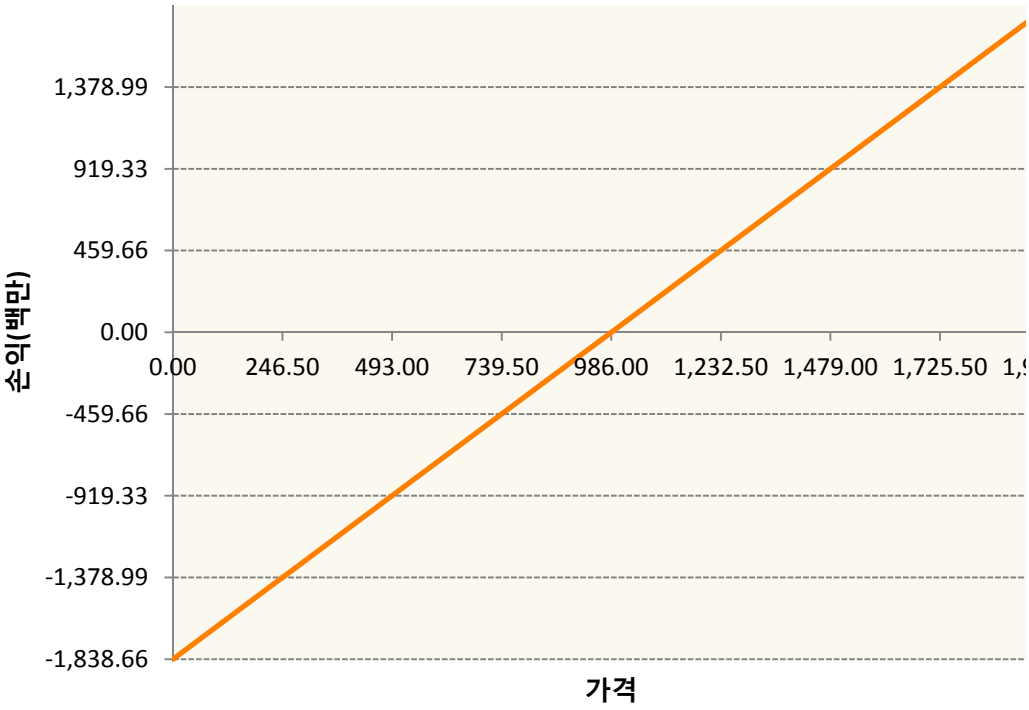
KWH7-KC HRW WHEAT FUT MAR17



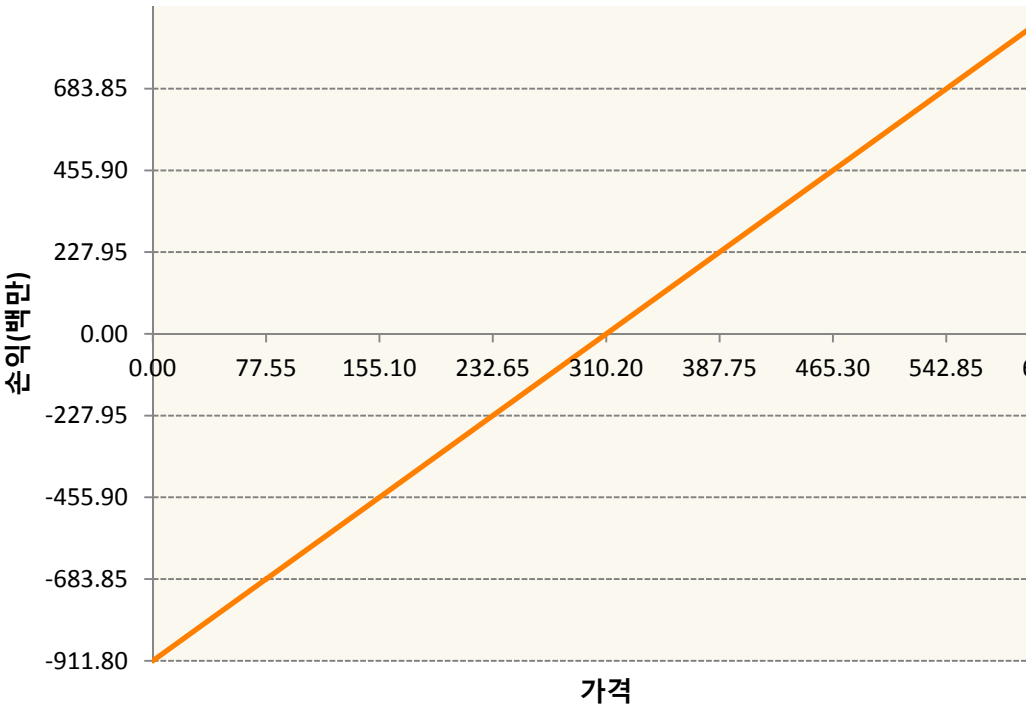
SBH7-Sugar #11 (WORLD) MAR17



SF7-SOYBEAN FUTURE JAN17

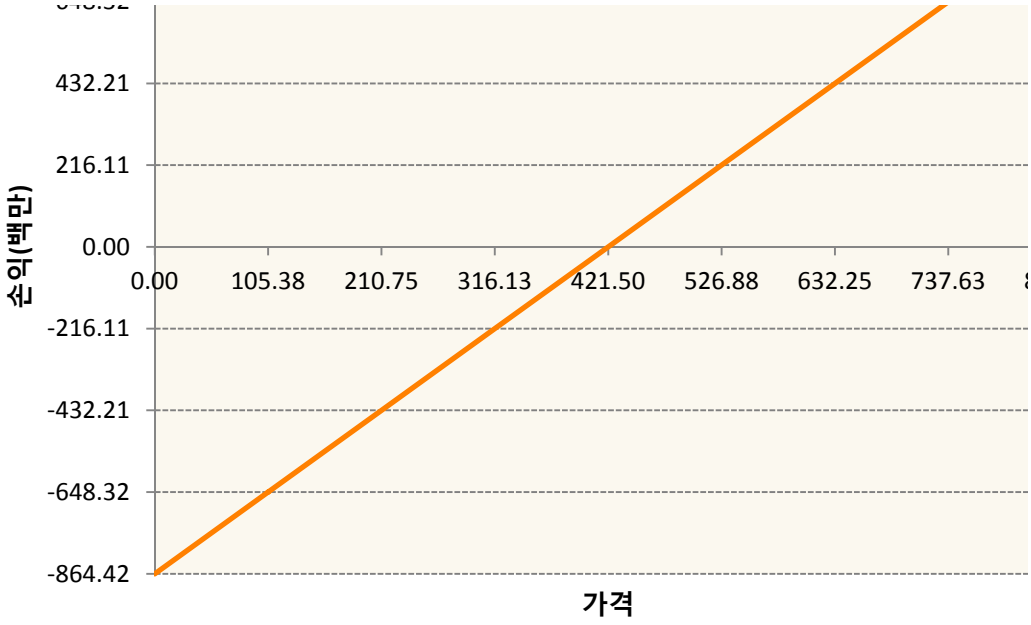


SMF7-SOYBEAN MEAL FUTR JAN17



WH7-WHEAT FUTURE(CBT) MAR17





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
BOF7	SOYBEAN OIL FUTR JAN17	71
CH7	CORN FUTURE MAR17	165
CTH7	COTTON NO.2 FUTR MAR17	36
KCH7	COFFEE "C" FUTURE MAR17	69
KWH7	KC HRW WHEAT FUT MAR17	24
SBH7	Sugar #11 (WORLD) MAR17	118
SF7	SOYBEAN FUTURE JAN17	147
SMF7	SOYBEAN MEAL FUTR JAN17	73
WH7	WHEAT FUTURE(CBT) MAR17	69

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	968